

공시일	2019-11-26
기준일	2019-11-25

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	2019-11-26
기준일	2019-11-25

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	13,582	0	13,582	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S191122

1,088

* 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	2019-11-26
기준일	2019-11-25

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)

745

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-11-26
기준일	2019-11-25

유로인덱스모(주식-파생형)

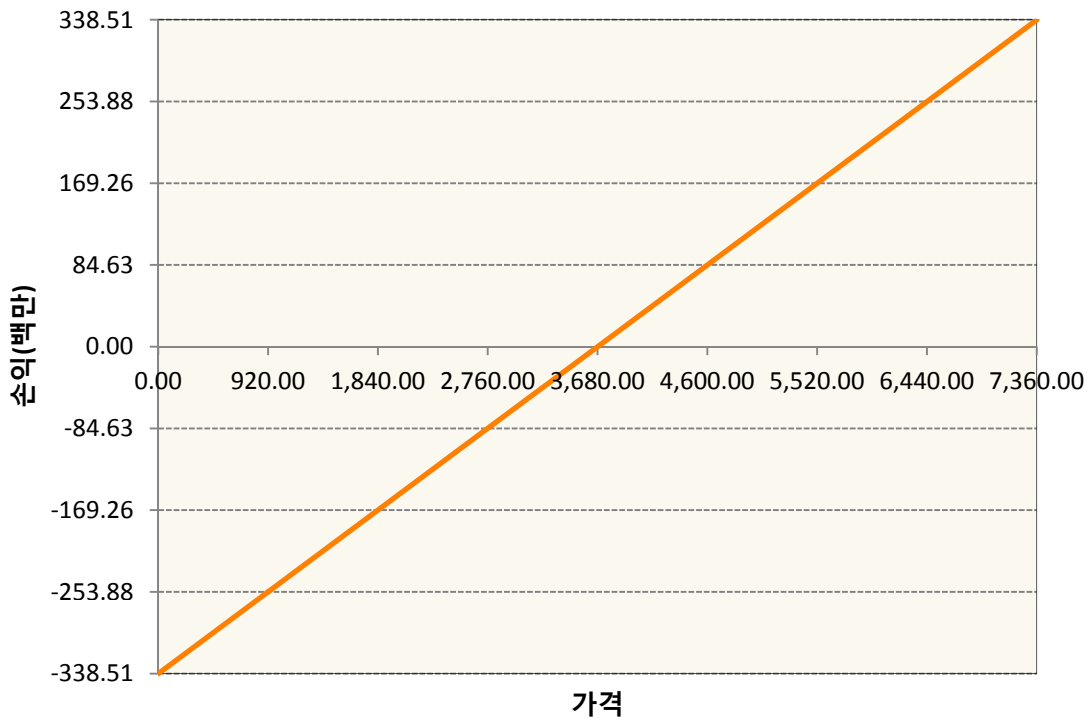
1. 계약금액

(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	2019-11-26
기준일	2019-11-25

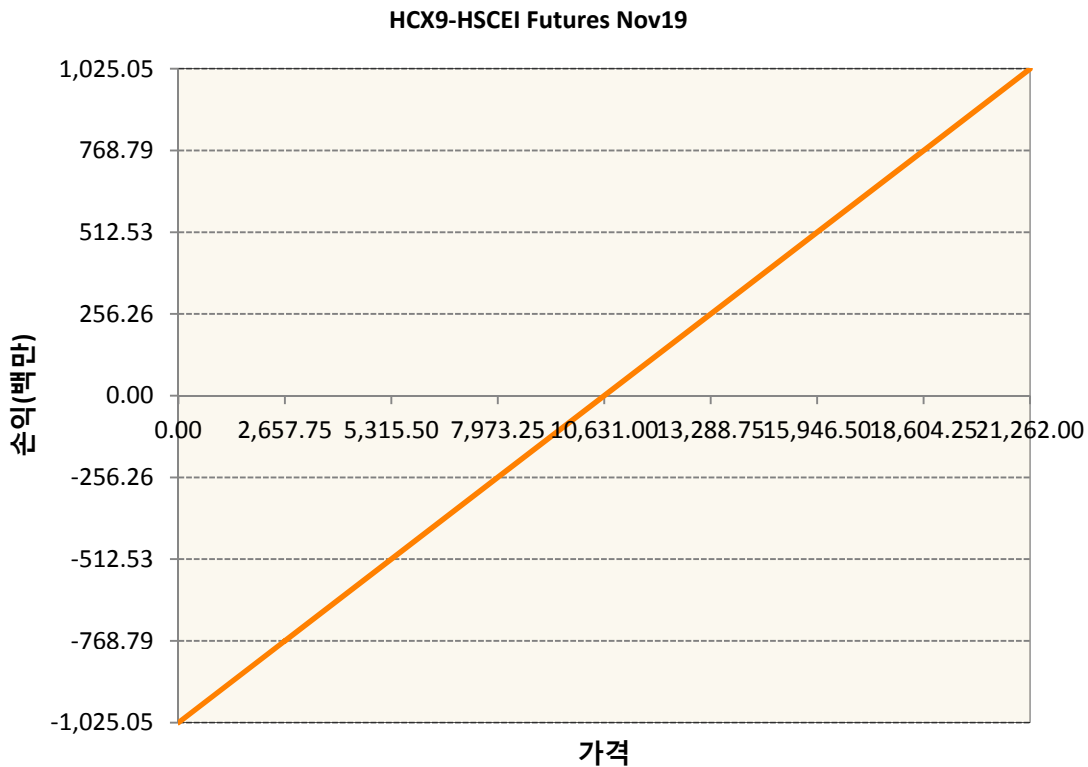
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,025	0	1,025	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

73

공시일	2019-11-26
기준일	2019-11-25

커버드콜모(주식혼합-파생형)

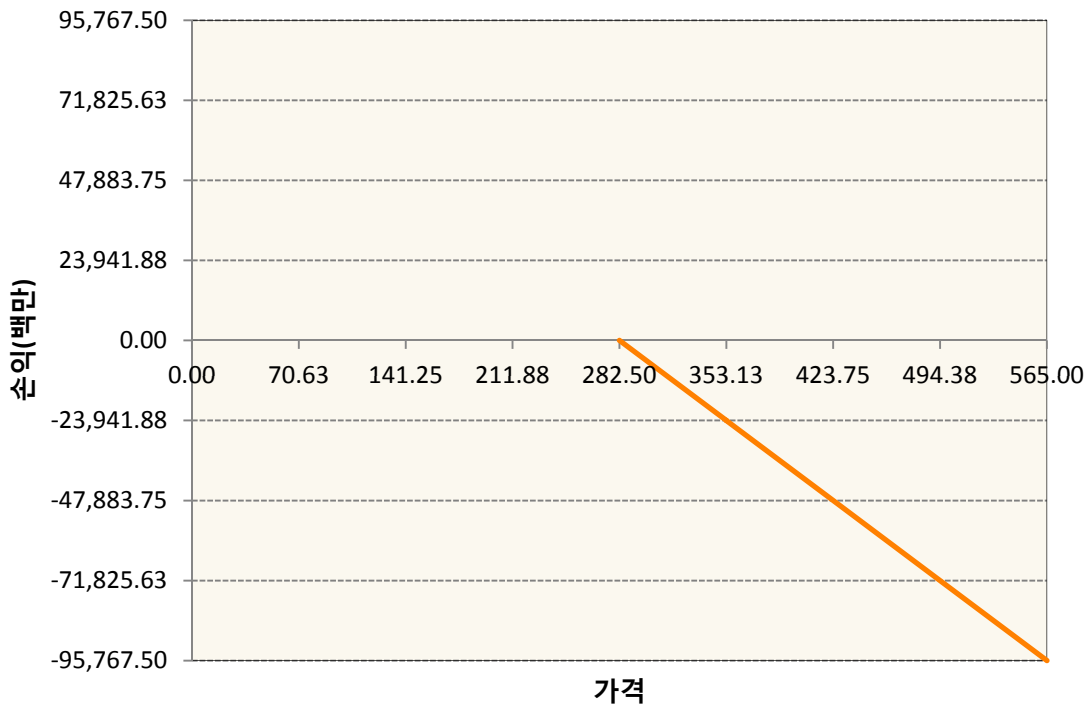
1. 계약금액

(단위:백만원)

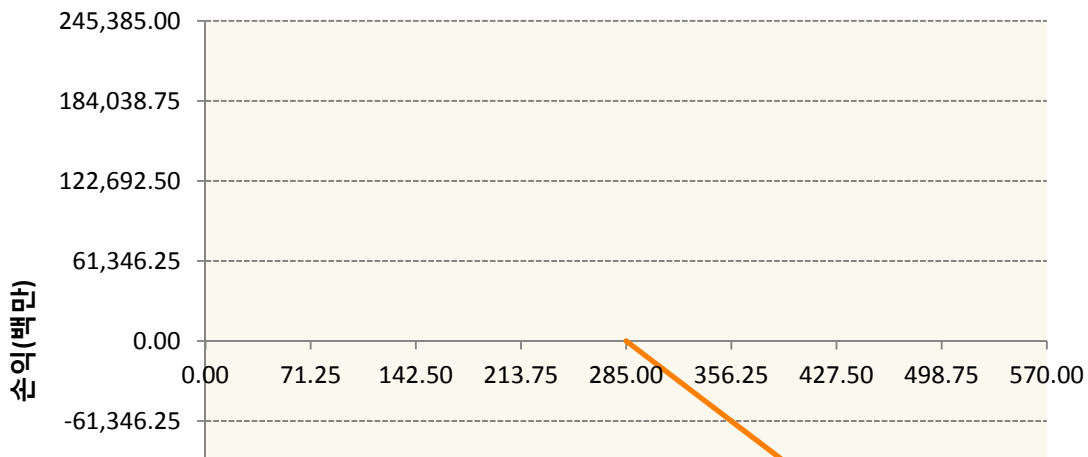
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	498,456	-498,456	장내

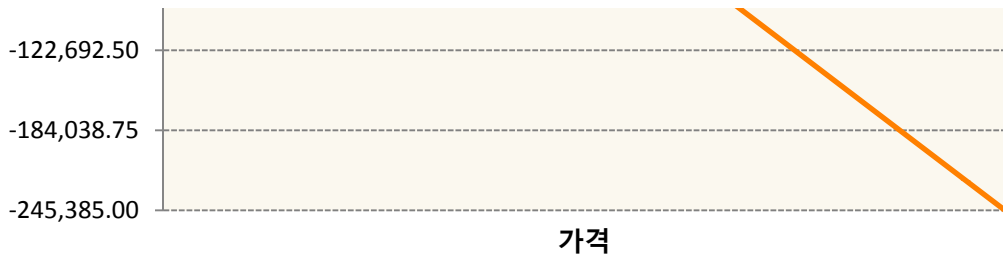
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PC2825-2019-12 콜282.5

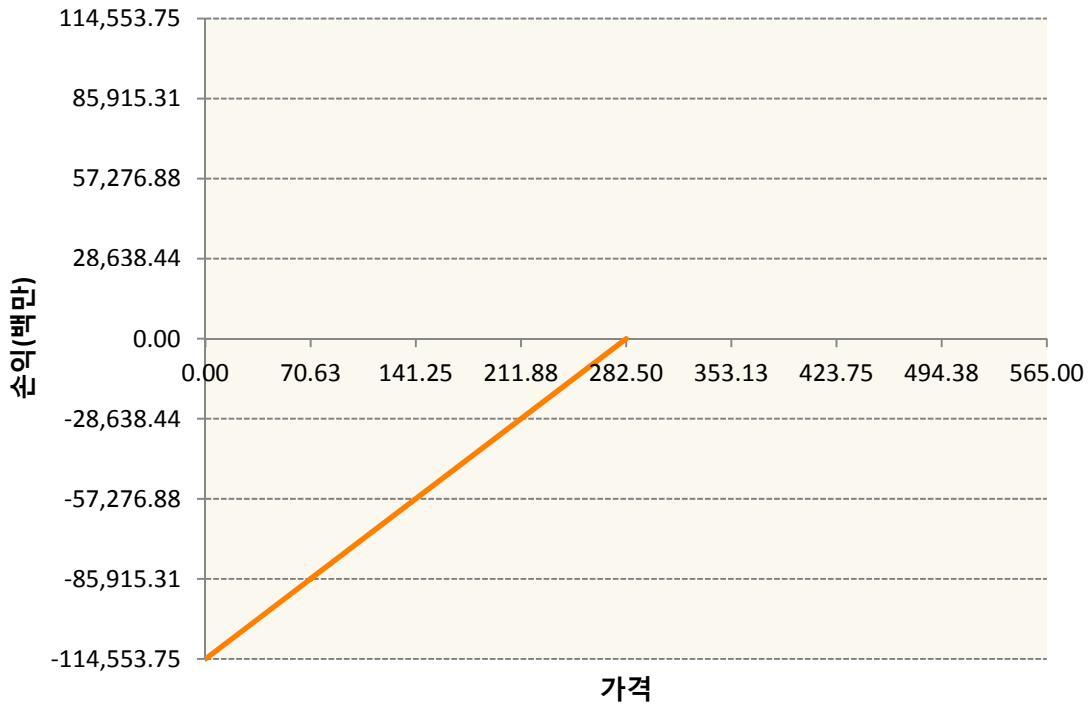


KR4201PC2858-2019-12 콜285

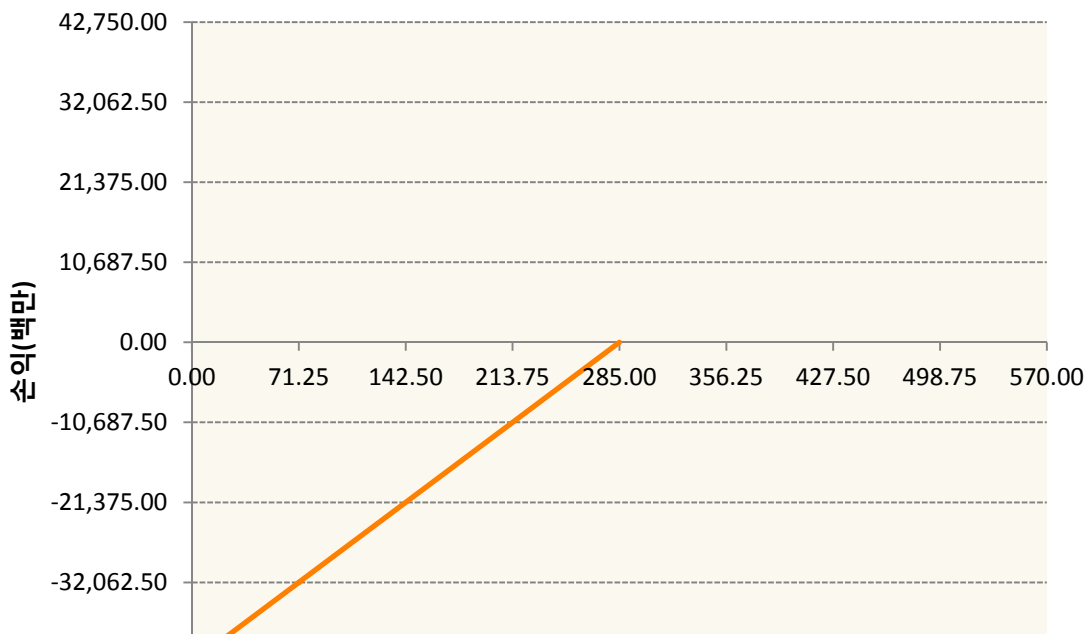




KR4301PC2824-2019-12 풋282.5



KR4301PC2857-2019-12 풋285



-42,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PC2825		2019-12 콜282.5						5,891
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,187	2,149	2,098	2,035	1,960	1,875	1,781	
-5.33%	2,019	1,925	1,819	1,702	1,577	1,444	1,305	
-2.67%	1,548	1,389	1,225	1,057	885	712	536	
0%	577	385	192	0	-192	-385	-577	
2.67%	-974	-1,145	-1,319	-1,497	-1,678	-1,860	-2,044	
5.33%	-3,012	-3,126	-3,251	-3,386	-3,530	-3,680	-3,836	
8.00%	-5,352	-5,409	-5,482	-5,568	-5,666	-5,774	-5,891	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						14,174
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4,640	4,570	4,472	4,344	4,188	4,006	3,799	
-5.33%	4,350	4,161	3,937	3,683	3,403	3,100	2,779	
-2.67%	3,455	3,098	2,720	2,327	1,921	1,504	1,079	
0%	1,444	965	483	0	-484	-969	-1,455	
2.67%	-2,010	-2,481	-2,956	-3,435	-3,916	-4,400	-4,886	
5.33%	-6,812	-7,157	-7,527	-7,917	-8,322	-8,740	-9,168	
8.00%	-12,540	-12,734	-12,965	-13,229	-13,521	-13,837	-14,174	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						7,901
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-7,886	-7,887	-7,887	-7,888	-7,891	-7,895	-7,901	
-5.33%	-4,842	-4,848	-4,858	-4,873	-4,893	-4,919	-4,950	
-2.67%	-1,905	-1,957	-2,017	-2,083	-2,155	-2,231	-2,311	
0%	335	224	112	0	-112	-224	-336	
2.67%	1,265	1,201	1,130	1,052	971	885	796	
5.33%	1,424	1,412	1,395	1,372	1,342	1,306	1,264	
8.00%	1,433	1,433	1,431	1,428	1,422	1,413	1,401	
KR4301PC2857		2019-12 풋285						3,075
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,073	-3,073	-3,073	-3,073	-3,073	-3,074	-3,075	
-5.33%	-1,946	-1,946	-1,948	-1,951	-1,955	-1,961	-1,969	
-2.67%	-835	-846	-861	-878	-897	-919	-942	
0%	115	77	39	0	-39	-79	-119	
2.67%	619	586	551	515	478	441	403	

