

공시일	2019-11-29
기준일	2019-11-28

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	2019-11-29
기준일	2019-11-28

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

1,102

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

632

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-11-29
기준일	2019-11-28

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)

732

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-11-29
기준일	2019-11-28

유로인덱스모(주식-파생형)

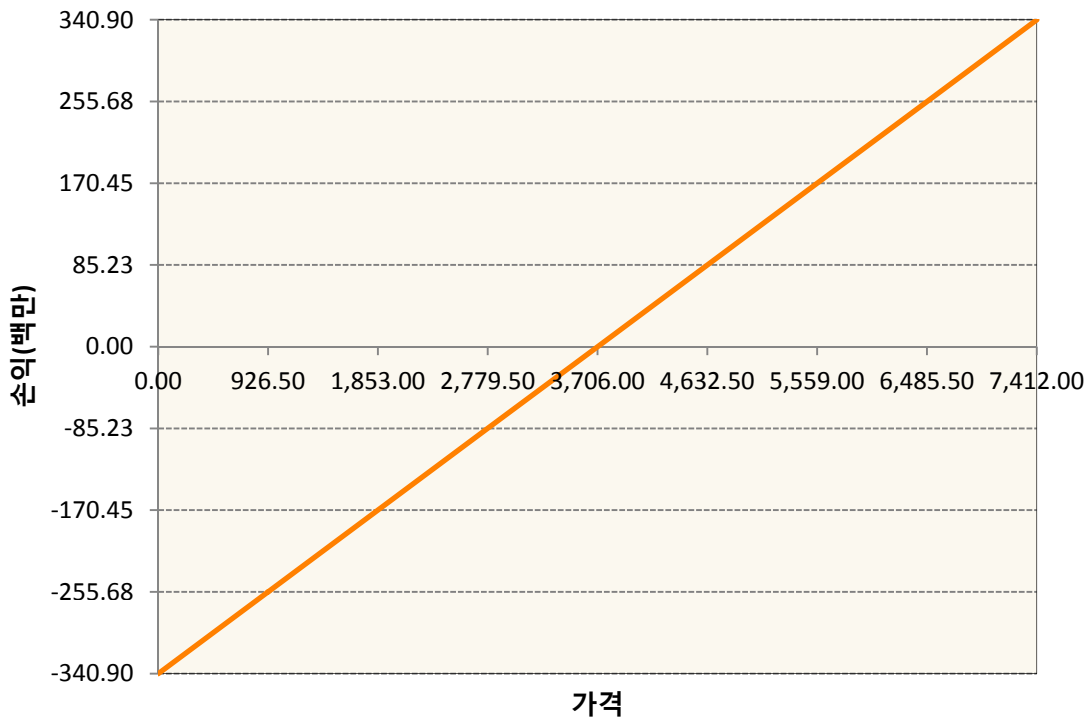
1. 계약금액

(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	2019-11-29
기준일	2019-11-28

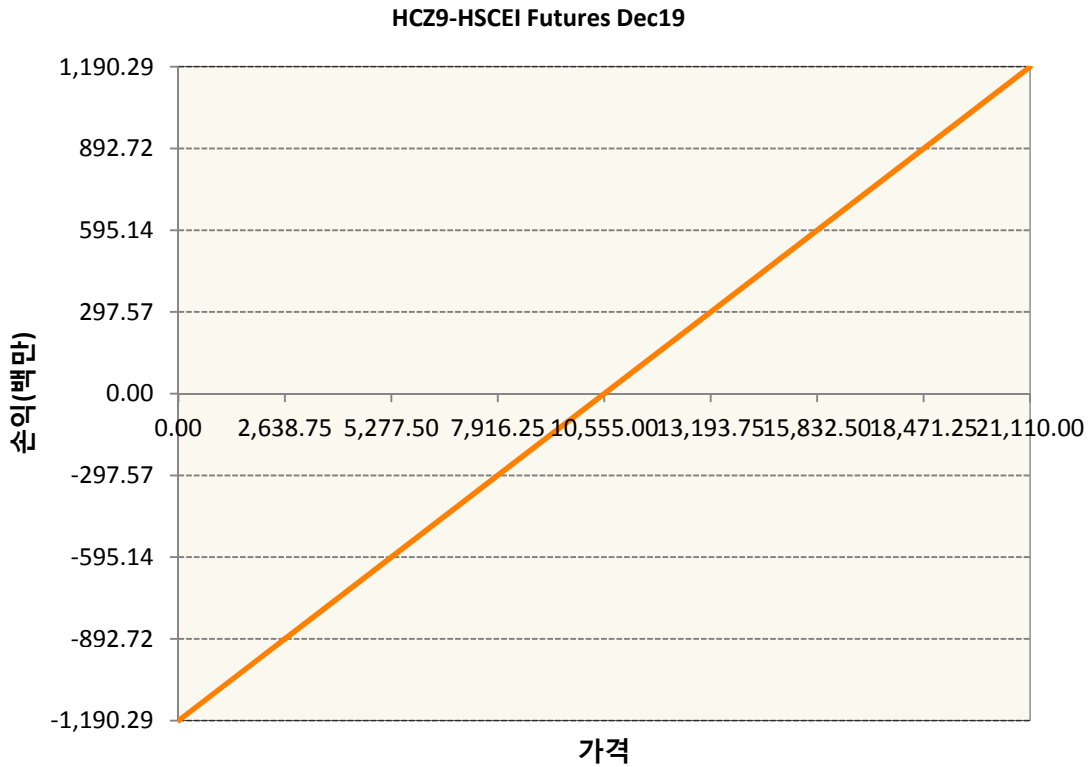
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,190	0	1,190	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ9	HSCEI Futures Dec19	95
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

86

공시일	2019-11-29
기준일	2019-11-28

커버드콜모(주식혼합-파생형)

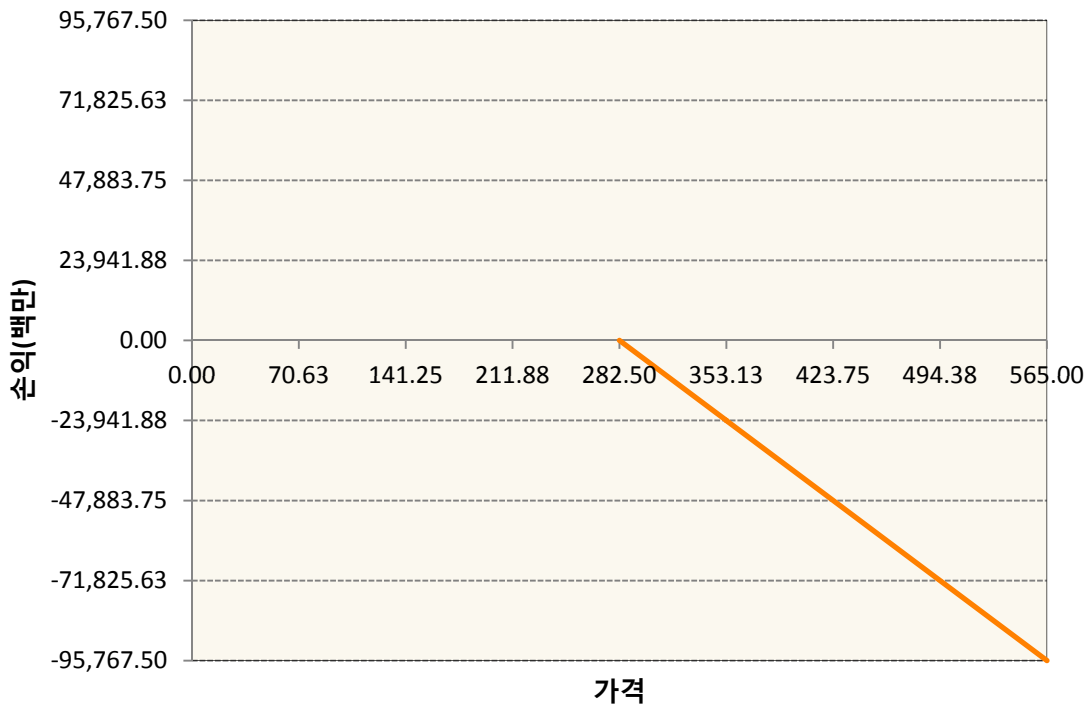
1. 계약금액

(단위:백만원)

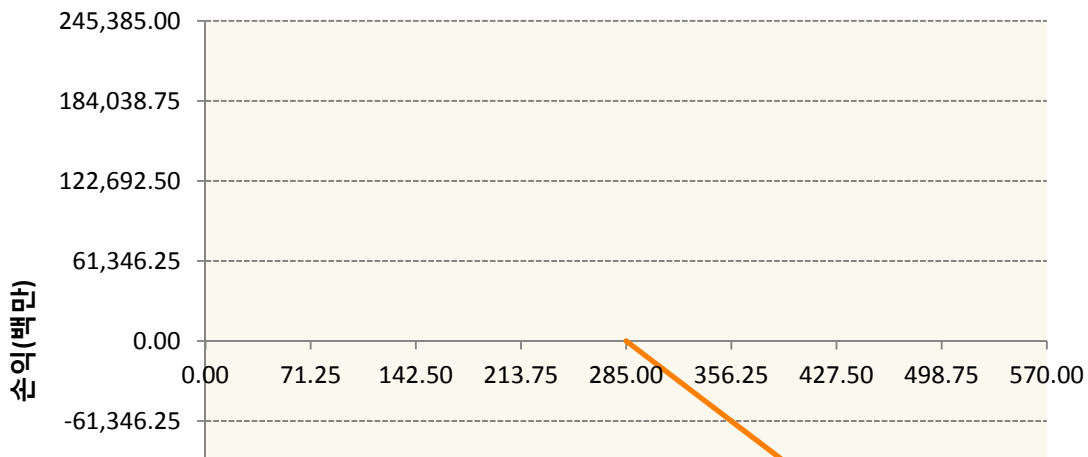
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	498,456	-498,456	장내

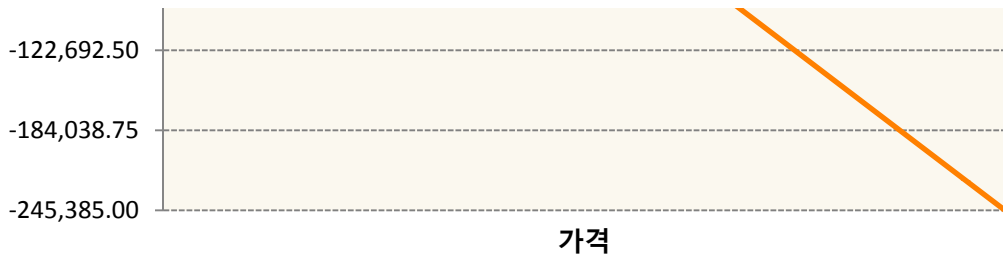
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PC2825-2019-12 콜282.5

