

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-06 |
| 기준일 | 2019-11-05 |

## 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 | 2019-11-06 |
| 기준일 | 2019-11-05 |

## 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

1,213

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

704

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-06 |
| 기준일 | 2019-11-05 |

## 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) | 389 |
| SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2) | 142 |

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 782 |
|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-06 |
| 기준일 | 2019-11-05 |

## 유로인덱스모(주식-파생형)

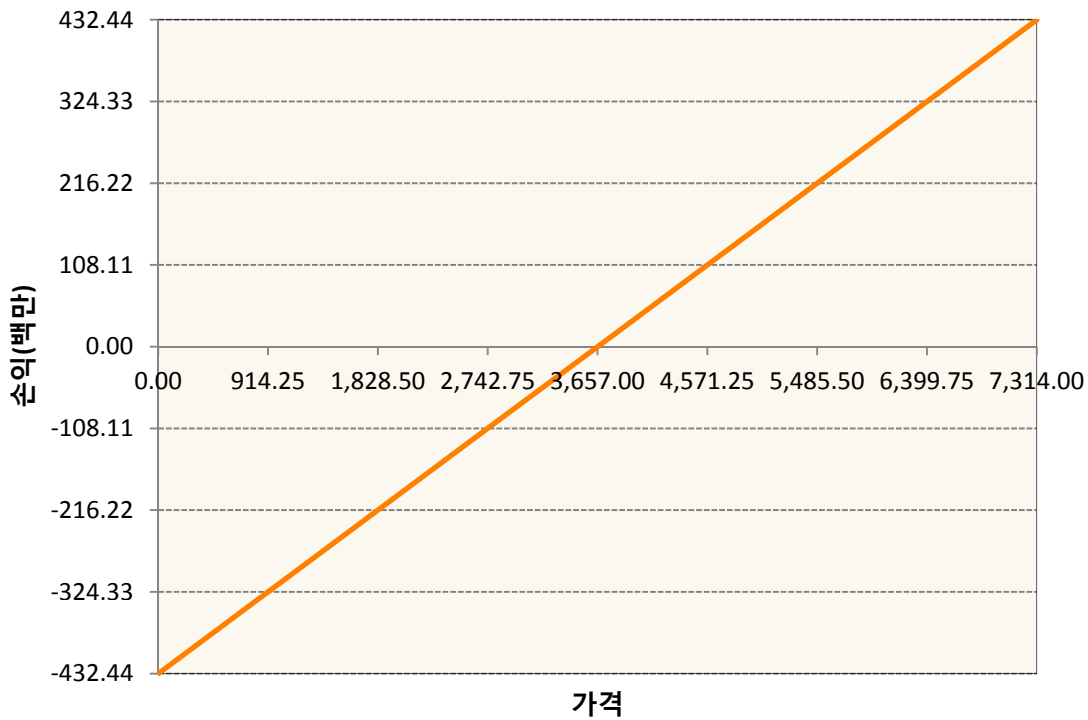
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 432   | 0     | 432       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

VGZ9-EURO STOXX 50 Dec19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGZ9 | EURO STOXX 50 Dec19 | 35 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 24 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-06 |
| 기준일 | 2019-11-05 |

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

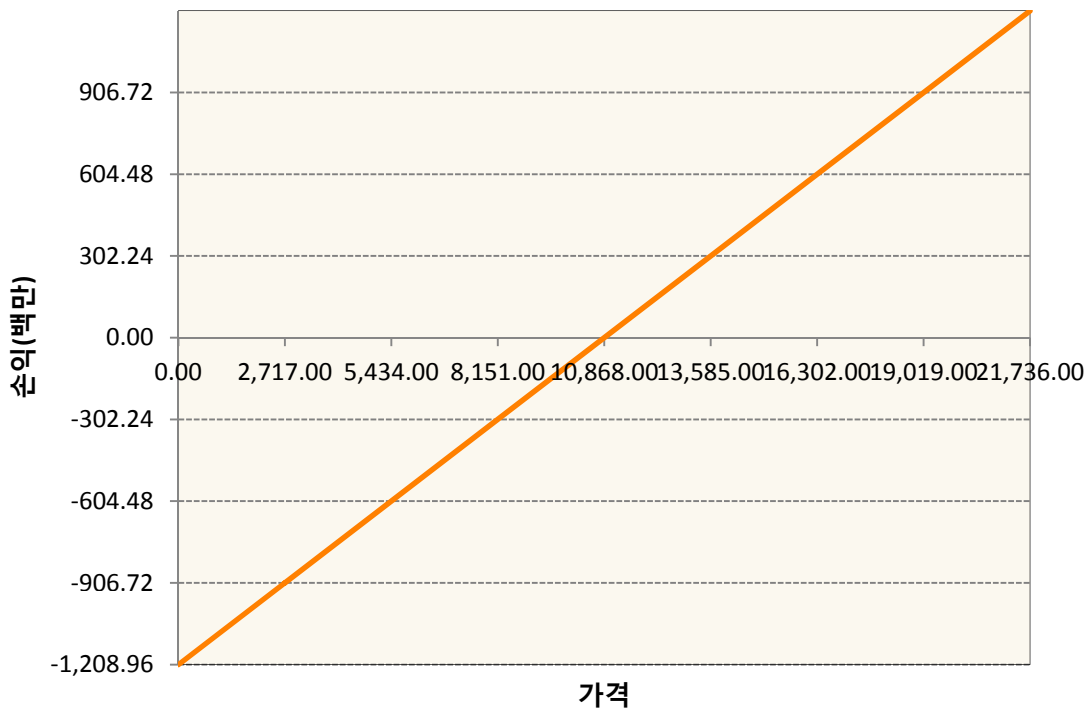
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,209 | 0     | 1,209     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

HCX9-HSCEI Futures Nov19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| HCX9 | HSCEI Futures Nov19 | 97 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 87 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-06 |
| 기준일 | 2019-11-05 |

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

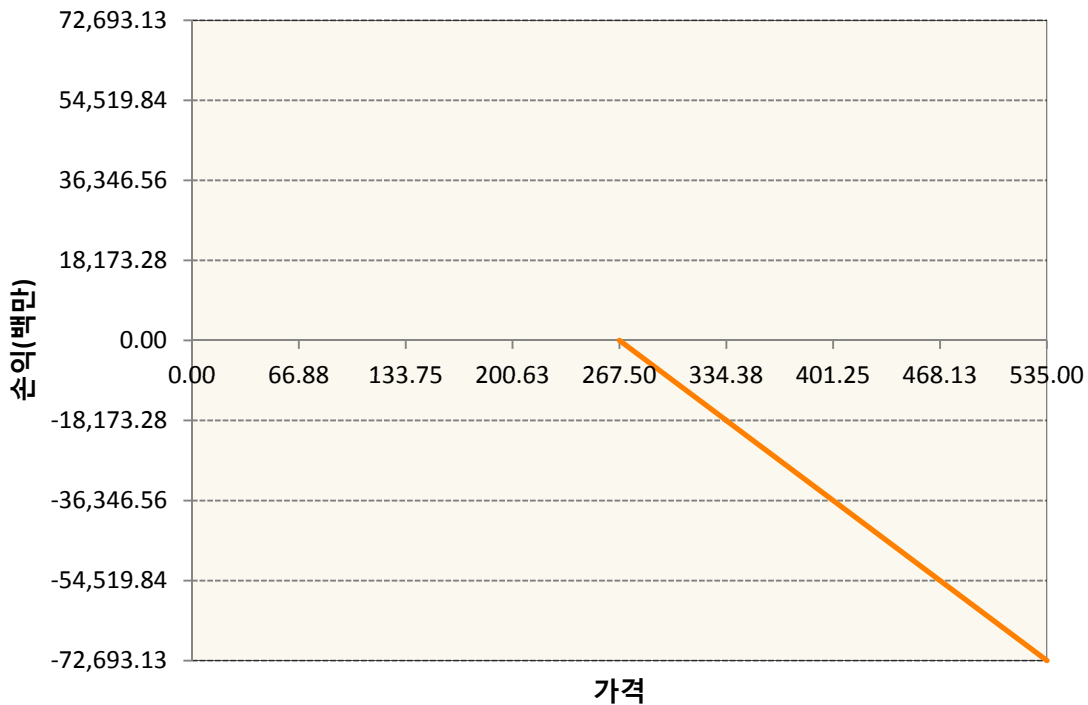
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

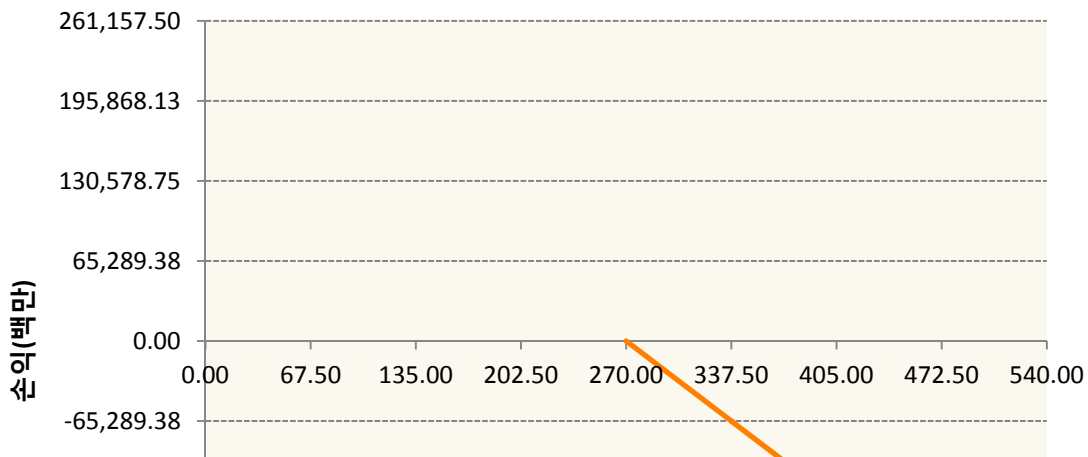
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)   | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 7,437 | 0       | 7,437     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 485,657 | -485,657  | 장내 |

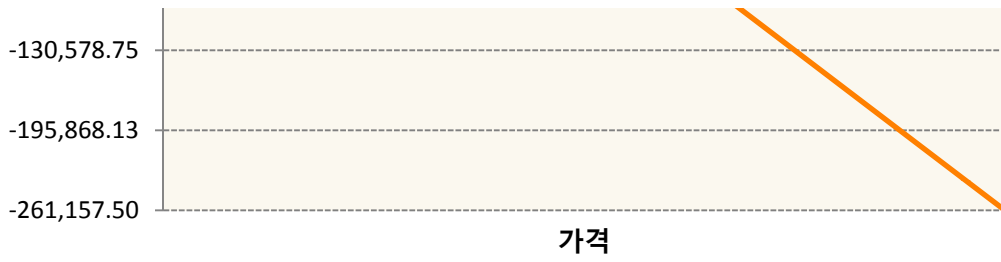
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201PB2677-2019-11 콜267.5**

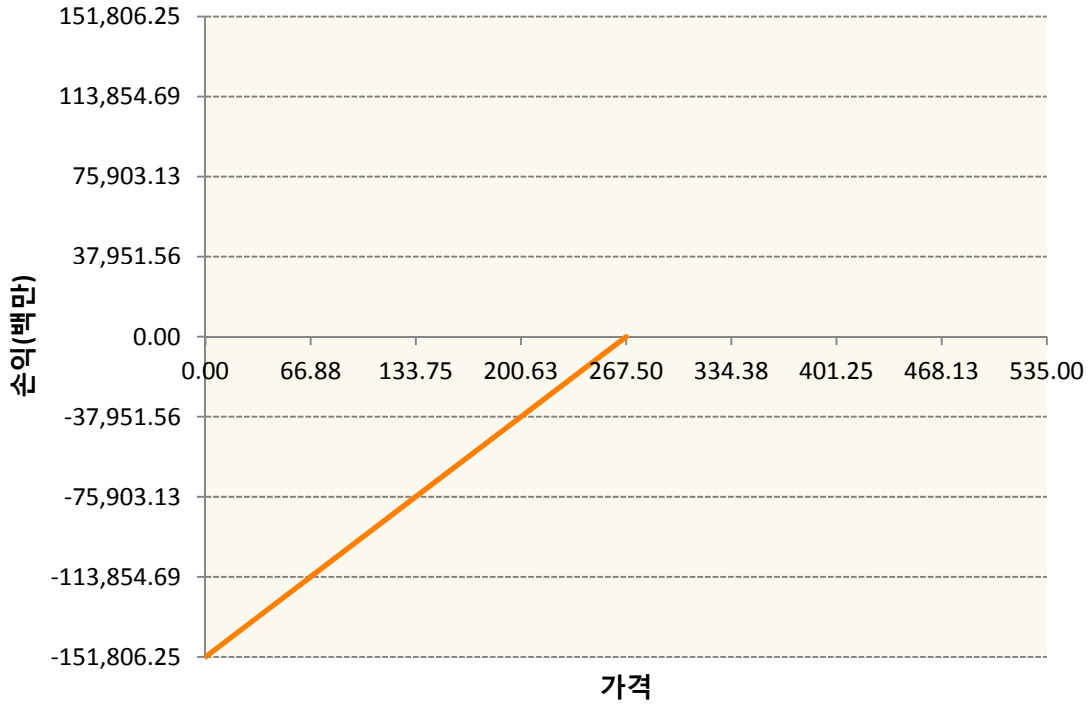


**KR4201PB2701-2019-11 콜270**





KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4201PB2677 |         | 2019-11 콜267.5 |        |        |        |        | 6,071  |  |
|--------------|---------|----------------|--------|--------|--------|--------|--------|--|
|              |         | 기초자산의 변동성      |        |        |        |        |        |  |
| 가격           | -25.00% | -16.67%        | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |  |
| -8.00%       | 4,347   | 4,264          | 4,177  | 4,088  | 3,997  | 3,904  | 3,810  |  |
| -5.33%       | 3,501   | 3,398          | 3,294  | 3,191  | 3,087  | 2,984  | 2,880  |  |
| -2.67%       | 1,993   | 1,929          | 1,858  | 1,782  | 1,702  | 1,619  | 1,534  |  |
| 0%           | 87      | 65             | 36     | 0      | -43    | -92    | -146   |  |
| 2.67%        | -1,947  | -1,951         | -1,959 | -1,970 | -1,987 | -2,009 | -2,036 |  |
| 5.33%        | -4,004  | -4,005         | -4,006 | -4,008 | -4,013 | -4,021 | -4,031 |  |
| 8.00%        | -6,064  | -6,064         | -6,064 | -6,064 | -6,065 | -6,067 | -6,071 |  |
| KR4201PB2701 |         | 2019-11 콜270   |        |        |        |        | 21,383 |  |
|              |         | 기초자산의 변동성      |        |        |        |        |        |  |
| 가격           | -25.00% | -16.67%        | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |  |
| -8.00%       | 13,774  | 13,535         | 13,276 | 13,001 | 12,714 | 12,416 | 12,110 |  |

|              |         |         |         |         |         |                |         |       |
|--------------|---------|---------|---------|---------|---------|----------------|---------|-------|
| -5.33%       | 11,522  | 11,150  | 10,777  | 10,404  | 10,031  | 9,658          | 9,285   |       |
| -2.67%       | 6,882   | 6,590   | 6,284   | 5,966   | 5,640   | 5,307          | 4,967   |       |
| 0%           | 449     | 327     | 176     | 0       | -199    | -417           | -652    |       |
| 2.67%        | -6,701  | -6,730  | -6,777  | -6,842  | -6,929  | -7,036         | -7,164  |       |
| 5.33%        | -14,011 | -14,015 | -14,024 | -14,041 | -14,069 | -14,109        | -14,164 |       |
| 8.00%        | -21,340 | -21,340 | -21,342 | -21,345 | -21,351 | -21,364        | -21,383 |       |
| KR4301PB2676 |         |         |         |         |         | 2019-11 풋267.5 |         | 3,730 |
| 기초자산의 변동성    |         |         |         |         |         |                |         |       |
| 가격           | -25.00% | -16.67% | -8.33%  | 0%      | 8.33%   | 16.67%         | 25.00%  |       |
| -8.00%       | -3,427  | -3,462  | -3,504  | -3,553  | -3,607  | -3,667         | -3,730  |       |
| -5.33%       | -507    | -599    | -693    | -788    | -883    | -979           | -1,076  |       |
| -2.67%       | -8      | -17     | -32     | -52     | -78     | -110           | -147    |       |
| 0%           | 1       | 1       | 1       | 0       | -1      | -4             | -8      |       |
| 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       |       |

