

공시일	2019-11-05
기준일	2019-11-04

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	2019-11-05
기준일	2019-11-04

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

1,209

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

702

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-11-05
기준일	2019-11-04

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(1)	384
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	140

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

772

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-11-05
기준일	2019-11-04

유로인덱스모(주식-파생형)

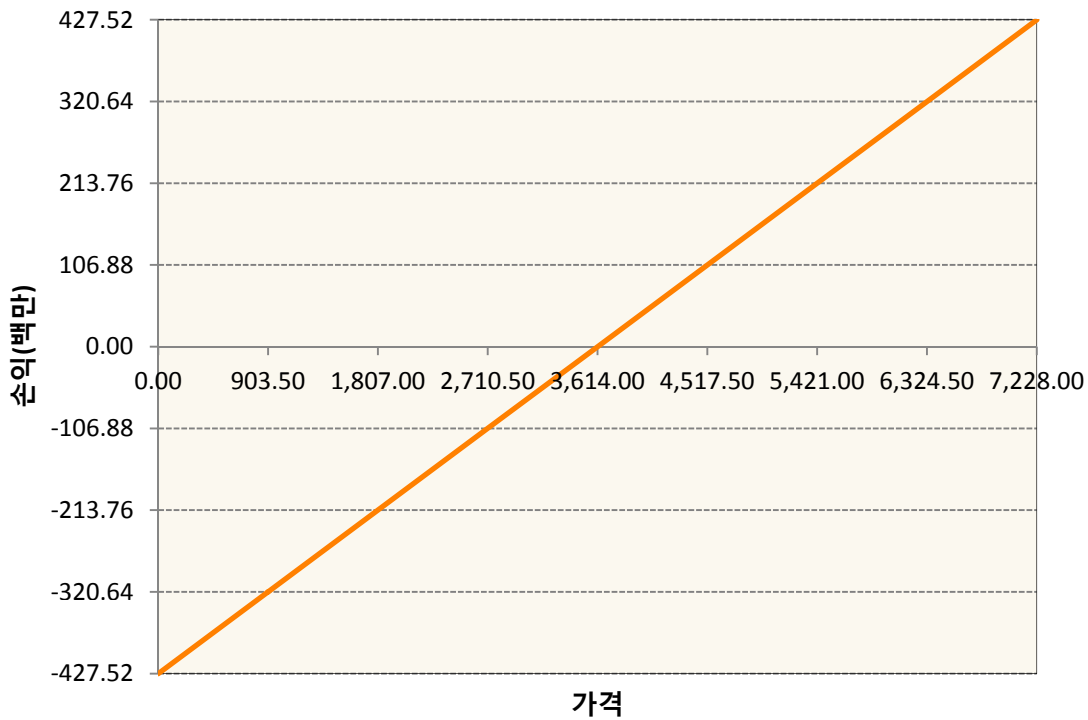
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

VGZ9-EURO STOXX 50 Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

24

공시일	2019-11-05
기준일	2019-11-04

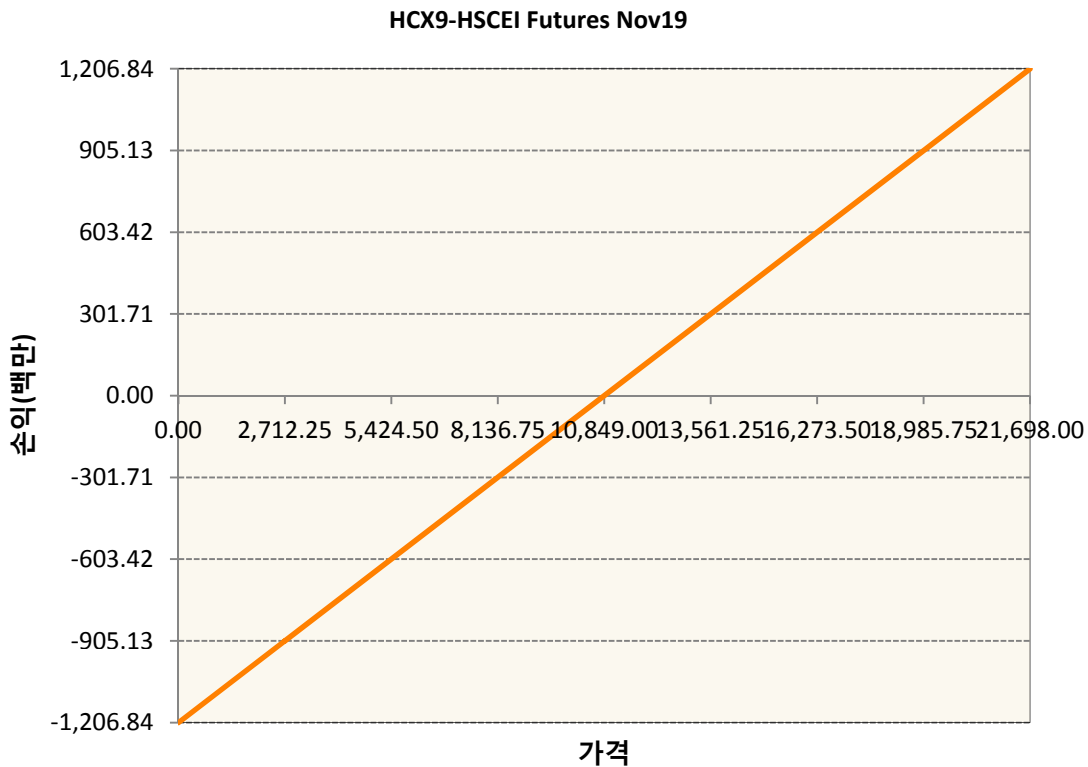
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,207	0	1,207	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGX9	HSCEI Futures Nov19	97
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

86

공시일	2019-11-05
기준일	2019-11-04

커버드콜모(주식혼합-파생형)

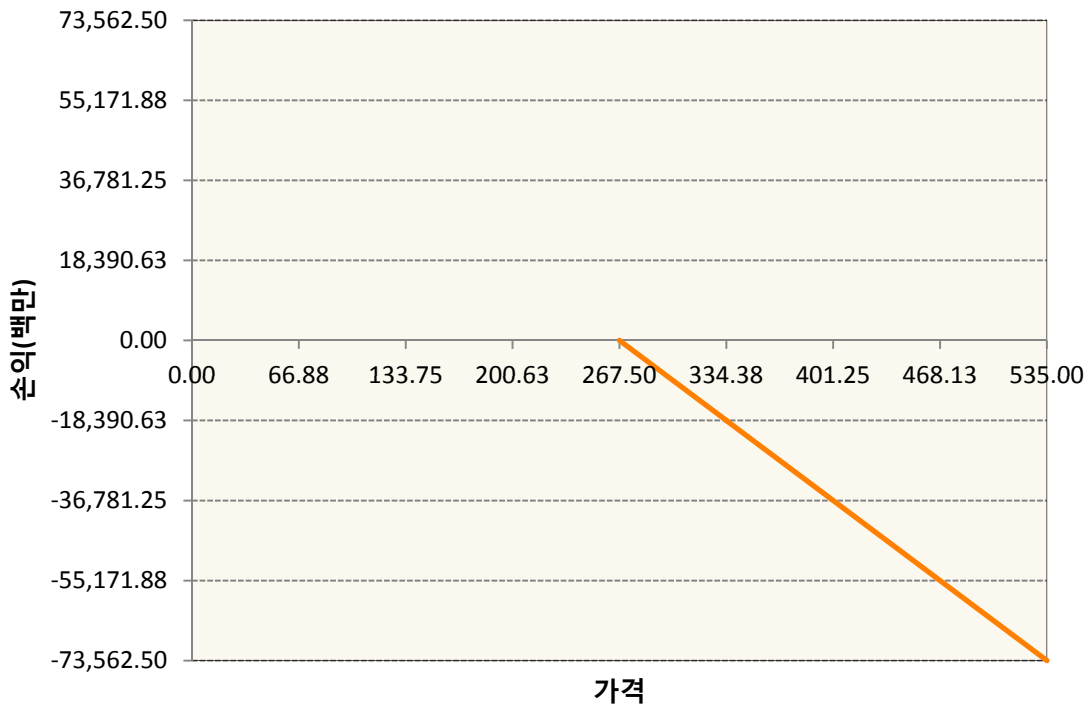
1. 계약금액

(단위:백만원)

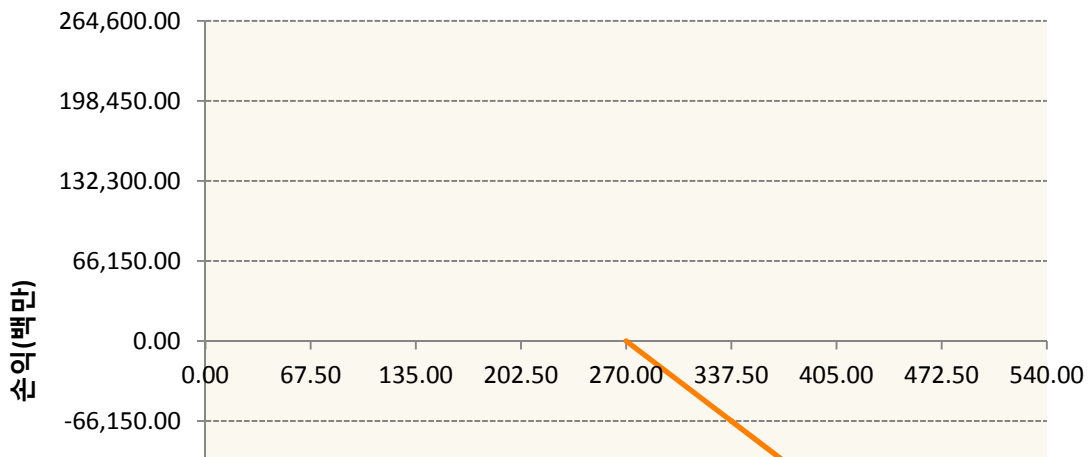
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	6,549	0	6,549	장내
누계	유가증권	옵션	0	493,313	-493,313	장내

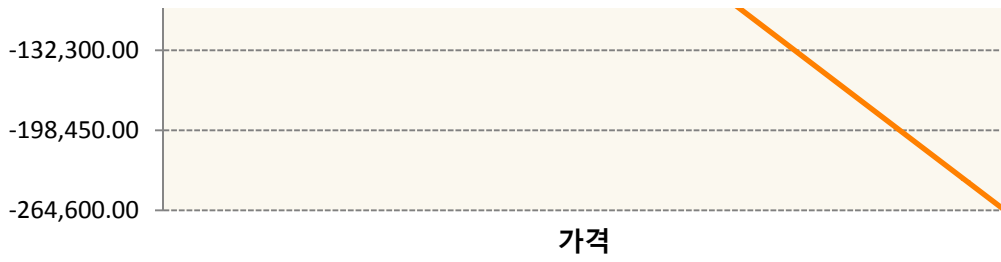
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PB2677-2019-11 콜267.5

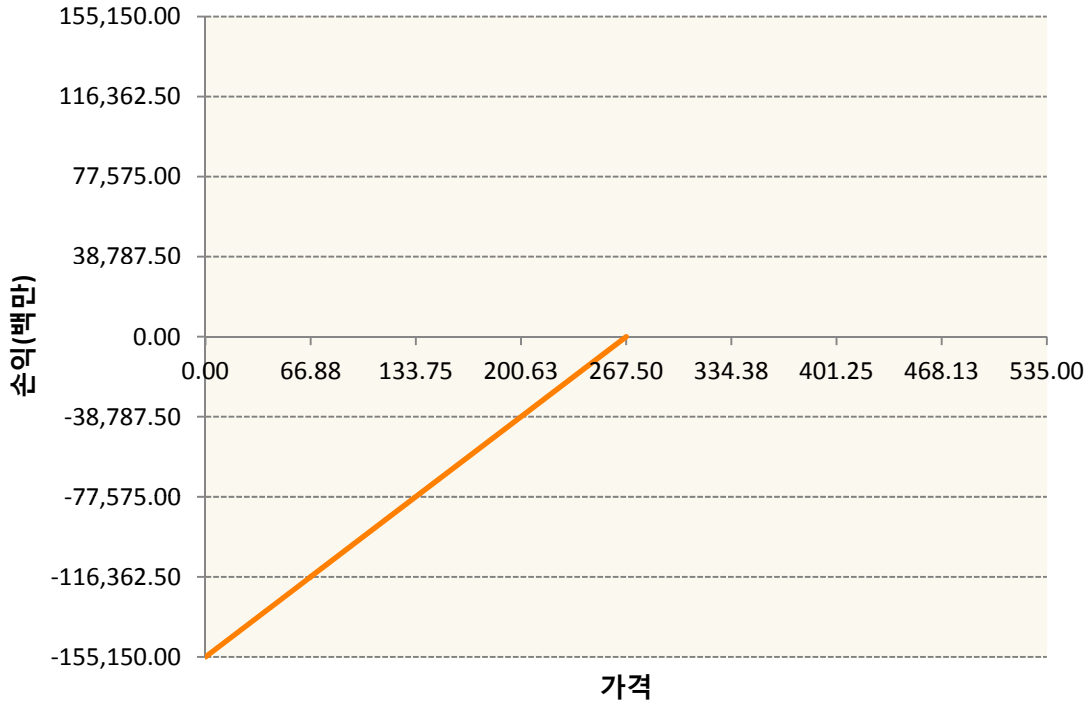


KR4201PB2701-2019-11 콜270





KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PB2677		2019-11 콜267.5					6,033	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4,036	3,956	3,872	3,784	3,693	3,600	3,504	
-5.33%	3,321	3,210	3,098	2,987	2,876	2,765	2,653	
-2.67%	1,961	1,876	1,787	1,695	1,599	1,502	1,402	
0%	134	97	52	0	-59	-124	-194	
2.67%	-1,884	-1,893	-1,908	-1,929	-1,956	-1,990	-2,029	
5.33%	-3,947	-3,949	-3,952	-3,958	-3,968	-3,981	-3,999	
8.00%	-6,017	-6,017	-6,018	-6,019	-6,022	-6,026	-6,033	
KR4201PB2701		2019-11 콜270					21,185	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	12,672	12,449	12,201	11,934	11,650	11,353	11,044	

-5.33%	10,800	10,416	10,029	9,640	9,250	8,859	8,466
-2.67%	6,703	6,347	5,983	5,612	5,237	4,857	4,475
0%	642	455	240	0	-260	-538	-830
2.67%	-6,397	-6,456	-6,539	-6,647	-6,781	-6,938	-7,116
5.33%	-13,721	-13,732	-13,754	-13,789	-13,841	-13,911	-13,999
8.00%	-21,094	-21,095	-21,099	-21,108	-21,124	-21,149	-21,185
KR4301PB2676 2019-11 풋267.5							4,698
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,451	-4,475	-4,507	-4,545	-4,591	-4,642	-4,698
-5.33%	-1,004	-1,113	-1,222	-1,331	-1,440	-1,549	-1,658
-2.67%	-37	-66	-103	-147	-198	-255	-317
0%	5	5	3	0	-5	-14	-25
2.67%	5	5	5	5	5	5	4
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

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

(단위:백만원)

