

공시일	2019-10-28
기준일	2019-10-25

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	2019-10-28
기준일	2019-10-25

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

1,190

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

691

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-28
기준일	2019-10-25

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)	139

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

769

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-10-28
기준일	2019-10-25

유로인덱스모(주식-파생형)

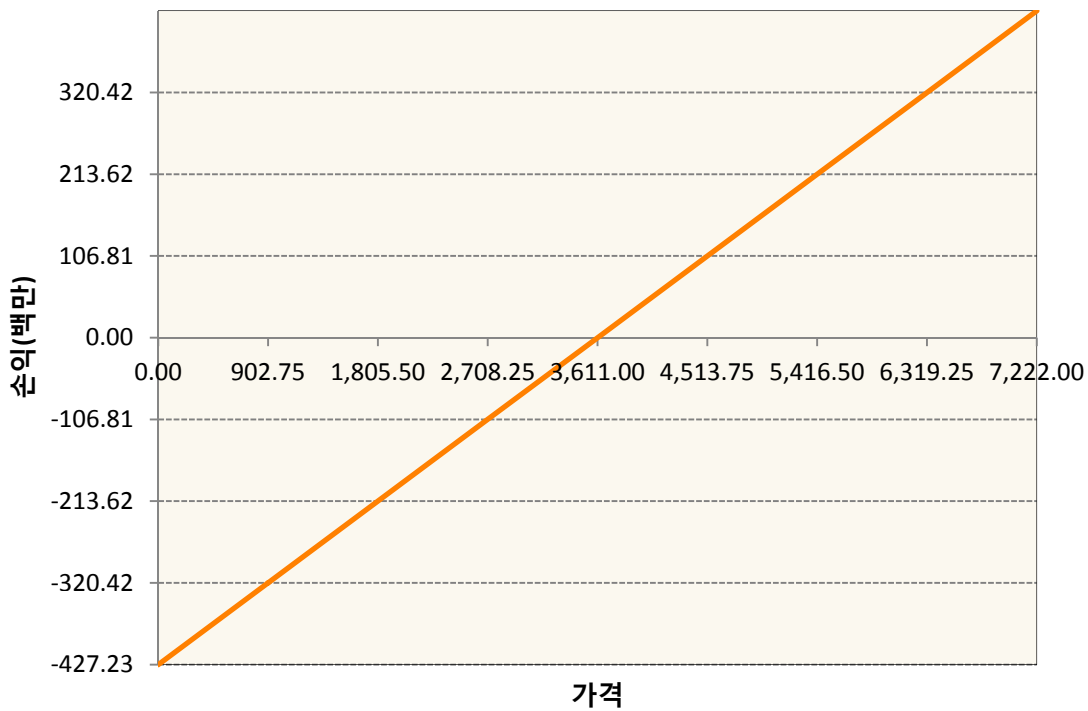
1. 계약금액

(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	2019-10-28
기준일	2019-10-25

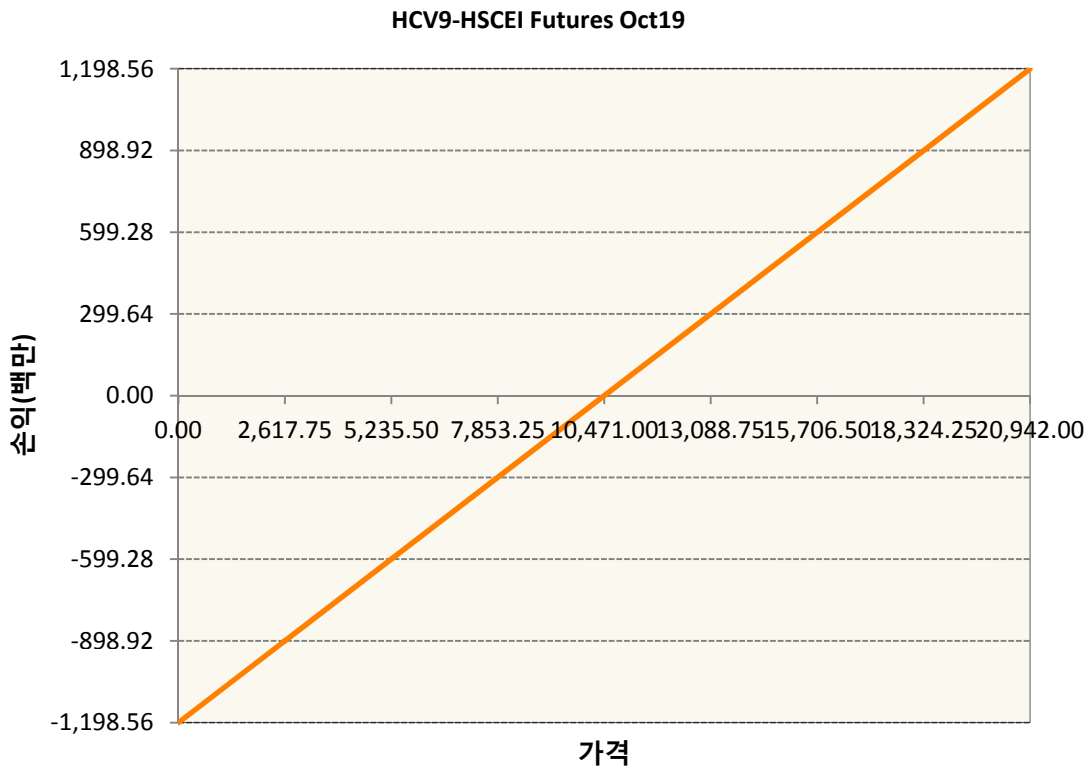
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,199	0	1,199	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	2019-10-28
기준일	2019-10-25

커버드콜모(주식혼합-파생형)

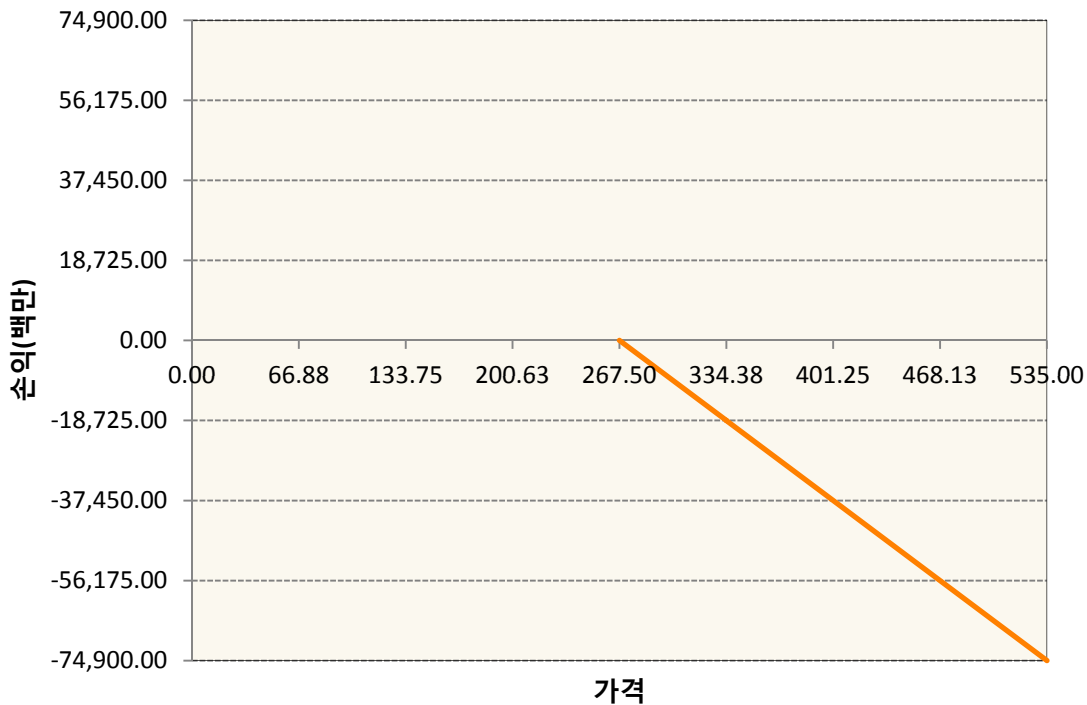
1. 계약금액

(단위:백만원)

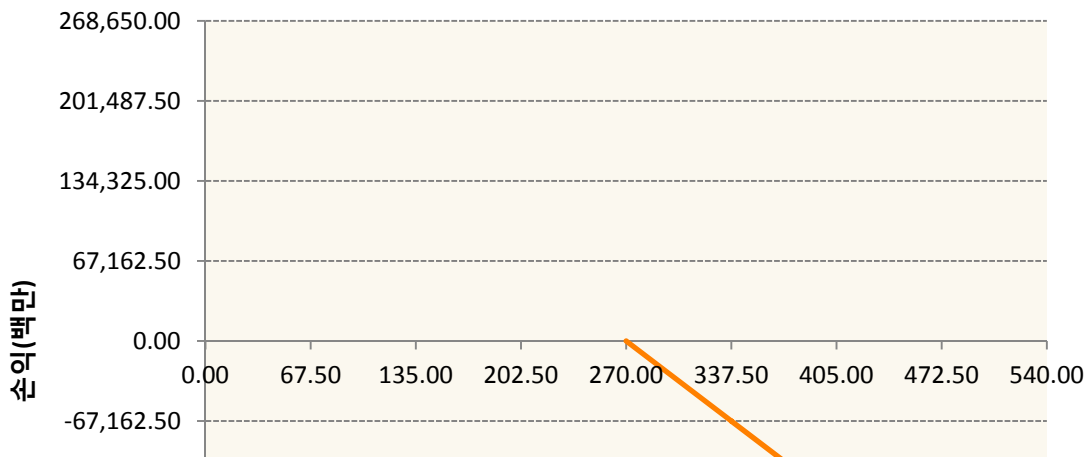
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	504,050	-504,050	장내

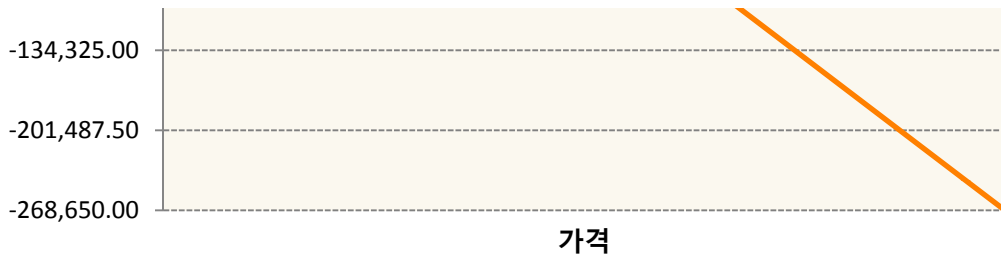
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PB2677-2019-11 콜267.5

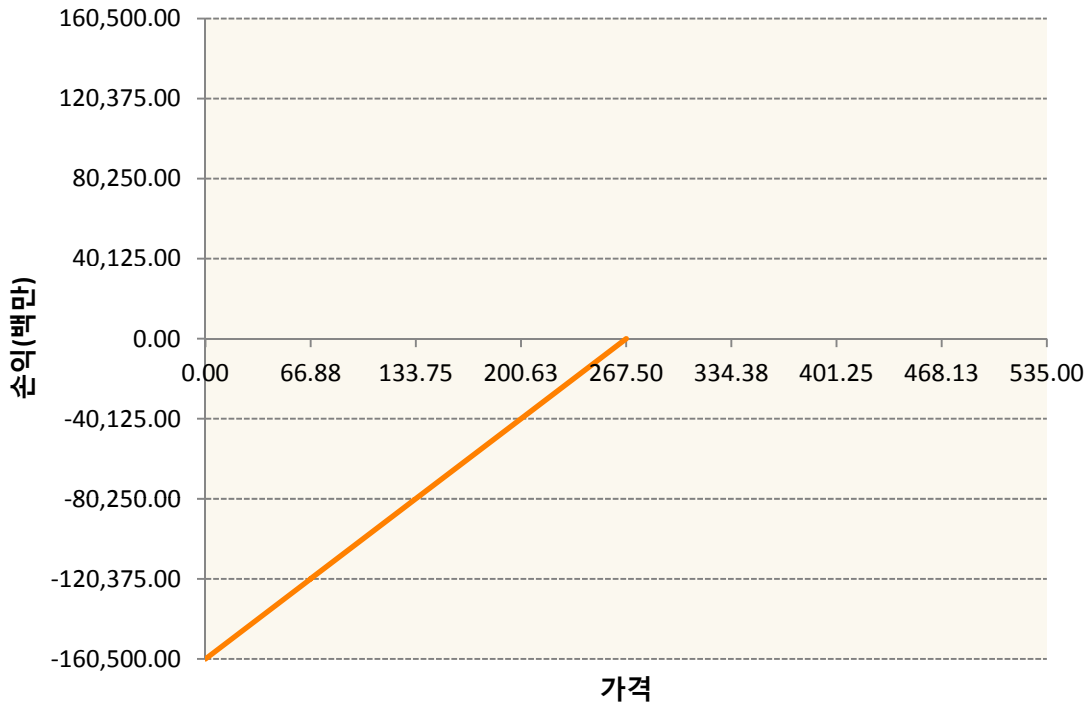


KR4201PB2701-2019-11 콜270





KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PB2677		2019-11 콜267.5					5,525
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,269	3,169	3,061	2,946	2,825	2,700	2,571
-5.33%	2,752	2,605	2,456	2,305	2,153	1,999	1,846
-2.67%	1,802	1,643	1,483	1,323	1,163	1,002	842
0%	405	275	140	0	-143	-289	-437
2.67%	-1,334	-1,415	-1,508	-1,610	-1,719	-1,836	-1,958
5.33%	-3,271	-3,311	-3,363	-3,426	-3,499	-3,581	-3,672
8.00%	-5,295	-5,311	-5,335	-5,369	-5,412	-5,464	-5,525
KR4201PB2701		2019-11 콜270					19,054
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,283	9,989	9,658	9,297	8,911	8,504	8,079

-5.33%	8,859	8,377	7,881	7,374	6,858	6,335	5,806
-2.67%	6,026	5,450	4,875	4,299	3,723	3,148	2,572
0%	1,580	1,064	536	0	-543	-1,092	-1,646
2.67%	-4,232	-4,586	-4,975	-5,392	-5,832	-6,291	-6,765
5.33%	-10,915	-11,106	-11,341	-11,615	-11,924	-12,264	-12,630
8.00%	-18,027	-18,109	-18,227	-18,382	-18,572	-18,797	-19,054
KR4301PB2676 2019-11 풋267.5							7,587
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,312	-7,334	-7,366	-7,407	-7,459	-7,519	-7,587
-5.33%	-3,252	-3,369	-3,492	-3,622	-3,756	-3,894	-4,035
-2.67%	-620	-778	-937	-1,096	-1,257	-1,418	-1,580
0%	219	158	84	0	-94	-195	-304
2.67%	325	317	304	284	256	219	175
5.33%	330	329	328	326	321	314	302
8.00%	330	330	330	330	329	328	326

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

(단위:백만원)

