

공시일	2019-11-21
기준일	2019-11-20

포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

84

공시일	2019-11-21
기준일	2019-11-20

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	2019-11-21
기준일	2019-11-20

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)

381

SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)

139

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

756

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-11-21
기준일	2019-11-20

유로인덱스모(주식-파생형)

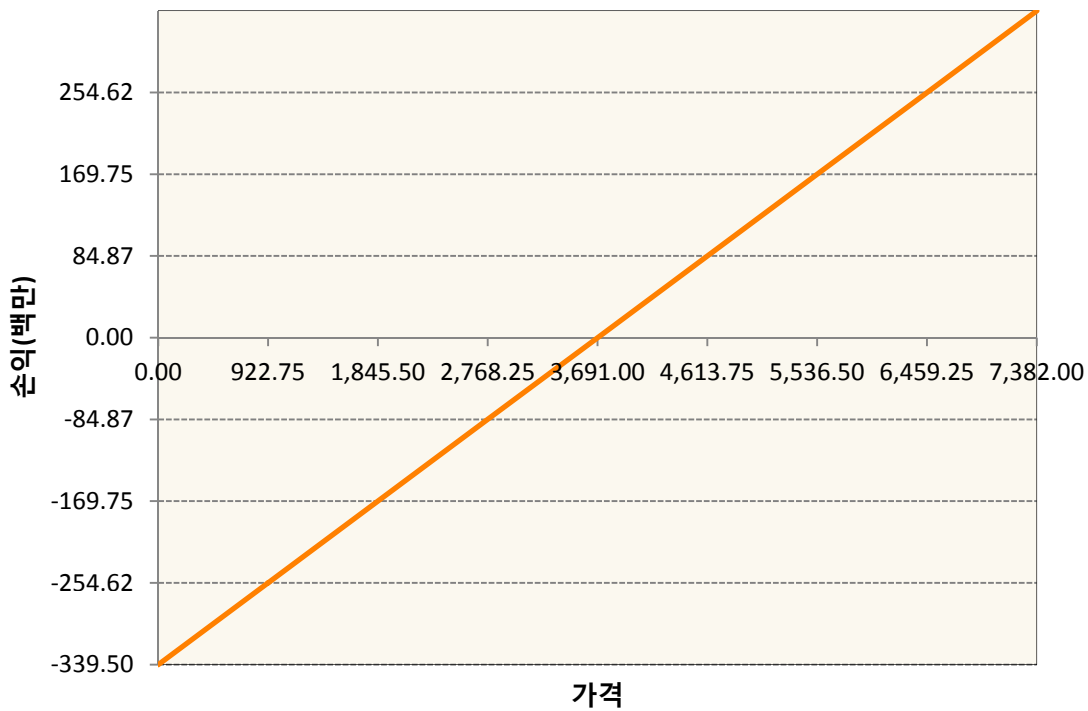
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	339	0	339	

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	2019-11-21
기준일	2019-11-20

차이나인덱스모(주식-파생형)

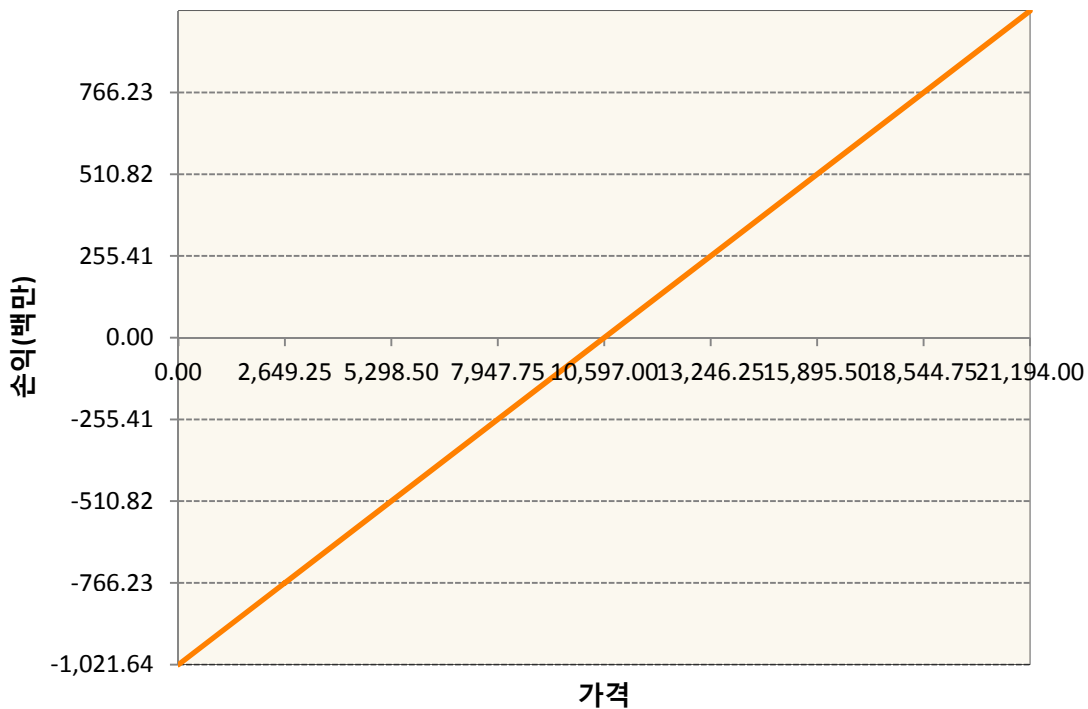
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,022	0	1,022	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCX9-HSCEI Futures Nov19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCX9	HSCEI Futures Nov19	82
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

73

공시일	2019-11-21
기준일	2019-11-20

커버드콜모(주식혼합-파생형)

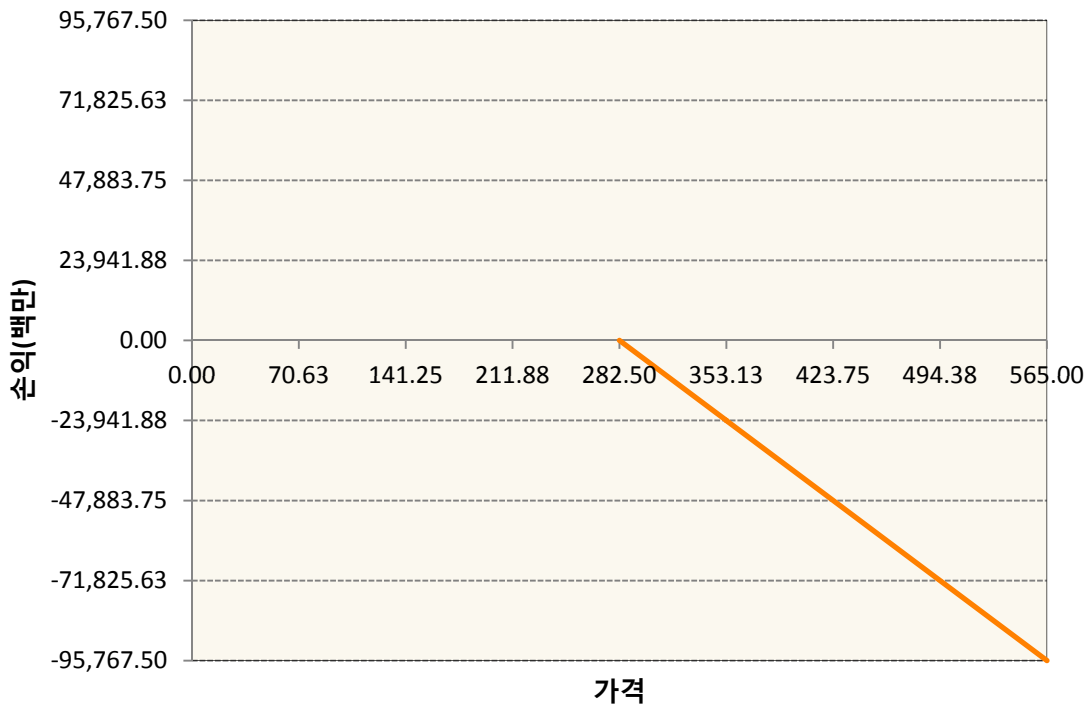
1. 계약금액

(단위:백만원)

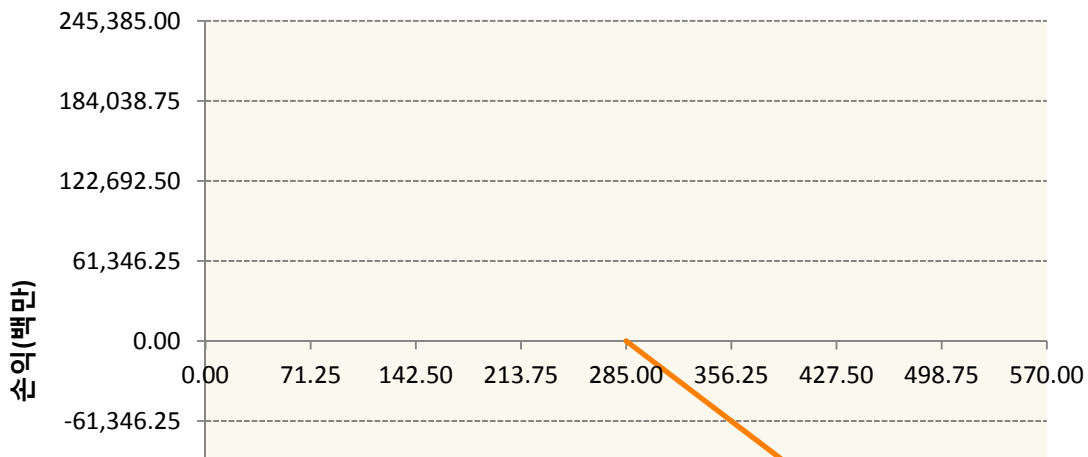
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	498,456	-498,456	장내

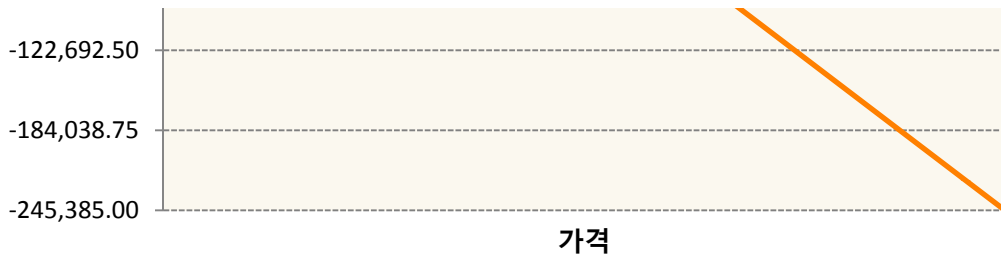
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PC2825-2019-12 콜282.5

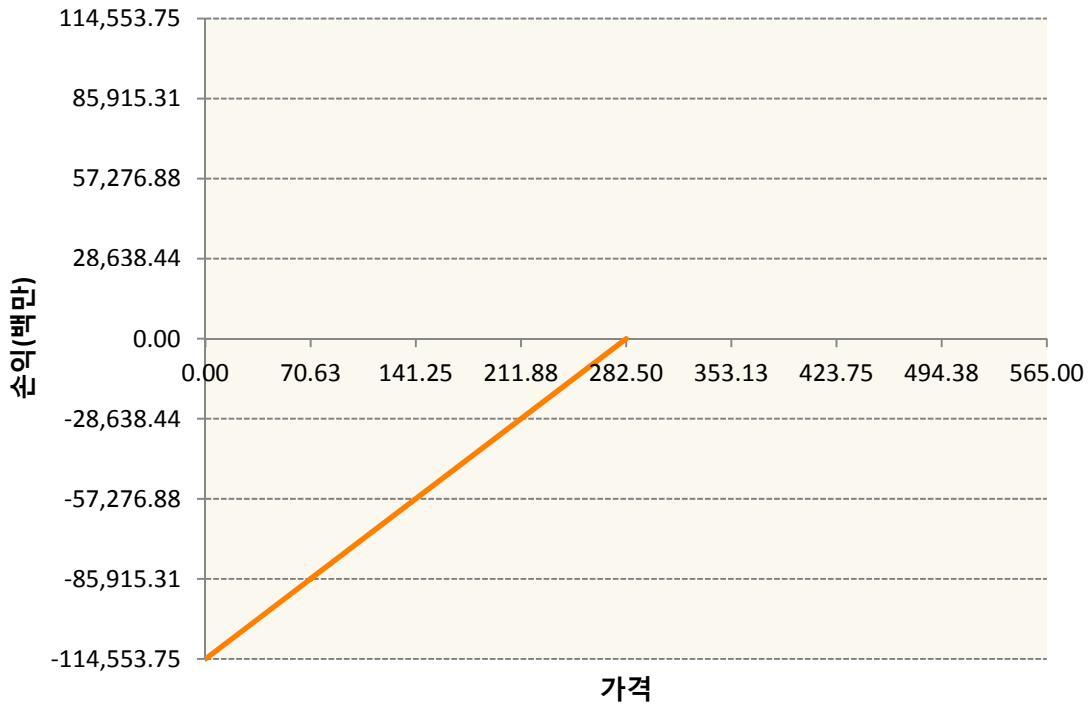


KR4201PC2858-2019-12 콜285

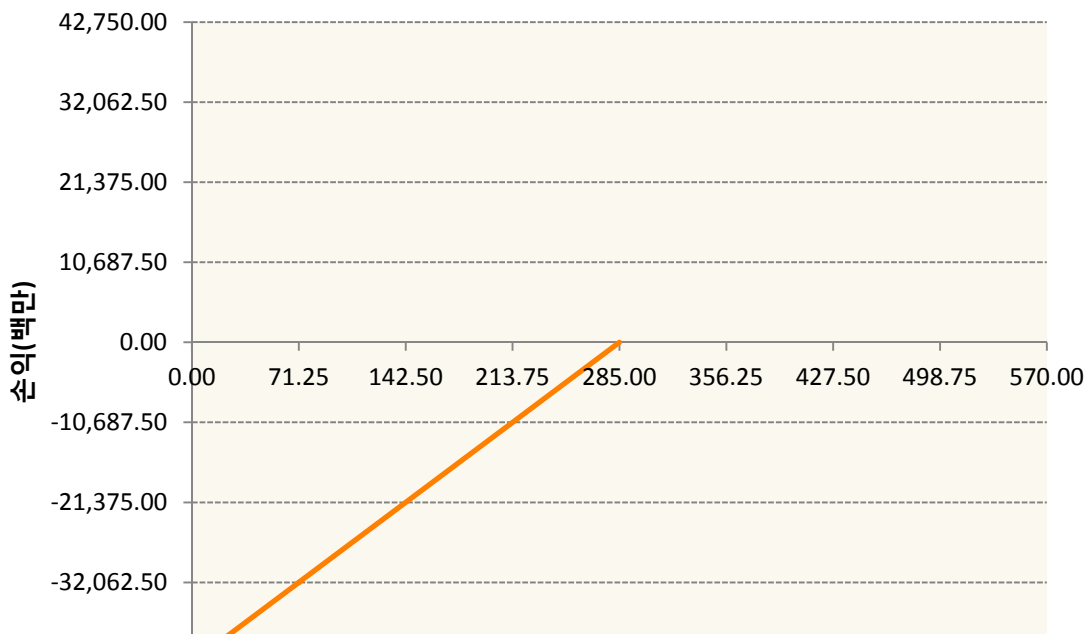




KR4301PC2824-2019-12 풋282.5



KR4301PC2857-2019-12 풋285



-42,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PC2825		2019-12 콜282.5						5,836
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,466	2,402	2,323	2,230	2,125	2,008	1,882	
-5.33%	2,226	2,100	1,961	1,812	1,654	1,489	1,318	
-2.67%	1,672	1,483	1,289	1,091	890	687	482	
0%	660	440	220	0	-220	-440	-660	
2.67%	-862	-1,063	-1,269	-1,477	-1,687	-1,899	-2,113	
5.33%	-2,826	-2,974	-3,134	-3,304	-3,481	-3,664	-3,852	
8.00%	-5,092	-5,181	-5,287	-5,407	-5,540	-5,683	-5,836	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						14,114
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5,379	5,254	5,091	4,892	4,660	4,399	4,112	
-5.33%	4,932	4,663	4,356	4,019	3,656	3,271	2,867	
-2.67%	3,823	3,384	2,926	2,454	1,969	1,476	974	
0%	1,660	1,108	555	0	-556	-1,112	-1,670	
2.67%	-1,780	-2,325	-2,875	-3,428	-3,984	-4,541	-5,100	
5.33%	-6,419	-6,852	-7,308	-7,781	-8,270	-8,770	-9,279	
8.00%	-11,950	-12,229	-12,548	-12,902	-13,283	-13,688	-14,114	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						7,739
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-7,703	-7,704	-7,705	-7,709	-7,715	-7,725	-7,739	
-5.33%	-4,667	-4,680	-4,700	-4,726	-4,760	-4,800	-4,847	
-2.67%	-1,788	-1,858	-1,936	-2,020	-2,110	-2,204	-2,302	
0%	382	254	127	0	-127	-255	-382	
2.67%	1,371	1,288	1,197	1,101	1,001	897	790	
5.33%	1,596	1,575	1,545	1,507	1,461	1,407	1,347	
8.00%	1,620	1,618	1,613	1,604	1,591	1,573	1,550	
KR4301PC2857		2019-12 풋285						3,015
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,008	-3,008	-3,008	-3,009	-3,010	-3,012	-3,015	
-5.33%	-1,882	-1,884	-1,888	-1,894	-1,902	-1,912	-1,925	
-2.67%	-785	-802	-823	-846	-873	-901	-931	
0%	133	89	45	0	-45	-91	-137	
2.67%	643	603	562	519	476	432	388	

