

공시일	2019-12-12
기준일	2019-12-11

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	2019-12-12
기준일	2019-12-11

스마트인덱스모

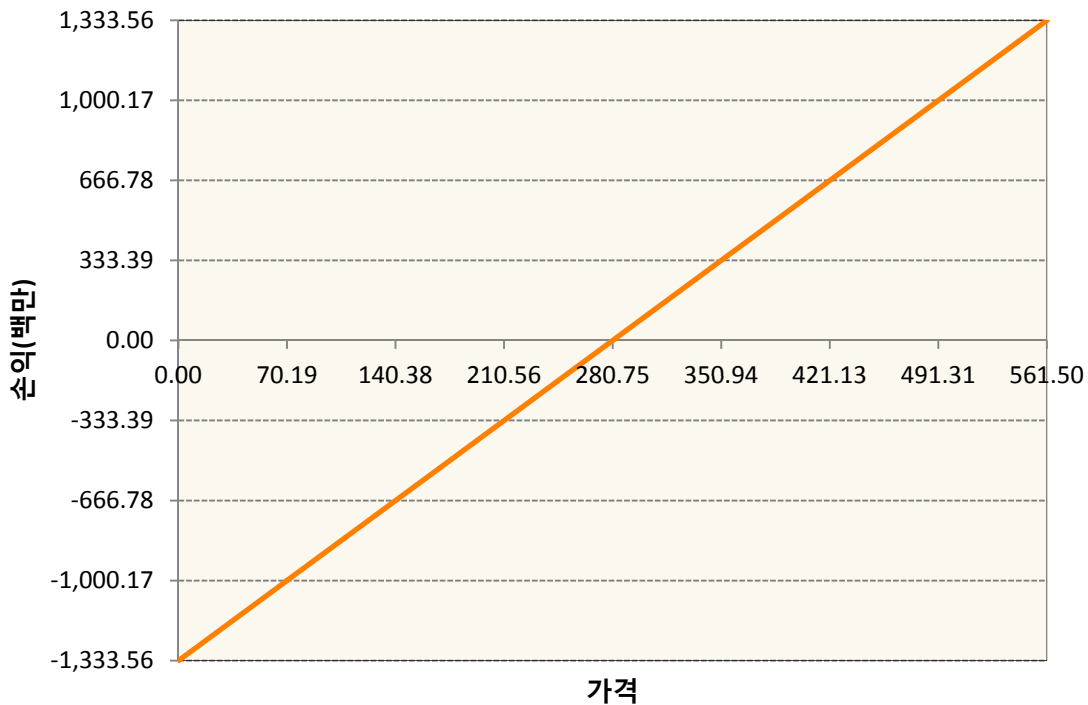
1. 계약금액

(단위:백만원)

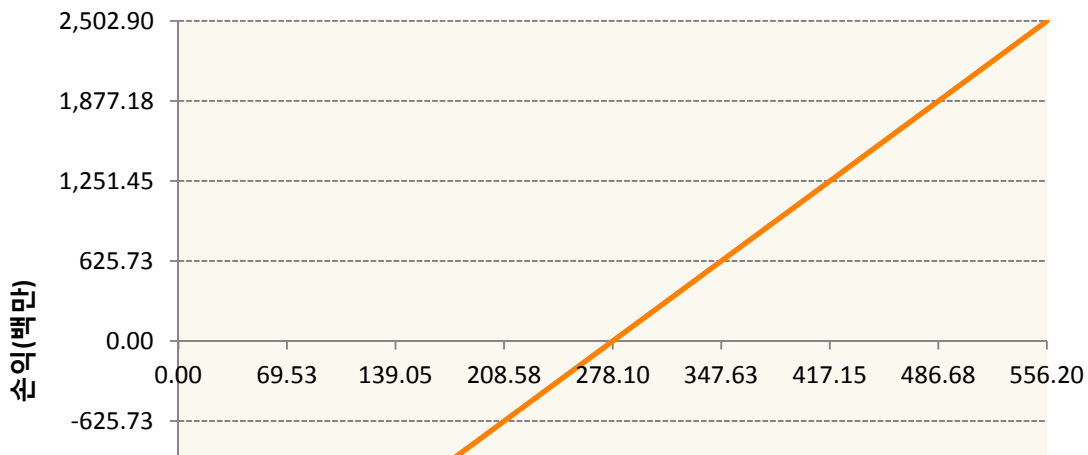
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,836	0	3,836	장내

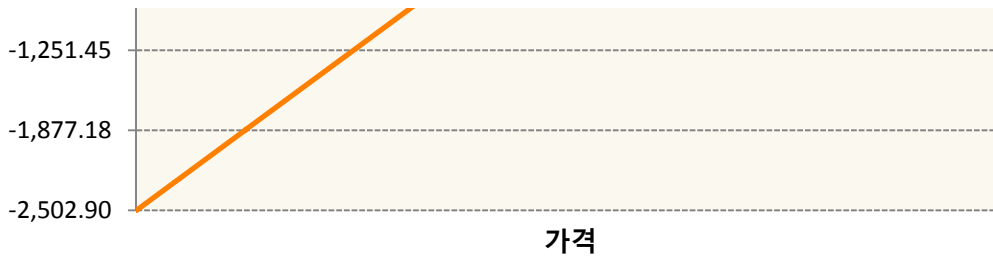
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						107
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107	
-5.33%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71	
-2.67%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	36	36	36	36	36	36	36	
5.33%	71	71	71	71	71	71	71	
8.00%	107	107	107	107	107	107	107	
KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						202
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-202	-202	-202	-202	-202	-202	-202	
-5.33%	-135	-135	-135	-135	-135	-135	-135	
-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%	135	135	135	135	135	135	135	
8.00%	202	202	202	202	202	202	202	

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

240

공시일	2019-12-12
기준일	2019-12-11

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

1,096

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

631

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-12
기준일	2019-12-11

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	6,551	0	6,551	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(1)	383
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	141

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

730

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-12
기준일	2019-12-11

유로인덱스모(주식-파생형)

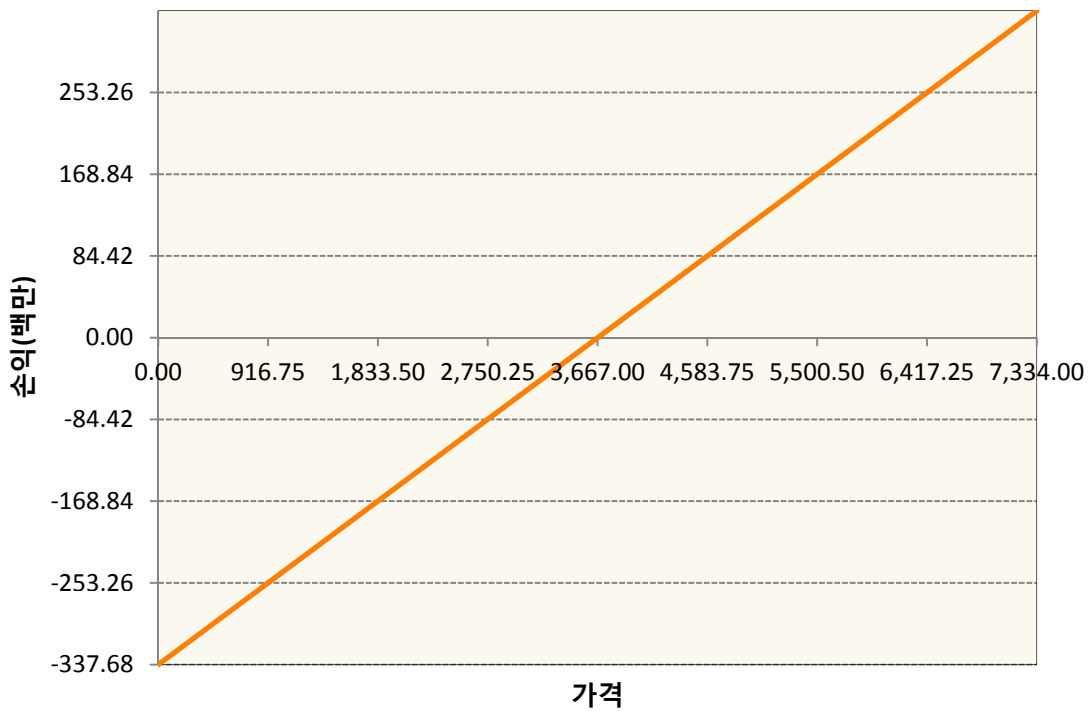
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	338	0	338	

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	2019-12-12
기준일	2019-12-11

차이나인덱스모(주식-파생형)

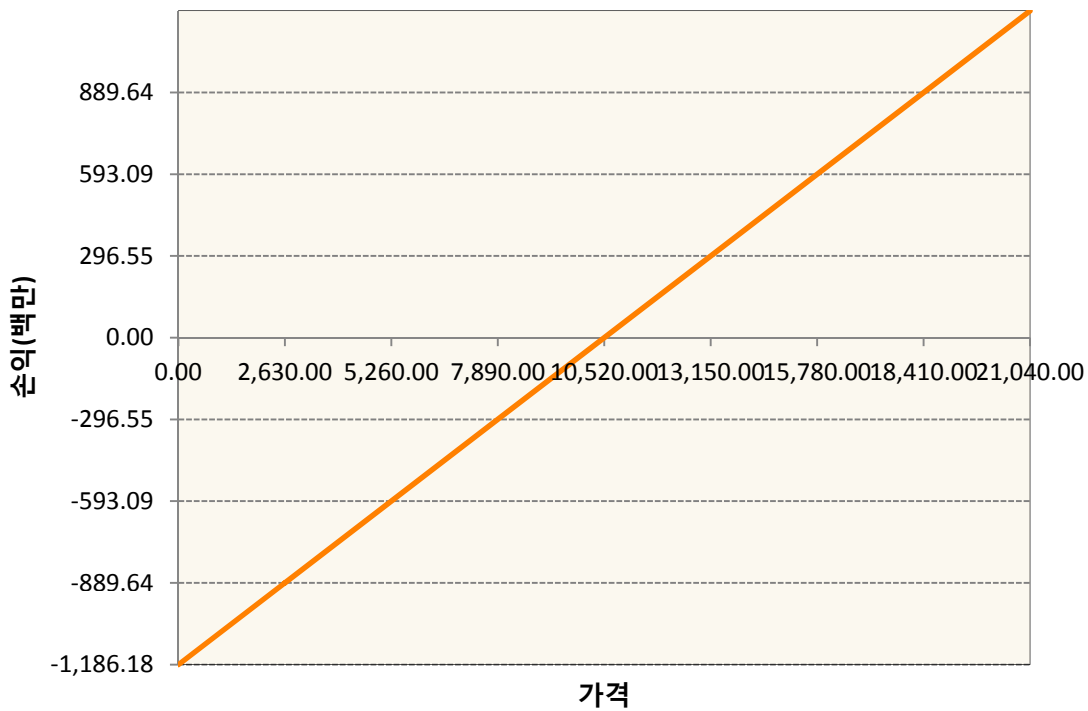
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,186	0	1,186	

2. 만기시점의 손익구조

HCZ9-HSCEI Futures Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ9	HSCEI Futures Dec19	95
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

85

공시일	2019-12-12
기준일	2019-12-11

커버드콜모(주식혼합-파생형)

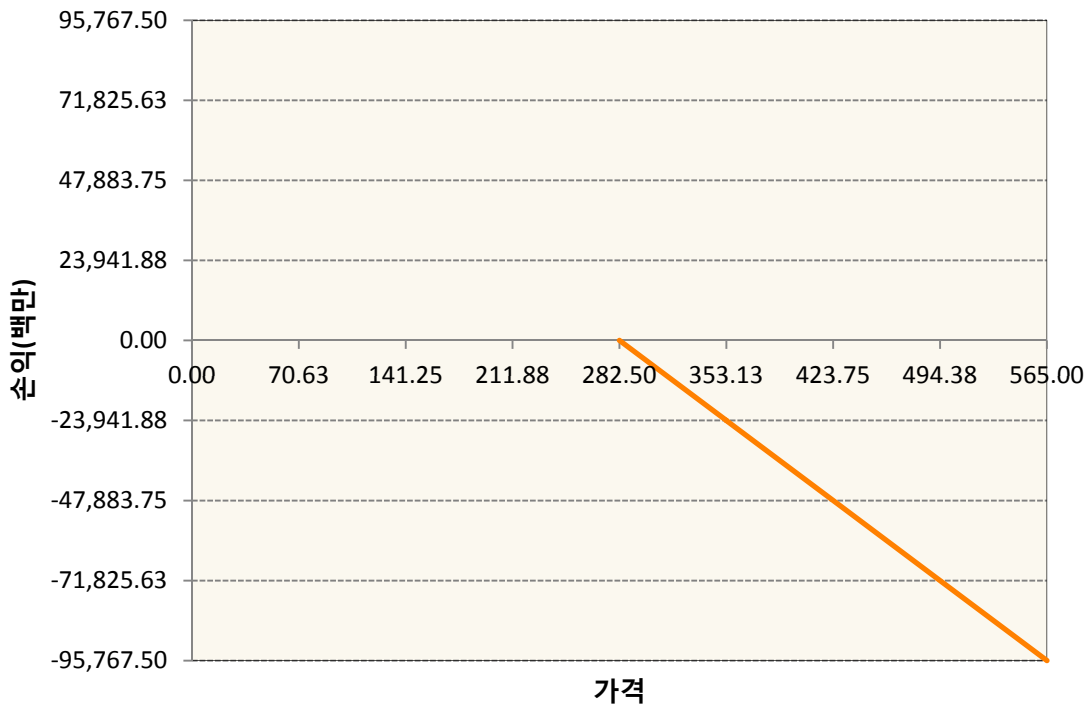
1. 계약금액

(단위:백만원)

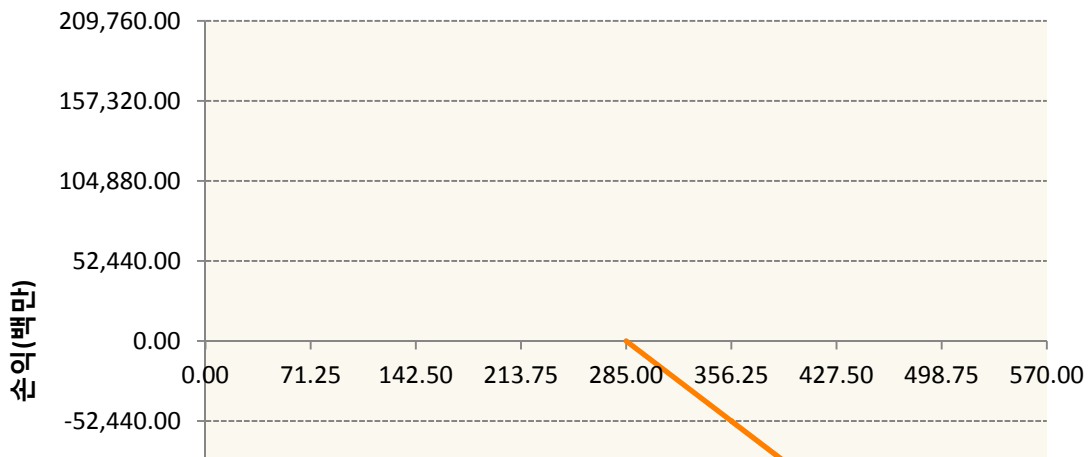
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	35,617	35,309	308	장내
누계	유가증권	옵션	0	497,831	-497,831	장내

