

공시일	2019-11-07
기준일	2019-11-06

## 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	2019-11-07
기준일	2019-11-06

## 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

1,212

\* 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	2019-11-07
기준일	2019-11-06

## 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)	385
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	140

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

773

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-11-07
기준일	2019-11-06

## 유로인덱스모(주식-파생형)

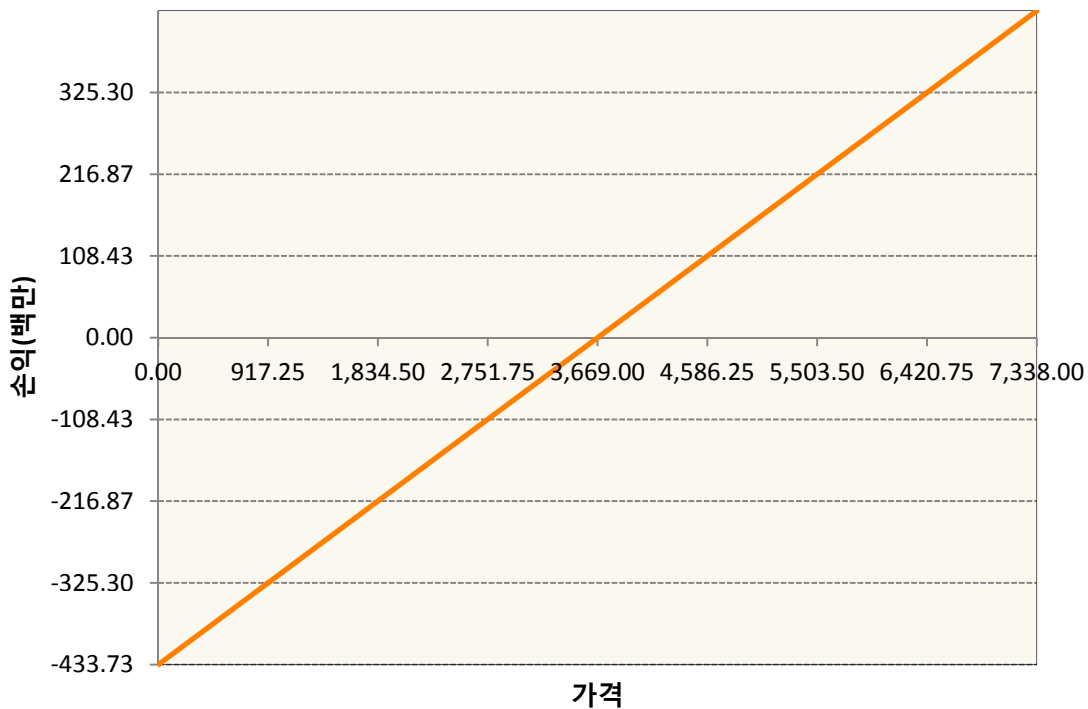
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	434	0	434	

### 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	2019-11-07
기준일	2019-11-06

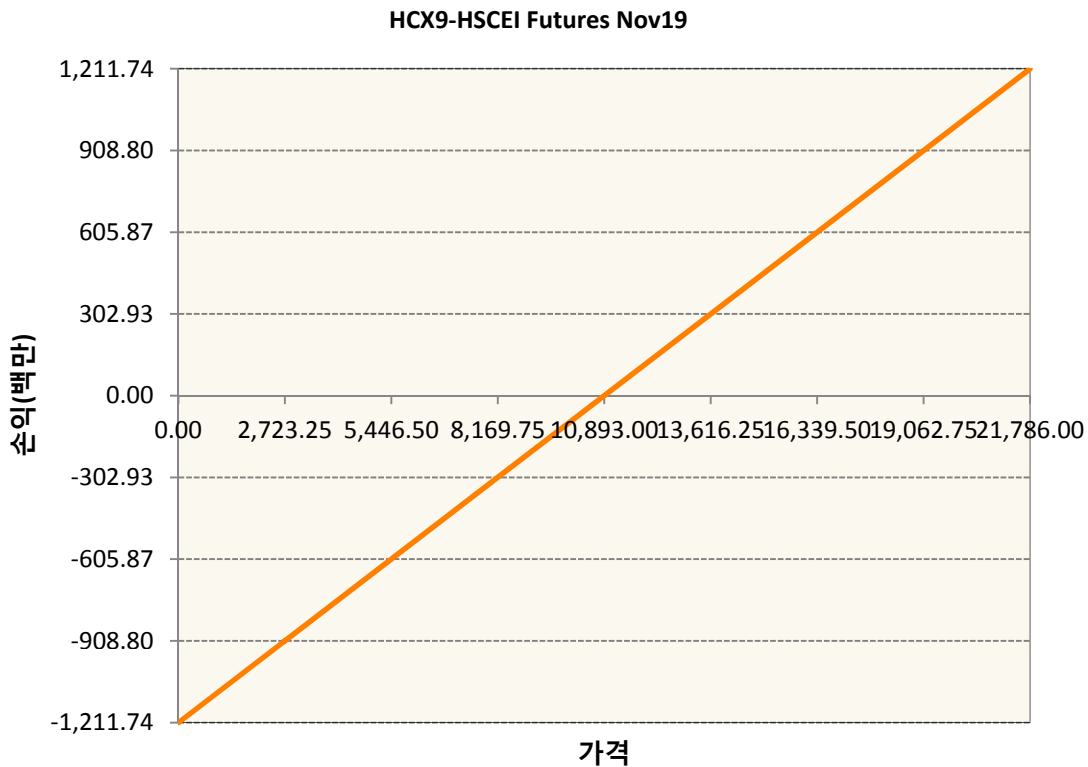
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,212	0	1,212	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HXC9	HSCEI Futures Nov19	97
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

86
----

공시일	2019-11-07
기준일	2019-11-06

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

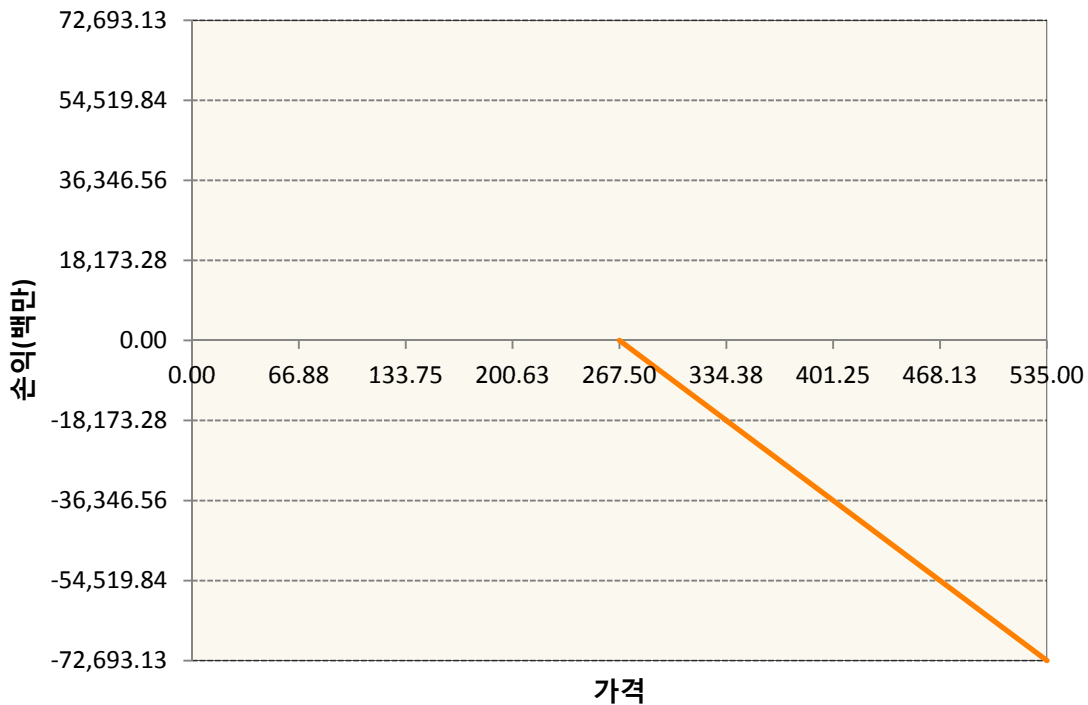
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

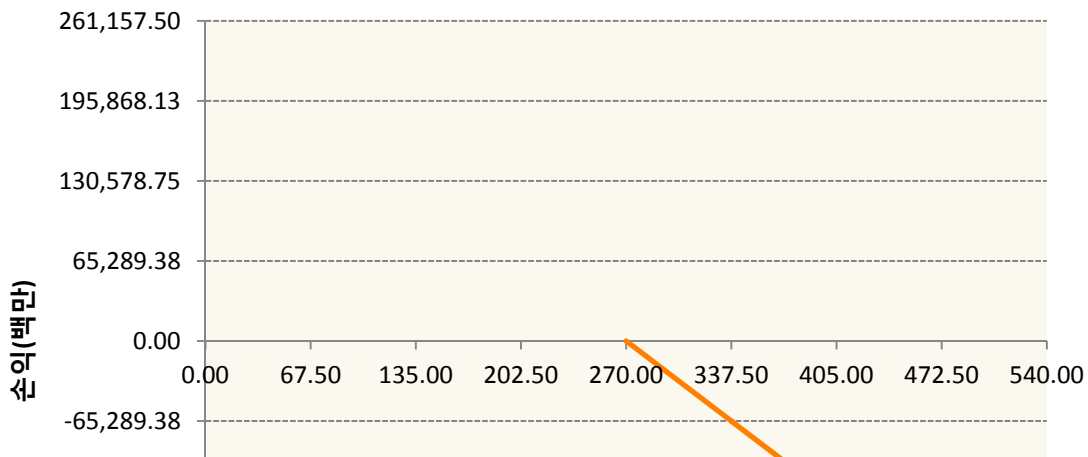
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	485,657	-485,657	장내

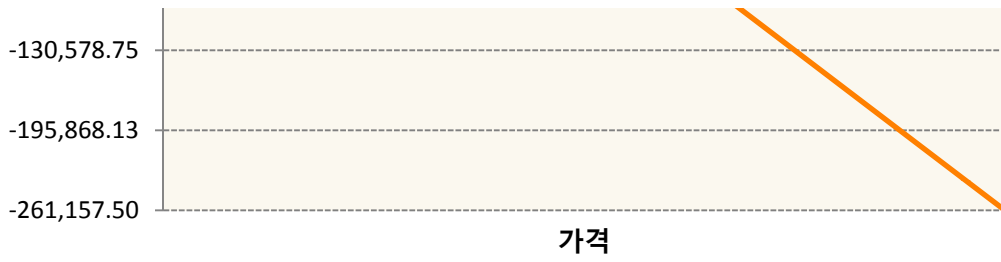
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201PB2677-2019-11 콜267.5**

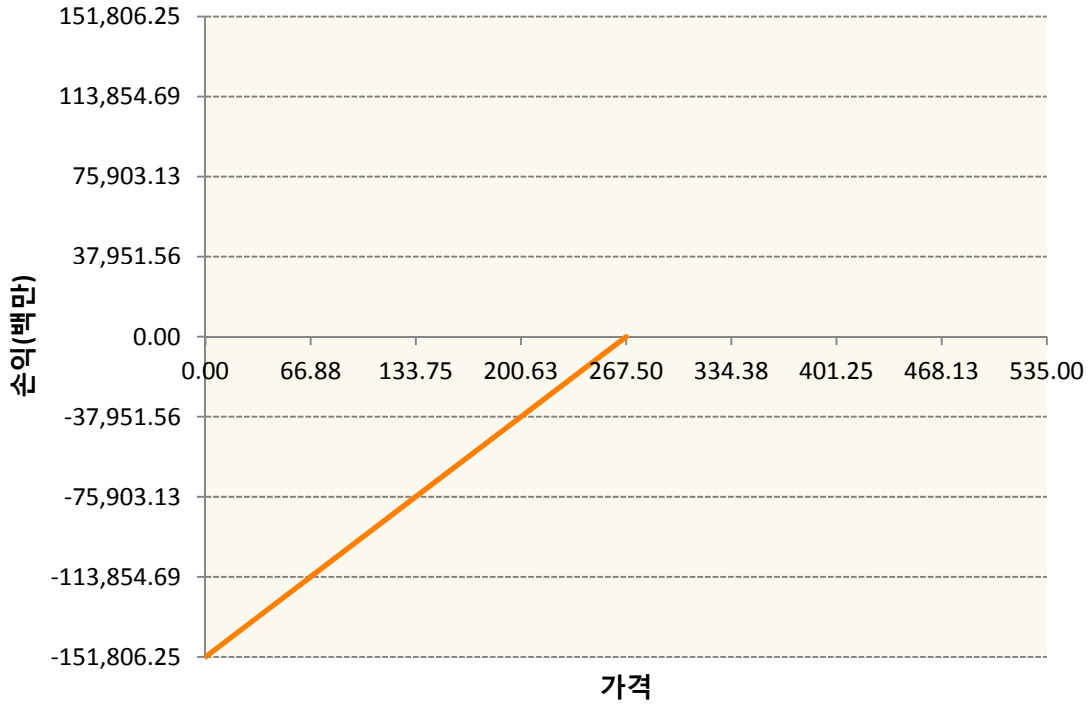


**KR4201PB2701-2019-11 콜270**





KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PB2677		2019-11 콜267.5					6,099	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4,391	4,314	4,234	4,151	4,066	3,979	3,891	
-5.33%	3,543	3,447	3,350	3,253	3,156	3,058	2,960	
-2.67%	2,002	1,945	1,883	1,815	1,744	1,668	1,590	
0%	68	52	29	0	-35	-76	-123	
2.67%	-1,975	-1,978	-1,983	-1,991	-2,003	-2,019	-2,040	
5.33%	-4,035	-4,035	-4,036	-4,037	-4,040	-4,045	-4,052	
8.00%	-6,095	-6,095	-6,095	-6,096	-6,096	-6,097	-6,099	
KR4201PB2701		2019-11 콜270					21,516	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	13,874	13,656	13,420	13,168	12,903	12,628	12,344	

-5.33%	11,657	11,306	10,954	10,603	10,251	9,899	9,547
-2.67%	6,921	6,658	6,380	6,090	5,790	5,483	5,169
0%	369	271	148	0	-170	-358	-565
2.67%	-6,834	-6,853	-6,885	-6,934	-7,000	-7,084	-7,186
5.33%	-14,156	-14,158	-14,164	-14,174	-14,192	-14,220	-14,260
8.00%	-21,491	-21,491	-21,491	-21,493	-21,497	-21,504	-21,516
KR4301PB2676                      2019-11 풋267.5							3,636
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,346	-3,380	-3,420	-3,467	-3,519	-3,575	-3,636
-5.33%	-455	-543	-632	-722	-814	-906	-999
-2.67%	-5	-13	-25	-41	-63	-90	-123
0%	1	0	0	0	-1	-3	-5
2.67%	1	1	1	1	1	0	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

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

(단위:백만원)

