

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-25 |
| 기준일 | 2019-11-22 |

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 | 2019-11-25 |
| 기준일 | 2019-11-22 |

SMART합성-MSCI선진국증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수 | 스왑 | 13,582 | 0 | 13,582 | 장외 |
| 누계 | 지수 | 스왑 | 13,582 | 0 | 13,582 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S191122

1,086

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

625

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-25 |
| 기준일 | 2019-11-22 |

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) | 378 |
| SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2) | 138 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

748

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-25 |
| 기준일 | 2019-11-22 |

유로인덱스모(주식-파생형)

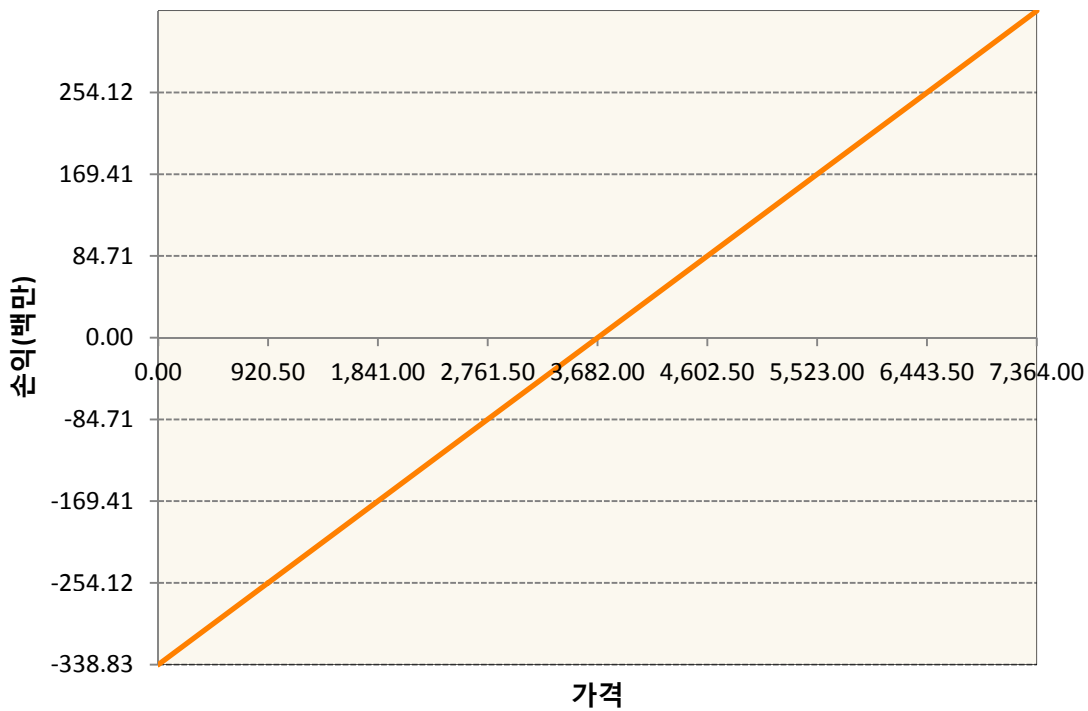
1. 계약금액

(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 | 2019-11-25 |
| 기준일 | 2019-11-22 |

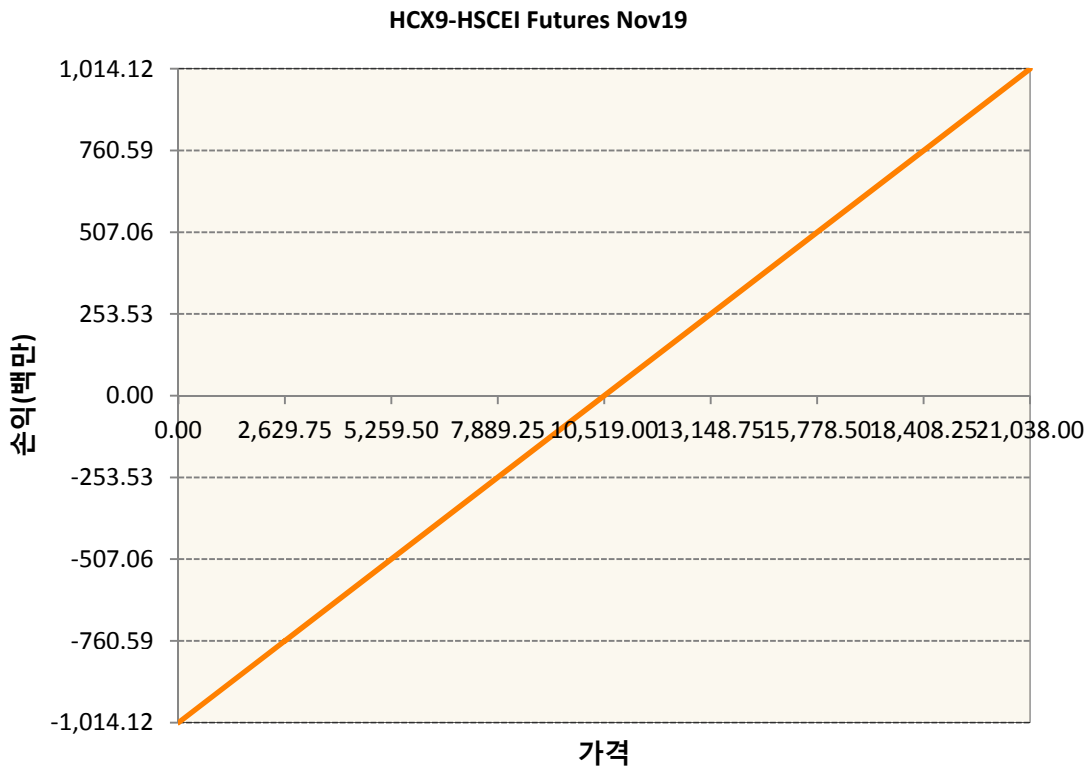
차이나인덱스모(주식-파생형)

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 | 1,014 | 0 | 1,014 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------|---------------------|----|
| HXC9 | HSCEI Futures Nov19 | 81 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

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

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-25 |
| 기준일 | 2019-11-22 |

커버드콜모(주식혼합-파생형)

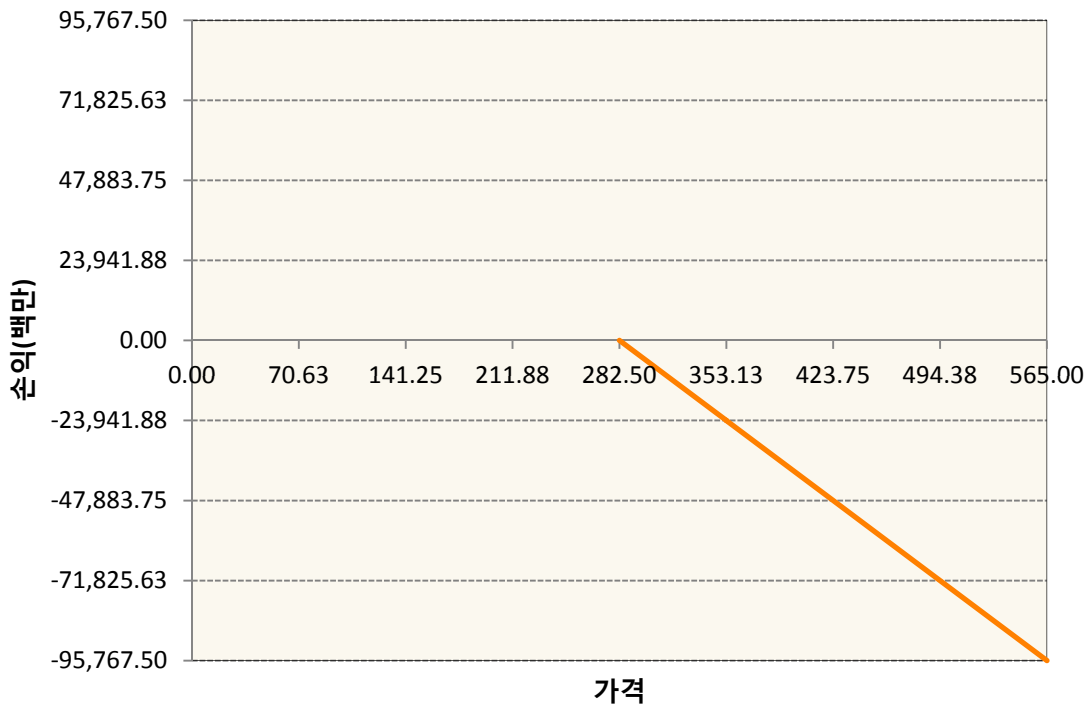
1. 계약금액

(단위:백만원)

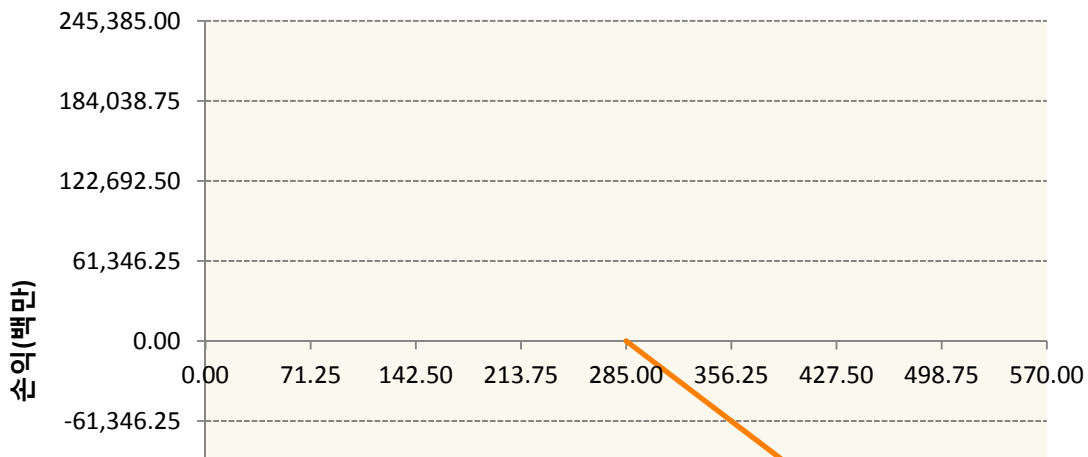
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 498,456 | -498,456 | 장내 |

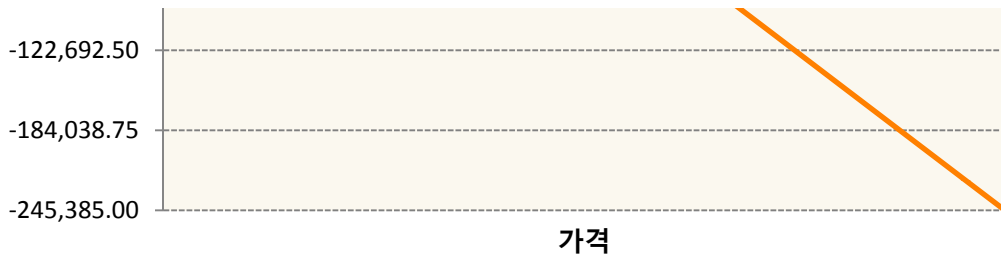
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PC2825-2019-12 콜282.5

