

공시일	2019-11-19
기준일	2019-11-18

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	2019-11-19
기준일	2019-11-18

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

1,225

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

707

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-11-19
기준일	2019-11-18

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)	379
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	138

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

751

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-11-19
기준일	2019-11-18

유로인덱스모(주식-파생형)

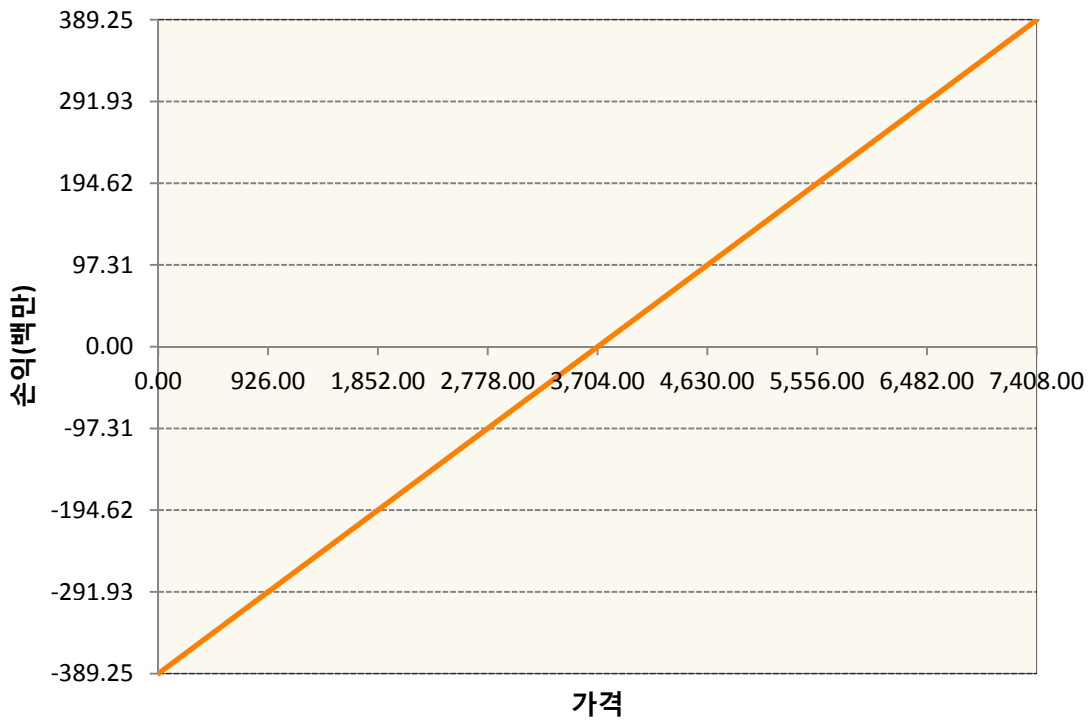
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	389	0	389	

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	2019-11-19
기준일	2019-11-18

차이나인덱스모(주식-파생형)

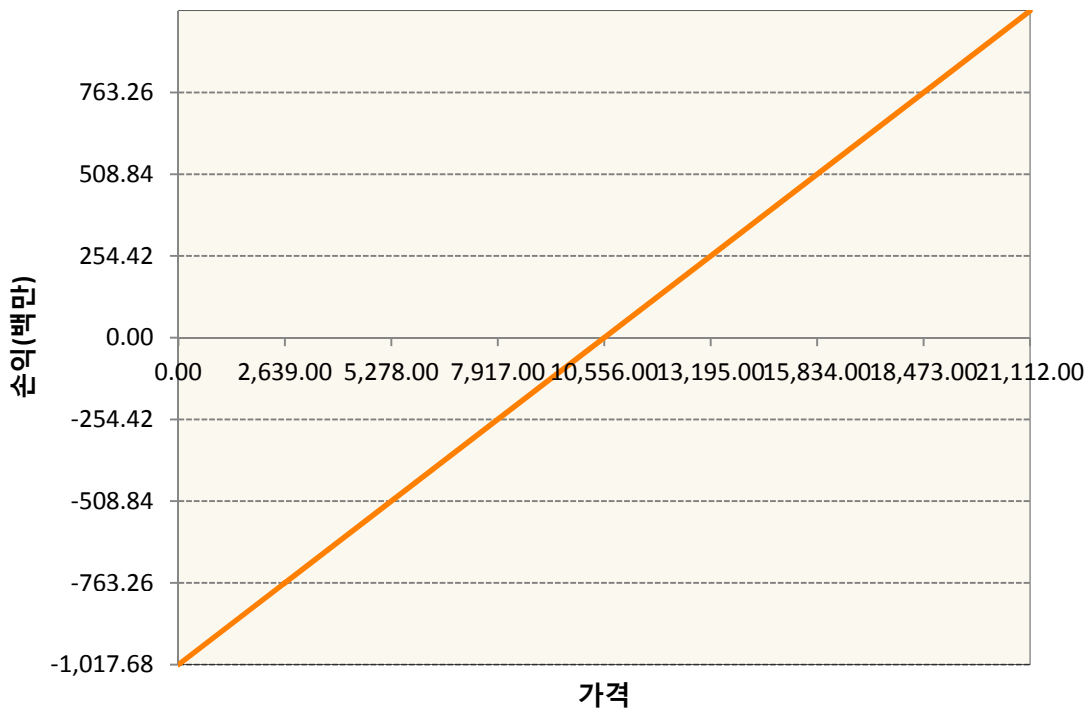
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,018	0	1,018	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)

73

공시일	2019-11-19
기준일	2019-11-18

커버드콜모(주식혼합-파생형)

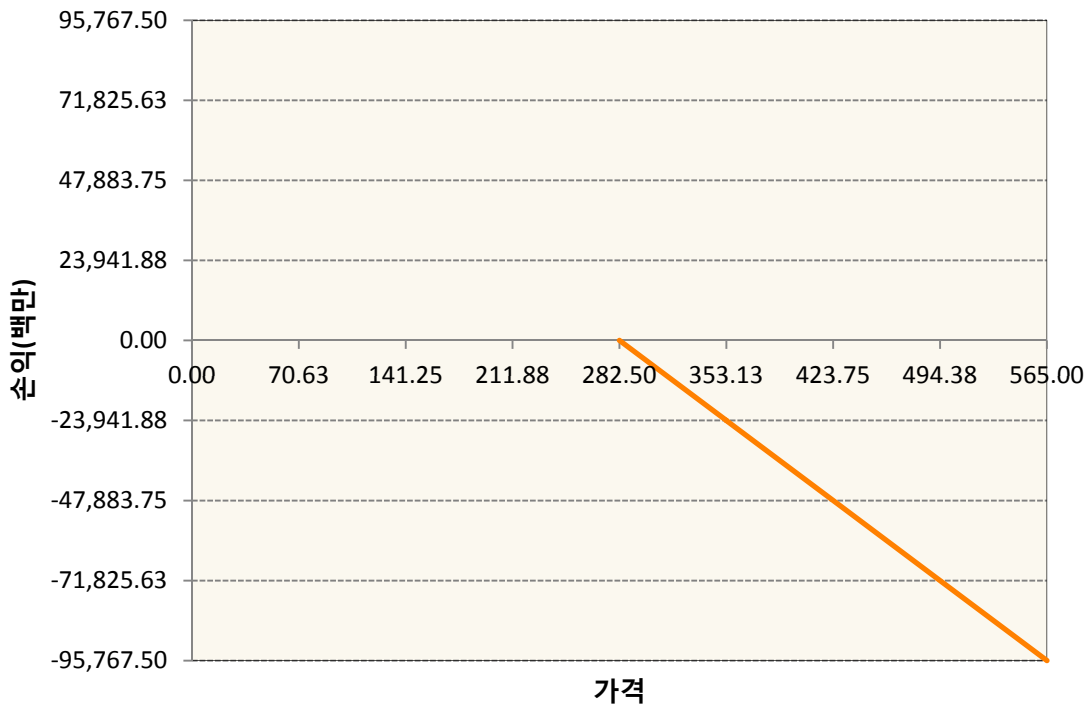
1. 계약금액

(단위:백만원)

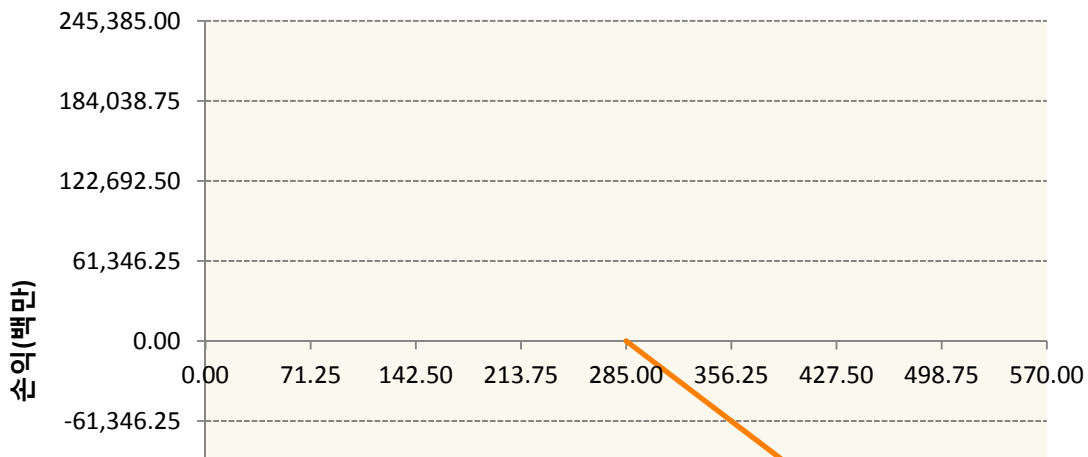
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	144,982	-144,982	장내
누계	유가증권	옵션	0	498,456	-498,456	장내

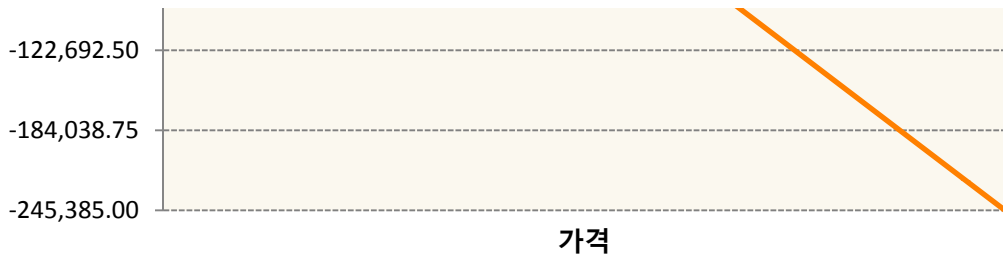
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PC2825-2019-12 콜282.5

