

공시일	2019-12-03
기준일	2019-12-02

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)

84

공시일	2019-12-03
기준일	2019-12-02

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

1,097

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

630

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-03
기준일	2019-12-02

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6,772	0	6,772	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(1)	378
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	138

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

734

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-03
기준일	2019-12-02

유로인덱스모(주식-파생형)

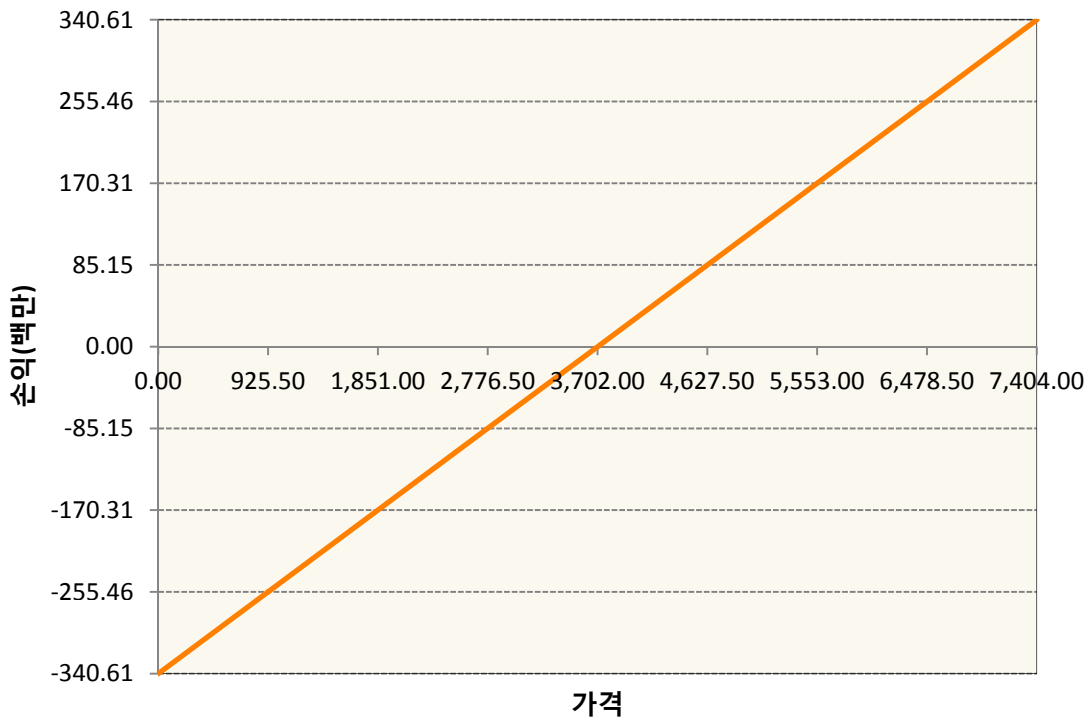
1. 계약금액

(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	2019-12-03
기준일	2019-12-02

차이나인덱스모(주식-파생형)

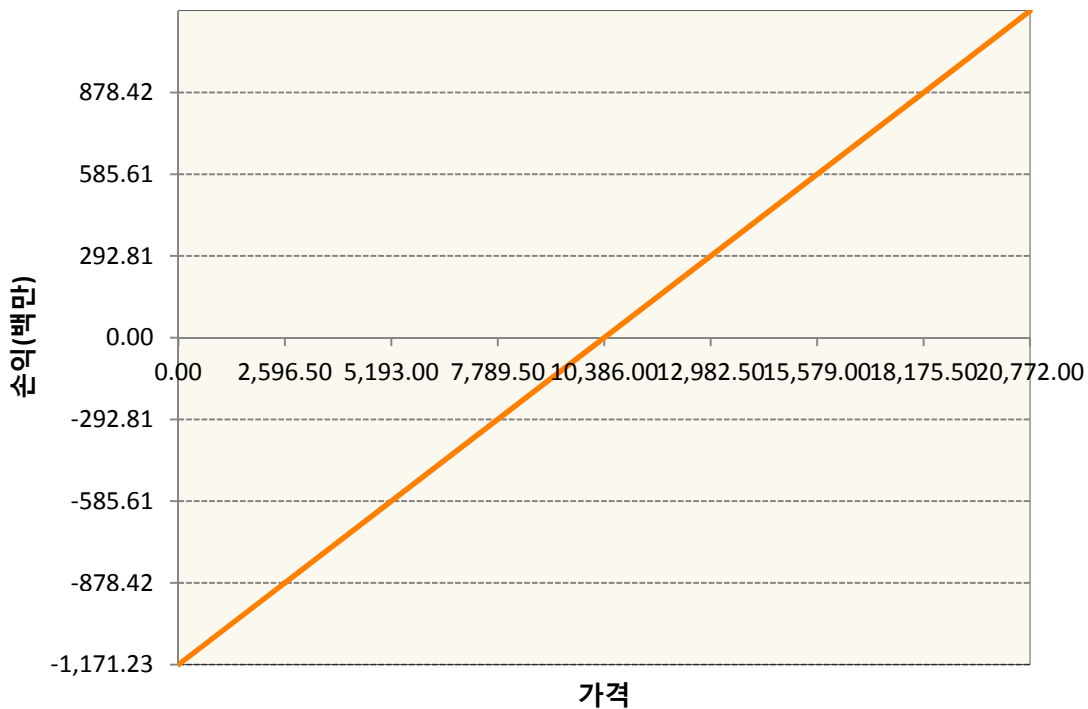
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,171	0	1,171	

2. 만기시점의 손익구조

HCZ9-HSCEI Futures Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ9	HSCEI Futures Dec19	94
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

84

공시일	2019-12-03
기준일	2019-12-02

커버드콜모(주식혼합-파생형)

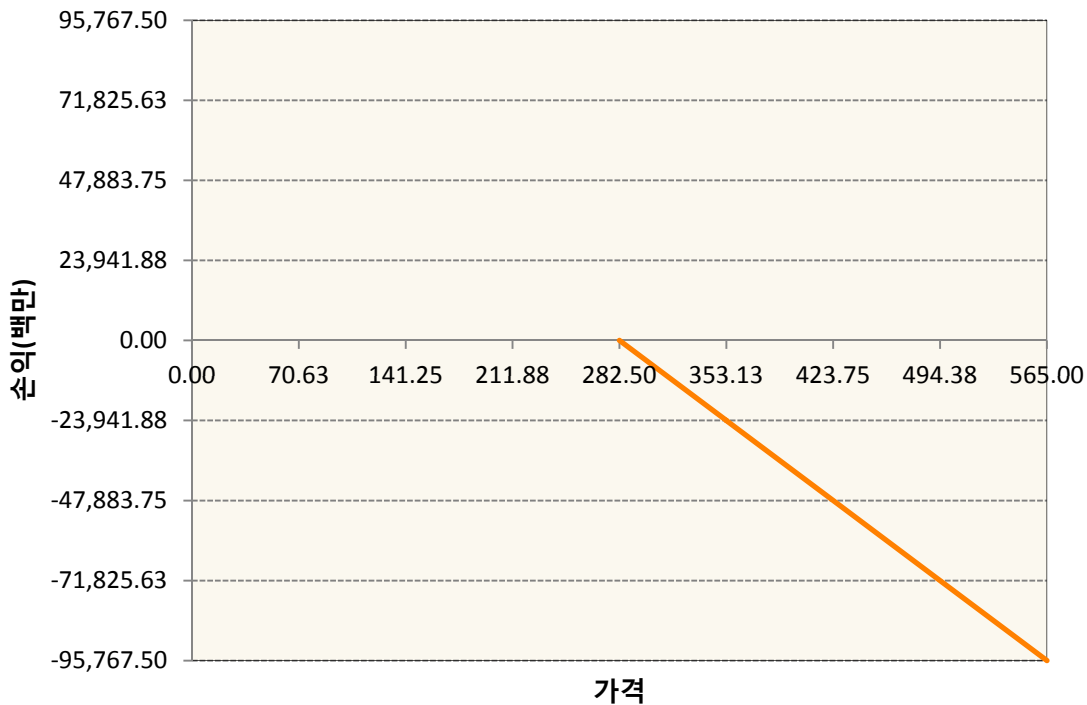
1. 계약금액

(단위:백만원)

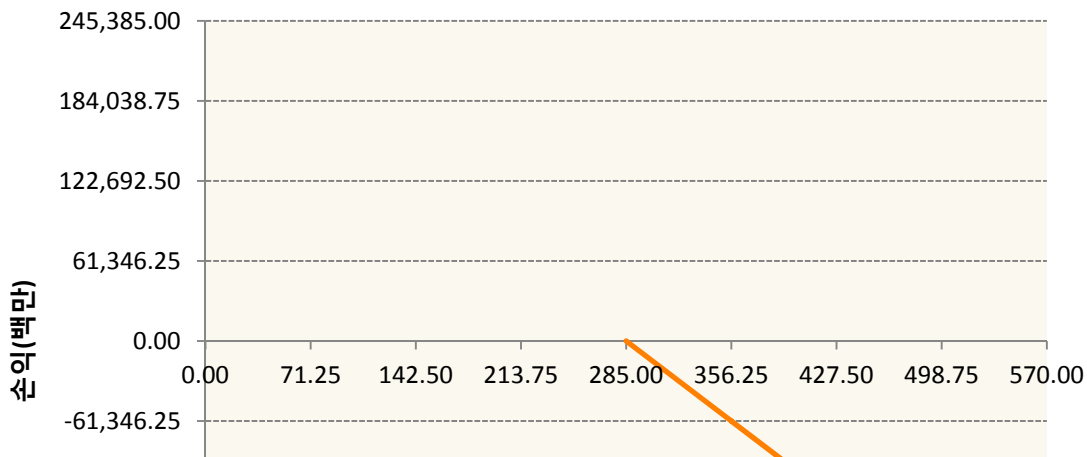
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	498,456	-498,456	장내

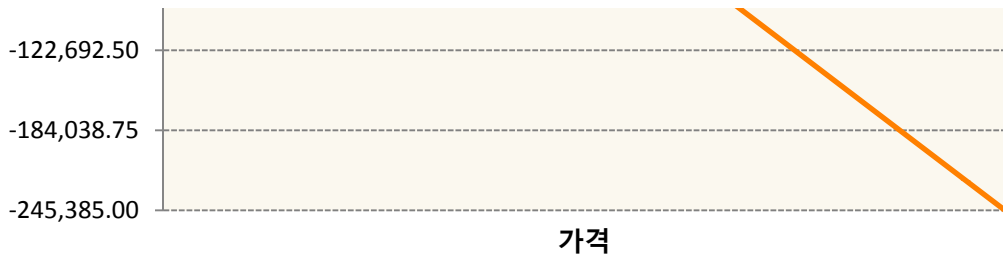
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PC2825-2019-12 콜282.5

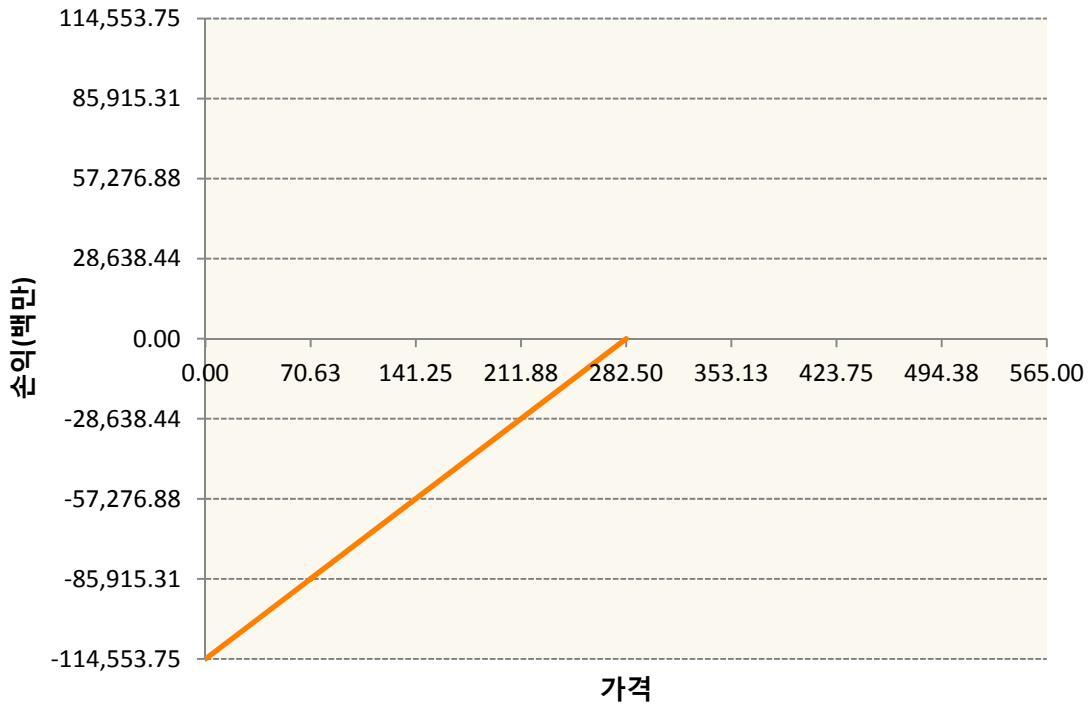


KR4201PC2858-2019-12 콜285

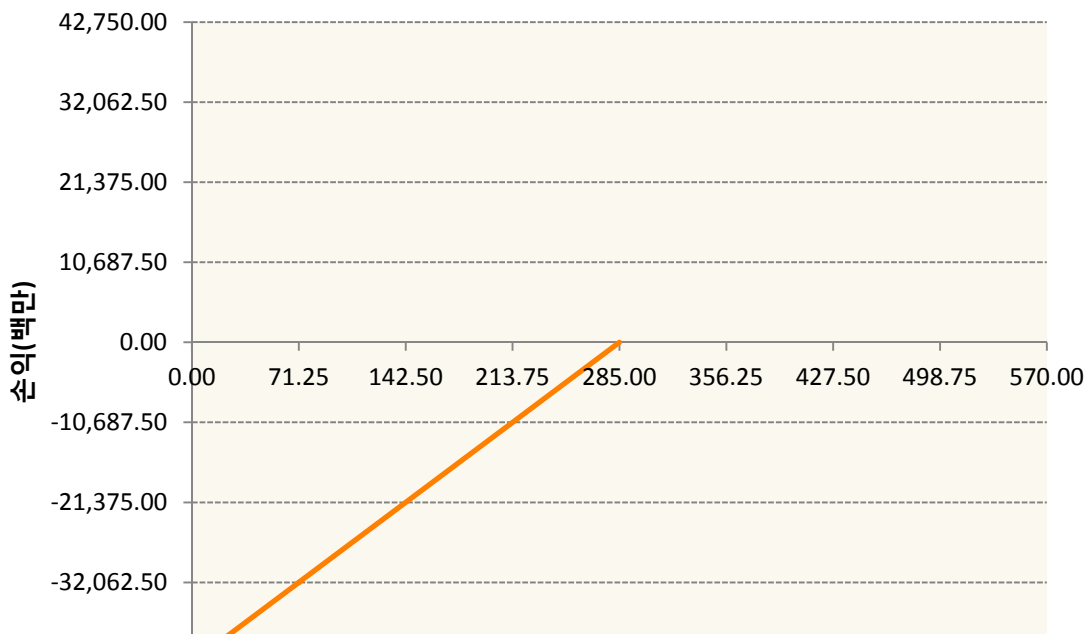




KR4301PC2824-2019-12 풋282.5



KR4301PC2857-2019-12 풋285



-42,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PC2825		2019-12 콜282.5						5,223
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,028	1,025	1,018	1,008	992	970	943	
-5.33%	1,008	988	959	922	876	822	760	
-2.67%	880	812	733	647	553	453	348	
0%	398	268	135	0	-137	-275	-415	
2.67%	-729	-875	-1,021	-1,168	-1,315	-1,462	-1,610	
5.33%	-2,548	-2,648	-2,755	-2,869	-2,988	-3,111	-3,237	
8.00%	-4,816	-4,859	-4,914	-4,979	-5,052	-5,134	-5,223	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						12,166
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,957	1,953	1,944	1,927	1,900	1,861	1,808	
-5.33%	1,933	1,901	1,853	1,785	1,697	1,589	1,462	
-2.67%	1,740	1,614	1,461	1,284	1,085	868	635	
0%	898	612	312	0	-321	-649	-983	
2.67%	-1,360	-1,741	-2,121	-2,501	-2,881	-3,261	-3,641	
5.33%	-5,423	-5,730	-6,050	-6,380	-6,718	-7,062	-7,412	
8.00%	-10,872	-11,029	-11,214	-11,424	-11,654	-11,903	-12,166	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						8,672
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-8,672	-8,672	-8,672	-8,672	-8,672	-8,672	-8,672	
-5.33%	-5,674	-5,674	-5,674	-5,675	-5,675	-5,677	-5,680	
-2.67%	-2,679	-2,683	-2,690	-2,701	-2,716	-2,735	-2,758	
0%	174	121	62	0	-66	-134	-205	
2.67%	1,981	1,901	1,818	1,735	1,651	1,566	1,481	
5.33%	2,383	2,367	2,344	2,315	2,281	2,241	2,198	
8.00%	2,404	2,403	2,402	2,399	2,394	2,387	2,377	
KR4301PC2857		2019-12 풋285						3,269
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,269	-3,269	-3,269	-3,269	-3,269	-3,269	-3,269	
-5.33%	-2,160	-2,160	-2,160	-2,160	-2,160	-2,160	-2,160	
-2.67%	-1,051	-1,051	-1,052	-1,054	-1,056	-1,060	-1,065	
0%	40	29	15	0	-17	-36	-57	
2.67%	888	855	822	789	757	724	691	

