

공시일	2019-10-31
기준일	2019-10-30

## 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)

85

공시일	2019-10-31
기준일	2019-10-30

## 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

1,199

\* 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	2019-10-31
기준일	2019-10-30

## 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)	380
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	139

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

765
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-31
기준일	2019-10-30

## 유로인덱스모(주식-파생형)

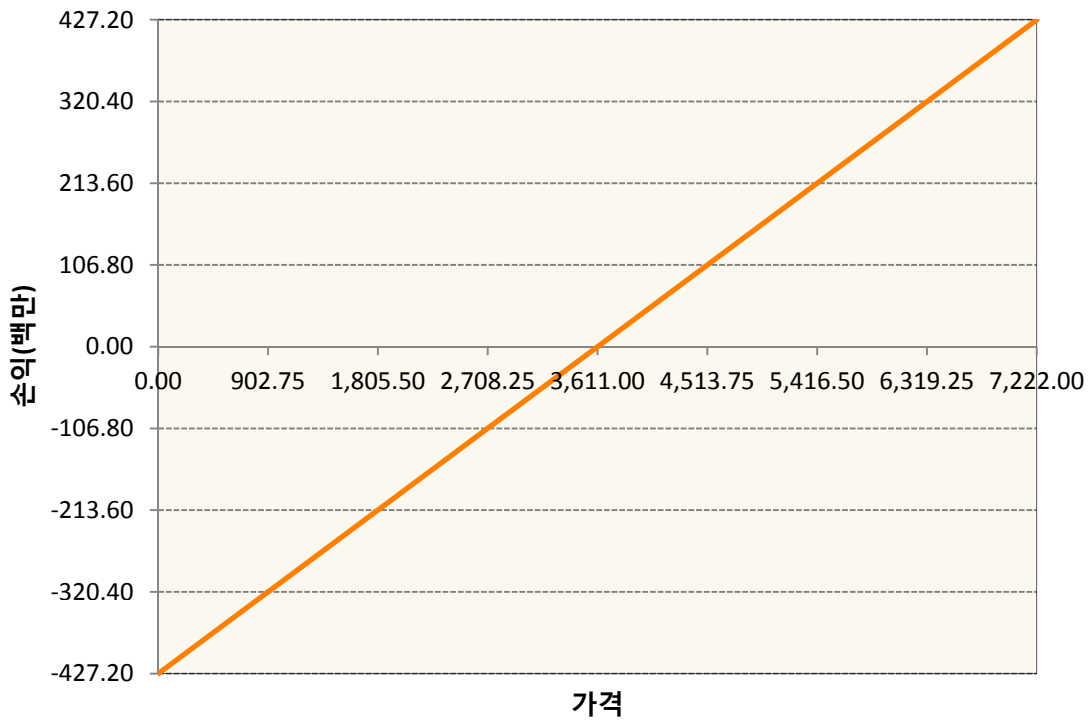
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

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

### 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	2019-10-31
기준일	2019-10-30

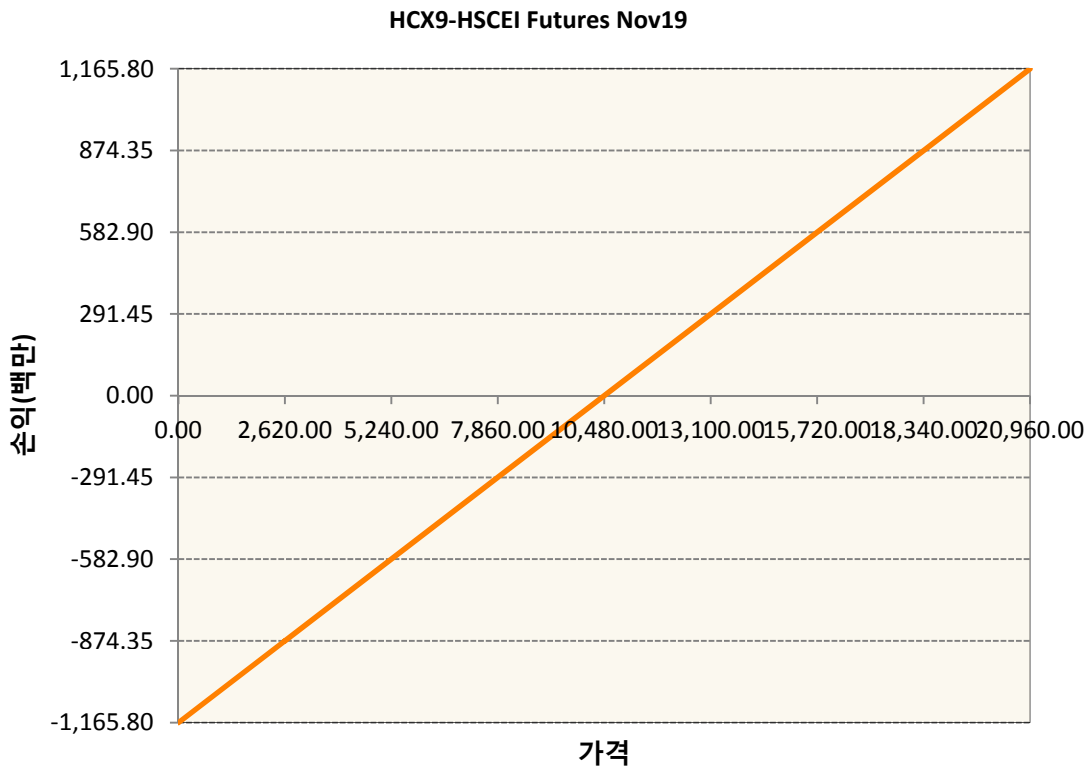
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,166	0	1,166	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGX9	HSCEI Futures Nov19	93
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

<b>83</b>
-----------

공시일	2019-10-31
기준일	2019-10-30

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

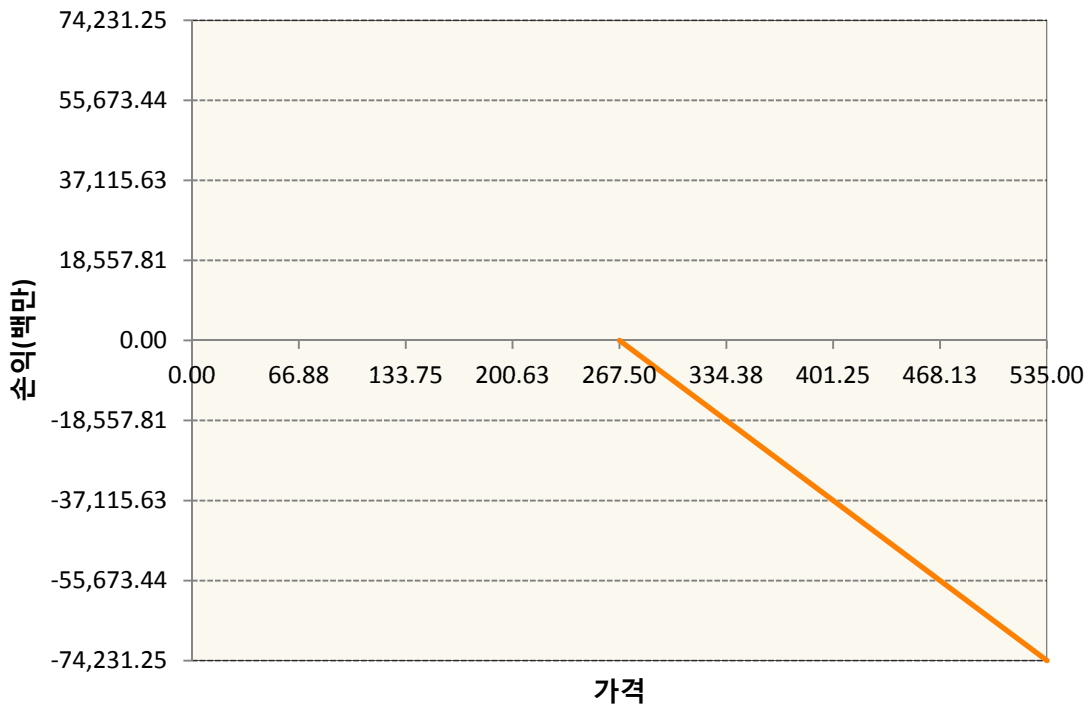
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

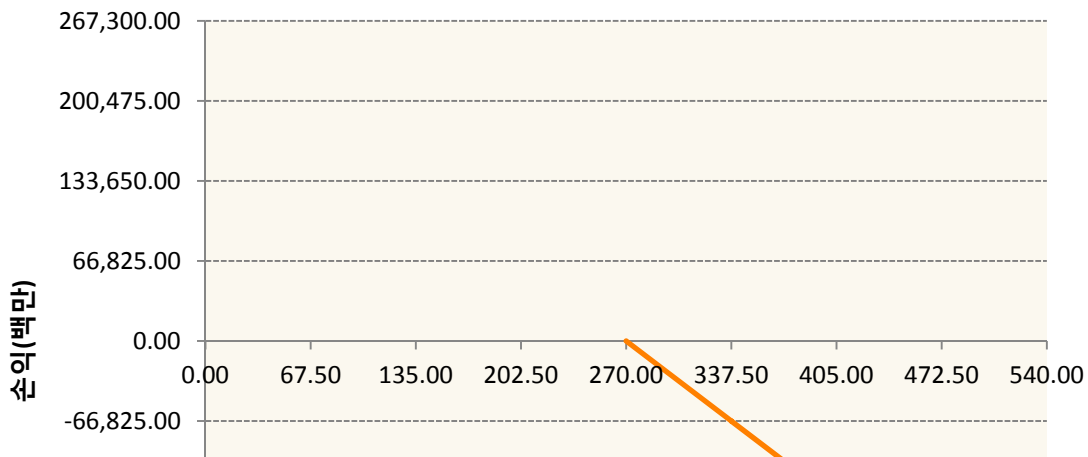
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	500,025	-500,025	장내

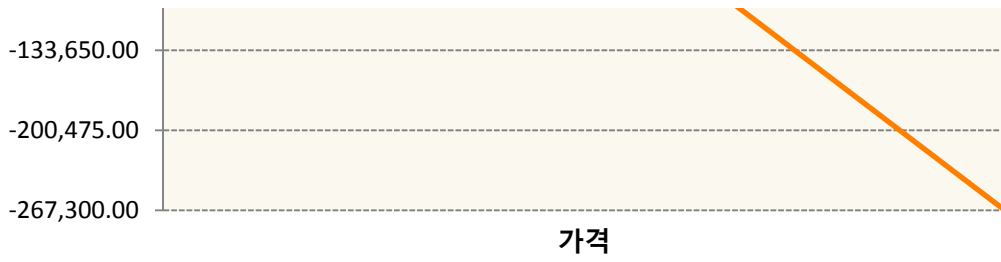
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201PB2677-2019-11 콜267.5**

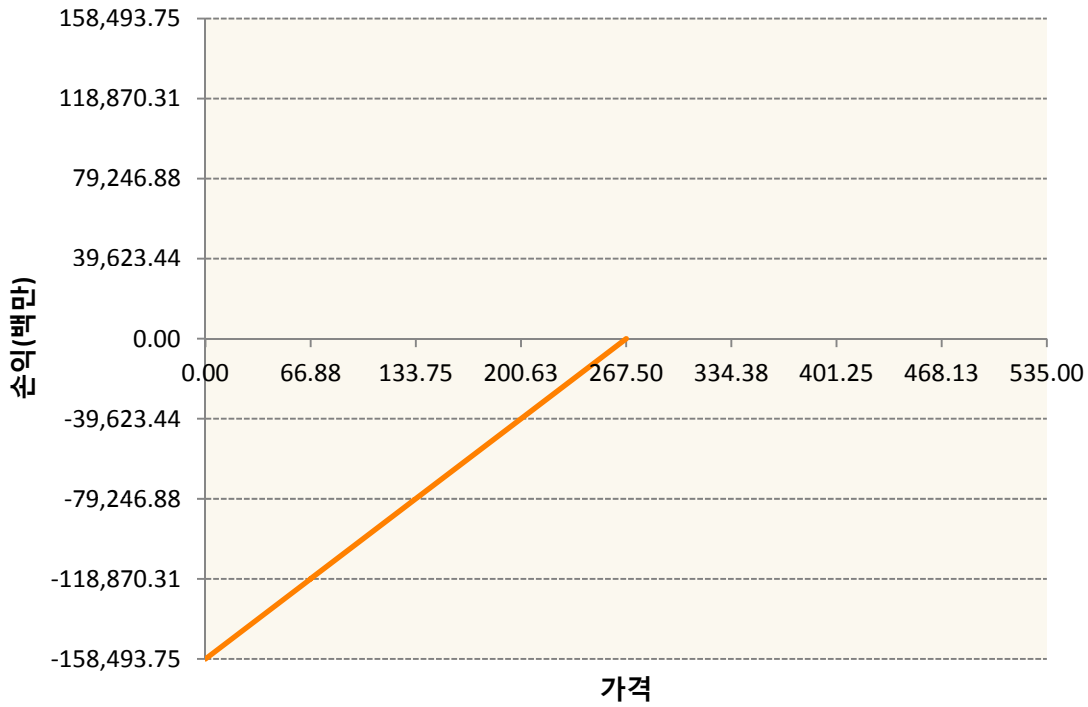


**KR4201PB2701-2019-11 콜270**





KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PB2677		2019-11 콜267.5					5,464
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,857	2,794	2,723	2,643	2,557	2,465	2,368
-5.33%	2,491	2,376	2,258	2,137	2,015	1,890	1,764
-2.67%	1,676	1,539	1,402	1,264	1,127	990	852
0%	348	236	120	0	-123	-248	-374
2.67%	-1,375	-1,439	-1,513	-1,595	-1,684	-1,779	-1,880
5.33%	-3,308	-3,334	-3,370	-3,415	-3,468	-3,530	-3,599
8.00%	-5,319	-5,327	-5,340	-5,360	-5,387	-5,422	-5,464
KR4201PB2701		2019-11 콜270					18,842
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,750	8,581	8,376	8,141	7,878	7,592	7,285

-5.33%	7,818	7,463	7,087	6,696	6,291	5,875	5,451
-2.67%	5,505	5,019	4,532	4,044	3,555	3,066	2,576
0%	1,376	925	466	0	-471	-945	-1,423
2.67%	-4,353	-4,644	-4,967	-5,314	-5,682	-6,067	-6,467
5.33%	-11,047	-11,183	-11,356	-11,562	-11,800	-12,065	-12,355
8.00%	-18,154	-18,201	-18,273	-18,372	-18,501	-18,658	-18,842
KR4301PB2676                      2019-11 풋267.5							8,164
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,045	-8,051	-8,061	-8,077	-8,100	-8,129	-8,164
-5.33%	-3,851	-3,920	-3,999	-4,086	-4,180	-4,279	-4,383
-2.67%	-810	-953	-1,095	-1,238	-1,381	-1,524	-1,667
0%	203	146	77	0	-85	-177	-275
2.67%	312	307	297	282	260	232	197
5.33%	315	315	315	314	311	307	300
8.00%	315	315	315	315	315	315	314