30,456

공시일	2019-11-05
기준일	2019-11-04

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

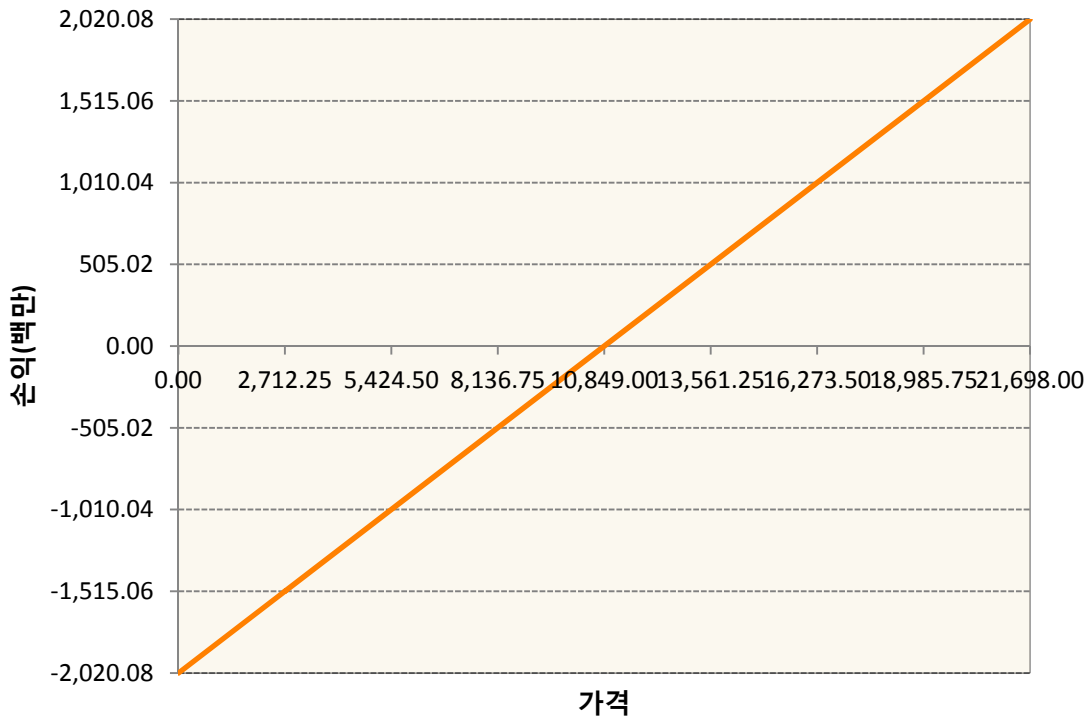
1. 계약금액

(단위:백만원)

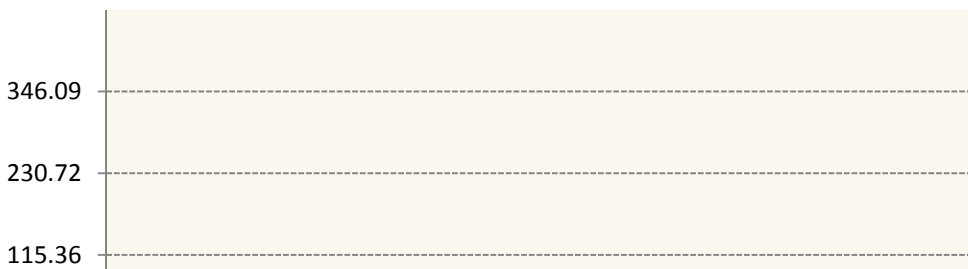
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,020	0	2,020	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,038	-5,038	장내
누계	통화	선도	666	2,748	-2,082	장외

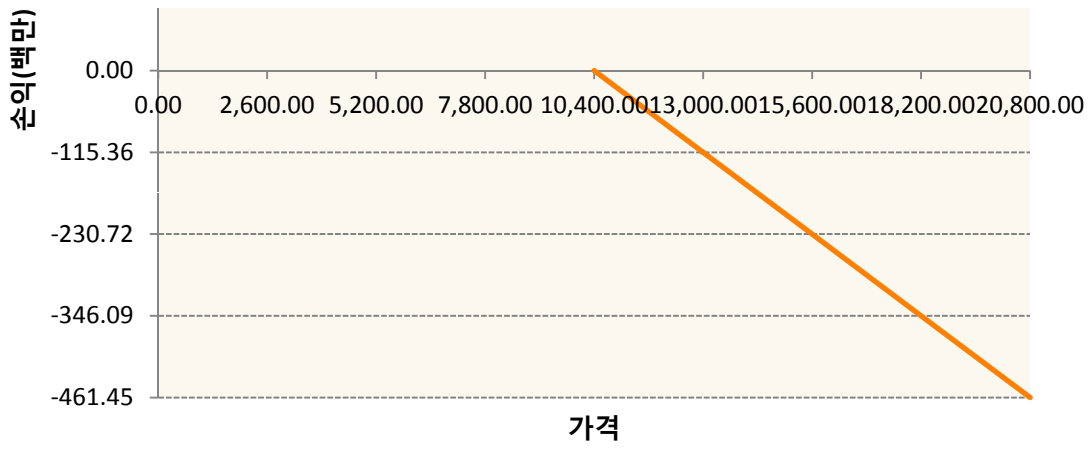
2. 만기시점의 손익구조

HCX9-HSCEI Futures Nov19

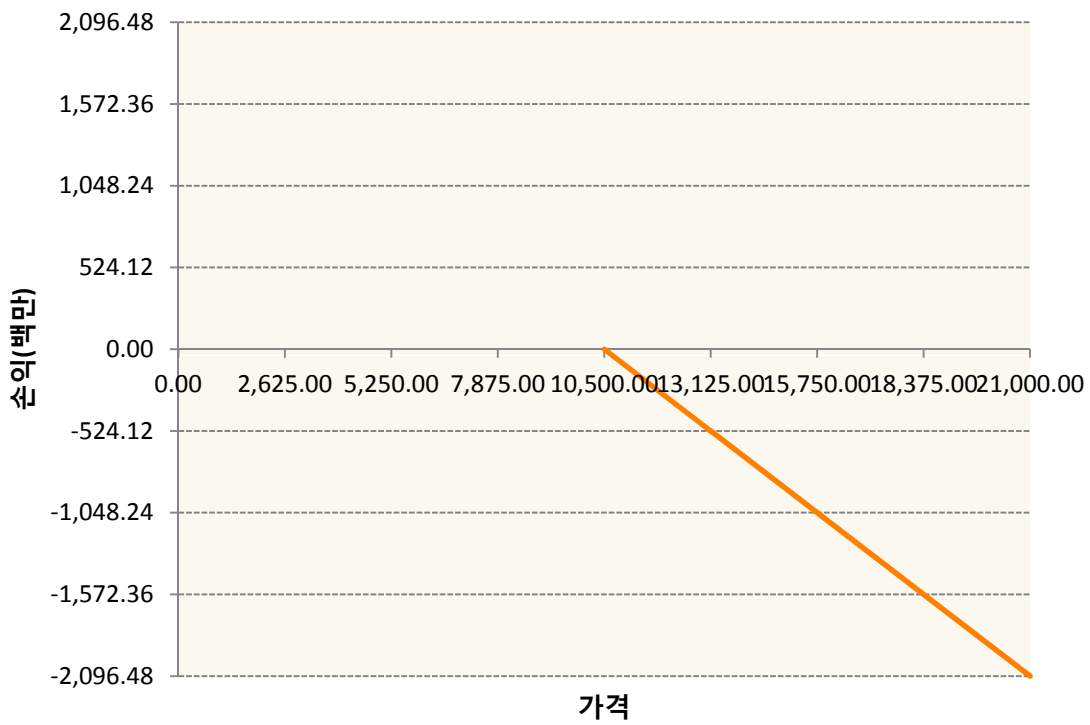


OHHIX9-C104-HSCEI

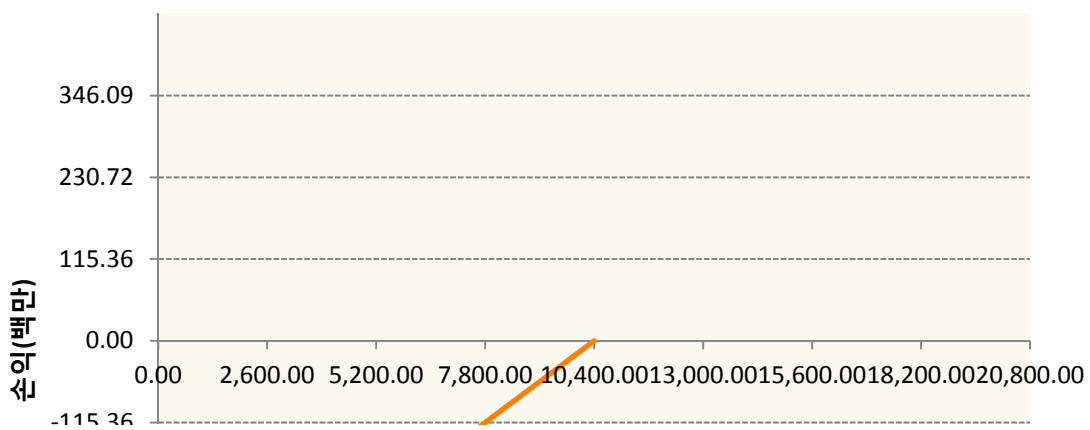


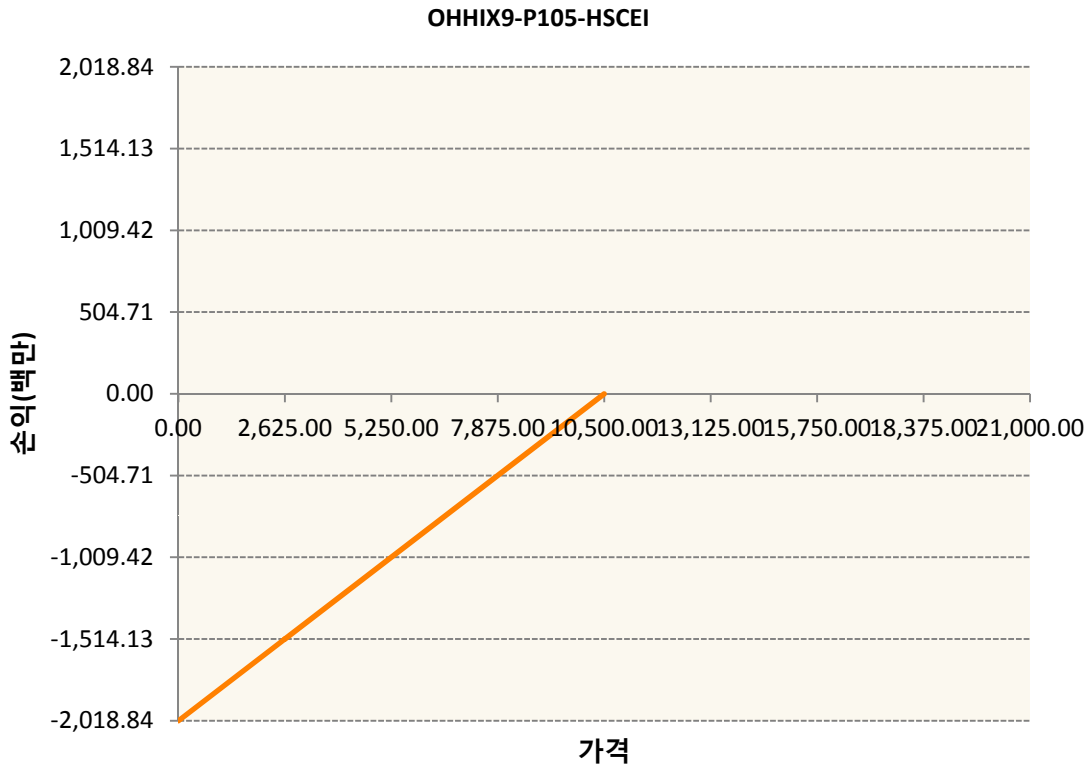


OHHIX9-C105-HSCEI



OHHIX9-P104-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	220
FX21019U00 HKD/KRW 22-11-19E	6
FX21019U02 HKD/KRW 22-11-19E	47
HCX9 HSCEI Futures Nov19	162
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)
	590

공시일	2019-11-05
기준일	2019-11-04

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

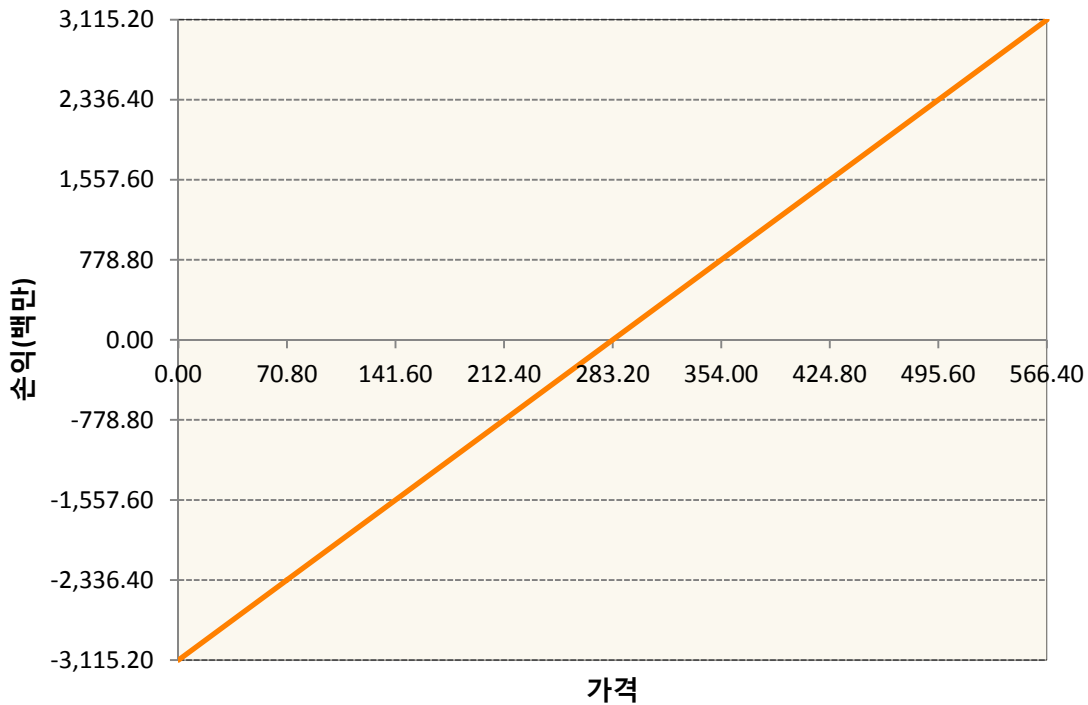
1. 계약금액

(단위:백만원)

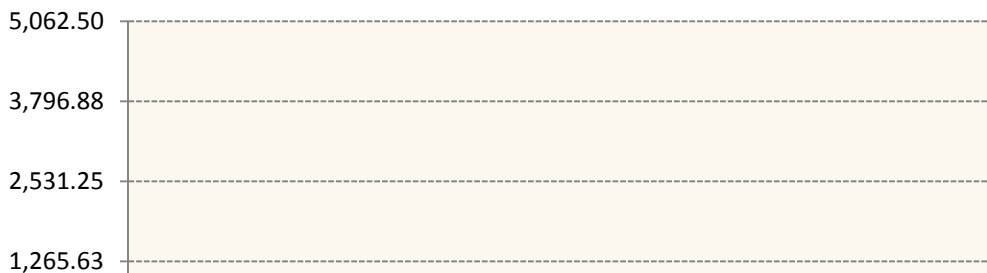
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	134	0	134	장내
누계	유가증권	선물	3,115	0	3,115	장내
누계	유가증권	스왑	10,625	0	10,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,879	-9,879	장내

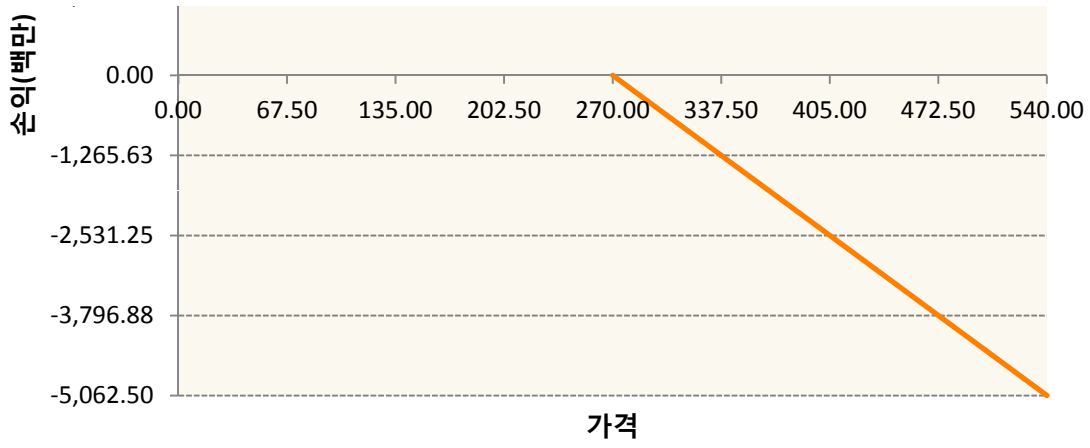
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

