

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-18 |
| 기준일 | 2019-11-15 |

## 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)

86

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-18 |
| 기준일 | 2019-11-15 |

## 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

1,216

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

701

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-18 |
| 기준일 | 2019-11-15 |

## 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) | 137 |

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

749

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-18 |
| 기준일 | 2019-11-15 |

## 유로인덱스모(주식-파생형)

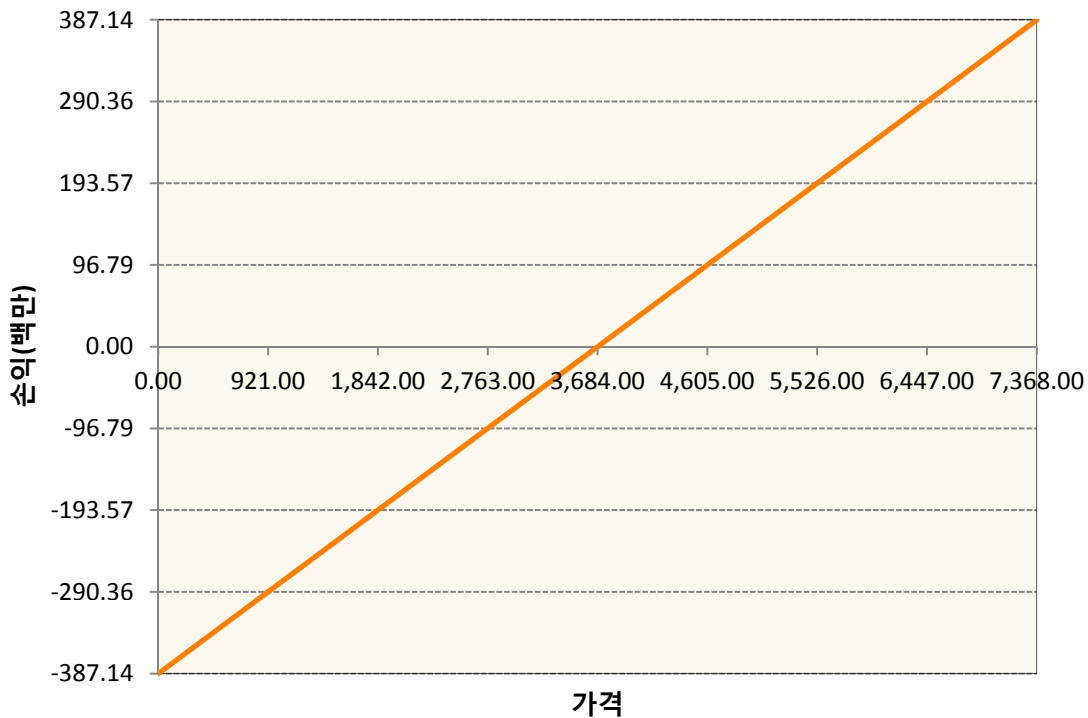
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 387   | 0     | 387       |    |

### 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 | 2019-11-18 |
| 기준일 | 2019-11-15 |

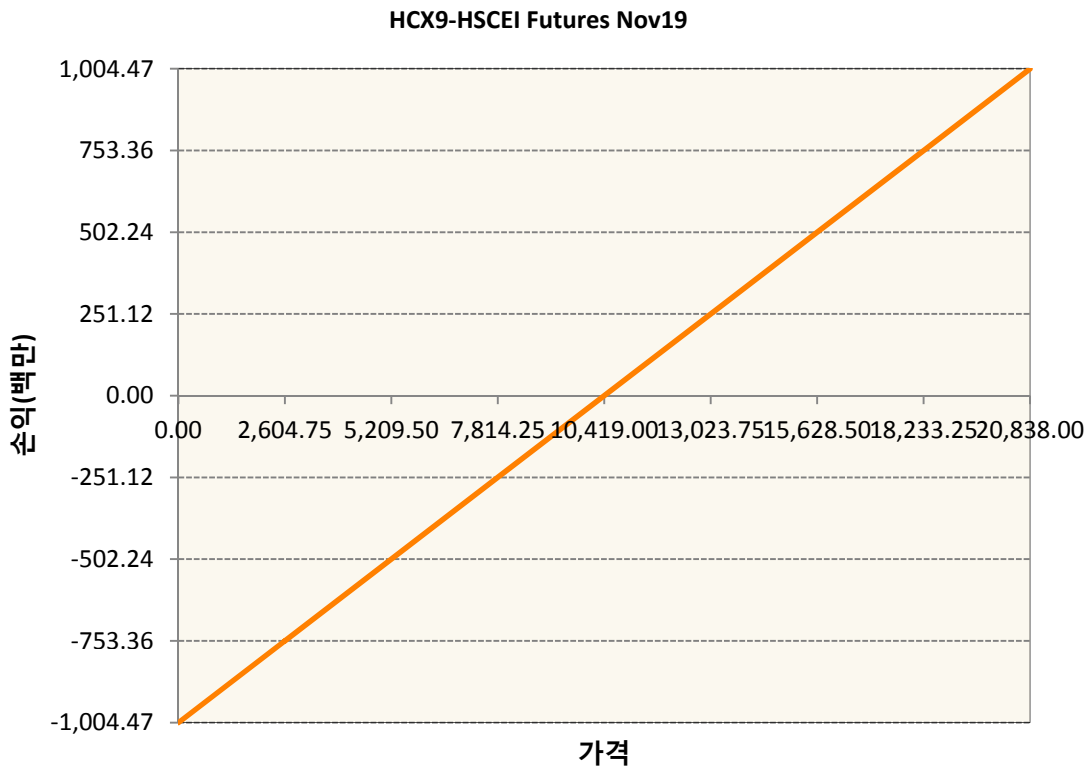
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 1,004 | 0     | 1,004     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| HGX9 | HSCEI Futures Nov19 | 80 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 72 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-18 |
| 기준일 | 2019-11-15 |

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

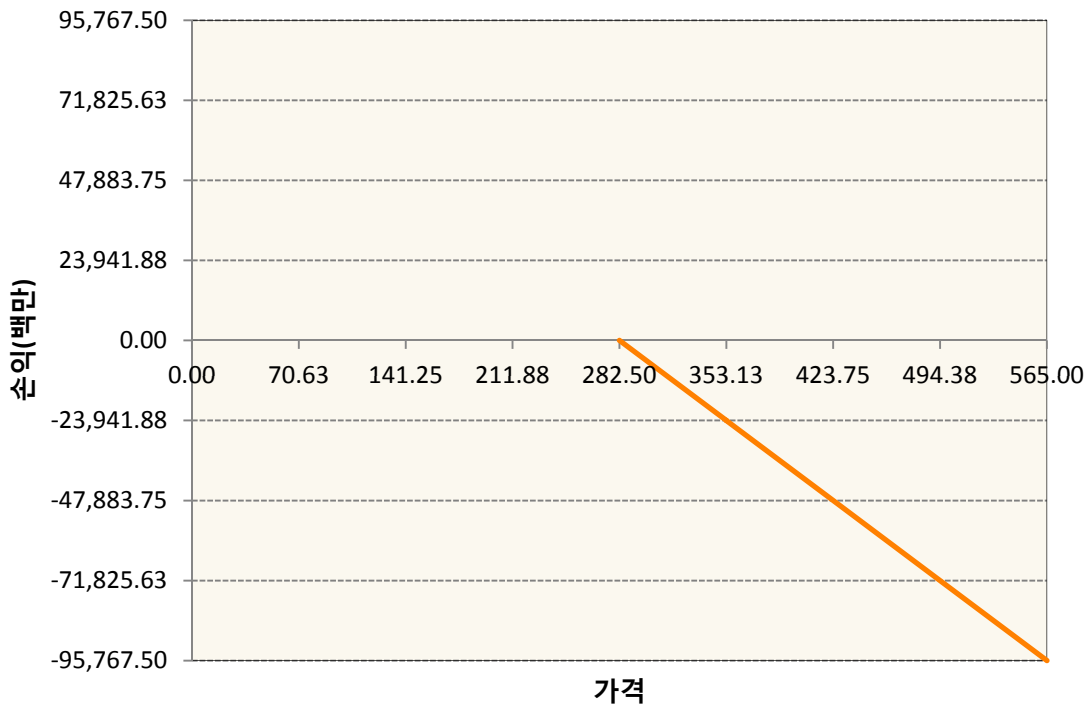
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

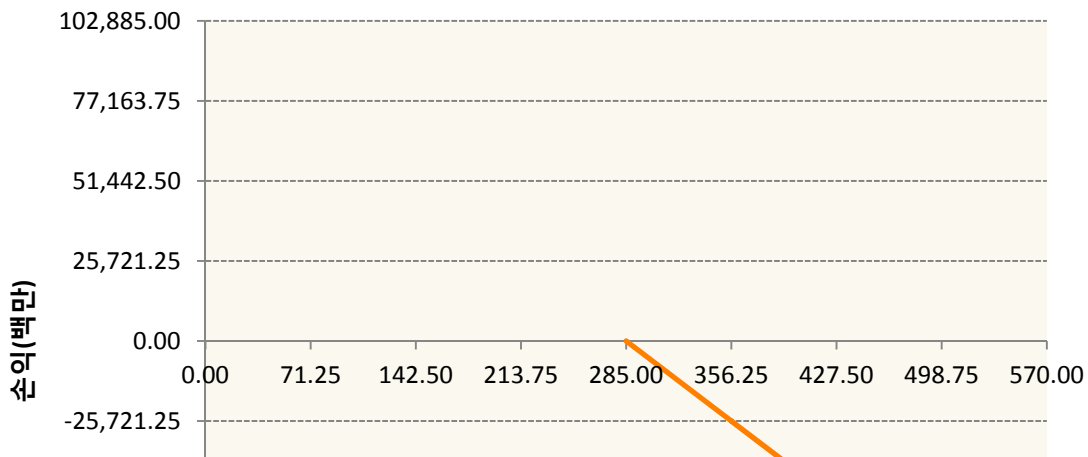
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2)   | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 69,931 | 252,968 | -183,037  | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 71,250 | 427,206 | -355,956  | 장내 |

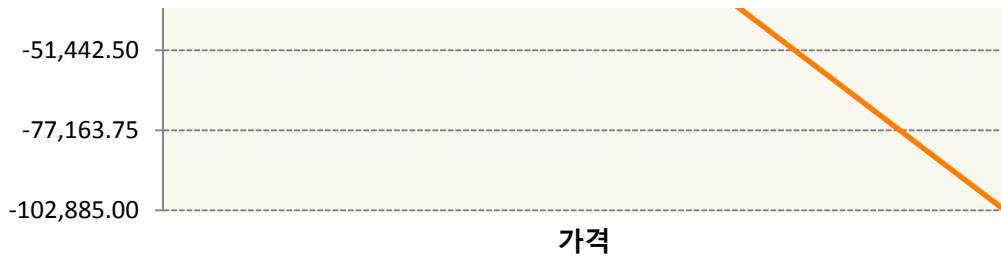
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201PC2825-2019-12 콜282.5

