

공시일	2019-12-16
기준일	2019-12-13

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	2019-12-16
기준일	2019-12-13

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

1,105

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

637

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-16
기준일	2019-12-13

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)	389
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	143

* 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	2019-12-16
기준일	2019-12-13

유로인덱스모(주식-파생형)

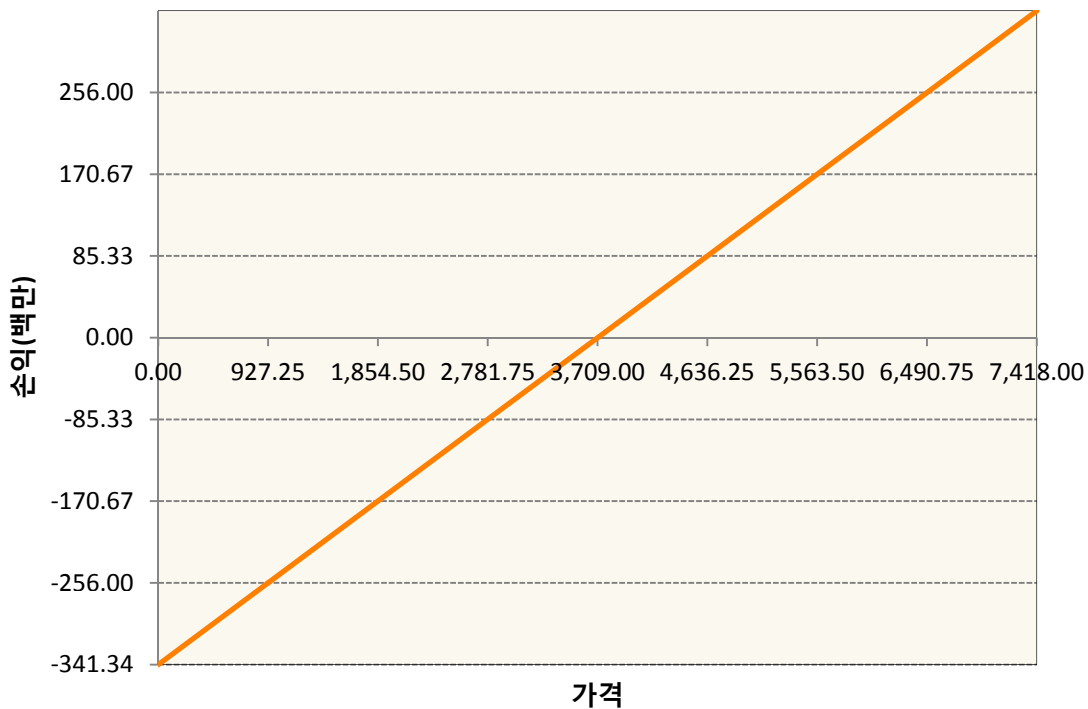
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	341	0	341	

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	2019-12-16
기준일	2019-12-13

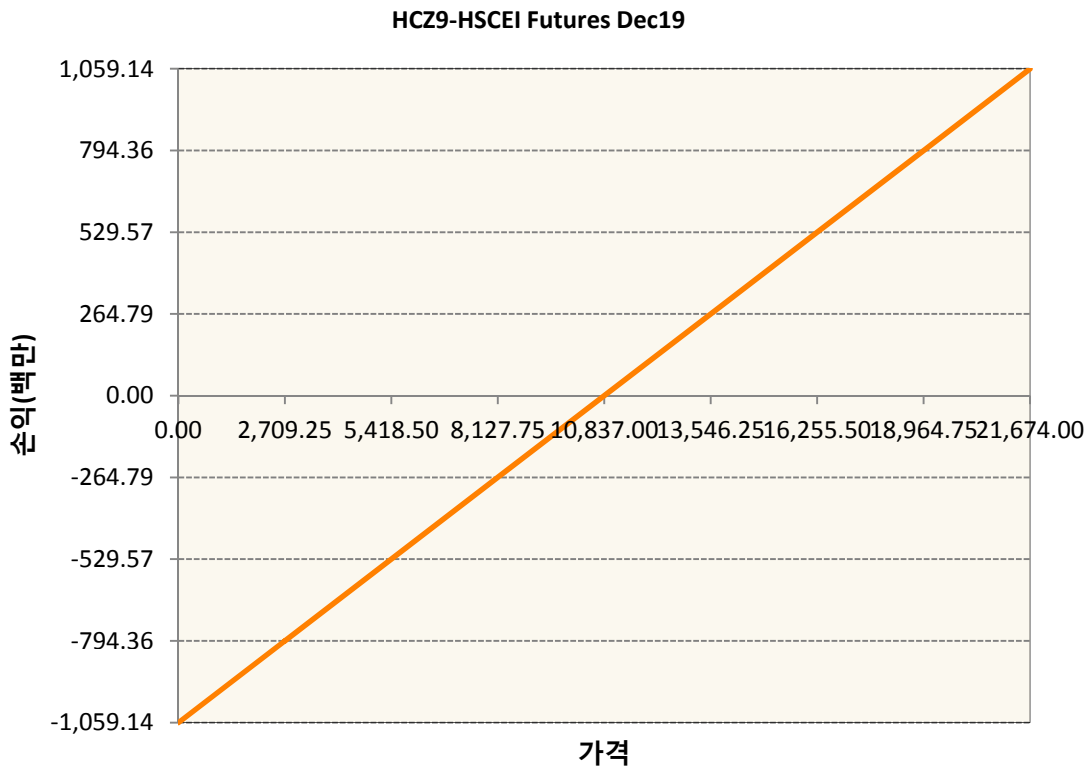
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,059	0	1,059	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ9	HSCEI Futures Dec19	85
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

76

공시일	2019-12-16
기준일	2019-12-13

커버드콜모(주식혼합-파생형)

