

공시일	2019-12-06
기준일	2019-12-05

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

공시일	2019-12-06
기준일	2019-12-05

스마트인덱스모

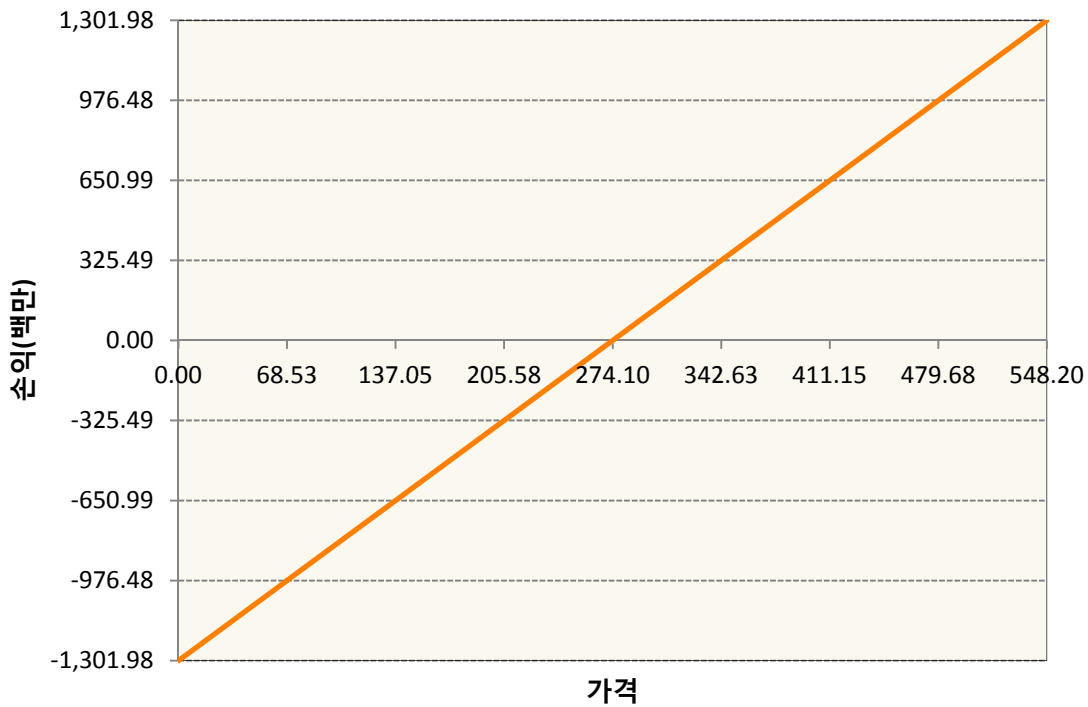
1. 계약금액

(단위:백만원)

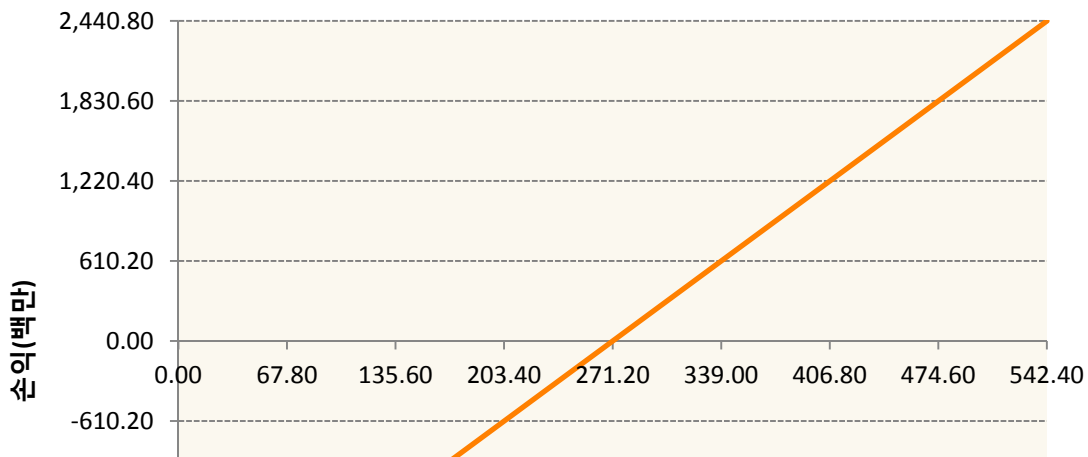
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,442	0	2,442	장내
누계	유가증권	선물	3,743	0	3,743	장내

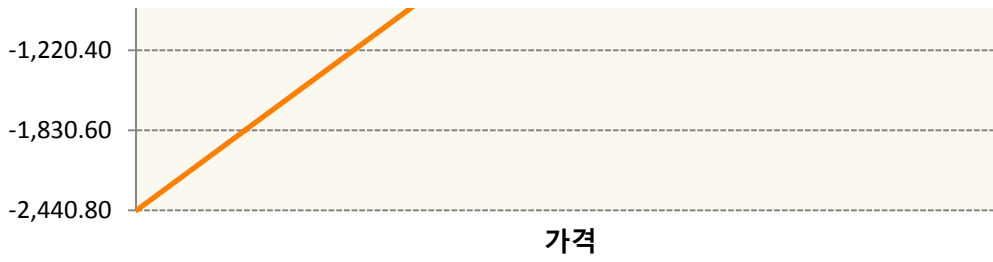
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						104
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104	
-5.33%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69	
-2.67%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	35	35	35	35	35	35	35	
5.33%	69	69	69	69	69	69	69	
8.00%	104	104	104	104	104	104	104	
KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						197
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197	
-5.33%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131	
-2.67%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	66	66	66	66	66	66	66	
5.33%	131	131	131	131	131	131	131	
8.00%	197	197	197	197	197	197	197	

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

238

공시일	2019-12-06
기준일	2019-12-05

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

1,089

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

627

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-06
기준일	2019-12-05

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)	382
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	139

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

738

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-06
기준일	2019-12-05

유로인덱스모(주식-파생형)

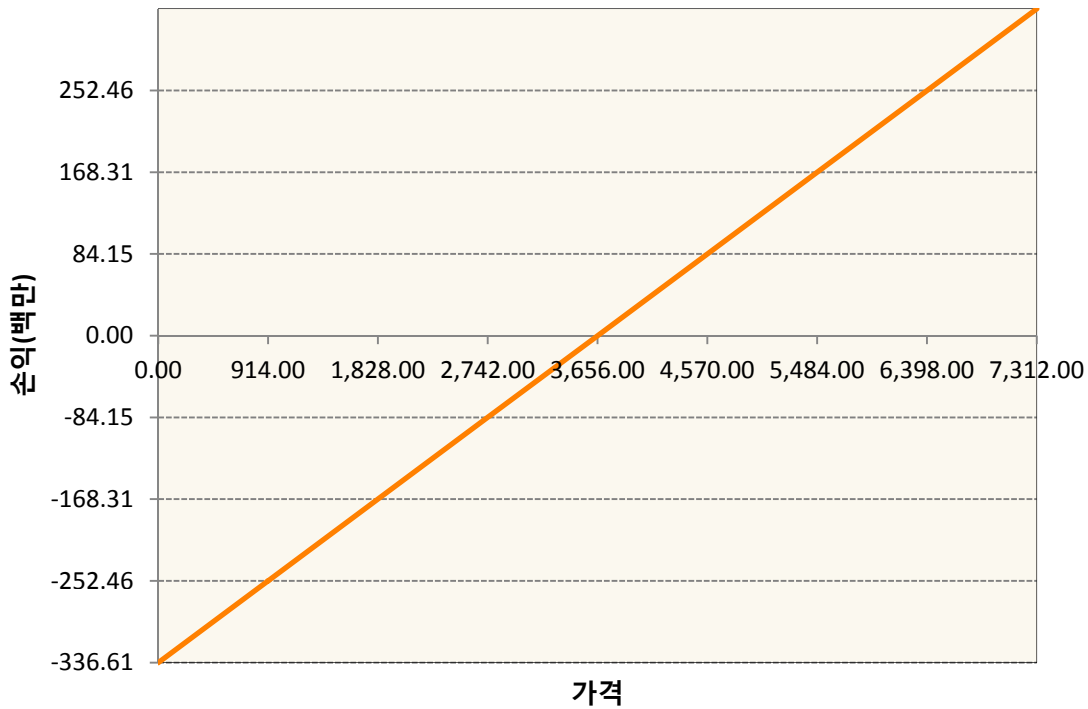
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	337	0	337	

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	2019-12-06
기준일	2019-12-05

차이나인덱스모(주식-파생형)

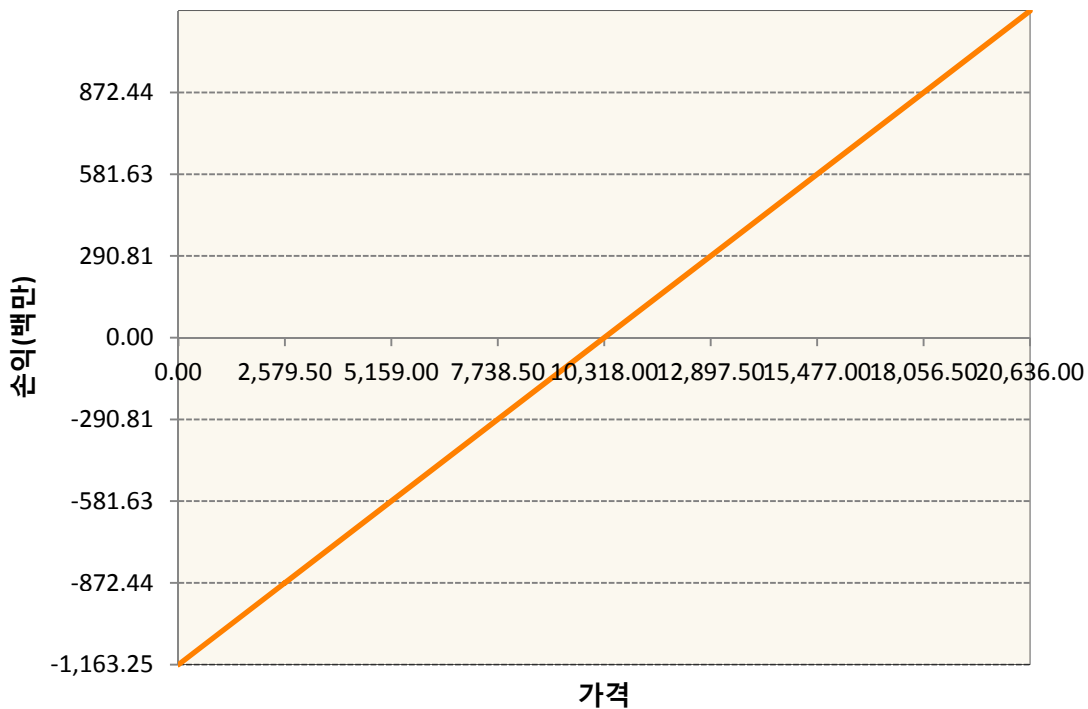
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,163	0	1,163	

2. 만기시점의 손익구조

HCZ9-HSCEI Futures Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

84

공시일	2019-12-06
기준일	2019-12-05

커버드콜모(주식혼합-파생형)

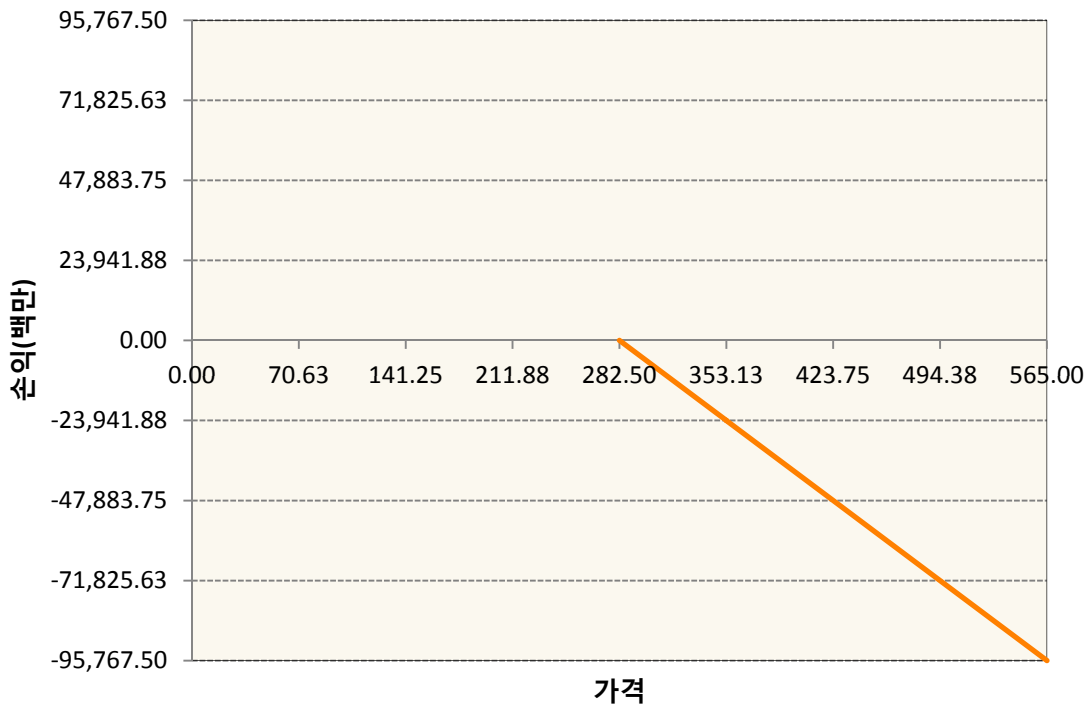
1. 계약금액

(단위:백만원)

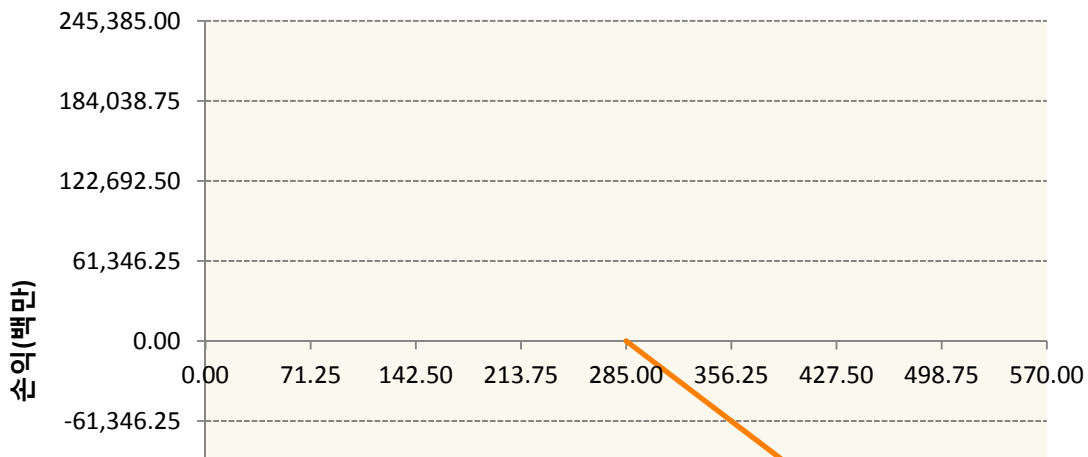
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	498,456	-498,456	장내

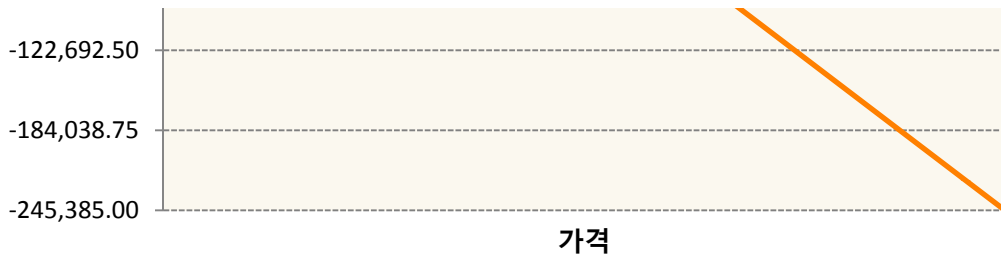
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PC2825-2019-12 콜282.5

