

공시일	2019-11-01
기준일	2019-10-31

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)

84

공시일	2019-11-01
기준일	2019-10-31

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

1,201

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

697

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-11-01
기준일	2019-10-31

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6,772	0	6,772	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(1)	378
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	138

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

763

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-11-01
기준일	2019-10-31

유로인덱스모(주식-파생형)

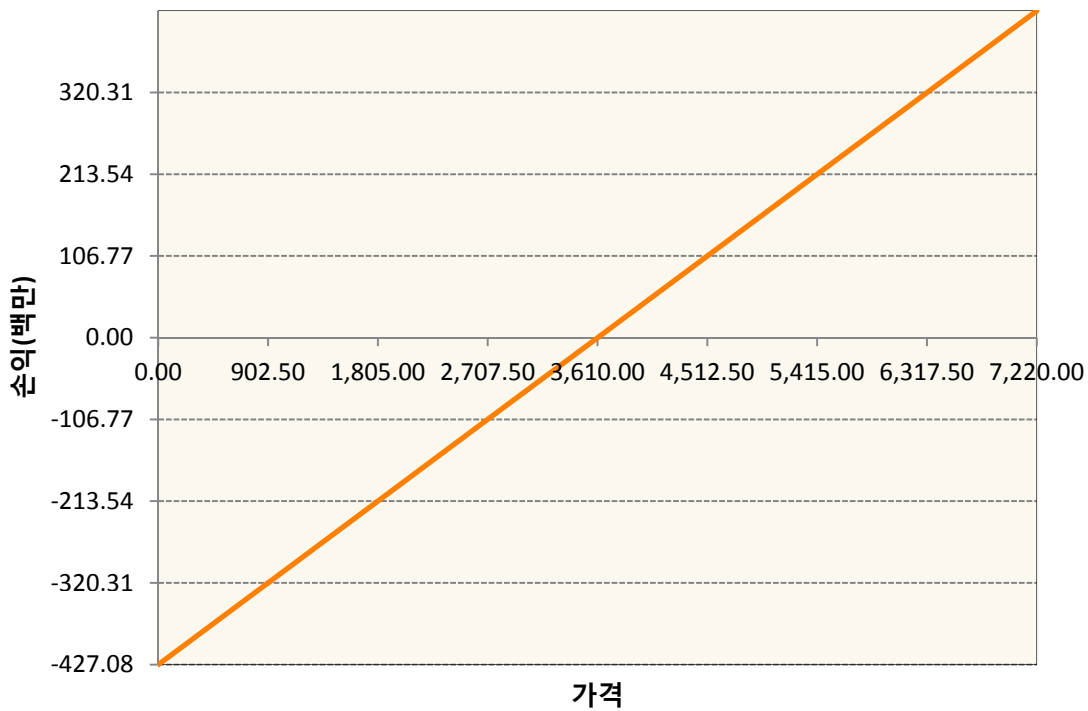
1. 계약금액

(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	2019-11-01
기준일	2019-10-31

차이나인덱스모(주식-파생형)

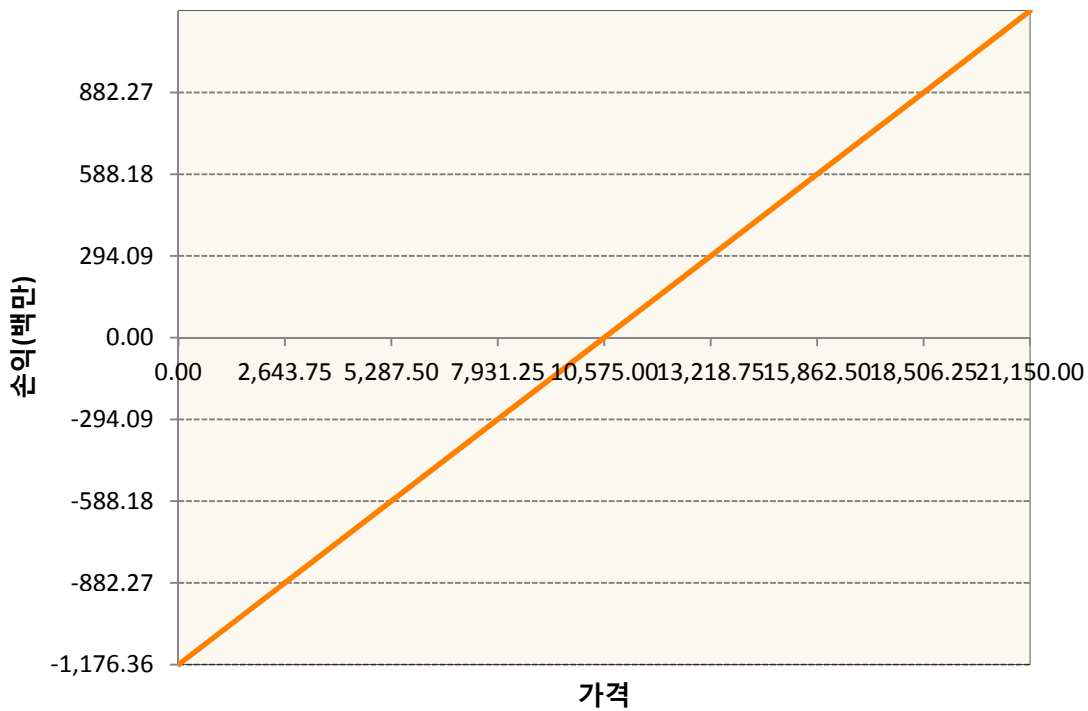
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,176	0	1,176	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCX9-HSCEI Futures Nov19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCX9	HSCEI Futures Nov19	94
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

84

공시일	2019-11-01
기준일	2019-10-31

커버드콜모(주식혼합-파생형)

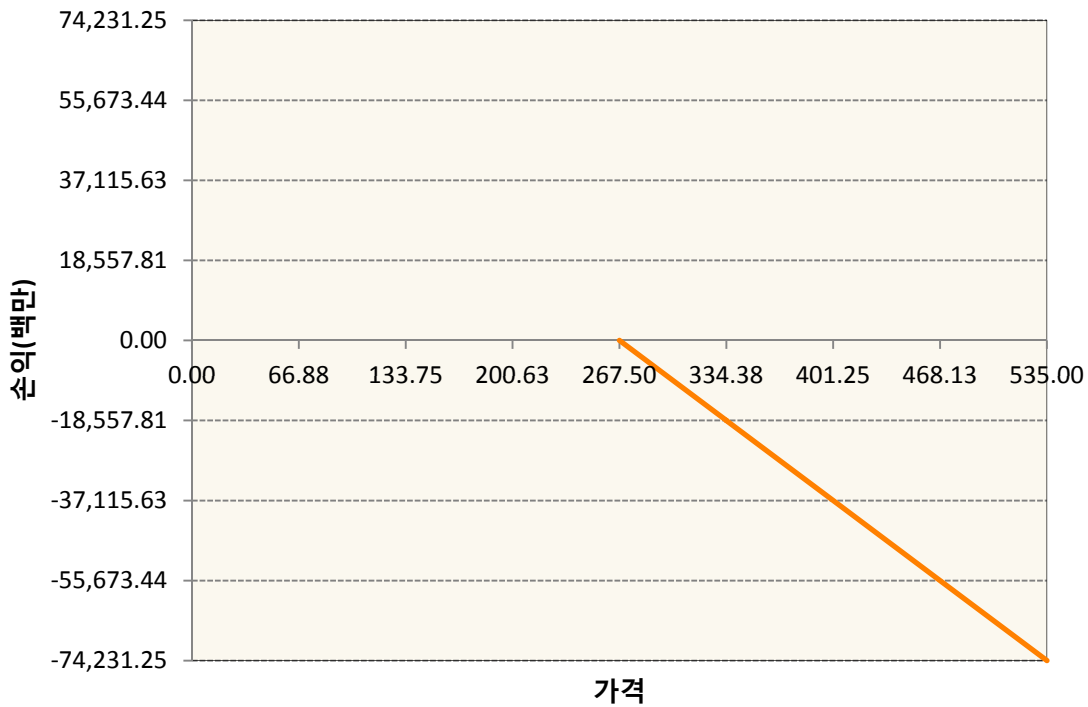
1. 계약금액

(단위:백만원)

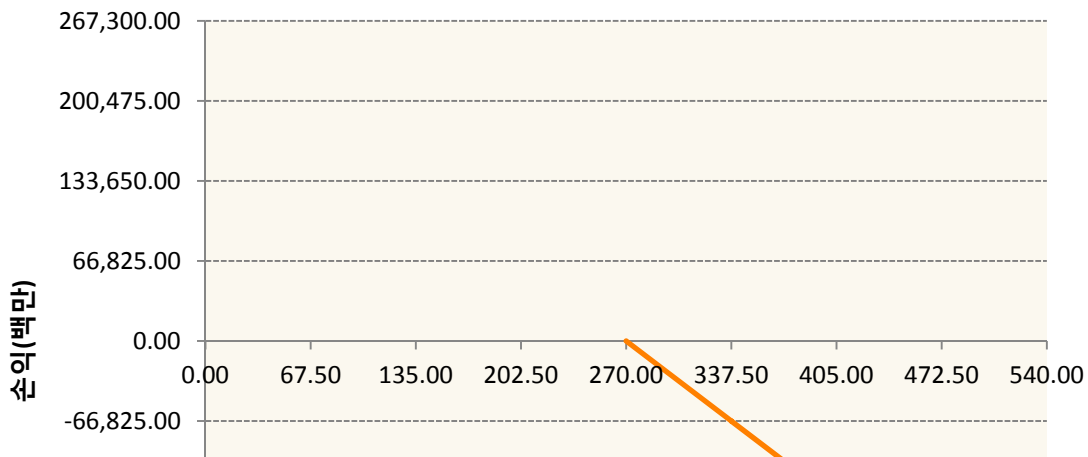
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	500,025	-500,025	장내

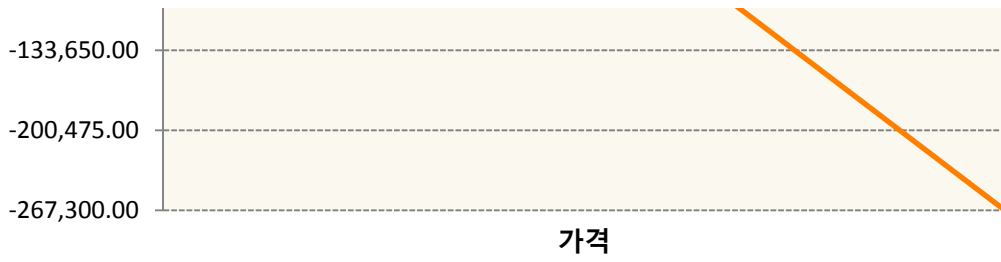
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PB2677-2019-11 콜267.5

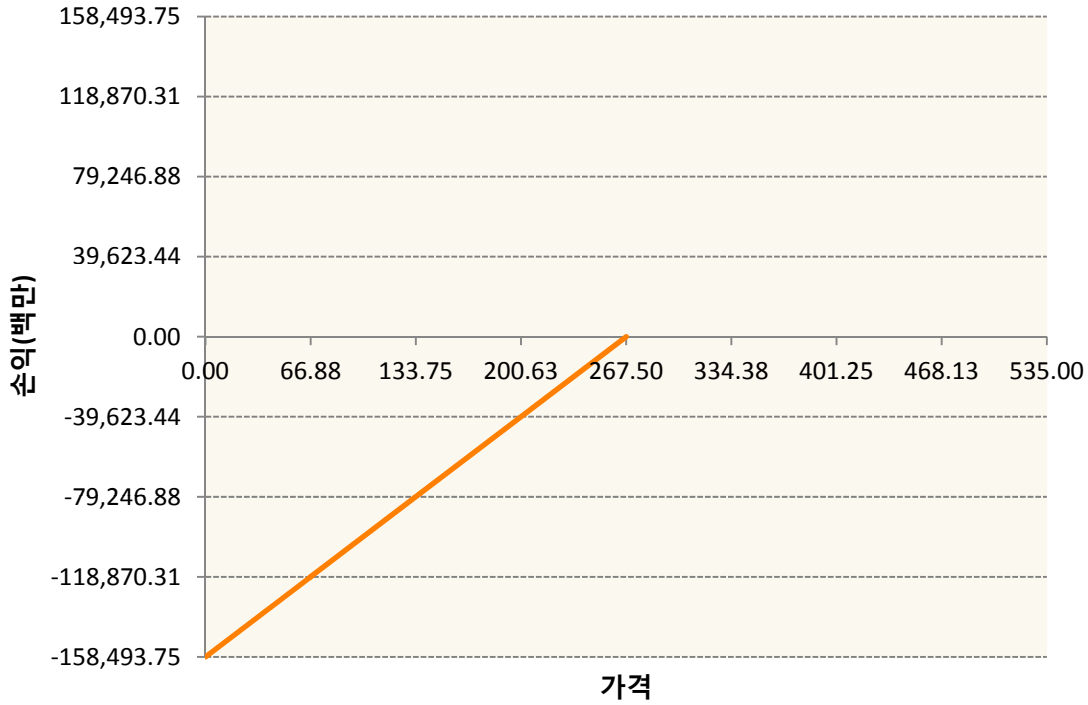


KR4201PB2701-2019-11 콜270





KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PB2677 2019-11 콜267.5							5,516
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,882	2,823	2,754	2,678	2,595	2,507	2,414
-5.33%	2,517	2,405	2,291	2,173	2,054	1,933	1,811
-2.67%	1,687	1,554	1,421	1,288	1,156	1,023	890
0%	328	223	114	0	-117	-236	-357
2.67%	-1,425	-1,482	-1,548	-1,623	-1,705	-1,793	-1,887
5.33%	-3,376	-3,397	-3,427	-3,466	-3,514	-3,569	-3,631
8.00%	-5,395	-5,401	-5,411	-5,428	-5,450	-5,480	-5,516
KR4201PB2701 2019-11 콜270							19,038
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,802	8,642	8,449	8,225	7,975	7,702	7,409

-5.33%	7,882	7,538	7,174	6,794	6,402	5,999	5,588
-2.67%	5,537	5,064	4,591	4,117	3,642	3,168	2,692
0%	1,311	883	445	0	-451	-906	-1,365
2.67%	-4,531	-4,795	-5,091	-5,413	-5,756	-6,118	-6,494
5.33%	-11,306	-11,421	-11,571	-11,754	-11,967	-12,207	-12,472
8.00%	-18,453	-18,489	-18,547	-18,630	-18,740	-18,876	-19,038
KR4301PB2676 2019-11 풋267.5							8,030
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,907	-7,913	-7,924	-7,941	-7,964	-7,994	-8,030
-5.33%	-3,721	-3,794	-3,875	-3,965	-4,061	-4,162	-4,267
-2.67%	-752	-892	-1,033	-1,174	-1,315	-1,456	-1,598
0%	188	135	72	0	-80	-168	-261
2.67%	280	276	268	254	235	210	178
5.33%	283	282	282	281	279	275	269
8.00%	283	283	283	283	282	282	281

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

(단위:백만원)