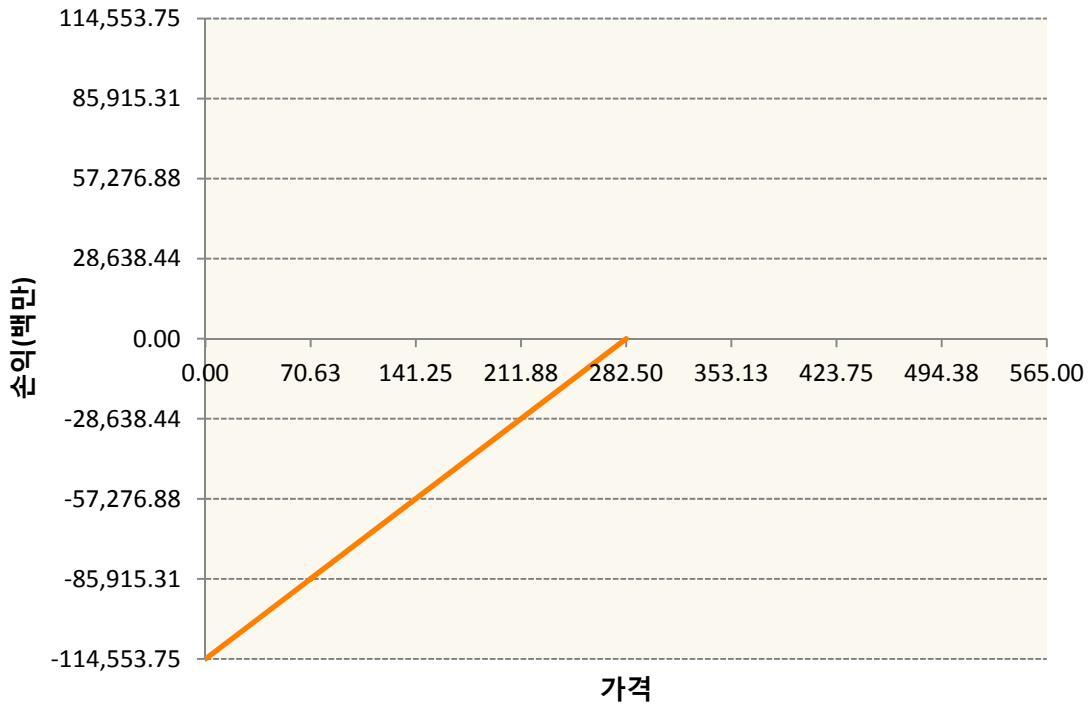


KR4201PC2858-2019-12 콜285

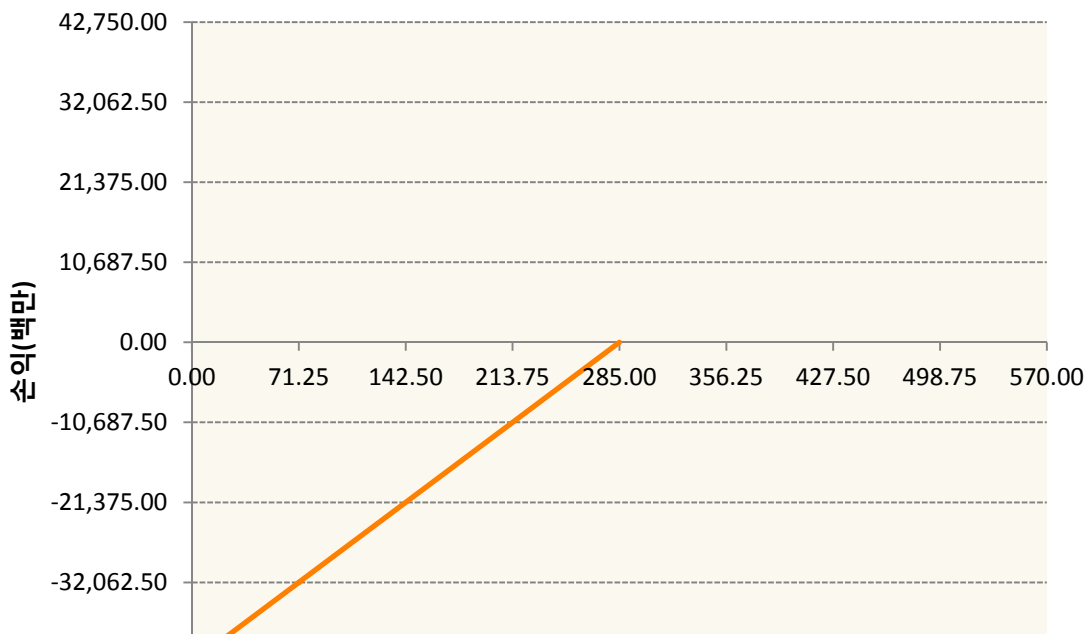




KR4301PC2824-2019-12 풋282.5



KR4301PC2857-2019-12 풋285



-42,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4201PC2825 | | 2019-12 콜282.5 | | | | | | 5,472 |
|--------------|---------|----------------|---------|---------|---------|---------|---------|--------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 1,935 | 1,897 | 1,847 | 1,783 | 1,707 | 1,620 | 1,523 | |
| -5.33% | 1,794 | 1,705 | 1,601 | 1,486 | 1,360 | 1,225 | 1,083 | |
| -2.67% | 1,409 | 1,254 | 1,091 | 921 | 747 | 568 | 387 | |
| 0% | 609 | 407 | 204 | 0 | -204 | -409 | -614 | |
| 2.67% | -712 | -914 | -1,117 | -1,321 | -1,526 | -1,732 | -1,938 | |
| 5.33% | -2,528 | -2,685 | -2,851 | -3,023 | -3,202 | -3,385 | -3,571 | |
| 8.00% | -4,705 | -4,801 | -4,914 | -5,039 | -5,174 | -5,319 | -5,472 | |
| KR4201PC2858 | | 2019-12 콜285 | | | | | | 13,108 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 4,115 | 4,046 | 3,947 | 3,817 | 3,657 | 3,468 | 3,253 | |
| -5.33% | 3,868 | 3,688 | 3,469 | 3,218 | 2,937 | 2,631 | 2,303 | |
| -2.67% | 3,134 | 2,790 | 2,419 | 2,026 | 1,616 | 1,192 | 756 | |
| 0% | 1,488 | 998 | 502 | 0 | -506 | -1,015 | -1,526 | |
| 2.67% | -1,416 | -1,948 | -2,481 | -3,014 | -3,548 | -4,081 | -4,615 | |
| 5.33% | -5,628 | -6,078 | -6,544 | -7,021 | -7,508 | -8,003 | -8,503 | |
| 8.00% | -10,881 | -11,183 | -11,520 | -11,885 | -12,274 | -12,683 | -13,108 | |
| KR4301PC2824 | | 2019-12 풋282.5 | | | | | | 8,160 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -8,146 | -8,146 | -8,146 | -8,147 | -8,150 | -8,153 | -8,160 | |
| -5.33% | -5,130 | -5,135 | -5,142 | -5,154 | -5,172 | -5,194 | -5,223 | |
| -2.67% | -2,175 | -2,214 | -2,262 | -2,318 | -2,381 | -2,450 | -2,524 | |
| 0% | 338 | 227 | 114 | 0 | -115 | -232 | -349 | |
| 2.67% | 1,749 | 1,644 | 1,536 | 1,426 | 1,314 | 1,200 | 1,084 | |
| 5.33% | 2,155 | 2,119 | 2,074 | 2,021 | 1,960 | 1,893 | 1,819 | |
| 8.00% | 2,208 | 2,203 | 2,194 | 2,181 | 2,161 | 2,136 | 2,105 | |
| KR4301PC2857 | | 2019-12 풋285 | | | | | | 3,131 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -3,128 | -3,128 | -3,128 | -3,128 | -3,129 | -3,129 | -3,131 | |
| -5.33% | -2,012 | -2,013 | -2,014 | -2,016 | -2,020 | -2,025 | -2,032 | |
| -2.67% | -905 | -913 | -925 | -939 | -955 | -975 | -996 | |
| 0% | 105 | 72 | 37 | 0 | -38 | -77 | -117 | |
| 2.67% | 780 | 735 | 690 | 645 | 600 | 554 | 509 | |

| | | | | | | | |
|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 5.33% | 1,030 | 1,009 | 984 | 956 | 926 | 894 | 861 |
| 8.00% | 1,074 | 1,070 | 1,064 | 1,055 | 1,043 | 1,029 | 1,013 |

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

(단위:백만원)

30,407

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-25 |
| 기준일 | 2019-11-22 |

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

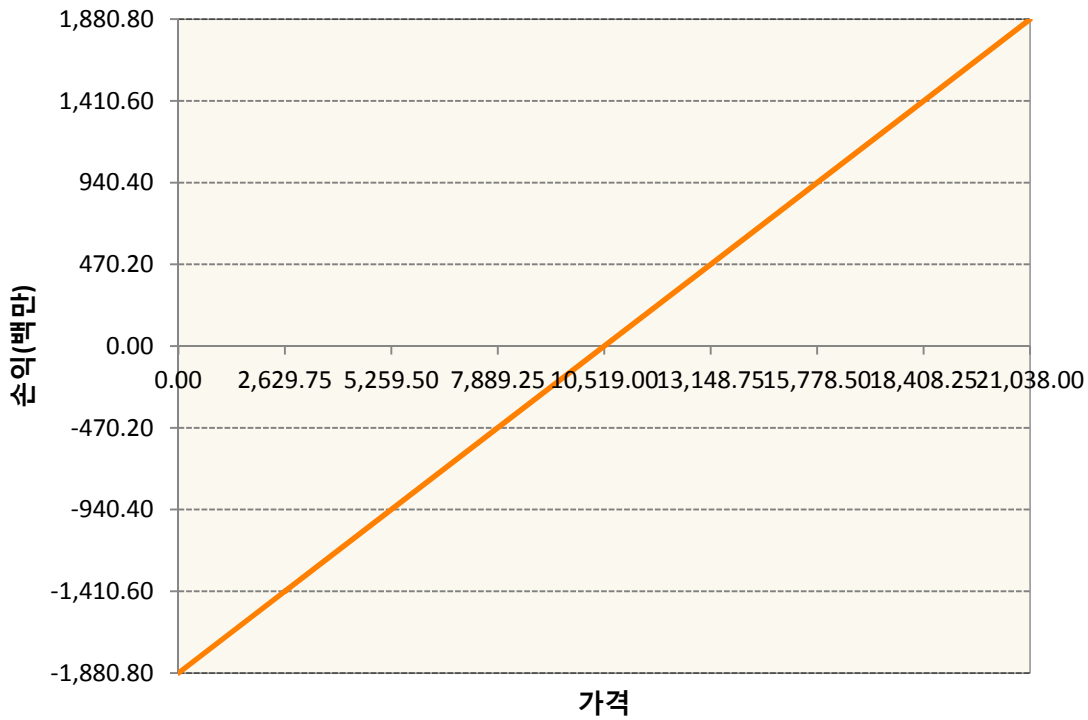
1. 계약금액

(단위:백만원)

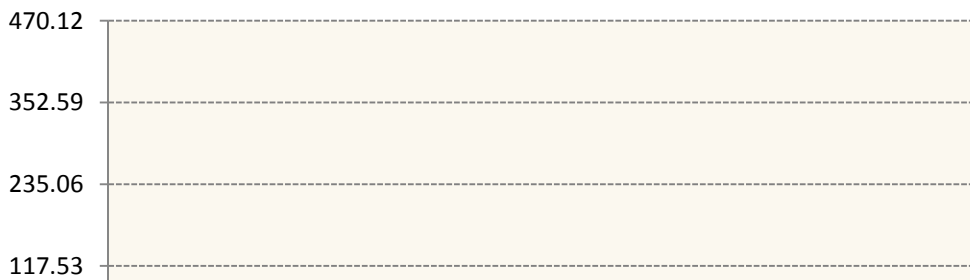
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,881 | 0 | 1,881 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 4,975 | -4,975 | 장내 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 2,122 | -2,122 | 장외 |

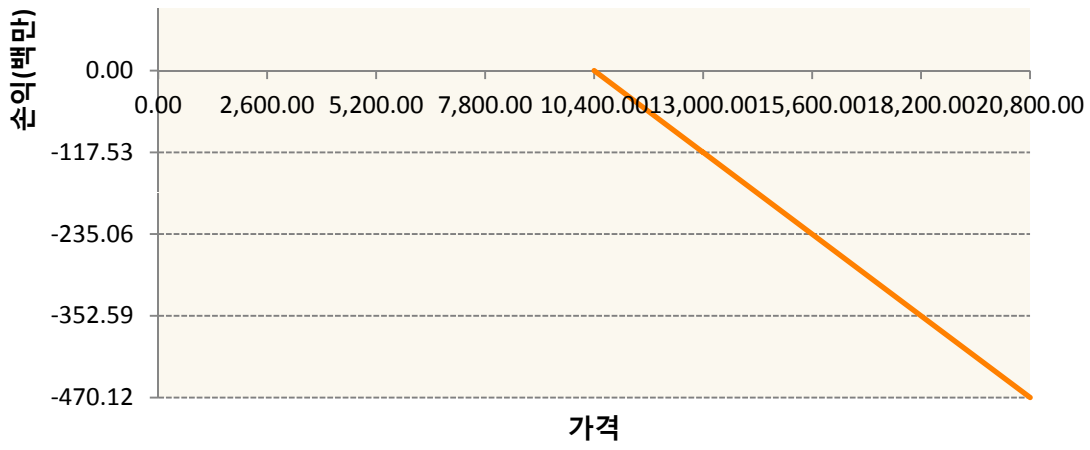
2. 만기시점의 손익구조

HCX9-HSCEI Futures Nov19

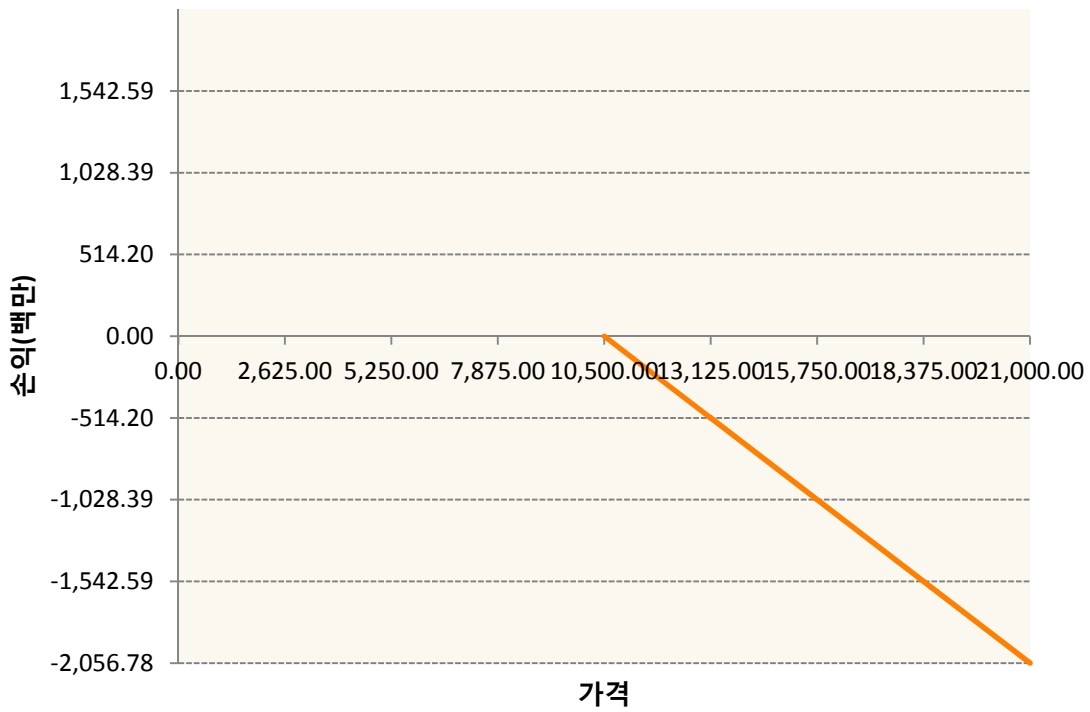


OHHIX9-C104-HSCEI

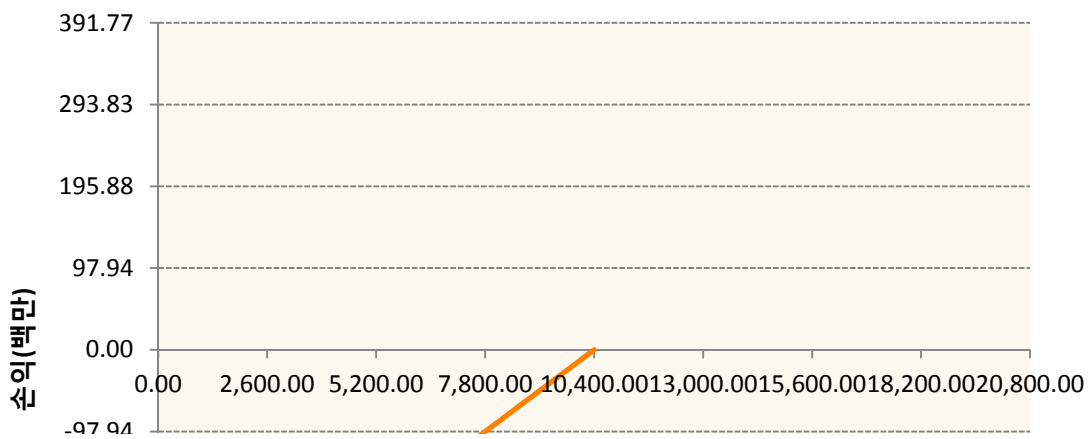


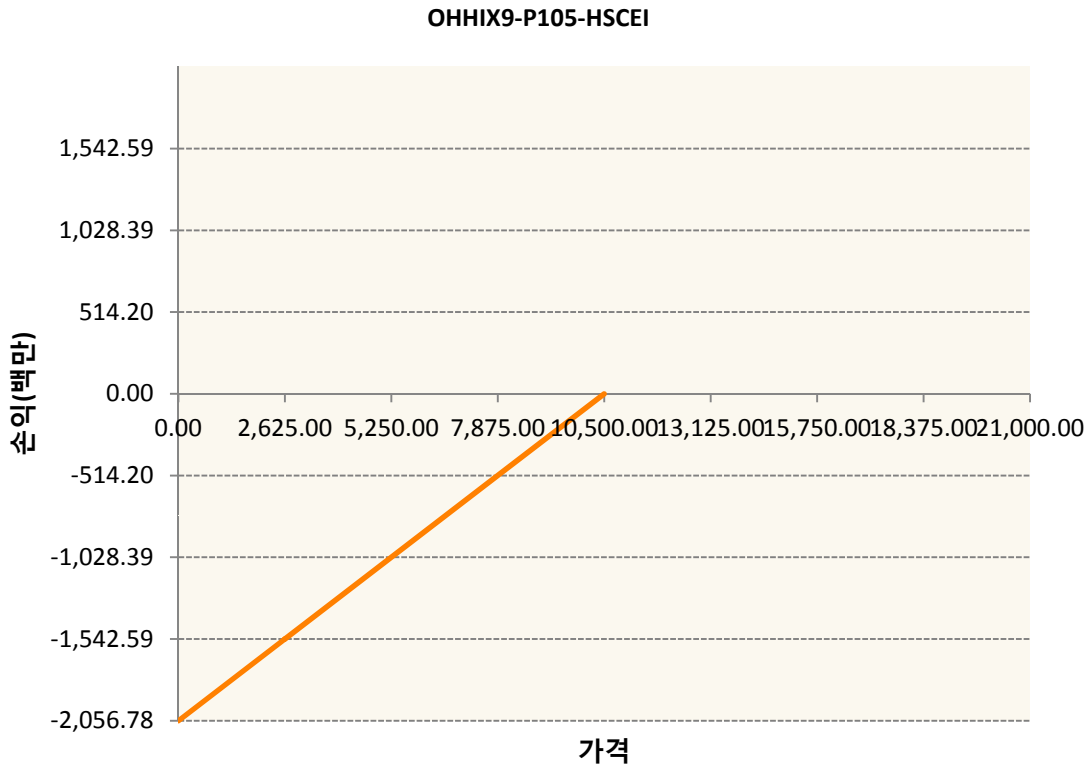
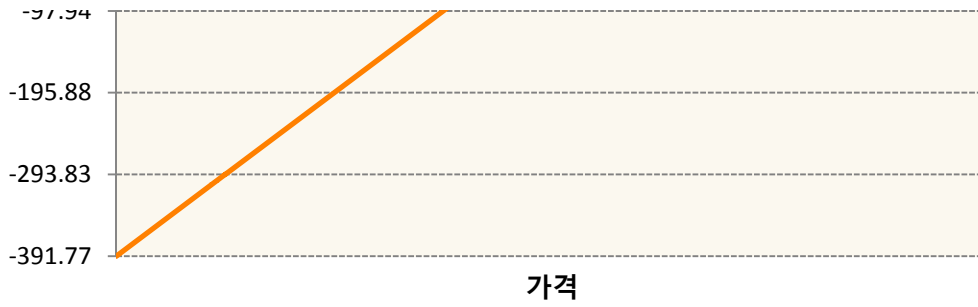


