

공시일	2019-11-28
기준일	2019-11-27

## 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	2019-11-28
기준일	2019-11-27

## 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

1,098

\* 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	2019-11-28
기준일	2019-11-27

## 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)	379
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	138

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

746

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-11-28
기준일	2019-11-27

## 유로인덱스모(주식-파생형)

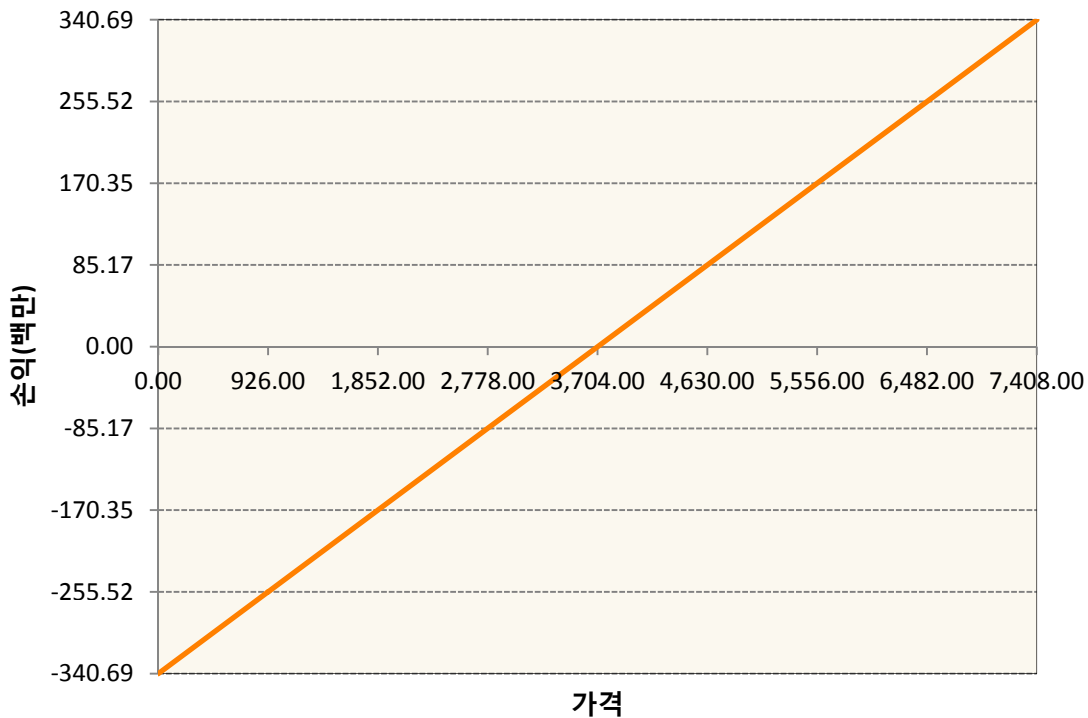
### 1. 계약금액

(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	2019-11-28
기준일	2019-11-27

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

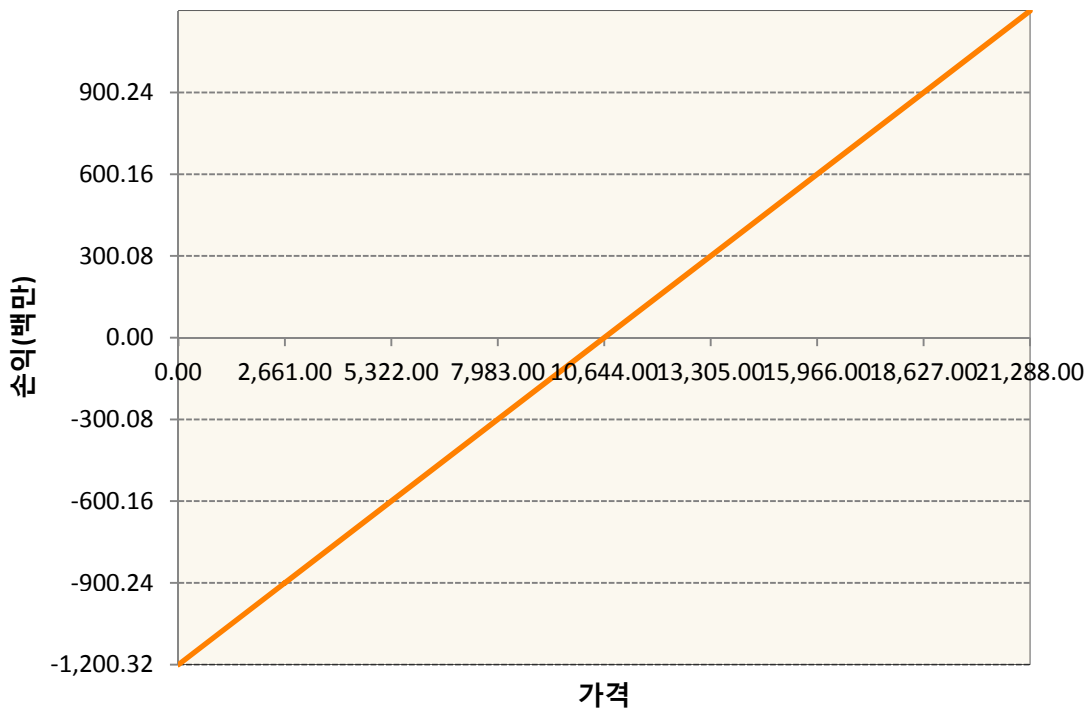
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,200	0	1,200	

### 2. 만기시점의 손익구조

HCZ9-HSCEI Futures Dec19



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ9	HSCEI Futures Dec19	96
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

87

공시일	2019-11-28
기준일	2019-11-27

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

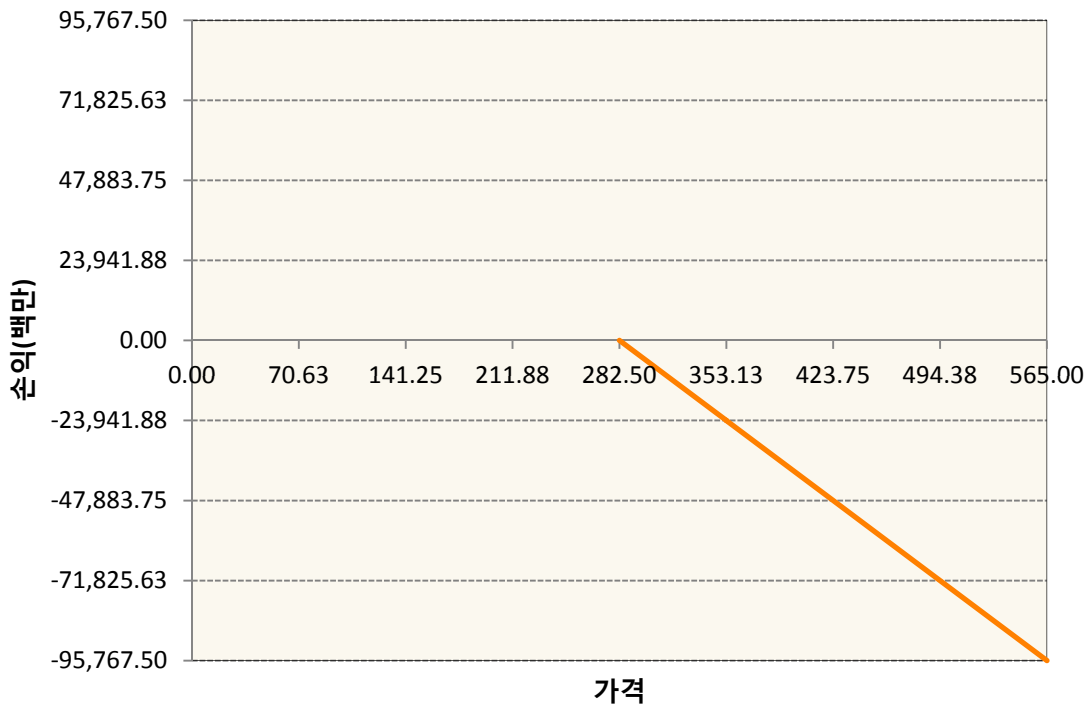
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

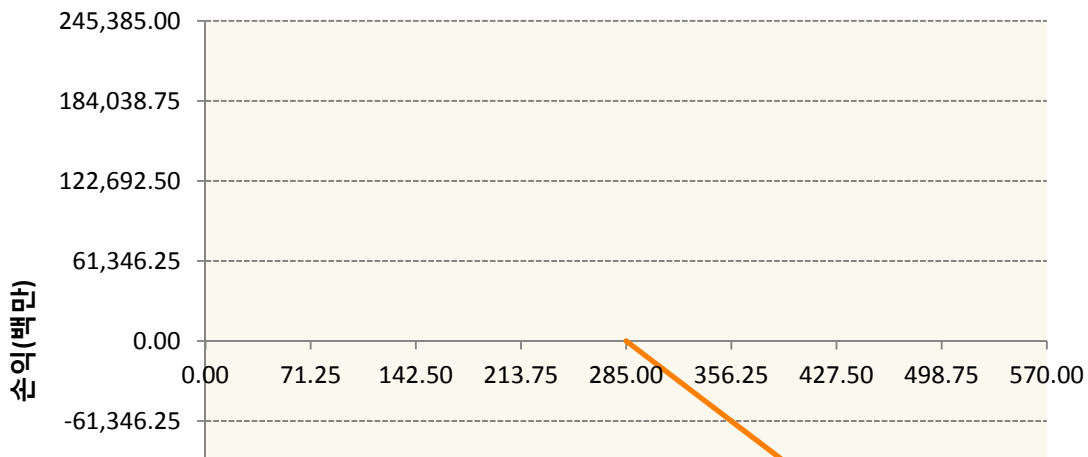
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	498,456	-498,456	장내

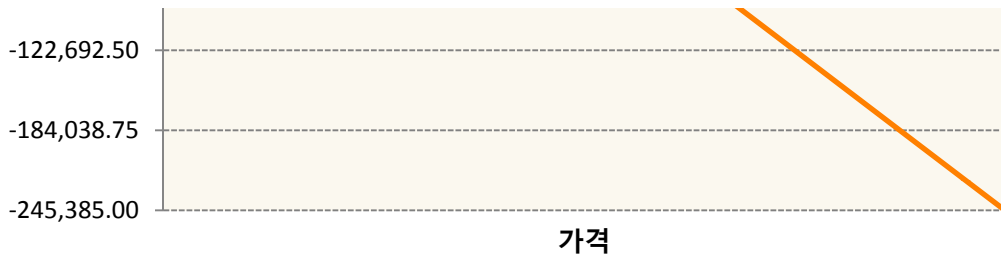
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201PC2825-2019-12 콜282.5**