5.33%	739	730	718	704	687	668	646
8.00%	749	749	747	744	740	735	727

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

(단위:백만원)

32,393

공시일	2019-11-26
기준일	2019-11-25

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

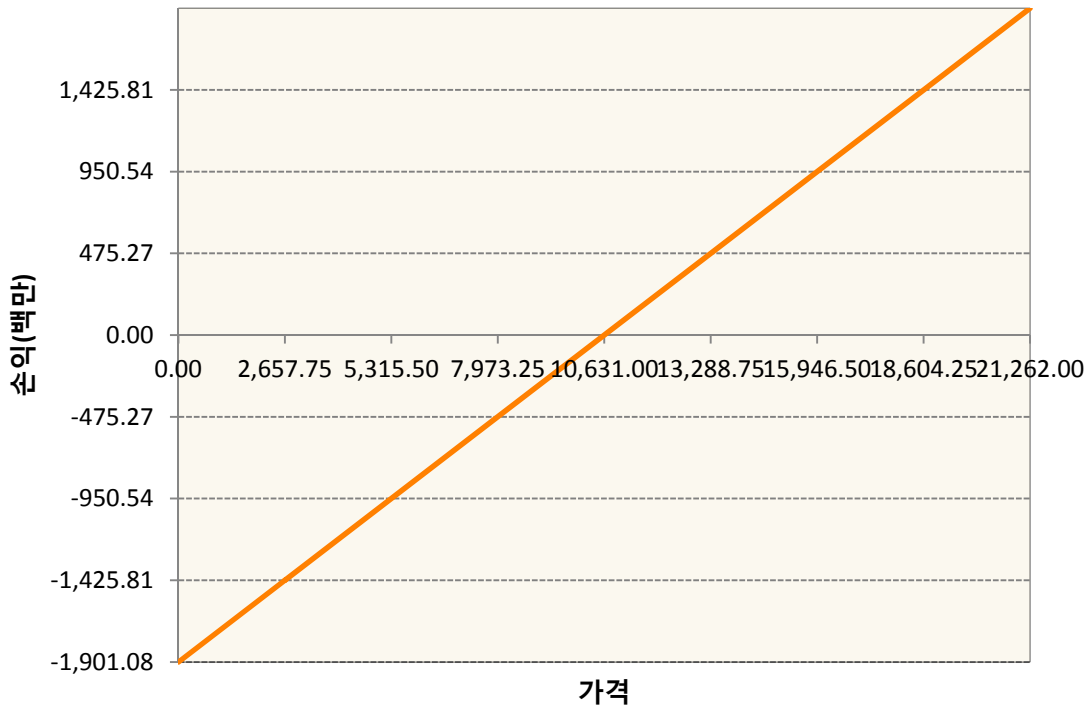
1. 계약금액

(단위:백만원)

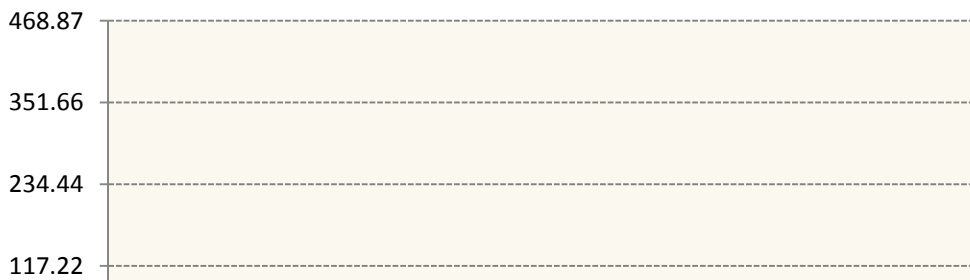
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,901	0	1,901	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,962	-4,962	장내
누계	통화	선도	0	2,116	-2,116	장외

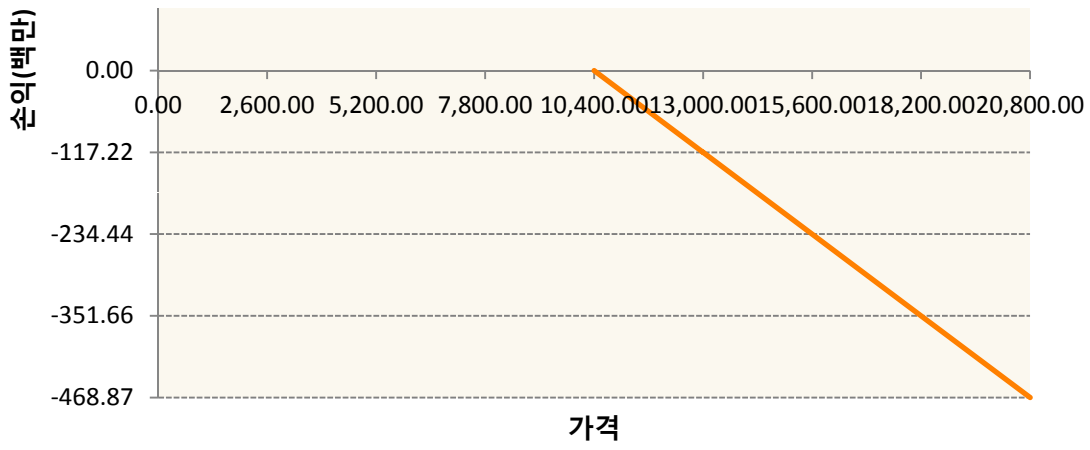
2. 만기시점의 손익구조

HCX9-HSCEI Futures Nov19

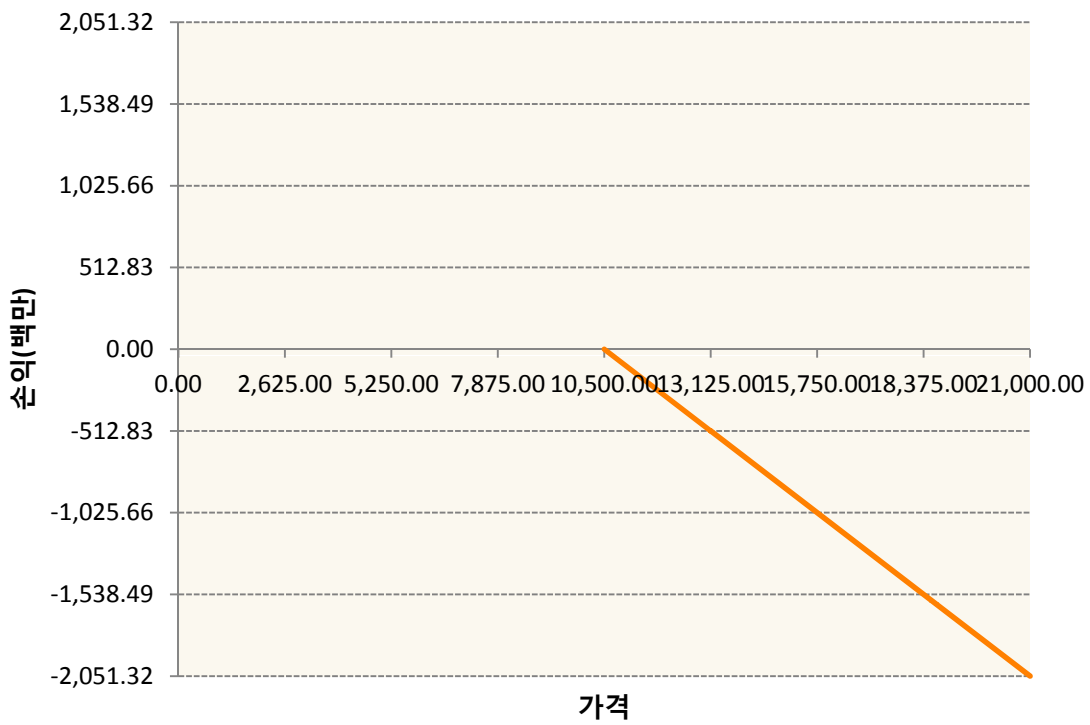


OHHIX9-C104-HSCEI

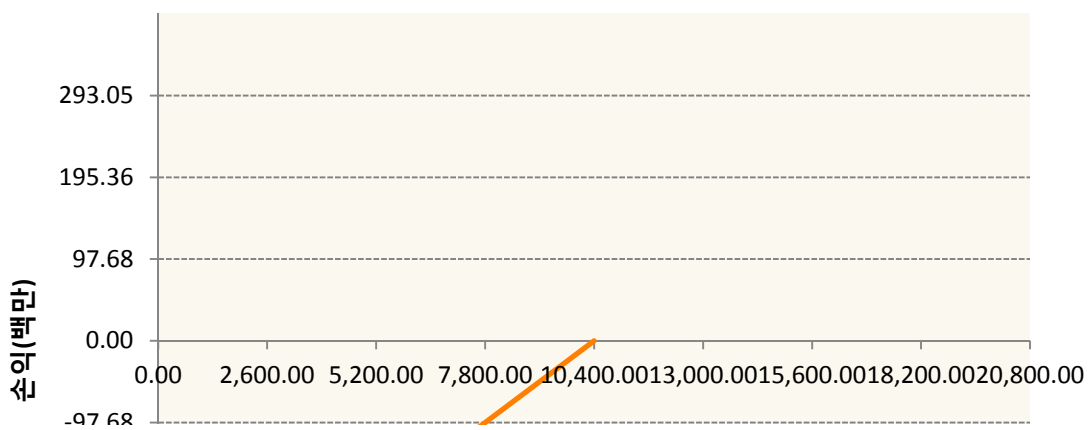


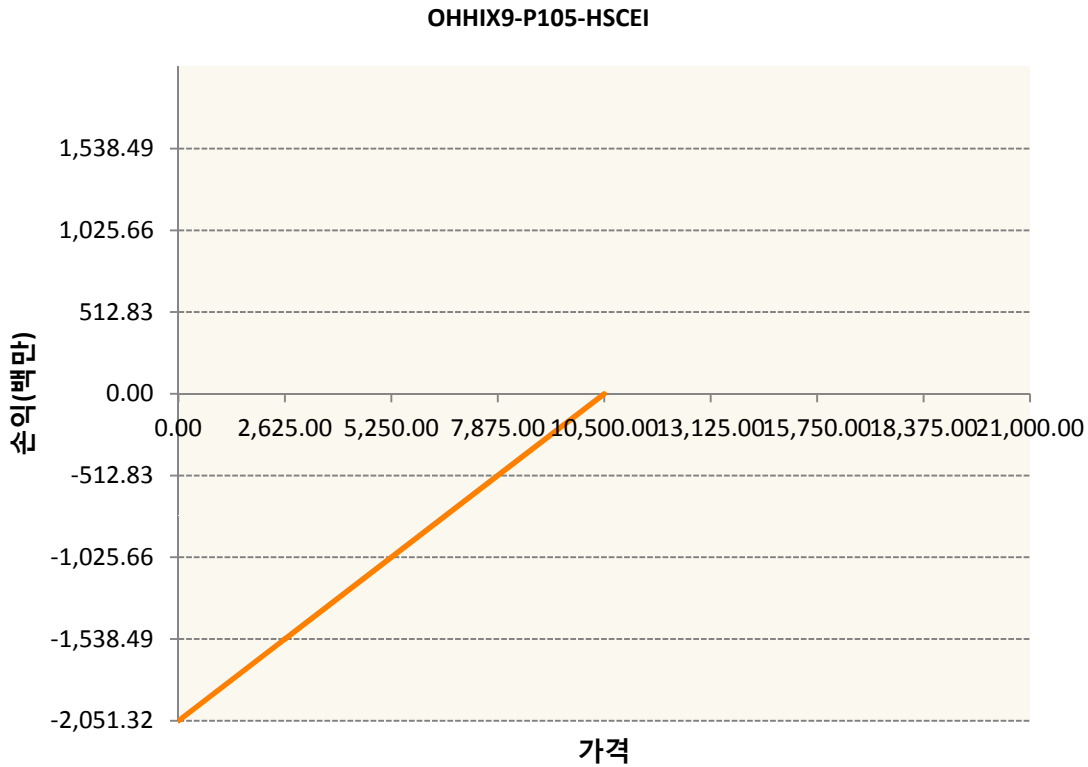
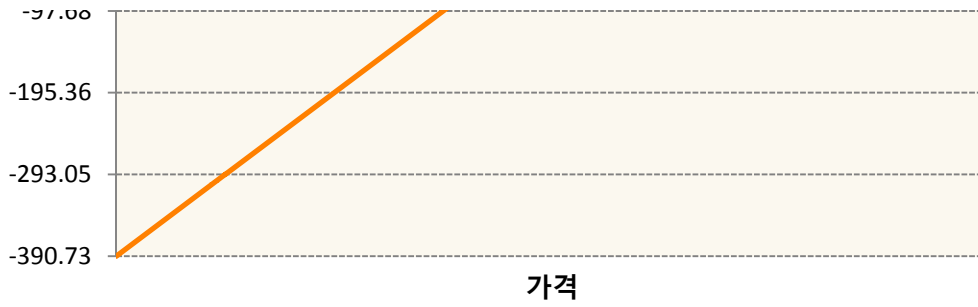


OHHIX9-C105-HSCEI



OHHIX9-P104-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	169
HCX9 HSCEI Futures Nov19	152
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)
	541