**30,071**

공시일	2019-11-07
기준일	2019-11-06

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

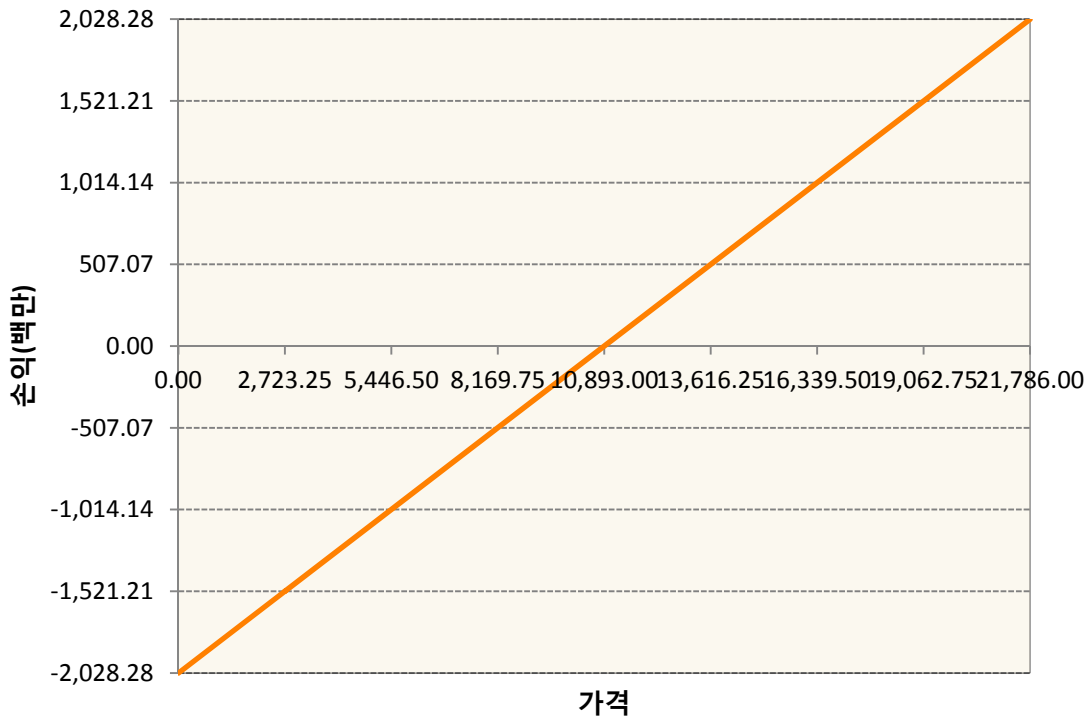
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

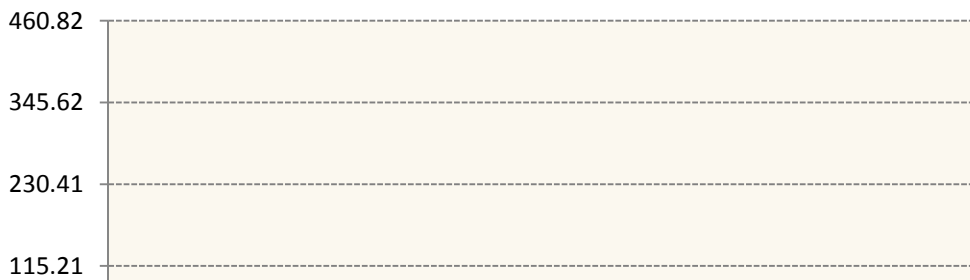
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,028	0	2,028	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,031	-5,031	장내
누계	통화	선도	665	2,744	-2,080	장외

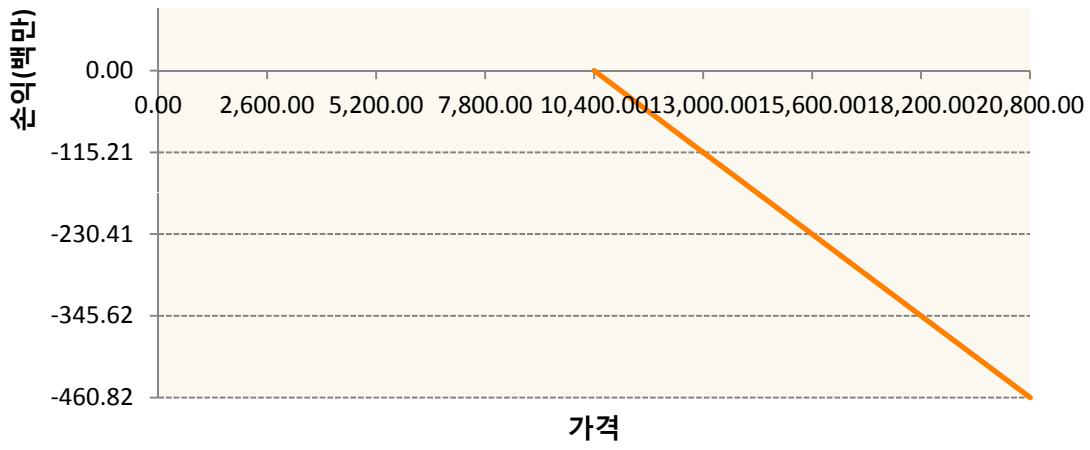
### 2. 만기시점의 손익구조

HCX9-HSCEI Futures Nov19

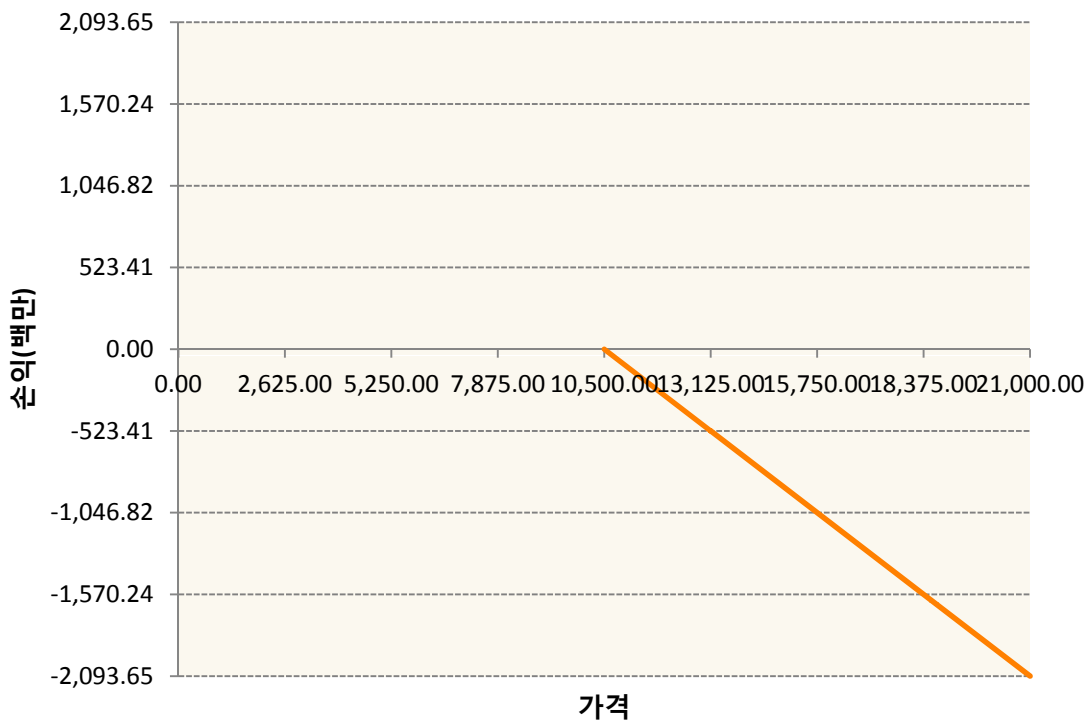


OHHIX9-C104-HSCEI

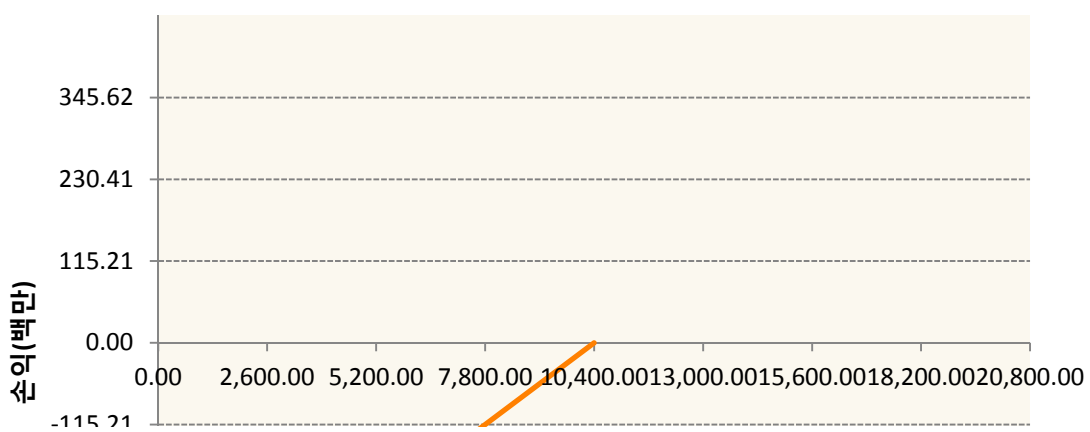


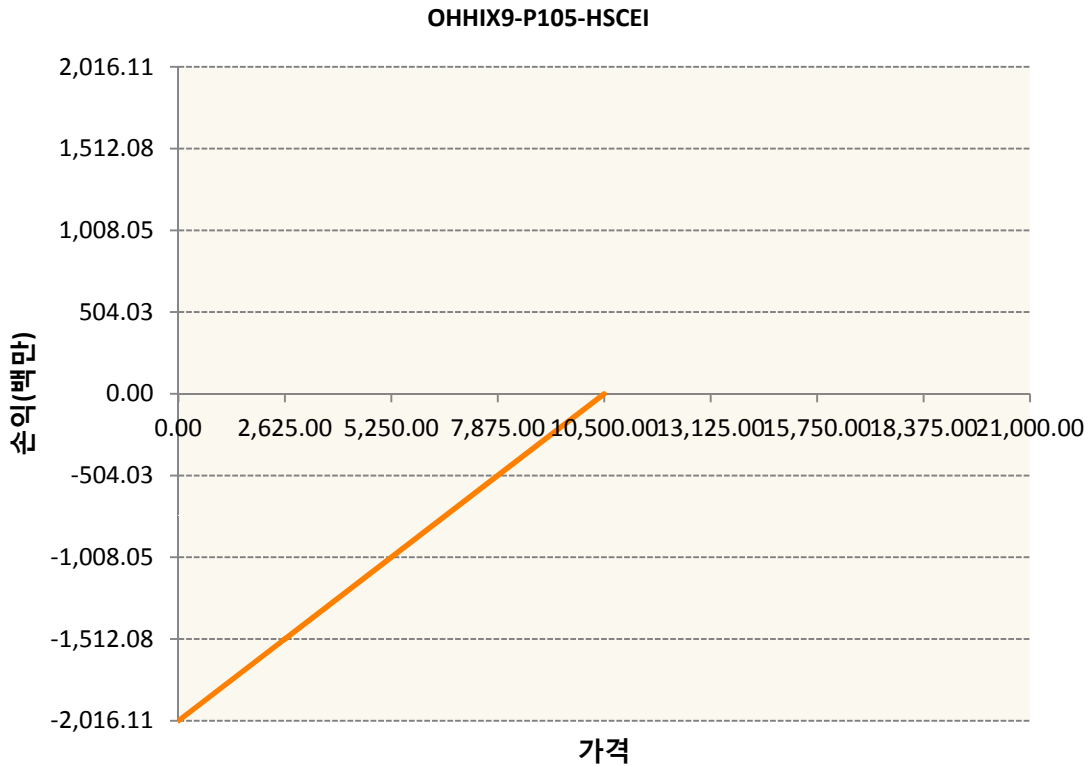


**OHHIX9-C105-HSCEI**



**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
HGX9 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)
	<b>589</b>

공시일	2019-11-07
기준일	2019-11-06

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

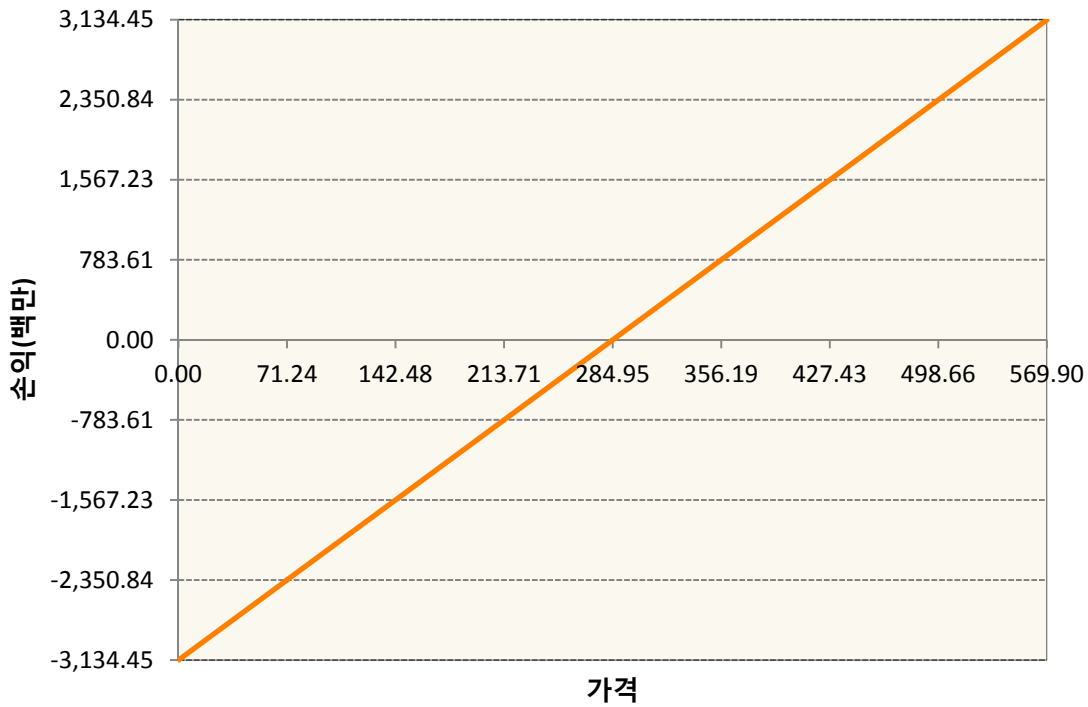
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

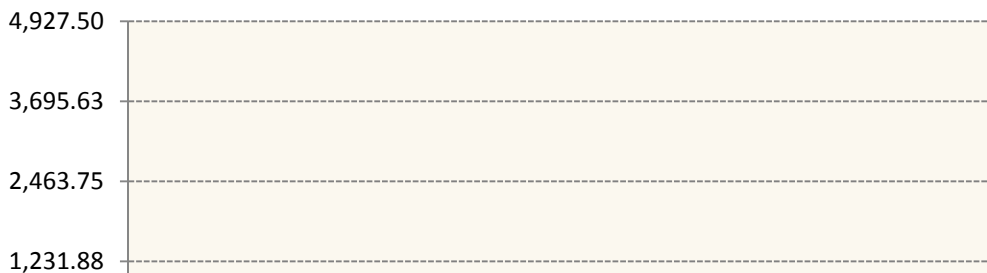
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	134	0	134	장내
누계	유가증권	선물	3,134	0	3,134	장내
누계	유가증권	스왑	10,625	0	10,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,611	-9,611	장내

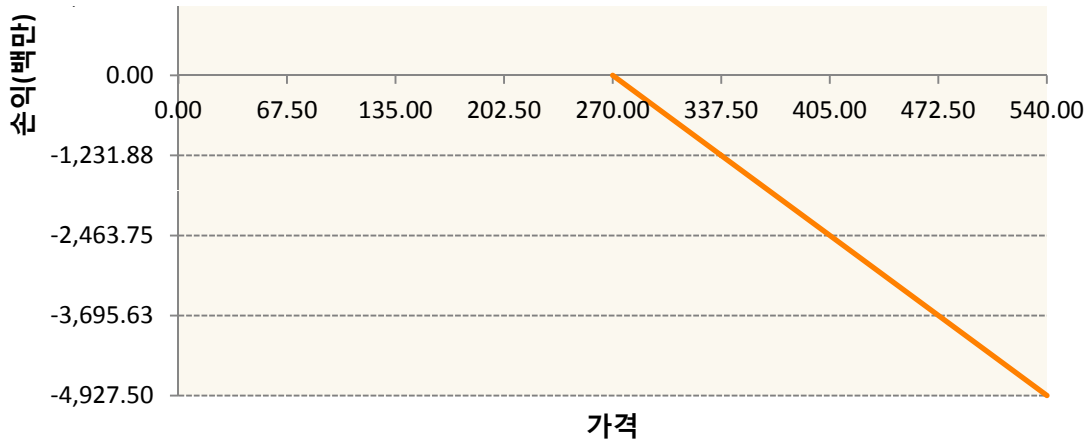
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