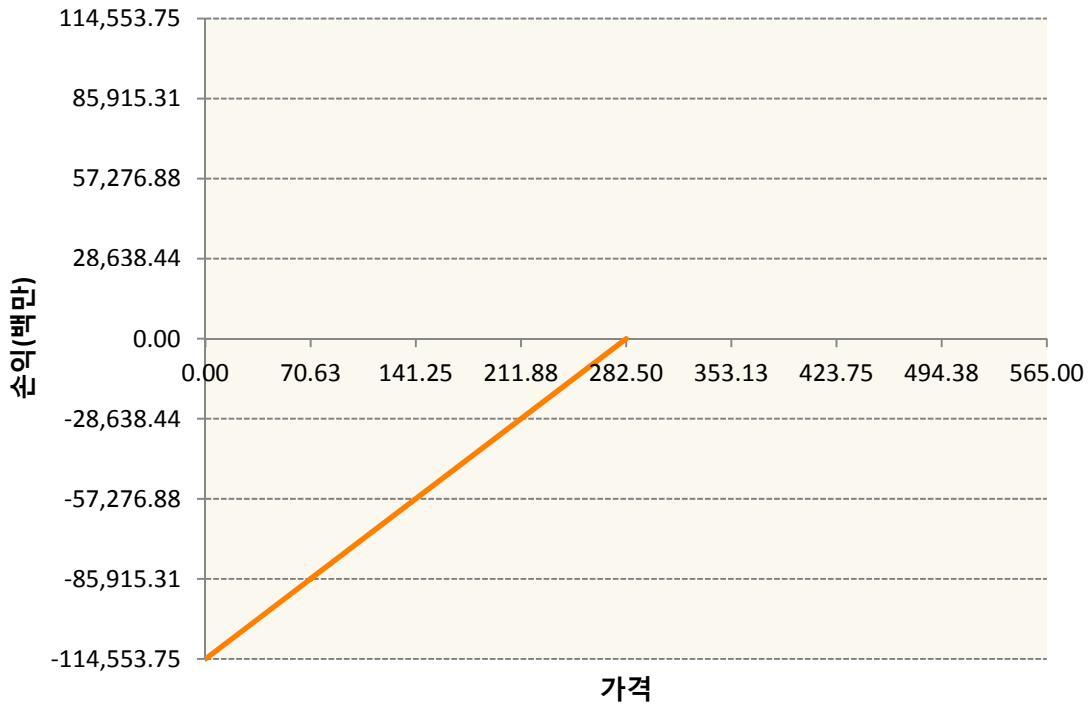


KR4201PC2858-2019-12 콜285

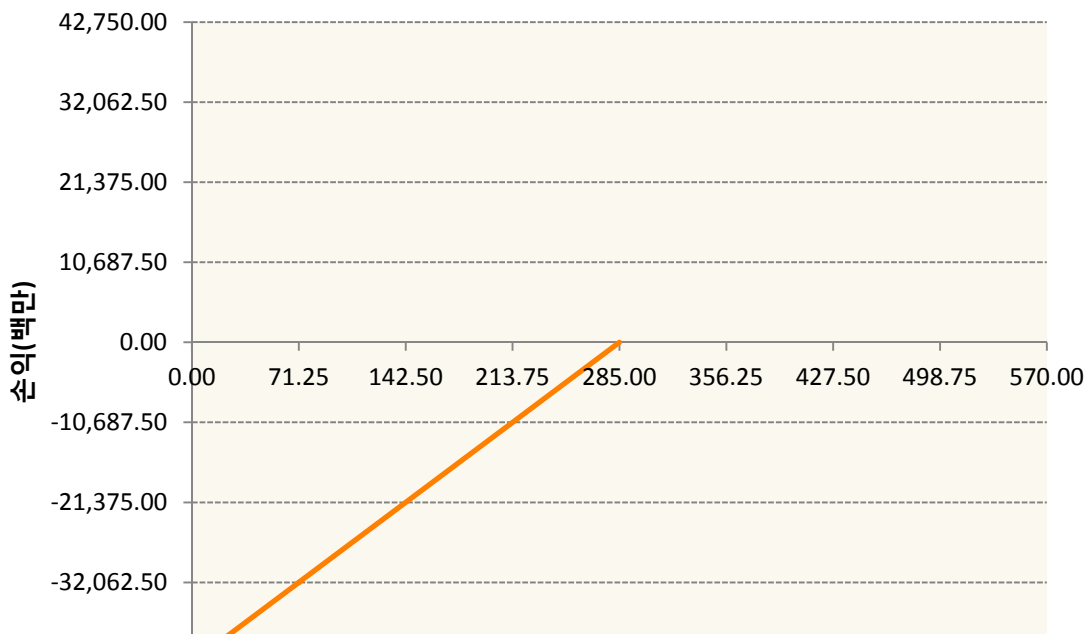




KR4301PC2824-2019-12 풋282.5



KR4301PC2857-2019-12 풋285



-42,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PC2825		2019-12 콜282.5						6,427
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,304	3,201	3,083	2,953	2,812	2,662	2,505	
-5.33%	2,875	2,703	2,524	2,339	2,149	1,956	1,759	
-2.67%	2,022	1,805	1,586	1,367	1,148	928	708	
0%	653	436	219	0	-220	-440	-661	
2.67%	-1,205	-1,376	-1,556	-1,743	-1,936	-2,134	-2,335	
5.33%	-3,423	-3,533	-3,658	-3,797	-3,947	-4,107	-4,274	
8.00%	-5,854	-5,912	-5,987	-6,077	-6,182	-6,299	-6,427	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						15,719
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	7,384	7,170	6,915	6,626	6,307	5,962	5,595	
-5.33%	6,542	6,156	5,744	5,310	4,859	4,394	3,917	
-2.67%	4,755	4,224	3,687	3,145	2,600	2,052	1,501	
0%	1,711	1,141	571	0	-571	-1,143	-1,715	
2.67%	-2,621	-3,107	-3,609	-4,123	-4,647	-5,179	-5,717	
5.33%	-7,985	-8,320	-8,692	-9,092	-9,518	-9,963	-10,425	
8.00%	-14,010	-14,200	-14,434	-14,707	-15,016	-15,354	-15,719	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						6,789
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-6,691	-6,696	-6,704	-6,717	-6,735	-6,759	-6,789	
-5.33%	-3,658	-3,700	-3,750	-3,809	-3,874	-3,946	-4,023	
-2.67%	-1,094	-1,209	-1,325	-1,443	-1,562	-1,683	-1,803	
0%	328	222	112	0	-115	-231	-349	
2.67%	730	695	650	596	535	467	393	
5.33%	781	777	768	754	735	710	679	
8.00%	784	784	783	781	778	771	762	
KR4301PC2857		2019-12 풋285						2,732
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,710	-2,711	-2,712	-2,715	-2,719	-2,724	-2,732	
-5.33%	-1,573	-1,582	-1,594	-1,609	-1,627	-1,647	-1,670	
-2.67%	-542	-576	-613	-652	-691	-732	-773	
0%	138	92	46	0	-46	-93	-139	
2.67%	384	363	338	310	280	248	214	

5.33%	426	422	416	407	396	382	366
8.00%	429	429	428	427	424	420	415

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

(단위:백만원)

31,494

공시일	2019-11-19
기준일	2019-11-18

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

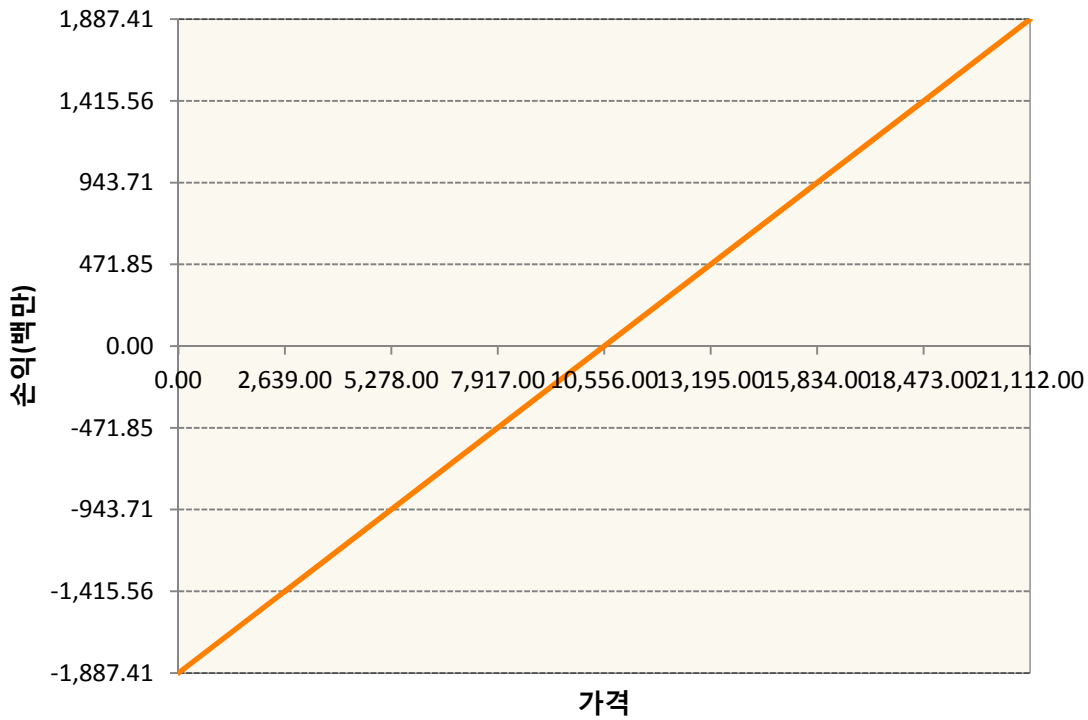
1. 계약금액

(단위:백만원)

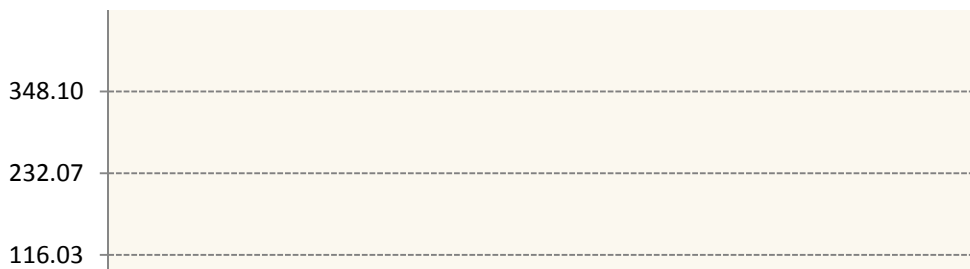
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,887	0	1,887	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,989	-4,989	장내
누계	통화	선도	669	2,764	-2,094	장외

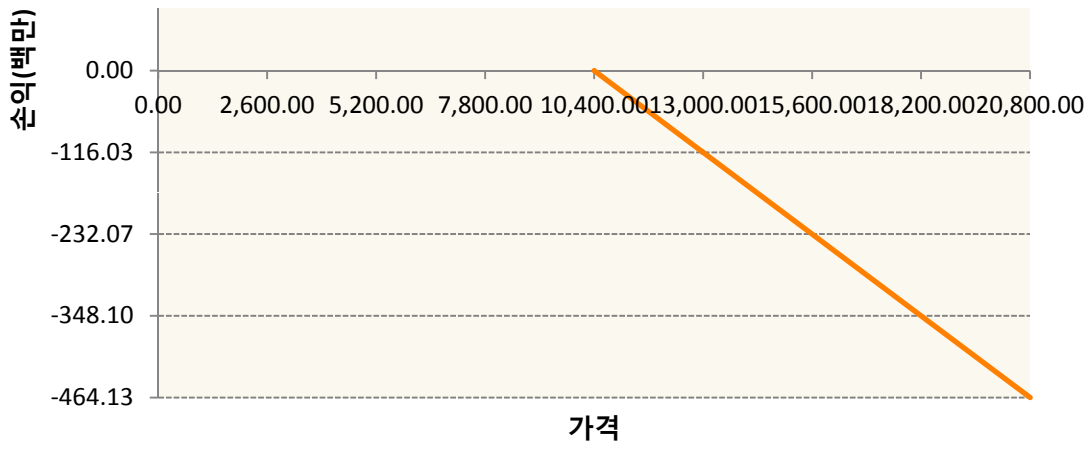
2. 만기시점의 손익구조

HCX9-HSCEI Futures Nov19

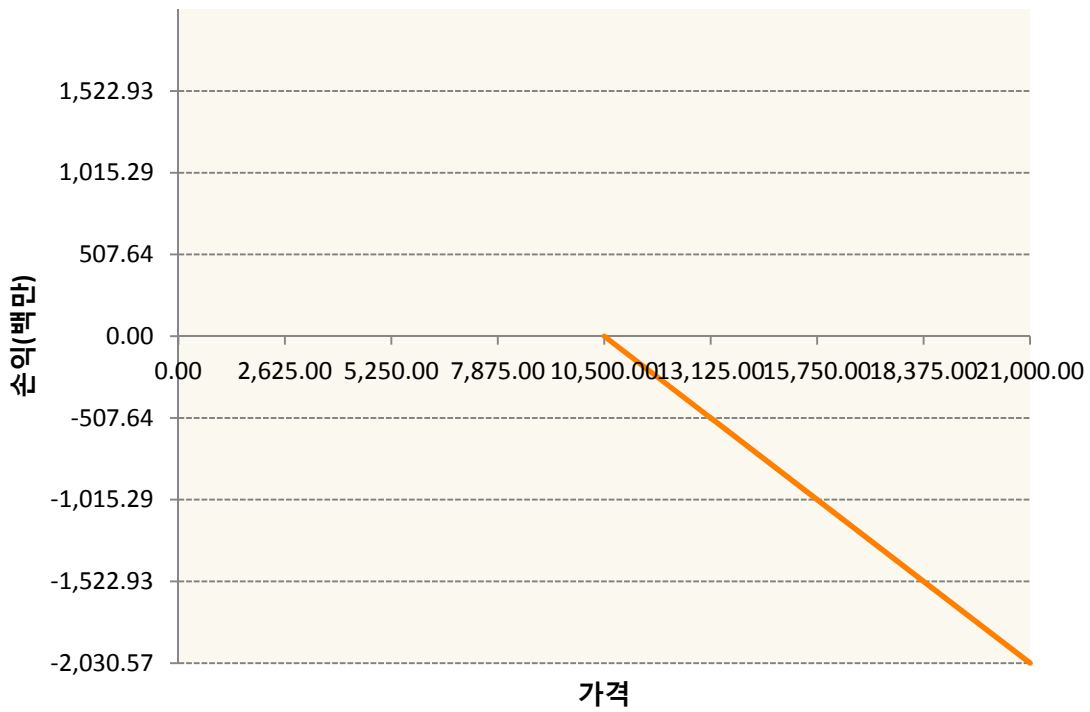


OHHIX9-C104-HSCEI

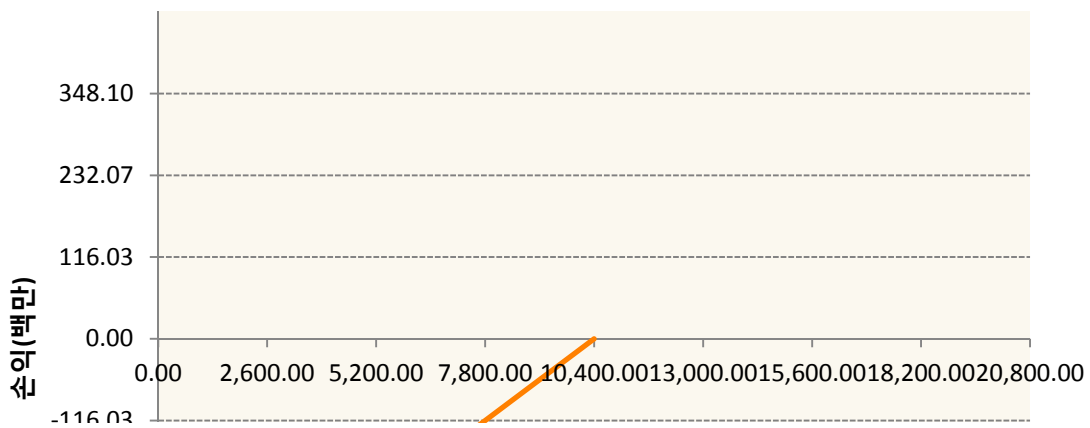


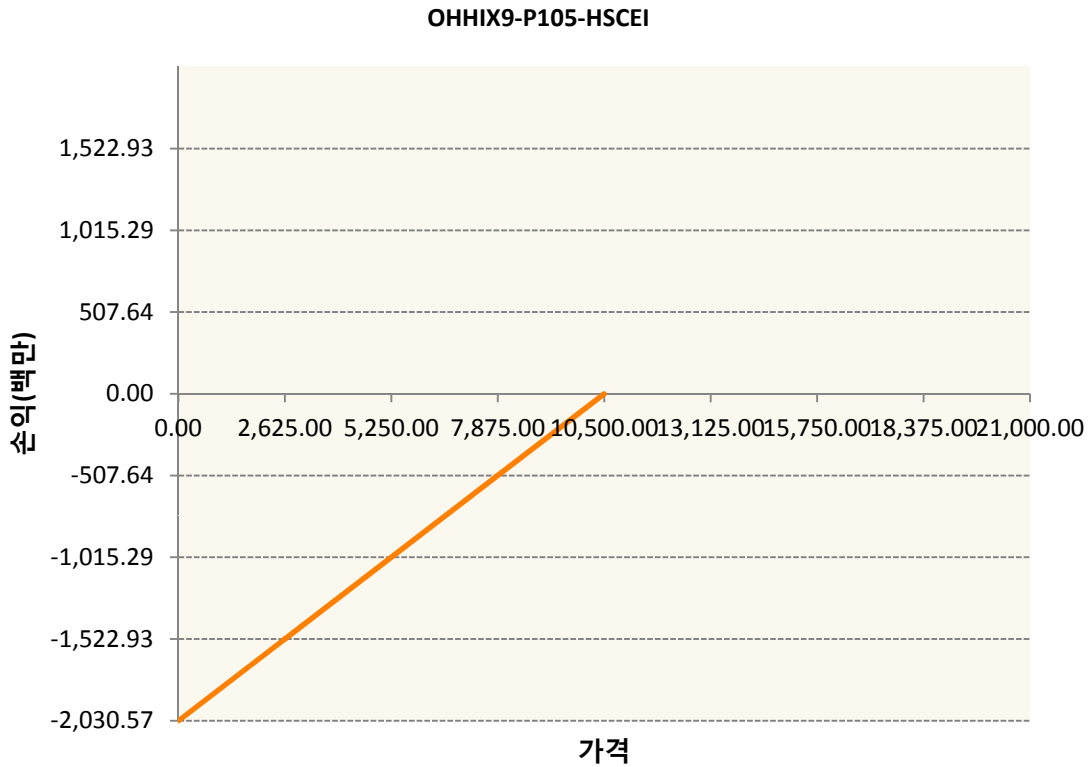


OHHIX9-C105-HSCEI



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
HCX9 HSCEI Futures Nov19	151
OHHIX9-C1C HSCEI	37
OHHIX9-C1C HSCEI	162
OHHIX9-P10 HSCEI	37
OHHIX9-P10 HSCEI	162

