

공시일	2019-11-22
기준일	2019-11-21

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	2019-11-22
기준일	2019-11-21

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

1,222

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

705

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-11-22
기준일	2019-11-21

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)	382
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	2019-11-22
기준일	2019-11-21

유로인덱스모(주식-파생형)

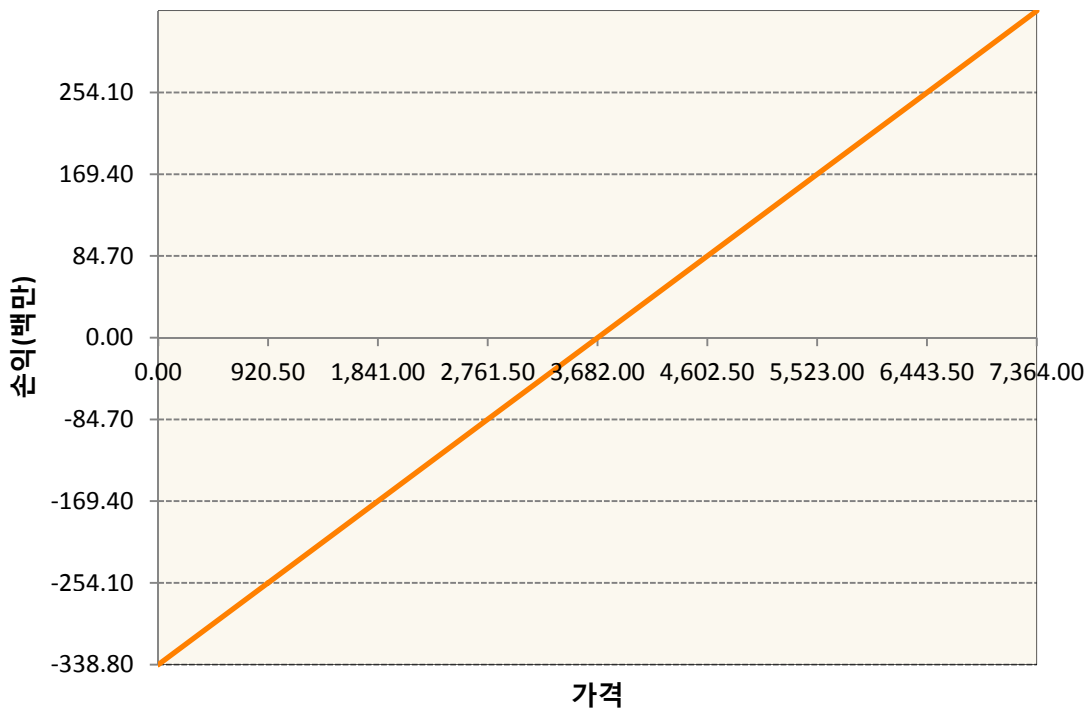
1. 계약금액

(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	2019-11-22
기준일	2019-11-21

차이나인덱스모(주식-파생형)

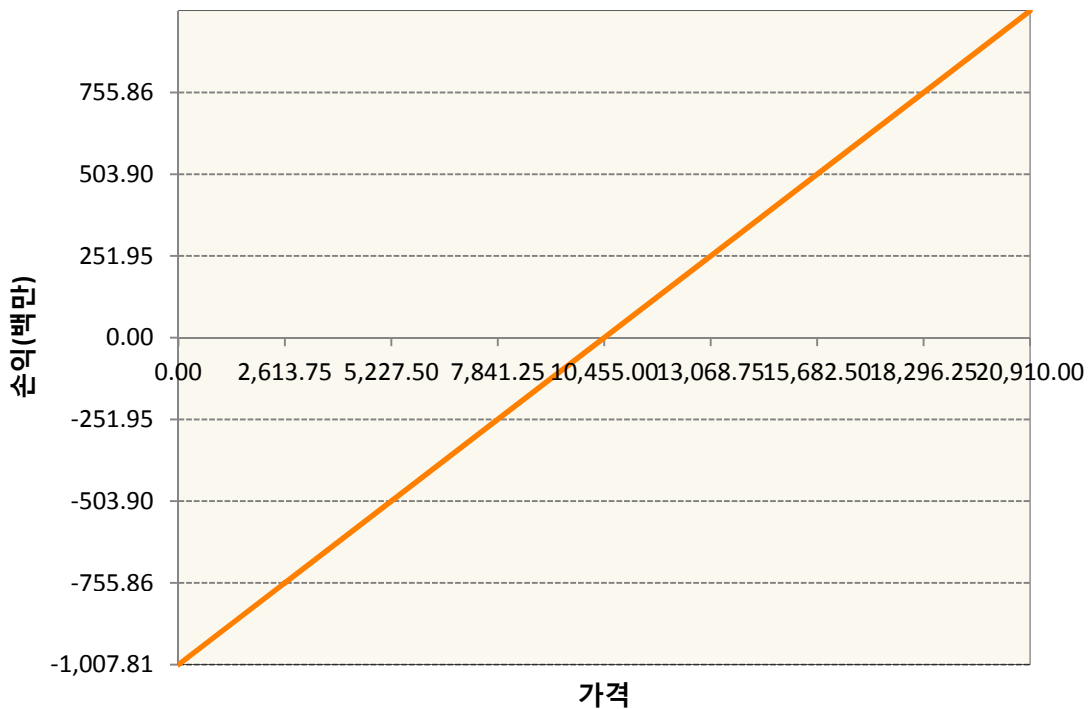
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,008	0	1,008	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCX9-HSCEI Futures Nov19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

72

공시일	2019-11-22
기준일	2019-11-21

커버드콜모(주식혼합-파생형)

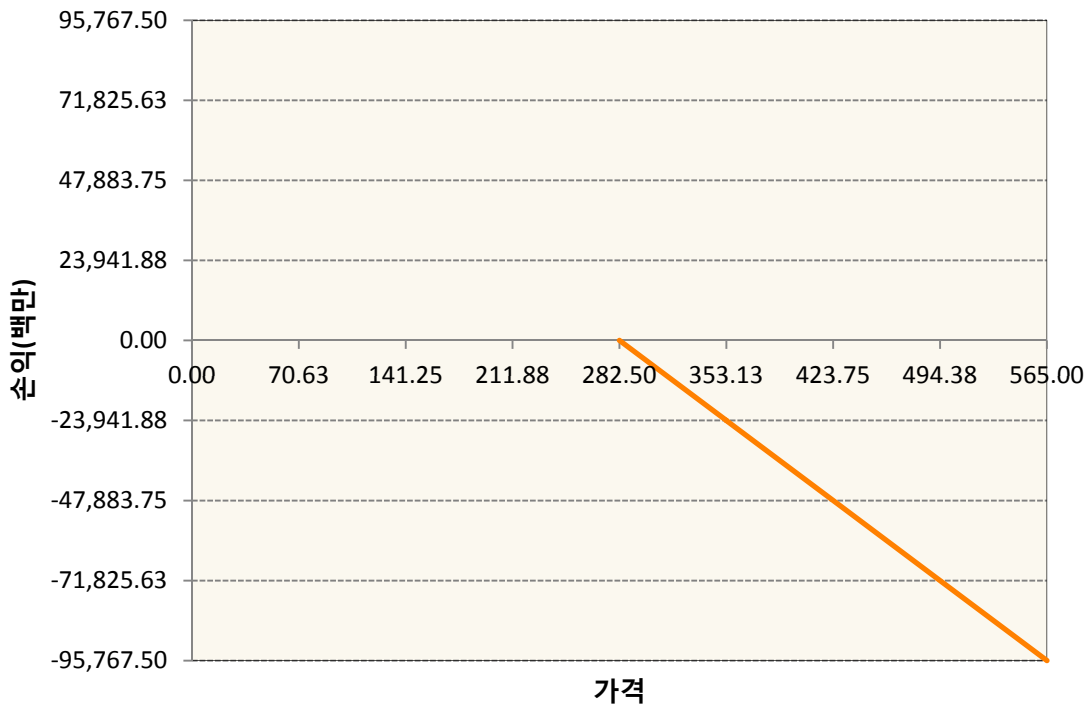
1. 계약금액

(단위:백만원)

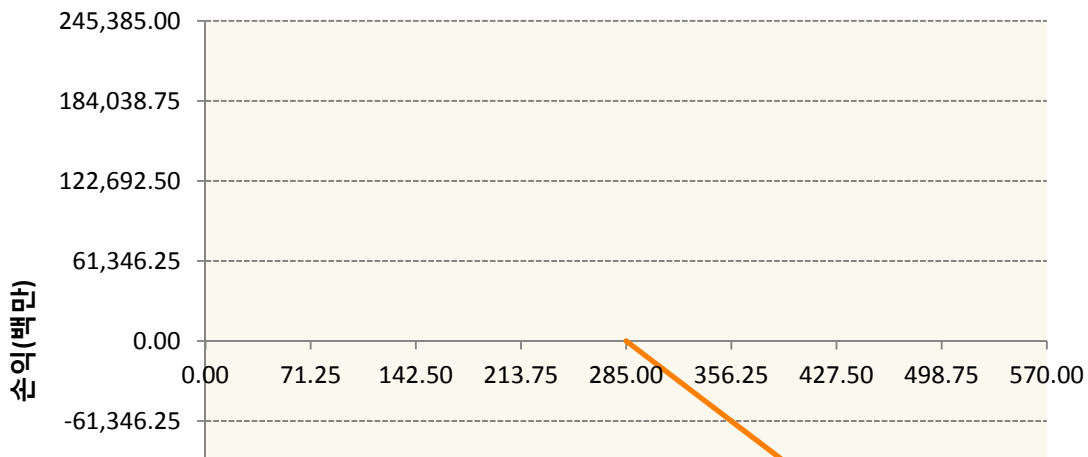
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	498,456	-498,456	장내

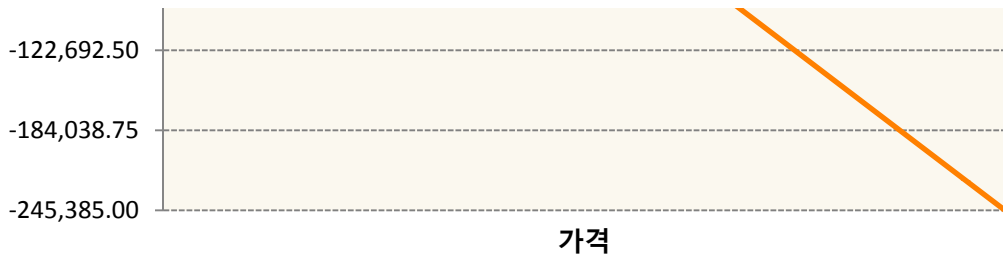
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PC2825-2019-12 콜282.5

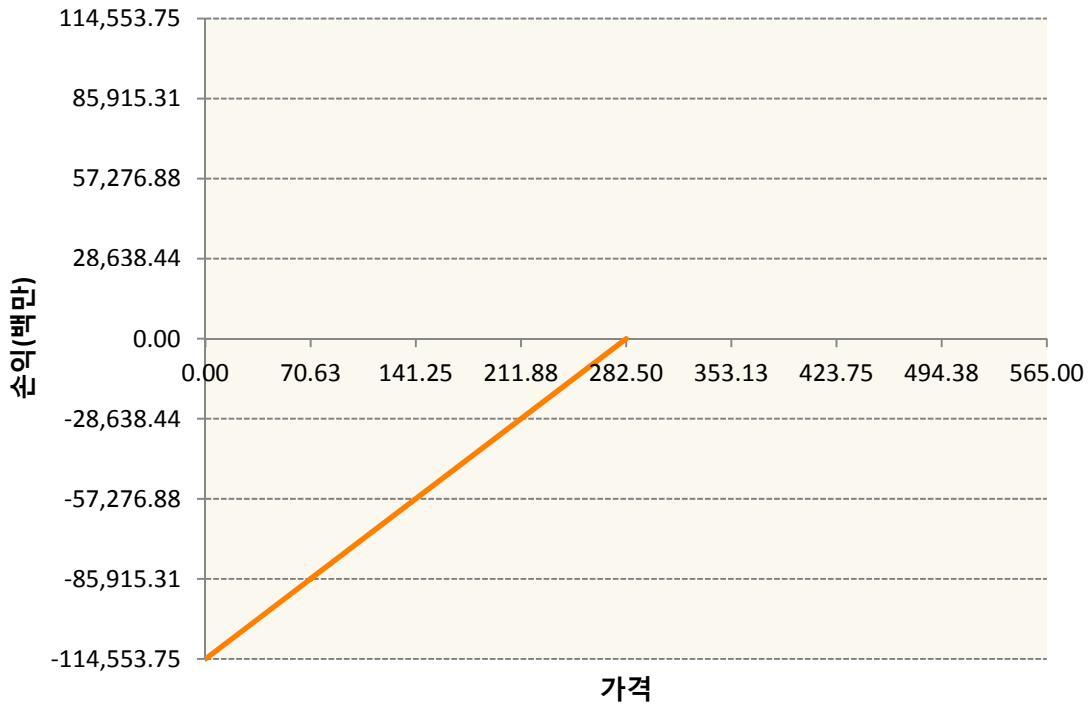


KR4201PC2858-2019-12 콜285

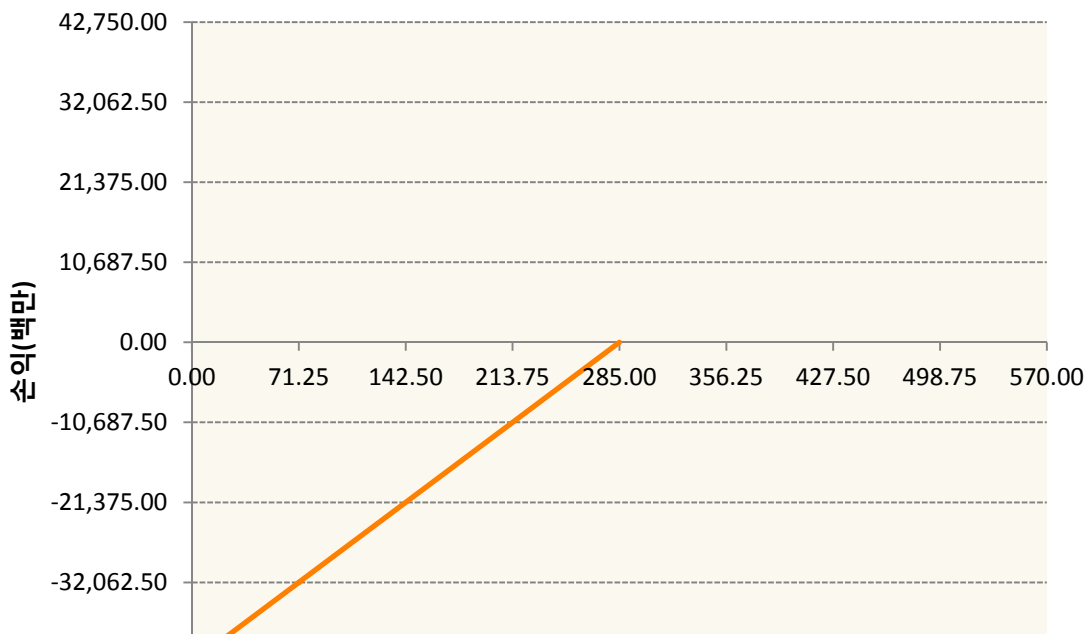




KR4301PC2824-2019-12 풋282.5



KR4301PC2857-2019-12 풋285



-42,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PC2825		2019-12 콜282.5						5,306
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,824	1,789	1,740	1,678	1,604	1,518	1,422	
-5.33%	1,696	1,611	1,511	1,398	1,275	1,142	1,001	
-2.67%	1,347	1,196	1,036	868	695	517	336	
0%	612	409	205	0	-206	-413	-621	
2.67%	-622	-832	-1,043	-1,254	-1,466	-1,678	-1,890	
5.33%	-2,350	-2,521	-2,700	-2,885	-3,074	-3,268	-3,464	
8.00%	-4,456	-4,568	-4,695	-4,835	-4,984	-5,142	-5,306	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						12,686
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,878	3,812	3,716	3,590	3,433	3,246	3,033	
-5.33%	3,653	3,481	3,270	3,025	2,750	2,447	2,122	
-2.67%	2,987	2,655	2,293	1,907	1,501	1,080	645	
0%	1,482	997	502	0	-507	-1,019	-1,535	
2.67%	-1,215	-1,761	-2,307	-2,854	-3,400	-3,946	-4,493	
5.33%	-5,195	-5,679	-6,175	-6,680	-7,192	-7,710	-8,232	
8.00%	-10,251	-10,594	-10,969	-11,370	-11,792	-12,232	-12,686	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						8,248
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-8,235	-8,235	-8,236	-8,237	-8,239	-8,242	-8,248	
-5.33%	-5,232	-5,236	-5,242	-5,253	-5,268	-5,288	-5,314	
-2.67%	-2,274	-2,308	-2,349	-2,400	-2,457	-2,522	-2,592	
0%	324	219	111	0	-113	-228	-344	
2.67%	1,922	1,805	1,687	1,567	1,446	1,325	1,202	
5.33%	2,459	2,410	2,351	2,285	2,211	2,131	2,046	
8.00%	2,545	2,537	2,523	2,503	2,476	2,442	2,402	
KR4301PC2857		2019-12 풋285						3,149
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,147	-3,147	-3,147	-3,147	-3,147	-3,148	-3,149	
-5.33%	-2,035	-2,036	-2,037	-2,039	-2,042	-2,047	-2,054	
-2.67%	-931	-938	-947	-960	-975	-992	-1,013	
0%	97	67	35	0	-36	-74	-112	
2.67%	833	786	739	692	645	598	551	