32,350

공시일	2019-11-01
기준일	2019-10-31

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

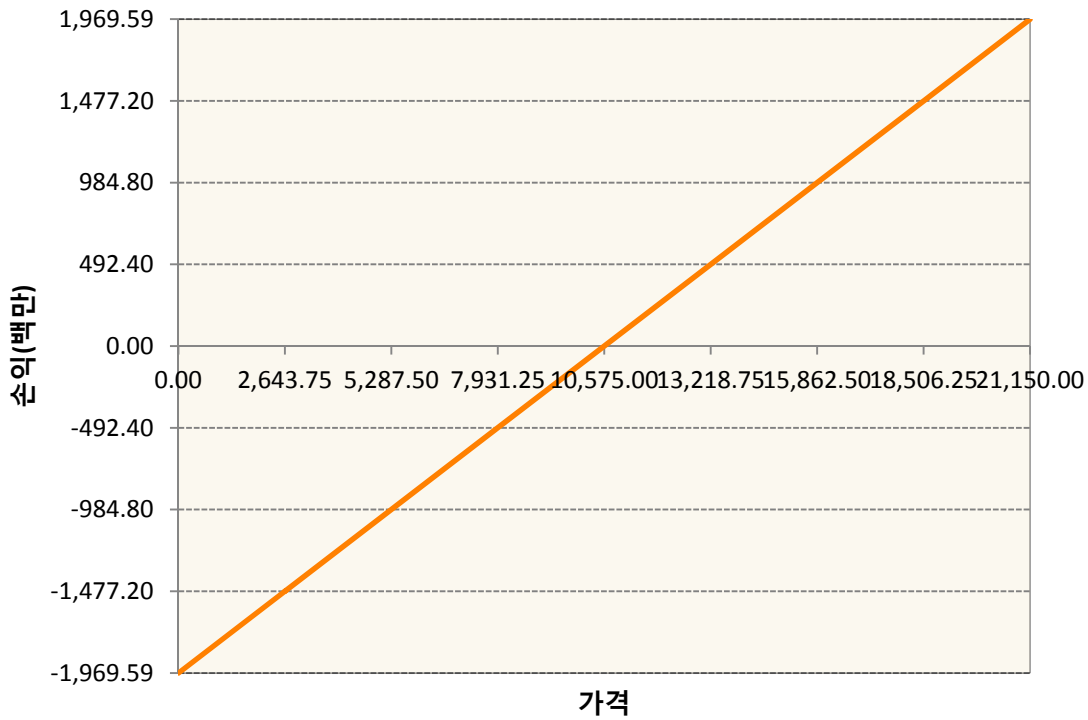
1. 계약금액

(단위:백만원)

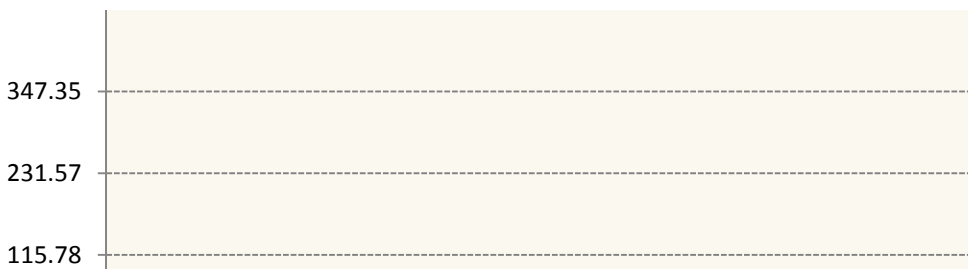
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,970	0	1,970	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,057	-5,057	장내
누계	통화	선도	668	2,758	-2,090	장외

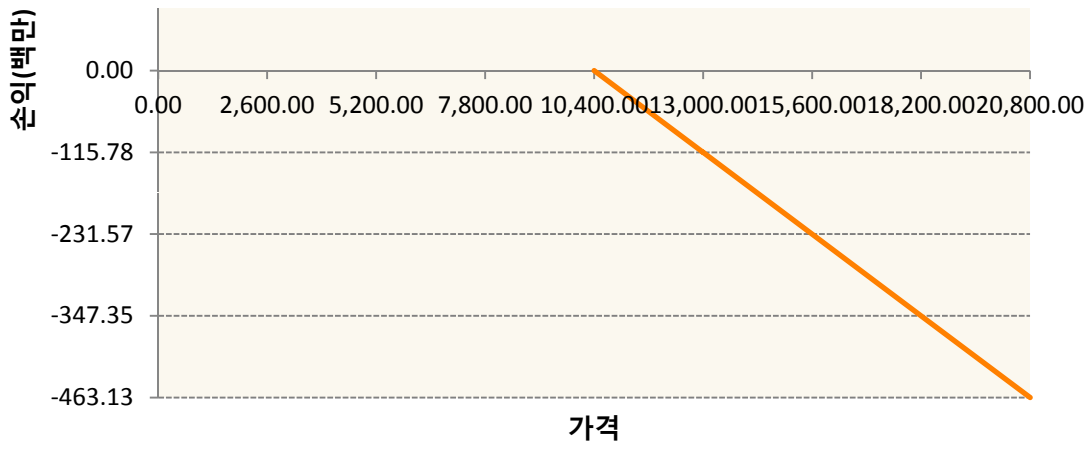
2. 만기시점의 손익구조

HCX9-HSCEI Futures Nov19

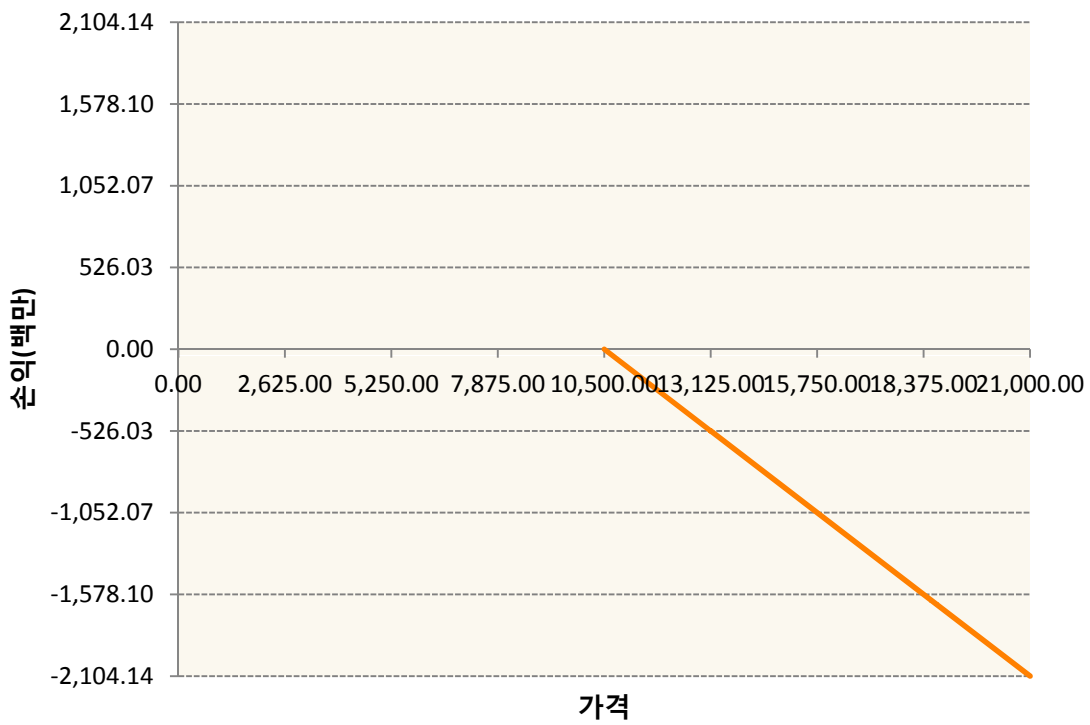


OHHIX9-C104-HSCEI

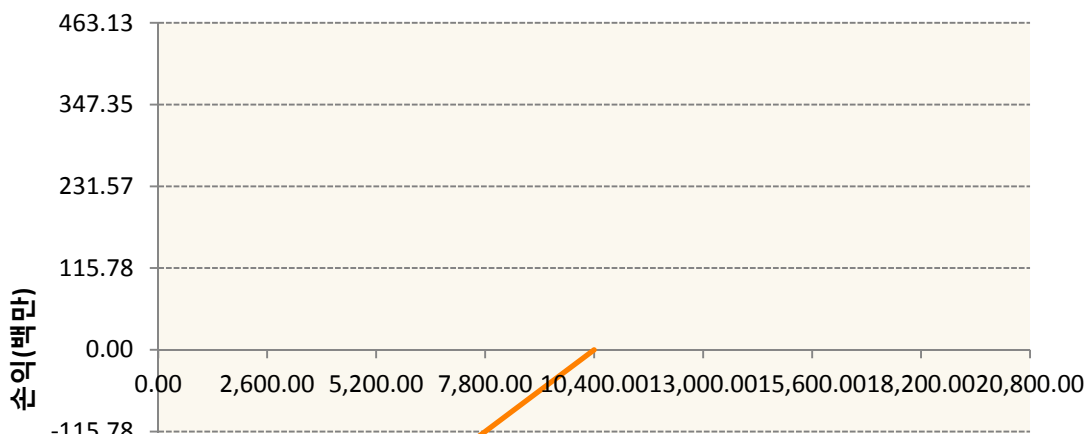


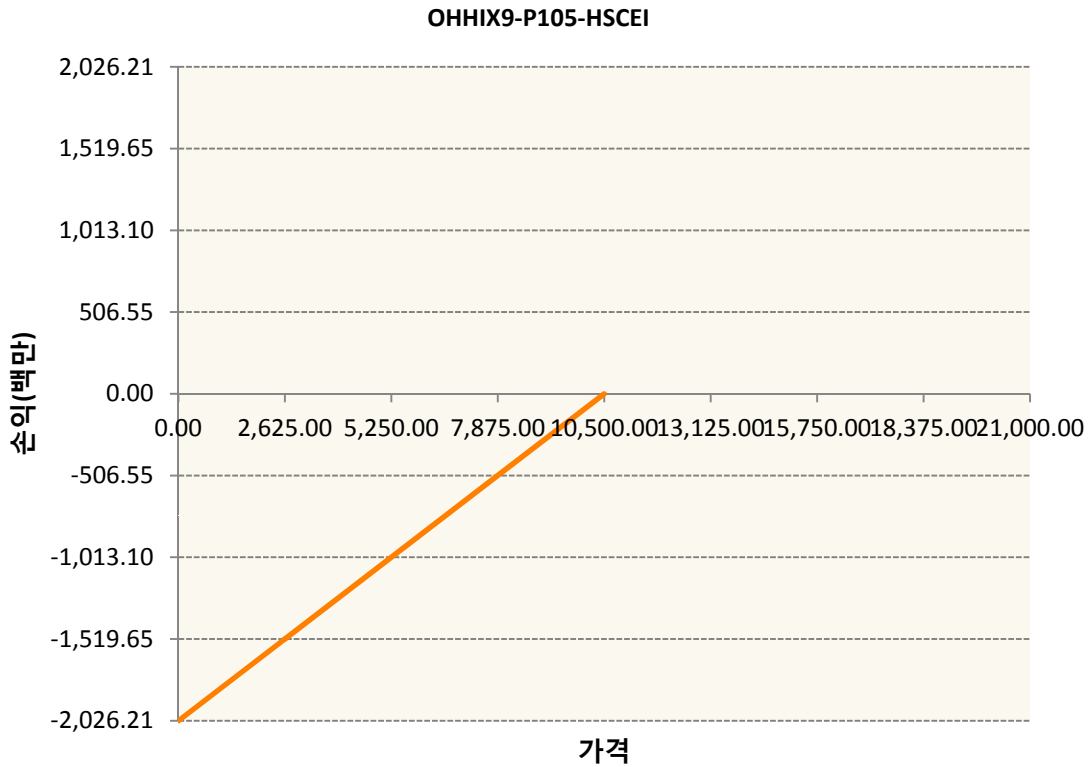


OHHIX9-C105-HSCEI



OHHIX9-P104-HSCEI





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	158
OHHIX9-C1C HSCEI	37
OHHIX9-C1C HSCEI	168
OHHIX9-P10 HSCEI	37
OHHIX9-P10 HSCEI	162

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	586

공시일	2019-11-01
기준일	2019-10-31

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

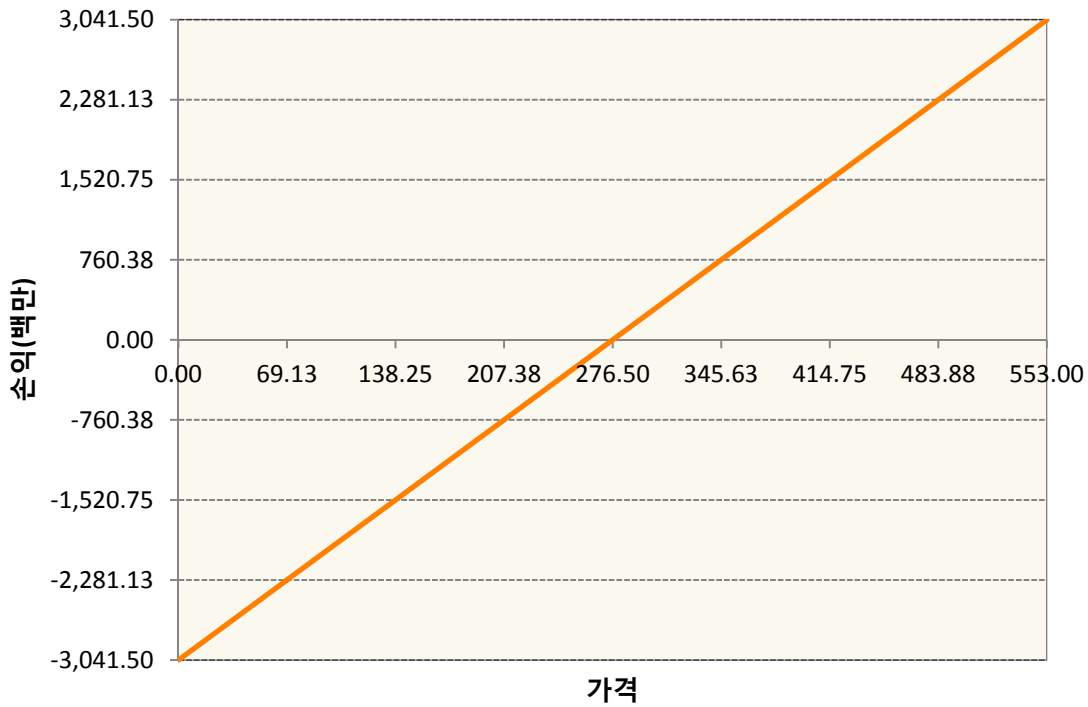
1. 계약금액

(단위:백만원)

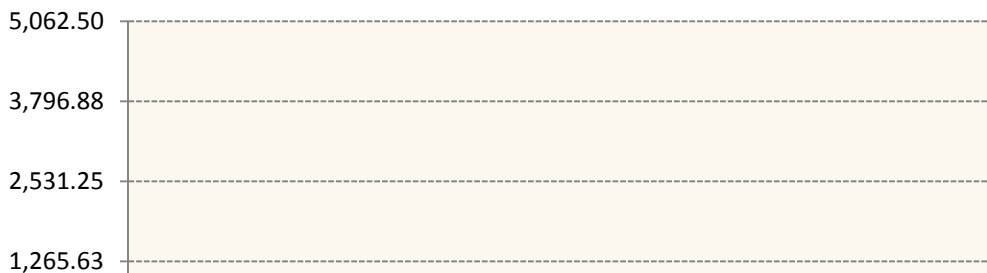
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,042	0	3,042	장내
누계	유가증권	스왑	10,625	0	10,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	10,013	-10,013	장내

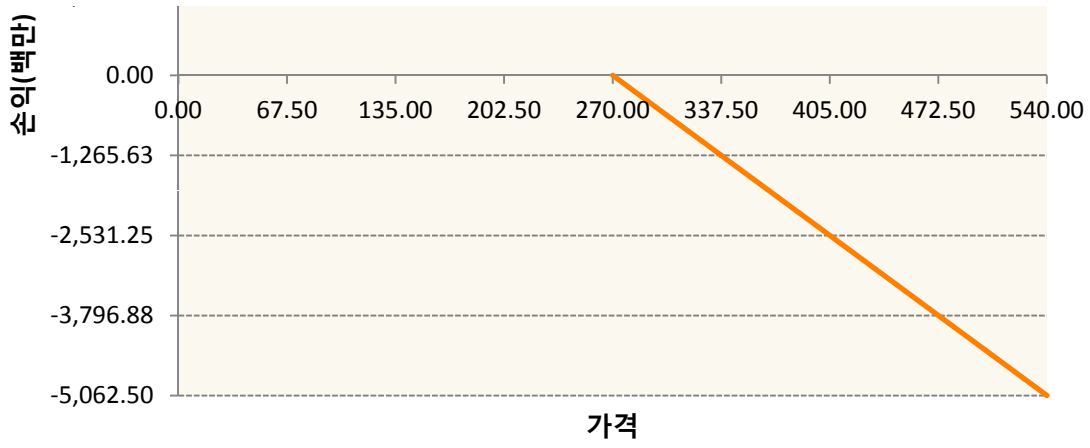
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