5.33%	794	779	762	741	717	690	662
8.00%	815	813	809	803	795	785	772

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

(단위:백만원)

31,067

공시일	2019-11-21
기준일	2019-11-20

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

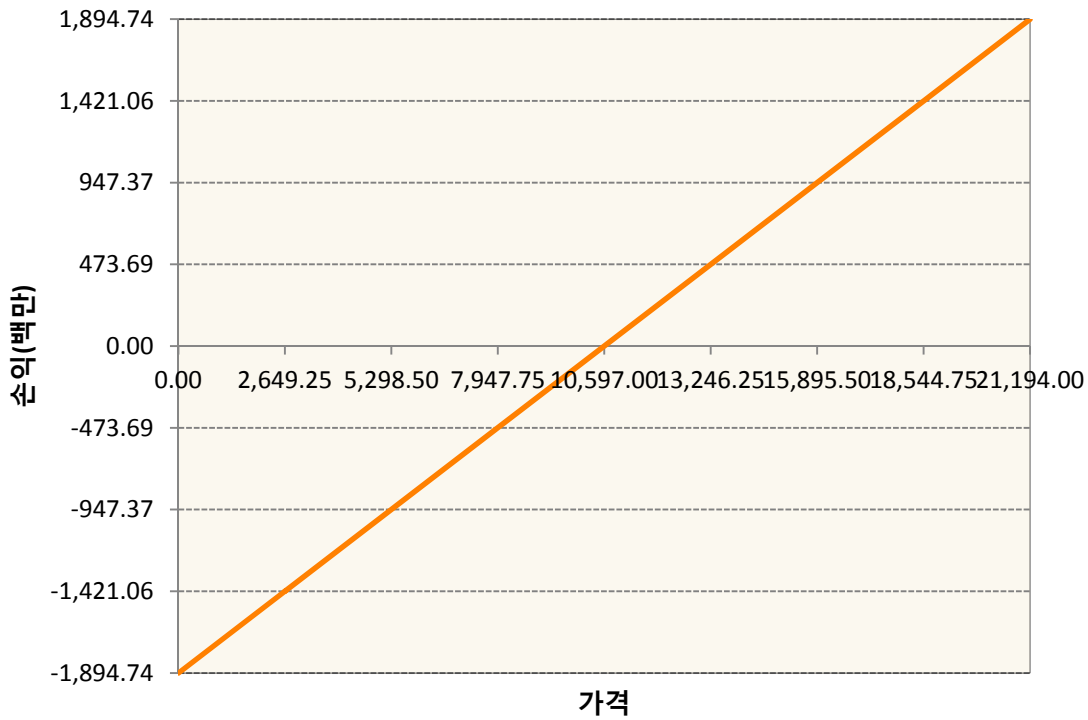
1. 계약금액

(단위:백만원)

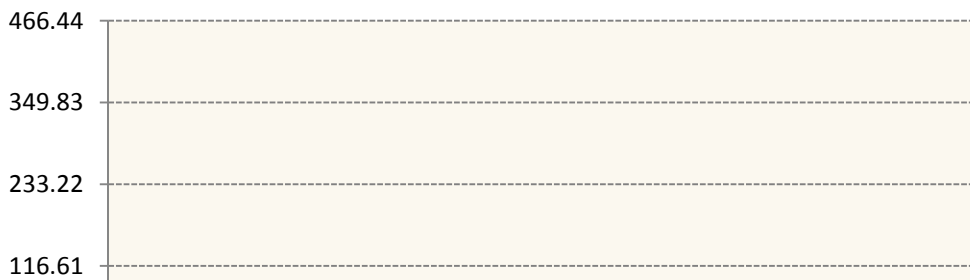
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,895	0	1,895	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,936	-4,936	장내
누계	통화	선도	673	4,883	-4,210	장외

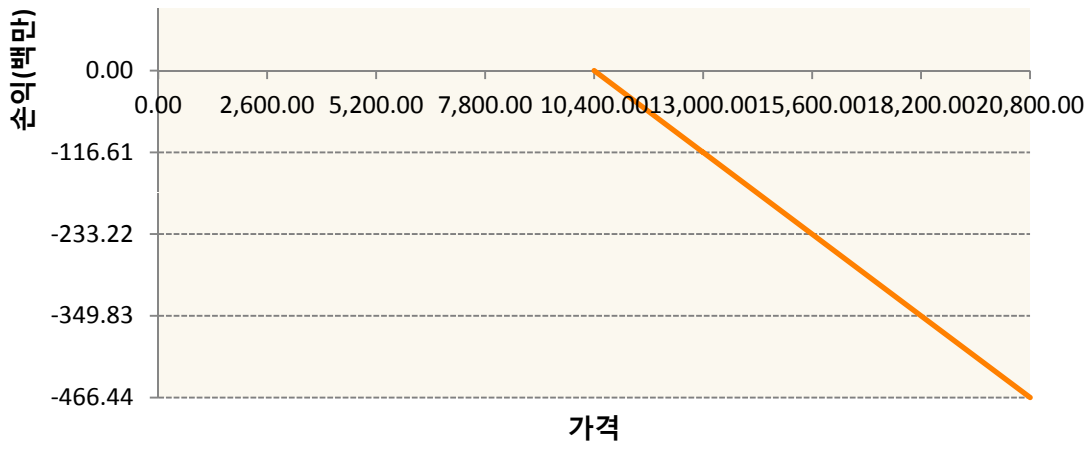
2. 만기시점의 손익구조

HCX9-HSCEI Futures Nov19

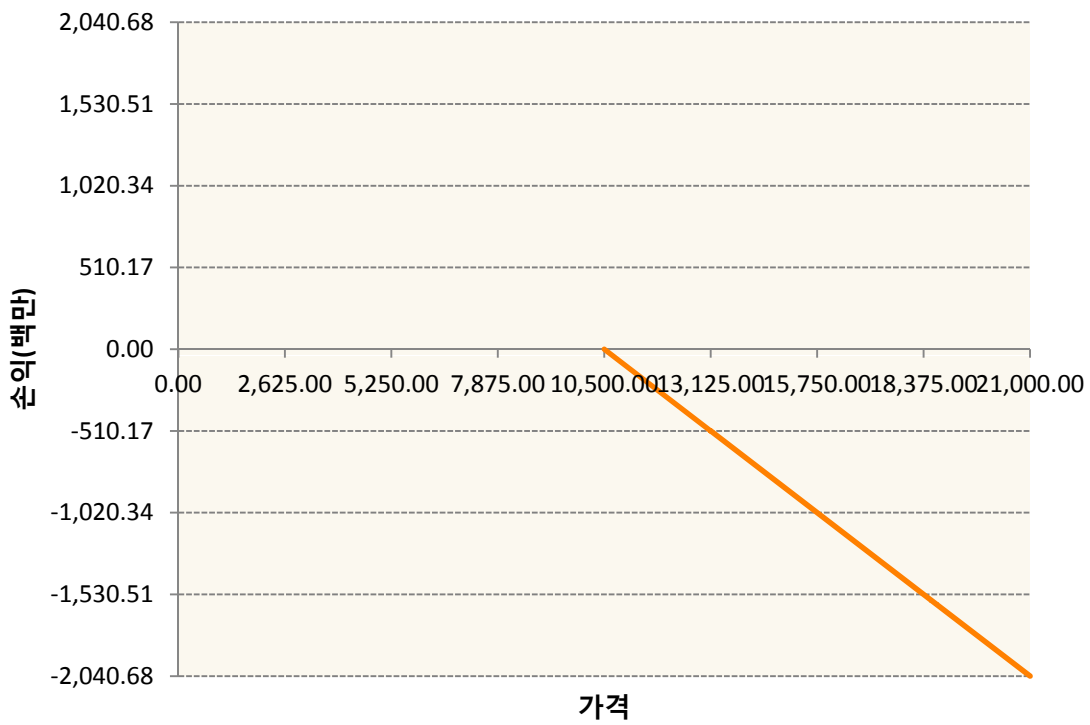


OHHIX9-C104-HSCEI

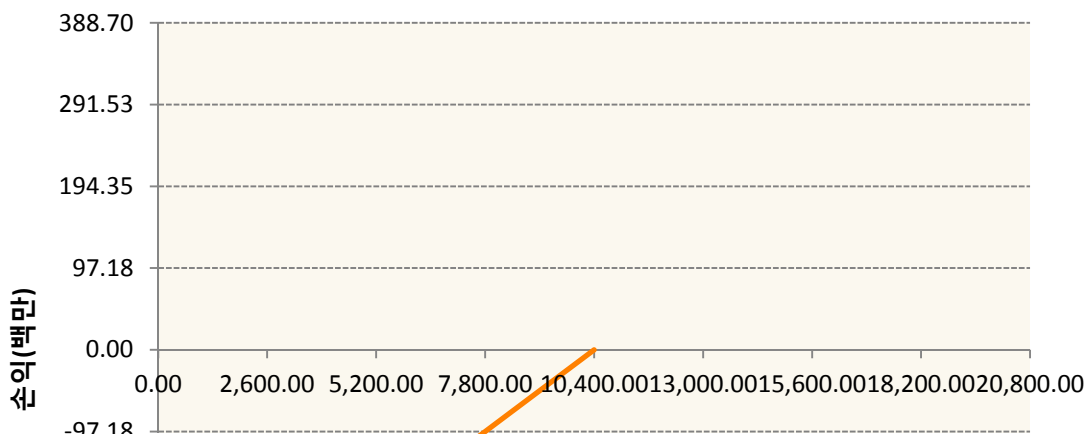


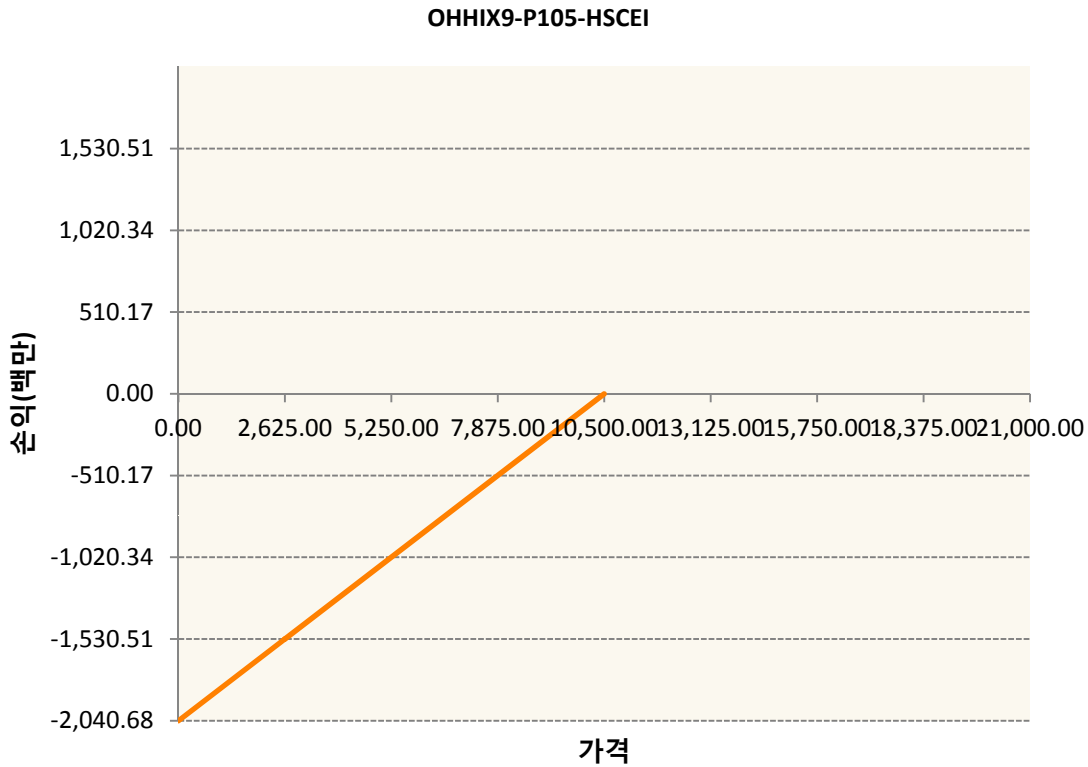
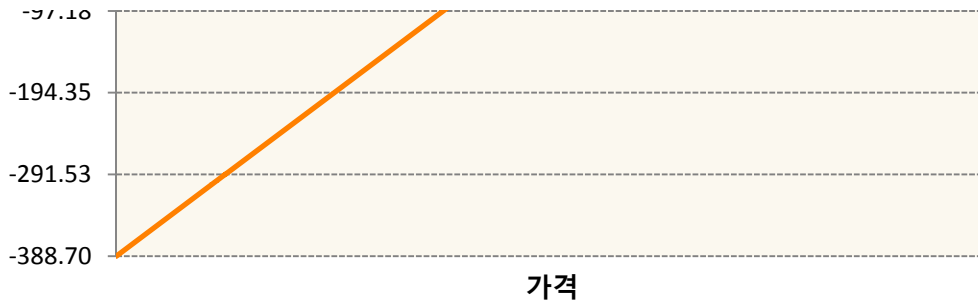


OHHIX9-C105-HSCEI



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
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	168
HCX9 HSCEI Futures Nov19	152
OHHIX9-C1C HSCEI	37
OHHIX9-C1C HSCEI	163
OHHIX9-P10 HSCEI	31
OHHIX9-P10 HSCEI	163

