

공시일	2019-11-14
기준일	2019-11-13

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	2019-11-14
기준일	2019-11-13

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

1,219

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

703

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-11-14
기준일	2019-11-13

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)	377
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	138

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

753

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-11-14
기준일	2019-11-13

유로인덱스모(주식-파생형)

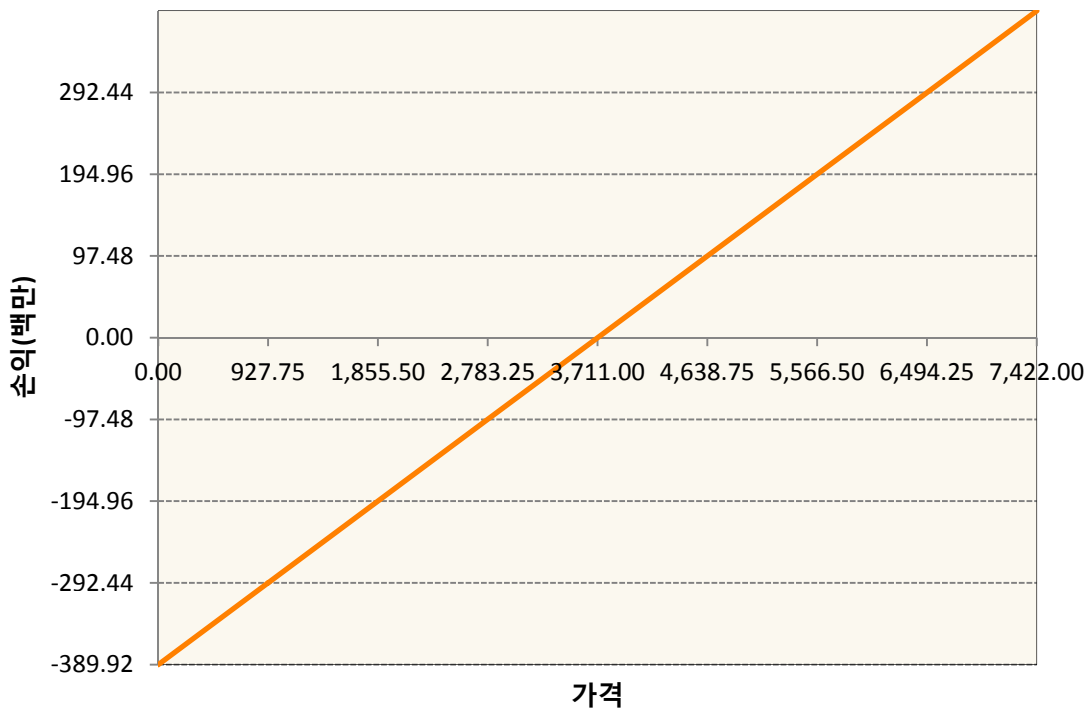
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	390	0	390	

2. 만기시점의 손익구조

VGZ9-EURO STOXX 50 Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	31
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

22

공시일	2019-11-14
기준일	2019-11-13

차이나인덱스모(주식-파생형)

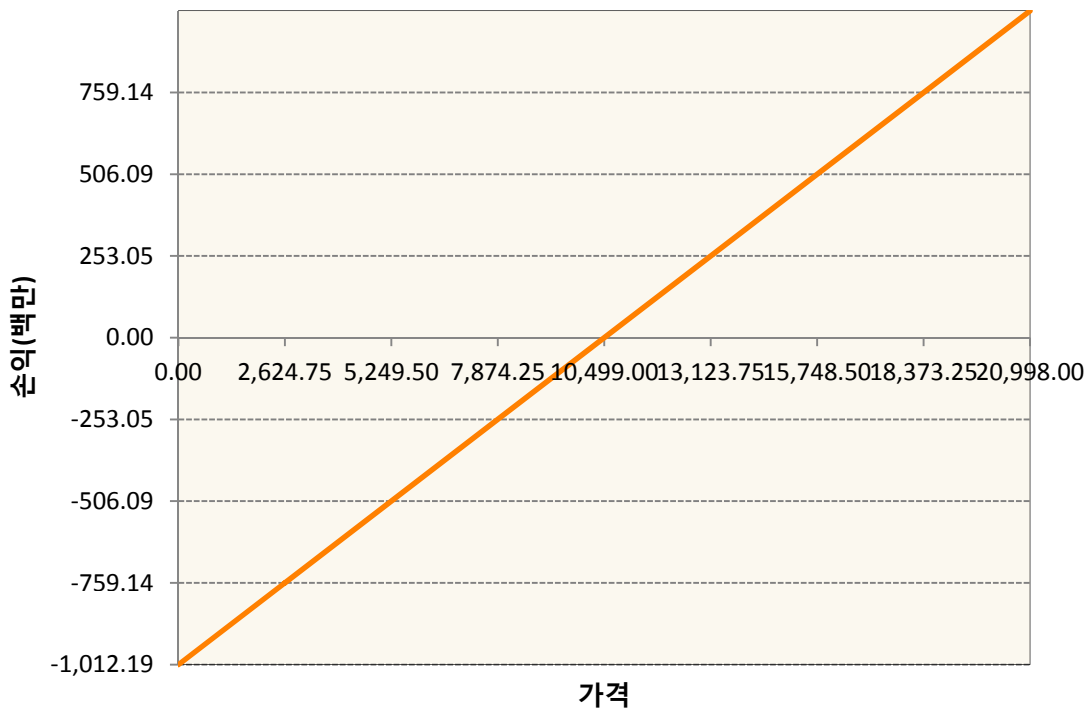
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,012	0	1,012	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCX9-HSCEI Futures Nov19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCX9	HSCEI Futures Nov19	81
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

72

공시일	2019-11-14
기준일	2019-11-13

커버드콜모(주식혼합-파생형)

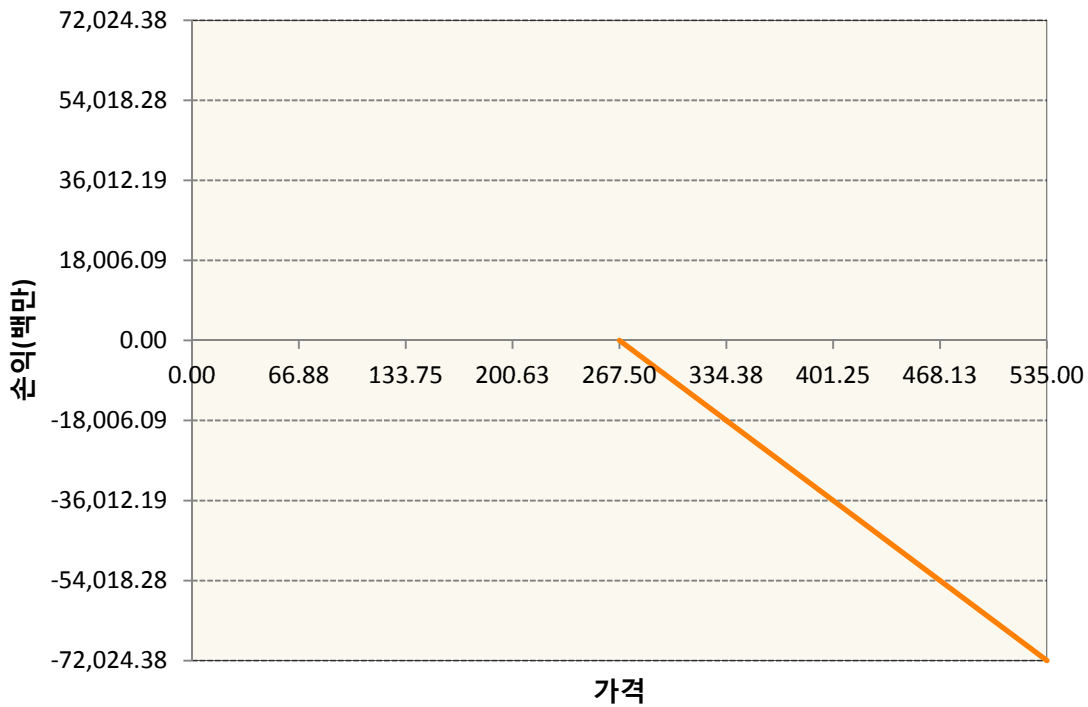
1. 계약금액

(단위:백만원)

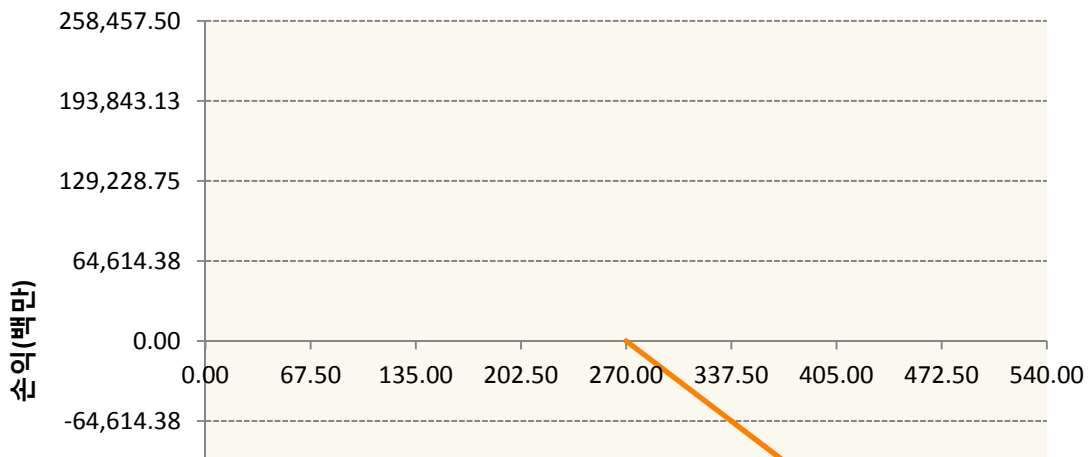
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	482,288	-482,288	장내

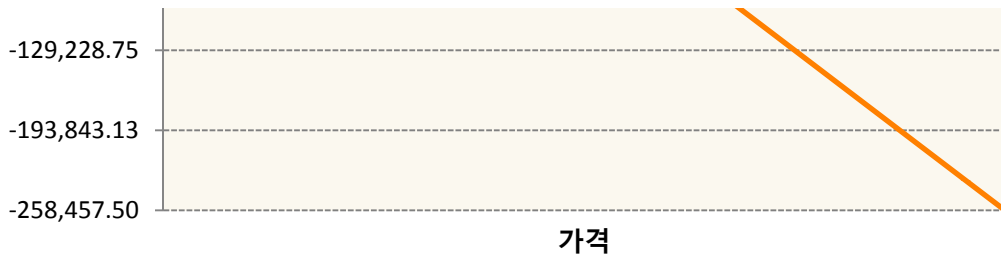
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PB2677-2019-11 콜267.5

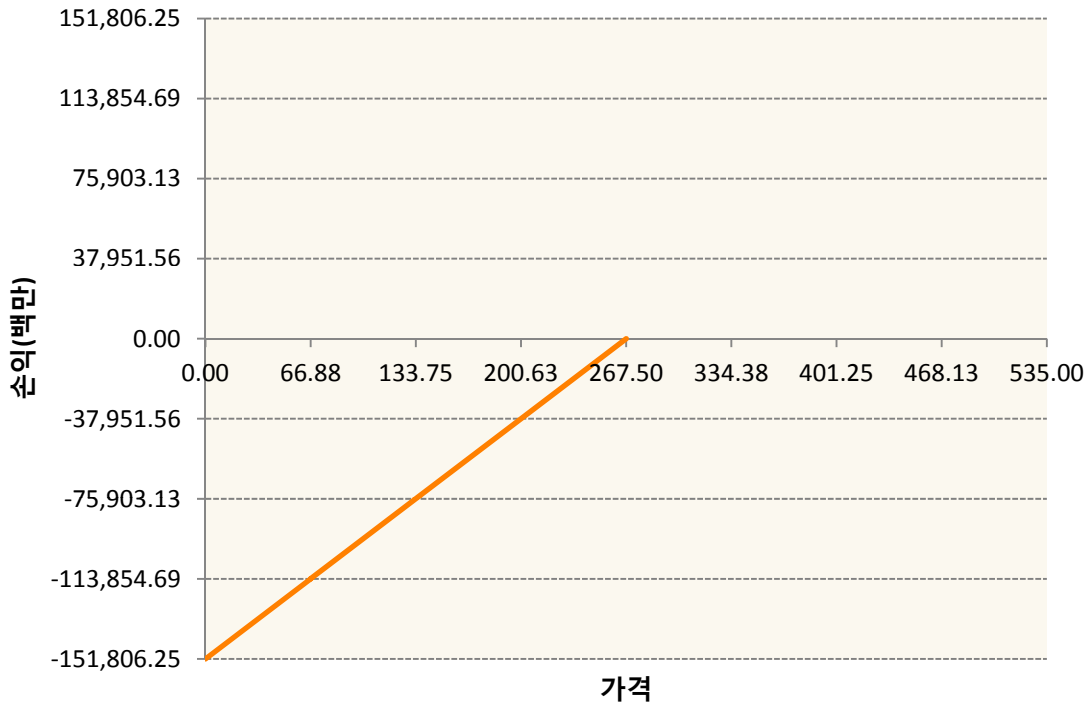


KR4201PB2701-2019-11 콜270





KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PB2677		2019-11 콜267.5					6,058
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,708	3,708	3,706	3,705	3,702	3,698	3,692
-5.33%	3,537	3,505	3,473	3,441	3,408	3,375	3,342
-2.67%	2,015	2,011	2,004	1,996	1,985	1,973	1,959
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	-2,019	-2,019	-2,019	-2,019	-2,019	-2,019	-2,019
5.33%	-4,039	-4,039	-4,039	-4,039	-4,039	-4,039	-4,039
8.00%	-6,058	-6,058	-6,058	-6,058	-6,058	-6,058	-6,058
KR4201PB2701		2019-11 콜270					21,537
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,793	10,793	10,792	10,791	10,789	10,785	10,779

-5.33%	10,664	10,607	10,540	10,467	10,387	10,302	10,214
-2.67%	7,051	6,992	6,925	6,850	6,769	6,683	6,593
0%	2	2	2	0	-3	-8	-16
2.67%	-7,177	-7,177	-7,177	-7,177	-7,177	-7,177	-7,177
5.33%	-14,357	-14,357	-14,357	-14,357	-14,357	-14,357	-14,357
8.00%	-21,537	-21,537	-21,537	-21,537	-21,537	-21,537	-21,537
KR4301PB2676 2019-11 풋267.5							4,954
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,954	-4,954	-4,954	-4,954	-4,954	-4,954	-4,954
-5.33%	-777	-801	-827	-854	-882	-911	-941
-2.67%	0	0	0	0	0	-1	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

