

공시일	2019-12-09
기준일	2019-12-06

## 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	2019-12-09
기준일	2019-12-06

## 스마트인덱스모

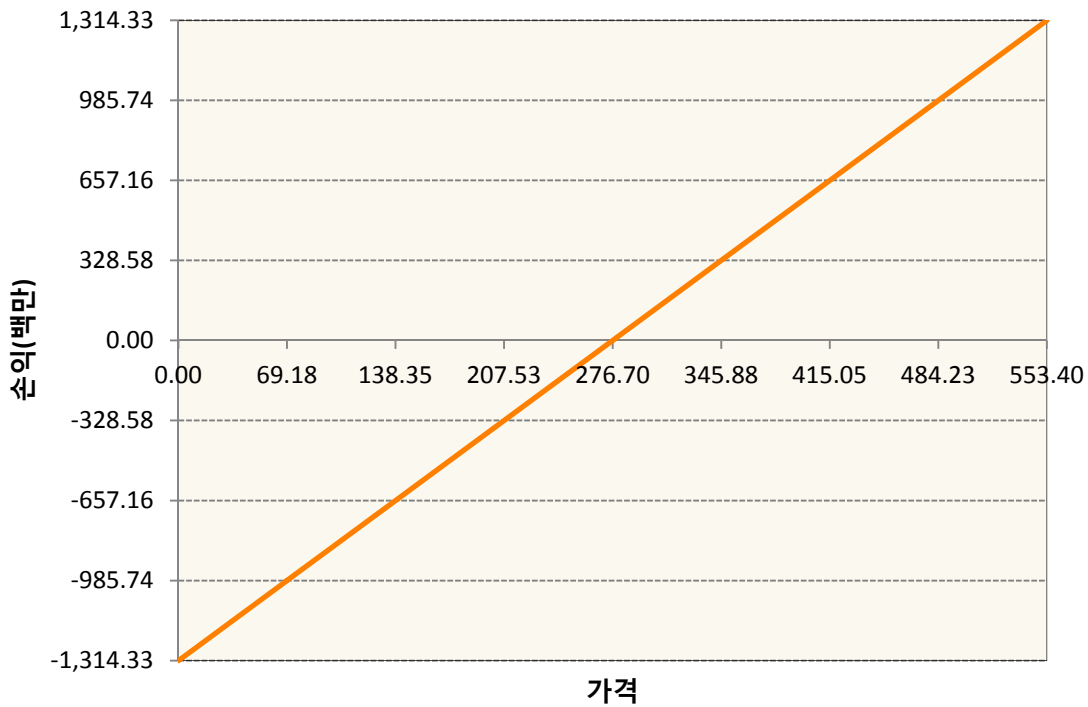
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

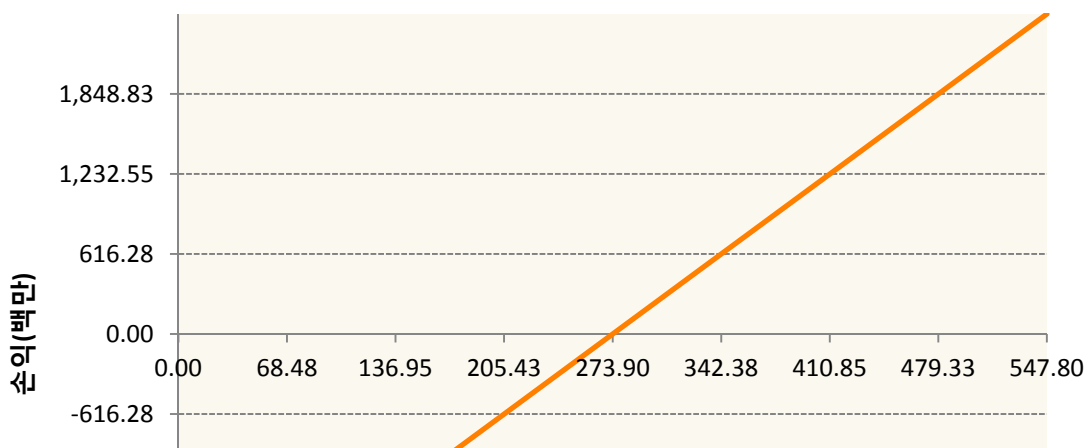
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,779	0	3,779	장내

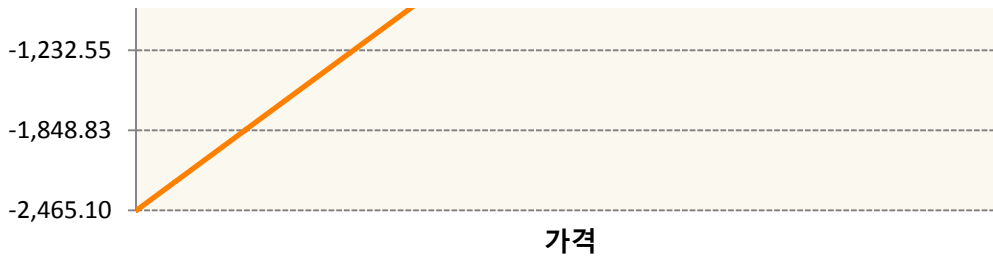
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물



KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물





**3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						105
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105	
-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%	105	105	105	105	105	105	105	
KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						199
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	
-5.33%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133	
-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%	133	133	133	133	133	133	133	
8.00%	199	199	199	199	199	199	199	

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

**240**

공시일	2019-12-09
기준일	2019-12-06

## 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

1,091

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

628

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-09
기준일	2019-12-06

## 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)	386
SWCSI50000 신한CSI500미래S190910(2)	141

\* 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	2019-12-09
기준일	2019-12-06

## 유로인덱스모(주식-파생형)

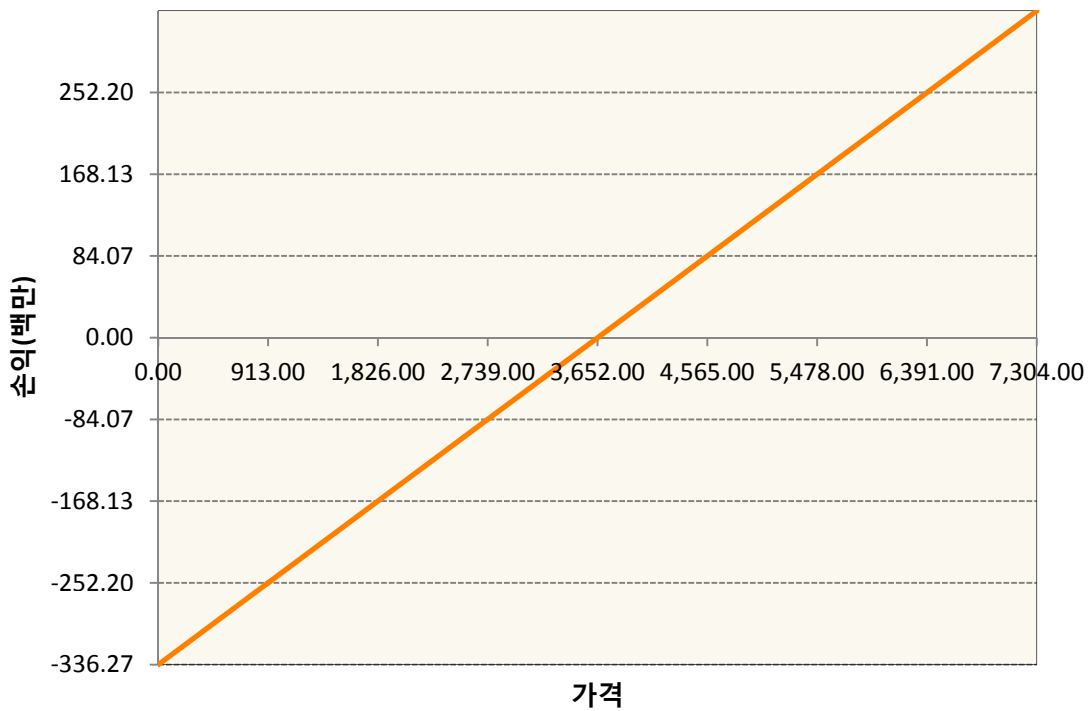
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	336	0	336	

### 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	2019-12-09
기준일	2019-12-06

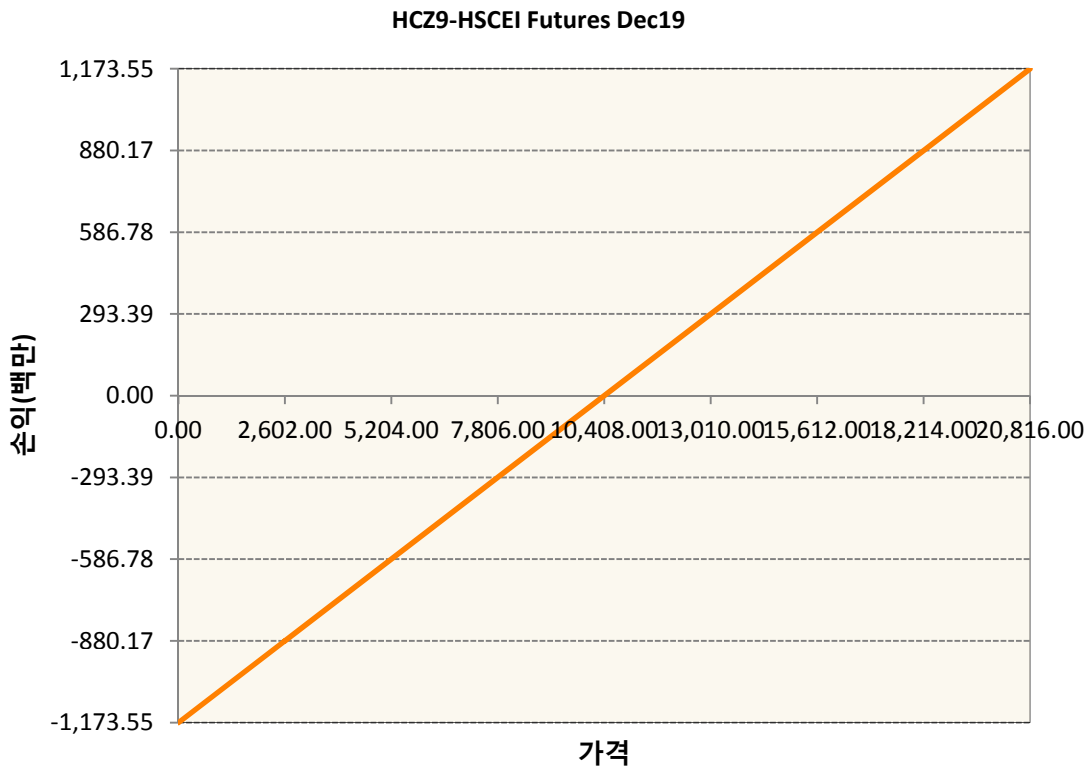
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ9	HSCEI Futures Dec19	94
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

84

공시일	2019-12-09
기준일	2019-12-06

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

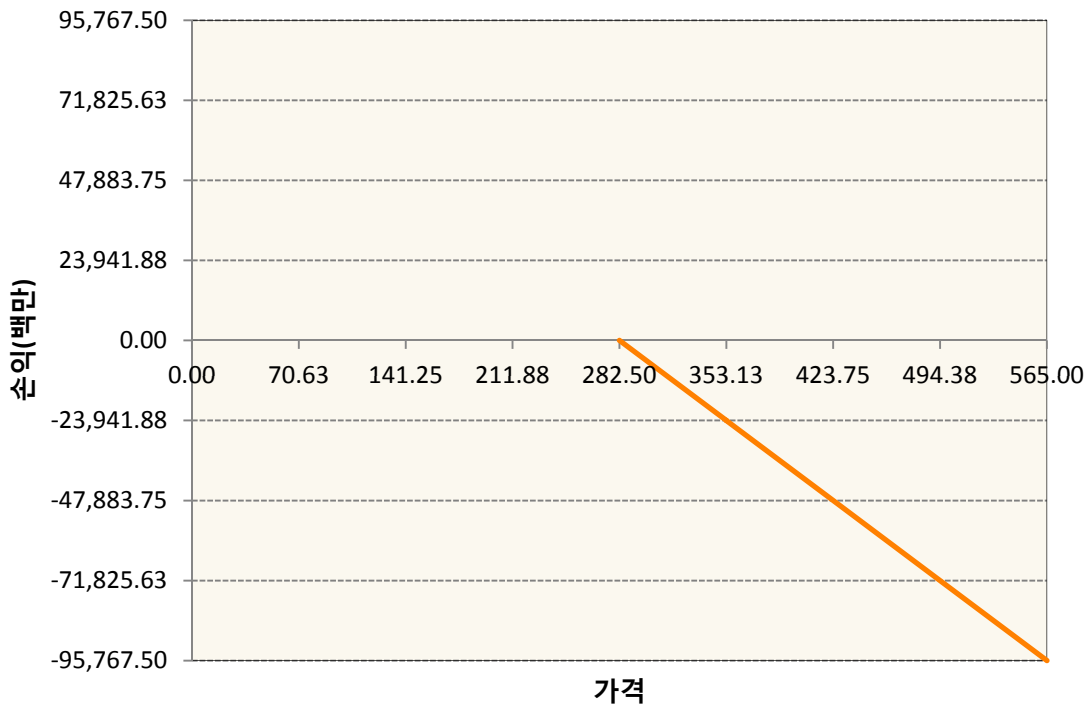
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

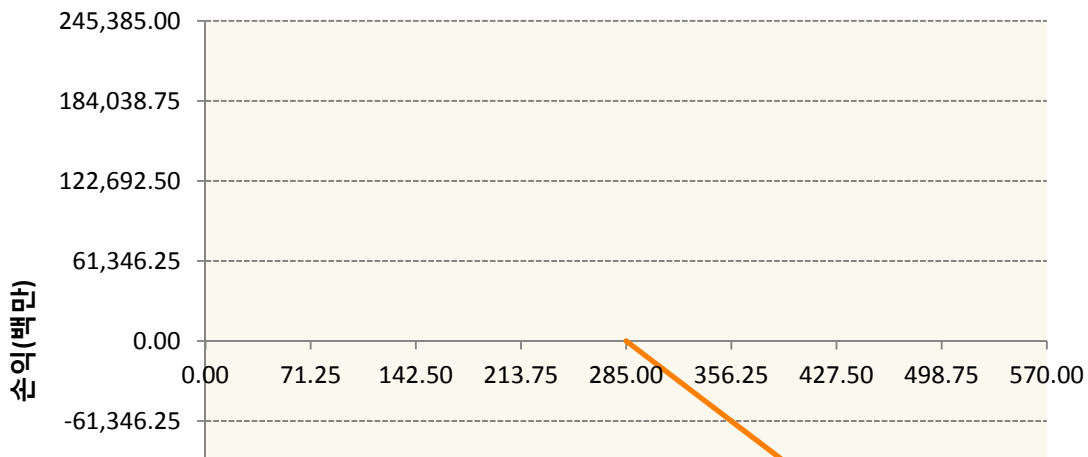
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	498,456	-498,456	장내

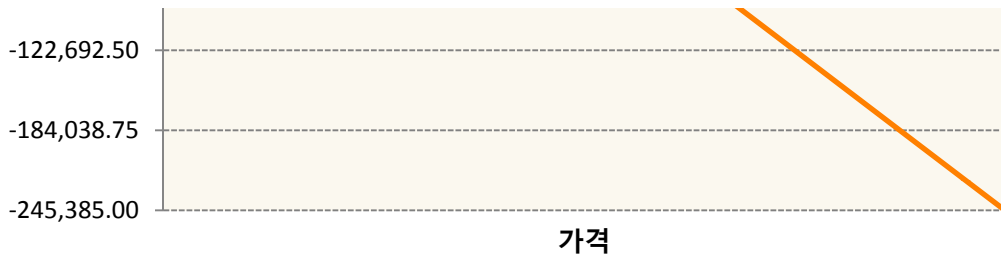
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201PC2825-2019-12 콜282.5**