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	575

공시일	2019-11-19
기준일	2019-11-18

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

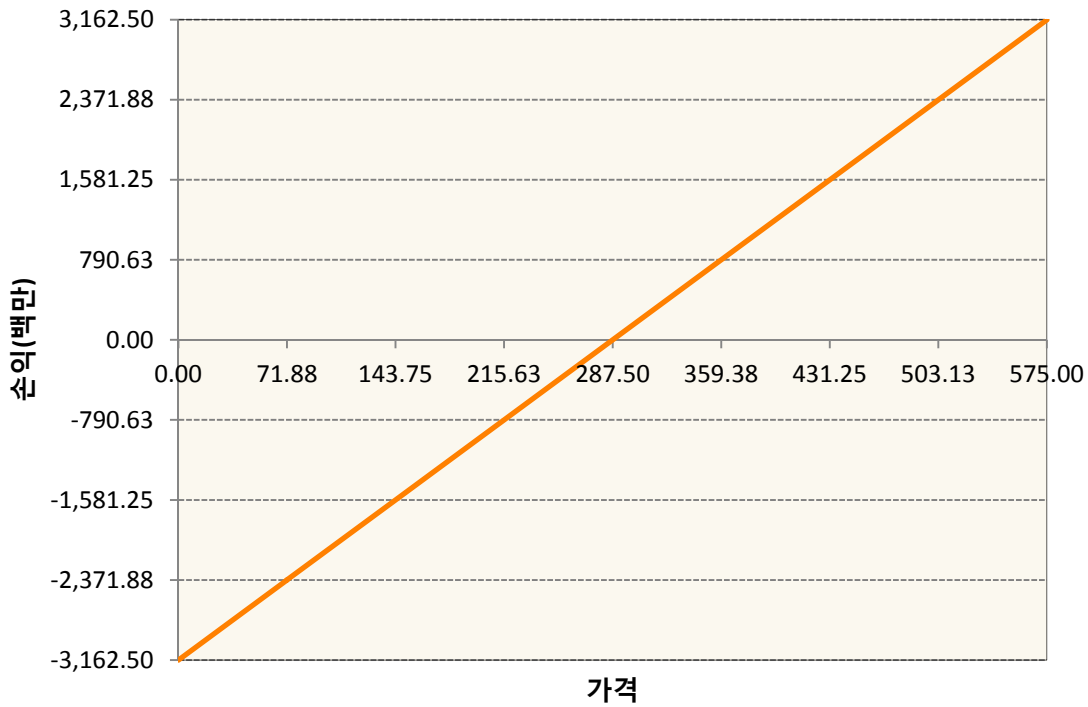
1. 계약금액

(단위:백만원)

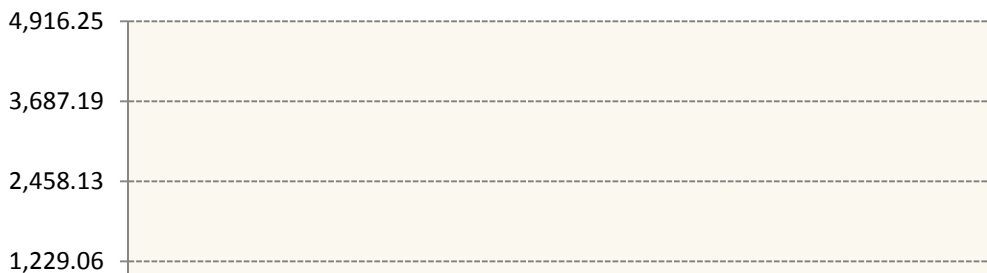
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,163	0	3,163	장내
누계	유가증권	스왑	9,625	0	9,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,728	-9,728	장내

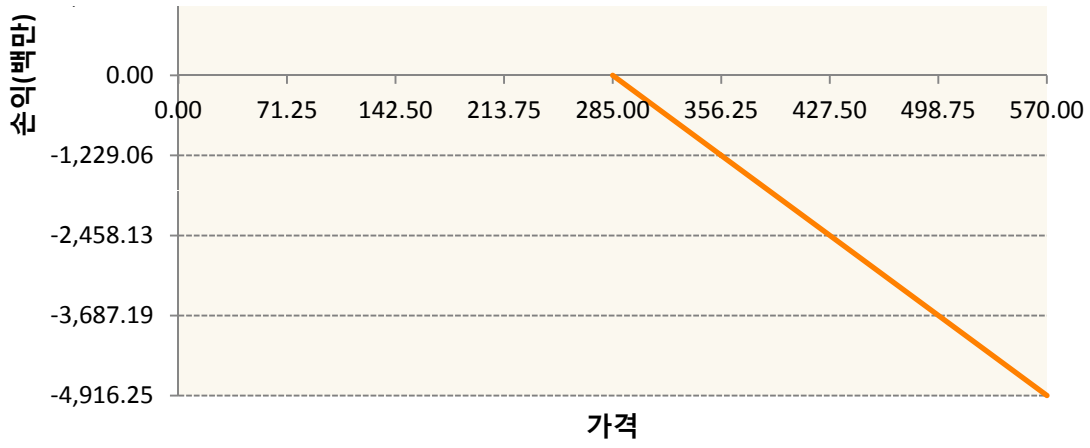
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

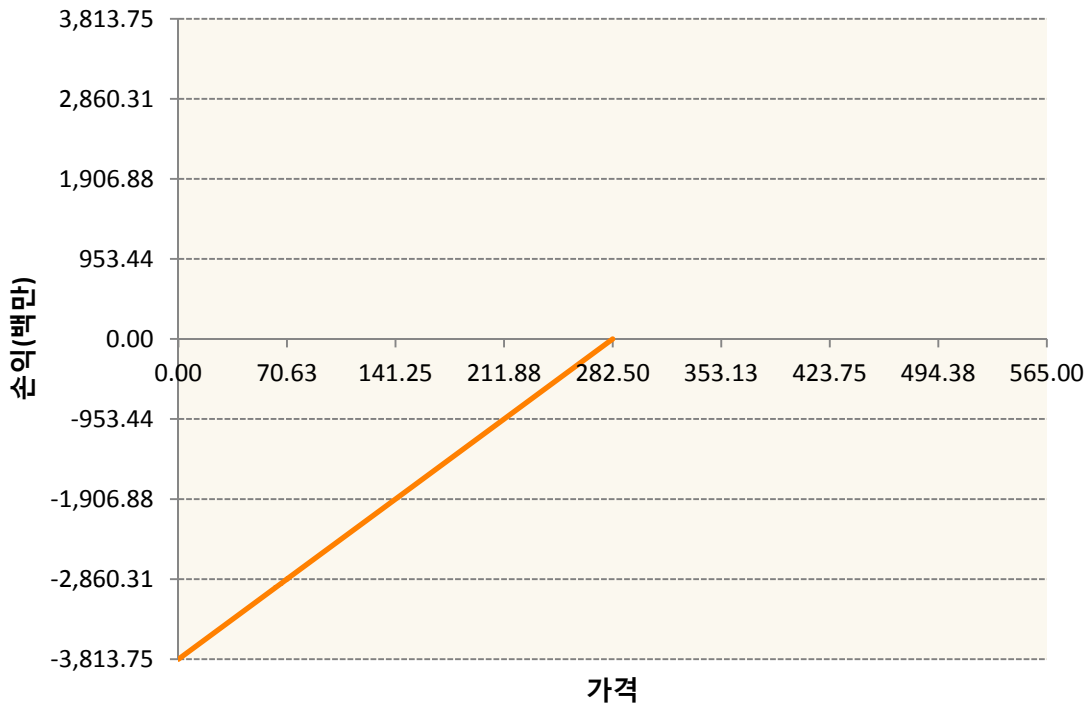


KR4201PC2858-2019-12 콜285

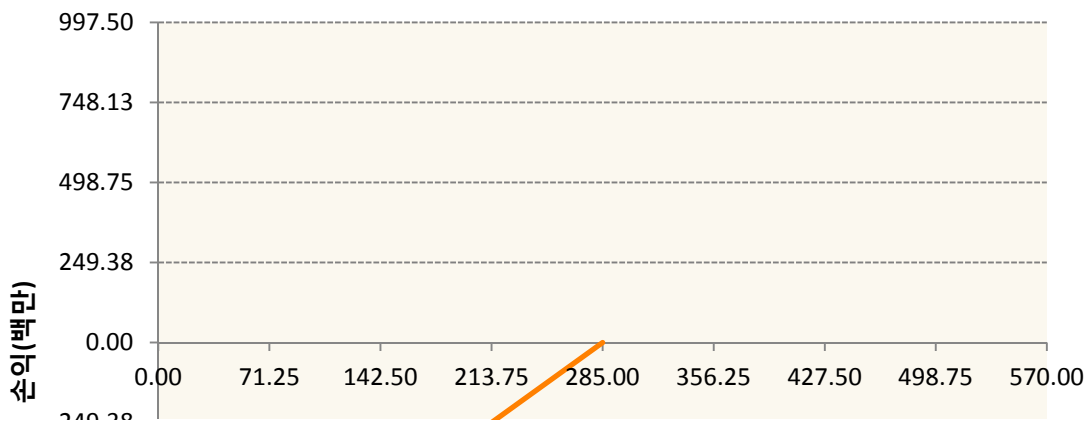




KR4301PC2824-2019-12 풋282.5



KR4301PC2857-2019-12 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						825
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-825	-825	-825	-825	-825	-825	-825	
-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%	825	825	825	825	825	825	825	
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%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168	
-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%	168	168	168	168	168	168	168	
8.00%	253	253	253	253	253	253	253	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						315
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	148	144	139	133	126	119	112	
-5.33%	131	123	115	106	97	88	78	
-2.67%	95	85	74	63	52	41	30	
0%	34	23	11	0	-11	-23	-34	
2.67%	-53	-62	-72	-83	-93	-104	-115	
5.33%	-160	-167	-174	-182	-191	-200	-209	
8.00%	-281	-284	-289	-295	-301	-308	-315	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						226
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-223	-223	-223	-224	-224	-225	-226
-5.33%	-122	-123	-125	-127	-129	-131	-134
-2.67%	-36	-40	-44	-48	-52	-56	-60
0%	11	7	4	0	-4	-8	-12
2.67%	24	23	22	20	18	16	13
5.33%	26	26	26	25	24	24	23
8.00%	26	26	26	26	26	26	25
KR4301PC2857 2019-12 풋285							64
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-63	-63	-63	-63	-63	-64	-64
-5.33%	-37	-37	-37	-38	-38	-38	-39
-2.67%	-13	-13	-14	-15	-16	-17	-18
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	9	8	8	7	7	6	5
5.33%	10	10	10	10	9	9	9
8.00%	10	10	10	10	10	10	10

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

(단위:백만원)

1,629

공시일	2019-11-19
기준일	2019-11-18

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

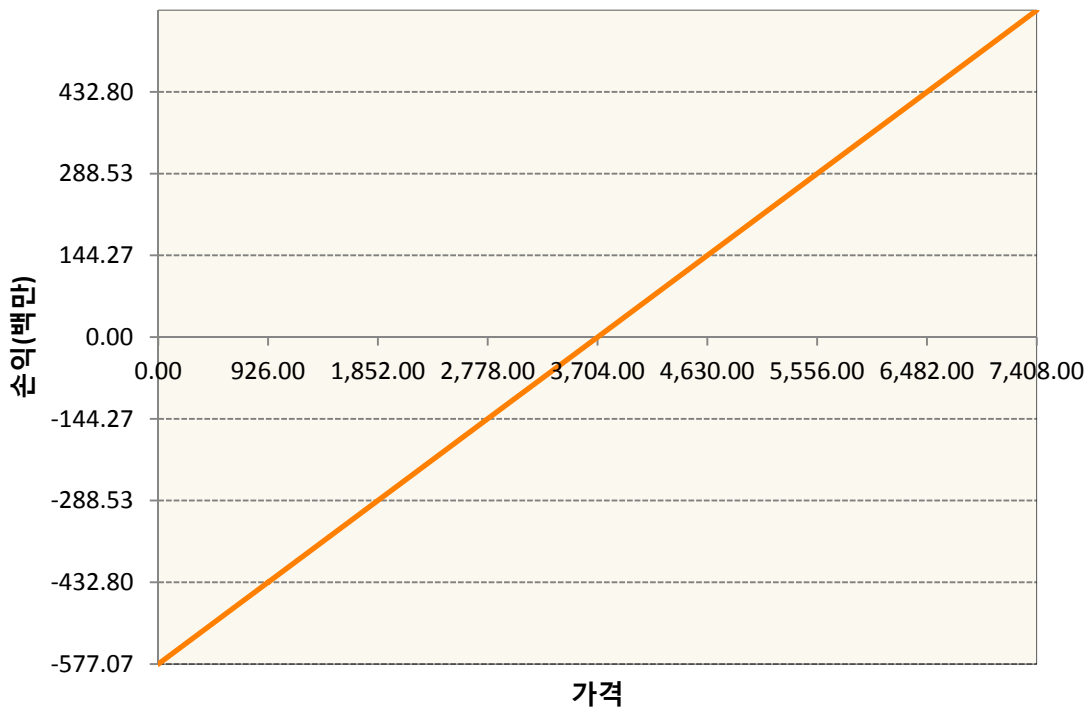
1. 계약금액

(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	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	577	0	577	
누계	유가증권	스왑	20,248	0	20,248	장외
누계	통화	선도	2,031	6,057	-4,026	장외

