

공시일	2019-12-02
기준일	2019-11-29

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)

83

공시일	2019-12-02
기준일	2019-11-29

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	2019-12-02
기준일	2019-11-29

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)

735

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-02
기준일	2019-11-29

유로인덱스모(주식-파생형)

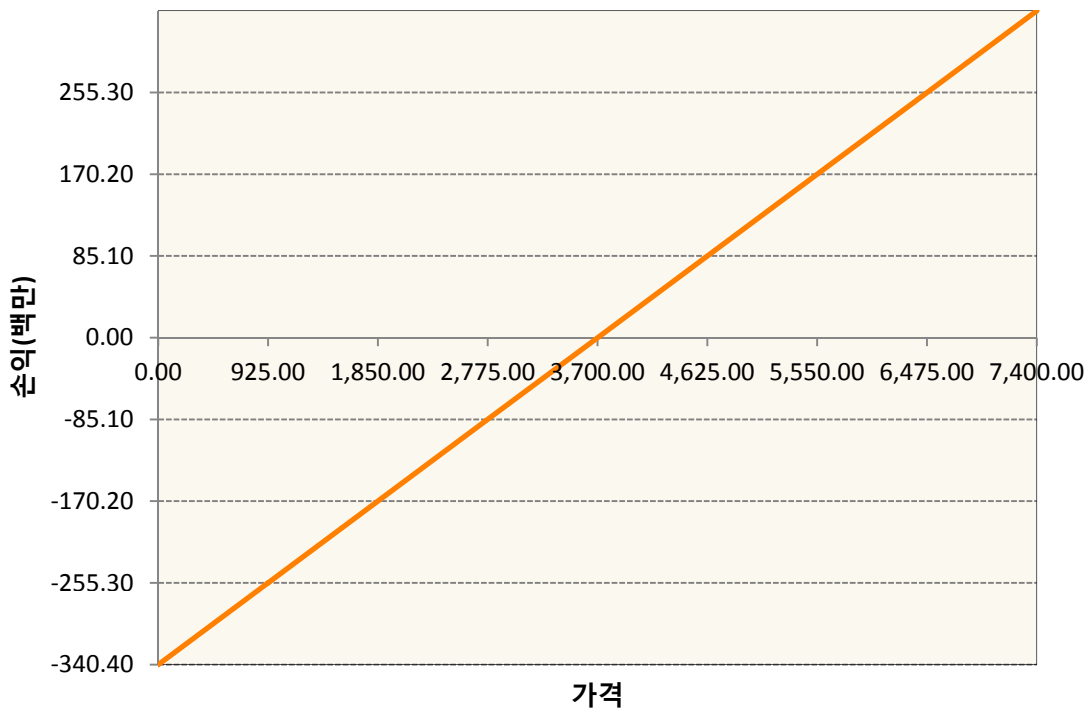
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	340	0	340	

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	2019-12-02
기준일	2019-11-29

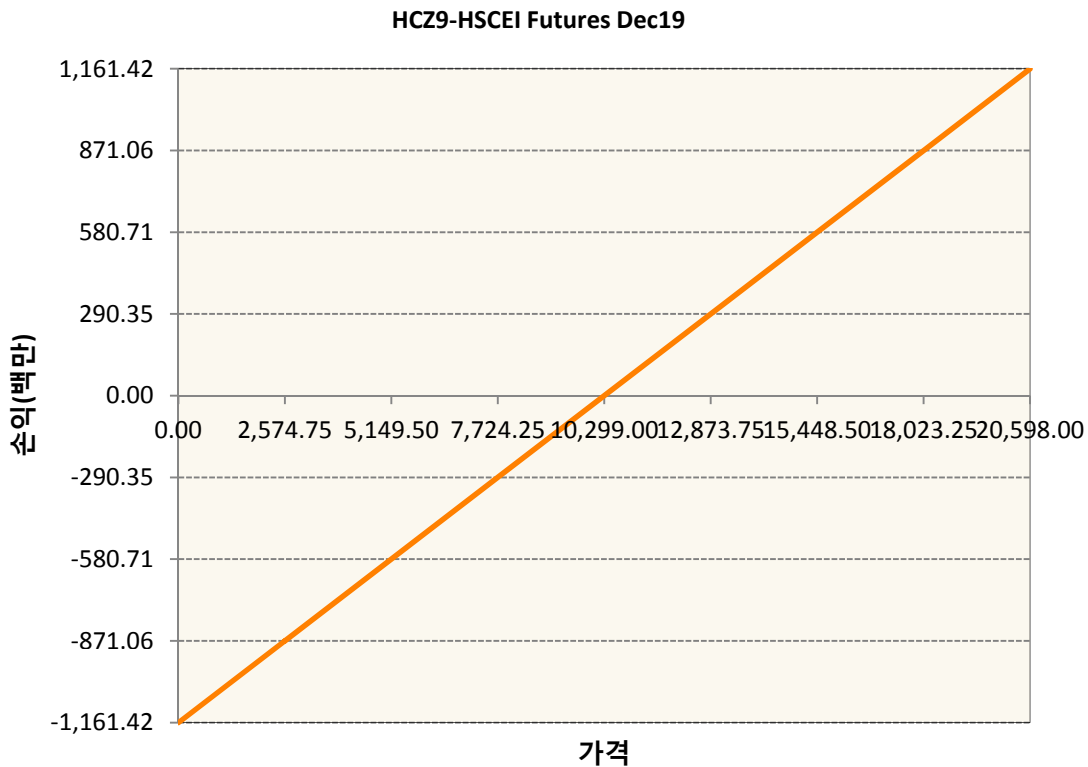
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,161	0	1,161	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ9	HSCEI Futures Dec19	93
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

84

공시일	2019-12-02
기준일	2019-11-29

커버드콜모(주식혼합-파생형)

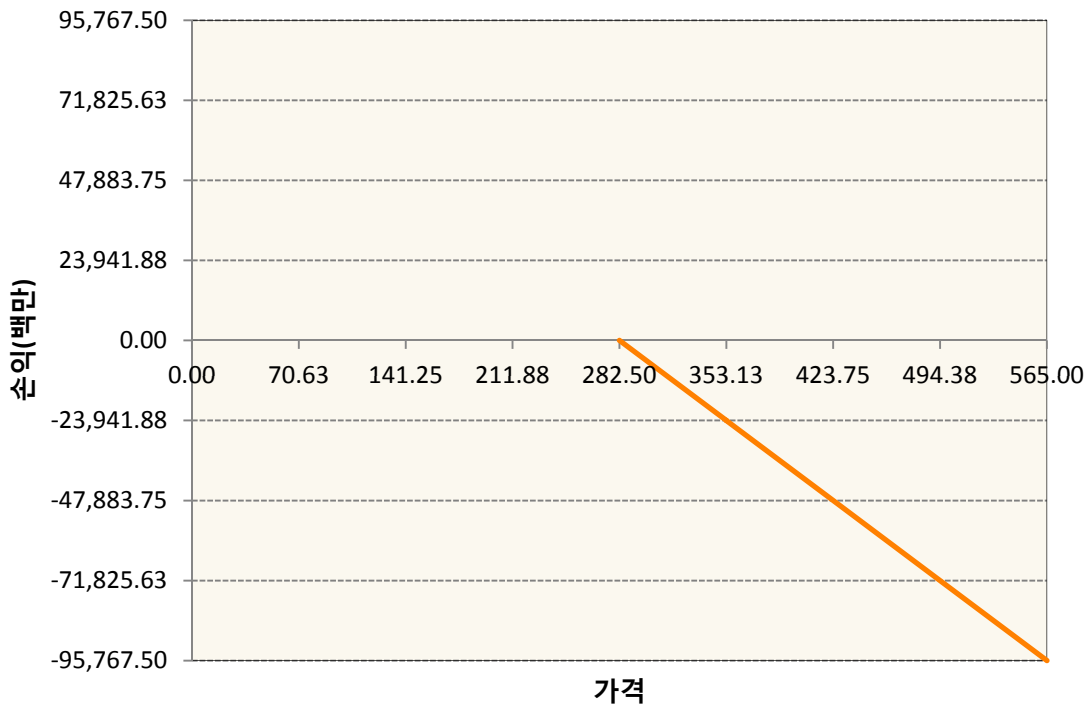
1. 계약금액

(단위:백만원)

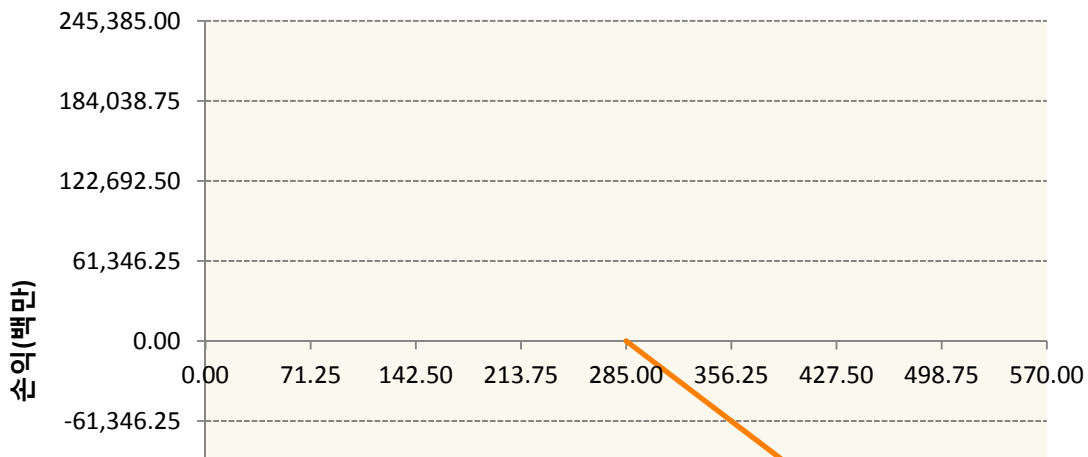
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	498,456	-498,456	장내

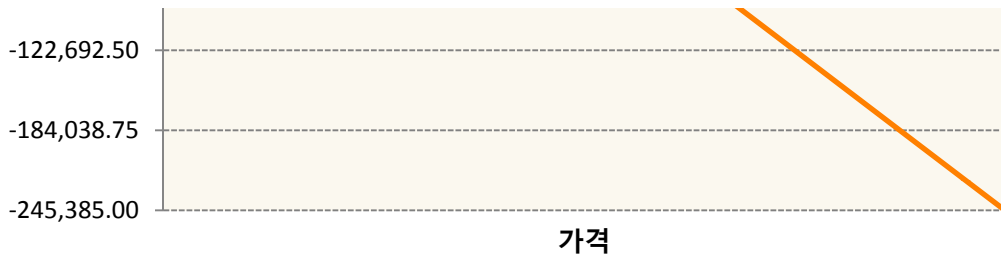
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PC2825-2019-12 콜282.5