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

(단위:백만원)

**32,180**

공시일	2019-10-31
기준일	2019-10-30

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

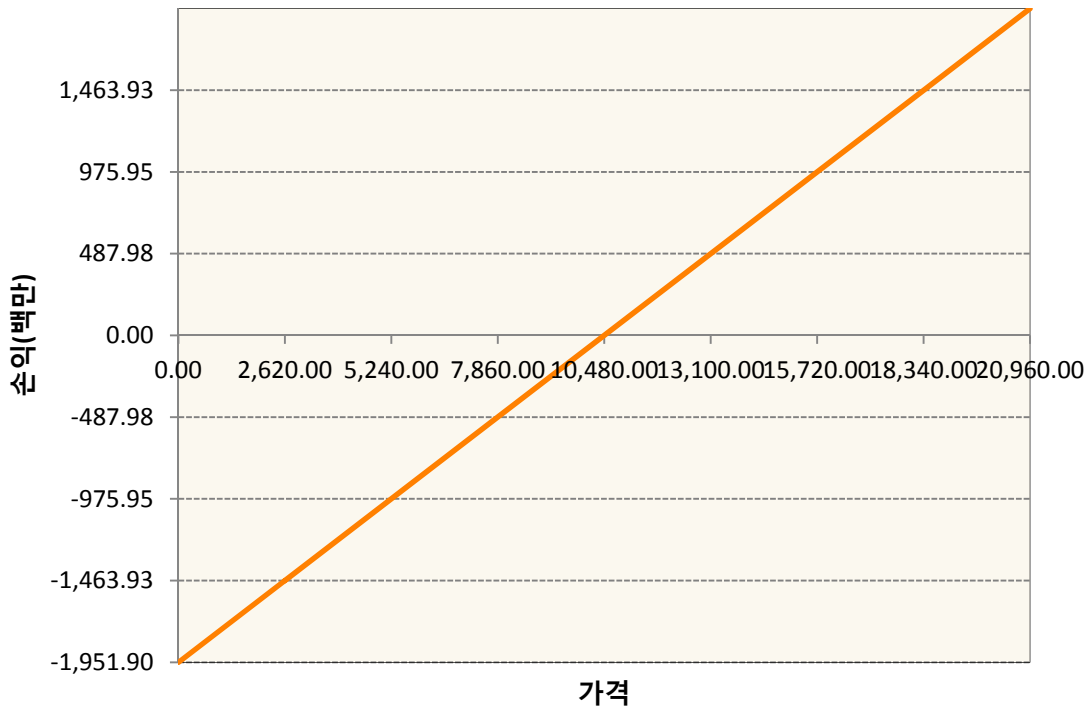
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,952	0	1,952	장내
누계	통화	선도	671	2,768	-2,098	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

HCX9-HSCEI Futures Nov19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	221
FX21019U00 HKD/KRW 22-11-19E	6
FX21019U02 HKD/KRW 22-11-19E	48
HCX9 HSCEI Futures Nov19	156

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

(단위:백만원)



공시일	2019-10-31
기준일	2019-10-30

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

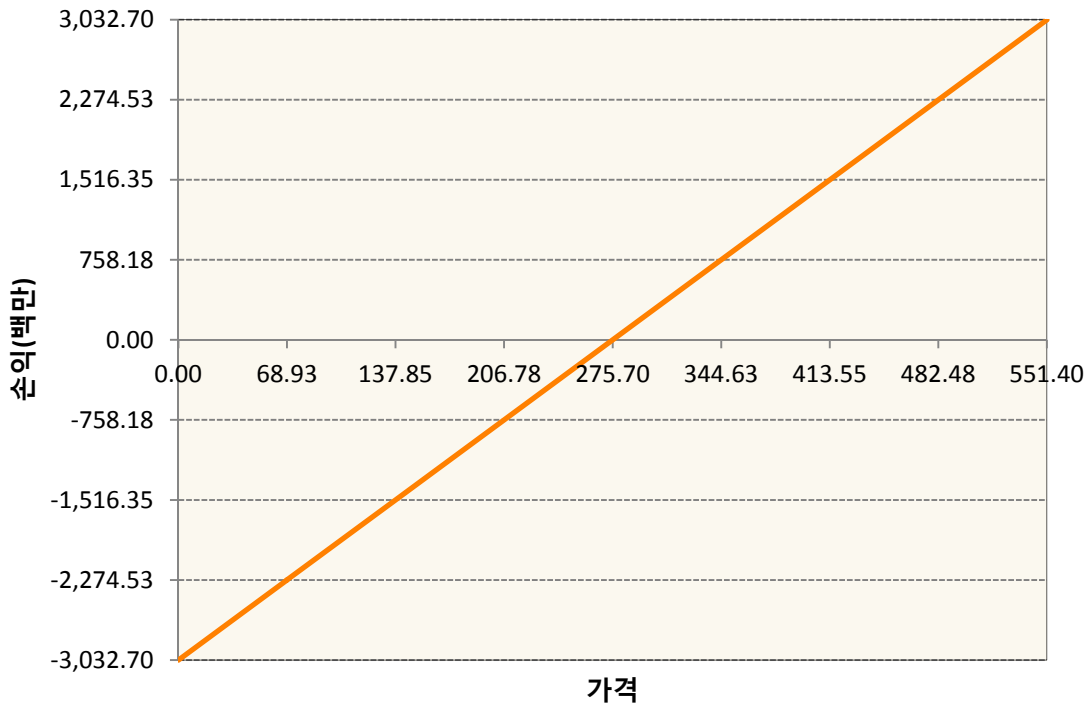
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

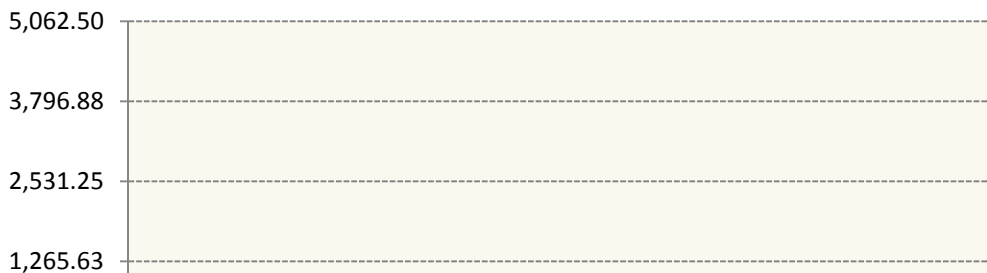
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,033	0	3,033	장내
누계	유가증권	스왑	10,625	0	10,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	10,013	-10,013	장내

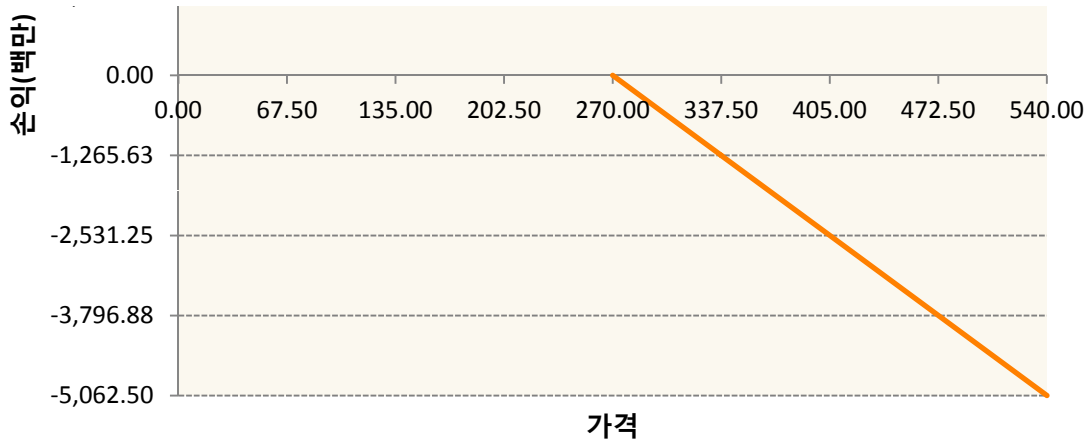
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

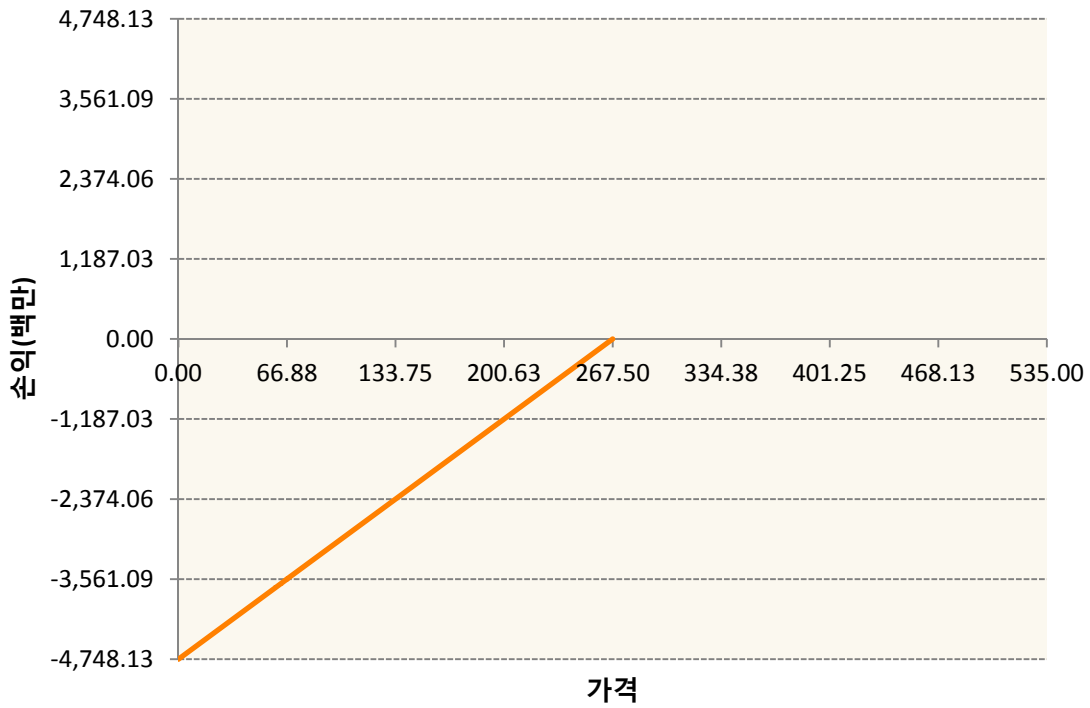


KR4201PB2701-2019-11 콜270

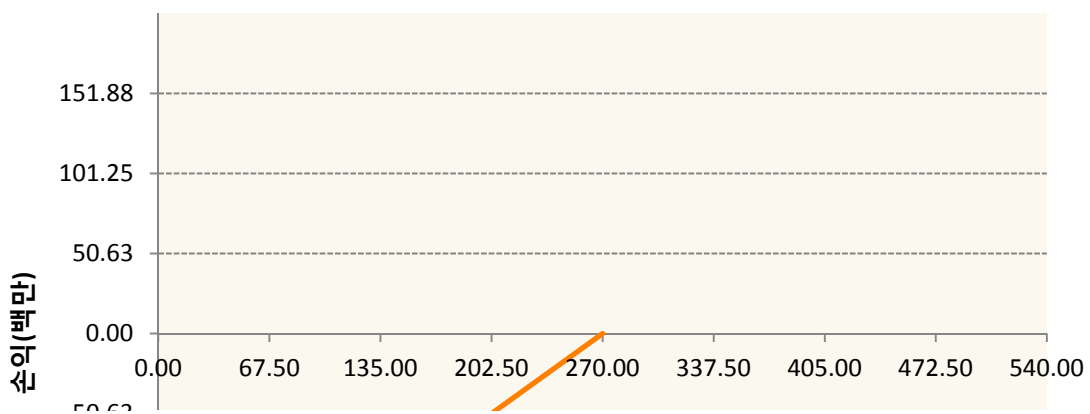




KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



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%	-607	-607	-607	-607	-607	-607	-607	
-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%	607	607	607	607	607	607	607	
8.00%	911	911	911	911	911	911	911	
KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						242
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-242	-242	-242	-242	-242	-242	-242	
-5.33%	-162	-162	-162	-162	-162	-162	-162	
-2.67%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	81	81	81	81	81	81	81	
5.33%	162	162	162	162	162	162	162	
8.00%	242	242	242	242	242	242	242	
KR4201PB2701		2019-11 콜270						357
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	166	163	159	154	149	144	138	
-5.33%	148	141	134	127	119	111	103	
-2.67%	104	95	86	77	67	58	49	
0%	26	18	9	0	-9	-18	-27	
2.67%	-82	-88	-94	-101	-108	-115	-122	
5.33%	-209	-212	-215	-219	-223	-229	-234	
8.00%	-344	-345	-346	-348	-350	-353	-357	
KR4301PB2676		2019-11 풋267.5						245
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-241	-241	-242	-242	-243	-244	-245
-5.33%	-115	-117	-120	-122	-125	-128	-131
-2.67%	-24	-29	-33	-37	-41	-46	-50
0%	6	4	2	0	-3	-5	-8
2.67%	9	9	9	8	8	7	6
5.33%	9	9	9	9	9	9	9
8.00%	9	9	9	9	9	9	9
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%	-6	-6	-6	-6	-7	-7	-7
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
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

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

(단위:백만원)