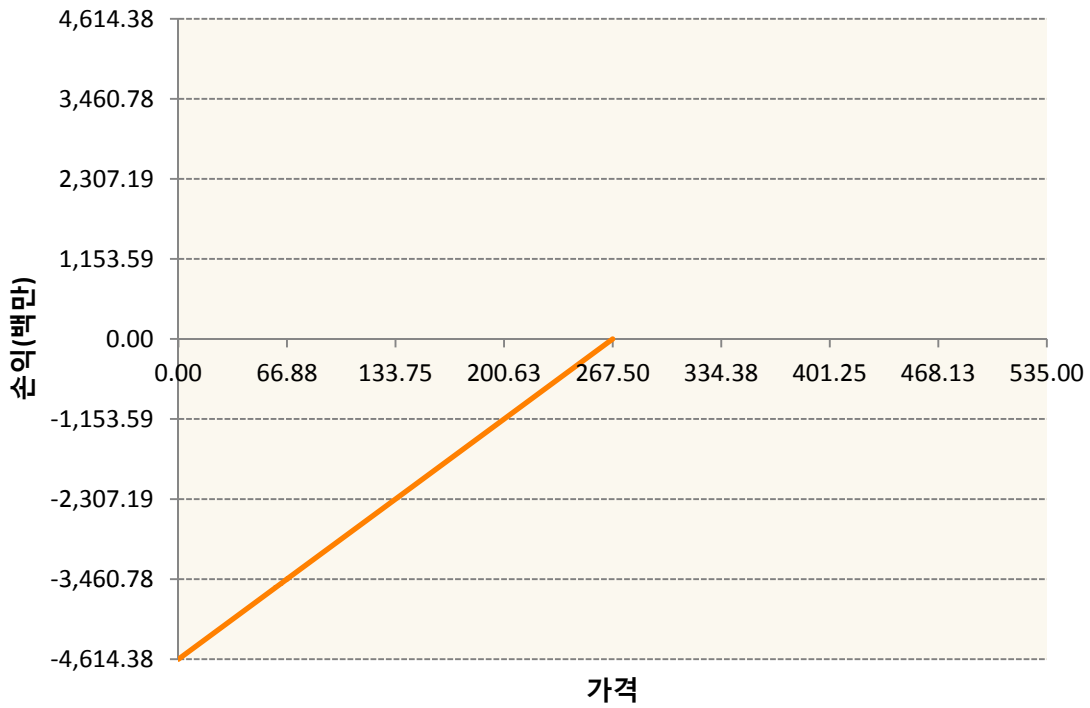


KR4201PB2701-2019-11 콜270

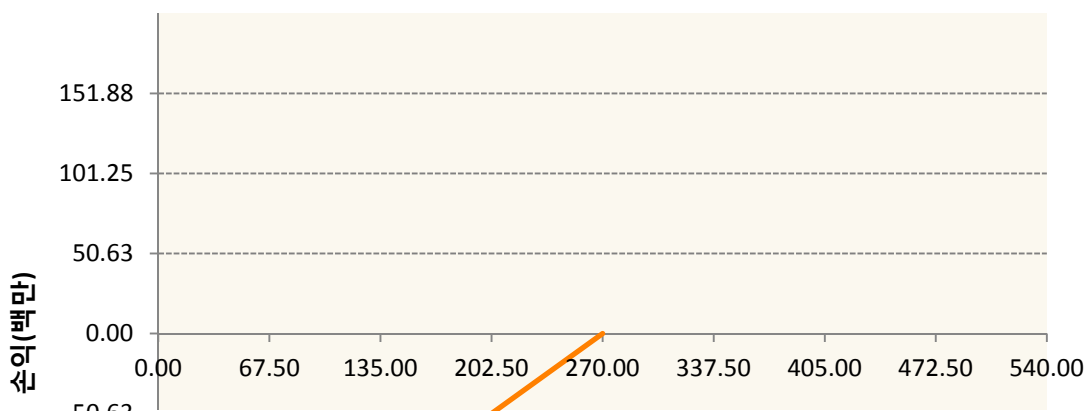


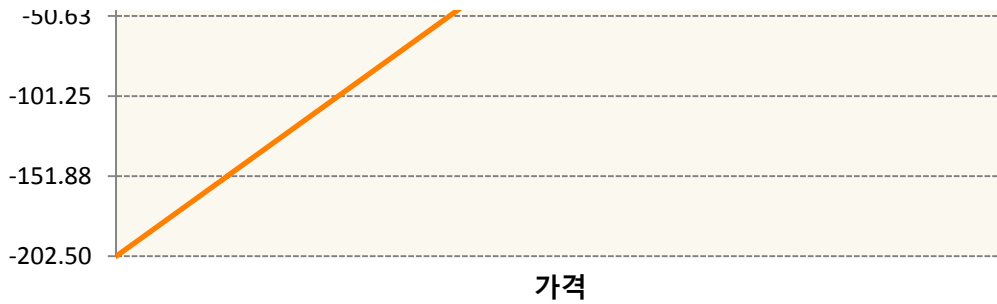


KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



KR4301PB2700-2019-11 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						906
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-906	-906	-906	-906	-906	-906	-906	
-5.33%	-604	-604	-604	-604	-604	-604	-604	
-2.67%	-302	-302	-302	-302	-302	-302	-302	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	302	302	302	302	302	302	302	
5.33%	604	604	604	604	604	604	604	
8.00%	906	906	906	906	906	906	906	
KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						249
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-249	-249	-249	-249	-249	-249	-249	
-5.33%	-166	-166	-166	-166	-166	-166	-166	
-2.67%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	83	83	83	83	83	83	83	
5.33%	166	166	166	166	166	166	166	
8.00%	249	249	249	249	249	249	249	
KR4201PB2701		2019-11 콜270						405
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	242	238	233	228	223	217	211	
-5.33%	207	199	192	184	177	169	162	
-2.67%	128	121	114	107	100	93	86	
0%	12	9	5	0	-5	-10	-16	
2.67%	-122	-124	-125	-127	-130	-133	-136	
5.33%	-263	-263	-263	-264	-265	-266	-268	
8.00%	-404	-404	-404	-404	-404	-405	-405	
KR4301PB2676		2019-11 풋267.5						140
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-132	-133	-134	-135	-137	-138	-140
-5.33%	-30	-33	-36	-40	-43	-46	-49
-2.67%	-1	-2	-3	-4	-6	-8	-9
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
KR4301PB2700 2019-11 풋270							8
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
-5.33%	-2	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-2.67%	0	0	0	0	-1	-1	-1
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)

1,579

공시일	2019-11-05
기준일	2019-11-04

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

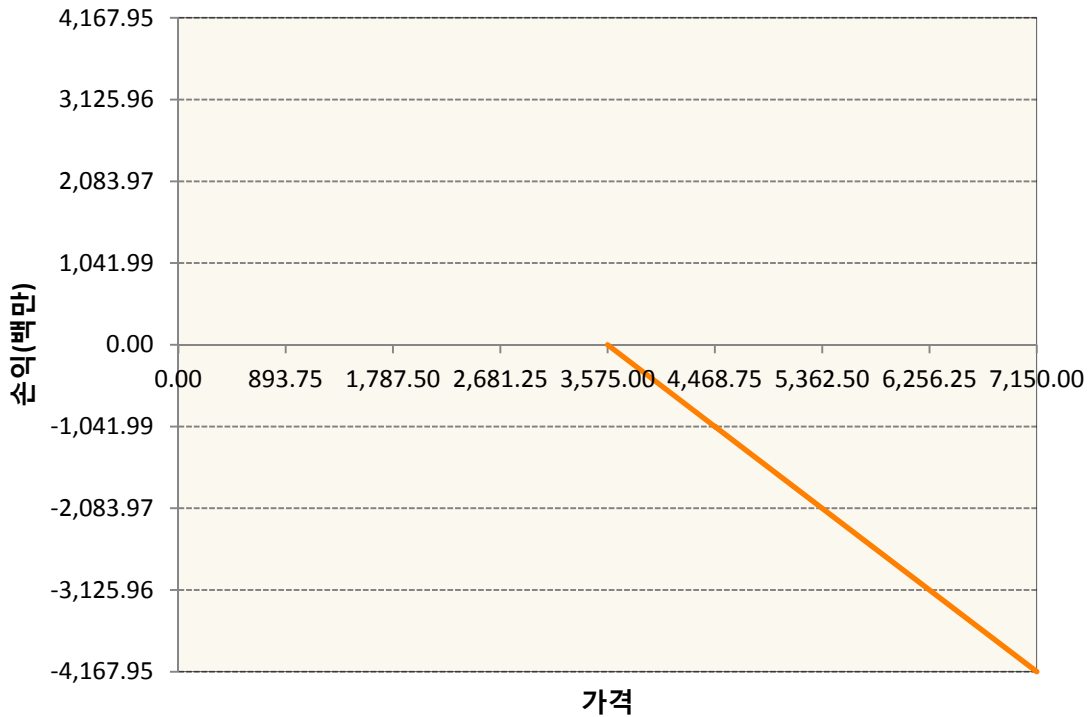
1. 계약금액

(단위:백만원)

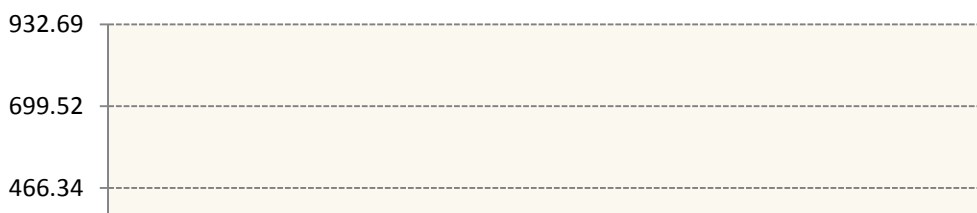
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,261	0	2,261	
누계	유가증권	스왑	20,353	0	20,353	장외
누계	유가증권	옵션	0	10,201	-10,201	장내
누계	통화	선도	2,042	6,088	-4,047	장외

