

공시일	2019-11-27
기준일	2019-11-26

## 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	2019-11-27
기준일	2019-11-26

## 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

1,096

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

631

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-11-27
기준일	2019-11-26

## 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)	377
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	137

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

742
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-11-27
기준일	2019-11-26

## 유로인덱스모(주식-파생형)

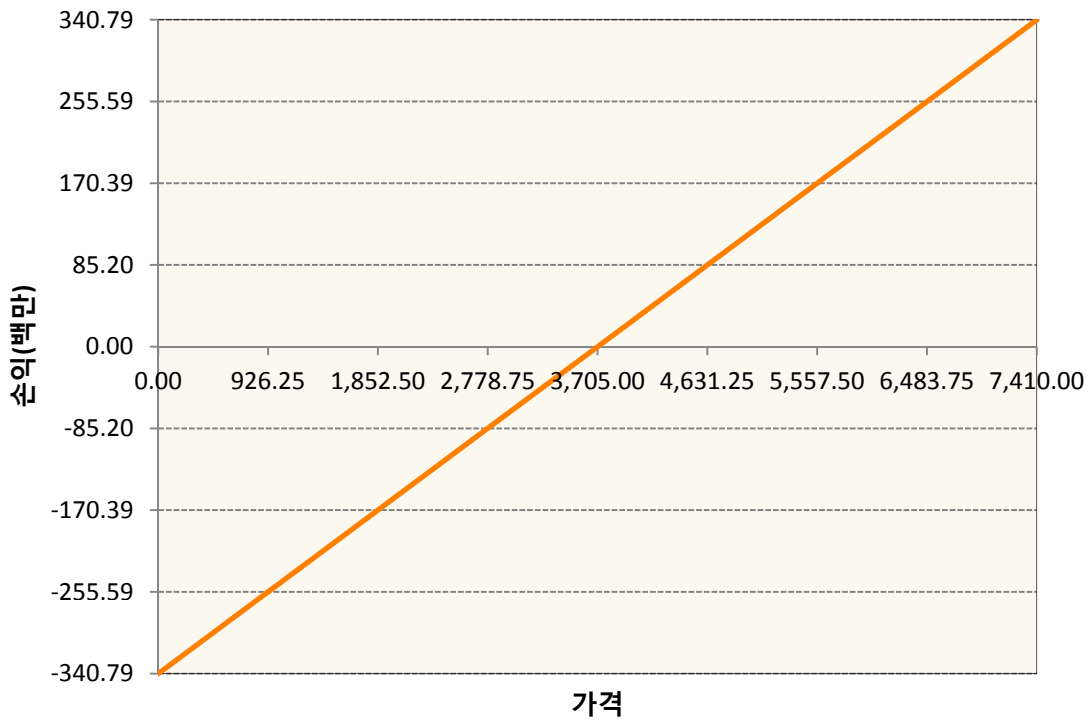
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	341	0	341	

### 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	2019-11-27
기준일	2019-11-26

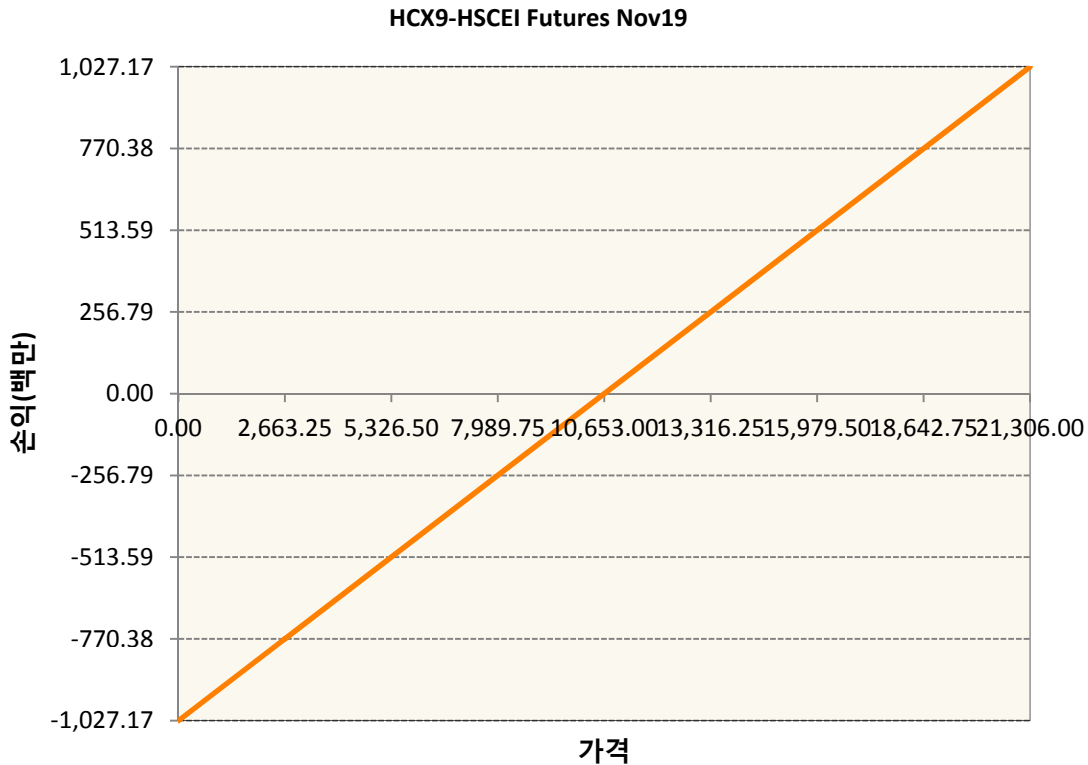
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,027	0	1,027	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	2019-11-27
기준일	2019-11-26

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

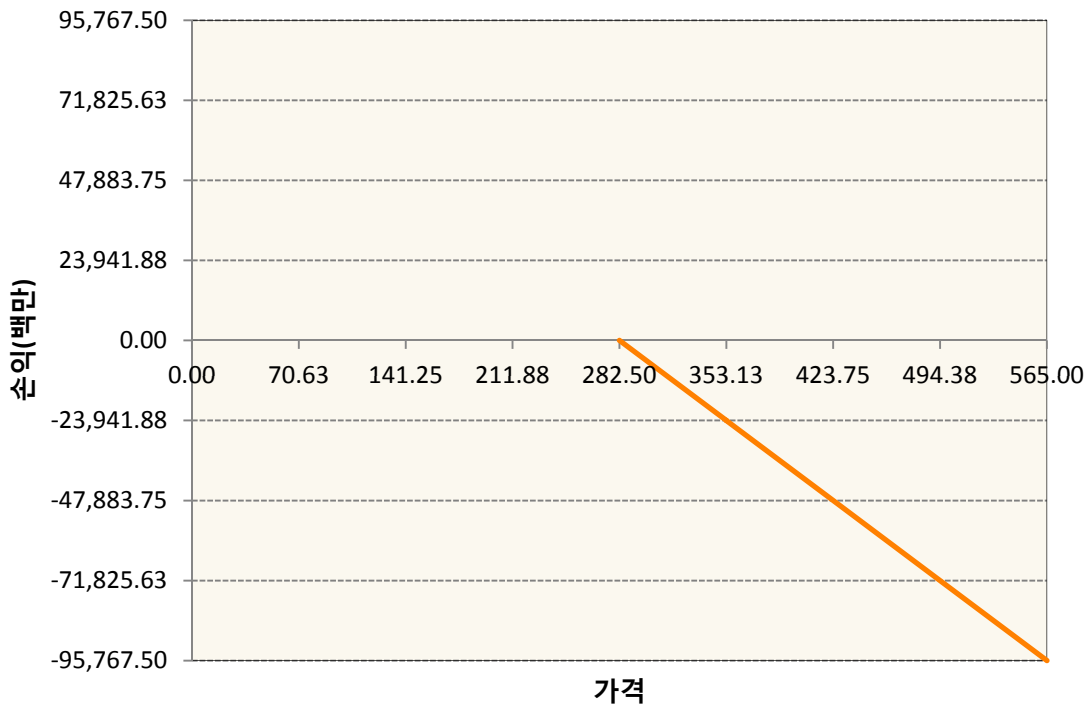
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

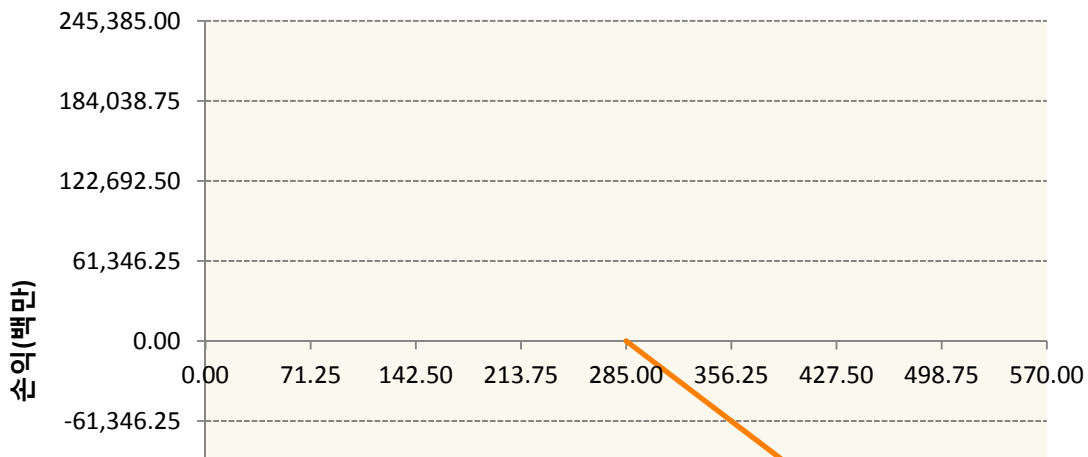
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	498,456	-498,456	장내

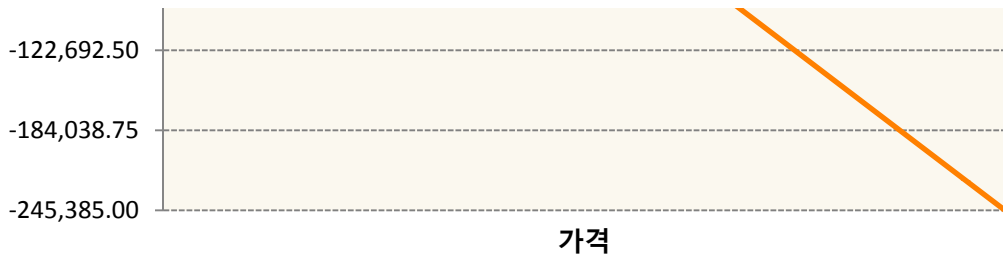
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201PC2825-2019-12 콜282.5**

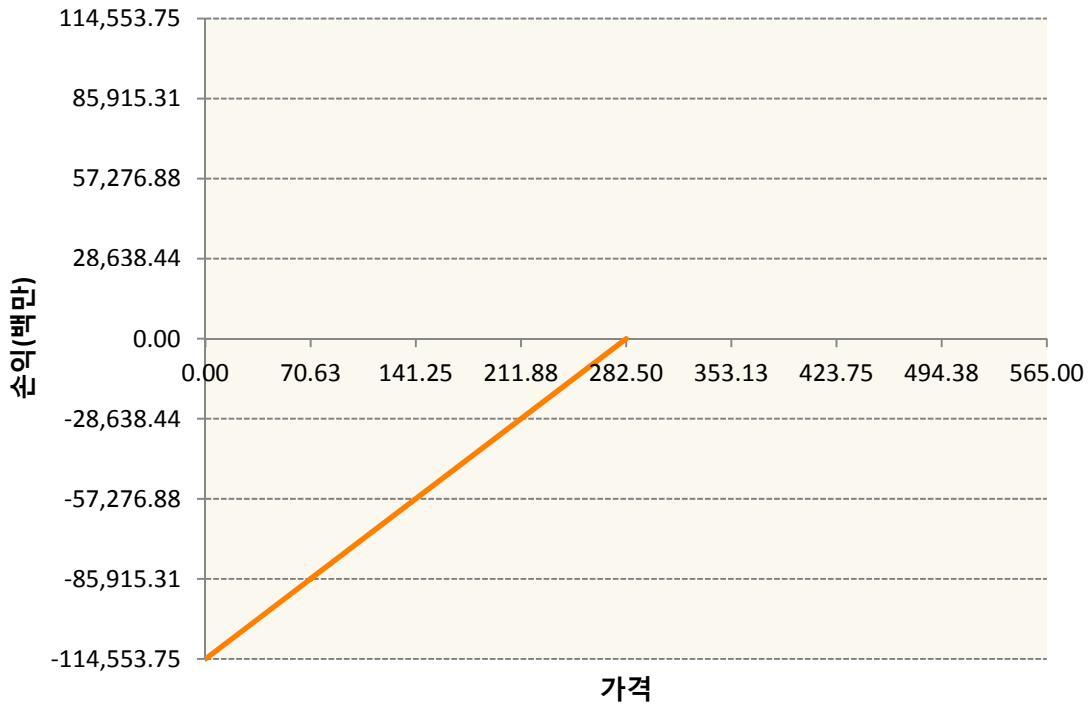


**KR4201PC2858-2019-12 콜285**

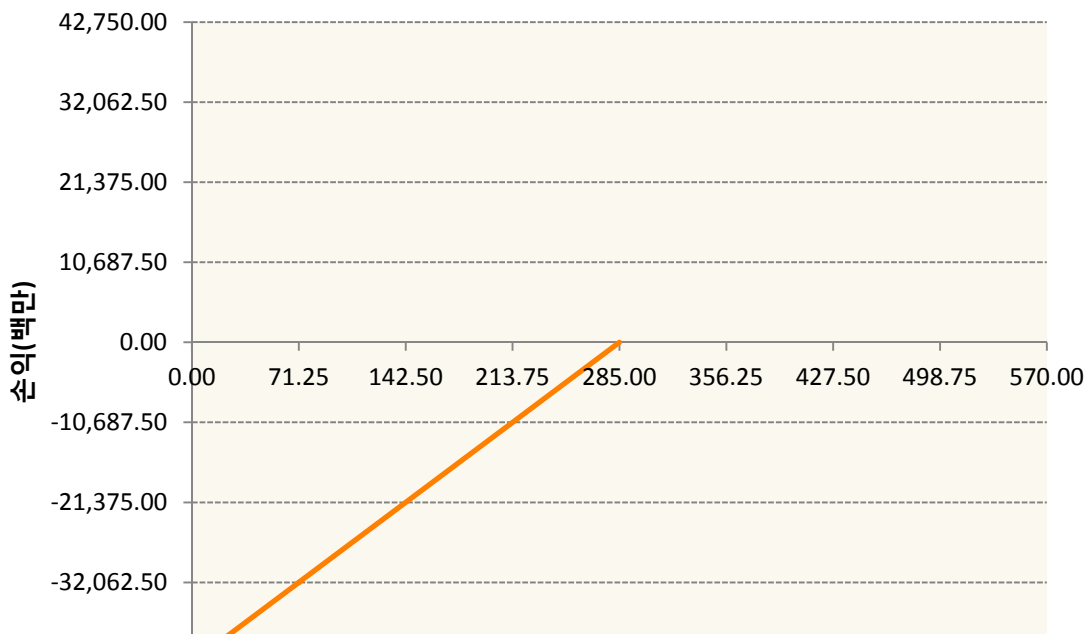




**KR4301PC2824-2019-12 풋282.5**



**KR4301PC2857-2019-12 풋285**



-42,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PC2825		2019-12 콜282.5						5,856
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,069	2,037	1,993	1,938	1,872	1,795	1,710	
-5.33%	1,924	1,840	1,744	1,636	1,520	1,396	1,265	
-2.67%	1,491	1,341	1,186	1,026	863	697	528	
0%	559	372	186	0	-186	-373	-559	
2.67%	-970	-1,136	-1,306	-1,480	-1,655	-1,832	-2,011	
5.33%	-3,003	-3,112	-3,233	-3,364	-3,502	-3,647	-3,798	
8.00%	-5,344	-5,399	-5,467	-5,548	-5,641	-5,744	-5,856	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						14,057
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4,351	4,294	4,211	4,101	3,965	3,803	3,617	
-5.33%	4,107	3,940	3,740	3,509	3,252	2,973	2,675	
-2.67%	3,298	2,966	2,613	2,242	1,858	1,462	1,058	
0%	1,391	929	466	0	-467	-936	-1,405	
2.67%	-1,991	-2,449	-2,912	-3,378	-3,846	-4,316	-4,788	
5.33%	-6,766	-7,101	-7,459	-7,837	-8,229	-8,634	-9,050	
8.00%	-12,496	-12,680	-12,900	-13,151	-13,430	-13,733	-14,057	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						8,000
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-7,990	-7,990	-7,991	-7,991	-7,993	-7,996	-8,000	
-5.33%	-4,948	-4,952	-4,960	-4,971	-4,987	-5,007	-5,033	
-2.67%	-1,990	-2,034	-2,086	-2,144	-2,209	-2,277	-2,351	
0%	322	215	107	0	-108	-215	-323	
2.67%	1,294	1,230	1,160	1,085	1,005	922	835	
5.33%	1,453	1,443	1,427	1,405	1,377	1,343	1,304	
8.00%	1,462	1,461	1,460	1,457	1,452	1,444	1,434	
KR4301PC2857		2019-12 풋285						3,105
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,104	-3,104	-3,104	-3,104	-3,104	-3,105	-3,105	
-5.33%	-1,978	-1,978	-1,979	-1,981	-1,985	-1,989	-1,995	
-2.67%	-864	-873	-885	-899	-916	-935	-956	
0%	108	73	37	0	-37	-75	-113	
2.67%	634	601	567	532	496	460	423	