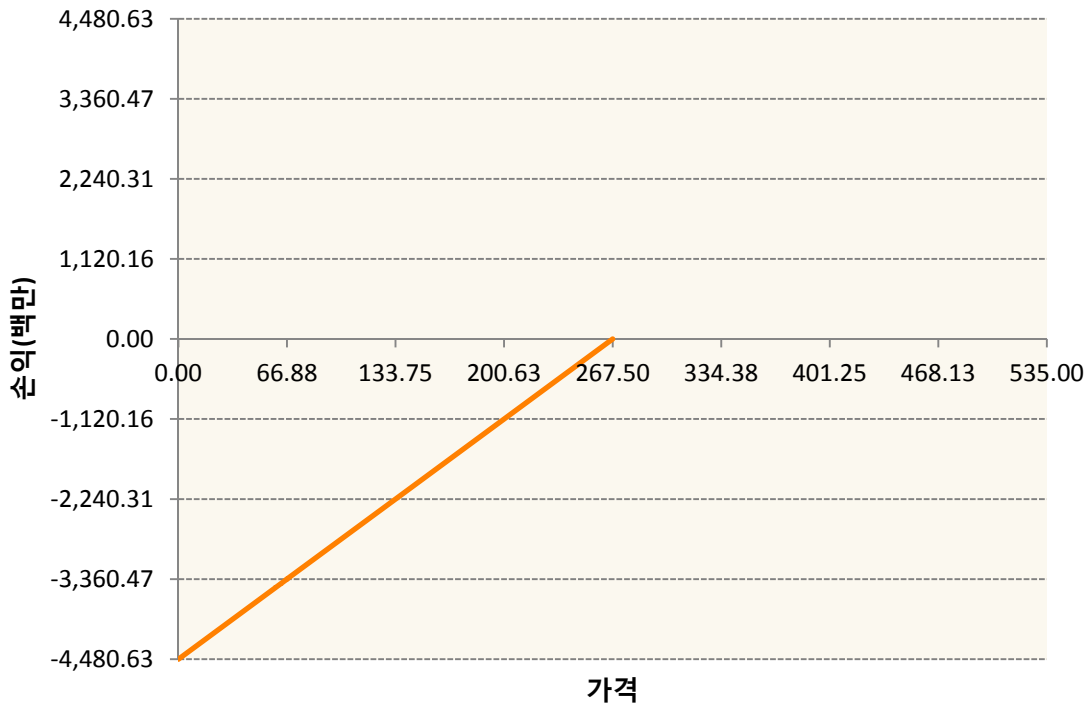


KR4201PB2701-2019-11 콜270

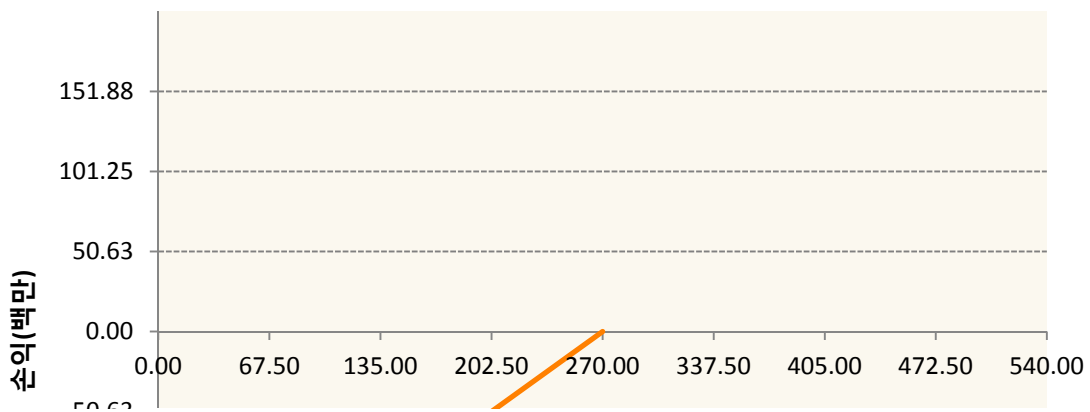




**KR4301PB2676-2019-11 풋267.5**



**KR4301PB2700-2019-11 풋270**





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						904
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-904	-904	-904	-904	-904	-904	-904	
-5.33%	-602	-602	-602	-602	-602	-602	-602	
-2.67%	-301	-301	-301	-301	-301	-301	-301	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	301	301	301	301	301	301	301	
5.33%	602	602	602	602	602	602	602	
8.00%	904	904	904	904	904	904	904	
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						406
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	262	258	253	248	243	238	233	
-5.33%	220	213	207	200	193	187	180	
-2.67%	131	126	120	115	109	103	98	
0%	7	5	3	0	-3	-7	-11	
2.67%	-129	-129	-130	-131	-132	-134	-136	
5.33%	-267	-267	-267	-267	-268	-268	-269	
8.00%	-405	-405	-405	-406	-406	-406	-406	
KR4301PB2676		2019-11 풋267.5						107
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-99	-100	-101	-102	-104	-106	-107
-5.33%	-13	-16	-19	-21	-24	-27	-29
-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
KR4301PB2700                      2019-11 풋270							6
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
-5.33%	-1	-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)

**1,555**

공시일	2019-11-07
기준일	2019-11-06

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

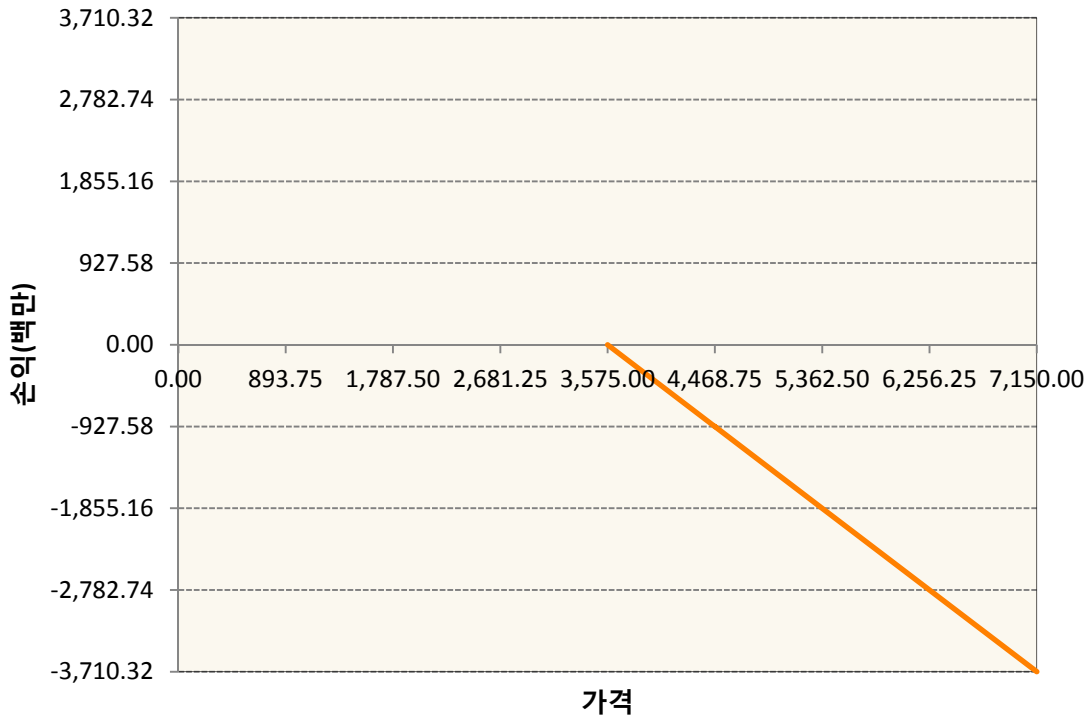
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

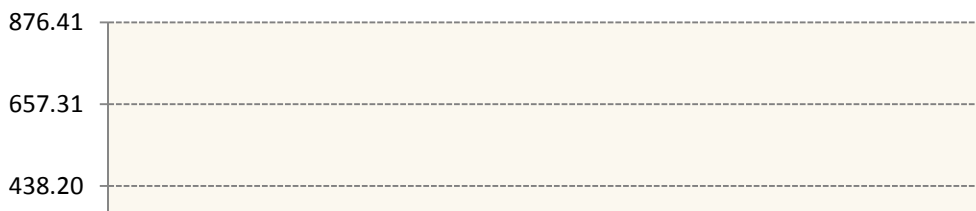
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,765	0	1,765	
누계	유가증권	스왑	20,130	0	20,130	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,173	-9,173	장내
누계	통화	선도	2,019	6,022	-4,003	장외

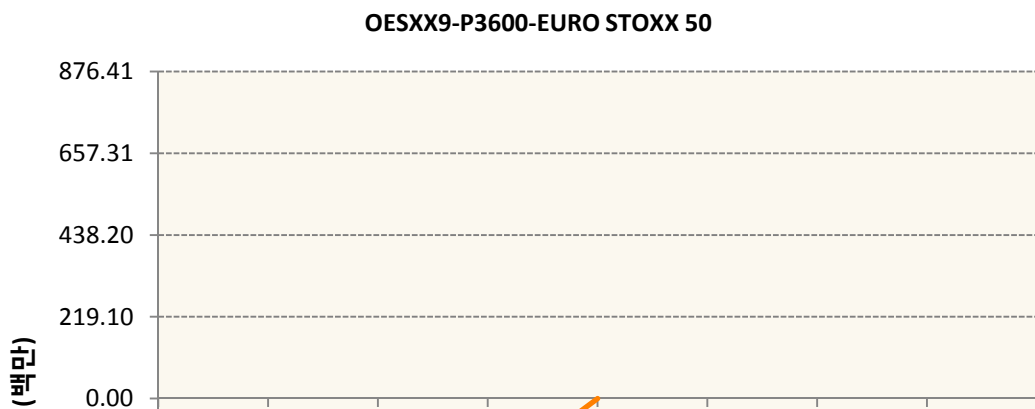
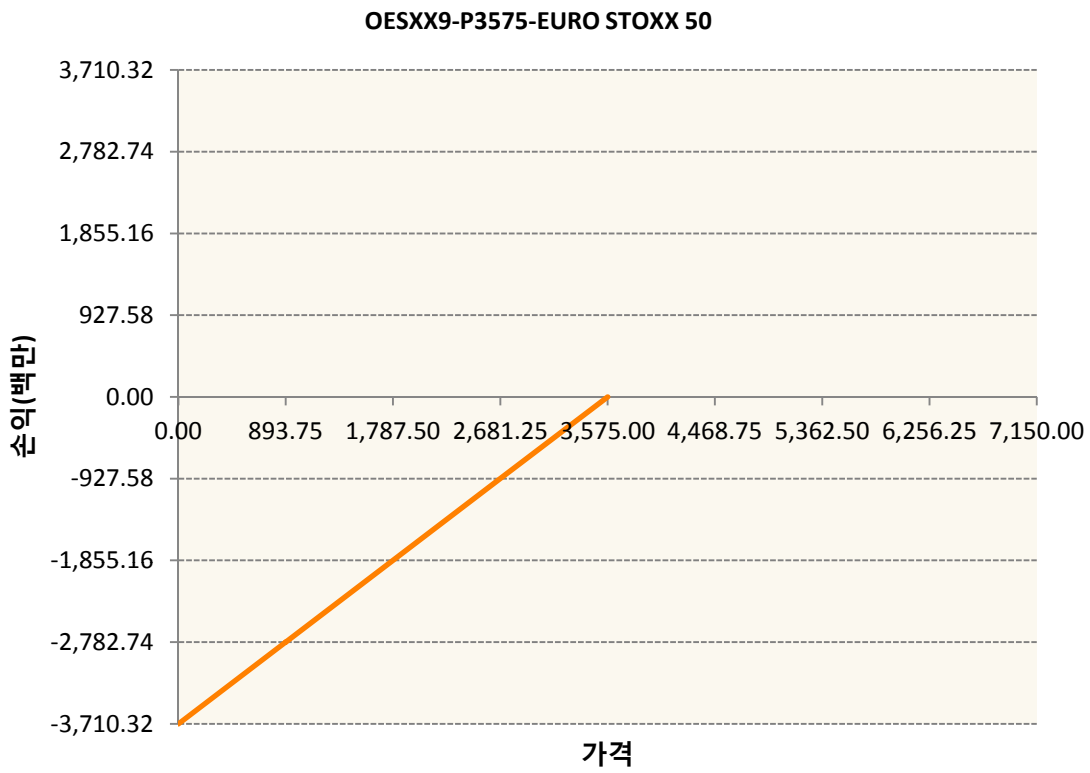
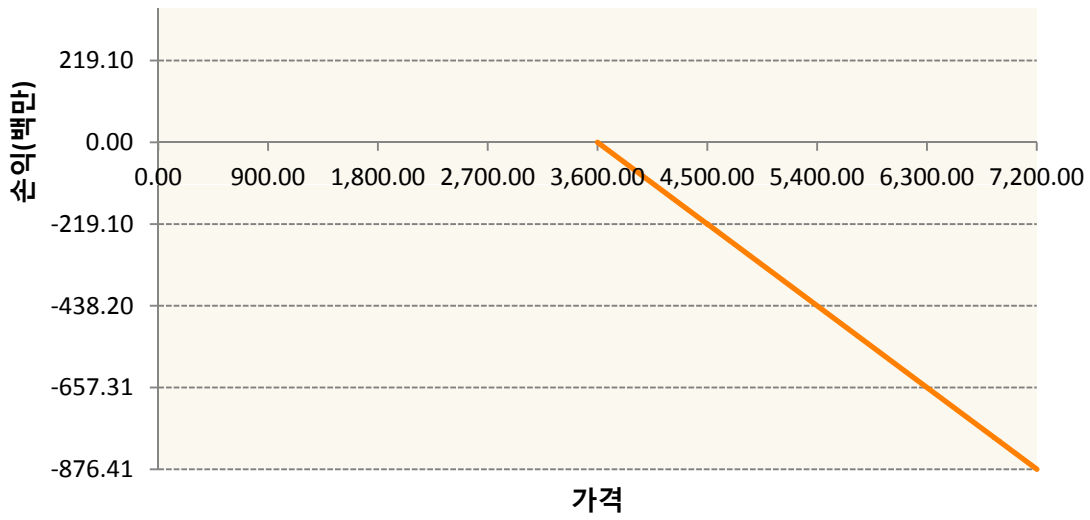
### 2. 만기시점의 손익구조