공시일	2019-11-26
기준일	2019-11-25

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

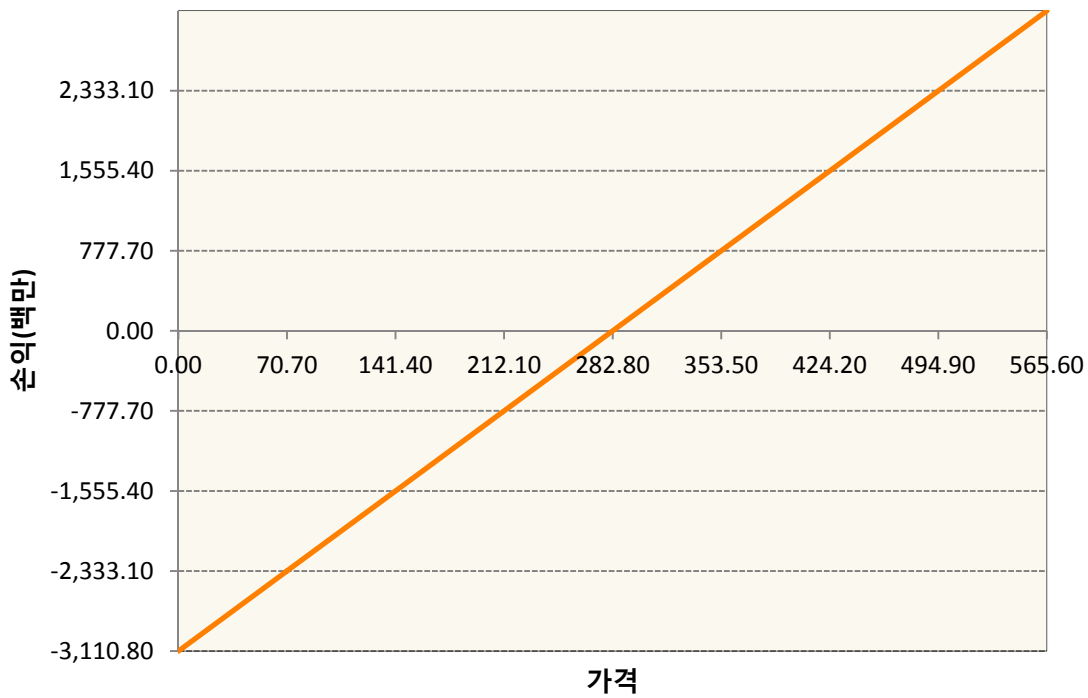
1. 계약금액

(단위:백만원)

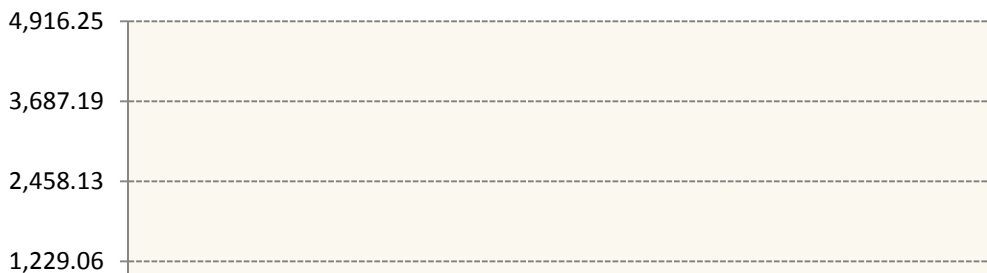
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,111	0	3,111	장내
누계	유가증권	스왑	9,625	0	9,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,657	-9,657	장내

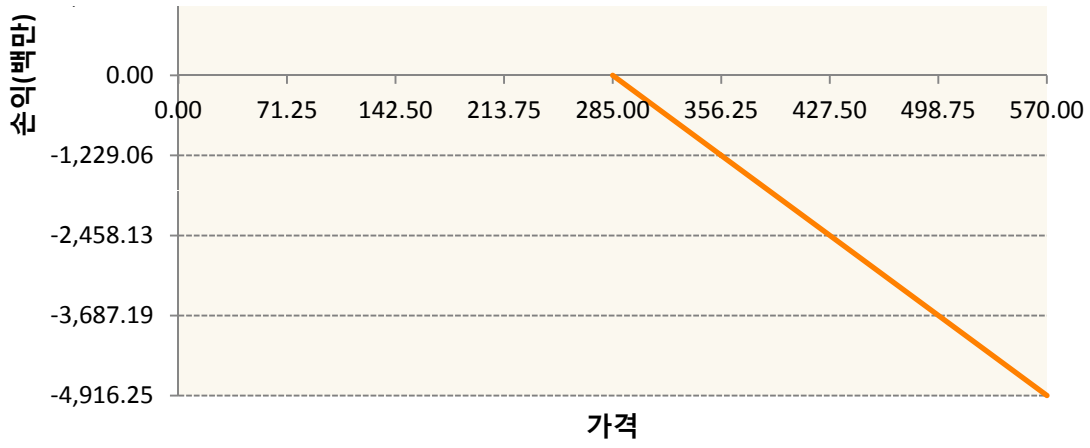
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

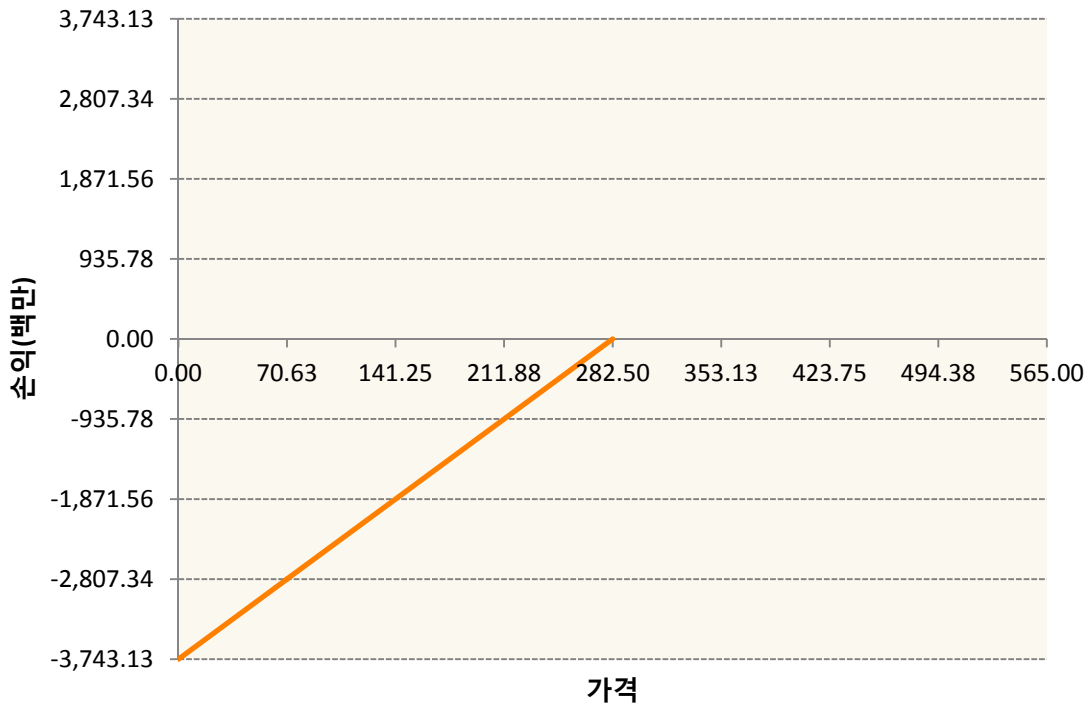


KR4201PC2858-2019-12 콜285

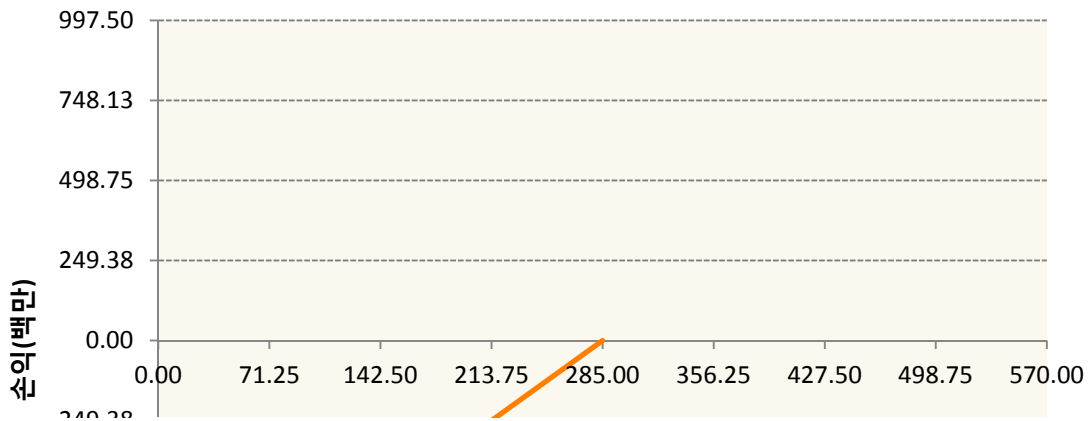




KR4301PC2824-2019-12 풋282.5



KR4301PC2857-2019-12 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						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						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						284
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	93	92	90	87	84	80	76	
-5.33%	87	83	79	74	68	62	56	
-2.67%	69	62	54	47	38	30	22	
0%	29	19	10	0	-10	-19	-29	
2.67%	-40	-50	-59	-69	-78	-88	-98	
5.33%	-136	-143	-151	-159	-167	-175	-184	
8.00%	-251	-255	-260	-265	-271	-277	-284	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						258
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-258	-258	-258	-258	-258	-258	-258
-5.33%	-158	-158	-159	-159	-160	-161	-162
-2.67%	-62	-64	-66	-68	-70	-73	-76
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	41	39	37	34	32	29	26
5.33%	47	46	46	45	44	43	41
8.00%	47	47	47	47	46	46	46
KR4301PC2857 2019-12 풋285							72
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
-5.33%	-45	-45	-45	-46	-46	-46	-46
-2.67%	-19	-20	-20	-20	-21	-21	-22
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	14	14	13	12	11	10	9
5.33%	17	17	17	16	16	16	15
8.00%	17	17	17	17	17	17	17

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

(단위:백만원)

1,689

공시일	2019-11-26
기준일	2019-11-25

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

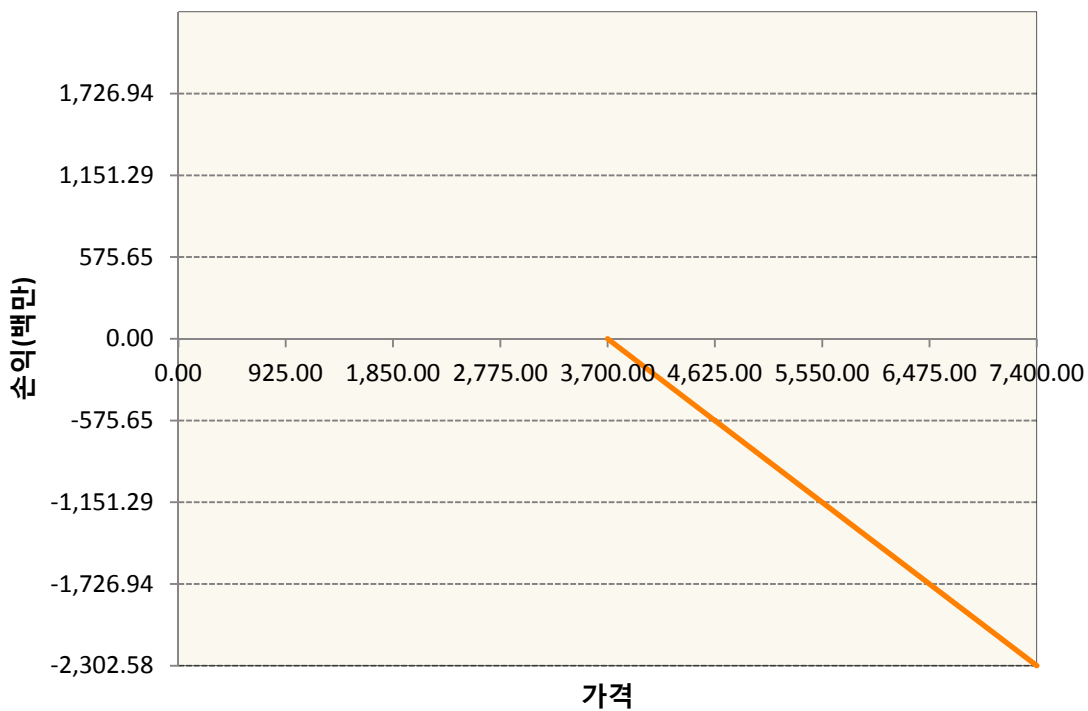
1. 계약금액

(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	1,335	0	1,335	
누계	유가증권	스왑	17,727	0	17,727	장외
누계	유가증권	옵션	0	8,759	-8,759	장내
누계	통화	선도	2,691	6,093	-3,402	장외

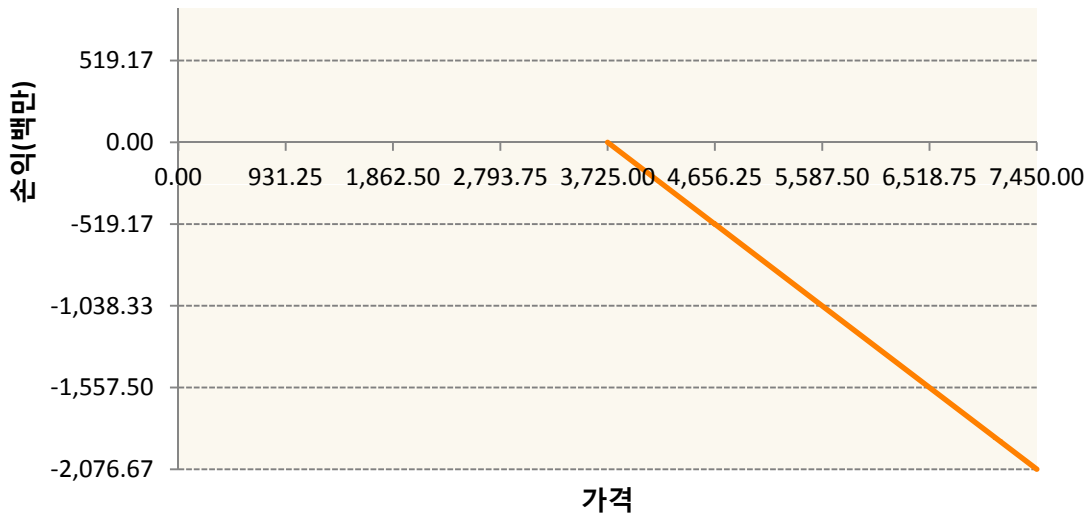
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ9-C3700-EURO STOXX 50