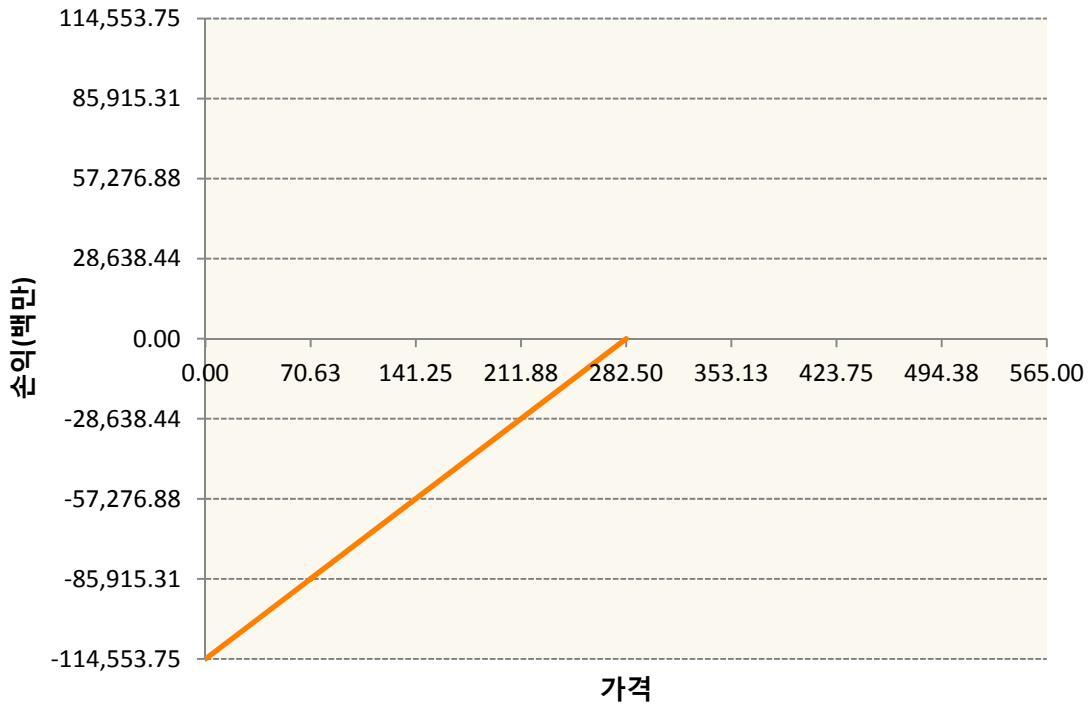


KR4201PC2858-2019-12 콜285

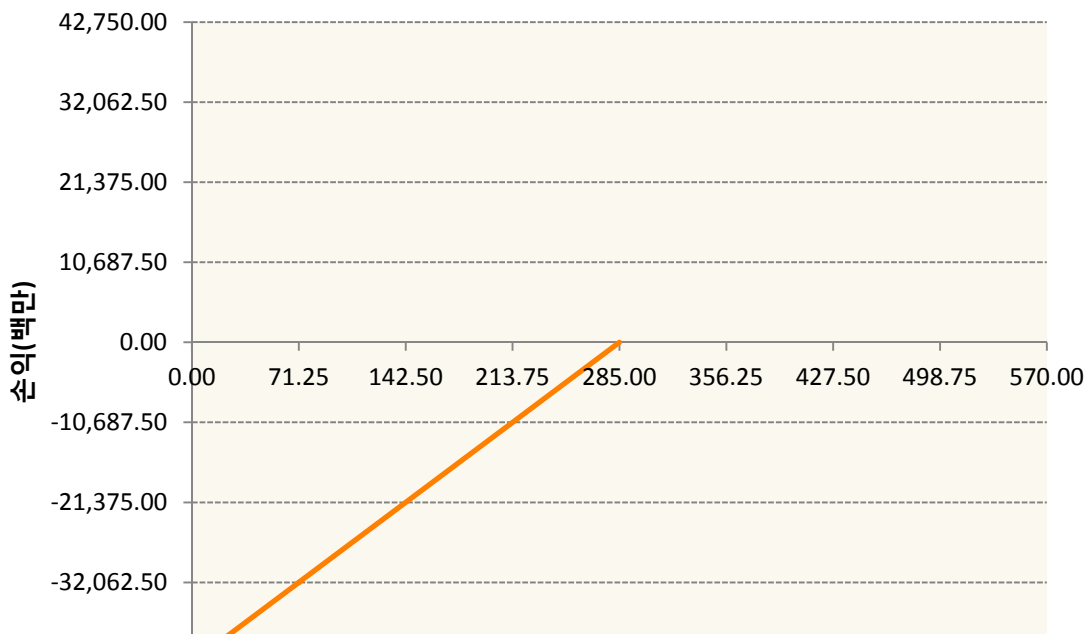




**KR4301PC2824-2019-12 풋282.5**



**KR4301PC2857-2019-12 풋285**



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

| KR4201PC2825 |         | 2019-12 콜282.5 |        |        |        |        |        | 6,401 |
|--------------|---------|----------------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|
| 기초자산의 변동성    |         |                |        |        |        |        |        |       |
| 가격           | -25.00% | -16.67%        | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |       |
| -8.00%       | 3,425   | 3,306          | 3,171  | 3,024  | 2,867  | 2,700  | 2,527  |       |
| -5.33%       | 2,953   | 2,766          | 2,571  | 2,370  | 2,165  | 1,956  | 1,744  |       |
| -2.67%       | 2,069   | 1,837          | 1,605  | 1,372  | 1,139  | 905    | 671    |       |
| 0%           | 694     | 464            | 233    | 0      | -234   | -468   | -703   |       |
| 2.67%        | -1,142  | -1,329         | -1,524 | -1,727 | -1,935 | -2,148 | -2,365 |       |
| 5.33%        | -3,329  | -3,455         | -3,597 | -3,752 | -3,919 | -4,095 | -4,279 |       |
| 8.00%        | -5,735  | -5,806         | -5,895 | -6,001 | -6,122 | -6,256 | -6,401 |       |
| KR4201PC2858 |         | 2019-12 콜285   |        |        |        |        |        | 6,574 |
| 기초자산의 변동성    |         |                |        |        |        |        |        |       |
| 가격           | -25.00% | -16.67%        | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |       |
| -8.00%       | 3,240   | 3,133          | 3,009  | 2,870  | 2,718  | 2,556  | 2,384  |       |
| -5.33%       | 2,843   | 2,663          | 2,472  | 2,273  | 2,067  | 1,855  | 1,639  |       |
| -2.67%       | 2,053   | 1,815          | 1,574  | 1,332  | 1,088  | 843    | 597    |       |
| 0%           | 761     | 508            | 254    | 0      | -254   | -509   | -763   |       |
| 2.67%        | -1,040  | -1,260         | -1,487 | -1,718 | -1,954 | -2,192 | -2,434 |       |
| 5.33%        | -3,258  | -3,416         | -3,589 | -3,775 | -3,971 | -4,175 | -4,386 |       |
| 8.00%        | -5,753  | -5,848         | -5,963 | -6,096 | -6,243 | -6,403 | -6,574 |       |
| KR4301PC2824 |         | 2019-12 풋282.5 |        |        |        |        |        | 6,717 |
| 기초자산의 변동성    |         |                |        |        |        |        |        |       |
| 가격           | -25.00% | -16.67%        | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |       |
| -8.00%       | -6,588  | -6,595         | -6,607 | -6,625 | -6,650 | -6,680 | -6,717 |       |
| -5.33%       | -3,576  | -3,627         | -3,686 | -3,754 | -3,830 | -3,911 | -3,998 |       |
| -2.67%       | -1,062  | -1,185         | -1,310 | -1,437 | -1,564 | -1,692 | -1,821 |       |
| 0%           | 352     | 238            | 120    | 0      | -123   | -247   | -372   |       |
| 2.67%        | 786     | 743            | 690    | 628    | 558    | 481    | 398    |       |
| 5.33%        | 851     | 844            | 832    | 814    | 789    | 758    | 719    |       |
| 8.00%        | 856     | 855            | 854    | 851    | 845    | 836    | 823    |       |
| KR4301PC2857 |         | 2019-12 풋285   |        |        |        |        |        | 2,700 |
| 기초자산의 변동성    |         |                |        |        |        |        |        |       |
| 가격           | -25.00% | -16.67%        | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |       |
| -8.00%       | -2,670  | -2,671         | -2,673 | -2,677 | -2,682 | -2,690 | -2,700 |       |
| -5.33%       | -1,538  | -1,549         | -1,564 | -1,582 | -1,603 | -1,627 | -1,653 |       |
| -2.67%       | -522    | -561           | -601   | -643   | -686   | -729   | -774   |       |
| 0%           | 146     | 98             | 49     | 0      | -49    | -98    | -148   |       |
| 2.67%        | 403     | 378            | 350    | 319    | 286    | 250    | 213    |       |

|       |     |     |     |     |     |     |     |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| 5.33% | 453 | 447 | 439 | 428 | 414 | 397 | 378 |
| 8.00% | 457 | 457 | 456 | 453 | 450 | 444 | 437 |

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

(단위:백만원)

**22,193**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-18 |
| 기준일 | 2019-11-15 |

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

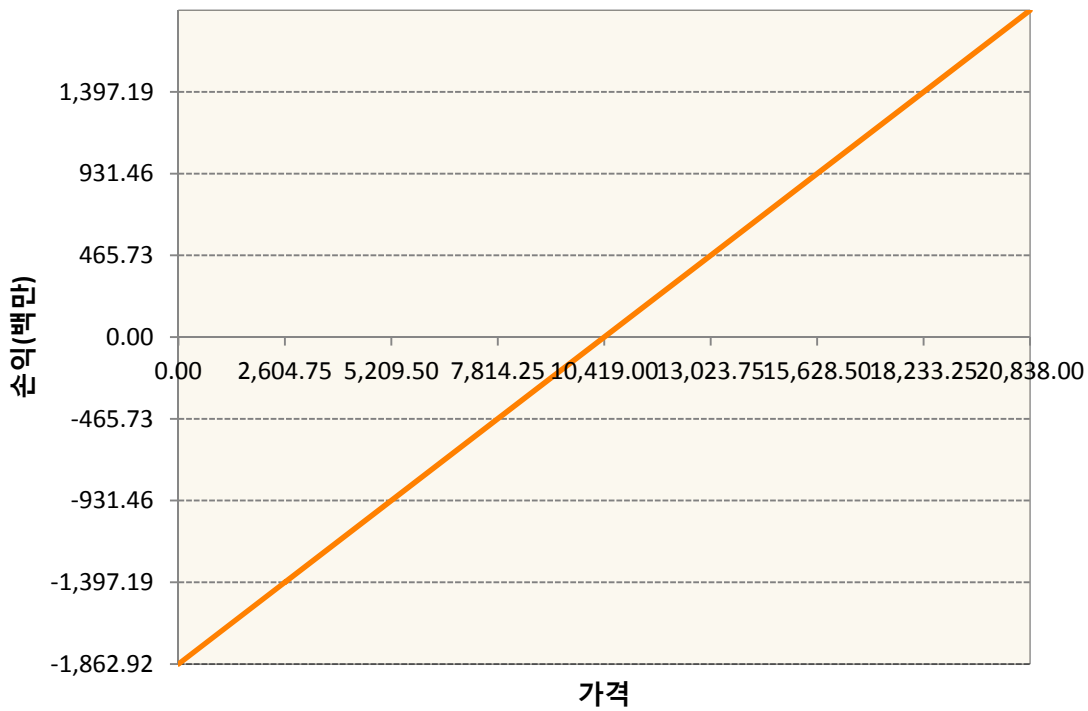
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

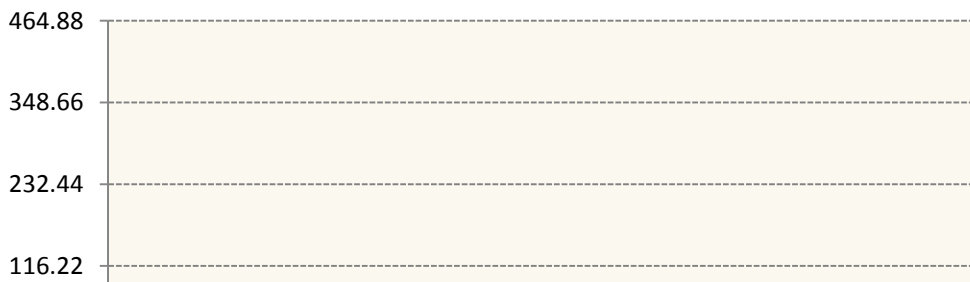
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,863 | 0     | 1,863     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 4,997 | -4,997    | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 671   | 2,768 | -2,098    | 장외 |

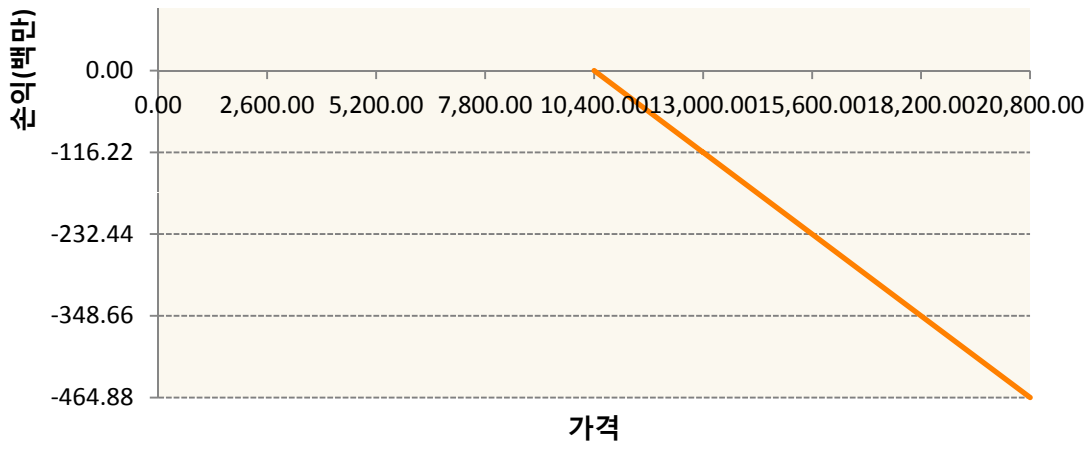
### 2. 만기시점의 손익구조

HCX9-HSCEI Futures Nov19

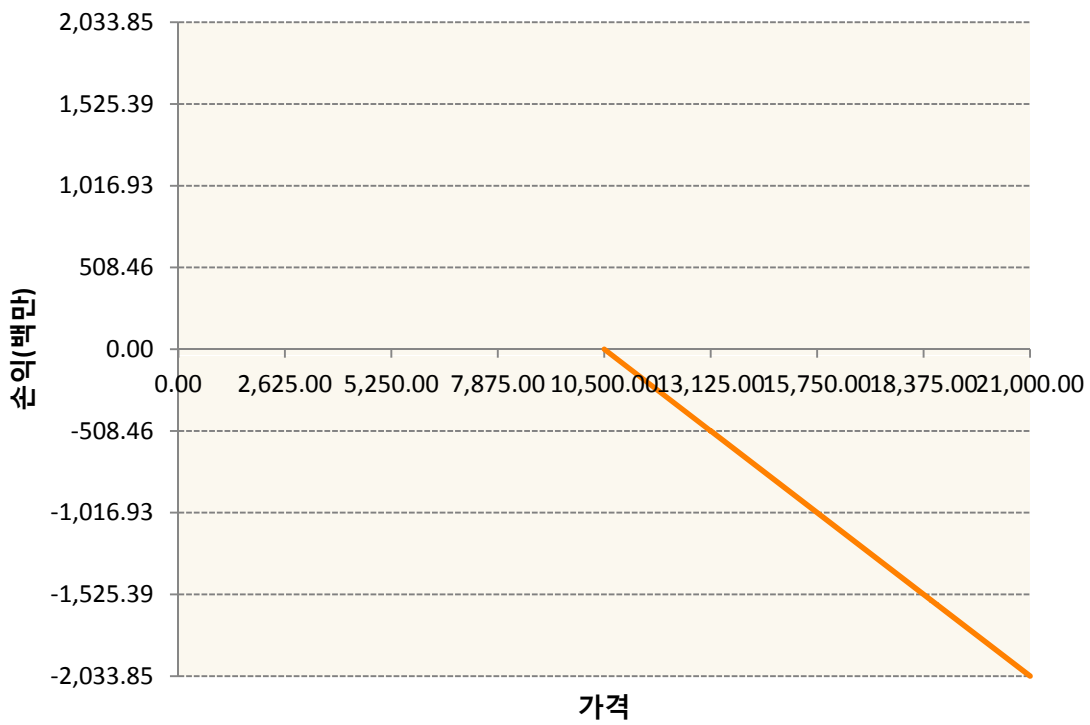


OHHIX9-C104-HSCEI

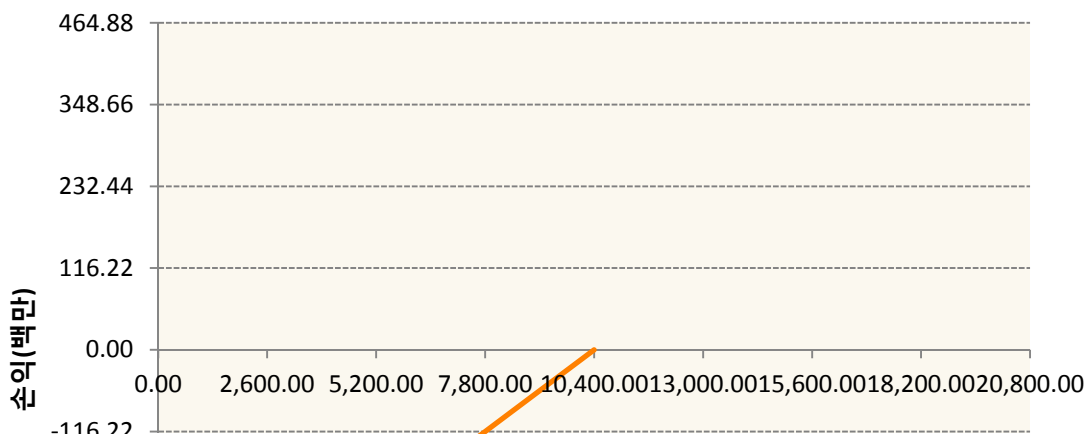


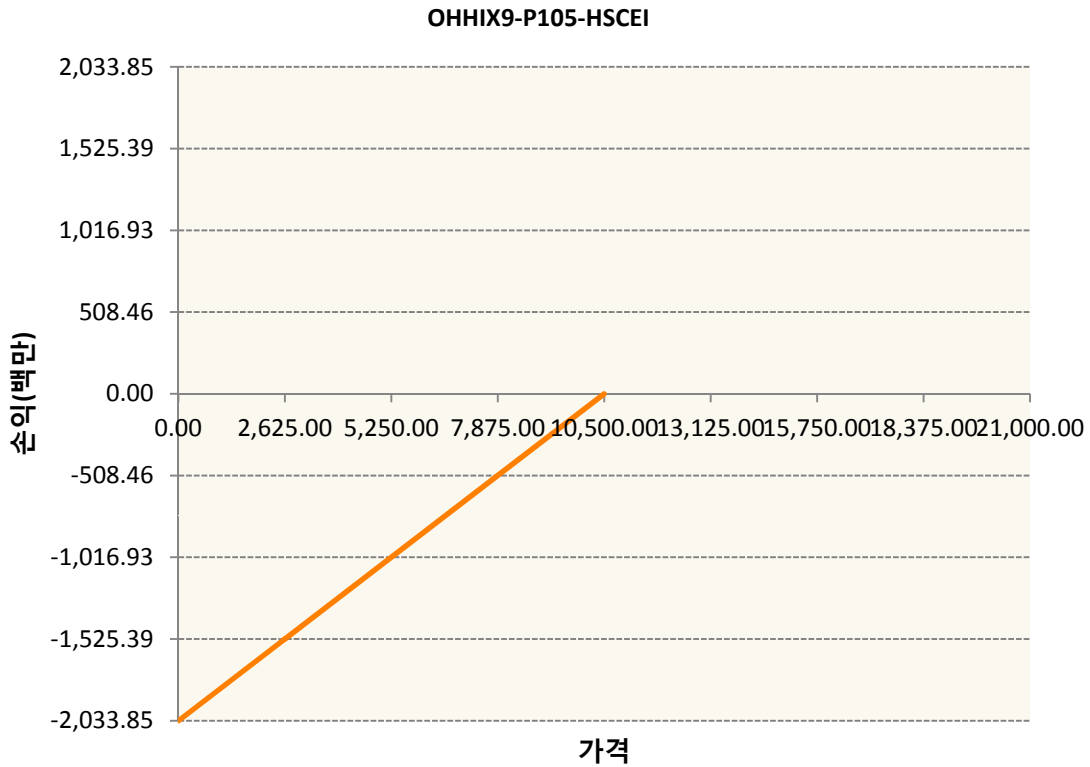
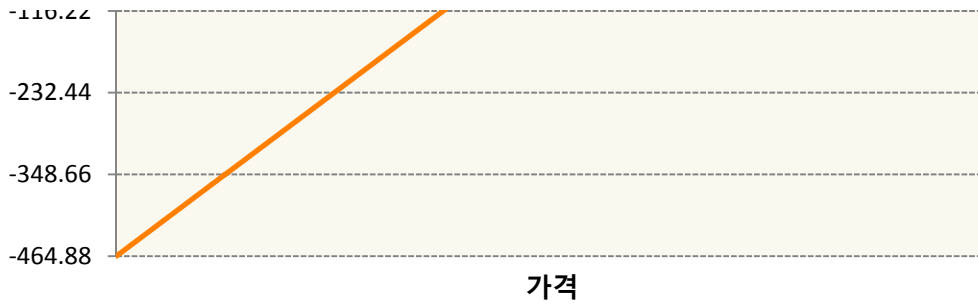