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

공시일	2019-11-21
기준일	2019-11-20

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

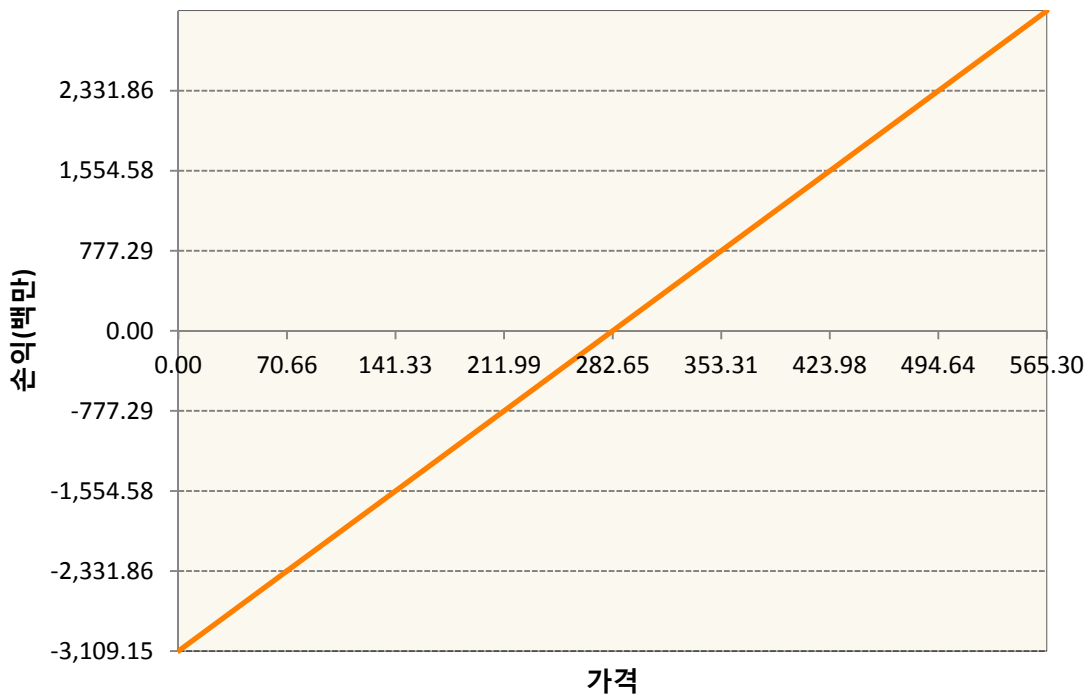
1. 계약금액

(단위:백만원)

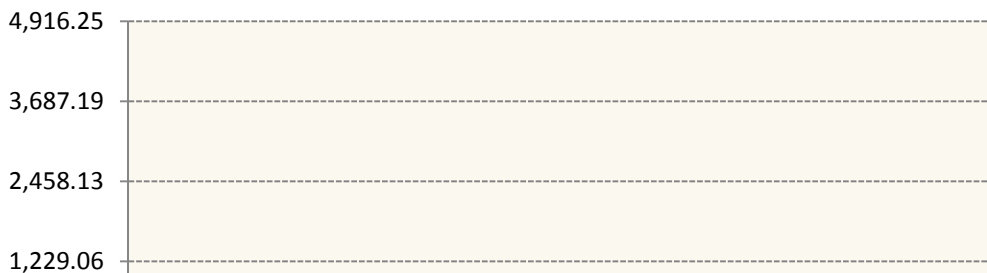
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,109	0	3,109	장내
누계	유가증권	스왑	9,625	0	9,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,728	-9,728	장내

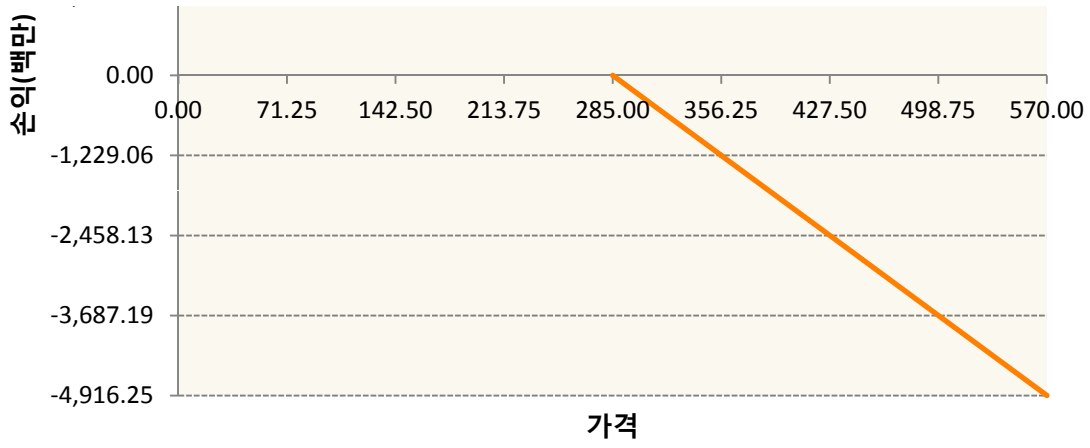
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

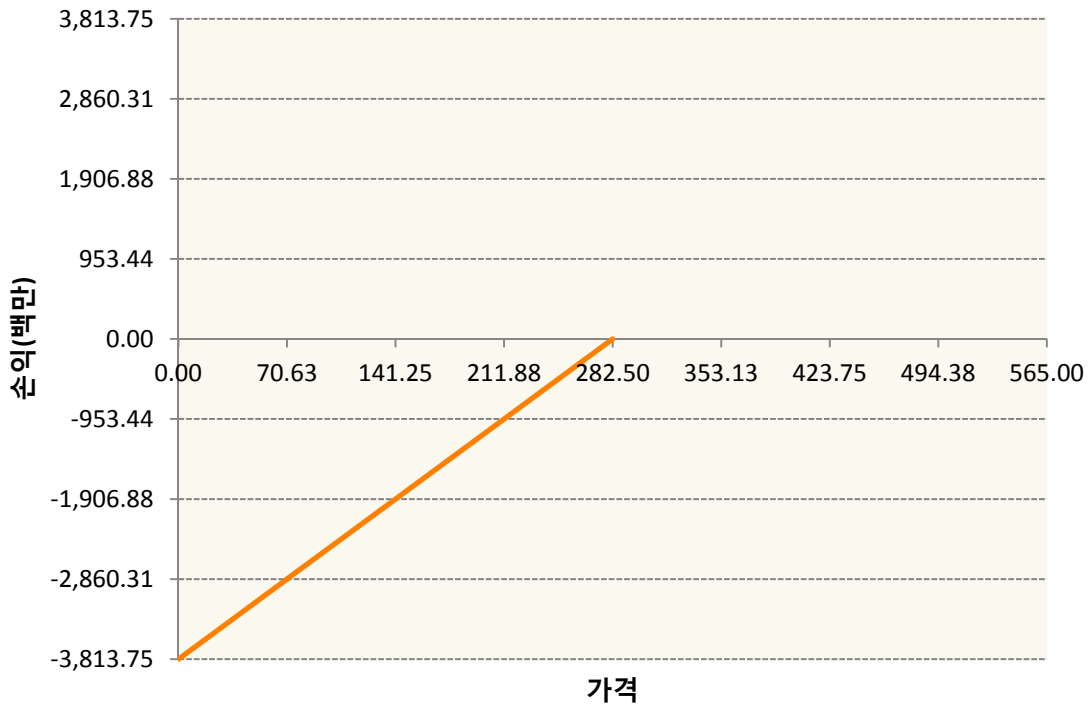


KR4201PC2858-2019-12 콜285

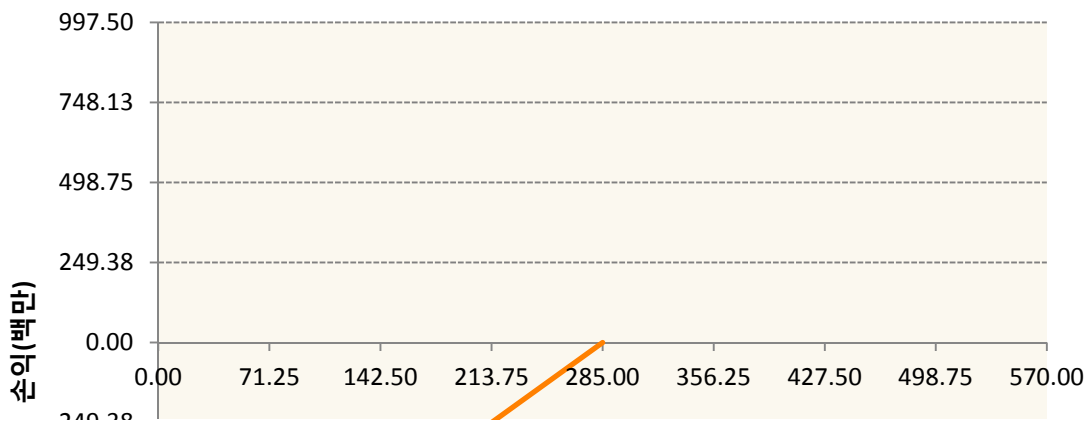


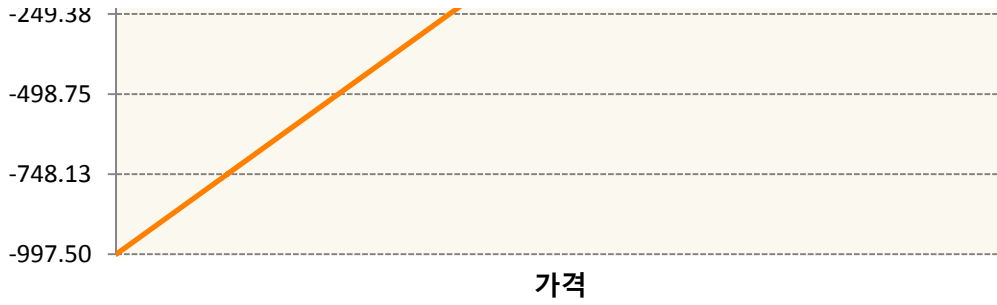


KR4301PC2824-2019-12 풋282.5



KR4301PC2857-2019-12 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						828
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-828	-828	-828	-828	-828	-828	-828	
-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%	828	828	828	828	828	828	828	
KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						248
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-248	-248	-248	-248	-248	-248	-248	
-5.33%	-166	-166	-166	-166	-166	-166	-166	
-2.67%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	83	83	83	83	83	83	83	
5.33%	166	166	166	166	166	166	166	
8.00%	248	248	248	248	248	248	248	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						283
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	108	105	102	98	93	88	82	
-5.33%	99	93	87	81	73	66	57	
-2.67%	77	68	59	49	39	30	20	
0%	33	22	11	0	-11	-22	-33	
2.67%	-36	-47	-58	-69	-80	-91	-102	
5.33%	-129	-137	-146	-156	-166	-176	-186	
8.00%	-239	-245	-251	-258	-266	-274	-283	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						258
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-256	-256	-257	-257	-257	-257	-258
-5.33%	-155	-156	-156	-157	-158	-160	-161
-2.67%	-60	-62	-64	-67	-70	-73	-77
0%	13	8	4	0	-4	-8	-13
2.67%	46	43	40	37	33	30	26
5.33%	53	52	51	50	49	47	45
8.00%	54	54	54	53	53	52	52
KR4301PC2857 2019-12 풋285							70
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70
-5.33%	-44	-44	-44	-44	-44	-45	-45
-2.67%	-18	-19	-19	-20	-20	-21	-22
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	15	14	13	12	11	10	9
5.33%	19	18	18	17	17	16	15
8.00%	19	19	19	19	19	18	18

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

(단위:백만원)

1,662

공시일	2019-11-21
기준일	2019-11-20

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

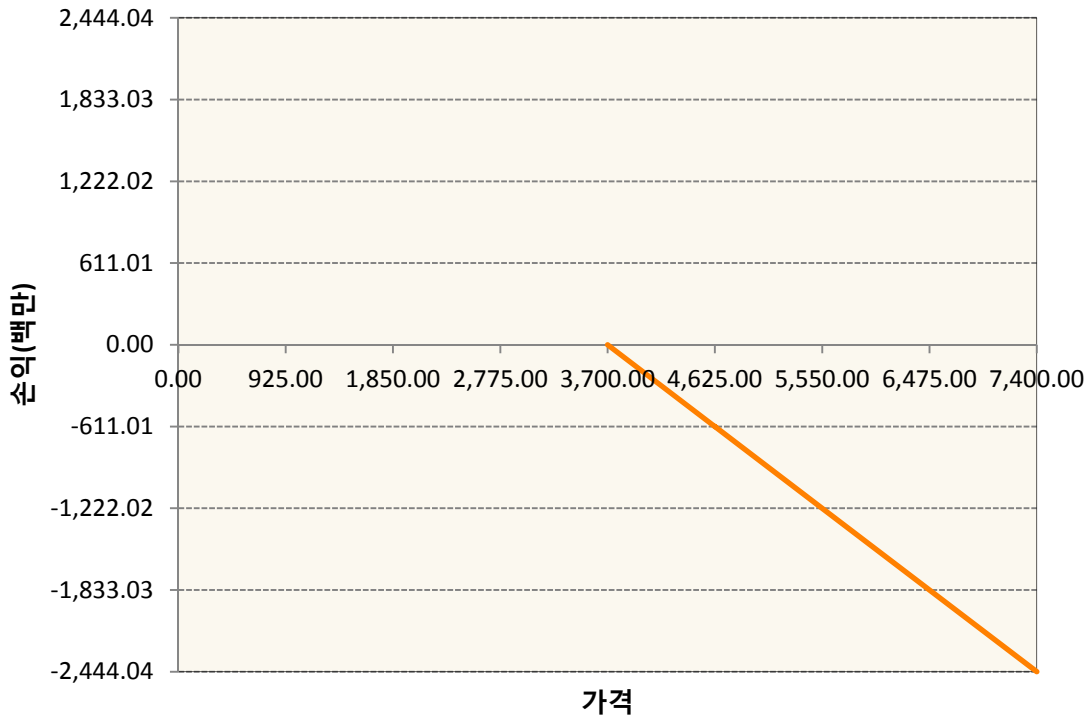
1. 계약금액

(단위:백만원)

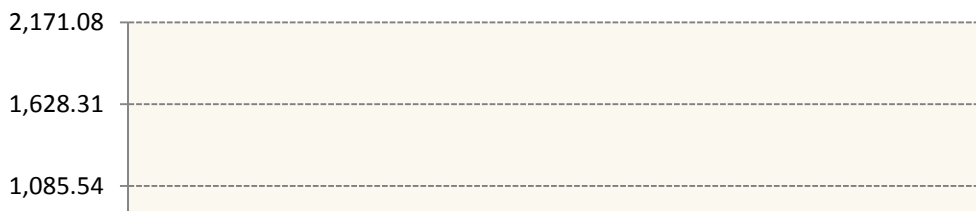
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	2	-2	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,579	0	1,579	
누계	유가증권	스왑	17,710	0	17,710	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,230	-9,230	장내
누계	통화	선도	2,689	6,087	-3,399	장외

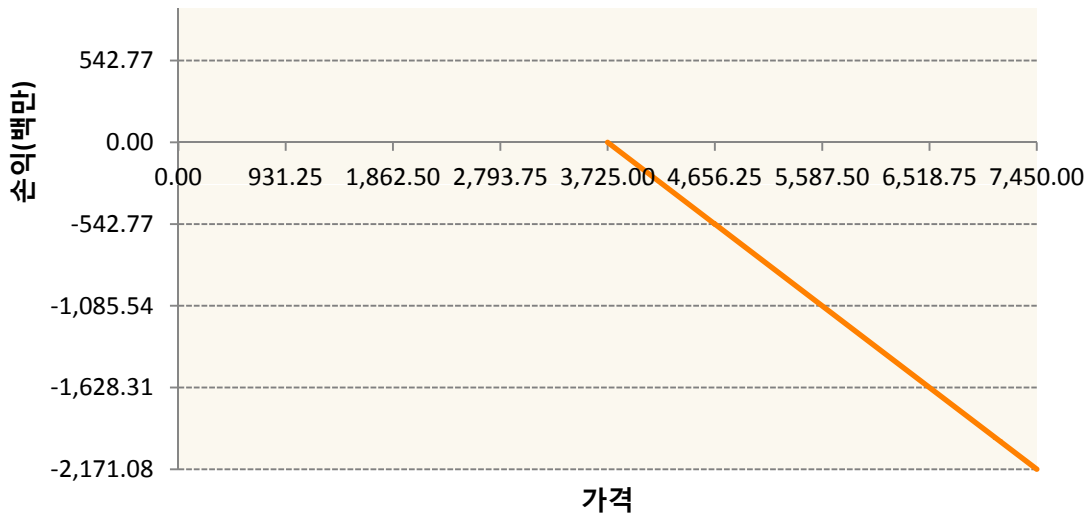
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ9-C3700-EURO STOXX 50