5.33%	1,177	1,164	1,148	1,130	1,110	1,089	1,066
8.00%	1,203	1,202	1,200	1,198	1,194	1,188	1,181

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

(단위:백만원)

31,029

공시일	2019-12-03
기준일	2019-12-02

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

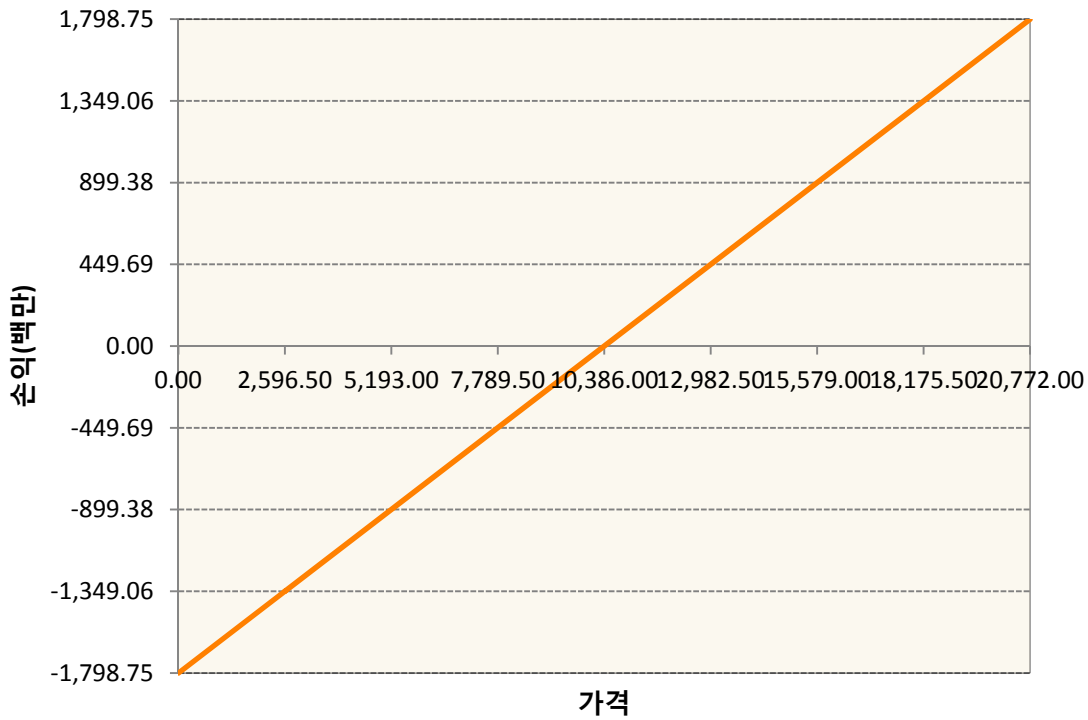
1. 계약금액

(단위:백만원)

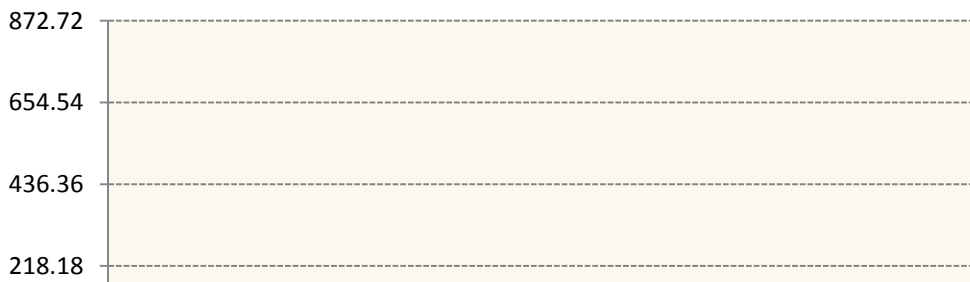
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,799	0	1,799	
누계	유가증권	옵션	0	4,949	-4,949	장내
누계	통화	선도	0	2,128	-2,128	장외

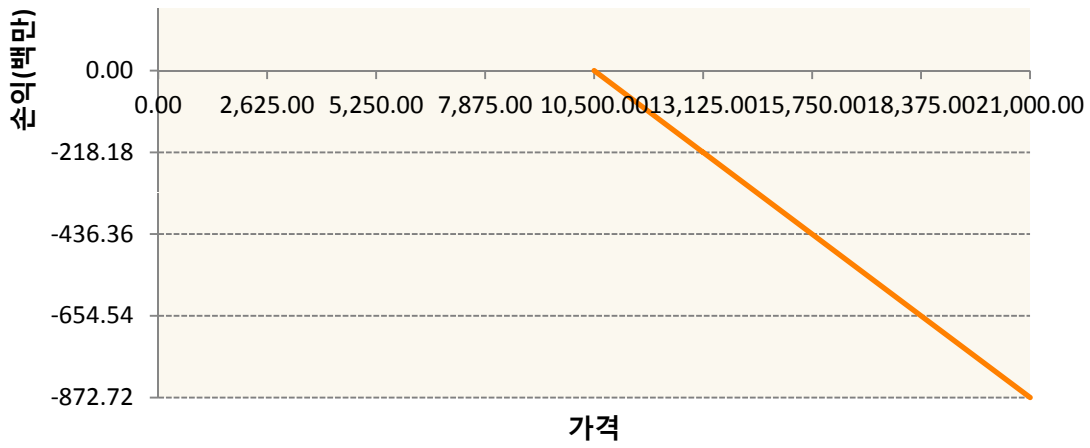
2. 만기시점의 손익구조

HCZ9-HSCEI Futures Dec19

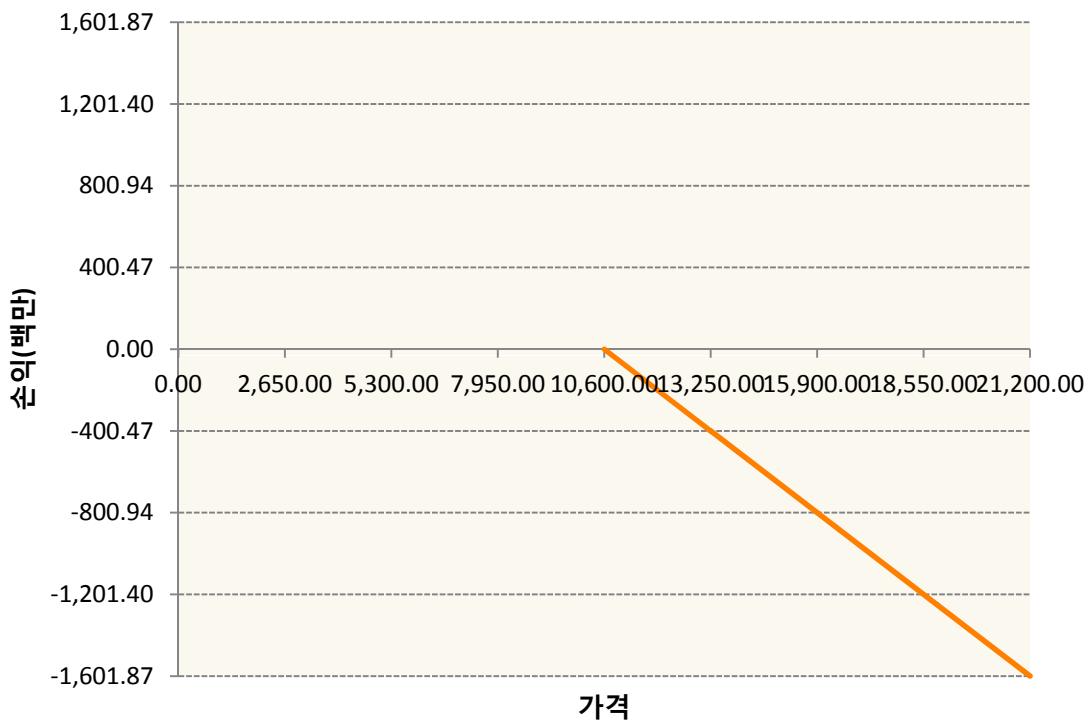


OHHIZ9-C105-HSCEI

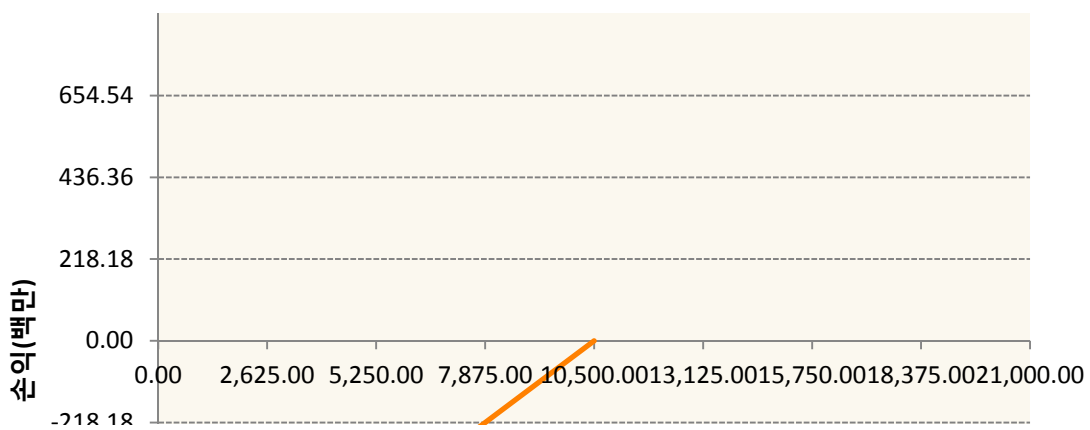


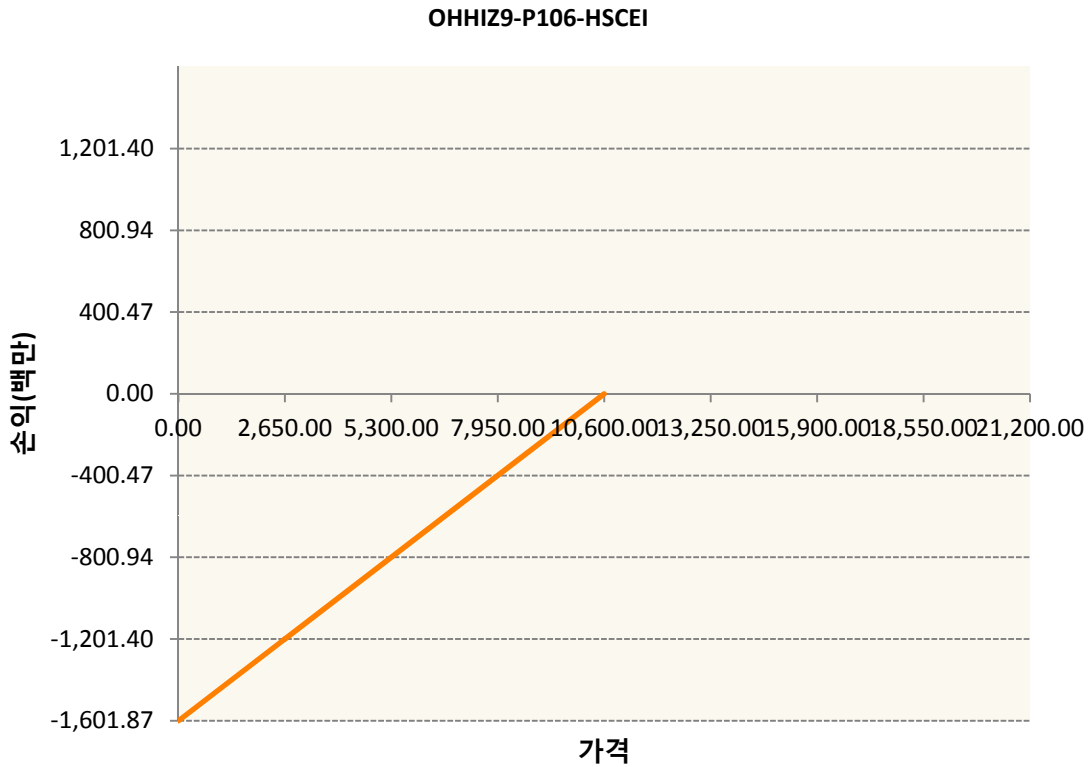


OHHIZ9-C106-HSCEI



OHHIZ9-P105-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	170
HCZ9 HSCEI Futures Dec19	144
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)