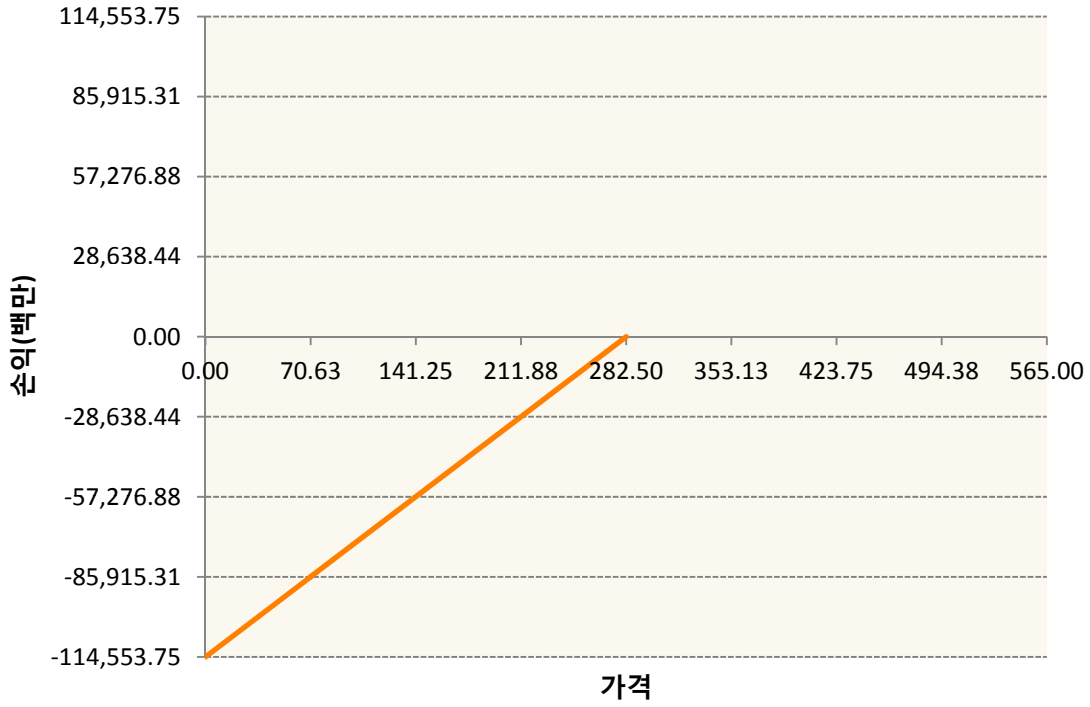


**KR4201PC2858-2019-12 콜285**

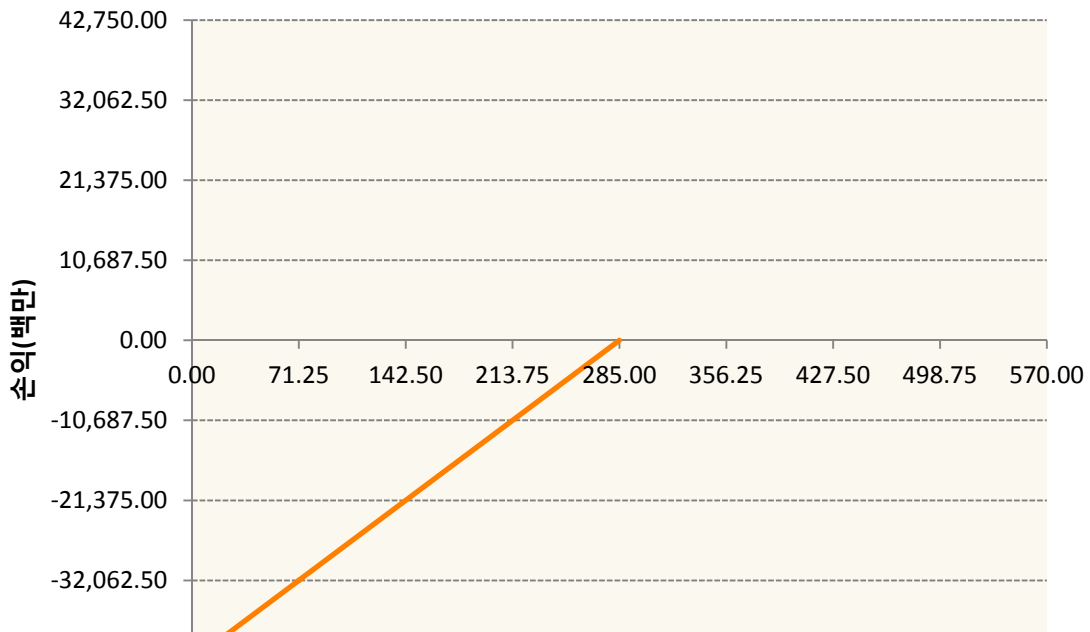




**KR4301PC2824-2019-12 풋282.5**



**KR4301PC2857-2019-12 풋285**



-42,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201PC2825		2019-12 콜282.5						5,116
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	596	596	595	594	592	587	581	
-5.33%	594	591	584	574	559	539	513	
-2.67%	557	529	493	449	399	343	281	
0%	274	187	95	0	-98	-198	-301	
2.67%	-704	-819	-934	-1,050	-1,165	-1,281	-1,396	
5.33%	-2,550	-2,618	-2,692	-2,773	-2,858	-2,948	-3,041	
8.00%	-4,893	-4,912	-4,939	-4,973	-5,014	-5,062	-5,116	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						11,639
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,009	1,009	1,009	1,007	1,004	998	988	
-5.33%	1,008	1,004	996	981	957	924	879	
-2.67%	966	925	867	791	698	589	464	
0%	559	389	202	0	-214	-437	-669	
2.67%	-1,214	-1,508	-1,803	-2,099	-2,394	-2,690	-2,986	
5.33%	-5,206	-5,432	-5,671	-5,919	-6,175	-6,437	-6,703	
8.00%	-10,851	-10,933	-11,038	-11,163	-11,306	-11,466	-11,639	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						8,856
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-8,856	-8,856	-8,856	-8,856	-8,856	-8,856	-8,856	
-5.33%	-5,866	-5,866	-5,866	-5,866	-5,866	-5,866	-5,866	
-2.67%	-2,877	-2,877	-2,878	-2,879	-2,881	-2,885	-2,890	
0%	78	57	30	0	-34	-72	-113	
2.67%	2,168	2,104	2,040	1,974	1,909	1,843	1,777	
5.33%	2,534	2,527	2,517	2,503	2,485	2,464	2,439	
8.00%	2,540	2,540	2,539	2,539	2,538	2,537	2,534	
KR4301PC2857		2019-12 풋285						3,304
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,304	-3,304	-3,304	-3,304	-3,304	-3,304	-3,304	
-5.33%	-2,198	-2,198	-2,198	-2,198	-2,198	-2,198	-2,198	
-2.67%	-1,092	-1,092	-1,092	-1,092	-1,092	-1,093	-1,093	
0%	12	9	5	0	-7	-15	-24	
2.67%	966	942	917	893	868	843	818	

5.33%	1,274	1,266	1,256	1,245	1,232	1,218	1,203
8.00%	1,286	1,286	1,286	1,285	1,284	1,283	1,280

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

(단위:백만원)

**30,316**

공시일	2019-12-09
기준일	2019-12-06

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

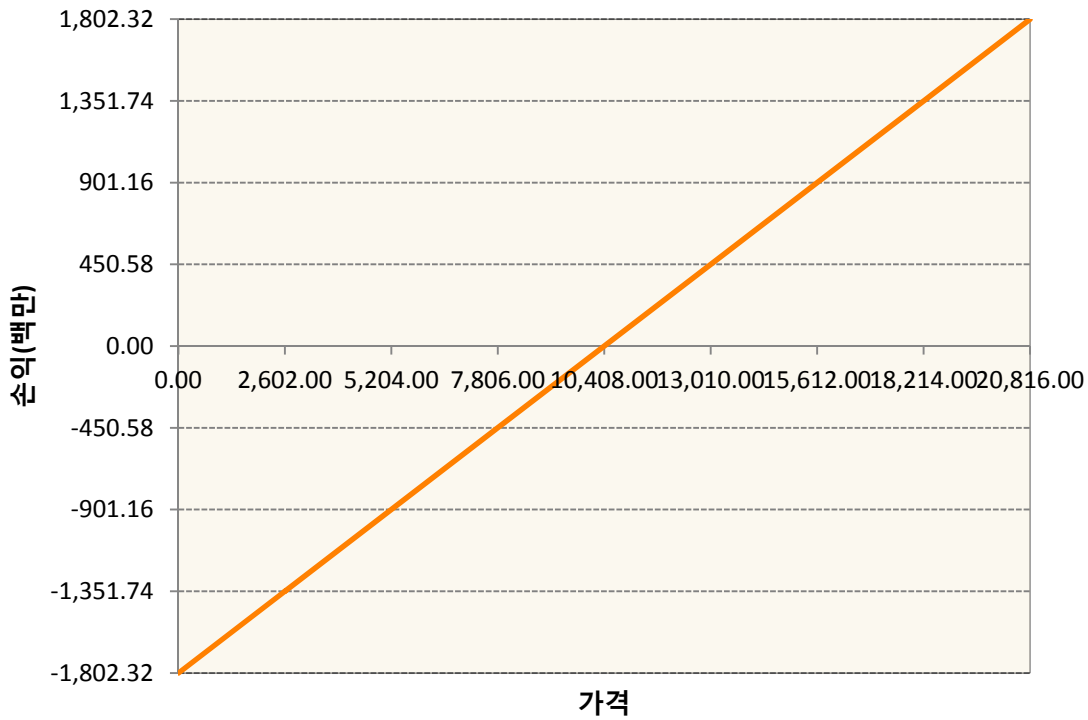
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

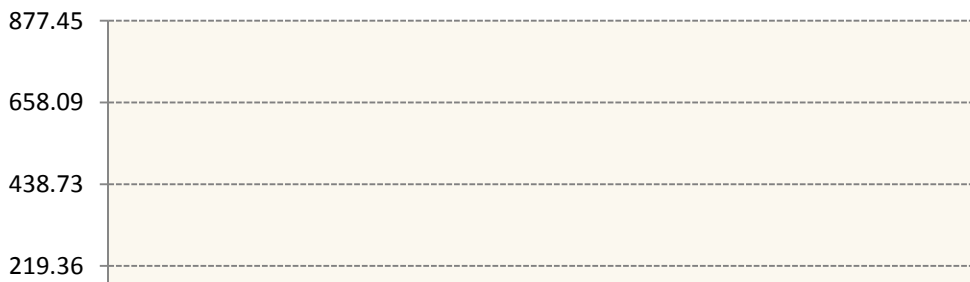
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,802	0	1,802	
누계	유가증권	옵션	0	4,976	-4,976	장내
누계	통화	선도	0	2,139	-2,139	장외