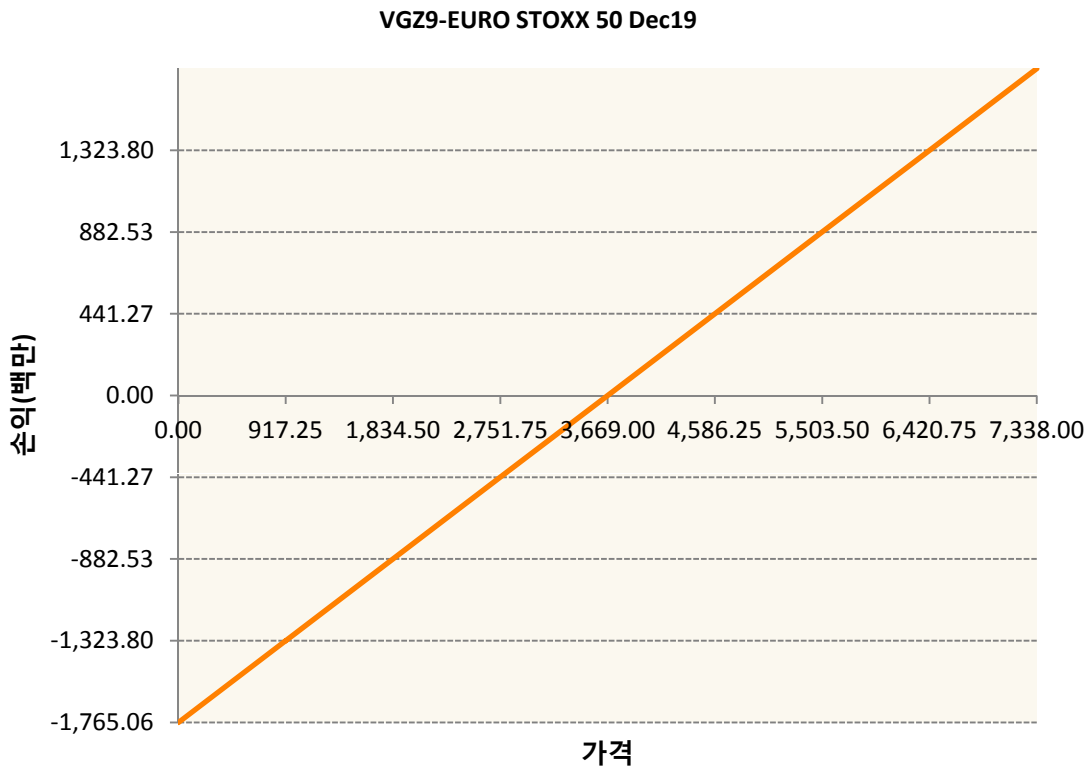
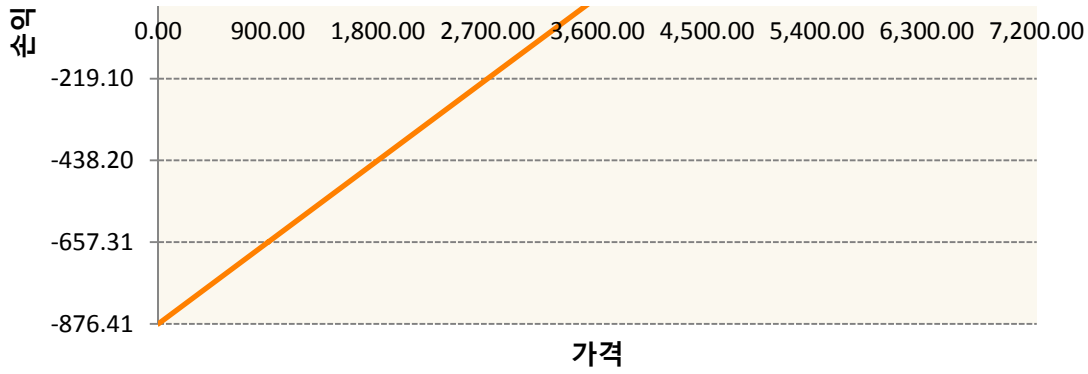
**OESXX9-C3575-EURO STOXX 50**



**OESXX9-C3600-EURO STOXX 50**







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		22
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E		482
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E		162
OESXX9-C35 EURO STOXX 50		297
OESXX9-C36 EURO STOXX 50		70
OESXX9-P35 EURO STOXX 50		297
OESXX9-P36 EURO STOXX 50		70
VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	141





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	2019-11-07
기준일	2019-11-06

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

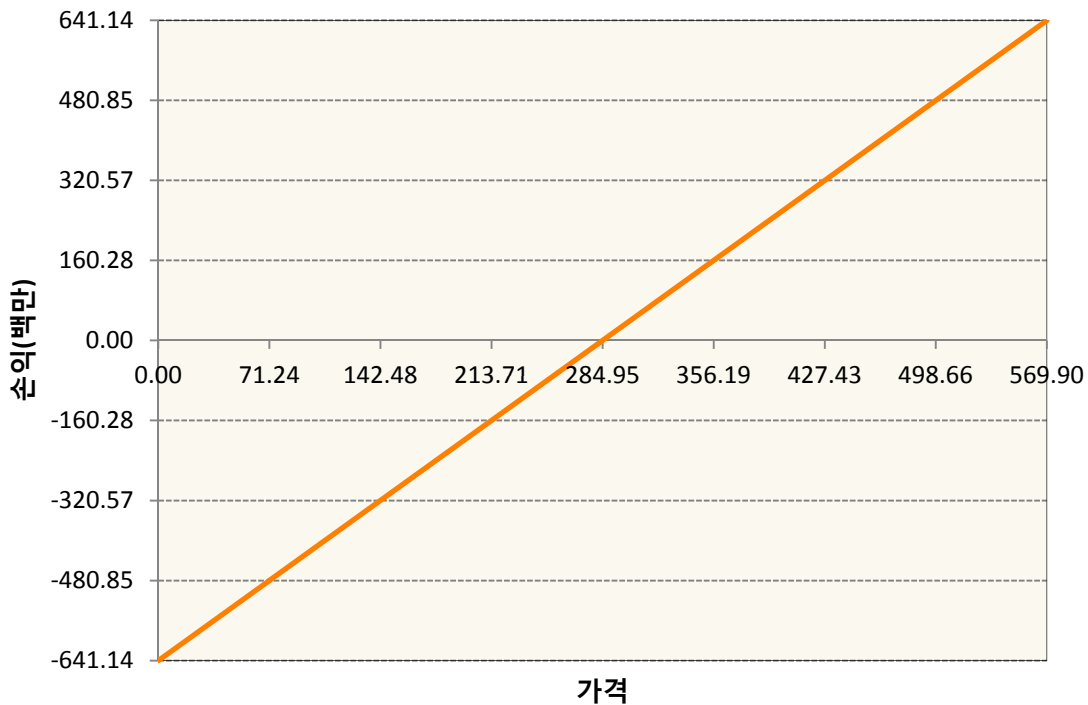
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	641	0	641	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	2019-11-07
기준일	2019-11-06

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

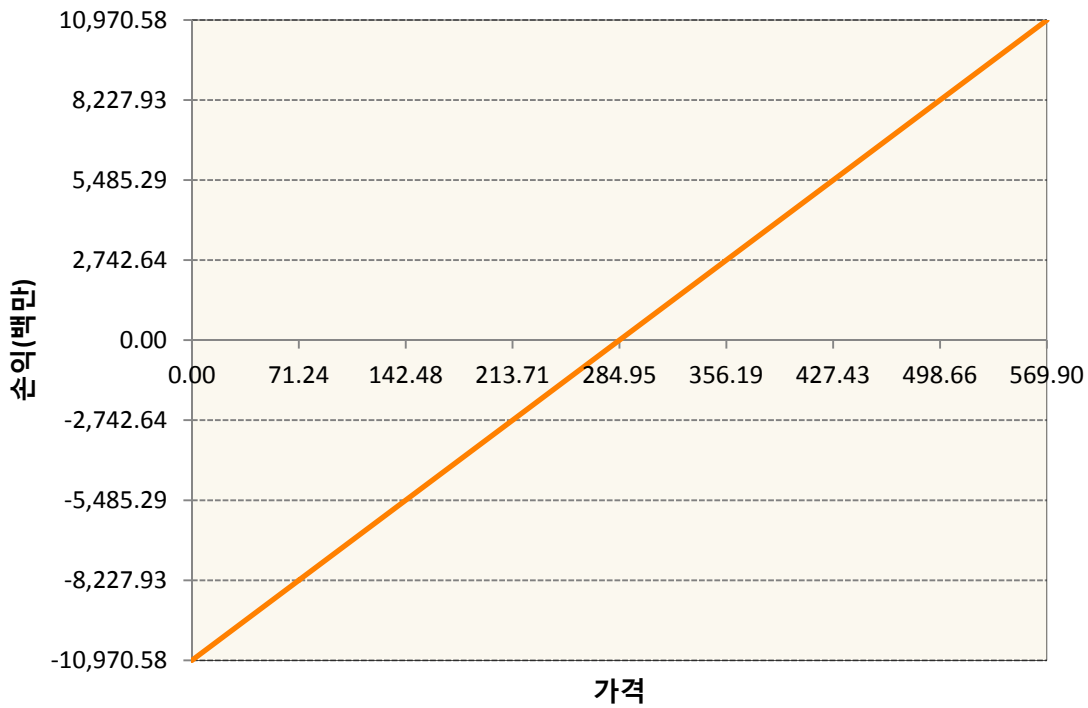
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

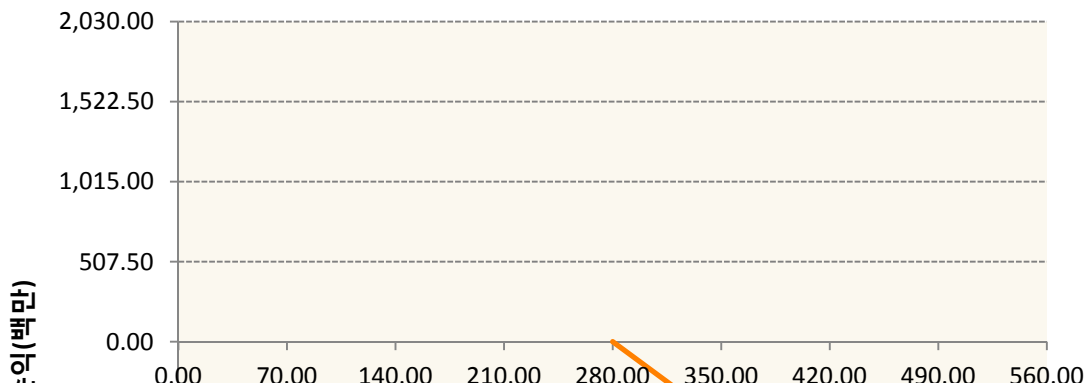
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	142	-142	장내
신규	유가증권	옵션	138	0	138	장내
누계	유가증권	선물	10,971	0	10,971	장내
누계	유가증권	옵션	3,359	20,181	-16,821	장내

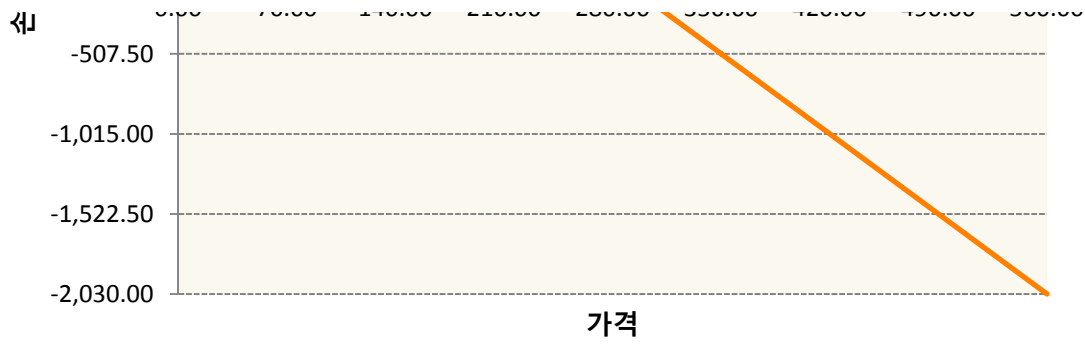
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