2. 만기시점의 손익구조

VGZ9-EURO STOXX 50 Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	24
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E	485
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E	162
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19	46

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

(단위:백만원)

348

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

(단위:백만원)

929

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

(단위:백만원)

81

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

(단위:백만원)

126

공시일	2019-11-19
기준일	2019-11-18

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

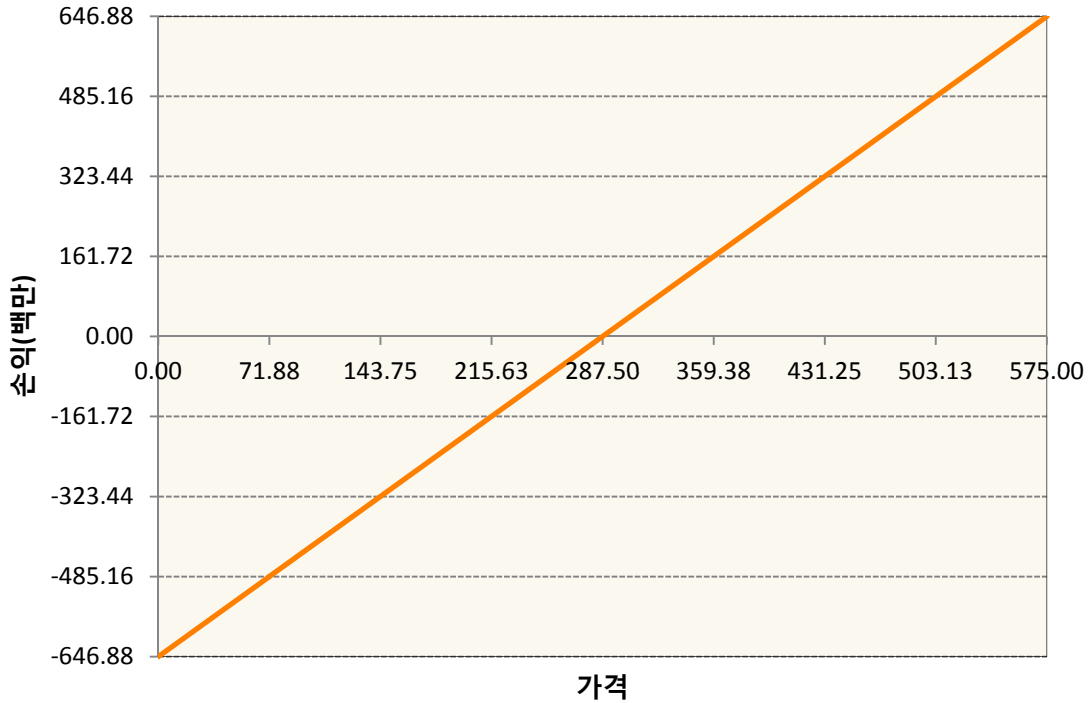
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	647	0	647	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						52
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52	
-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%	52	52	52	52	52	52	52	

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-11-19
기준일	2019-11-18

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

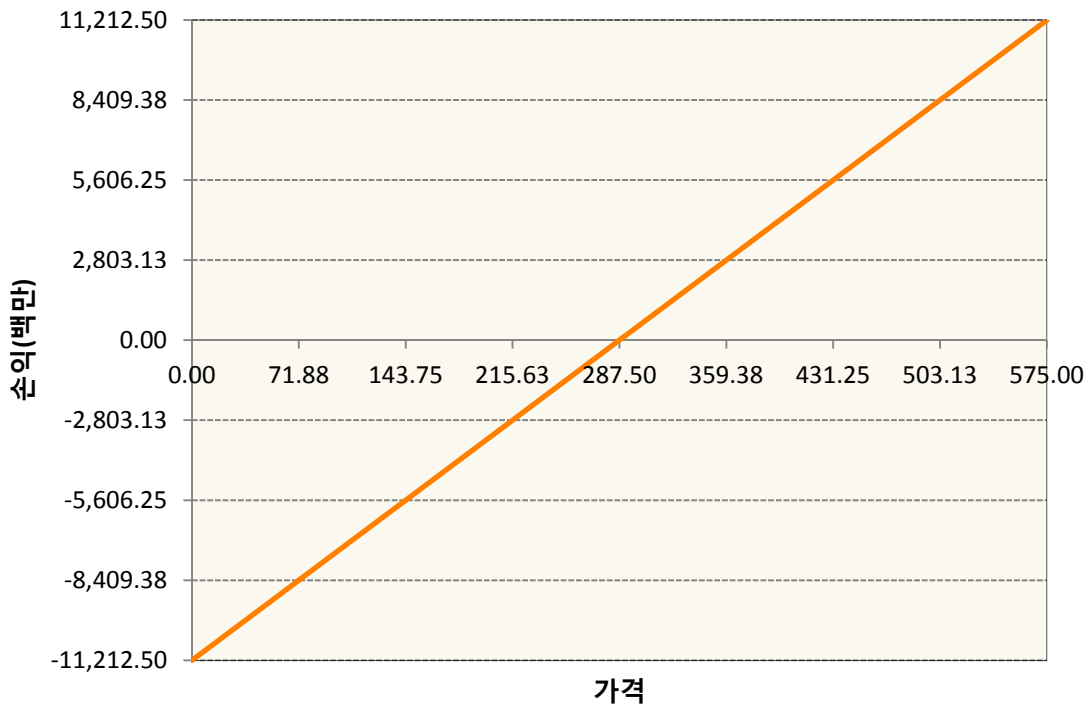
1. 계약금액

(단위:백만원)

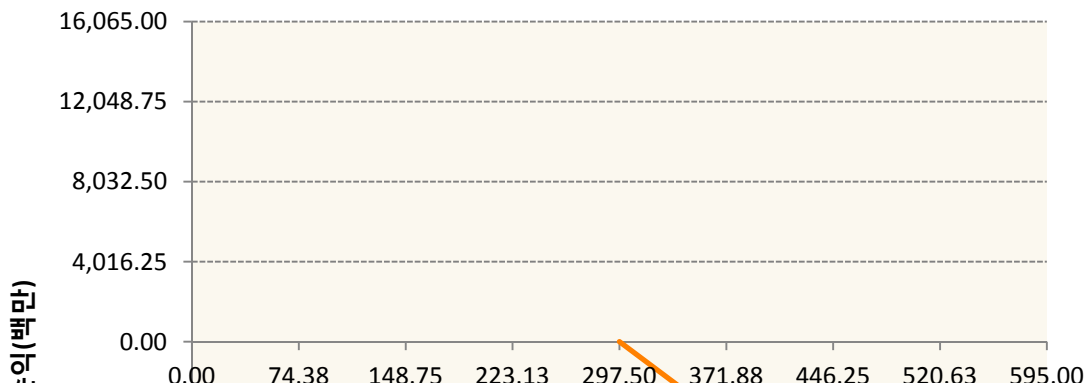
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,213	0	11,213	장내
누계	유가증권	옵션	1,491	21,390	-19,899	장내

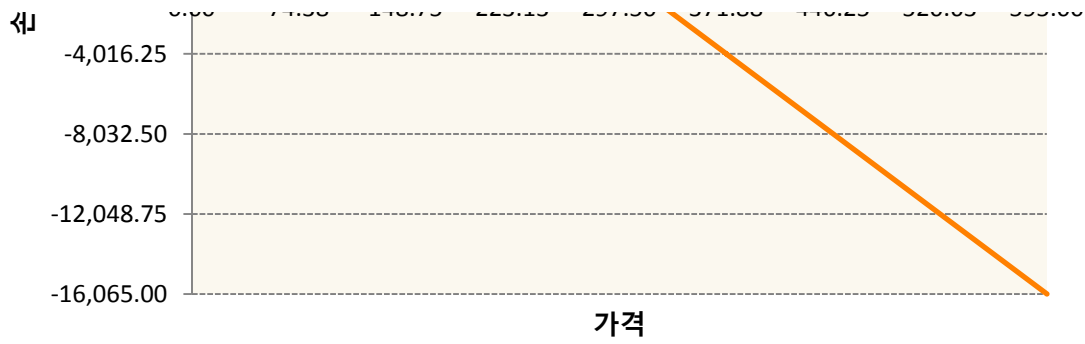
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