**OHHIX9-C105-HSCEI**



**OHHIX9-P104-HSCEI**





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)    | (단위:백만원) |
|------------------------------|----------|
| FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E | 221      |
| FX21019U00 HKD/KRW 22-11-19E | 6        |
| FX21019U02 HKD/KRW 22-11-19E | 48       |
| HGX9 HSCEI Futures Nov19     | 149      |
| 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)   |
|--|------------|
|  | <b>575</b> |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-18 |
| 기준일 | 2019-11-15 |

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

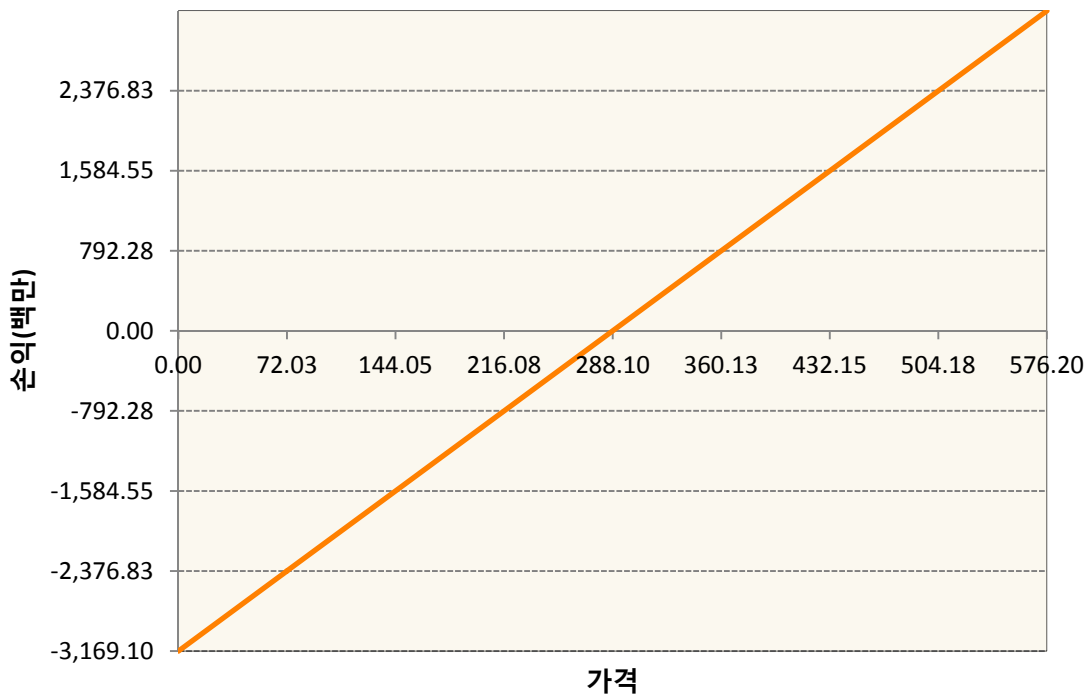
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

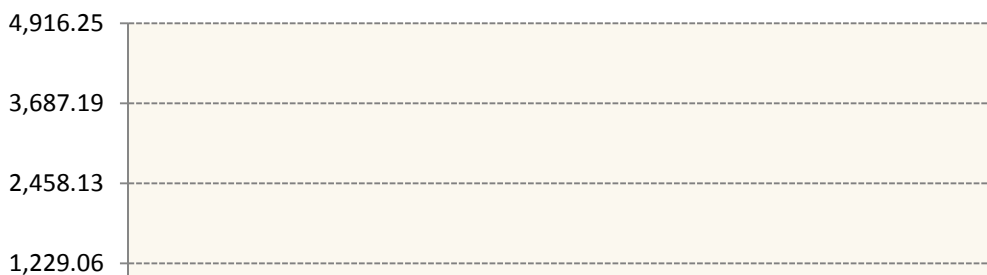
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 9,858 | -9,858    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 3,169 | 0     | 3,169     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 9,625 | 0     | 9,625     | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 9,728 | -9,728    | 장내 |

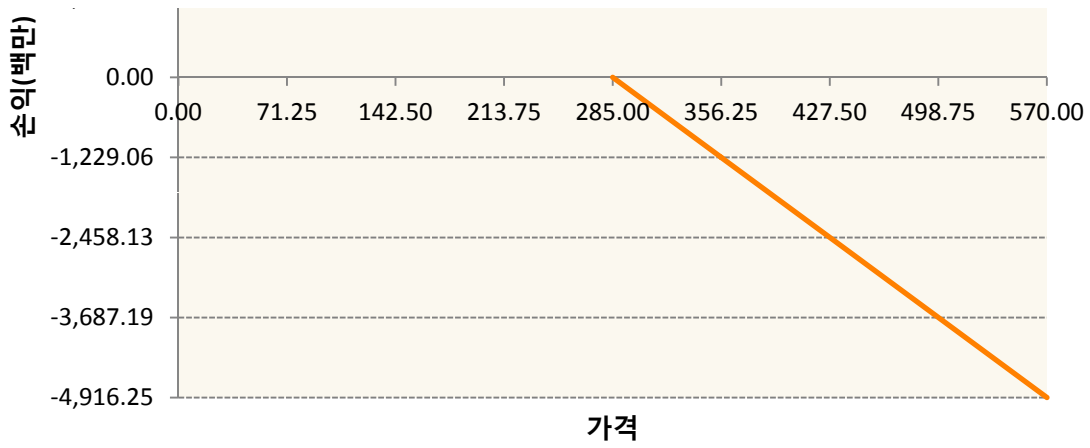
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

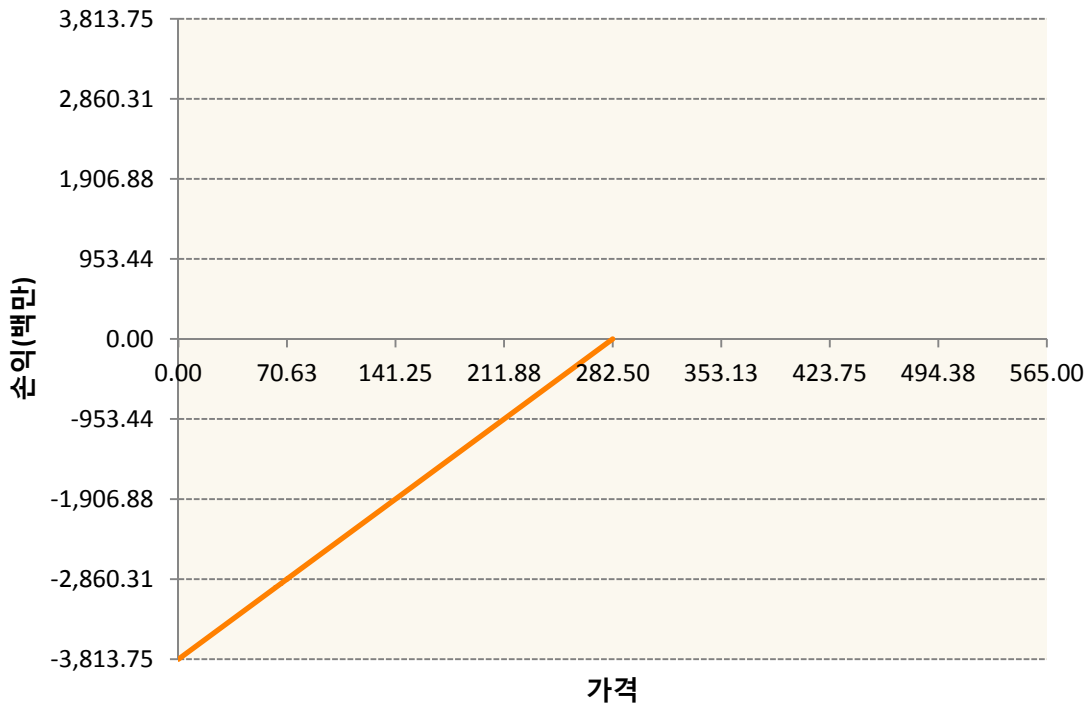


KR4201PC2858-2019-12 콜285

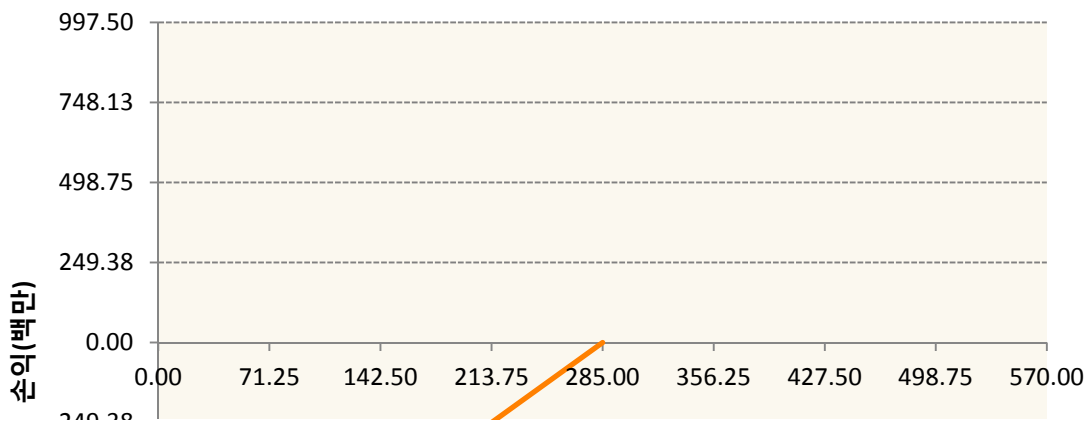




**KR4301PC2824-2019-12 풋282.5**



**KR4301PC2857-2019-12 풋285**





**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%       | -551    | -551               | -551   | -551 | -551  | -551   | -551   |     |
| -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%        | 551     | 551                | 551    | 551  | 551   | 551    | 551    |     |
| 8.00%        | 826     | 826                | 826    | 826  | 826   | 826    | 826    |     |
| KR4101PC0002 |         | 2019-12 코스피200지수선물 |        |      |       |        |        | 253 |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | -253    | -253               | -253   | -253 | -253  | -253   | -253   |     |
| -5.33%       | -169    | -169               | -169   | -169 | -169  | -169   | -169   |     |
| -2.67%       | -84     | -84                | -84    | -84  | -84   | -84    | -84    |     |
| 0%           | 0       | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |     |
| 2.67%        | 84      | 84                 | 84     | 84   | 84    | 84     | 84     |     |
| 5.33%        | 169     | 169                | 169    | 169  | 169   | 169    | 169    |     |
| 8.00%        | 253     | 253                | 253    | 253  | 253   | 253    | 253    |     |
| KR4201PC2858 |         | 2019-12 콜285       |        |      |       |        |        | 314 |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | 155     | 150                | 144    | 137  | 130   | 122    | 114    |     |
| -5.33%       | 136     | 127                | 118    | 109  | 99    | 89     | 78     |     |
| -2.67%       | 98      | 87                 | 75     | 64   | 52    | 40     | 29     |     |
| 0%           | 36      | 24                 | 12     | 0    | -12   | -24    | -36    |     |
| 2.67%        | -50     | -60                | -71    | -82  | -93   | -105   | -116   |     |
| 5.33%        | -156    | -163               | -172   | -180 | -190  | -199   | -210   |     |
| 8.00%        | -275    | -279               | -285   | -291 | -298  | -306   | -314   |     |
| KR4301PC2824 |         | 2019-12 풋282.5     |        |      |       |        |        | 224 |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |

|                           |         |         |        |      |       |        |        |
|---------------------------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| -8.00%                    | -219    | -220    | -220   | -221 | -221  | -222   | -224   |
| -5.33%                    | -119    | -121    | -123   | -125 | -128  | -130   | -133   |
| -2.67%                    | -35     | -39     | -44    | -48  | -52   | -56    | -61    |
| 0%                        | 12      | 8       | 4      | 0    | -4    | -8     | -12    |
| 2.67%                     | 26      | 25      | 23     | 21   | 19    | 16     | 13     |
| 5.33%                     | 28      | 28      | 28     | 27   | 26    | 25     | 24     |
| 8.00%                     | 28      | 28      | 28     | 28   | 28    | 28     | 27     |
| KR4301PC2857 2019-12 풋285 |         |         |        |      |       |        | 63     |
| 기초자산의 변동성                 |         |         |        |      |       |        |        |
| 가격                        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                    | -62     | -62     | -62    | -62  | -63   | -63    | -63    |
| -5.33%                    | -36     | -36     | -36    | -37  | -37   | -38    | -39    |
| -2.67%                    | -12     | -13     | -14    | -15  | -16   | -17    | -18    |
| 0%                        | 3       | 2       | 1      | 0    | -1    | -2     | -3     |
| 2.67%                     | 9       | 9       | 8      | 7    | 7     | 6      | 5      |
| 5.33%                     | 11      | 10      | 10     | 10   | 10    | 9      | 9      |
| 8.00%                     | 11      | 11      | 11     | 11   | 10    | 10     | 10     |

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

(단위:백만원)

1,619

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-18 |
| 기준일 | 2019-11-15 |

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

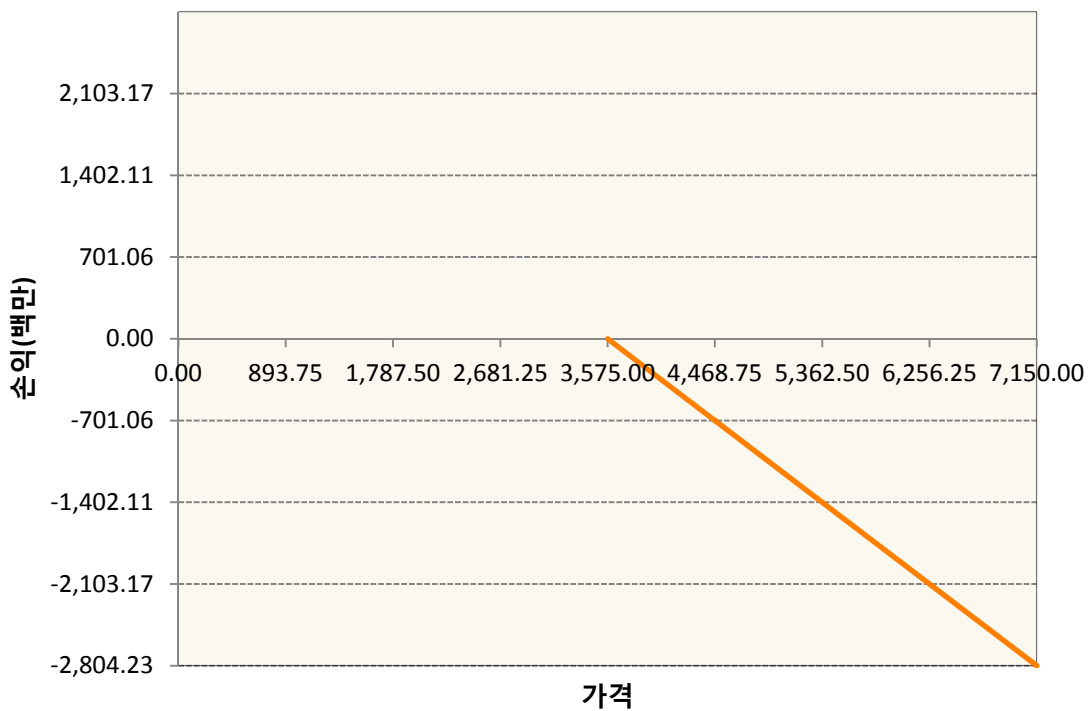
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

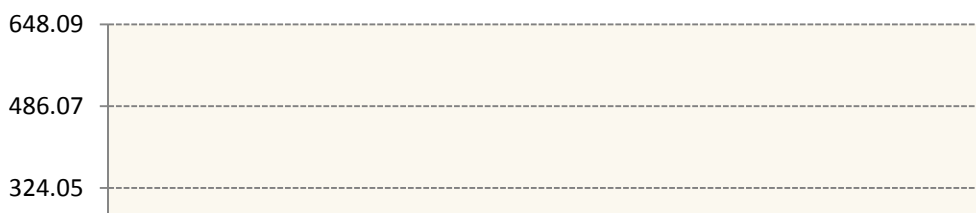
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 스왑   | 0      | 0     | 0         | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0      | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 574    | 0     | 574       |    |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 20,203 | 0     | 20,203    | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 6,905 | -6,905    | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 2,027  | 6,044 | -4,017    | 장외 |