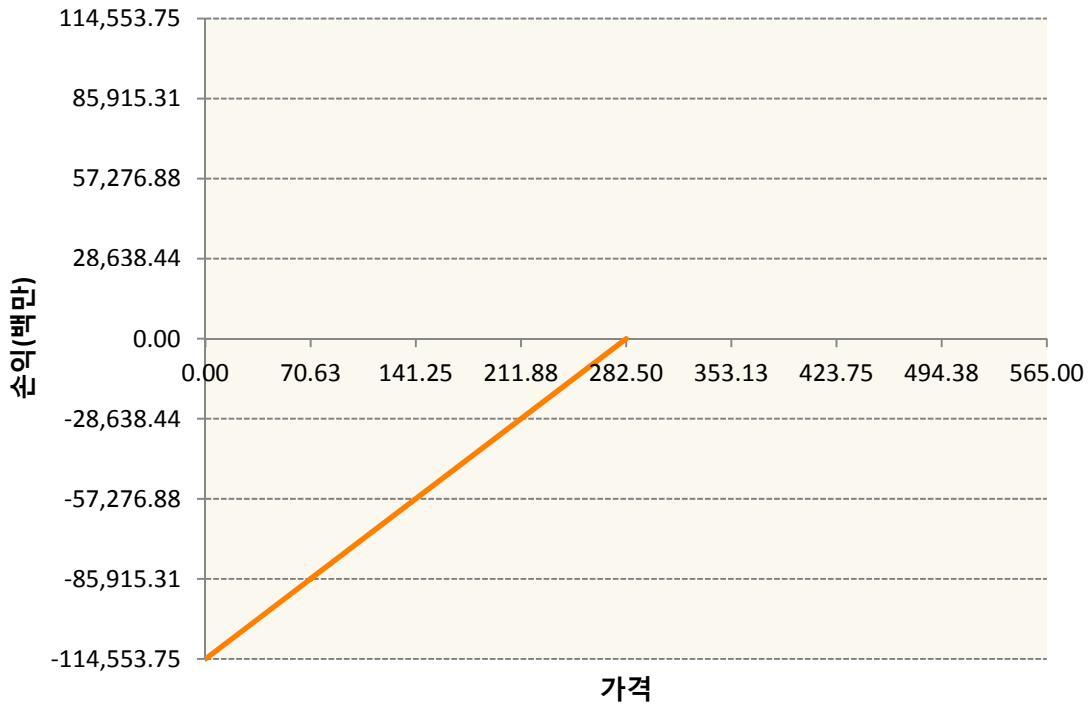


KR4201PC2858-2019-12 콜285

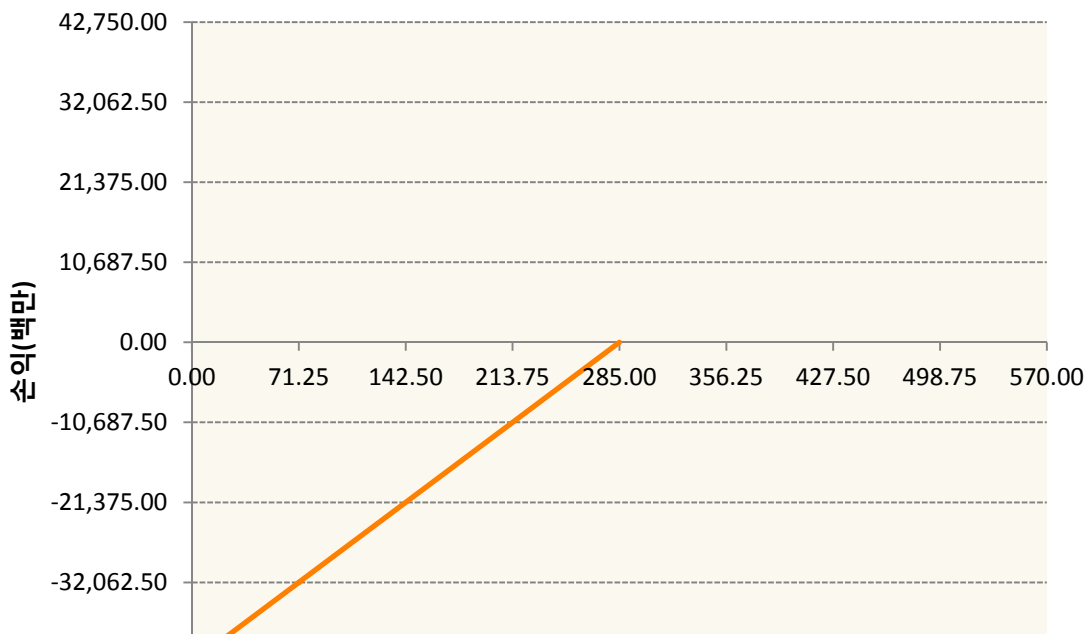




KR4301PC2824-2019-12 풋282.5



KR4301PC2857-2019-12 풋285



-42,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PC2825		2019-12 콜282.5						5,079
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,172	1,164	1,151	1,131	1,103	1,068	1,025	
-5.33%	1,135	1,103	1,059	1,005	941	868	786	
-2.67%	967	880	783	677	563	443	318	
0%	454	306	154	0	-156	-314	-473	
2.67%	-630	-798	-967	-1,135	-1,304	-1,473	-1,642	
5.33%	-2,334	-2,465	-2,602	-2,745	-2,892	-3,042	-3,195	
8.00%	-4,493	-4,565	-4,649	-4,744	-4,848	-4,960	-5,079	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						11,903
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,319	2,307	2,285	2,250	2,199	2,130	2,042	
-5.33%	2,267	2,211	2,131	2,025	1,895	1,741	1,566	
-2.67%	1,991	1,820	1,619	1,392	1,142	873	587	
0%	1,043	710	361	0	-370	-748	-1,133	
2.67%	-1,181	-1,613	-2,045	-2,477	-2,909	-3,342	-3,774	
5.33%	-4,996	-5,377	-5,768	-6,166	-6,570	-6,979	-7,392	
8.00%	-10,142	-10,378	-10,643	-10,931	-11,239	-11,564	-11,903	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						8,624
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-8,623	-8,623	-8,623	-8,623	-8,623	-8,623	-8,624	
-5.33%	-5,633	-5,633	-5,633	-5,634	-5,636	-5,639	-5,644	
-2.67%	-2,647	-2,653	-2,663	-2,678	-2,698	-2,723	-2,752	
0%	190	132	68	0	-72	-147	-225	
2.67%	2,100	2,005	1,909	1,813	1,716	1,620	1,523	
5.33%	2,656	2,624	2,586	2,541	2,489	2,433	2,373	
8.00%	2,706	2,703	2,699	2,691	2,680	2,664	2,644	
KR4301PC2857		2019-12 풋285						3,251
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,251	-3,251	-3,251	-3,251	-3,251	-3,251	-3,251	
-5.33%	-2,144	-2,144	-2,144	-2,145	-2,145	-2,145	-2,146	
-2.67%	-1,039	-1,039	-1,041	-1,044	-1,047	-1,053	-1,060	
0%	46	33	18	0	-20	-41	-64	
2.67%	910	874	838	802	765	729	692	

5.33%	1,264	1,243	1,220	1,196	1,170	1,142	1,113
8.00%	1,313	1,311	1,307	1,300	1,292	1,283	1,271

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

(단위:백만원)

29,846

공시일	2019-12-02
기준일	2019-11-29

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

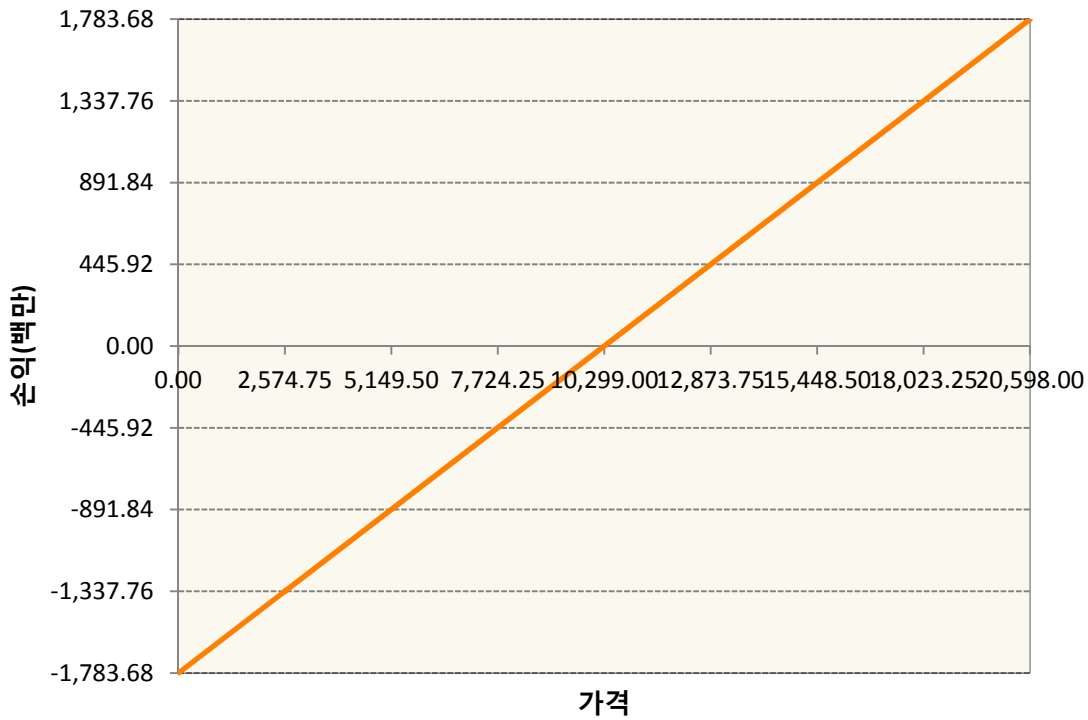
1. 계약금액

(단위:백만원)

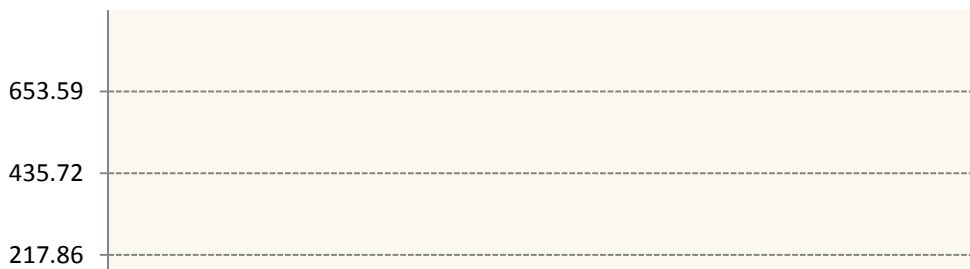
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,784	0	1,784	
누계	유가증권	옵션	0	4,942	-4,942	장내
누계	통화	선도	0	2,125	-2,125	장외

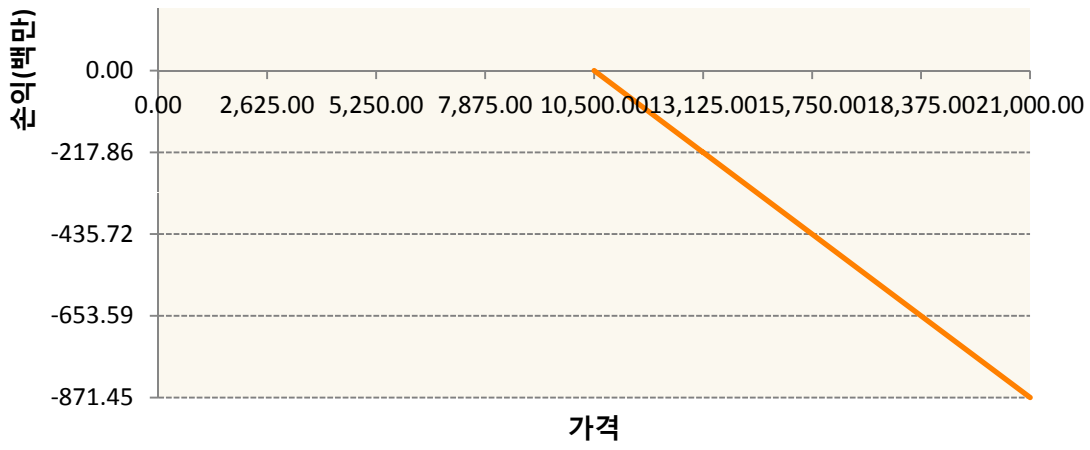
2. 만기시점의 손익구조

HCZ9-HSCEI Futures Dec19

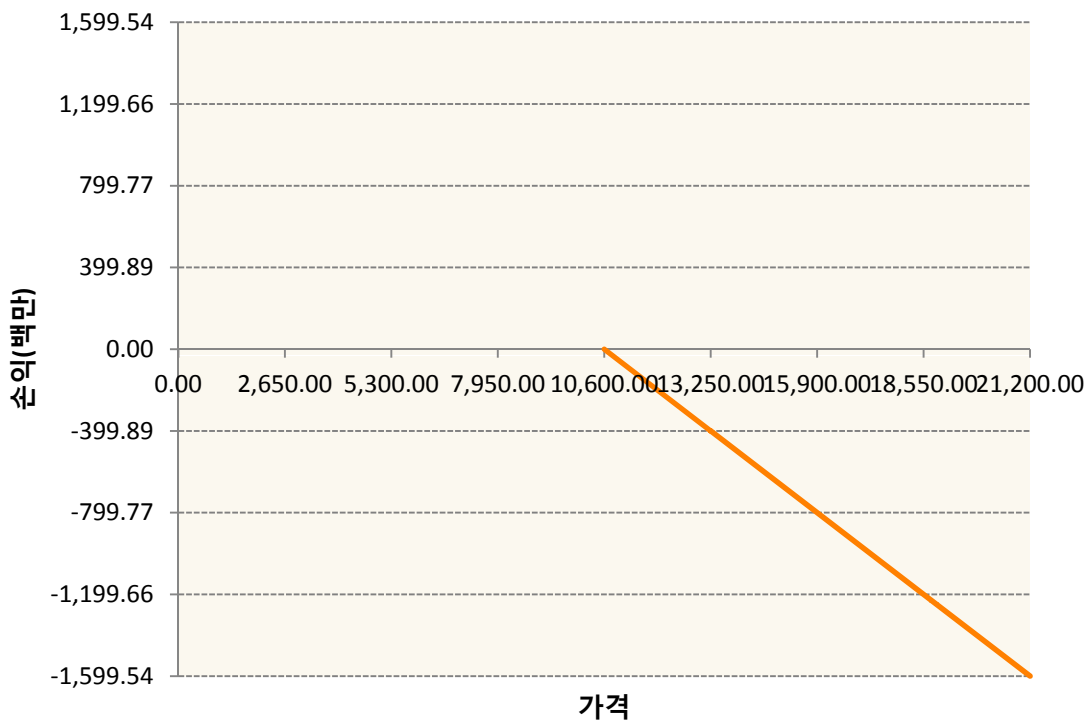


OHHIZ9-C105-HSCEI

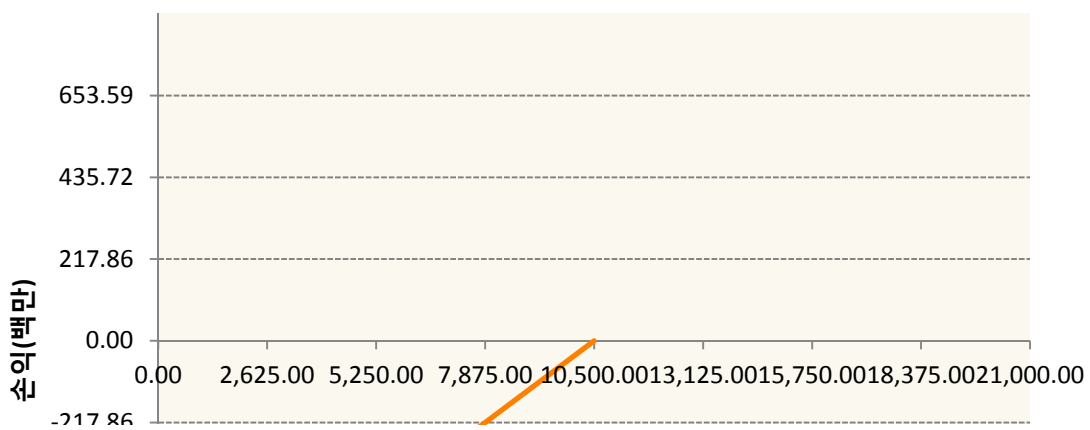


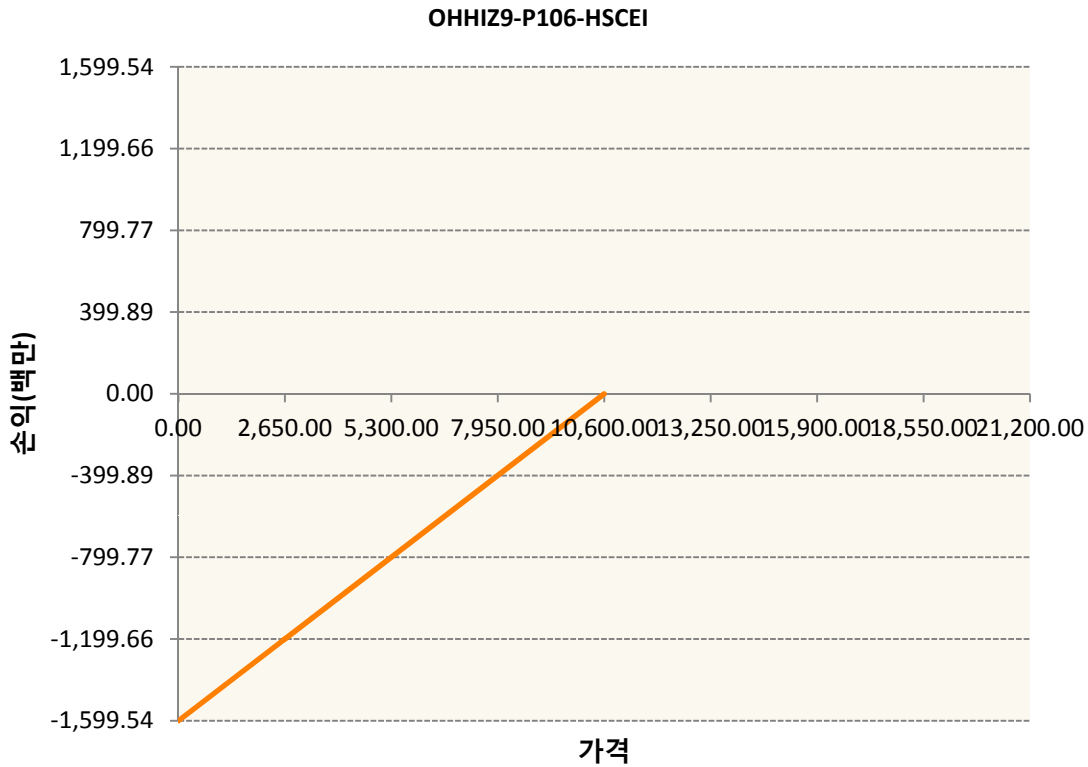
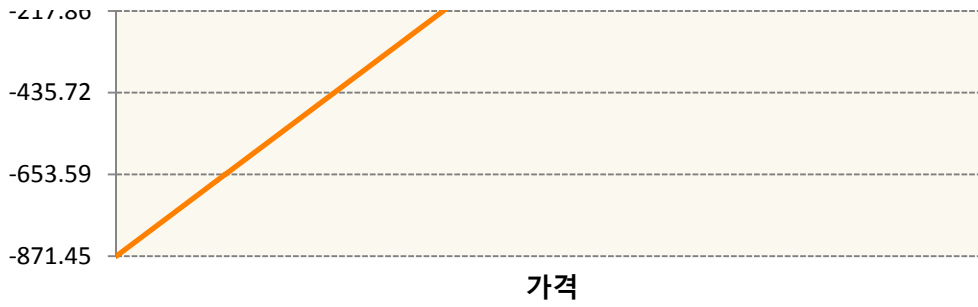