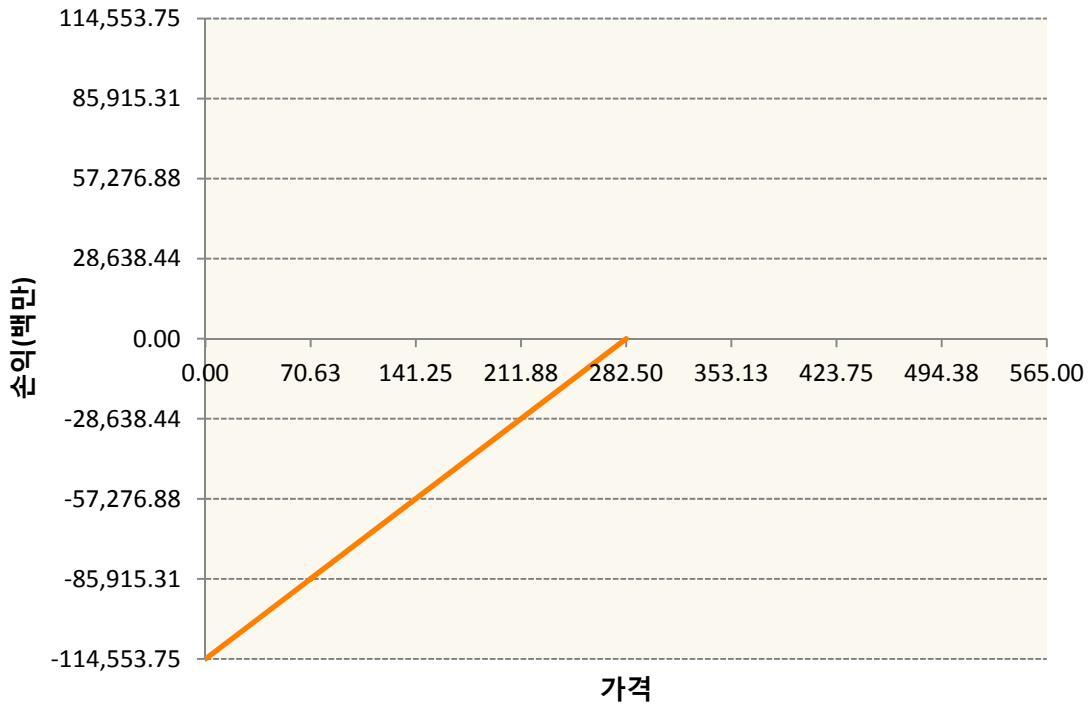


KR4201PC2858-2019-12 콜285

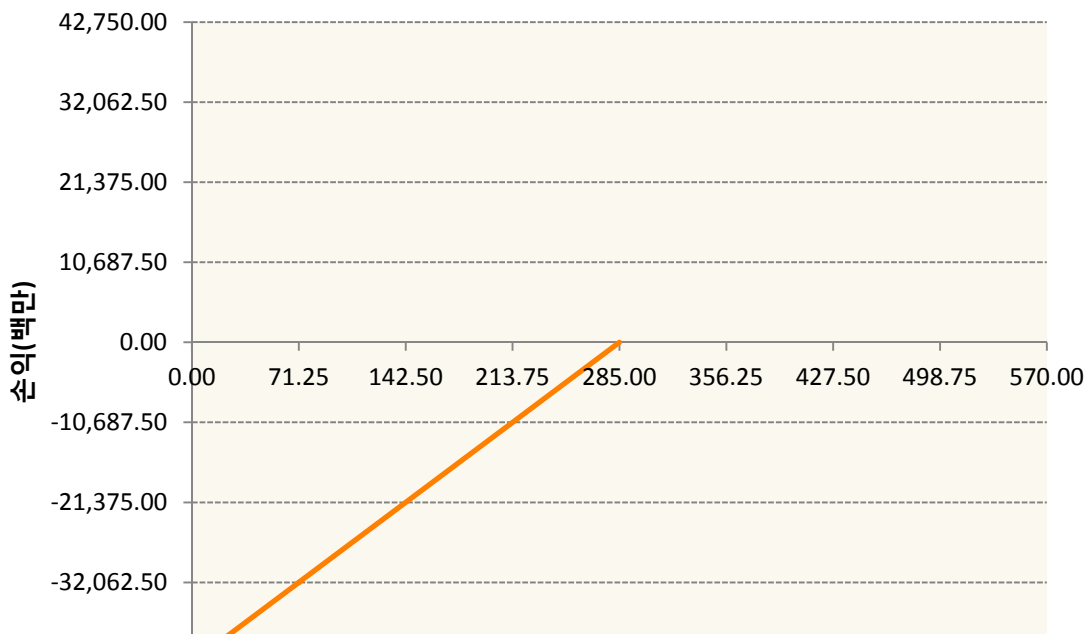




KR4301PC2824-2019-12 풋282.5



KR4301PC2857-2019-12 풋285



-42,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PC2825		2019-12 콜282.5						4,357
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	413	413	412	411	409	405	399	
-5.33%	412	409	405	397	385	368	346	
-2.67%	392	373	346	312	271	223	168	
0%	231	161	84	0	-89	-182	-279	
2.67%	-411	-533	-656	-779	-902	-1,026	-1,150	
5.33%	-1,849	-1,955	-2,064	-2,176	-2,291	-2,407	-2,524	
8.00%	-3,949	-3,997	-4,055	-4,121	-4,194	-4,273	-4,357	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						9,745
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	693	693	693	691	689	683	673	
-5.33%	692	690	684	672	653	625	586	
-2.67%	670	643	601	543	467	375	267	
0%	446	319	169	0	-186	-387	-600	
2.67%	-657	-938	-1,226	-1,518	-1,814	-2,114	-2,416	
5.33%	-3,590	-3,897	-4,208	-4,520	-4,834	-5,150	-5,466	
8.00%	-8,439	-8,614	-8,811	-9,025	-9,253	-9,494	-9,745	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						8,816
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-8,816	-8,816	-8,816	-8,816	-8,816	-8,816	-8,816	
-5.33%	-5,862	-5,862	-5,862	-5,862	-5,862	-5,862	-5,862	
-2.67%	-2,908	-2,908	-2,909	-2,909	-2,910	-2,912	-2,916	
0%	38	29	17	0	-21	-46	-76	
2.67%	2,640	2,571	2,501	2,430	2,358	2,285	2,212	
5.33%	3,707	3,669	3,625	3,577	3,525	3,470	3,413	
8.00%	3,797	3,795	3,791	3,785	3,776	3,764	3,749	
KR4301PC2857		2019-12 풋285						3,273
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,273	-3,273	-3,273	-3,273	-3,273	-3,273	-3,273	
-5.33%	-2,180	-2,180	-2,180	-2,180	-2,180	-2,180	-2,180	
-2.67%	-1,087	-1,087	-1,087	-1,087	-1,087	-1,088	-1,088	
0%	5	4	3	0	-4	-9	-15	
2.67%	1,050	1,033	1,014	993	972	950	927	

5.33%	1,668	1,645	1,620	1,595	1,569	1,543	1,517
8.00%	1,766	1,763	1,759	1,754	1,746	1,738	1,727

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

(단위:백만원)

25,000

공시일	2019-12-06
기준일	2019-12-05

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

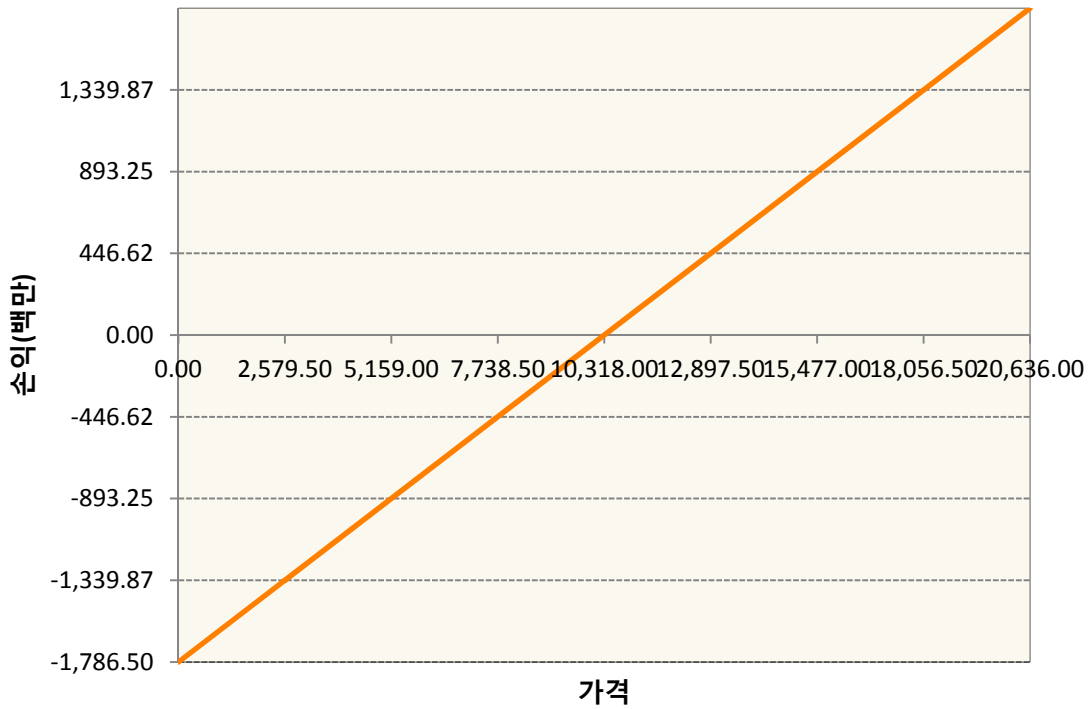
1. 계약금액

(단위:백만원)

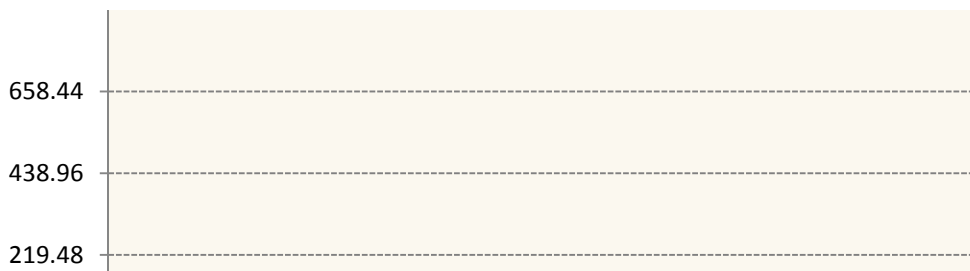
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,786	0	1,786	
누계	유가증권	옵션	0	4,979	-4,979	장내
누계	통화	선도	0	2,141	-2,141	장외

