

공시일	2019-12-05
기준일	2019-12-04

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	2019-12-05
기준일	2019-12-04

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

1,083

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

623

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-05
기준일	2019-12-04

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)

732

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-05
기준일	2019-12-04

유로인덱스모(주식-파생형)

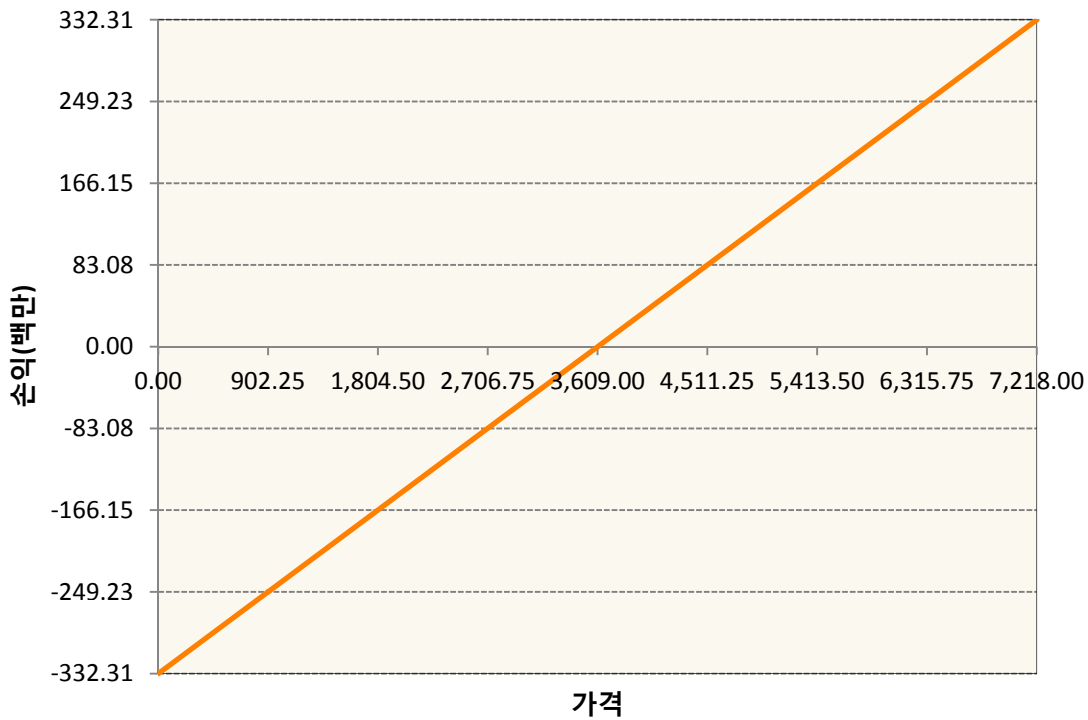
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	332	0	332	

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	2019-12-05
기준일	2019-12-04

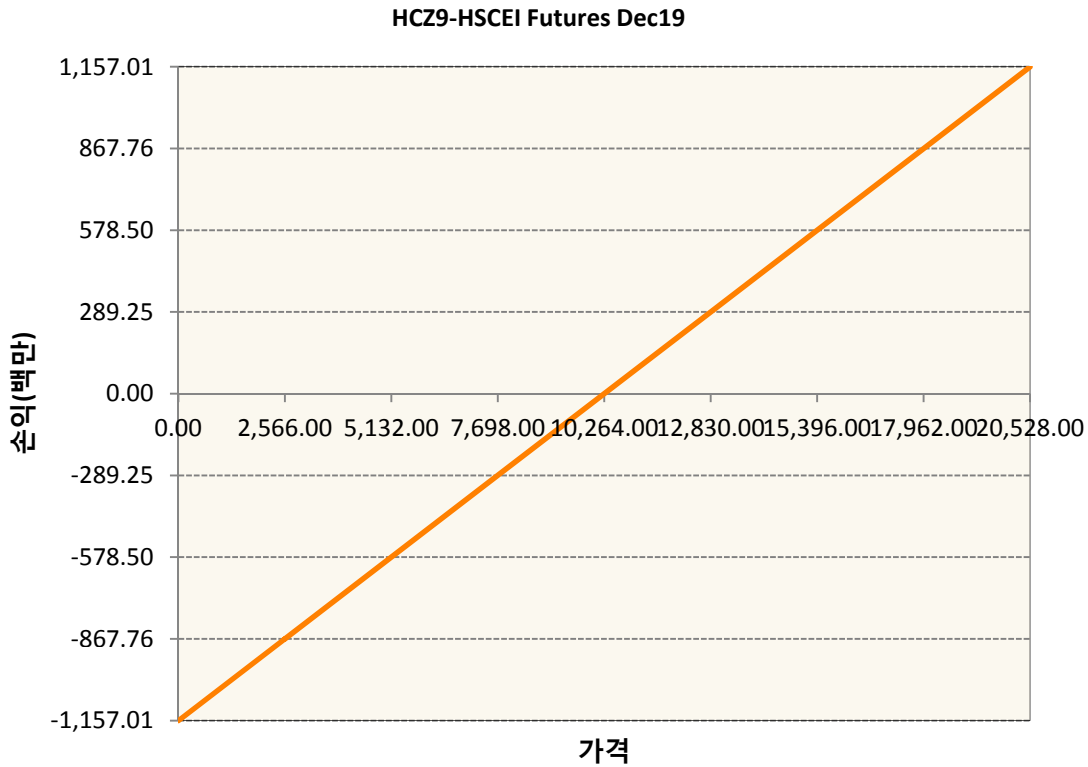
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,157	0	1,157	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

83

공시일	2019-12-05
기준일	2019-12-04

커버드콜모(주식혼합-파생형)

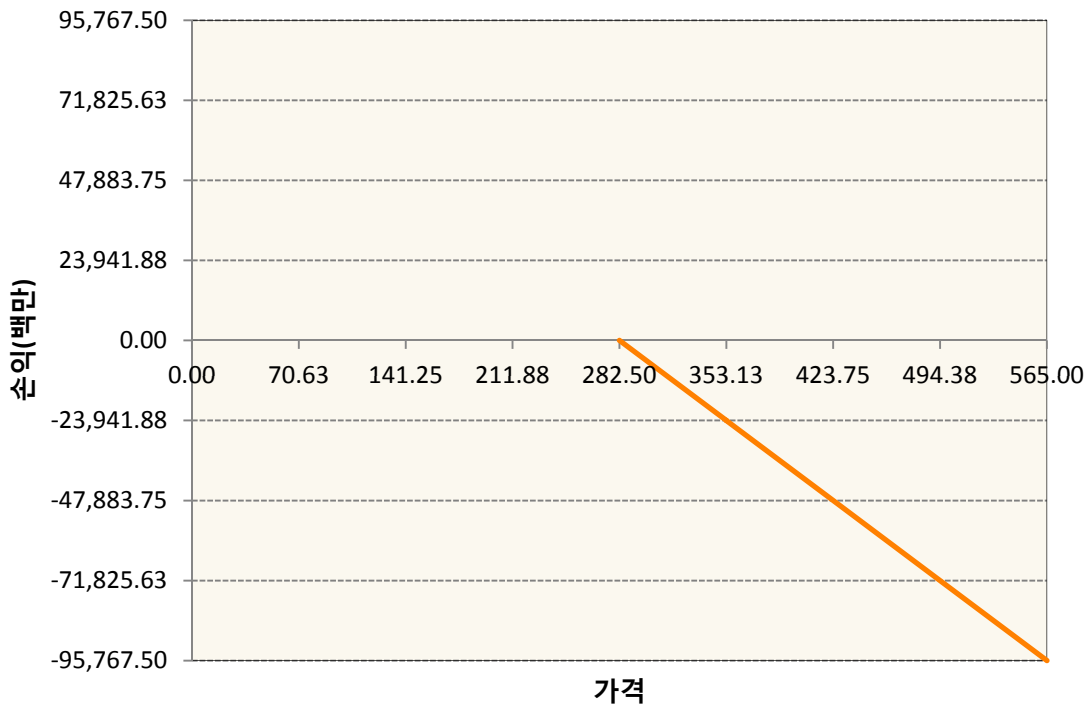
1. 계약금액

(단위:백만원)

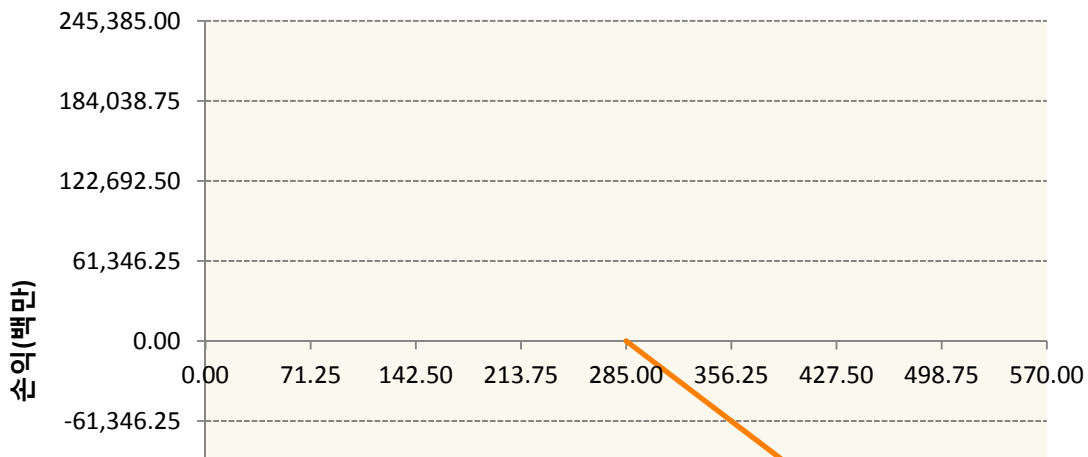
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	498,456	-498,456	장내

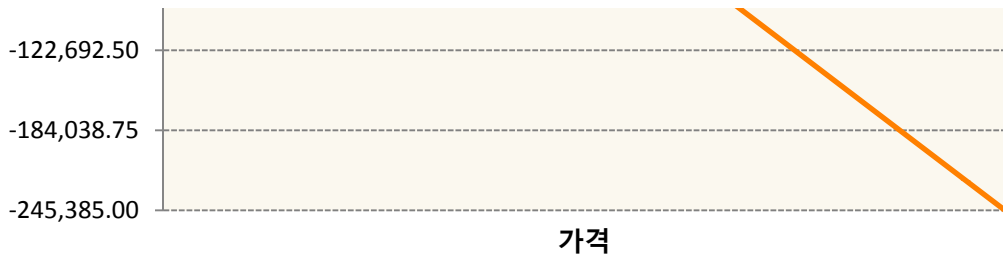
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PC2825-2019-12 콜282.5

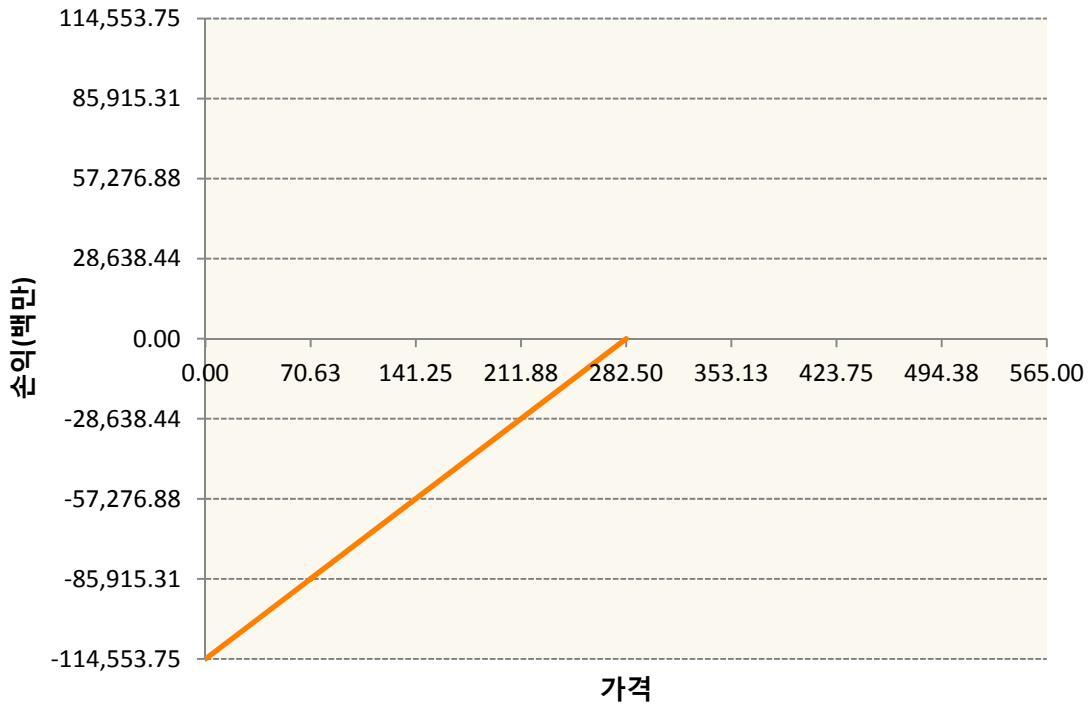


KR4201PC2858-2019-12 콜285

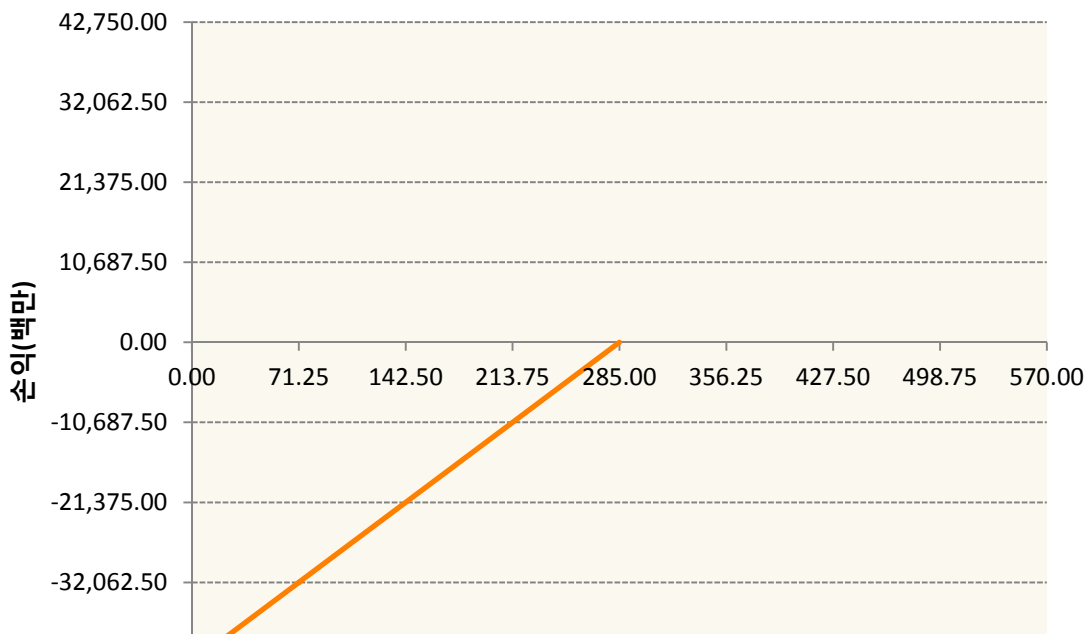




KR4301PC2824-2019-12 풋282.5



KR4301PC2857-2019-12 풋285



-42,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PC2825		2019-12 콜282.5						4,559
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	549	549	548	545	541	534	523	
-5.33%	546	541	532	518	499	473	442	
-2.67%	509	479	441	393	338	275	206	
0%	281	194	100	0	-104	-211	-322	
2.67%	-476	-609	-741	-874	-1,008	-1,141	-1,274	
5.33%	-1,999	-2,108	-2,222	-2,339	-2,458	-2,580	-2,704	
8.00%	-4,125	-4,176	-4,238	-4,308	-4,385	-4,469	-4,559	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						10,328
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	966	965	964	961	954	943	925	
-5.33%	963	957	944	922	889	843	783	
-2.67%	917	870	804	717	610	485	342	
0%	571	402	210	0	-226	-466	-716	
2.67%	-798	-1,115	-1,437	-1,761	-2,088	-2,417	-2,747	
5.33%	-3,994	-4,315	-4,639	-4,967	-5,298	-5,631	-5,965	
8.00%	-8,956	-9,139	-9,344	-9,569	-9,809	-10,063	-10,328	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						8,806
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-8,806	-8,806	-8,806	-8,806	-8,806	-8,806	-8,806	
-5.33%	-5,843	-5,843	-5,843	-5,843	-5,843	-5,843	-5,843	
-2.67%	-2,880	-2,880	-2,881	-2,882	-2,885	-2,890	-2,896	
0%	63	47	26	0	-31	-67	-107	
2.67%	2,522	2,444	2,365	2,286	2,207	2,127	2,047	
5.33%	3,421	3,385	3,344	3,298	3,248	3,194	3,137	
8.00%	3,492	3,491	3,487	3,481	3,472	3,460	3,445	
KR4301PC2857		2019-12 풋285						3,277
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,277	-3,277	-3,277	-3,277	-3,277	-3,277	-3,277	
-5.33%	-2,181	-2,181	-2,181	-2,181	-2,181	-2,181	-2,181	
-2.67%	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085	-1,086	-1,087	
0%	10	8	5	0	-6	-14	-23	
2.67%	1,026	1,004	980	955	930	904	878	

