

공시일	2019-11-20
기준일	2019-11-19

## 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)

85

공시일	2019-11-20
기준일	2019-11-19

## 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

1,227

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

708

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-11-20
기준일	2019-11-19

## SMART중국본토중소형CSI500상장

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6,772	0	6,772	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(1)	385
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	140

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

<b>763</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-11-20
기준일	2019-11-19

## 유로인덱스모(주식-파생형)

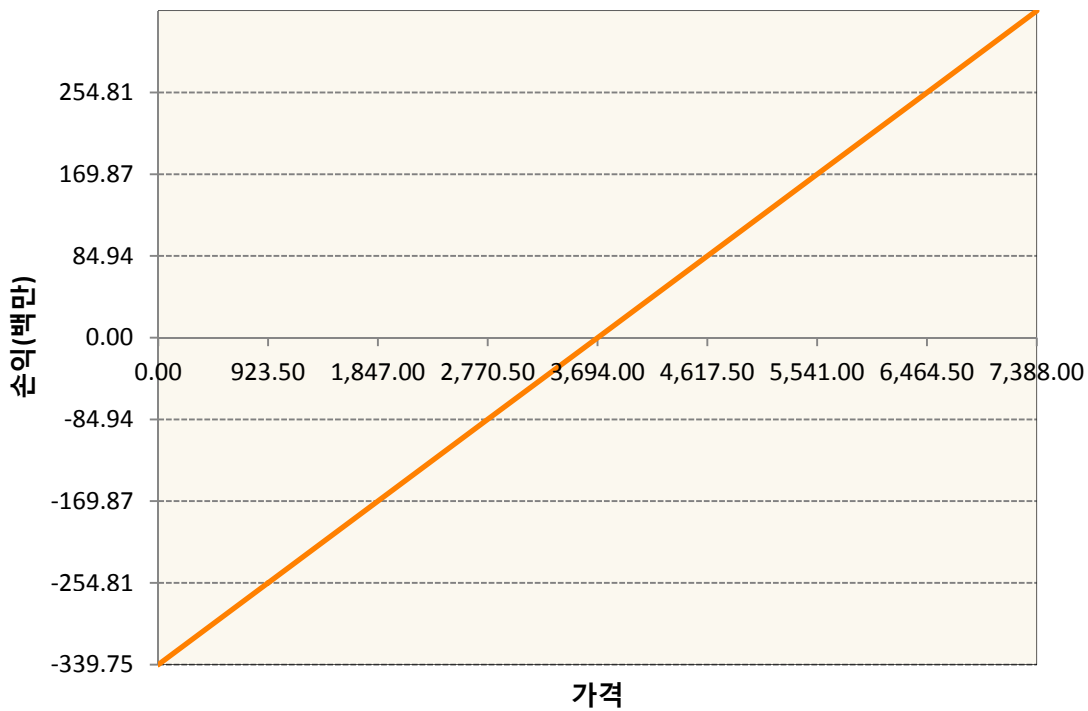
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	340	0	340	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGZ9-EURO STOXX 50 Dec19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	27
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

19
----

공시일	2019-11-20
기준일	2019-11-19

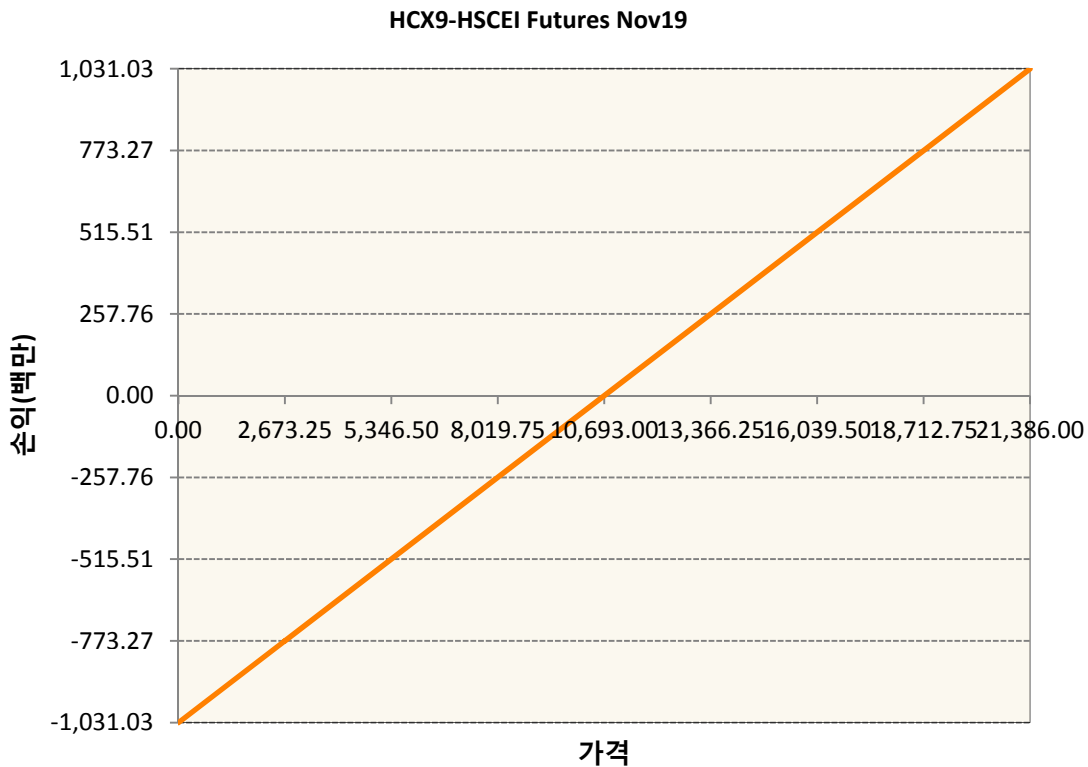
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,031	0	1,031	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGX9	HSCEI Futures Nov19	82
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

74
----

공시일	2019-11-20
기준일	2019-11-19

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

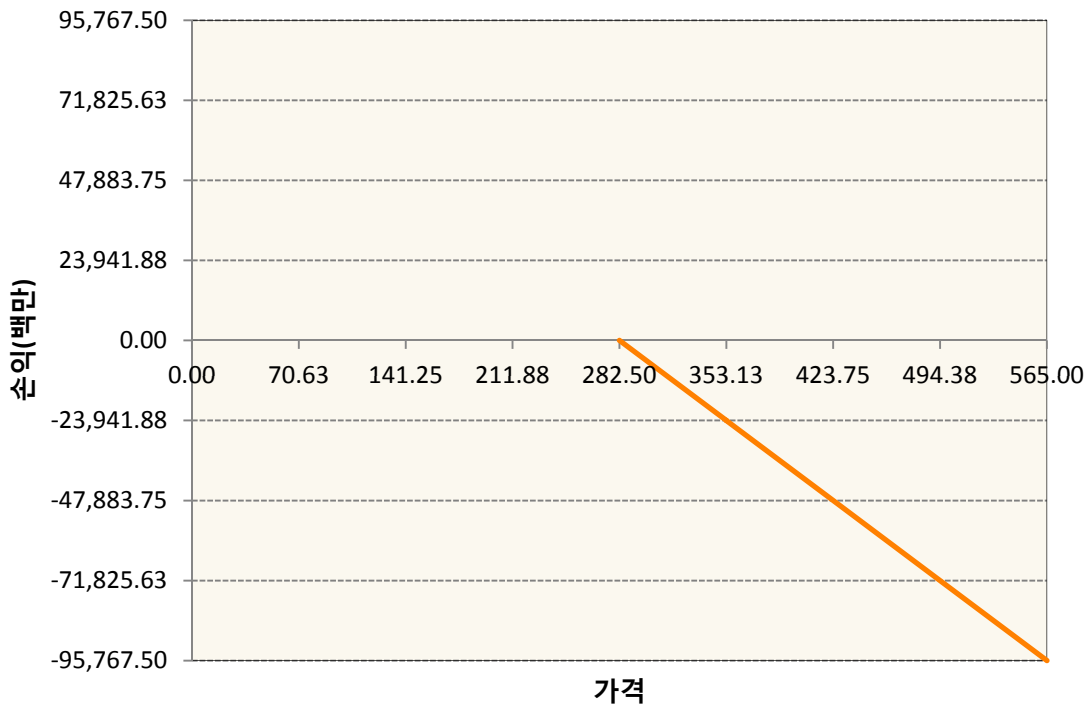
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

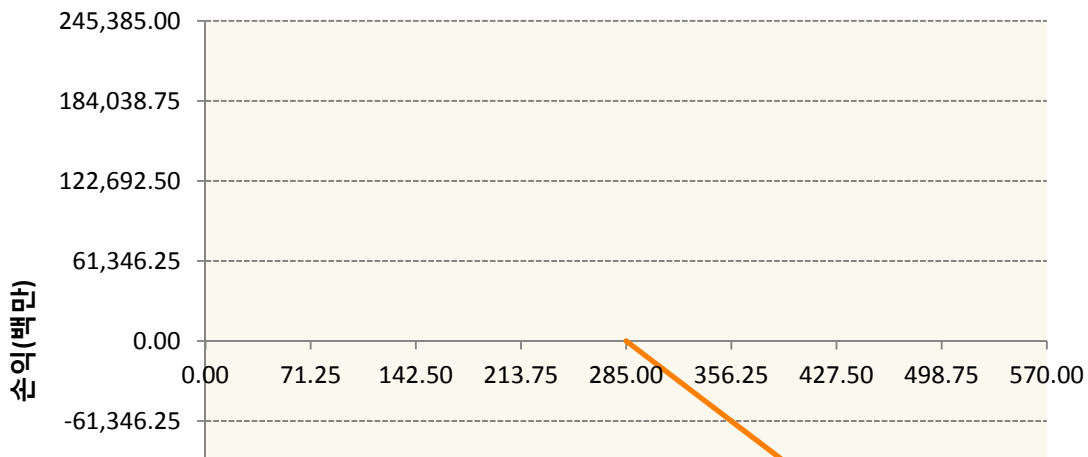
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	498,456	-498,456	장내

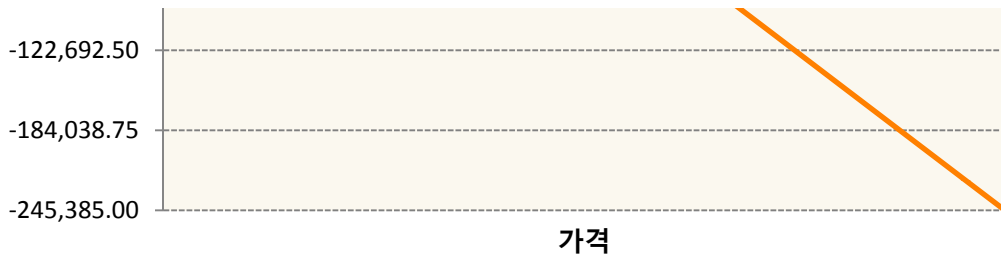
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201PC2825-2019-12 콜282.5**

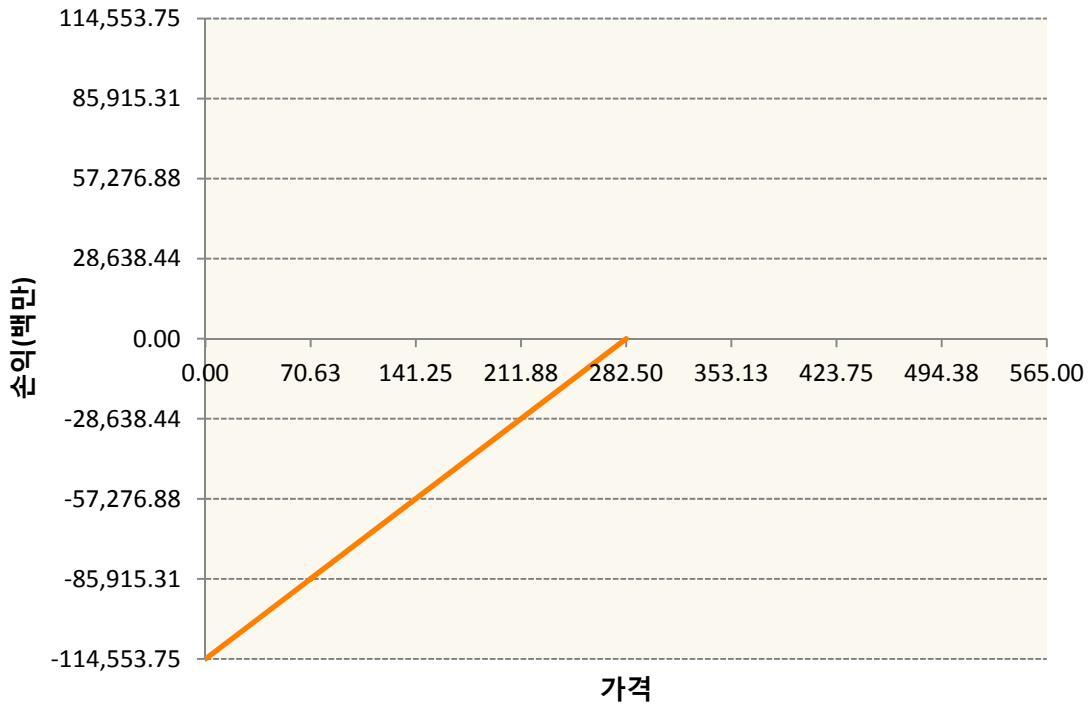


**KR4201PC2858-2019-12 콜285**

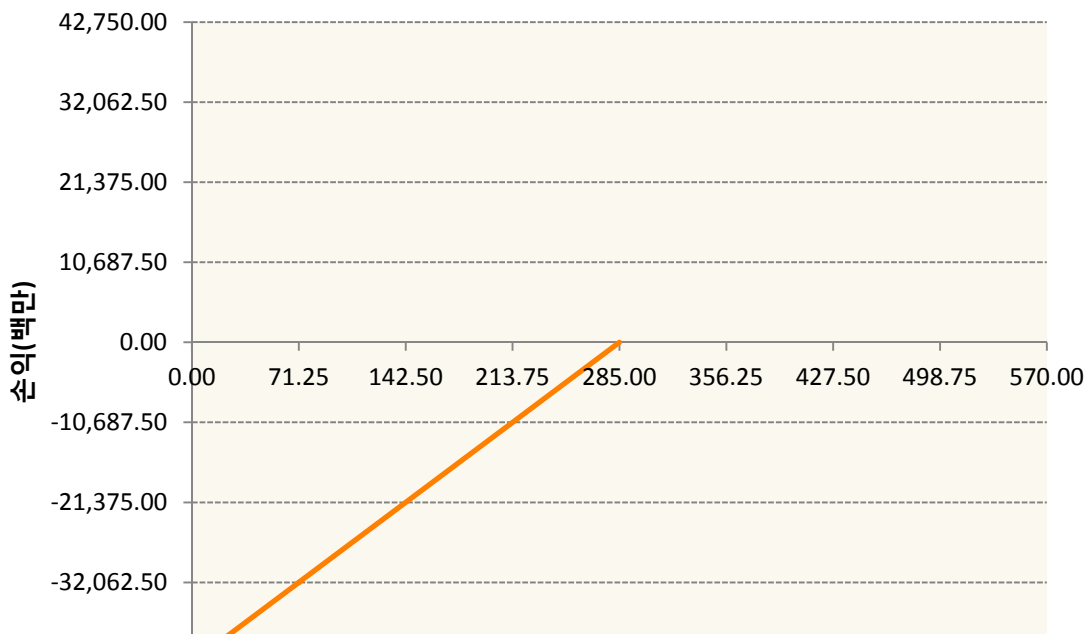




**KR4301PC2824-2019-12 풋282.5**



**KR4301PC2857-2019-12 풋285**



-42,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PC2825		2019-12 콜282.5						6,329
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,116	3,024	2,917	2,797	2,666	2,526	2,377	
-5.33%	2,736	2,576	2,407	2,231	2,050	1,864	1,675	
-2.67%	1,951	1,740	1,527	1,314	1,100	885	670	
0%	650	434	217	0	-218	-437	-655	
2.67%	-1,152	-1,326	-1,509	-1,698	-1,892	-2,090	-2,291	
5.33%	-3,334	-3,447	-3,576	-3,718	-3,870	-4,031	-4,199	
8.00%	-5,744	-5,804	-5,882	-5,974	-6,080	-6,199	-6,329	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						15,443
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	6,919	6,731	6,503	6,240	5,945	5,625	5,281	
-5.33%	6,185	5,829	5,444	5,036	4,608	4,165	3,709	
-2.67%	4,557	4,048	3,531	3,007	2,478	1,945	1,409	
0%	1,691	1,128	564	0	-564	-1,128	-1,692	
2.67%	-2,485	-2,978	-3,484	-4,000	-4,524	-5,055	-5,592	
5.33%	-7,741	-8,086	-8,466	-8,873	-9,303	-9,751	-10,215	
8.00%	-13,699	-13,898	-14,139	-14,419	-14,732	-15,075	-15,443	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						7,035
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-6,968	-6,970	-6,975	-6,983	-6,996	-7,013	-7,035	
-5.33%	-3,918	-3,948	-3,986	-4,032	-4,086	-4,146	-4,211	
-2.67%	-1,243	-1,346	-1,452	-1,560	-1,670	-1,781	-1,894	
0%	332	223	113	0	-114	-229	-346	
2.67%	797	758	711	656	593	524	449	
5.33%	856	851	842	828	809	784	752	
8.00%	859	858	858	856	852	847	838	
KR4301PC2857		2019-12 풋285						2,814
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,800	-2,800	-2,801	-2,802	-2,805	-2,809	-2,814	
-5.33%	-1,662	-1,668	-1,677	-1,688	-1,701	-1,718	-1,736	
-2.67%	-602	-632	-664	-697	-732	-769	-806	
0%	135	90	45	0	-45	-90	-136	
2.67%	417	395	369	340	310	277	243	