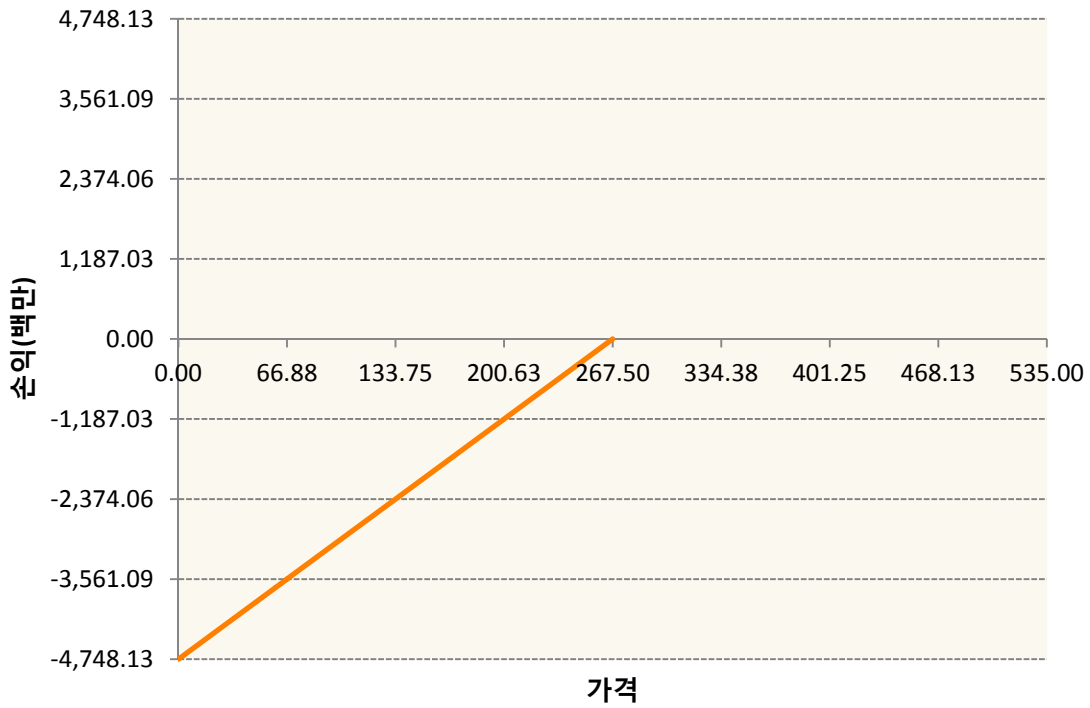


KR4201PB2701-2019-11 콜270

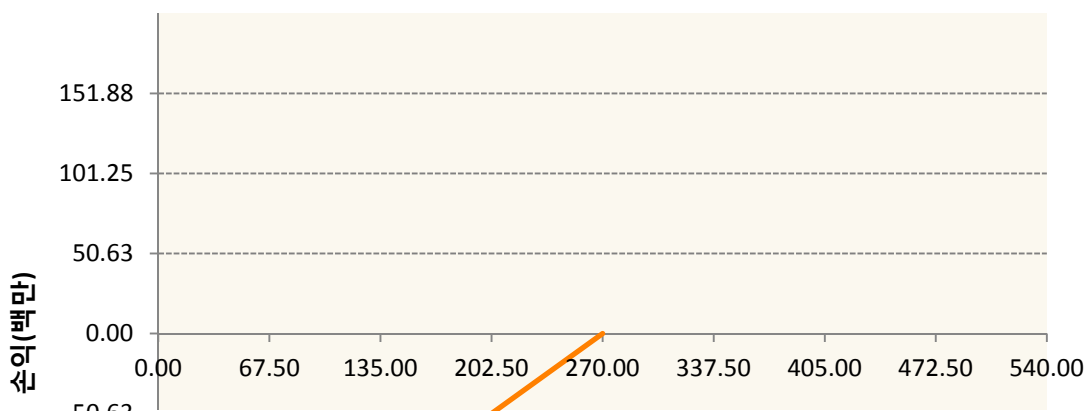




KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



KR4301PB2700-2019-11 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						909
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-909	-909	-909	-909	-909	-909	-909	
-5.33%	-606	-606	-606	-606	-606	-606	-606	
-2.67%	-303	-303	-303	-303	-303	-303	-303	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	303	303	303	303	303	303	303	
5.33%	606	606	606	606	606	606	606	
8.00%	909	909	909	909	909	909	909	
KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						243
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-243	-243	-243	-243	-243	-243	-243	
-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%	243	243	243	243	243	243	243	
KR4201PB2701		2019-11 콜270						361
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	167	164	160	156	151	146	140	
-5.33%	149	143	136	129	121	114	106	
-2.67%	105	96	87	78	69	60	51	
0%	25	17	8	0	-9	-17	-26	
2.67%	-86	-91	-96	-103	-109	-116	-123	
5.33%	-214	-216	-219	-223	-227	-231	-236	
8.00%	-349	-350	-351	-353	-355	-358	-361	
KR4301PB2676		2019-11 풋267.5						241
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-237	-237	-237	-238	-239	-239	-241
-5.33%	-111	-114	-116	-119	-122	-125	-128
-2.67%	-23	-27	-31	-35	-39	-44	-48
0%	6	4	2	0	-2	-5	-8
2.67%	8	8	8	8	7	6	5
5.33%	8	8	8	8	8	8	8
8.00%	8	8	8	8	8	8	8
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	-6	-6	-7
-2.67%	-2	-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)

1,688

공시일	2019-11-01
기준일	2019-10-31

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

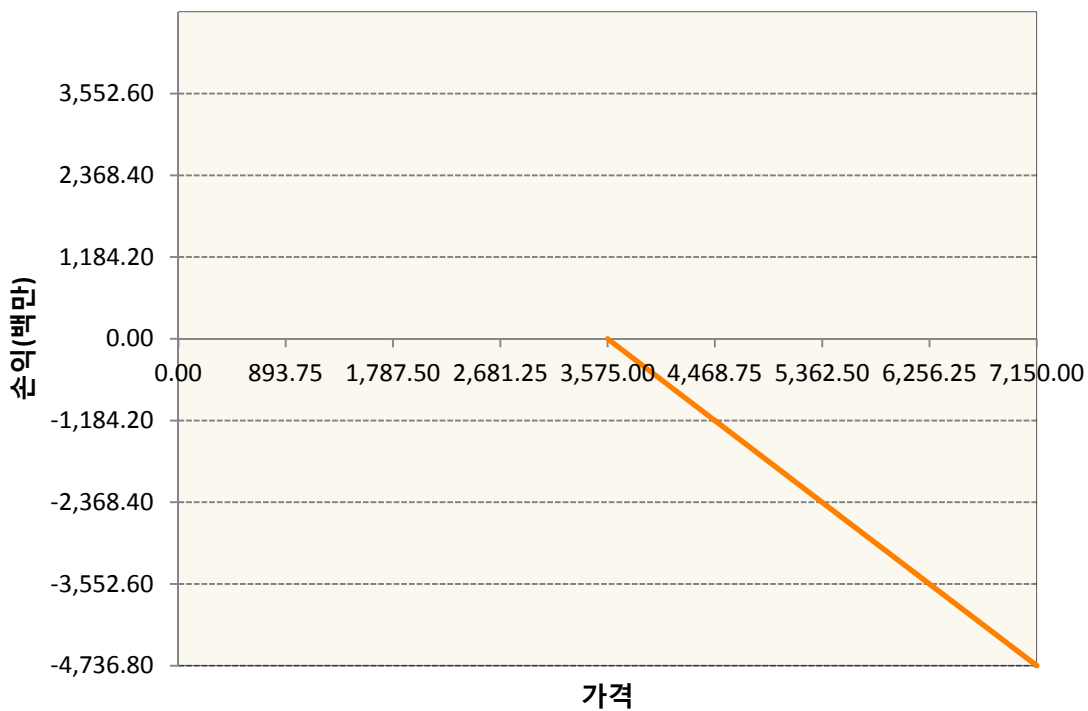
1. 계약금액

(단위:백만원)

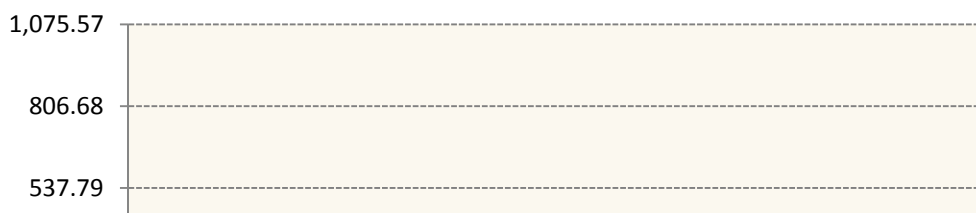
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,970	0	2,970	
누계	유가증권	스왑	20,409	0	20,409	장외
누계	유가증권	옵션	0	11,625	-11,625	장내
누계	통화	선도	2,047	6,105	-4,058	장외

