

공시일	2019-11-04
기준일	2019-11-01

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	2019-11-04
기준일	2019-11-01

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	2019-11-04
기준일	2019-11-01

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)	381
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	139

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

768

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-11-04
기준일	2019-11-01

유로인덱스모(주식-파생형)

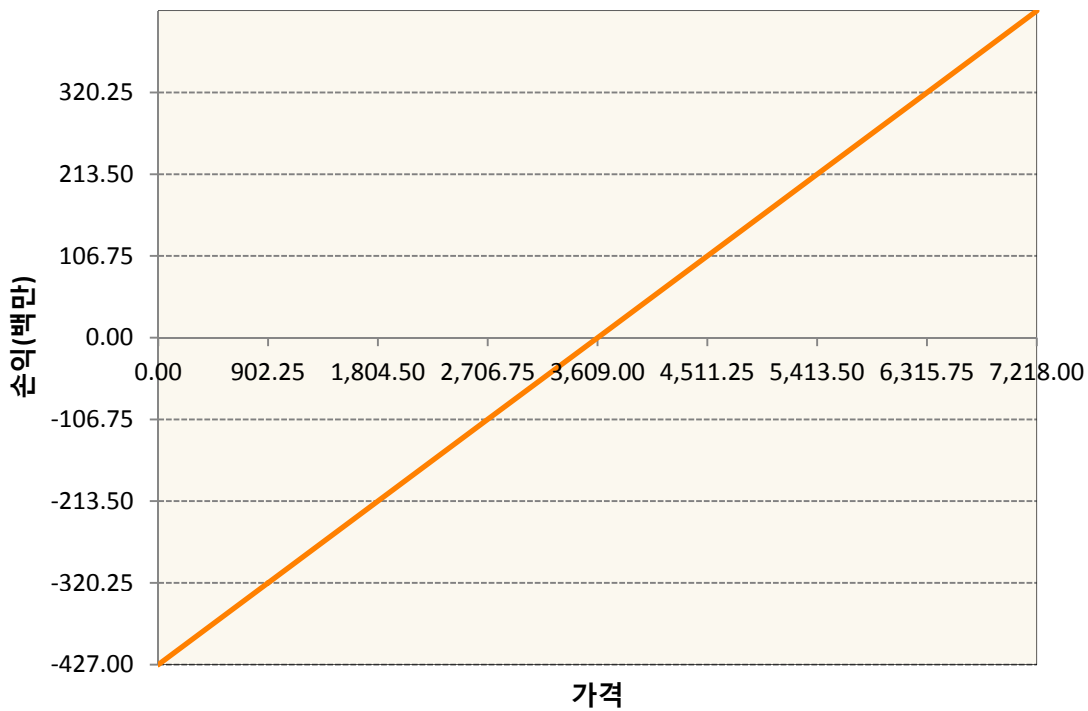
1. 계약금액

(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	2019-11-04
기준일	2019-11-01

차이나인덱스모(주식-파생형)

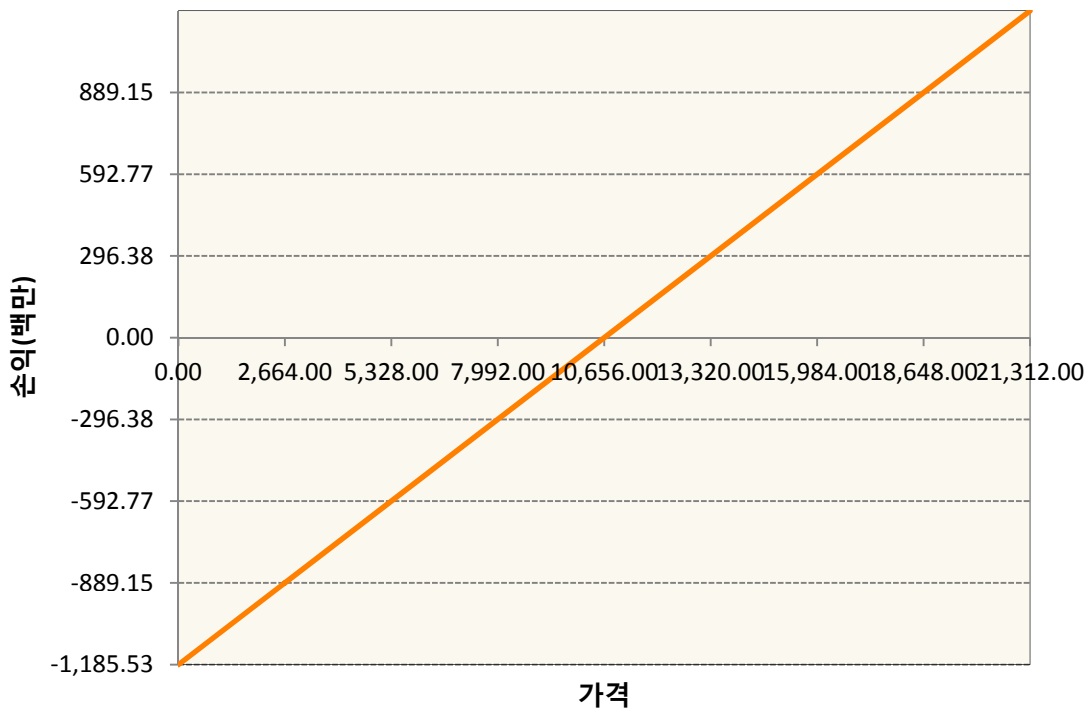
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,186	0	1,186	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCX9-HSCEI Futures Nov19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCX9	HSCEI Futures Nov19	95
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

85

공시일	2019-11-04
기준일	2019-11-01

커버드콜모(주식혼합-파생형)

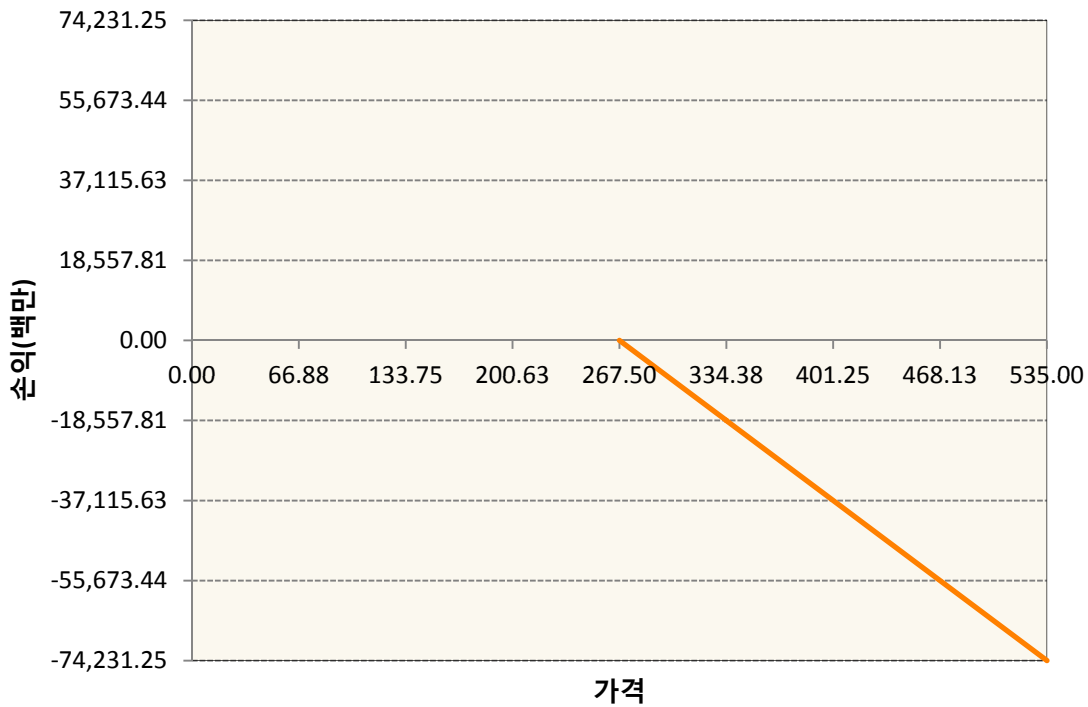
1. 계약금액

(단위:백만원)

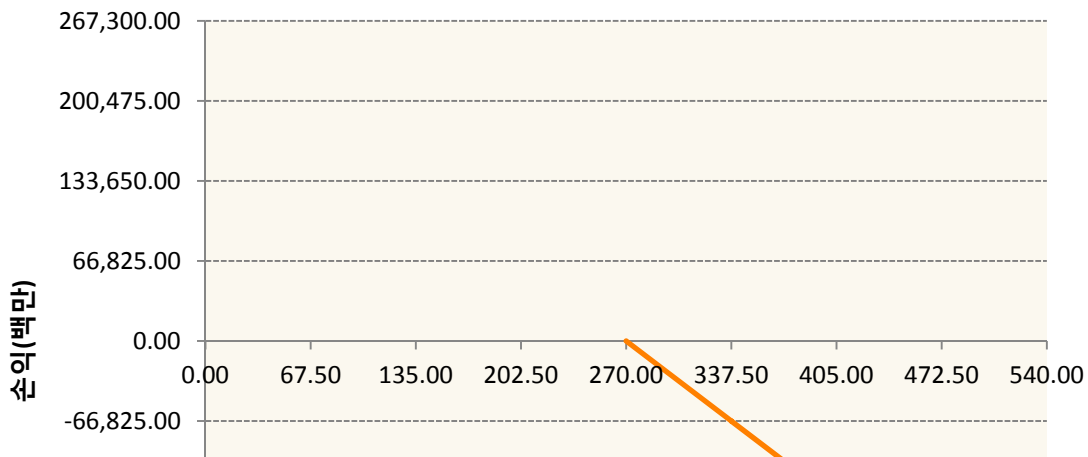
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	500,025	-500,025	장내

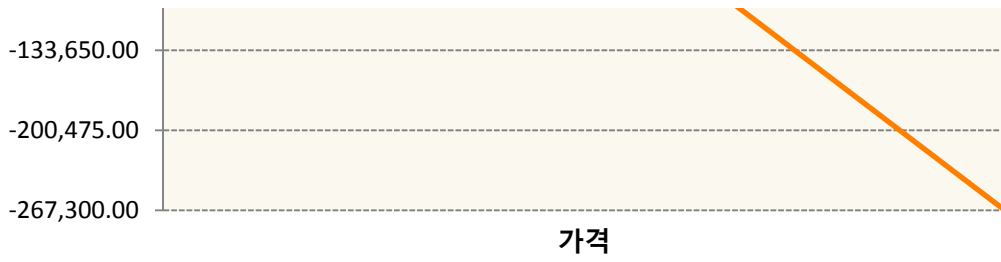
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PB2677-2019-11 콜267.5

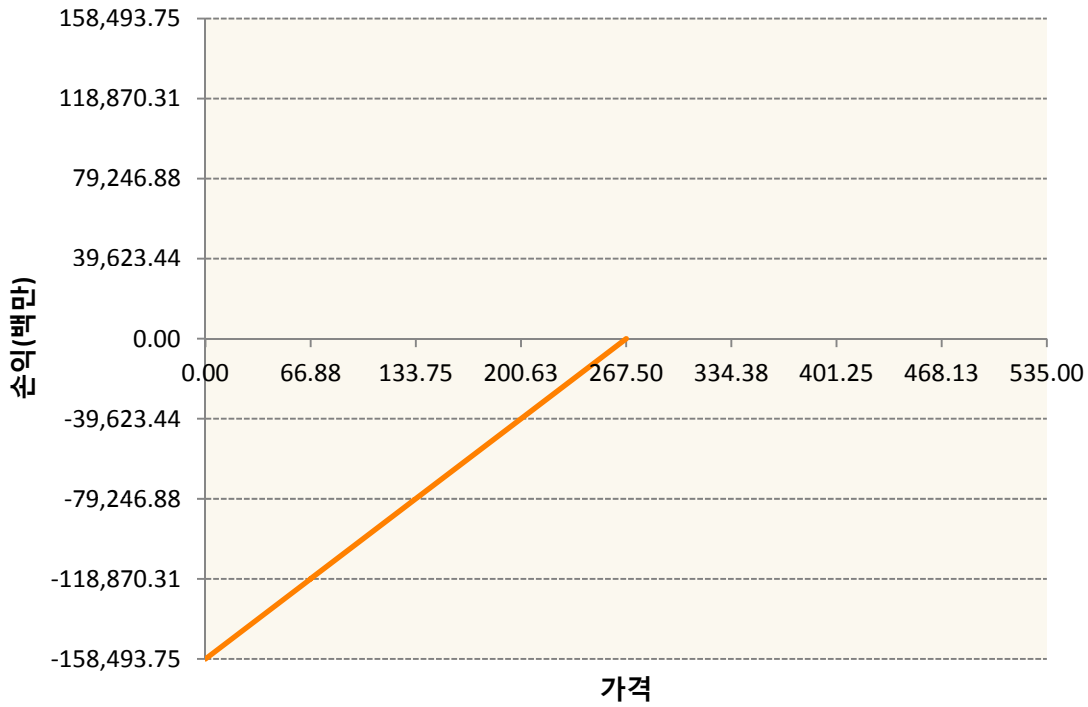


KR4201PB2701-2019-11 콜270





KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PB2677		2019-11 콜267.5					5,750	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,319	3,249	3,171	3,086	2,996	2,902	2,804	
-5.33%	2,834	2,716	2,596	2,475	2,354	2,231	2,109	
-2.67%	1,813	1,691	1,567	1,443	1,318	1,193	1,067	
0%	264	183	94	0	-99	-202	-308	
2.67%	-1,615	-1,651	-1,696	-1,751	-1,813	-1,882	-1,957	
5.33%	-3,629	-3,640	-3,657	-3,681	-3,712	-3,751	-3,796	
8.00%	-5,679	-5,682	-5,687	-5,695	-5,708	-5,726	-5,750	
KR4201PB2701		2019-11 콜270					19,987	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	10,261	10,068	9,842	9,590	9,315	9,019	8,707	

-5.33%	9,014	8,634	8,242	7,840	7,431	7,016	6,596
-2.67%	6,052	5,594	5,135	4,676	4,217	3,758	3,299
0%	1,112	758	386	0	-397	-804	-1,218
2.67%	-5,272	-5,453	-5,668	-5,913	-6,184	-6,478	-6,791
5.33%	-12,342	-12,405	-12,496	-12,617	-12,765	-12,941	-13,141
8.00%	-19,630	-19,646	-19,675	-19,721	-19,788	-19,876	-19,987
KR4301PB2676 2019-11 풋267.5							6,854
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,681	-6,693	-6,711	-6,736	-6,769	-6,808	-6,854
-5.33%	-2,632	-2,731	-2,835	-2,943	-3,054	-3,168	-3,285
-2.67%	-352	-461	-574	-690	-809	-929	-1,052
0%	80	62	35	0	-43	-94	-151
2.67%	100	99	97	94	88	79	66
5.33%	100	100	100	100	99	99	97
8.00%	100	100	100	100	100	100	100

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

(단위:백만원)