5.33%	1,567	1,545	1,521	1,496	1,471	1,444	1,418
8.00%	1,646	1,643	1,640	1,634	1,627	1,619	1,608

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

(단위:백만원)

26,574

공시일	2019-12-05
기준일	2019-12-04

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

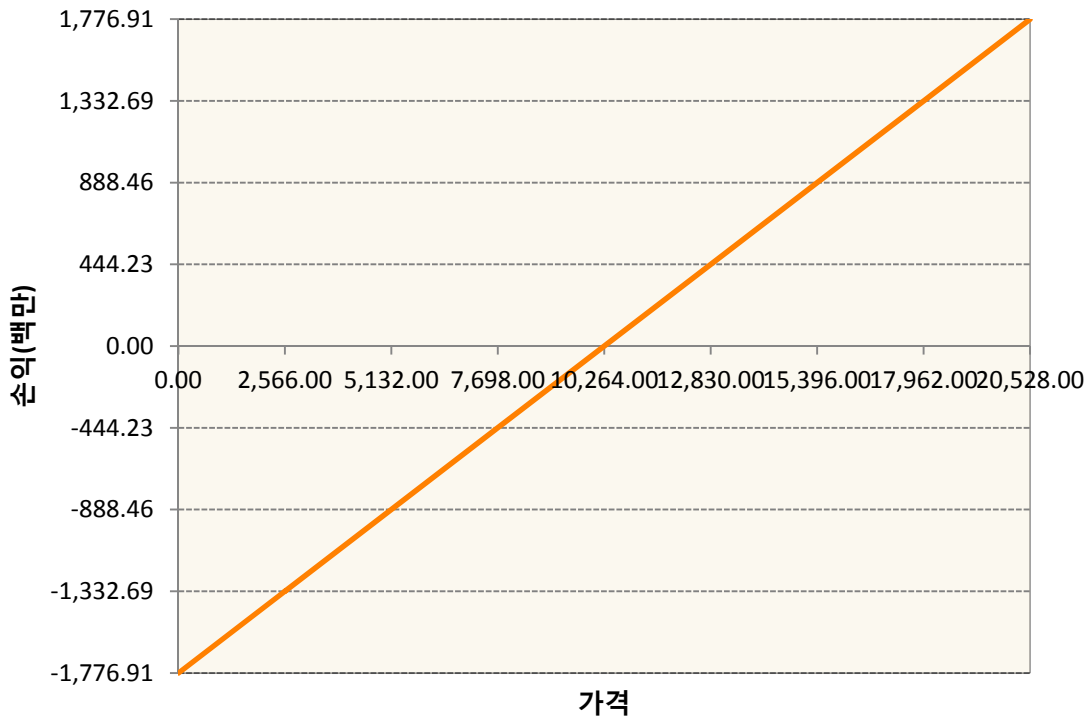
1. 계약금액

(단위:백만원)

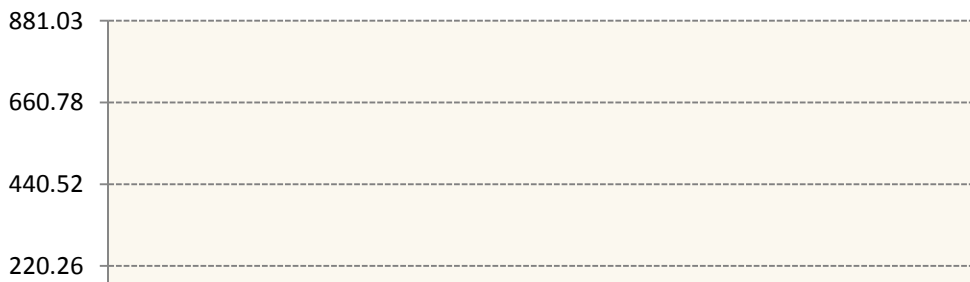
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,777	0	1,777	
누계	유가증권	옵션	0	4,996	-4,996	장내
누계	통화	선도	0	2,148	-2,148	장외

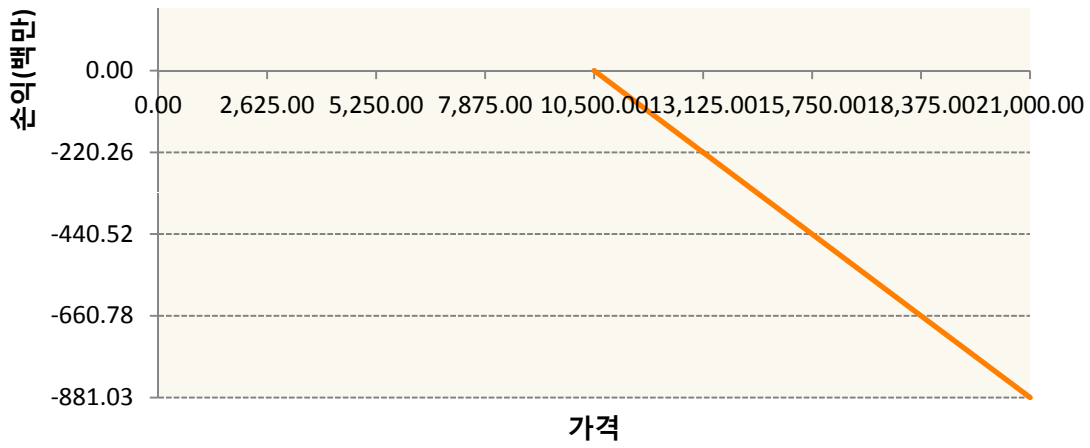
2. 만기시점의 손익구조

HCZ9-HSCEI Futures Dec19

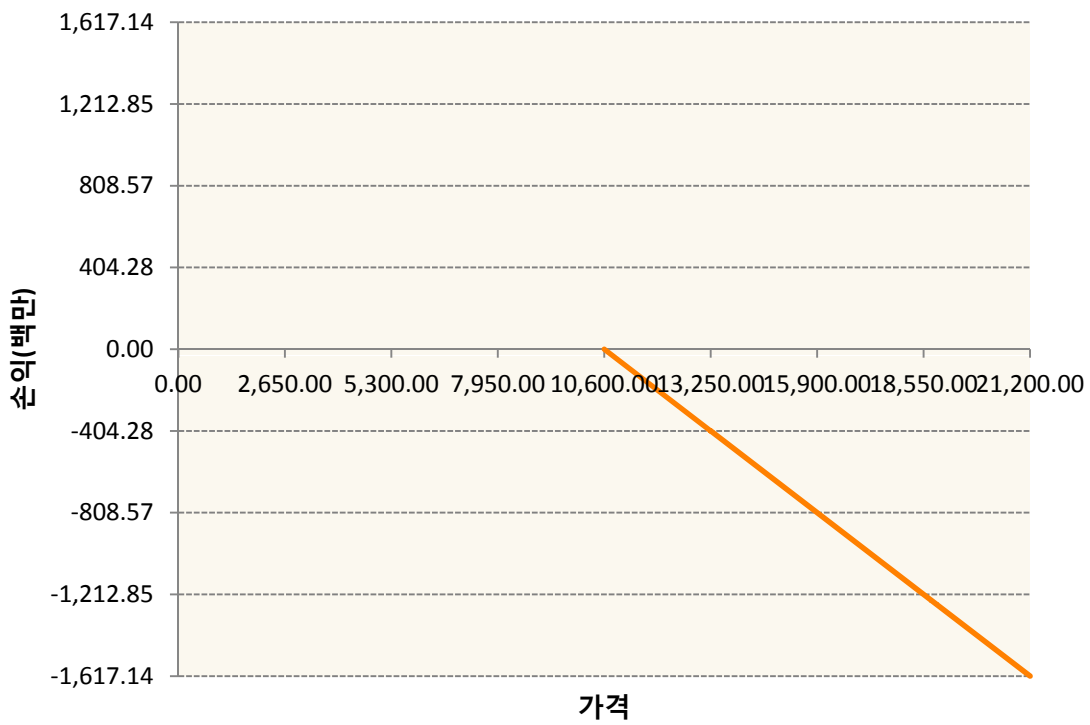


OHHIZ9-C105-HSCEI

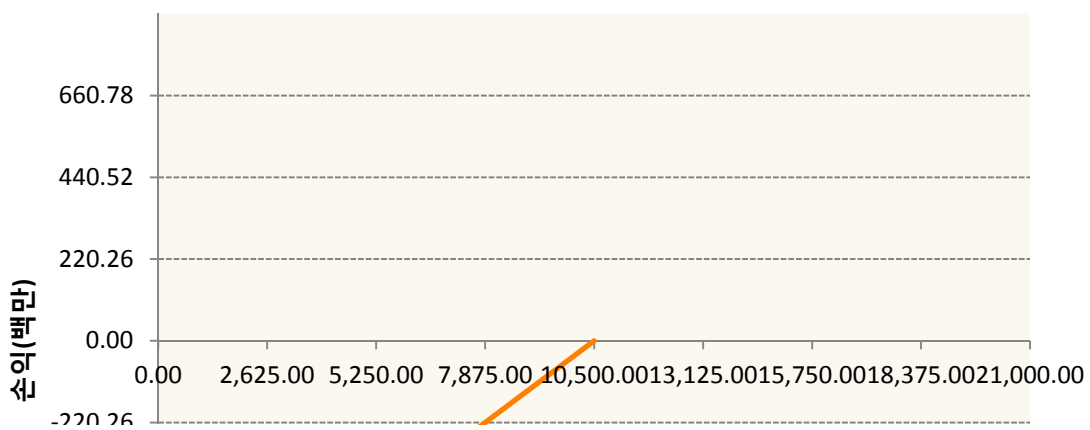


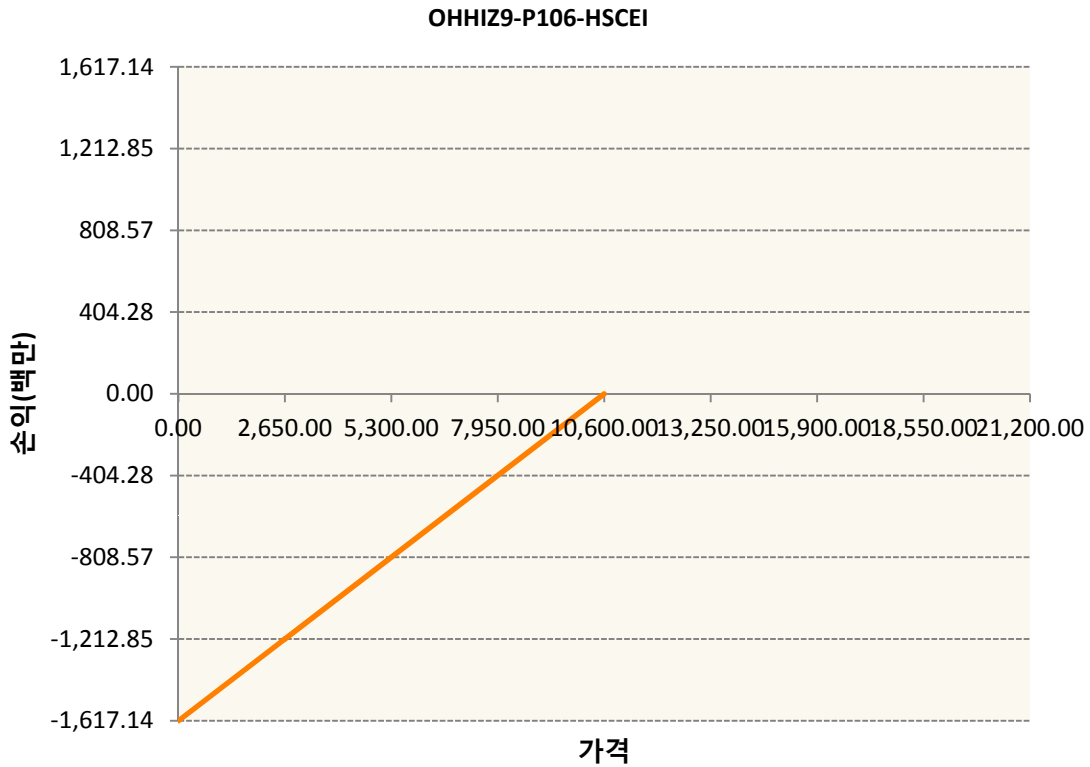


OHHIZ9-C106-HSCEI



OHHIZ9-P105-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	172
HCZ9 HSCEI Futures Dec19	142
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	2019-12-05
기준일	2019-12-04