OHHIX9-C105-HSCEI



OHHIX9-P104-HSCEI





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | (단위:백만원) |
|------------------------------|----------|
| FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E | 170 |
| HCX9 HSCEI Futures Nov19 | 150 |
| OHHIX9-C1C HSCEI | 38 |
| OHHIX9-C1C HSCEI | 165 |
| OHHIX9-P10 HSCEI | 31 |
| OHHIX9-P10 HSCEI | 165 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|--|----------|
| | 540 |

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-25 |
| 기준일 | 2019-11-22 |

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

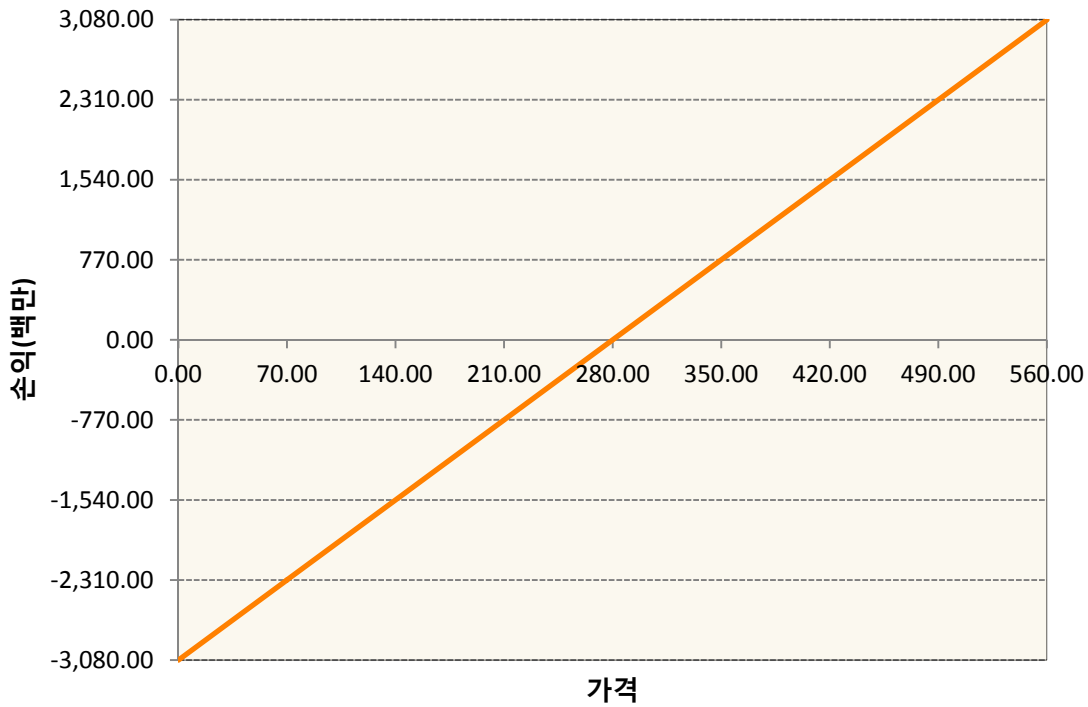
1. 계약금액

(단위:백만원)

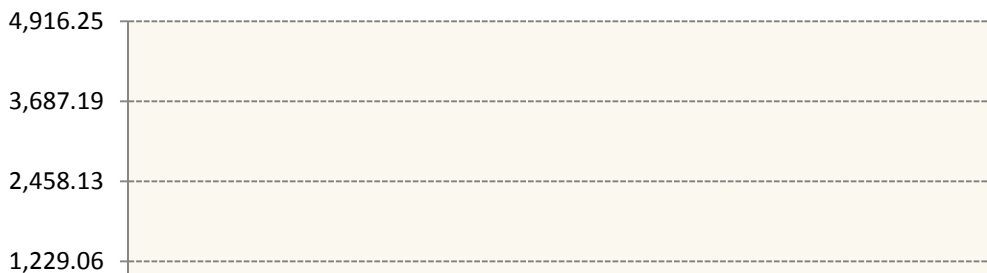
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 139 | 0 | 139 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,080 | 0 | 3,080 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 9,625 | 0 | 9,625 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 9,657 | -9,657 | 장내 |

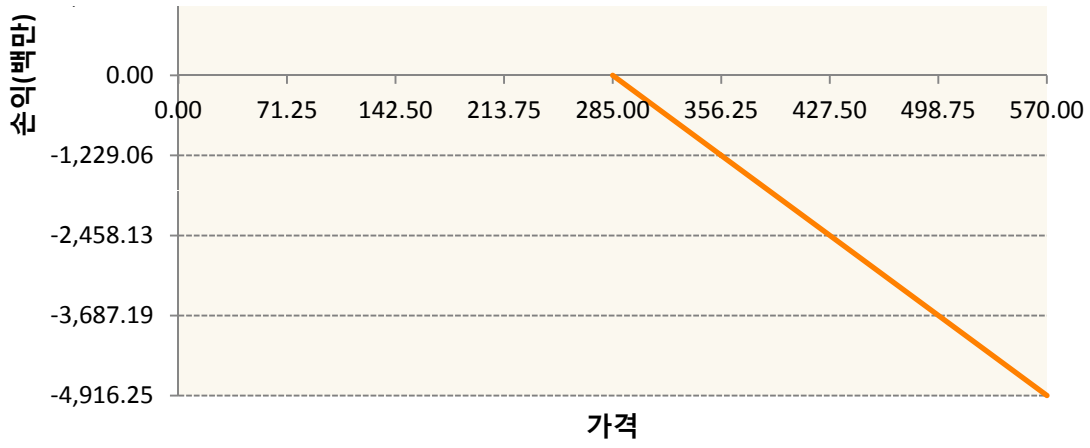
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

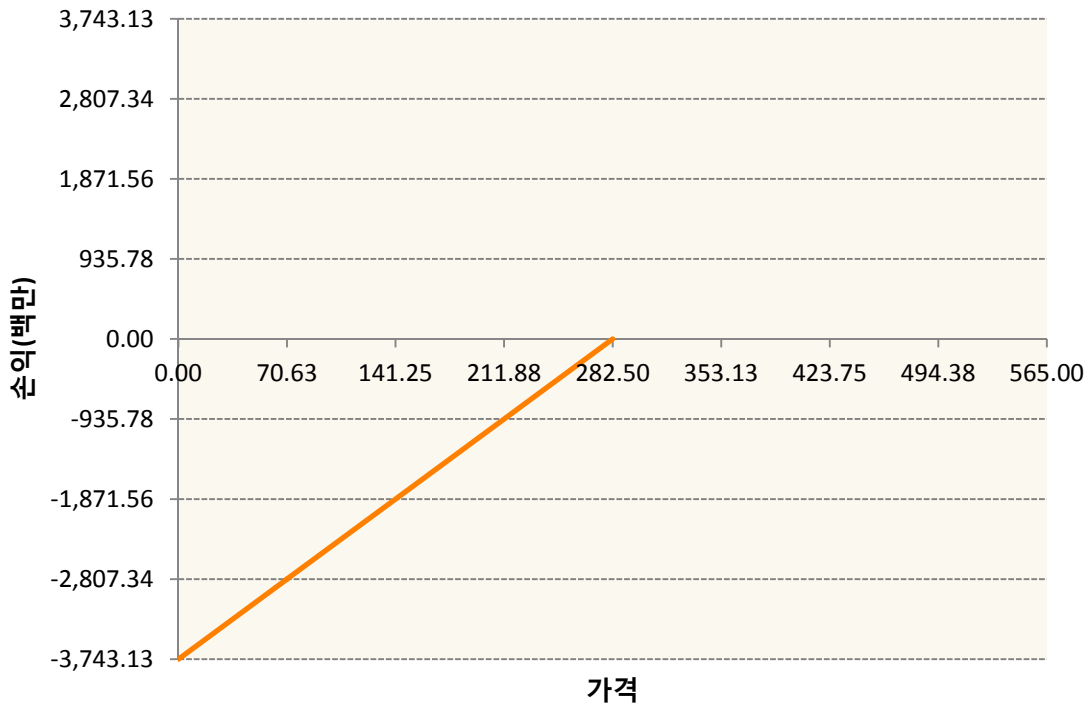


KR4201PC2858-2019-12 콜285

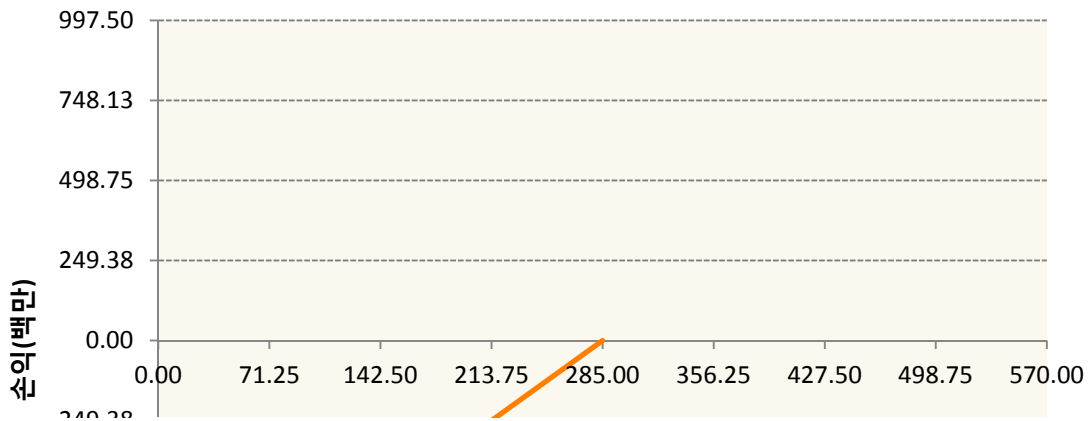




KR4301PC2824-2019-12 풋282.5



KR4301PC2857-2019-12 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| 2.529E+11 | | UBCSFXC1 INDEX_16 | | | | | | 831 |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -831 | -831 | -831 | -831 | -831 | -831 | -831 | |
| -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% | 831 | 831 | 831 | 831 | 831 | 831 | 831 | |
| KR4101PC0002 | | 2019-12 코스피200지수선물 | | | | | | 246 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -246 | -246 | -246 | -246 | -246 | -246 | -246 | |
| -5.33% | -164 | -164 | -164 | -164 | -164 | -164 | -164 | |
| -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% | 164 | 164 | 164 | 164 | 164 | 164 | 164 | |
| 8.00% | 246 | 246 | 246 | 246 | 246 | 246 | 246 | |
| KR4201PC2858 | | 2019-12 콜285 | | | | | | 263 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 82 | 81 | 79 | 76 | 73 | 69 | 65 | |
| -5.33% | 77 | 74 | 70 | 64 | 59 | 53 | 46 | |
| -2.67% | 63 | 56 | 48 | 41 | 32 | 24 | 15 | |
| 0% | 30 | 20 | 10 | 0 | -10 | -20 | -31 | |
| 2.67% | -28 | -39 | -50 | -60 | -71 | -82 | -92 | |
| 5.33% | -113 | -122 | -131 | -141 | -150 | -160 | -170 | |
| 8.00% | -218 | -224 | -231 | -238 | -246 | -254 | -263 | |
| KR4301PC2824 | | 2019-12 풋282.5 | | | | | | 267 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |

| | | | | | | | |
|--|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| -8.00% | -266 | -266 | -266 | -266 | -266 | -266 | -267 |
| -5.33% | -168 | -168 | -168 | -168 | -169 | -170 | -171 |
| -2.67% | -71 | -72 | -74 | -76 | -78 | -80 | -82 |
| 0% | 11 | 7 | 4 | 0 | -4 | -8 | -11 |
| 2.67% | 57 | 54 | 50 | 47 | 43 | 39 | 35 |
| 5.33% | 70 | 69 | 68 | 66 | 64 | 62 | 59 |
| 8.00% | 72 | 72 | 72 | 71 | 71 | 70 | 69 |
| KR4301PC2857 2019-12 풋285 | | | | | | | 73 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -73 | -73 | -73 | -73 | -73 | -73 | -73 |
| -5.33% | -47 | -47 | -47 | -47 | -47 | -47 | -47 |
| -2.67% | -21 | -21 | -22 | -22 | -22 | -23 | -23 |
| 0% | 2 | 2 | 1 | 0 | -1 | -2 | -3 |
| 2.67% | 18 | 17 | 16 | 15 | 14 | 13 | 12 |
| 5.33% | 24 | 24 | 23 | 22 | 22 | 21 | 20 |
| 8.00% | 25 | 25 | 25 | 25 | 24 | 24 | 24 |

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

(단위:백만원)

1,664

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-25 |
| 기준일 | 2019-11-22 |

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

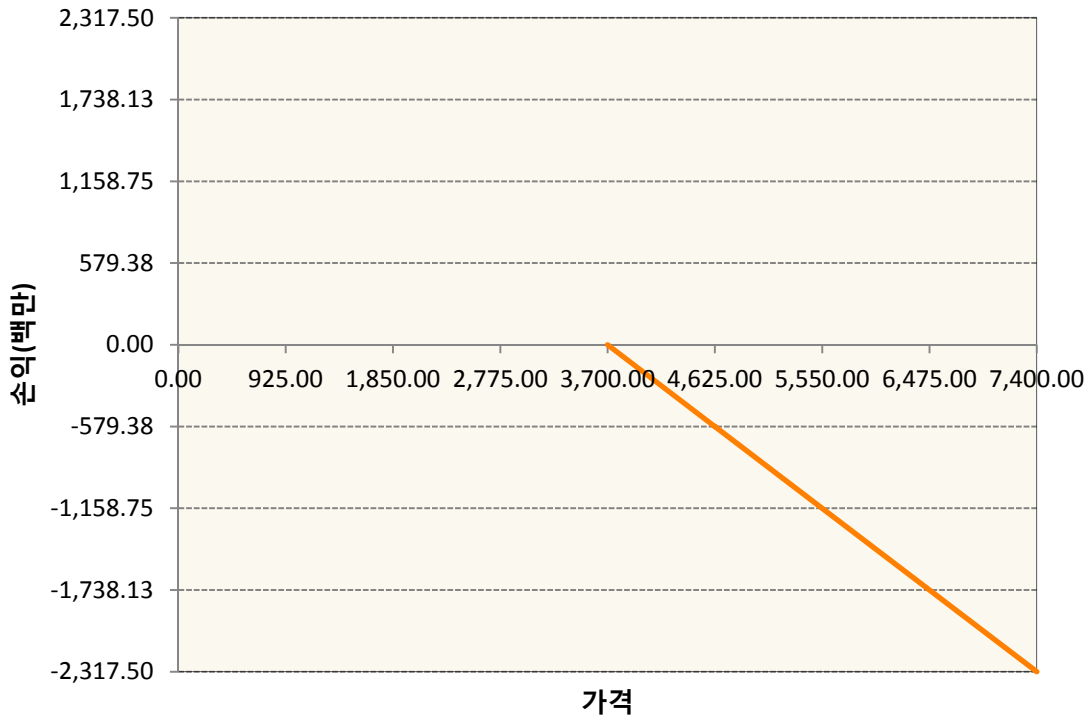
1. 계약금액

(단위:백만원)

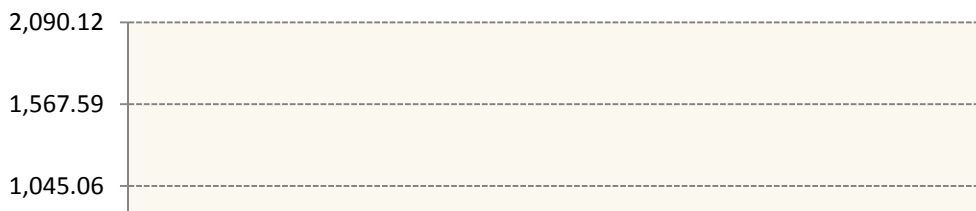
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,336 | 0 | 1,336 | |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 17,843 | 0 | 17,843 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 8,815 | -8,815 | 장내 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 2,709 | 6,133 | -3,424 | 장외 |