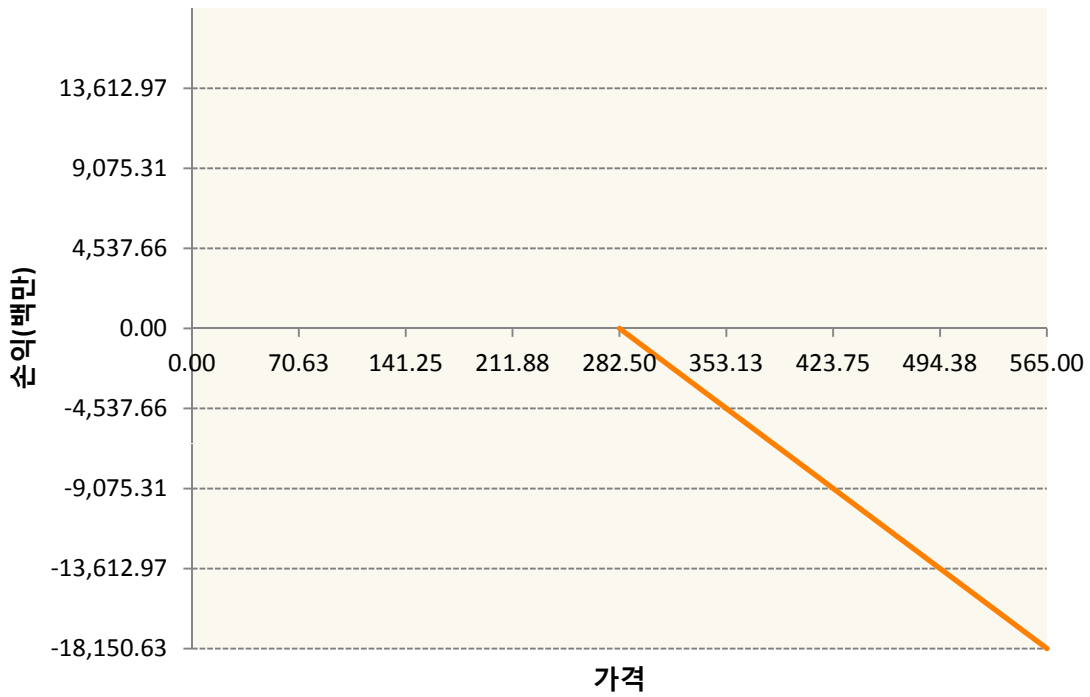


KR4201PB2800-2019-11 콜280

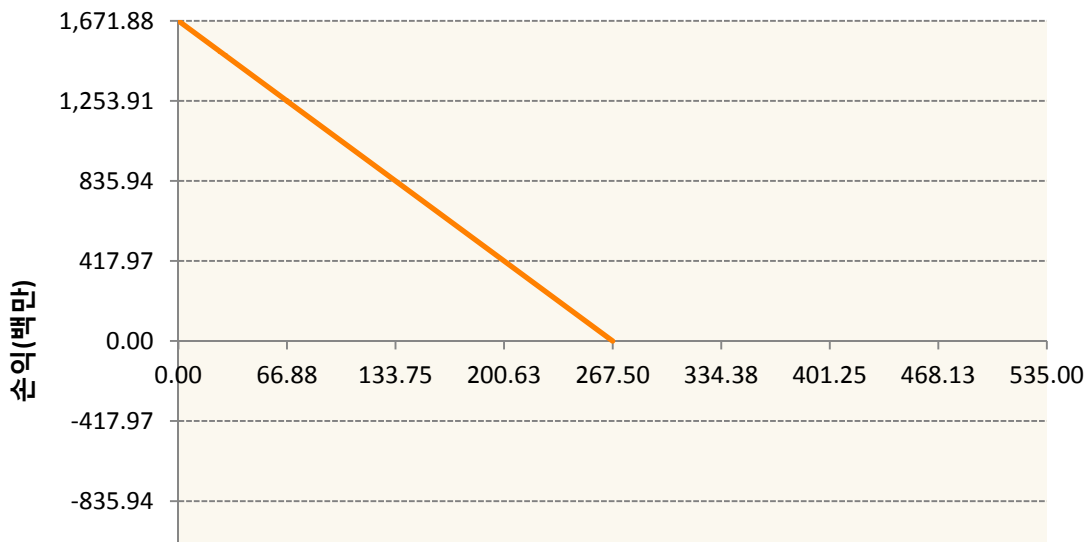


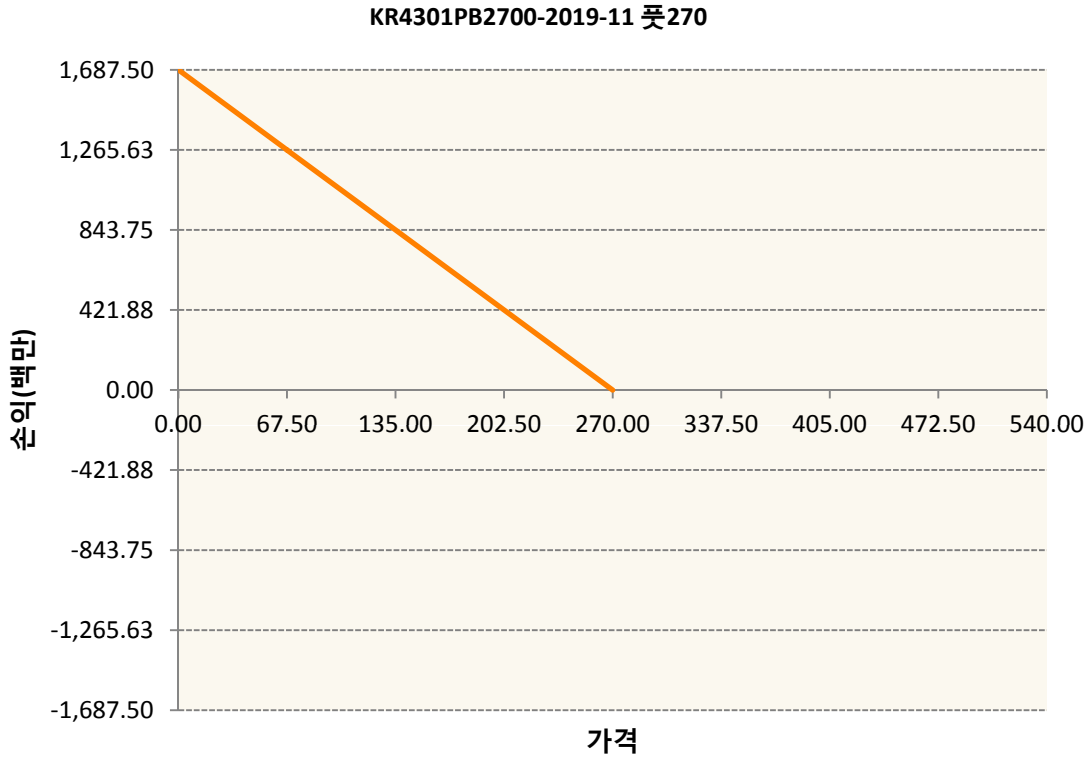
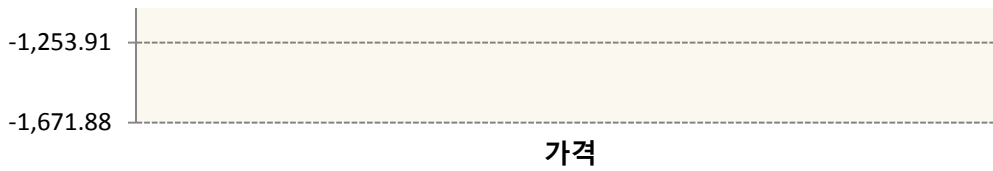


KR4201PB2826-2019-11 콜282.5



KR4301PB2676-2019-11 풋267.5





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

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						876
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-876	-876	-876	-876	-876	-876	-876	
-5.33%	-584	-584	-584	-584	-584	-584	-584	
-2.67%	-292	-292	-292	-292	-292	-292	-292	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	292	292	292	292	292	292	292	
5.33%	584	584	584	584	584	584	584	
8.00%	876	876	876	876	876	876	876	
KR4201PB2800		2019-11 콜280						147
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	52	51	51	50	49	49	48	
-5.33%	49	48	46	45	43	41	39	
-2.67%	37	34	32	29	27	24	21	

0%	8	5	3	0	-3	-5	-8
2.67%	-38	-39	-40	-42	-44	-46	-48
5.33%	-91	-91	-92	-92	-93	-94	-95
8.00%	-145	-146	-146	-146	-146	-146	-147
KR4201PB2826                      2019-11 콜282.5							1,245
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	362	360	358	354	350	344	337
-5.33%	349	341	332	320	308	294	279
-2.67%	279	259	238	217	195	173	151
0%	72	48	24	0	-24	-49	-73
2.67%	-290	-305	-321	-338	-356	-376	-395
5.33%	-744	-748	-755	-763	-772	-784	-796
8.00%	-1,226	-1,226	-1,228	-1,231	-1,234	-1,239	-1,245
KR4301PB2676                      2019-11 풋267.5							40
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	37	37	38	38	39	39	40
-5.33%	5	6	7	8	9	10	11
-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
KR4301PB2700                      2019-11 풋270							54
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	52	52	52	52	53	53	54
-5.33%	12	13	14	15	16	17	18
-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)

**2,246**

공시일	2019-11-07
기준일	2019-11-06

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	5,785	0	5,785	
누계	유가증권	수익증권	183,255	0	183,255	

### 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	2019-11-07
기준일	2019-11-06

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,735	0	1,735	
누계	유가증권	수익증권	210,085	0	210,085	

### 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	2019-11-07
기준일	2019-11-06

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	5,785	0	5,785	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	526,409	0	526,409	
누계	통화	선도	0	526,505	-526,505	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		1,851
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E		1,944
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E		926
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		648
FX21019V00 KRW/USD 12-11-19E		1,518
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		685
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,666
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		2,443
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		463
FX21019V02 KRW/USD 21-11-19E		5,035
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,720
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,388
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,777
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,490
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,814
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		926
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		926
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,851
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,851
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)

**13,541**

공시일	2019-11-07
기준일	2019-11-06

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

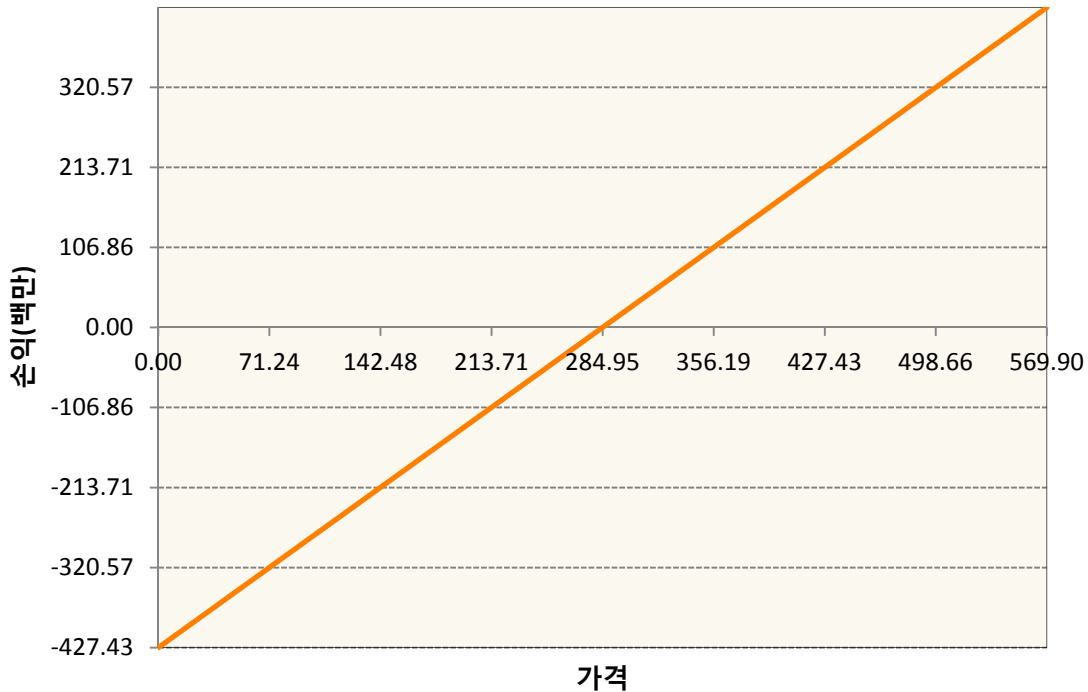
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

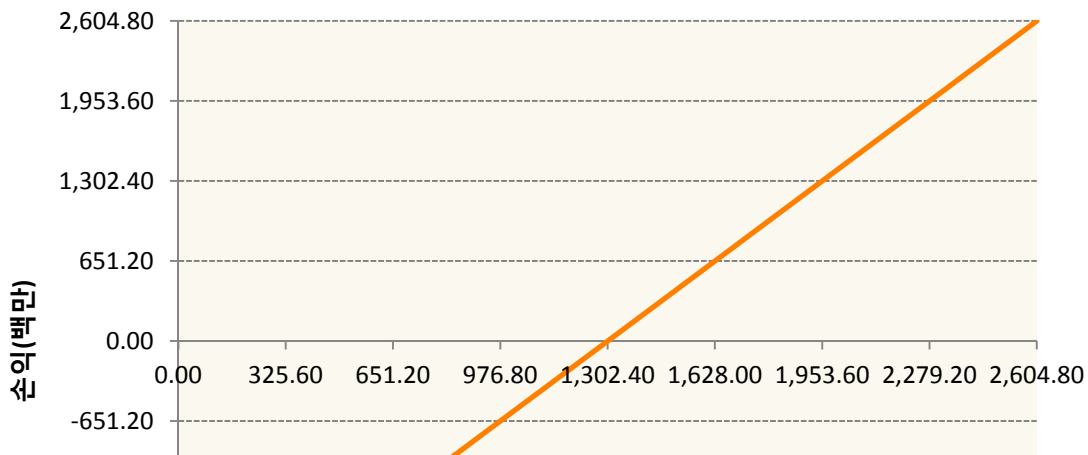
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,822	0	4,822	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



KR4108PC0005-2019-12 KRX300 선물





-5.33%	-139	-139	-139	-139	-139	-139	-139
-2.67%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	69	69	69	69	69	69	69
5.33%	139	139	139	139	139	139	139
8.00%	208	208	208	208	208	208	208
KR4111PB0001 2019-11 삼성전자개별선물							143
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-143	-143	-143	-143	-143	-143	-143
-5.33%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-95
-2.67%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	48	48	48	48	48	48	48
5.33%	95	95	95	95	95	95	95
8.00%	143	143	143	143	143	143	143

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

(단위:백만원)

355

공시일	2019-11-07
기준일	2019-11-06

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

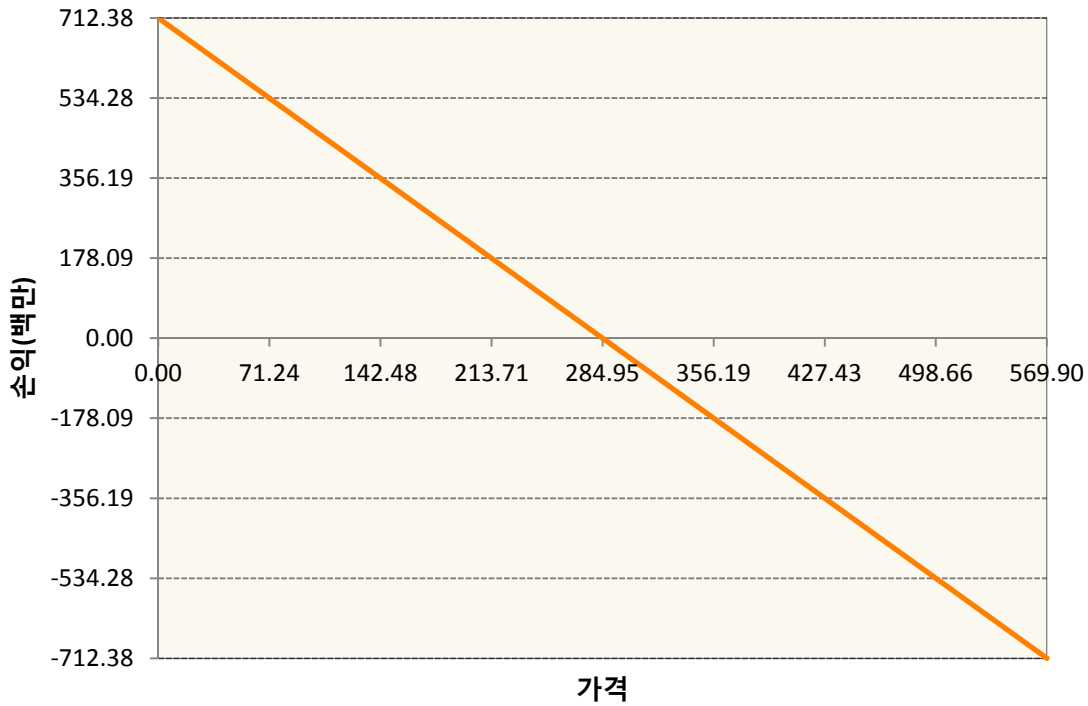
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

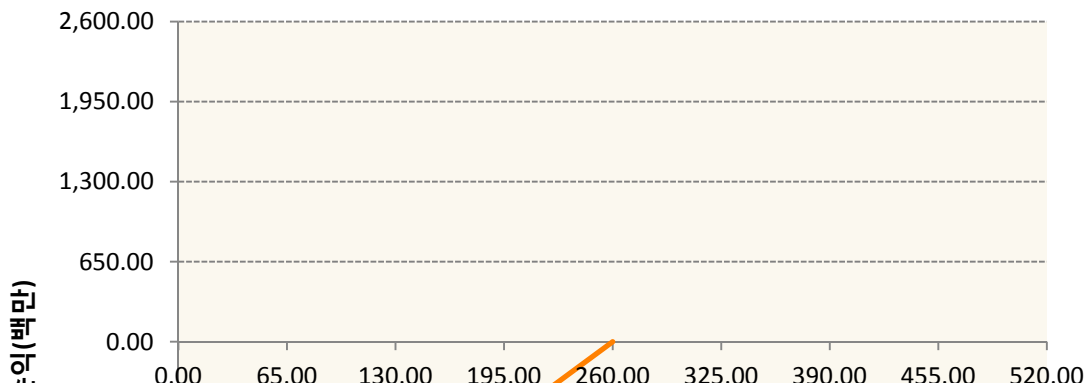
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	712	-712	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,650	-3,650	장내

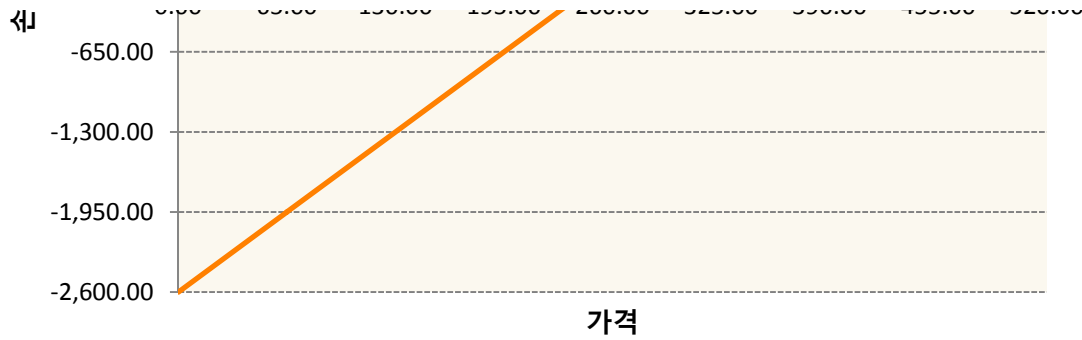
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