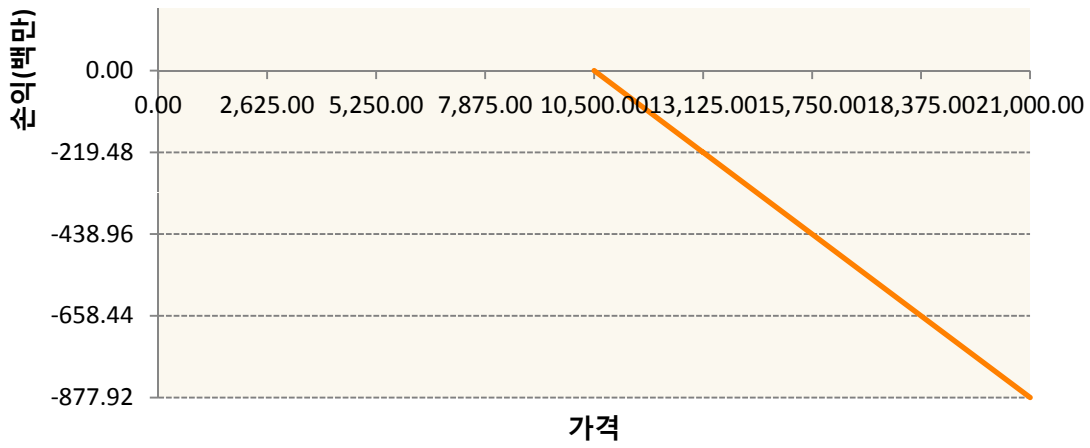
2. 만기시점의 손익구조

HCZ9-HSCEI Futures Dec19

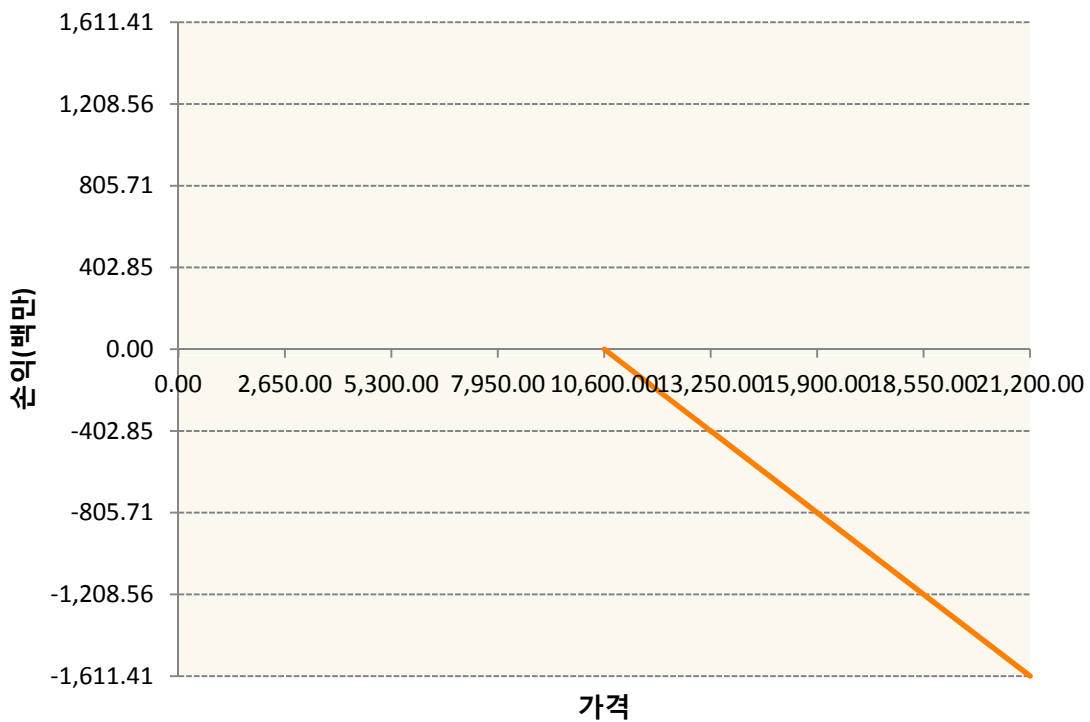


OHHIZ9-C105-HSCEI

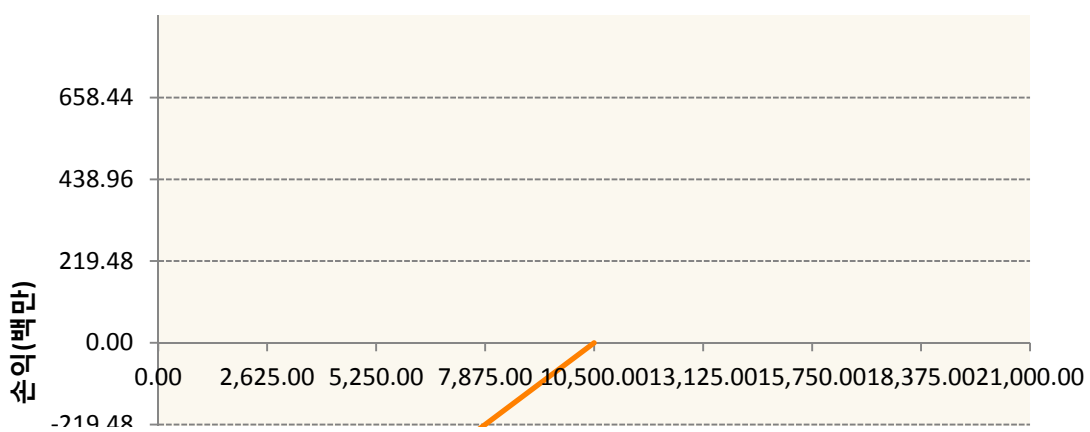


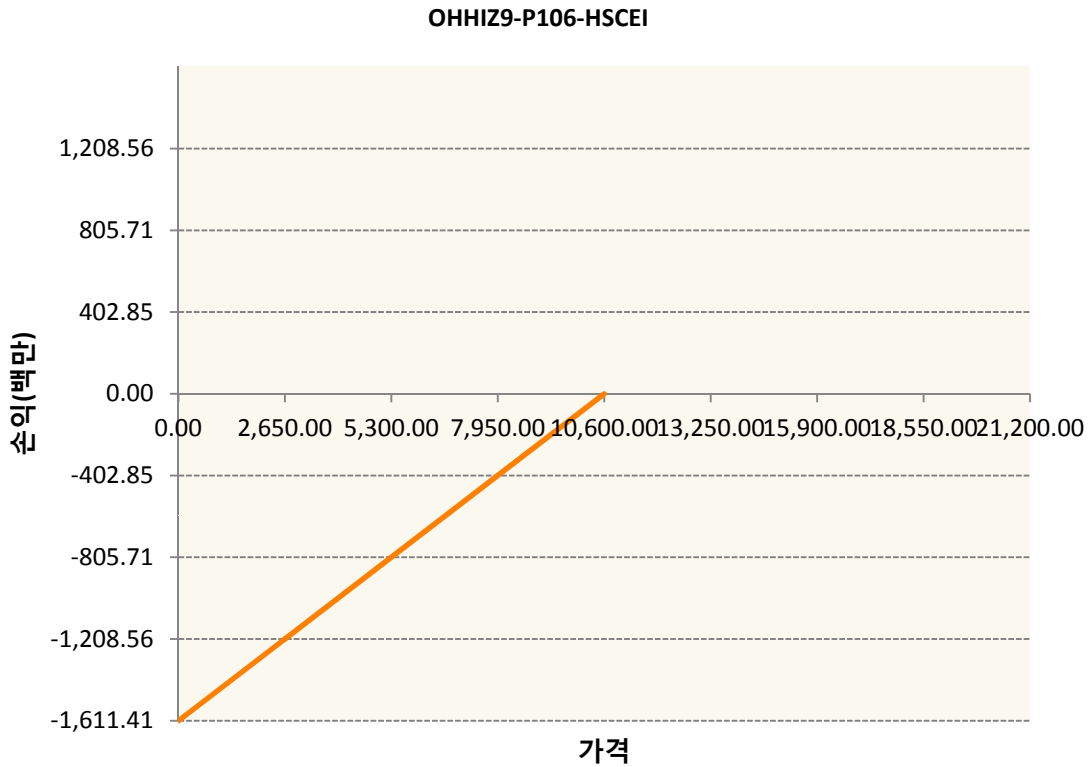


OHHIZ9-C106-HSCEI



OHHIZ9-P105-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	171
HCZ9 HSCEI Futures Dec19	143
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	2019-12-06
기준일	2019-12-05

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

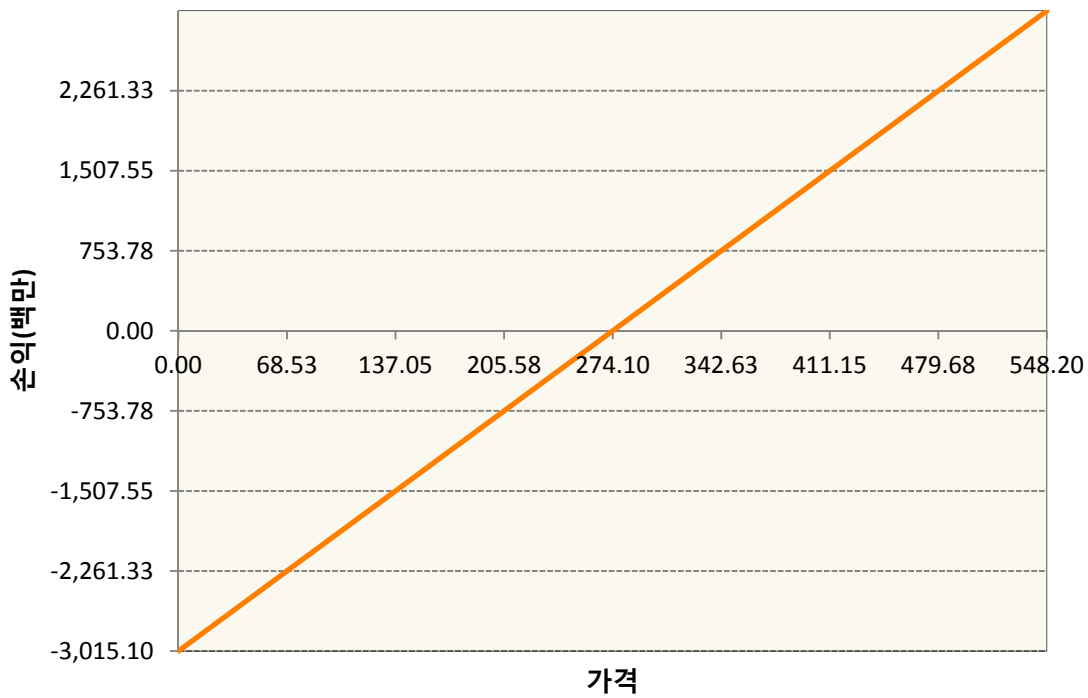
1. 계약금액

(단위:백만원)

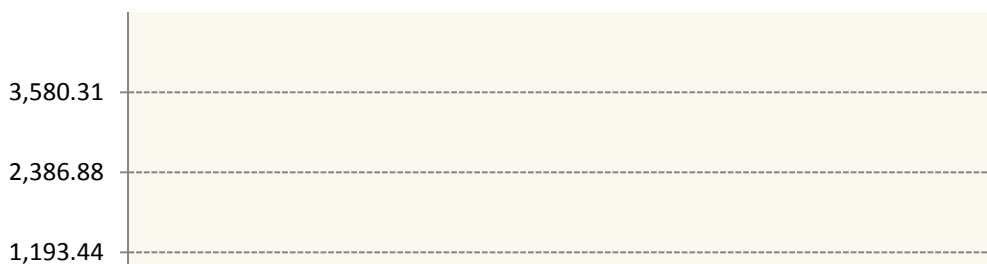
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,015	0	3,015	장내
누계	유가증권	스왑	9,625	0	9,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,514	-9,514	장내

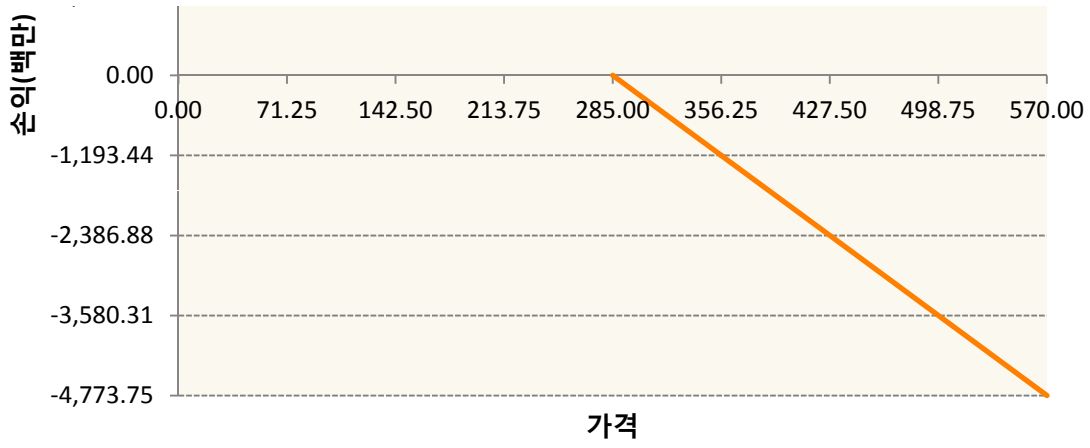
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

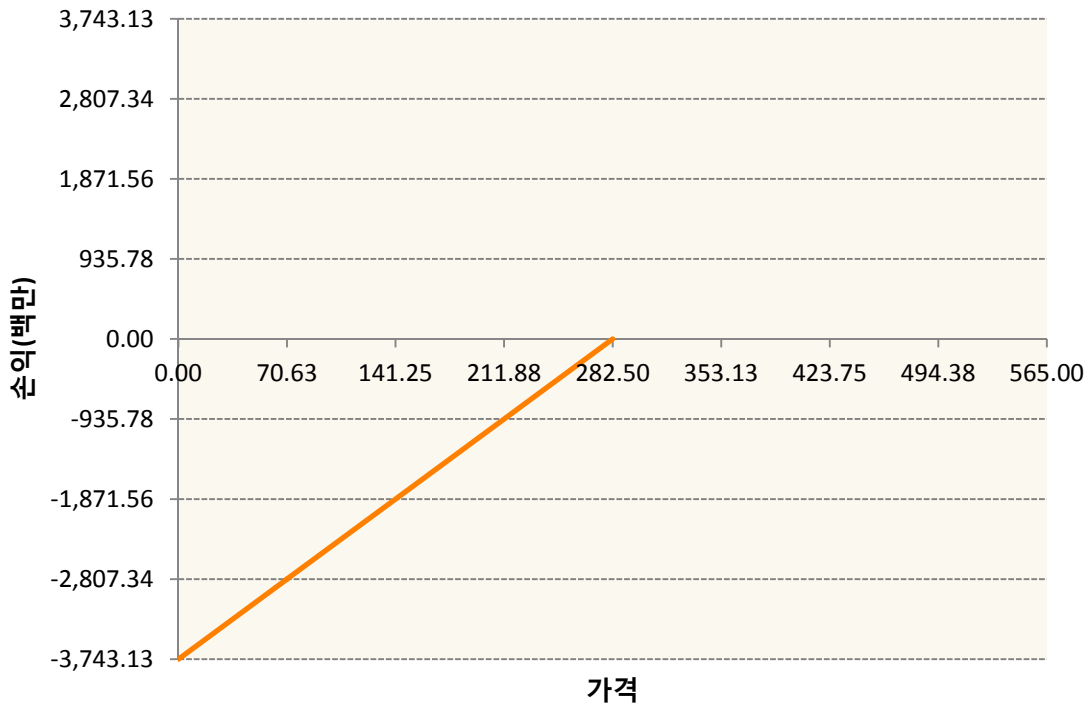


KR4201PC2858-2019-12 콜285

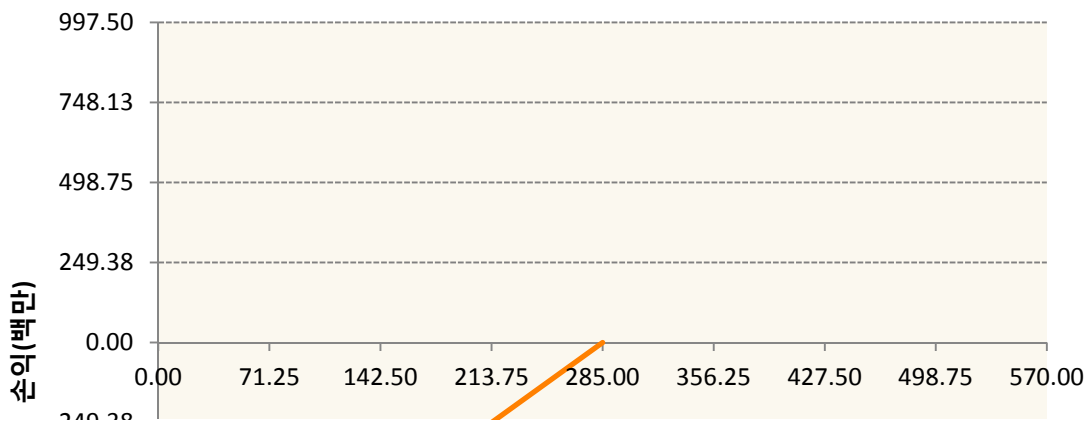




KR4301PC2824-2019-12 풋282.5



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%	-160	-160	-160	-160	-160	-160	-160	
-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%	160	160	160	160	160	160	160	
8.00%	241	241	241	241	241	241	241	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						190
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	13	12	11	
-2.67%	13	13	12	11	9	7	5	
0%	9	6	3	0	-4	-8	-12	
2.67%	-13	-18	-24	-30	-35	-41	-47	
5.33%	-70	-76	-82	-88	-94	-100	-106	
8.00%	-164	-168	-171	-176	-180	-185	-190	
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%	-192	-192	-192	-192	-192	-192	-192
-2.67%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-95
0%	1	1	1	0	-1	-2	-2
2.67%	86	84	82	79	77	75	72
5.33%	121	120	118	117	115	113	112
8.00%	124	124	124	124	123	123	122
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	0
2.67%	24	24	24	23	23	22	22
5.33%	39	38	38	37	37	36	35
8.00%	41	41	41	41	41	41	40

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

(단위:백만원)

1,585

공시일	2019-12-06
기준일	2019-12-05

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

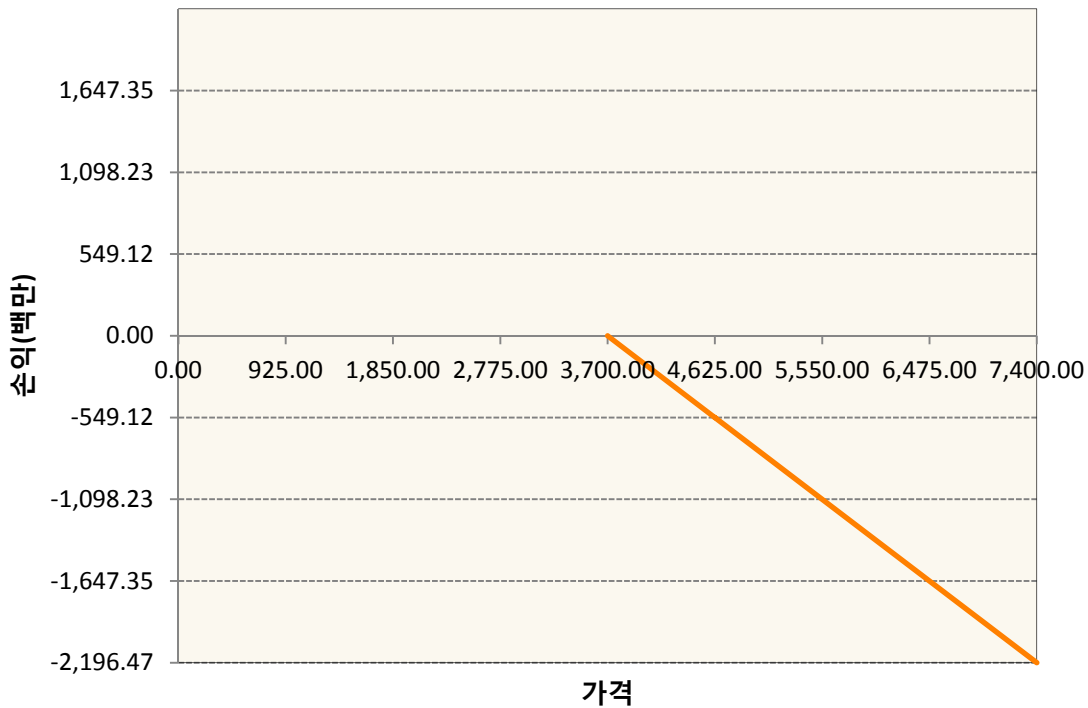
1. 계약금액

(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	1,042	0	1,042	
누계	유가증권	스왑	18,037	0	18,037	장외
누계	유가증권	옵션	0	8,324	-8,324	장내
누계	통화	선도	2,739	6,200	-3,461	장외