5.33%	1,145	1,118	1,087	1,055	1,020	984	946
8.00%	1,211	1,205	1,195	1,183	1,168	1,150	1,130

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

(단위:백만원)

29,621

공시일	2019-11-22
기준일	2019-11-21

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

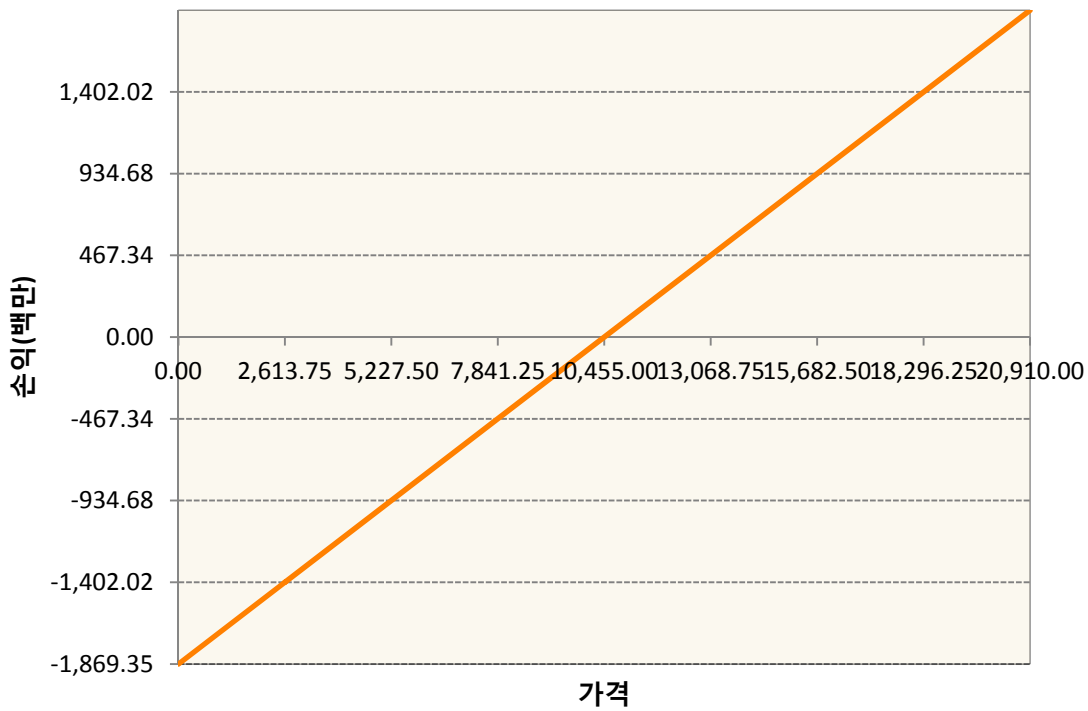
1. 계약금액

(단위:백만원)

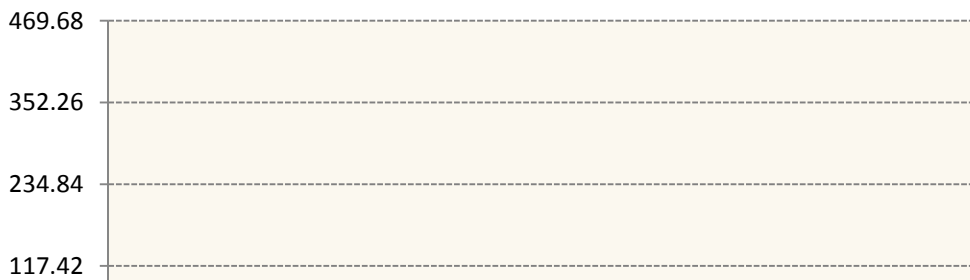
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,869	0	1,869	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,971	-4,971	장내
누계	통화	선도	677	4,917	-4,239	장외

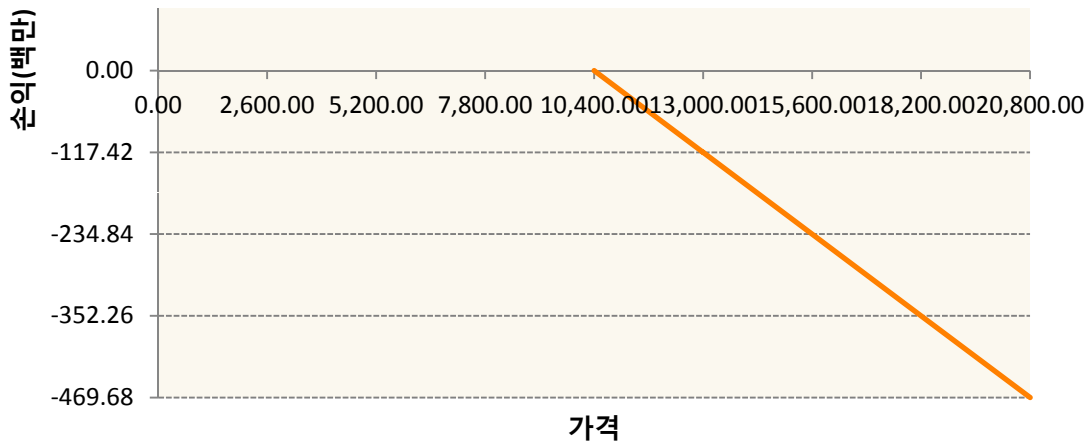
2. 만기시점의 손익구조

HCX9-HSCEI Futures Nov19

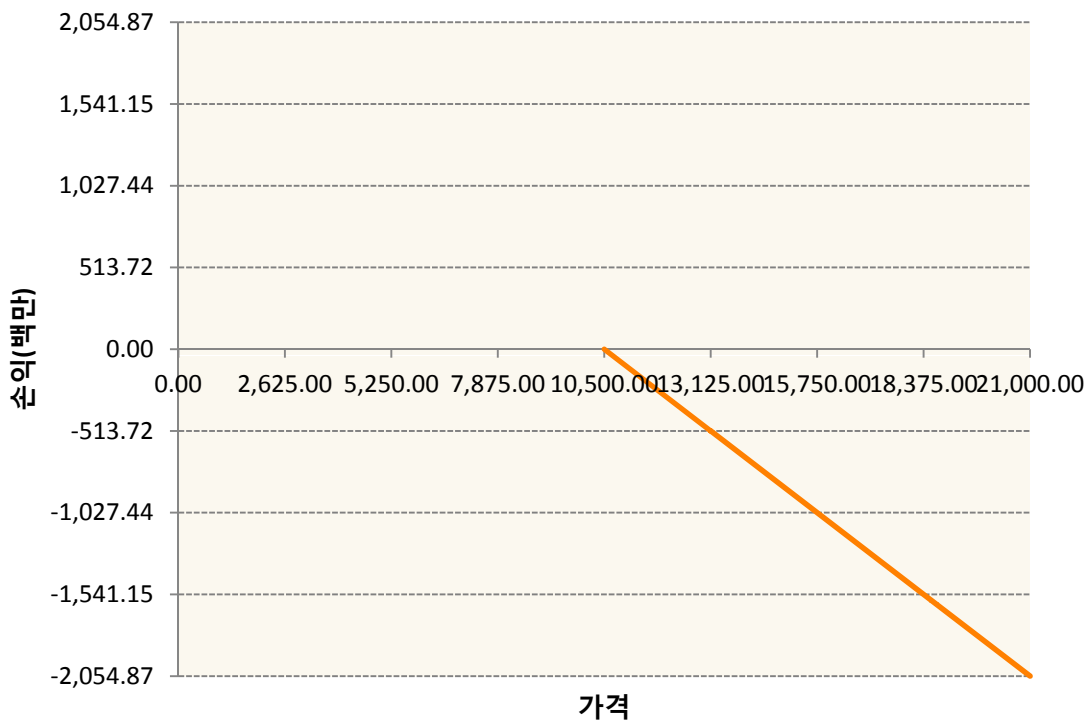


OHHIX9-C104-HSCEI

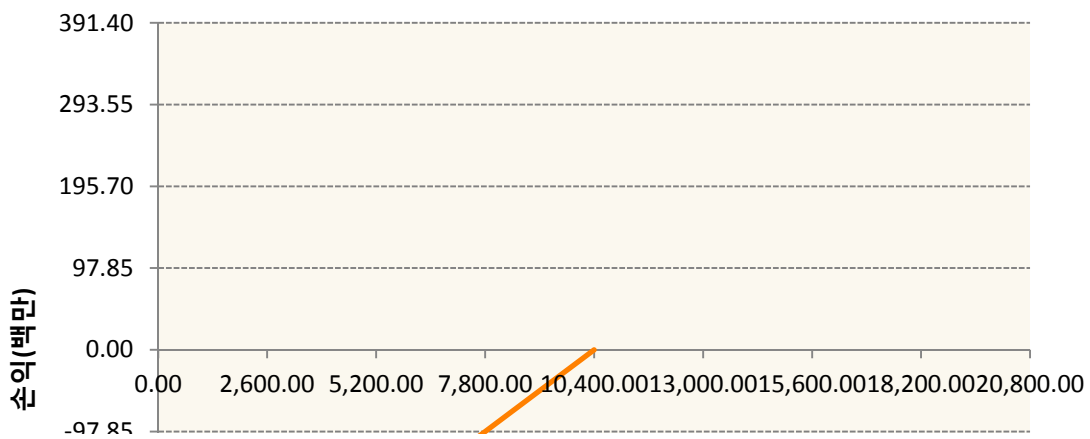


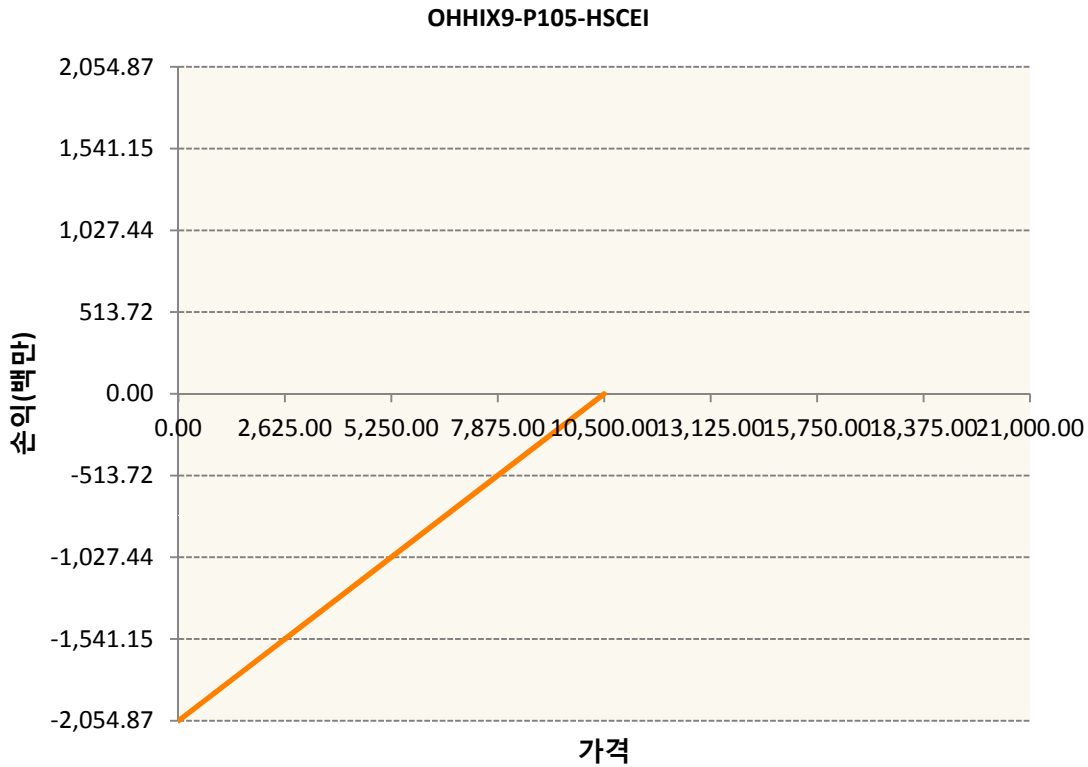
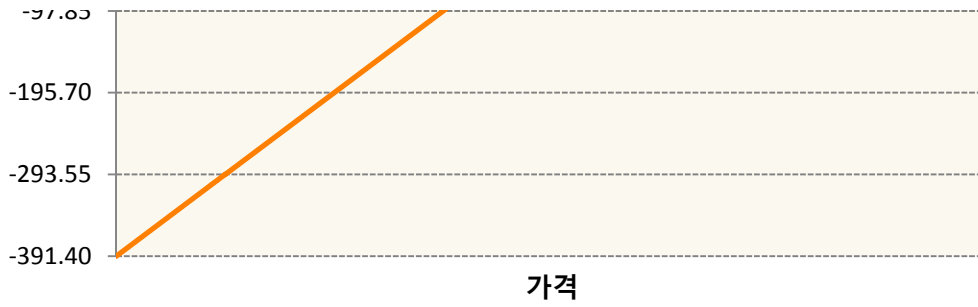