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

(단위:백만원)

29,947

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-06 |
| 기준일 | 2019-11-05 |

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

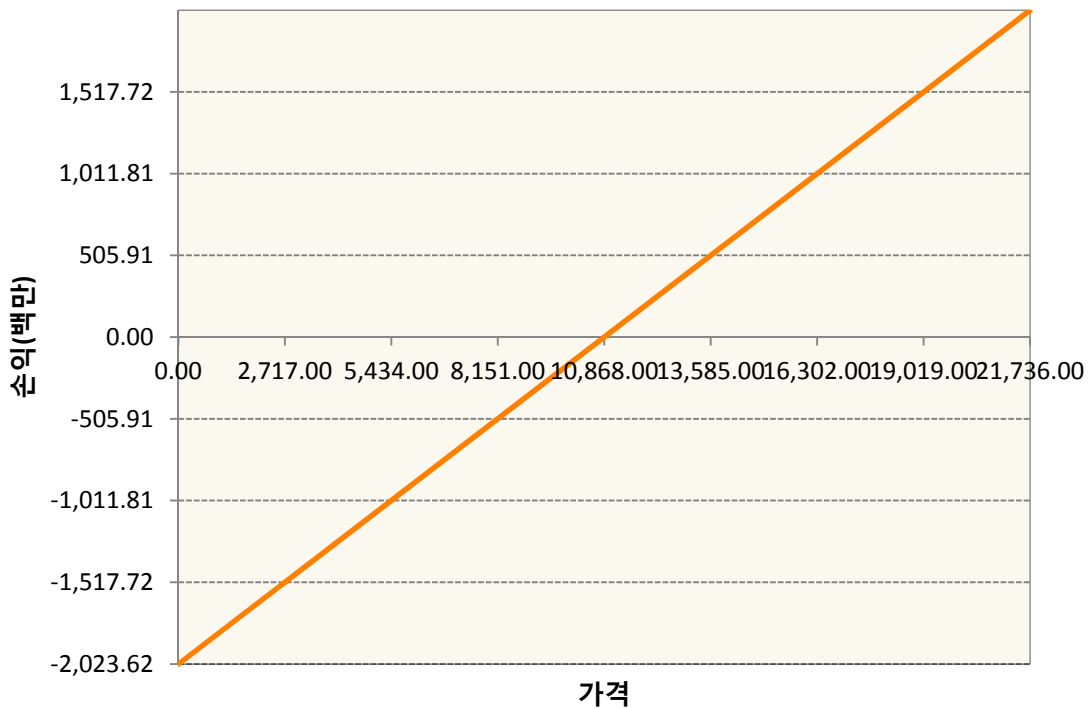
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

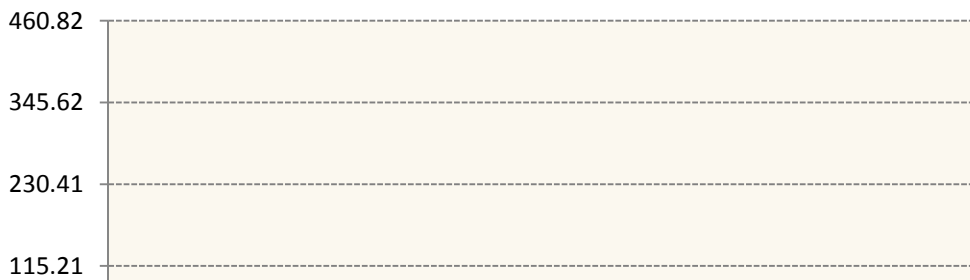
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,024 | 0     | 2,024     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 5,031 | -5,031    | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 665   | 2,744 | -2,080    | 장외 |

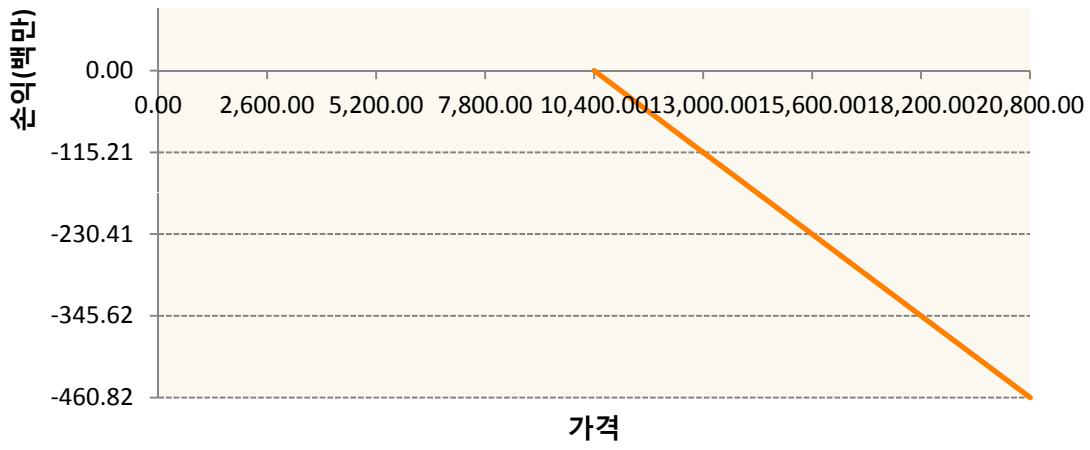
### 2. 만기시점의 손익구조

HCX9-HSCEI Futures Nov19

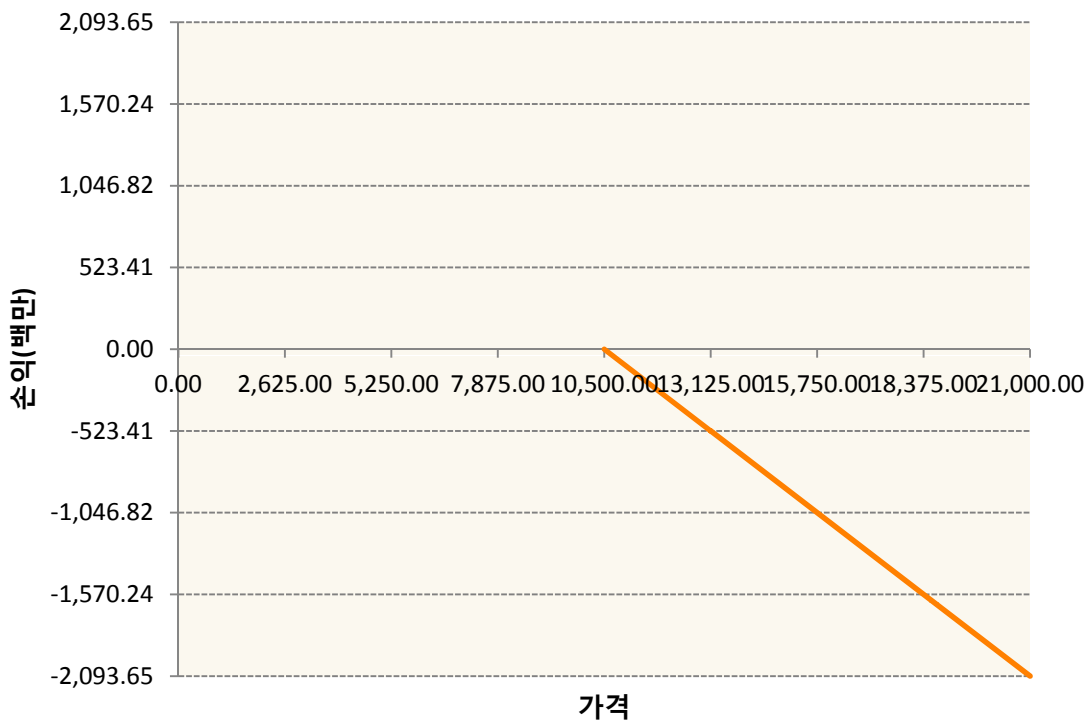


OHHIX9-C104-HSCEI

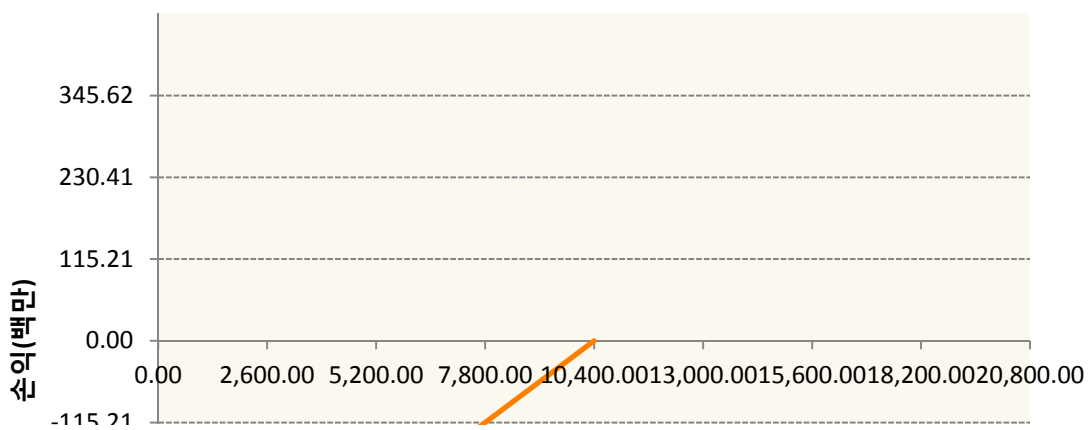


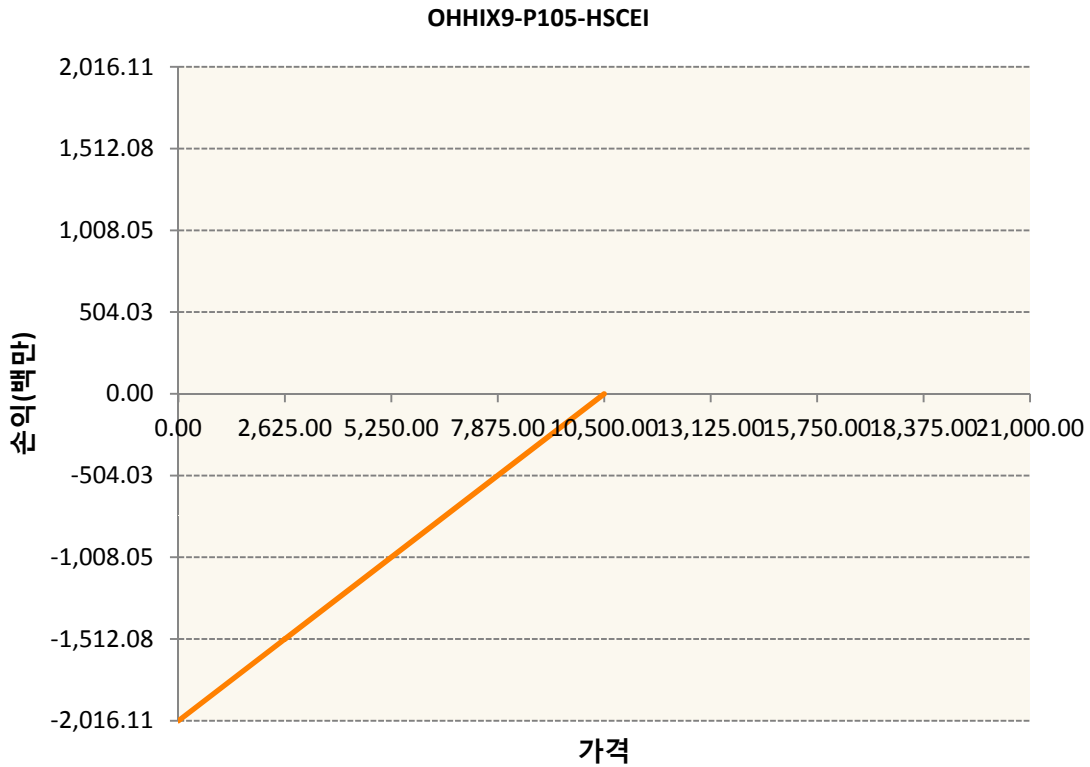


**OHHIX9-C105-HSCEI**



**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             | 167      |
| OHHIX9-P10 HSCEI             | 37       |
| OHHIX9-P10 HSCEI             | 161      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|--|----------|
|  | 592      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-06 |
| 기준일 | 2019-11-05 |

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

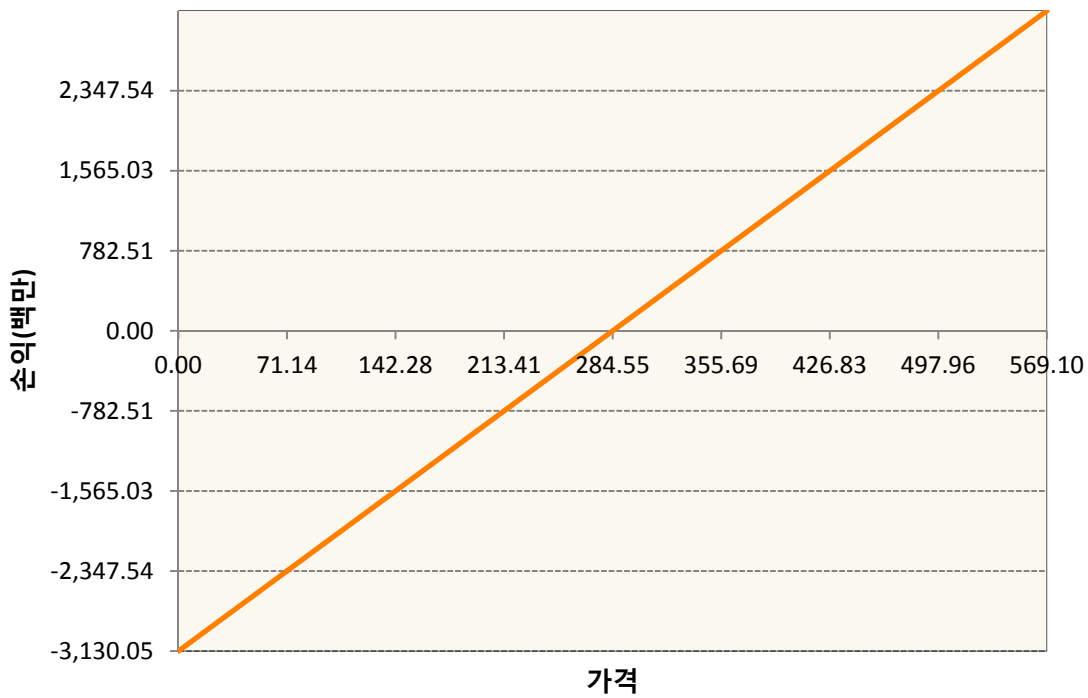
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

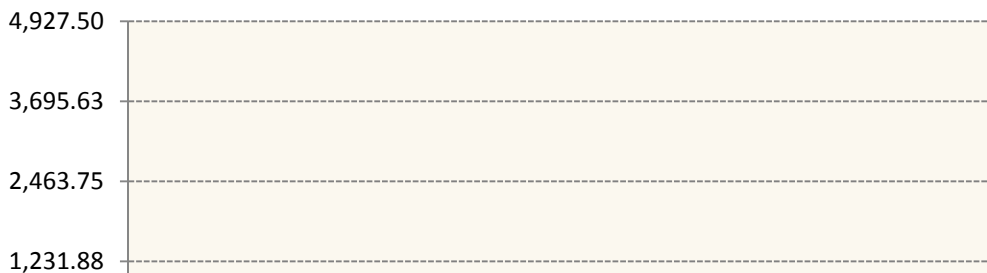
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑   | 0      | 0     | 0         | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 128    | 0     | 128       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 3,130  | 0     | 3,130     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 10,625 | 0     | 10,625    | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 9,744 | -9,744    | 장내 |