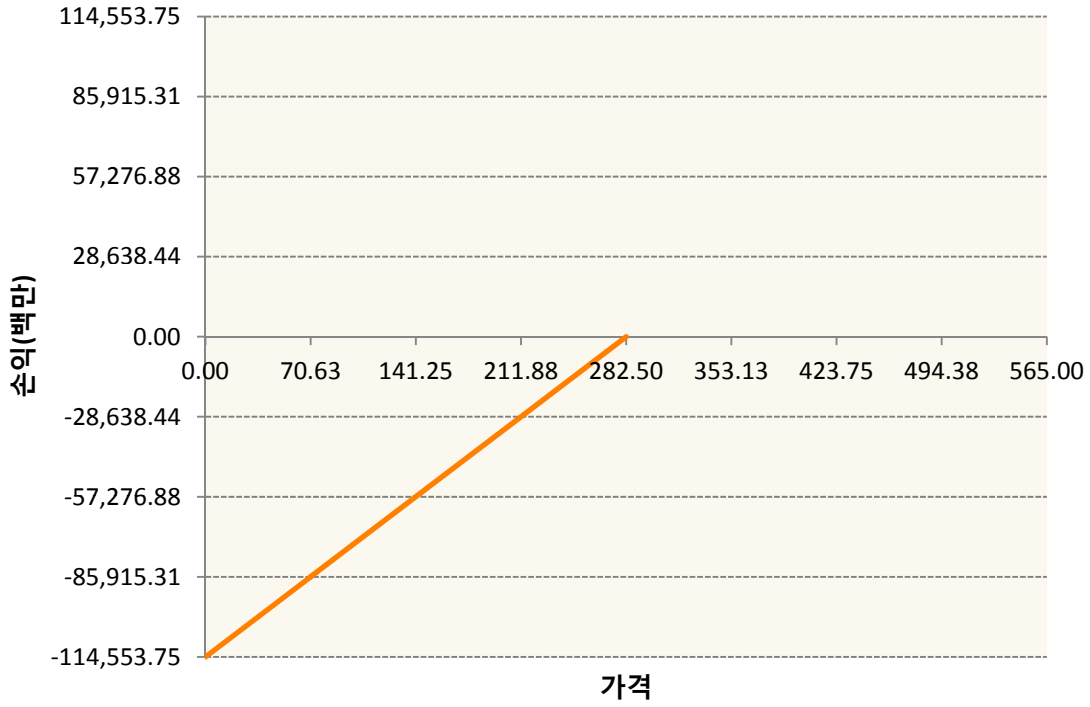


**KR4201PC2858-2019-12 콜285**

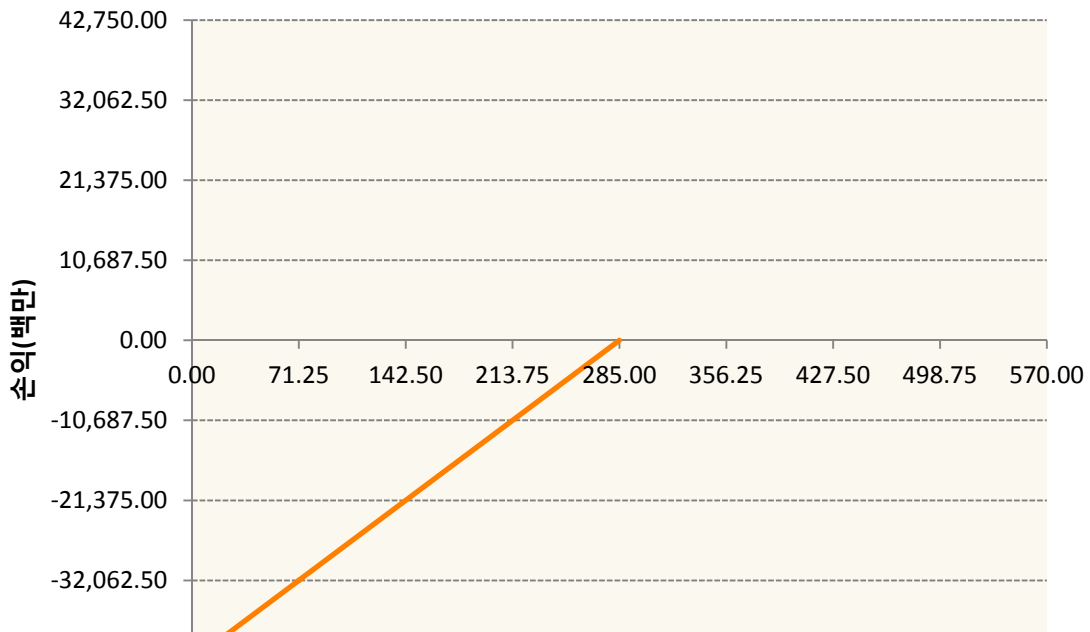




**KR4301PC2824-2019-12 풋282.5**



**KR4301PC2857-2019-12 풋285**



-42,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PC2825		2019-12 콜282.5						6,020
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,181	2,148	2,104	2,048	1,982	1,905	1,820	
-5.33%	2,024	1,938	1,839	1,730	1,613	1,489	1,359	
-2.67%	1,552	1,400	1,244	1,084	922	757	590	
0%	545	363	182	0	-182	-363	-545	
2.67%	-1,076	-1,230	-1,389	-1,552	-1,717	-1,886	-2,056	
5.33%	-3,189	-3,283	-3,390	-3,507	-3,632	-3,765	-3,904	
8.00%	-5,581	-5,624	-5,681	-5,749	-5,829	-5,920	-6,020	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						14,481
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4,586	4,528	4,445	4,334	4,198	4,036	3,851	
-5.33%	4,323	4,151	3,947	3,713	3,455	3,175	2,877	
-2.67%	3,442	3,103	2,745	2,373	1,988	1,594	1,192	
0%	1,373	916	459	0	-459	-919	-1,380	
2.67%	-2,237	-2,670	-3,109	-3,553	-4,001	-4,451	-4,904	
5.33%	-7,235	-7,531	-7,854	-8,198	-8,559	-8,935	-9,323	
8.00%	-13,120	-13,271	-13,456	-13,673	-13,919	-14,189	-14,481	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						7,866
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-7,855	-7,856	-7,856	-7,857	-7,858	-7,861	-7,866	
-5.33%	-4,803	-4,808	-4,817	-4,829	-4,847	-4,870	-4,897	
-2.67%	-1,859	-1,910	-1,968	-2,031	-2,100	-2,172	-2,249	
0%	315	210	105	0	-105	-210	-315	
2.67%	1,107	1,058	1,001	938	870	798	721	
5.33%	1,210	1,204	1,194	1,179	1,159	1,134	1,103	
8.00%	1,214	1,214	1,213	1,212	1,209	1,204	1,197	
KR4301PC2857		2019-12 풋285						3,074
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,072	-3,072	-3,072	-3,072	-3,072	-3,073	-3,074	
-5.33%	-1,942	-1,943	-1,944	-1,946	-1,950	-1,955	-1,961	
-2.67%	-828	-838	-852	-868	-886	-907	-929	
0%	111	74	37	0	-38	-75	-113	
2.67%	566	538	508	477	445	411	377	

5.33%	652	647	639	629	617	602	585
8.00%	658	657	657	655	653	649	645

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

(단위:백만원)

**33,272**

공시일	2019-11-28
기준일	2019-11-27

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

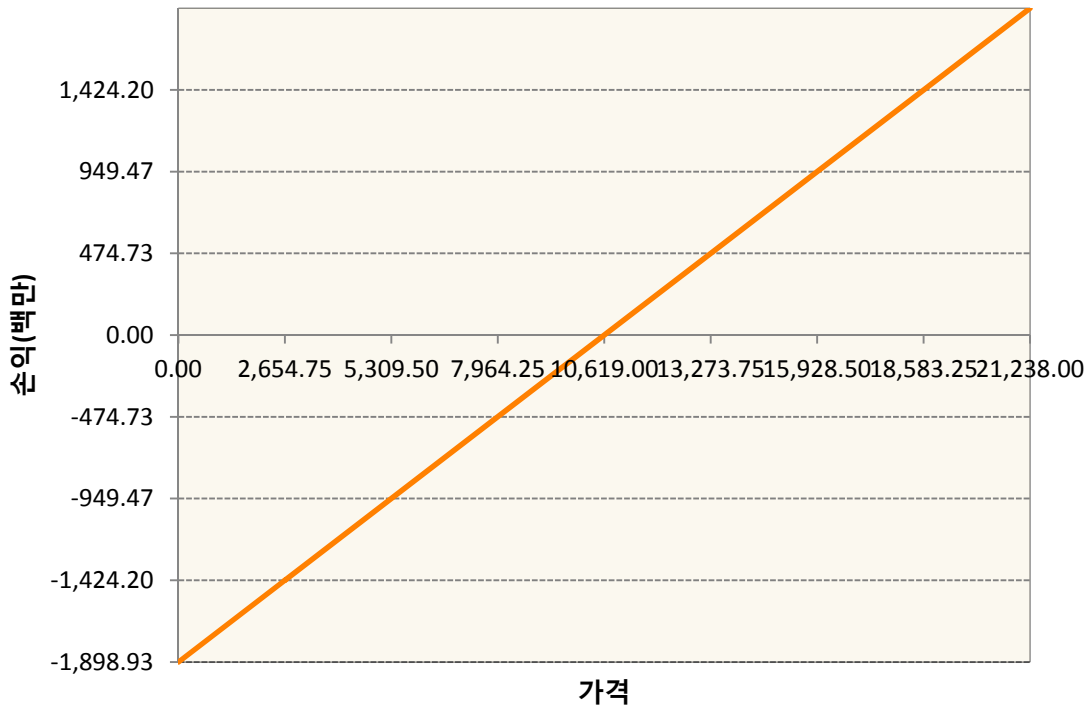
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

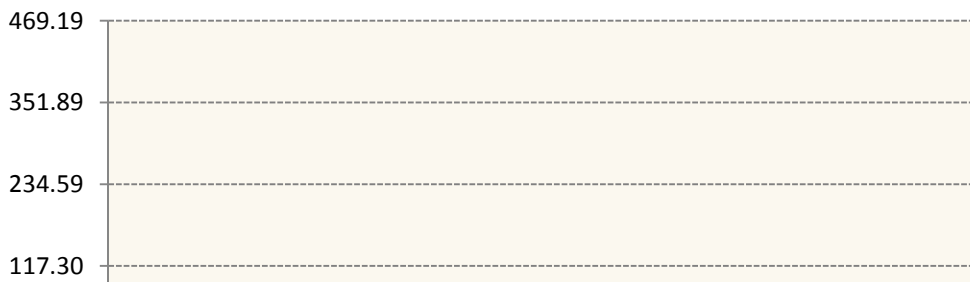
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,899	0	1,899	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,966	-4,966	장내
누계	통화	선도	0	2,117	-2,117	장외

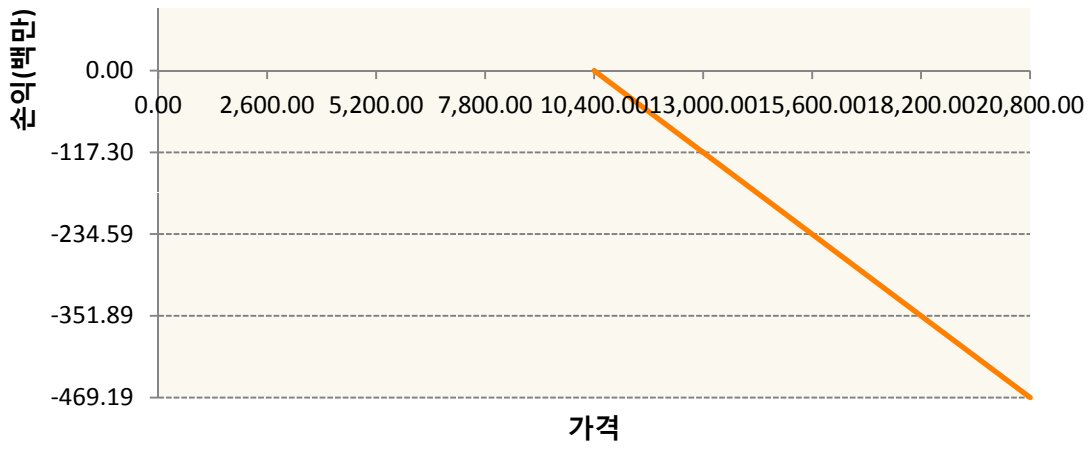
### 2. 만기시점의 손익구조

HCX9-HSCEI Futures Nov19

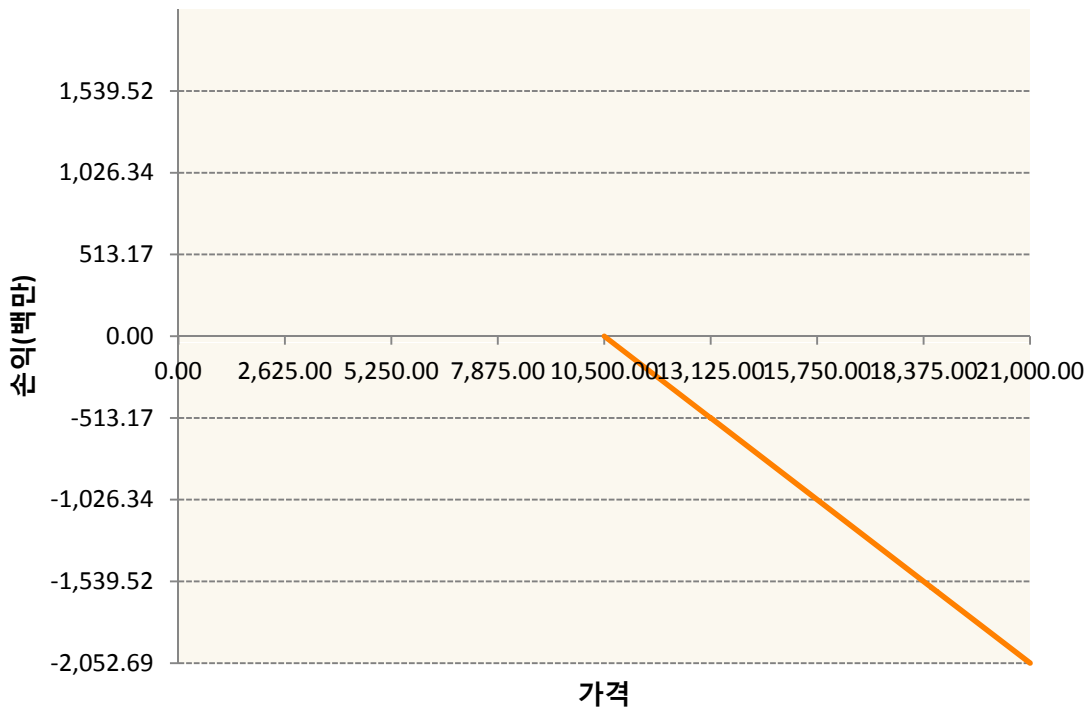


OHHIX9-C104-HSCEI

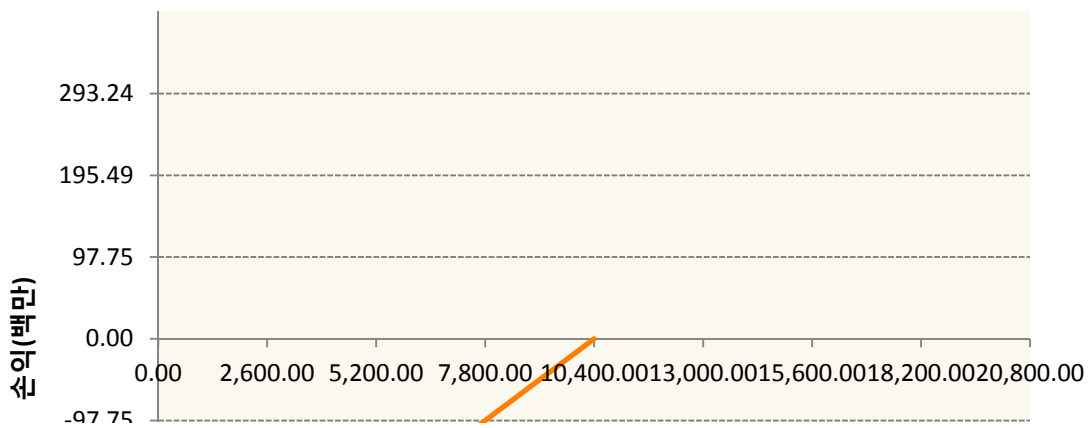


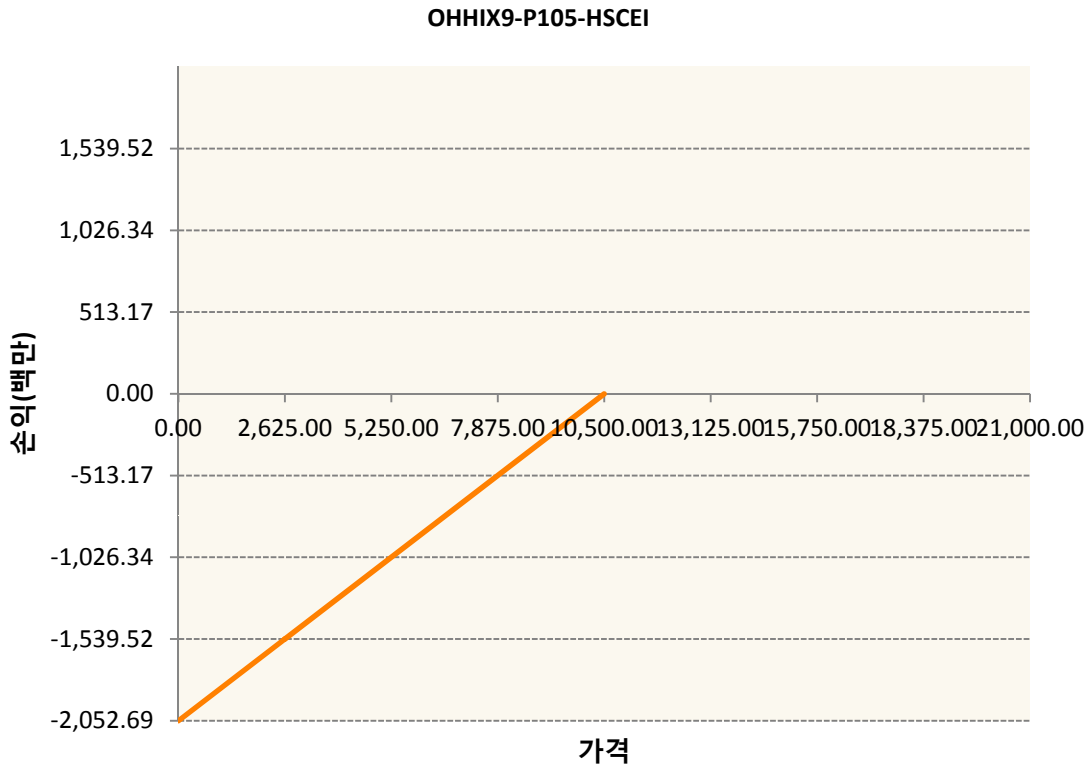
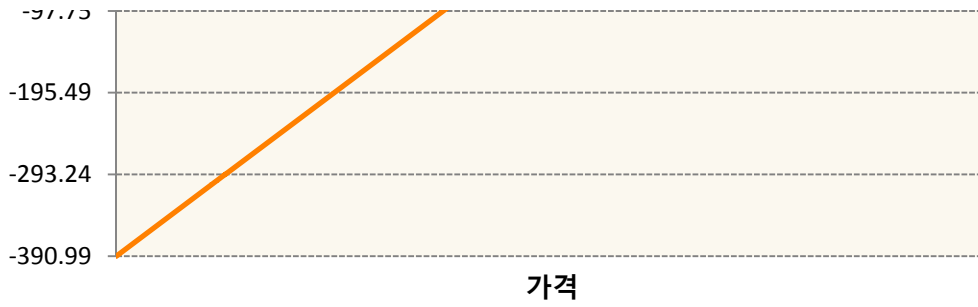