28,804

공시일	2019-11-14
기준일	2019-11-13

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

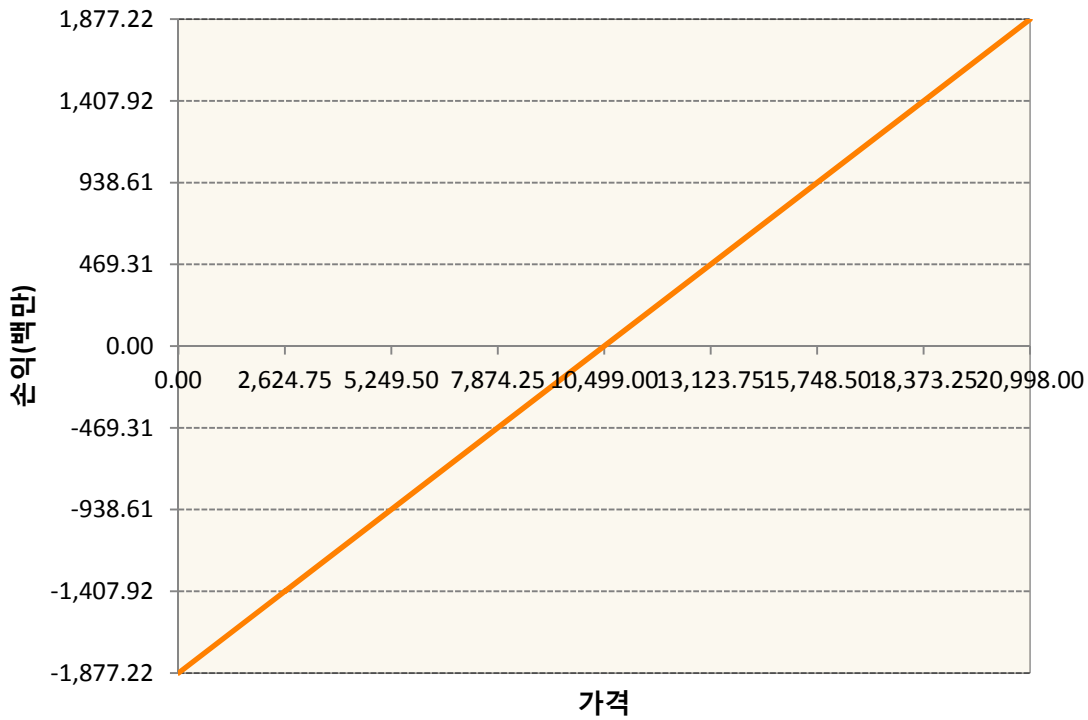
1. 계약금액

(단위:백만원)

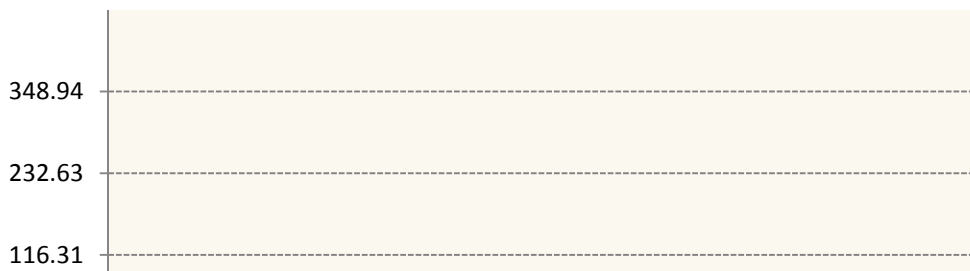
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,877	0	1,877	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,001	-5,001	장내
누계	통화	선도	671	2,771	-2,100	장외

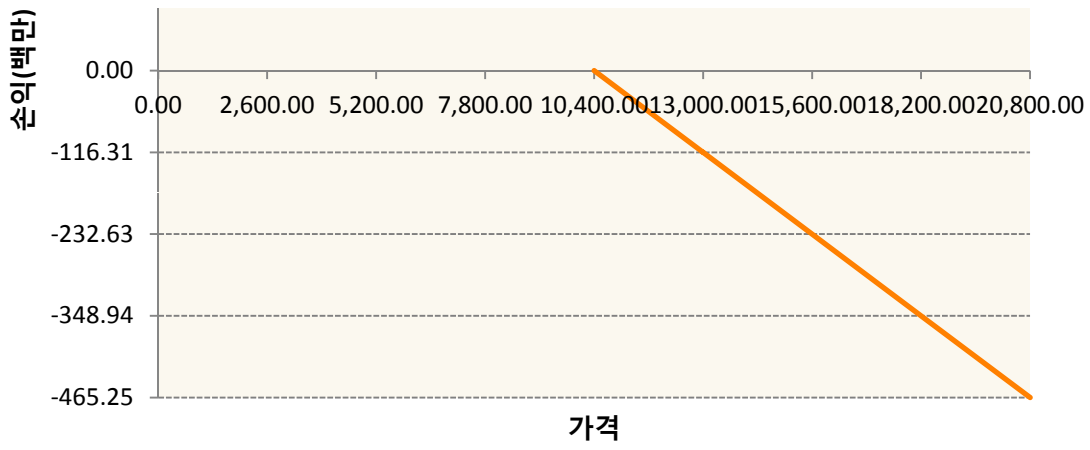
2. 만기시점의 손익구조

HCX9-HSCEI Futures Nov19

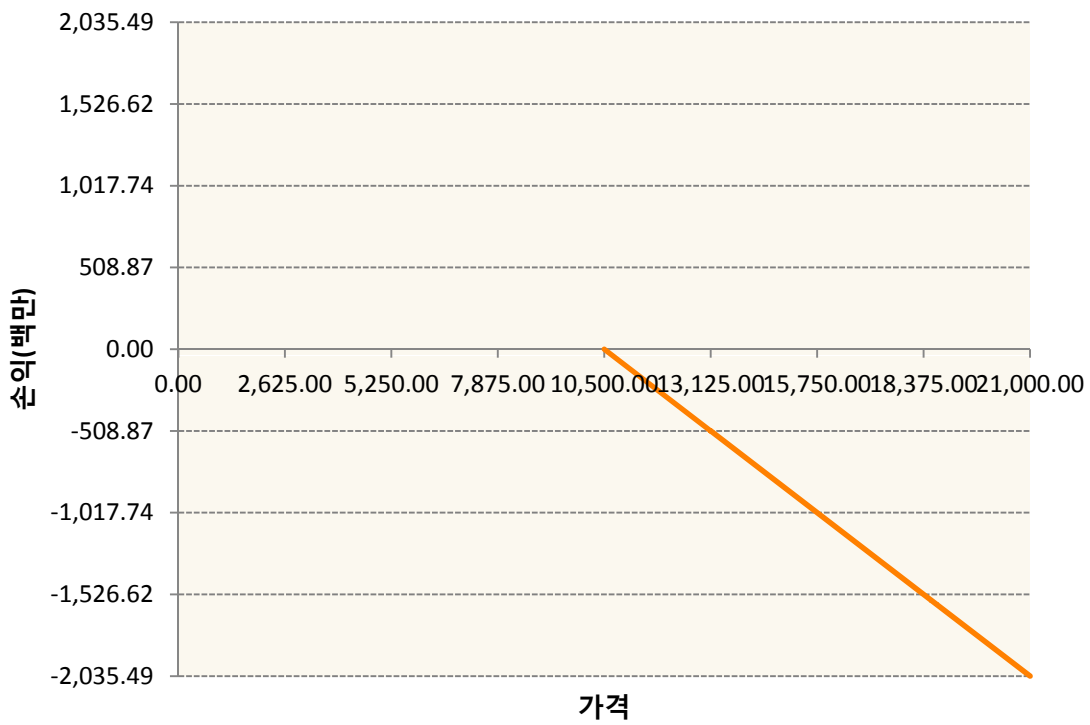


OHHIX9-C104-HSCEI

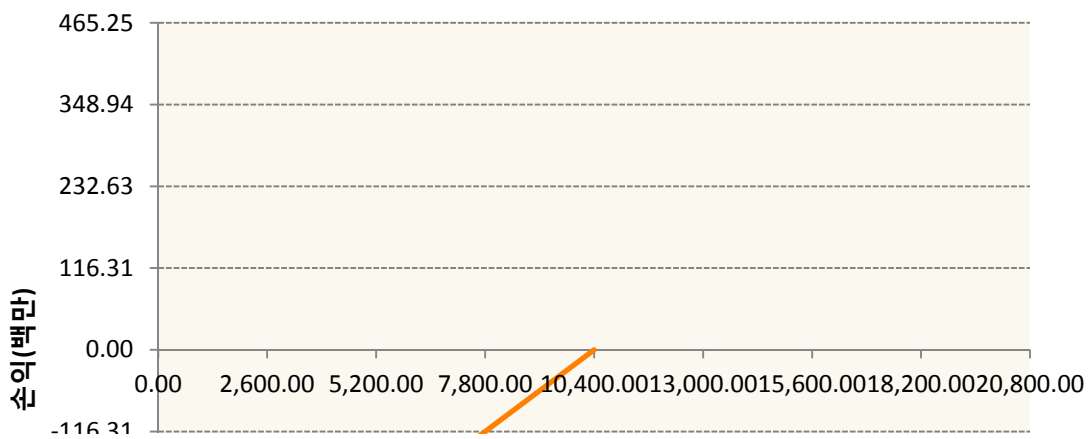


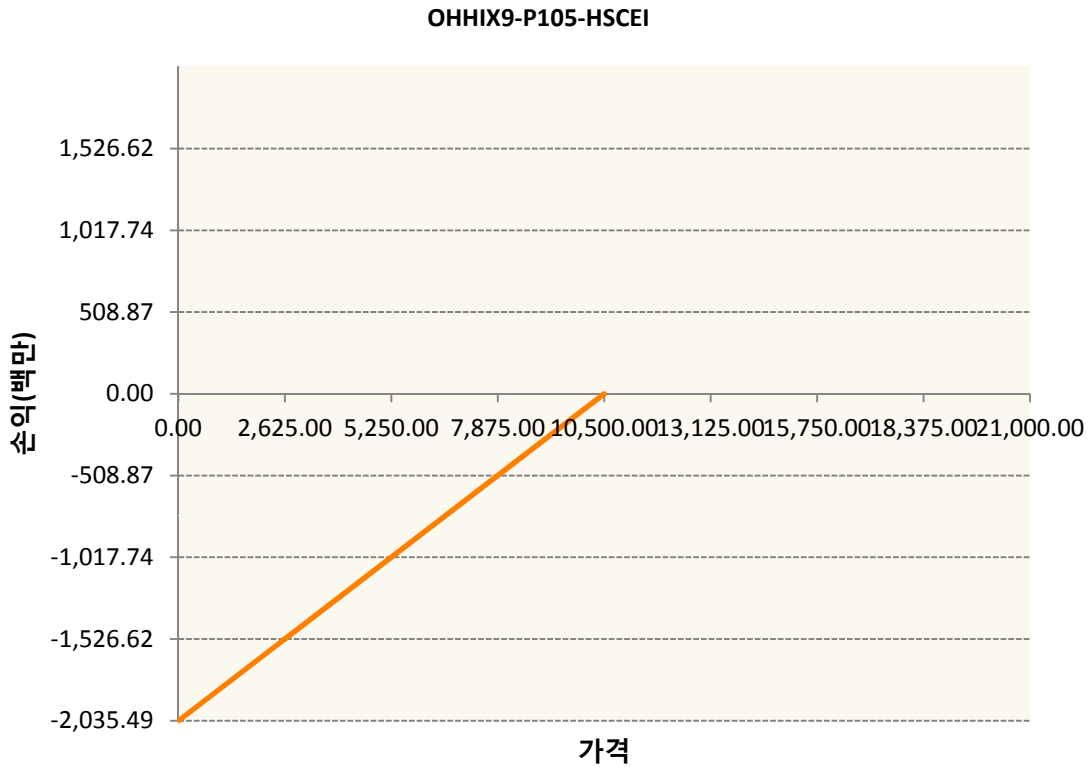
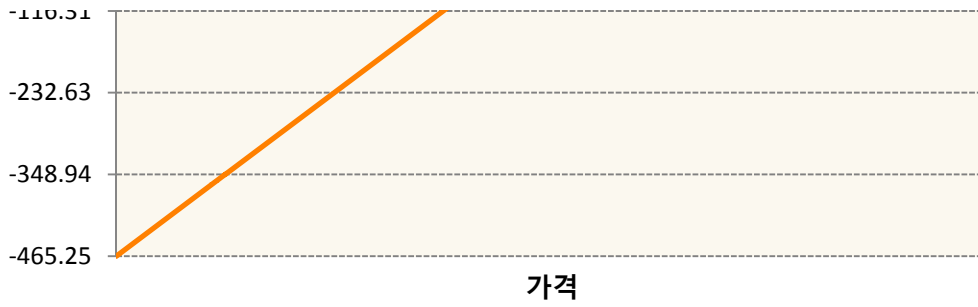


OHHIX9-C105-HSCEI



OHHIX9-P104-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	222
FX21019U00 HKD/KRW 22-11-19E	6
FX21019U02 HKD/KRW 22-11-19E	48
HCX9 HSCEI Futures Nov19	150
OHHIX9-C1C HSCEI	37
OHHIX9-C1C HSCEI	163
OHHIX9-P10 HSCEI	37
OHHIX9-P10 HSCEI	163

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

공시일	2019-11-14
기준일	2019-11-13

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

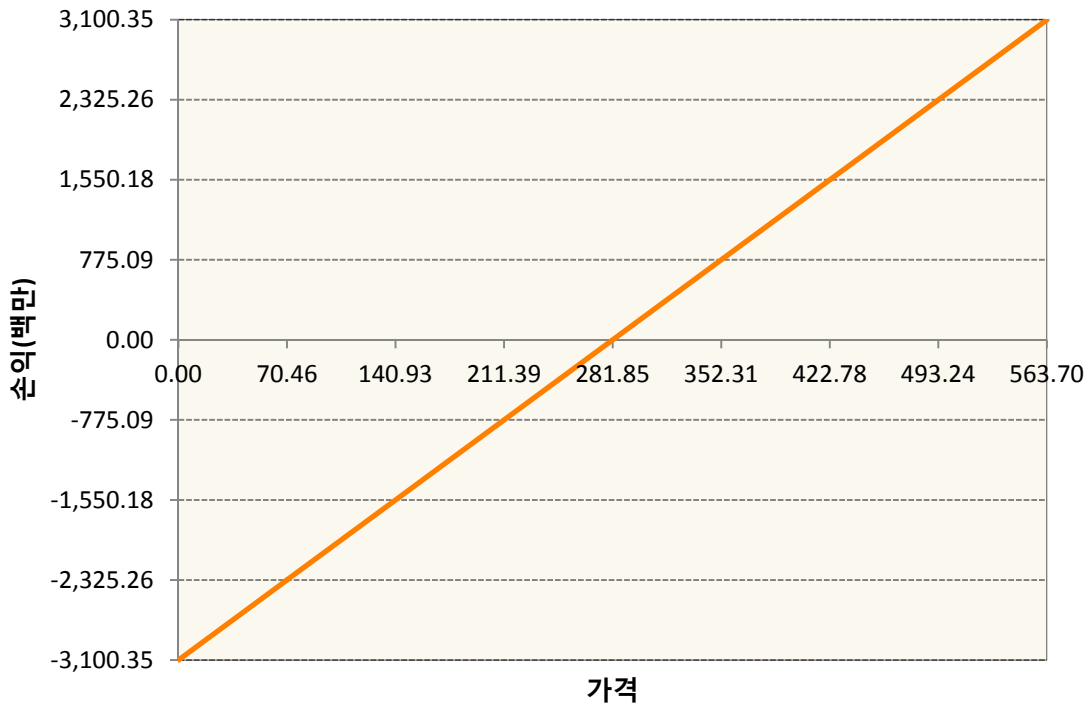
1. 계약금액

(단위:백만원)