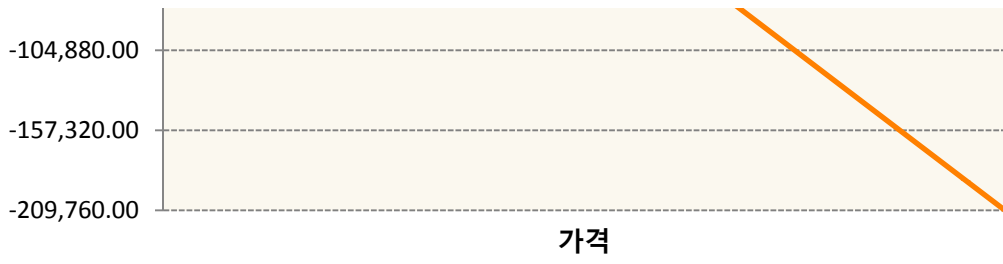
2. 만기시점의 손익구조

KR4201PC2825-2019-12 콜282.5

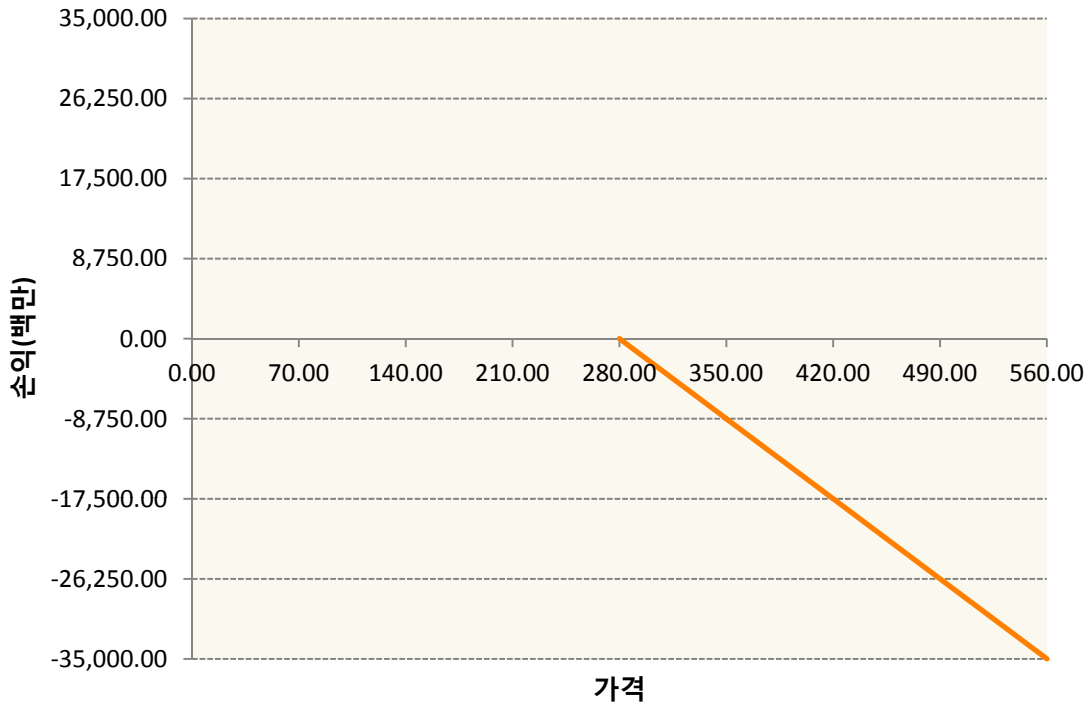


KR4201PC2858-2019-12 콜285

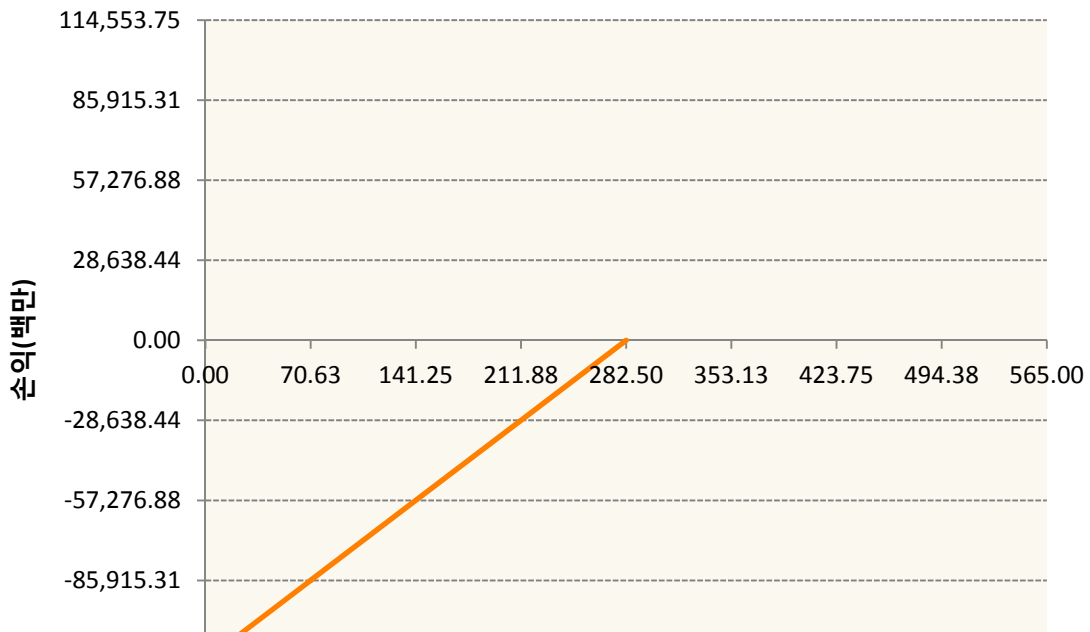


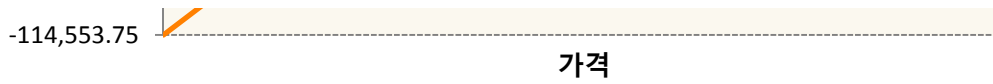


KR4201Q12803-2020-01 콜280

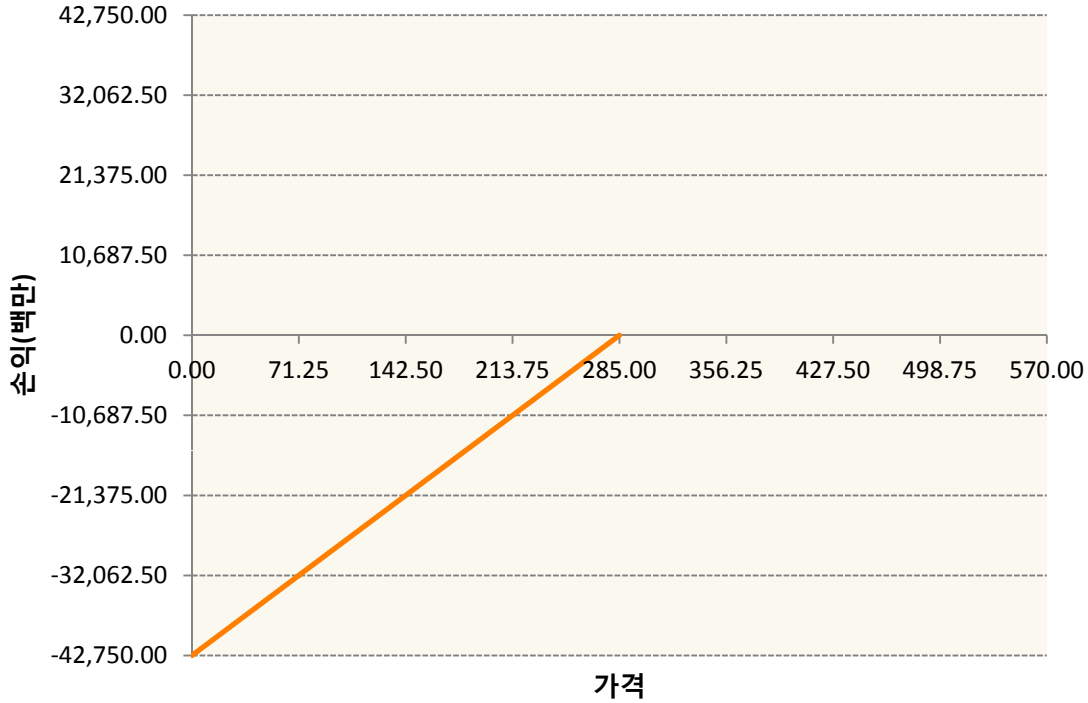


KR4301PC2824-2019-12 풋282.5





KR4301PC2857-2019-12 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PC2825		2019-12 콜282.5						6,581
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	264	264	264	264	264	264	264	264
-5.33%	264	264	264	264	264	264	264	264
-2.67%	264	264	262	260	257	251	245	
0%	116	79	40	0	-41	-83	-126	
2.67%	-1,536	-1,550	-1,567	-1,587	-1,611	-1,637	-1,665	
5.33%	-4,047	-4,048	-4,048	-4,048	-4,049	-4,050	-4,053	
8.00%	-6,581	-6,581	-6,581	-6,581	-6,581	-6,581	-6,581	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						12,824
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	199	199	199	199	199	199	199	199
-5.33%	199	199	199	199	199	199	199	199
-2.67%	199	199	199	198	196	193	188	
0%	132	95	51	0	-57	-119	-185	
2.67%	-2,073	-2,147	-2,226	-2,309	-2,394	-2,482	-2,572	

5.33%	-7,323	-7,324	-7,327	-7,332	-7,339	-7,351	-7,366
8.00%	-12,823	-12,823	-12,823	-12,823	-12,823	-12,823	-12,824
KR4201Q12803 2020-01 콜280							2,144
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,040	1,003	959	910	857	799	738
-5.33%	916	854	788	718	645	571	494
-2.67%	674	590	505	420	333	246	158
0%	278	185	93	0	-93	-185	-278
2.67%	-281	-367	-454	-543	-632	-722	-812
5.33%	-983	-1,051	-1,123	-1,198	-1,276	-1,356	-1,438
8.00%	-1,790	-1,836	-1,888	-1,945	-2,008	-2,074	-2,144
KR4301PC2824 2019-12 풋282.5							9,048
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,048	-9,048	-9,048	-9,048	-9,048	-9,048	-9,048
-5.33%	-6,017	-6,017	-6,017	-6,017	-6,017	-6,017	-6,017
-2.67%	-2,987	-2,987	-2,987	-2,987	-2,987	-2,987	-2,987
0%	30	22	12	0	-13	-28	-43
2.67%	947	947	947	947	946	945	943
5.33%	947	947	947	947	947	947	947
8.00%	947	947	947	947	947	947	947
KR4301PC2857 2019-12 풋285							3,363
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,363	-3,363	-3,363	-3,363	-3,363	-3,363	-3,363
-5.33%	-2,242	-2,242	-2,242	-2,242	-2,242	-2,242	-2,242
-2.67%	-1,120	-1,120	-1,120	-1,120	-1,120	-1,120	-1,120
0%	1	0	0	0	-1	-1	-2
2.67%	707	706	703	700	696	692	687
5.33%	710	710	710	710	710	710	710
8.00%	710	710	710	710	710	710	710

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

(단위:백만원)

42,991

공시일	2019-12-12
기준일	2019-12-11

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

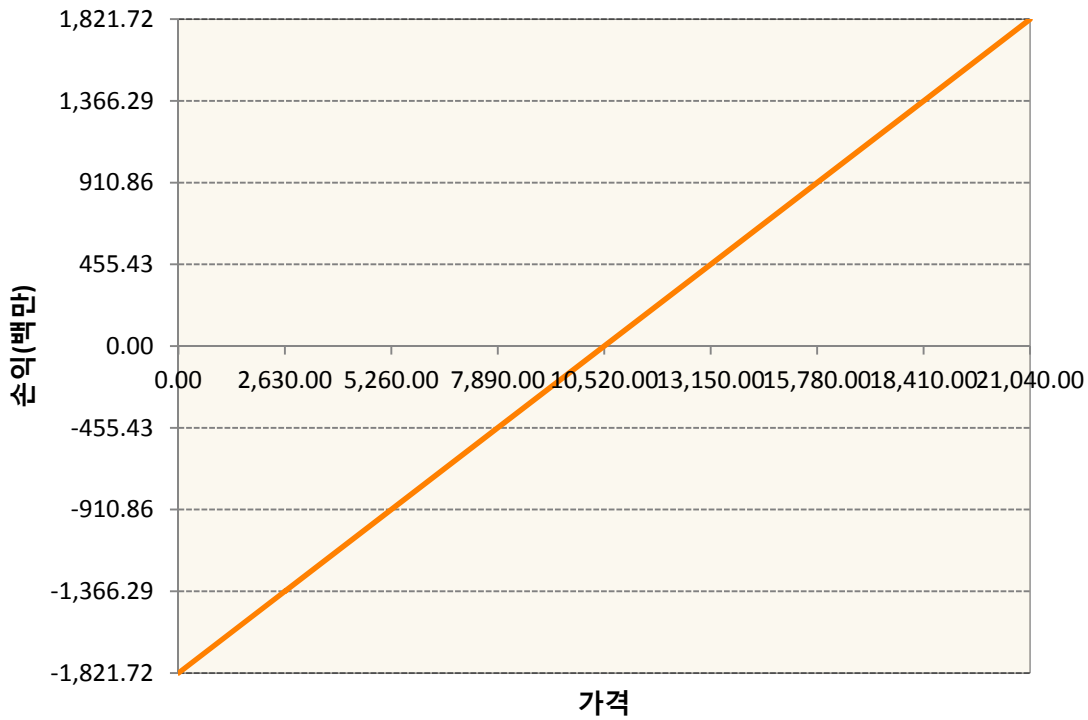
1. 계약금액

(단위:백만원)

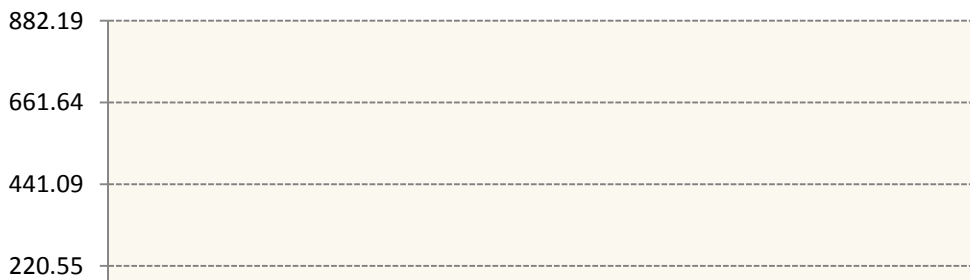
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,822	0	1,822	
누계	유가증권	옵션	0	5,003	-5,003	장내
누계	통화	선도	0	2,151	-2,151	장외