5.33%	757	749	738	724	708	689	669
8.00%	767	767	765	763	759	754	747

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

(단위:백만원)

**32,618**

공시일	2019-11-27
기준일	2019-11-26

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

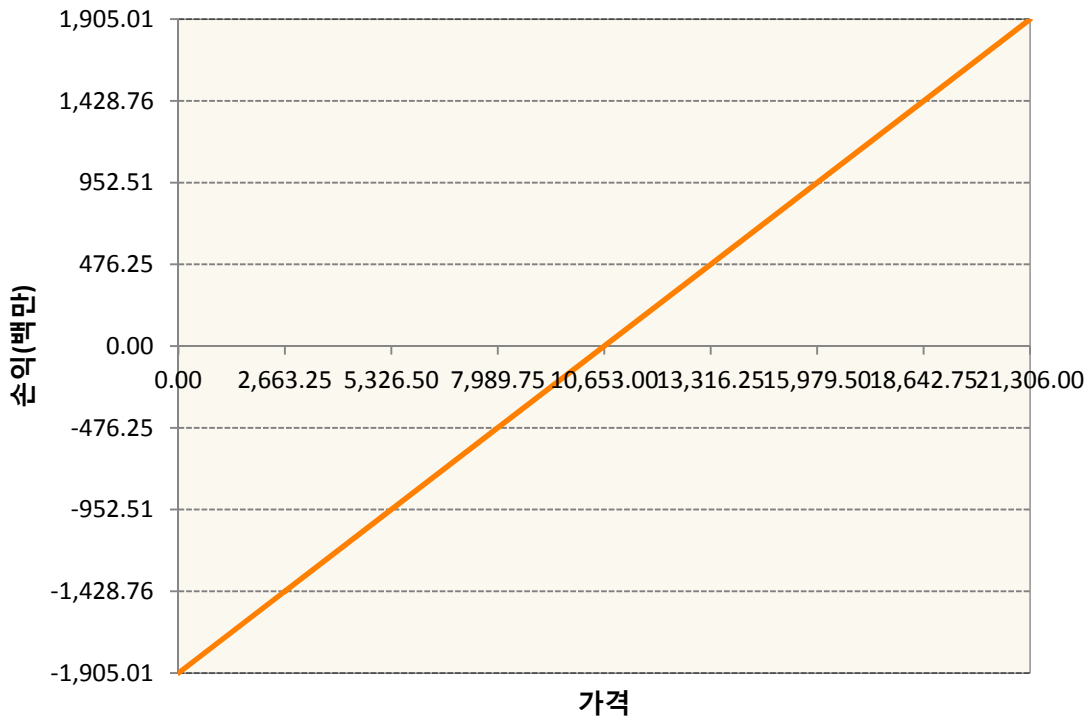
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

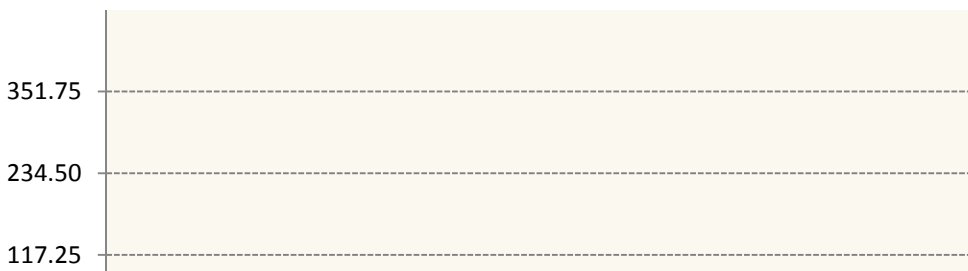
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,905	0	1,905	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,964	-4,964	장내
누계	통화	선도	0	2,117	-2,117	장외

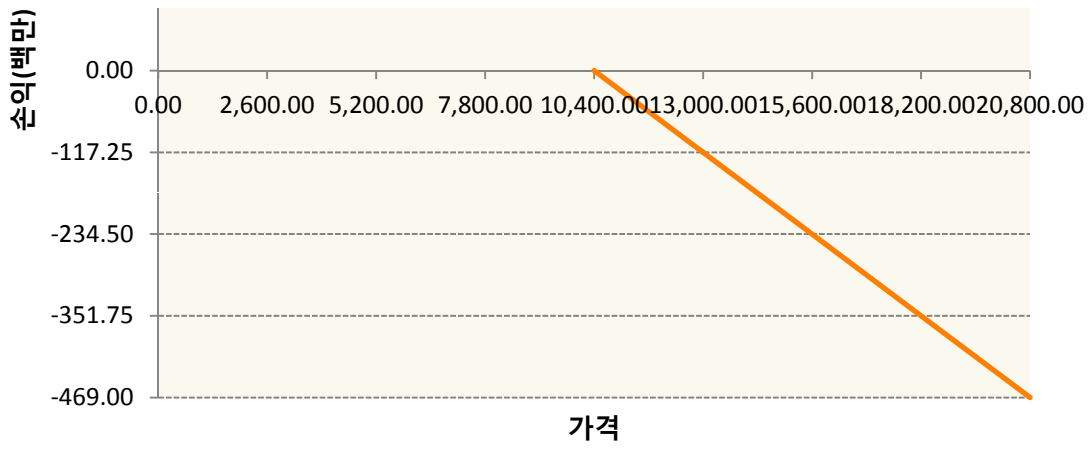
### 2. 만기시점의 손익구조

HCX9-HSCEI Futures Nov19

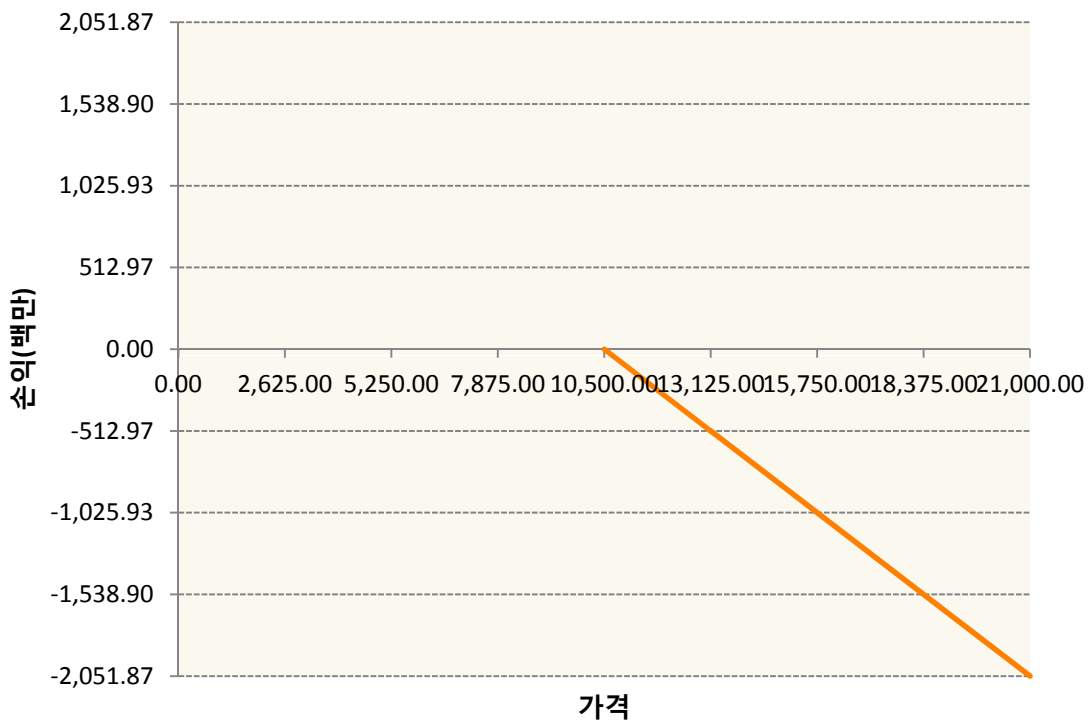


OHHIX9-C104-HSCEI

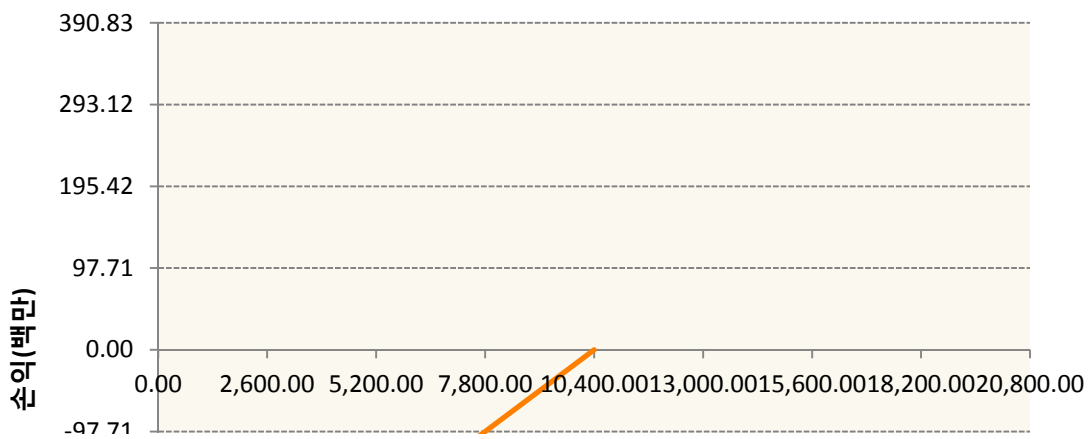


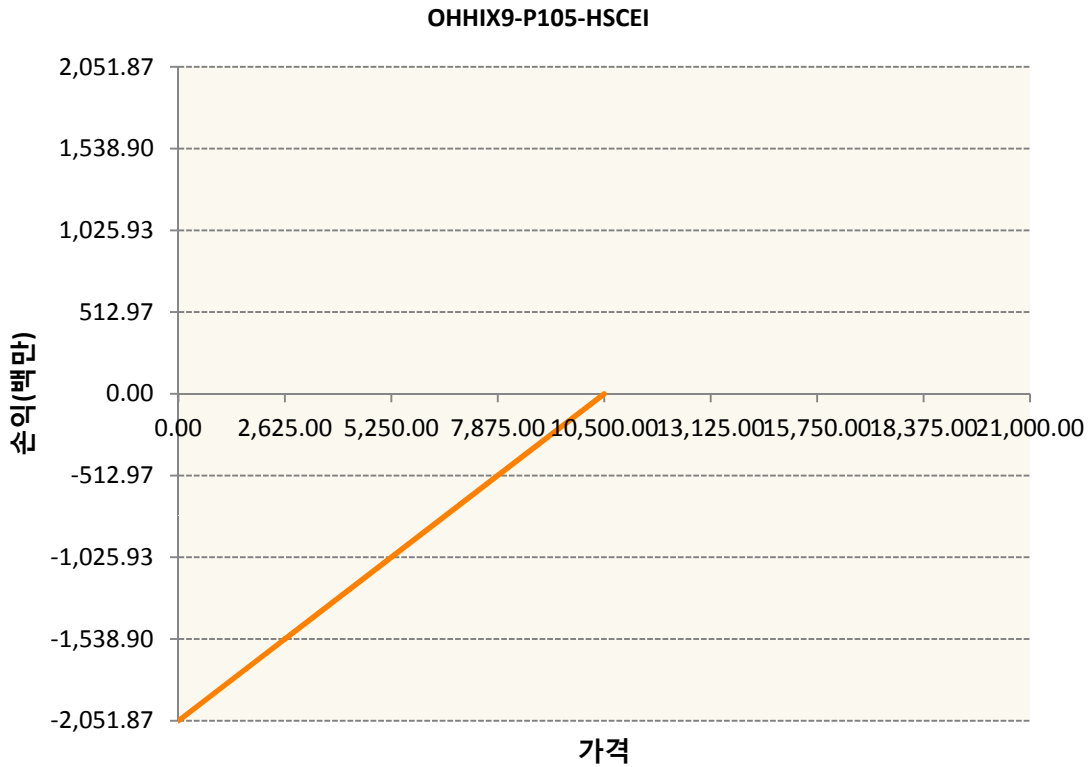
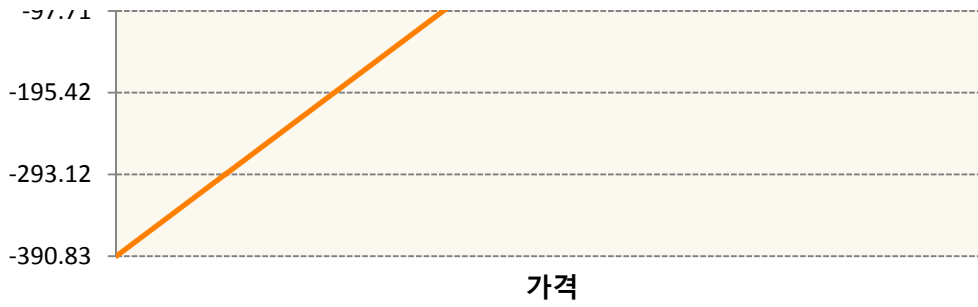