31,589

공시일	2019-11-04
기준일	2019-11-01

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

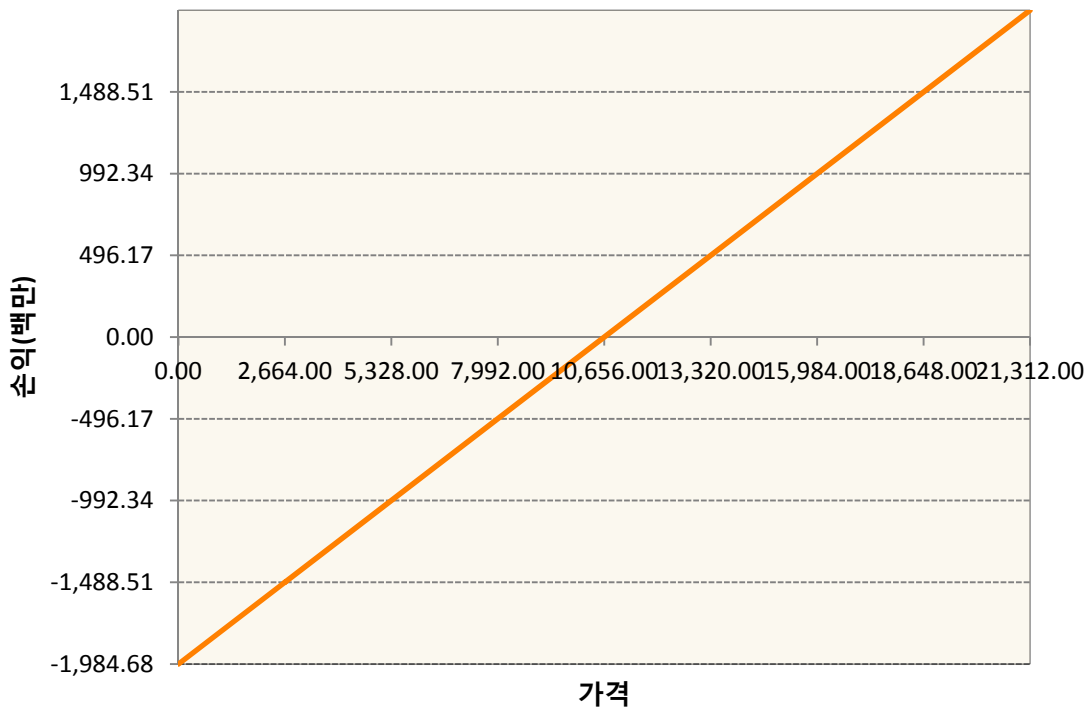
1. 계약금액

(단위:백만원)

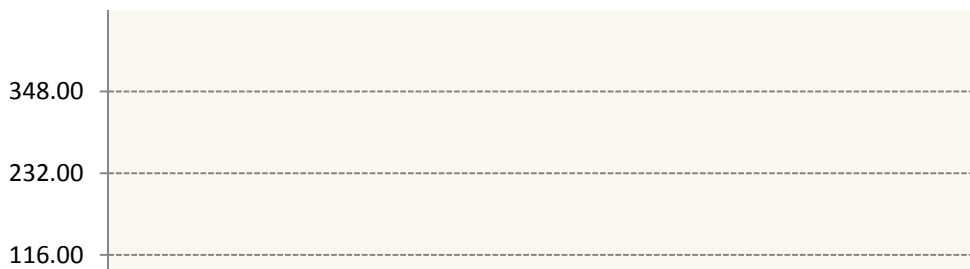
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,985	0	1,985	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,066	-5,066	장내
누계	통화	선도	669	2,763	-2,094	장외

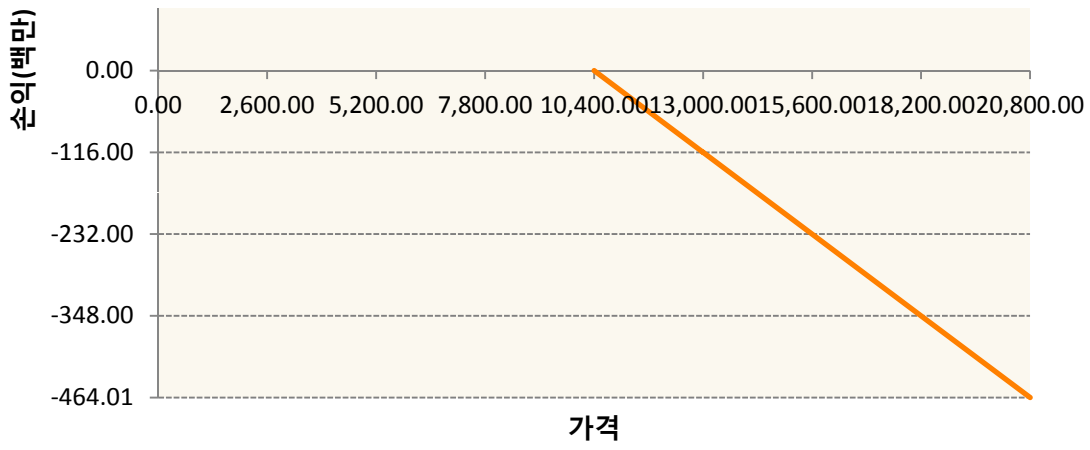
2. 만기시점의 손익구조

HCX9-HSCEI Futures Nov19

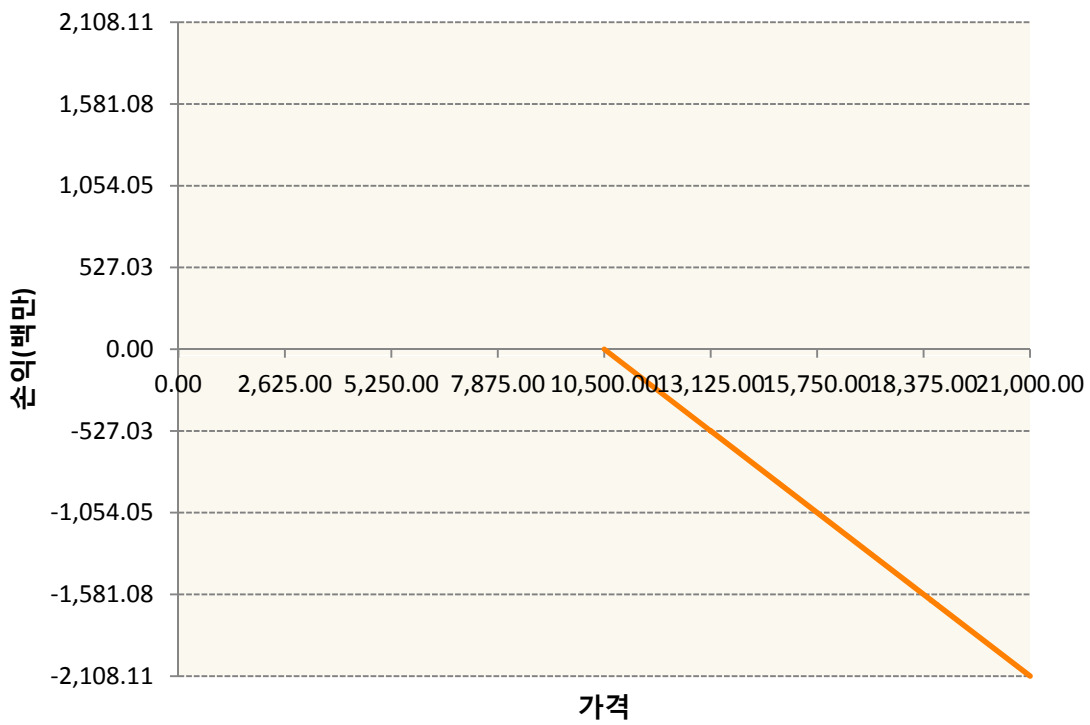


OHHIX9-C104-HSCEI

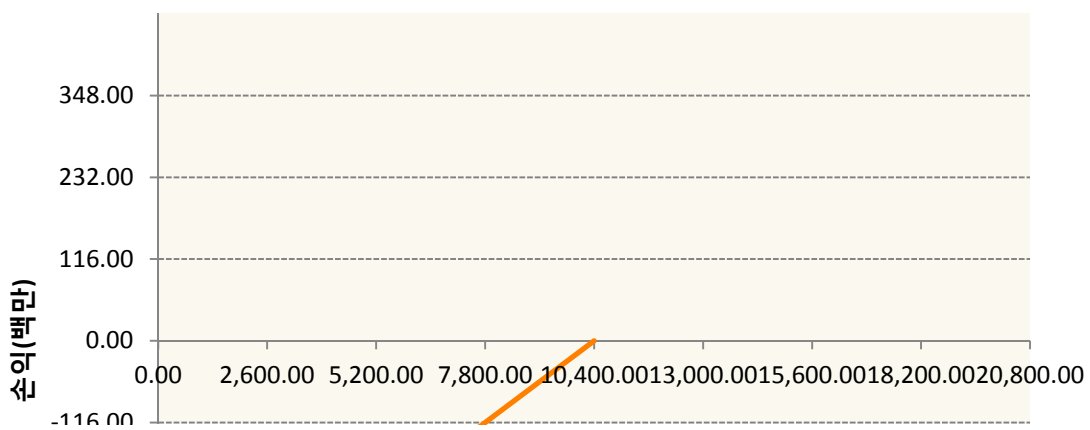


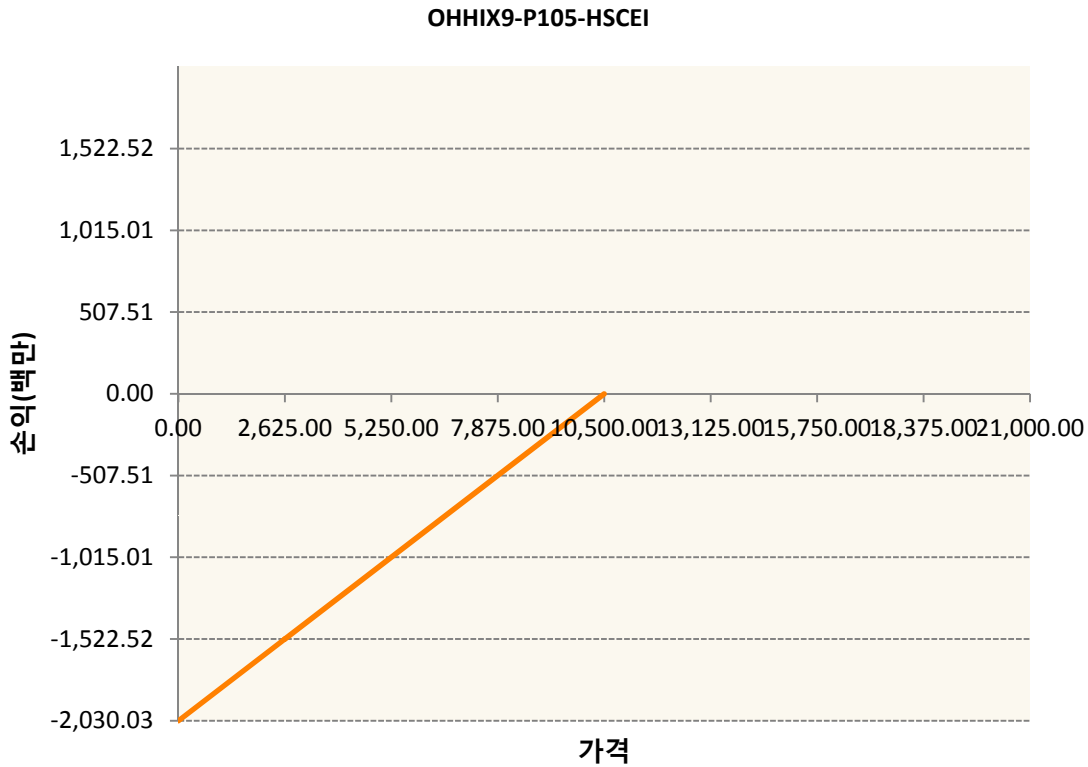
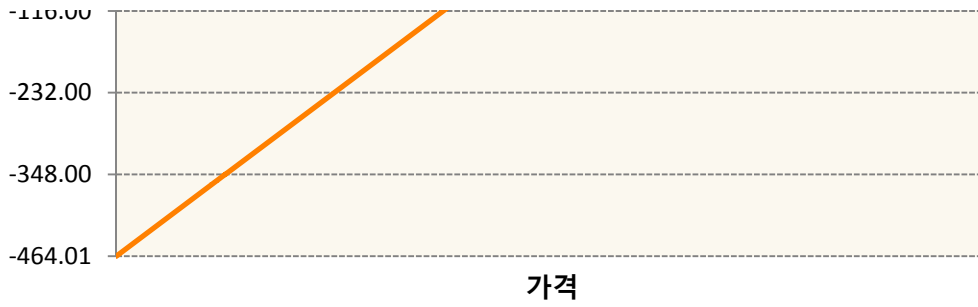


OHHIX9-C105-HSCEI



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	159
OHHIX9-C1C HSCEI	37
OHHIX9-C1C HSCEI	169
OHHIX9-P10 HSCEI	37
OHHIX9-P10 HSCEI	162

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	589

공시일	2019-11-04
기준일	2019-11-01

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

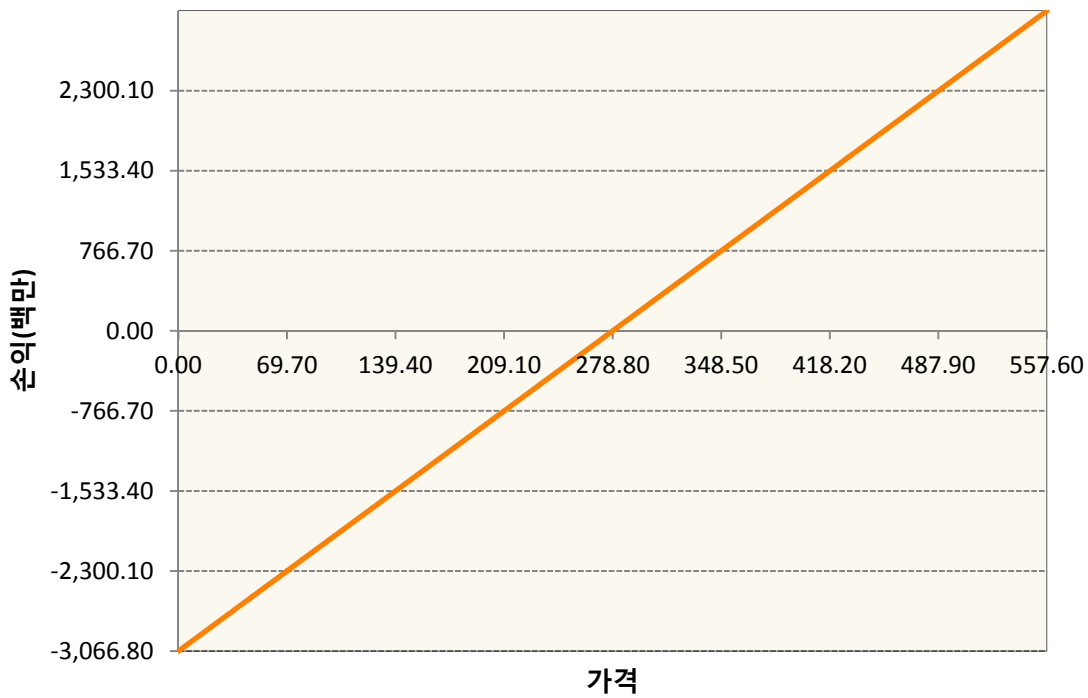
1. 계약금액

(단위:백만원)

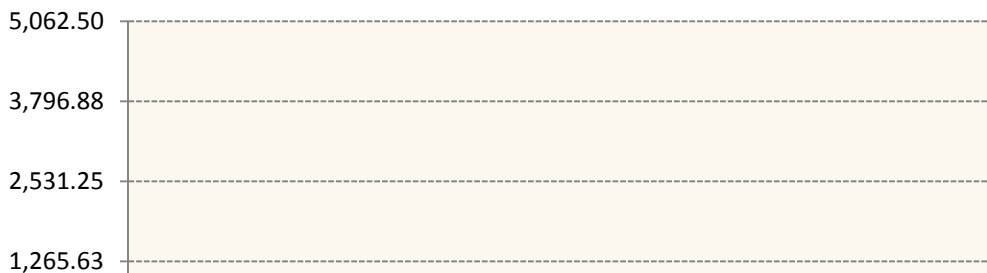
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,067	0	3,067	장내
누계	유가증권	스왑	10,625	0	10,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	10,013	-10,013	장내

