

공시일	2019-12-13
기준일	2019-12-12

## 포커스농산물모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	5	0	5	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음



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

(단위:백만원)

161

공시일	2019-12-13
기준일	2019-12-12

## 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	2019-12-13
기준일	2019-12-12

## 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)	140

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

729
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-13
기준일	2019-12-12

## 유로인덱스모(주식-파생형)

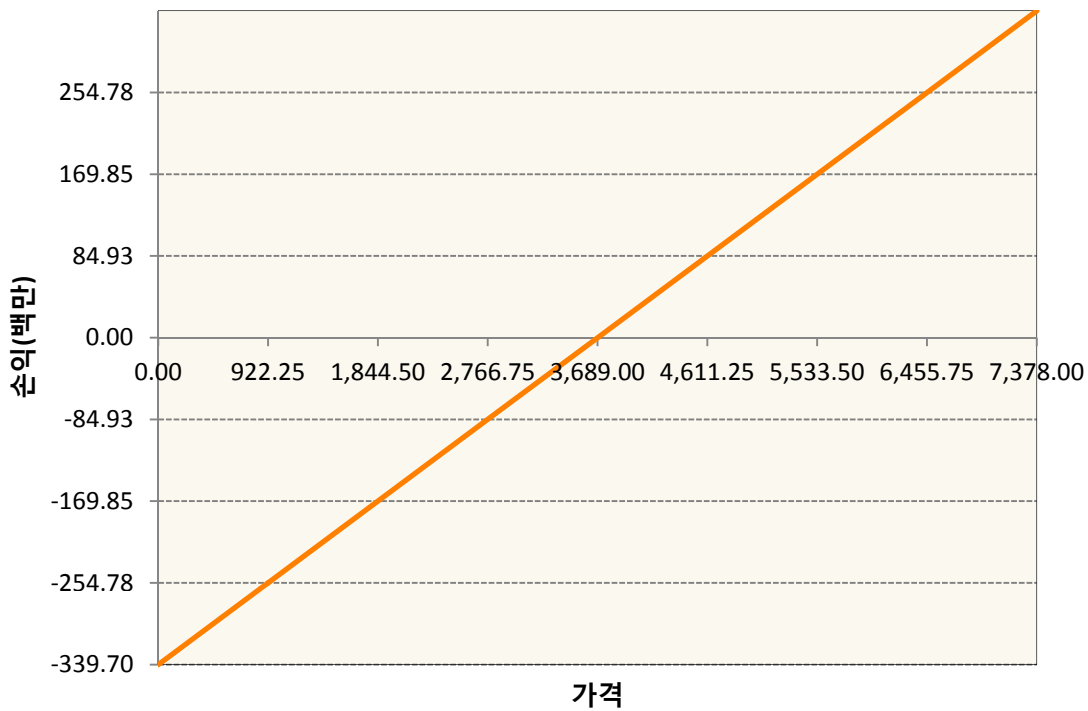
### 1. 계약금액

(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	2019-12-13
기준일	2019-12-12

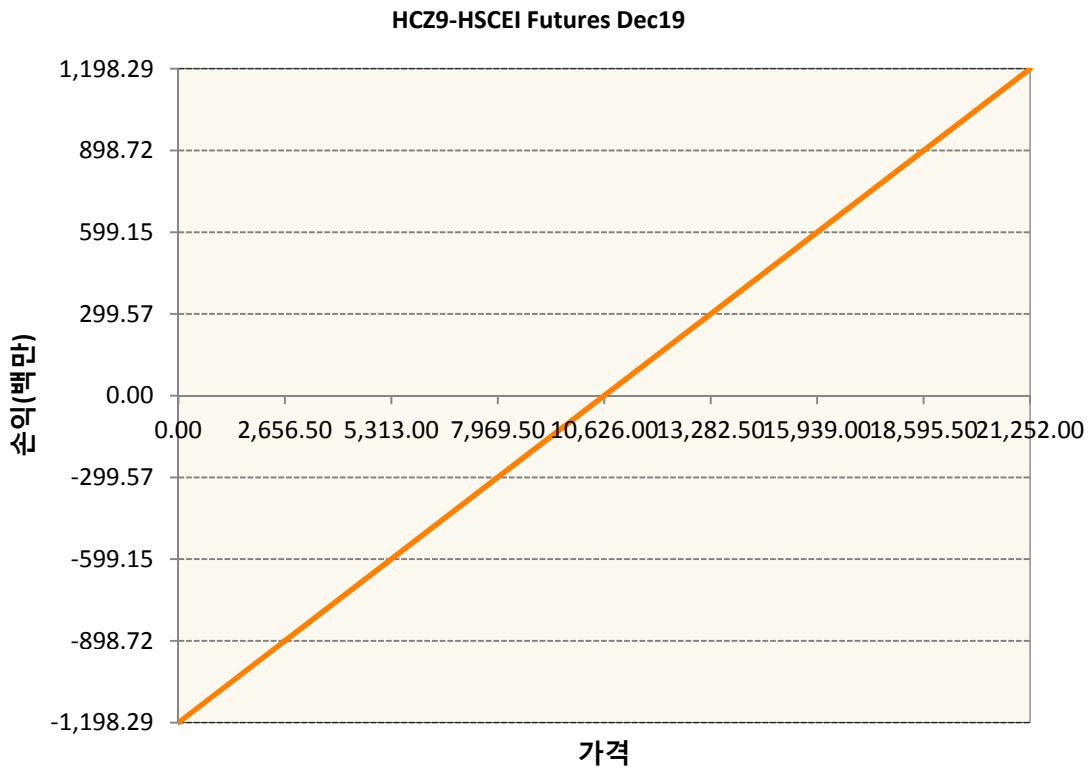
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,198	0	1,198	

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ9	HSCEI Futures Dec19	96
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

86
----

공시일	2019-12-13
기준일	2019-12-12

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

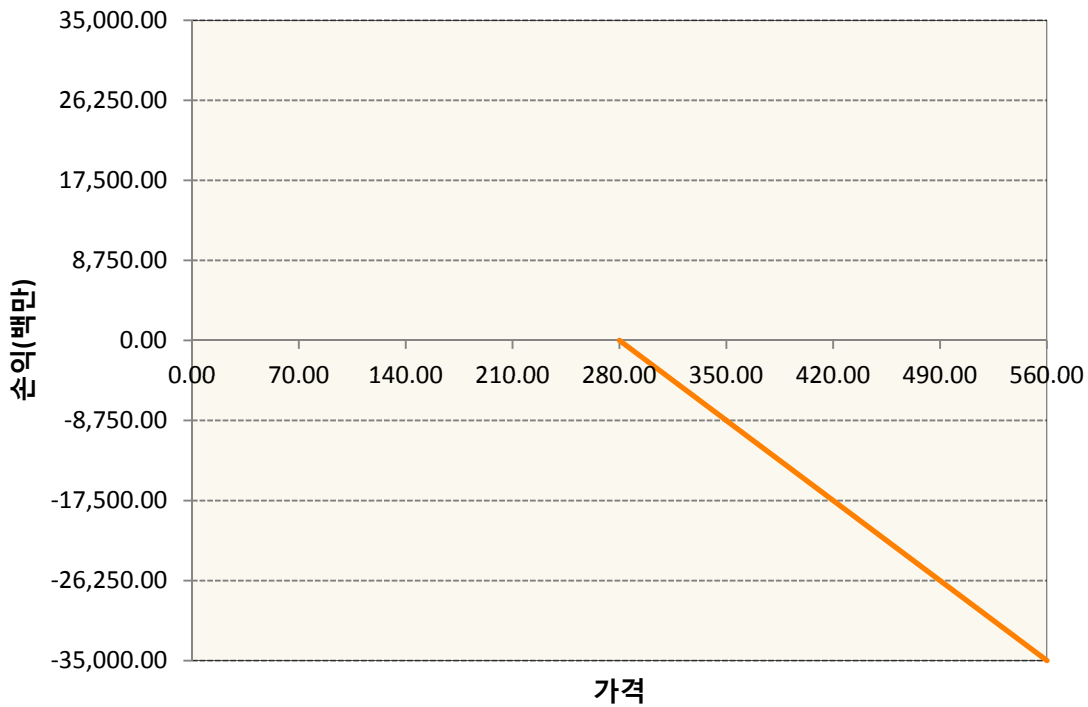
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

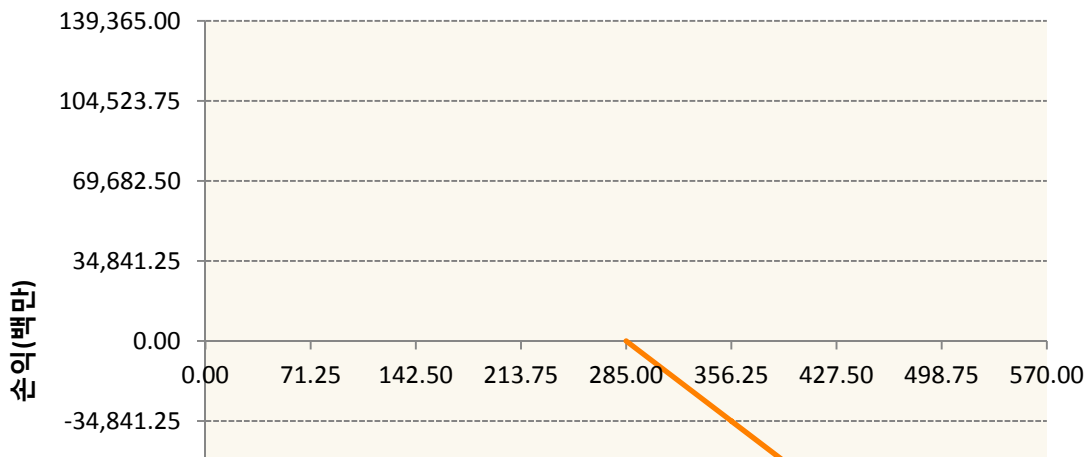
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	143,619	-143,619	장내
누계	유가증권	옵션	0	177,528	-177,528	장내

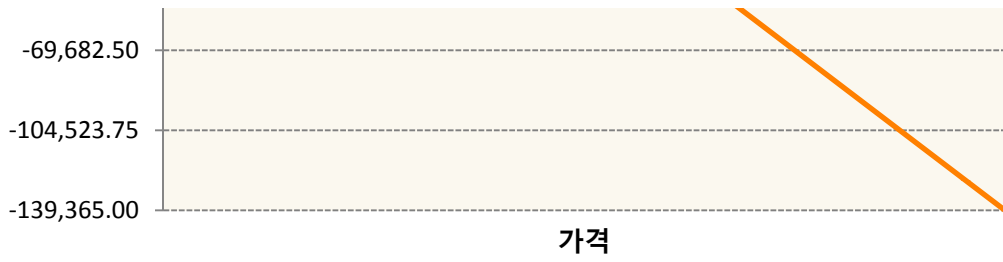
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q12803-2020-01 콜280

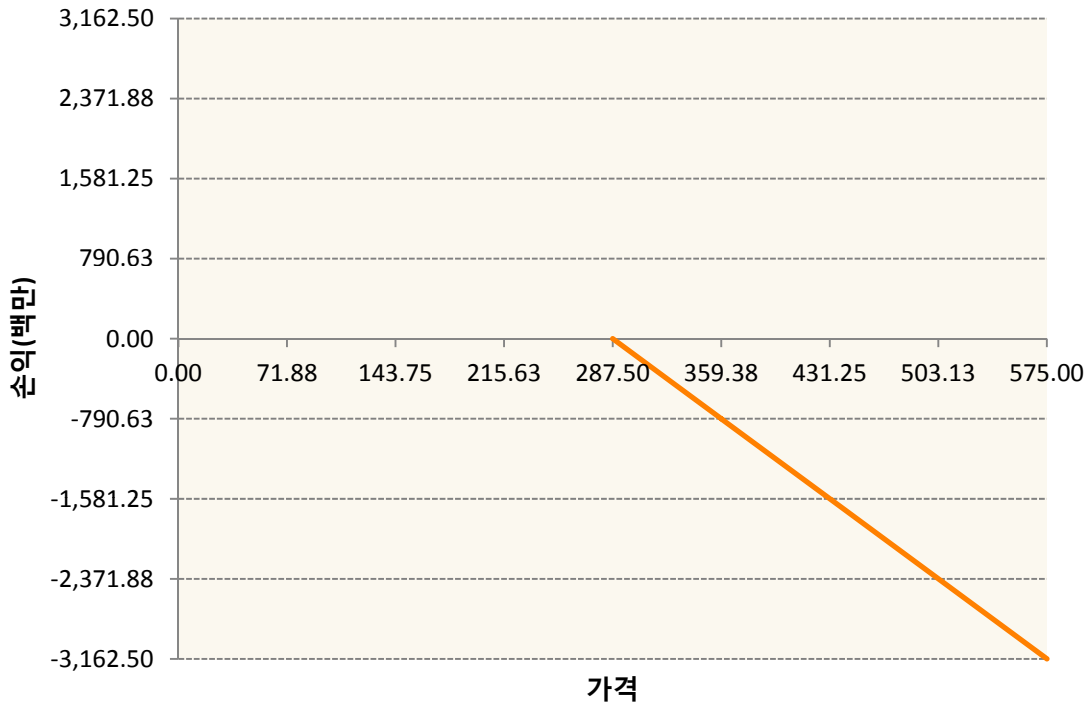


KR4201Q12852-2020-01 콜285





KR4201Q12878-2020-01 콜287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q12803		2020-01 콜280					2,343
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,308	1,257	1,201	1,141	1,077	1,010	941
-5.33%	1,117	1,042	965	885	805	723	640
-2.67%	778	688	598	508	417	327	236
0%	268	179	90	0	-90	-181	-271
2.67%	-402	-475	-552	-631	-712	-794	-878
5.33%	-1,196	-1,247	-1,304	-1,366	-1,432	-1,501	-1,574
8.00%	-2,068	-2,099	-2,136	-2,180	-2,230	-2,284	-2,343
KR4201Q12852		2020-01 콜285					8,514
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,067	3,926	3,759	3,571	3,364	3,141	2,904