**OHHIX9-C105-HSCEI**



**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)

542

공시일	2019-11-27
기준일	2019-11-26

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

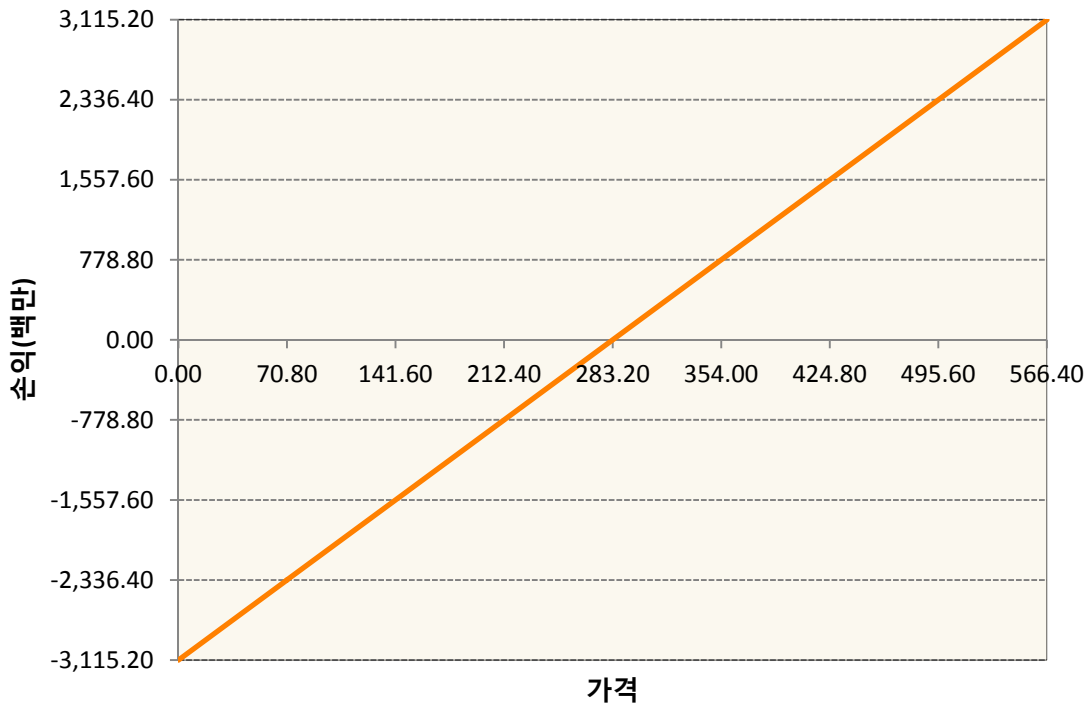
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

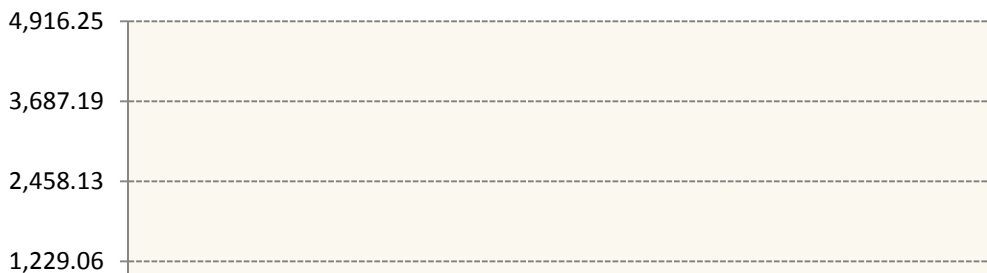
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,115	0	3,115	장내
누계	유가증권	스왑	9,625	0	9,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,657	-9,657	장내

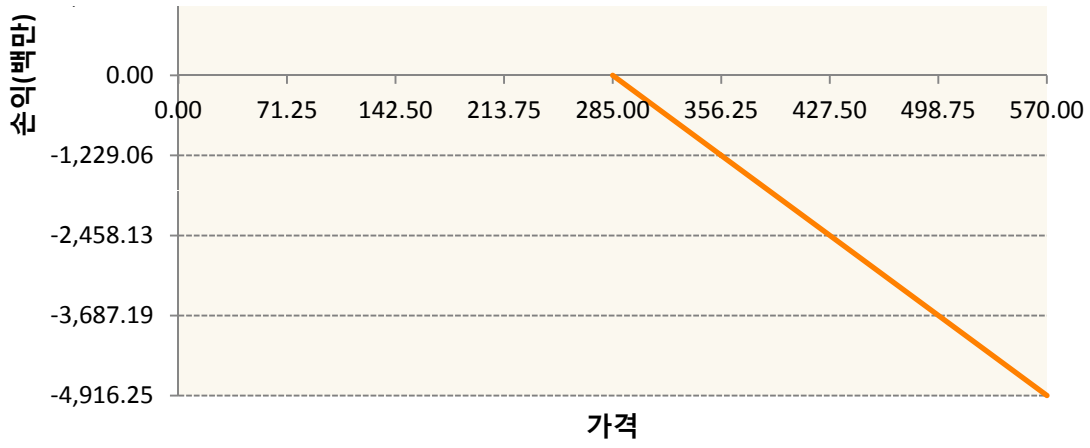
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

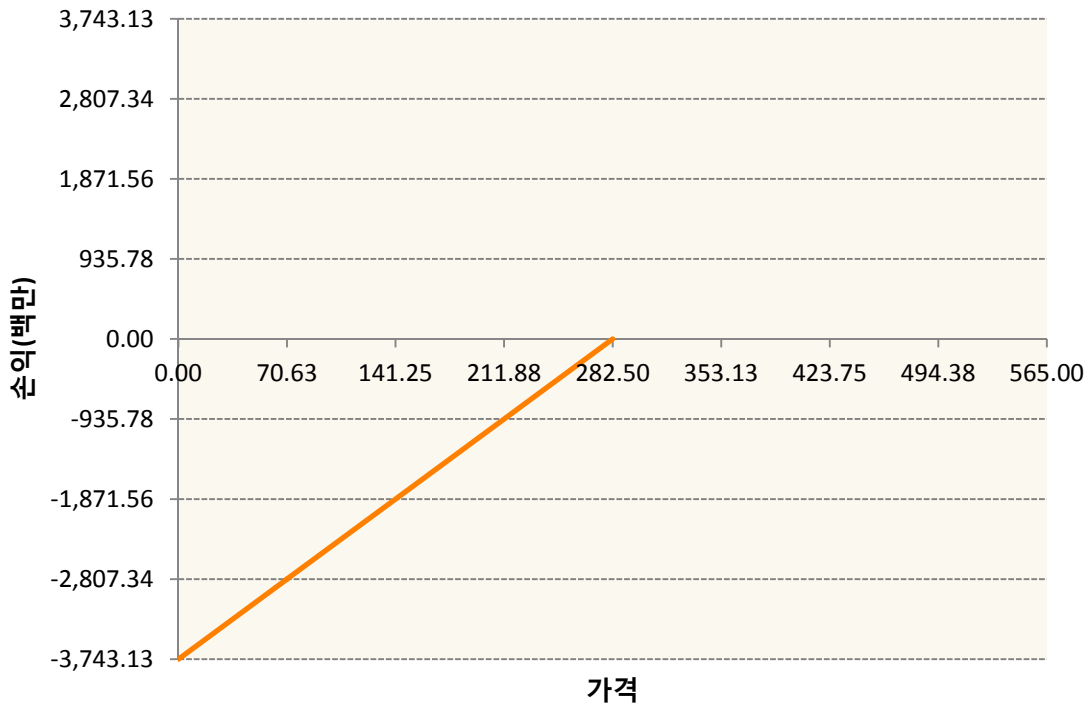


KR4201PC2858-2019-12 콜285

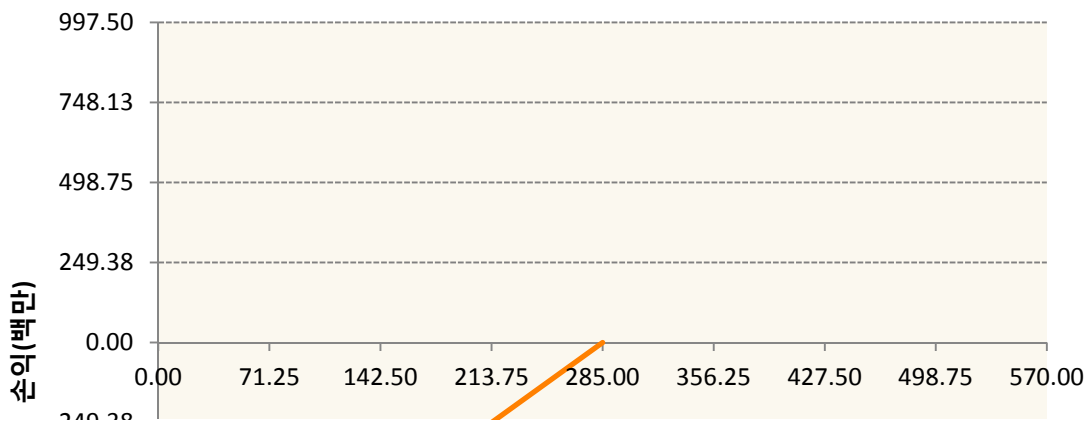




KR4301PC2824-2019-12 풋282.5



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%	-165	-165	-165	-165	-165	-165	-165	
-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%	165	165	165	165	165	165	165	
8.00%	248	248	248	248	248	248	248	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						282
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	87	86	84	82	79	76	72	
-5.33%	82	79	75	70	65	60	54	
-2.67%	66	59	52	45	37	29	21	
0%	28	19	9	0	-9	-19	-28	
2.67%	-40	-49	-58	-68	-77	-86	-96	
5.33%	-136	-142	-149	-157	-165	-173	-181	
8.00%	-250	-254	-258	-263	-269	-275	-282	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						261
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-261	-261	-261	-261	-261	-261	-261
-5.33%	-162	-162	-162	-162	-163	-164	-164
-2.67%	-65	-66	-68	-70	-72	-74	-77
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	42	40	38	35	33	30	27
5.33%	47	47	47	46	45	44	43
8.00%	48	48	48	48	47	47	47
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%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-47
-2.67%	-20	-20	-21	-21	-21	-22	-22
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	15	14	13	12	12	11	10
5.33%	18	17	17	17	17	16	16
8.00%	18	18	18	18	18	18	17

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

(단위:백만원)

**1,697**

공시일	2019-11-27
기준일	2019-11-26

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

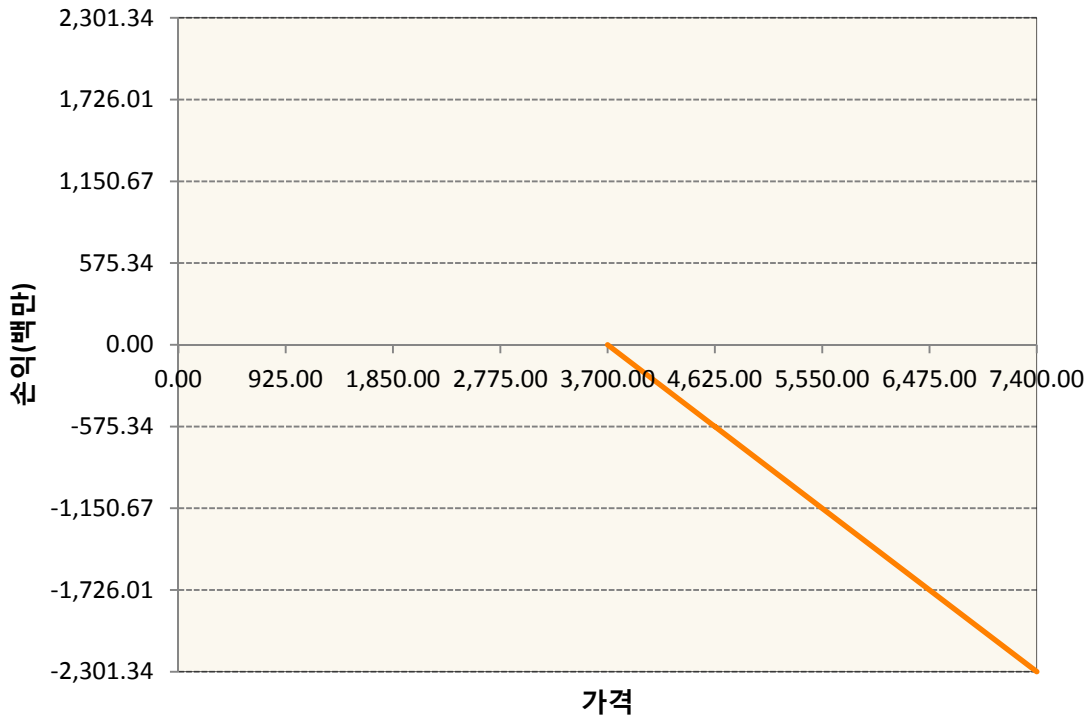
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

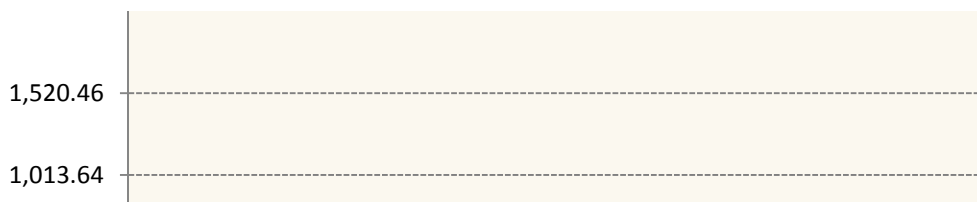
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,296	0	1,296	
누계	유가증권	스왑	17,719	0	17,719	장외
누계	유가증권	옵션	0	8,657	-8,657	장내
누계	통화	선도	2,690	6,090	-3,400	장외