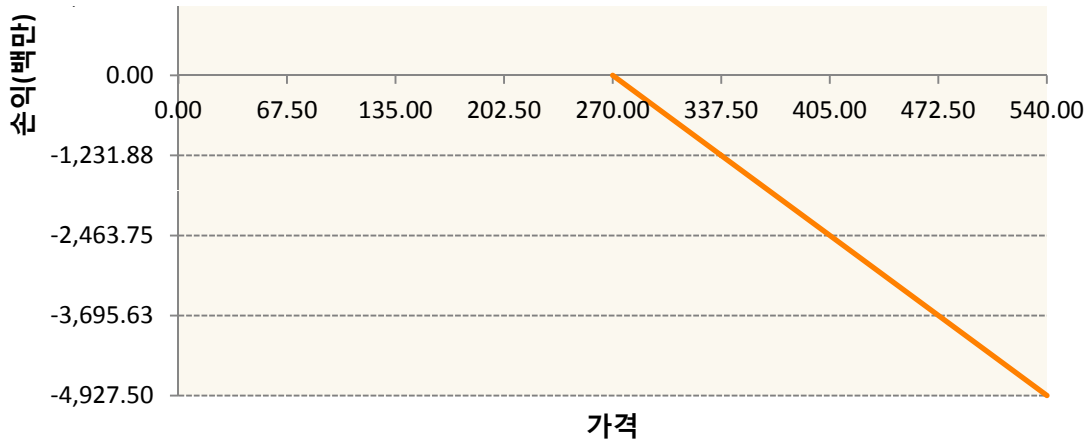
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

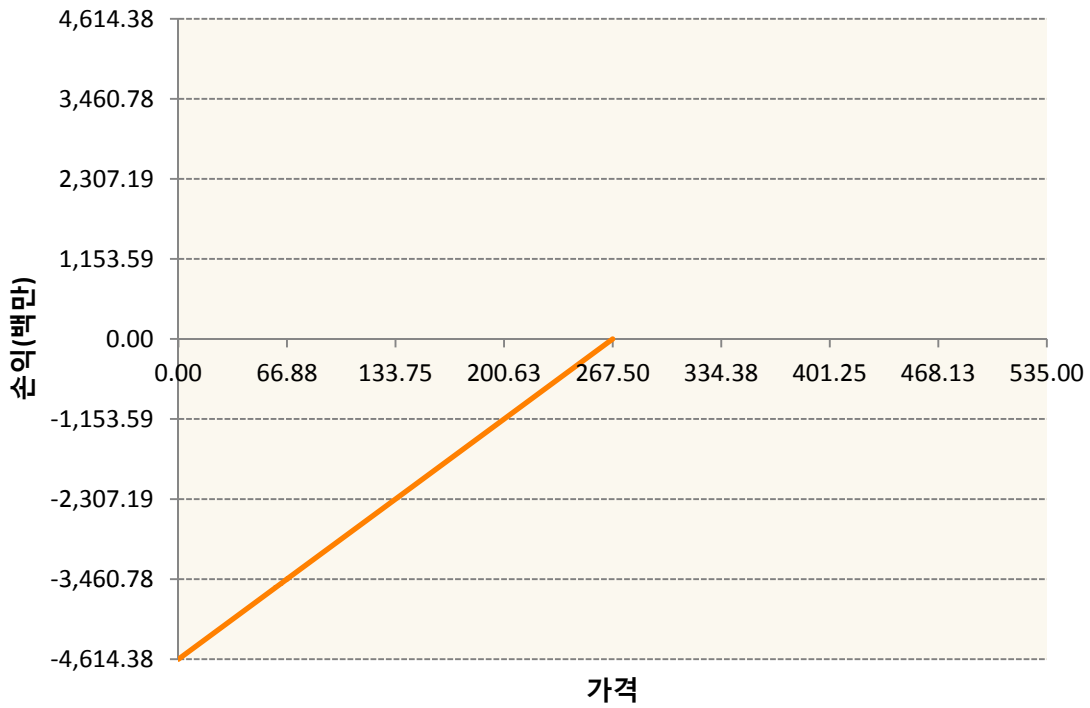


KR4201PB2701-2019-11 콜270

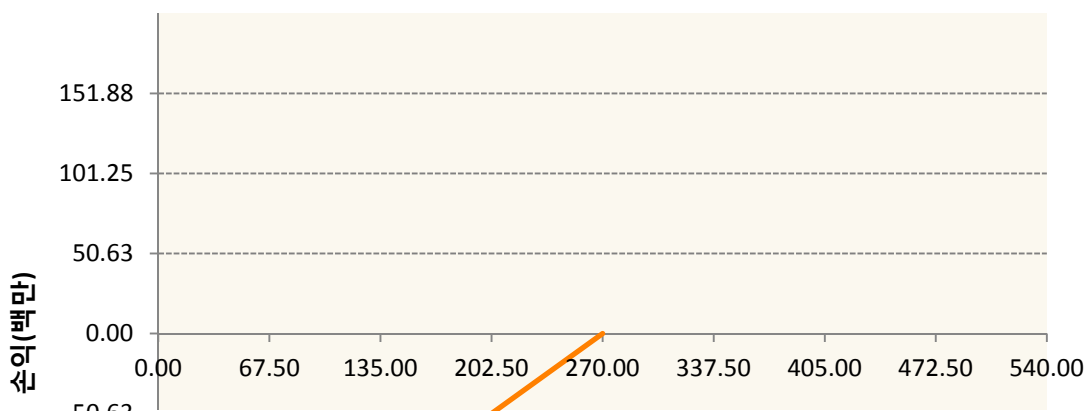




**KR4301PB2676-2019-11 풋267.5**



**KR4301PB2700-2019-11 풋270**





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

| 2.529E+11    |         | UBCSFXC1 INDEX_16  |        |      |       |        |        | 905 |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | -905    | -905               | -905   | -905 | -905  | -905   | -905   |     |
| -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%        | 905     | 905                | 905    | 905  | 905   | 905    | 905    |     |
| KR4101PC0002 |         | 2019-12 코스피200지수선물 |        |      |       |        |        | 250 |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | -250    | -250               | -250   | -250 | -250  | -250   | -250   |     |
| -5.33%       | -167    | -167               | -167   | -167 | -167  | -167   | -167   |     |
| -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%        | 167     | 167                | 167    | 167  | 167   | 167    | 167    |     |
| 8.00%        | 250     | 250                | 250    | 250  | 250   | 250    | 250    |     |
| KR4201PB2701 |         | 2019-11 콜270       |        |      |       |        |        | 403 |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | 260     | 255                | 250    | 245  | 240   | 234    | 228    |     |
| -5.33%       | 217     | 210                | 203    | 196  | 189   | 182    | 175    |     |
| -2.67%       | 130     | 124                | 119    | 113  | 106   | 100    | 94     |     |
| 0%           | 8       | 6                  | 3      | 0    | -4    | -8     | -12    |     |
| 2.67%        | -126    | -127               | -128   | -129 | -131  | -133   | -135   |     |
| 5.33%        | -264    | -264               | -265   | -265 | -265  | -266   | -267   |     |
| 8.00%        | -403    | -403               | -403   | -403 | -403  | -403   | -403   |     |
| KR4301PB2676 |         | 2019-11 풋267.5     |        |      |       |        |        | 113 |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |

|  |         |         |        |      |       |        |        |
|--|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| -8.00%   | -104    | -105    | -107   | -108 | -110  | -111   | -113   |
| -5.33%   | -15     | -18     | -21    | -24  | -27   | -30    | -33    |
| -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 |         |         |        |      |       |        | 7      |
| 기초자산의 변동성                                      |         |         |        |      |       |        |        |
| 가격   | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%   | -6      | -6      | -6     | -6   | -6    | -6     | -7     |
| -5.33%   | -2      | -2      | -2     | -2   | -2    | -2     | -2     |
| -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)

**1,557**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-06 |
| 기준일 | 2019-11-05 |

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

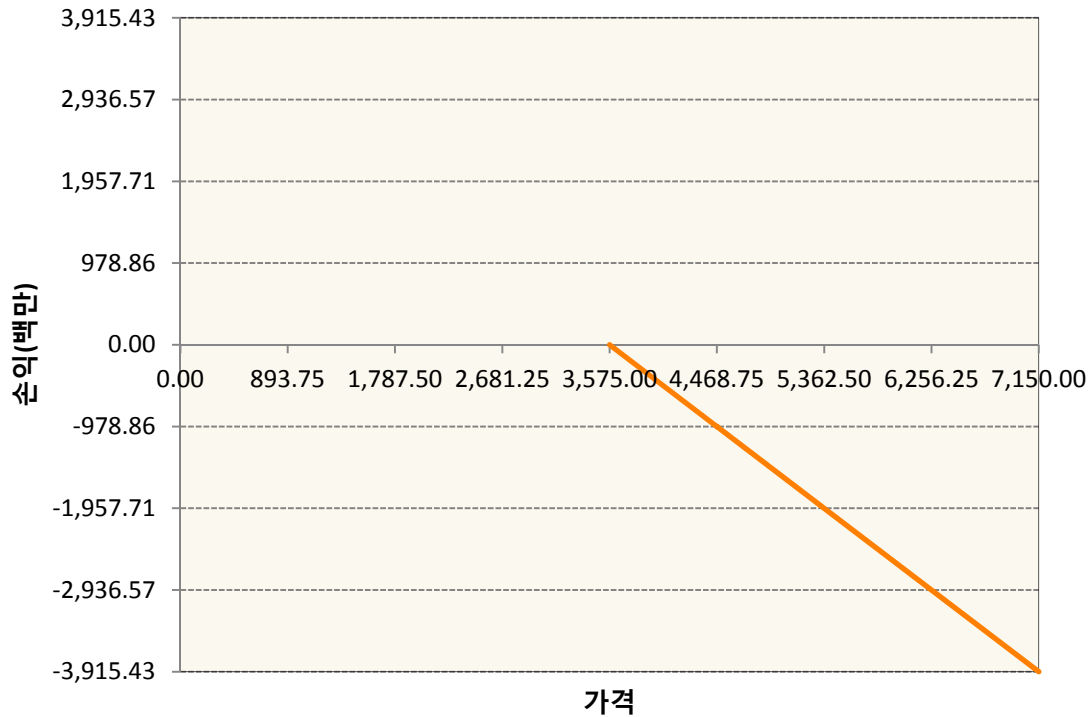
### 1. 계약금액

(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   | 1,952  | 0     | 1,952     |    |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 20,245 | 0     | 20,245    | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 9,594 | -9,594    | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 2,031  | 6,056 | -4,025    | 장외 |

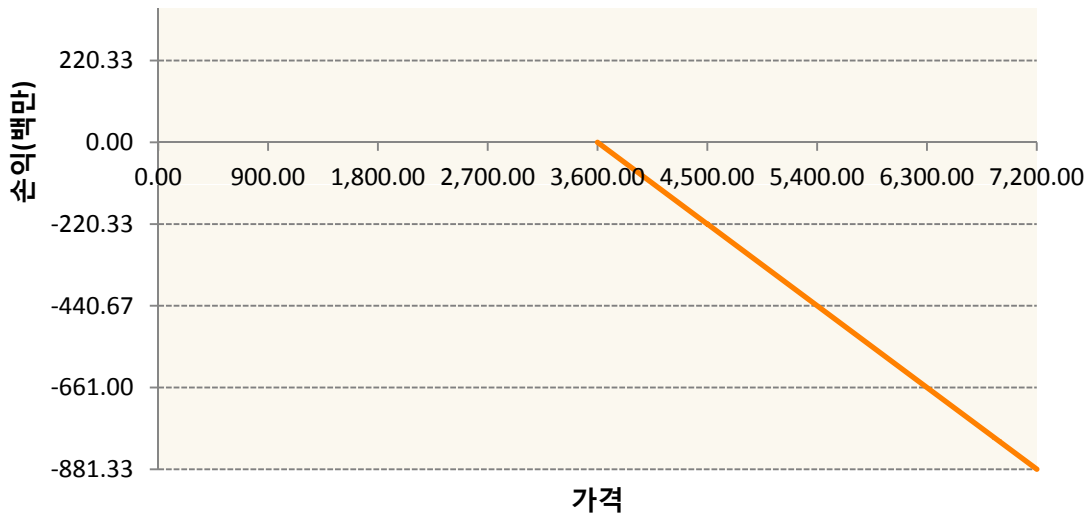
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXX9-C3575-EURO STOXX 50**