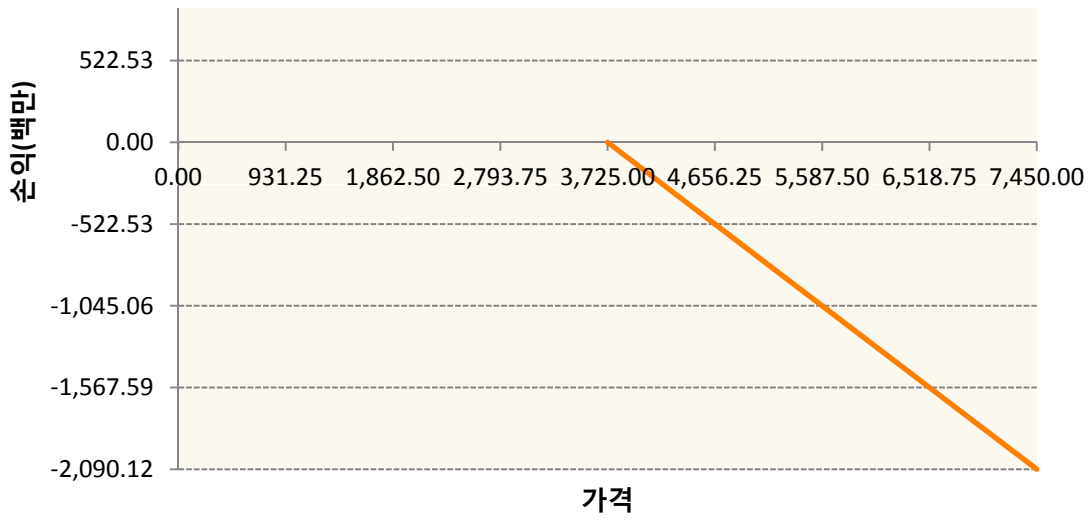
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ9-C3700-EURO STOXX 50

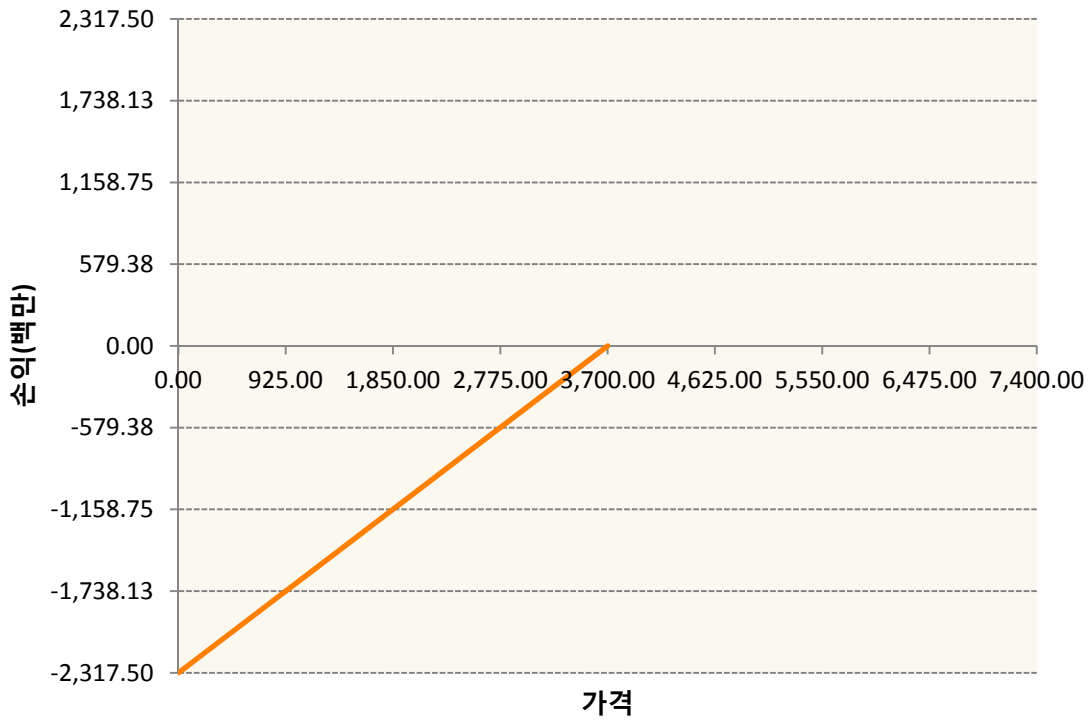


OESXZ9-C3725-EURO STOXX 50

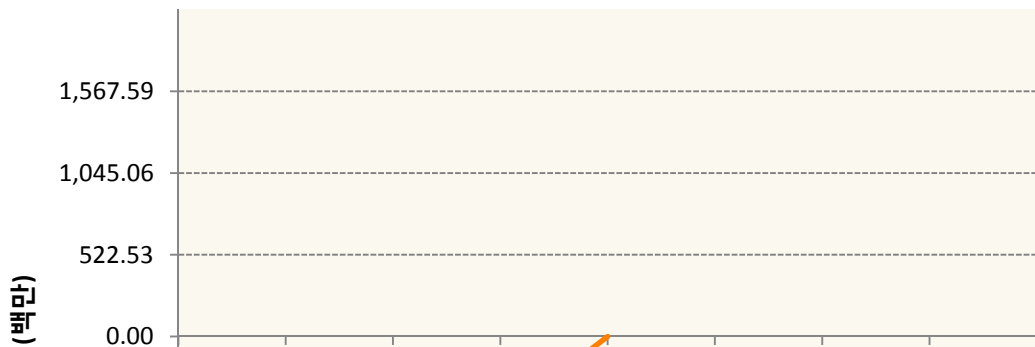


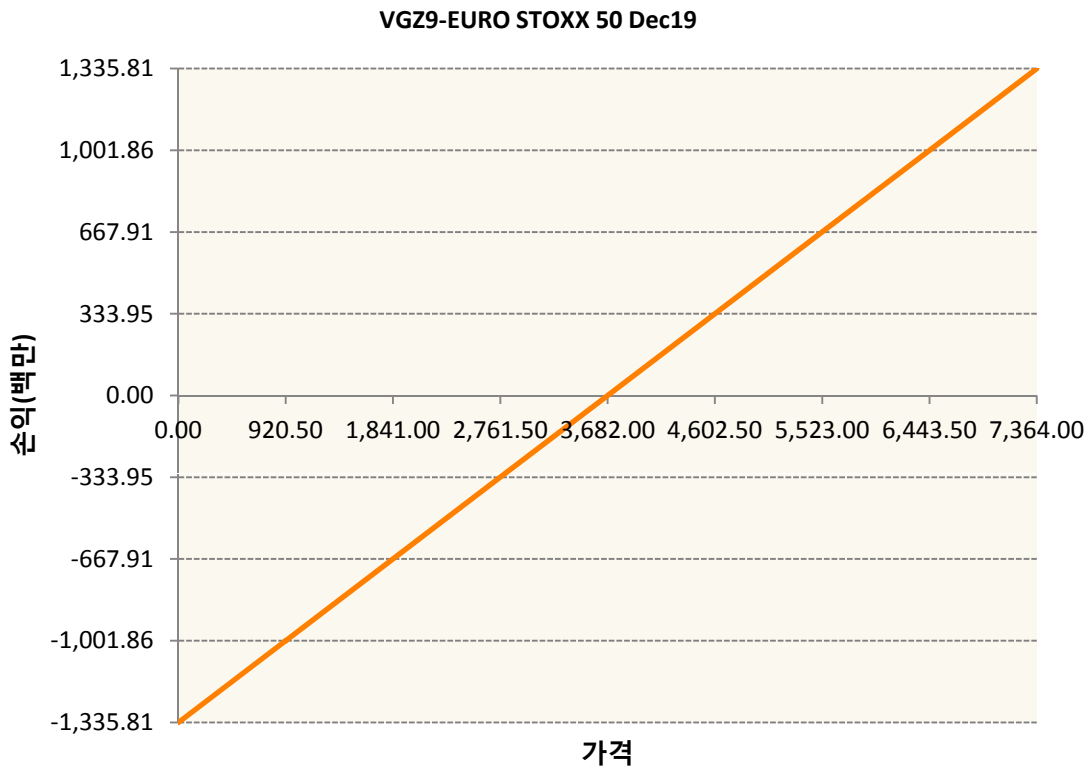
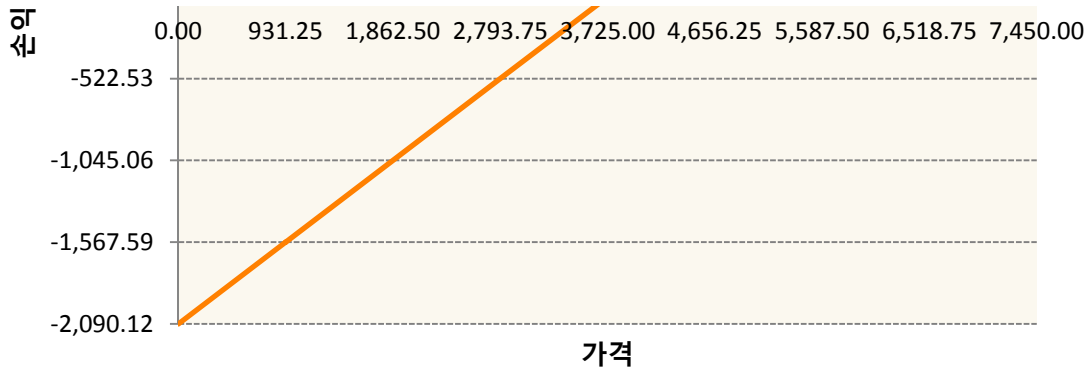


OESXZ9-P3700-EURO STOXX 50



OESXZ9-P3725-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | |
|---|-----|
| 260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY | 15 |
| FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E | 491 |
| FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E | 165 |
| FX21019X02 EUR/KRW 27-12-19E | 52 |
| OESXZ9-C37 EURO STOXX 50 | 185 |
| OESXZ9-C37 EURO STOXX 50 | 167 |
| OESXZ9-P37 EURO STOXX 50 | 185 |
| OESXZ9-P37 EURO STOXX 50 | 167 |
| VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19 | 107 |

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

(단위:백만원)

889

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

(단위:백만원)

912

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

(단위:백만원)

80

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

(단위:백만원)

124

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

(단위:백만원)

40

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-25 |
| 기준일 | 2019-11-22 |

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

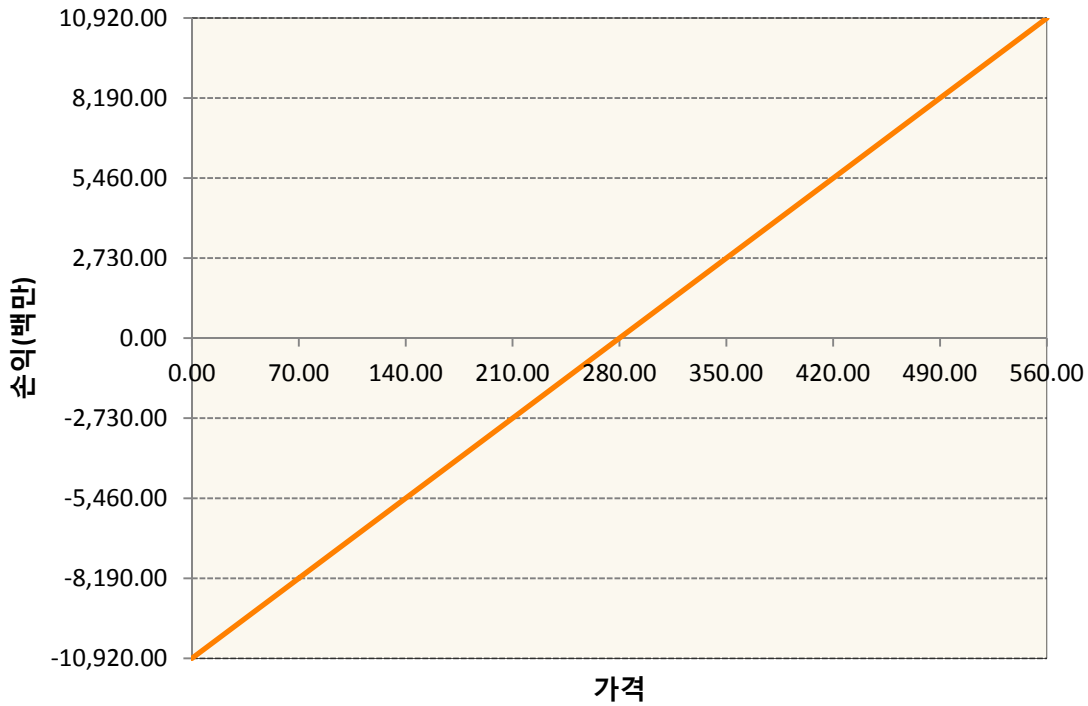
1. 계약금액

(단위:백만원)

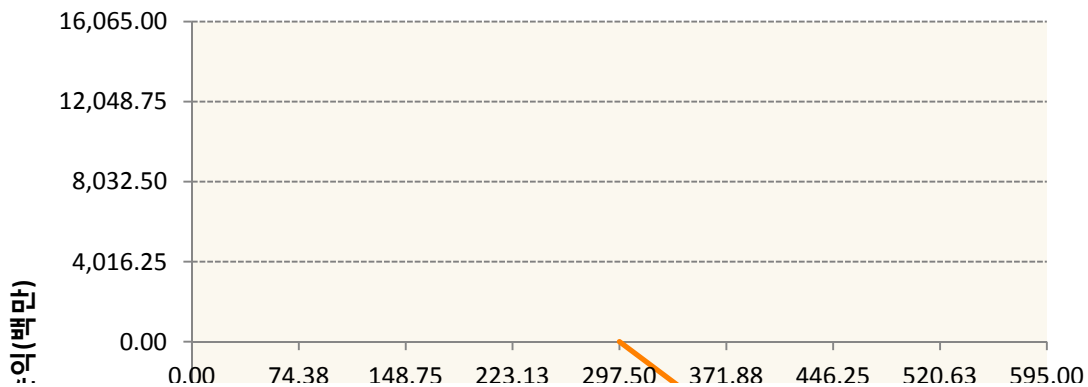
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 10,920 | 0 | 10,920 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 1,348 | 21,390 | -20,042 | 장내 |

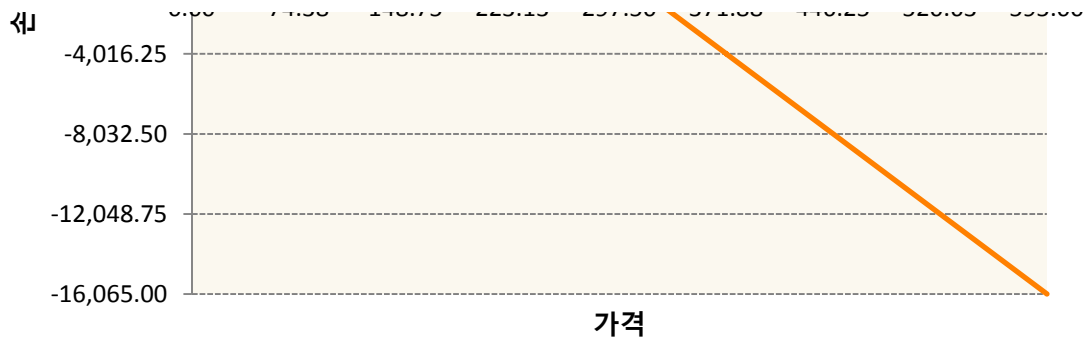
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

