

공시일	2019-12-10
기준일	2019-12-09

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	2019-12-10
기준일	2019-12-09

스마트인덱스모

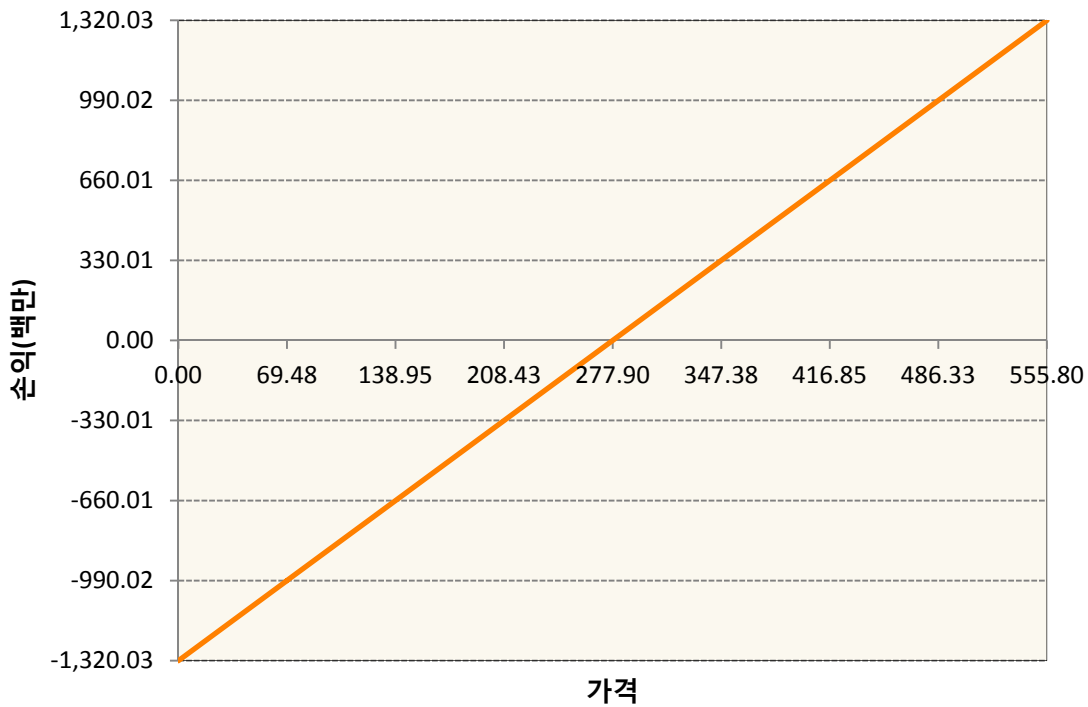
1. 계약금액

(단위:백만원)

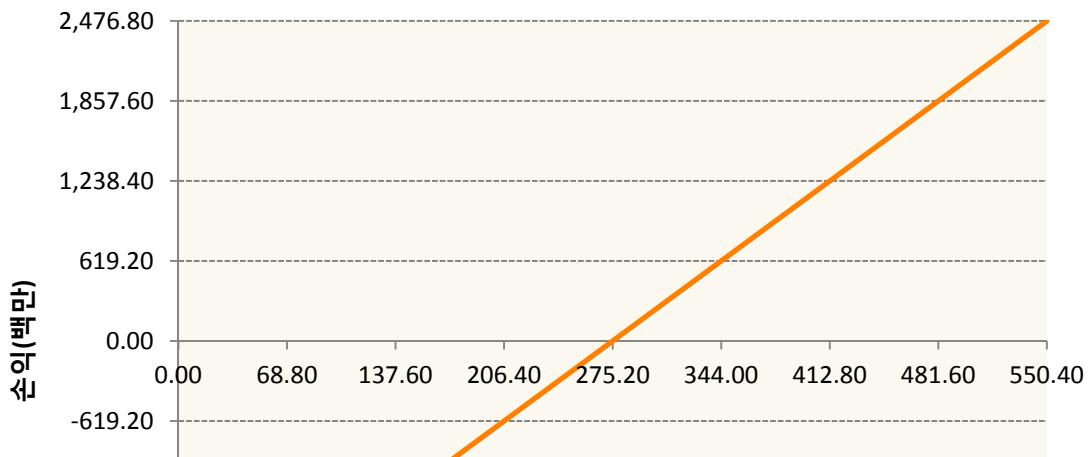
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,797	0	3,797	장내

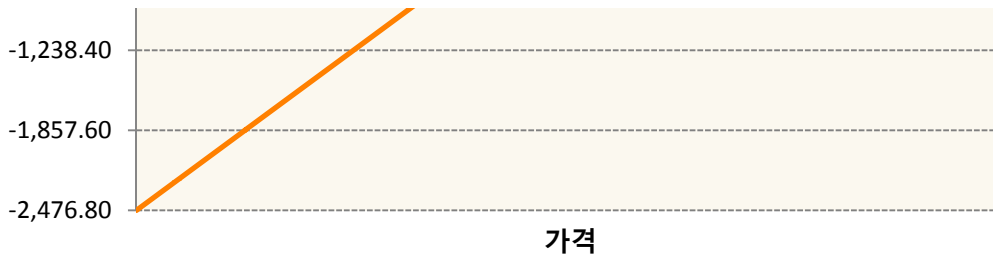
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						106
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106	
-5.33%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70	
-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%	70	70	70	70	70	70	70	
8.00%	106	106	106	106	106	106	106	
KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						200
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-200	-200	-200	-200	-200	-200	-200	
-5.33%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133	
-2.67%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	67	67	67	67	67	67	67	
5.33%	133	133	133	133	133	133	133	
8.00%	200	200	200	200	200	200	200	

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

240

공시일	2019-12-10
기준일	2019-12-09

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

1,099

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

633

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-10
기준일	2019-12-09

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)	387
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	141

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

740

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-10
기준일	2019-12-09

유로인덱스모(주식-파생형)

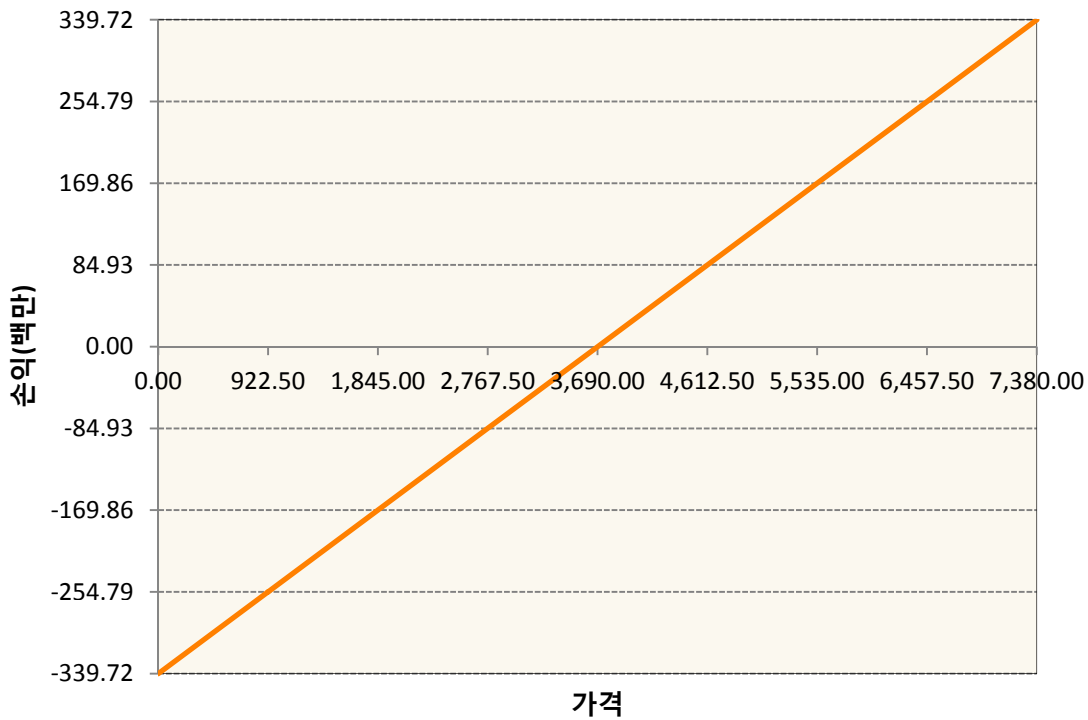
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

VGZ9-EURO STOXX 50 Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	27
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

19

공시일	2019-12-10
기준일	2019-12-09

차이나인덱스모(주식-파생형)

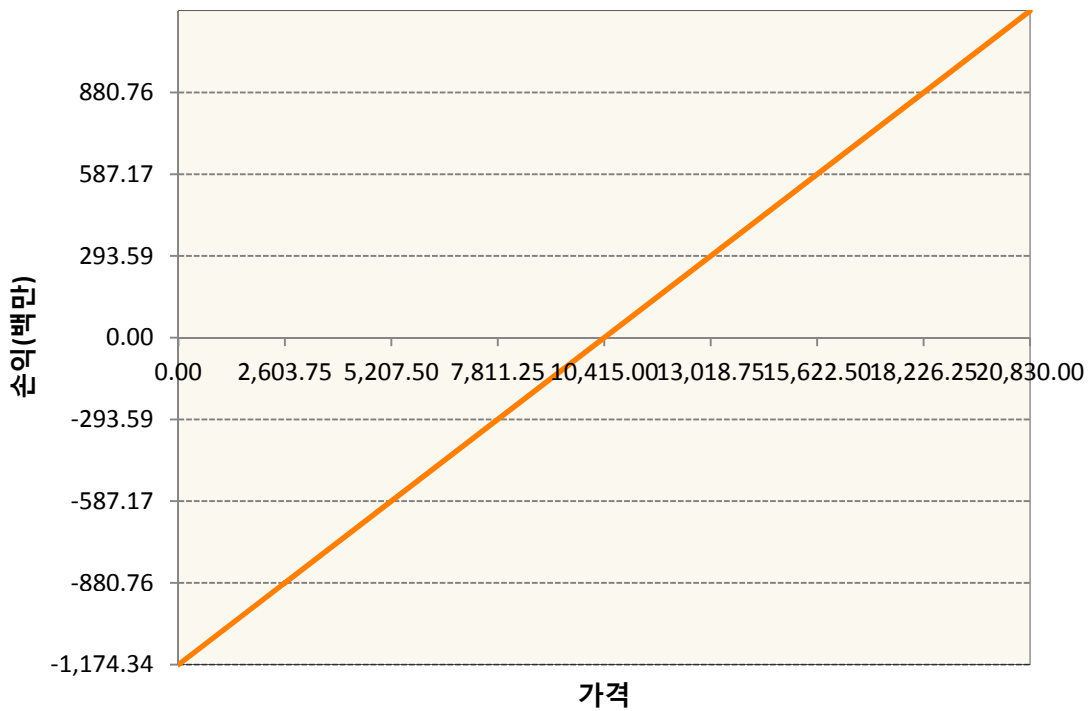
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,174	0	1,174	

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	2019-12-10
기준일	2019-12-09

커버드콜모(주식혼합-파생형)

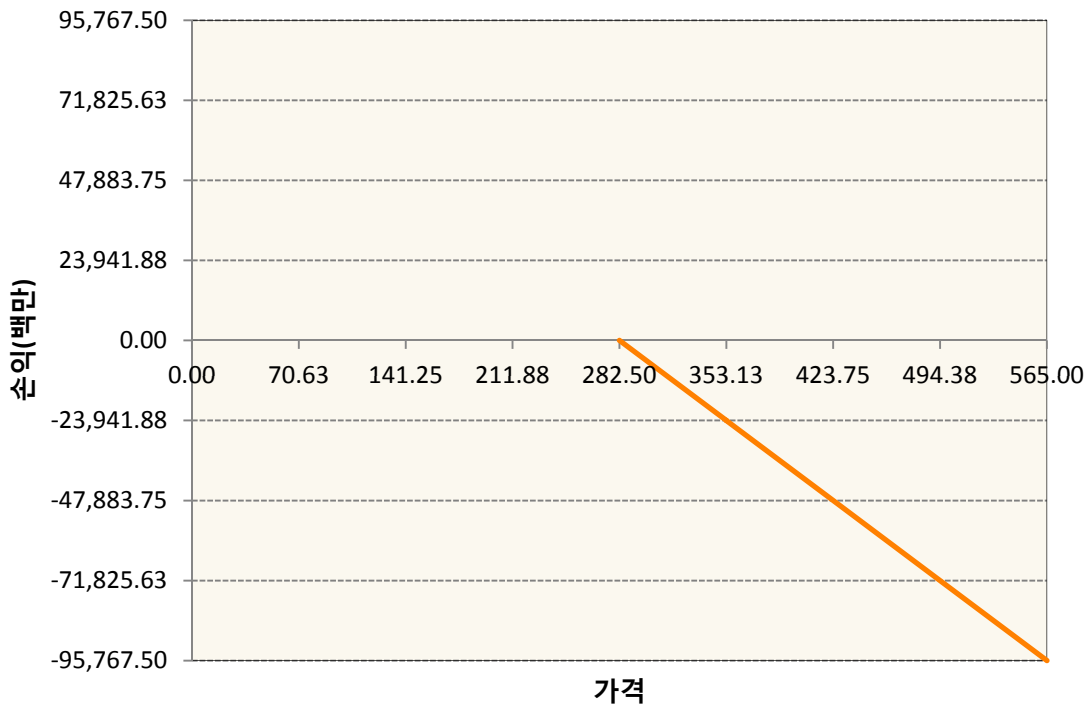
1. 계약금액

(단위:백만원)

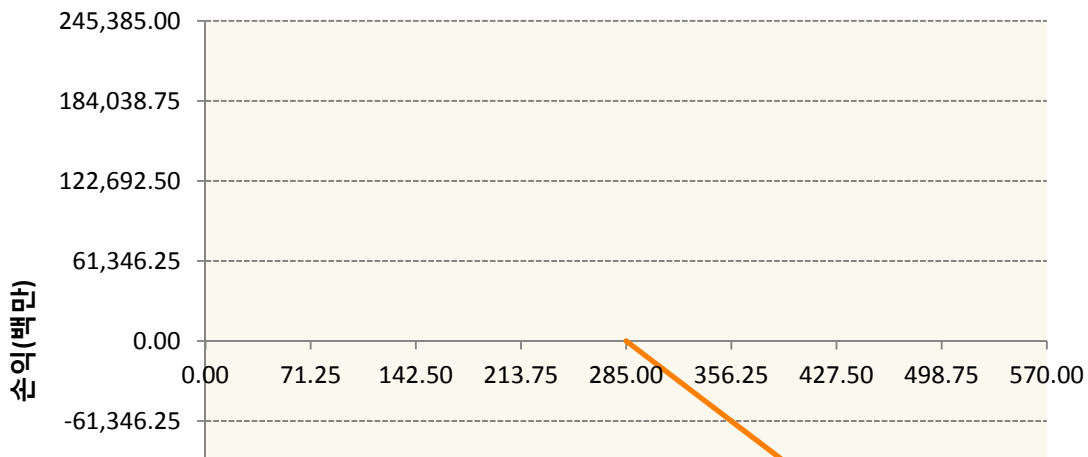
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	498,456	-498,456	장내

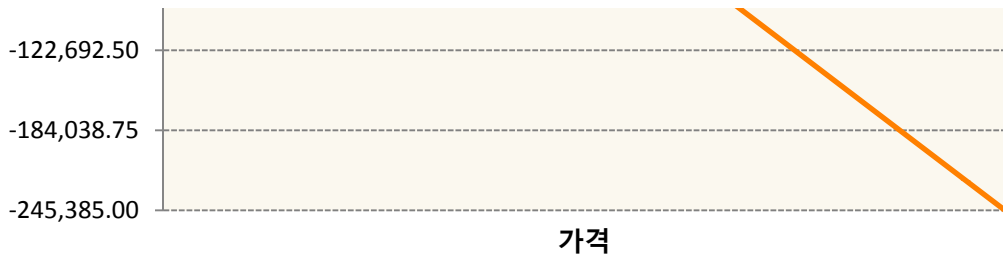
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PC2825-2019-12 콜282.5