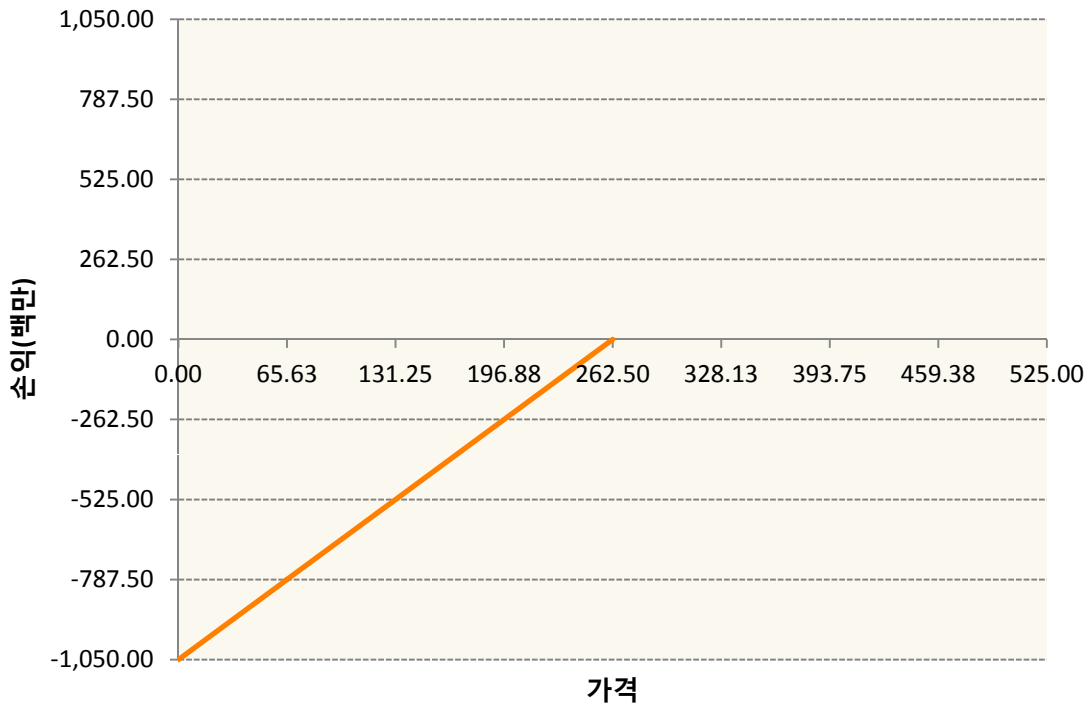


KR4301PB2601-2019-11 풋260





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						17
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8	-9	-11	-13	-14	-16	-17
-5.33%	0	0	0	-1	-1	-1	-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	-8	-9	-10	-10	-11	-12
-5.33%	0	0	-1	-1	-1	-1	-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	2019-11-07
기준일	2019-11-06

## 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	15,582	0	15,582	
누계	통화	선도	636	15,919	-15,283	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	2019-11-07
기준일	2019-11-06

## 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	680	0	680	장외
누계	통화	선도	199	346	-147	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
FX21019X00 KRW/EUR 31-01-20E	6

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

(단위:백만원)

<b>61</b>
-----------

공시일	2019-11-07
기준일	2019-11-06

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

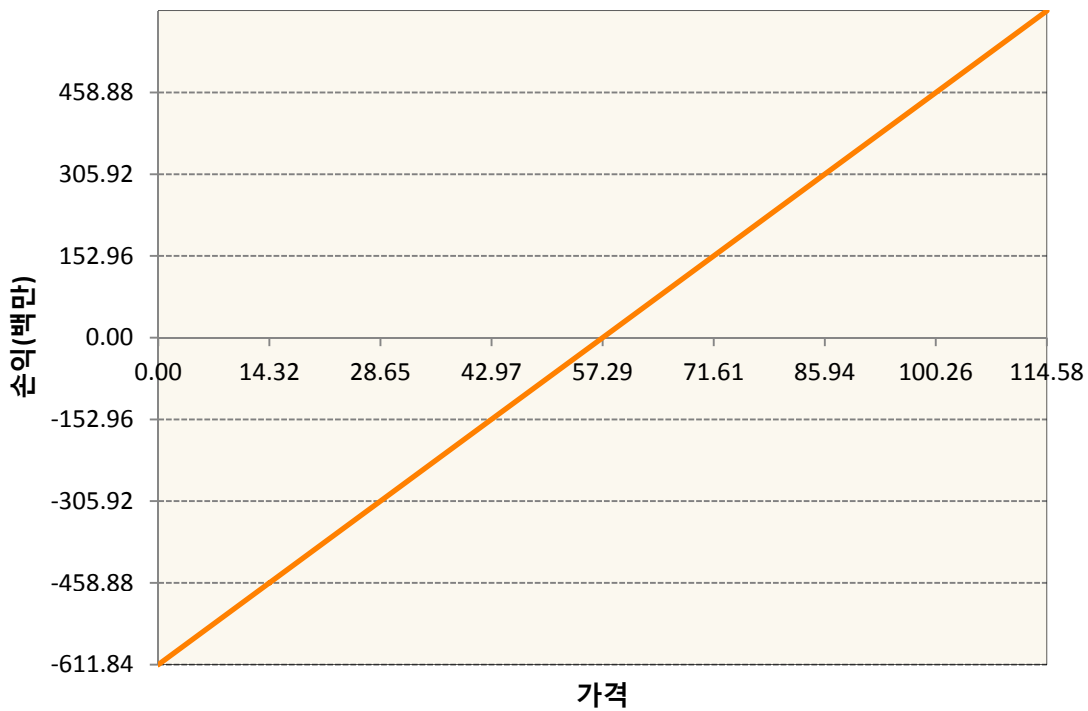
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

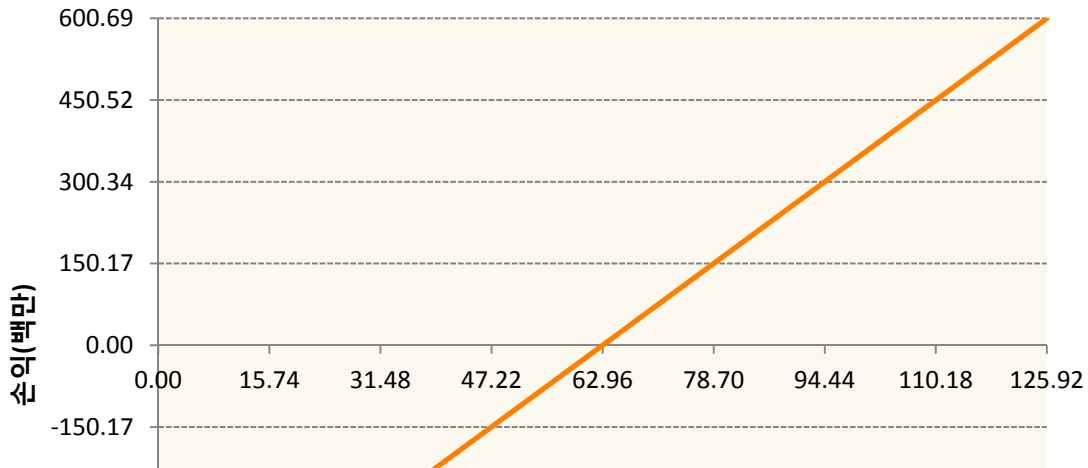
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,595	290	2,305	