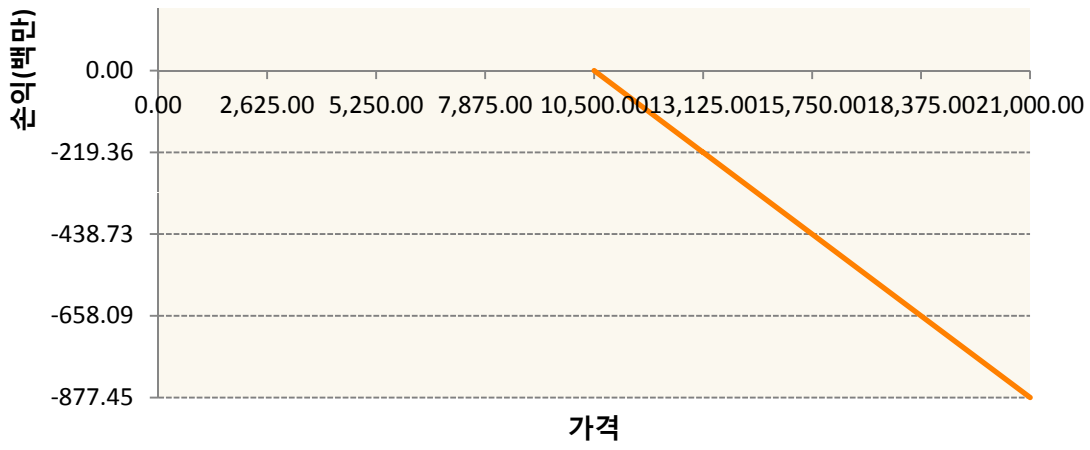
### 2. 만기시점의 손익구조

HCZ9-HSCEI Futures Dec19

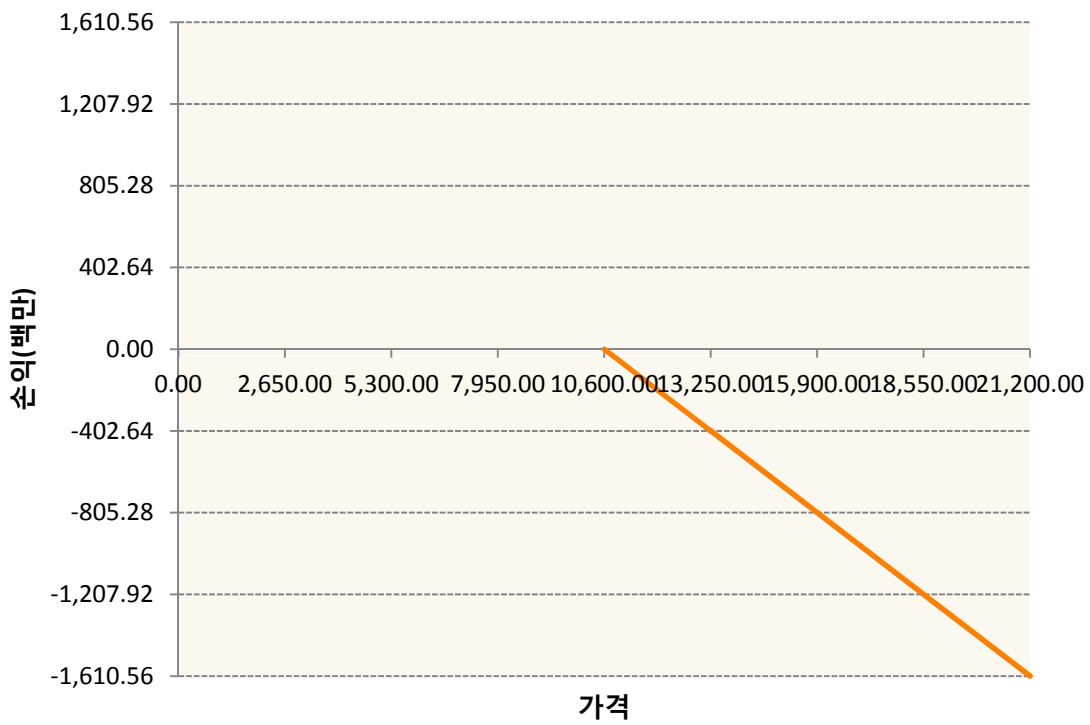


OHHIZ9-C105-HSCEI

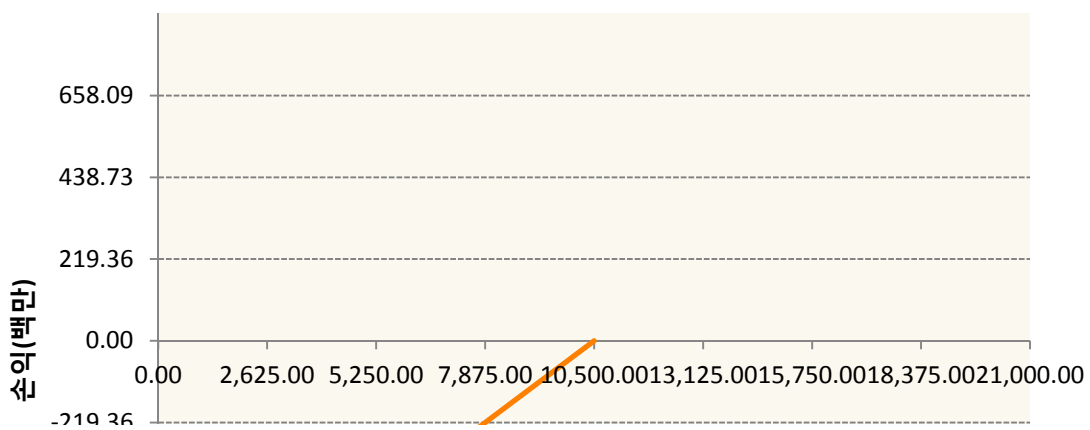


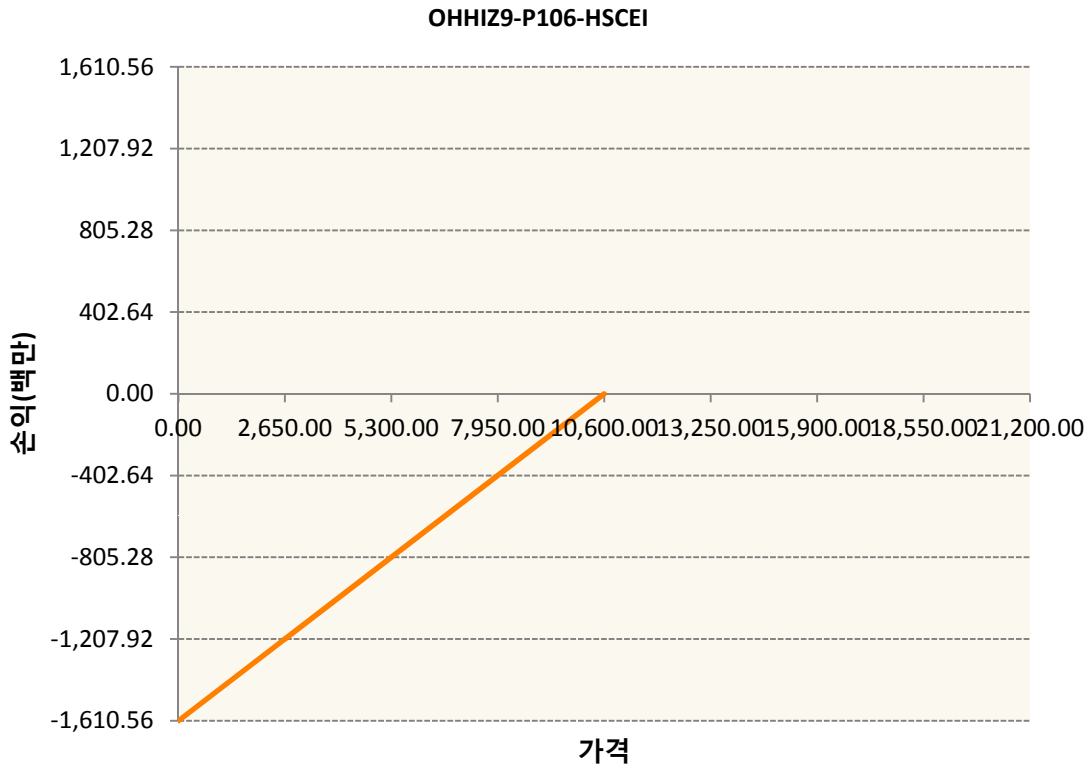


**OHHIZ9-C106-HSCEI**



**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	2019-12-09
기준일	2019-12-06

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

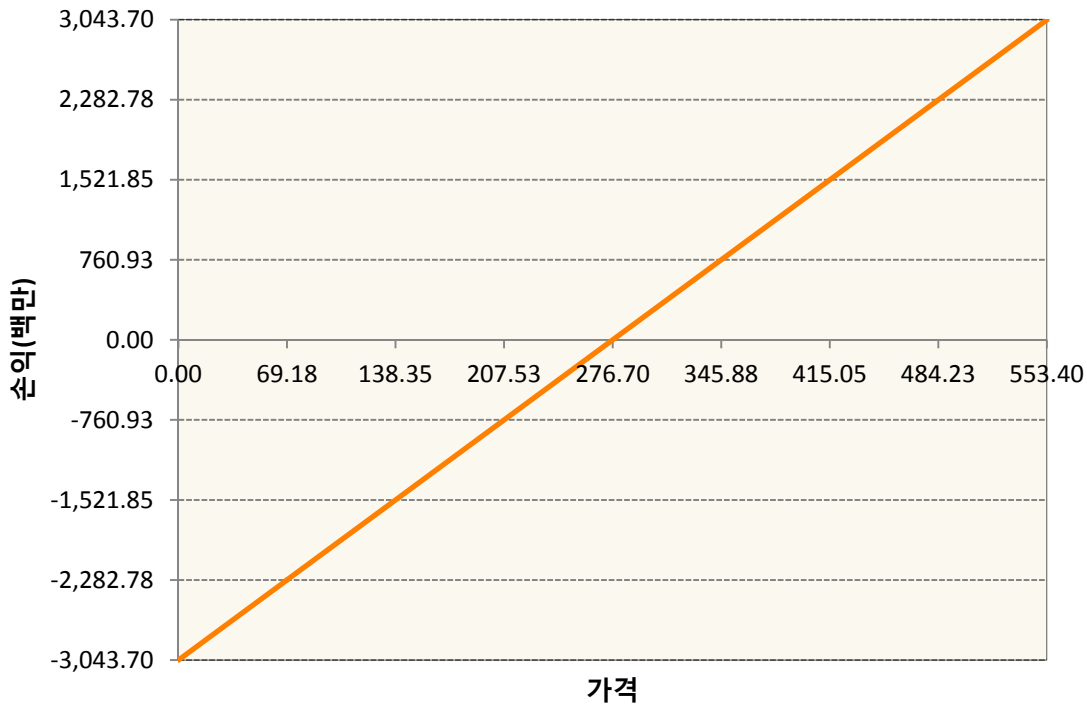
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

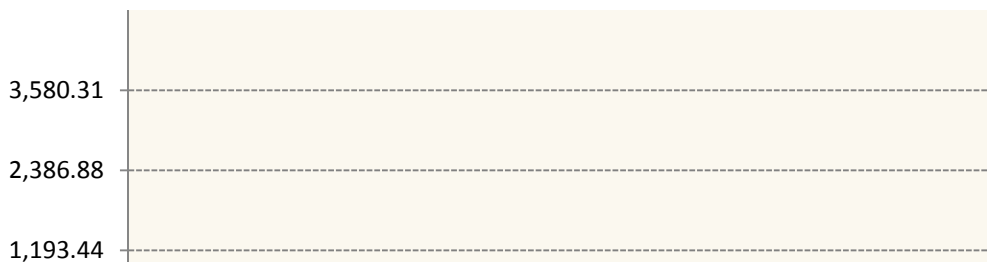
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,044	0	3,044	장내
누계	유가증권	스왑	9,625	0	9,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,514	-9,514	장내

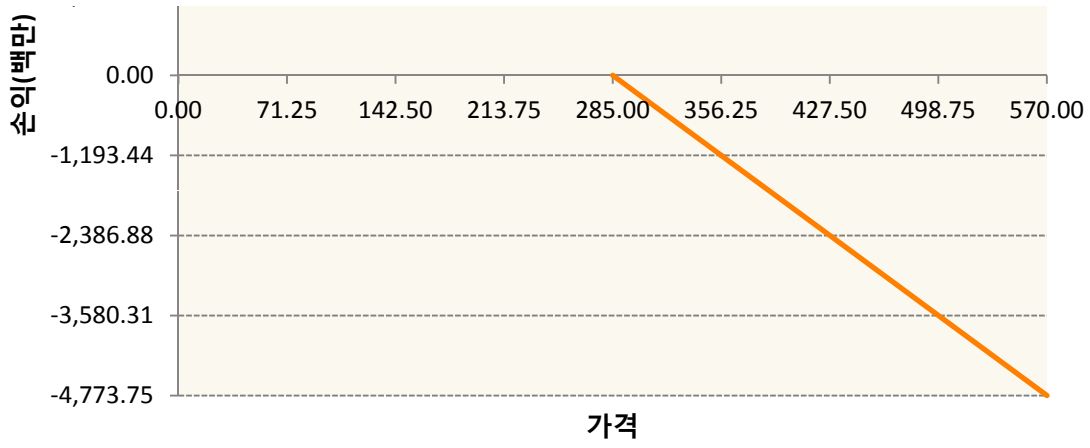
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

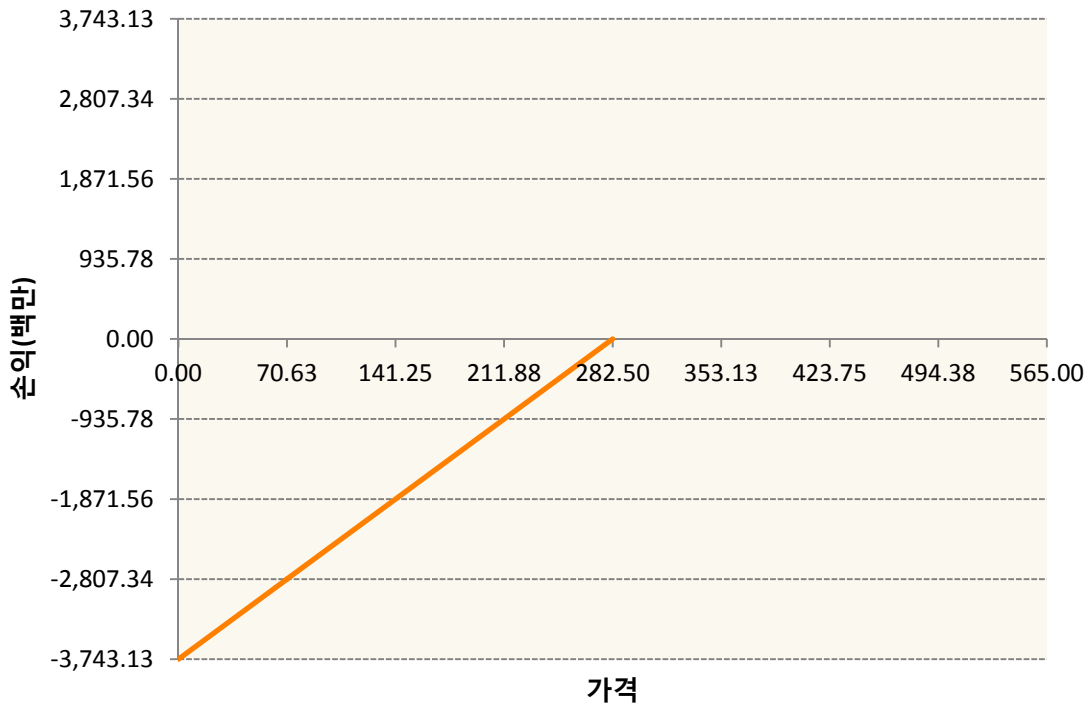


KR4201PC2858-2019-12 콜285

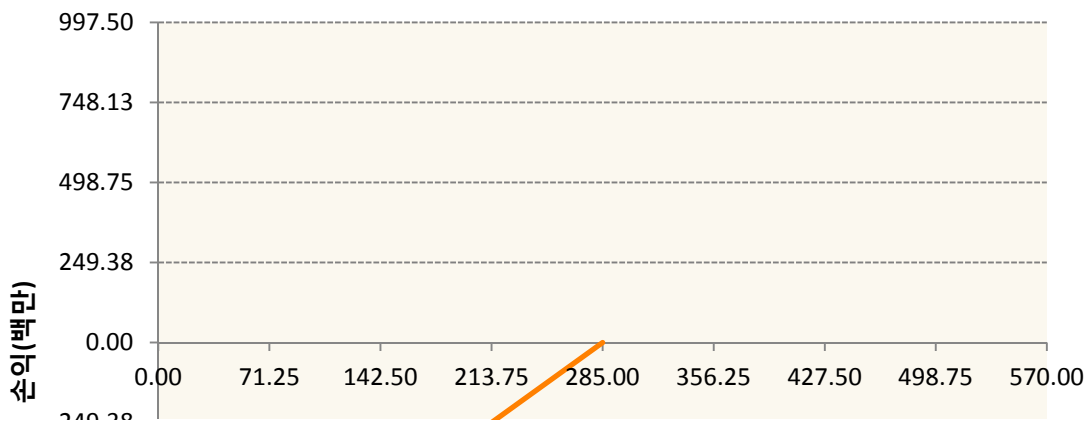




**KR4301PC2824-2019-12 풋282.5**



**KR4301PC2857-2019-12 풋285**





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						833
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-833	-833	-833	-833	-833	-833	-833	
-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%	833	833	833	833	833	833	833	
KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						243
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-243	-243	-243	-243	-243	-243	-243	
-5.33%	-162	-162	-162	-162	-162	-162	-162	
-2.67%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	81	81	81	81	81	81	81	
5.33%	162	162	162	162	162	162	162	
8.00%	243	243	243	243	243	243	243	
KR4201PC2858		2019-12 콜285						226
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	20	20	20	20	20	19	19	
-5.33%	20	20	19	19	19	18	17	
-2.67%	19	18	17	15	14	11	9	
0%	11	8	4	0	-4	-9	-13	
2.67%	-24	-29	-35	-41	-47	-52	-58	
5.33%	-101	-106	-110	-115	-120	-125	-130	
8.00%	-211	-213	-215	-217	-220	-223	-226	
KR4301PC2824		2019-12 풋282.5						289
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-289	-289	-289	-289	-289	-289	-289
-5.33%	-192	-192	-192	-192	-192	-192	-192
-2.67%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94
0%	3	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	71	69	67	65	62	60	58
5.33%	83	83	82	82	81	81	80
8.00%	83	83	83	83	83	83	83
KR4301PC2857                      2019-12 풋285							77
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
-5.33%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-26
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	23	22	21	21	20	20	19
5.33%	30	30	29	29	29	28	28
8.00%	30	30	30	30	30	30	30

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

(단위:백만원)

**1,682**

공시일	2019-12-09
기준일	2019-12-06

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

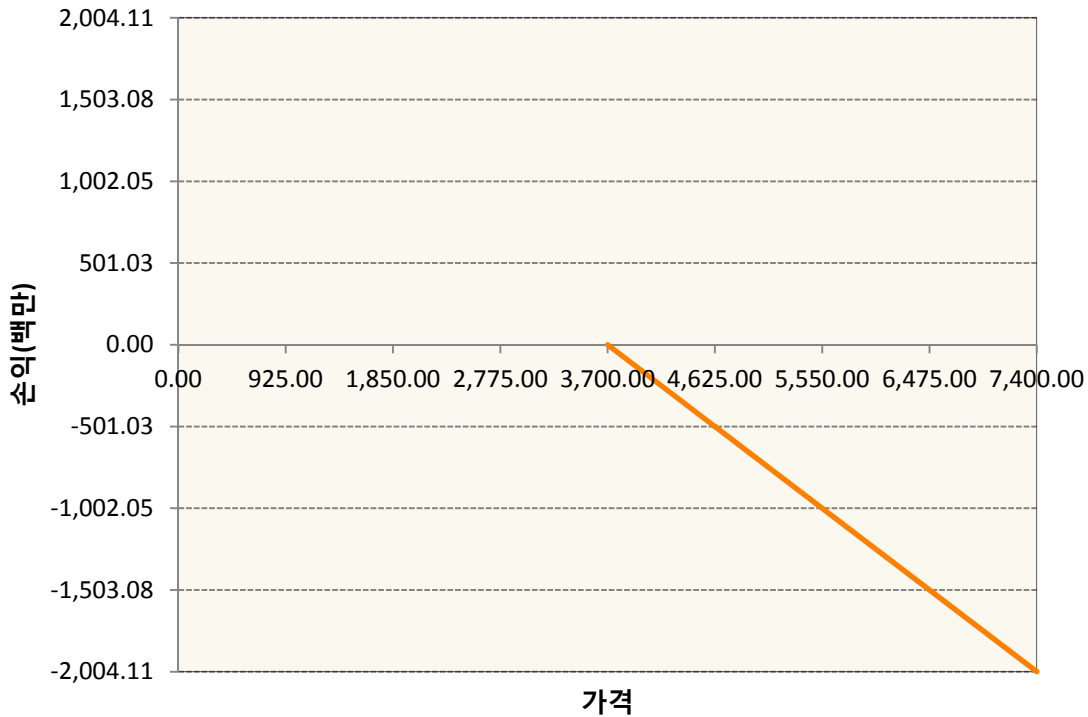
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