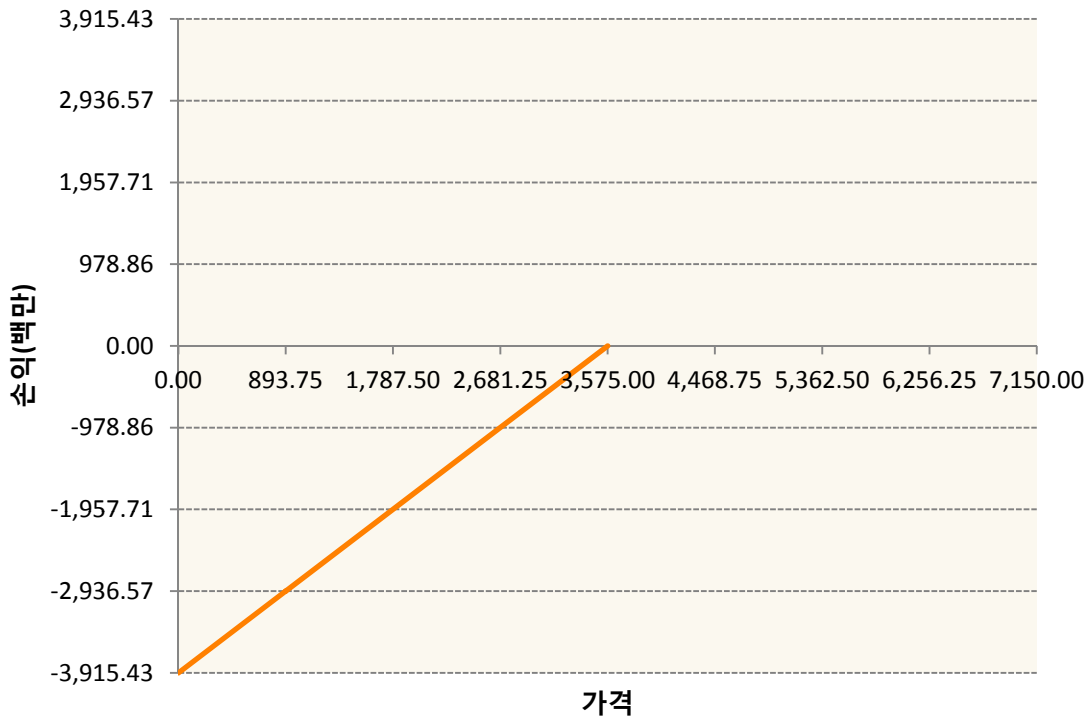


**OESXX9-C3600-EURO STOXX 50**

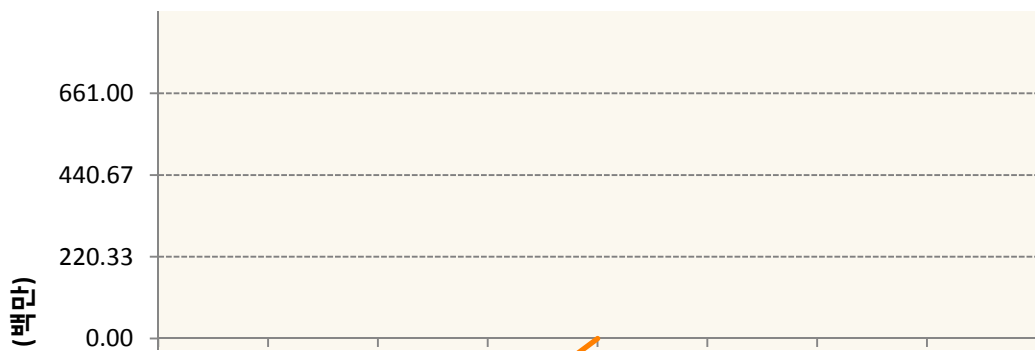


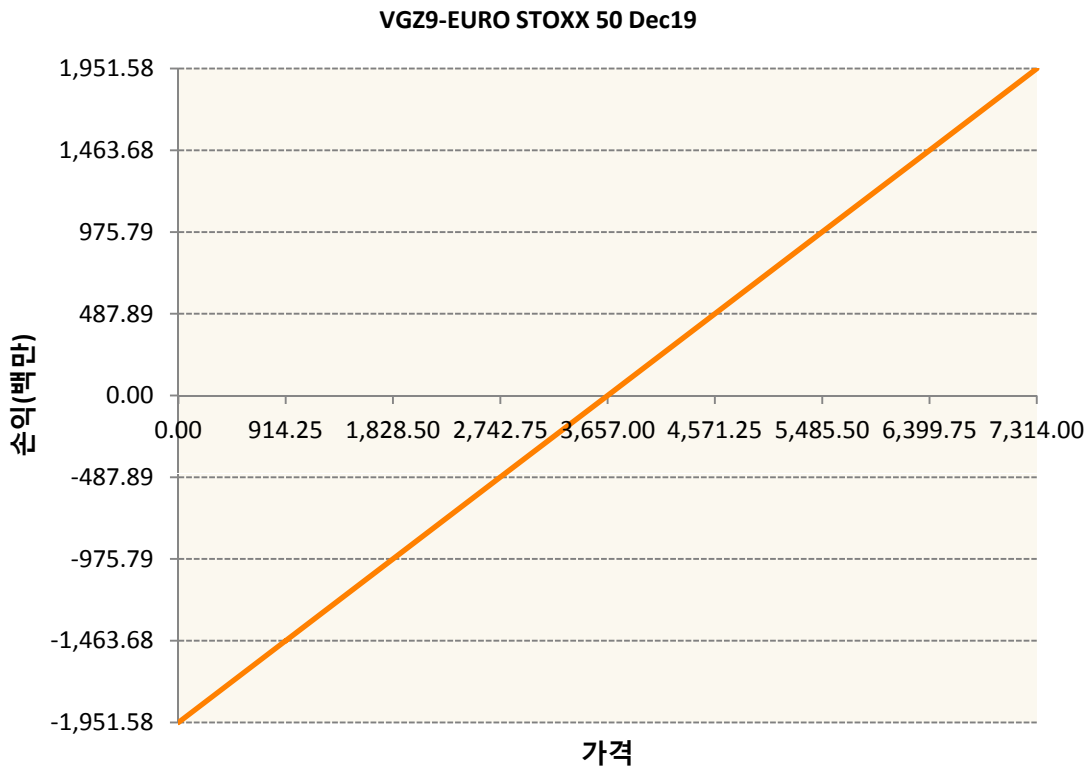
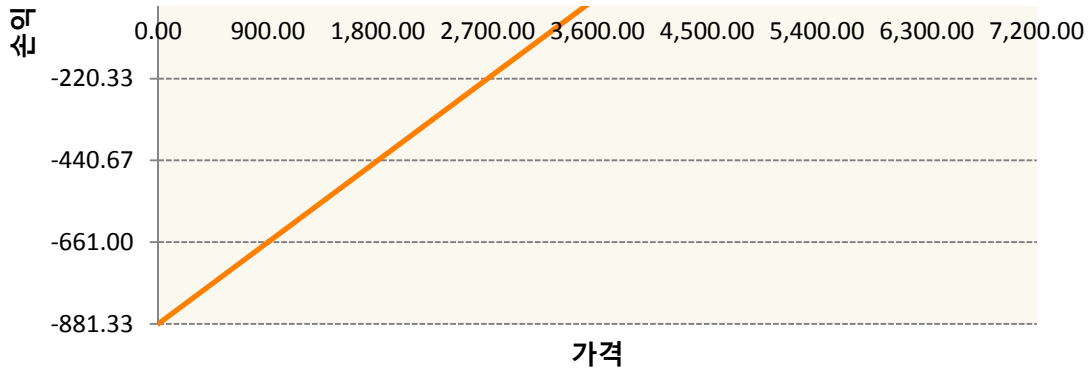


OESXX9-P3575-EURO STOXX 50



OESXX9-P3600-EURO STOXX 50





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)               |                     | (단위:백만원) |
|---|---------------------|----------|
| 260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY |                     | 22       |
| FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E            |                     | 484      |
| FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E            |                     | 162      |
| OESXX9-C35 EURO STOXX 50                |                     | 313      |
| OESXX9-C36 EURO STOXX 50                |                     | 71       |
| OESXX9-P35 EURO STOXX 50                |                     | 313      |
| OESXX9-P36 EURO STOXX 50                |                     | 71       |
| VGZ9                                    | EURO STOXX 50 Dec19 | 156      |

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

(단위:백만원)

969



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

(단위:백만원)

946



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

(단위:백만원)

83



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

(단위:백만원)

129

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-06 |
| 기준일 | 2019-11-05 |

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

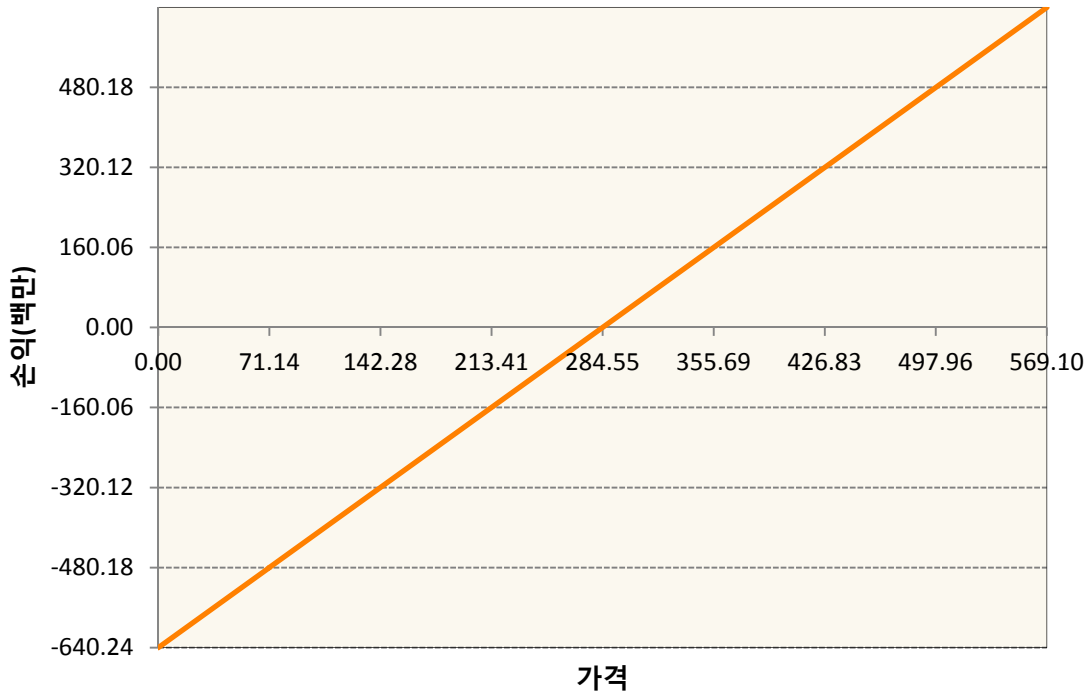
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 640   | 0     | 640       | 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 | 2019-11-06 |
| 기준일 | 2019-11-05 |

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

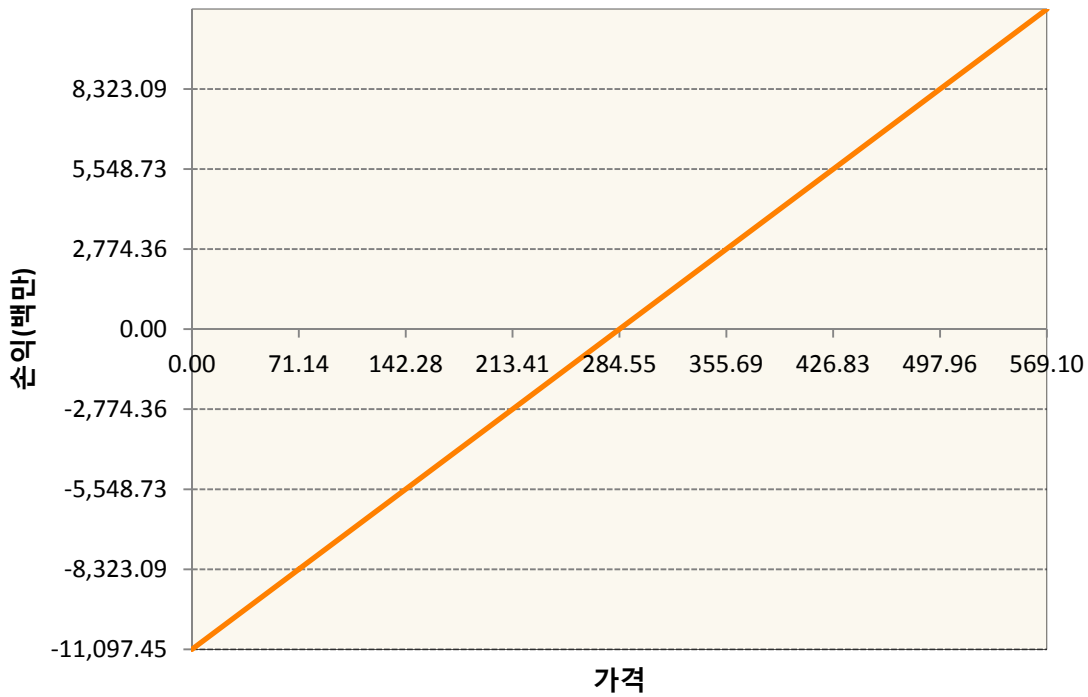
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

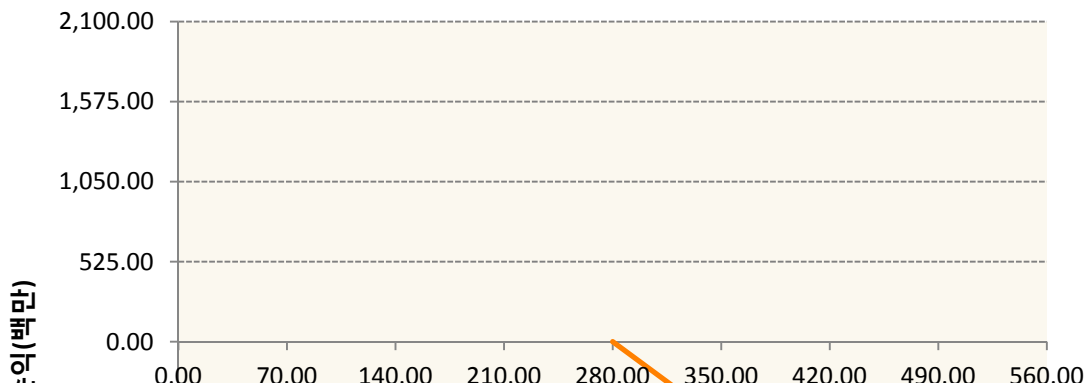
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 213    | -213      | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 209    | 202    | 7         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 11,097 | 0      | 11,097    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 3,359  | 20,321 | -16,962   | 장내 |

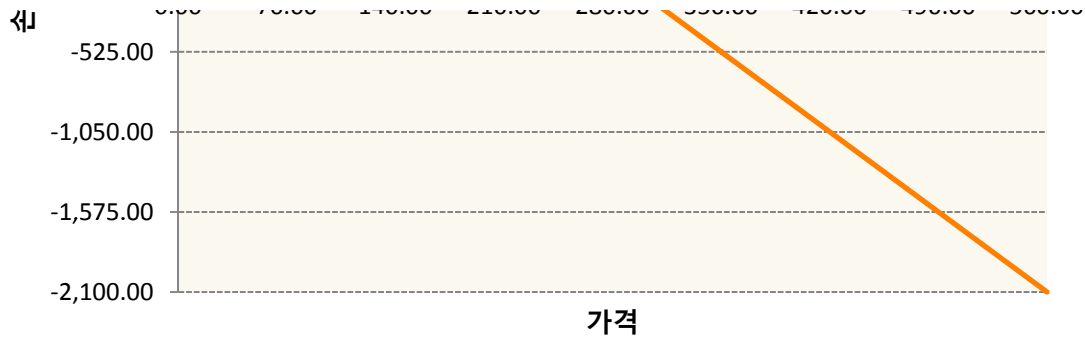
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