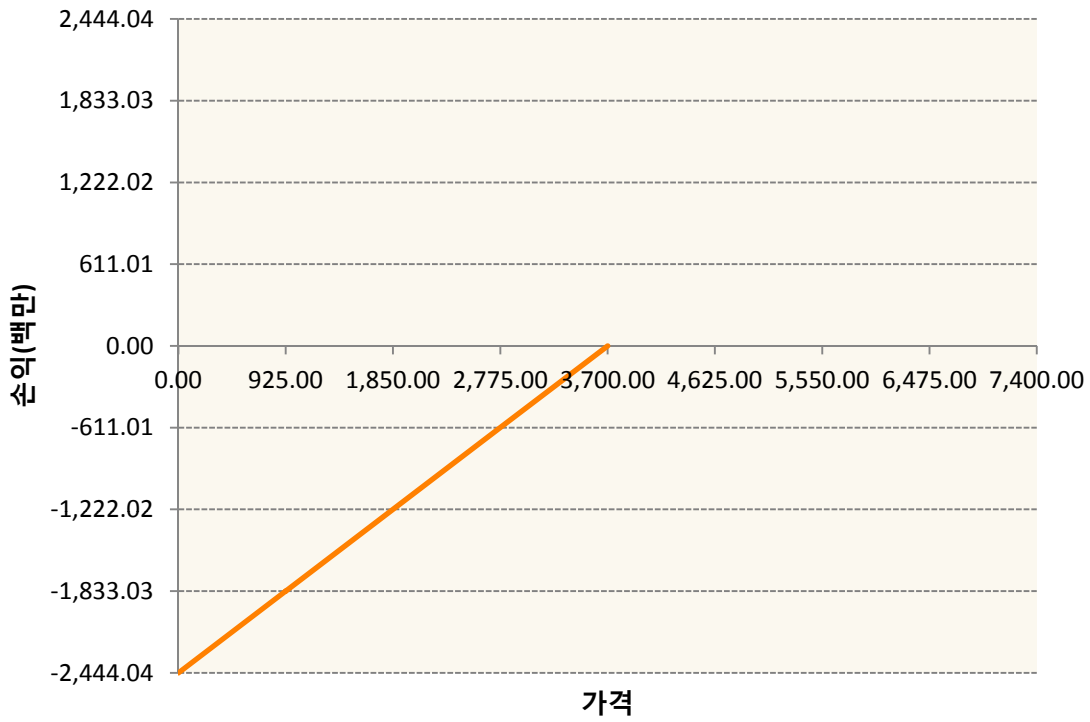


OESXZ9-C3725-EURO STOXX 50

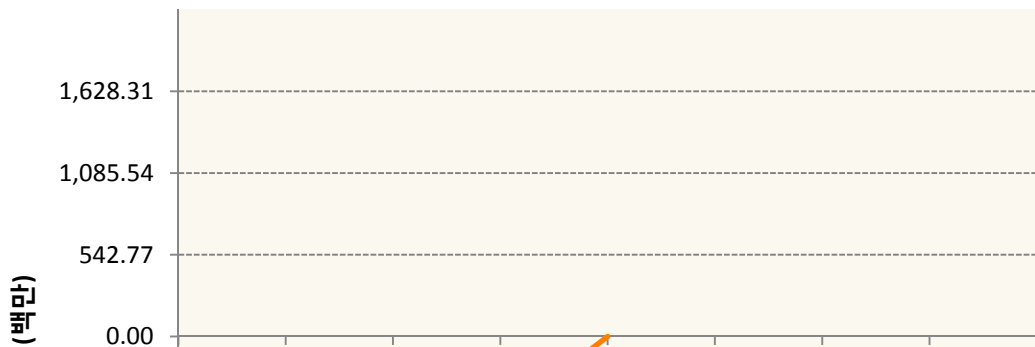


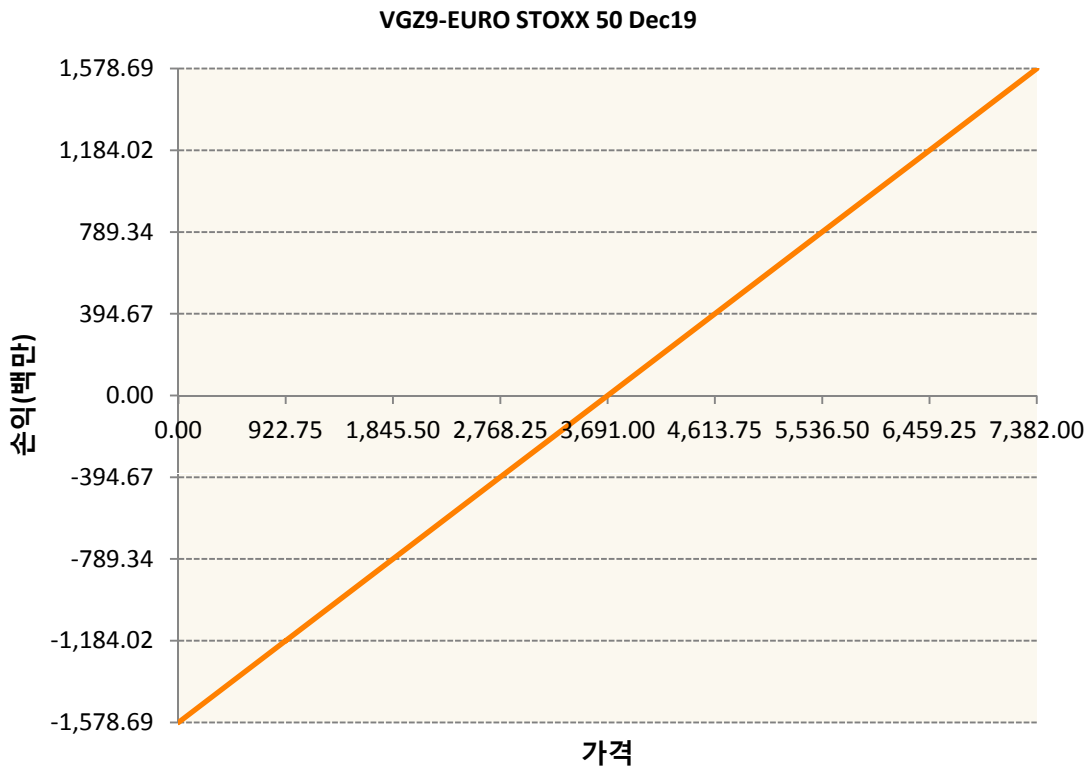
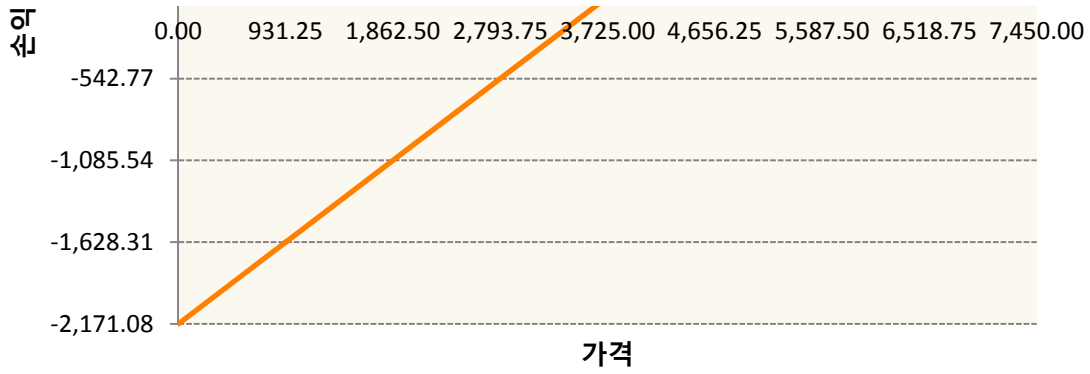


OESXZ9-P3700-EURO STOXX 50



OESXZ9-P3725-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	19
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E	487
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E	163
FX21019X02 EUR/KRW 27-12-19E	52
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	196
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	174
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	196
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	174
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19	126

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

(단위:백만원)

931

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

(단위:백만원)

916

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

(단위:백만원)

80

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

(단위:백만원)

124

공시일	2019-11-21
기준일	2019-11-20

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

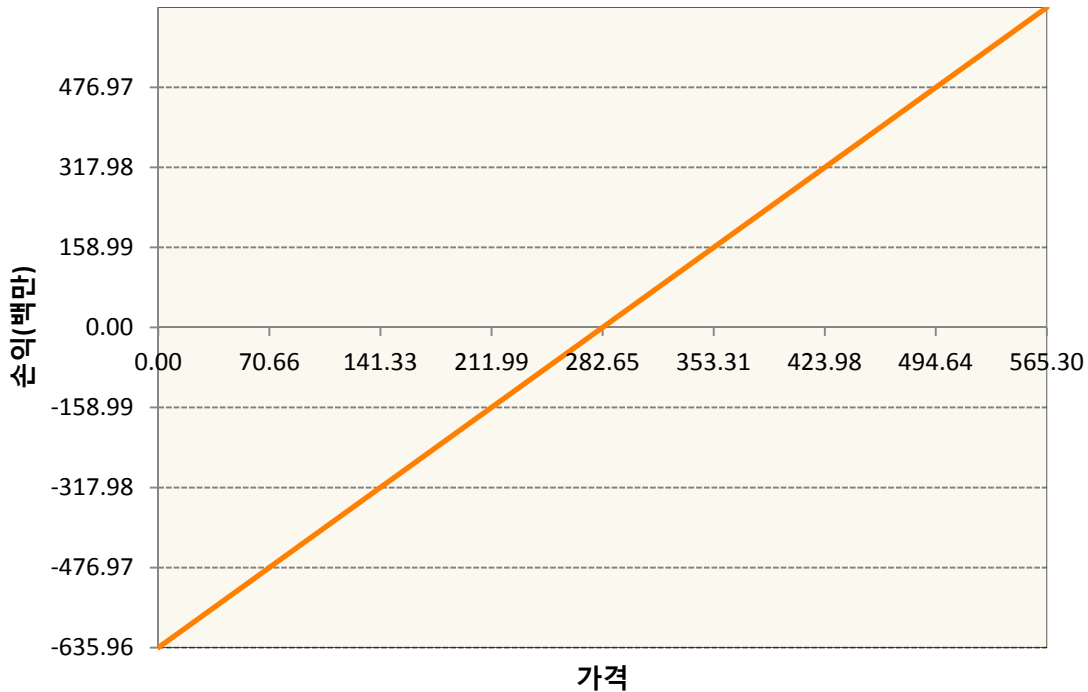
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	636	0	636	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						51
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51	
-5.33%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	17	17	17	17	17	17	17	
5.33%	34	34	34	34	34	34	34	
8.00%	51	51	51	51	51	51	51	

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

(단위:백만원)

40

공시일	2019-11-21
기준일	2019-11-20

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

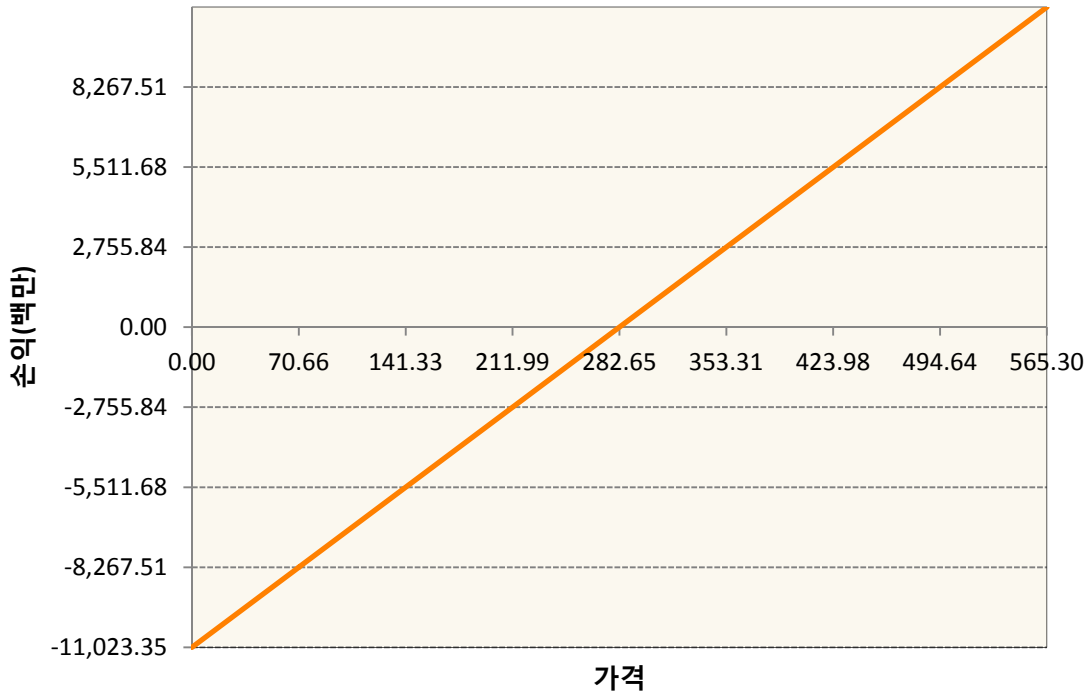
1. 계약금액

(단위:백만원)

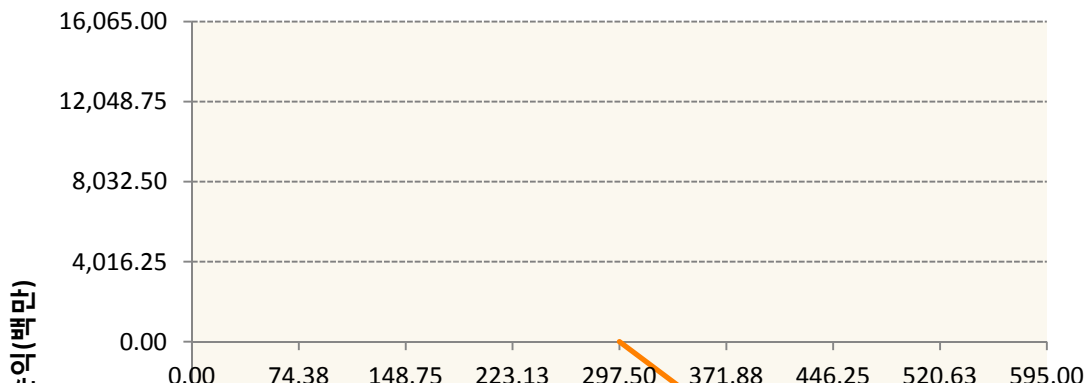
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,023	0	11,023	장내
누계	유가증권	옵션	1,348	21,390	-20,042	장내

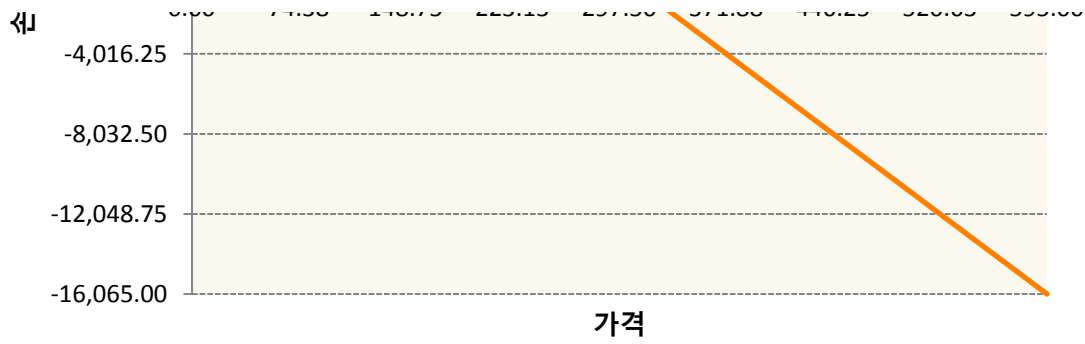
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