OHHIZ9-C106-HSCEI



OHHIZ9-P105-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	170
HCZ9 HSCEI Futures Dec19	143
OHHIZ9-C1C HSCEI	70
OHHIZ9-C1C HSCEI	128
OHHIZ9-P10 HSCEI	70
OHHIZ9-P10 HSCEI	128

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

533

공시일	2019-12-02
기준일	2019-11-29

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

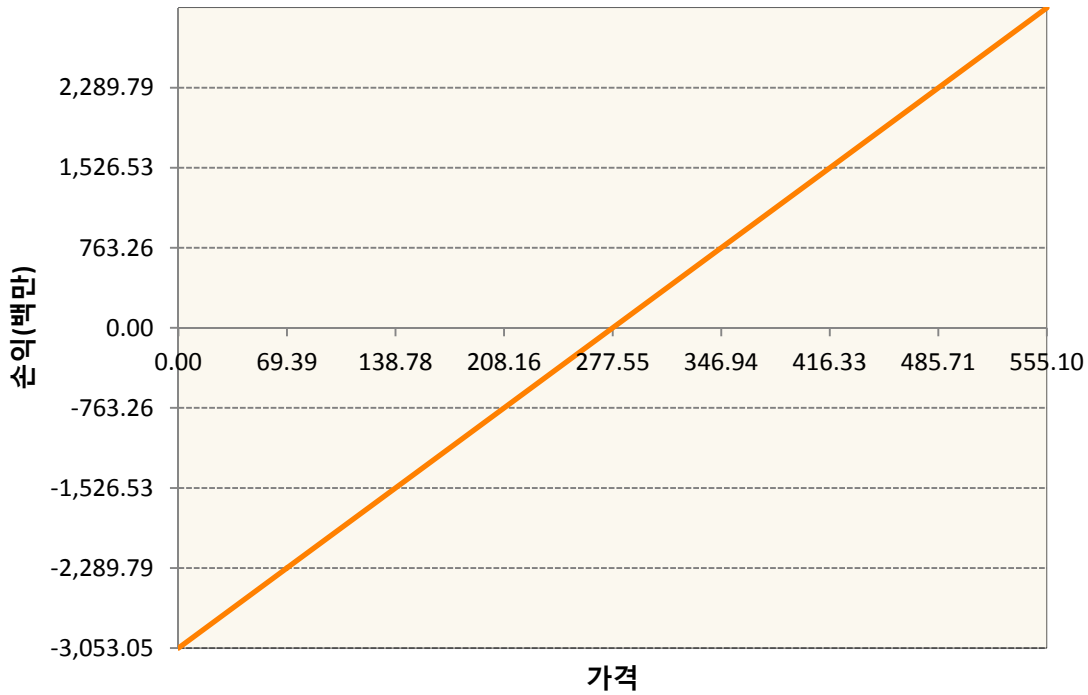
1. 계약금액

(단위:백만원)

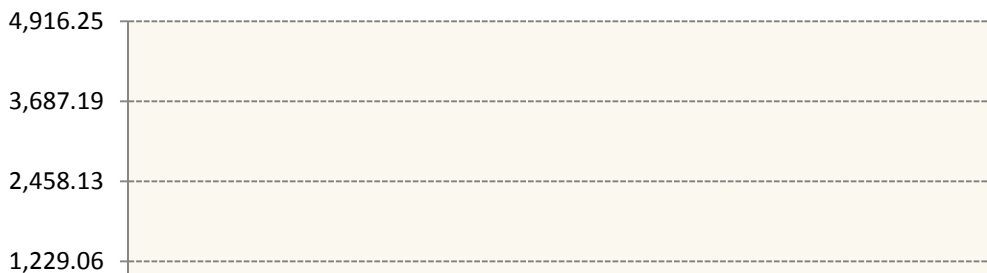
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,053	0	3,053	장내
누계	유가증권	스왑	9,625	0	9,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,657	-9,657	장내

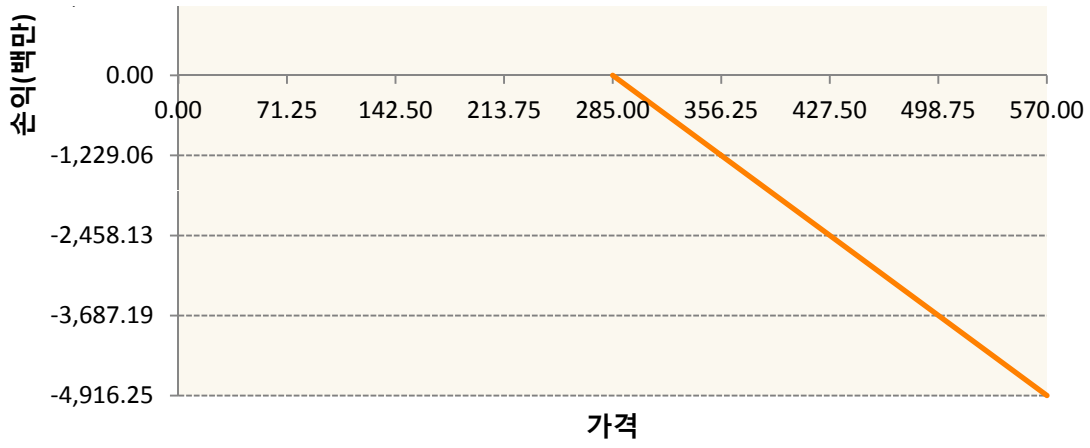
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

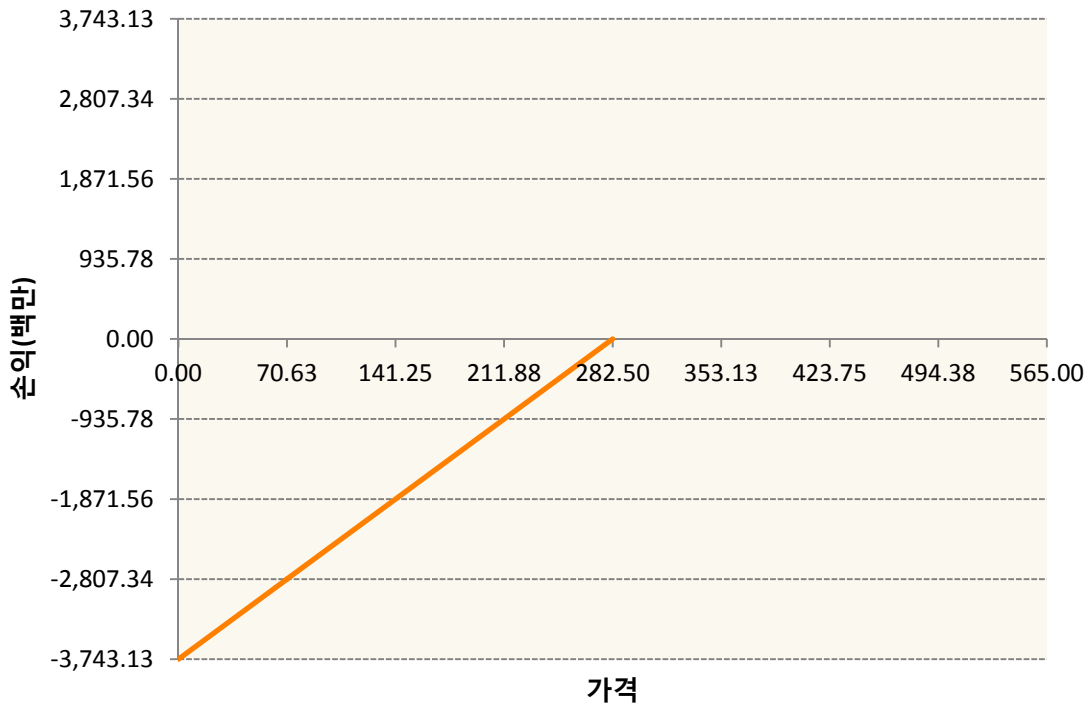


KR4201PC2858-2019-12 콜285

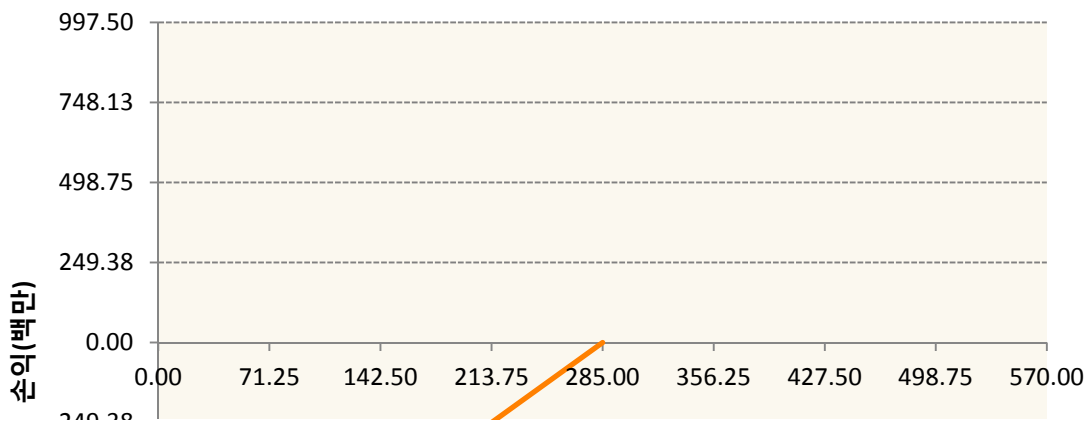




KR4301PC2824-2019-12 풋282.5



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						244
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-244	-244	-244	-244	-244	-244	-244	
-5.33%	-162	-162	-162	-162	-162	-162	-162	
-2.67%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	81	81	81	81	81	81	81	
5.33%	162	162	162	162	162	162	162	
8.00%	244	244	244	244	244	244	244	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						238
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	46	46	46	45	44	43	41	
-5.33%	45	44	43	41	38	35	31	
-2.67%	40	36	32	28	23	17	12	
0%	21	14	7	0	-7	-15	-23	
2.67%	-24	-32	-41	-50	-58	-67	-76	
5.33%	-100	-108	-116	-124	-132	-140	-148	
8.00%	-203	-208	-213	-219	-225	-232	-238	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						282
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-282	-282	-282	-282	-282	-282	-282
-5.33%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
-2.67%	-86	-87	-87	-88	-88	-89	-90
0%	6	4	2	0	-2	-5	-7
2.67%	69	66	62	59	56	53	50
5.33%	87	86	84	83	81	80	78
8.00%	88	88	88	88	88	87	86
KR4301PC2857 2019-12 풋285							76
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
-5.33%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
-2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-25	-25
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	21	20	20	19	18	17	16
5.33%	29	29	28	28	27	27	26
8.00%	31	31	30	30	30	30	30

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

(단위:백만원)

1,673

공시일	2019-12-02
기준일	2019-11-29

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

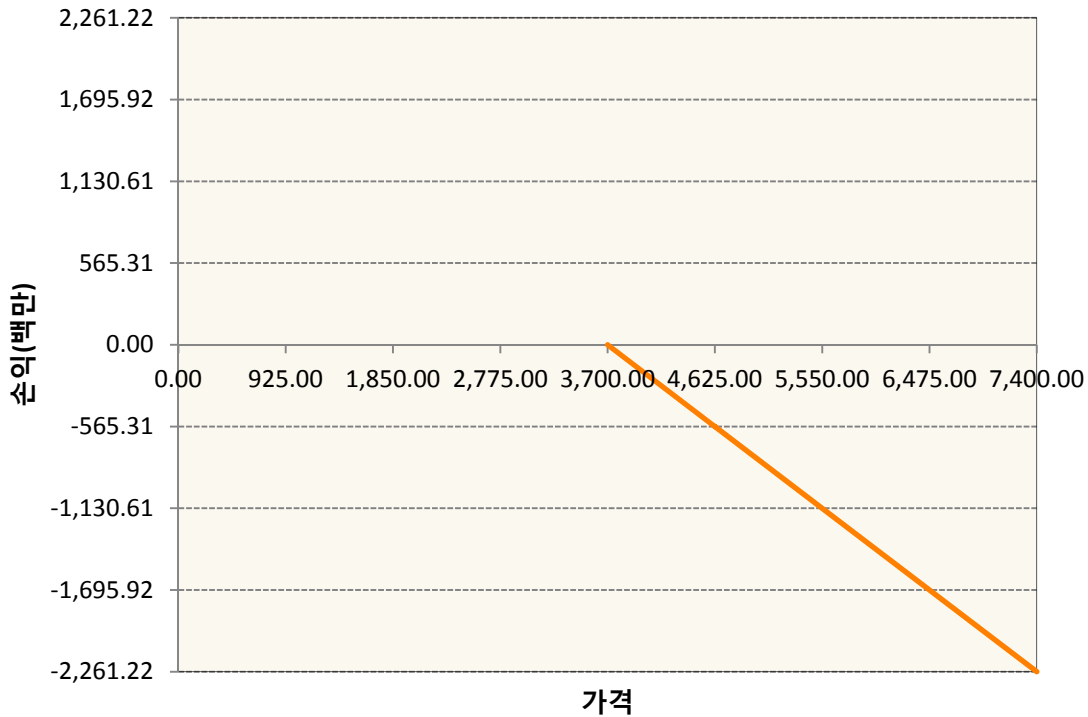
1. 계약금액

(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	1,246	0	1,246	
누계	유가증권	스왑	17,779	0	17,779	장외
누계	유가증권	옵션	0	8,591	-8,591	장내
누계	통화	선도	2,699	6,111	-3,412	장외

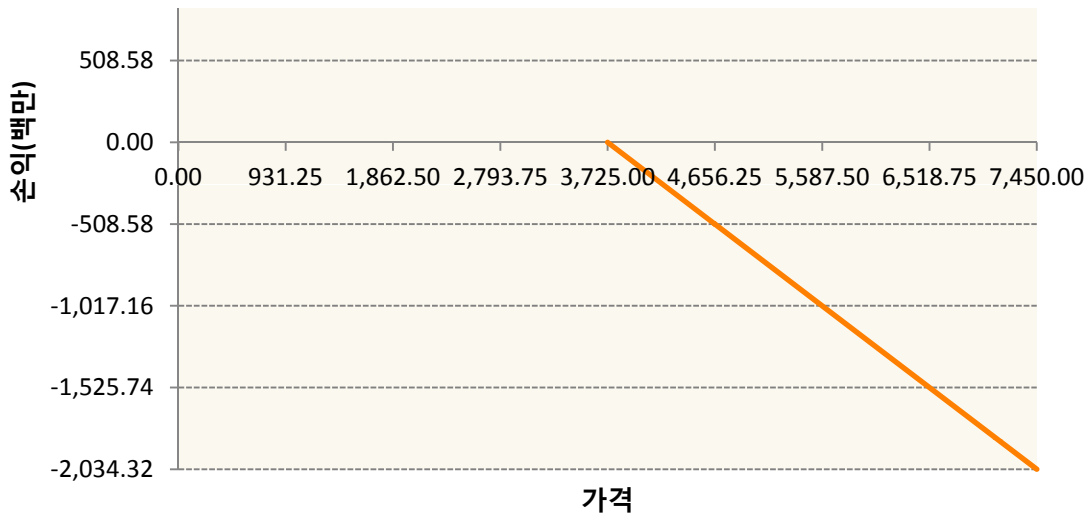
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ9-C3700-EURO STOXX 50