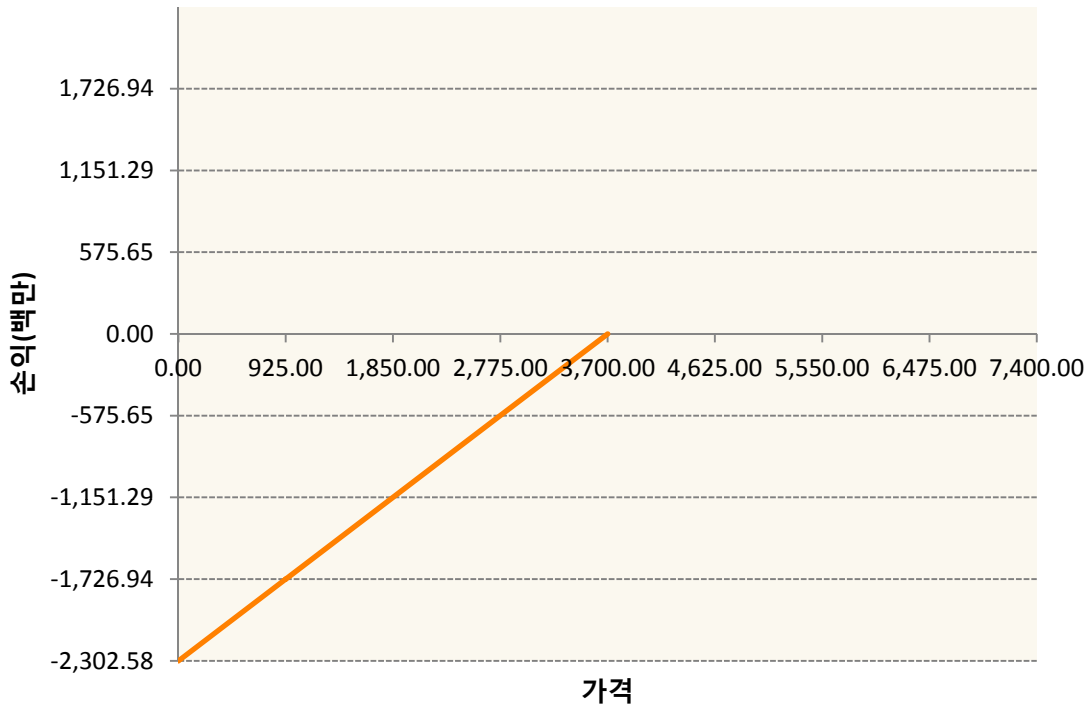


OESXZ9-C3725-EURO STOXX 50

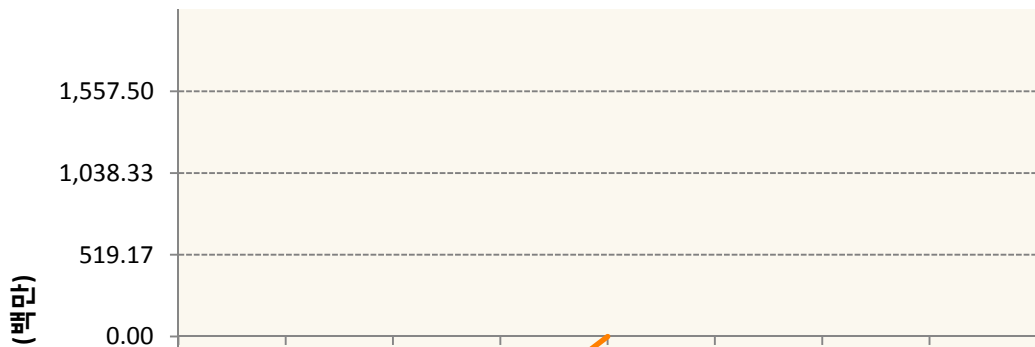


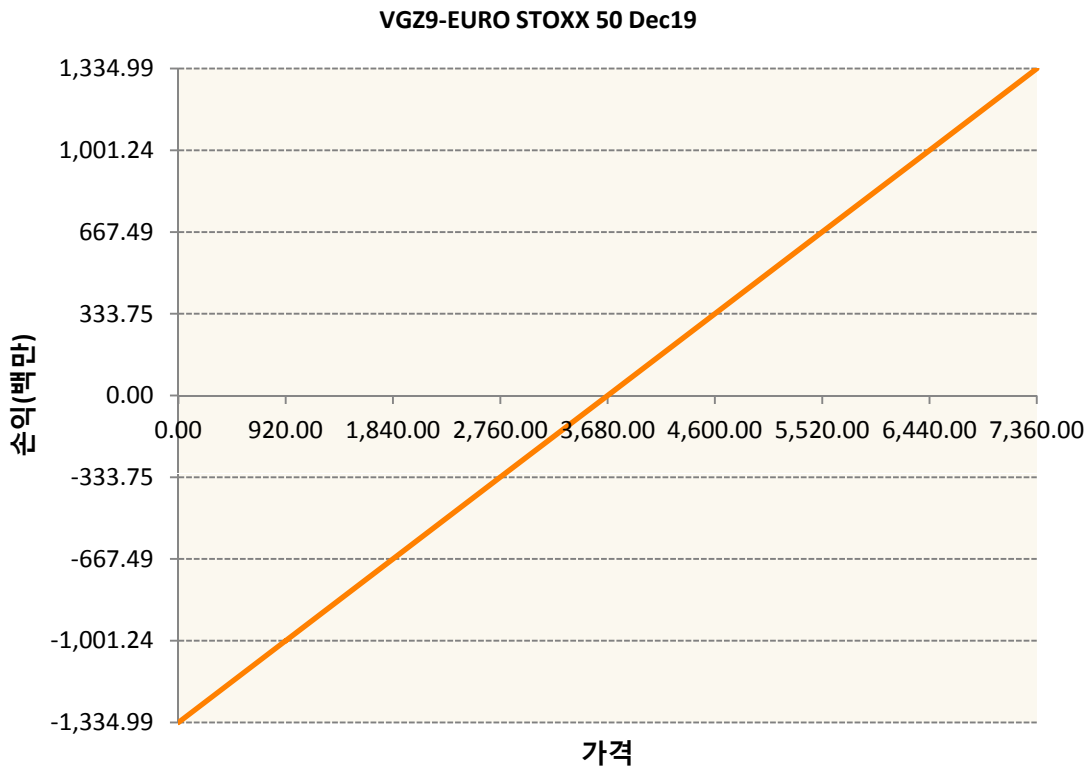
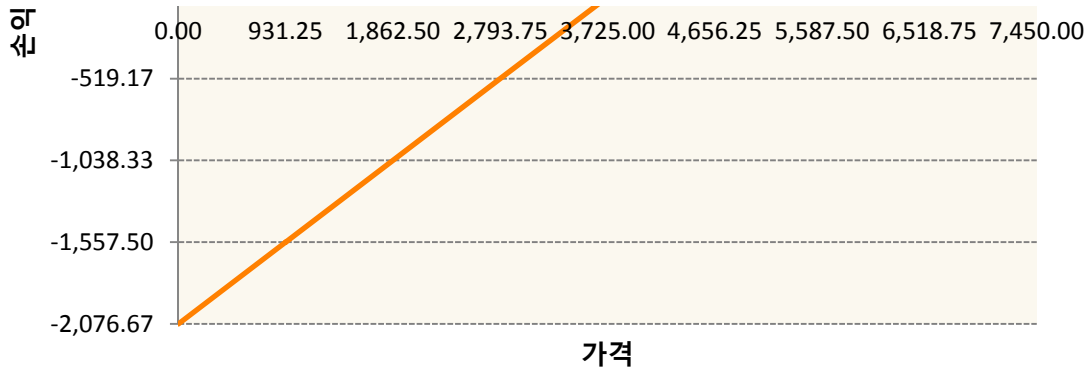


OESXZ9-P3700-EURO STOXX 50



OESXZ9-P3725-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	15
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E	487
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E	163
FX21019X02 EUR/KRW 27-12-19E	52
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	184
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	166
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	184
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	166
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19	107

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

(단위:백만원)

881

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

(단위:백만원)

921

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

(단위:백만원)

80

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

(단위:백만원)

125

공시일	2019-11-26
기준일	2019-11-25

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

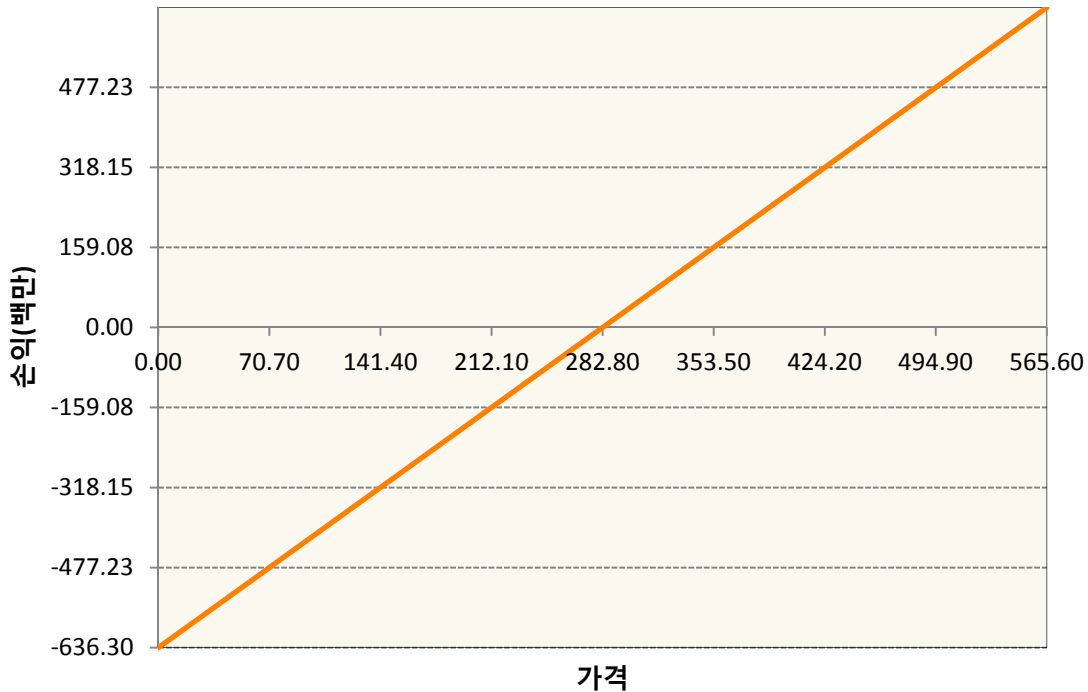
1. 계약금액

(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	2019-11-26
기준일	2019-11-25

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

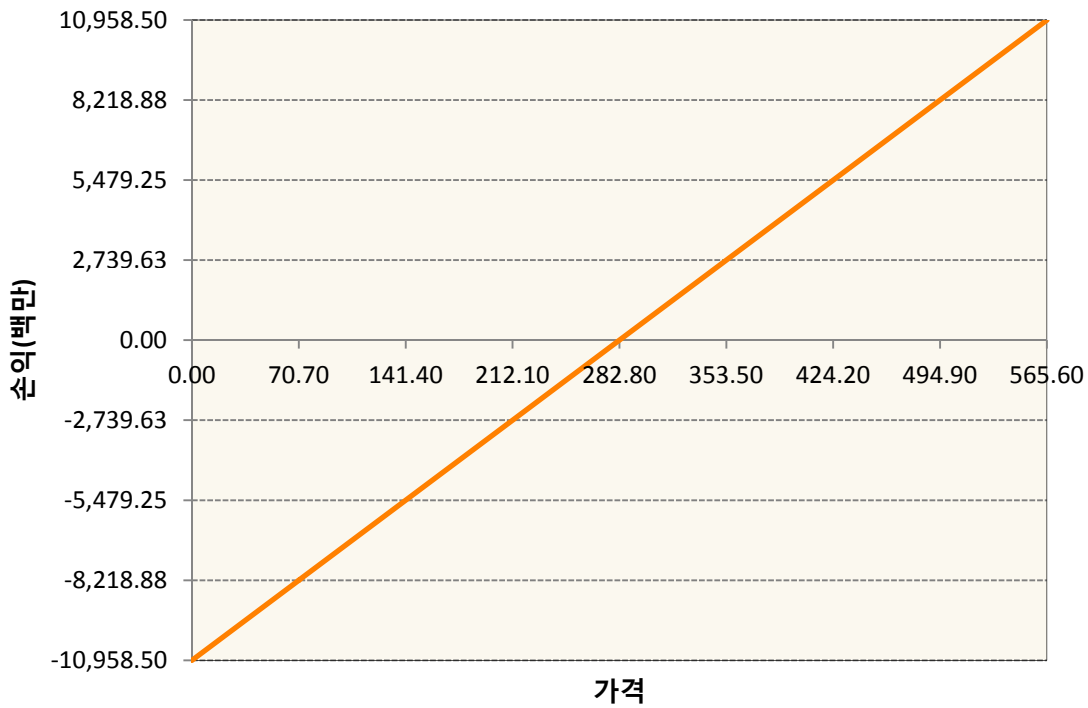
1. 계약금액

(단위:백만원)

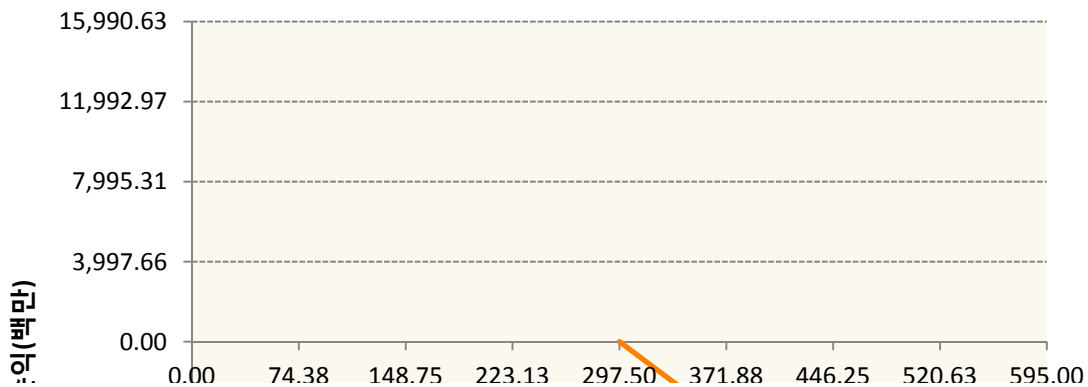
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	71	-71	장내
신규	유가증권	옵션	149	72	77	장내
누계	유가증권	선물	10,959	0	10,959	장내
누계	유가증권	옵션	1,277	21,241	-19,964	장내

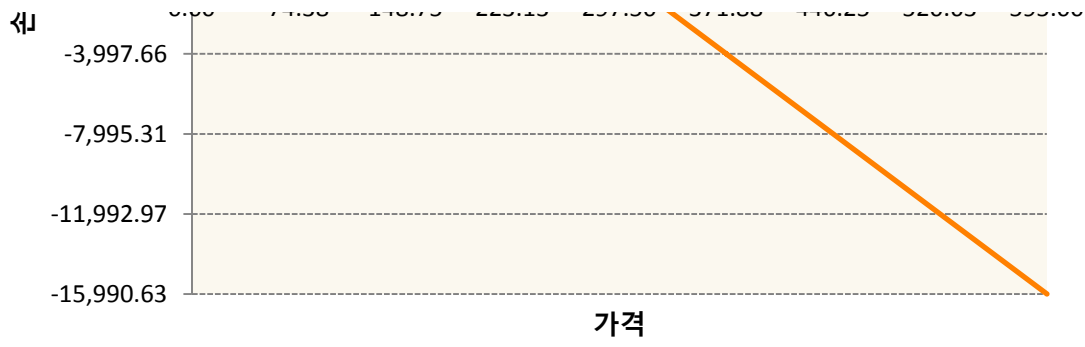
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