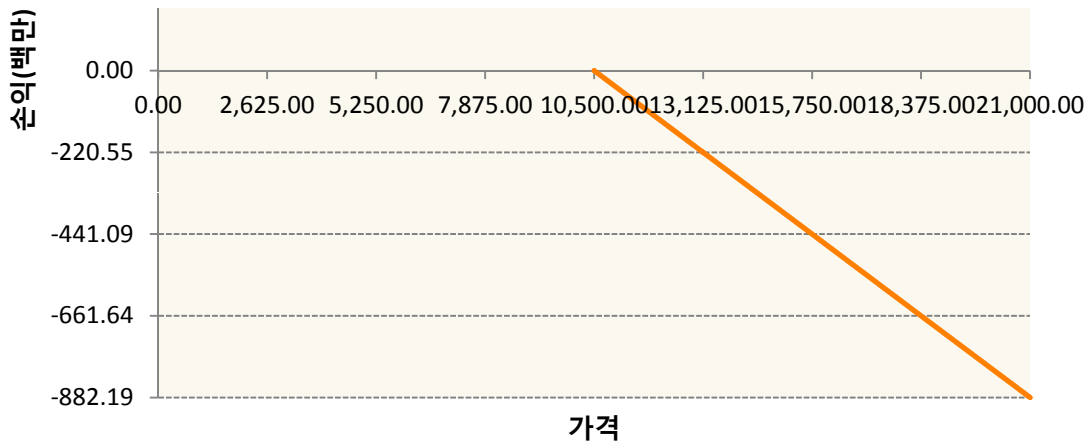
2. 만기시점의 손익구조

HCZ9-HSCEI Futures Dec19

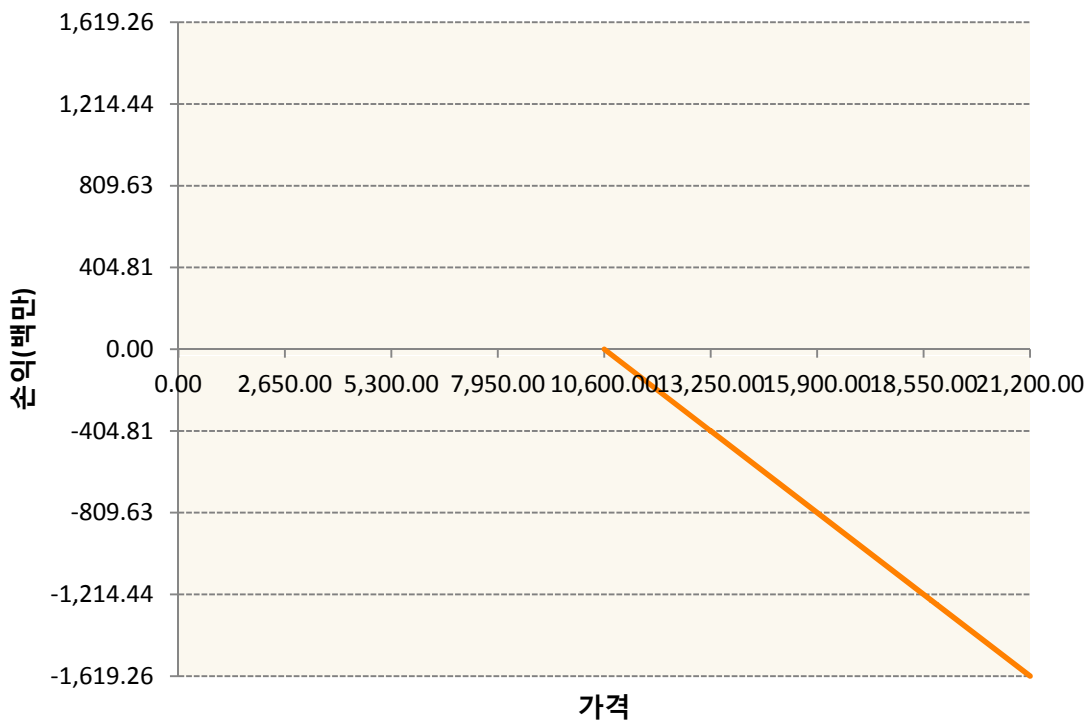


OHHI29-C105-HSCEI

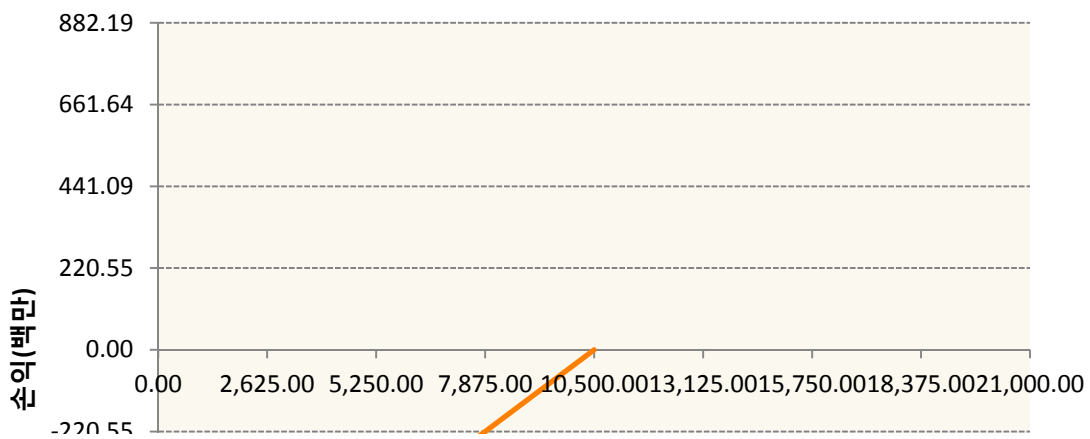


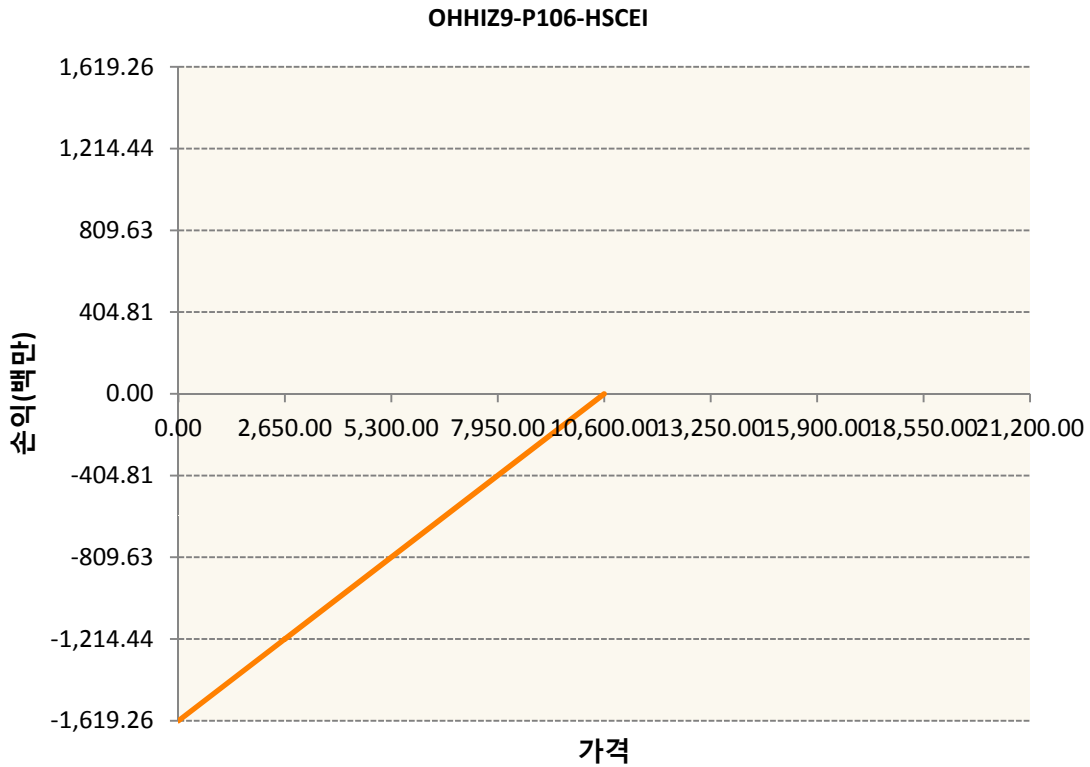
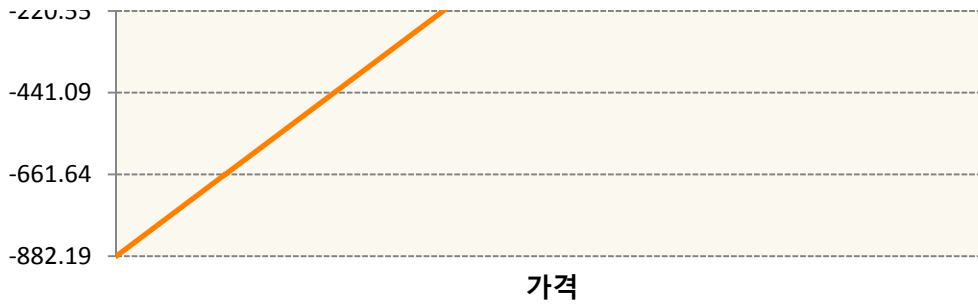


OHHIZ9-C106-HSCEI



OHHIZ9-P105-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	172
HCZ9 HSCEI Futures Dec19	146
OHHIZ9-C1C HSCEI	71
OHHIZ9-C1C HSCEI	130
OHHIZ9-P10 HSCEI	71
OHHIZ9-P10 HSCEI	130

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	536

공시일	2019-12-12
기준일	2019-12-11

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

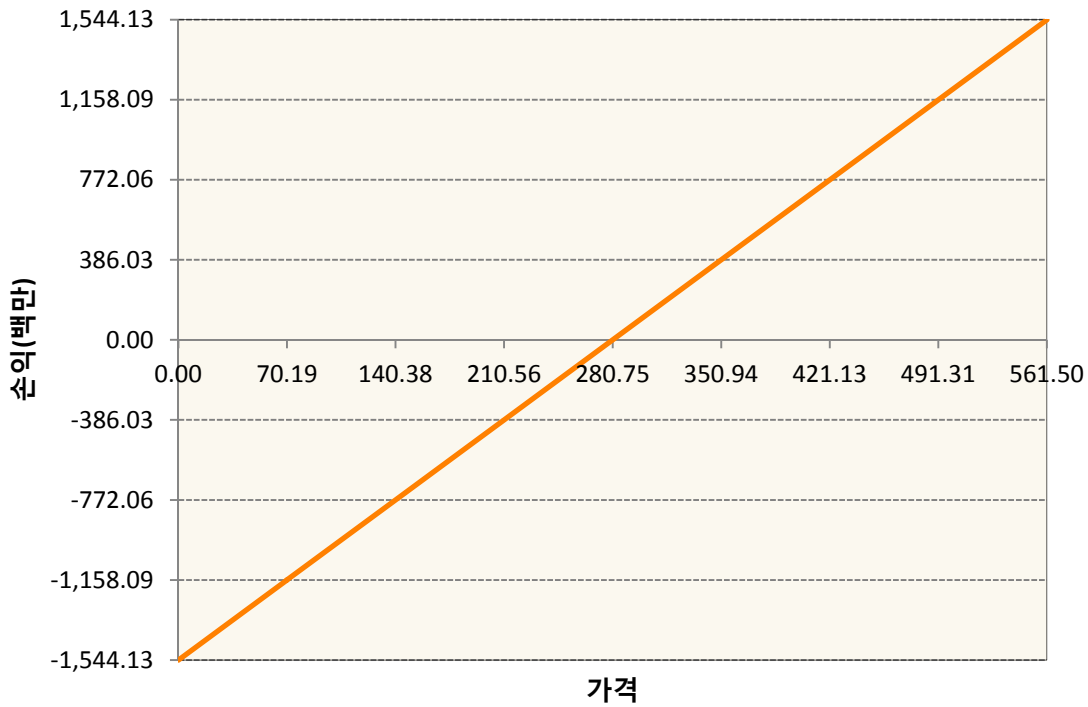
1. 계약금액

(단위:백만원)

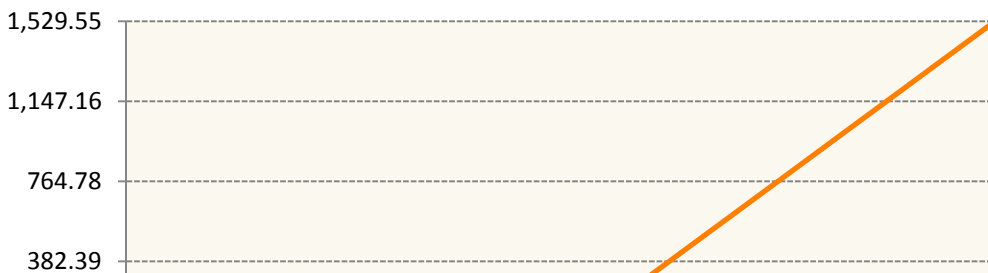
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,525	1,541	-16	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,074	0	3,074	장내
누계	유가증권	스왑	8,625	0	8,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,514	-9,514	장내

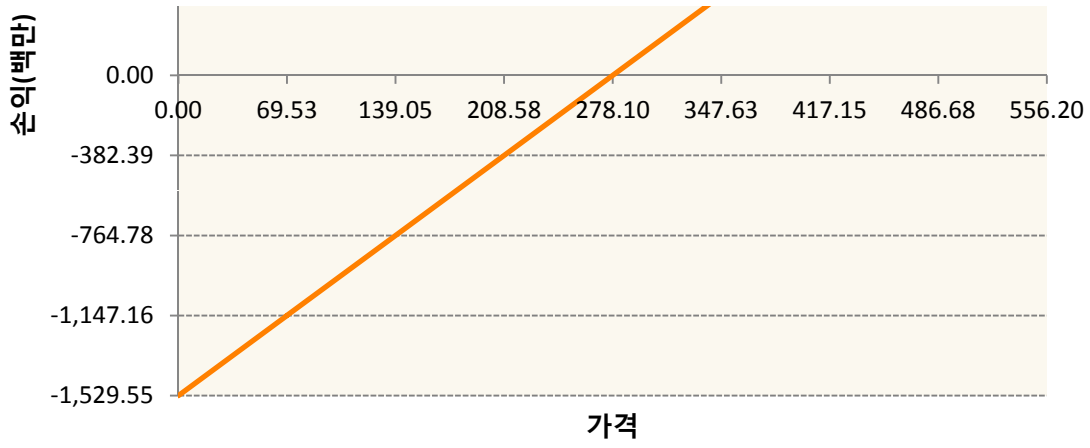
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

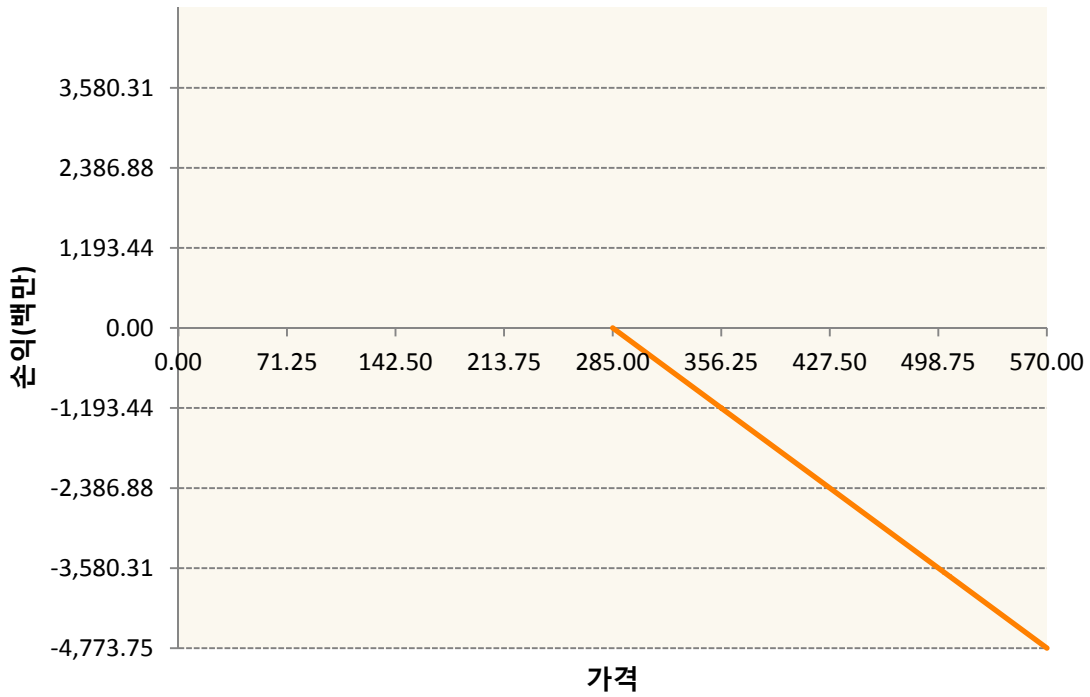


KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

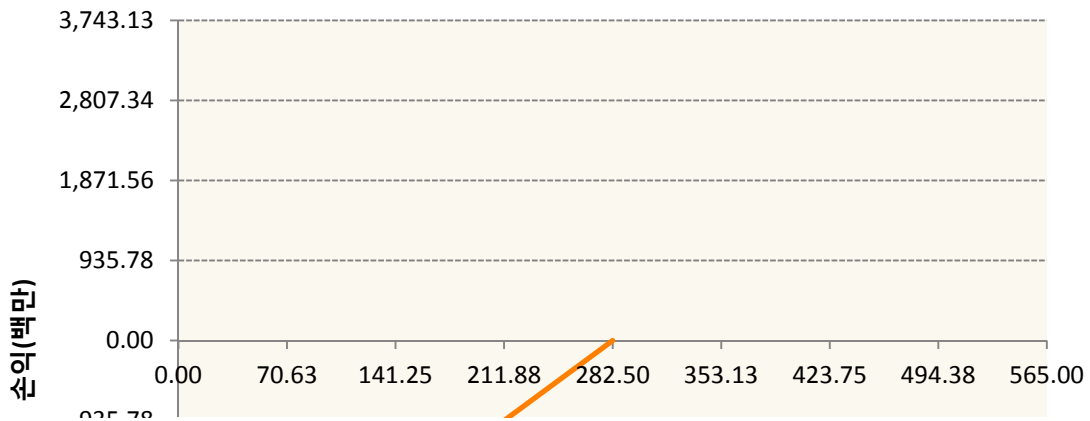




KR4201PC2858-2019-12 콜285

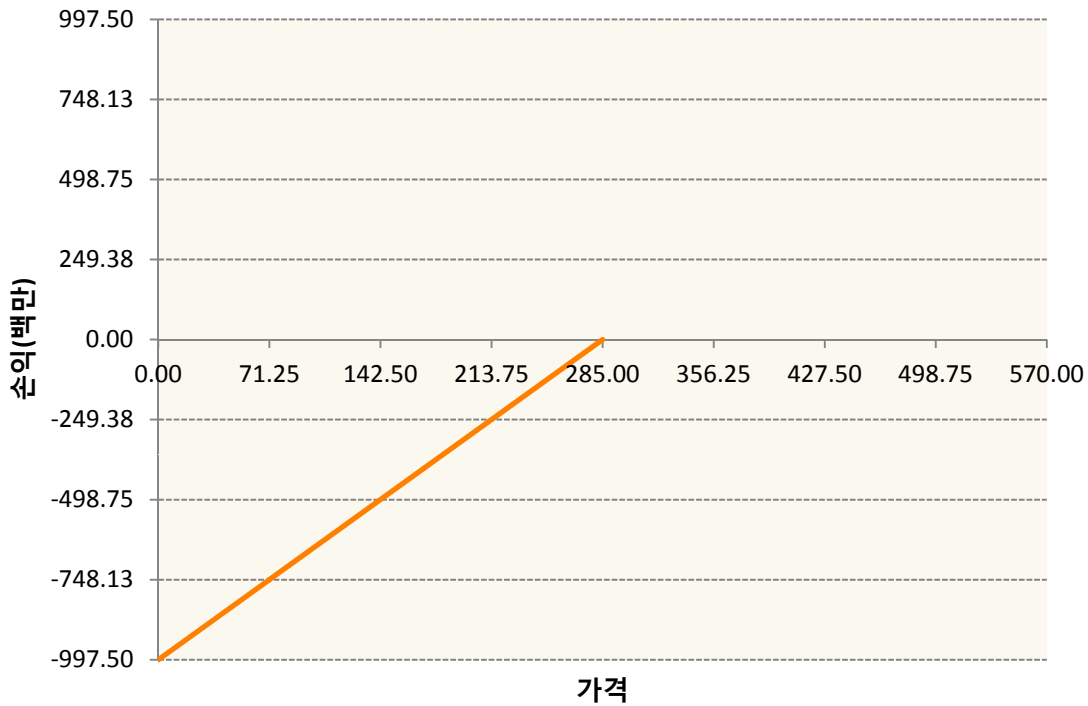


KR4301PC2824-2019-12 풋282.5





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				123
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123
-5.33%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	41	41	41	41	41	41	41
5.33%	82	82	82	82	82	82	82
8.00%	123	123	123	123	123	123	123