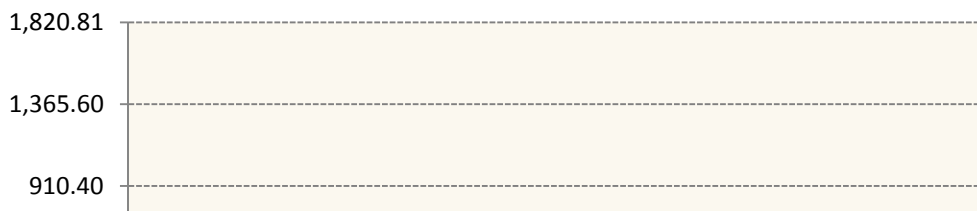
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	709	0	709	
누계	유가증권	스왑	18,063	0	18,063	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,650	-7,650	장내
누계	통화	선도	2,742	6,209	-3,466	장외

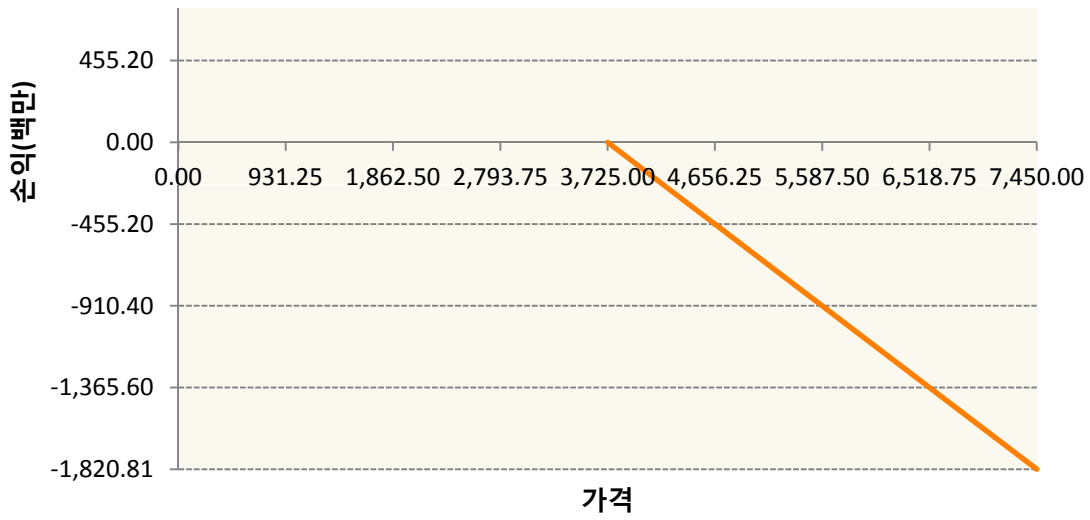
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXZ9-C3700-EURO STOXX 50**

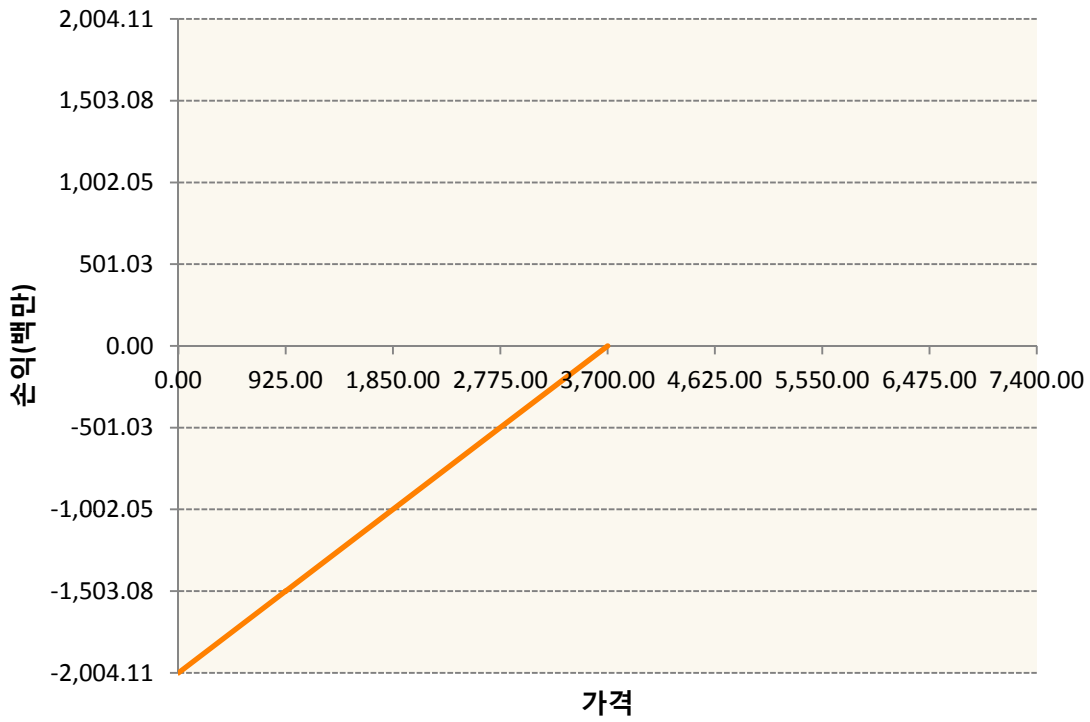


**OESXZ9-C3725-EURO STOXX 50**

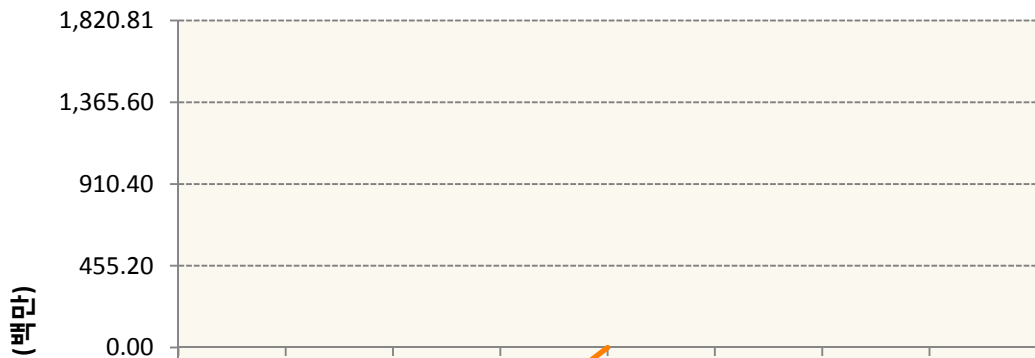


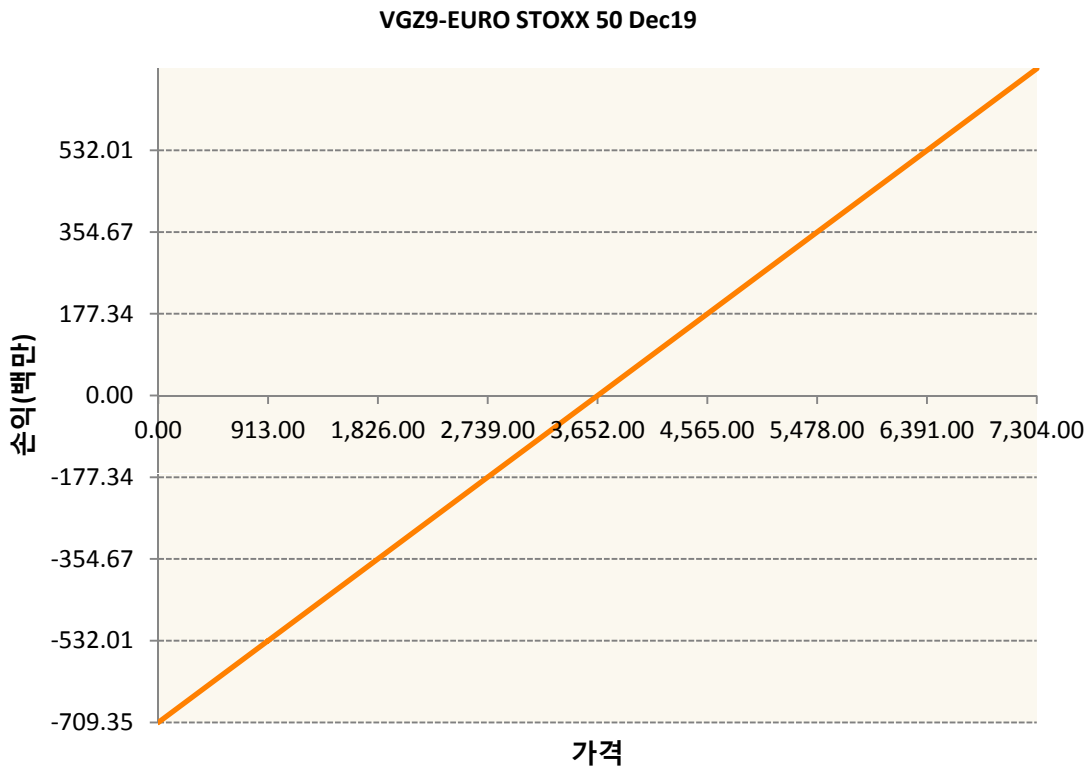
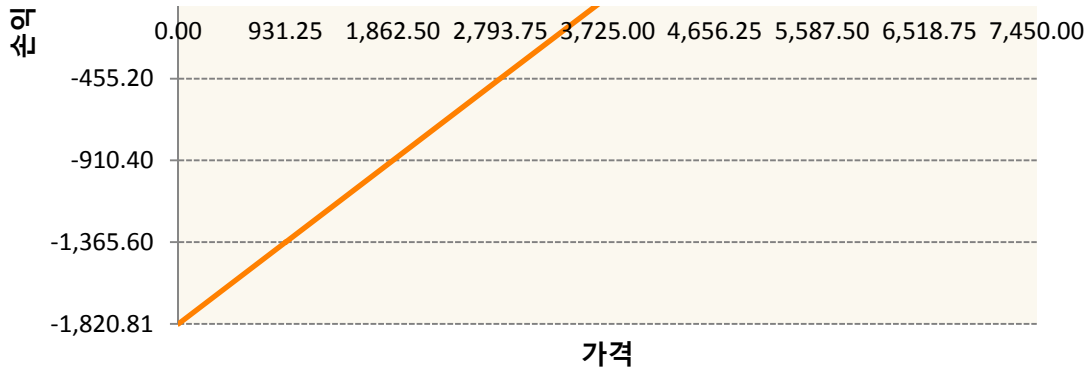


**OESXZ9-P3700-EURO STOXX 50**



**OESXZ9-P3725-EURO STOXX 50**





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	9
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	160
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	146
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	160
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	146
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19	57

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

(단위:백만원)

784



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

(단위:백만원)

897



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

(단위:백만원)

78



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

(단위:백만원)

122



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

(단위:백만원)

39

공시일	2019-12-09
기준일	2019-12-06

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

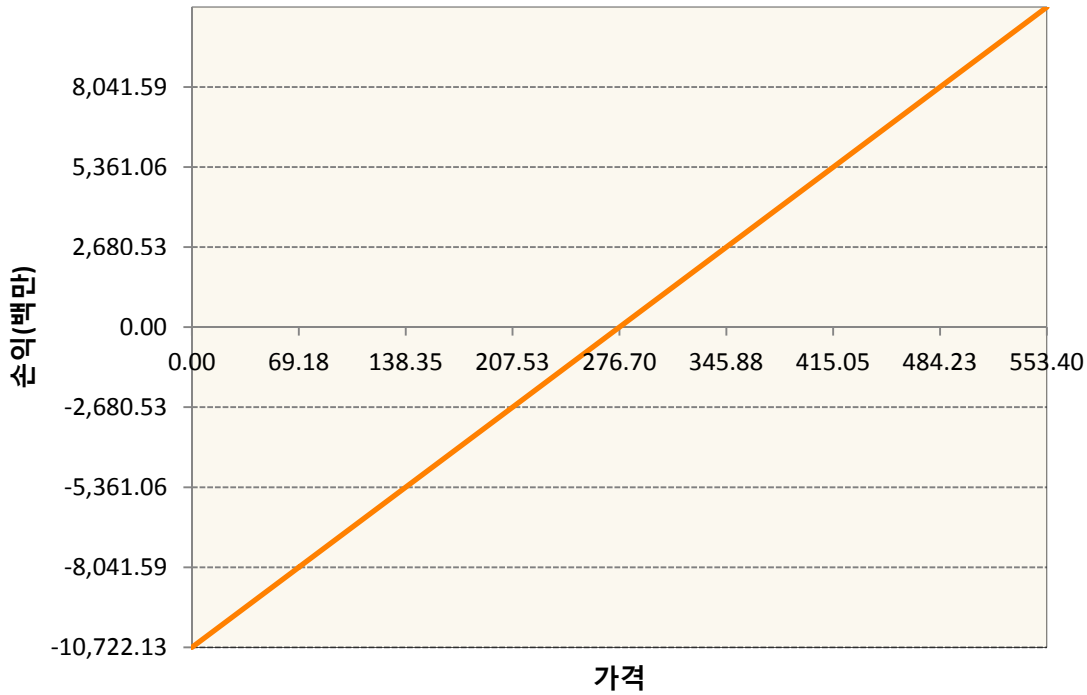
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

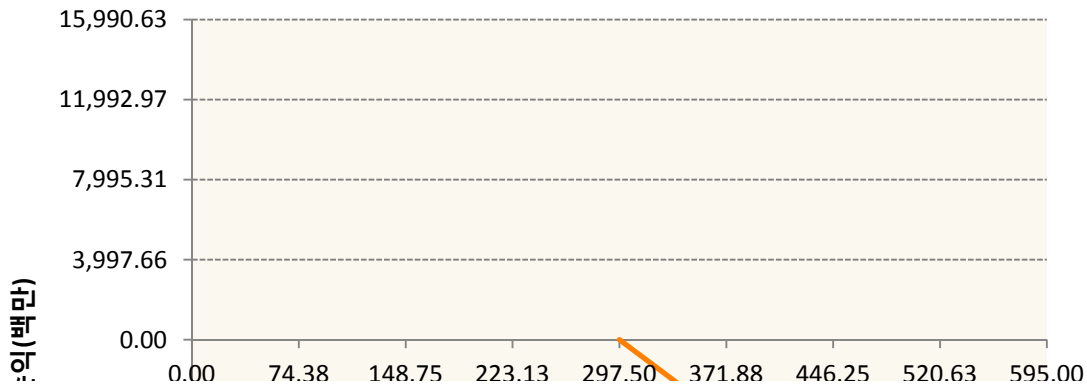
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,722	0	10,722	장내
누계	유가증권	옵션	1,277	21,241	-19,964	장내