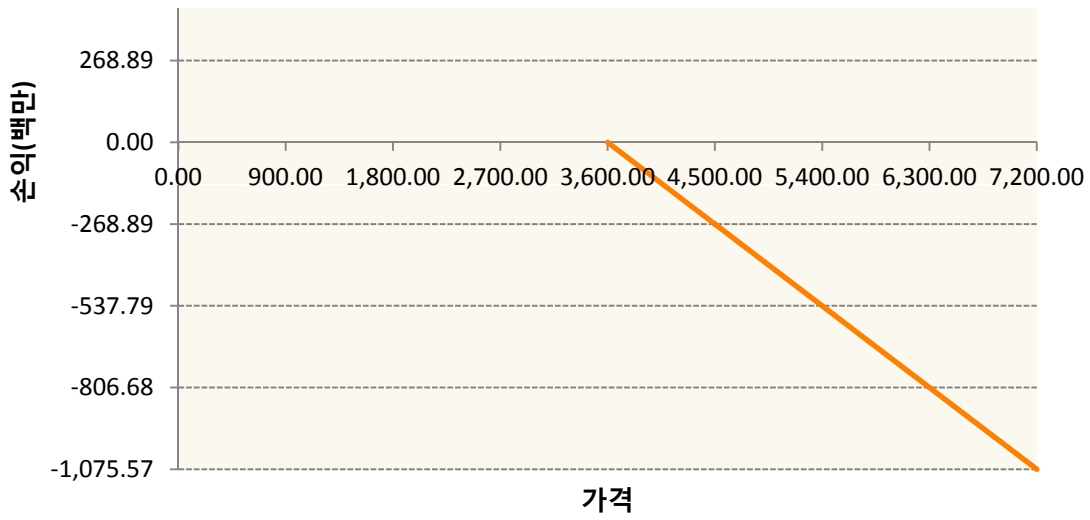
2. 만기시점의 손익구조

OESXX9-C3575-EURO STOXX 50

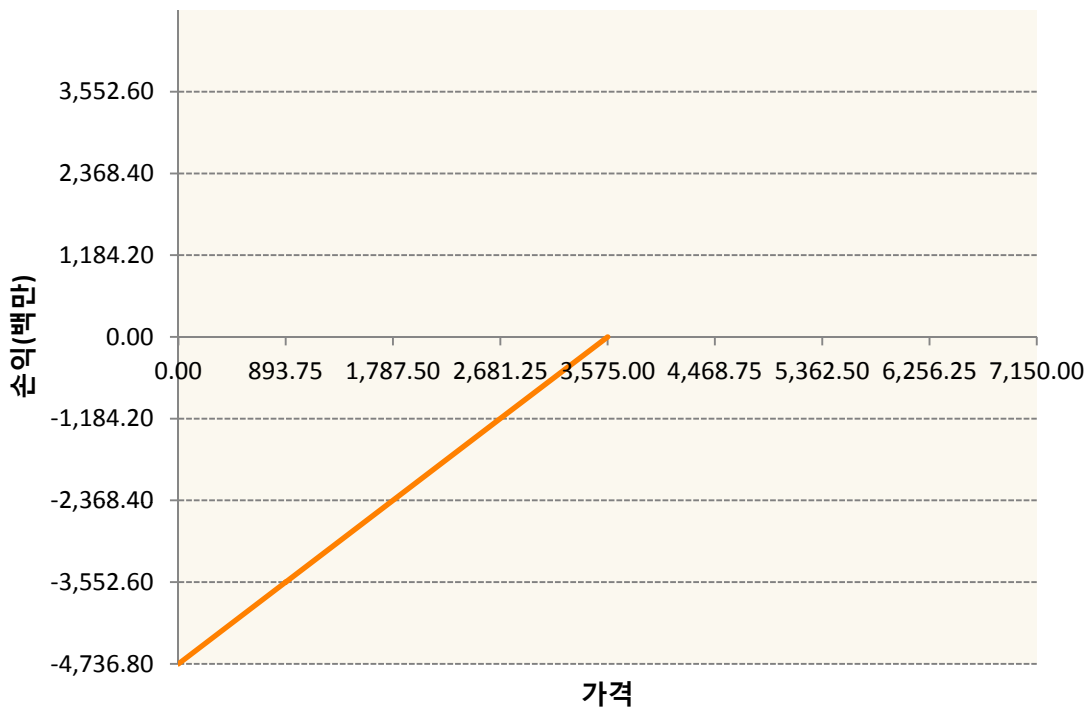


OESXX9-C3600-EURO STOXX 50

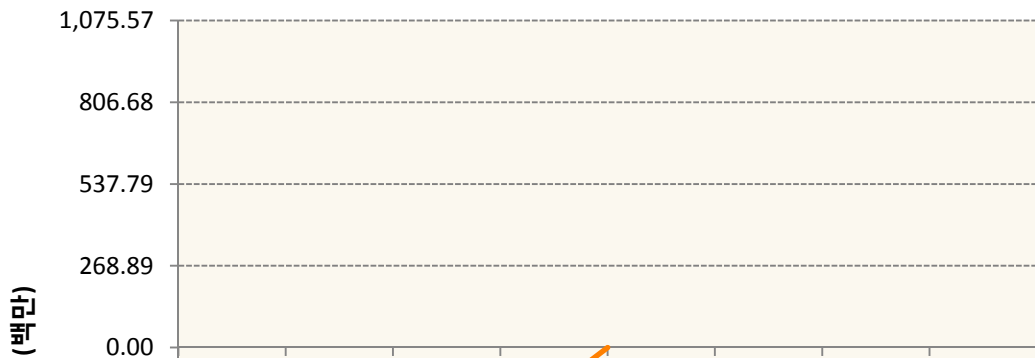


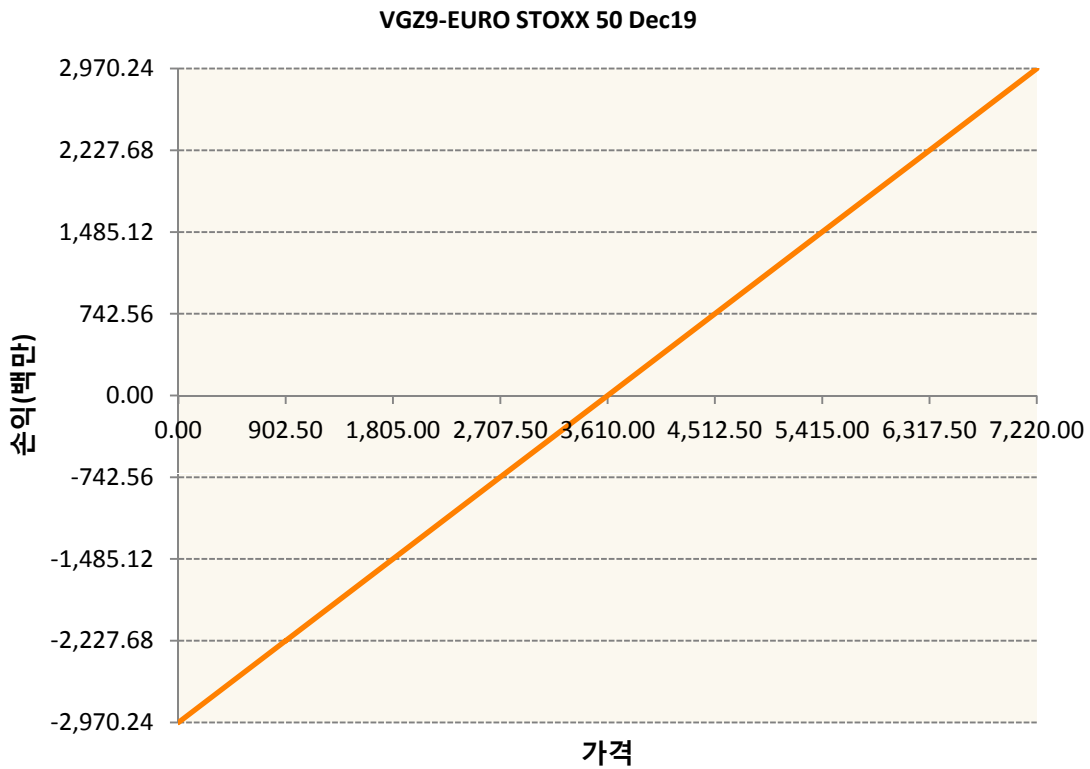
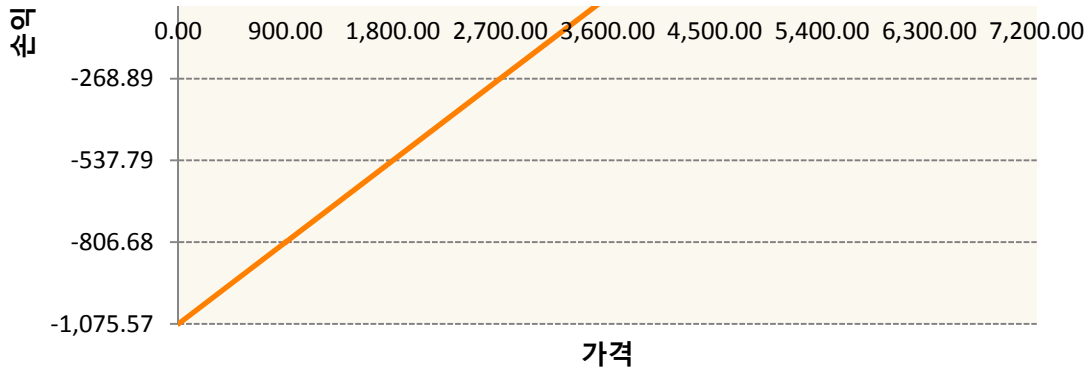


OESXX9-P3575-EURO STOXX 50



OESXX9-P3600-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	19
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E	488
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E	164
OESXX9-C35 EURO STOXX 50	379
OESXX9-C36 EURO STOXX 50	86
OESXX9-P35 EURO STOXX 50	379
OESXX9-P36 EURO STOXX 50	86
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19	238

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

(단위:백만원)

1,138

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

(단위:백만원)

919

공시일	2019-11-01
기준일	2019-10-31

ETF스마트레버리지목표전환형9호

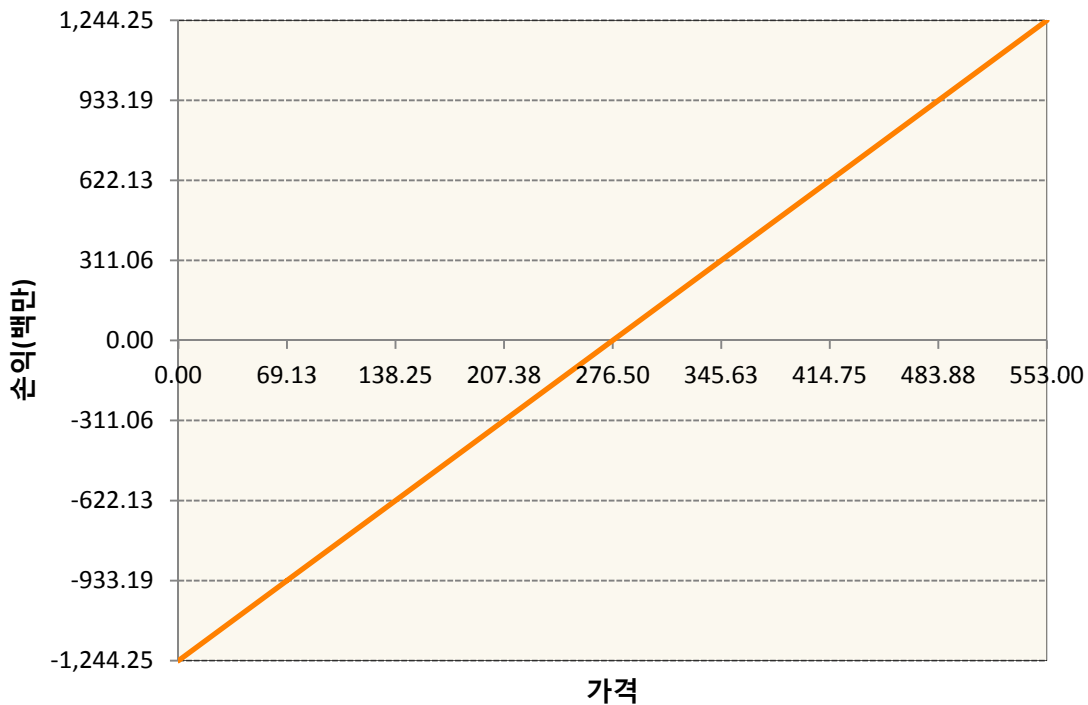
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,244	0	1,244	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						99
가격	기초자산의 변동성							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99	
-5.33%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66	
-2.67%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	33	33	33	33	33	33	33	
5.33%	66	66	66	66	66	66	66	
8.00%	99	99	99	99	99	99	99	

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

(단위:백만원)

80

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

(단위:백만원)

124

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

(단위:백만원)

40

공시일	2019-11-01
기준일	2019-10-31

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

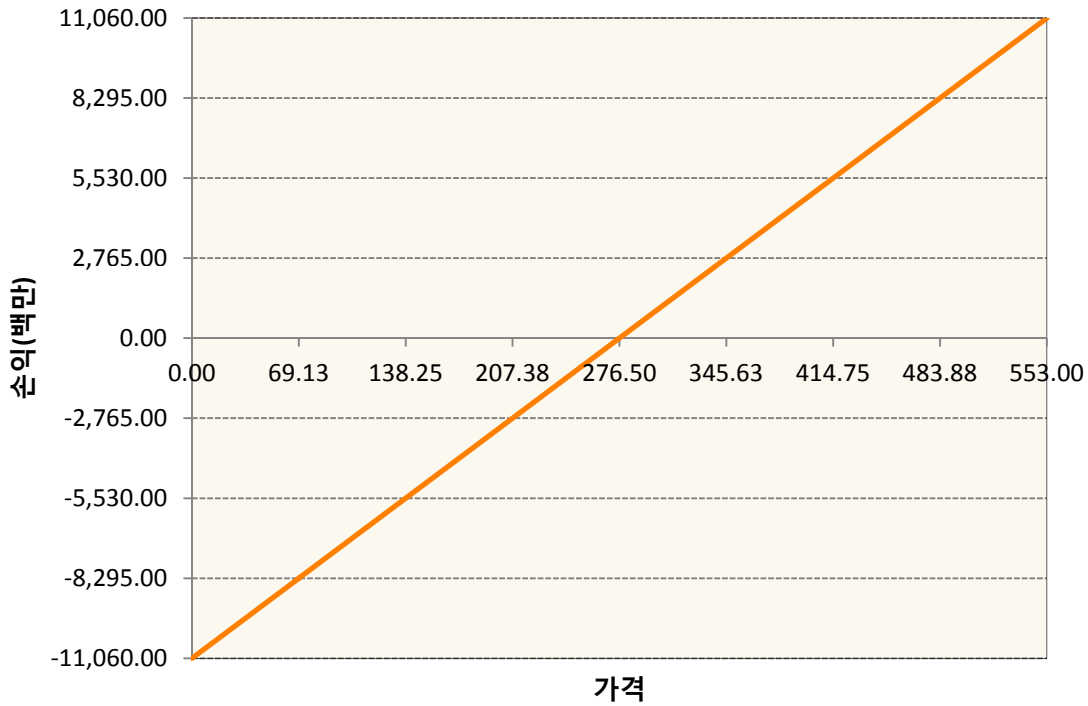
1. 계약금액

(단위:백만원)

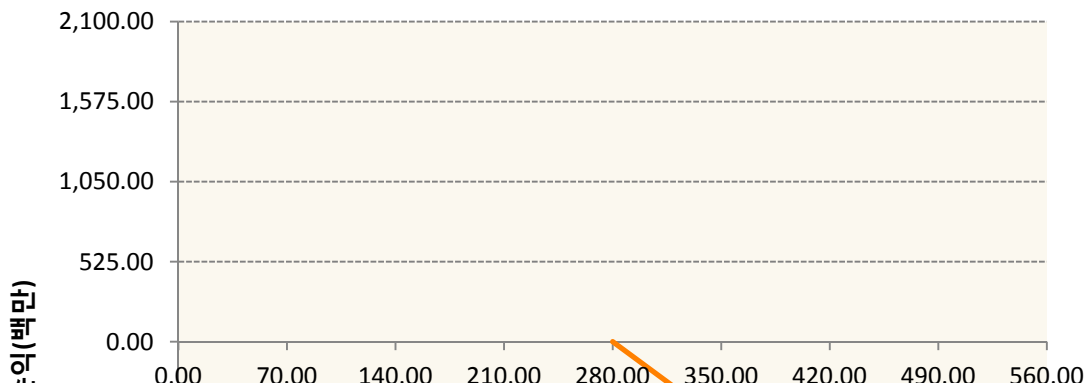
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,060	0	11,060	장내
누계	유가증권	옵션	3,561	20,604	-17,043	장내

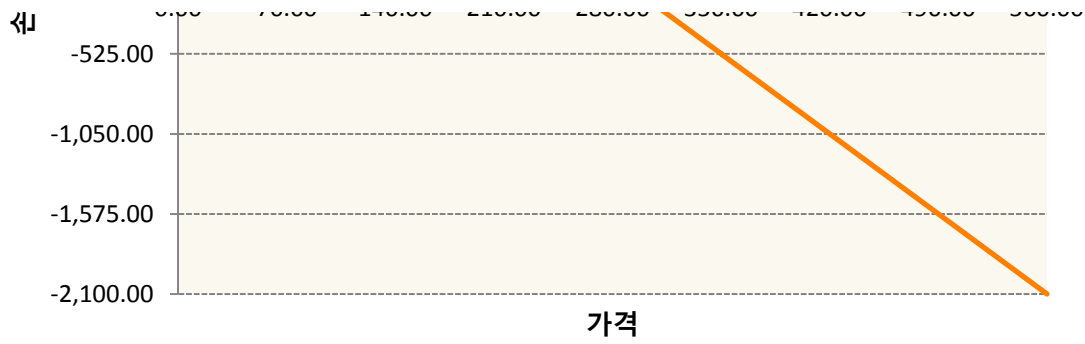
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