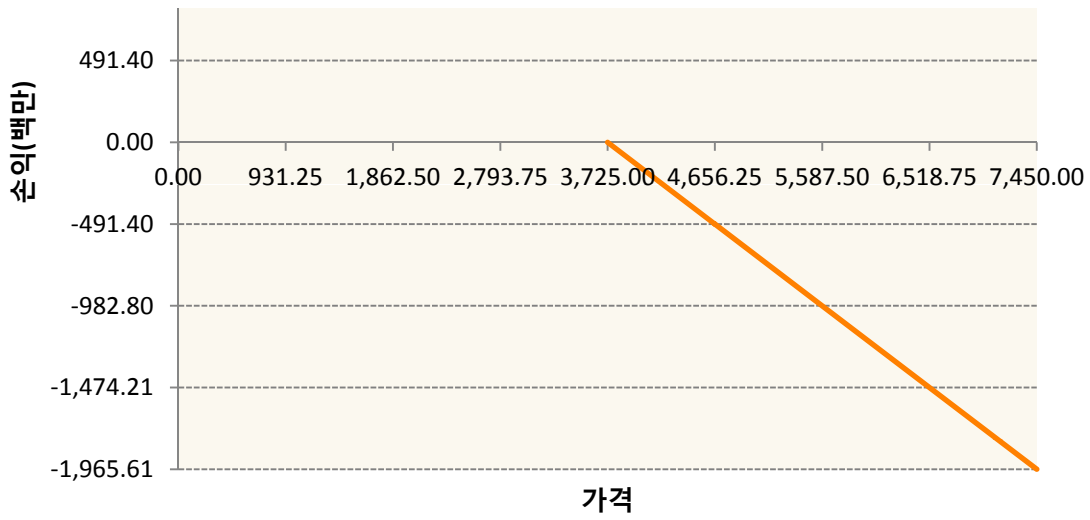
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ9-C3700-EURO STOXX 50

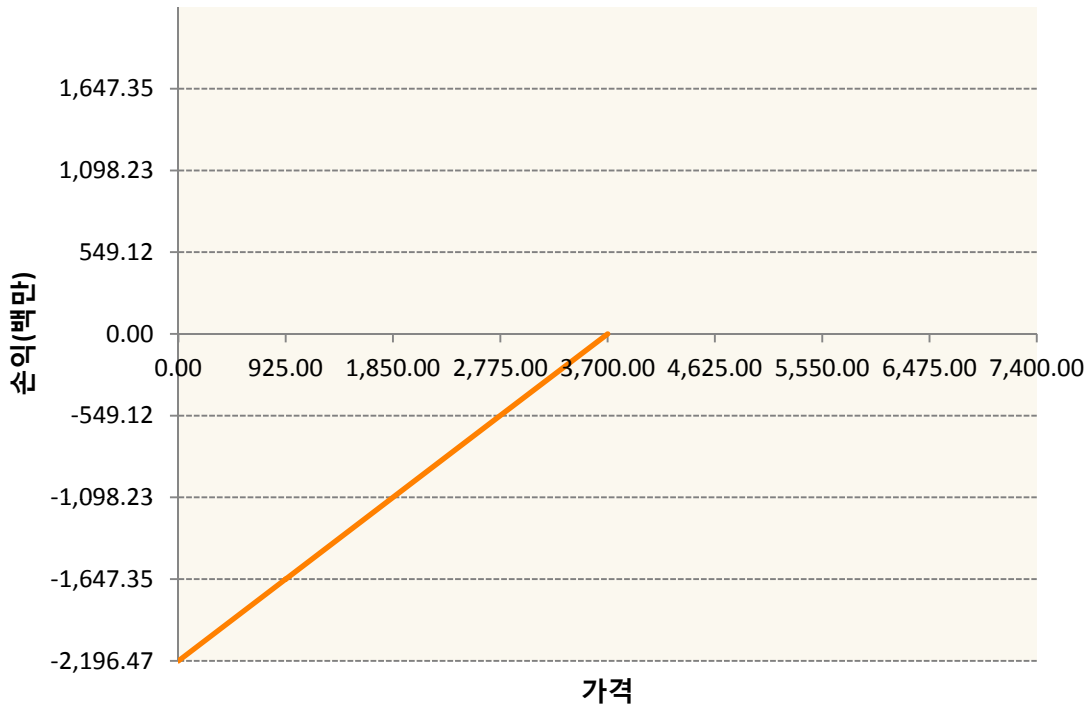


OESXZ9-C3725-EURO STOXX 50

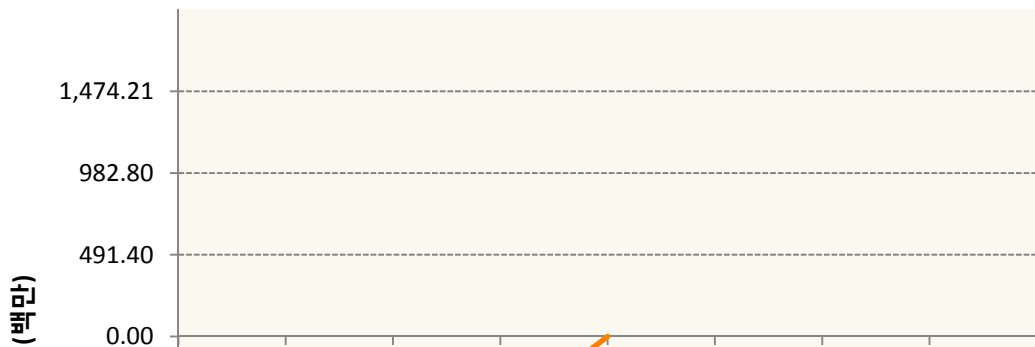


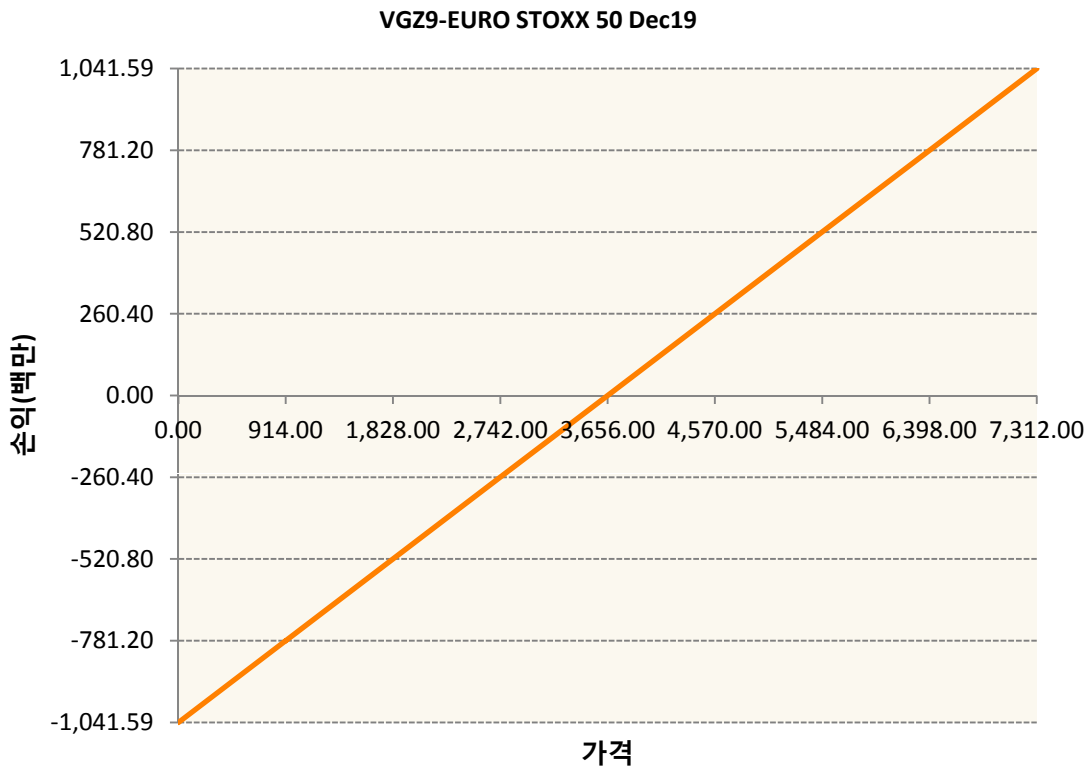
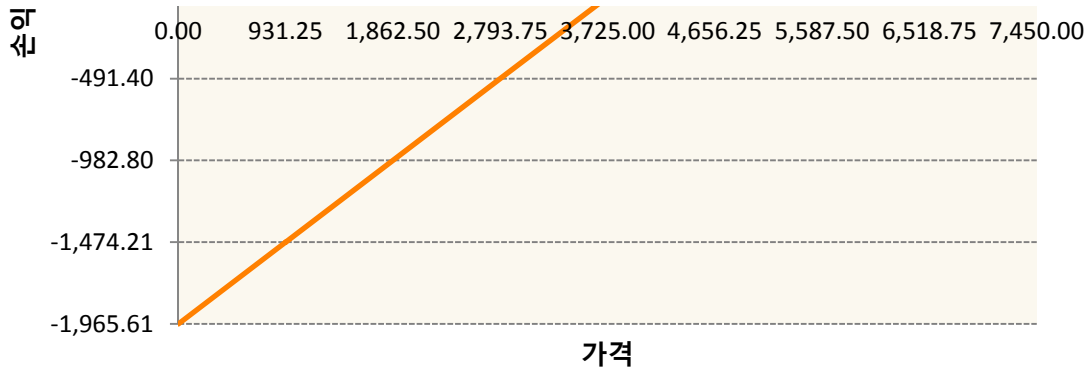


OESXZ9-P3700-EURO STOXX 50



OESXZ9-P3725-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	13
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E	496
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E	166
FX21019X02 EUR/KRW 27-12-19E	53
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	176
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	157
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	176
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	157
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19	83

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

(단위:백만원)

844

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

(단위:백만원)

891

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

(단위:백만원)

78

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

(단위:백만원)

121

공시일	2019-12-06
기준일	2019-12-05

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

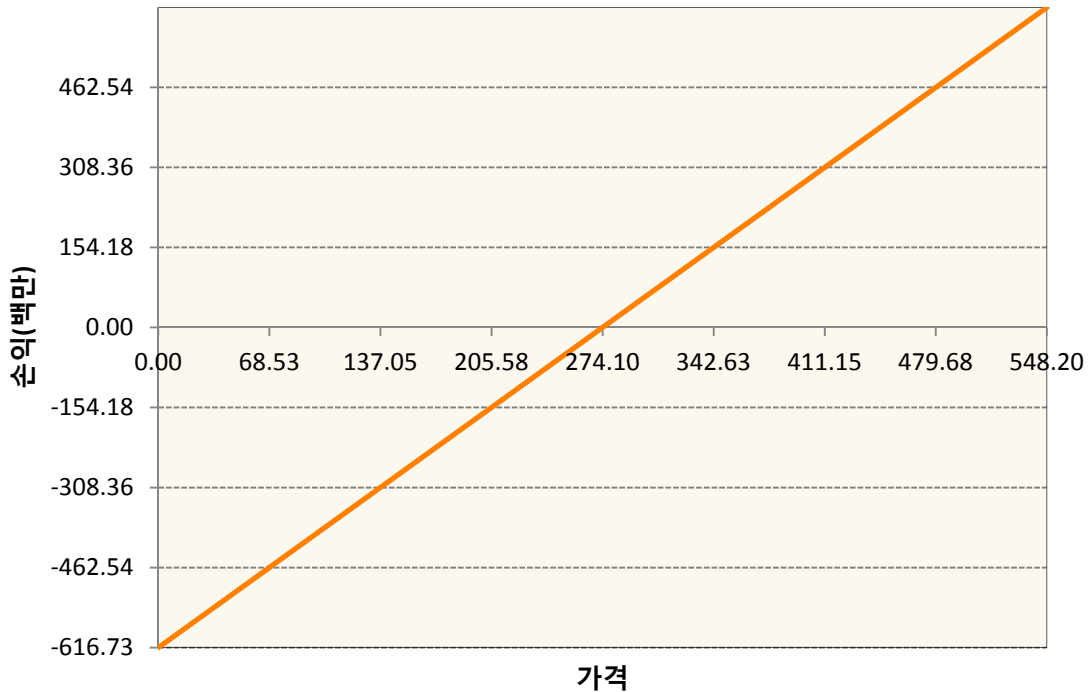
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	617	0	617	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	2019-12-06
기준일	2019-12-05

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

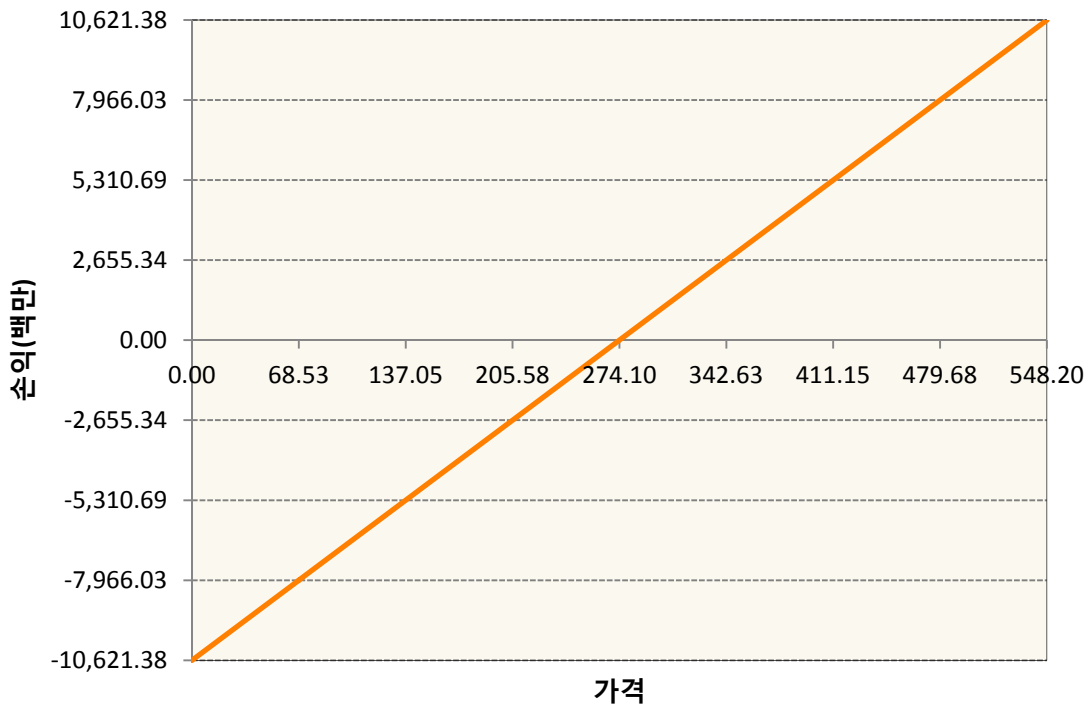
1. 계약금액

(단위:백만원)

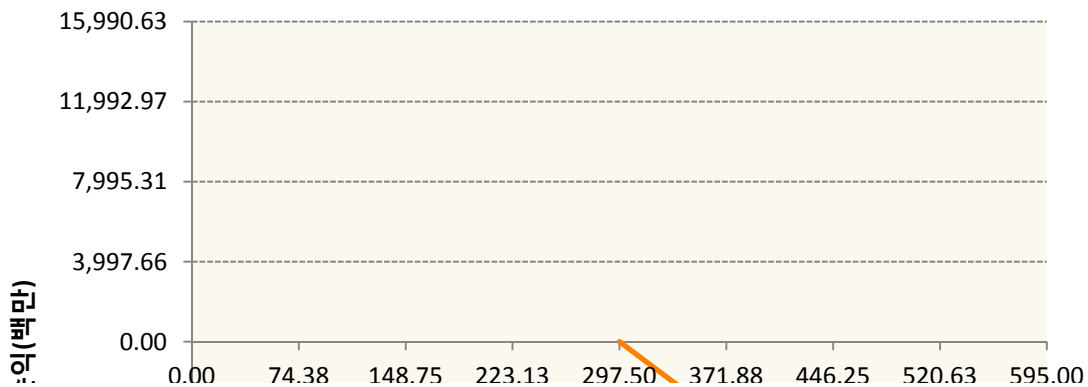
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,621	0	10,621	장내
누계	유가증권	옵션	1,277	21,241	-19,964	장내