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

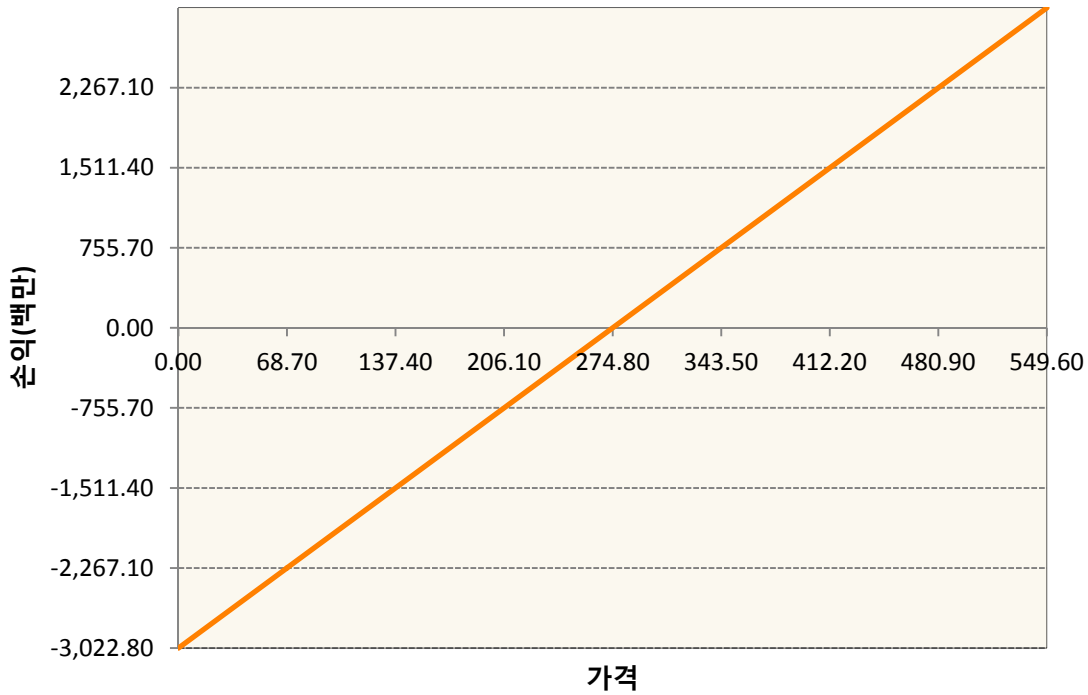
1. 계약금액

(단위:백만원)

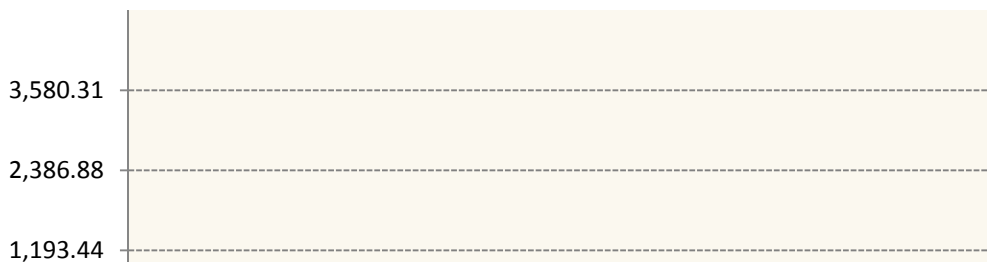
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	142	0	142	장내
누계	유가증권	선물	3,023	0	3,023	장내
누계	유가증권	스왑	9,625	0	9,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,514	-9,514	장내

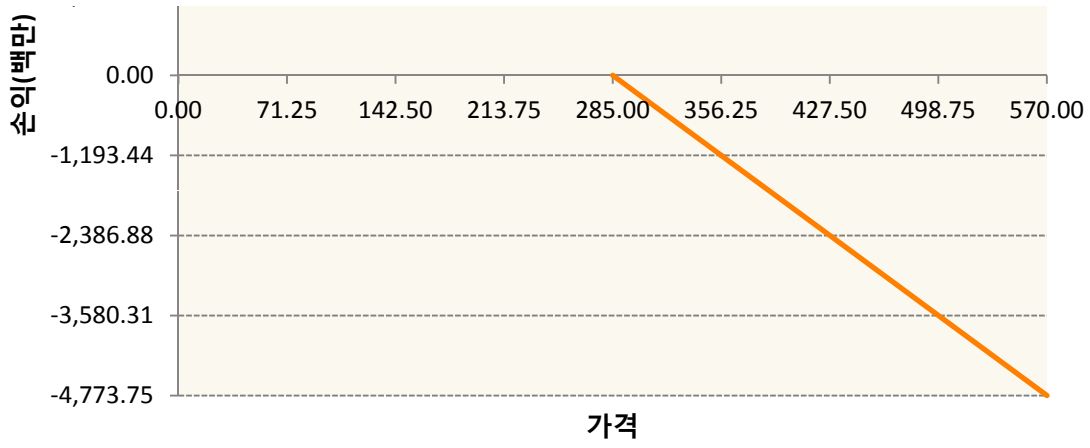
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

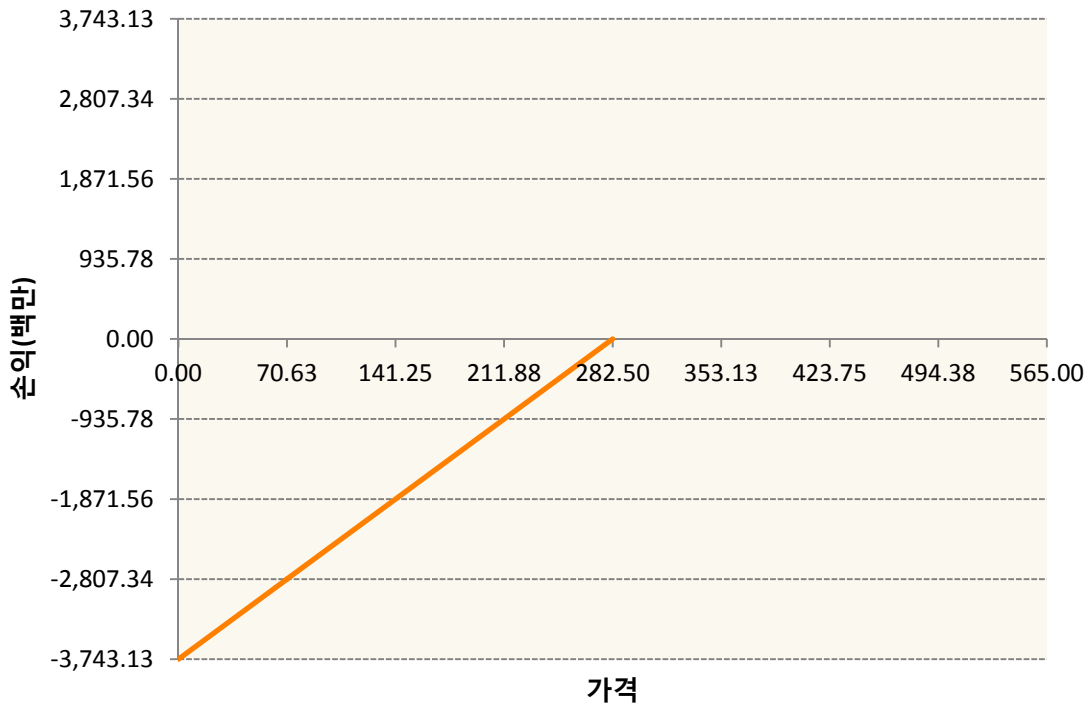


KR4201PC2858-2019-12 콜285

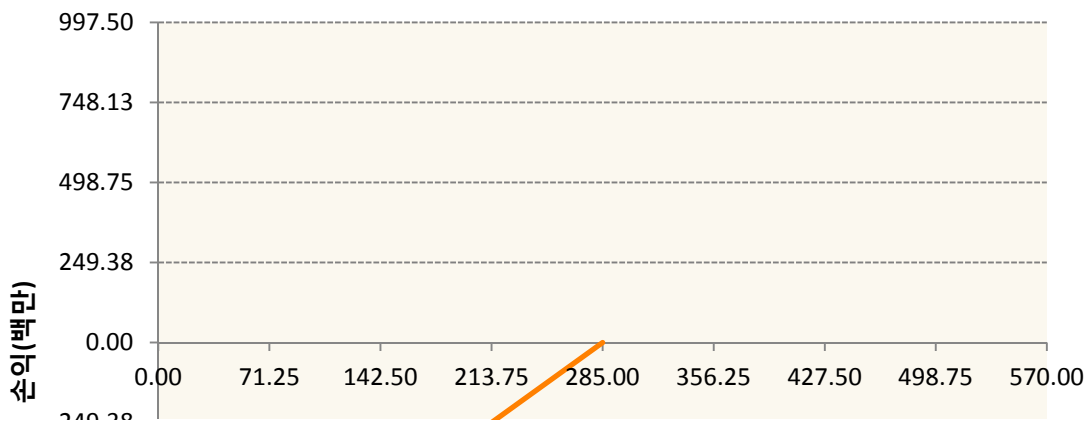




KR4301PC2824-2019-12 풋282.5



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						241
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-241	-241	-241	-241	-241	-241	-241	
-5.33%	-161	-161	-161	-161	-161	-161	-161	
-2.67%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	80	80	80	80	80	80	80	
5.33%	161	161	161	161	161	161	161	
8.00%	241	241	241	241	241	241	241	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						201
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	19	19	19	19	19	18	18	
-5.33%	19	19	18	18	17	16	15	
-2.67%	18	17	16	14	12	9	7	
0%	11	8	4	0	-4	-9	-14	
2.67%	-16	-22	-28	-34	-41	-47	-53	
5.33%	-78	-84	-90	-97	-103	-110	-116	
8.00%	-174	-178	-182	-186	-191	-196	-201	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						288
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-288	-288	-288	-288	-288	-288	-288
-5.33%	-191	-191	-191	-191	-191	-191	-191
-2.67%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-95
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	82	80	77	75	72	70	67
5.33%	112	111	109	108	106	104	102
8.00%	114	114	114	114	113	113	113
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%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	24	23	23	22	22	21	20
5.33%	37	36	35	35	34	34	33
8.00%	38	38	38	38	38	38	38

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

(단위:백만원)

1,614

공시일	2019-12-05
기준일	2019-12-04

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

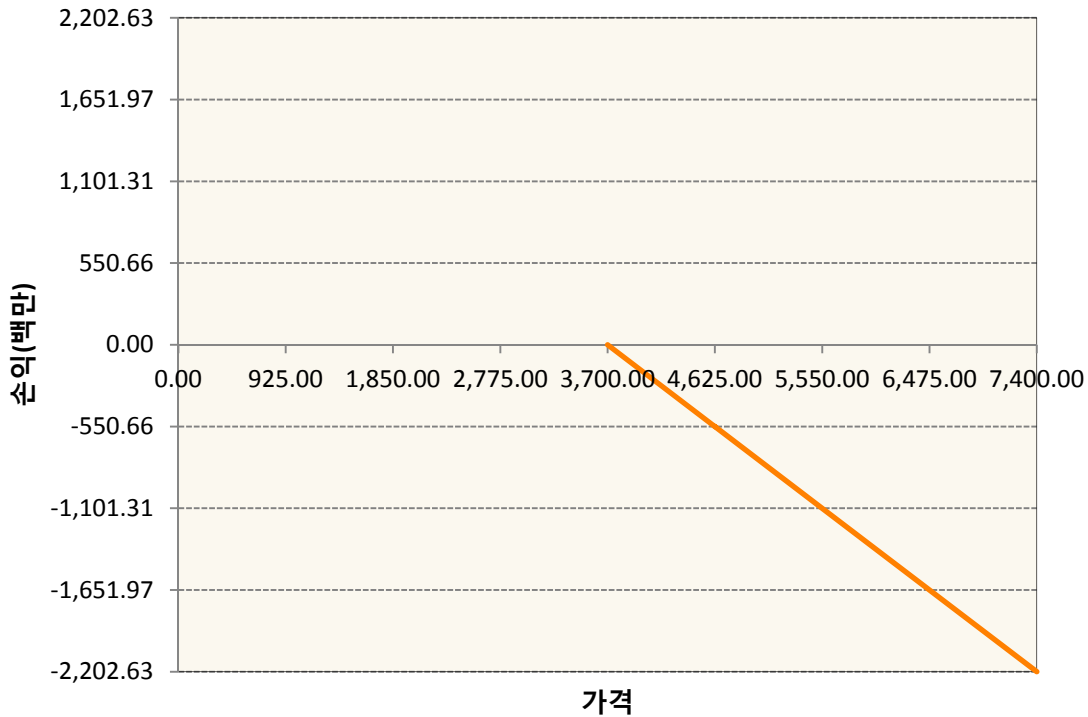
1. 계약금액

(단위:백만원)

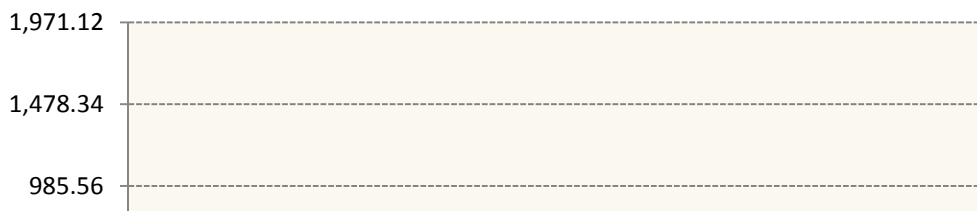
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,028	0	1,028	
누계	유가증권	스왑	18,088	0	18,088	장외
누계	유가증권	옵션	0	8,347	-8,347	장내
누계	통화	선도	2,746	6,217	-3,471	장외

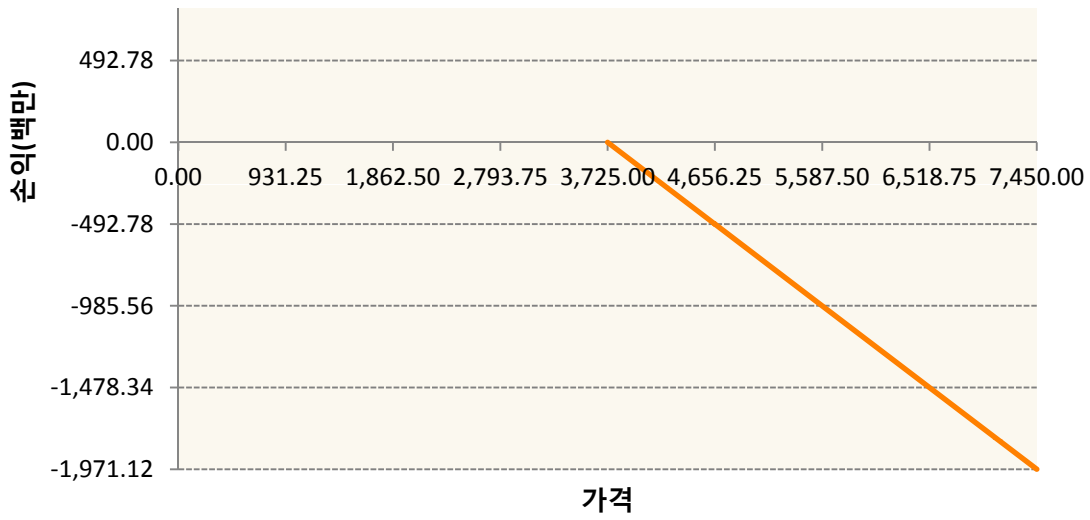
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ9-C3700-EURO STOXX 50