30,949

공시일	2019-10-28
기준일	2019-10-25

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

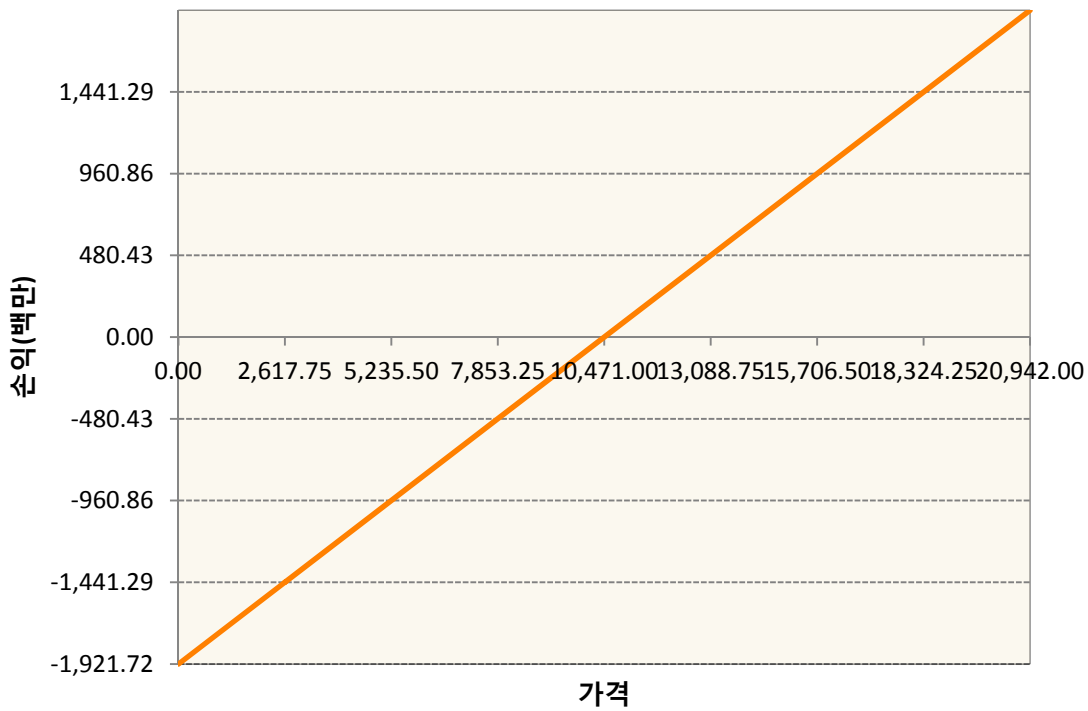
1. 계약금액

(단위:백만원)

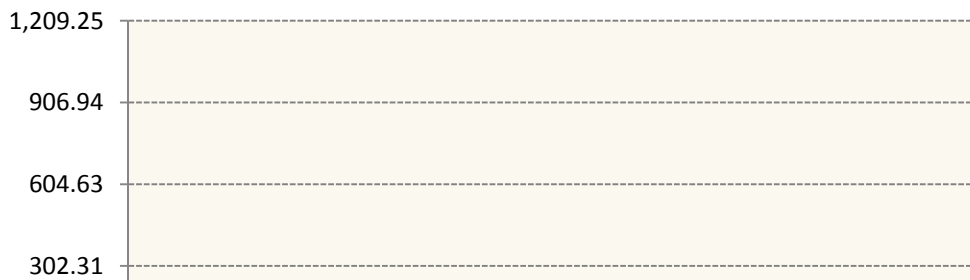
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,922	0	1,922	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,861	-4,861	장내
누계	통화	선도	673	2,781	-2,107	장외

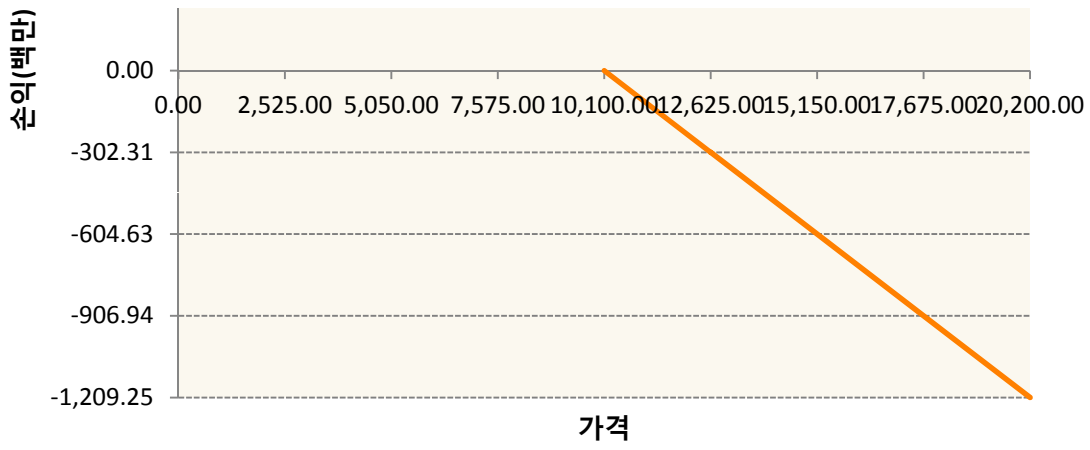
2. 만기시점의 손익구조

HCV9-HSCEI Futures Oct19

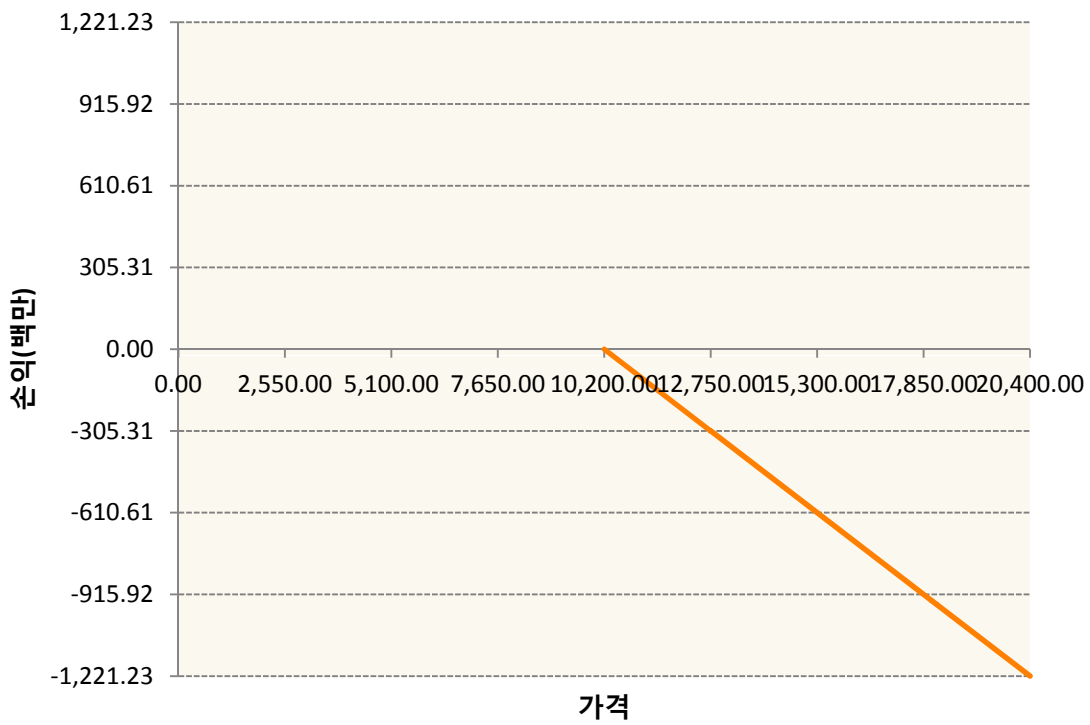


OHHIV9-C101-HSCEI

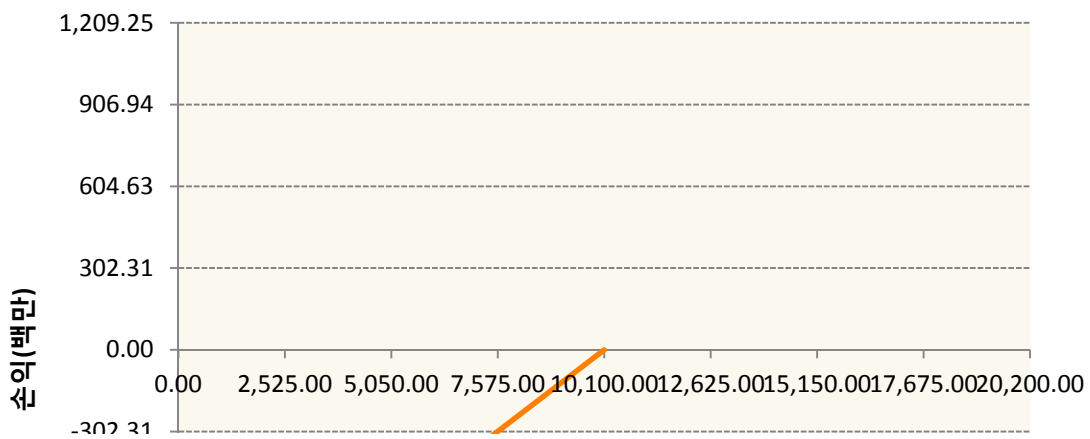


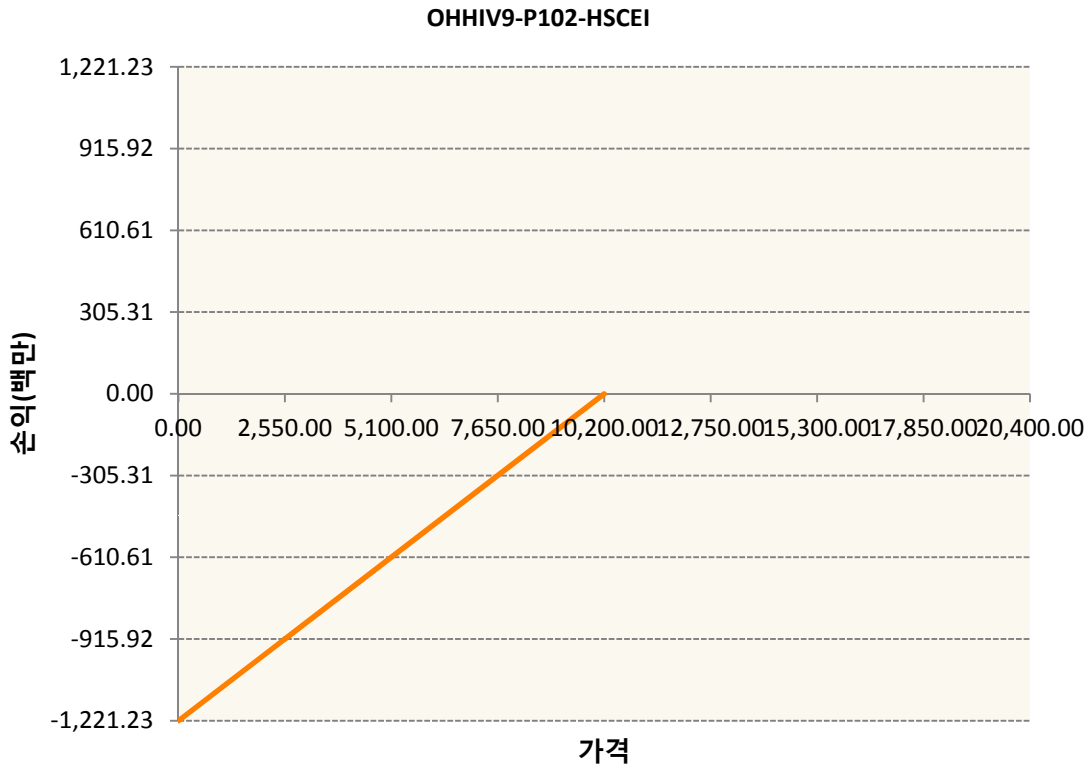


OHHIV9-C102-HSCEI



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	97
OHHIV9-C1C HSCEI	98
OHHIV9-P1C HSCEI	97
OHHIV9-P1C HSCEI	98

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

공시일	2019-10-28
기준일	2019-10-25

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

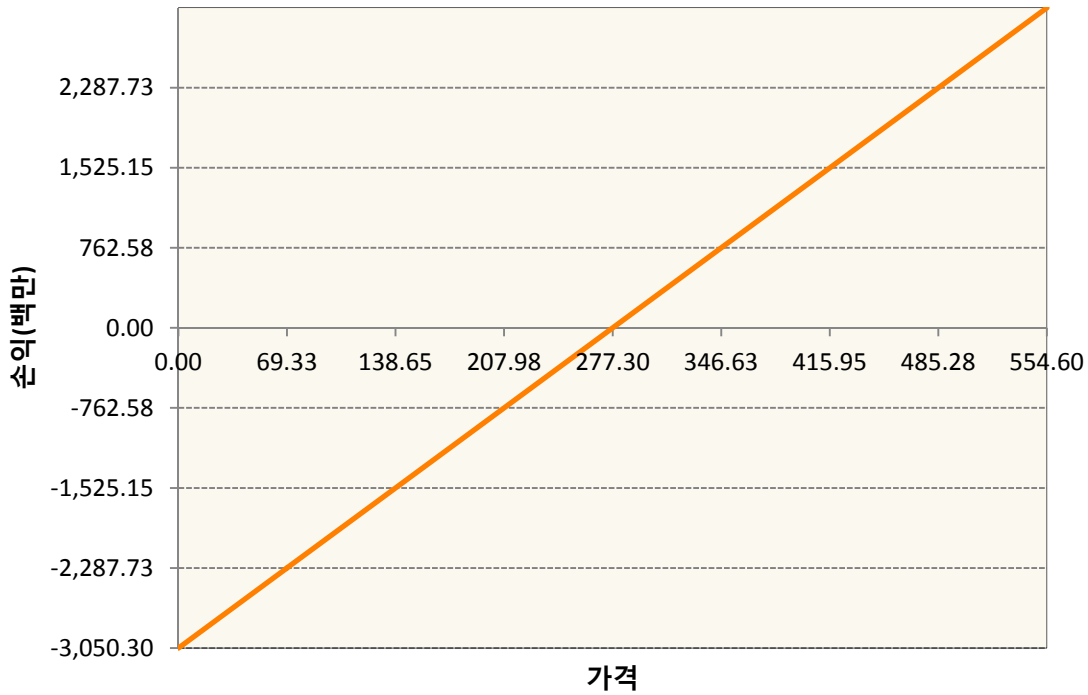
1. 계약금액

(단위:백만원)

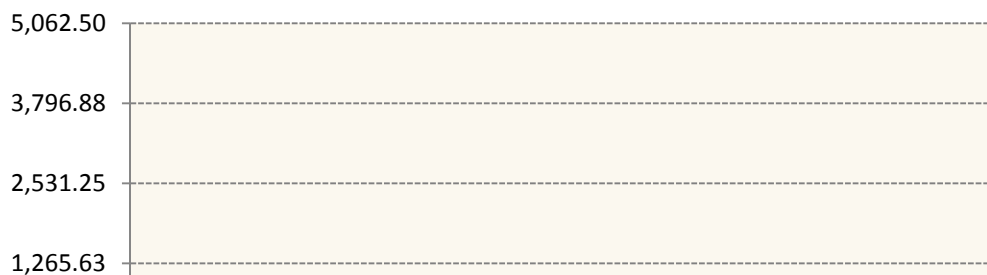
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,050	0	3,050	장내
누계	유가증권	스왑	10,625	0	10,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	10,147	-10,147	장내