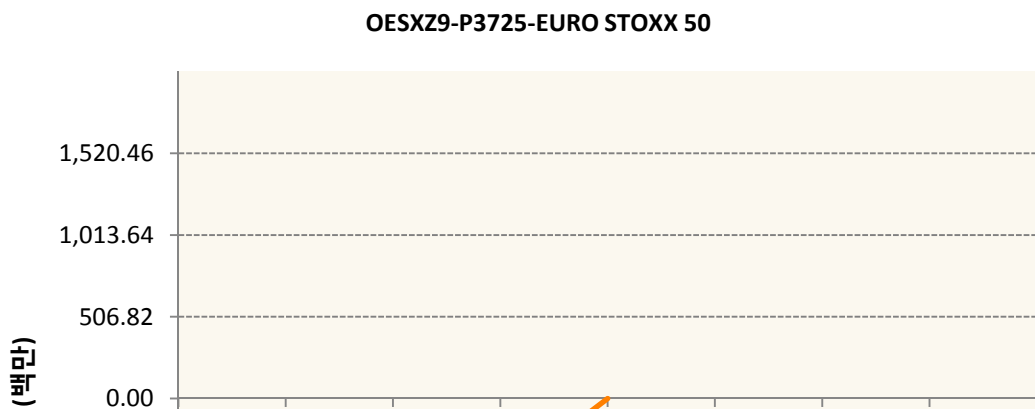
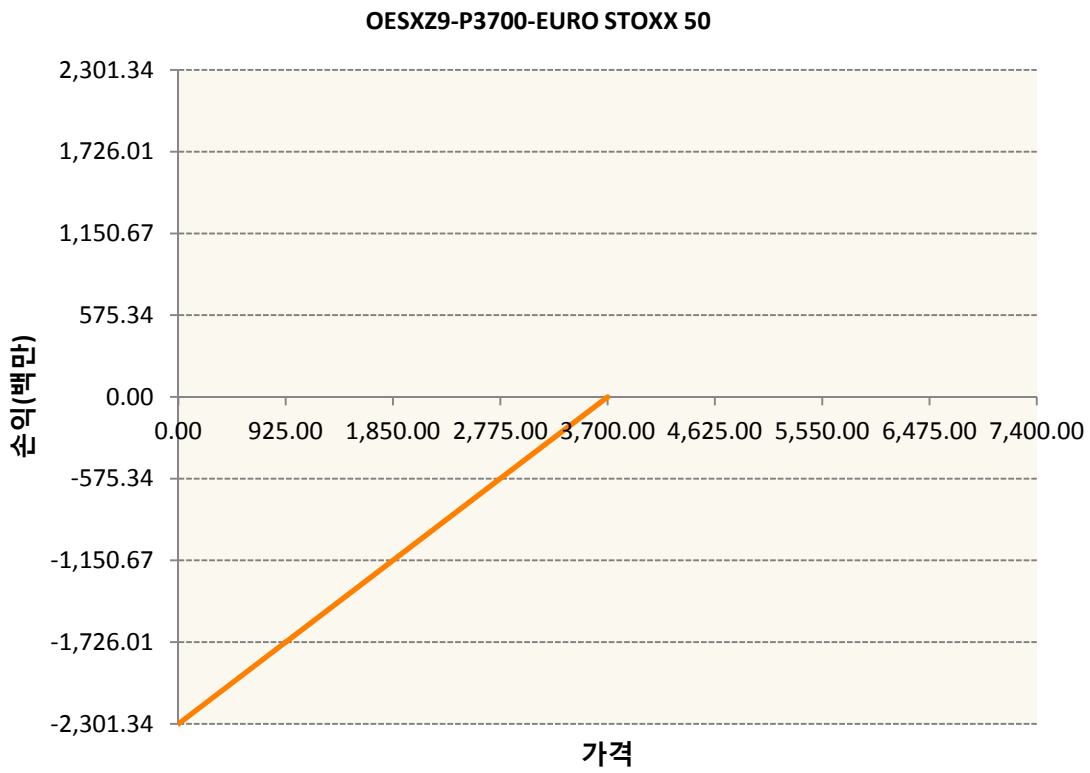
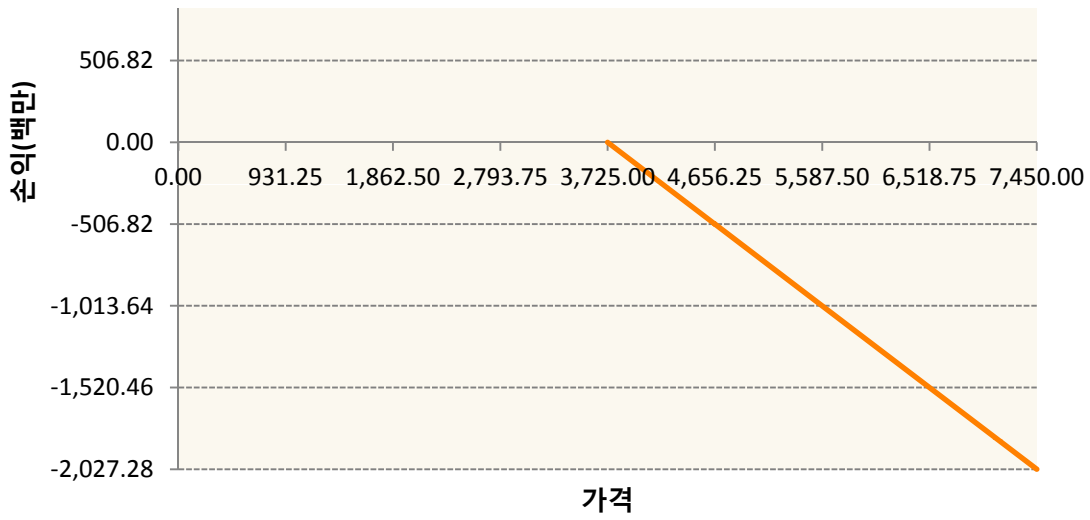
### 2. 만기시점의 손익구조

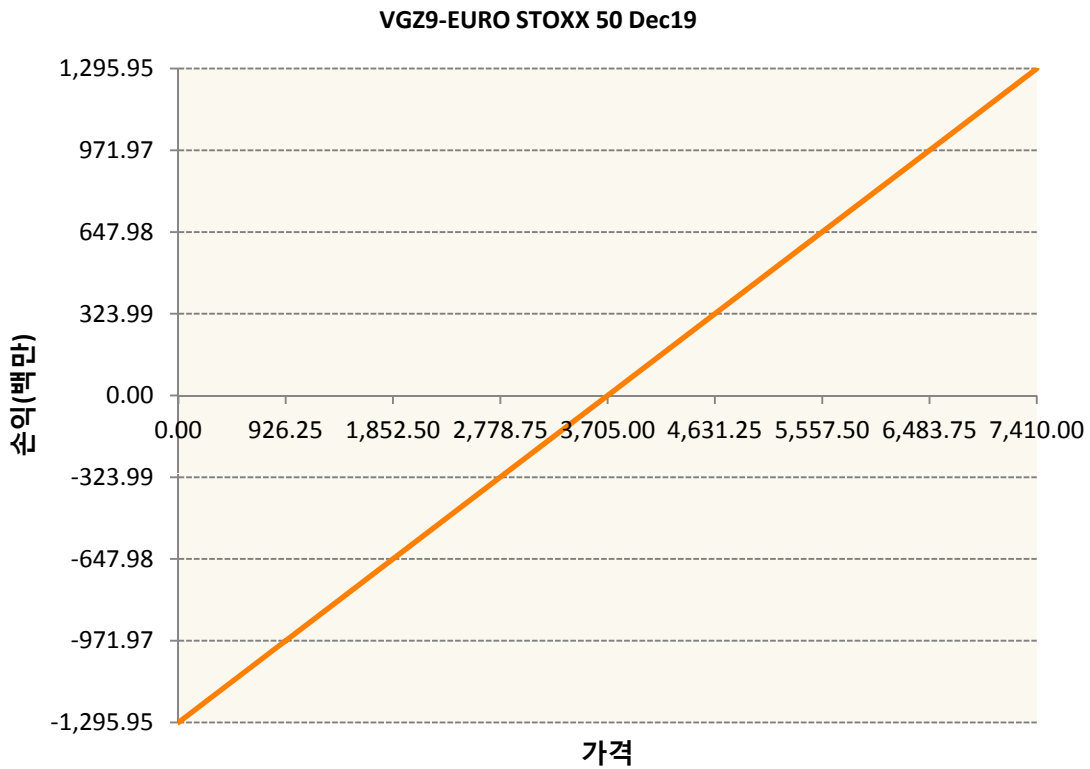
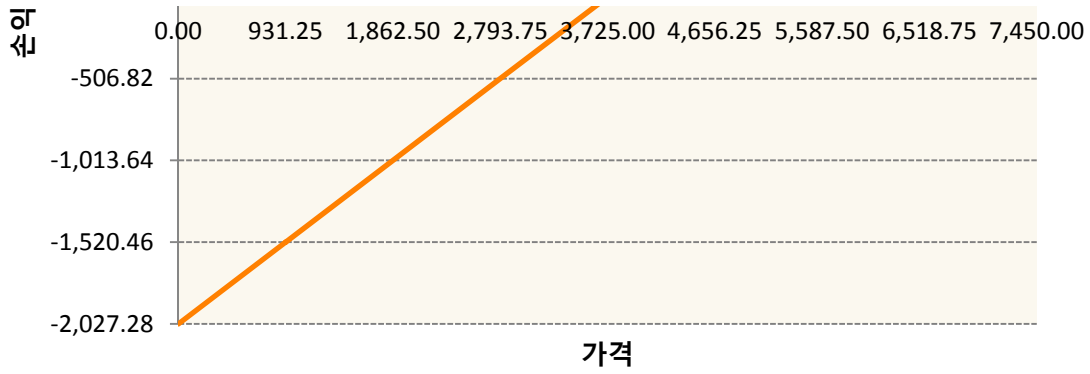
**OESXZ9-C3700-EURO STOXX 50**



**OESXZ9-C3725-EURO STOXX 50**







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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	23
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	162
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	184
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	162
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19	104

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

(단위:백만원)

881



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

(단위:백만원)

919



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

(단위:백만원)

80



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

(단위:백만원)

125

공시일	2019-11-27
기준일	2019-11-26

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

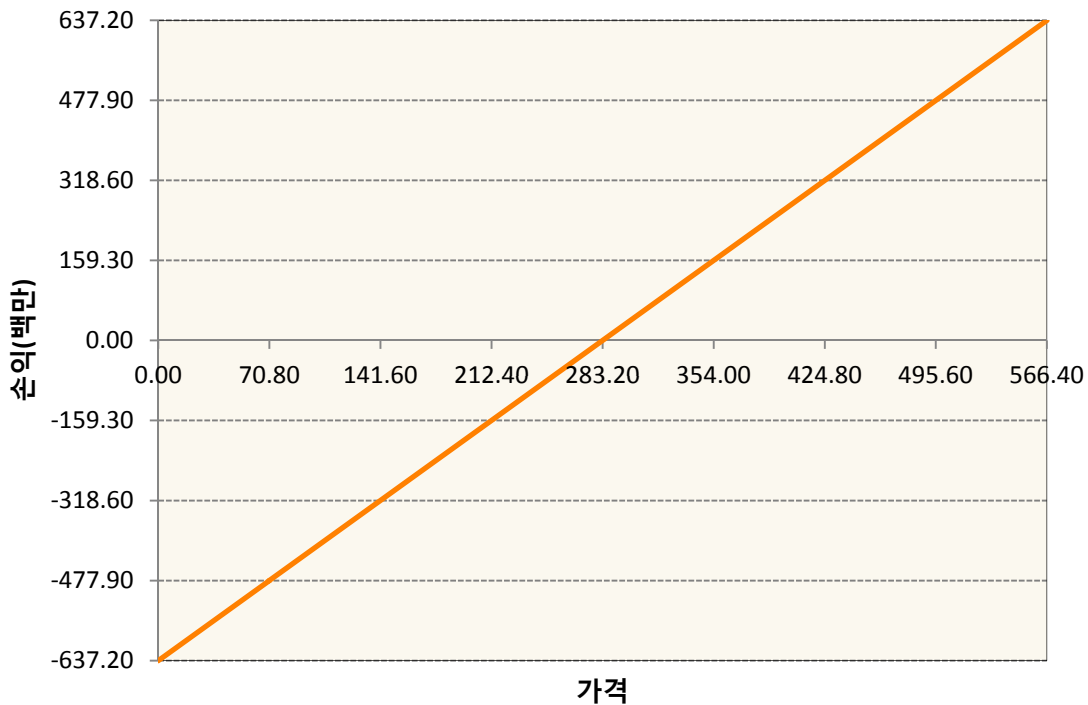
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	637	0	637	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	2019-11-27
기준일	2019-11-26

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

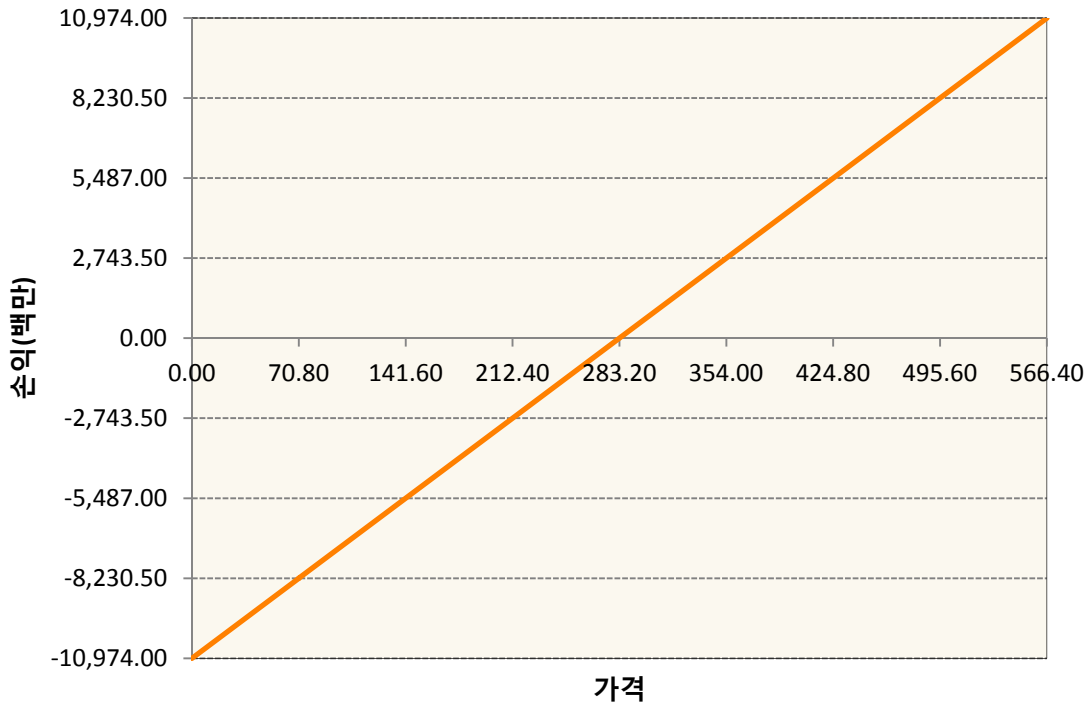
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

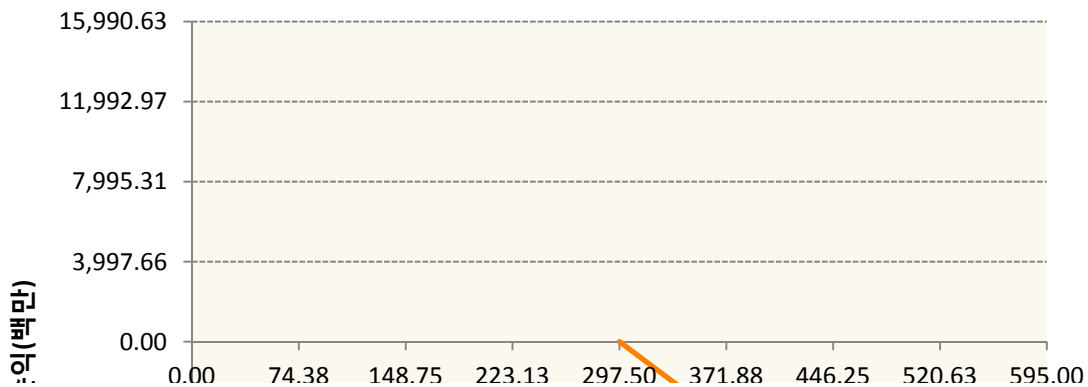
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,974	0	10,974	장내
누계	유가증권	옵션	1,277	21,241	-19,964	장내

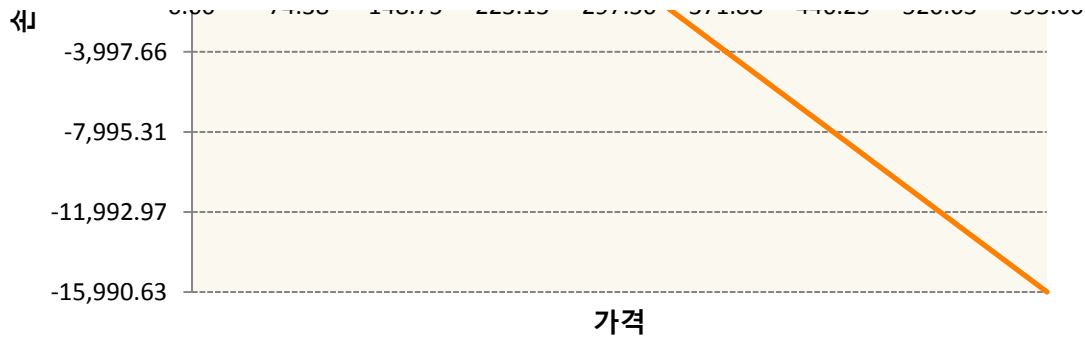
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