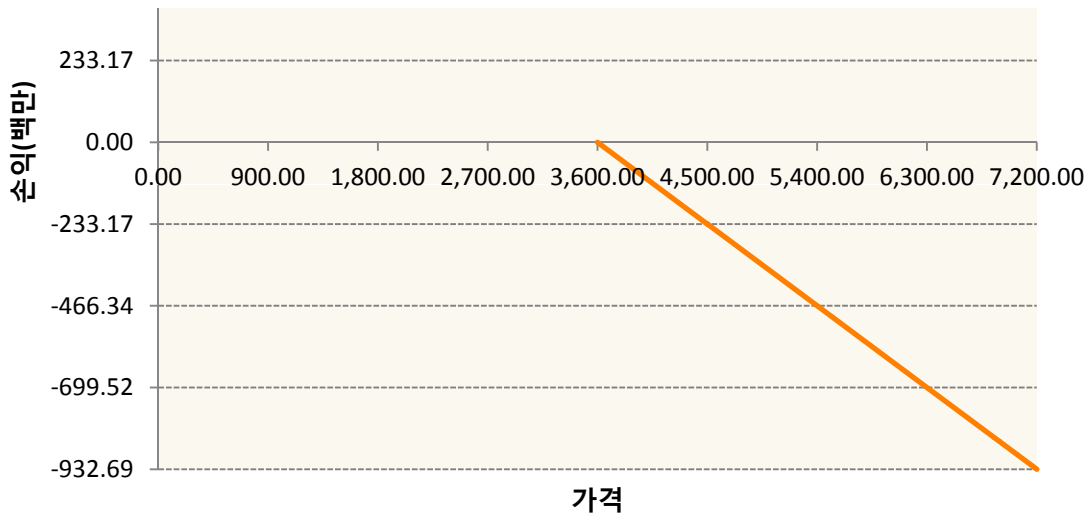
2. 만기시점의 손익구조

OESXX9-C3575-EURO STOXX 50

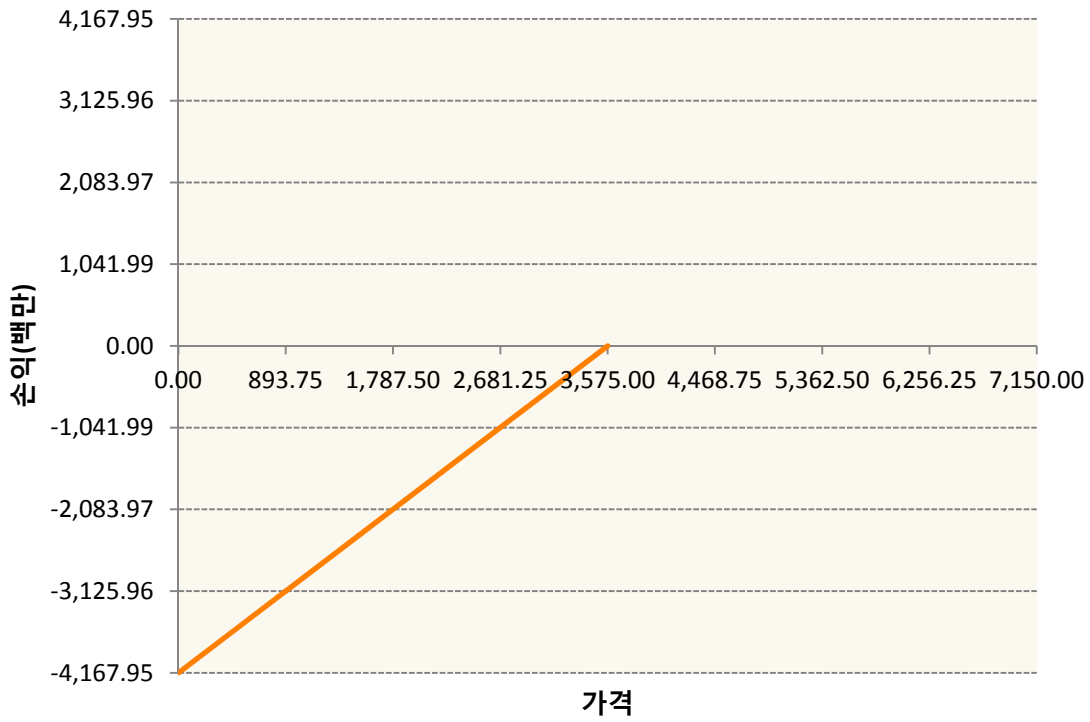


OESXX9-C3600-EURO STOXX 50

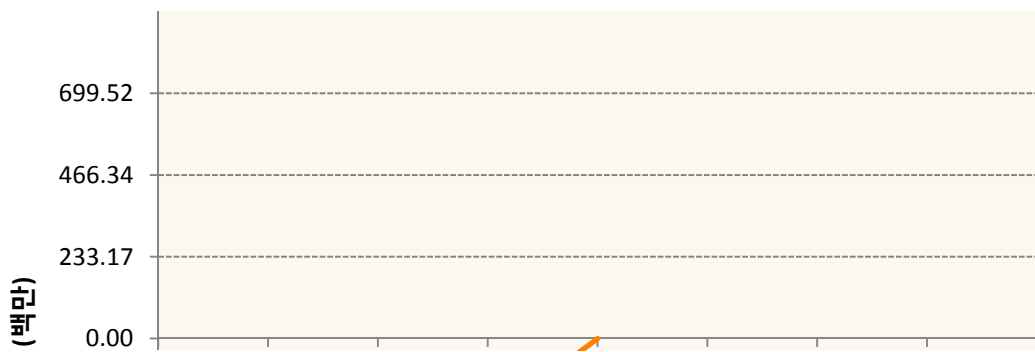


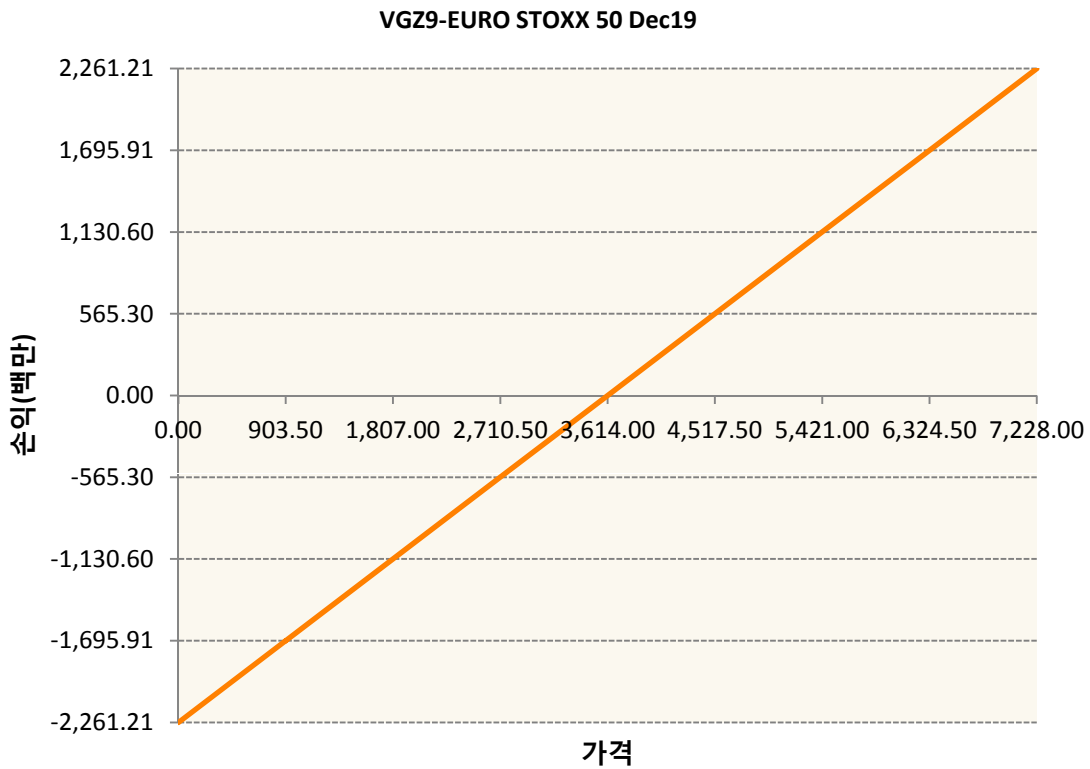
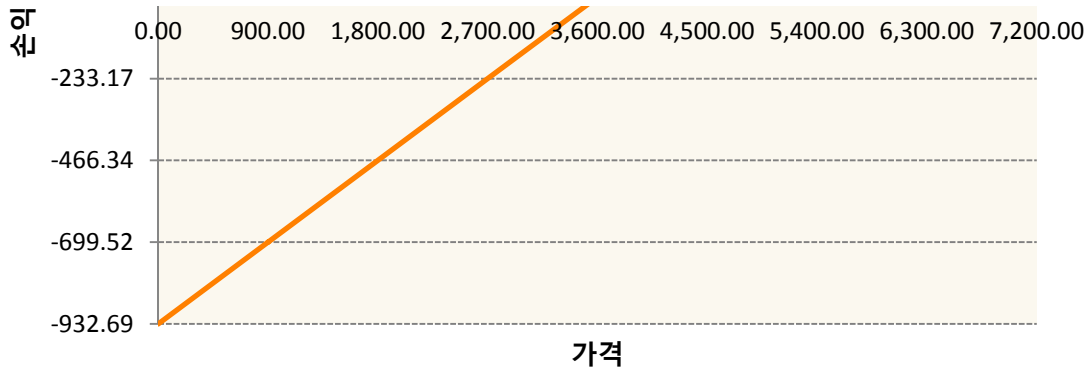


OESXX9-P3575-EURO STOXX 50



OESXX9-P3600-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		19
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E		487
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E		163
OESXX9-C35 EURO STOXX 50		333
OESXX9-C36 EURO STOXX 50		75
OESXX9-P35 EURO STOXX 50		333
OESXX9-P36 EURO STOXX 50		75
VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	181

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

(단위:백만원)

1,017

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

(단위:백만원)

940

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

(단위:백만원)

82

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

(단위:백만원)

128

공시일	2019-11-05
기준일	2019-11-04

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

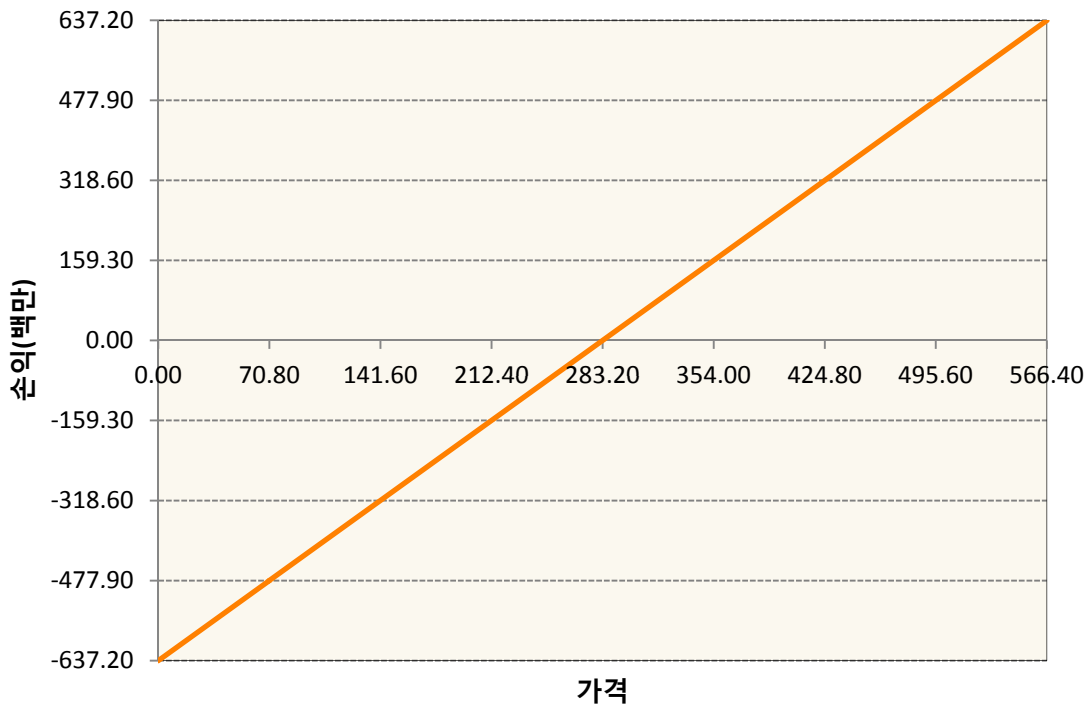
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	637	0	637	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						51
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51	
-5.33%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	
-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%	34	34	34	34	34	34	34	
8.00%	51	51	51	51	51	51	51	

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-11-05
기준일	2019-11-04

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

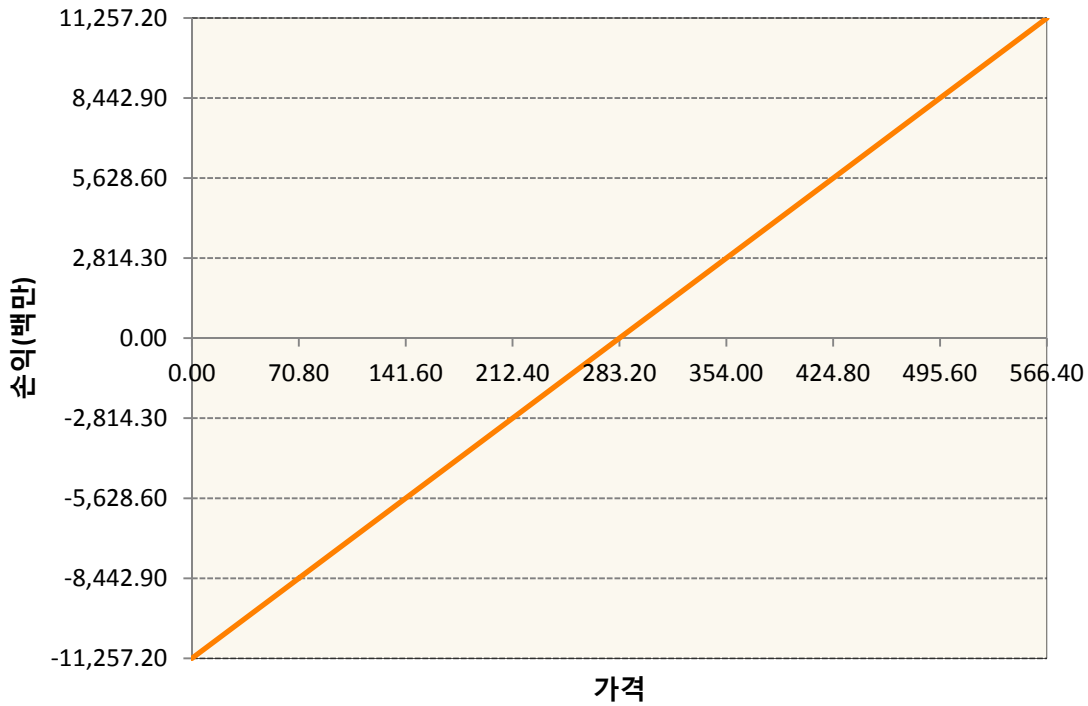
1. 계약금액

(단위:백만원)

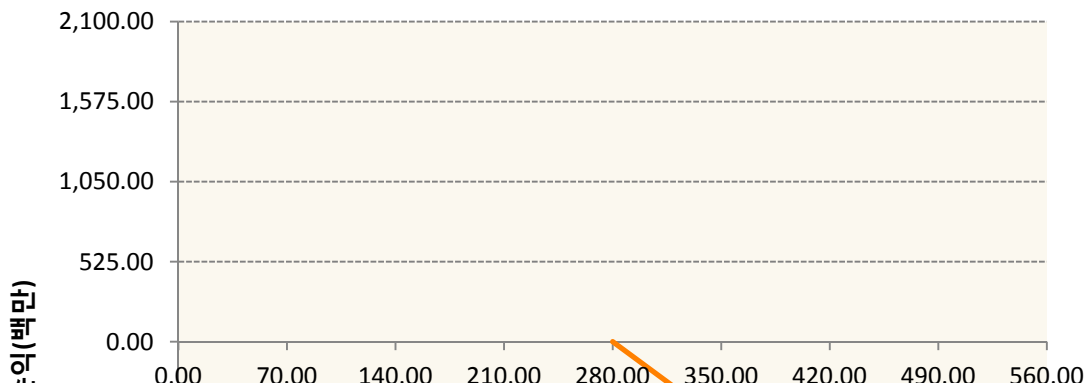
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,257	0	11,257	장내
누계	유가증권	옵션	3,561	20,533	-16,972	장내

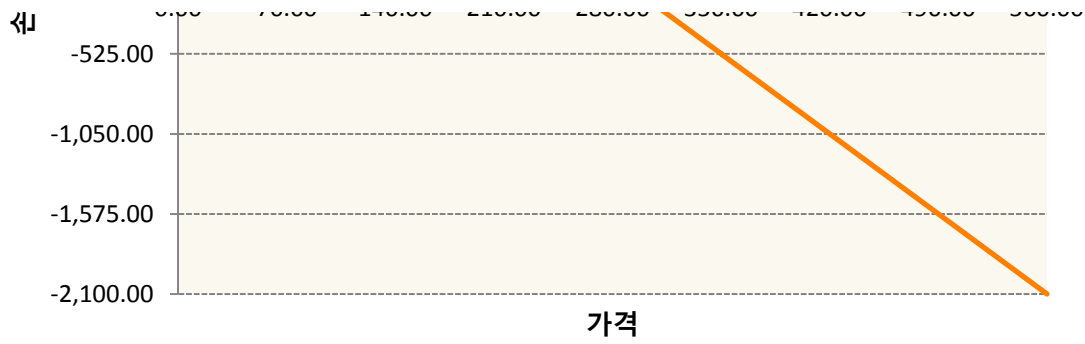
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