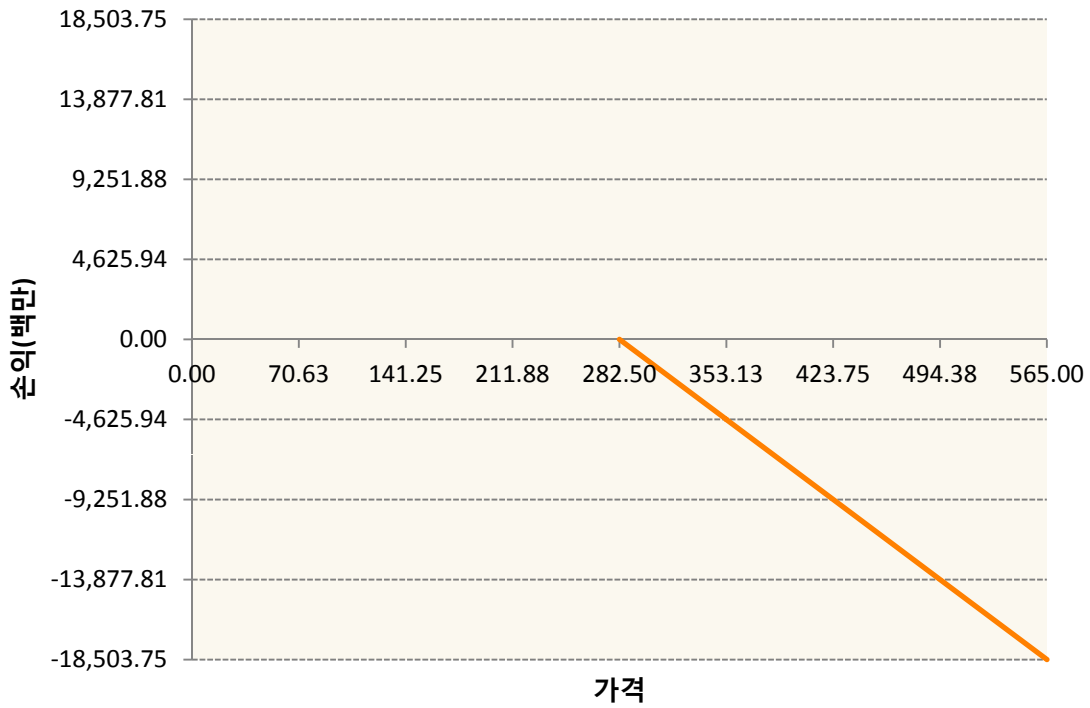


KR4201PB2800-2019-11 콜280

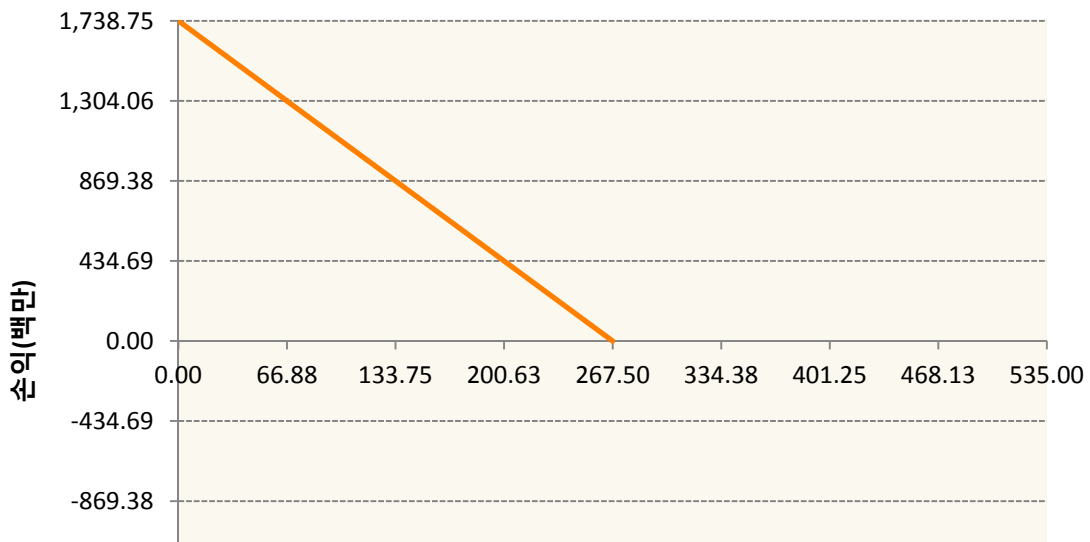


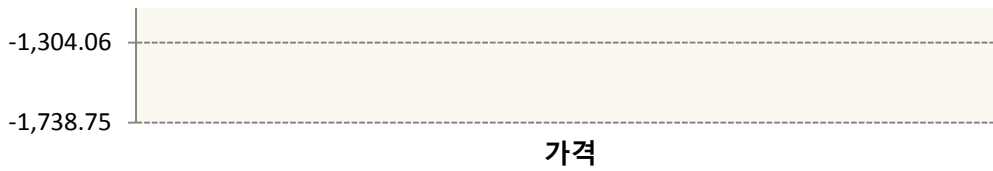


KR4201PB2826-2019-11 콜282.5

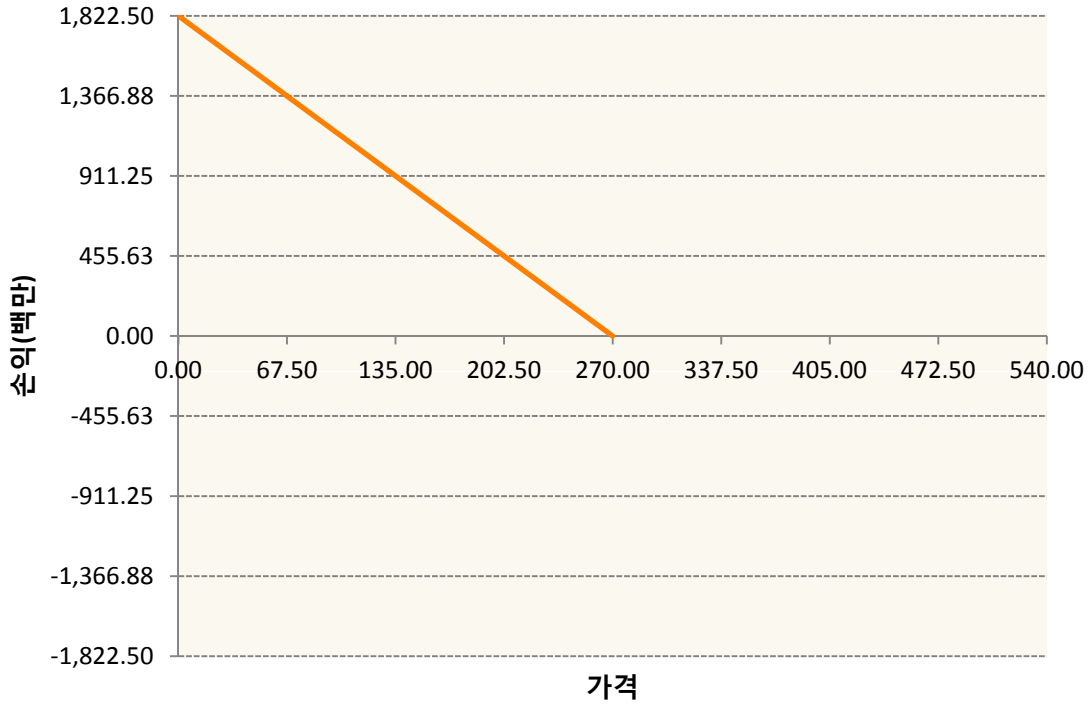


KR4301PB2676-2019-11 풋267.5





KR4301PB2700-2019-11 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						883
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-883	-883	-883	-883	-883	-883	-883	
-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%	883	883	883	883	883	883	883	
KR4201PB2800		2019-11 콜280						117
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	30	30	30	29	28	27	26	
-5.33%	29	28	27	26	24	22	20	
-2.67%	24	22	20	17	14	11	8	

0%	11	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	-16	-20	-24	-27	-31	-35	-38
5.33%	-56	-59	-62	-65	-68	-71	-74
8.00%	-105	-107	-108	-110	-112	-115	-117
KR4201PB2826 2019-11 콜282.5							949
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	210	208	206	202	197	191	183
-5.33%	204	198	190	180	168	155	140
-2.67%	175	159	142	122	101	78	54
0%	86	58	29	0	-30	-60	-91
2.67%	-108	-141	-174	-207	-240	-273	-307
5.33%	-420	-448	-476	-505	-535	-565	-596
8.00%	-825	-841	-859	-880	-902	-925	-949
KR4301PB2676 2019-11 풋267.5							88
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	87	87	87	87	87	88	88
-5.33%	41	42	43	43	45	46	47
-2.67%	8	10	11	13	14	16	18
0%	-2	-1	-1	0	1	2	3
2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-2	-2
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
KR4301PB2700 2019-11 풋270							105
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	104	104	104	104	104	104	105
-5.33%	55	56	56	57	58	58	59
-2.67%	15	16	18	19	21	22	24
0%	-3	-2	-1	0	1	3	4
2.67%	-6	-6	-6	-5	-5	-4	-4
5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6

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

(단위:백만원)

1,765

공시일	2019-11-01
기준일	2019-10-31

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	6,980	0	6,980	
누계	유가증권	수익증권	168,977	0	168,977	

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	2019-11-01
기준일	2019-10-31

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	2,909	0	2,909	
누계	유가증권	수익증권	209,309	0	209,309	

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	2019-11-01
기준일	2019-10-31

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	69,804	0	69,804	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	485,921	0	485,921	
누계	통화	선도	0	503,869	-503,869	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		1,955
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E		931
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		652
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E		1,526
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		689
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,675
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		2,457
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		465
FX21019V02 KRW/USD 21-11-19E		5,063
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,747
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,396
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,792
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,498
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,829
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		931
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		931
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,861
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,861
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		931
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		931
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		931
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		931
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		465

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

(단위:백만원)

12,772

공시일	2019-11-01
기준일	2019-10-31

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

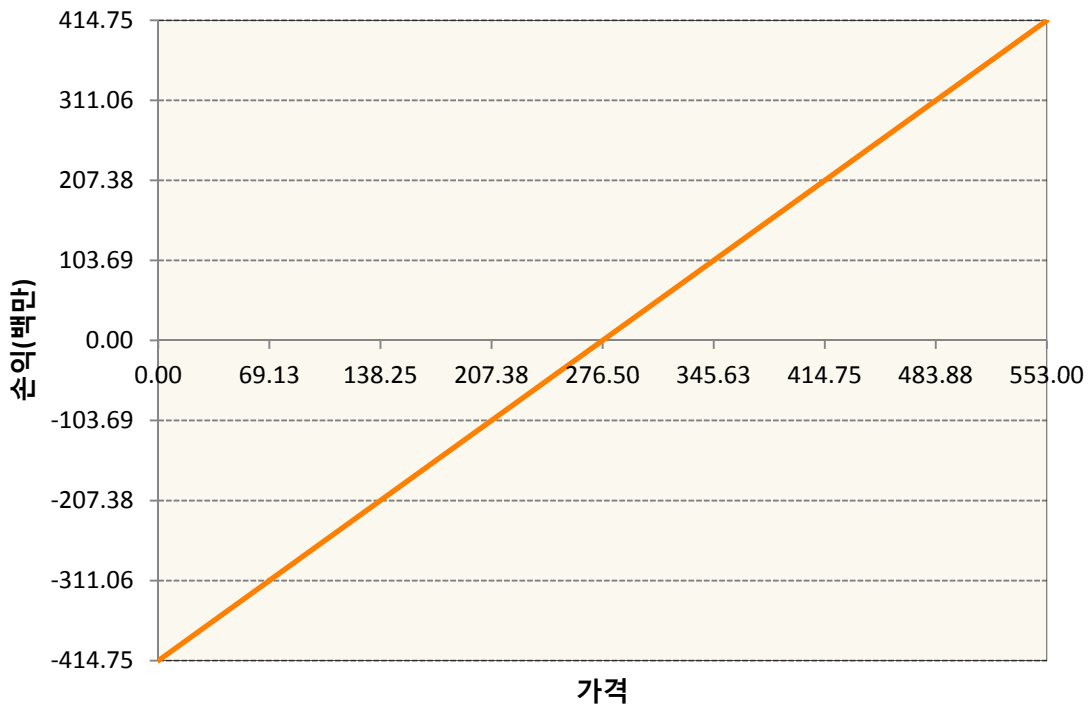
1. 계약금액

(단위:백만원)

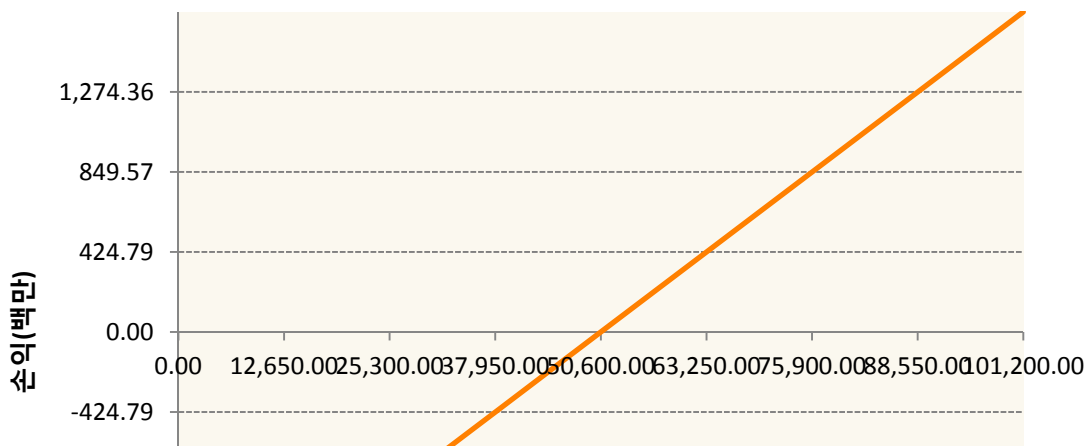
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,114	0	2,114	장내

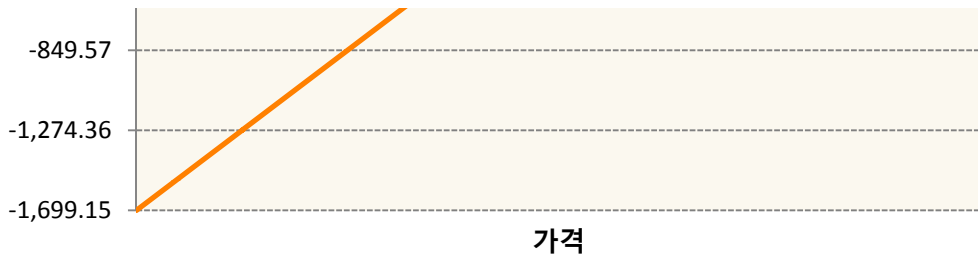
2. 만기시점의 손익구조

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)

178

공시일	2019-11-01
기준일	2019-10-31

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

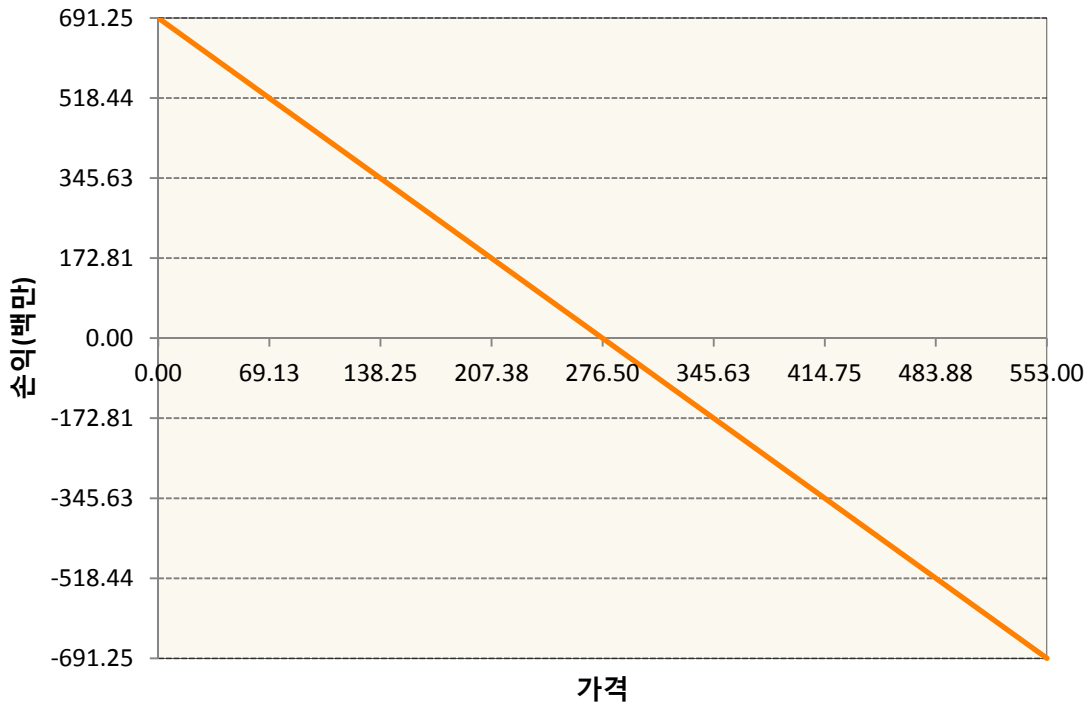
1. 계약금액

(단위:백만원)

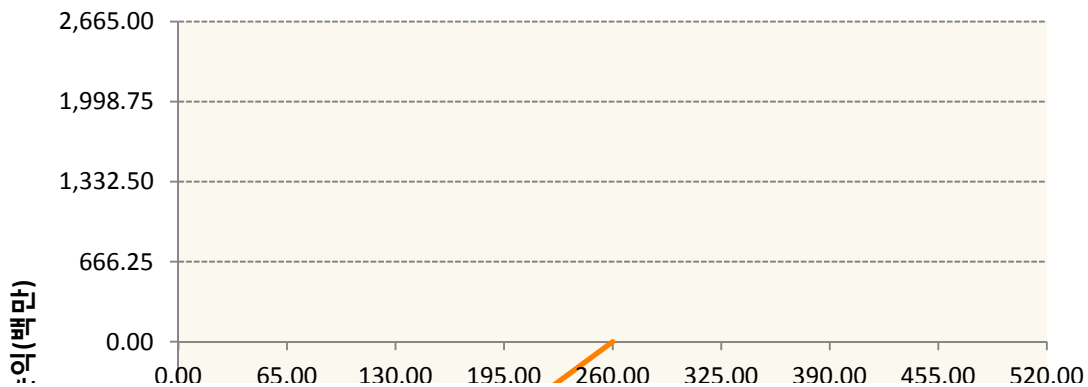
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	691	-691	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,715	-3,715	장내

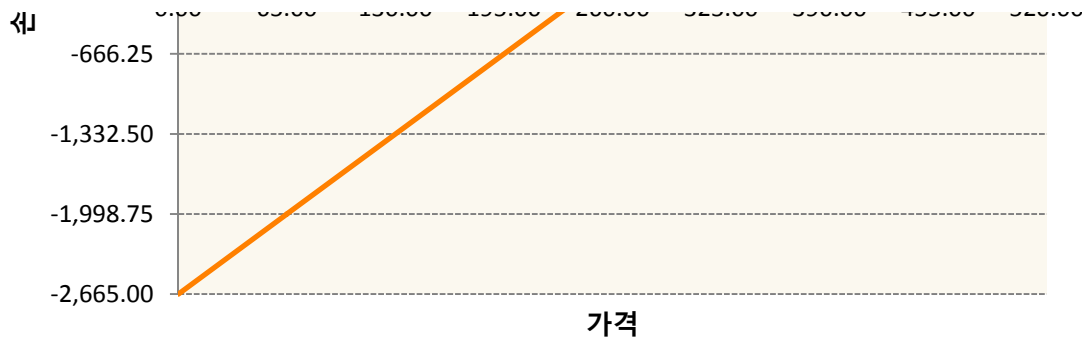
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