5.33%	466	462	456	447	435	421	404
8.00%	470	469	469	467	465	461	455

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

(단위:백만원)

**31,747**

공시일	2019-11-20
기준일	2019-11-19

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

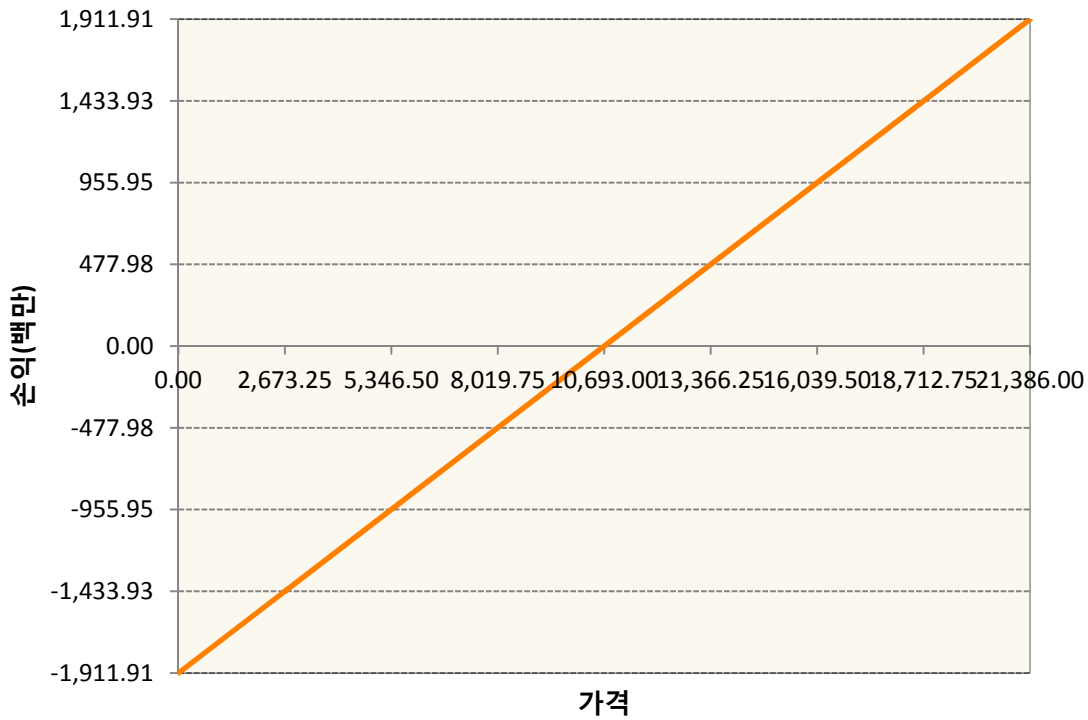
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

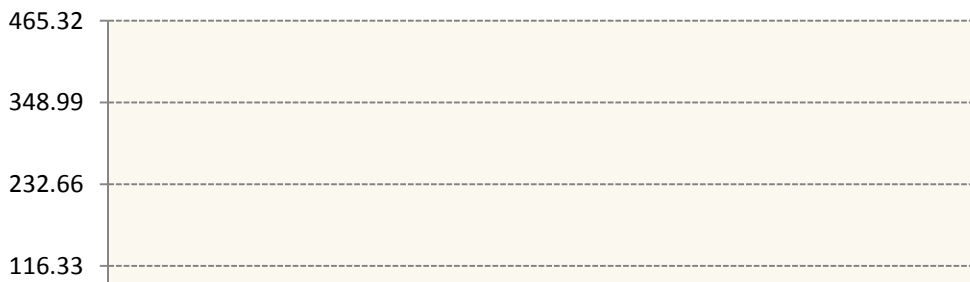
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,912	0	1,912	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,002	-5,002	장내
누계	통화	선도	671	2,771	-2,100	장외

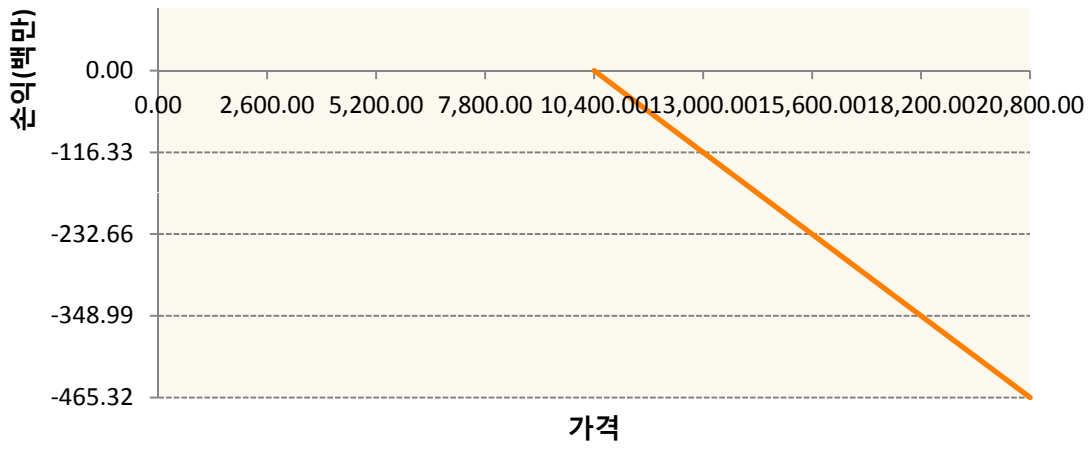
### 2. 만기시점의 손익구조

HCX9-HSCEI Futures Nov19

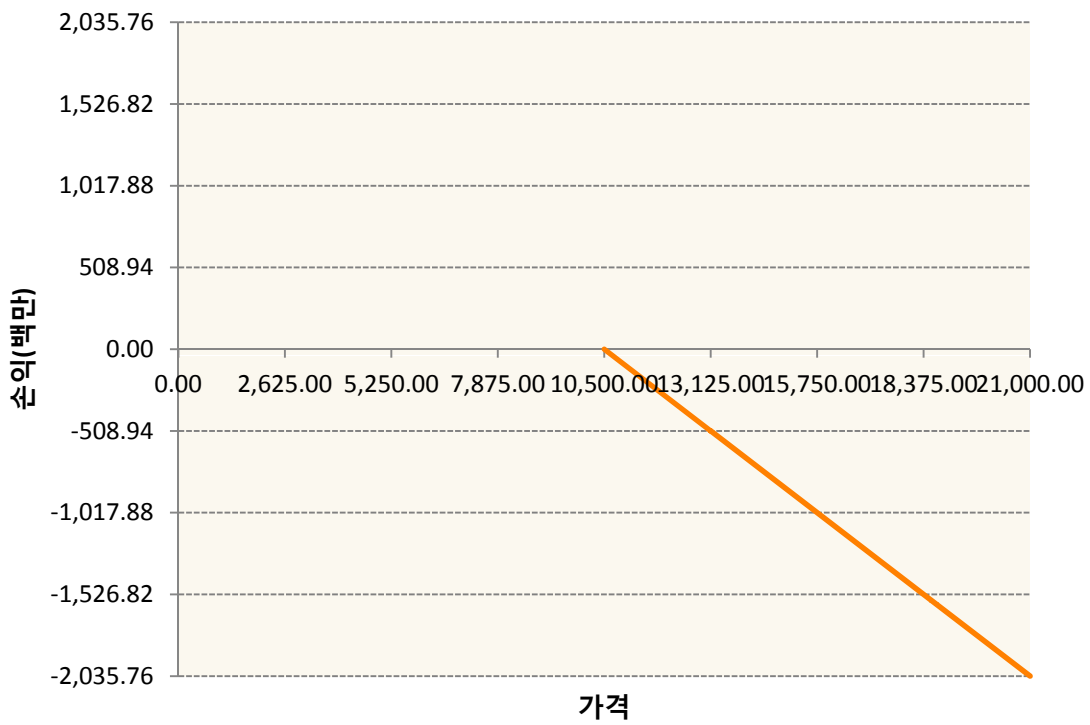


OHHIX9-C104-HSCEI

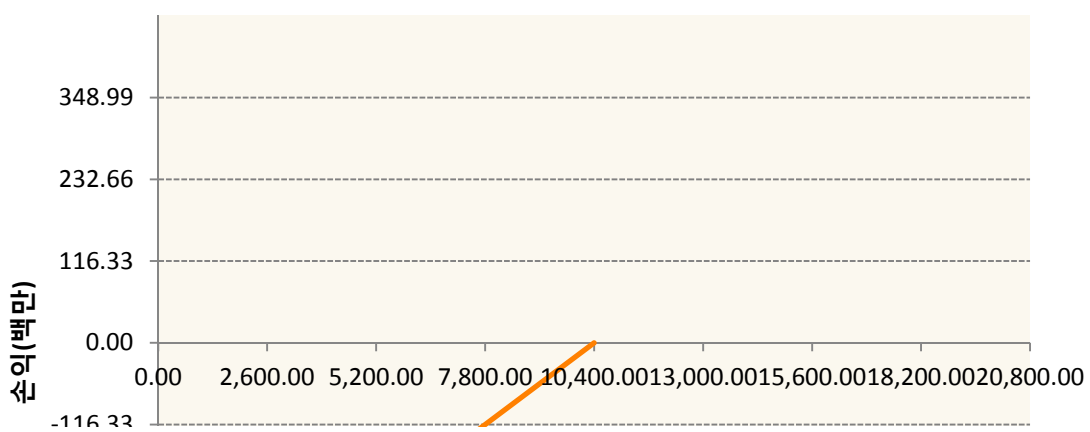


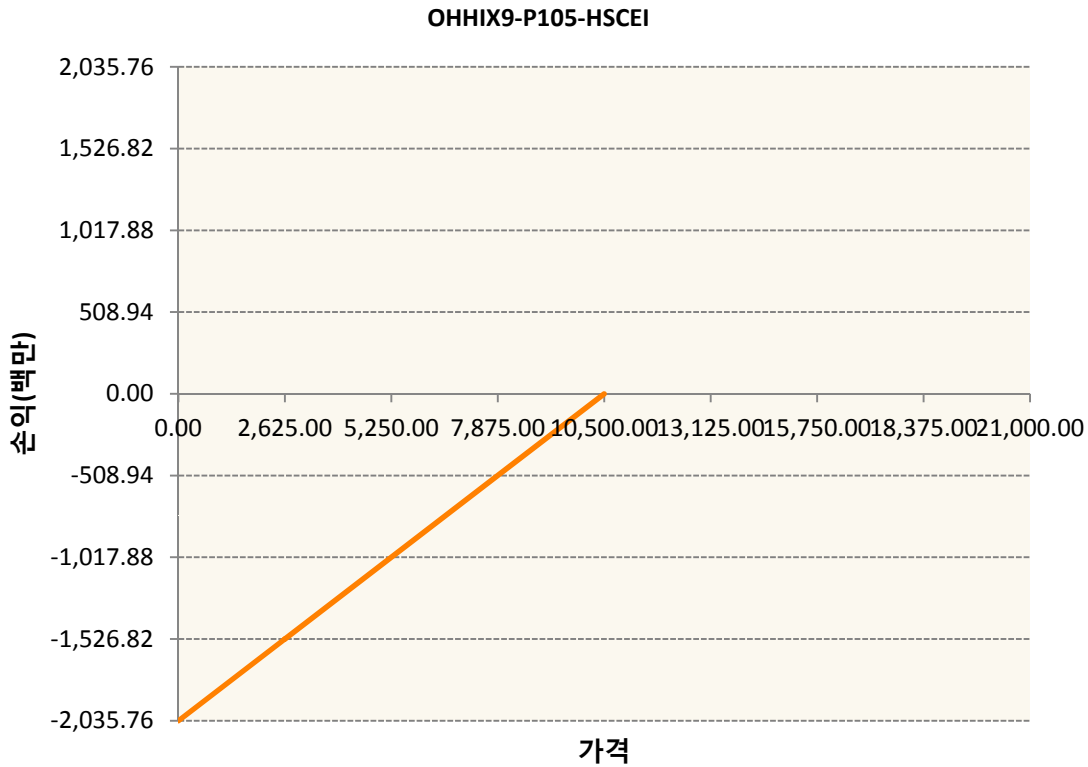
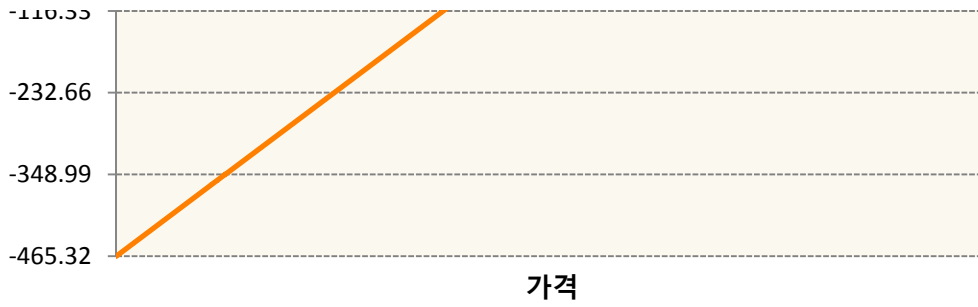


OHHIX9-C105-HSCEI



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
HGX9 HSCEI Futures Nov19	153
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>578</b>

