

공시일	2019-11-08
기준일	2019-11-07

포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	5	0	5	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

84

공시일	2019-11-08
기준일	2019-11-07

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	2019-11-08
기준일	2019-11-07

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)	388
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	142

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

771

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-11-08
기준일	2019-11-07

유로인덱스모(주식-파생형)

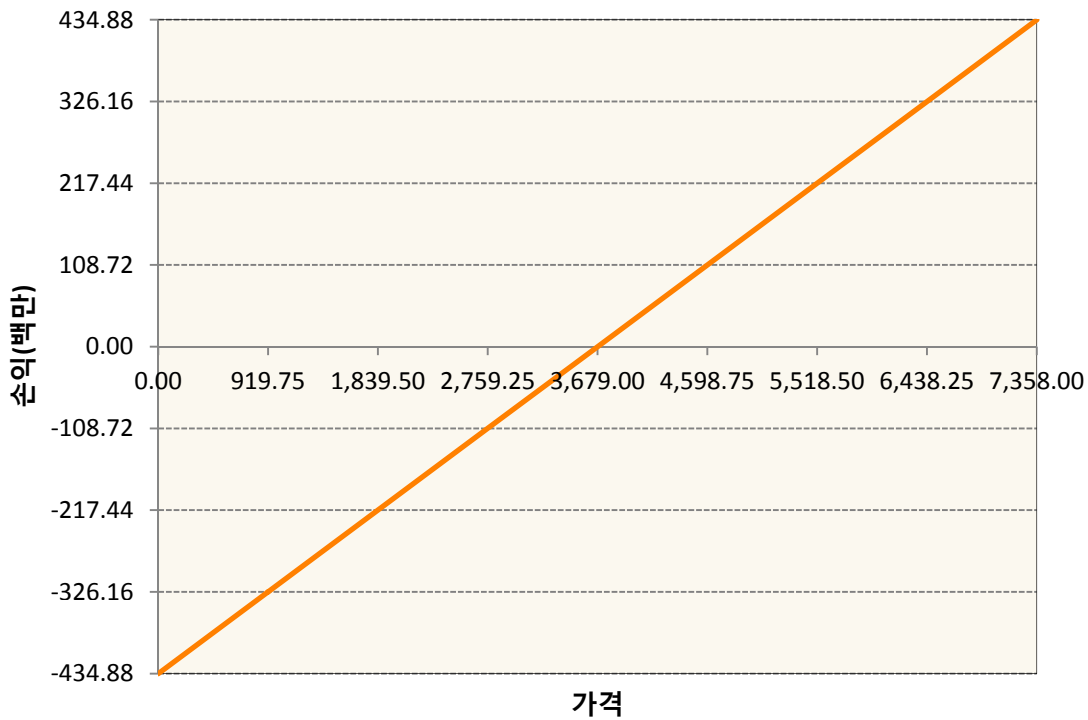
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	435	0	435	

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)

25

공시일	2019-11-08
기준일	2019-11-07

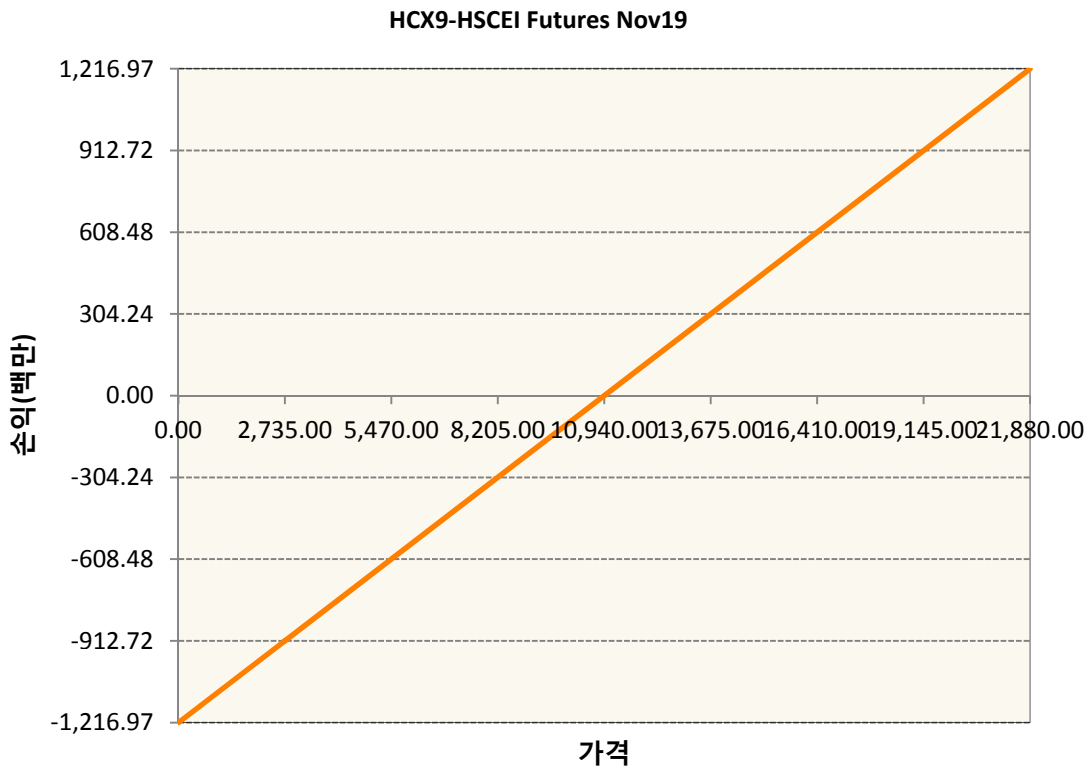
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,217	0	1,217	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

87

공시일	2019-11-08
기준일	2019-11-07

커버드콜모(주식혼합-파생형)

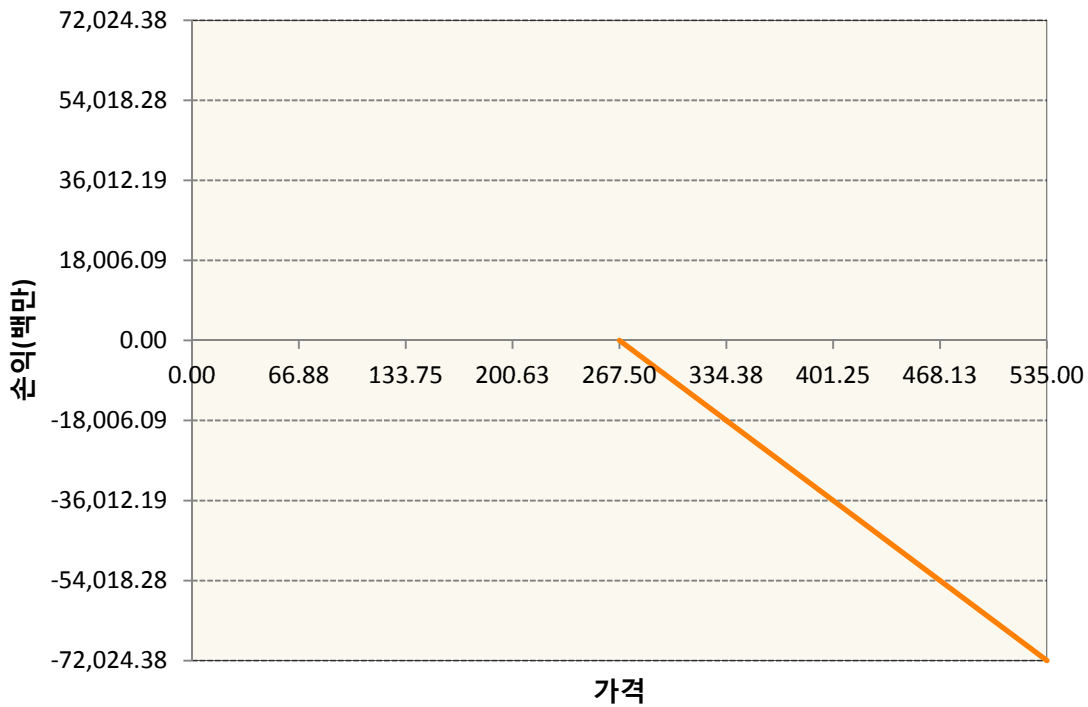
1. 계약금액

(단위:백만원)

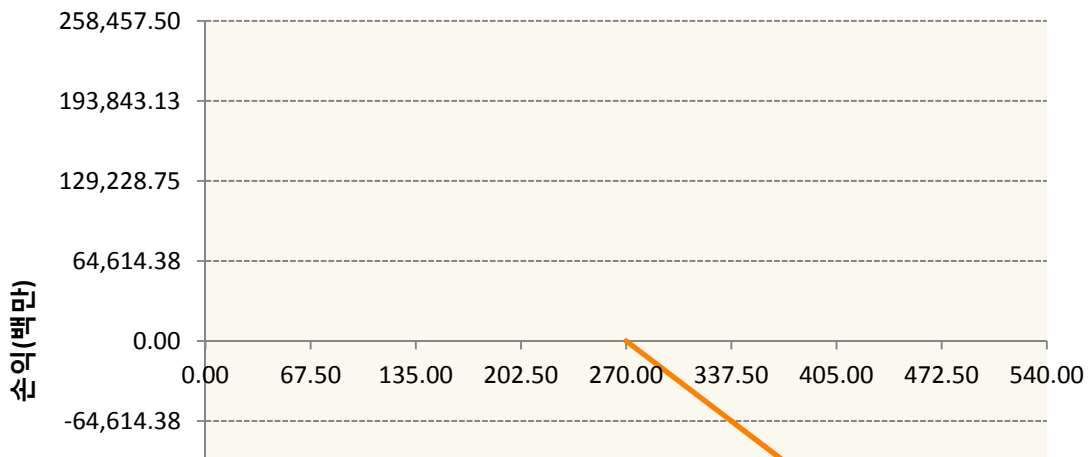
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	3,184	0	3,184	장내
누계	유가증권	옵션	0	482,288	-482,288	장내

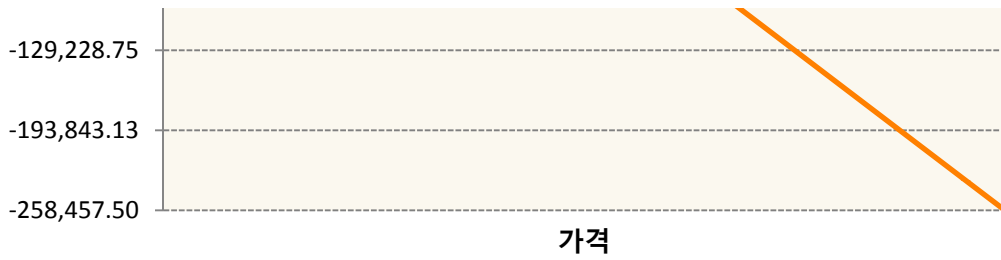
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PB2677-2019-11 콜267.5

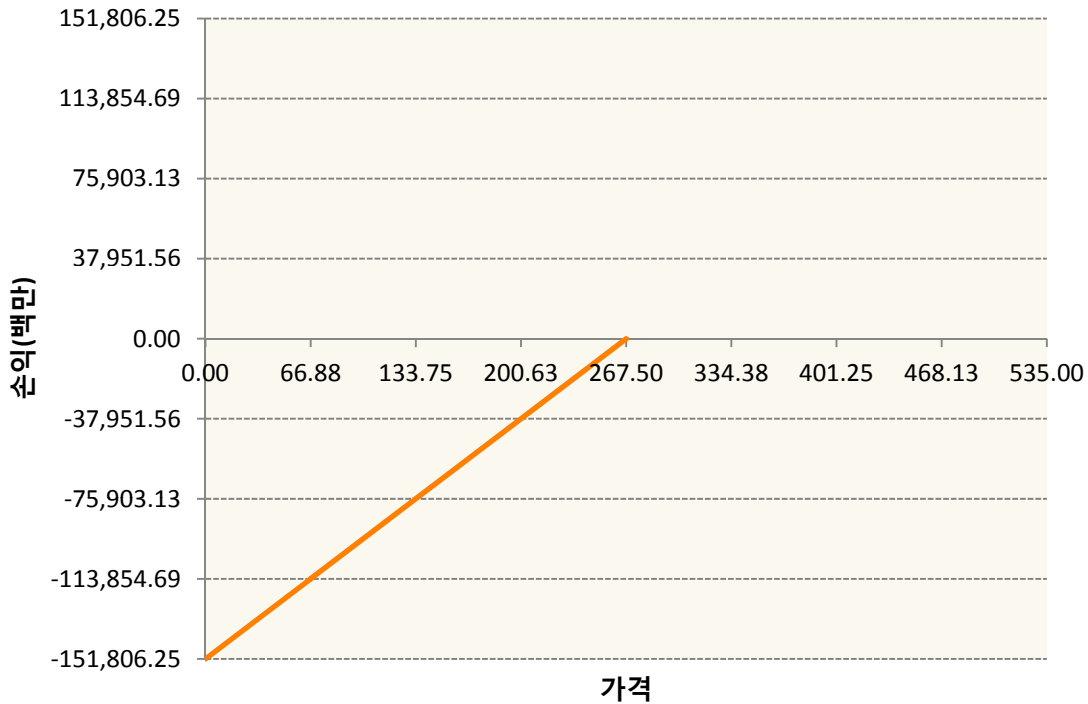


KR4201PB2701-2019-11 콜270





KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PB2677		2019-11 콜267.5					6,059	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4,341	4,273	4,201	4,126	4,049	3,970	3,890	
-5.33%	3,527	3,438	3,347	3,257	3,167	3,076	2,985	
-2.67%	1,986	1,937	1,881	1,821	1,757	1,689	1,618	
0%	53	41	23	0	-29	-63	-102	
2.67%	-1,976	-1,977	-1,980	-1,986	-1,994	-2,006	-2,022	
5.33%	-4,016	-4,016	-4,016	-4,017	-4,019	-4,022	-4,027	
8.00%	-6,057	-6,057	-6,057	-6,057	-6,057	-6,058	-6,059	
KR4201PB2701		2019-11 콜270					21,372	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	13,622	13,436	13,231	13,010	12,775	12,530	12,276	

-5.33%	11,555	11,230	10,904	10,578	10,252	9,926	9,600
-2.67%	6,859	6,622	6,369	6,105	5,832	5,550	5,263
0%	303	225	124	0	-144	-307	-486
2.67%	-6,854	-6,866	-6,889	-6,924	-6,973	-7,039	-7,120
5.33%	-14,103	-14,104	-14,106	-14,113	-14,124	-14,143	-14,171
8.00%	-21,358	-21,358	-21,358	-21,359	-21,361	-21,365	-21,372
KR4301PB2676 2019-11 풋267.5							3,675
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,410	-3,439	-3,476	-3,518	-3,566	-3,618	-3,675
-5.33%	-460	-547	-634	-723	-813	-903	-994
-2.67%	-5	-12	-23	-38	-59	-85	-116
0%	0	0	0	0	-1	-2	-5
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)