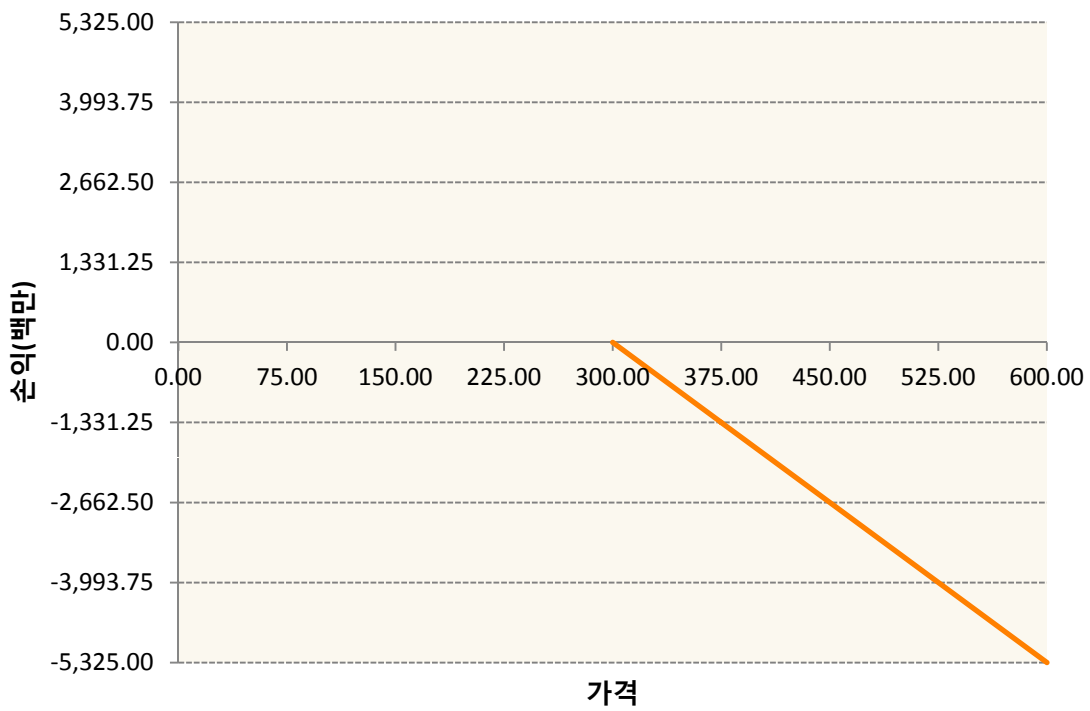


KR4201PC2973-2019-12 콜297.5

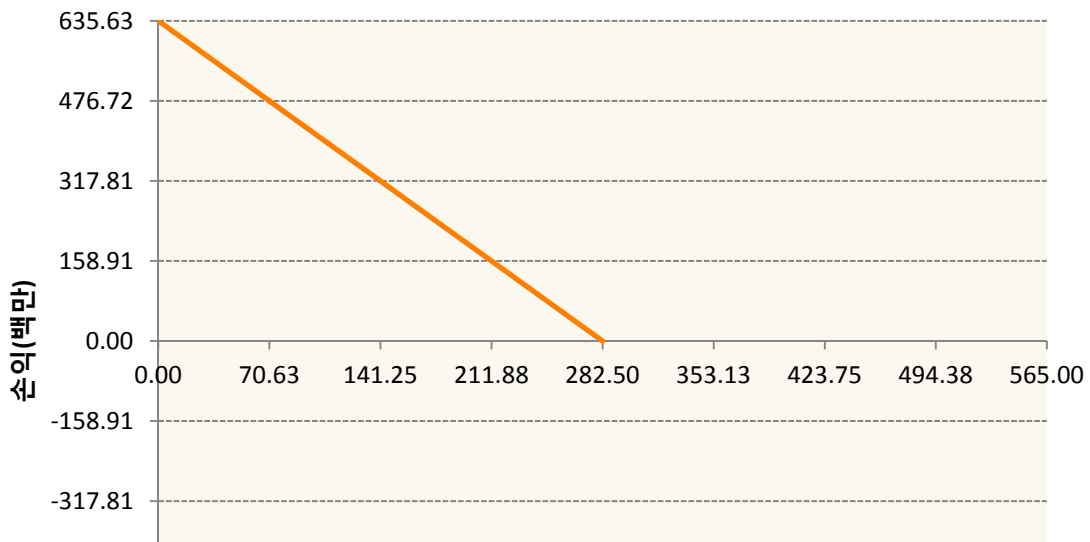


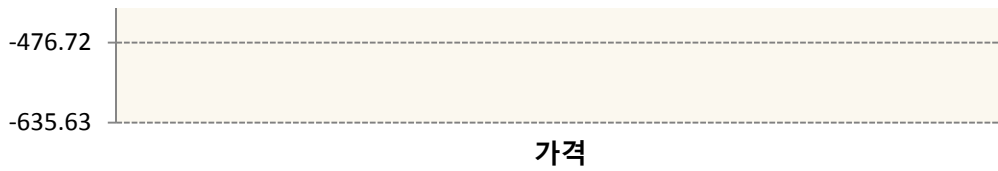


KR4201PC3005-2019-12 콜300

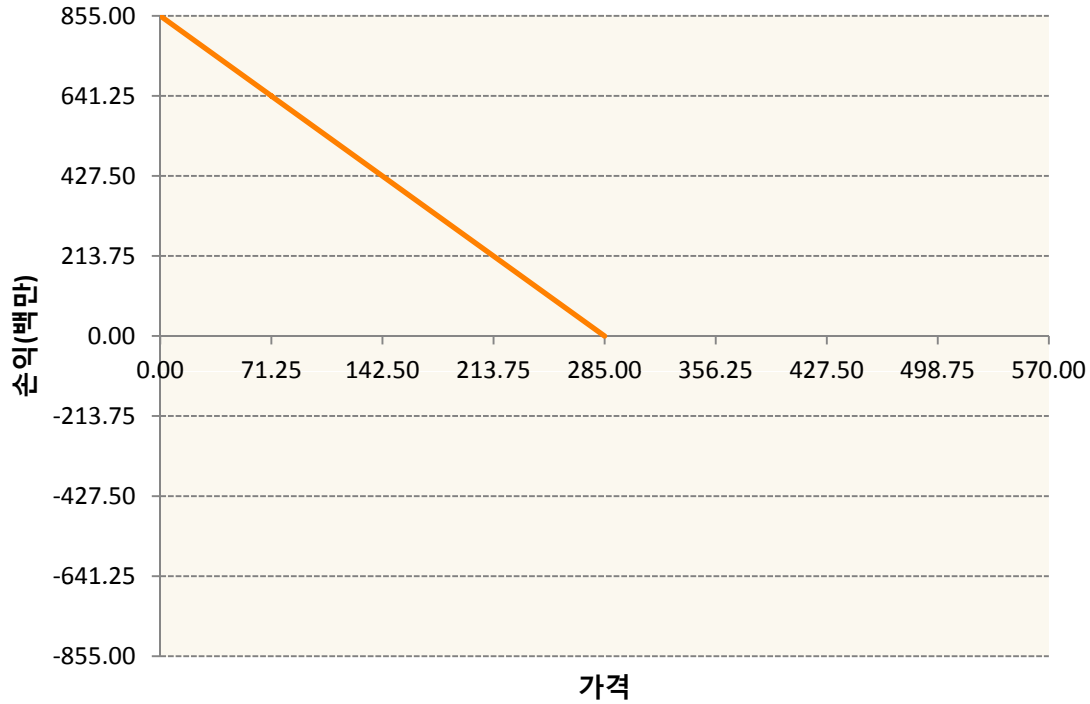


KR4301PC2824-2019-12 풋282.5





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%	-597	-597	-597	-597	-597	-597	-597	
-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%	597	597	597	597	597	597	597	
8.00%	896	896	896	896	896	896	896	
KR4201PC2973		2019-12 콜297.5						757
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	212	208	203	196	186	175	162	
-5.33%	201	192	180	165	149	130	110	
-2.67%	169	150	128	105	80	53	26	

0%	93	63	32	0	-33	-66	-99
2.67%	-50	-86	-123	-160	-197	-234	-271
5.33%	-271	-307	-343	-380	-417	-454	-491
8.00%	-565	-594	-625	-657	-689	-723	-757
KR4201PC3005 2019-12 콜300							232
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	58	57	56	54	51	48	44
-5.33%	56	53	50	46	41	36	30
-2.67%	48	42	36	29	22	14	6
0%	28	19	10	0	-10	-20	-31
2.67%	-11	-23	-35	-47	-58	-70	-82
5.33%	-75	-88	-100	-112	-125	-137	-150
8.00%	-165	-175	-186	-197	-209	-220	-232
KR4301PC2824 2019-12 풋282.5							38
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	37	37	37	37	37	38	38
-5.33%	20	21	21	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%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
KR4301PC2857 2019-12 풋285							55
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	54	54	54	54	54	54	55
-5.33%	31	32	32	32	33	33	33
-2.67%	11	12	12	13	14	15	15
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-8	-7	-7	-6	-6	-5	-4
5.33%	-9	-8	-8	-8	-8	-8	-7
8.00%	-9	-9	-9	-9	-8	-8	-8

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

(단위:백만원)

1,588

공시일	2019-11-19
기준일	2019-11-18

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	202,580	0	202,580	

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	2019-11-19
기준일	2019-11-18

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	211,424	0	211,424	

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	2019-11-19
기준일	2019-11-18

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	536,591	0	536,591	
누계	통화	선도	0	529,964	-529,964	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		1,863
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E		1,956
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		652
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		689
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,677
FX21019V02 KRW/USD 21-11-19E		5,068
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,751
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,397
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,795
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,500
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,832
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		932
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		932
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,863
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,863
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		932
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		932
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		932
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		932
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		466
FX21019X00 KRW/USD 06-12-19E		652
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		466
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		466
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		466
FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E		1,528
FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E		932

FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E

466
932
1,528

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

(단위:백만원)

13,300

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

(단위:백만원)

190

공시일	2019-11-19
기준일	2019-11-18

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

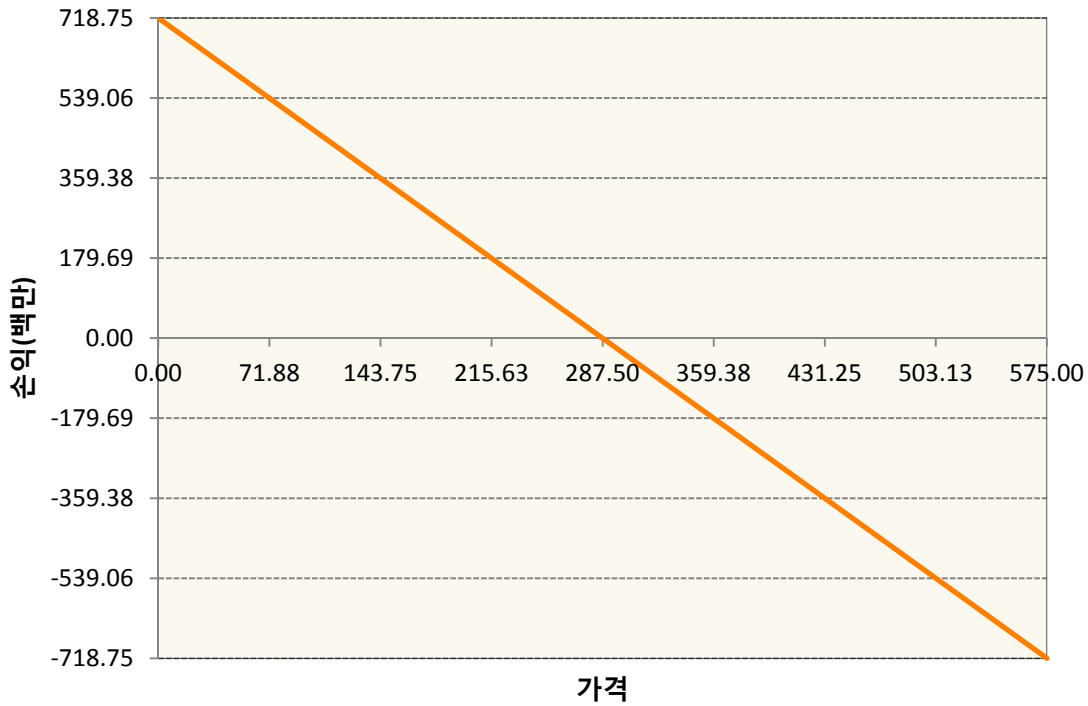
1. 계약금액

(단위:백만원)

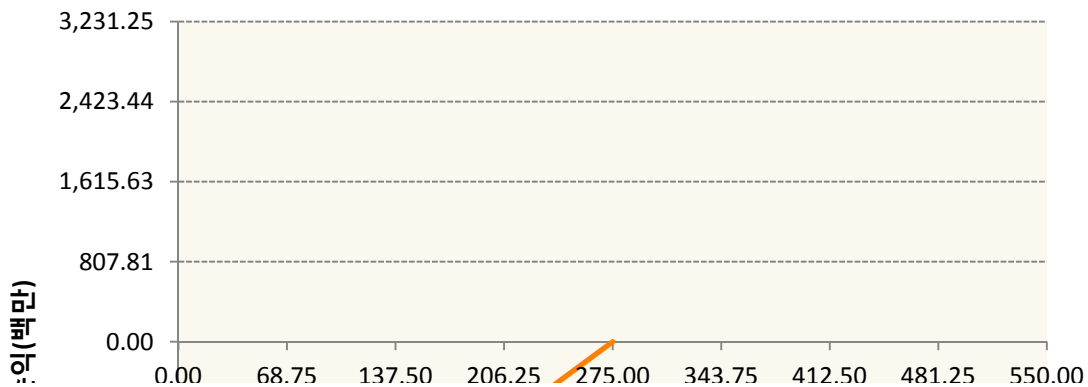
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	719	-719	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,856	-3,856	장내

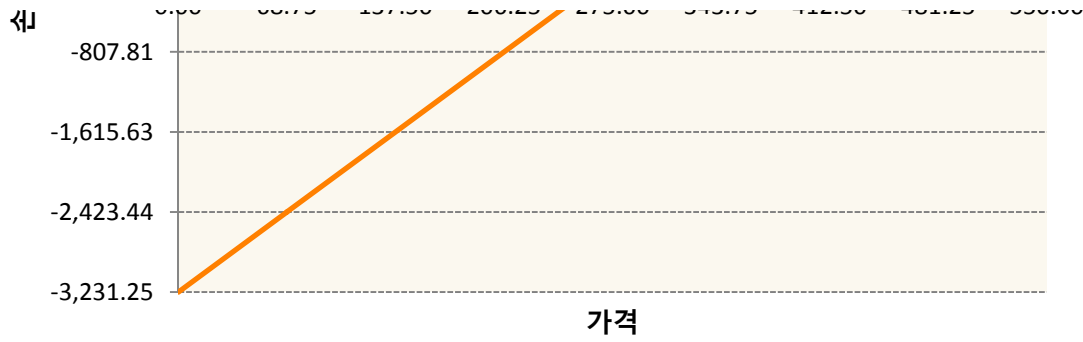
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

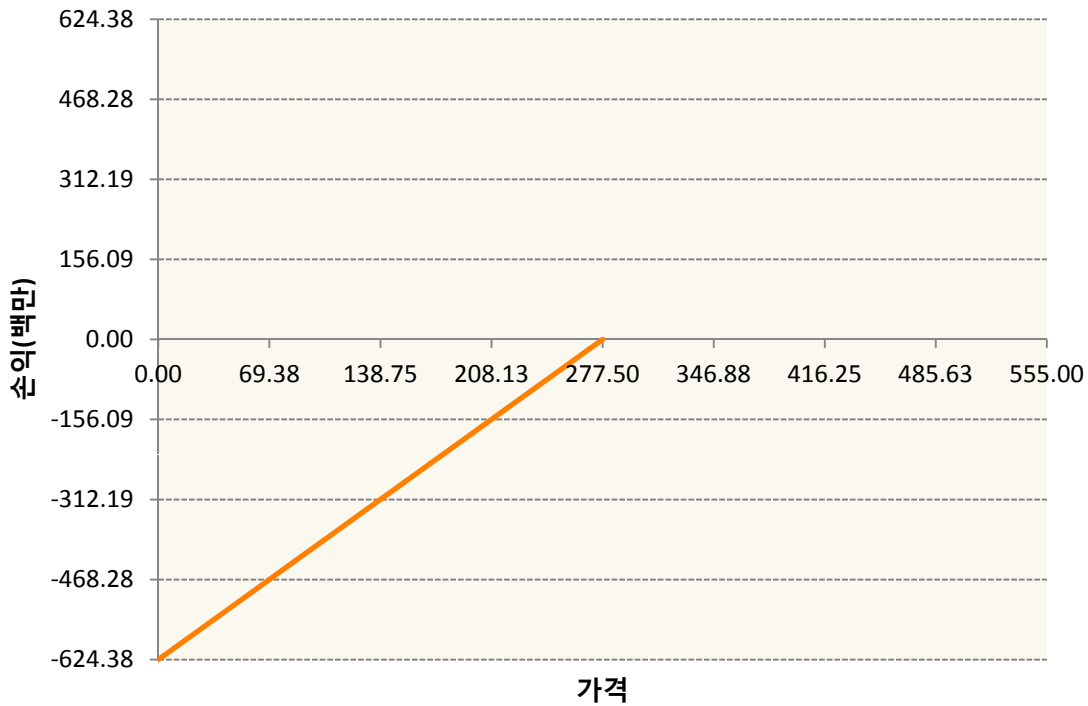


KR4301PC2758-2019-12 풋275





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%	-125	-126	-127	-129	-131	-133	-135
-5.33%	-50	-53	-56	-59	-63	-66	-70
-2.67%	-8	-11	-14	-17	-20	-24	-27
0%	4	3	1	0	-2	-4	-6
2.67%	5	5	5	4	4	3	2
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	5	5	5	5	5	5	5
KR4301PC2774 2019-12 풋277.5							30
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-29	-29	-29	-29	-29	-30	-30
-5.33%	-13	-14	-14	-15	-15	-16	-16
-2.67%	-3	-3	-4	-5	-5	-6	-7
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	2	2	2	1	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)

161

공시일	2019-11-19
기준일	2019-11-18

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	15,190	0	15,190	
누계	통화	선도	349	15,383	-15,034	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019V01 KRW/USD 10-12-19E		369
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		317
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		317
FX21019X01 KRW/USD 13-01-20E		228
FX21019X02 USD/KRW 25-11-19E		28

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

(단위:백만원)

395

공시일	2019-11-19
기준일	2019-11-18

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	684	0	684	장외
누계	통화	선도	200	406	-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	2019-11-19
기준일	2019-11-18