**1,693**

공시일	2019-10-31
기준일	2019-10-30

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

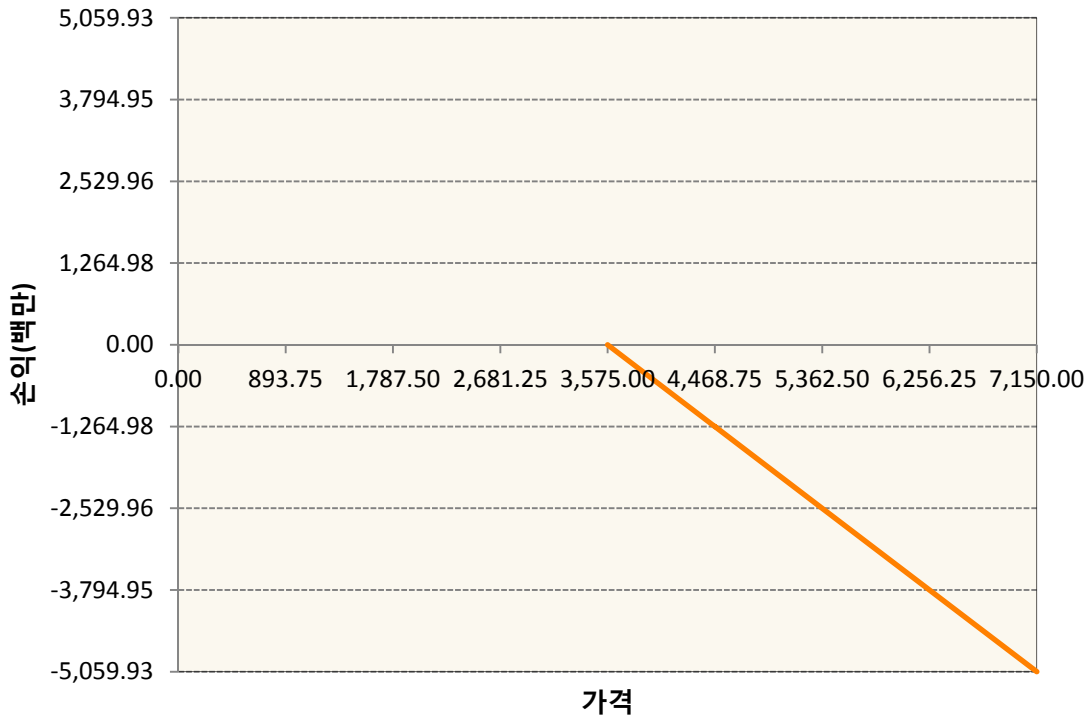
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

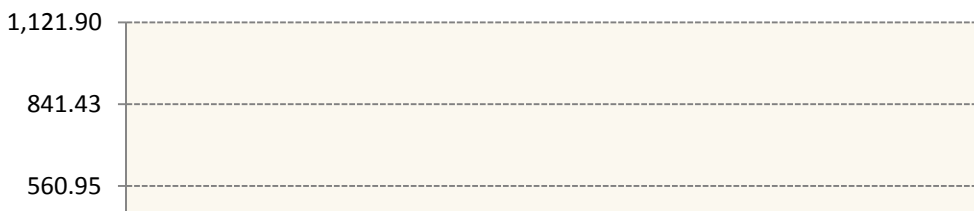
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	3	-3	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,350	0	3,350	
누계	유가증권	스왑	20,401	0	20,401	장외
누계	유가증권	옵션	0	12,364	-12,364	장내
누계	통화	선도	2,046	6,103	-4,057	장외

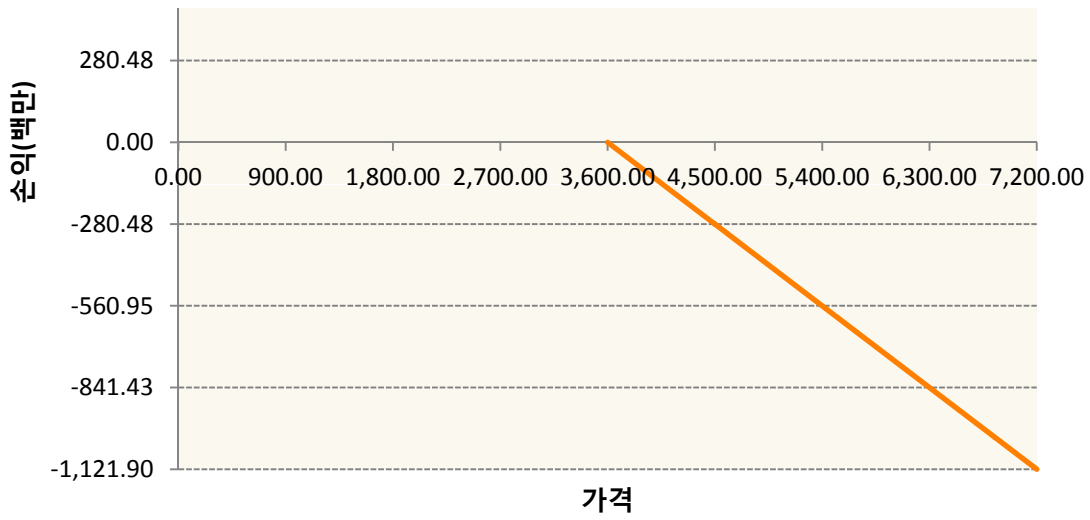
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXX9-C3575-EURO STOXX 50

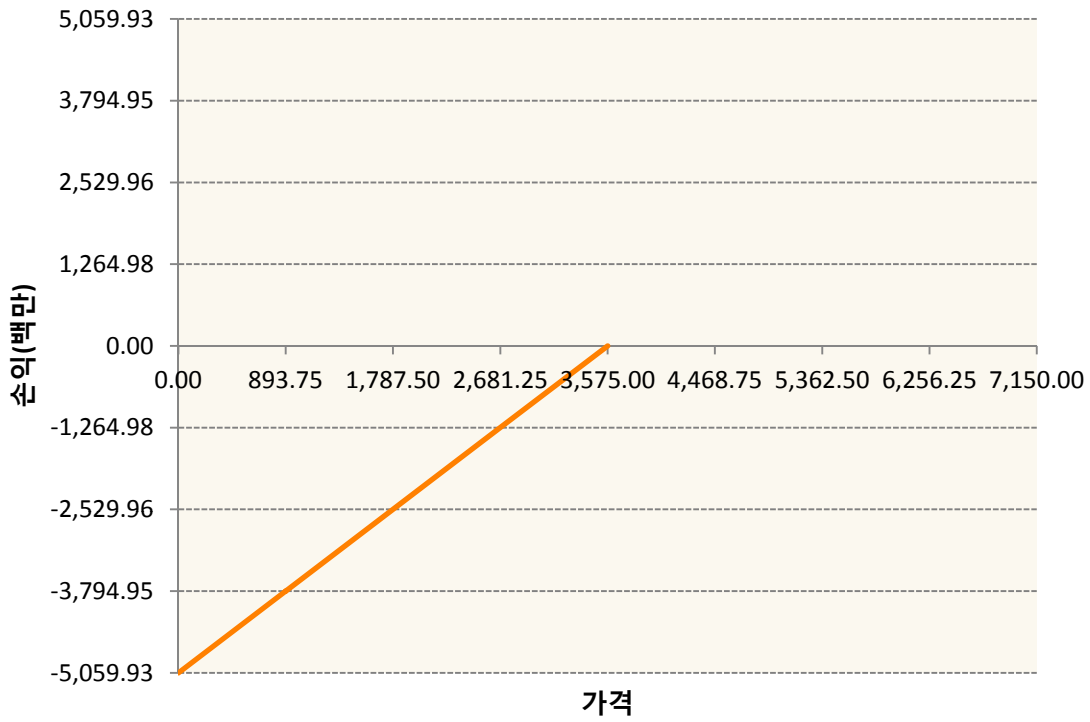


OESXX9-C3600-EURO STOXX 50

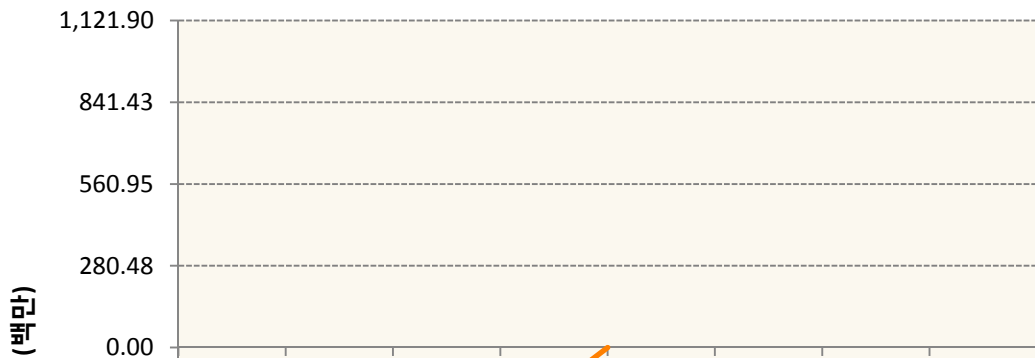


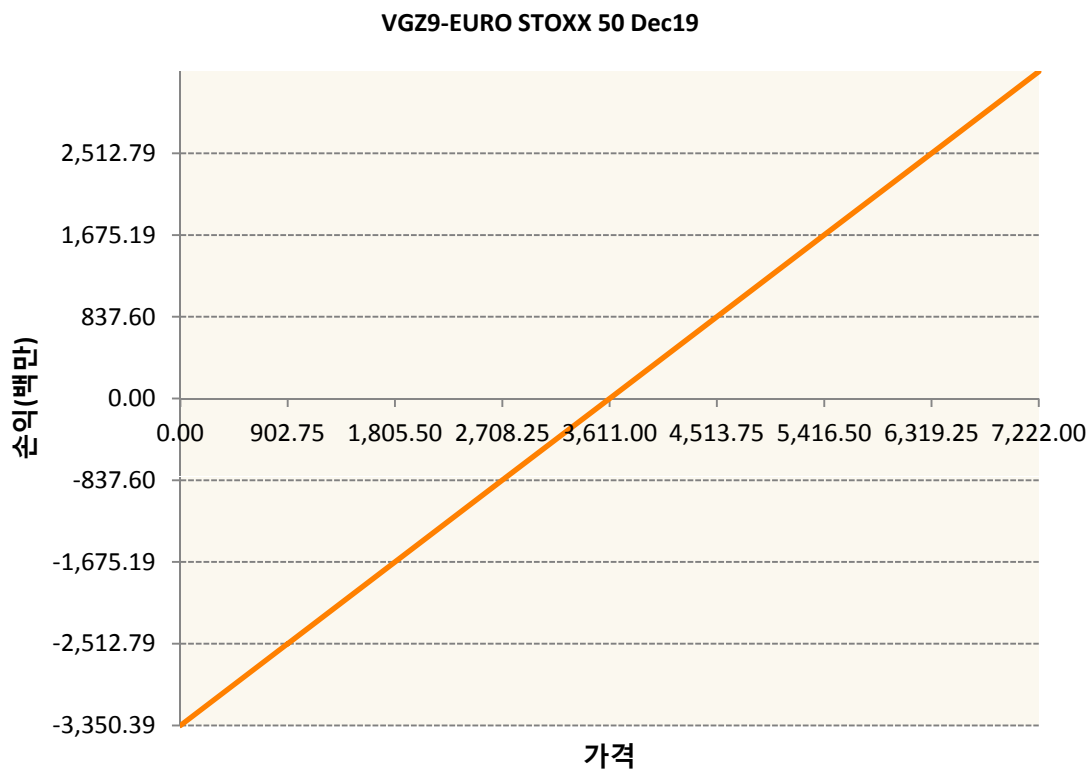
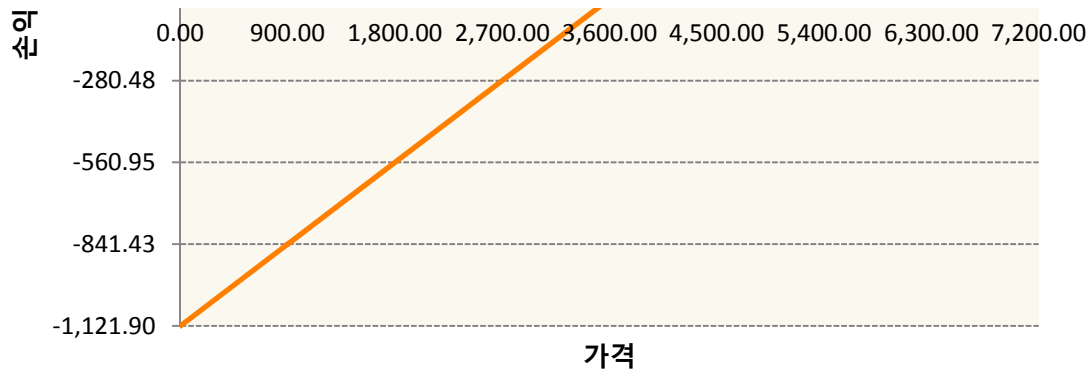


OESXX9-P3575-EURO STOXX 50



OESXX9-P3600-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		16
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E		488
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E		164
OESXX9-C35 EURO STOXX 50		405
OESXX9-C36 EURO STOXX 50		90
OESXX9-P35 EURO STOXX 50		405
OESXX9-P36 EURO STOXX 50		90
VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	268

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

(단위:백만원)

1,197



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

(단위:백만원)

923



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

(단위:백만원)

80



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

(단위:백만원)

125

공시일	2019-10-31
기준일	2019-10-30

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

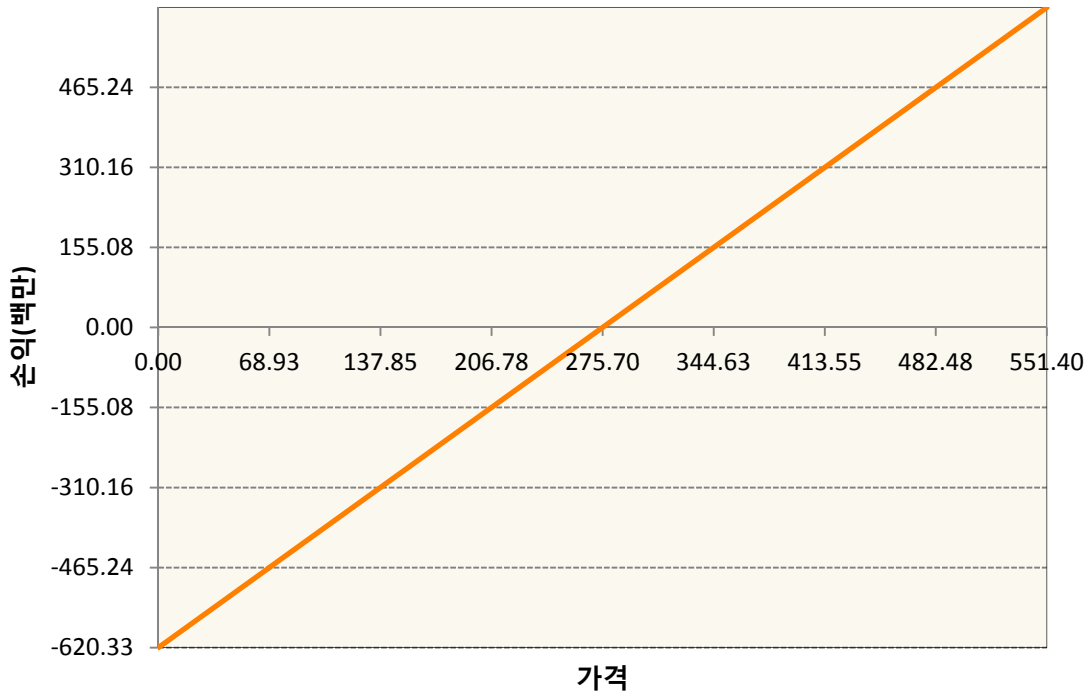
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	620	0	620	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)