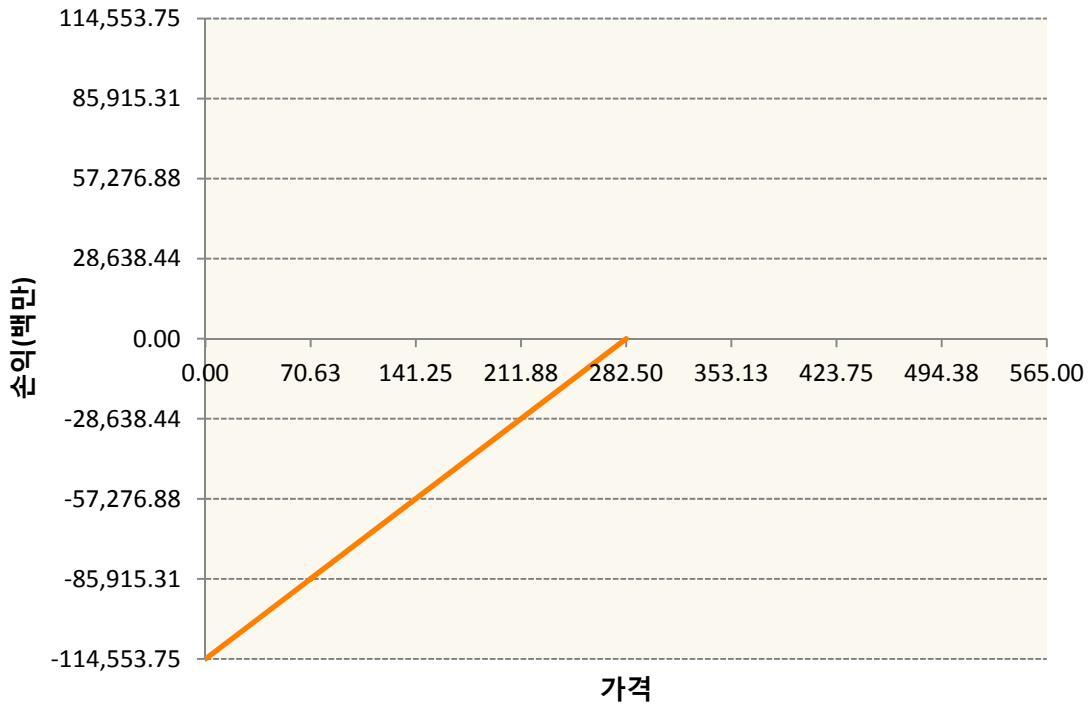


KR4201PC2858-2019-12 콜285

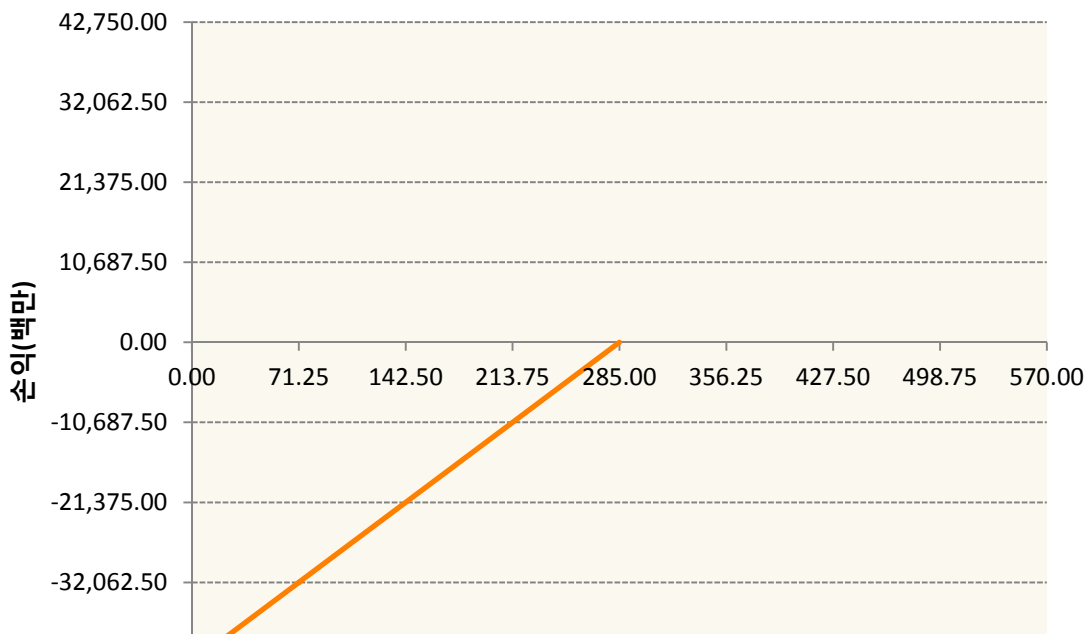




KR4301PC2824-2019-12 풋282.5



KR4301PC2857-2019-12 풋285



-42,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PC2825		2019-12 콜282.5						5,654
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	398	398	398	398	398	397	397	
-5.33%	398	397	397	396	393	389	383	
-2.67%	390	381	368	350	328	302	271	
0%	189	129	66	0	-68	-138	-209	
2.67%	-942	-1,014	-1,088	-1,164	-1,240	-1,318	-1,396	
5.33%	-3,128	-3,146	-3,169	-3,198	-3,232	-3,271	-3,314	
8.00%	-5,618	-5,619	-5,621	-5,626	-5,632	-5,641	-5,654	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						12,751
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	556	556	556	556	556	556	555	
-5.33%	556	556	555	554	552	547	539	
-2.67%	551	543	528	506	474	433	382	
0%	336	238	125	0	-135	-279	-429	
2.67%	-1,523	-1,732	-1,942	-2,152	-2,362	-2,572	-2,782	
5.33%	-6,363	-6,451	-6,554	-6,670	-6,798	-6,935	-7,081	
8.00%	-12,576	-12,584	-12,599	-12,622	-12,655	-12,698	-12,751	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						8,959
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-8,959	-8,959	-8,959	-8,959	-8,959	-8,959	-8,959	
-5.33%	-5,954	-5,954	-5,954	-5,954	-5,954	-5,954	-5,954	
-2.67%	-2,948	-2,948	-2,948	-2,948	-2,948	-2,948	-2,949	
0%	43	32	17	0	-20	-43	-67	
2.67%	1,814	1,788	1,760	1,729	1,696	1,661	1,625	
5.33%	1,880	1,880	1,880	1,880	1,879	1,877	1,875	
8.00%	1,880	1,880	1,880	1,880	1,880	1,880	1,880	
KR4301PC2857		2019-12 풋285						3,332
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,332	-3,332	-3,332	-3,332	-3,332	-3,332	-3,332	
-5.33%	-2,220	-2,220	-2,220	-2,220	-2,220	-2,220	-2,220	
-2.67%	-1,108	-1,108	-1,108	-1,108	-1,108	-1,108	-1,108	
0%	3	3	2	0	-2	-6	-9	
2.67%	928	911	894	877	860	843	826	

5.33%	1,052	1,052	1,051	1,050	1,049	1,046	1,043
8.00%	1,053	1,053	1,053	1,053	1,053	1,053	1,052

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

(단위:백만원)

33,753

공시일	2019-12-10
기준일	2019-12-09

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

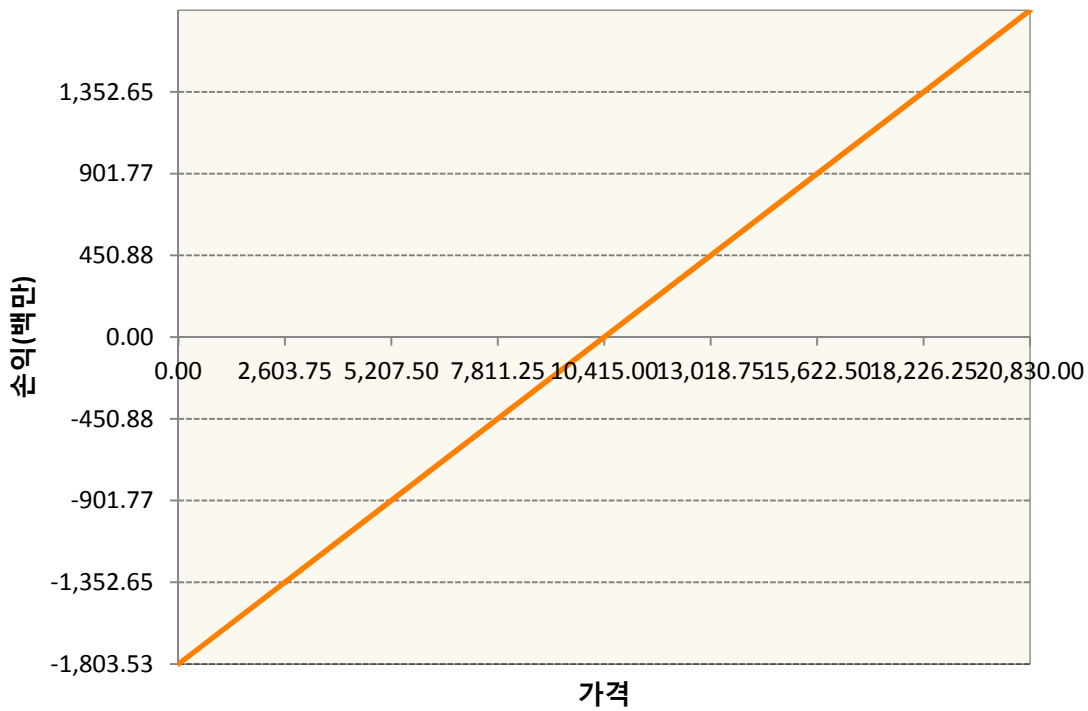
1. 계약금액

(단위:백만원)

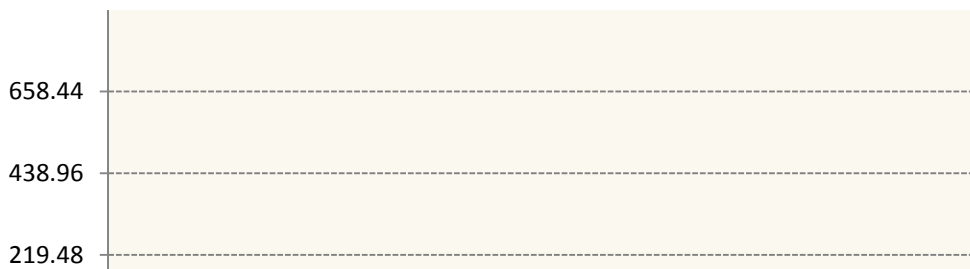
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,804	0	1,804	
누계	유가증권	옵션	0	4,979	-4,979	장내
누계	통화	선도	0	2,140	-2,140	장외