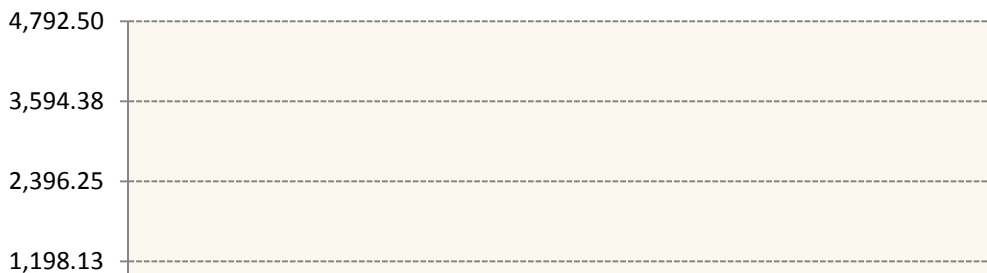
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	1,000	-1,000	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,100	0	3,100	장내
누계	유가증권	스왑	9,625	0	9,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,476	-9,476	장내

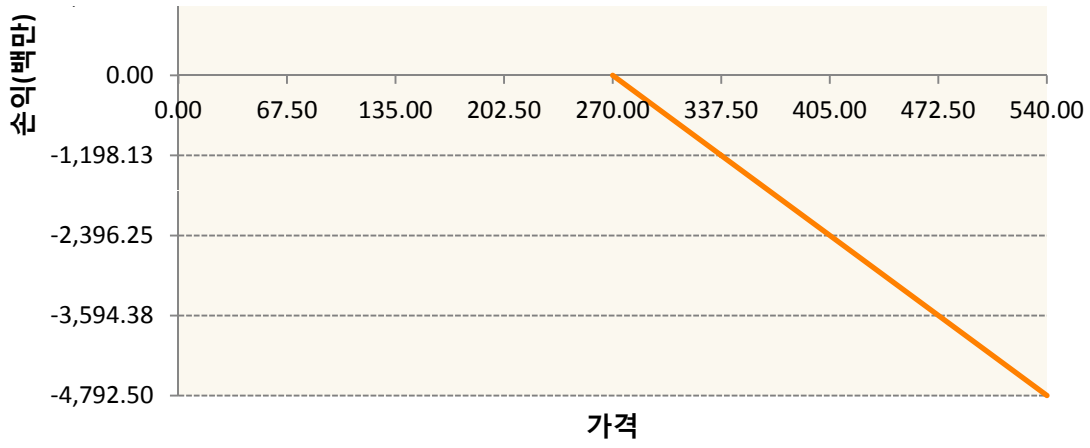
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

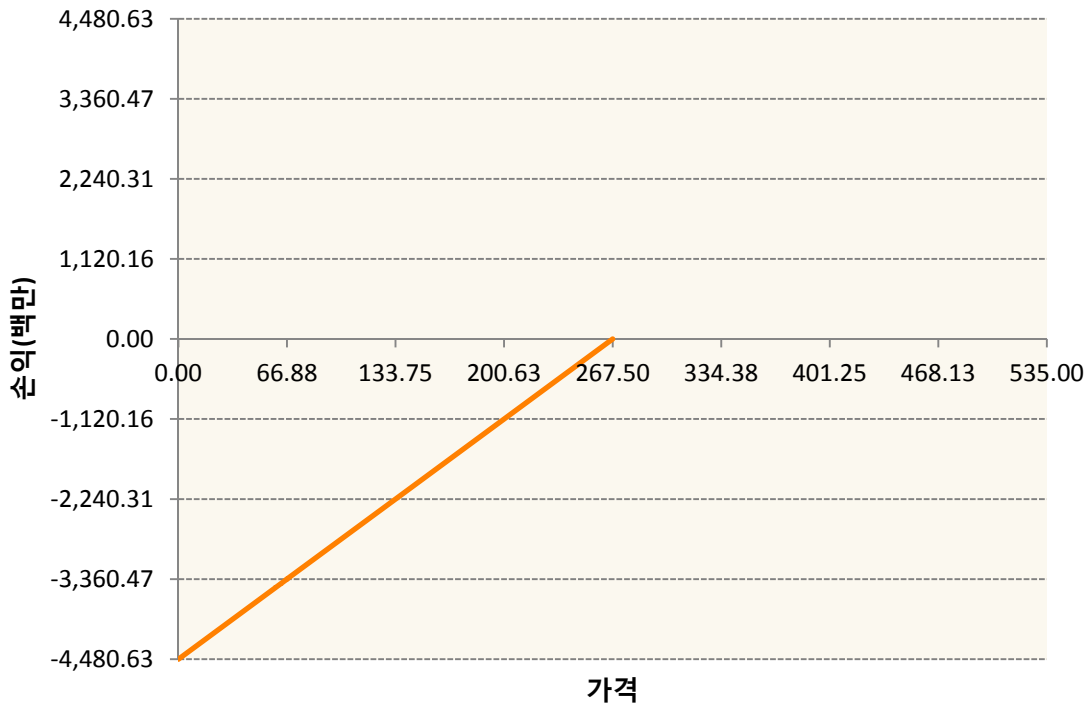


KR4201PB2701-2019-11 콜270

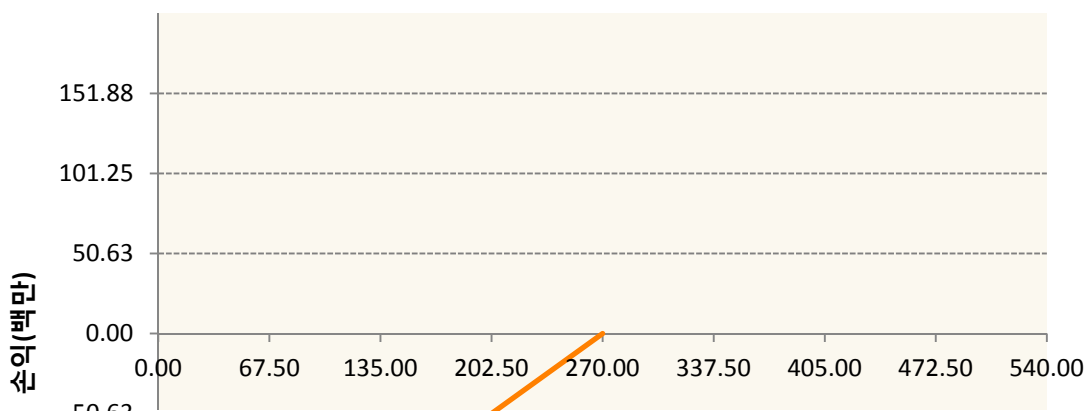




KR4301PB2676-2019-11 풋267.5



KR4301PB2700-2019-11 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						826
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-826	-826	-826	-826	-826	-826	-826	
-5.33%	-550	-550	-550	-550	-550	-550	-550	
-2.67%	-275	-275	-275	-275	-275	-275	-275	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	275	275	275	275	275	275	275	
5.33%	550	550	550	550	550	550	550	
8.00%	826	826	826	826	826	826	826	
KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						248
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-248	-248	-248	-248	-248	-248	-248	
-5.33%	-165	-165	-165	-165	-165	-165	-165	
-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%	165	165	165	165	165	165	165	
8.00%	248	248	248	248	248	248	248	
KR4201PB2701		2019-11 콜270						399
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	200	200	200	200	200	200	200	
-5.33%	198	197	195	194	193	191	189	
-2.67%	131	130	128	127	126	124	122	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133	
5.33%	-266	-266	-266	-266	-266	-266	-266	
8.00%	-399	-399	-399	-399	-399	-399	-399	
KR4301PB2676		2019-11 풋267.5						146
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-146	-146	-146	-146	-146	-146	-146
-5.33%	-23	-24	-24	-25	-26	-27	-28
-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
KR4301PB2700 2019-11 풋270							8
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-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)

1,440

공시일	2019-11-14
기준일	2019-11-13

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

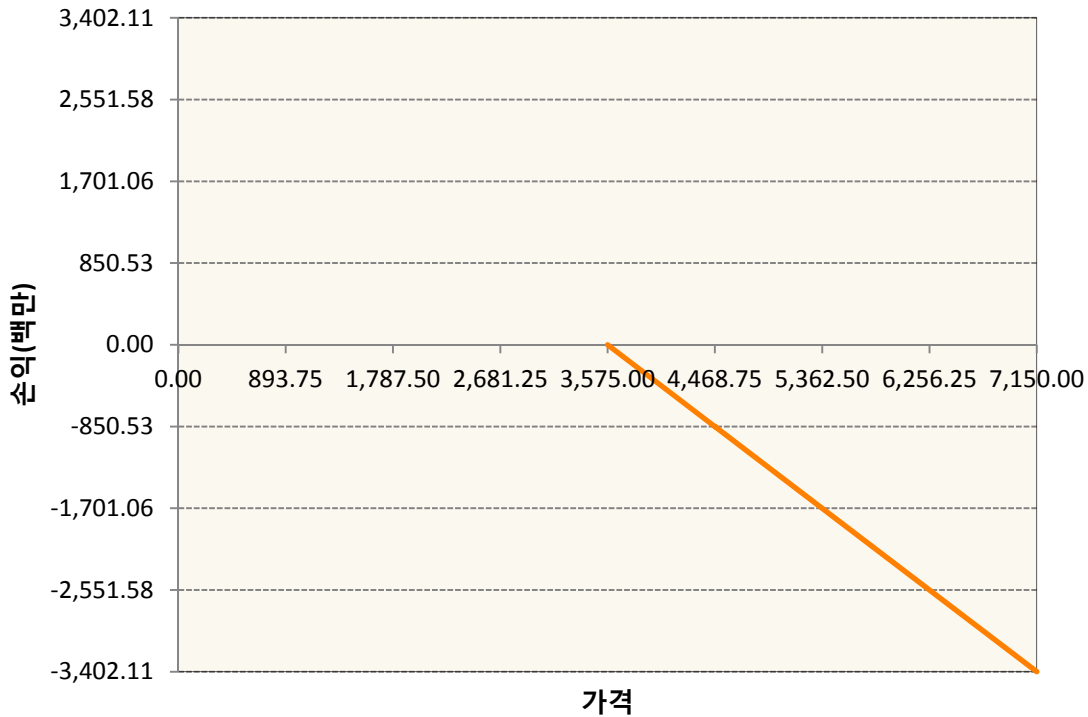
1. 계약금액

(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	1,349	0	1,349	
누계	유가증권	스왑	20,204	0	20,204	장외
누계	유가증권	옵션	0	8,378	-8,378	장내
누계	통화	선도	2,027	6,044	-4,017	장외