40

공시일	2019-10-31
기준일	2019-10-30

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

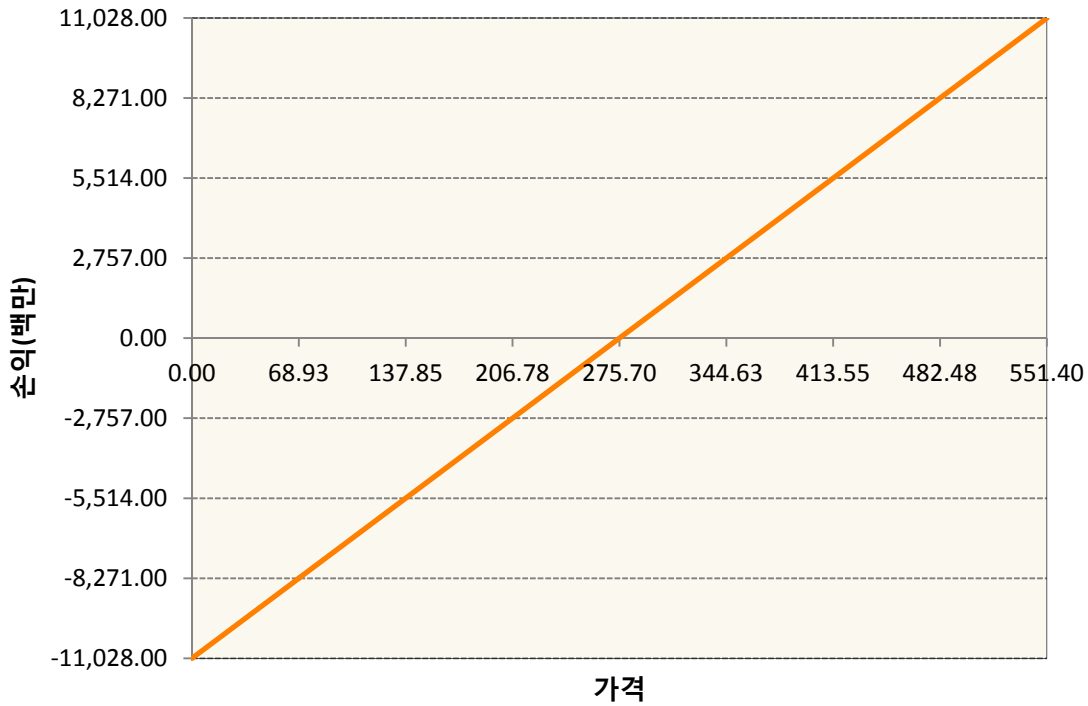
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

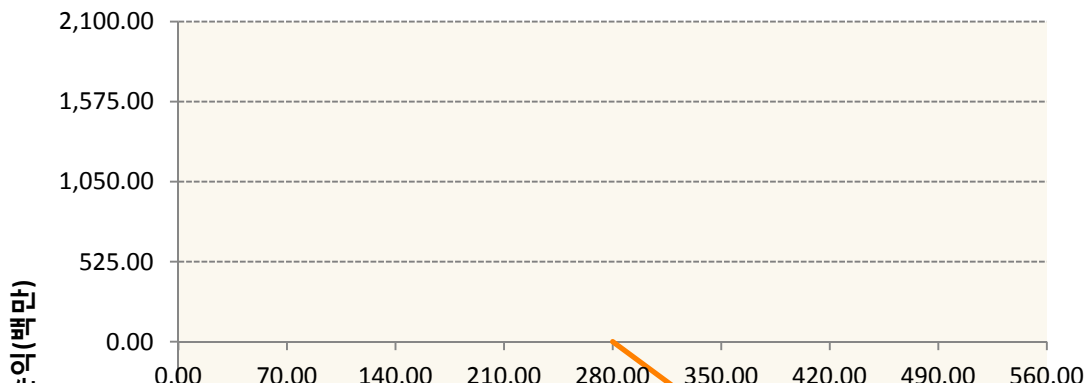
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,028	0	11,028	장내
누계	유가증권	옵션	3,561	20,604	-17,043	장내

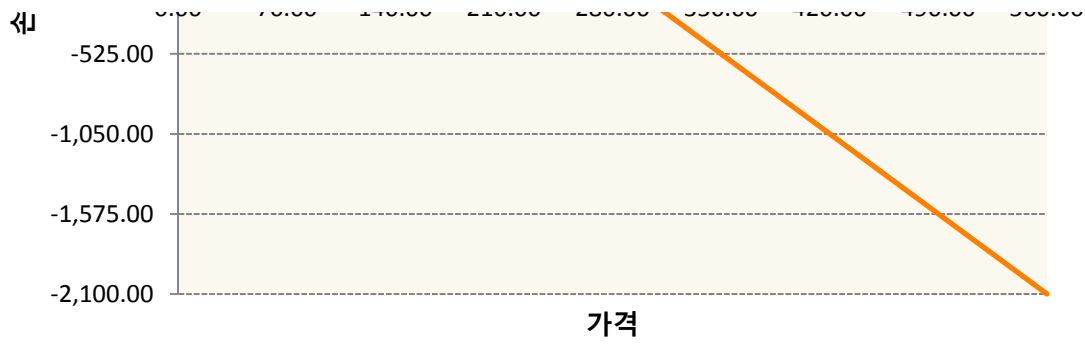
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

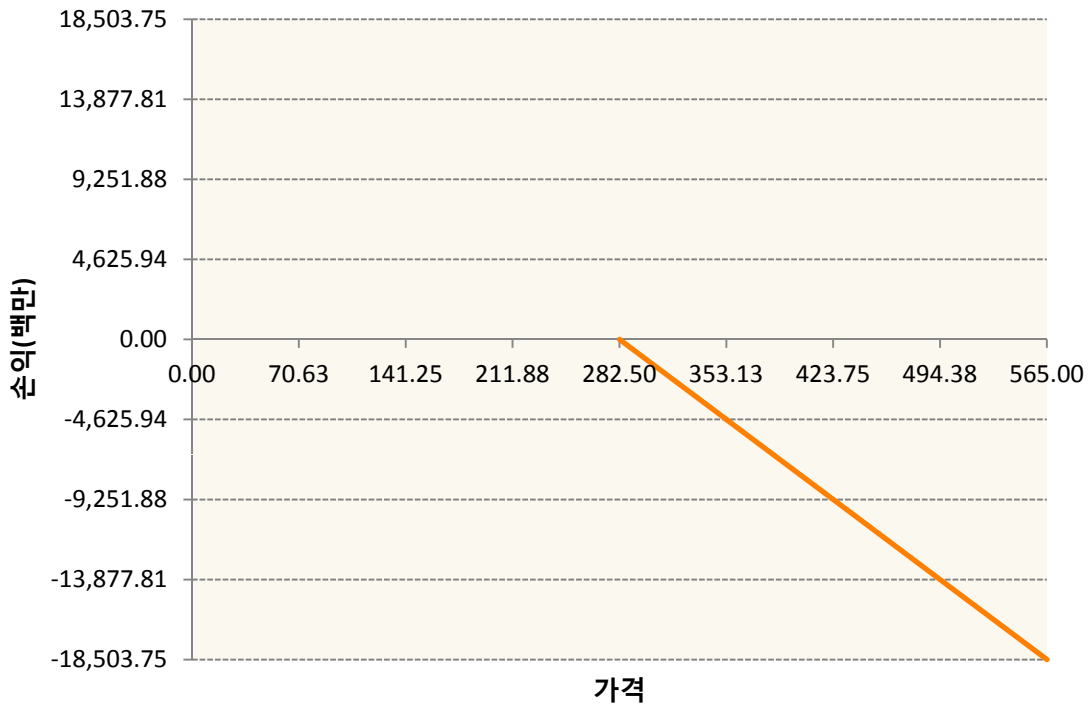


KR4201PB2800-2019-11 콜280

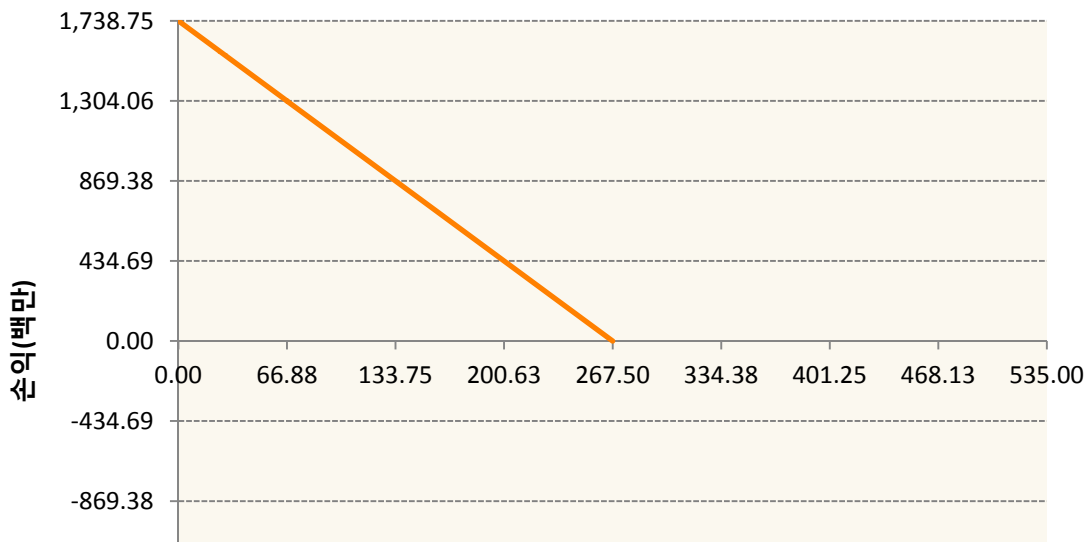


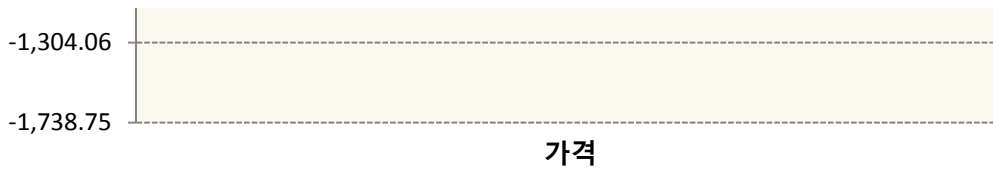


KR4201PB2826-2019-11 콜282.5

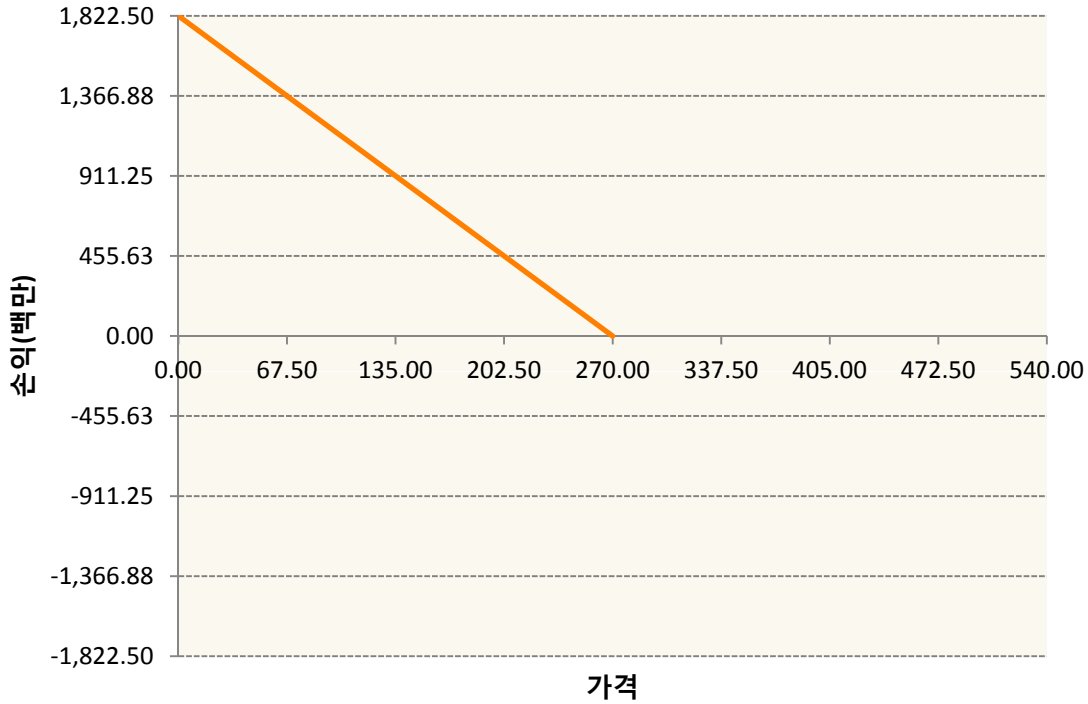


KR4301PB2676-2019-11 풋267.5





**KR4301PB2700-2019-11 풋270**



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

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						882
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-882	-882	-882	-882	-882	-882	-882	
-5.33%	-588	-588	-588	-588	-588	-588	-588	
-2.67%	-294	-294	-294	-294	-294	-294	-294	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	294	294	294	294	294	294	294	
5.33%	588	588	588	588	588	588	588	
8.00%	882	882	882	882	882	882	882	
KR4201PB2800		2019-11 콜280						116
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	31	31	30	29	29	28	26	
-5.33%	30	29	27	26	24	22	20	
-2.67%	24	22	20	17	14	11	8	