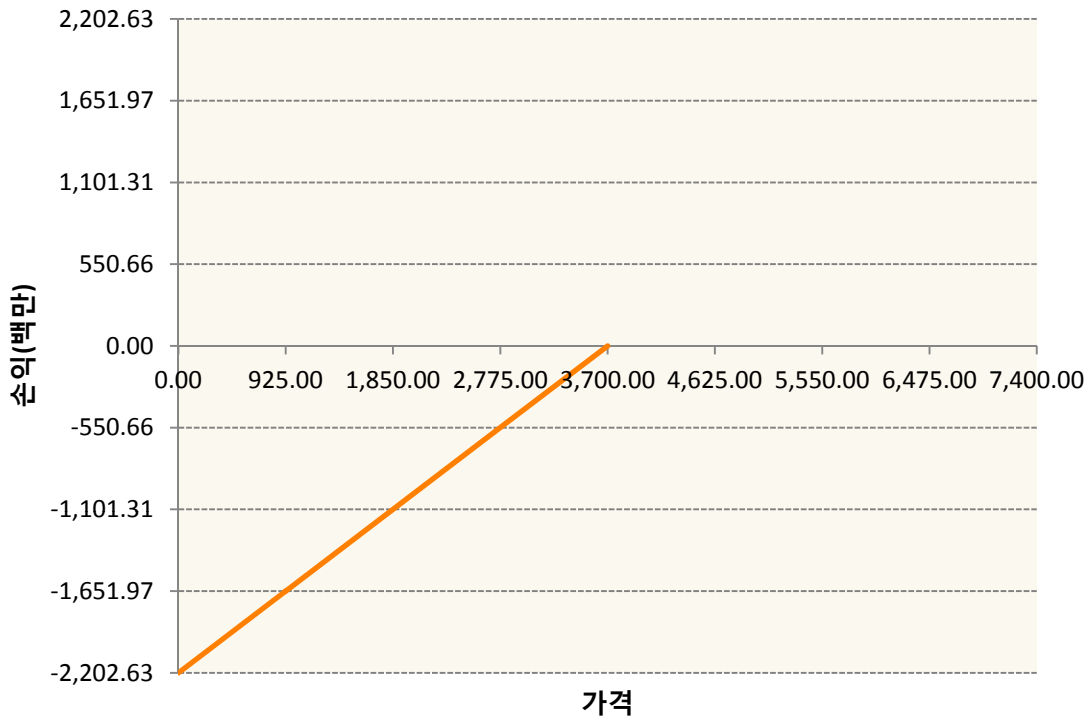


OESXZ9-C3725-EURO STOXX 50

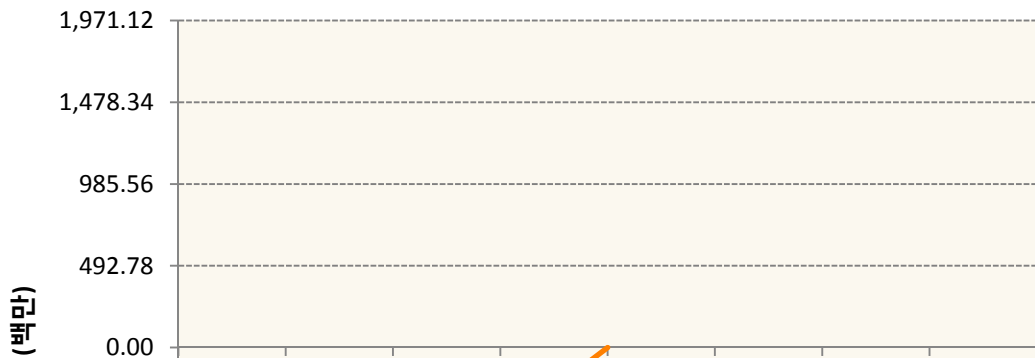


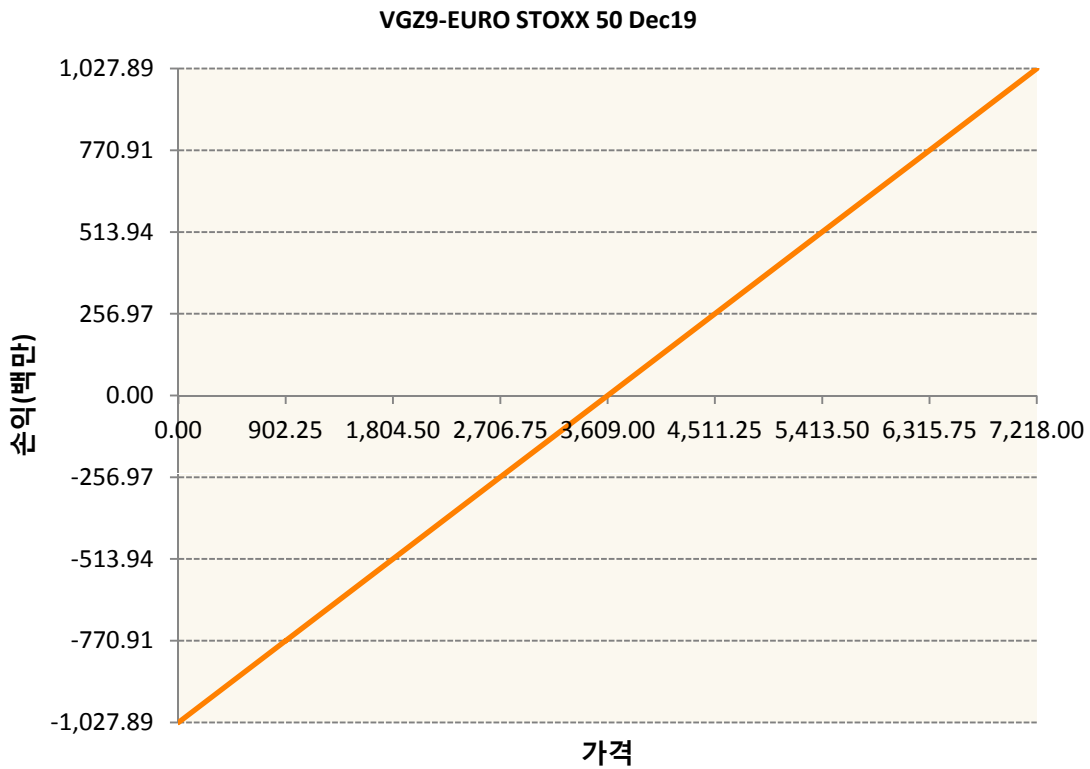
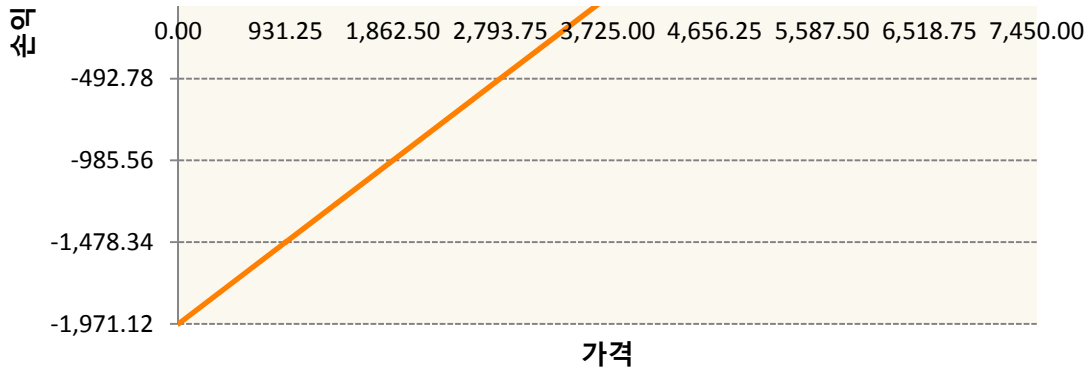


OESXZ9-P3700-EURO STOXX 50



OESXZ9-P3725-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	4
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E	497
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E	167
FX21019X02 EUR/KRW 27-12-19E	53
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	176
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	158
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	176
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	158
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19	82

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

(단위:백만원)

835

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

(단위:백만원)

896

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

(단위:백만원)

78

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

(단위:백만원)

122

공시일	2019-12-05
기준일	2019-12-04

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

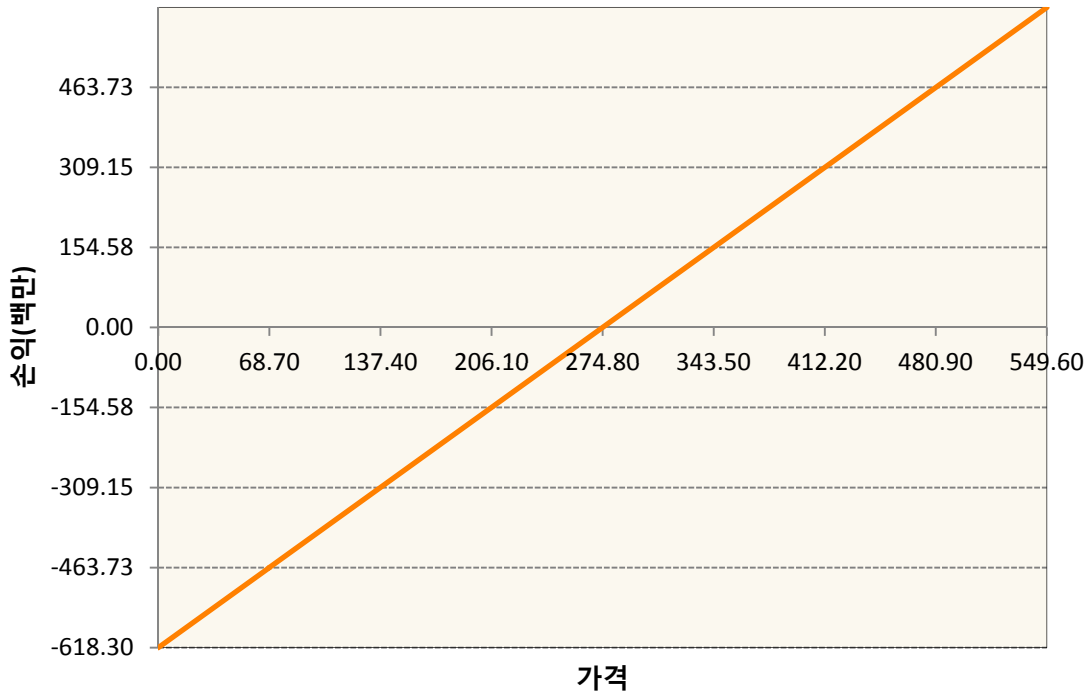
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	618	0	618	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						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	0	
2.67%	16	16	16	16	16	16	16	
5.33%	33	33	33	33	33	33	33	
8.00%	49	49	49	49	49	49	49	

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

(단위:백만원)

39

공시일	2019-12-05
기준일	2019-12-04

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

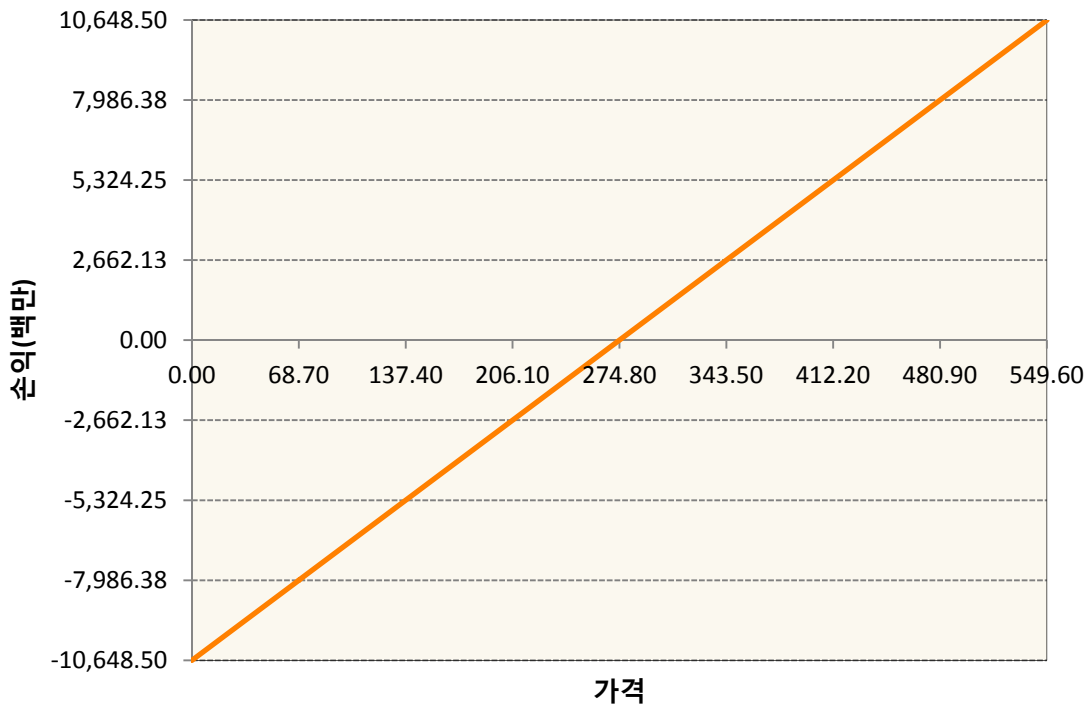
1. 계약금액

(단위:백만원)

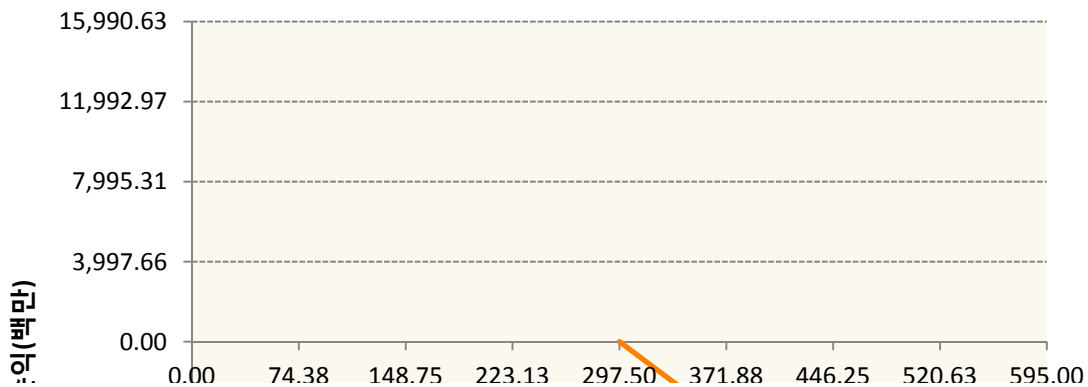
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,649	0	10,649	장내
누계	유가증권	옵션	1,277	21,241	-19,964	장내

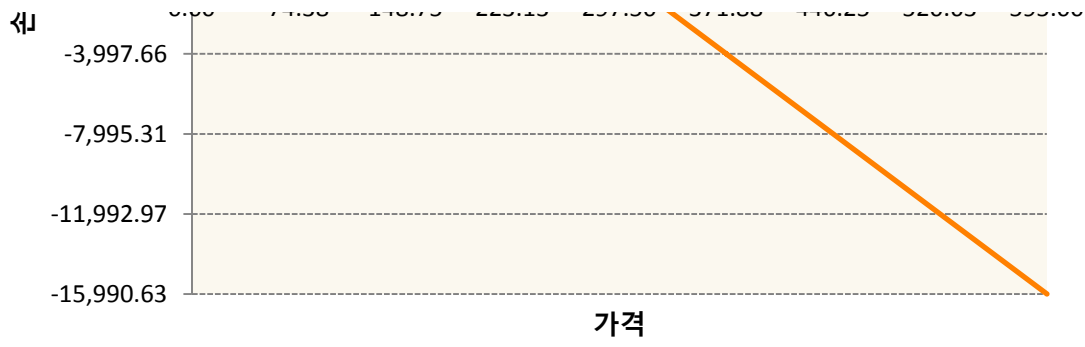
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