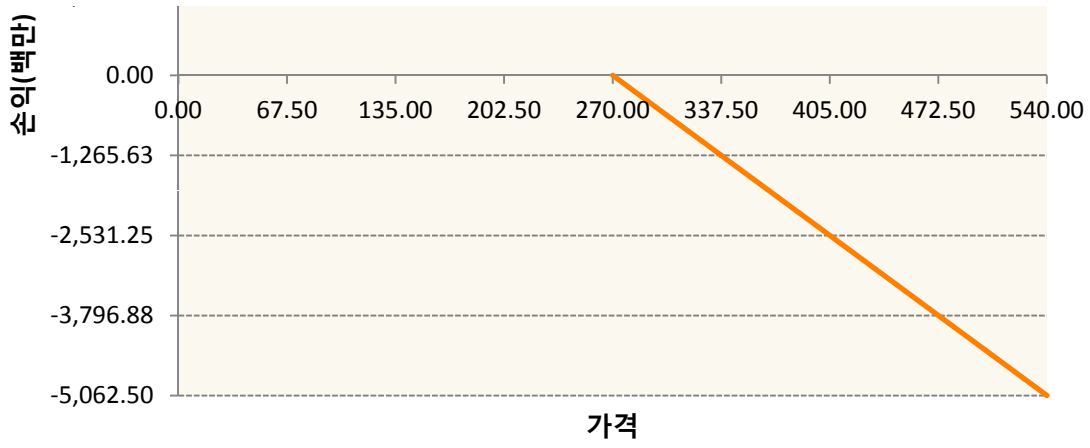
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

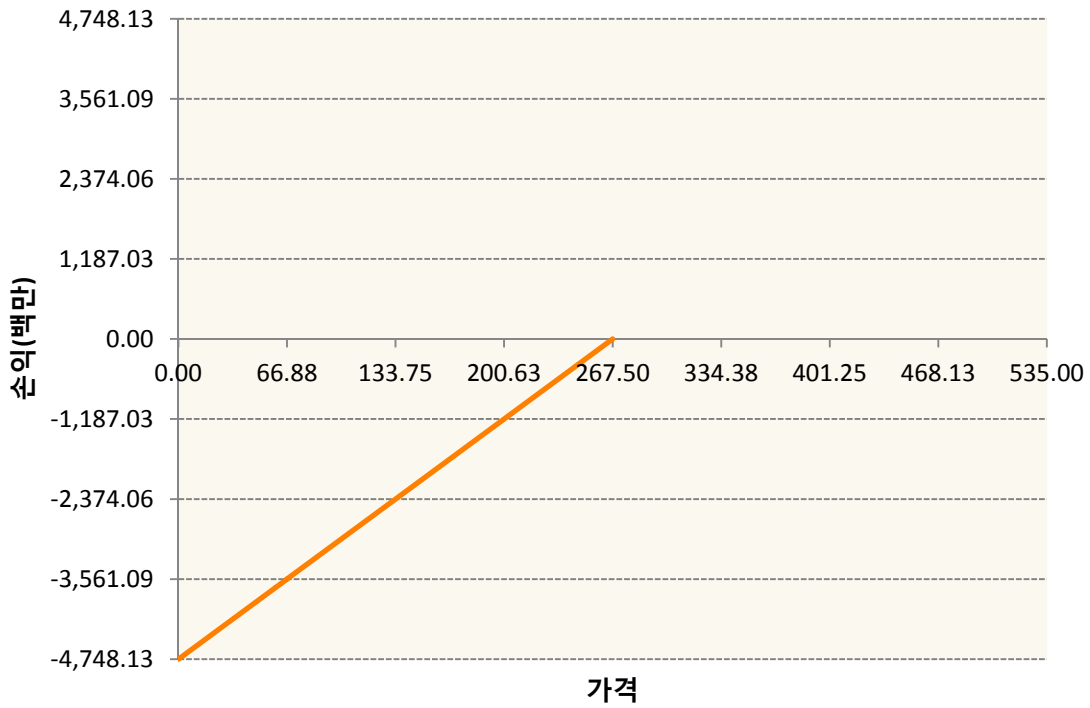


KR4201PB2701-2019-11 콜270

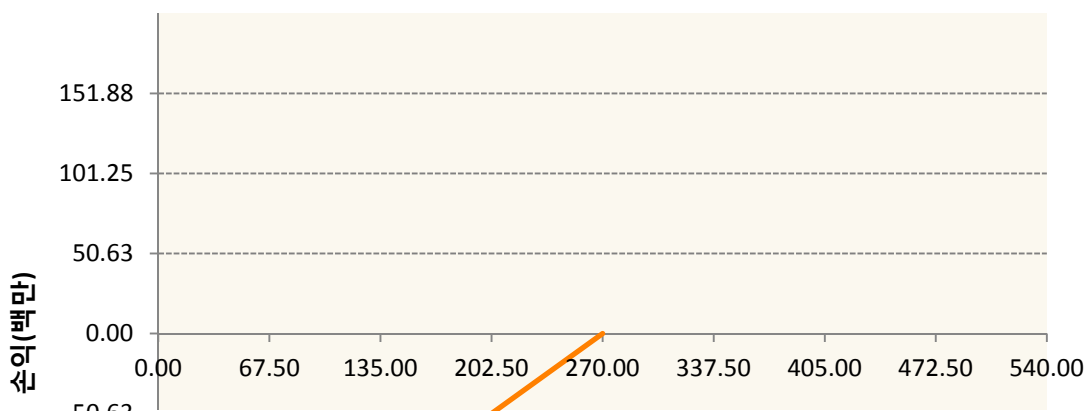




KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



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						245
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-245	-245	-245	-245	-245	-245	-245	
-5.33%	-163	-163	-163	-163	-163	-163	-163	
-2.67%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	82	82	82	82	82	82	82	
5.33%	163	163	163	163	163	163	163	
8.00%	245	245	245	245	245	245	245	
KR4201PB2701		2019-11 콜270						379
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	194	191	186	182	176	171	165	
-5.33%	171	164	156	148	141	133	125	
-2.67%	115	106	97	89	80	71	62	
0%	21	14	7	0	-8	-15	-23	
2.67%	-100	-103	-107	-112	-117	-123	-129	
5.33%	-234	-235	-237	-239	-242	-245	-249	
8.00%	-372	-372	-373	-374	-375	-376	-379	
KR4301PB2676		2019-11 풋267.5						205
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-200	-201	-201	-202	-203	-204	-205
-5.33%	-79	-82	-85	-88	-91	-95	-98
-2.67%	-11	-14	-17	-21	-24	-28	-32
0%	2	2	1	0	-1	-3	-5
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							10
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
-5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-2	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	0
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)

1,642

공시일	2019-11-04
기준일	2019-11-01

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

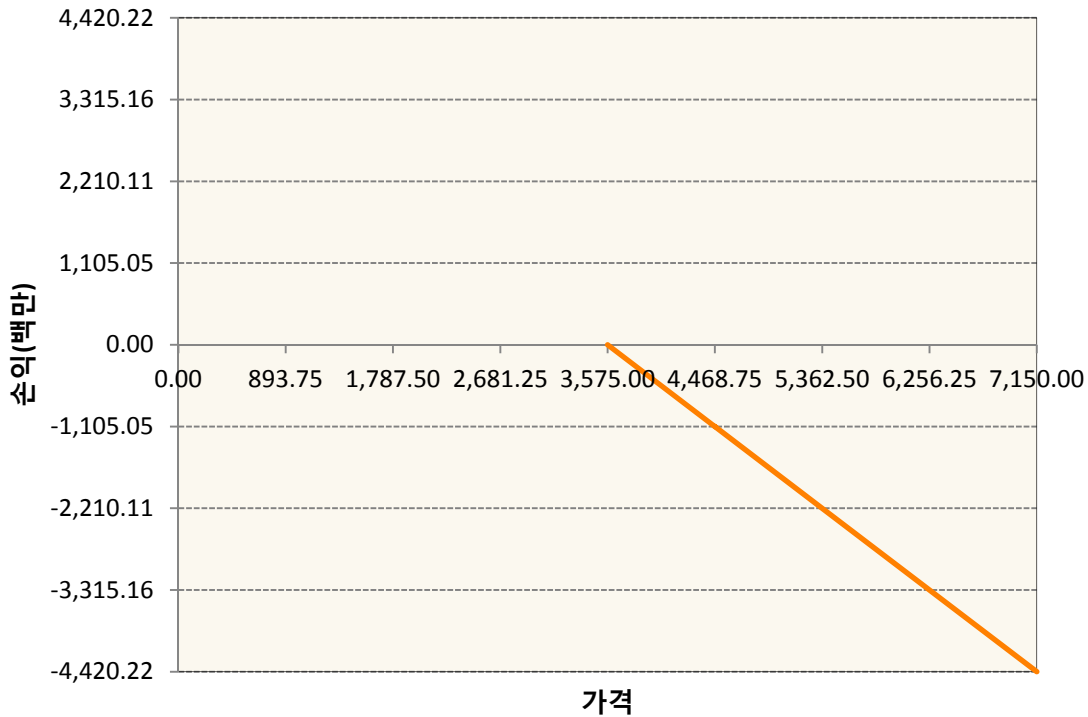
1. 계약금액

(단위:백만원)

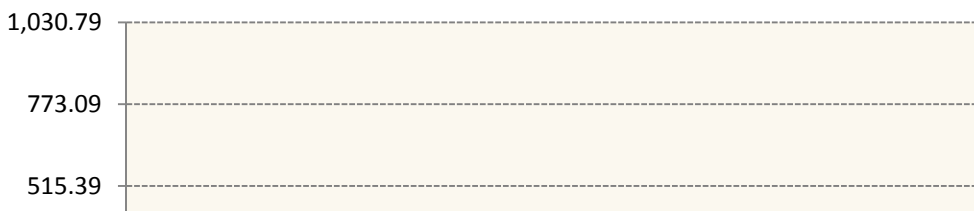
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,590	0	2,590	
누계	유가증권	스왑	20,448	0	20,448	장외
누계	유가증권	옵션	0	10,902	-10,902	장내
누계	통화	선도	2,051	6,117	-4,066	장외