공시일	2019-11-20
기준일	2019-11-19

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

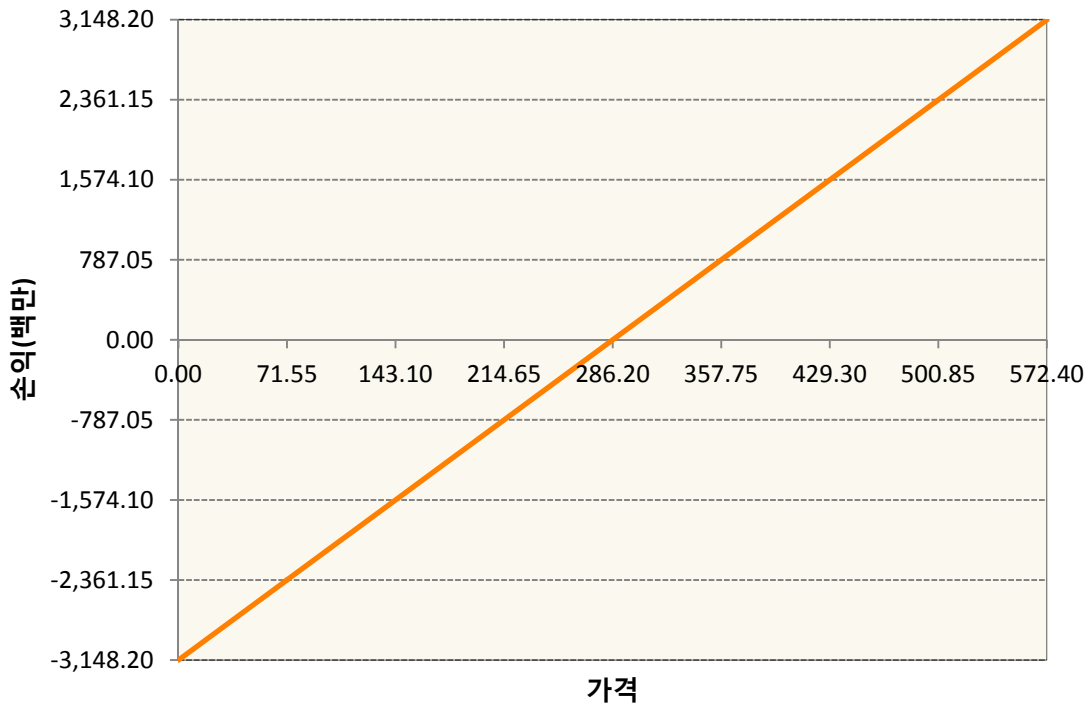
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

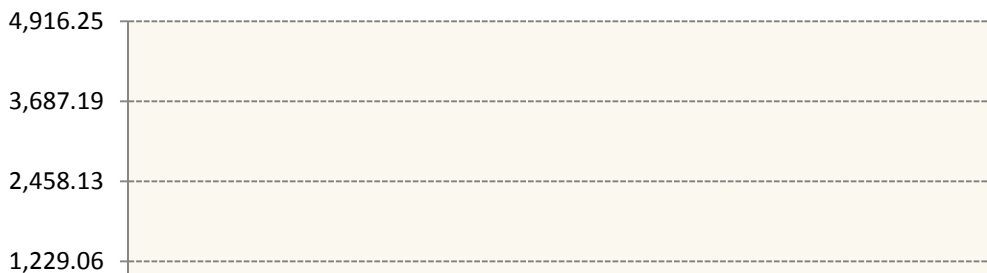
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,148	0	3,148	장내
누계	유가증권	스왑	9,625	0	9,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,728	-9,728	장내

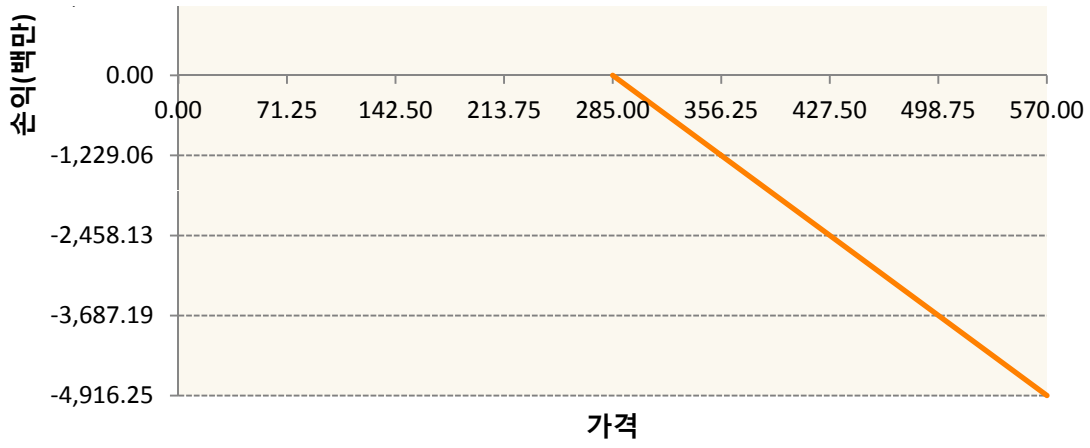
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

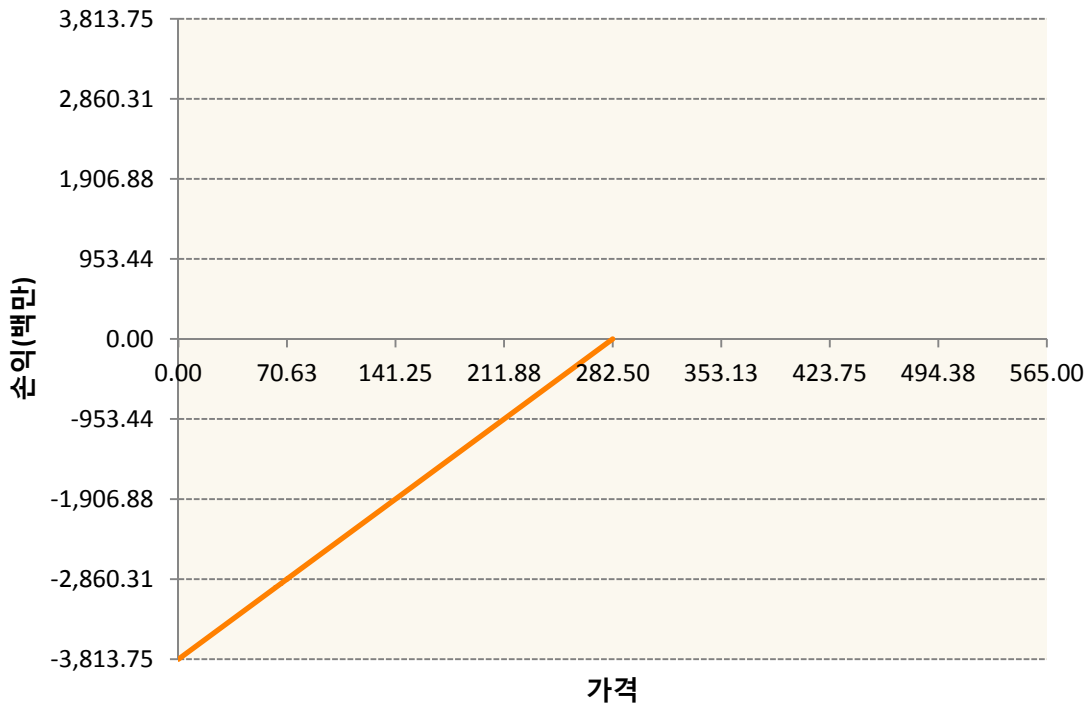


KR4201PC2858-2019-12 콜285

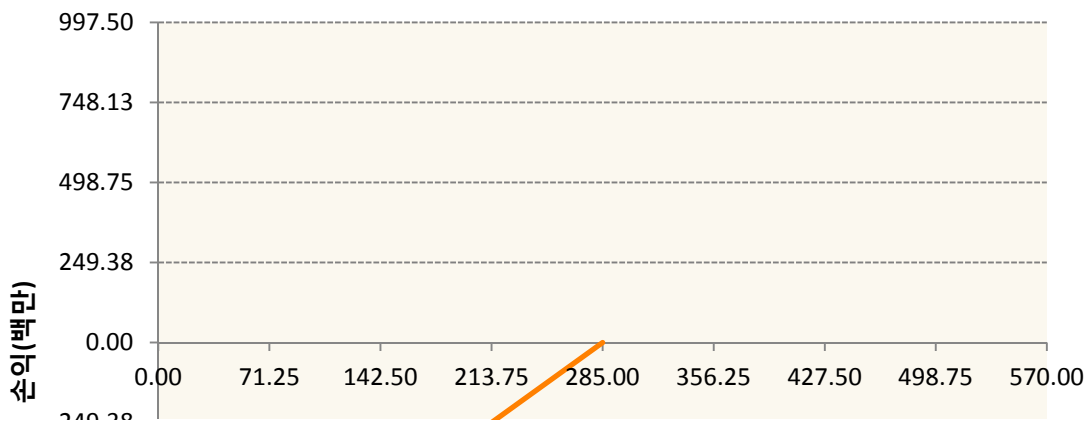




**KR4301PC2824-2019-12 풋282.5**



**KR4301PC2857-2019-12 풋285**





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						827
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-827	-827	-827	-827	-827	-827	-827	
-5.33%	-552	-552	-552	-552	-552	-552	-552	
-2.67%	-276	-276	-276	-276	-276	-276	-276	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	276	276	276	276	276	276	276	
5.33%	552	552	552	552	552	552	552	
8.00%	827	827	827	827	827	827	827	
KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						252
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252	
-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%	252	252	252	252	252	252	252	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						309
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	139	135	130	125	119	113	106	
-5.33%	124	117	109	101	92	83	74	
-2.67%	91	81	71	60	50	39	28	
0%	34	23	11	0	-11	-23	-34	
2.67%	-50	-60	-70	-80	-91	-101	-112	
5.33%	-155	-162	-170	-178	-186	-195	-205	
8.00%	-274	-278	-283	-289	-295	-302	-309	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						234
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-232	-232	-232	-232	-233	-233	-234
-5.33%	-130	-131	-133	-134	-136	-138	-140
-2.67%	-41	-45	-48	-52	-56	-59	-63
0%	11	7	4	0	-4	-8	-12
2.67%	27	25	24	22	20	17	15
5.33%	28	28	28	28	27	26	25
8.00%	29	29	29	28	28	28	28
KR4301PC2857                      2019-12 풋285							66
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-65	-65	-65	-65	-65	-66	-66
-5.33%	-39	-39	-39	-39	-40	-40	-41
-2.67%	-14	-15	-15	-16	-17	-18	-19
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	10	9	9	8	7	6	6
5.33%	11	11	11	10	10	10	9
8.00%	11	11	11	11	11	11	11

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

(단위:백만원)

**1,645**

공시일	2019-11-20
기준일	2019-11-19

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

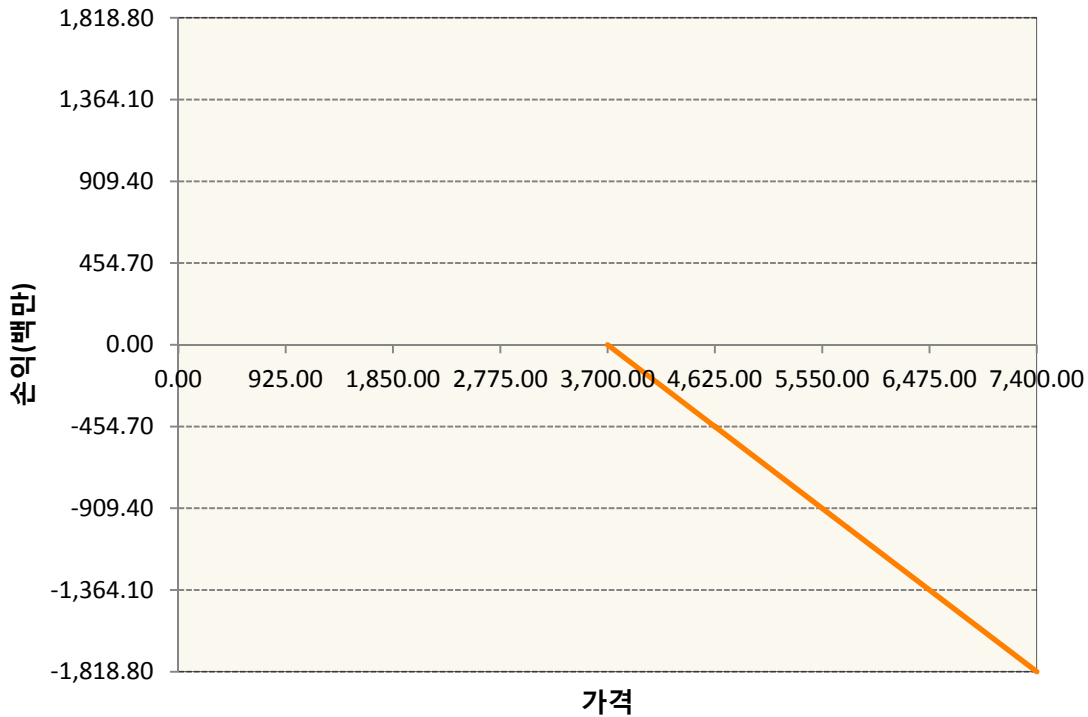
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

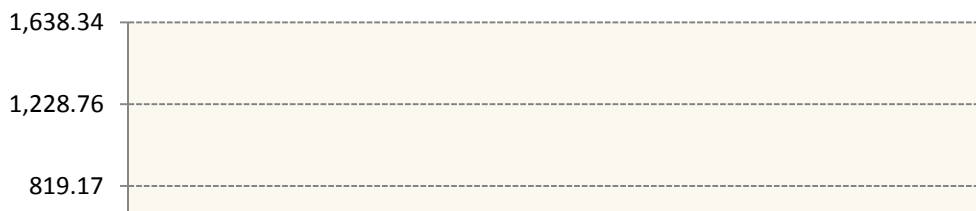
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	432	0	432	
누계	유가증권	스왑	20,325	0	20,325	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,914	-6,914	장내
누계	통화	선도	2,039	6,080	-4,041	장외

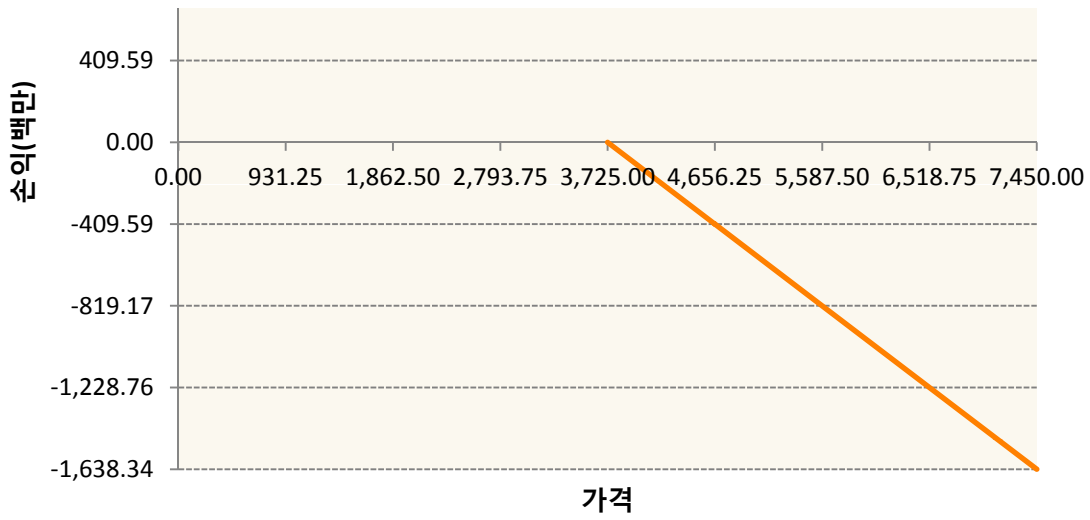
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXZ9-C3700-EURO STOXX 50**