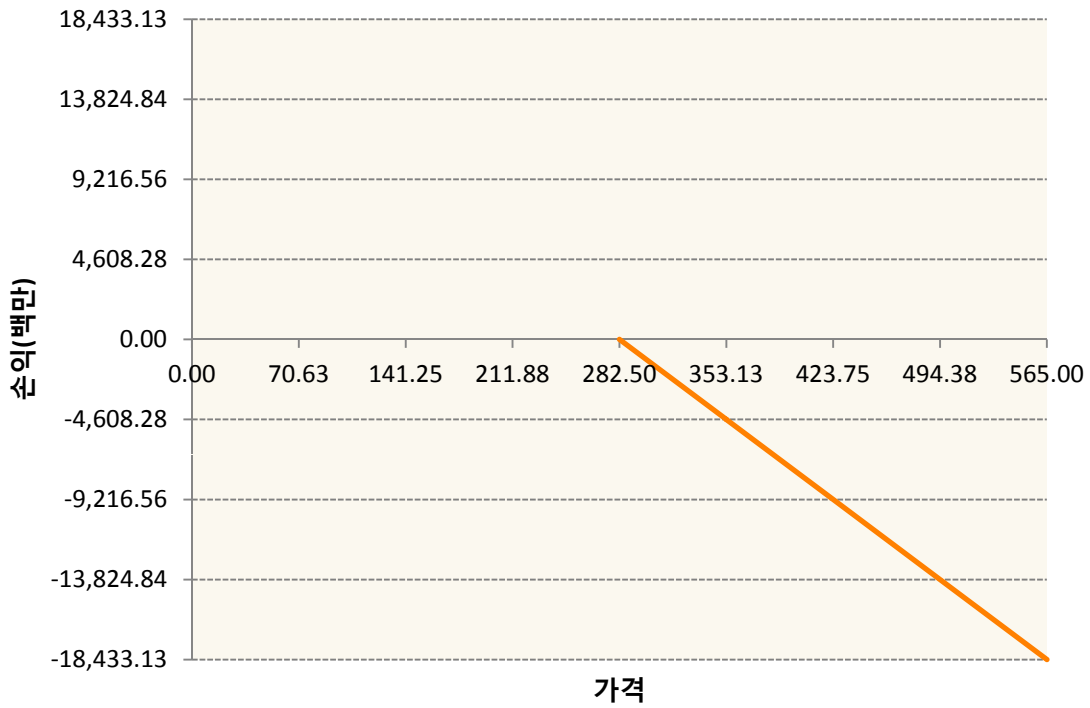


KR4201PB2800-2019-11 콜280

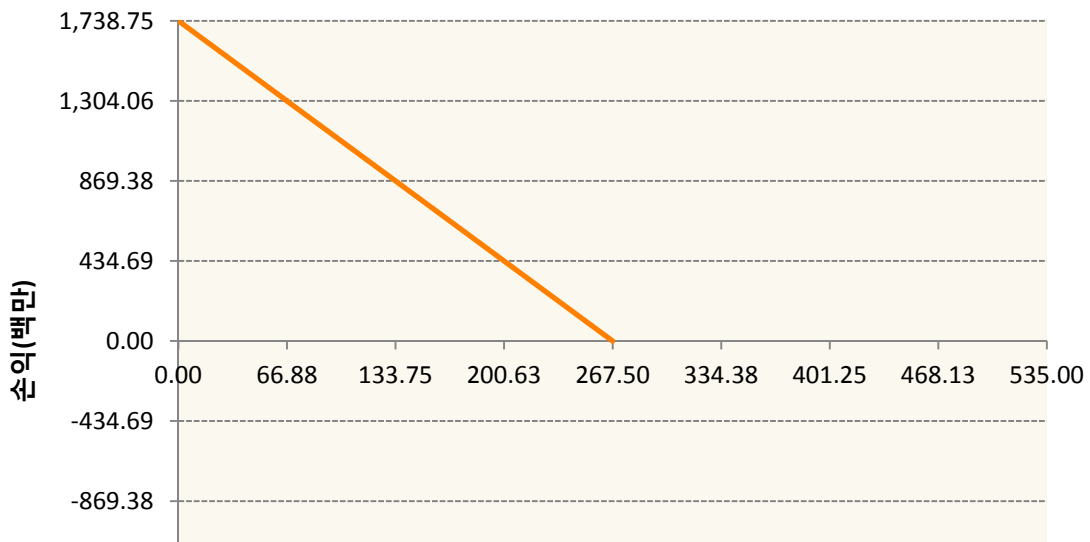


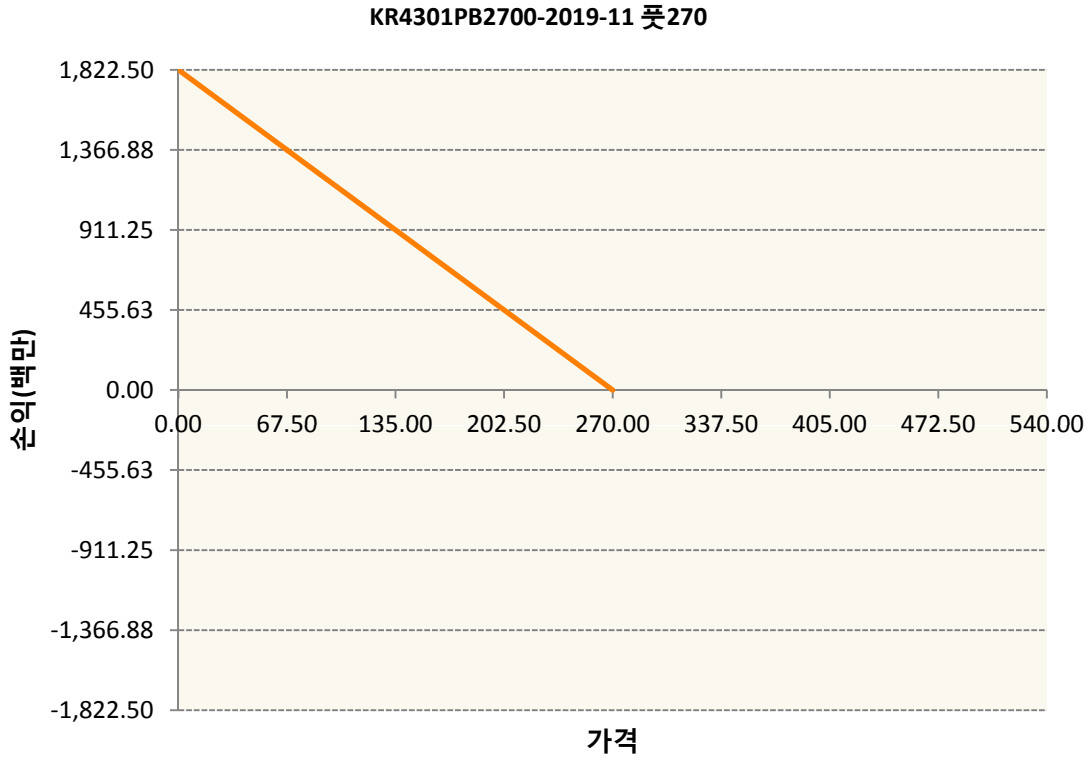
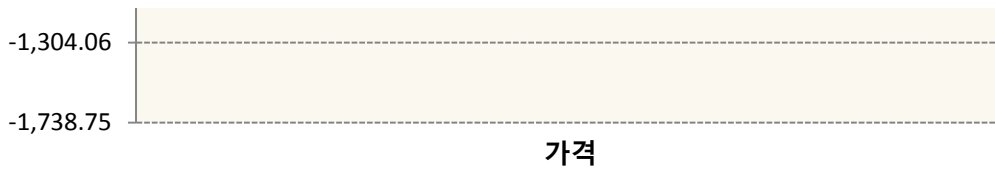


KR4201PB2826-2019-11 콜282.5



KR4301PB2676-2019-11 풋267.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						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%	-599	-599	-599	-599	-599	-599	-599	
-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%	599	599	599	599	599	599	599	
8.00%	898	898	898	898	898	898	898	
KR4201PB2800		2019-11 콜280						143
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	48	48	47	46	45	44	43	
-5.33%	45	44	42	41	39	37	34	
-2.67%	35	32	29	26	24	21	18	

0%	9	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	-32	-34	-37	-39	-41	-44	-47
5.33%	-84	-85	-86	-87	-89	-90	-92
8.00%	-140	-140	-140	-141	-141	-142	-143

KR4201PB2826 2019-11 콜282.5 1,183

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	332	330	327	323	317	310	302
-5.33%	320	311	301	288	275	259	243
-2.67%	258	238	216	193	170	146	122
0%	84	56	28	0	-28	-56	-84
2.67%	-237	-258	-281	-305	-329	-354	-379
5.33%	-665	-675	-687	-702	-717	-734	-753
8.00%	-1,141	-1,144	-1,148	-1,155	-1,162	-1,172	-1,183

KR4301PB2676 2019-11 풋267.5 53

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	50	50	51	51	51	52	53
-5.33%	11	12	14	15	16	17	19
-2.67%	0	1	1	2	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

KR4301PB2700 2019-11 풋270 70

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	68	68	68	69	69	69	70
-5.33%	22	23	24	25	27	28	29
-2.67%	2	2	3	4	5	6	7
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)

2,136

공시일	2019-11-05
기준일	2019-11-04

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	4,637	0	4,637	
누계	유가증권	수익증권	177,456	0	177,456	

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	2019-11-05
기준일	2019-11-04

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	208,331	0	208,331	

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	2019-11-05
기준일	2019-11-04

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	5,796	0	5,796	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	512,334	0	512,334	
누계	통화	선도	0	515,960	-515,960	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		1,855
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E		1,947
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E		927
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		649
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E		1,521
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		686
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,669
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		2,448
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		464
FX21019V02 KRW/USD 21-11-19E		5,045
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,730
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,391
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,782
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,493
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,819
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		927
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		927
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,855
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,855
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		927
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		927
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		927
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		927
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		464
FX21019X00 KRW/USD 06-12-19E		649
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		464

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

(단위:백만원)

13,194

공시일	2019-11-05
기준일	2019-11-04

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

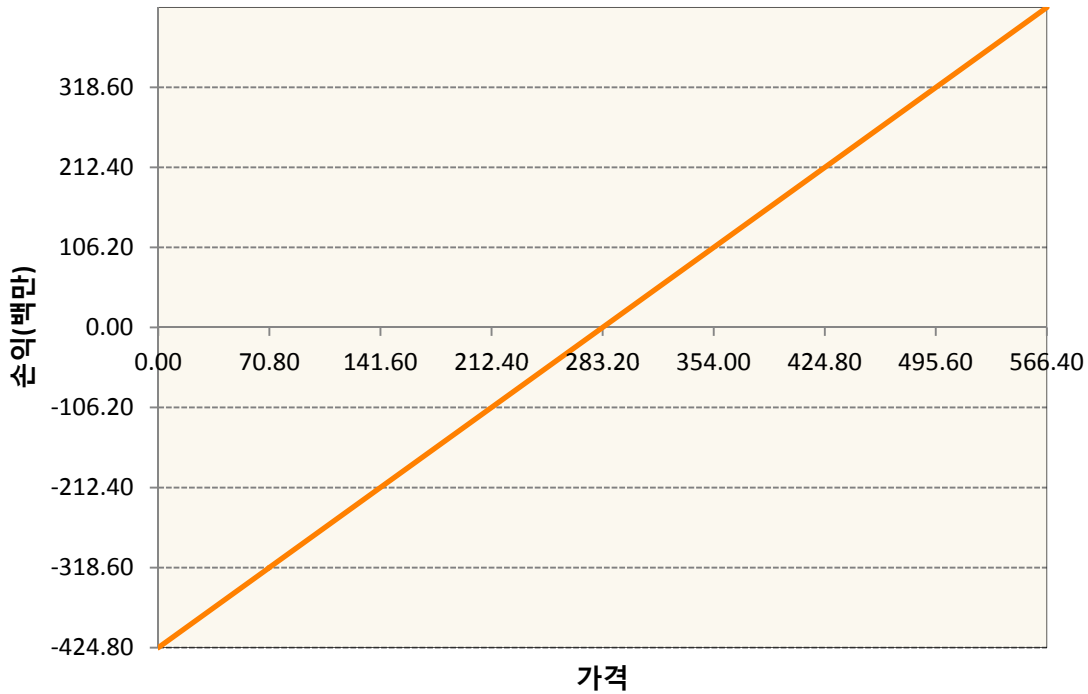
1. 계약금액

(단위:백만원)

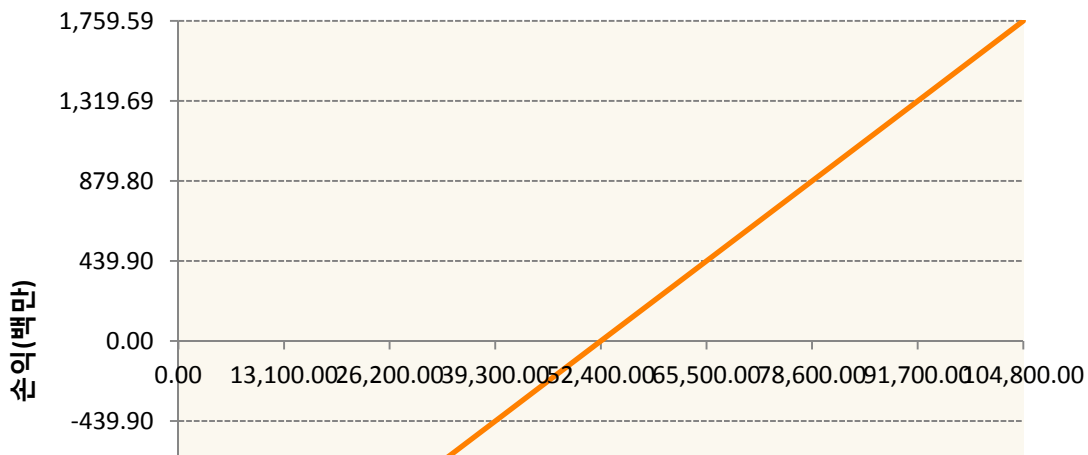
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,184	0	2,184	장내

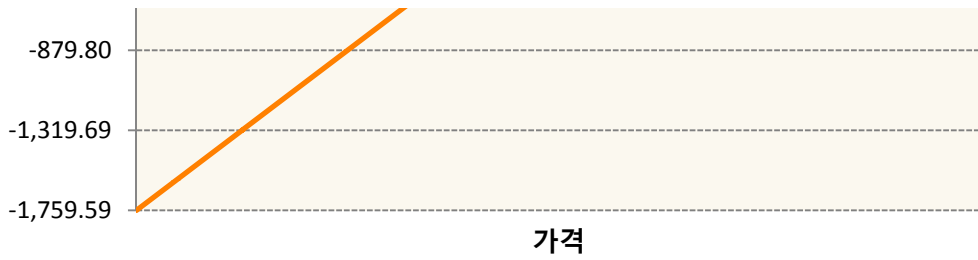
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



KR4111PB0001-2019-11 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						34
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	
-5.33%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23	
-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%	23	23	23	23	23	23	23	
8.00%	34	34	34	34	34	34	34	
KR4111PB0001		2019-11 삼성전자개별선물						140
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-140	-140	-140	-140	-140	-140	-140	
-5.33%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94	
-2.67%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	47	47	47	47	47	47	47	
5.33%	94	94	94	94	94	94	94	
8.00%	140	140	140	140	140	140	140	

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

185

공시일	2019-11-05
기준일	2019-11-04

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

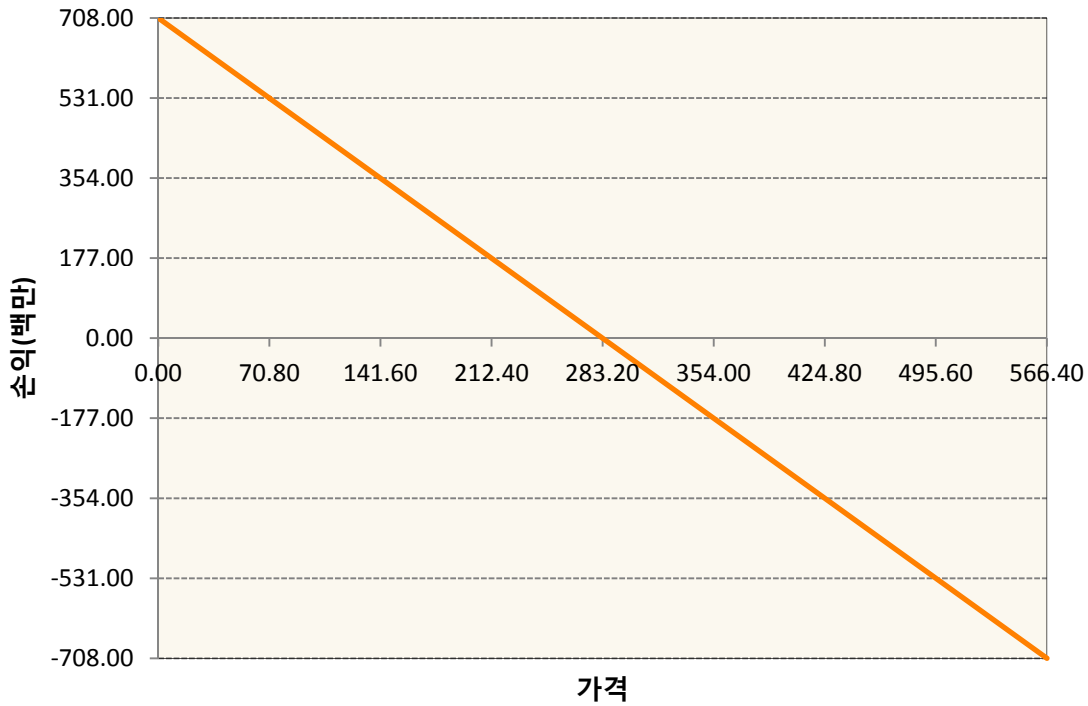
1. 계약금액

(단위:백만원)

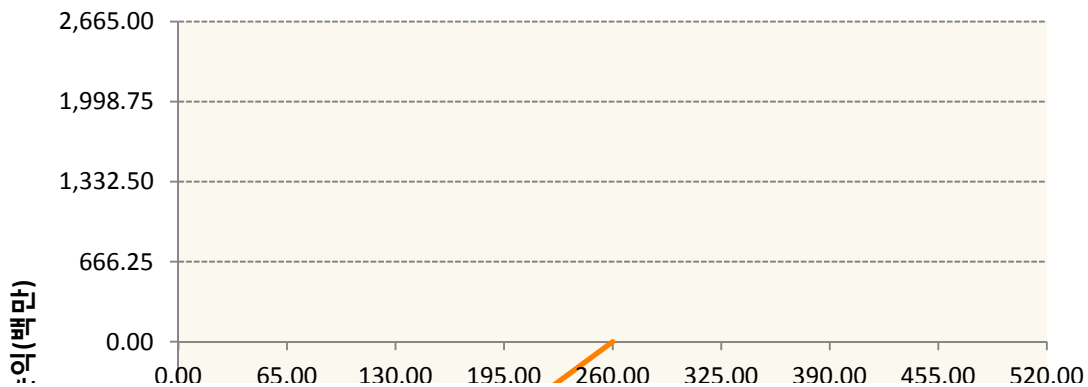
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	708	-708	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,715	-3,715	장내