29,901

공시일	2019-11-08
기준일	2019-11-07

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

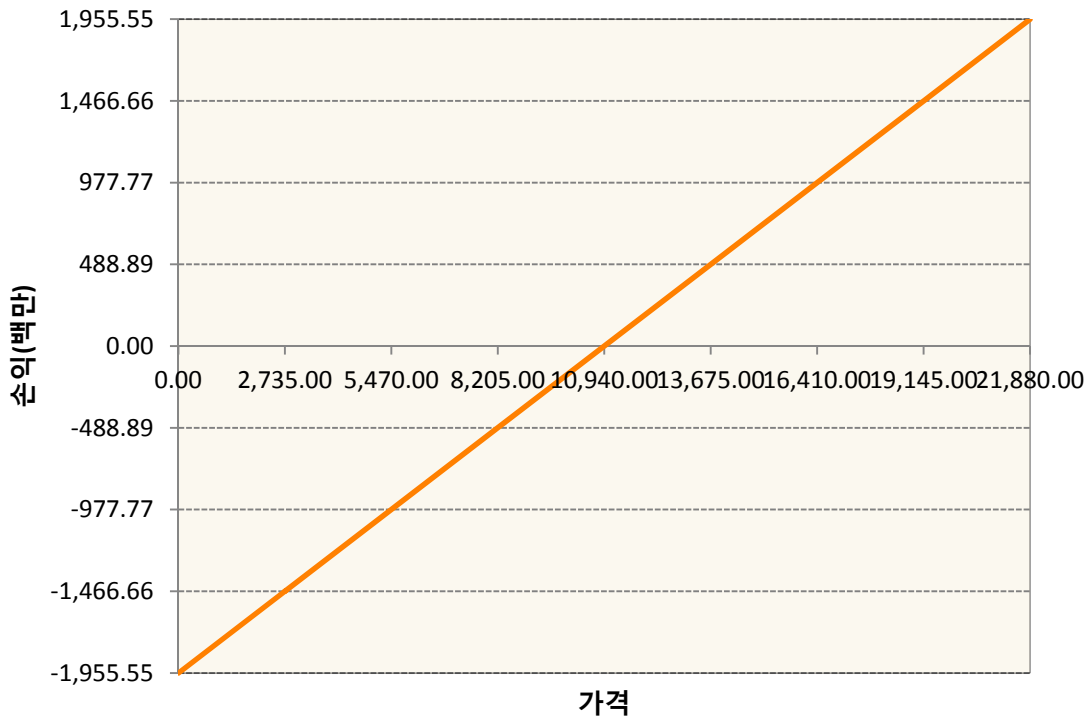
1. 계약금액

(단위:백만원)

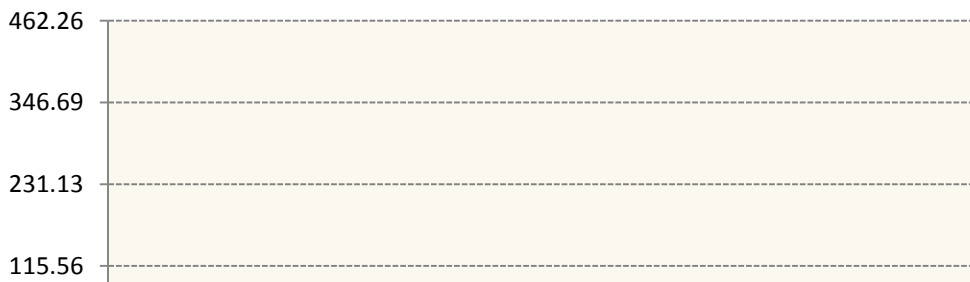
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,956	0	1,956	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,892	-4,892	장내
누계	통화	선도	667	2,753	-2,086	장외

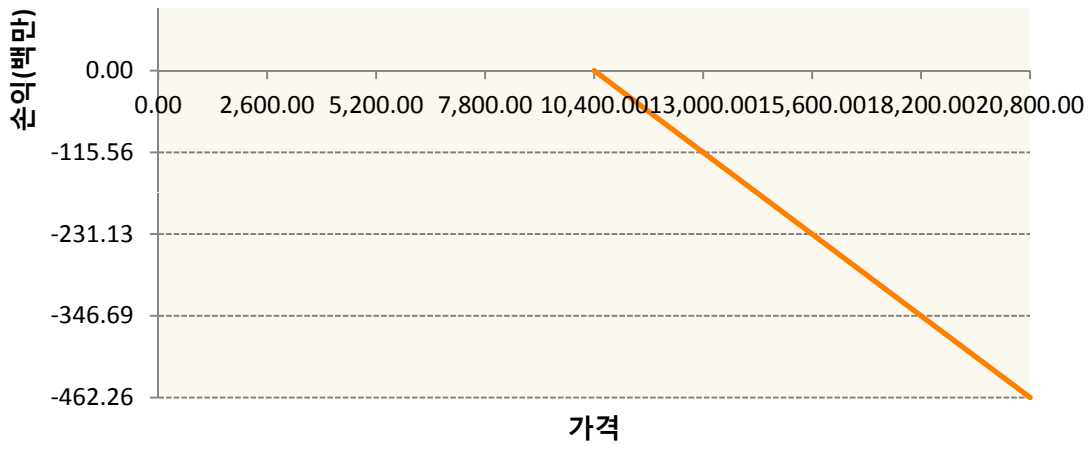
2. 만기시점의 손익구조

HCX9-HSCEI Futures Nov19

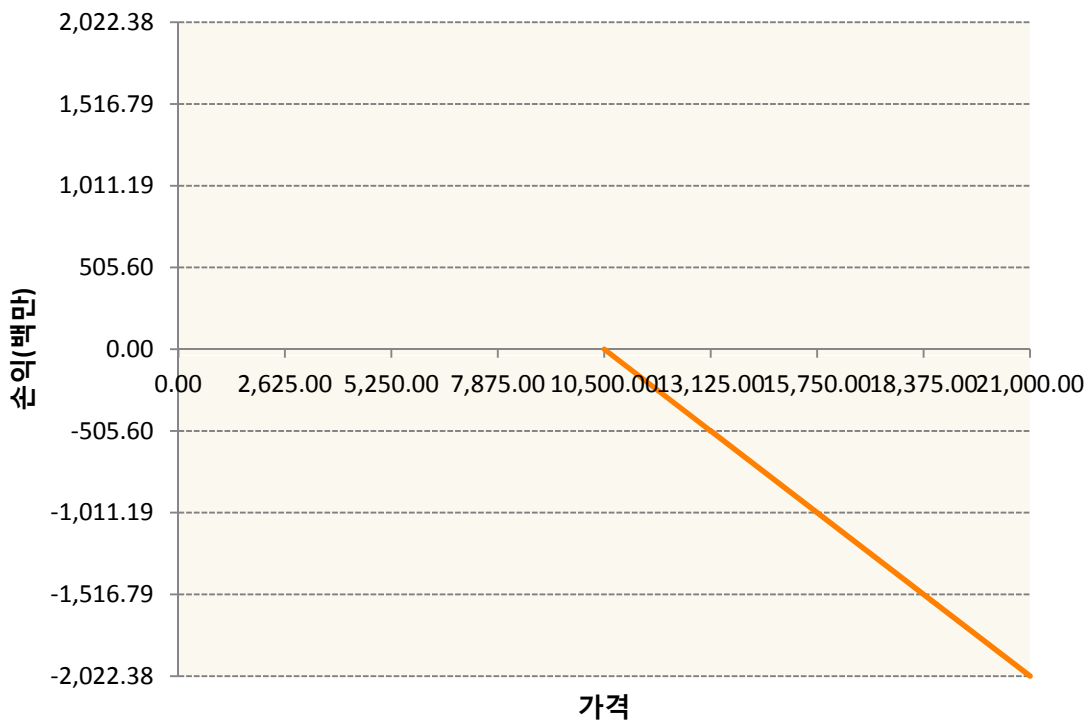


OHHIX9-C104-HSCEI

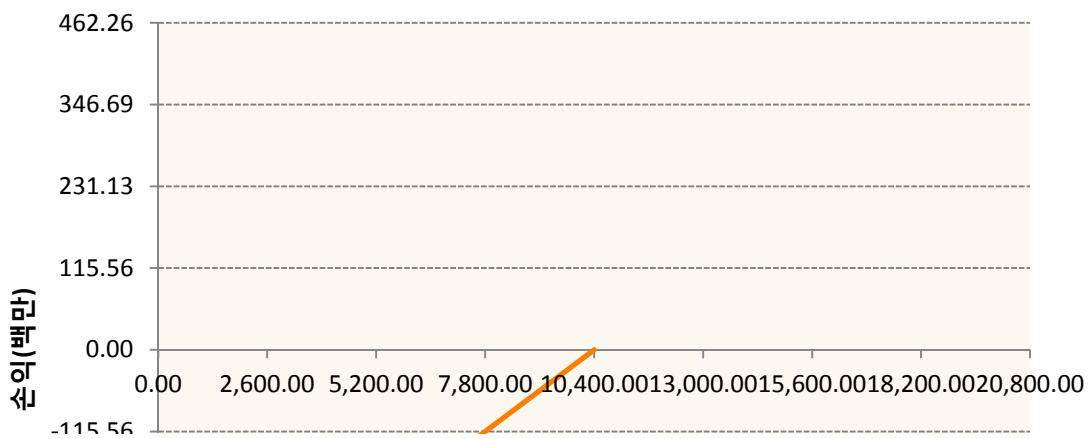


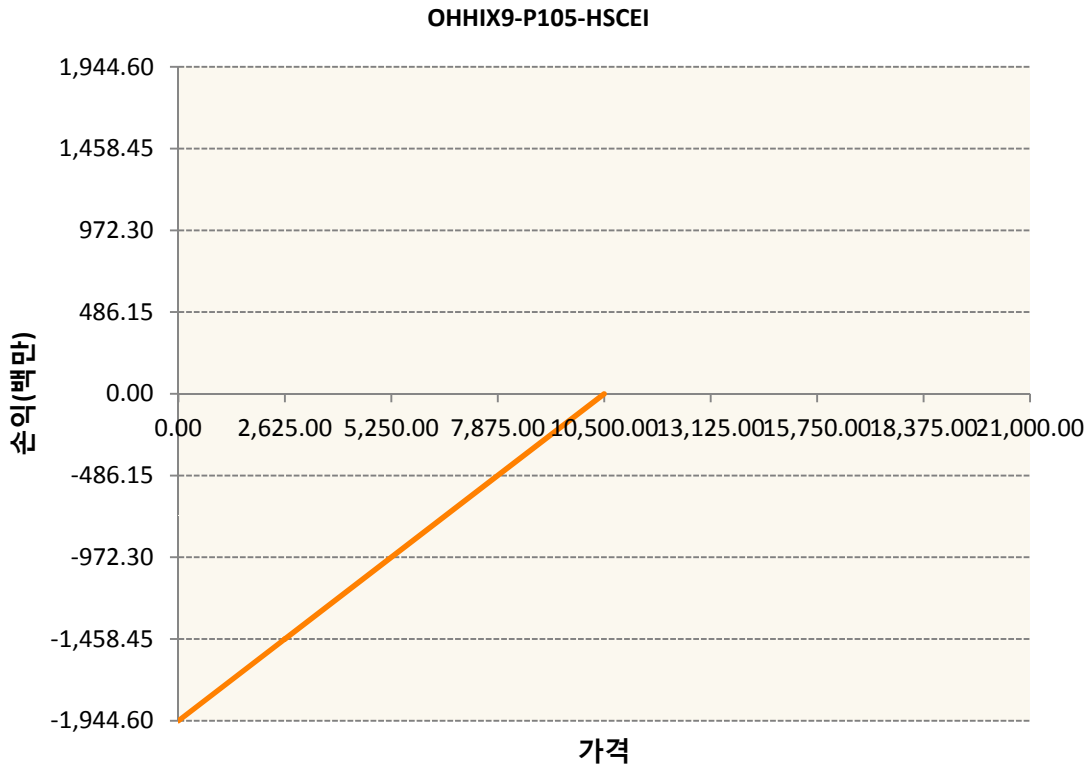


OHHIX9-C105-HSCEI



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	156
OHHIX9-C1C HSCEI	37
OHHIX9-C1C HSCEI	162
OHHIX9-P10 HSCEI	37
OHHIX9-P10 HSCEI	156

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	577

공시일	2019-11-08
기준일	2019-11-07

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

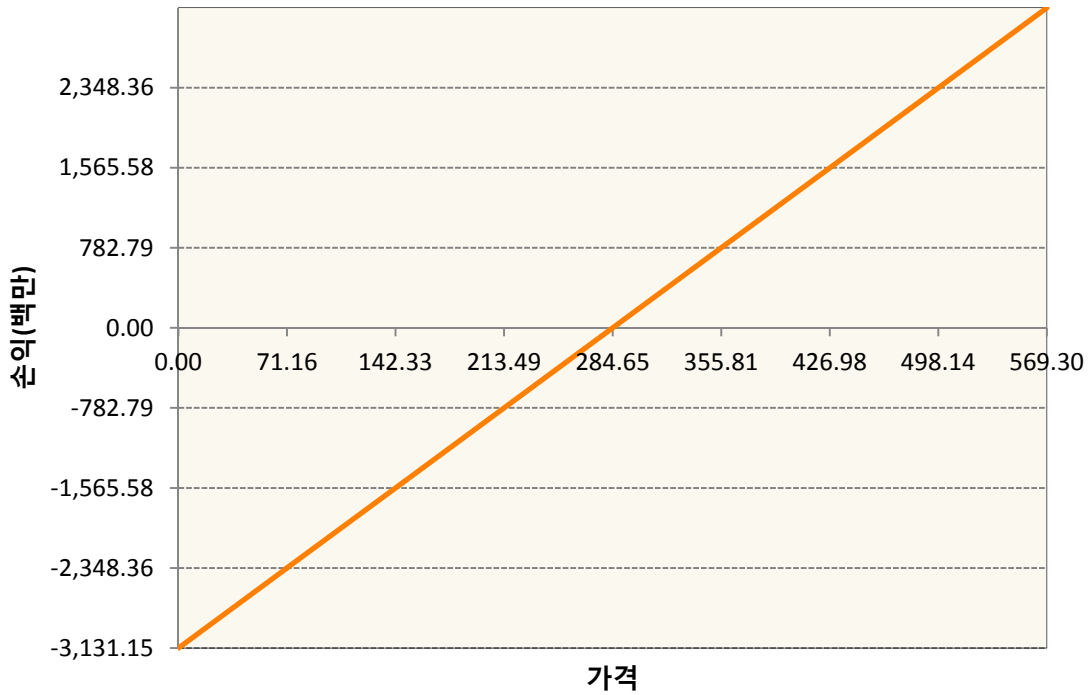
1. 계약금액

(단위:백만원)

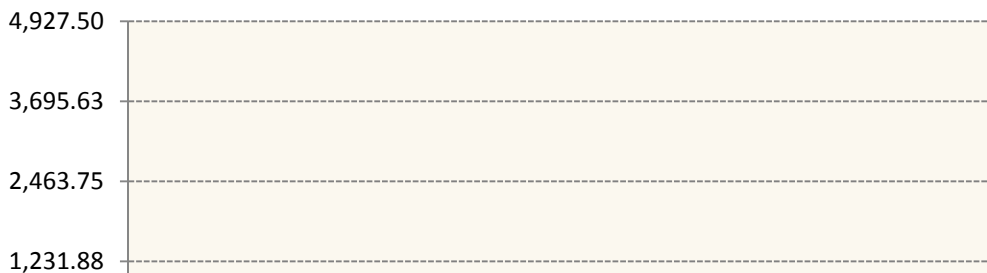
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,131	0	3,131	장내
누계	유가증권	스왑	10,625	0	10,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,611	-9,611	장내