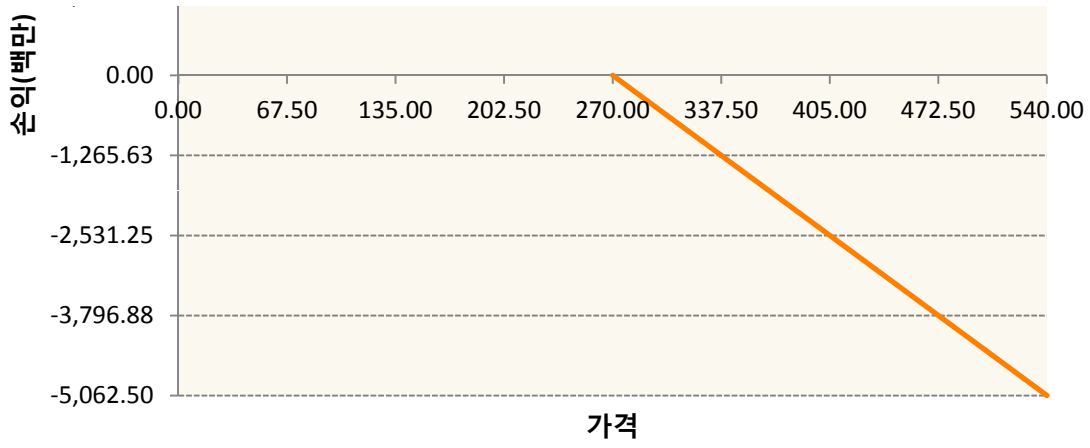
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

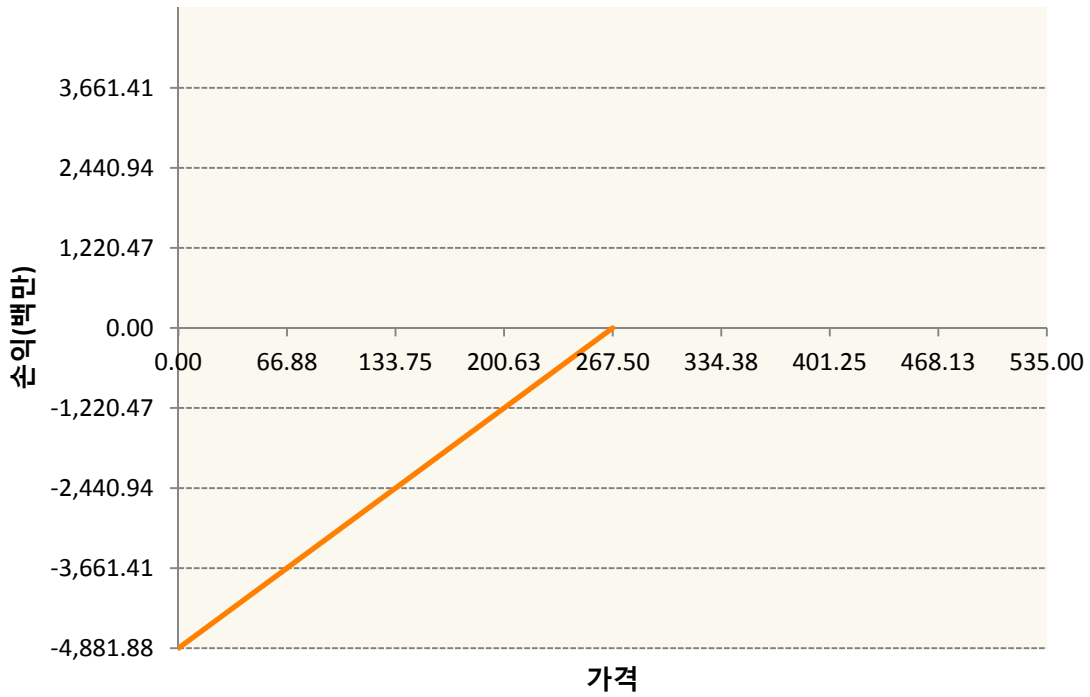


KR4201PB2701-2019-11 콜270

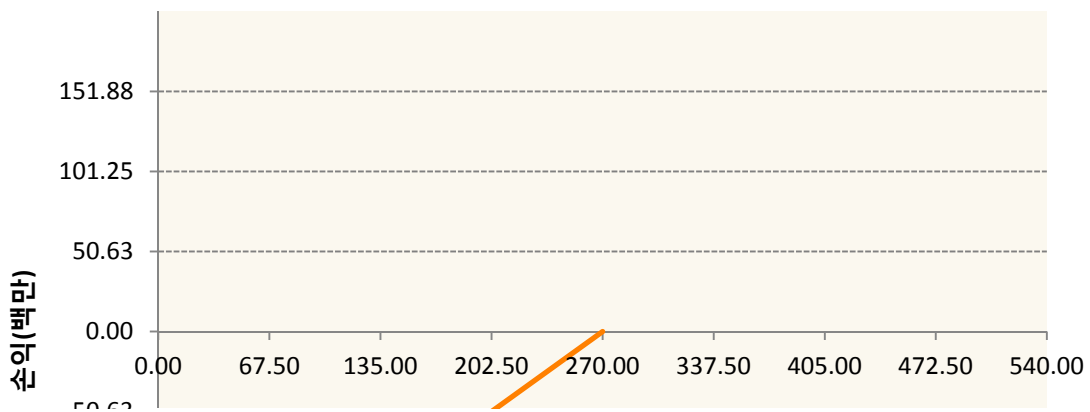




KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



KR4301PB2700-2019-11 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						914
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-914	-914	-914	-914	-914	-914	-914	
-5.33%	-609	-609	-609	-609	-609	-609	-609	
-2.67%	-305	-305	-305	-305	-305	-305	-305	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	305	305	305	305	305	305	305	
5.33%	609	609	609	609	609	609	609	
8.00%	914	914	914	914	914	914	914	
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						359
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	194	188	182	175	168	160	152	
-5.33%	167	158	149	139	129	119	109	
-2.67%	114	103	92	81	70	59	48	
0%	30	20	10	0	-10	-21	-31	
2.67%	-80	-86	-94	-102	-110	-119	-127	
5.33%	-206	-209	-214	-219	-225	-231	-238	
8.00%	-340	-341	-343	-346	-350	-354	-359	
KR4301PB2676		2019-11 풋267.5						231
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-222	-223	-224	-225	-227	-229	-231
-5.33%	-99	-102	-106	-110	-114	-118	-123
-2.67%	-19	-24	-28	-33	-38	-43	-48
0%	7	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	10	10	9	9	8	7	5
5.33%	10	10	10	10	10	10	9
8.00%	10	10	10	10	10	10	10
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	-6	-6	-6	-6	-6
-2.67%	-1	-2	-2	-2	-2	-2	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
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)

1,670

공시일	2019-10-28
기준일	2019-10-25

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

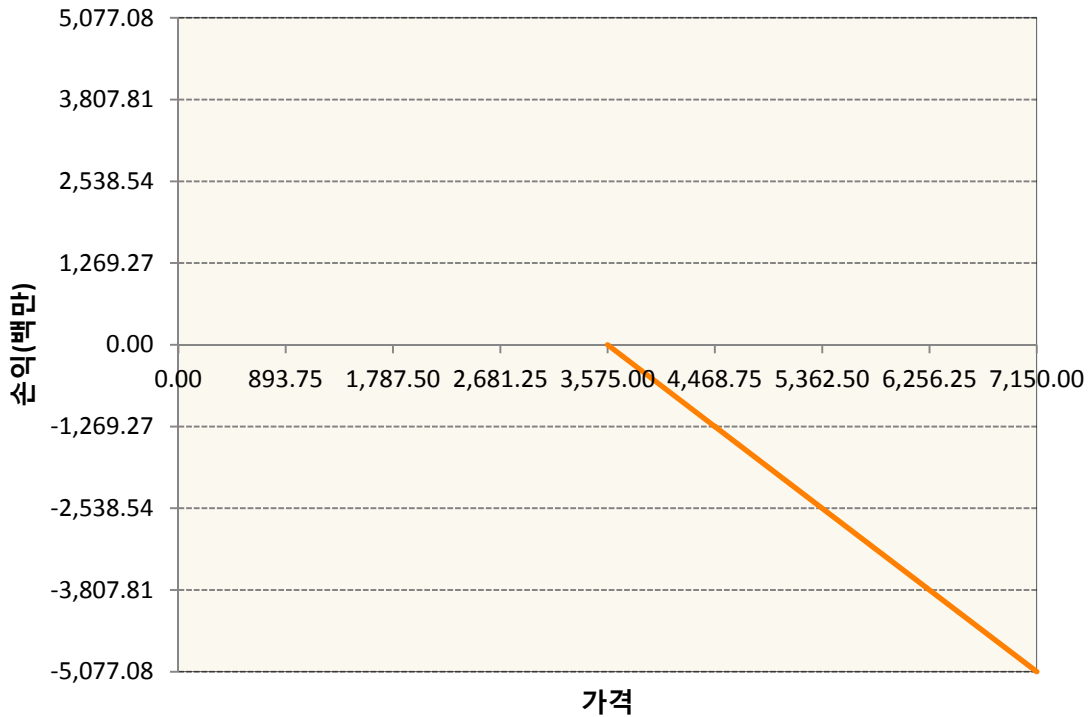
1. 계약금액

(단위:백만원)

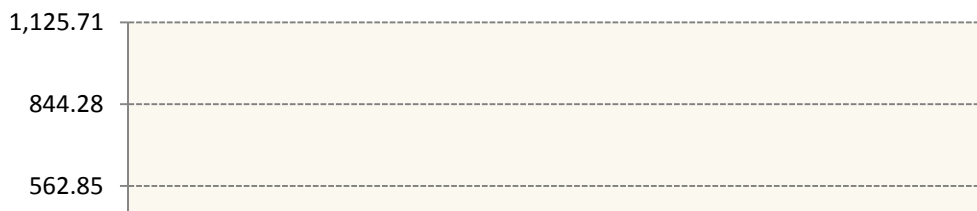
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,368	0	3,368	
누계	유가증권	스왑	23,789	0	23,789	장외
누계	유가증권	옵션	0	12,406	-12,406	장내
누계	통화	선도	0	6,124	-6,124	장외