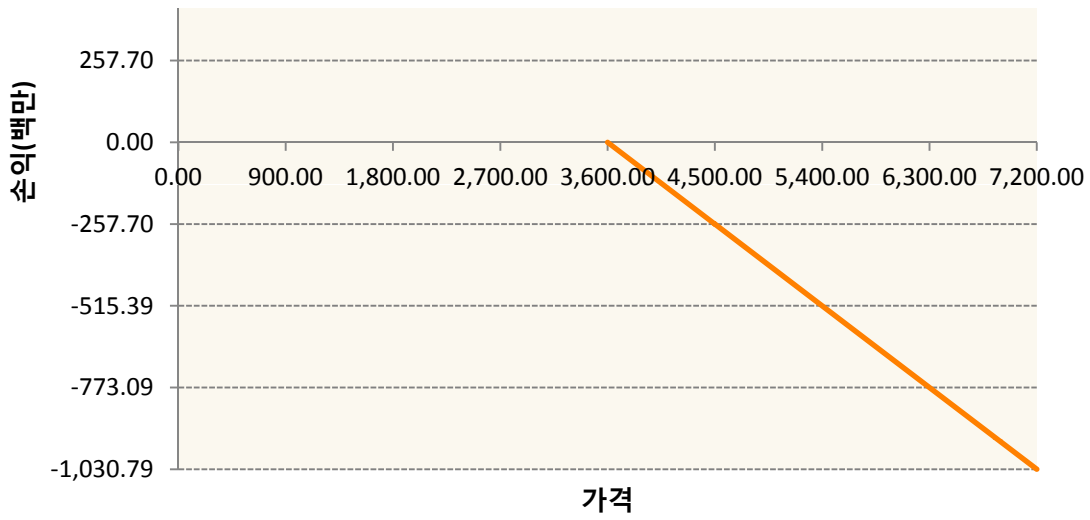
2. 만기시점의 손익구조

OESXX9-C3575-EURO STOXX 50

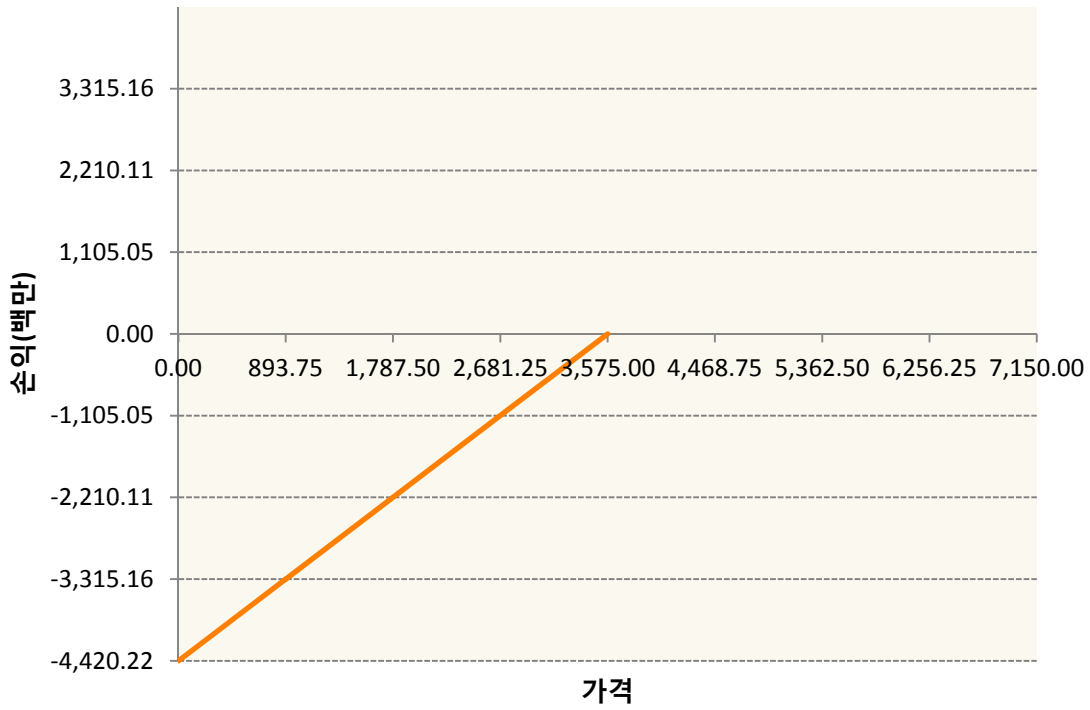


OESXX9-C3600-EURO STOXX 50

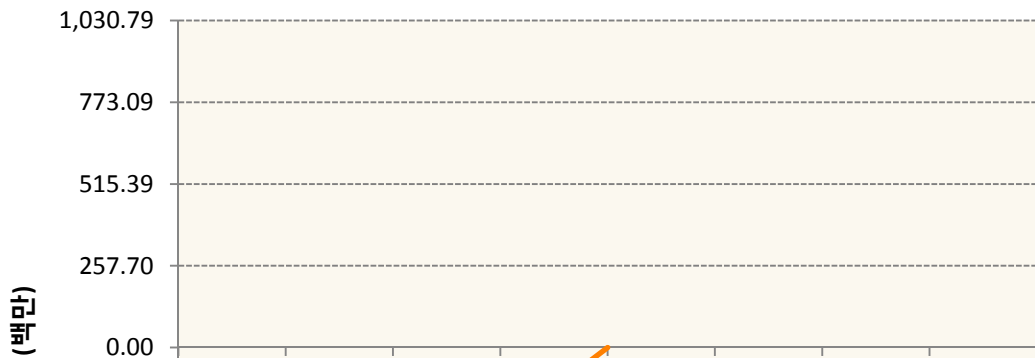


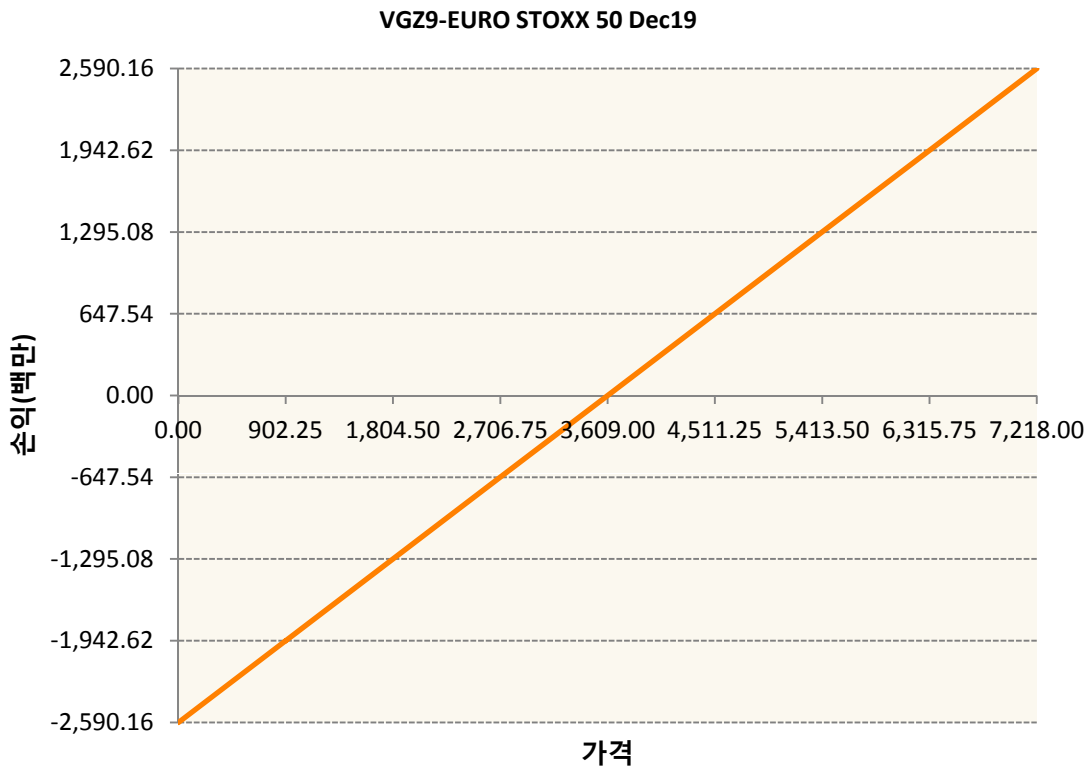
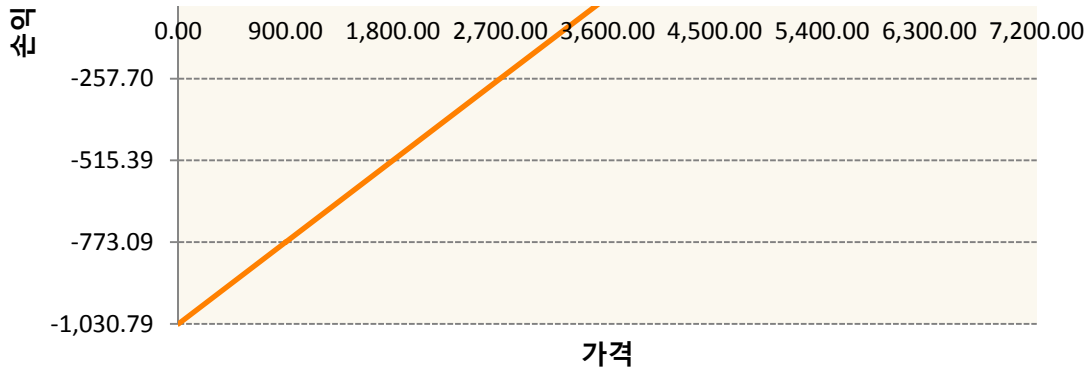


OESXX9-P3575-EURO STOXX 50



OESXX9-P3600-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	14
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E	489
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E	164
OESXX9-C35 EURO STOXX 50	354
OESXX9-C36 EURO STOXX 50	82
OESXX9-P35 EURO STOXX 50	354
OESXX9-P36 EURO STOXX 50	82
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19	207

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

(단위:백만원)

1,071

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

(단위:백만원)

927

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

(단위:백만원)

81

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

(단위:백만원)

125

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

(단위:백만원)

40

공시일	2019-11-04
기준일	2019-11-01

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

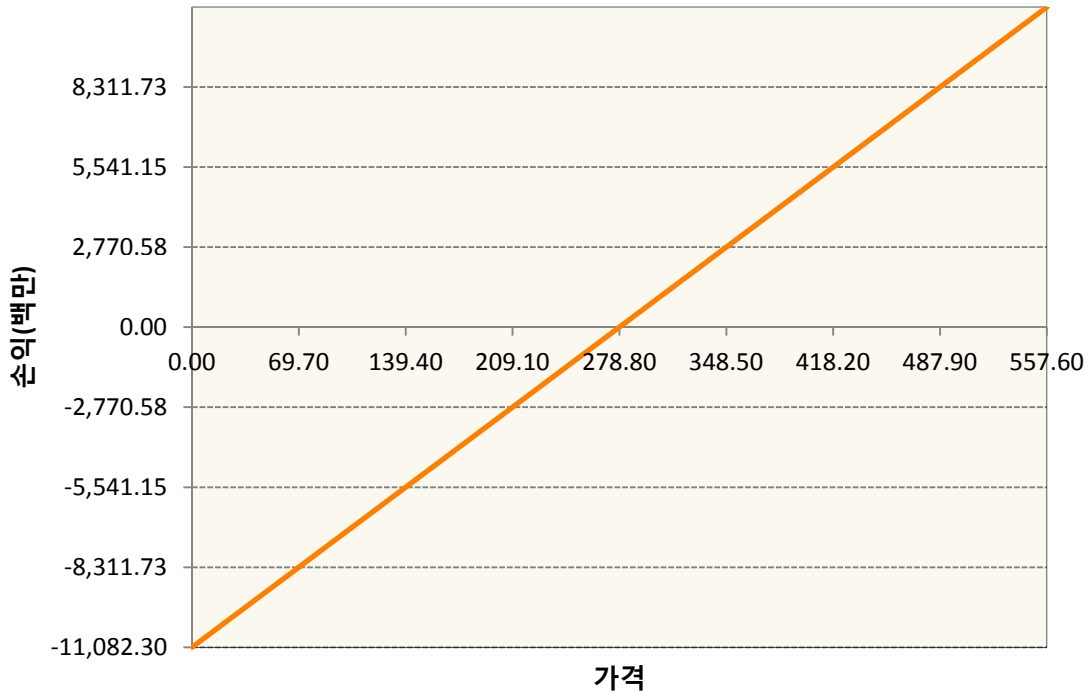
1. 계약금액

(단위:백만원)

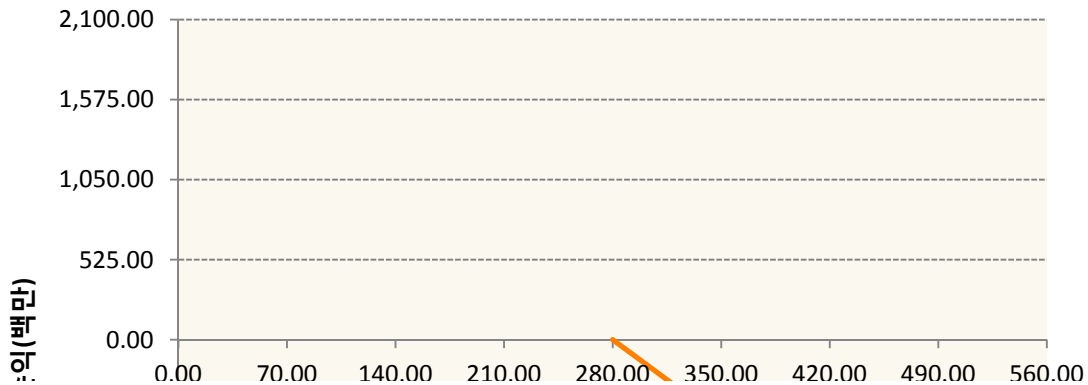
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	70	-70	장내
신규	유가증권	옵션	70	0	70	장내
누계	유가증권	선물	11,082	0	11,082	장내
누계	유가증권	옵션	3,561	20,533	-16,972	장내

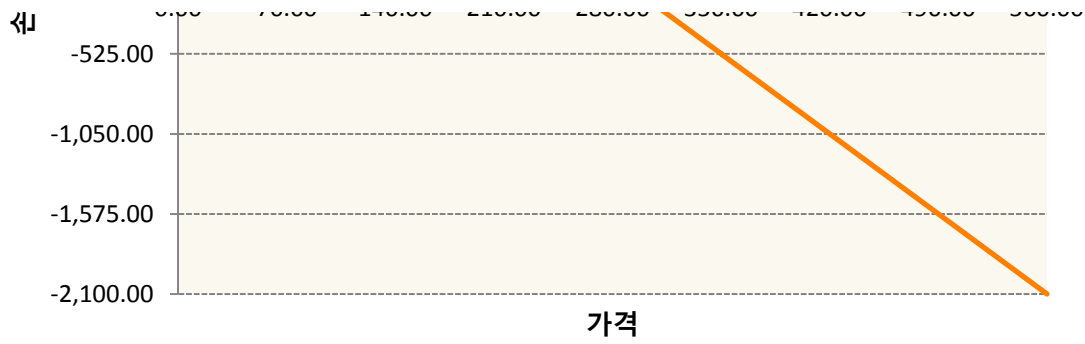
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

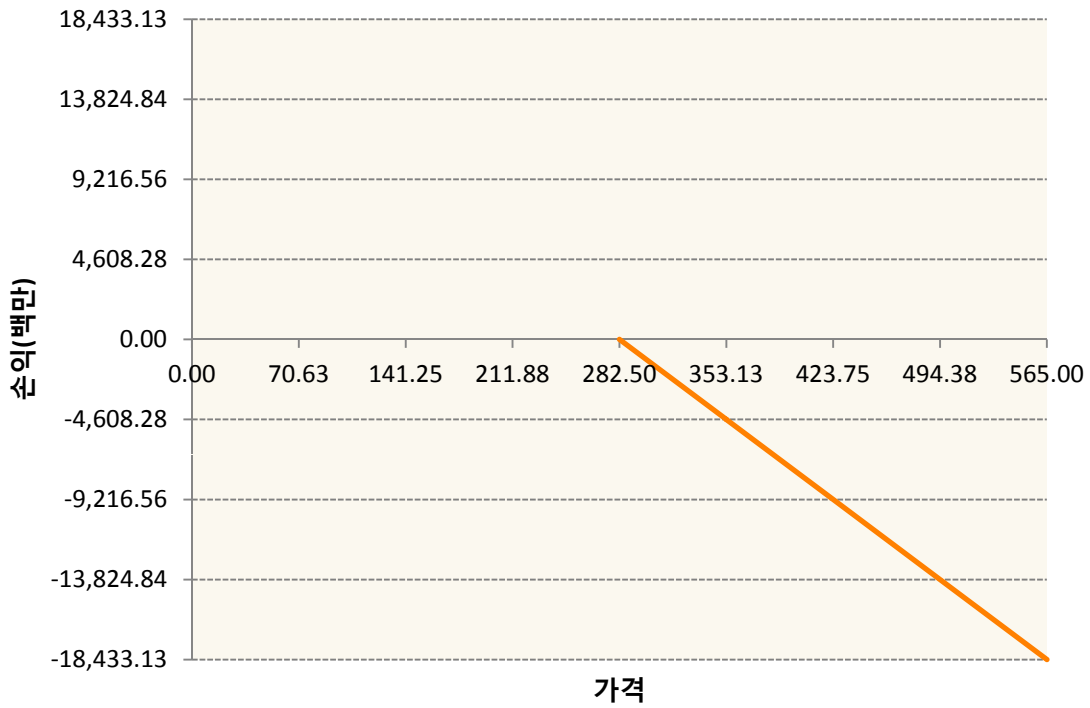


KR4201PB2800-2019-11 콜280

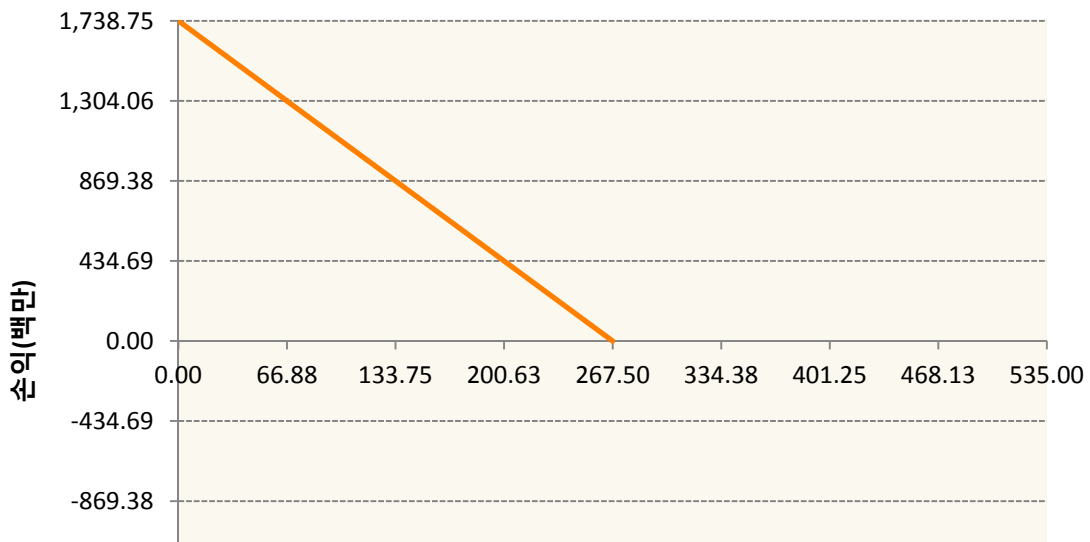


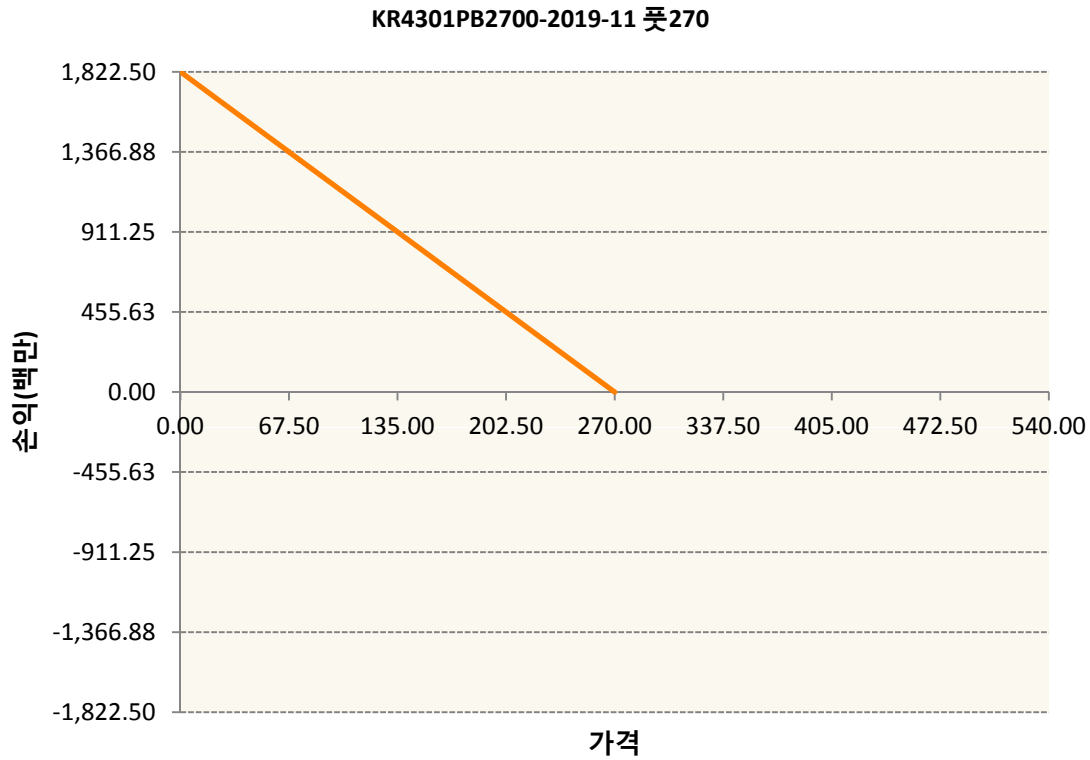
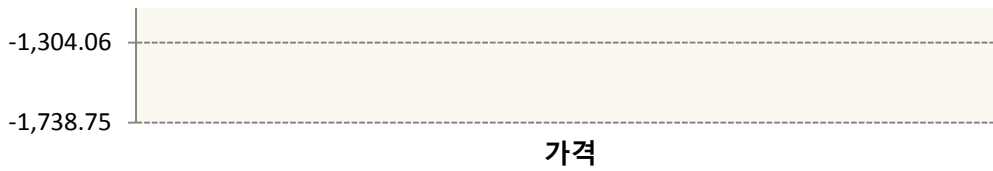