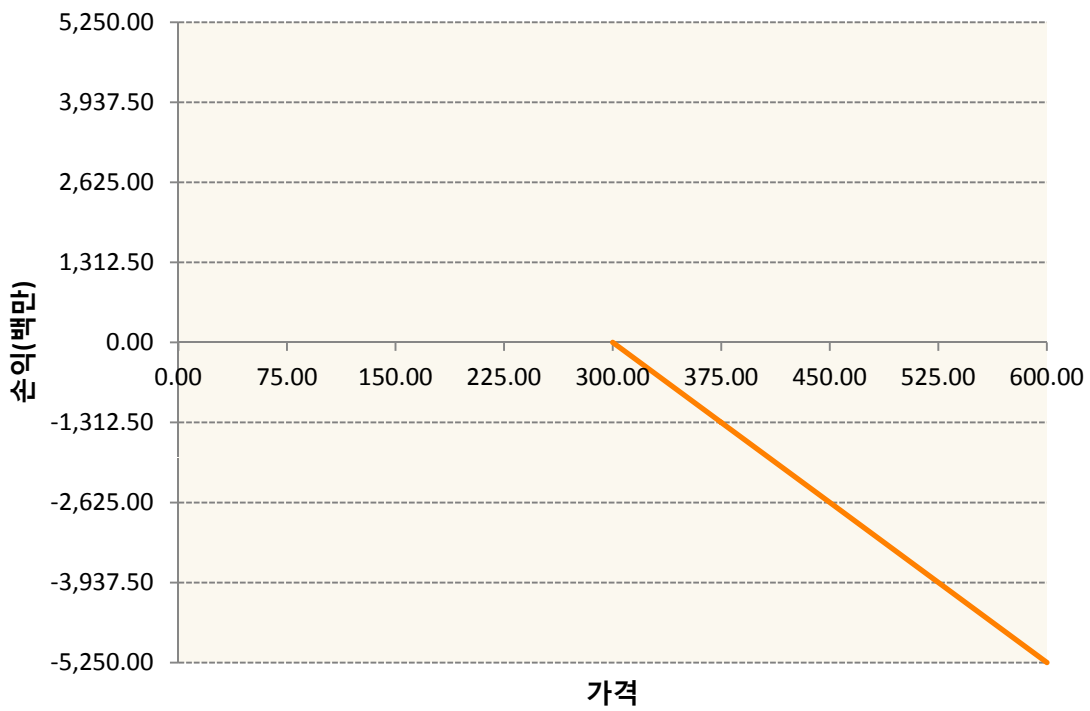


KR4201PC2973-2019-12 콜297.5

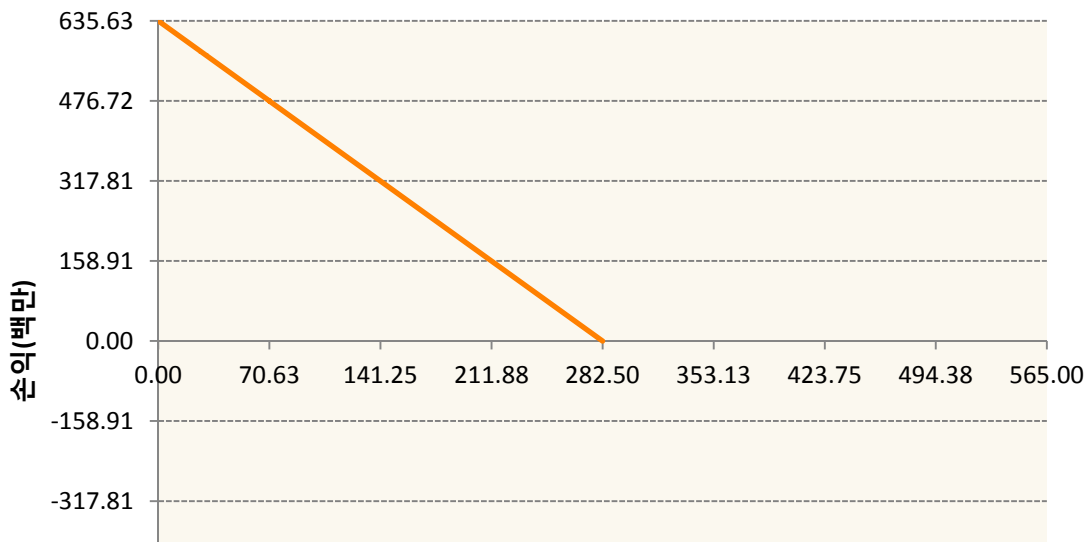


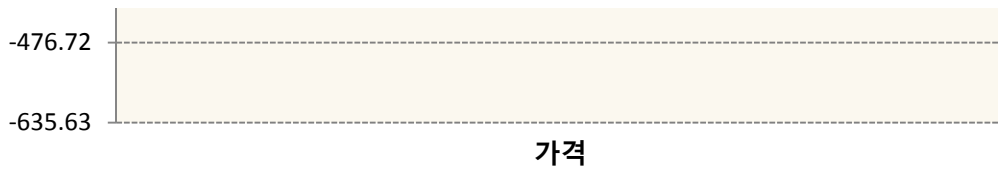


KR4201PC3005-2019-12 콜300

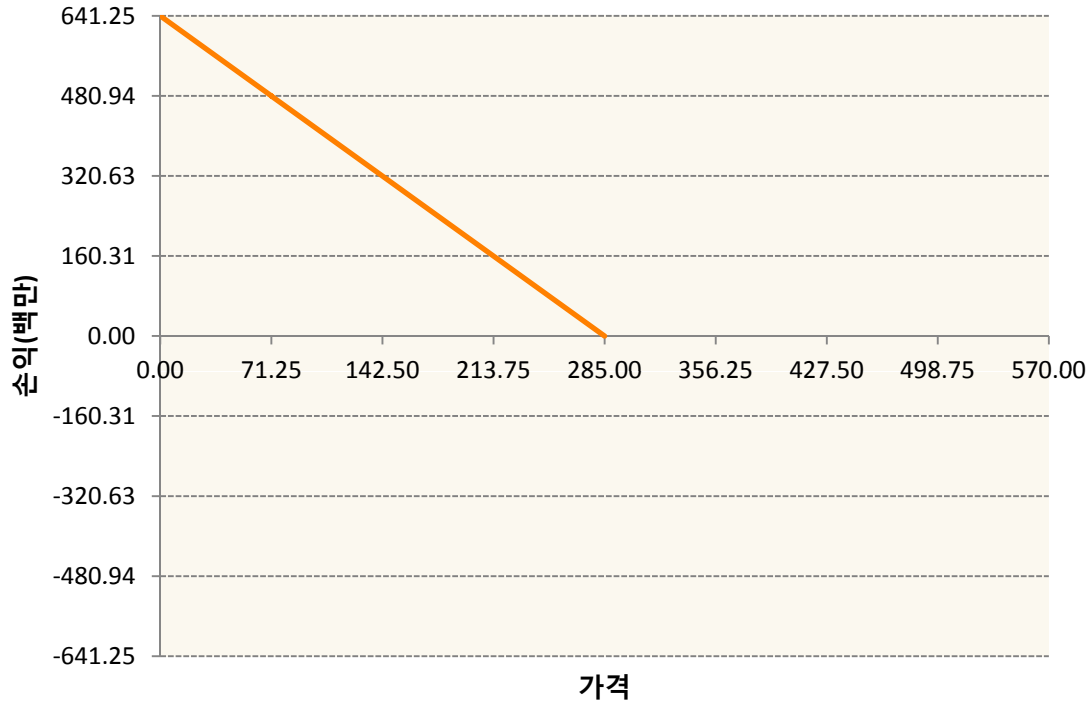


KR4301PC2824-2019-12 풋282.5





KR4301PC2857-2019-12 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						850
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-850	-850	-850	-850	-850	-850	-850	
-5.33%	-567	-567	-567	-567	-567	-567	-567	
-2.67%	-283	-283	-283	-283	-283	-283	-283	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	283	283	283	283	283	283	283	
5.33%	567	567	567	567	567	567	567	
8.00%	850	850	850	850	850	850	850	
KR4201PC2973		2019-12 콜297.5						290
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	6	6	6	6	6	6	6	
-5.33%	6	6	6	6	6	6	5	
-2.67%	6	6	6	5	4	3	1	

0%	6	5	3	0	-4	-9	-14
2.67%	-1	-7	-14	-22	-32	-43	-55
5.33%	-39	-54	-70	-86	-104	-122	-140
8.00%	-157	-179	-201	-223	-246	-268	-290
KR4201PC3005 2019-12 콜300							77
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-2.67%	1	1	1	1	1	1	0
0%	1	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	0	-1	-3	-5	-7	-10	-13
5.33%	-8	-11	-16	-20	-25	-30	-36
8.00%	-35	-42	-49	-56	-63	-70	-77
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%	16	16	16	16	16	16	16
0%	0	0	0	0	0	0	1
2.67%	-14	-14	-13	-13	-12	-12	-11
5.33%	-19	-19	-19	-18	-18	-18	-17
8.00%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
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	0
2.67%	-15	-15	-15	-14	-14	-14	-13
5.33%	-24	-23	-23	-22	-22	-22	-21
8.00%	-25	-25	-25	-25	-24	-24	-24

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

(단위:백만원)

909

공시일	2019-12-05
기준일	2019-12-04

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	208,469	0	208,469	

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	2019-12-05
기준일	2019-12-04

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	217,582	0	217,582	

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	2019-12-05
기준일	2019-12-04

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	552,501	0	552,501	
누계	통화	선도	0	608,018	-608,018	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		669
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		707
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,720
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,873
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,433
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,538
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		955
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		955
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		955
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		955
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		478
FX21019X00 KRW/USD 06-12-19E		669
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		478
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		478
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		478
FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E		1,567
FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E		955
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		478
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		955
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		1,567
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		1,911
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		3,287
FX21019X02 KRW/USD 26-12-19E		4,815
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		4,873
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		191
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,866

FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E

2,866
2,389
2,580

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

(단위:백만원)

15,353

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

(단위:백만원)

178

공시일	2019-12-05
기준일	2019-12-04

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

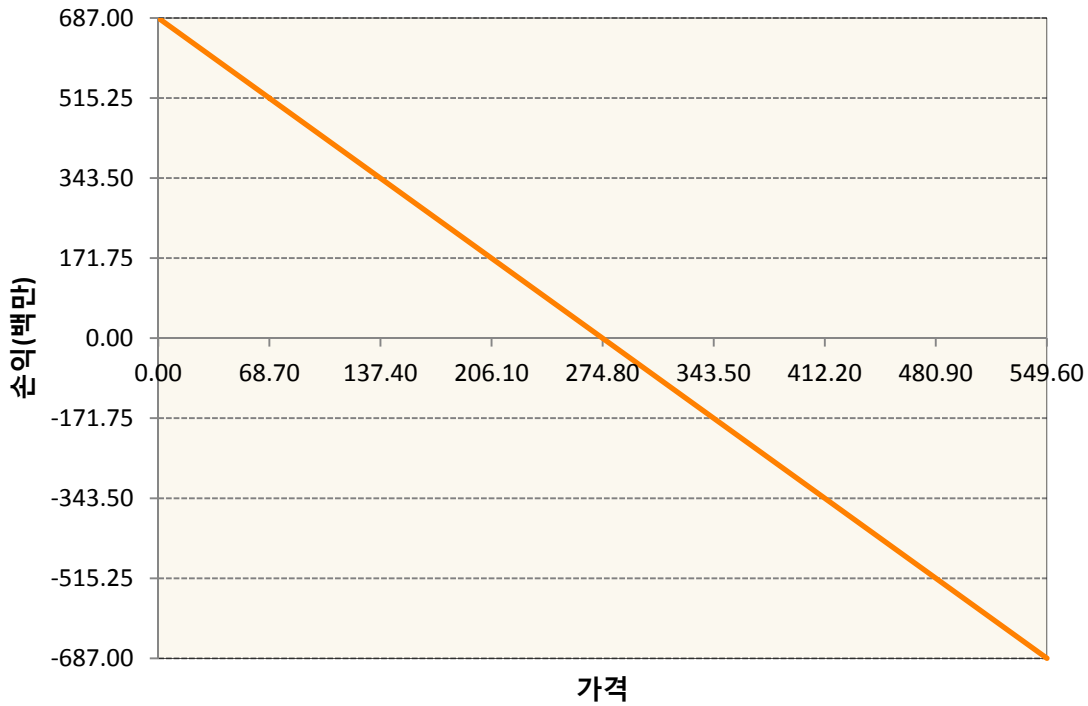
1. 계약금액

(단위:백만원)

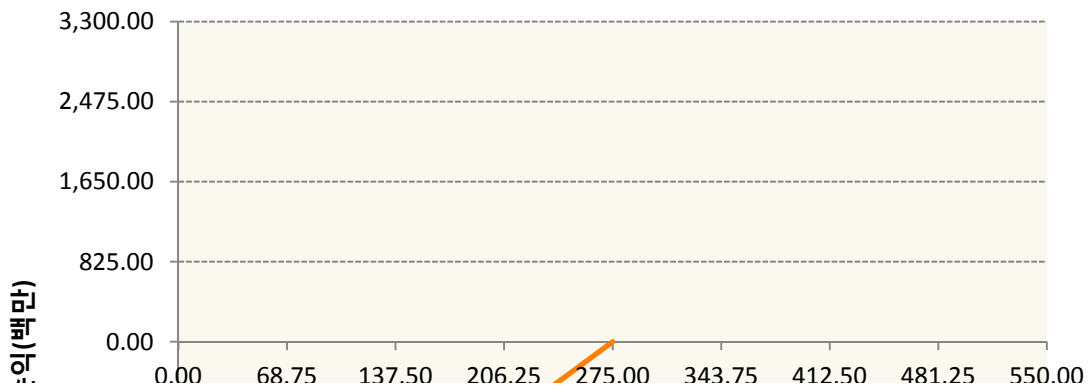
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	687	-687	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,994	-3,994	장내

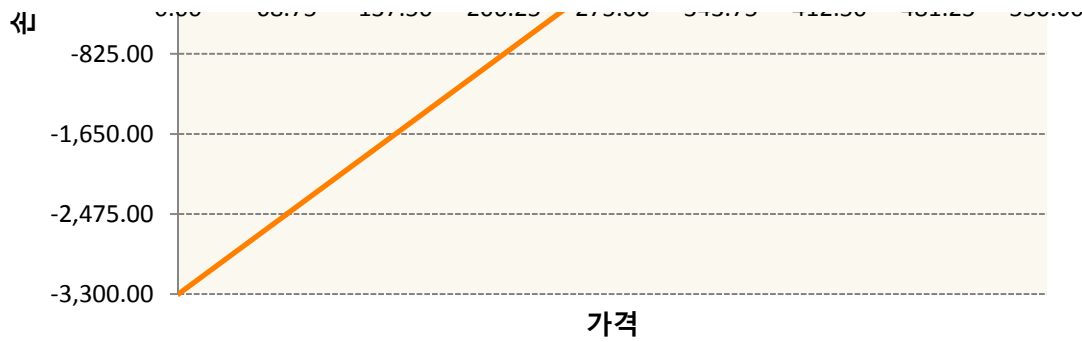
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