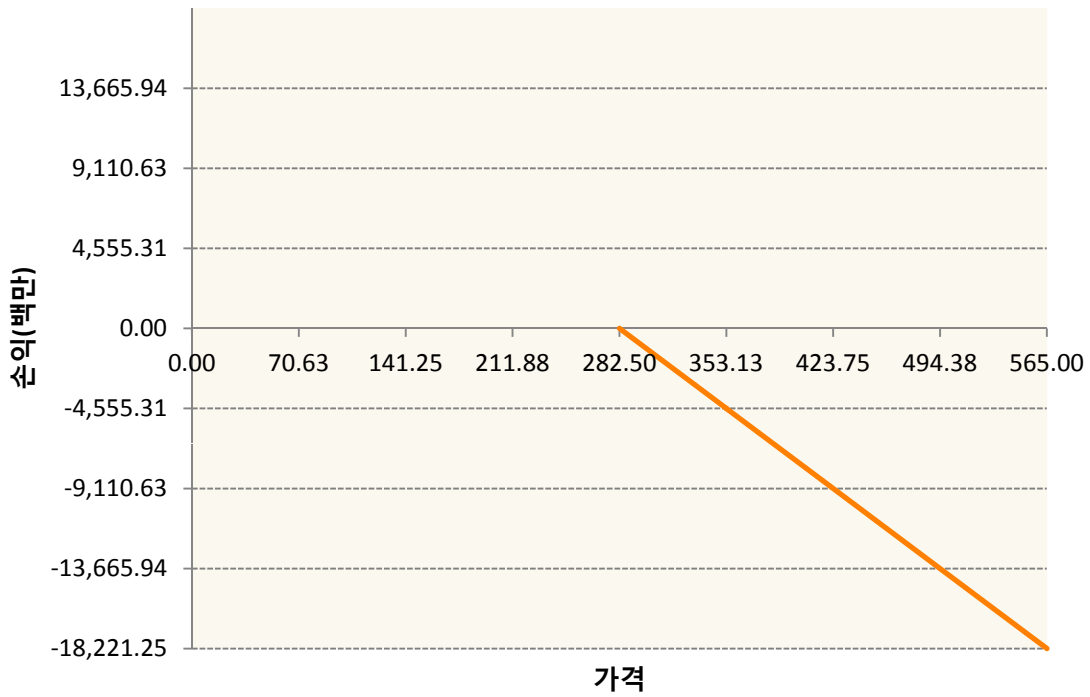


KR4201PB2800-2019-11 콜280

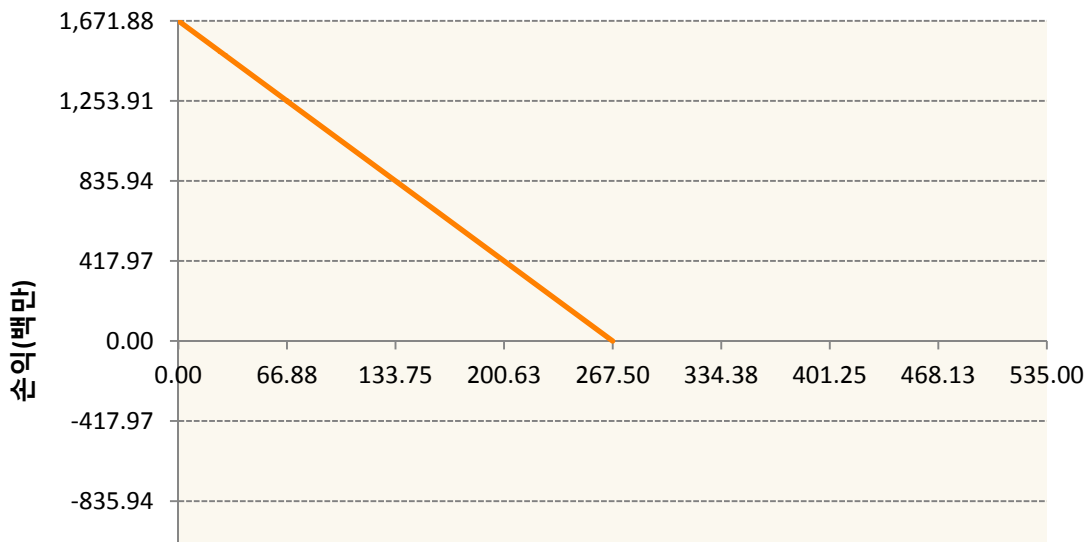


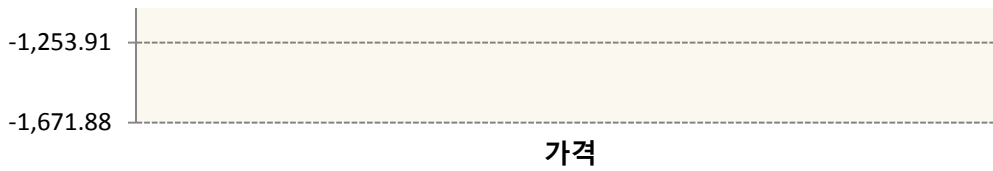


KR4201PB2826-2019-11 콜282.5

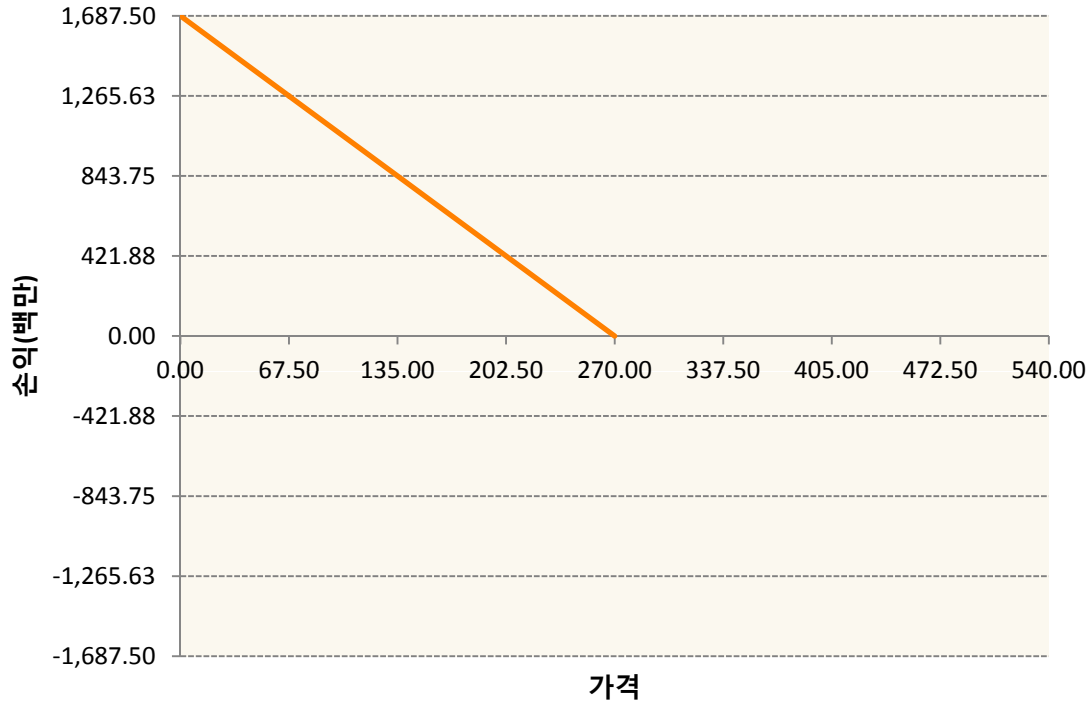


KR4301PB2676-2019-11 풋267.5





KR4301PB2700-2019-11 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101PC0002 |         | 2019-12 코스피200지수선물 |        |      |       |        |        | 887 |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
|              |         | 기초자산의 변동성          |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | -887    | -887               | -887   | -887 | -887  | -887   | -887   |     |
| -5.33%       | -592    | -592               | -592   | -592 | -592  | -592   | -592   |     |
| -2.67%       | -296    | -296               | -296   | -296 | -296  | -296   | -296   |     |
| 0%           | 0       | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |     |
| 2.67%        | 296     | 296                | 296    | 296  | 296   | 296    | 296    |     |
| 5.33%        | 592     | 592                | 592    | 592  | 592   | 592    | 592    |     |
| 8.00%        | 887     | 887                | 887    | 887  | 887   | 887    | 887    |     |
| KR4201PB2800 |         | 2019-11 콜280       |        |      |       |        |        | 150 |
|              |         | 기초자산의 변동성          |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | 54      | 54                 | 53     | 53   | 52    | 51     | 49     |     |
| -5.33%       | 51      | 50                 | 48     | 46   | 44    | 42     | 40     |     |
| -2.67%       | 38      | 36                 | 33     | 30   | 27    | 24     | 21     |     |

|  |         |         |        |        |        |        |        |
|--|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 0%   | 8       | 6       | 3      | 0      | -3     | -6     | -9     |
| 2.67%  | -38     | -39     | -41    | -43    | -45    | -47    | -49    |
| 5.33%  | -92     | -92     | -93    | -94    | -95    | -96    | -97    |
| 8.00%  | -148    | -148    | -148   | -149   | -149   | -149   | -150   |
| KR4201PB2826                      2019-11 콜282.5 |         |         |        |        |        |        | 1,234  |
| 기초자산의 변동성  |         |         |        |        |        |        |        |
| 가격   | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%   | 375     | 373     | 370    | 365    | 360    | 352    | 344    |
| -5.33%   | 360     | 350     | 339    | 326    | 312    | 296    | 280    |
| -2.67%   | 284     | 262     | 240    | 217    | 194    | 170    | 146    |
| 0%   | 78      | 52      | 26     | 0      | -26    | -52    | -78    |
| 2.67%  | -278    | -295    | -313   | -333   | -353   | -374   | -396   |
| 5.33%  | -727    | -733    | -741   | -751   | -763   | -776   | -790   |
| 8.00%  | -1,208  | -1,209  | -1,212 | -1,215 | -1,220 | -1,226 | -1,234 |
| KR4301PB2676                      2019-11 풋267.5 |         |         |        |        |        |        | 41     |
| 기초자산의 변동성  |         |         |        |        |        |        |        |
| 가격   | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%   | 38      | 38      | 39     | 39     | 40     | 40     | 41     |
| -5.33%   | 6       | 7       | 8      | 9      | 10     | 11     | 12     |
| -2.67%   | 0       | 0       | 0      | 1      | 1      | 1      | 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      |
| KR4301PB2700                      2019-11 풋270   |         |         |        |        |        |        | 55     |
| 기초자산의 변동성  |         |         |        |        |        |        |        |
| 가격   | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%   | 53      | 53      | 53     | 53     | 54     | 54     | 55     |
| -5.33%   | 13      | 14      | 15     | 16     | 17     | 18     | 19     |
| -2.67%   | 0       | 1       | 1      | 2      | 2      | 3      | 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)

**2,225**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-06 |
| 기준일 | 2019-11-05 |

## 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 | 177,420 | 0     | 177,420   |    |

### 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 | 2019-11-06 |
| 기준일 | 2019-11-05 |

## 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 | 208,288 | 0     | 208,288   |    |

### 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 | 2019-11-06 |
| 기준일 | 2019-11-05 |

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)   | 매도(2)   | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 8,102   | 0       | 8,102     |    |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0       | 0       | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 520,334 | 0       | 520,334   |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0       | 526,778 | -526,778  | 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 |                                 | 1,852 |
| FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E |                                 | 1,945 |
| FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E |                                 | 926   |
| FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E |                                 | 648   |
| FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E |                                 | 1,519 |
| FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E |                                 | 685   |
| FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E |                                 | 1,667 |
| FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E |                                 | 2,445 |
| FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E |                                 | 463   |
| FX21019V02 KRW/USD 21-11-19E |                                 | 5,037 |
| FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E |                                 | 4,723 |
| FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E |                                 | 1,389 |
| FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E |                                 | 2,778 |
| FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E |                                 | 1,491 |
| FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E |                                 | 2,815 |
| FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E |                                 | 926   |
| FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E |                                 | 926   |
| FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E |                                 | 1,852 |
| FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E |                                 | 1,852 |
| FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E |                                 | 926   |
| FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E |                                 | 926   |
| FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E |                                 | 926   |
| FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E |                                 | 926   |
| FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E |                                 | 463   |
| FX21019X00 KRW/USD 06-12-19E |                                 | 648   |
| FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E |                                 | 463   |

FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E

463

FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E

463

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

(단위:백만원)

**13,552**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-06 |
| 기준일 | 2019-11-05 |

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

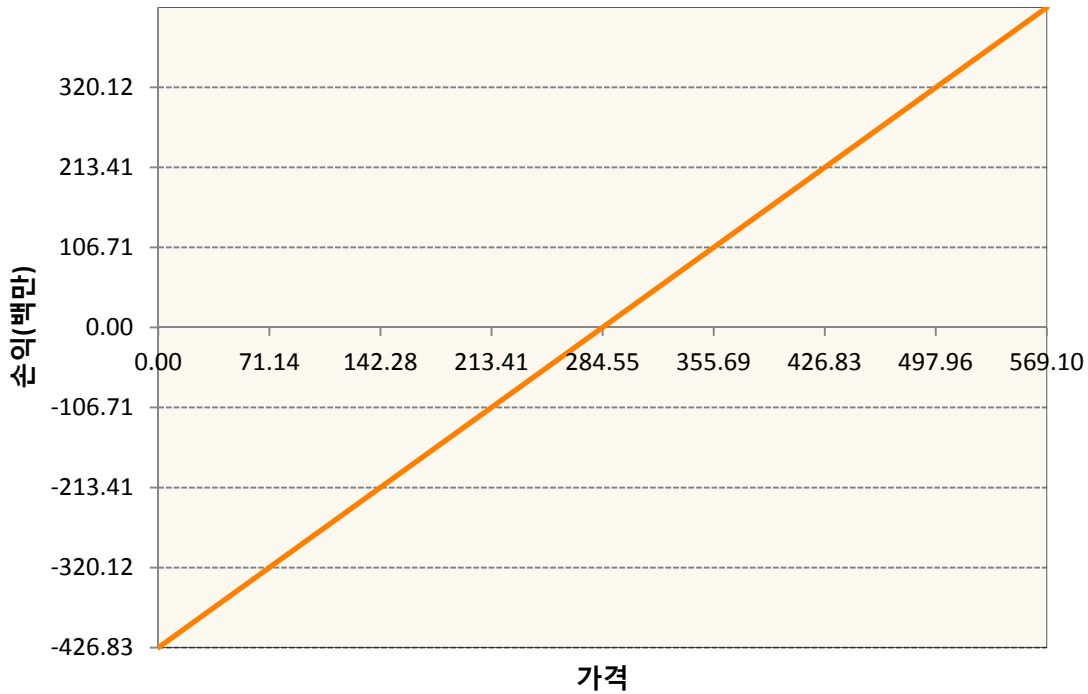
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

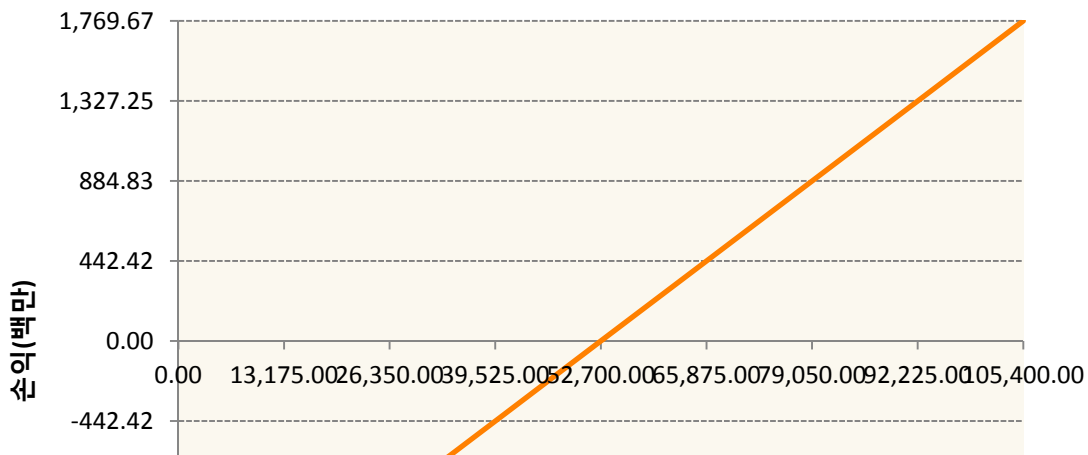
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,196 | 0     | 2,196     | 장내 |

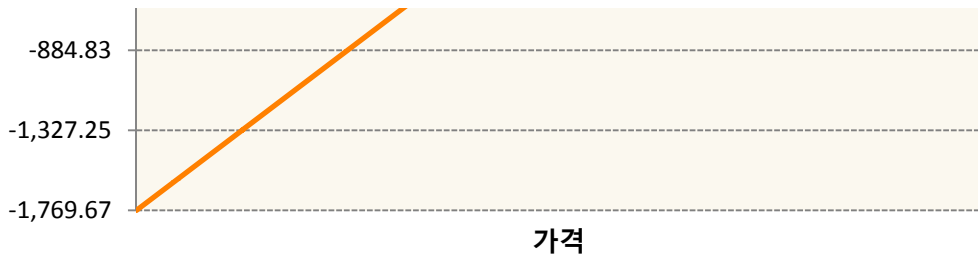
### 2. 만기시점의 손익구조

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 |        |      |       |        |        | 142 |
|--------------|---------|------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
| 기초자산의 변동성    |         |                  |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%          | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | -142    | -142             | -142   | -142 | -142  | -142   | -142   |     |
| -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%        | 142     | 142              | 142    | 142  | 142   | 142    | 142    |     |

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

**186**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-06 |
| 기준일 | 2019-11-05 |

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

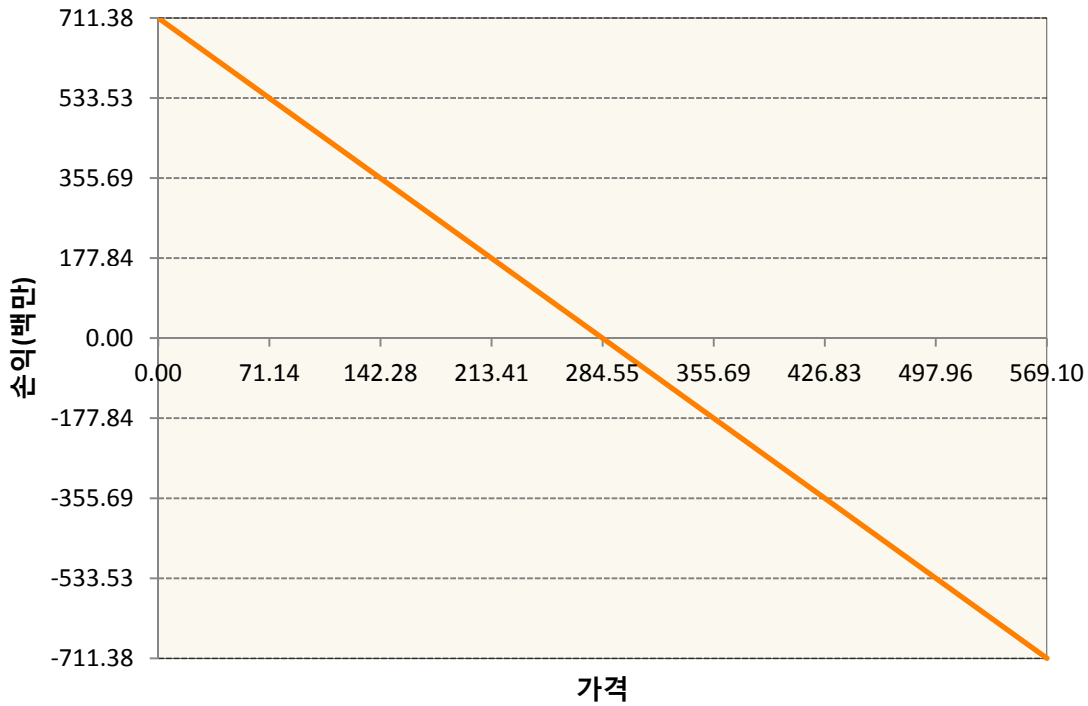
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