OHHIX9-C105-HSCEI



OHHIX9-P104-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019Q03 KRW/HKD 22-11-19E	224
FX21019U00 HKD/KRW 22-11-19E	6
FX21019U02 HKD/KRW 22-11-19E	48
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	170
HCX9 HSCEI Futures Nov19	150
OHHIX9-C1C HSCEI	38
OHHIX9-C1C HSCEI	164
OHHIX9-P10 HSCEI	31
OHHIX9-P10 HSCEI	164

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

공시일	2019-11-22
기준일	2019-11-21

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

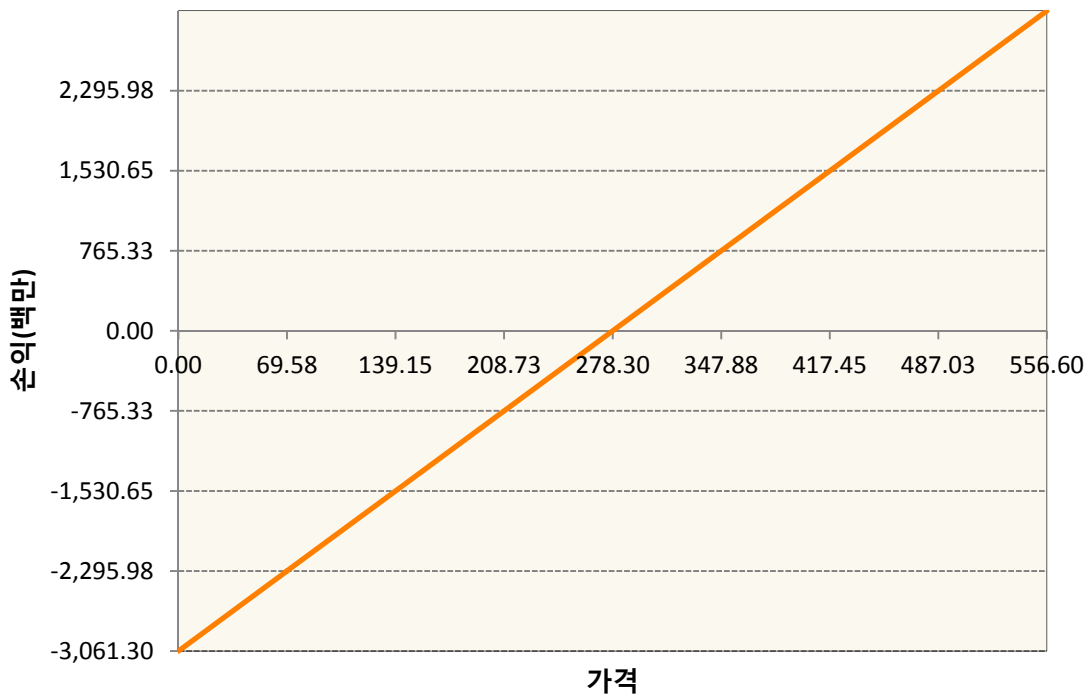
1. 계약금액

(단위:백만원)

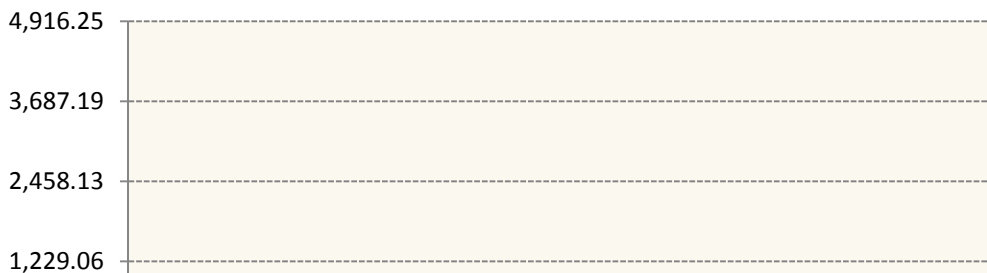
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	73	-73	장내
누계	유가증권	선물	3,061	0	3,061	장내
누계	유가증권	스왑	9,625	0	9,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,799	-9,799	장내

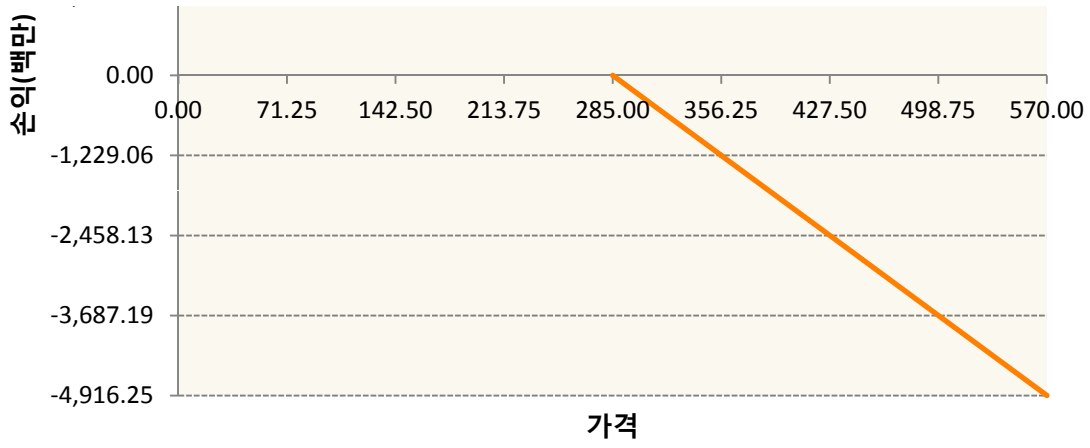
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

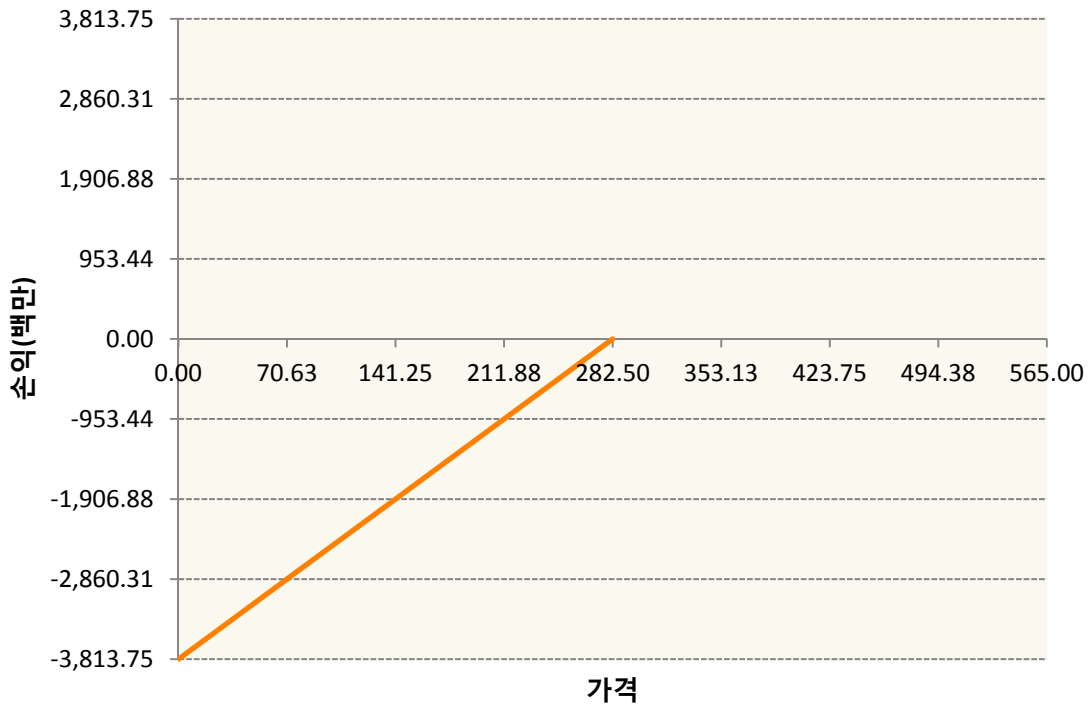


KR4201PC2858-2019-12 콜285

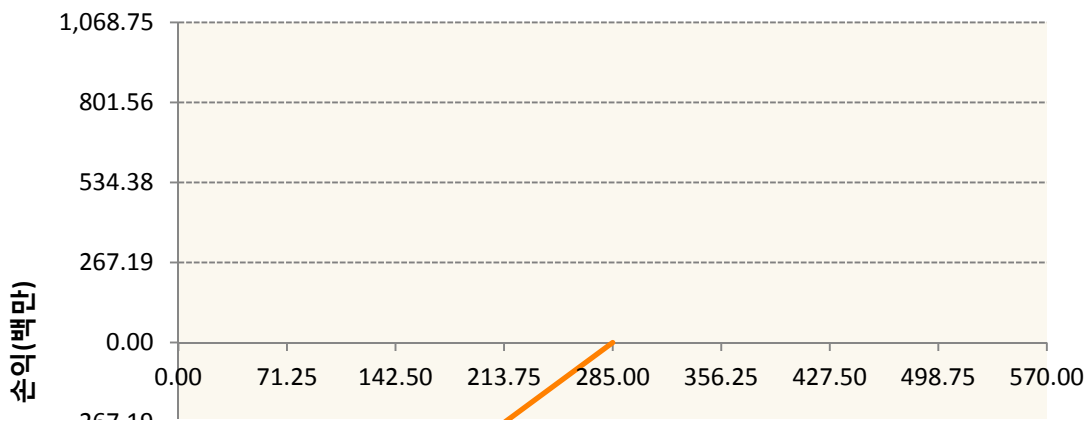




KR4301PC2824-2019-12 풋282.5



KR4301PC2857-2019-12 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						830
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-830	-830	-830	-830	-830	-830	-830	
-5.33%	-554	-554	-554	-554	-554	-554	-554	
-2.67%	-277	-277	-277	-277	-277	-277	-277	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	277	277	277	277	277	277	277	
5.33%	554	554	554	554	554	554	554	
8.00%	830	830	830	830	830	830	830	
KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						245
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-245	-245	-245	-245	-245	-245	-245	
-5.33%	-163	-163	-163	-163	-163	-163	-163	
-2.67%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	82	82	82	82	82	82	82	
5.33%	163	163	163	163	163	163	163	
8.00%	245	245	245	245	245	245	245	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						254
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	78	76	74	72	69	65	61	
-5.33%	73	70	66	61	55	49	43	
-2.67%	60	53	46	38	30	22	13	
0%	30	20	10	0	-10	-20	-31	
2.67%	-24	-35	-46	-57	-68	-79	-90	
5.33%	-104	-114	-124	-134	-144	-154	-165	
8.00%	-205	-212	-220	-228	-236	-245	-254	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						275
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-274	-274	-274	-274	-274	-274	-275
-5.33%	-174	-174	-175	-175	-175	-176	-177
-2.67%	-76	-77	-78	-80	-82	-84	-86
0%	11	7	4	0	-4	-8	-11
2.67%	64	60	56	52	48	44	40
5.33%	82	80	78	76	74	71	68
8.00%	85	84	84	83	82	81	80
KR4301PC2857 2019-12 풋285							79
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-5.33%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-2.67%	-23	-23	-24	-24	-24	-25	-25
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	21	20	18	17	16	15	14
5.33%	29	28	27	26	25	25	24
8.00%	30	30	30	30	29	29	28

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

(단위:백만원)

1,665

공시일	2019-11-22
기준일	2019-11-21

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

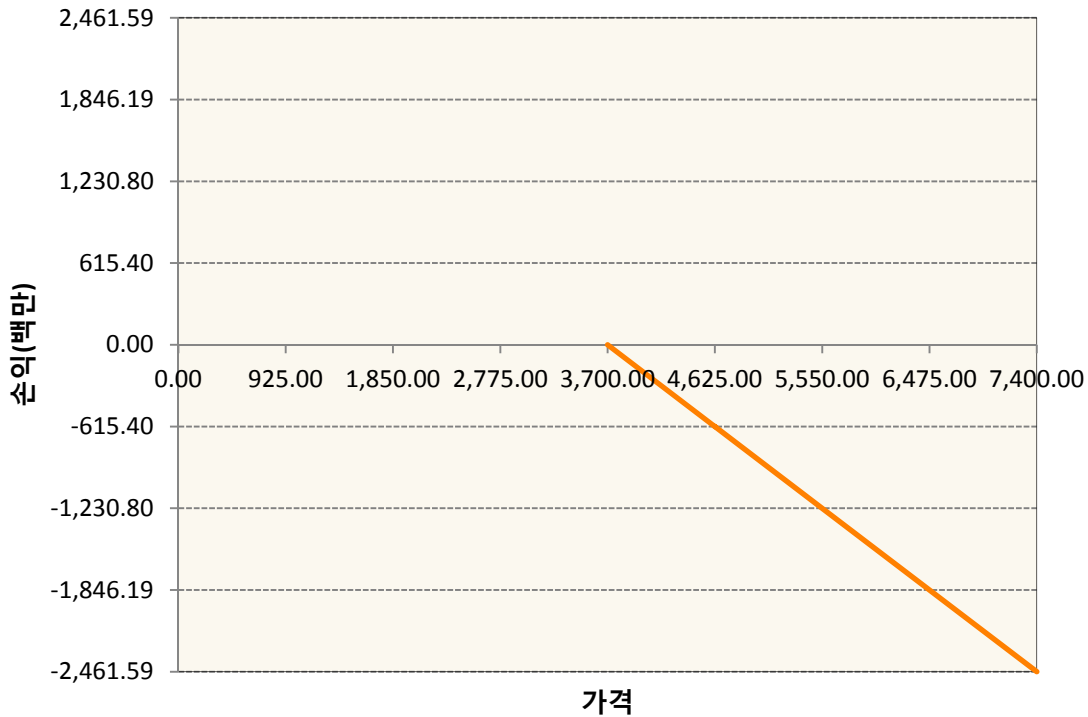
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,527	0	1,527	
누계	유가증권	스왑	17,837	0	17,837	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,199	-9,199	장내
누계	통화	선도	2,708	6,131	-3,423	장외

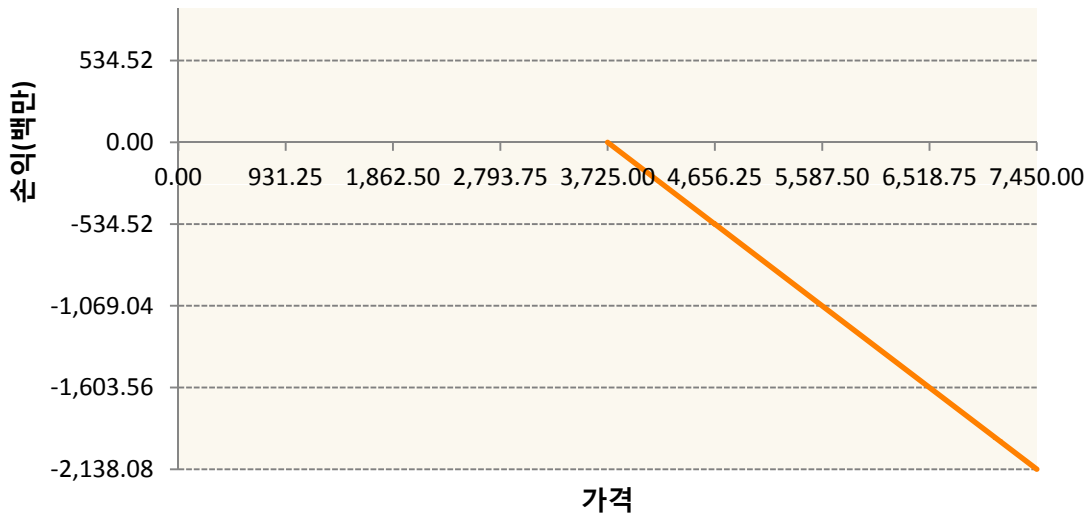
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ9-C3700-EURO STOXX 50