KR4201PB2826-2019-11 콜282.5



KR4301PB2676-2019-11 풋267.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						885
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-885	-885	-885	-885	-885	-885	-885	
-5.33%	-590	-590	-590	-590	-590	-590	-590	
-2.67%	-295	-295	-295	-295	-295	-295	-295	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	295	295	295	295	295	295	295	
5.33%	590	590	590	590	590	590	590	
8.00%	885	885	885	885	885	885	885	
KR4201PB2800		2019-11 콜280						127
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	37	37	36	35	35	34	32	
-5.33%	35	34	33	31	29	27	25	
-2.67%	28	26	23	20	17	14	11	

0%	11	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	-22	-25	-28	-31	-35	-38	-42
5.33%	-66	-68	-71	-73	-76	-78	-81
8.00%	-118	-119	-120	-122	-123	-125	-127
KR4201PB2826 2019-11 콜282.5							1,034
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	256	254	251	247	241	234	225
-5.33%	247	240	230	219	206	191	174
-2.67%	207	189	168	147	124	100	75
0%	89	60	30	0	-30	-61	-91
2.67%	-148	-179	-210	-241	-272	-303	-335
5.33%	-505	-527	-550	-574	-600	-626	-653
8.00%	-941	-951	-964	-979	-995	-1,014	-1,034
KR4301PB2676 2019-11 풋267.5							75
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	73	73	74	74	74	75	75
-5.33%	29	30	31	32	34	35	36
-2.67%	4	5	6	8	9	10	12
0%	-1	-1	0	0	0	1	2
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
KR4301PB2700 2019-11 풋270							92
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	91	91	92	92	92	92	92
-5.33%	43	44	44	45	46	47	48
-2.67%	8	10	11	13	14	16	17
0%	-2	-1	-1	0	1	2	3
2.67%	-3	-3	-2	-2	-2	-2	-2
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-2
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3

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

(단위:백만원)

1,884

공시일	2019-11-04
기준일	2019-11-01

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	4,662	0	4,662	
누계	유가증권	수익증권	173,986	0	173,986	

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	2019-11-04
기준일	2019-11-01

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	209,738	0	209,738	

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	2019-11-04
기준일	2019-11-01

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	23,312	0	23,312	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	510,145	0	510,145	
누계	통화	선도	0	512,981	-512,981	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		1,865
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E		1,958
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E		932
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		653
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E		1,529
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		690
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,678
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		2,462
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		466
FX21019V02 KRW/USD 21-11-19E		5,073
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,756
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,399
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,797
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,501
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,835
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		932
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		932
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,865
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,865
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		932
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		932
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		932
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		932
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		466
FX21019X00 KRW/USD 06-12-19E		653

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

(단위:백만원)

13,071

공시일	2019-11-04
기준일	2019-11-01

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

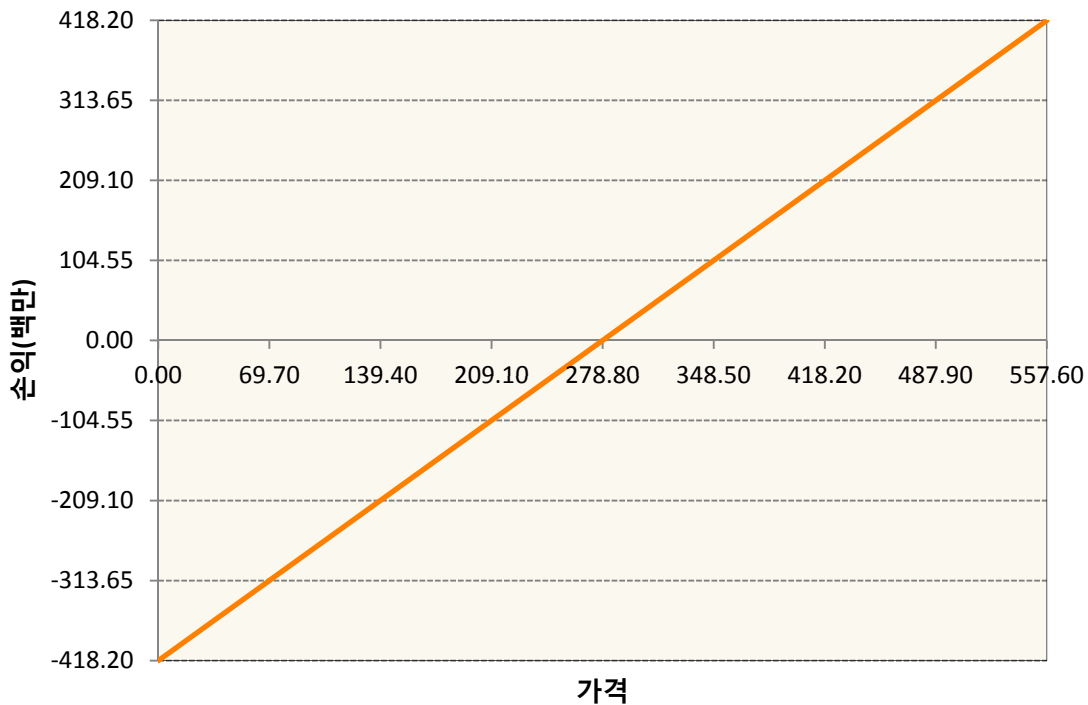
1. 계약금액

(단위:백만원)

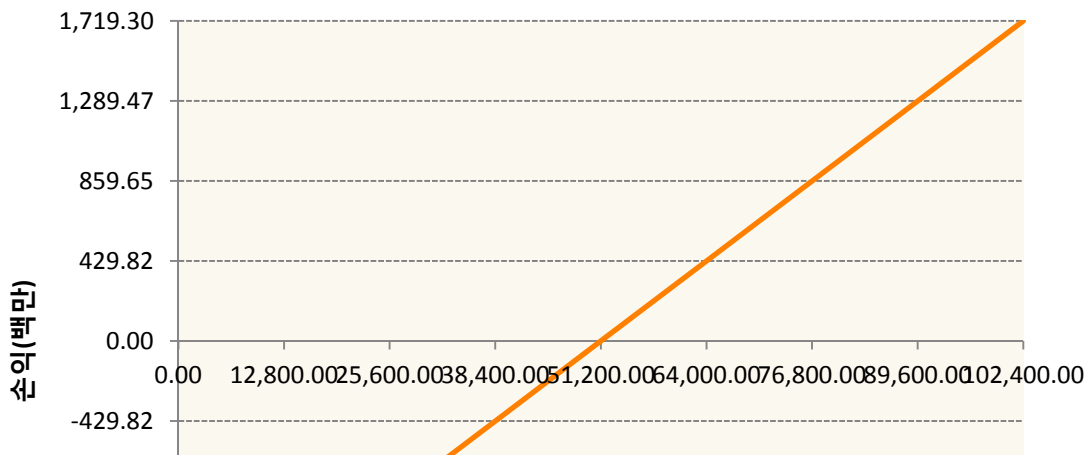
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,137	0	2,137	장내

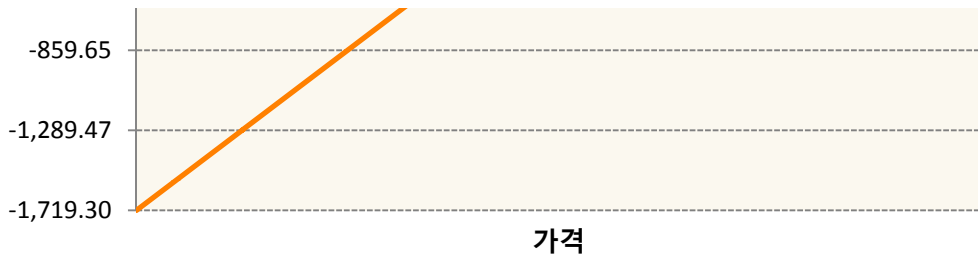
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



KR4111PB0001-2019-11 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

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

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

181

공시일	2019-11-04
기준일	2019-11-01

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

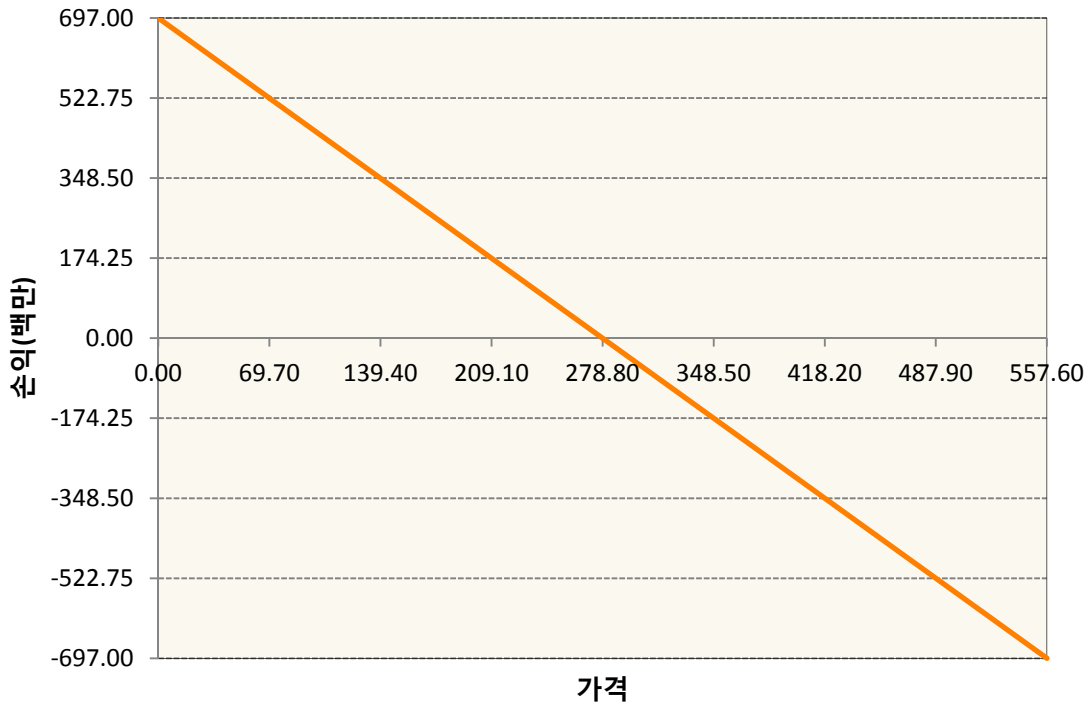
1. 계약금액

(단위:백만원)

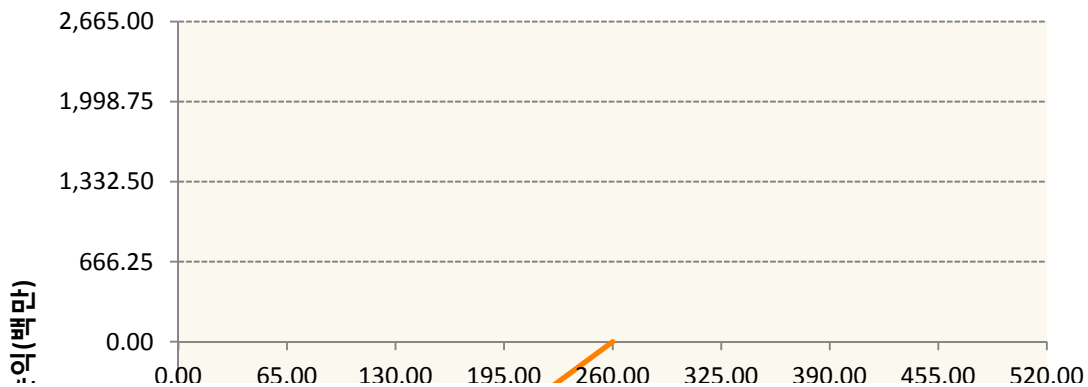
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	697	-697	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,715	-3,715	장내

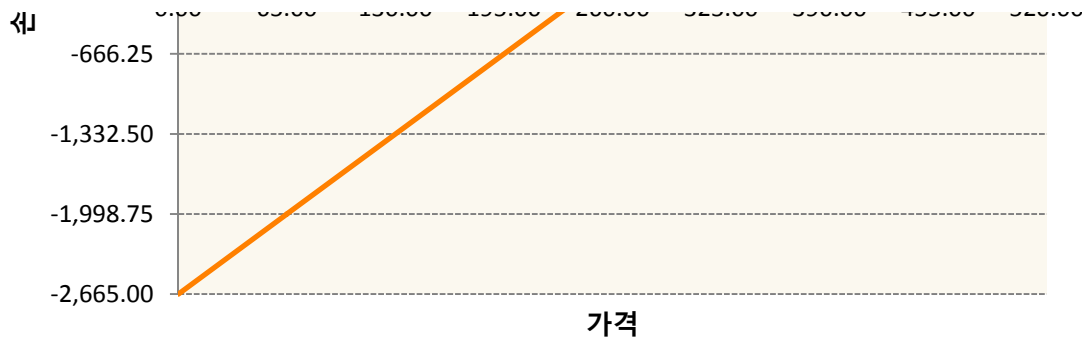
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