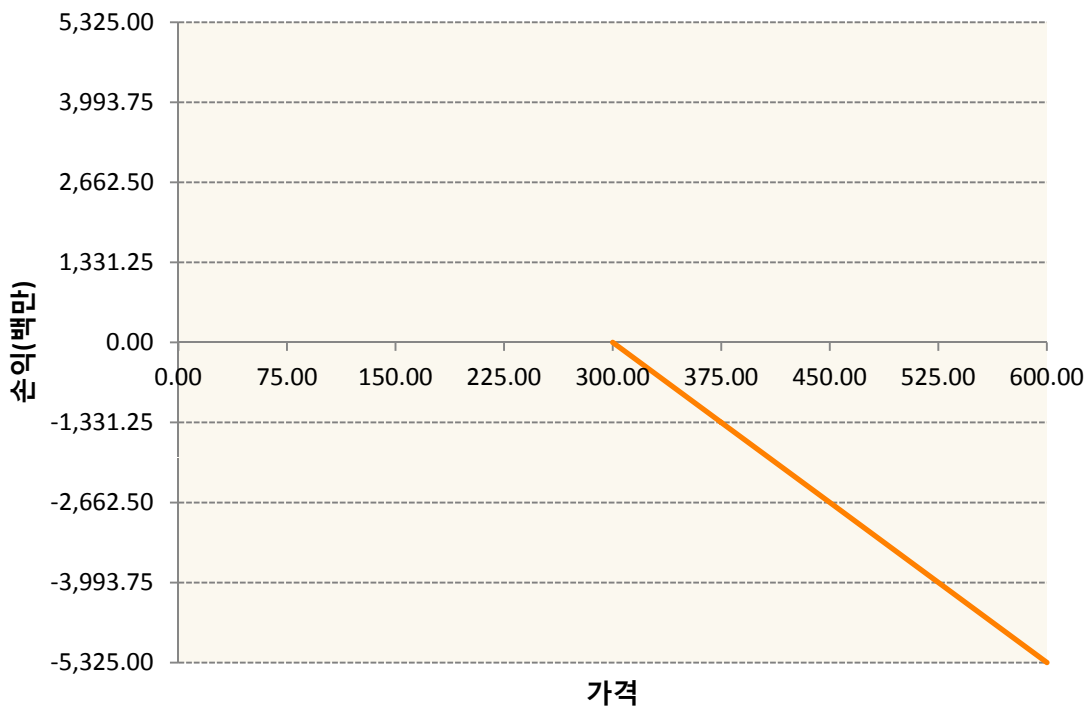


KR4201PC2973-2019-12 콜297.5

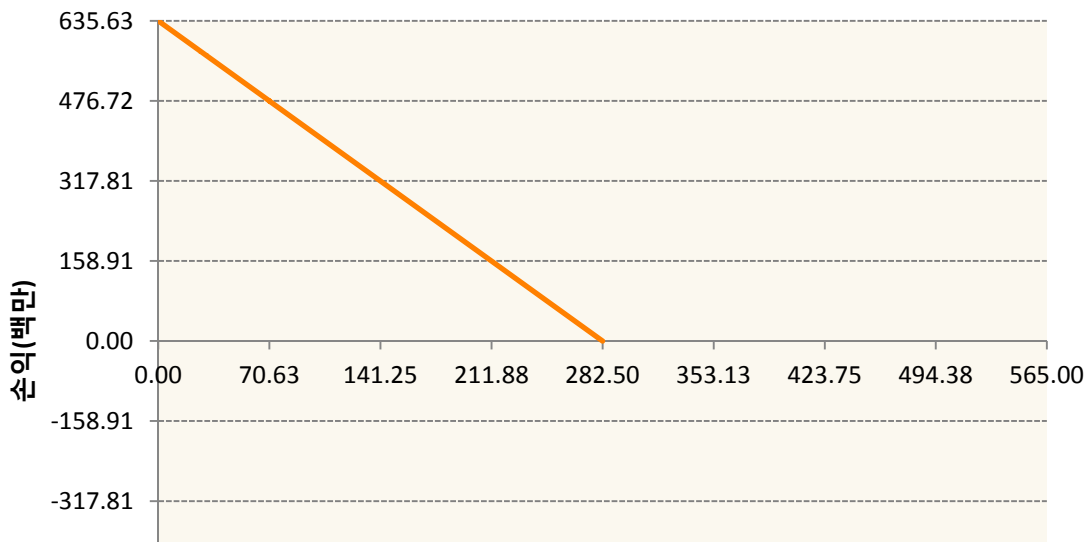


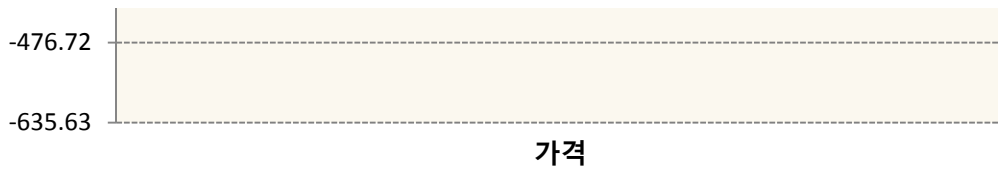


KR4201PC3005-2019-12 콜300

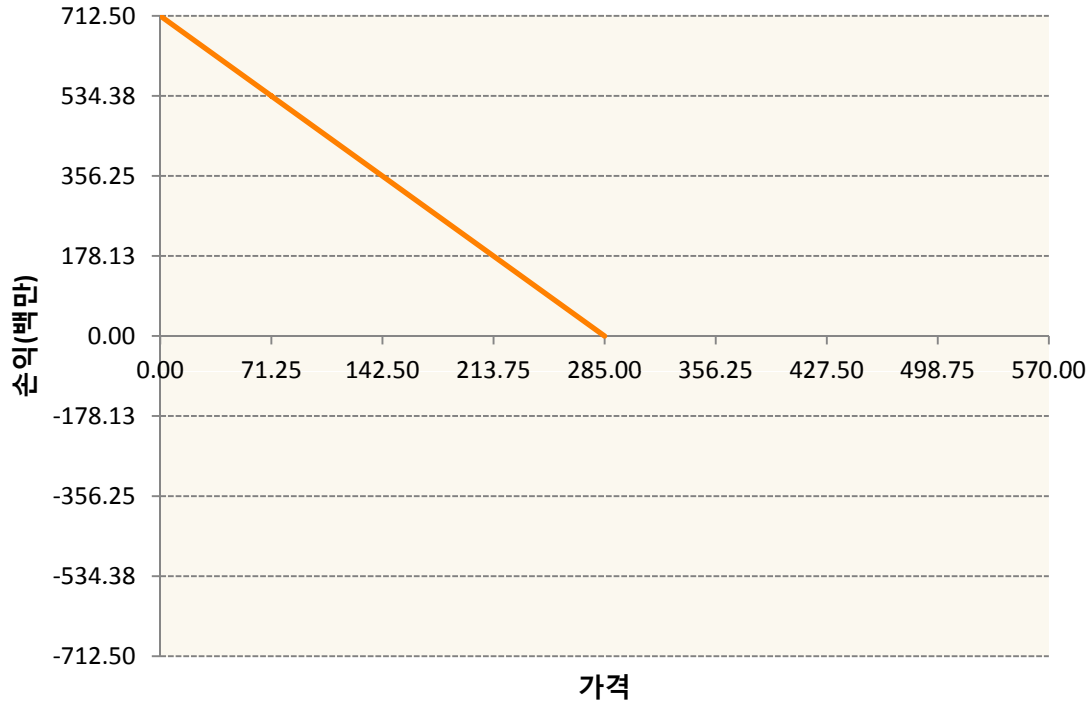


KR4301PC2824-2019-12 풋282.5





KR4301PC2857-2019-12 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101PC0002 | | 2019-12 코스피200지수선물 | | | | | 872 |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -872 | -872 | -872 | -872 | -872 | -872 | -872 |
| -5.33% | -581 | -581 | -581 | -581 | -581 | -581 | -581 |
| -2.67% | -291 | -291 | -291 | -291 | -291 | -291 | -291 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 291 | 291 | 291 | 291 | 291 | 291 | 291 |
| 5.33% | 581 | 581 | 581 | 581 | 581 | 581 | 581 |
| 8.00% | 872 | 872 | 872 | 872 | 872 | 872 | 872 |
| KR4201PC2973 | | 2019-12 콜297.5 | | | | | 556 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 91 | 90 | 89 | 87 | 83 | 79 | 73 |
| -5.33% | 89 | 86 | 82 | 77 | 69 | 60 | 49 |
| -2.67% | 81 | 74 | 64 | 52 | 38 | 22 | 5 |

| | | | | | | | |
|--|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 0% | 55 | 39 | 20 | 0 | -22 | -46 | -70 |
| 2.67% | -11 | -37 | -65 | -94 | -124 | -154 | -185 |
| 5.33% | -141 | -175 | -209 | -243 | -277 | -312 | -346 |
| 8.00% | -350 | -384 | -418 | -452 | -487 | -521 | -556 |
| KR4201PC3005 2019-12 콜300 | | | | | | | 166 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 23 | 23 | 23 | 22 | 22 | 20 | 19 |
| -5.33% | 23 | 23 | 22 | 20 | 18 | 16 | 13 |
| -2.67% | 21 | 20 | 17 | 14 | 10 | 5 | 0 |
| 0% | 15 | 11 | 6 | 0 | -6 | -13 | -21 |
| 2.67% | -1 | -9 | -17 | -26 | -35 | -45 | -54 |
| 5.33% | -36 | -47 | -58 | -69 | -80 | -91 | -102 |
| 8.00% | -96 | -108 | -119 | -131 | -143 | -154 | -166 |
| KR4301PC2824 2019-12 풋282.5 | | | | | | | 45 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 45 | 45 | 45 | 45 | 45 | 45 | 45 |
| -5.33% | 28 | 28 | 29 | 29 | 29 | 29 | 29 |
| -2.67% | 12 | 12 | 13 | 13 | 13 | 14 | 14 |
| 0% | -2 | -1 | -1 | 0 | 1 | 1 | 2 |
| 2.67% | -10 | -9 | -9 | -8 | -7 | -7 | -6 |
| 5.33% | -12 | -12 | -12 | -11 | -11 | -11 | -10 |
| 8.00% | -12 | -12 | -12 | -12 | -12 | -12 | -12 |
| 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% | 15 | 15 | 15 | 16 | 16 | 16 | 17 |
| 0% | -2 | -1 | -1 | 0 | 1 | 1 | 2 |
| 2.67% | -13 | -12 | -12 | -11 | -10 | -9 | -8 |
| 5.33% | -17 | -17 | -16 | -16 | -15 | -15 | -14 |
| 8.00% | -18 | -18 | -18 | -18 | -17 | -17 | -17 |

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

(단위:백만원)

1,288

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-25 |
| 기준일 | 2019-11-22 |

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 | 206,043 | 0 | 206,043 | |

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 | 2019-11-25 |
| 기준일 | 2019-11-22 |

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 | 215,043 | 0 | 215,043 | |

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 | 2019-11-25 |
| 기준일 | 2019-11-22 |

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 | 545,901 | 0 | 545,901 | |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 656,058 | -656,058 | 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 | | 1,886 |
| FX21019U04 KRW/USD 25-11-19E | | 1,981 |
| FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E | | 660 |
| FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E | | 698 |
| FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E | | 1,698 |
| FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E | | 4,810 |
| FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E | | 1,415 |
| FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E | | 2,829 |
| FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E | | 1,518 |
| FX21019V02 KRW/USD 25-11-19E | | 2,867 |
| FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E | | 943 |
| FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E | | 943 |
| FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E | | 1,886 |
| FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E | | 1,886 |
| FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E | | 943 |
| FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E | | 943 |
| FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E | | 943 |
| FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E | | 943 |
| FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E | | 472 |
| FX21019X00 KRW/USD 06-12-19E | | 660 |
| FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E | | 472 |
| FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E | | 472 |
| FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E | | 472 |
| FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E | | 1,547 |
| FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E | | 943 |
| FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E | | 472 |

| | |
|------------------------------|-------|
| FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E | 943 |
| FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E | 1,547 |
| FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E | 1,886 |
| FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E | 3,244 |
| FX21019X02 KRW/USD 26-12-19E | 4,753 |
| FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E | 4,810 |

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

(단위:백만원)

16,516

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

(단위:백만원)

186

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-25 |
| 기준일 | 2019-11-22 |

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

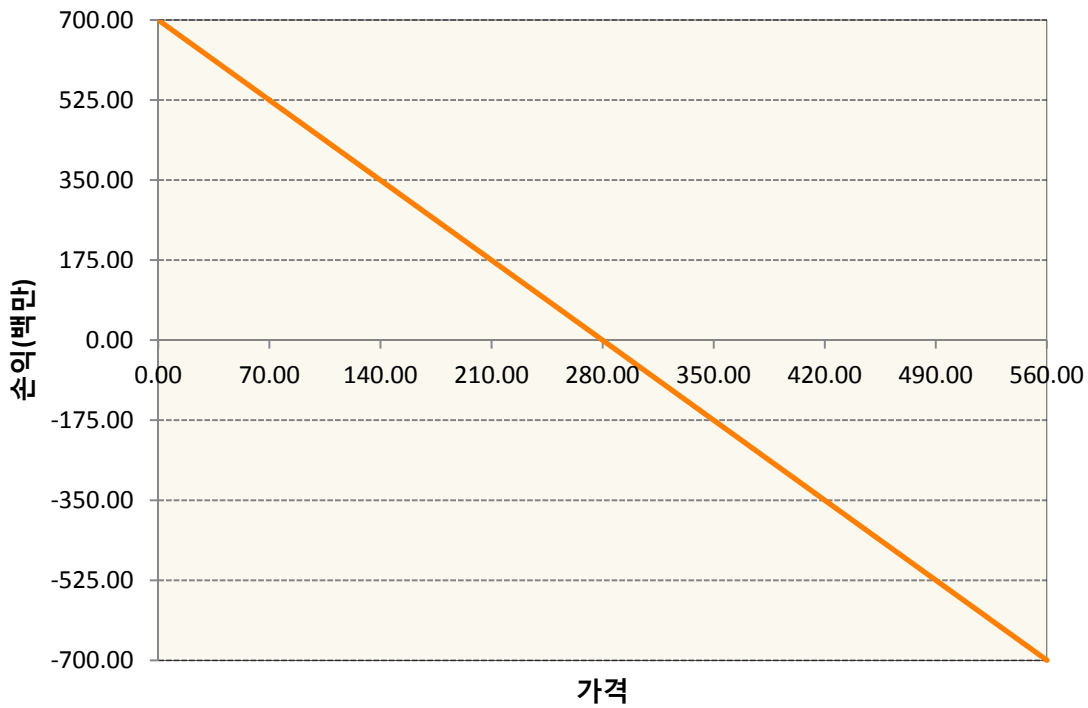
1. 계약금액

(단위:백만원)

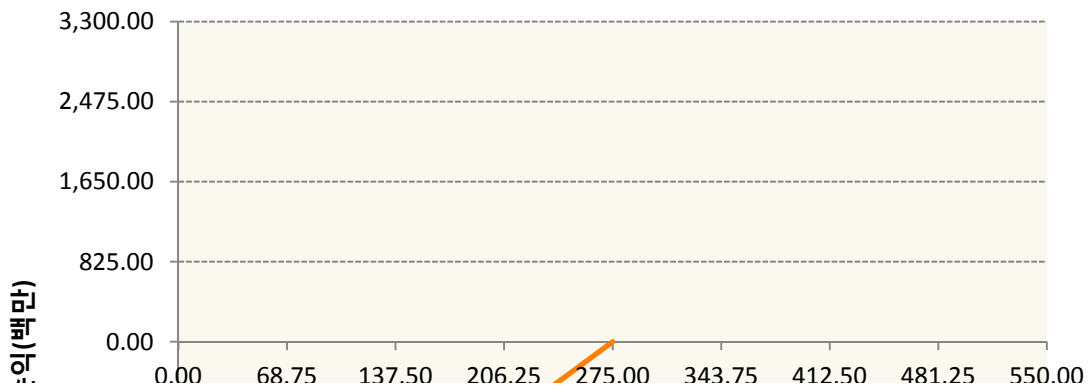
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 700 | -700 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 3,994 | -3,994 | 장내 |

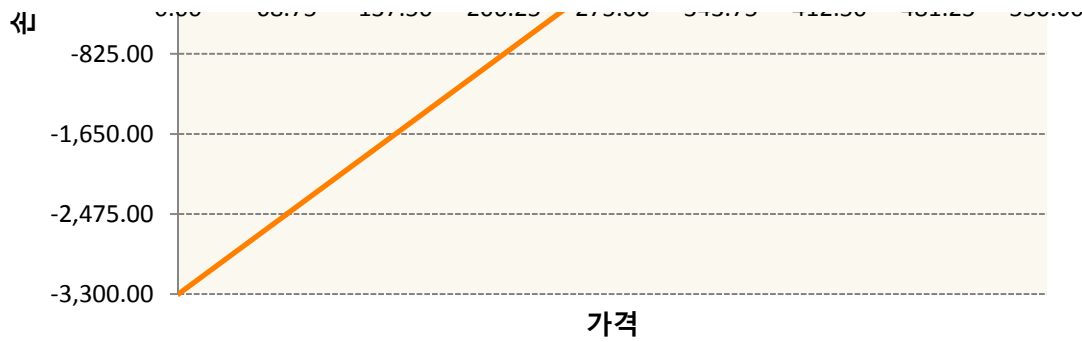
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