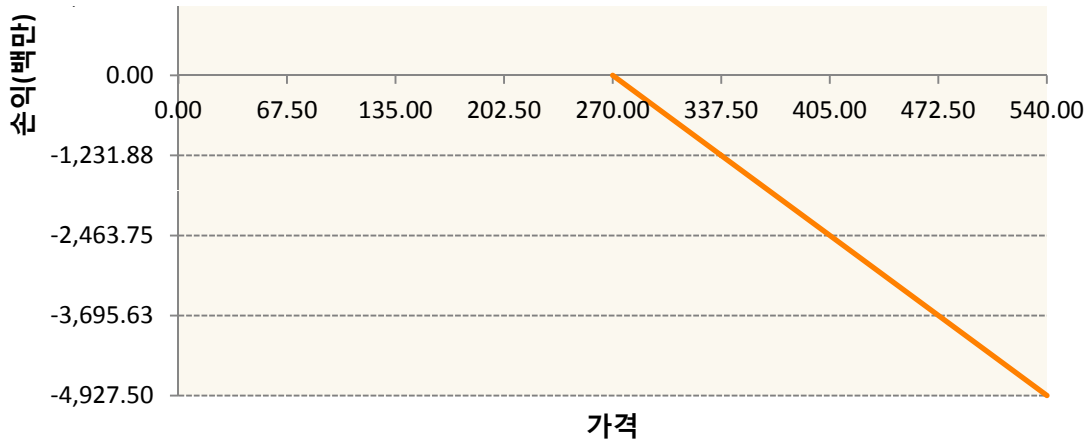
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

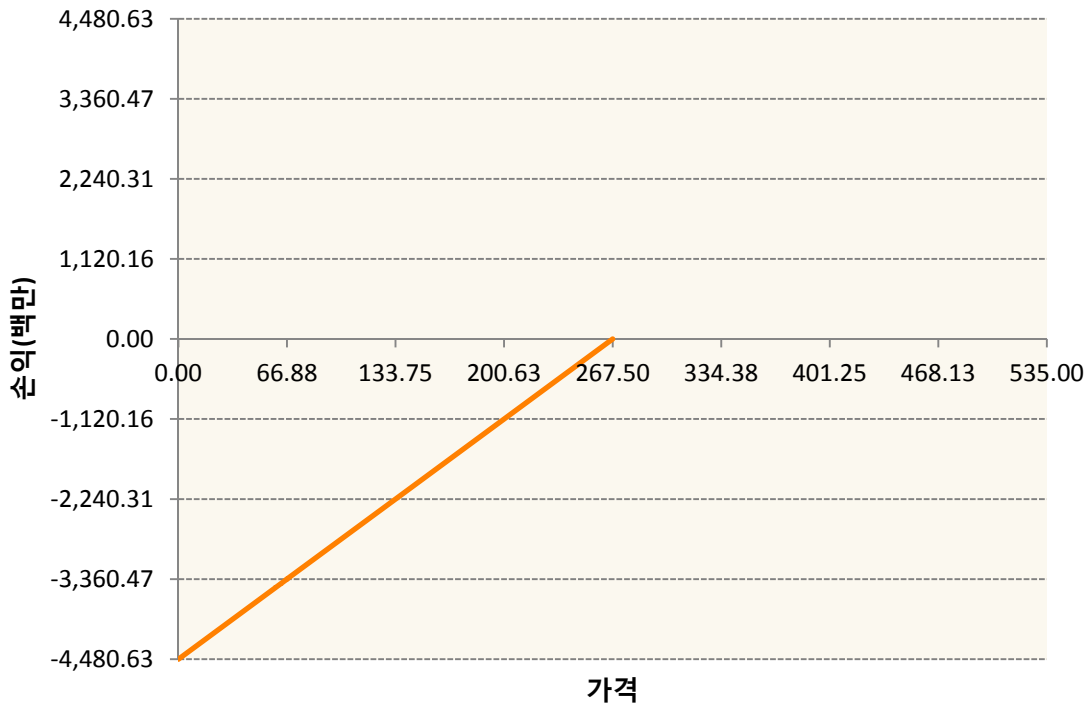


KR4201PB2701-2019-11 콜270

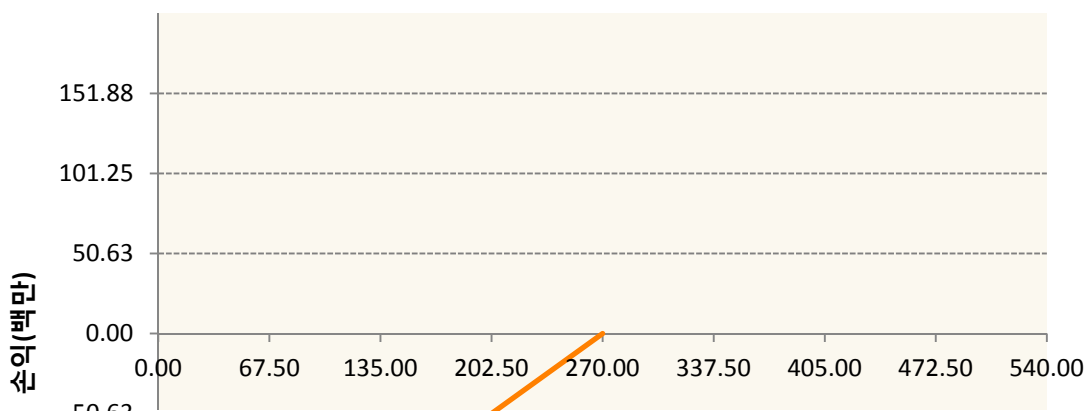




KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



KR4301PB2700-2019-11 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						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						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						407
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	260	256	252	248	244	239	234	
-5.33%	220	214	208	202	195	189	183	
-2.67%	131	126	121	116	111	106	100	
0%	6	4	2	0	-3	-6	-9	
2.67%	-131	-131	-131	-132	-133	-134	-136	
5.33%	-269	-269	-269	-269	-269	-270	-270	
8.00%	-407	-407	-407	-407	-407	-407	-407	
KR4301PB2676		2019-11 풋267.5						108
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-101	-102	-103	-104	-105	-107	-108
-5.33%	-14	-16	-19	-21	-24	-27	-29
-2.67%	0	0	-1	-1	-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
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)

1,553

공시일	2019-11-08
기준일	2019-11-07

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

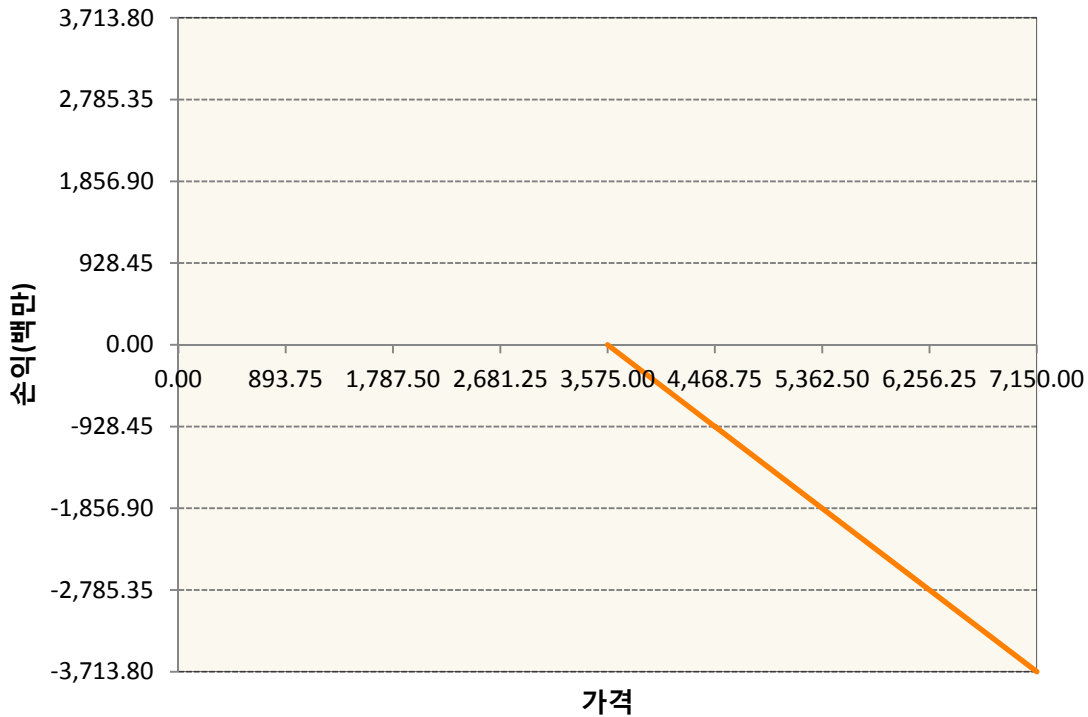
1. 계약금액

(단위:백만원)

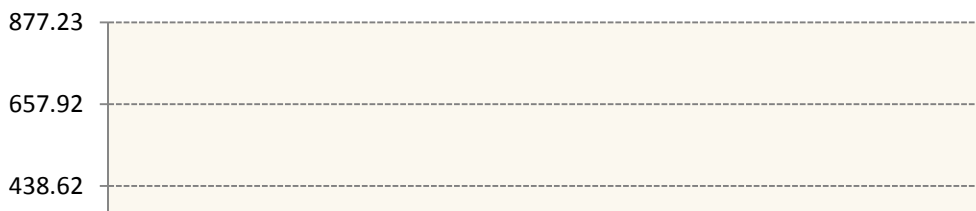
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,770	0	1,770	
누계	유가증권	스왑	20,149	0	20,149	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,182	-9,182	장내
누계	통화	선도	2,021	6,028	-4,006	장외