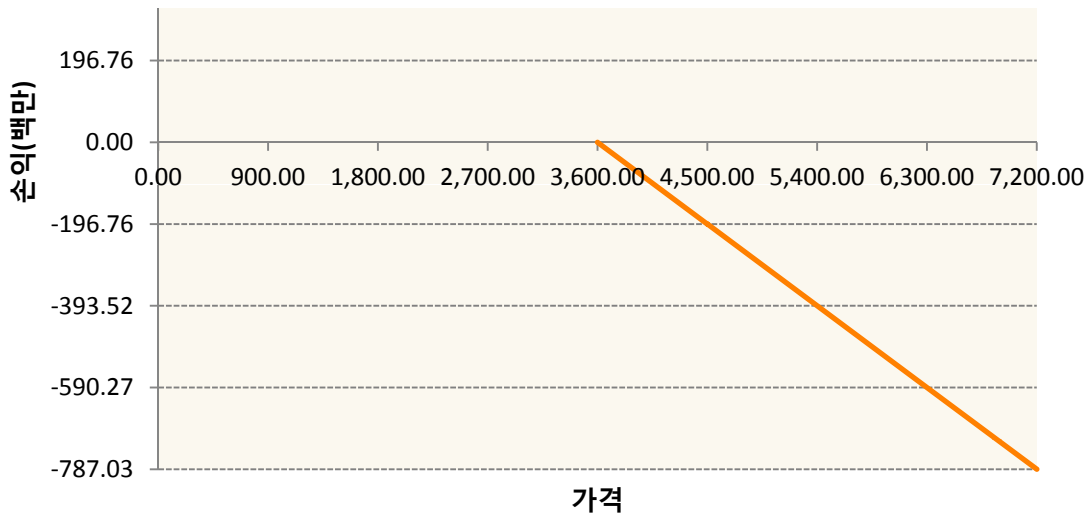
2. 만기시점의 손익구조

OESXX9-C3575-EURO STOXX 50

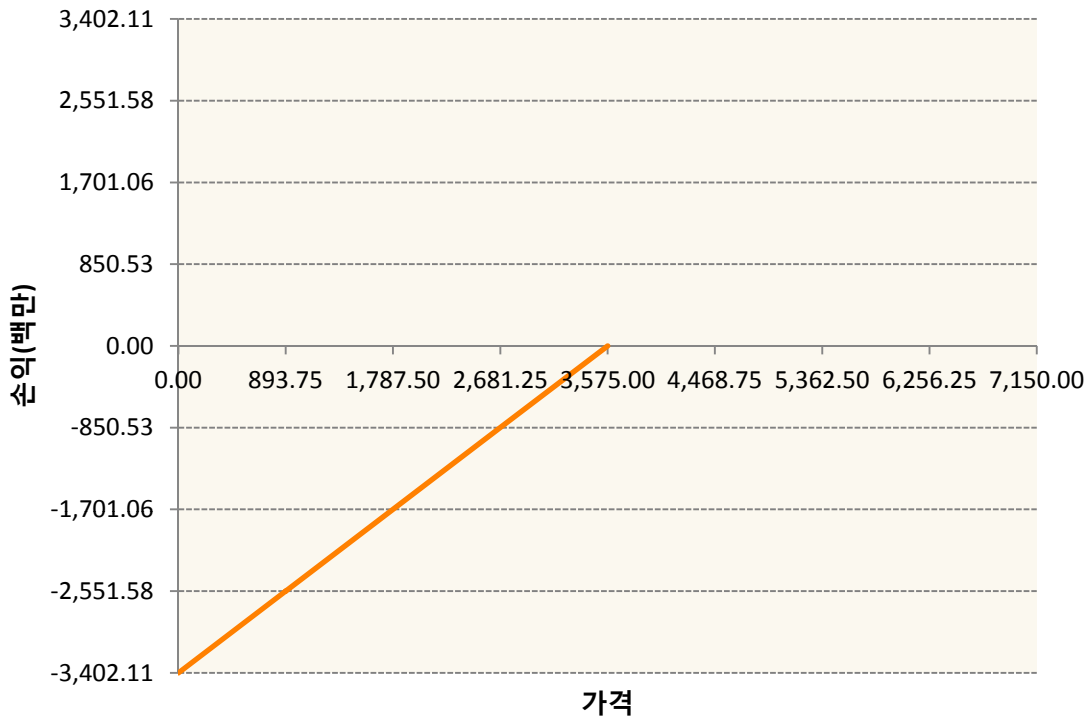


OESXX9-C3600-EURO STOXX 50

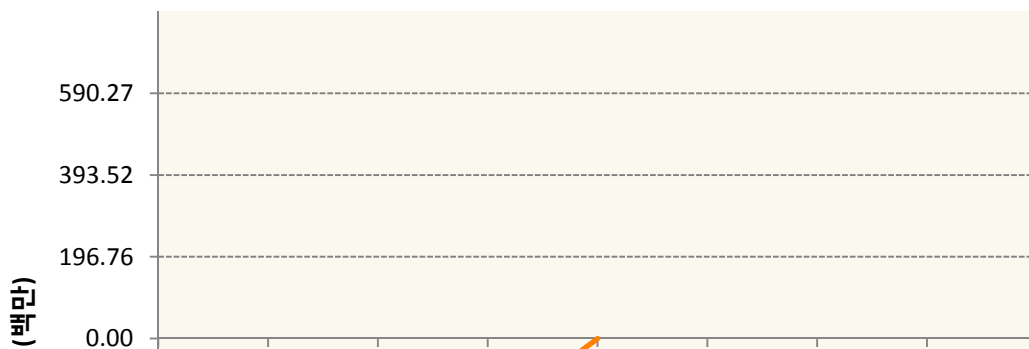


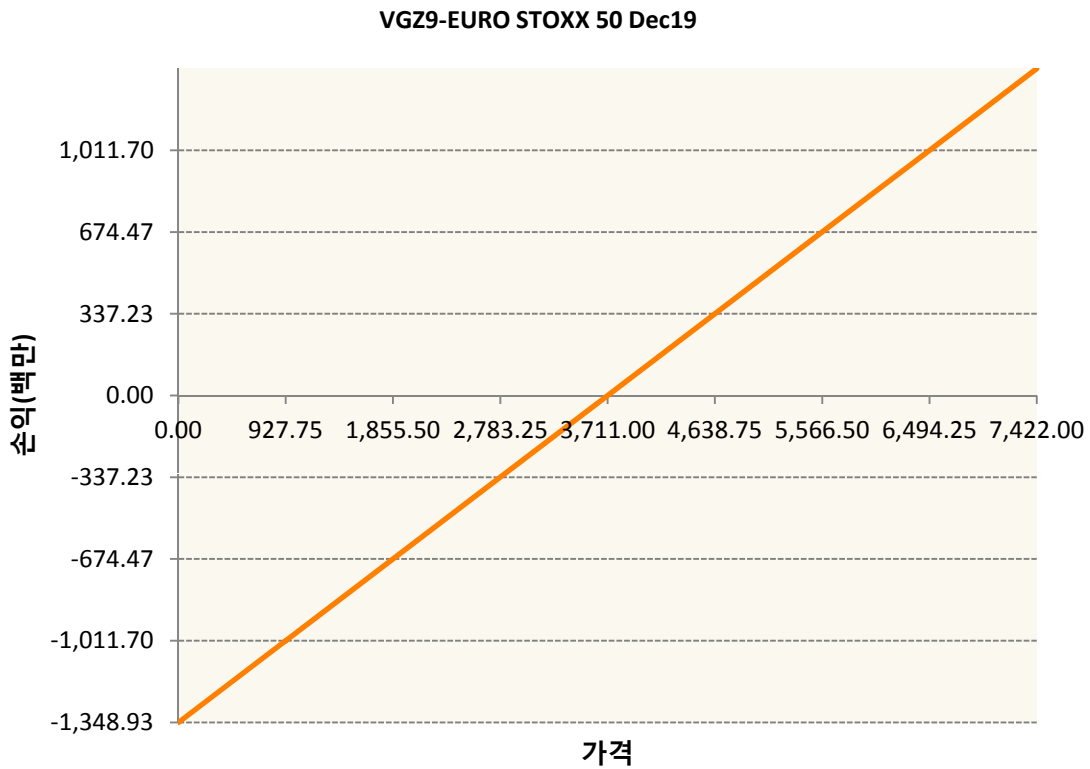
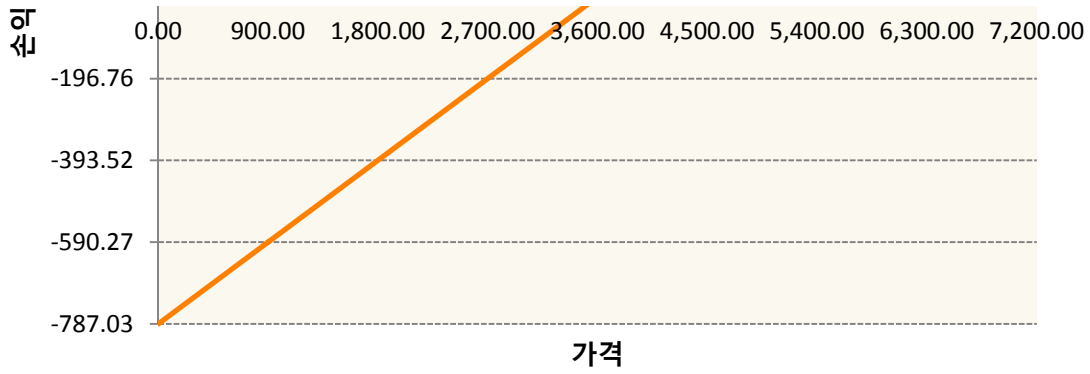


OESXX9-P3575-EURO STOXX 50



OESXX9-P3600-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		24
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E		484
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E		162
OESXX9-C35 EURO STOXX 50		272
OESXX9-C36 EURO STOXX 50		63
OESXX9-P35 EURO STOXX 50		272
OESXX9-P36 EURO STOXX 50		63
VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	108

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

(단위:백만원)

859

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

(단위:백만원)

906

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

(단위:백만원)

79

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

(단위:백만원)

123

공시일	2019-11-14
기준일	2019-11-13

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

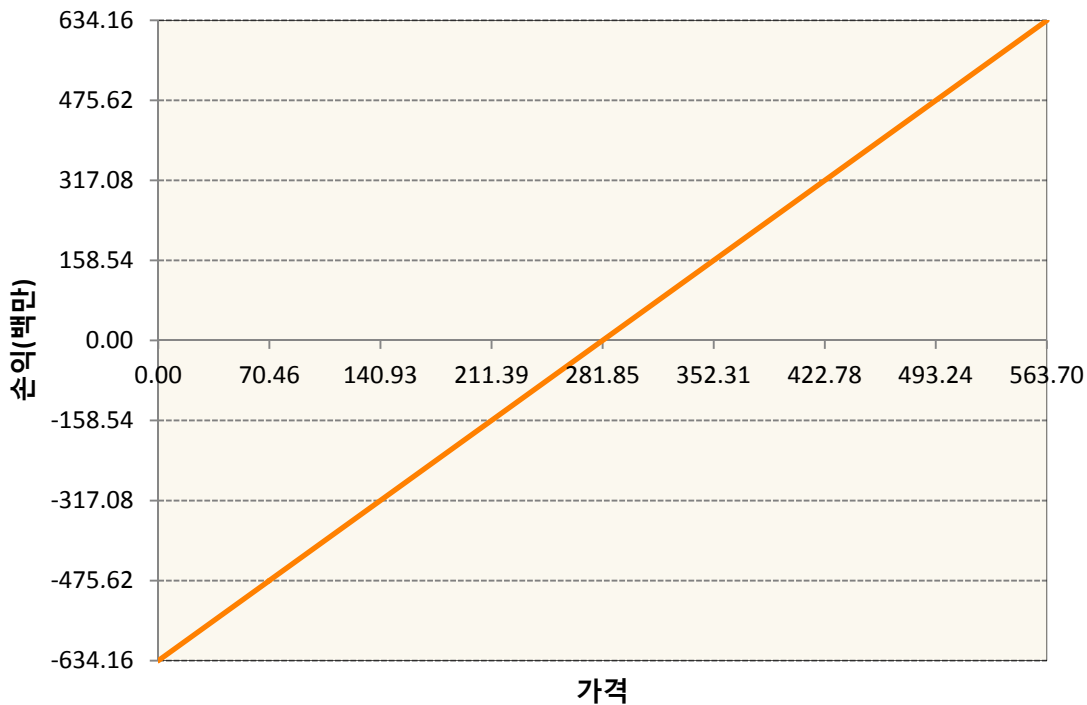
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	634	0	634	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)

40

공시일	2019-11-14
기준일	2019-11-13

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

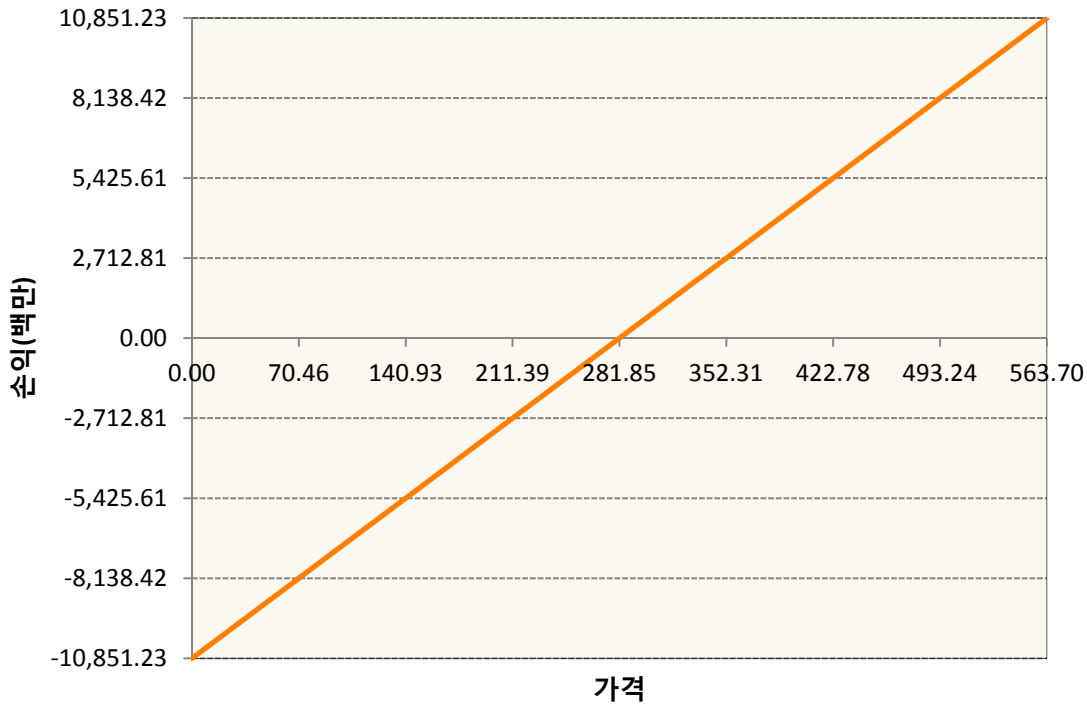
1. 계약금액

(단위:백만원)

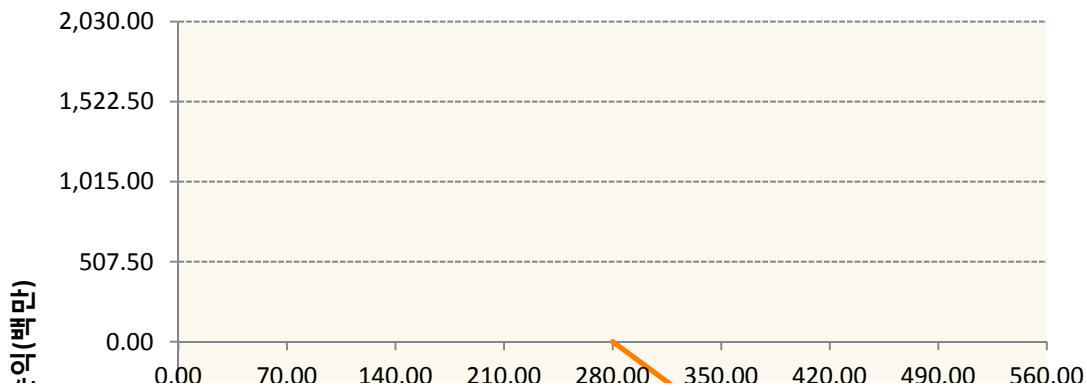
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,851	0	10,851	장내
누계	유가증권	옵션	3,359	20,181	-16,821	장내

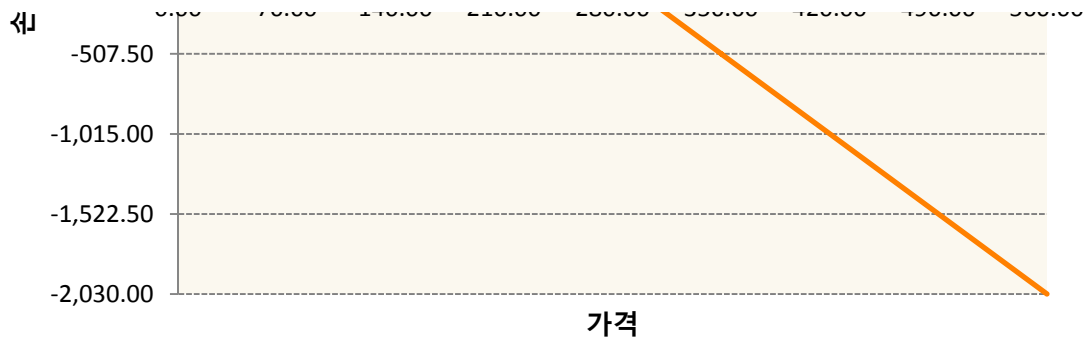
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