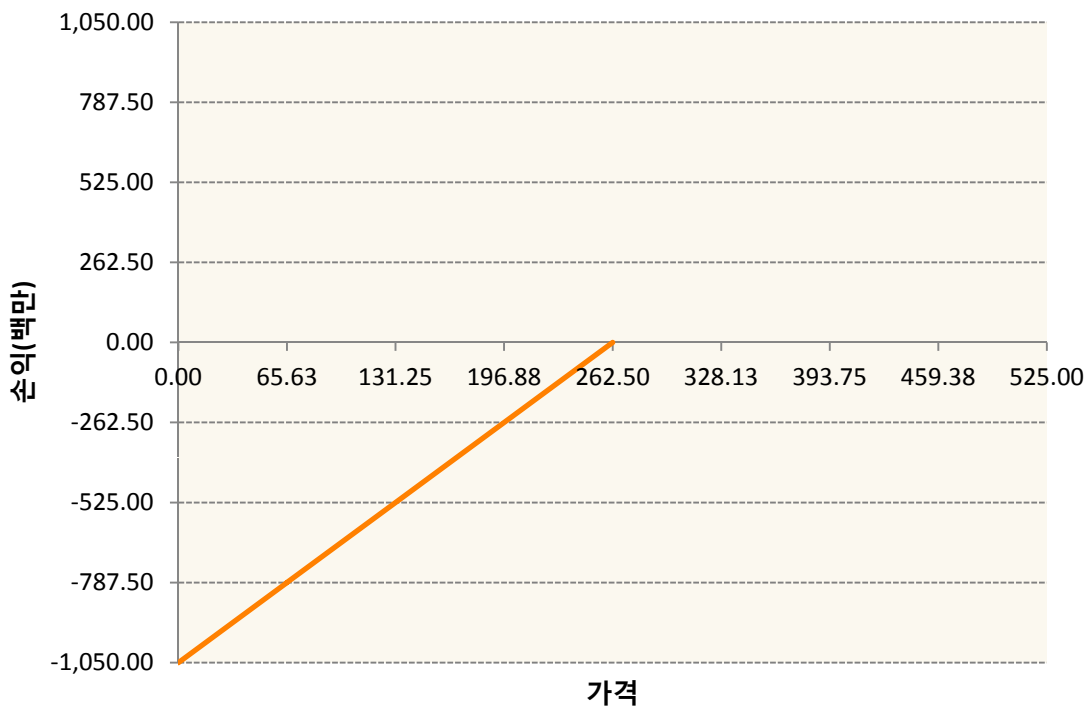


KR4301PB2601-2019-11 풋260





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						57
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-46	-48	-50	-51	-53	-55	-57
-5.33%	-7	-9	-11	-13	-15	-17	-19
-2.67%	0	0	-1	-1	-2	-3	-4
0%	0	0	0	0	0	0	0
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

30

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-26	-27	-27	-28	-28	-29	-30
-5.33%	-6	-7	-8	-9	-9	-10	-11
-2.67%	0	-1	-1	-1	-2	-2	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
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)

62

공시일	2019-11-04
기준일	2019-11-01

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	349	-349	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	15,688	0	15,688	
누계	통화	선도	233	16,039	-15,806	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		317
FX21019V02 KRW/USD 13-11-19E		280
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		317
FX21019V04 USD/KRW 13-11-19E		19

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

(단위:백만원)

415

공시일	2019-11-04
기준일	2019-11-01

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	280	-78	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
FX21019X00 KRW/EUR 31-01-20E	3

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

(단위:백만원)

60

공시일	2019-11-04
기준일	2019-11-01

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

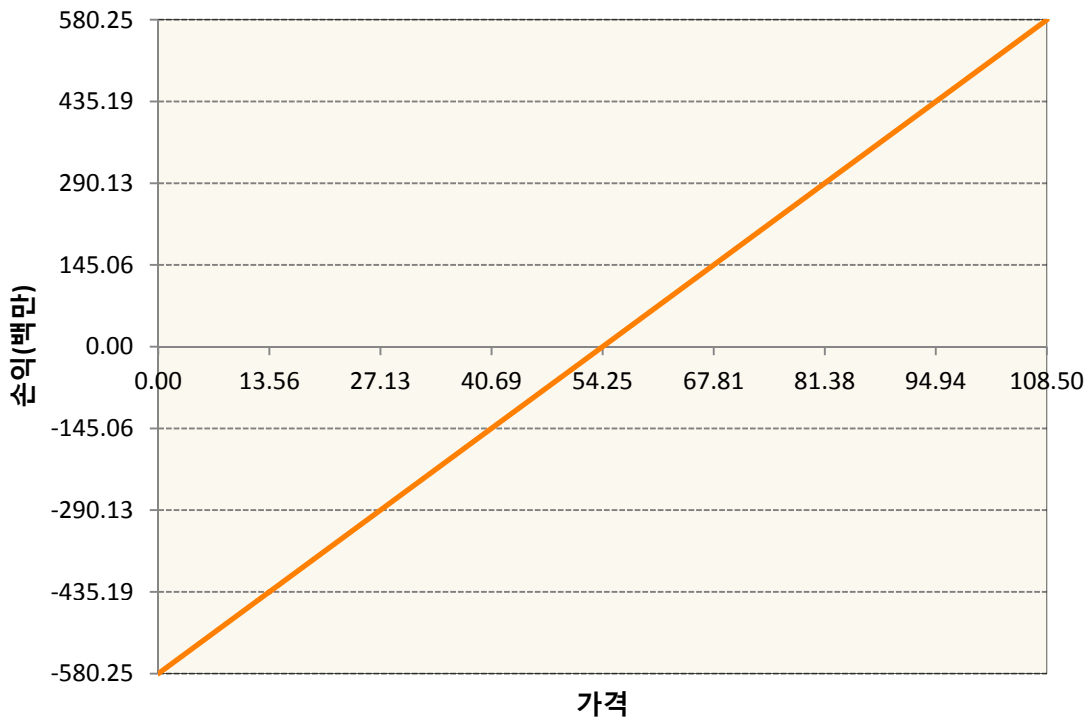
1. 계약금액

(단위:백만원)

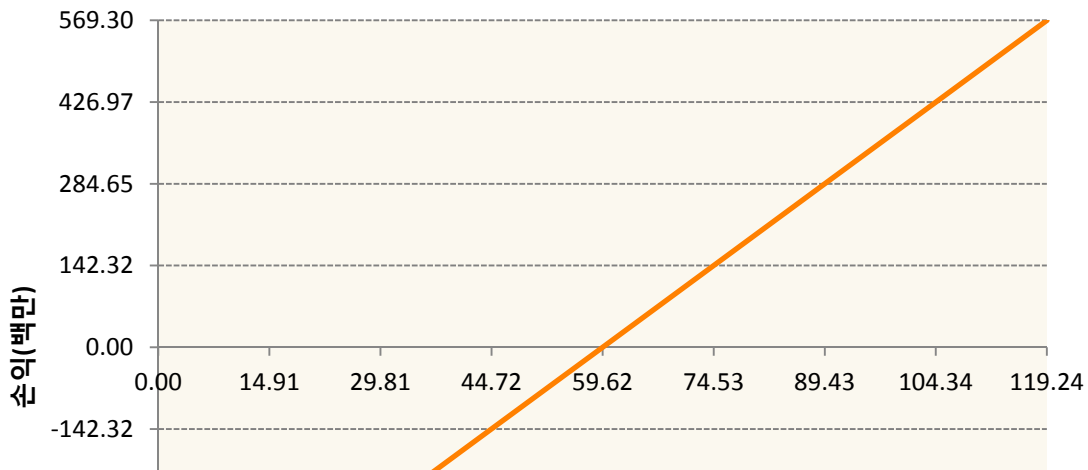
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,453	291	2,162	

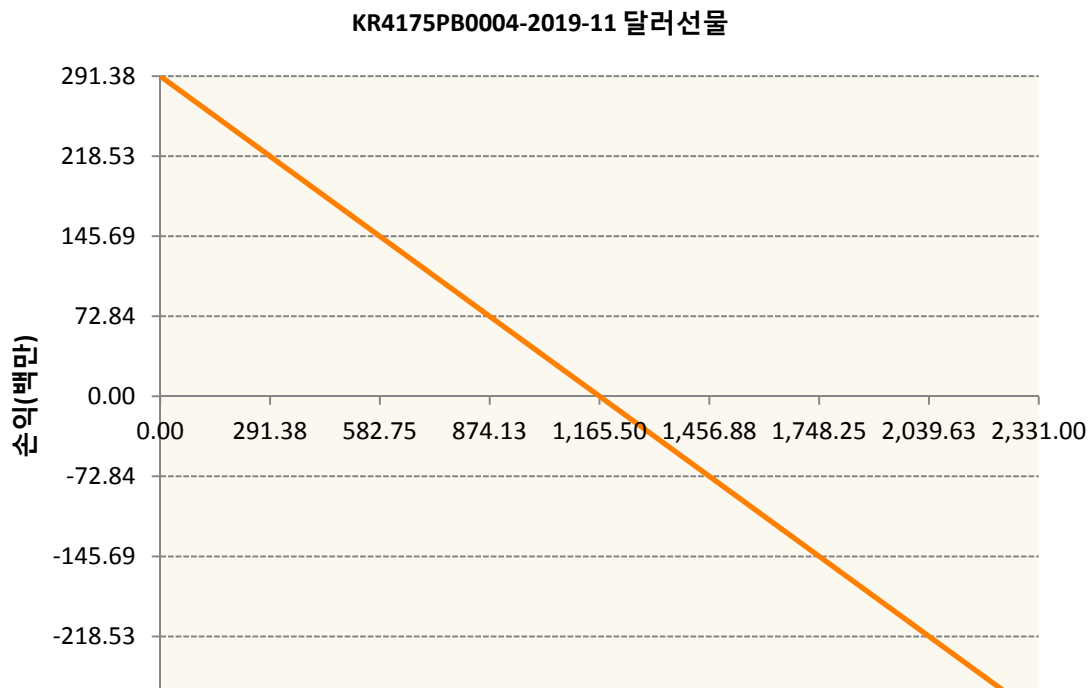
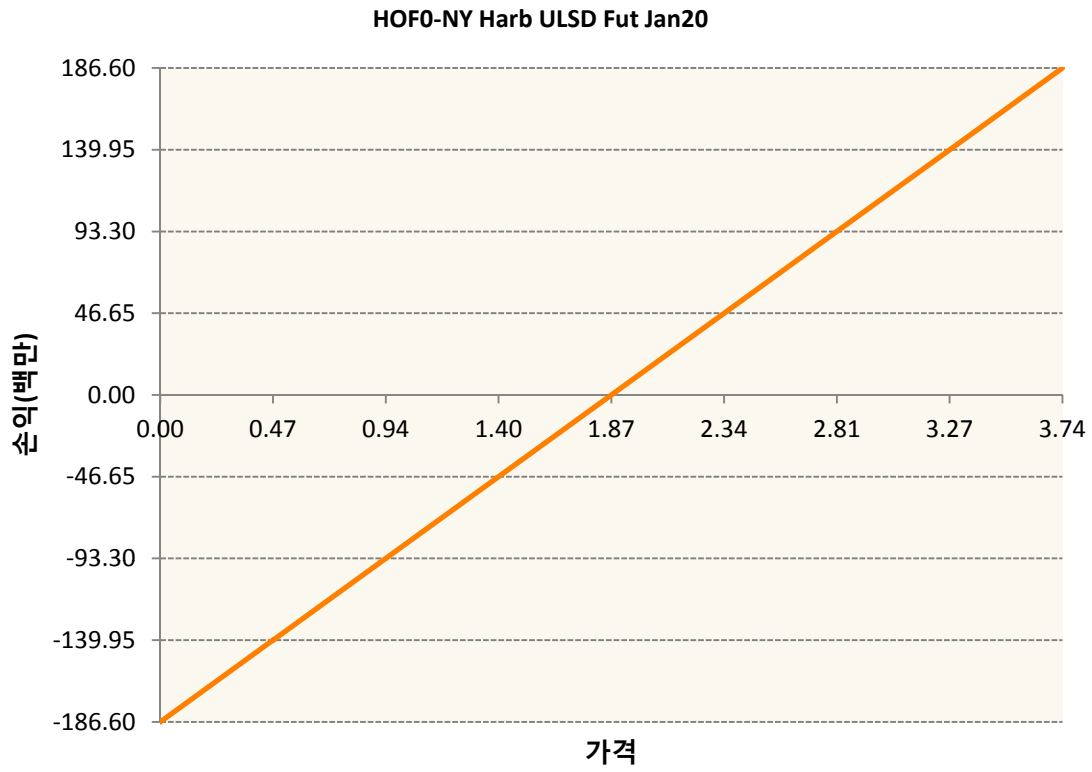
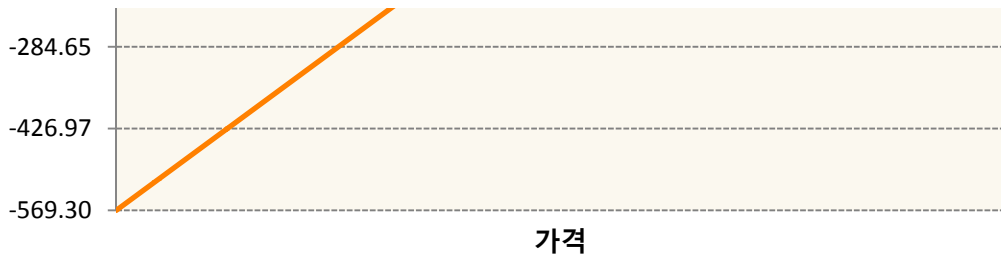
2. 만기시점의 손익구조

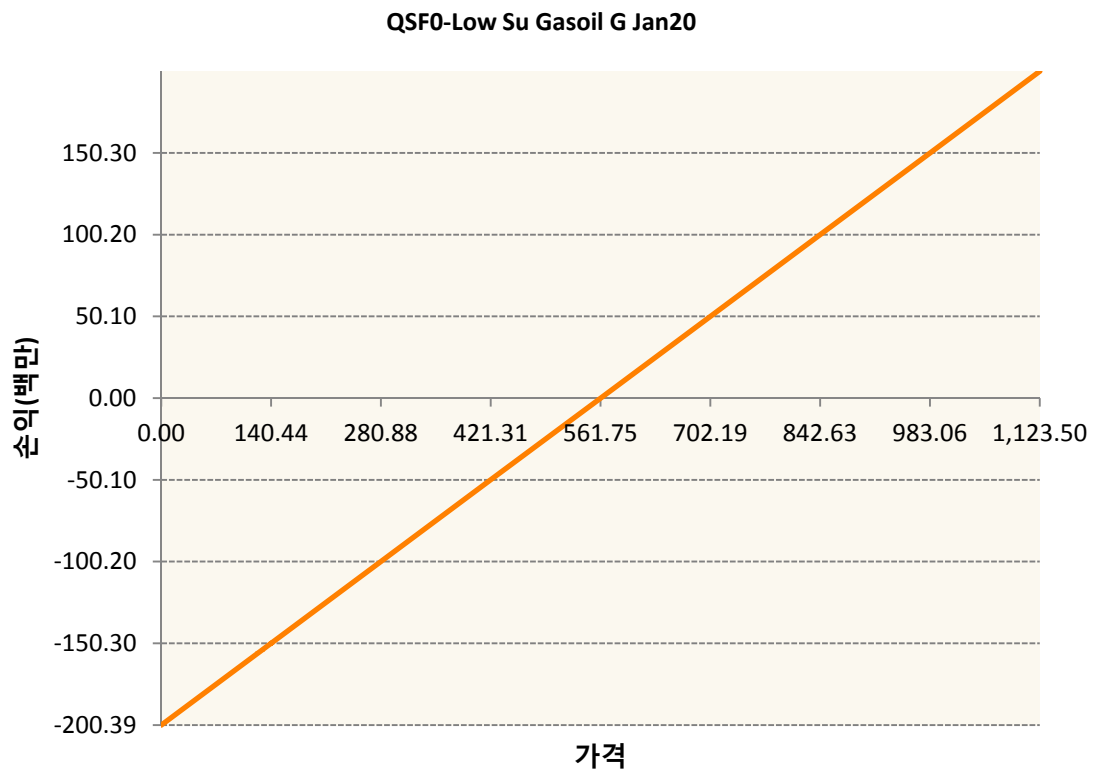
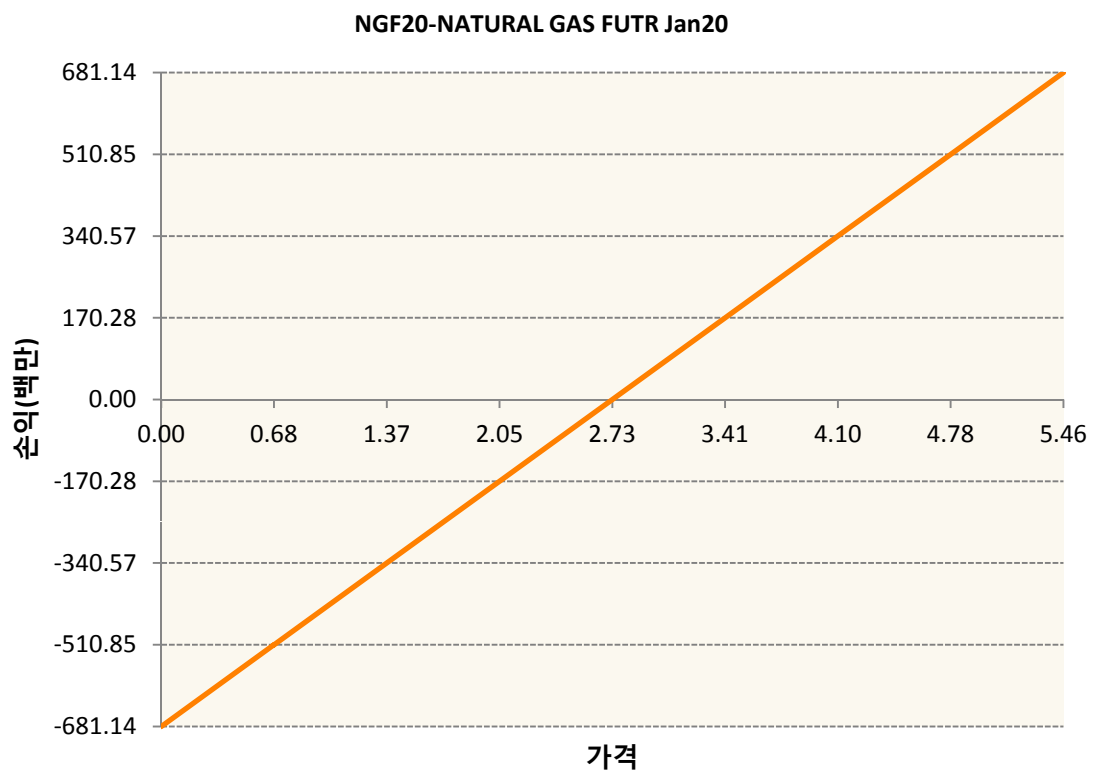
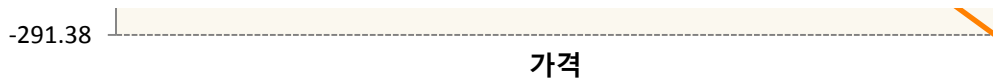
CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20