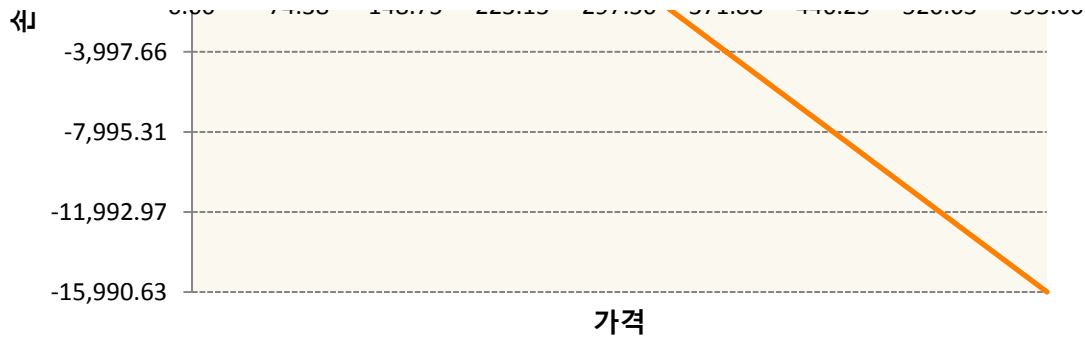
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

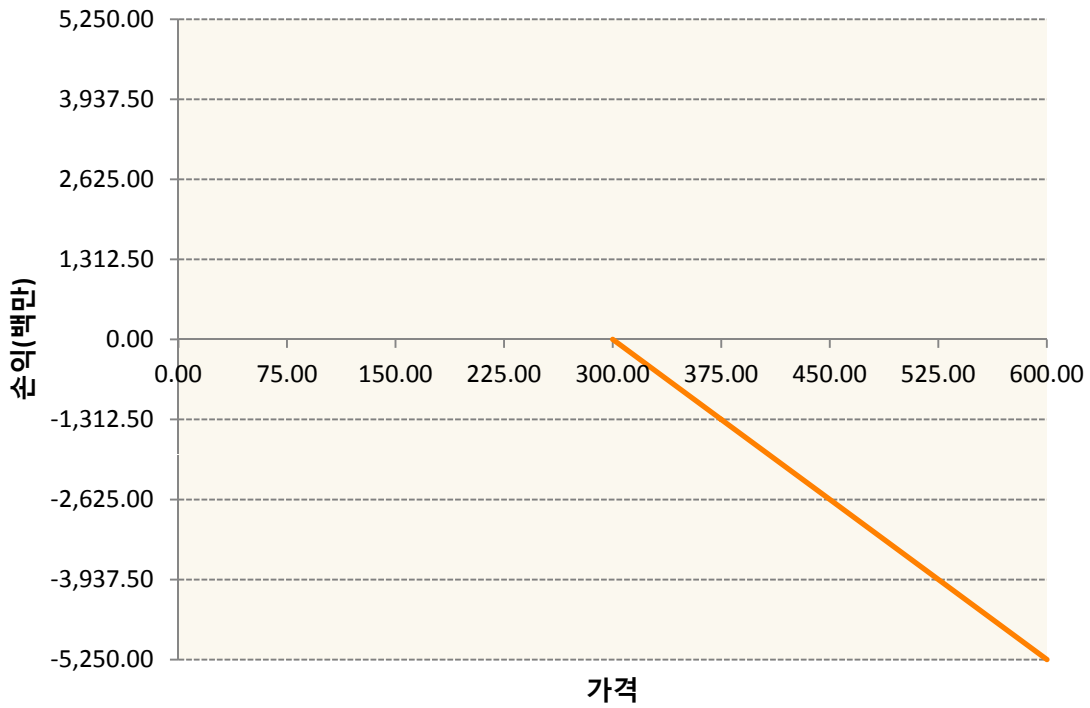


KR4201PC2973-2019-12 콜297.5

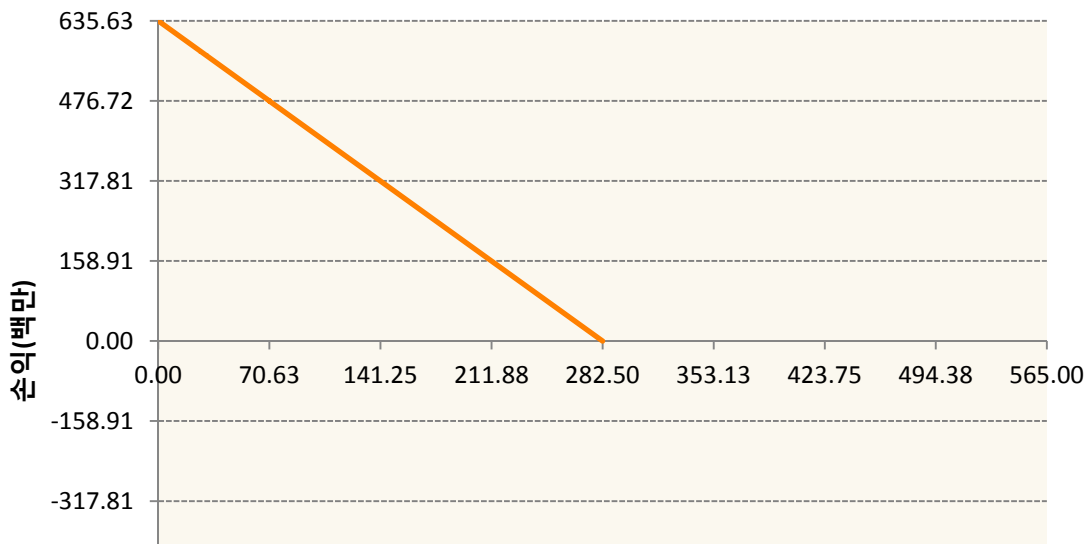


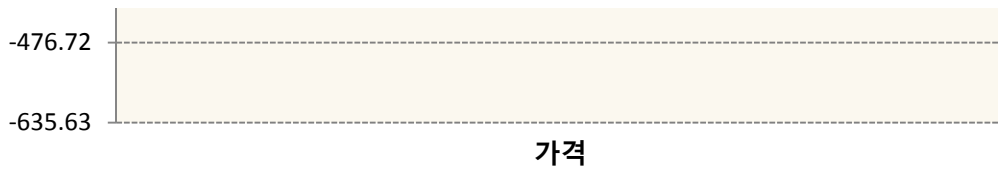


KR4201PC3005-2019-12 콜300

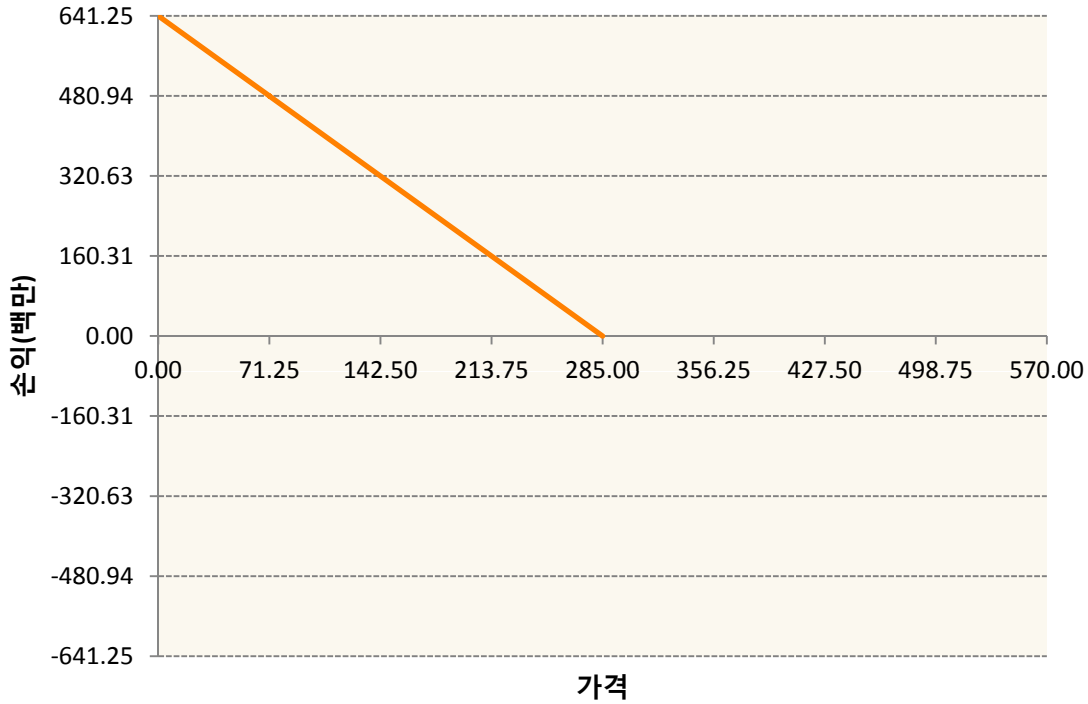


KR4301PC2824-2019-12 풋282.5





KR4301PC2857-2019-12 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101PC0002		2019-12 코스피200지수선물						857
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-857	-857	-857	-857	-857	-857	-857	
-5.33%	-572	-572	-572	-572	-572	-572	-572	
-2.67%	-286	-286	-286	-286	-286	-286	-286	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	286	286	286	286	286	286	286	
5.33%	572	572	572	572	572	572	572	
8.00%	857	857	857	857	857	857	857	
KR4201PC2973		2019-12 콜297.5						318
		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	4	4	
-2.67%	5	5	5	4	4	3	1	

0%	4	3	2	0	-3	-7	-12
2.67%	-3	-8	-14	-22	-31	-41	-52
5.33%	-50	-64	-80	-96	-112	-129	-146
8.00%	-202	-222	-241	-260	-280	-299	-318
KR4201PC3005                      2019-12 콜300							83
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	0	0
0%	1	1	0	0	-1	-1	-3
2.67%	0	-1	-3	-4	-7	-9	-12
5.33%	-9	-13	-17	-21	-26	-31	-36
8.00%	-45	-52	-58	-64	-70	-77	-83
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	1
2.67%	-12	-12	-11	-11	-11	-10	-10
5.33%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
8.00%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
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%	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%	-14	-14	-14	-13	-13	-13	-12
5.33%	-19	-19	-19	-19	-18	-18	-18
8.00%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19

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

(단위:백만원)

911

공시일	2019-12-09
기준일	2019-12-06

## 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	208,371	0	208,371	

### 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	2019-12-09
기준일	2019-12-06

## 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	217,478	0	217,478	

### 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	2019-12-09
기준일	2019-12-06

## 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	552,194	0	552,194	
누계	통화	선도	0	578,740	-578,740	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		4,854
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,428
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,532
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		1,903
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		3,274
FX21019X02 KRW/USD 26-12-19E		4,796
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		4,854
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		190
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,855
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,855
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,379
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)

14,618



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

(단위:백만원)

178

공시일	2019-12-09
기준일	2019-12-06

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

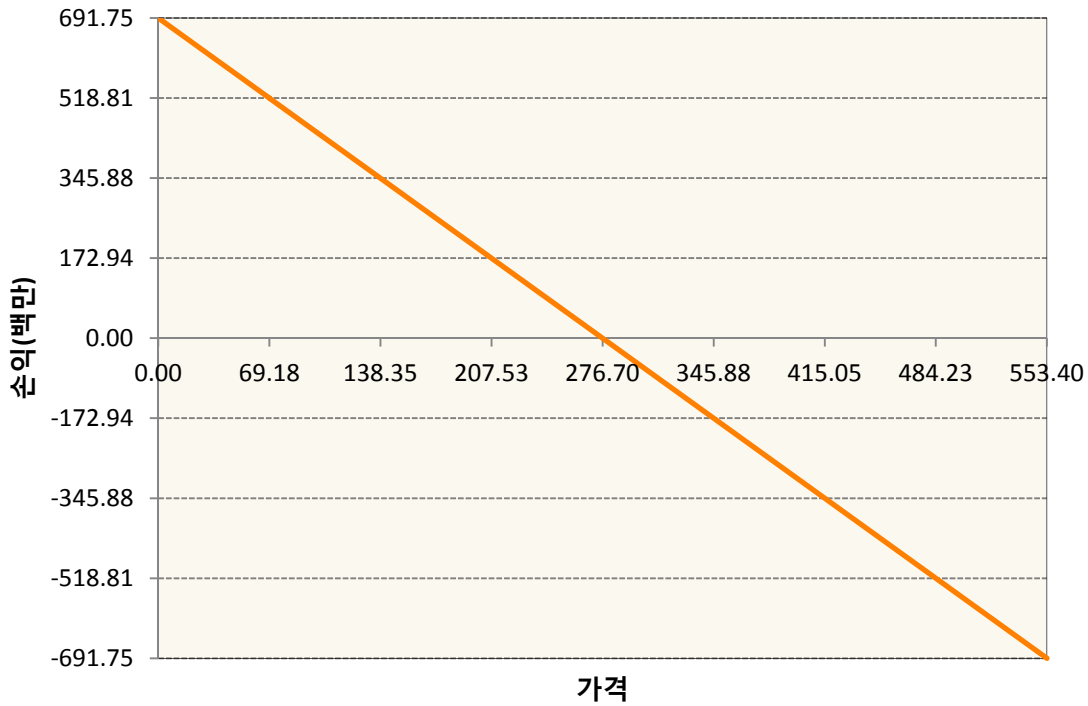
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

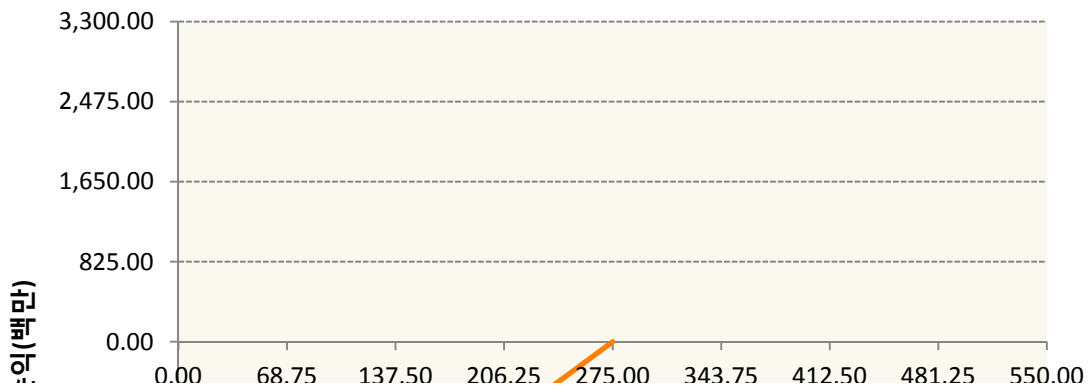
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	692	-692	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,994	-3,994	장내

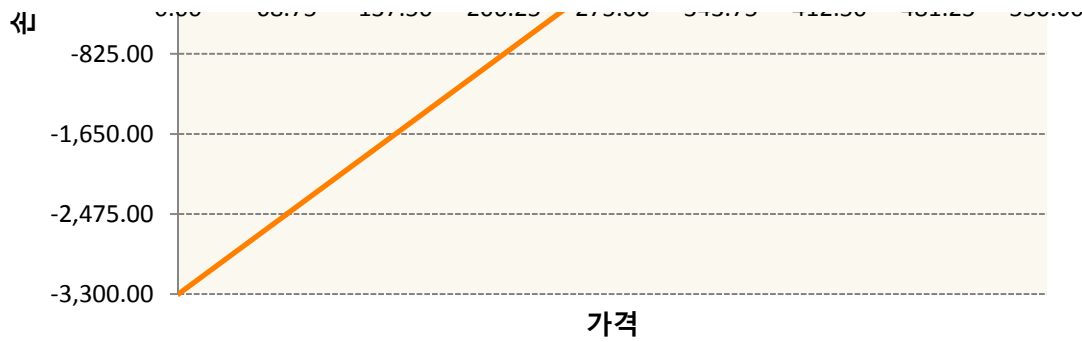
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101PC0002-2019-12 코스피200지수선물