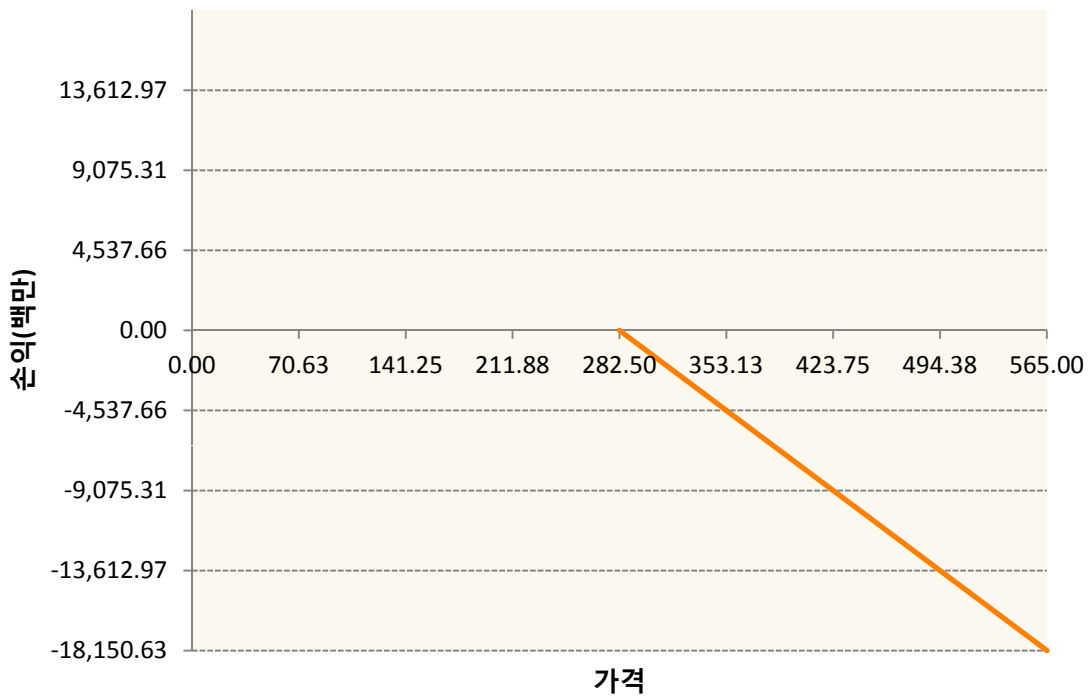


KR4201PB2800-2019-11 콜280

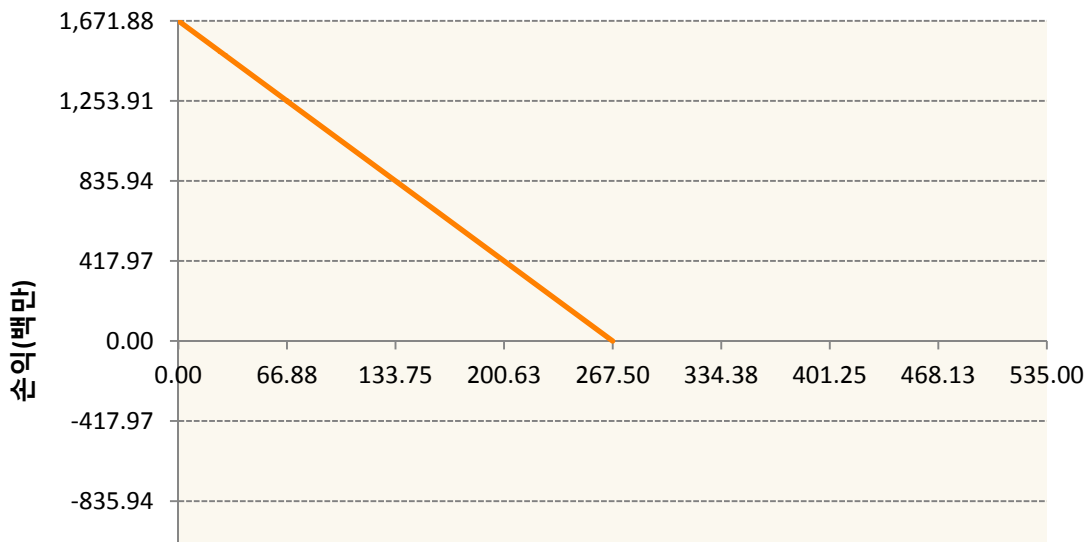


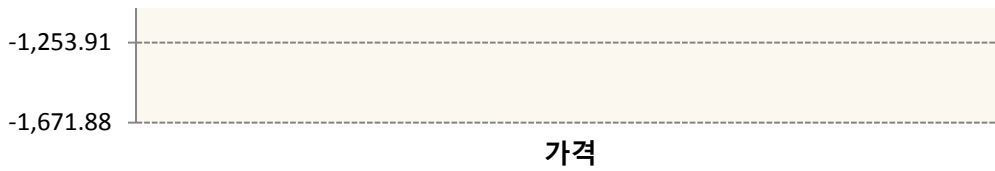


KR4201PB2826-2019-11 콜282.5

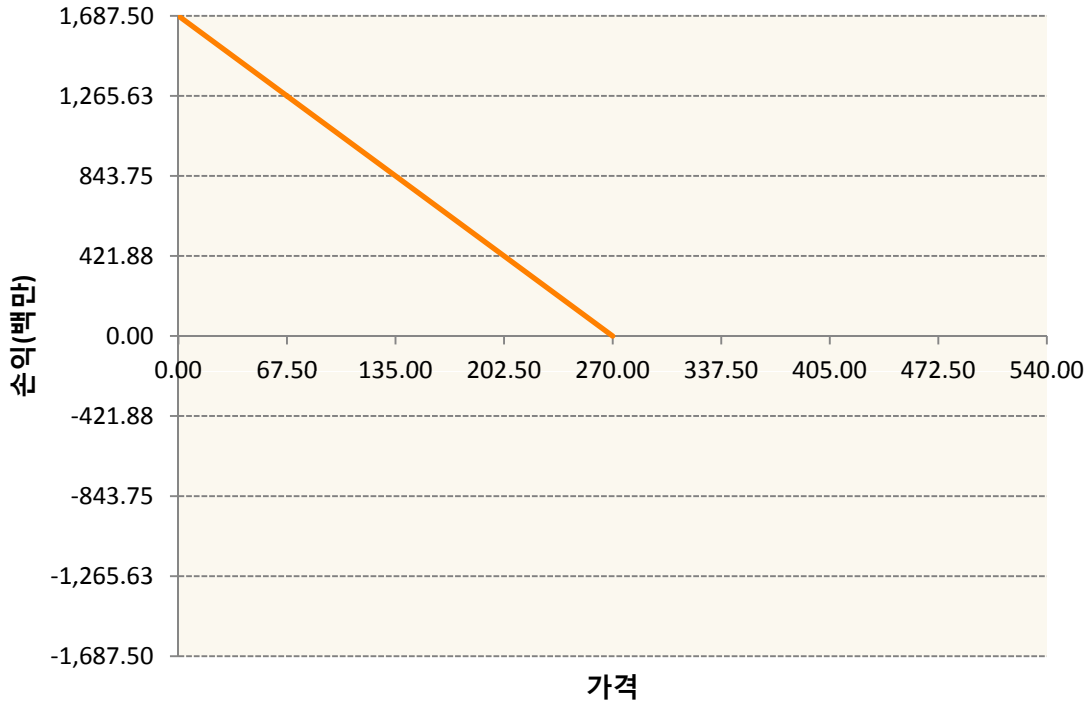


KR4301PB2676-2019-11 풋267.5





KR4301PB2700-2019-11 풋270



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						866
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-866	-866	-866	-866	-866	-866	-866	
-5.33%	-578	-578	-578	-578	-578	-578	-578	
-2.67%	-289	-289	-289	-289	-289	-289	-289	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	289	289	289	289	289	289	289	
5.33%	578	578	578	578	578	578	578	
8.00%	866	866	866	866	866	866	866	
KR4201PB2800		2019-11 콜280						156
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	17	17	17	17	17	17	17	
-5.33%	17	17	17	17	17	17	17	
-2.67%	17	17	16	16	16	15	15	

0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
5.33%	-101	-101	-101	-101	-101	-101	-101
8.00%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
KR4201PB2826 2019-11 콜282.5							1,298
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	69	69	69	69	69	69	69
-5.33%	69	69	69	69	69	69	69
-2.67%	69	69	68	68	67	66	64
0%	24	16	8	0	-8	-17	-25
2.67%	-335	-337	-339	-341	-344	-348	-352
5.33%	-816	-816	-816	-816	-816	-816	-816
8.00%	-1,298	-1,298	-1,298	-1,298	-1,298	-1,298	-1,298
KR4301PB2676 2019-11 풋267.5							55
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	55	55	55	55	55	55	55
-5.33%	9	9	9	9	10	10	10
-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
KR4301PB2700 2019-11 풋270							70
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	70	70	70	70	70	70	70
-5.33%	23	23	23	23	23	24	24
-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)

2,699

공시일	2019-11-14
기준일	2019-11-13

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	7,007	0	7,007	
누계	유가증권	수익증권	200,913	0	200,913	

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	2019-11-14
기준일	2019-11-13

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	1,752	0	1,752	
누계	유가증권	수익증권	213,365	0	213,365	

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	2019-11-14
기준일	2019-11-13

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

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	542,124	0	542,124	
누계	통화	선도	0	531,466	-531,466	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		1,868
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E		1,962
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		654
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		691
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,682
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		2,466
FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E		467
FX21019V02 KRW/USD 21-11-19E		5,082
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,765
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,401
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,803
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,504
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,840
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		934
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		934
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,868
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,868
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		934
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		934
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		934
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		934
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		467
FX21019X00 KRW/USD 06-12-19E		654
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		467
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		467
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		467

FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E

1,532

FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E

934

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

(단위:백만원)

13,443

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

(단위:백만원)

185

공시일	2019-11-14
기준일	2019-11-13

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

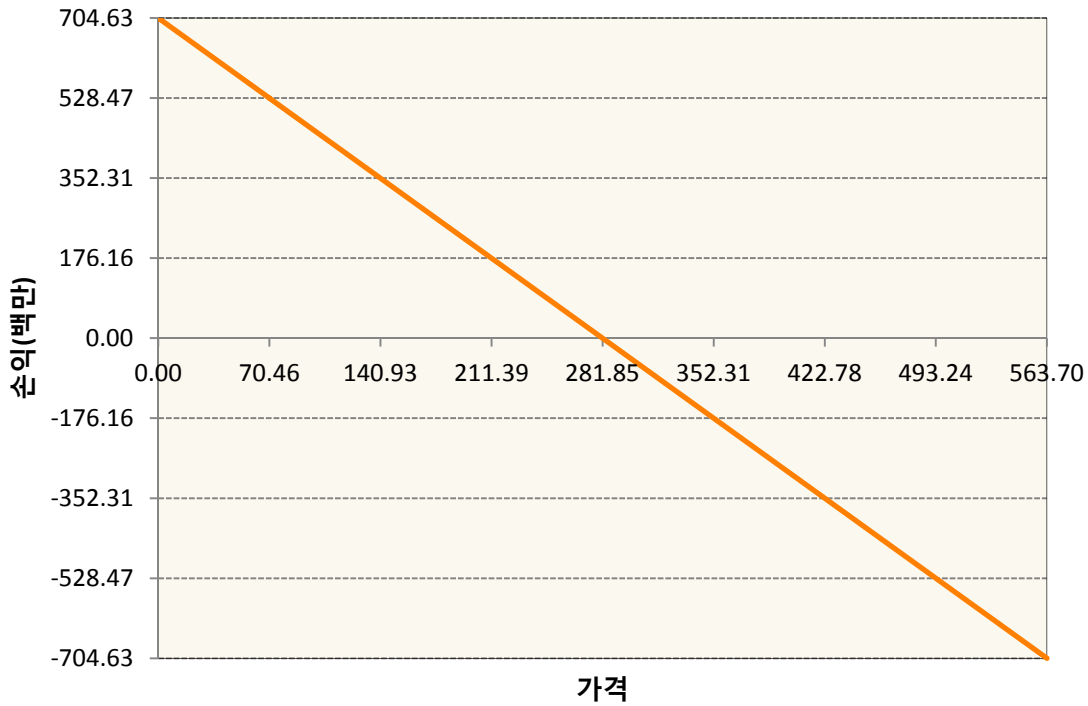
1. 계약금액

(단위:백만원)

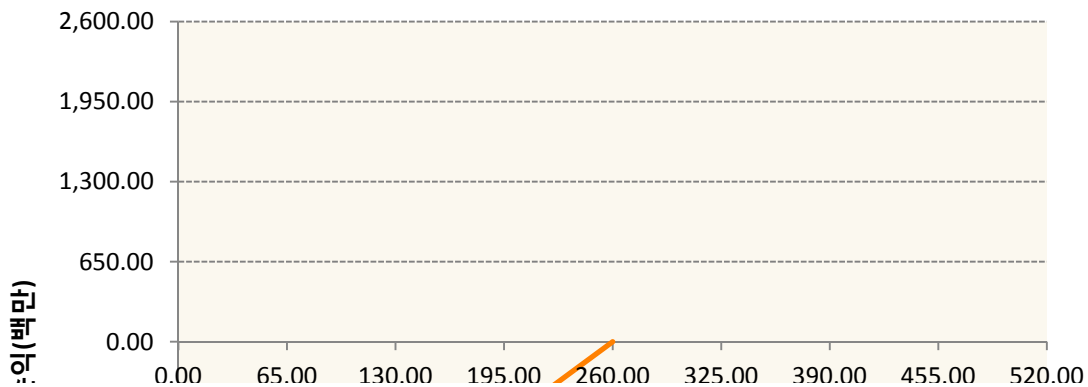
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	705	-705	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,650	-3,650	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

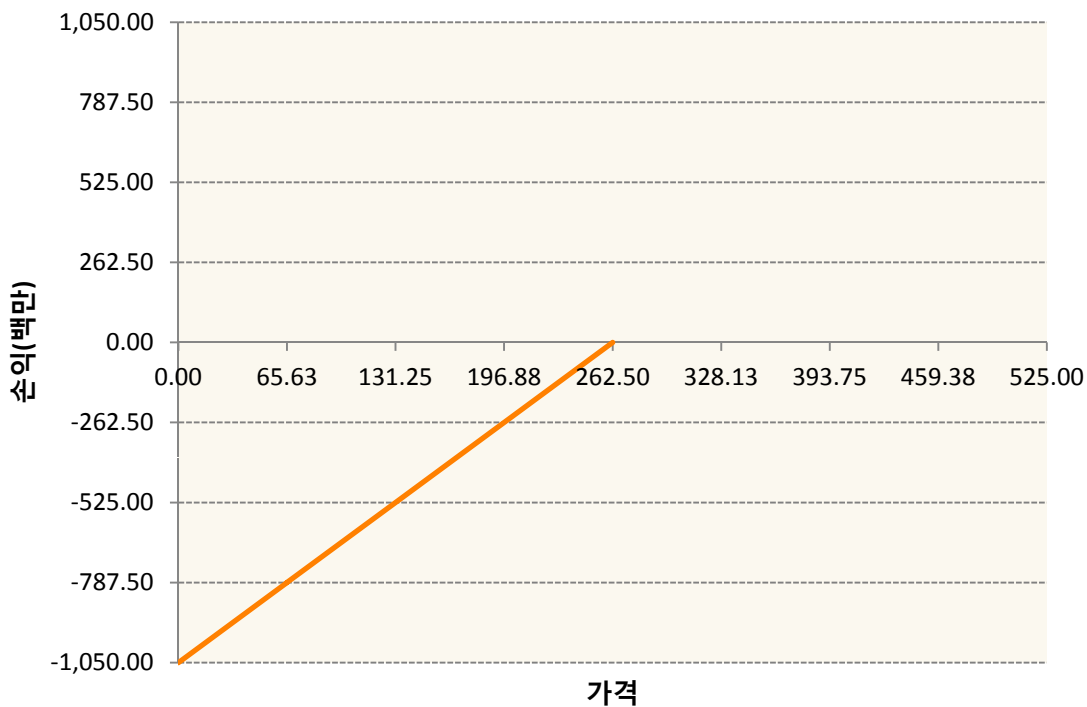


KR4301PB2601-2019-11 풋260





KR4301PB2627-2019-11 풋262.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						56
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	56	56	56	56	56	56	56	
-5.33%	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%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56	
KR4301PB2601		2019-11 풋260						16
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14	-14	-14	-15	-15	-16	-16
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-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