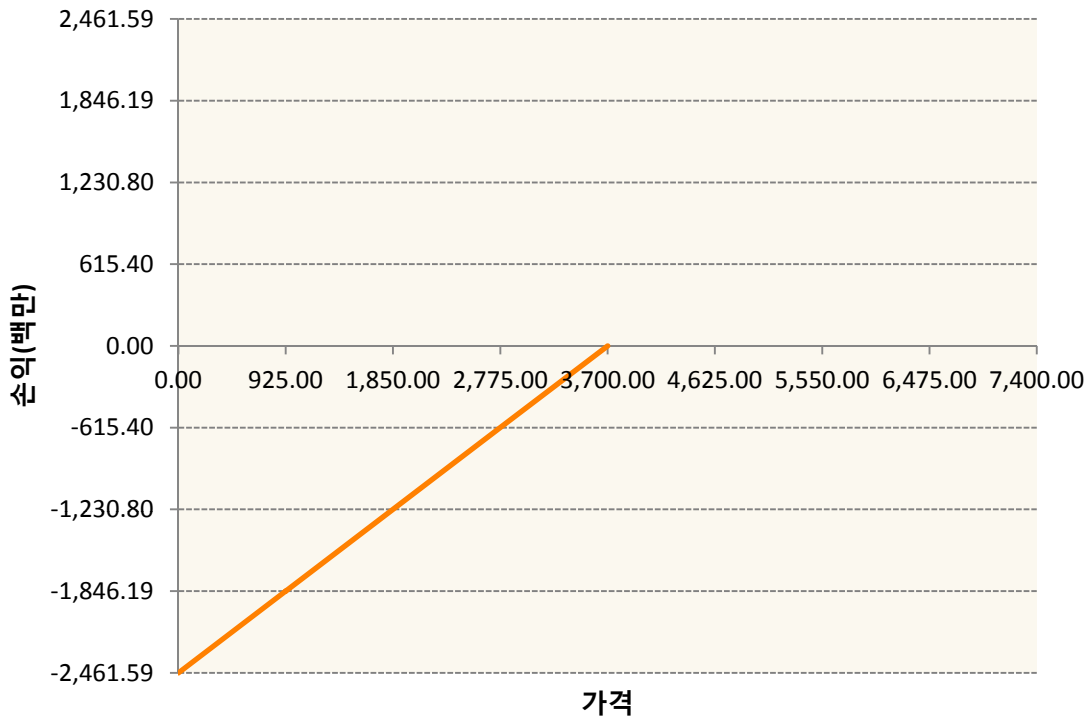


OESXZ9-C3725-EURO STOXX 50

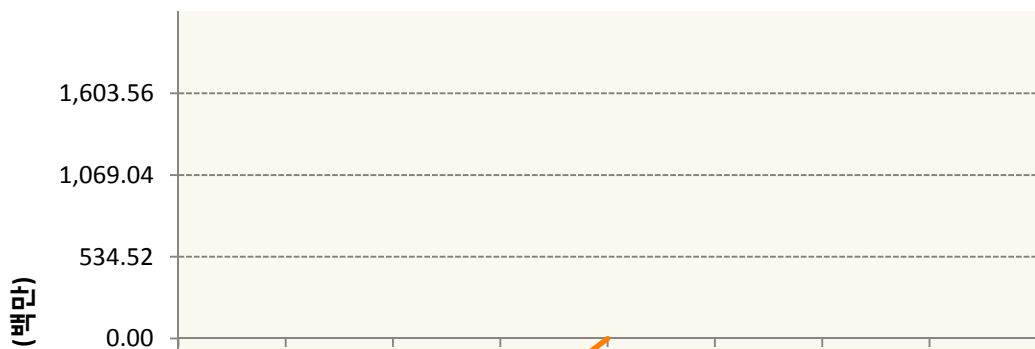


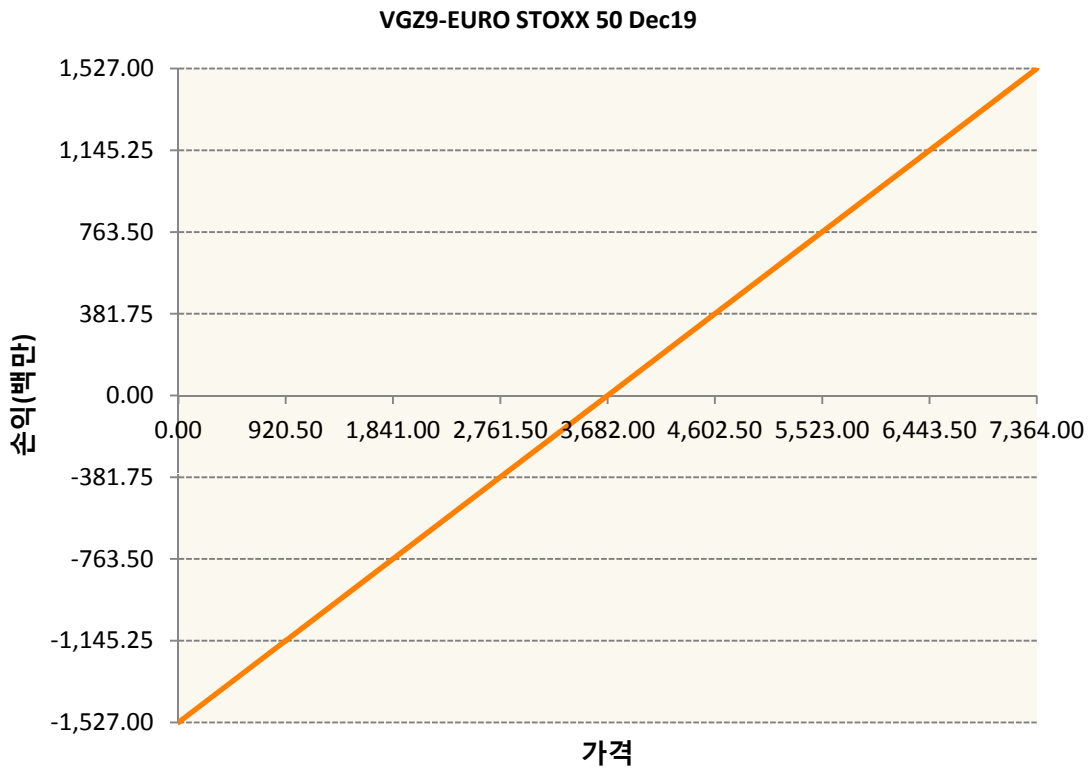
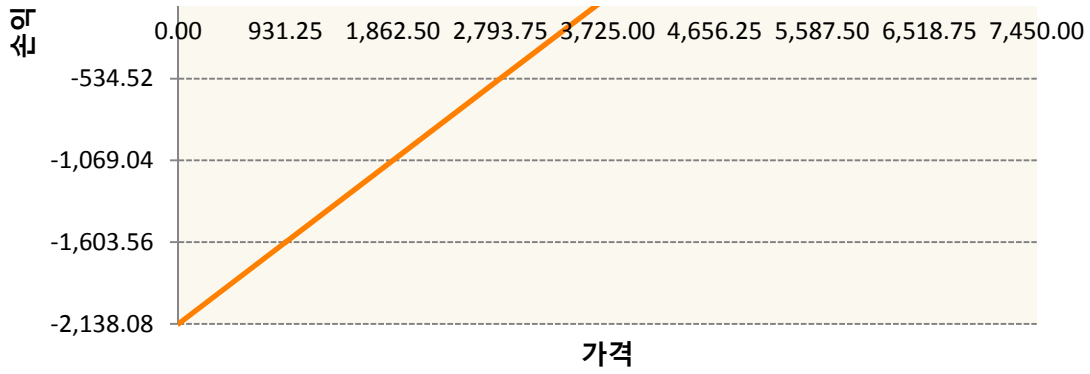


OESXZ9-P3700-EURO STOXX 50



OESXZ9-P3725-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	16
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E	490
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E	164
FX21019X02 EUR/KRW 27-12-19E	52
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	197
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	171
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	197
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	171
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19	122

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

(단위:백만원)

922

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

(단위:백만원)

908

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

(단위:백만원)

79

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

(단위:백만원)

123

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

(단위:백만원)

40

공시일	2019-11-22
기준일	2019-11-21

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

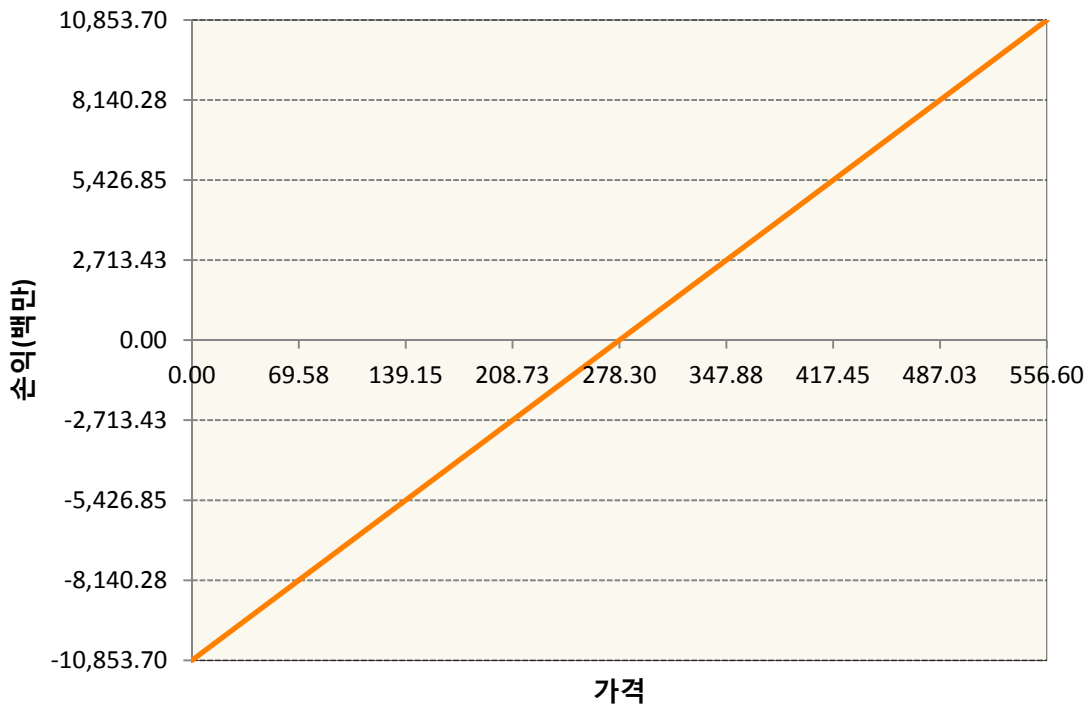
1. 계약금액

(단위:백만원)

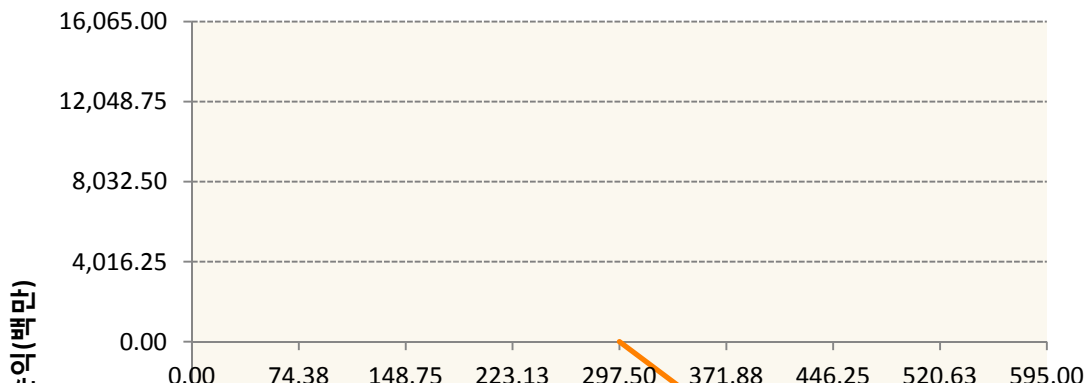
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,854	0	10,854	장내
누계	유가증권	옵션	1,348	21,390	-20,042	장내

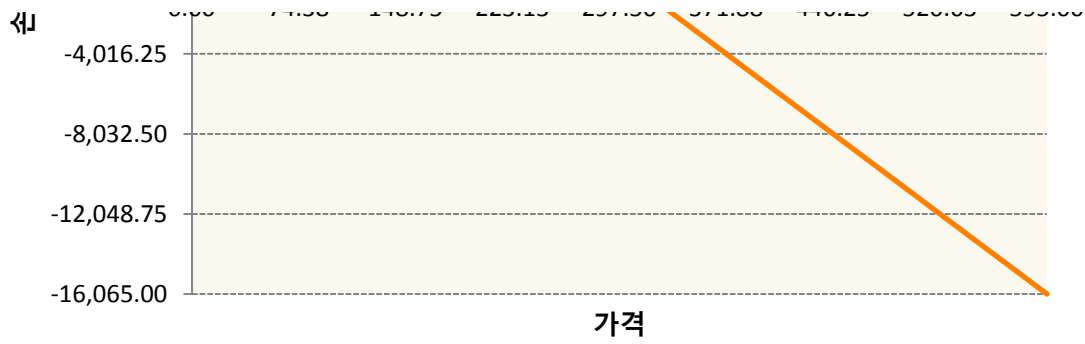
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