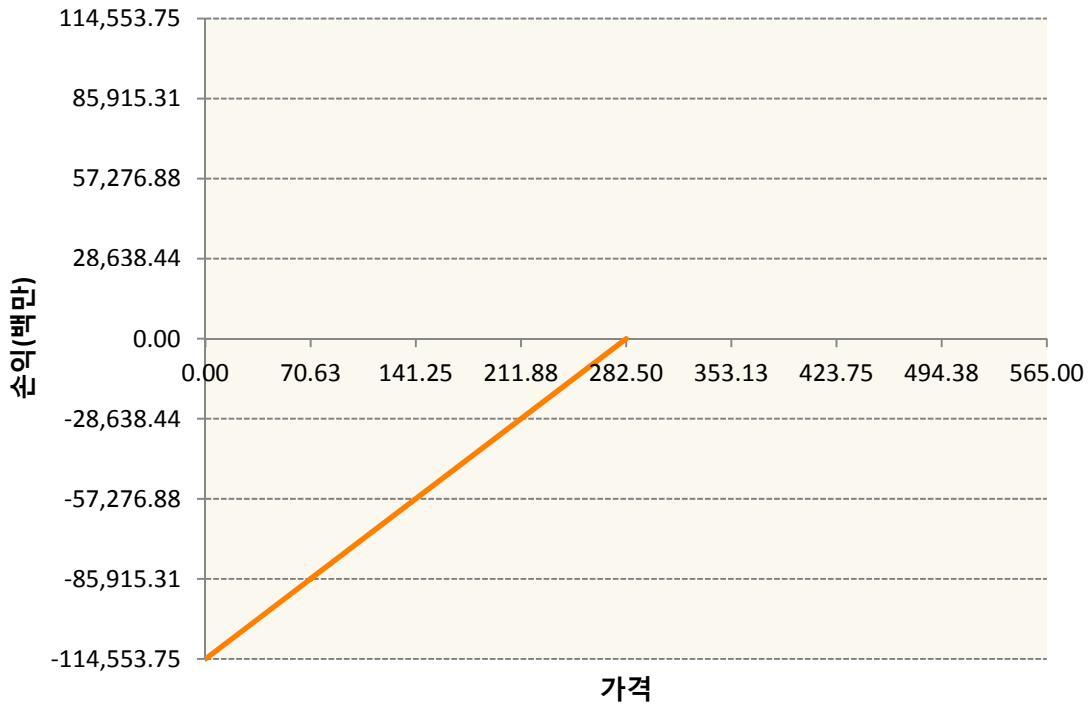


KR4201PC2858-2019-12 콜285

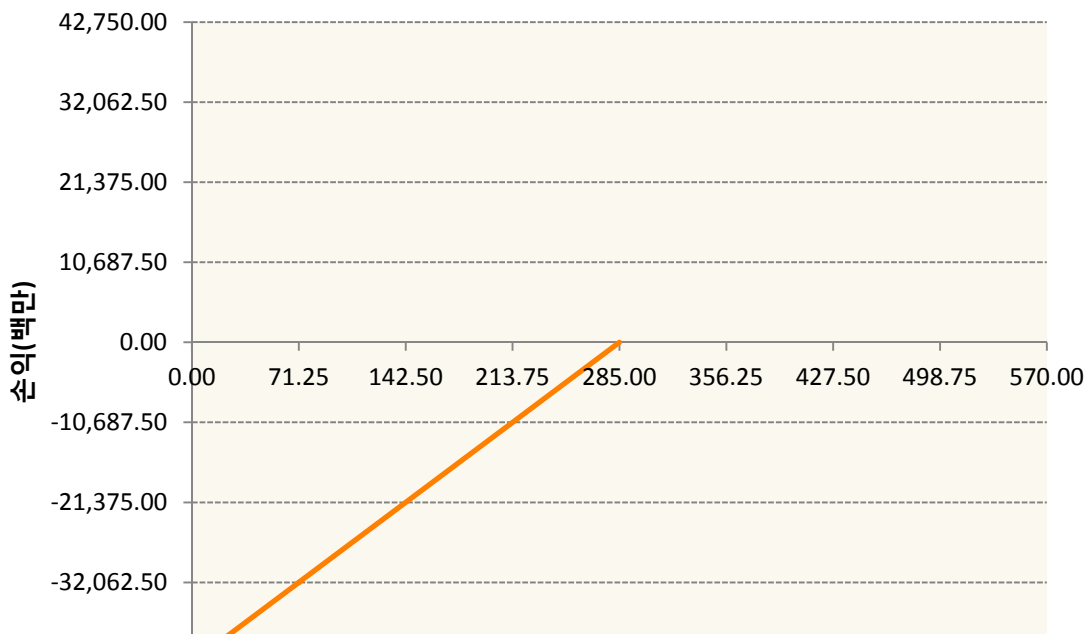




KR4301PC2824-2019-12 풋282.5



KR4301PC2857-2019-12 풋285



-42,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PC2825		2019-12 콜282.5						5,800
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,856	1,834	1,803	1,761	1,709	1,648	1,578	
-5.33%	1,750	1,683	1,604	1,513	1,414	1,306	1,192	
-2.67%	1,385	1,252	1,113	969	821	670	515	
0%	523	349	175	0	-175	-349	-524	
2.67%	-967	-1,124	-1,285	-1,448	-1,614	-1,781	-1,950	
5.33%	-2,994	-3,095	-3,207	-3,328	-3,457	-3,591	-3,732	
8.00%	-5,344	-5,391	-5,450	-5,522	-5,605	-5,698	-5,800	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						13,859
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,832	3,795	3,738	3,659	3,555	3,429	3,280	
-5.33%	3,662	3,535	3,376	3,188	2,974	2,737	2,480	
-2.67%	3,007	2,721	2,412	2,084	1,741	1,385	1,019	
0%	1,288	862	432	0	-435	-871	-1,309	
2.67%	-1,962	-2,396	-2,834	-3,274	-3,717	-4,160	-4,605	
5.33%	-6,700	-7,013	-7,348	-7,701	-8,069	-8,448	-8,837	
8.00%	-12,445	-12,608	-12,805	-13,032	-13,286	-13,562	-13,859	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						8,165
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-8,160	-8,160	-8,160	-8,161	-8,161	-8,163	-8,165	
-5.33%	-5,123	-5,125	-5,128	-5,135	-5,145	-5,158	-5,176	
-2.67%	-2,136	-2,168	-2,207	-2,252	-2,304	-2,360	-2,421	
0%	296	198	99	0	-100	-199	-299	
2.67%	1,345	1,284	1,217	1,145	1,069	990	908	
5.33%	1,504	1,496	1,482	1,463	1,439	1,409	1,373	
8.00%	1,511	1,511	1,510	1,508	1,505	1,499	1,490	
KR4301PC2857		2019-12 풋285						3,154
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,153	-3,153	-3,153	-3,153	-3,153	-3,154	-3,154	
-5.33%	-2,029	-2,030	-2,030	-2,031	-2,033	-2,035	-2,039	
-2.67%	-912	-918	-926	-936	-949	-963	-980	
0%	94	64	33	0	-33	-67	-101	
2.67%	662	630	597	564	530	495	460	

5.33%	790	783	773	760	745	728	709
8.00%	799	799	798	796	793	789	783

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

(단위:백만원)

33,022

공시일	2019-11-29
기준일	2019-11-28

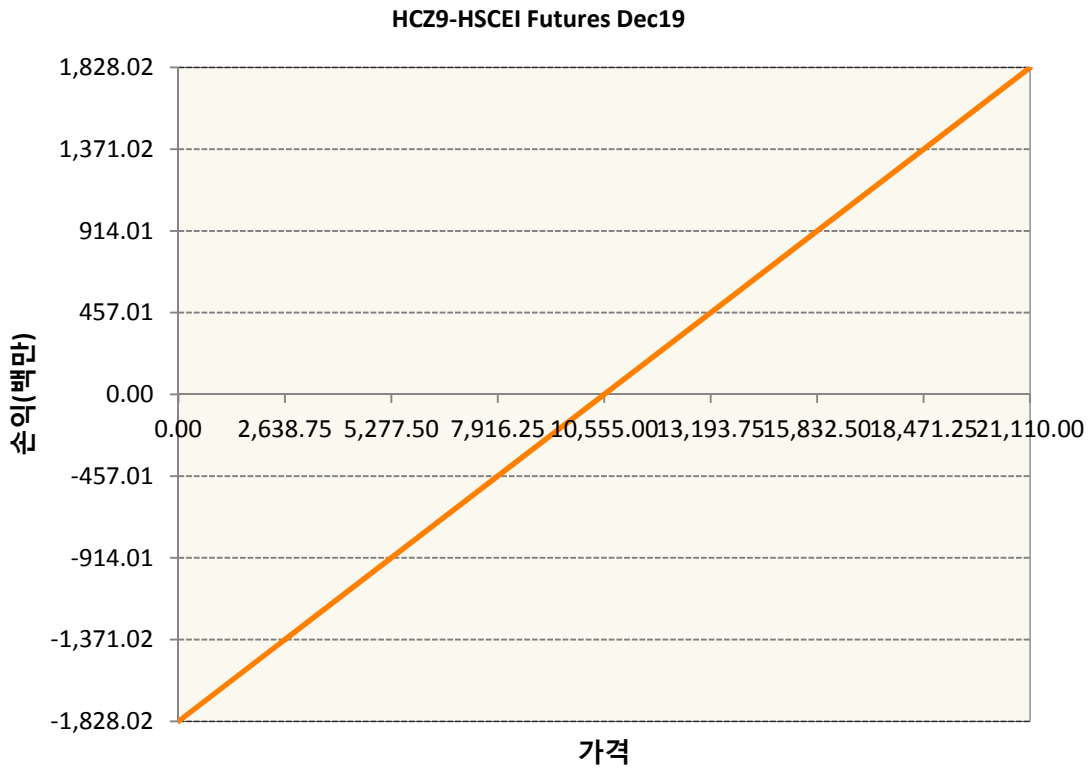
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,828	0	1,828	
누계	통화	선도	0	2,120	-2,120	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	170
HCZ9 HSCEI Futures Dec19	146

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

(단위:백만원)

184

공시일	2019-11-29
기준일	2019-11-28

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

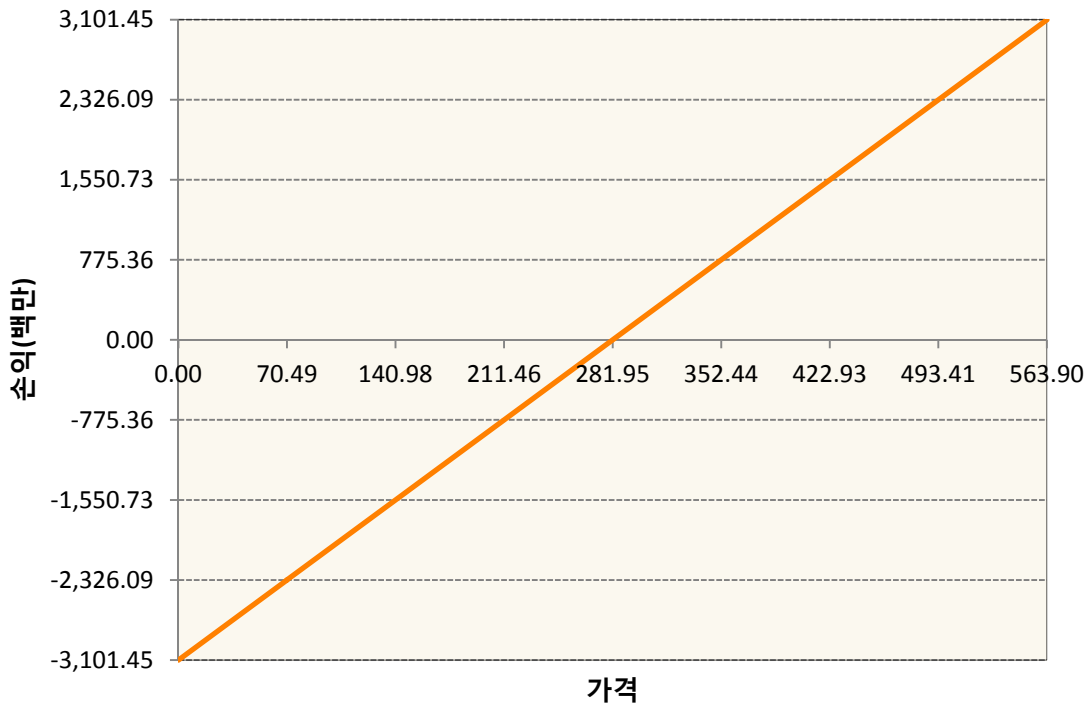
1. 계약금액

(단위:백만원)

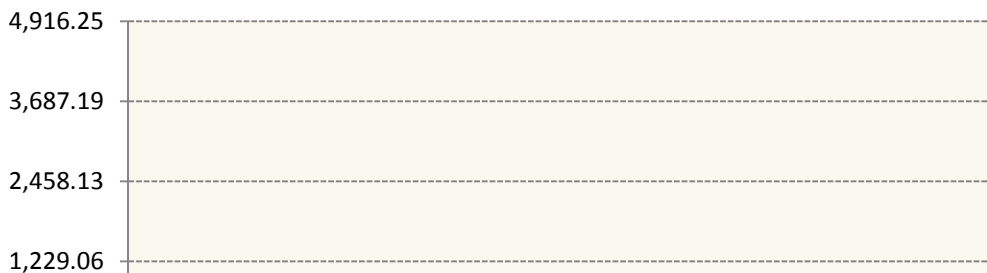
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,101	0	3,101	장내
누계	유가증권	스왑	9,625	0	9,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,657	-9,657	장내

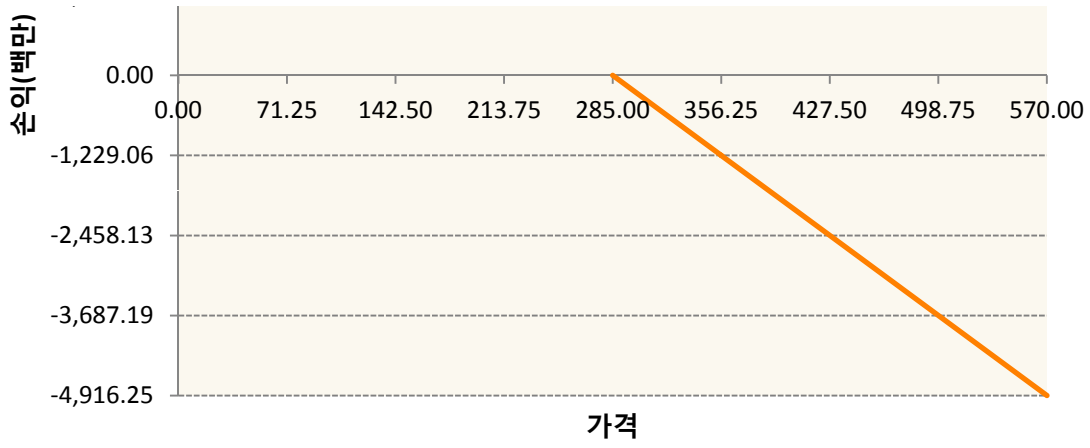
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