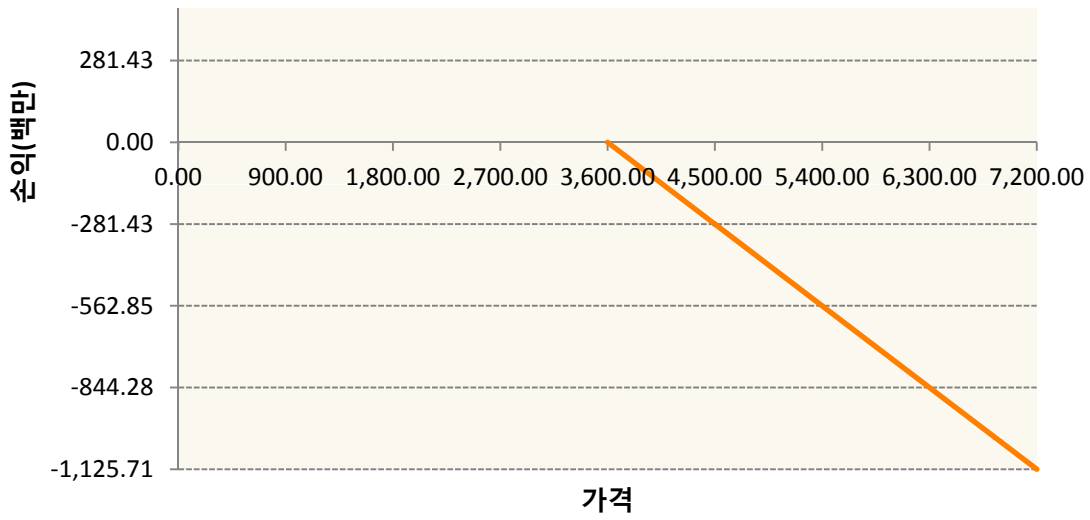
2. 만기시점의 손익구조

OESXX9-C3575-EURO STOXX 50

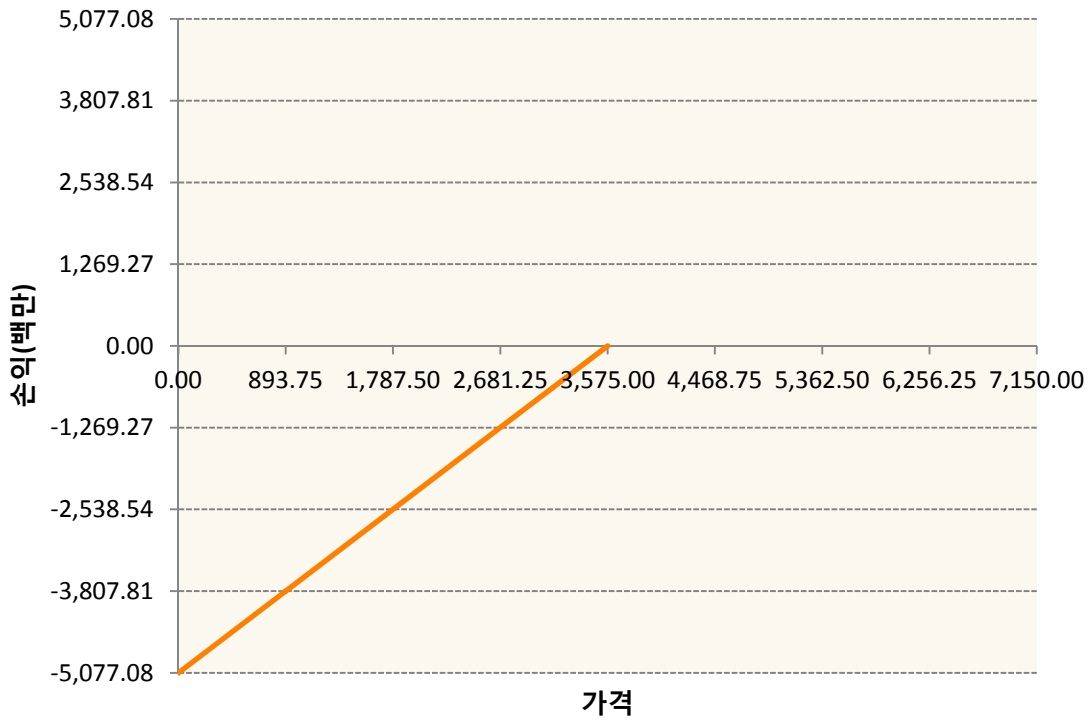


OESXX9-C3600-EURO STOXX 50

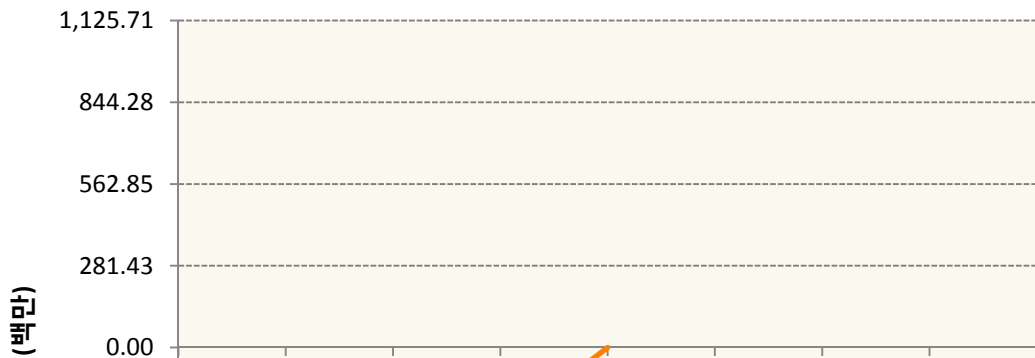


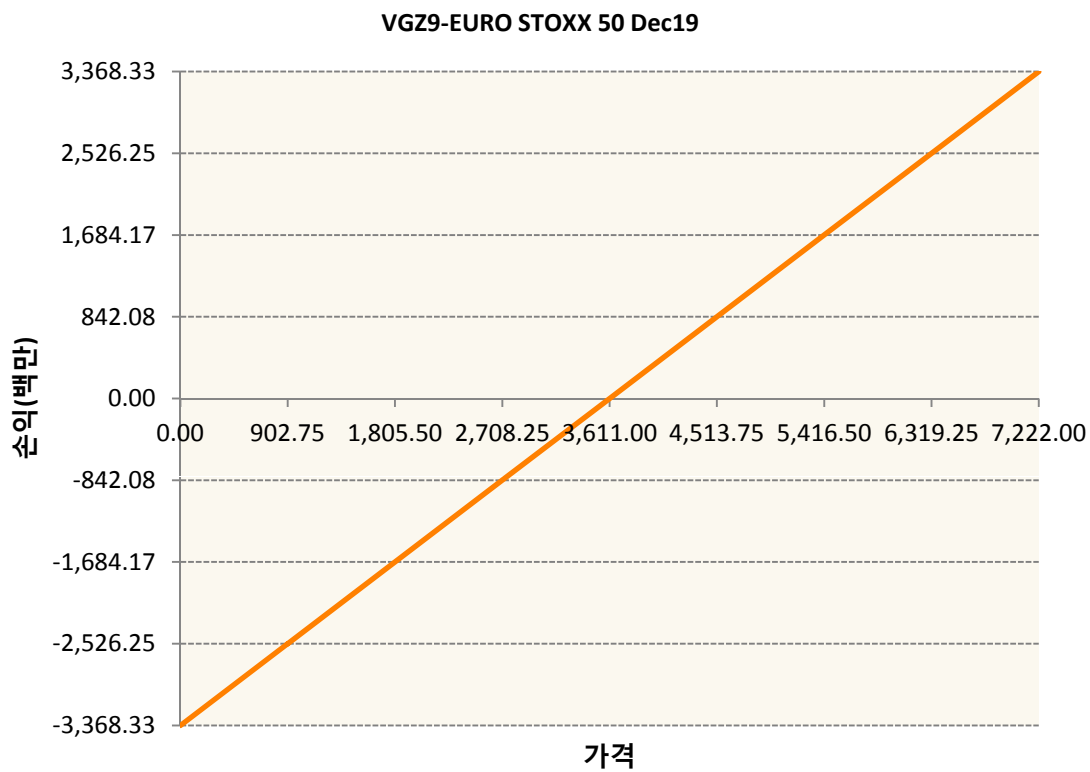
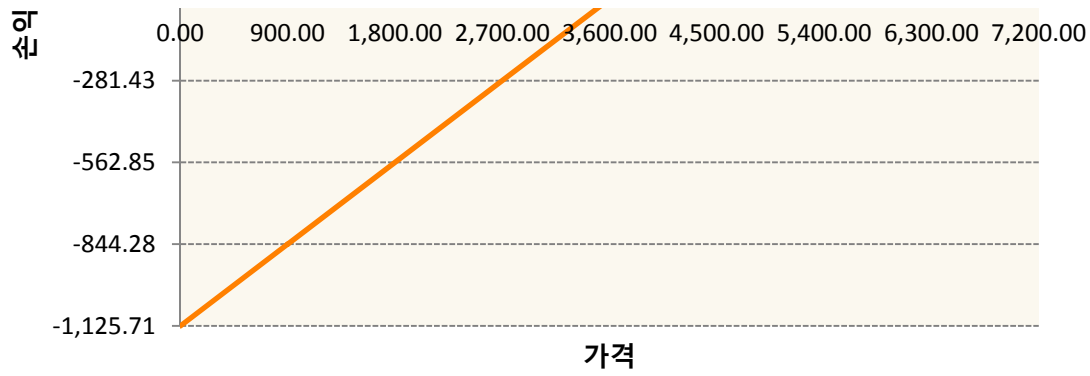


OESXX9-P3575-EURO STOXX 50



OESXX9-P3600-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		16
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E		490
OESXX9-C35 EURO STOXX 50		406
OESXX9-C36 EURO STOXX 50		90
OESXX9-P35 EURO STOXX 50		406
OESXX9-P36 EURO STOXX 50		90
VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	269

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

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

(단위:백만원)

949

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

(단위:백만원)

83

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

(단위:백만원)

128

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-10-28
기준일	2019-10-25

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

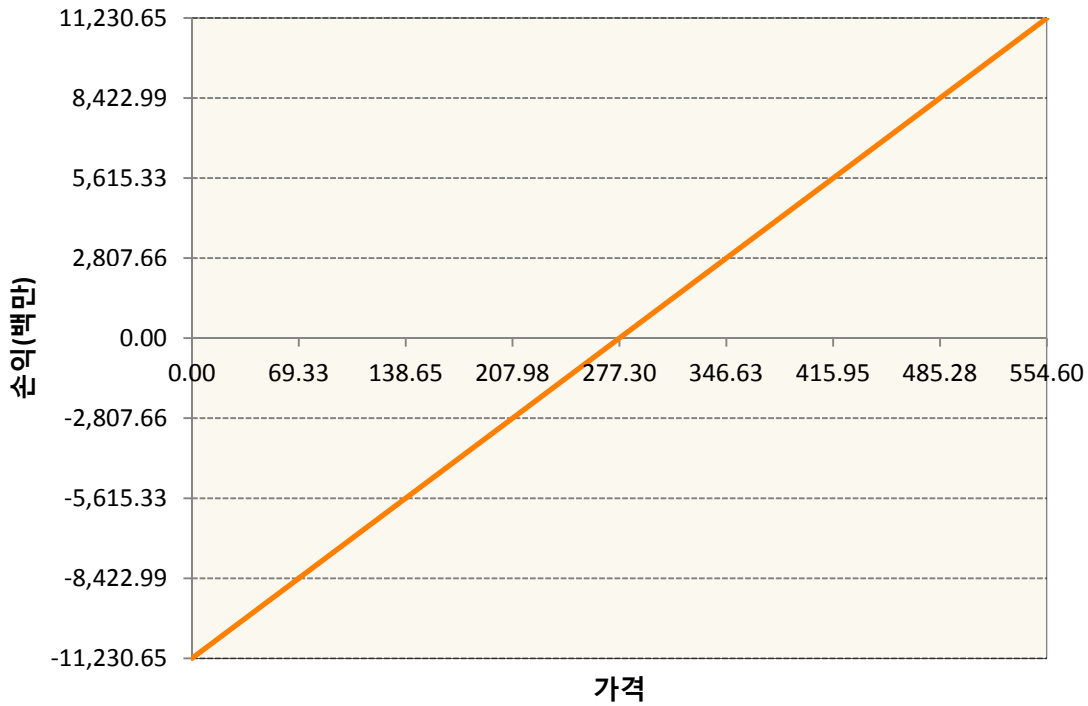
1. 계약금액

(단위:백만원)

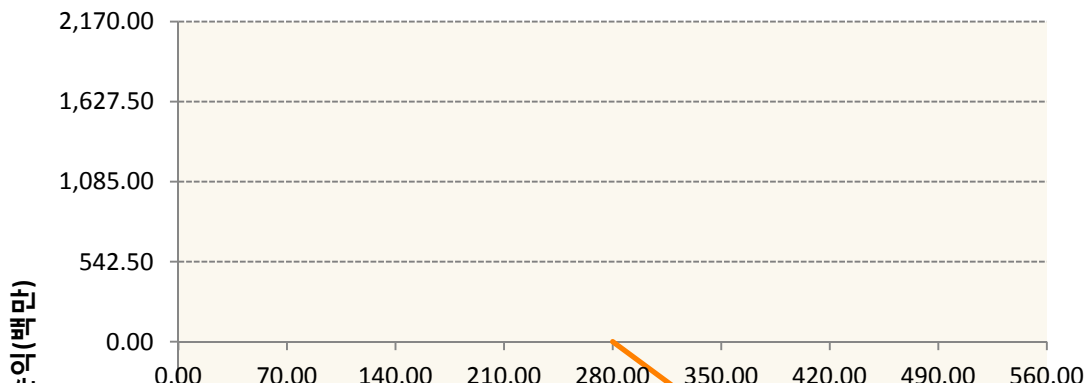
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	69	-69	장내
신규	유가증권	옵션	70	0	70	장내
누계	유가증권	선물	11,231	0	11,231	장내
누계	유가증권	옵션	3,561	20,744	-17,183	장내

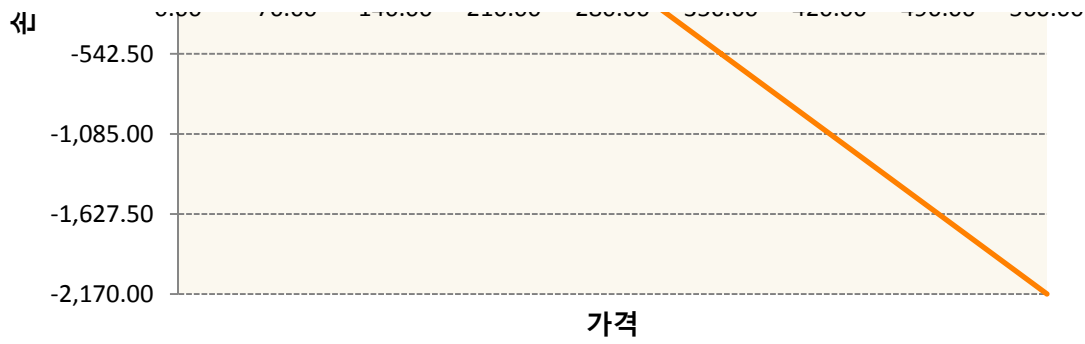
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

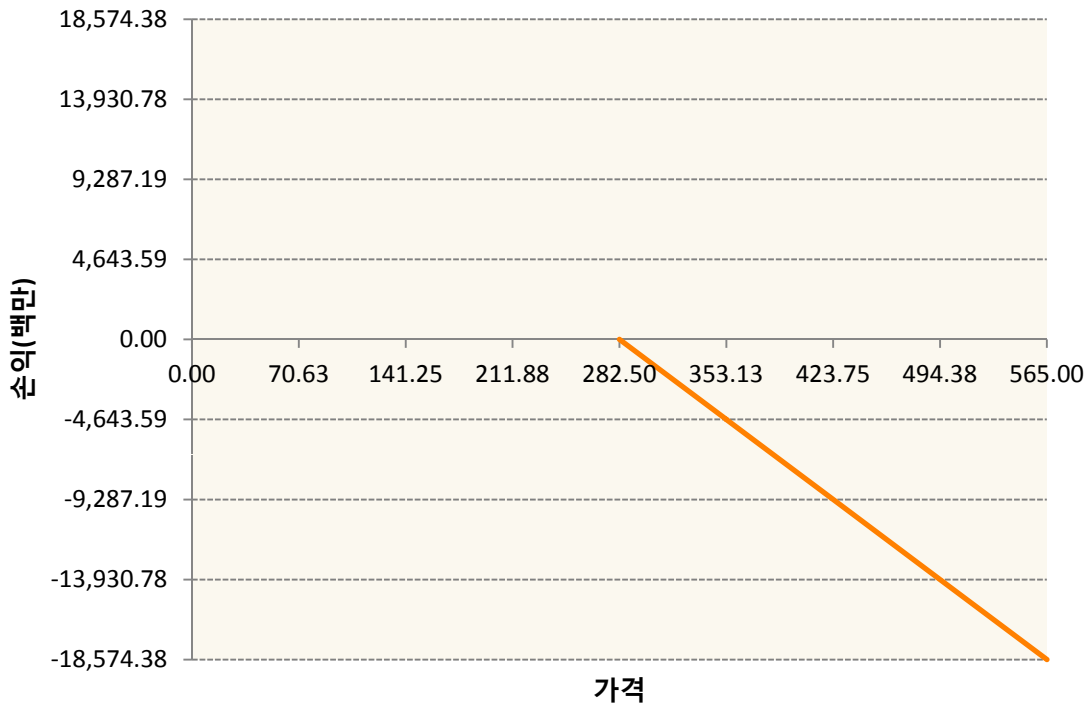


KR4201PB2800-2019-11 콜280

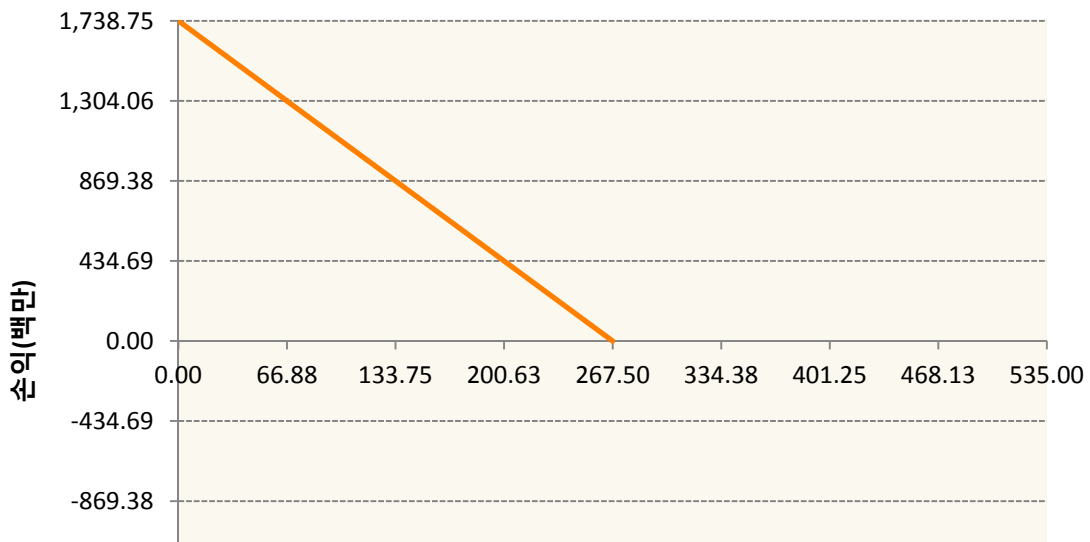


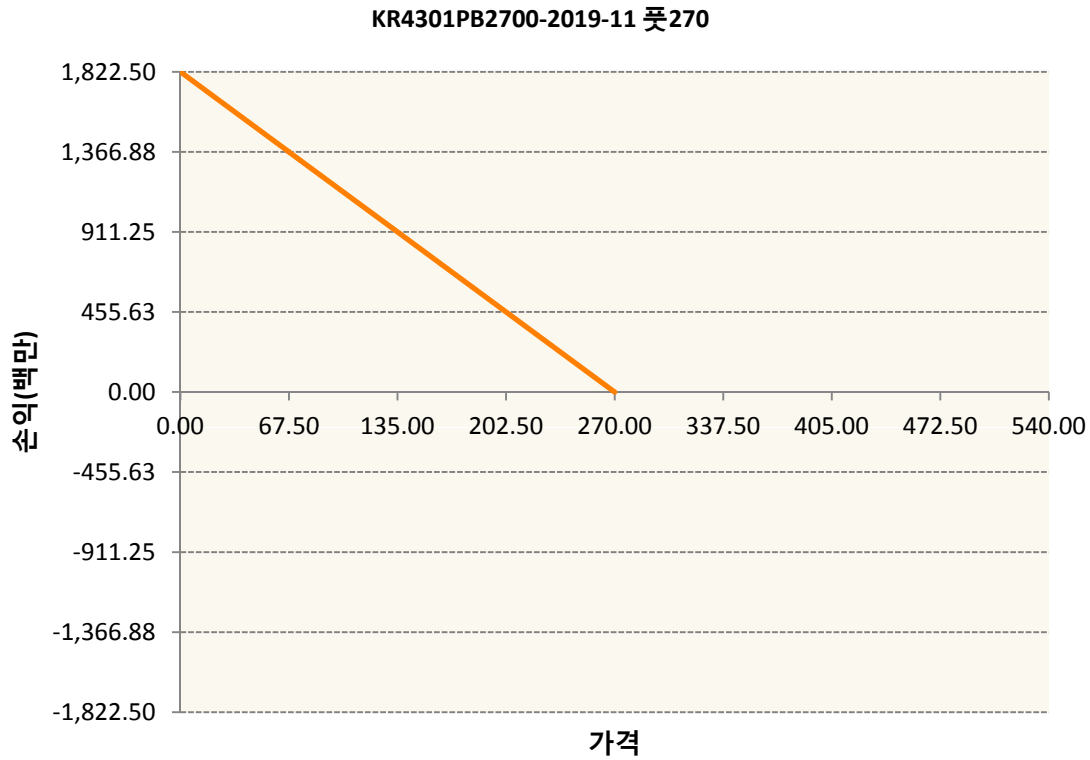
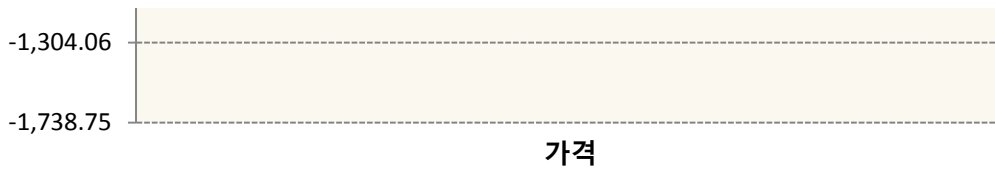