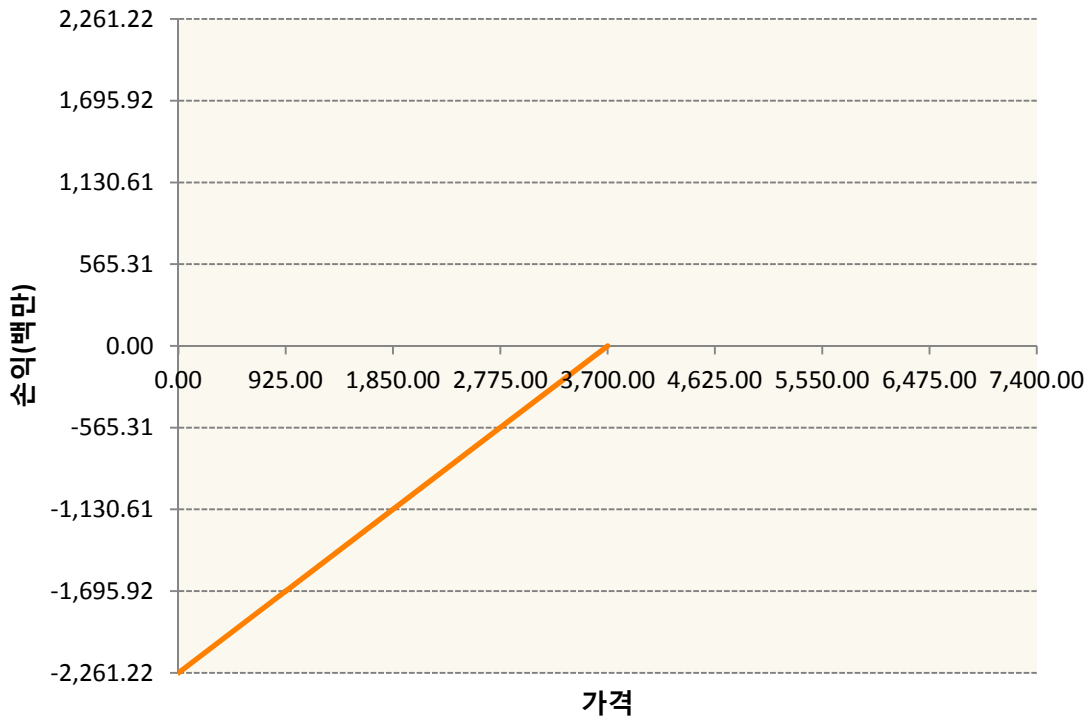


OESXZ9-C3725-EURO STOXX 50

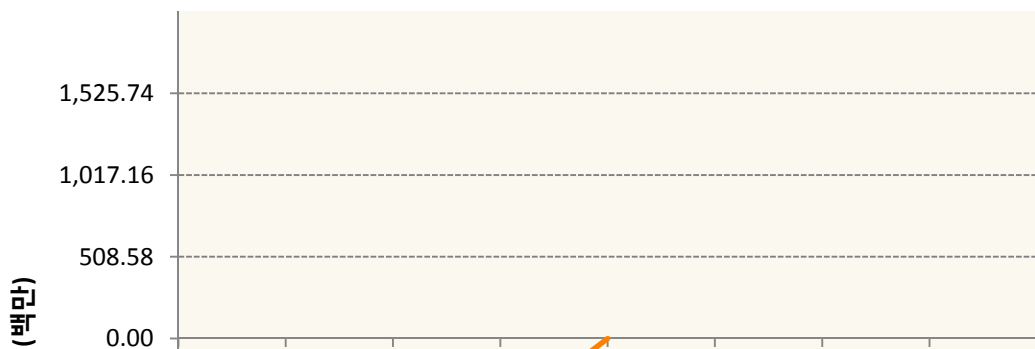


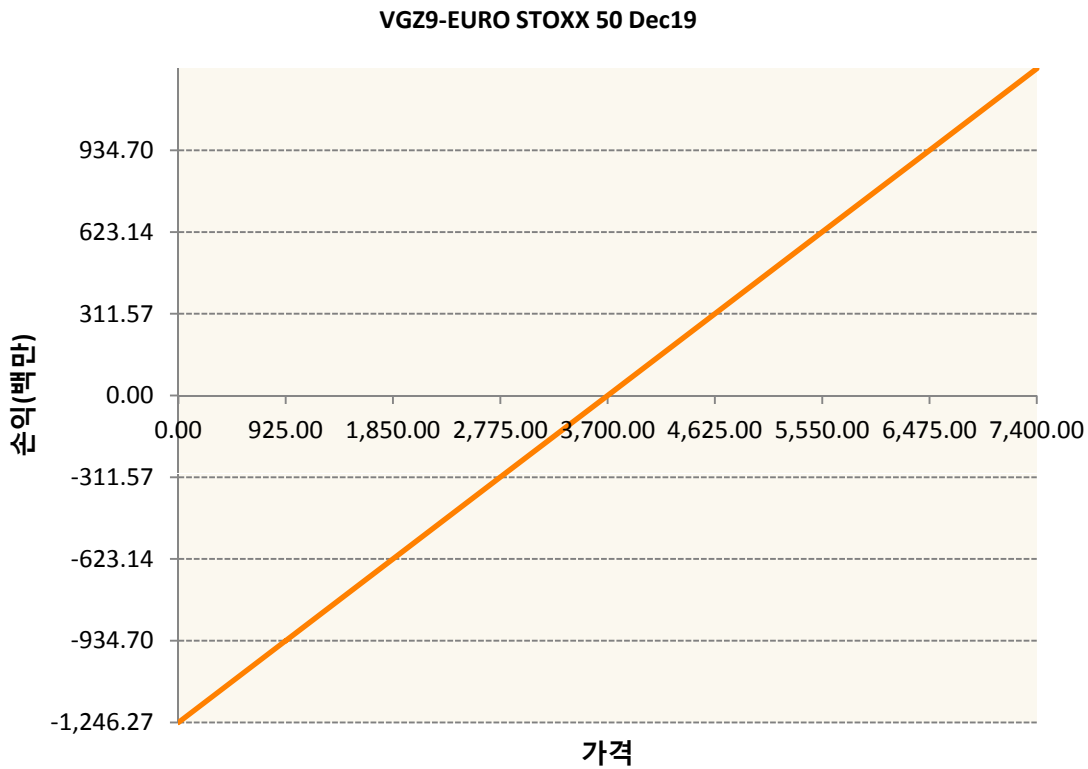
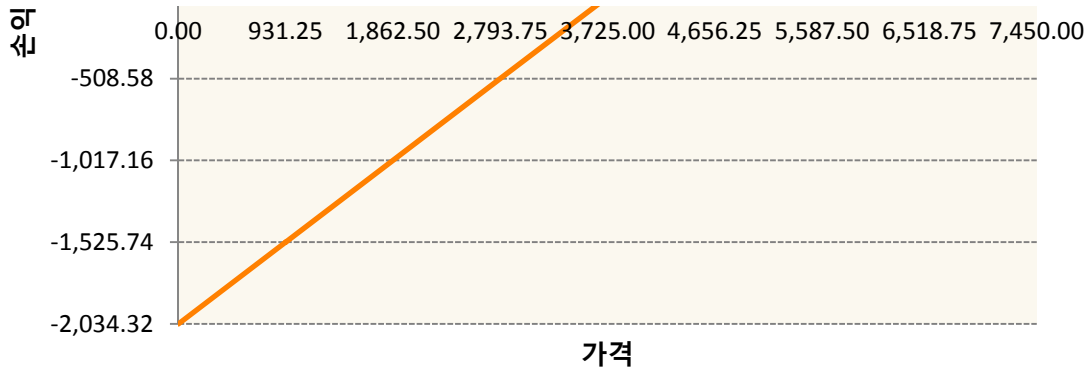


OESXZ9-P3700-EURO STOXX 50



OESXZ9-P3725-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	26
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E	489
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E	164
FX21019X02 EUR/KRW 27-12-19E	52
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	181
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	163
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	181
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	163
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19	100

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

(단위:백만원)

875

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

(단위:백만원)

905

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

(단위:백만원)

79

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

(단위:백만원)

123

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

(단위:백만원)

40

공시일	2019-12-02
기준일	2019-11-29

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

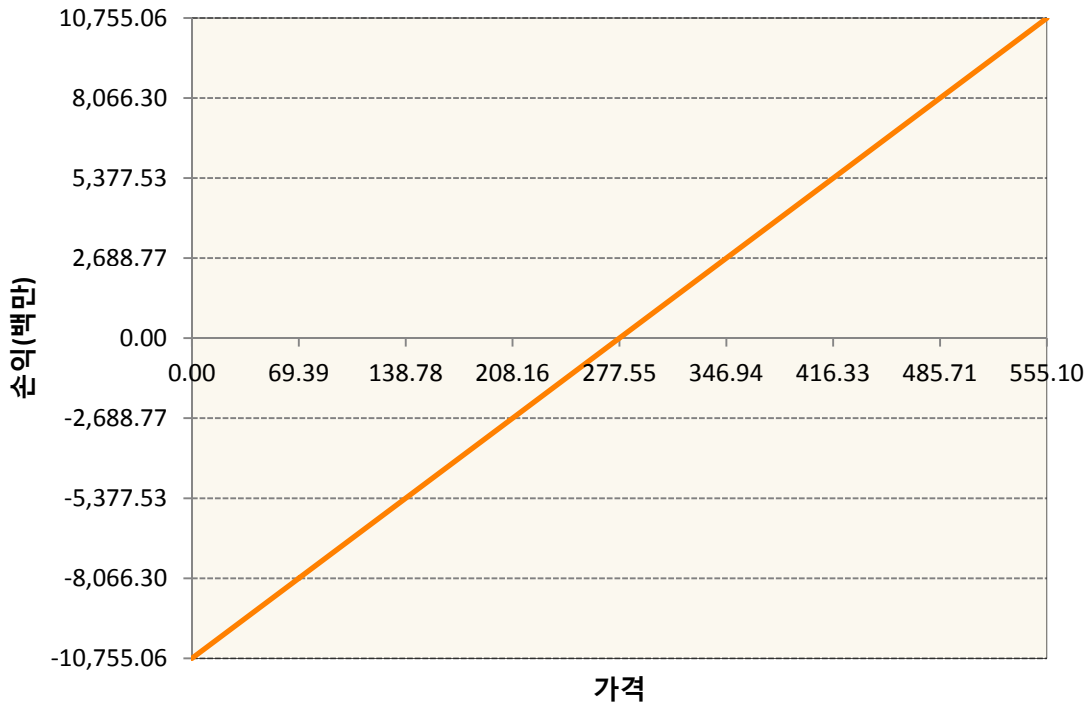
1. 계약금액

(단위:백만원)

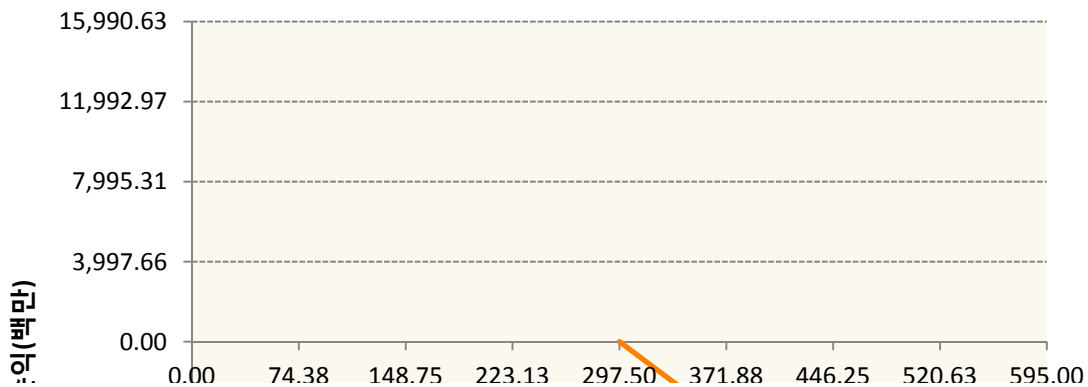
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,755	0	10,755	장내
누계	유가증권	옵션	1,277	21,241	-19,964	장내

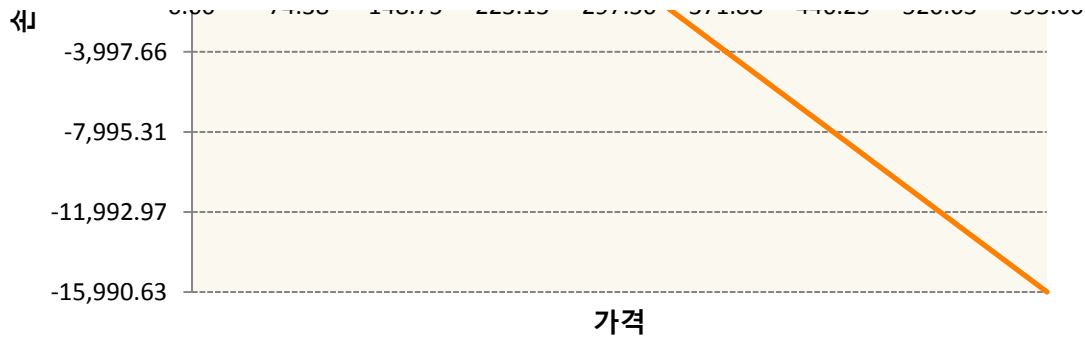
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