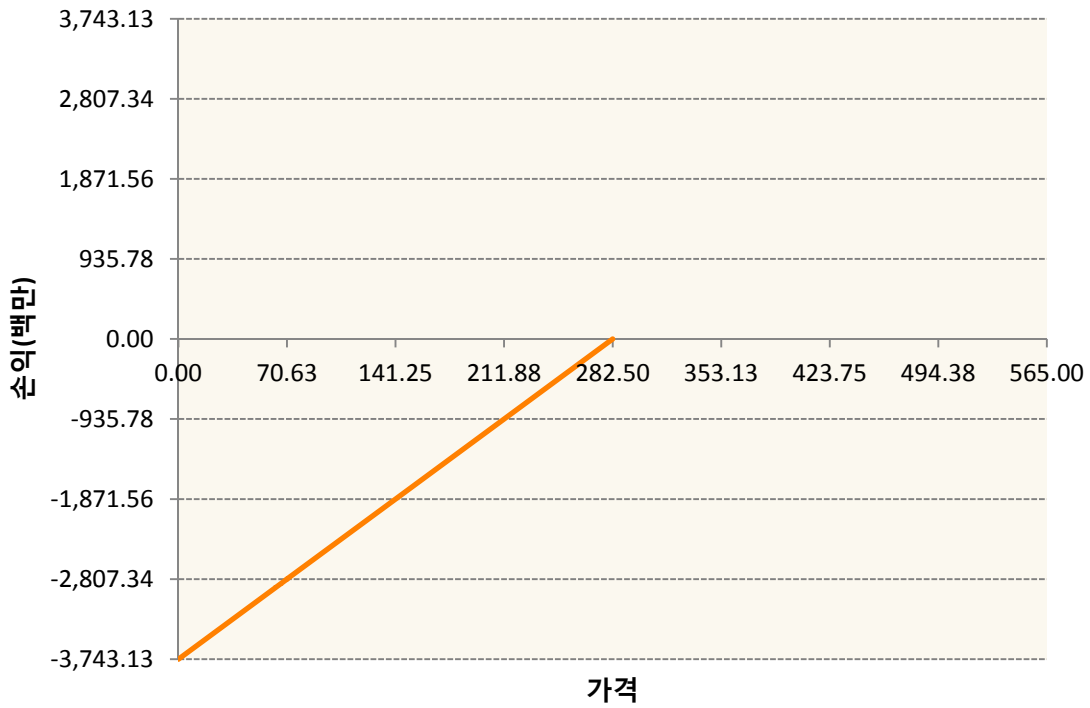


KR4201PC2858-2019-12 콜285

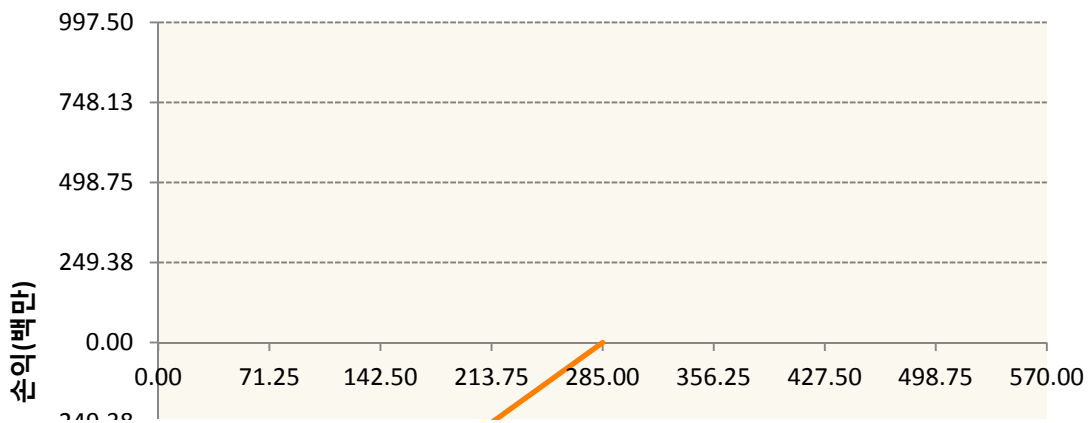




KR4301PC2824-2019-12 풋282.5



KR4301PC2857-2019-12 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						832
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-832	-832	-832	-832	-832	-832	-832	
-5.33%	-555	-555	-555	-555	-555	-555	-555	
-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%	555	555	555	555	555	555	555	
8.00%	832	832	832	832	832	832	832	
KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						247
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-247	-247	-247	-247	-247	-247	-247	
-5.33%	-165	-165	-165	-165	-165	-165	-165	
-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%	165	165	165	165	165	165	165	
8.00%	247	247	247	247	247	247	247	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						278
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	77	76	75	73	71	69	66	
-5.33%	73	71	68	64	60	55	50	
-2.67%	60	55	48	42	35	28	20	
0%	26	17	9	0	-9	-17	-26	
2.67%	-39	-48	-57	-66	-74	-83	-92	
5.33%	-134	-141	-147	-154	-162	-169	-177	
8.00%	-249	-253	-257	-261	-266	-272	-278	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						267
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-267	-267	-267	-267	-267	-267	-267
-5.33%	-167	-167	-168	-168	-168	-169	-169
-2.67%	-70	-71	-72	-74	-75	-77	-79
0%	10	6	3	0	-3	-7	-10
2.67%	44	42	40	37	35	32	30
5.33%	49	49	48	48	47	46	45
8.00%	49	49	49	49	49	49	49
KR4301PC2857 2019-12 풋285							74
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
-5.33%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-48
-2.67%	-21	-21	-22	-22	-22	-22	-23
0%	2	1	1	0	-1	-2	-2
2.67%	15	15	14	13	12	12	11
5.33%	18	18	18	18	17	17	17
8.00%	19	19	19	19	19	18	18

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

(단위:백만원)

1,713

공시일	2019-11-29
기준일	2019-11-28

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

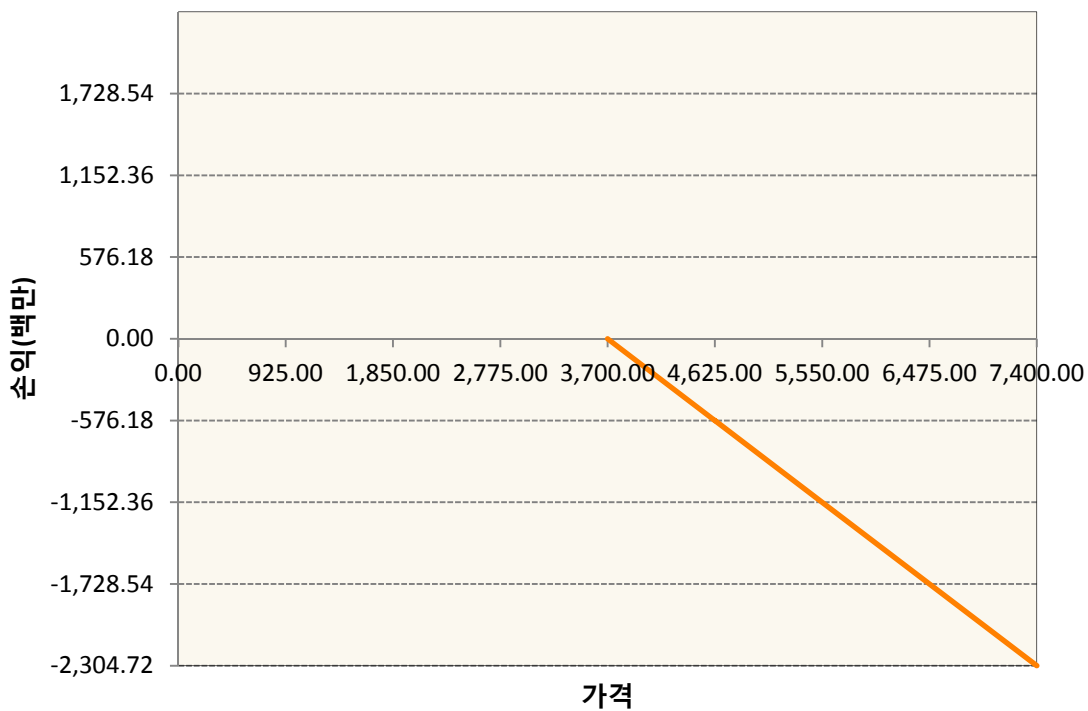
1. 계약금액

(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	17,744	0	17,744	장외
누계	유가증권	옵션	0	8,670	-8,670	장내
누계	통화	선도	2,694	6,099	-3,405	장외

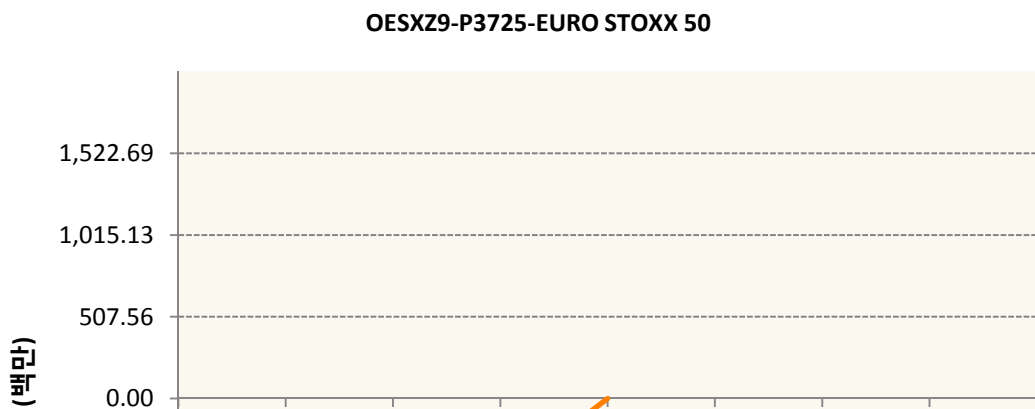
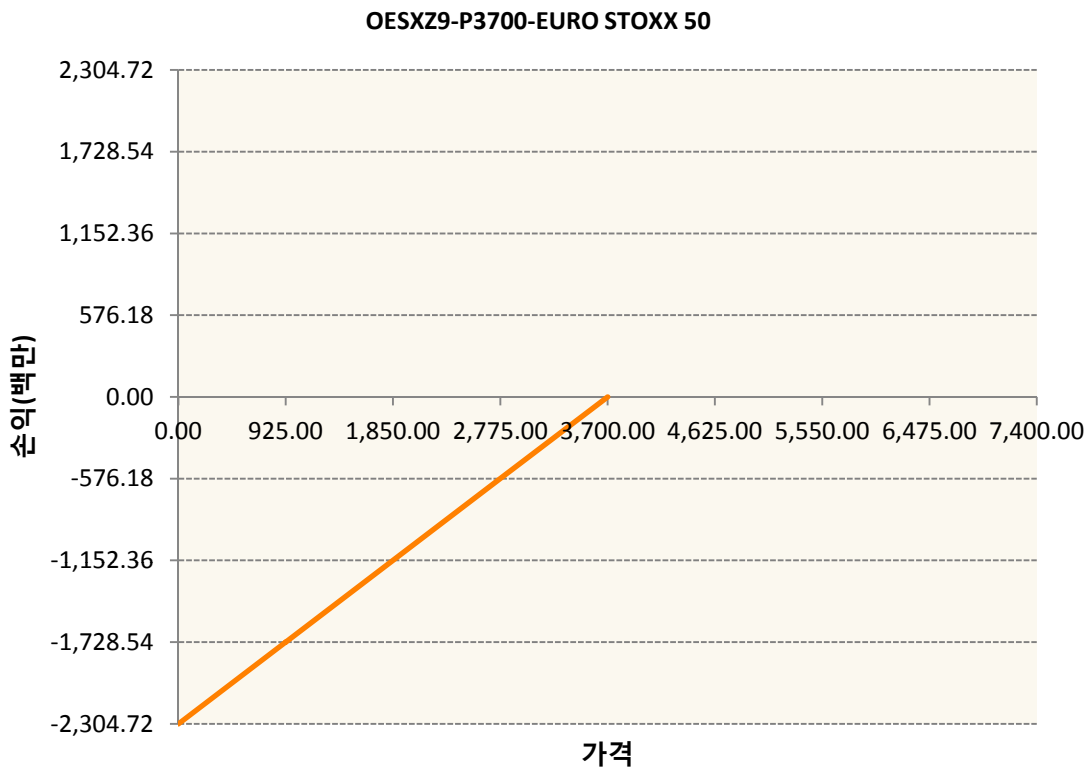
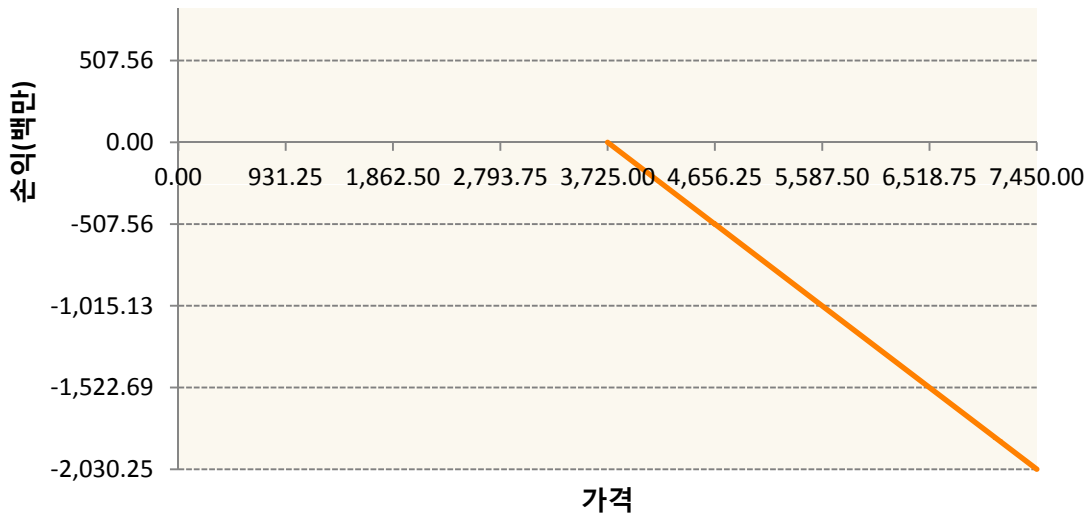
2. 만기시점의 손익구조

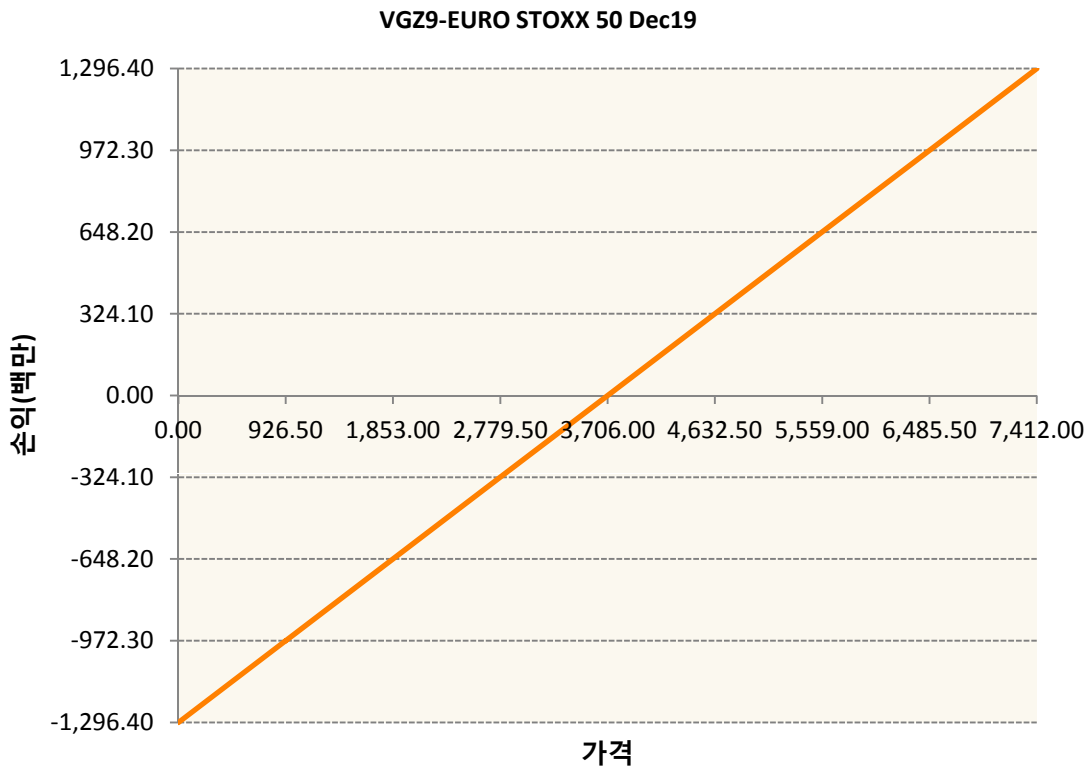
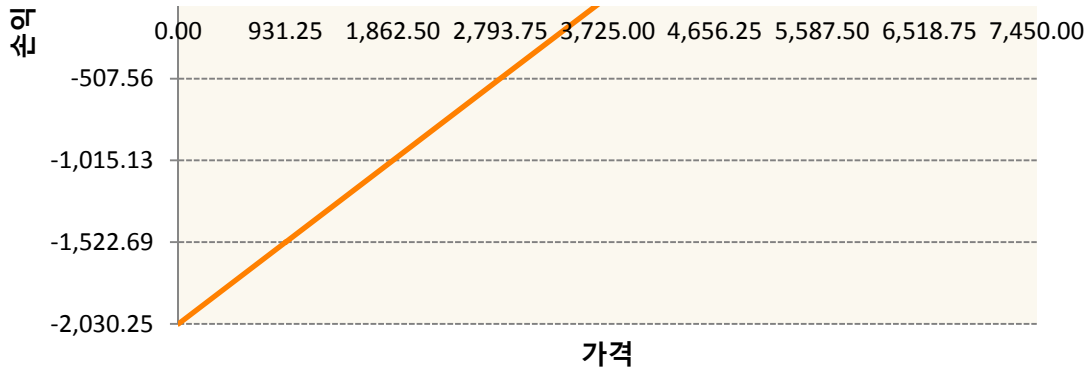
OESXZ9-C3700-EURO STOXX 50