-5.33%	3,591	3,352	3,095	2,824	2,542	2,251	1,952
-2.67%	2,649	2,323	1,992	1,656	1,316	974	630
0%	1,092	728	364	0	-364	-728	-1,092
2.67%	-1,123	-1,461	-1,805	-2,152	-2,503	-2,856	-3,211
5.33%	-3,915	-4,180	-4,462	-4,758	-5,064	-5,379	-5,701
8.00%	-7,129	-7,307	-7,511	-7,736	-7,981	-8,241	-8,514
KR4201Q12878                      2020-01 콜287.5							183
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	81	78	75	71	67	62	57
-5.33%	72	68	62	57	51	45	38
-2.67%	55	48	41	34	26	19	11
0%	24	16	8	0	-8	-16	-25
2.67%	-21	-29	-37	-45	-53	-61	-69
5.33%	-79	-86	-93	-100	-107	-115	-123
8.00%	-149	-153	-159	-164	-170	-177	-183

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

(단위:백만원)

**10,378**

공시일	2019-12-13
기준일	2019-12-12

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

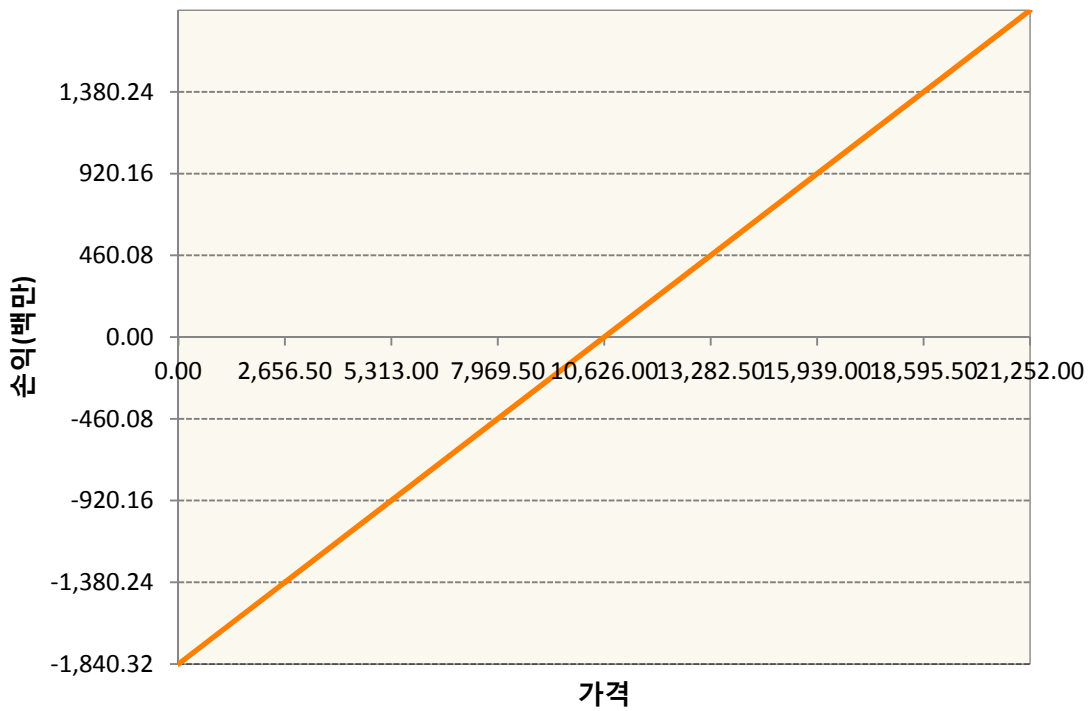
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

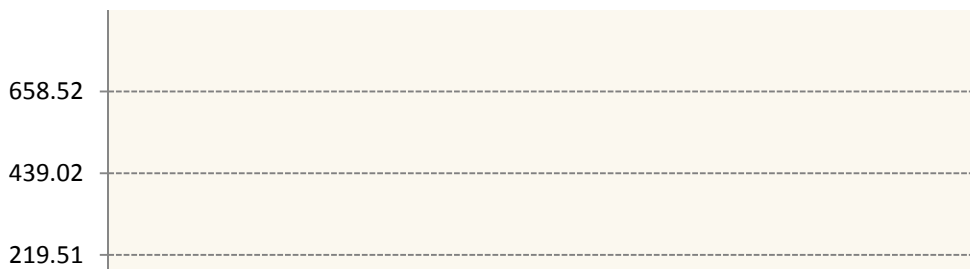
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,840	0	1,840	
누계	유가증권	옵션	0	4,979	-4,979	장내
누계	통화	선도	0	2,141	-2,141	장외

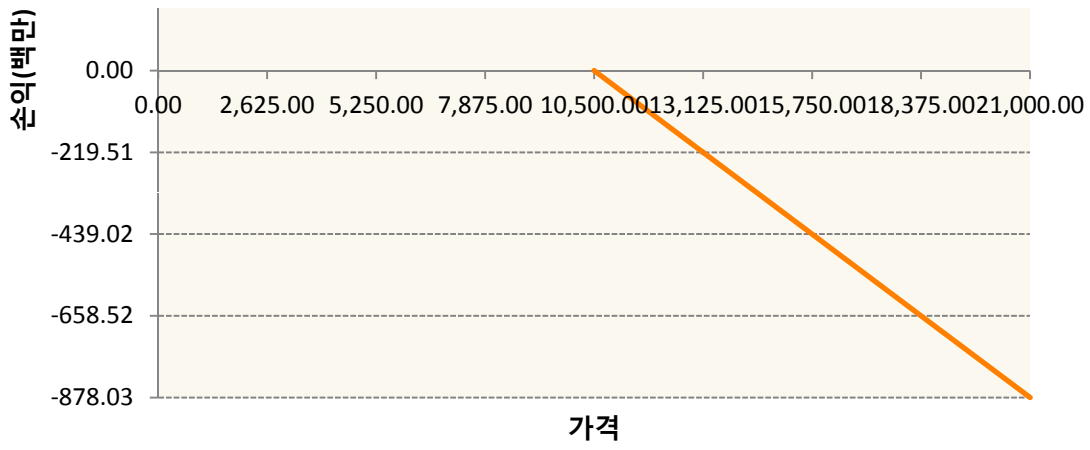
### 2. 만기시점의 손익구조

HCZ9-HSCEI Futures Dec19

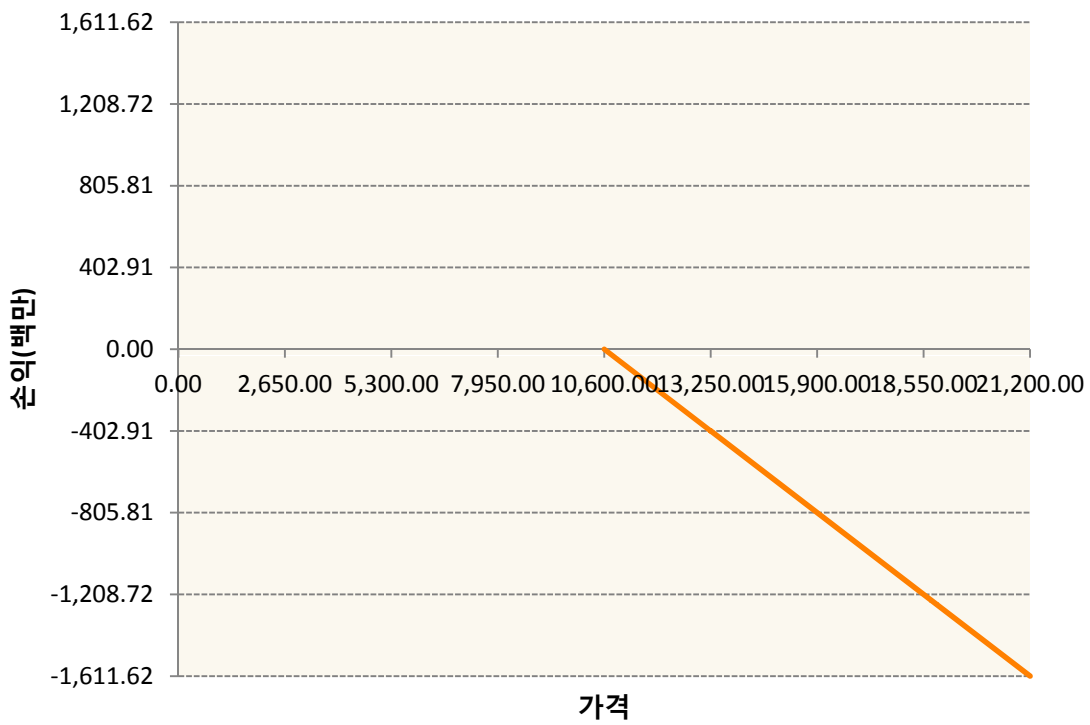


OHHIZ9-C105-HSCEI

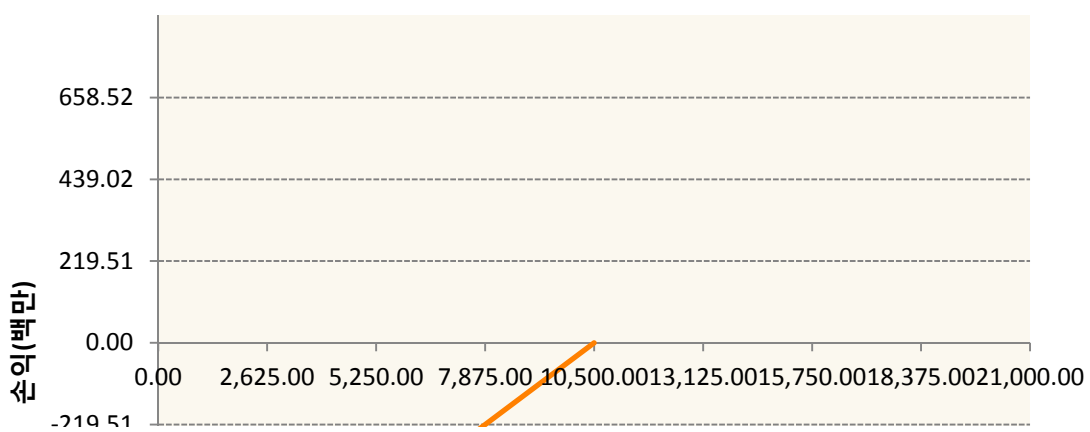


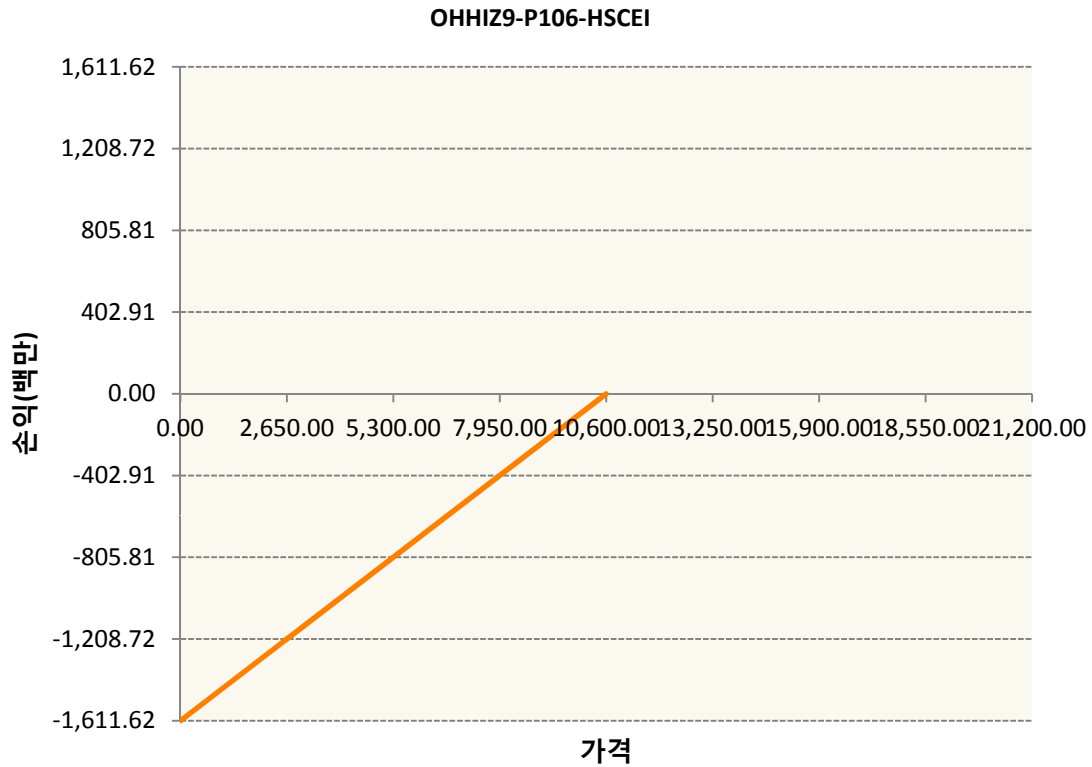
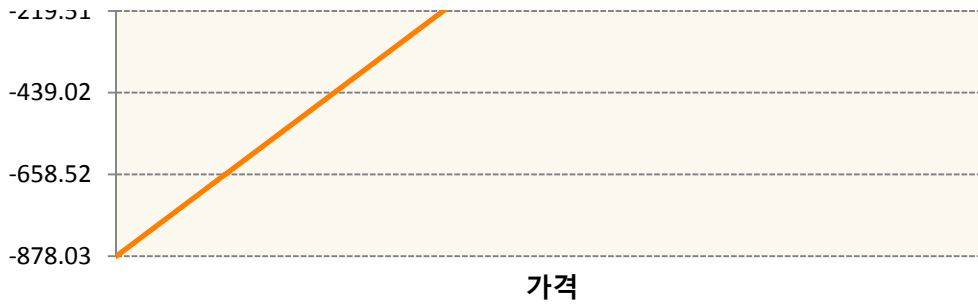


**OHHIZ9-C106-HSCEI**



**OHHIZ9-P105-HSCEI**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	171
HCZ9 HSCEI Futures Dec19	147
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)
	536



5.33%	498	498	498	498	498	498	498
8.00%	747	747	747	747	747	747	747
KR4101Q30005                      2020-03 코스피200지수선물							251
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-251	-251	-251	-251	-251	-251	-251
-5.33%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
-2.67%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	84	84	84	84	84	84	84
5.33%	167	167	167	167	167	167	167
8.00%	251	251	251	251	251	251	251

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

(단위:백만원)

