

공시일	2019-12-04
기준일	2019-12-03

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	2019-12-04
기준일	2019-12-03

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

1,090

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

626

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-04
기준일	2019-12-03

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)	380
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	138

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

736

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-04
기준일	2019-12-03

유로인덱스모(주식-파생형)

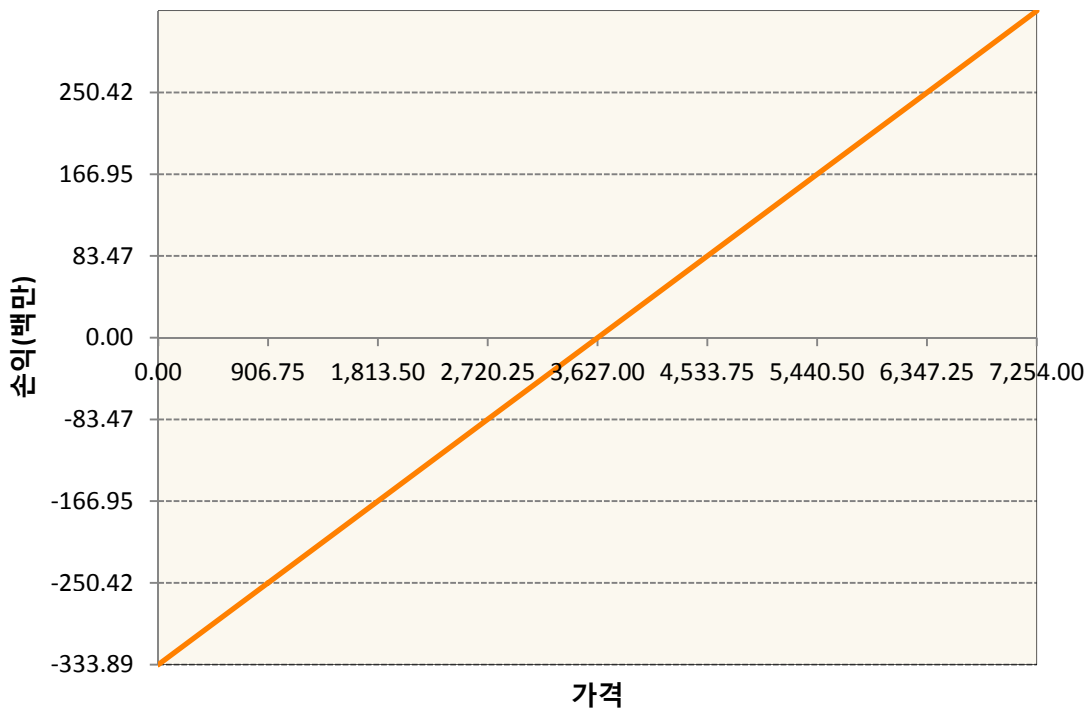
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	334	0	334	

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)

18

공시일	2019-12-04
기준일	2019-12-03

차이나인덱스모(주식-파생형)

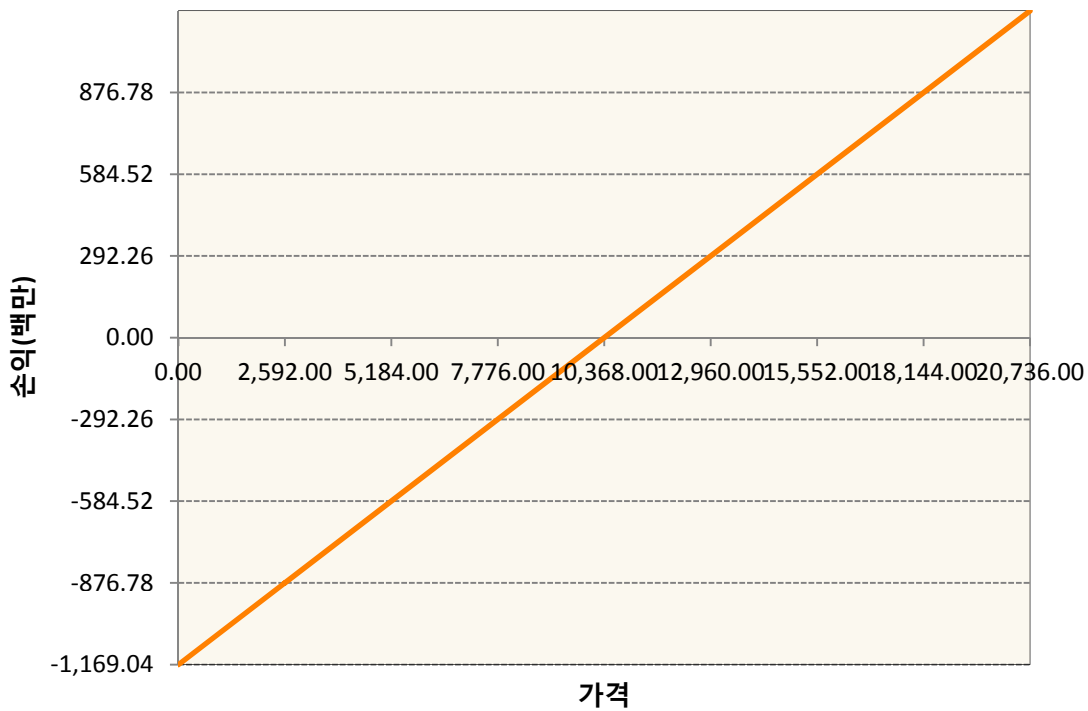
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,169	0	1,169	

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	2019-12-04
기준일	2019-12-03

커버드콜모(주식혼합-파생형)

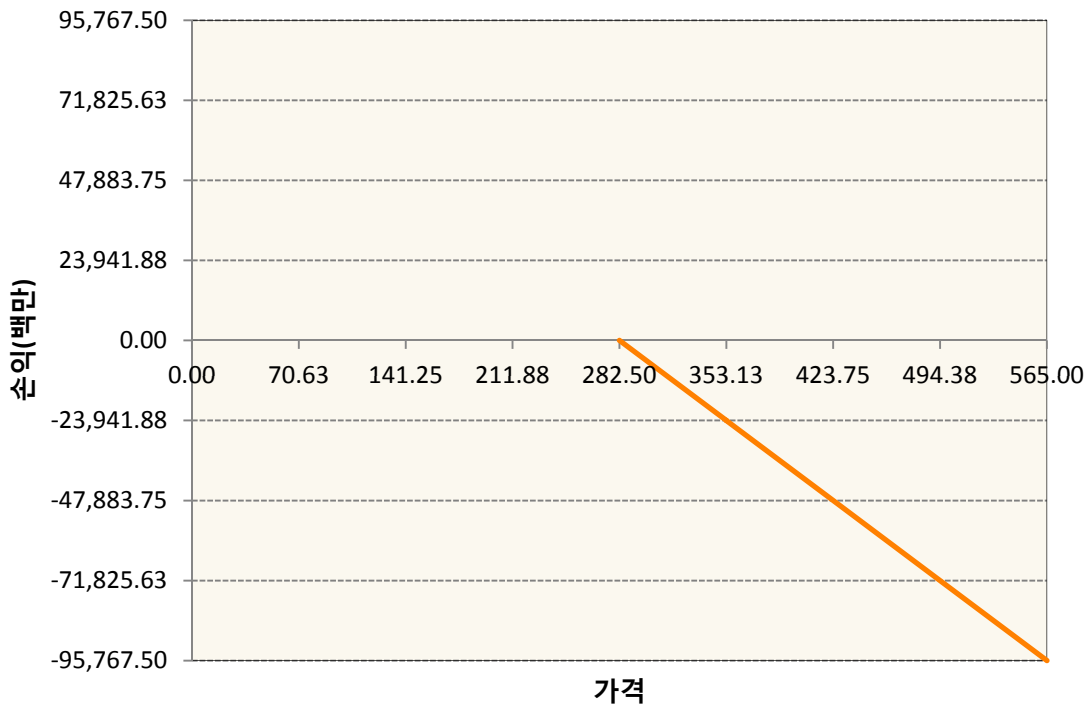
1. 계약금액

(단위:백만원)

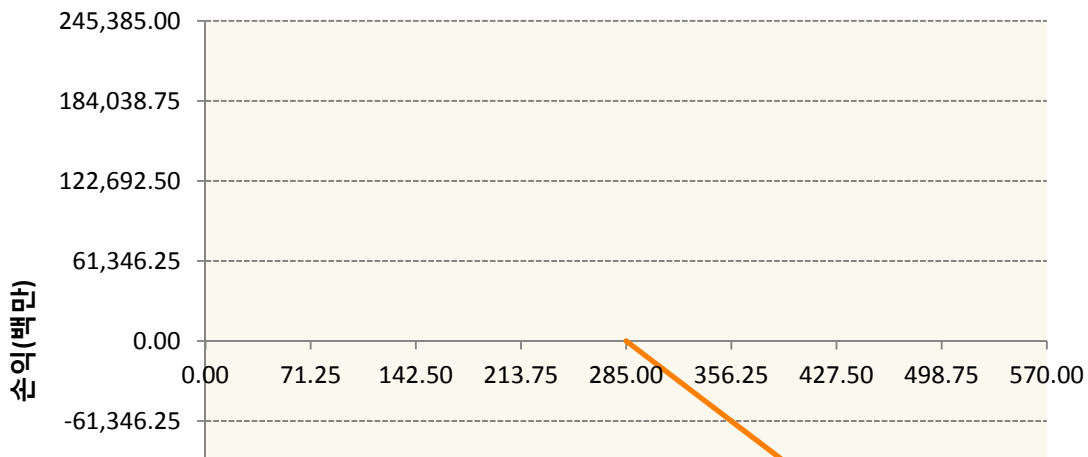
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	498,456	-498,456	장내

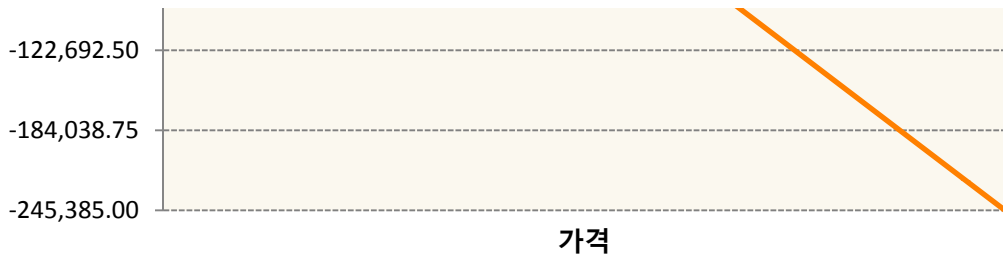
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PC2825-2019-12 콜282.5

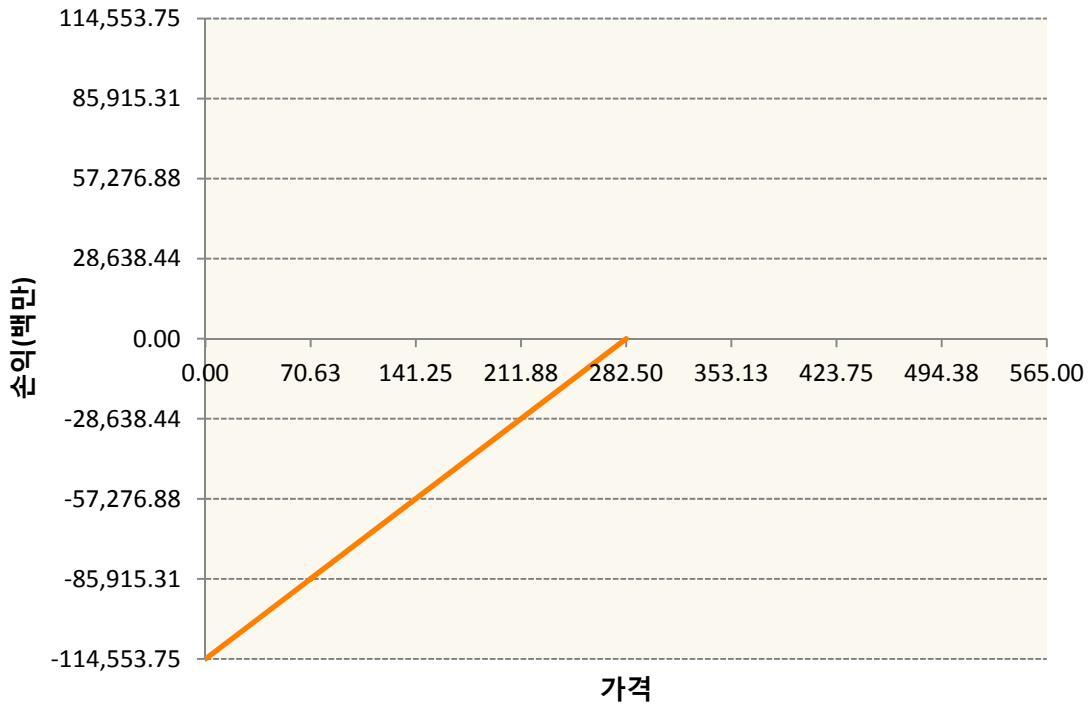


KR4201PC2858-2019-12 콜285

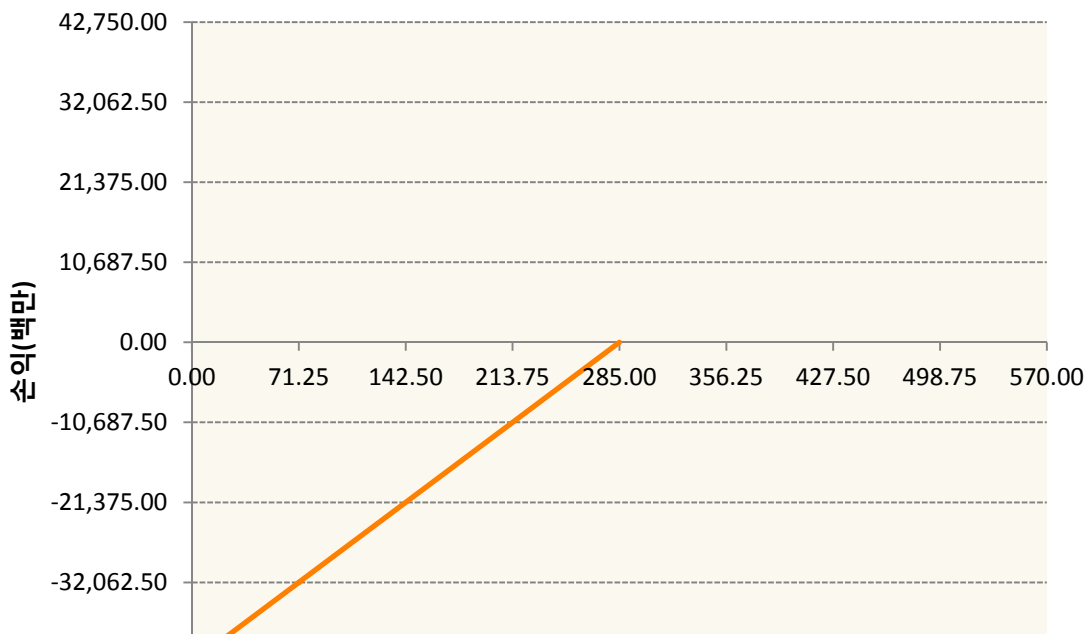




KR4301PC2824-2019-12 풋282.5



KR4301PC2857-2019-12 풋285



-42,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PC2825		2019-12 콜282.5						4,988
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	812	810	807	801	791	777	759	
-5.33%	802	790	772	746	713	672	625	
-2.67%	721	670	610	541	464	380	291	
0%	351	238	121	0	-124	-249	-377	
2.67%	-635	-776	-917	-1,058	-1,199	-1,340	-1,481	
5.33%	-2,357	-2,458	-2,566	-2,680	-2,797	-2,918	-3,042	
8.00%	-4,584	-4,628	-4,683	-4,747	-4,820	-4,901	-4,988	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						11,498
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,497	1,495	1,491	1,482	1,466	1,442	1,408	
-5.33%	1,486	1,469	1,440	1,396	1,335	1,258	1,164	
-2.67%	1,373	1,286	1,174	1,038	881	705	512	
0%	763	525	270	0	-282	-573	-872	
2.67%	-1,141	-1,498	-1,855	-2,213	-2,572	-2,931	-3,290	
5.33%	-4,904	-5,213	-5,532	-5,858	-6,190	-6,527	-6,867	
8.00%	-10,207	-10,368	-10,555	-10,765	-10,994	-11,239	-11,498	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						8,753
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-8,753	-8,753	-8,753	-8,753	-8,753	-8,753	-8,753	
-5.33%	-5,769	-5,769	-5,769	-5,769	-5,769	-5,770	-5,771	
-2.67%	-2,785	-2,786	-2,789	-2,795	-2,803	-2,815	-2,830	
0%	126	90	47	0	-52	-107	-166	
2.67%	2,204	2,121	2,037	1,953	1,869	1,785	1,700	
5.33%	2,755	2,732	2,704	2,670	2,631	2,587	2,539	
8.00%	2,786	2,786	2,784	2,780	2,774	2,766	2,754	
KR4301PC2857		2019-12 풋285						3,279
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,279	-3,279	-3,279	-3,279	-3,279	-3,279	-3,279	
-5.33%	-2,175	-2,175	-2,175	-2,175	-2,175	-2,175	-2,176	
-2.67%	-1,071	-1,071	-1,072	-1,072	-1,074	-1,076	-1,079	
0%	25	19	10	0	-12	-26	-42	
2.67%	952	922	891	861	830	799	768	