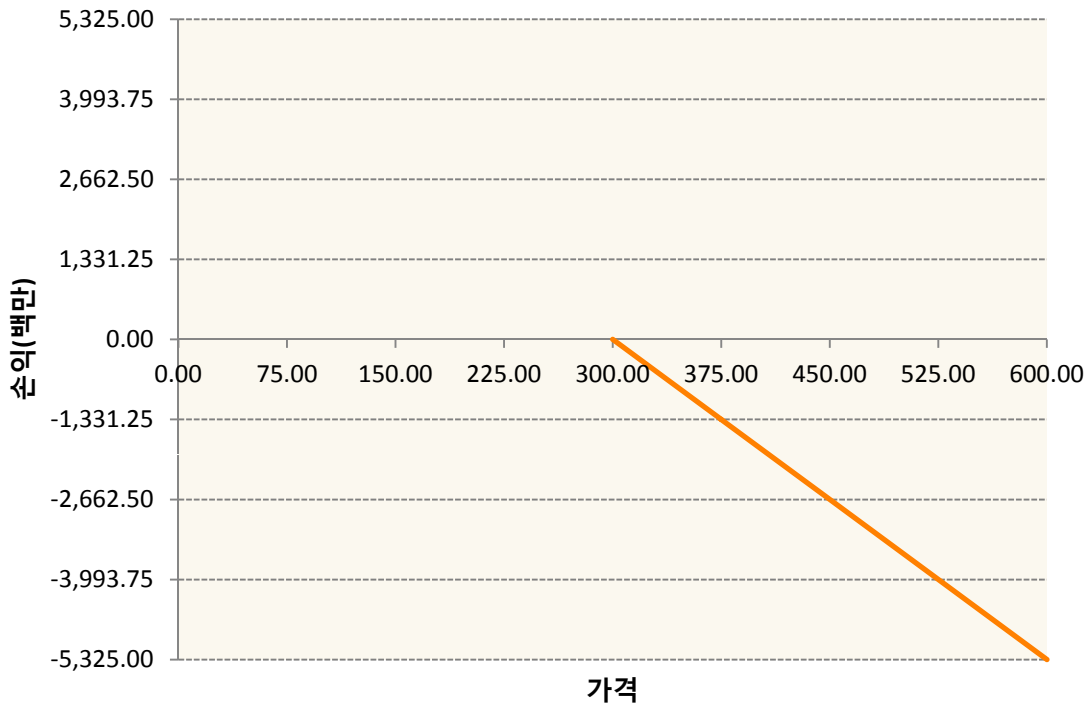


KR4201PC2973-2019-12 콜297.5

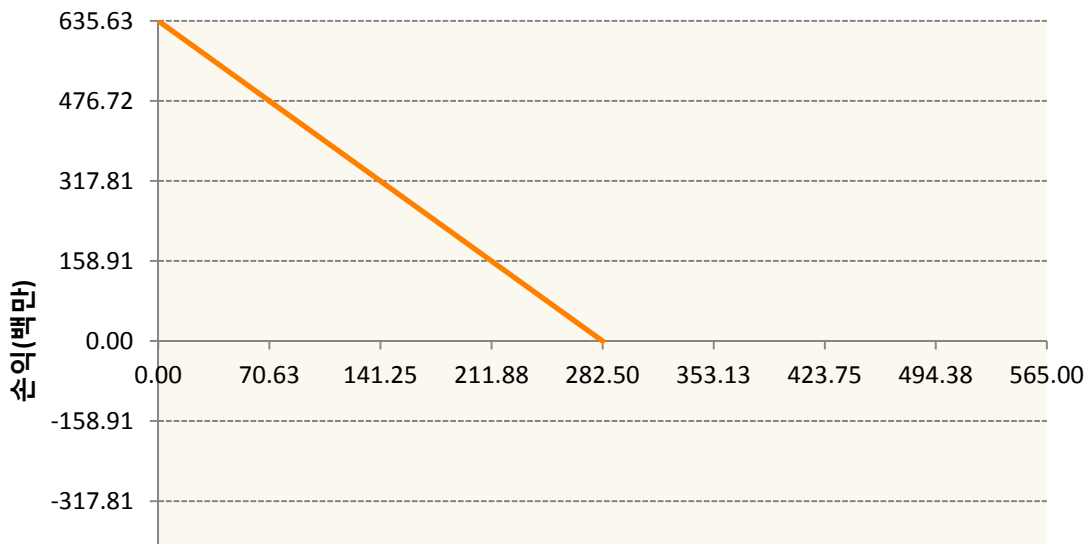


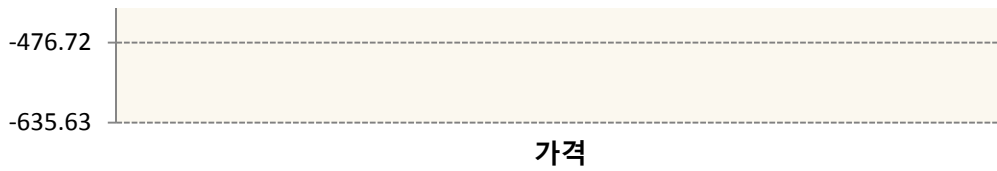


KR4201PC3005-2019-12 콜300

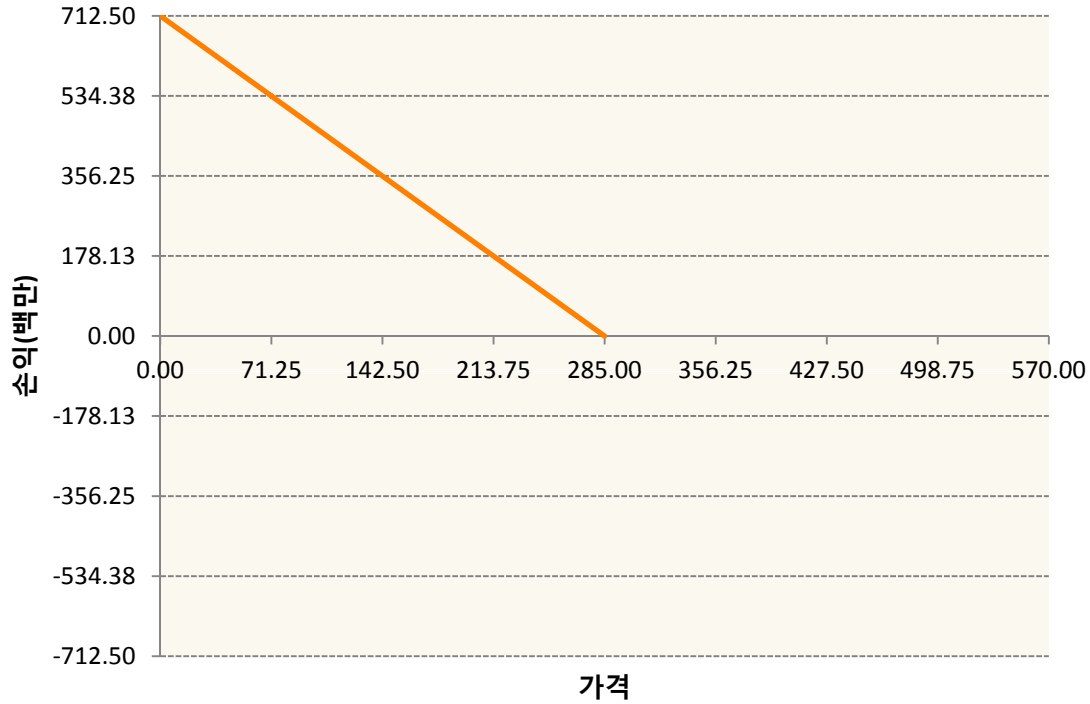


KR4301PC2824-2019-12 풋282.5





KR4301PC2857-2019-12 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						868
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-868	-868	-868	-868	-868	-868	-868	
-5.33%	-579	-579	-579	-579	-579	-579	-579	
-2.67%	-289	-289	-289	-289	-289	-289	-289	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	289	289	289	289	289	289	289	
5.33%	579	579	579	579	579	579	579	
8.00%	868	868	868	868	868	868	868	
KR4201PC2973		2019-12 콜297.5						534
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	86	85	84	82	78	74	68	
-5.33%	84	82	78	72	65	56	45	
-2.67%	77	70	61	49	35	20	2	

0%	53	38	20	0	-22	-45	-69
2.67%	-6	-32	-60	-88	-118	-148	-179
5.33%	-126	-160	-194	-229	-263	-298	-333
8.00%	-321	-356	-392	-427	-463	-499	-534
KR4201PC3005 2019-12 콜300							159
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	22	22	22	21	20	19	18
-5.33%	22	21	20	19	17	15	12
-2.67%	20	19	16	13	9	5	0
0%	15	11	6	0	-6	-13	-21
2.67%	0	-8	-16	-24	-33	-43	-52
5.33%	-32	-43	-54	-65	-76	-87	-98
8.00%	-88	-100	-112	-123	-135	-147	-159
KR4301PC2824 2019-12 풋282.5							46
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	46	46	46	46	46	46	46
-5.33%	29	29	29	29	29	29	29
-2.67%	13	13	13	13	14	14	14
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-11	-10	-9	-9	-8	-7	-7
5.33%	-14	-13	-13	-13	-12	-12	-11
8.00%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-13
KR4301PC2857 2019-12 풋285							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%	16	16	16	16	16	17	17
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-14	-13	-12	-12	-11	-10	-9
5.33%	-19	-19	-18	-18	-17	-16	-16
8.00%	-20	-20	-20	-20	-19	-19	-19

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

(단위:백만원)

1,256

공시일	2019-11-22
기준일	2019-11-21

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	205,765	0	205,765	

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	2019-11-22
기준일	2019-11-21

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	214,755	0	214,755	

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	2019-11-22
기준일	2019-11-21

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	545,213	0	545,213	
누계	통화	선도	0	655,613	-655,613	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		1,885
FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E		1,979
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		660
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		697
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,696
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,807
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,414
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,827
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,517
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		2,865
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		942
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		942
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,885
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,885
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		942
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		942
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		942
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		942
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		471
FX21019X00 KRW/USD 06-12-19E		660
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		471
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		471
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		471
FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E		1,546
FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E		942
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		471

FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E	942
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E	1,546
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E	1,885
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E	3,242
FX21019X02 KRW/USD 26-12-19E	4,750
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E	4,807

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

(단위:백만원)

16,432

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

(단위:백만원)

185

공시일	2019-11-22
기준일	2019-11-21

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

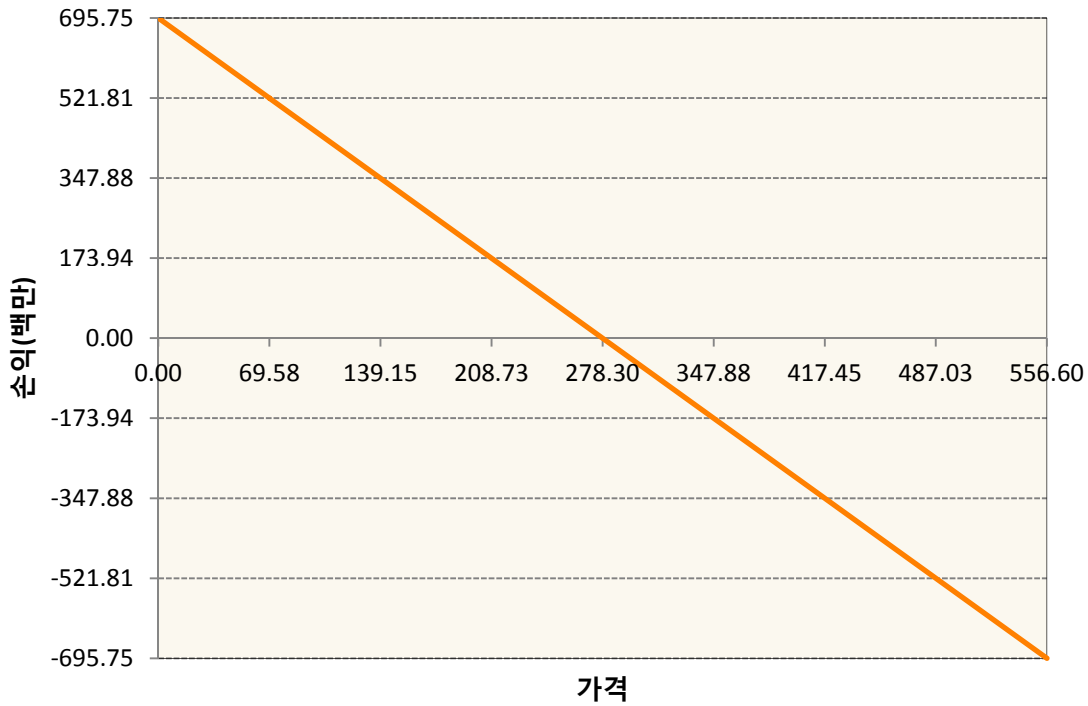
1. 계약금액

(단위:백만원)

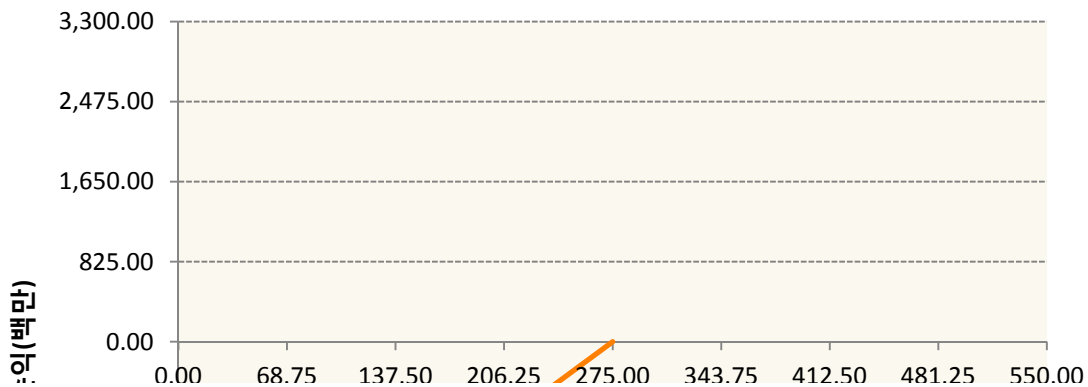
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	140	-140	장내
누계	유가증권	선물	0	696	-696	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,994	-3,994	장내

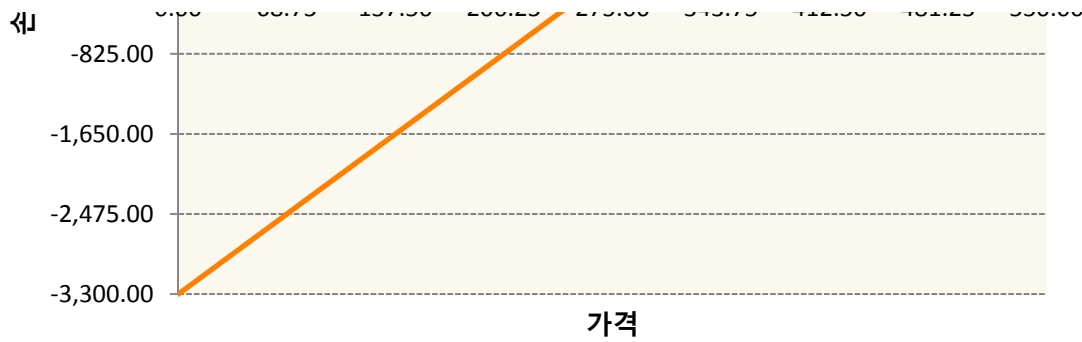
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