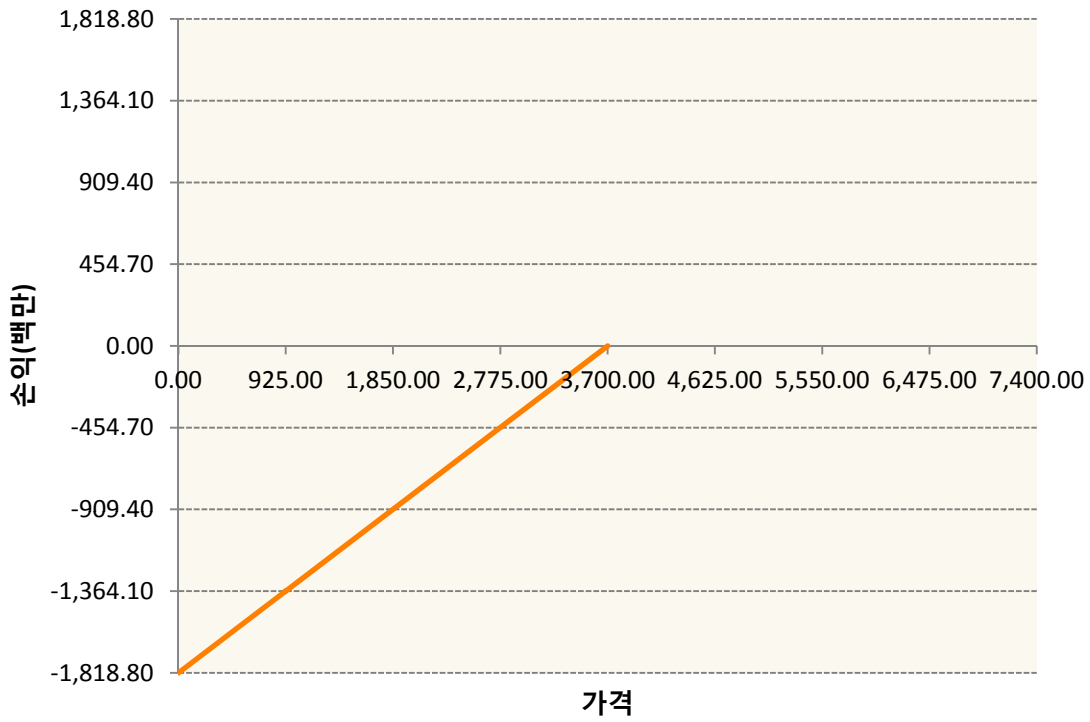


**OESXZ9-C3725-EURO STOXX 50**

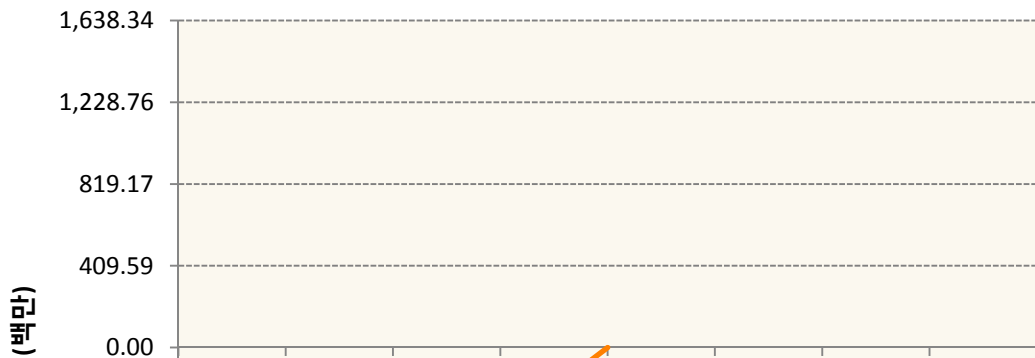


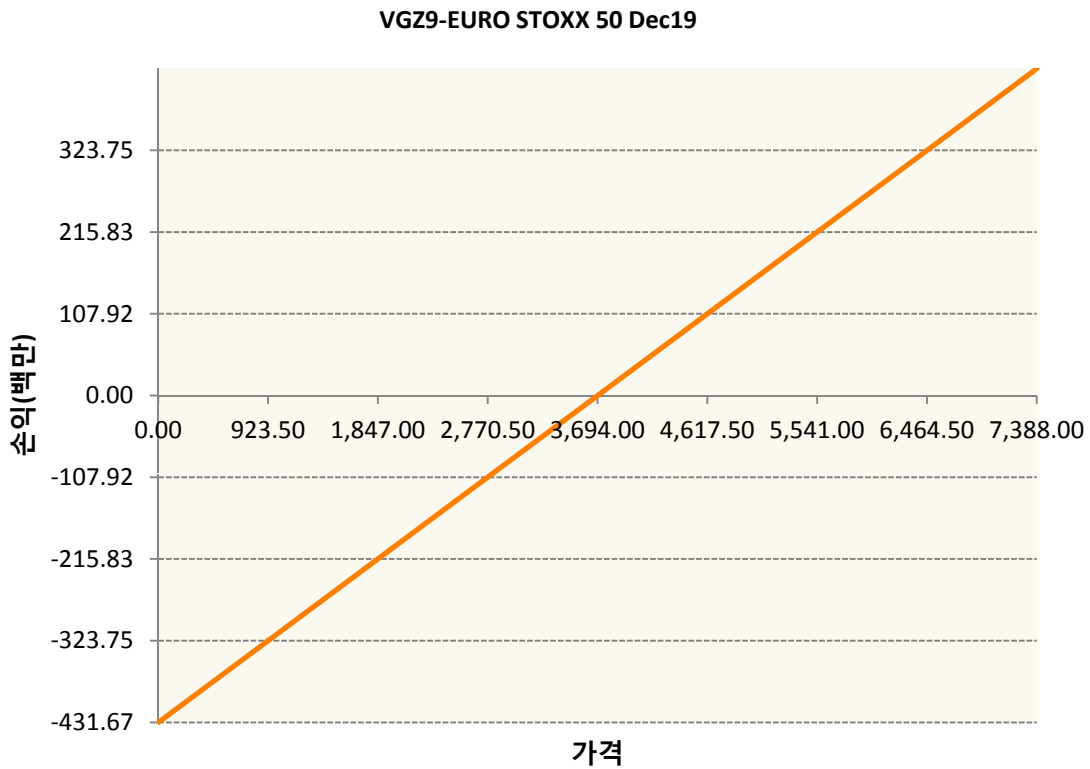
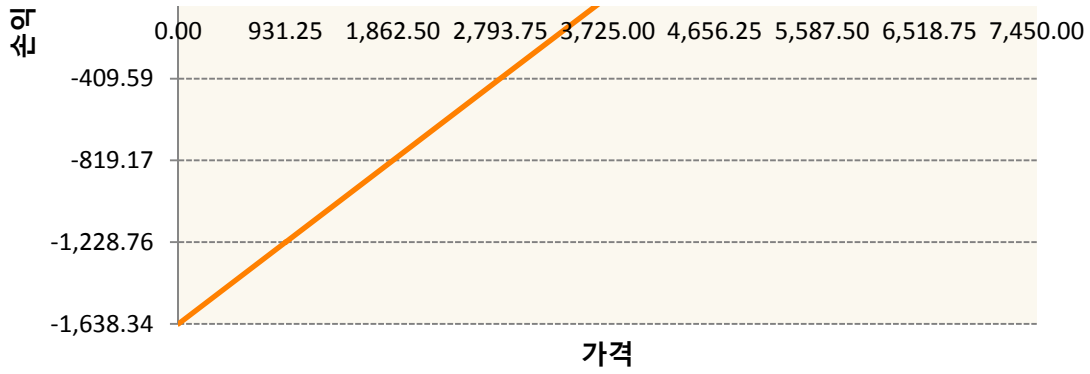


OESXZ9-P3700-EURO STOXX 50



OESXZ9-P3725-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		24
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E		486
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E		163
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50		146
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50		131
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50		146
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50		131
VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	35

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

(단위:백만원)

719



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

(단위:백만원)

926



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

(단위:백만원)

81



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

(단위:백만원)

126

공시일	2019-11-20
기준일	2019-11-19

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

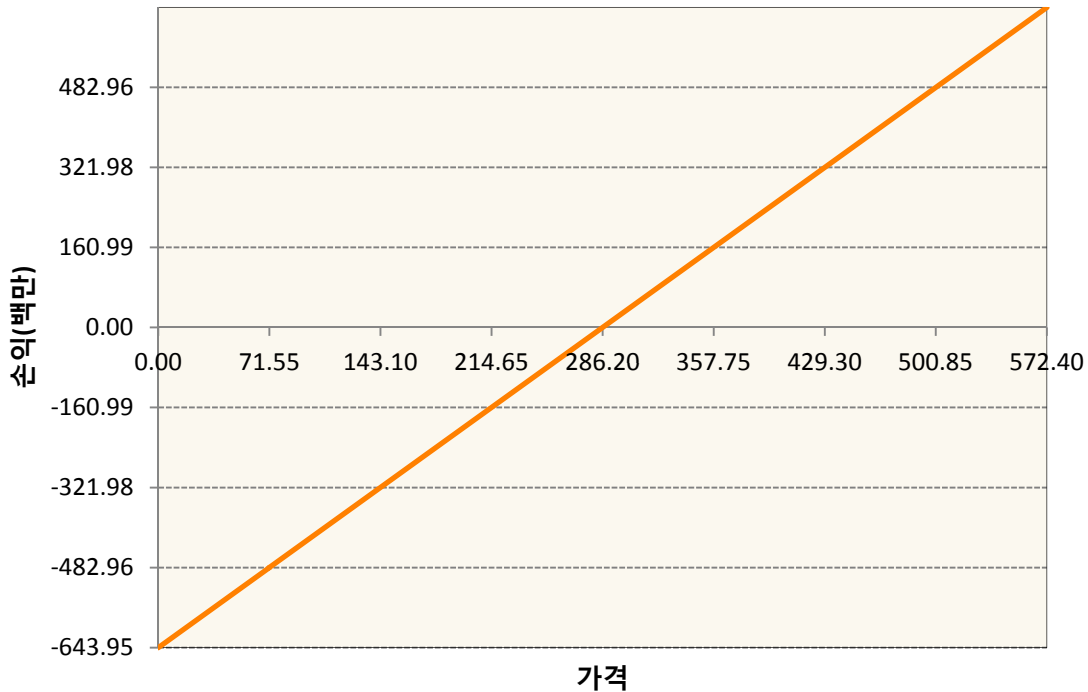
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	644	0	644	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)

40

공시일	2019-11-20
기준일	2019-11-19

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

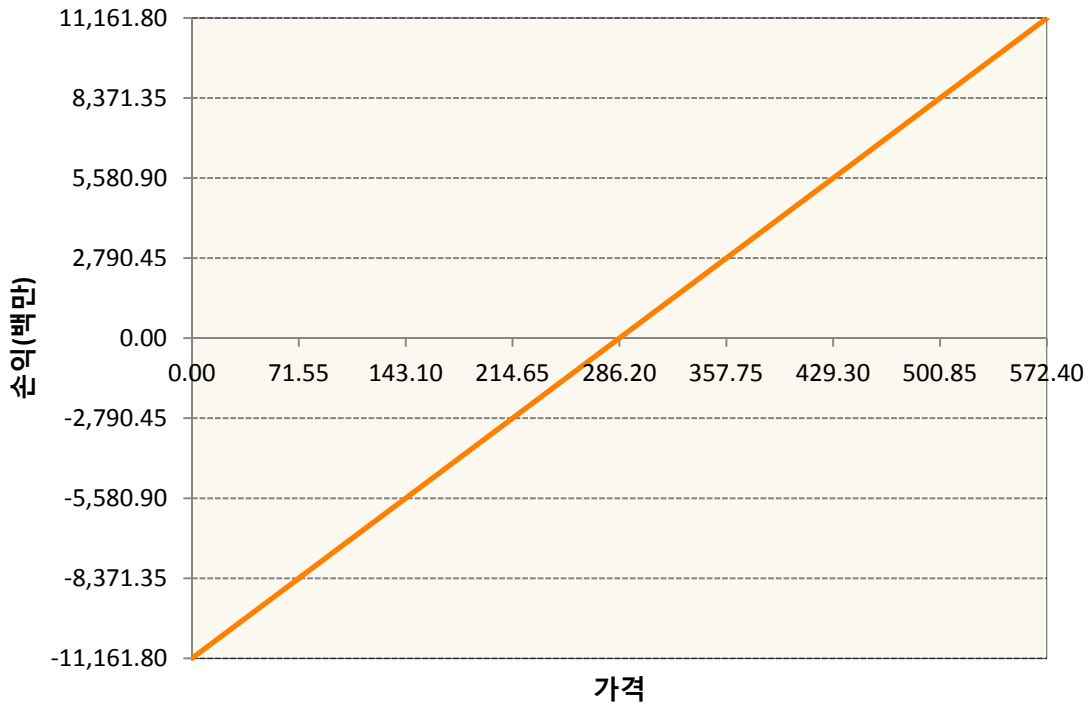
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

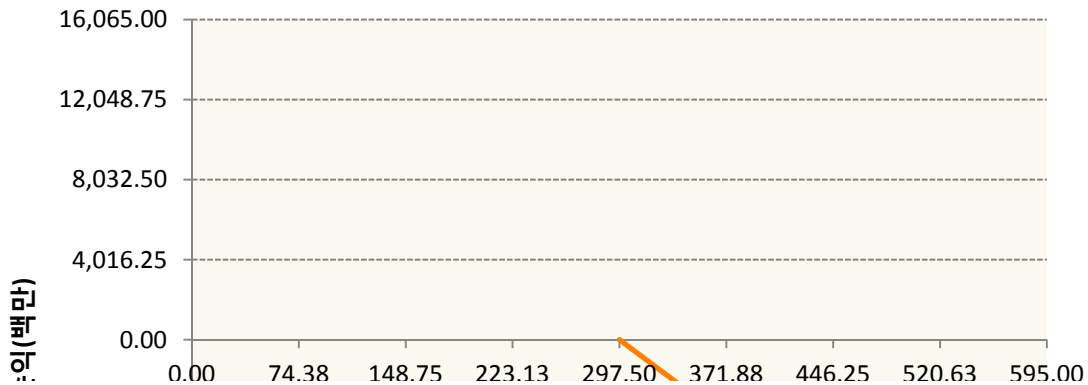
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	144	-144	장내
누계	유가증권	선물	11,162	0	11,162	장내
누계	유가증권	옵션	1,348	21,390	-20,042	장내

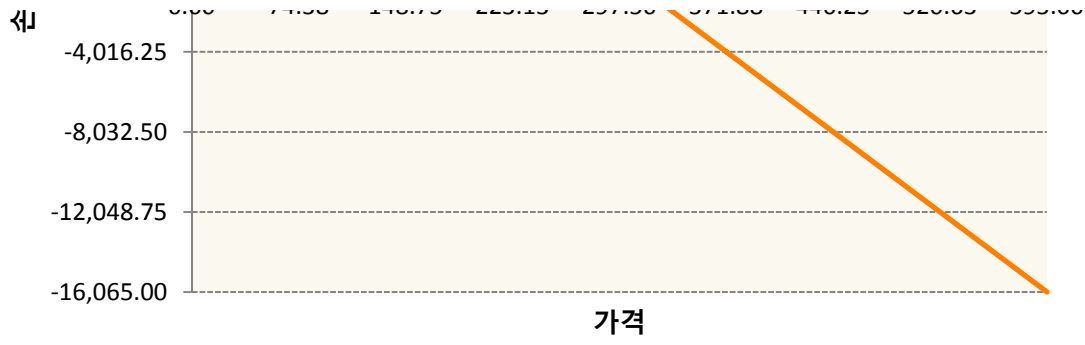
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