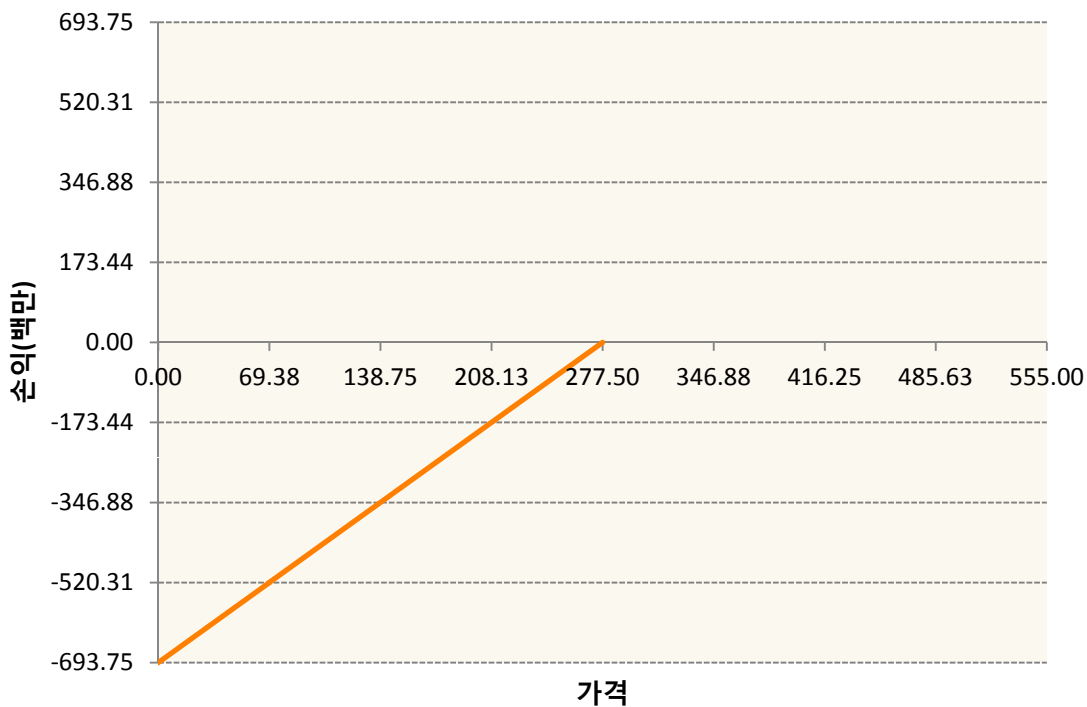


KR4301PC2758-2019-12 풋275





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						232
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-232	-232	-232	-232	-232	-232	-232
-5.33%	-143	-143	-143	-143	-143	-143	-144
-2.67%	-56	-56	-57	-58	-59	-60	-61
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	15	15	15	15	14	14	13
5.33%	16	16	16	16	16	15	15
8.00%	16	16	16	16	16	16	16
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%	6	6	6	6	5	5	5
5.33%	6	6	6	6	6	6	6
8.00%	6	6	6	6	6	6	6

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

(단위:백만원)

**413**

공시일	2019-12-09
기준일	2019-12-06

## 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	15,279	0	15,279	
누계	통화	선도	0	19,724	-19,724	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)

<b>498</b>
------------

공시일	2019-12-09
기준일	2019-12-06

## 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	1,014	0	1,014	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)

79
----

공시일	2019-12-09
기준일	2019-12-06

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

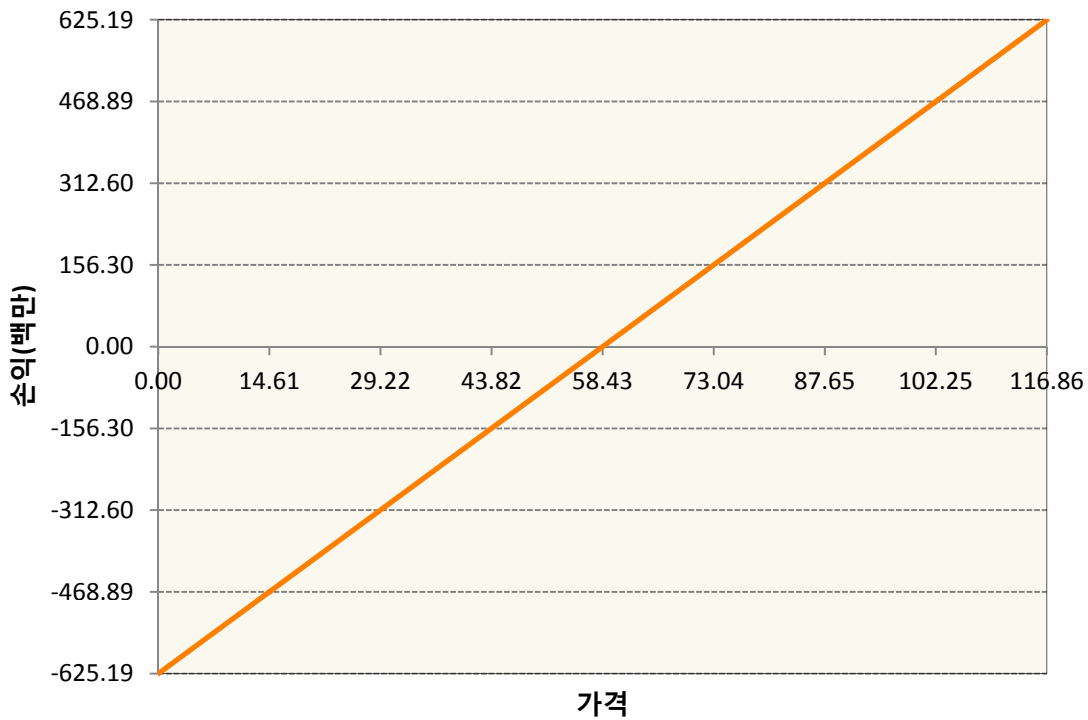
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

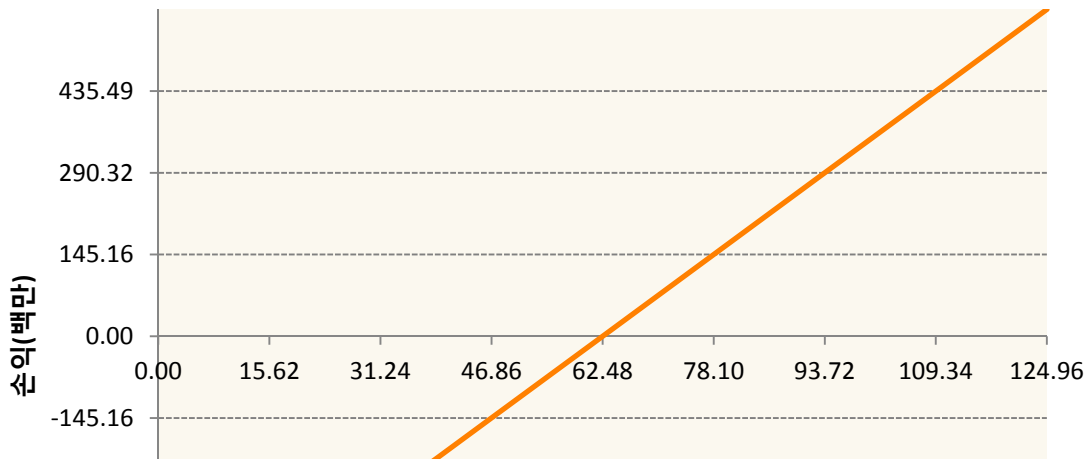
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,456	297	2,159	

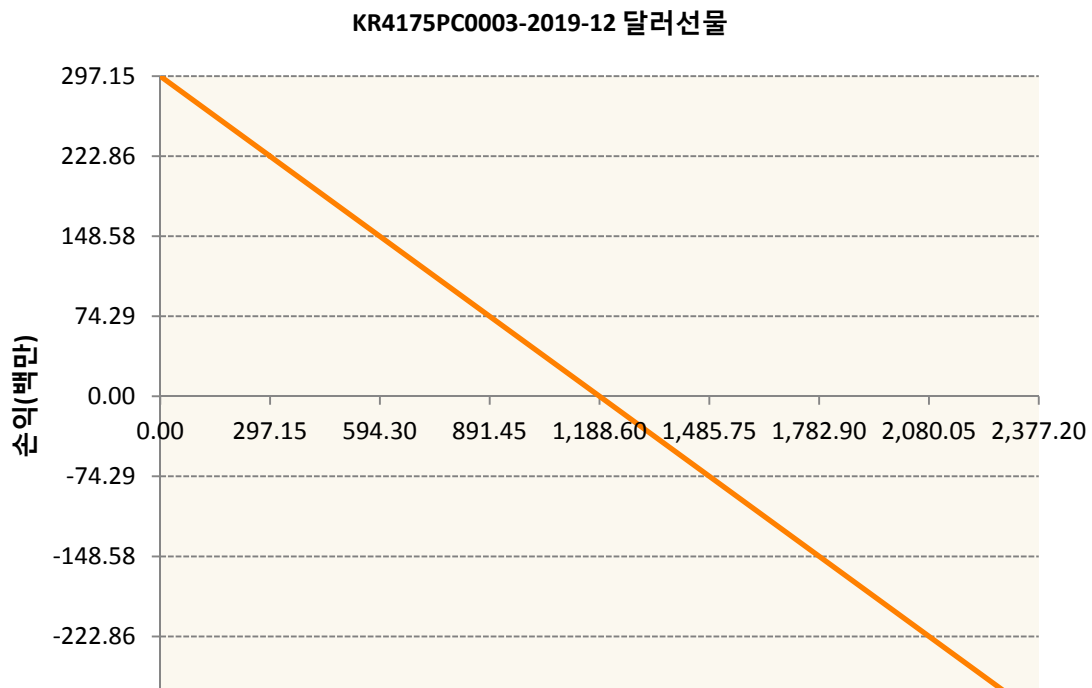
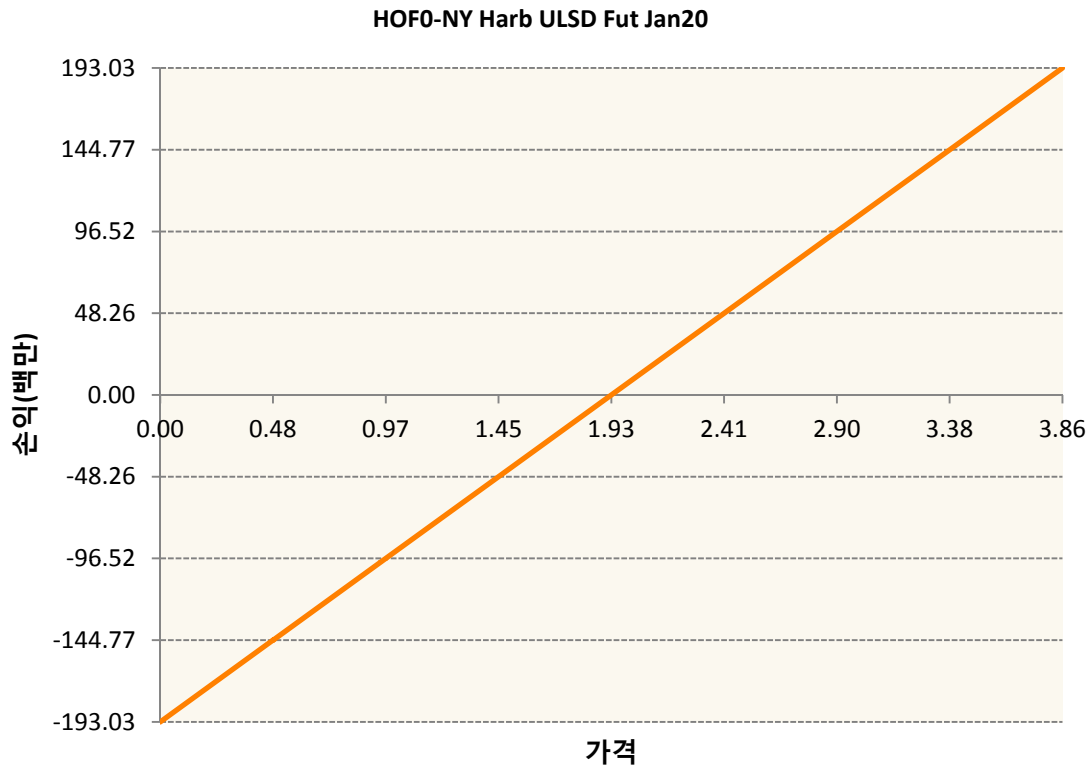
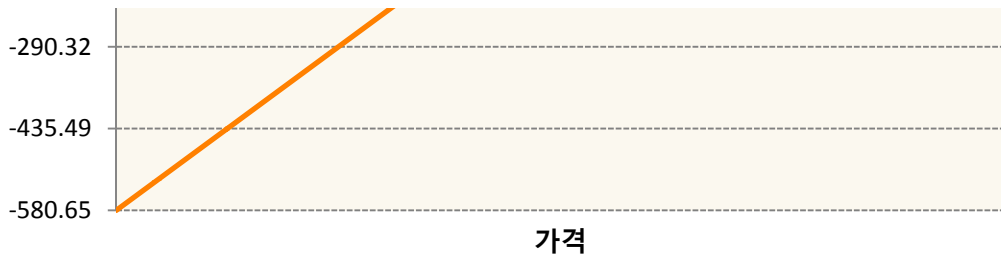
### 2. 만기시점의 손익구조

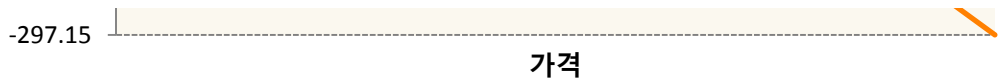
CLF0-WTI CRUDE FUTURE Jan20



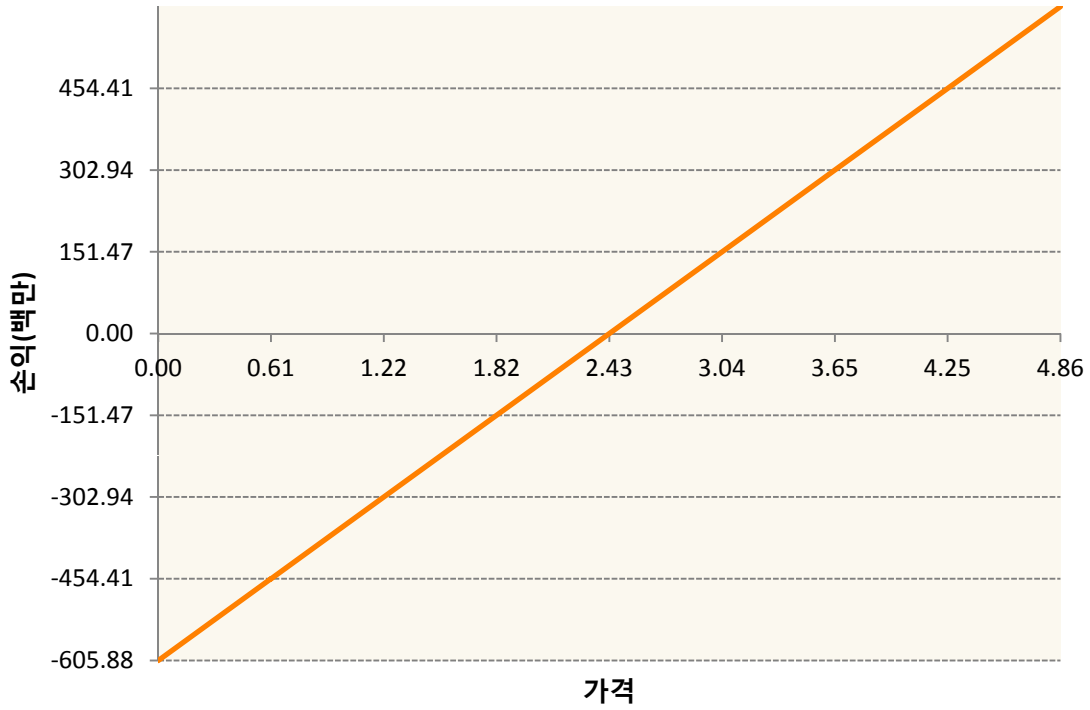
COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20