**944**

공시일	2019-12-13
기준일	2019-12-12

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

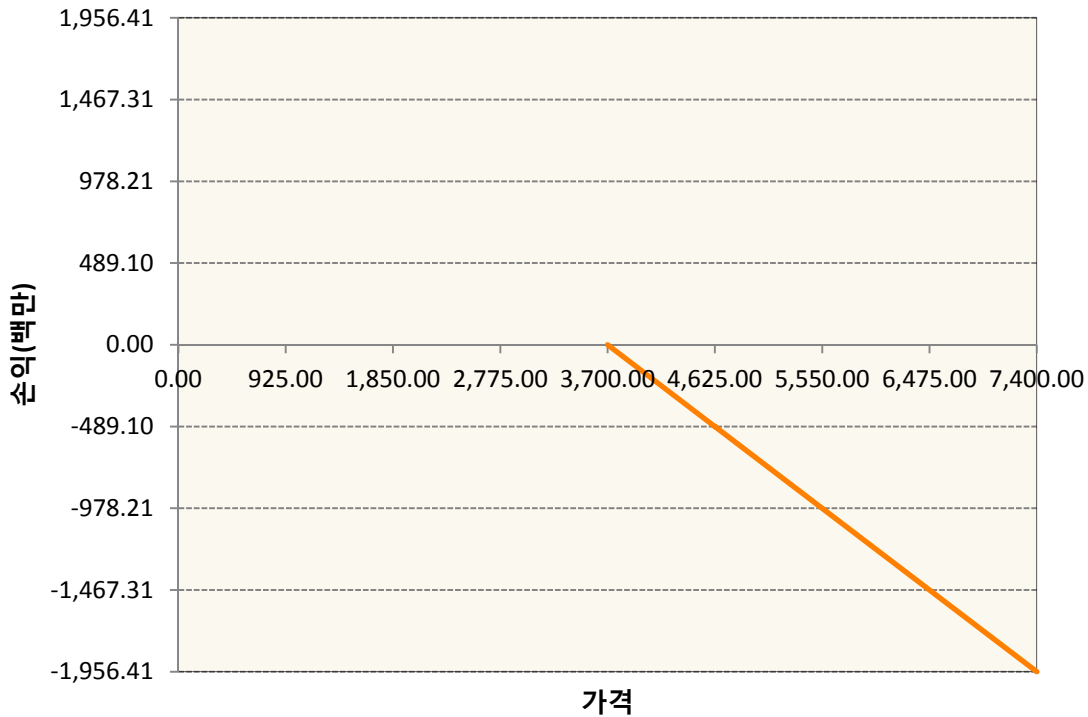
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

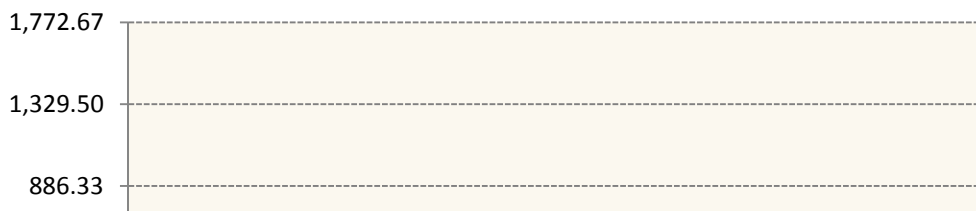
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	621	0	621	
누계	유가증권	스왑	18,074	0	18,074	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,458	-7,458	장내
누계	통화	선도	2,744	6,213	-3,469	장외

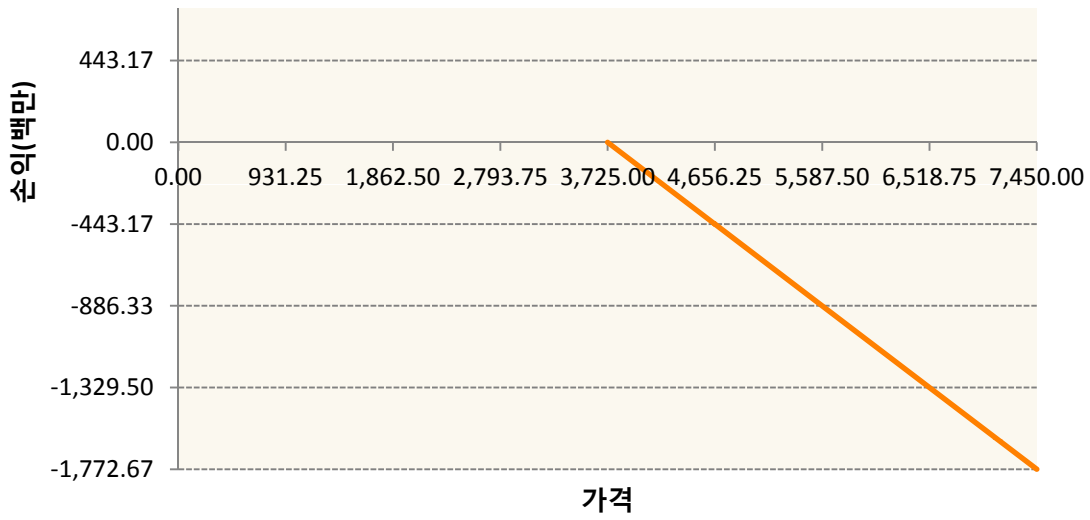
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXZ9-C3700-EURO STOXX 50**

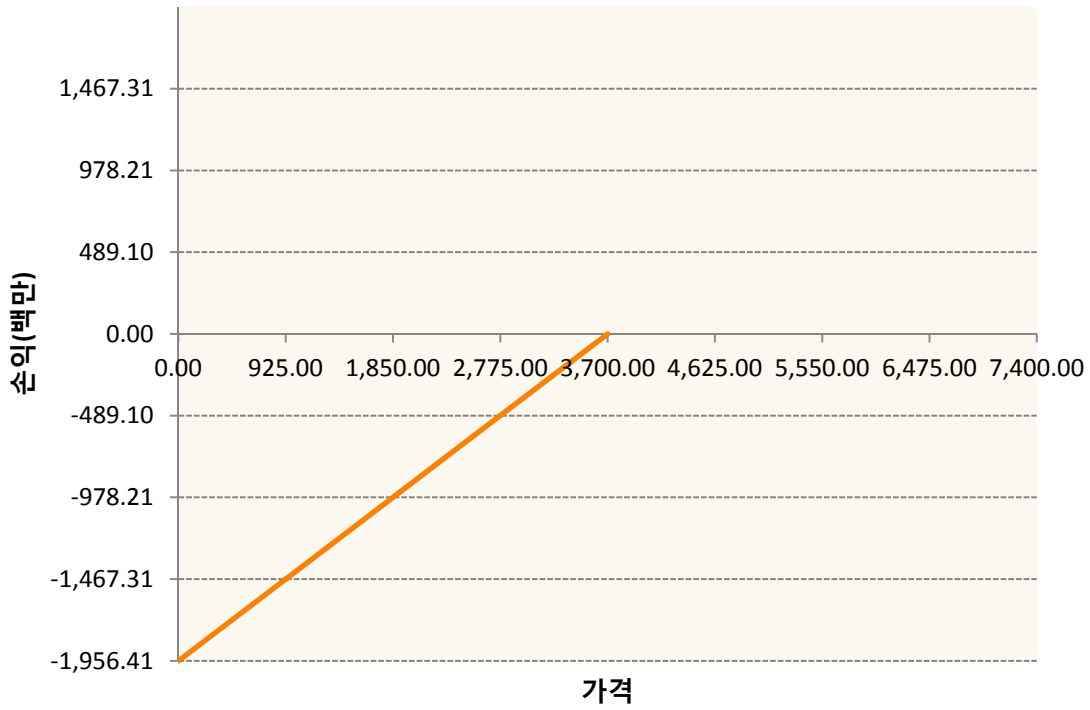


**OESXZ9-C3725-EURO STOXX 50**

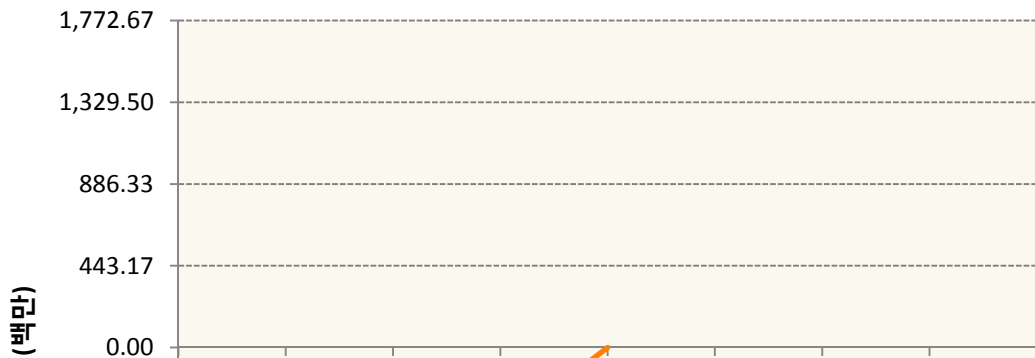


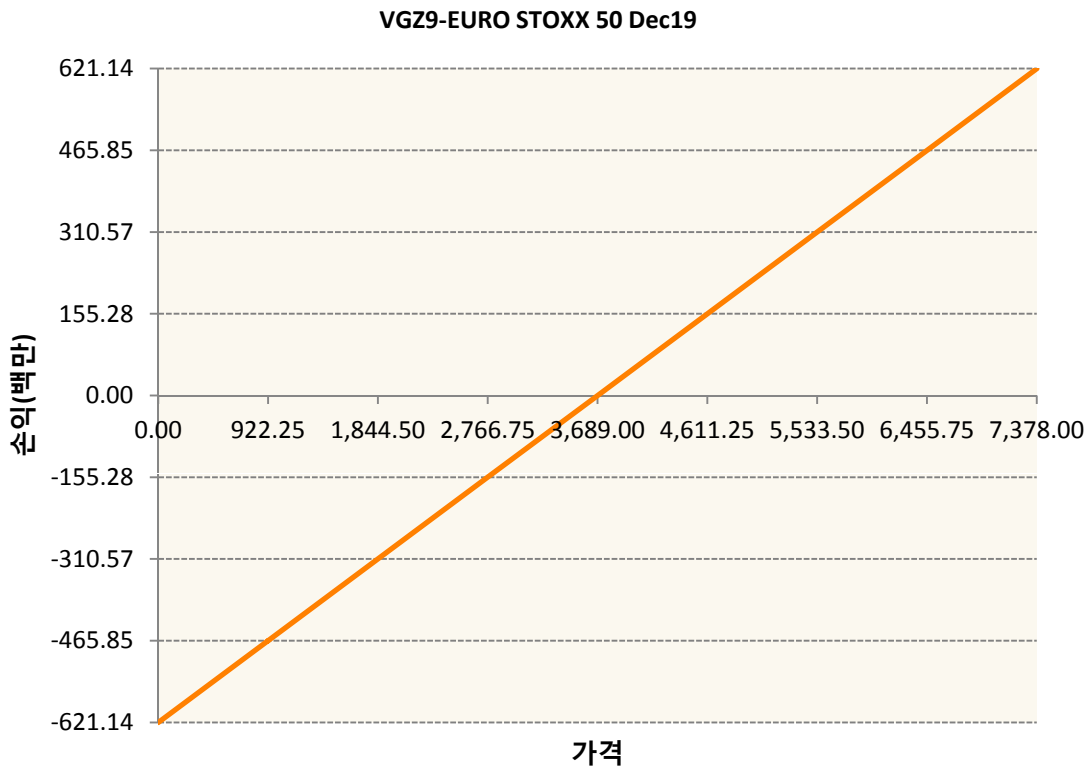
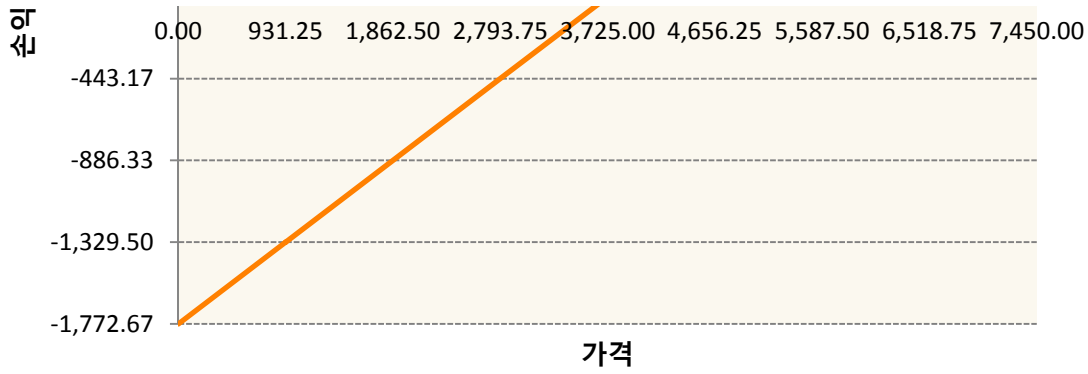


OESXZ9-P3700-EURO STOXX 50



OESXZ9-P3725-EURO STOXX 50





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	21
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	157
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	142
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	157
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	142
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19	50

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

(단위:백만원)

782



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

(단위:백만원)

923



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

(단위:백만원)

81



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

(단위:백만원)

125

공시일	2019-12-13
기준일	2019-12-12

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

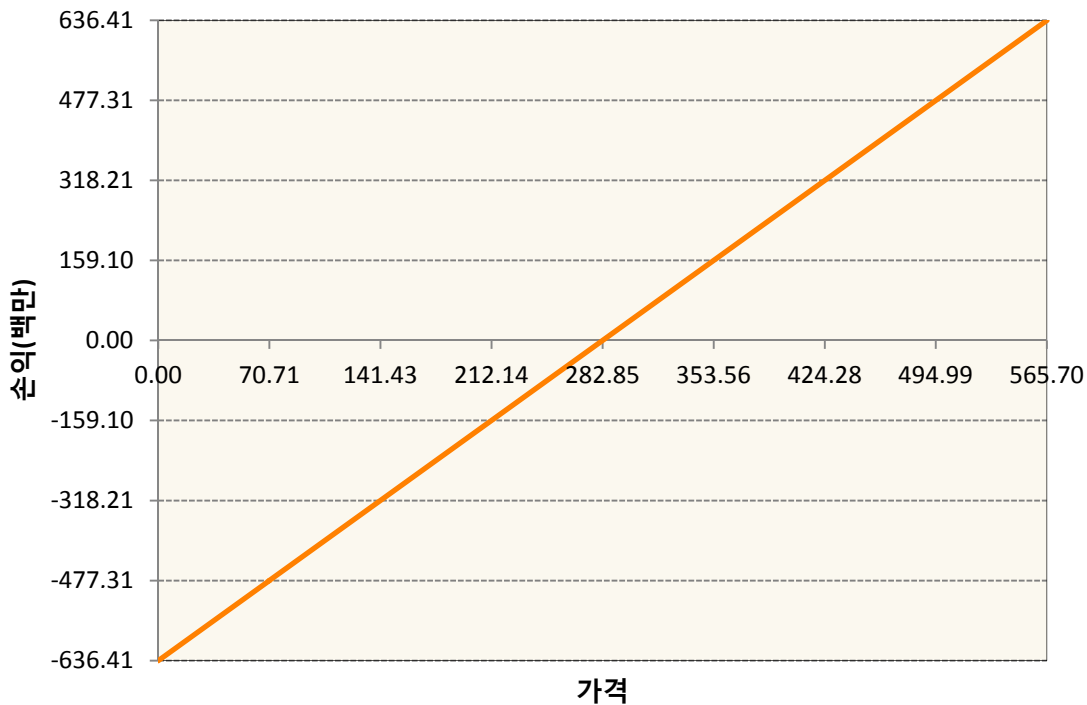
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	635	0	635	장내
누계	유가증권	선물	636	0	636	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						51
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51	
-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%	17	17	17	17	17	17	17	
5.33%	34	34	34	34	34	34	34	
8.00%	51	51	51	51	51	51	51	