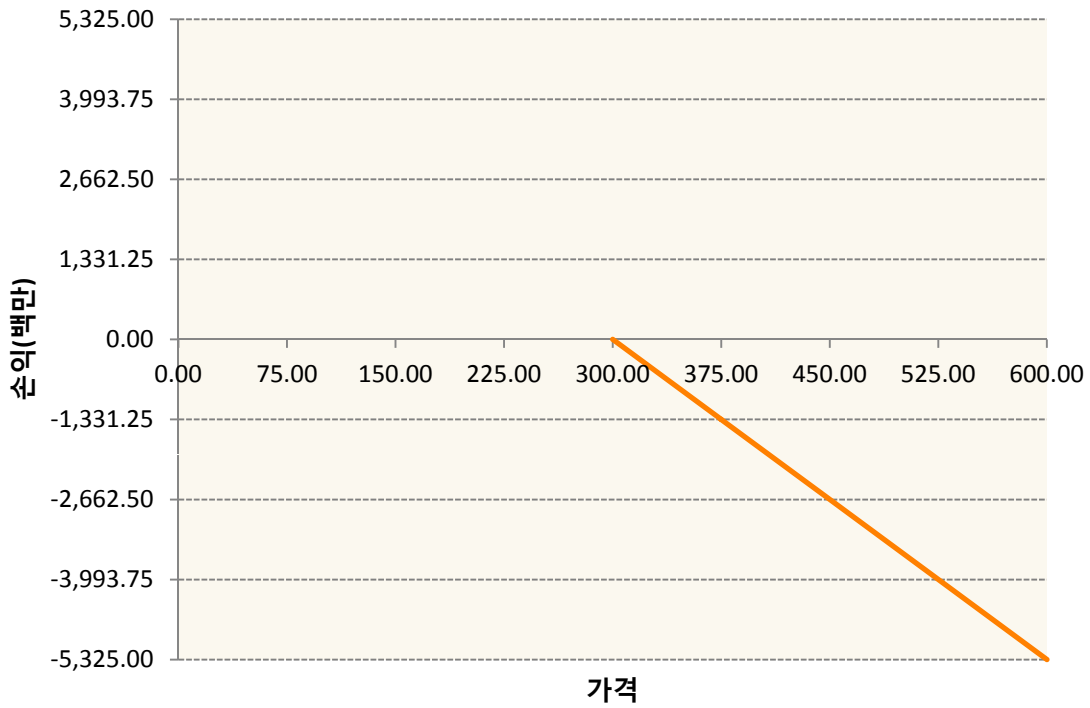


KR4201PC2973-2019-12 콜297.5

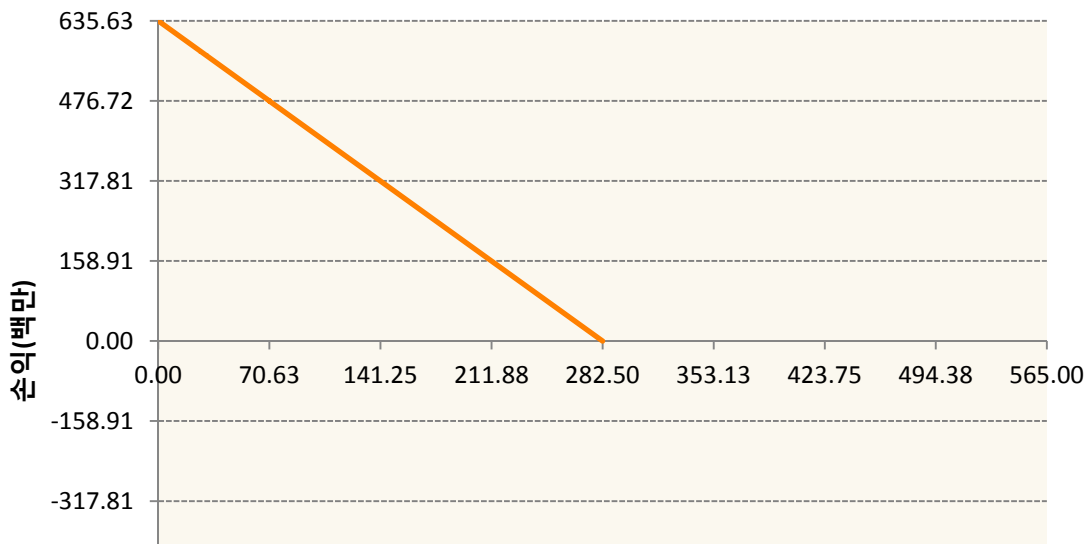


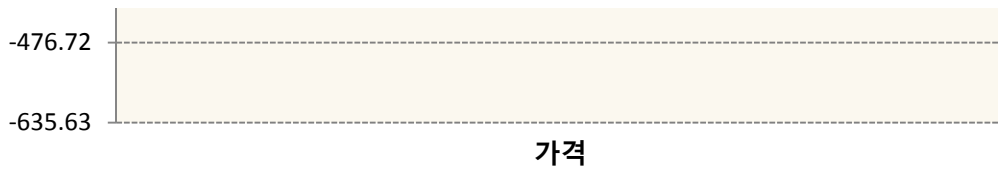


KR4201PC3005-2019-12 콜300

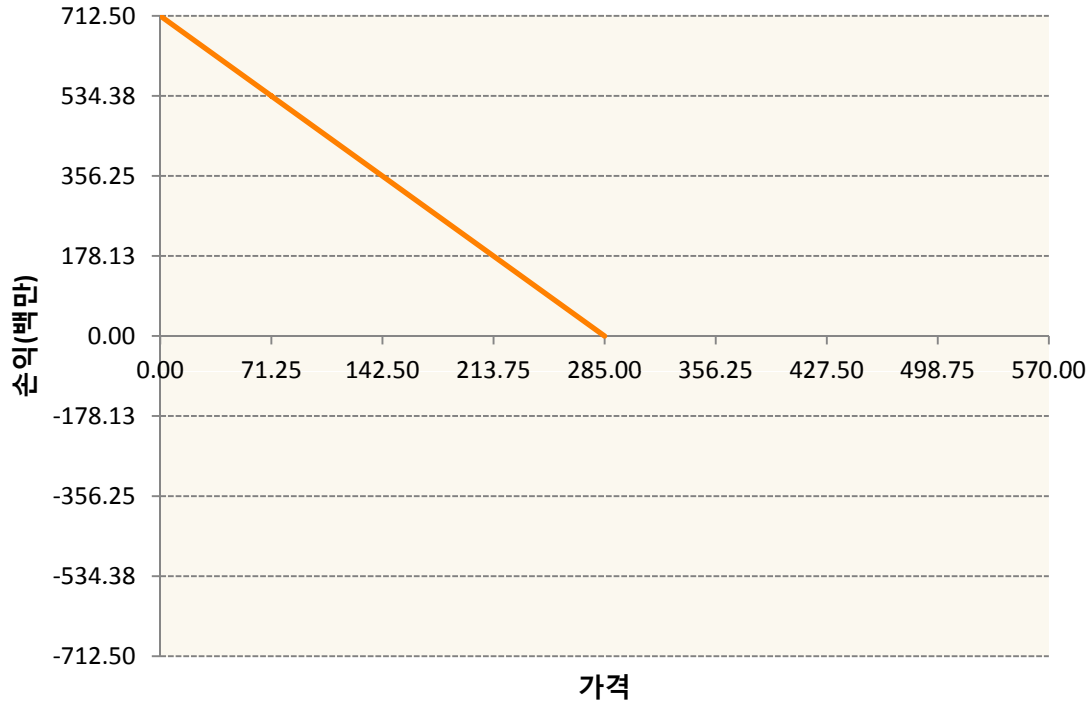


KR4301PC2824-2019-12 풋282.5





KR4301PC2857-2019-12 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						893
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-893	-893	-893	-893	-893	-893	-893	
-5.33%	-595	-595	-595	-595	-595	-595	-595	
-2.67%	-298	-298	-298	-298	-298	-298	-298	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	298	298	298	298	298	298	298	
5.33%	595	595	595	595	595	595	595	
8.00%	893	893	893	893	893	893	893	
KR4201PC2973		2019-12 콜297.5						732
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	192	189	184	178	170	160	148	
-5.33%	183	175	164	151	136	119	101	
-2.67%	155	138	119	97	73	49	23	

0%	88	60	30	0	-31	-63	-96
2.67%	-44	-79	-115	-151	-187	-224	-260
5.33%	-254	-290	-326	-363	-399	-436	-473
8.00%	-540	-569	-600	-632	-665	-698	-732
KR4201PC3005                      2019-12 콜300							224
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	52	51	50	49	46	44	40
-5.33%	50	48	45	42	38	33	27
-2.67%	44	39	33	27	20	13	5
0%	26	18	9	0	-10	-20	-30
2.67%	-10	-21	-32	-44	-55	-67	-79
5.33%	-70	-82	-95	-107	-119	-131	-143
8.00%	-156	-167	-178	-189	-201	-212	-224
KR4301PC2824                      2019-12 풋282.5							39
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	39	39	39	39	39	39	39
-5.33%	22	22	22	22	23	23	23
-2.67%	7	7	8	9	9	10	11
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-4	-4	-4	-4	-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							47
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	47	47	47	47	47	47	47
-5.33%	28	28	28	28	28	29	29
-2.67%	10	11	11	12	12	13	13
0%	-2	-2	-1	0	1	2	2
2.67%	-7	-7	-6	-6	-5	-5	-4
5.33%	-8	-8	-8	-7	-7	-7	-7
8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8

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

(단위:백만원)

**1,546**

공시일	2019-11-20
기준일	2019-11-19

## 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	203,882	0	203,882	

### 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	2019-11-20
기준일	2019-11-19

## 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	212,797	0	212,797	

### 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	2019-11-20
기준일	2019-11-19

## 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	540,432	0	540,432	
누계	통화	선도	0	594,892	-594,892	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		1,681
FX21019V02 KRW/USD 21-11-19E		5,081
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,764
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,401
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,802
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

FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E	467
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E	934
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E	1,532
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E	1,868
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E	3,213

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

(단위:백만원)

**14,911**



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

(단위:백만원)

189

공시일	2019-11-20
기준일	2019-11-19

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

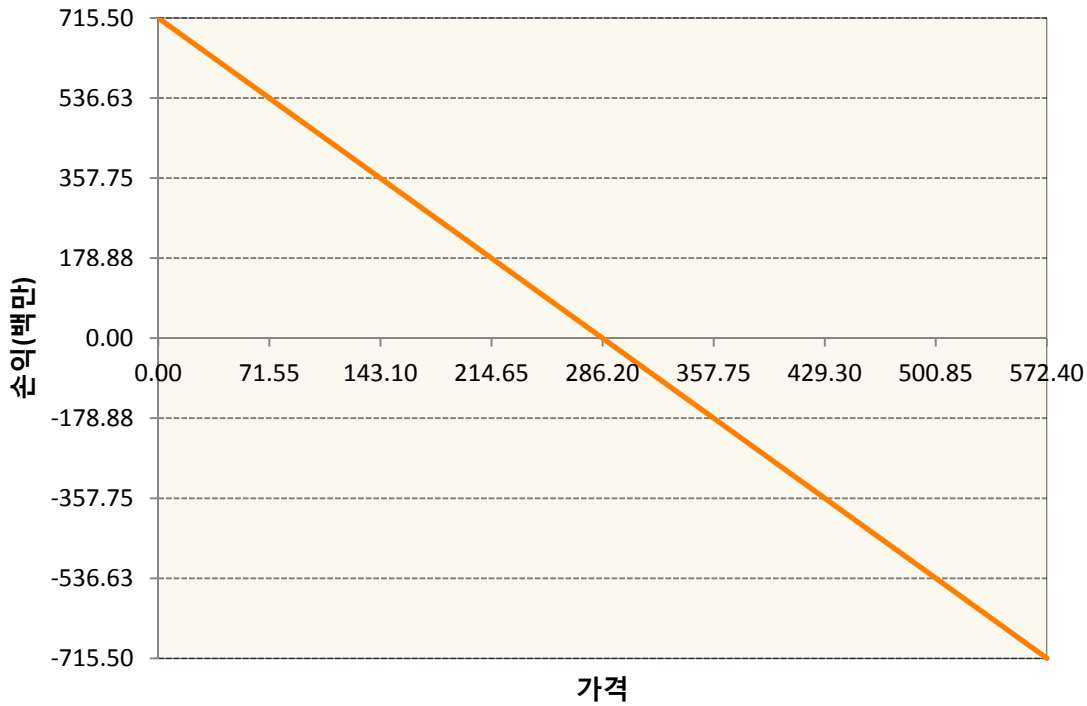
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

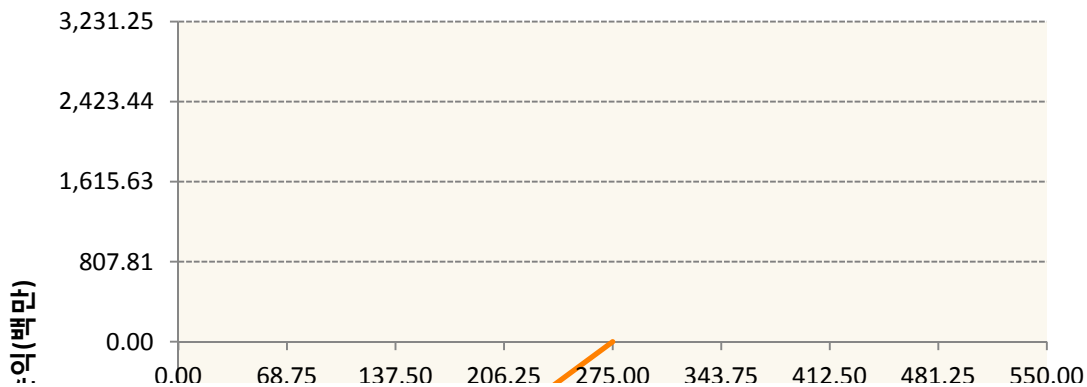
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	716	-716	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,856	-3,856	장내

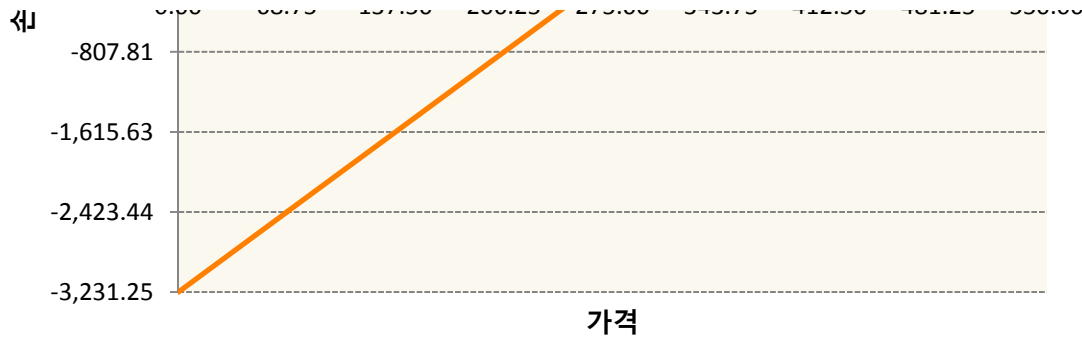
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