5.33%	1,325	1,309	1,290	1,270	1,248	1,225	1,201
8.00%	1,364	1,362	1,360	1,357	1,352	1,346	1,338

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

(단위:백만원)

29,559

공시일	2019-12-04
기준일	2019-12-03

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

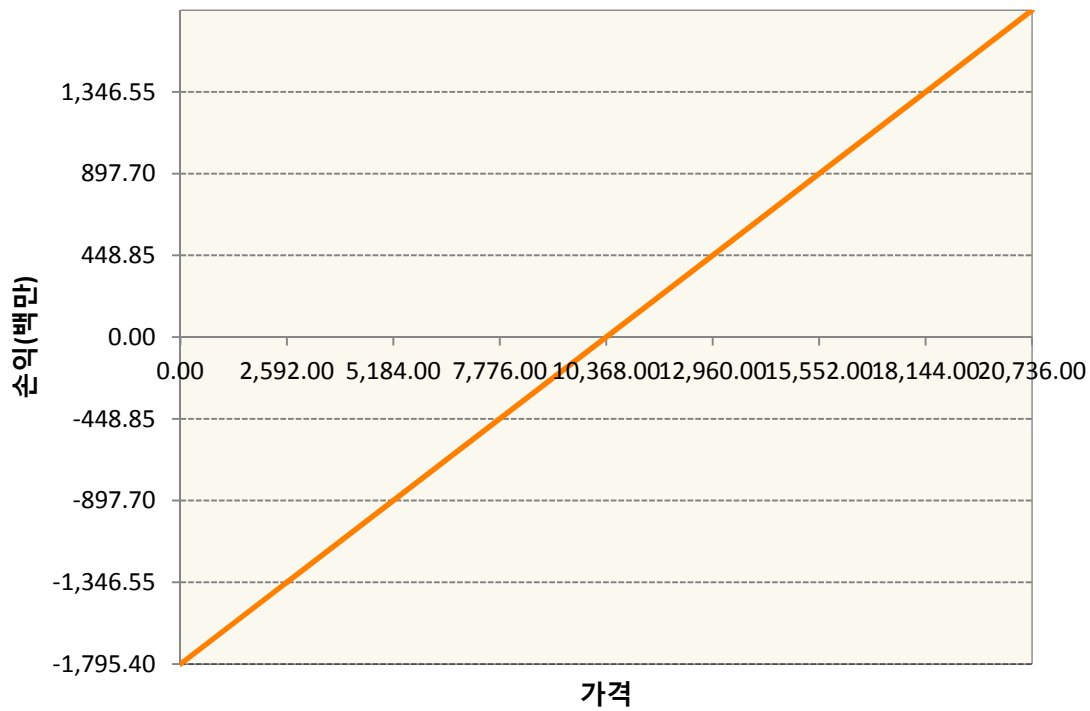
1. 계약금액

(단위:백만원)

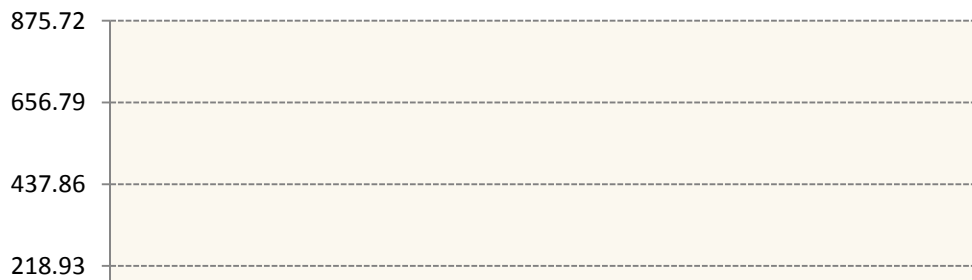
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,795	0	1,795	
누계	유가증권	옵션	0	4,966	-4,966	장내
누계	통화	선도	0	2,135	-2,135	장외

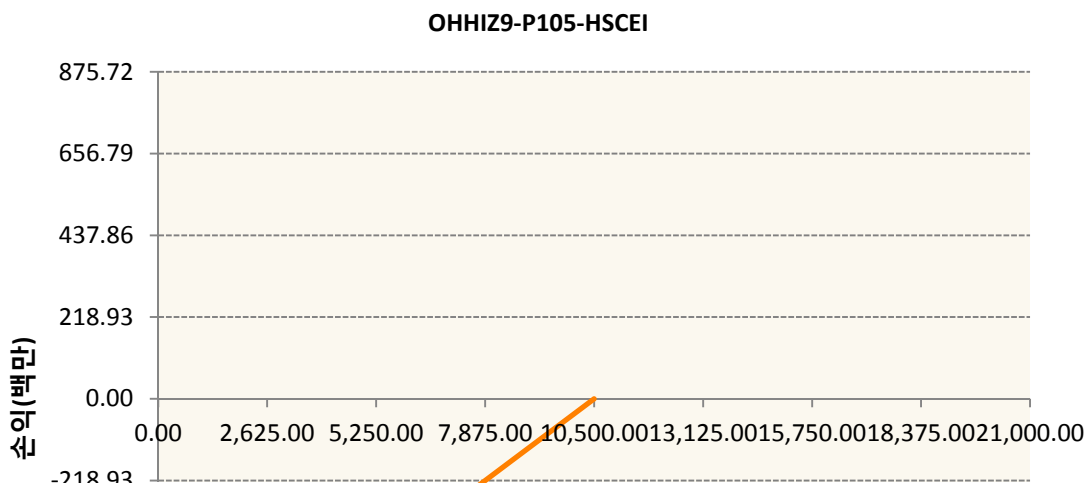
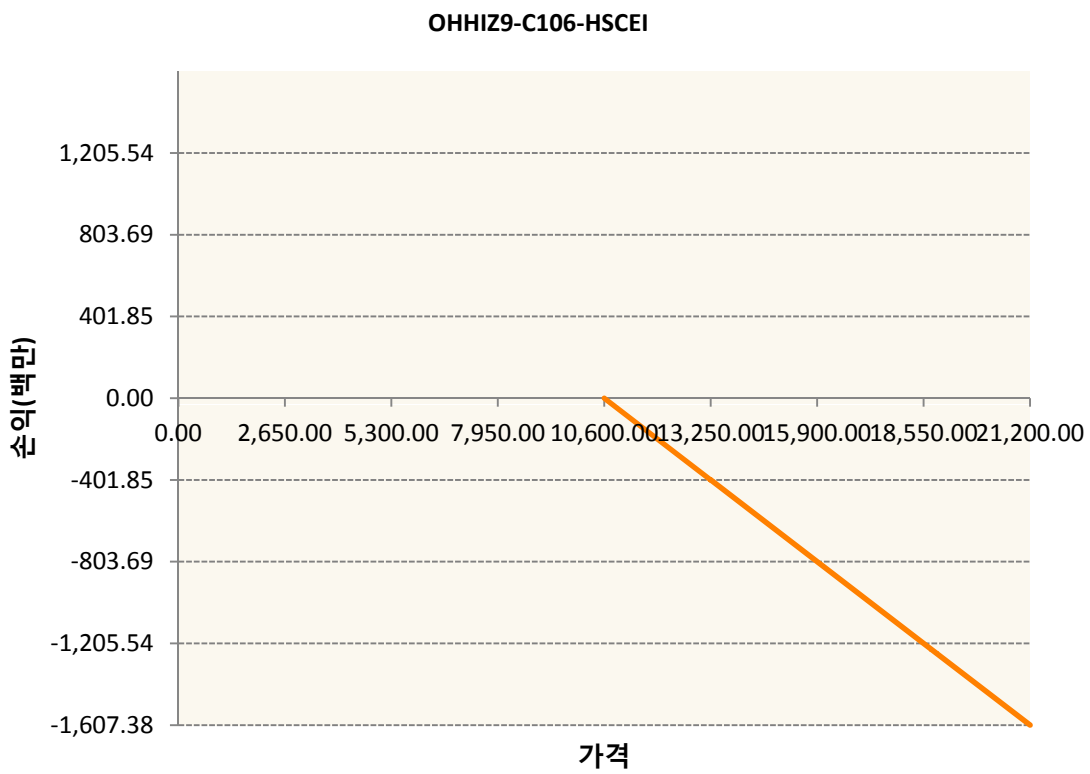
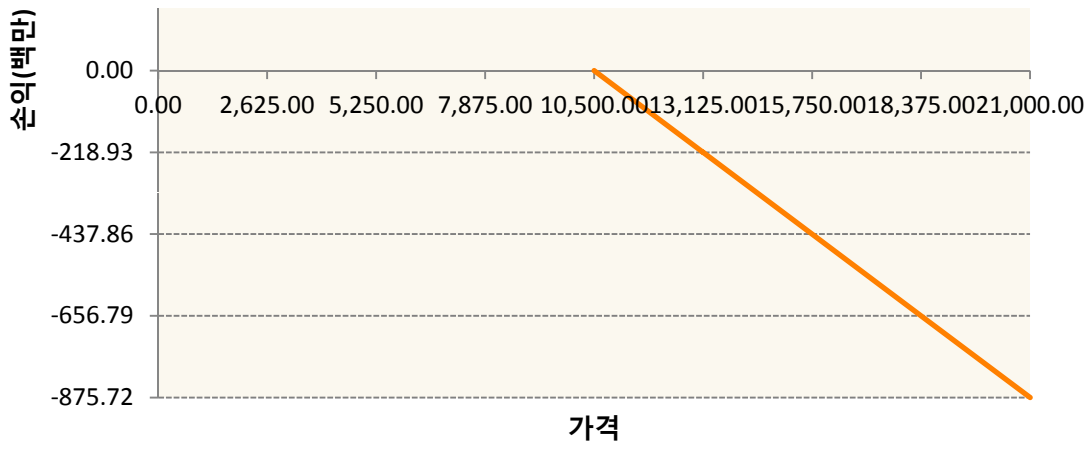
2. 만기시점의 손익구조

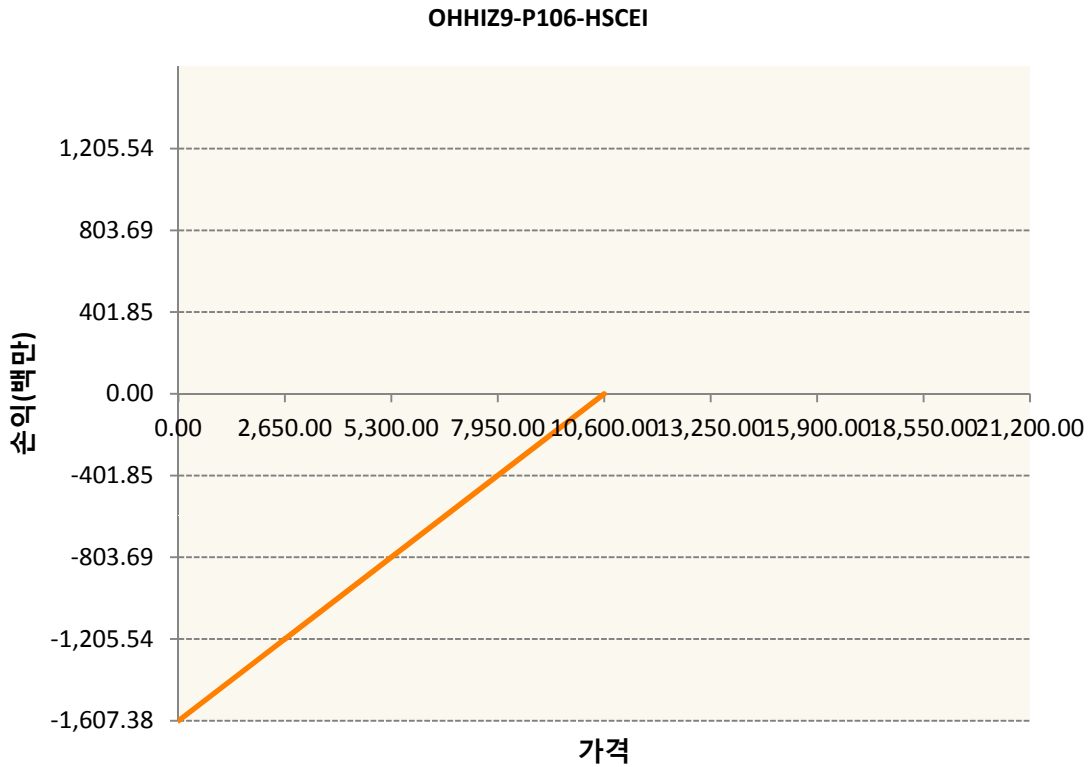
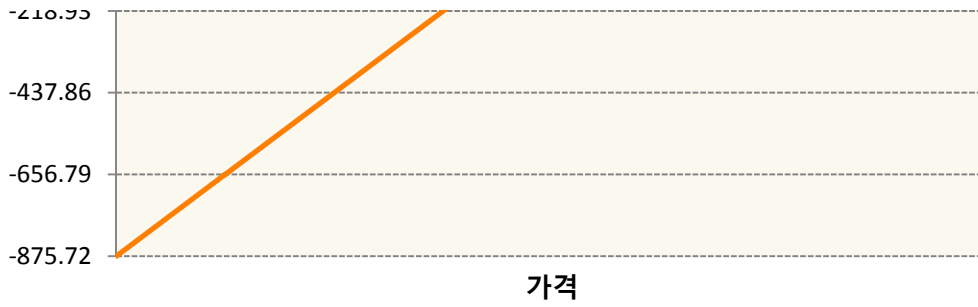
HCZ9-HSCEI Futures Dec19