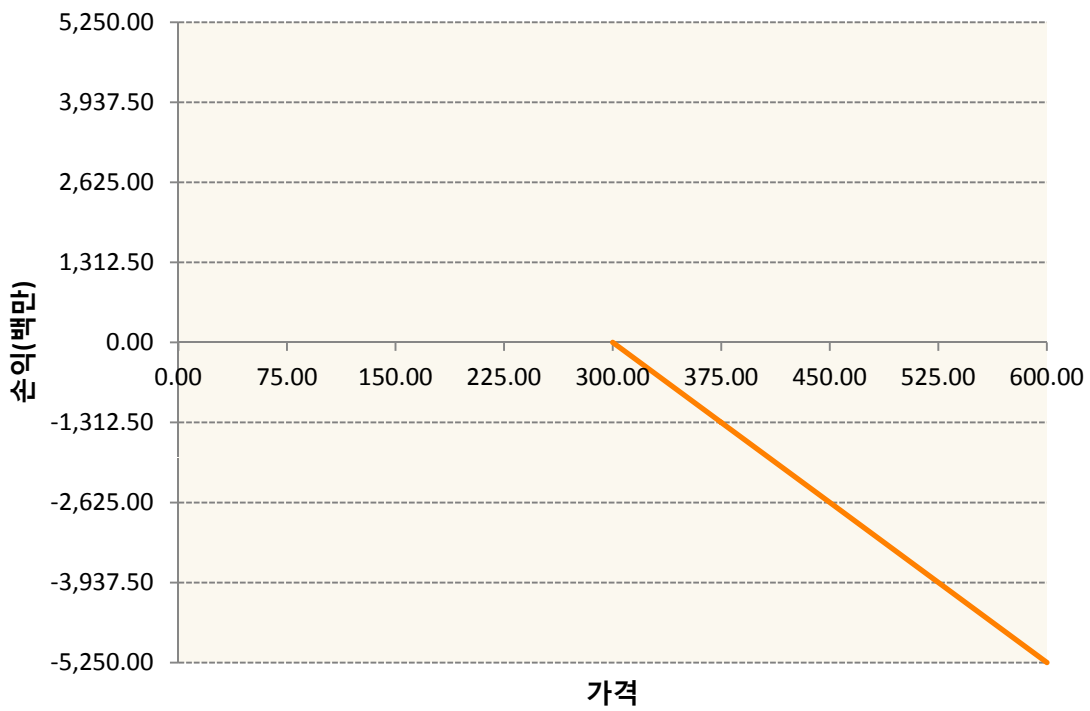


KR4201PC2973-2019-12 콜297.5

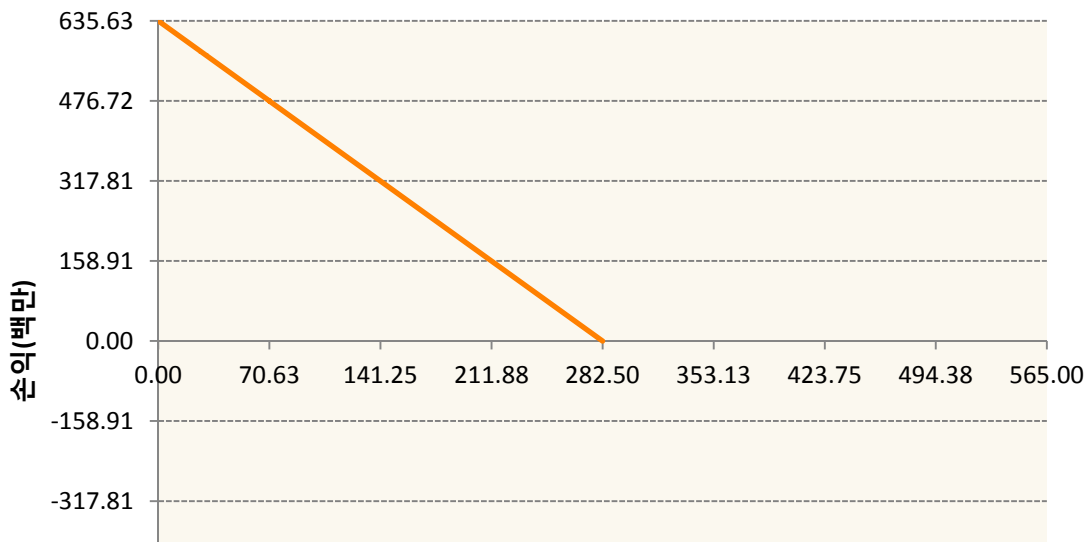


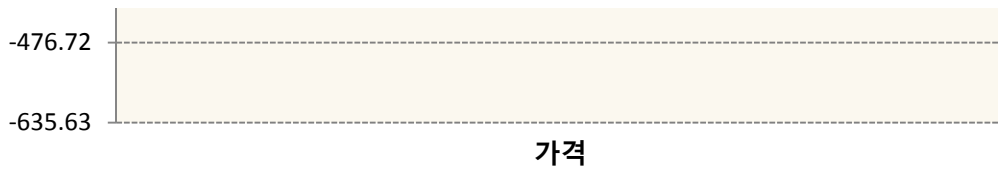


KR4201PC3005-2019-12 콜300

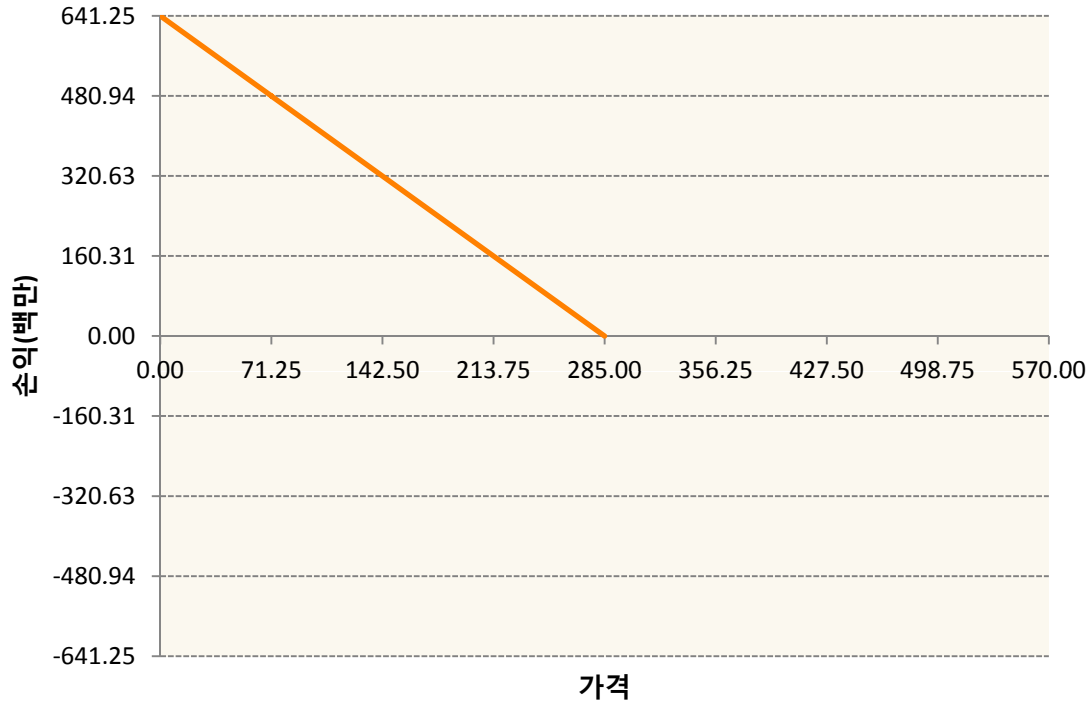


KR4301PC2824-2019-12 풋282.5





KR4301PC2857-2019-12 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						875
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-875	-875	-875	-875	-875	-875	-875	
-5.33%	-583	-583	-583	-583	-583	-583	-583	
-2.67%	-292	-292	-292	-292	-292	-292	-292	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	292	292	292	292	292	292	292	
5.33%	583	583	583	583	583	583	583	
8.00%	875	875	875	875	875	875	875	
KR4201PC2973		2019-12 콜297.5						605
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	98	97	96	94	92	88	82	
-5.33%	96	94	90	85	78	69	59	
-2.67%	87	80	70	58	44	29	12	

0%	56	39	21	0	-22	-45	-69
2.67%	-24	-51	-79	-107	-136	-166	-195
5.33%	-181	-213	-245	-277	-309	-341	-374
8.00%	-425	-454	-484	-513	-544	-574	-605
KR4201PC3005 2019-12 콜300							179
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	25	25	24	24	23	22	21
-5.33%	24	24	23	22	20	18	15
-2.67%	23	21	18	15	11	7	2
0%	15	11	6	0	-6	-13	-20
2.67%	-4	-12	-21	-29	-38	-47	-56
5.33%	-47	-57	-67	-78	-88	-98	-109
8.00%	-117	-127	-137	-147	-158	-168	-179
KR4301PC2824 2019-12 풋282.5							44
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	44	44	44	44	44	44	44
-5.33%	27	27	27	27	27	27	27
-2.67%	11	11	11	12	12	12	13
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-7	-7	-6	-6	-5	-5	-4
5.33%	-8	-8	-8	-8	-7	-7	-7
8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
KR4301PC2857 2019-12 풋285							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	30
-2.67%	13	13	13	13	13	14	14
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-9	-9	-8	-8	-7	-7	-6
5.33%	-11	-11	-11	-11	-10	-10	-10
8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11

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

(단위:백만원)

1,353

공시일	2019-11-26
기준일	2019-11-25

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	205,514	0	205,514	

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	2019-11-26
기준일	2019-11-25

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	214,497	0	214,497	

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	2019-11-26
기준일	2019-11-25

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	544,660	0	544,660	
누계	통화	선도	0	535,198	-535,198	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		659
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		696
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,693
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,798
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,411
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,515
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		941
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		941
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,882
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,882
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		941
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		941
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		941
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		941
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		470
FX21019X00 KRW/USD 06-12-19E		659
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		470
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		470
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		470
FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E		1,543
FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E		941
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		470
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		941
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		1,543
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		1,882
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		3,236

FX21019X02 KRW/USD 26-12-19E

4,742

FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E

4,798

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

(단위:백만원)

13,472

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

(단위:백만원)

188

공시일	2019-11-26
기준일	2019-11-25

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

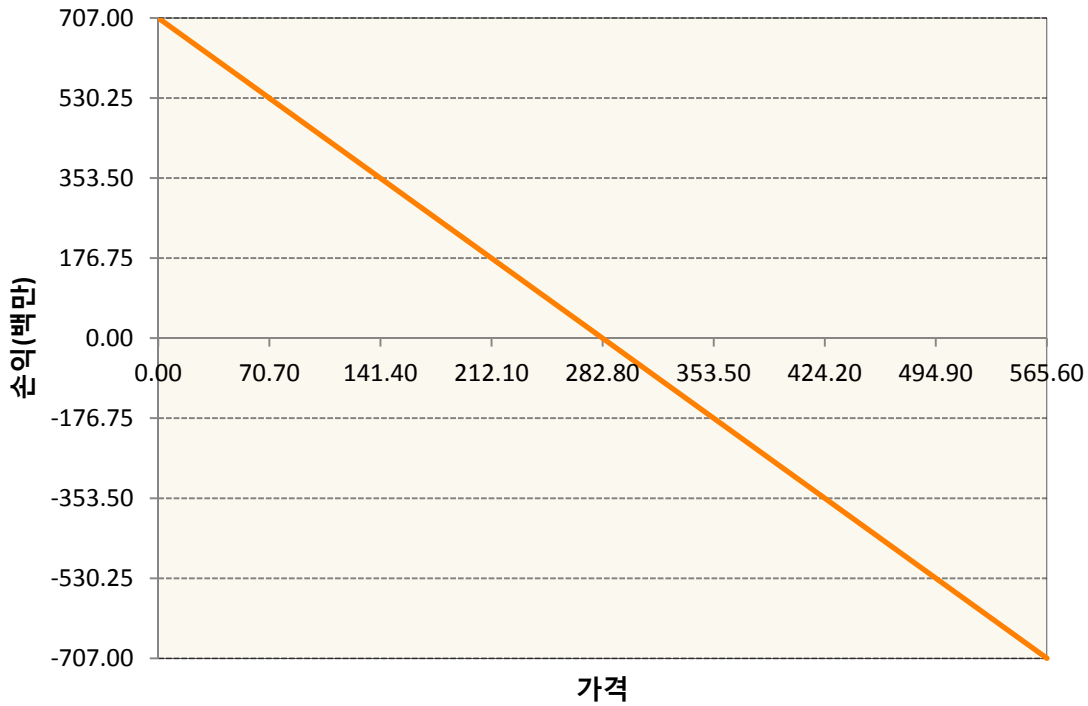
1. 계약금액

(단위:백만원)

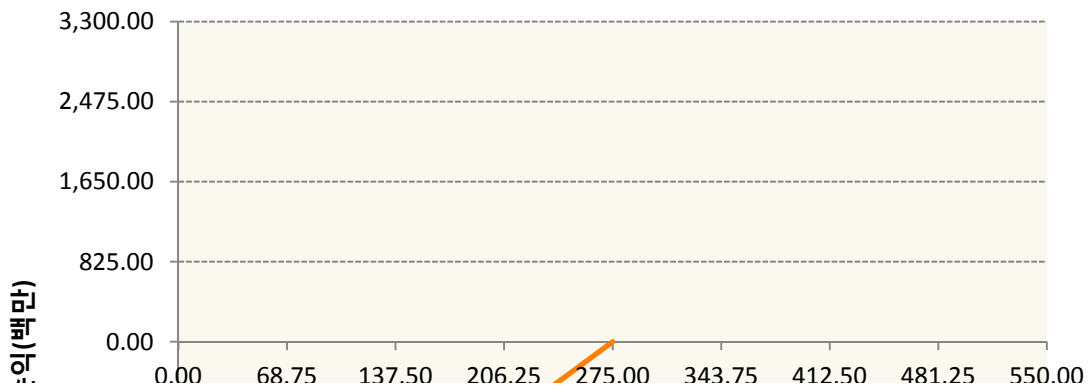
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	707	-707	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,994	-3,994	장내

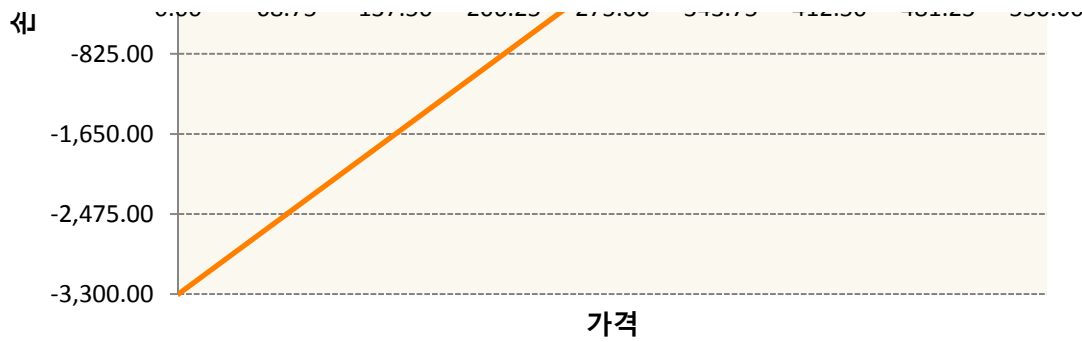
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