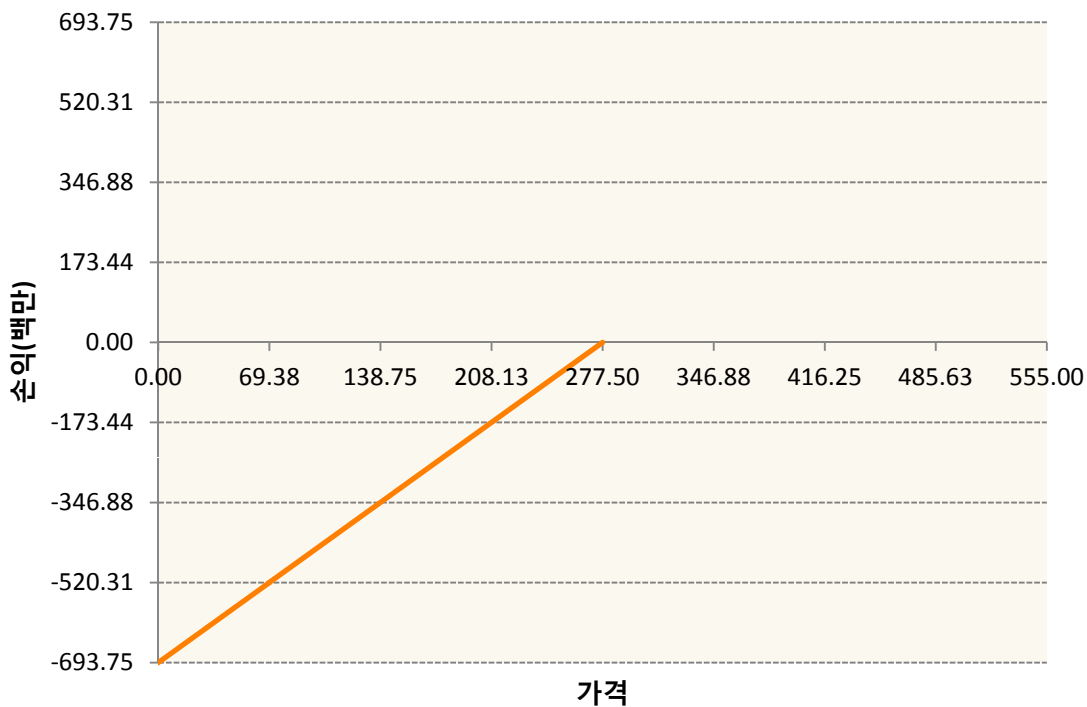


KR4301PC2758-2019-12 풋275





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 | | | | | | 197 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|--|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -195 | -195 | -195 | -195 | -196 | -196 | -197 |
| -5.33% | -107 | -108 | -109 | -111 | -113 | -115 | -117 |
| -2.67% | -32 | -35 | -39 | -42 | -45 | -49 | -52 |
| 0% | 9 | 6 | 3 | 0 | -3 | -6 | -10 |
| 2.67% | 21 | 20 | 18 | 17 | 15 | 13 | 11 |
| 5.33% | 22 | 22 | 22 | 21 | 21 | 20 | 19 |
| 8.00% | 22 | 22 | 22 | 22 | 22 | 22 | 21 |
| KR4301PC2774 2019-12 풋277.5 | | | | | | | 45 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -44 | -44 | -44 | -45 | -45 | -45 | -45 |
| -5.33% | -26 | -26 | -26 | -26 | -27 | -27 | -27 |
| -2.67% | -9 | -10 | -10 | -11 | -11 | -12 | -13 |
| 0% | 2 | 1 | 1 | 0 | -1 | -1 | -2 |
| 2.67% | 6 | 6 | 5 | 5 | 5 | 4 | 4 |
| 5.33% | 7 | 7 | 7 | 7 | 6 | 6 | 6 |
| 8.00% | 7 | 7 | 7 | 7 | 7 | 7 | 7 |

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

(단위:백만원)

294

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-25 |
| 기준일 | 2019-11-22 |

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 | 15,455 | 0 | 15,455 | |
| 누계 | 통화 | 선도 | 354 | 19,228 | -18,874 | 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 | | 321 |
| FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E | | 321 |
| 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)

| |
|------------|
| 493 |
|------------|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-25 |
| 기준일 | 2019-11-22 |

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 | 1,002 | 0 | 1,002 | 장외 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 274 | 274 | 0 | 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 |
| 2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR) | 25 |
| 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 |
| FX21019X03 EUR/KRW 31-01-20E | 3 |

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

(단위:백만원)

| |
|----|
| 77 |
|----|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-25 |
| 기준일 | 2019-11-22 |

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

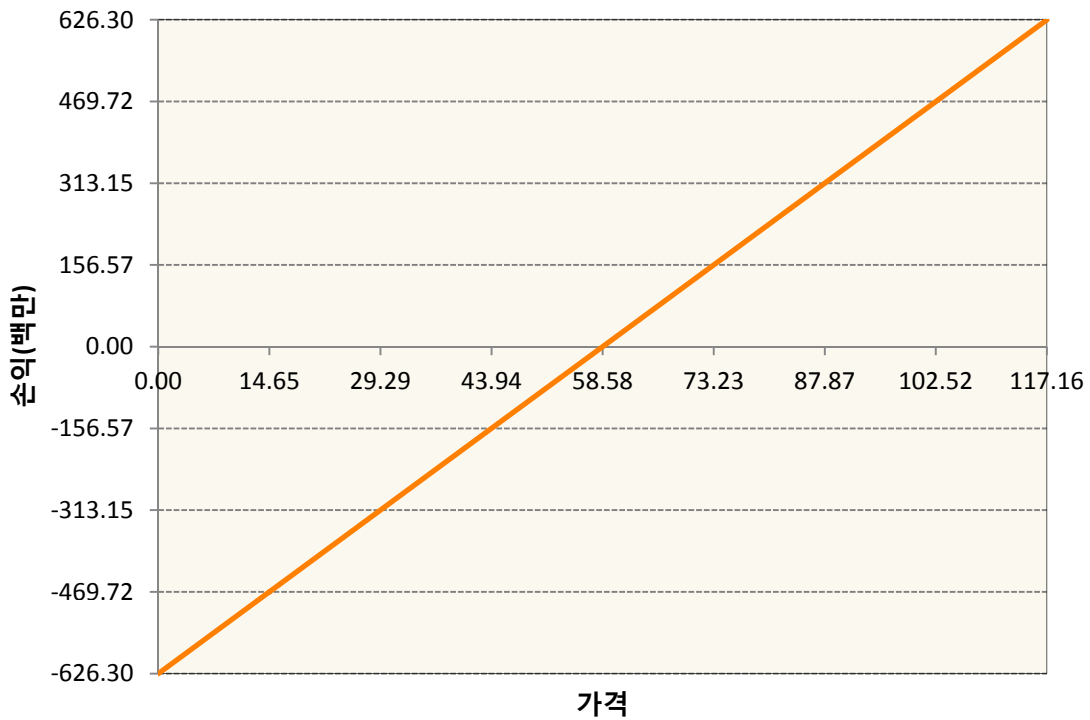
1. 계약금액

(단위:백만원)

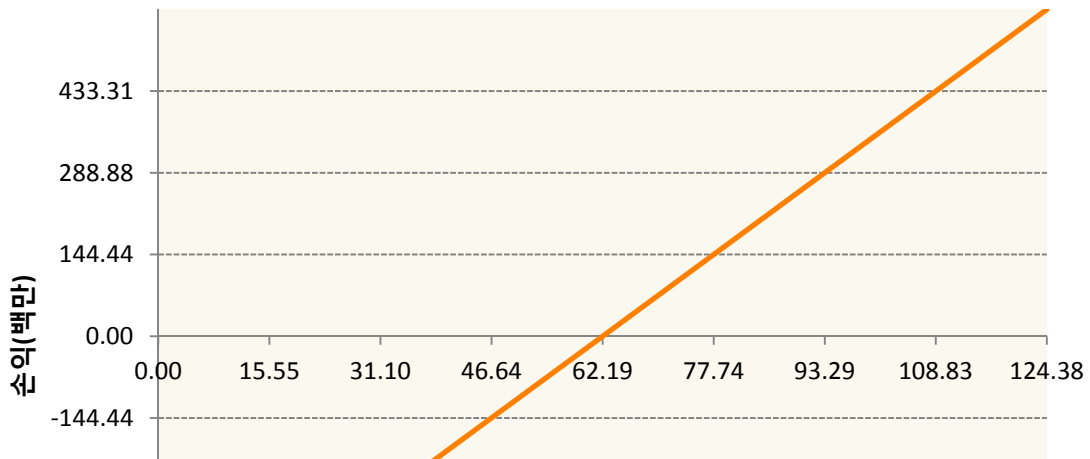
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,513 | 295 | 2,218 | |