OHHIZ9-C105-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	171
HCZ9 HSCEI Futures Dec19	144
OHHIZ9-C1C HSCEI	70
OHHIZ9-C1C HSCEI	129
OHHIZ9-P10 HSCEI	70
OHHIZ9-P10 HSCEI	129

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

534

공시일	2019-12-04
기준일	2019-12-03

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

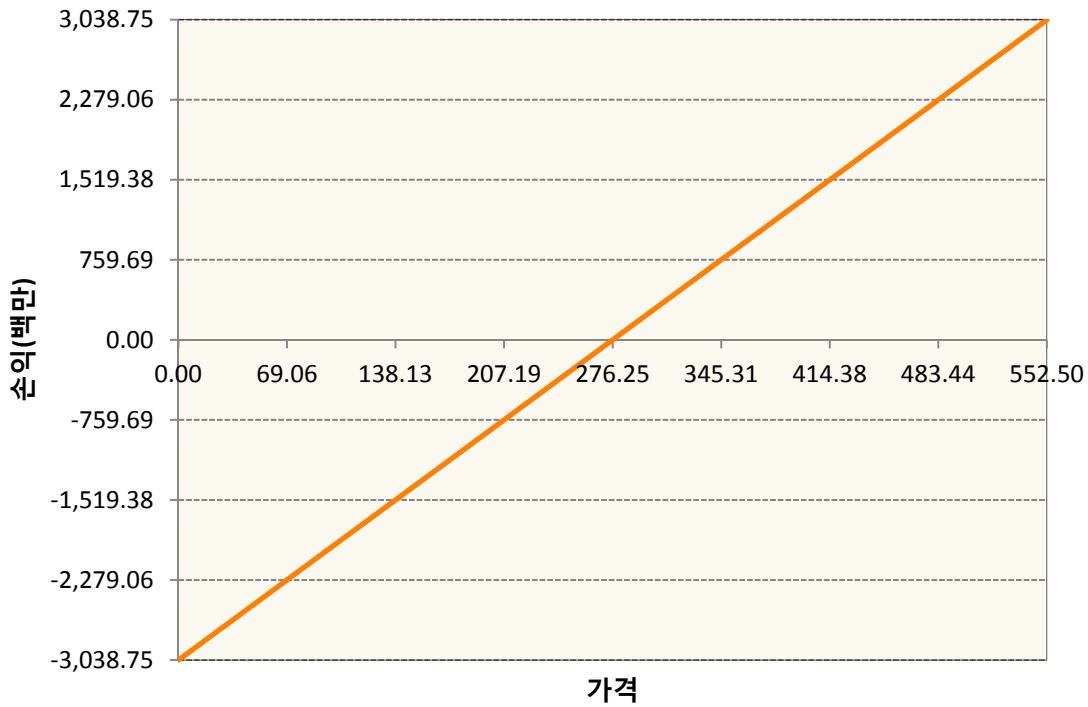
1. 계약금액

(단위:백만원)

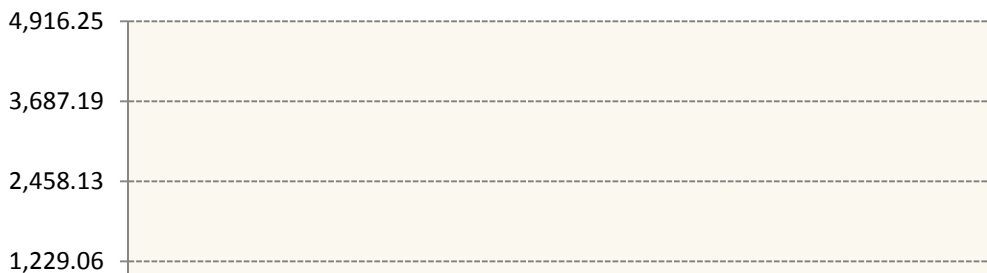
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,039	0	3,039	장내
누계	유가증권	스왑	9,625	0	9,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,657	-9,657	장내

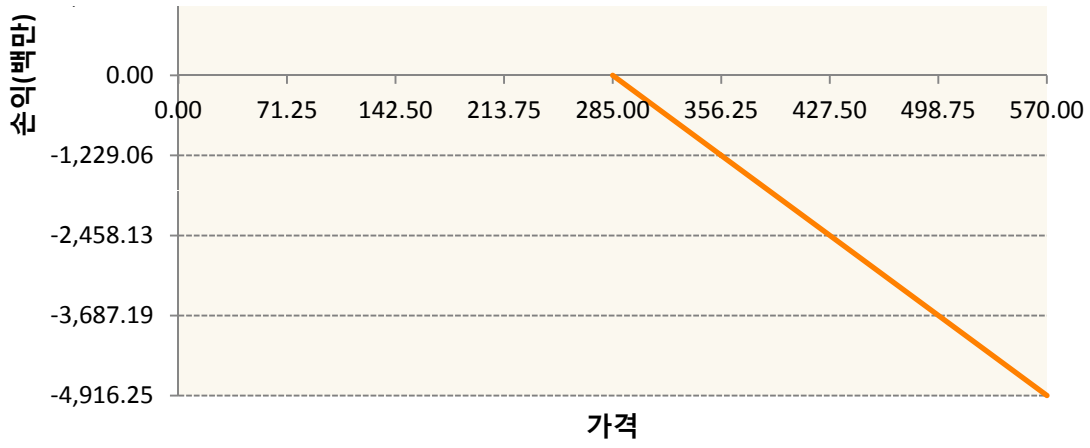
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

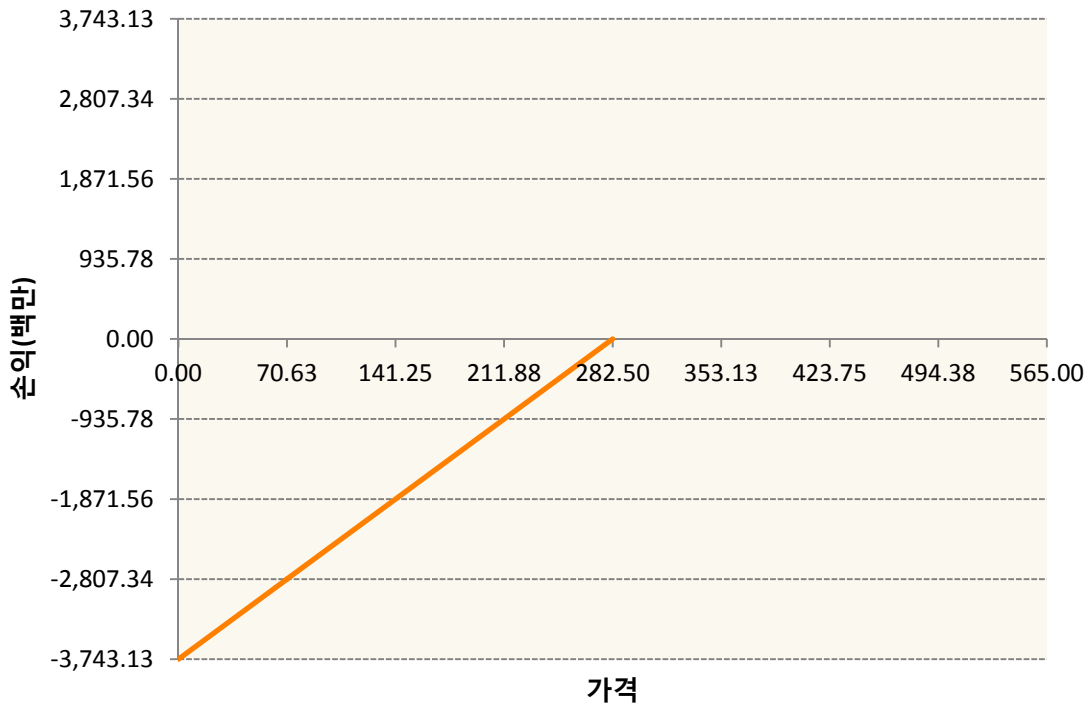


KR4201PC2858-2019-12 콜285

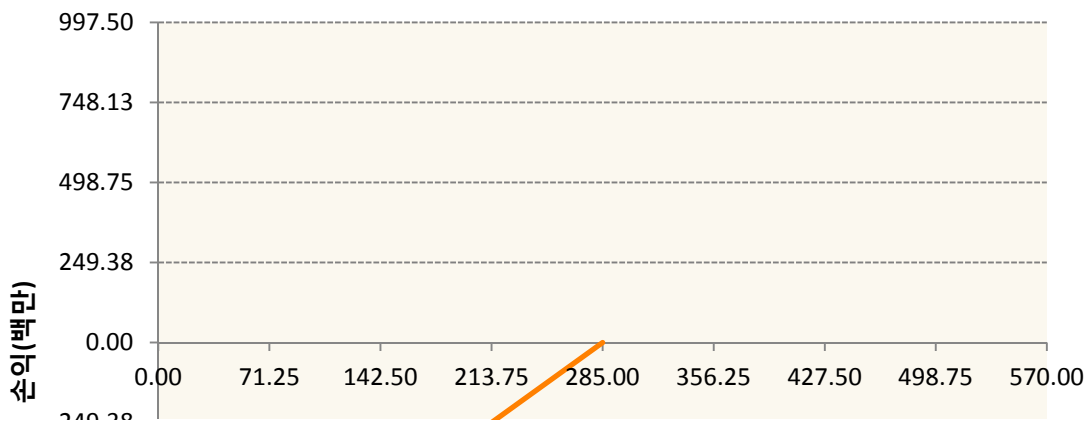




KR4301PC2824-2019-12 풋282.5



KR4301PC2857-2019-12 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						834
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-834	-834	-834	-834	-834	-834	-834	
-5.33%	-556	-556	-556	-556	-556	-556	-556	
-2.67%	-278	-278	-278	-278	-278	-278	-278	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	278	278	278	278	278	278	278	
5.33%	556	556	556	556	556	556	556	
8.00%	834	834	834	834	834	834	834	
KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						243
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-243	-243	-243	-243	-243	-243	-243	
-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%	243	243	243	243	243	243	243	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						230
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	30	30	30	30	29	29	28	
-5.33%	30	29	29	28	27	25	23	
-2.67%	28	26	24	21	18	14	10	
0%	15	11	5	0	-6	-11	-17	
2.67%	-23	-30	-37	-44	-52	-59	-66	
5.33%	-98	-104	-111	-117	-124	-131	-138	
8.00%	-204	-208	-211	-216	-220	-225	-230	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						286
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-286	-286	-286	-286	-286	-286	-286
-5.33%	-188	-188	-188	-188	-189	-189	-189
-2.67%	-91	-91	-91	-91	-92	-92	-92
0%	4	3	2	0	-2	-4	-5
2.67%	72	69	67	64	61	58	56
5.33%	90	89	88	87	86	85	83
8.00%	91	91	91	91	91	90	90
KR4301PC2857 2019-12 풋285							77
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
-5.33%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
0%	1	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	22	22	21	20	19	19	18
5.33%	31	31	30	30	29	29	28
8.00%	32	32	32	32	32	31	31

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

(단위:백만원)

1,673

공시일	2019-12-04
기준일	2019-12-03

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

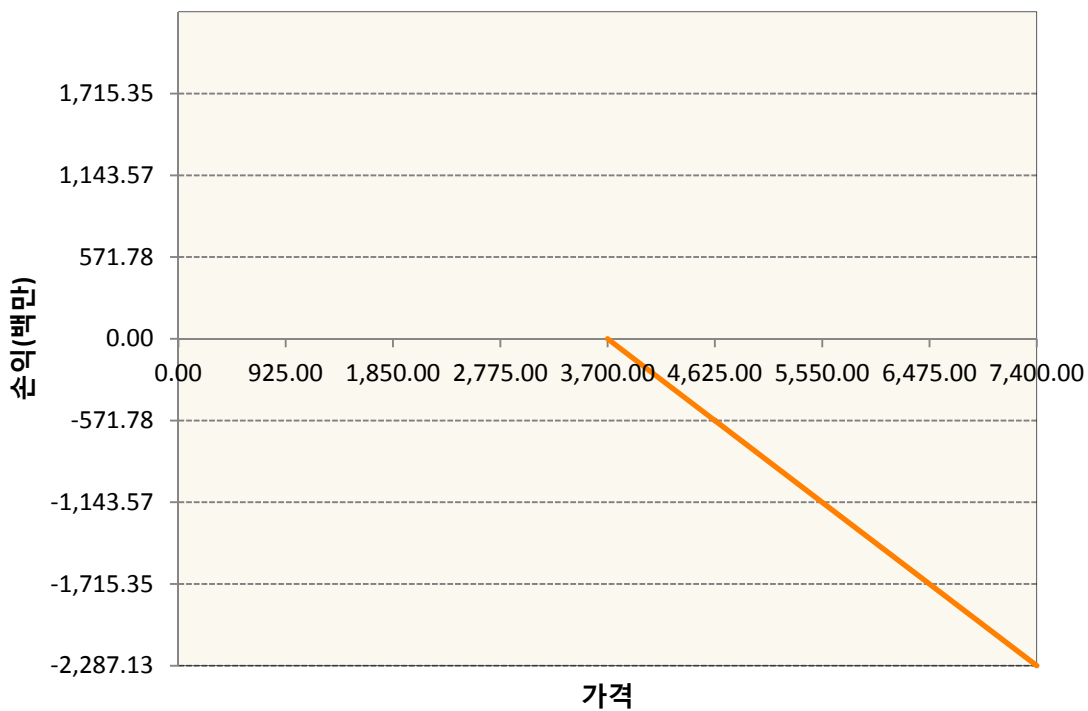
1. 계약금액

(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	1,174	0	1,174	
누계	유가증권	스왑	17,984	0	17,984	장외
누계	유가증권	옵션	0	8,592	-8,592	장내
누계	통화	선도	2,730	6,182	-3,451	장외

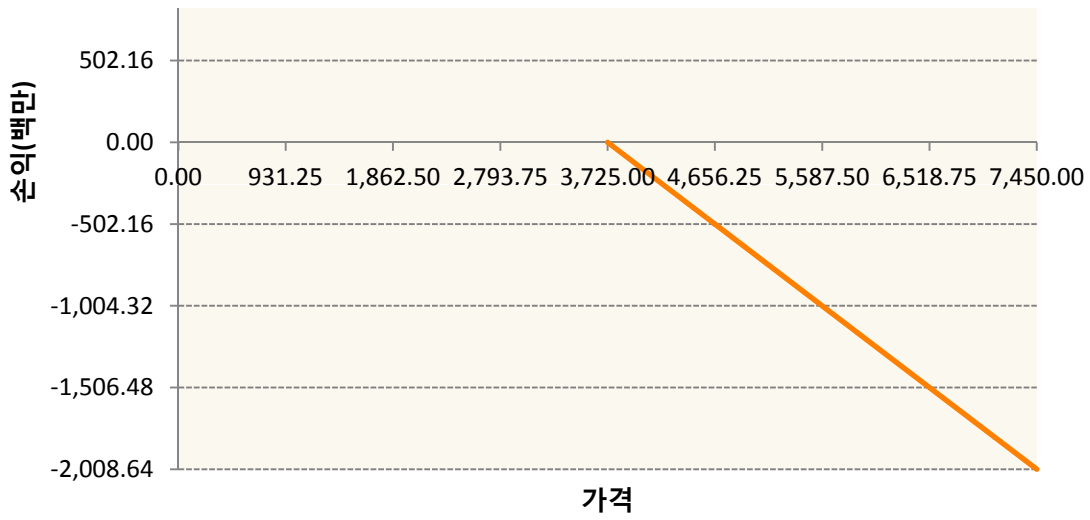
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ9-C3700-EURO STOXX 50