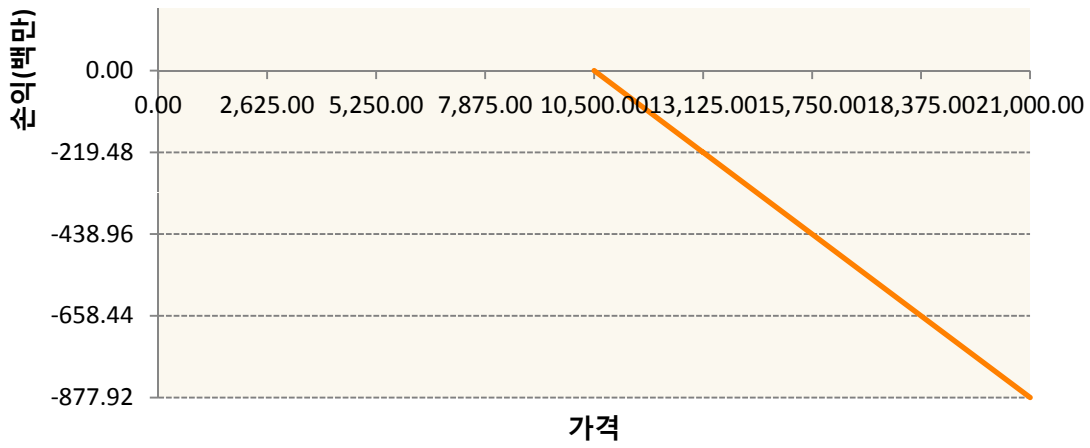
2. 만기시점의 손익구조

HCZ9-HSCEI Futures Dec19

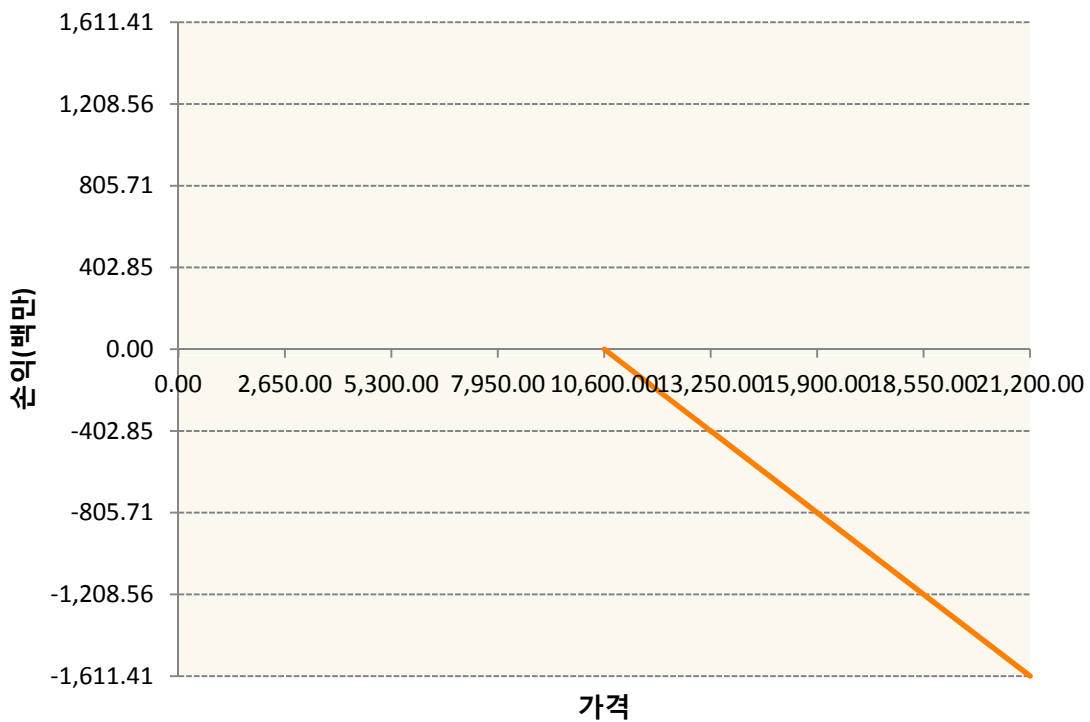


OHHIZ9-C105-HSCEI

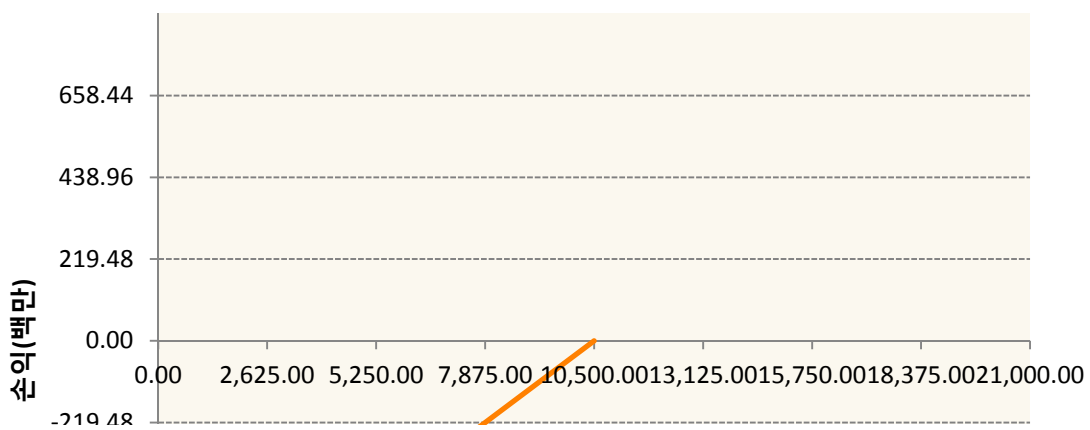


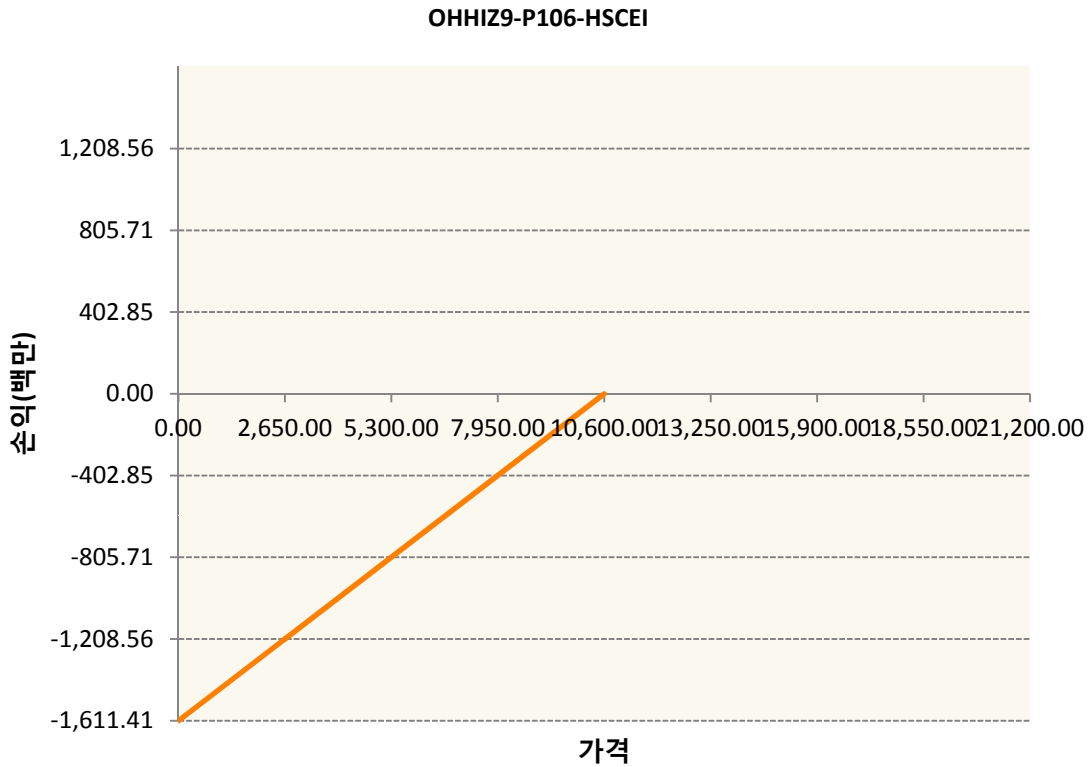


OHHIZ9-C106-HSCEI



OHHIZ9-P105-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	171
HCZ9 HSCEI Futures Dec19	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)
	535

공시일	2019-12-10
기준일	2019-12-09

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

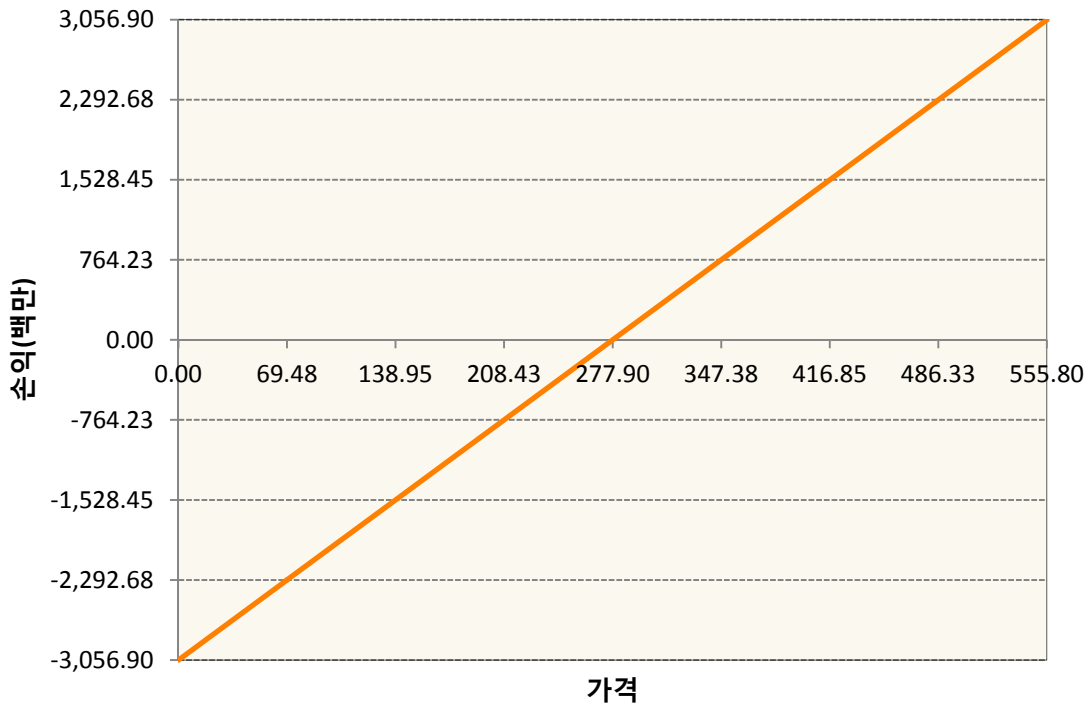
1. 계약금액

(단위:백만원)

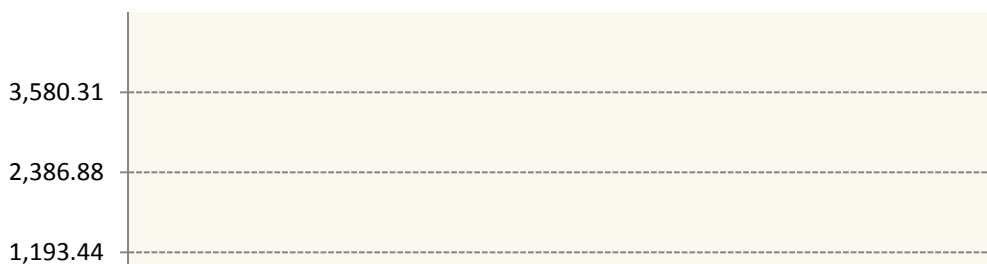
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	1,000	-1,000	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,057	0	3,057	장내
누계	유가증권	스왑	8,625	0	8,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,514	-9,514	장내

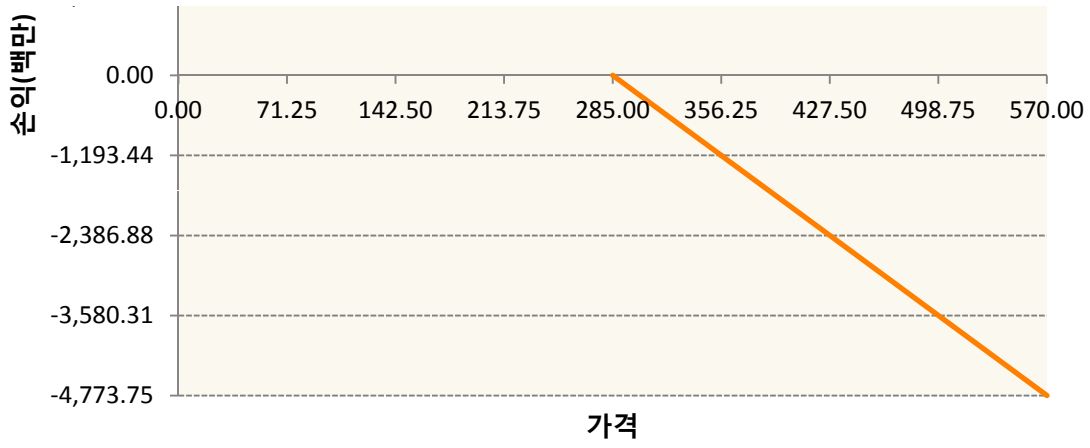
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

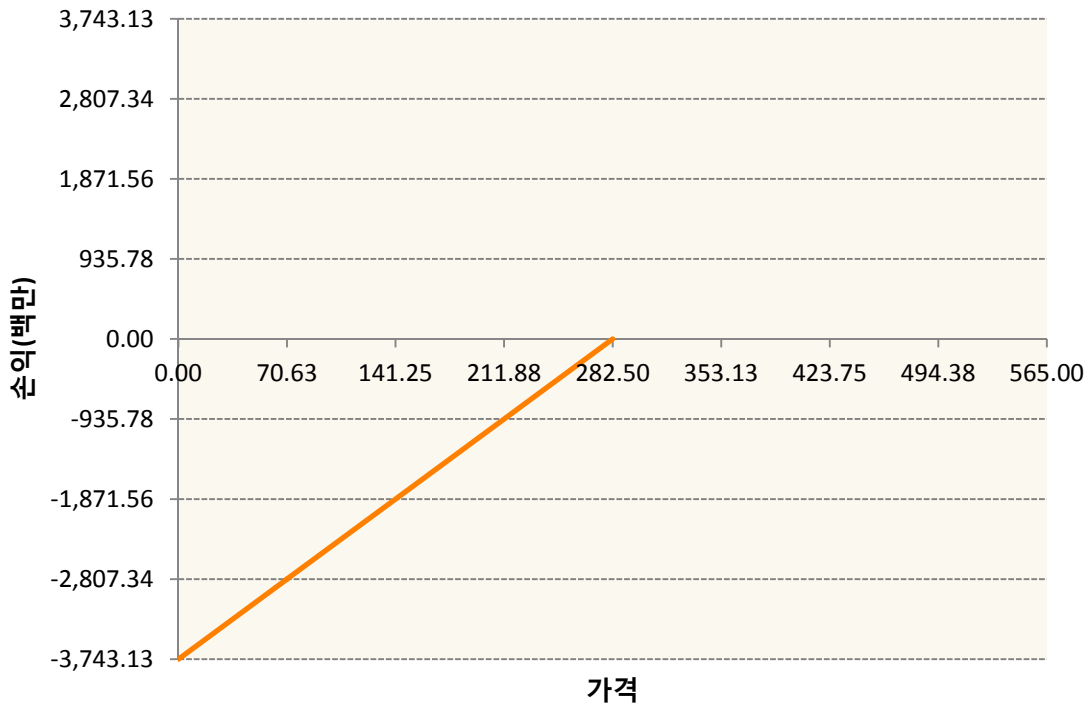


KR4201PC2858-2019-12 콜285

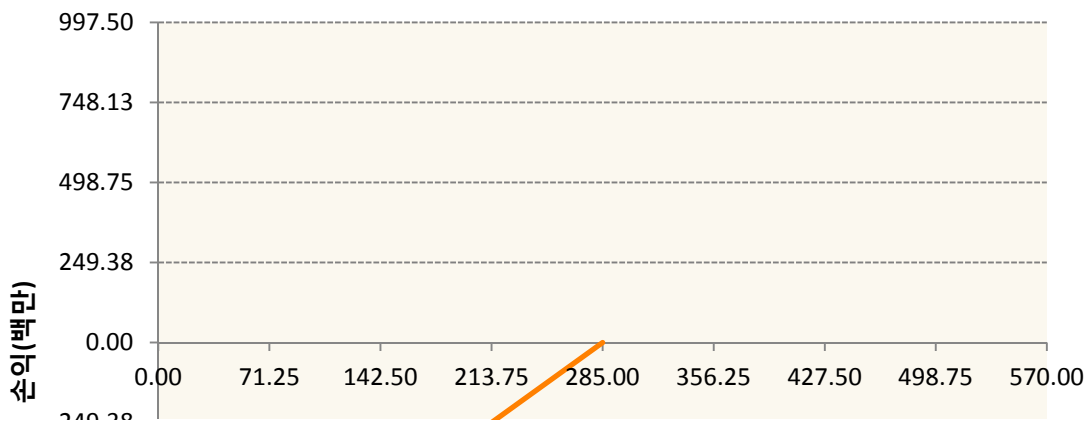




KR4301PC2824-2019-12 풋282.5



KR4301PC2857-2019-12 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						747
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-747	-747	-747	-747	-747	-747	-747	
-5.33%	-498	-498	-498	-498	-498	-498	-498	
-2.67%	-249	-249	-249	-249	-249	-249	-249	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	249	249	249	249	249	249	249	
5.33%	498	498	498	498	498	498	498	
8.00%	747	747	747	747	747	747	747	
KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						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%	-163	-163	-163	-163	-163	-163	-163	
-2.67%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	82	82	82	82	82	82	82	
5.33%	163	163	163	163	163	163	163	
8.00%	245	245	245	245	245	245	245	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						248
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	11	11	11	11	11	11	11	
-5.33%	11	11	11	11	11	11	10	
-2.67%	11	11	10	10	9	8	7	
0%	7	5	2	0	-3	-5	-8	
2.67%	-30	-34	-38	-42	-46	-50	-54	
5.33%	-124	-125	-127	-130	-132	-135	-138	
8.00%	-245	-245	-245	-246	-246	-247	-248	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						293
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-293	-293	-293	-293	-293	-293	-293
-5.33%	-195	-195	-195	-195	-195	-195	-195
-2.67%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	59	58	58	56	55	54	53
5.33%	61	61	61	61	61	61	61
8.00%	61	61	61	61	61	61	61
KR4301PC2857 2019-12 풋285							78
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
-5.33%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
-2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	22	21	21	20	20	20	19
5.33%	25	25	25	25	24	24	24
8.00%	25	25	25	25	25	25	25

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

(단위:백만원)