OHHIX9-C105-HSCEI



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)

541

공시일	2019-11-28
기준일	2019-11-27

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

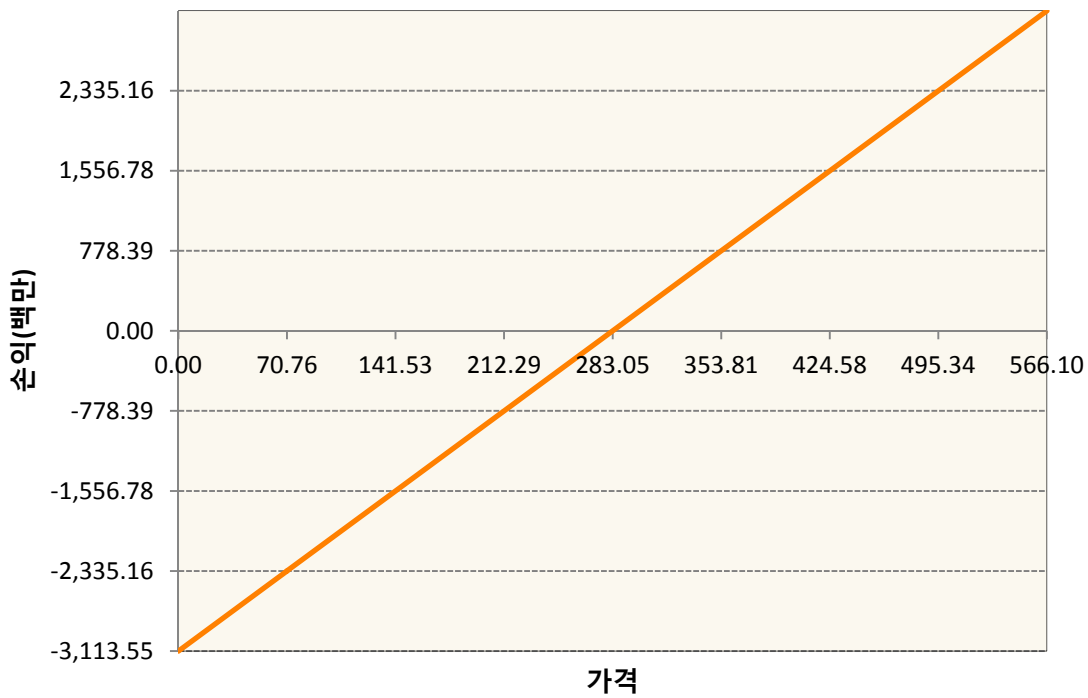
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

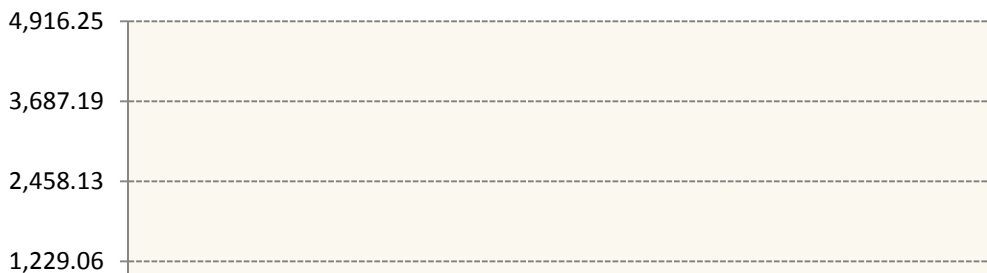
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,114	0	3,114	장내
누계	유가증권	스왑	9,625	0	9,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,657	-9,657	장내

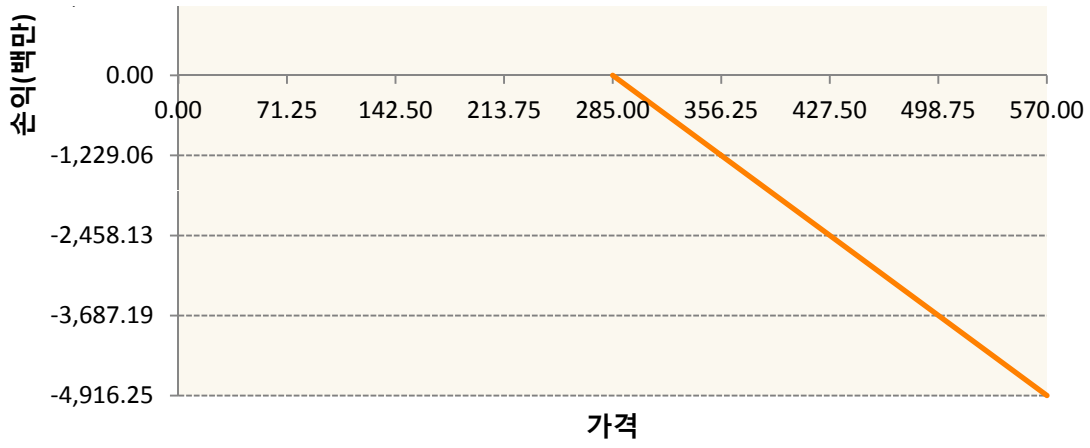
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

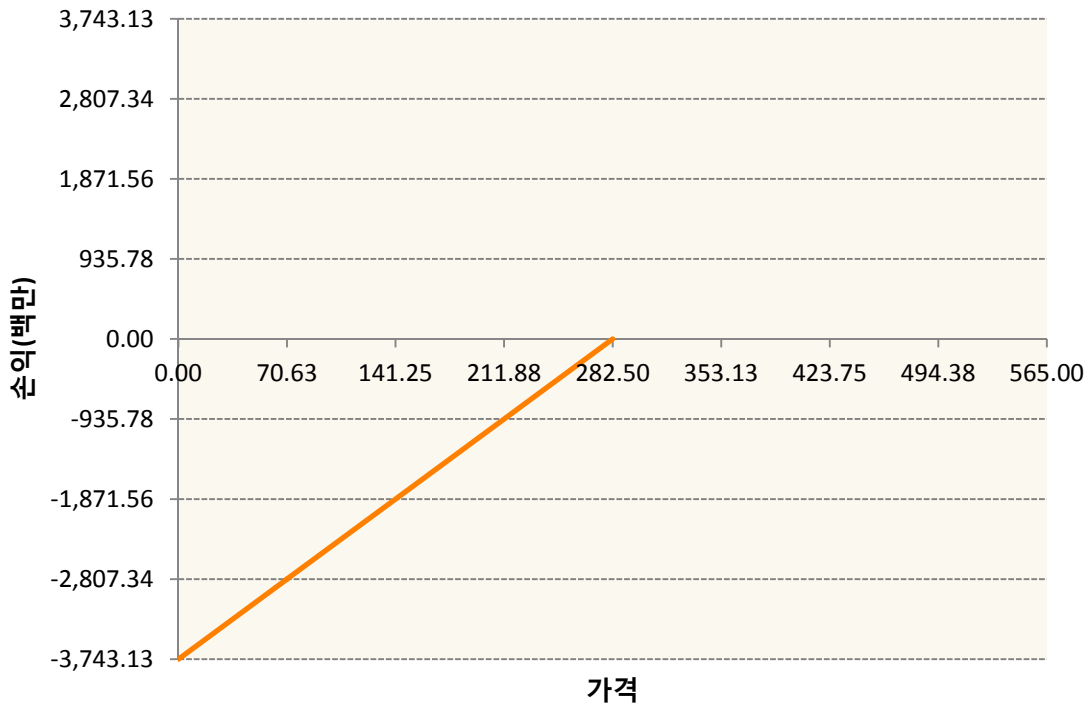


KR4201PC2858-2019-12 콜285

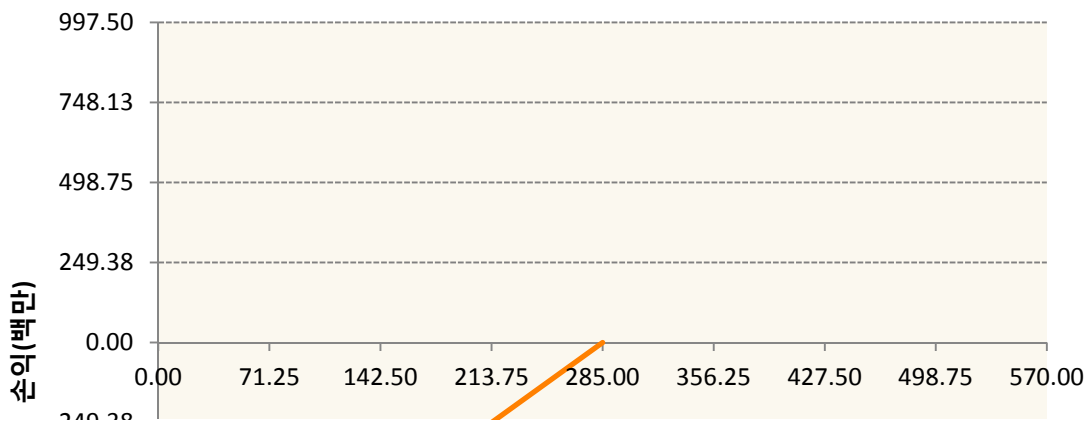




KR4301PC2824-2019-12 풋282.5



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						249
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-249	-249	-249	-249	-249	-249	-249	
-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%	249	249	249	249	249	249	249	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						290
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	92	91	89	87	84	81	77	
-5.33%	87	83	79	74	69	64	58	
-2.67%	69	62	55	48	40	32	24	
0%	28	18	9	0	-9	-18	-28	
2.67%	-45	-53	-62	-71	-80	-89	-98	
5.33%	-145	-151	-157	-164	-171	-179	-187	
8.00%	-263	-266	-270	-274	-279	-284	-290	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						257
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-257	-257	-257	-257	-257	-257	-257
-5.33%	-157	-157	-157	-158	-158	-159	-160
-2.67%	-61	-62	-64	-66	-69	-71	-73
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	36	35	33	31	28	26	24
5.33%	40	39	39	39	38	37	36
8.00%	40	40	40	40	39	39	39
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	-45	-45	-46	-46
-2.67%	-19	-20	-20	-20	-21	-21	-22
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	13	13	12	11	10	10	9
5.33%	15	15	15	15	14	14	14
8.00%	15	15	15	15	15	15	15

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

(단위:백만원)

**1,703**

공시일	2019-11-28
기준일	2019-11-27

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

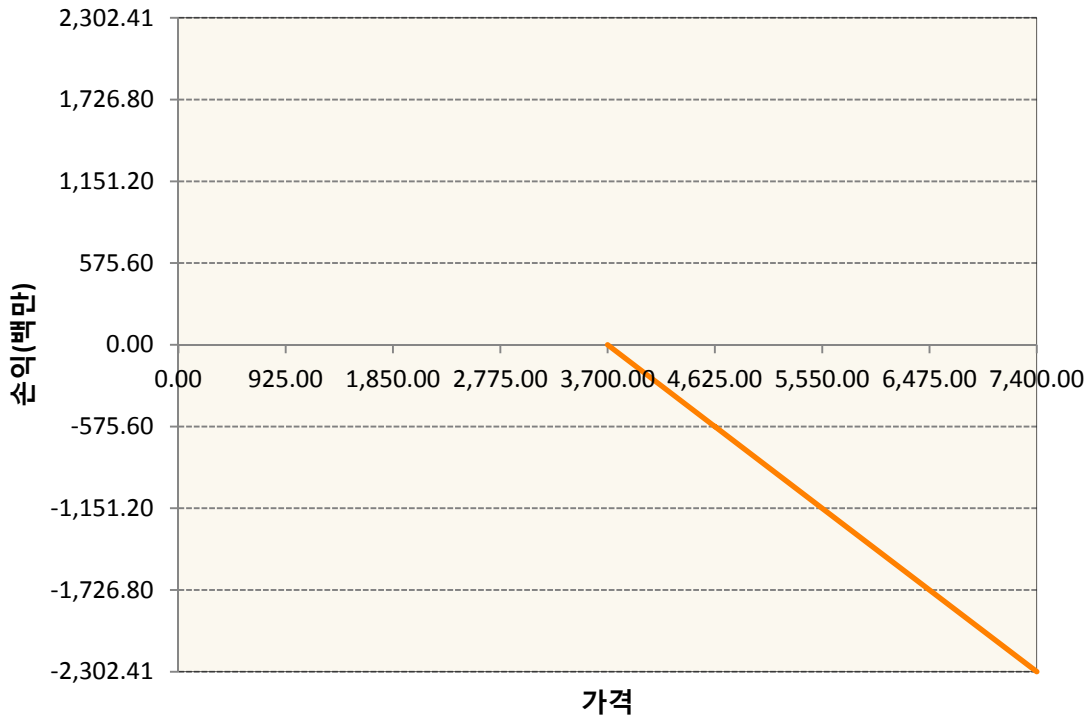
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

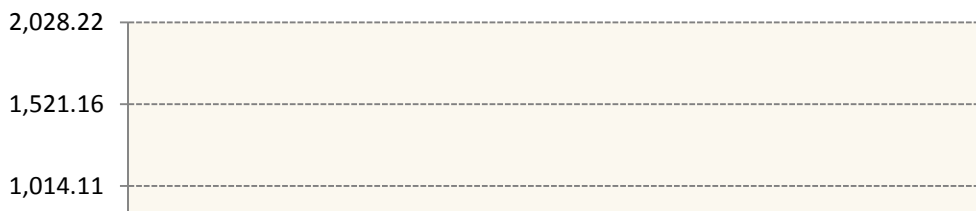
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,296	0	1,296	
누계	유가증권	스왑	17,726	0	17,726	장외
누계	유가증권	옵션	0	8,661	-8,661	장내
누계	통화	선도	2,691	6,093	-3,402	장외

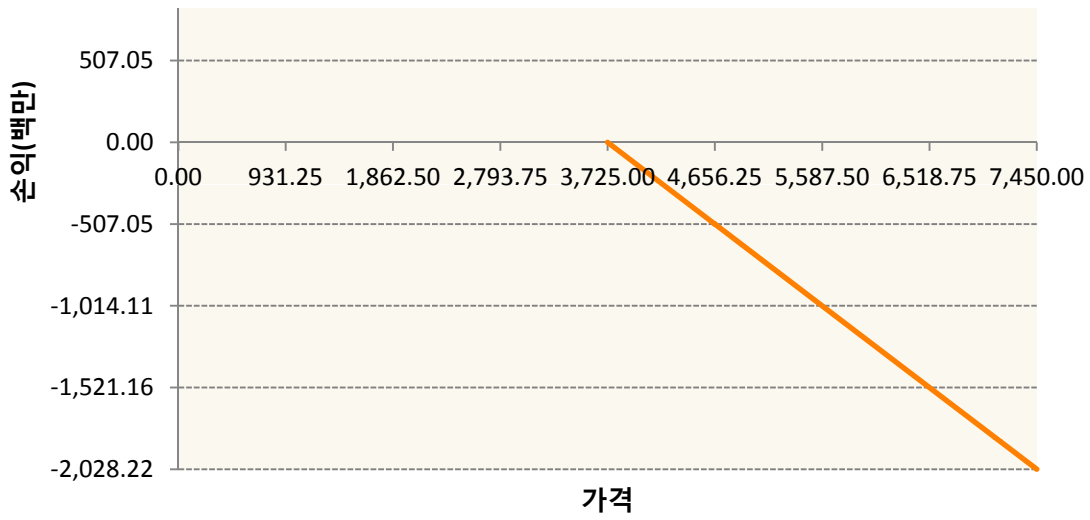
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXZ9-C3700-EURO STOXX 50**