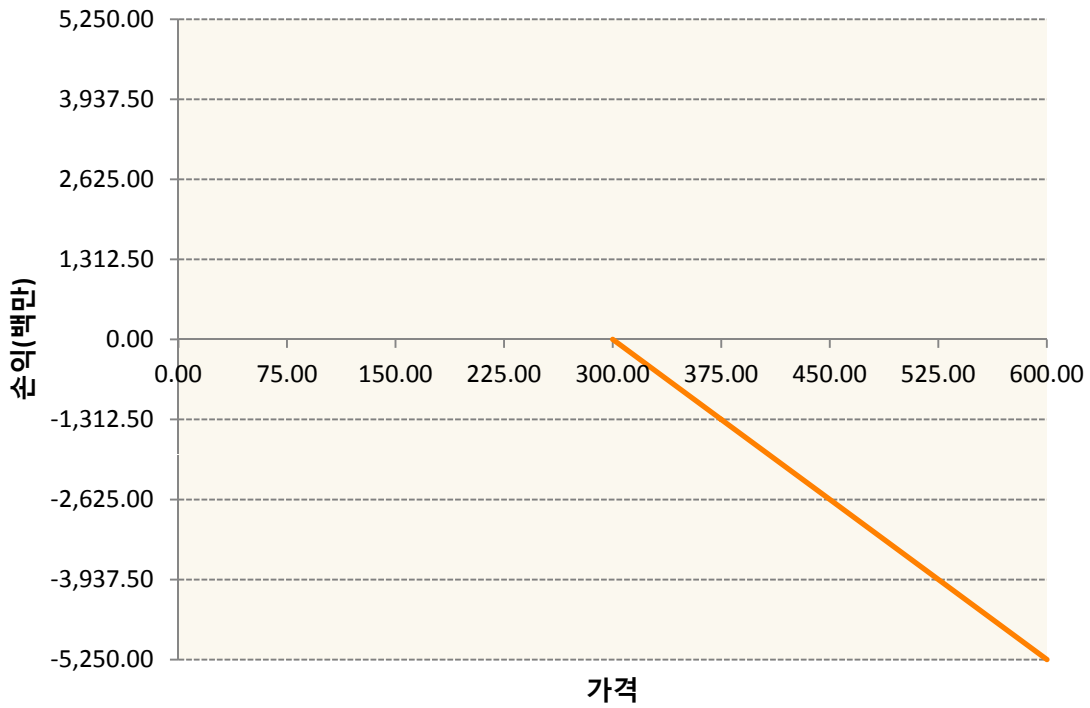


KR4201PC2973-2019-12 콜297.5

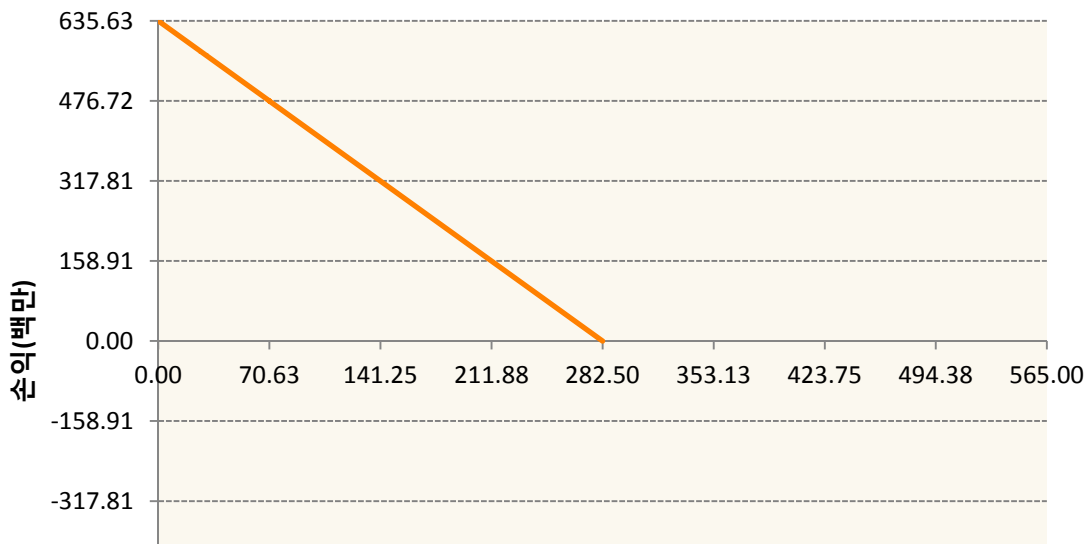


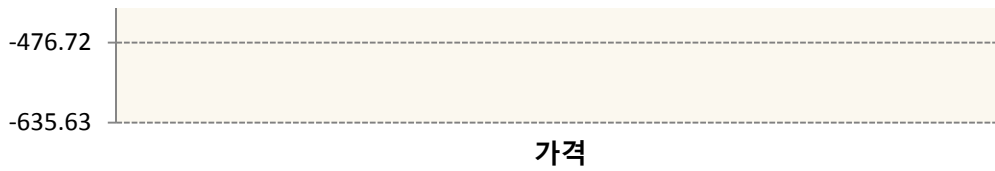


KR4201PC3005-2019-12 콜300

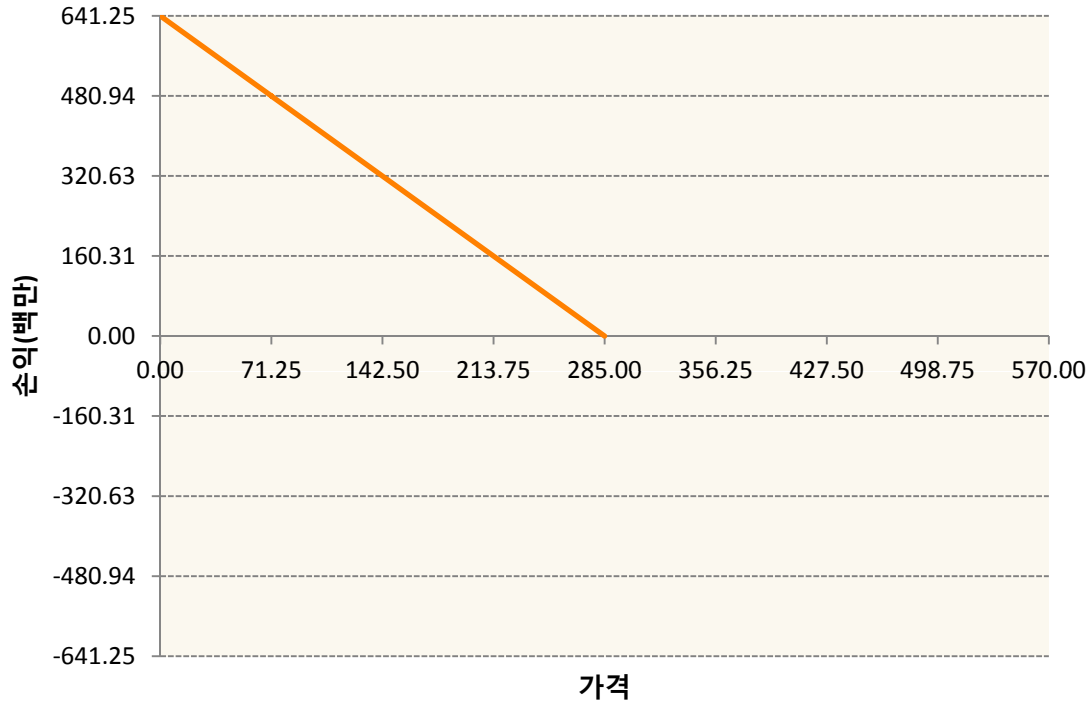


KR4301PC2824-2019-12 풋282.5





KR4301PC2857-2019-12 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						858
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-858	-858	-858	-858	-858	-858	-858	
-5.33%	-572	-572	-572	-572	-572	-572	-572	
-2.67%	-286	-286	-286	-286	-286	-286	-286	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	286	286	286	286	286	286	286	
5.33%	572	572	572	572	572	572	572	
8.00%	858	858	858	858	858	858	858	
KR4201PC2973		2019-12 콜297.5						429
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	33	33	32	32	32	31	29	
-5.33%	32	32	32	30	28	26	22	
-2.67%	31	30	27	23	18	11	3	

0%	24	18	10	0	-12	-25	-39
2.67%	-5	-21	-37	-56	-75	-96	-117
5.33%	-89	-114	-139	-165	-191	-218	-244
8.00%	-259	-287	-316	-344	-372	-400	-429
KR4201PC3005 2019-12 콜300							121
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7	7	7	7	7	7	7
-5.33%	7	7	7	7	7	6	5
-2.67%	7	7	6	5	4	2	0
0%	6	4	3	0	-3	-7	-11
2.67%	-1	-4	-9	-14	-20	-26	-32
5.33%	-21	-28	-35	-43	-51	-59	-68
8.00%	-66	-75	-84	-94	-103	-112	-121
KR4301PC2824 2019-12 풋282.5							48
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	48	48	48	48	48	48	48
-5.33%	31	31	31	31	31	31	31
-2.67%	15	15	15	15	15	15	15
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-12	-11	-11	-10	-10	-9	-8
5.33%	-15	-15	-14	-14	-14	-14	-13
8.00%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
KR4301PC2857 2019-12 풋285							49
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	49	49	49	49	49	49	49
-5.33%	32	32	32	32	32	32	32
-2.67%	16	16	16	16	16	16	16
0%	-1	0	0	0	0	1	1
2.67%	-14	-13	-13	-12	-11	-11	-10
5.33%	-19	-19	-18	-18	-18	-17	-17
8.00%	-20	-20	-20	-20	-19	-19	-19

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

(단위:백만원)

1,097

공시일	2019-12-02
기준일	2019-11-29

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	206,707	0	206,707	

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	2019-12-02
기준일	2019-11-29

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	215,741	0	215,741	

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	2019-12-02
기준일	2019-11-29

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	547,759	0	547,759	
누계	통화	선도	0	539,927	-539,927	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		661
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		699
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,701
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,819
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,417
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,521
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		945
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		945
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		945
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		945
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		472
FX21019X00 KRW/USD 06-12-19E		661
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		1,550
FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E		945
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		472
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		945
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		1,550
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		1,890
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		3,251
FX21019X02 KRW/USD 26-12-19E		4,763
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		4,819
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		189
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,835

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

(단위:백만원)

13,584

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

(단위:백만원)

184

공시일	2019-12-02
기준일	2019-11-29

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

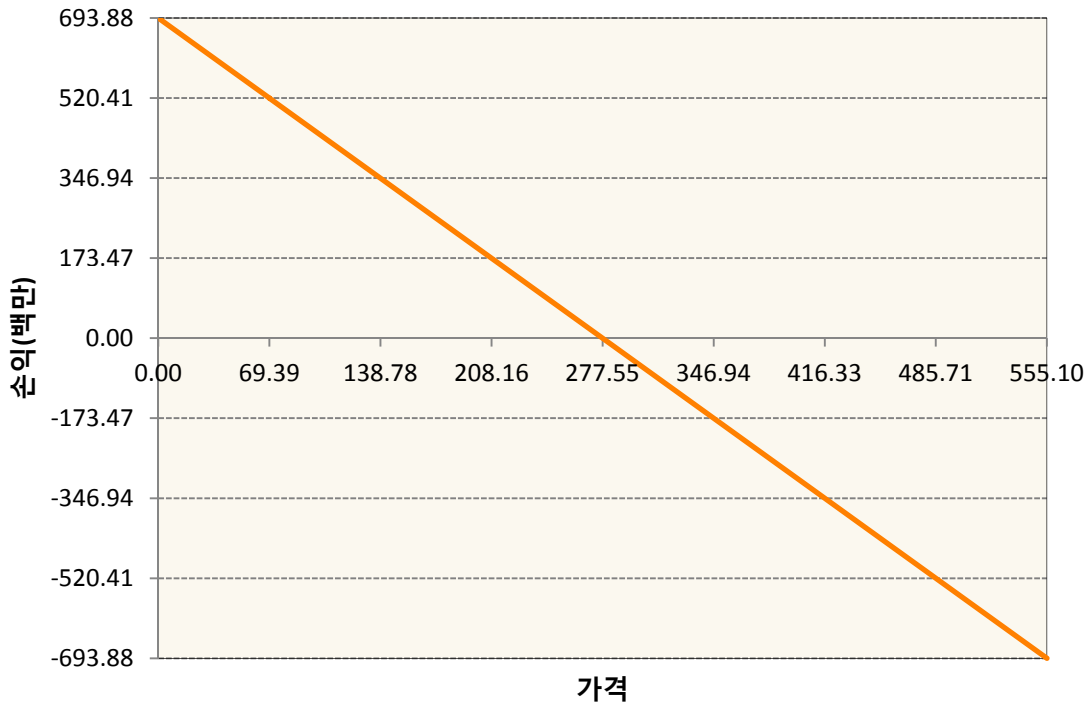
1. 계약금액

(단위:백만원)

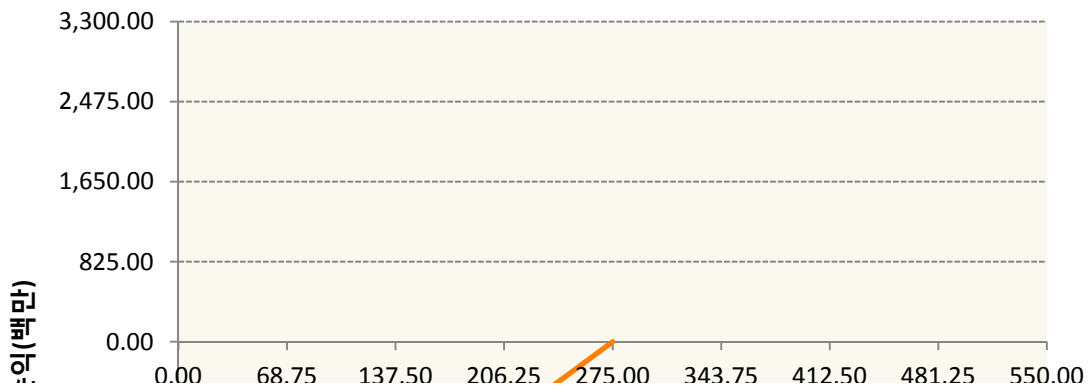
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	694	-694	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,994	-3,994	장내

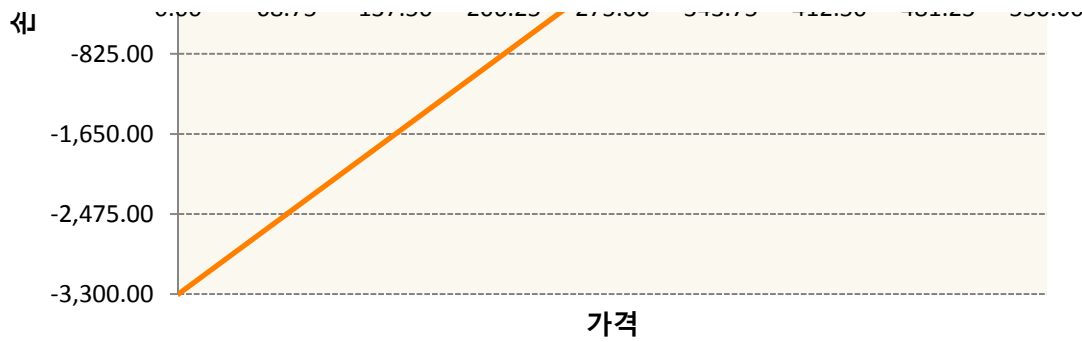
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