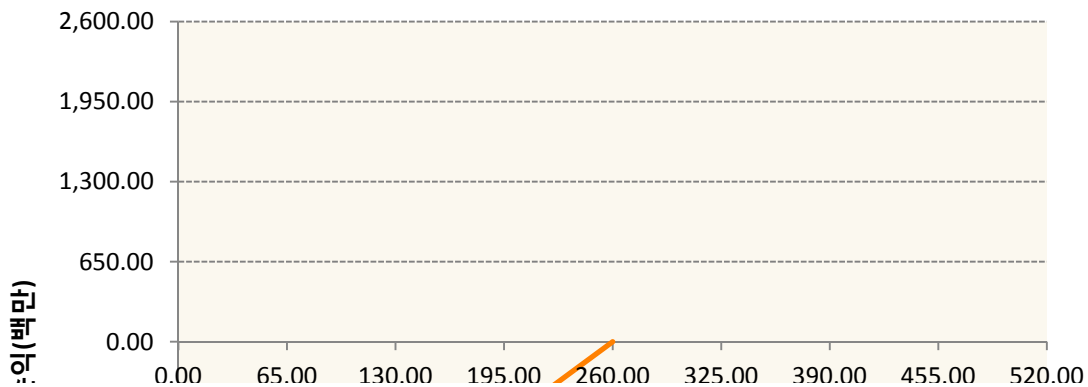
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 65    | 0     | 65        | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 0     | 711   | -711      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 3,650 | -3,650    | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

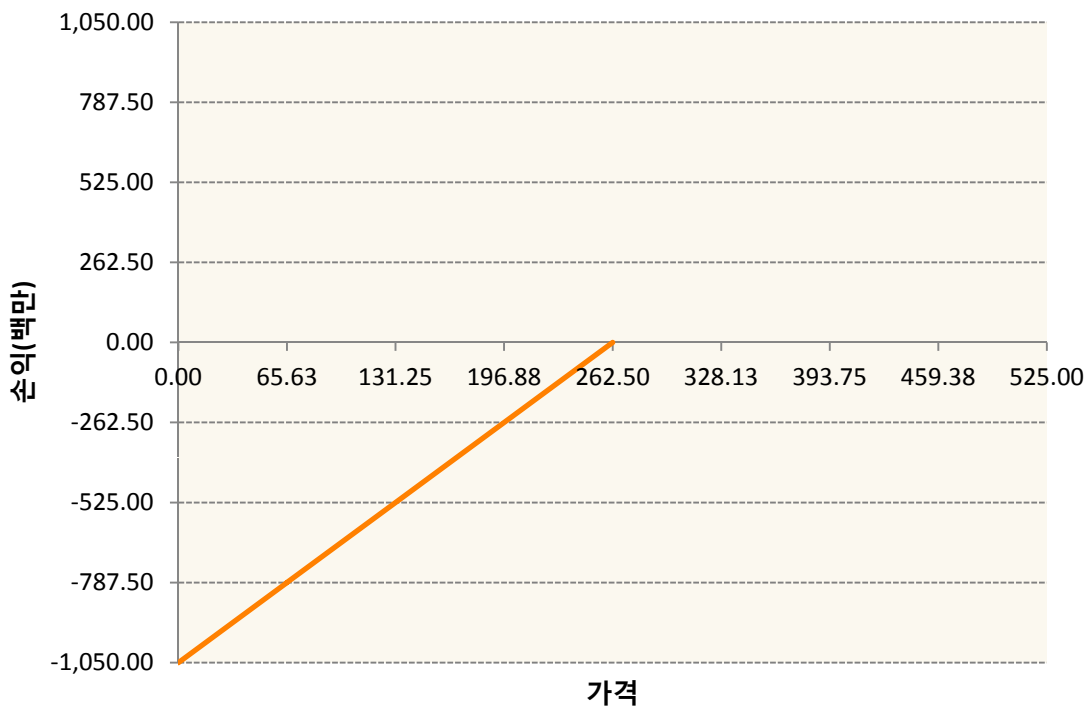


KR4301PB2601-2019-11 풋260





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       |        |     |       |        |        | 19 |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |     |       |        |        |    |

|        |         |         |        |     |       |        |        |
|--------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격     | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -9      | -10     | -12    | -14 | -15   | -17    | -19    |
| -5.33% | 0       | 0       | -1     | -1  | -1    | -2     | -2     |
| -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

12

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |     |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | -8      | -9      | -10    | -10 | -11   | -12    | -12    |
| -5.33%    | 0       | 0       | -1     | -1  | -1    | -2     | -2     |
| -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)

46

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-06 |
| 기준일 | 2019-11-05 |

## 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 | 15,571 | 0      | 15,571    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 637    | 15,927 | -15,291   | 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)

|     |
|-----|
| 426 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-06 |
| 기준일 | 2019-11-05 |

## 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   | 684   | 0     | 684       | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 200   | 277   | -77       | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                              |    |
|------------------------------|----|
| 2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR) | 36 |
| 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)

|    |
|----|
| 59 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-06 |
| 기준일 | 2019-11-05 |

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

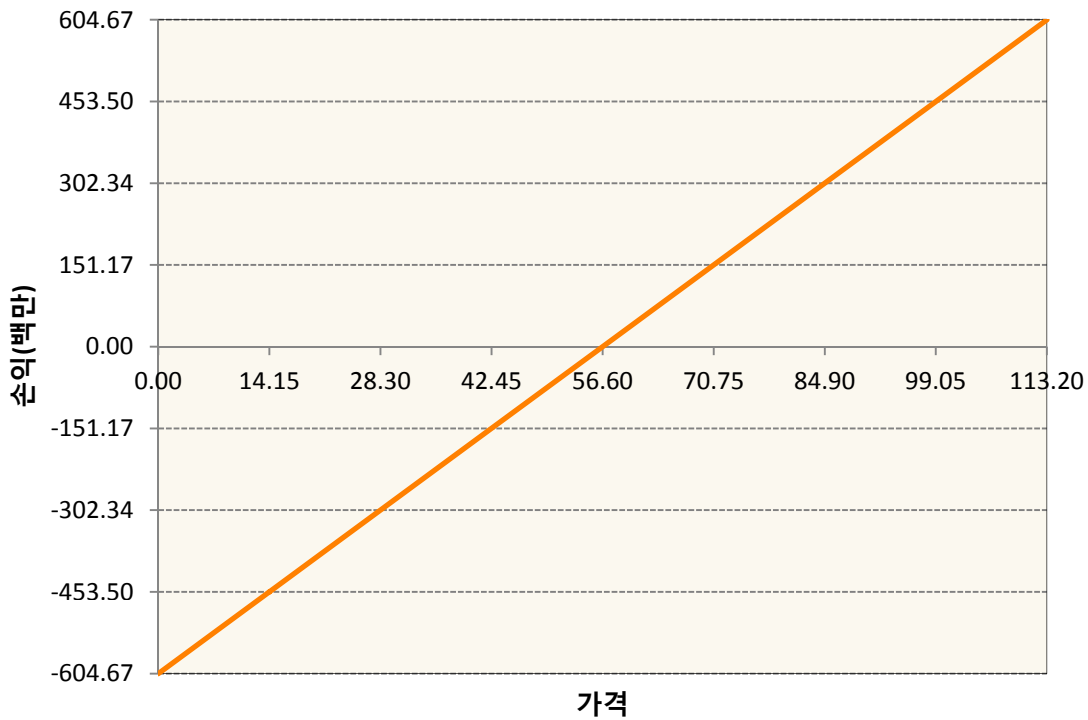
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

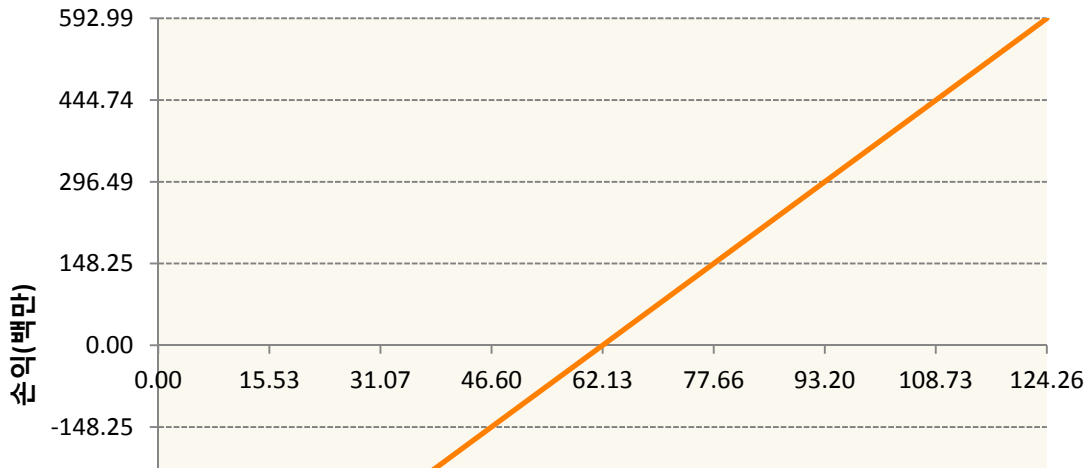
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,567 | 290   | 2,278     |    |

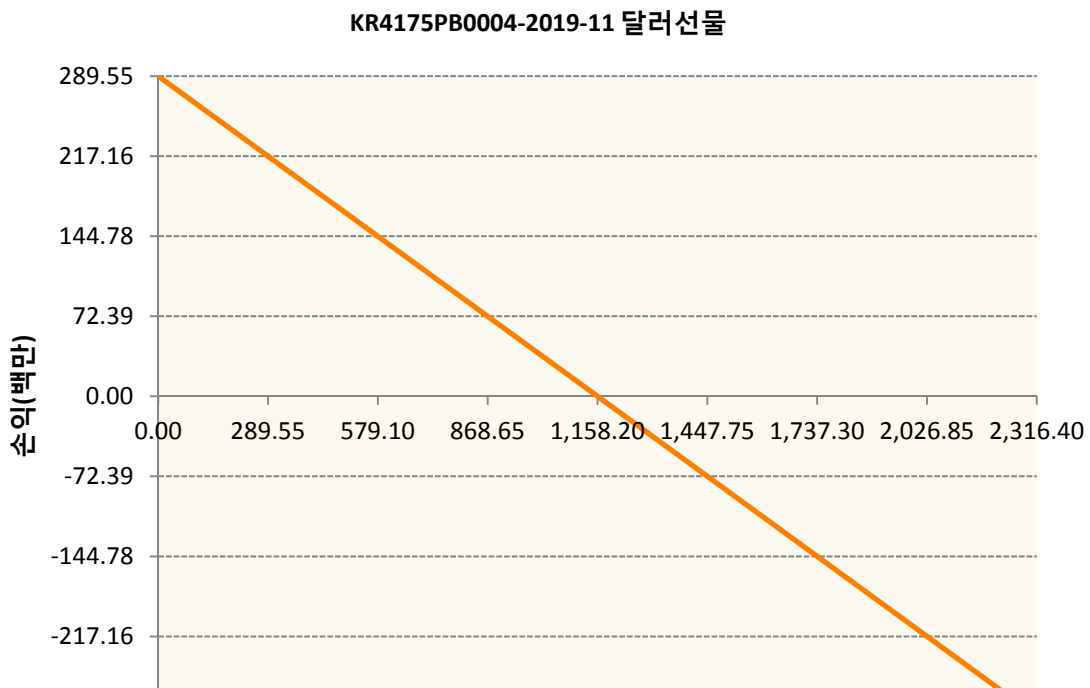
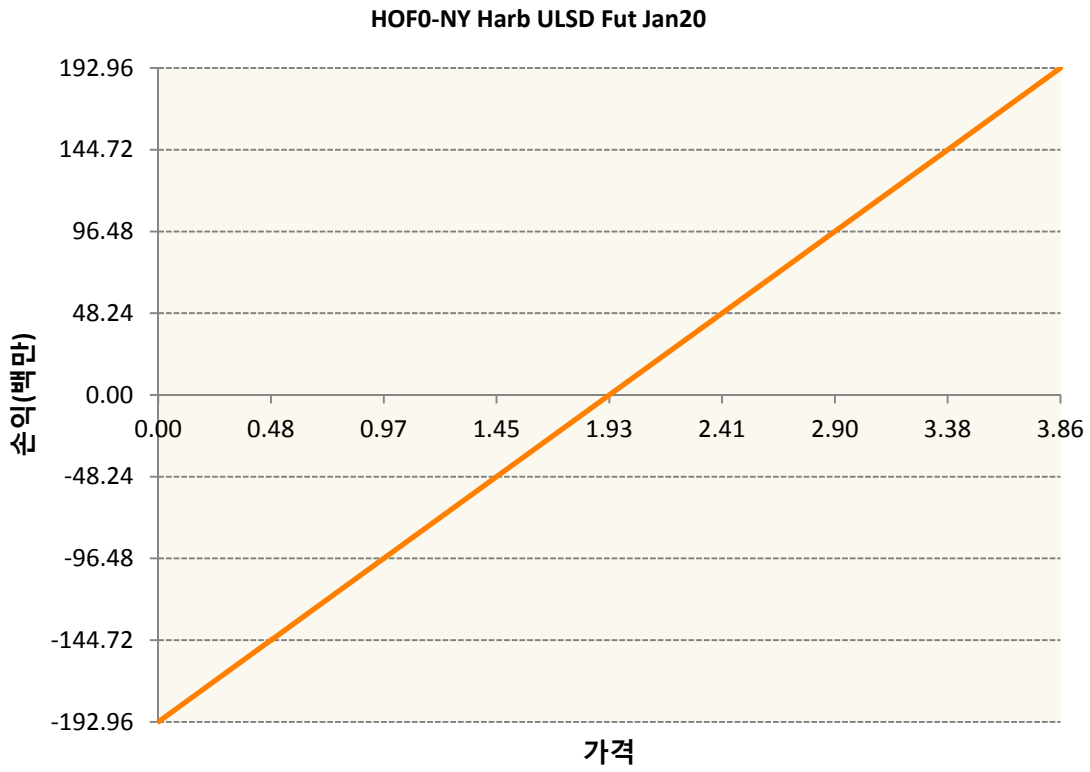
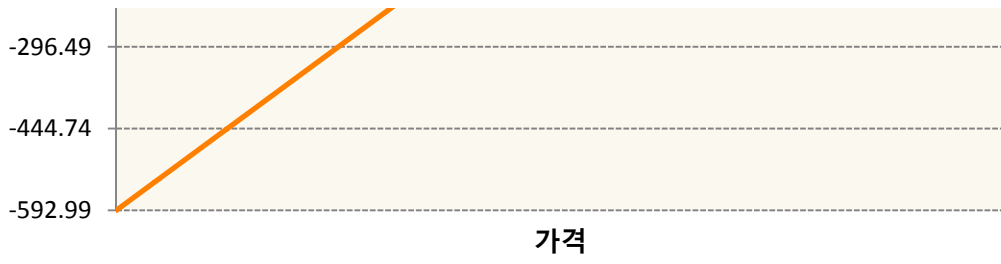
### 2. 만기시점의 손익구조

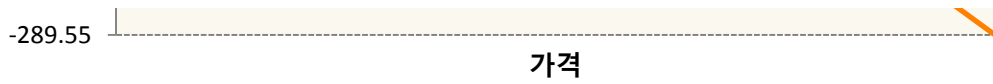
CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20