KR4101Q30005 2020-03 코스피200지수선물 123

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123
-5.33%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	41	41	41	41	41	41	41
5.33%	82	82	82	82	82	82	82
8.00%	123	123	123	123	123	123	123

KR4201PC2858 2019-12 콜285 292

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5
-5.33%	5	5	5	5	5	5	5
-2.67%	5	5	5	5	4	4	4
0%	3	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	-47	-49	-51	-53	-54	-56	-59
5.33%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-168
8.00%	-292	-292	-292	-292	-292	-292	-292

KR4301PC2824 2019-12 풋282.5 296

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-296	-296	-296	-296	-296	-296	-296
-5.33%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197
-2.67%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	31	31	31	31	31	31	31
5.33%	31	31	31	31	31	31	31
8.00%	31	31	31	31	31	31	31

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%	17	16	16	16	16	16	16
5.33%	17	17	17	17	17	17	17
8.00%	17	17	17	17	17	17	17

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

(단위:백만원)

1,822

공시일	2019-12-12
기준일	2019-12-11

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

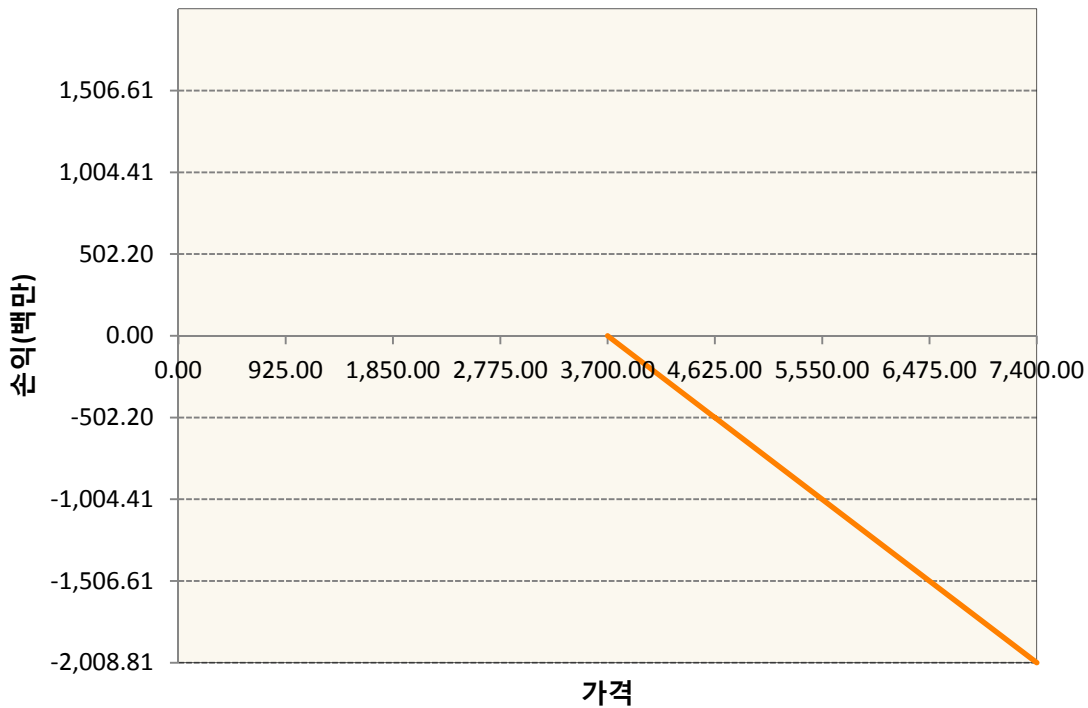
1. 계약금액

(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	712	0	712	
누계	유가증권	스왑	18,106	0	18,106	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,668	-7,668	장내
누계	통화	선도	2,749	6,224	-3,475	장외

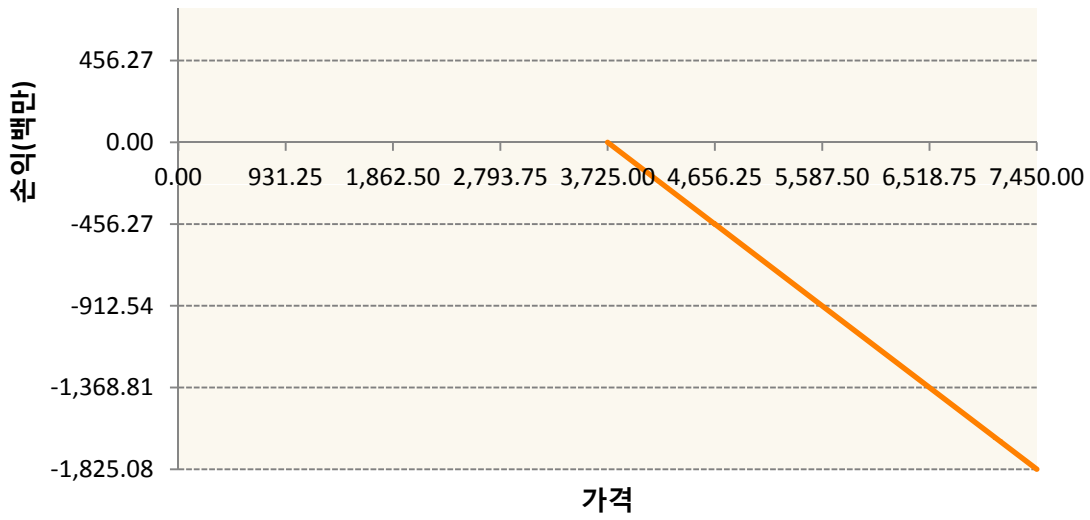
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ9-C3700-EURO STOXX 50

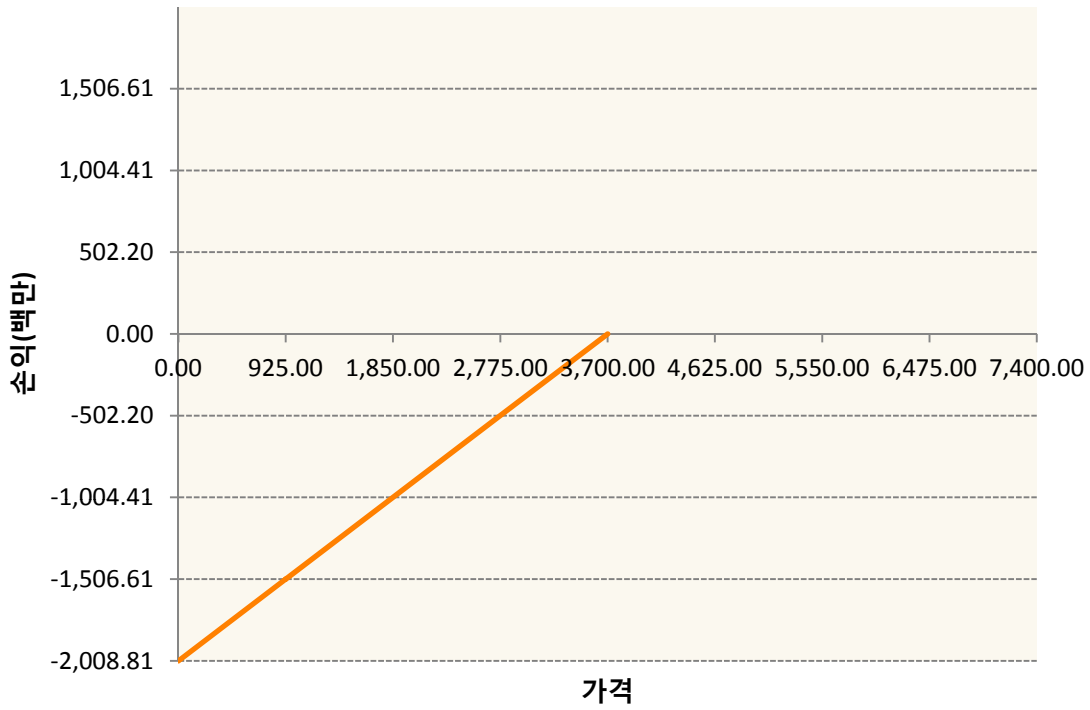


OESXZ9-C3725-EURO STOXX 50

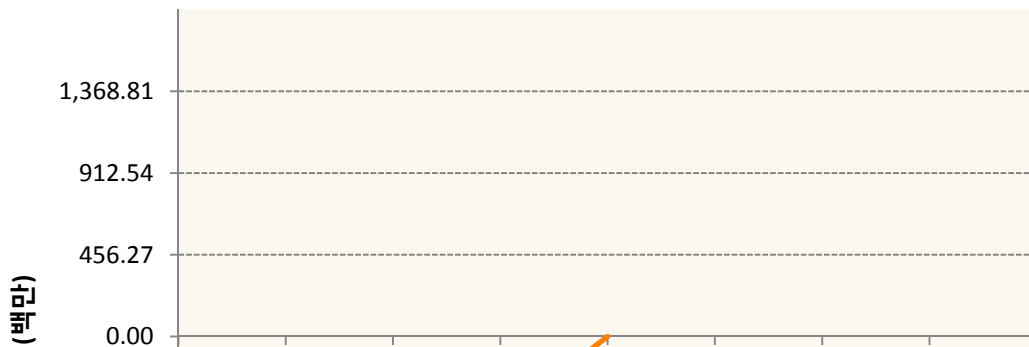


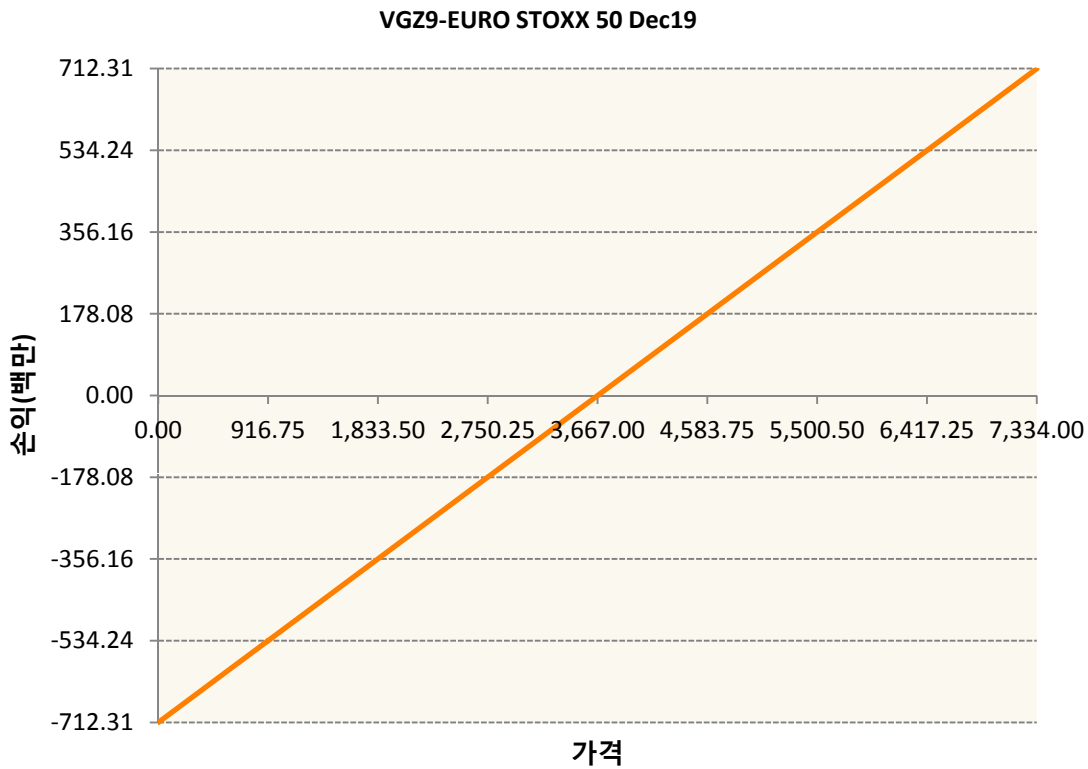
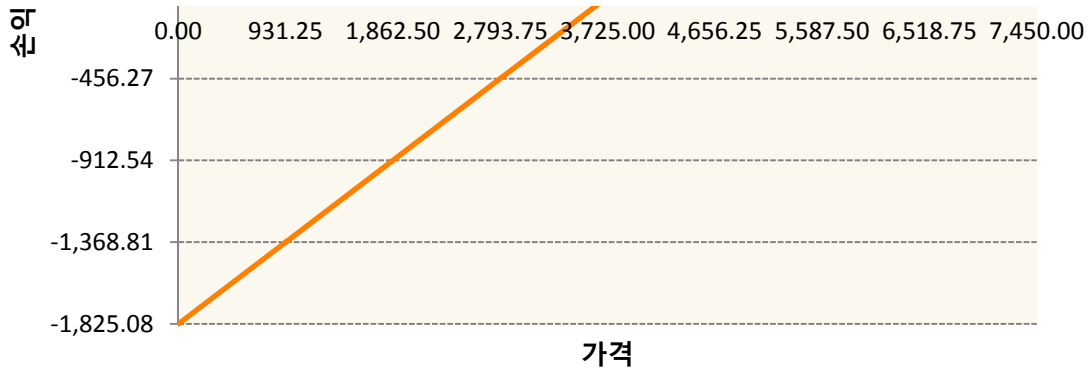


OESXZ9-P3700-EURO STOXX 50



OESXZ9-P3725-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		18
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E		498
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E		167
FX21019X02 EUR/KRW 27-12-19E		53
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50		161
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50		146
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50		161
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50		146
VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	57

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

(단위:백만원)

796

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	2019-12-12
기준일	2019-12-11

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

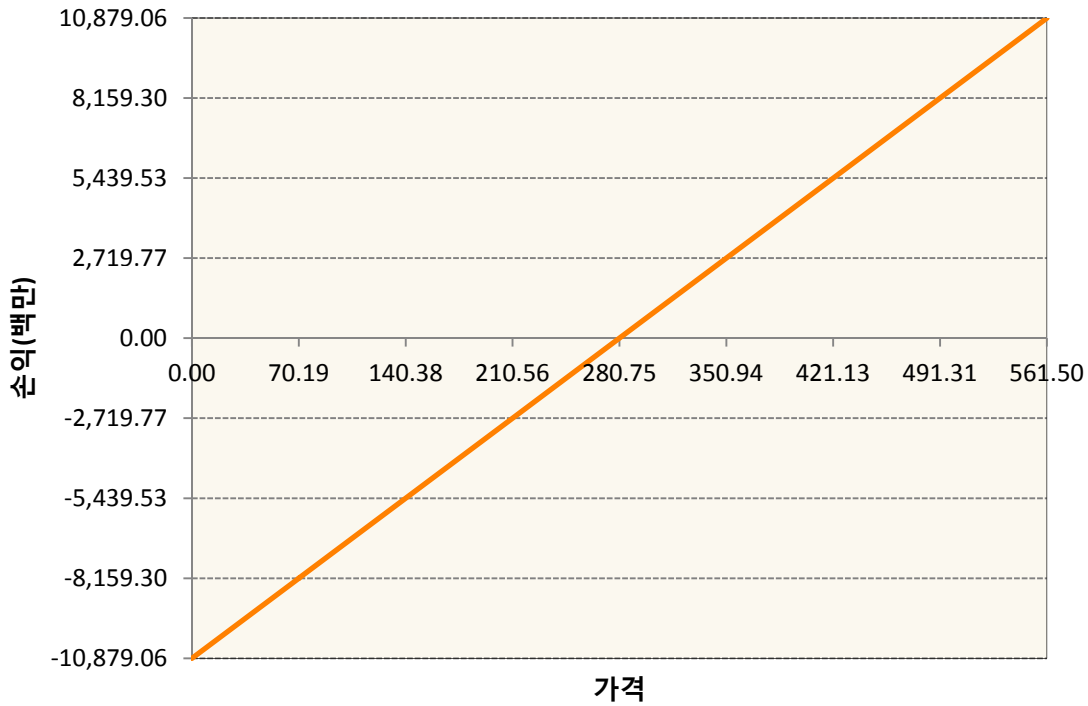
1. 계약금액

(단위:백만원)