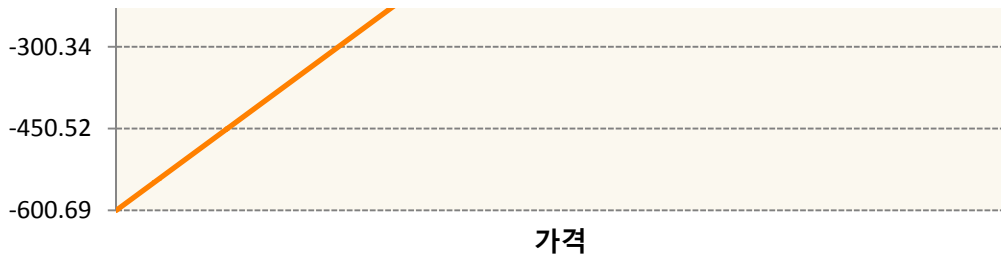
### 2. 만기시점의 손익구조

CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20

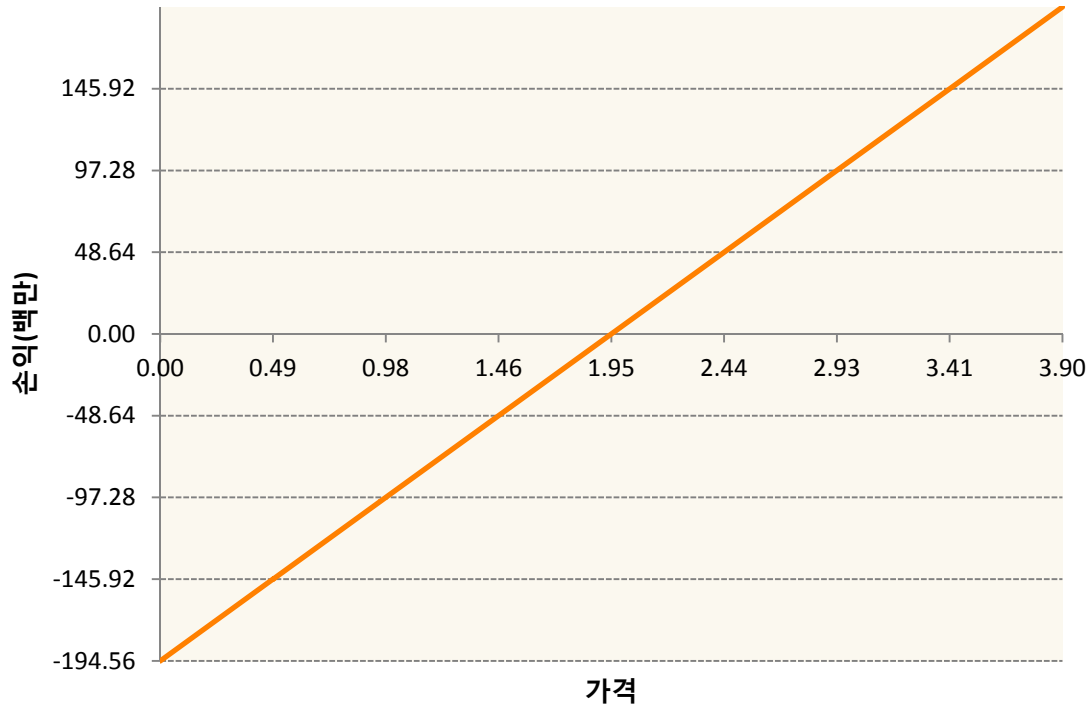


COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20

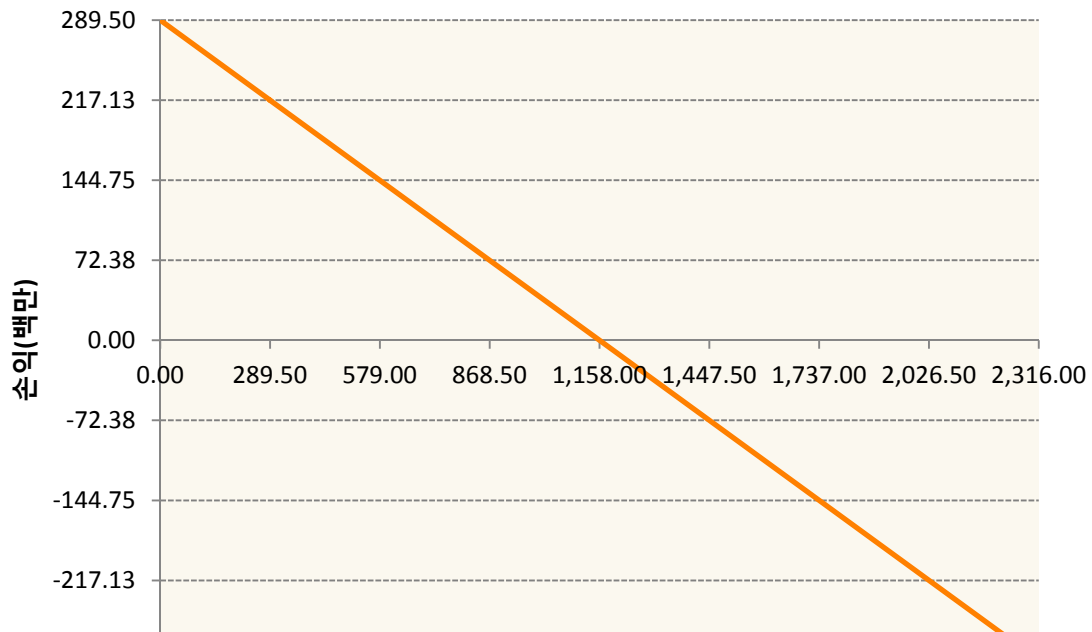


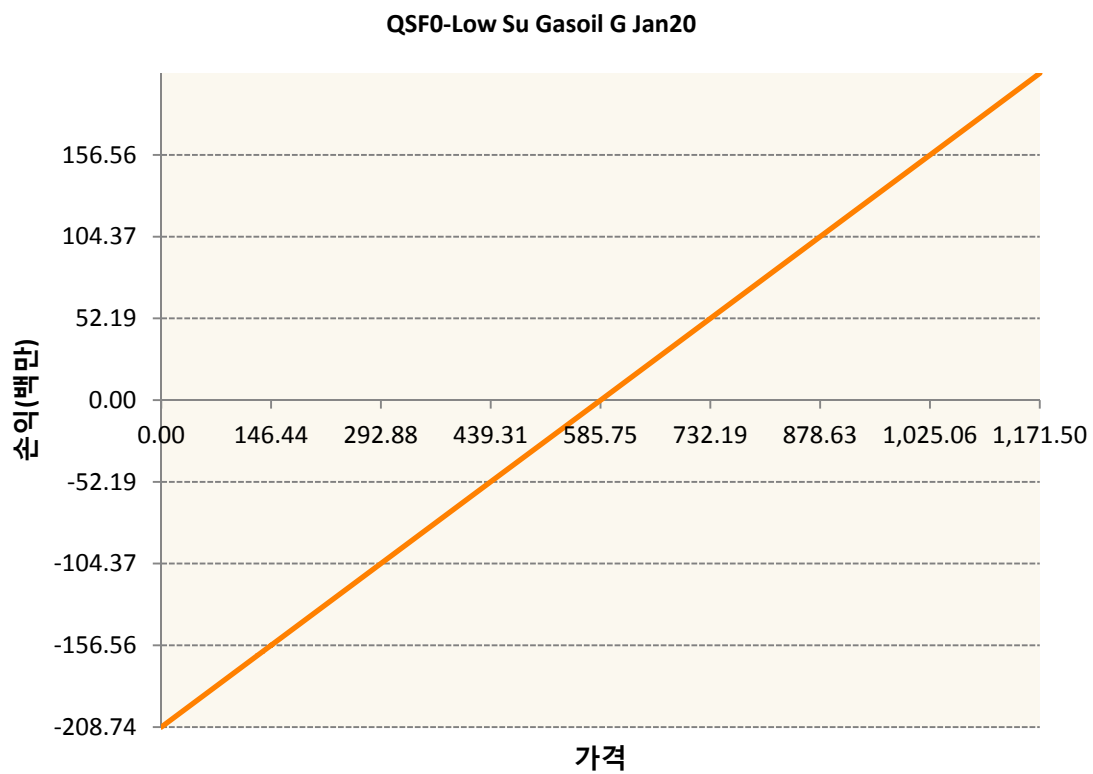
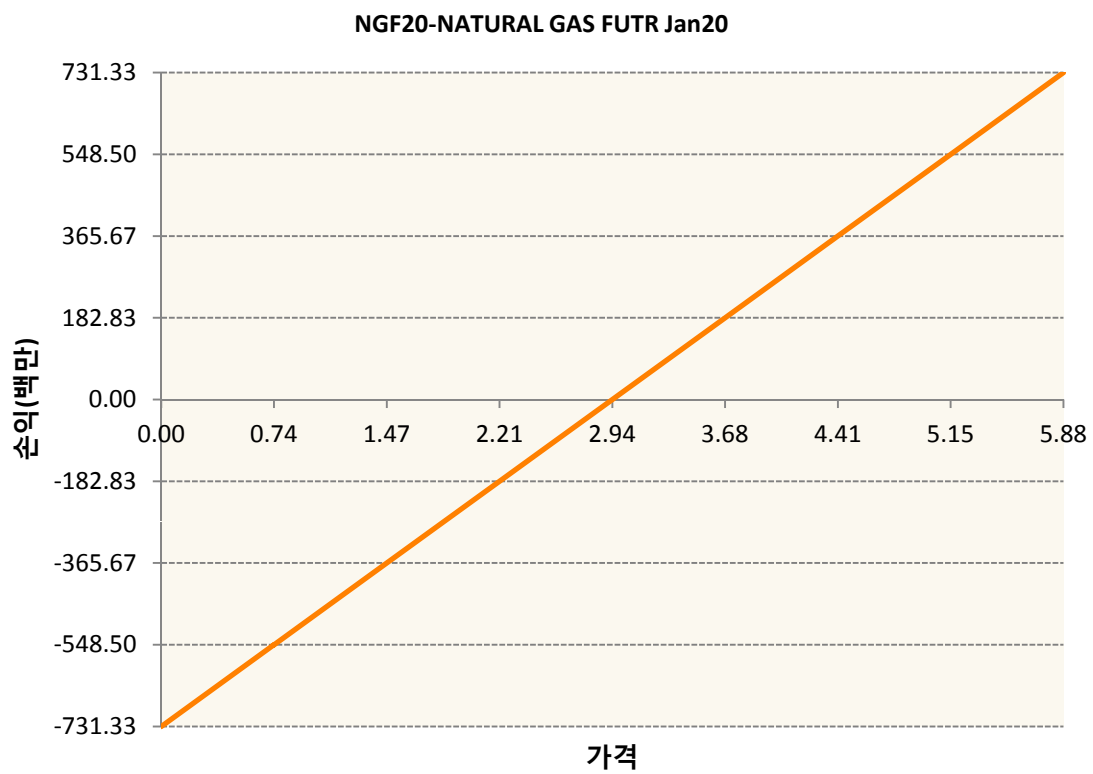
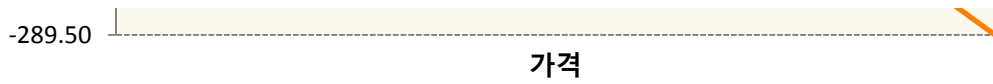


HOF0-NY Harb ULSD Fut Jan20

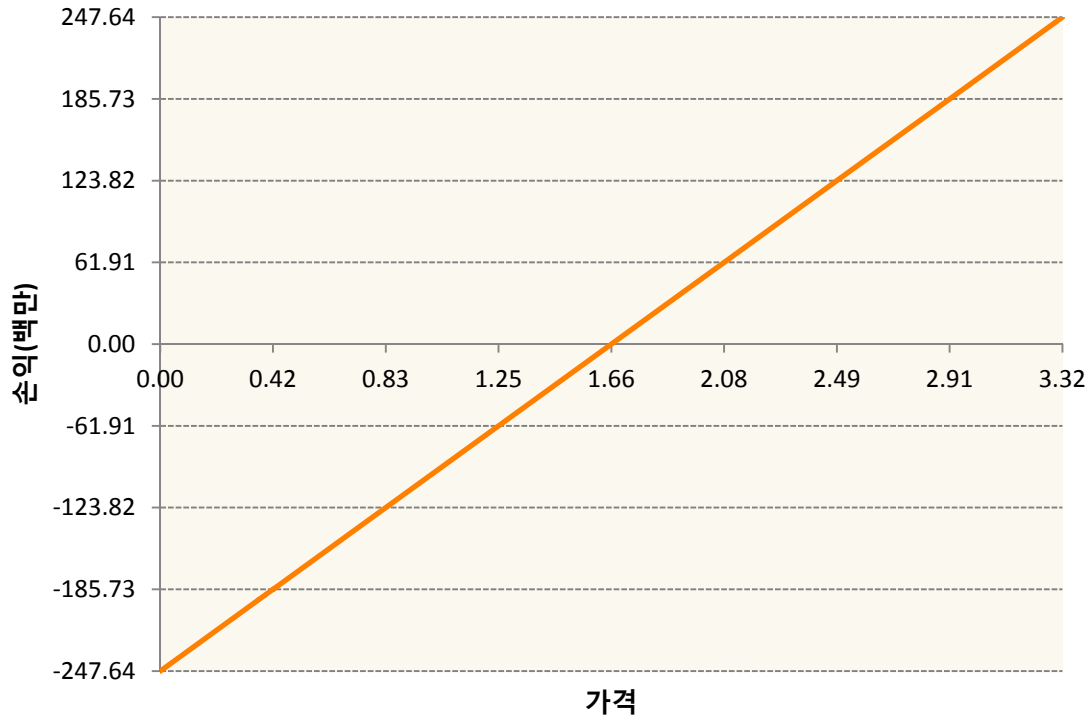


KR4175PB0004-2019-11 달러선물





XBF0-GASOLINE RBOB FUT Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLF0	WTI CRUDE FUTURE Jan20	49
COF0	BRENT CRUDE FUTR Jan20	48
HOF0	NY Harb ULSD Fut Jan20	16
KR4175PB00	2019-11 달러선물	23
NGF20	NATURAL GAS FUTR Jan20	59
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	17
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	20

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

(단위:백만원)

435

공시일	2019-11-07
기준일	2019-11-06

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

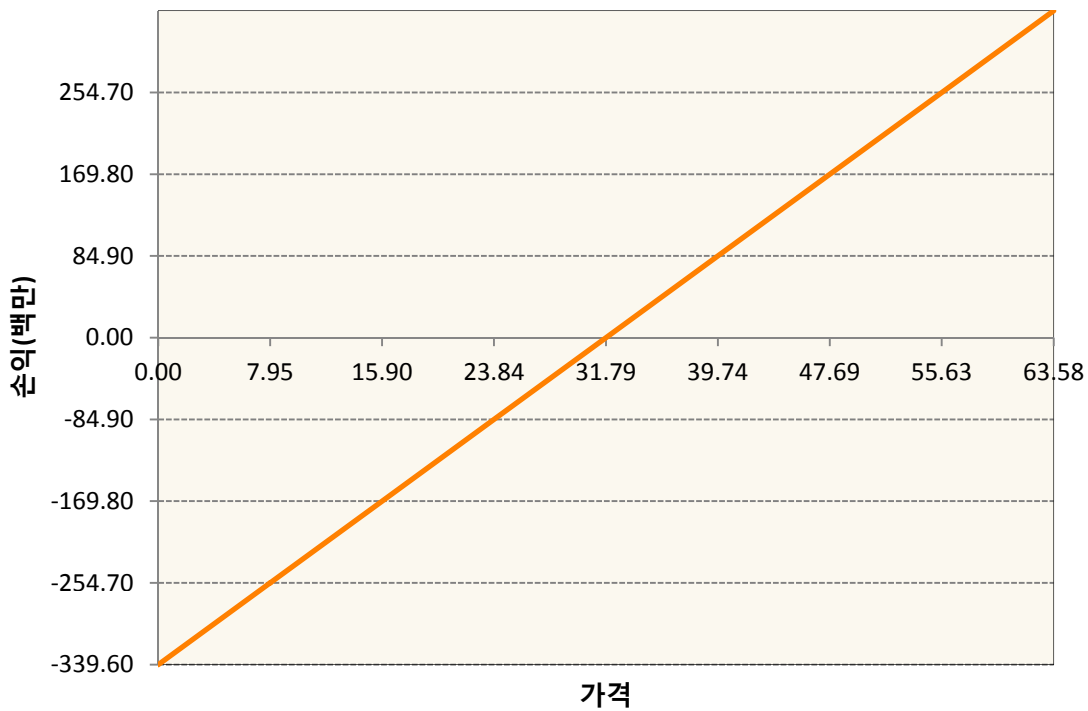
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

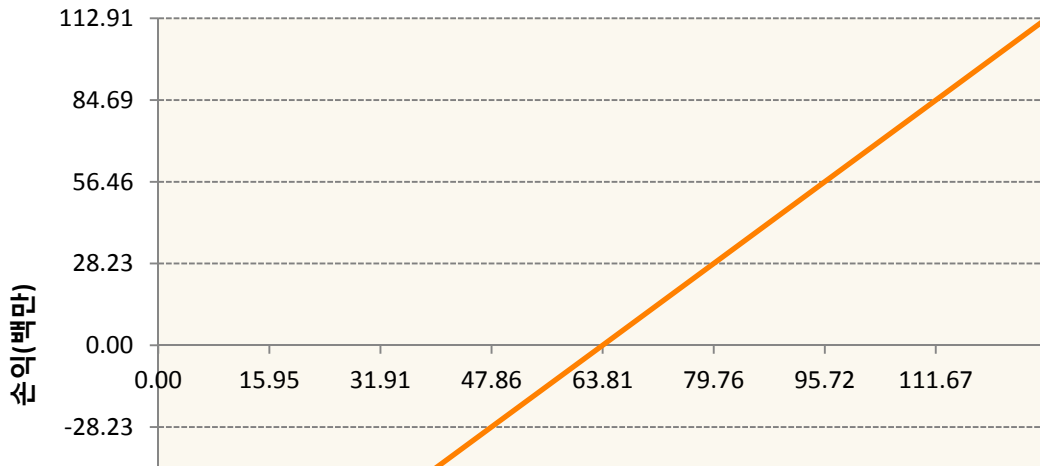
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,883	93	2,790	

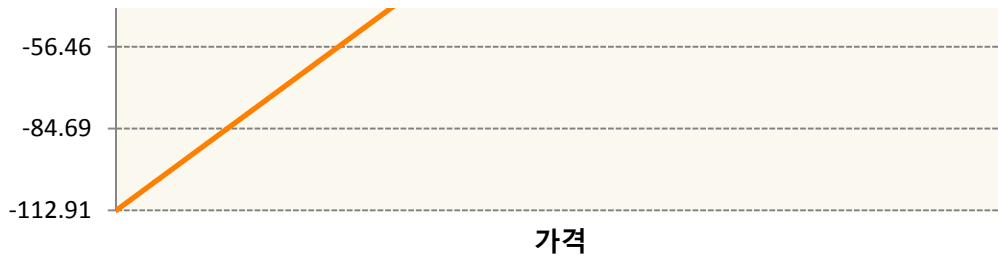
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20**