0%	11	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	-15	-19	-23	-27	-31	-35	-38
5.33%	-55	-57	-60	-64	-67	-70	-74
8.00%	-103	-104	-106	-108	-111	-113	-116
KR4201PB2826                      2019-11 콜282.5							940
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	214	213	210	206	200	193	184
-5.33%	207	201	193	182	169	155	139
-2.67%	178	161	143	122	100	76	52
0%	88	60	30	0	-31	-62	-93
2.67%	-102	-136	-170	-204	-239	-273	-307
5.33%	-407	-436	-466	-497	-528	-560	-592
8.00%	-805	-823	-843	-865	-888	-913	-940
KR4301PB2676                      2019-11 풋267.5							90
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	88	88	88	89	89	89	90
-5.33%	42	43	44	45	46	47	48
-2.67%	9	10	12	14	15	17	18
0%	-2	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-2
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
KR4301PB2700                      2019-11 풋270							106
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	105	105	105	105	106	106	106
-5.33%	56	57	57	58	59	60	61
-2.67%	15	17	18	20	22	23	25
0%	-3	-2	-1	0	1	3	4
2.67%	-7	-6	-6	-6	-5	-5	-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)

**1,752**

공시일	2019-10-31
기준일	2019-10-30

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,920	0	2,920	
누계	유가증권	수익증권	162,707	0	162,707	

### 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	2019-10-31
기준일	2019-10-30

## 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	207,306	0	207,306	

### 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	2019-10-31
기준일	2019-10-30

## 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	417,856	0	417,856	
누계	통화	선도	0	500,064	-500,064	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		1,869
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E		1,962
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E		934
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		654
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E		1,533
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		692
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,682
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		2,467
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		467
FX21019V02 KRW/USD 21-11-19E		5,084
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,766
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,402
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,803
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,505
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,841
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		934
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		934
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,869
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,869
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		934
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		934
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		934
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		934

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

(단위:백만원)

12,734

공시일	2019-10-31
기준일	2019-10-30

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

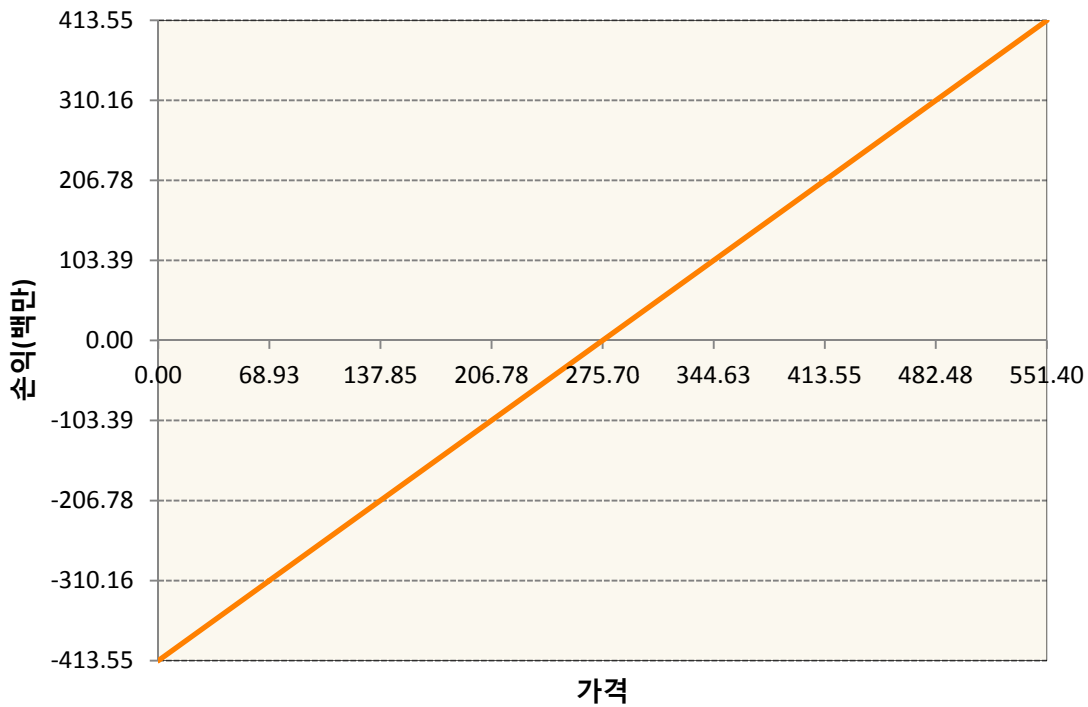
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

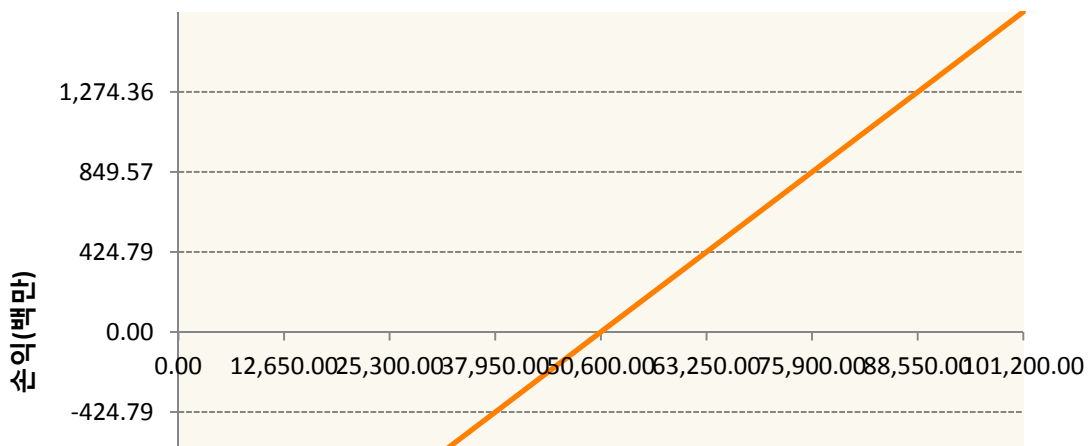
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,113	0	2,113	장내

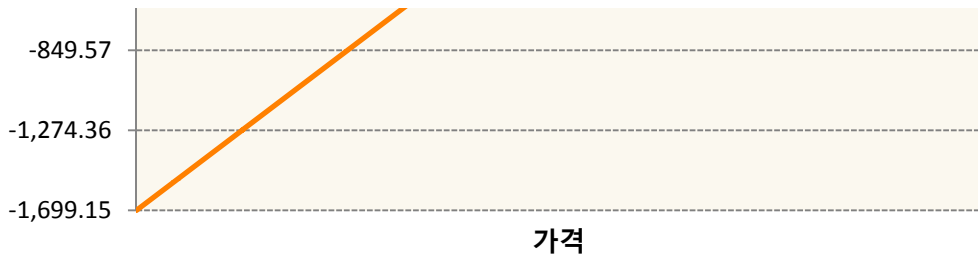
### 2. 만기시점의 손익구조

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						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)

**181**

공시일	2019-10-31
기준일	2019-10-30

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

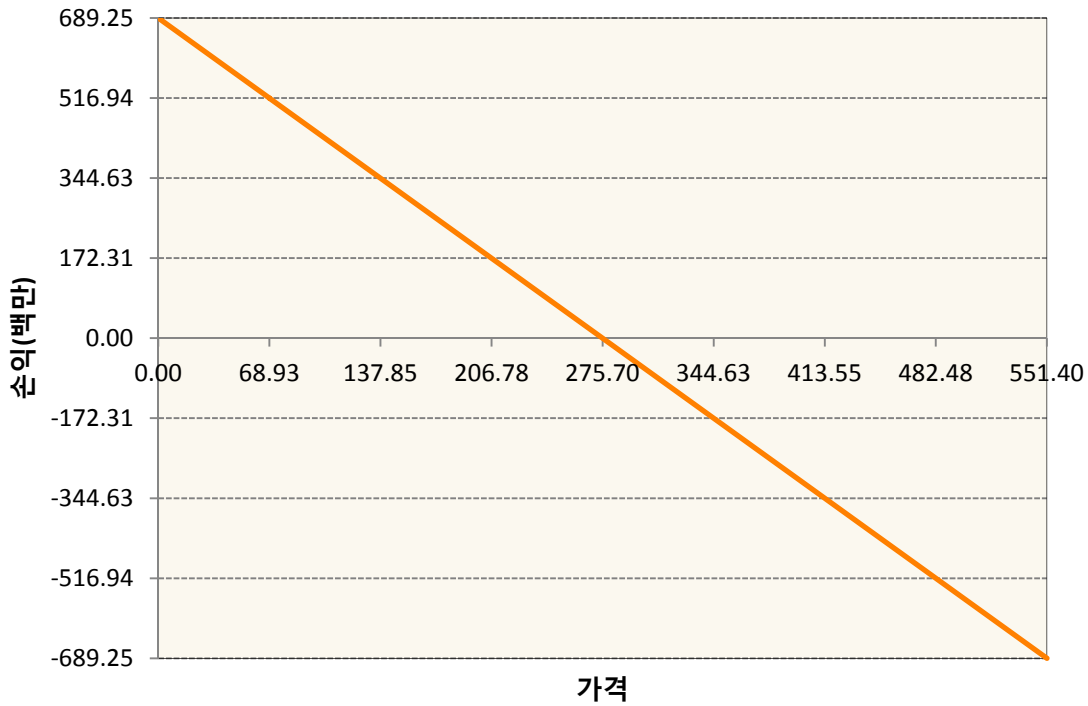
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

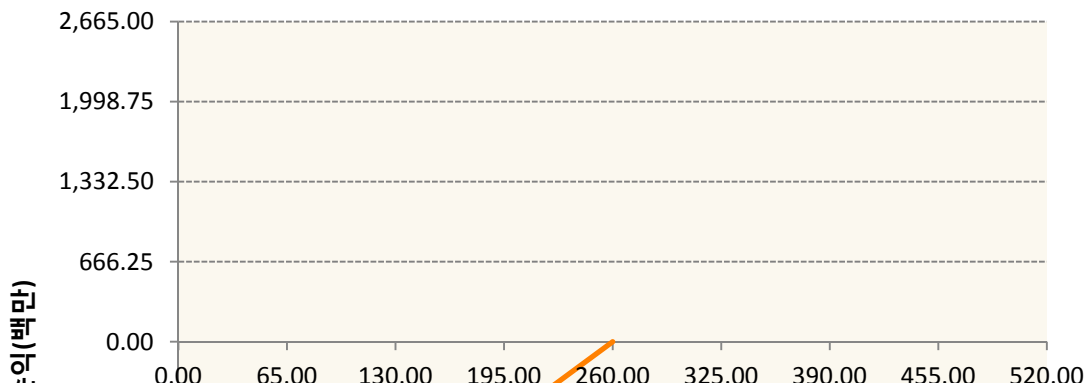
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	689	-689	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,715	-3,715	장내

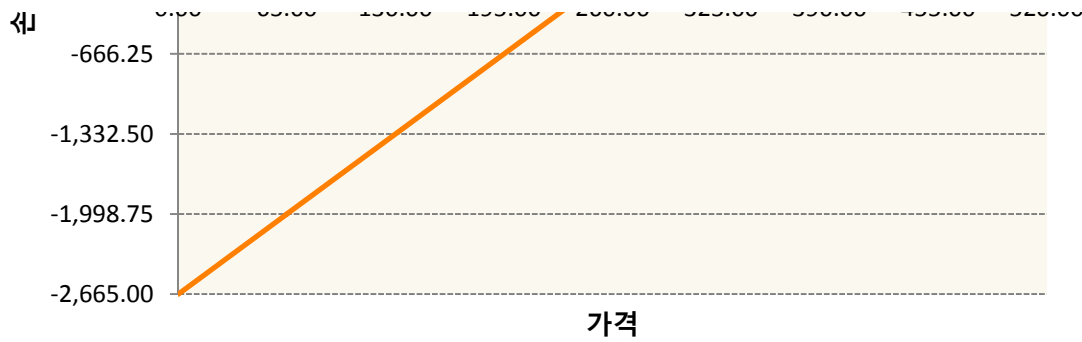
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

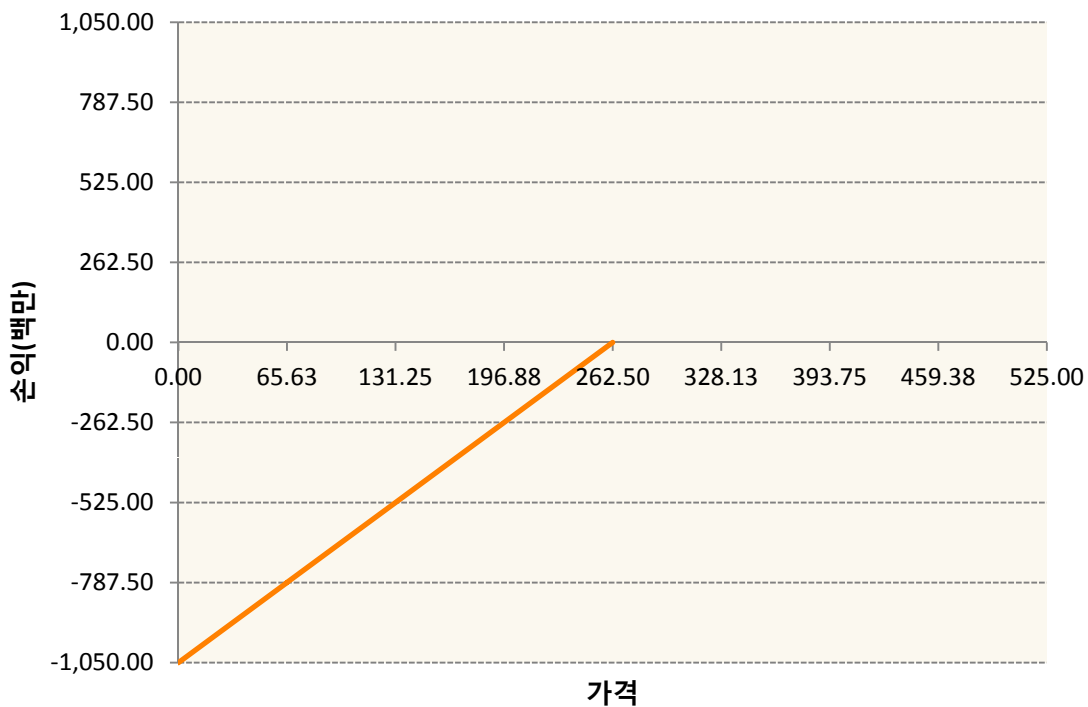


KR4301PB2601-2019-11 풋260





KR4301PB2627-2019-11 풋262.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						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						79
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-70	-71	-72	-74	-75	-77	-79
-5.33%	-18	-20	-22	-25	-27	-30	-32
-2.67%	-1	-2	-3	-4	-6	-7	-9
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

39

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-36	-37	-37	-37	-38	-38	-39
-5.33%	-12	-13	-14	-15	-16	-17	-18
-2.67%	-1	-2	-2	-3	-4	-5	-5
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