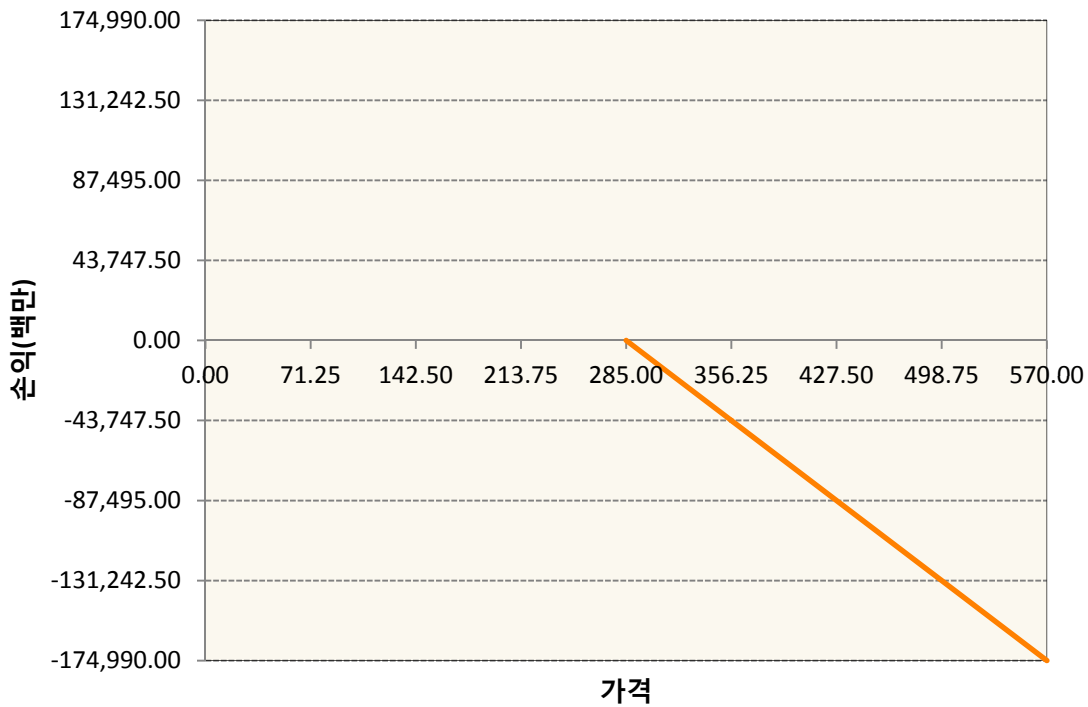
1. 계약금액

(단위:백만원)

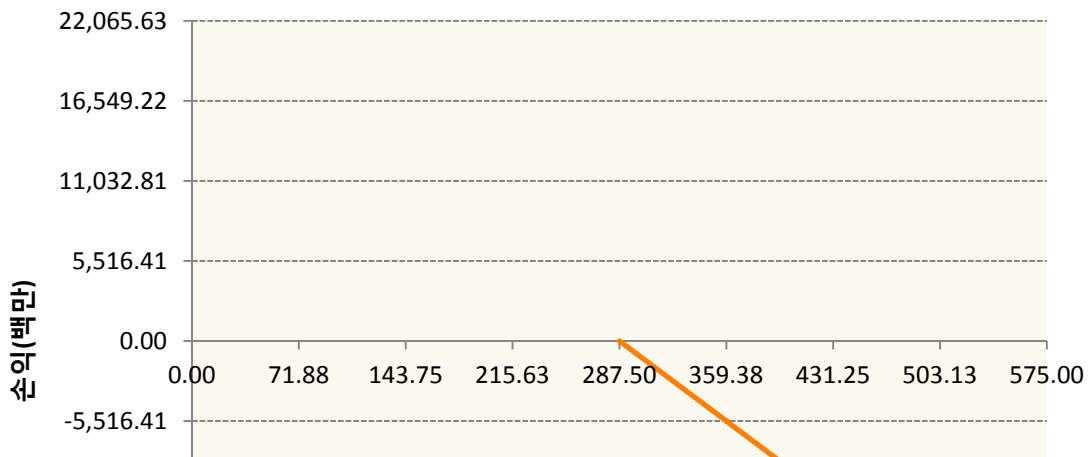
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	358,928	-358,928	장내
누계	유가증권	옵션	0	495,379	-495,379	장내

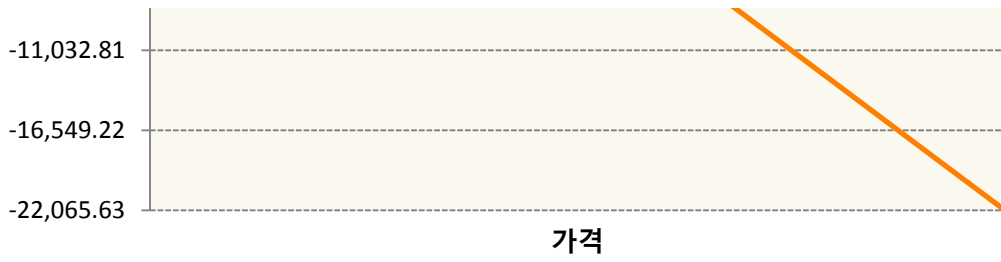
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q12852-2020-01 콜285