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

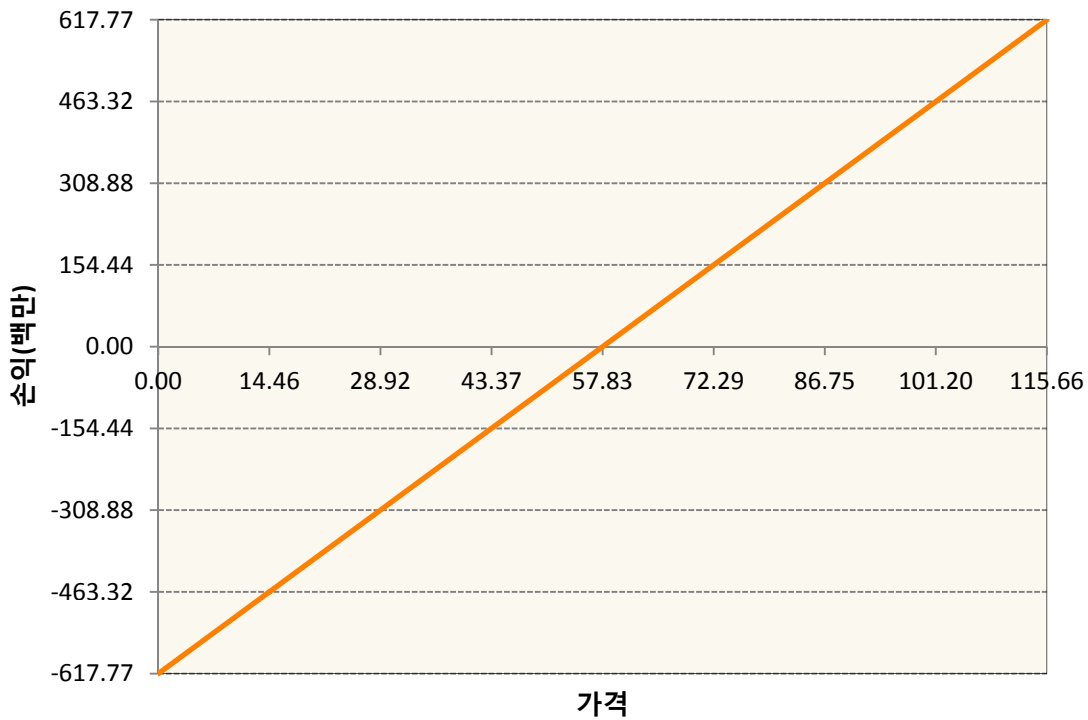
1. 계약금액

(단위:백만원)

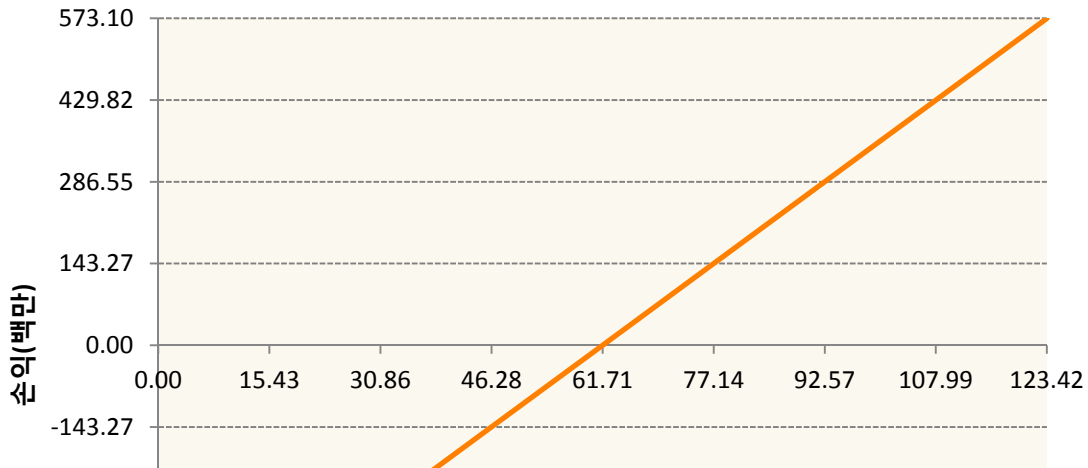
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,523	291	2,232	

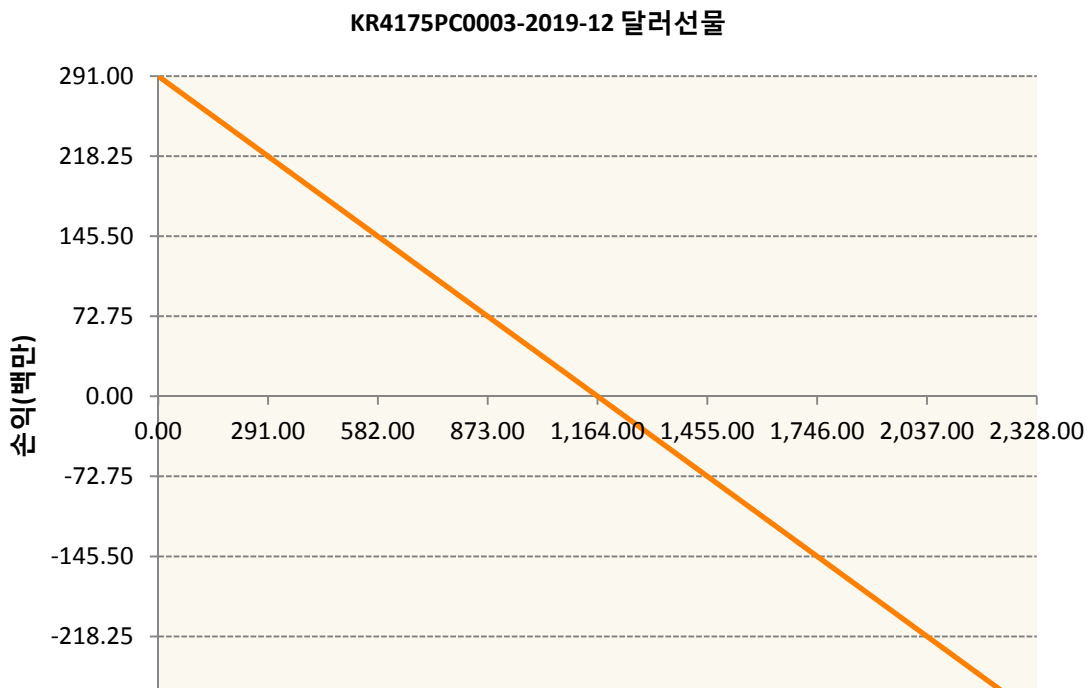
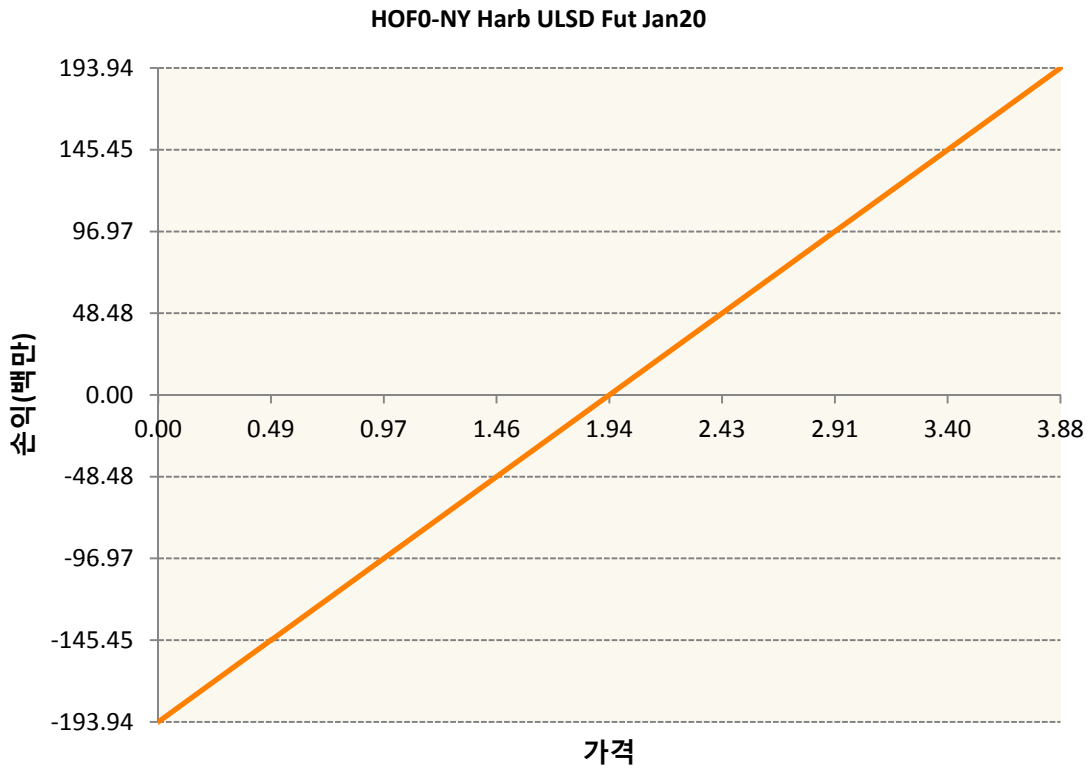
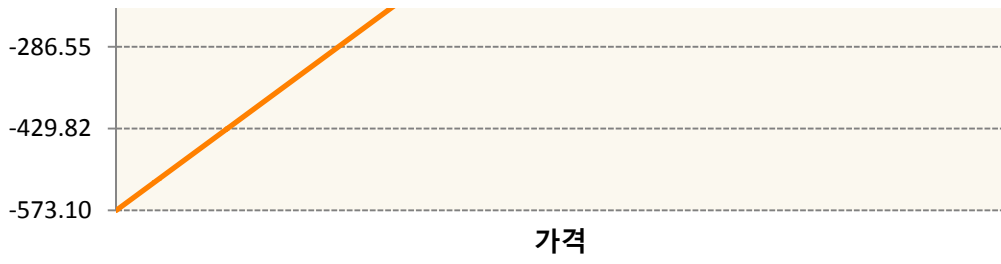
2. 만기시점의 손익구조

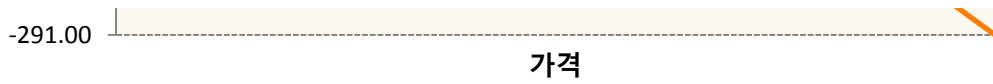
CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20



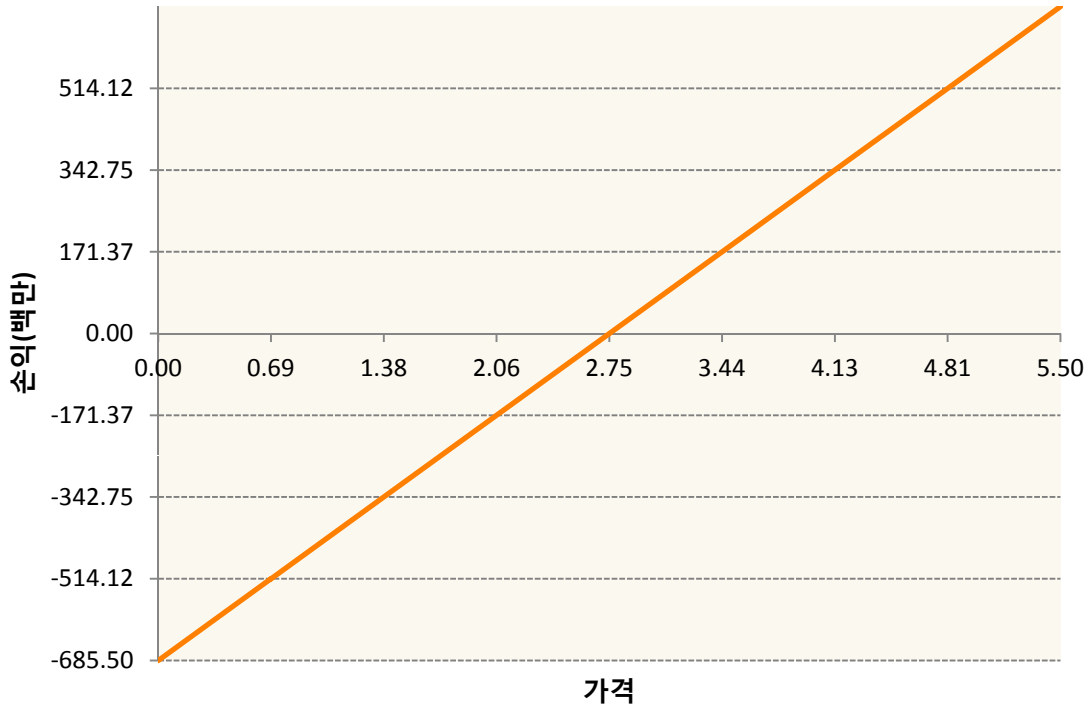
COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20