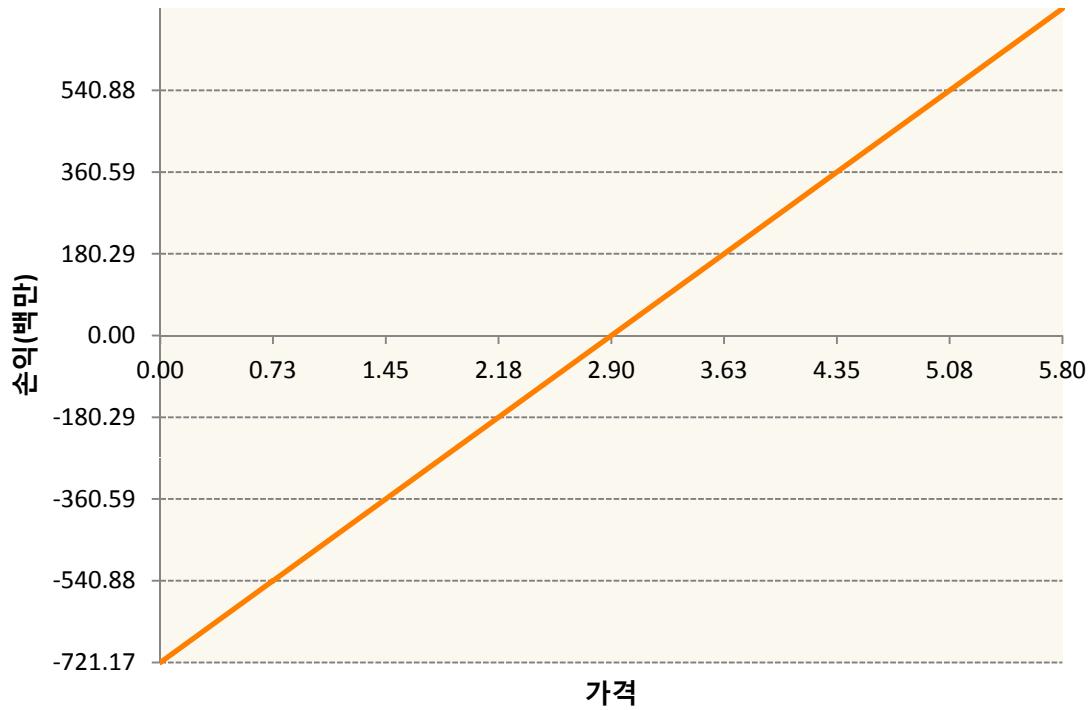
COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20



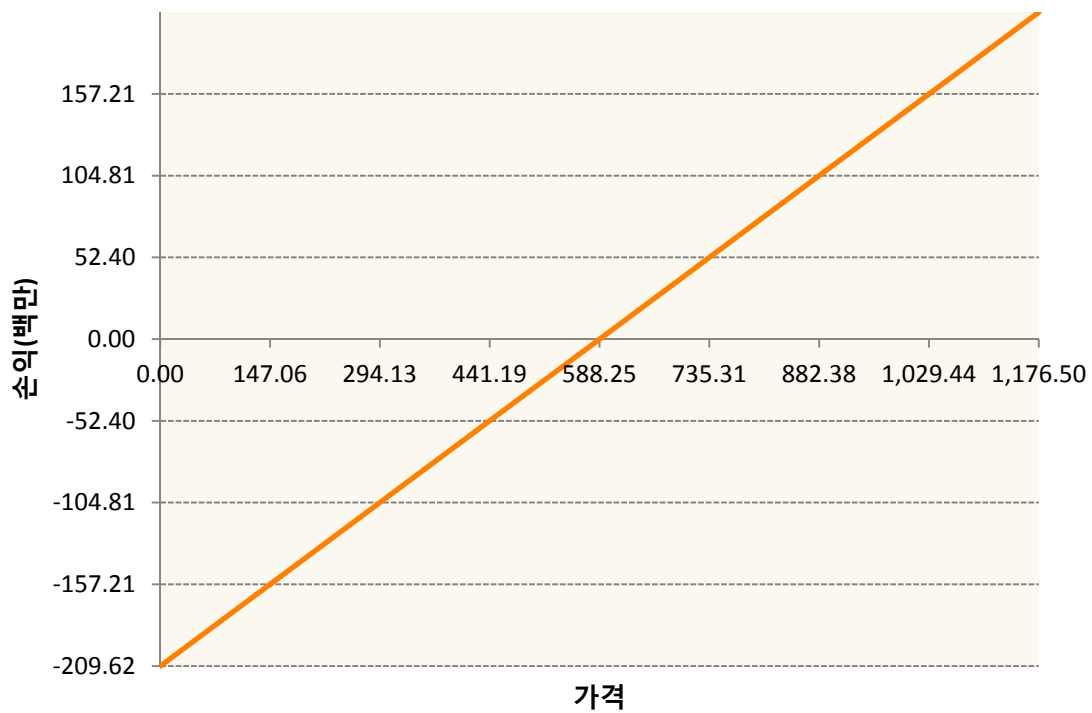




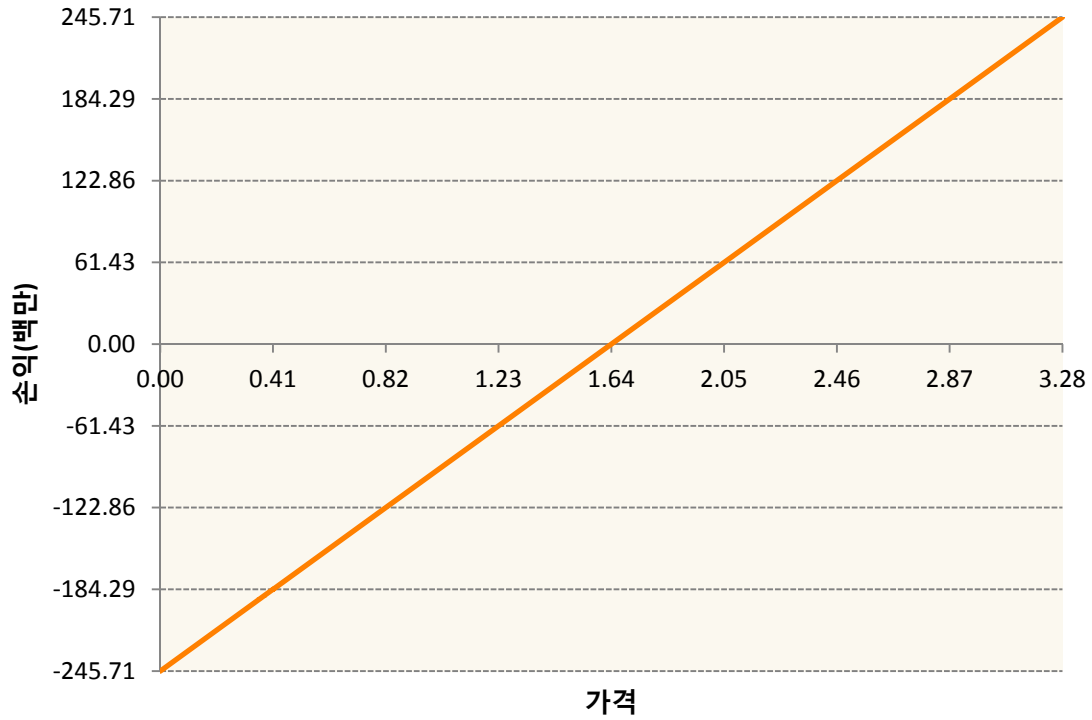
NGF20-NATURAL GAS FUTR Jan20



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  | 15 |
| KR4175PB00 | 2019-11 달러선물            | 23 |
| NGF20      | NATURAL GAS FUTR Jan20  | 58 |
| QSF0       | Low Su Gasoil G Jan20   | 17 |
| XBF0       | GASOLINE RBOB FUT Jan20 | 20 |

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

(단위:백만원)

430

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-06 |
| 기준일 | 2019-11-05 |

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

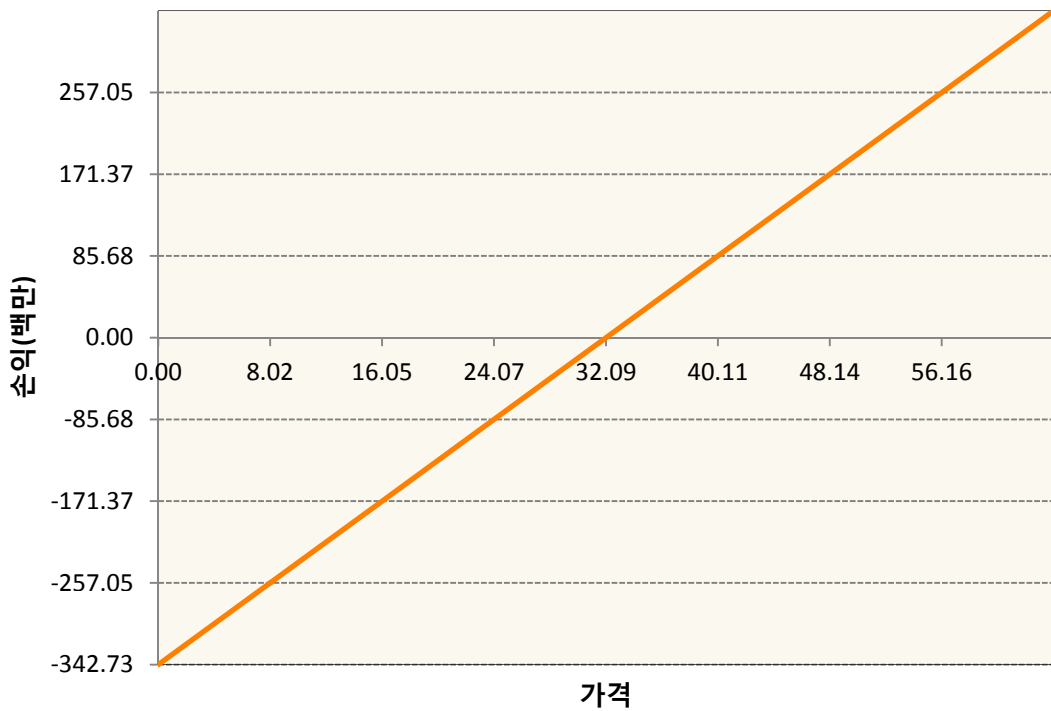
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

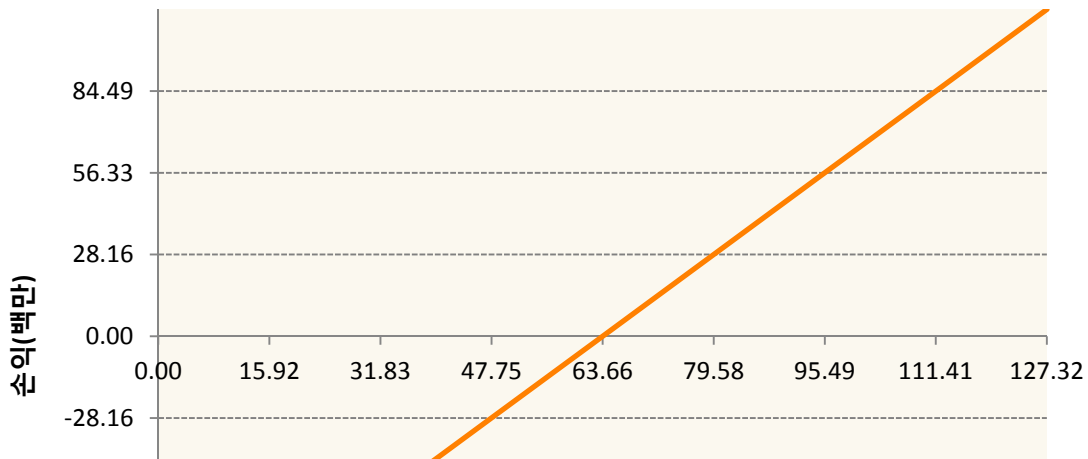
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,876 | 93    | 2,783     |    |

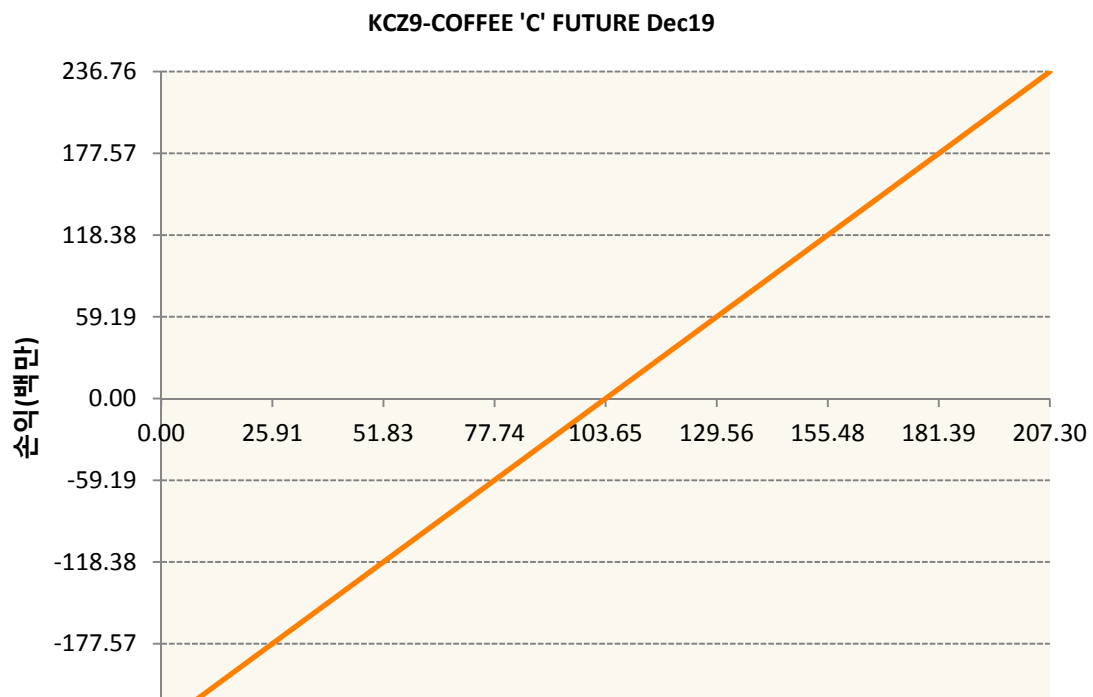
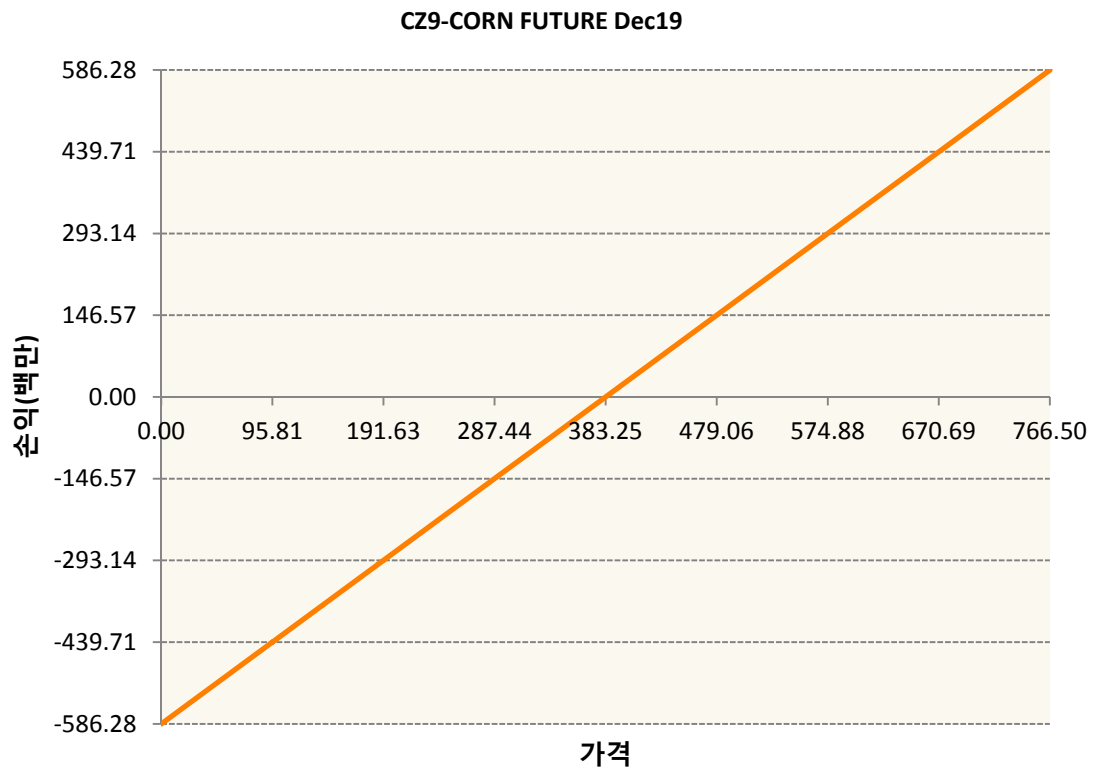
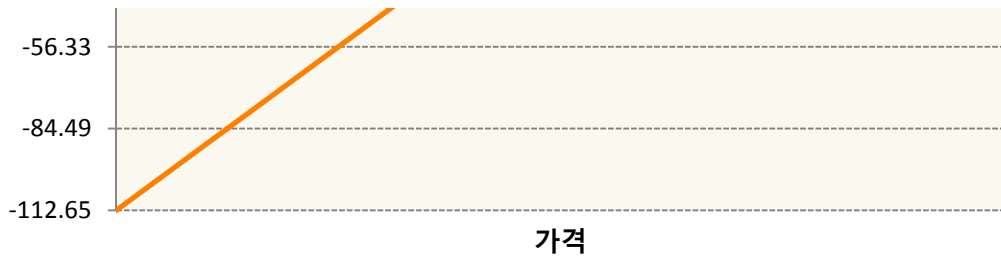
### 2. 만기시점의 손익구조