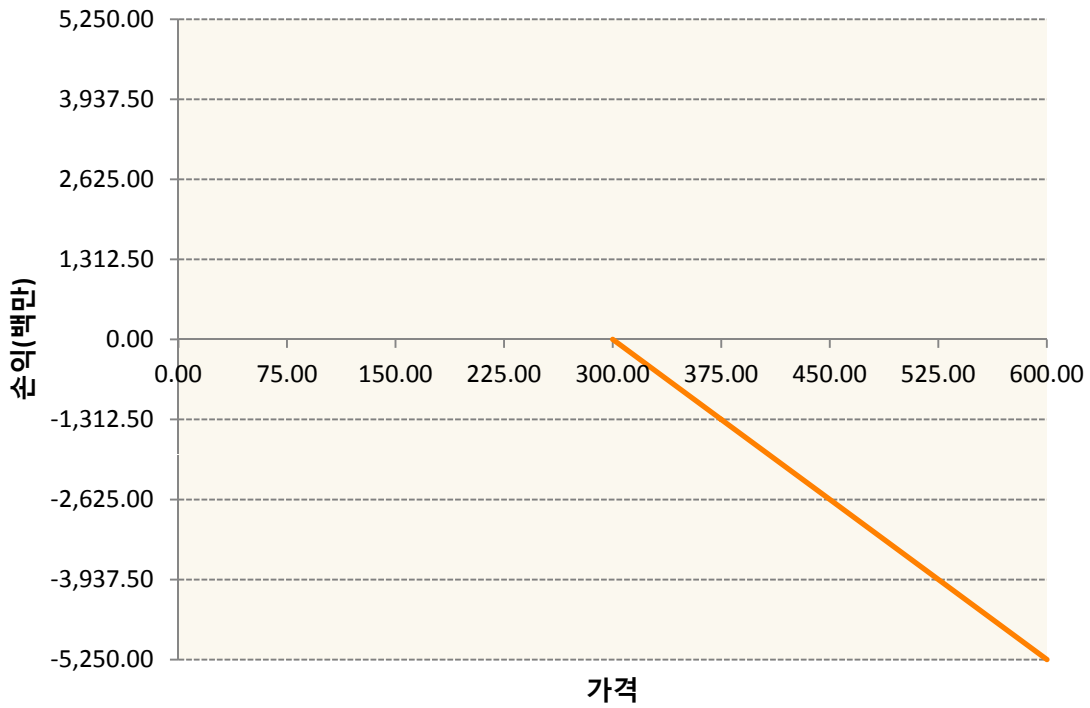


KR4201PC2973-2019-12 콜297.5

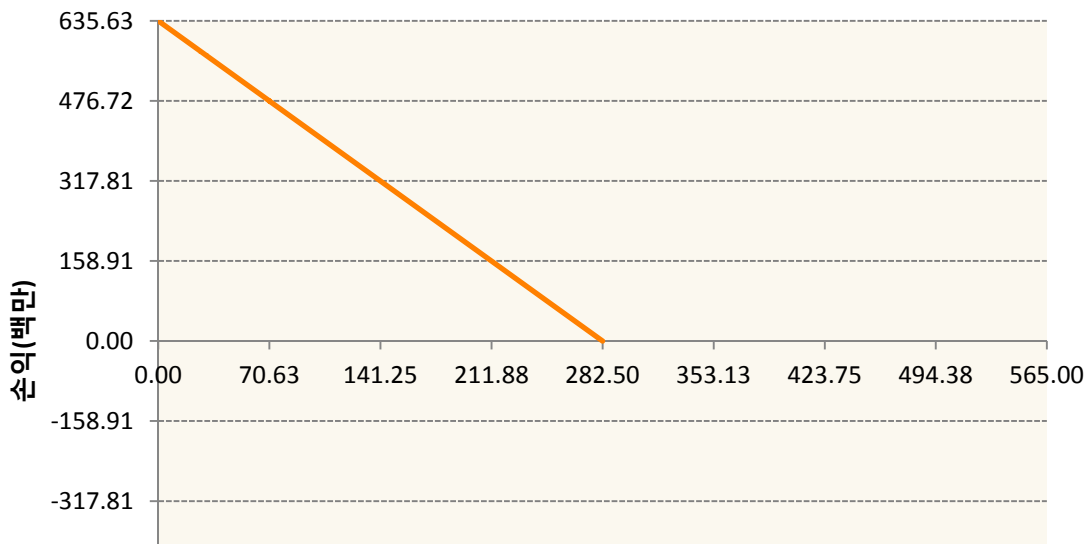


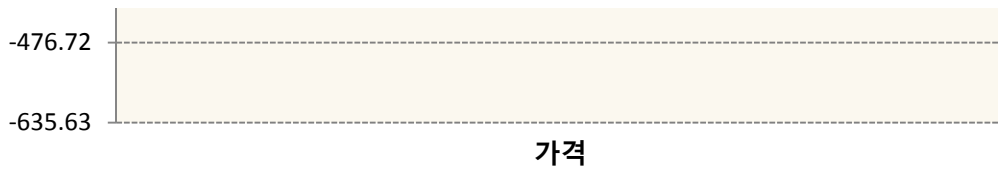


KR4201PC3005-2019-12 콜300

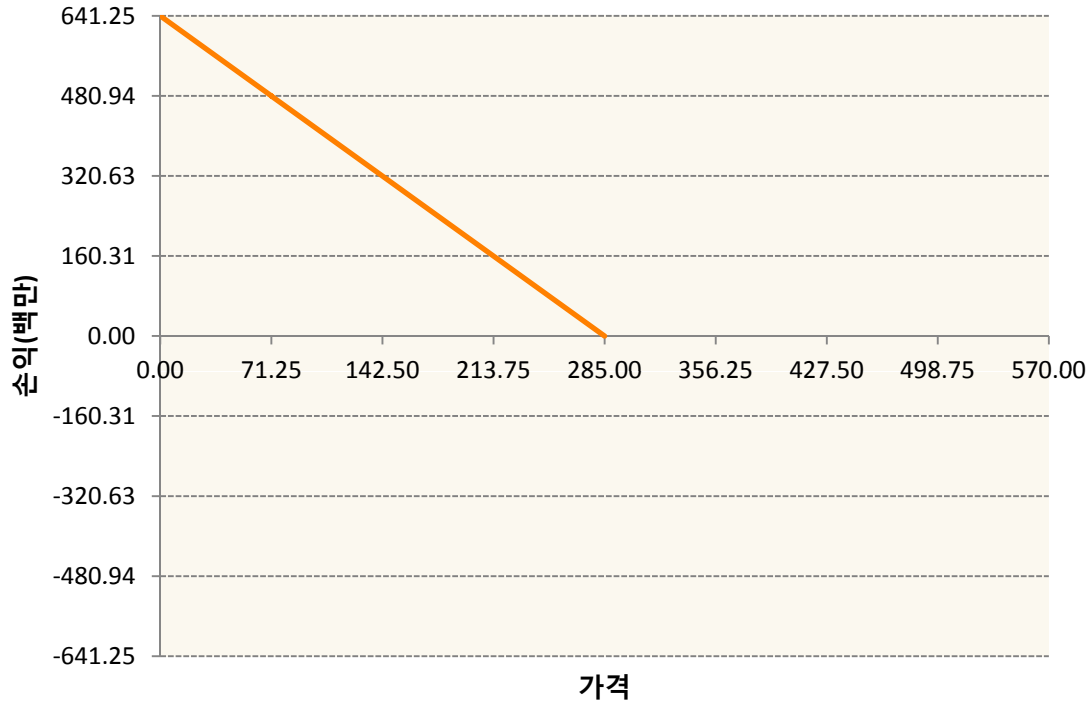


KR4301PC2824-2019-12 풋282.5





KR4301PC2857-2019-12 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						874
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-874	-874	-874	-874	-874	-874	-874	
-5.33%	-582	-582	-582	-582	-582	-582	-582	
-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%	582	582	582	582	582	582	582	
8.00%	874	874	874	874	874	874	874	
KR4201PC2973		2019-12 콜297.5						589
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	87	86	86	84	82	79	74	
-5.33%	86	84	81	76	70	63	54	
-2.67%	79	72	64	53	41	27	11	

0%	51	36	19	0	-20	-42	-65
2.67%	-23	-48	-75	-102	-129	-157	-186
5.33%	-173	-205	-236	-267	-298	-329	-360
8.00%	-414	-442	-471	-500	-530	-559	-589
KR4201PC3005                      2019-12 콜300							173
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	22	22	21	21	21	20	19
-5.33%	21	21	20	19	18	16	13
-2.67%	20	18	16	14	10	6	2
0%	14	10	5	0	-6	-12	-19
2.67%	-4	-12	-19	-27	-36	-44	-53
5.33%	-44	-54	-64	-74	-84	-94	-104
8.00%	-113	-123	-133	-143	-153	-163	-173
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	28	28	28	28	28
-2.67%	11	11	12	12	12	13	13
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-7	-7	-6	-6	-6	-5	-5
5.33%	-8	-8	-8	-8	-8	-7	-7
8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
KR4301PC2857                      2019-12 풋285							47
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	47	47	47	47	47	47	47
-5.33%	30	30	30	30	30	30	30
-2.67%	13	13	13	13	14	14	14
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-10	-9	-9	-8	-7	-7	-6
5.33%	-11	-11	-11	-11	-11	-10	-10
8.00%	-12	-11	-11	-11	-11	-11	-11

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

(단위:백만원)

**1,328**

공시일	2019-11-27
기준일	2019-11-26

## 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	206,021	0	206,021	

### 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	2019-11-27
기준일	2019-11-26

## 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	215,026	0	215,026	

### 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	2019-11-27
기준일	2019-11-26

## 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	545,981	0	545,981	
누계	통화	선도	0	535,516	-535,516	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		697
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,694
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,801
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,412
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,516
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		941
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		941
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,883
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,883
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		471
FX21019X00 KRW/USD 06-12-19E		659
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		1,544
FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E		941
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		471
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		941
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		1,544
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		1,883
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		3,238

FX21019X02 KRW/USD 26-12-19E

4,744

FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E

4,801

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

(단위:백만원)

**13,485**



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

(단위:백만원)

187

공시일	2019-11-27
기준일	2019-11-26

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

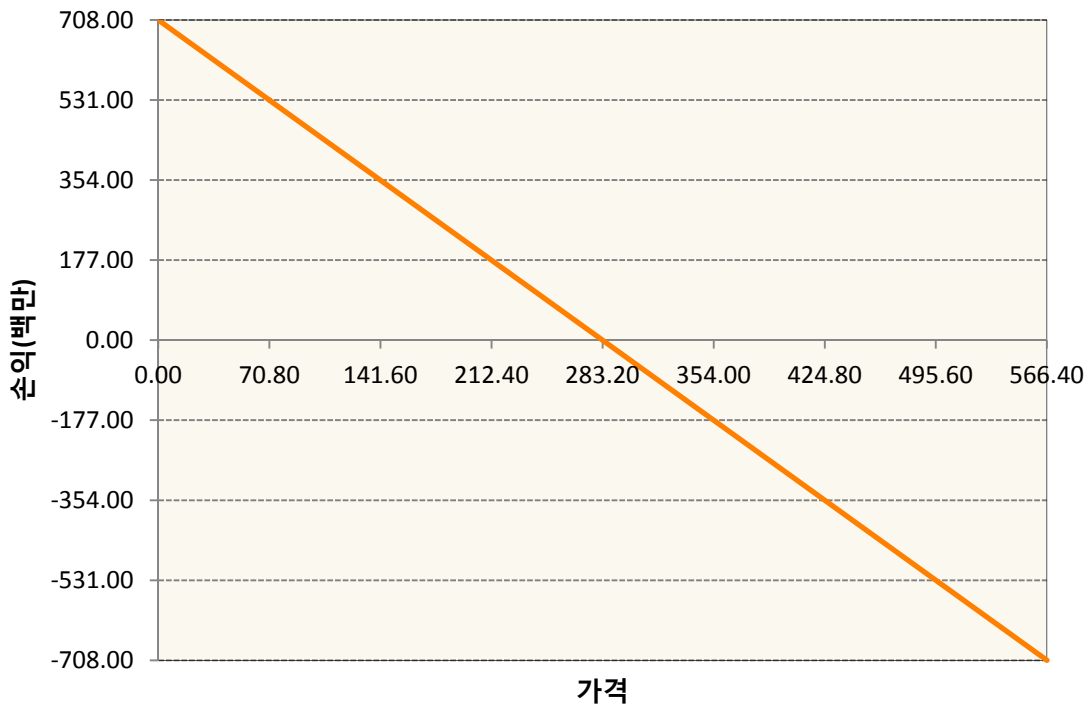
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

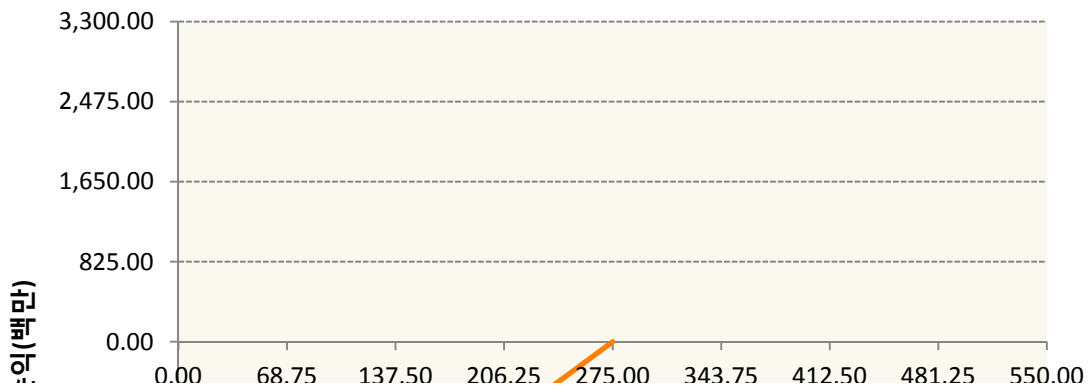
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	708	-708	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,994	-3,994	장내

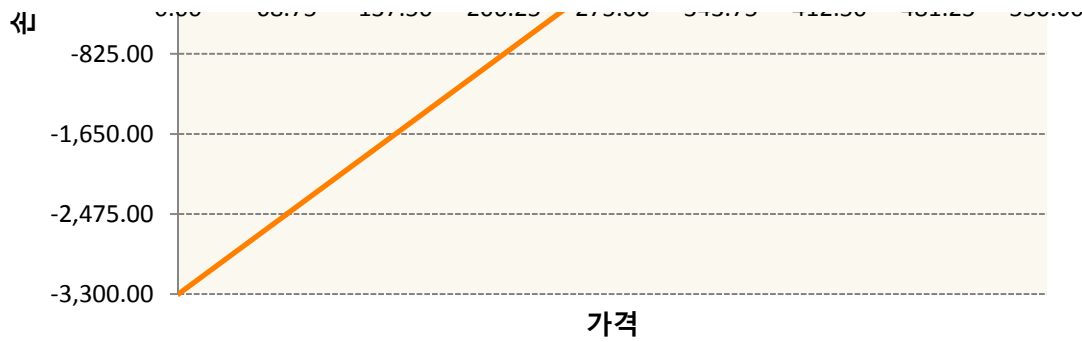
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