OESXZ9-C3725-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	26
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E	488
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E	164
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)

883

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

(단위:백만원)

917

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

(단위:백만원)

80

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

(단위:백만원)

125

공시일	2019-11-29
기준일	2019-11-28

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

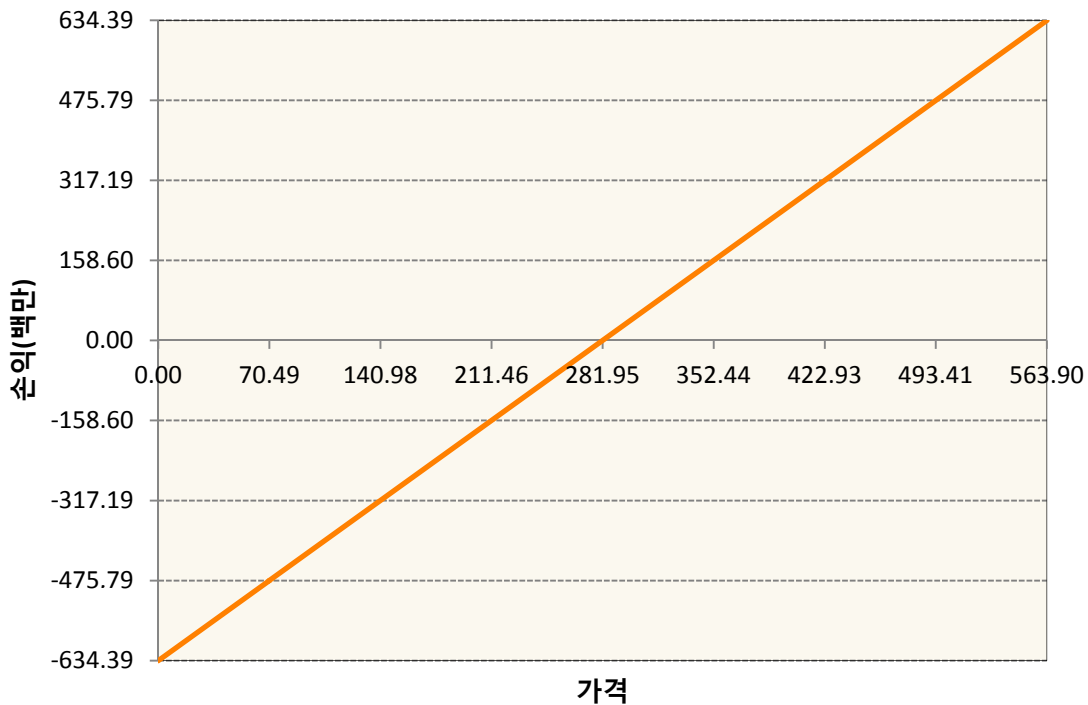
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	634	0	634	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	2019-11-29
기준일	2019-11-28

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

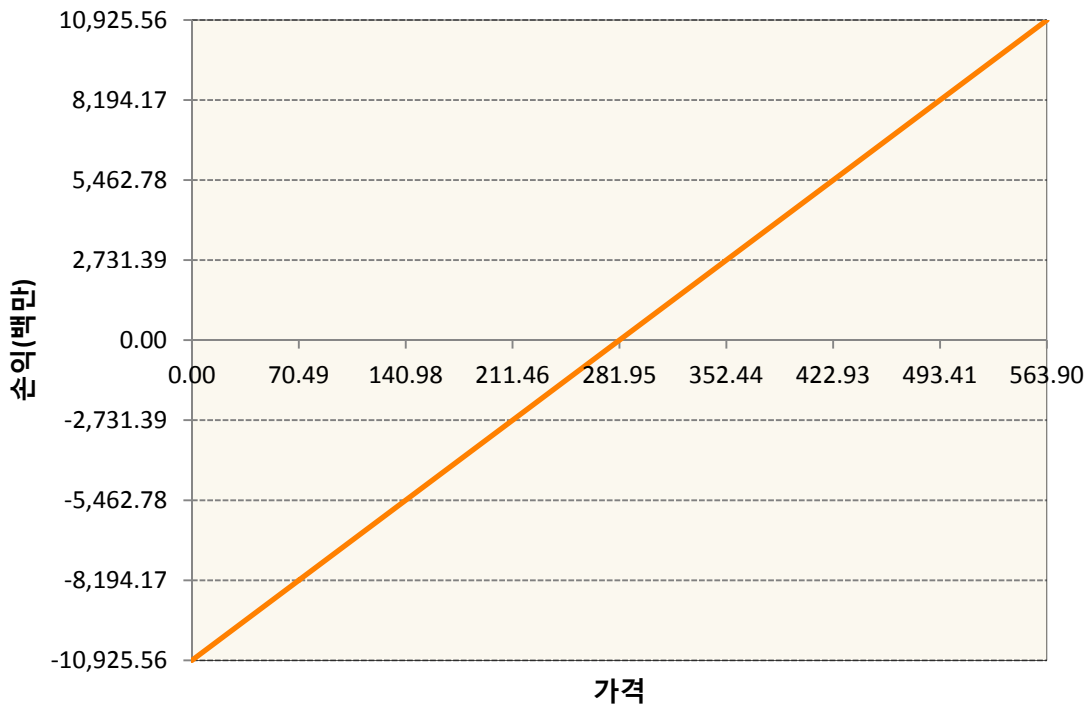
1. 계약금액

(단위:백만원)

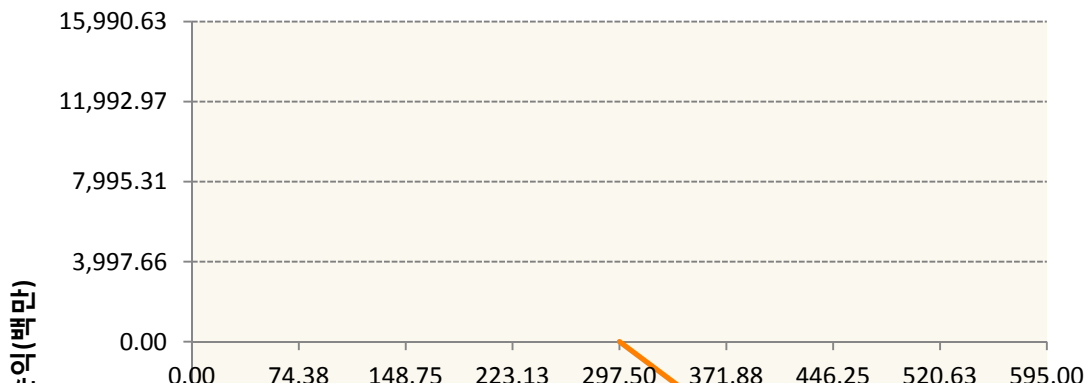
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,926	0	10,926	장내
누계	유가증권	옵션	1,277	21,241	-19,964	장내

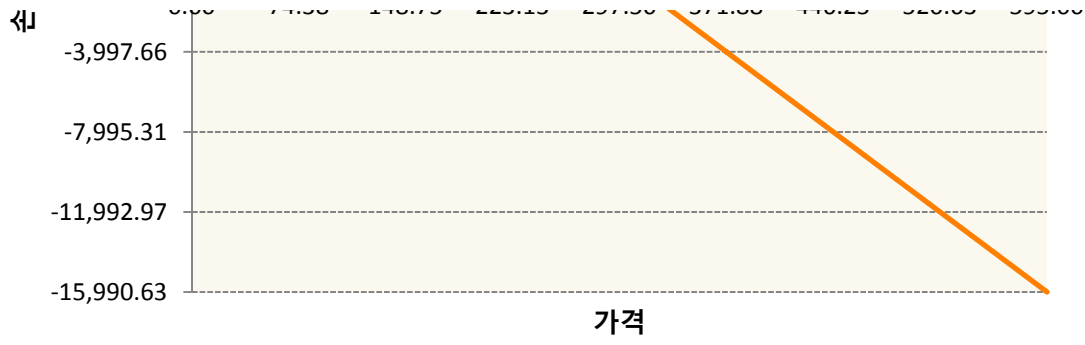
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