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

(단위:백만원)

40

공시일	2019-12-13
기준일	2019-12-12

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

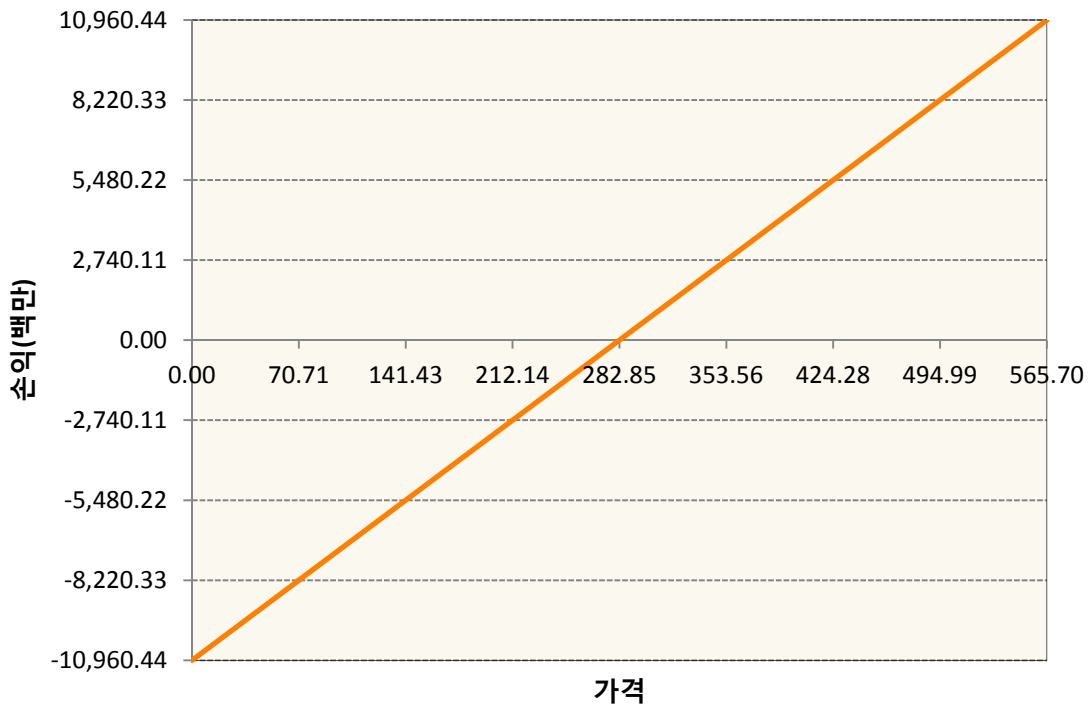
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

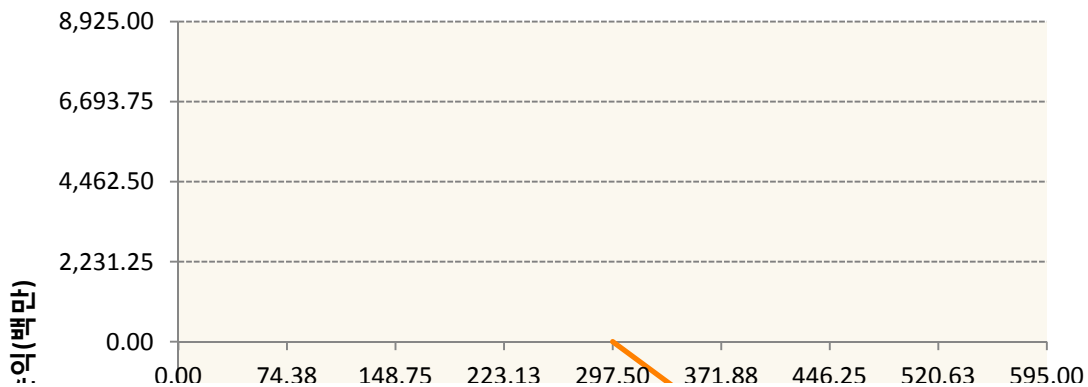
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	10,932	0	10,932	장내
신규	유가증권	옵션	418	21,385	-20,967	장내
누계	유가증권	선물	10,960	0	10,960	장내
누계	유가증권	옵션	427	21,375	-20,948	장내

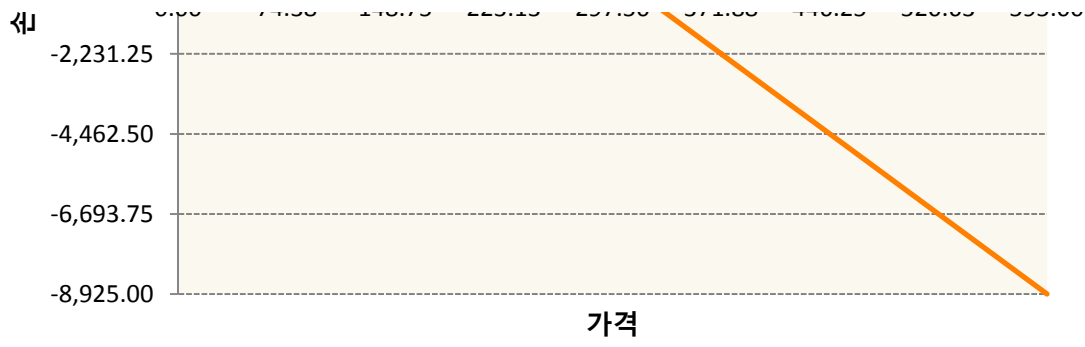
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

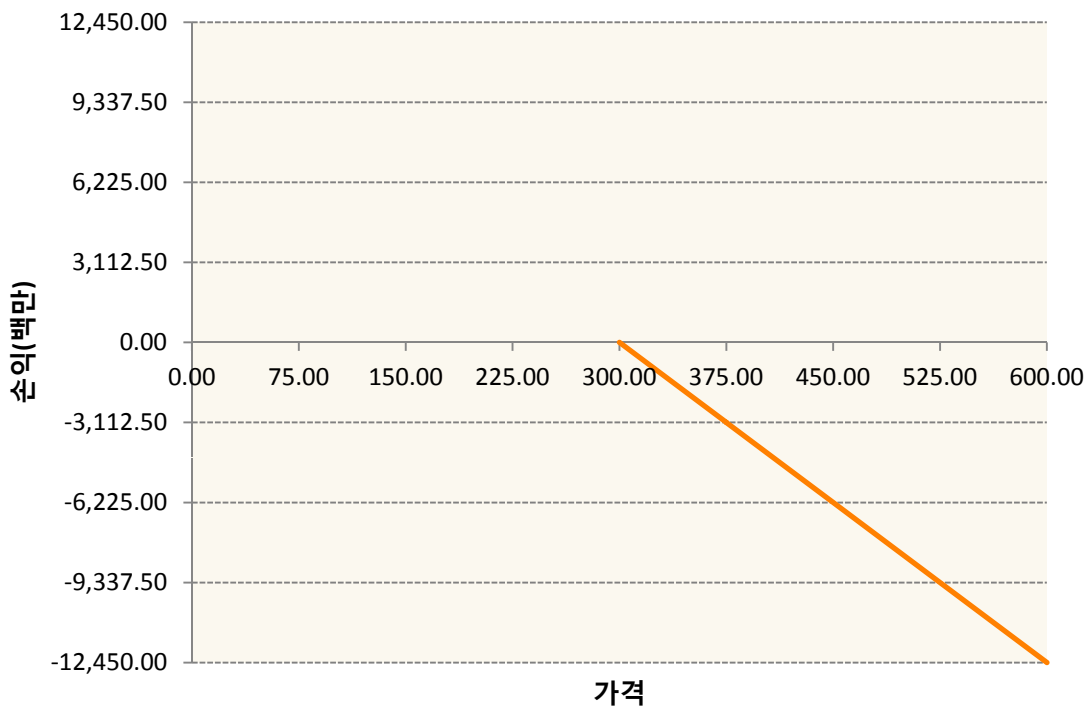


KR4201Q12977-2020-01 콜297.5

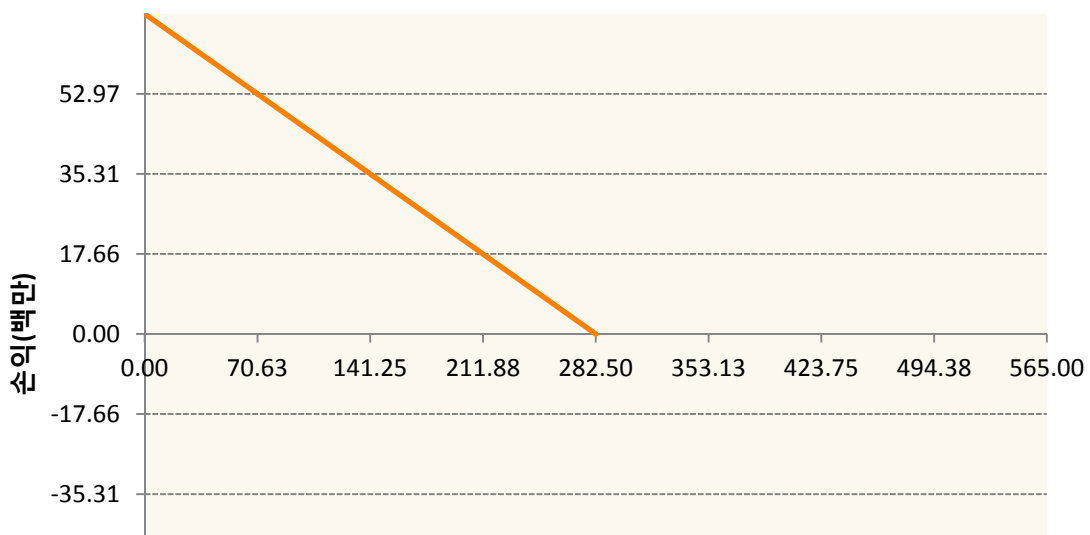


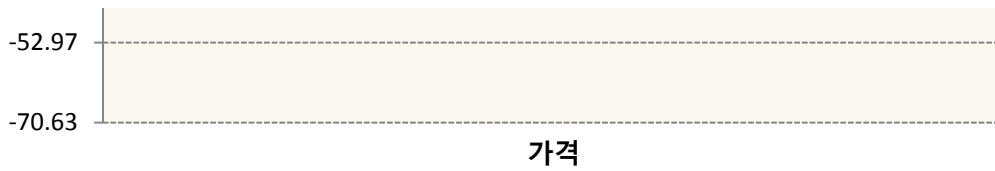


KR4201Q13009-2020-01 콜300

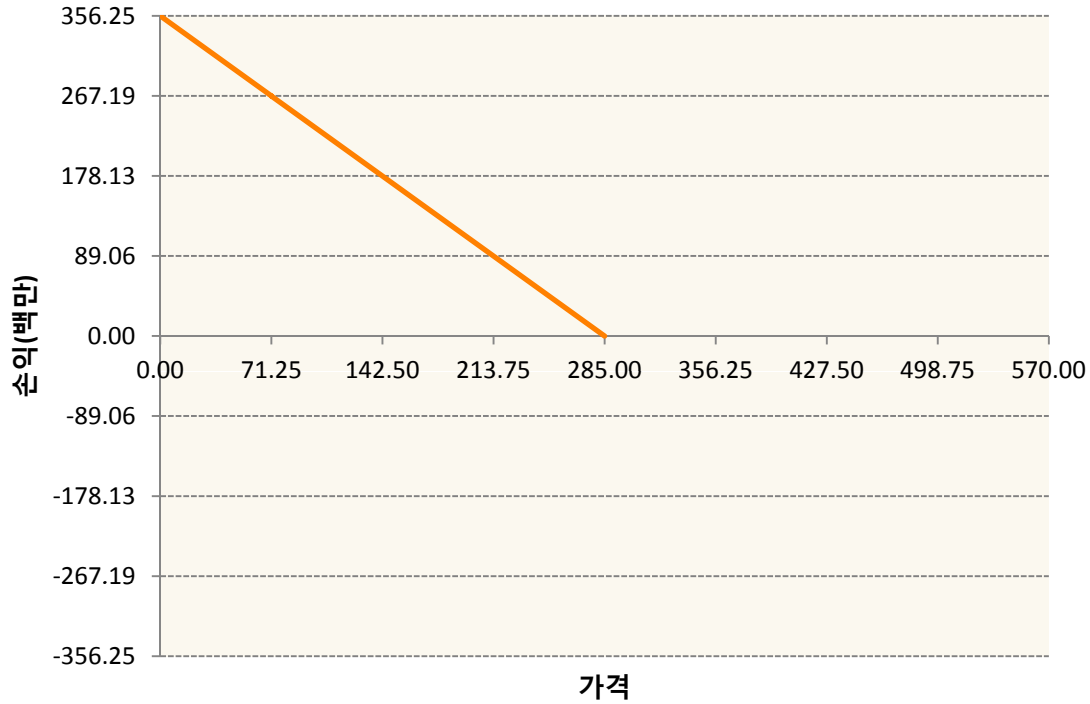


KR4301Q12827-2020-01 풋282.5





KR4301Q12850-2020-01 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						884
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-884	-884	-884	-884	-884	-884	-884	
-5.33%	-589	-589	-589	-589	-589	-589	-589	
-2.67%	-295	-295	-295	-295	-295	-295	-295	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	295	295	295	295	295	295	295	
5.33%	589	589	589	589	589	589	589	
8.00%	884	884	884	884	884	884	884	
KR4201Q12977		2020-01 콜297.5						404
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	123	120	116	111	104	96	87	
-5.33%	115	109	101	91	81	69	56	
-2.67%	96	85	71	57	41	25	8	