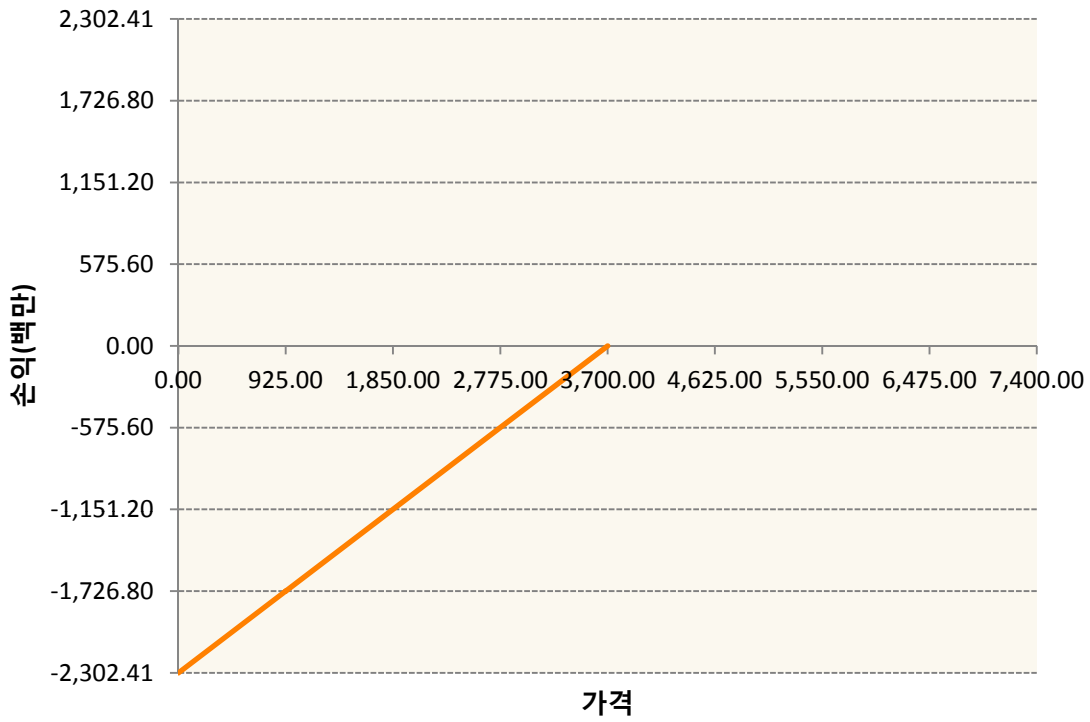


**OESXZ9-C3725-EURO STOXX 50**

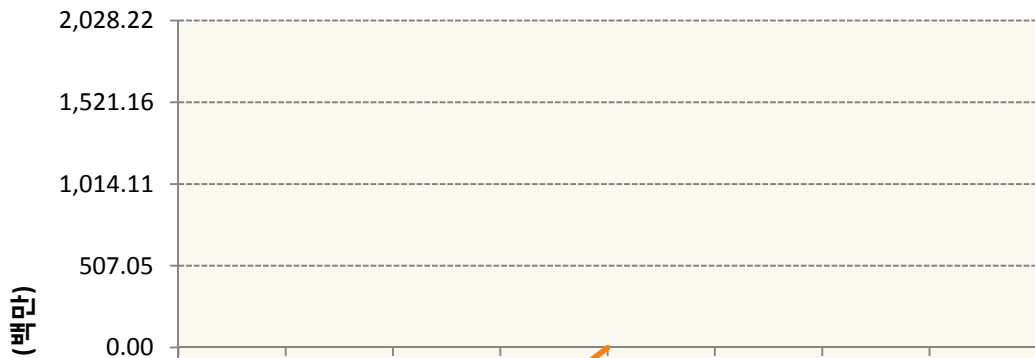


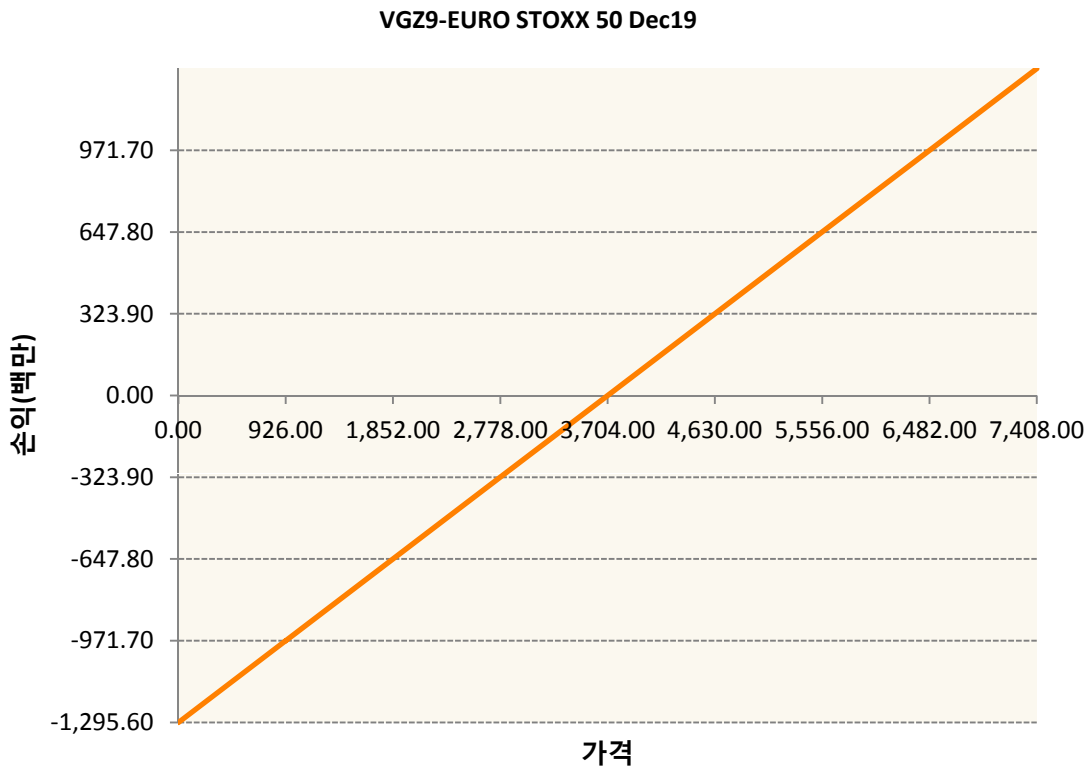
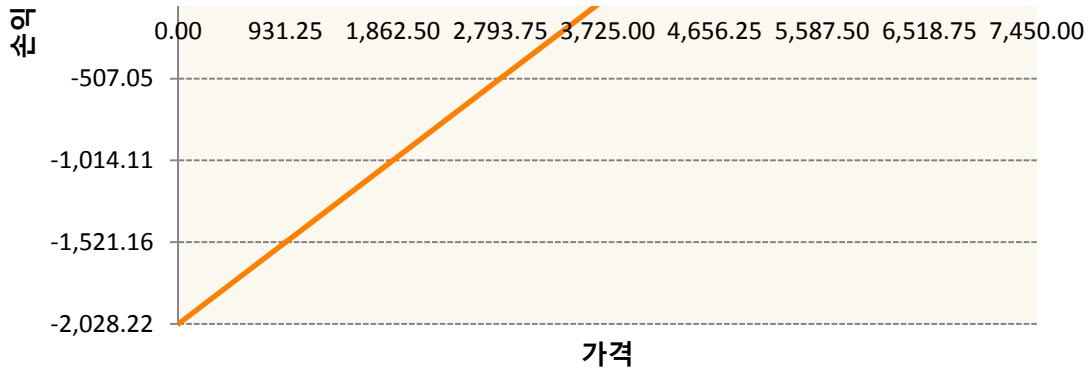


OESXZ9-P3700-EURO STOXX 50



OESXZ9-P3725-EURO STOXX 50





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	24
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)

880



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

(단위:백만원)

922



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

(단위:백만원)

81



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

(단위:백만원)

125



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

(단위:백만원)

40

공시일	2019-11-28
기준일	2019-11-27

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

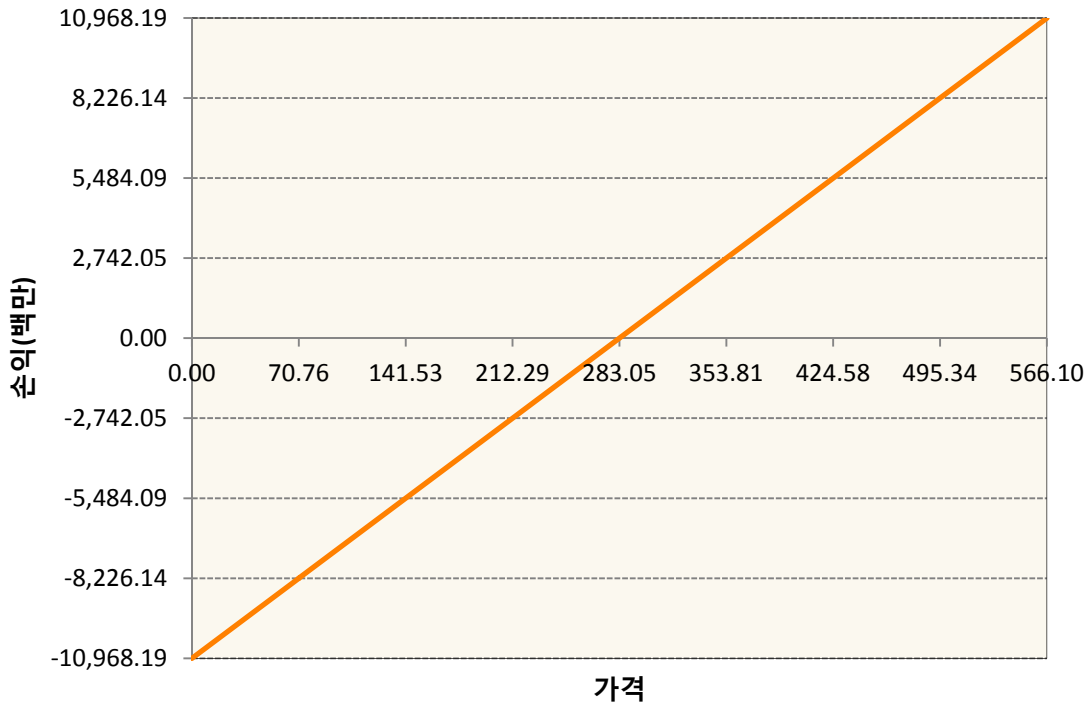
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

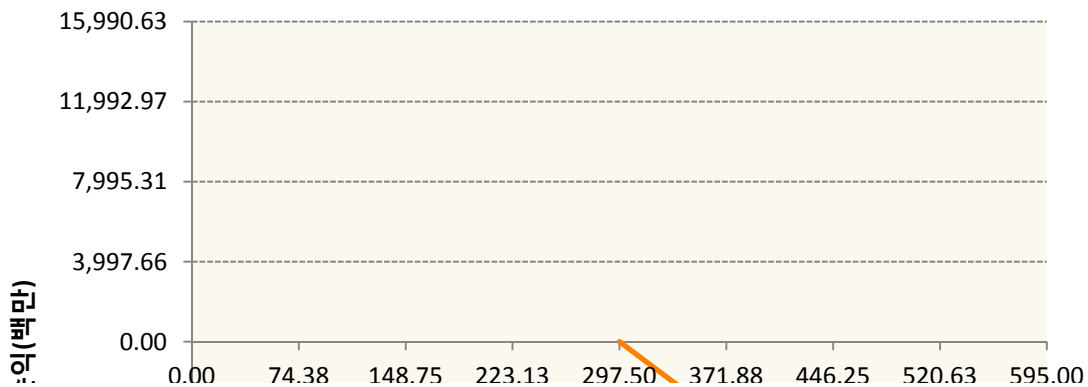
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,968	0	10,968	장내
누계	유가증권	옵션	1,277	21,241	-19,964	장내

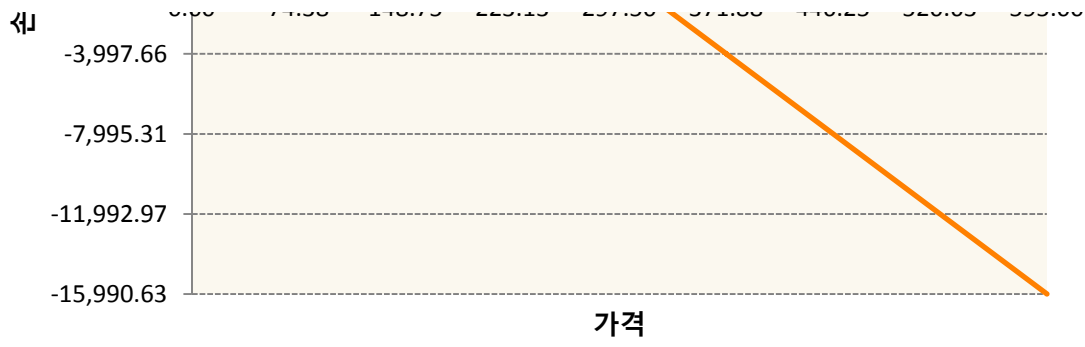
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