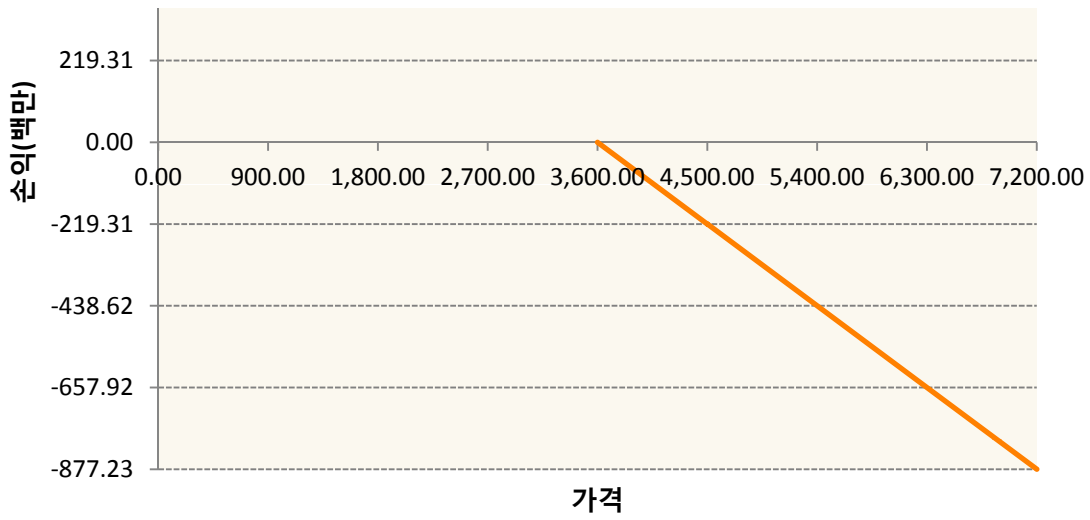
2. 만기시점의 손익구조

OESXX9-C3575-EURO STOXX 50

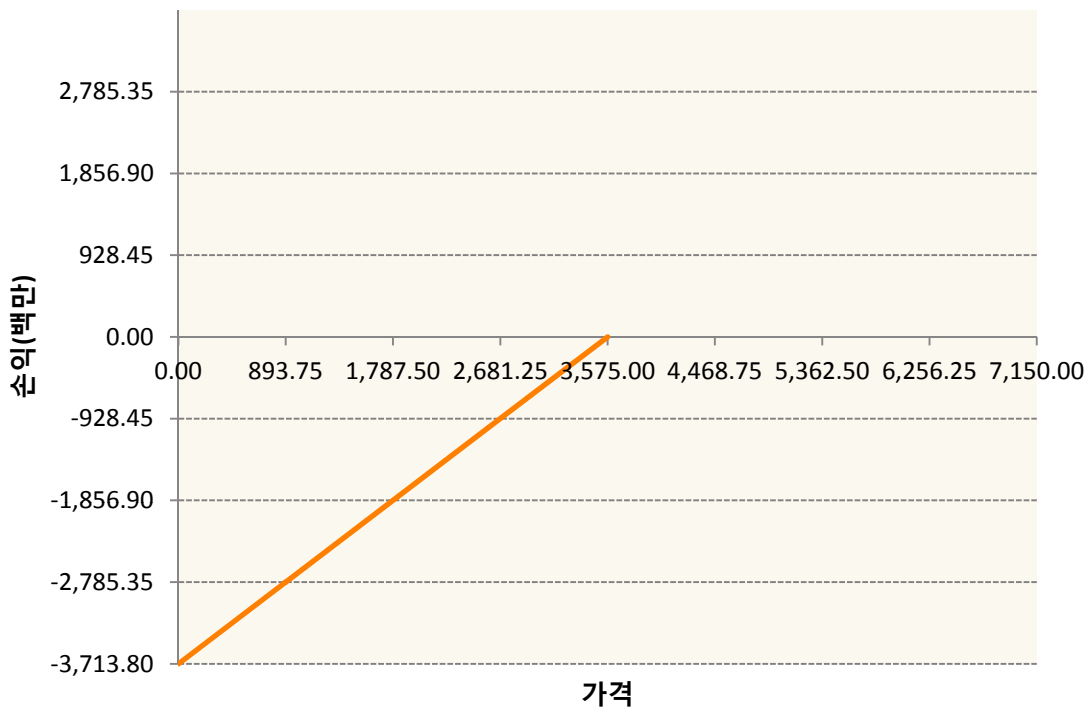


OESXX9-C3600-EURO STOXX 50

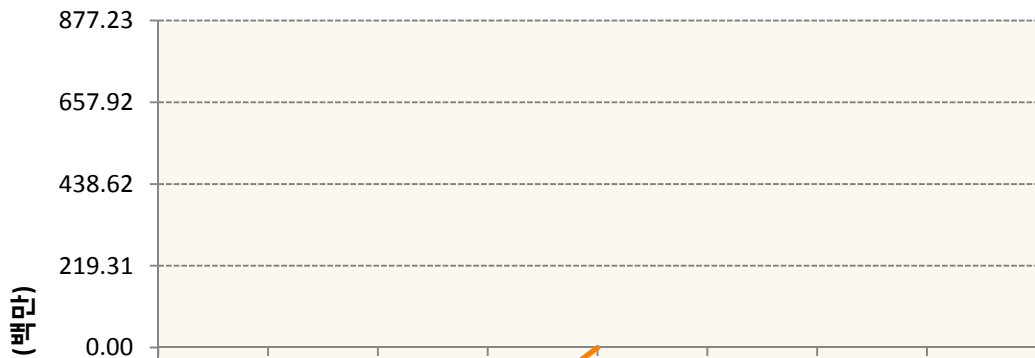


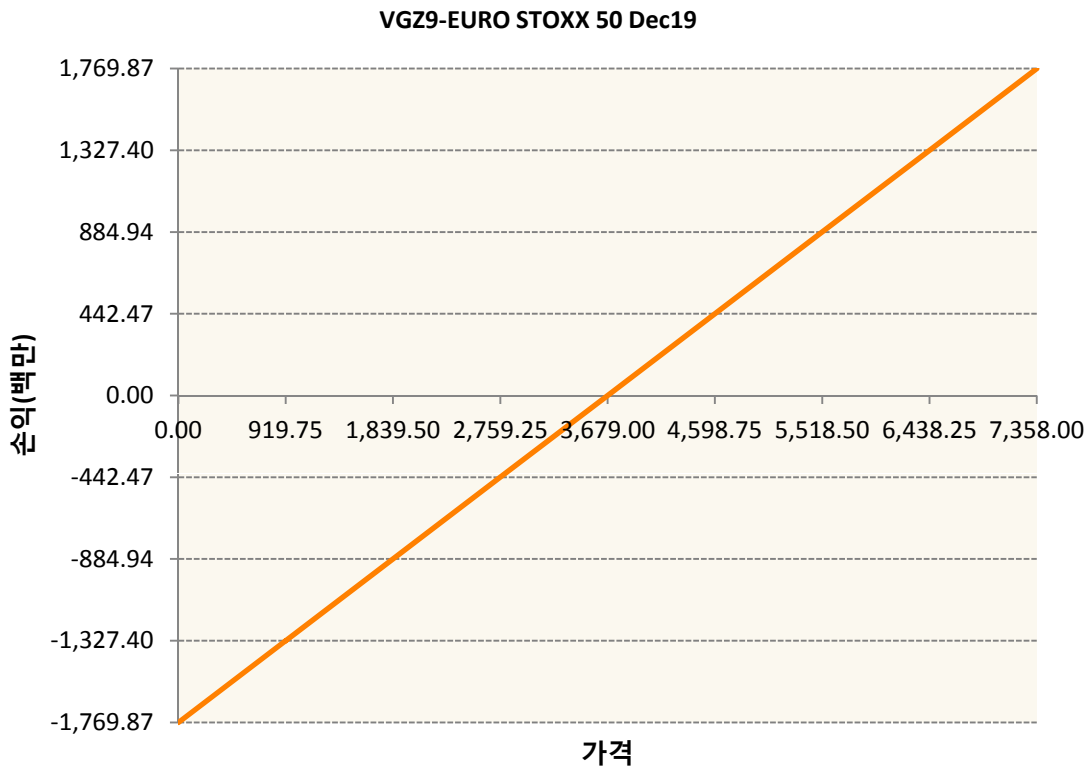
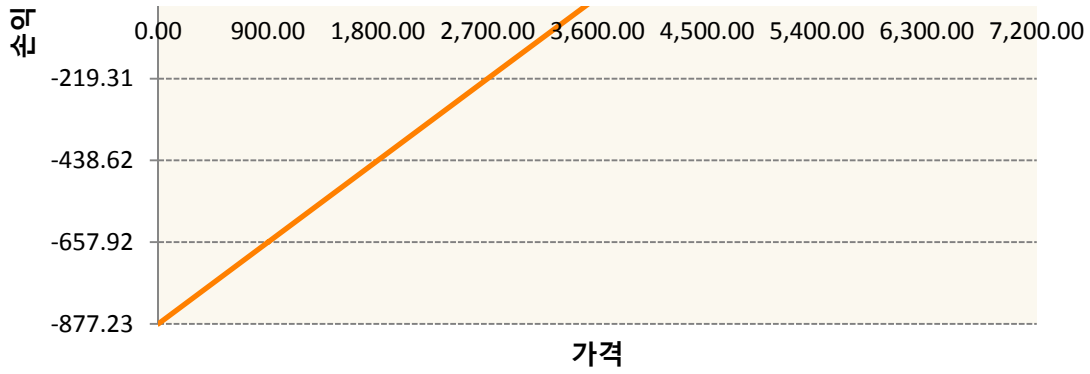


OESXX9-P3575-EURO STOXX 50



OESXX9-P3600-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		23
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	142

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

(단위:백만원)

914

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

(단위:백만원)

80

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

(단위:백만원)

124

공시일	2019-11-08
기준일	2019-11-07

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

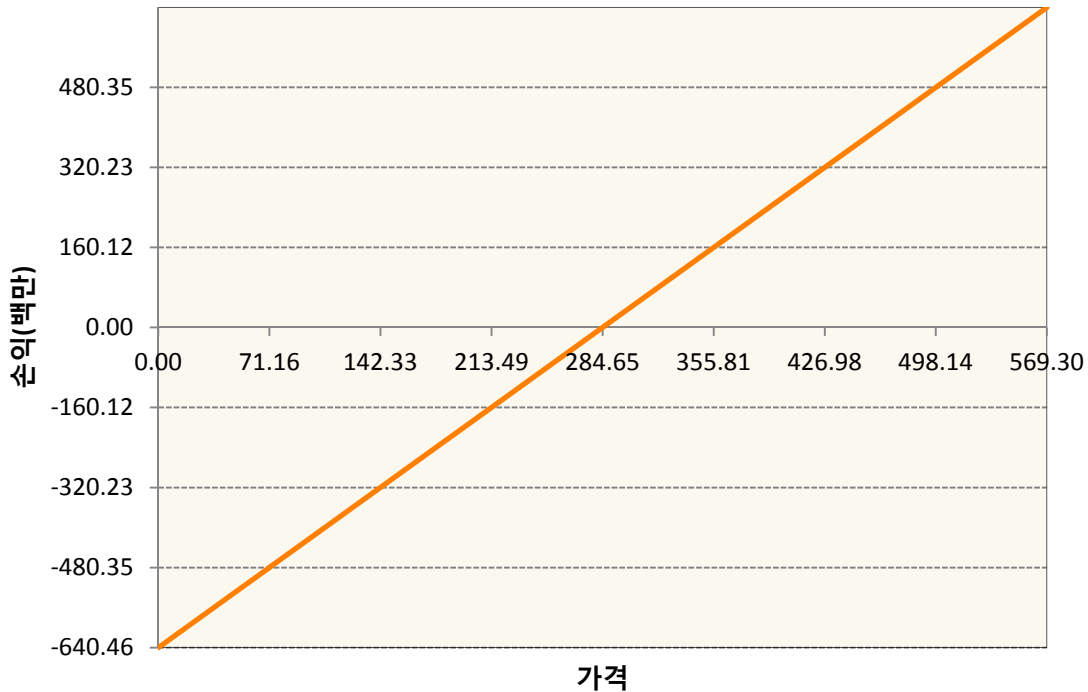
1. 계약금액

(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

가격	기초자산의 변동성						
	-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)

40

공시일	2019-11-08
기준일	2019-11-07

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

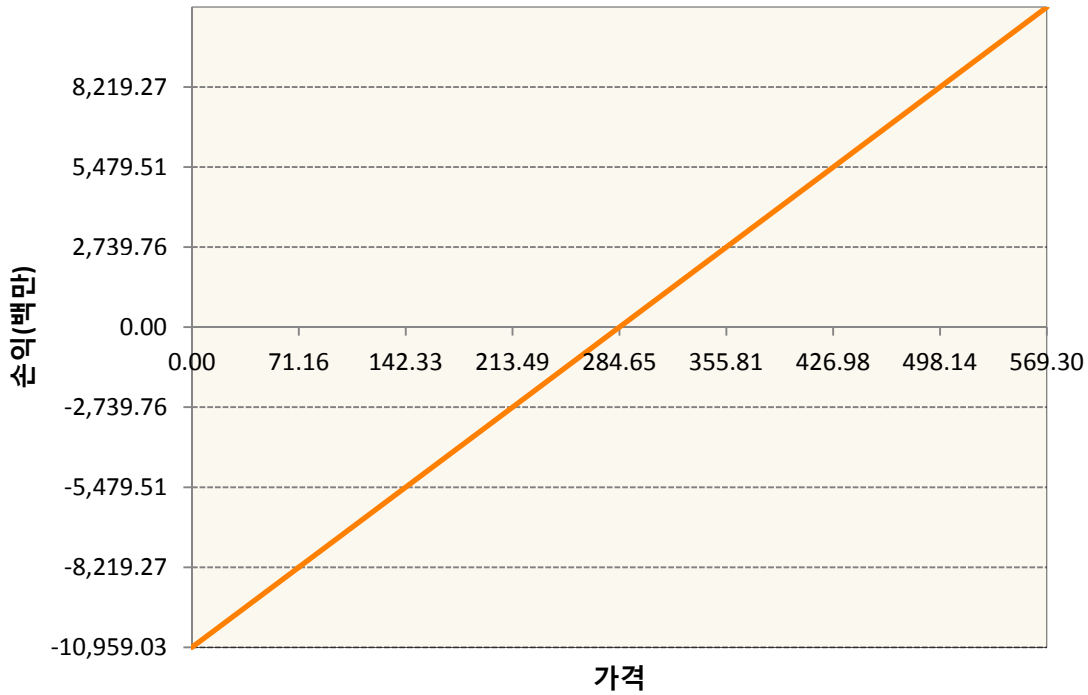
1. 계약금액

(단위:백만원)

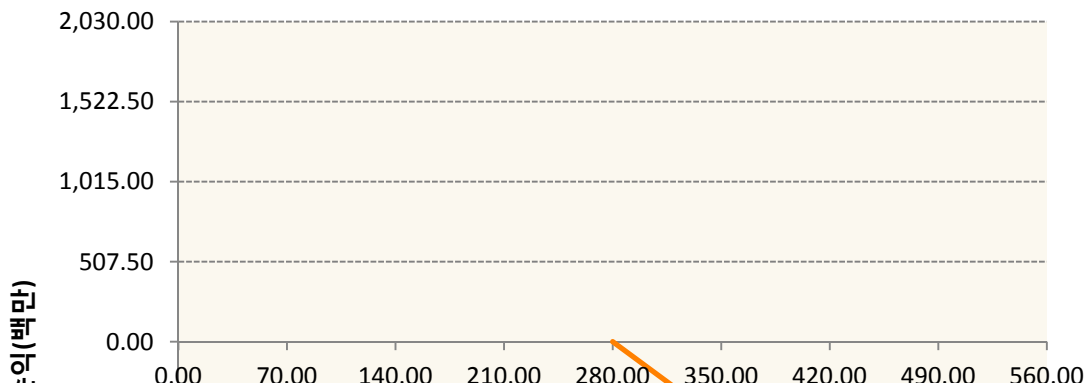
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,959	0	10,959	장내
누계	유가증권	옵션	3,359	20,181	-16,821	장내

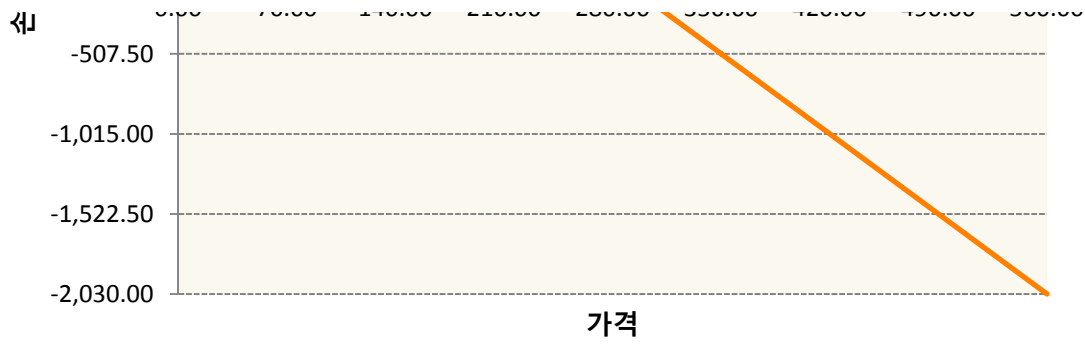
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