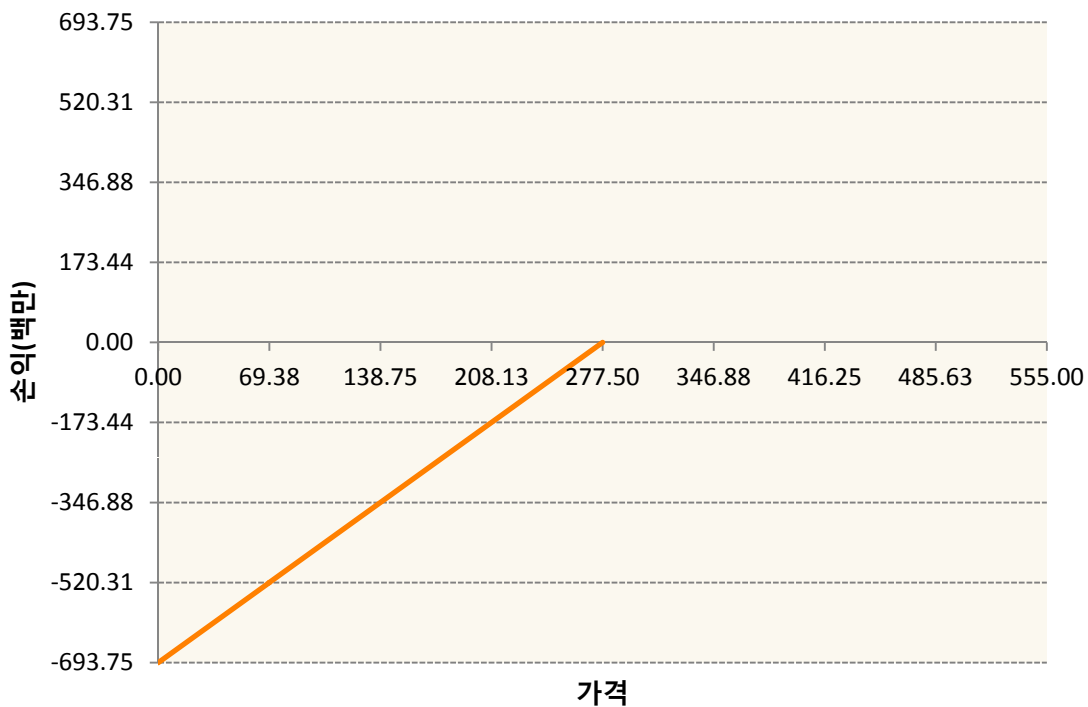


KR4301PC2758-2019-12 풋275





KR4301PC2774-2019-12 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						55
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	55	55	55	55	55	55	55	
-5.33%	37	37	37	37	37	37	37	
-2.67%	18	18	18	18	18	18	18	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37	
8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55	
KR4301PC2758		2019-12 풋275						221
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-220	-220	-220	-220	-220	-221	-221
-5.33%	-132	-132	-132	-133	-133	-134	-135
-2.67%	-48	-50	-51	-53	-55	-58	-60
0%	8	5	3	0	-3	-6	-8
2.67%	24	23	22	21	19	18	16
5.33%	25	25	25	25	24	24	23
8.00%	25	25	25	25	25	25	25
KR4301PC2774 2019-12 풋277.5							49
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-5.33%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
-2.67%	-13	-13	-13	-13	-14	-14	-14
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	7	7	7	6	6	6	5
5.33%	8	8	8	8	8	8	8
8.00%	8	8	8	8	8	8	8

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

(단위:백만원)

360

공시일	2019-12-02
기준일	2019-11-29

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	15,156	0	15,156	
누계	통화	선도	0	14,907	-14,907	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019V01 KRW/USD 10-12-19E		374
FX21019X01 KRW/USD 13-01-20E		232
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		293
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		294

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

(단위:백만원)

375

공시일	2019-12-02
기준일	2019-11-29

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	998	0	998	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	2019-12-02
기준일	2019-11-29

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

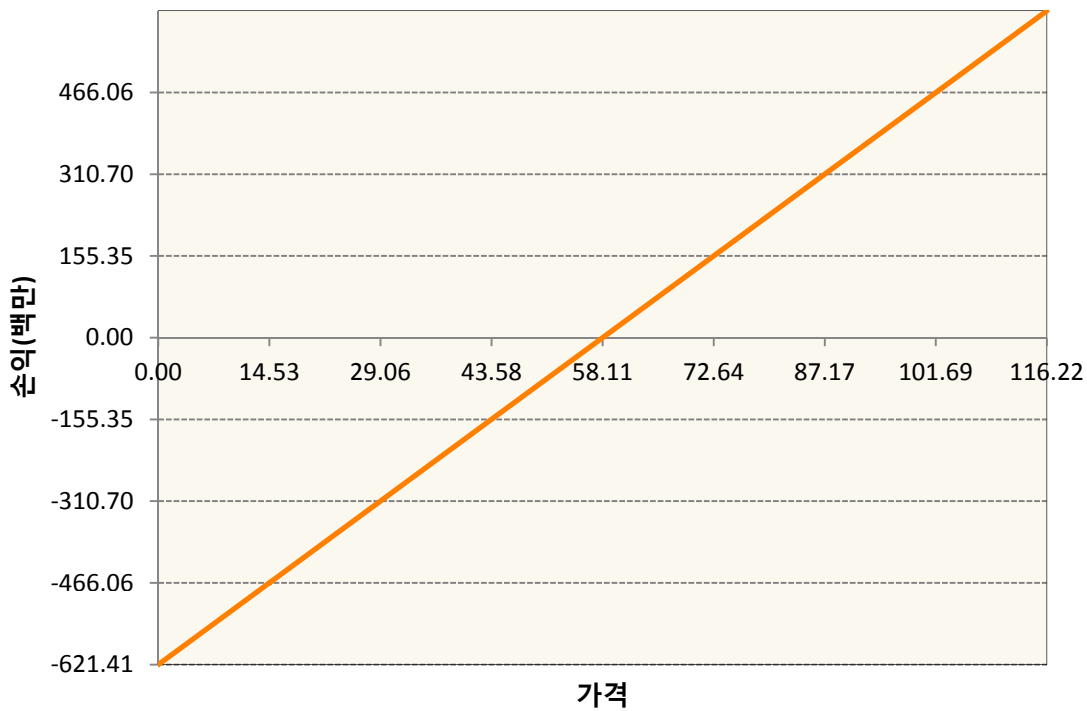
1. 계약금액

(단위:백만원)

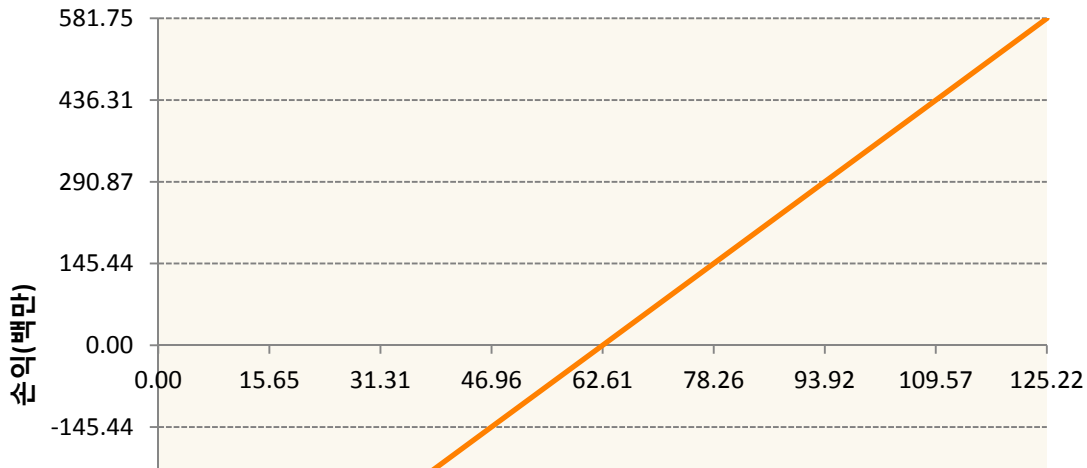
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,482	295	2,187	

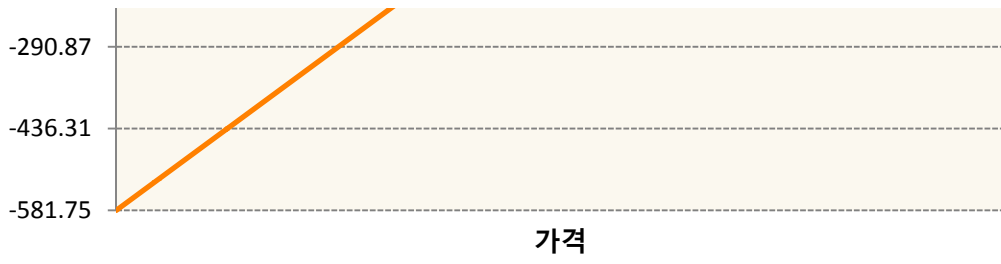
2. 만기시점의 손익구조

CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20

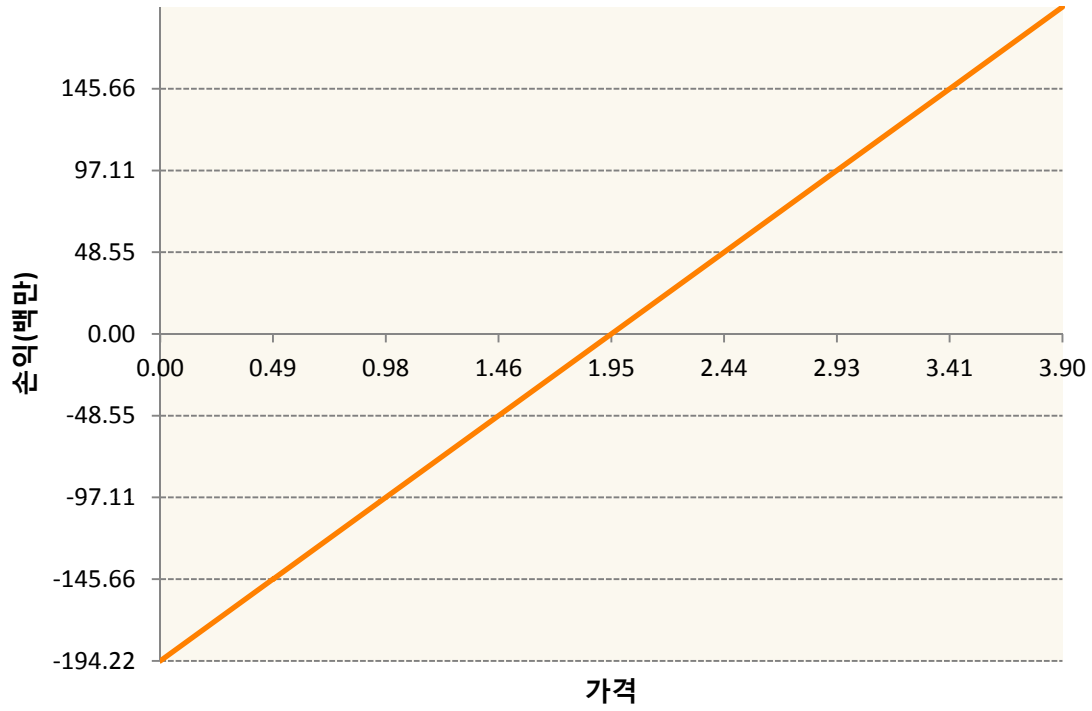


COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20

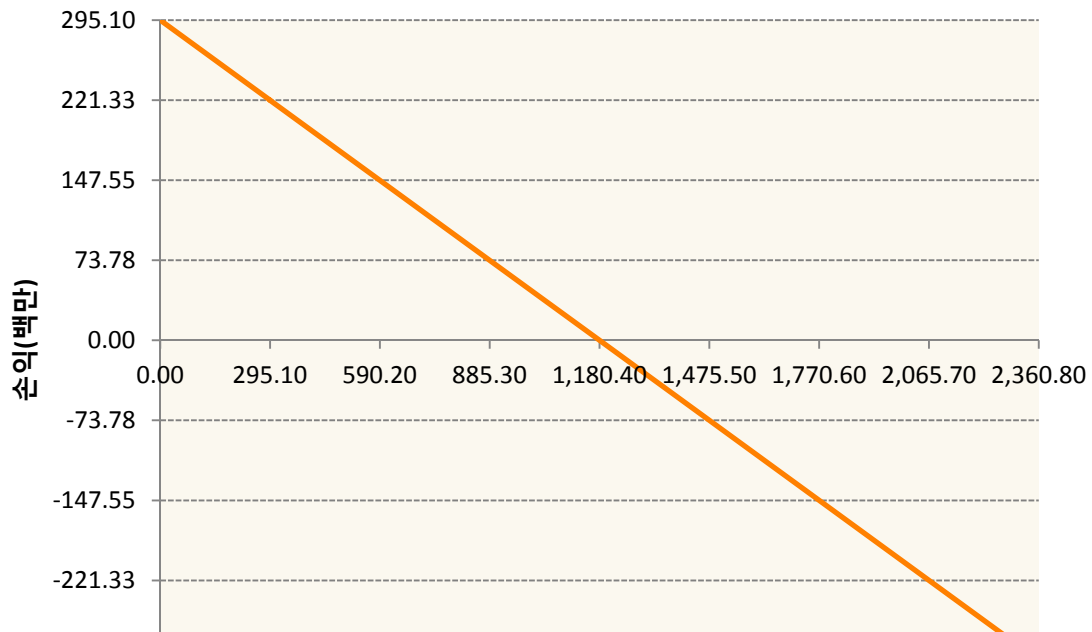


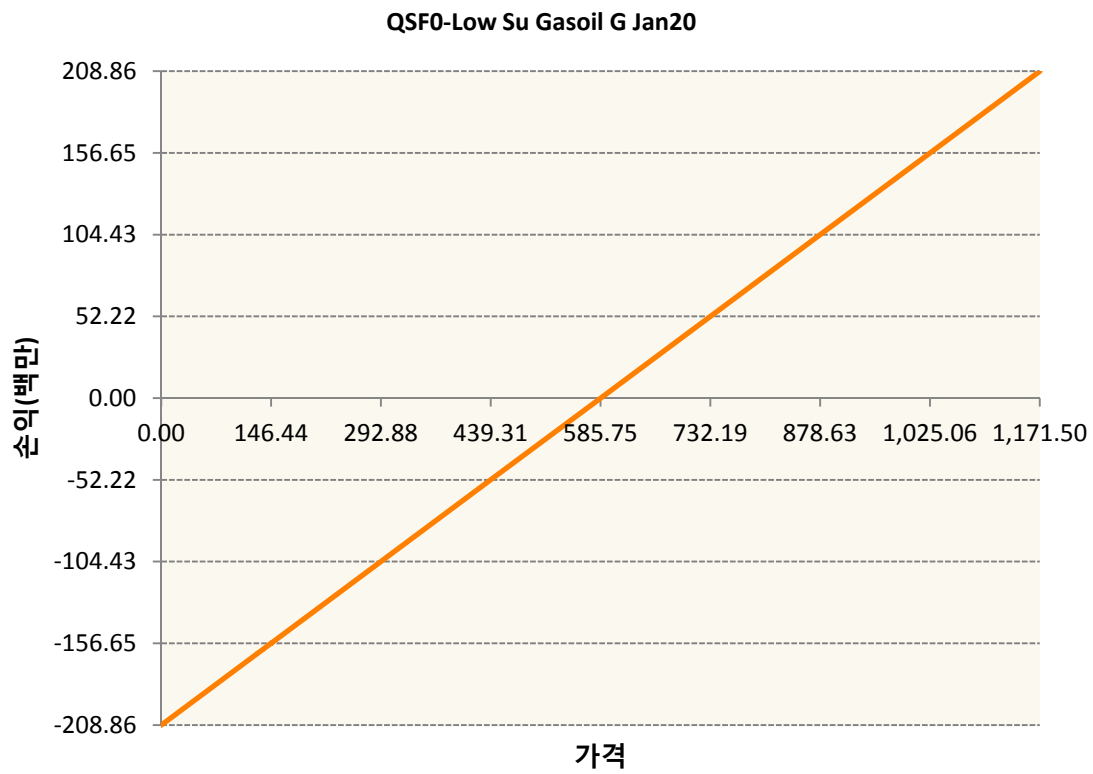
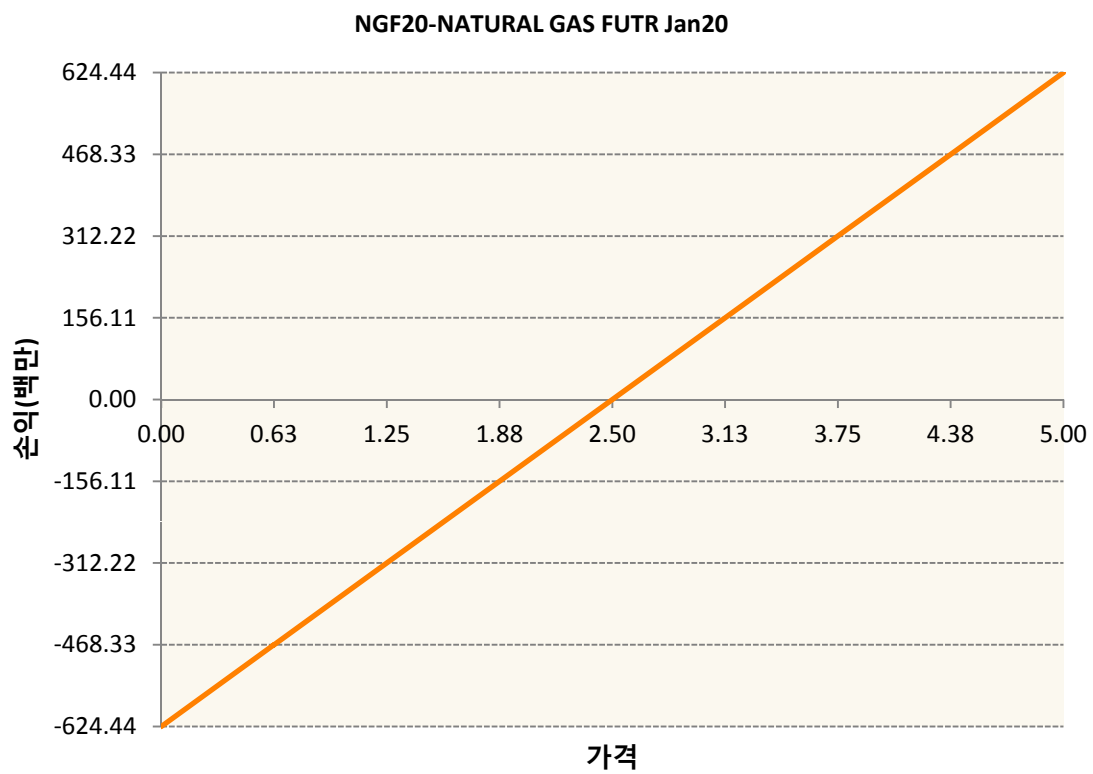
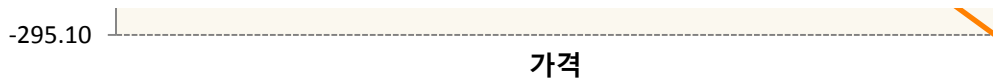