15

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-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)

44

공시일	2019-11-14
기준일	2019-11-13

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	350	-350	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	15,356	0	15,356	
누계	통화	선도	0	15,427	-15,427	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019V01 KRW/USD 10-12-19E		370
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		318
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		318
FX21019X01 KRW/USD 13-01-20E		229

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

(단위:백만원)

390

공시일	2019-11-14
기준일	2019-11-13

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	682	0	682	장외
누계	통화	선도	199	405	-206	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
FX21019X01 KRW/EUR 31-01-20E	5

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

(단위:백만원)

62

공시일	2019-11-14
기준일	2019-11-13

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

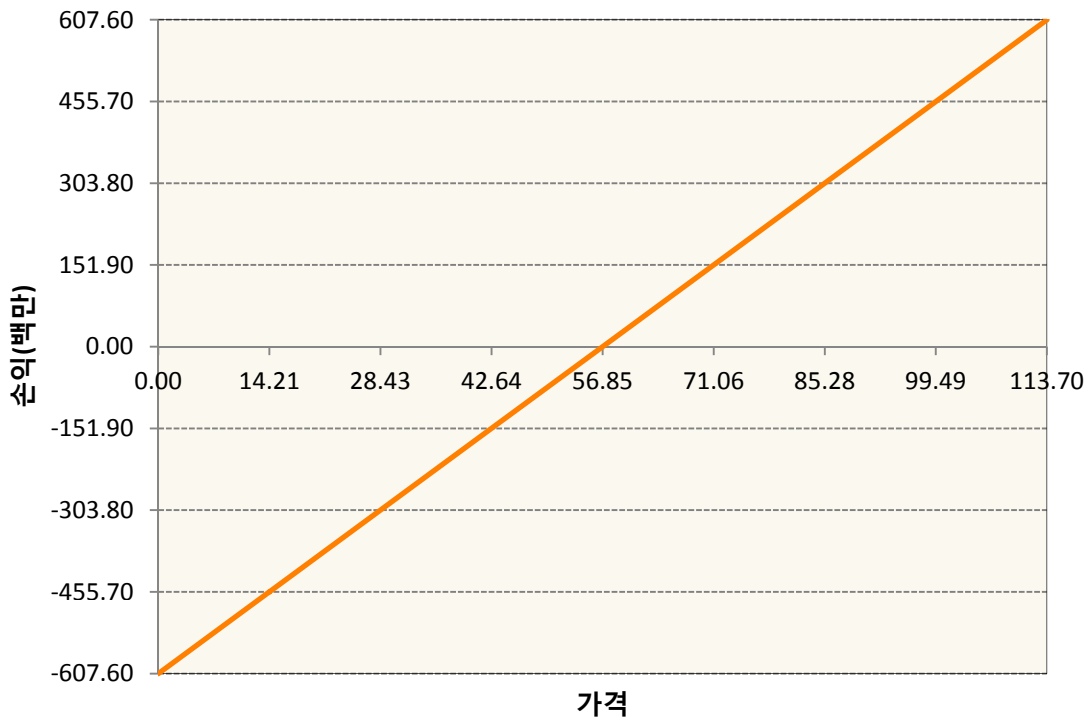
1. 계약금액

(단위:백만원)

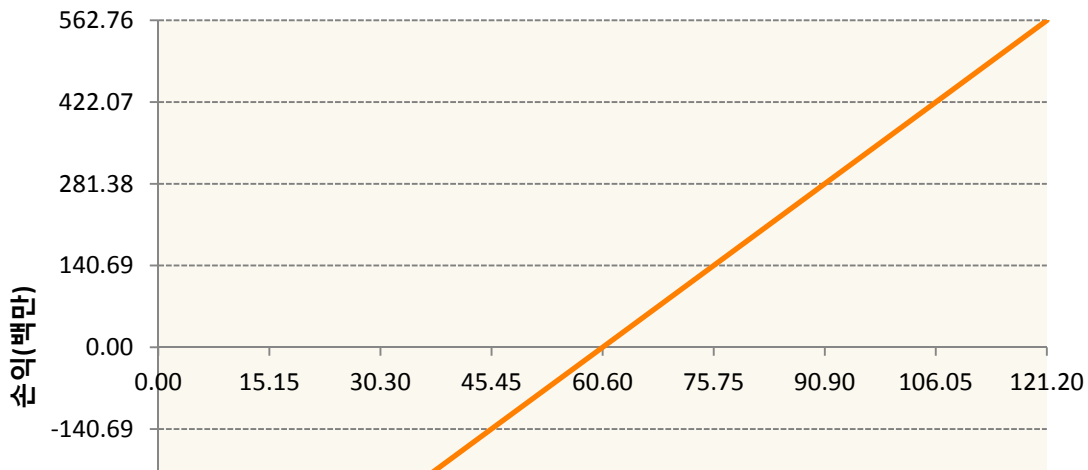
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,482	292	2,190	