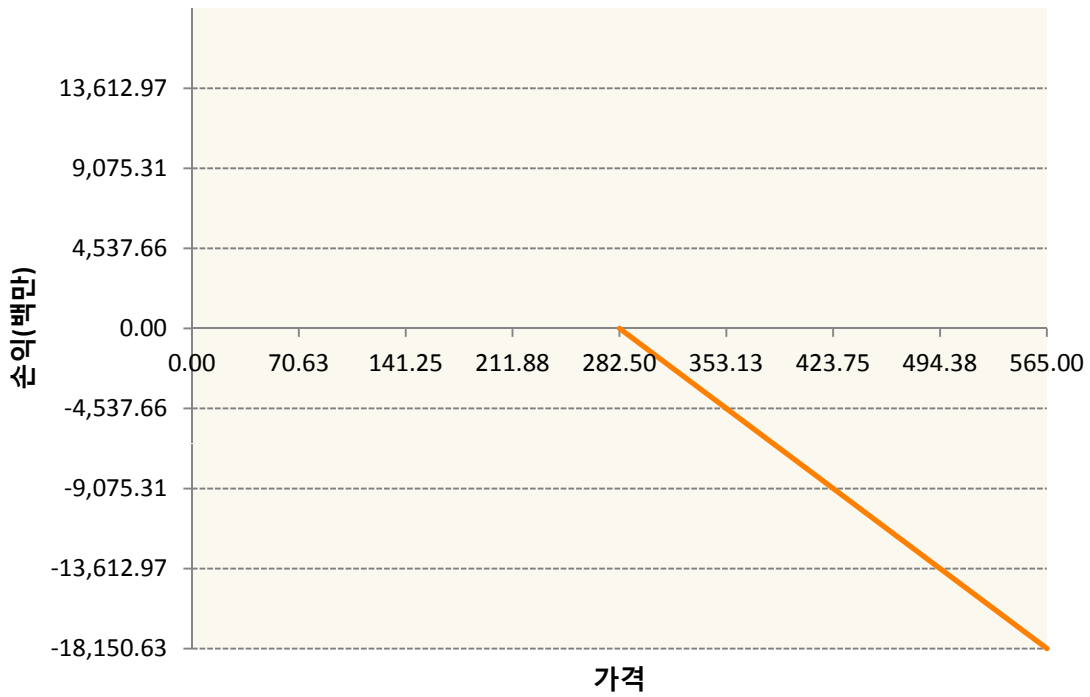


KR4201PB2800-2019-11 콜280

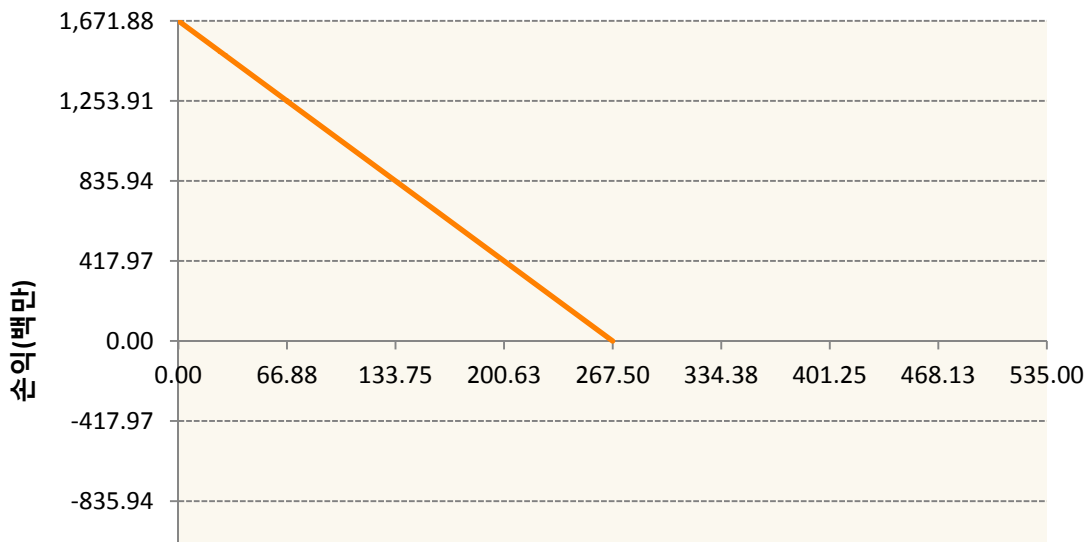


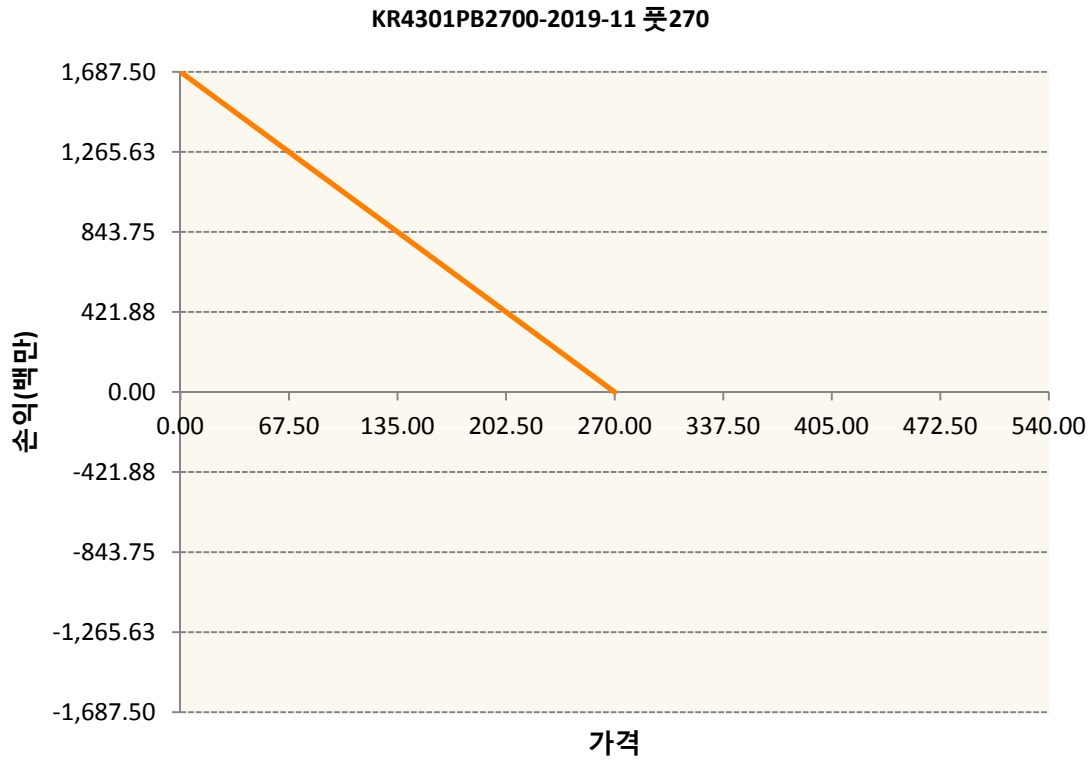
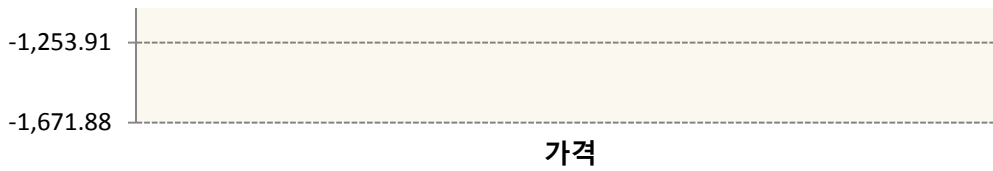


KR4201PB2826-2019-11 콜282.5



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						148
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	49	49	49	48	48	47	46	
-5.33%	47	46	45	43	42	40	38	
-2.67%	36	34	31	29	26	24	22	

0%	7	5	2	0	-2	-5	-7
2.67%	-39	-40	-41	-43	-44	-46	-47
5.33%	-92	-92	-93	-93	-94	-95	-96
8.00%	-147	-147	-147	-147	-147	-148	-148
KR4201PB2826 2019-11 콜282.5							1,253
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	339	338	336	334	331	326	321
-5.33%	330	324	316	306	296	284	271
-2.67%	268	250	232	212	192	172	151
0%	68	45	23	0	-23	-46	-68
2.67%	-298	-311	-325	-341	-357	-375	-393
5.33%	-756	-759	-764	-771	-779	-788	-799
8.00%	-1,239	-1,239	-1,240	-1,242	-1,245	-1,248	-1,253
KR4301PB2676 2019-11 풋267.5							40
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	38	38	38	39	39	40	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%	53	53	53	53	53	54	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)

2,255

공시일	2019-11-08
기준일	2019-11-07

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	5,797	0	5,797	
누계	유가증권	수익증권	189,453	0	189,453	

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	2019-11-08
기준일	2019-11-07

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	210,547	0	210,547	

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	2019-11-08
기준일	2019-11-07

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	11,593	0	11,593	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	539,328	0	539,328	
누계	통화	선도	0	527,597	-527,597	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		1,948
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

FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E

464

FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E

464

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

(단위:백만원)

13,581

공시일	2019-11-08
기준일	2019-11-07

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

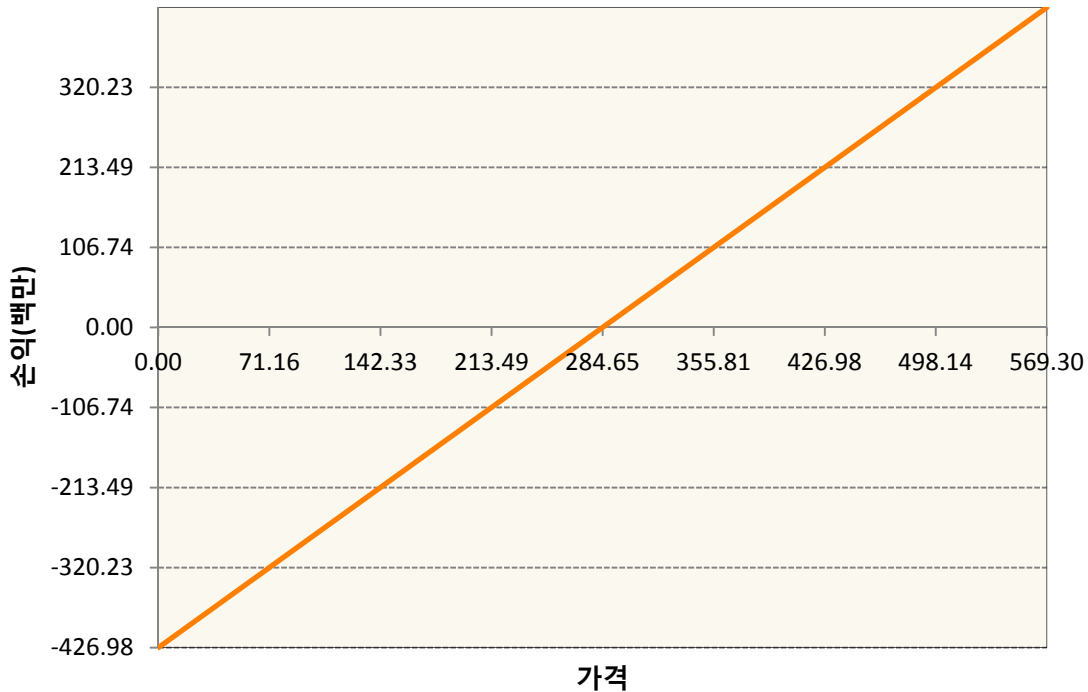
1. 계약금액

(단위:백만원)

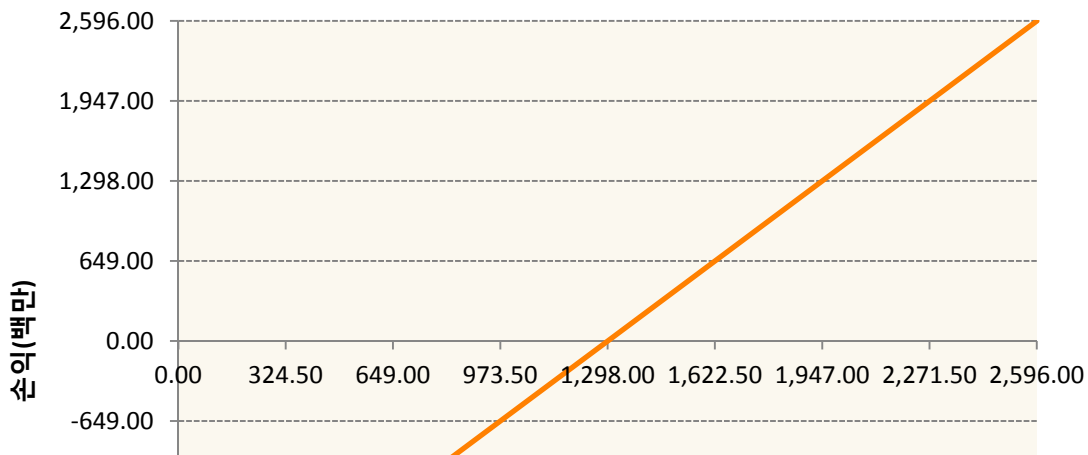
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,803	0	4,803	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



KR4108PC0005-2019-12 KRX300 선물



-5.33%	-138	-138	-138	-138	-138	-138	-138
-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%	138	138	138	138	138	138	138
8.00%	208	208	208	208	208	208	208
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%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-95
-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%	95	95	95	95	95	95	95
8.00%	142	142	142	142	142	142	142

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

(단위:백만원)

340

공시일	2019-11-08
기준일	2019-11-07

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

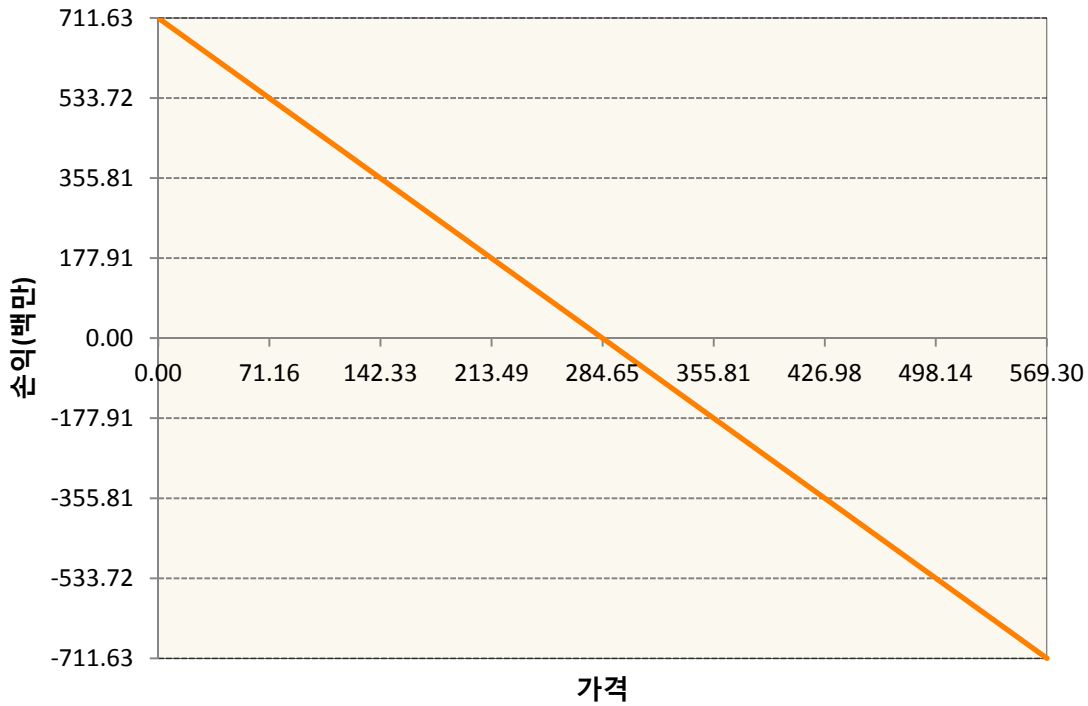
1. 계약금액

(단위:백만원)

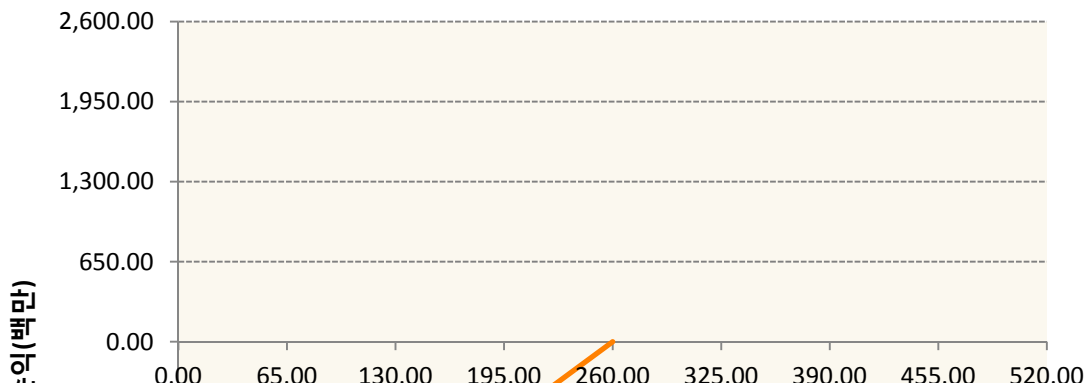
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	712	-712	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,650	-3,650	장내

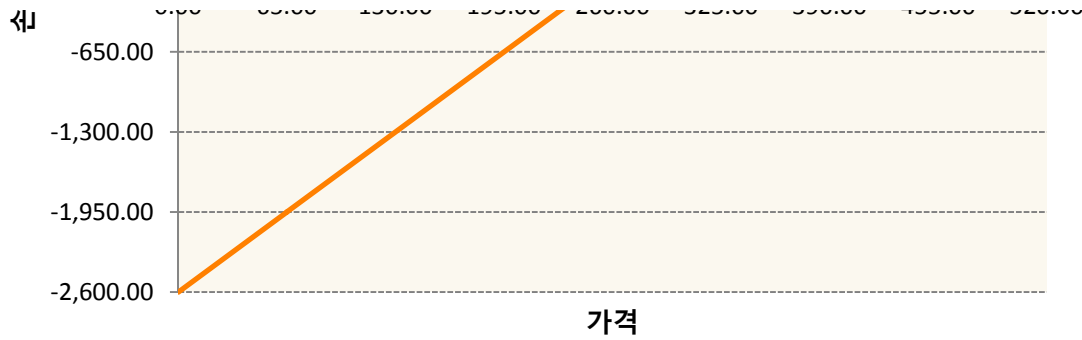
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