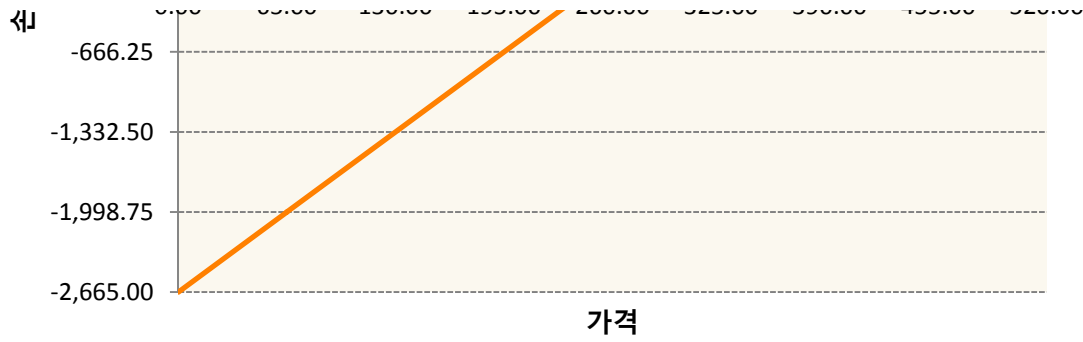
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

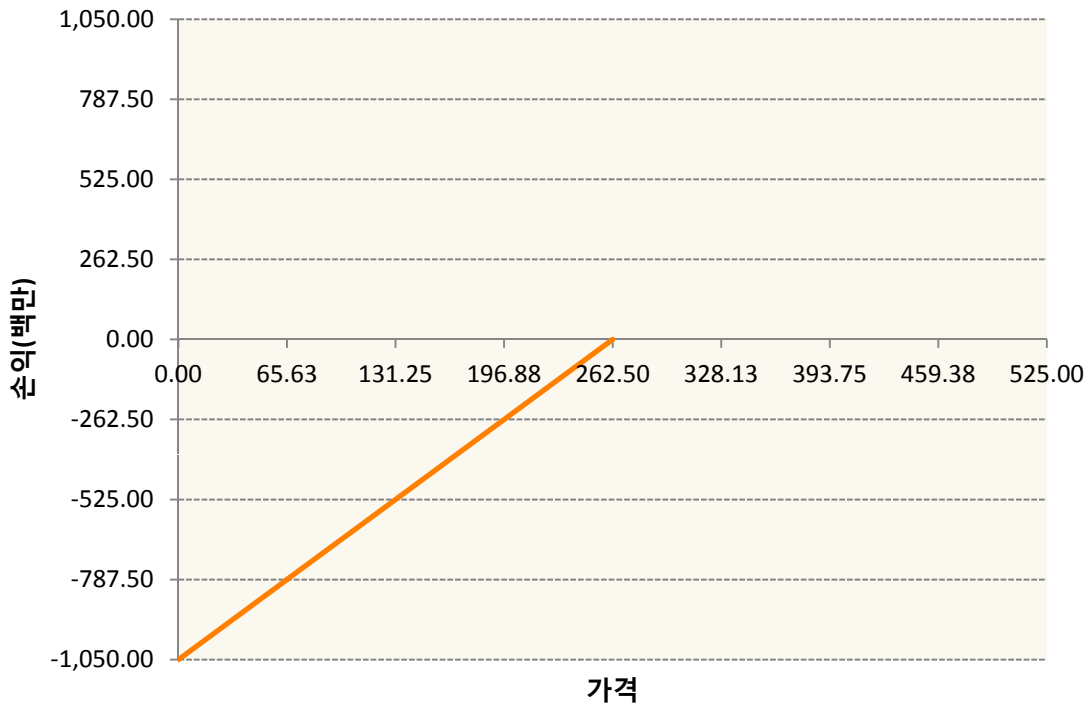


KR4301PB2601-2019-11 풋260





KR4301PB2627-2019-11 풋262.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						57
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	57	57	57	57	57	57	57	
-5.33%	38	38	38	38	38	38	38	
-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%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38	
8.00%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57	
KR4301PB2601		2019-11 풋260						29
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-18	-19	-21	-23	-25	-27	-29
-5.33%	-1	-1	-2	-2	-3	-4	-5
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
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

17

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-13	-14	-14	-15	-16	-16	-17
-5.33%	-1	-1	-2	-2	-3	-3	-4
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
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)

47

공시일	2019-11-05
기준일	2019-11-04

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	15,575	0	15,575	
누계	통화	선도	638	15,951	-15,313	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019V01 KRW/USD 10-12-19E		367
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		315
FX21019V02 KRW/USD 13-11-19E		278
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		315
FX21019V04 USD/KRW 13-11-19E		19
FX21019X00 USD/KRW 13-11-19E		32

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

(단위:백만원)

424

공시일	2019-11-05
기준일	2019-11-04

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	687	0	687	장외
누계	통화	선도	201	279	-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	2019-11-05
기준일	2019-11-04

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

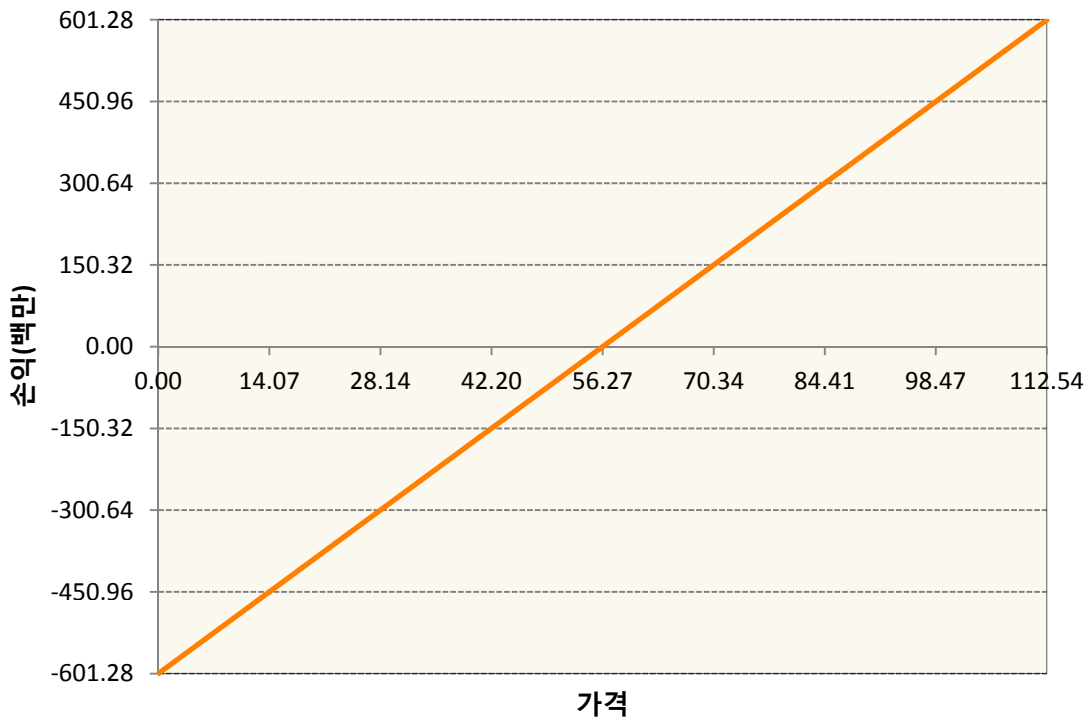
1. 계약금액

(단위:백만원)

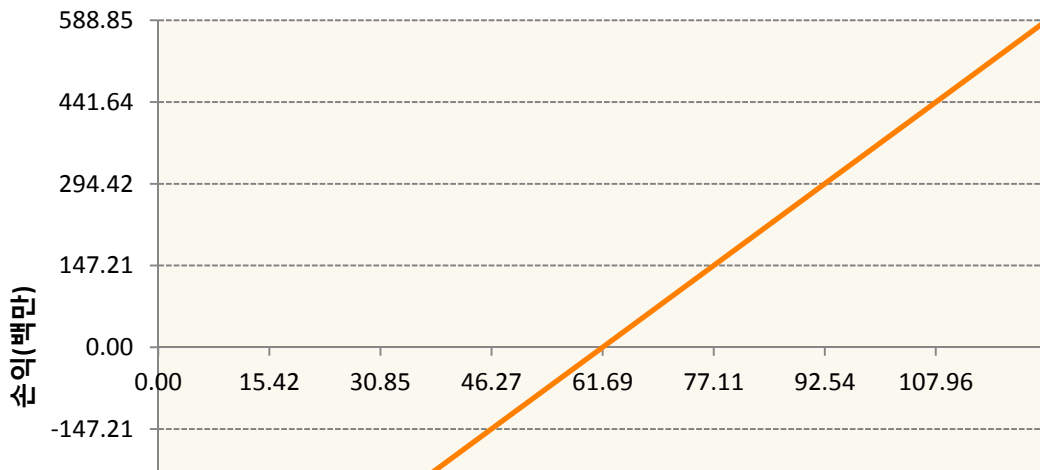
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,528	290	2,238	