532

공시일	2019-12-03
기준일	2019-12-02

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

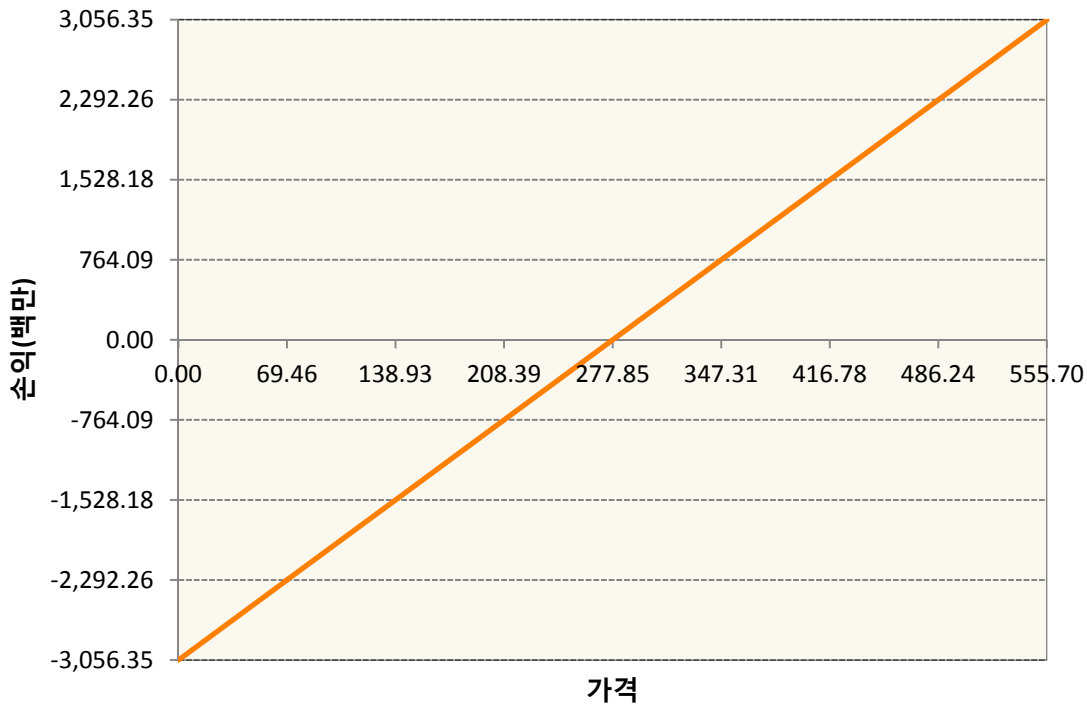
1. 계약금액

(단위:백만원)

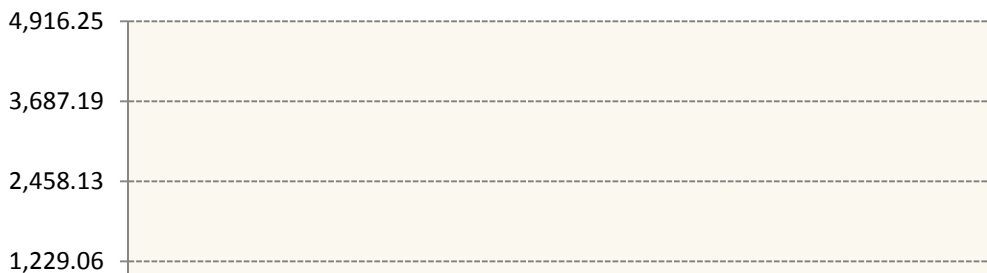
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,056	0	3,056	장내
누계	유가증권	스왑	9,625	0	9,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,657	-9,657	장내

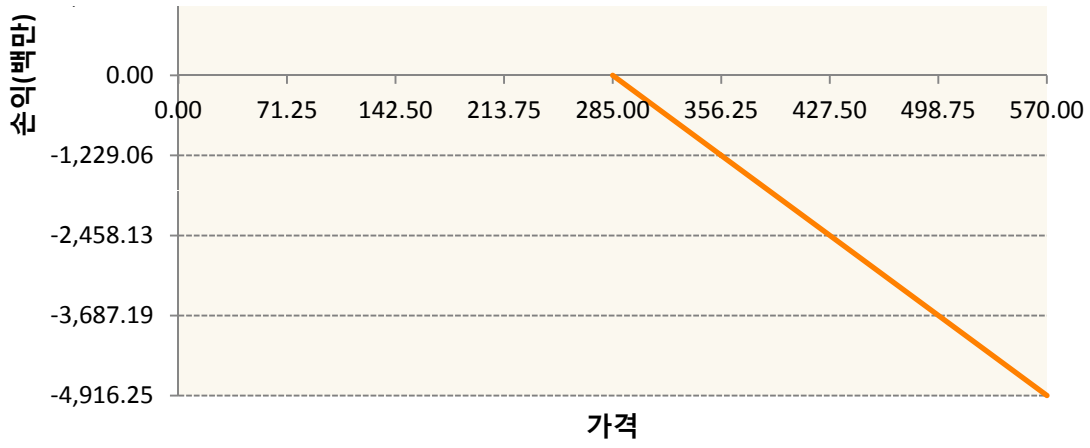
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

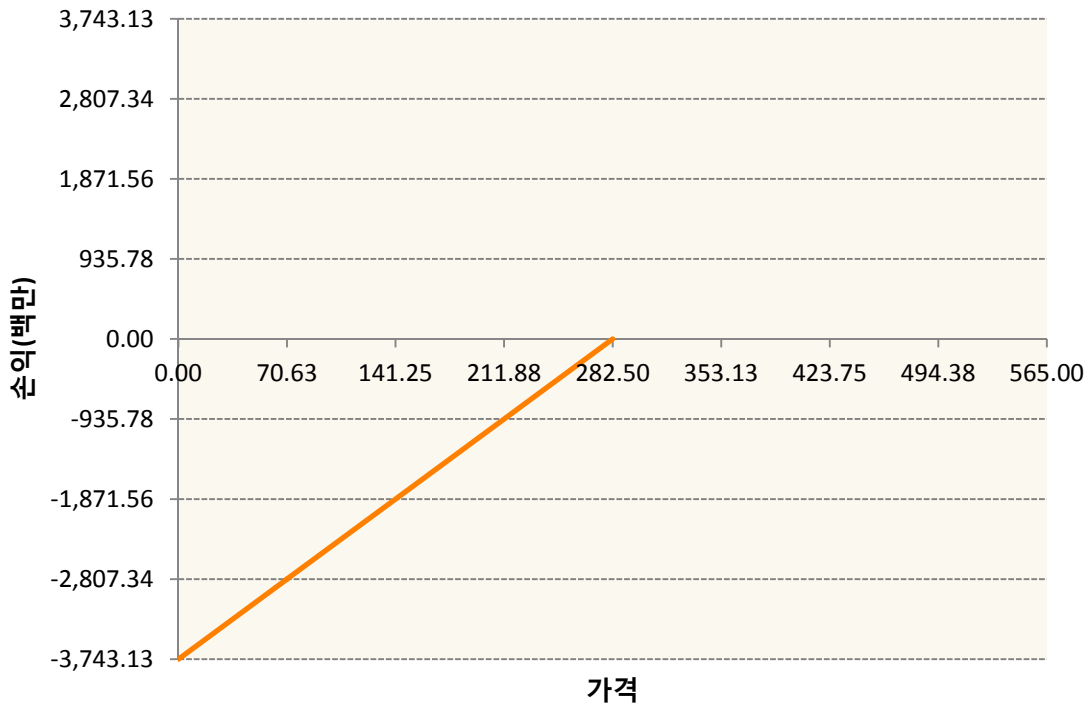


KR4201PC2858-2019-12 콜285

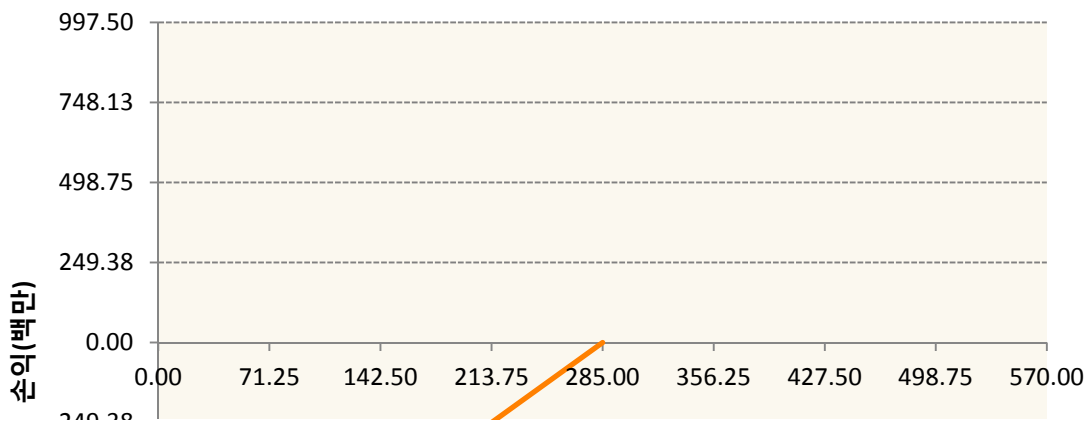




KR4301PC2824-2019-12 풋282.5



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%	-163	-163	-163	-163	-163	-163	-163	
-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%	163	163	163	163	163	163	163	
8.00%	244	244	244	244	244	244	244	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						244
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	39	39	39	39	38	37	36	
-5.33%	39	38	37	36	34	32	29	
-2.67%	35	32	29	26	22	17	13	
0%	18	12	6	0	-6	-13	-20	
2.67%	-27	-35	-42	-50	-58	-65	-73	
5.33%	-109	-115	-121	-128	-135	-141	-148	
8.00%	-218	-221	-225	-229	-233	-238	-244	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						283
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-283	-283	-283	-283	-283	-283	-283
-5.33%	-185	-185	-185	-185	-185	-186	-186
-2.67%	-88	-88	-88	-88	-89	-89	-90
0%	6	4	2	0	-2	-4	-7
2.67%	65	62	59	57	54	51	48
5.33%	78	77	77	76	75	73	72
8.00%	79	79	78	78	78	78	78
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%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	21	20	19	18	18	17	16
5.33%	27	27	27	26	26	25	25
8.00%	28	28	28	28	28	28	28

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

(단위:백만원)

1,696

공시일	2019-12-03
기준일	2019-12-02

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

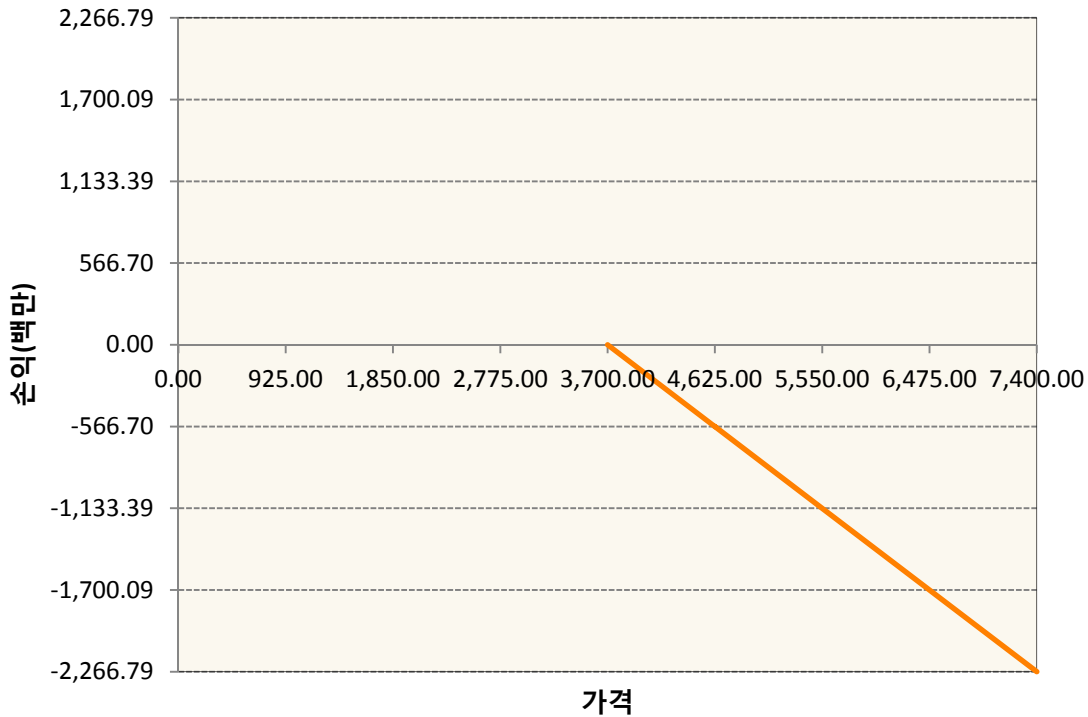
1. 계약금액

(단위:백만원)

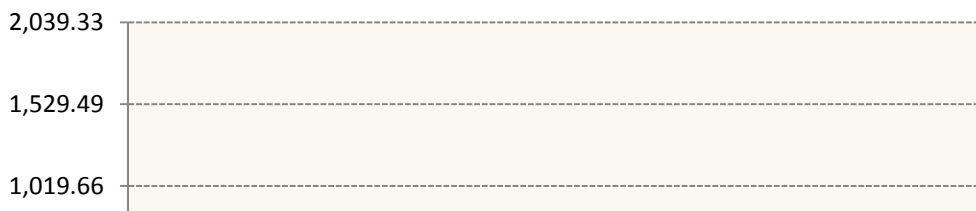
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,247	0	1,247	
누계	유가증권	스왑	17,823	0	17,823	장외
누계	유가증권	옵션	0	8,612	-8,612	장내
누계	통화	선도	2,706	6,126	-3,420	장외

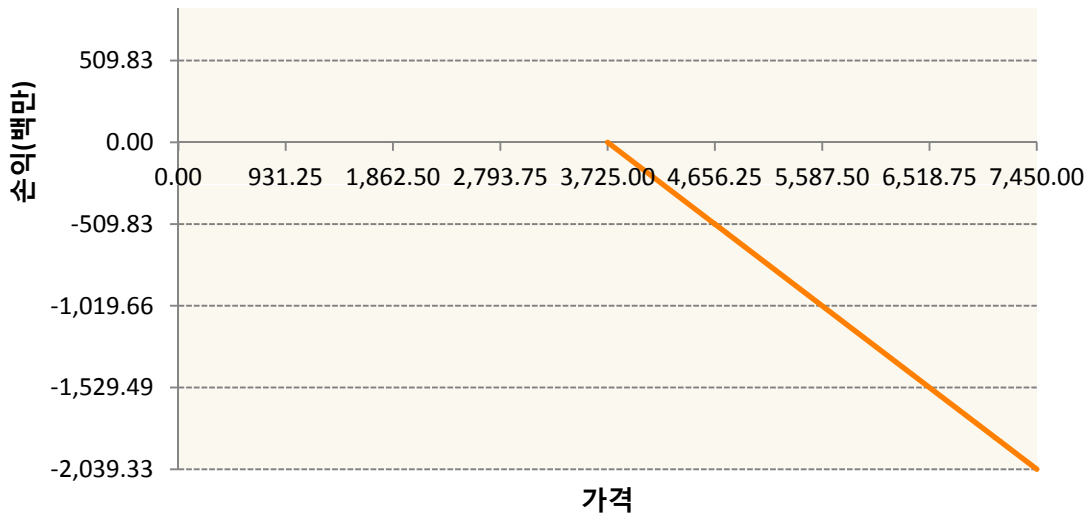
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ9-C3700-EURO STOXX 50