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

(단위:백만원)

90

공시일	2019-10-31
기준일	2019-10-30

## H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	263	-263	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	16,075	0	16,075	
누계	통화	선도	234	16,073	-15,839	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019V01 KRW/USD 10-12-19E		370
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		318
FX21019V02 KRW/USD 13-11-19E		280
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		318
FX21019V04 USD/KRW 13-11-19E		19

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

(단위:백만원)

415
-----

공시일	2019-10-31
기준일	2019-10-30

## 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	689	0	689	장외
누계	통화	선도	201	240	-39	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	37
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	2019-10-31
기준일	2019-10-30

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

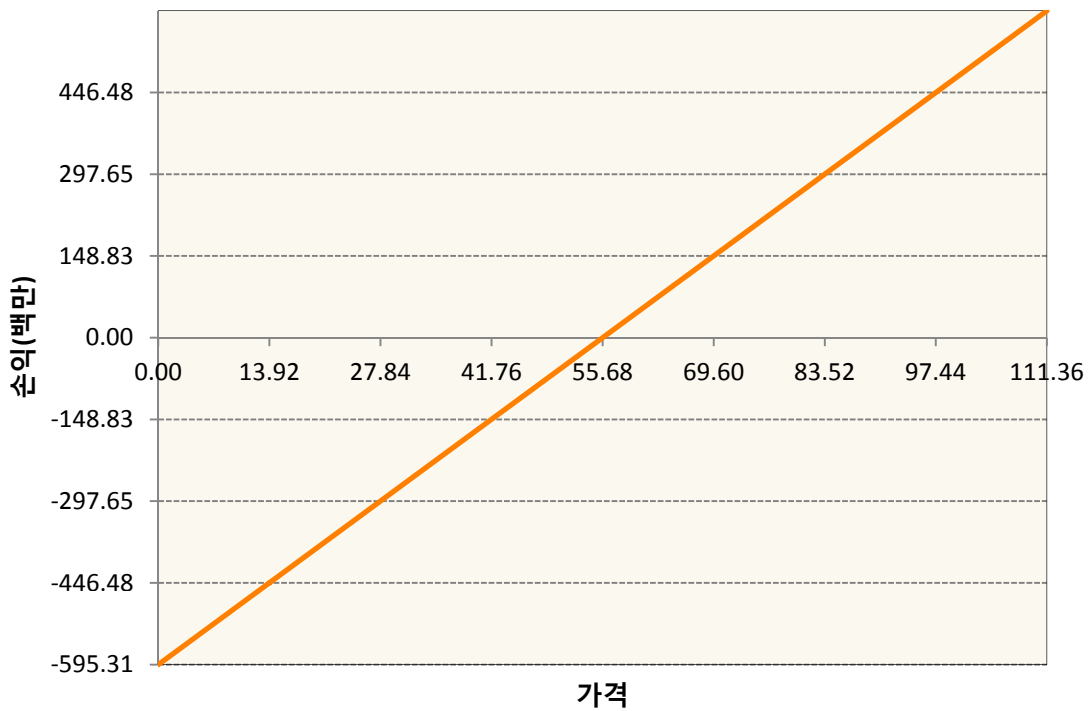
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

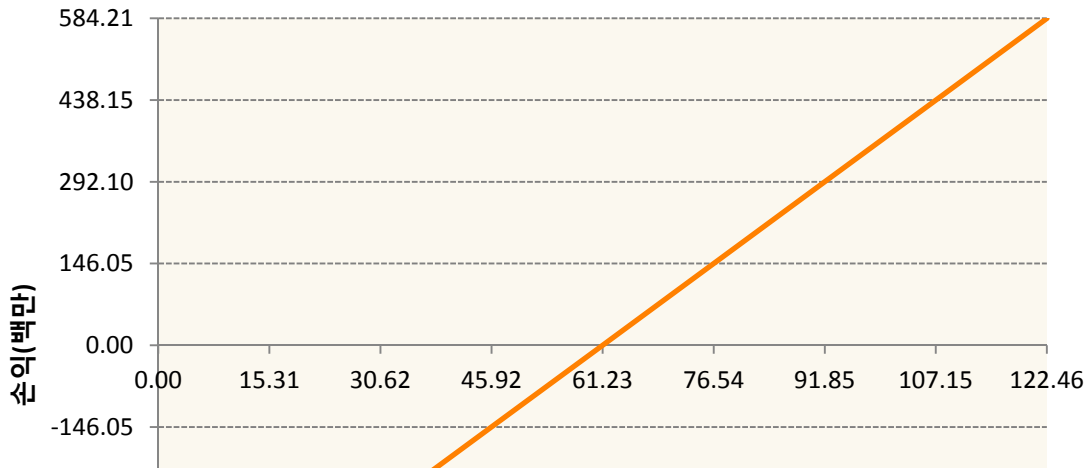
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,503	292	2,211	