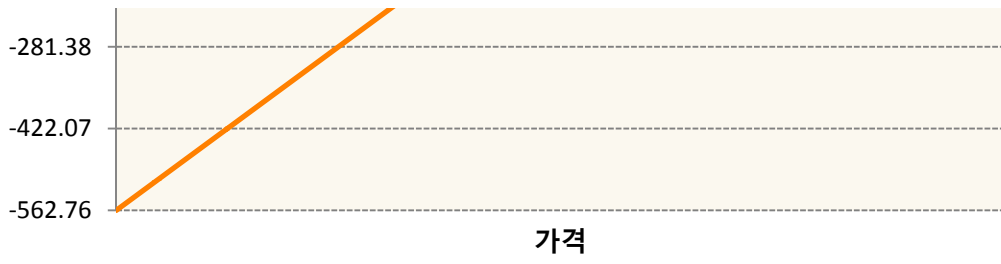
2. 만기시점의 손익구조

CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20

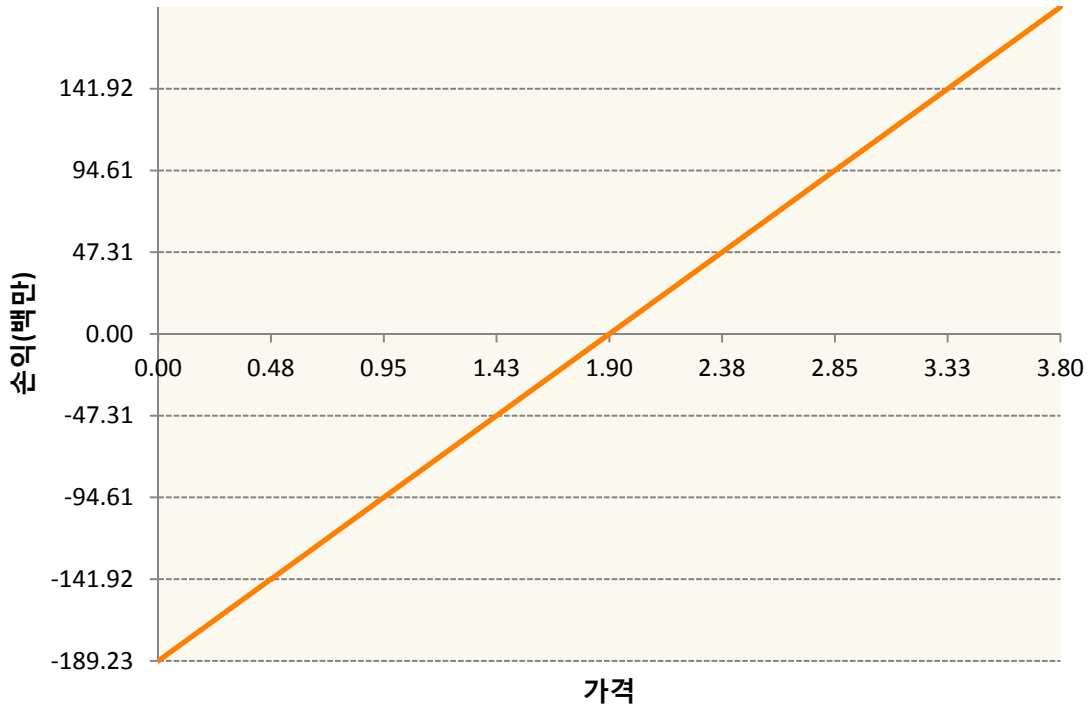


COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20

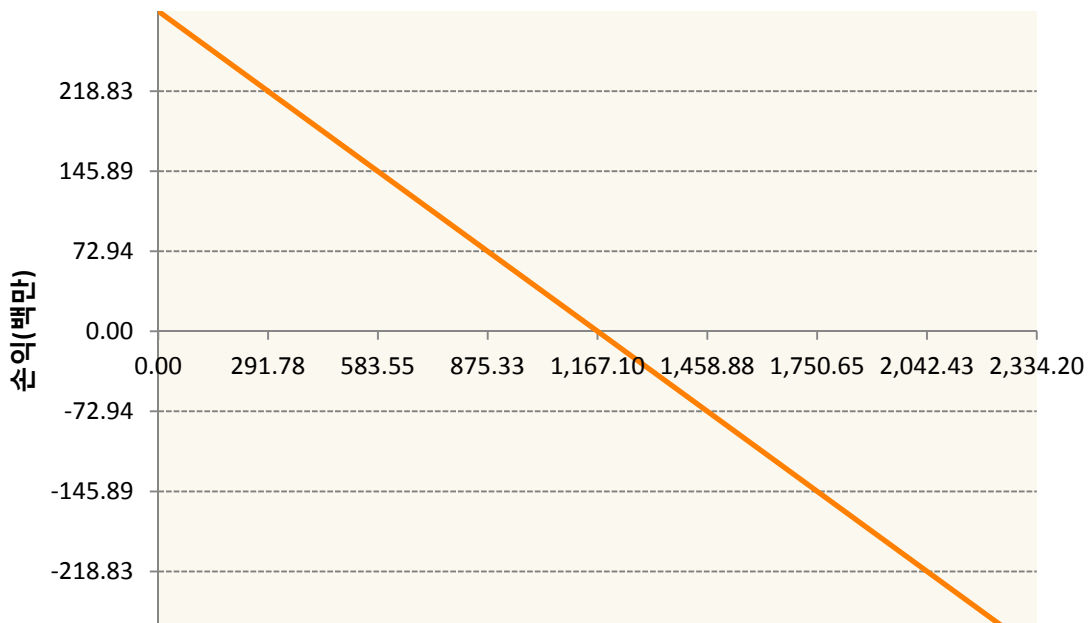


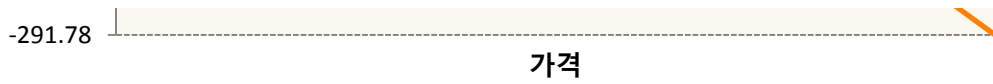


HOF0-NY Harb ULSD Fut Jan20

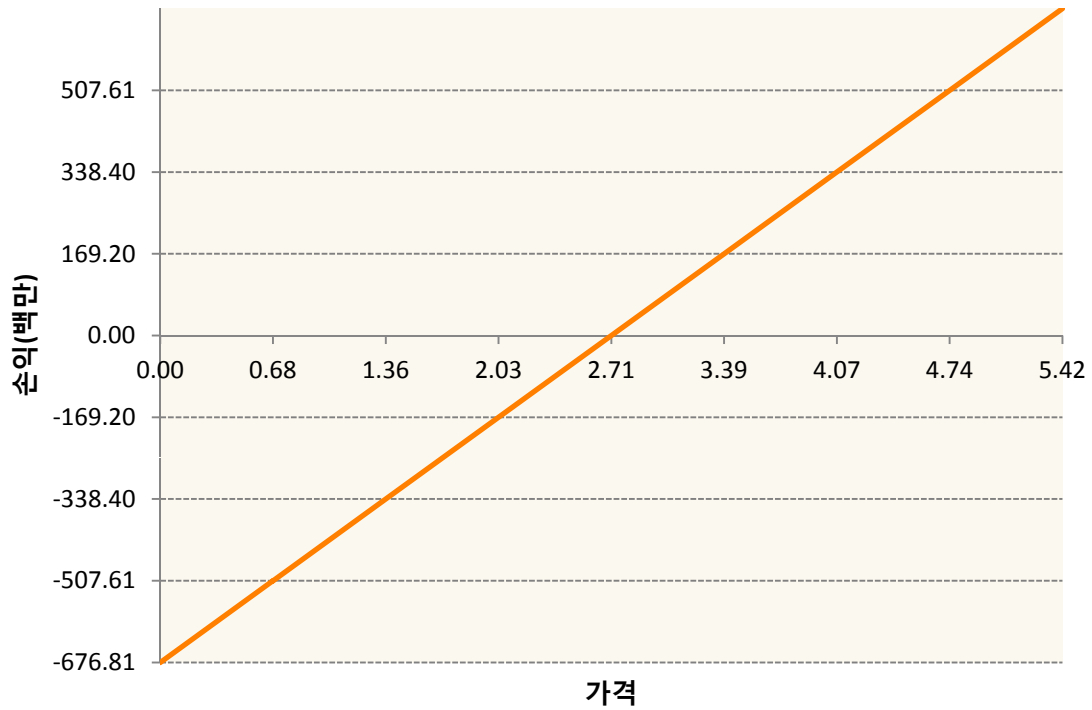


KR4175PB0004-2019-11 달러선물

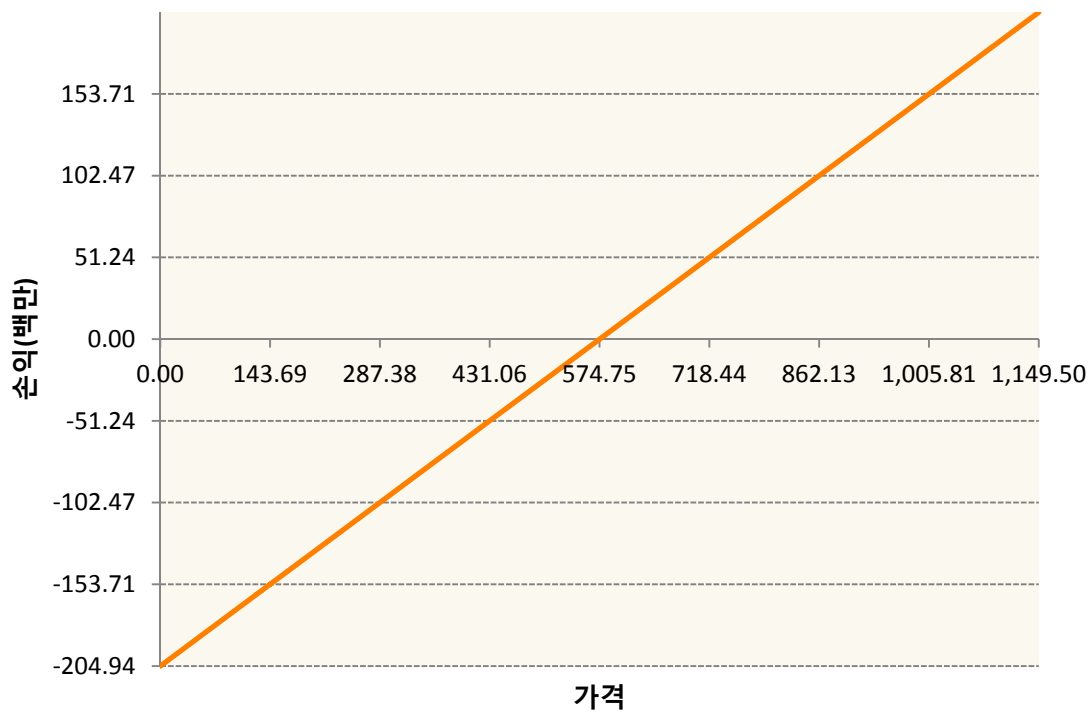




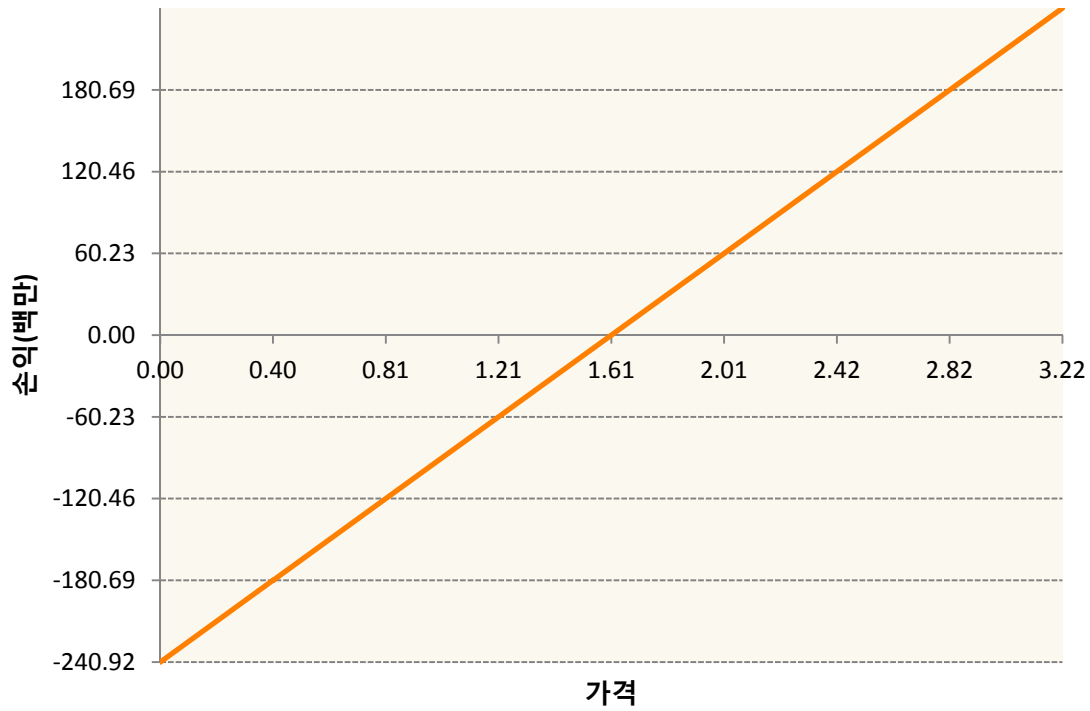
NGF20-NATURAL GAS FUTR Jan20



QSF0-Low Su Gasoil G Jan20



XBF0-GASOLINE RBOB FUT Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLF0	WTI CRUDE FUTURE Jan20	49
COH0	BRENT CRUDE FUTR Mar20	45
HOF0	NY Harb ULSD Fut Jan20	15
KR4175PB00	2019-11 달러선물	23
NGF20	NATURAL GAS FUTR Jan20	54
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	16
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	19

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

(단위:백만원)

416

공시일	2019-11-14
기준일	2019-11-13

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

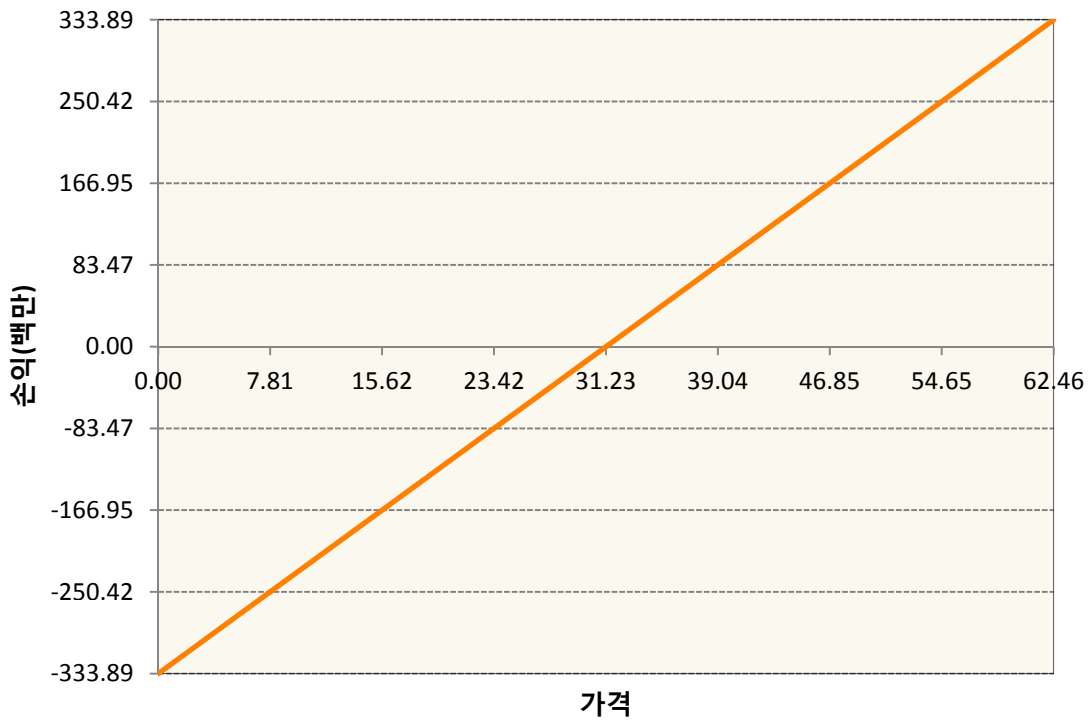
1. 계약금액

(단위:백만원)

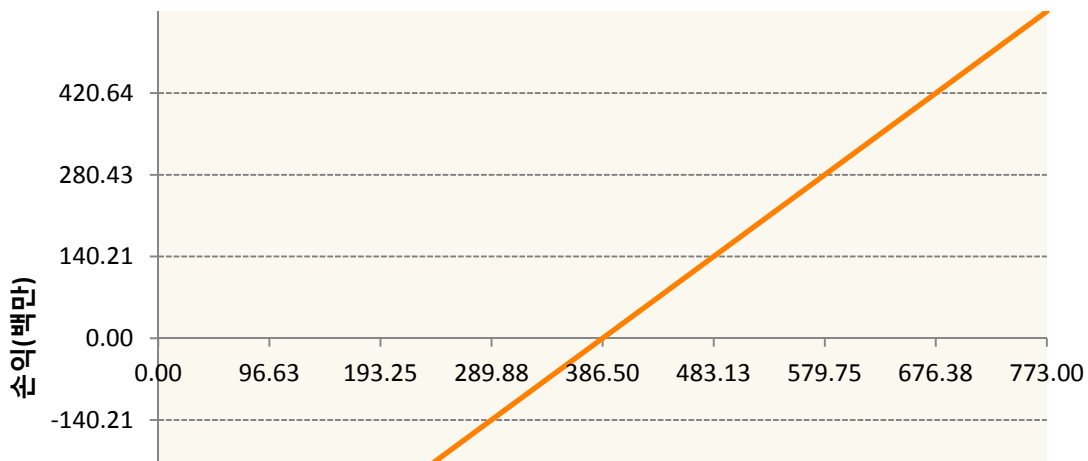
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,827	93	2,734	

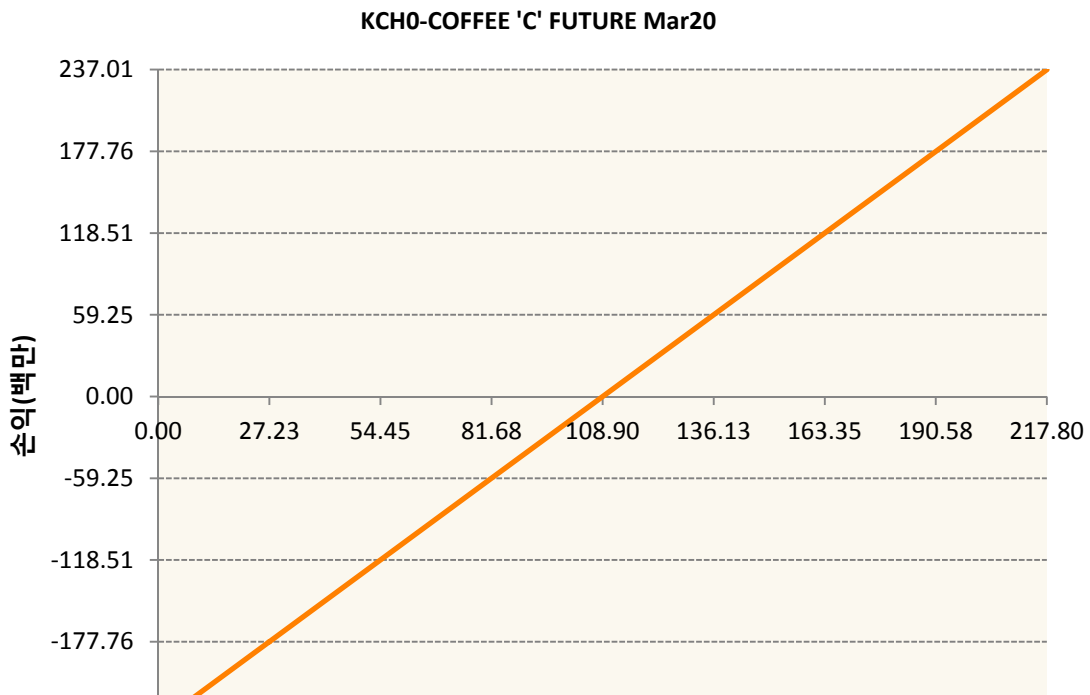
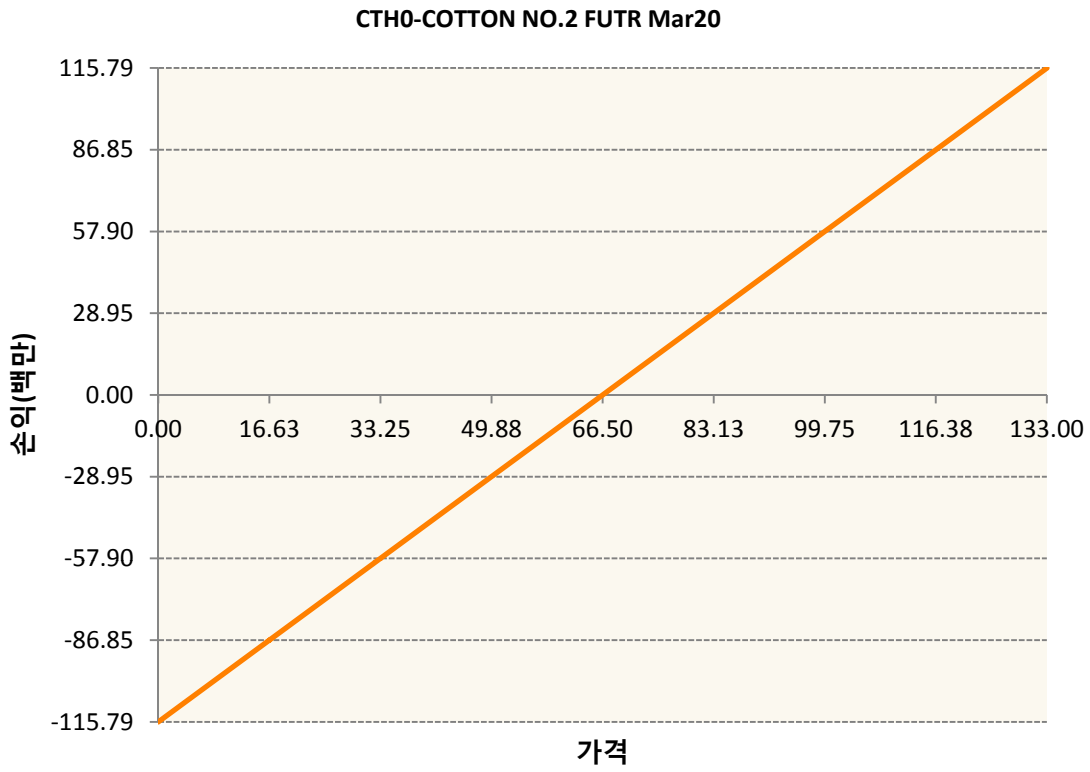
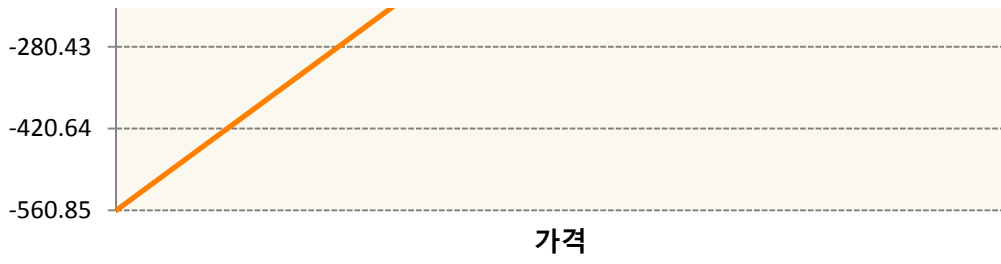
2. 만기시점의 손익구조

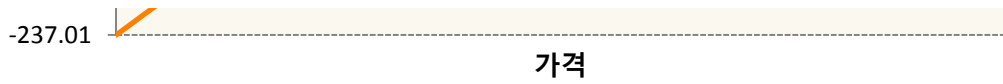
BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20