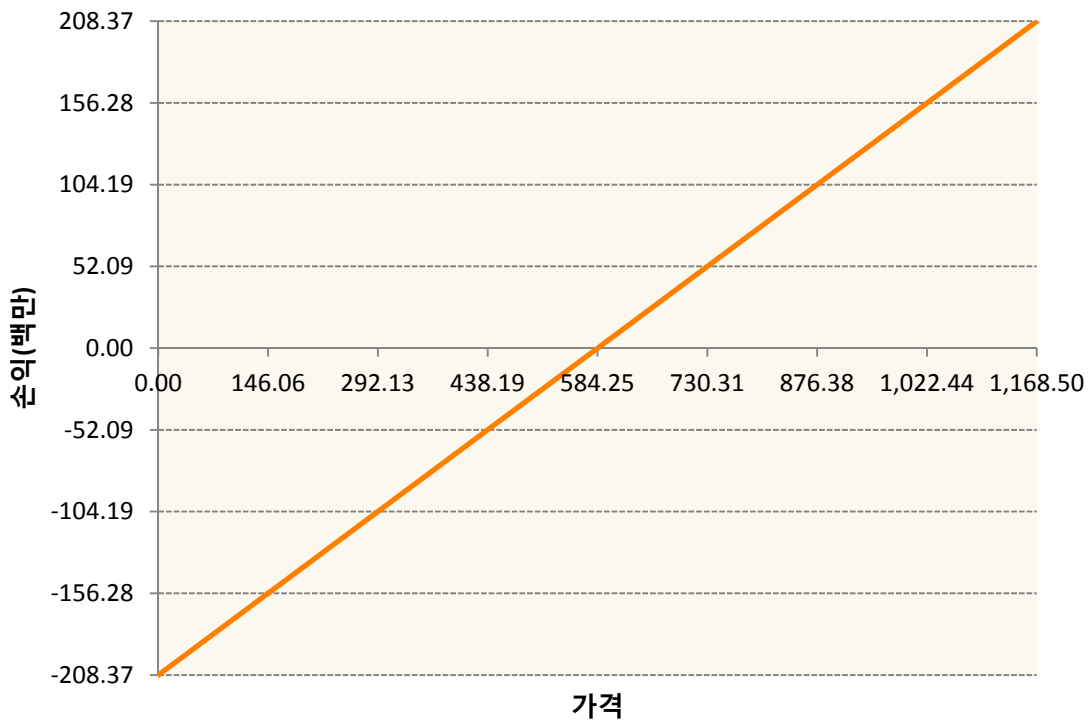




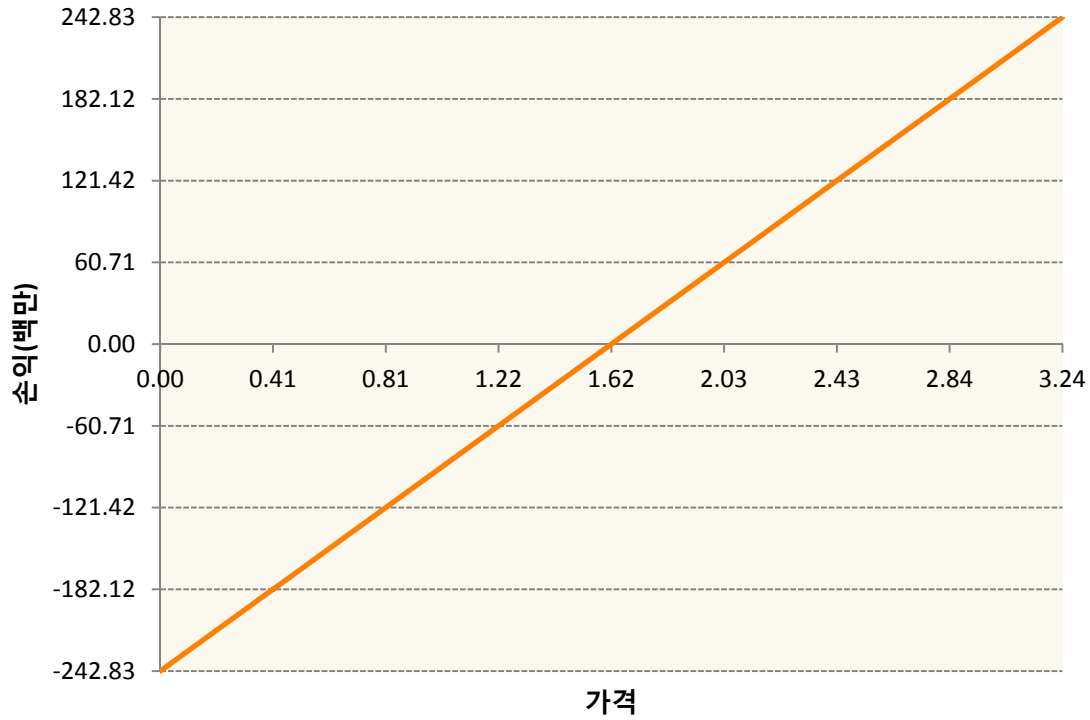
NGF20-NATURAL GAS FUTR Jan20



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)

402

공시일	2019-12-09
기준일	2019-12-06

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

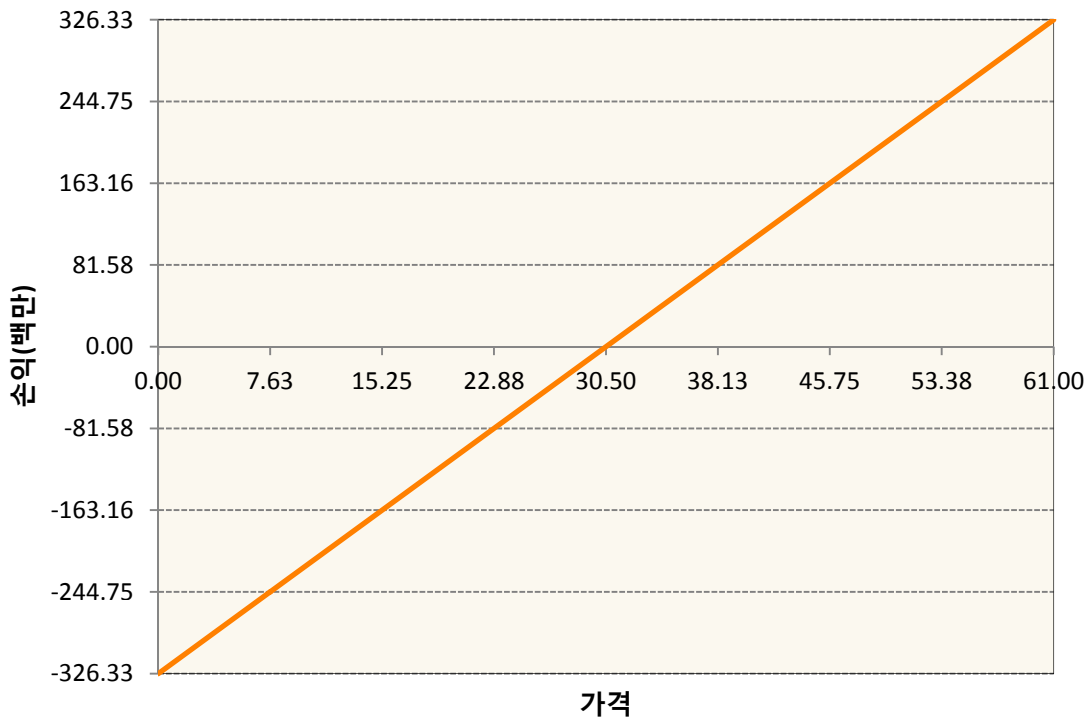
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

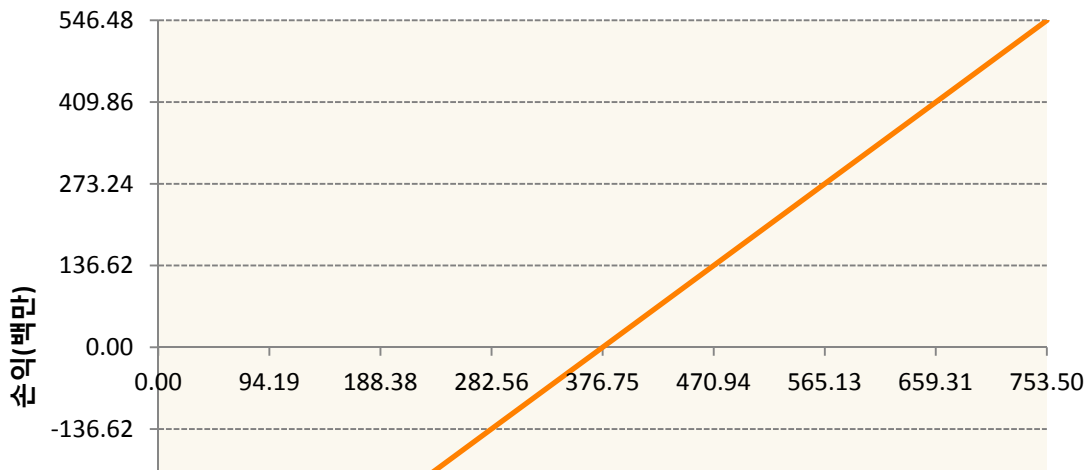
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,789	95	2,694	

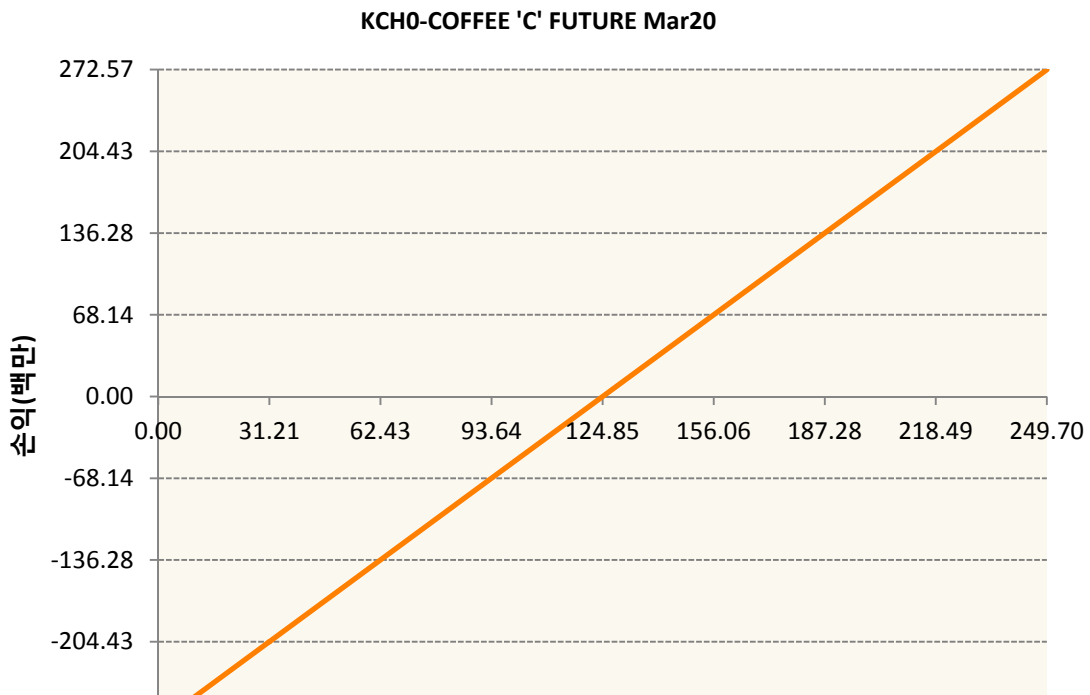
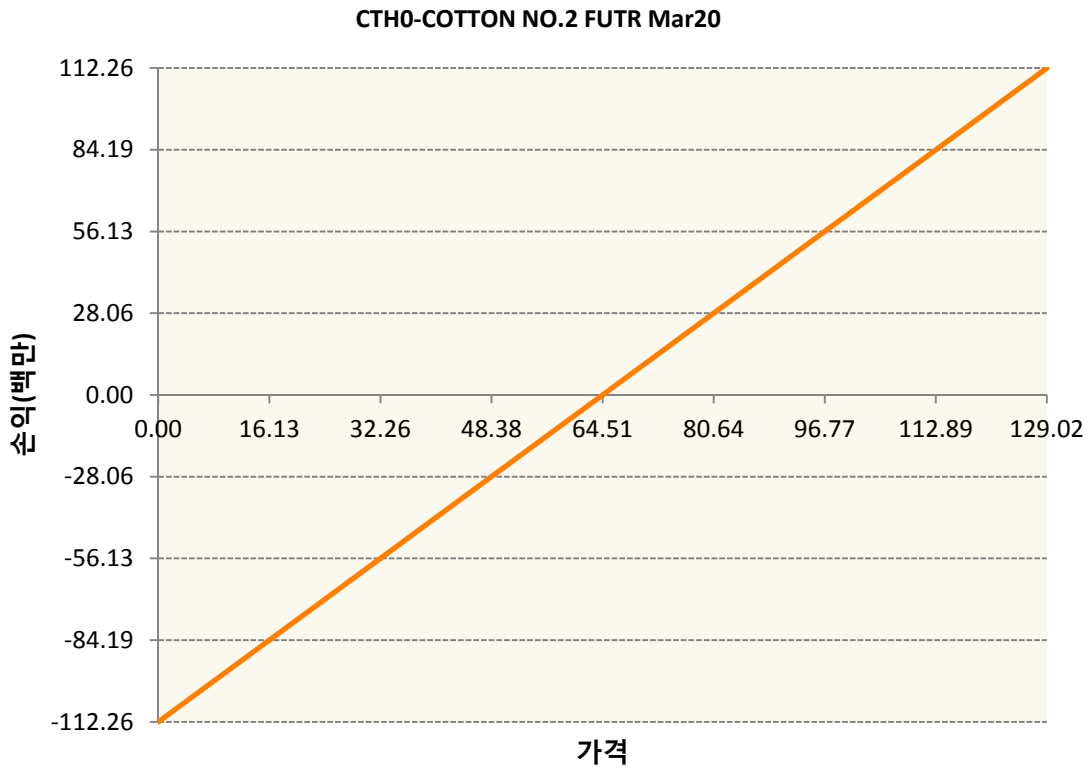
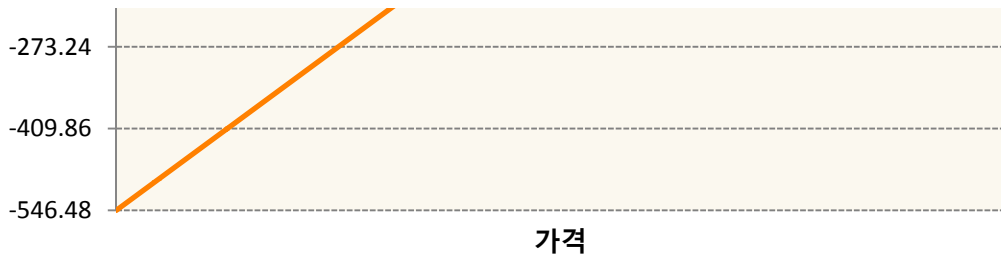
### 2. 만기시점의 손익구조