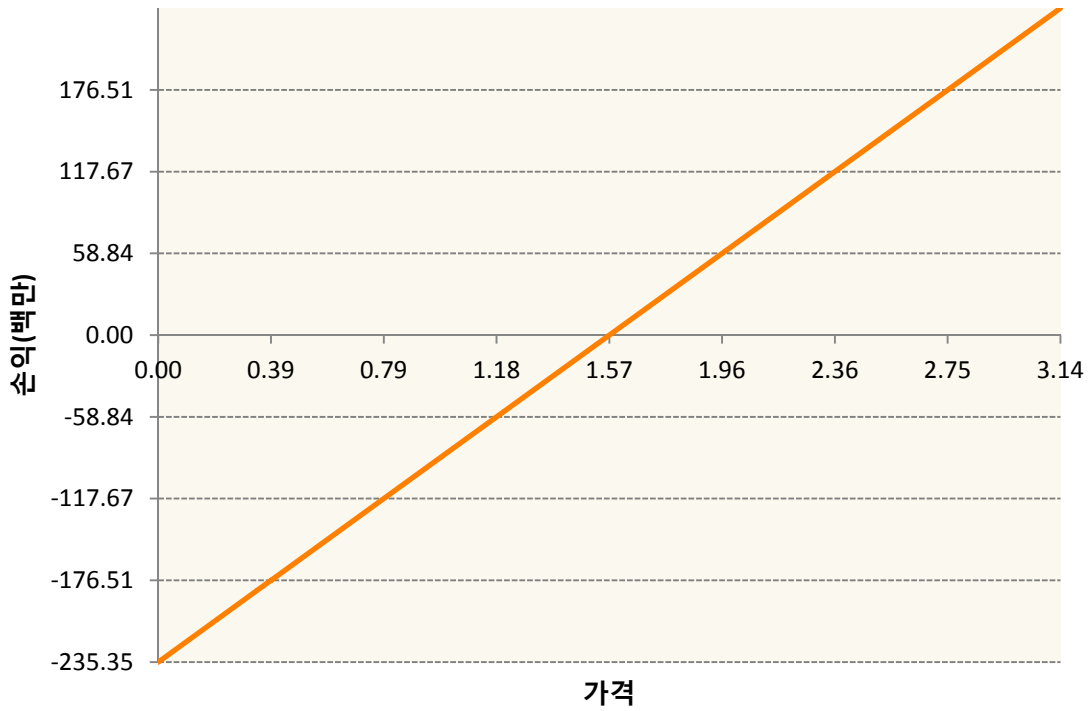
COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20







XBF0-GASOLINE RBOB FUT Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLF0	WTI CRUDE FUTURE Jan20	46
COF0	BRENT CRUDE FUTR Jan20	46
HOF0	NY Harb ULSD Fut Jan20	15
KR4175PB00	2019-11 달러선물	23
NGF20	NATURAL GAS FUTR Jan20	54
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	16
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	19

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

(단위:백만원)

410

공시일	2019-11-04
기준일	2019-11-01

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

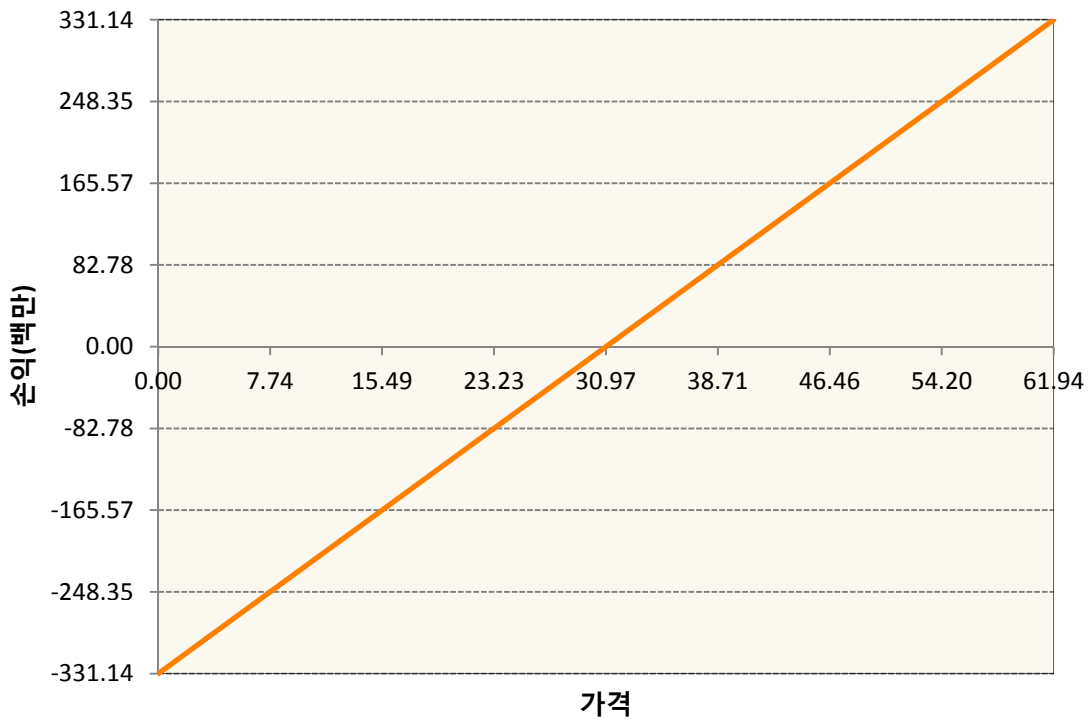
1. 계약금액

(단위:백만원)

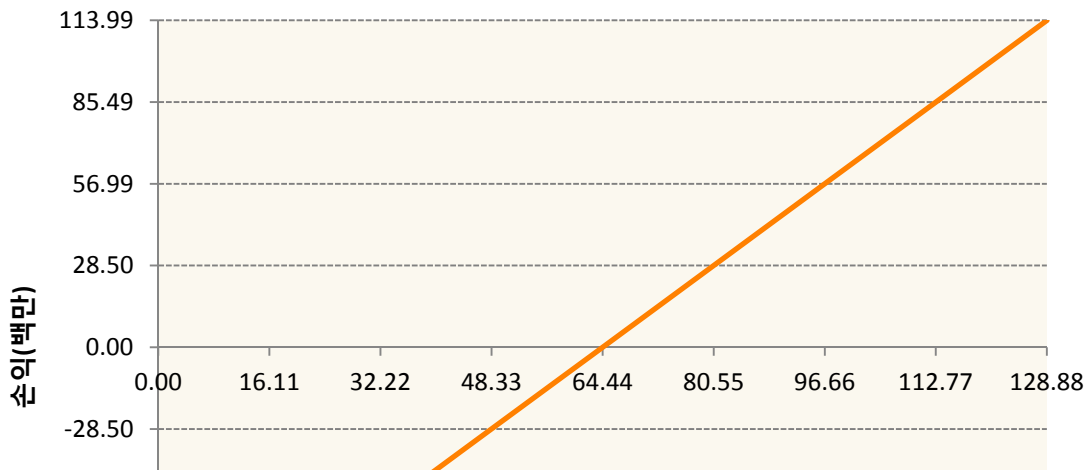
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,869	93	2,776	

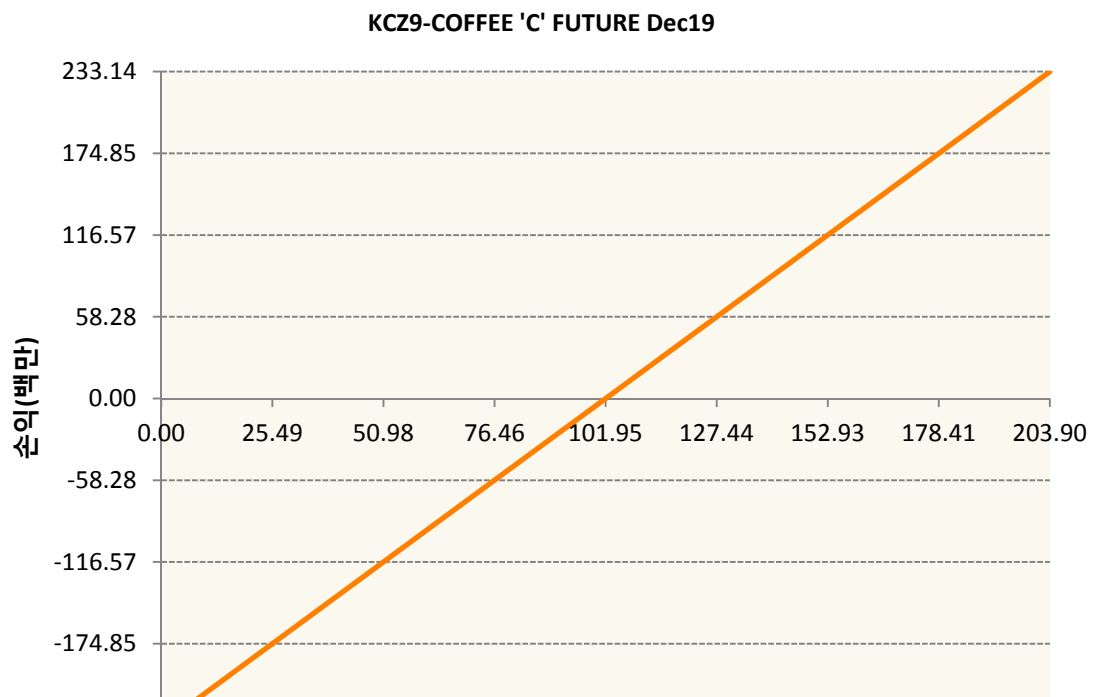
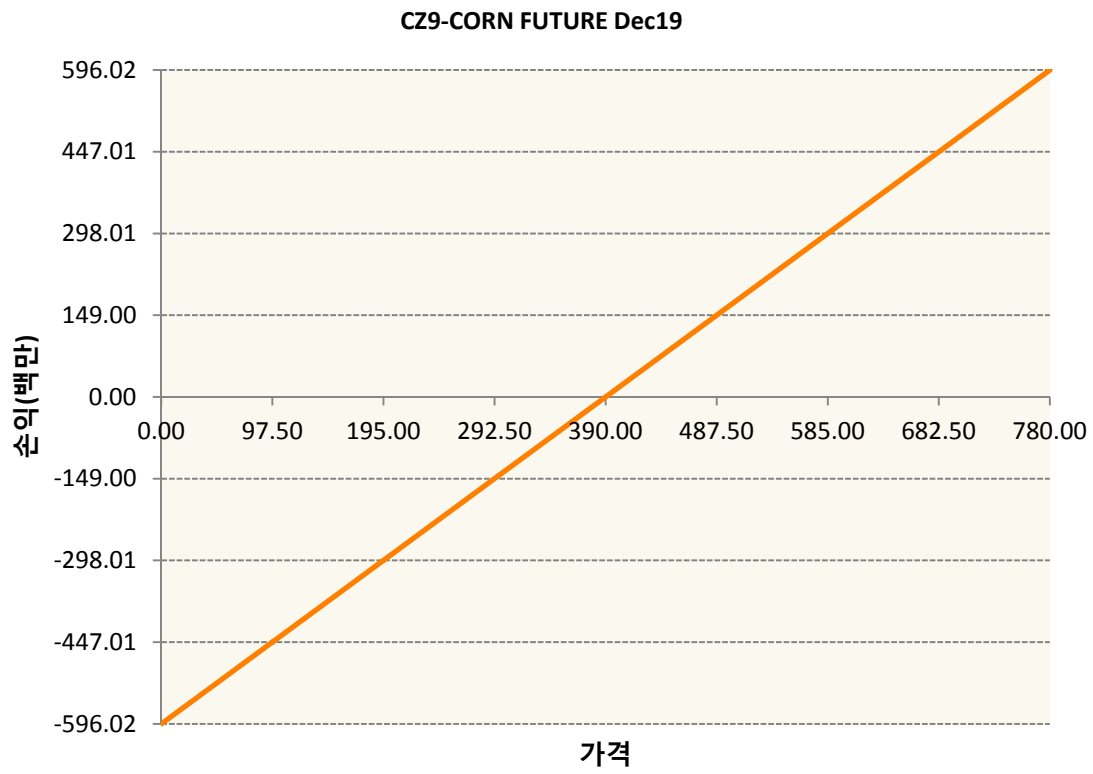
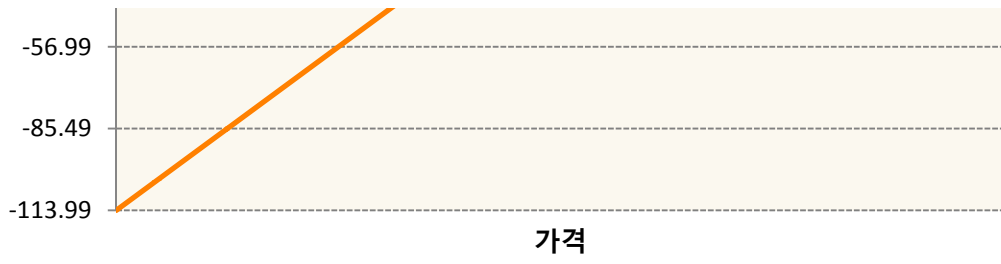
2. 만기시점의 손익구조