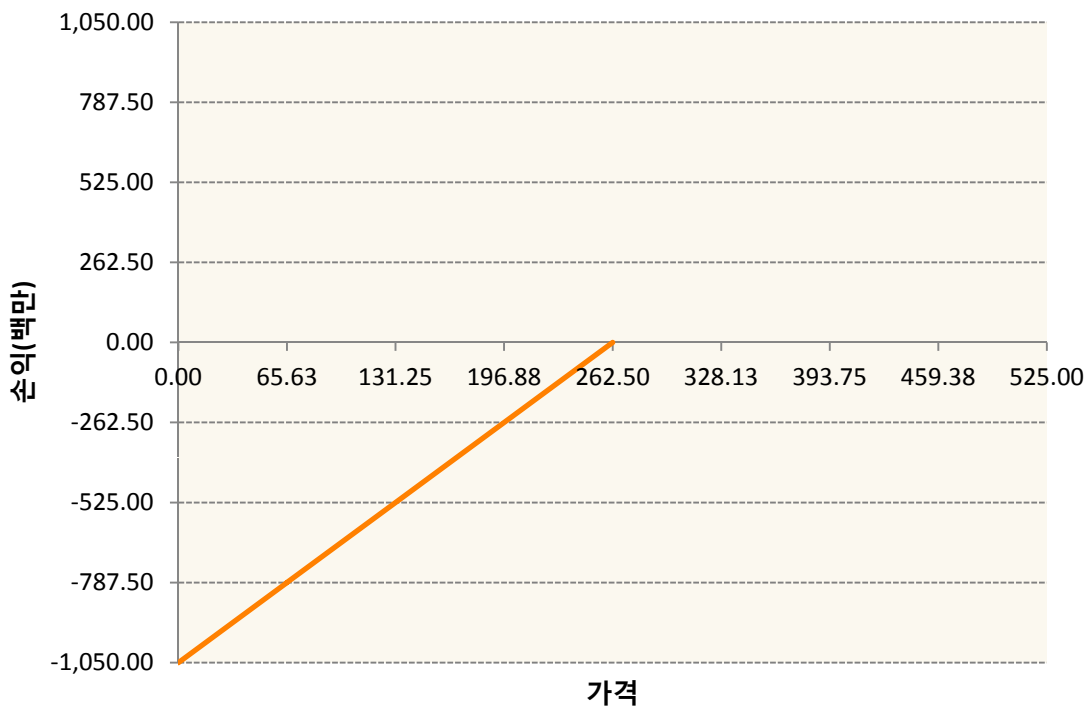


KR4301PB2601-2019-11 풋260





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						76
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-67	-68	-70	-71	-73	-75	-76
-5.33%	-16	-19	-21	-23	-26	-28	-30
-2.67%	-1	-2	-3	-4	-5	-7	-8
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

38

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-35	-36	-36	-36	-37	-37	-38
-5.33%	-11	-12	-13	-14	-15	-16	-17
-2.67%	-1	-2	-2	-3	-4	-4	-5
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)

86

공시일	2019-11-01
기준일	2019-10-31

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	16,008	0	16,008	
누계	통화	선도	233	16,008	-15,776	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019V01 KRW/USD 10-12-19E		369
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		316
FX21019V02 KRW/USD 13-11-19E		279
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		316
FX21019V04 USD/KRW 13-11-19E		19

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

(단위:백만원)

412

공시일	2019-11-01
기준일	2019-10-31

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	202	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)

60

공시일	2019-11-01
기준일	2019-10-31

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

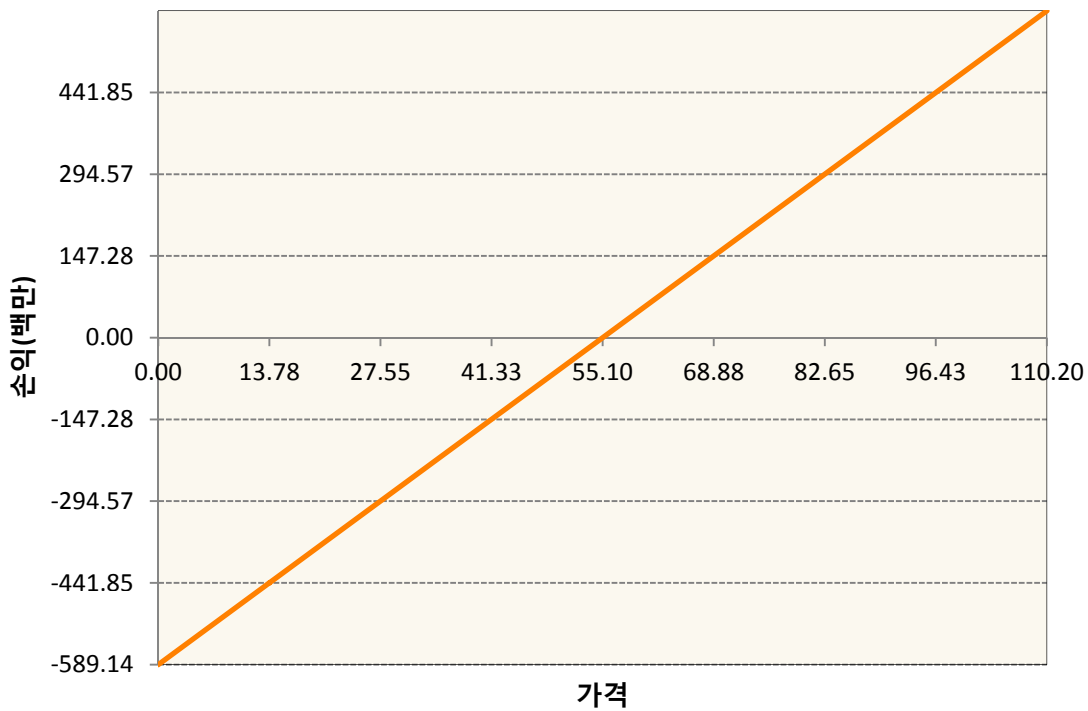
1. 계약금액

(단위:백만원)

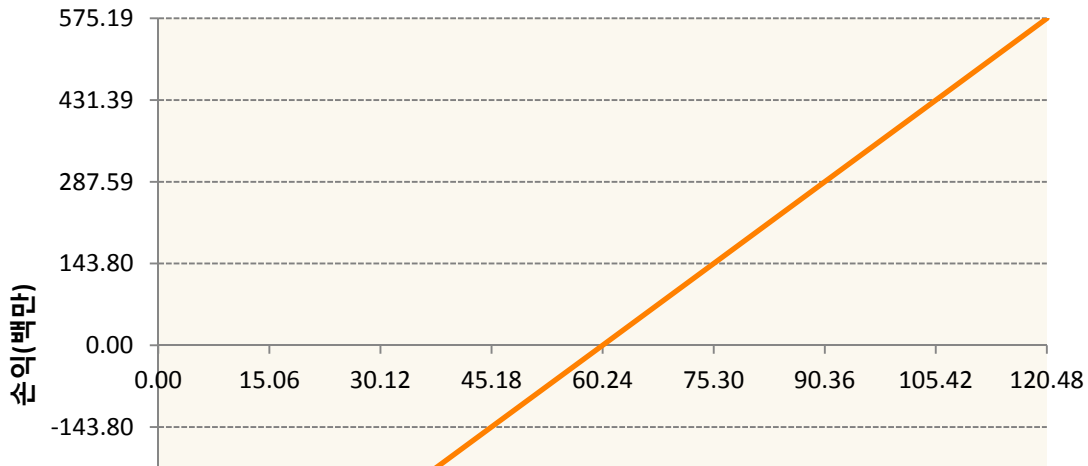
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,490	291	2,199	

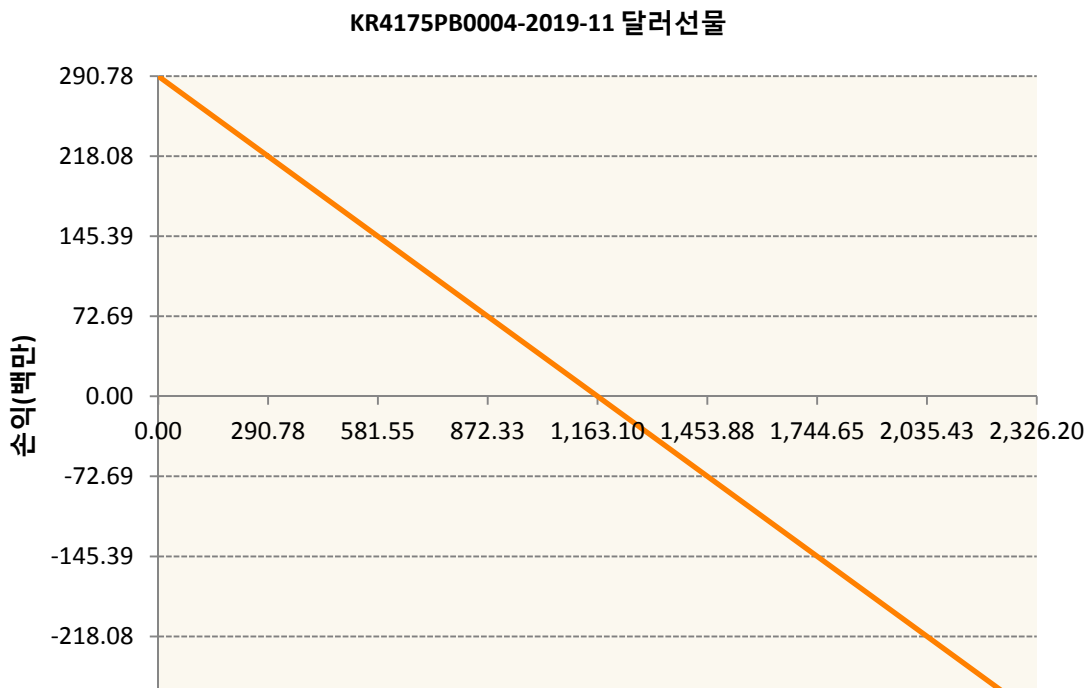
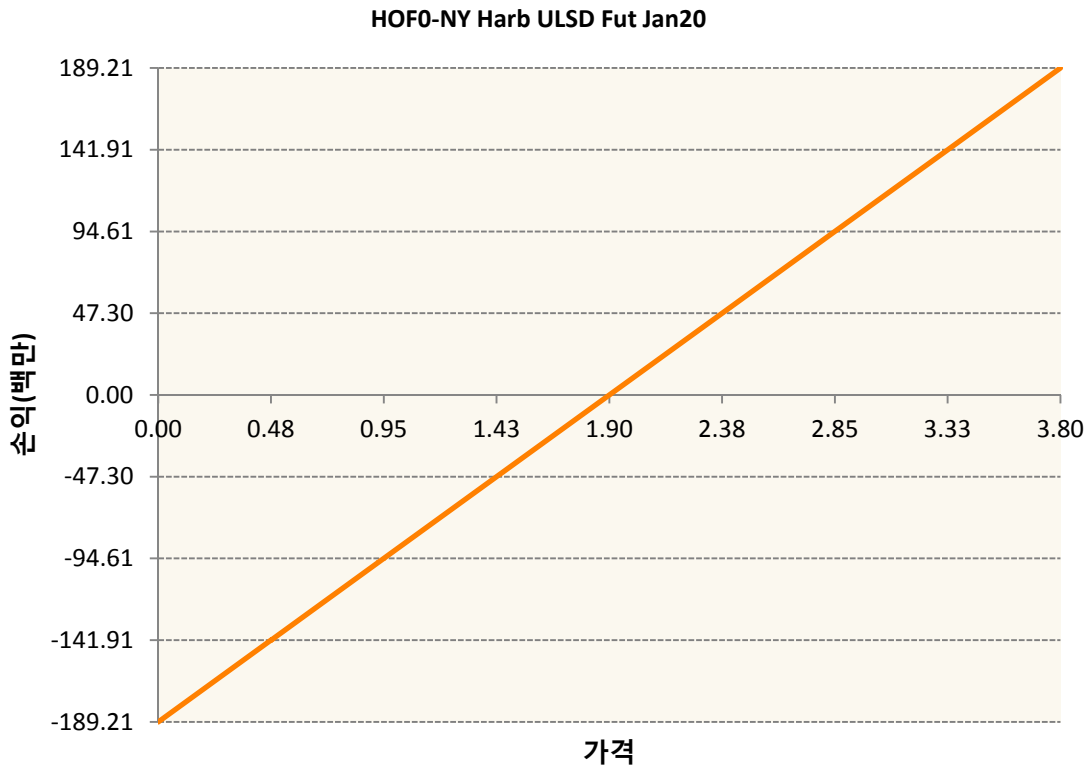
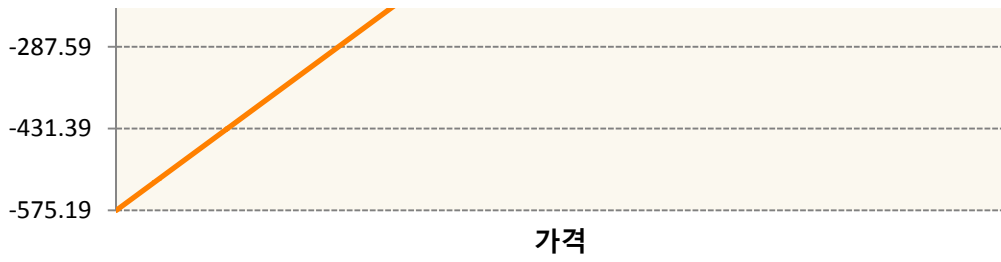
2. 만기시점의 손익구조