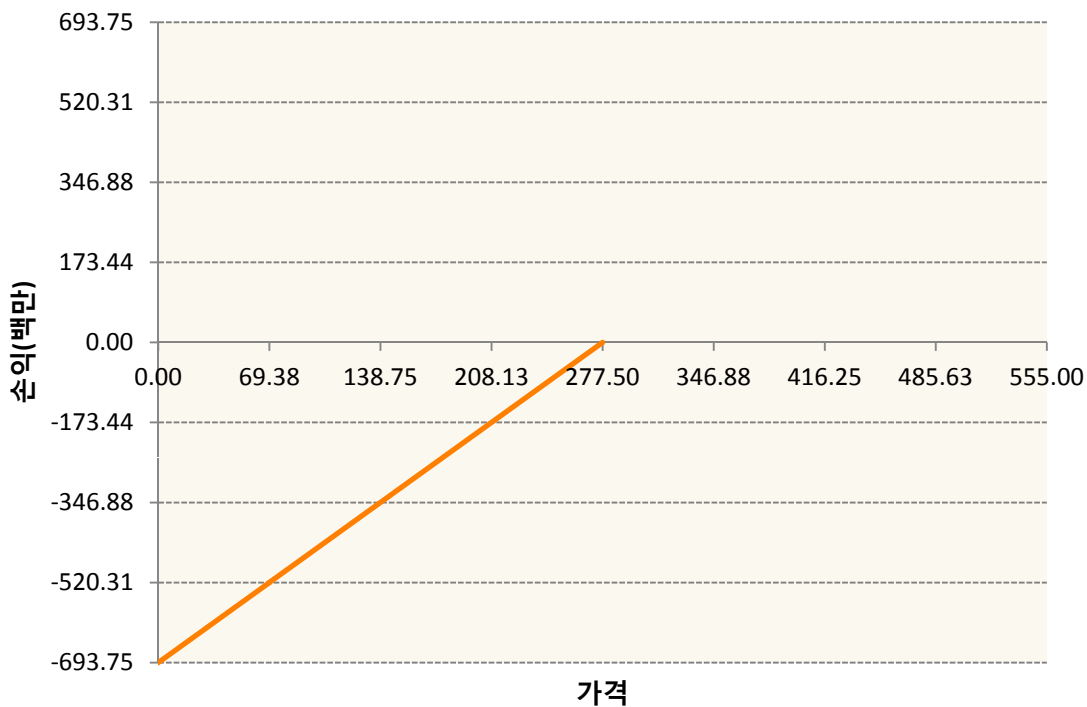


KR4301PC2758-2019-12 풋275





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%	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						178
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-175	-176	-176	-176	-177	-177	-178
-5.33%	-88	-90	-91	-93	-95	-97	-99
-2.67%	-21	-24	-28	-31	-34	-37	-41
0%	6	4	2	0	-2	-5	-7
2.67%	10	10	10	9	8	7	6
5.33%	11	11	11	10	10	10	10
8.00%	11	11	11	11	11	11	10
KR4301PC2774 2019-12 풋277.5							42
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-42
-5.33%	-23	-23	-23	-23	-24	-24	-24
-2.67%	-7	-7	-8	-9	-9	-10	-11
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	4	3	3	3	3	2	2
5.33%	4	4	4	4	4	4	3
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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

(단위:백만원)

247

공시일	2019-11-26
기준일	2019-11-25

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	351	-351	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	15,071	0	15,071	
누계	통화	선도	0	15,182	-15,182	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019V01 KRW/USD 10-12-19E		373
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		320
FX21019X01 KRW/USD 13-01-20E		230
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		292

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

(단위:백만원)

382

공시일	2019-11-26
기준일	2019-11-25

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	995	0	995	장외
누계	통화	선도	272	272	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)

76

공시일	2019-11-26
기준일	2019-11-25

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

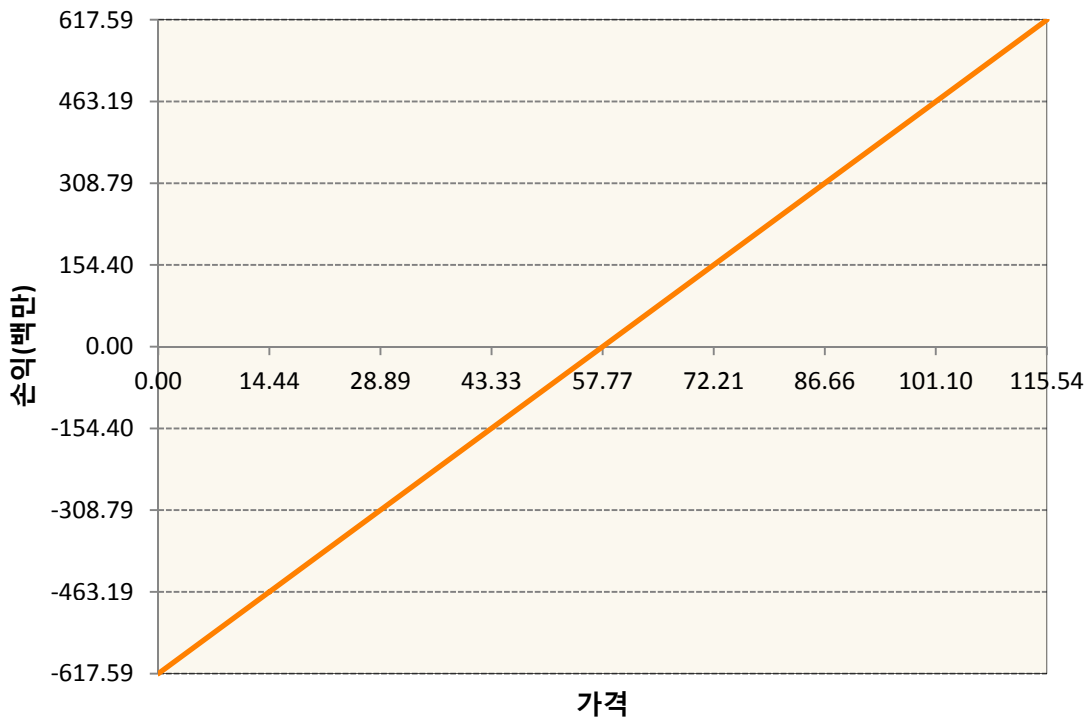
1. 계약금액

(단위:백만원)

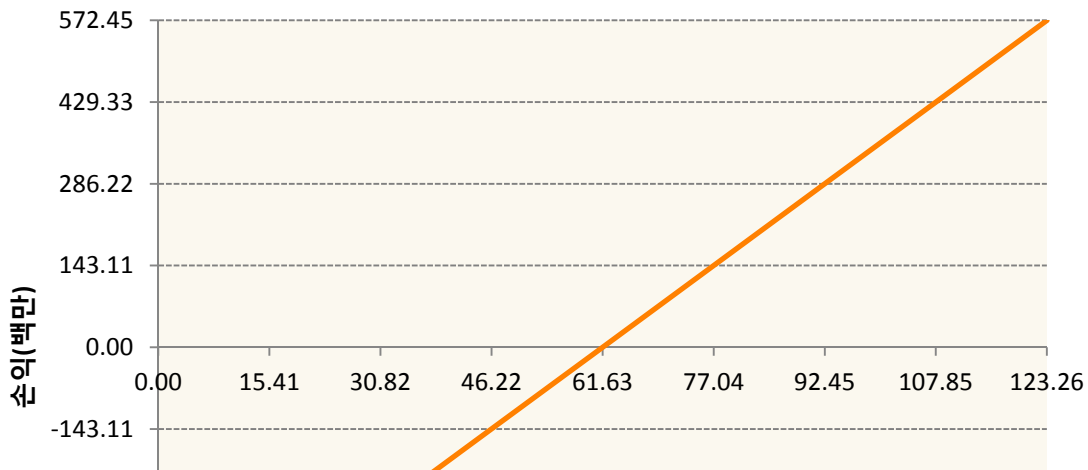
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,516	294	2,222	

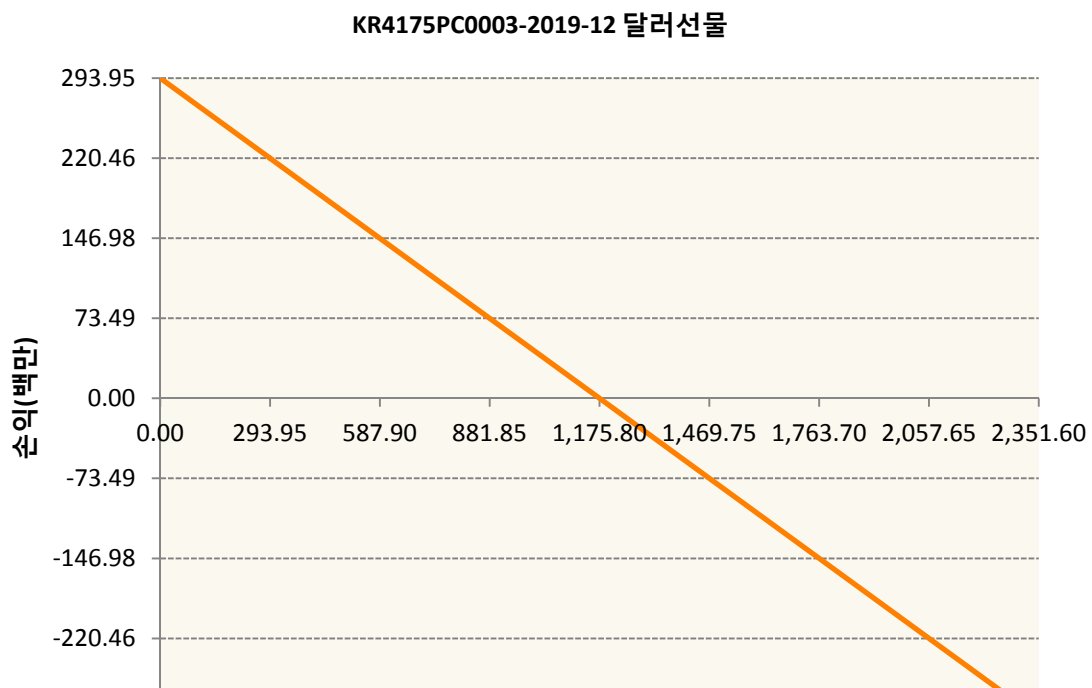
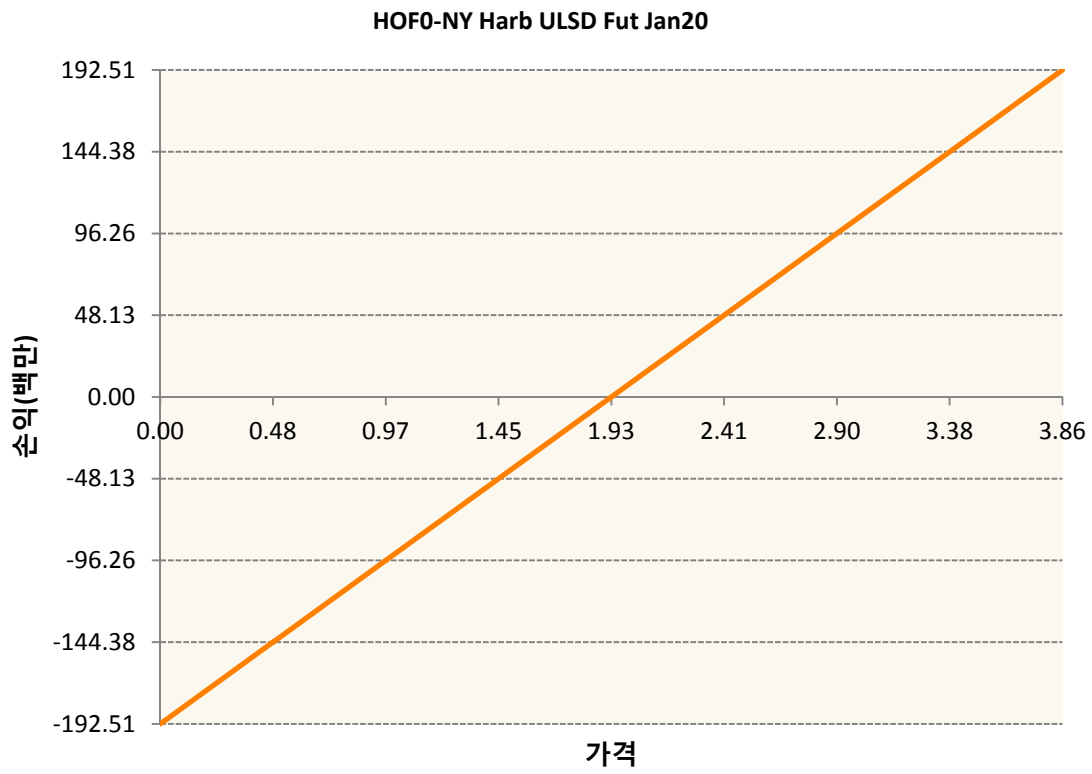
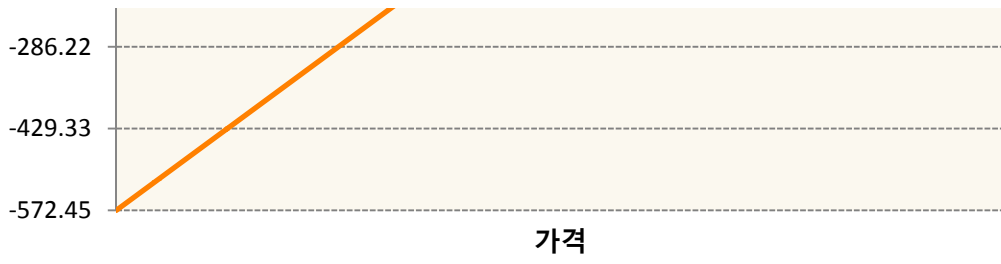
2. 만기시점의 손익구조

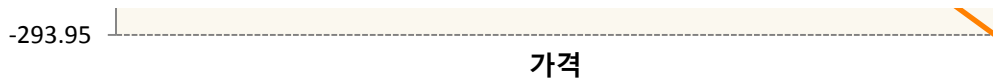
CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20



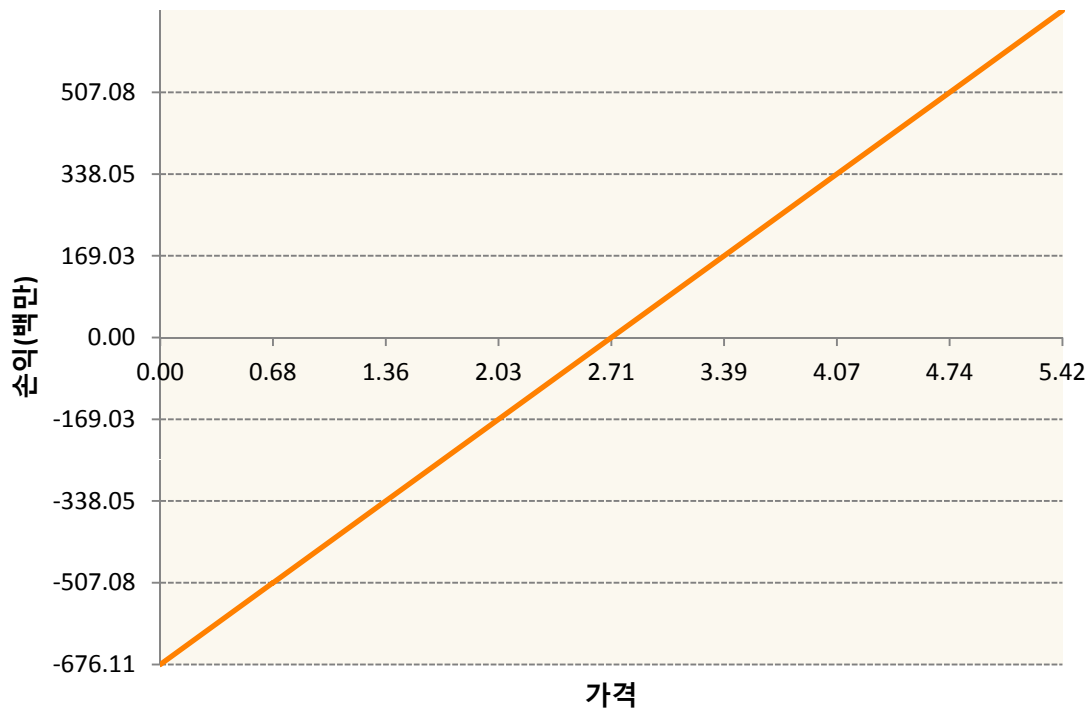
COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20