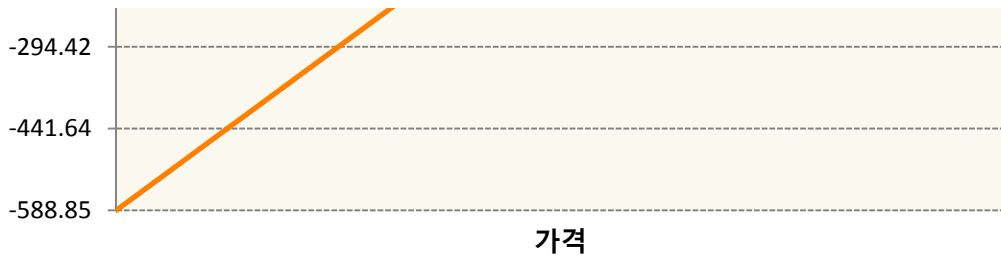
2. 만기시점의 손익구조

CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20

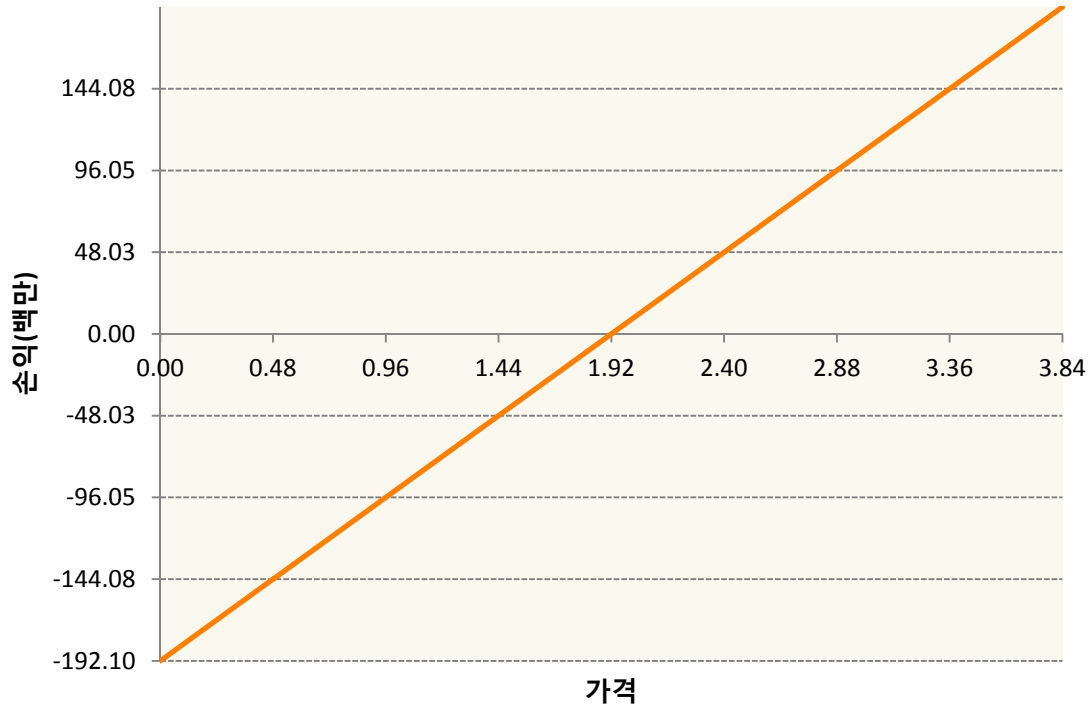


COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20

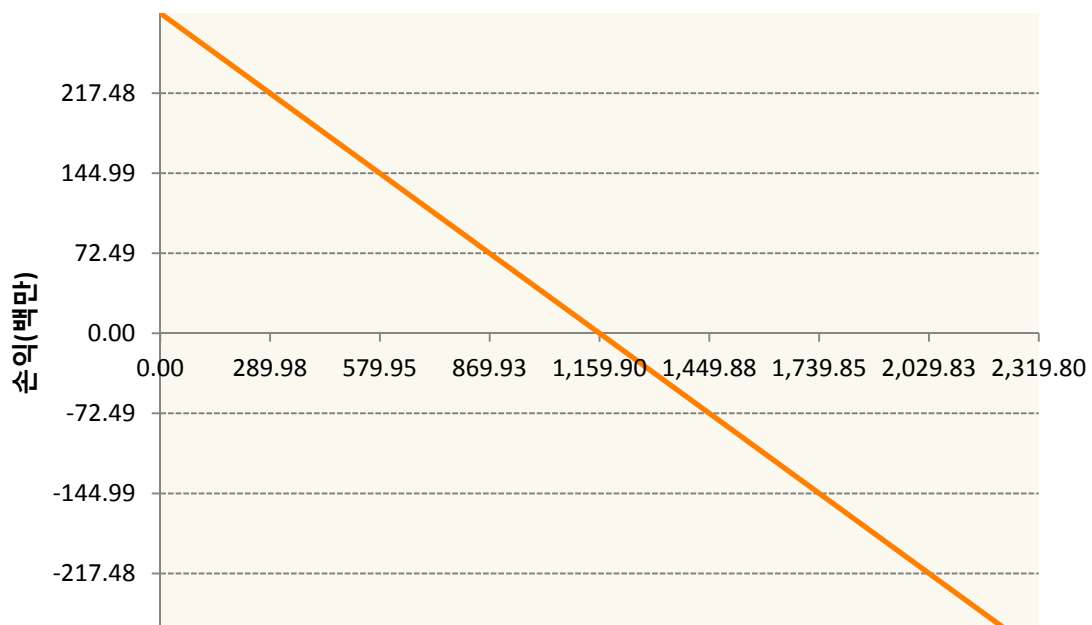


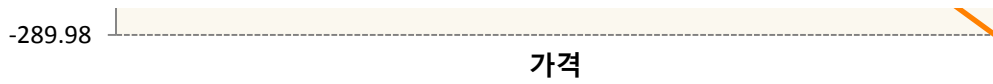


HOF0-NY Harb ULSD Fut Jan20

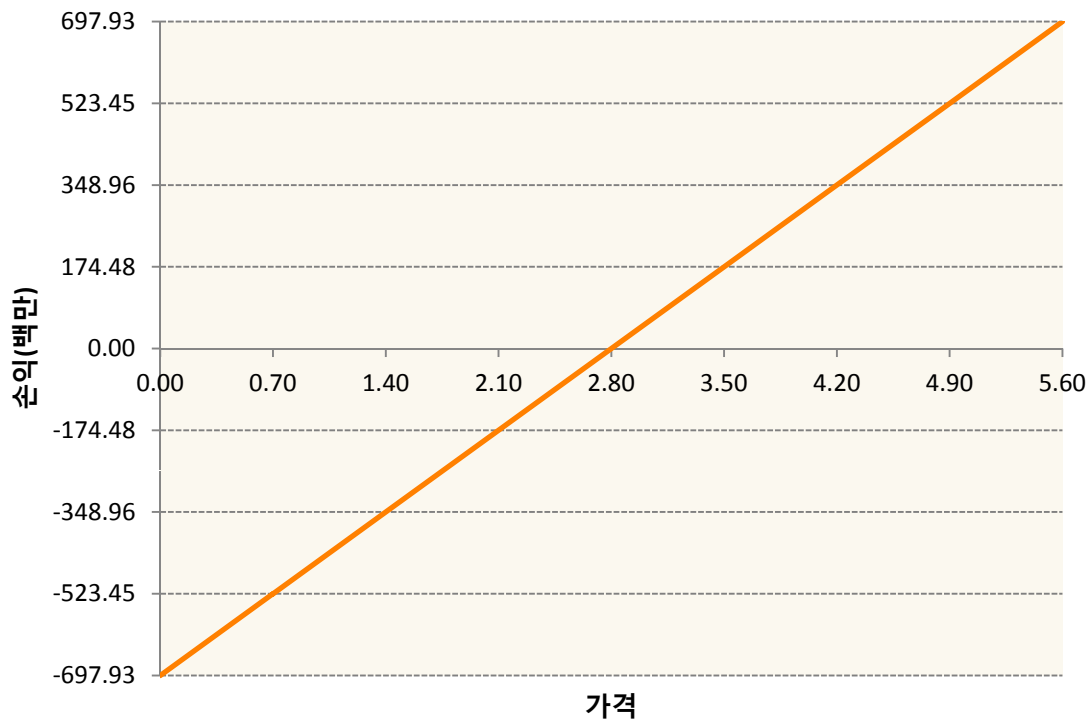


KR4175PB0004-2019-11 달러선물

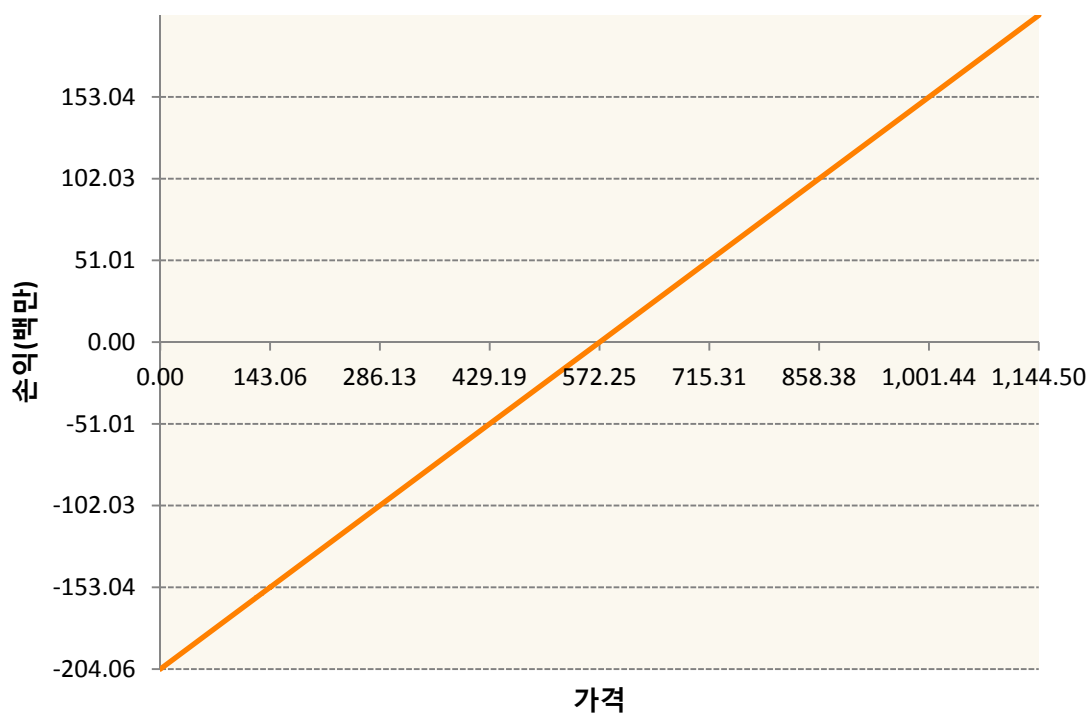




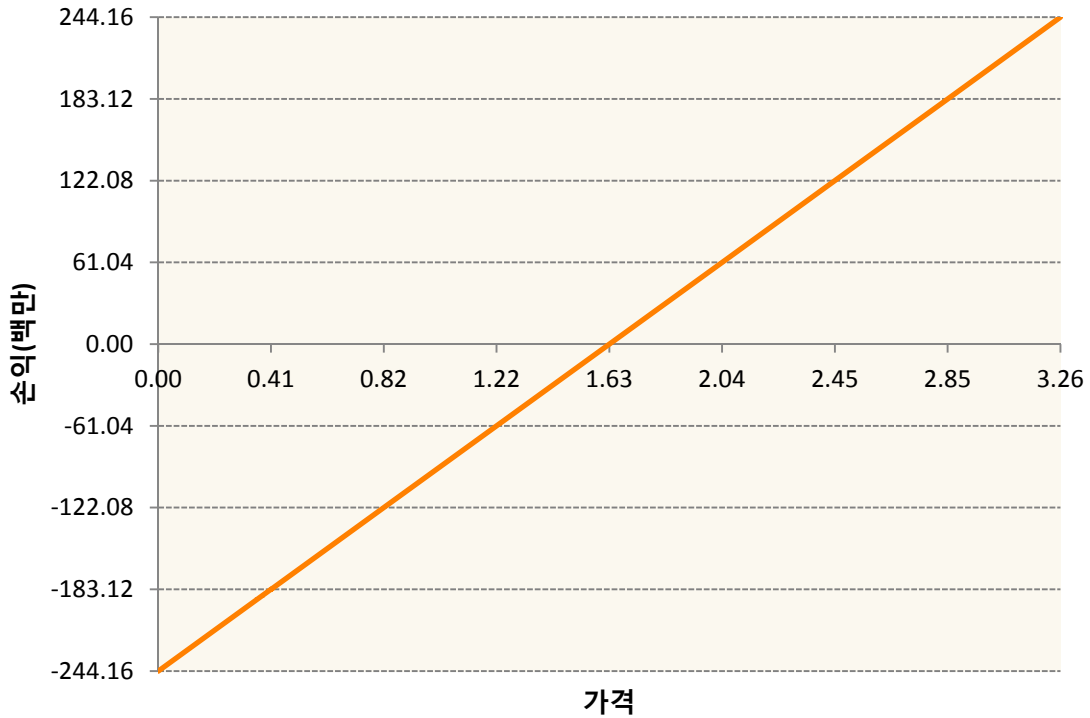
NGF20-NATURAL GAS FUTR Jan20



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	56
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	16
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	20

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

424

공시일	2019-11-05
기준일	2019-11-04

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

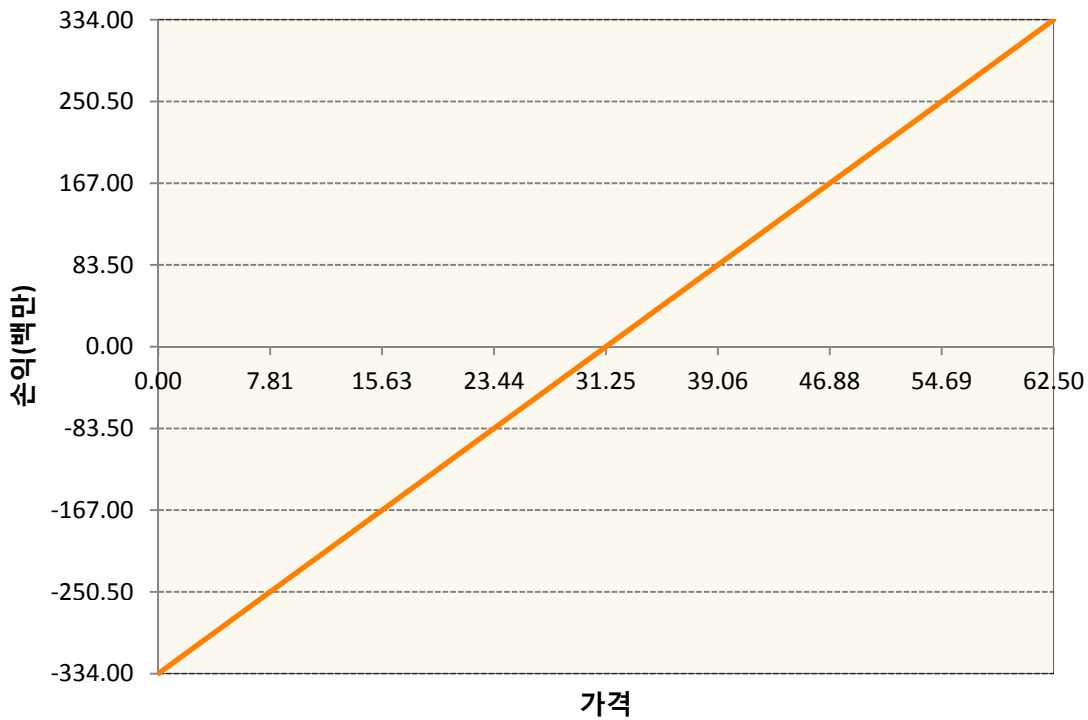
1. 계약금액

(단위:백만원)

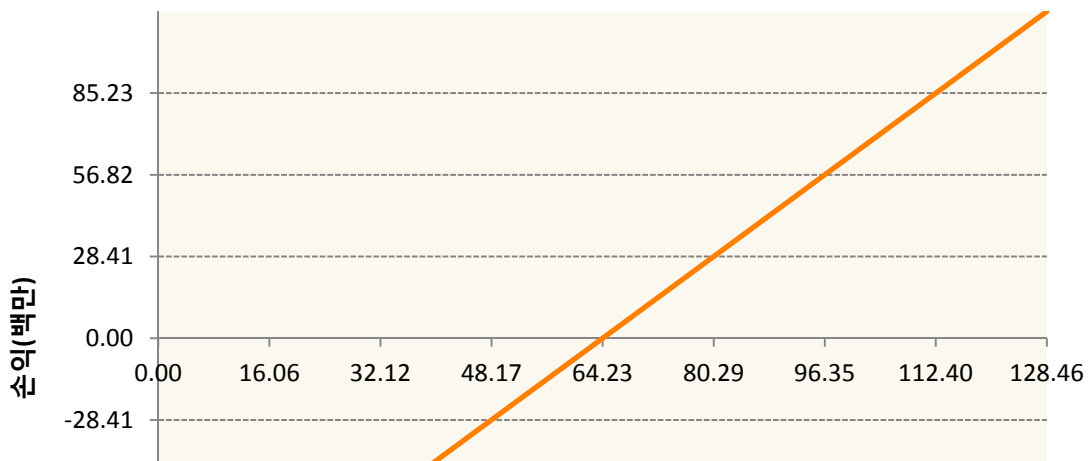
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,882	93	2,789	

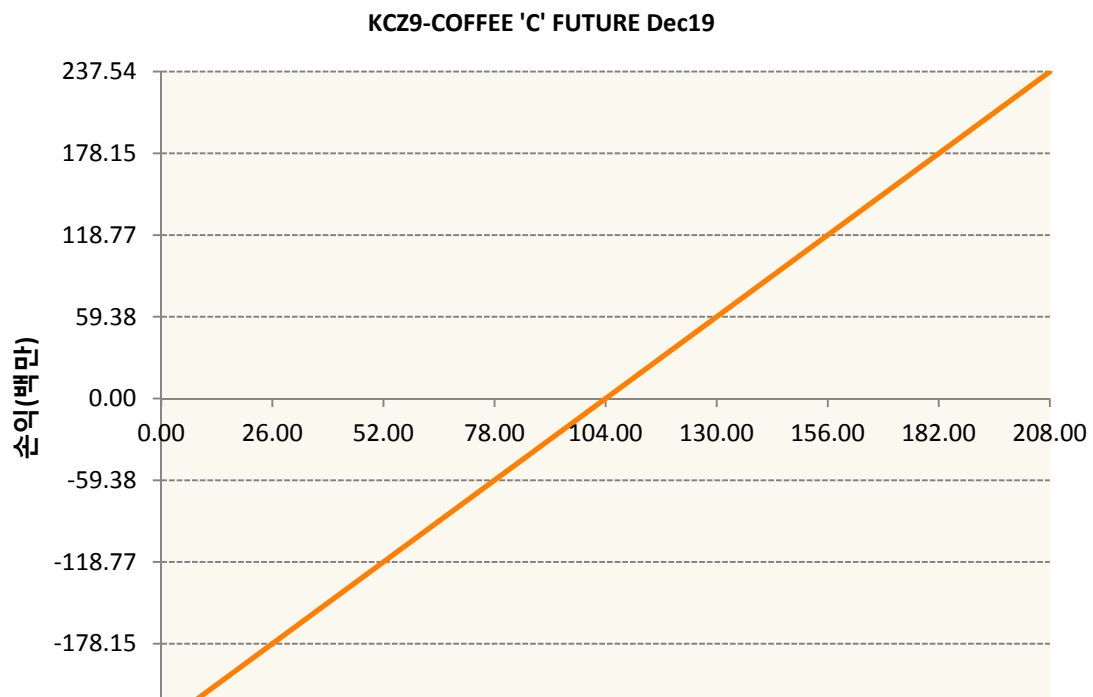
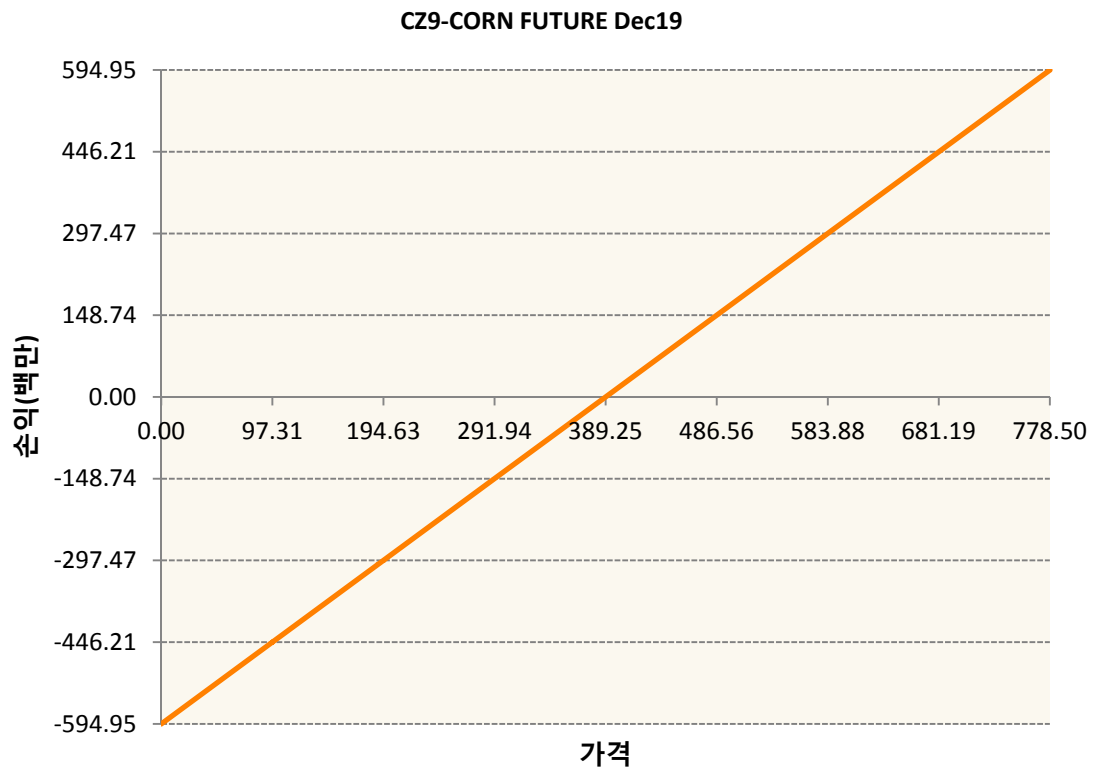
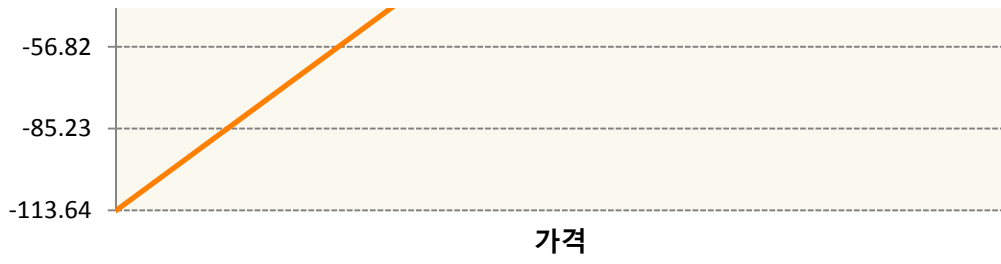
2. 만기시점의 손익구조