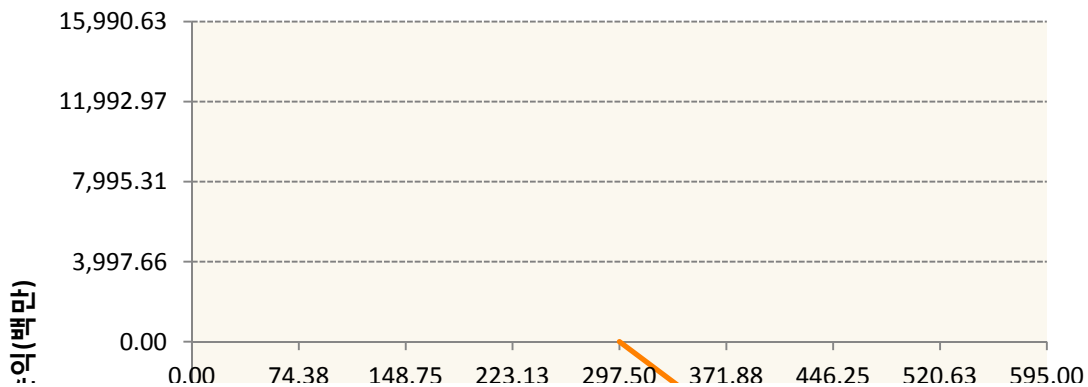
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,879	0	10,879	장내
누계	유가증권	옵션	1,277	21,241	-19,964	장내

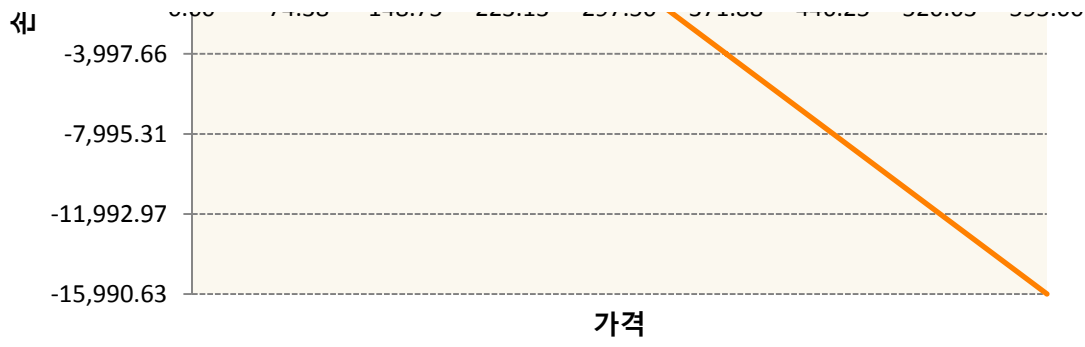
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

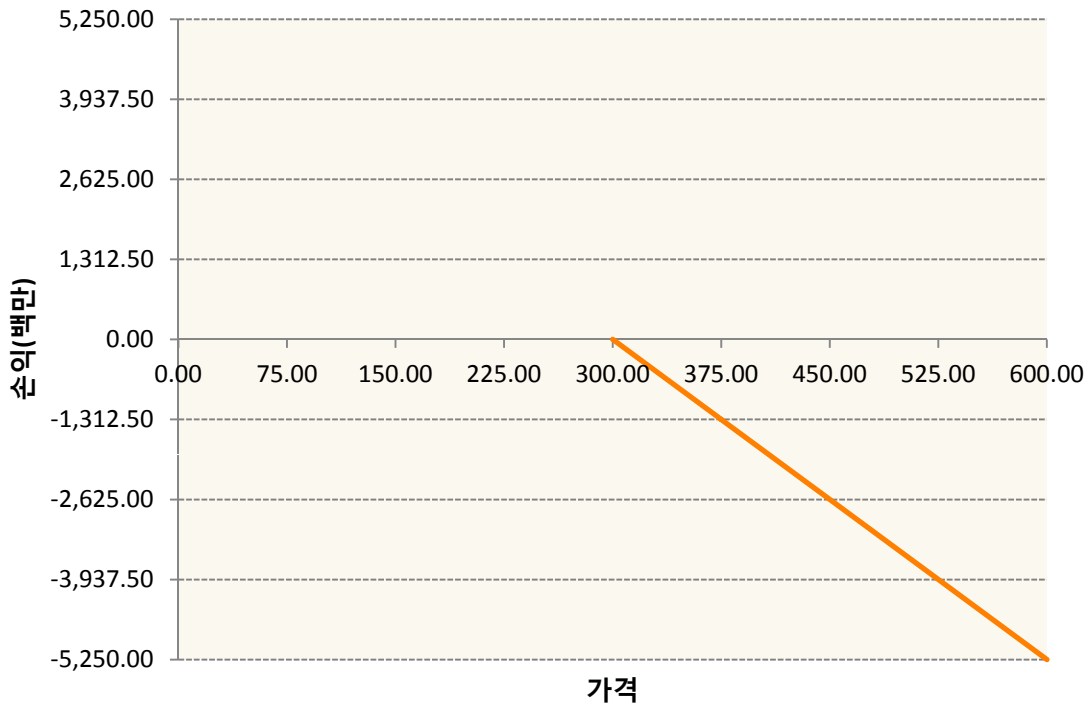


KR4201PC2973-2019-12 콜297.5

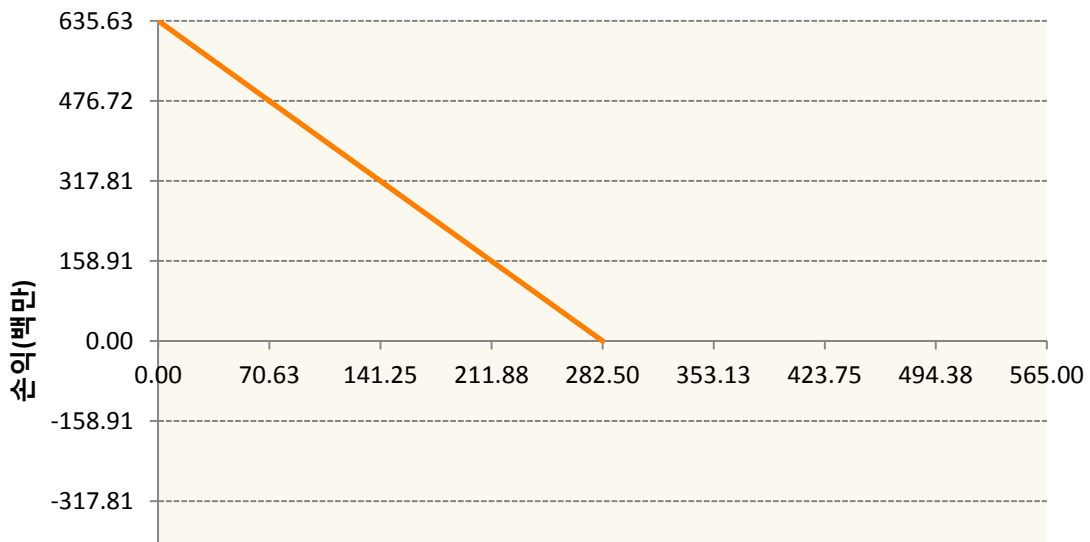


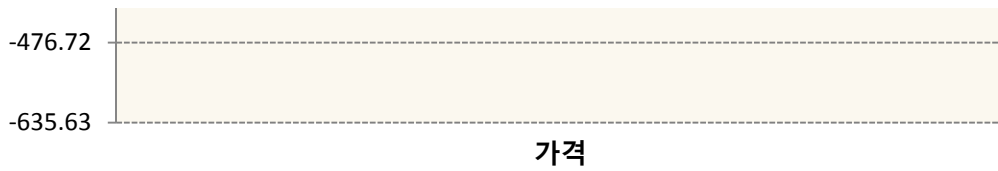


KR4201PC3005-2019-12 콜300

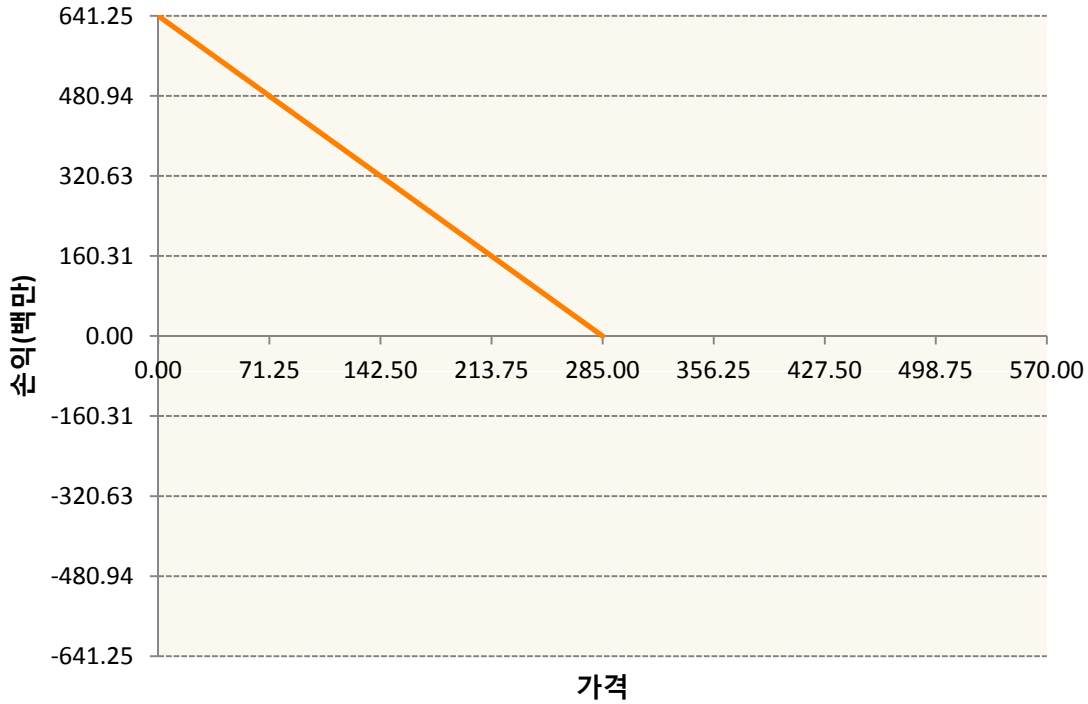


KR4301PC2824-2019-12 풋282.5





KR4301PC2857-2019-12 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						869
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-869	-869	-869	-869	-869	-869	-869	
-5.33%	-579	-579	-579	-579	-579	-579	-579	
-2.67%	-290	-290	-290	-290	-290	-290	-290	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	290	290	290	290	290	290	290	
5.33%	579	579	579	579	579	579	579	
8.00%	869	869	869	869	869	869	869	
KR4201PC2973		2019-12 콜297.5						307
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0	
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0	
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	

0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	-1	-2	-3	-4
5.33%	-26	-32	-38	-45	-52	-59	-66
8.00%	-284	-286	-290	-293	-298	-302	-307
KR4201PC3005 2019-12 콜300							67
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	-2	-3	-4	-5	-7	-9	-10
8.00%	-54	-56	-58	-60	-62	-65	-67
KR4301PC2824 2019-12 풋282.5							50
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	50	50	50	50	50	50	50
-5.33%	33	33	33	33	33	33	33
-2.67%	17	17	17	17	17	17	17
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
KR4301PC2857 2019-12 풋285							50
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	50	50	50	50	50	50	50
-5.33%	34	34	34	34	34	34	34
-2.67%	17	17	17	17	17	17	17
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-11	-11	-11	-10	-10	-10	-10
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)

758

공시일	2019-12-12
기준일	2019-12-11

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	210,163	0	210,163	

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	2019-12-12
기준일	2019-12-11

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	219,361	0	219,361	

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	2019-12-12
기준일	2019-12-11

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	557,283	0	557,283	
누계	통화	선도	0	577,637	-577,637	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019V01 KRW/USD 16-12-19E		1,720
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,874
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,434
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,539
FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E		1,567
FX21019X00 KRW/USD 12-12-19E		956
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		478
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		956
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		1,567
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		1,912
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		3,288
FX21019X02 KRW/USD 26-12-19E		4,817
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		4,874
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		191
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,867
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,867
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,389
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,581
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E		1,663
FX21019Z00 KRW/USD 10-01-20E		1,147
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E		1,567
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E		956

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

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

179

공시일	2019-12-12
기준일	2019-12-11

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

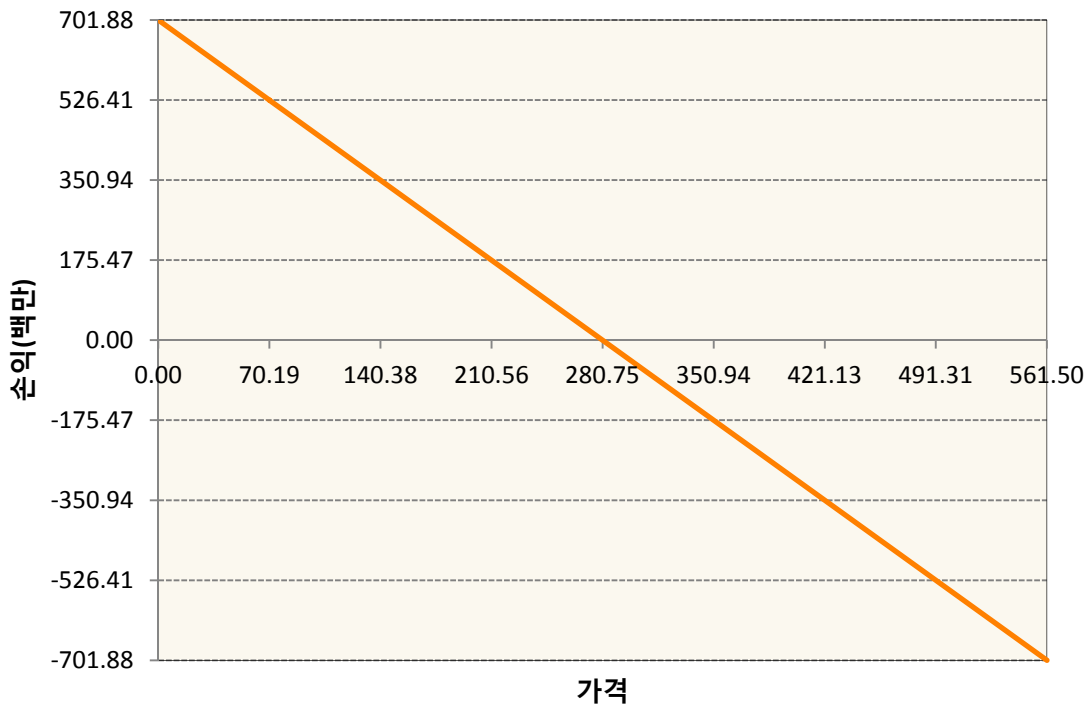
1. 계약금액

(단위:백만원)

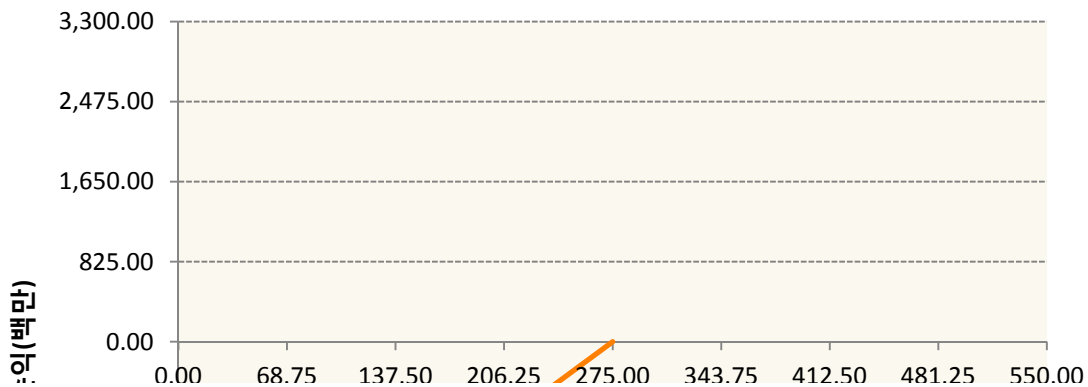
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	702	-702	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,994	-3,994	장내