KR4201PB2826-2019-11 콜282.5



KR4301PB2676-2019-11 풋267.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						898
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-898	-898	-898	-898	-898	-898	-898	
-5.33%	-598	-598	-598	-598	-598	-598	-598	
-2.67%	-299	-299	-299	-299	-299	-299	-299	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	299	299	299	299	299	299	299	
5.33%	598	598	598	598	598	598	598	
8.00%	898	898	898	898	898	898	898	
KR4201PB2800		2019-11 콜280						124
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	44	43	42	40	39	37	35	
-5.33%	40	38	36	34	31	28	25	
-2.67%	32	28	25	21	17	13	9	

0%	14	9	5	0	-5	-9	-14
2.67%	-17	-21	-26	-30	-35	-39	-44
5.33%	-58	-62	-65	-69	-73	-77	-81
8.00%	-108	-110	-112	-115	-118	-121	-124
KR4201PB2826 2019-11 콜282.5							995
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	308	303	296	287	275	261	246
-5.33%	290	277	261	243	222	199	175
-2.67%	236	210	182	153	123	91	59
0%	111	75	37	0	-38	-76	-114
2.67%	-110	-150	-189	-229	-269	-309	-349
5.33%	-431	-465	-499	-534	-571	-607	-644
8.00%	-832	-854	-878	-905	-934	-964	-995
KR4301PB2676 2019-11 풋267.5							82
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	79	79	80	80	81	81	82
-5.33%	35	36	38	39	41	42	44
-2.67%	7	8	10	12	14	15	17
0%	-2	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-4	-3	-3	-3	-3	-2	-2
5.33%	-4	-4	-4	-4	-3	-3	-3
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
KR4301PB2700 2019-11 풋270							98
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	96	96	96	97	97	97	98
-5.33%	48	49	50	51	52	54	55
-2.67%	12	14	15	17	19	21	23
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-6	-6	-6	-5	-5	-4	-4
5.33%	-7	-7	-7	-6	-6	-6	-6
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-6

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

(단위:백만원)

1,836

공시일	2019-10-28
기준일	2019-10-25

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	158,595	0	158,595	

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	2019-10-28
기준일	2019-10-25

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	4,105	0	4,105	
누계	유가증권	수익증권	204,527	0	204,527	

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	2019-10-28
기준일	2019-10-25

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	419,247	0	419,247	
누계	통화	선도	0	431,781	-431,781	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
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E		1,877
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E		1,971
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E		938
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		657
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E		1,539
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		694
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,689
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		2,477
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		469
FX21019V02 KRW/USD 21-11-19E		5,105
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,786
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,408
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,815
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,511
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,853
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		938
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		938

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

(단위:백만원)

11,008

공시일	2019-10-28
기준일	2019-10-25

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

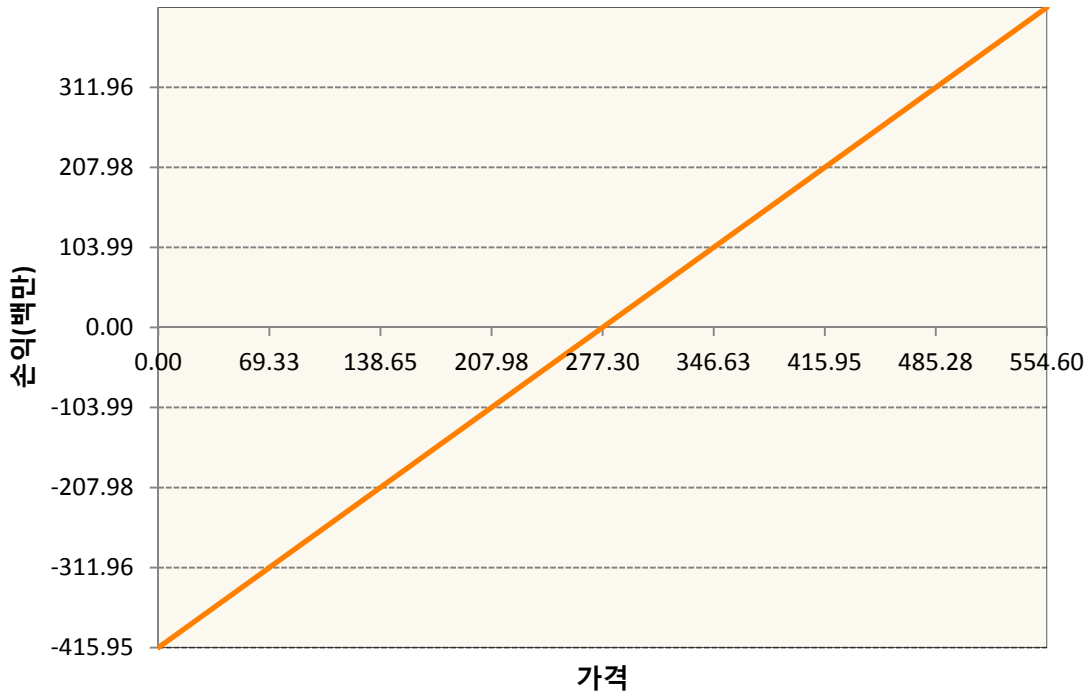
1. 계약금액

(단위:백만원)

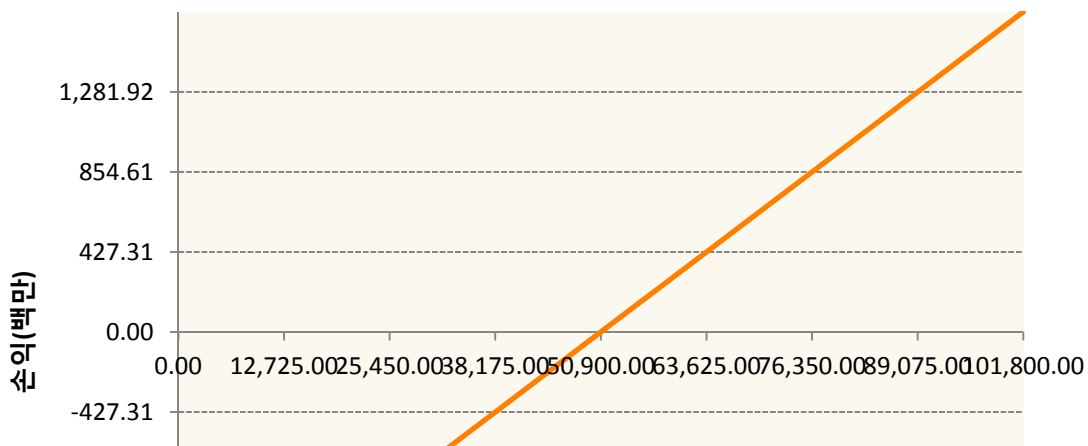
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,125	0	2,125	장내

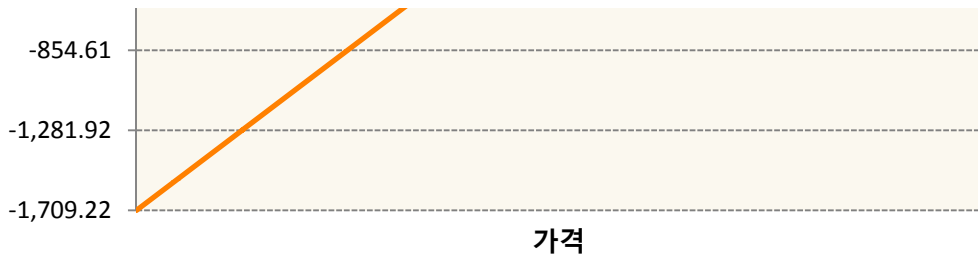
2. 만기시점의 손익구조

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%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91	
-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%	91	91	91	91	91	91	91	
8.00%	137	137	137	137	137	137	137	

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

186

공시일	2019-10-28
기준일	2019-10-25

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

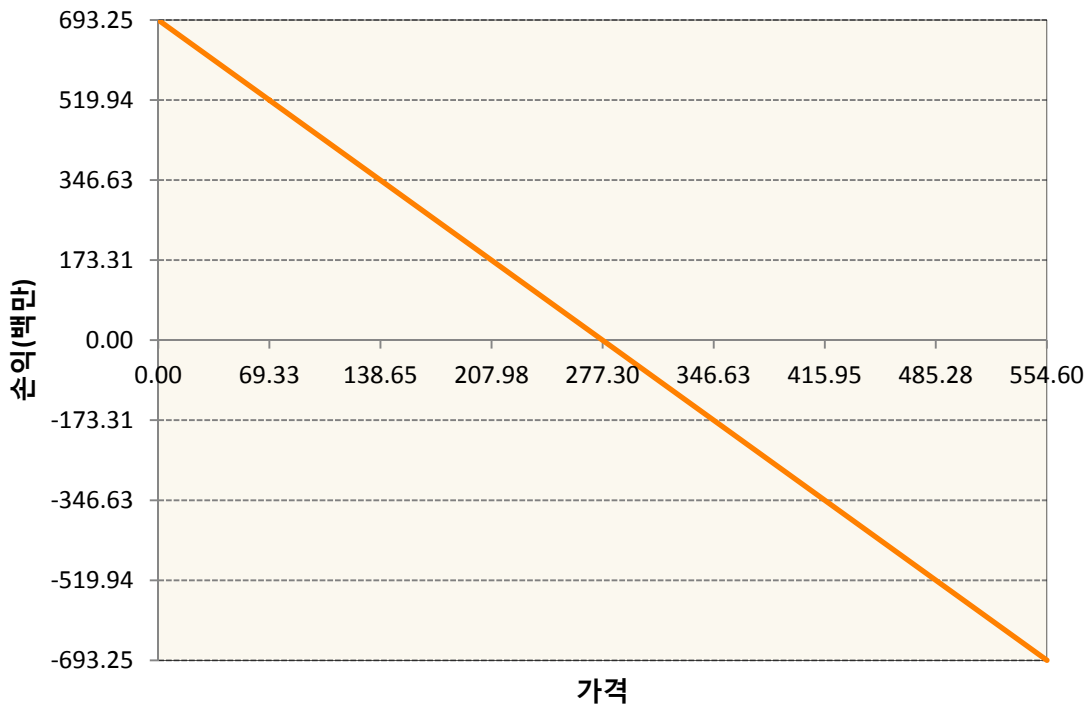
1. 계약금액

(단위:백만원)

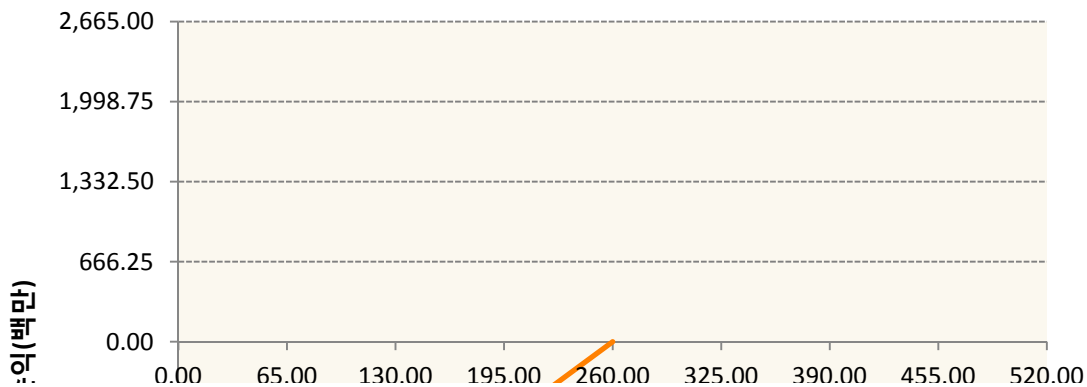
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	131	0	131	장내
누계	유가증권	선물	0	693	-693	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,715	-3,715	장내

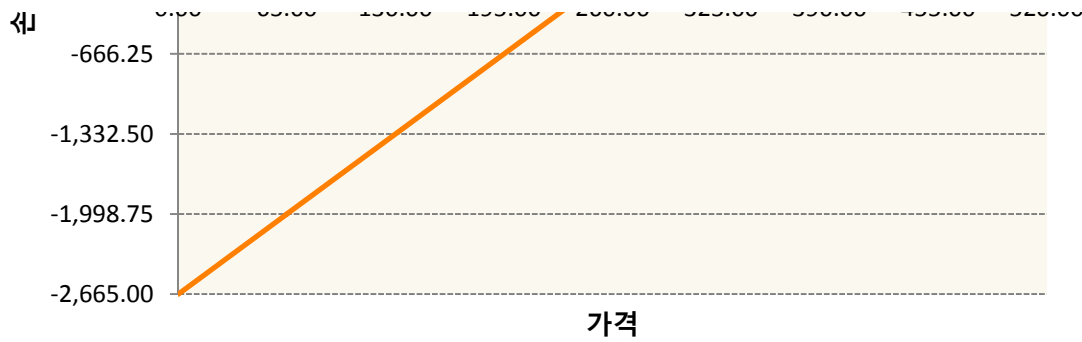
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