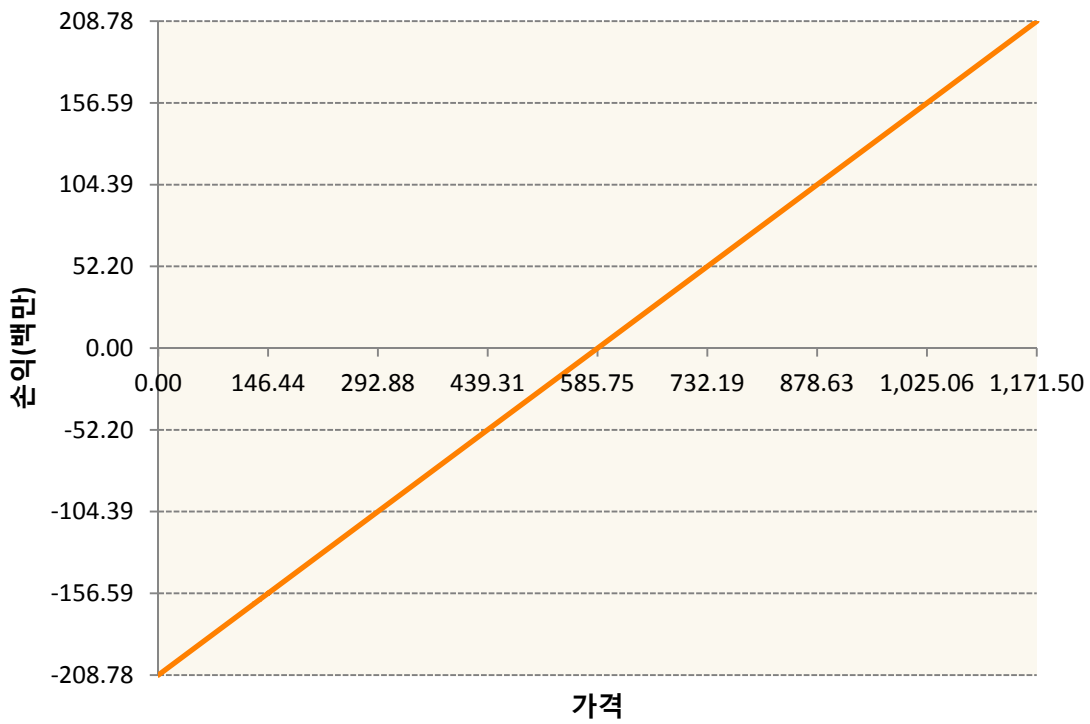




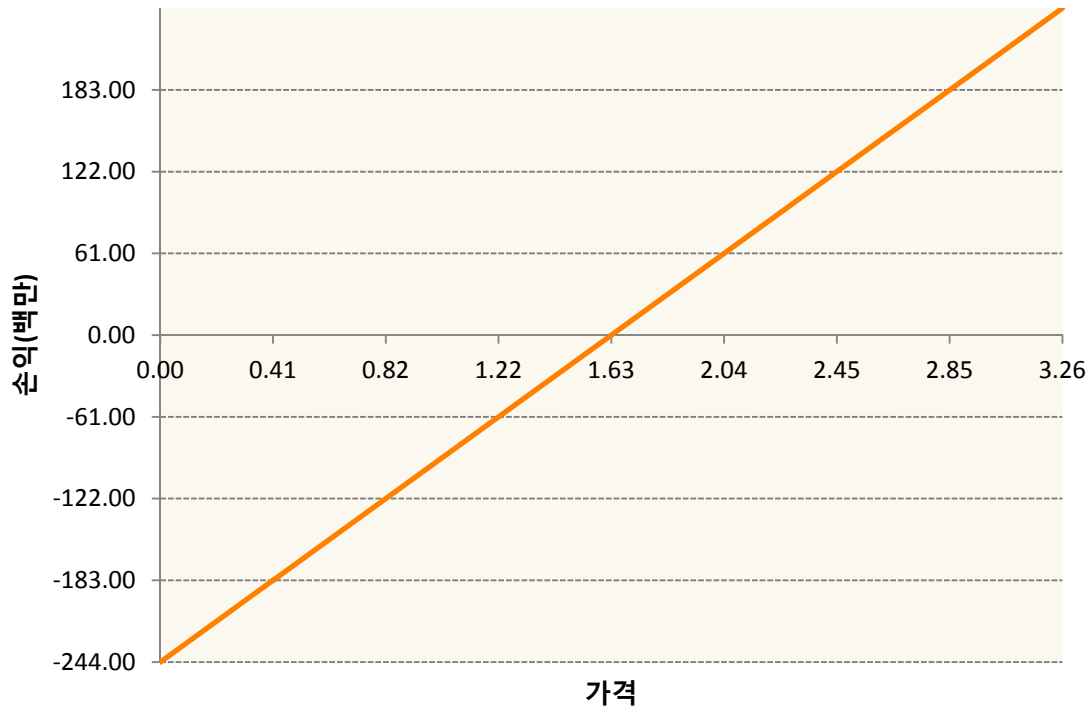
NGF20-NATURAL GAS FUTR Jan20



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	46
HOF0	NY Harb ULSD Fut Jan20	16
KR4175PC00	2019-12 달러선물	23
NGF20	NATURAL GAS FUTR Jan20	55
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	17
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	20

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

(단위:백만원)

418

공시일	2019-11-19
기준일	2019-11-18

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

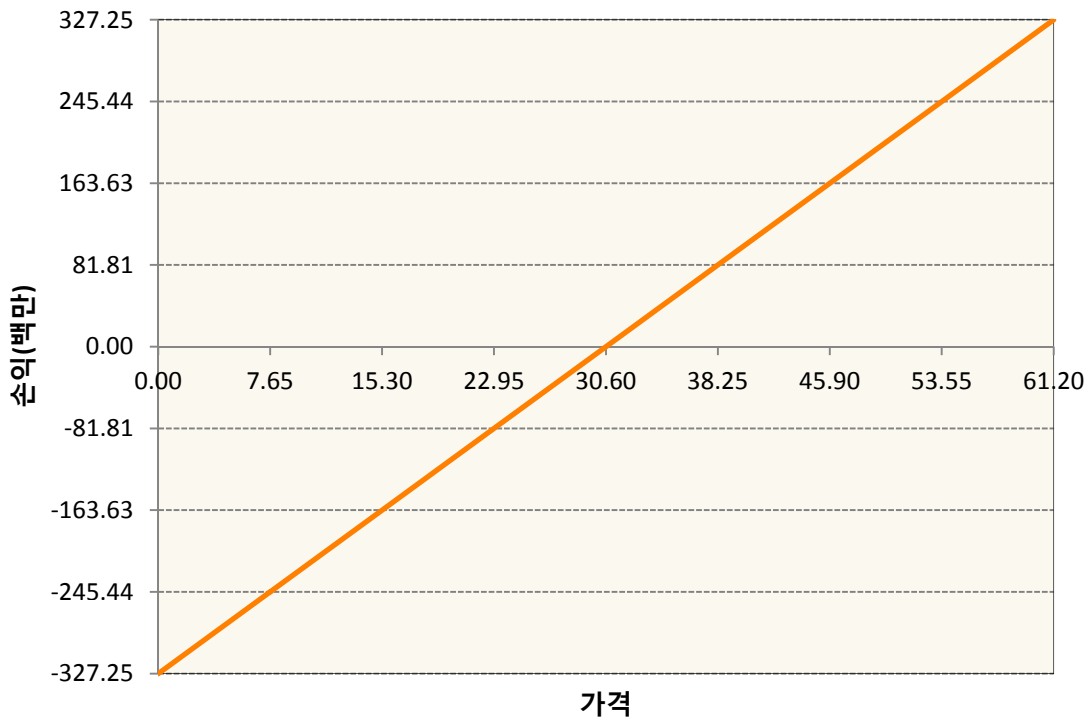
1. 계약금액

(단위:백만원)

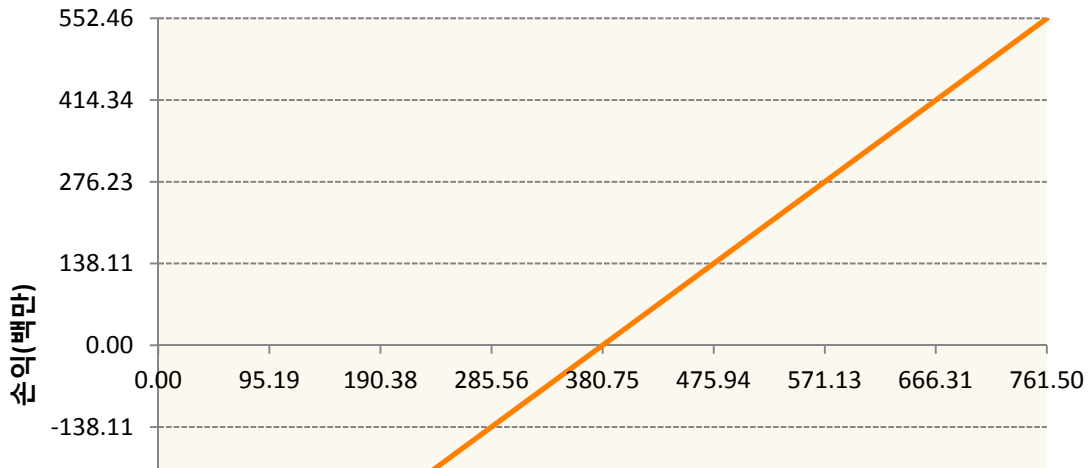
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,809	93	2,716	

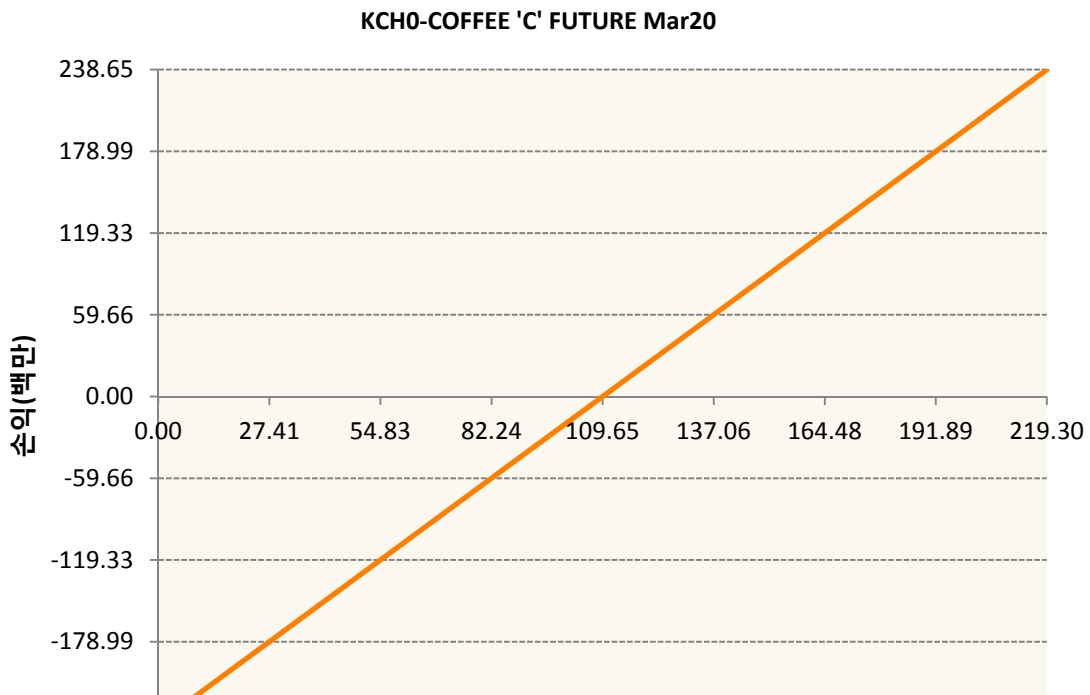
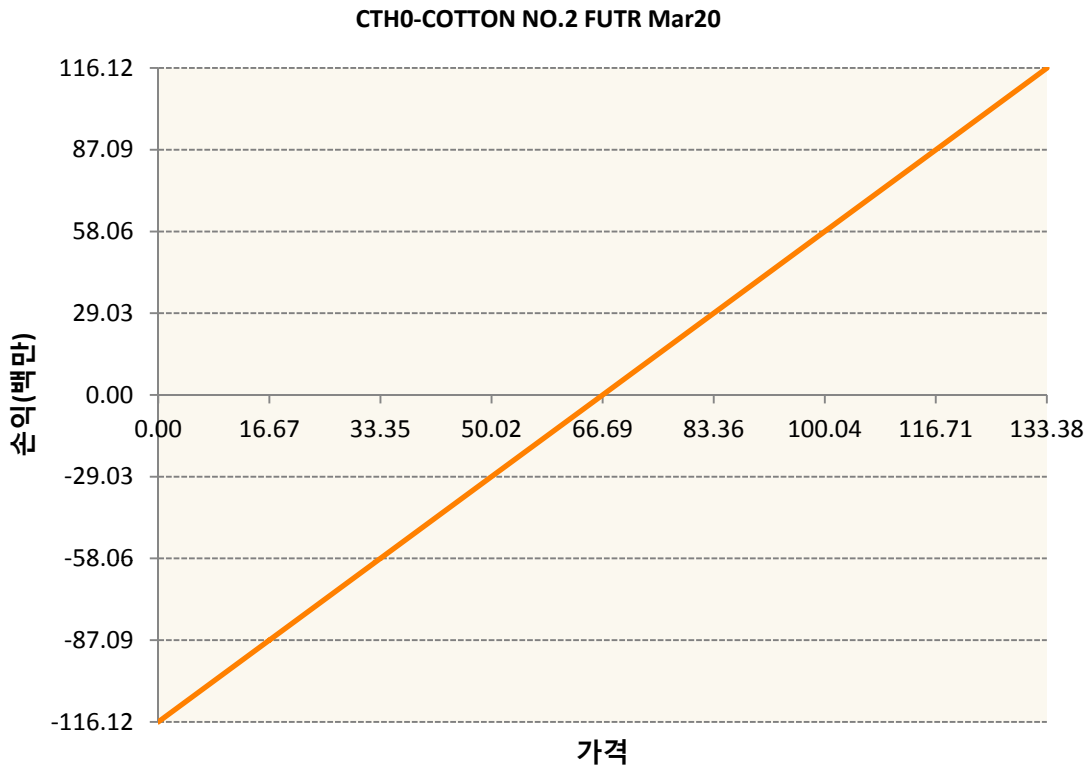
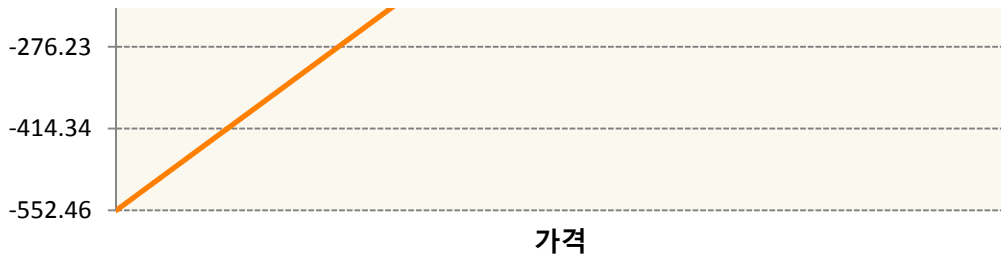
2. 만기시점의 손익구조

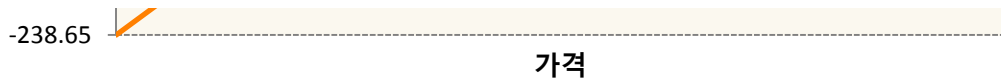
BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20