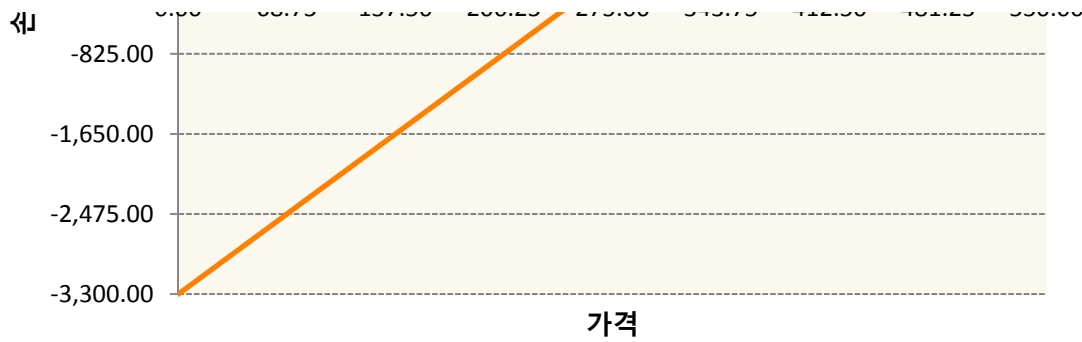
2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

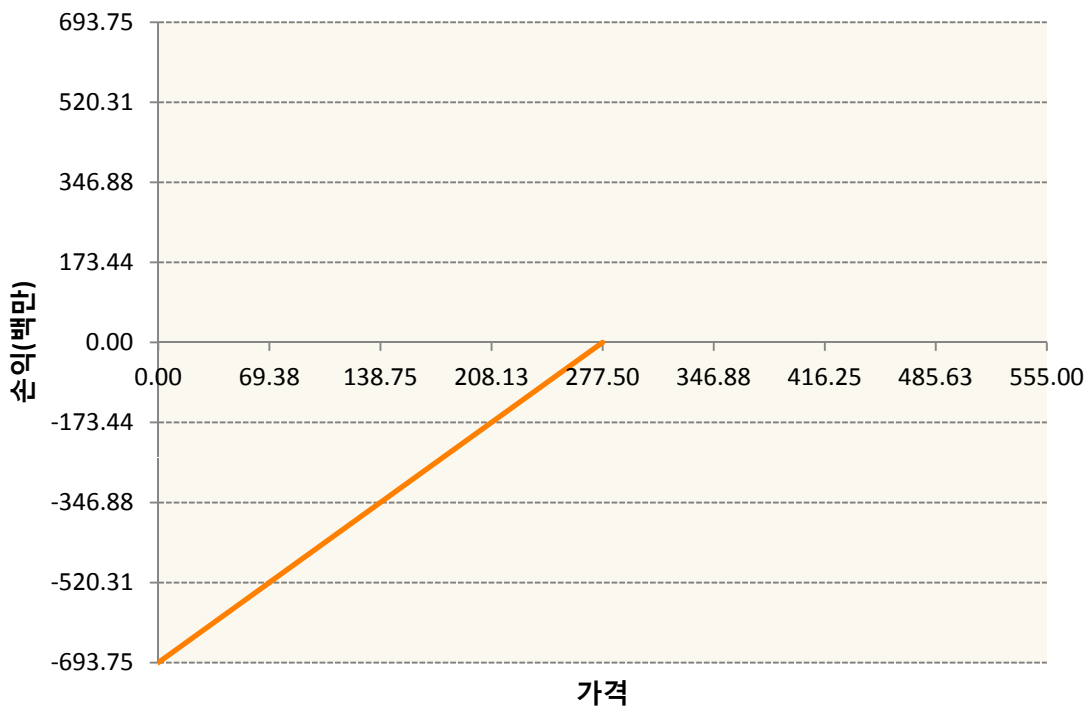


KR4301PC2758-2019-12 풋275





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						206
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-206	-206	-206	-206	-206	-206	-206
-5.33%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116
-2.67%	-27	-27	-27	-28	-28	-28	-29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

KR4301PC2774 2019-12 풋277.5 49

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-5.33%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-2.67%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

297

공시일	2019-12-12
기준일	2019-12-11

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	15,065	0	15,065	
누계	통화	선도	0	14,766	-14,766	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019X01 KRW/USD 13-01-20E		234
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		296
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		297
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E		354

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

(단위:백만원)

369

공시일	2019-12-12
기준일	2019-12-11

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	1,017	0	1,017	장외
누계	통화	선도	318	358	-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)

78

공시일	2019-12-12
기준일	2019-12-11

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

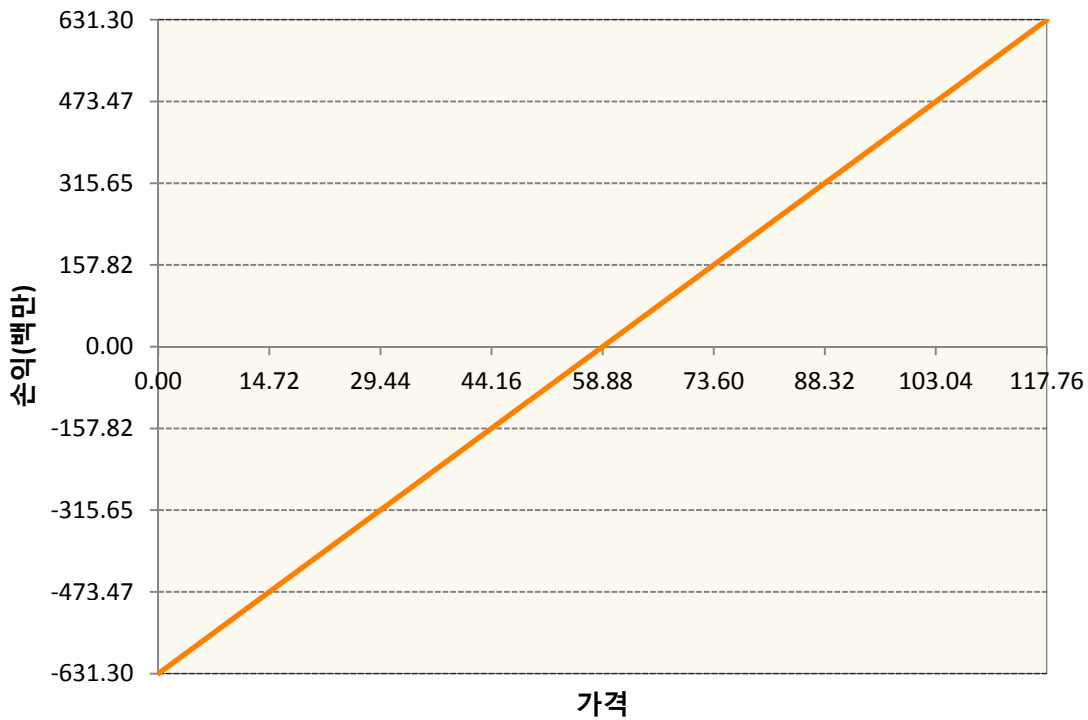
1. 계약금액

(단위:백만원)

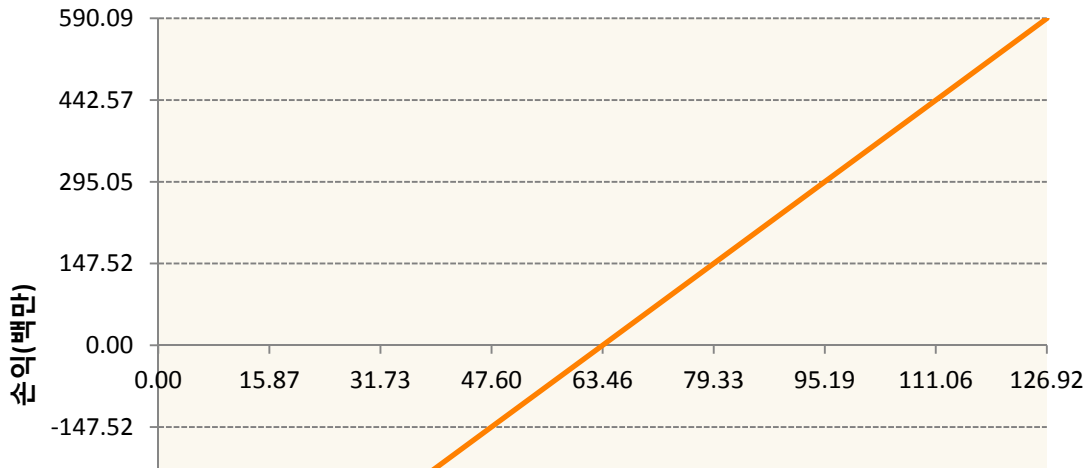
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,380	299	2,082	

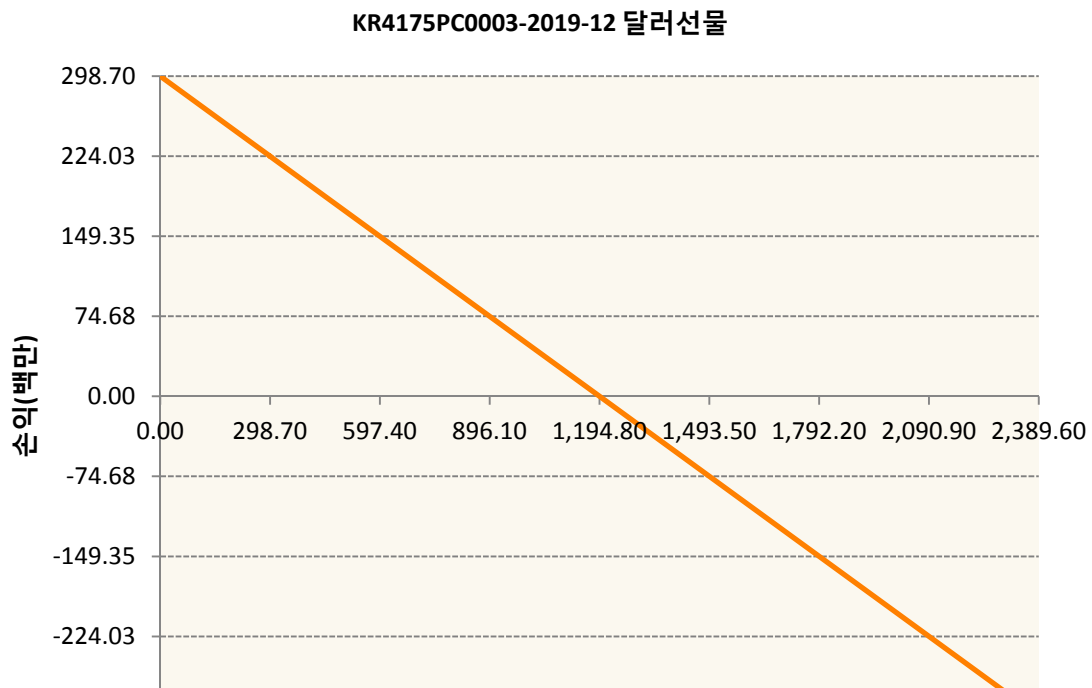
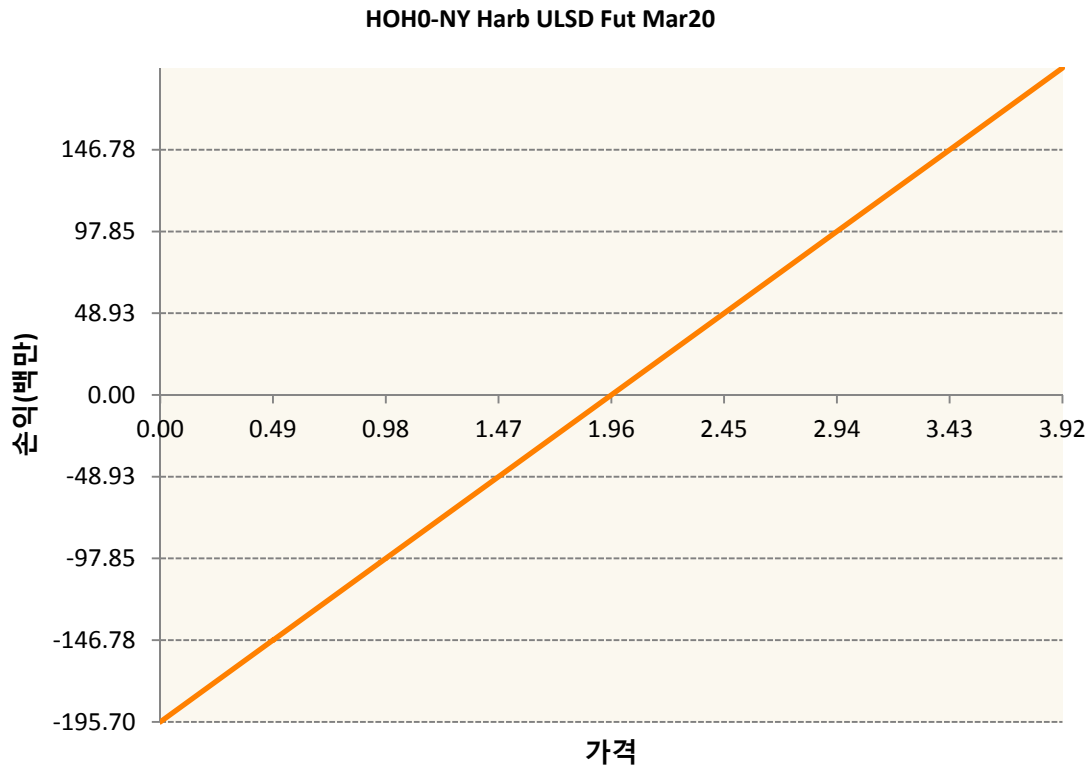
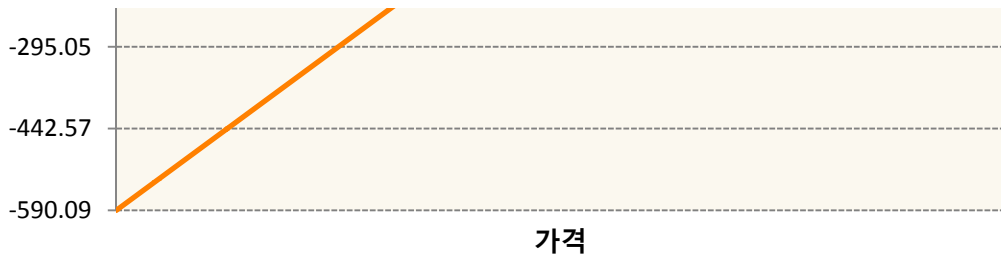
2. 만기시점의 손익구조