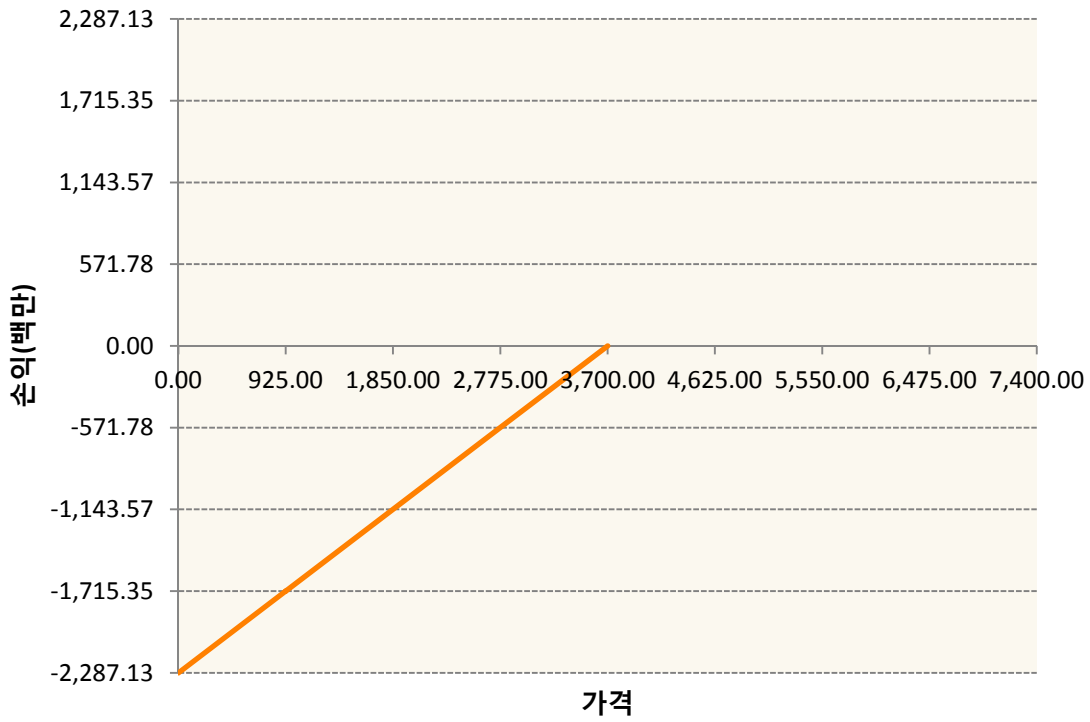


OESXZ9-C3725-EURO STOXX 50

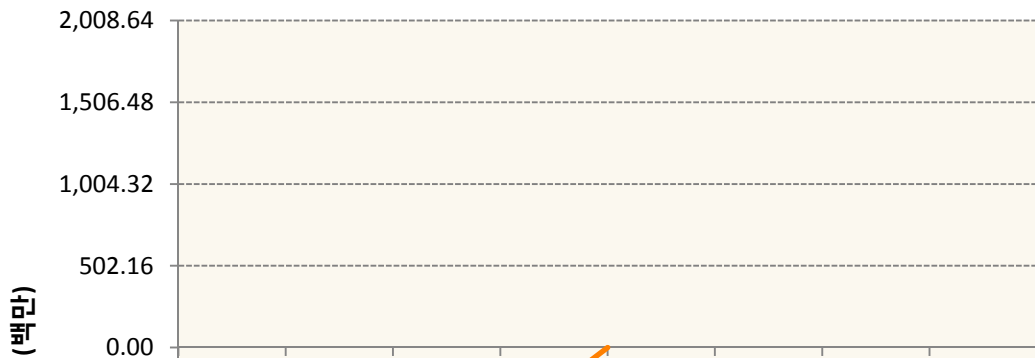


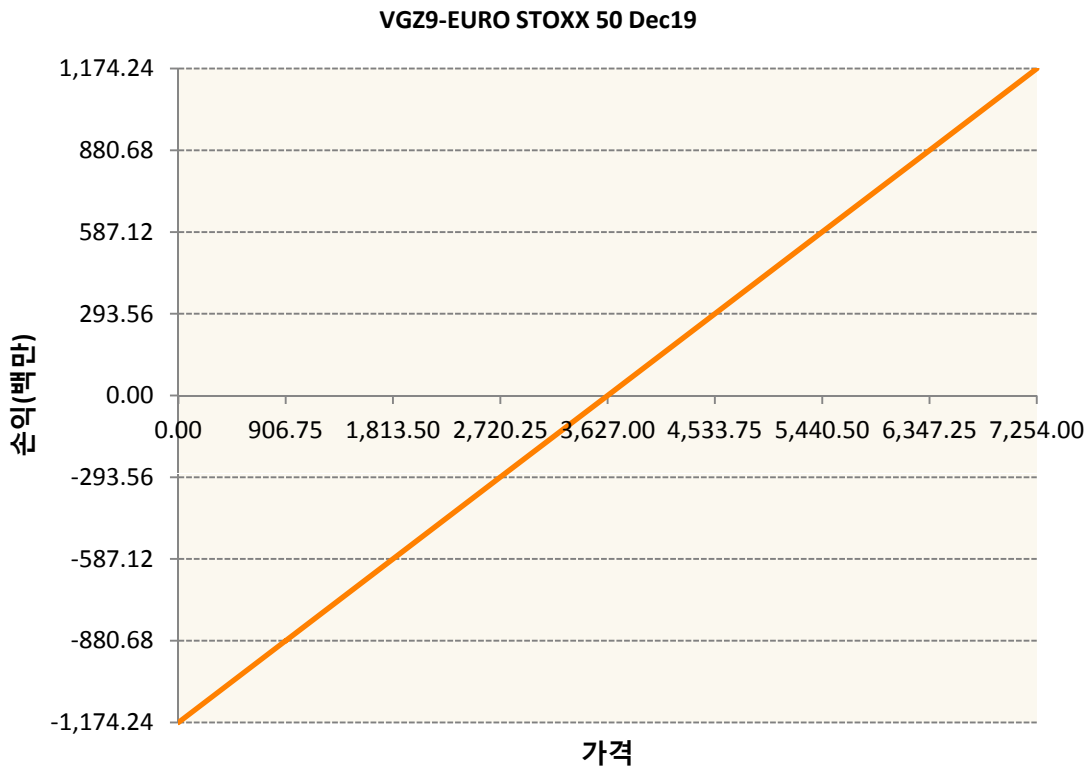
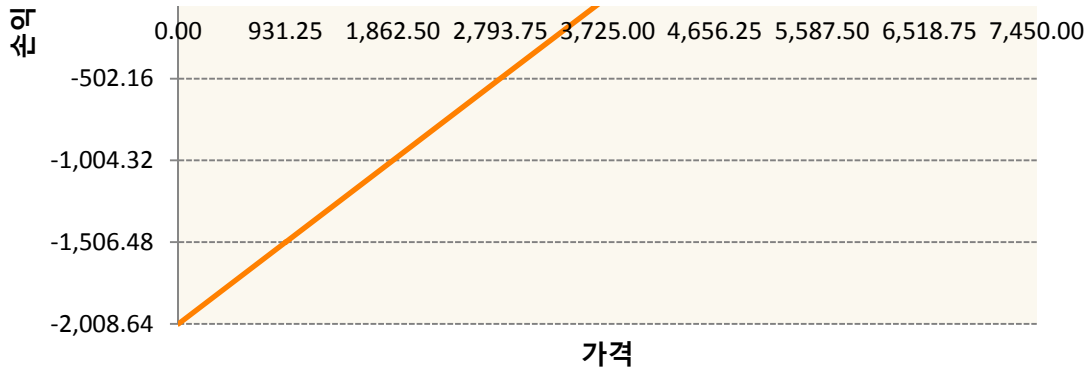


OESXZ9-P3700-EURO STOXX 50



OESXZ9-P3725-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	1
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E	495
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E	166
FX21019X02 EUR/KRW 27-12-19E	53
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	183
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	161
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	183
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	161
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19	94

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

(단위:백만원)

852

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

(단위:백만원)

902

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)

39

공시일	2019-12-04
기준일	2019-12-03

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

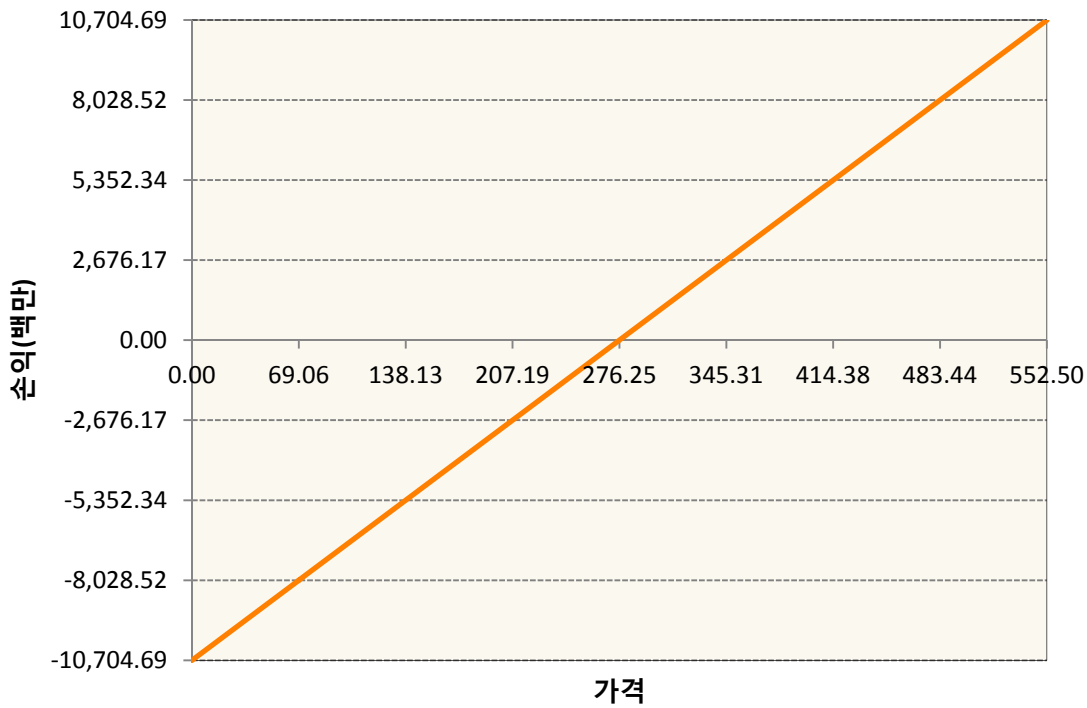
1. 계약금액

(단위:백만원)

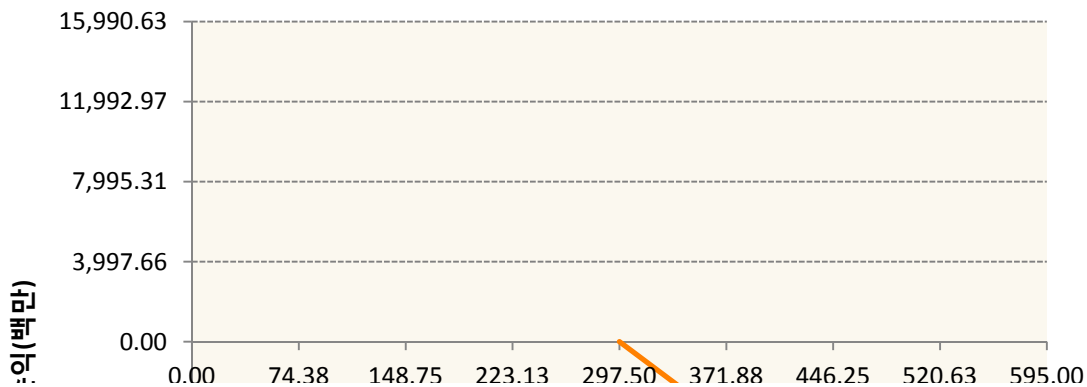
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,705	0	10,705	장내
누계	유가증권	옵션	1,277	21,241	-19,964	장내

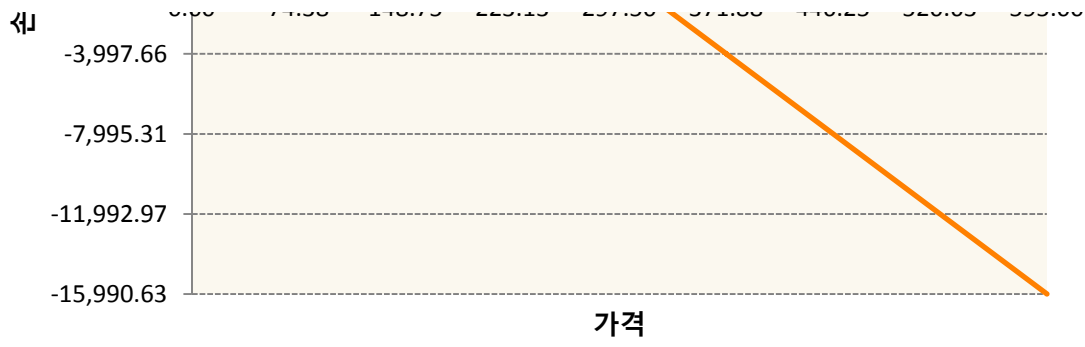
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