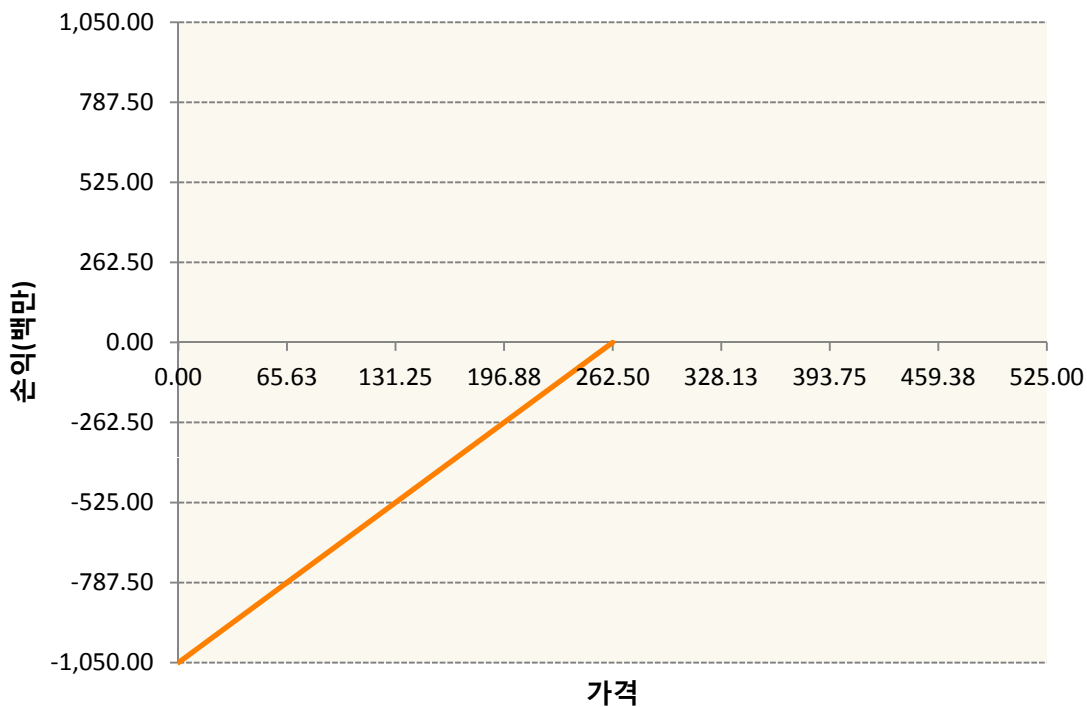


KR4301PB2601-2019-11 풋260





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						72
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-59	-61	-63	-65	-67	-70	-72
-5.33%	-15	-17	-20	-22	-25	-28	-30
-2.67%	-1	-2	-3	-4	-6	-7	-9
0%	1	0	0	0	0	-1	-2
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

KR4301PB2627

2019-11 풋262.5

35

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-31	-32	-32	-33	-34	-35	-35
-5.33%	-10	-11	-12	-13	-14	-15	-16
-2.67%	-1	-2	-2	-3	-4	-5	-5
0%	0	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	1	1	1	1	0	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)

89

공시일	2019-10-28
기준일	2019-10-25

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	176	-176	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	16,392	0	16,392	
누계	통화	선도	0	20,129	-20,129	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019Q03 KRW/USD 28-10-19E		319
FX21019V01 KRW/USD 10-12-19E		372
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		319
FX21019V02 KRW/USD 13-11-19E		282
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		319

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

(단위:백만원)

513

공시일	2019-10-28
기준일	2019-10-25

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	691	0	691	장외
누계	통화	선도	202	202	0	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

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

(단위:백만원)

59

공시일	2019-10-28
기준일	2019-10-25

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

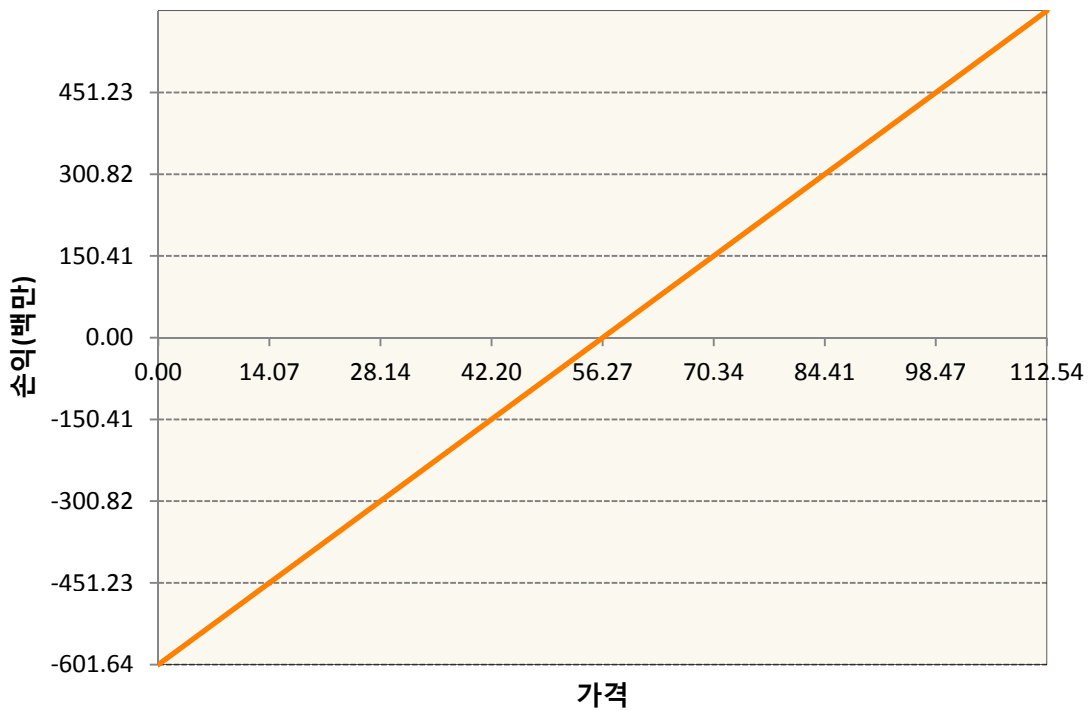
1. 계약금액

(단위:백만원)

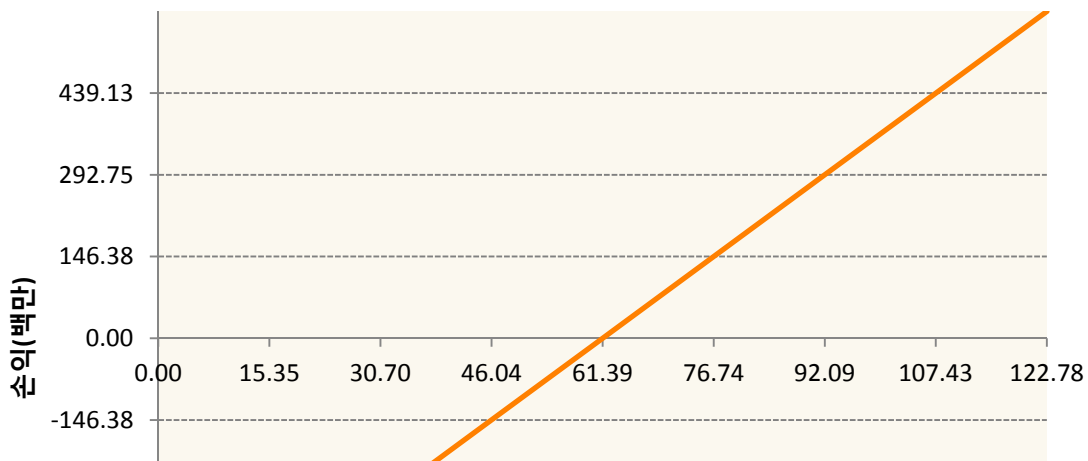
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,474	293	2,181	

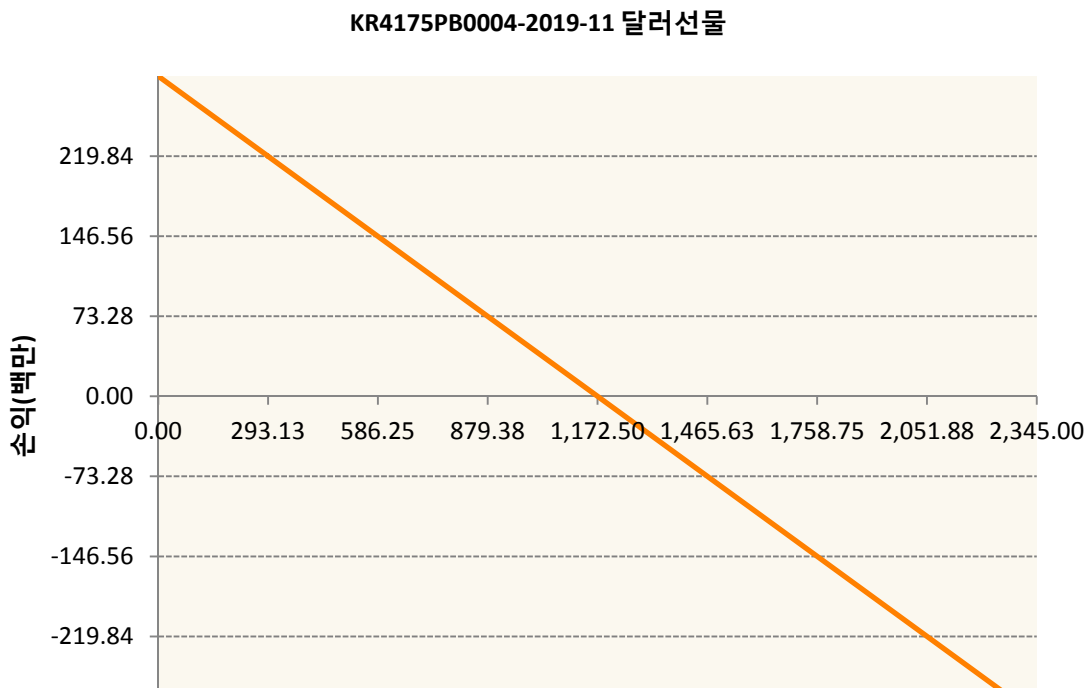
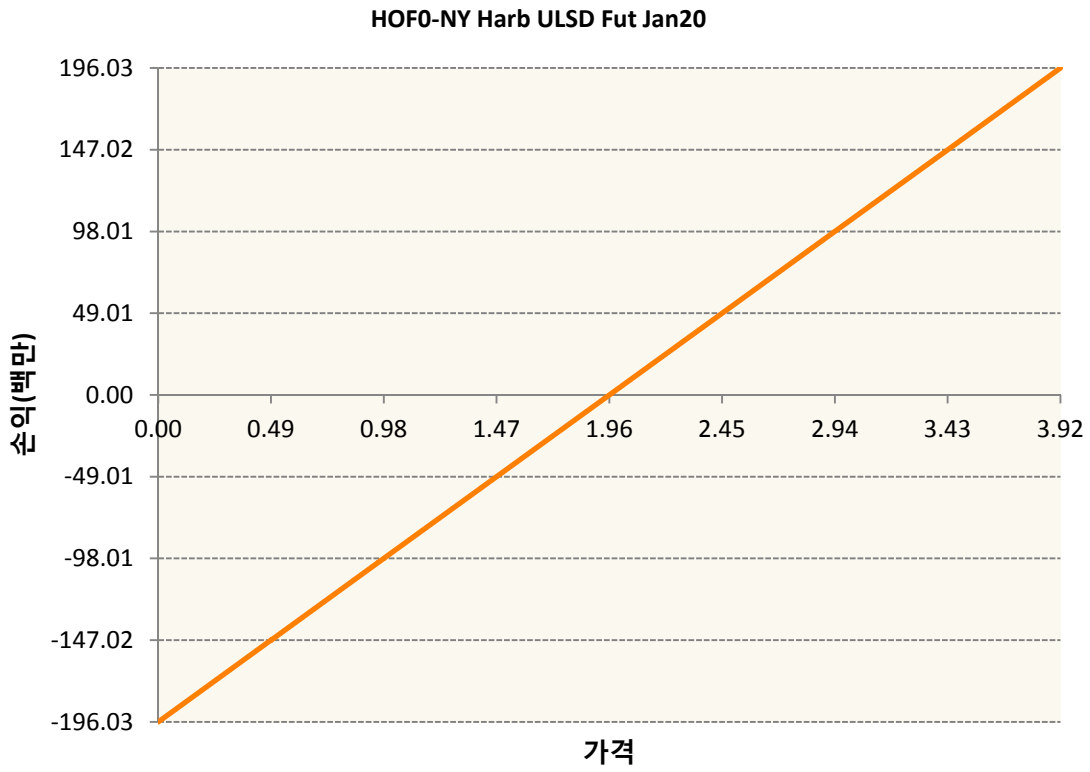
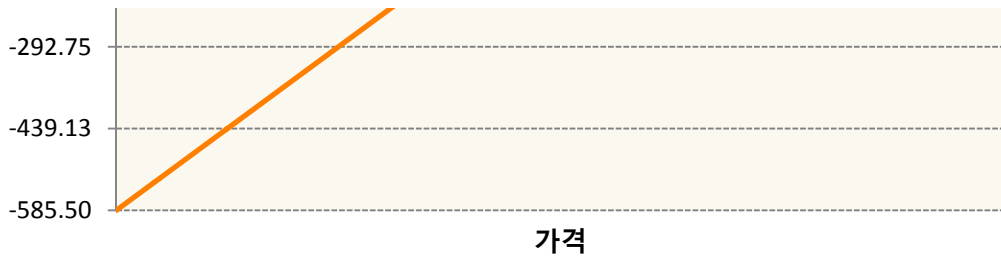
2. 만기시점의 손익구조

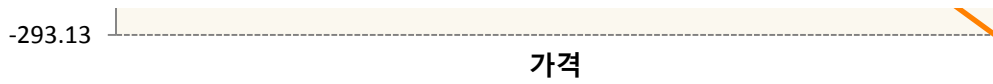
CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20



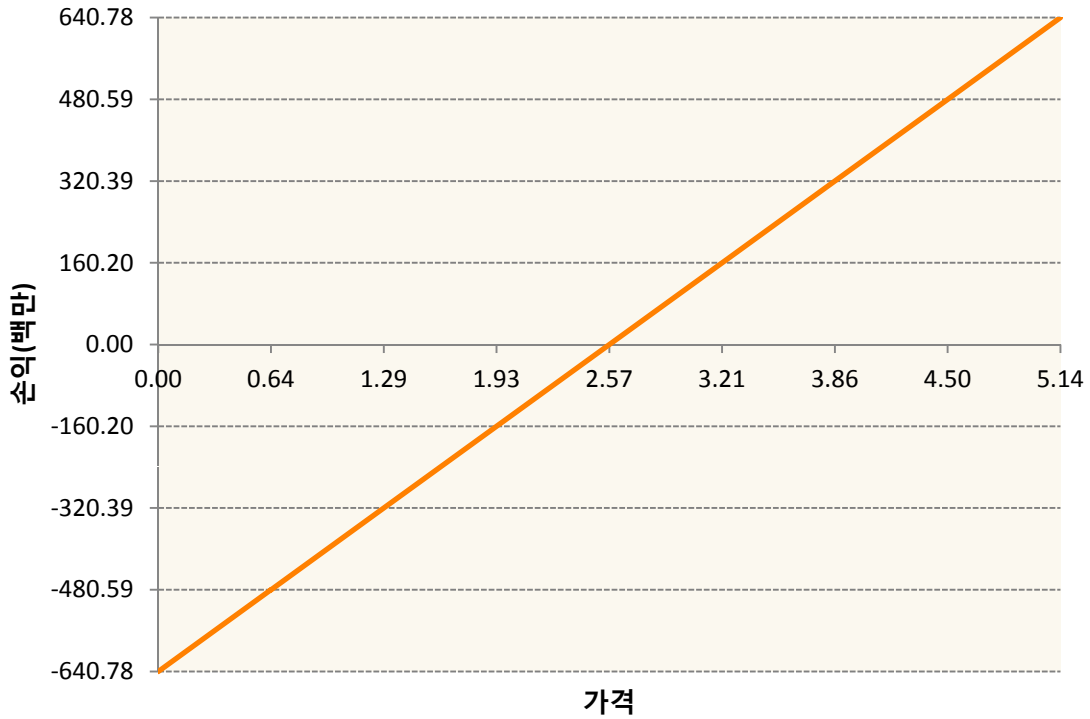
COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20