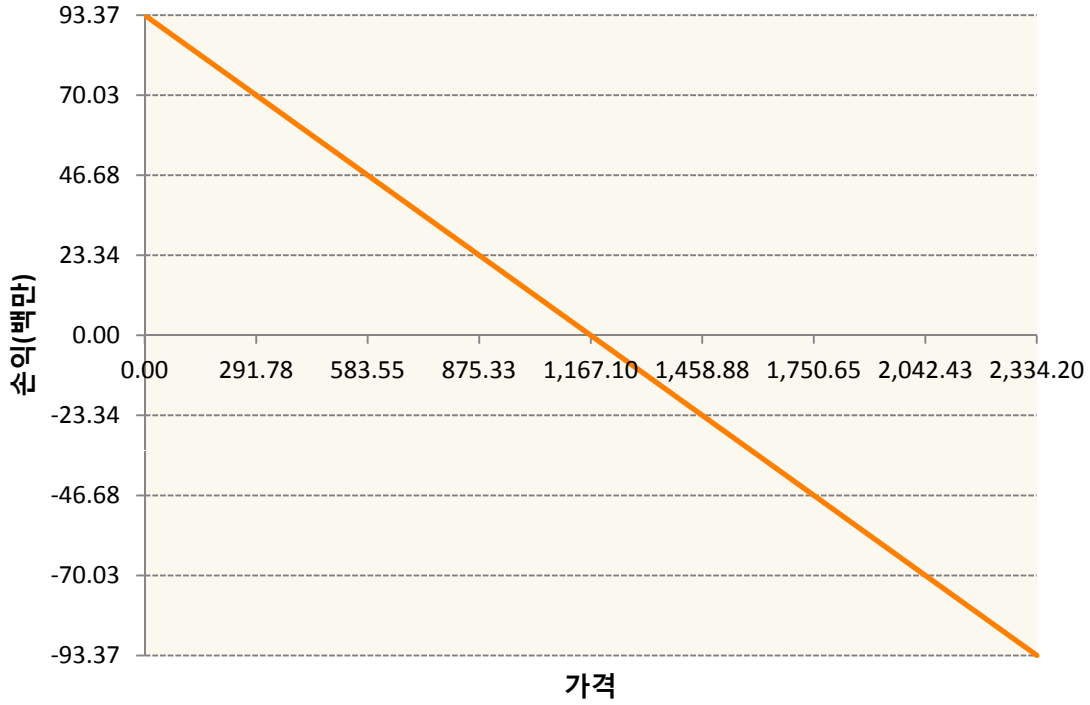
CH0-CORN FUTURE Mar20



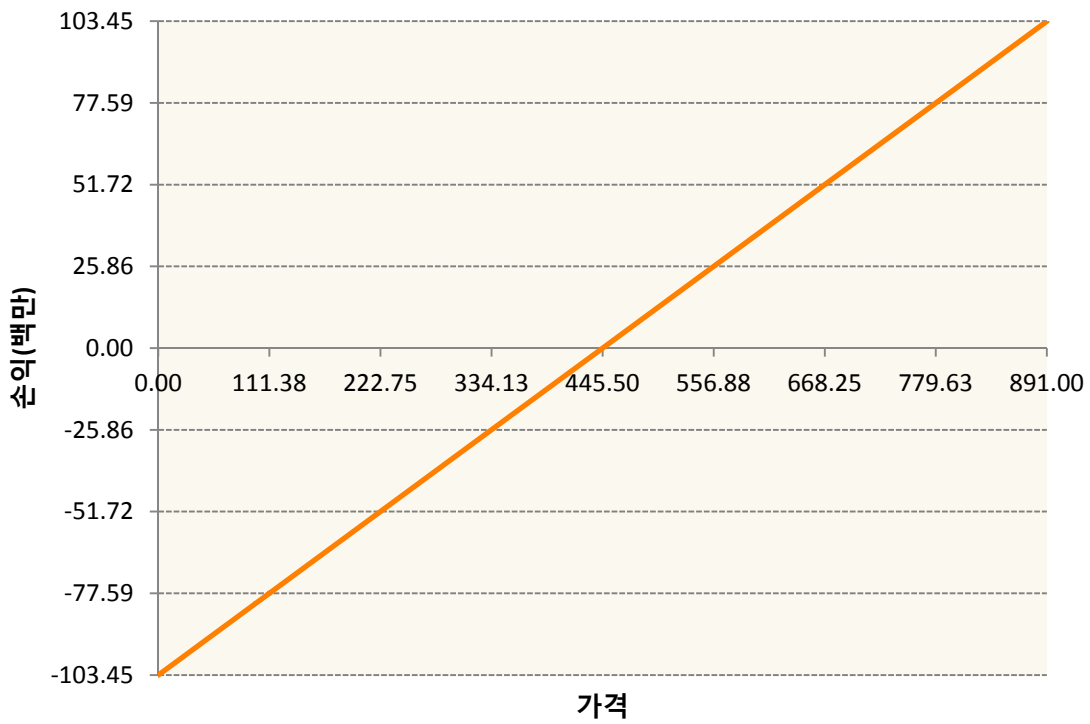




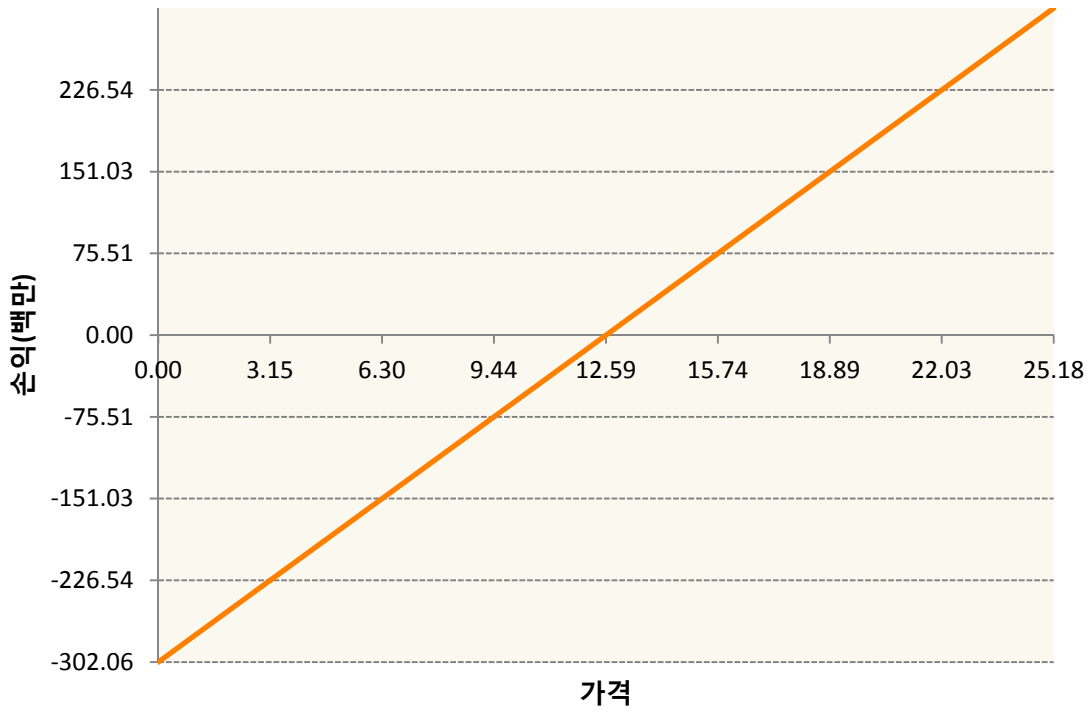
KR4175PB0004-2019-11 달러선물



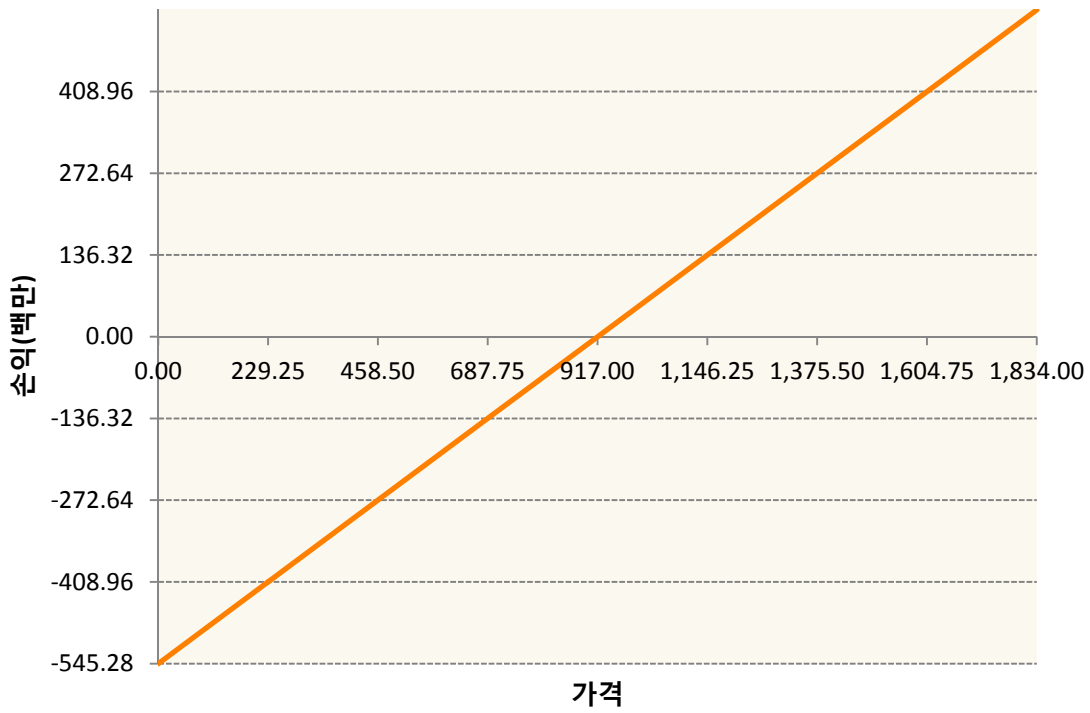
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



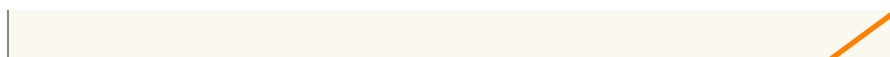
SBH0-Sugar Mar20

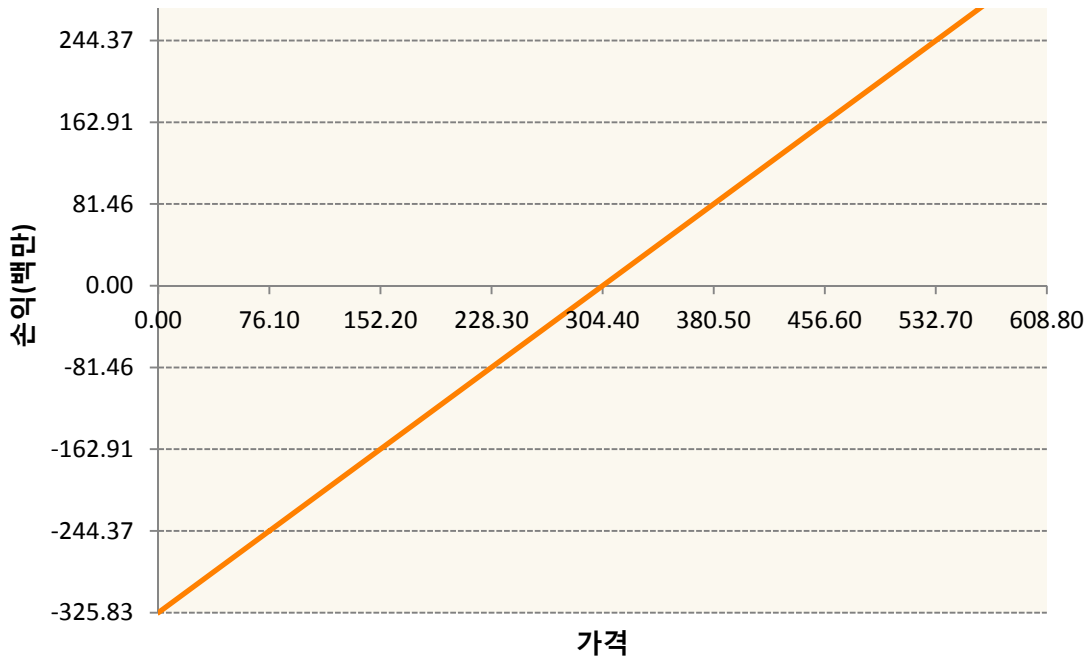


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20

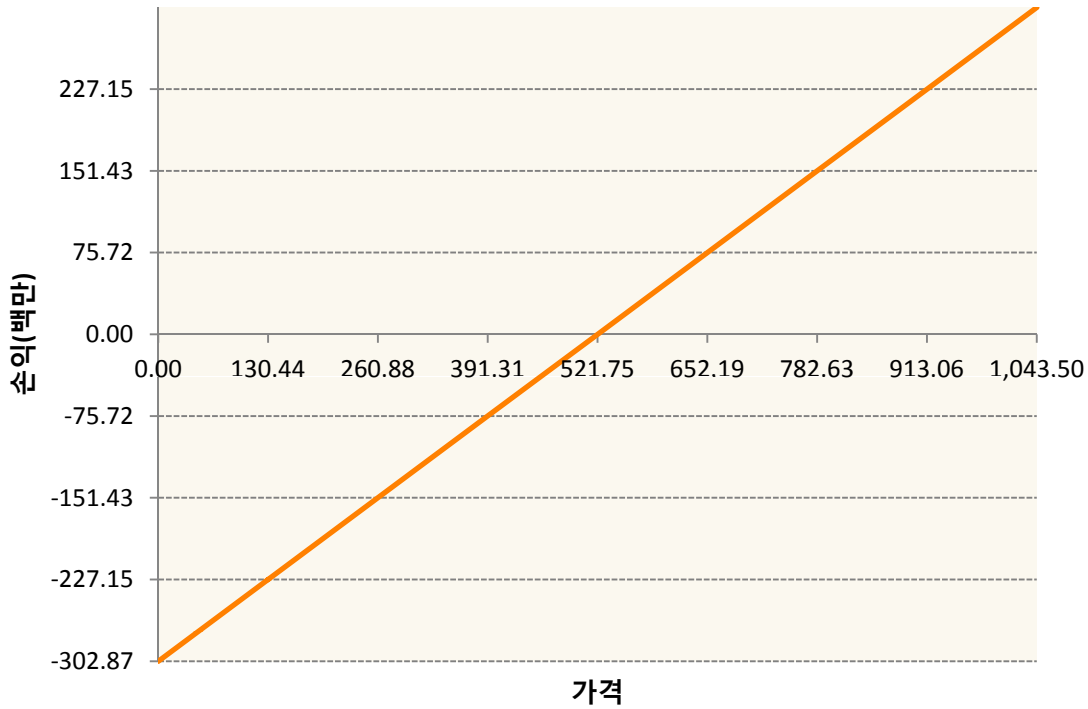


SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





WHO-WHEAT FUTURE(CBT) Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF0	SOYBEAN OIL FUTR Jan20	27
CH0	CORN FUTURE Mar20	45
CTH0	COTTON NO.2 FUTR Mar20	9
KCH0	COFFEE 'C' FUTURE Mar20	19
KR4175PB00	2019-11 달러선물	7

KWH0	KC HRW WHEAT FUT Mar20	8
SBH0	Sugar Mar20	24
SF0	SOYBEAN FUTURE Jan20	44
SMF0	SOYBEAN MEAL FUTR Jan20	26
WH0	WHEAT FUTURE(CBT) Mar20	24

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

(단위:백만원)

249