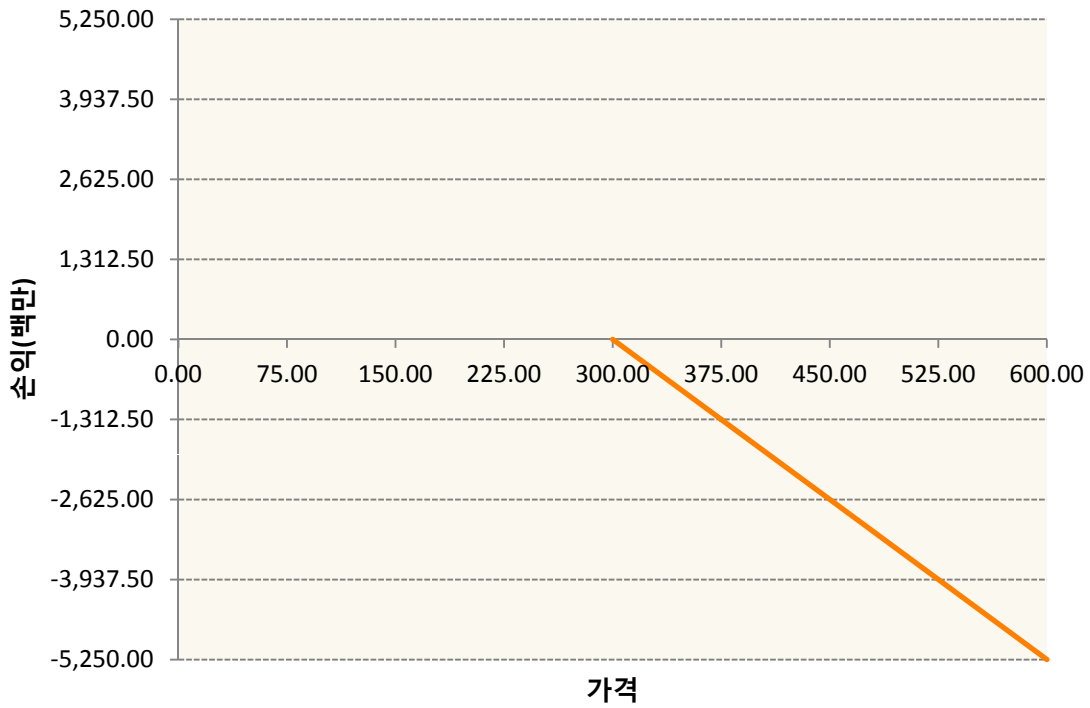


KR4201PC2973-2019-12 콜297.5

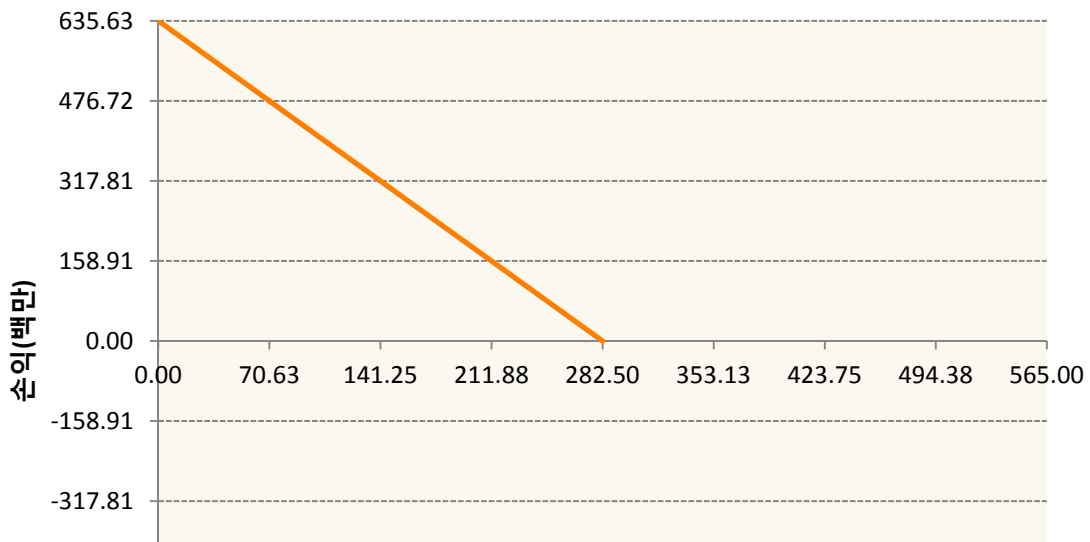


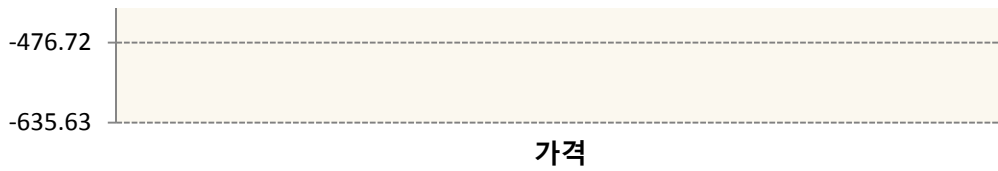


KR4201PC3005-2019-12 콜300

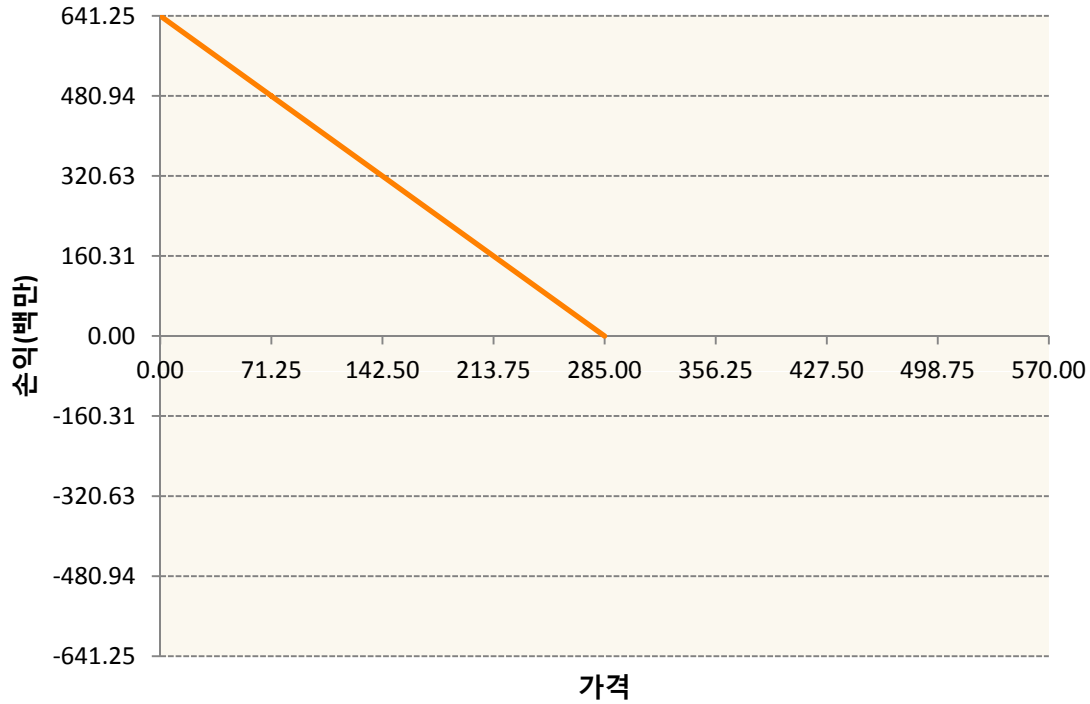


KR4301PC2824-2019-12 풋282.5





KR4301PC2857-2019-12 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						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						560
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	68	68	67	67	65	63	60	
-5.33%	67	66	64	61	57	52	45	
-2.67%	63	58	52	44	34	23	10	

0%	43	30	16	0	-18	-36	-56
2.67%	-20	-43	-67	-91	-116	-142	-168
5.33%	-160	-189	-218	-247	-276	-306	-335
8.00%	-395	-421	-448	-476	-504	-532	-560
KR4201PC3005 2019-12 콜300							163
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	16	16	16	16	16	15	15
-5.33%	16	16	16	15	14	13	11
-2.67%	16	15	13	11	8	5	2
0%	11	8	4	0	-5	-10	-16
2.67%	-4	-10	-17	-24	-32	-39	-47
5.33%	-40	-49	-58	-68	-77	-86	-96
8.00%	-106	-115	-125	-134	-144	-153	-163
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	28	28	29	29	29
-2.67%	12	12	12	12	13	13	13
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-7	-7	-7	-6	-6	-5	-5
5.33%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
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	31	31
-2.67%	14	14	14	14	14	14	15
0%	-1	-1	0	0	0	1	2
2.67%	-10	-9	-9	-8	-8	-7	-7
5.33%	-12	-12	-12	-11	-11	-11	-11
8.00%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12

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

(단위:백만원)

1,282

공시일	2019-11-29
기준일	2019-11-28

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	206,670	0	206,670	

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	2019-11-29
기준일	2019-11-28

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	215,700	0	215,700	

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	2019-11-29
기준일	2019-11-28

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	547,631	0	547,631	
누계	통화	선도	0	609,661	-609,661	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		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 23-01-20E		1,519
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		3,245

FX21019X02 KRW/USD 26-12-19E	4,754
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E	4,810
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	189
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,830
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,830

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

(단위:백만원)

15,324

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

(단위:백만원)

187

공시일	2019-11-29
기준일	2019-11-28

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

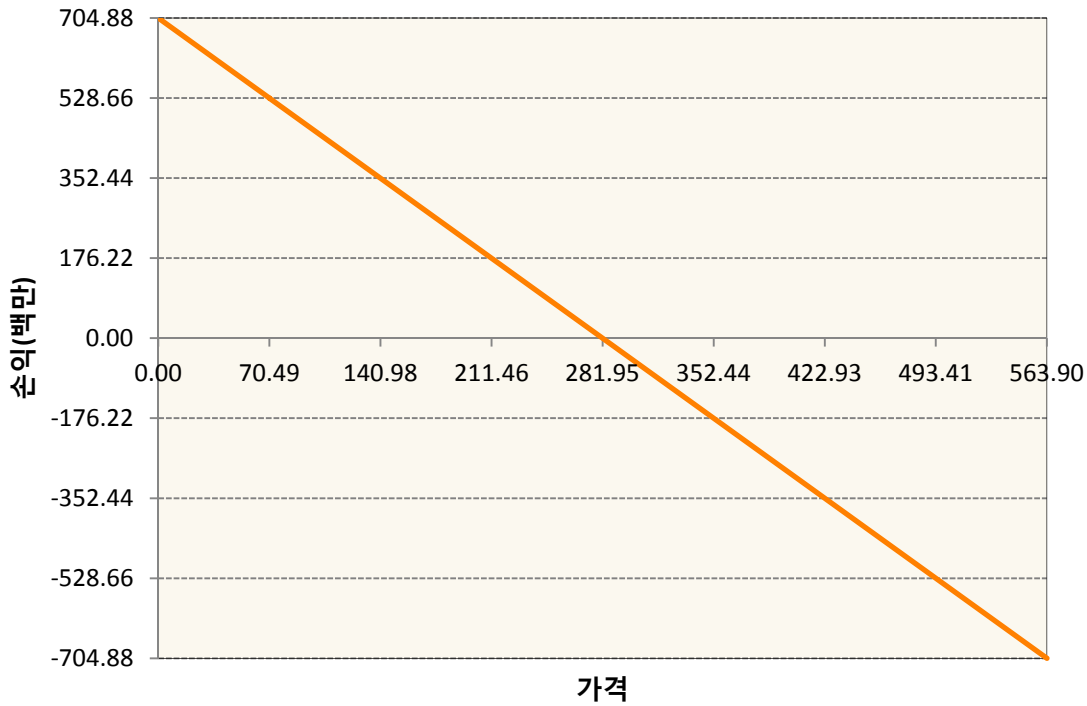
1. 계약금액

(단위:백만원)

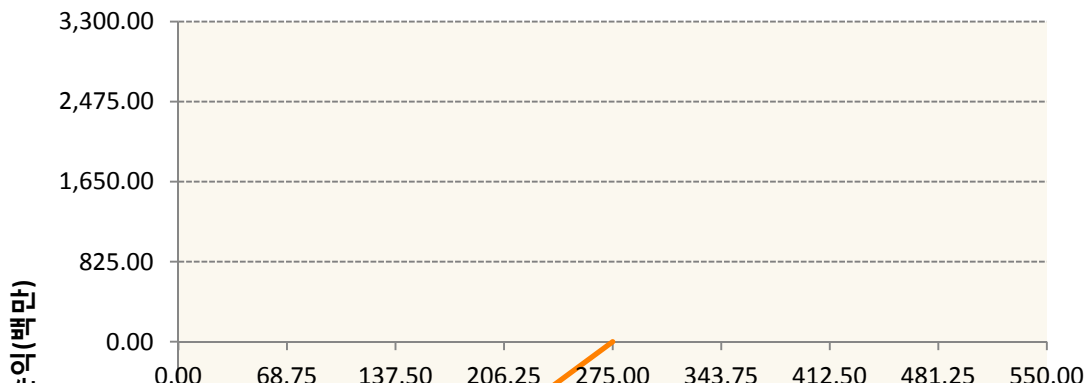
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	705	-705	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,994	-3,994	장내

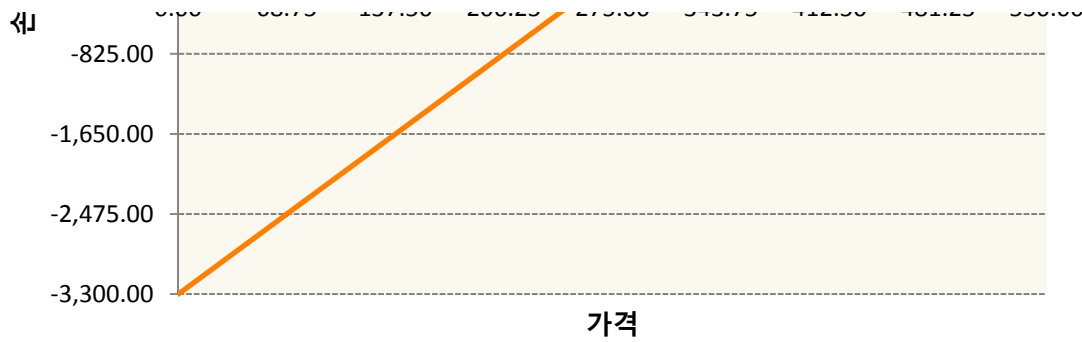
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

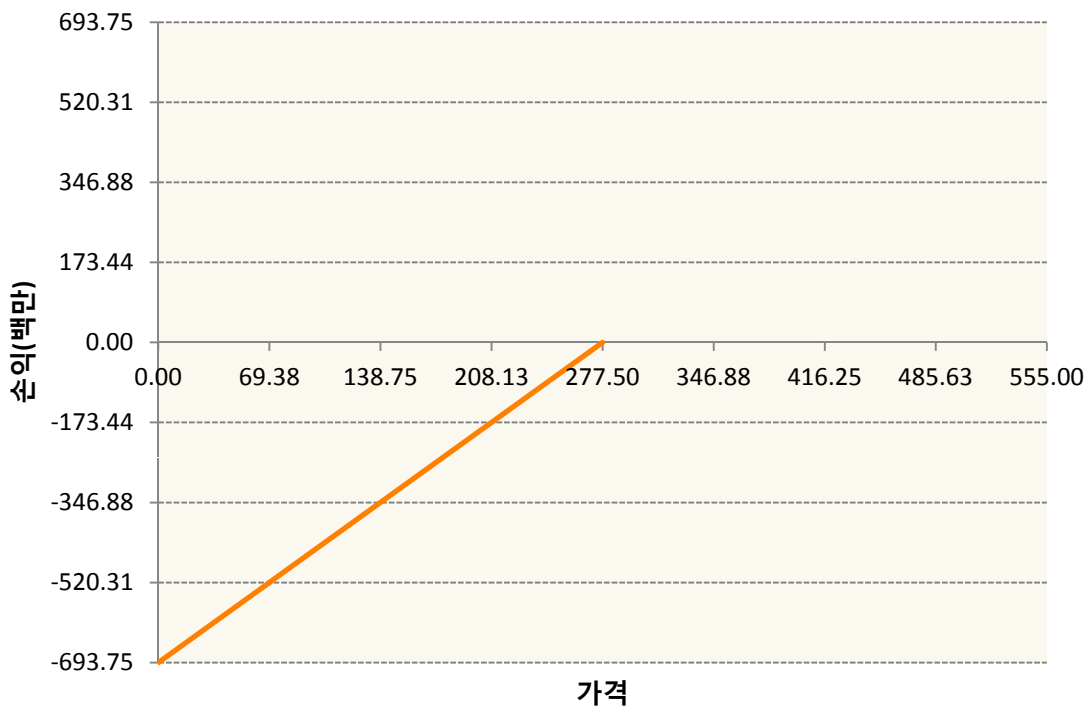


KR4301PC2758-2019-12 풋275





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						187
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-186	-186	-186	-186	-187	-187	-187
-5.33%	-98	-98	-99	-101	-102	-104	-105
-2.67%	-25	-28	-31	-34	-36	-39	-42
0%	6	4	2	0	-2	-4	-7
2.67%	10	10	9	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							44
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-44
-5.33%	-25	-25	-25	-25	-25	-26	-26
-2.67%	-8	-8	-9	-9	-10	-10	-11
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	4	4	3	3	3	3	2
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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

(단위:백만원)

268

공시일	2019-11-29
기준일	2019-11-28

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	15,152	0	15,152	
누계	통화	선도	0	18,888	-18,888	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019V01 KRW/USD 10-12-19E		374
FX21019V03 KRW/USD 29-11-19E		321
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)

475

공시일	2019-11-29
기준일	2019-11-28

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	996	0	996	장외
누계	통화	선도	273	273	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	2019-11-29
기준일	2019-11-28