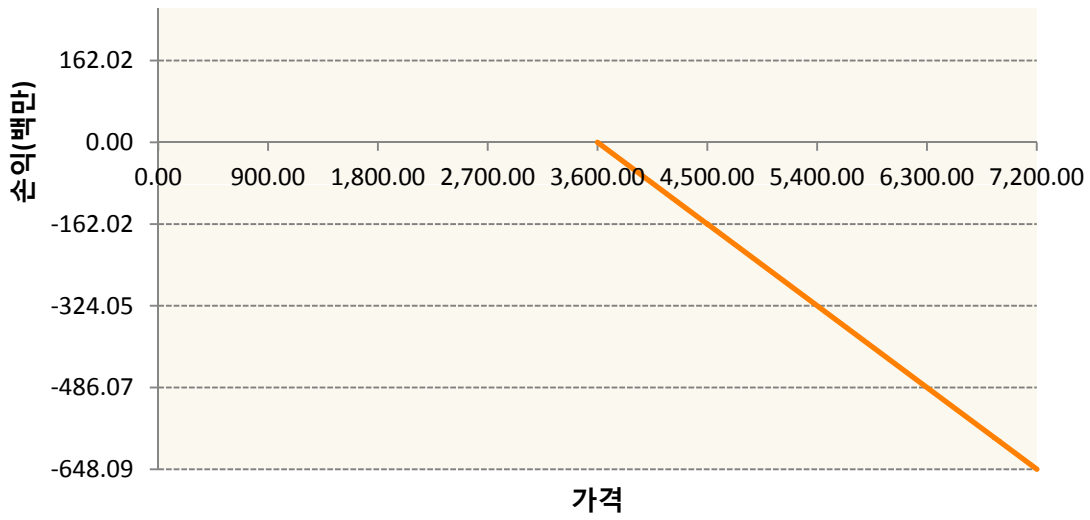
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXX9-C3575-EURO STOXX 50

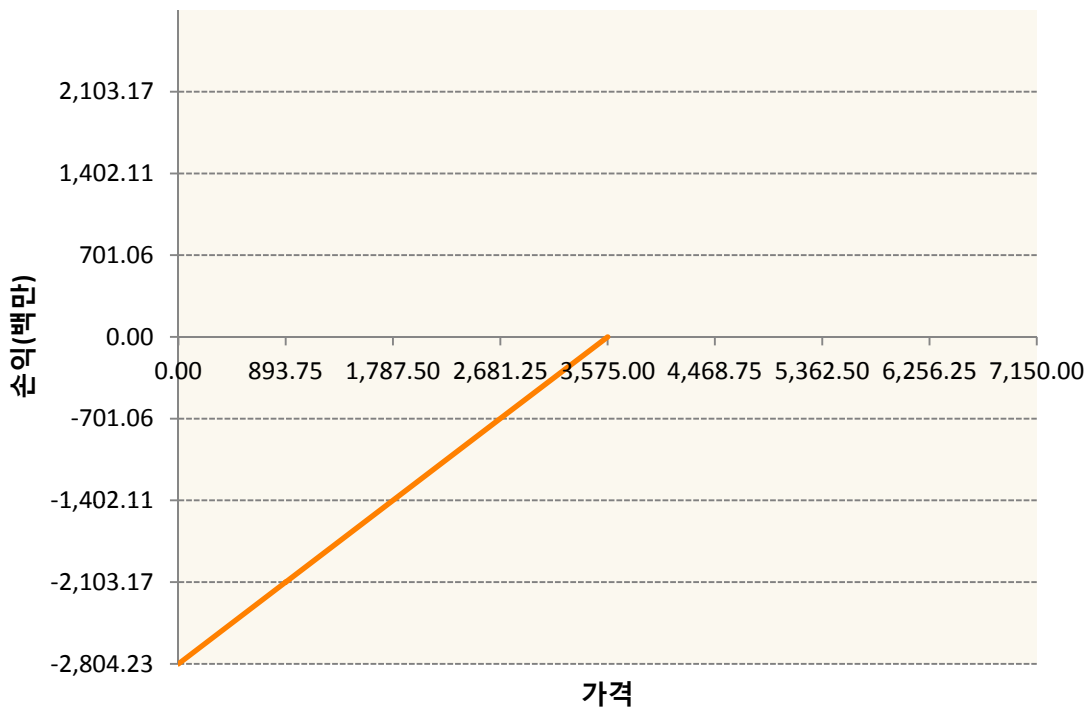


OESXX9-C3600-EURO STOXX 50

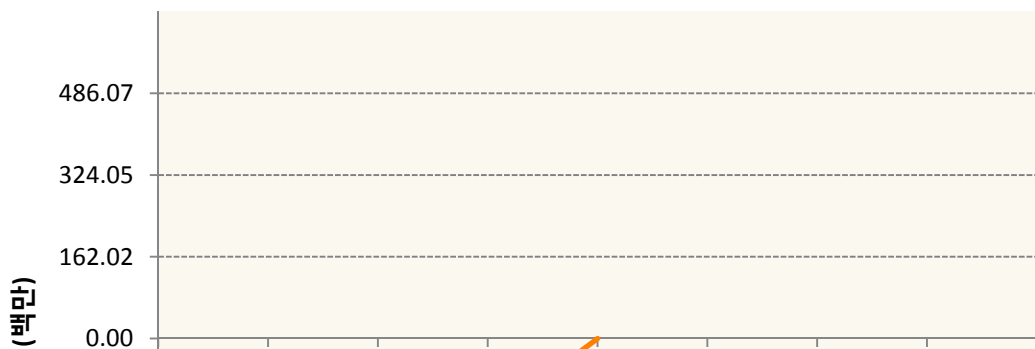


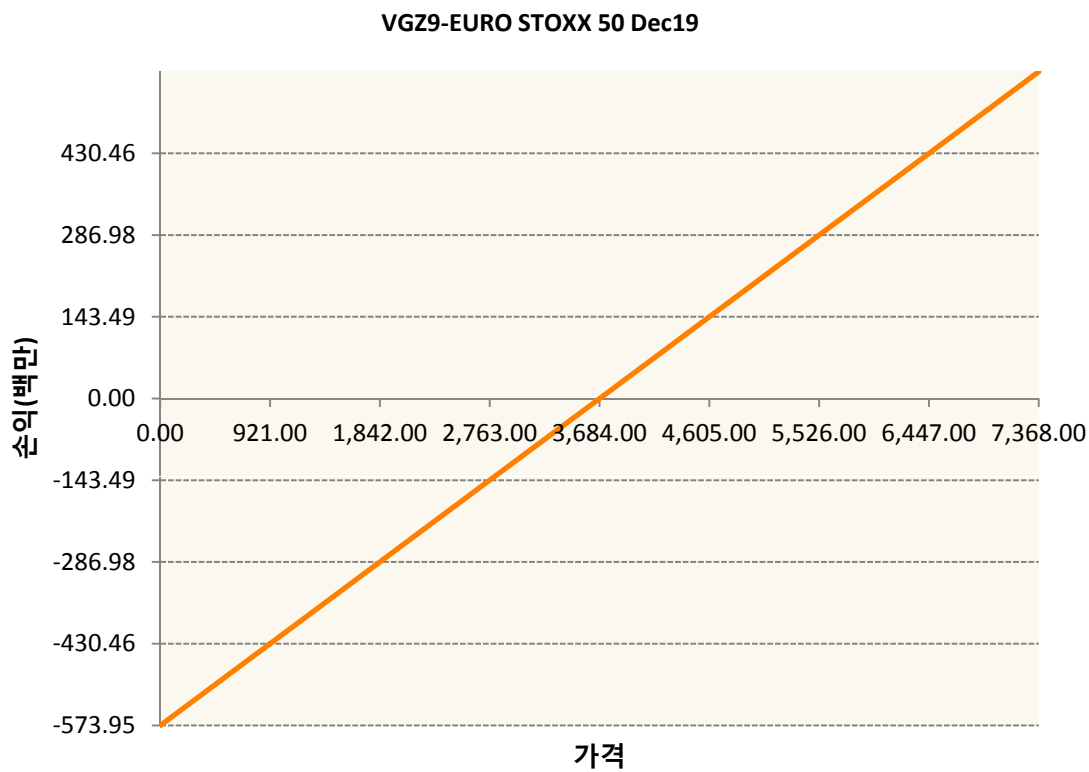
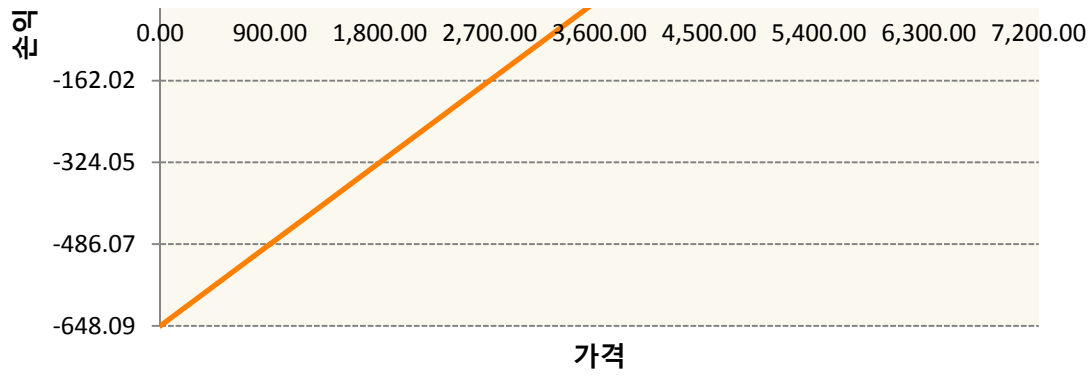


OESXX9-P3575-EURO STOXX 50



OESXX9-P3600-EURO STOXX 50





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)               |                     | (단위:백만원) |
|---|---------------------|----------|
| 260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY |                     | 24       |
| FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E            |                     | 483      |
| FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E            |                     | 162      |
| OESXX9-C35 EURO STOXX 50                |                     | 224      |
| OESXX9-C36 EURO STOXX 50                |                     | 52       |
| OESXX9-P35 EURO STOXX 50                |                     | 224      |
| OESXX9-P36 EURO STOXX 50                |                     | 52       |
| VGZ9                                    | EURO STOXX 50 Dec19 | 46       |

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

(단위:백만원)

733



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

(단위:백만원)

931



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

(단위:백만원)

81



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

(단위:백만원)

126



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

(단위:백만원)

41

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-18 |
| 기준일 | 2019-11-15 |

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

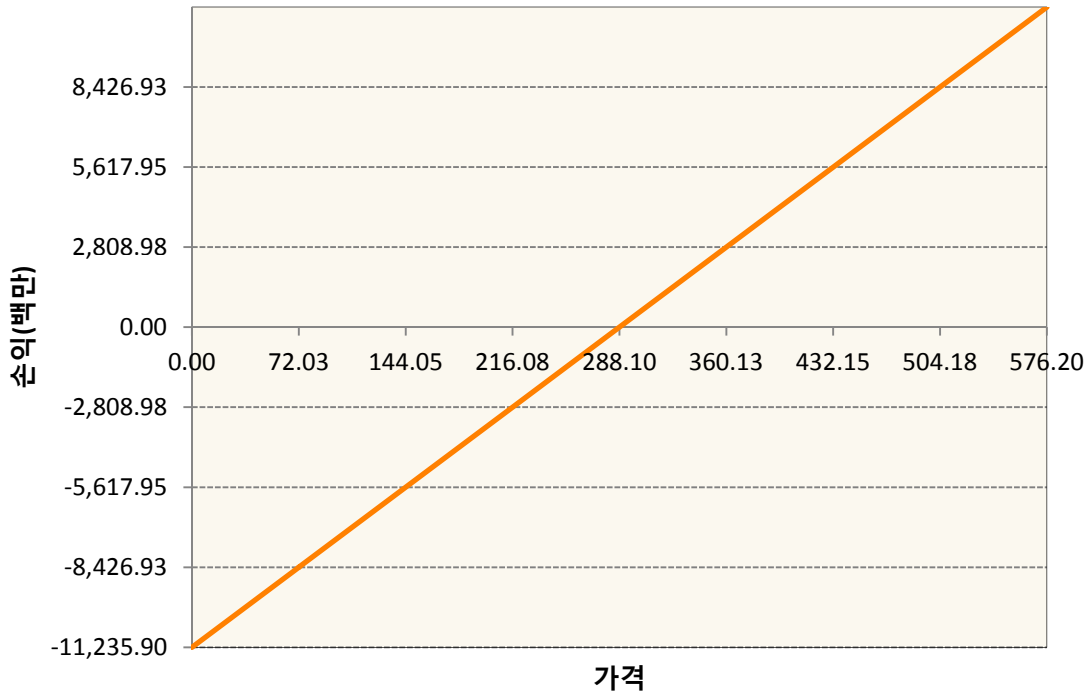
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

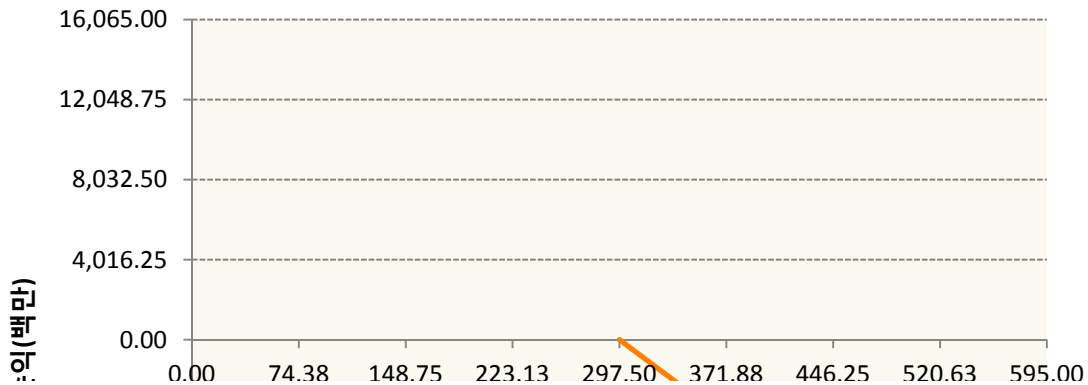
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 143    | 0      | 143       | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 774    | 6,116  | -5,342    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 11,236 | 0      | 11,236    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 1,491  | 21,390 | -19,899   | 장내 |

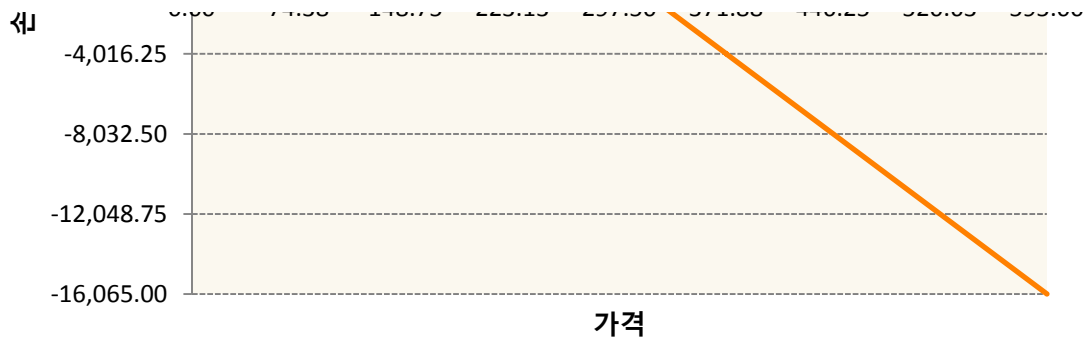
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