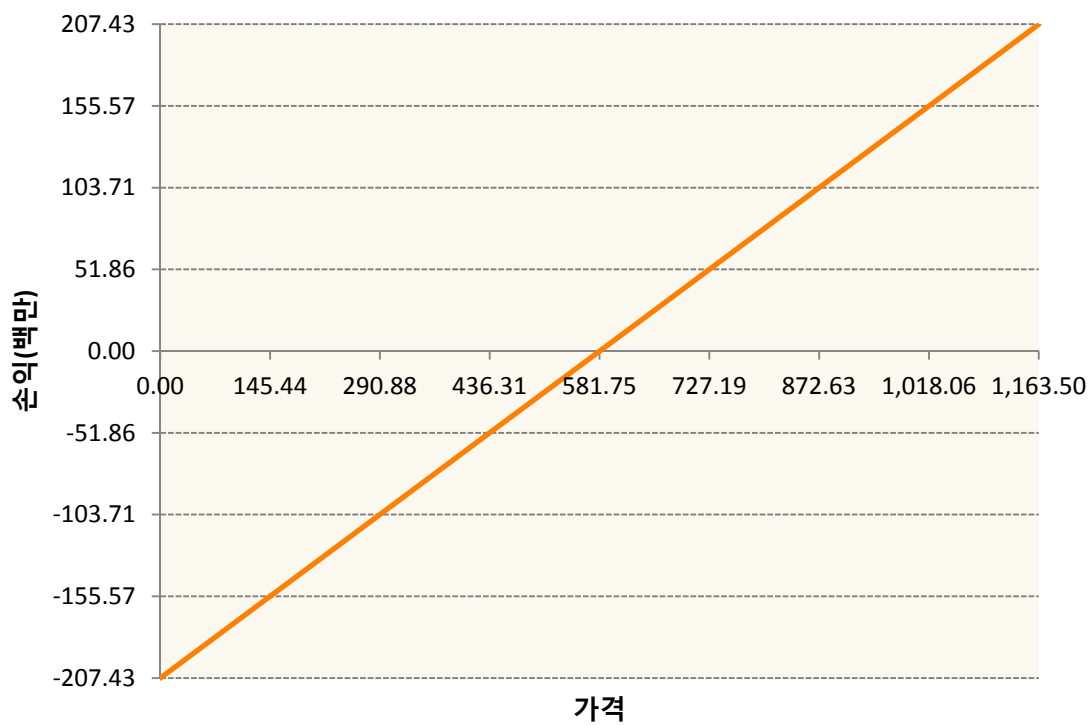




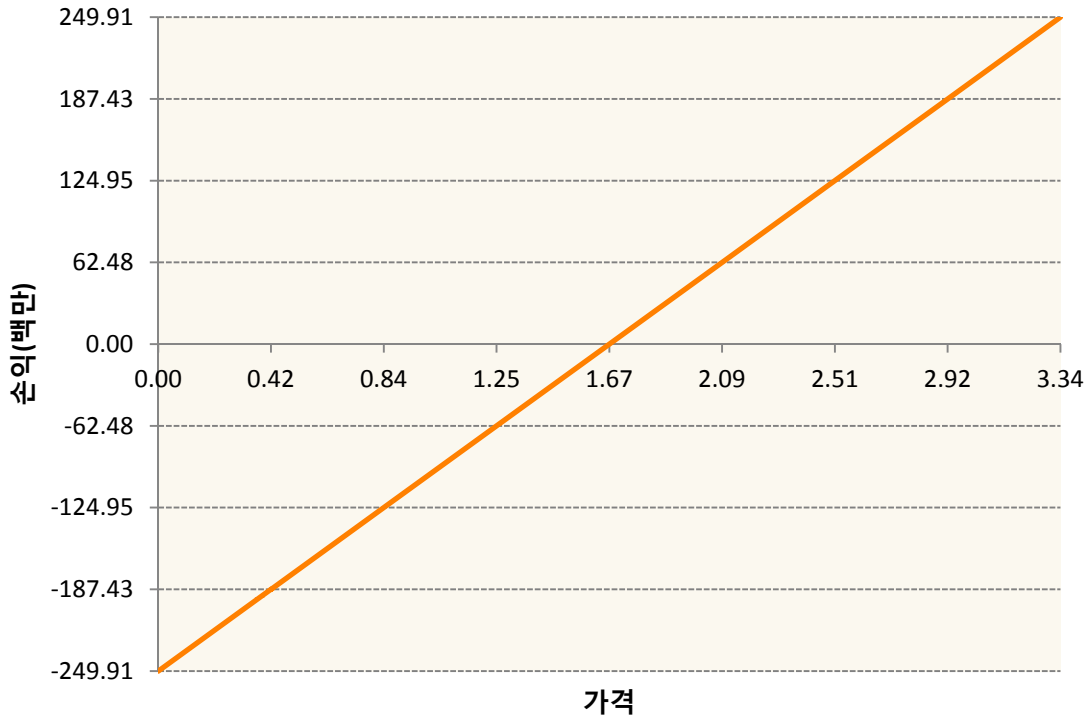
NGF20-NATURAL GAS FUTR Jan20



QSF0-Low Su Gasoil G Jan20



XBF0-GASOLINE RBOB FUT Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF0	WTI CRUDE FUTURE Jan20	49
COH0	BRENT CRUDE FUTR Mar20	46
HOF0	NY Harb ULSD Fut Jan20	15
KR4175PC00	2019-12 달러선물	24
NGF20	NATURAL GAS FUTR Jan20	54
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	17
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	20

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

417

공시일	2019-11-26
기준일	2019-11-25

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

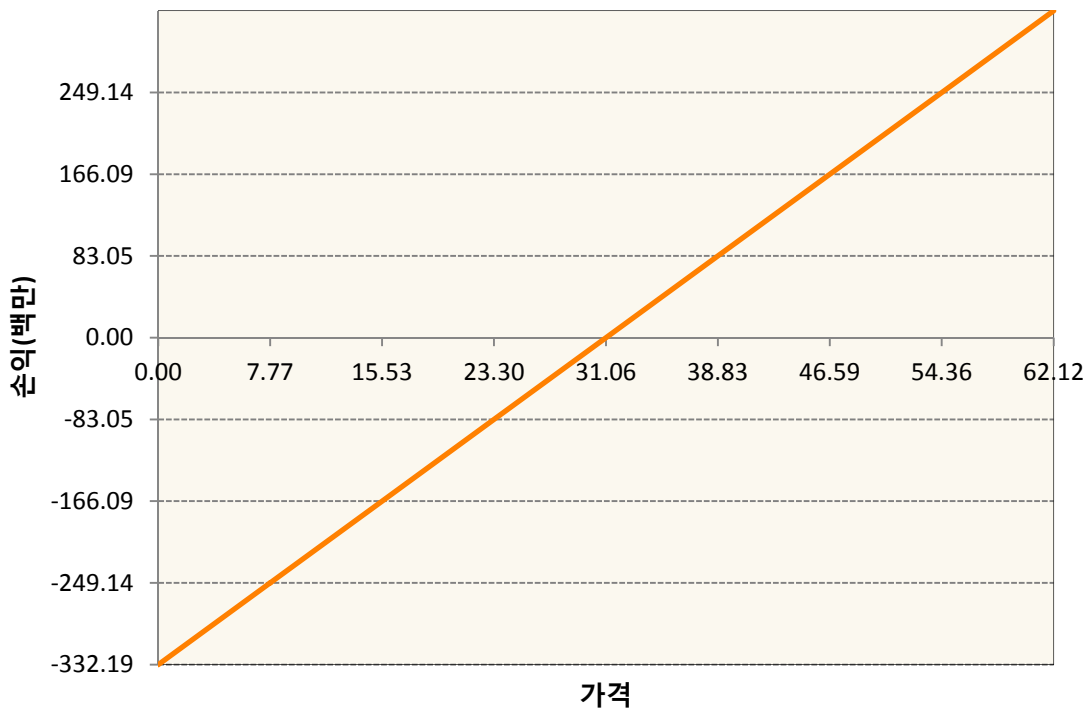
1. 계약금액

(단위:백만원)

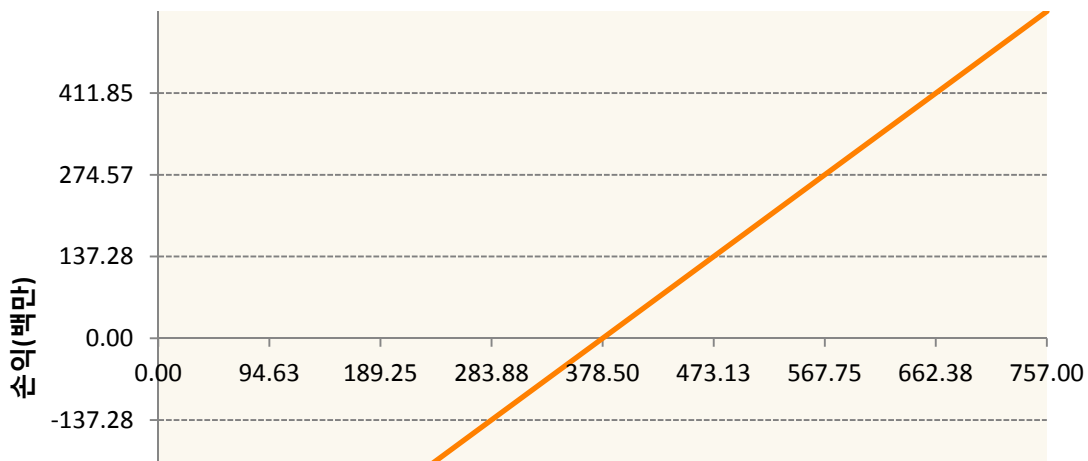
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,811	94	2,717	