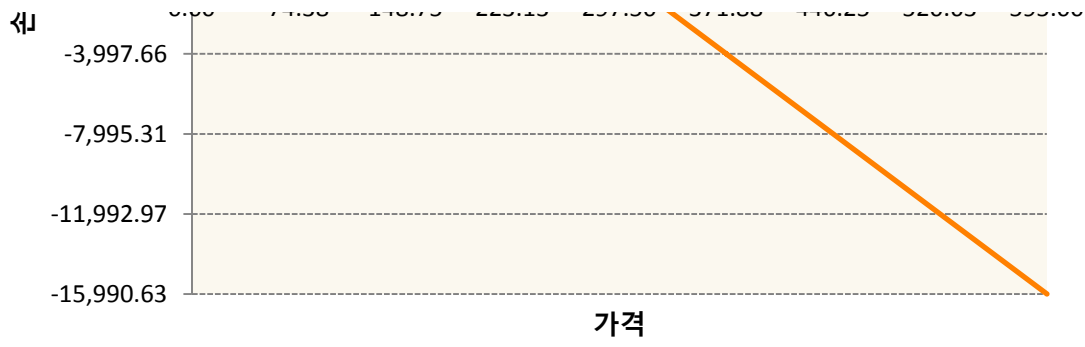
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

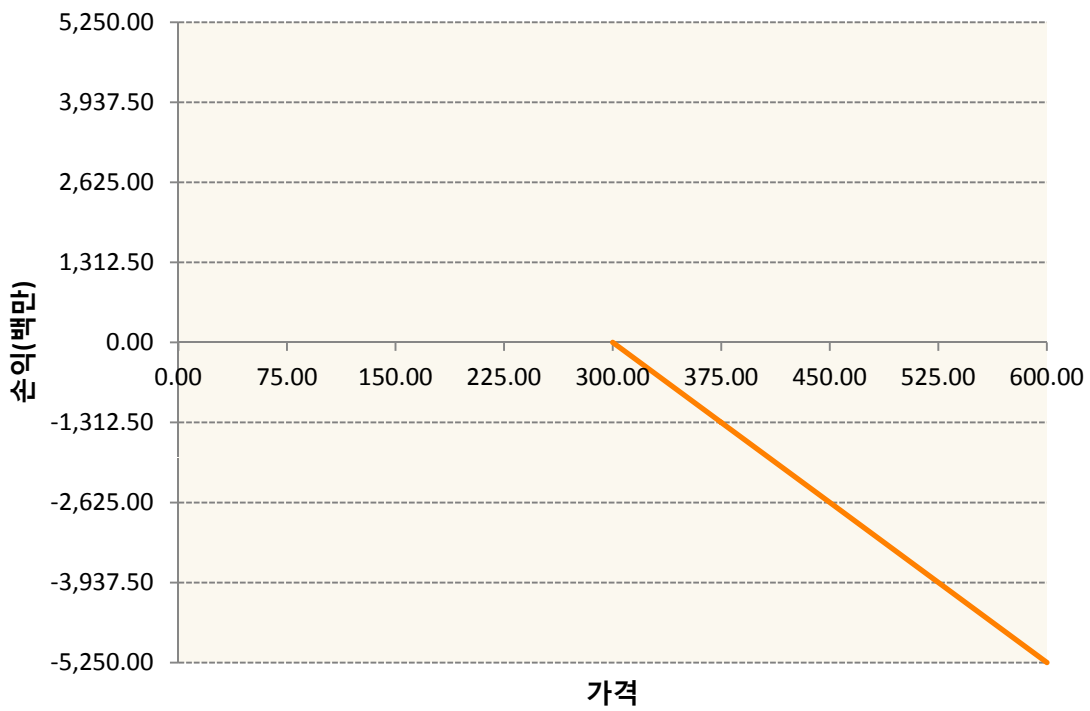


KR4201PC2973-2019-12 콜297.5

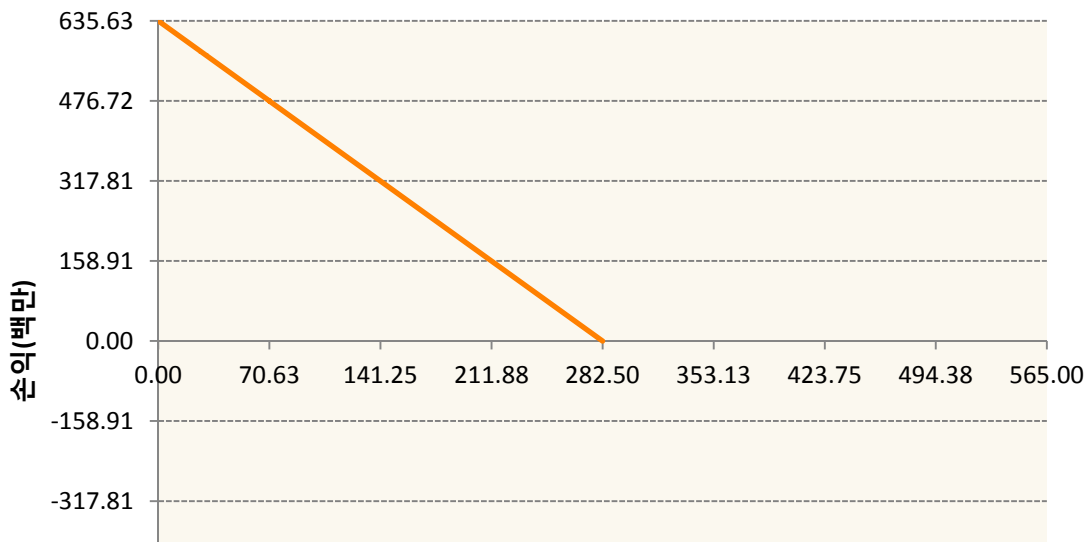


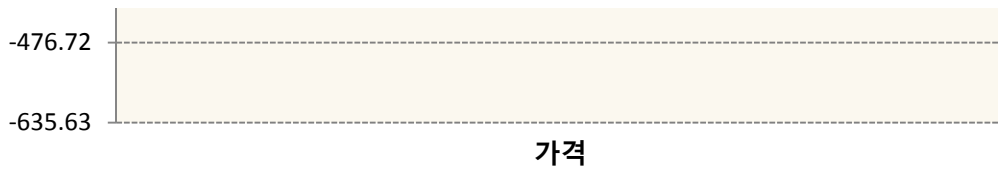


KR4201PC3005-2019-12 콜300

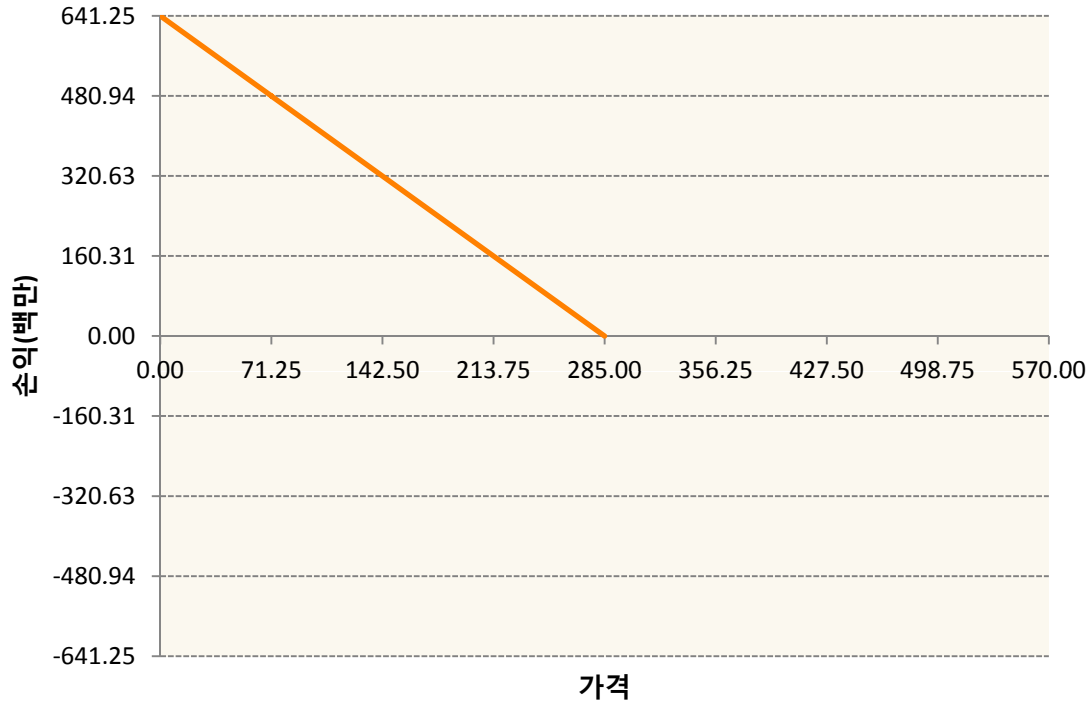


KR4301PC2824-2019-12 풋282.5





KR4301PC2857-2019-12 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						847
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-847	-847	-847	-847	-847	-847	-847	
-5.33%	-565	-565	-565	-565	-565	-565	-565	
-2.67%	-282	-282	-282	-282	-282	-282	-282	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	282	282	282	282	282	282	282	
5.33%	565	565	565	565	565	565	565	
8.00%	847	847	847	847	847	847	847	
KR4201PC2973		2019-12 콜297.5						250
		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	3	3	
-2.67%	3	3	3	3	2	2	0	

0%	3	3	2	0	-2	-6	-10
2.67%	-1	-4	-9	-15	-22	-31	-40
5.33%	-27	-39	-52	-66	-81	-97	-113
8.00%	-127	-147	-168	-188	-209	-229	-250
KR4201PC3005 2019-12 콜300							65
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	0	0	0
0%	1	0	0	0	0	-1	-2
2.67%	0	-1	-2	-3	-5	-7	-9
5.33%	-5	-8	-11	-15	-19	-23	-28
8.00%	-27	-33	-39	-46	-52	-58	-65
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%	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	-14	-14	-13	-13	-13	-12
5.33%	-21	-20	-20	-20	-20	-19	-19
8.00%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
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%	-16	-15	-15	-15	-15	-14	-14
5.33%	-25	-25	-24	-24	-24	-23	-23
8.00%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26

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

(단위:백만원)

864

공시일	2019-12-06
기준일	2019-12-05

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	207,833	0	207,833	

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	2019-12-06
기준일	2019-12-05

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	216,906	0	216,906	

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	2019-12-06
기준일	2019-12-05

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	550,478	0	550,478	
누계	통화	선도	0	605,931	-605,931	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		667
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		705
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,714
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,856
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,428
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,533
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		952
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		952
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		952
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		952
FX21019V04 KRW/USD 06-12-19E		476
FX21019X00 KRW/USD 06-12-19E		667
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		476
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		476
FX21019X00 KRW/USD 10-12-19E		476
FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E		1,562
FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E		952
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		476
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		952
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		1,562
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		1,904
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		3,275
FX21019X02 KRW/USD 26-12-19E		4,799
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		4,856
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		190
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,856

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

2,856
2,380
2,571

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

(단위:백만원)

15,285

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

(단위:백만원)

177

공시일	2019-12-06
기준일	2019-12-05

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

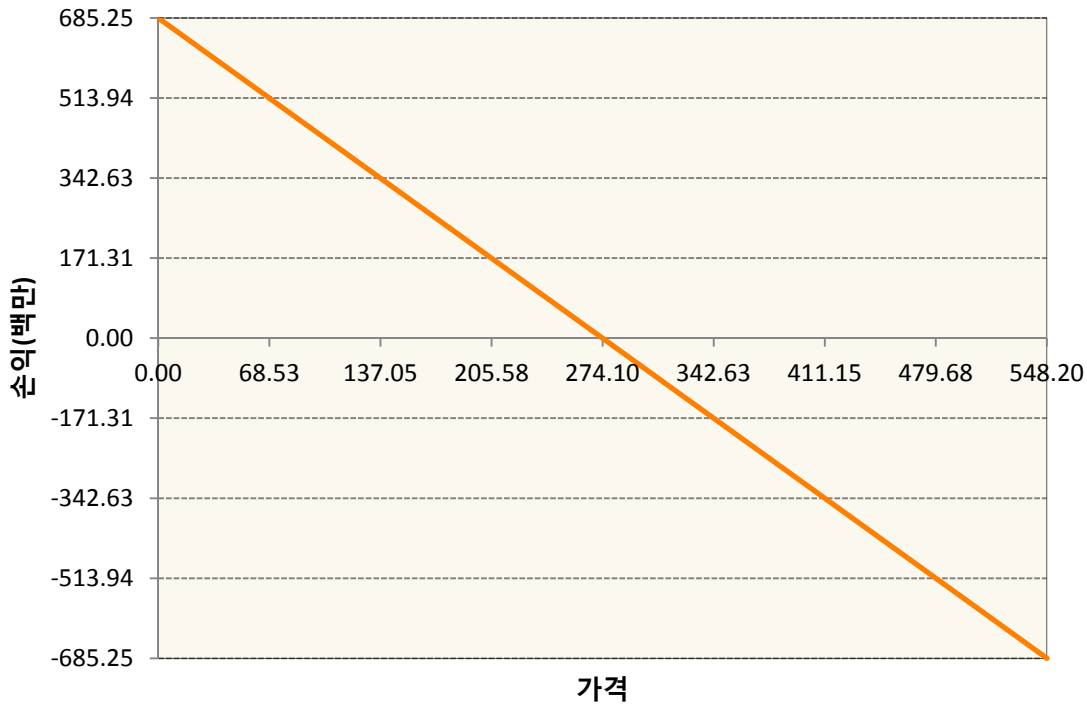
1. 계약금액

(단위:백만원)

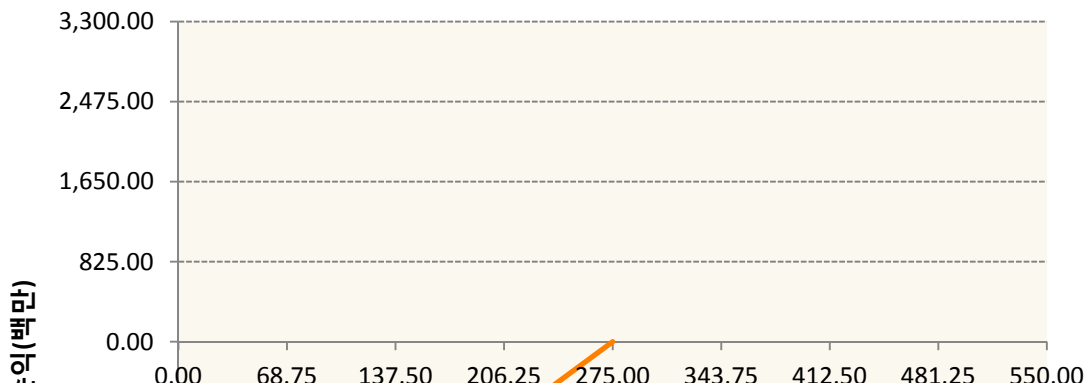
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	685	-685	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,994	-3,994	장내