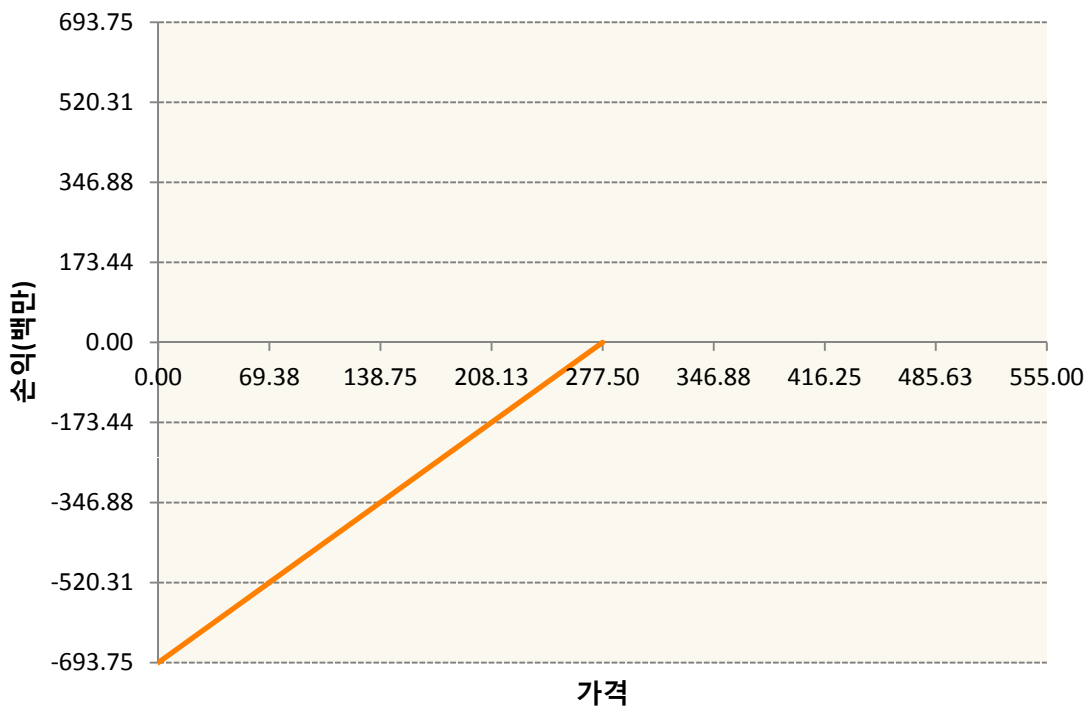


KR4301PC2758-2019-12 풋275





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%	37	37	37	37	37	37	37	
-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%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37	
8.00%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56	
KR4301PC2758		2019-12 풋275						204
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-202	-202	-202	-202	-203	-203	-204
-5.33%	-114	-115	-116	-117	-119	-121	-123
-2.67%	-37	-40	-43	-46	-49	-53	-56
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	25	24	22	21	18	16	14
5.33%	28	27	27	26	26	25	24
8.00%	28	28	28	28	27	27	27
KR4301PC2774 2019-12 풋277.5							46
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
-5.33%	-27	-27	-27	-28	-28	-28	-28
-2.67%	-10	-10	-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	8	8	7	7
8.00%	8	8	8	8	8	8	8

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

(단위:백만원)

310

공시일	2019-11-22
기준일	2019-11-21

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	15,437	0	15,437	
누계	통화	선도	353	19,215	-18,861	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019V01 KRW/USD 10-12-19E		373
FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E		320
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		320
FX21019X01 KRW/USD 13-01-20E		231
FX21019X02 USD/KRW 25-11-19E		28
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		292

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

(단위:백만원)

490

공시일	2019-11-22
기준일	2019-11-21

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	692	0	692	장외
누계	통화	선도	437	476	-39	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
FX21019X03 EUR/KRW 31-01-20E	19

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

(단위:백만원)

73

공시일	2019-11-22
기준일	2019-11-21

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

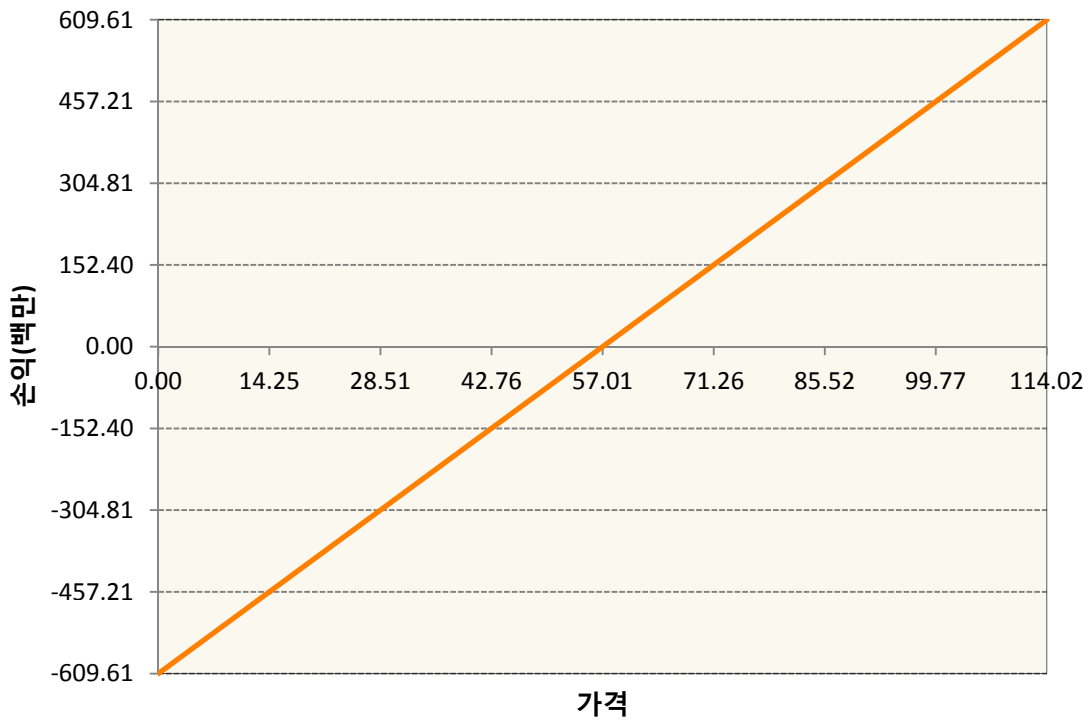
1. 계약금액

(단위:백만원)

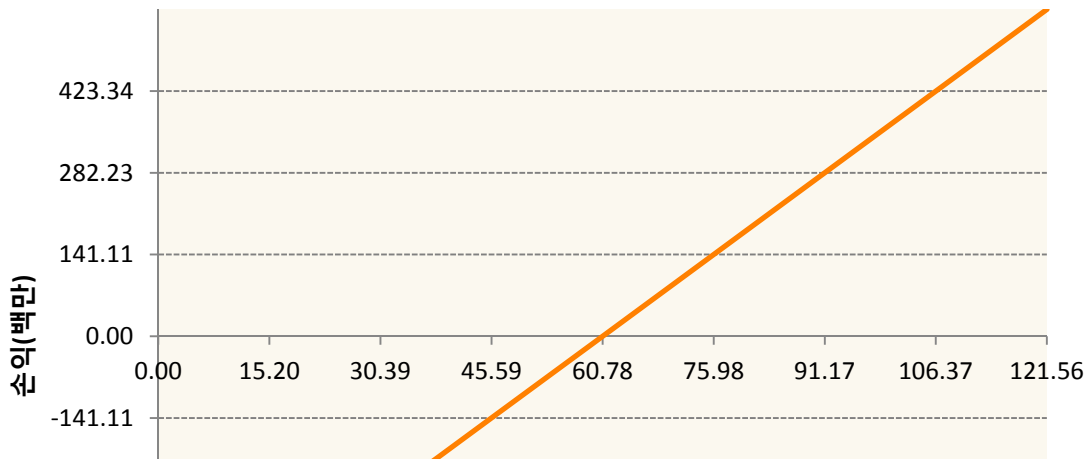
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,466	294	2,172	