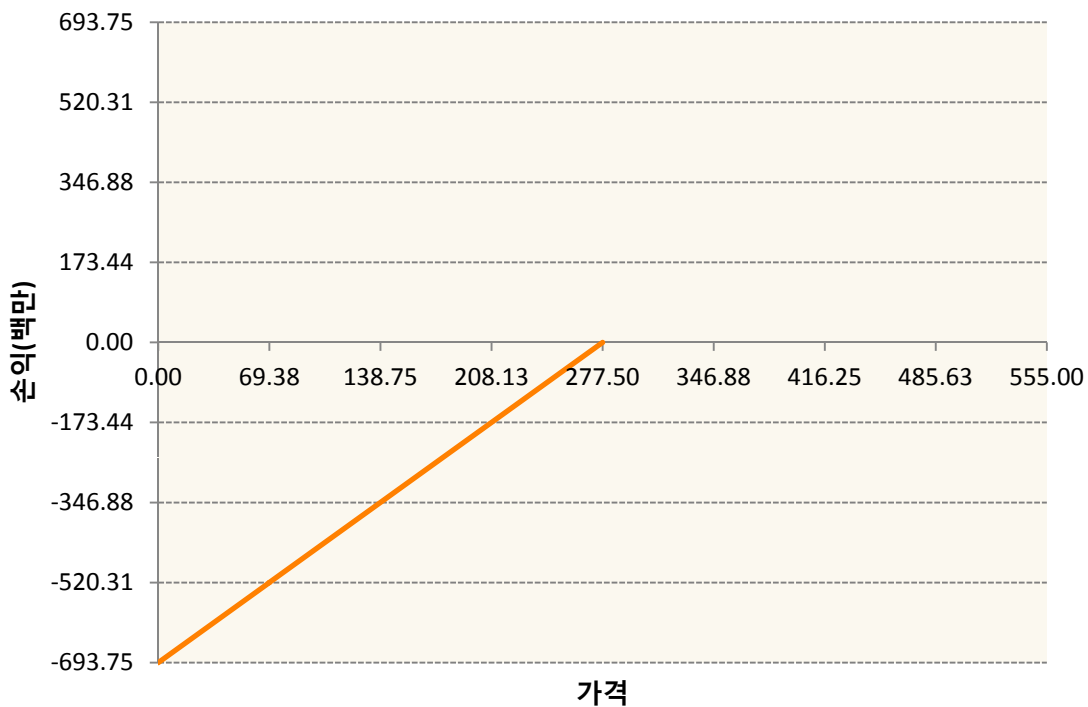


KR4301PC2758-2019-12 풋275





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						182
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-179	-179	-180	-180	-180	-181	-182
-5.33%	-92	-93	-94	-96	-98	-100	-102
-2.67%	-23	-26	-29	-32	-35	-38	-41
0%	6	4	2	0	-2	-5	-7
2.67%	10	10	10	9	8	7	6
5.33%	10	10	10	10	10	10	10
8.00%	10	10	10	10	10	10	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%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
-5.33%	-23	-24	-24	-24	-24	-25	-25
-2.67%	-7	-8	-8	-9	-9	-10	-11
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	4	3	3	3	3	3	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)

**254**

공시일	2019-11-27
기준일	2019-11-26

## 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	15,108	0	15,108	
누계	통화	선도	0	15,191	-15,191	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		231
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		292

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

(단위:백만원)

<b>383</b>
------------

공시일	2019-11-27
기준일	2019-11-26

## 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)

<b>76</b>
-----------

공시일	2019-11-27
기준일	2019-11-26

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

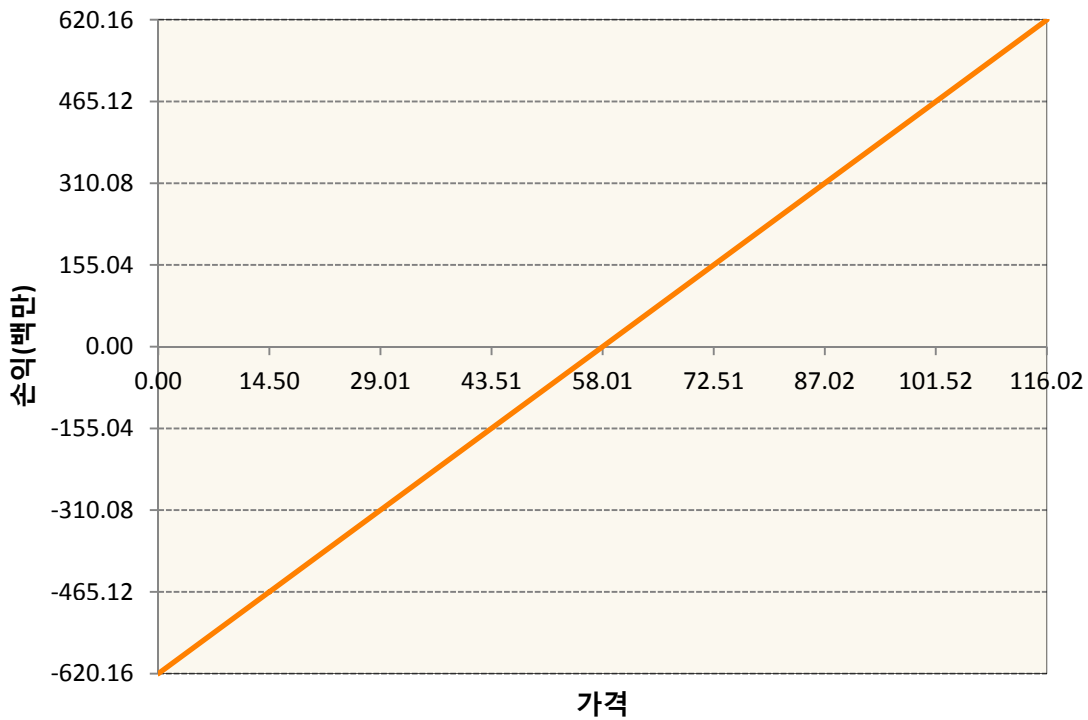
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

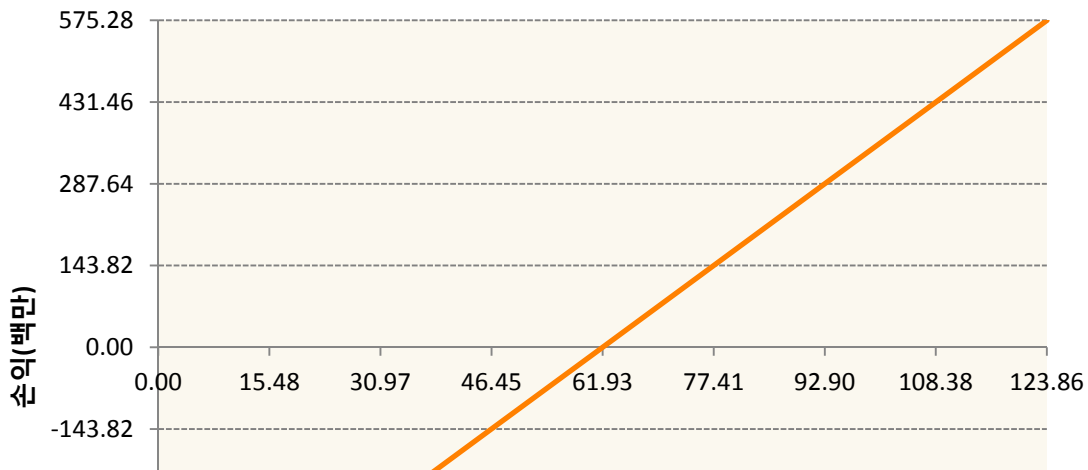
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,492	294	2,198	

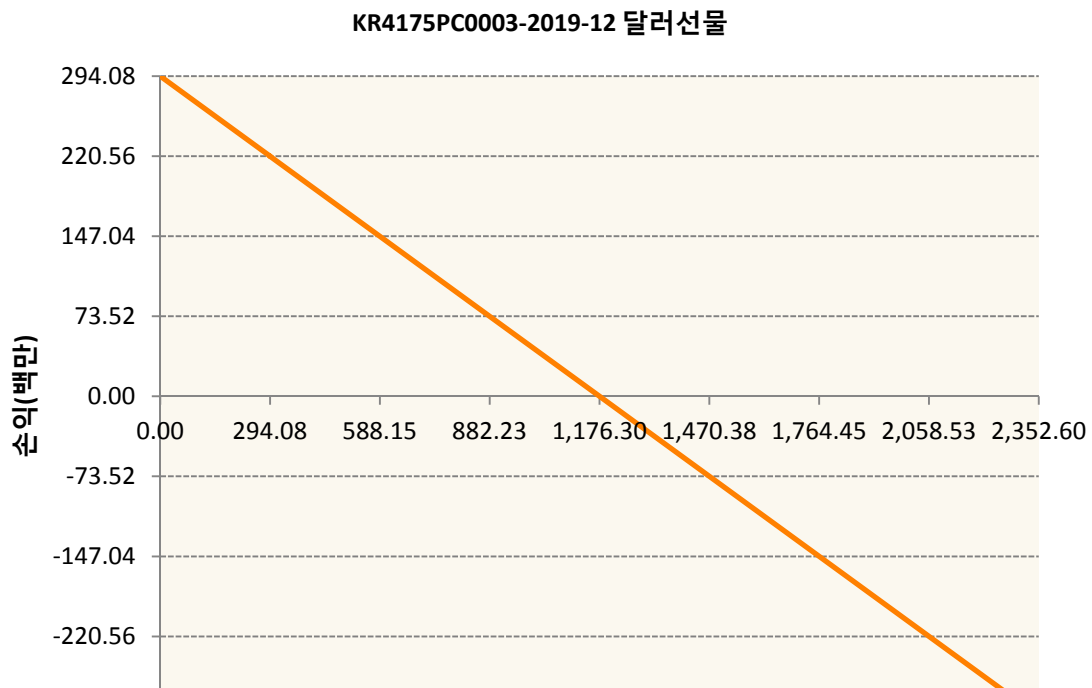
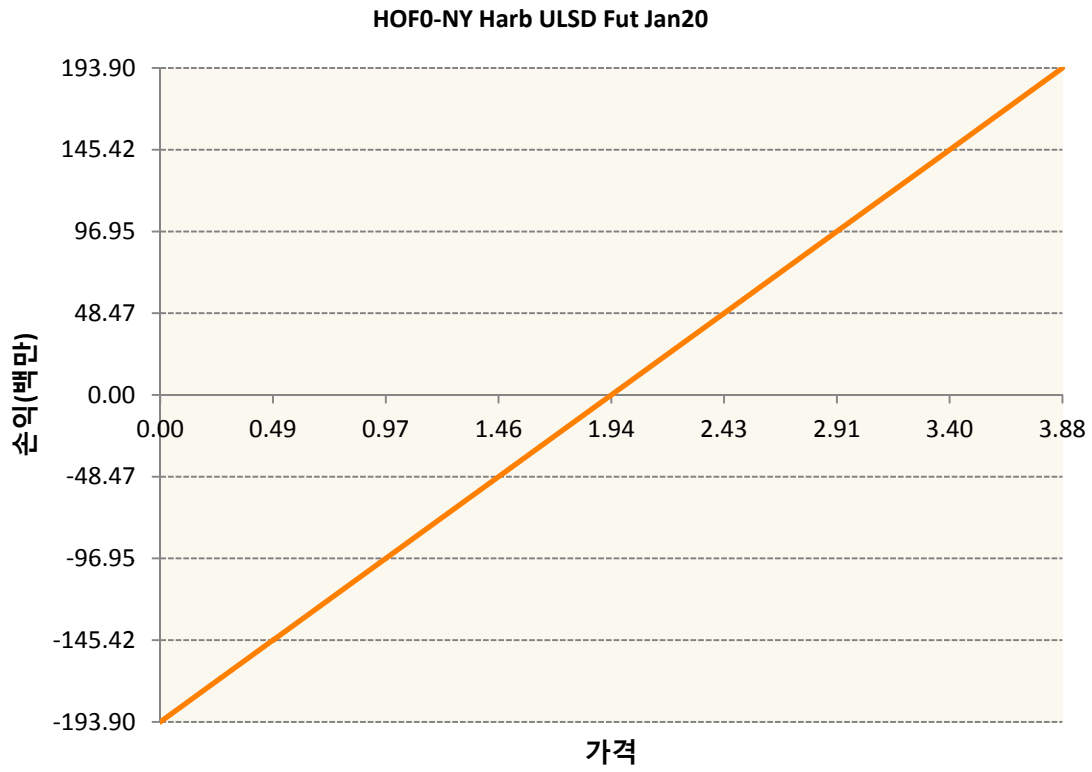
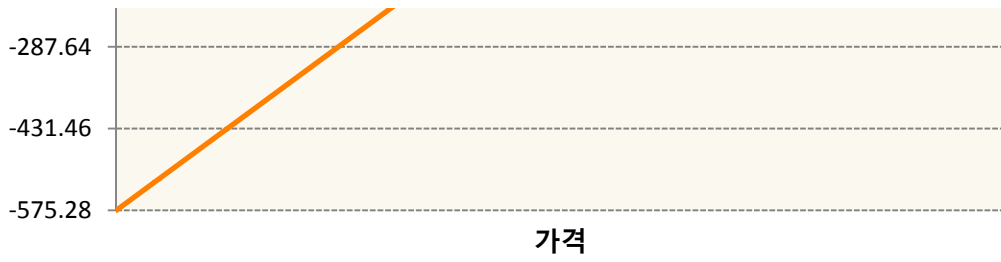
### 2. 만기시점의 손익구조

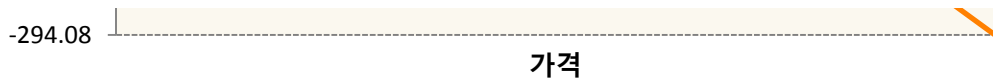
CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20



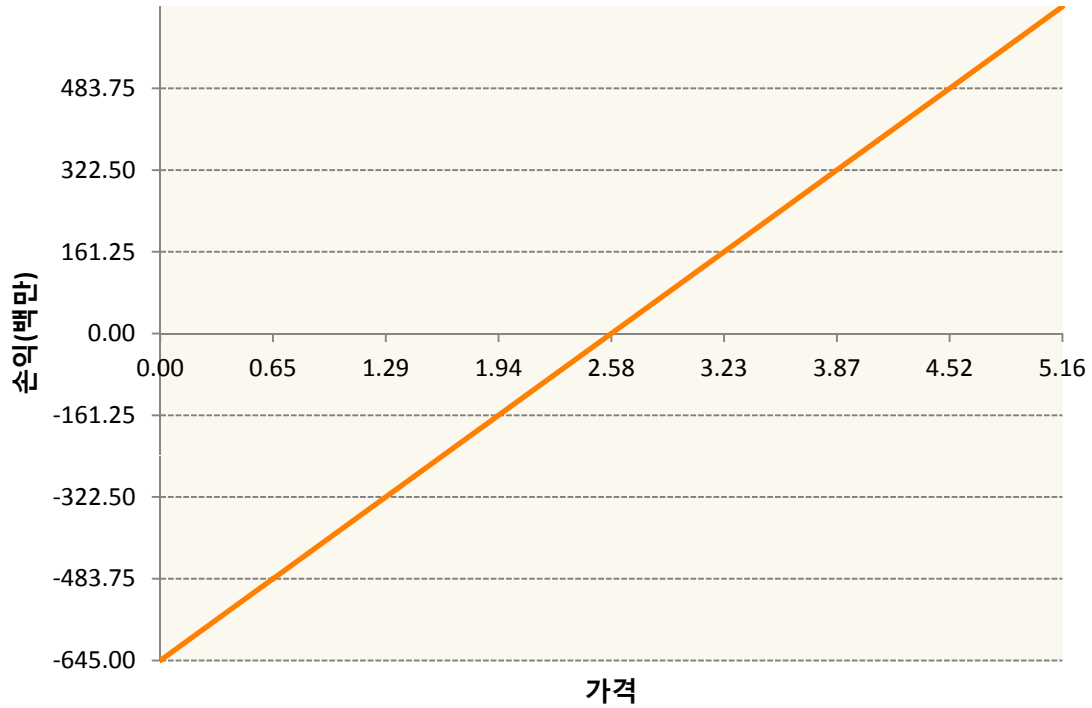
COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20