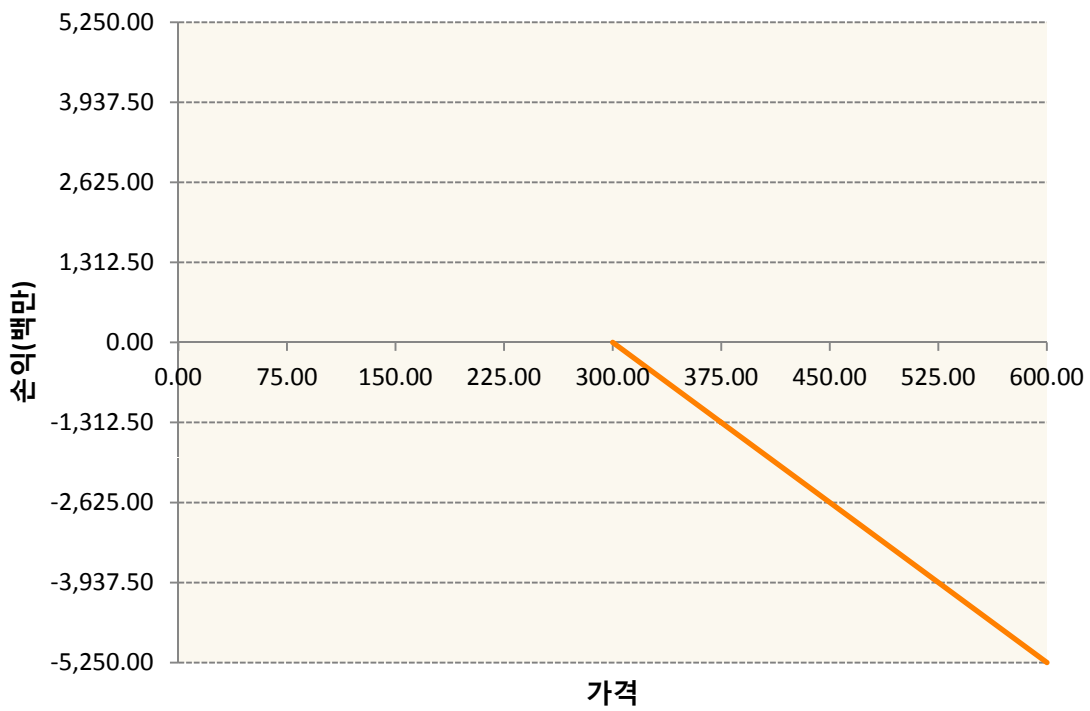


KR4201PC2973-2019-12 콜297.5

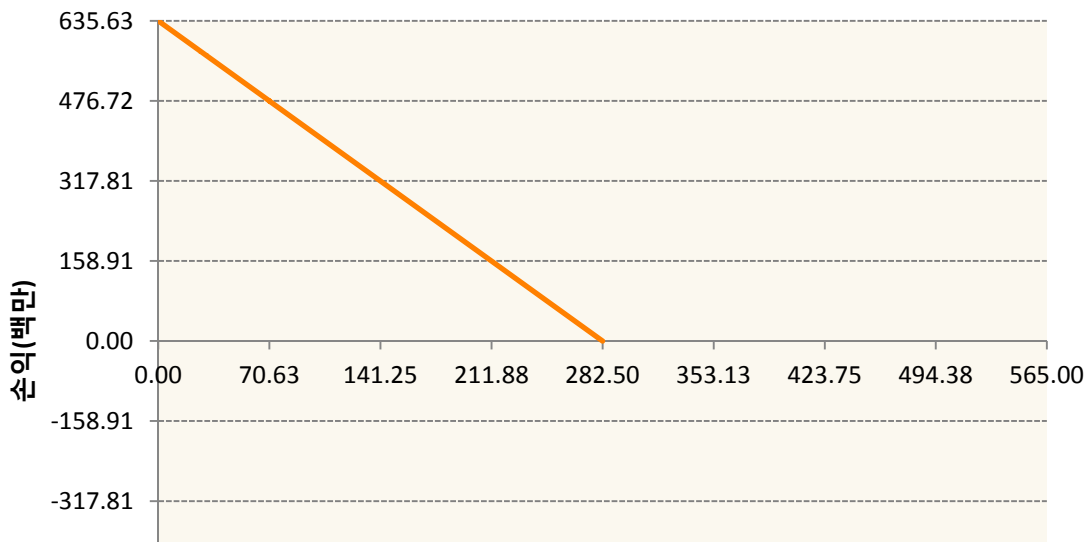


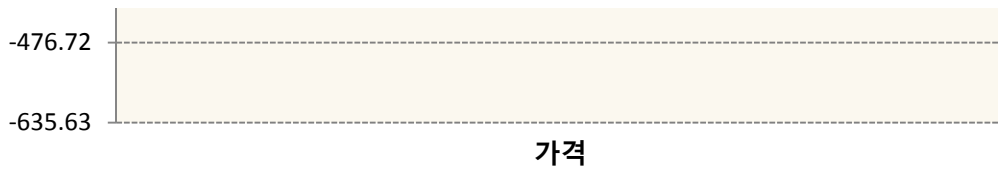


KR4201PC3005-2019-12 콜300

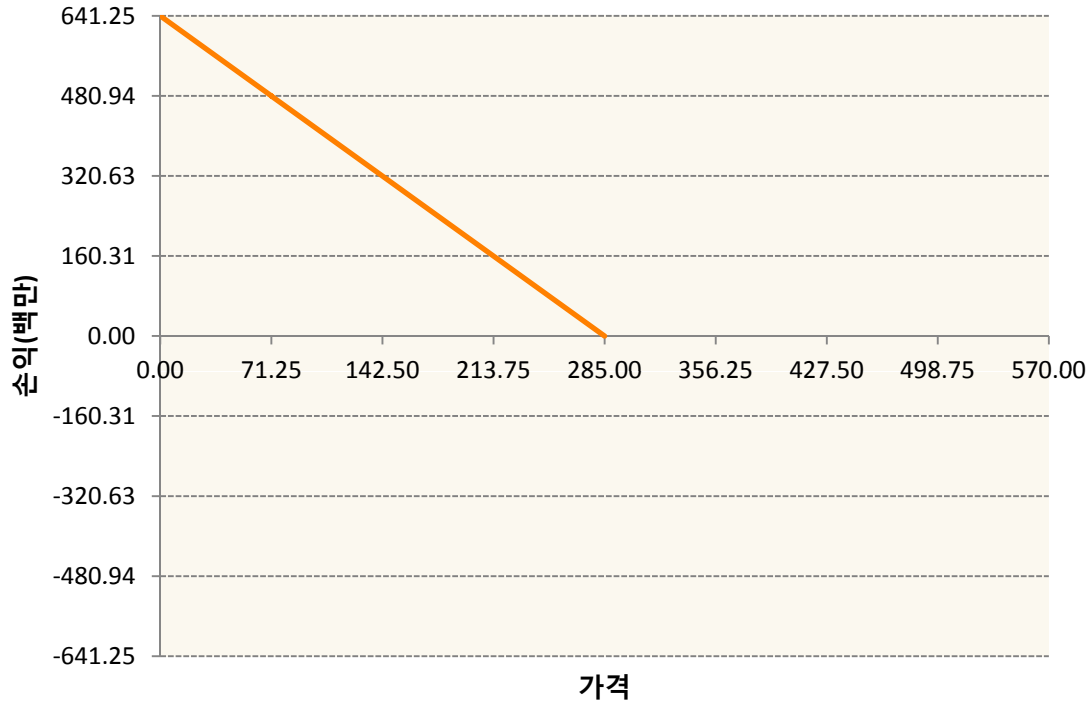


KR4301PC2824-2019-12 풋282.5





KR4301PC2857-2019-12 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						856
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-856	-856	-856	-856	-856	-856	-856	
-5.33%	-571	-571	-571	-571	-571	-571	-571	
-2.67%	-285	-285	-285	-285	-285	-285	-285	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	285	285	285	285	285	285	285	
5.33%	571	571	571	571	571	571	571	
8.00%	856	856	856	856	856	856	856	
KR4201PC2973		2019-12 콜297.5						361
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	13	13	13	13	13	13	13	
-5.33%	13	13	13	13	12	12	10	
-2.67%	13	13	12	11	9	6	2	

0%	11	8	5	0	-6	-14	-22
2.67%	-4	-13	-24	-36	-49	-63	-79
5.33%	-65	-84	-103	-124	-144	-165	-187
8.00%	-219	-243	-266	-290	-313	-337	-361
KR4201PC3005 2019-12 콜300							98
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3	3	3	3	3	3	3
-5.33%	3	3	3	3	3	2	2
-2.67%	3	3	2	2	2	1	0
0%	2	2	1	0	-1	-3	-6
2.67%	0	-2	-5	-8	-12	-16	-20
5.33%	-14	-19	-24	-30	-36	-43	-49
8.00%	-52	-60	-68	-75	-83	-90	-98
KR4301PC2824 2019-12 풋282.5							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%	32	32	32	32	32	32	32
-2.67%	15	15	15	16	16	16	16
0%	-1	0	0	0	0	1	1
2.67%	-12	-12	-11	-11	-10	-10	-9
5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-14	-14
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%	33	33	33	33	33	33	33
-2.67%	16	16	16	16	16	16	16
0%	0	0	0	0	0	0	1
2.67%	-14	-14	-13	-13	-12	-12	-12
5.33%	-20	-20	-19	-19	-19	-18	-18
8.00%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20

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

(단위:백만원)

990

공시일	2019-12-04
기준일	2019-12-03

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	208,357	0	208,357	

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	2019-12-04
기준일	2019-12-03

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	217,466	0	217,466	

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	2019-12-04
기준일	2019-12-03

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	552,225	0	552,225	
누계	통화	선도	0	542,669	-542,669	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		665
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		703
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,710
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,844
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,425
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,529
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		950
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		950
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		950
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		950
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		475
FX21019X00 KRW/USD 06-12-19E		665
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		475
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		475
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		475
FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E		1,558
FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E		950
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		475
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		950
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		1,558
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		1,900
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		3,267
FX21019X02 KRW/USD 26-12-19E		4,787
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		4,844
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		190
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,849

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

(단위:백만원)

13,653

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

(단위:백만원)

179

공시일	2019-12-04
기준일	2019-12-03

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

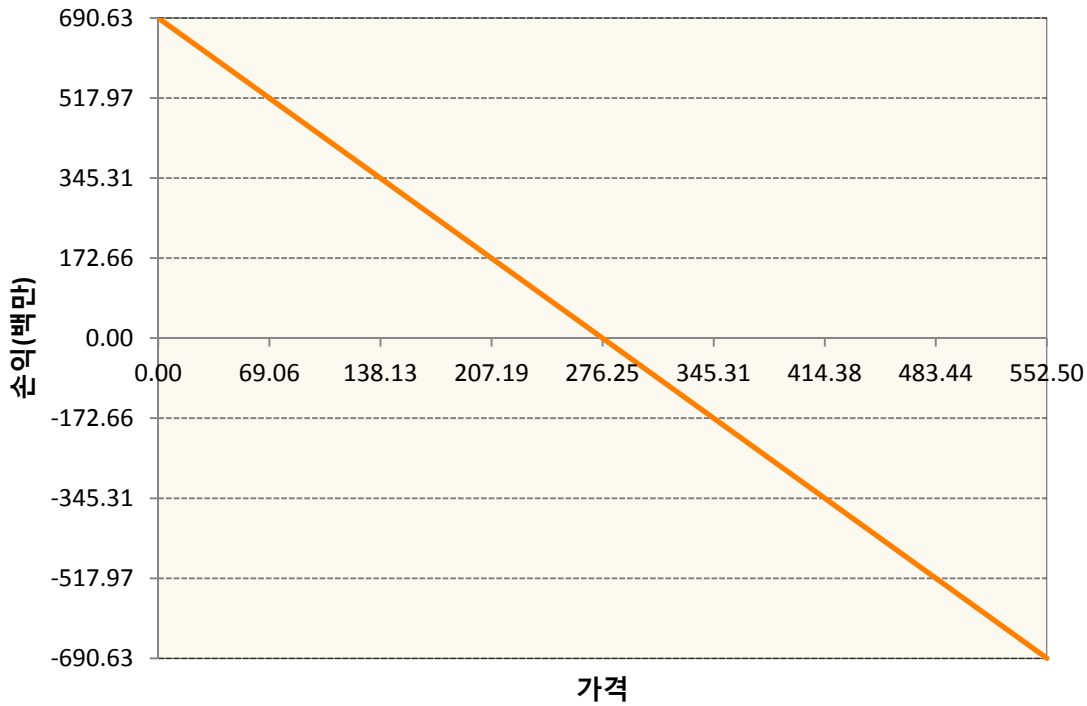
1. 계약금액

(단위:백만원)

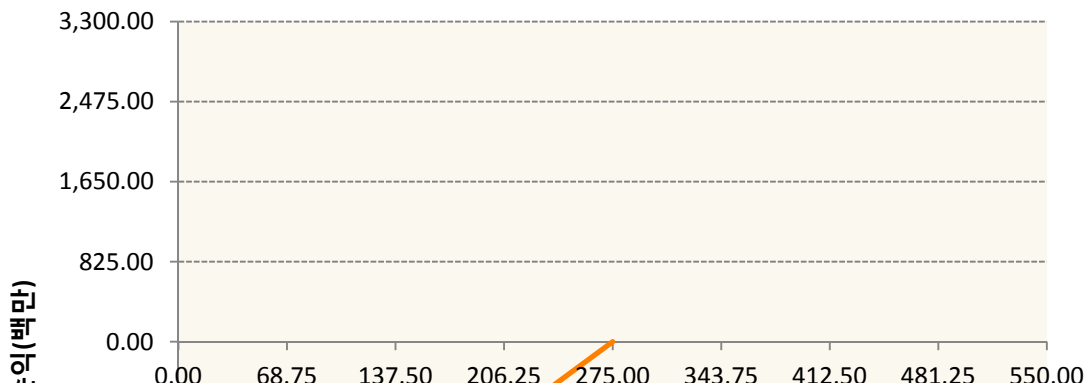
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	691	-691	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,994	-3,994	장내

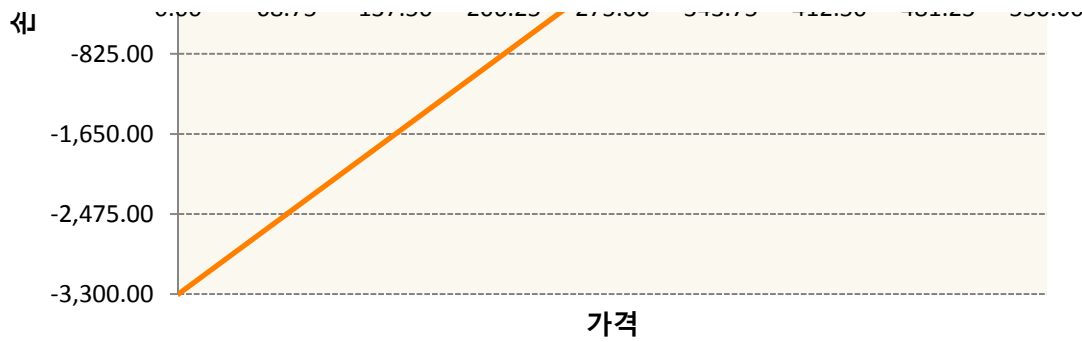
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

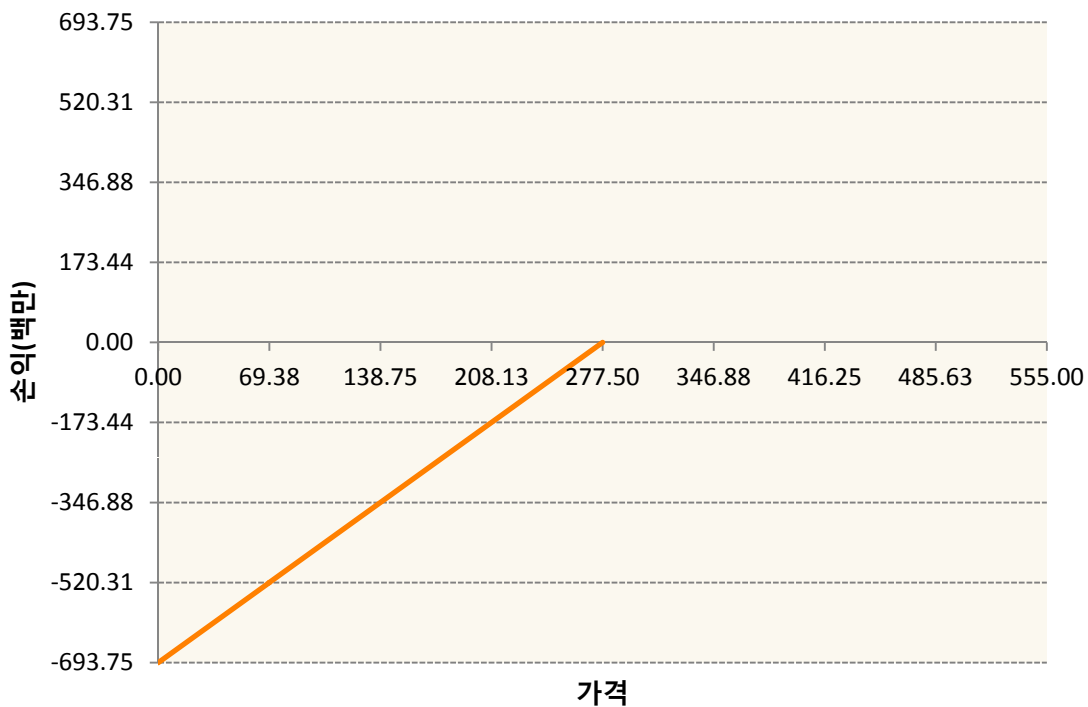


KR4301PC2758-2019-12 풋275





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						228
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-228	-228	-228	-228	-228	-228	-228
-5.33%	-140	-140	-140	-140	-141	-141	-141
-2.67%	-54	-55	-56	-57	-59	-61	-62
0%	7	5	2	0	-2	-5	-7
2.67%	22	22	21	20	19	18	17
5.33%	23	23	23	23	23	23	22
8.00%	23	23	23	23	23	23	23
KR4301PC2774 2019-12 풋277.5							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%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
-2.67%	-14	-14	-14	-14	-15	-15	-15
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	7	7	7	7	6	6	6
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)