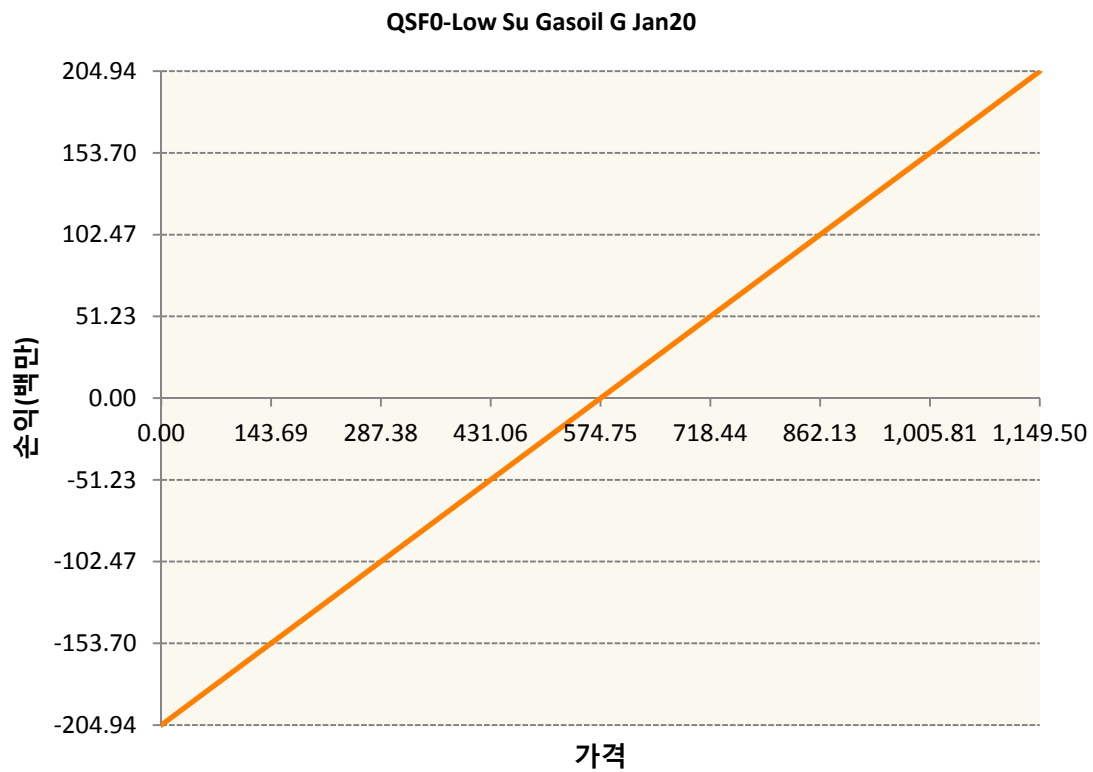
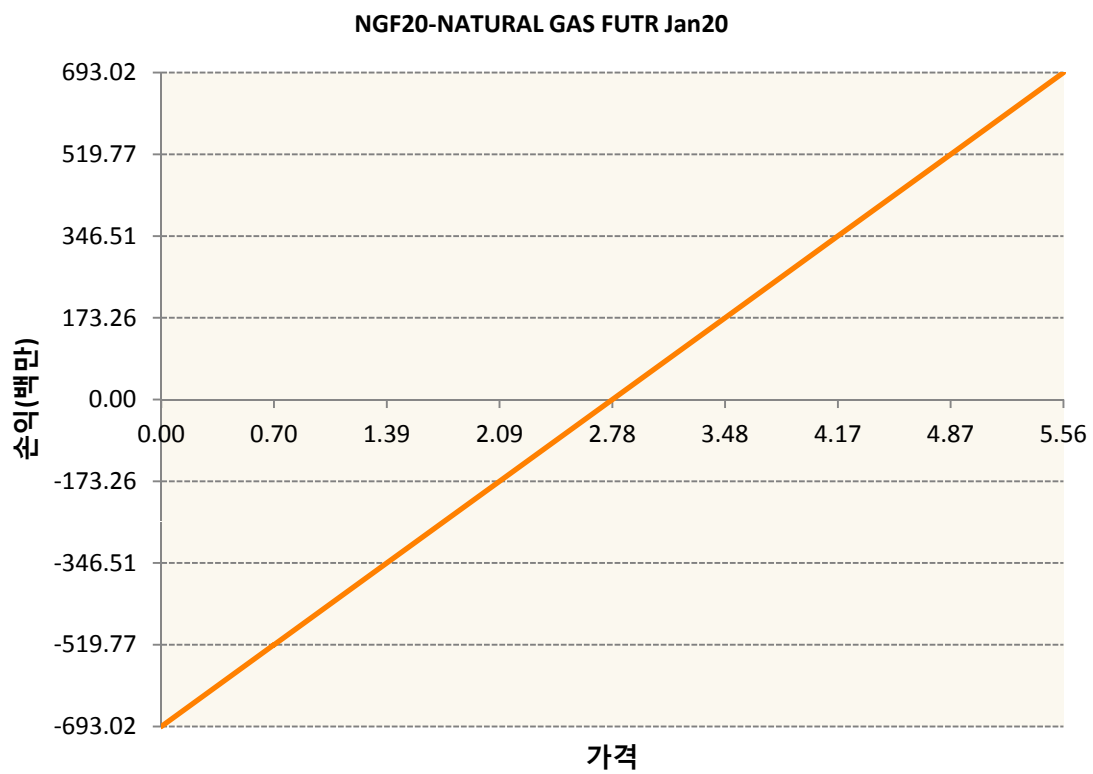
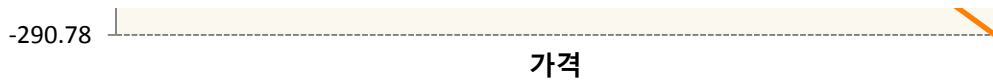
CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20



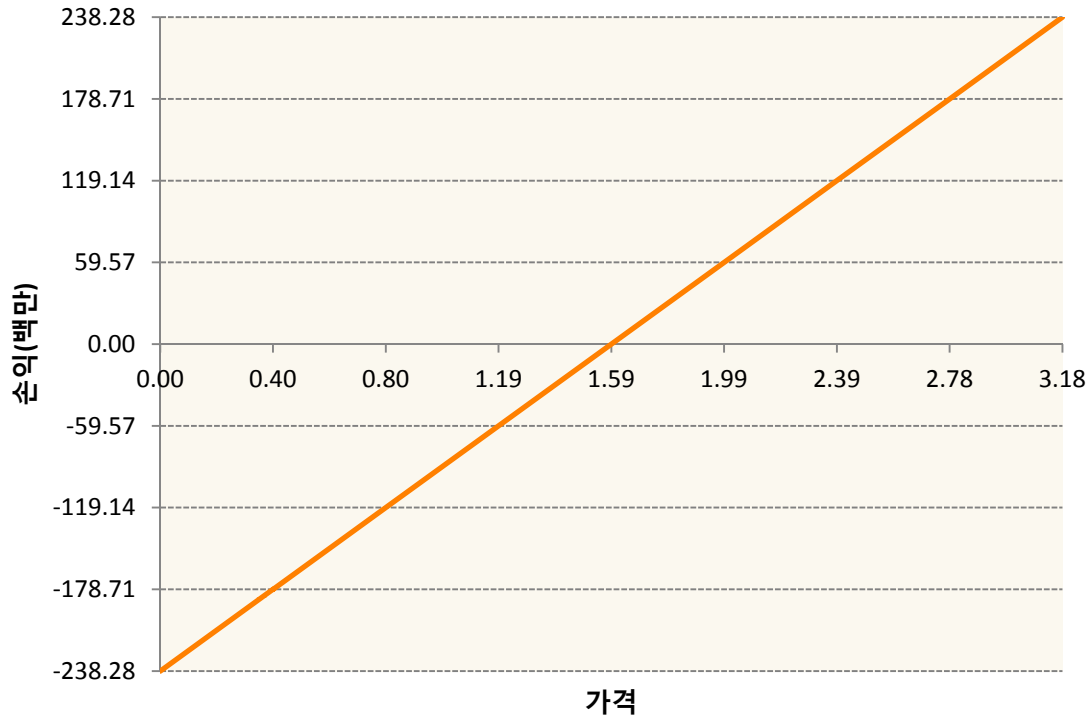
COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20







XBF0-GASOLINE RBOB FUT Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLF0	WTI CRUDE FUTURE Jan20	47
COF0	BRENT CRUDE FUTR Jan20	46
HOF0	NY Harb ULSD Fut Jan20	15
KR4175PB00	2019-11 달러선물	23
NGF20	NATURAL GAS FUTR Jan20	55
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	16
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	19

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

(단위:백만원)

416

공시일	2019-11-01
기준일	2019-10-31

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

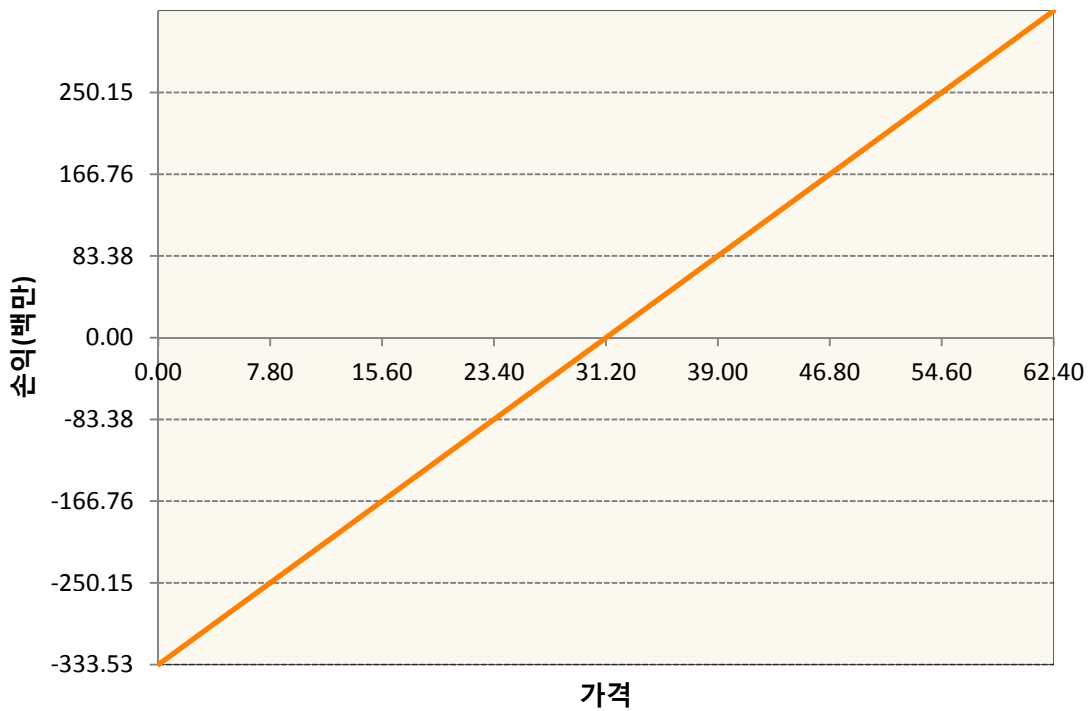
1. 계약금액

(단위:백만원)

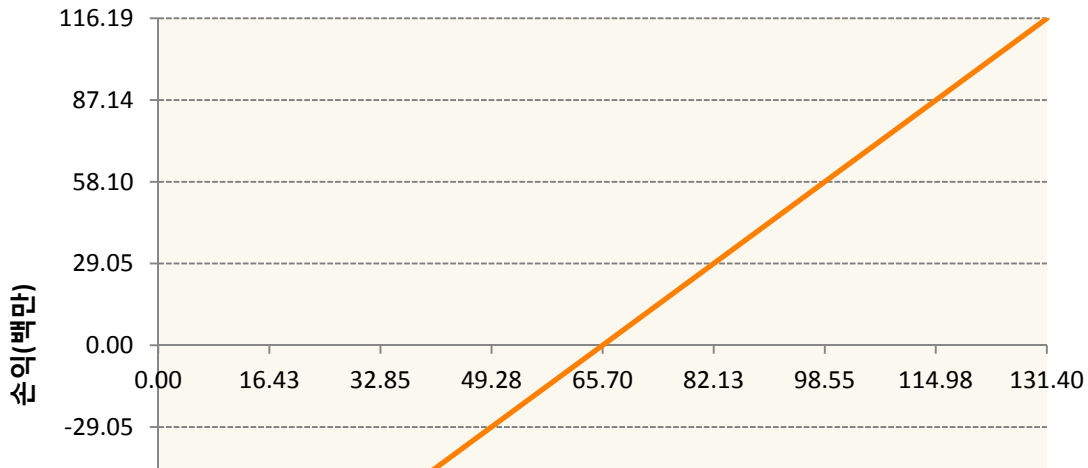
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,864	93	2,771	

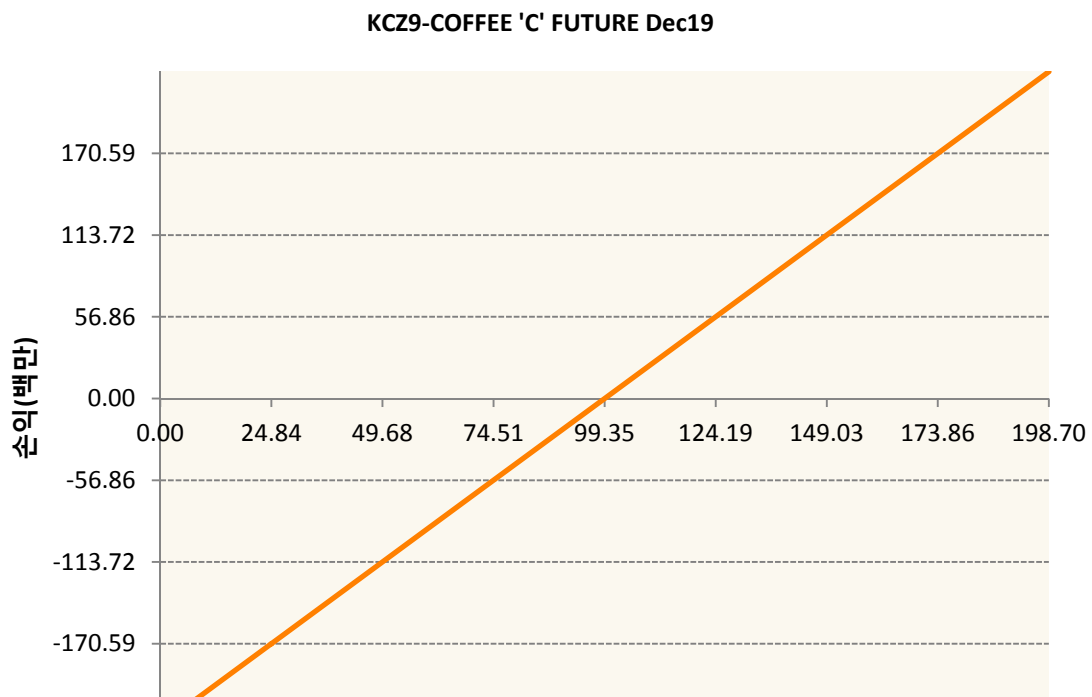
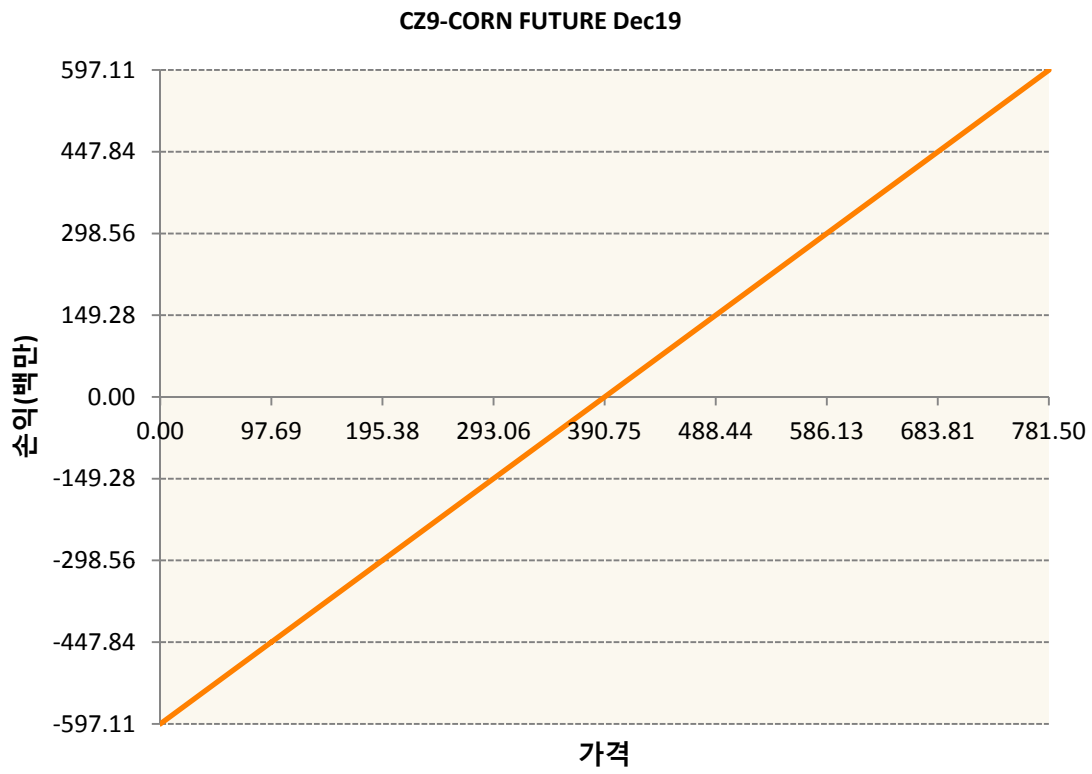
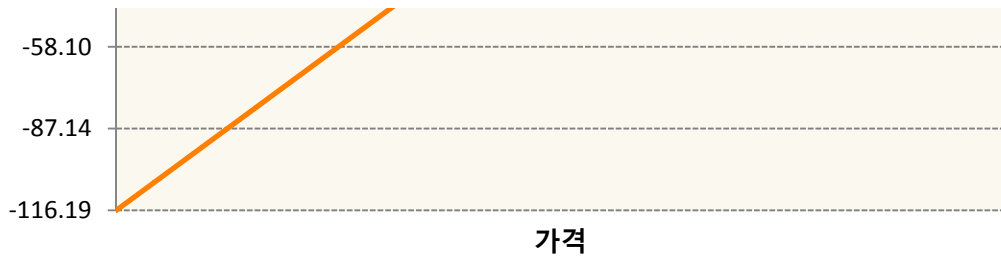
2. 만기시점의 손익구조