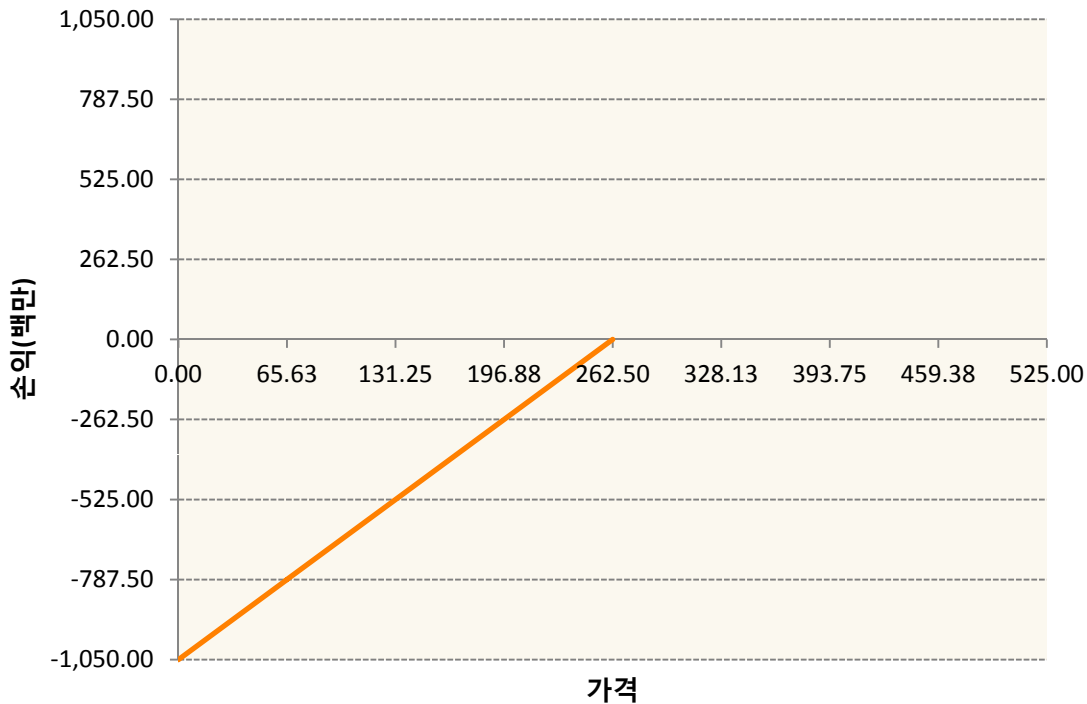


KR4301PB2601-2019-11 풋260





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	-9	-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)

45

공시일	2019-11-08
기준일	2019-11-07

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	15,624	0	15,624	
누계	통화	선도	638	15,952	-15,314	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)

427

공시일	2019-11-08
기준일	2019-11-07

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	681	0	681	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)

61

공시일	2019-11-08
기준일	2019-11-07

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

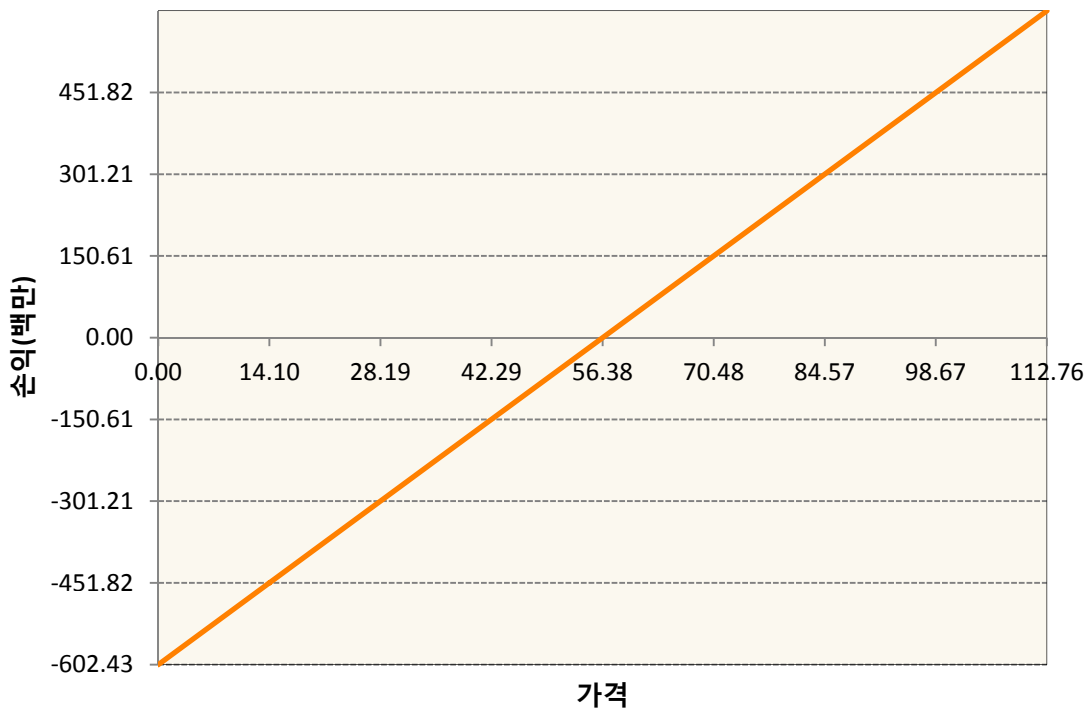
1. 계약금액

(단위:백만원)

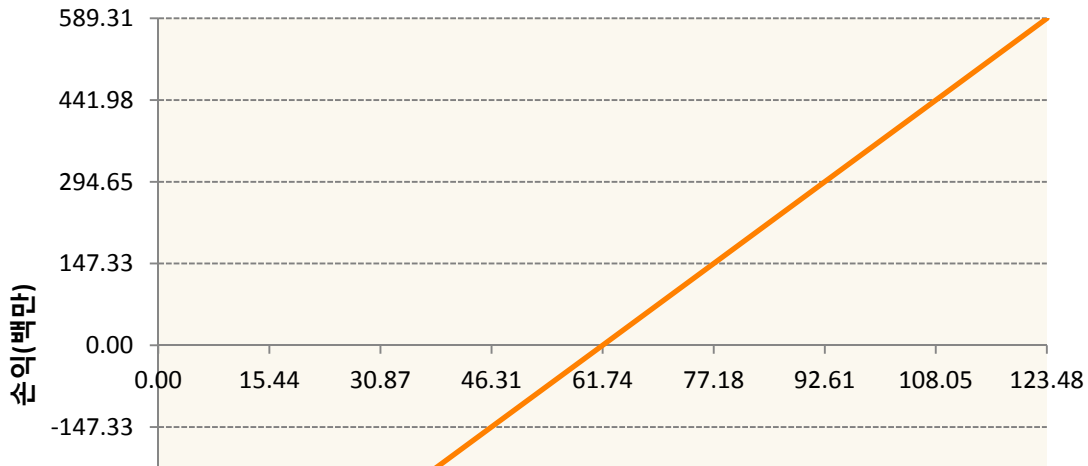
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,556	290	2,266	

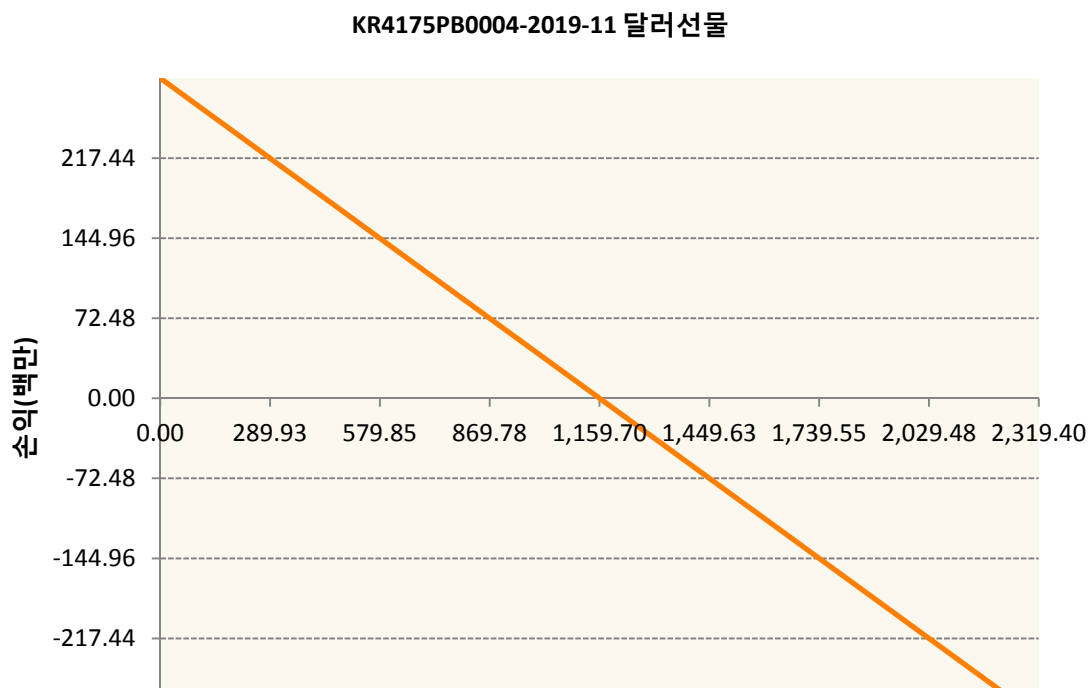
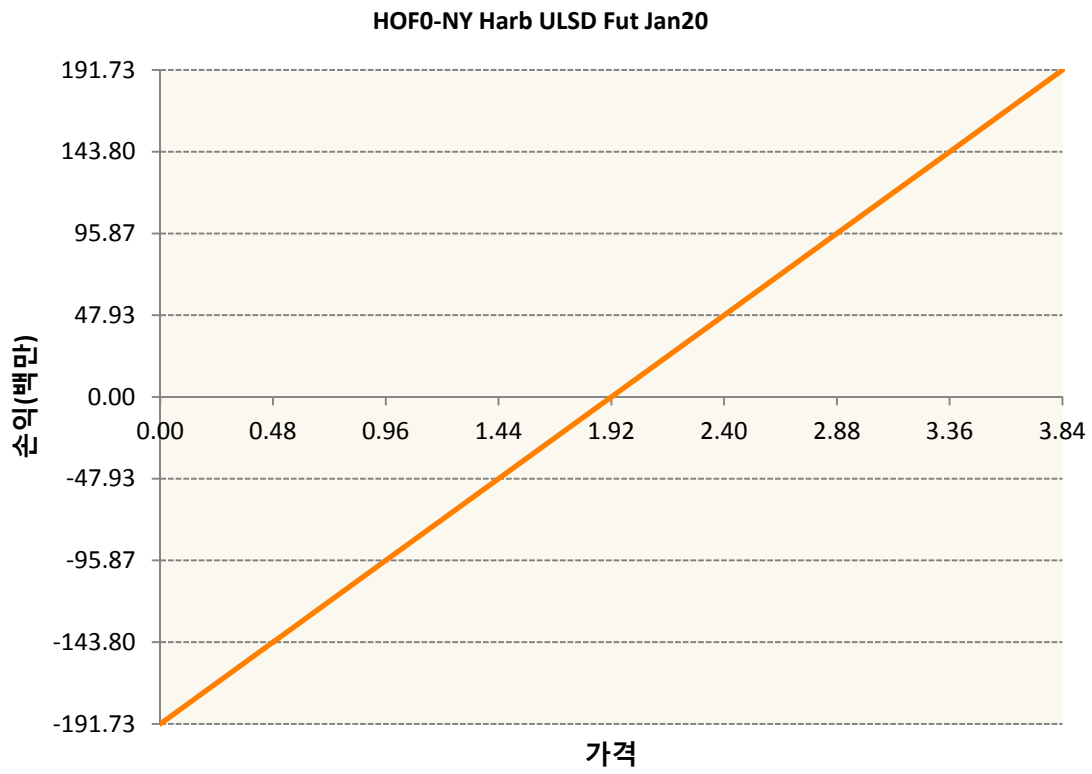
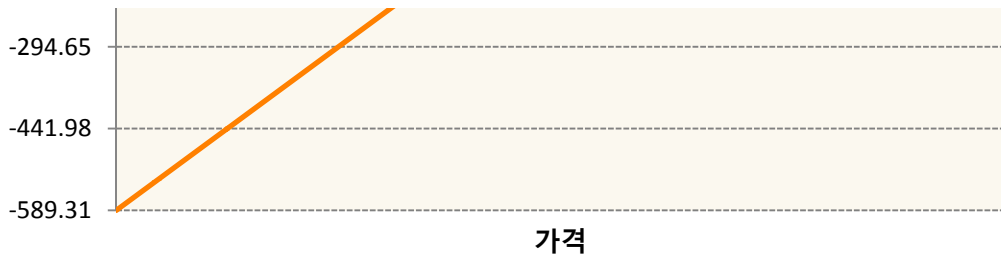
2. 만기시점의 손익구조

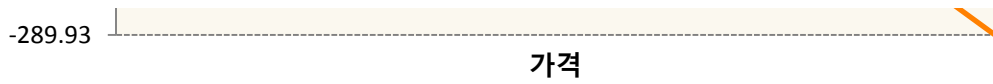
CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20