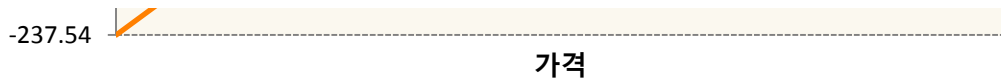
BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20



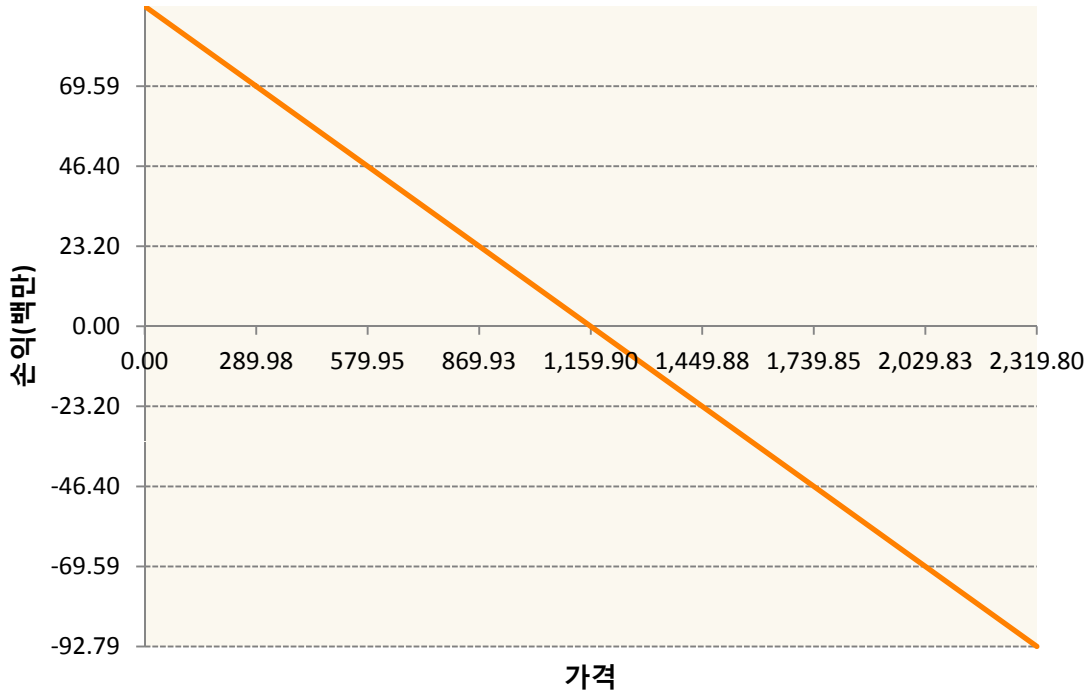
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



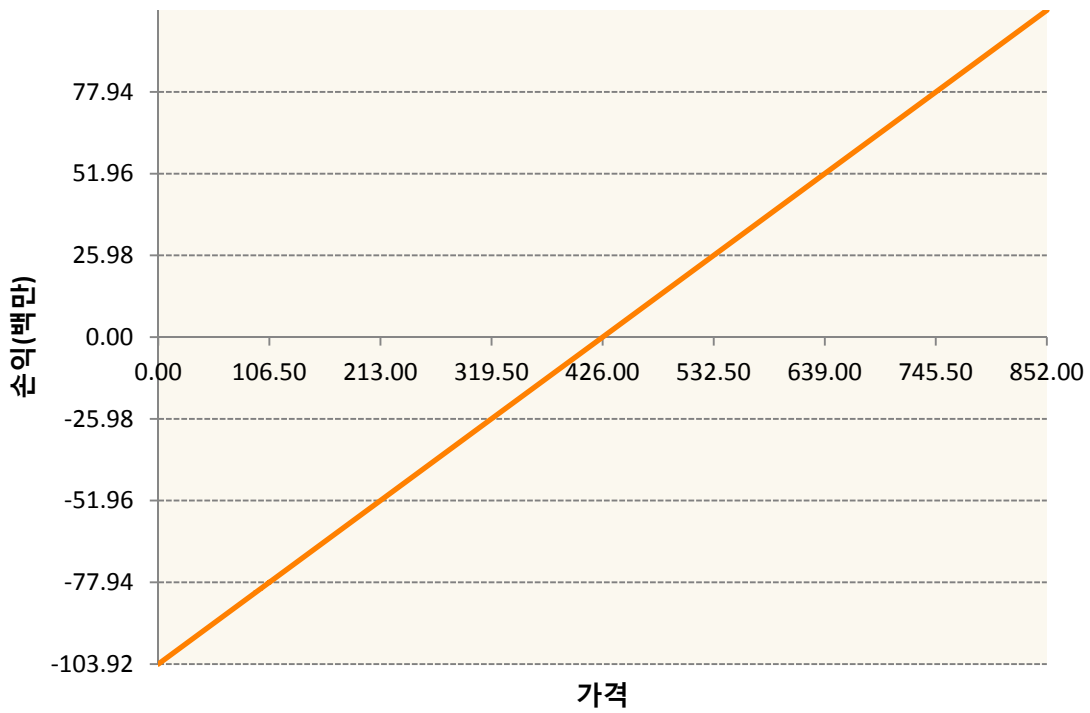




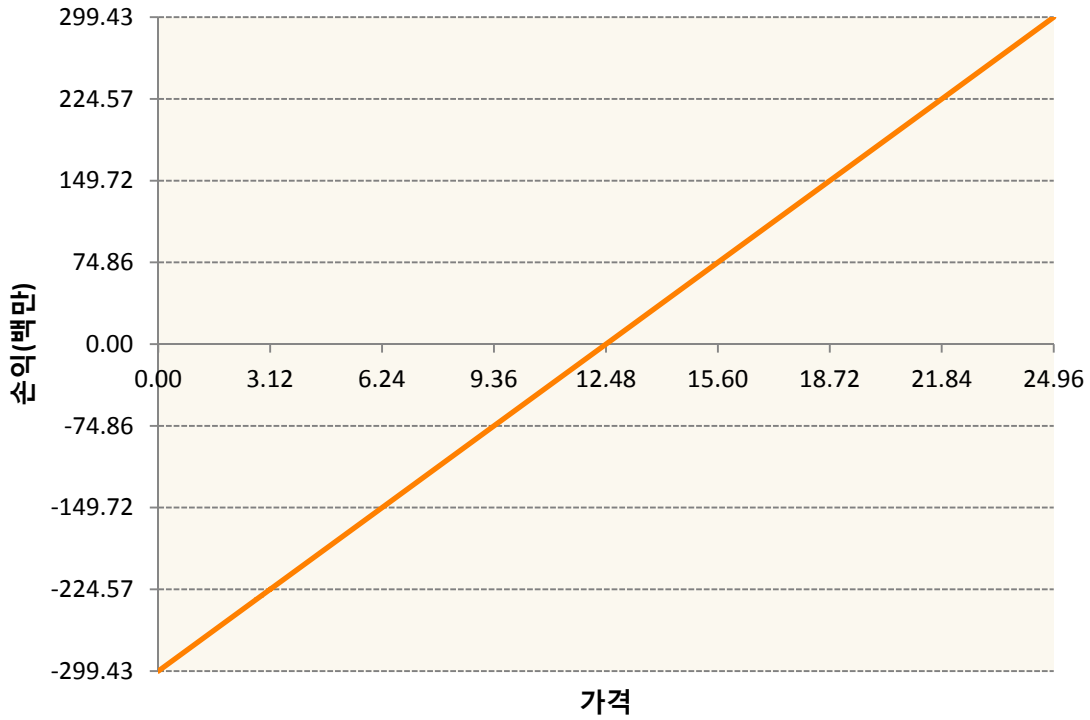
KR4175PB0004-2019-11 달러선물



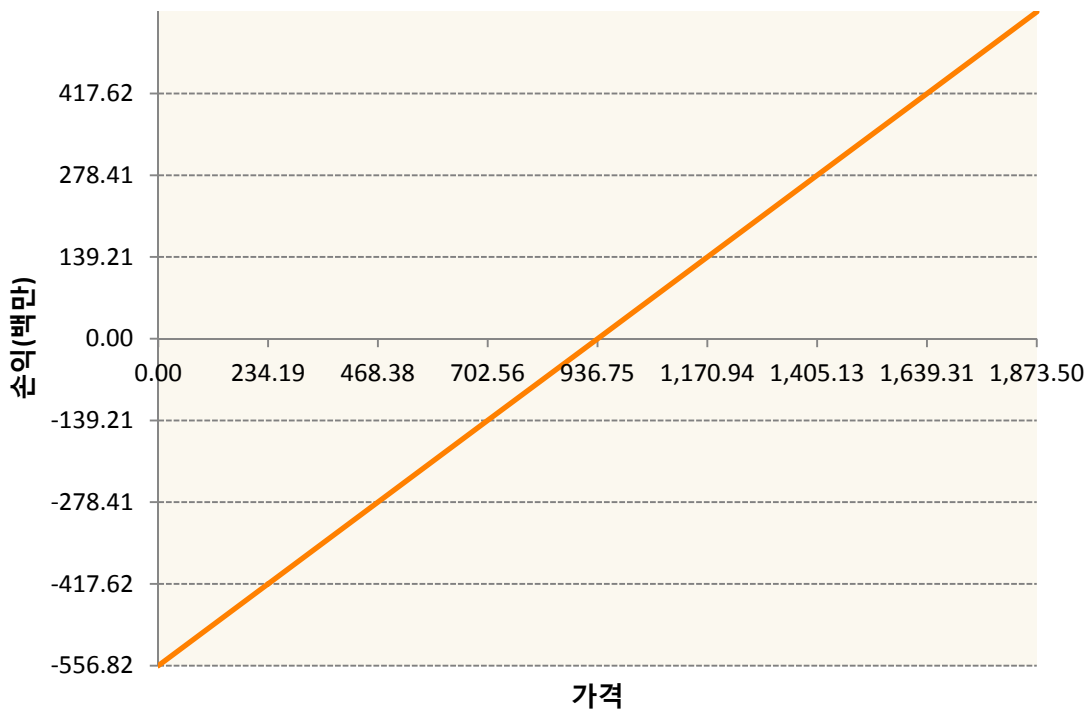
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



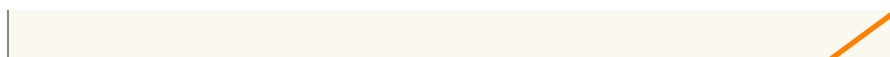
SBH0-Sugar Mar20

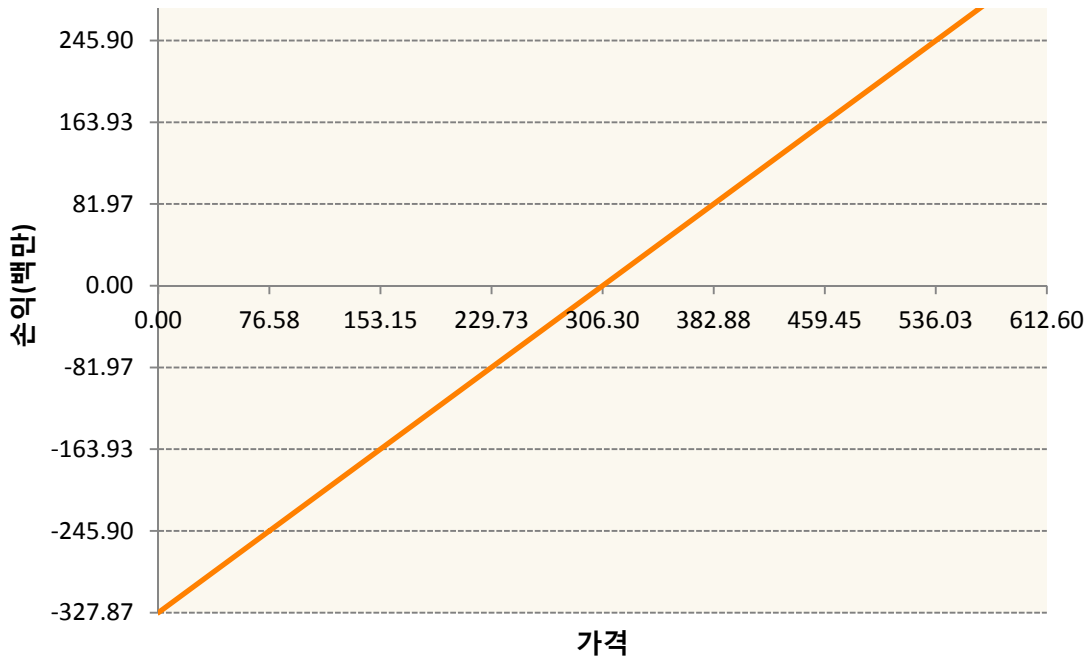


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20

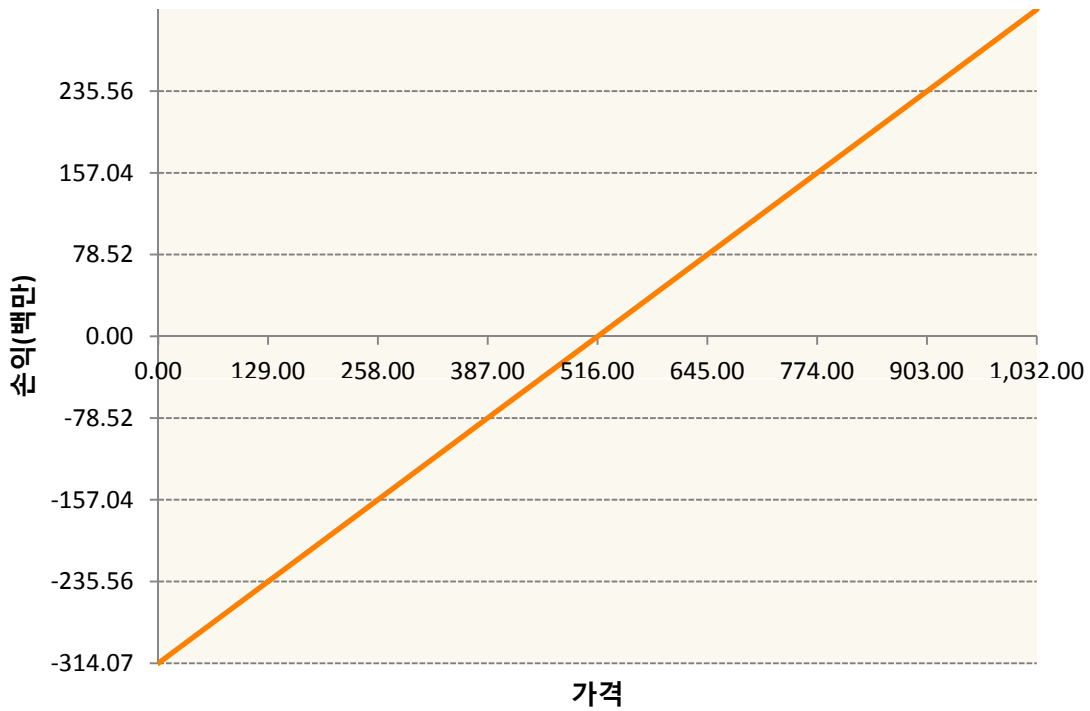


SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





WZ9-WHEAT FUTURE(CBT) Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF0	SOYBEAN OIL FUTR Jan20	27
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	45
SMF0	SOYBEAN MEAL FUTR Jan20	26
WZ9	WHEAT FUTURE(CBT) Dec19	25

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

(단위:백만원)

256