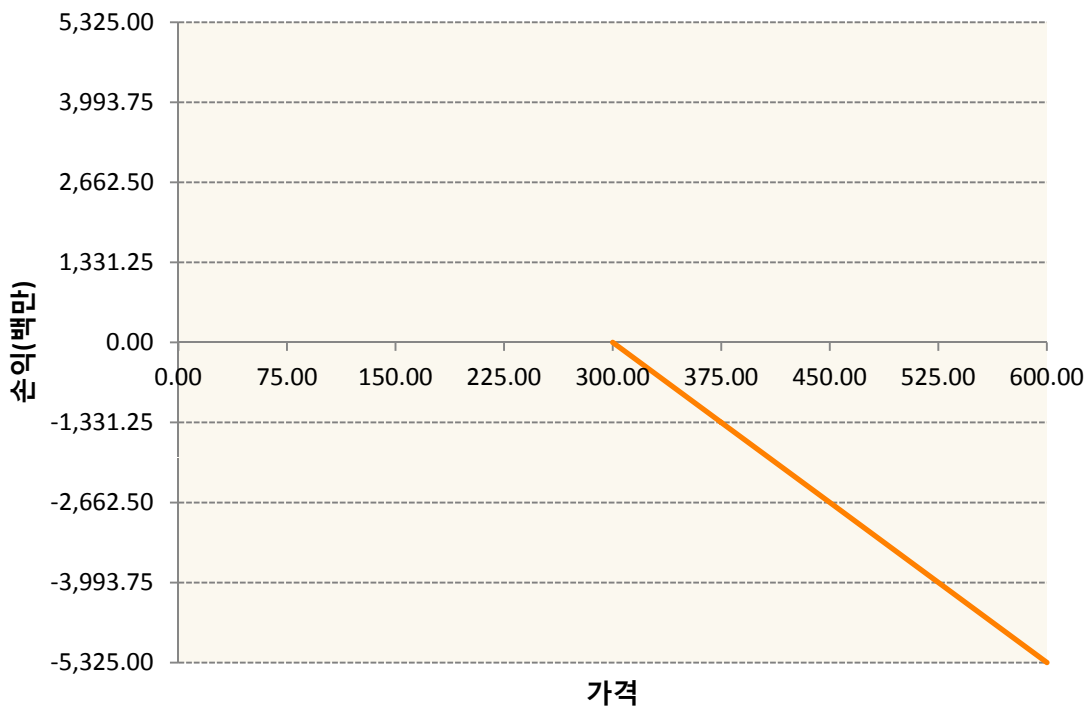


KR4201PC2973-2019-12 콜297.5

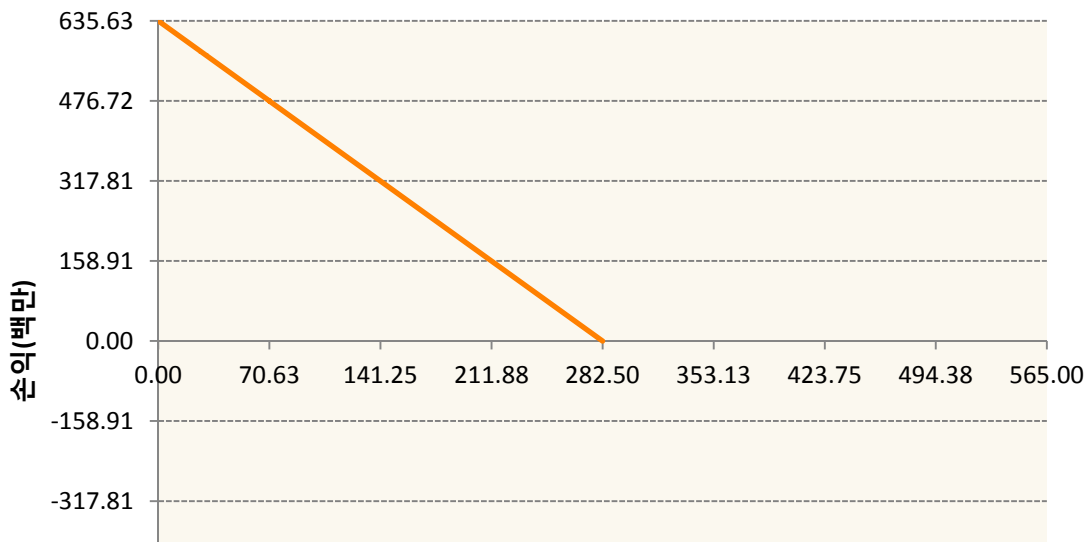


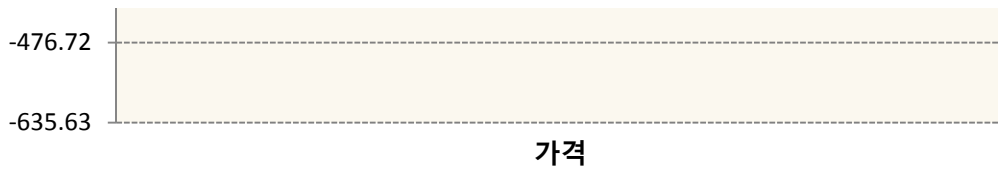


KR4201PC3005-2019-12 콜300

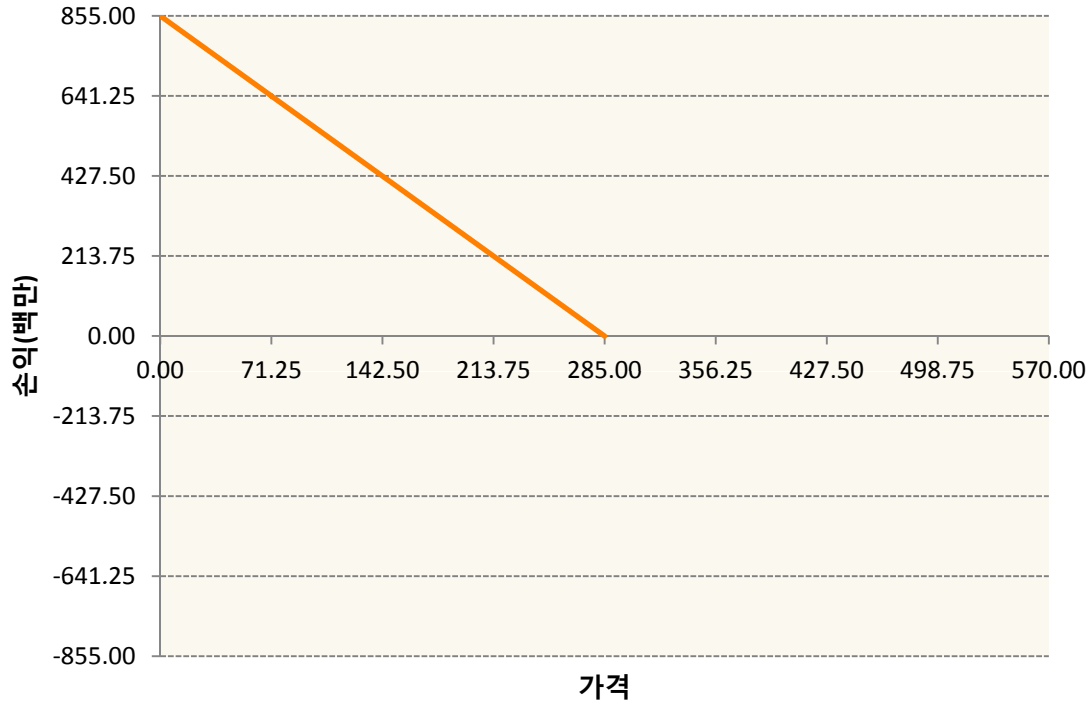


KR4301PC2824-2019-12 풋282.5





KR4301PC2857-2019-12 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101PC0002 |         | 2019-12 코스피200지수선물 |        |      |       |        |        | 896 |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
|              |         | 기초자산의 변동성          |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | -896    | -896               | -896   | -896 | -896  | -896   | -896   |     |
| -5.33%       | -598    | -598               | -598   | -598 | -598  | -598   | -598   |     |
| -2.67%       | -299    | -299               | -299   | -299 | -299  | -299   | -299   |     |
| 0%           | 0       | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |     |
| 2.67%        | 299     | 299                | 299    | 299  | 299   | 299    | 299    |     |
| 5.33%        | 598     | 598                | 598    | 598  | 598   | 598    | 598    |     |
| 8.00%        | 896     | 896                | 896    | 896  | 896   | 896    | 896    |     |
| KR4201PC2973 |         | 2019-12 콜297.5     |        |      |       |        |        | 766 |
|              |         | 기초자산의 변동성          |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | 236     | 231                | 224    | 214  | 203   | 189    | 173    |     |
| -5.33%       | 222     | 210                | 195    | 178  | 159   | 138    | 115    |     |
| -2.67%       | 183     | 161                | 137    | 111  | 83    | 54     | 24     |     |

|  |         |         |        |      |       |        |        |
|--|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 0%   | 101     | 68      | 34     | 0    | -35   | -71    | -107   |
| 2.67%  | -46     | -86     | -125   | -164 | -203  | -243   | -282   |
| 5.33%  | -268    | -307    | -345   | -384 | -424  | -463   | -502   |
| 8.00%  | -560    | -591    | -624   | -659 | -694  | -730   | -766   |
| KR4201PC3005                      2019-12 콜300   |         |         |        |      |       |        | 236    |
| 기초자산의 변동성  |         |         |        |      |       |        |        |
| 가격   | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%   | 65      | 64      | 62     | 60   | 57    | 53     | 48     |
| -5.33%   | 62      | 59      | 55     | 50   | 45    | 38     | 32     |
| -2.67%   | 53      | 46      | 39     | 32   | 23    | 14     | 5      |
| 0%   | 31      | 21      | 11     | 0    | -11   | -22    | -34    |
| 2.67%  | -10     | -23     | -35    | -48  | -61   | -74    | -86    |
| 5.33%  | -75     | -88     | -101   | -115 | -128  | -141   | -154   |
| 8.00%  | -164    | -175    | -187   | -199 | -211  | -224   | -236   |
| KR4301PC2824                      2019-12 풋282.5 |         |         |        |      |       |        | 37     |
| 기초자산의 변동성  |         |         |        |      |       |        |        |
| 가격   | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%   | 37      | 37      | 37     | 37   | 37    | 37     | 37     |
| -5.33%   | 20      | 20      | 20     | 21   | 21    | 22     | 22     |
| -2.67%   | 6       | 7       | 7      | 8    | 9     | 9      | 10     |
| 0%   | -2      | -1      | -1     | 0    | 1     | 1      | 2      |
| 2.67%  | -4      | -4      | -4     | -3   | -3    | -3     | -2     |
| 5.33%  | -5      | -5      | -5     | -5   | -4    | -4     | -4     |
| 8.00%  | -5      | -5      | -5     | -5   | -5    | -5     | -5     |
| KR4301PC2857                      2019-12 풋285   |         |         |        |      |       |        | 54     |
| 기초자산의 변동성  |         |         |        |      |       |        |        |
| 가격   | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%   | 53      | 53      | 53     | 54   | 54    | 54     | 54     |
| -5.33%   | 31      | 31      | 31     | 32   | 32    | 33     | 33     |
| -2.67%   | 10      | 11      | 12     | 13   | 14    | 15     | 15     |
| 0%   | -3      | -2      | -1     | 0    | 1     | 2      | 3      |
| 2.67%  | -8      | -8      | -7     | -6   | -6    | -5     | -4     |
| 5.33%  | -9      | -9      | -9     | -9   | -8    | -8     | -8     |
| 8.00%  | -9      | -9      | -9     | -9   | -9    | -9     | -9     |

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

(단위:백만원)

**1,598**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-18 |
| 기준일 | 2019-11-15 |

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)   | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 3,500   | 0     | 3,500     |    |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 202,987 | 0     | 202,987   |    |

### 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 | 2019-11-18 |
| 기준일 | 2019-11-15 |

## 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 | 211,859 | 0     | 211,859   |    |

### 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 | 2019-11-18 |
| 기준일 | 2019-11-15 |

## 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 | 537,957 | 0       | 537,957   |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0       | 567,551 | -567,551  | 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 |                                 | 1,867 |
| FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E |                                 | 1,960 |
| FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E |                                 | 653   |
| FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E |                                 | 691   |
| FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E |                                 | 1,680 |
| FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E |                                 | 2,464 |
| FX21019V01 KRW/USD 18-11-19E |                                 | 467   |
| FX21019V02 KRW/USD 21-11-19E |                                 | 5,077 |
| FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E |                                 | 4,760 |
| FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E |                                 | 1,400 |
| FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E |                                 | 2,800 |
| FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E |                                 | 1,503 |
| FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E |                                 | 2,837 |
| FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E |                                 | 933   |
| FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E |                                 | 933   |
| FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E |                                 | 1,867 |
| FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E |                                 | 1,867 |
| FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E |                                 | 933   |
| FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E |                                 | 933   |
| FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E |                                 | 933   |
| FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E |                                 | 933   |
| FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E |                                 | 467   |
| FX21019X00 KRW/USD 06-12-19E |                                 | 653   |
| 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 | 1,531 |
| FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E | 933   |
| FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E | 467   |
| FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E | 933   |
| FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E | 1,531 |

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

(단위:백만원)

**14,283**



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

(단위:백만원)

190

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-18 |
| 기준일 | 2019-11-15 |

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

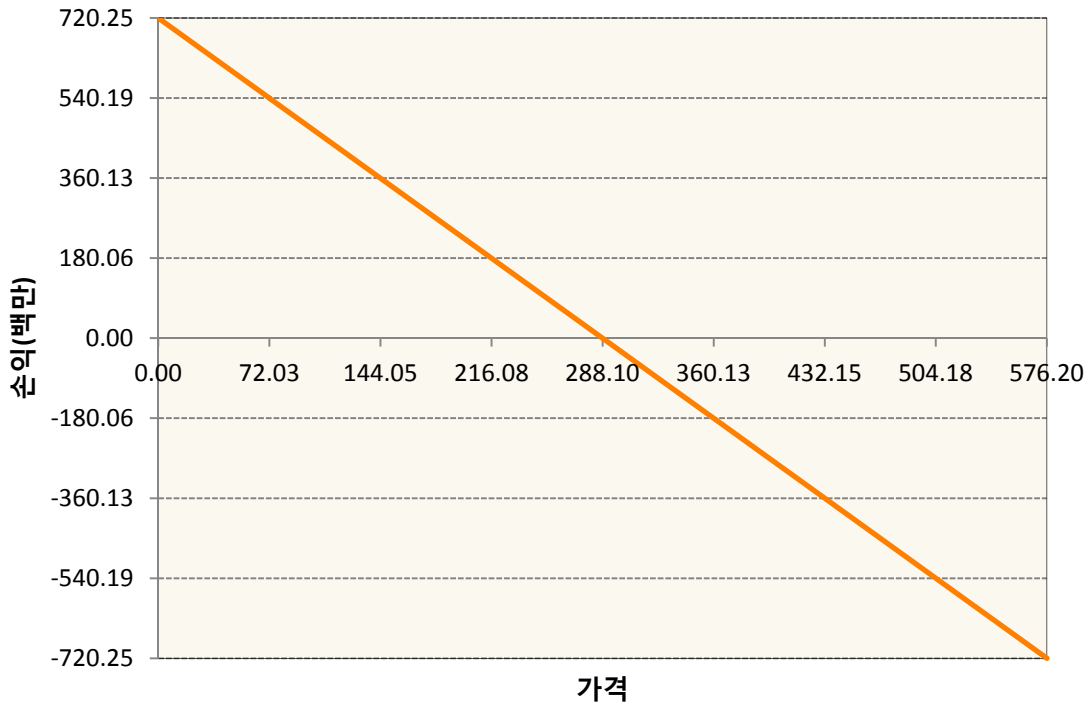
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

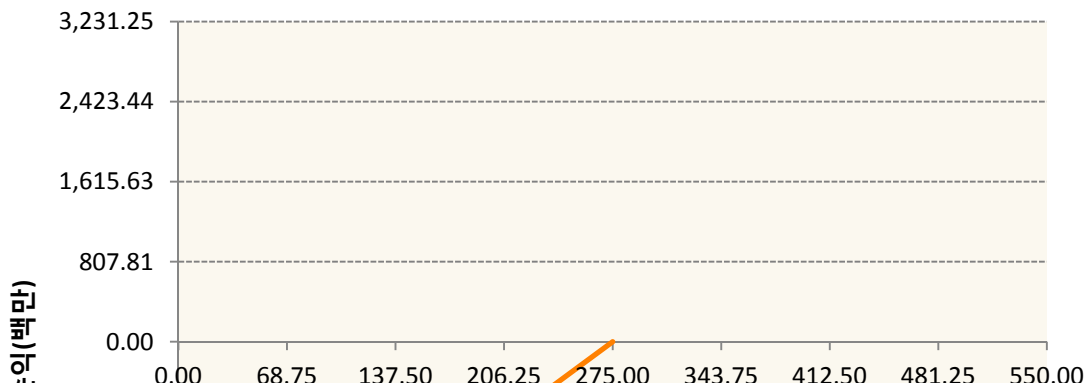
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 1,730 | -1,730    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 0     | 720   | -720      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 3,856 | -3,856    | 장내 |