1,658

공시일	2019-12-10
기준일	2019-12-09

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

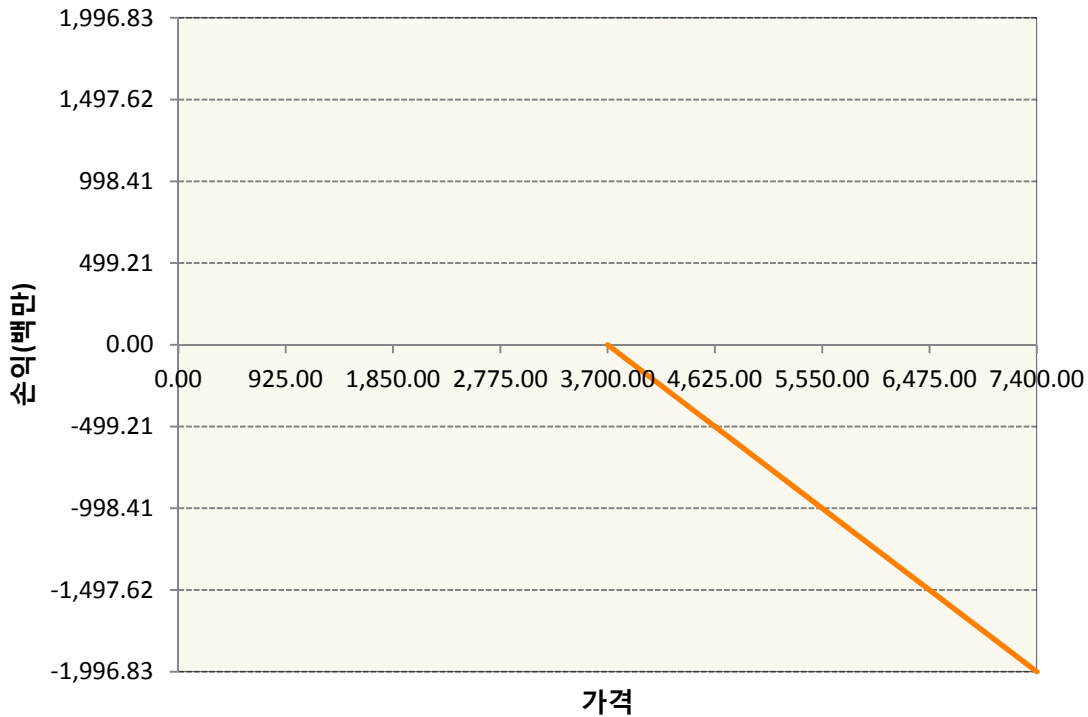
1. 계약금액

(단위:백만원)

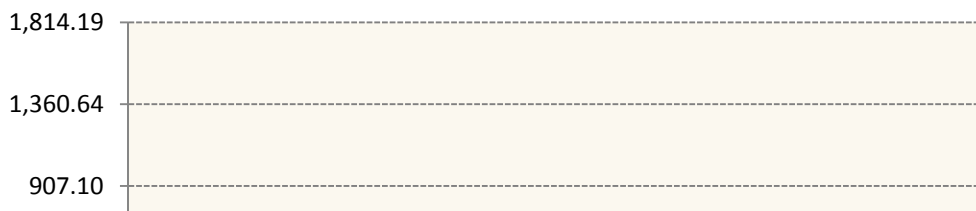
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	717	0	717	
누계	유가증권	스왑	17,998	0	17,998	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,622	-7,622	장내
누계	통화	선도	2,733	6,186	-3,454	장외

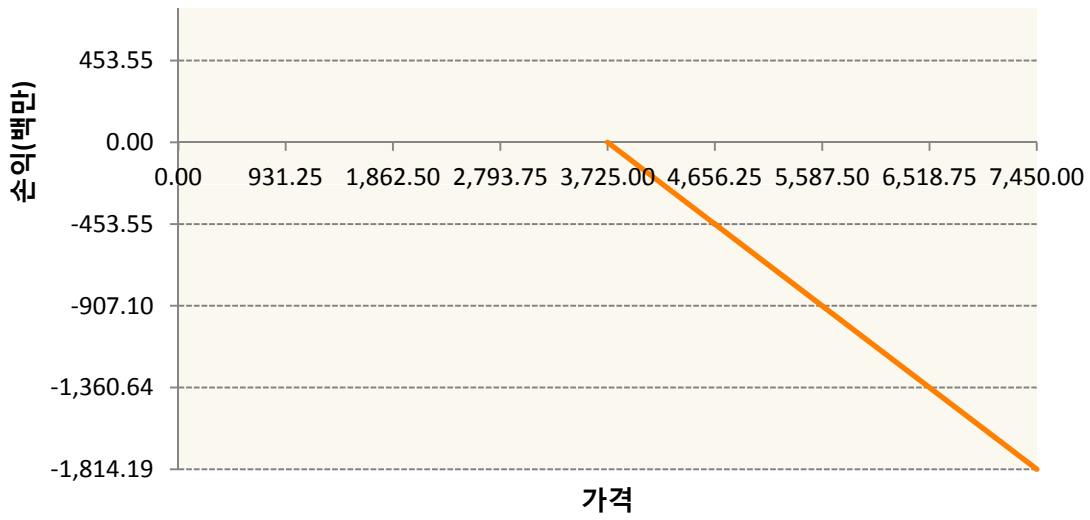
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ9-C3700-EURO STOXX 50

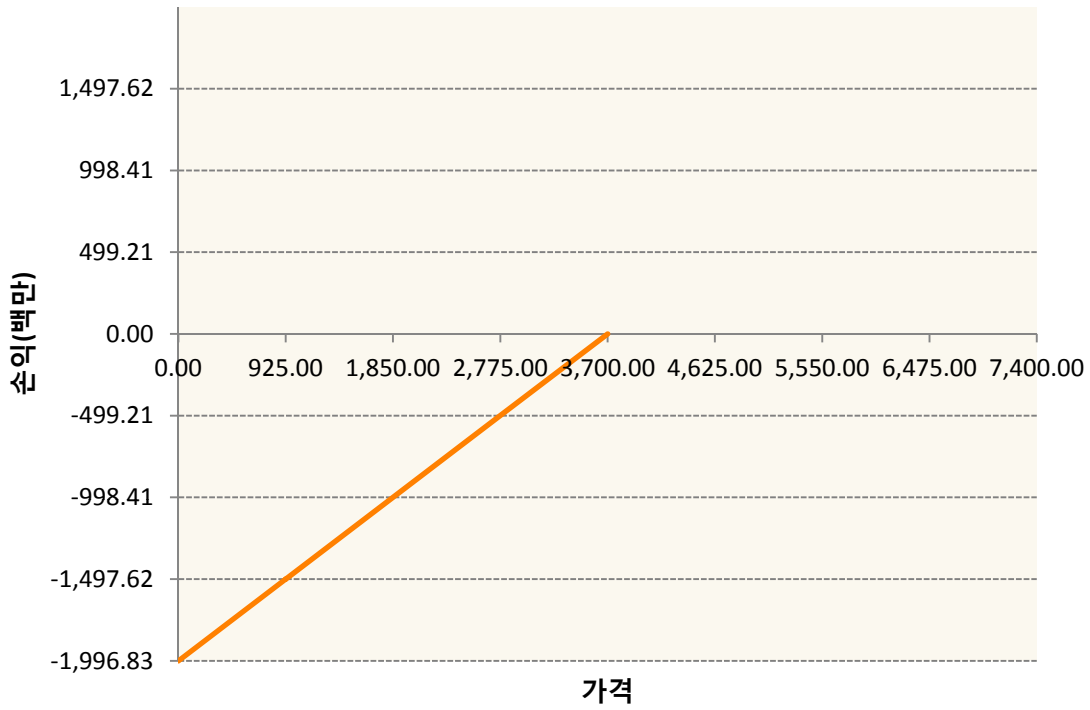


OESXZ9-C3725-EURO STOXX 50

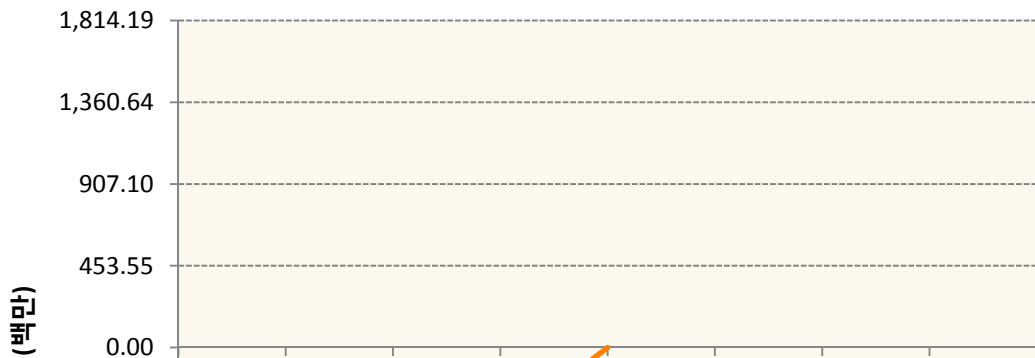


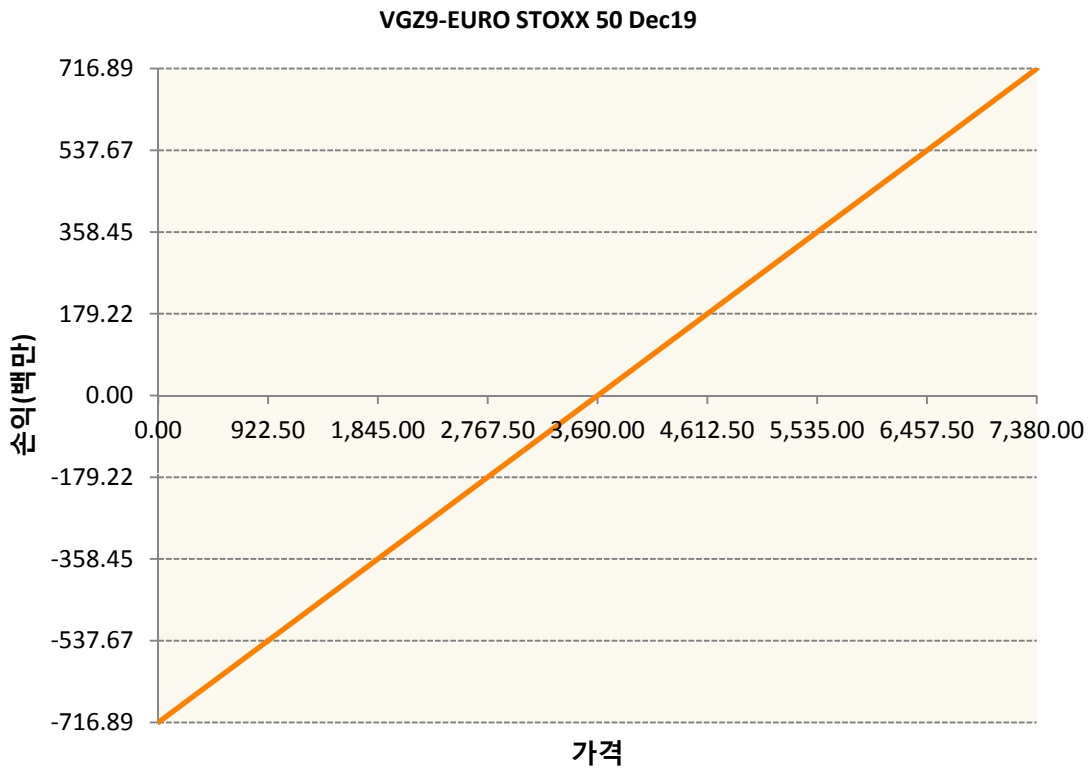
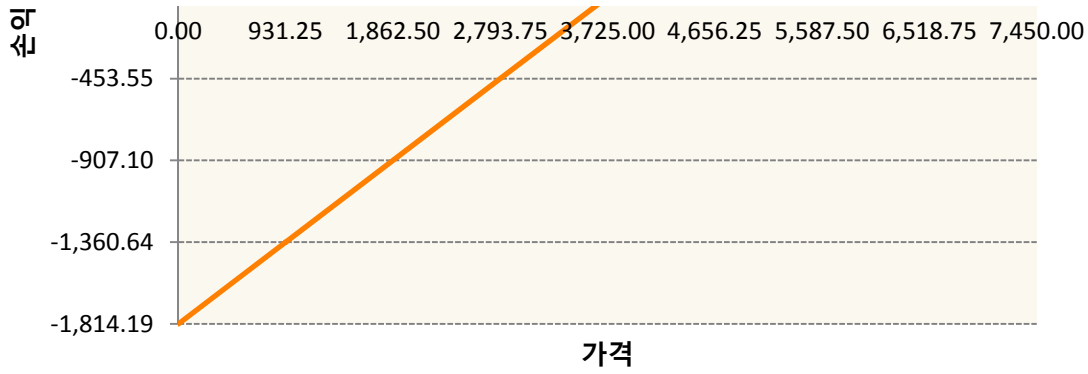


OESXZ9-P3700-EURO STOXX 50



OESXZ9-P3725-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	23
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E	495
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E	166
FX21019X02 EUR/KRW 27-12-19E	53
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	160
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	145
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	160
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	145
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19	57

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

(단위:백만원)

797

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

(단위:백만원)

900

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

(단위:백만원)

79

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

(단위:백만원)

122

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

(단위:백만원)

39

공시일	2019-12-10
기준일	2019-12-09

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

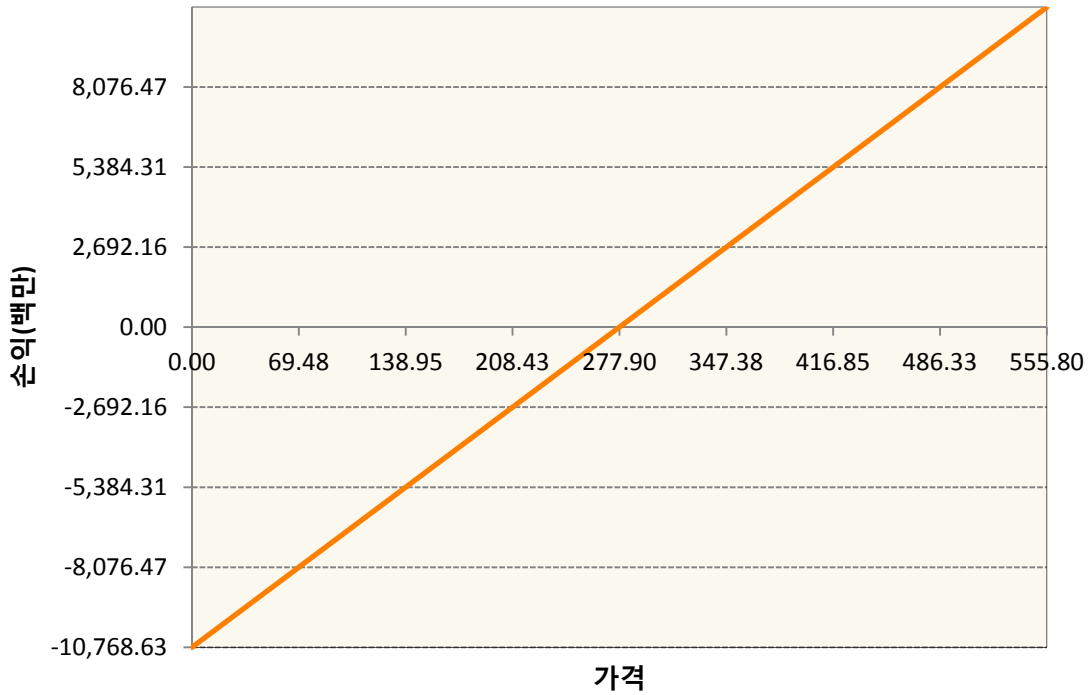
1. 계약금액

(단위:백만원)

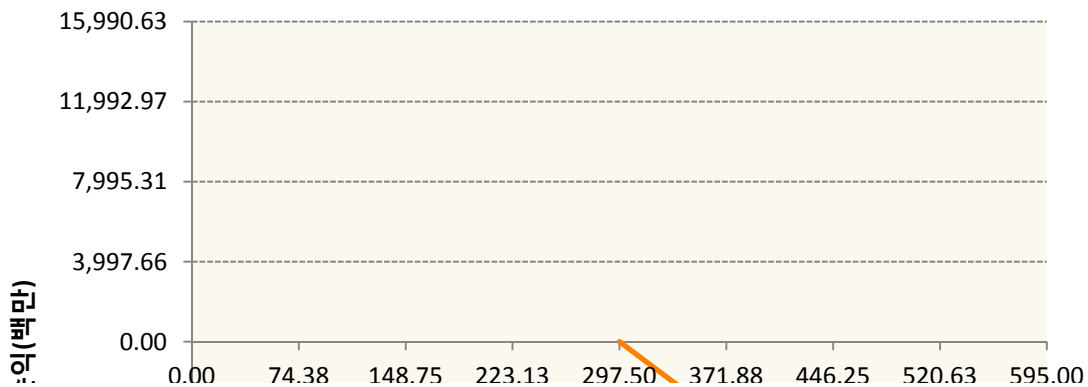
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,769	0	10,769	장내
누계	유가증권	옵션	1,277	21,241	-19,964	장내