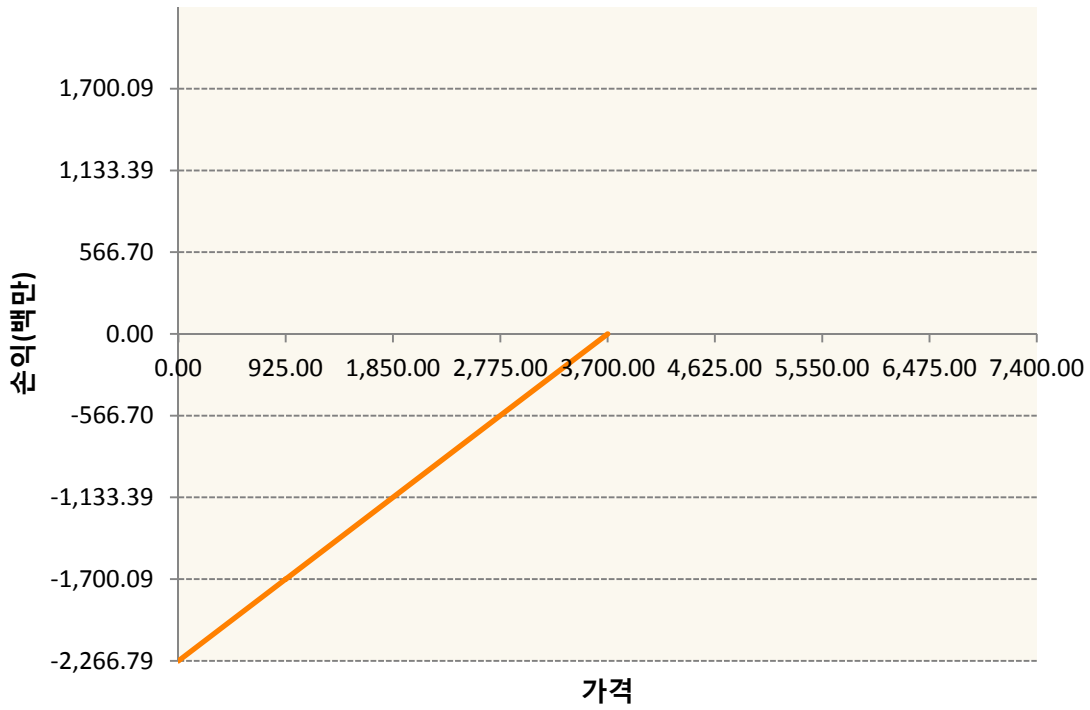


OESXZ9-C3725-EURO STOXX 50

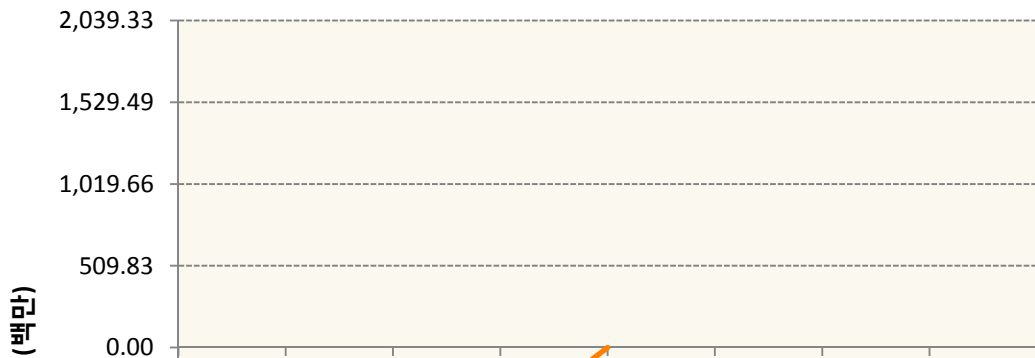


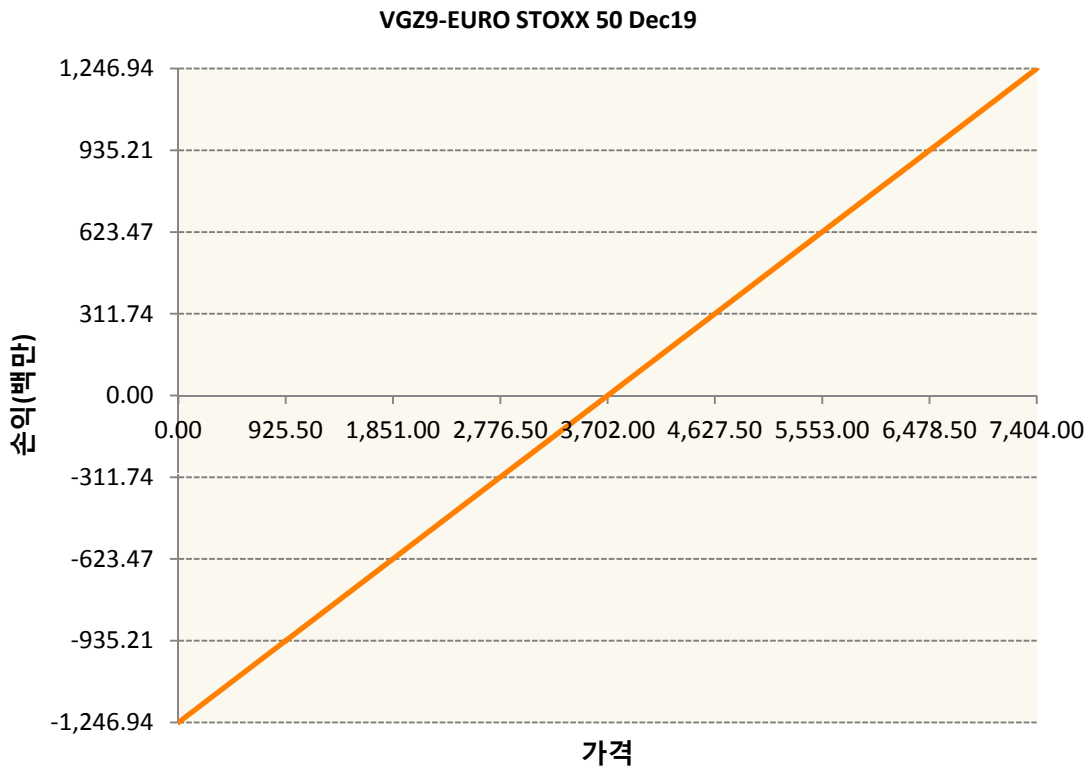
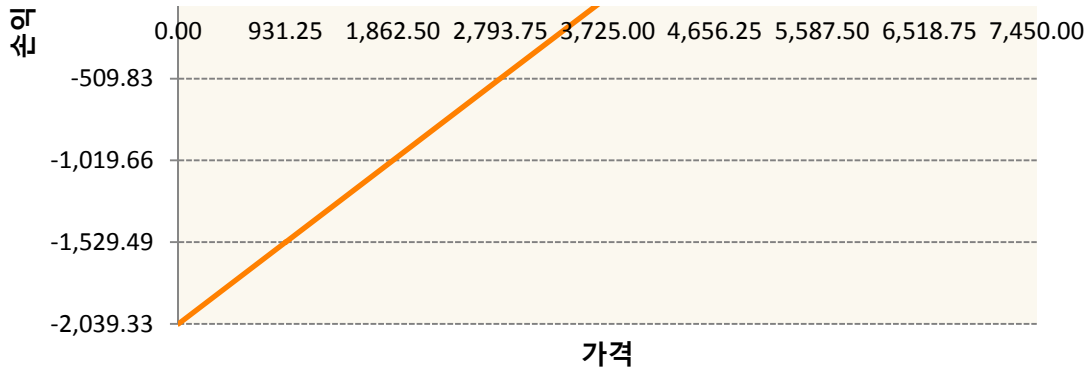


OESXZ9-P3700-EURO STOXX 50



OESXZ9-P3725-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	23
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E	490
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)

874

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

(단위:백만원)

906

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

(단위:백만원)

79

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

(단위:백만원)

123

공시일	2019-12-03
기준일	2019-12-02

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

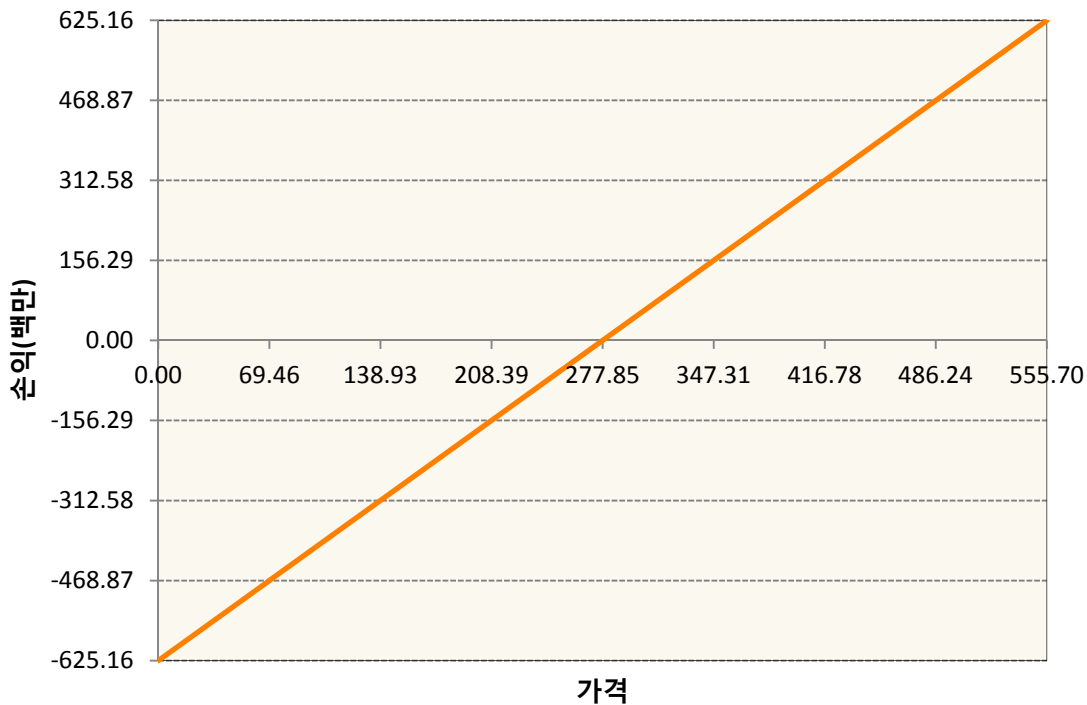
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	625	0	625	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						50
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
-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%	33	33	33	33	33	33	33	
8.00%	50	50	50	50	50	50	50	

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

(단위:백만원)

40

공시일	2019-12-03
기준일	2019-12-02

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

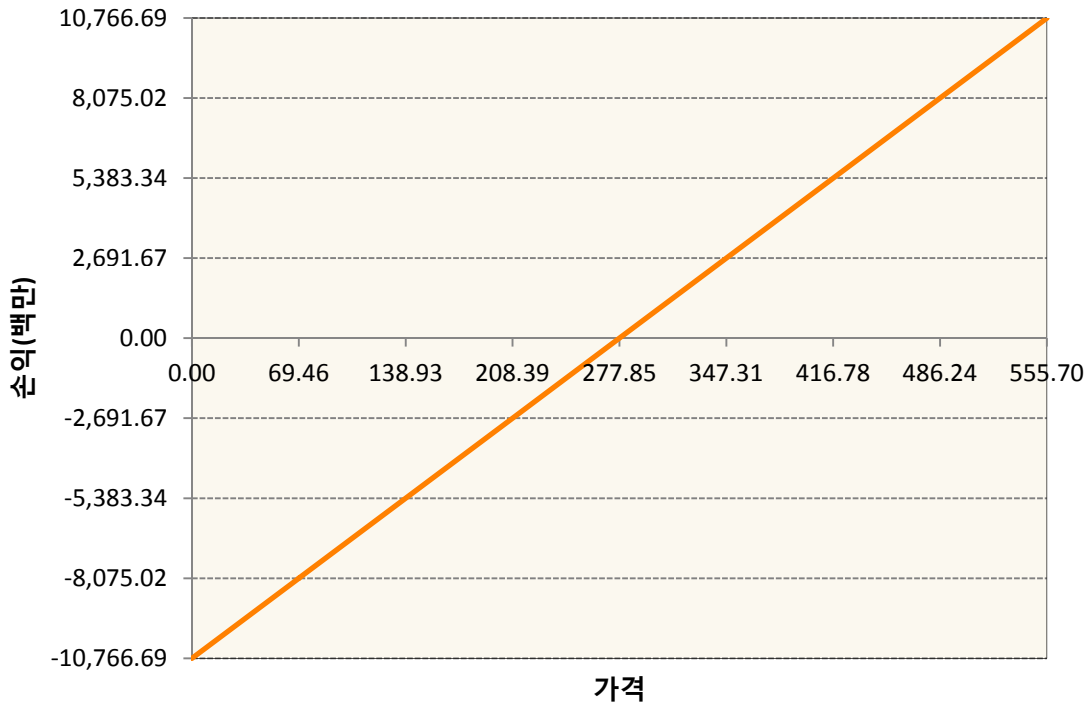
1. 계약금액

(단위:백만원)

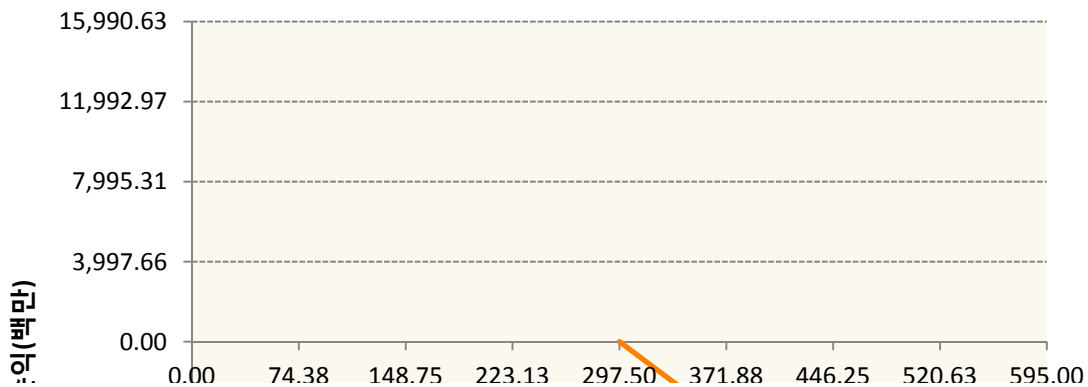
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,767	0	10,767	장내
누계	유가증권	옵션	1,277	21,241	-19,964	장내

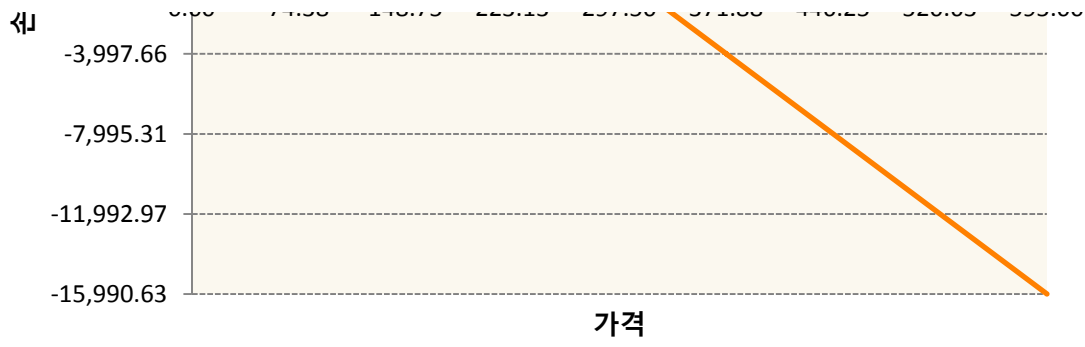
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