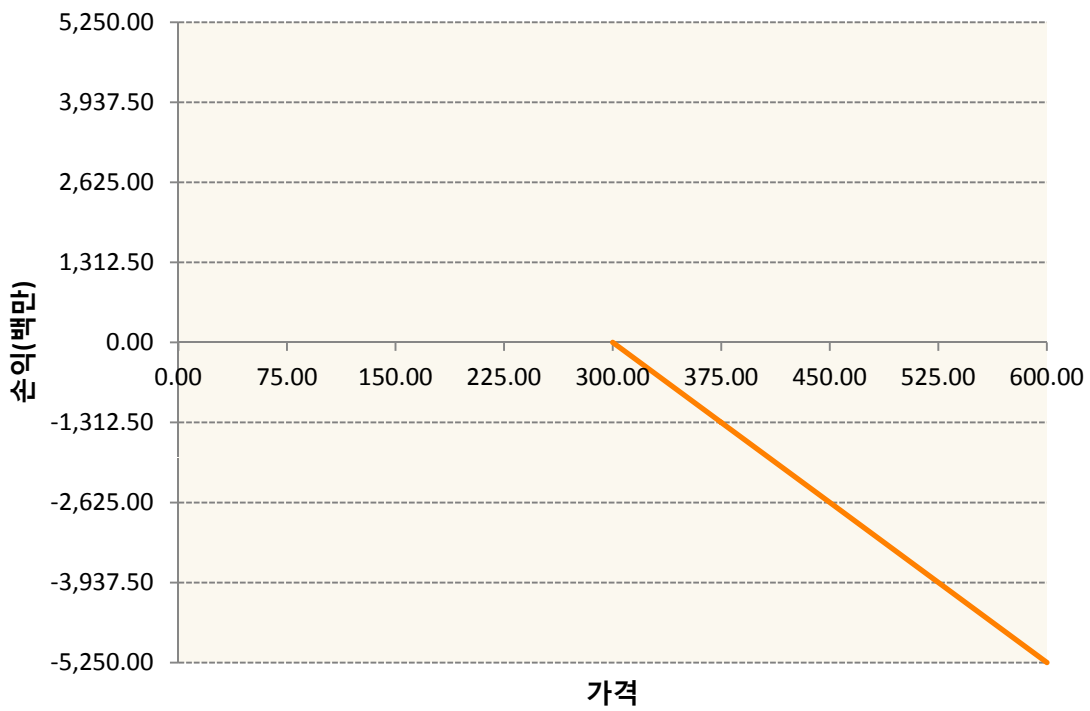


KR4201PC2973-2019-12 콜297.5

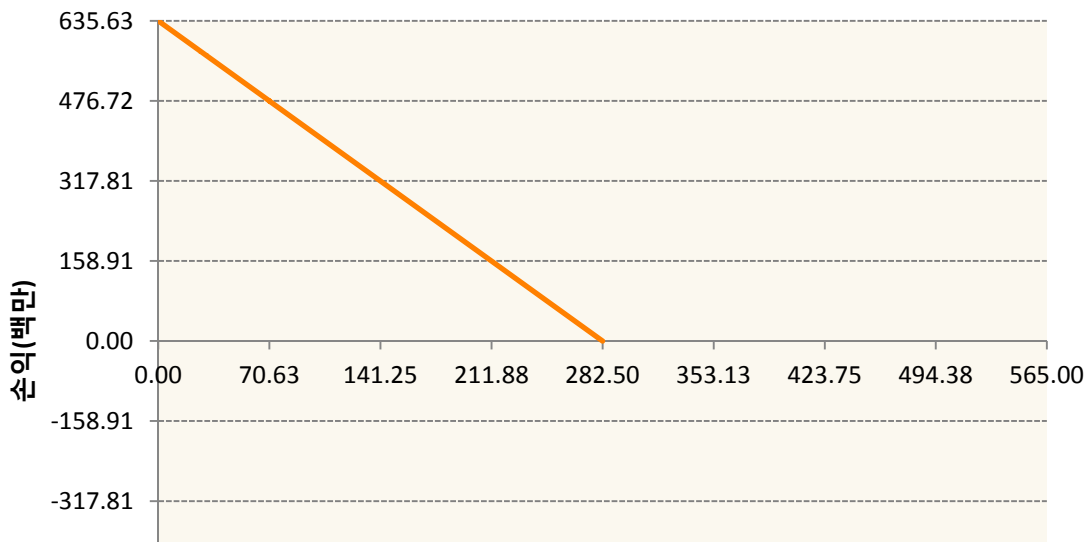


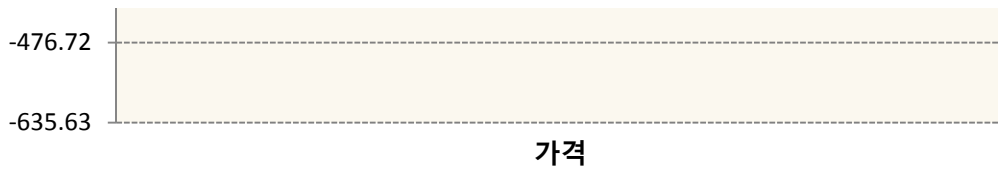


KR4201PC3005-2019-12 콜300

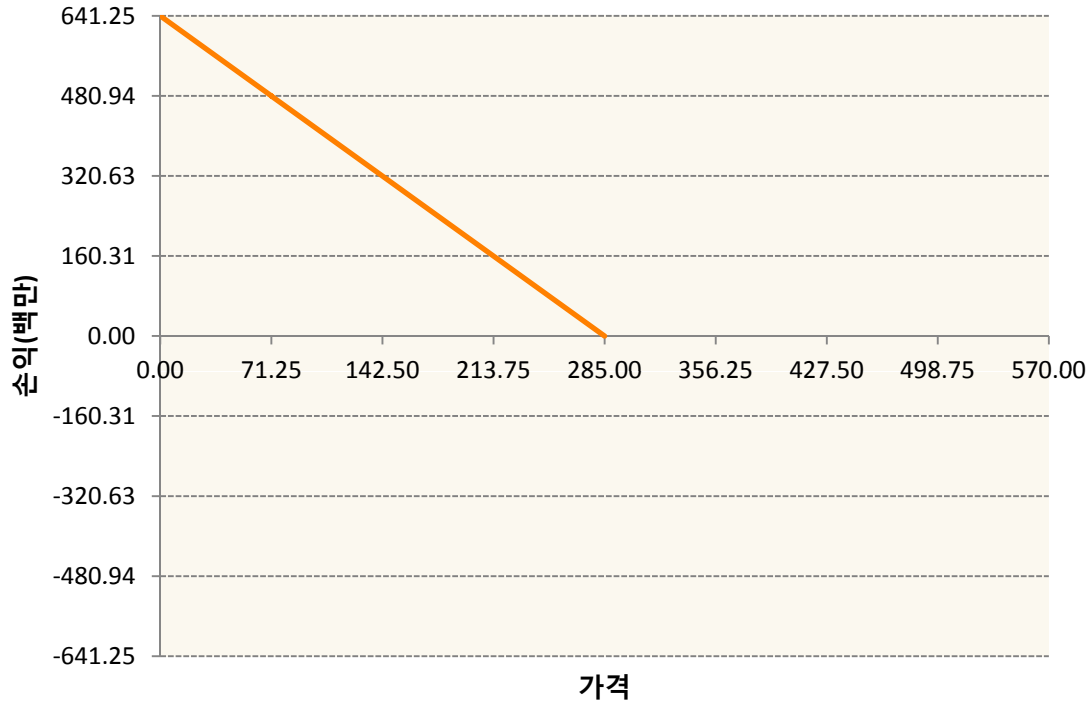


KR4301PC2824-2019-12 풋282.5





KR4301PC2857-2019-12 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						877
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-877	-877	-877	-877	-877	-877	-877	
-5.33%	-585	-585	-585	-585	-585	-585	-585	
-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%	585	585	585	585	585	585	585	
8.00%	877	877	877	877	877	877	877	
KR4201PC2973		2019-12 콜297.5						612
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	91	90	89	88	86	83	78	
-5.33%	89	87	84	80	74	67	58	
-2.67%	82	75	67	56	44	30	14	

0%	52	37	19	0	-20	-42	-65
2.67%	-28	-54	-81	-108	-135	-163	-191
5.33%	-191	-221	-252	-282	-312	-343	-373
8.00%	-447	-473	-500	-527	-555	-583	-612
KR4201PC3005                      2019-12 콜300							180
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	23	22	22	22	21	21	20
-5.33%	22	22	21	20	19	17	14
-2.67%	21	19	17	14	11	7	3
0%	14	10	5	0	-6	-12	-19
2.67%	-6	-13	-21	-29	-37	-46	-55
5.33%	-49	-59	-69	-78	-88	-98	-108
8.00%	-122	-132	-141	-151	-160	-170	-180
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%	10	11	11	11	12	12	12
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-6	-6	-6	-5	-5	-4	-4
5.33%	-7	-7	-7	-7	-6	-6	-6
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
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	29
-2.67%	12	13	13	13	13	14	14
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-8	-8	-8	-7	-7	-6	-6
5.33%	-10	-10	-10	-9	-9	-9	-9
8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10

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

(단위:백만원)

**1,362**

공시일	2019-11-28
기준일	2019-11-27

## 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	206,106	0	206,106	

### 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	2019-11-28
기준일	2019-11-27

## 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	215,117	0	215,117	

### 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	2019-11-28
기준일	2019-11-27

## 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	546,284	0	546,284	
누계	통화	선도	0	608,730	-608,730	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		1,695
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,803
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,413
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,516
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		942
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		942
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,884
FX21019V04 KRW/USD 29-11-19E		1,884
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		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		942
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		471
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		942
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		1,544
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		1,884
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		3,240

FX21019X02 KRW/USD 26-12-19E	4,746
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E	4,803
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	188
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,825
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,825

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

(단위:백만원)

**15,309**



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

(단위:백만원)

188

공시일	2019-11-28
기준일	2019-11-27

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

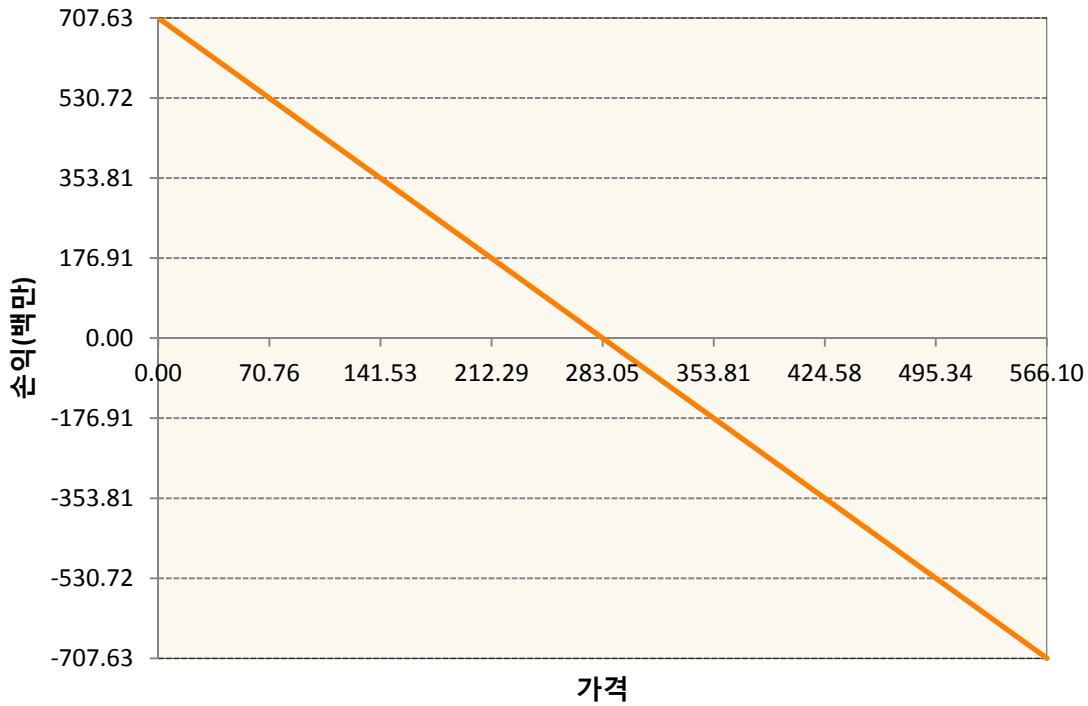
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

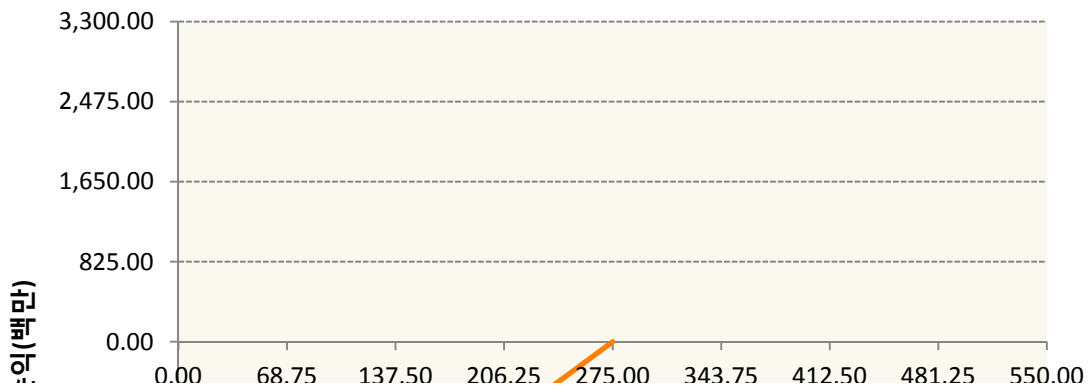
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	708	-708	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,994	-3,994	장내

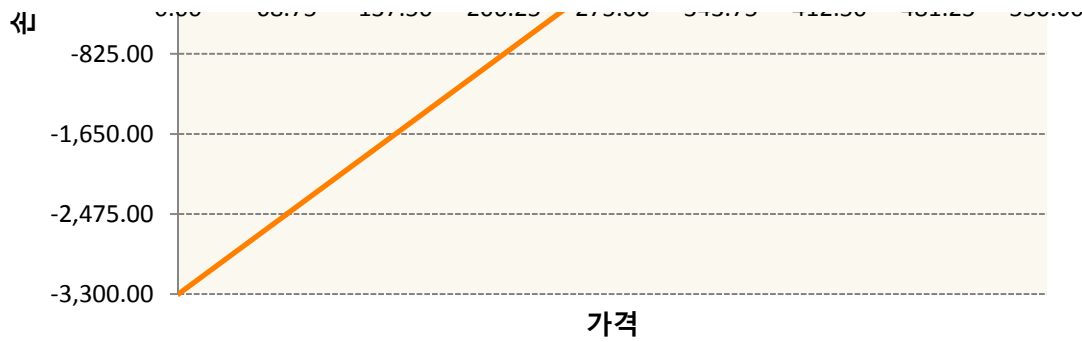
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