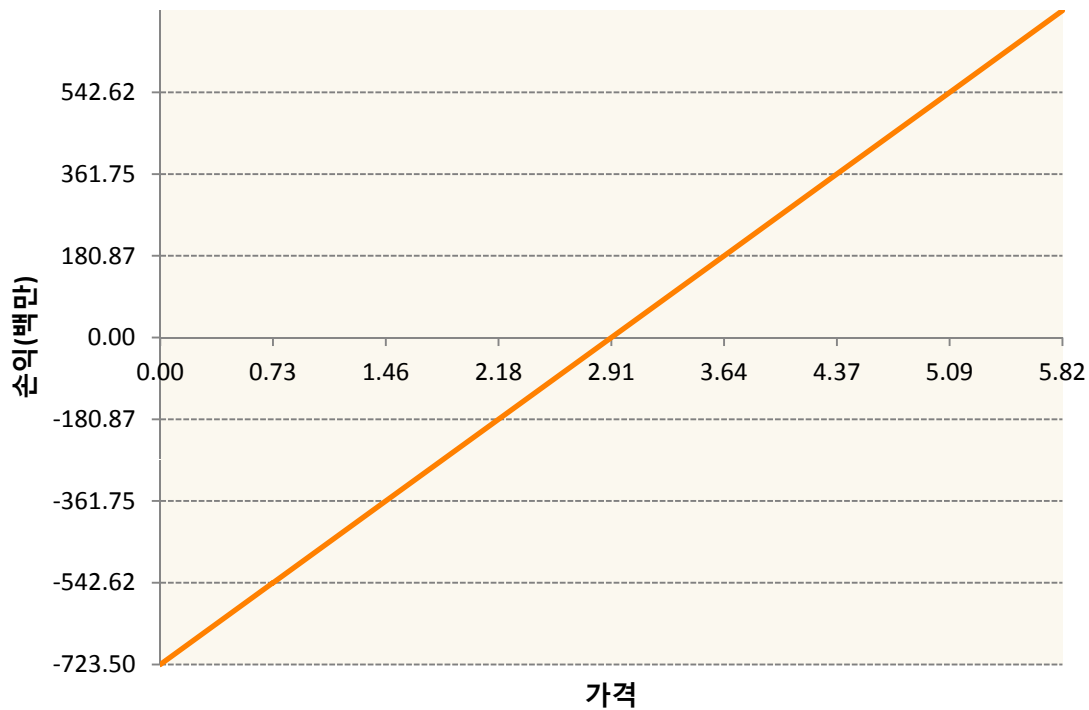
COF0-BRENT CRUDE FUTR Jan20



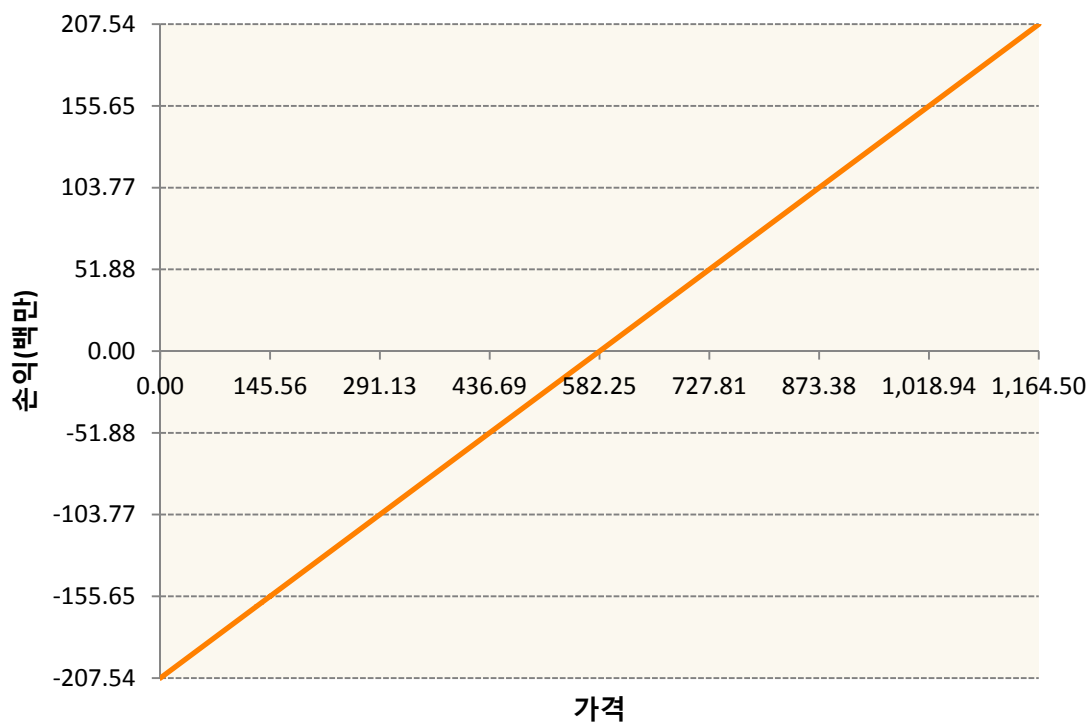




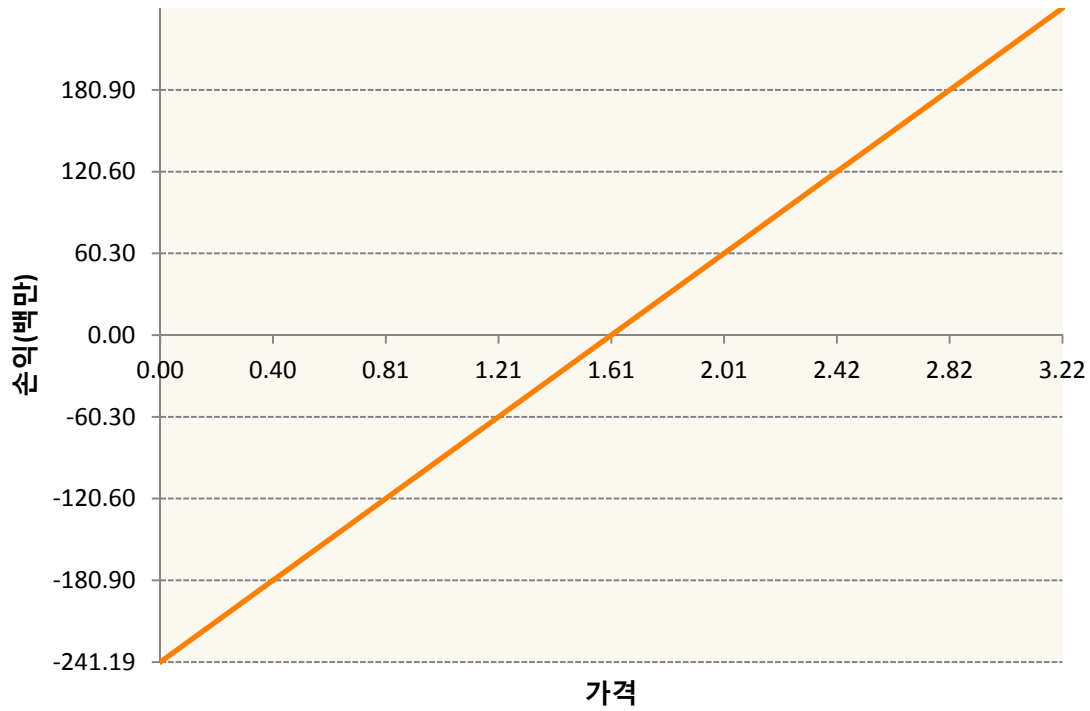
NGF20-NATURAL GAS FUTR Jan20



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	19

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

(단위:백만원)

429

공시일	2019-11-08
기준일	2019-11-07

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

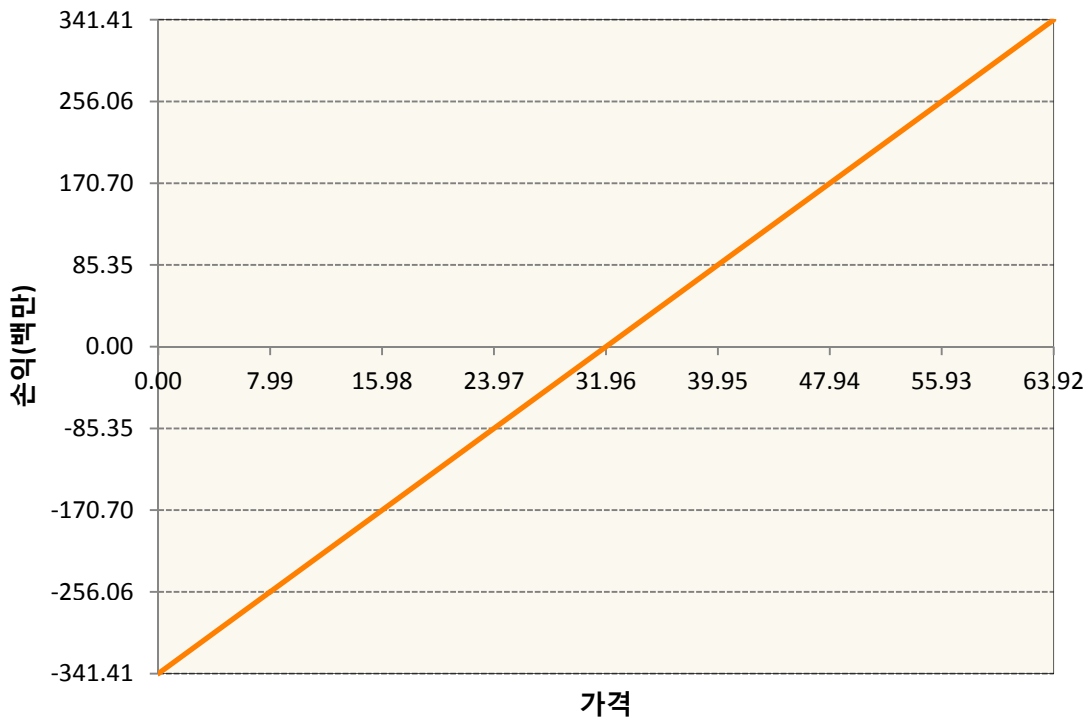
1. 계약금액

(단위:백만원)

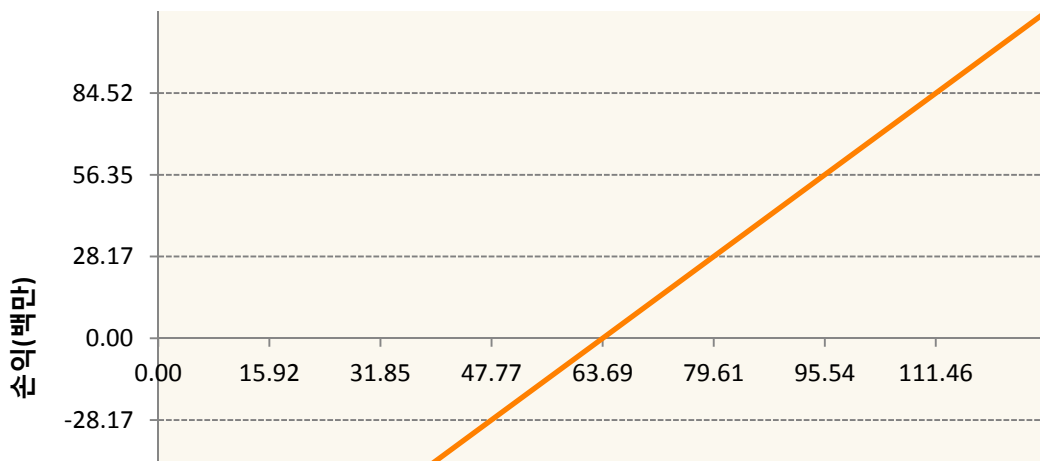
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,874	93	2,782	

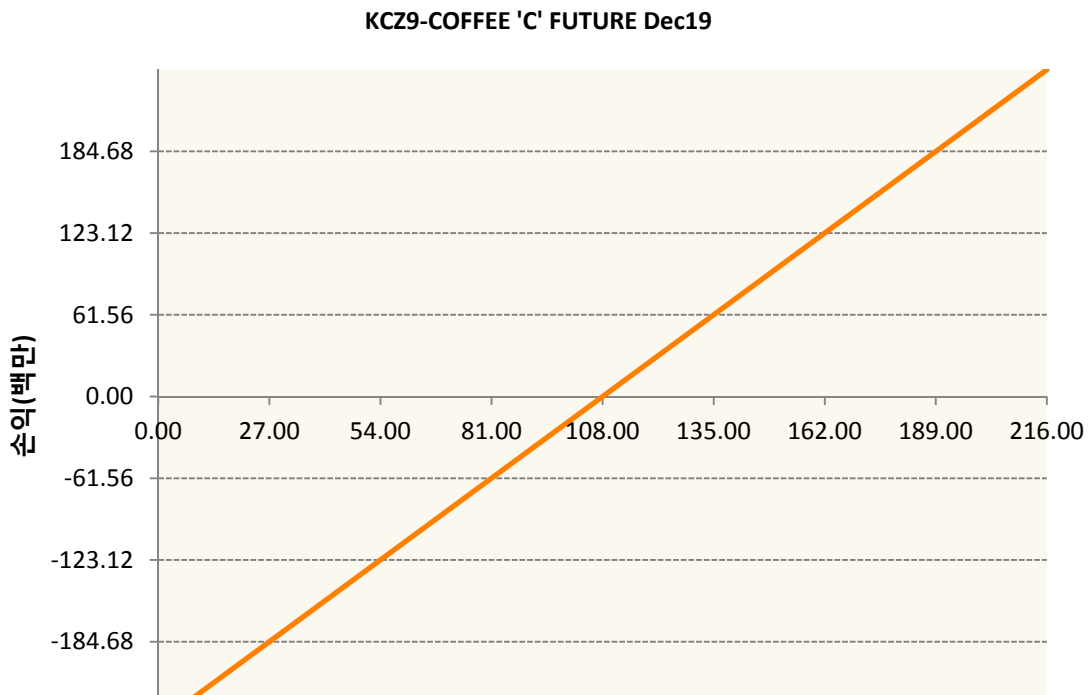
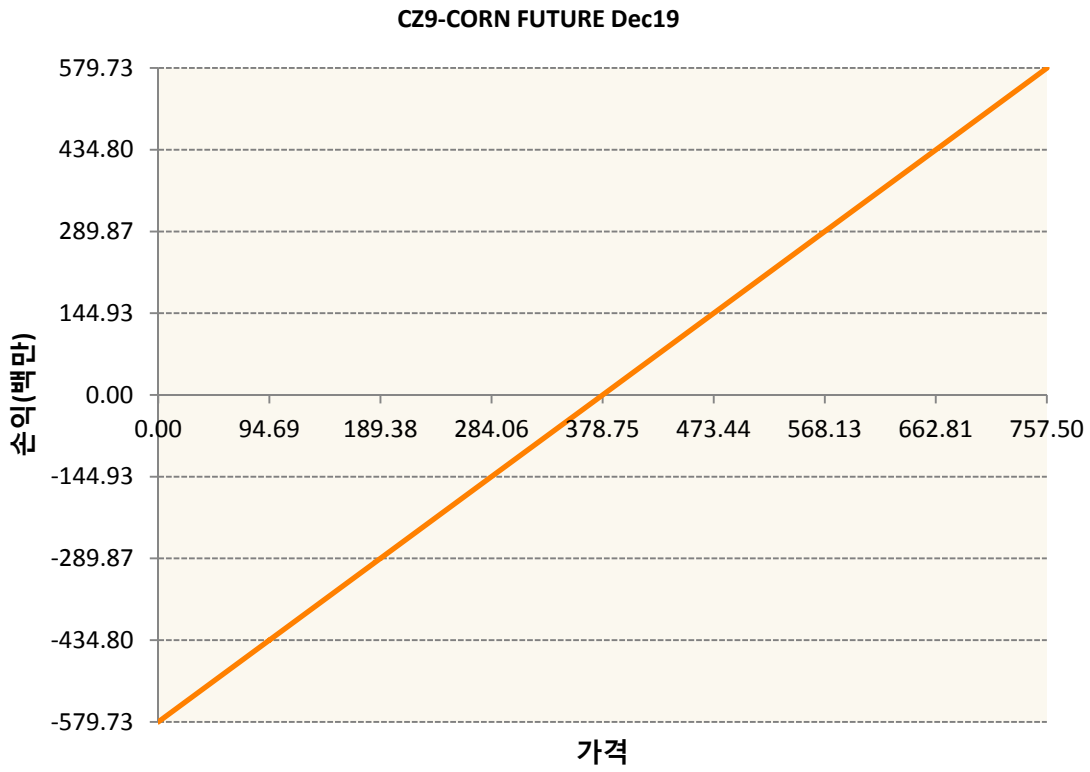
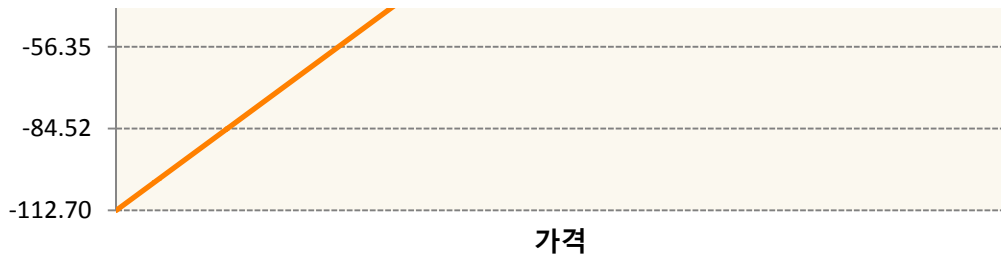
2. 만기시점의 손익구조