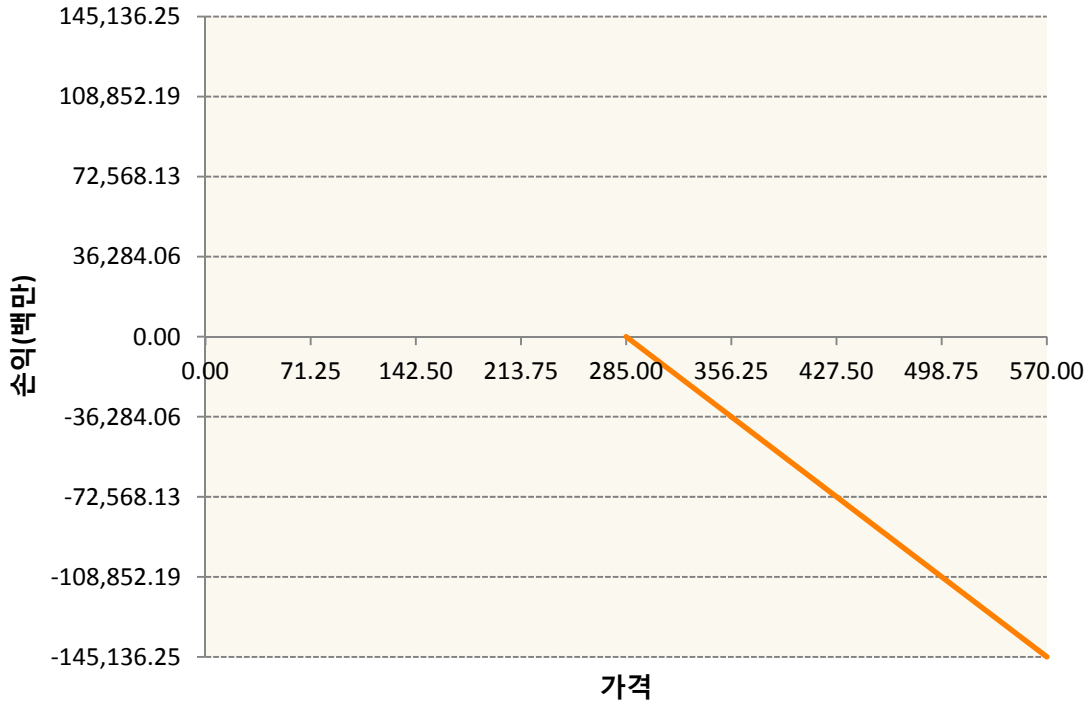


KR4201Q12878-2020-01 콜287.5

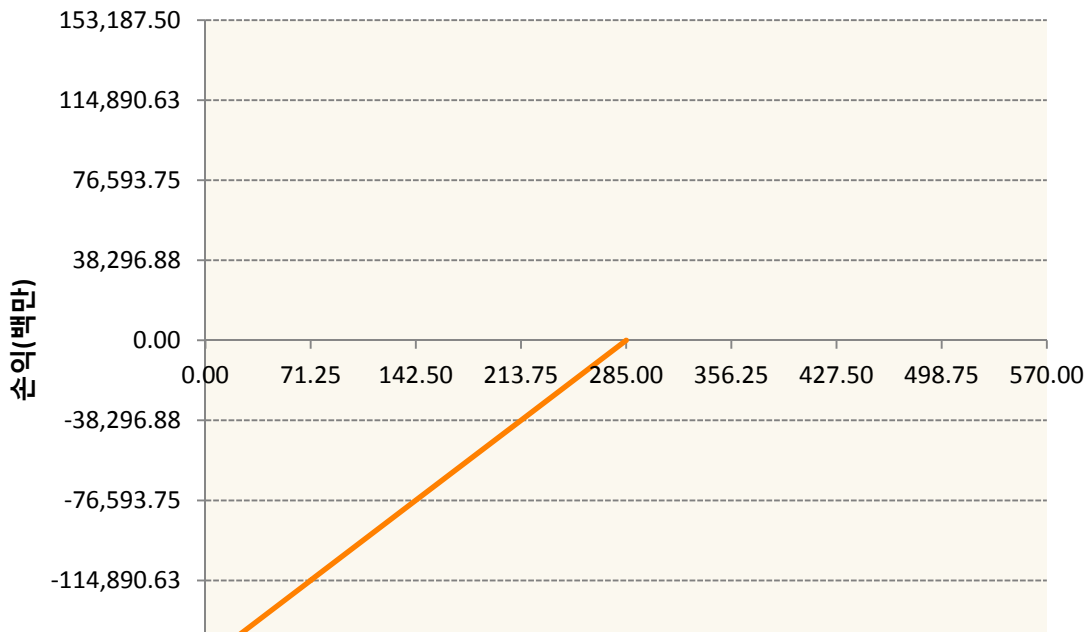




KR4201Q22851-2020-02 콜285



KR4301Q12850-2020-01 풋285



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q12852		2020-01 콜285						11,730
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	6,402	6,170	5,910	5,628	5,328	5,012	4,683	
-5.33%	5,496	5,140	4,771	4,393	4,006	3,613	3,215	
-2.67%	3,835	3,402	2,967	2,532	2,097	1,660	1,224	
0%	1,292	864	433	0	-435	-871	-1,309	
2.67%	-2,078	-2,426	-2,790	-3,168	-3,556	-3,952	-4,356	
5.33%	-6,076	-6,313	-6,579	-6,870	-7,183	-7,512	-7,856	
8.00%	-10,469	-10,605	-10,775	-10,976	-11,204	-11,457	-11,730	
KR4201Q12878		2020-01 콜287.5						1,416
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	714	690	661	630	596	559	521	
-5.33%	624	583	541	497	451	404	356	
-2.67%	448	396	343	290	236	182	128	
0%	166	111	56	0	-56	-111	-167	
2.67%	-223	-271	-320	-371	-422	-474	-527	
5.33%	-699	-734	-772	-813	-856	-900	-947	
8.00%	-1,234	-1,256	-1,281	-1,310	-1,343	-1,378	-1,416	
KR4201Q22851		2020-02 콜285						9,592
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	6,448	6,039	5,609	5,163	4,704	4,235	3,758	
-5.33%	5,325	4,827	4,321	3,809	3,292	2,772	2,249	
-2.67%	3,735	3,187	2,638	2,089	1,540	990	441	
0%	1,657	1,106	553	0	-554	-1,109	-1,664	
2.67%	-889	-1,398	-1,916	-2,443	-2,975	-3,512	-4,052	
5.33%	-3,840	-4,274	-4,732	-5,206	-5,695	-6,195	-6,704	
8.00%	-7,115	-7,461	-7,840	-8,248	-8,678	-9,127	-9,592	
KR4301Q12850		2020-01 풋285						8,904
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-8,723	-8,733	-8,751	-8,776	-8,810	-8,853	-8,904	
-5.33%	-4,701	-4,772	-4,855	-4,949	-5,053	-5,165	-5,283	
-2.67%	-1,374	-1,541	-1,710	-1,881	-2,053	-2,226	-2,400	
0%	464	314	159	0	-162	-327	-494	
2.67%	1,015	960	892	812	721	620	511	

5.33%	1,096	1,087	1,072	1,049	1,017	977	927
8.00%	1,102	1,101	1,099	1,095	1,088	1,077	1,060

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

(단위:백만원)