0%	56	38	19	0	-20	-40	-61
2.67%	-16	-38	-61	-83	-106	-129	-151
5.33%	-126	-150	-173	-196	-219	-243	-266
8.00%	-275	-295	-316	-337	-359	-381	-404
KR4201Q13009 2020-01 콜300							523
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	144	141	137	130	123	113	102
-5.33%	137	130	120	109	96	81	64
-2.67%	117	103	86	68	48	27	5
0%	71	49	25	0	-26	-53	-80
2.67%	-13	-43	-73	-103	-134	-165	-196
5.33%	-148	-181	-213	-246	-278	-311	-343
8.00%	-336	-367	-397	-428	-460	-491	-523
KR4301Q12827 2020-01 풋282.5							4
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4	4	4	4	4	4	4
-5.33%	2	2	3	3	3	3	3
-2.67%	1	1	1	1	1	1	1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-1	-1	-1	-1	0	0	0
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
KR4301Q12850 2020-01 풋285							24
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	23	23	23	23	23	23	24
-5.33%	14	14	14	14	14	15	15
-2.67%	5	5	6	6	6	7	7
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-4	-4	-4	-3	-3	-3	-2
5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-4	-4
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5

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

(단위:백만원)

1,458

공시일	2019-12-13
기준일	2019-12-12

## 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	208,953	0	208,953	

### 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	2019-12-13
기준일	2019-12-12

## 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	218,099	0	218,099	

### 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	2019-12-13
기준일	2019-12-12

## 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	554,124	0	554,124	
누계	통화	선도	0	563,849	-563,849	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		1,709
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,842
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,424
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,529
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		475
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		949
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		1,557
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		1,899
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		3,266
FX21019X02 KRW/USD 26-12-19E		4,785
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		4,842
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		190
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,848
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,848
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,374
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,563
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E		1,652
FX21019Z00 KRW/USD 10-01-20E		1,139
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E		1,557
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E		949
FX21019Z02 KRW/USD 16-01-20E		1,709

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

(단위:백만원)

**14,074**

공시일	2019-12-13
기준일	2019-12-12

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

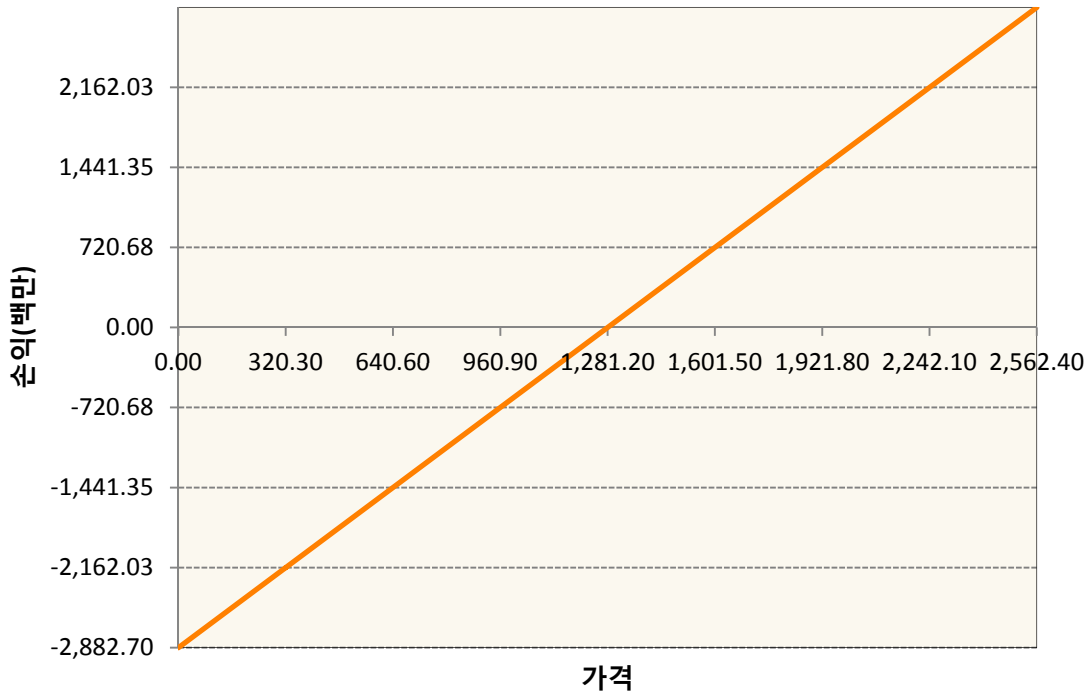
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,883	0	2,883	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4108Q30000-2020-03 KRX300 선물



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

(단위:백만원)

183

공시일	2019-12-13
기준일	2019-12-12

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

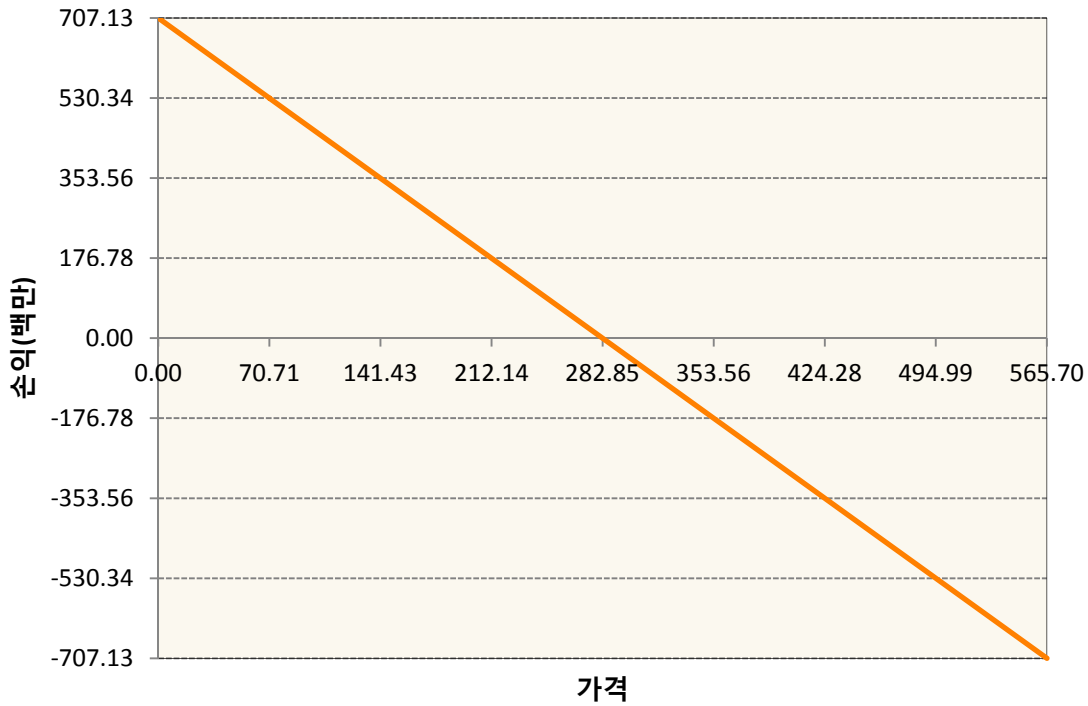
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

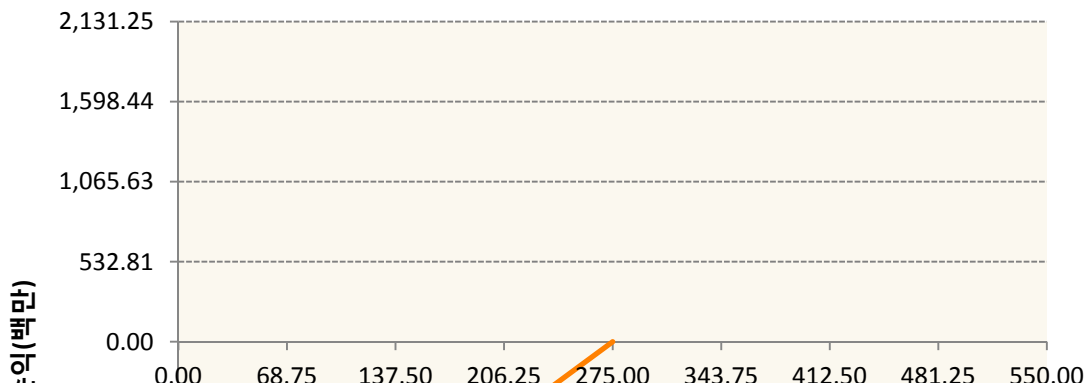
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	704	-704	장내
신규	유가증권	옵션	0	4,034	-4,034	장내
누계	유가증권	선물	0	707	-707	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,004	-4,004	장내

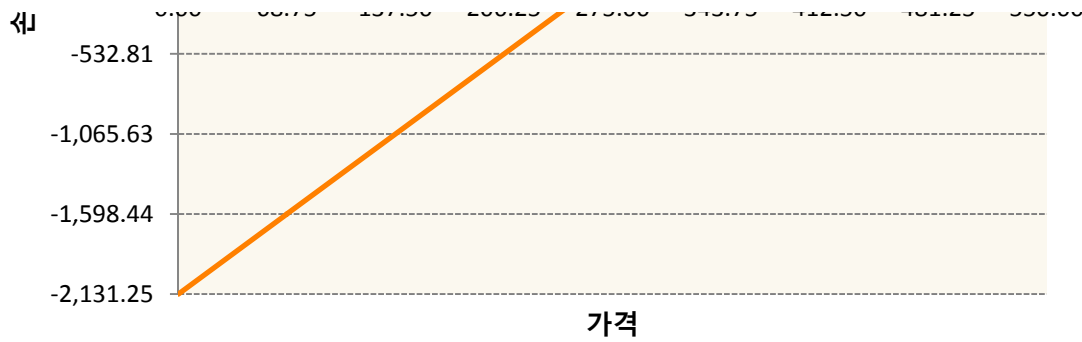
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

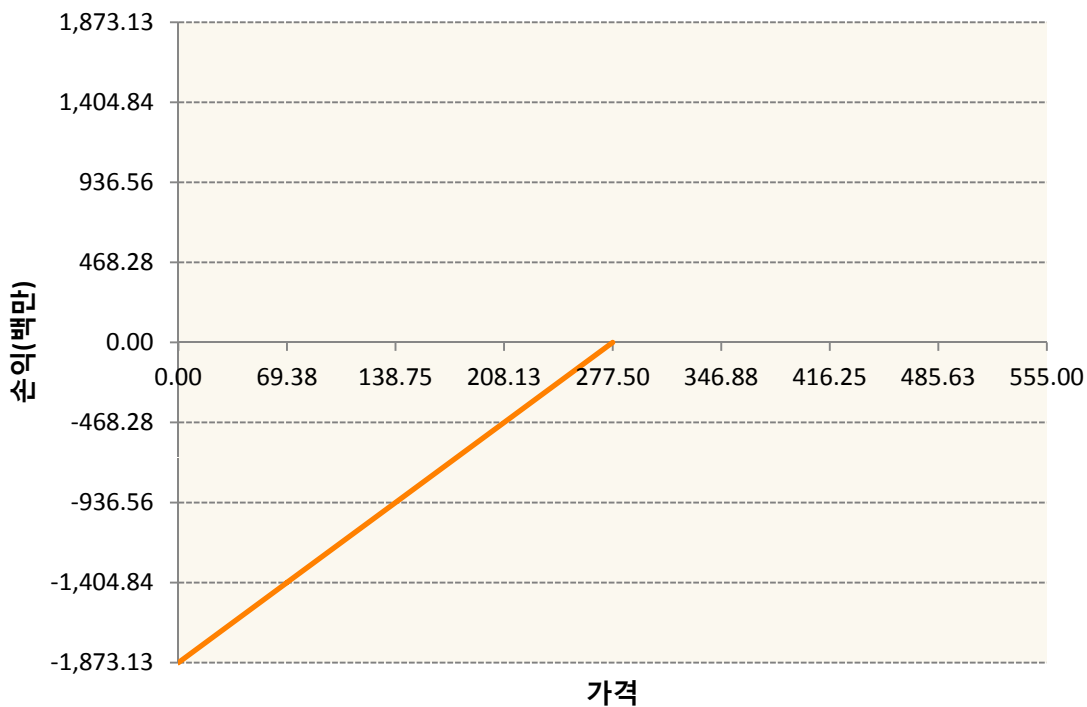


KR4301Q12751-2020-01 풋275





KR4301Q12777-2020-01 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						57
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	57	57	57	57	57	57	57	
-5.33%	38	38	38	38	38	38	38	
-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%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38	
8.00%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57	
KR4301Q12751		2020-01 풋275						100
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-94	-94	-95	-96	-97	-99	-100
-5.33%	-42	-44	-46	-49	-51	-53	-55
-2.67%	-9	-11	-14	-16	-19	-21	-24
0%	4	3	2	0	-2	-4	-5
2.67%	7	7	6	6	5	4	3
5.33%	7	7	7	7	7	6	6
8.00%	7	7	7	7	7	7	7

KR4301Q12777                      2020-01 풋277.5                      98

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-94	-95	-95	-96	-97	-97	-98
-5.33%	-47	-48	-50	-51	-53	-55	-57
-2.67%	-12	-14	-16	-18	-21	-23	-25
0%	5	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	9	9	8	7	6	5	4
5.33%	10	10	9	9	9	9	8
8.00%	10	10	10	10	10	9	9

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

(단위:백만원)

**215**

공시일	2019-12-13
기준일	2019-12-12

## H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	447	-447	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	14,534	0	14,534	
누계	통화	선도	0	14,669	-14,669	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019X01 KRW/USD 13-01-20E		233
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		294
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		295
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E		351

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

(단위:백만원)

<b>366</b>
------------

공시일	2019-12-13
기준일	2019-12-12

## 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	1,015	0	1,015	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)