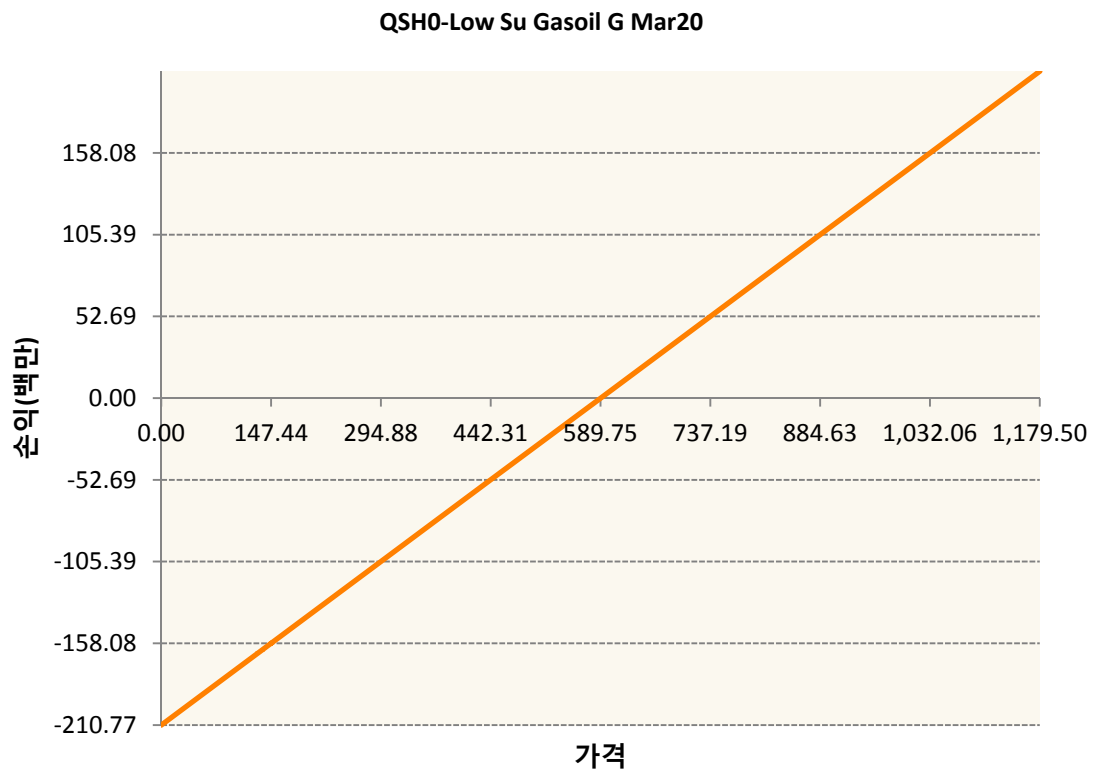
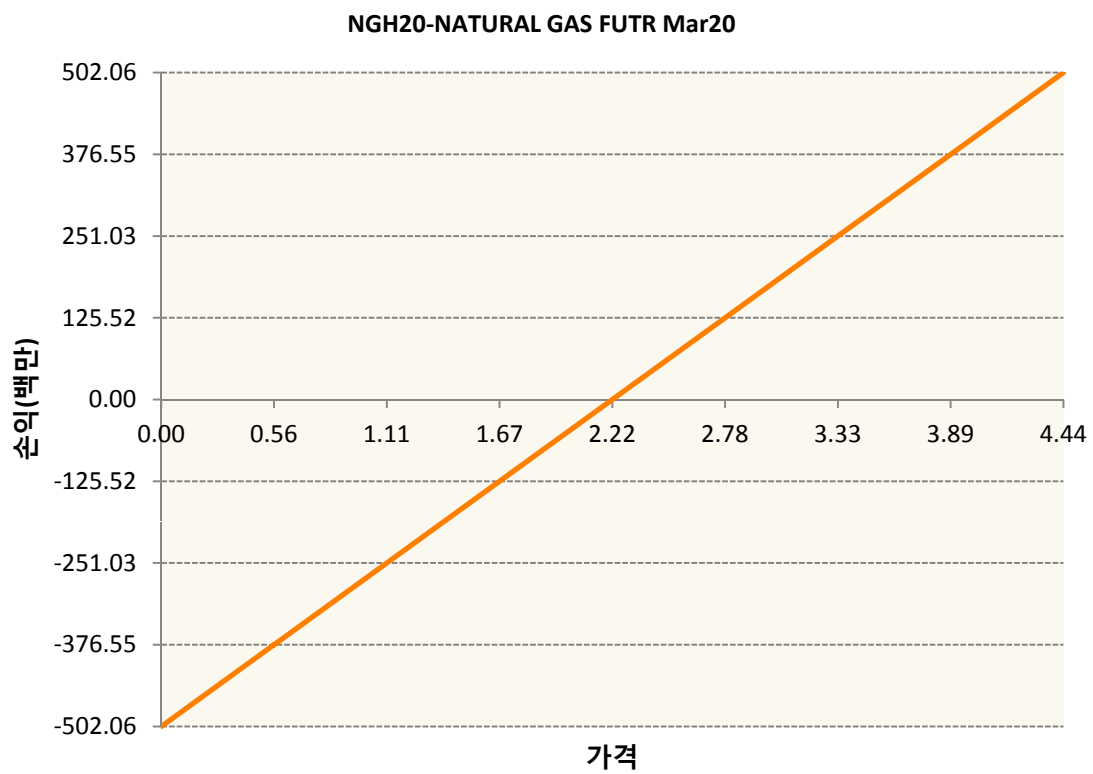
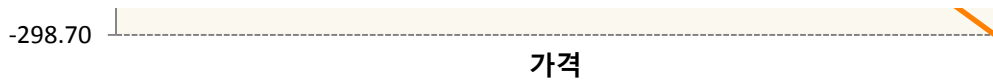
CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20



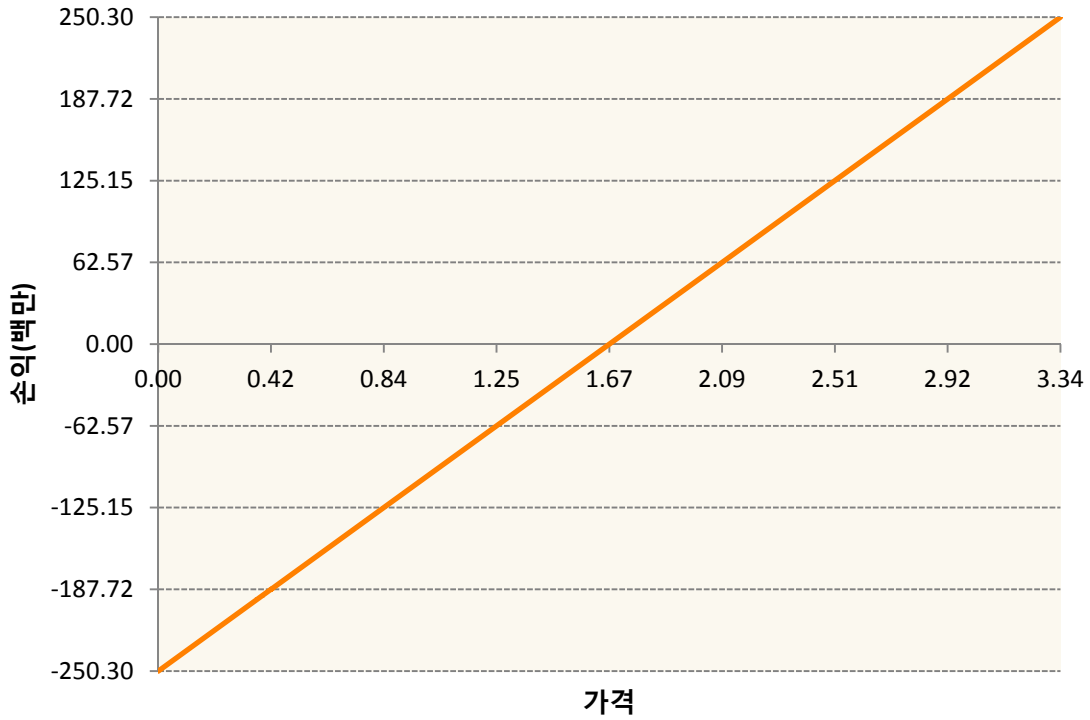
COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20







XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	51
COH0	BRENT CRUDE FUTR Mar20	47
HOH0	NY Harb ULSD Fut Mar20	16
KR4175PC00	2019-12 달러선물	24
NGH20	NATURAL GAS FUTR Mar20	40
QSH0	Low Su Gasoil G Mar20	17
XBH0	GASOLINE RBOB FUT Mar20	20

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

(단위:백만원)

386

공시일	2019-12-12
기준일	2019-12-11

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

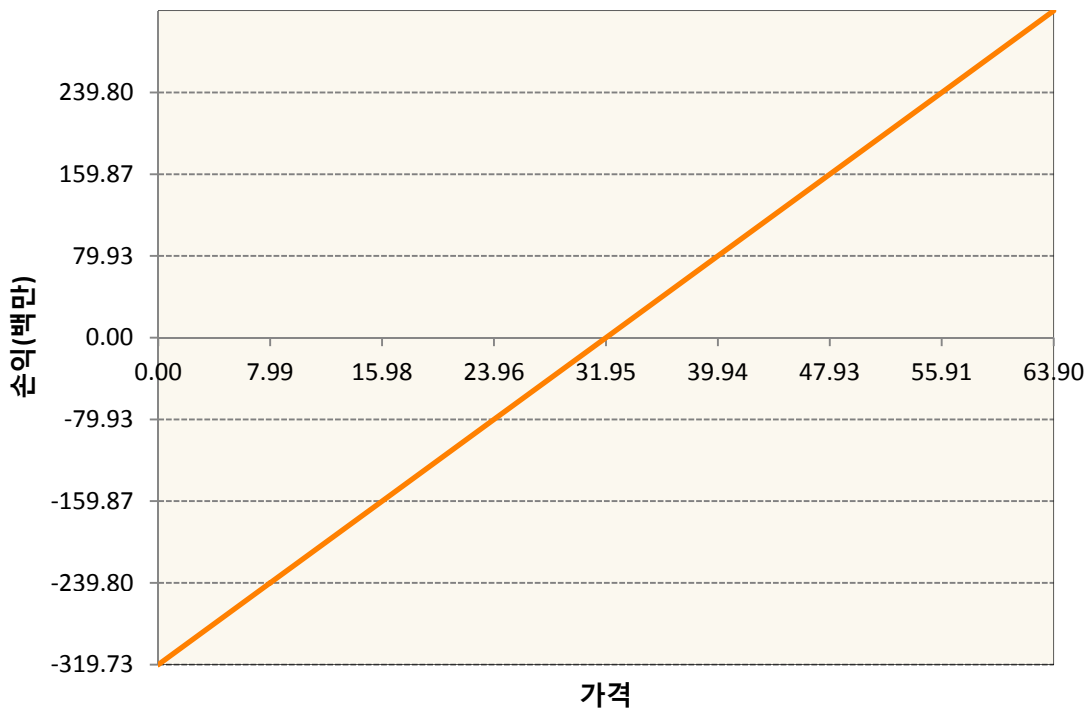
1. 계약금액

(단위:백만원)

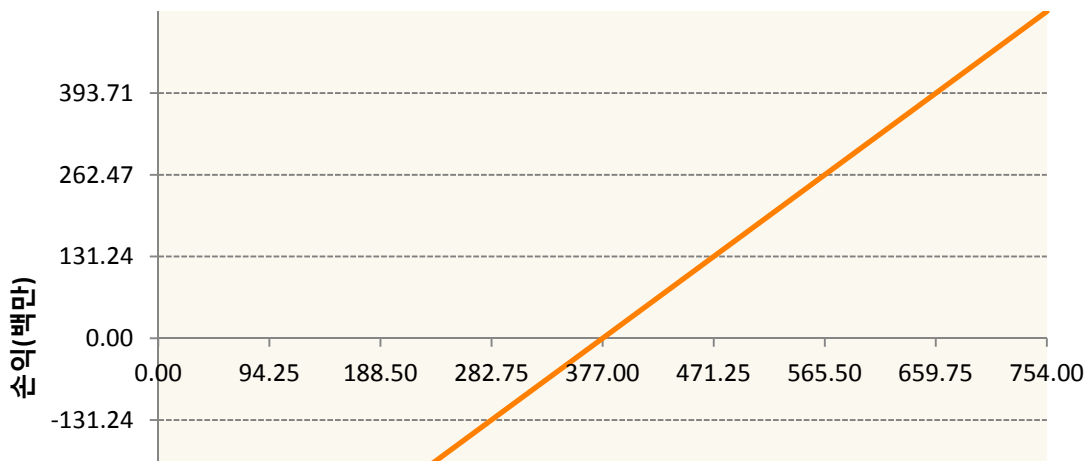
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,782	96	2,686	

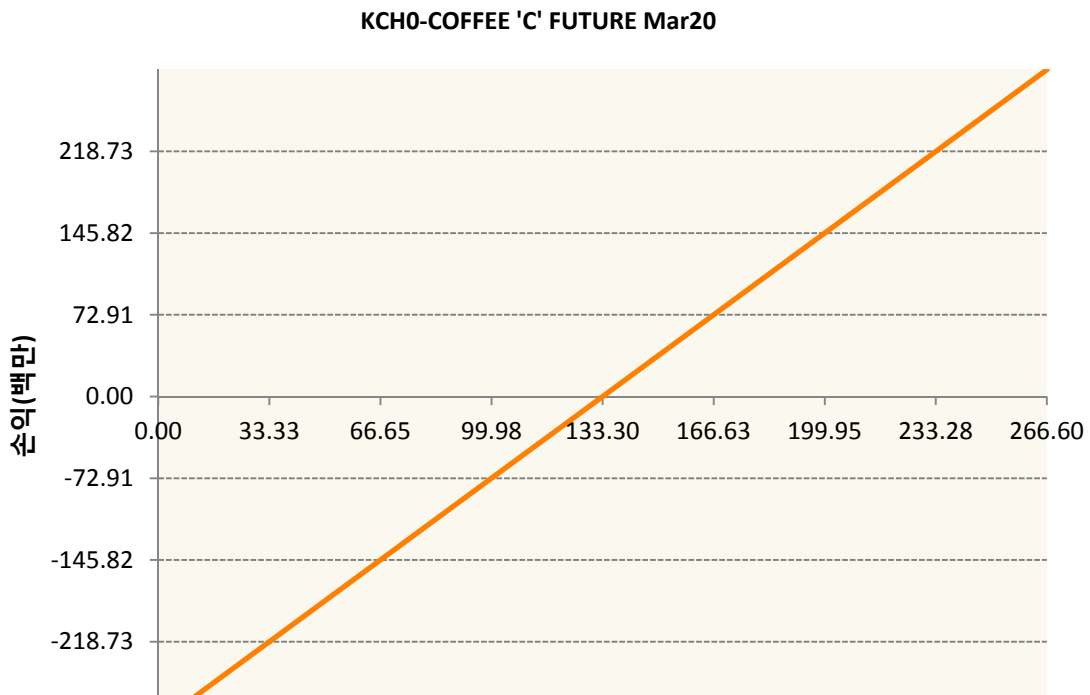
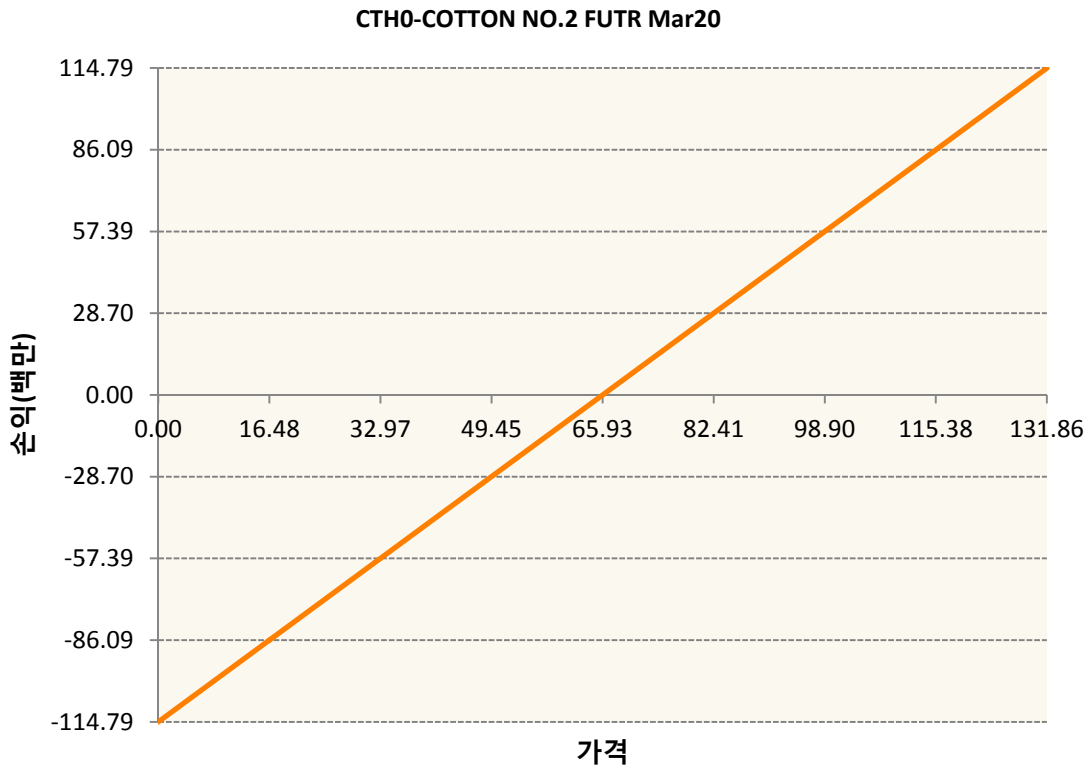
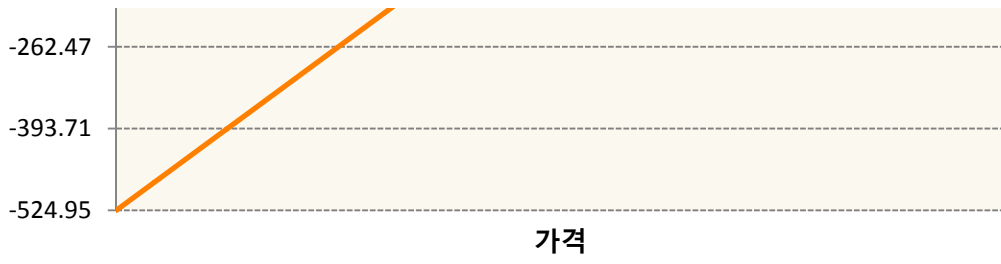
2. 만기시점의 손익구조