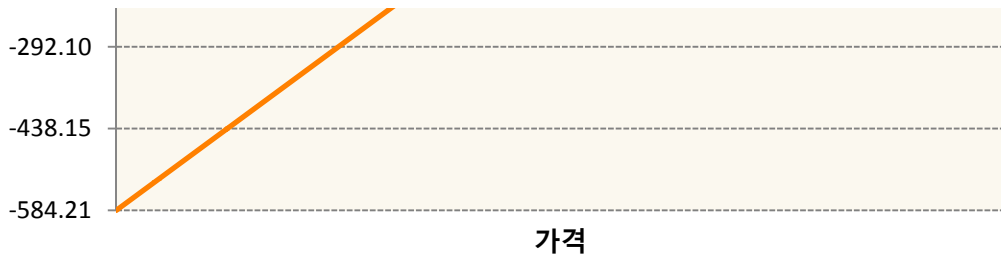
### 2. 만기시점의 손익구조

CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20

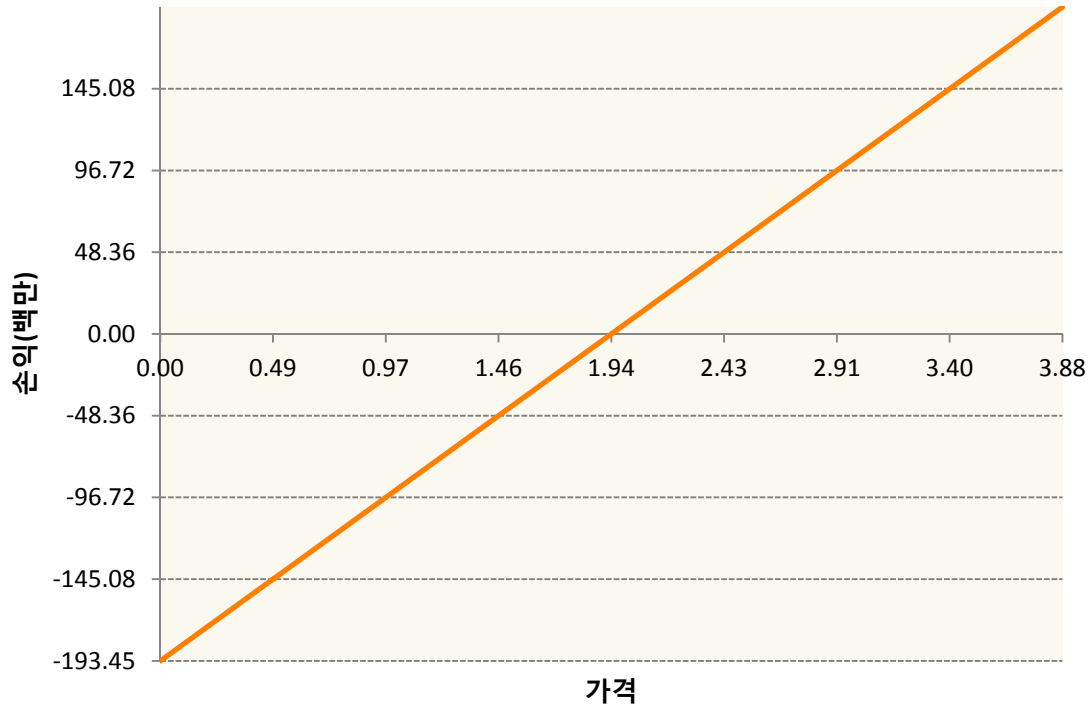


COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20

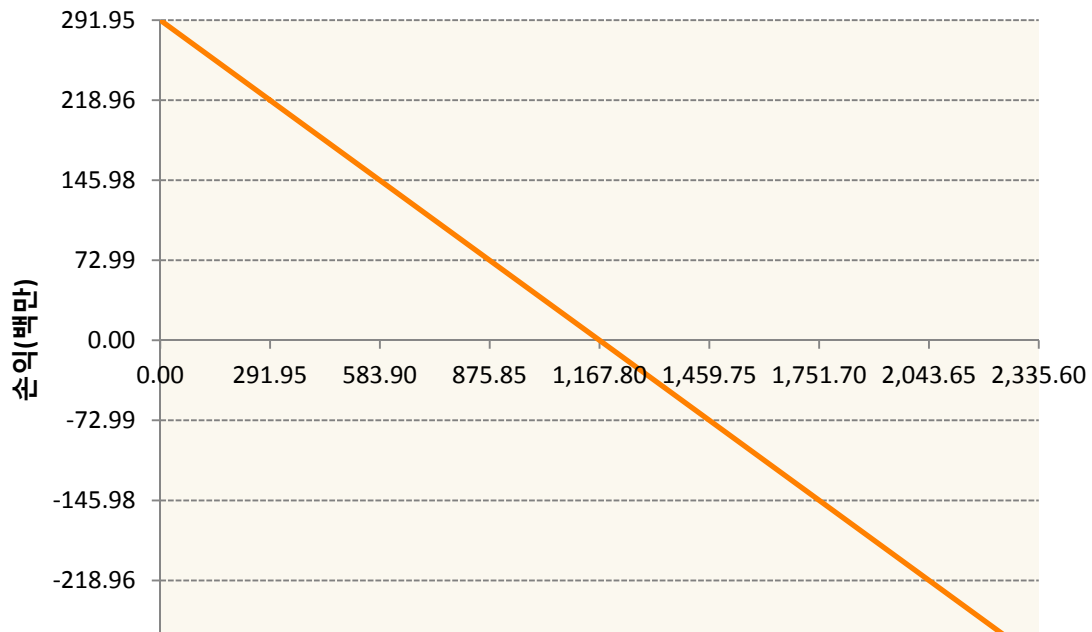


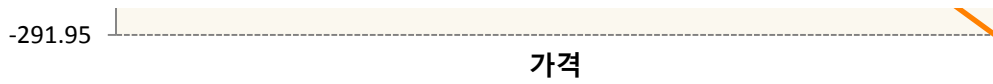


HOF0-NY Harb ULSD Fut Jan20

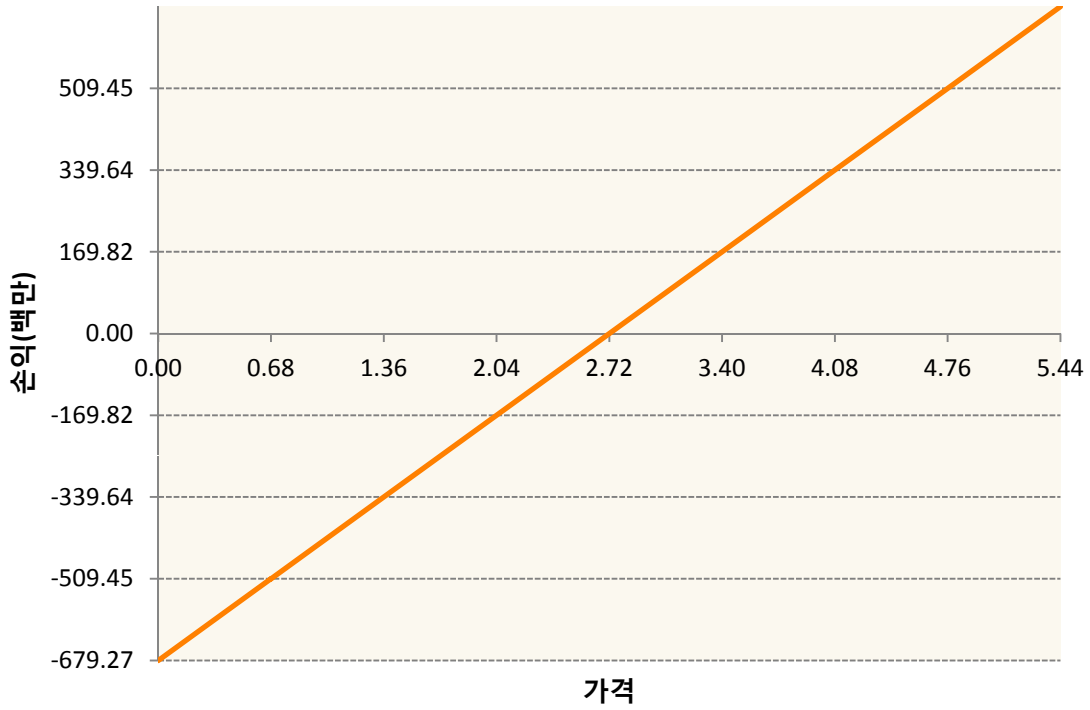


KR4175PB0004-2019-11 달러선물

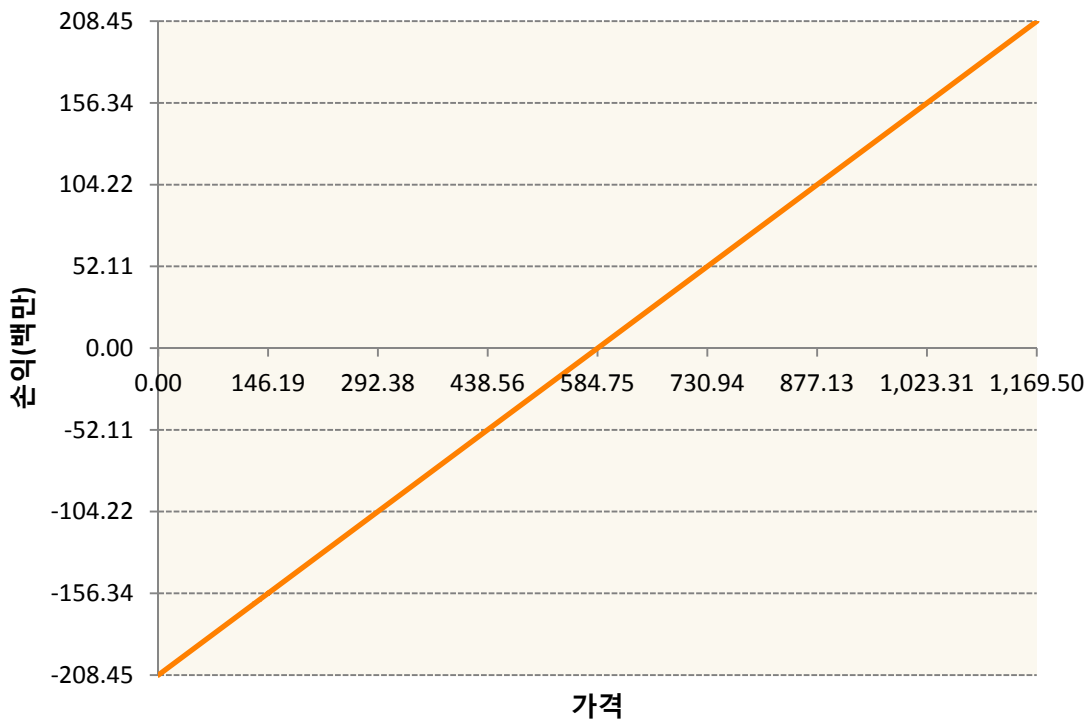




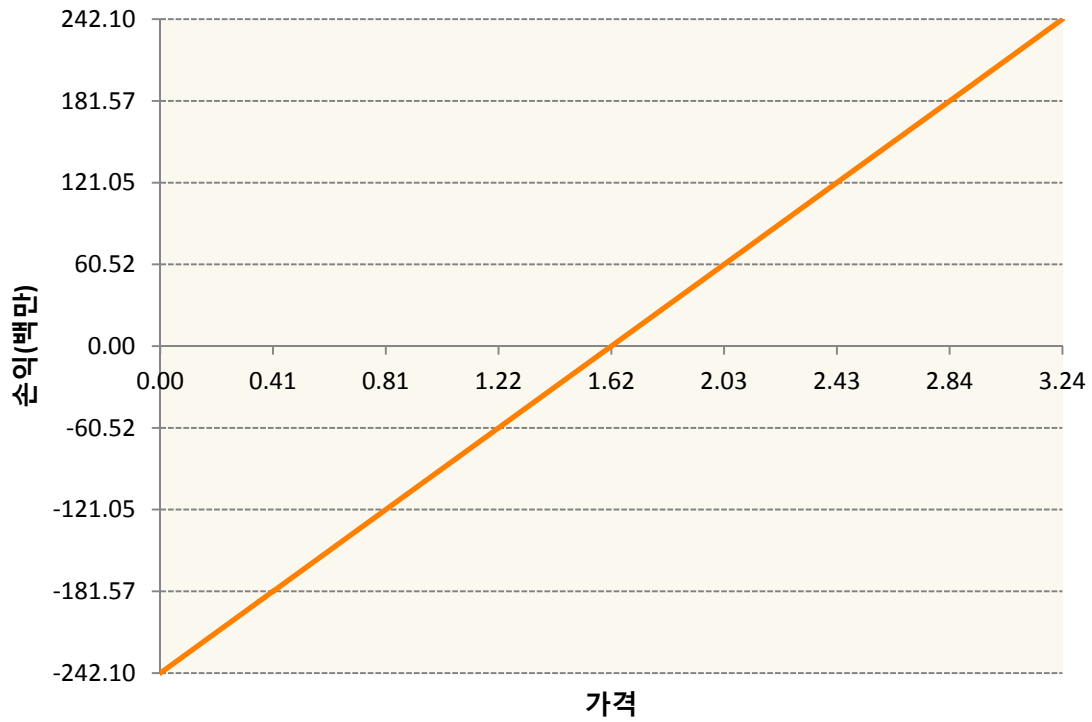
NGF20-NATURAL GAS FUTR Jan20



QSF0-Low Su Gasoil G Jan20



XBF0-GASOLINE RBOB FUT Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLF0	WTI CRUDE FUTURE Jan20	48
COF0	BRENT CRUDE FUTR Jan20	47
HOF0	NY Harb ULSD Fut Jan20	15
KR4175PB00	2019-11 달러선물	23
NGF20	NATURAL GAS FUTR Jan20	54
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	17
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	19

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

(단위:백만원)

417

공시일	2019-10-31
기준일	2019-10-30

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

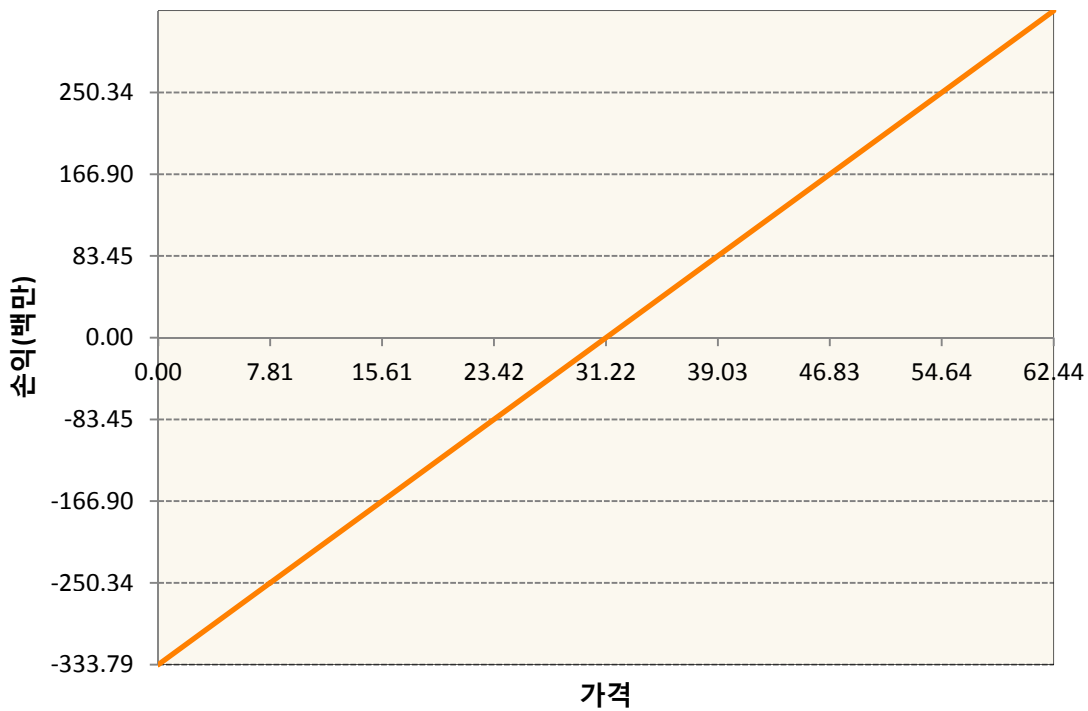
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

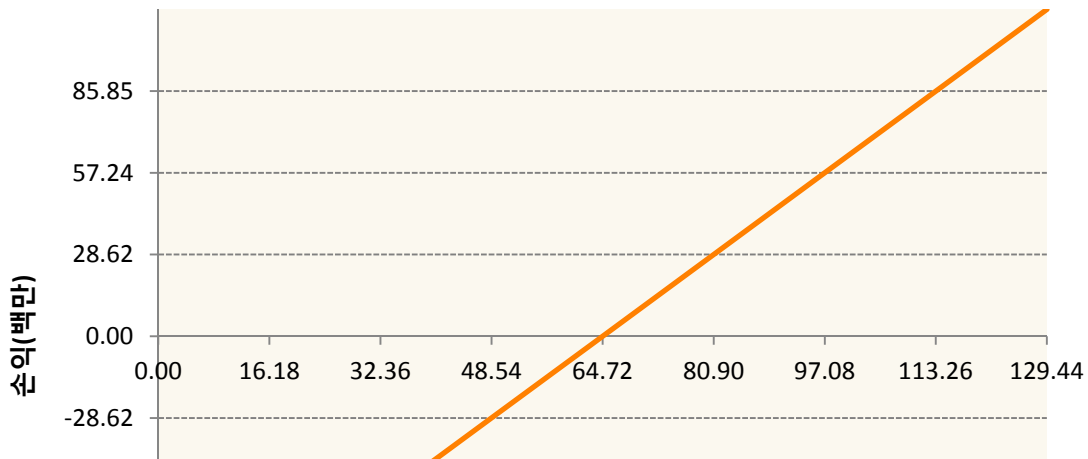
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,858	93	2,764	

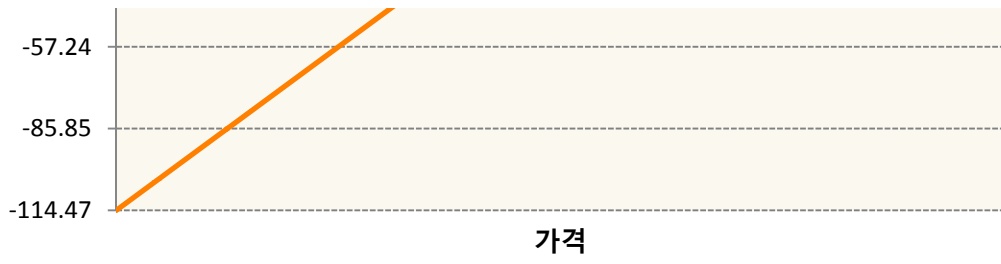
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20**