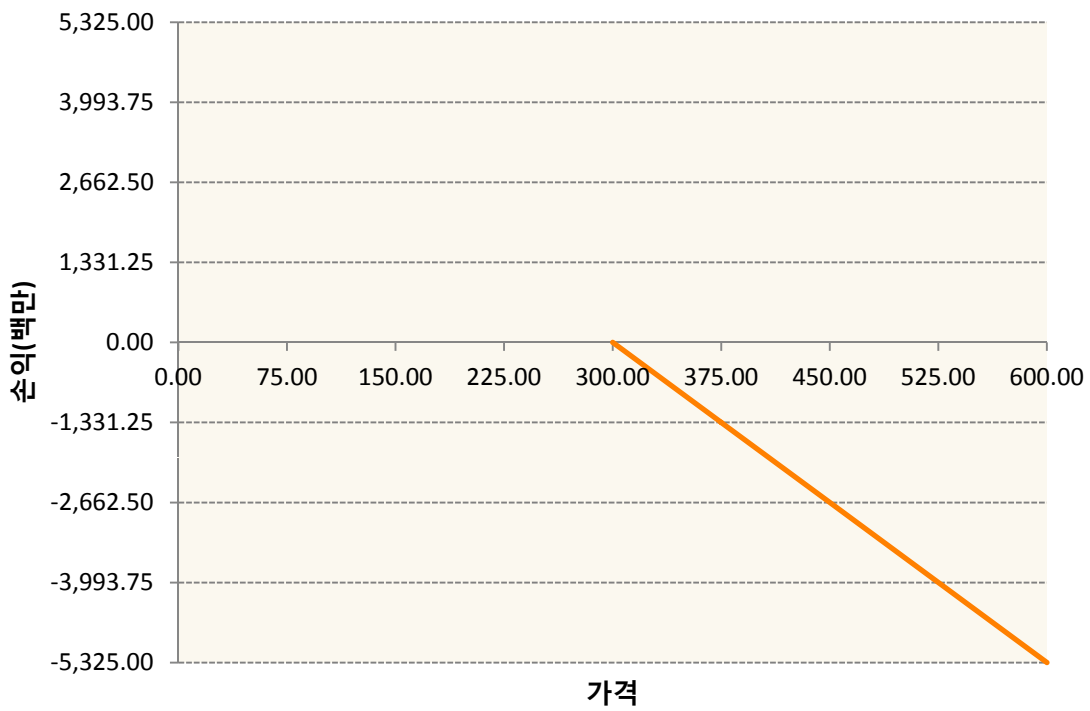


KR4201PC2973-2019-12 콜297.5

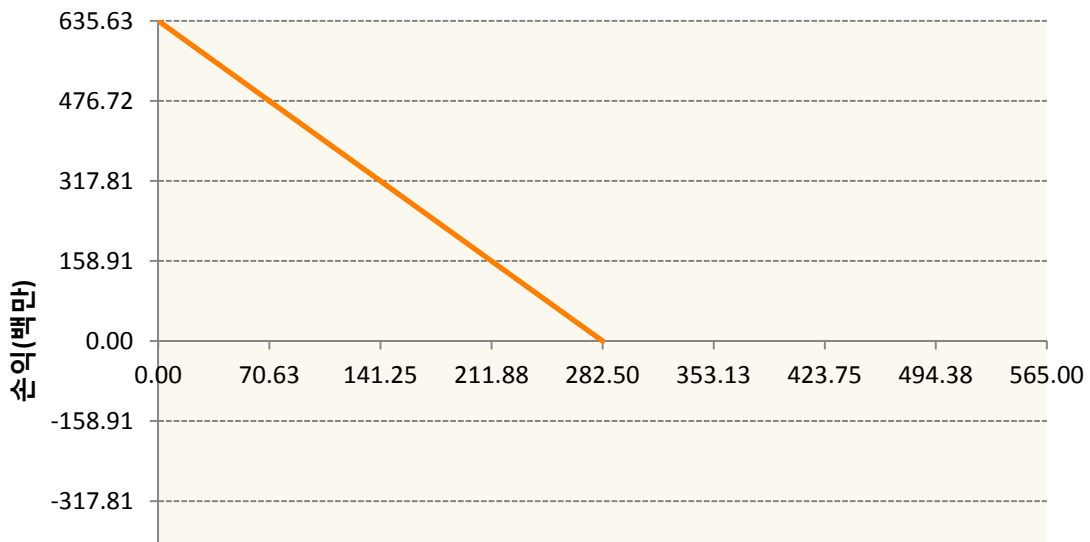


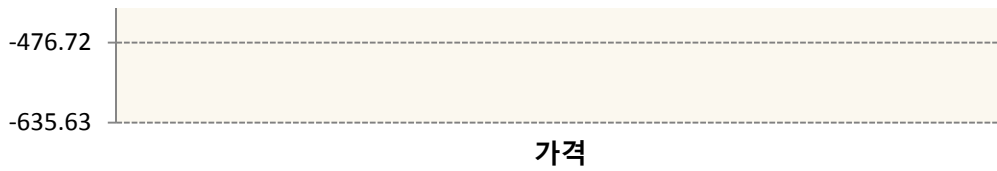


KR4201PC3005-2019-12 콜300

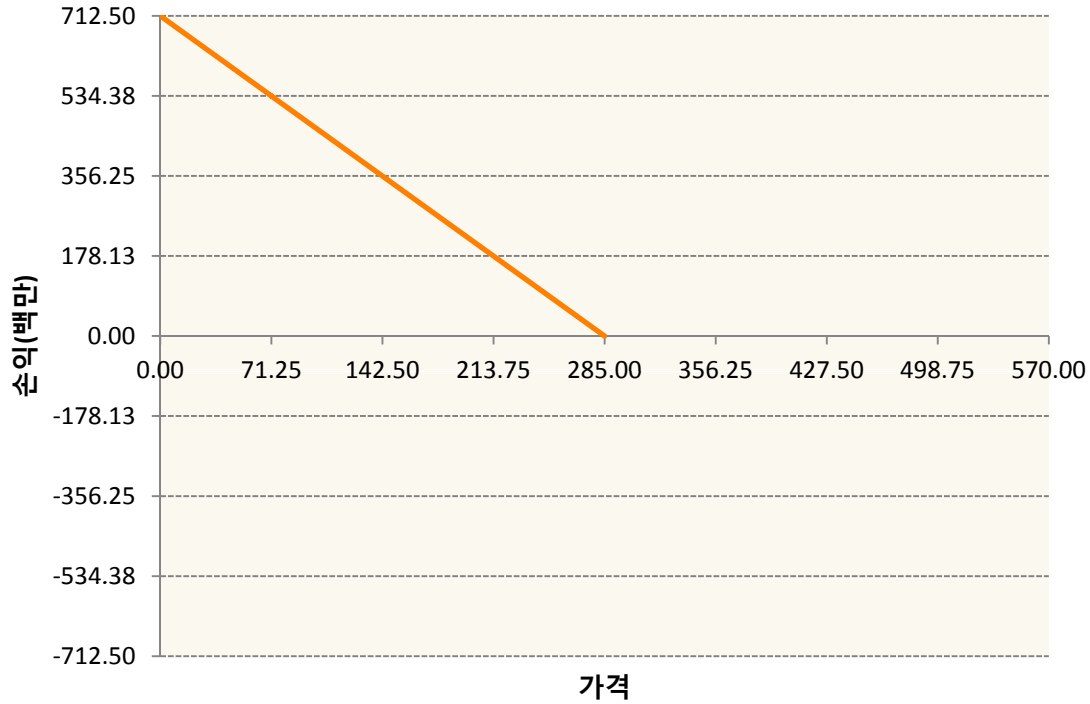


KR4301PC2824-2019-12 풋282.5





KR4301PC2857-2019-12 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						880
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-880	-880	-880	-880	-880	-880	-880	
-5.33%	-587	-587	-587	-587	-587	-587	-587	
-2.67%	-293	-293	-293	-293	-293	-293	-293	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	293	293	293	293	293	293	293	
5.33%	587	587	587	587	587	587	587	
8.00%	880	880	880	880	880	880	880	
KR4201PC2973		2019-12 콜297.5						637
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	136	135	132	128	122	115	106	
-5.33%	132	127	120	110	99	86	70	
-2.67%	116	104	89	72	53	32	10	

0%	73	51	26	0	-27	-56	-85
2.67%	-21	-53	-86	-119	-153	-188	-222
5.33%	-184	-221	-258	-295	-332	-369	-406
8.00%	-426	-460	-494	-530	-565	-601	-637
KR4201PC3005 2019-12 콜300							192
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	36	36	35	34	33	31	28
-5.33%	35	34	32	30	27	23	19
-2.67%	32	29	25	20	14	8	1
0%	21	15	8	0	-8	-17	-26
2.67%	-4	-13	-23	-34	-45	-55	-66
5.33%	-49	-61	-73	-85	-98	-110	-122
8.00%	-120	-132	-144	-156	-168	-180	-192
KR4301PC2824 2019-12 풋282.5							43
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	43	43	43	43	43	43	43
-5.33%	26	26	26	26	26	27	27
-2.67%	10	10	11	11	12	12	13
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-8	-7	-7	-6	-6	-5	-4
5.33%	-9	-9	-9	-8	-8	-8	-7
8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
KR4301PC2857 2019-12 풋285							50
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	50	50	50	50	50	50	50
-5.33%	31	31	31	32	32	32	32
-2.67%	13	13	14	14	15	15	16
0%	-2	-1	-1	0	1	2	2
2.67%	-11	-10	-9	-9	-8	-7	-6
5.33%	-13	-13	-13	-12	-12	-12	-11
8.00%	-14	-14	-13	-13	-13	-13	-13

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

(단위:백만원)

1,400

공시일	2019-11-21
기준일	2019-11-20

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	204,614	0	204,614	

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	2019-11-21
기준일	2019-11-20

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	213,558	0	213,558	

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	2019-11-21
기준일	2019-11-20

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	542,285	0	542,285	
누계	통화	선도	0	596,166	-596,166	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		1,872
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E		1,966
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		655
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		693
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,685
FX21019V02 KRW/USD 21-11-19E		5,092
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,774
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,404
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,808
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,507
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,846
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		936
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		936
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,872
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,872
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		936
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		936
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		936
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		936
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		468
FX21019X00 KRW/USD 06-12-19E		655
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		468
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		468
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		468
FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E		1,535
FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E		936

FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E	468
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E	936
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E	1,535
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E	1,872
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E	3,220

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

(단위:백만원)

14,949

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

(단위:백만원)

187

공시일	2019-11-21
기준일	2019-11-20

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

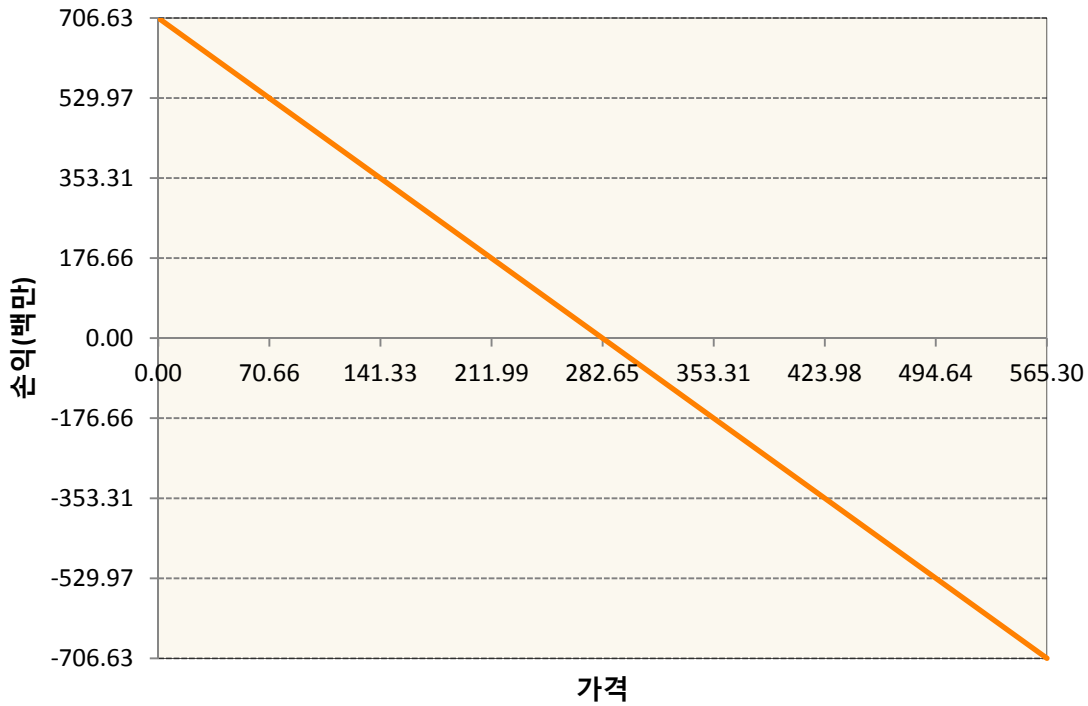
1. 계약금액

(단위:백만원)

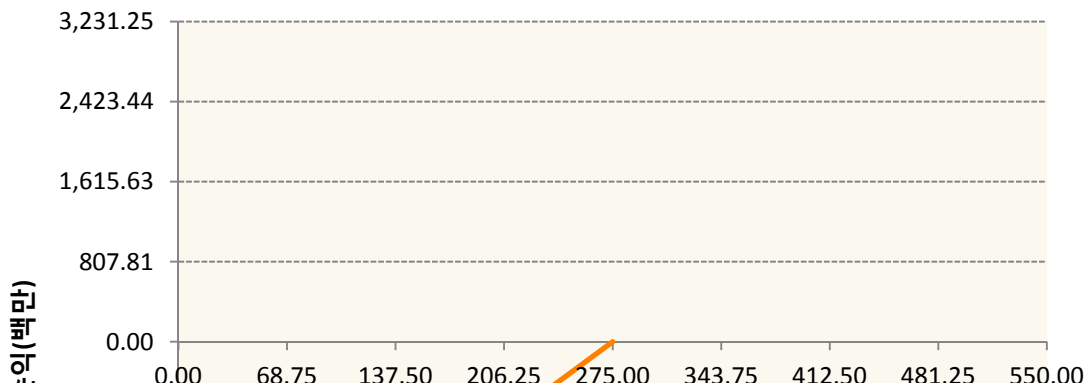
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	707	-707	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,856	-3,856	장내

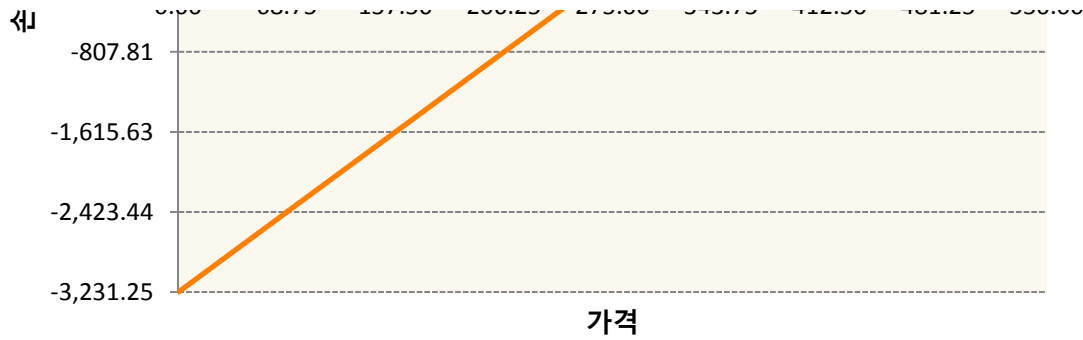
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