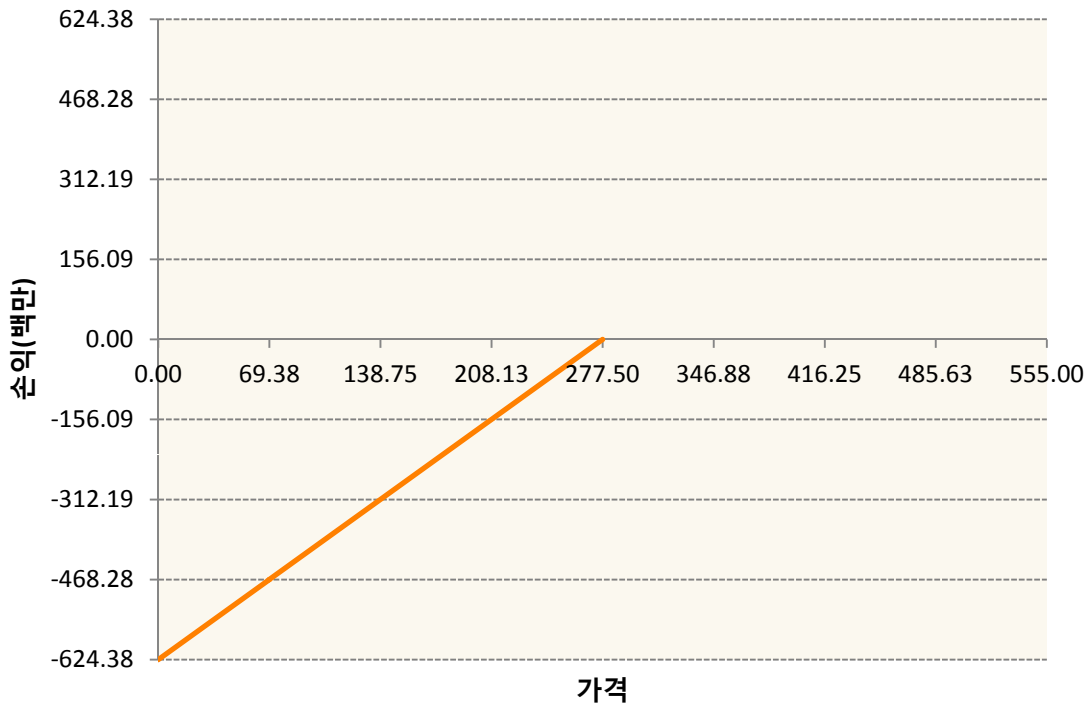


KR4301PC2758-2019-12 풋275





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						142
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-134	-135	-136	-137	-139	-140	-142
-5.33%	-56	-59	-62	-65	-68	-71	-74
-2.67%	-9	-13	-16	-19	-22	-25	-29
0%	4	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	5	5	5	5	4	4	3
5.33%	6	6	5	5	5	5	5
8.00%	6	6	6	6	6	5	5

KR4301PC2774                      2019-12 풋277.5                      31

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-30	-30	-31	-31	-31	-31	-31
-5.33%	-14	-15	-15	-16	-16	-17	-17
-2.67%	-3	-4	-4	-5	-6	-6	-7
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
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)

**172**

공시일	2019-11-20
기준일	2019-11-19

## 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	15,304	0	15,304	
누계	통화	선도	350	15,424	-15,074	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
FX21019X02 USD/KRW 25-11-19E		28

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

(단위:백만원)

395
-----

공시일	2019-11-20
기준일	2019-11-19

## 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	687	0	687	장외
누계	통화	선도	201	472	-272	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	37
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
FX21019X02 KRW/EUR 31-01-20E	5

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

(단위:백만원)

64

공시일	2019-11-20
기준일	2019-11-19

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

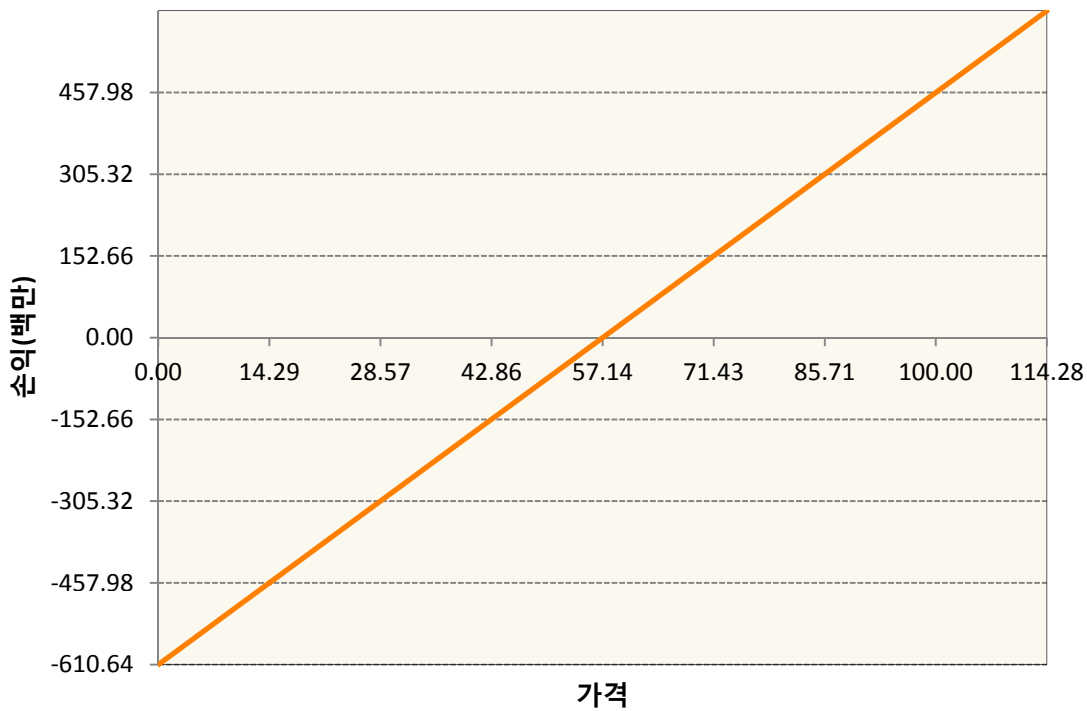
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

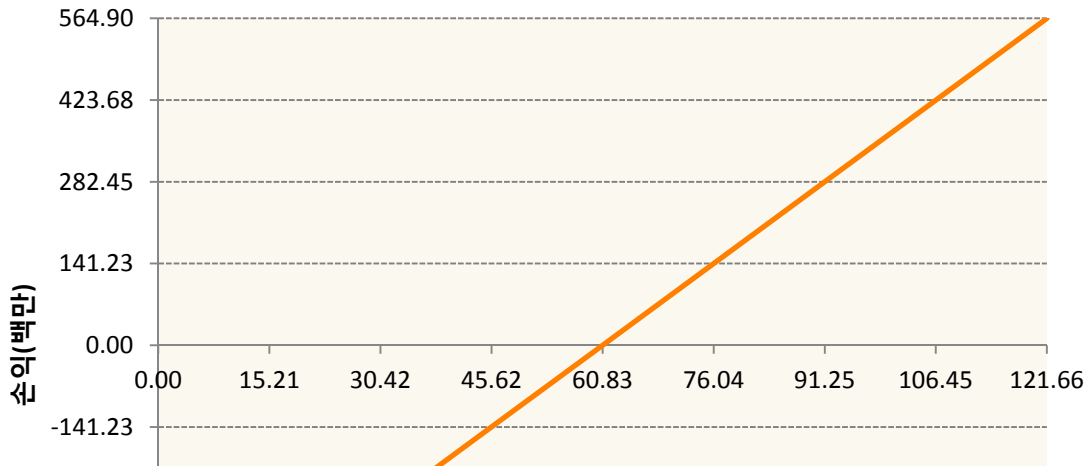
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,467	292	2,175	

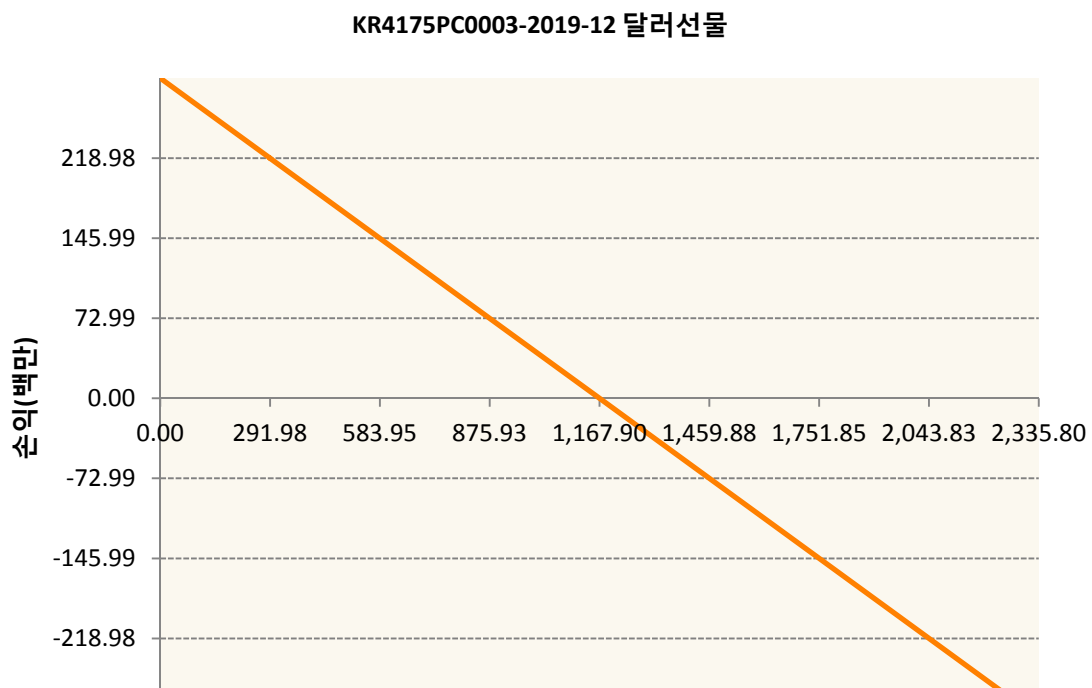
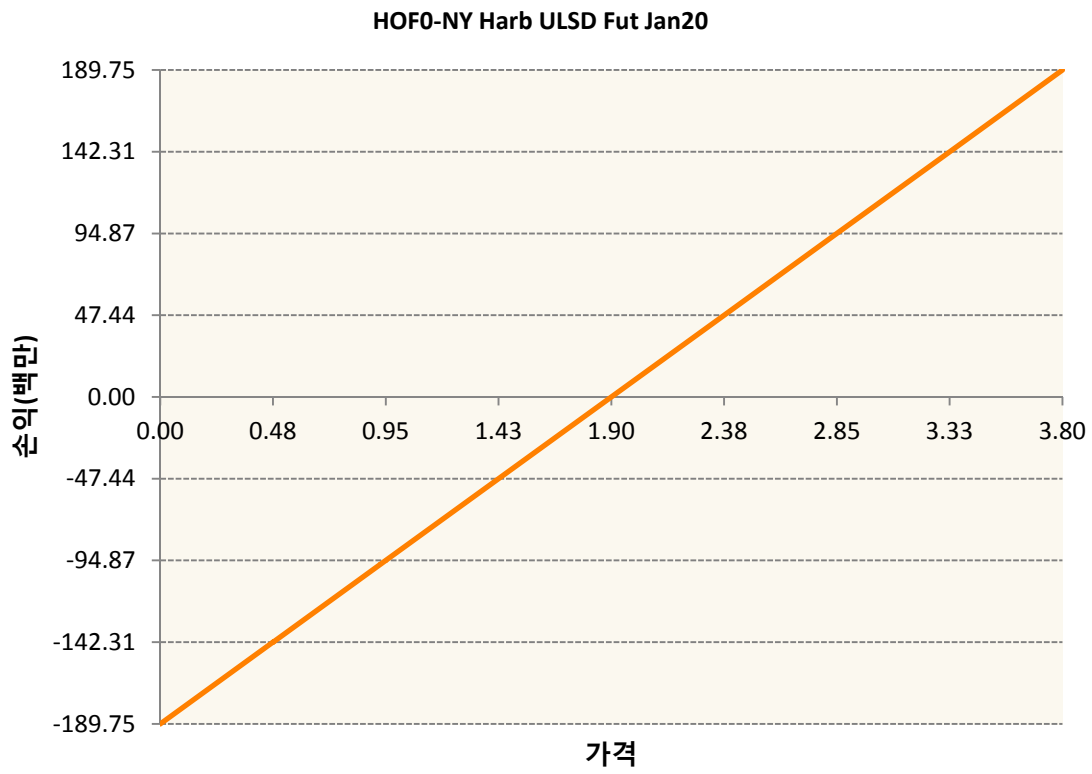
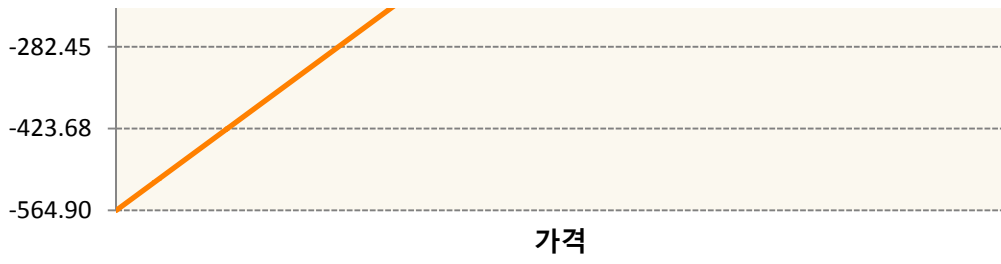
### 2. 만기시점의 손익구조