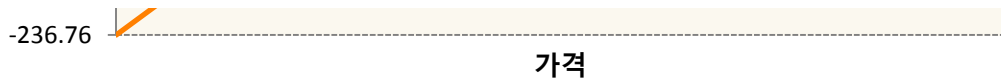
**BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20**



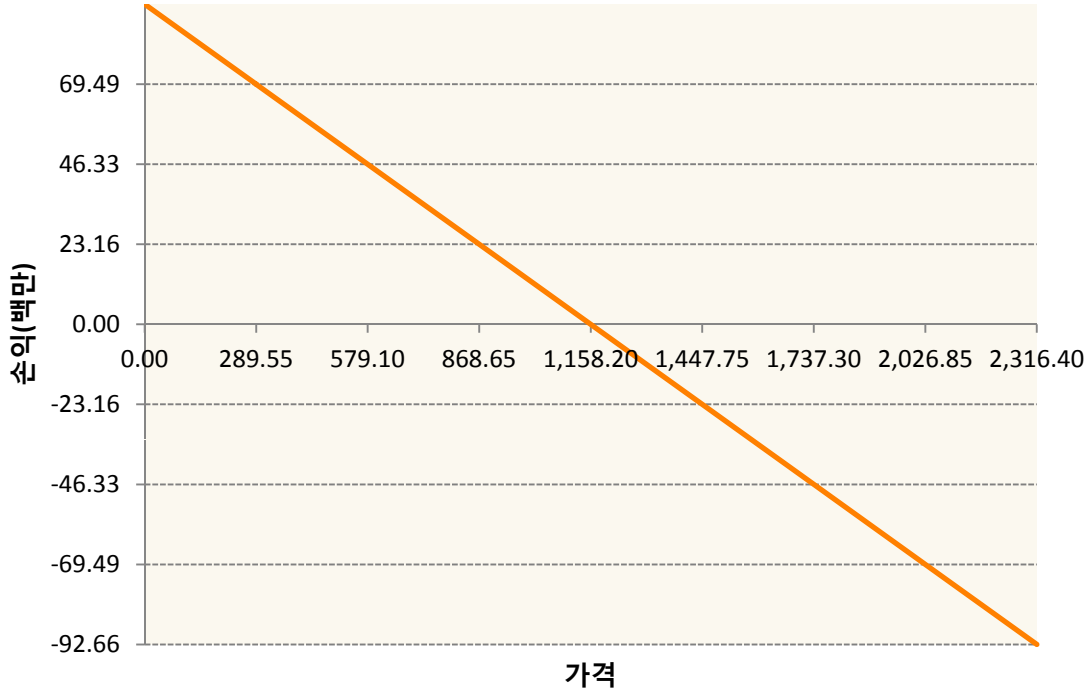
**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**



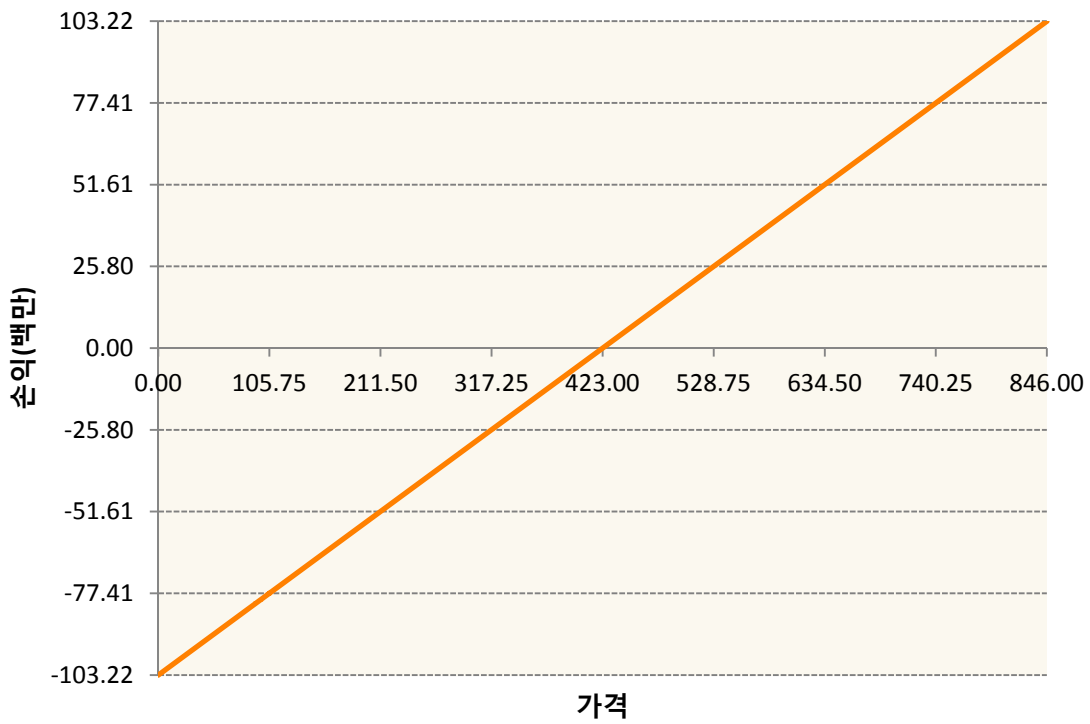




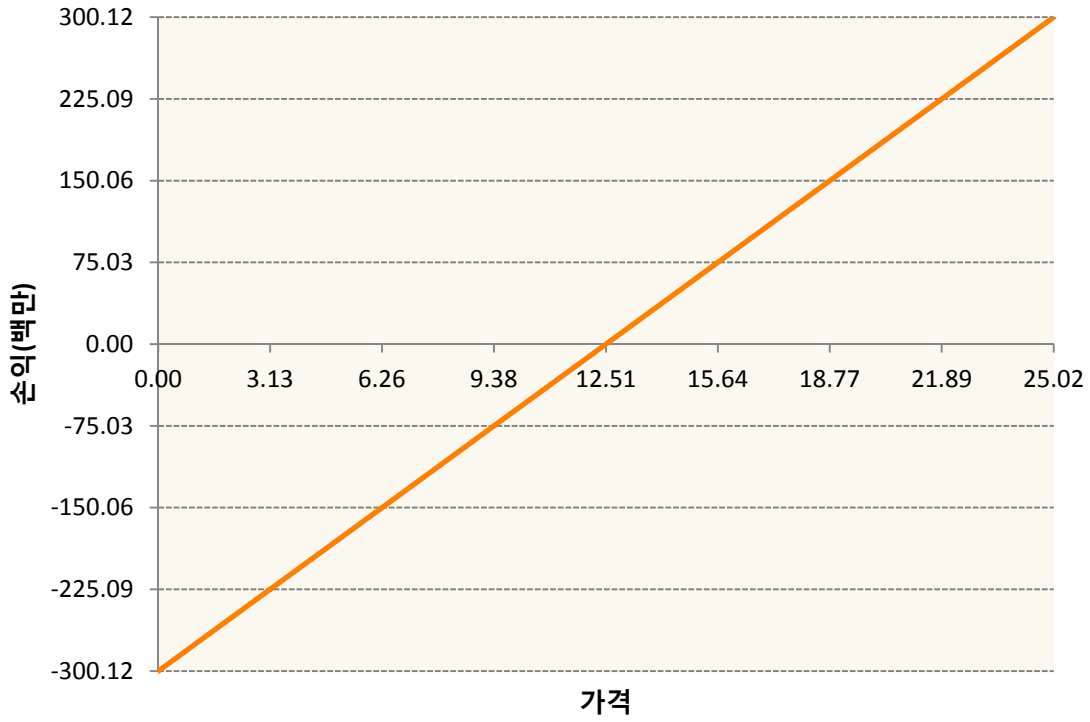
**KR4175PB0004-2019-11 달러선물**



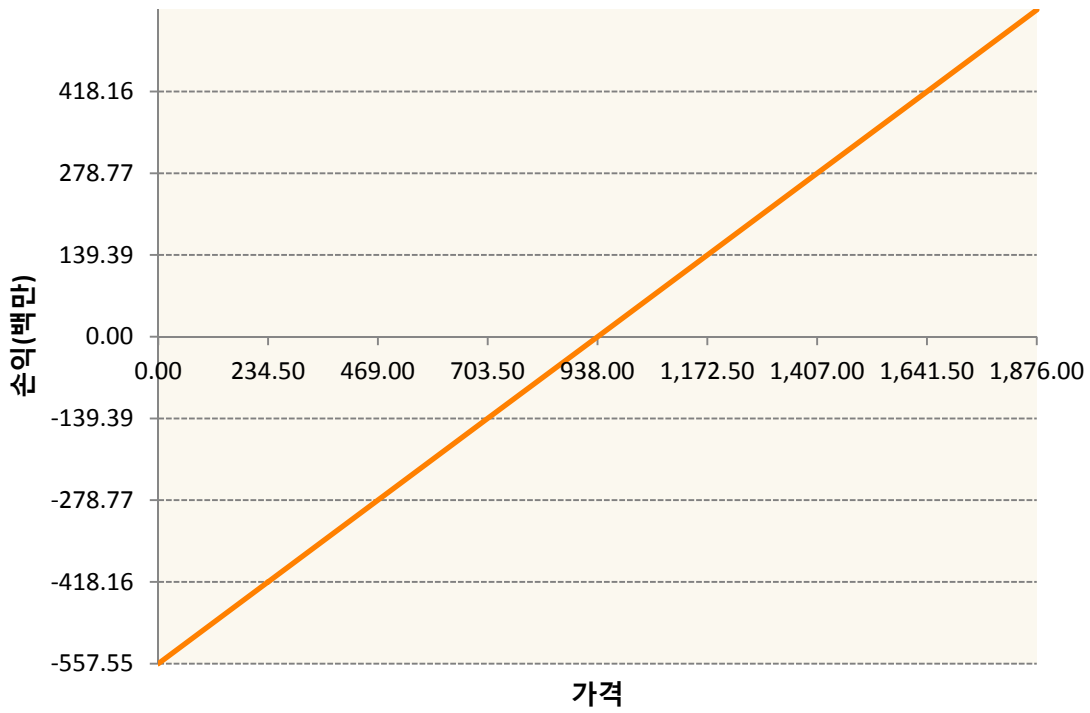
**KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19**



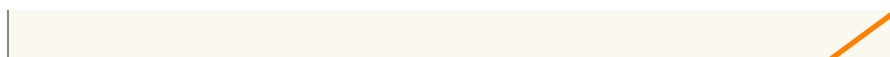
SBH0-Sugar Mar20

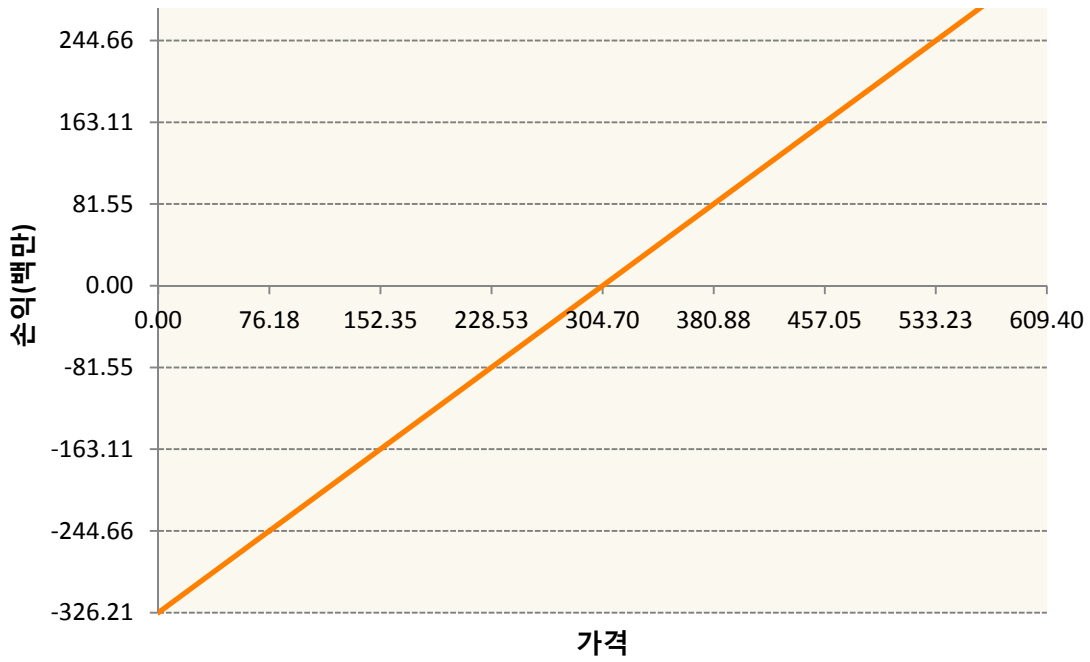


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20

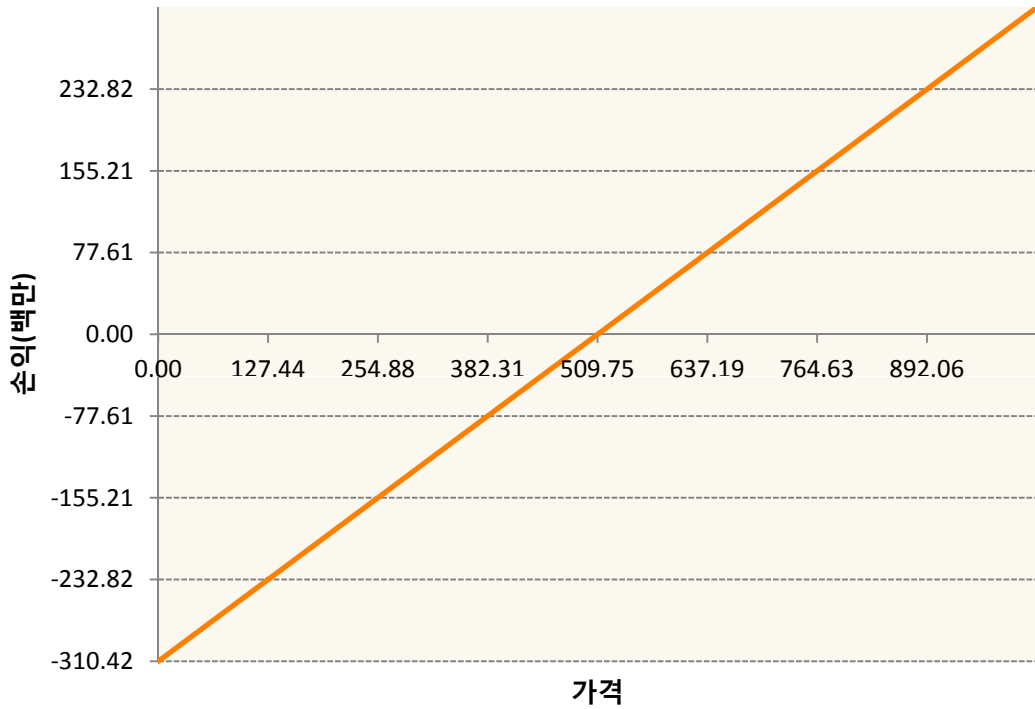


SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





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       | 47 |
| 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)

**254**