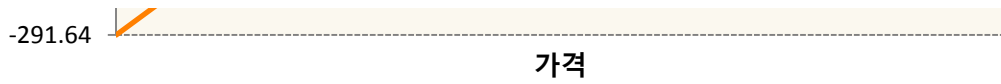
BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20



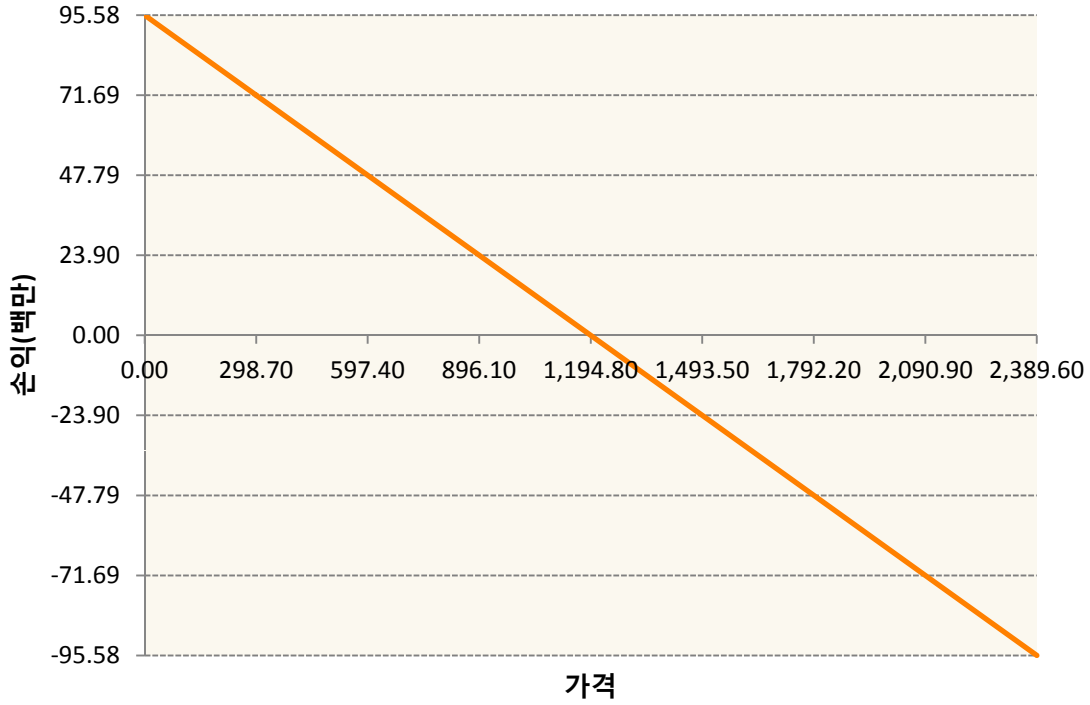
CH0-CORN FUTURE Mar20



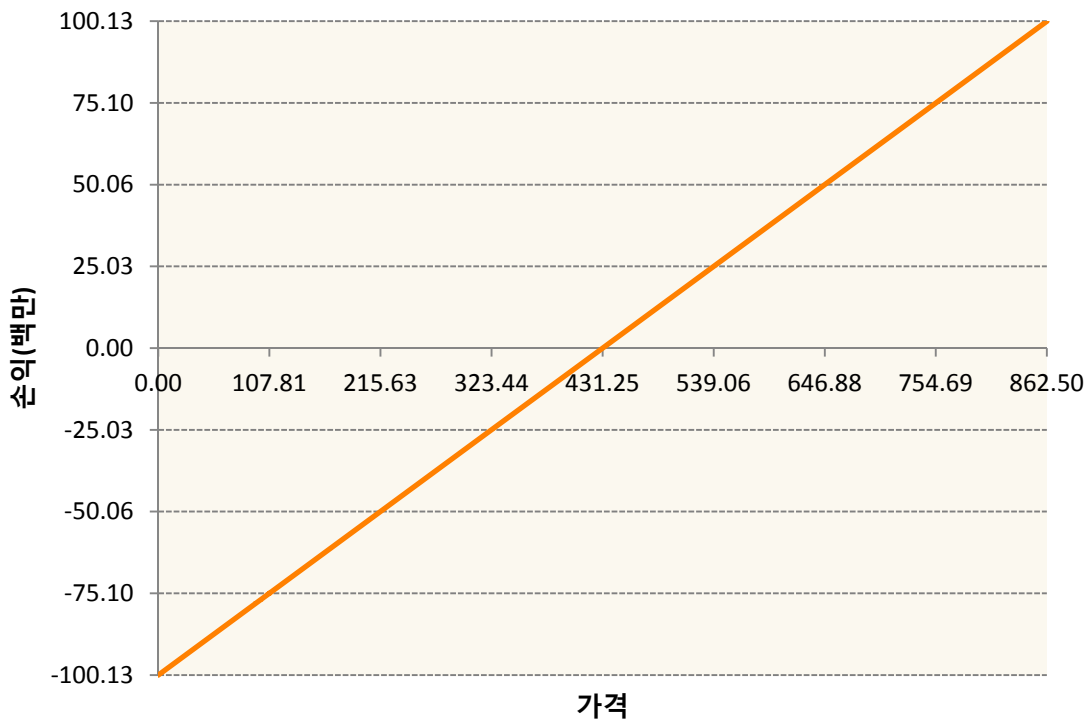




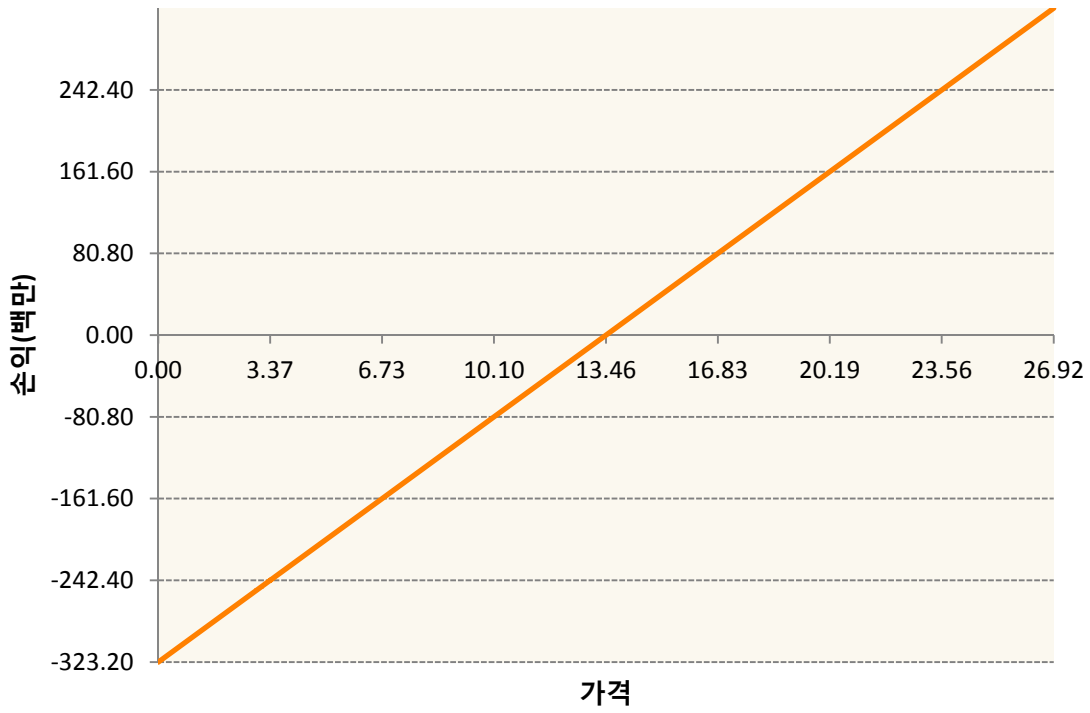
KR4175PC0003-2019-12 달러선물



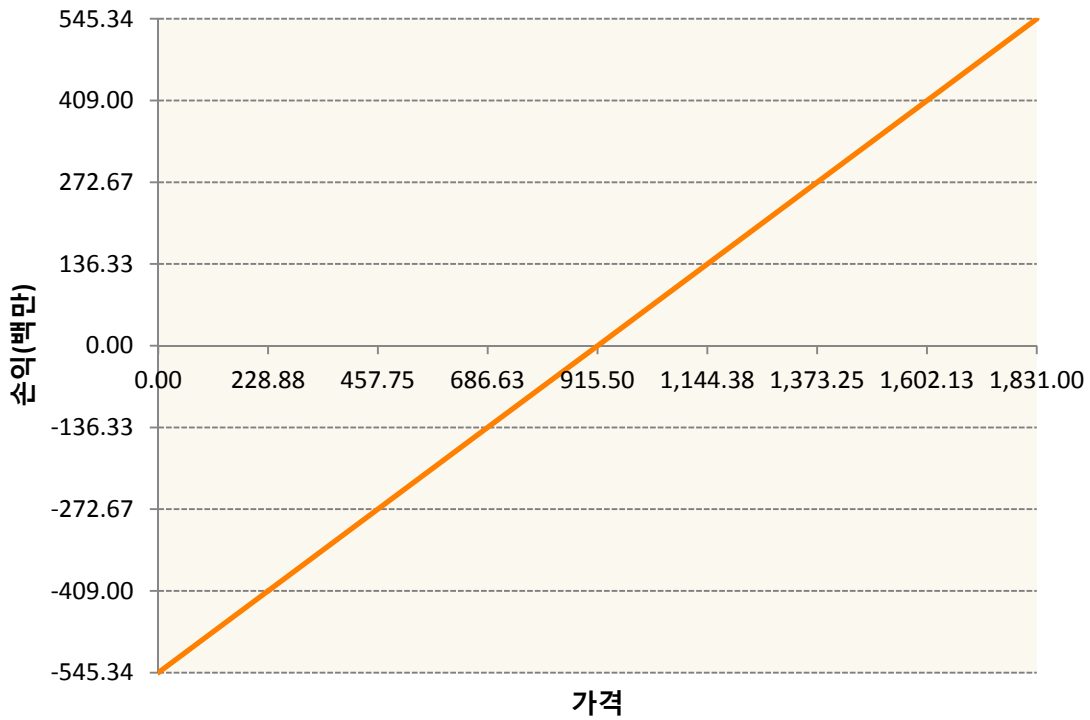
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



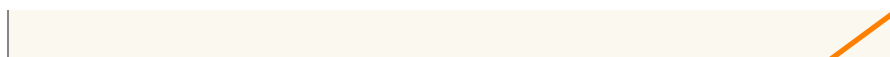
SBH0-Sugar Mar20

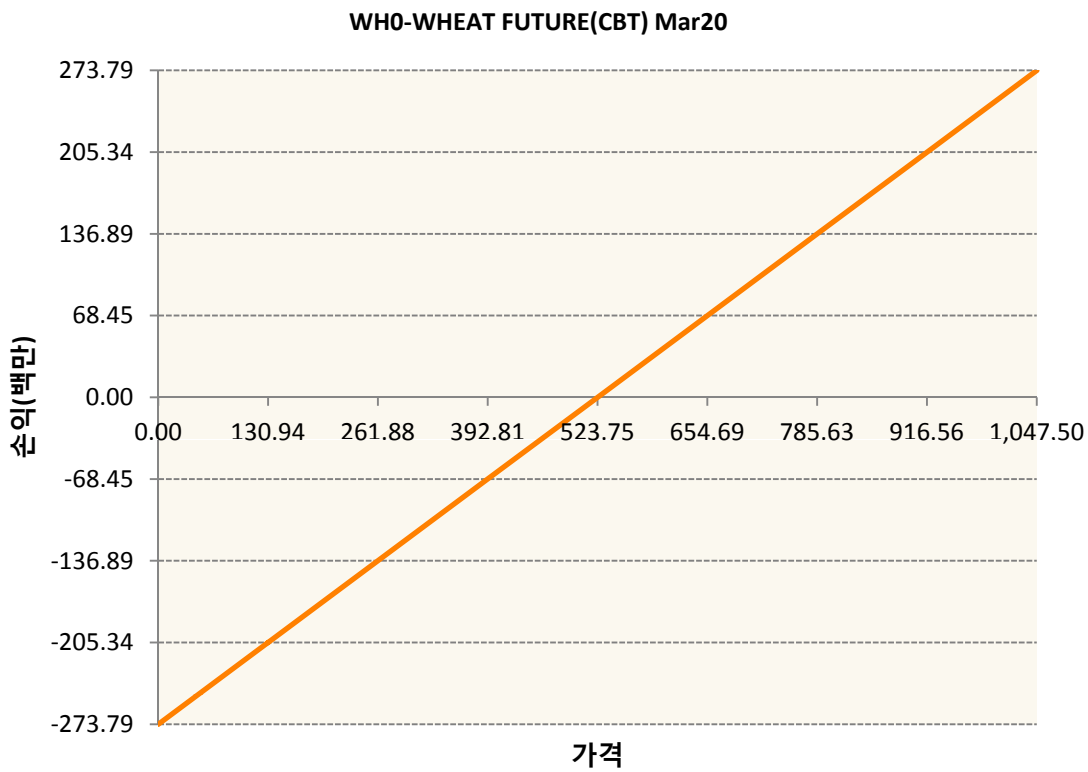
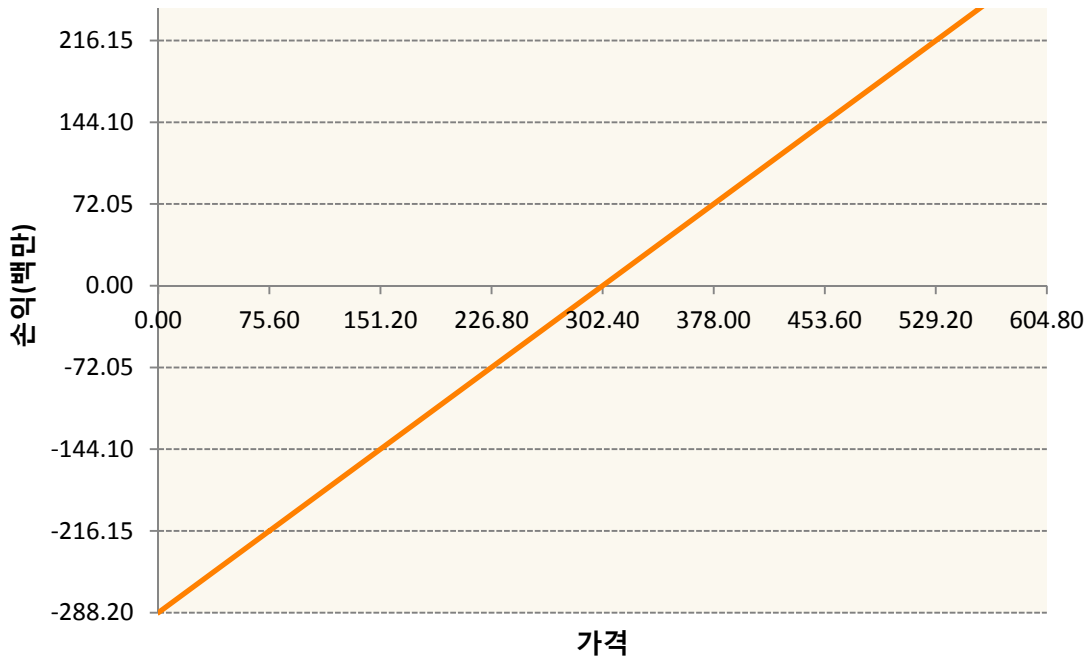


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20



SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH0	SOYBEAN OIL FUTR Mar20	26
CH0	CORN FUTURE Mar20	42
CTH0	COTTON NO.2 FUTR Mar20	9
KCH0	COFFEE 'C' FUTURE Mar20	23
KR4175PC00	2019-12 달러선물	8

KWH0	KC HRW WHEAT FUT Mar20	8
SBH0	Sugar Mar20	26
SH0	SOYBEAN FUTURE Mar20	44
SMH0	SOYBEAN MEAL FUTR Mar20	23
WH0	WHEAT FUTURE(CBT) Mar20	22

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

(단위:백만원)

244