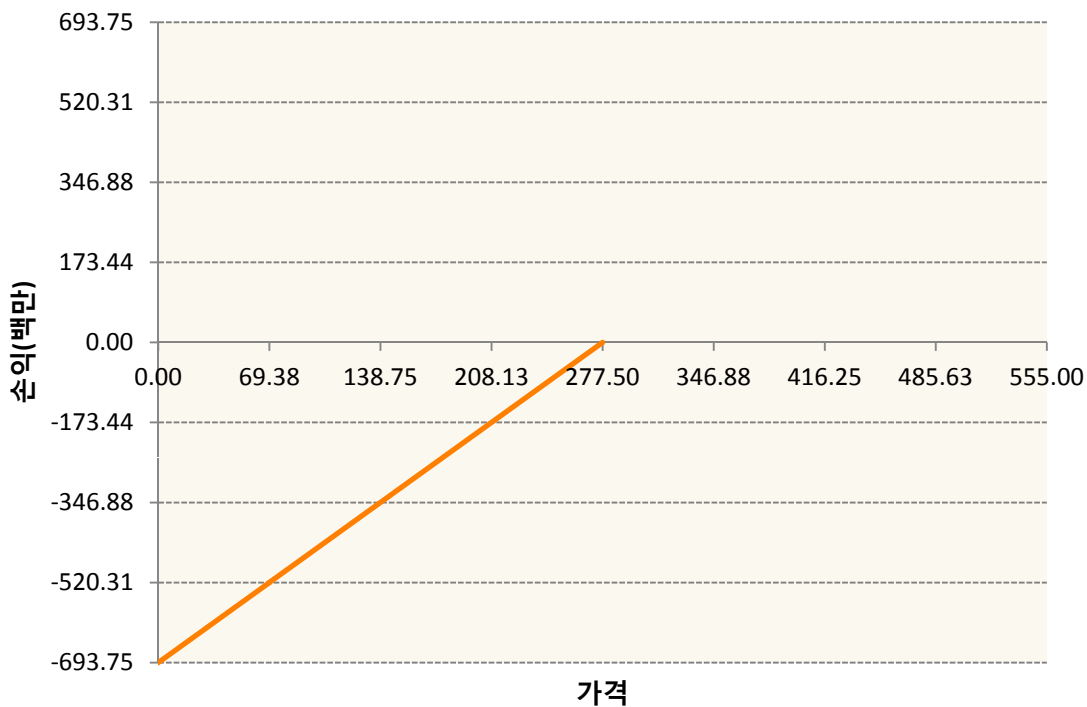


KR4301PC2758-2019-12 풋275





KR4301PC2774-2019-12 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						57
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	57	57	57	57	57	57	57	
-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%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57	
KR4301PC2758		2019-12 풋275						173
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-171	-171	-171	-172	-172	-173	-173
-5.33%	-83	-85	-86	-88	-90	-92	-94
-2.67%	-18	-21	-25	-28	-31	-34	-37
0%	5	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	8	7	7	7	6	6	5
5.33%	8	8	8	8	8	7	7
8.00%	8	8	8	8	8	8	8

KR4301PC2774                      2019-12 풋277.5                      41

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
-5.33%	-22	-22	-22	-23	-23	-23	-24
-2.67%	-6	-7	-7	-8	-9	-9	-10
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	3	3	3	2	2	2	2
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

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

(단위:백만원)

**233**

공시일	2019-11-28
기준일	2019-11-27

## 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	15,117	0	15,117	
누계	통화	선도	0	18,859	-18,859	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
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		293

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

(단위:백만원)

474
-----

공시일	2019-11-28
기준일	2019-11-27

## 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	2019-11-28
기준일	2019-11-27

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

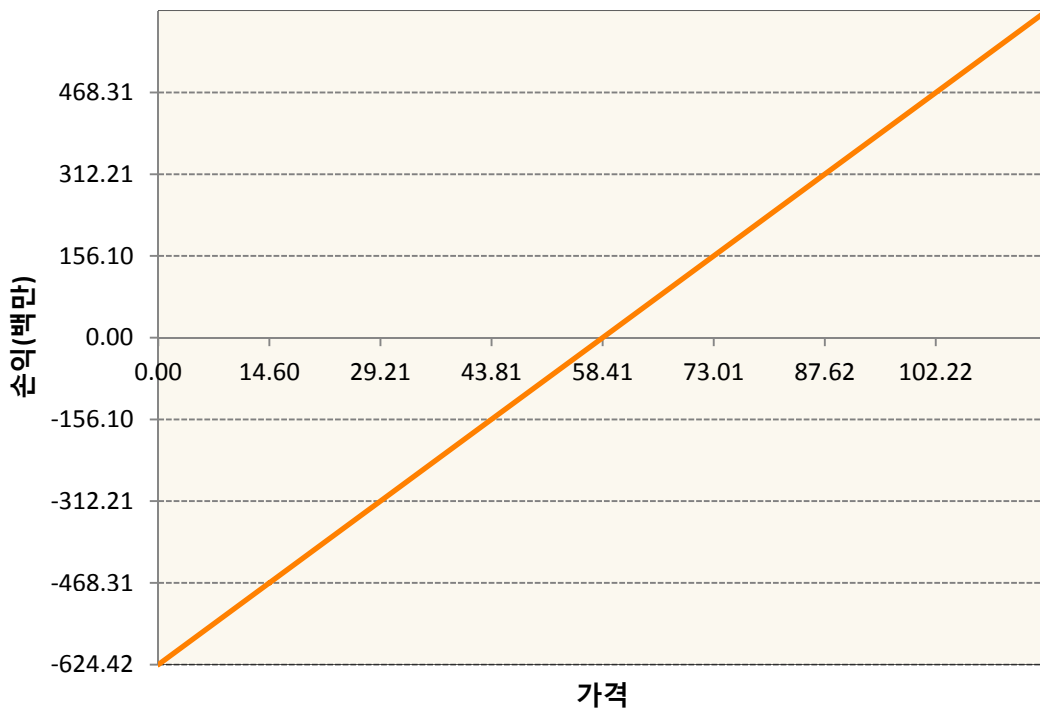
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

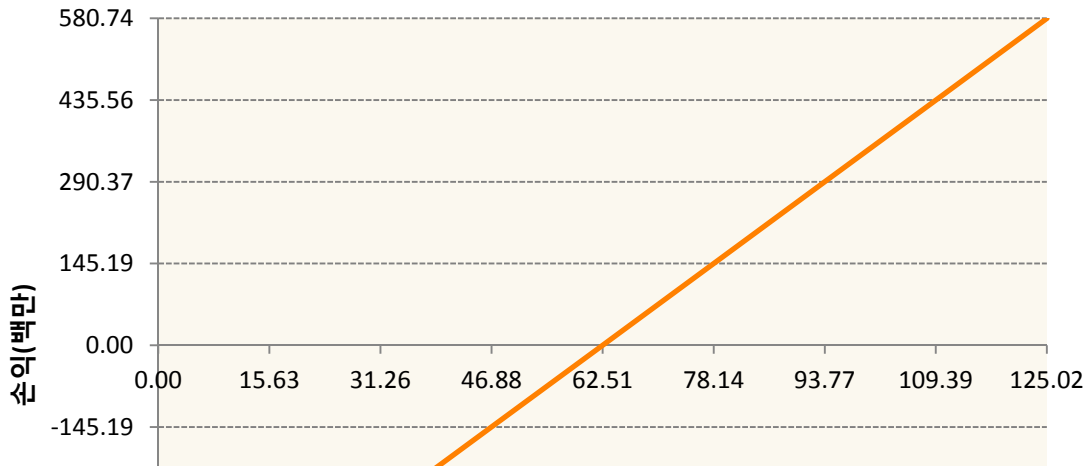
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,497	294	2,203	

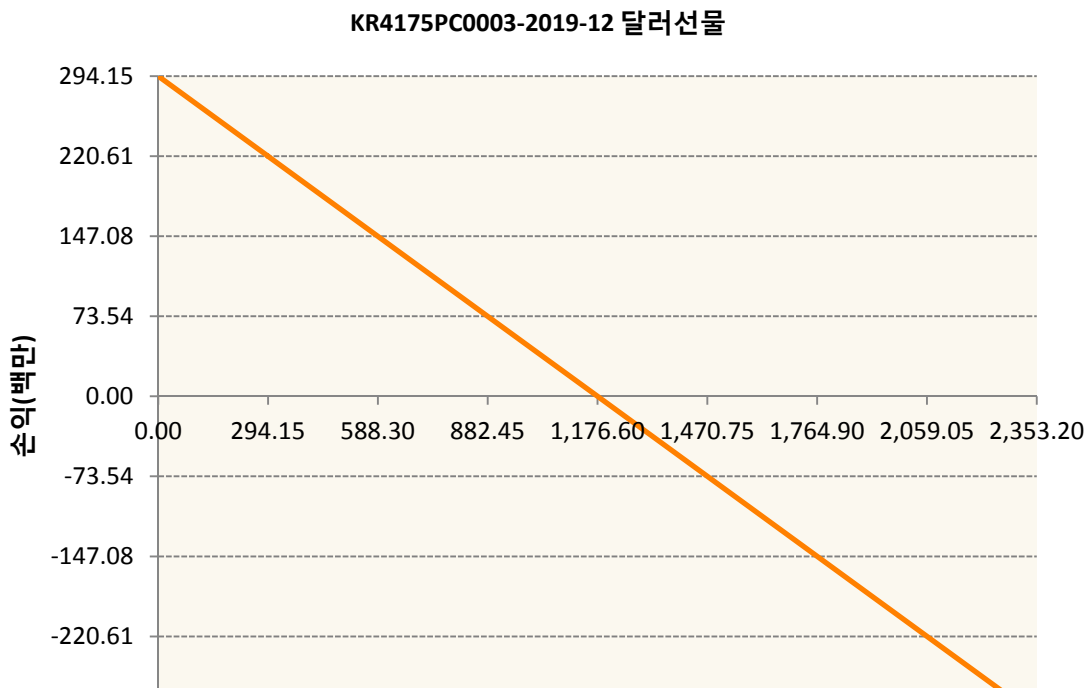
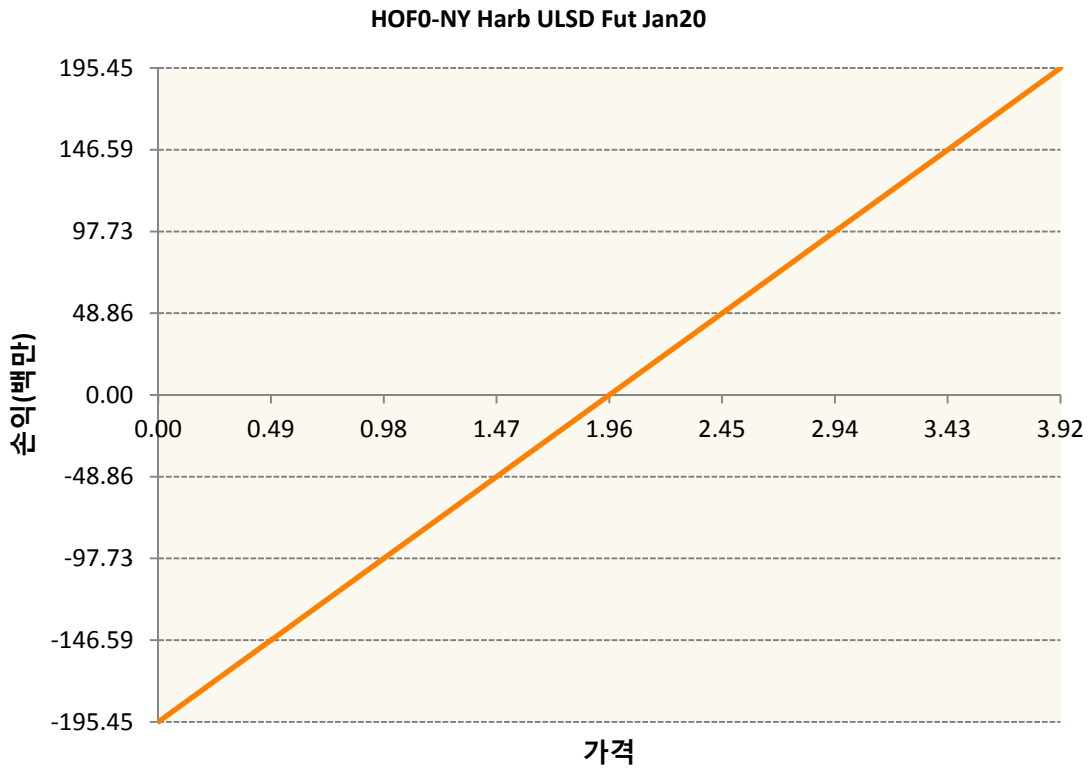
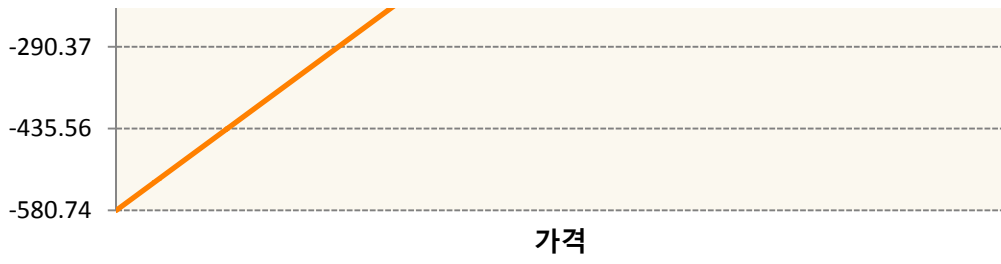
### 2. 만기시점의 손익구조

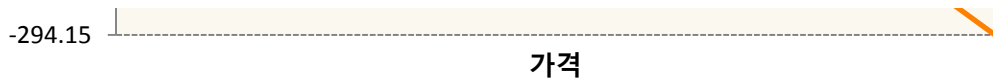
CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20



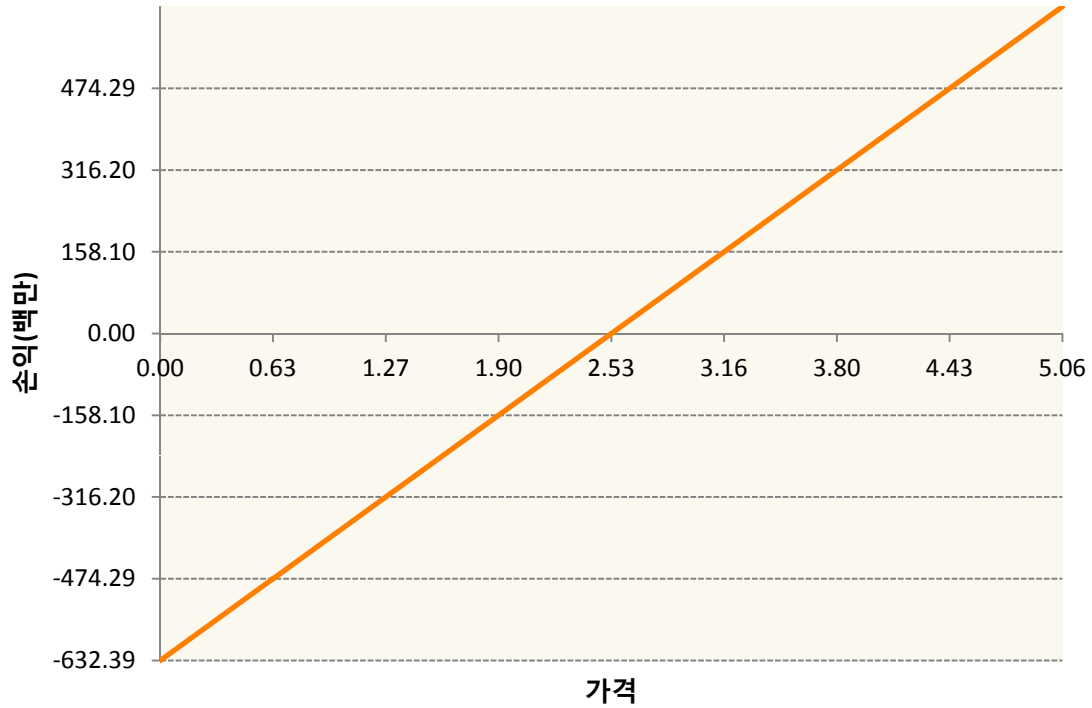
COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20