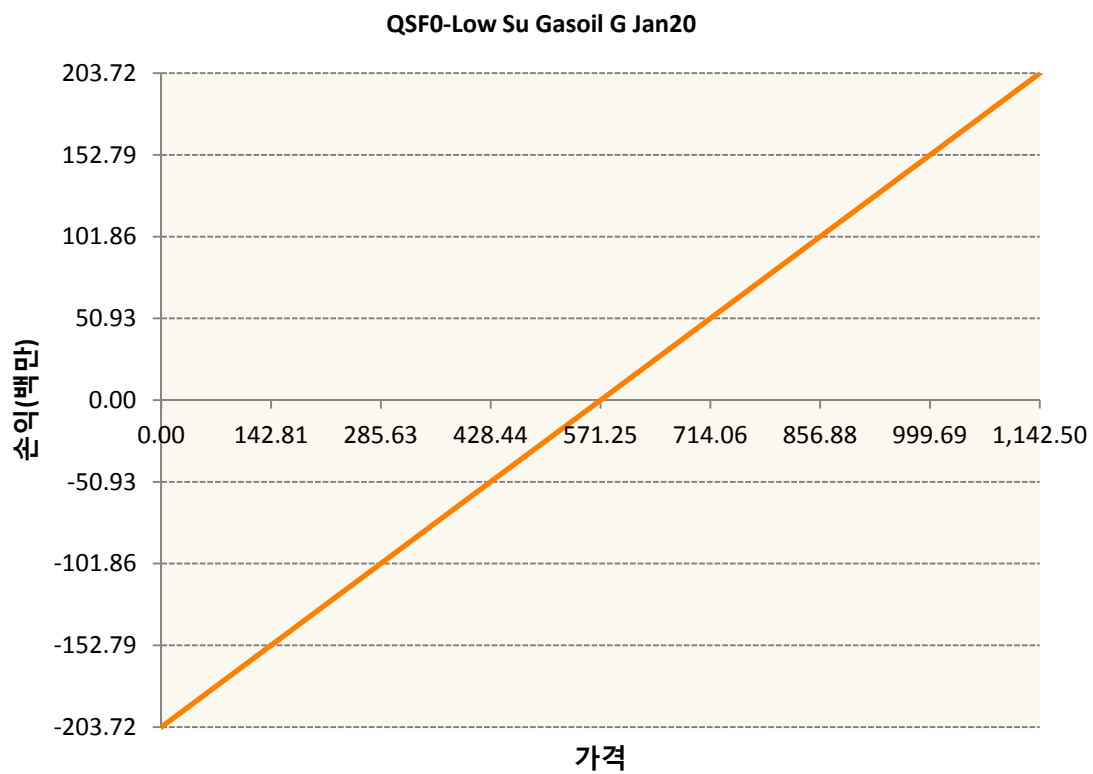
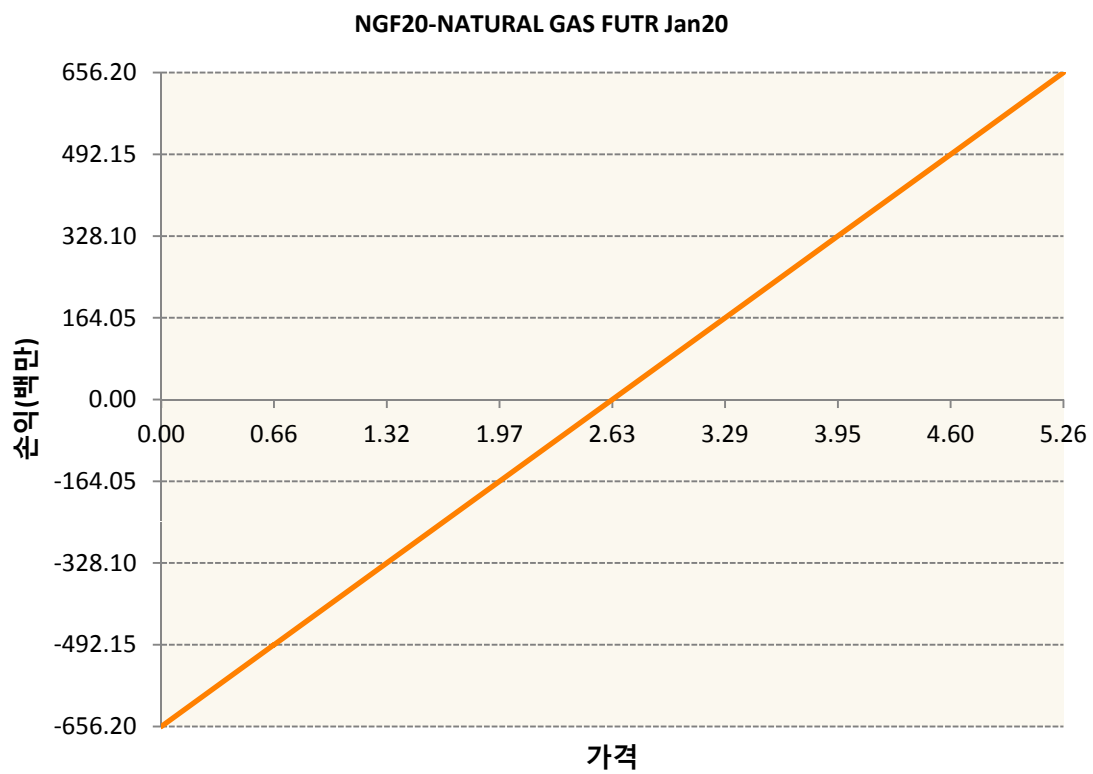
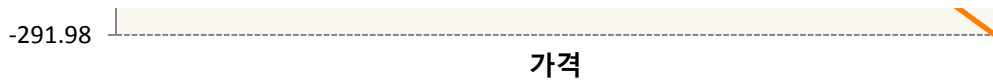
CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20



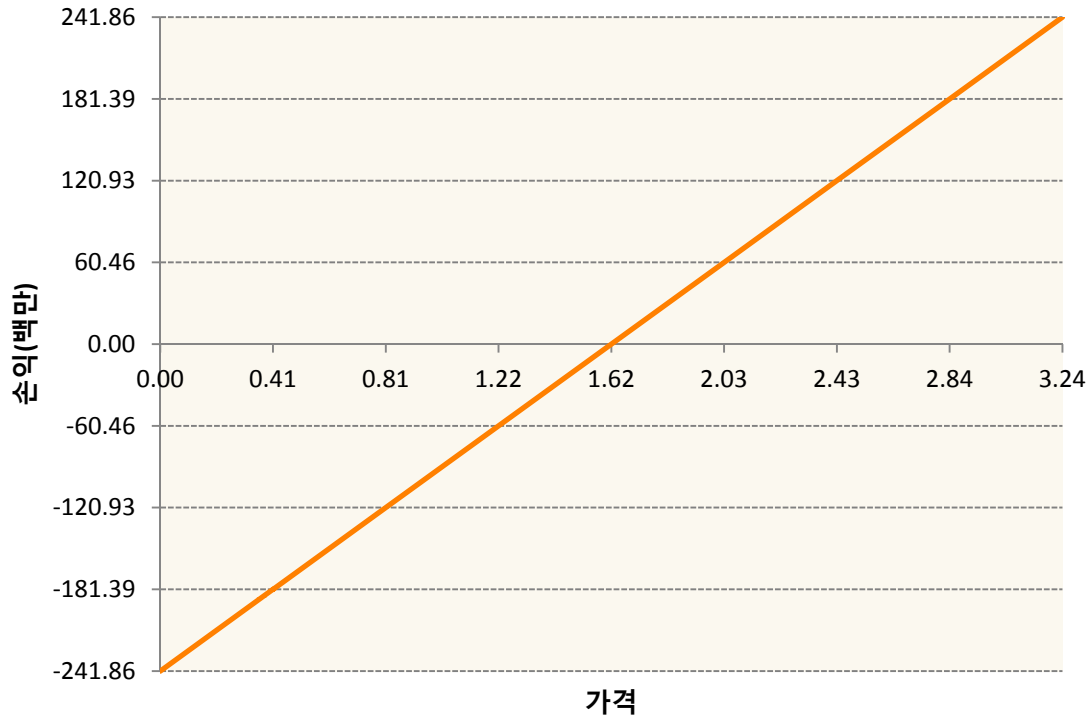
COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20







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	52
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	16
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	19

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

(단위:백만원)

409

공시일	2019-11-20
기준일	2019-11-19

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

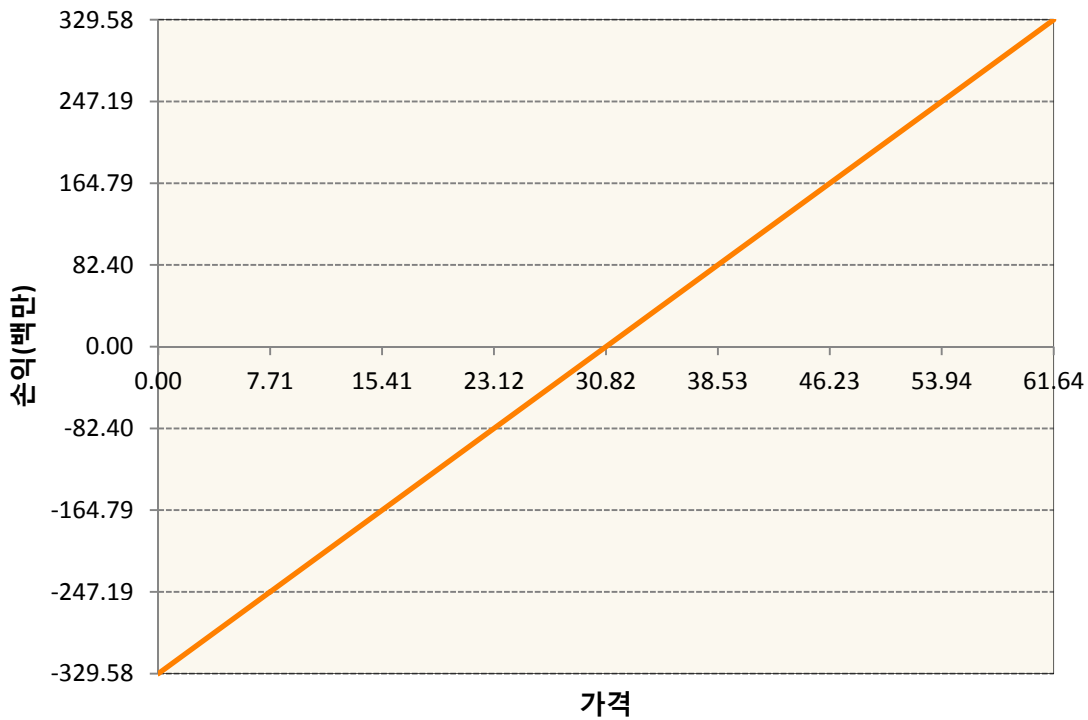
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

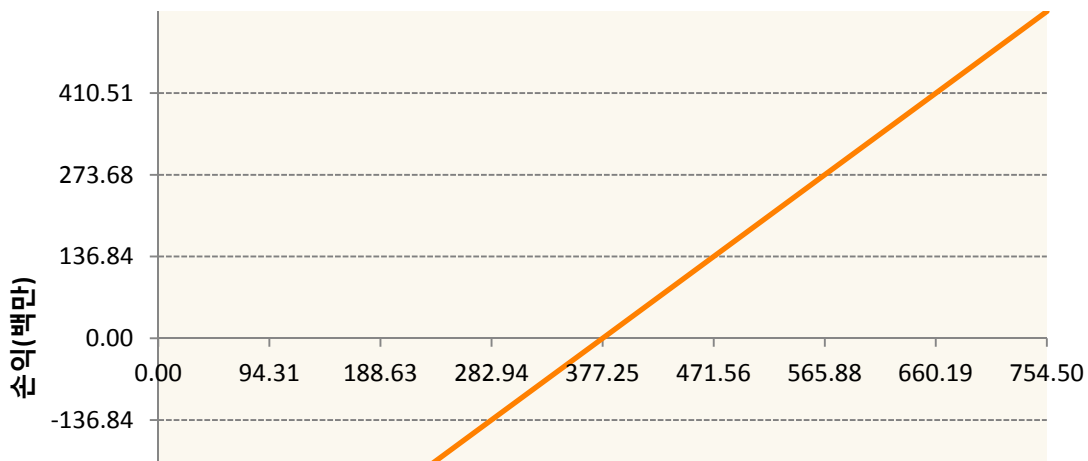
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,797	93	2,704	

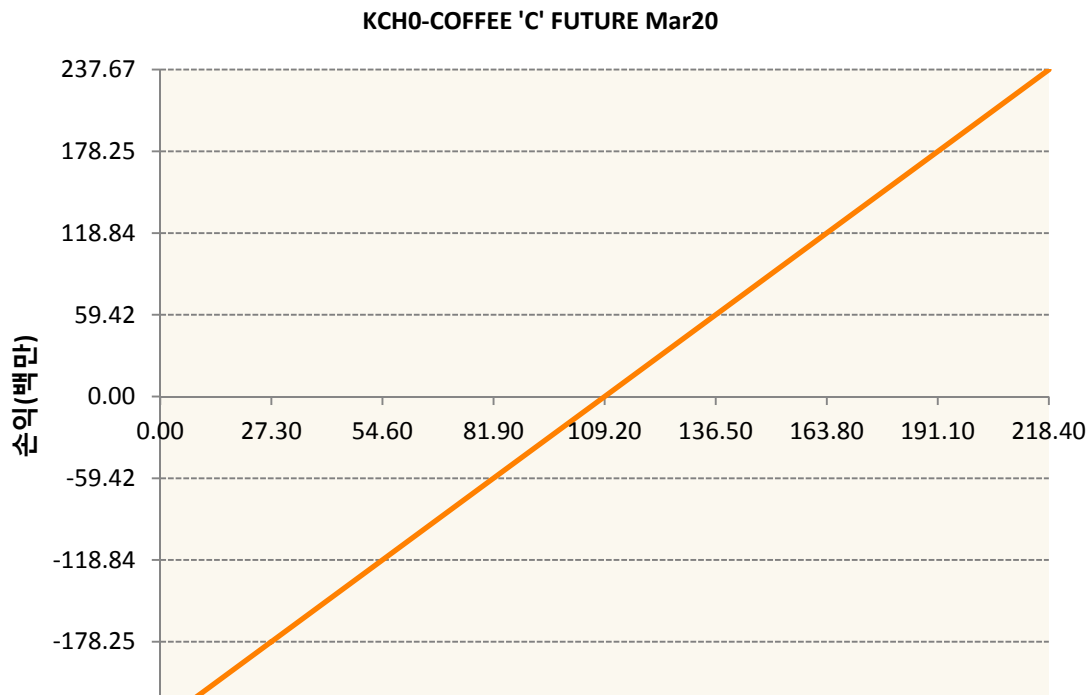
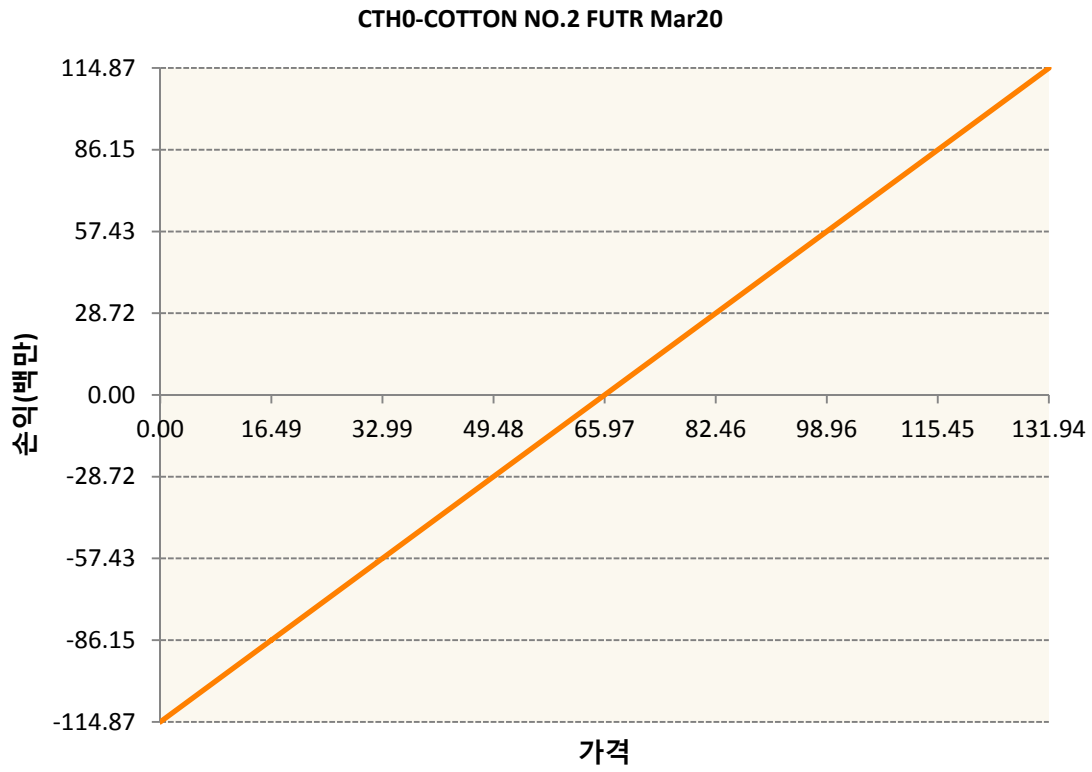
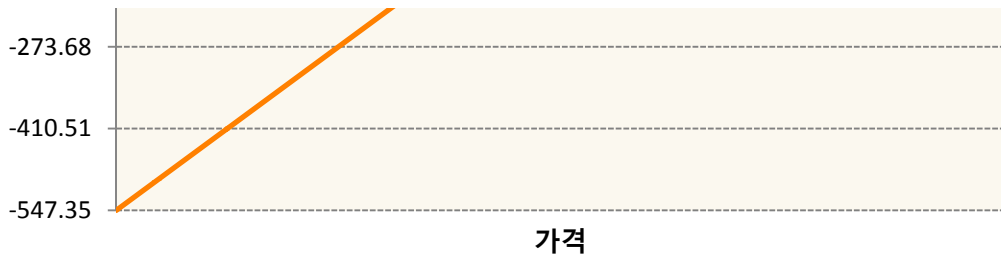
### 2. 만기시점의 손익구조