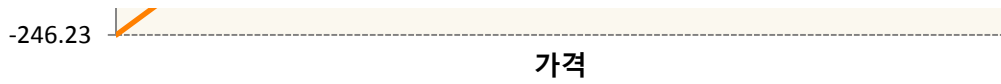
BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20



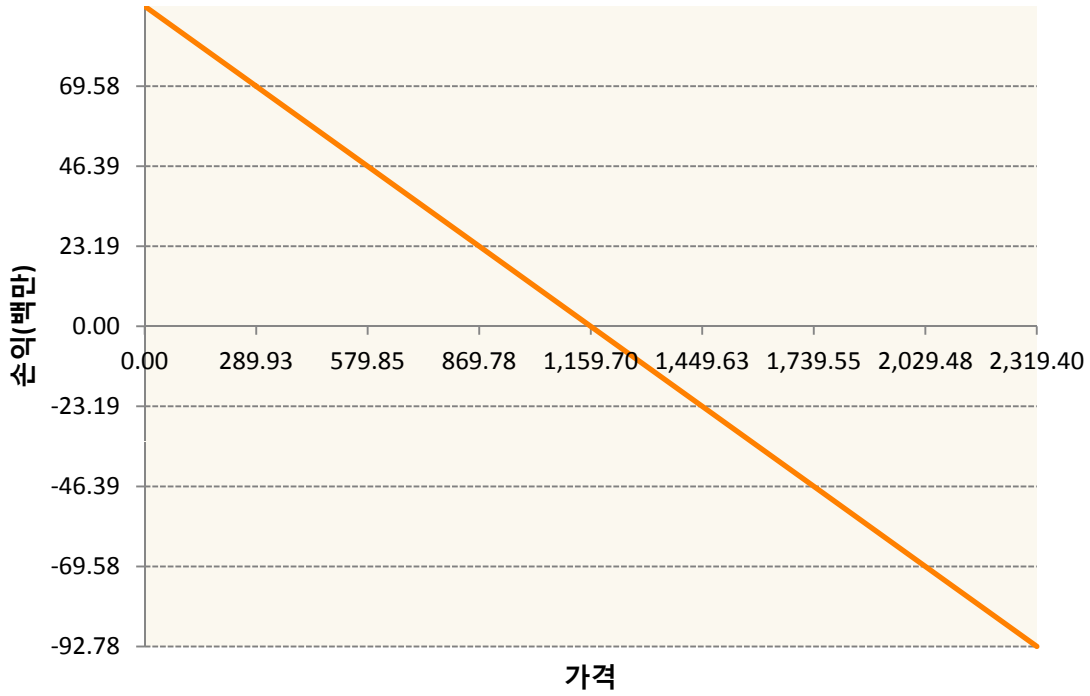
CTZ9-COTTON NO.2 FUTR Dec19



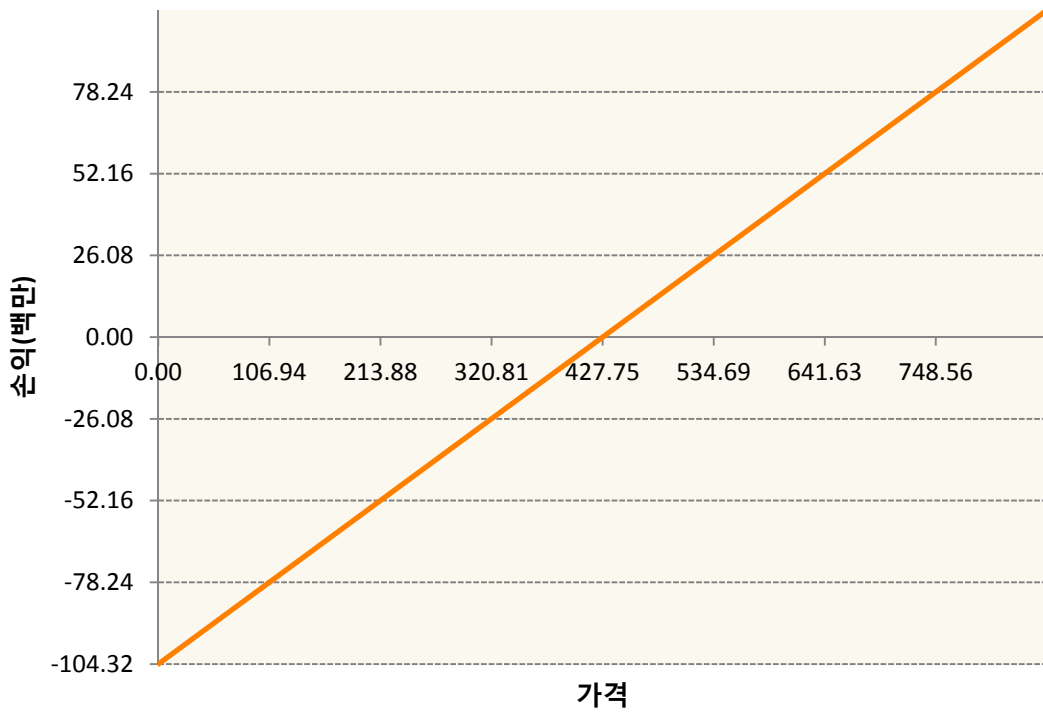




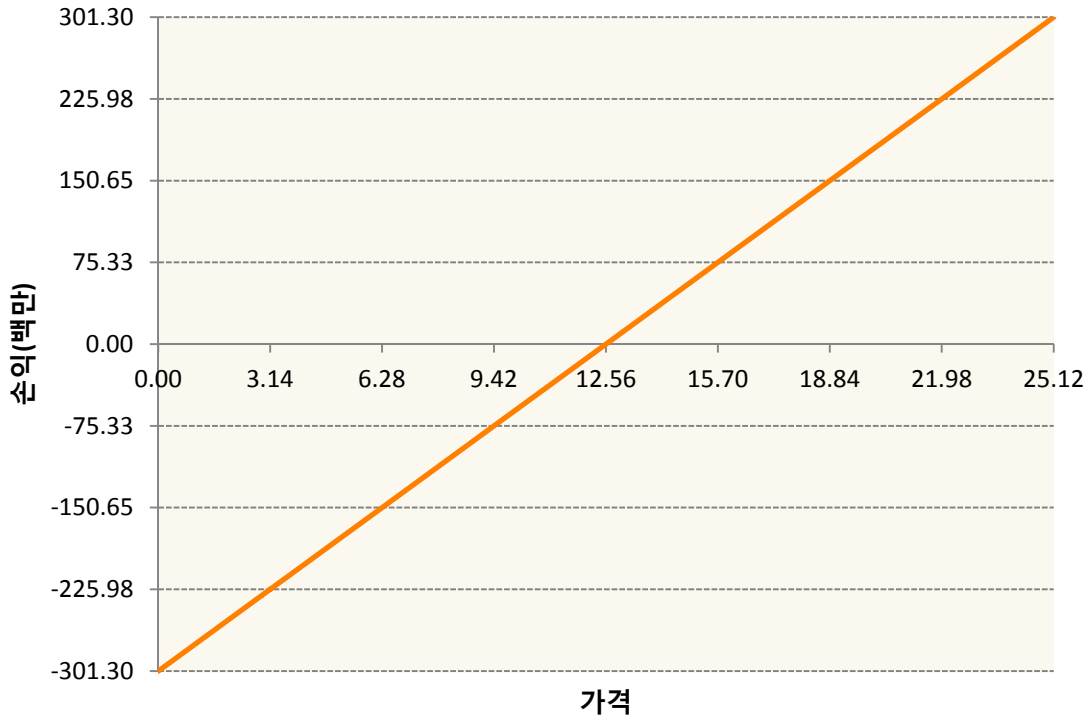
KR4175PB0004-2019-11 달러선물



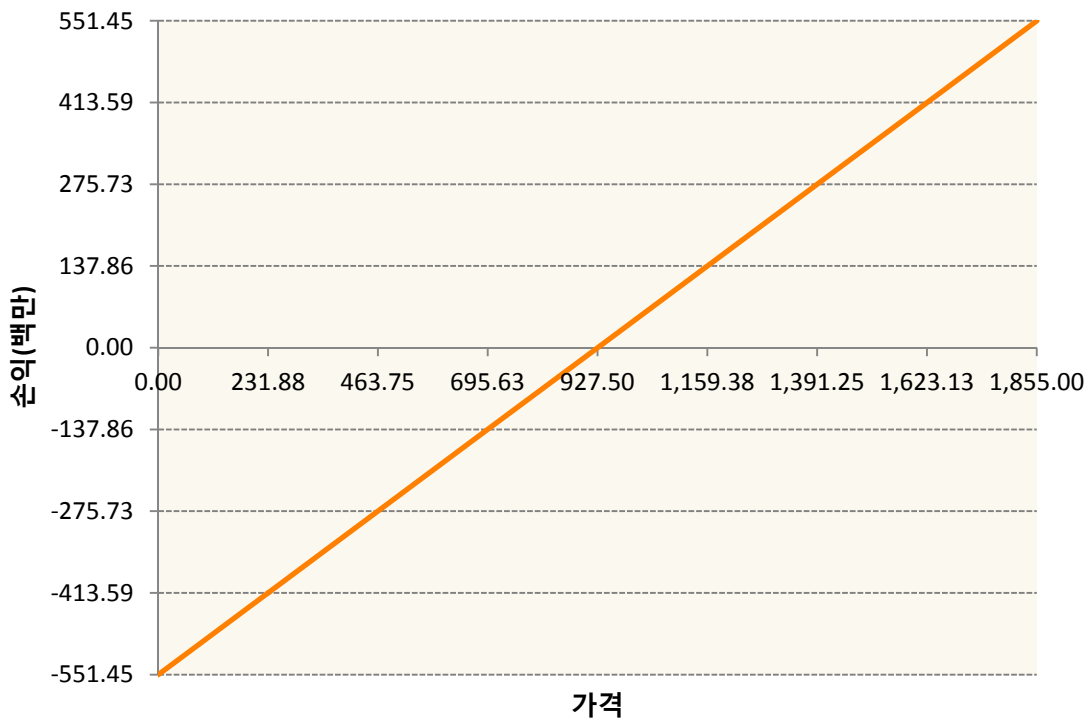
KWZ9-KC HRW WHEAT FUT Dec19



SBH0-Sugar Mar20

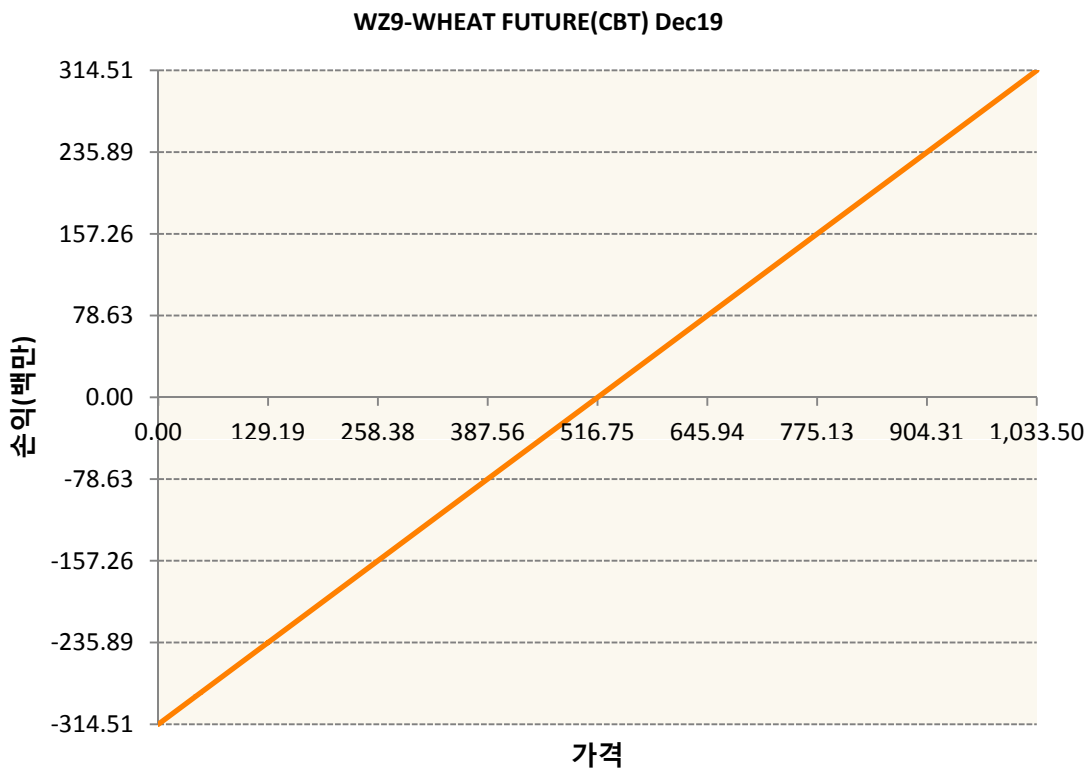
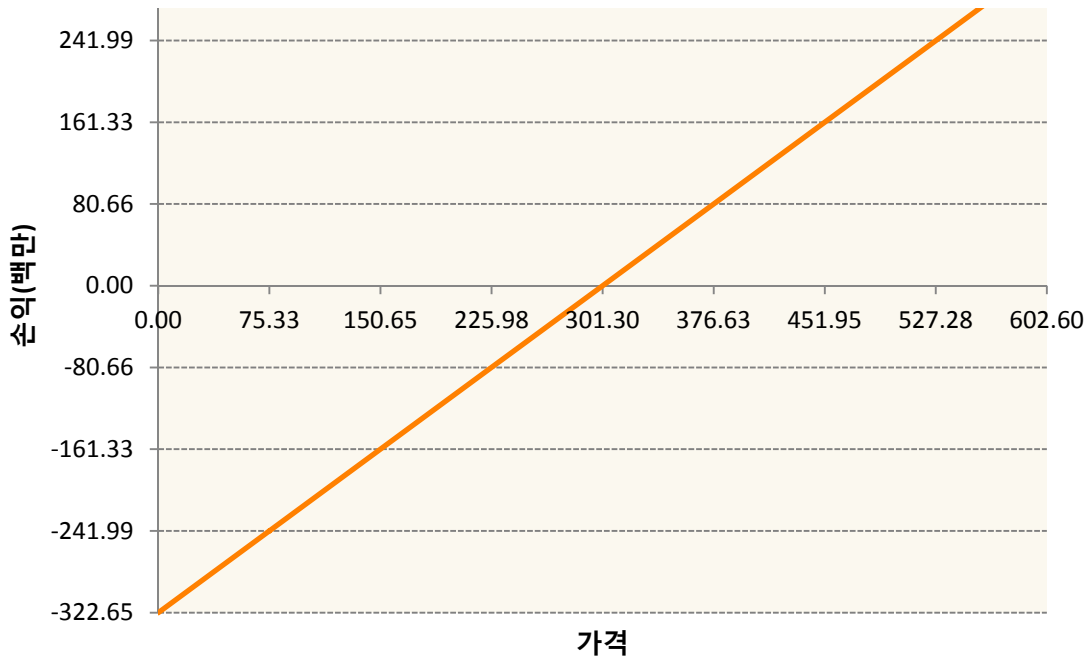


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20



SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF0	SOYBEAN OIL FUTR Jan20	27
CTZ9	COTTON NO.2 FUTR Dec19	9
CZ9	CORN FUTURE Dec19	46
KCZ9	COFFEE 'C' FUTURE Dec19	20
KR4175PB00	2019-11 달러선물	7

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

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

(단위:백만원)

255