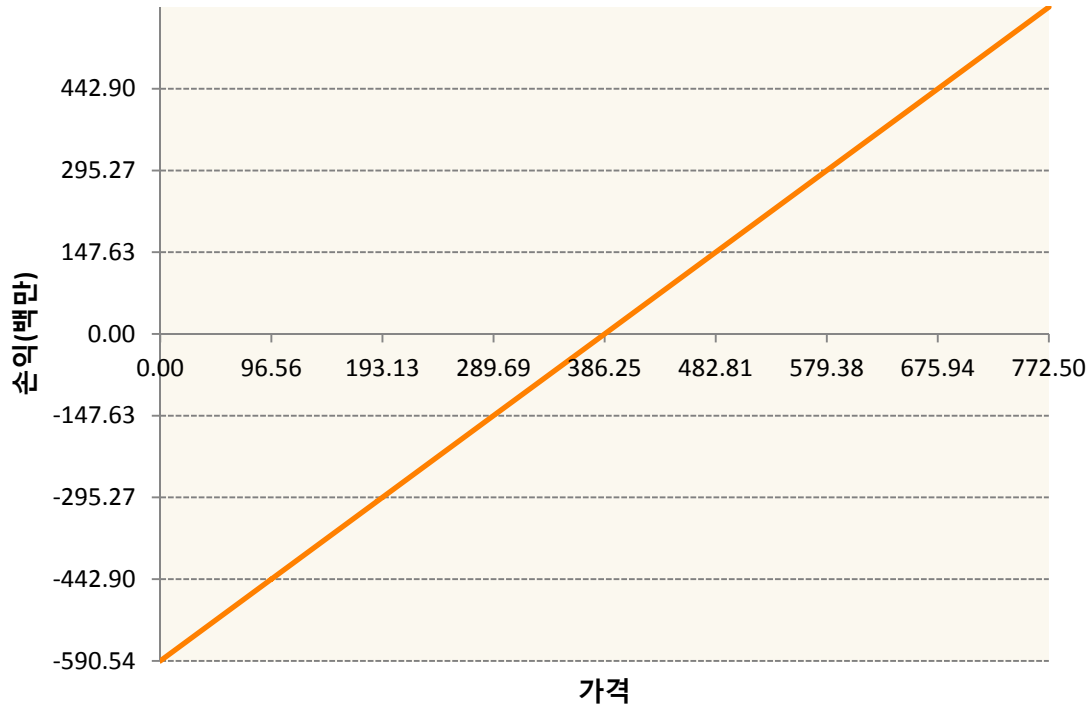


**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**

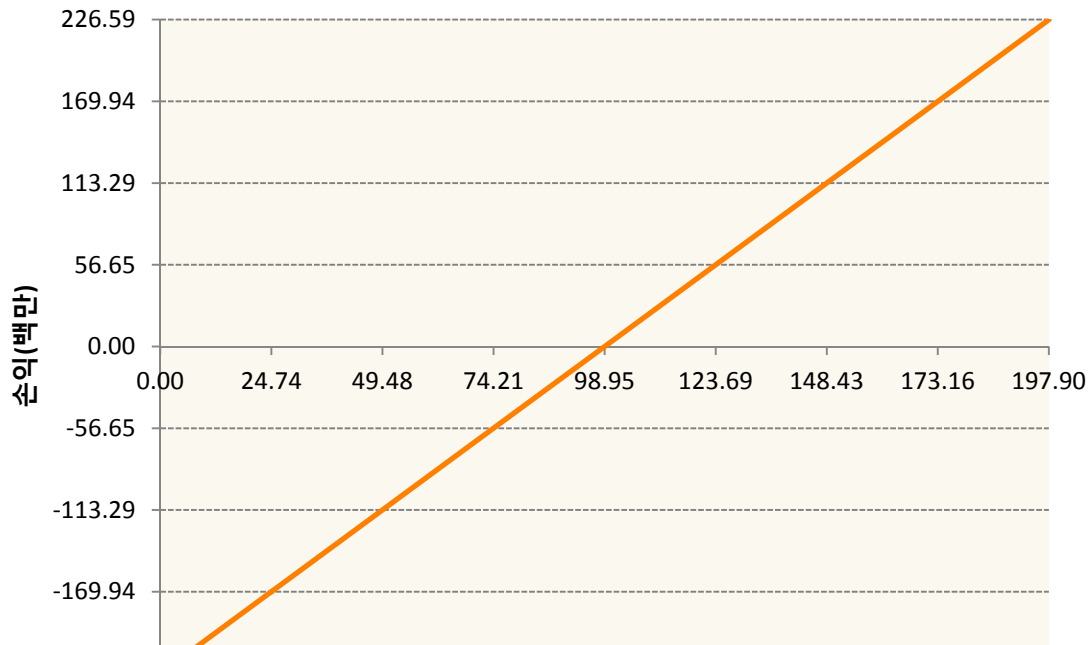


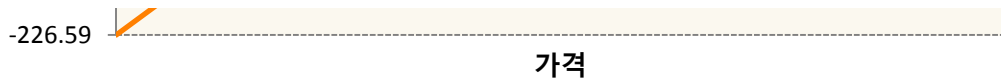


**CZ9-CORN FUTURE Dec19**

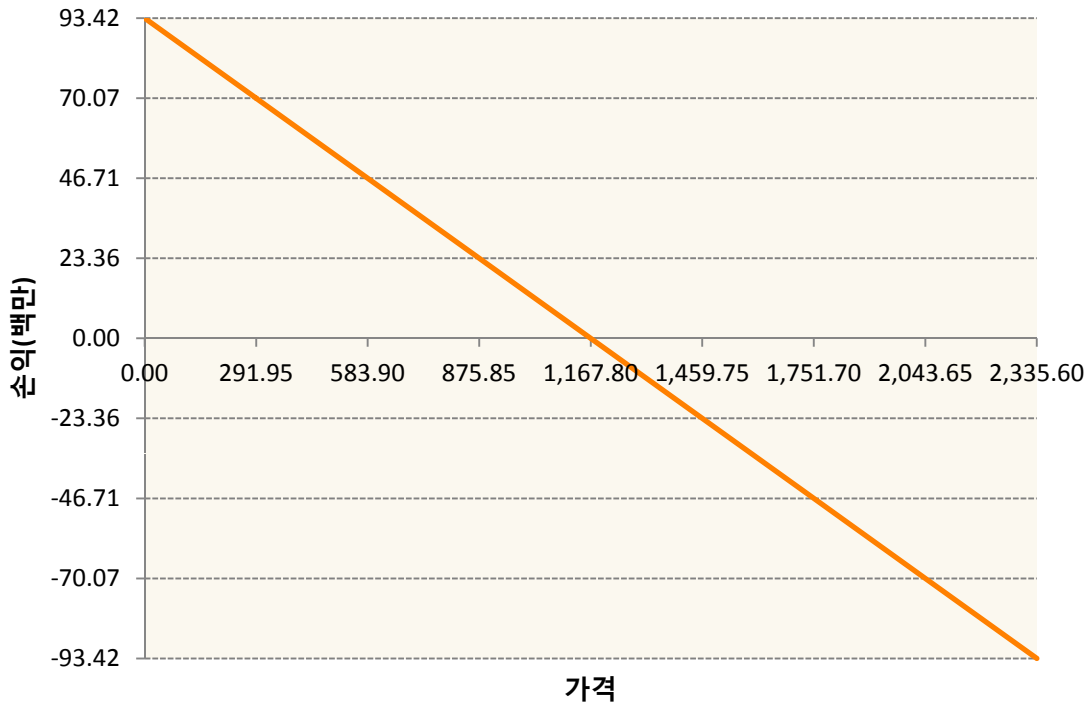


**KCZ9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19**

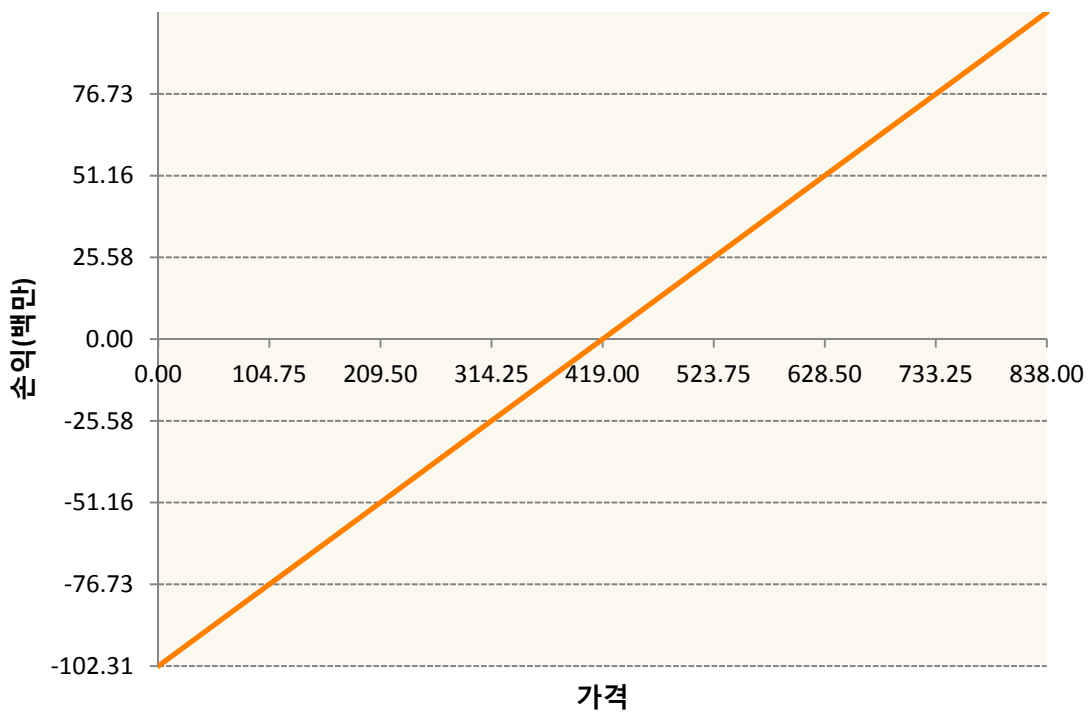




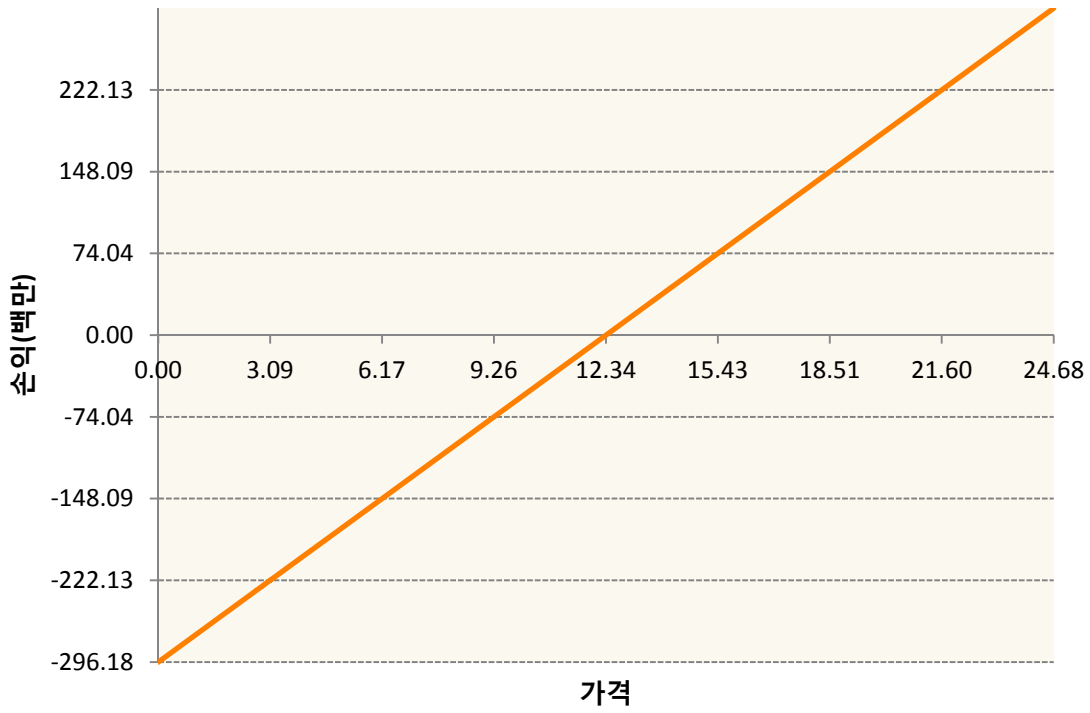
KR4175PB0004-2019-11 달러선물



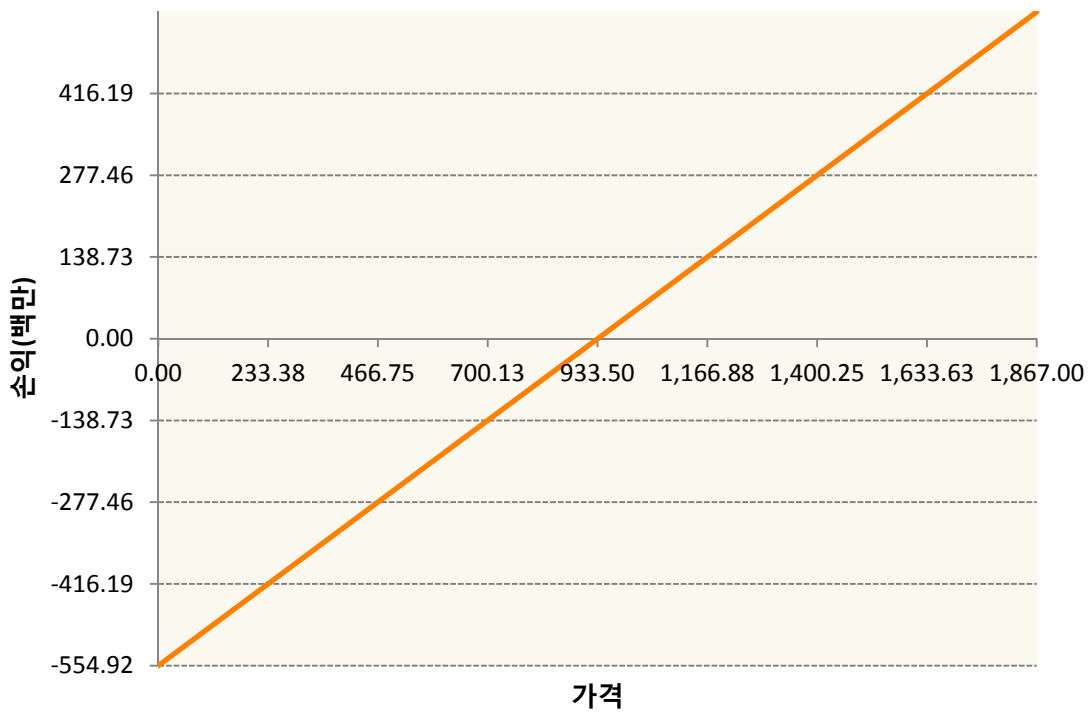
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



SBH0-Sugar Mar20

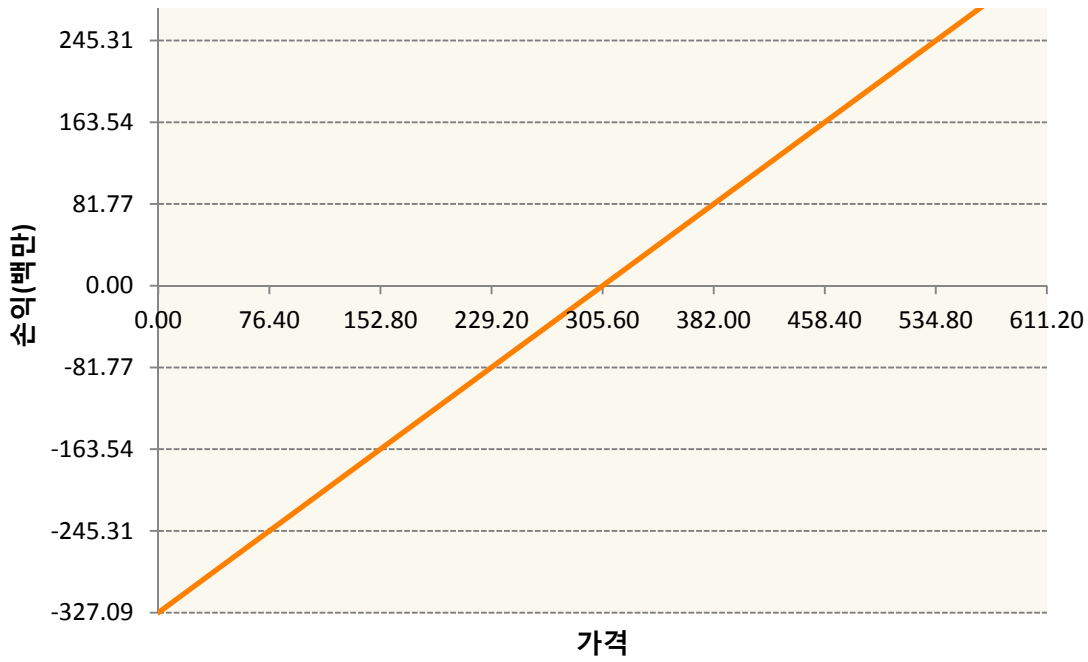


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20

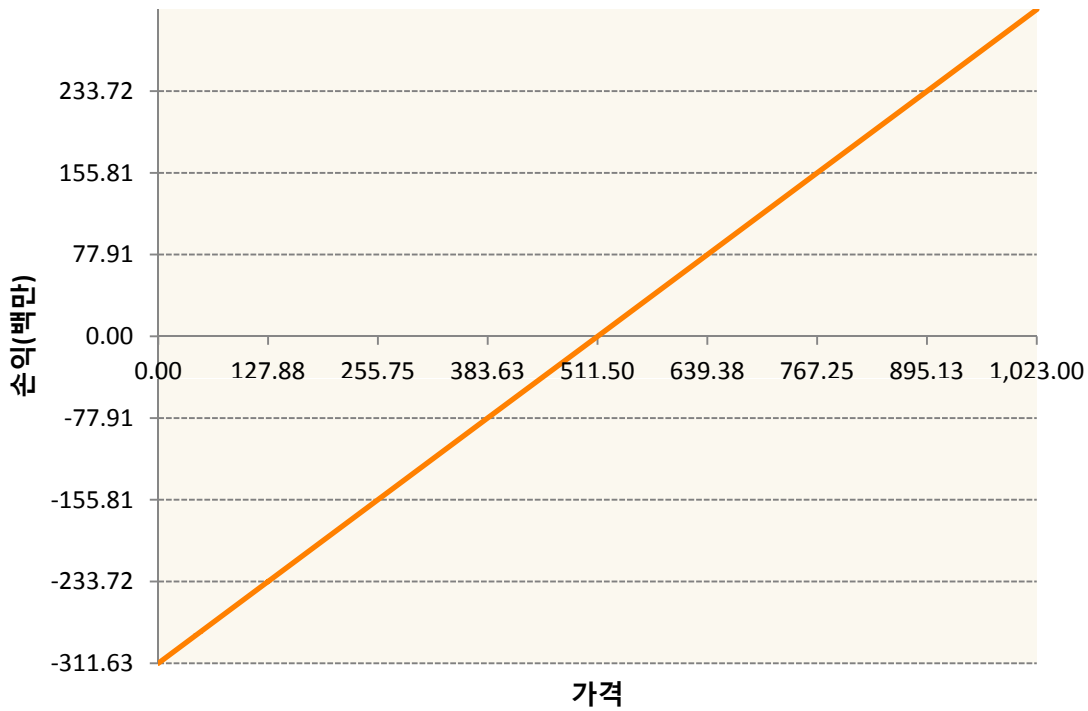


SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





WZ9-WHEAT FUTURE(CBT) Dec19



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)

**254**