390

공시일	2019-12-04
기준일	2019-12-03

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	15,281	0	15,281	
누계	통화	선도	0	14,982	-14,982	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019V01 KRW/USD 10-12-19E		376
FX21019X01 KRW/USD 13-01-20E		233
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		294
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		295

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

(단위:백만원)

377

공시일	2019-12-04
기준일	2019-12-03

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	1,010	0	1,010	장외
누계	통화	선도	276	355	-79	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)	19
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
FX21019Z00 KRW/EUR 28-02-20E	6

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

(단위:백만원)

79

공시일	2019-12-04
기준일	2019-12-03

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

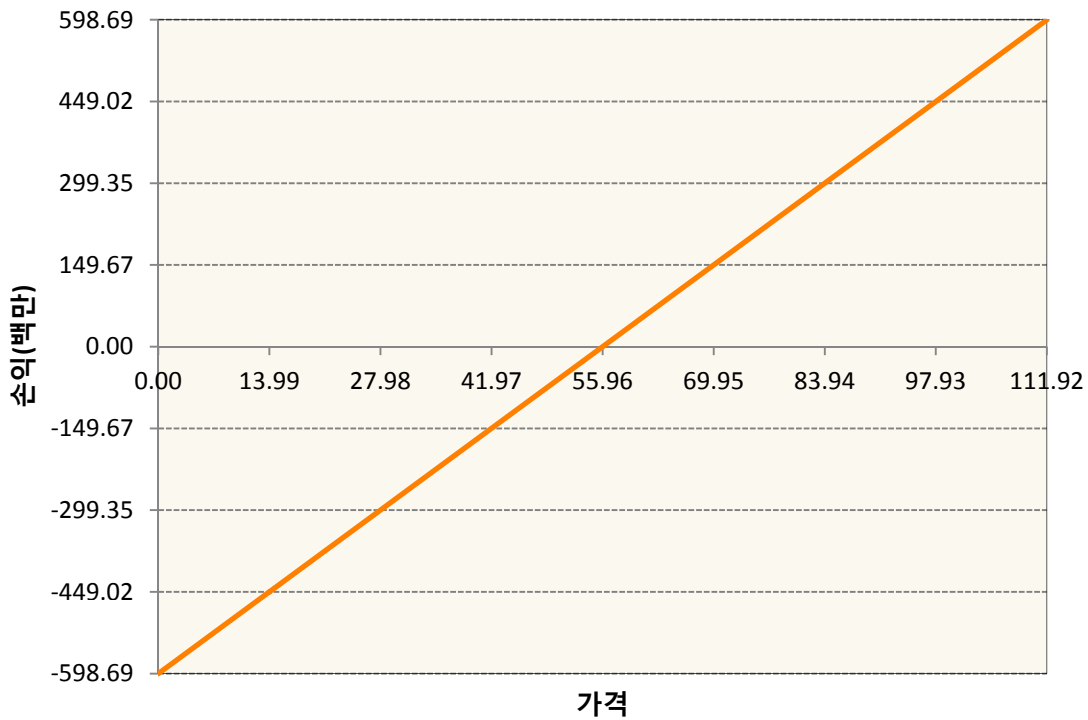
1. 계약금액

(단위:백만원)

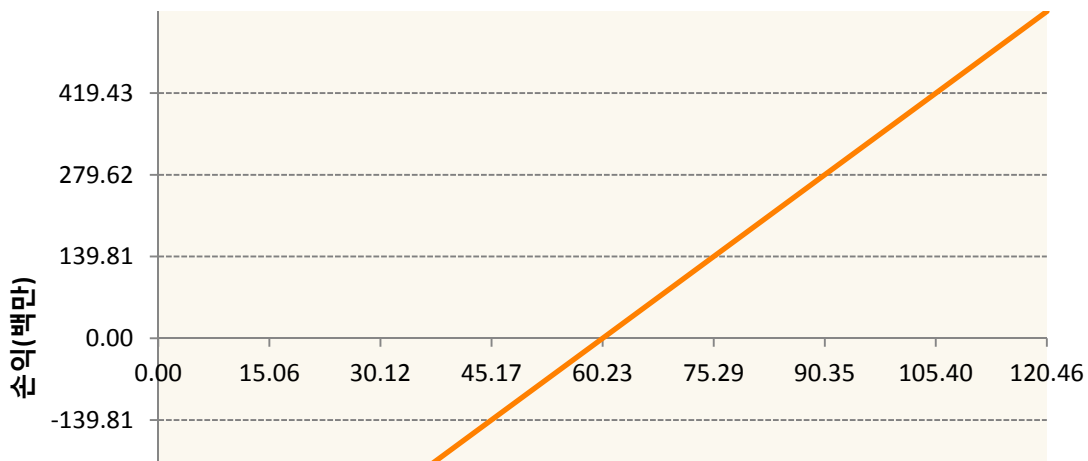
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,368	297	2,072	

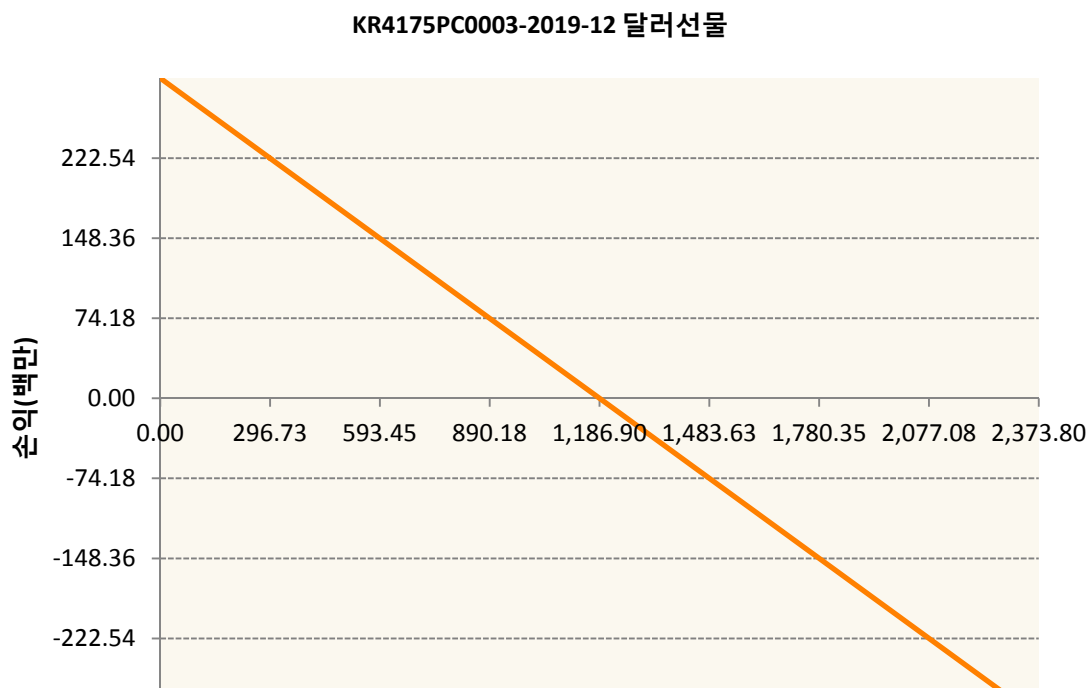
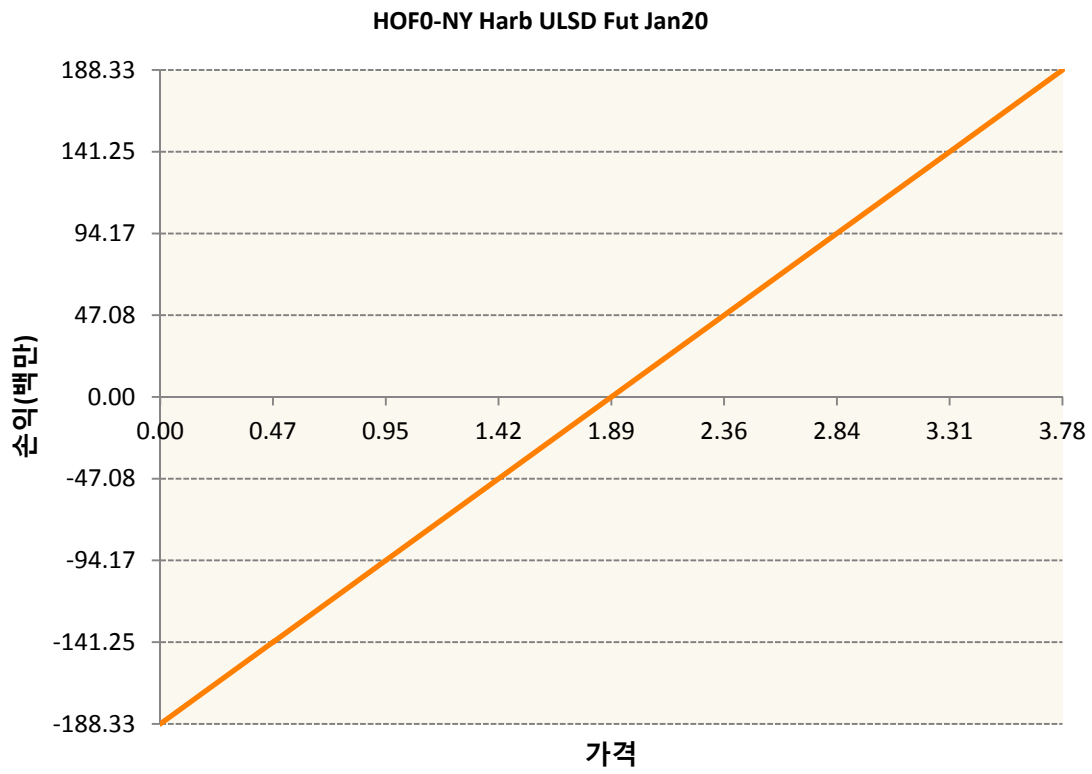
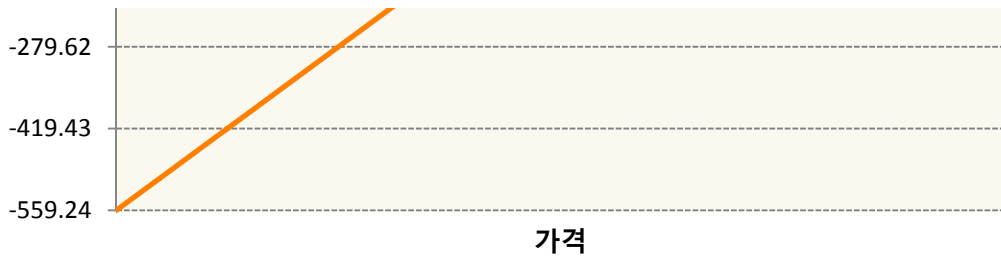
2. 만기시점의 손익구조

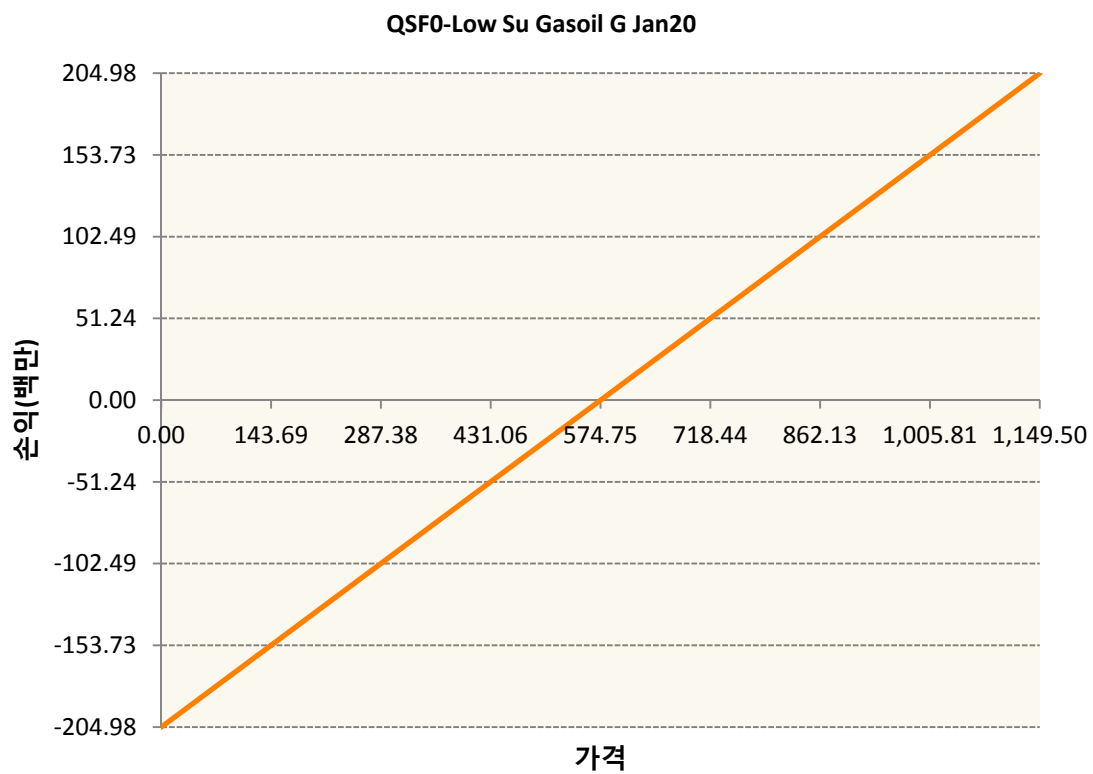
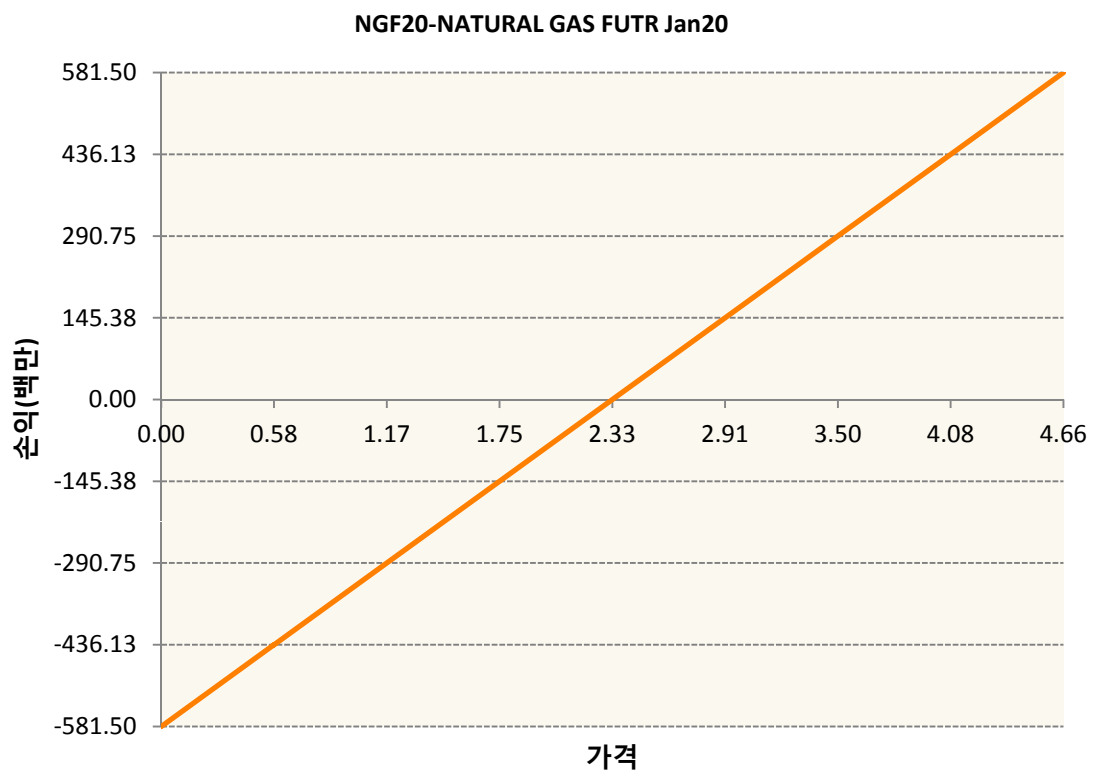
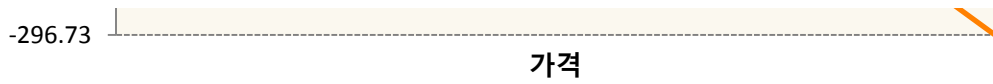
CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20