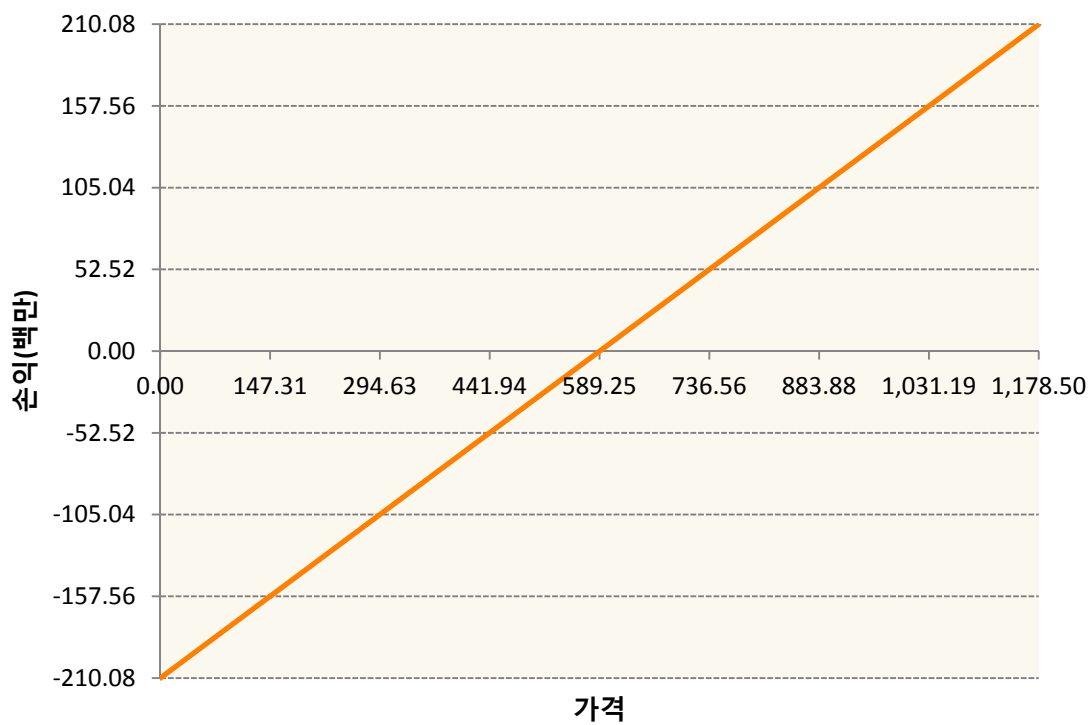




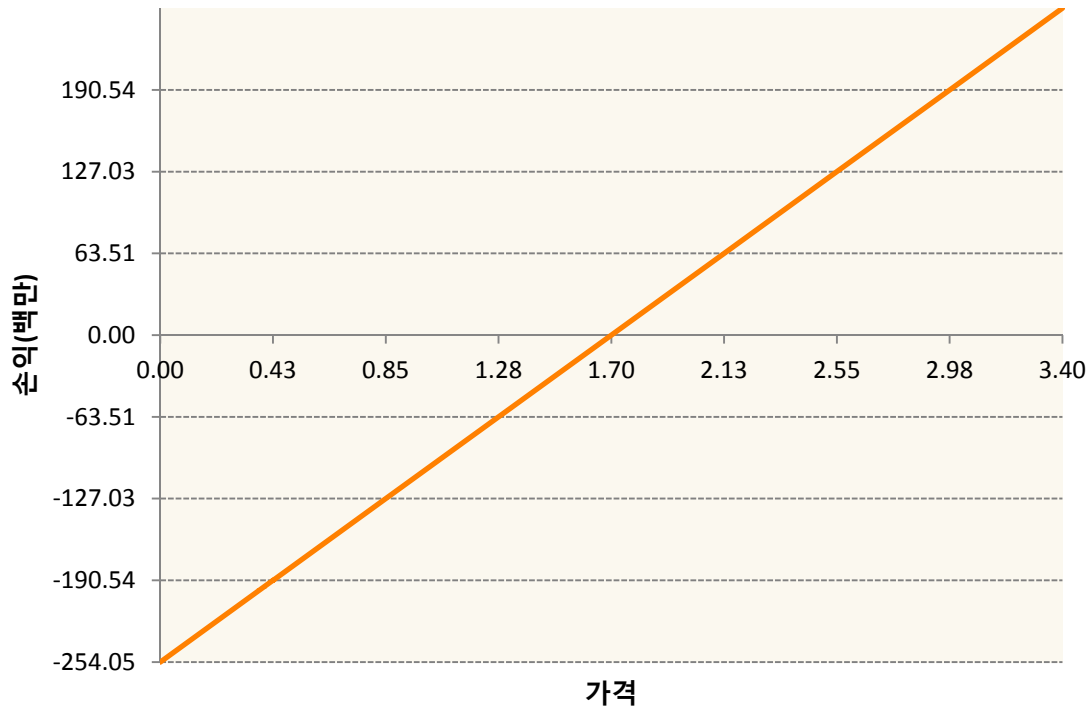
NGF20-NATURAL GAS FUTR Jan20



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	51
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	17
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	20

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

(단위:백만원)

412

공시일	2019-11-28
기준일	2019-11-27

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

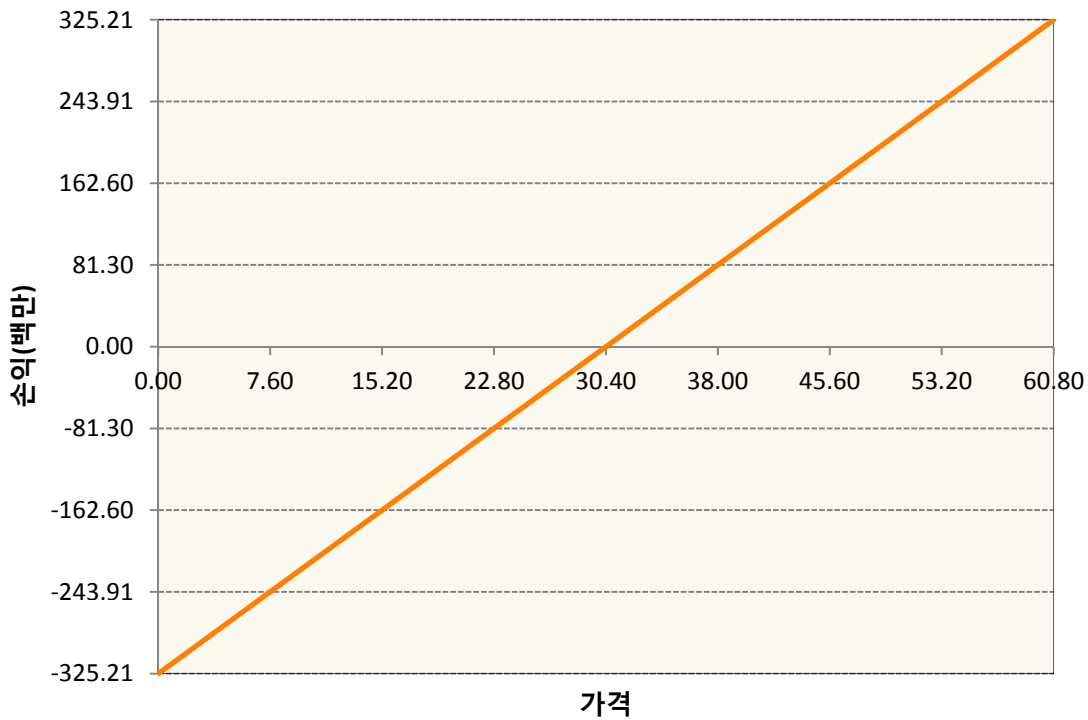
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

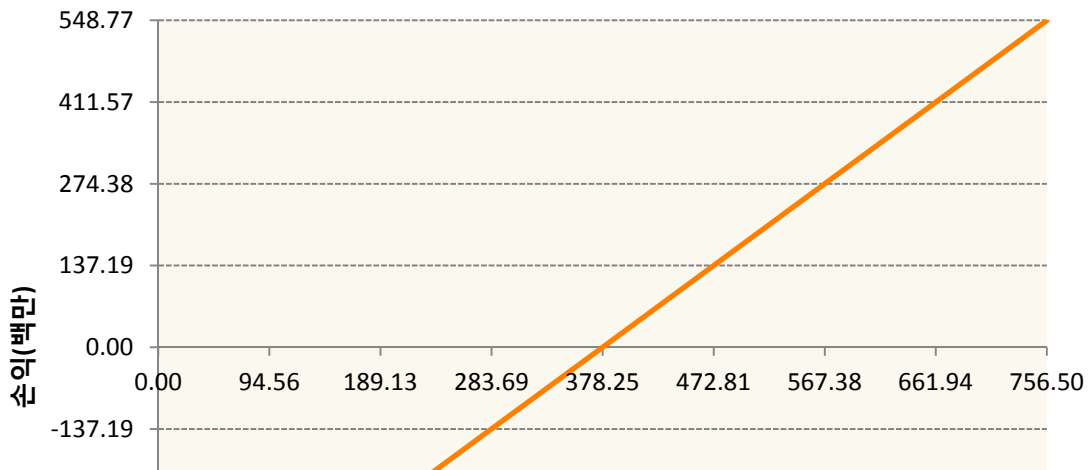
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,805	94	2,711	

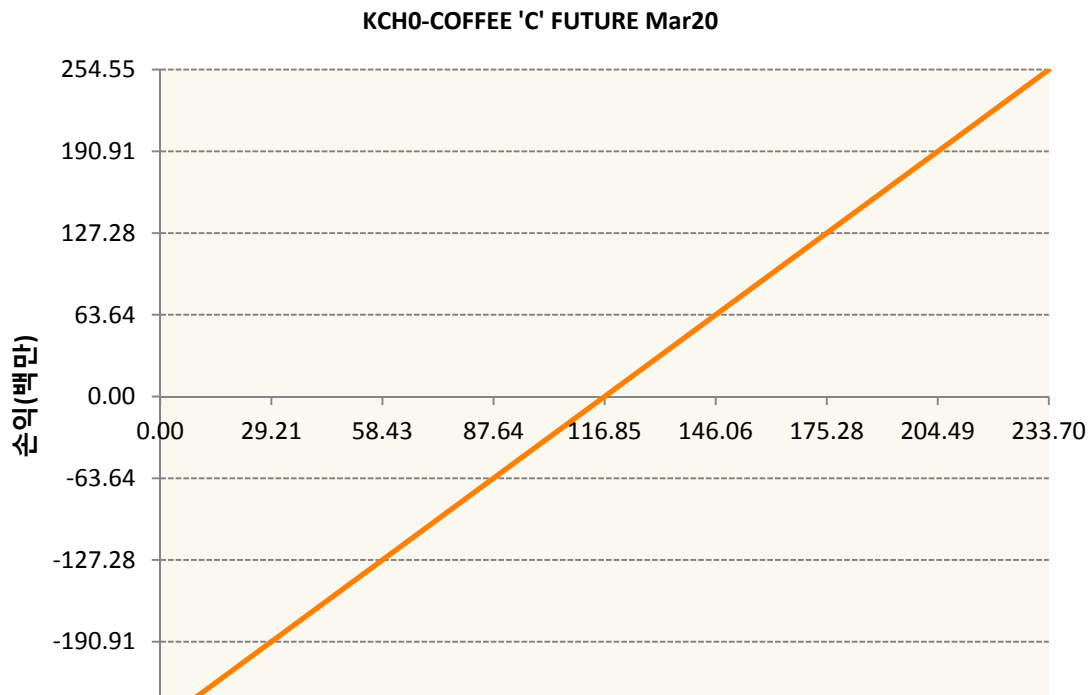
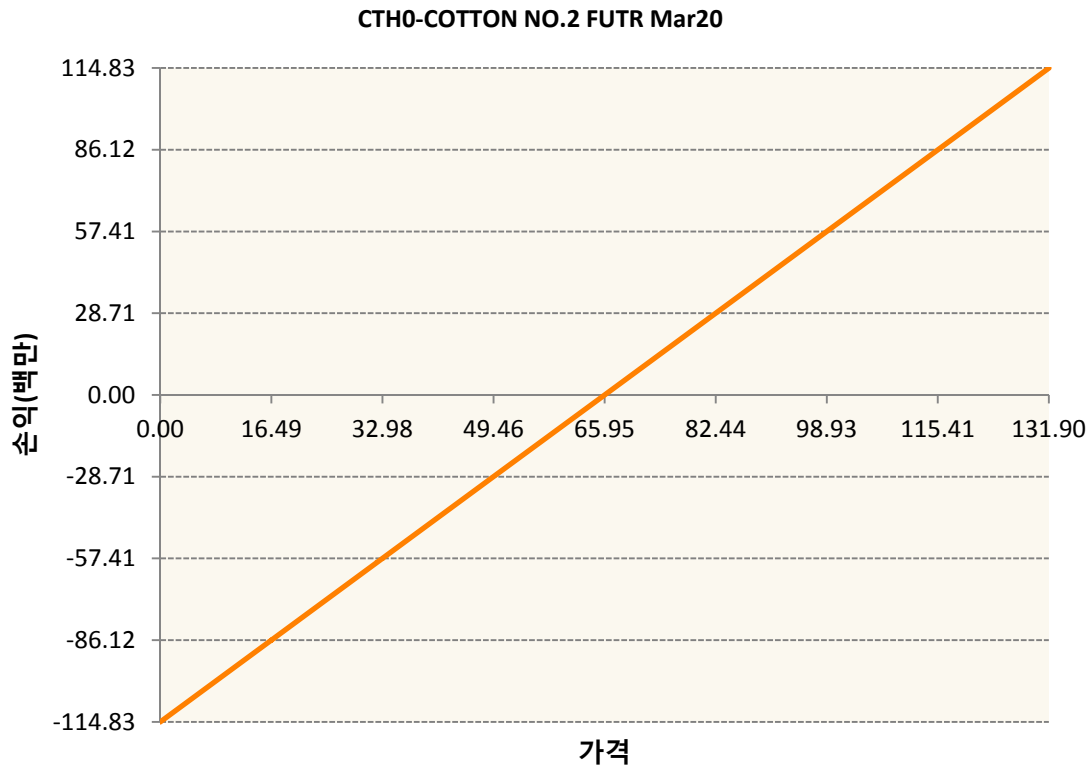
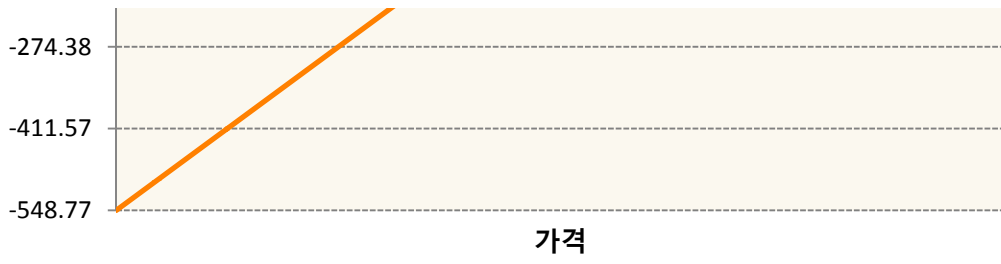
### 2. 만기시점의 손익구조

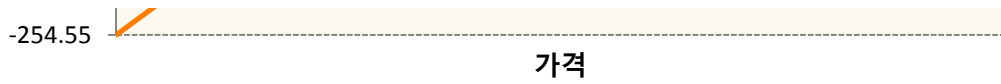
**BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20**