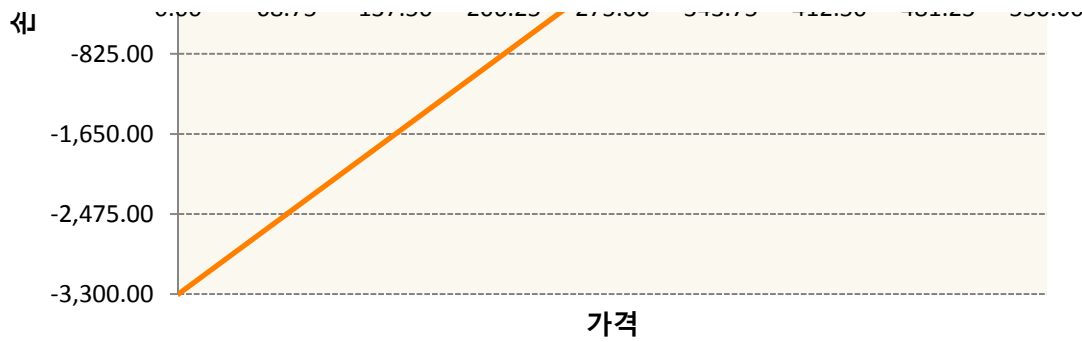
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

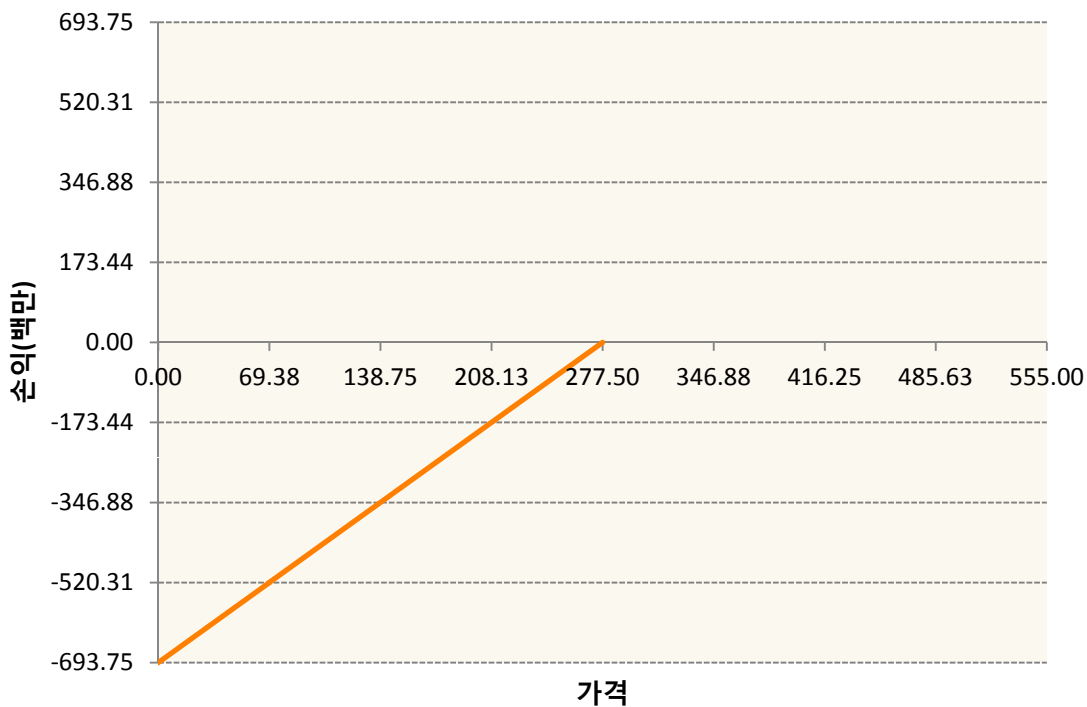


KR4301PC2758-2019-12 풋275





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%	36	36	36	36	36	36	36	
-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%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	
8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55	
KR4301PC2758		2019-12 풋275						245
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-245	-245	-245	-245	-245	-245	-245
-5.33%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
-2.67%	-71	-71	-71	-72	-72	-73	-74
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	36	35	34	33	31	30	28
5.33%	38	38	38	38	38	37	37
8.00%	38	38	38	38	38	38	38
KR4301PC2774 2019-12 풋277.5							53
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-2.67%	-16	-16	-17	-17	-17	-17	-17
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	11	11	10	10	9	9	9
5.33%	12	12	12	12	12	12	12
8.00%	12	12	12	12	12	12	12

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

(단위:백만원)

438

공시일	2019-12-06
기준일	2019-12-05

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	15,228	0	15,228	
누계	통화	선도	0	15,020	-15,020	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019V01 KRW/USD 10-12-19E		377
FX21019X01 KRW/USD 13-01-20E		233
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		295
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		296

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

(단위:백만원)

379

공시일	2019-12-06
기준일	2019-12-05

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	1,013	0	1,013	장외
누계	통화	선도	317	356	-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	2019-12-06
기준일	2019-12-05

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

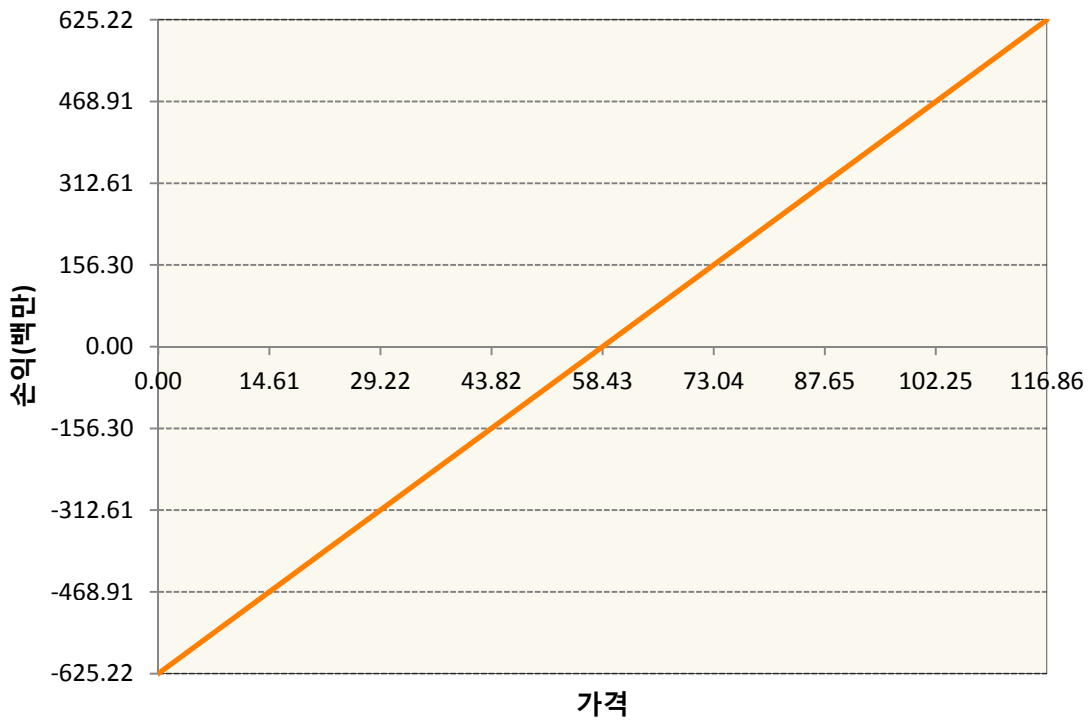
1. 계약금액

(단위:백만원)

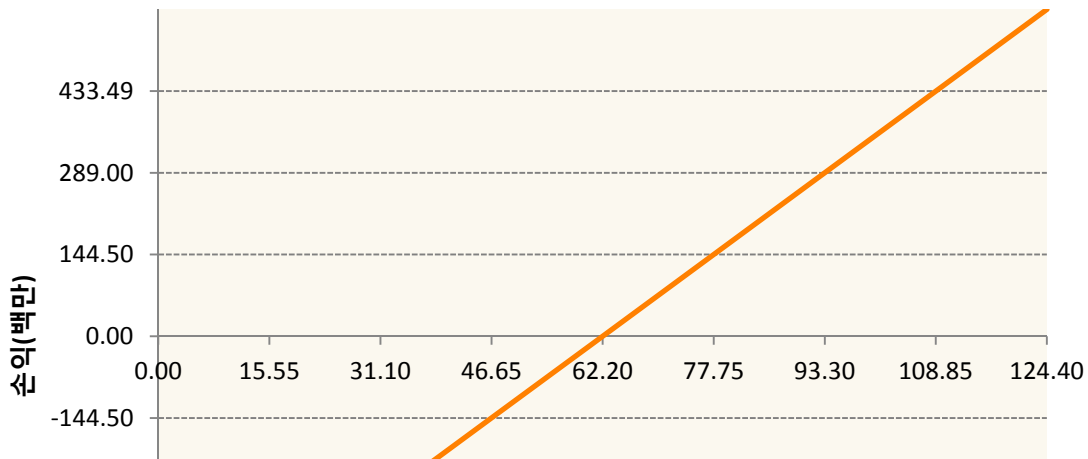
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,441	298	2,143	