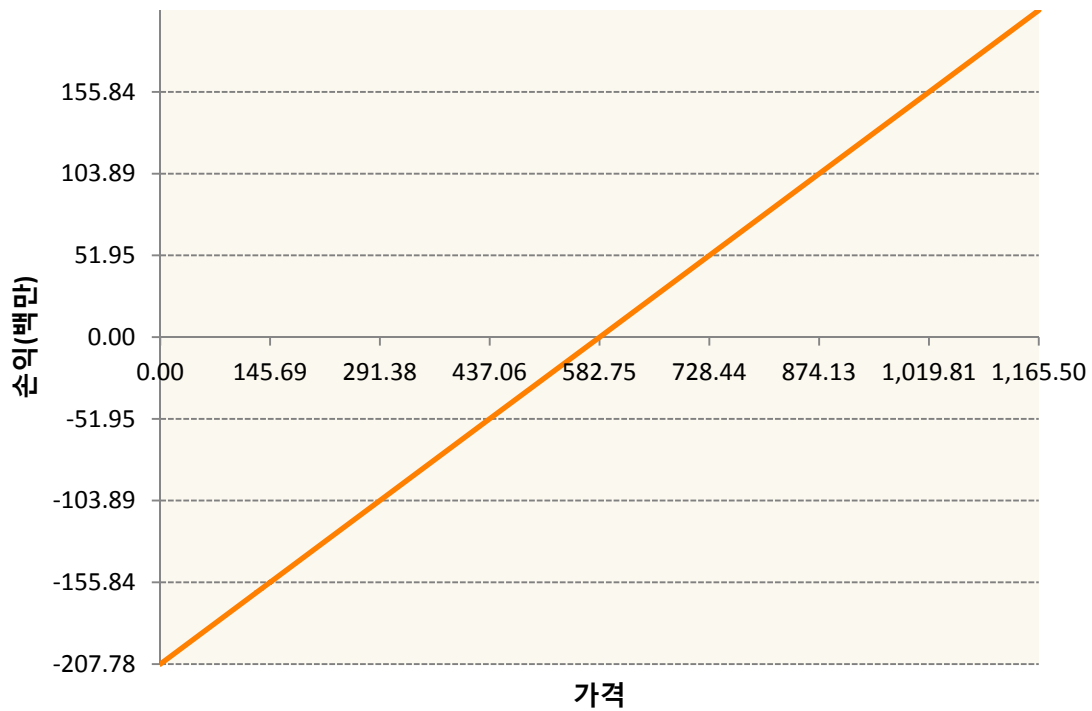




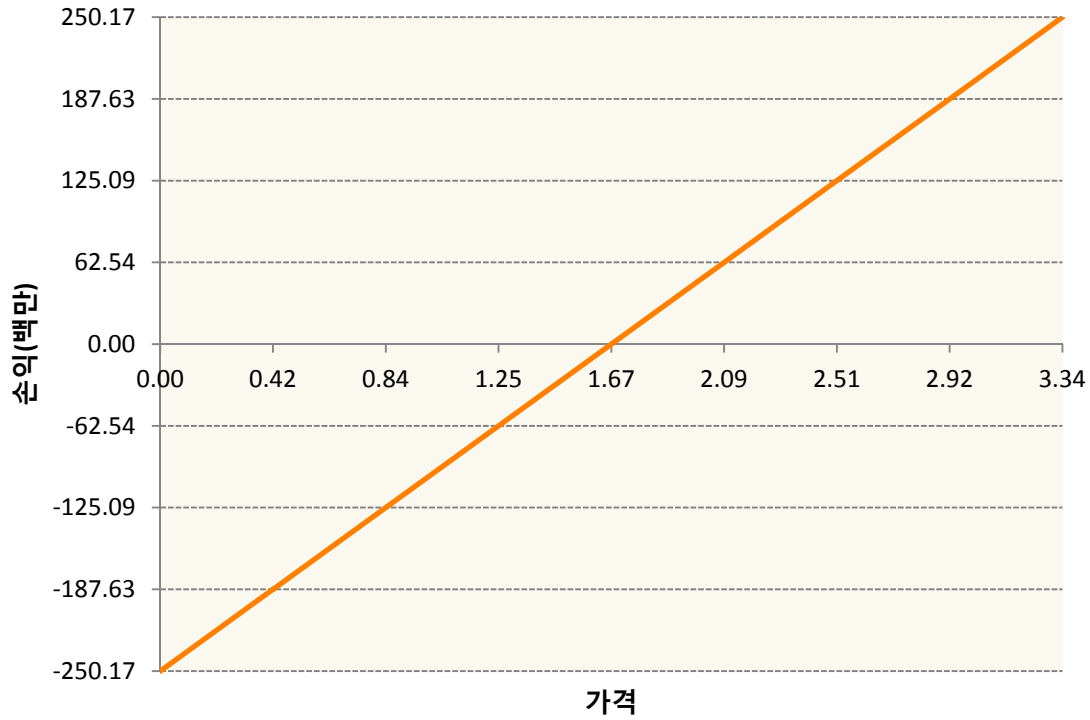
NGF20-NATURAL GAS FUTR Jan20



QSF0-Low Su Gasoil G Jan20



XBF0-GASOLINE RBOB FUT Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLF0	WTI CRUDE FUTURE Jan20	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)

412

공시일	2019-11-27
기준일	2019-11-26

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

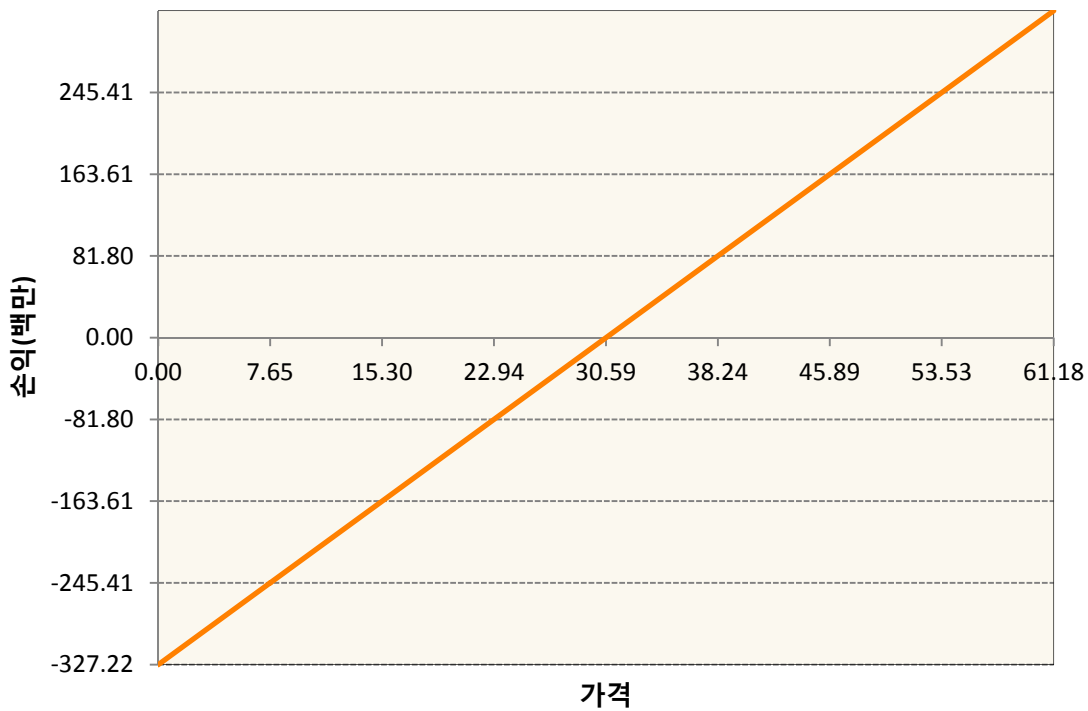
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

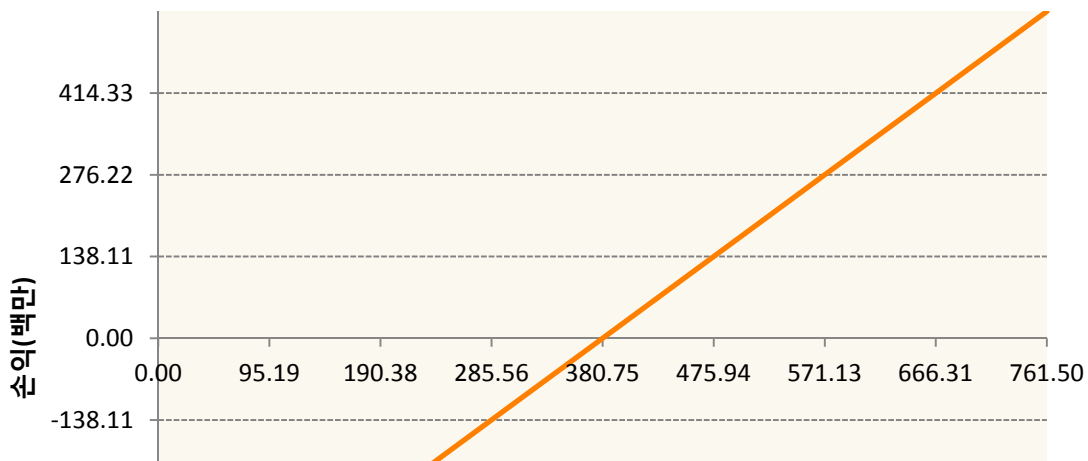
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,826	94	2,732	

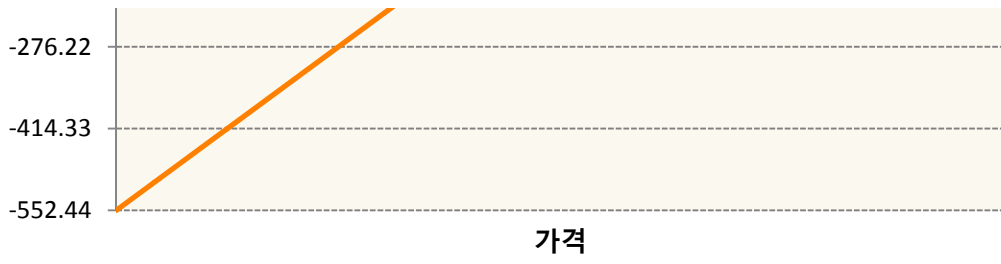
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20**