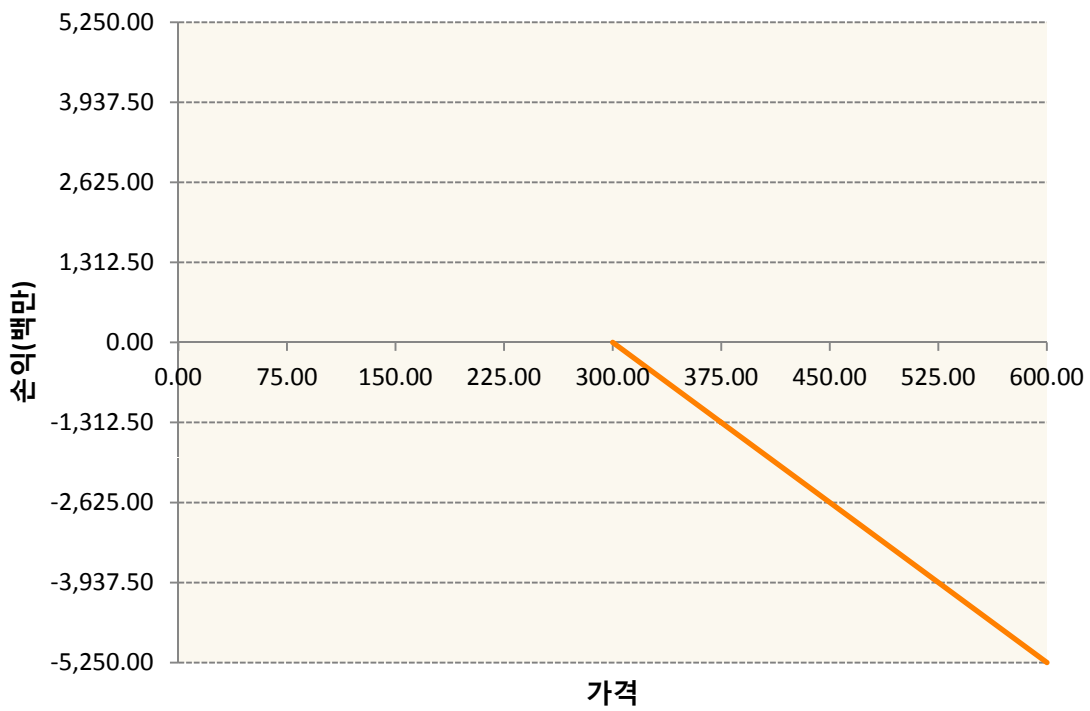


KR4201PC2973-2019-12 콜297.5

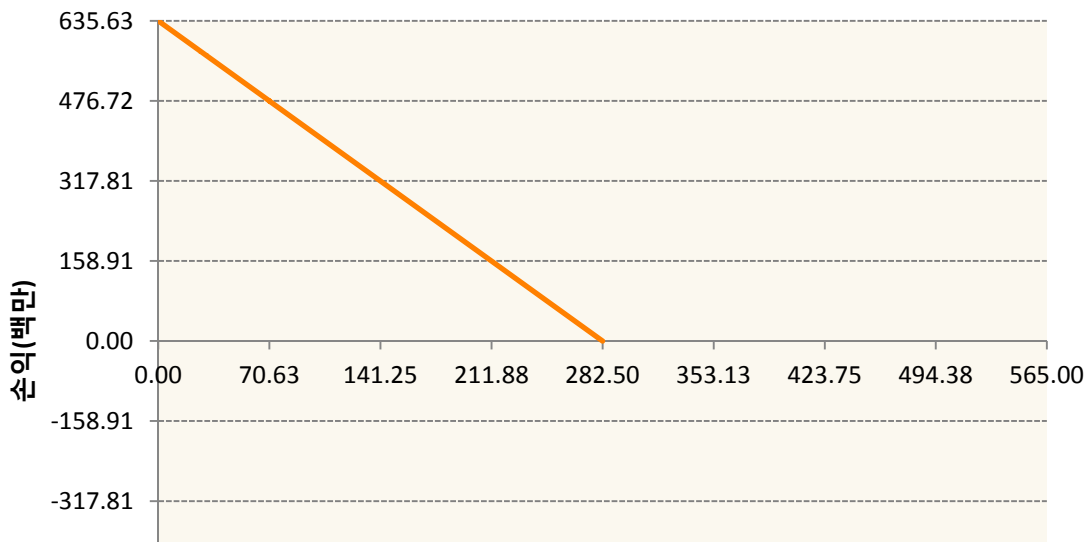


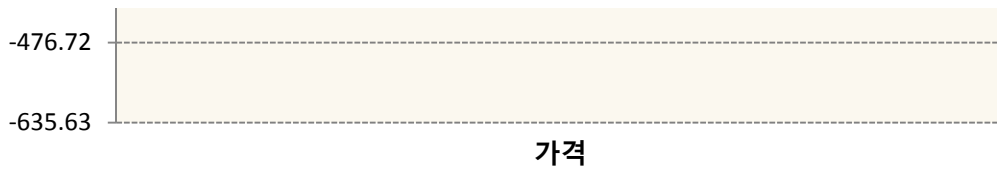


KR4201PC3005-2019-12 콜300

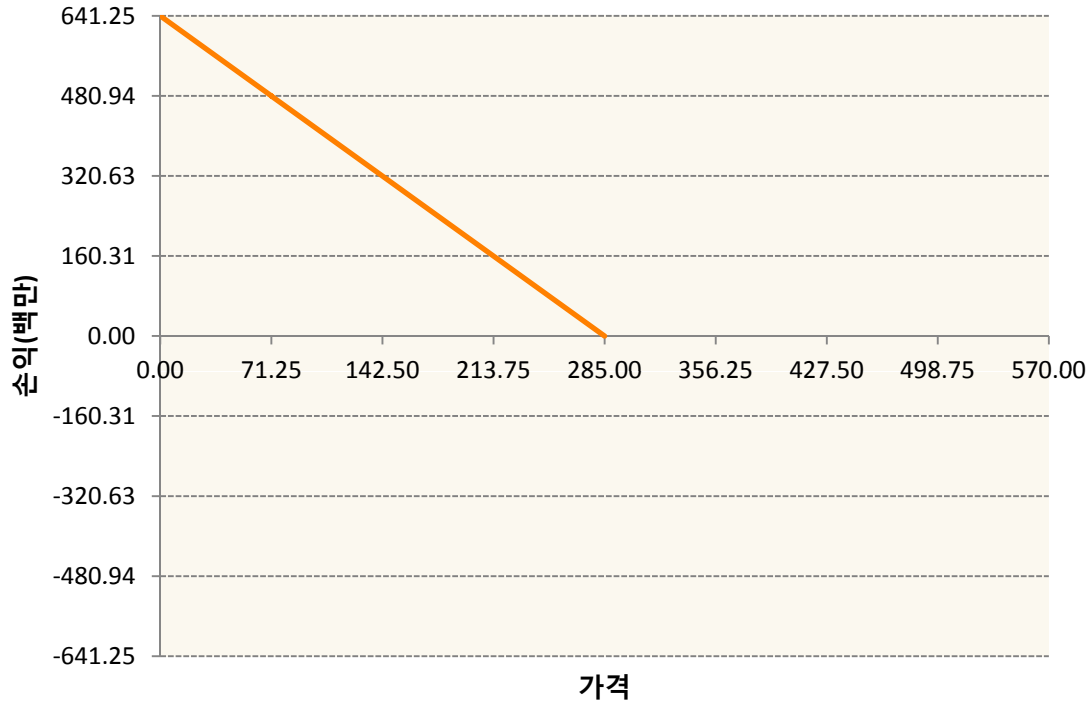


KR4301PC2824-2019-12 풋282.5





KR4301PC2857-2019-12 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						860
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-860	-860	-860	-860	-860	-860	-860	
-5.33%	-573	-573	-573	-573	-573	-573	-573	
-2.67%	-287	-287	-287	-287	-287	-287	-287	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	287	287	287	287	287	287	287	
5.33%	573	573	573	573	573	573	573	
8.00%	860	860	860	860	860	860	860	
KR4201PC2973		2019-12 콜297.5						410
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	21	21	21	21	21	20	20	
-5.33%	21	21	21	20	19	18	16	
-2.67%	21	20	18	16	13	9	3	

0%	16	12	7	0	-8	-18	-29
2.67%	-7	-19	-32	-47	-63	-81	-98
5.33%	-86	-107	-130	-152	-175	-198	-222
8.00%	-262	-287	-311	-336	-360	-385	-410
KR4201PC3005 2019-12 콜300							114
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4	4	4	4	4	4	4
-5.33%	4	4	4	4	4	4	3
-2.67%	4	4	4	4	3	2	0
0%	4	3	2	0	-2	-5	-8
2.67%	-1	-4	-7	-11	-16	-21	-26
5.33%	-19	-25	-32	-38	-45	-52	-60
8.00%	-65	-73	-81	-89	-97	-105	-114
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	32	32
-2.67%	15	15	15	15	15	15	15
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-11	-11	-10	-10	-9	-9	-8
5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-12	-12
8.00%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
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%	-13	-13	-12	-12	-11	-11	-10
5.33%	-18	-17	-17	-17	-17	-16	-16
8.00%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18

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

(단위:백만원)

1,057

공시일	2019-12-03
기준일	2019-12-02

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	207,277	0	207,277	

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	2019-12-03
기준일	2019-12-02

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	216,334	0	216,334	

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	2019-12-03
기준일	2019-12-02

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	549,241	0	549,241	
누계	통화	선도	0	540,795	-540,795	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		663
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		700
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,704
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,827
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,420
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,524
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		946
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		946
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		946
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		946
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		473
FX21019X00 KRW/USD 06-12-19E		663
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		473
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		473
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		473
FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E		1,552
FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E		946
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		473
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		946
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		1,552
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		1,893
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		3,256
FX21019X02 KRW/USD 26-12-19E		4,770
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		4,827
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		189
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,839

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

(단위:백만원)

13,606

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

(단위:백만원)

180

공시일	2019-12-03
기준일	2019-12-02

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

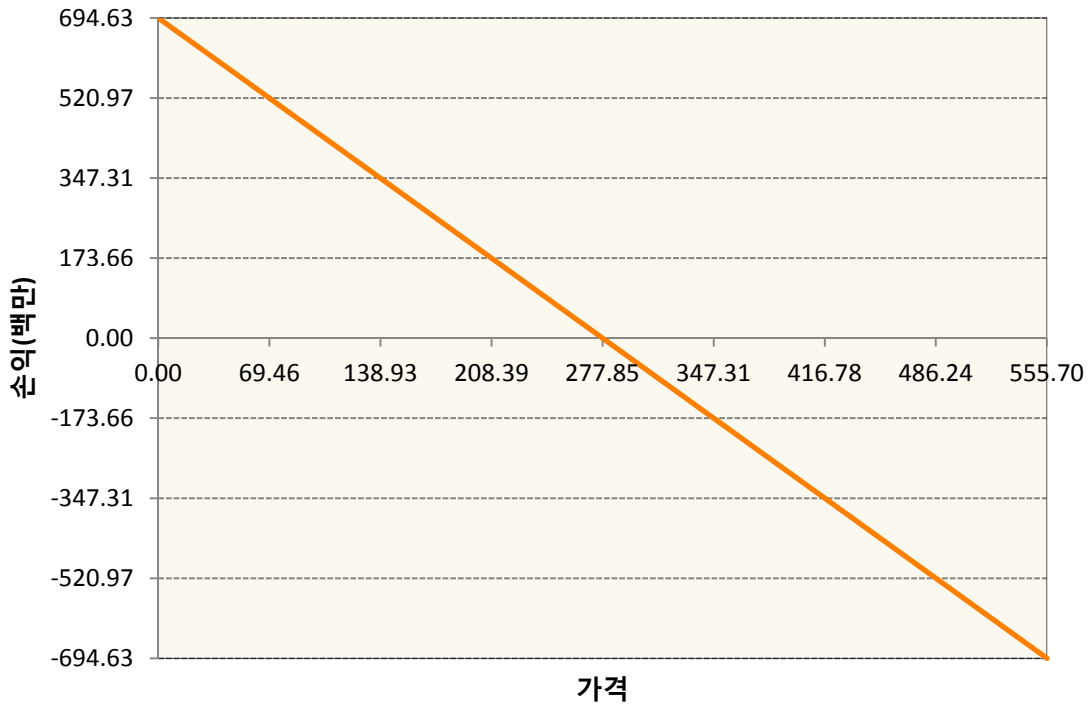
1. 계약금액

(단위:백만원)

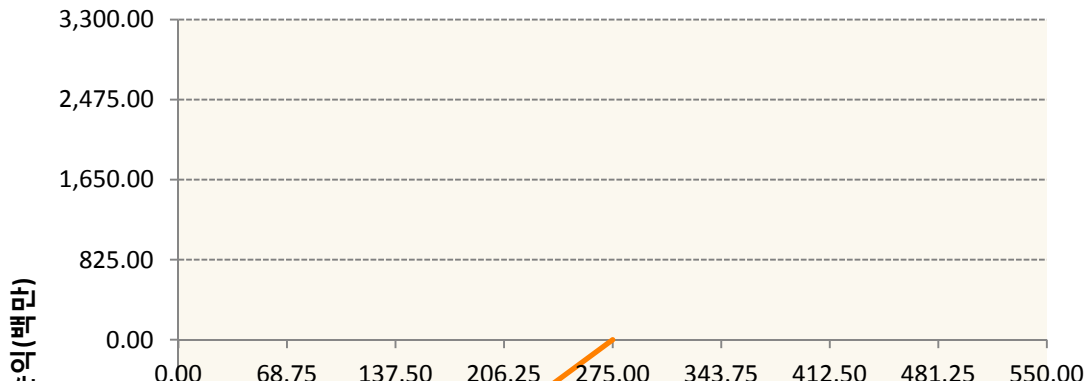
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	695	-695	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,994	-3,994	장내

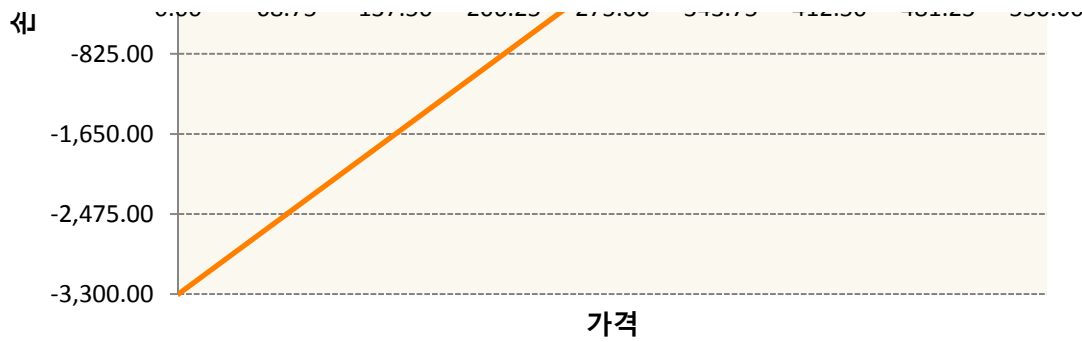
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