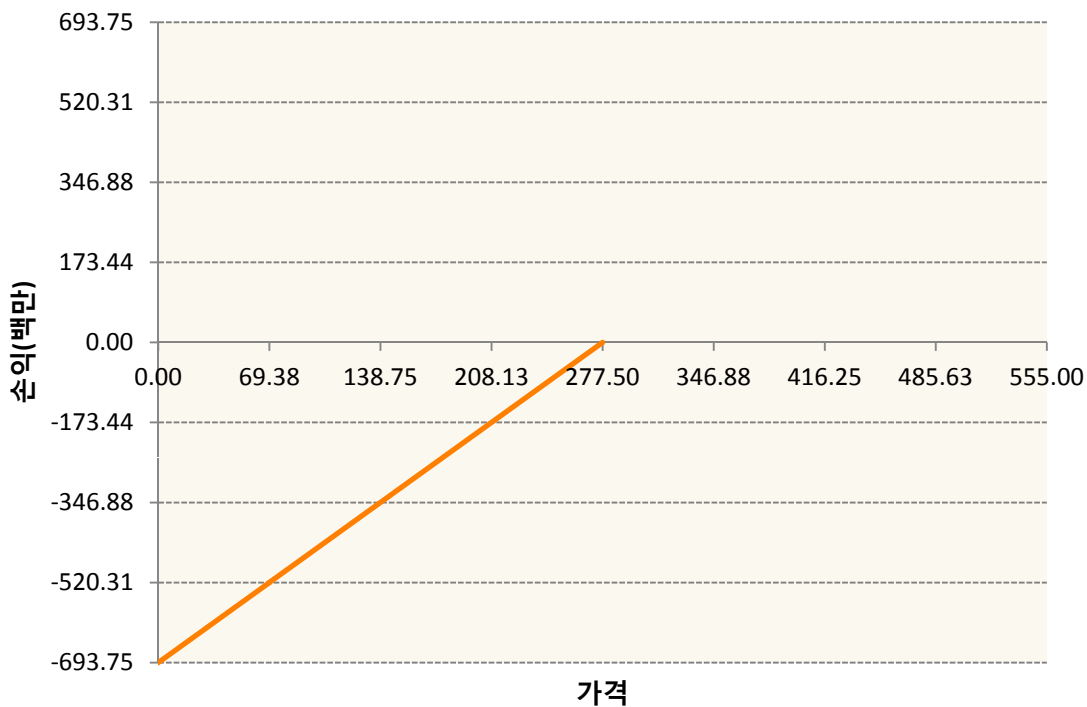


KR4301PC2758-2019-12 풋275





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						240
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-240	-240	-240	-240	-240	-240	-240
-5.33%	-153	-153	-153	-153	-153	-153	-153
-2.67%	-65	-66	-67	-67	-68	-69	-70
0%	7	5	2	0	-2	-5	-7
2.67%	32	31	30	29	27	26	24
5.33%	34	34	34	33	33	33	33
8.00%	34	34	34	34	34	34	34
KR4301PC2774 2019-12 풋277.5							52
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
-5.33%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	10	10	9	9	8	8	8
5.33%	11	11	11	11	11	11	11
8.00%	11	11	11	11	11	11	11

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

(단위:백만원)

424

공시일	2019-12-05
기준일	2019-12-04

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	15,288	0	15,288	
누계	통화	선도	0	15,072	-15,072	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019V01 KRW/USD 10-12-19E		378
FX21019X01 KRW/USD 13-01-20E		234
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		296
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		297

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

(단위:백만원)

381

공시일	2019-12-05
기준일	2019-12-04

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	1,016	0	1,016	장외
누계	통화	선도	317	357	-40	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
FX21019Z00 EUR/KRW 28-02-20E	3

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

(단위:백만원)

81

공시일	2019-12-05
기준일	2019-12-04

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

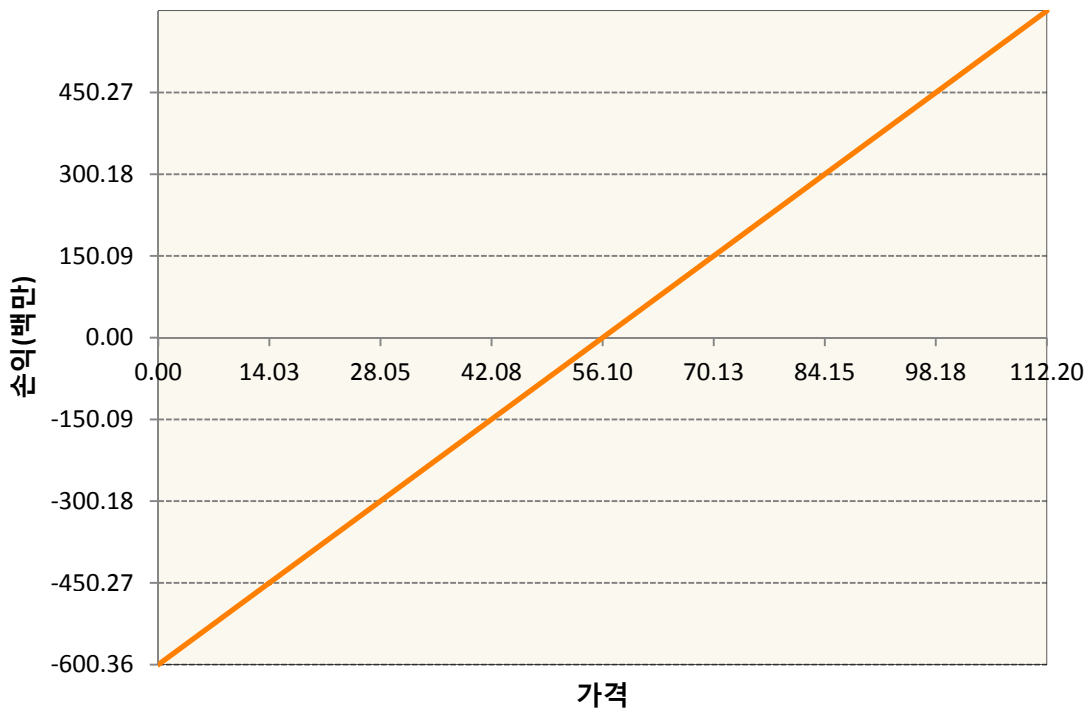
1. 계약금액

(단위:백만원)

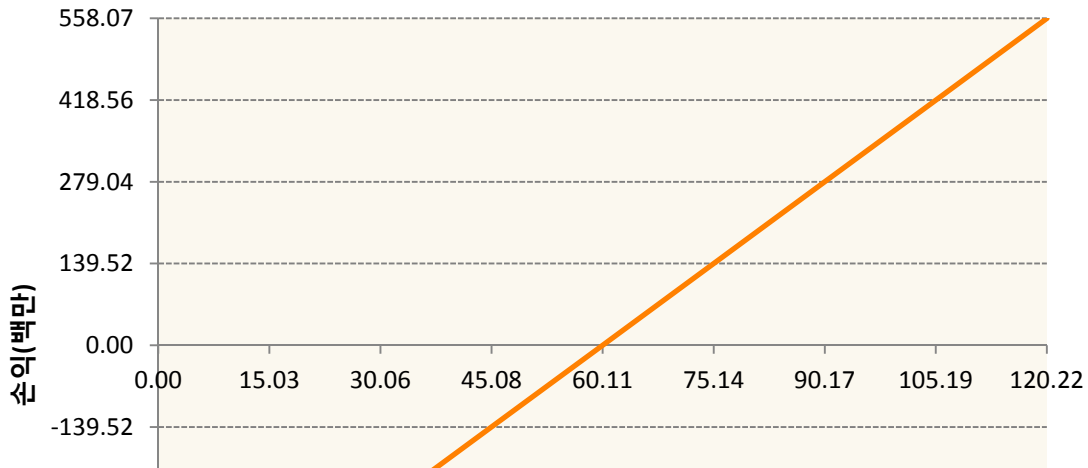
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,393	299	2,094	

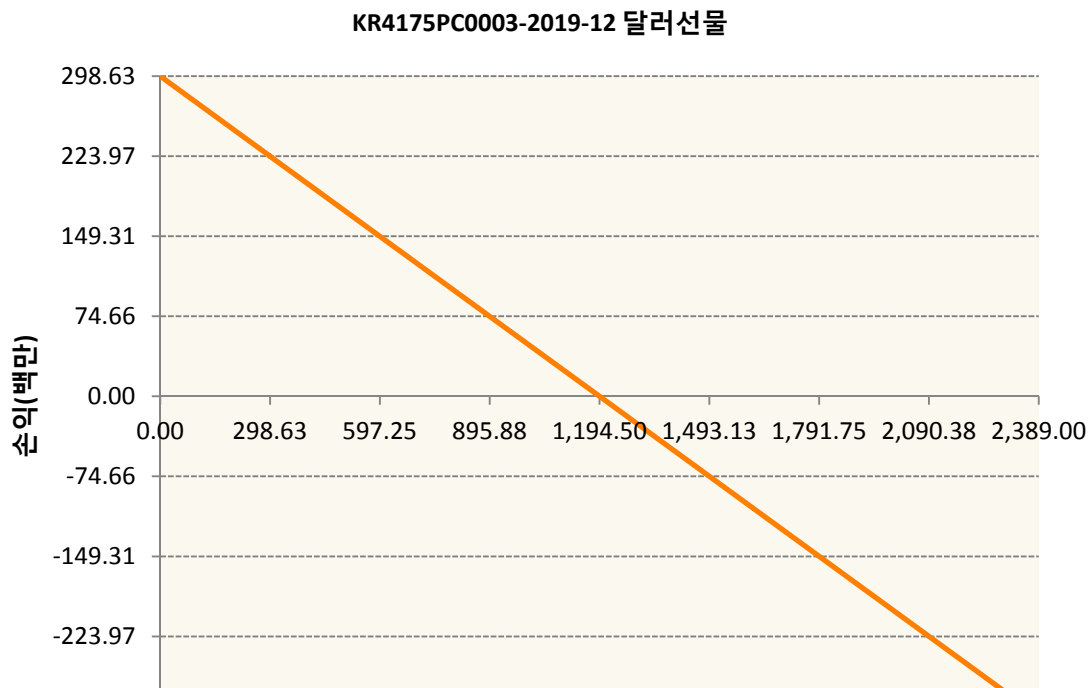
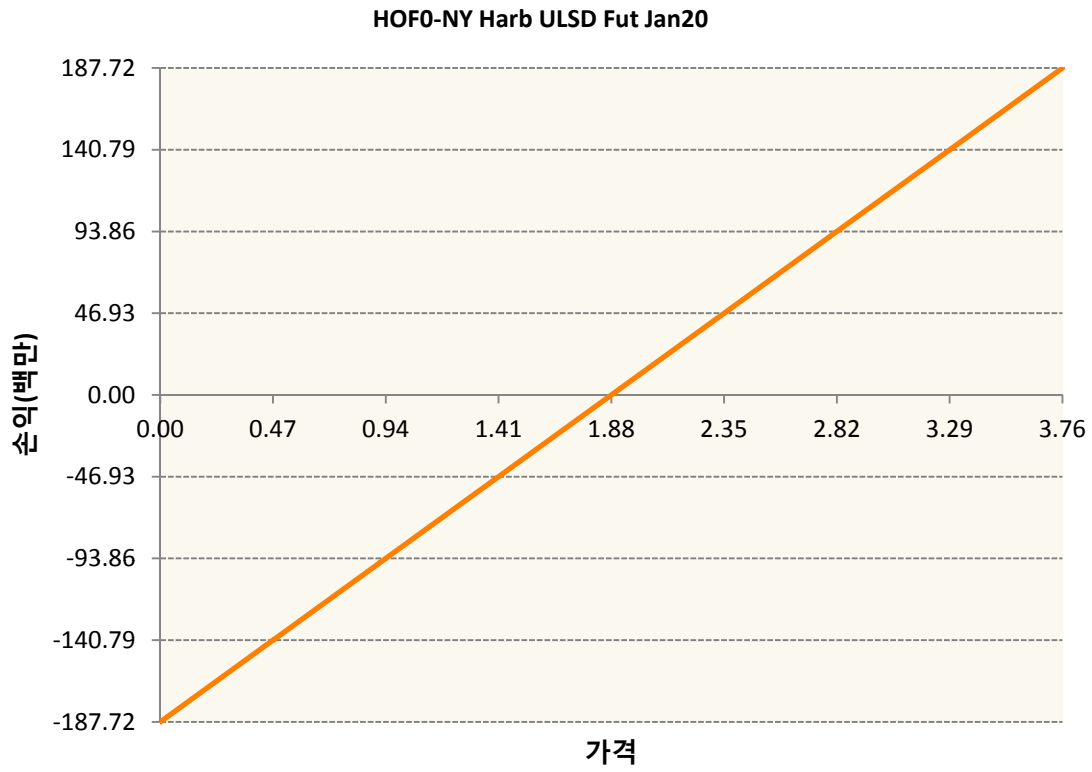
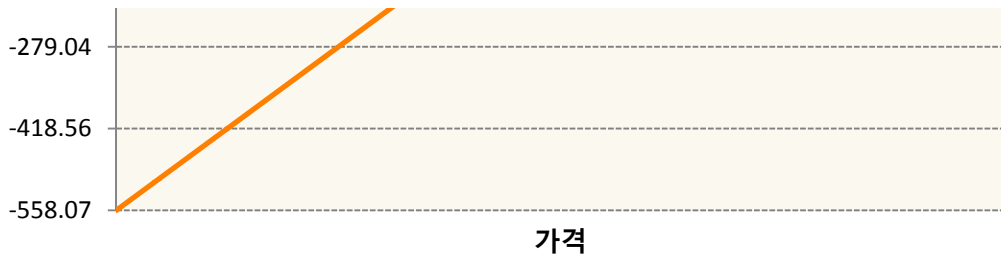
2. 만기시점의 손익구조

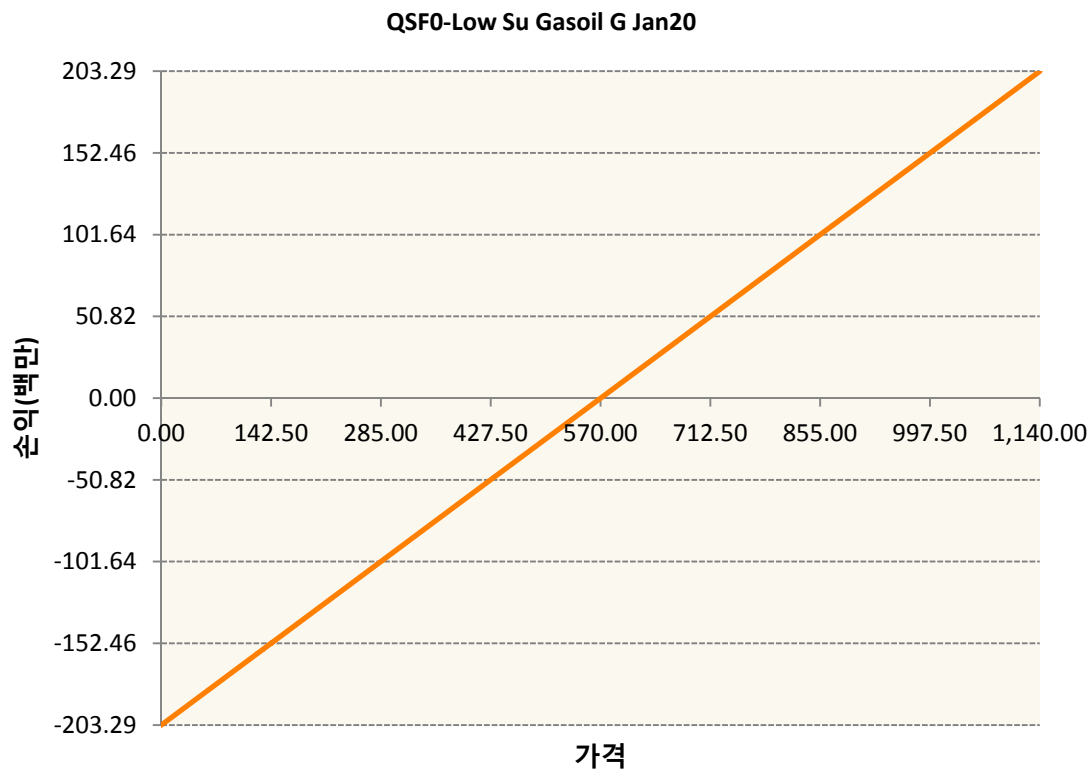
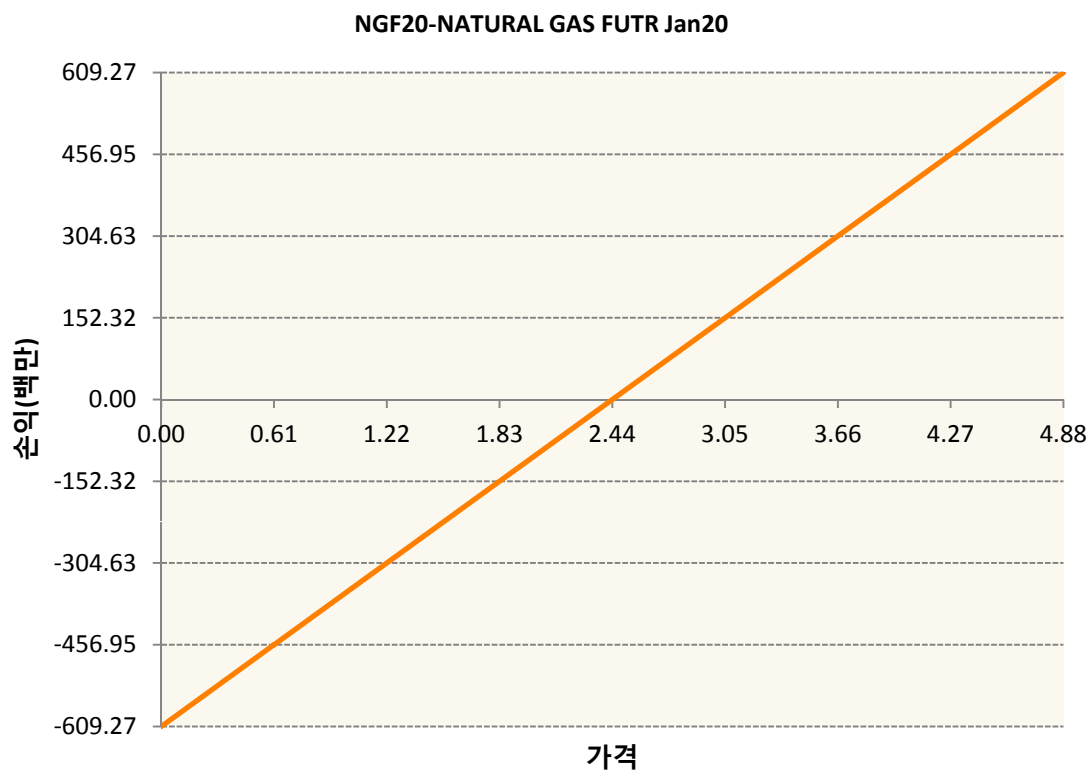
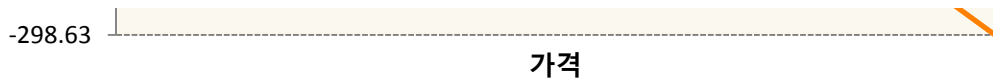
CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20