78
----

공시일	2019-12-13
기준일	2019-12-12

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

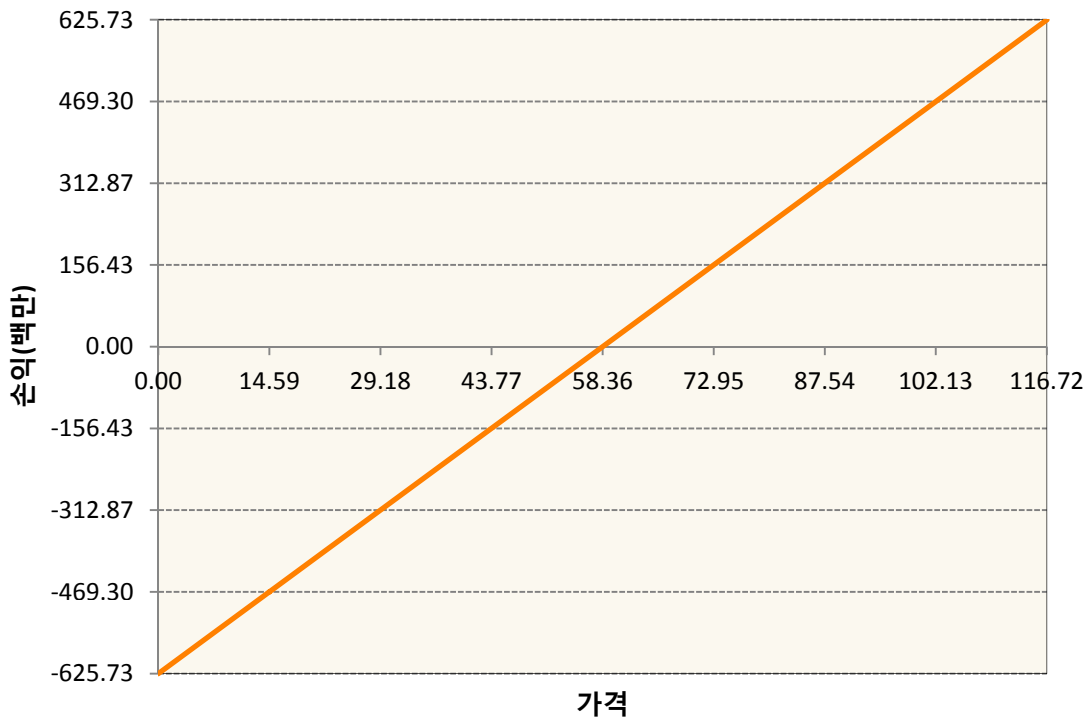
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

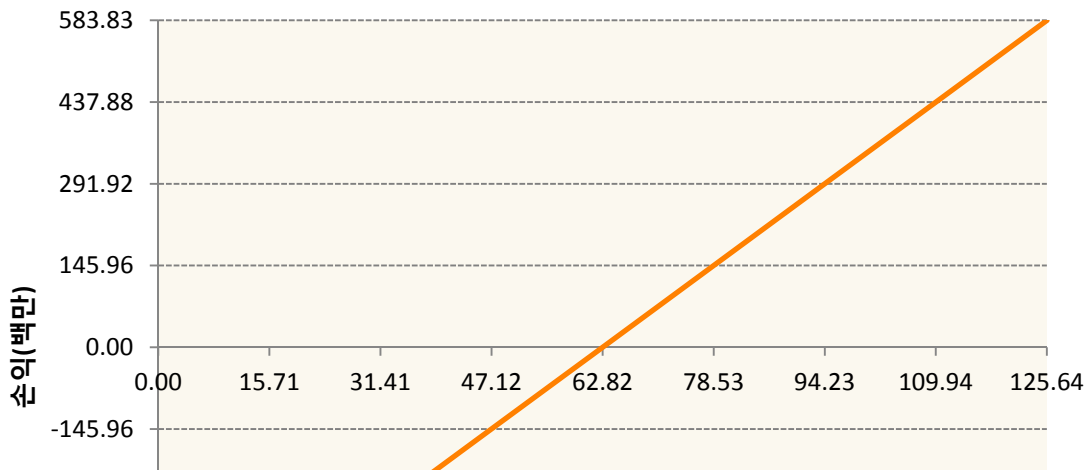
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,354	297	2,057	

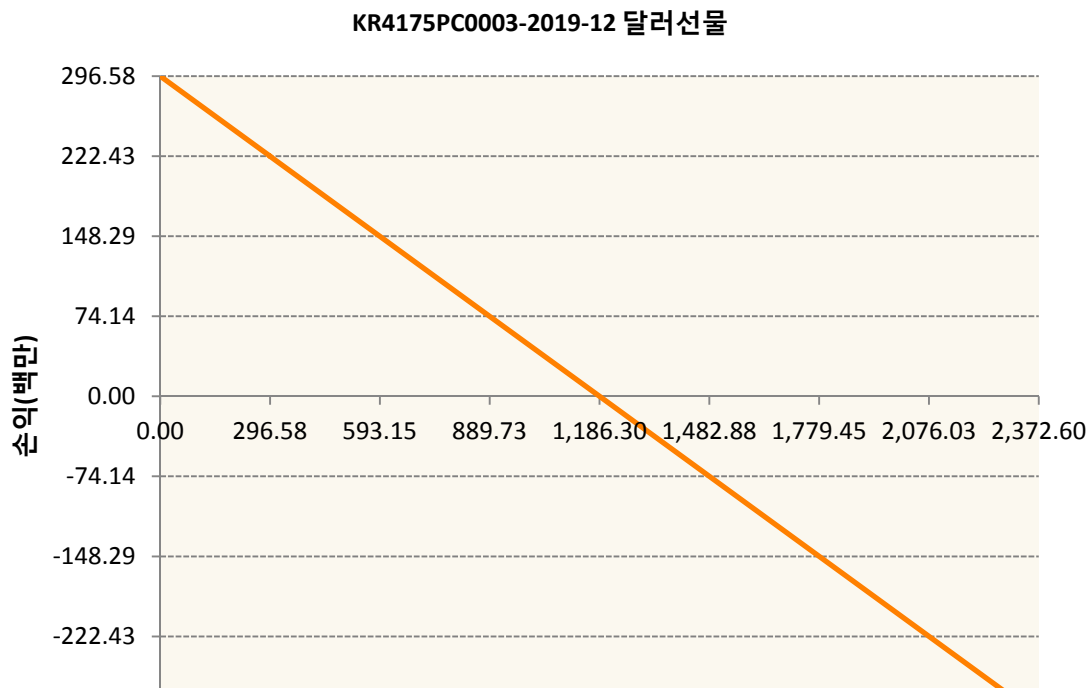
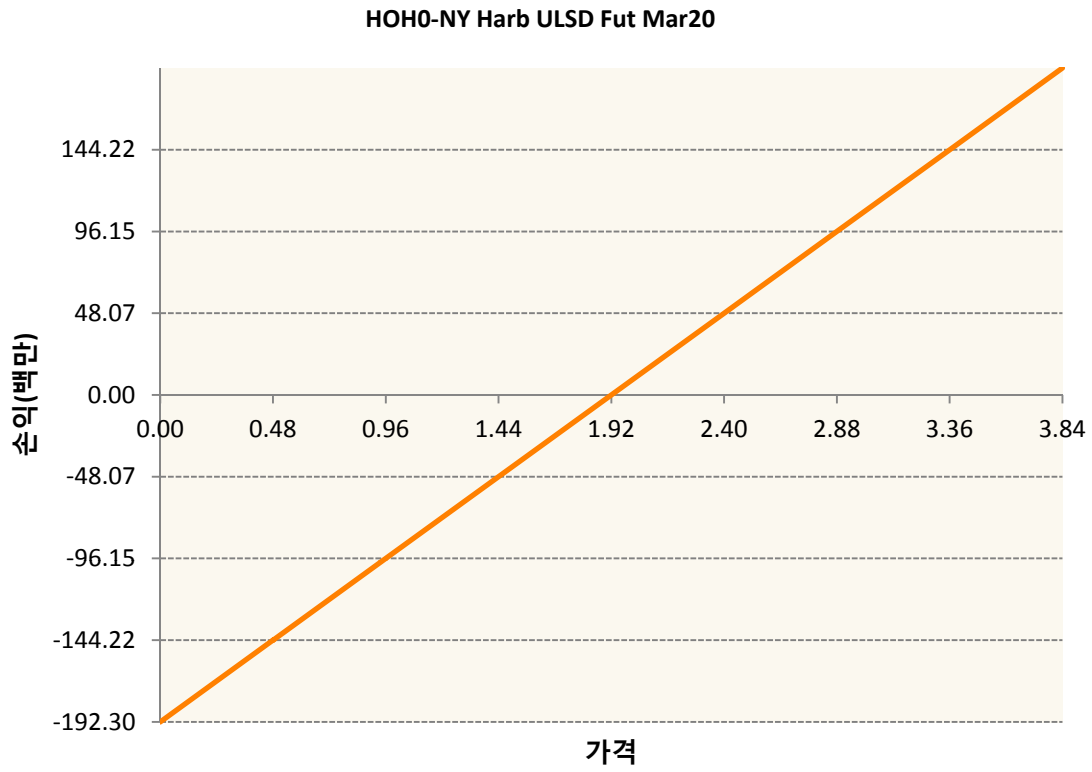
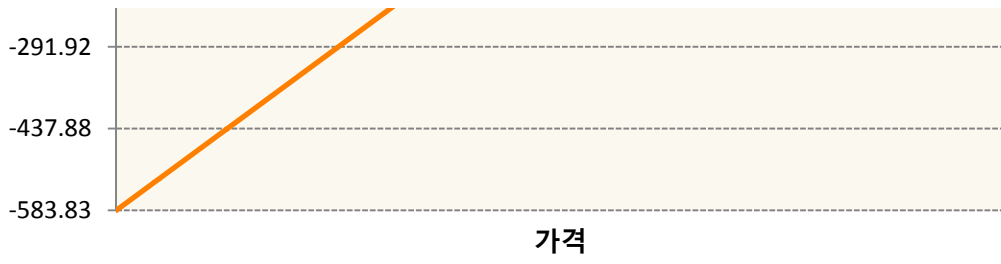
### 2. 만기시점의 손익구조

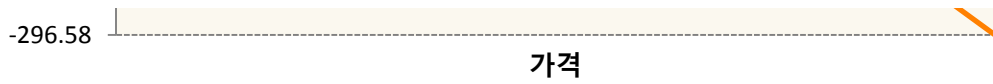
CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20



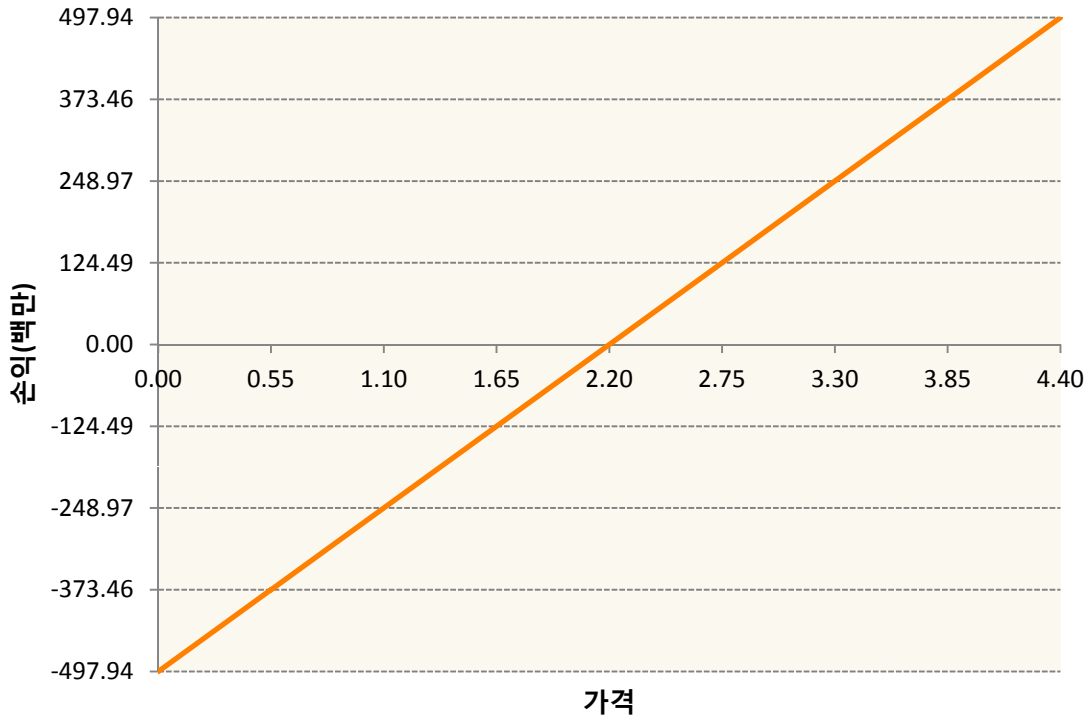
COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20