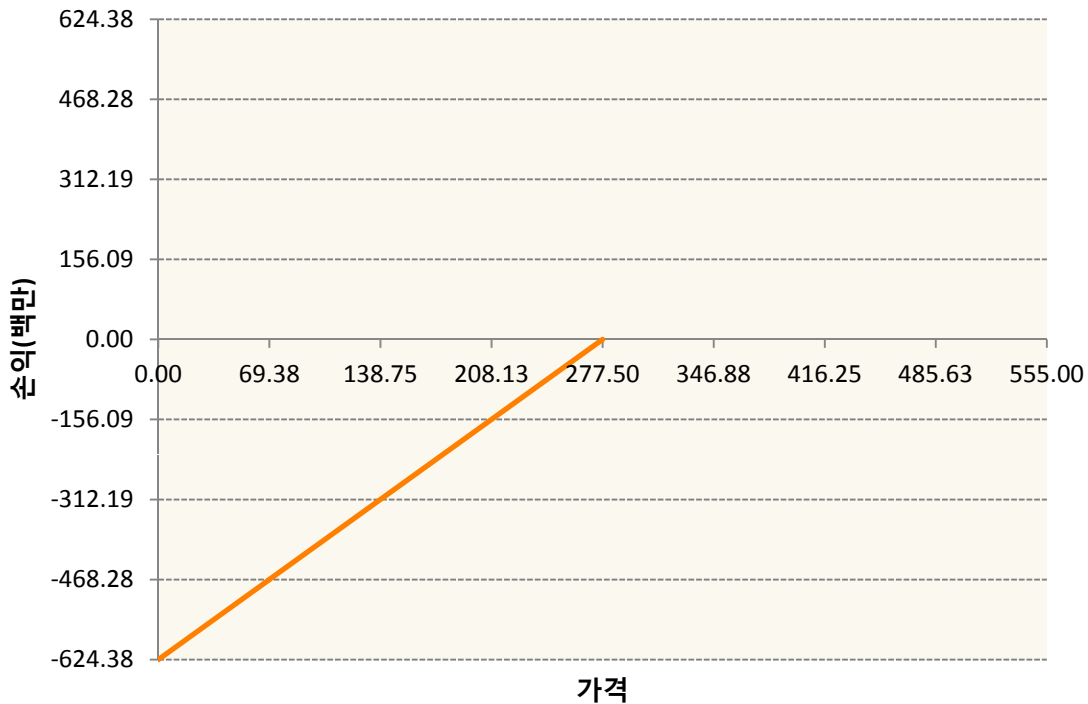


KR4301PC2758-2019-12 풋275





KR4301PC2774-2019-12 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						56
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	56	56	56	56	56	56	56	
-5.33%	38	38	38	38	38	38	38	
-2.67%	19	19	19	19	19	19	19	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
5.33%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38	
8.00%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56	
KR4301PC2758		2019-12 풋275						173
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-168	-168	-169	-170	-171	-172	-173
-5.33%	-84	-86	-88	-91	-93	-96	-98
-2.67%	-21	-25	-28	-32	-35	-39	-42
0%	7	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	14	13	12	11	10	9	7
5.33%	14	14	14	14	14	13	12
8.00%	14	14	14	14	14	14	14
KR4301PC2774 2019-12 풋277.5							37
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-36	-36	-36	-36	-37	-37	-37
-5.33%	-20	-20	-20	-21	-21	-21	-22
-2.67%	-6	-6	-7	-8	-8	-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

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

(단위:백만원)

239

공시일	2019-11-21
기준일	2019-11-20

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	15,356	0	15,356	
누계	통화	선도	351	15,457	-15,106	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019V01 KRW/USD 10-12-19E		371
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)

396

공시일	2019-11-21
기준일	2019-11-20

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	473	-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	2019-11-21
기준일	2019-11-20

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

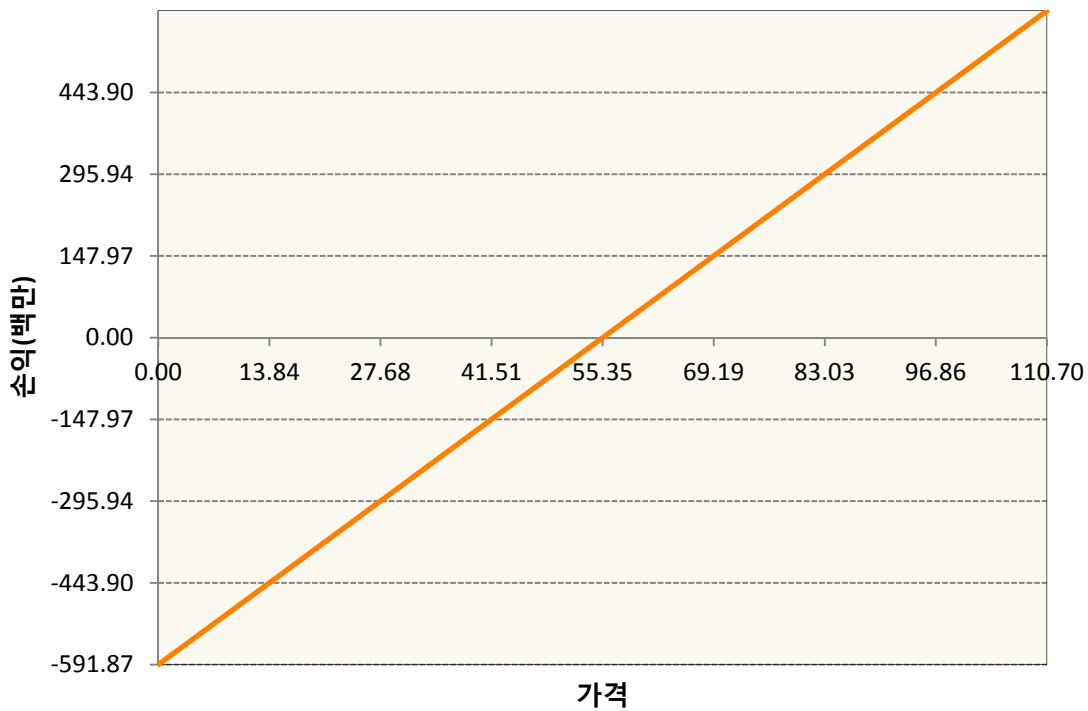
1. 계약금액

(단위:백만원)

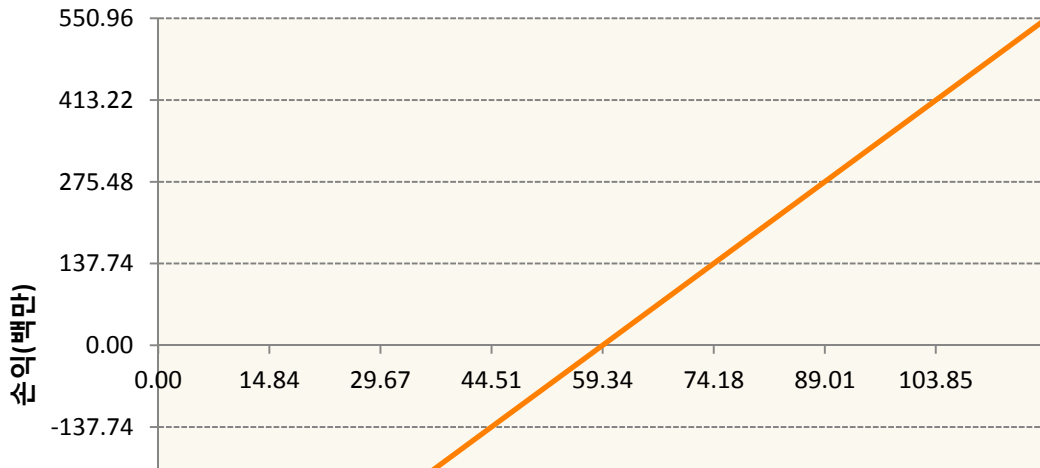
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,413	293	2,120	