30,028

공시일	2019-12-16
기준일	2019-12-13

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

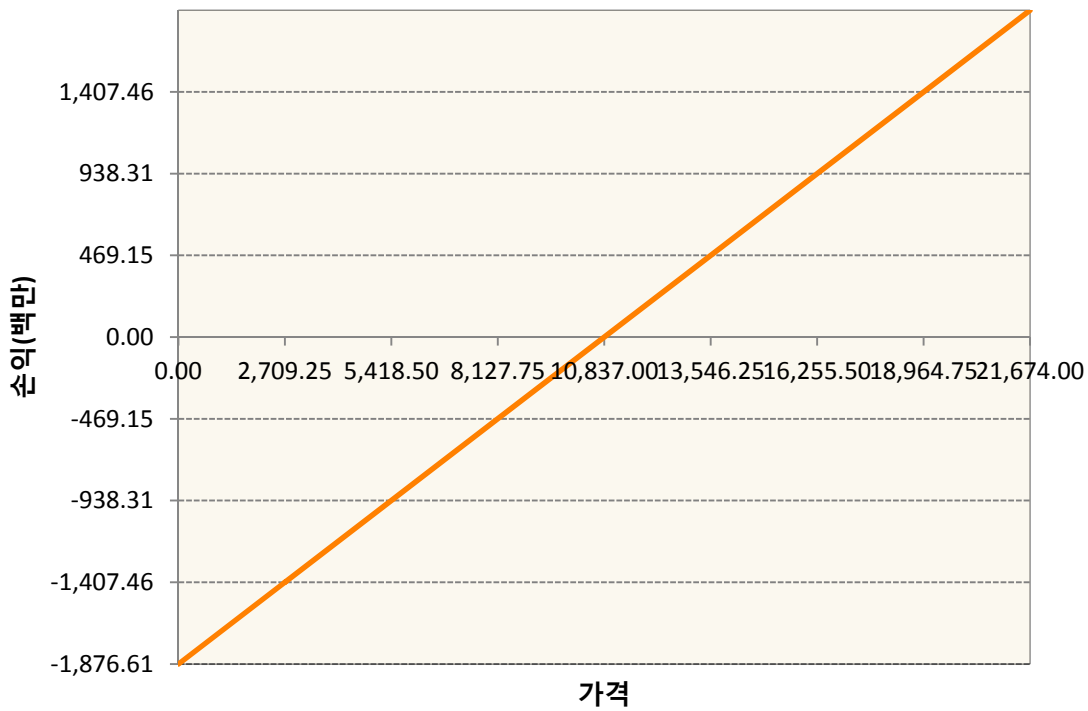
1. 계약금액

(단위:백만원)

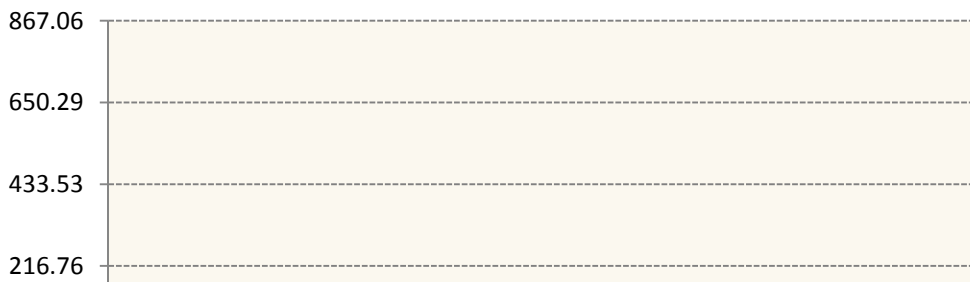
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,877	0	1,877	
누계	유가증권	옵션	0	4,917	-4,917	장내
누계	통화	선도	0	2,114	-2,114	장외