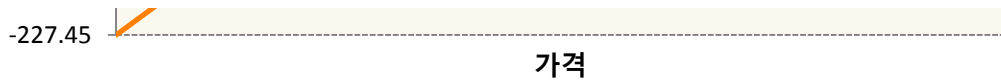
BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20



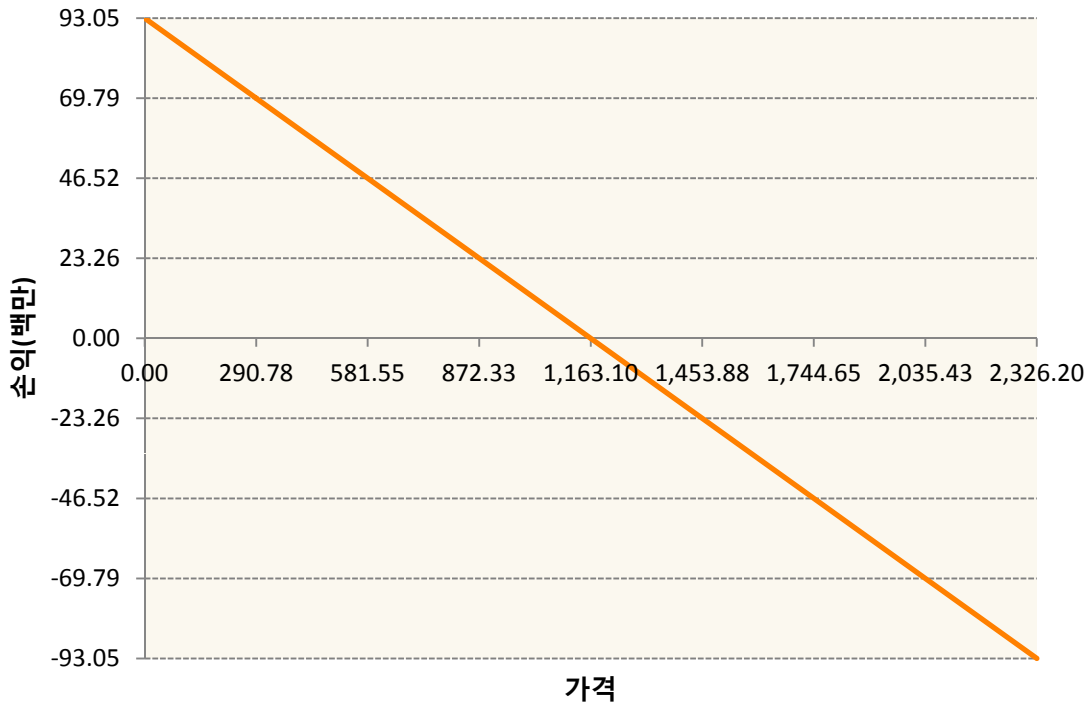
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



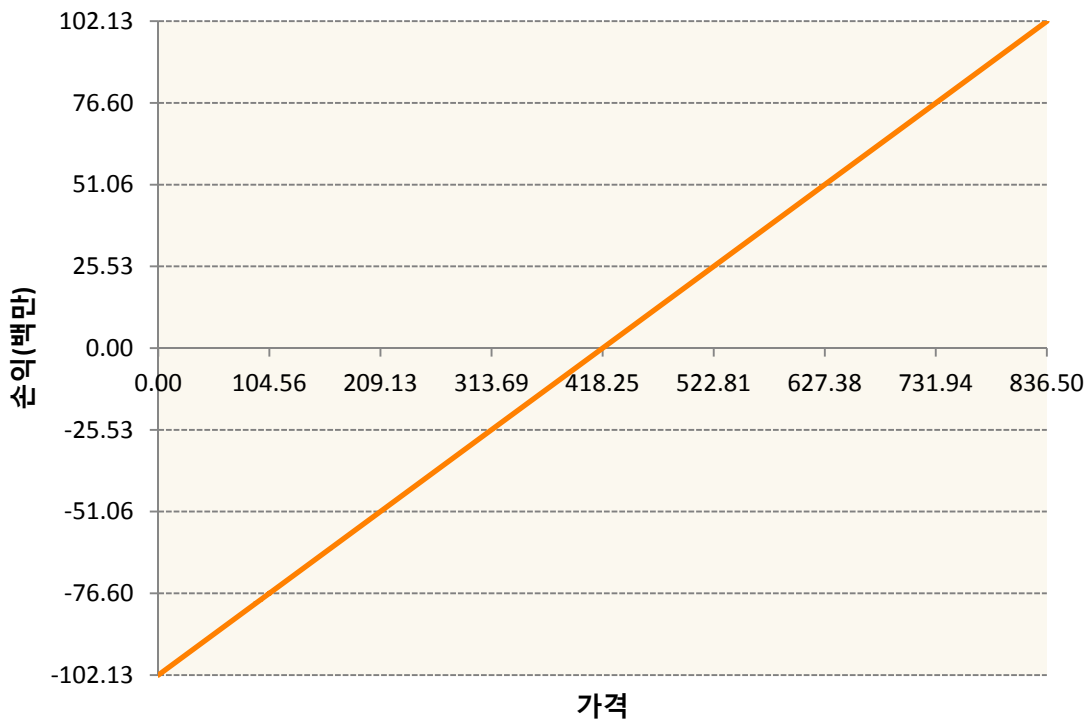




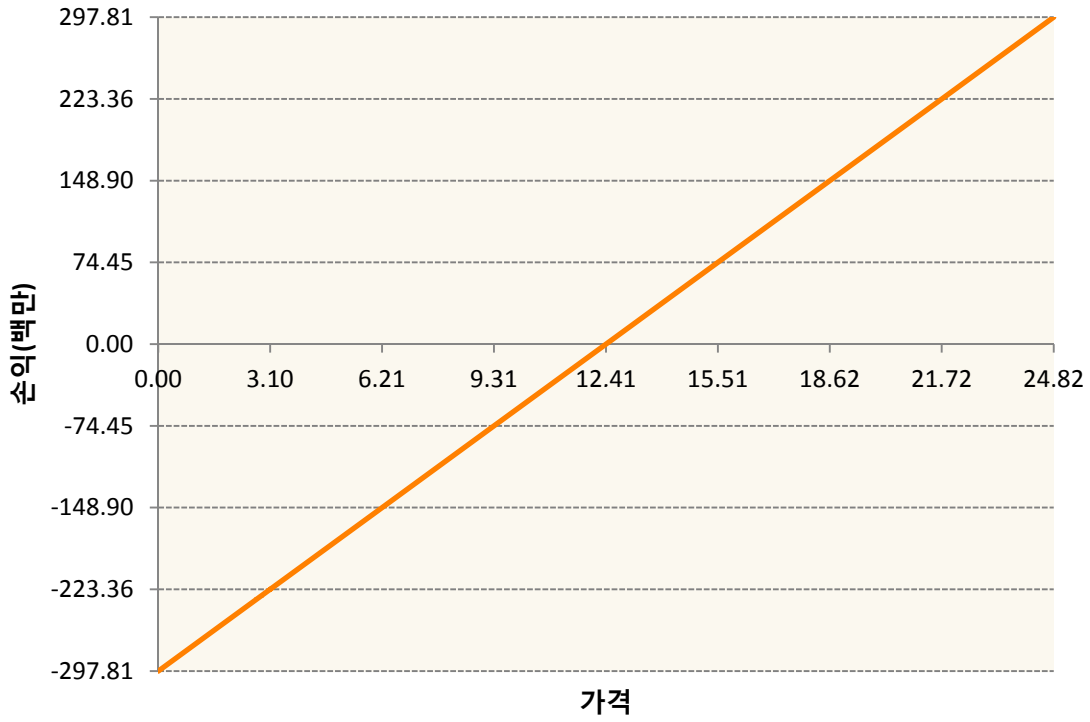
KR4175PB0004-2019-11 달러선물



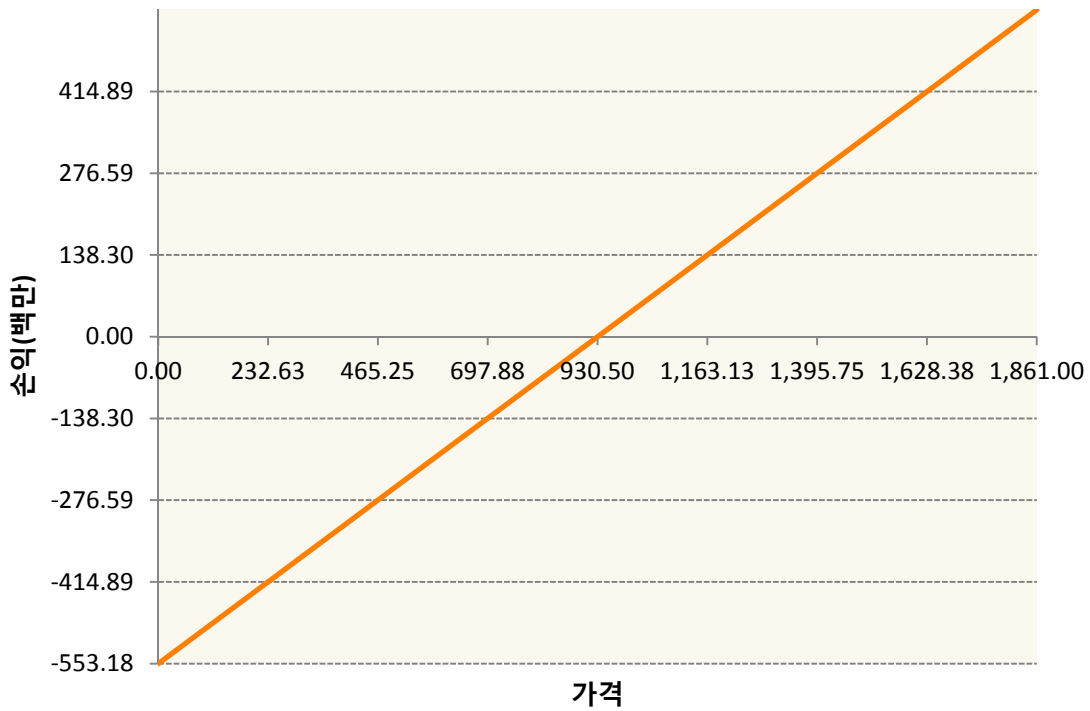
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



SBH0-Sugar Mar20

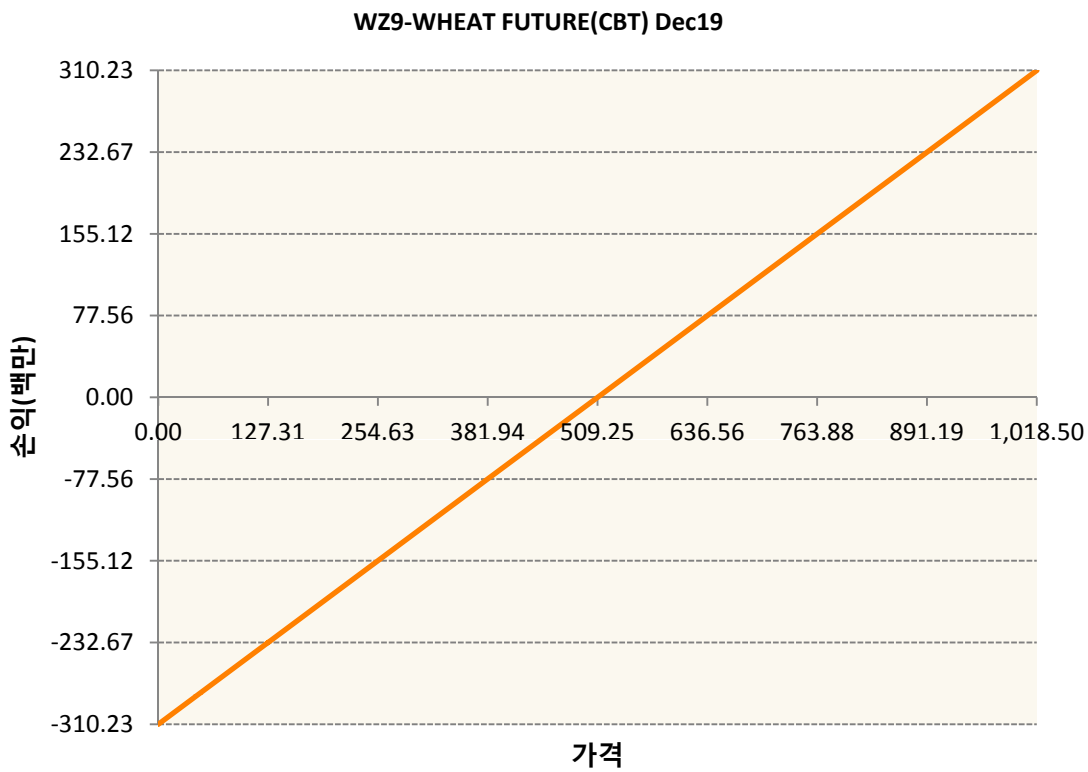
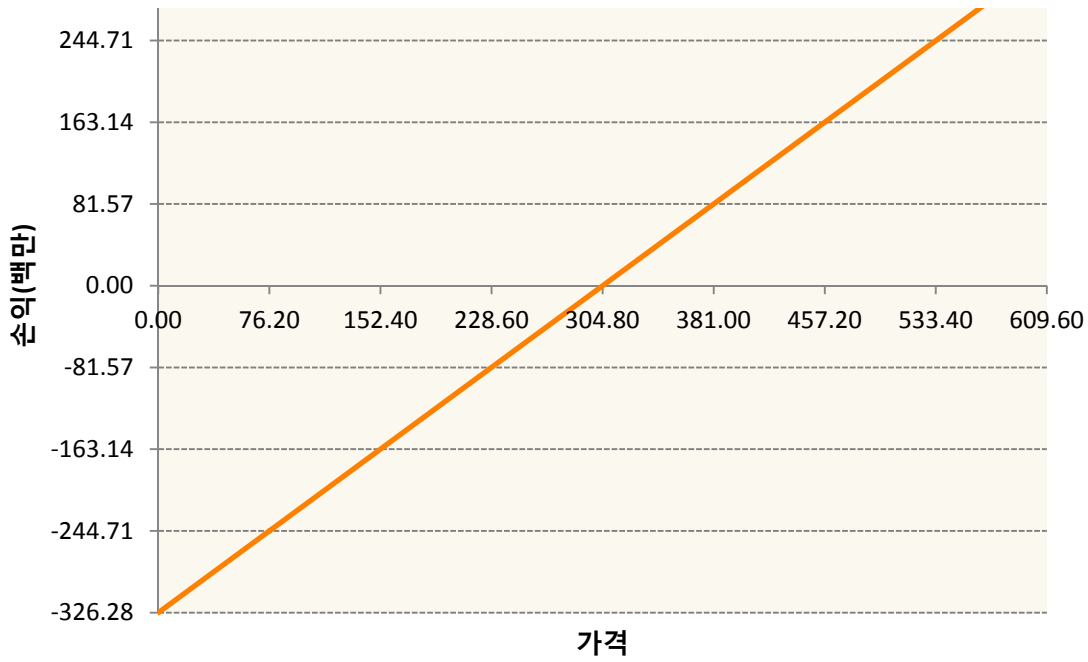


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20



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	48
KCZ9	COFFEE 'C' FUTURE Dec19	18
KR4175PB00	2019-11 달러선물	7

KWZ9	KC HRW WHEAT FUT Dec19	8
SBH0	Sugar Mar20	24
SF0	SOYBEAN FUTURE Jan20	44
SMF0	SOYBEAN MEAL FUTR Jan20	26
WZ9	WHEAT FUTURE(CBT) Dec19	25

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

(단위:백만원)

254