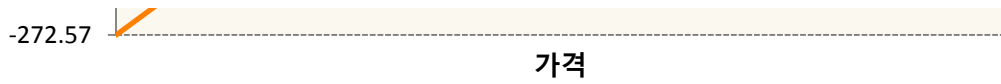
**BOF0-SOYBEAN OIL FUTR Jan20**



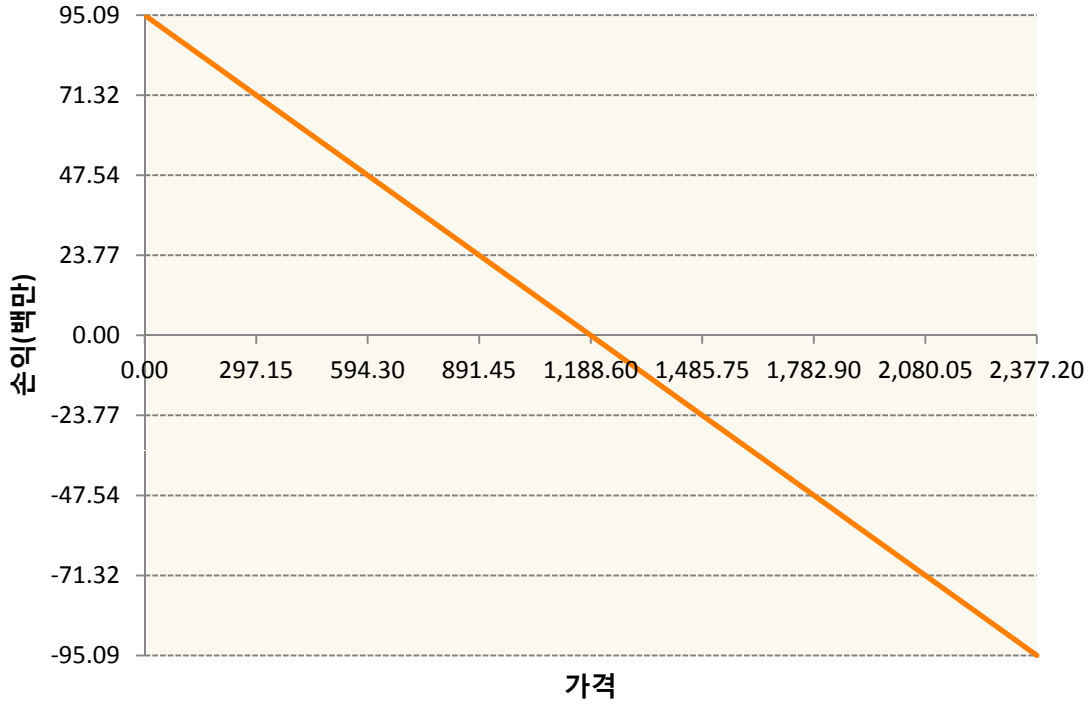
**CH0-CORN FUTURE Mar20**



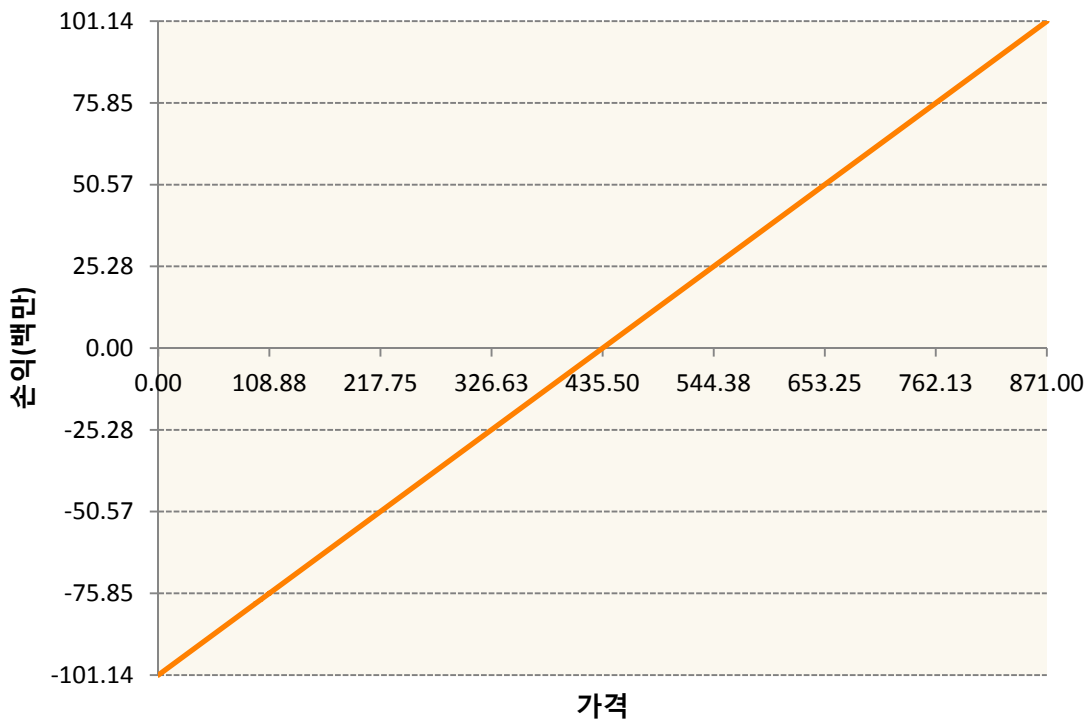




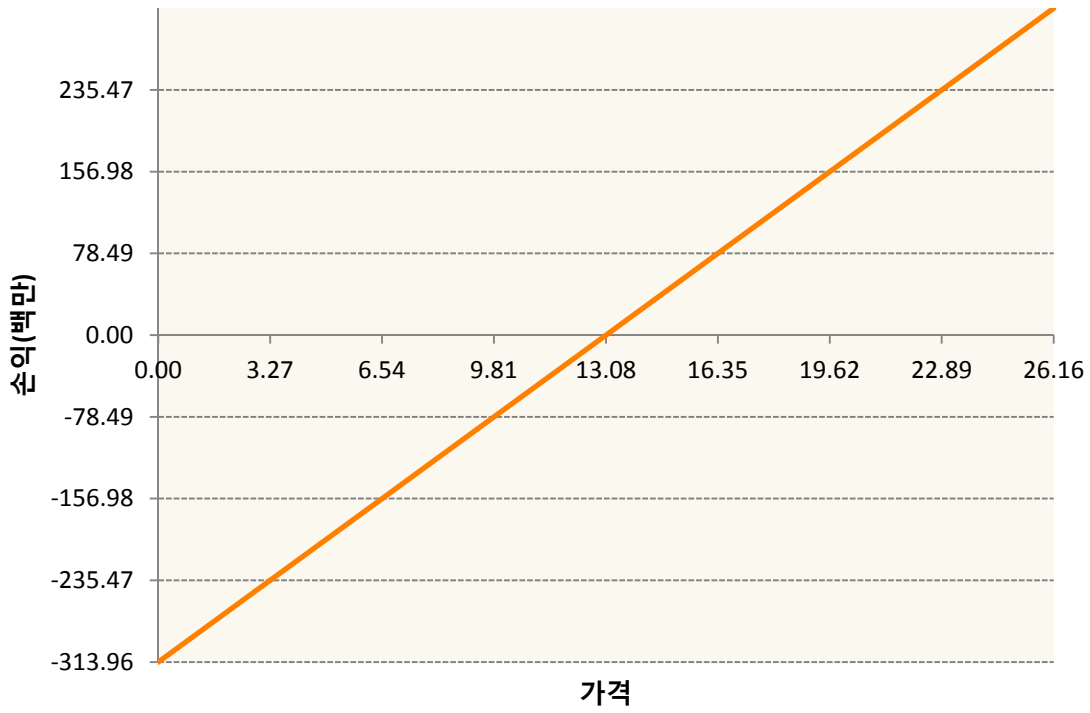
KR4175PC0003-2019-12 달러선물



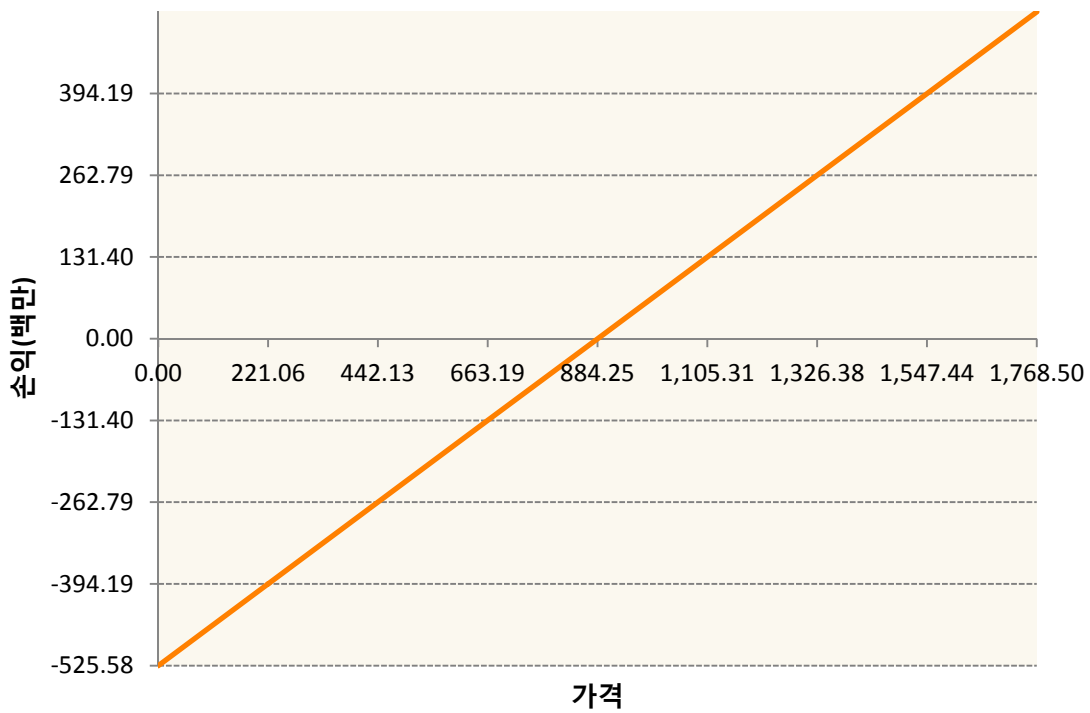
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

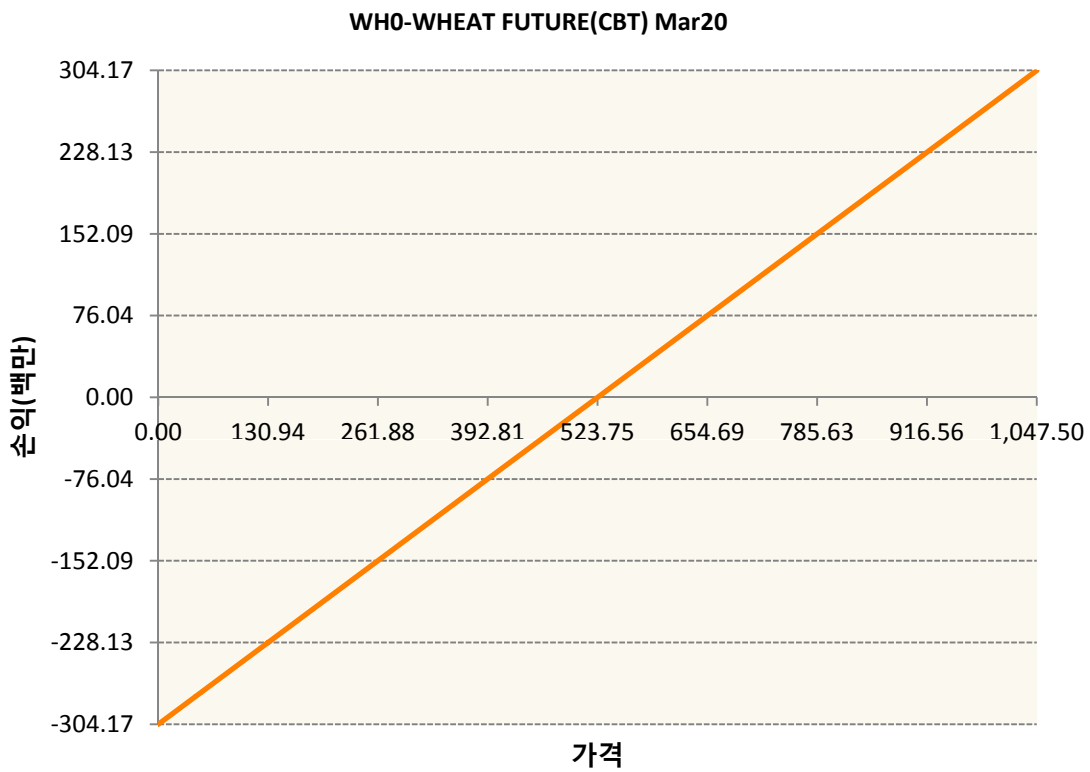
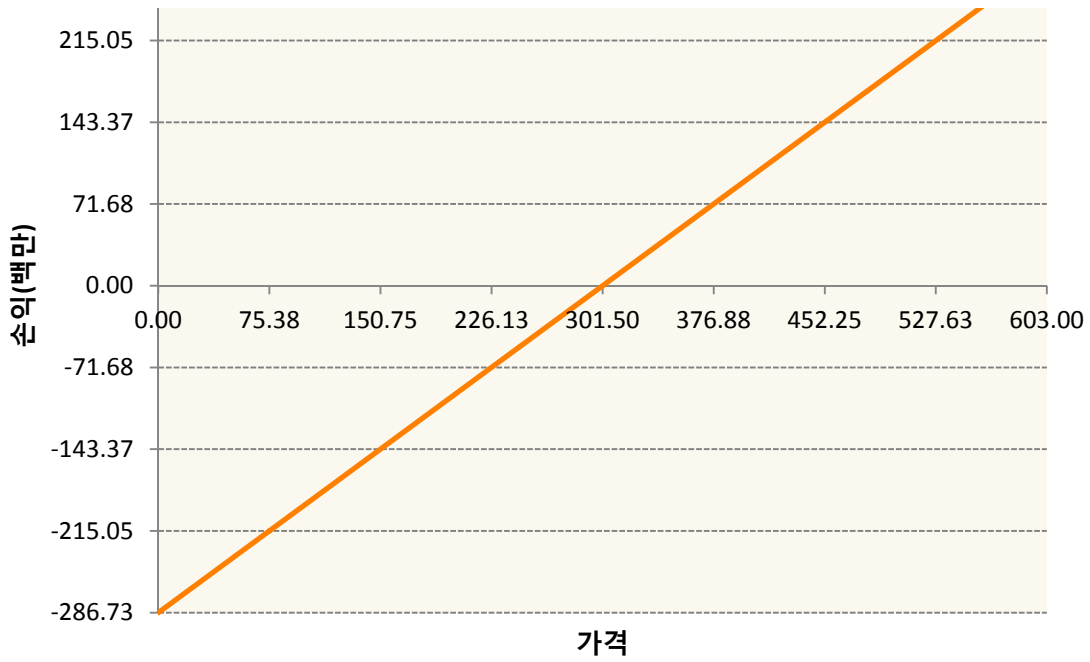


SF0-SOYBEAN FUTURE Jan20



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

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

(단위:백만원)

**246**