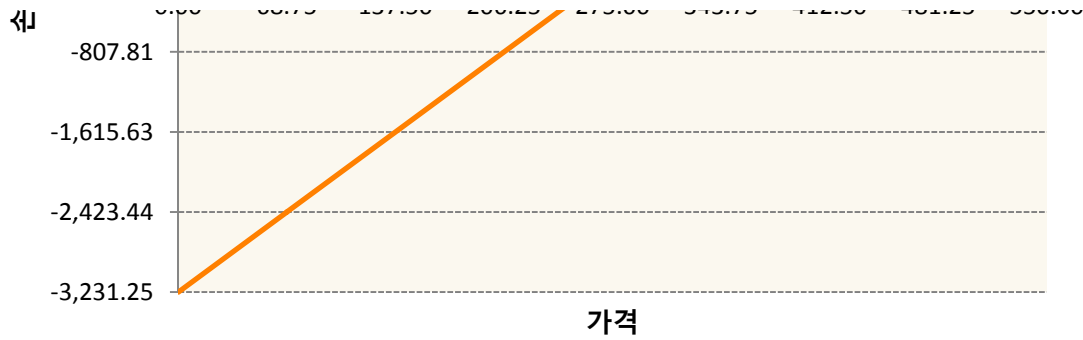
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

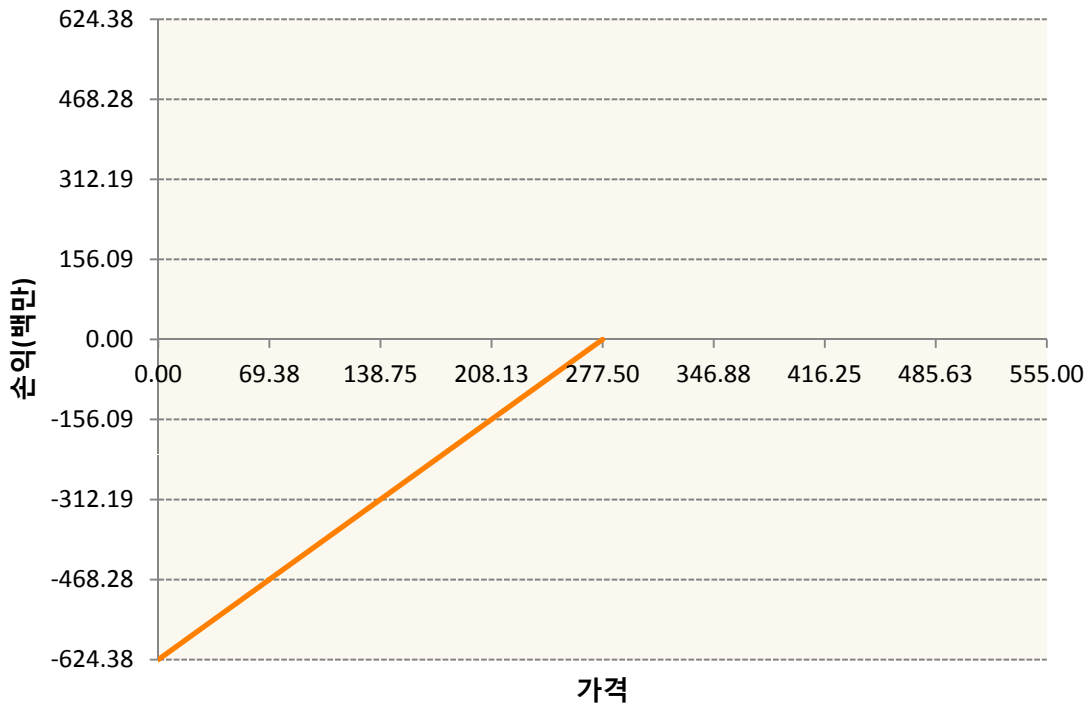


KR4301PC2758-2019-12 풋275





KR4301PC2774-2019-12 풋277.5



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    |     |
| KR4301PC2758 |           | 2019-12 풋275       |        |     |       |        |        | 135 |
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |     |       |        |        |     |

|        |         |         |        |      |       |        |        |
|--------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격     | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -124    | -125    | -126   | -128 | -130  | -133   | -135   |
| -5.33% | -50     | -53     | -57    | -60  | -64   | -67    | -71    |
| -2.67% | -8      | -11     | -15    | -18  | -22   | -25    | -29    |
| 0%     | 4       | 3       | 2      | 0    | -2    | -4     | -6     |
| 2.67%  | 6       | 6       | 6      | 5    | 4     | 4      | 3      |
| 5.33%  | 6       | 6       | 6      | 6    | 6     | 6      | 5      |
| 8.00%  | 6       | 6       | 6      | 6    | 6     | 6      | 6      |

KR4301PC2774                      2019-12 풋277.5                      30

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |     |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | -28     | -28     | -29    | -29 | -29   | -29    | -30    |
| -5.33%    | -13     | -13     | -14    | -15 | -15   | -16    | -16    |
| -2.67%    | -3      | -3      | -4     | -5  | -6    | -6     | -7     |
| 0%        | 1       | 1       | 0      | 0   | 0     | -1     | -2     |
| 2.67%     | 2       | 2       | 2      | 2   | 1     | 1      | 1      |
| 5.33%     | 2       | 2       | 2      | 2   | 2     | 2      | 2      |
| 8.00%     | 2       | 2       | 2      | 2   | 2     | 2      | 2      |

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

(단위:백만원)

**164**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-18 |
| 기준일 | 2019-11-15 |

## 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 | 15,233 | 0      | 15,233    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 350    | 15,411 | -15,061   | 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 |                                 | 317 |
| FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E |                                 | 317 |
| FX21019X01 KRW/USD 13-01-20E |                                 | 229 |
| FX21019X02 USD/KRW 25-11-19E |                                 | 28  |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 397 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-18 |
| 기준일 | 2019-11-15 |

## 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 | 2019-11-18 |
| 기준일 | 2019-11-15 |

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

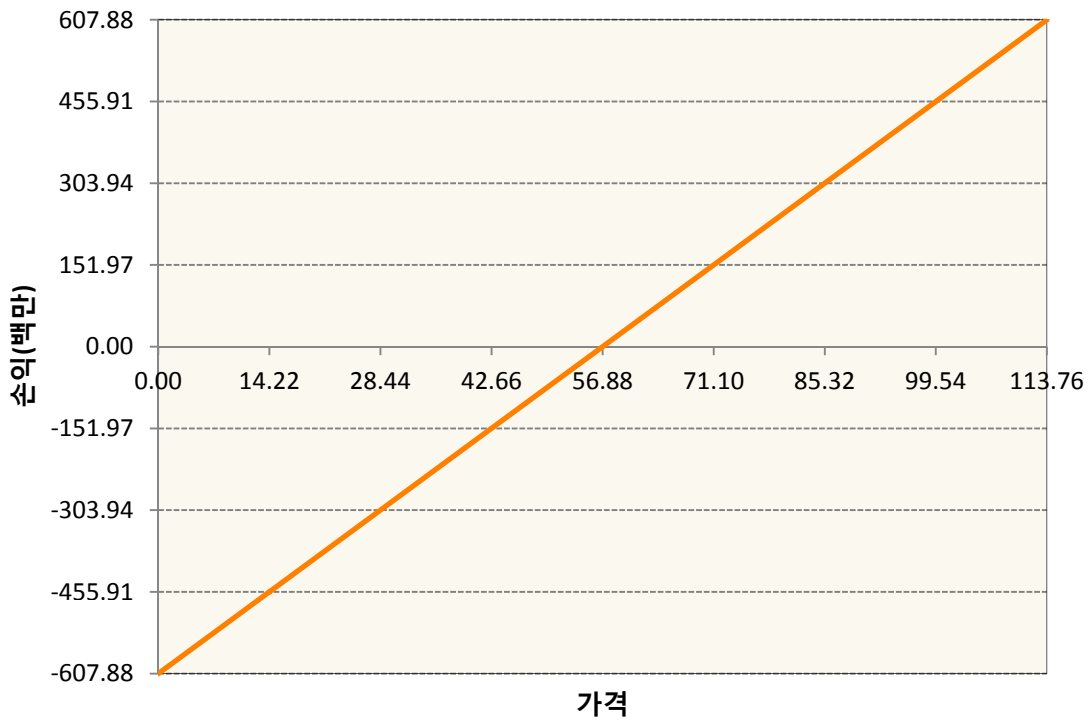
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

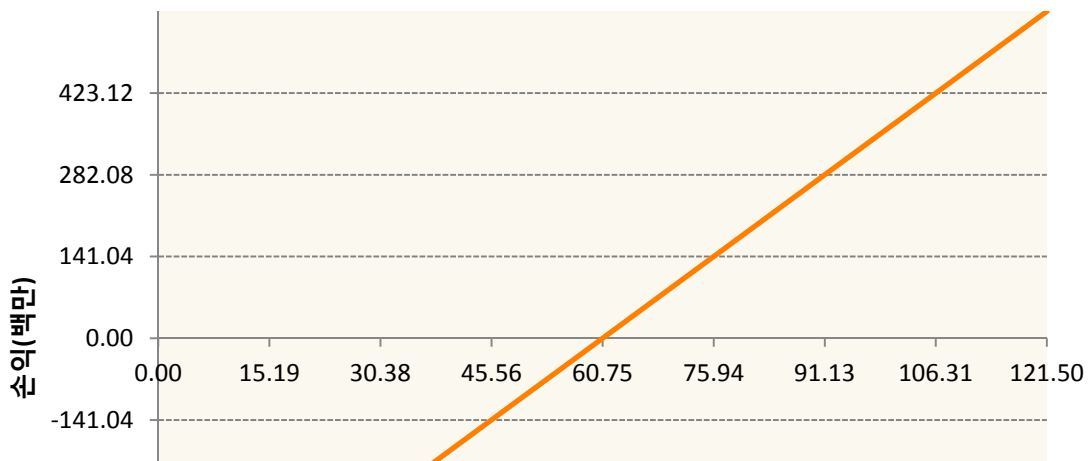
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,489 | 291   | 2,197     |    |