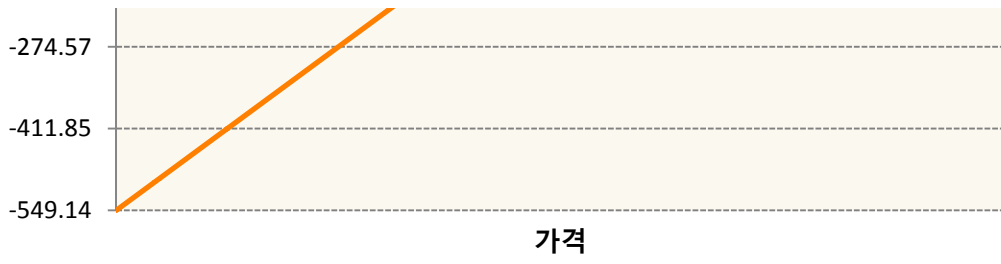
2. 만기시점의 손익구조

BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20

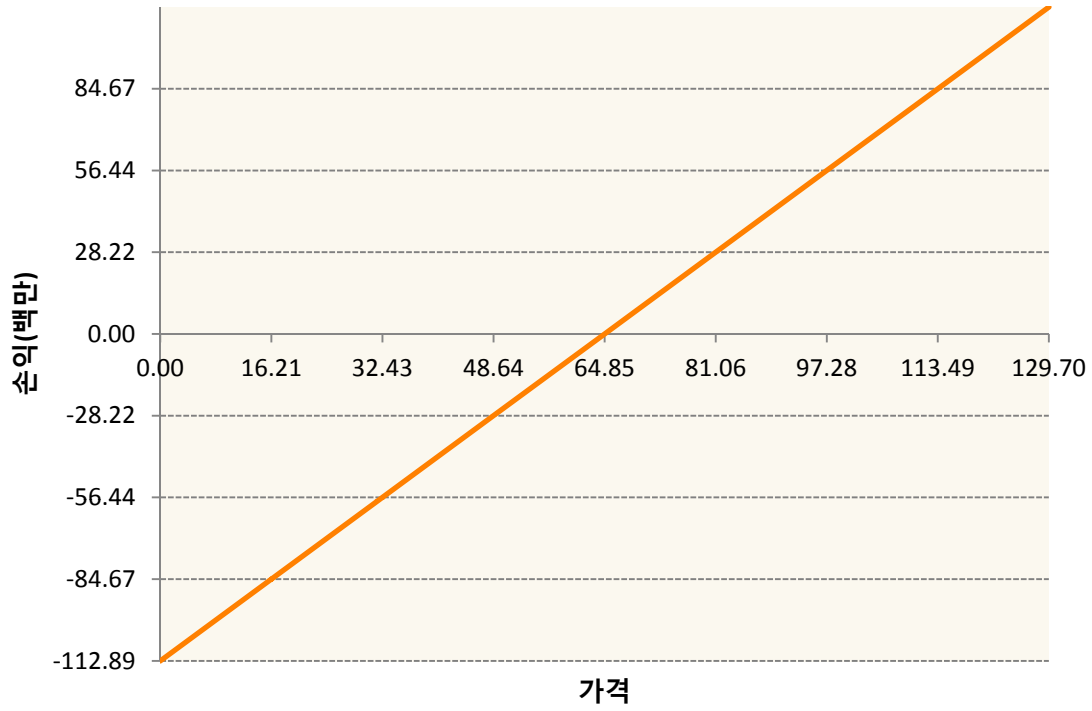


CH0-CORN FUTURE Mar20

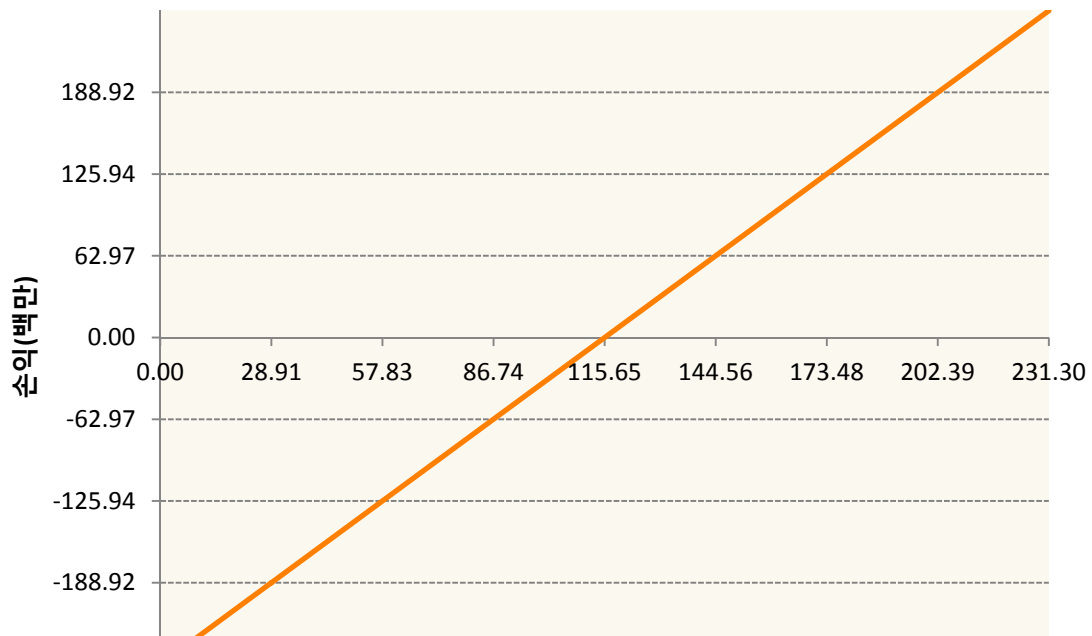


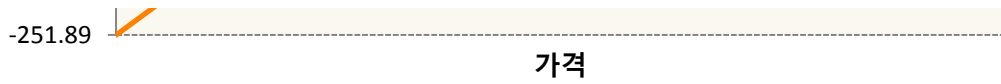


CTH0-COTTON NO.2 FUTR Mar20



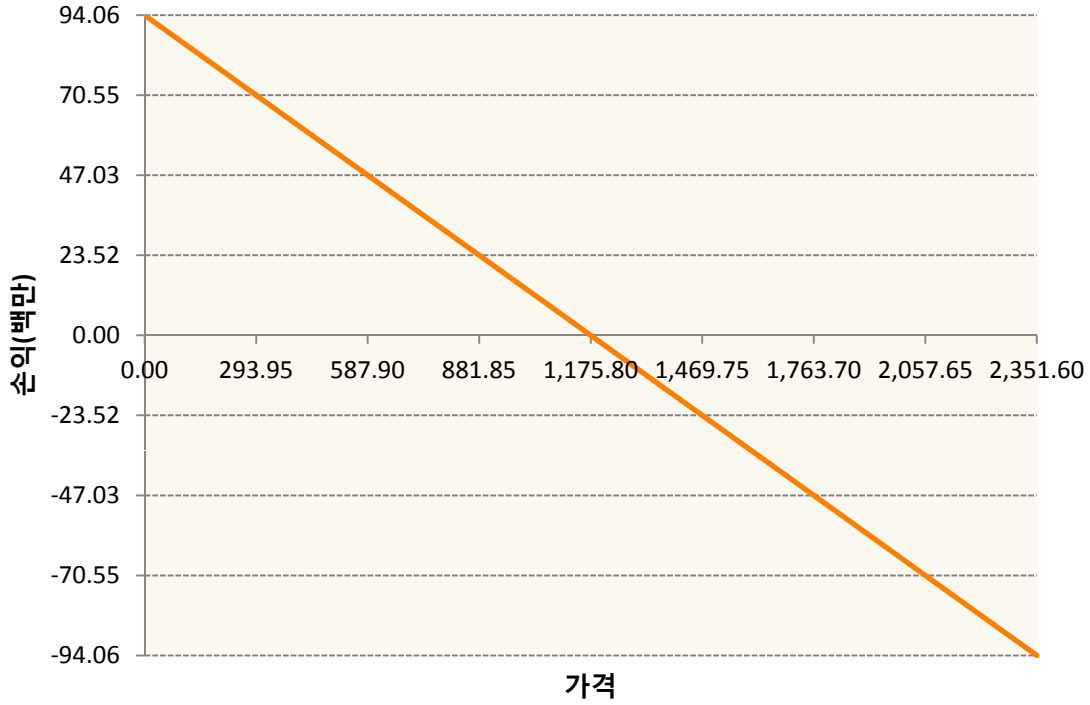
KCH0-COFFEE 'C' FUTURE Mar20





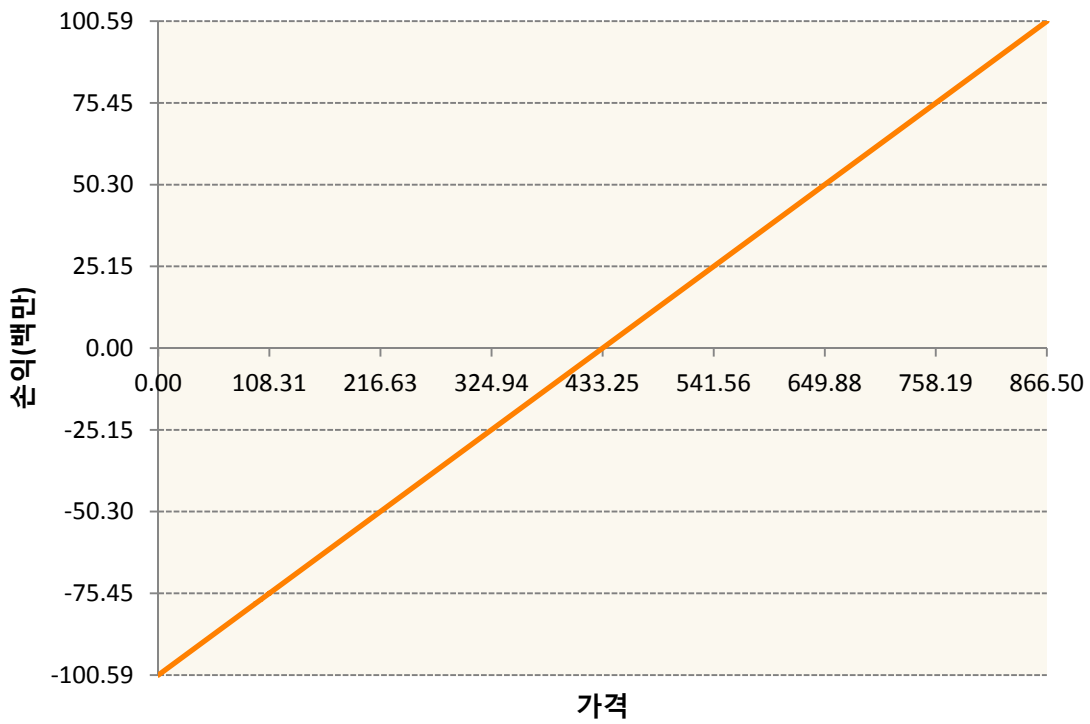
가격

KR4175PC0003-2019-12 달러선물



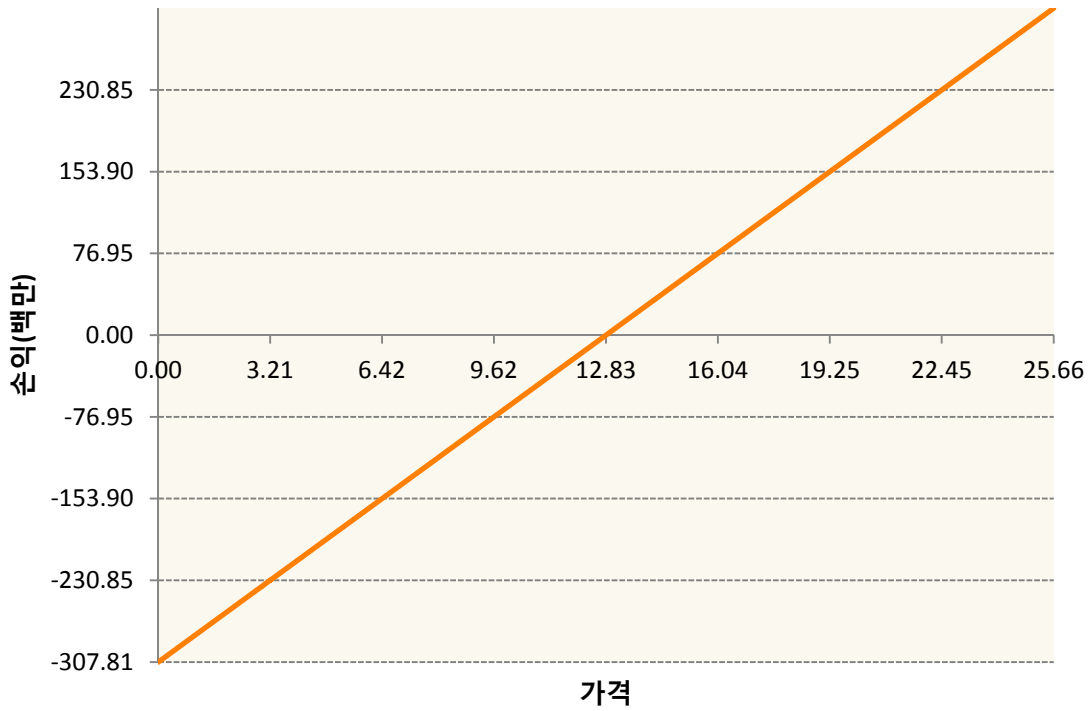
가격

KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20

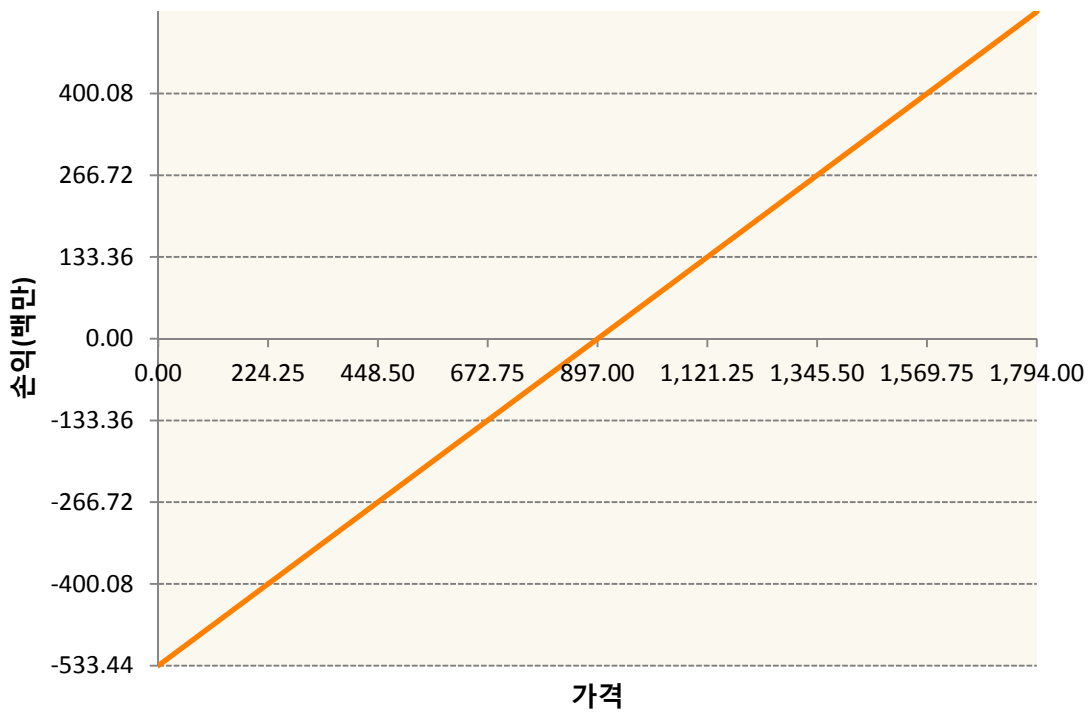


가격

SBH0-Sugar Mar20

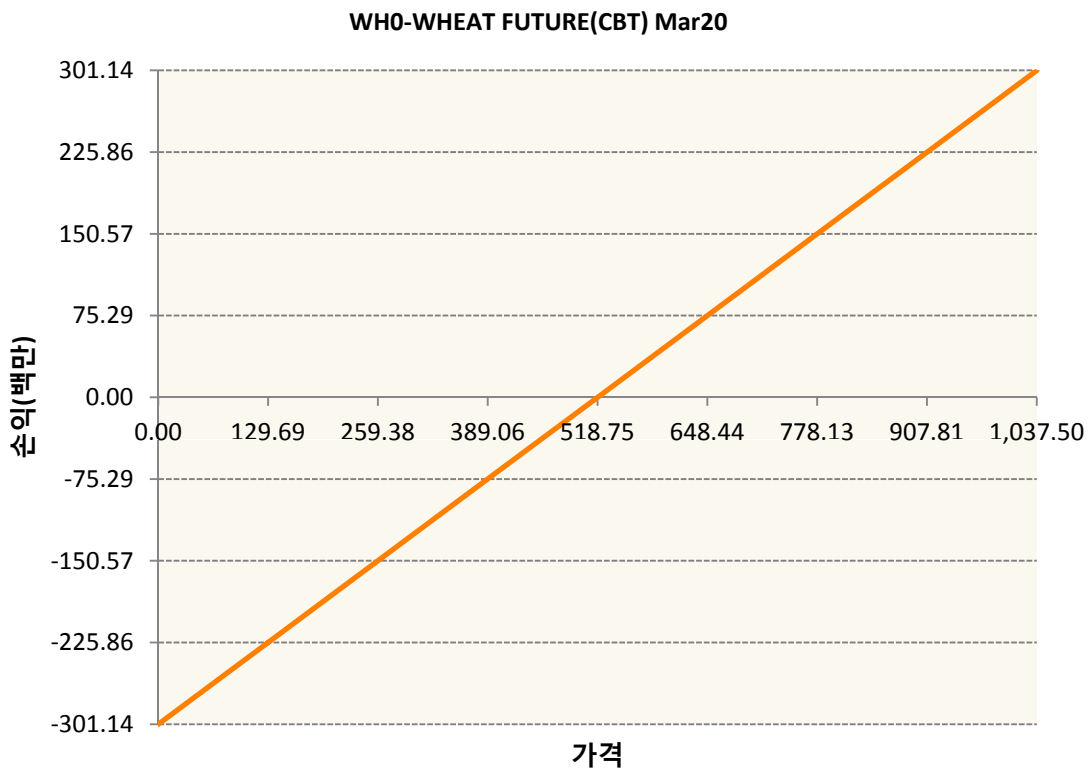
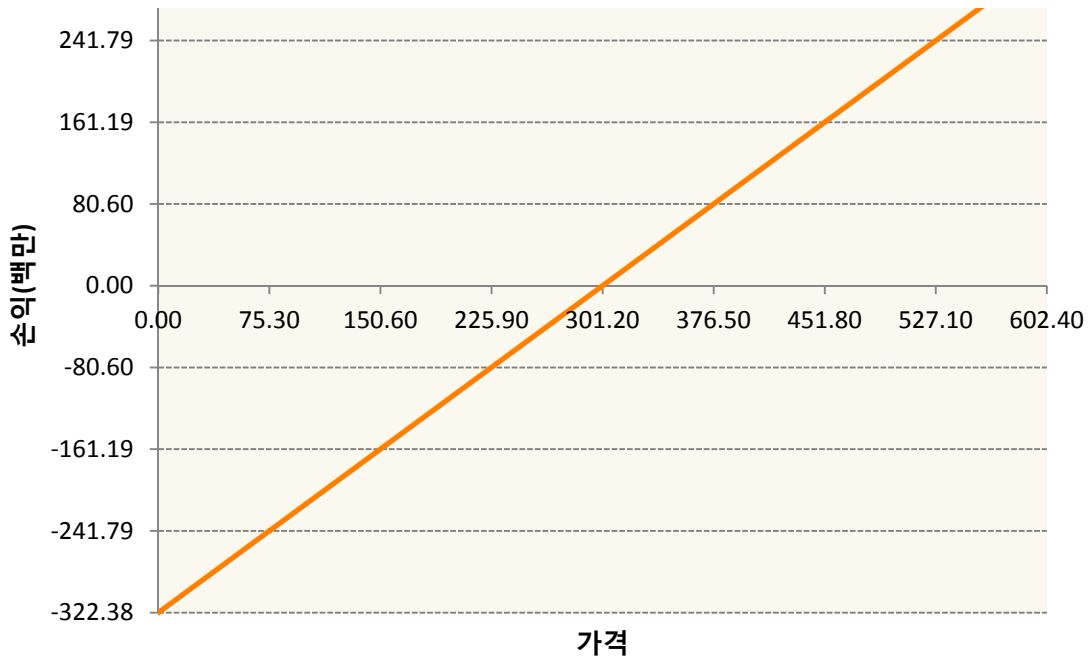


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20



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	20
KR4175PC00	2019-12 달러선물	8

KWH0	KC HRW WHEAT FUT Mar20	8
SBH0	Sugar Mar20	25
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)

247