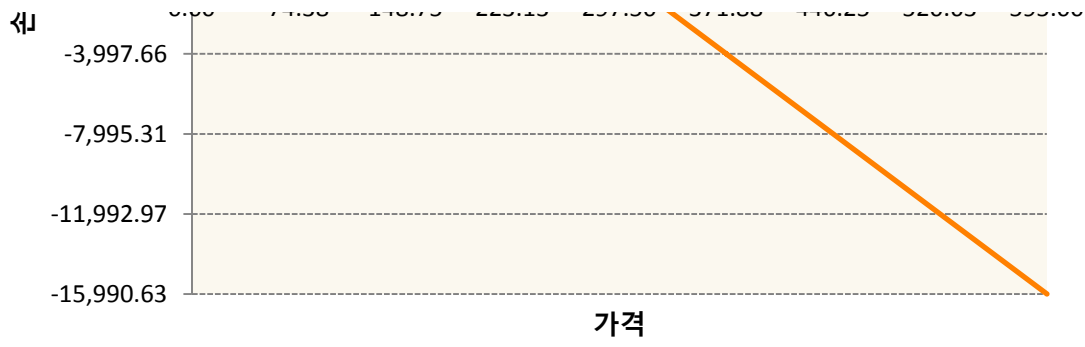
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

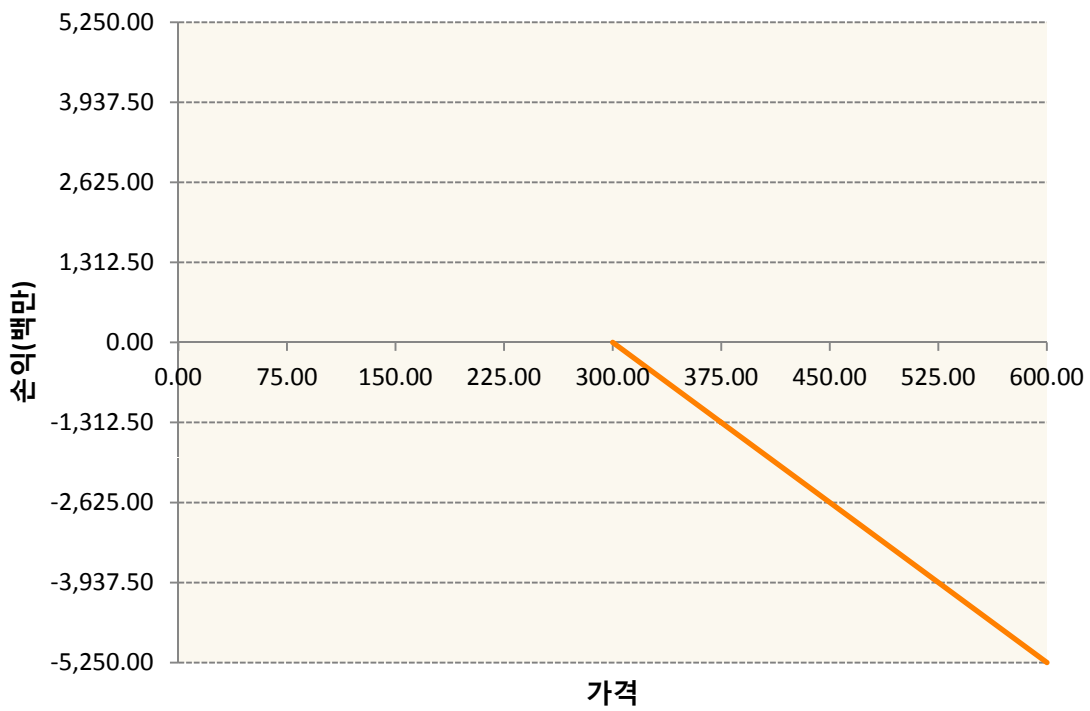


KR4201PC2973-2019-12 콜297.5

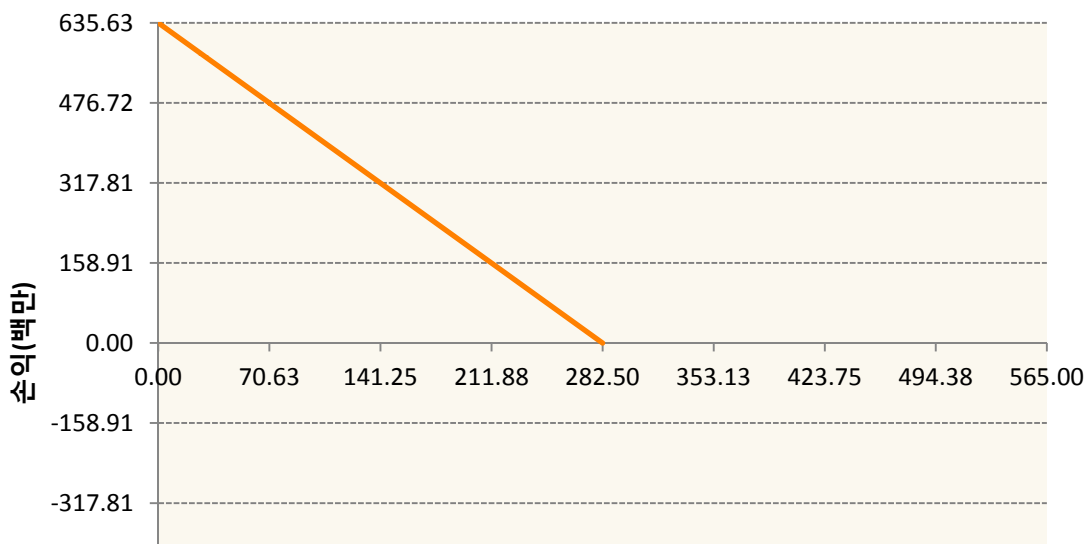


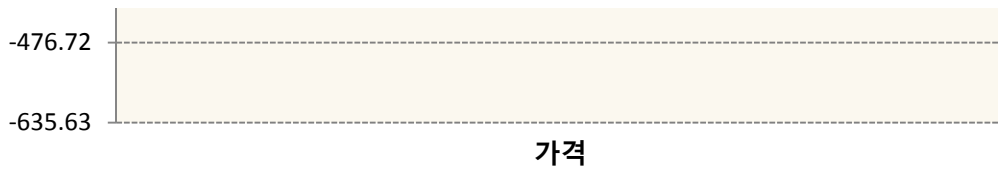


KR4201PC3005-2019-12 콜300

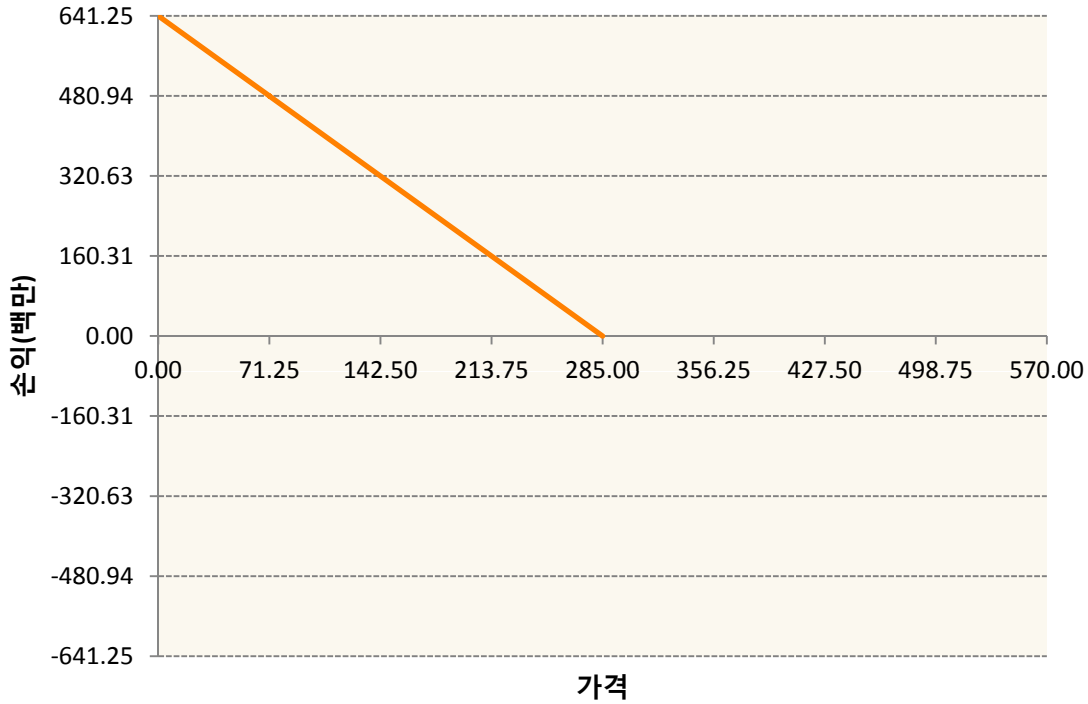


KR4301PC2824-2019-12 풋282.5





KR4301PC2857-2019-12 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						862
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-862	-862	-862	-862	-862	-862	-862	
-5.33%	-575	-575	-575	-575	-575	-575	-575	
-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%	575	575	575	575	575	575	575	
8.00%	862	862	862	862	862	862	862	
KR4201PC2973		2019-12 콜297.5						288
		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	

공시일	2019-12-10
기준일	2019-12-09

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	208,336	0	208,336	

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	2019-12-10
기준일	2019-12-09

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	217,442	0	217,442	

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	2019-12-10
기준일	2019-12-09

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	552,134	0	552,134	
누계	통화	선도	0	578,886	-578,886	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		666
FX21019V00 KRW/USD 10-12-19E		704
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,713
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,855
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,428
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,533
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		1,561
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		1,561
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		1,904
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		3,275
FX21019X02 KRW/USD 26-12-19E		4,798
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		4,855
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		190
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,856
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,856
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,380
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,570
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E		1,656
FX21019Z00 KRW/USD 10-01-20E		1,142

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

(단위:백만원)

14,528

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

(단위:백만원)

179

공시일	2019-12-10
기준일	2019-12-09

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

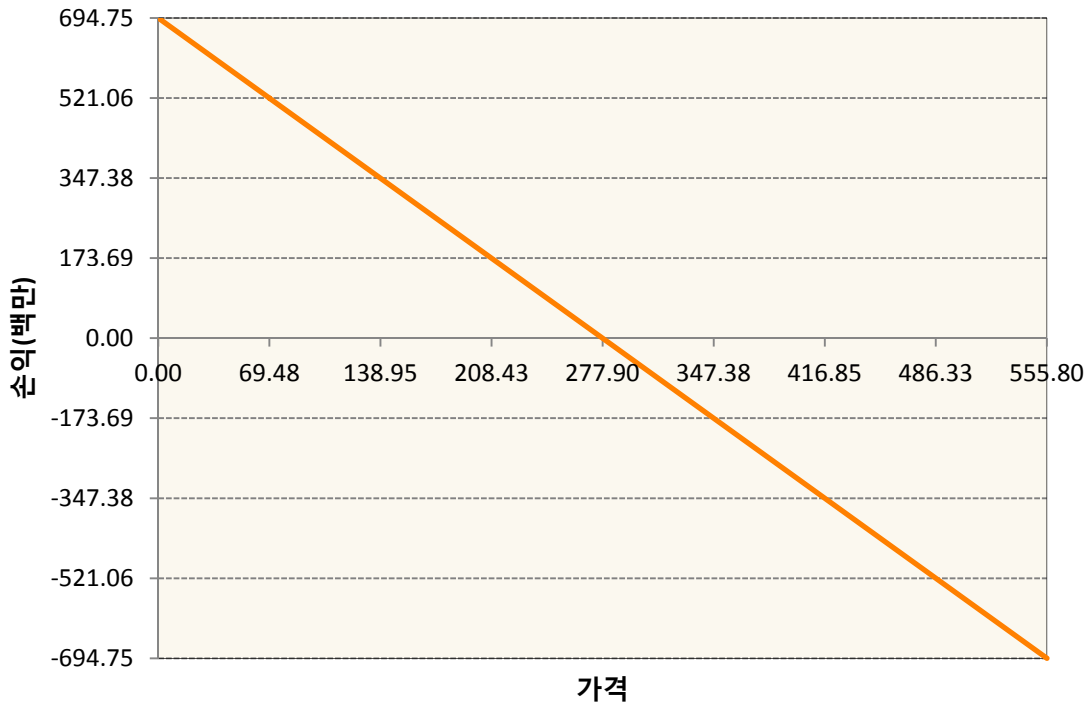
1. 계약금액

(단위:백만원)

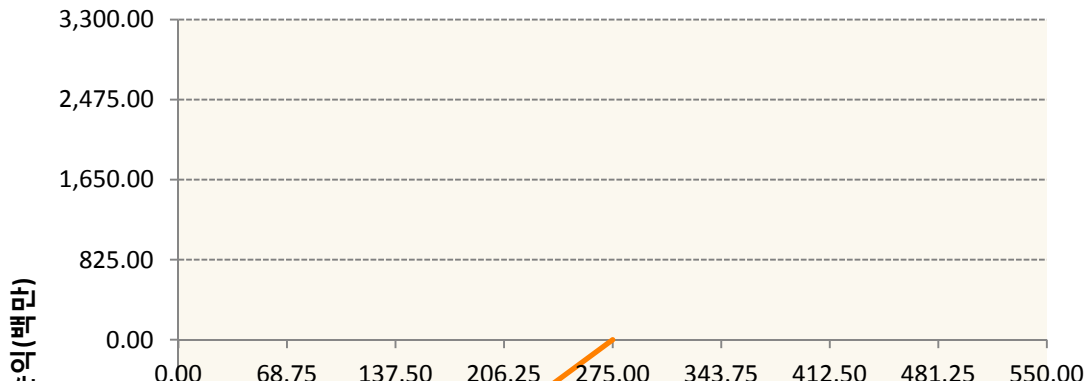
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	695	-695	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,994	-3,994	장내

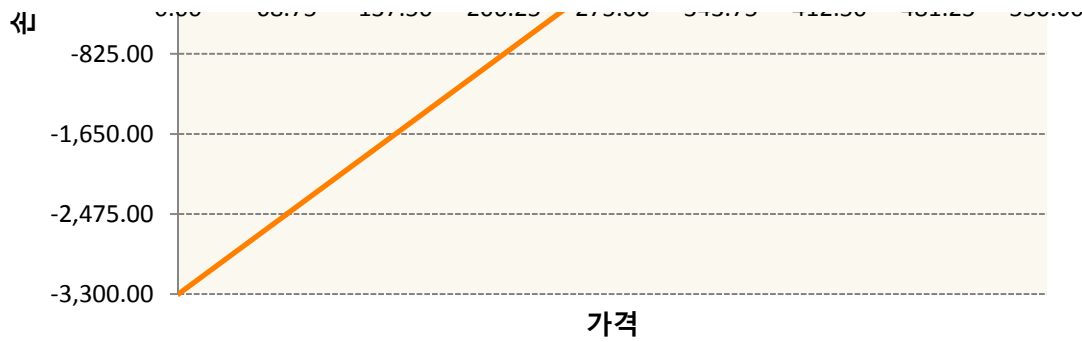
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