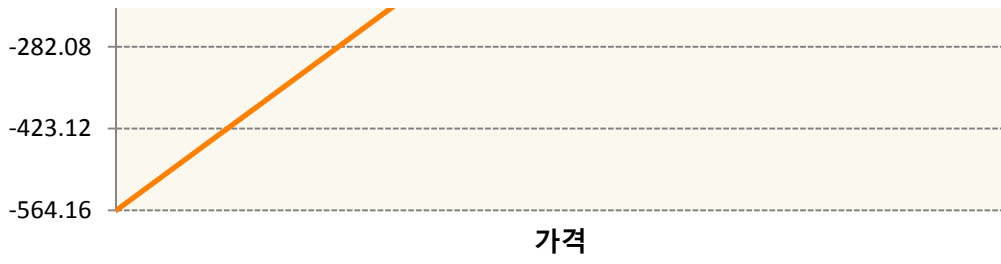
### 2. 만기시점의 손익구조

CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20

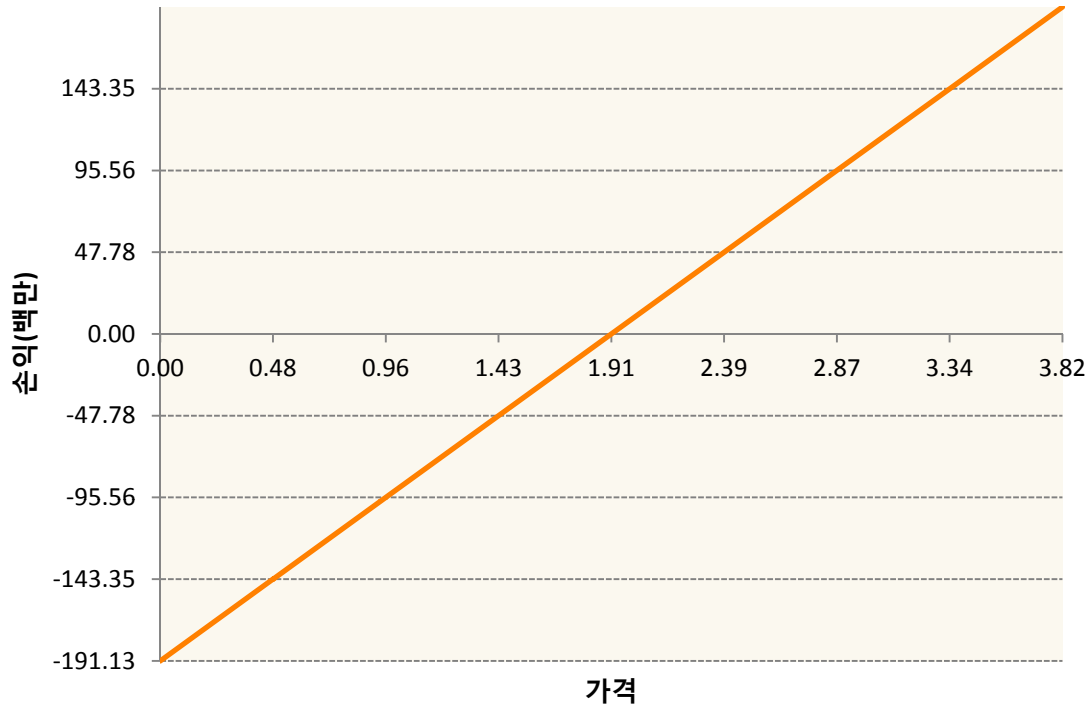


COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20

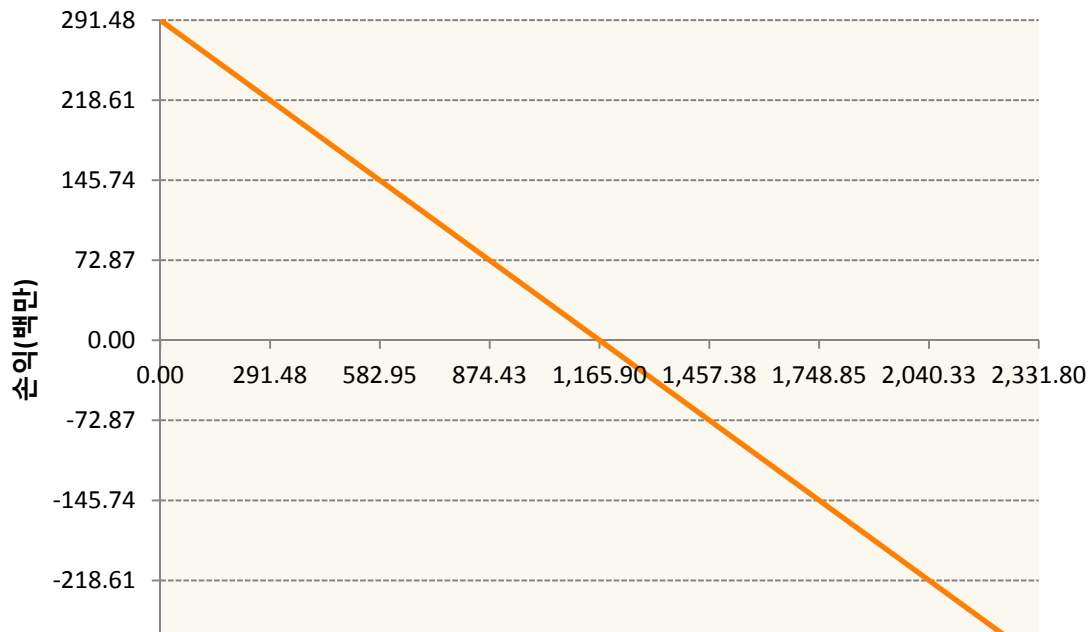


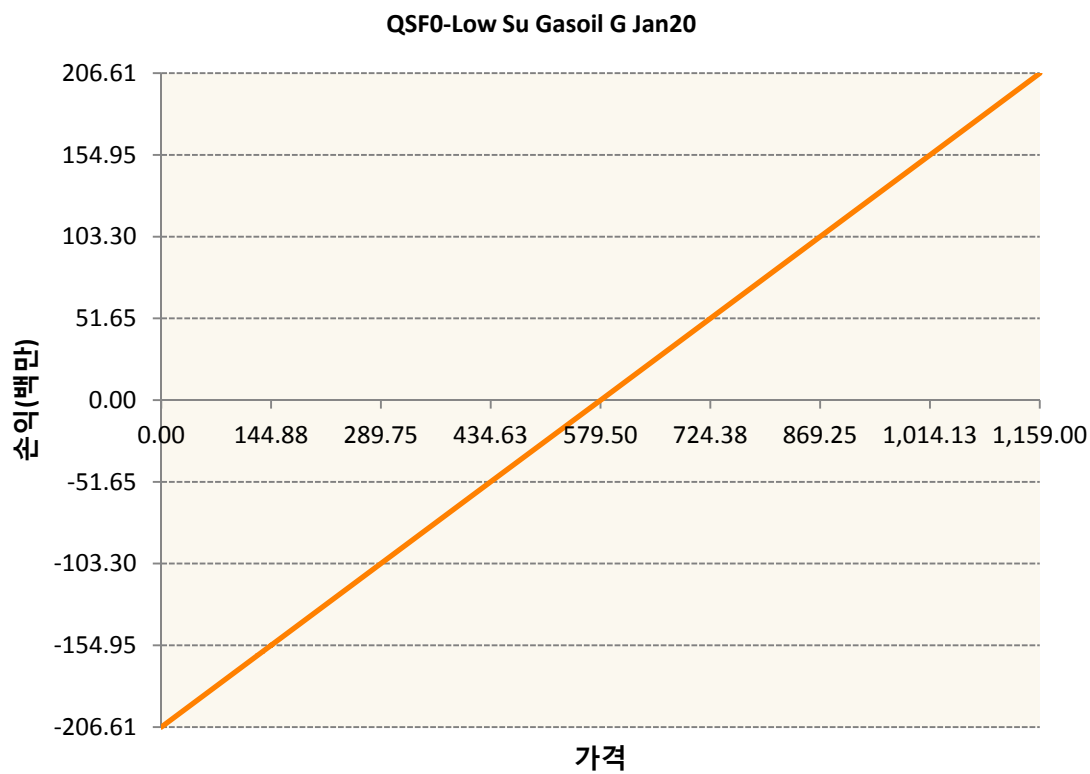
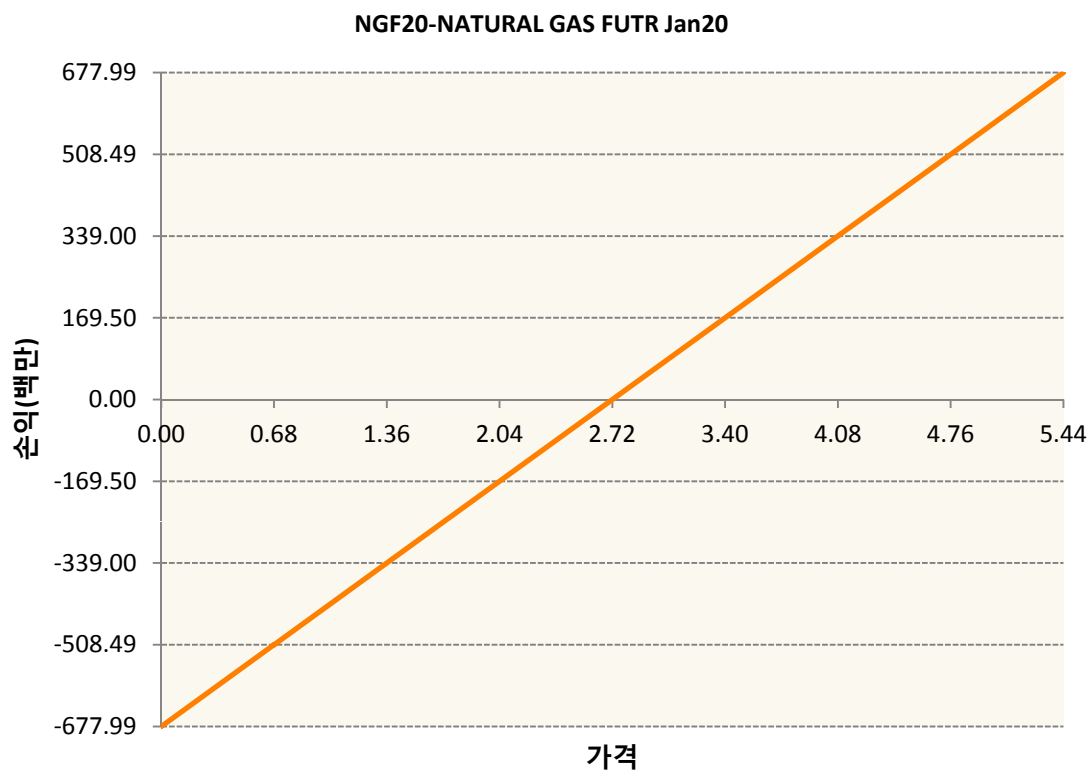
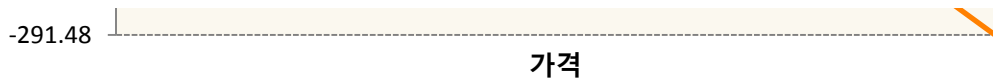


HOF0-NY Harb ULSD Fut Jan20

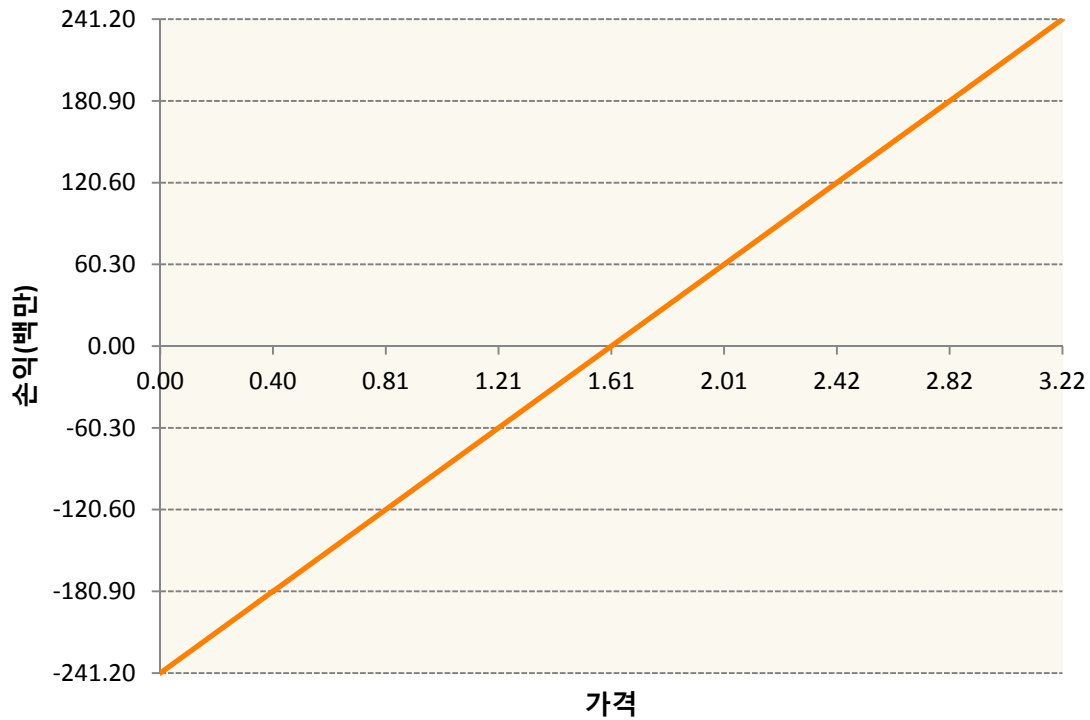


KR4175PC0003-2019-12 달러선물





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 |
| KR4175PC00 | 2019-12 달러선물            | 23 |
| NGF20      | NATURAL GAS FUTR Jan20  | 54 |
| QSF0       | Low Su Gasoil G Jan20   | 17 |
| XBF0       | GASOLINE RBOB FUT Jan20 | 19 |

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

(단위:백만원)

417

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-18 |
| 기준일 | 2019-11-15 |

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

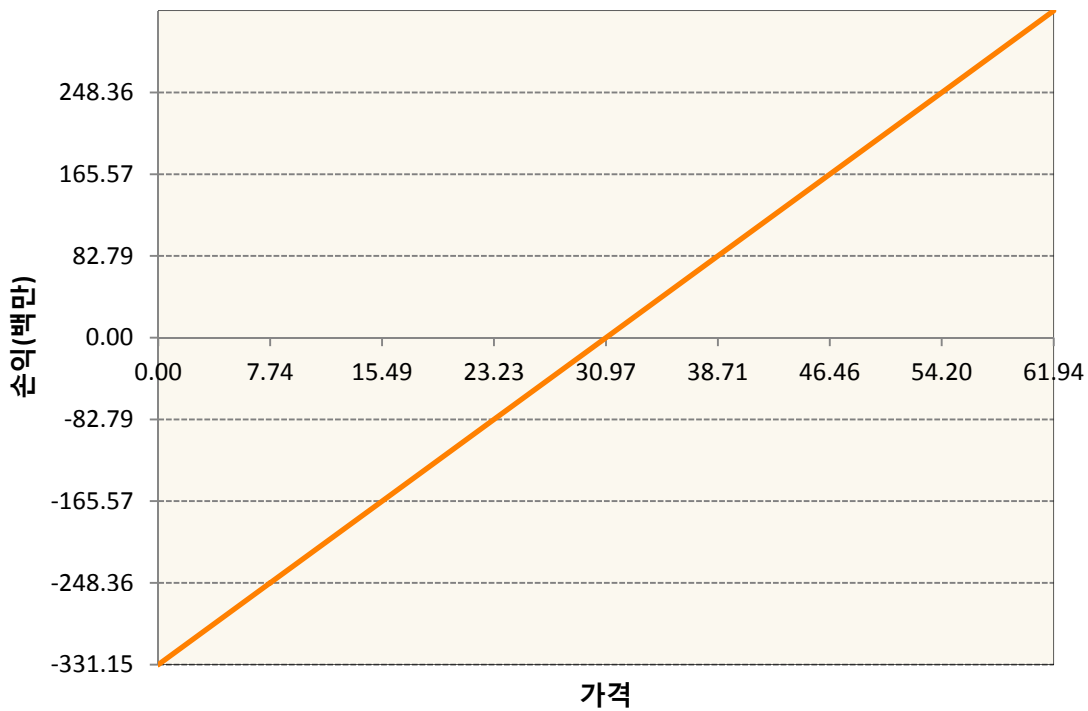
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

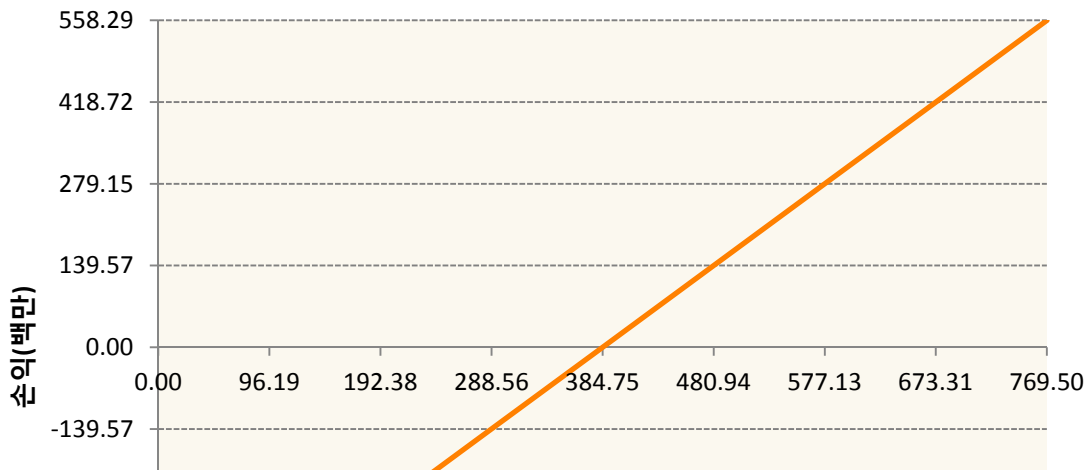
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,823 | 93    | 2,730     |    |

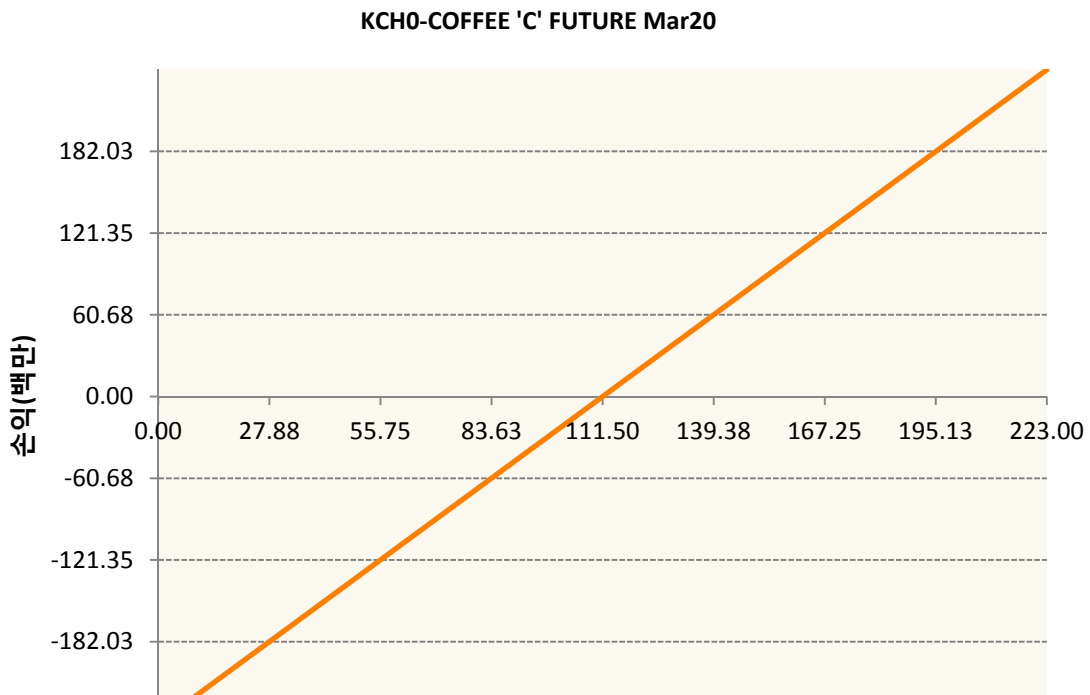
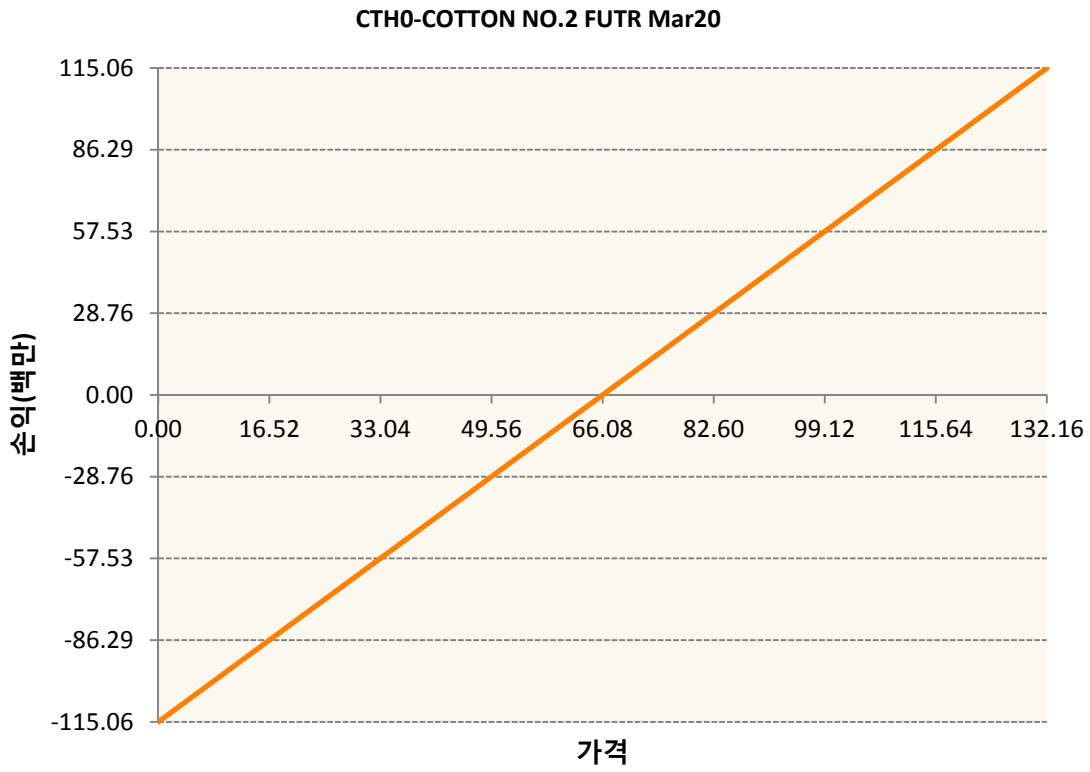
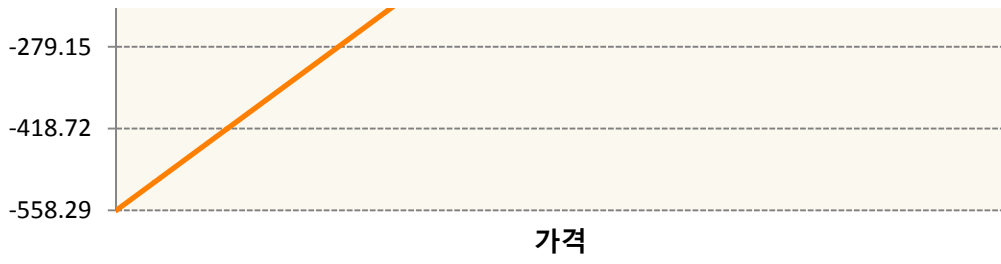
### 2. 만기시점의 손익구조