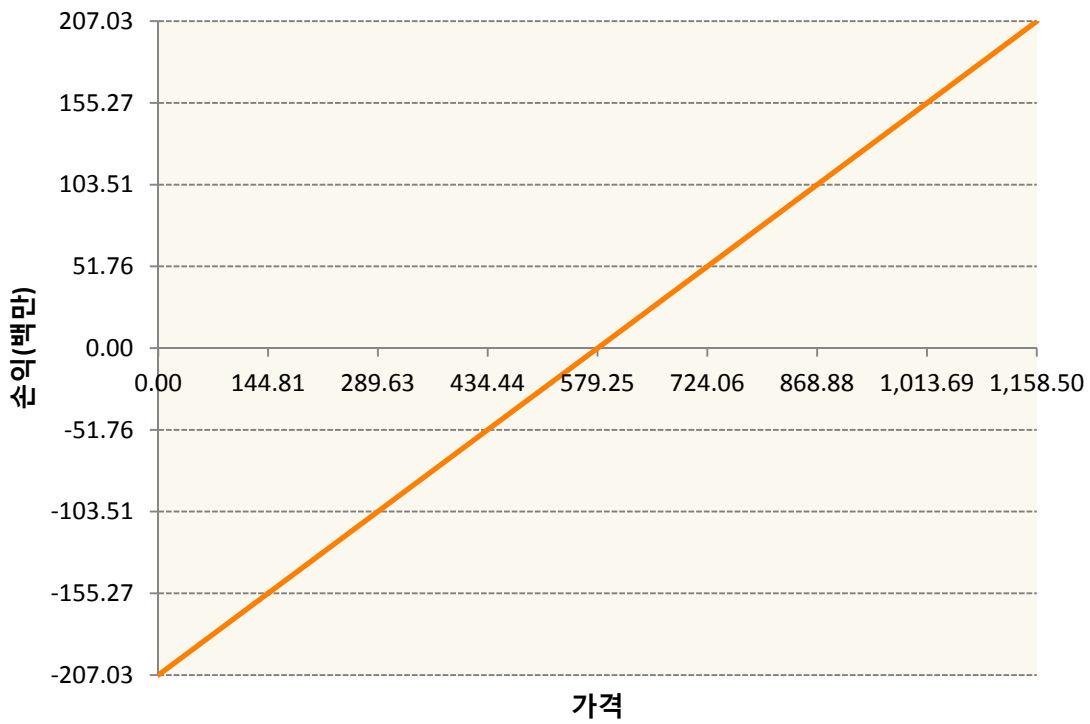




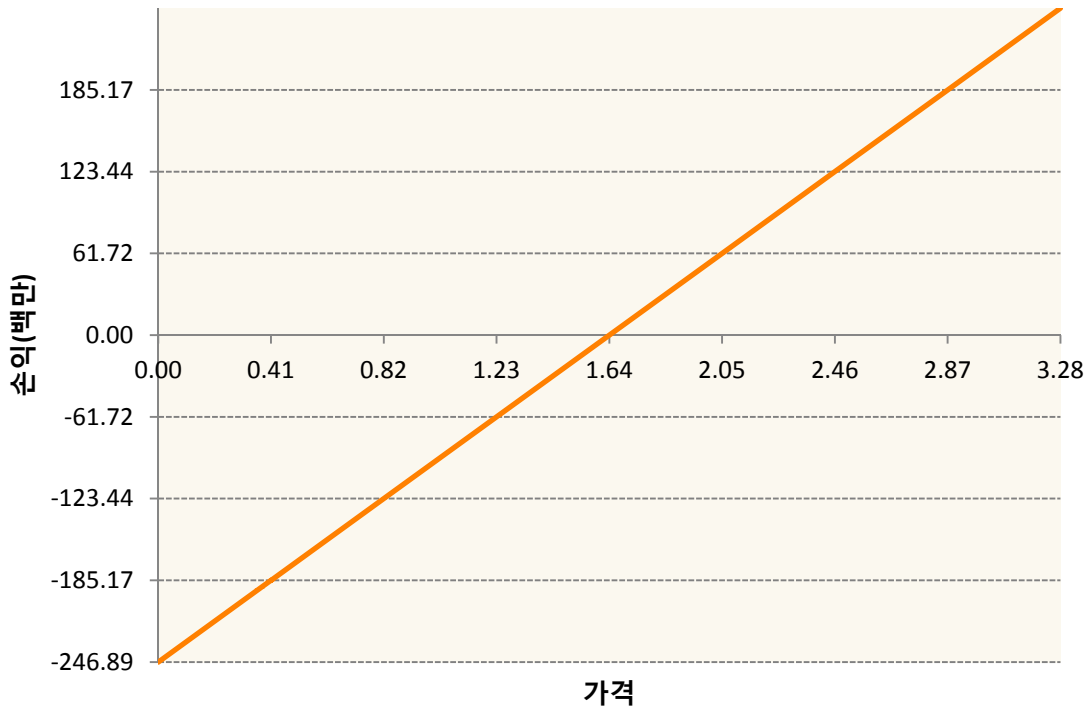
NGH20-NATURAL GAS FUTR Mar20



QSH0-Low Su Gasoil G Mar20



XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	50
COH0	BRENT CRUDE FUTR Mar20	47
HOH0	NY Harb ULSD Fut Mar20	15
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)

381

공시일	2019-12-13
기준일	2019-12-12

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

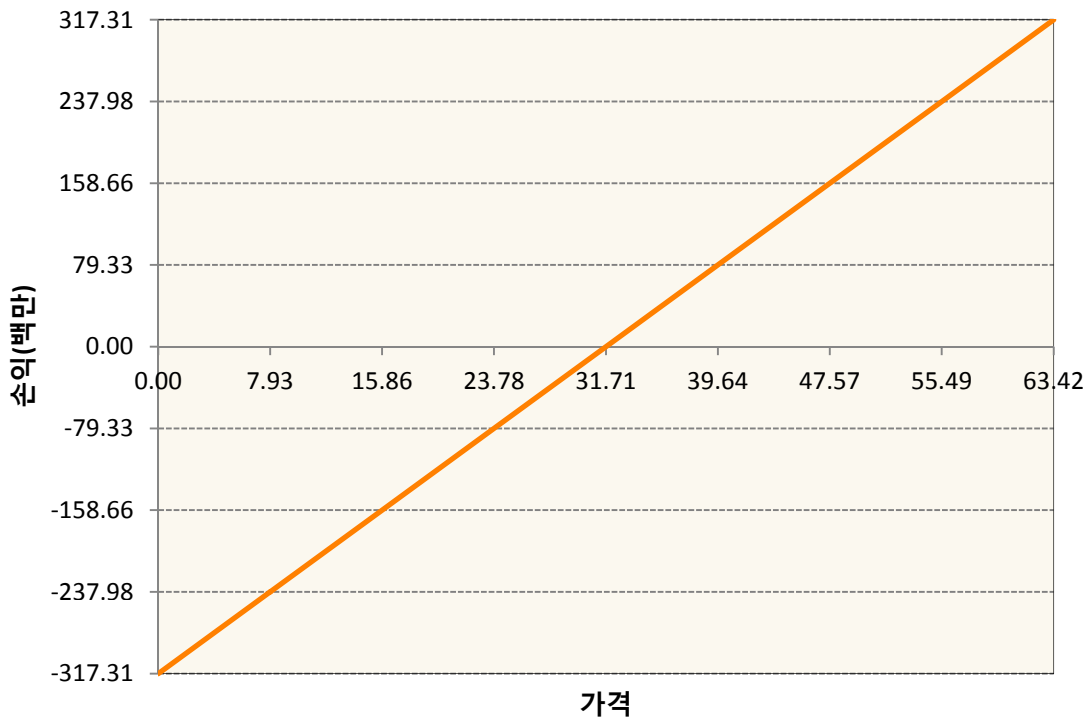
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

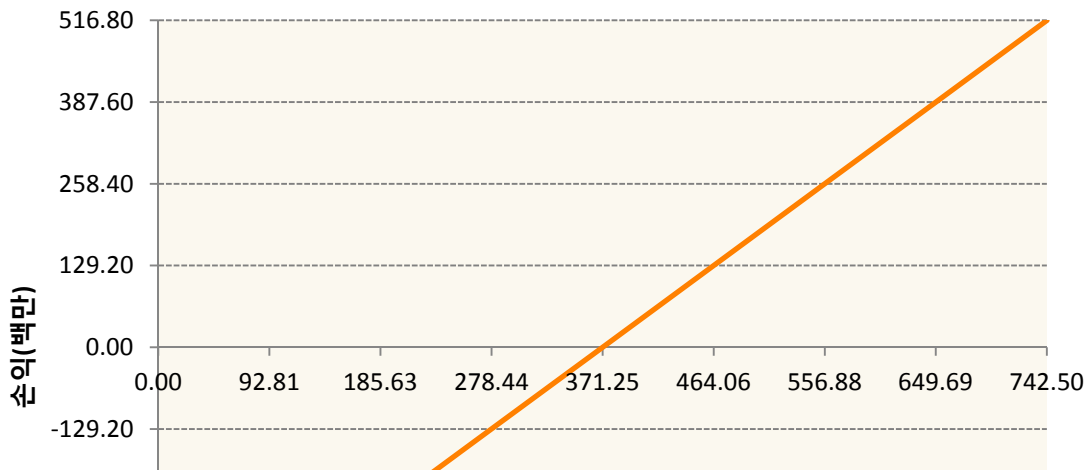
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,764	95	2,669	

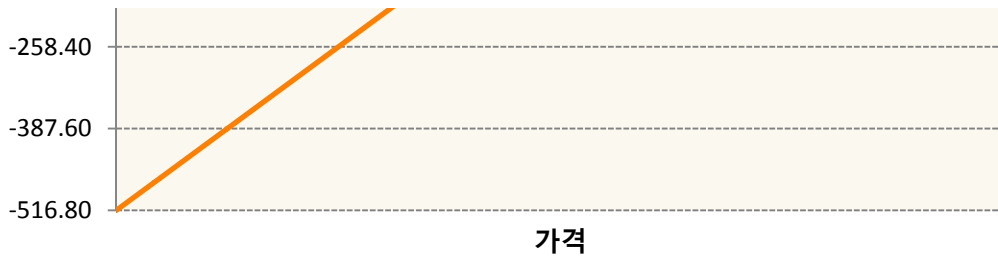
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20**