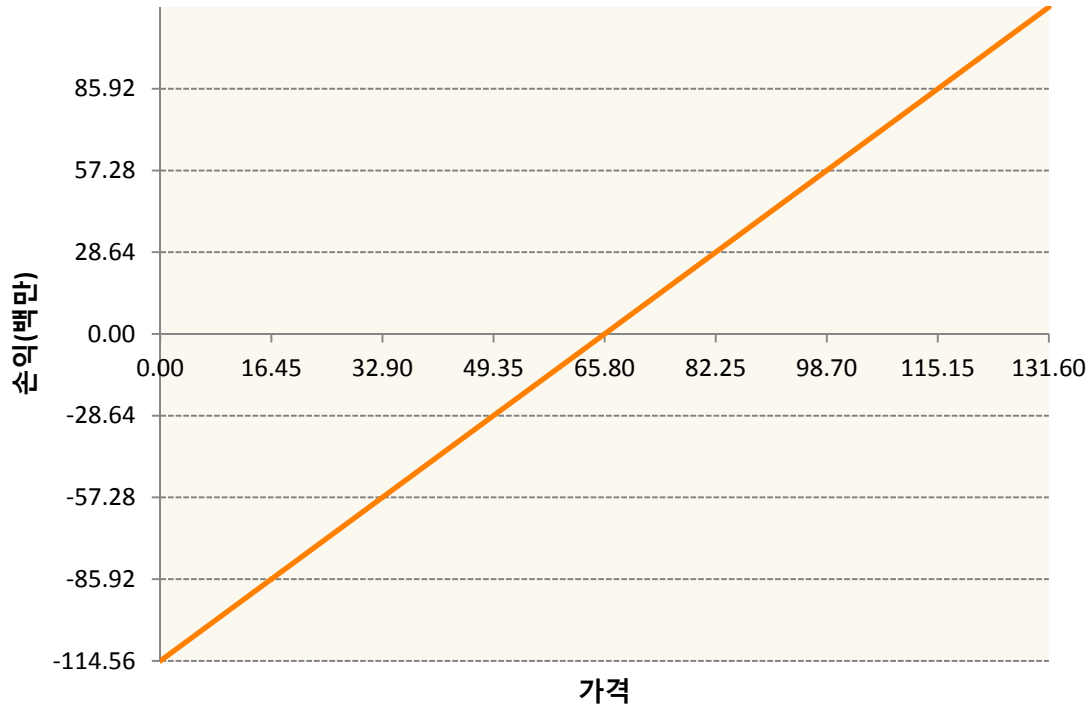


**CH0-CORN FUTURE Mar20**

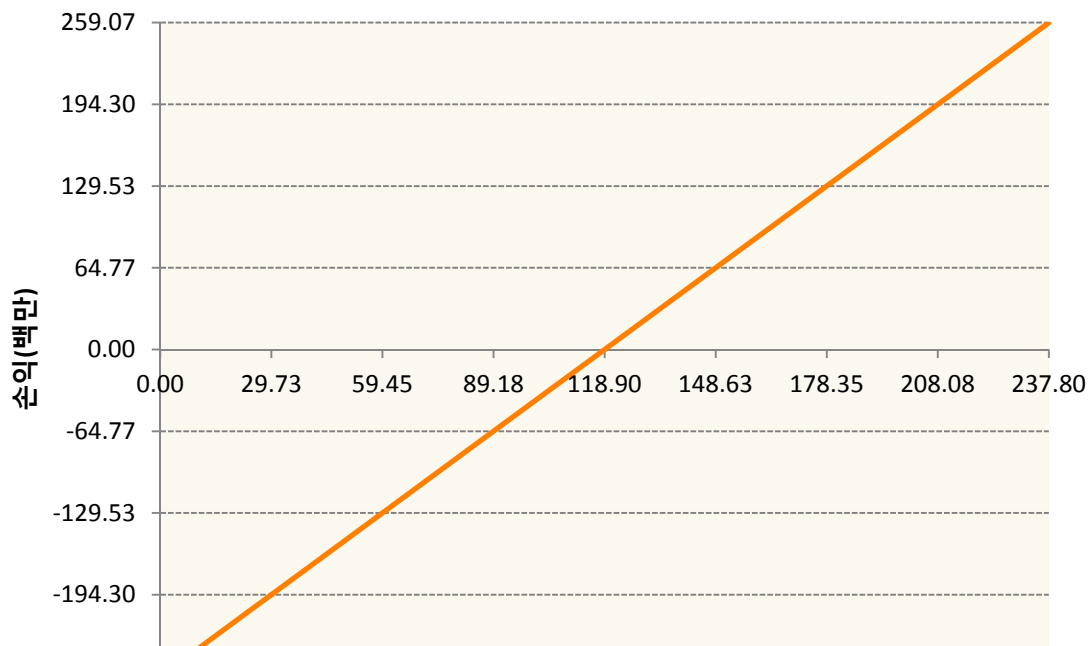


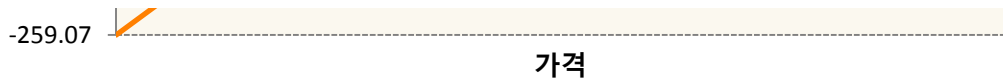


CTH0-COTTON NO.2 FUTR Mar20

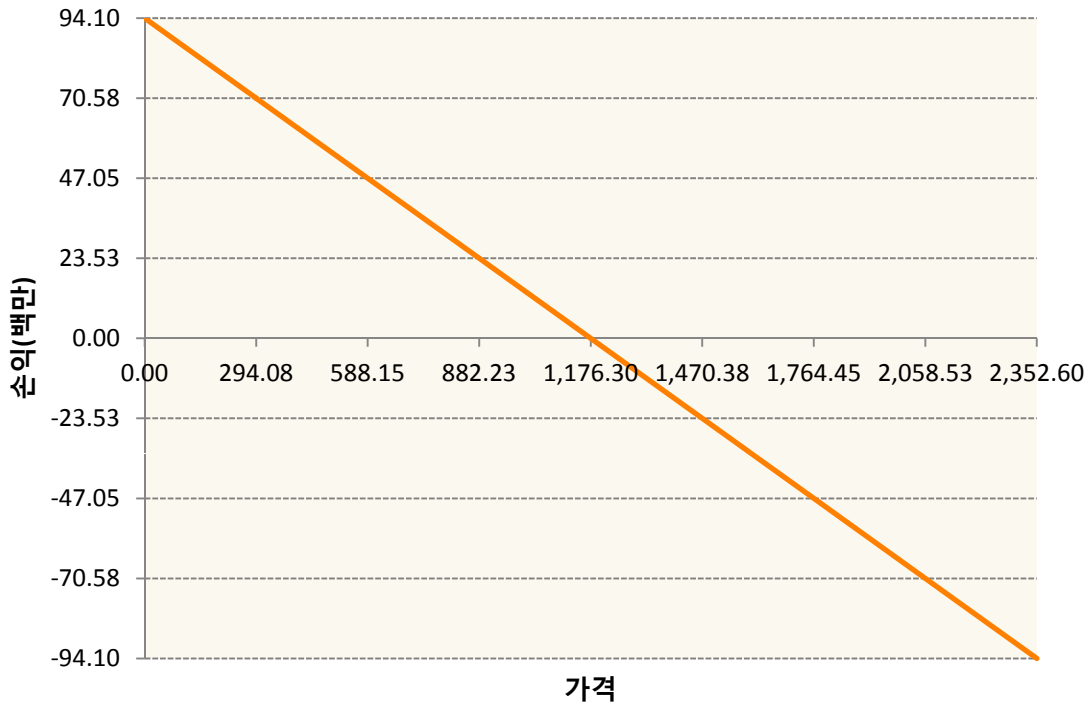


KCH0-COFFEE 'C' FUTURE Mar20

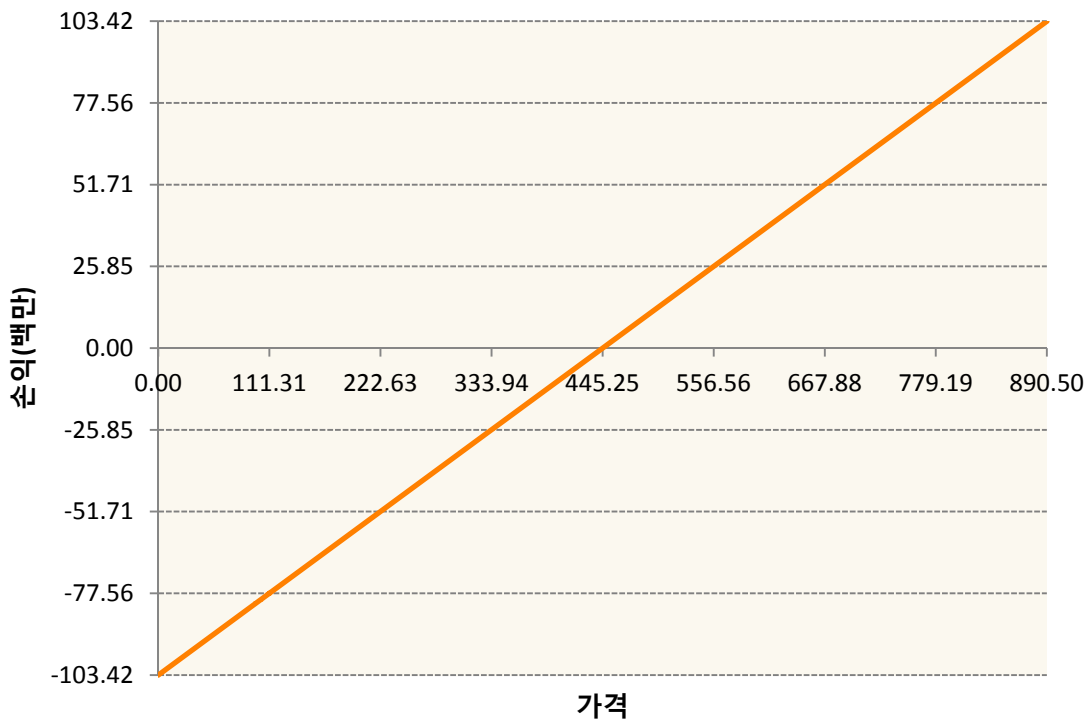




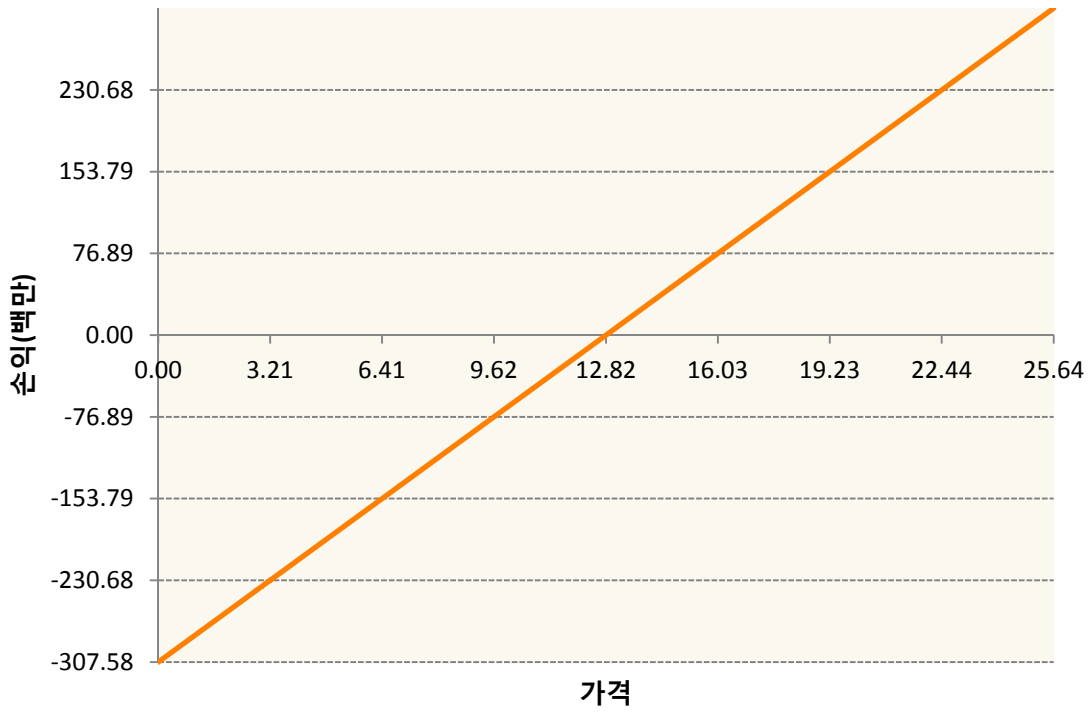
KR4175PC0003-2019-12 달러선물



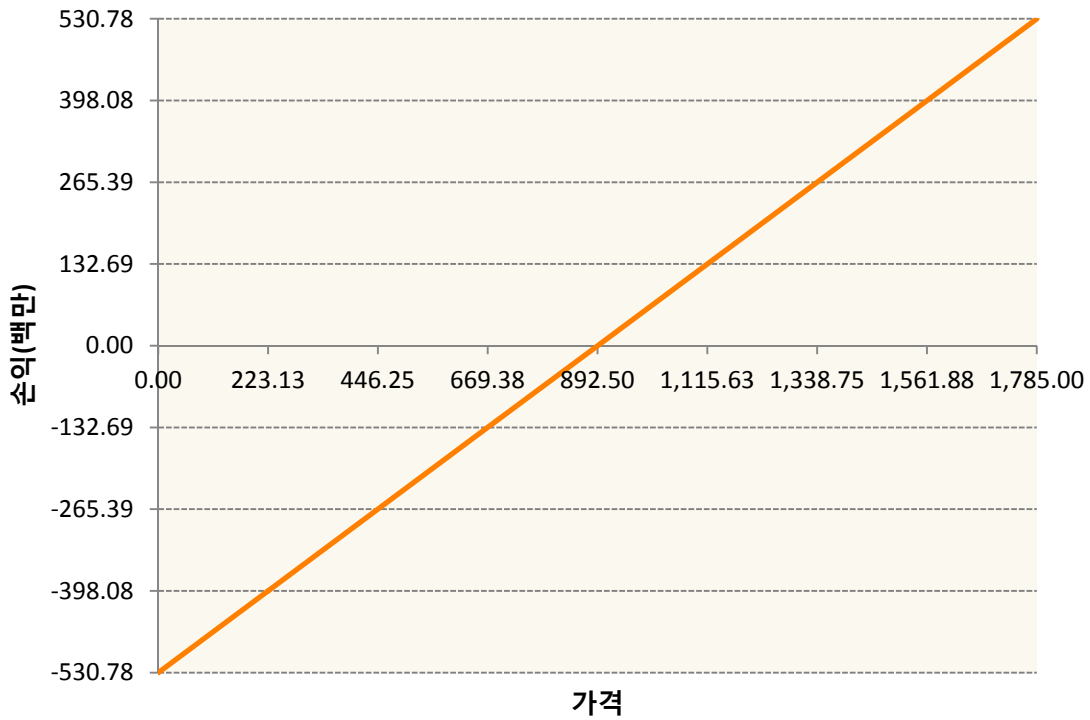
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

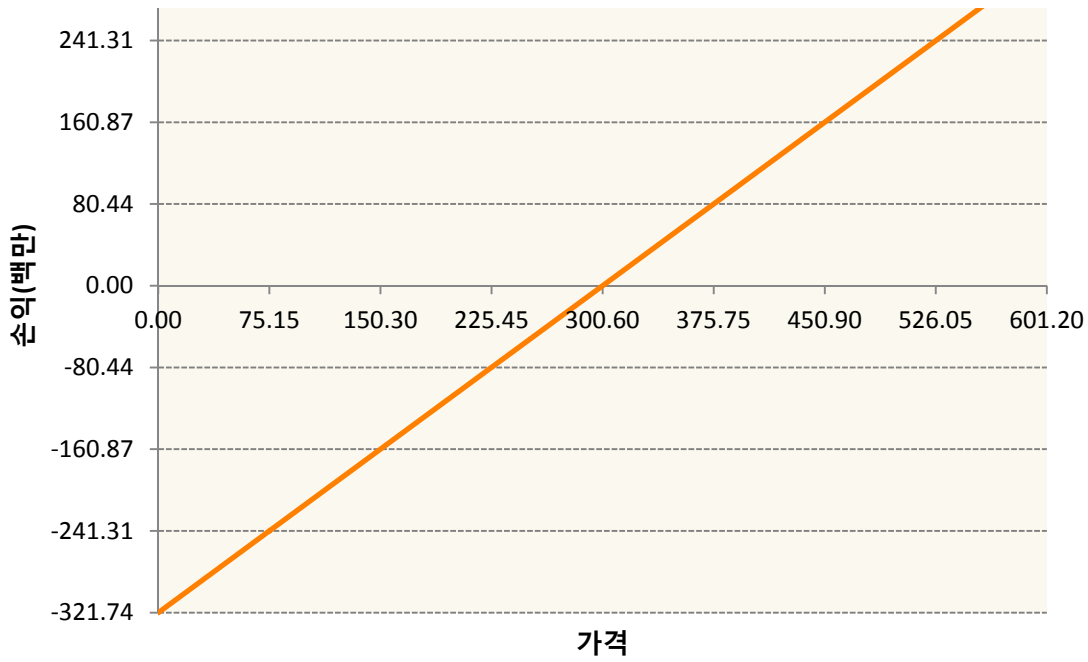


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20

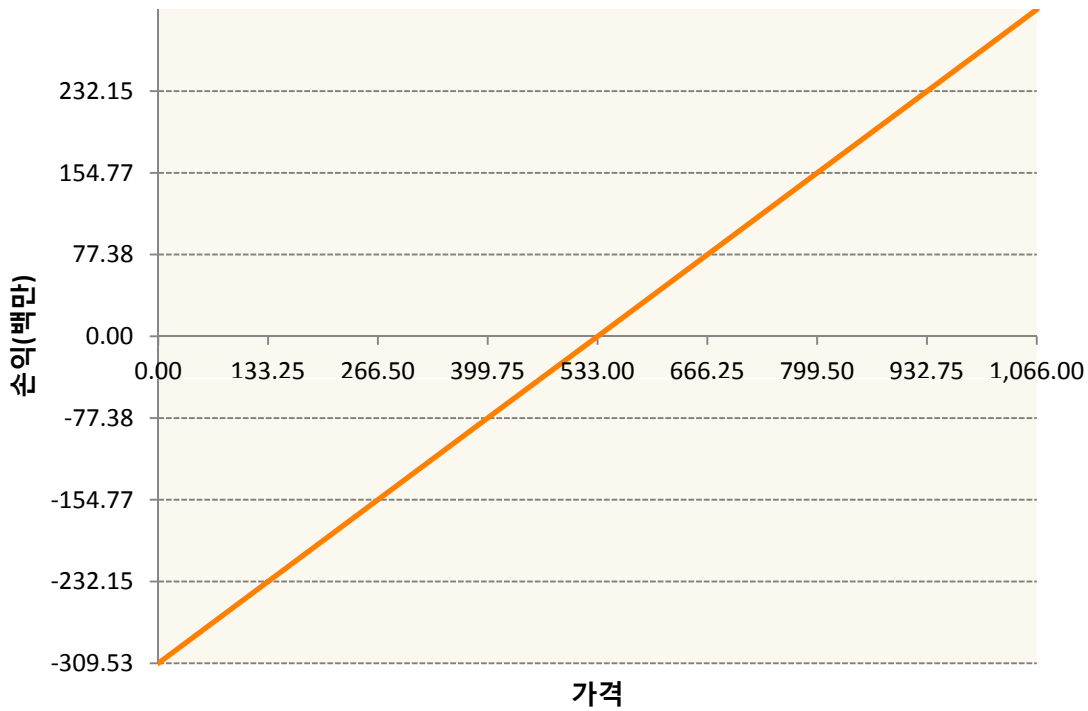


SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





WHO-WHEAT FUTURE(CBT) Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF0	SOYBEAN OIL FUTR Jan20	26
CH0	CORN FUTURE Mar20	44
CTH0	COTTON NO.2 FUTR Mar20	9
KCH0	COFFEE 'C' FUTURE Mar20	21
KR4175PC00	2019-12 달러선물	8

KWH0	KC HRW WHEAT FUT Mar20	8
SBH0	Sugar Mar20	25
SF0	SOYBEAN FUTURE Jan20	42
SMF0	SOYBEAN MEAL FUTR Jan20	26
WH0	WHEAT FUTURE(CBT) Mar20	25

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

(단위:백만원)

**249**