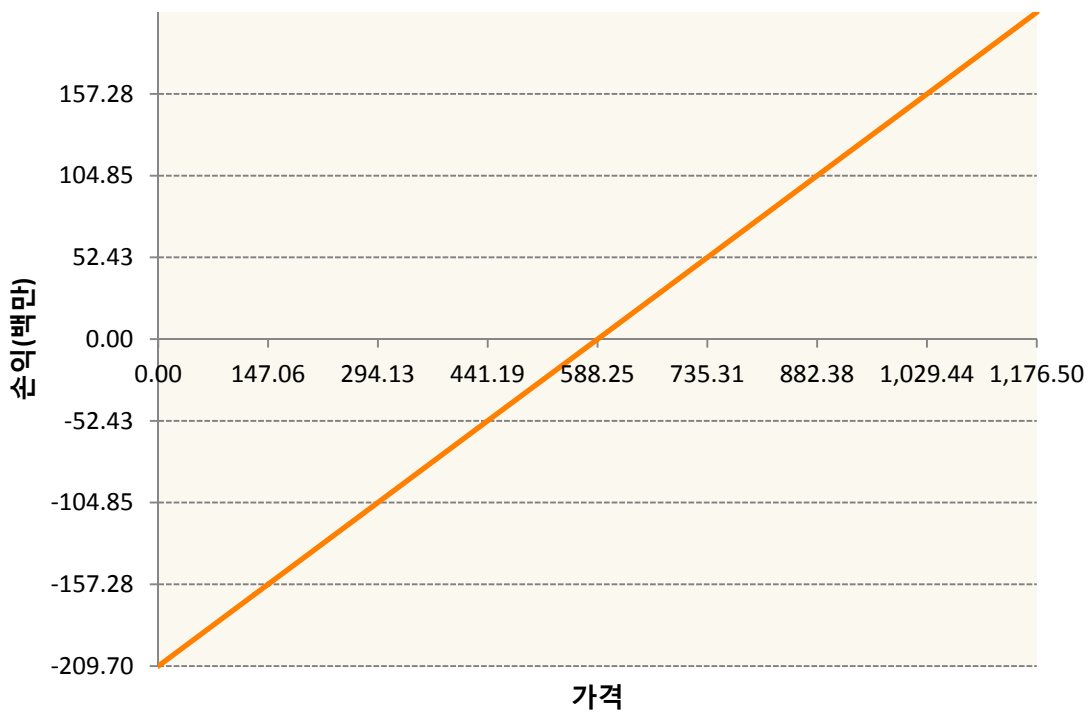




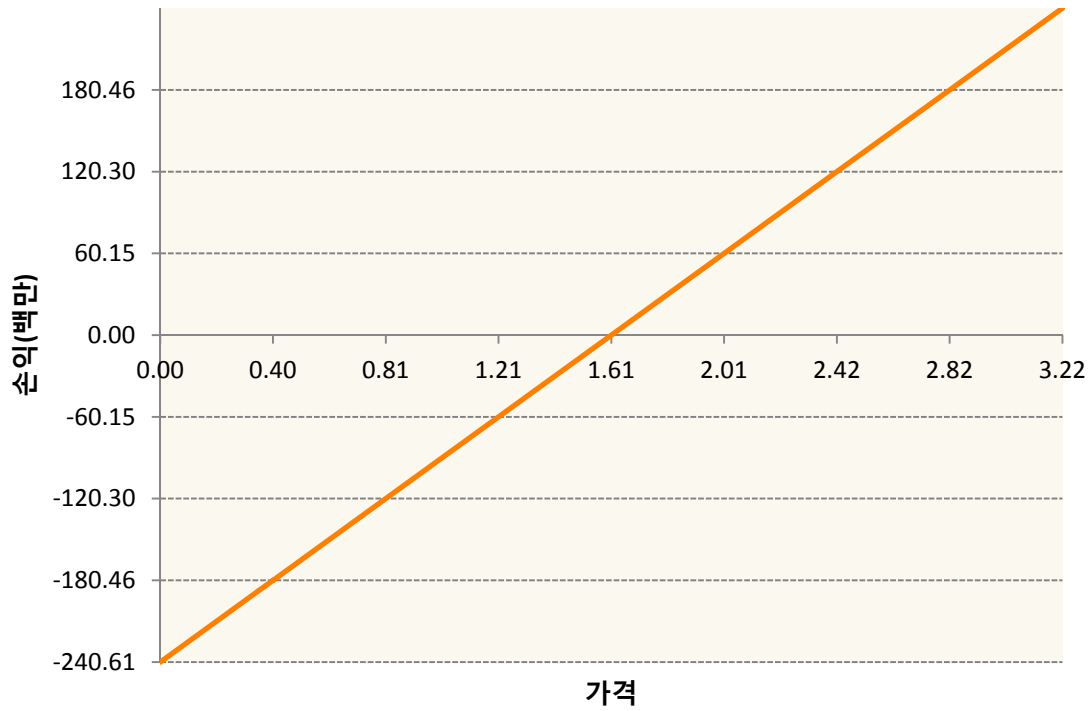
NGF20-NATURAL GAS FUTR Jan20



QSF0-Low Su Gasoil G Jan20



XBF0-GASOLINE RBOB FUT Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLF0	WTI CRUDE FUTURE Jan20	48
COF0	BRENT CRUDE FUTR Jan20	47
HOF0	NY Harb ULSD Fut Jan20	16
KR4175PB00	2019-11 달러선물	23
NGF20	NATURAL GAS FUTR Jan20	51
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	17
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	19

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

(단위:백만원)

411

공시일	2019-10-28
기준일	2019-10-25

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

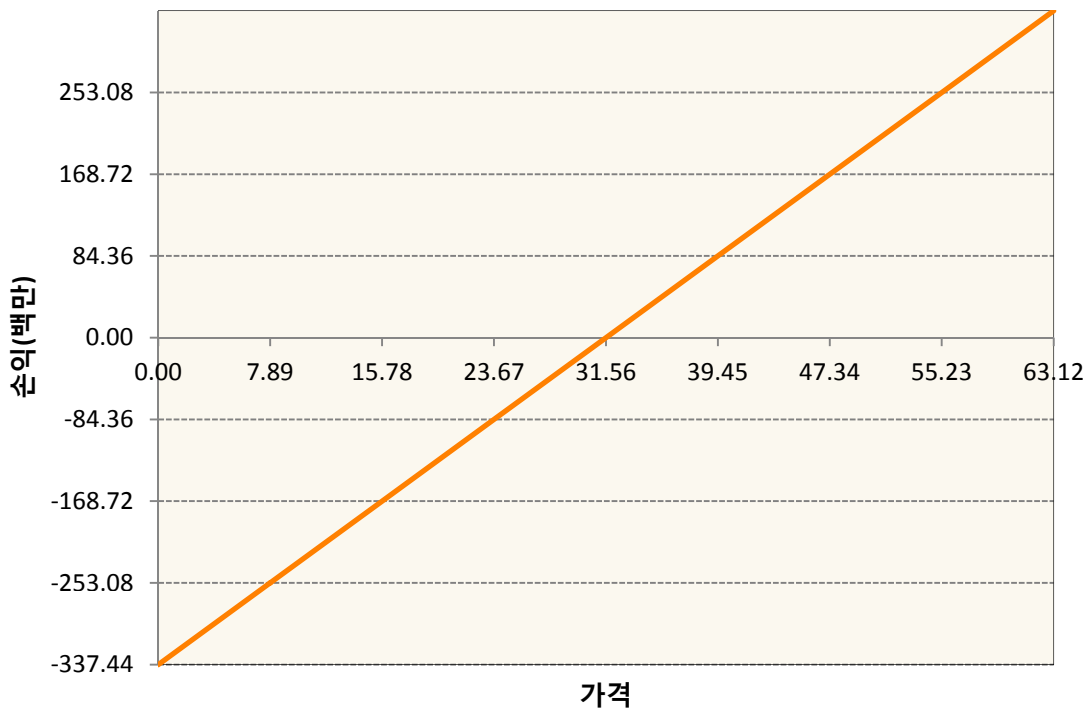
1. 계약금액

(단위:백만원)

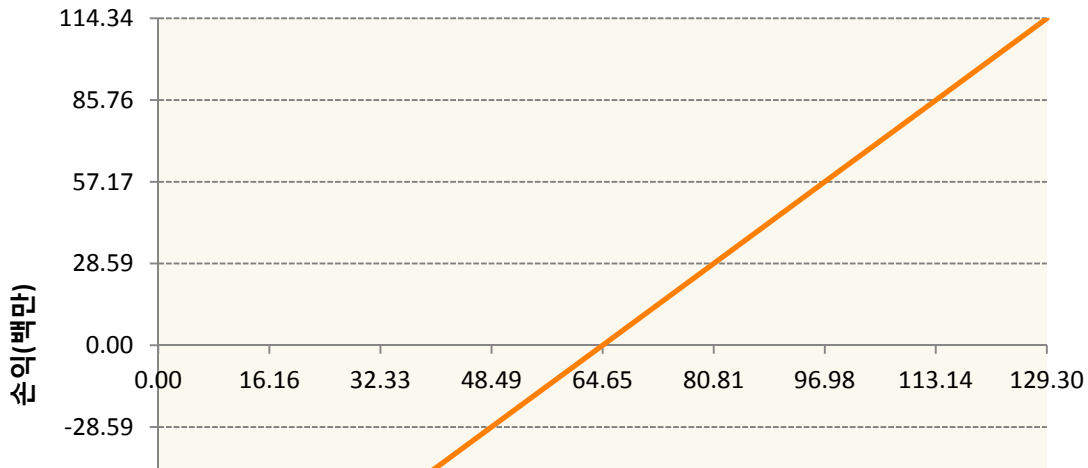
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,869	94	2,775	

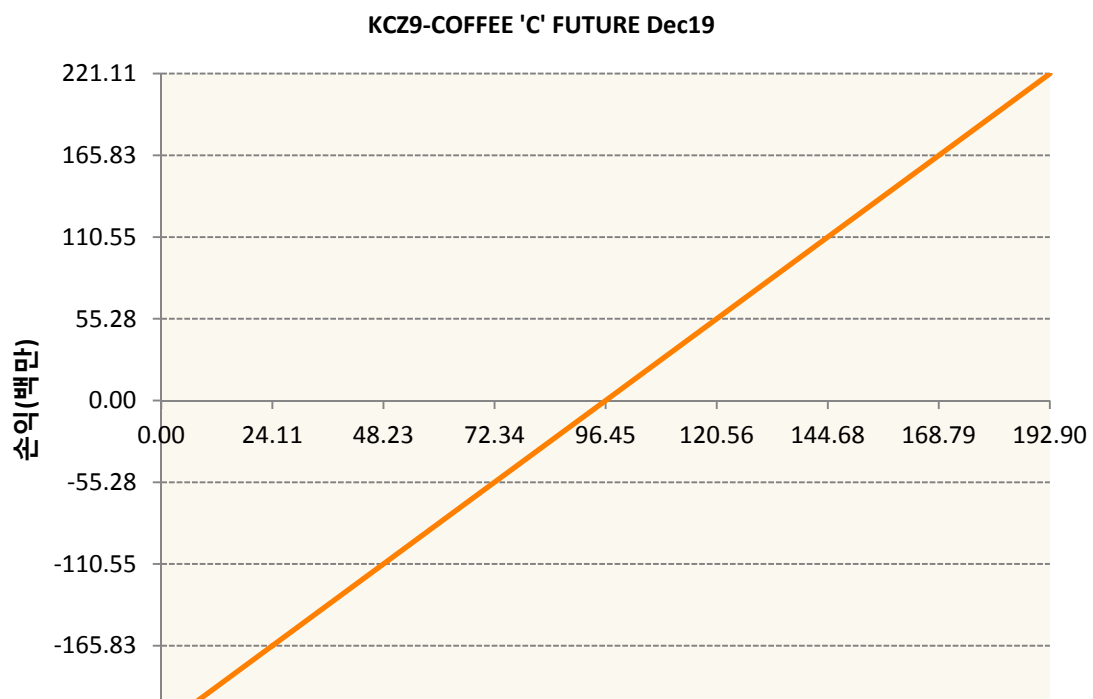
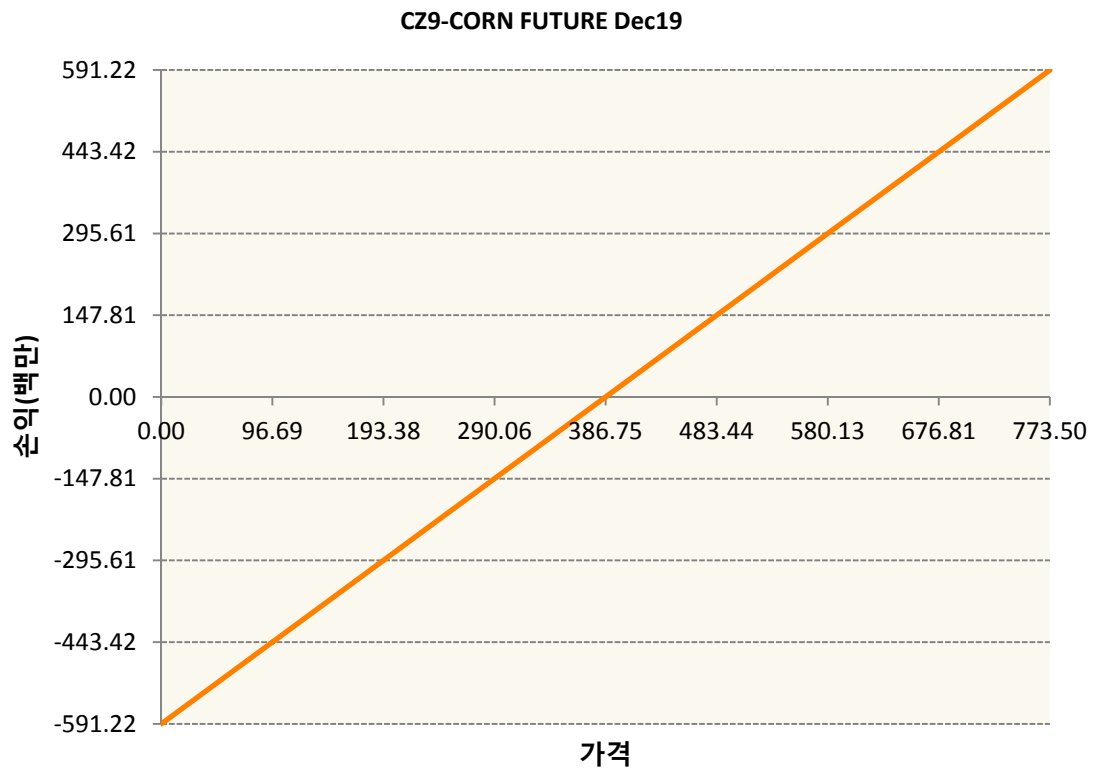
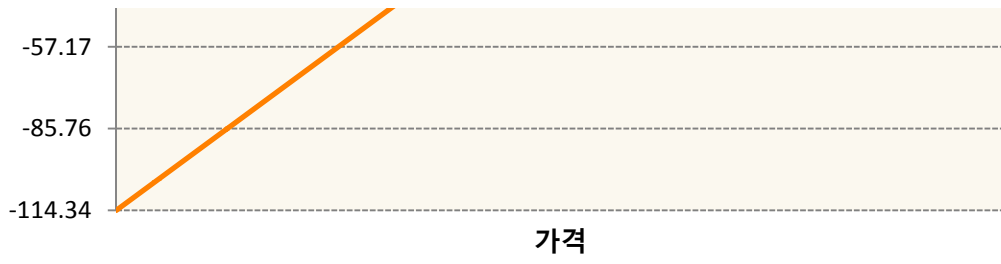
2. 만기시점의 손익구조

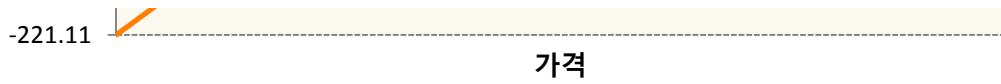
BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20