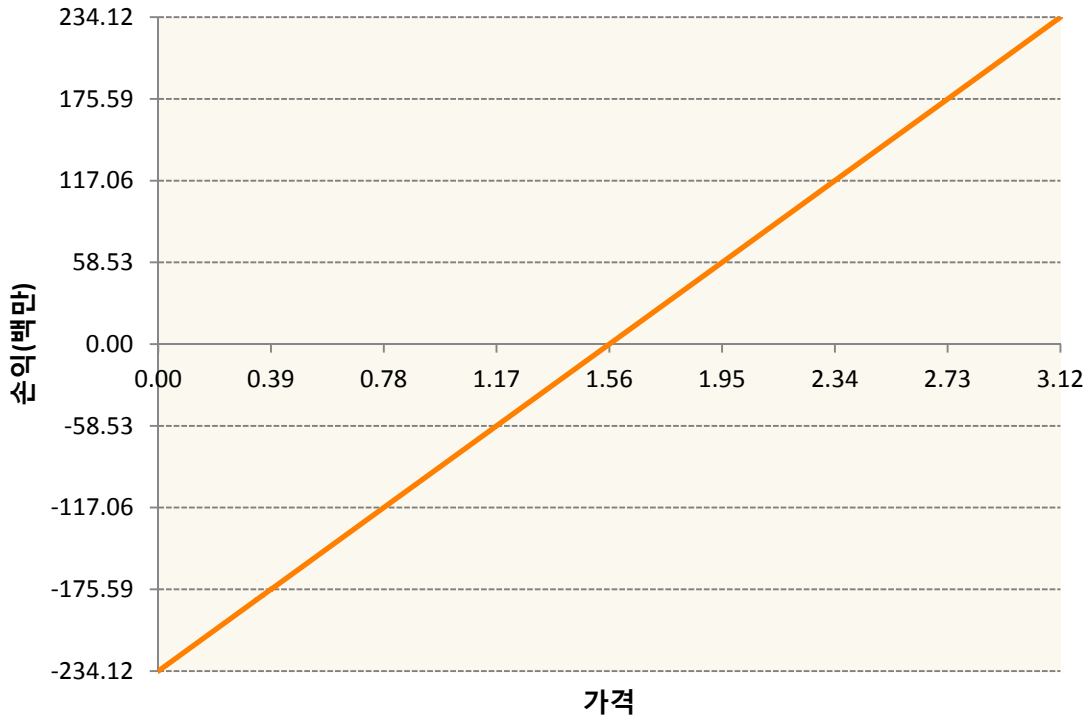
COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20







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	49
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	16
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	19

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

(단위:백만원)

393

공시일	2019-12-05
기준일	2019-12-04

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

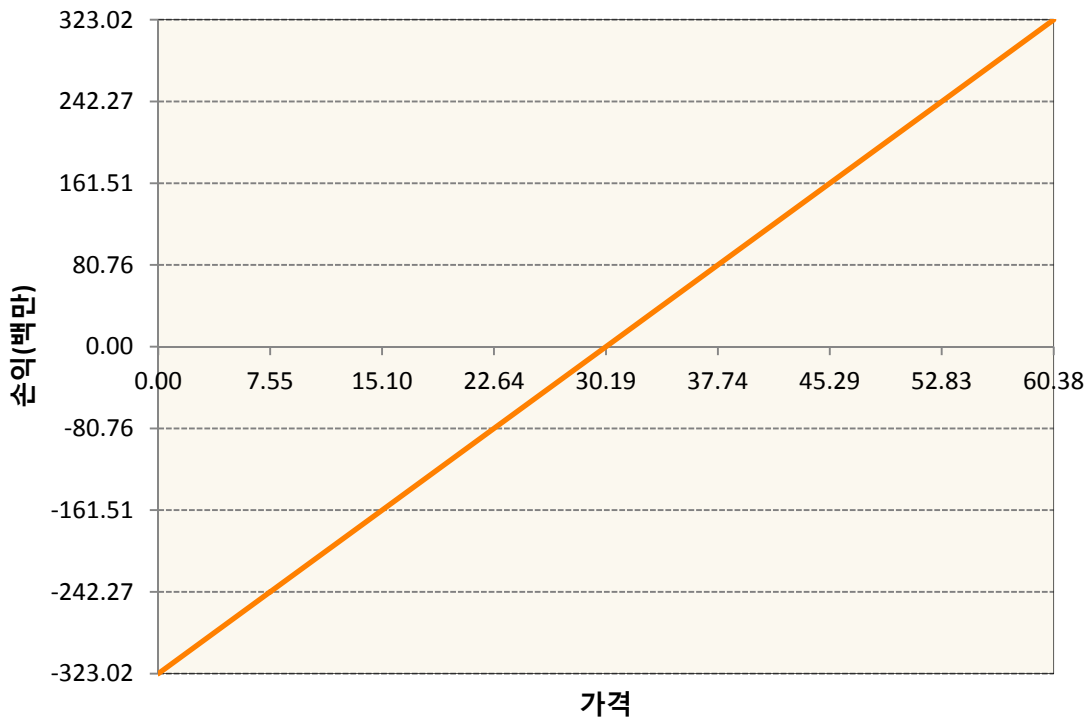
1. 계약금액

(단위:백만원)

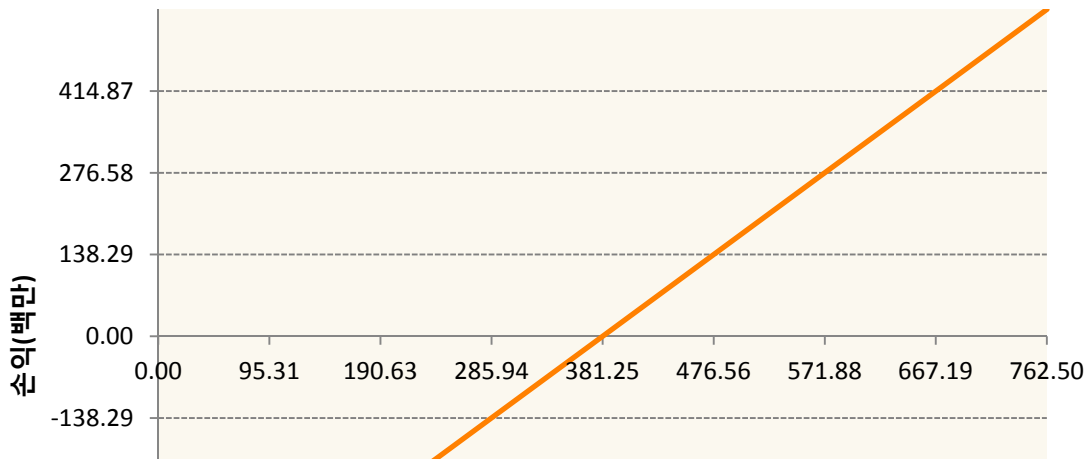
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,771	96	2,675	

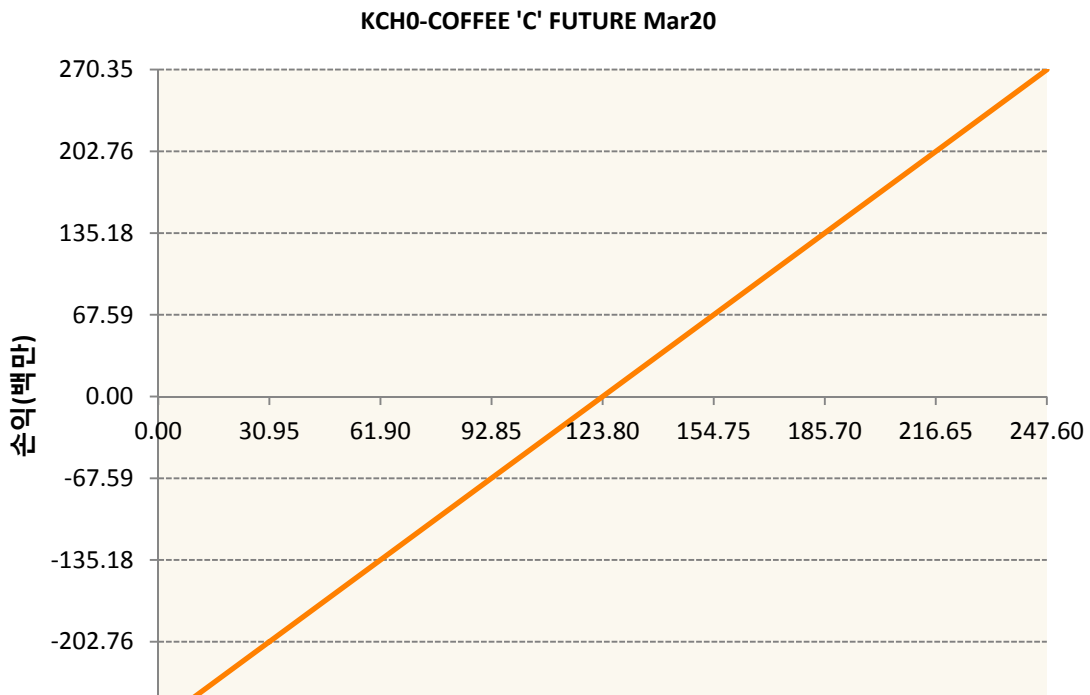
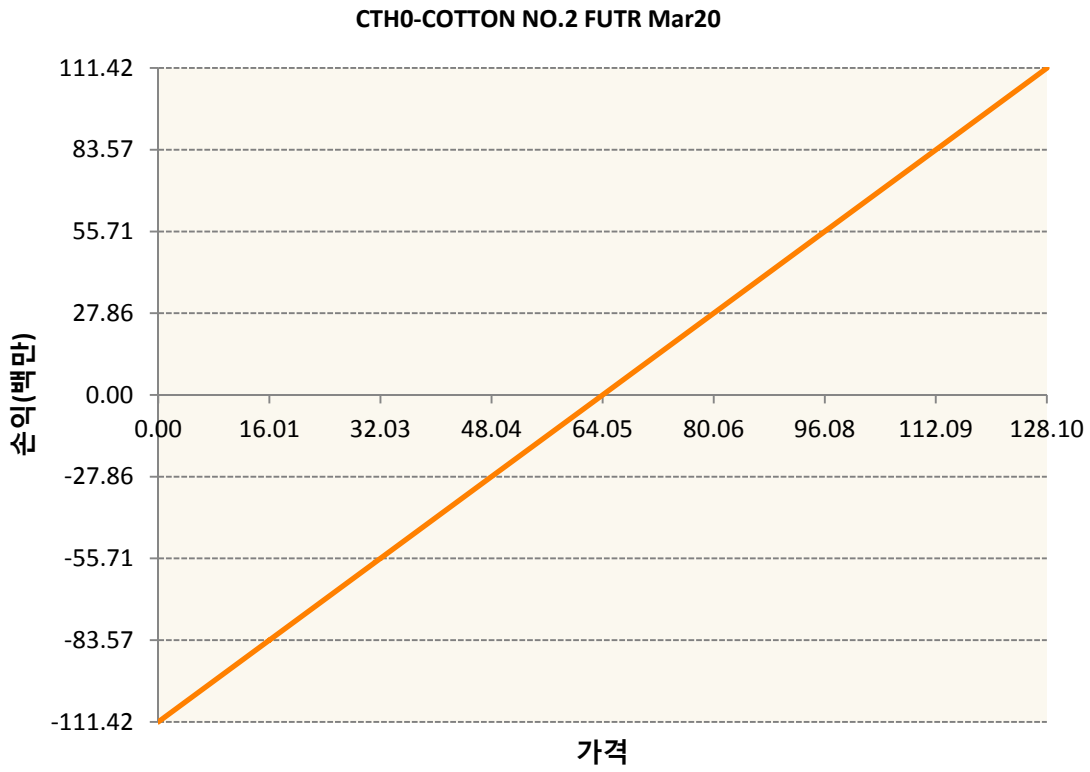
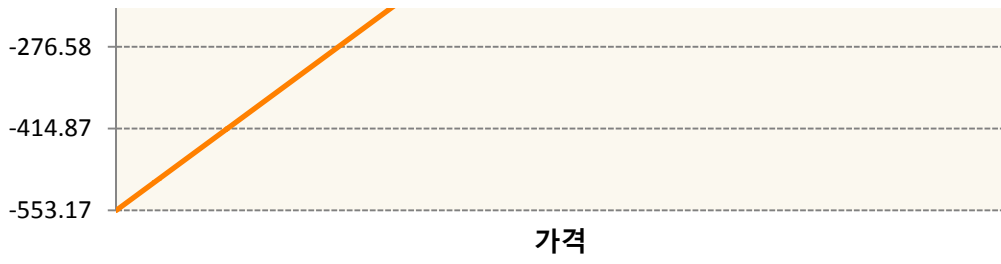
2. 만기시점의 손익구조