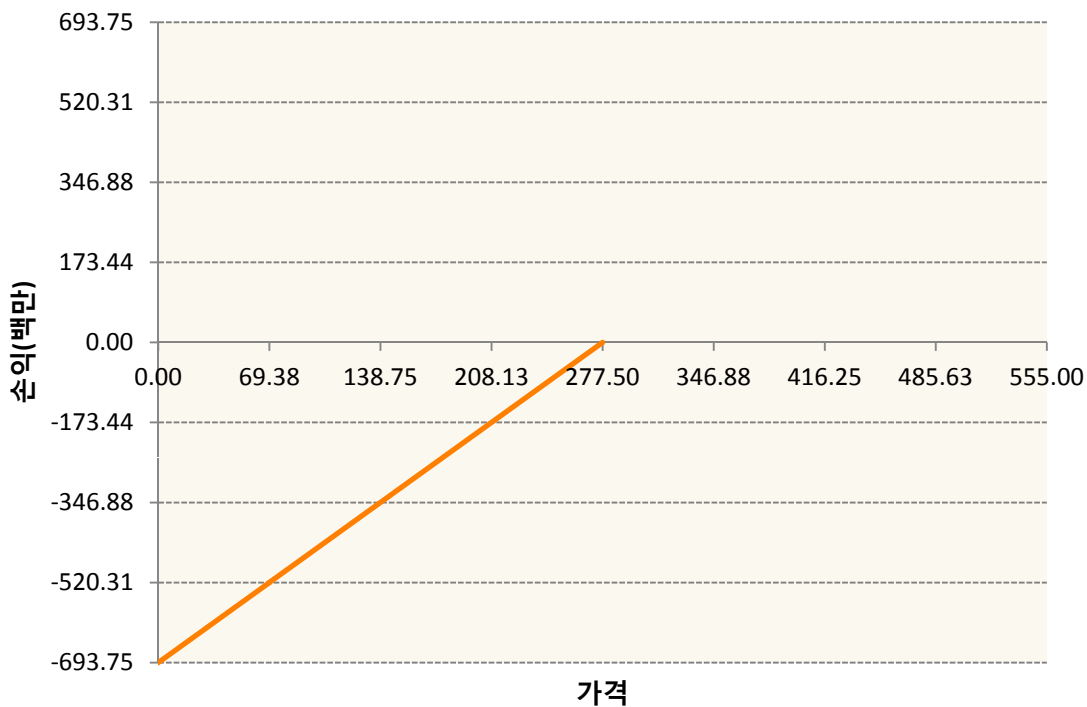


KR4301PC2758-2019-12 풋275





KR4301PC2774-2019-12 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						56
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	56	56	56	56	56	56	56	
-5.33%	37	37	37	37	37	37	37	
-2.67%	19	19	19	19	19	19	19	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37	
8.00%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56	
KR4301PC2758		2019-12 풋275						227
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-227	-227	-227	-227	-227	-227	-227
-5.33%	-138	-138	-138	-138	-138	-138	-138
-2.67%	-49	-50	-50	-51	-51	-52	-52
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	3	3	3	3	3	3	3
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

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

(단위:백만원)

409

공시일	2019-12-10
기준일	2019-12-09

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	356	-356	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	14,922	0	14,922	
누계	통화	선도	0	19,729	-19,729	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
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E		352
FX21019Z00 KRW/USD 11-12-19E		25

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

(단위:백만원)

495

공시일	2019-12-10
기준일	2019-12-09

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	1,011	0	1,011	장외
누계	통화	선도	316	355	-39	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)

79

공시일	2019-12-10
기준일	2019-12-09

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

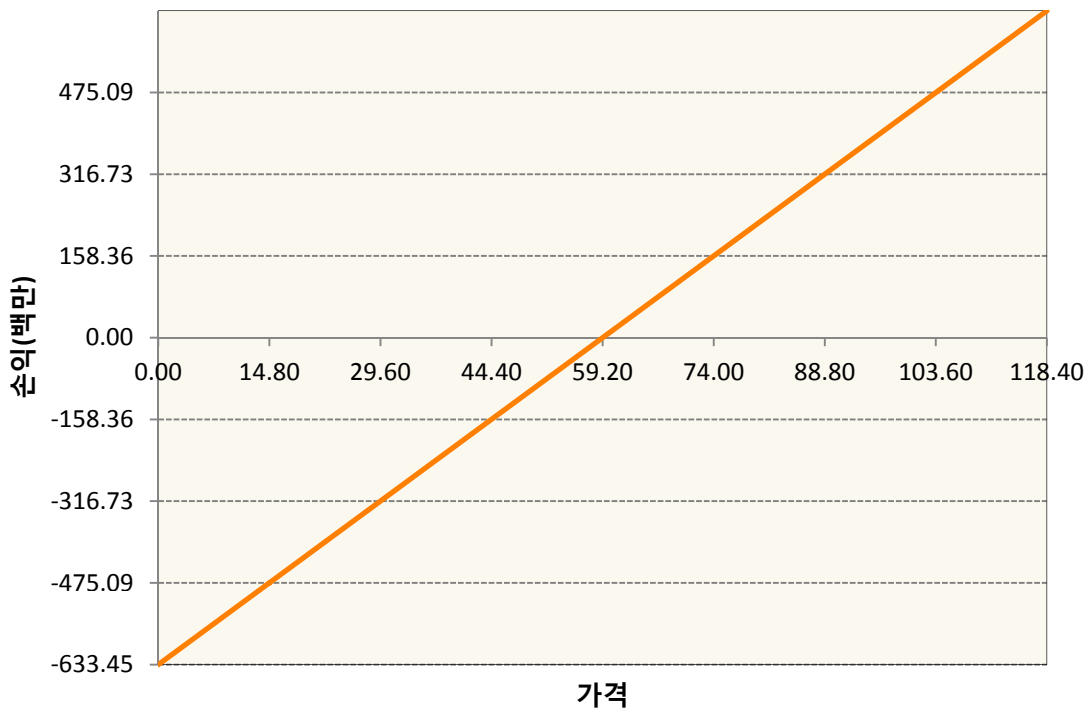
1. 계약금액

(단위:백만원)

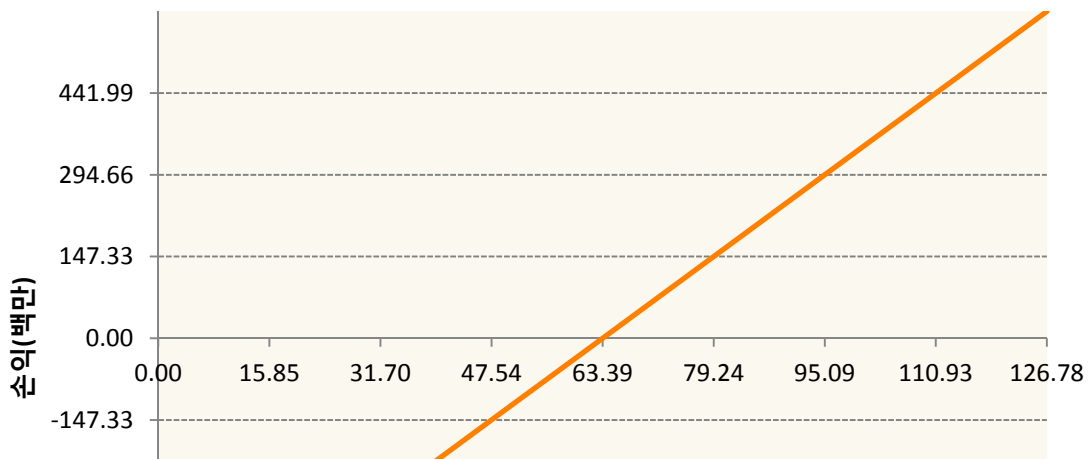
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,457	297	2,159	