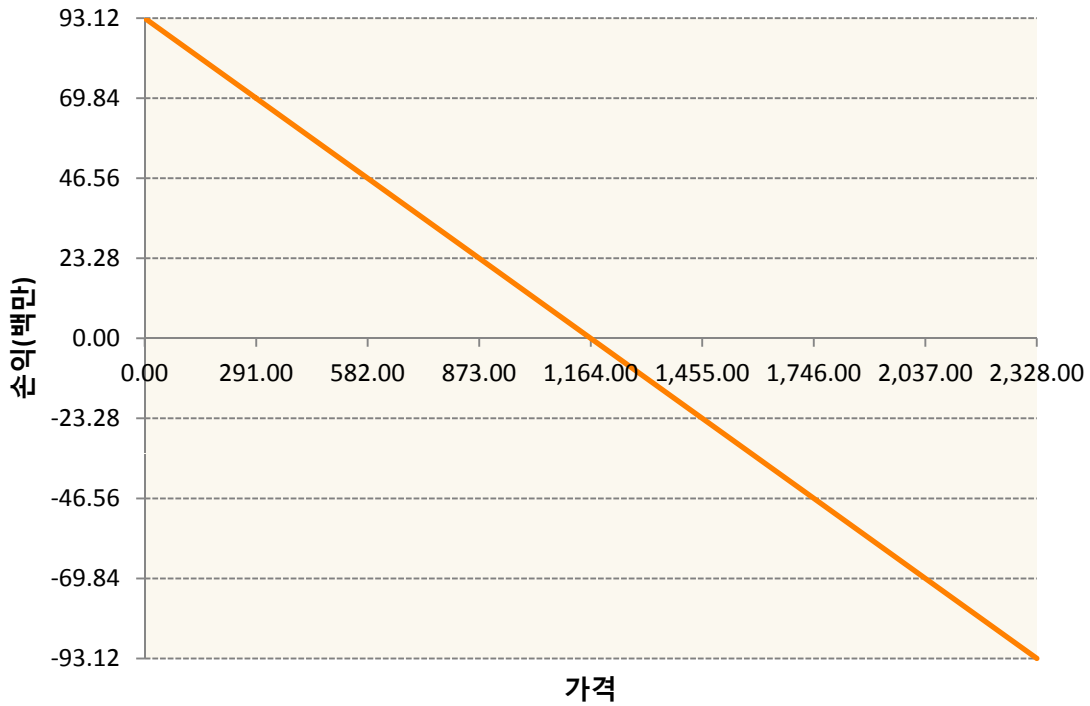
CH0-CORN FUTURE Mar20



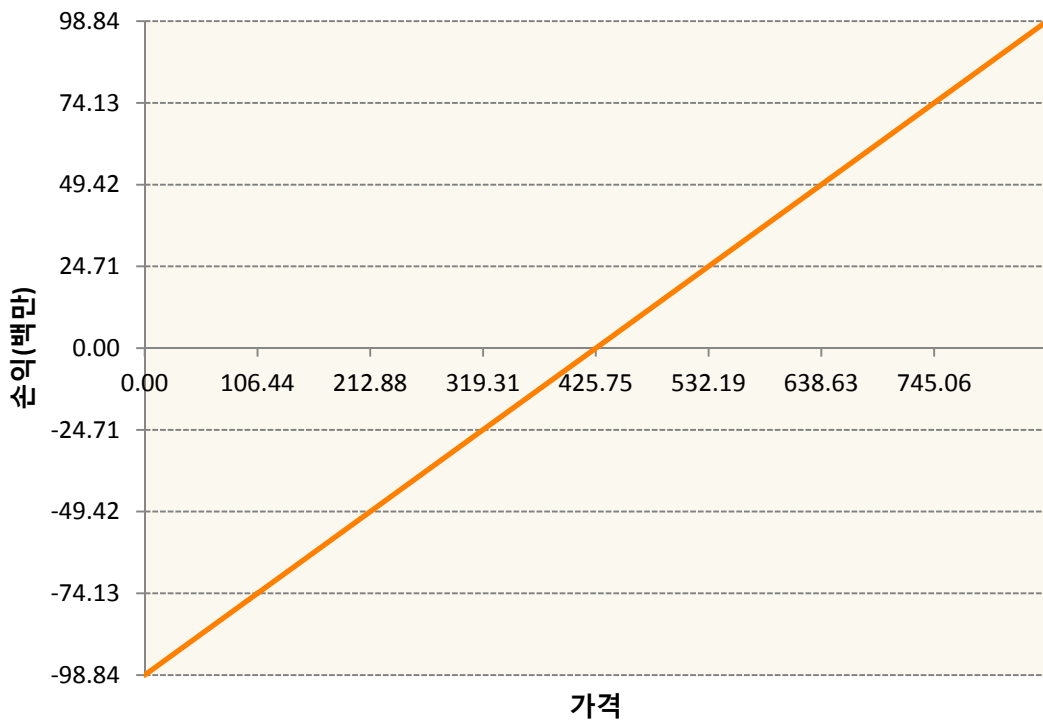




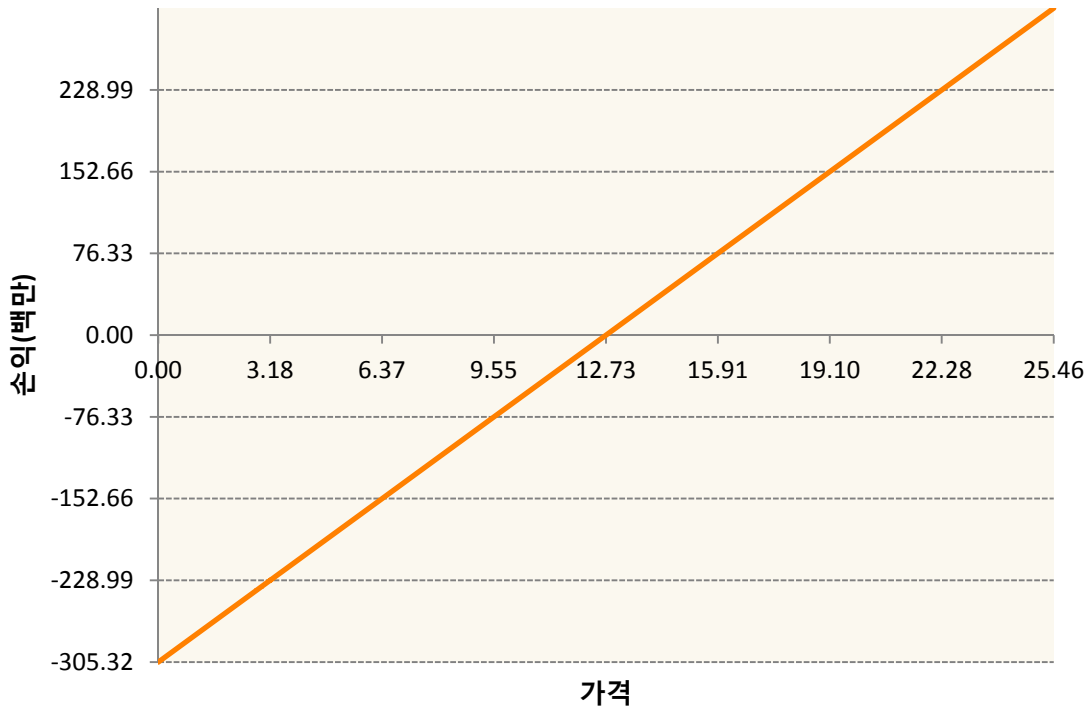
KR4175PC0003-2019-12 달러선물



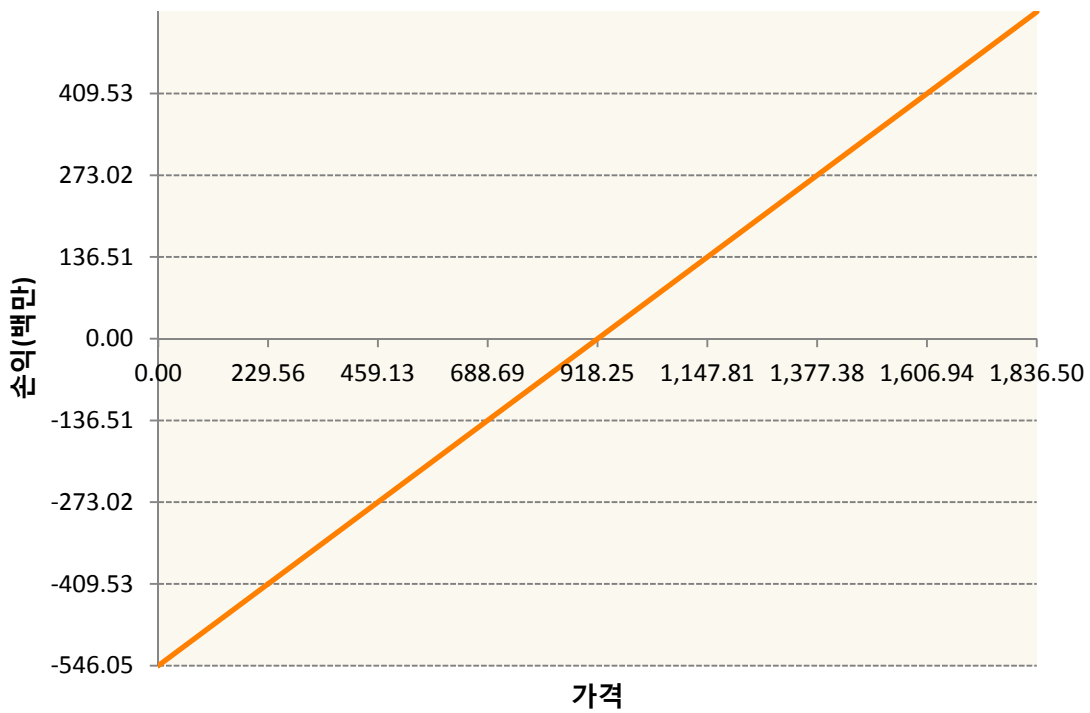
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



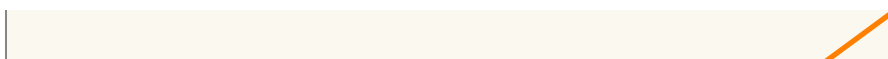
SBH0-Sugar Mar20

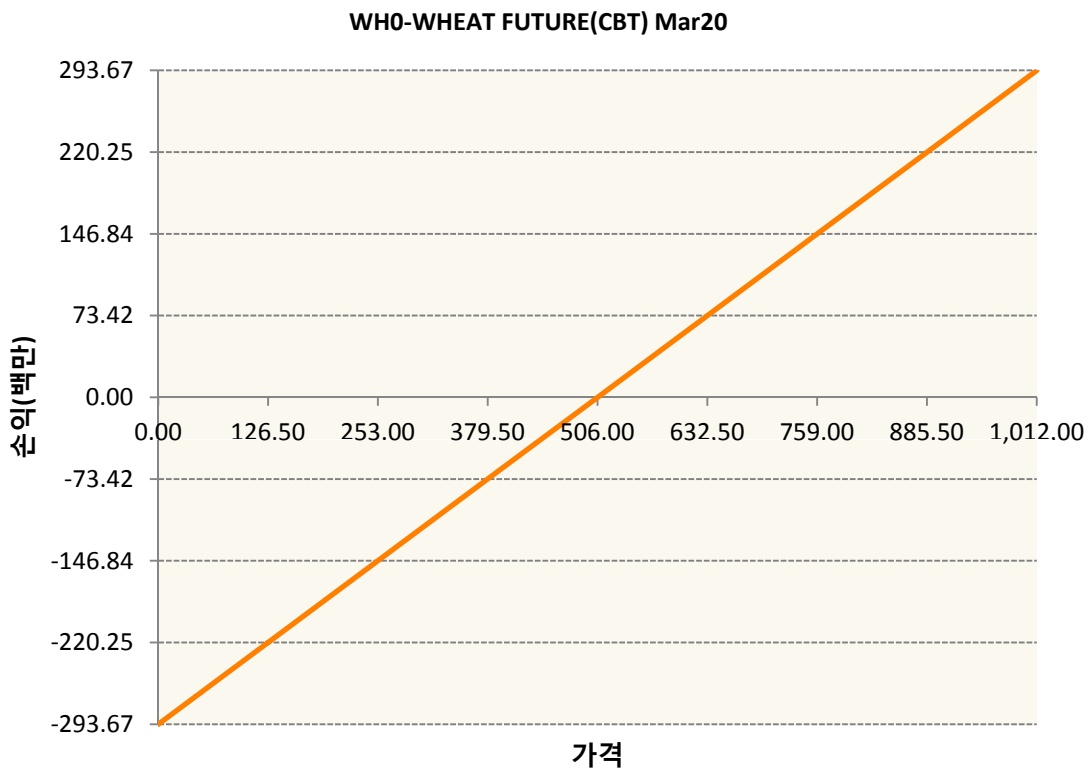
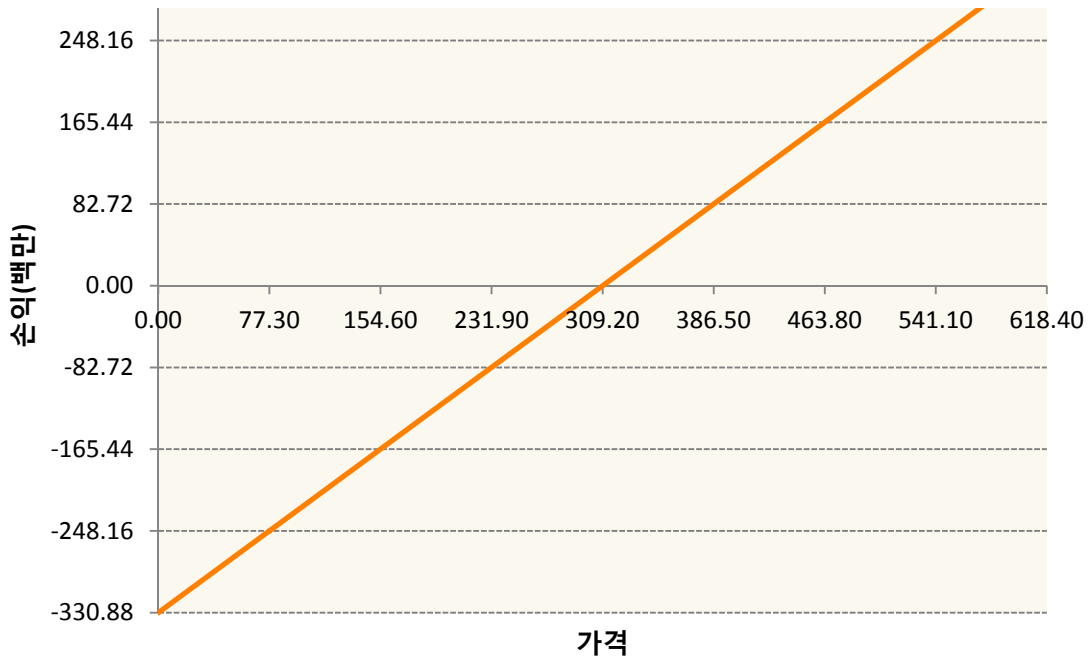


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20



SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF0	SOYBEAN OIL FUTR Jan20	26
CH0	CORN FUTURE Mar20	44
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	24
SF0	SOYBEAN FUTURE Jan20	44
SMF0	SOYBEAN MEAL FUTR Jan20	26
WH0	WHEAT FUTURE(CBT) Mar20	23

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

(단위:백만원)

246