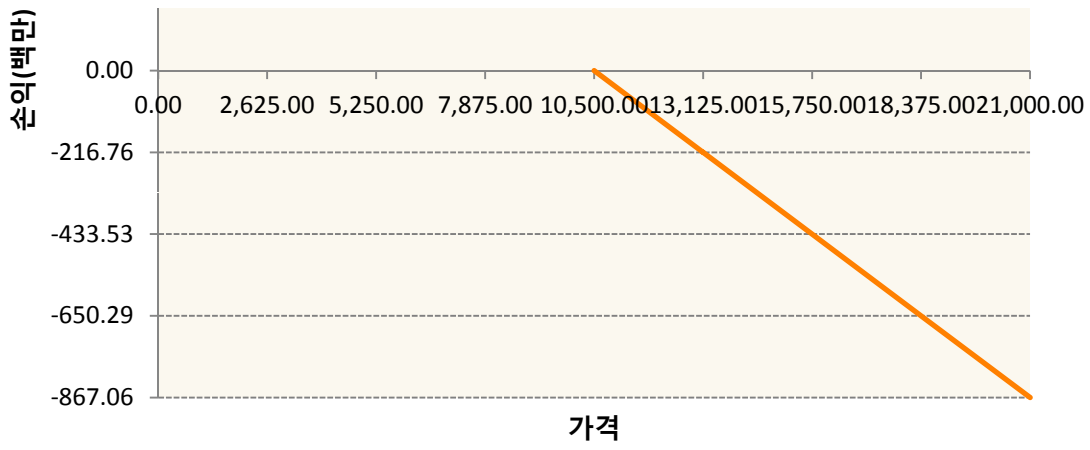
2. 만기시점의 손익구조

HCZ9-HSCEI Futures Dec19

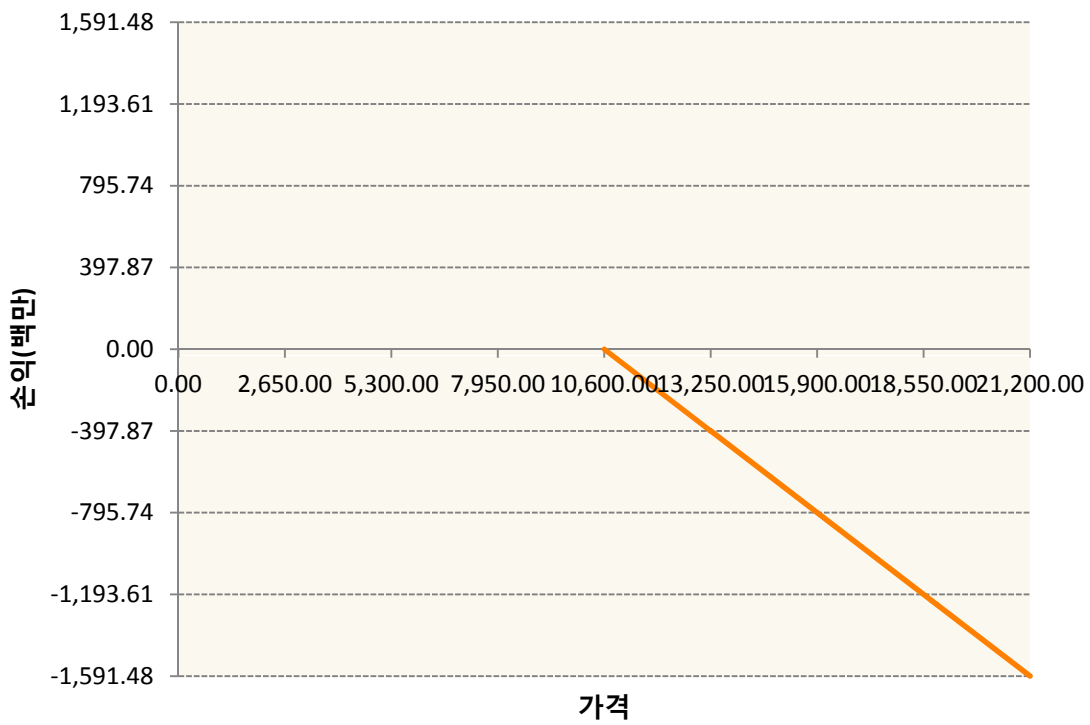


OHHIZ9-C105-HSCEI

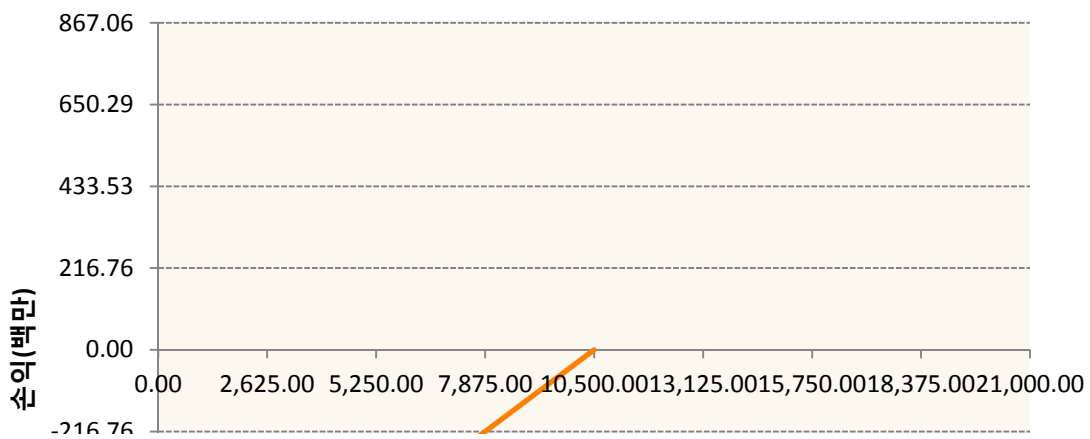


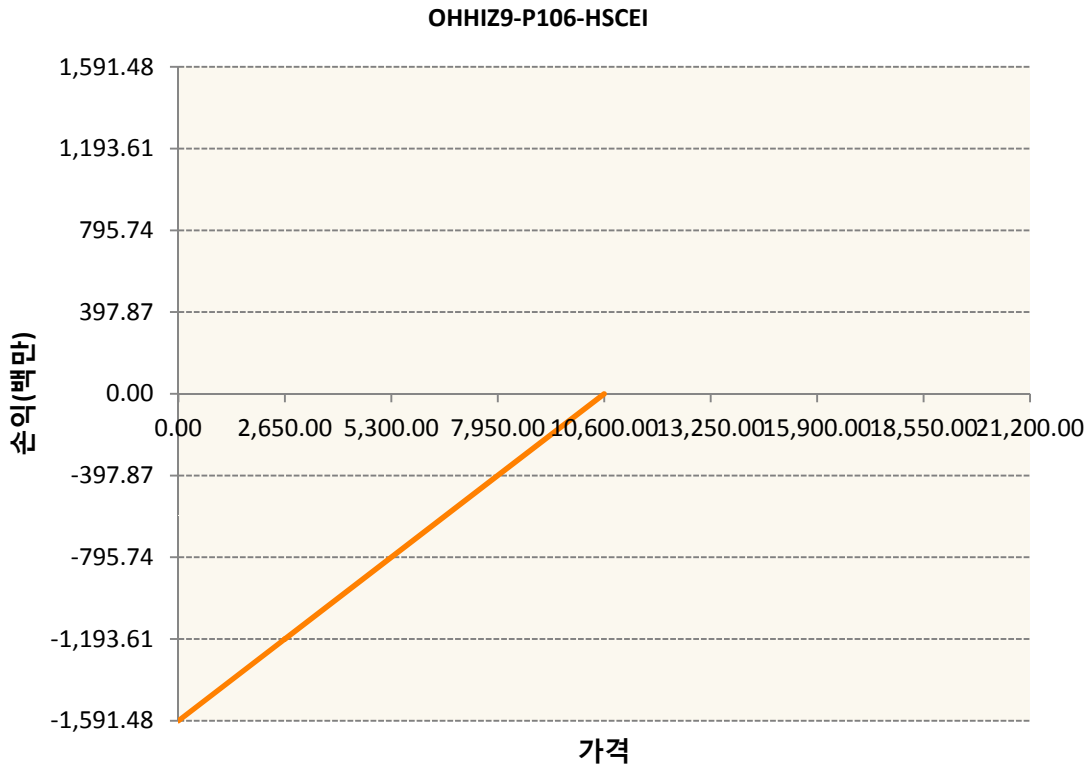


OHHIZ9-C106-HSCEI



OHHIZ9-P105-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	169
HCZ9 HSCEI Futures Dec19	150
OHHIZ9-C1C HSCEI	69
OHHIZ9-C1C HSCEI	127
OHHIZ9-P10 HSCEI	69
OHHIZ9-P10 HSCEI	127