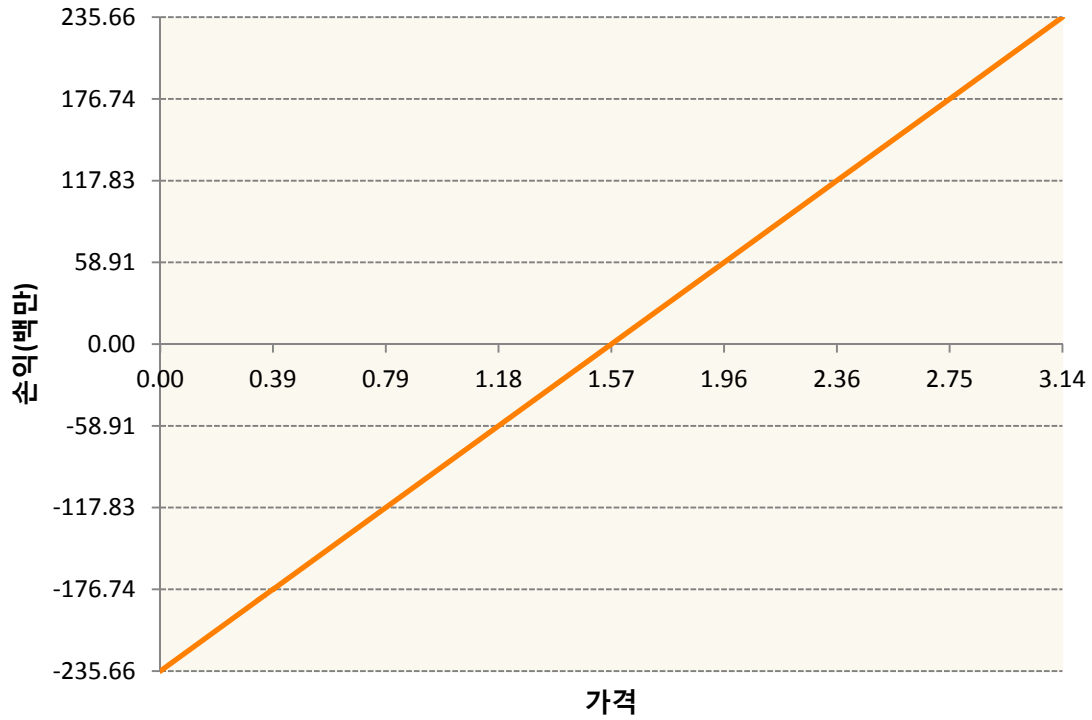
COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20







XBF0-GASOLINE RBOB FUT Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLF0	WTI CRUDE FUTURE Jan20	48
COH0	BRENT CRUDE FUTR Mar20	45
HOF0	NY Harb ULSD Fut Jan20	15
KR4175PC00	2019-12 달러선물	24
NGF20	NATURAL GAS FUTR Jan20	47
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	16
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	19

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

(단위:백만원)

388

공시일	2019-12-04
기준일	2019-12-03

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

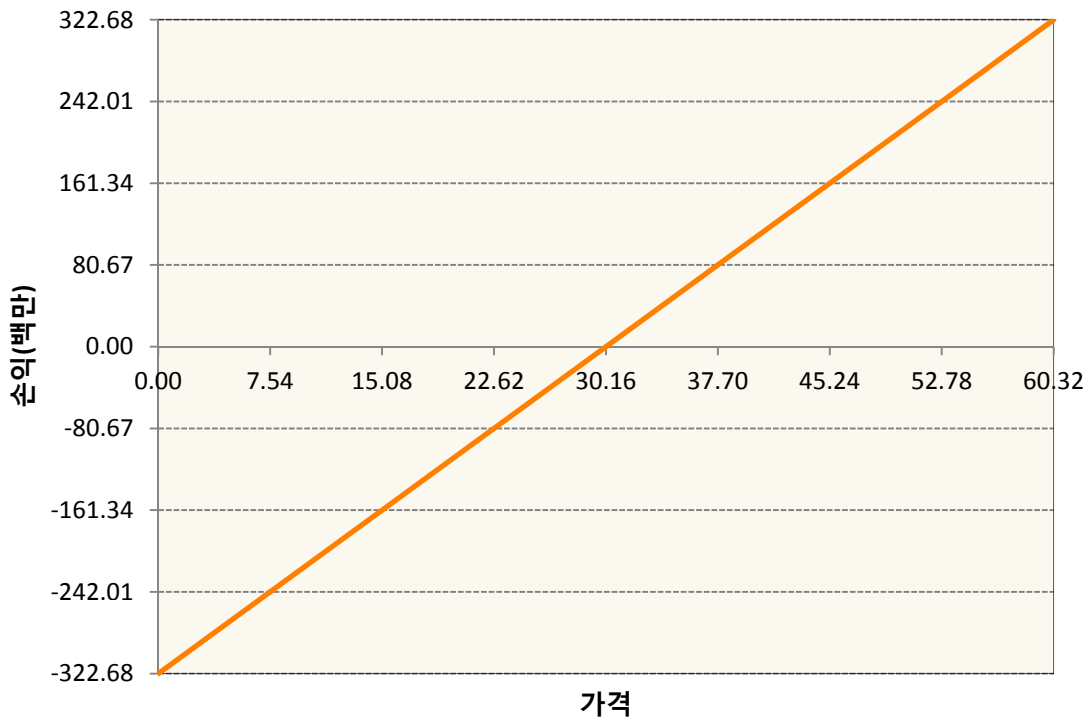
1. 계약금액

(단위:백만원)

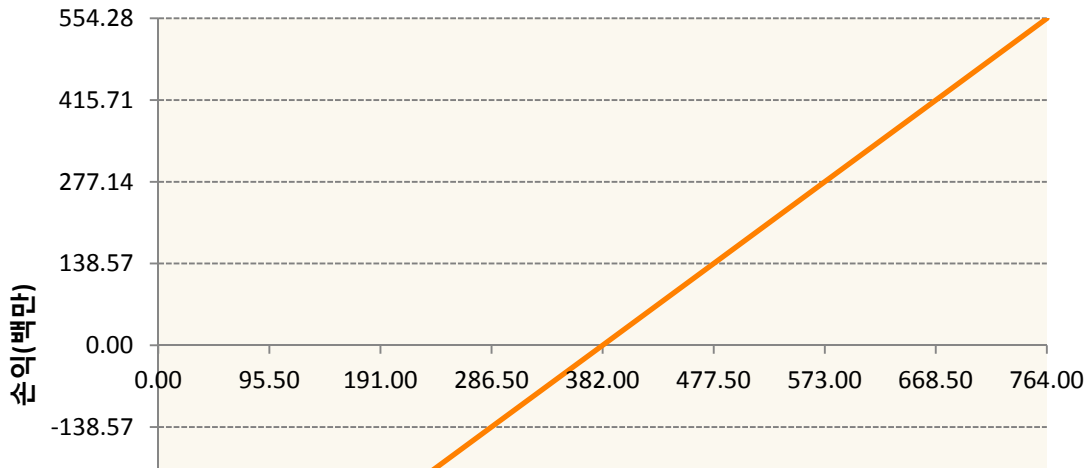
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,772	95	2,677	