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

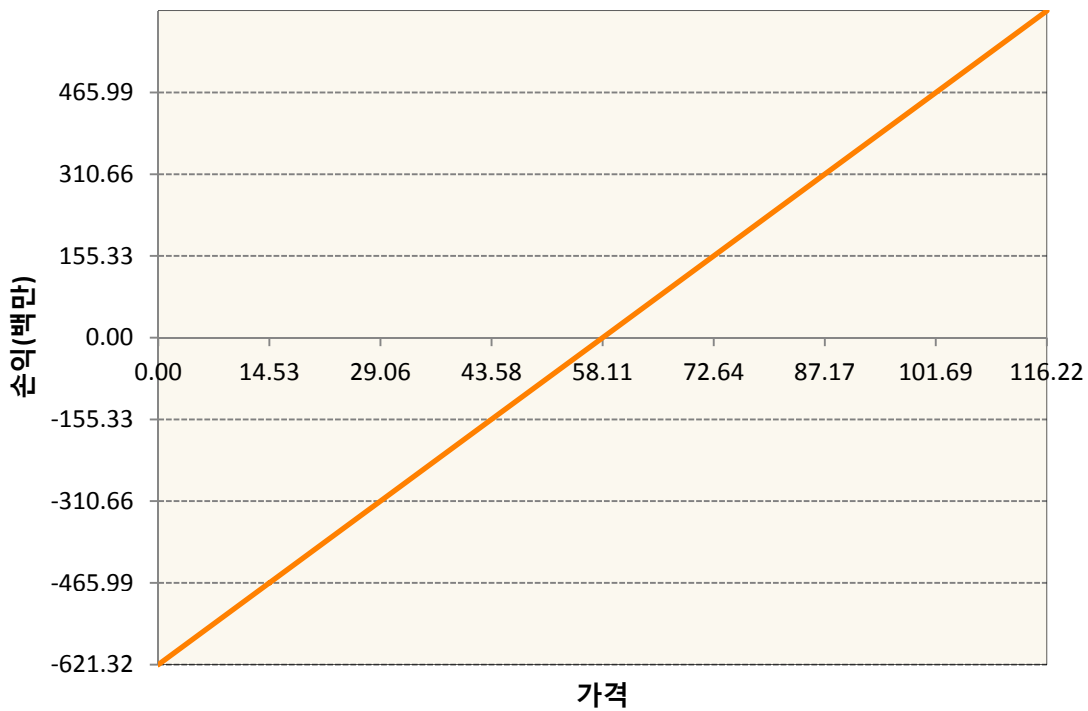
1. 계약금액

(단위:백만원)

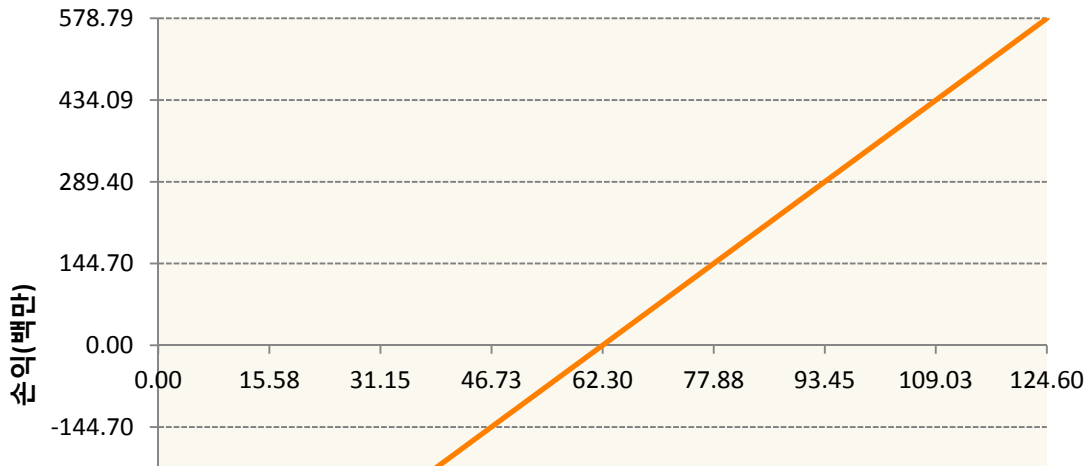
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,479	295	2,184	

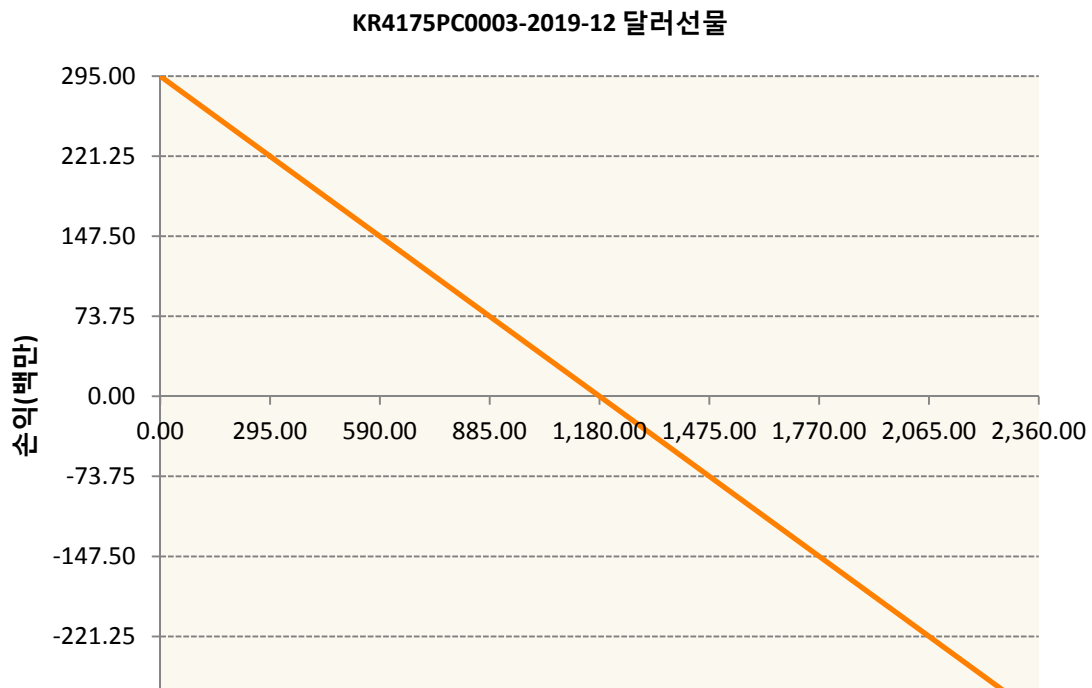
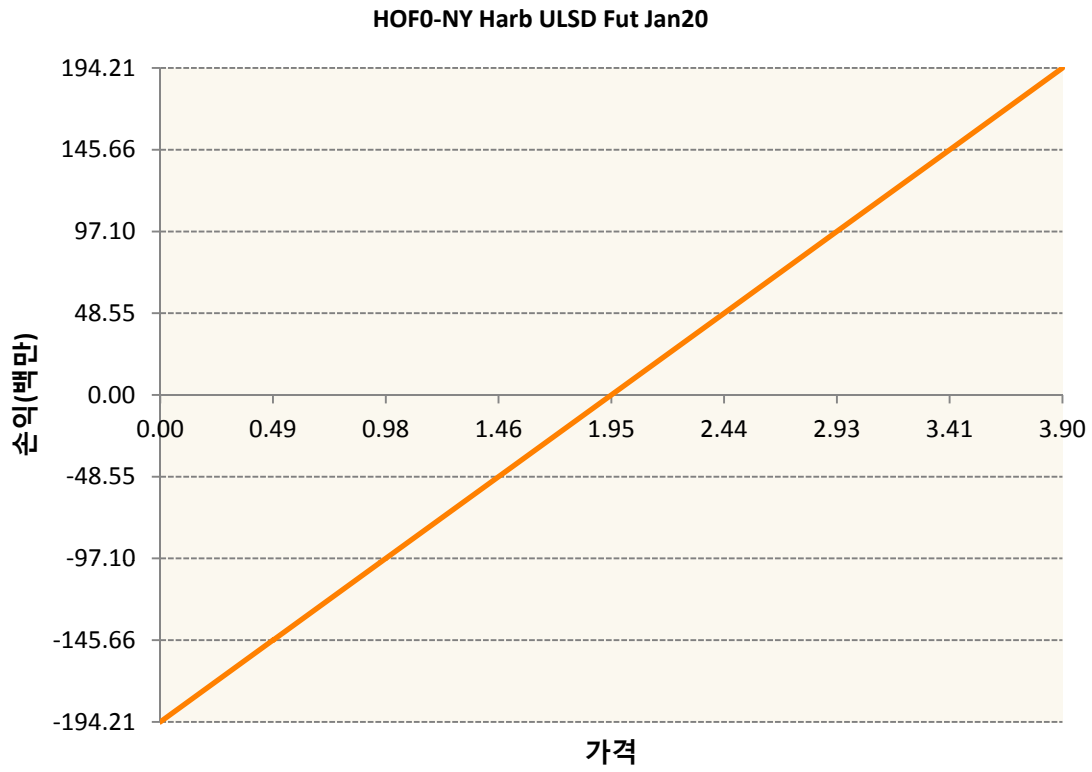
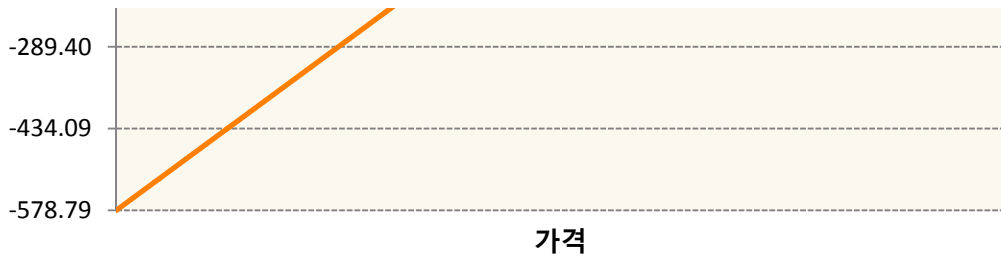
2. 만기시점의 손익구조

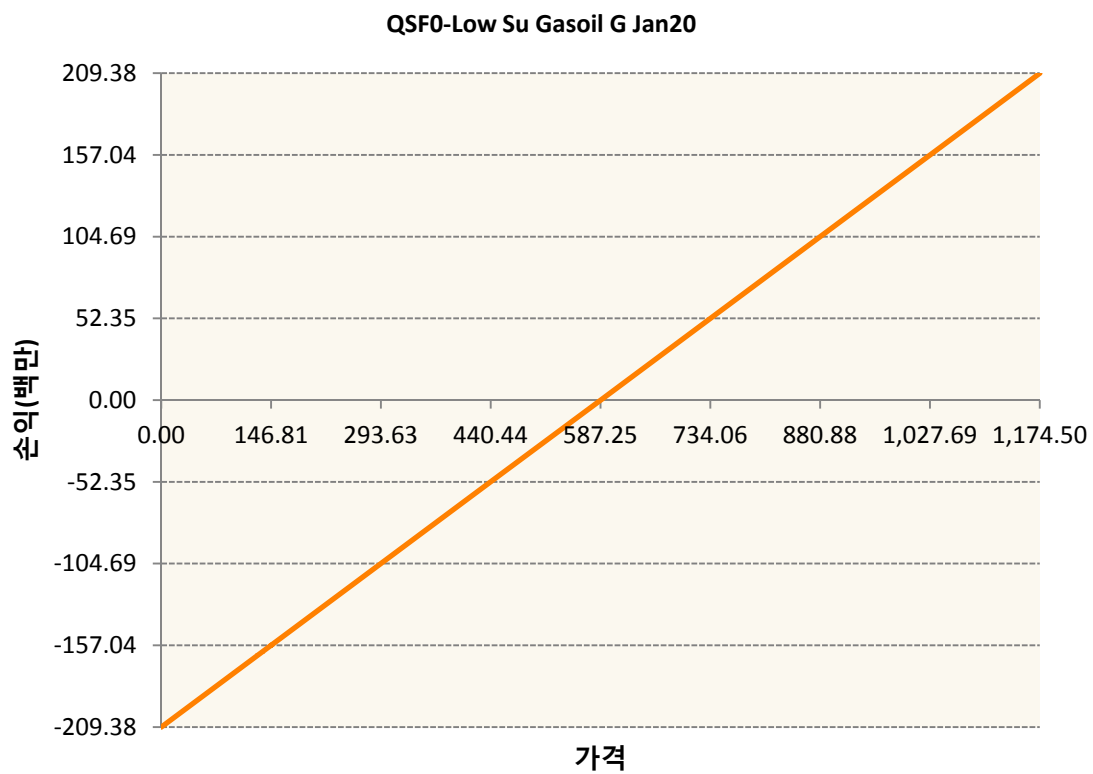
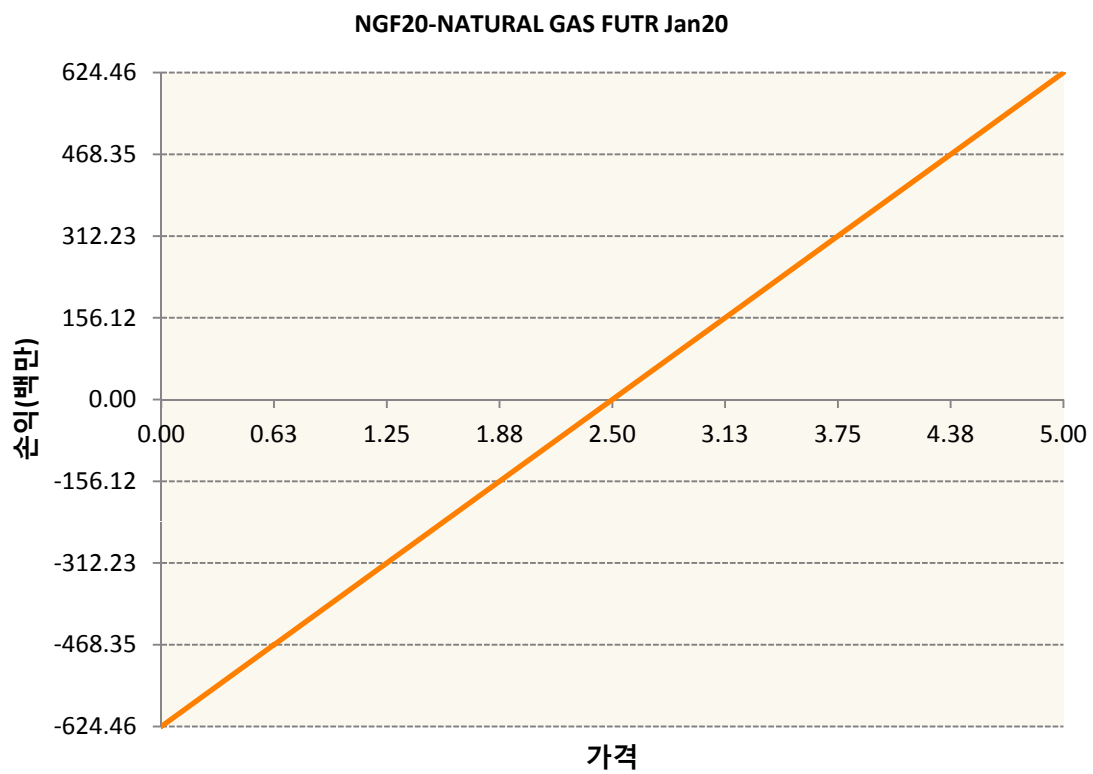
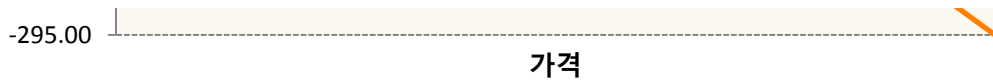
CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20