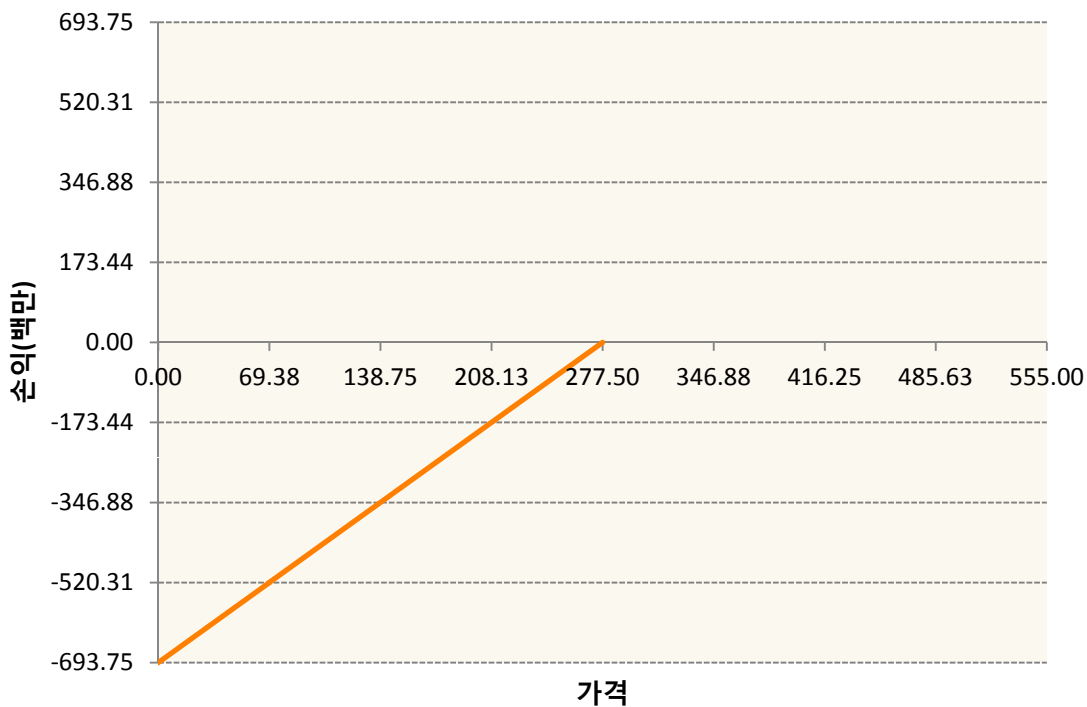


KR4301PC2758-2019-12 풋275





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						219
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-219	-219	-219	-219	-219	-219	-219
-5.33%	-131	-131	-131	-131	-132	-132	-133
-2.67%	-46	-48	-49	-51	-53	-55	-57
0%	7	5	2	0	-2	-5	-7
2.67%	18	18	17	16	15	14	13
5.33%	19	19	19	18	18	18	18
8.00%	19	19	19	19	19	19	19

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	-13	-14	-14
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	6	6	6	6	5	5	5
5.33%	7	7	7	7	6	6	6
8.00%	7	7	7	7	7	7	7

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

(단위:백만원)

361

공시일	2019-12-03
기준일	2019-12-02

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	15,197	0	15,197	
누계	통화	선도	0	14,931	-14,931	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019V01 KRW/USD 10-12-19E		375
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)

376

공시일	2019-12-03
기준일	2019-12-02

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	1,001	0	1,001	장외
누계	통화	선도	274	274	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	2019-12-03
기준일	2019-12-02

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

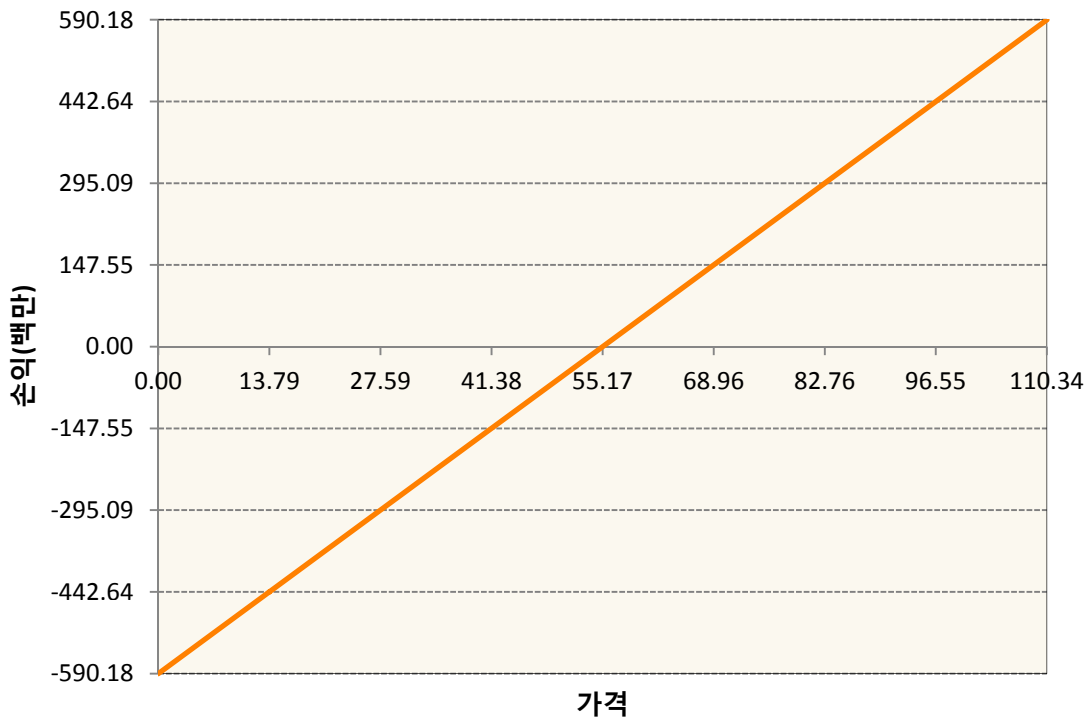
1. 계약금액

(단위:백만원)

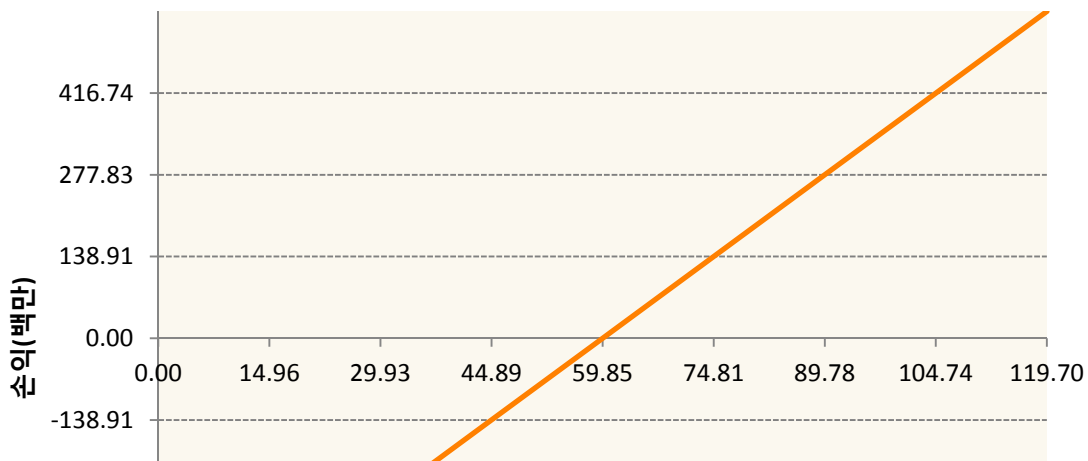
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,345	296	2,050	

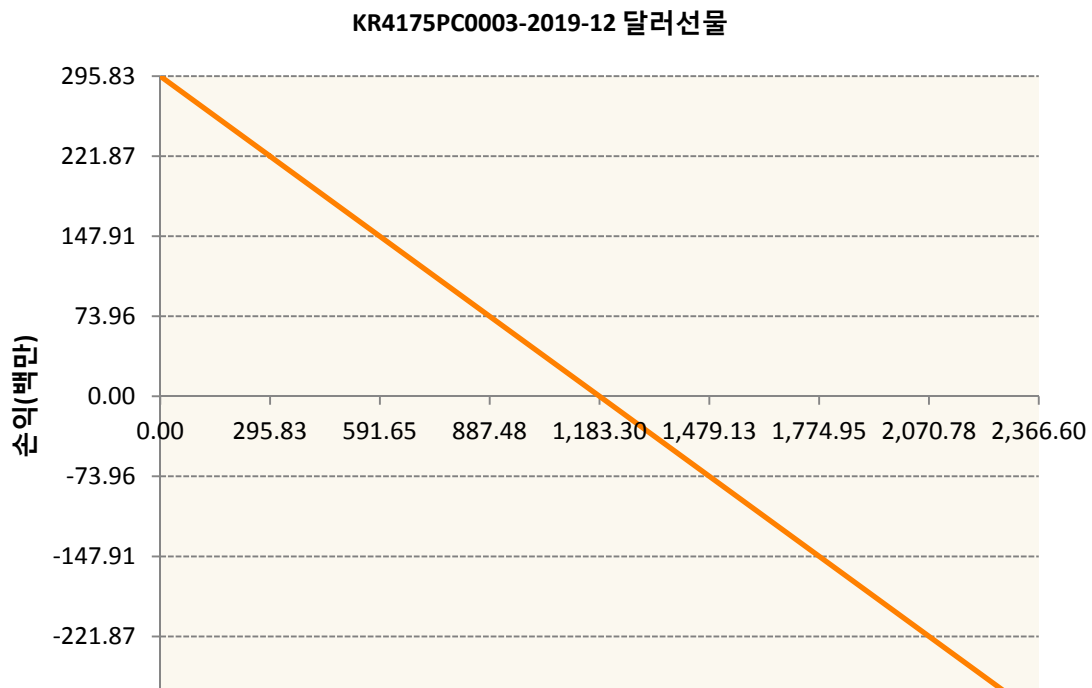
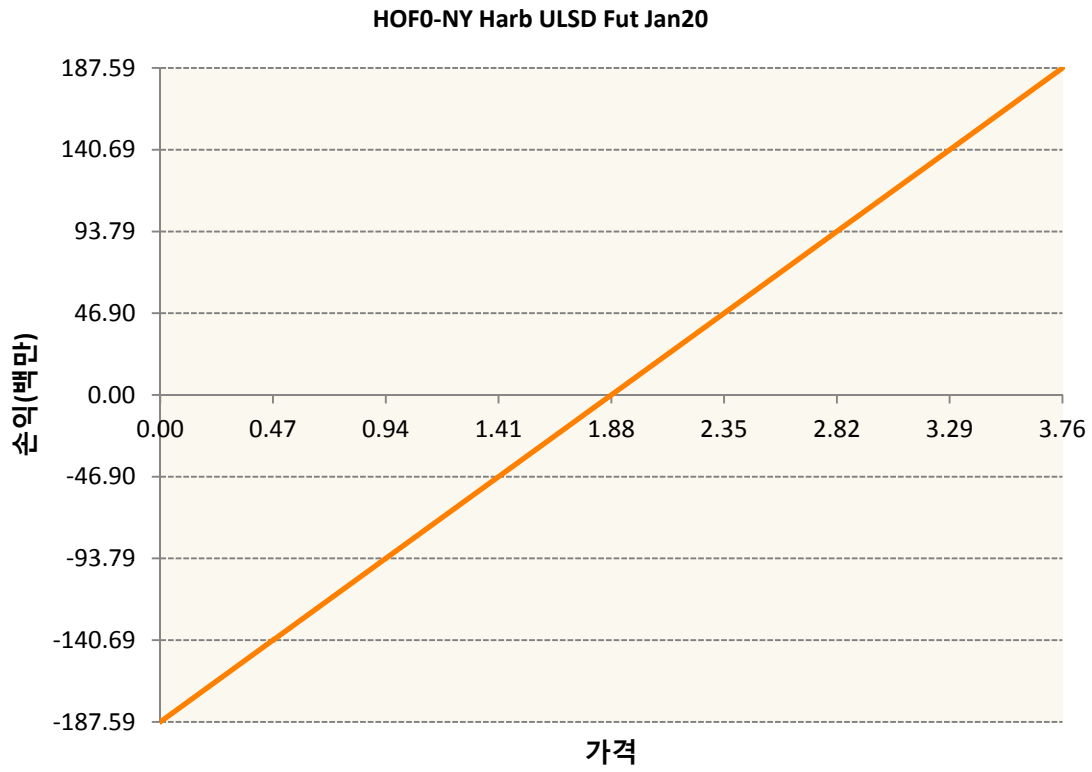
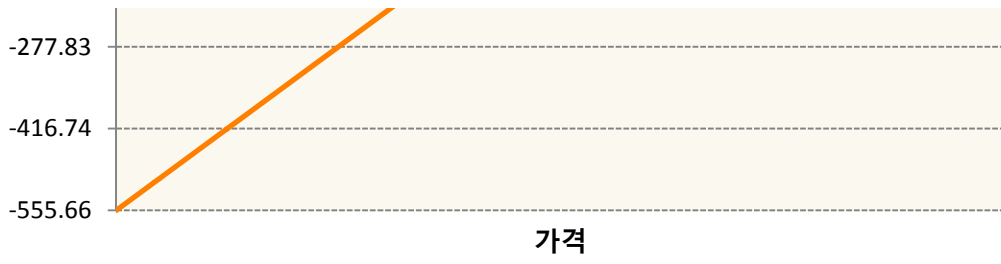
2. 만기시점의 손익구조

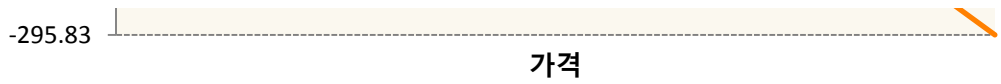
CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20



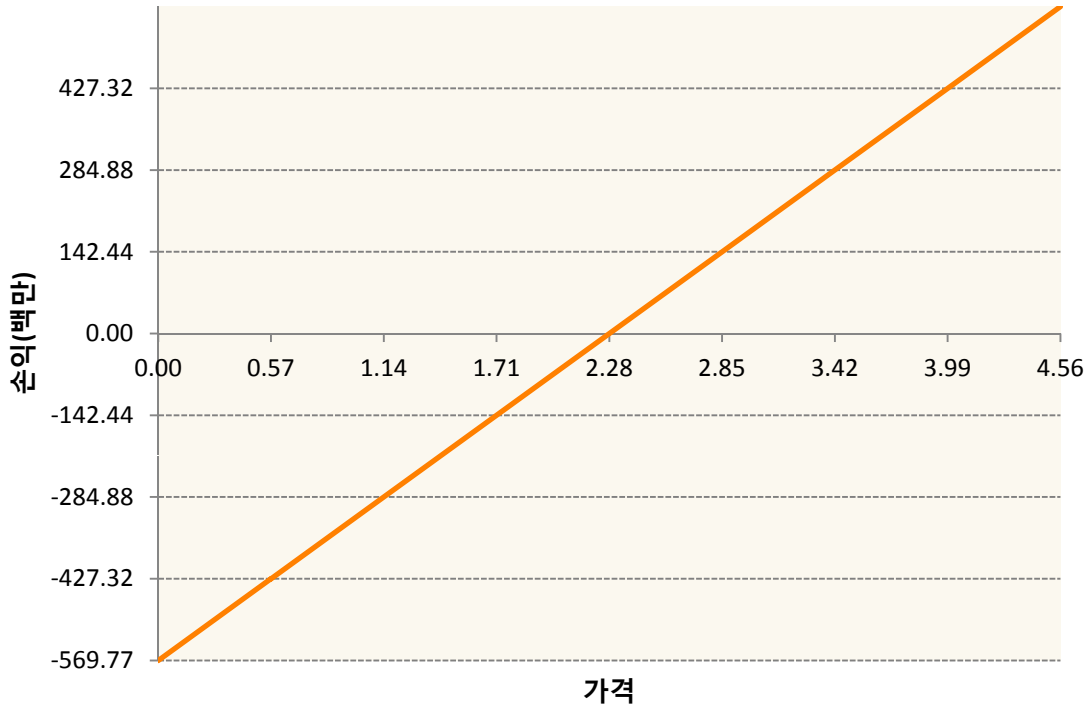
COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20