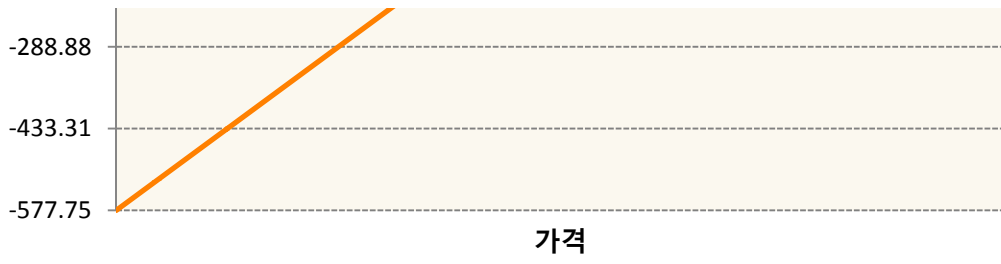
2. 만기시점의 손익구조

CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20

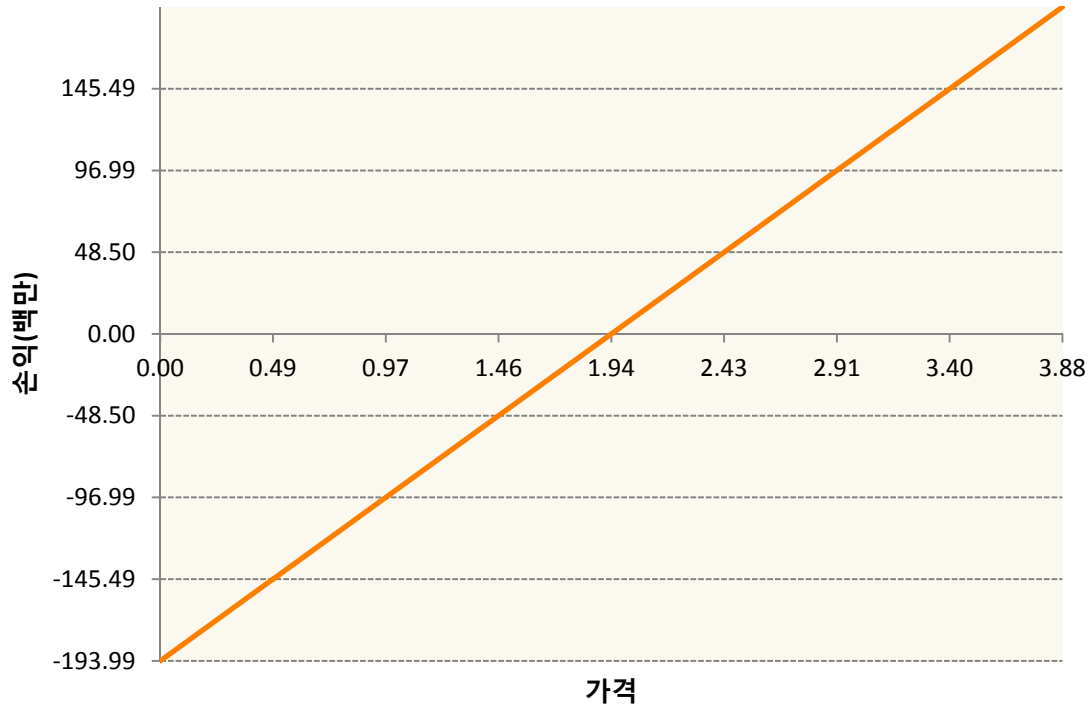


COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20

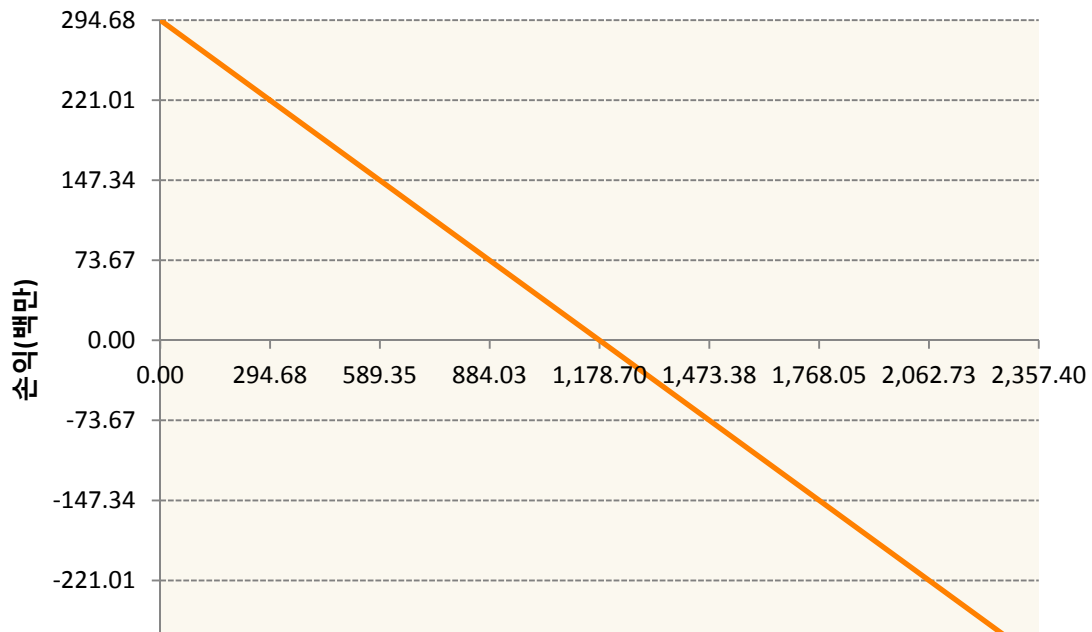


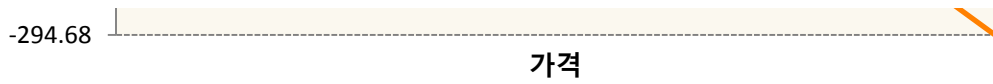


HOF0-NY Harb ULSD Fut Jan20

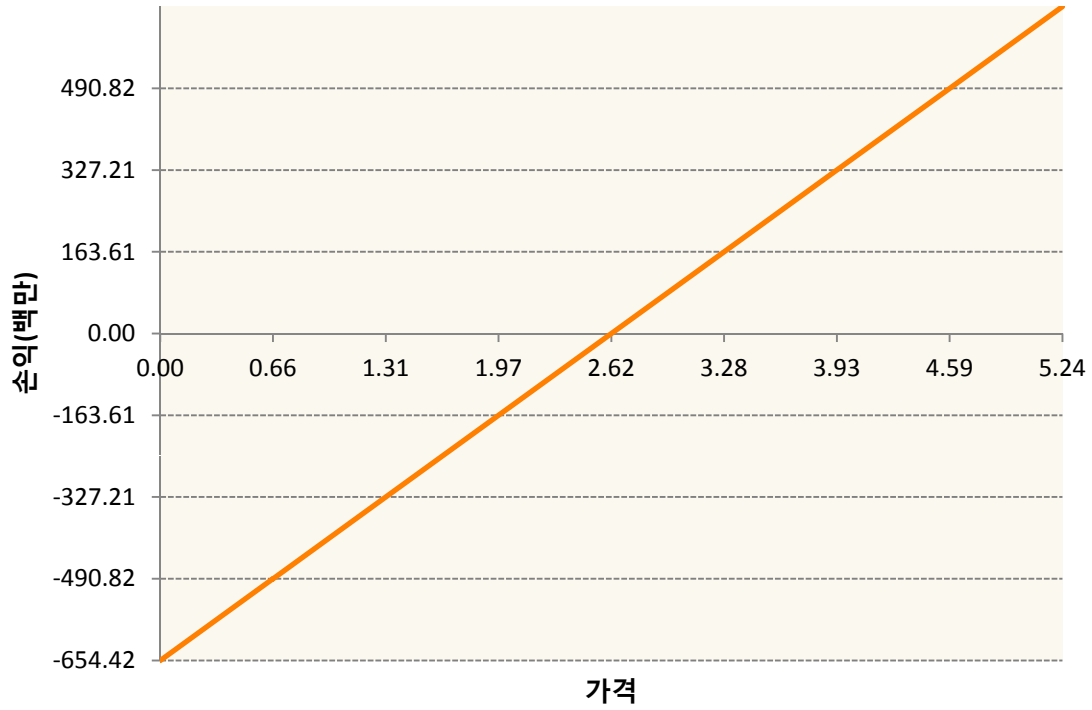


KR4175PC0003-2019-12 달러선물

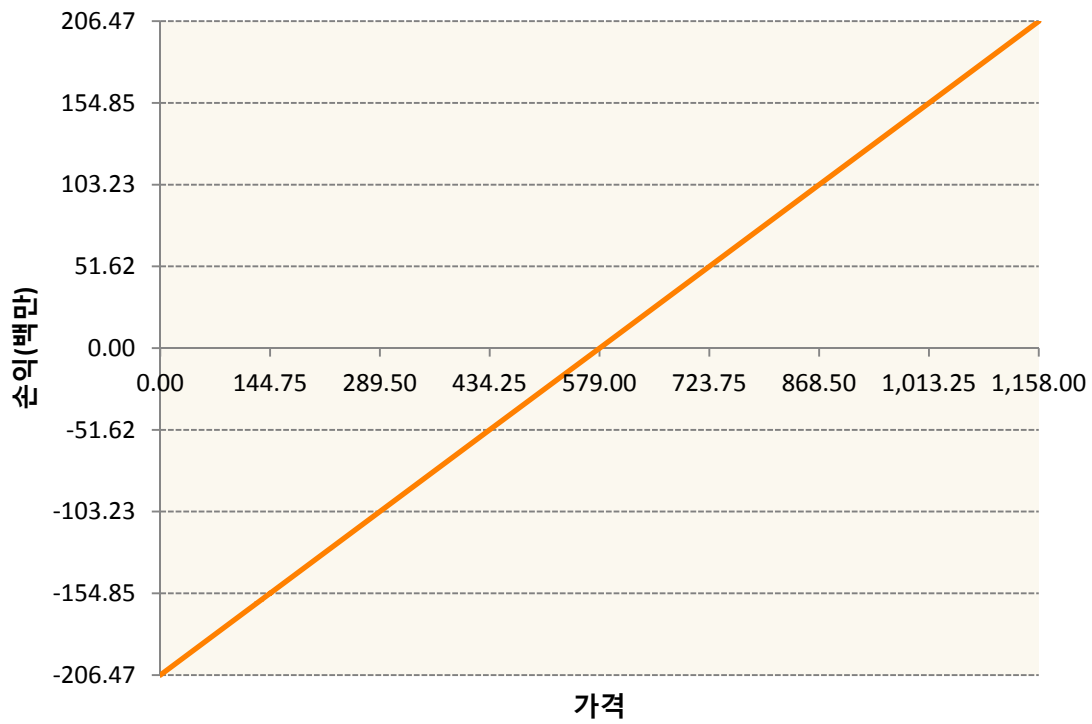




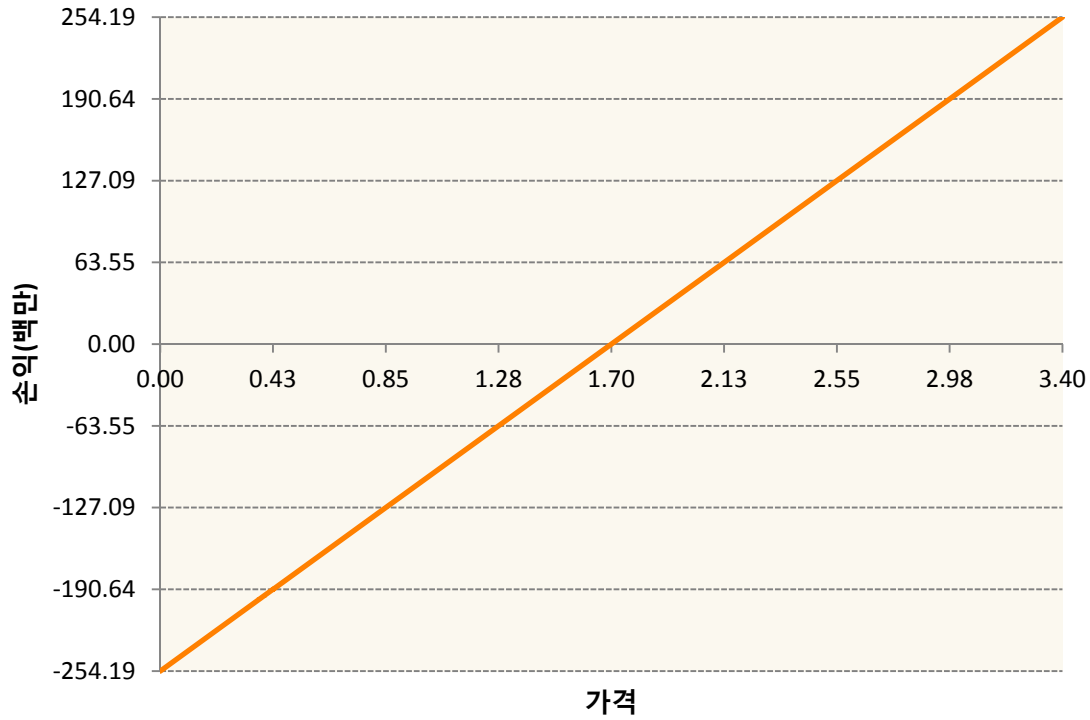
NGF20-NATURAL GAS FUTR Jan20



QSF0-Low Su Gasoil G Jan20



XBF0-GASOLINE RBOB FUT Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| CLF0 | WTI CRUDE FUTURE Jan20 | 50 |
| COH0 | BRENT CRUDE FUTR Mar20 | 46 |
| HOF0 | NY Harb ULSD Fut Jan20 | 16 |
| KR4175PC00 | 2019-12 달러선물 | 24 |
| NGF20 | NATURAL GAS FUTR Jan20 | 52 |
| QSF0 | Low Su Gasoil G Jan20 | 17 |
| XBF0 | GASOLINE RBOB FUT Jan20 | 20 |

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

(단위:백만원)

418

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-11-25 |
| 기준일 | 2019-11-22 |

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

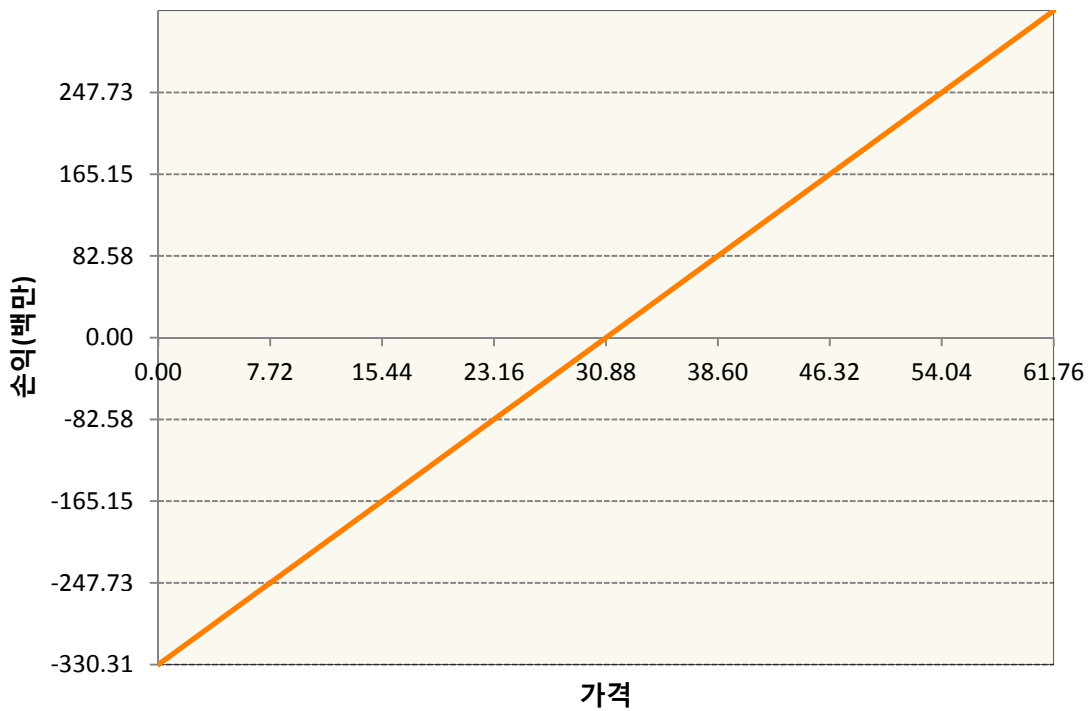
1. 계약금액

(단위:백만원)

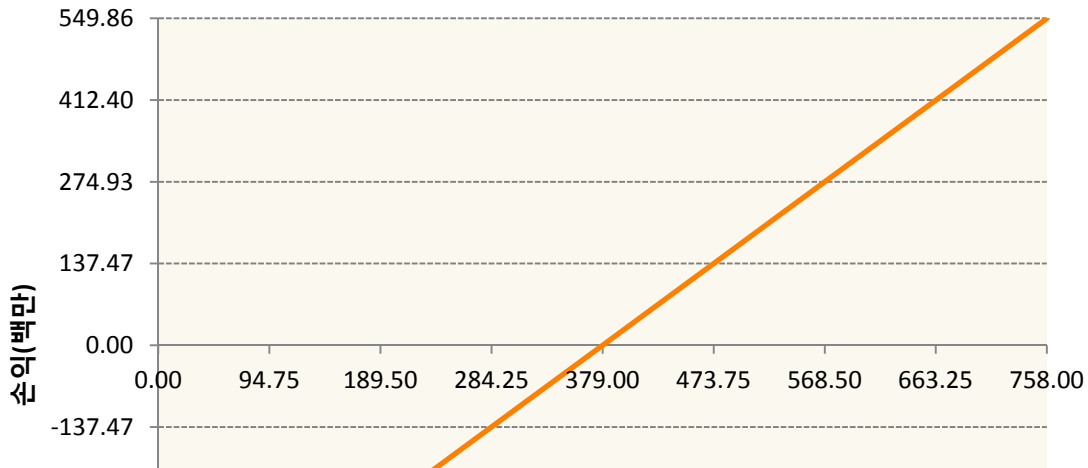
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,804 | 94 | 2,710 | |

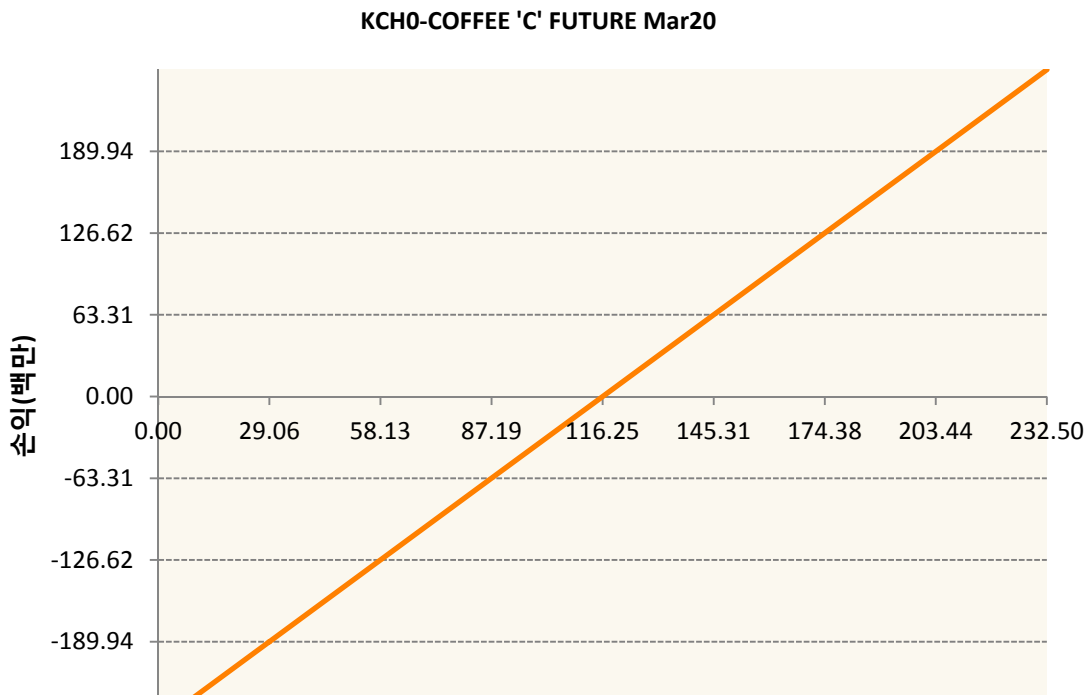
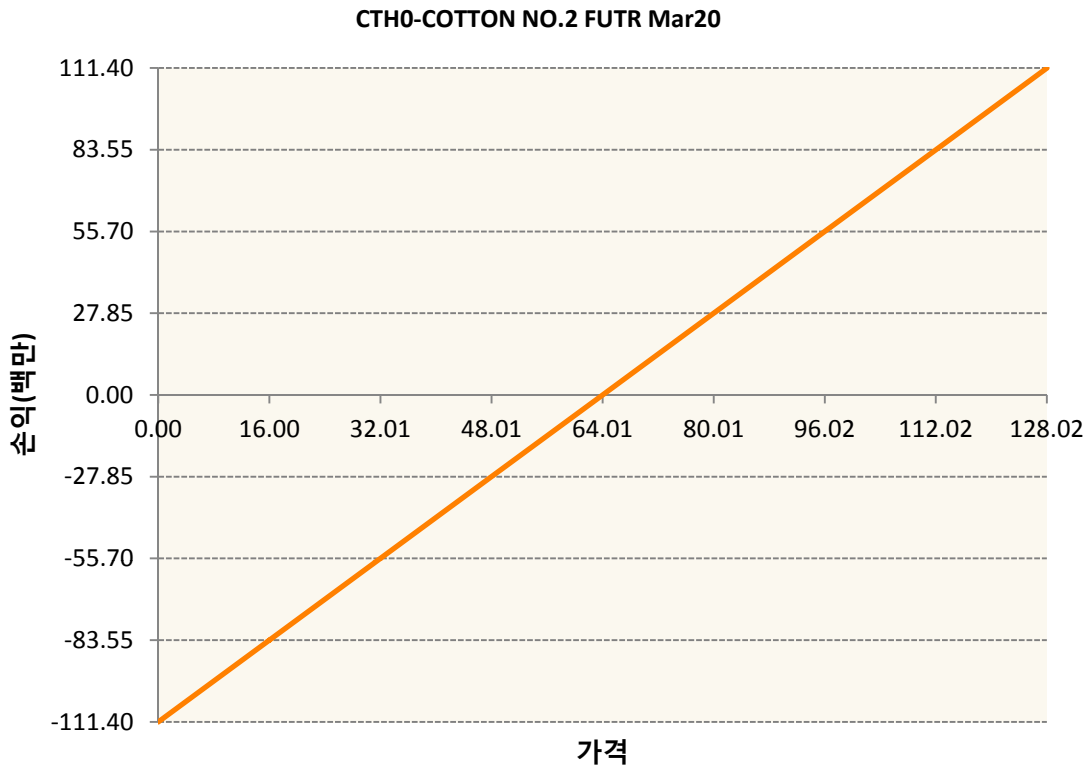
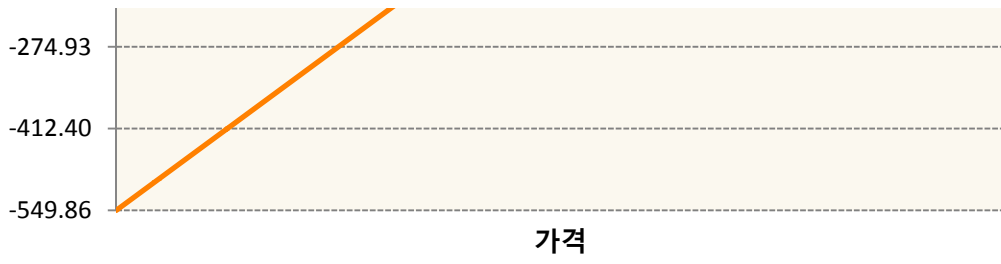
2. 만기시점의 손익구조