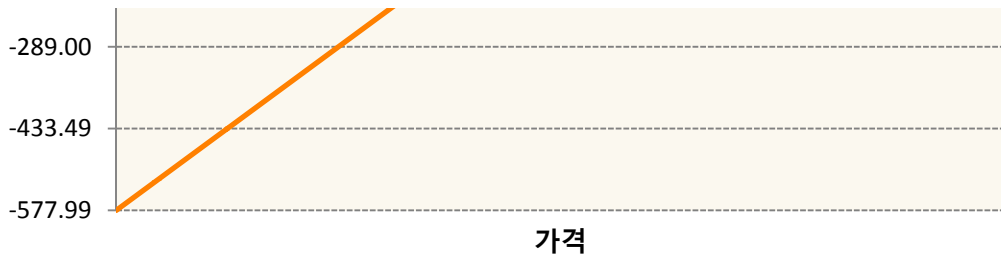
2. 만기시점의 손익구조

CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20

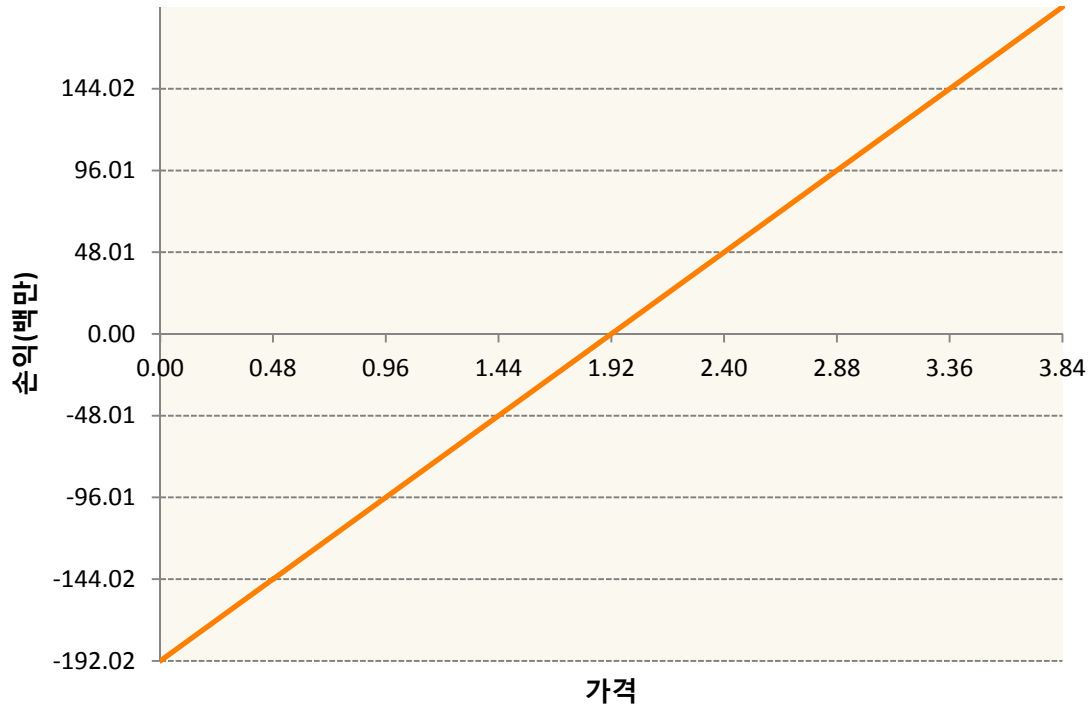


COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20

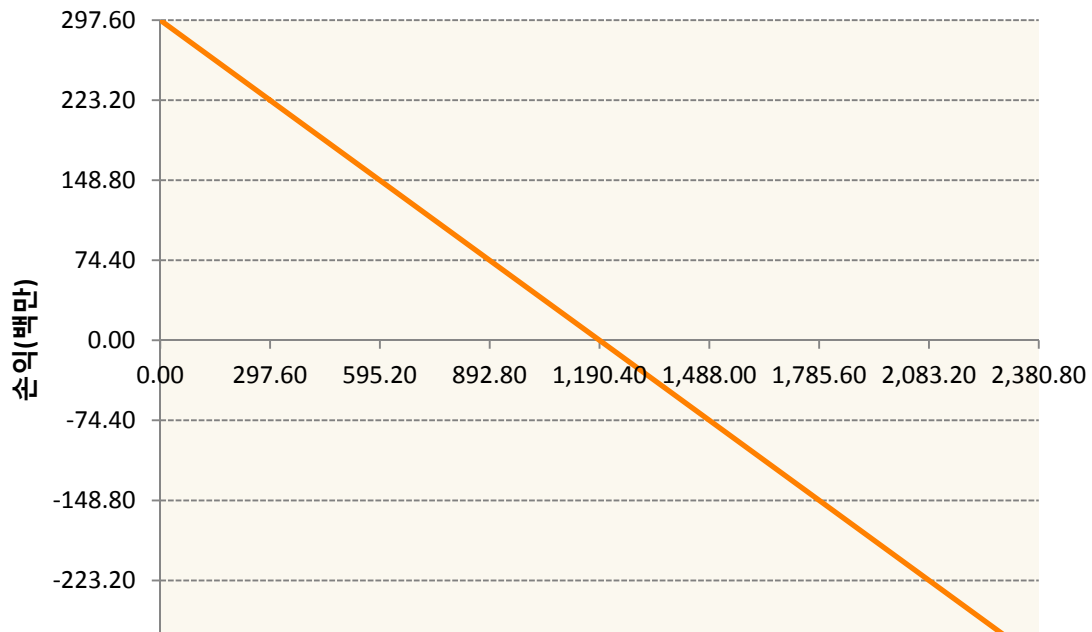


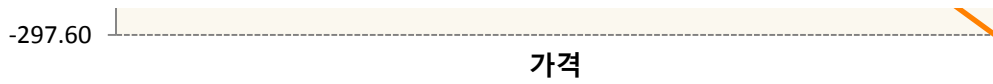


HOF0-NY Harb ULSD Fut Jan20

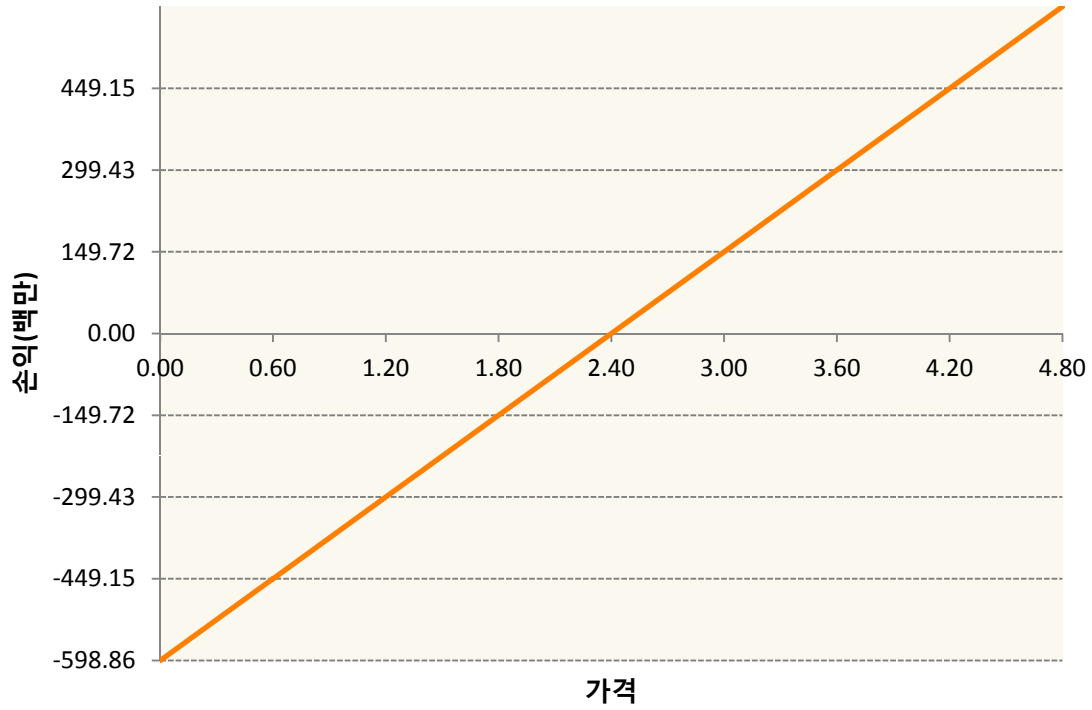


KR4175PC0003-2019-12 달러선물

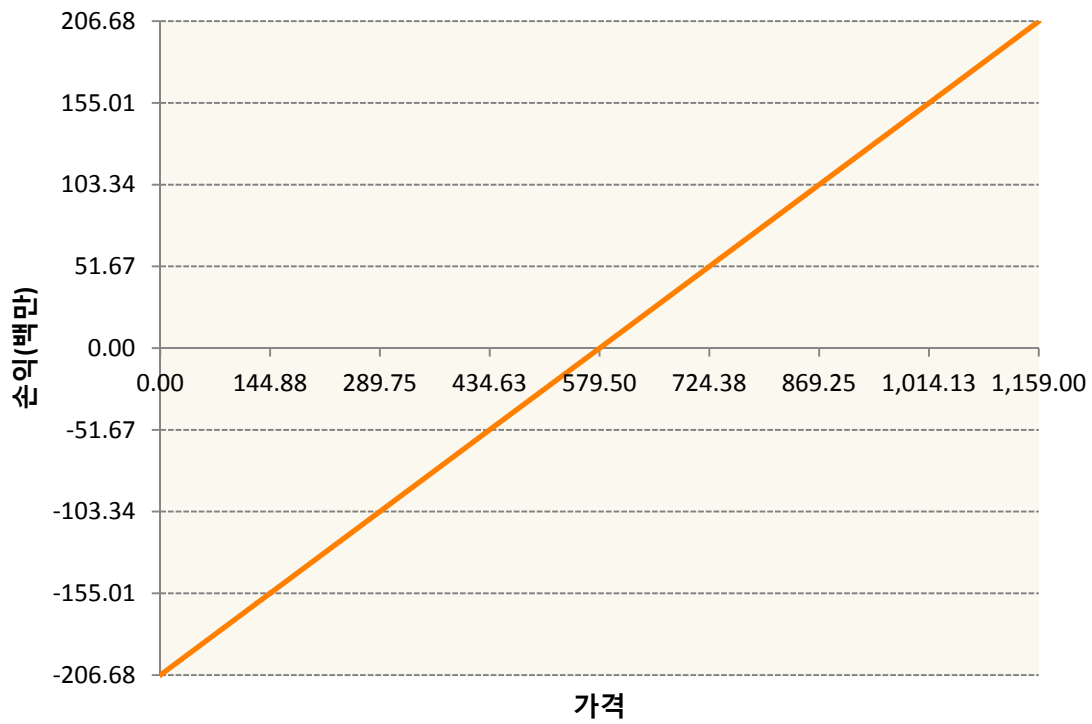




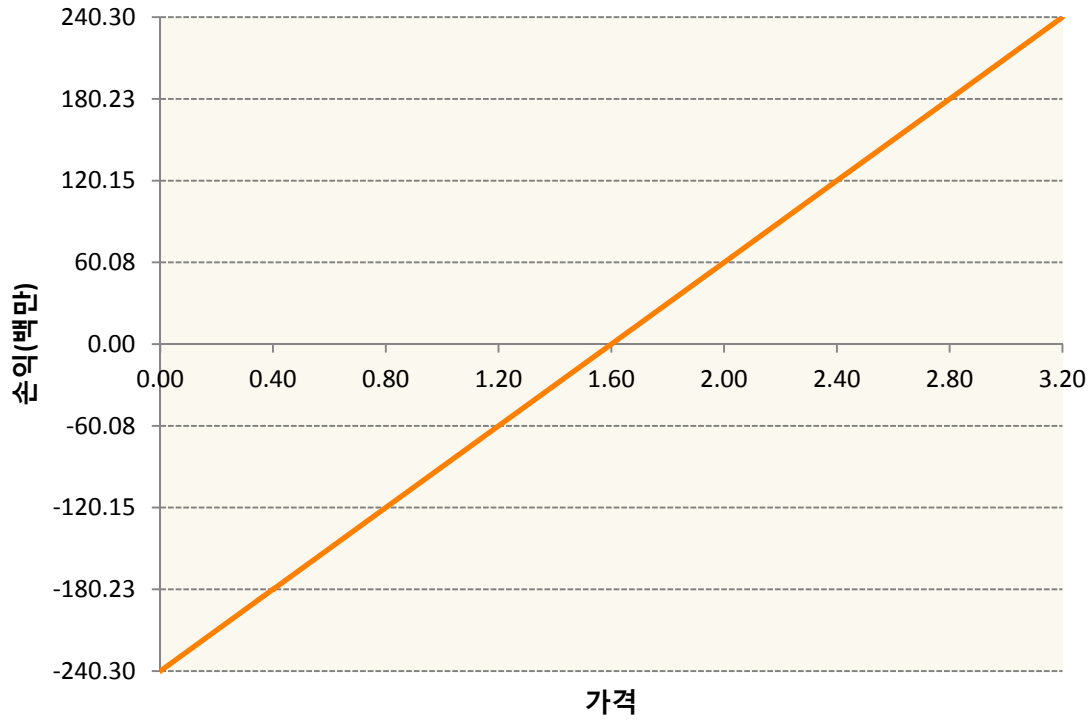
NGF20-NATURAL GAS FUTR Jan20



QSF0-Low Su Gasoil G Jan20



XBF0-GASOLINE RBOB FUT Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLF0	WTI CRUDE FUTURE Jan20	50
COH0	BRENT CRUDE FUTR Mar20	46
HOF0	NY Harb ULSD Fut Jan20	15
KR4175PC00	2019-12 달러선물	24
NGF20	NATURAL GAS FUTR Jan20	48
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	17
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	19

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

(단위:백만원)

401

공시일	2019-12-06
기준일	2019-12-05

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

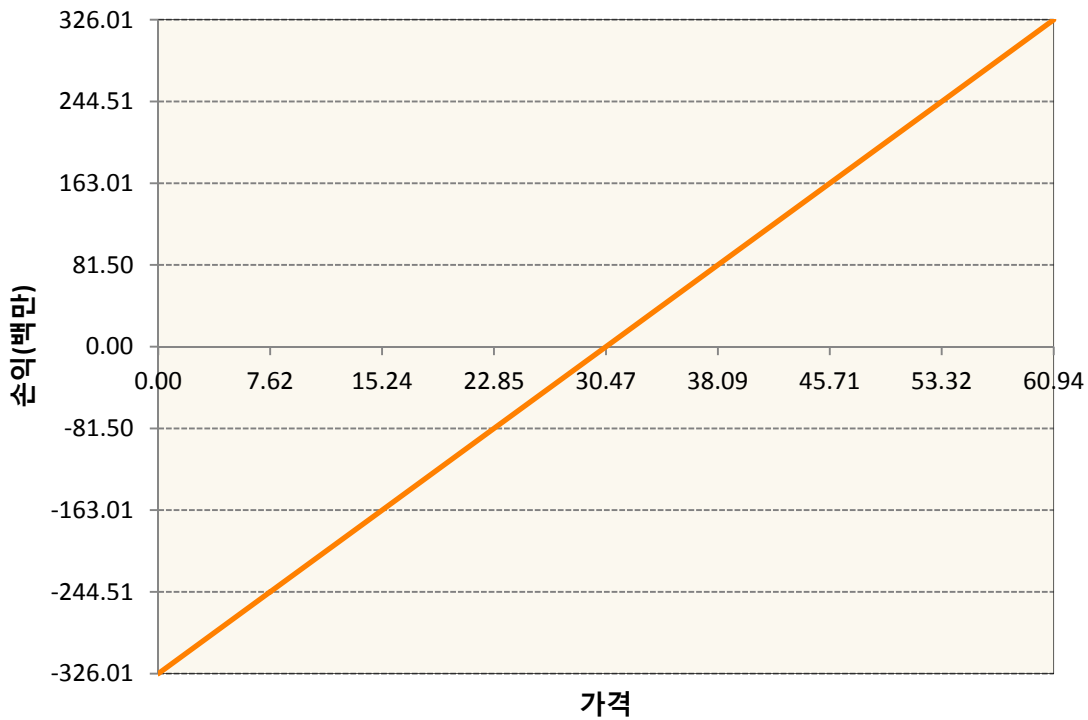
1. 계약금액

(단위:백만원)

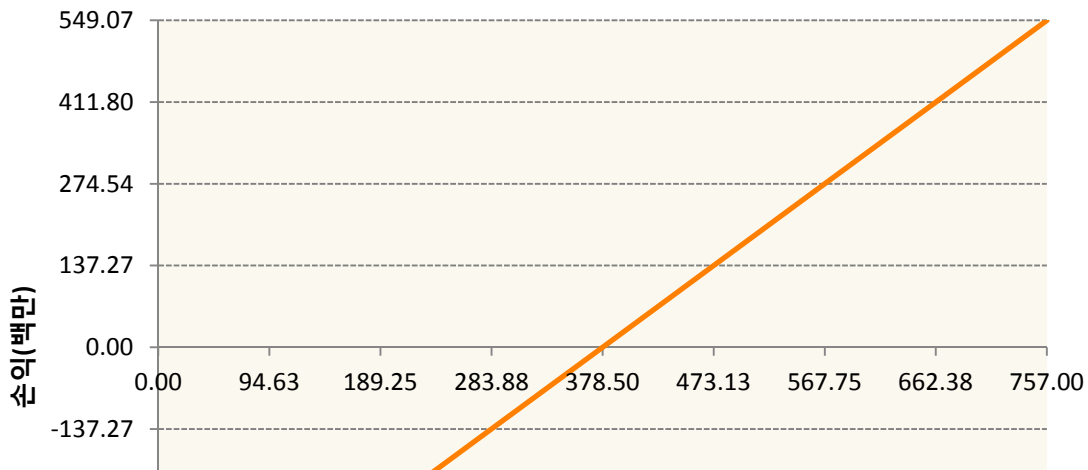
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,778	95	2,683	

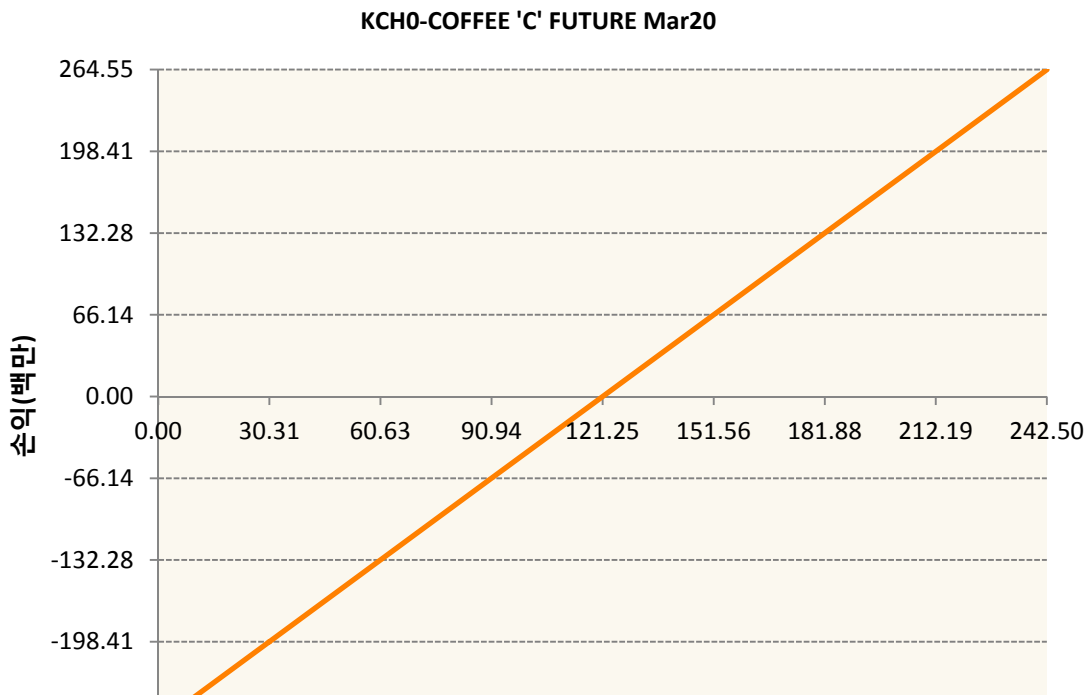
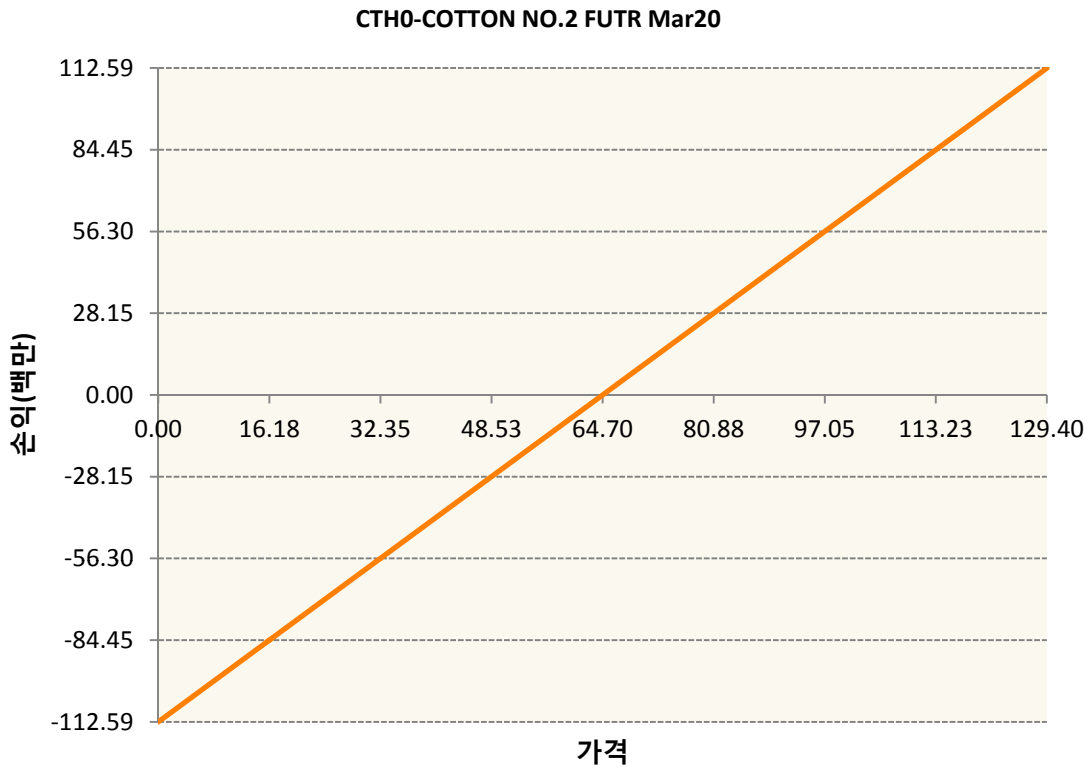
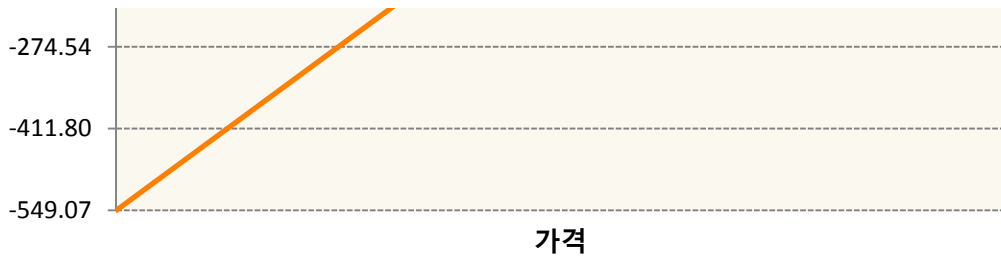
2. 만기시점의 손익구조