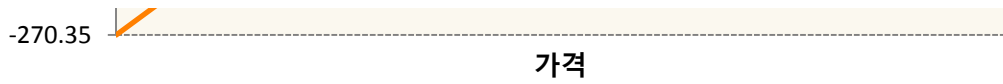
BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20



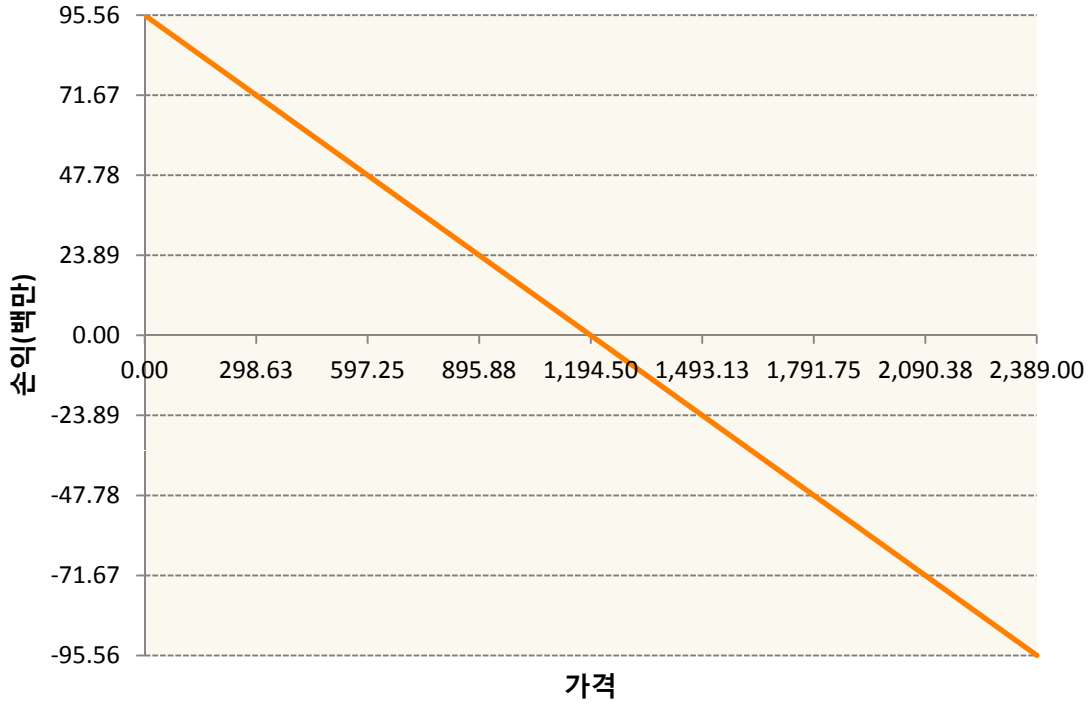
CH0-CORN FUTURE Mar20



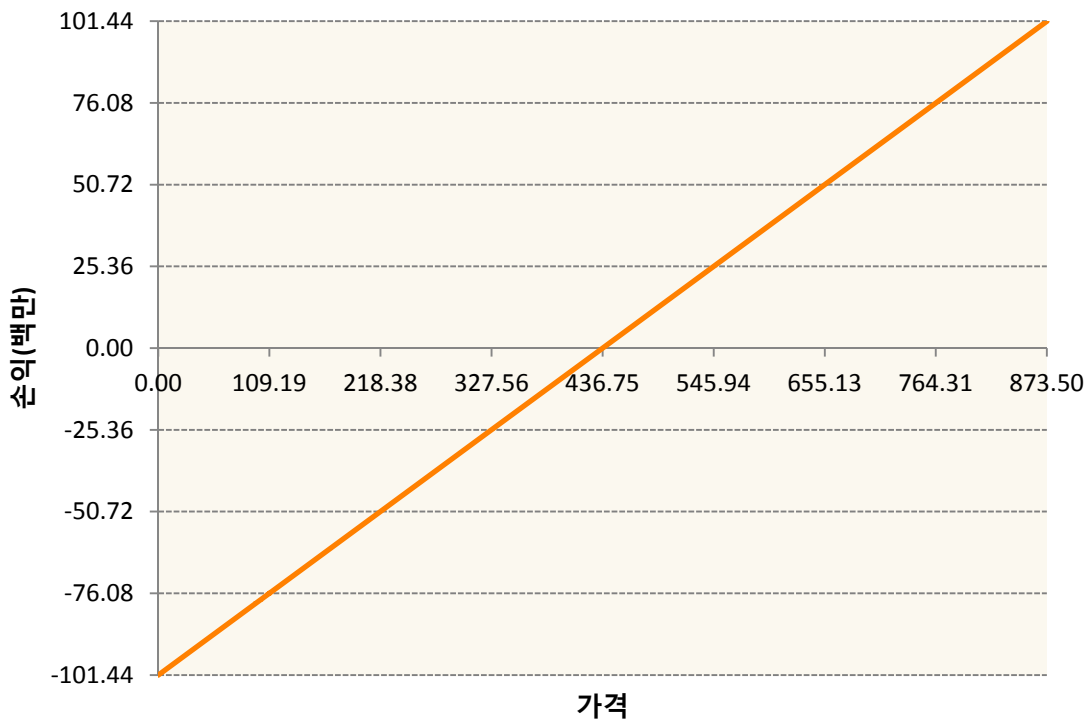




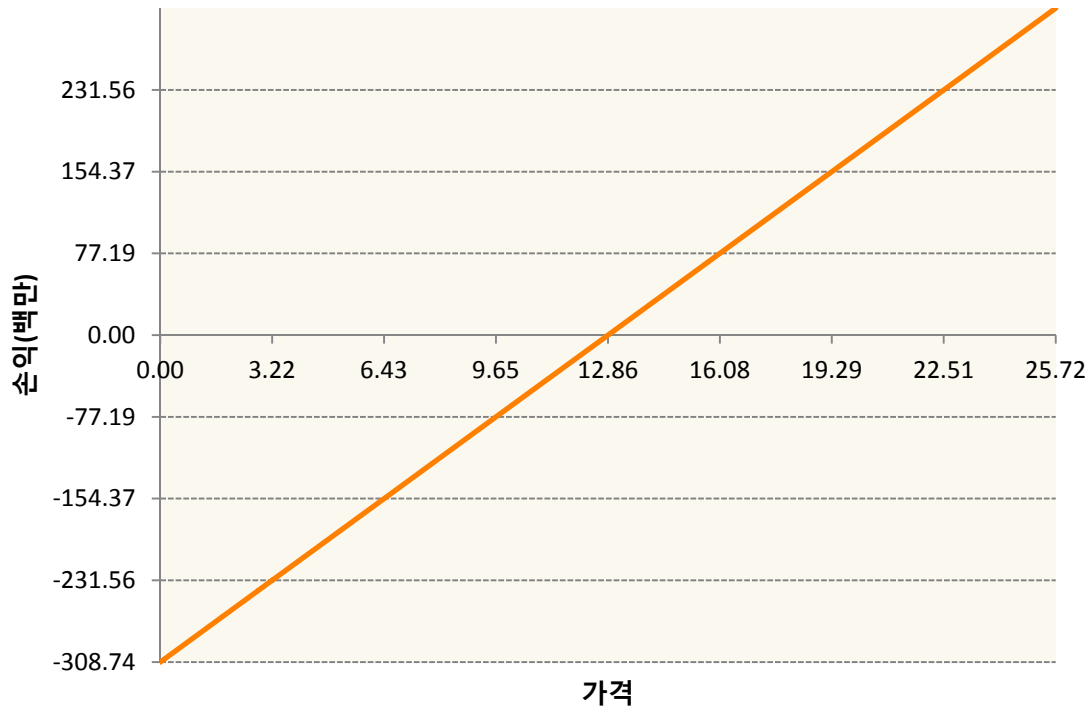
KR4175PC0003-2019-12 달러선물



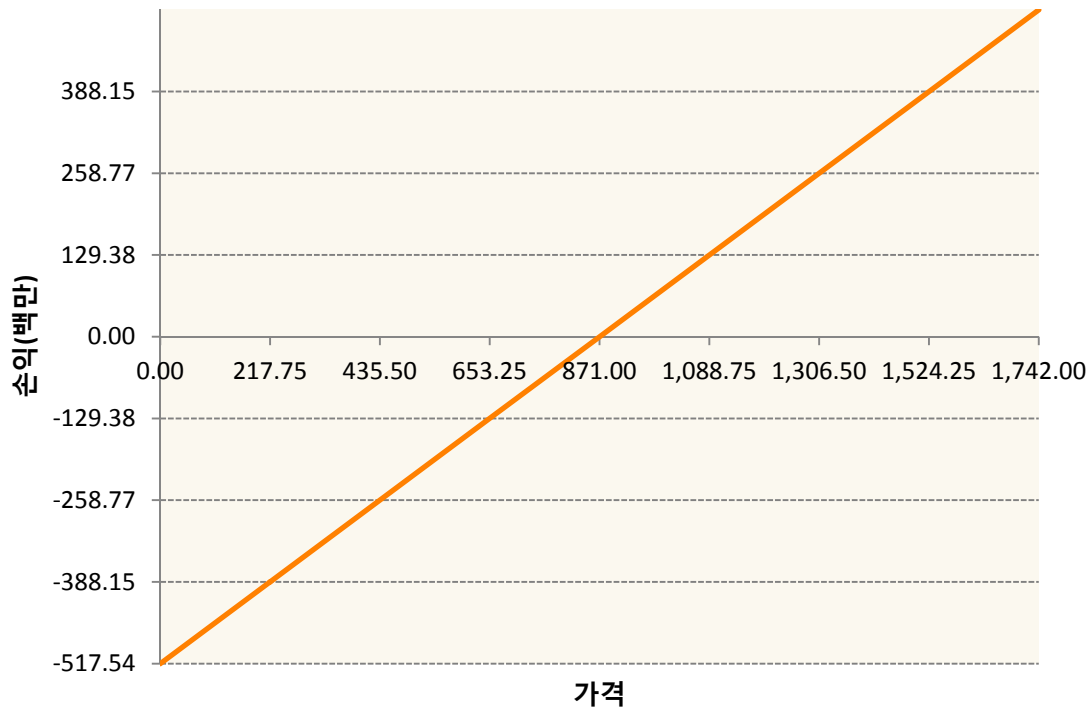
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

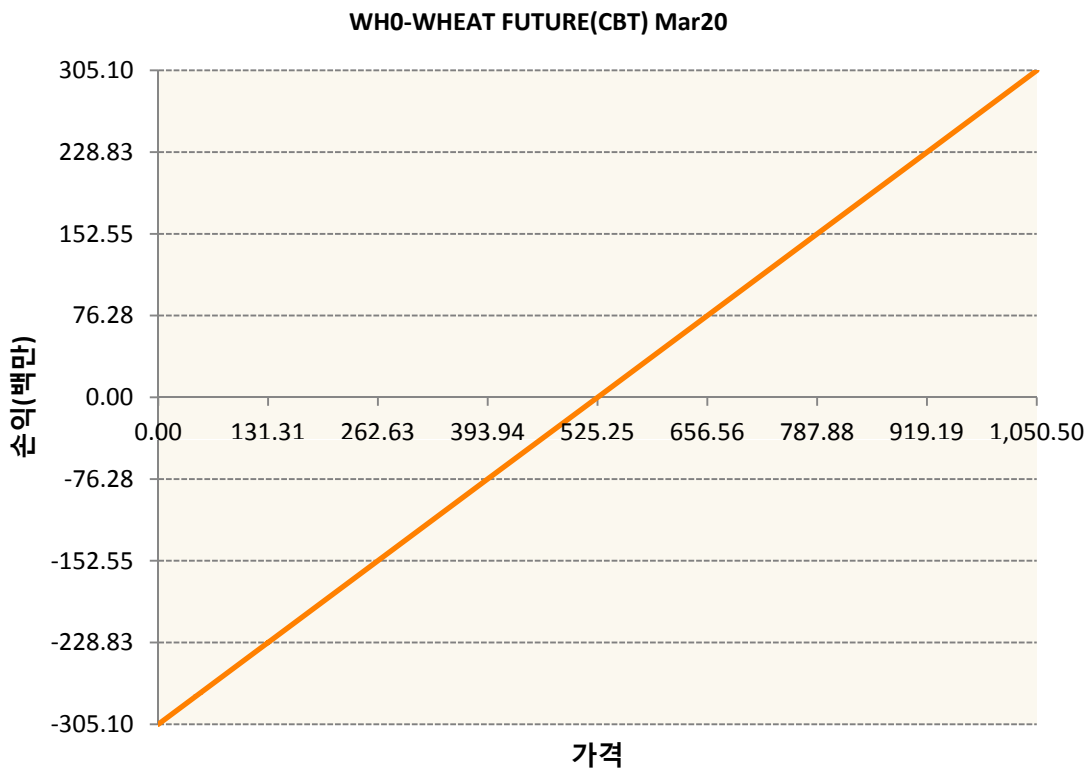
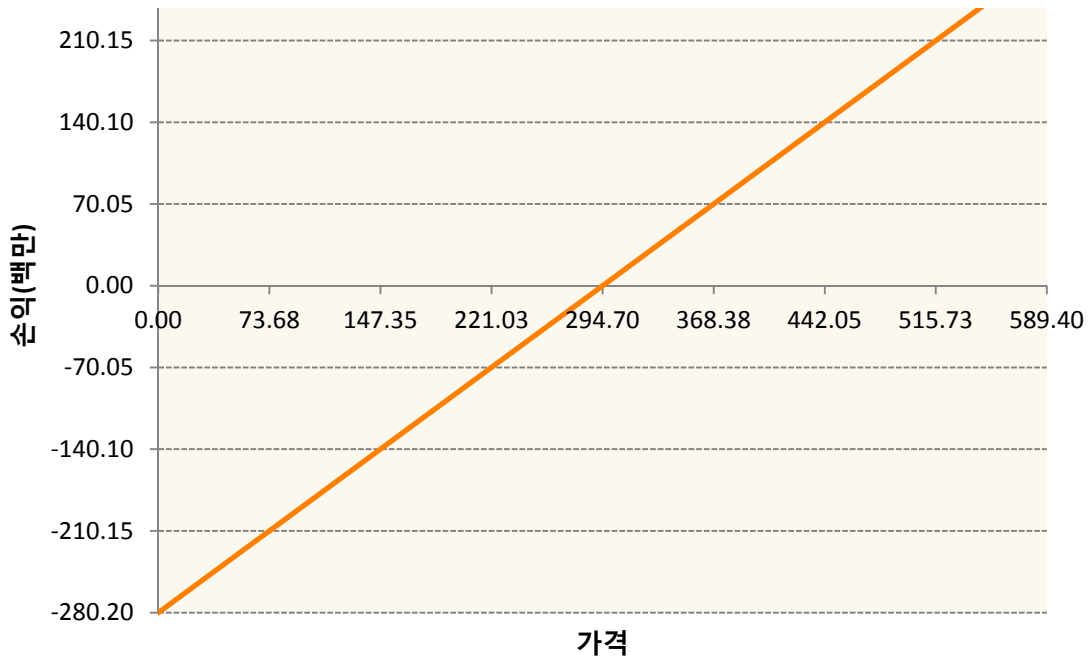


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20



SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF0	SOYBEAN OIL FUTR Jan20	26
CH0	CORN FUTURE Mar20	44
CTH0	COTTON NO.2 FUTR Mar20	9
KCH0	COFFEE 'C' FUTURE Mar20	22
KR4175PC00	2019-12 달러선물	8

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

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

(단위:백만원)

245