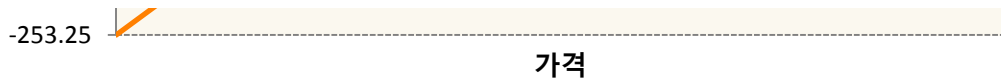
BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20



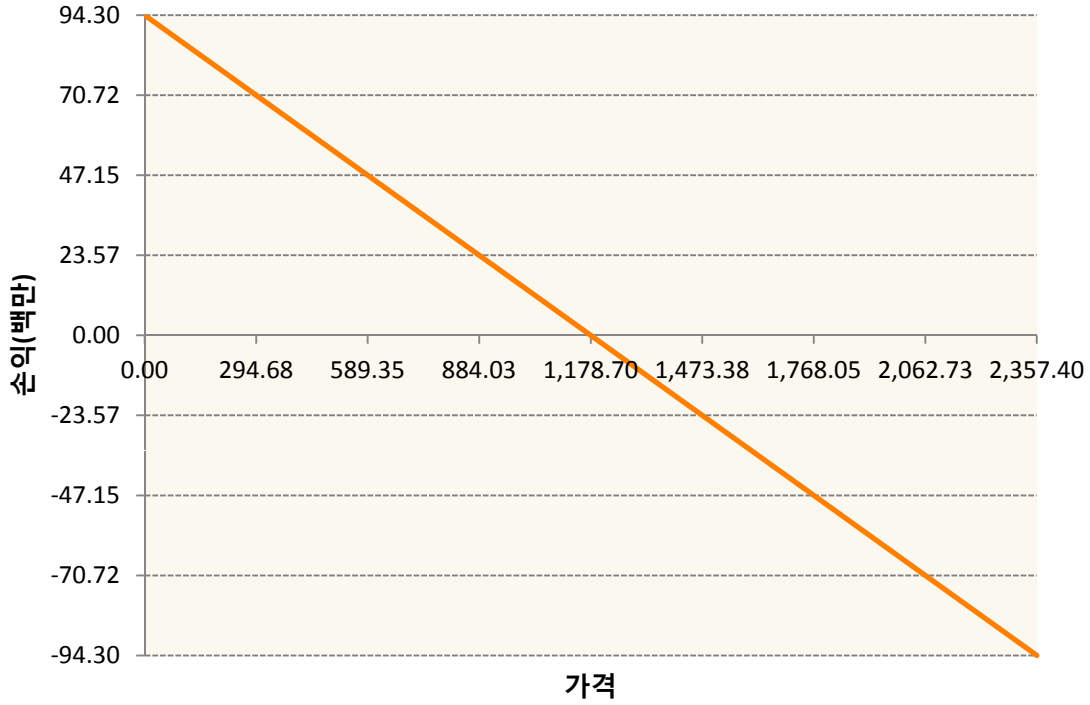
CH0-CORN FUTURE Mar20



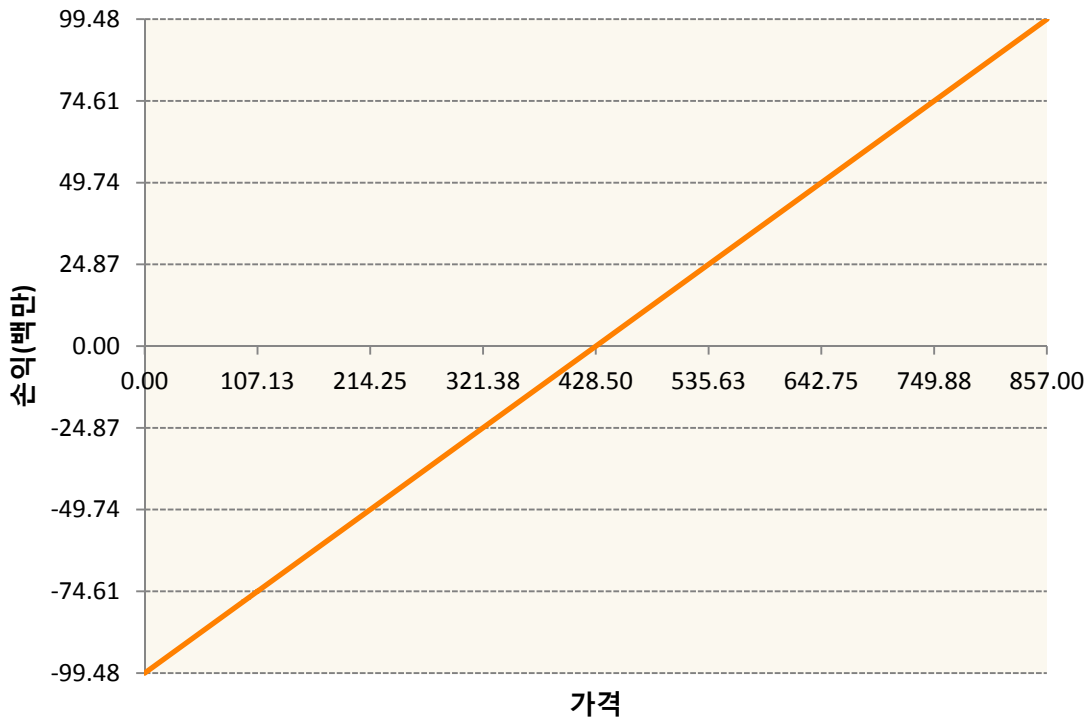




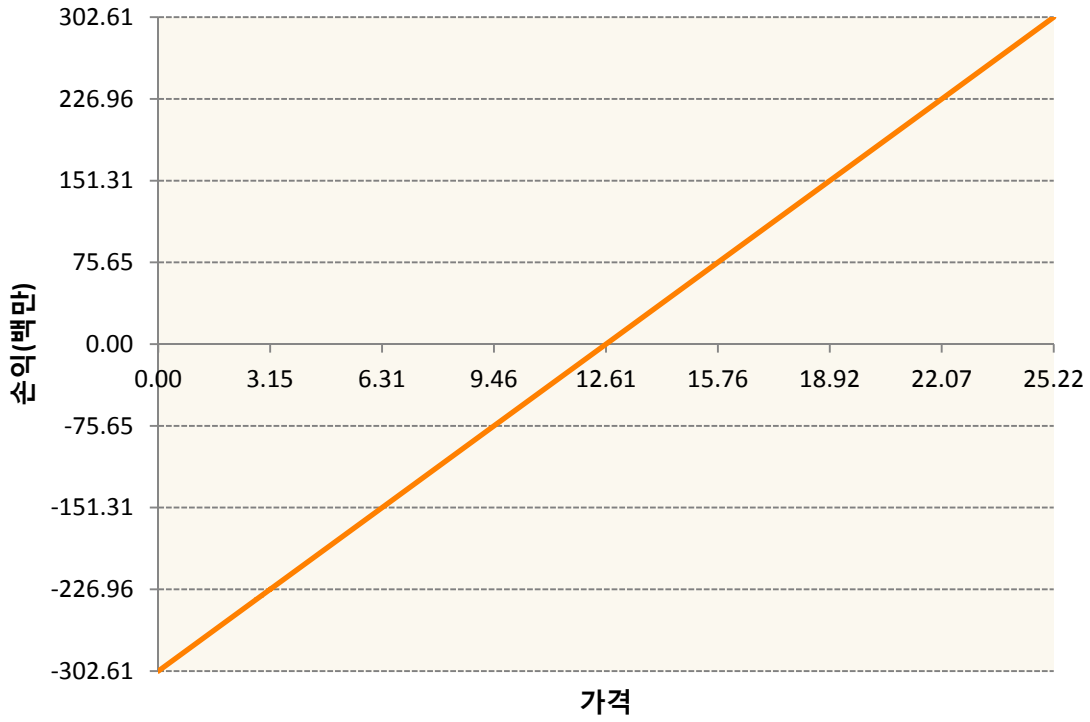
KR4175PC0003-2019-12 달러선물



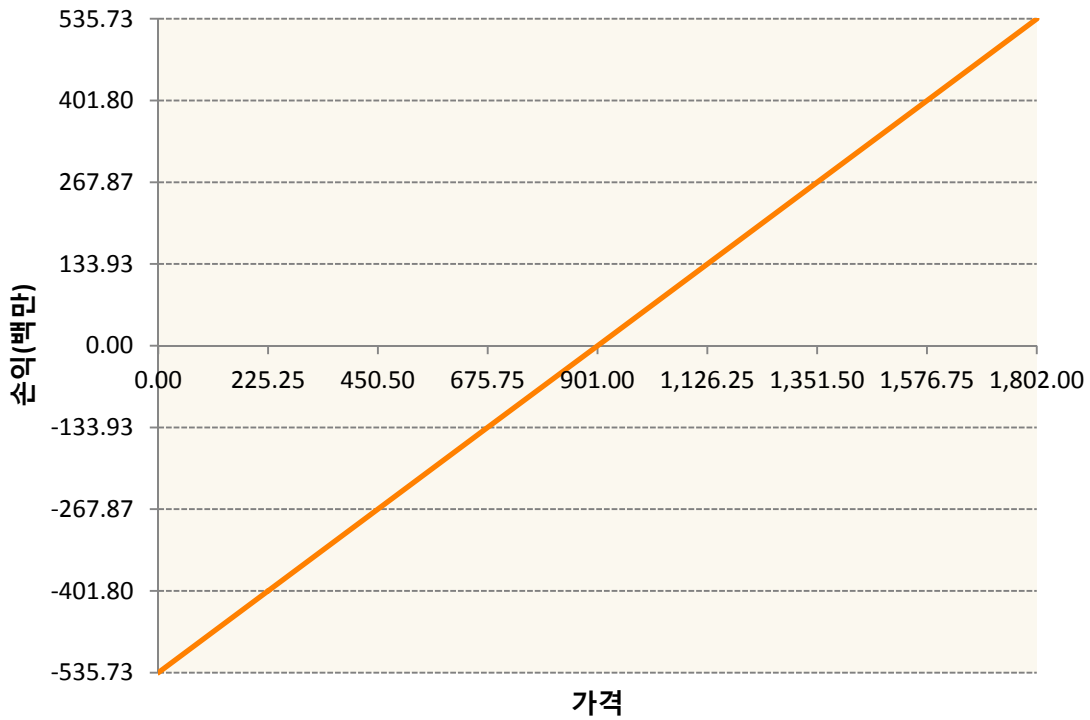
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

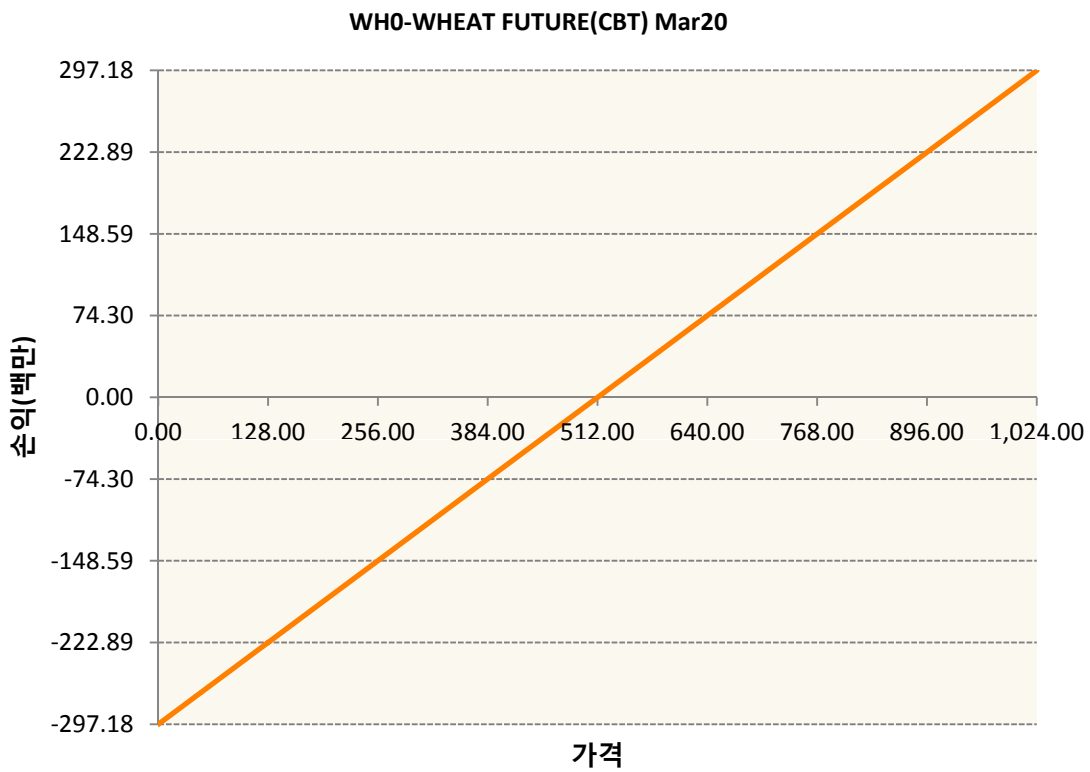
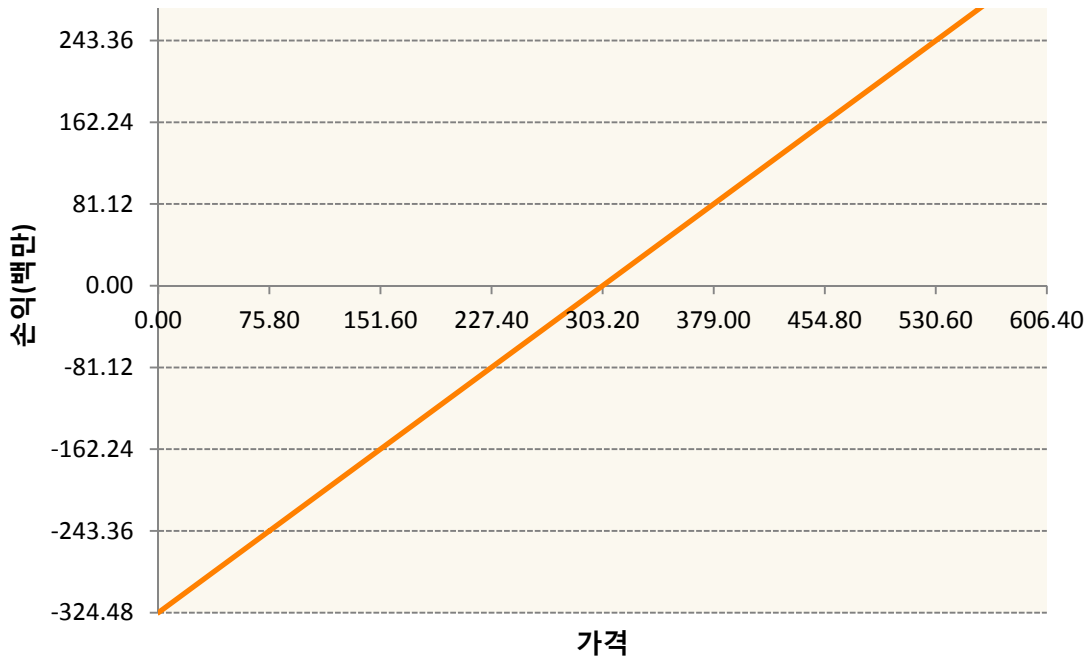


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20



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 | 20 |
| 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