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	533

공시일	2019-12-16
기준일	2019-12-13

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

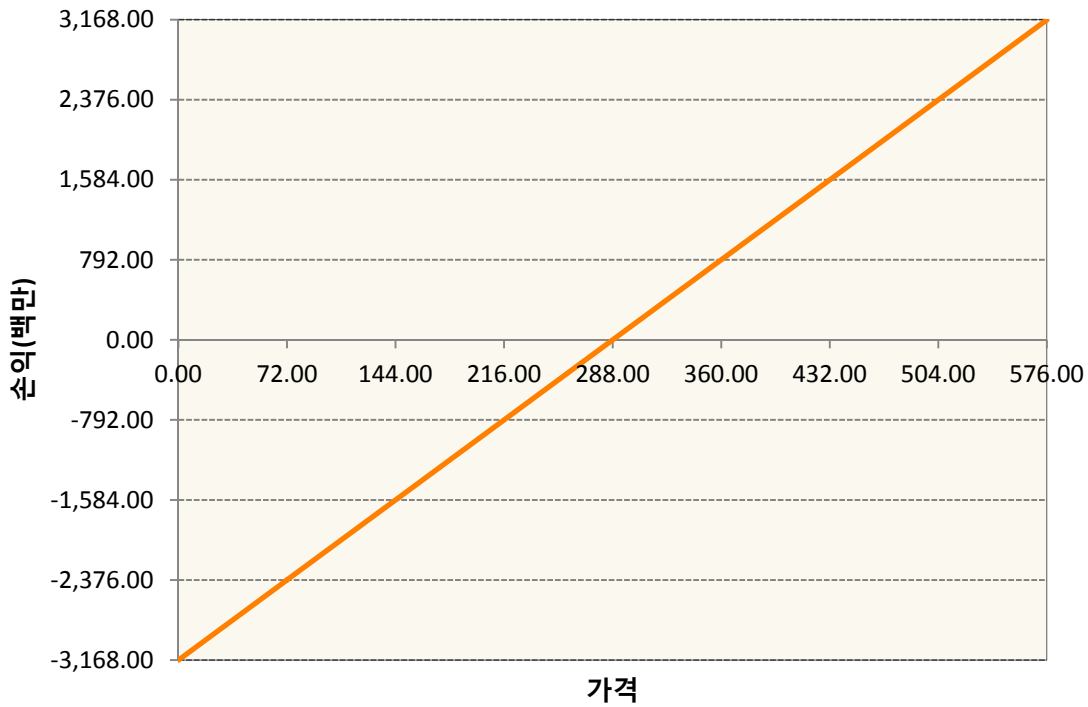
1. 계약금액

(단위:백만원)

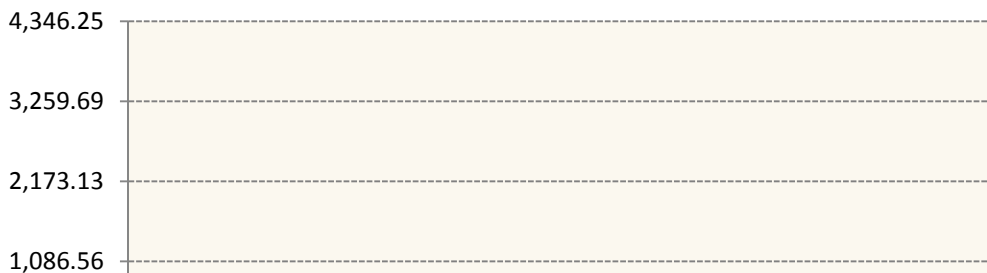
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	9,393	-9,393	장내
누계	유가증권	선물	3,168	0	3,168	장내
누계	유가증권	스왑	8,625	0	8,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,266	-9,266	장내

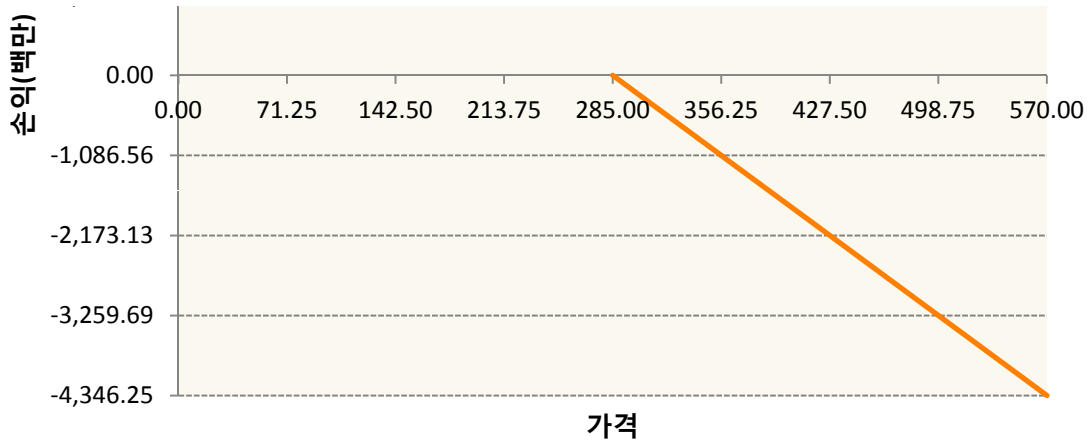
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