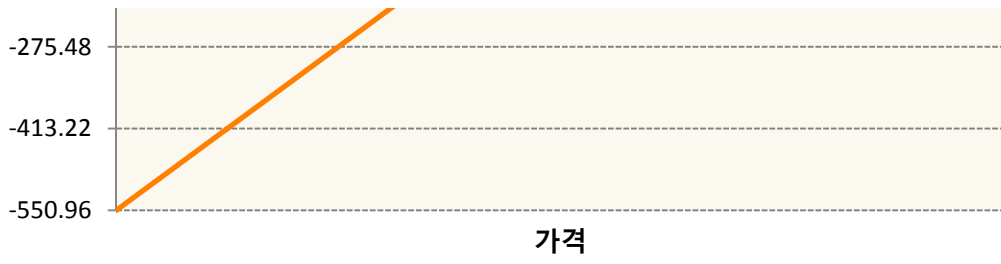
2. 만기시점의 손익구조

CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20

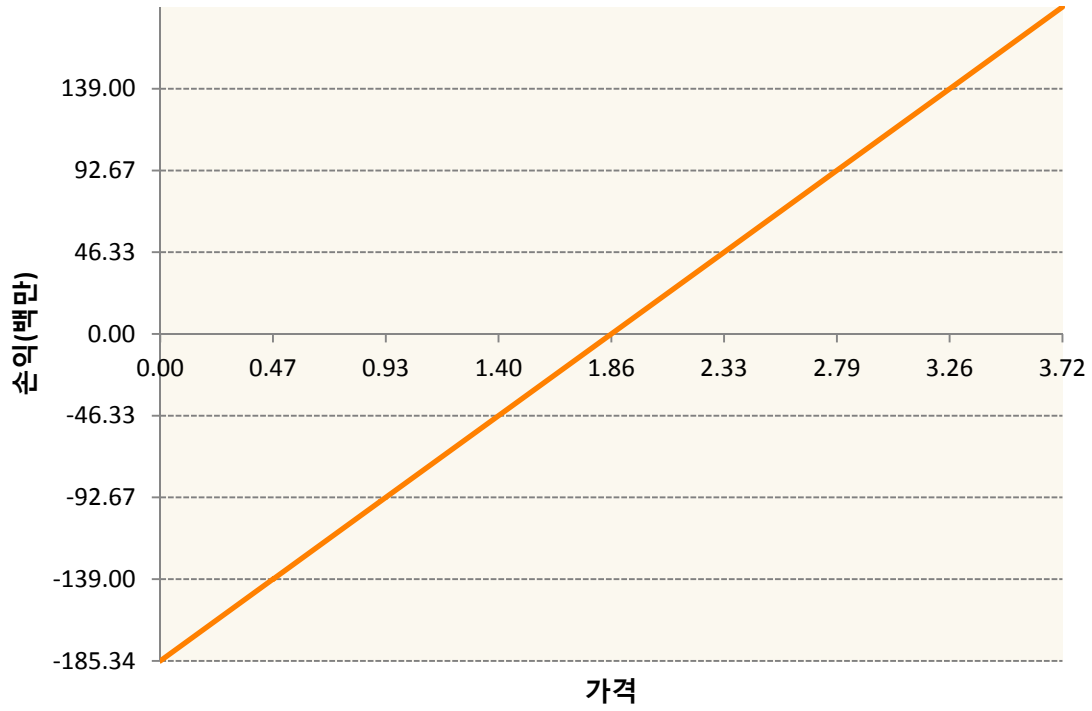


COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20

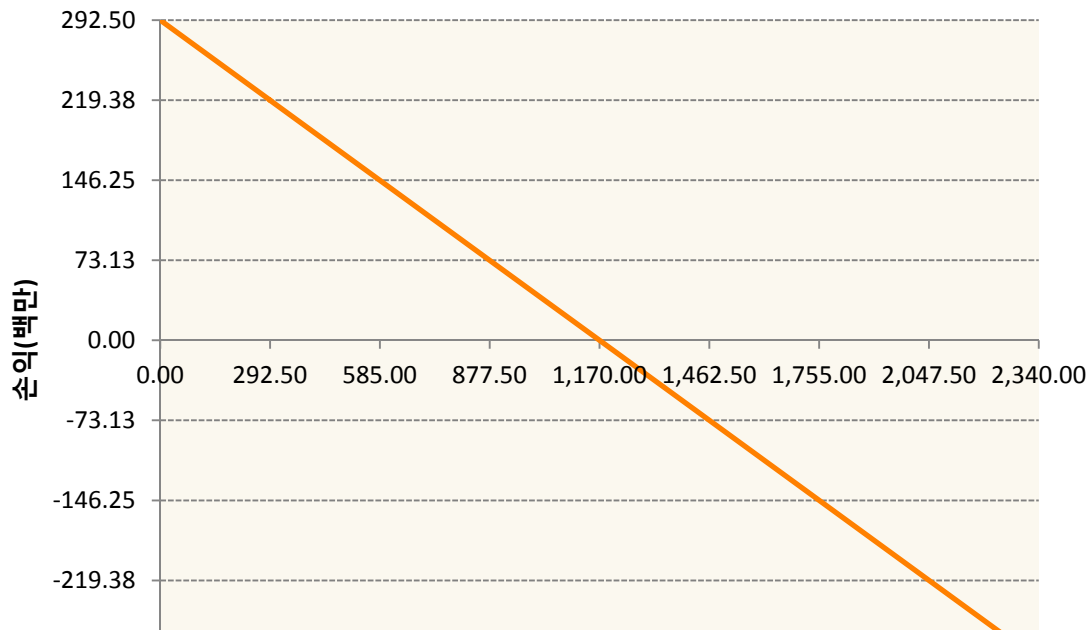


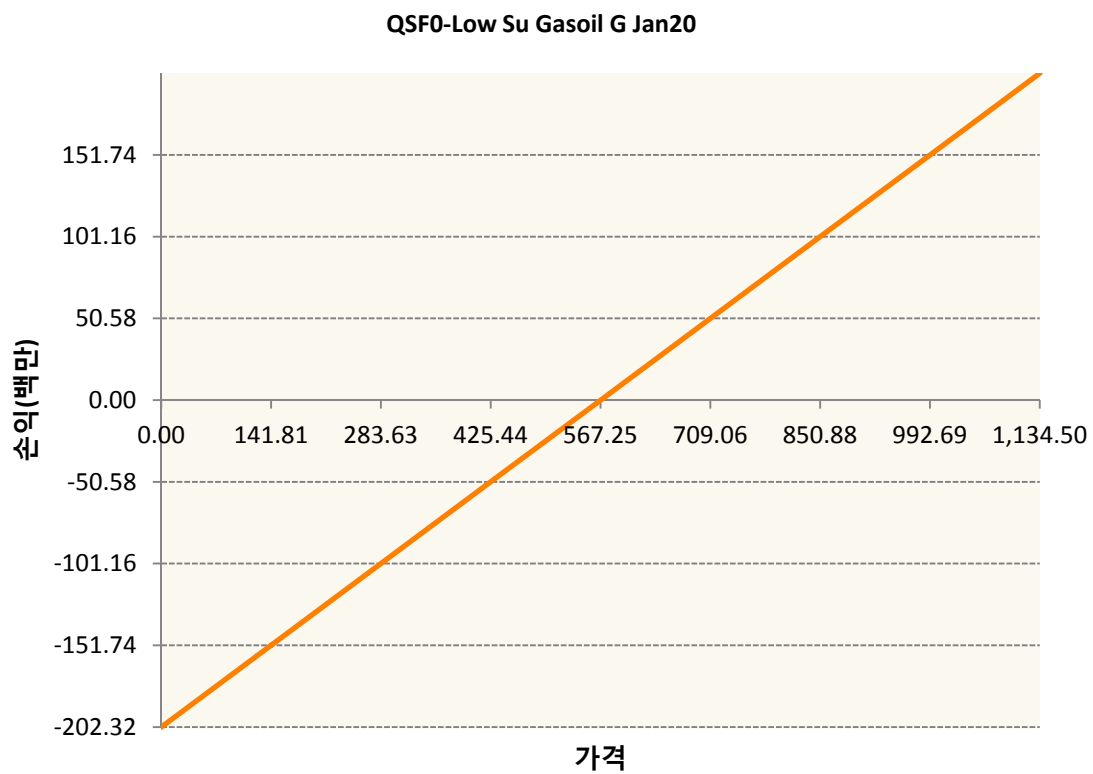
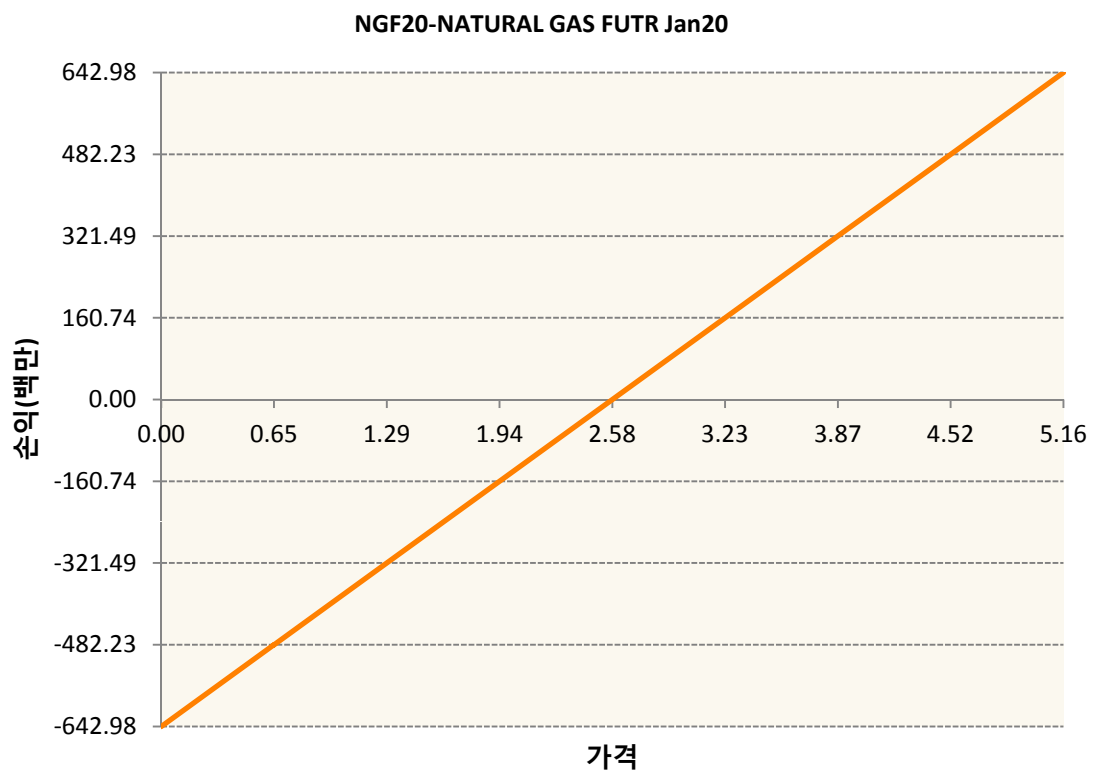
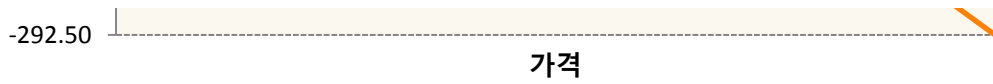


HOF0-NY Harb ULSD Fut Jan20

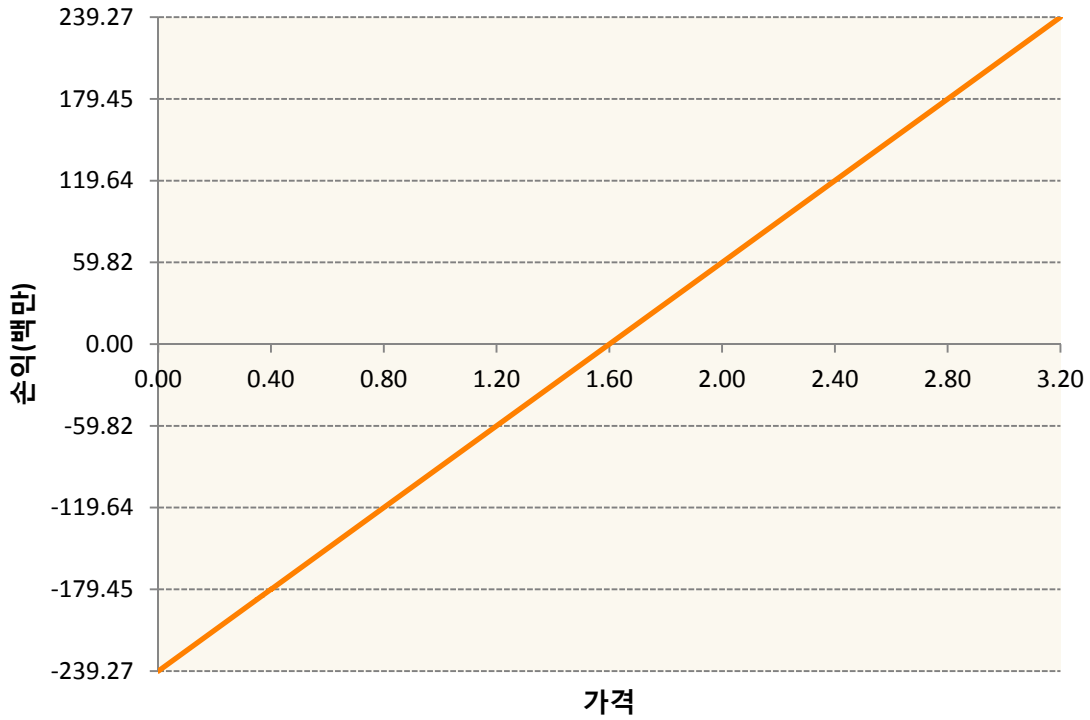


KR4175PC0003-2019-12 달러선물





XBF0-GASOLINE RBOB FUT Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLF0	WTI CRUDE FUTURE Jan20	47
COH0	BRENT CRUDE FUTR Mar20	44
HOF0	NY Harb ULSD Fut Jan20	15
KR4175PC00	2019-12 달러선물	23
NGF20	NATURAL GAS FUTR Jan20	51
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	16
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	19

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

(단위:백만원)

401

공시일	2019-11-21
기준일	2019-11-20

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

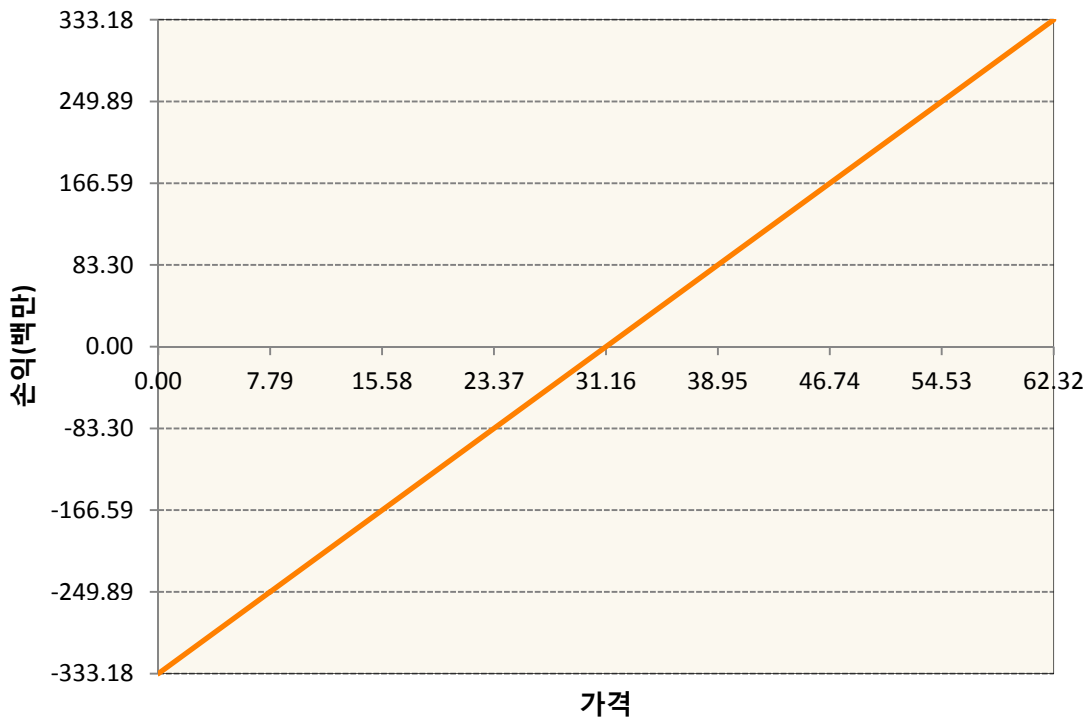
1. 계약금액

(단위:백만원)

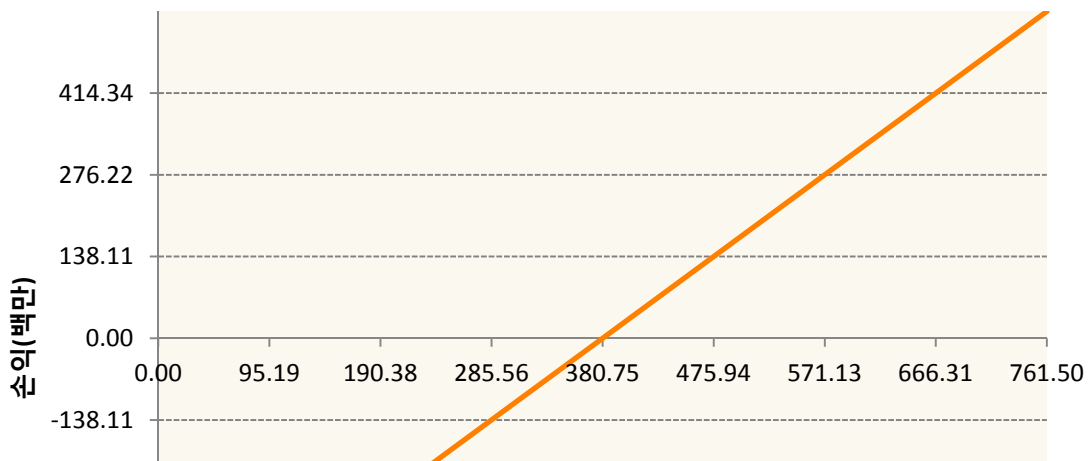
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,802	94	2,708	