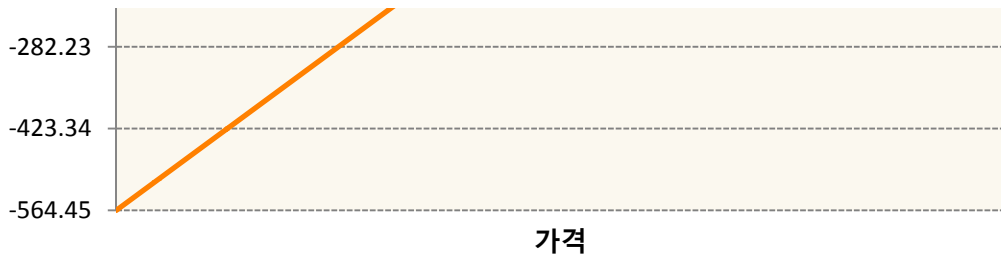
2. 만기시점의 손익구조

CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20

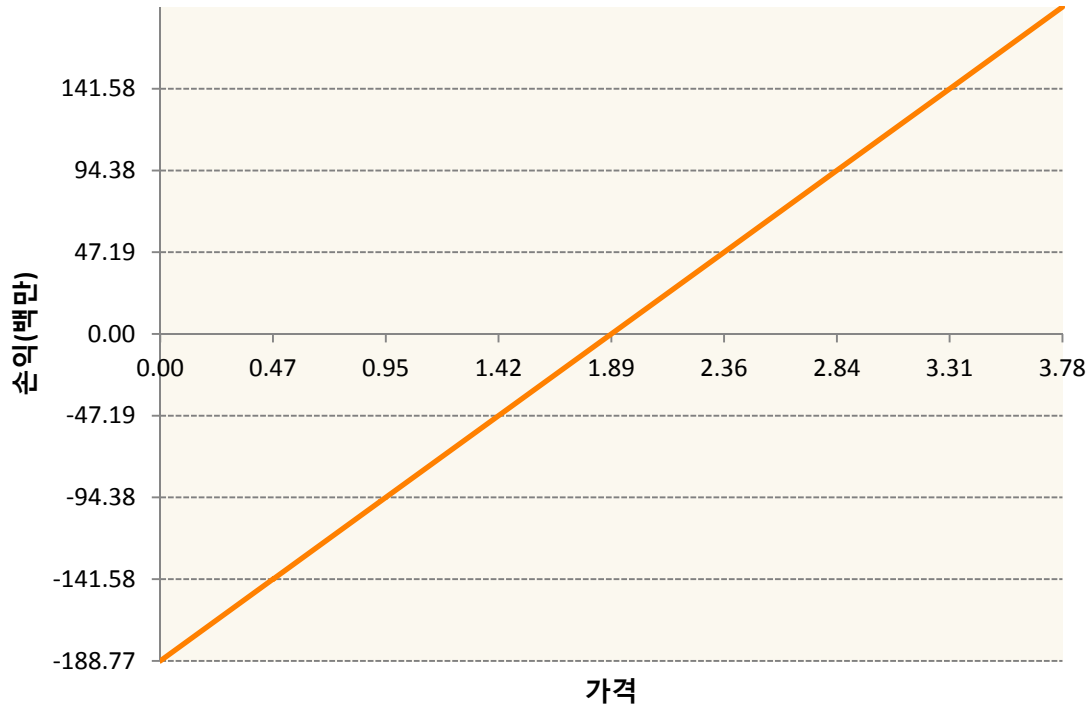


COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20

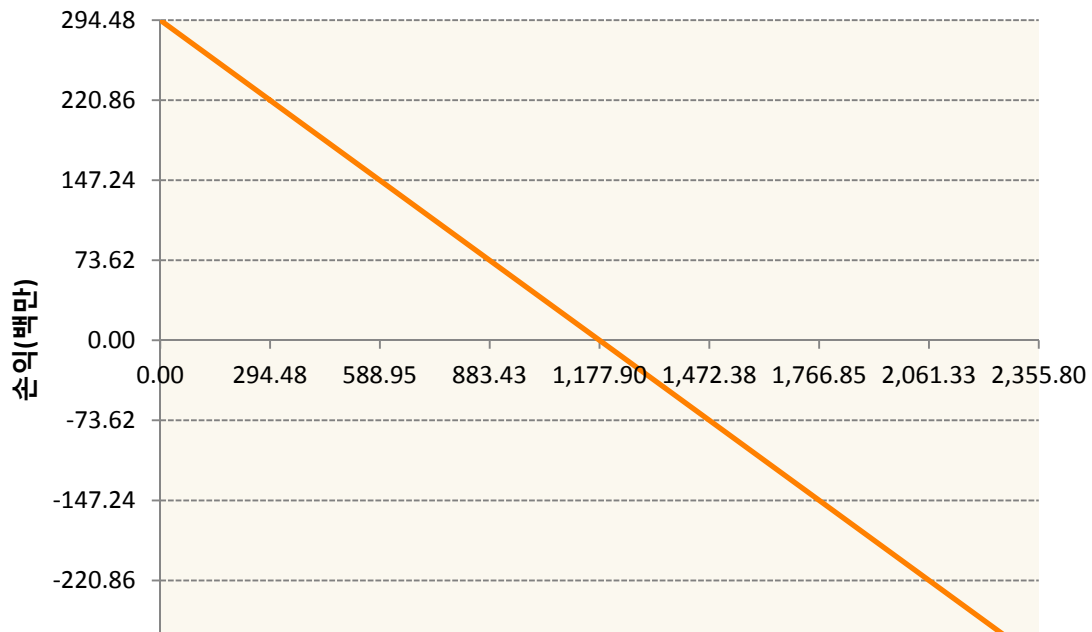


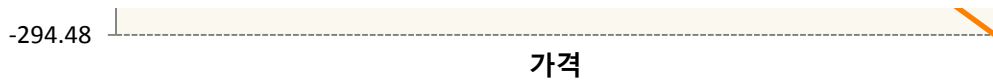


HOF0-NY Harb ULSD Fut Jan20

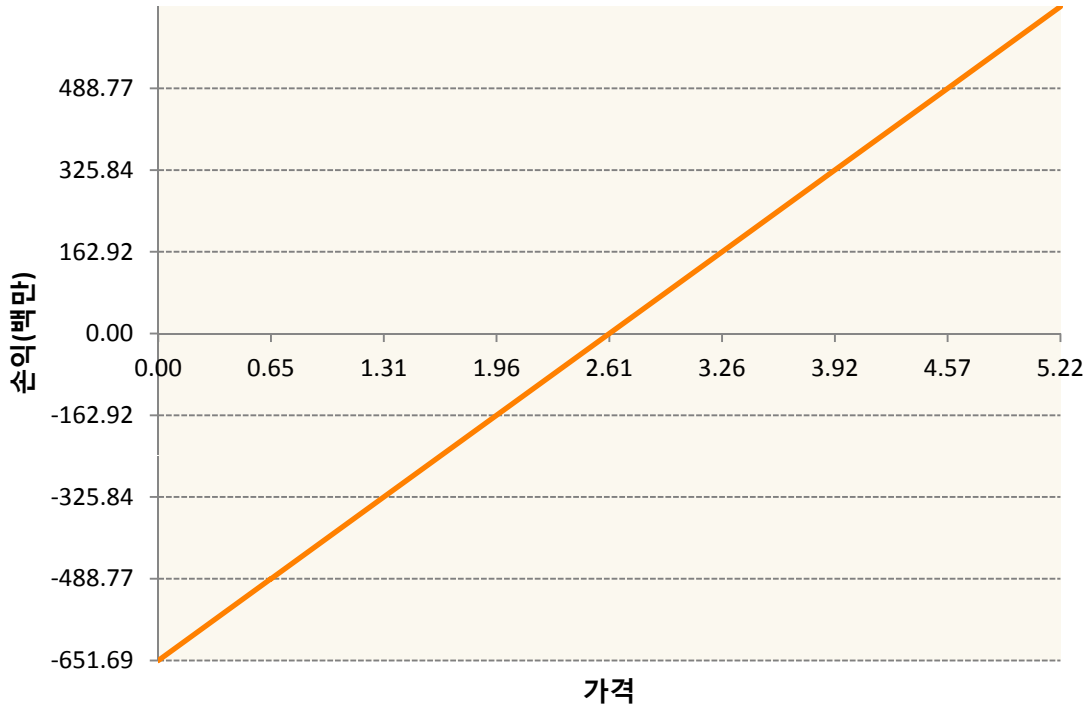


KR4175PC0003-2019-12 달러선물

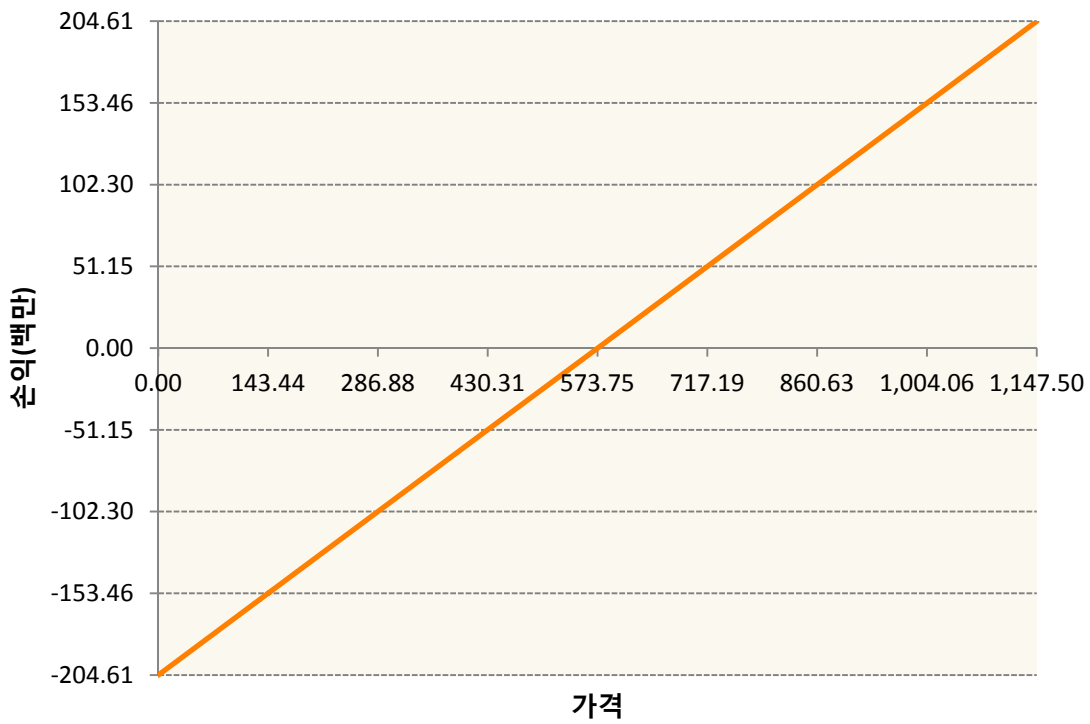




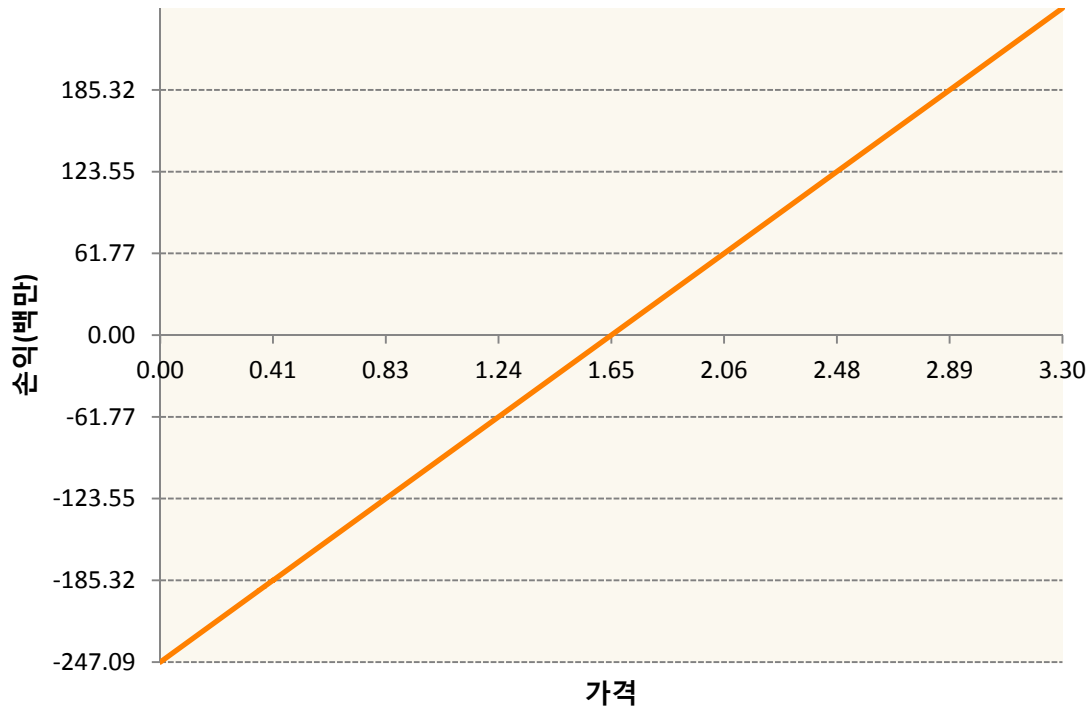
NGF20-NATURAL GAS FUTR Jan20



QSF0-Low Su Gasoil G Jan20



XBF0-GASOLINE RBOB FUT Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLF0	WTI CRUDE FUTURE Jan20	49
COH0	BRENT CRUDE FUTR Mar20	45
HOF0	NY Harb ULSD Fut Jan20	15
KR4175PC00	2019-12 달러선물	24
NGF20	NATURAL GAS FUTR Jan20	52
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	16
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	20

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

(단위:백만원)

410

공시일	2019-11-22
기준일	2019-11-21

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

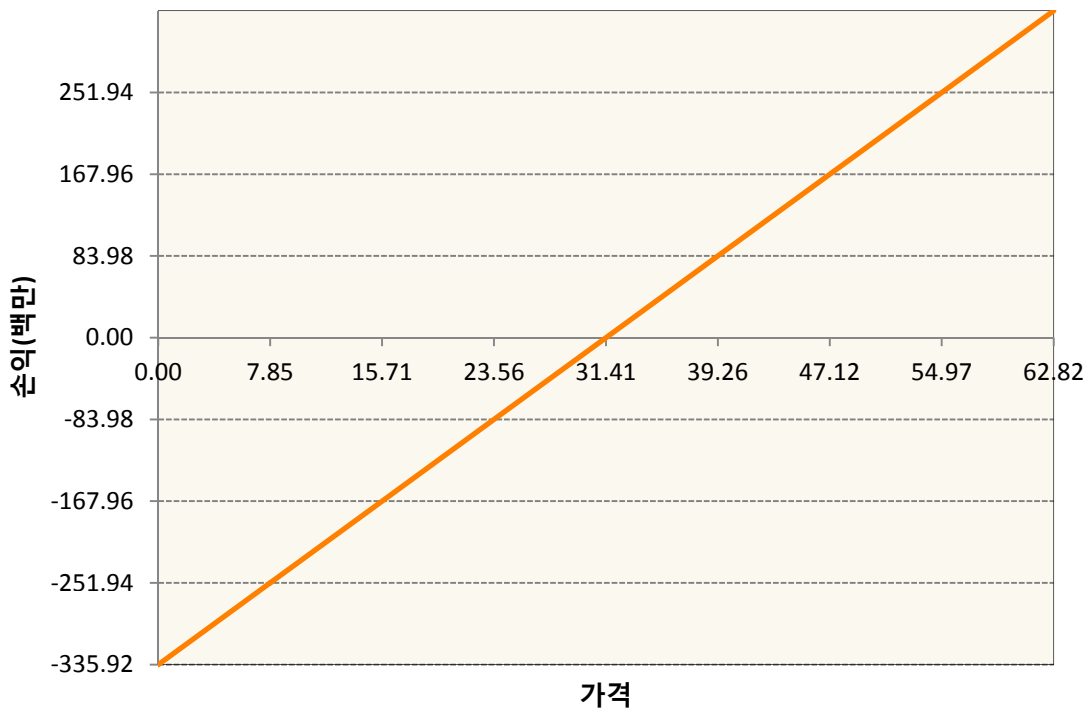
1. 계약금액

(단위:백만원)

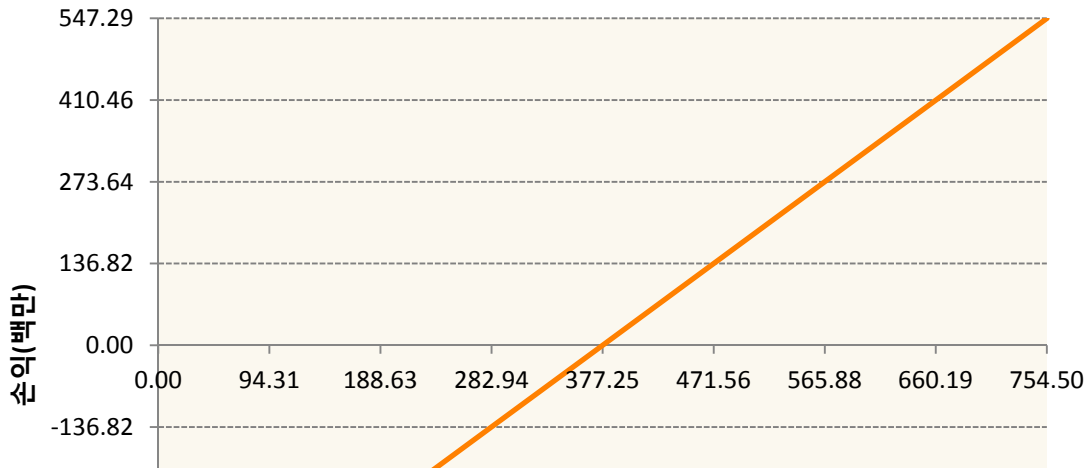
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,806	94	2,711	

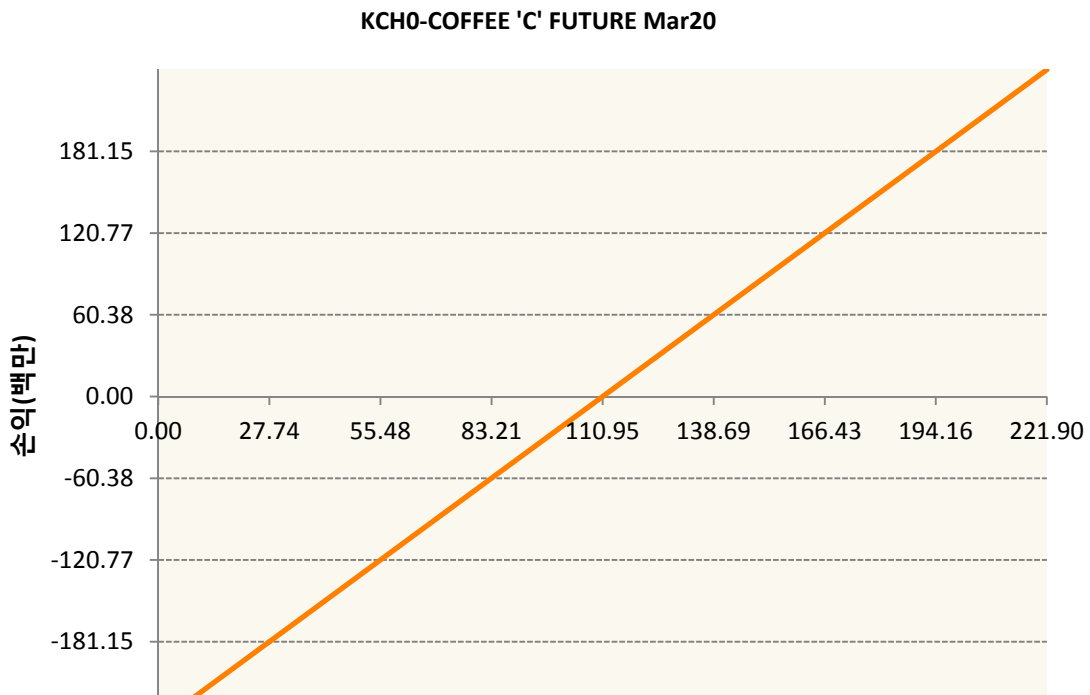
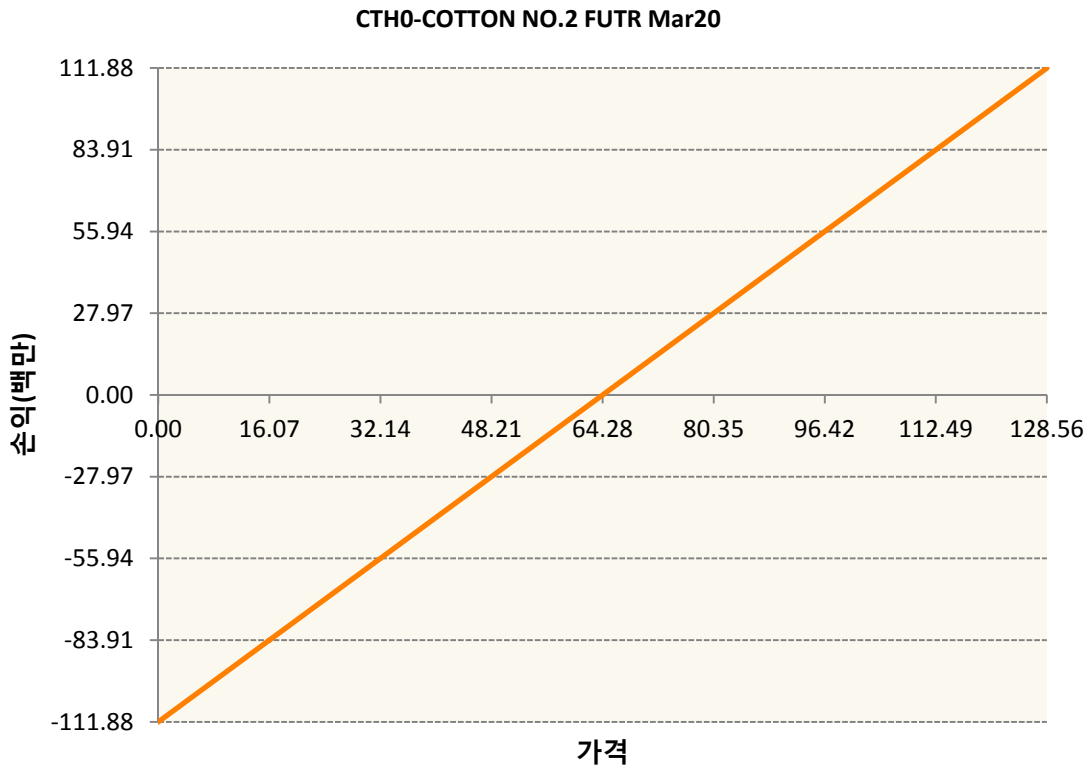
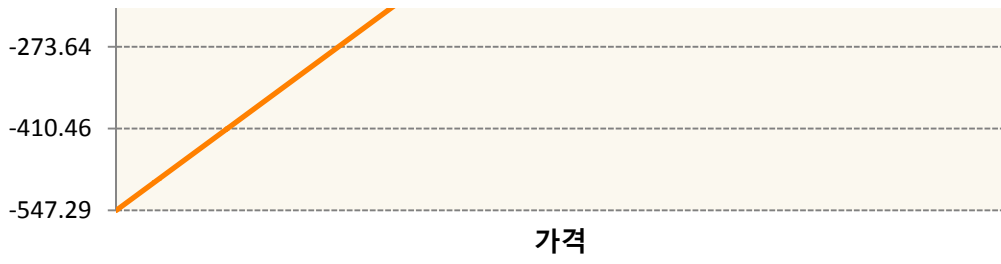
2. 만기시점의 손익구조

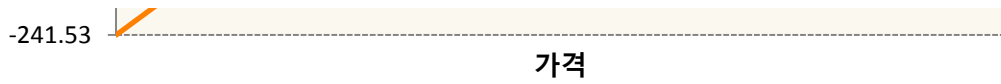
BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20