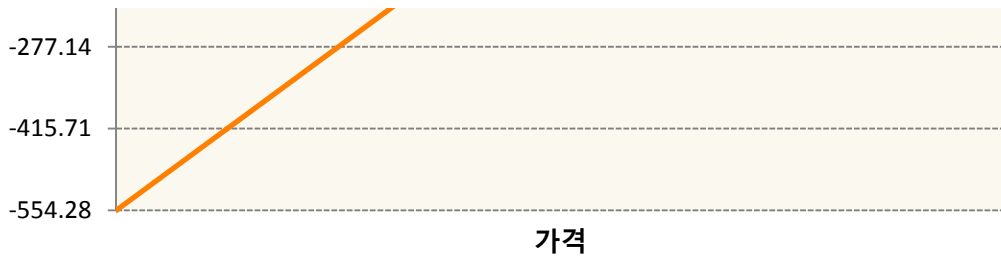
2. 만기시점의 손익구조

BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20

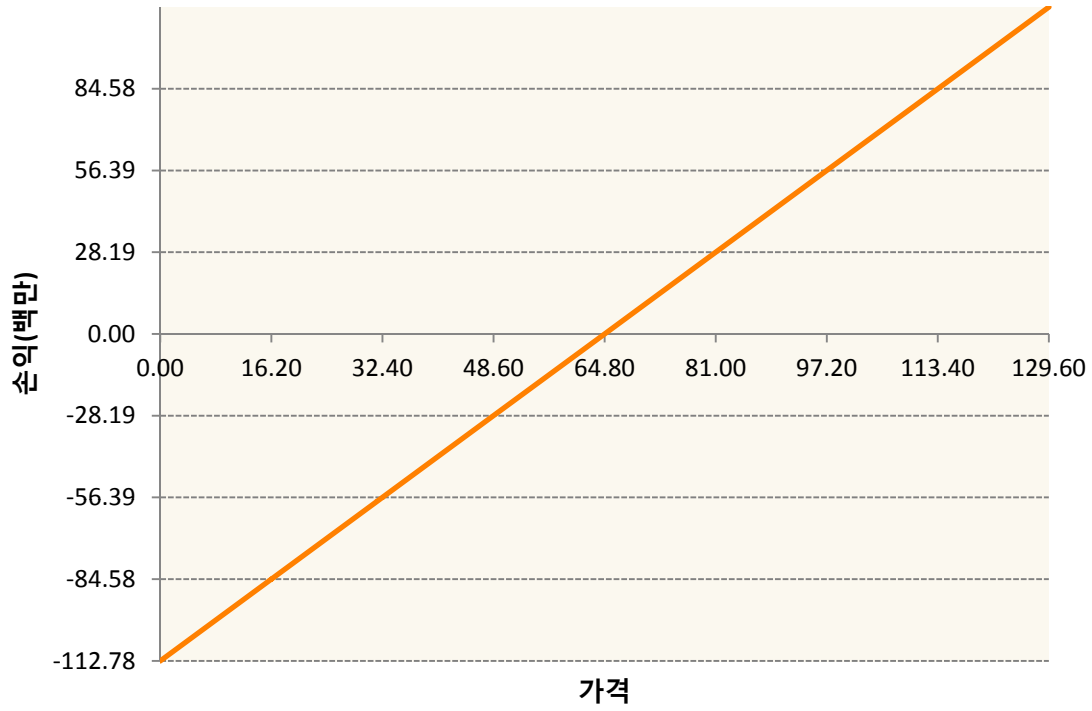


CH0-CORN FUTURE Mar20

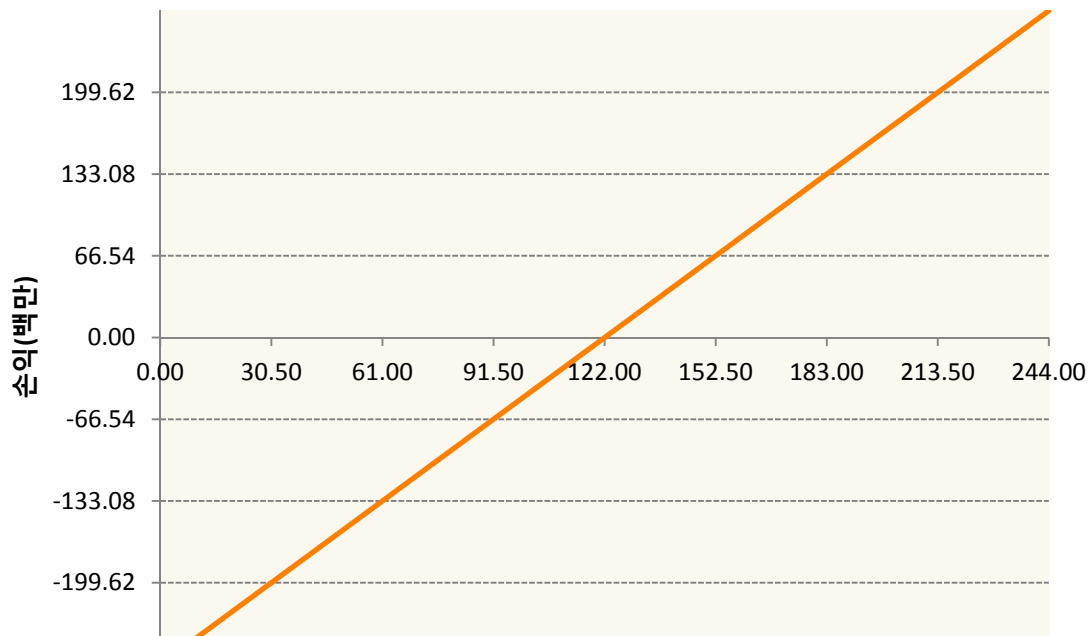


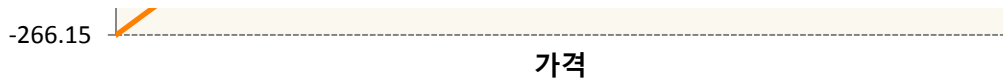


CTH0-COTTON NO.2 FUTR Mar20

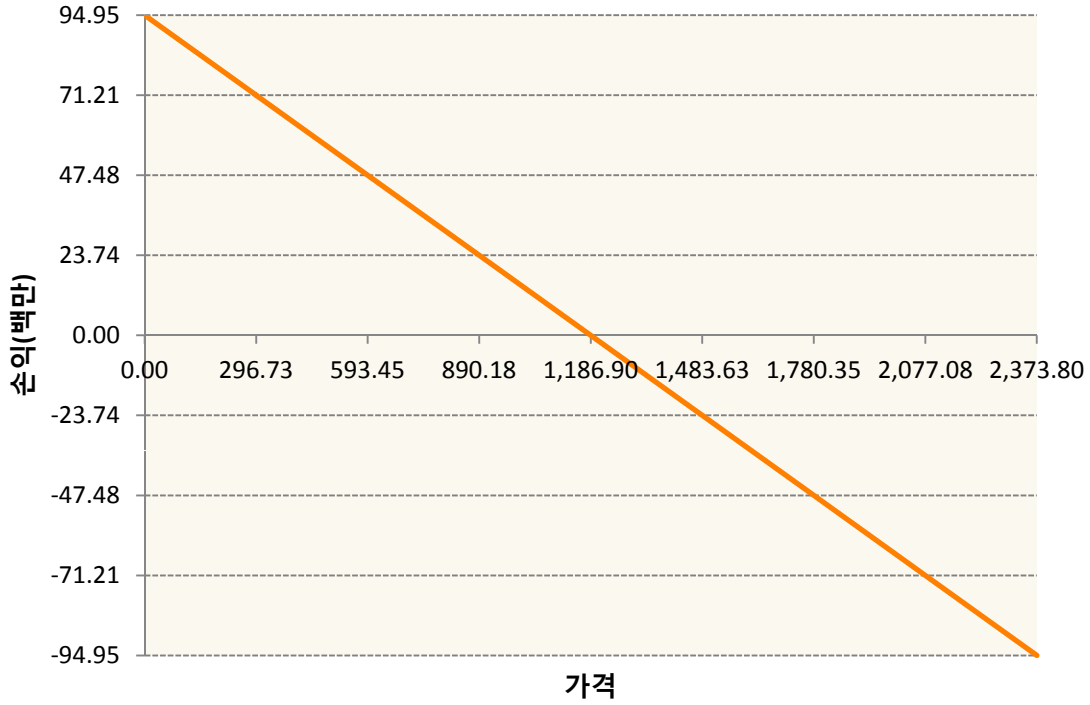


KCH0-COFFEE 'C' FUTURE Mar20

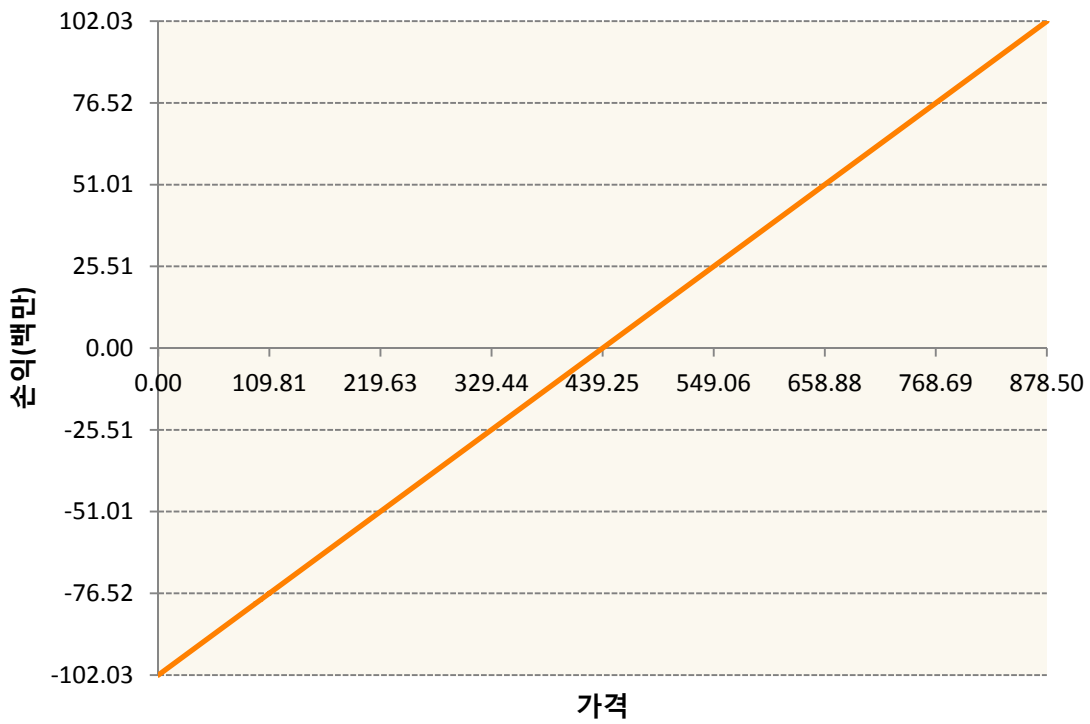




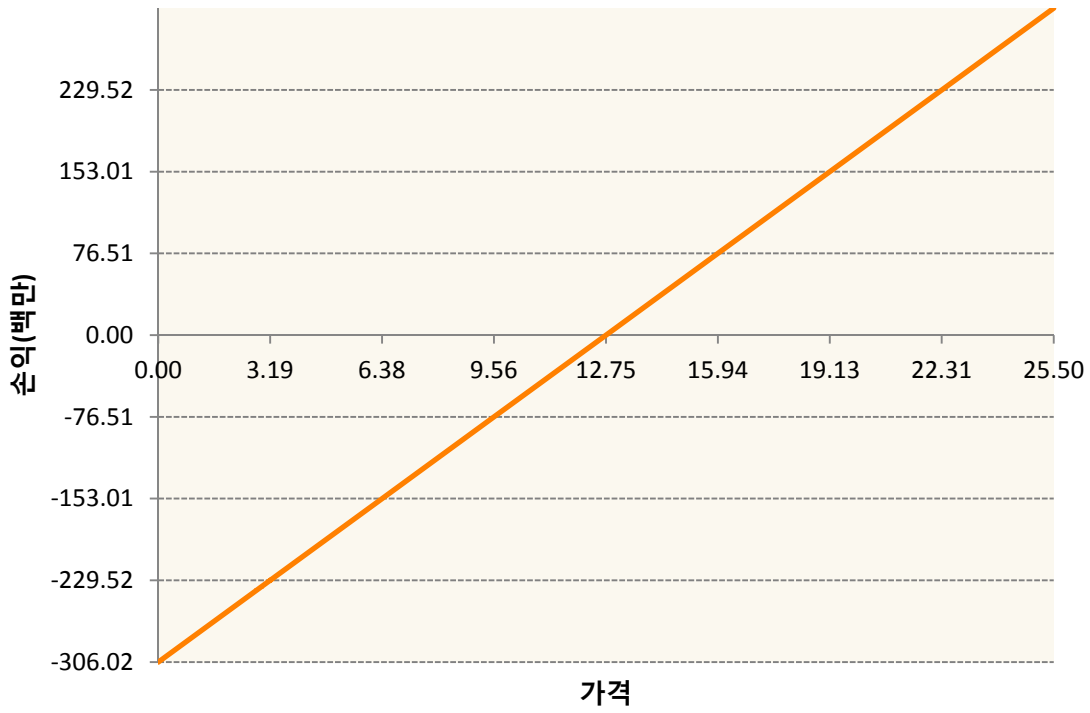
KR4175PC0003-2019-12 달러선물



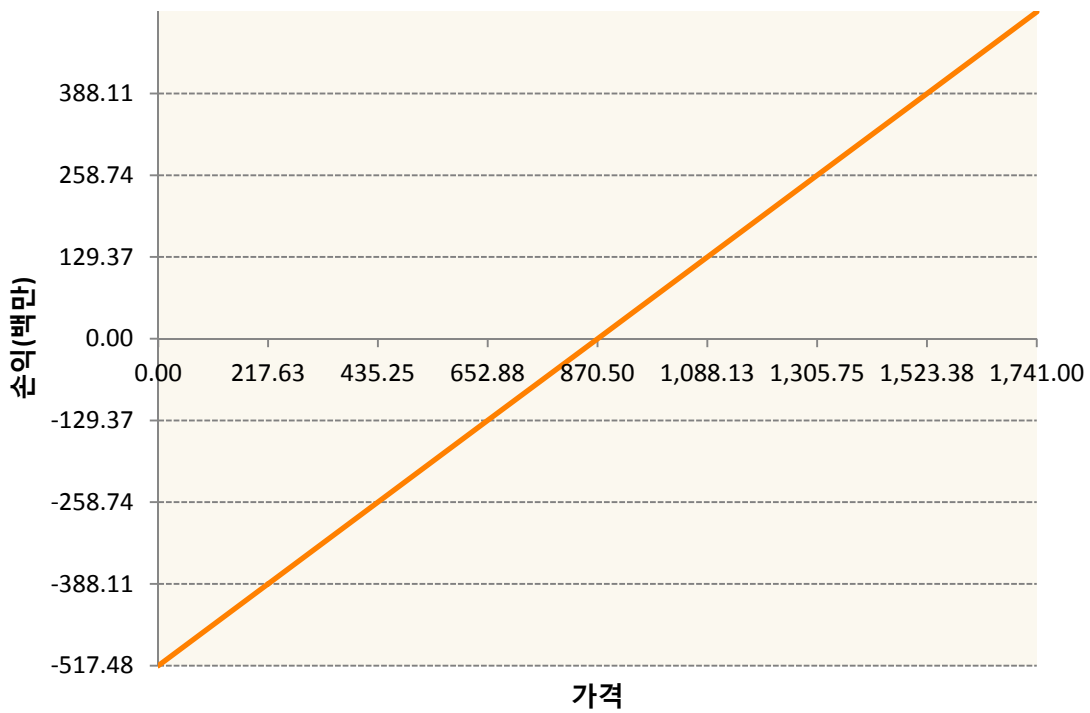
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

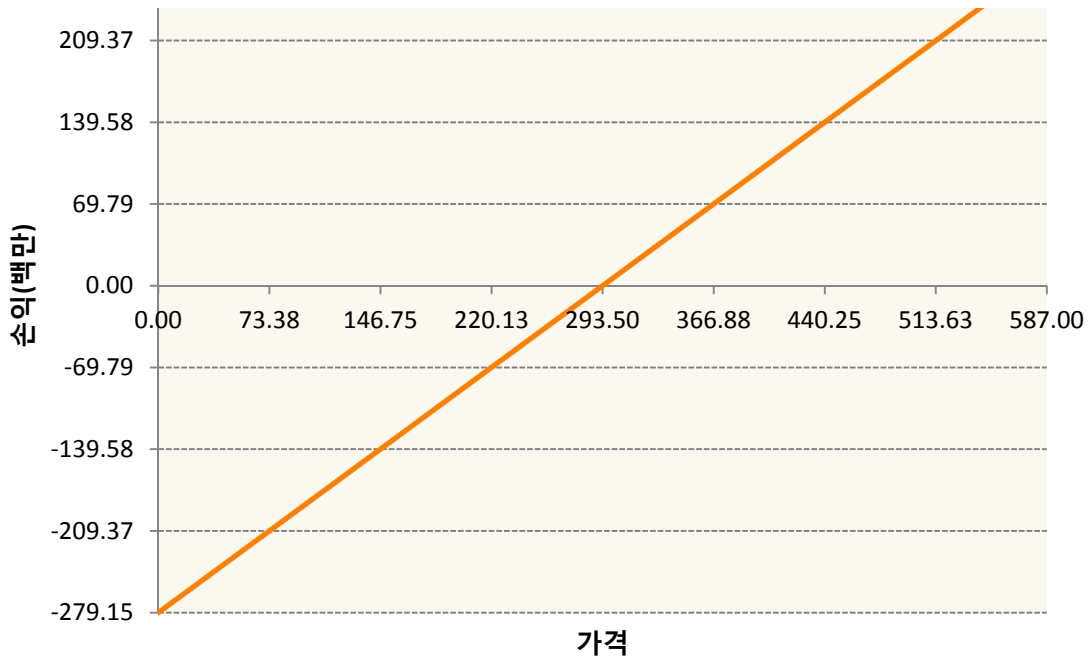


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20

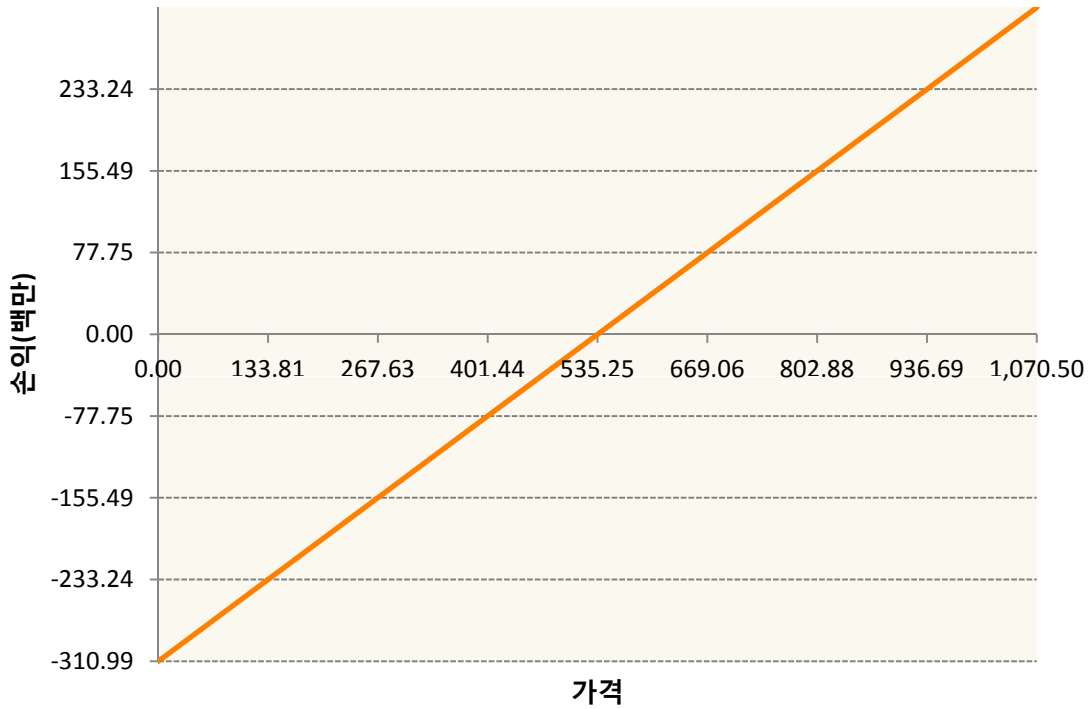


SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





WHO-WHEAT FUTURE(CBT) Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

KWH0	KC HRW WHEAT FUT Mar20	8
SBH0	Sugar Mar20	24
SF0	SOYBEAN FUTURE Jan20	41
SMF0	SOYBEAN MEAL FUTR Jan20	22
WH0	WHEAT FUTURE(CBT) Mar20	25

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

(단위:백만원)

246