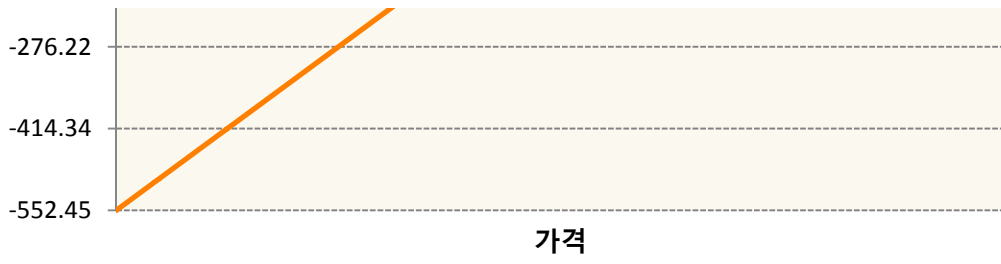
2. 만기시점의 손익구조

BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20

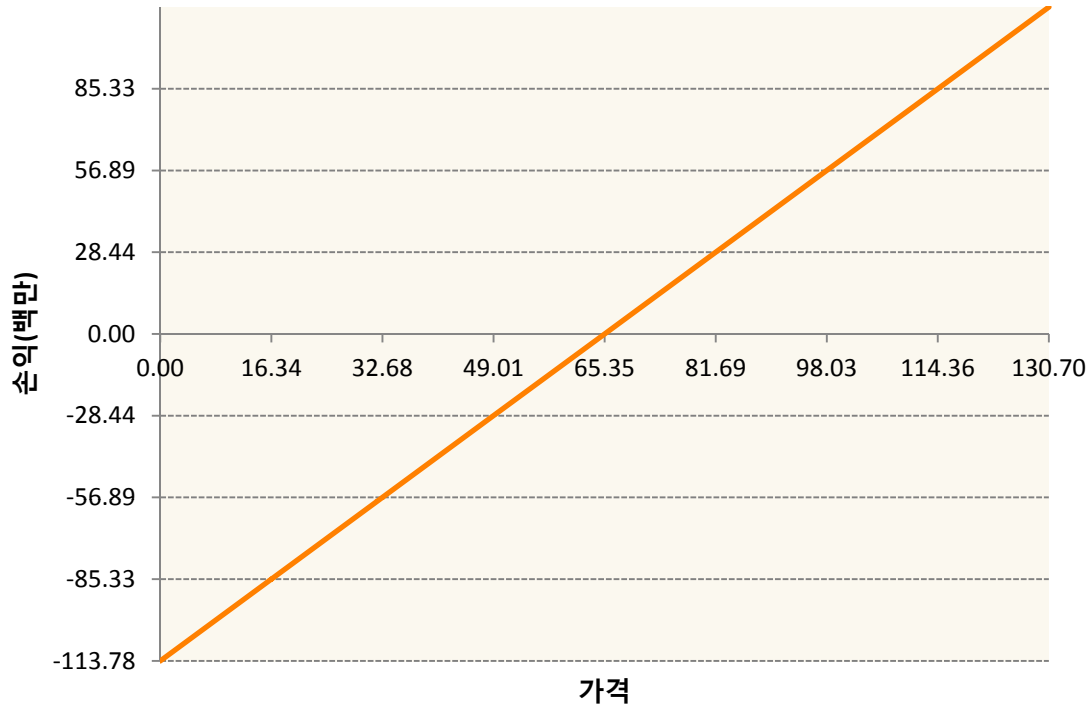


CH0-CORN FUTURE Mar20

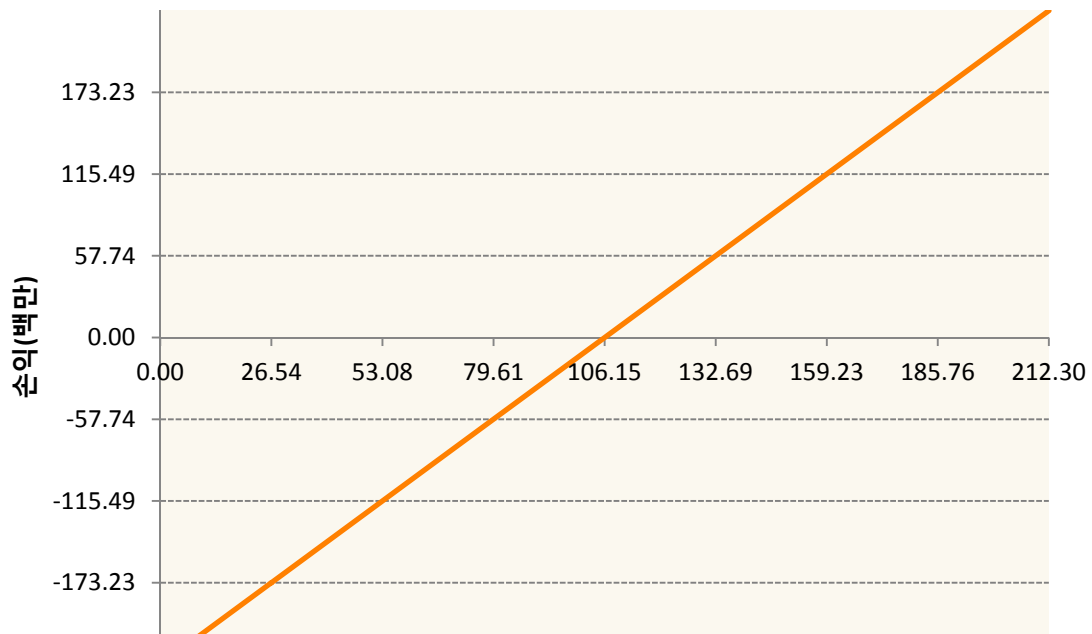


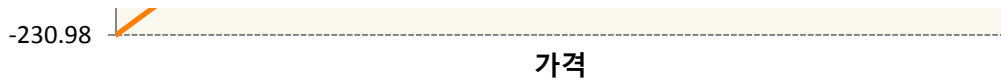


CTH0-COTTON NO.2 FUTR Mar20

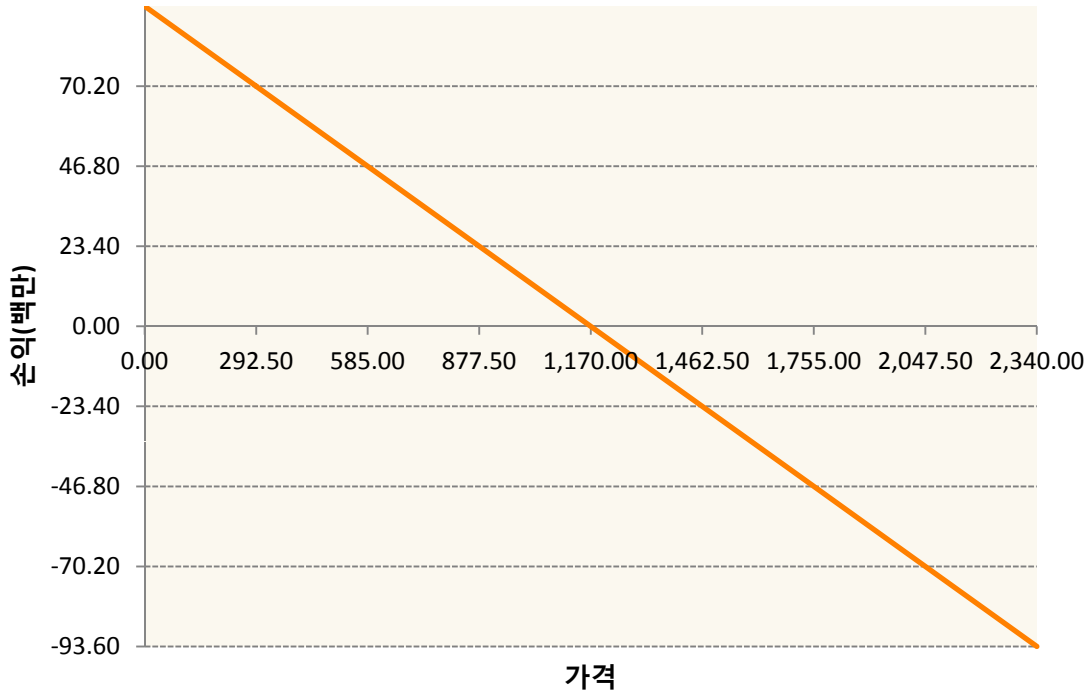


KCH0-COFFEE 'C' FUTURE Mar20

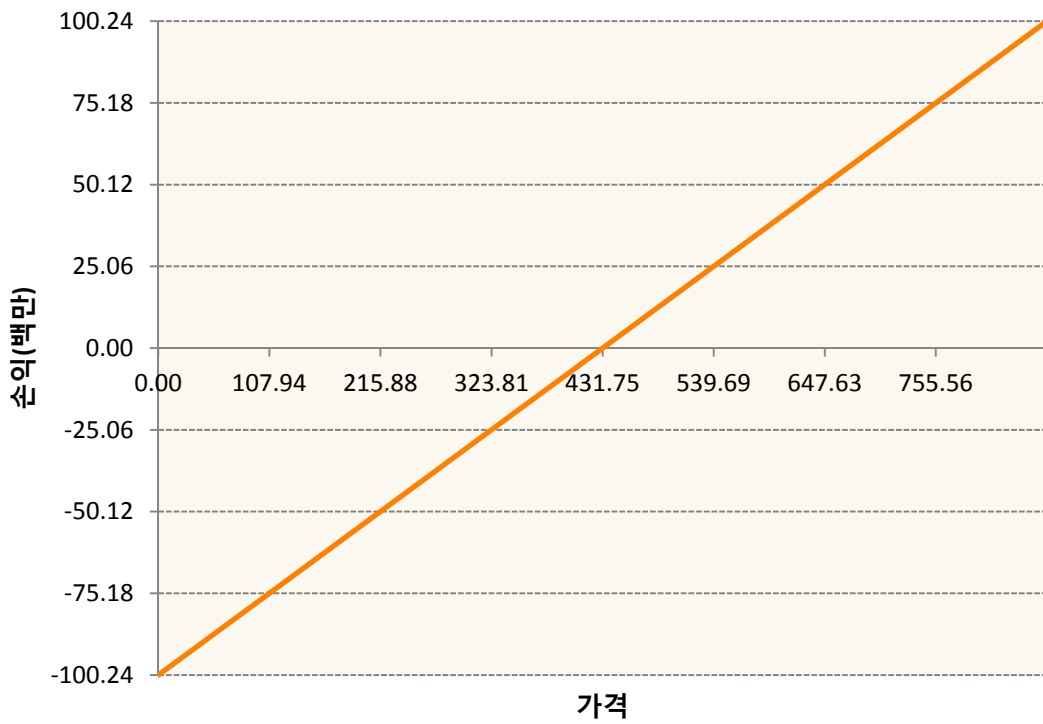




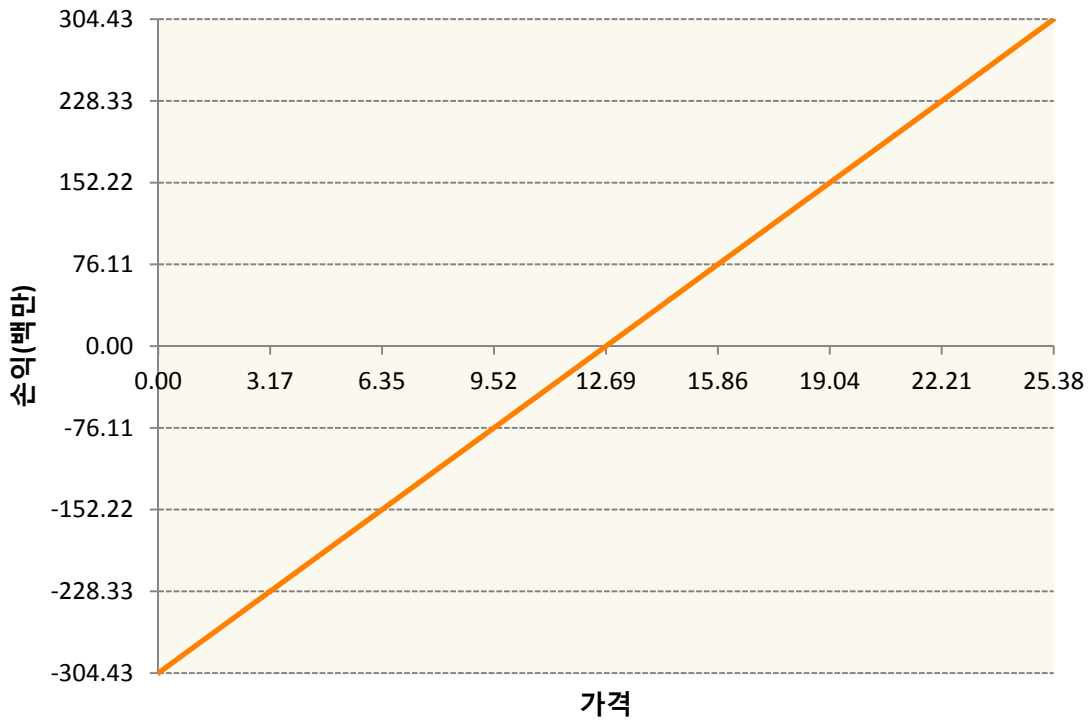
KR4175PC0003-2019-12 달러선물



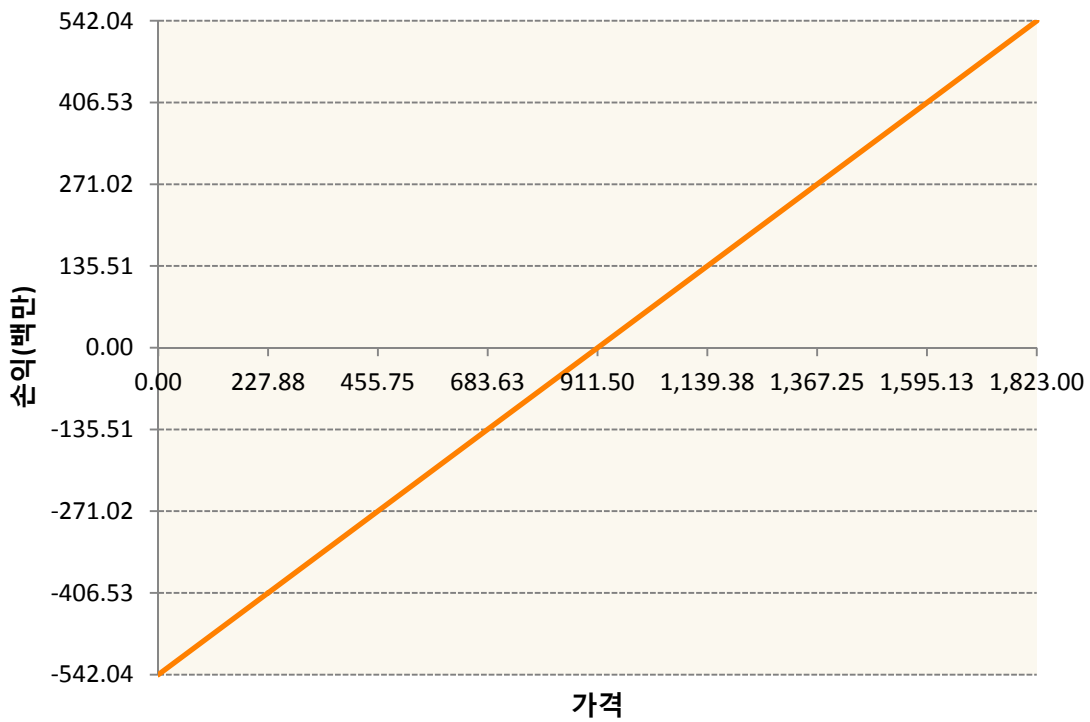
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



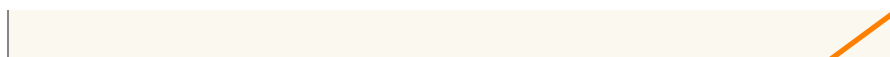
SBH0-Sugar Mar20

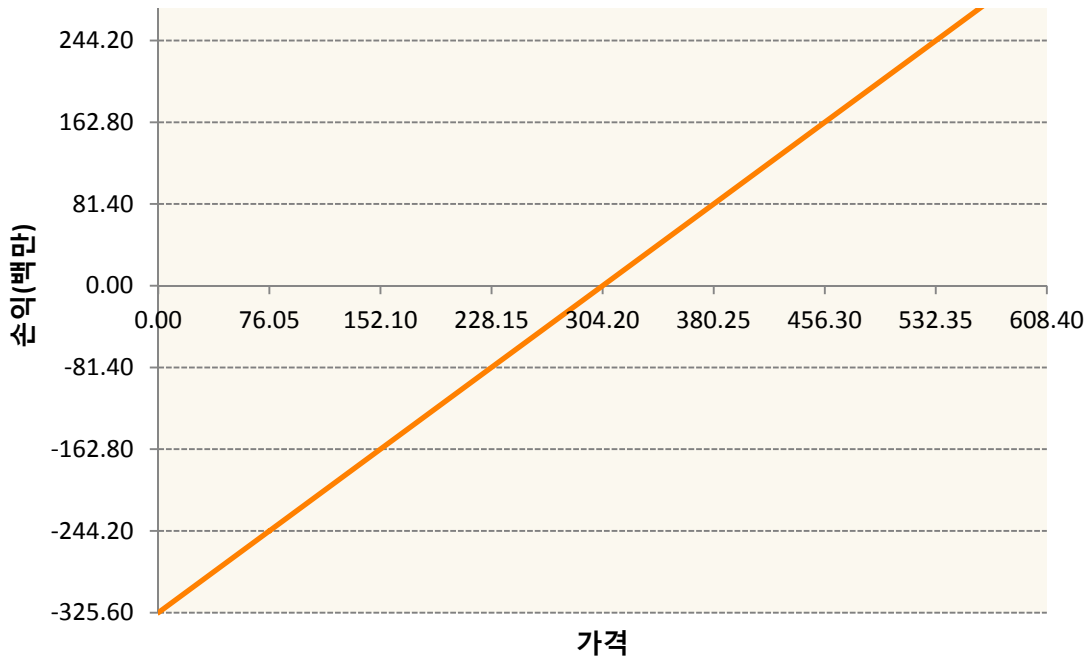


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20

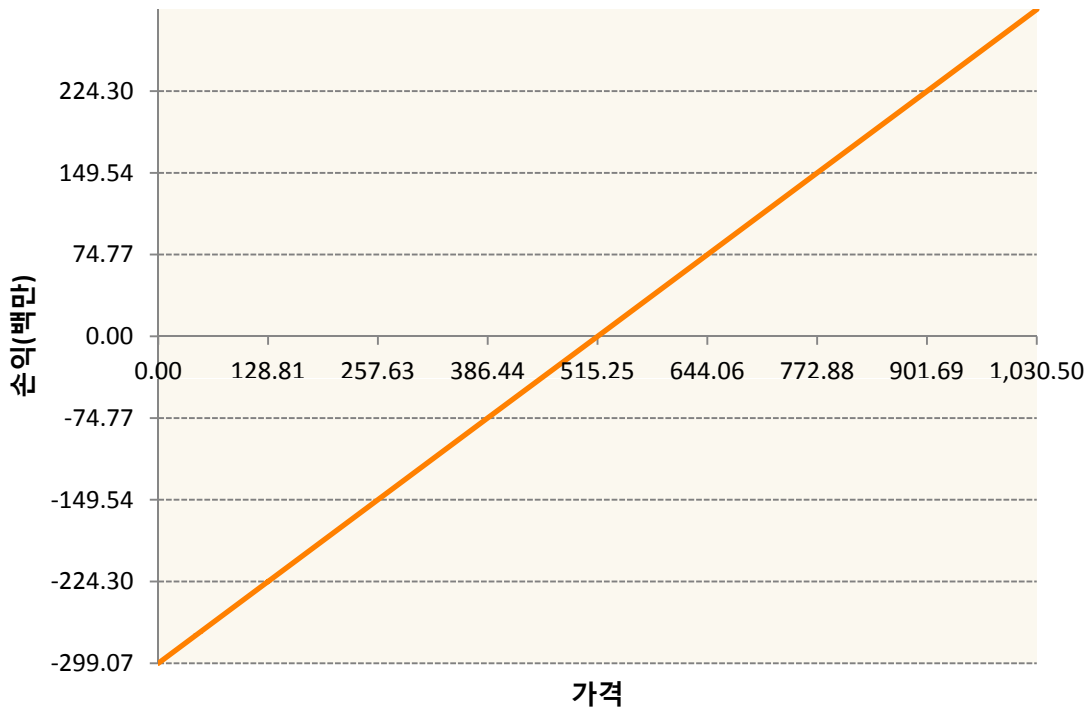


SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





WHO-WHEAT FUTURE(CBT) Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF0	SOYBEAN OIL FUTR Jan20	27
CH0	CORN FUTURE Mar20	44
CTH0	COTTON NO.2 FUTR Mar20	9
KCH0	COFFEE 'C' FUTURE Mar20	18
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