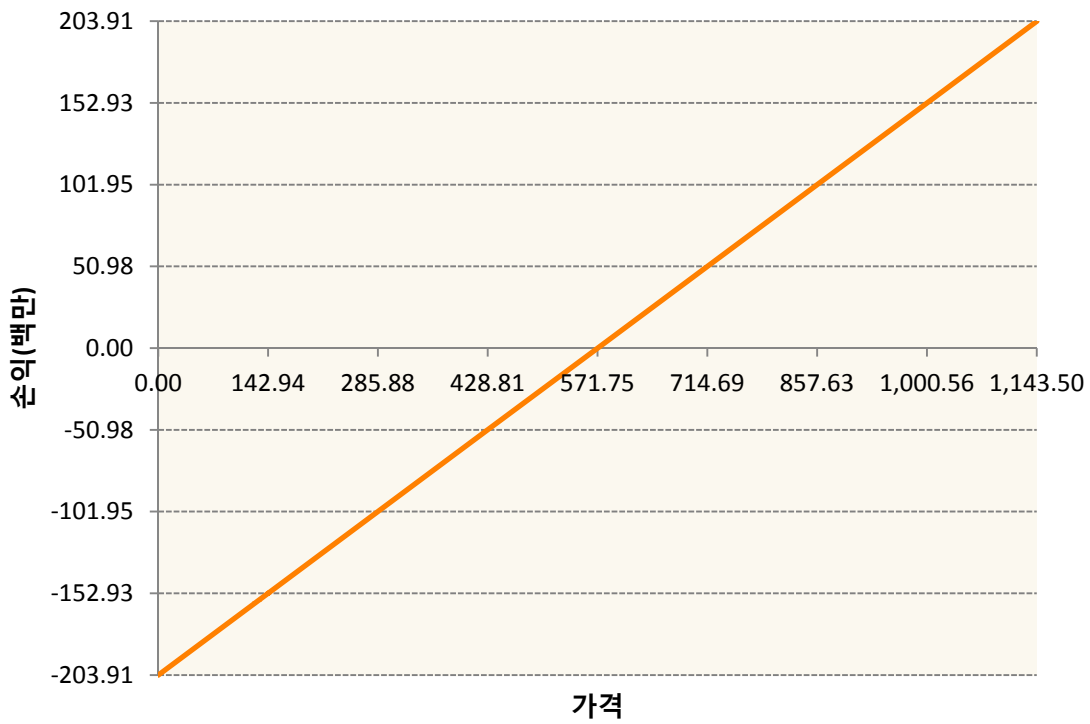




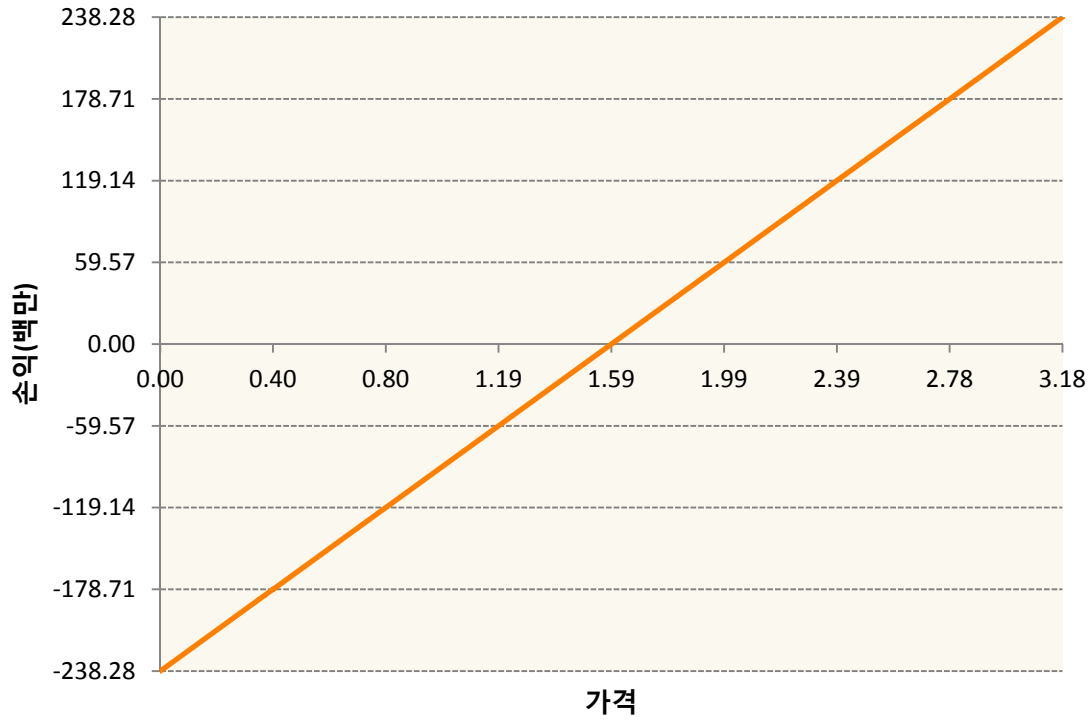
NGF20-NATURAL GAS FUTR Jan20



QSF0-Low Su Gasoil G Jan20



XBF0-GASOLINE RBOB FUT Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLF0	WTI CRUDE FUTURE Jan20	47
COH0	BRENT CRUDE FUTR Mar20	44
HOF0	NY Harb ULSD Fut Jan20	15
KR4175PC00	2019-12 달러선물	24
NGF20	NATURAL GAS FUTR Jan20	46
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	16
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	19

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

(단위:백만원)

384

공시일	2019-12-03
기준일	2019-12-02

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

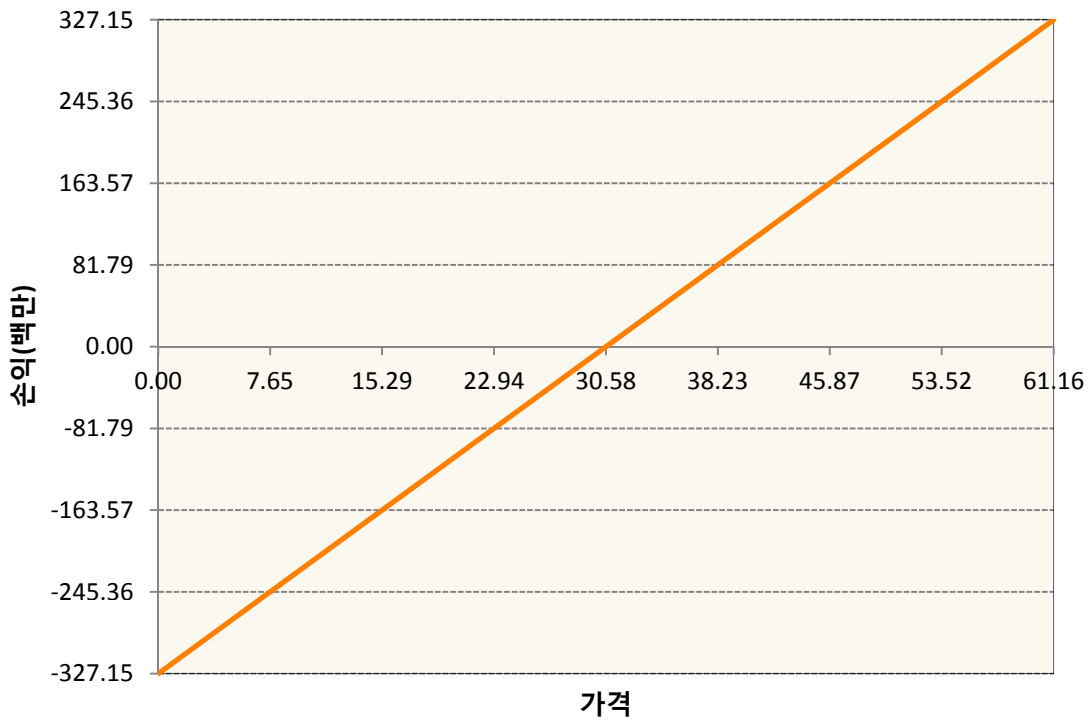
1. 계약금액

(단위:백만원)

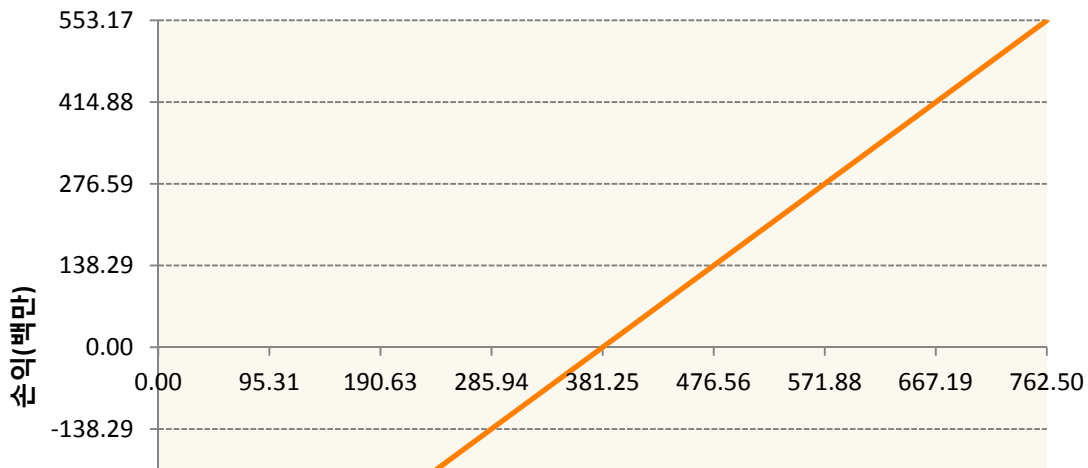
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,783	95	2,688	

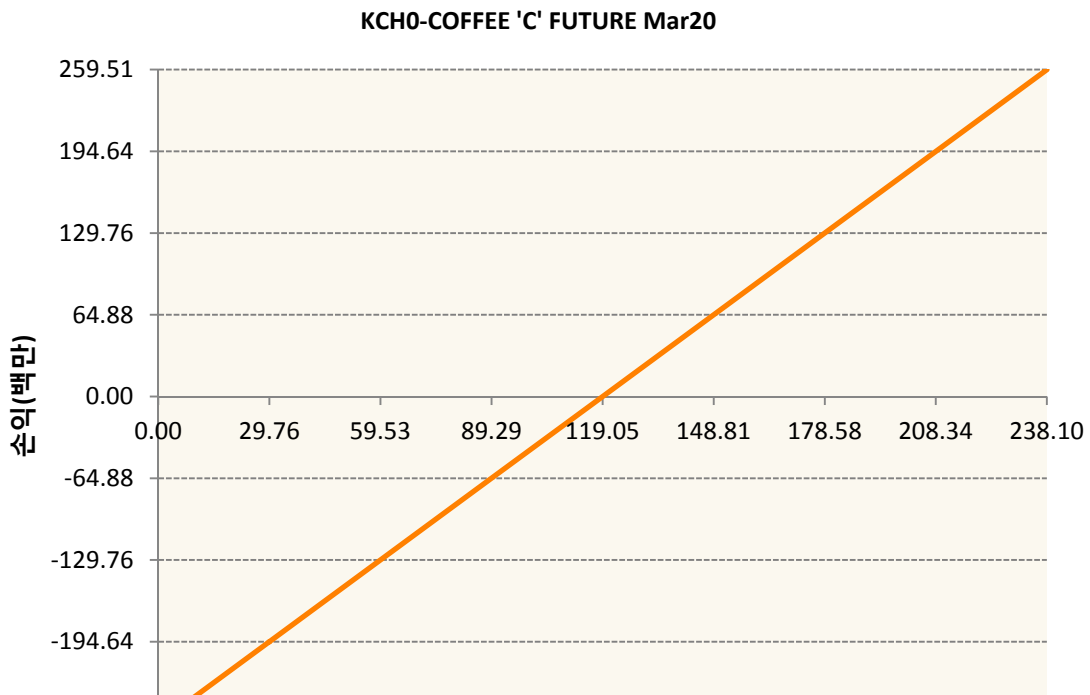
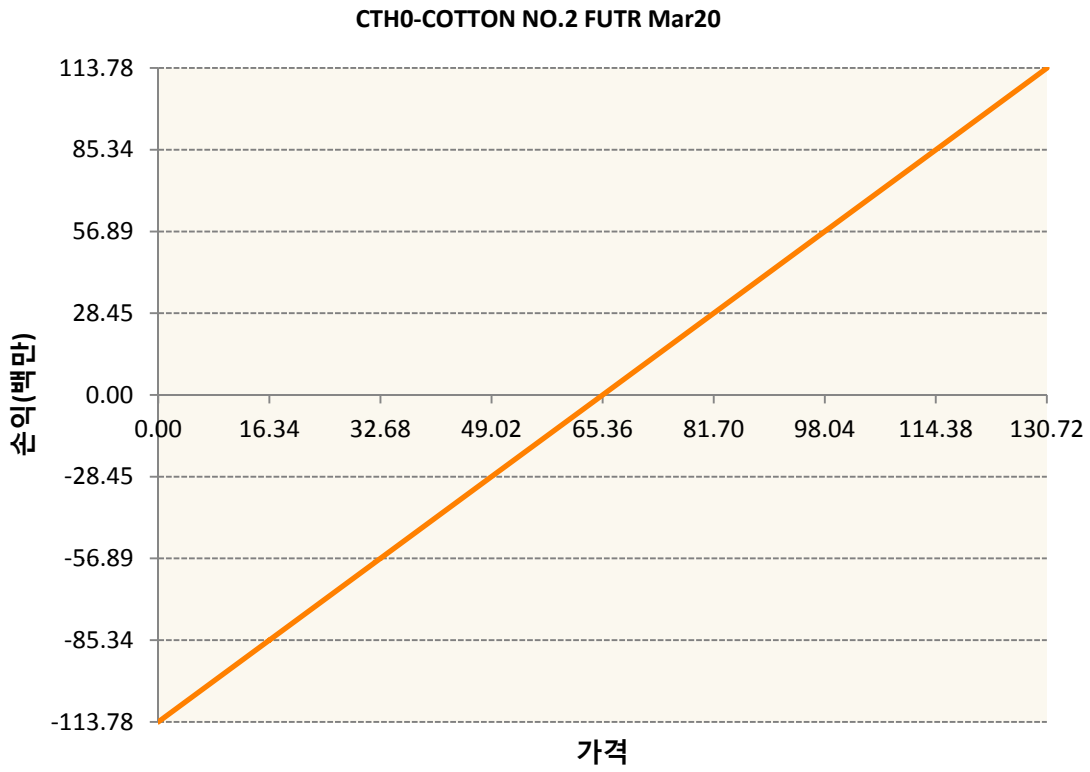
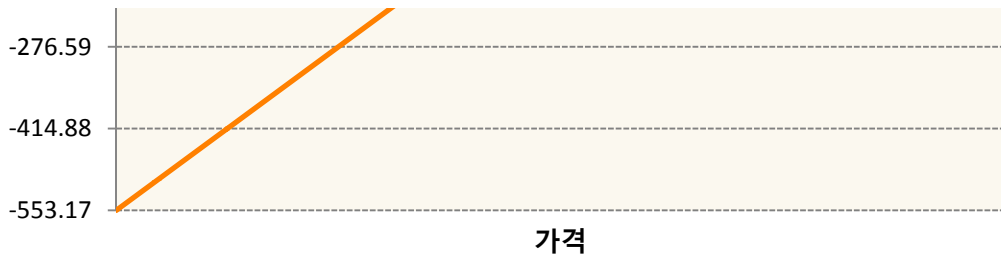
2. 만기시점의 손익구조