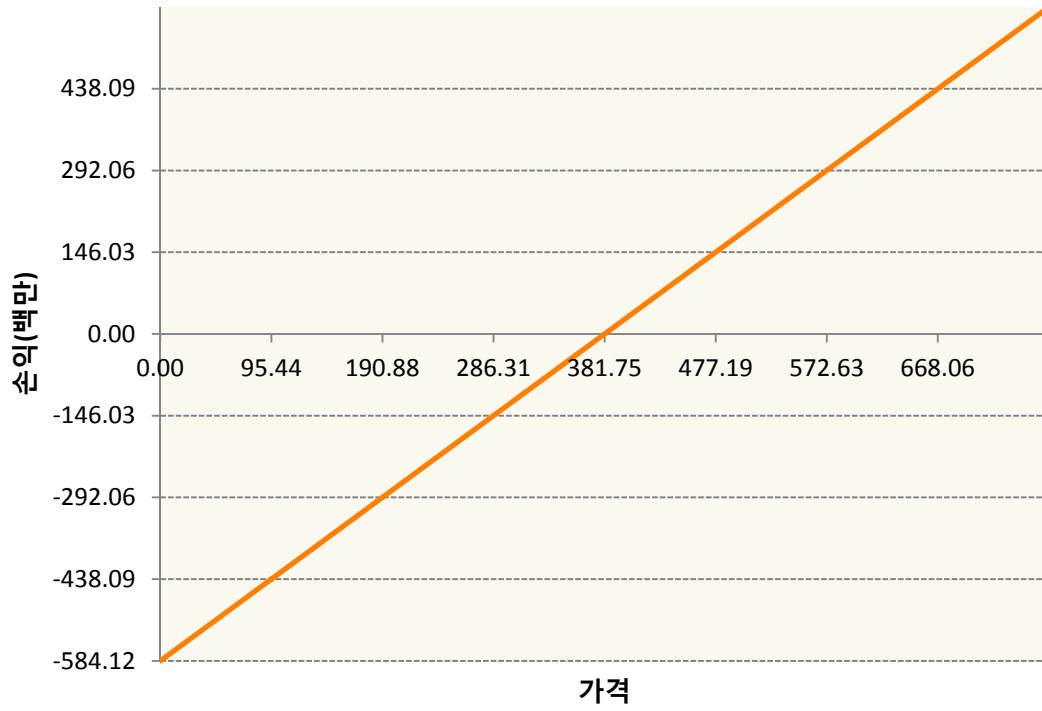


**CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19**

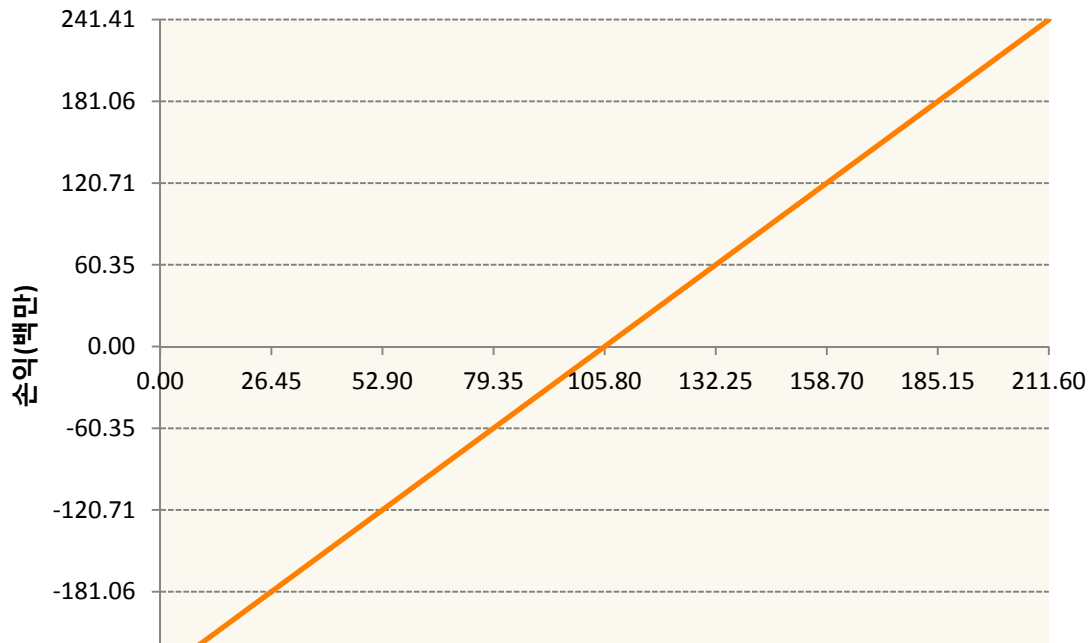


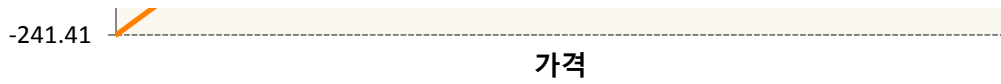


**CZ9-CORN FUTURE Dec19**

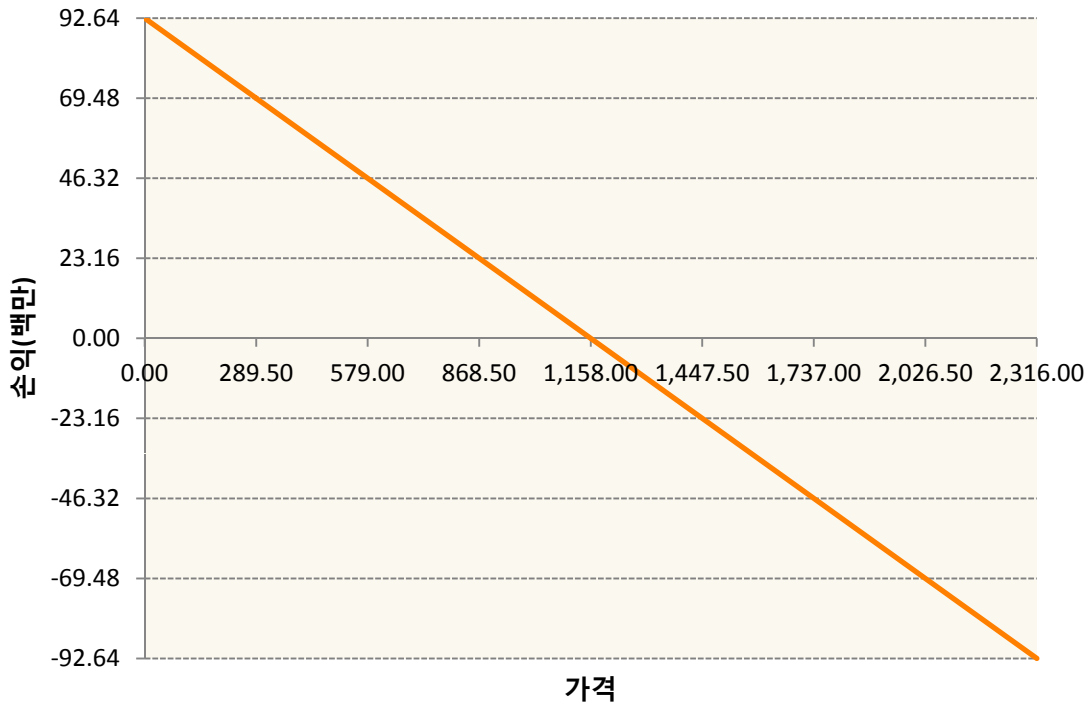


**KCZ9-COFFEE 'C' FUTURE Dec19**

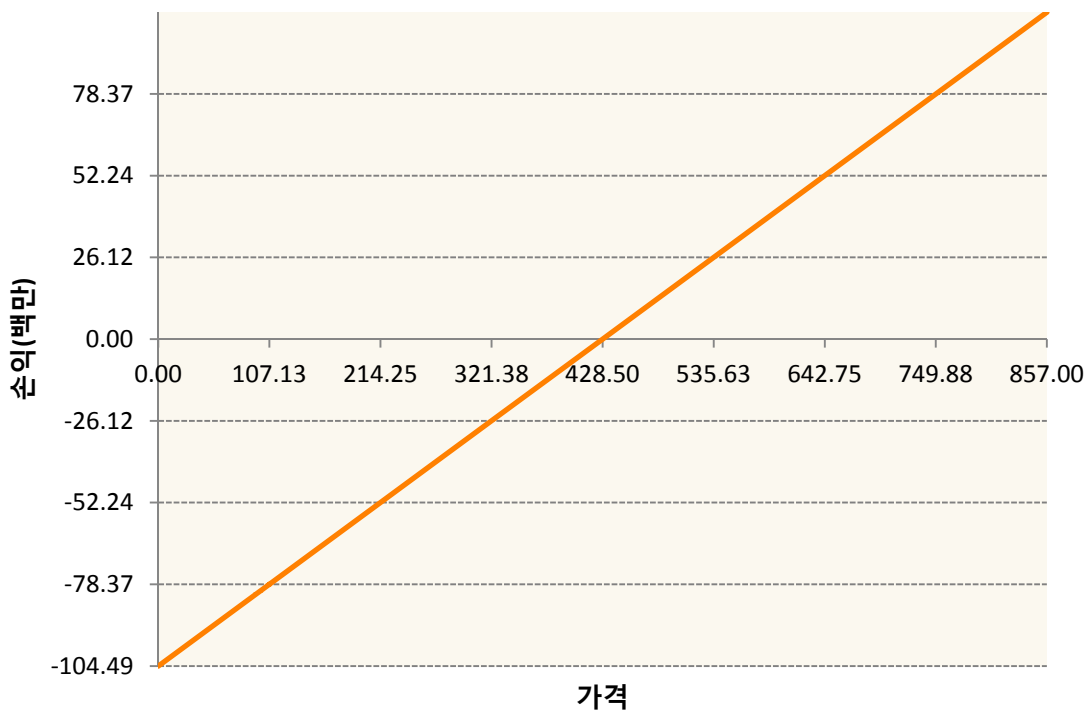




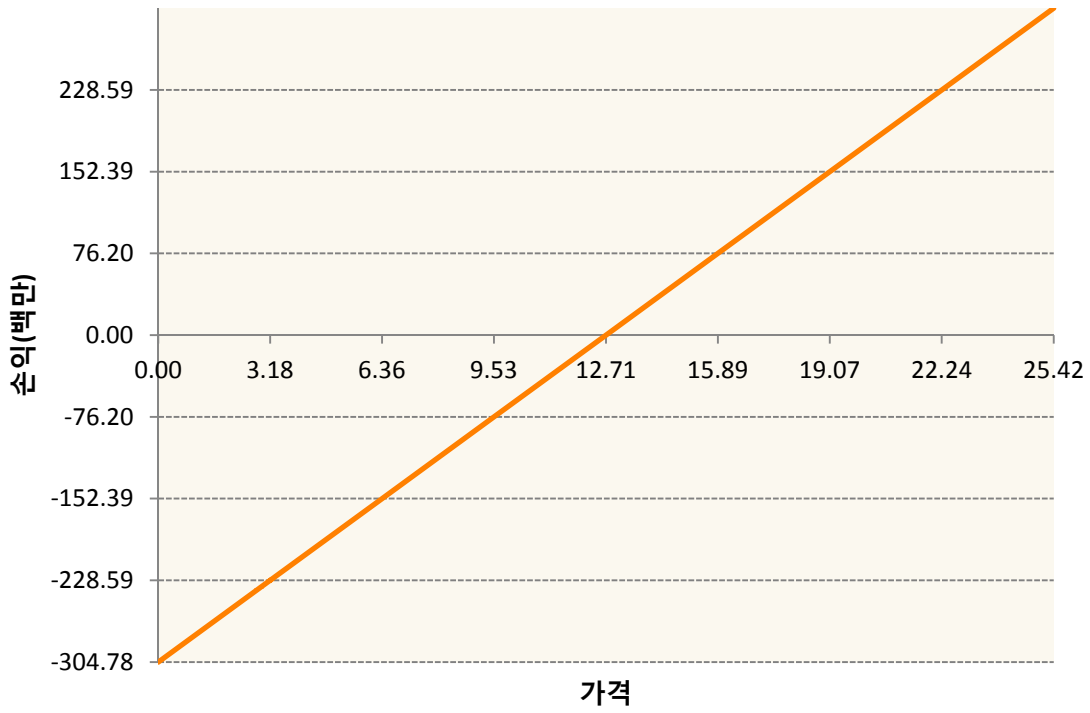
KR4175PB0004-2019-11 달러선물



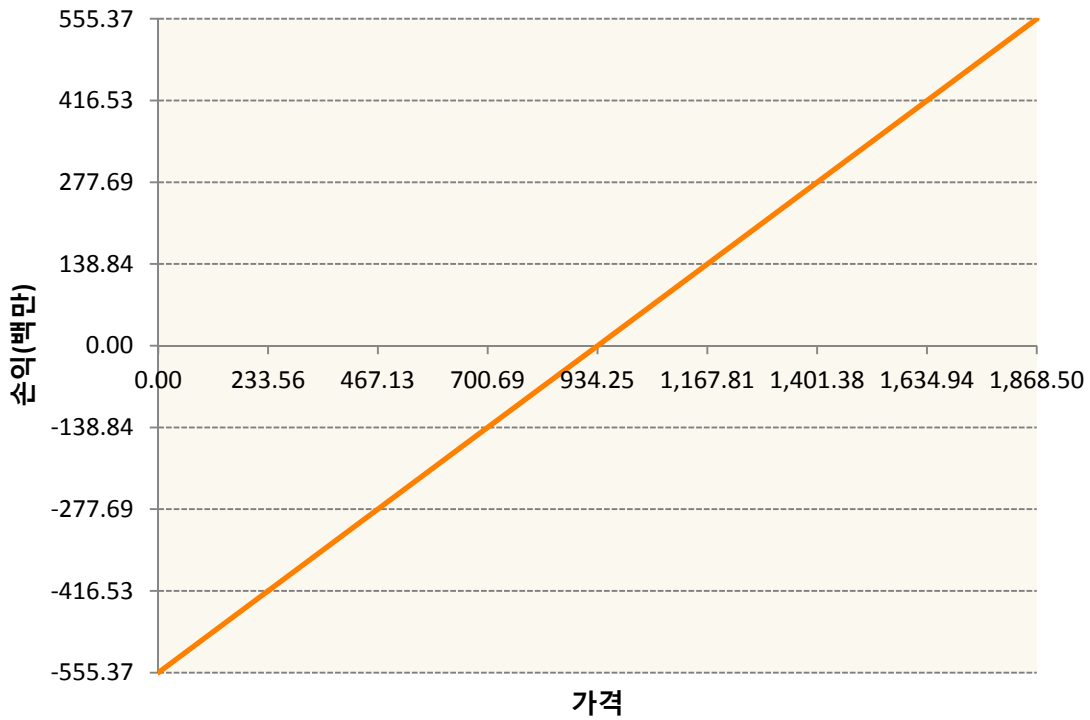
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



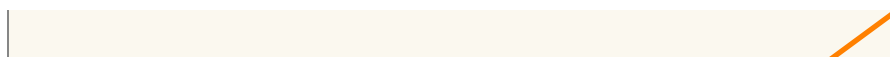
SBH0-Sugar Mar20

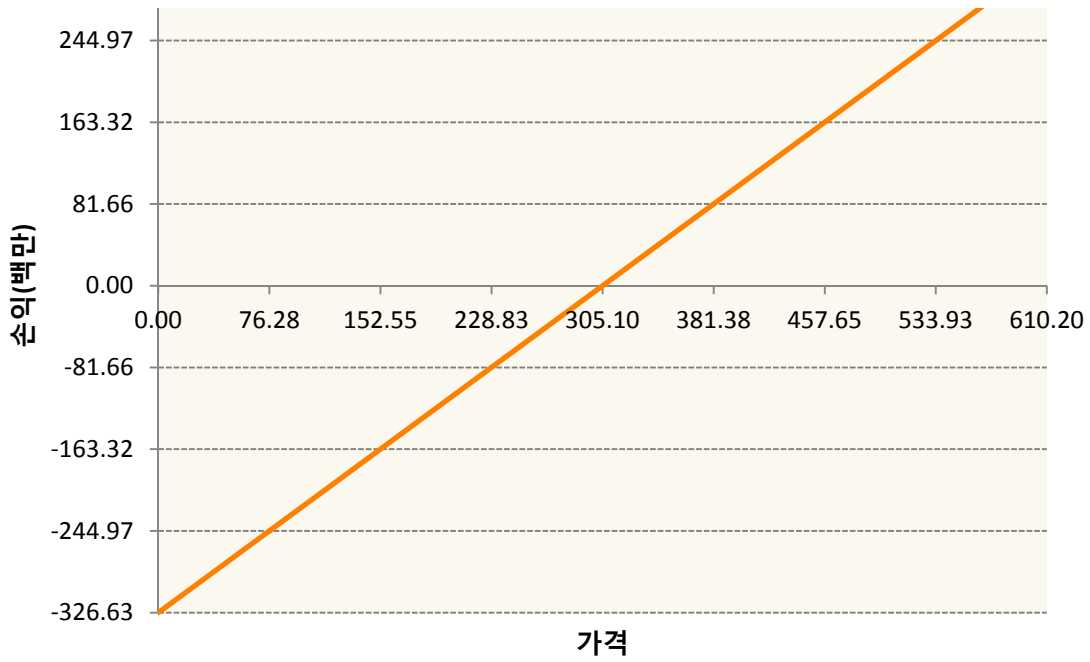


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20

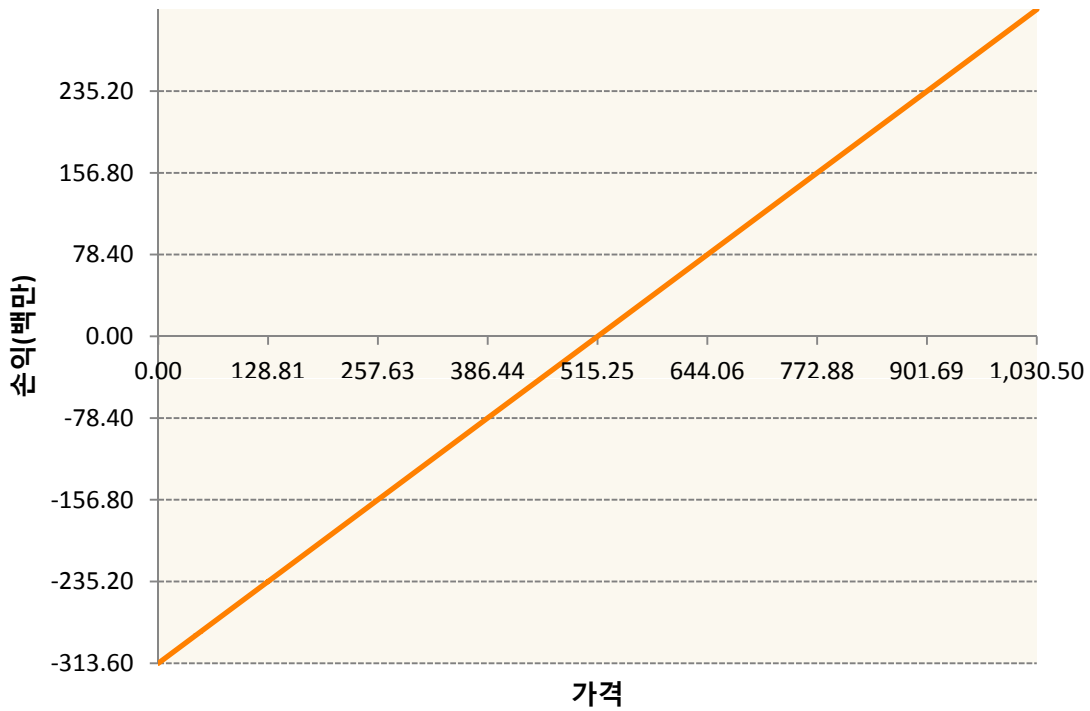


SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





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	44
SMF0	SOYBEAN MEAL FUTR Jan20	26
WZ9	WHEAT FUTURE(CBT) Dec19	25

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

(단위:백만원)

**256**