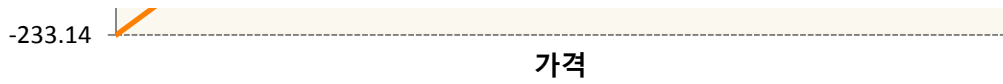
BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20



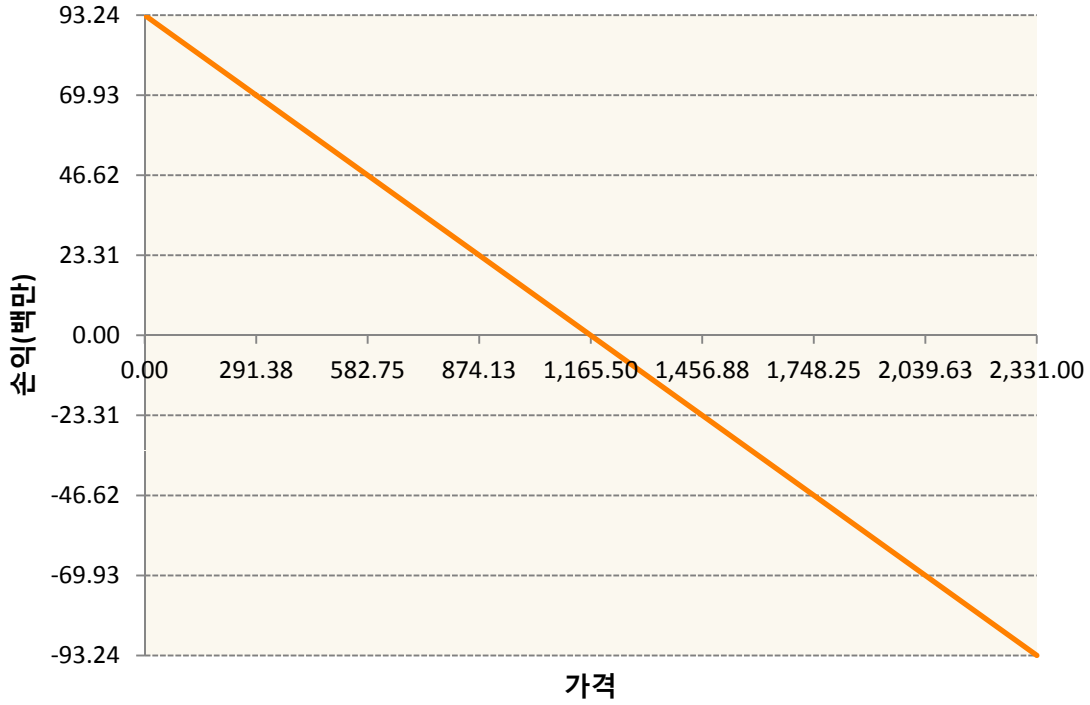
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



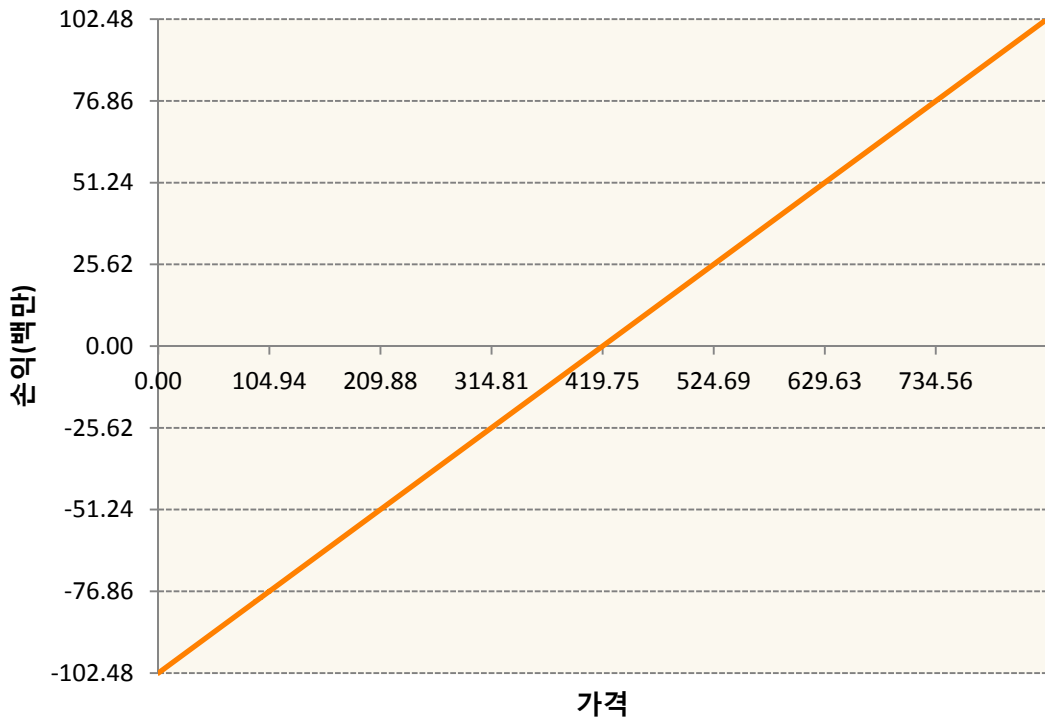




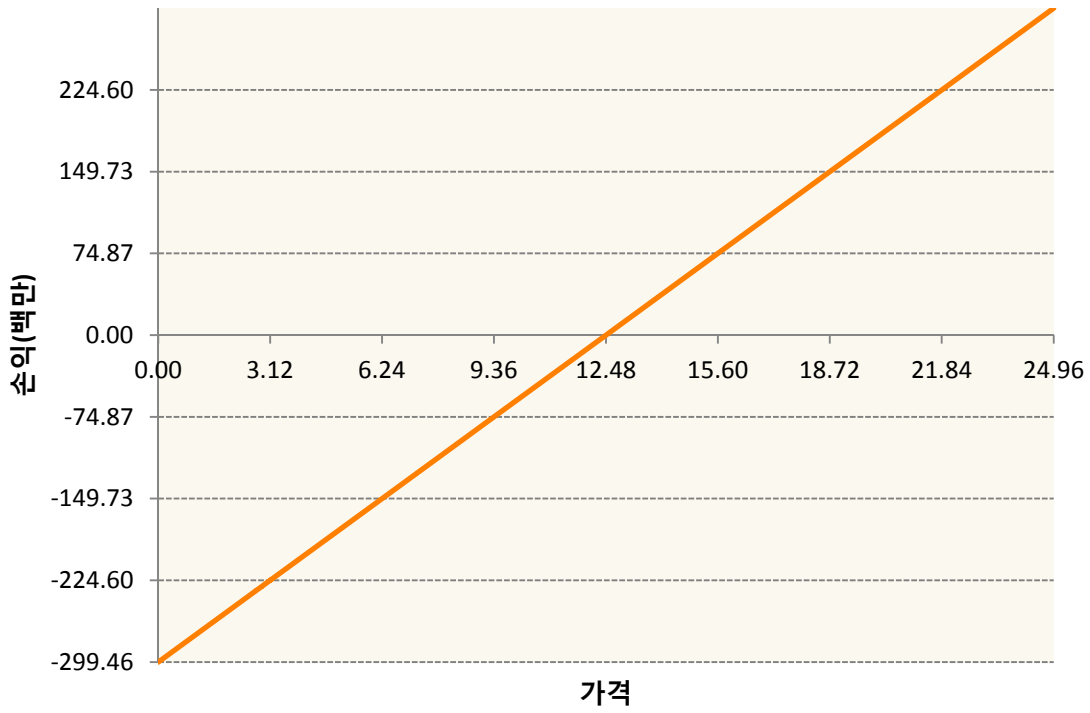
KR4175PB0004-2019-11 달러선물



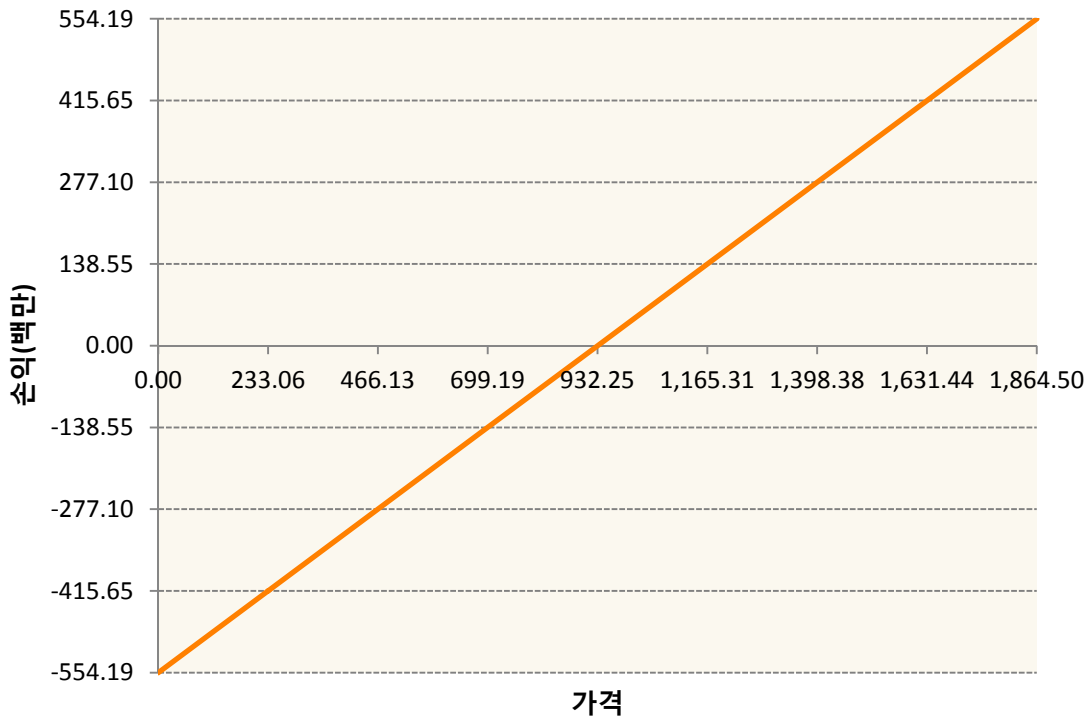
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



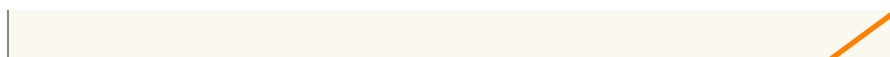
SBH0-Sugar Mar20

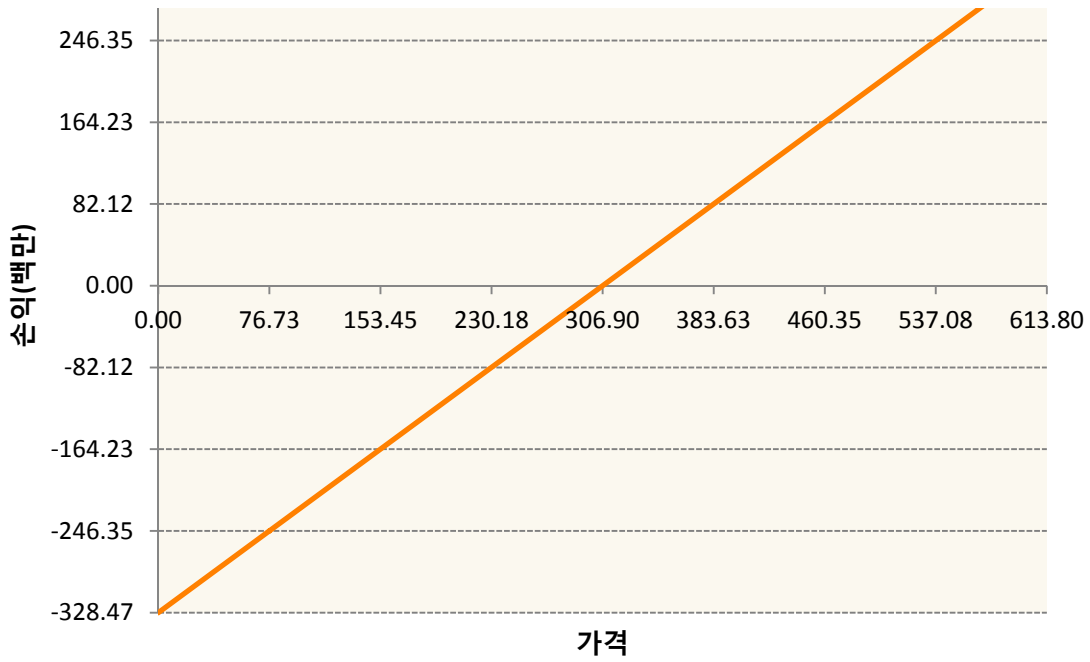


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20

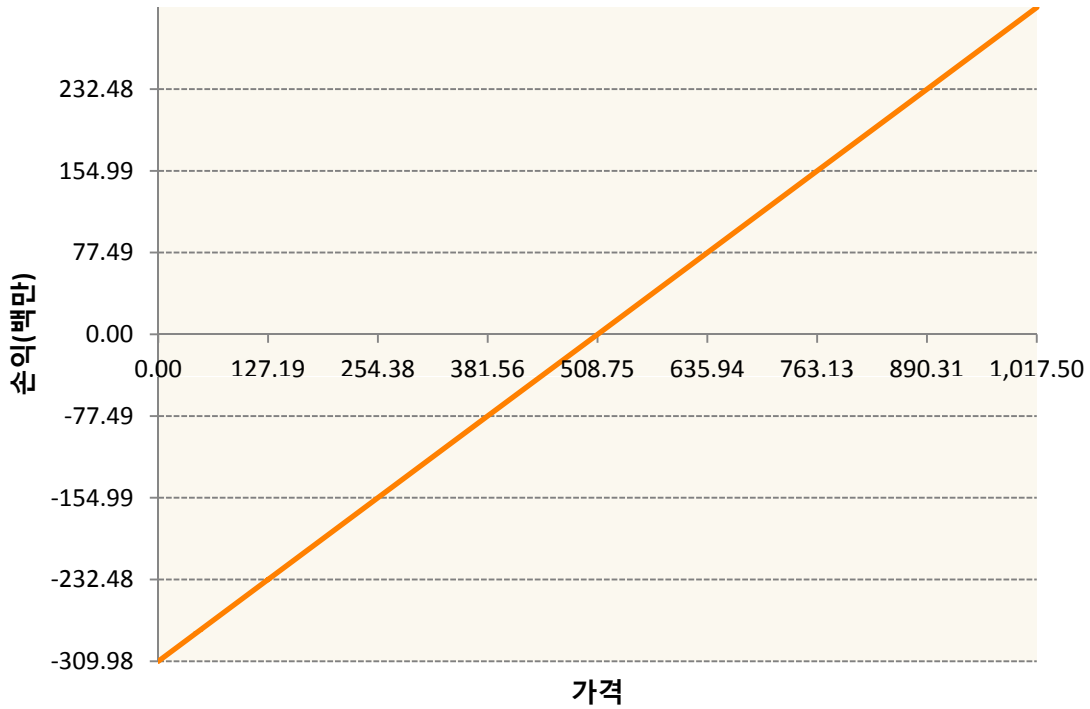


SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





WZ9-WHEAT FUTURE(CBT) Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF0	SOYBEAN OIL FUTR Jan20	26
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	9
CZ9	CORN FUTURE Dec19	48
KCZ9	COFFEE 'C' FUTURE Dec19	19
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