HOF0-NY Harb ULSD Fut Jan20

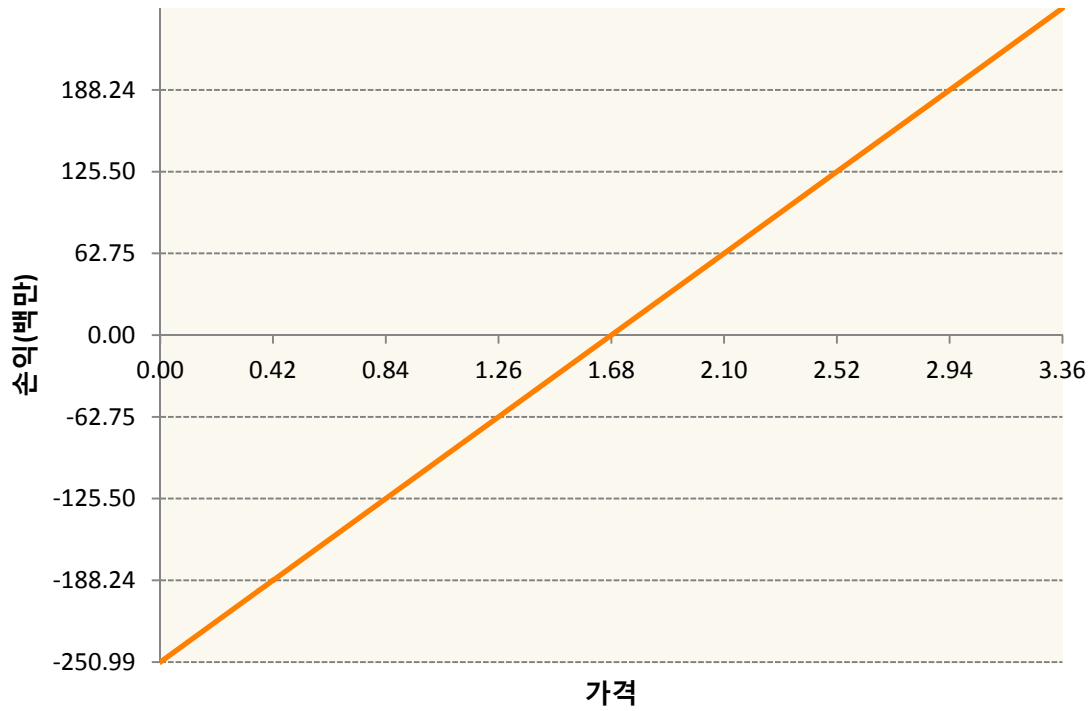


KR4175PC0003-2019-12 달러선물





XBF0-GASOLINE RBOB FUT Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLF0	WTI CRUDE FUTURE Jan20	50
COH0	BRENT CRUDE FUTR Mar20	47
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	2019-12-02
기준일	2019-11-29

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

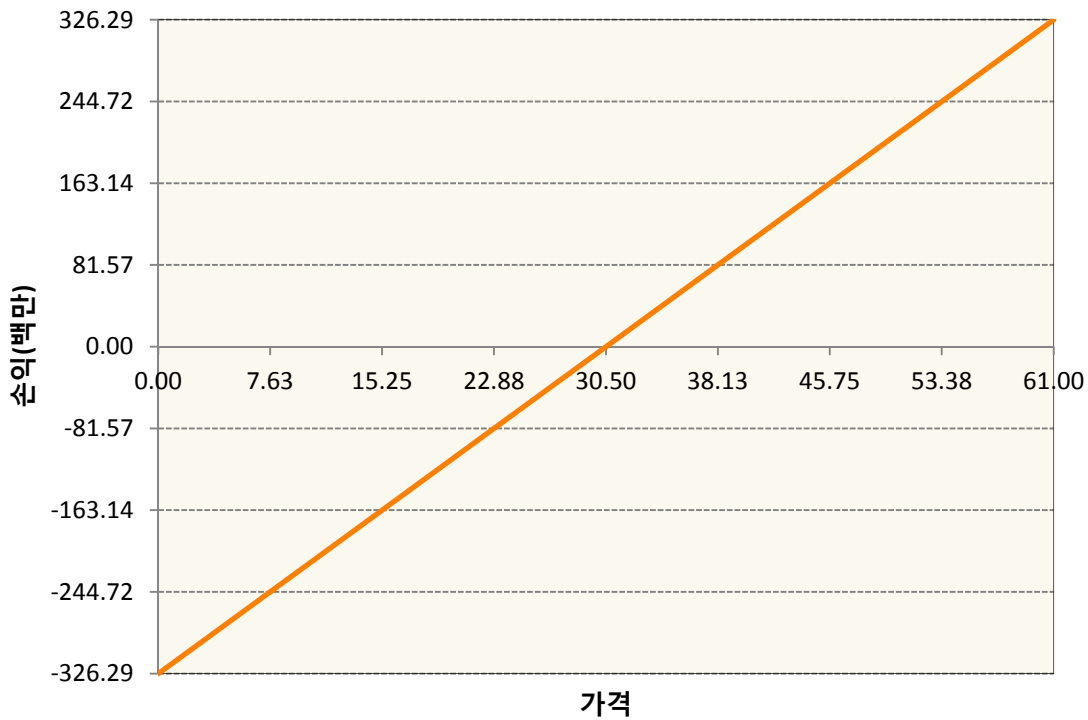
1. 계약금액

(단위:백만원)

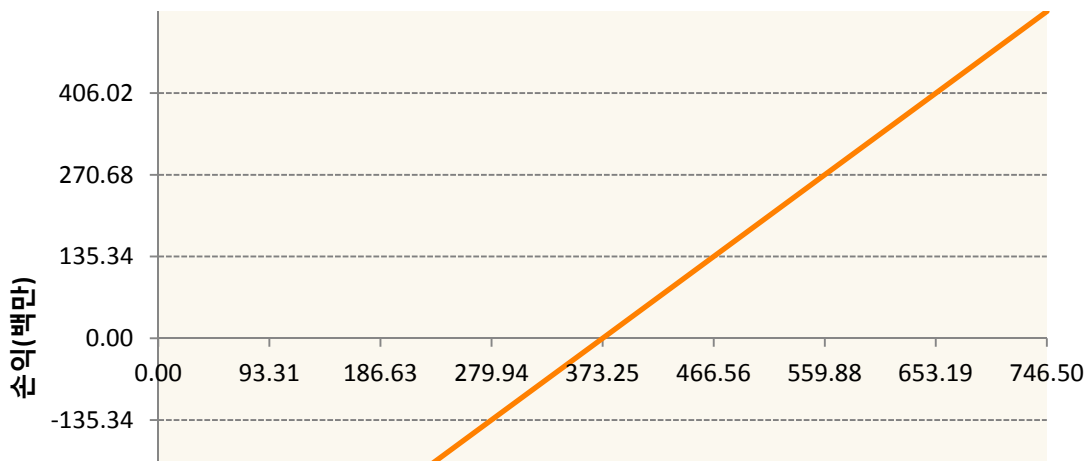
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,796	94	2,702	

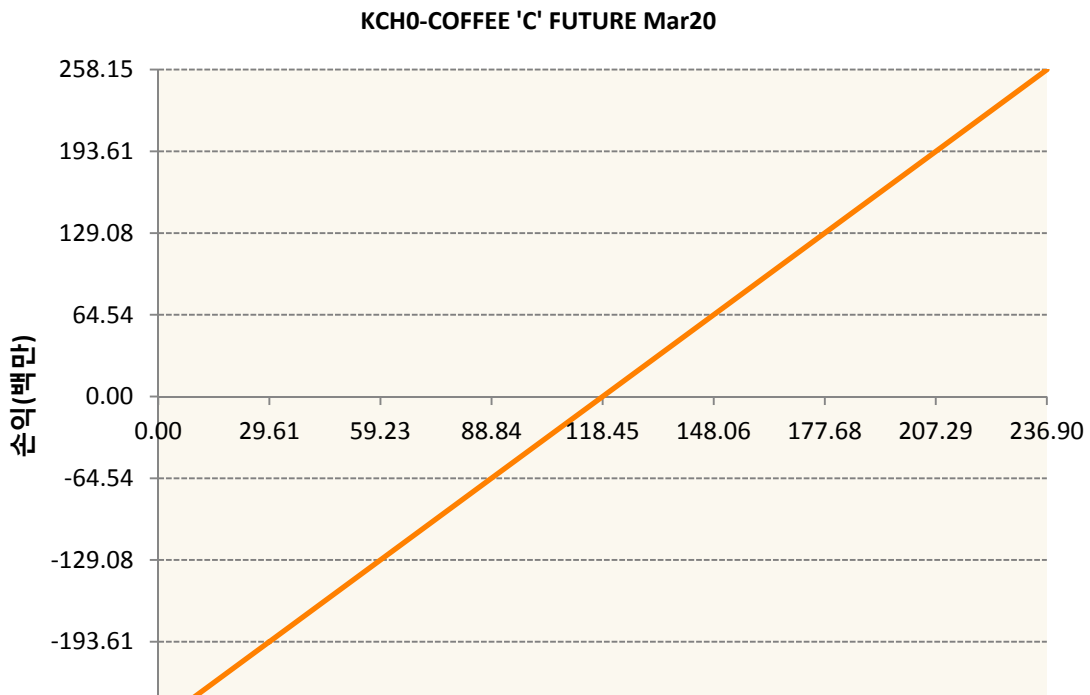
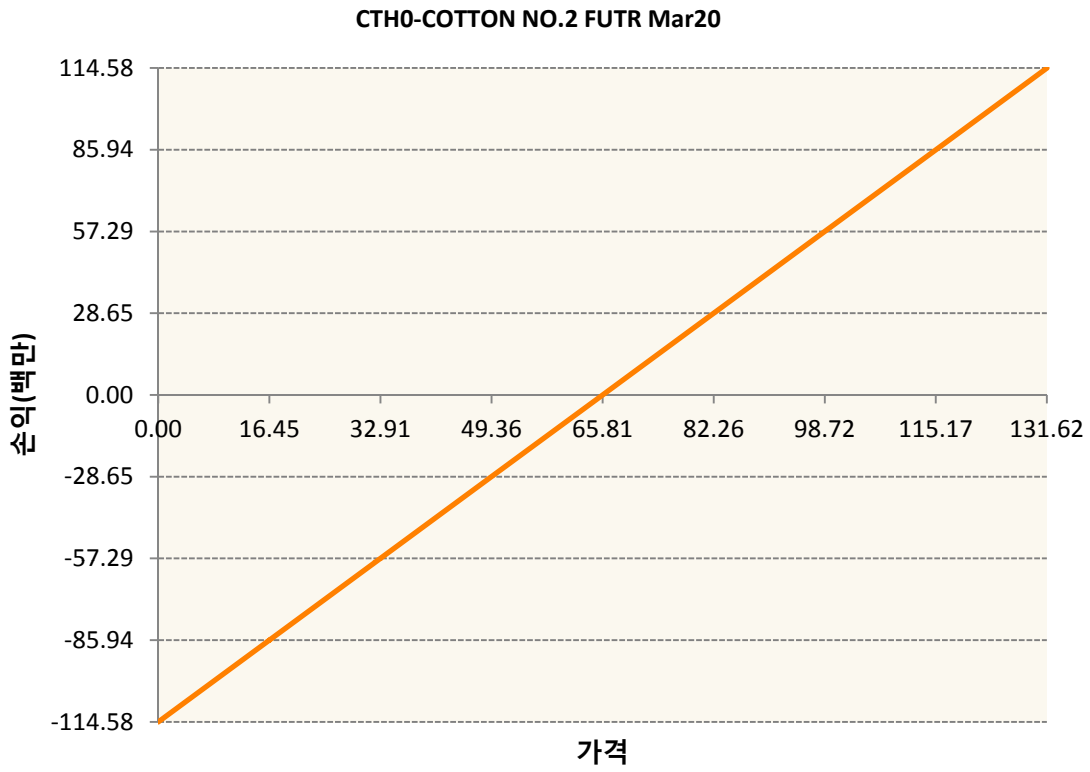
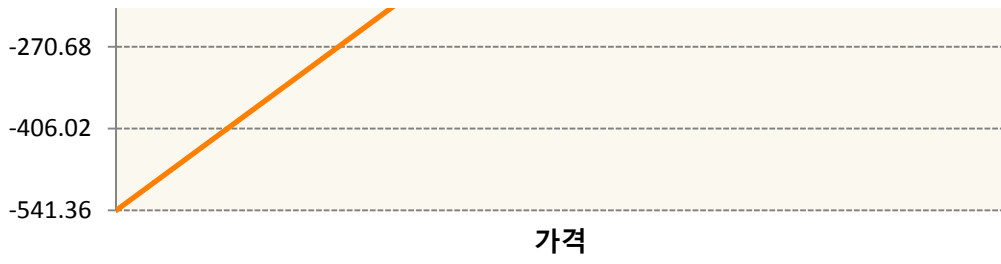
2. 만기시점의 손익구조