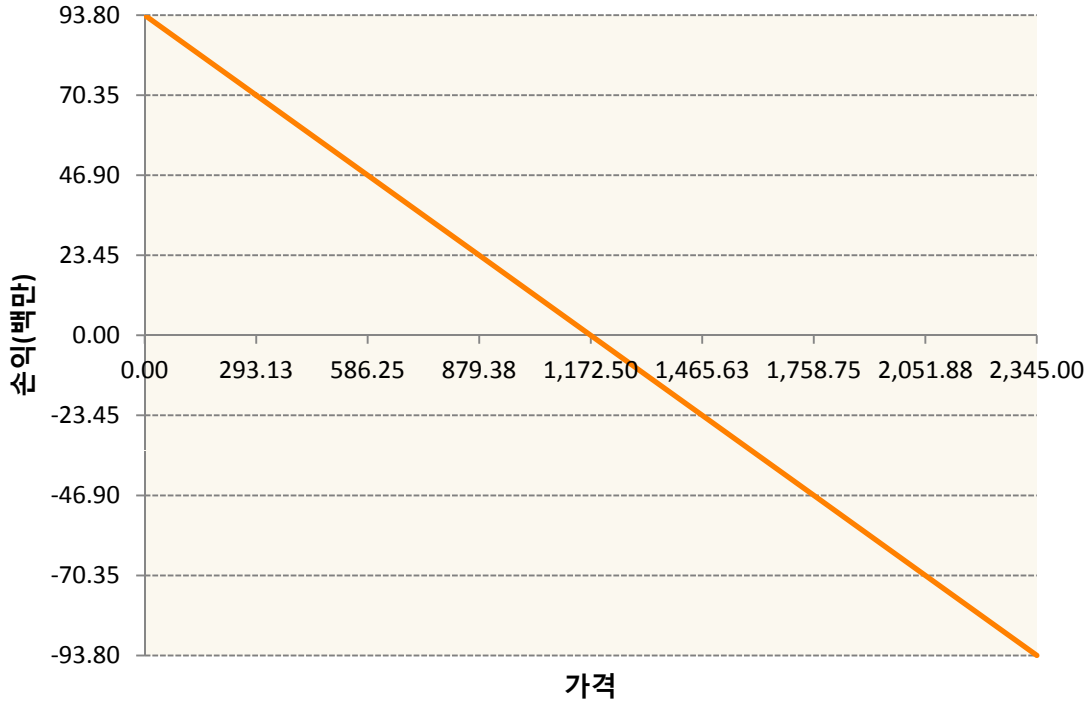
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



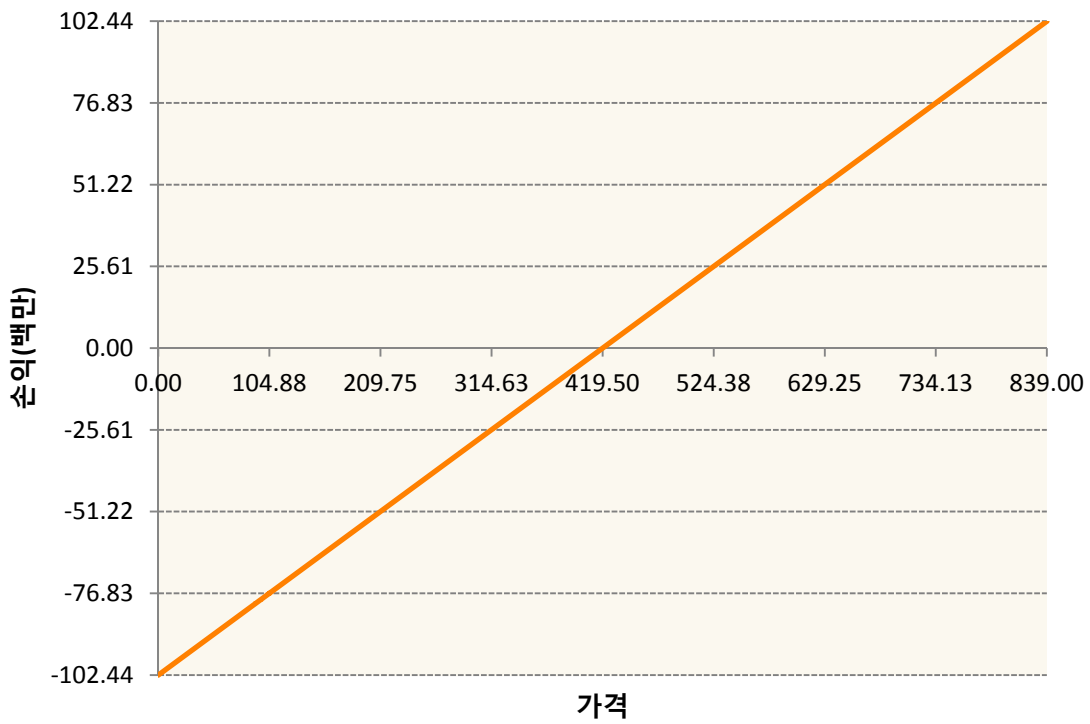




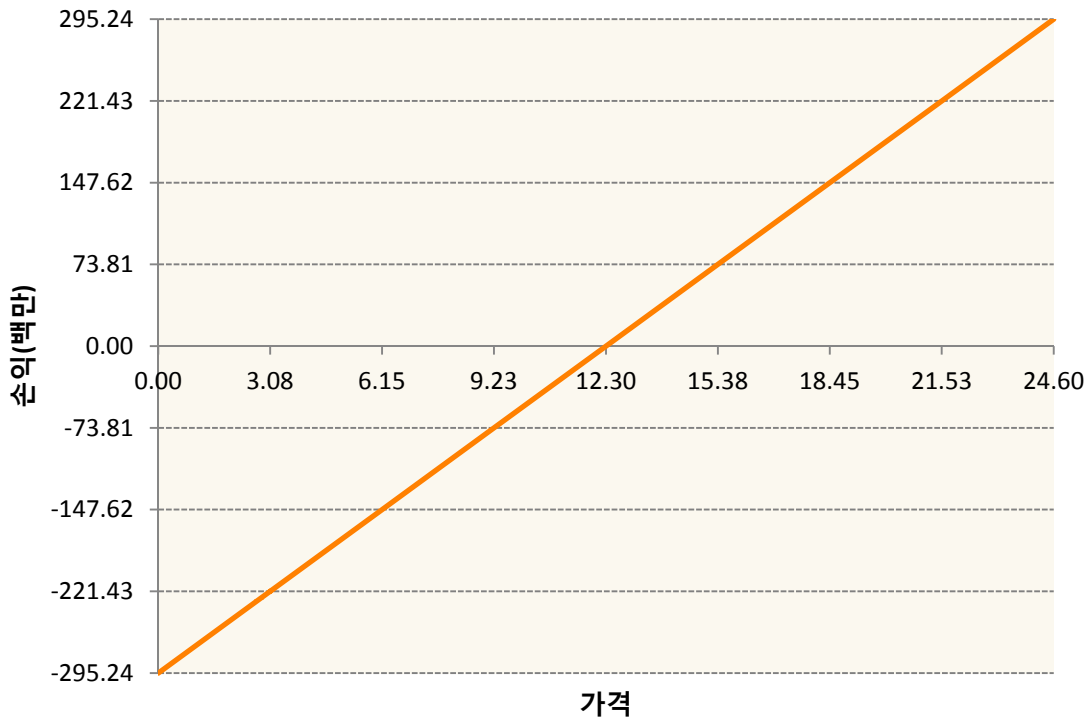
KR4175PB0004-2019-11 달러선물



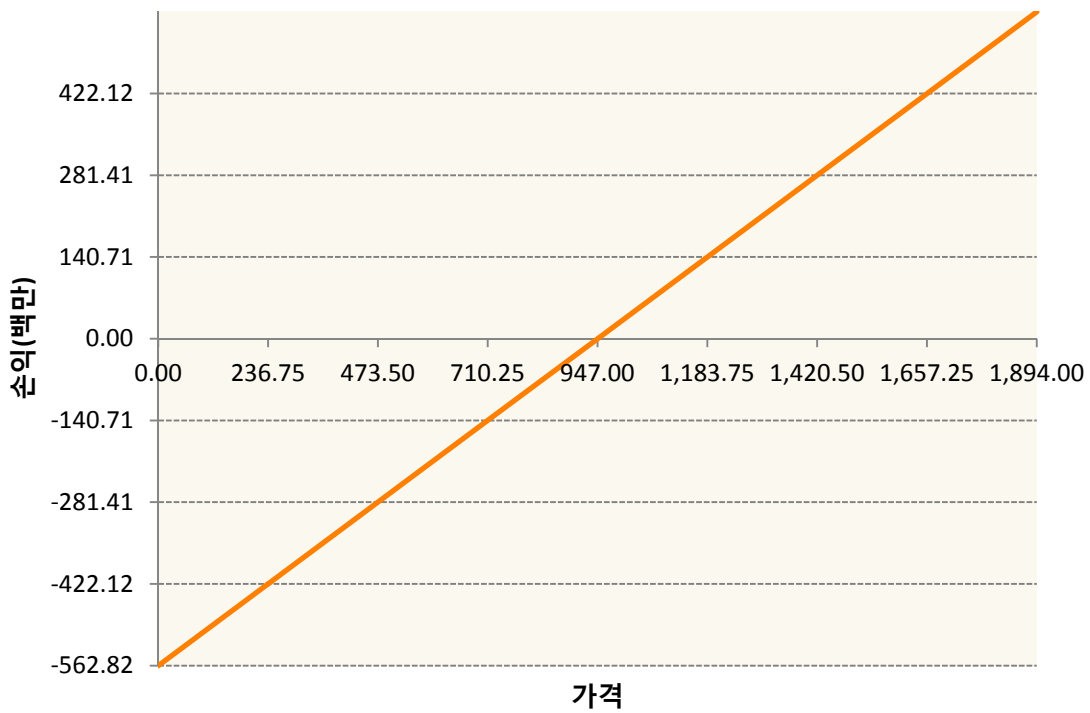
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



SBH0-Sugar Mar20

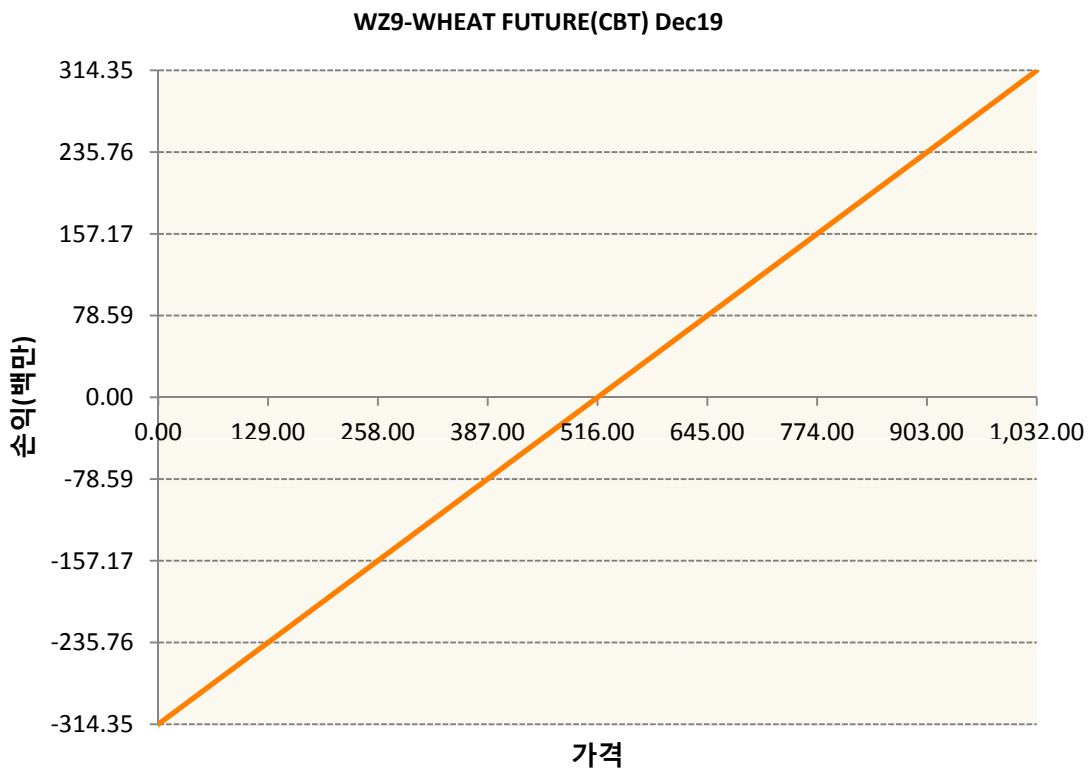
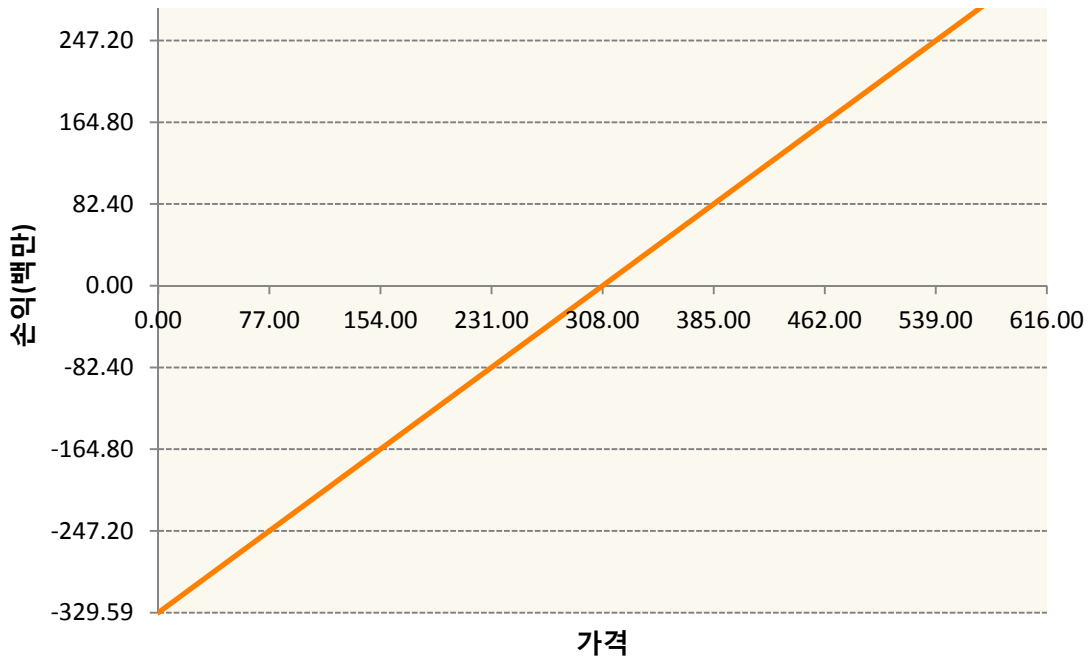


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20



SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOF0	SOYBEAN OIL FUTR Jan20	27
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	9
CZ9	CORN FUTURE Dec19	47
KCZ9	COFFEE 'C' FUTURE Dec19	18
KR4175PB00	2019-11 달러선물	8

KWZ9	KC HRW WHEAT FUT Dec19	8
SBH0	Sugar Mar20	24
SF0	SOYBEAN FUTURE Jan20	45
SMF0	SOYBEAN MEAL FUTR Jan20	26
WZ9	WHEAT FUTURE(CBT) Dec19	25

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

(단위:백만원)

255