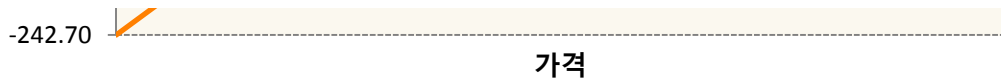
**BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20**



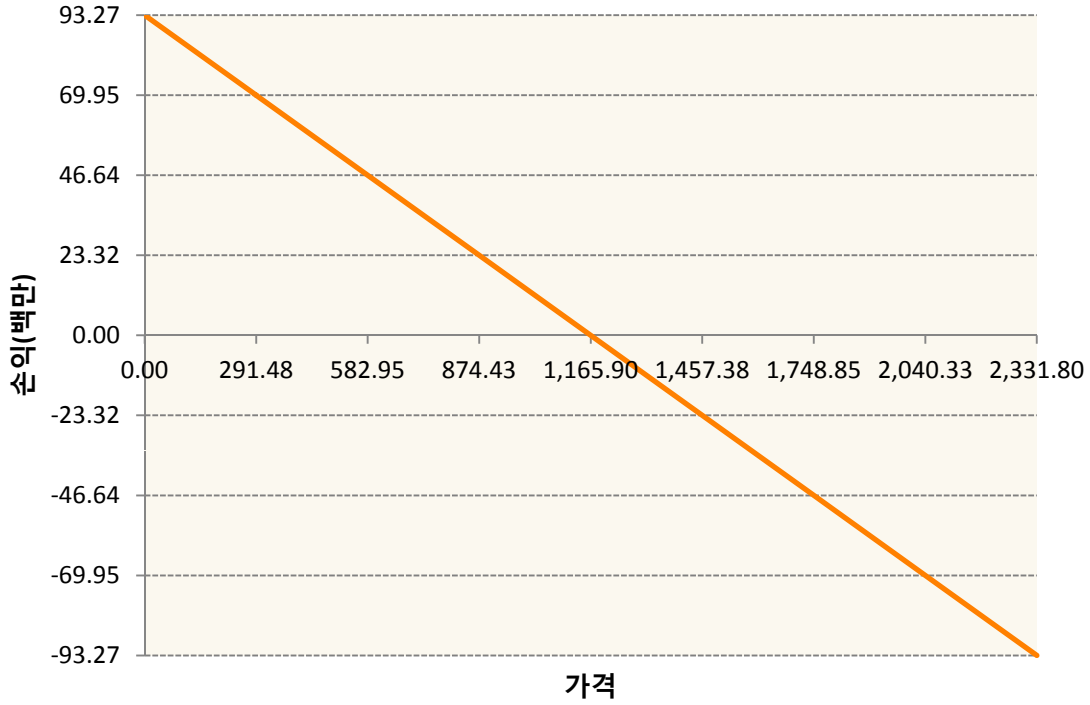
**CH0-CORN FUTURE Mar20**



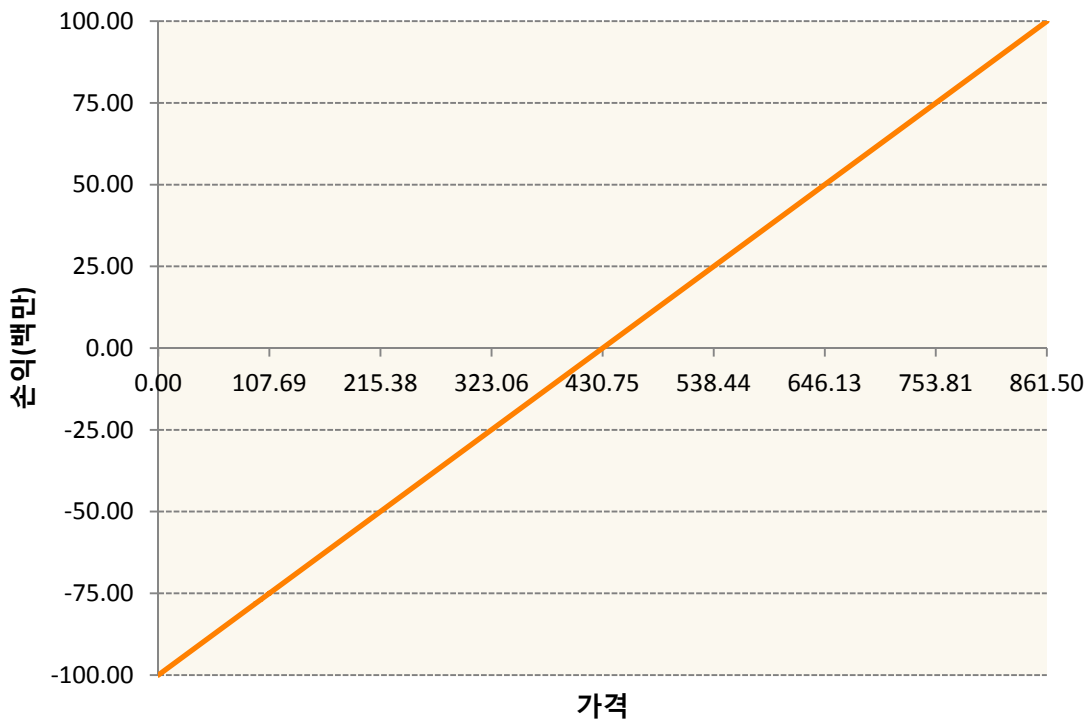




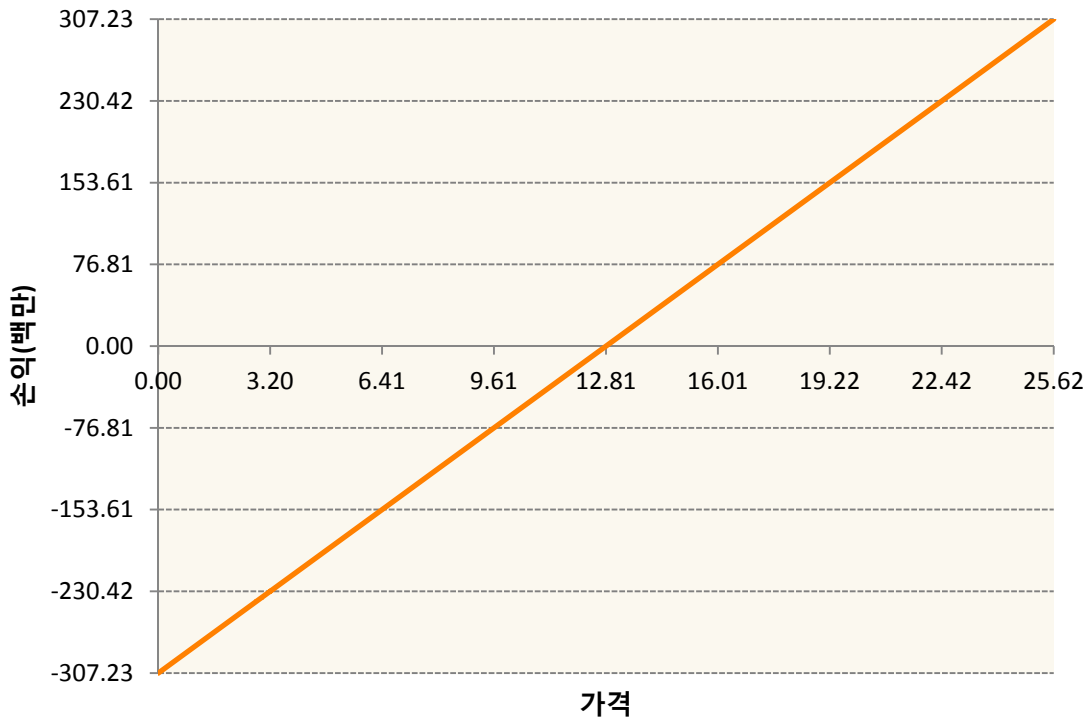
**KR4175PC0003-2019-12 달러선물**



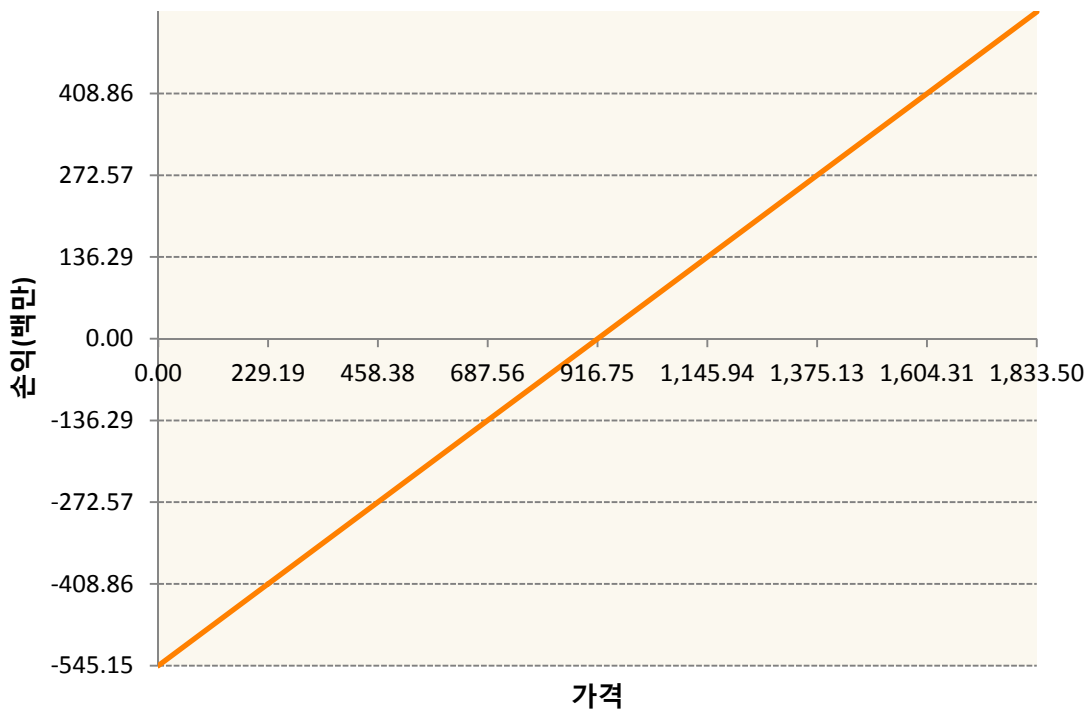
**KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20**



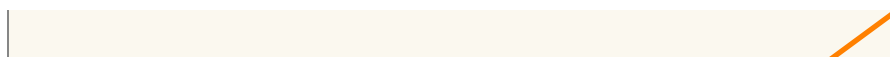
SBH0-Sugar Mar20

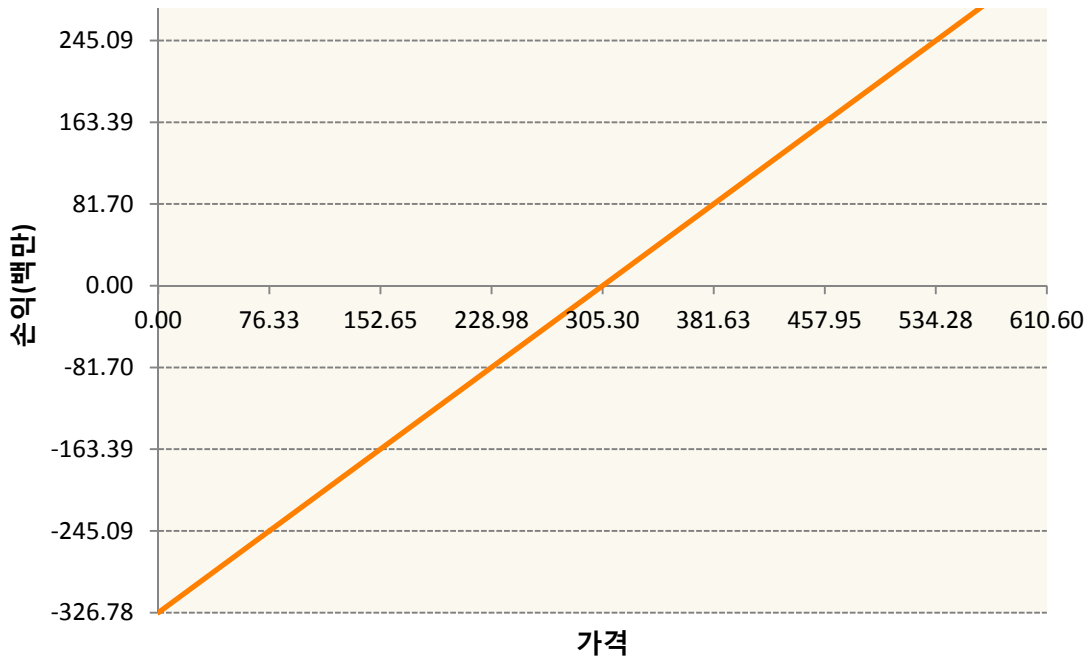


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20

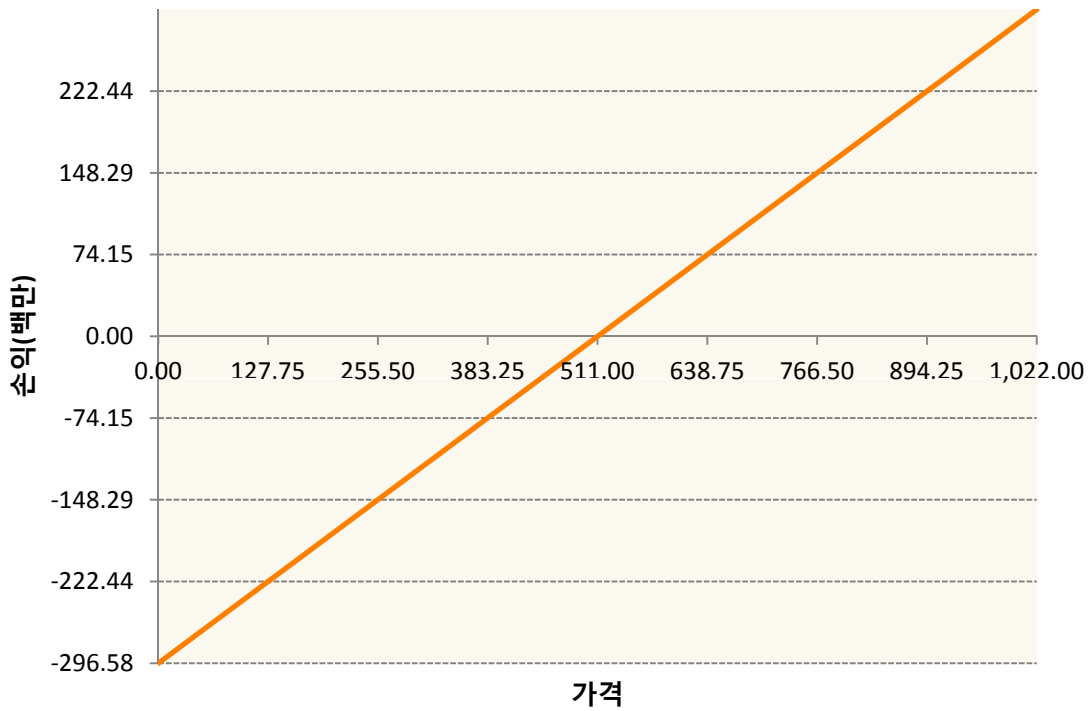


SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





WHO-WHEAT FUTURE(CBT) Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|            |                         |    |
|------------|-------------------------|----|
| BOF0       | SOYBEAN OIL FUTR Jan20  | 26 |
| CH0        | CORN FUTURE Mar20       | 45 |
| CTH0       | COTTON NO.2 FUTR Mar20  | 9  |
| KCH0       | COFFEE 'C' FUTURE Mar20 | 19 |
| KR4175PC00 | 2019-12 달러선물            | 7  |

|      |                         |    |
|------|-------------------------|----|
| KWH0 | KC HRW WHEAT FUT Mar20  | 8  |
| SBH0 | Sugar Mar20             | 25 |
| 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**