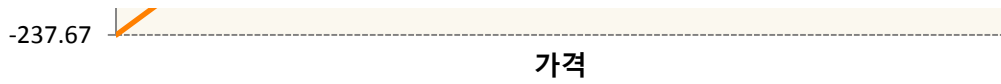
**BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20**



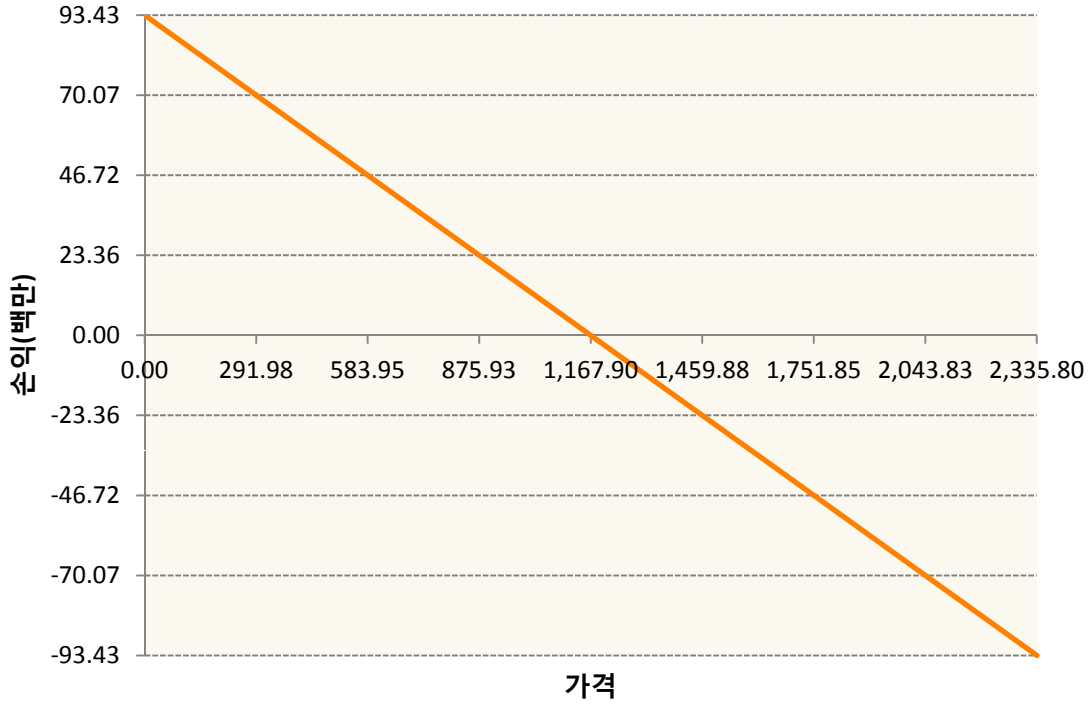
**CH0-CORN FUTURE Mar20**



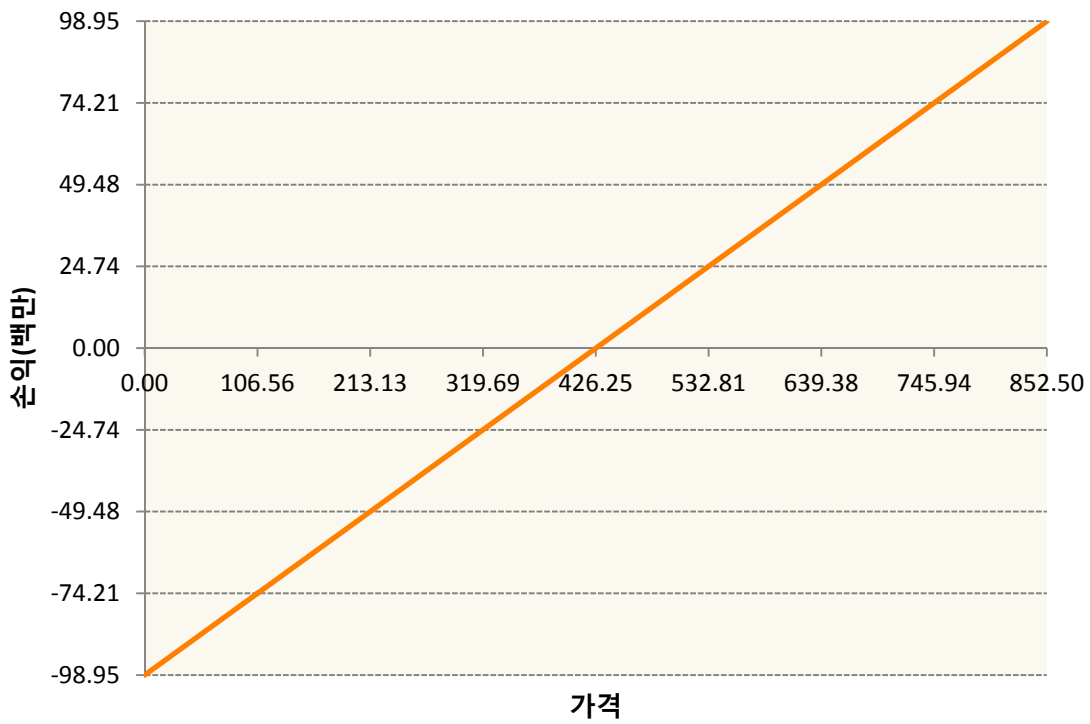




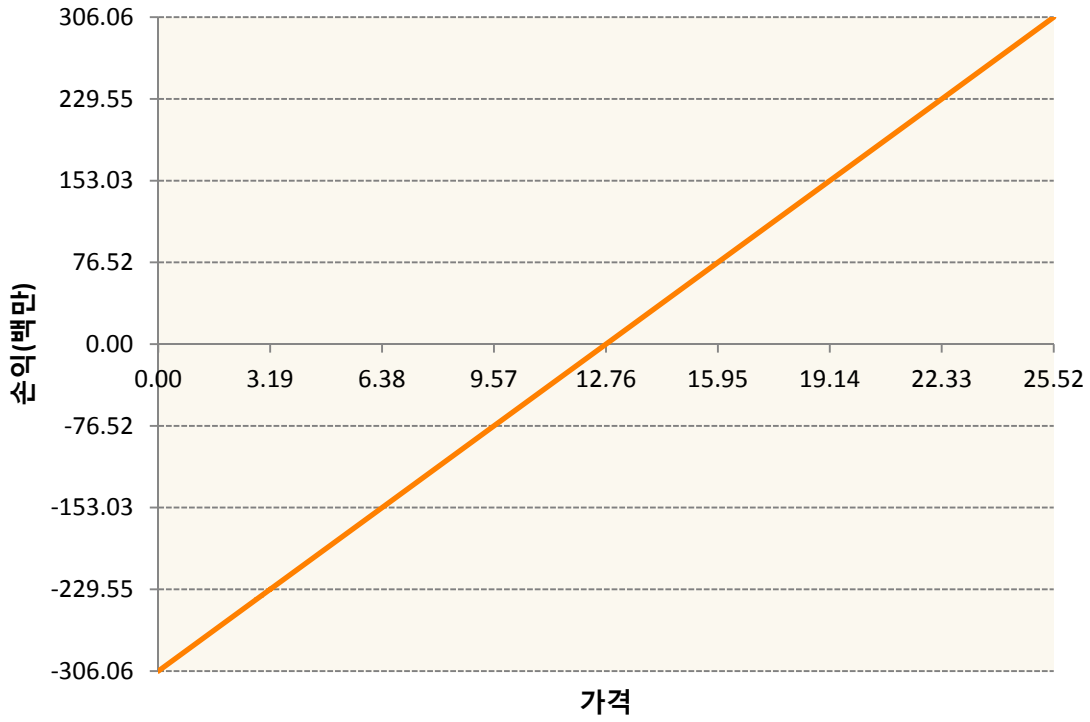
KR4175PC0003-2019-12 달러선물



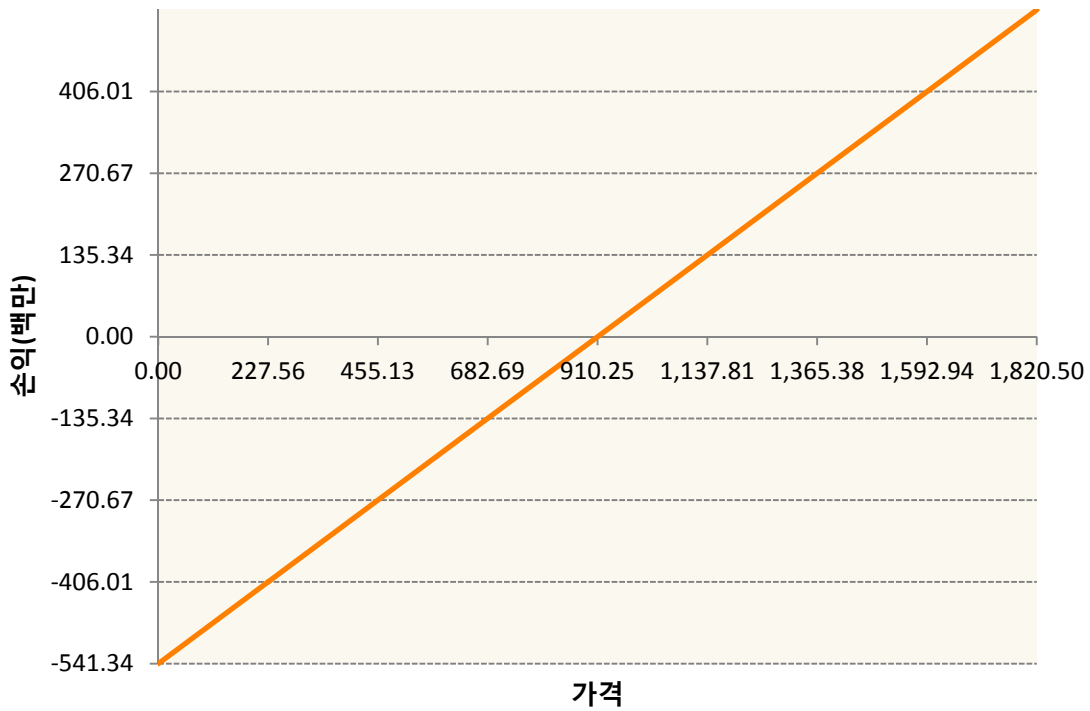
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



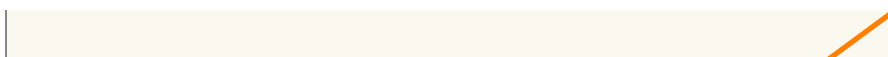
SBH0-Sugar Mar20

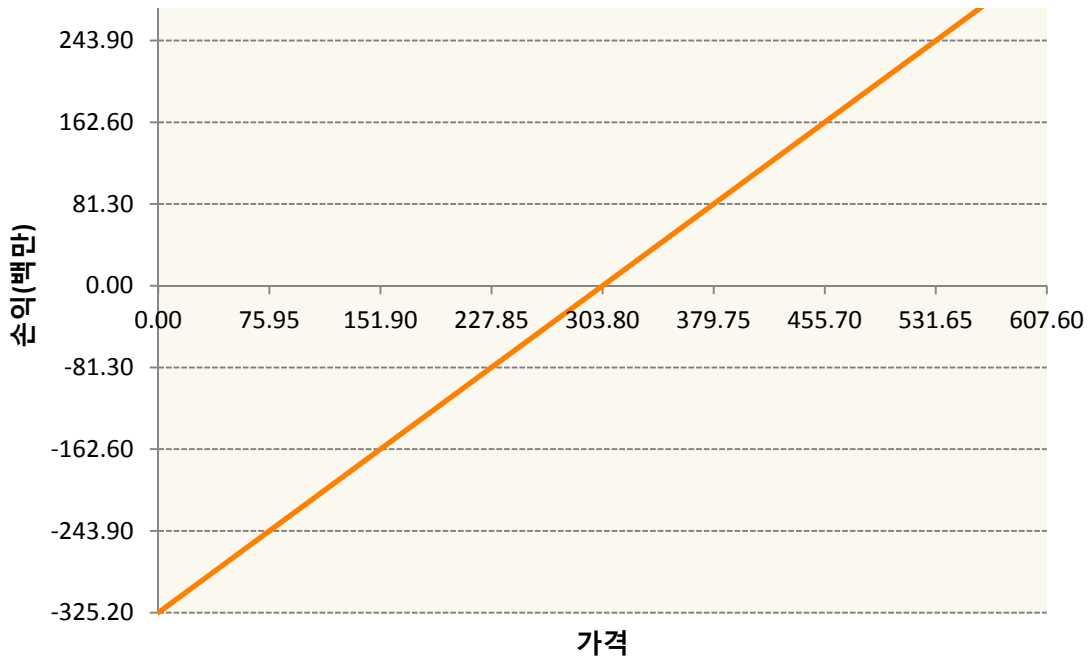


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20

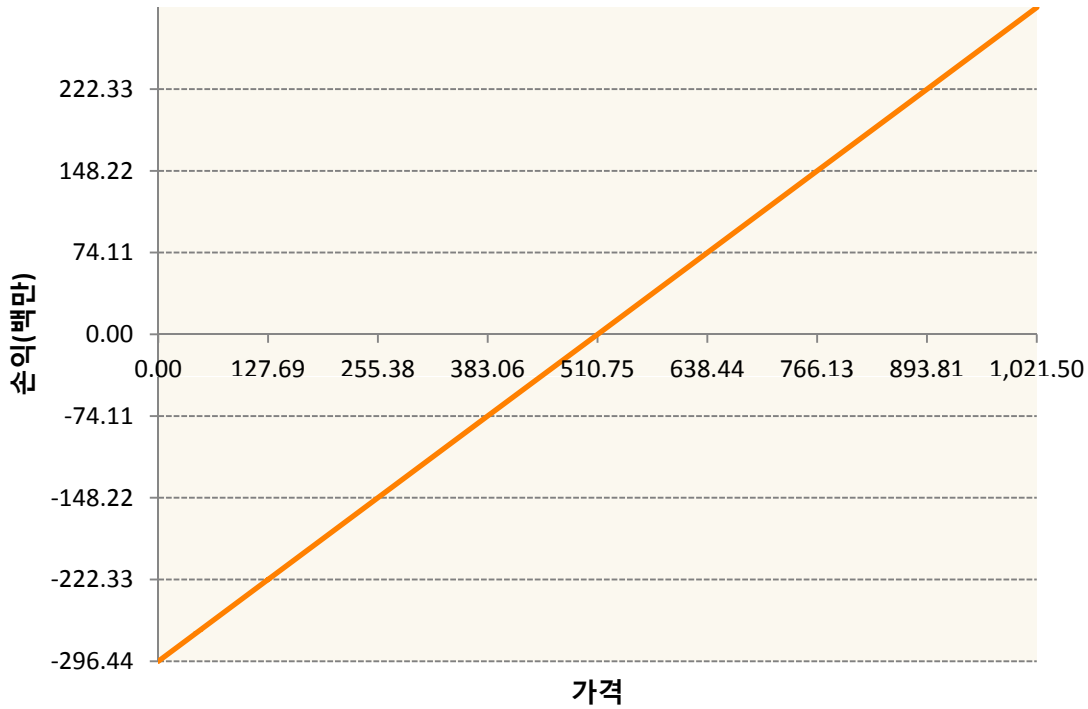


SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





WHO-WHEAT FUTURE(CBT) Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF0	SOYBEAN OIL FUTR Jan20	26
CH0	CORN FUTURE Mar20	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	43
SMF0	SOYBEAN MEAL FUTR Jan20	26
WH0	WHEAT FUTURE(CBT) Mar20	24

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

(단위:백만원)

**245**