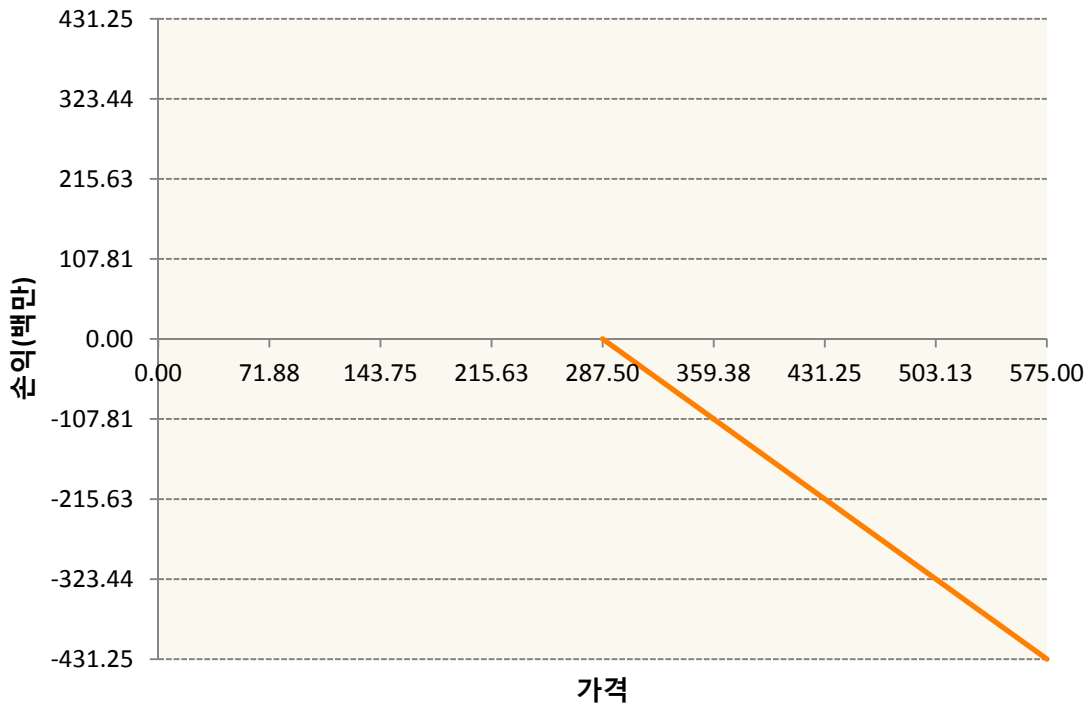


KR4201Q12852-2020-01 콜285

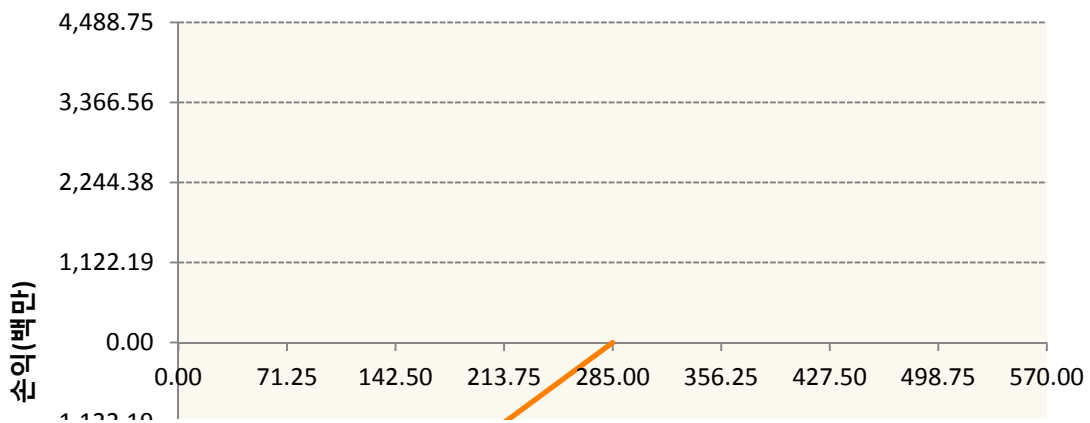




KR4201Q12878-2020-01 콜287.5



KR4301Q12850-2020-01 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	
KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						255
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-255	-255	-255	-255	-255	-255	-255	
-5.33%	-170	-170	-170	-170	-170	-170	-170	
-2.67%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	85	85	85	85	85	85	85	
5.33%	170	170	170	170	170	170	170	
8.00%	255	255	255	255	255	255	255	
KR4201Q12852		2020-01 콜285						291
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	159	153	147	140	132	124	116	
-5.33%	137	128	119	109	100	90	80	
-2.67%	95	84	74	63	52	41	30	
0%	32	21	11	0	-11	-22	-33	
2.67%	-52	-60	-69	-79	-88	-98	-108	
5.33%	-151	-157	-163	-171	-178	-187	-195	
8.00%	-260	-263	-268	-273	-278	-285	-291	
KR4201Q12878		2020-01 콜287.5						28
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	14	13	13	12	12	11	10
-5.33%	12	11	11	10	9	8	7
-2.67%	9	8	7	6	5	4	3
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-4	-5	-6	-7	-8	-9	-10
5.33%	-14	-14	-15	-16	-17	-18	-18
8.00%	-24	-25	-25	-26	-26	-27	-28
KR4301Q12850 2020-01 풋285							261
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-256	-256	-256	-257	-258	-259	-261
-5.33%	-138	-140	-142	-145	-148	-151	-155
-2.67%	-40	-45	-50	-55	-60	-65	-70
0%	14	9	5	0	-5	-10	-14
2.67%	30	28	26	24	21	18	15
5.33%	32	32	31	31	30	29	27
8.00%	32	32	32	32	32	32	31

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

(단위:백만원)

1,518

공시일	2019-12-16
기준일	2019-12-13

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

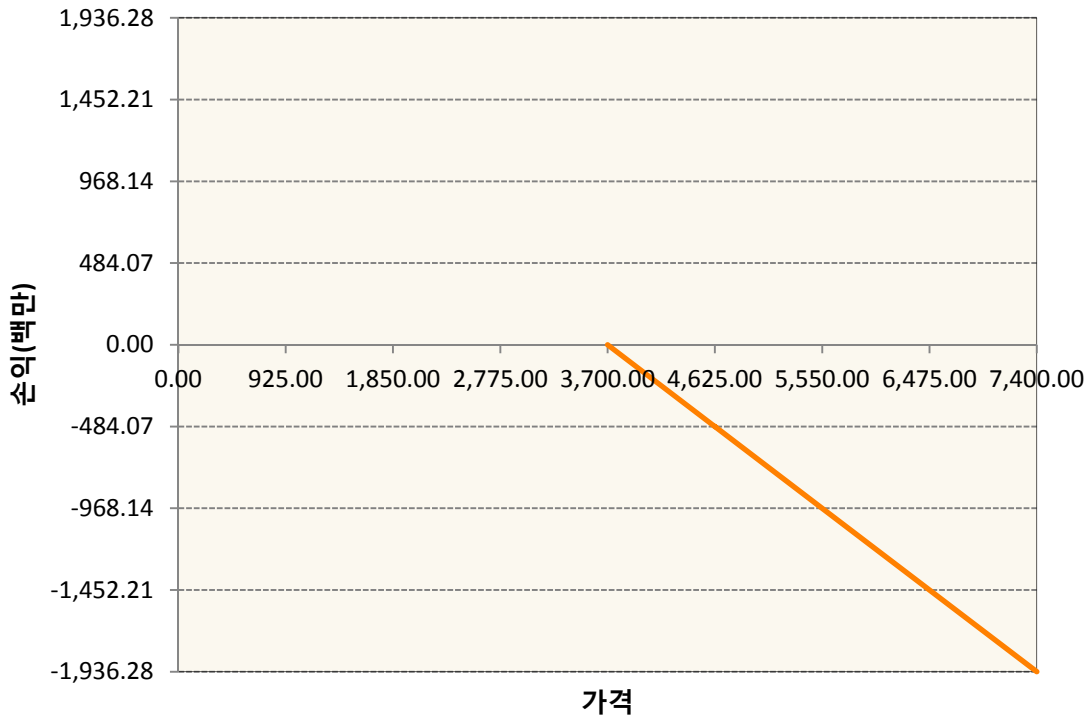
1. 계약금액

(단위:백만원)