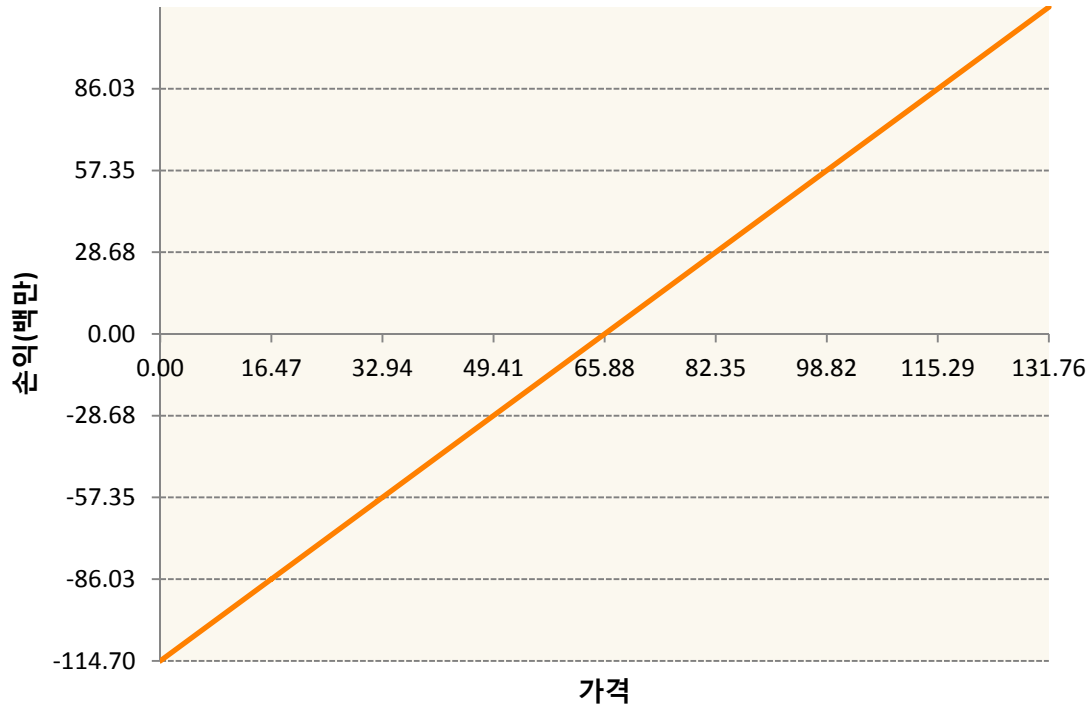


**CH0-CORN FUTURE Mar20**

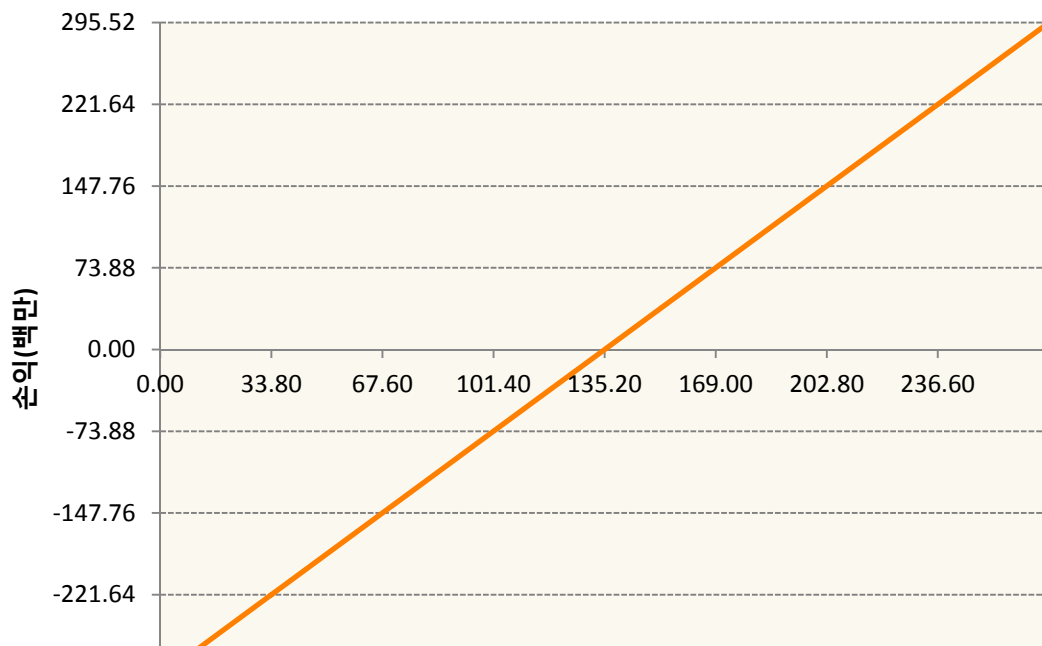


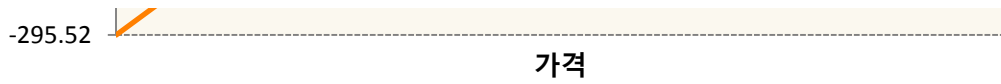


CTH0-COTTON NO.2 FUTR Mar20

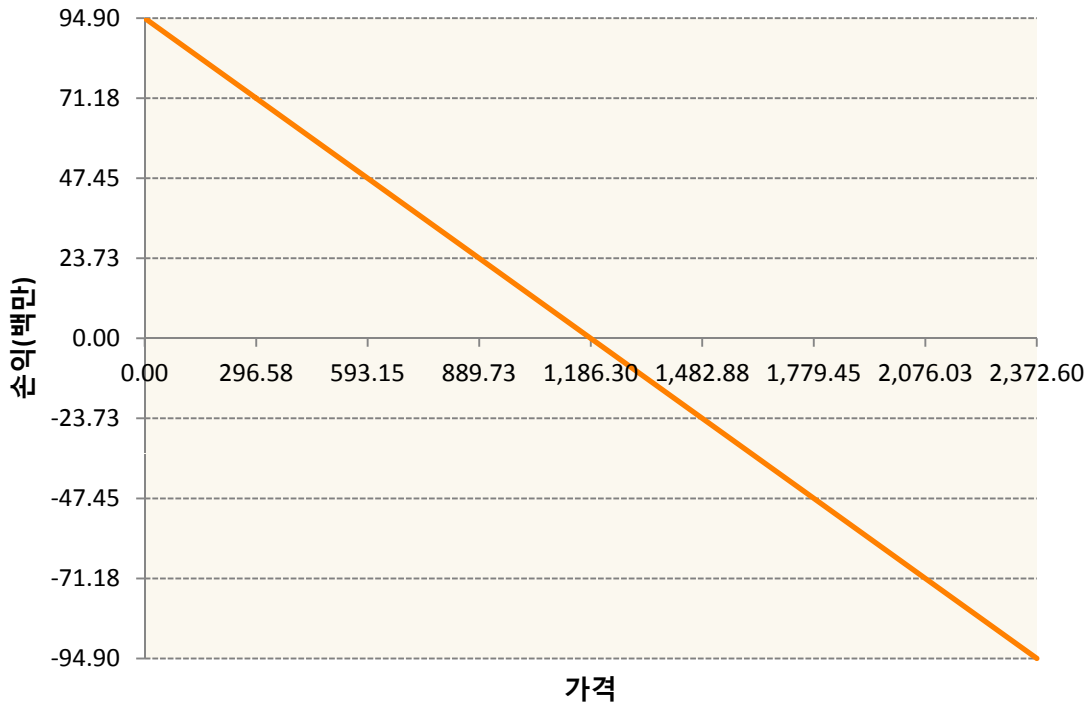


KCH0-COFFEE 'C' FUTURE Mar20

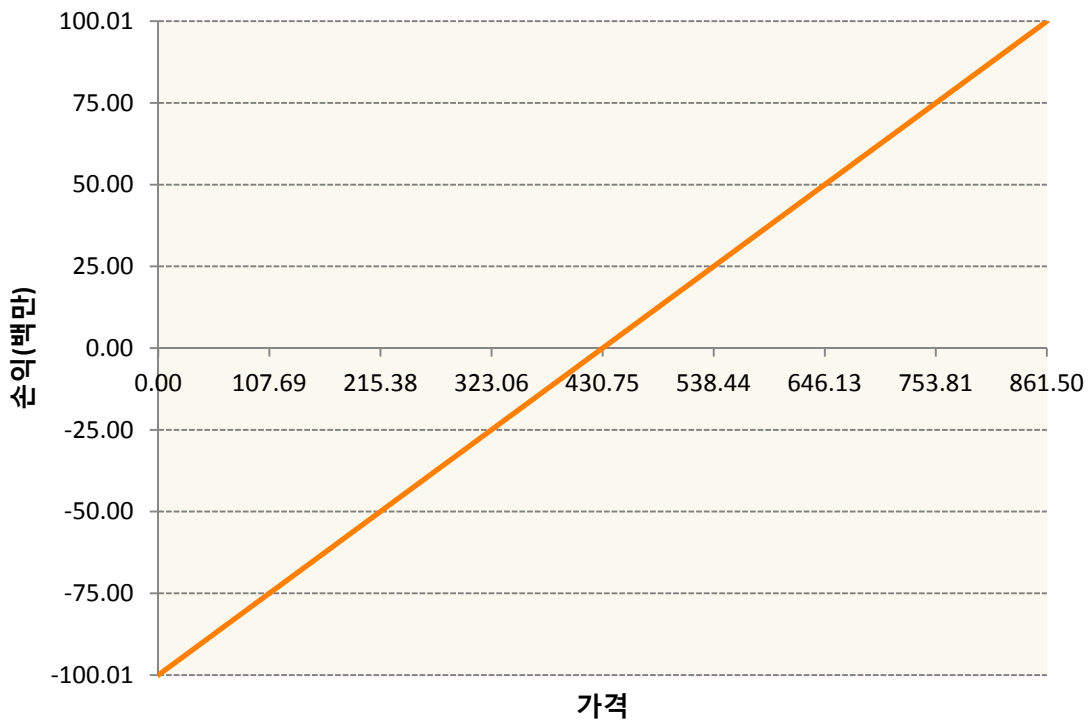




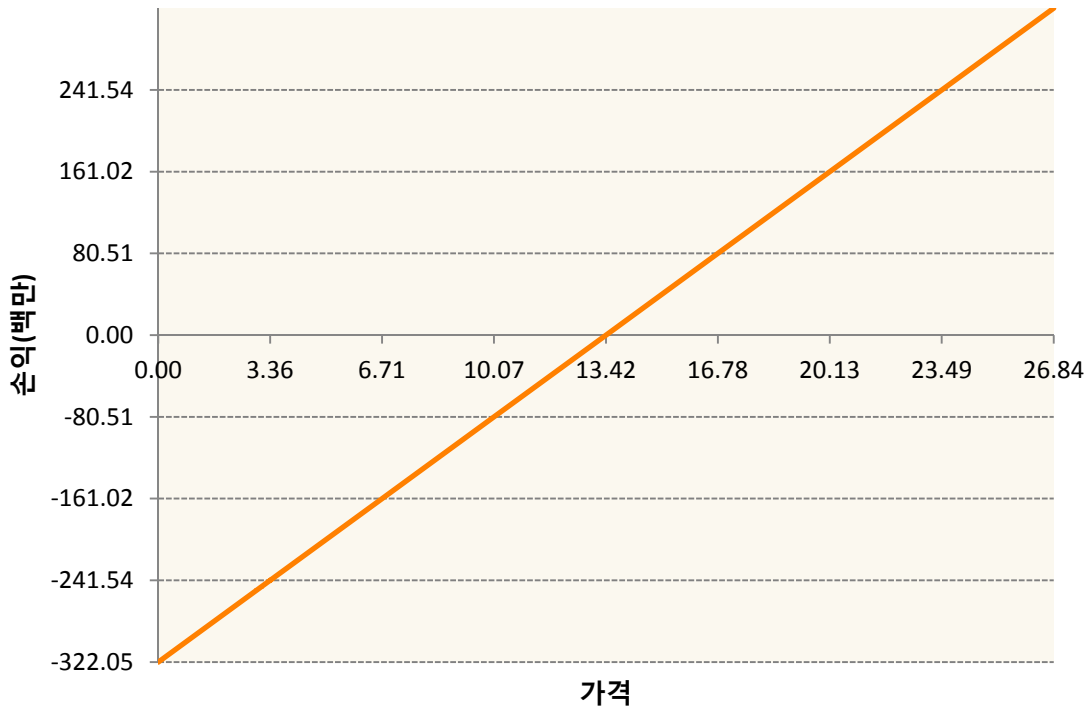
KR4175PC0003-2019-12 달러선물



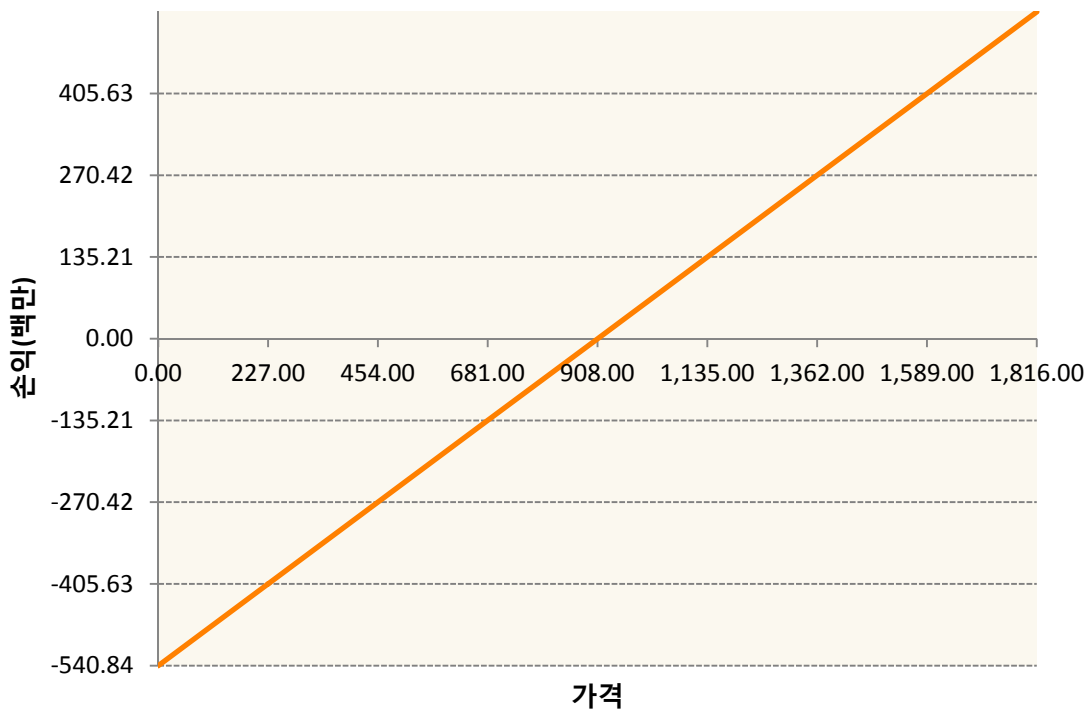
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

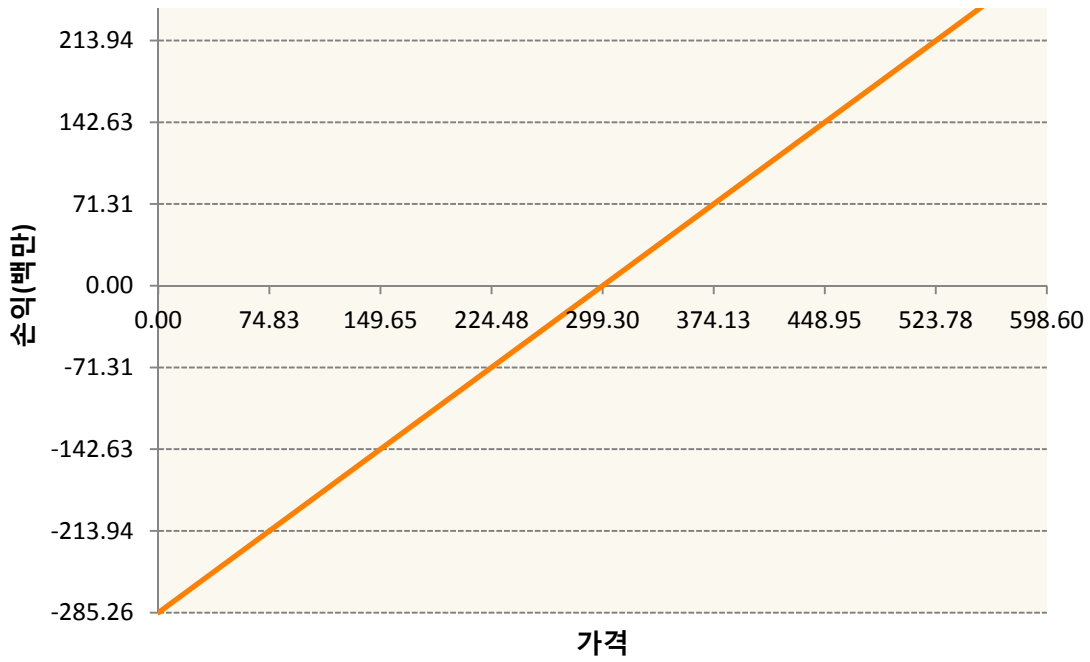


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20

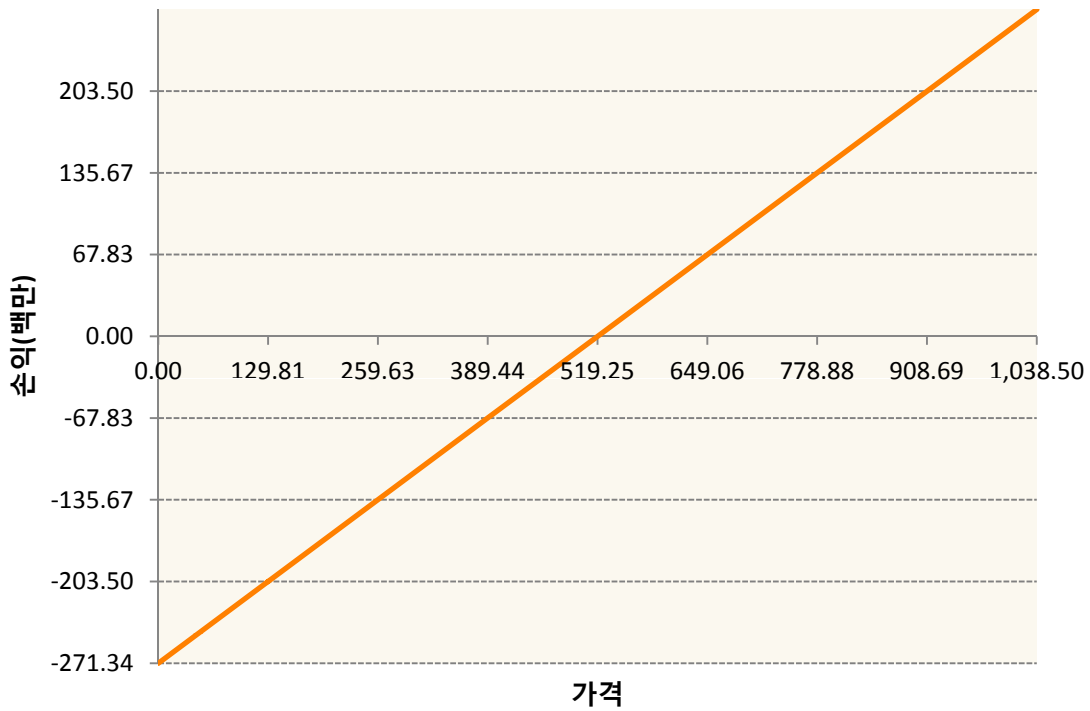


SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





WHO-WHEAT FUTURE(CBT) Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH0	SOYBEAN OIL FUTR Mar20	25
CH0	CORN FUTURE Mar20	41
CTH0	COTTON NO.2 FUTR Mar20	9
KCH0	COFFEE 'C' FUTURE Mar20	24
KR4175PC00	2019-12 달러선물	8

KWH0	KC HRW WHEAT FUT Mar20	8
SBH0	Sugar Mar20	26
SH0	SOYBEAN FUTURE Mar20	43
SMH0	SOYBEAN MEAL FUTR Mar20	23
WH0	WHEAT FUTURE(CBT) Mar20	22

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

(단위:백만원)

**241**