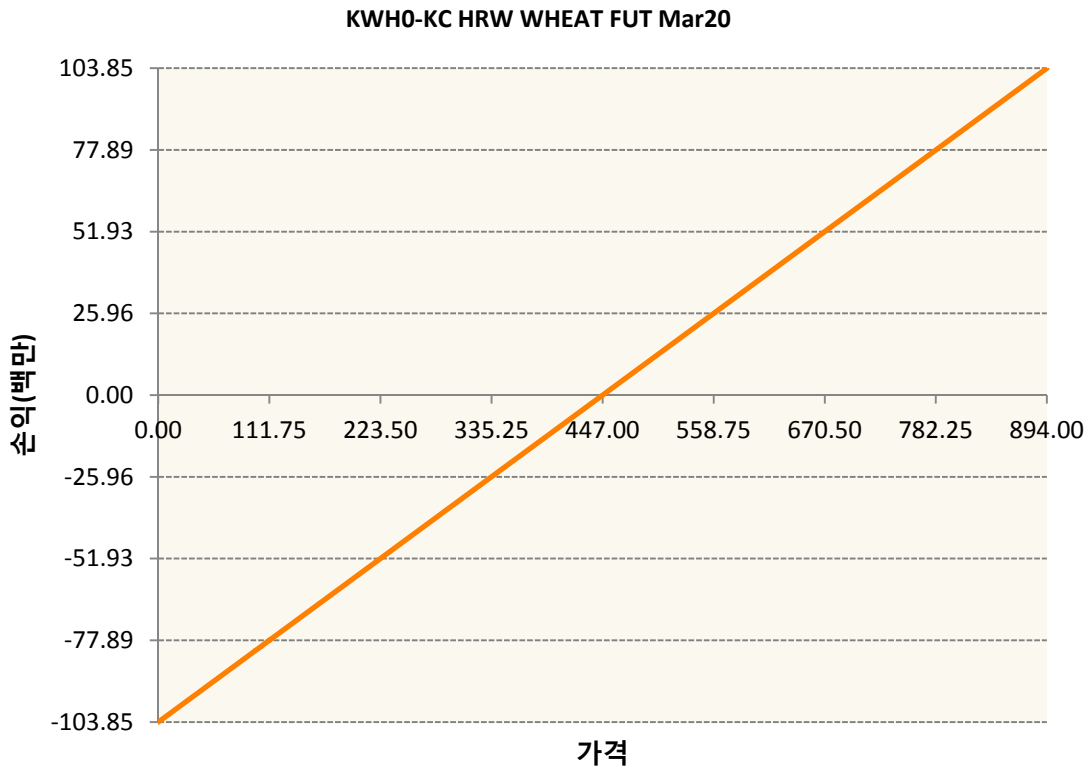
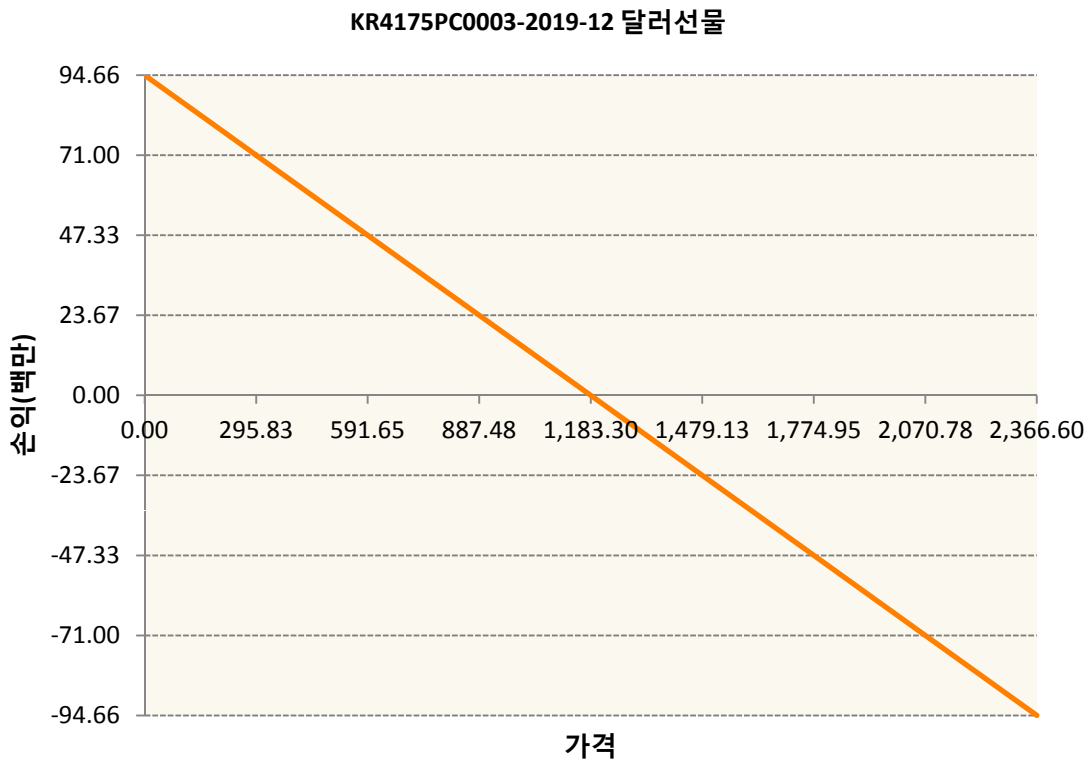
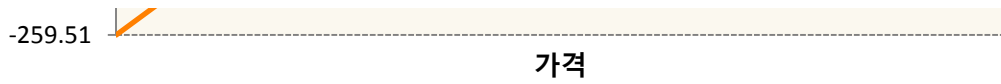
BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20



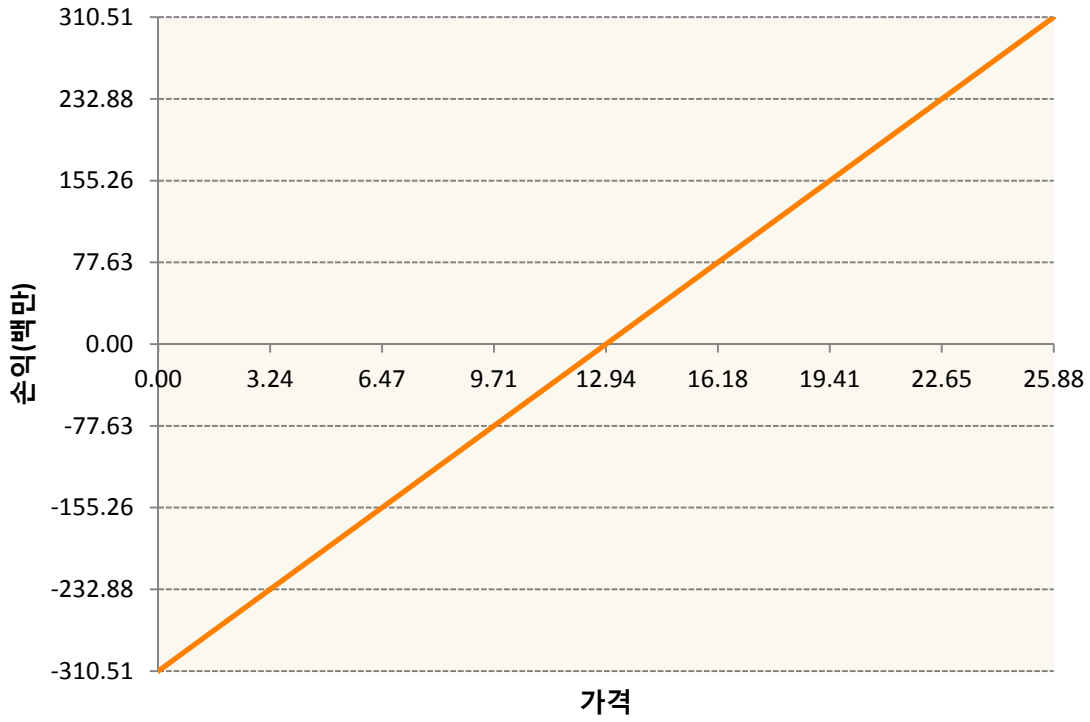
CH0-CORN FUTURE Mar20



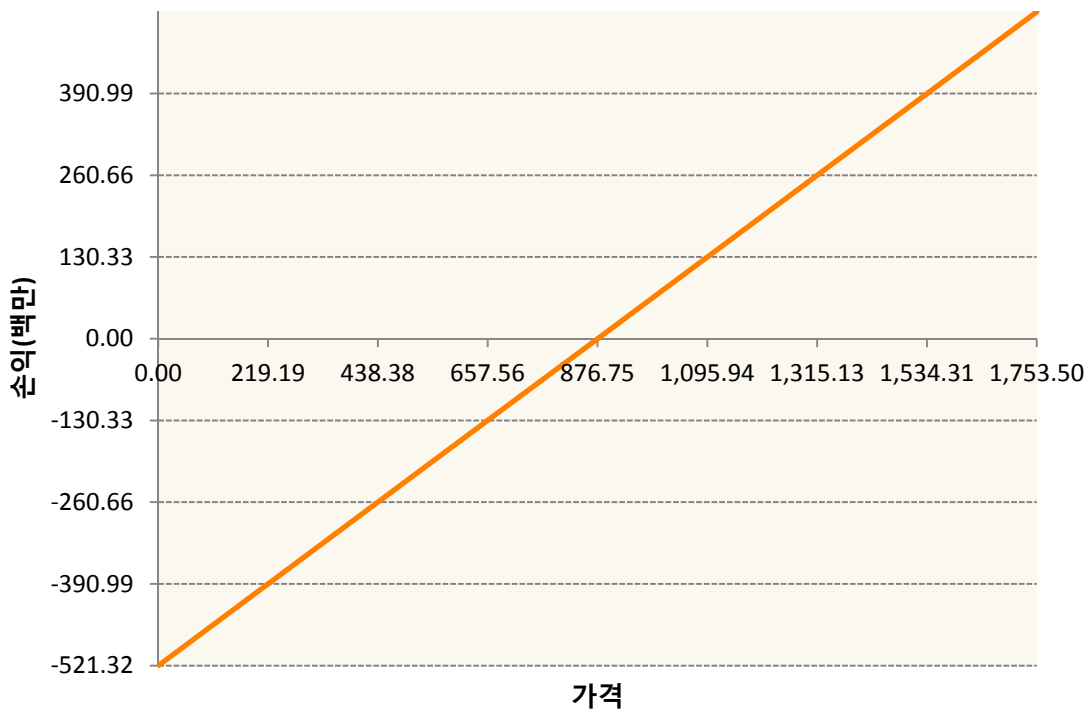




SBH0-Sugar Mar20

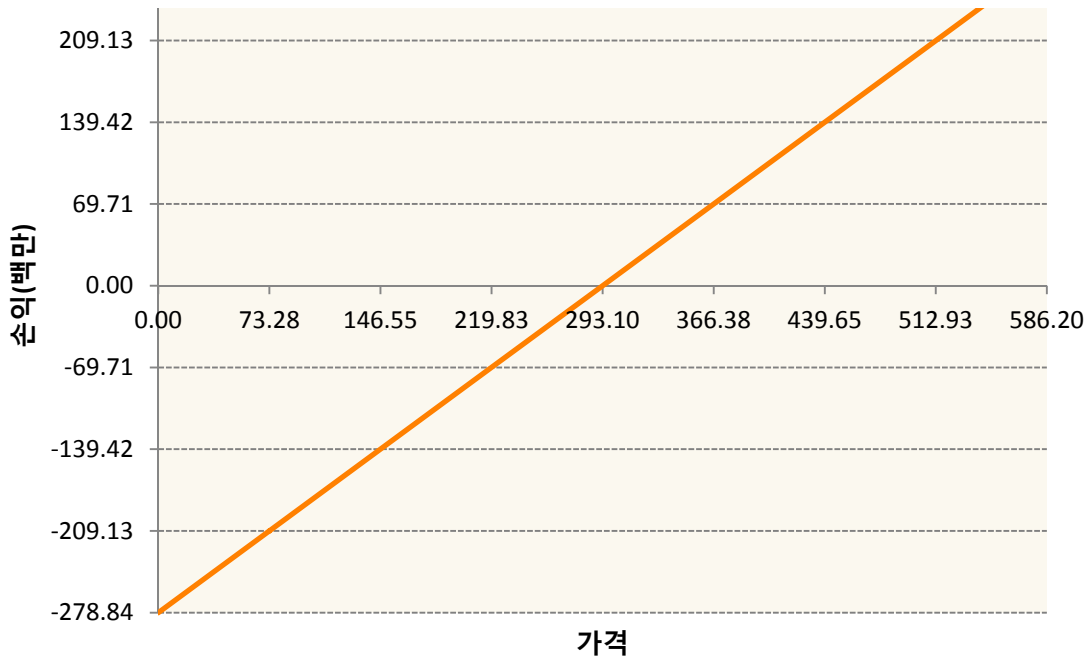


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20

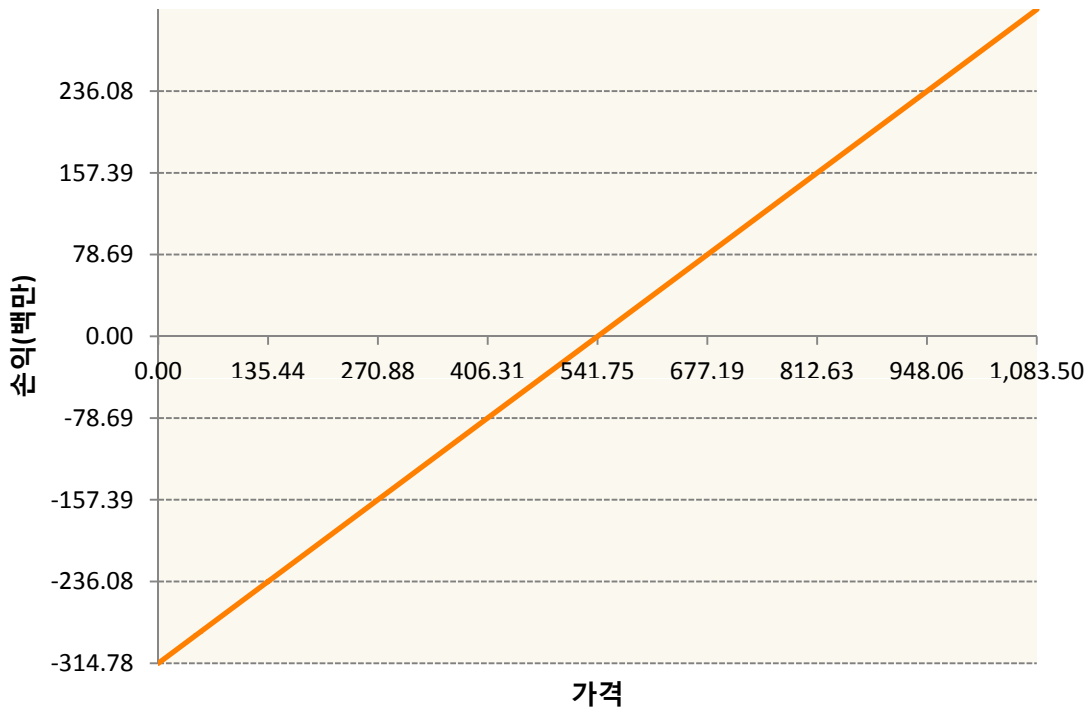


SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





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	22
WH0	WHEAT FUTURE(CBT) Mar20	25

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

(단위:백만원)

247