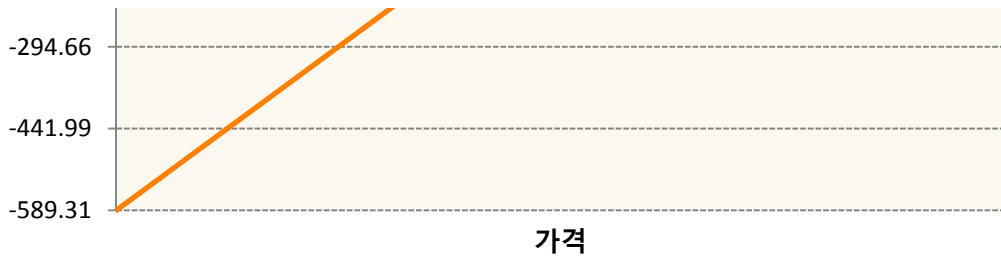
2. 만기시점의 손익구조

CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20

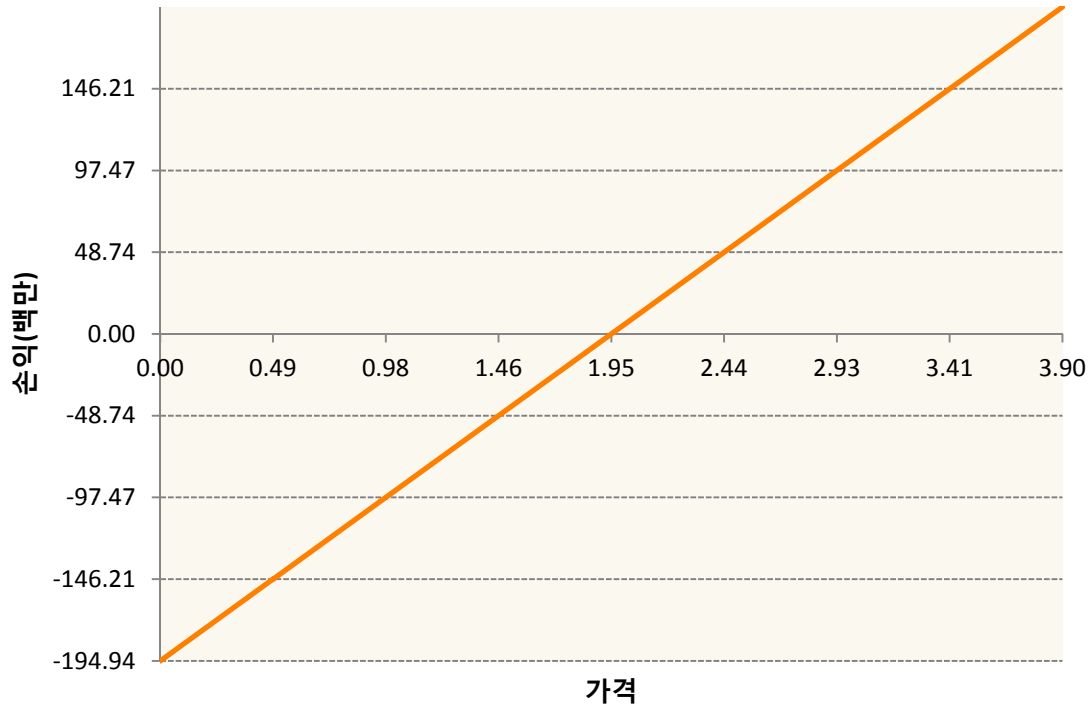


COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20

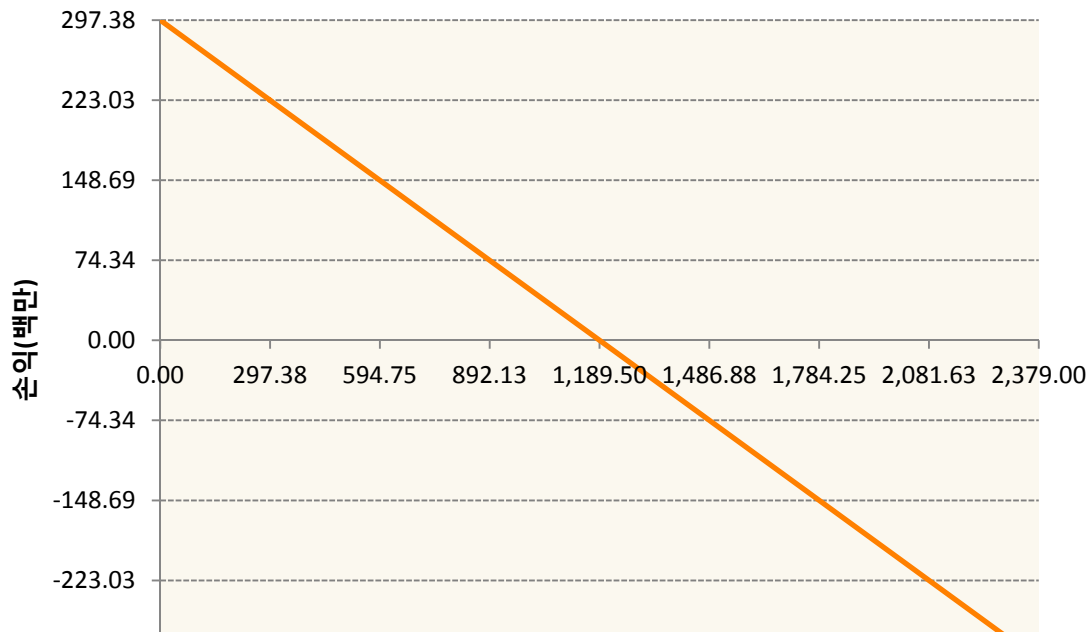


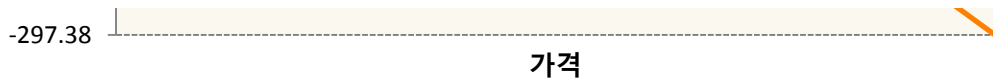


HOF0-NY Harb ULSD Fut Jan20

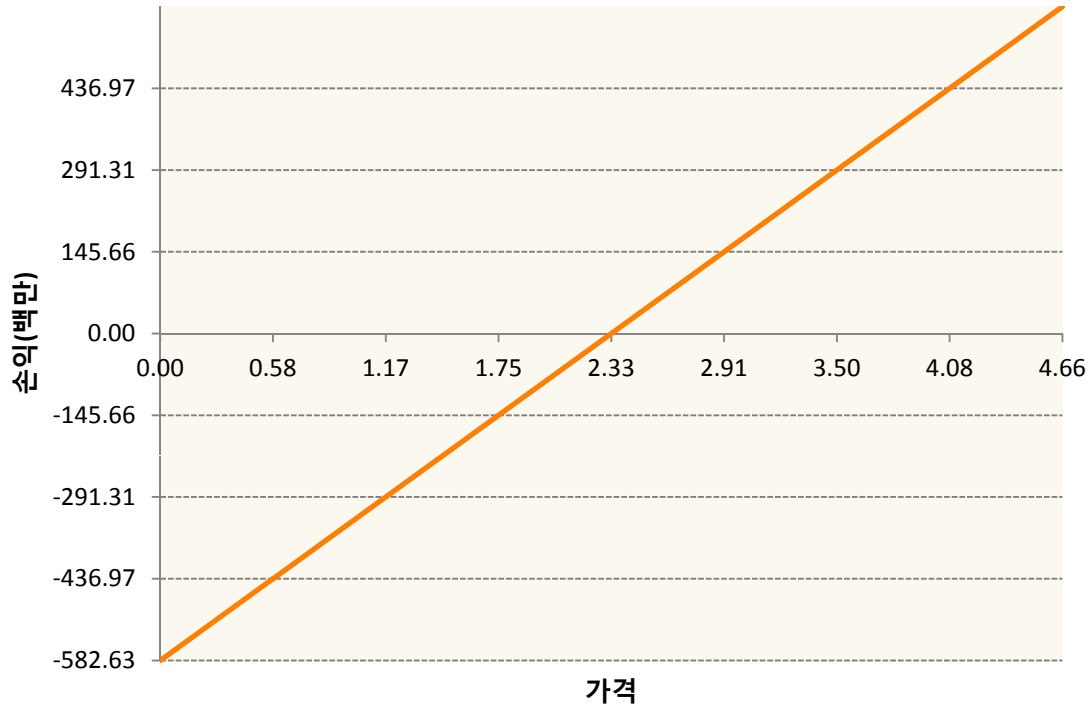


KR4175PC0003-2019-12 달러선물

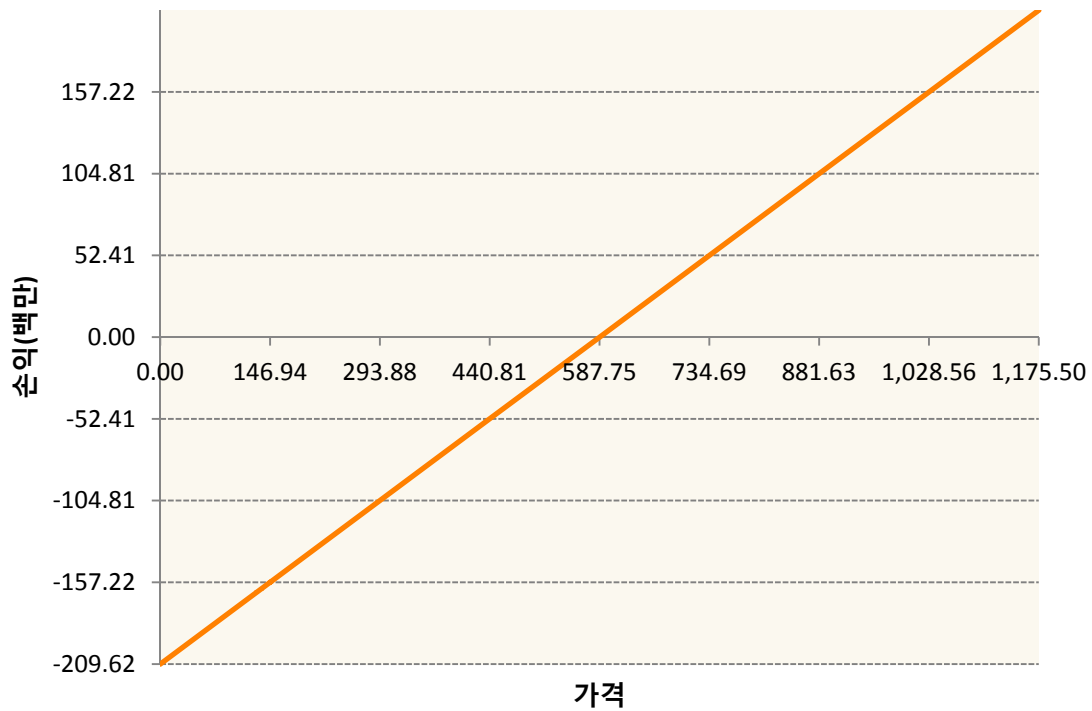




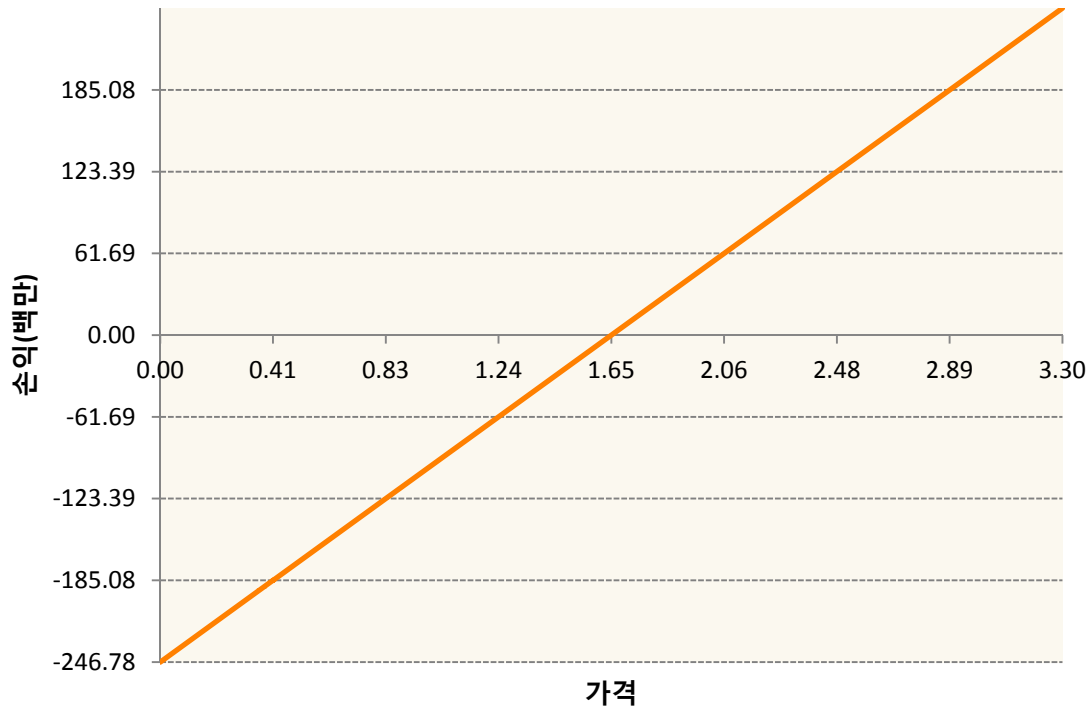
NGF20-NATURAL GAS FUTR Jan20



QSF0-Low Su Gasoil G Jan20



XBF0-GASOLINE RBOB FUT Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLF0	WTI CRUDE FUTURE Jan20	51
COH0	BRENT CRUDE FUTR Mar20	47
HOF0	NY Harb ULSD Fut Jan20	16
KR4175PC00	2019-12 달러선물	24
NGF20	NATURAL GAS FUTR Jan20	47
QSF0	Low Su Gasoil G Jan20	17
XBF0	GASOLINE RBOB FUT Jan20	20

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

(단위:백만원)

402

공시일	2019-12-10
기준일	2019-12-09

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

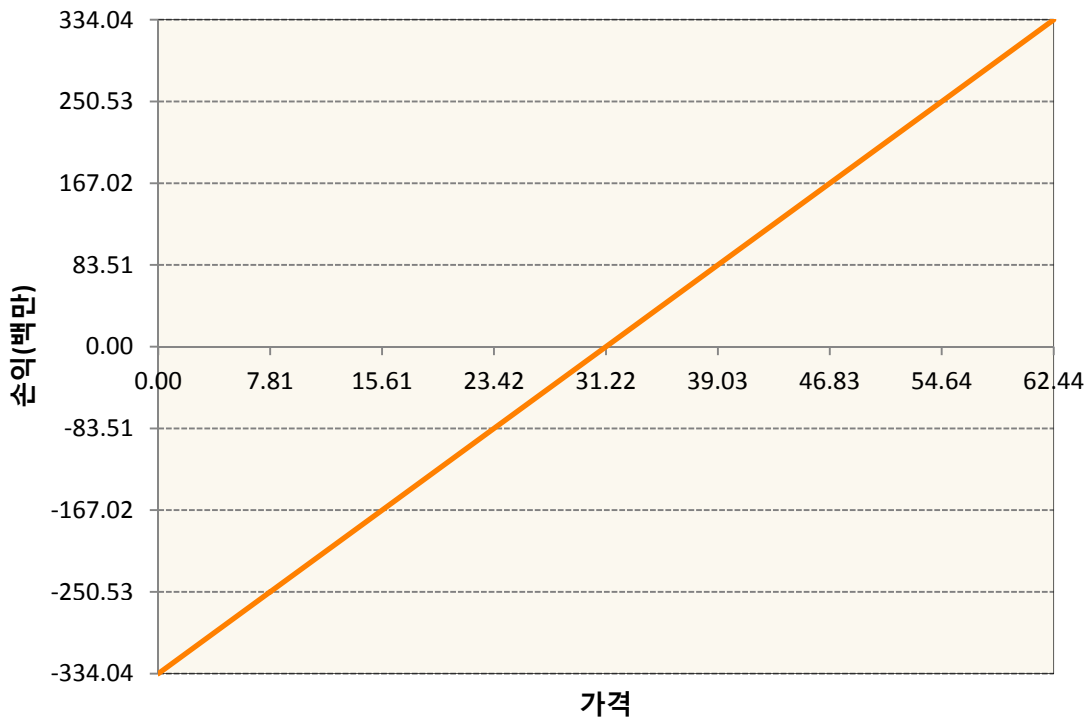
1. 계약금액

(단위:백만원)

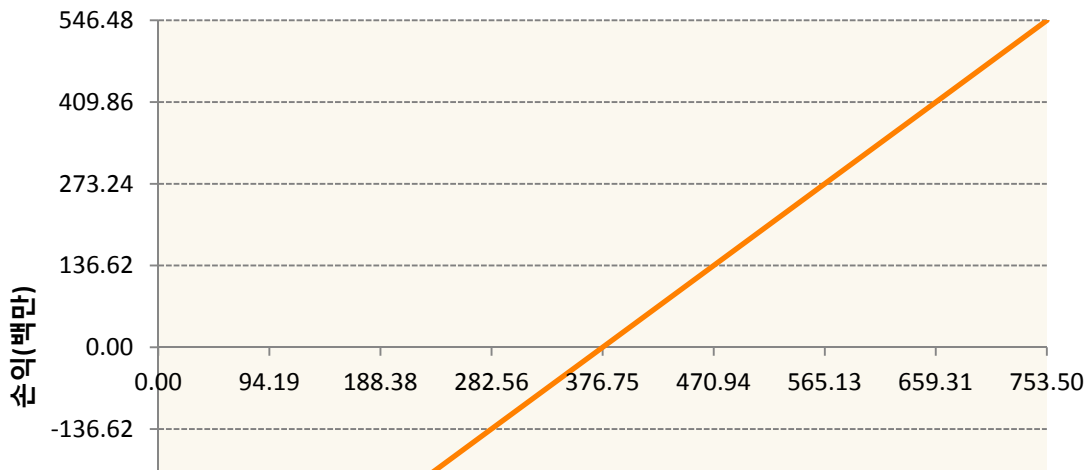
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,802	95	2,707	

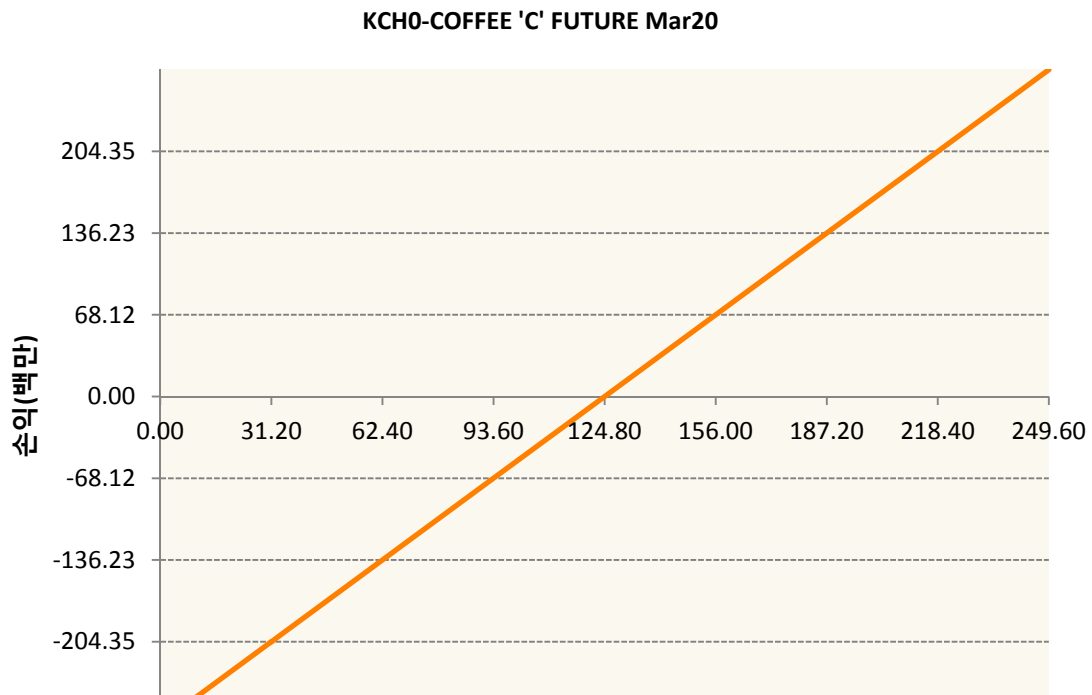
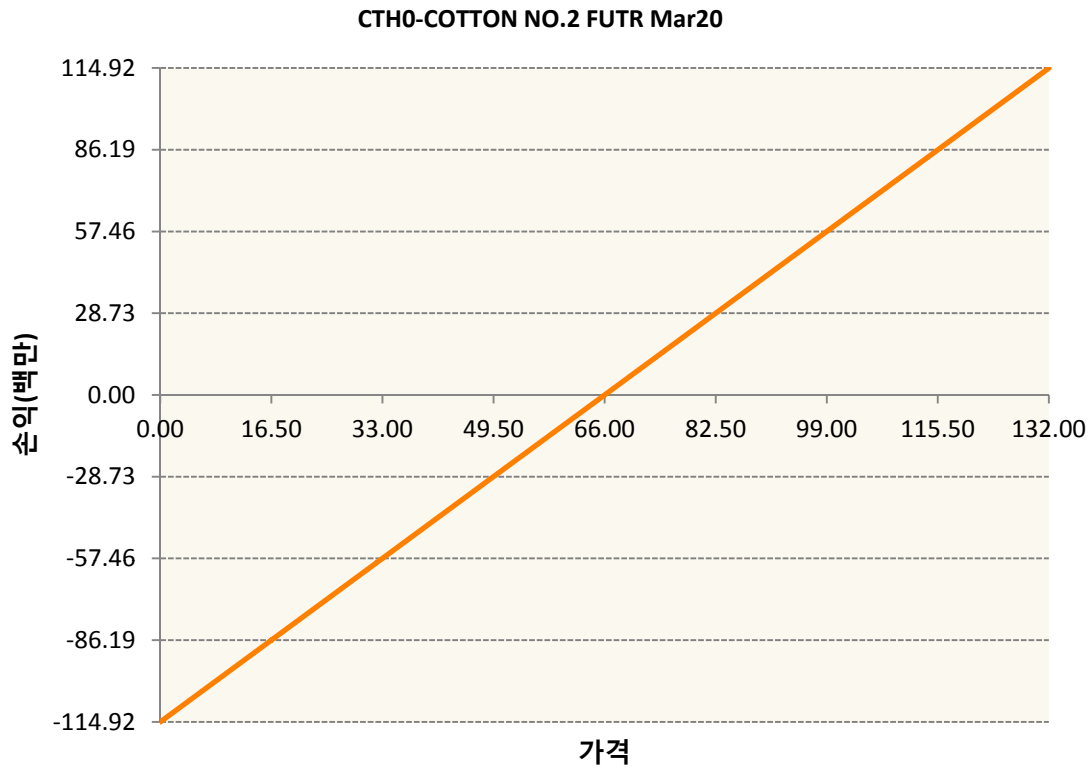
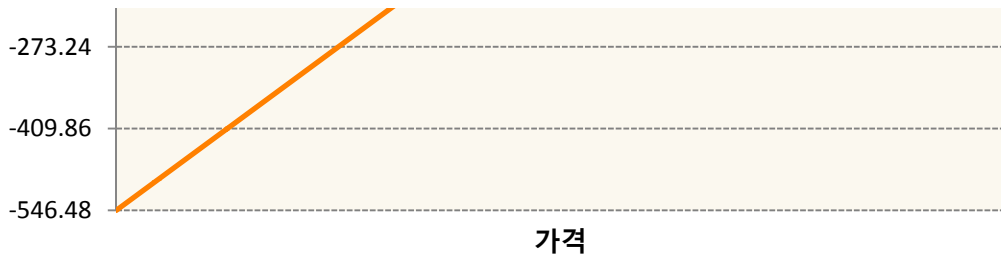
2. 만기시점의 손익구조