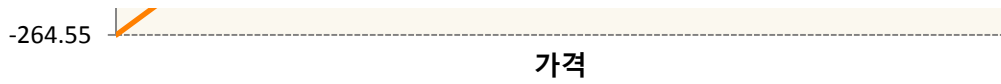
BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20



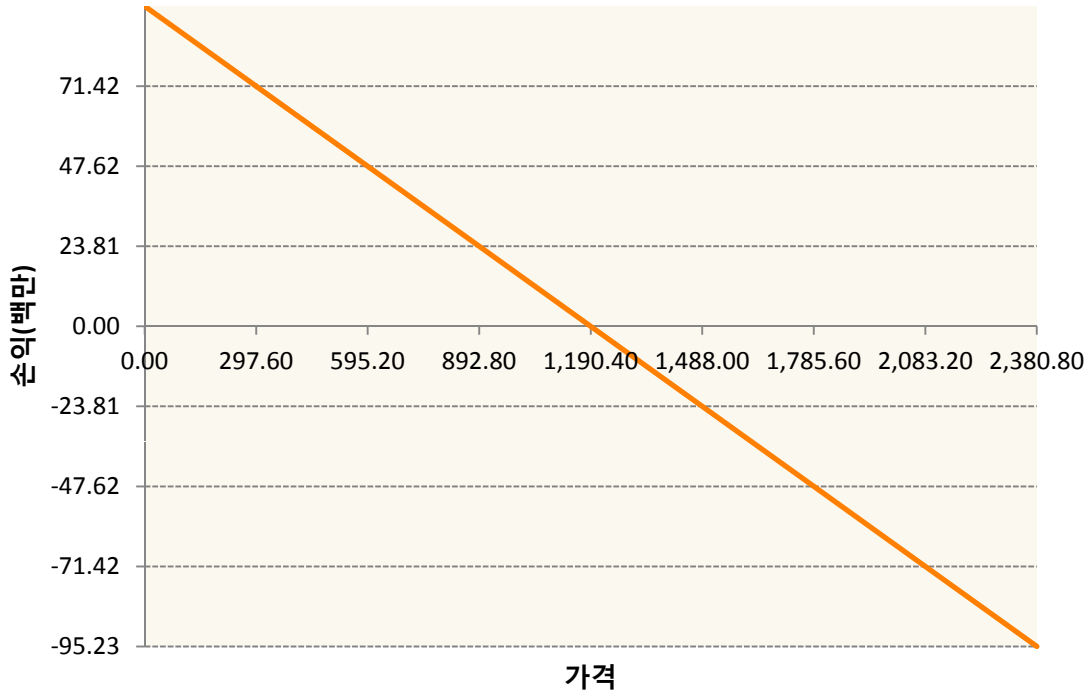
CH0-CORN FUTURE Mar20



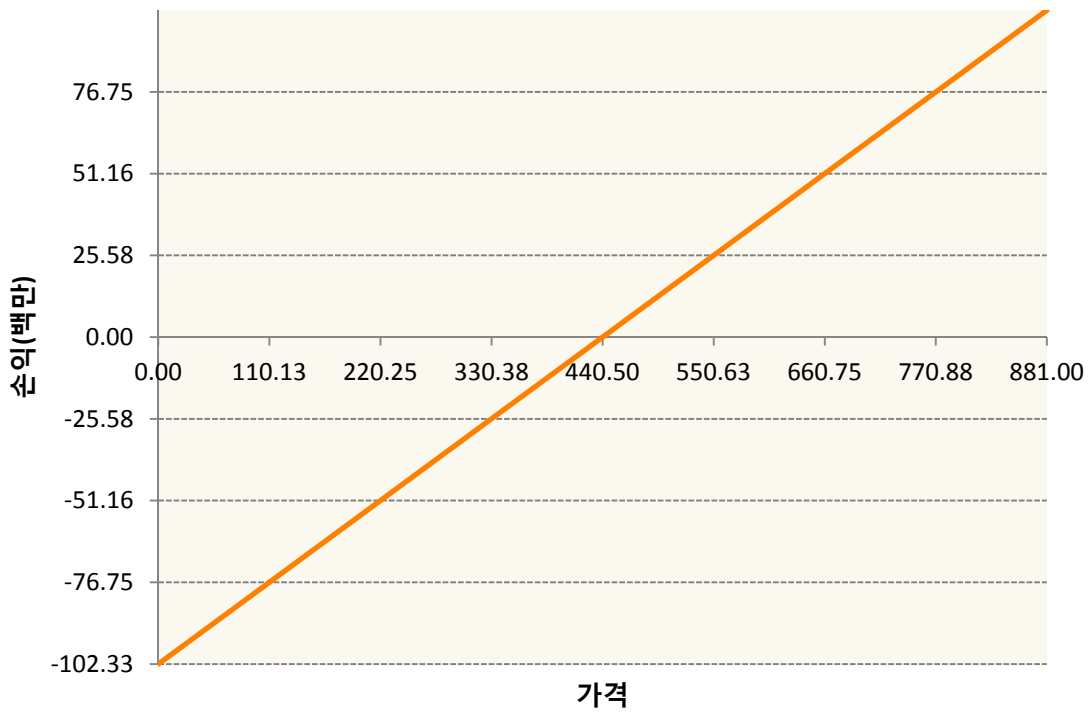




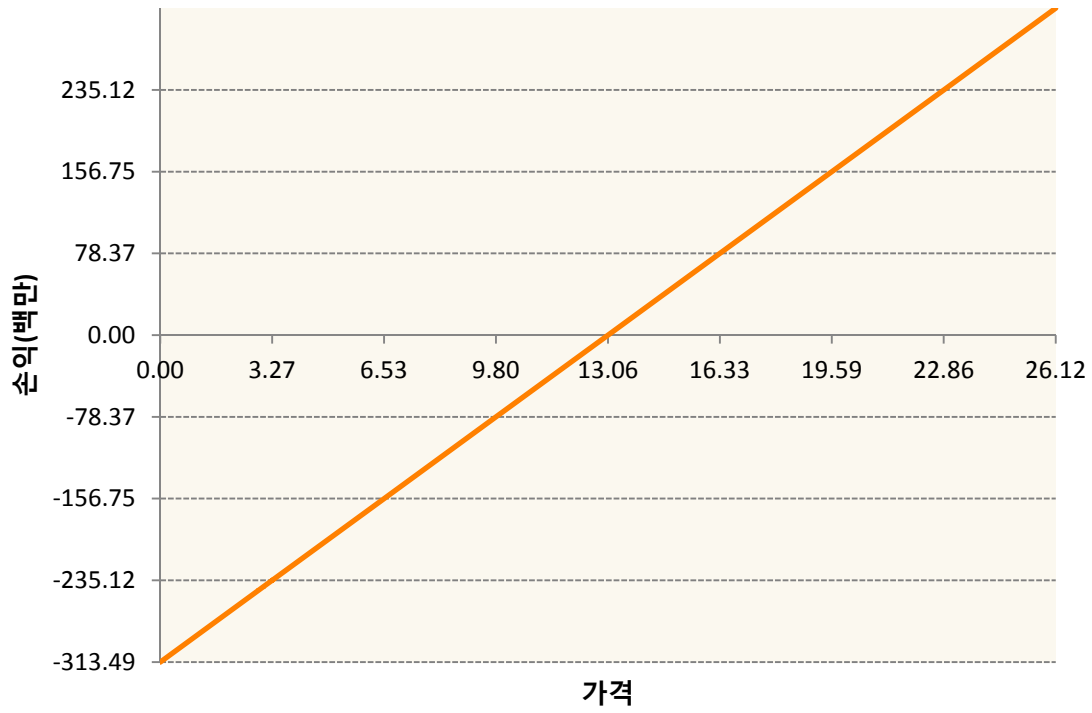
KR4175PC0003-2019-12 달러선물



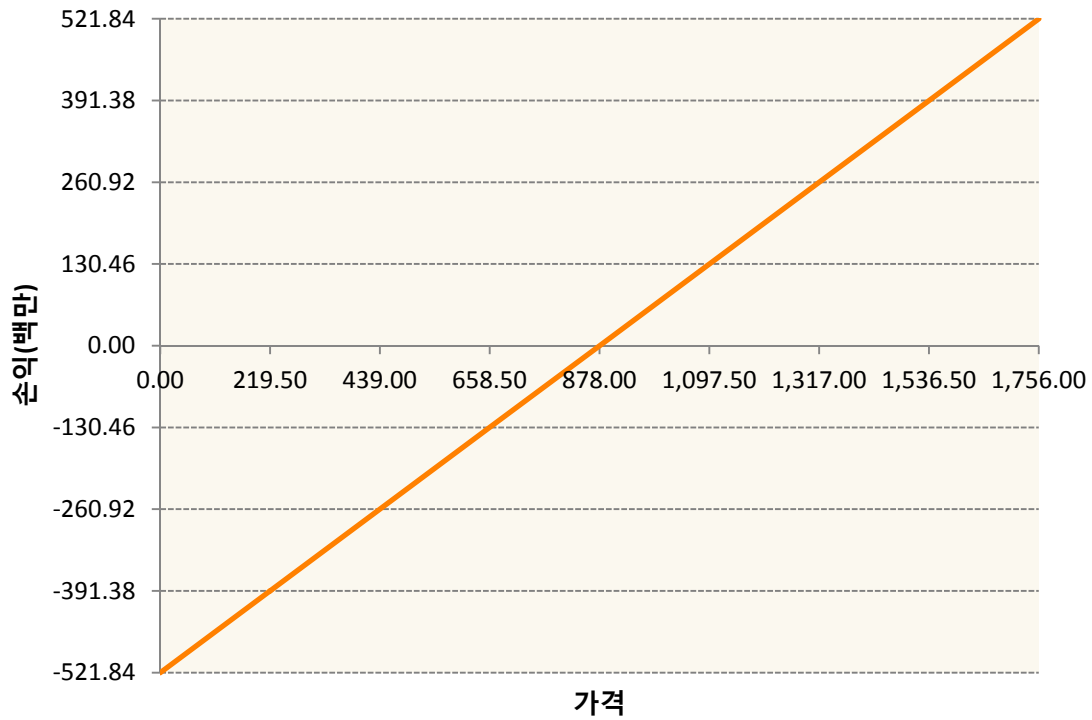
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

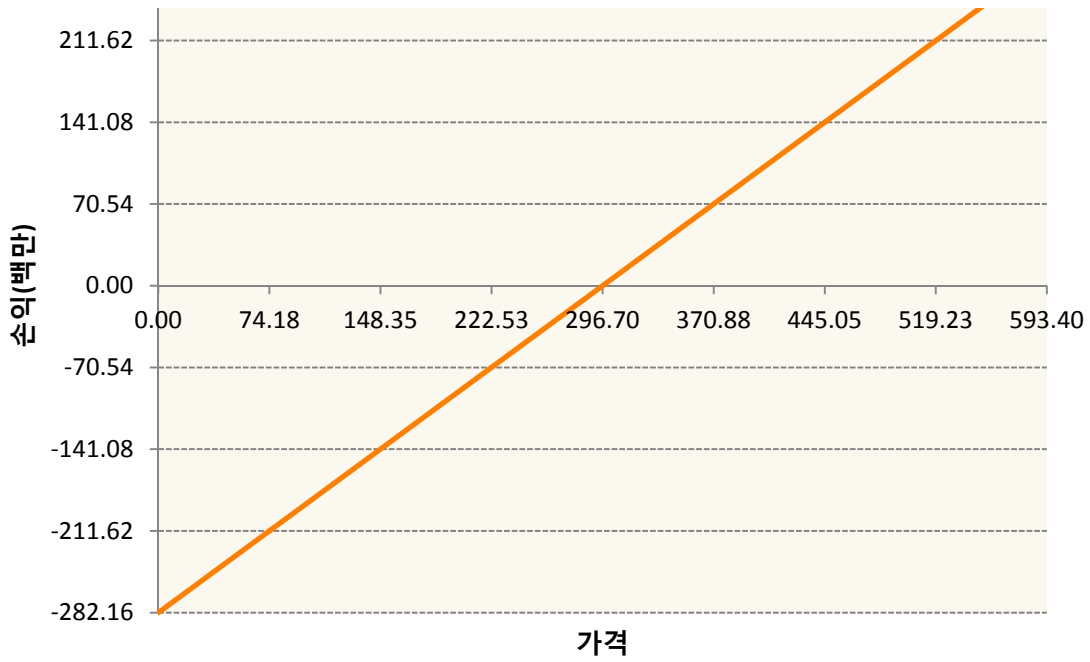


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20

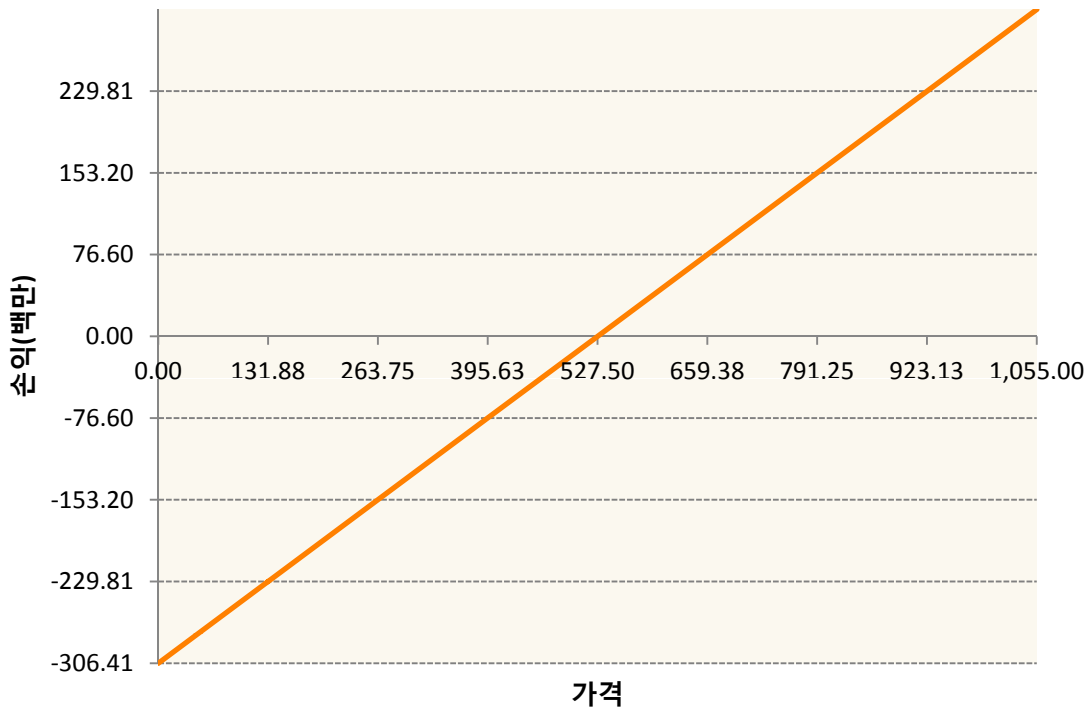


SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





WHO-WHEAT FUTURE(CBT) Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF0	SOYBEAN OIL FUTR Jan20	26
CH0	CORN FUTURE Mar20	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	23
WH0	WHEAT FUTURE(CBT) Mar20	25

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

(단위:백만원)

245