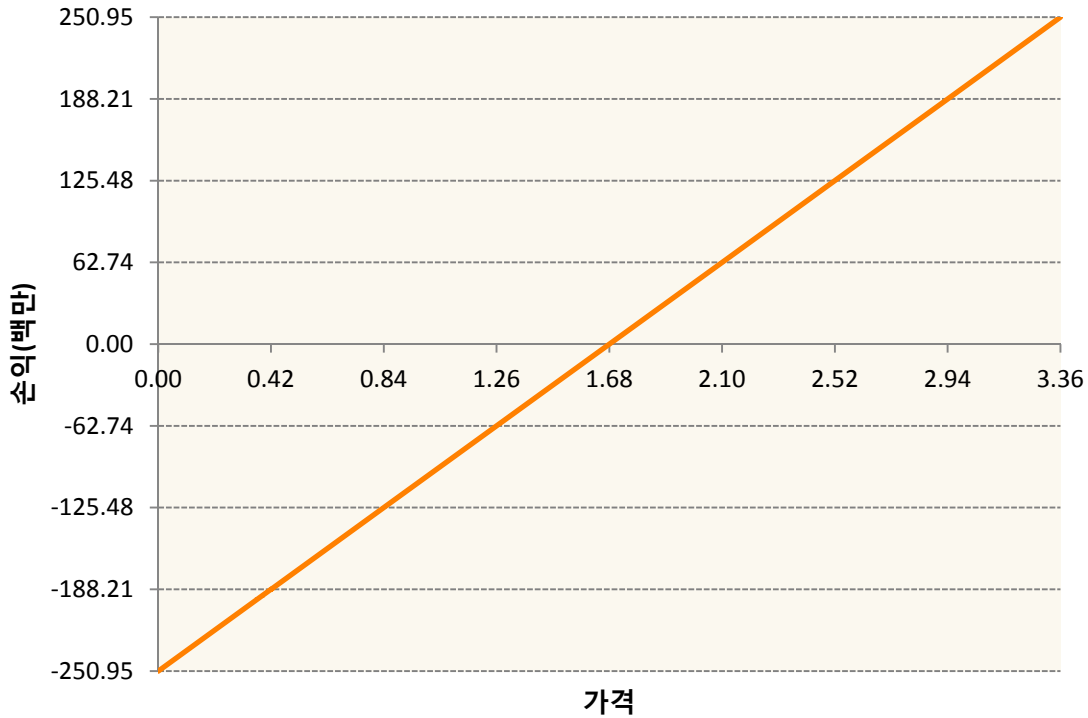
COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20







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	50
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	17
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	20

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

405

공시일	2019-11-29
기준일	2019-11-28

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

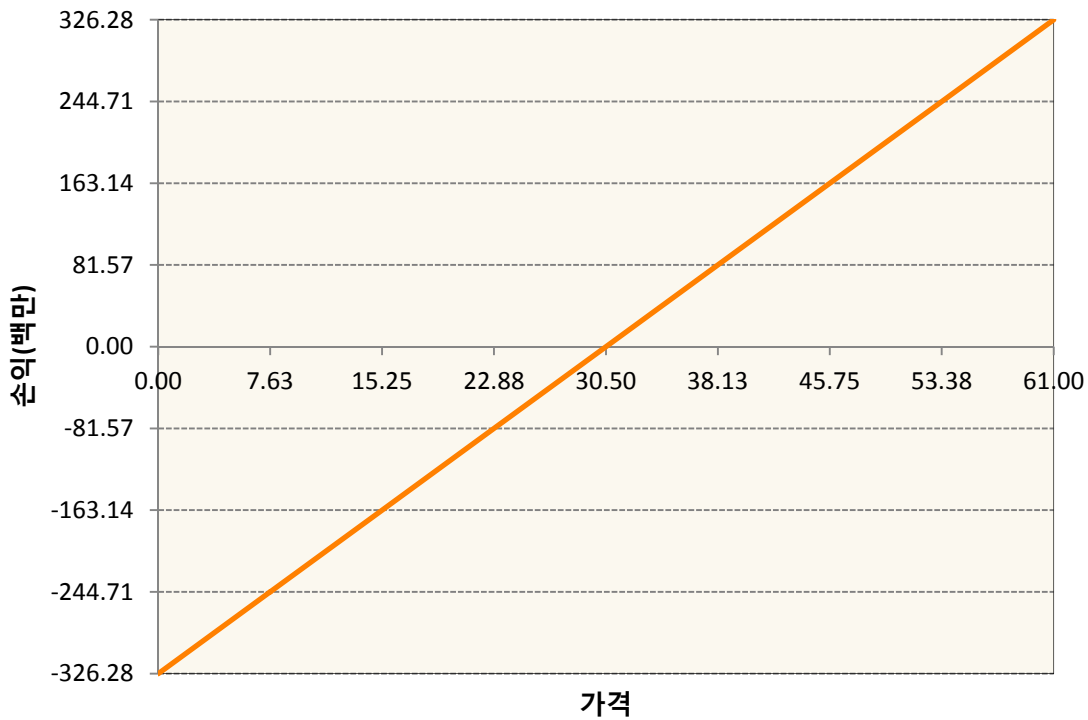
1. 계약금액

(단위:백만원)

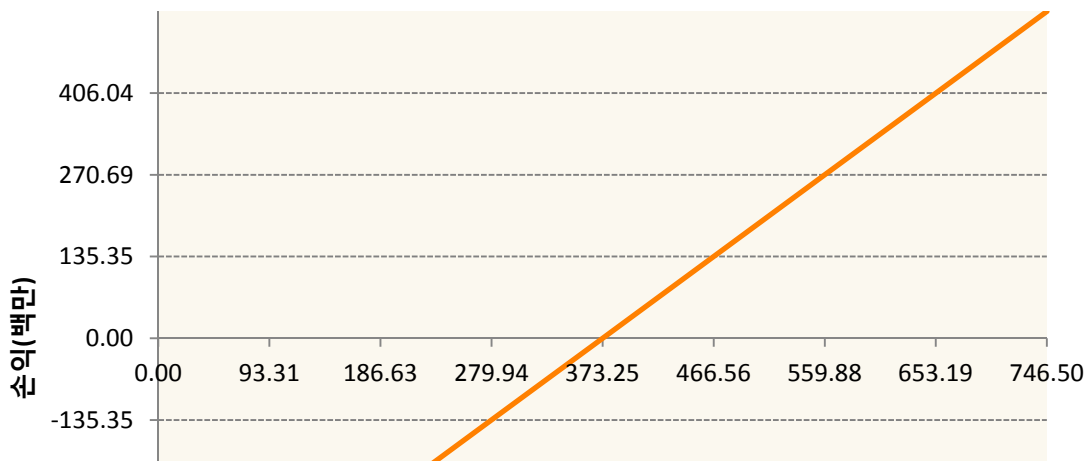
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,796	94	2,702	

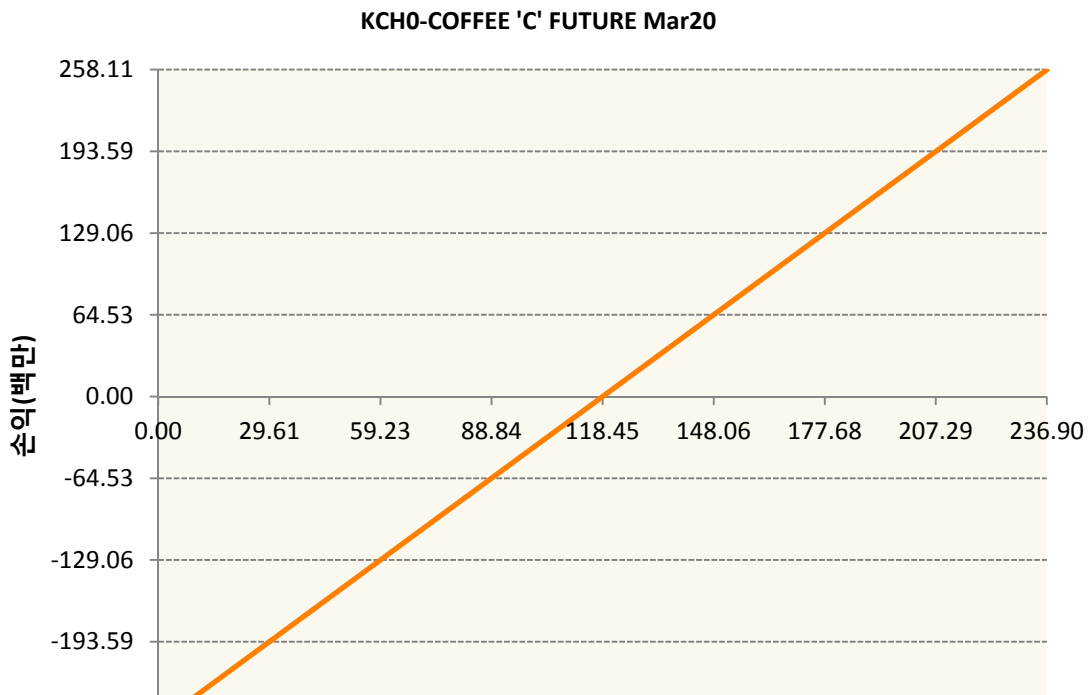
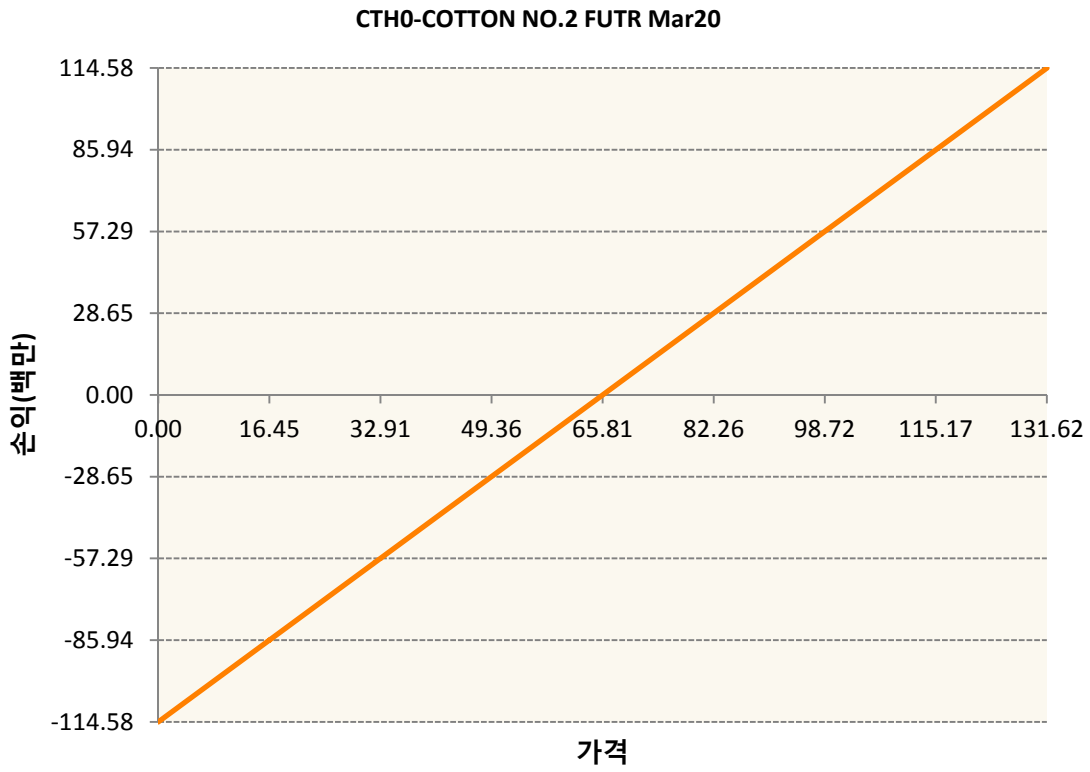
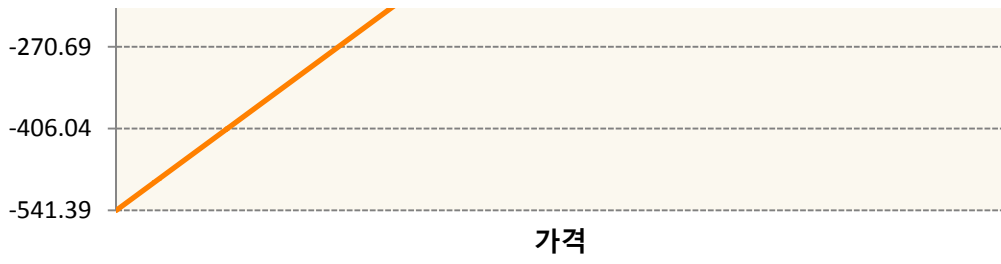
2. 만기시점의 손익구조

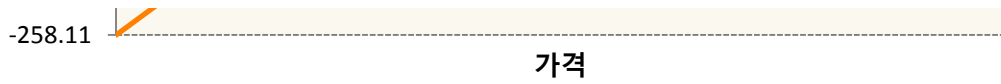
BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20