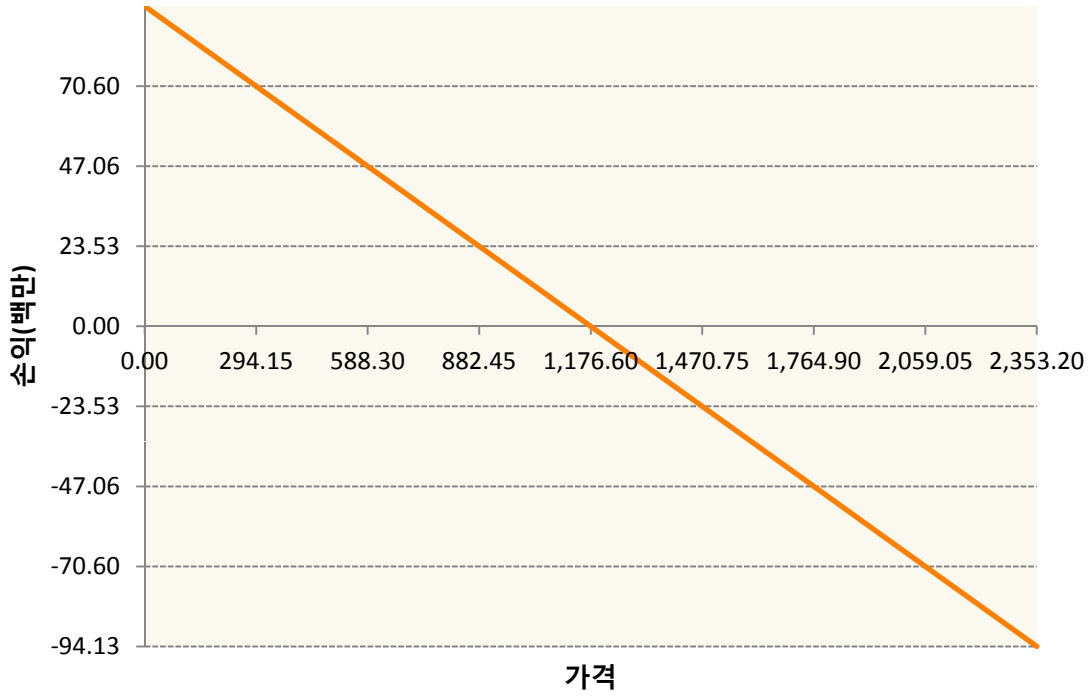
**CH0-CORN FUTURE Mar20**



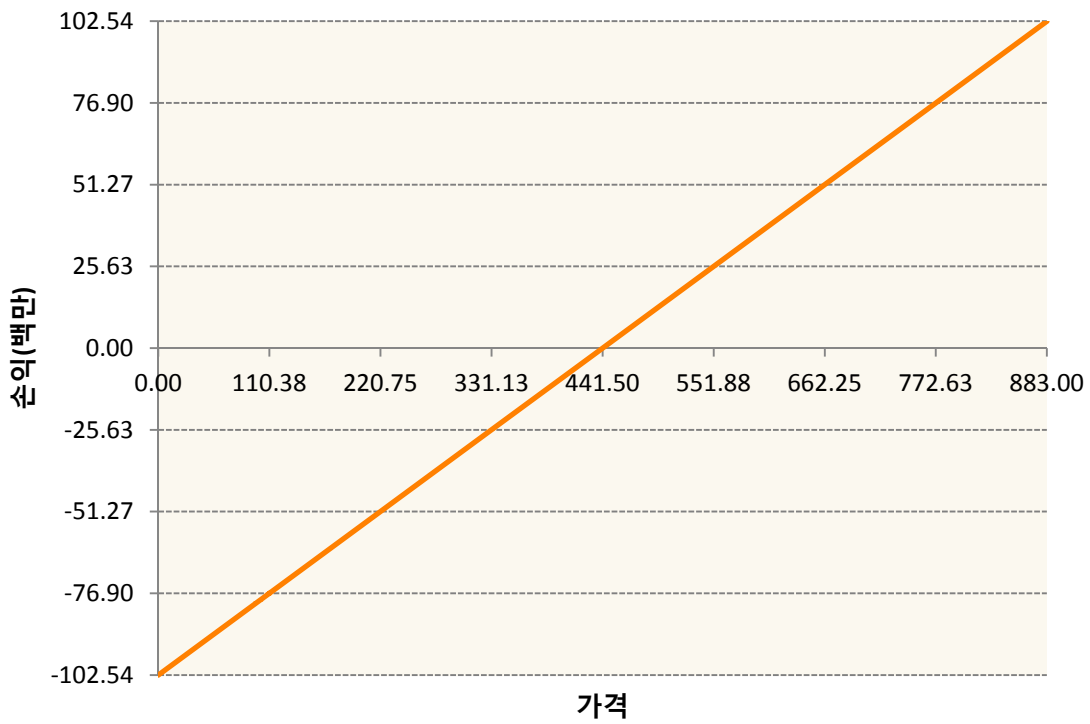




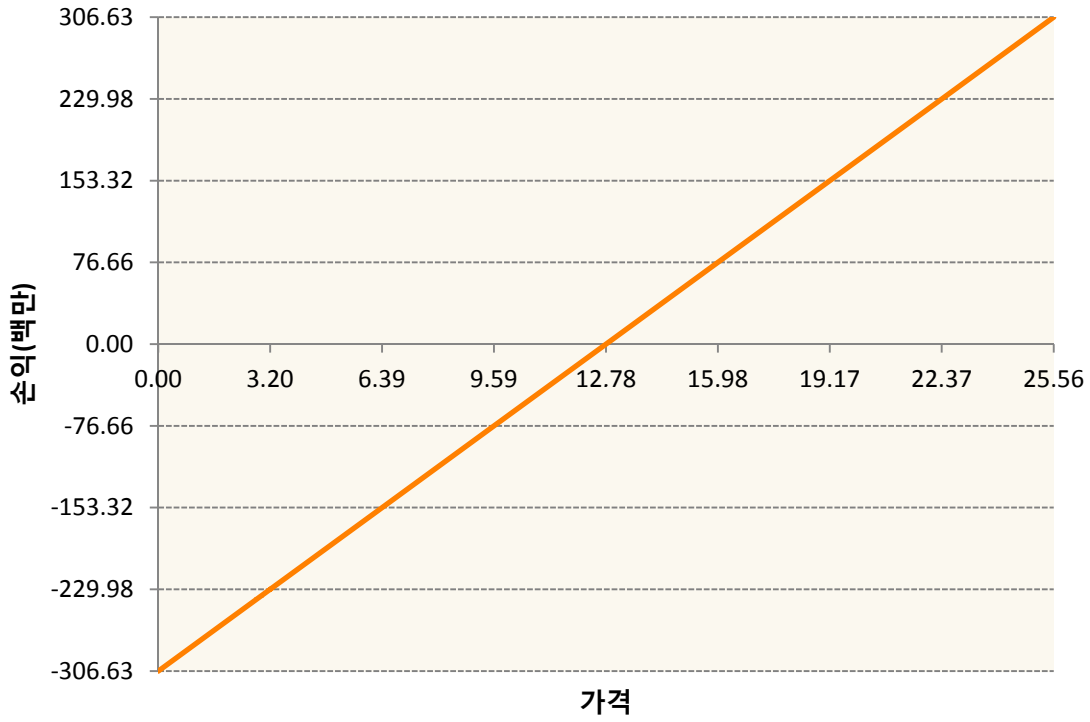
KR4175PC0003-2019-12 달러선물



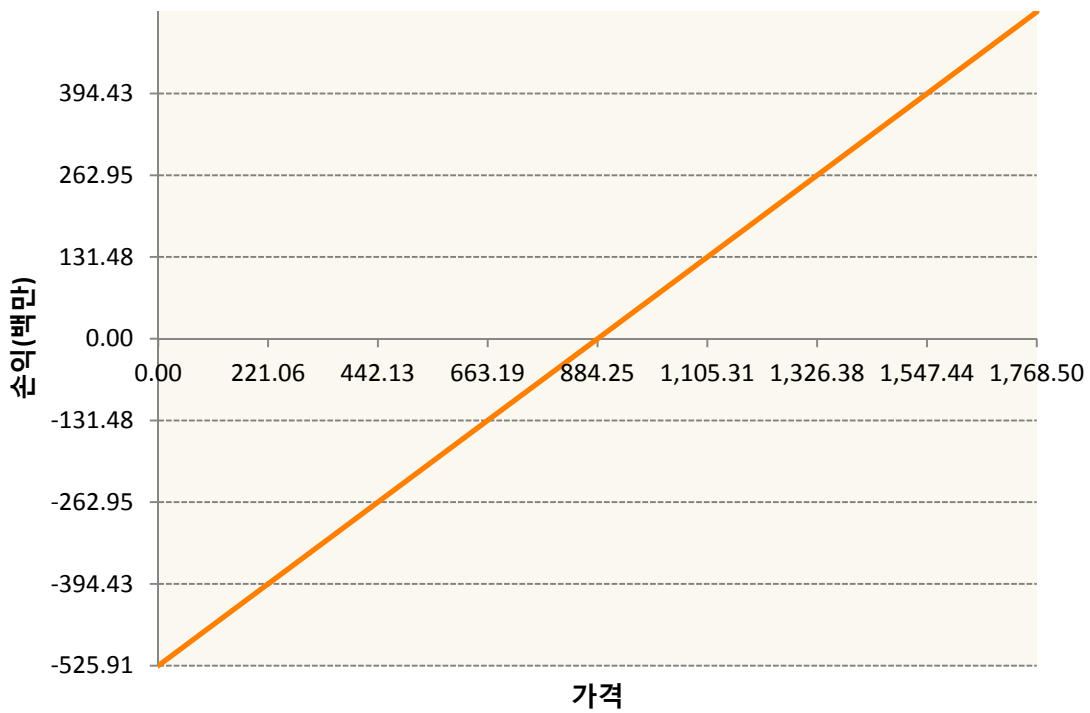
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



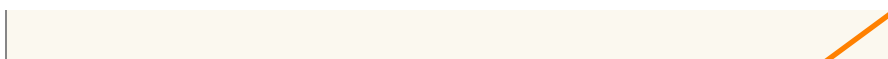
SBH0-Sugar Mar20

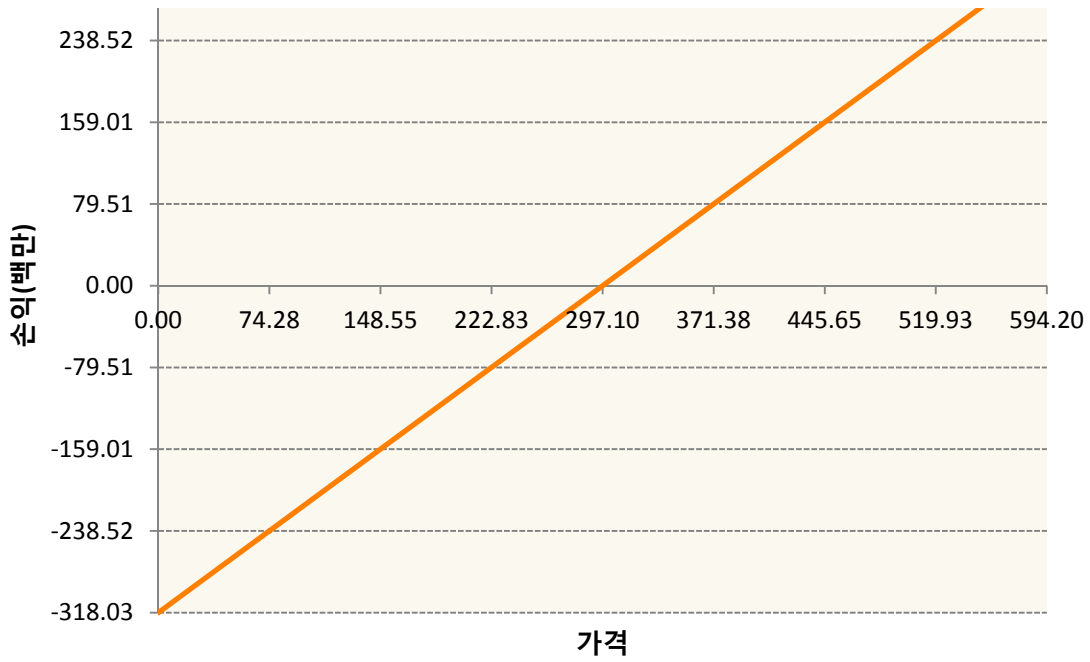


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20

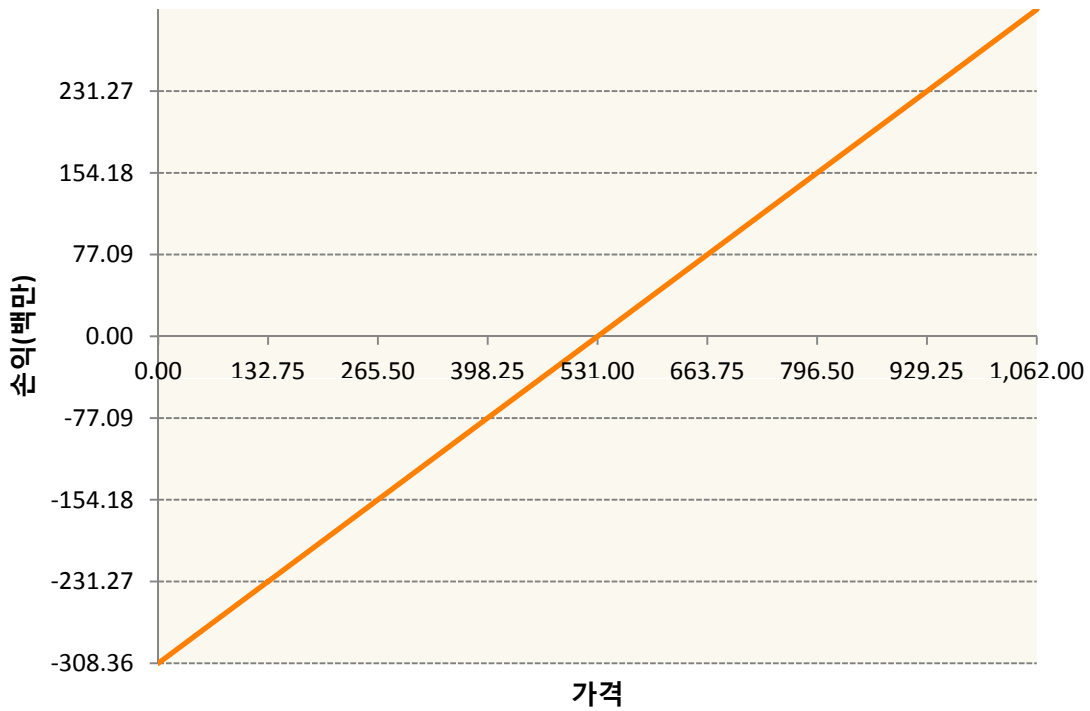


SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





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	20
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	25
WH0	WHEAT FUTURE(CBT) Mar20	25

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

(단위:백만원)

**247**