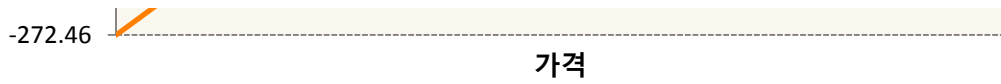
BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20



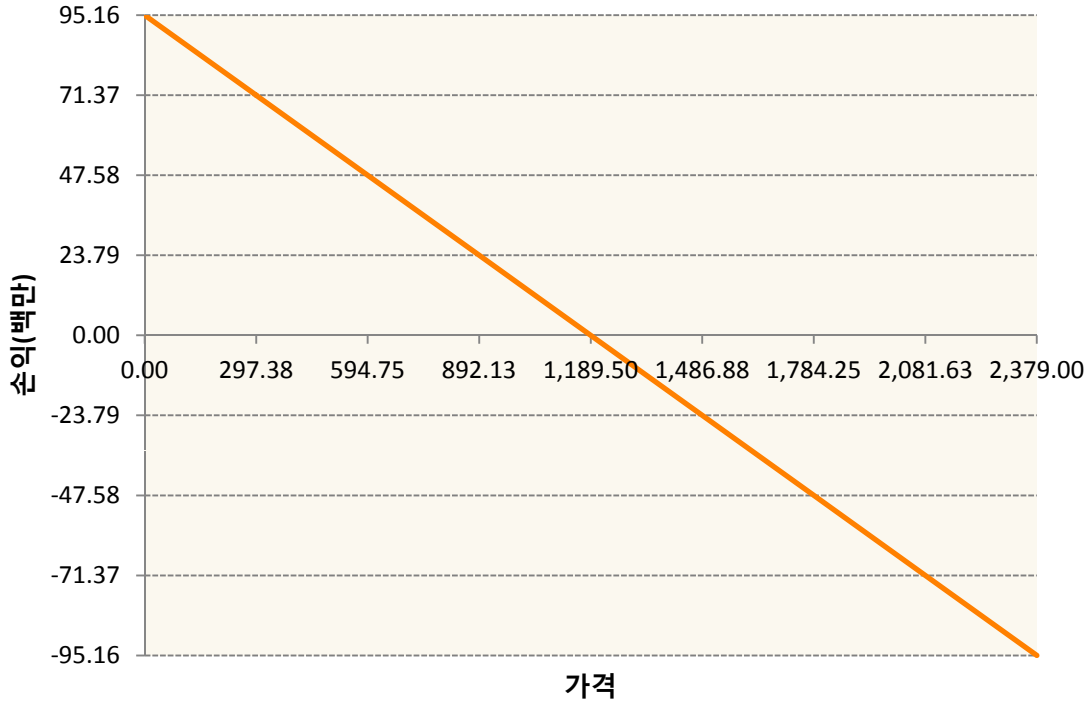
CH0-CORN FUTURE Mar20



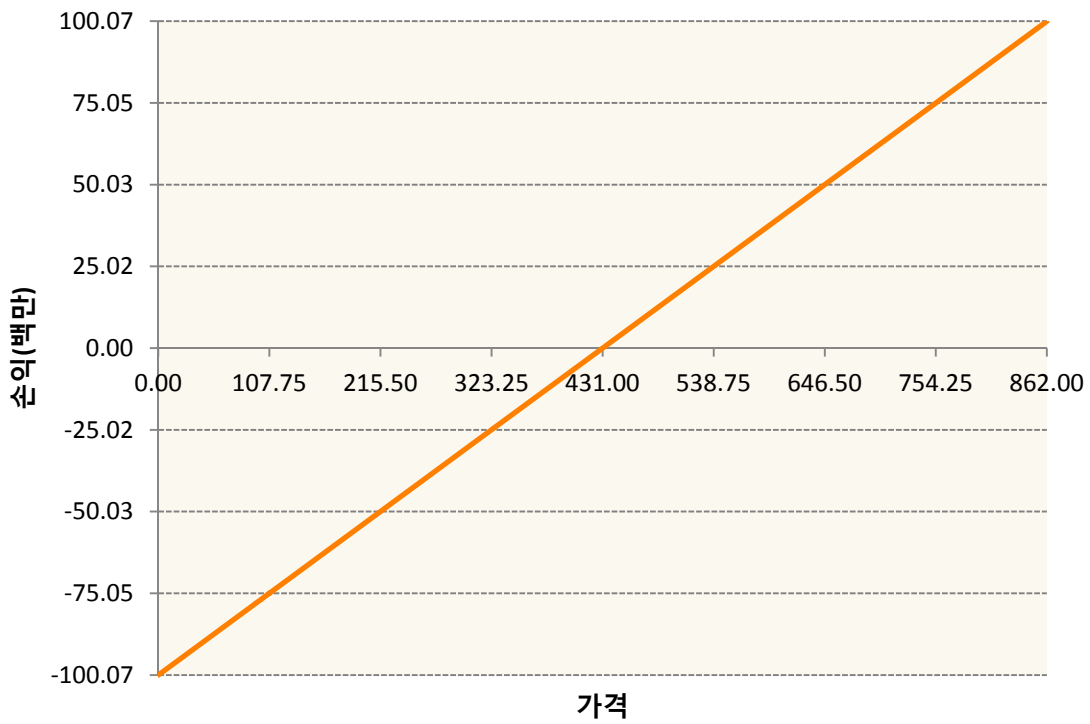




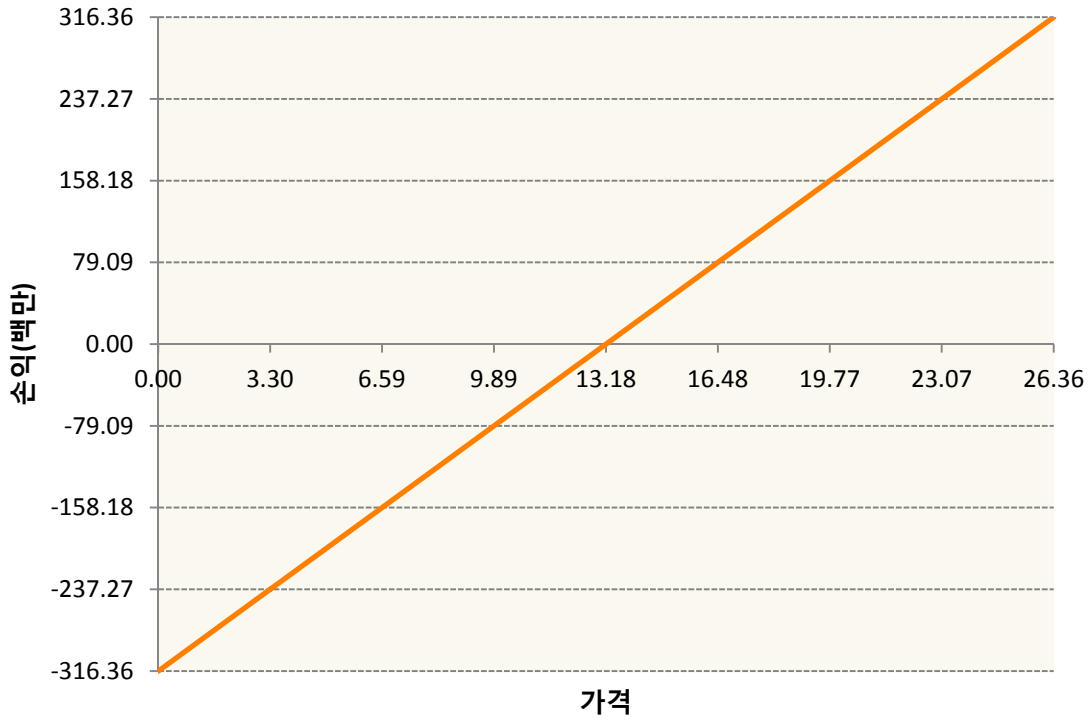
KR4175PC0003-2019-12 달러선물



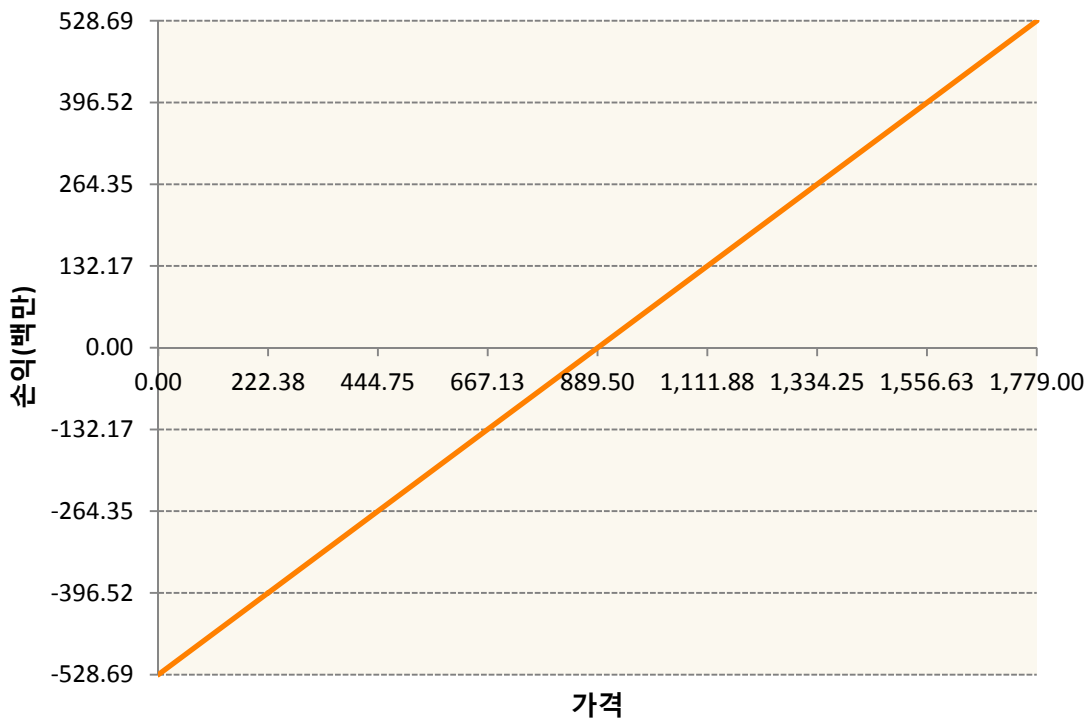
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

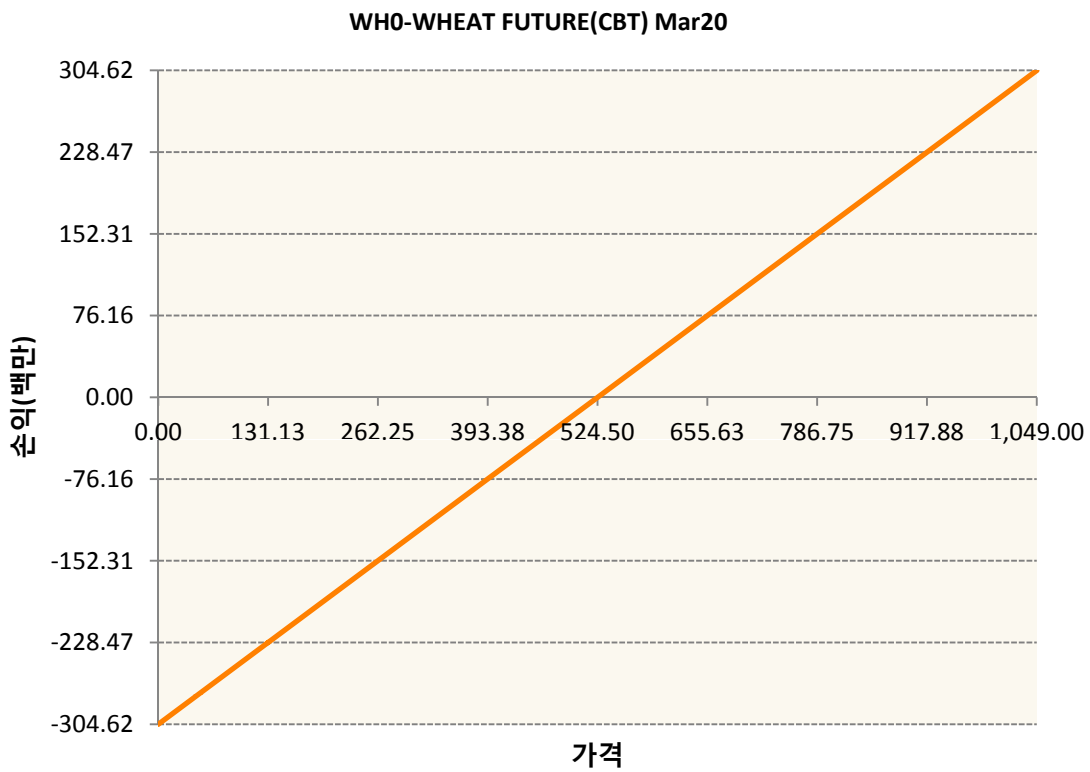
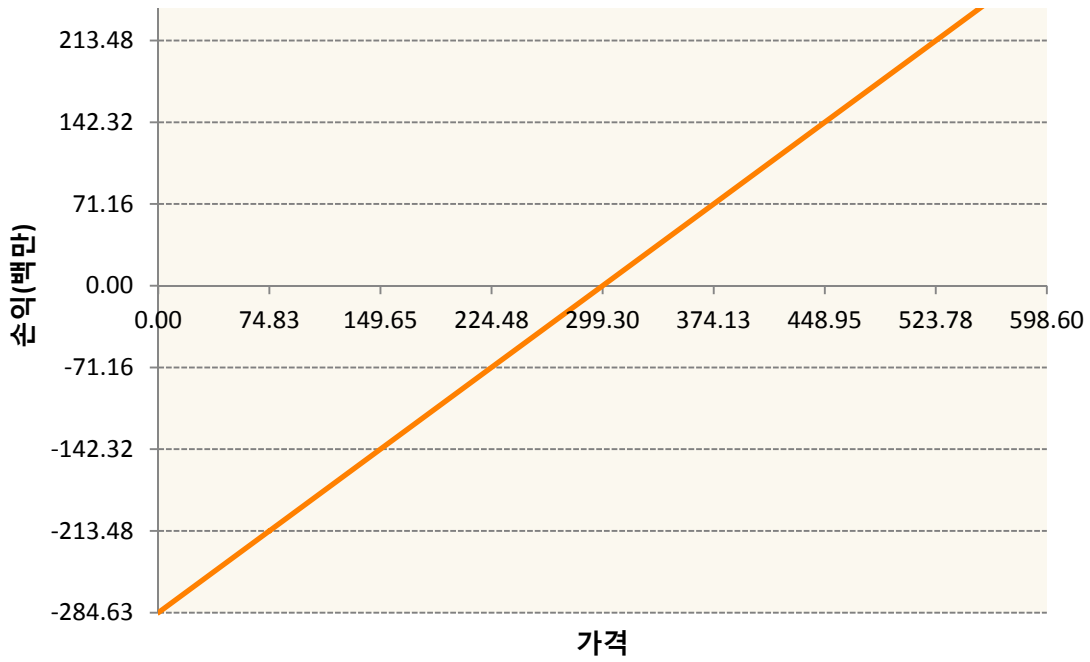


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20



SMF0-SOYBEAN MEAL FUTR Jan20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF0	SOYBEAN OIL FUTR Jan20	27
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	42
SMF0	SOYBEAN MEAL FUTR Jan20	23
WH0	WHEAT FUTURE(CBT) Mar20	24

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

(단위:백만원)

246