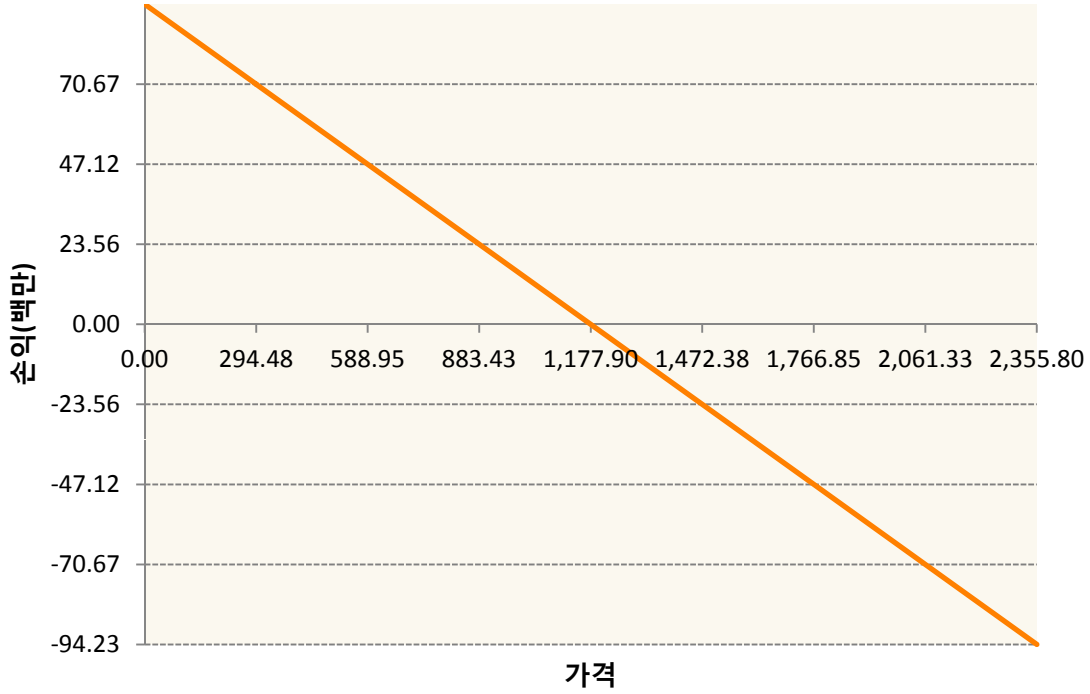
CH0-CORN FUTURE Mar20



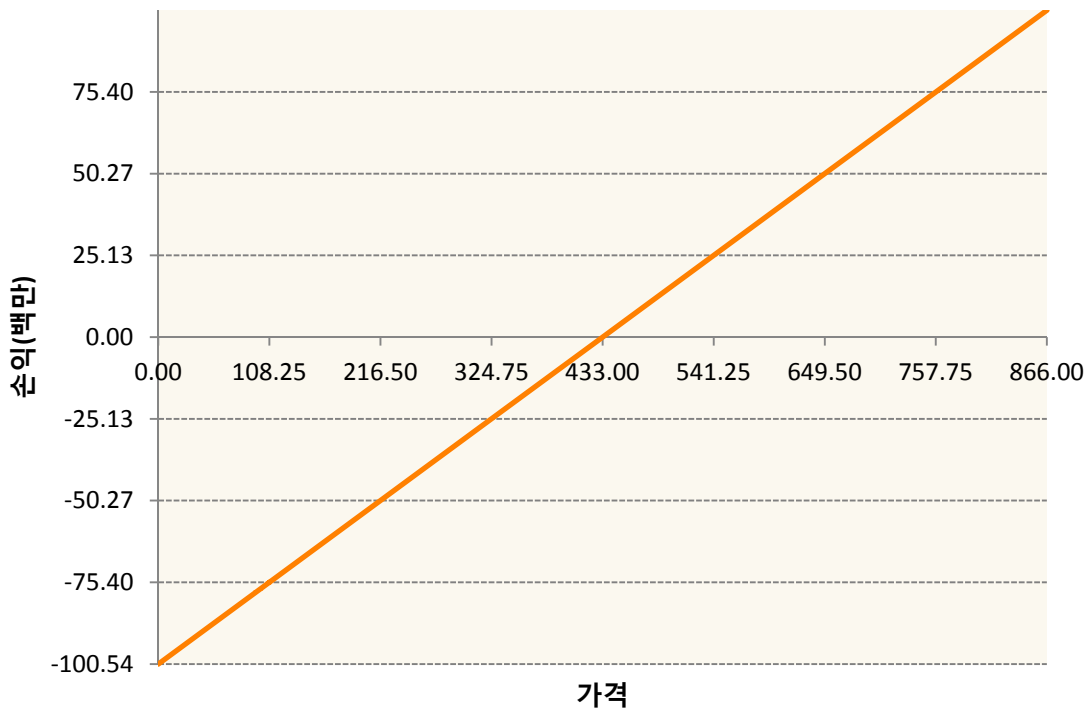




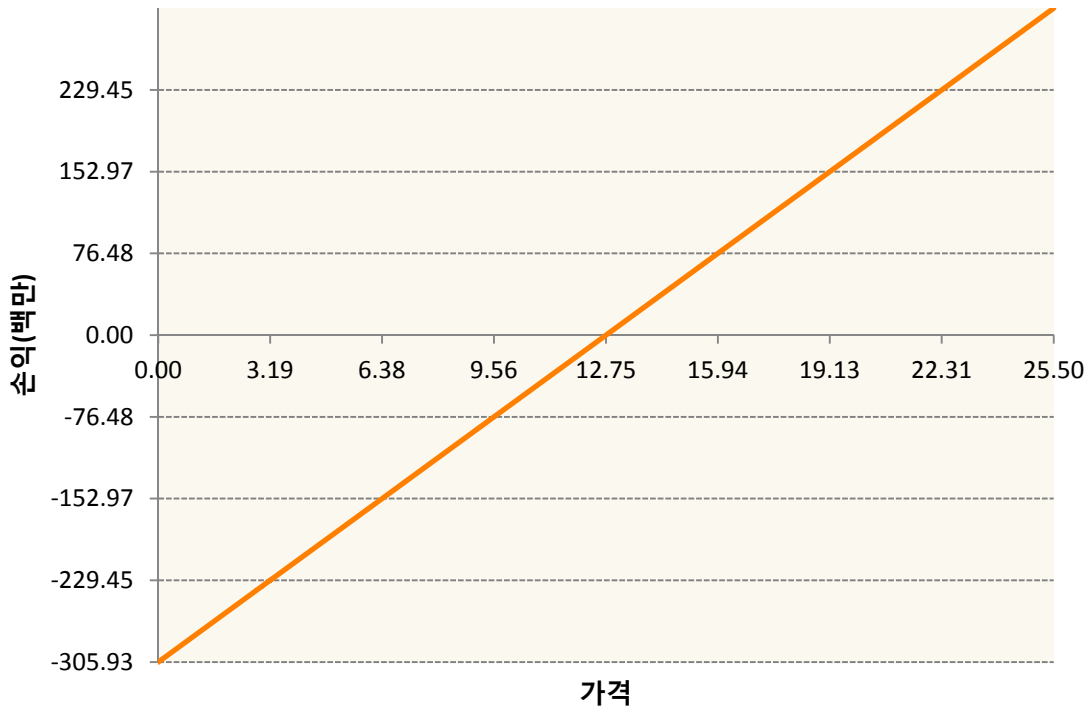
KR4175PC0003-2019-12 달러선물



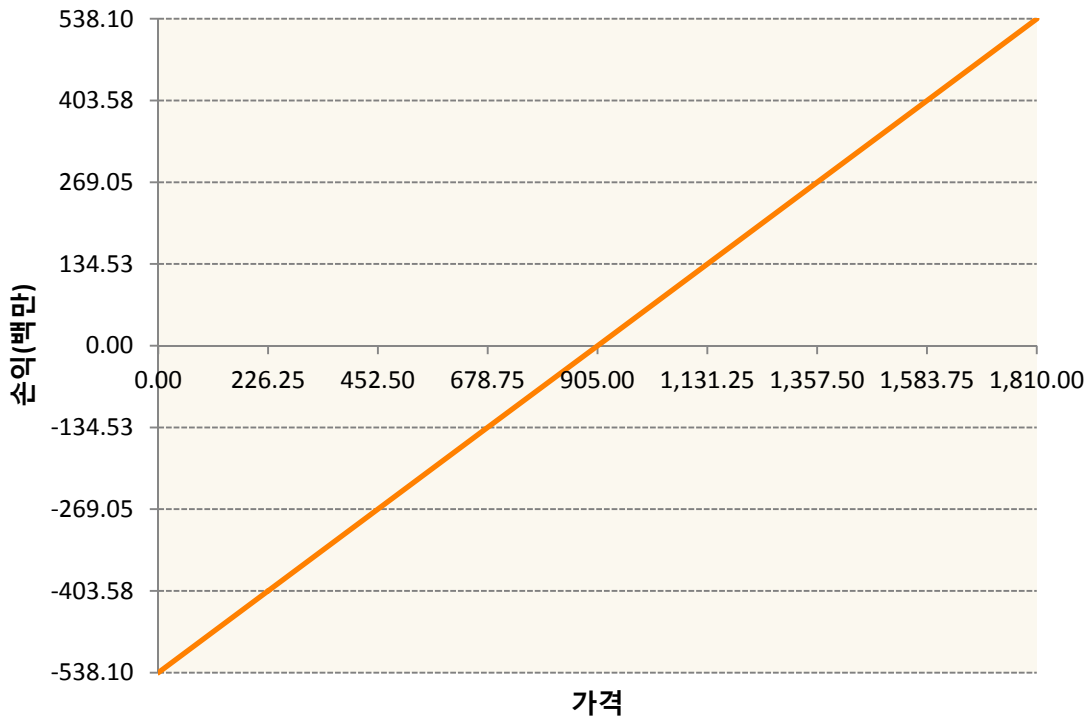
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



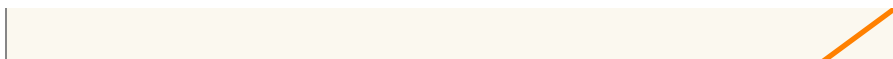
SBH0-Sugar Mar20

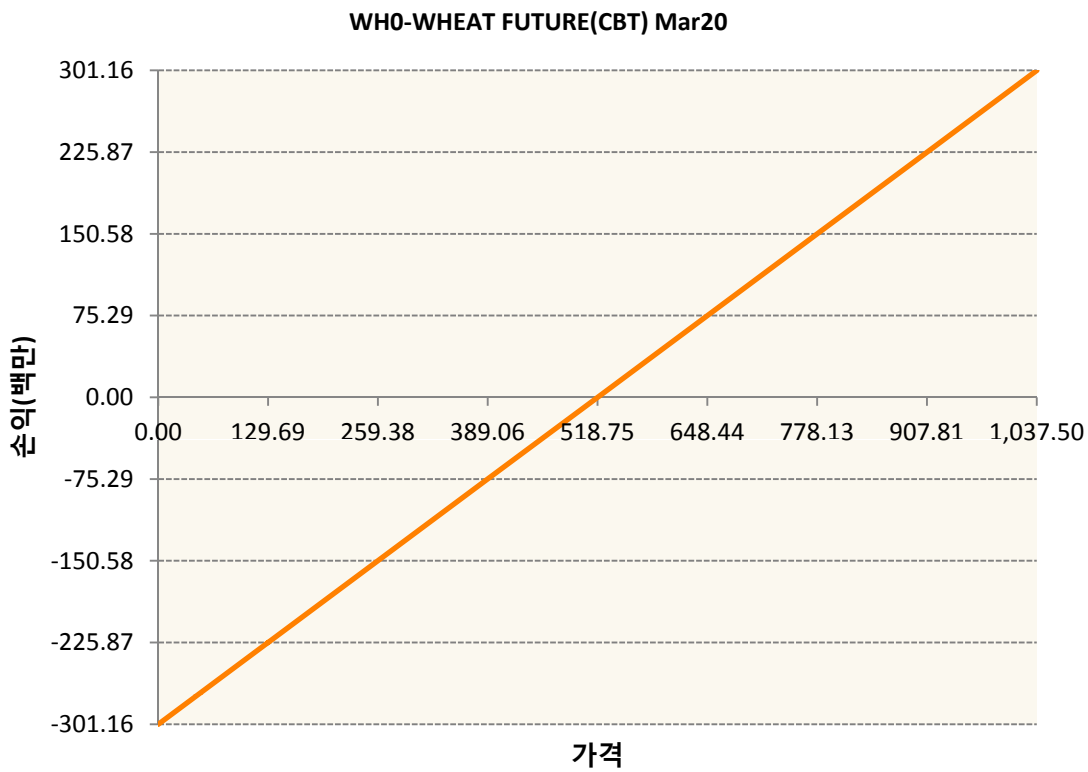
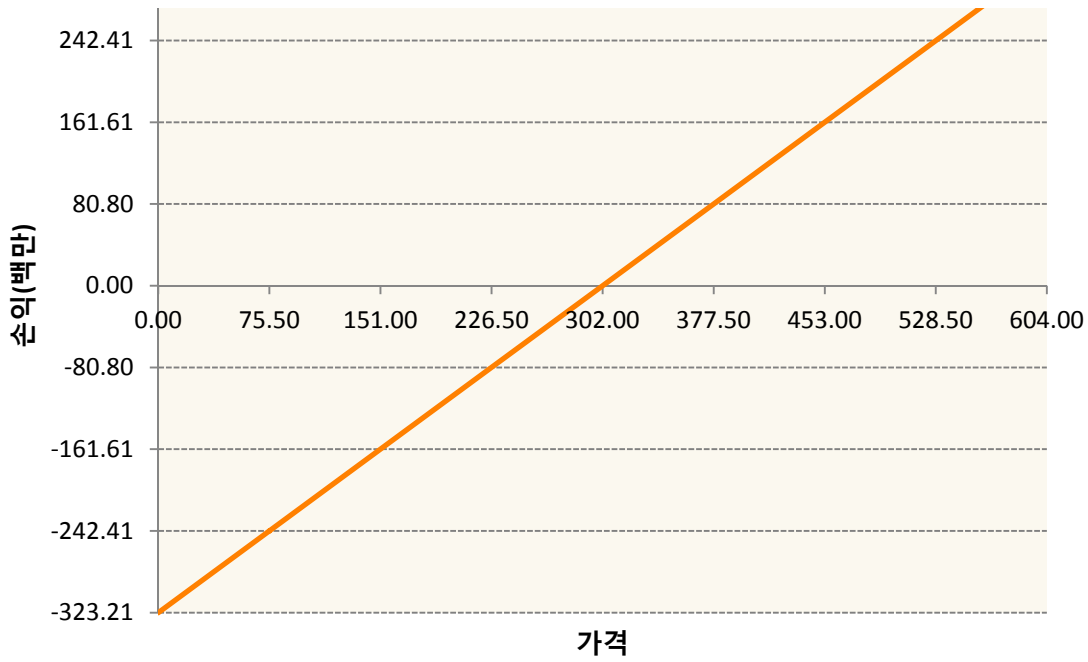


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20



SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF0	SOYBEAN OIL FUTR Jan20	27
CH0	CORN FUTURE Mar20	44
CTH0	COTTON NO.2 FUTR Mar20	9
KCH0	COFFEE 'C' FUTURE Mar20	19
KR4175PC00	2019-12 달러선물	8

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)

246