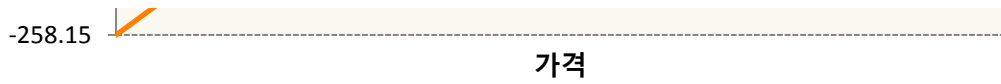
BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20



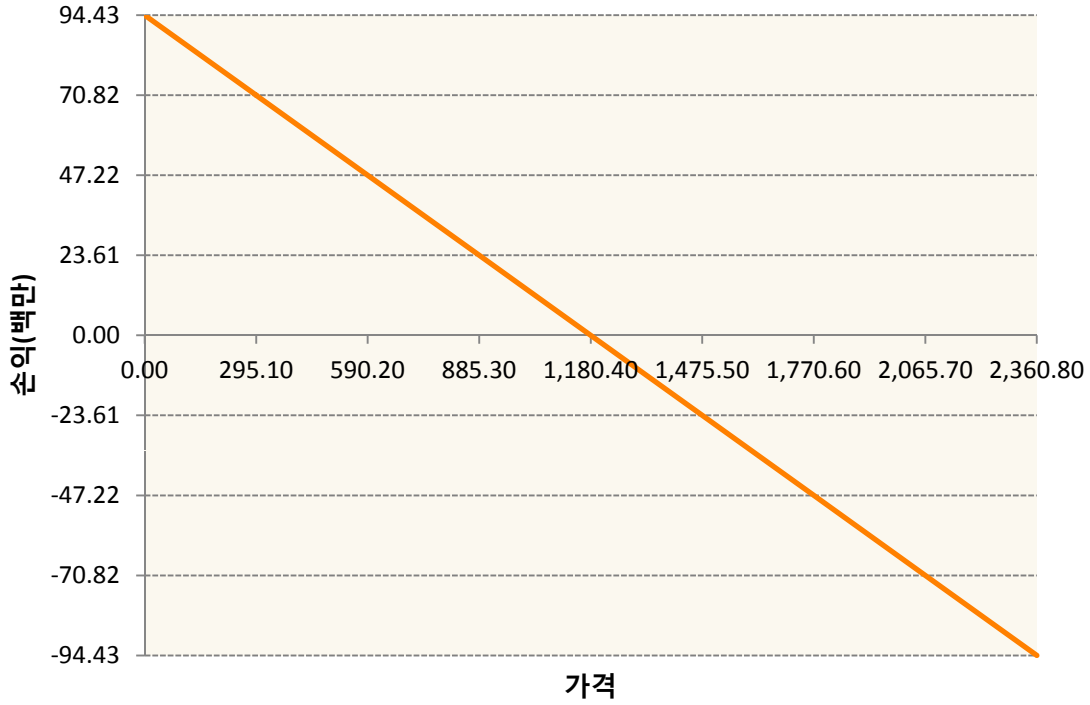
CH0-CORN FUTURE Mar20



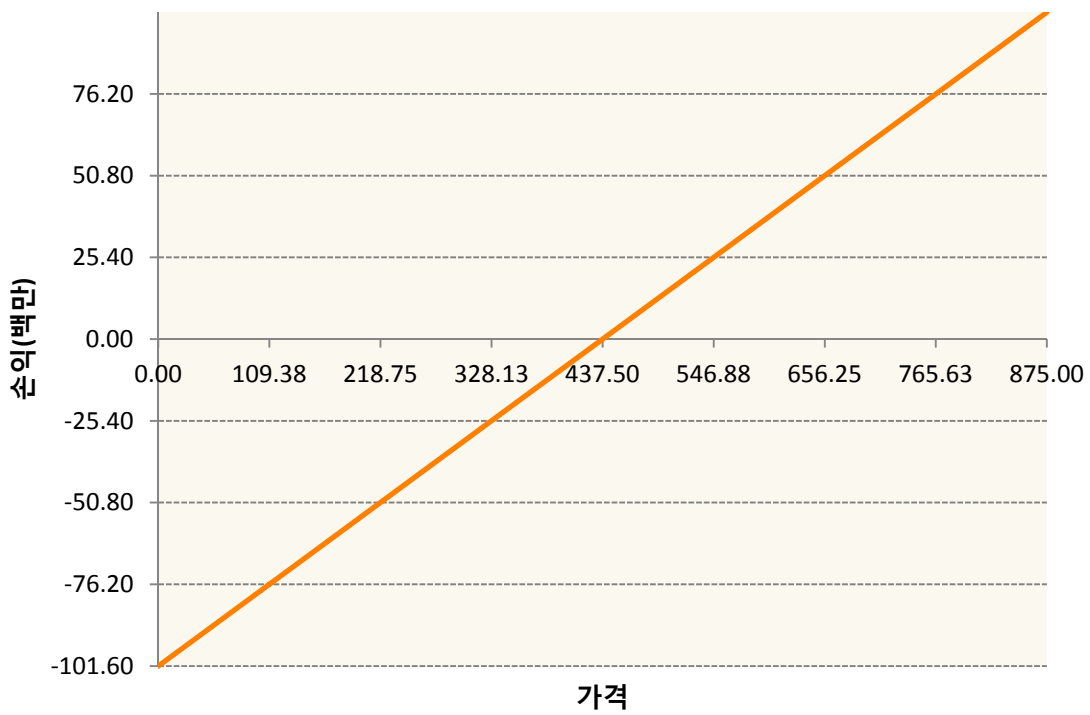




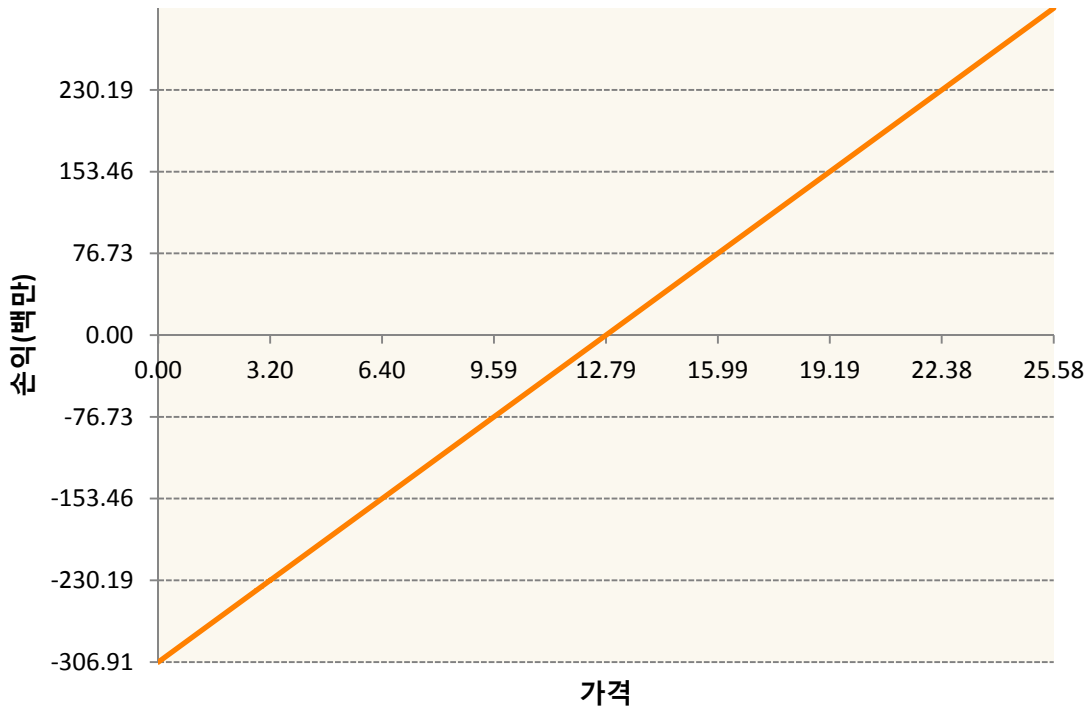
KR4175PC0003-2019-12 달러선물



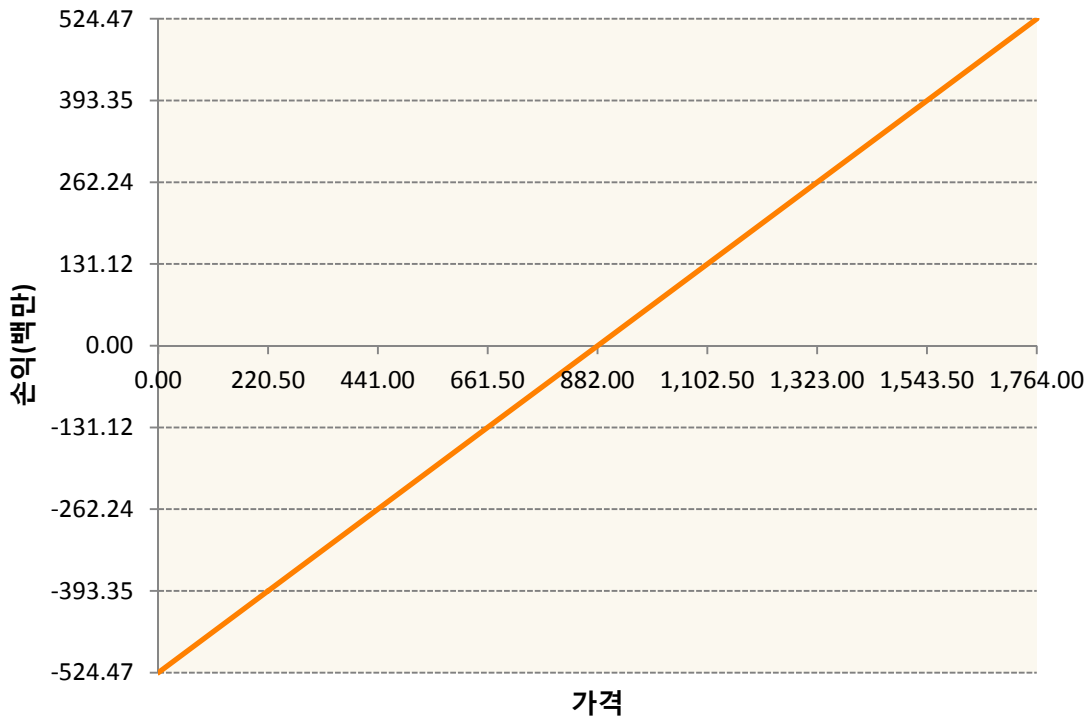
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

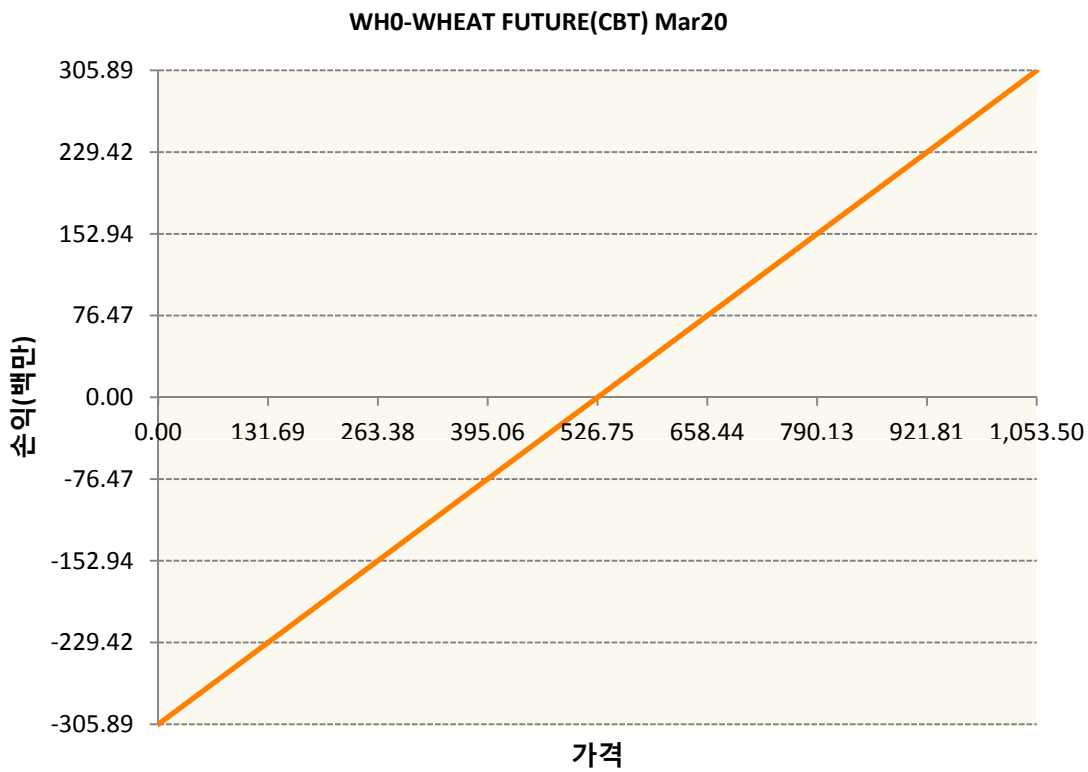
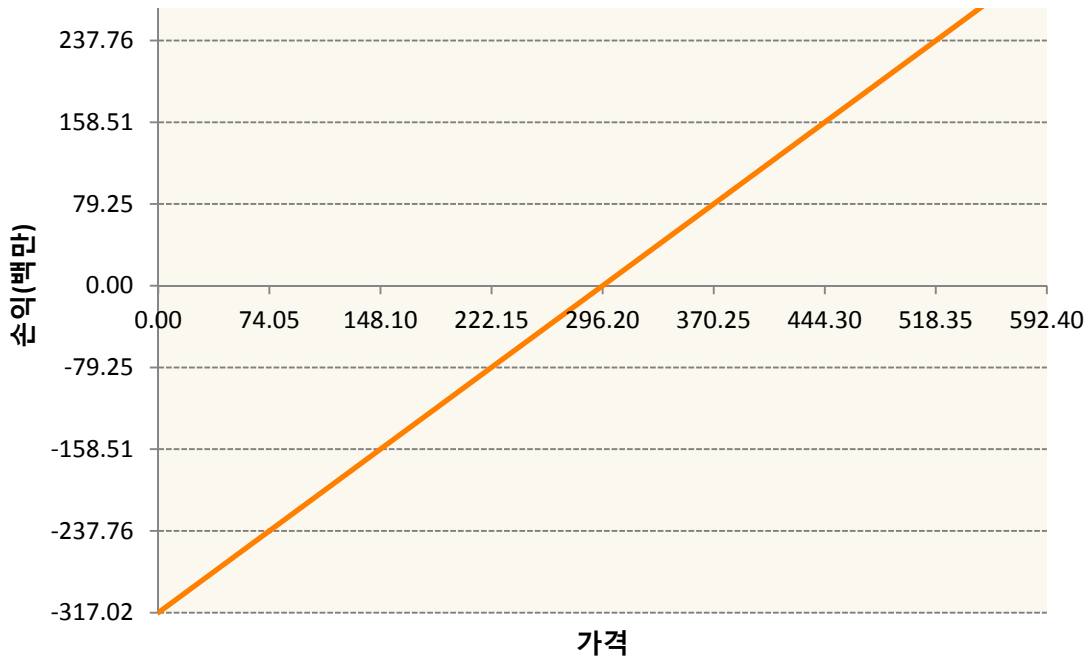


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20



SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





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