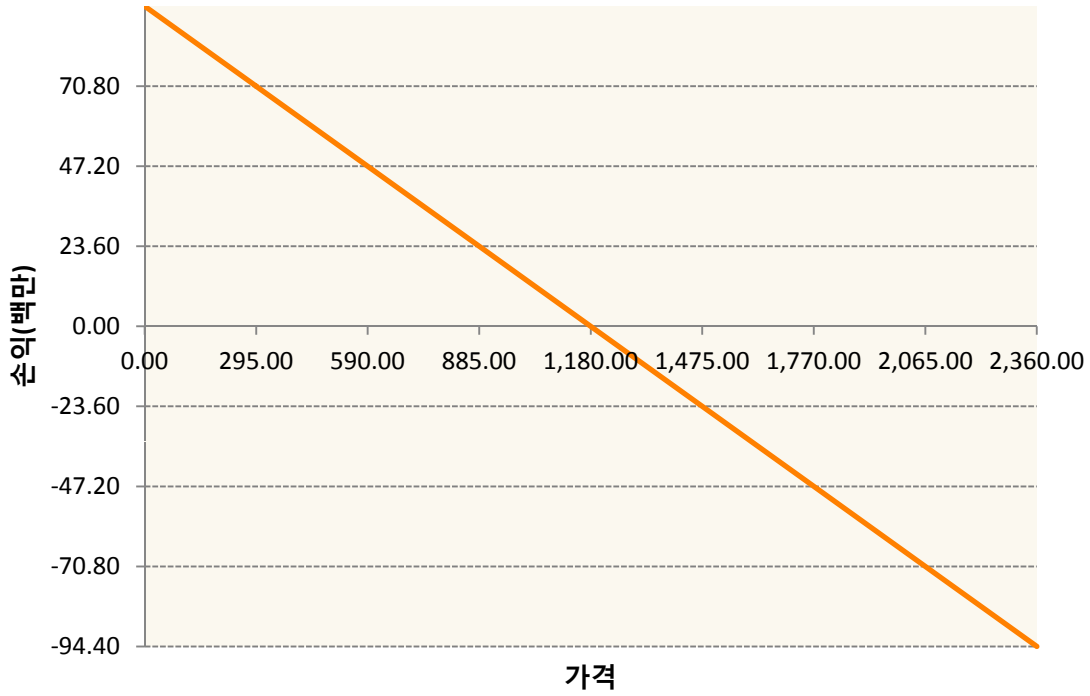
CH0-CORN FUTURE Mar20



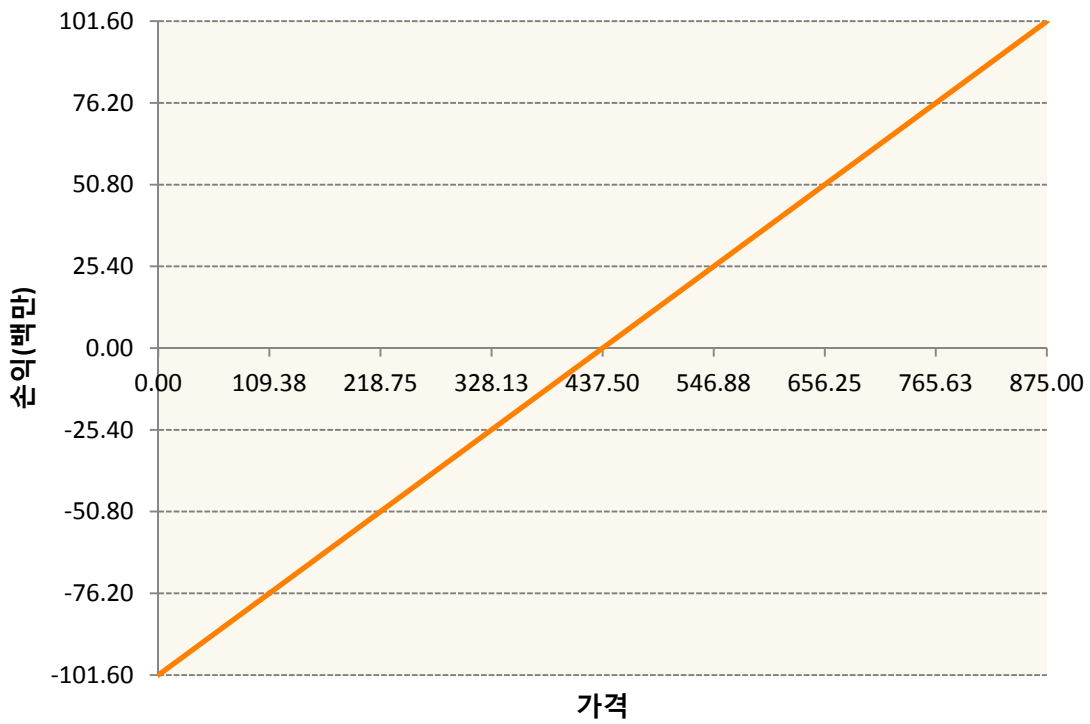




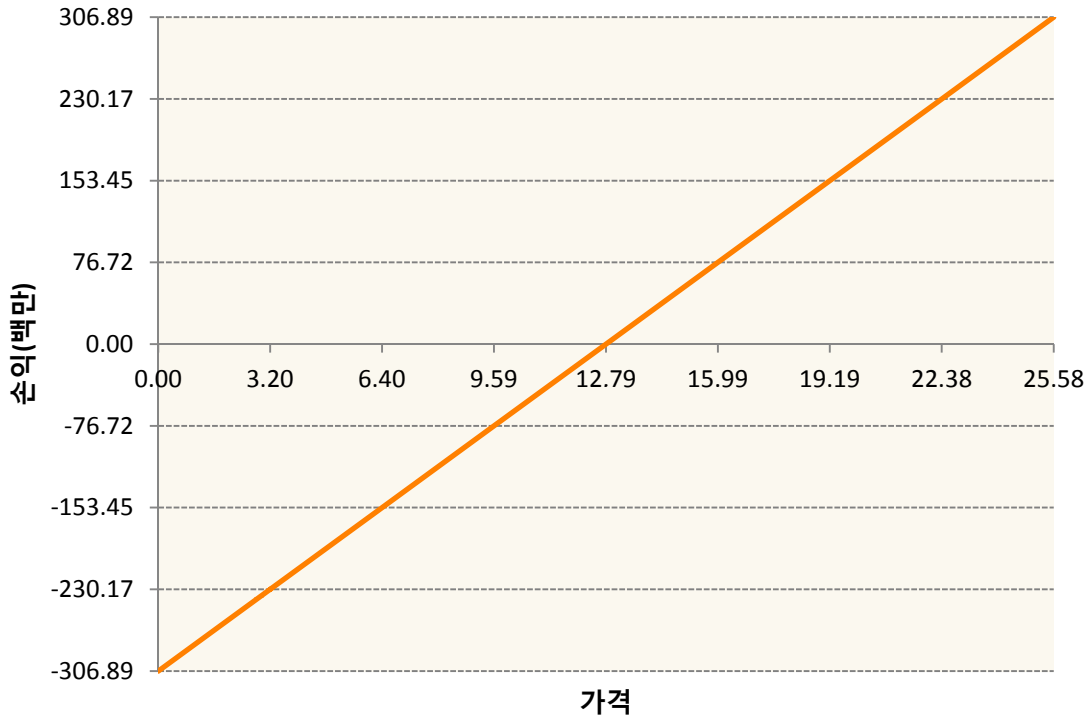
KR4175PC0003-2019-12 달러선물



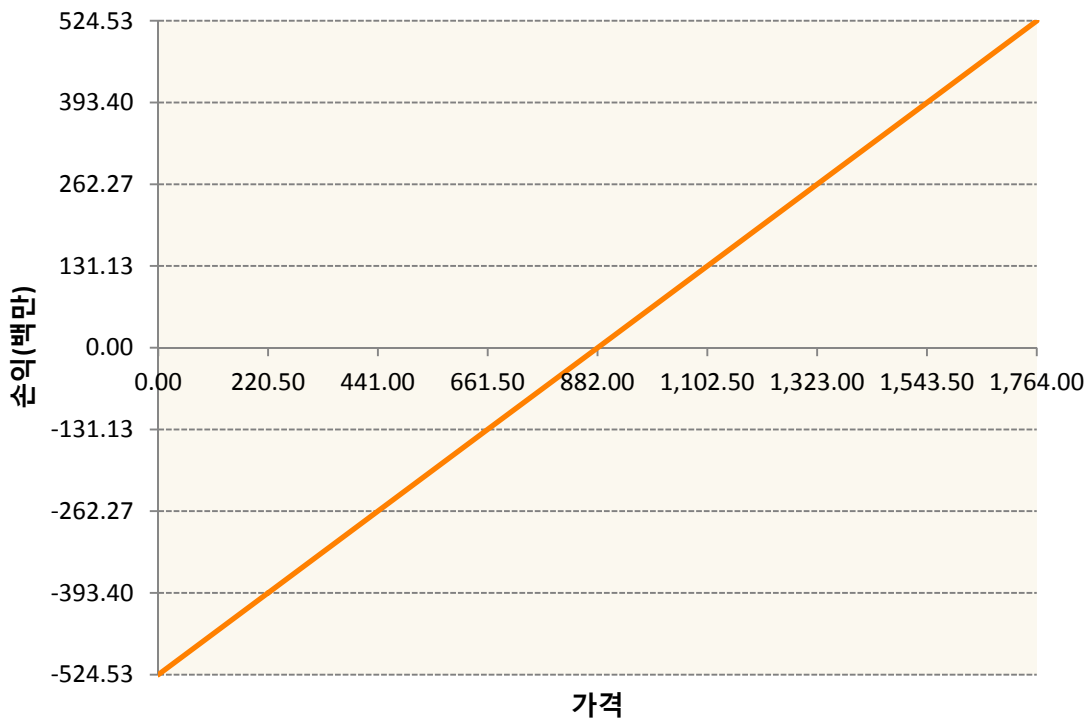
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

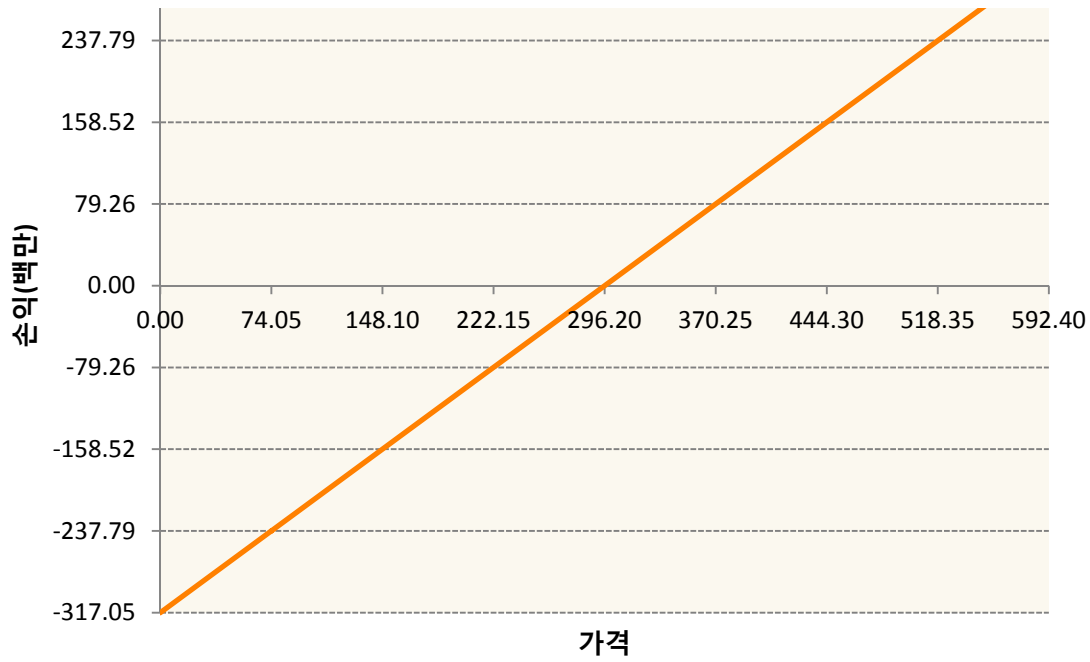


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20

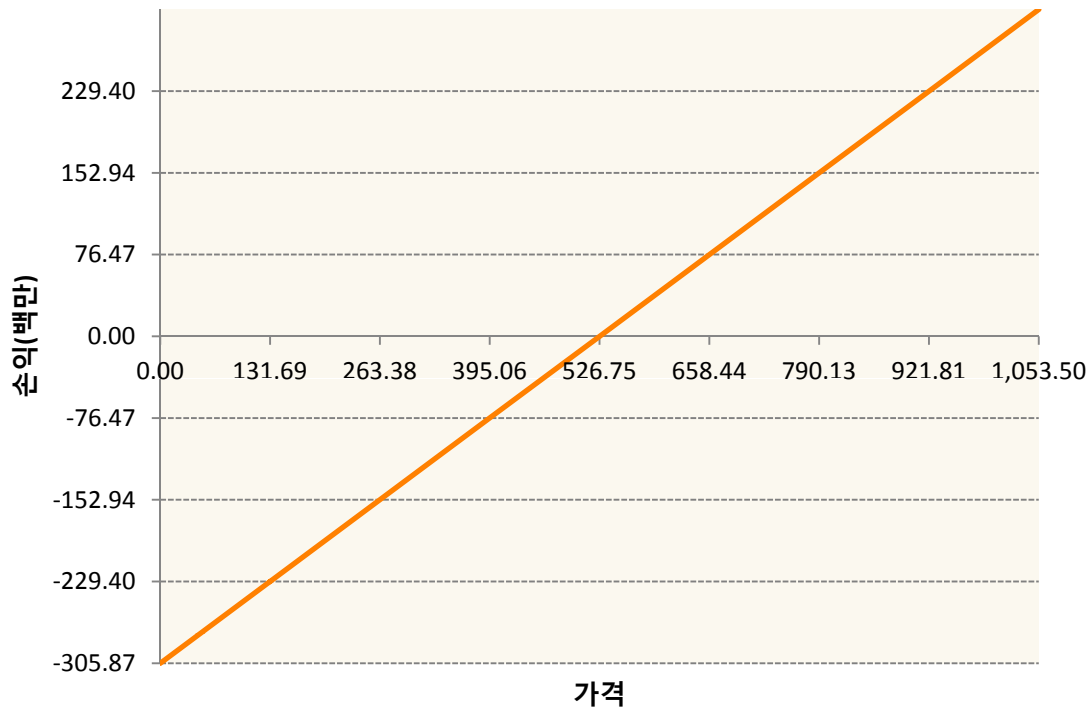


SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





WHO-WHEAT FUTURE(CBT) Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF0	SOYBEAN OIL FUTR Jan20	26
CH0	CORN FUTURE Mar20	43
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	25
WH0	WHEAT FUTURE(CBT) Mar20	24

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

(단위:백만원)

246