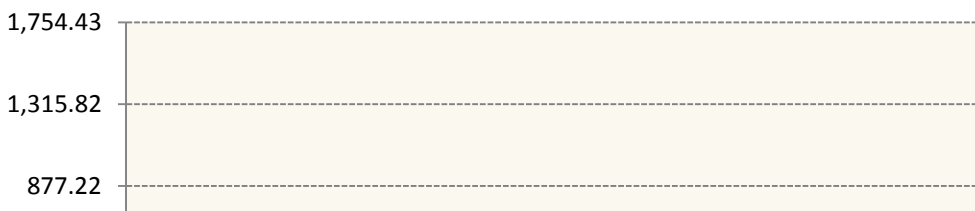
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	625	0	625	
누계	유가증권	스왑	17,889	0	17,889	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,381	-7,381	장내
누계	통화	선도	2,716	6,149	-3,433	장외

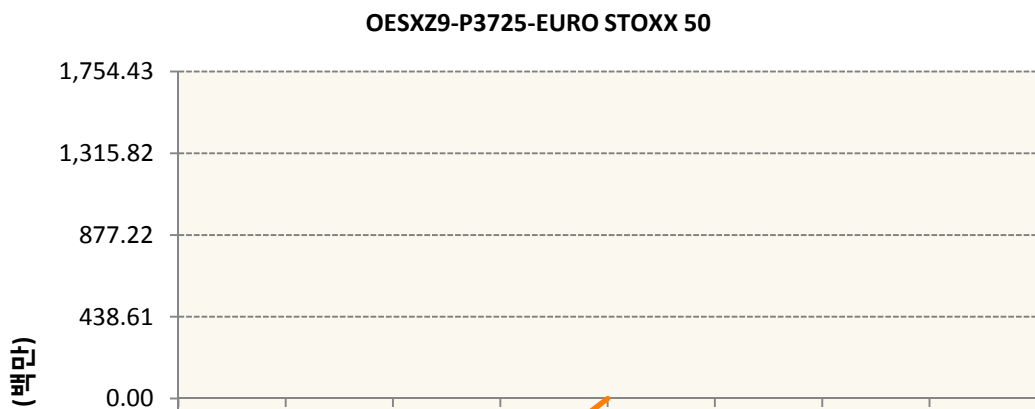
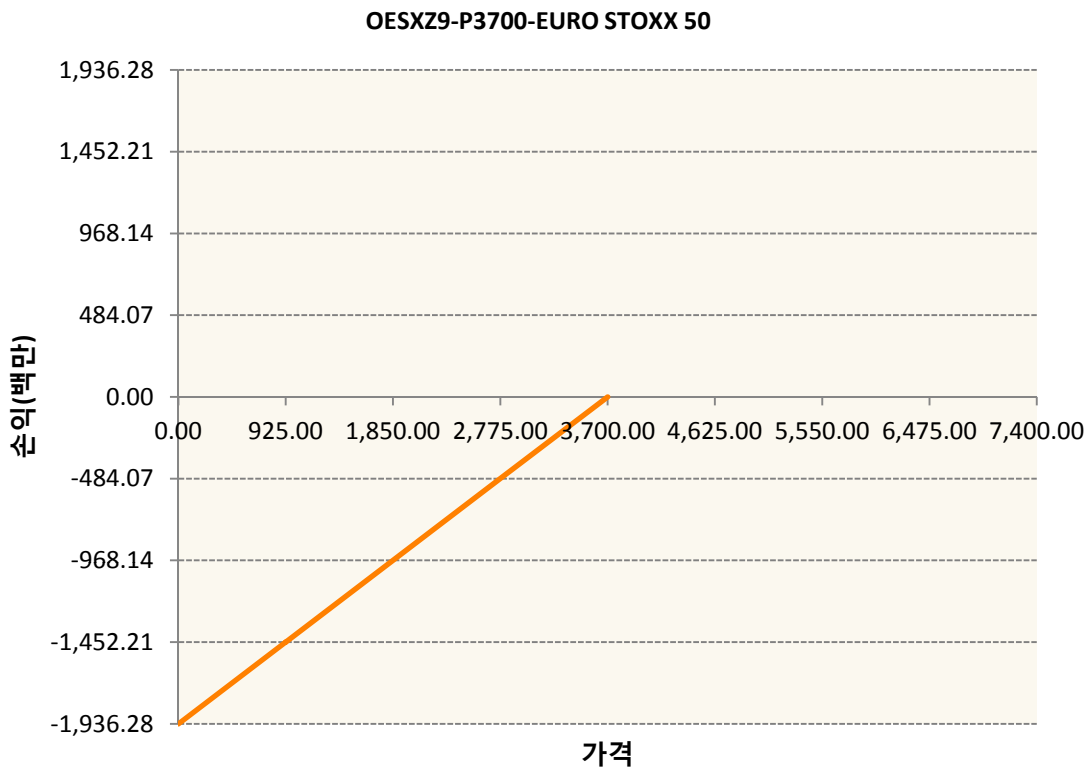
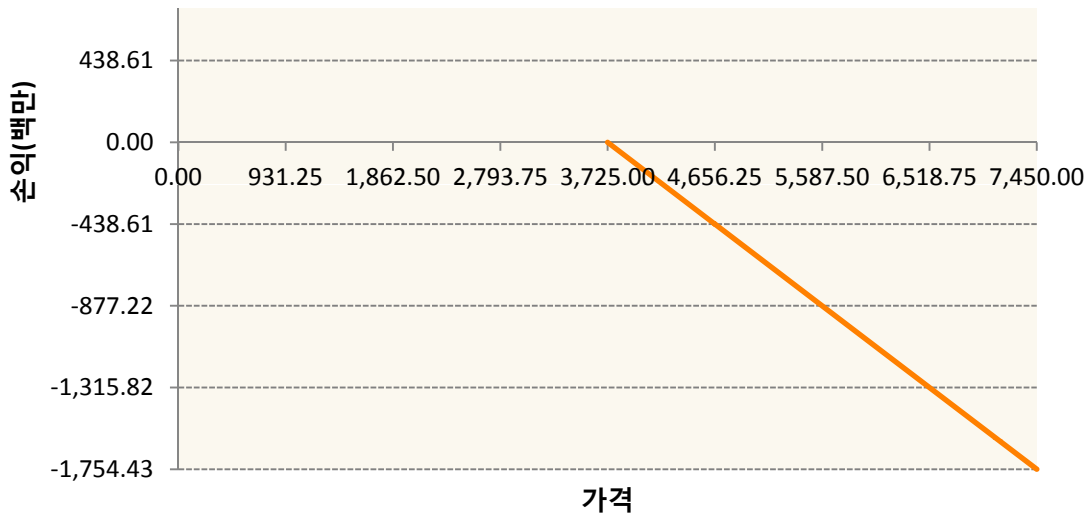
2. 만기시점의 손익구조

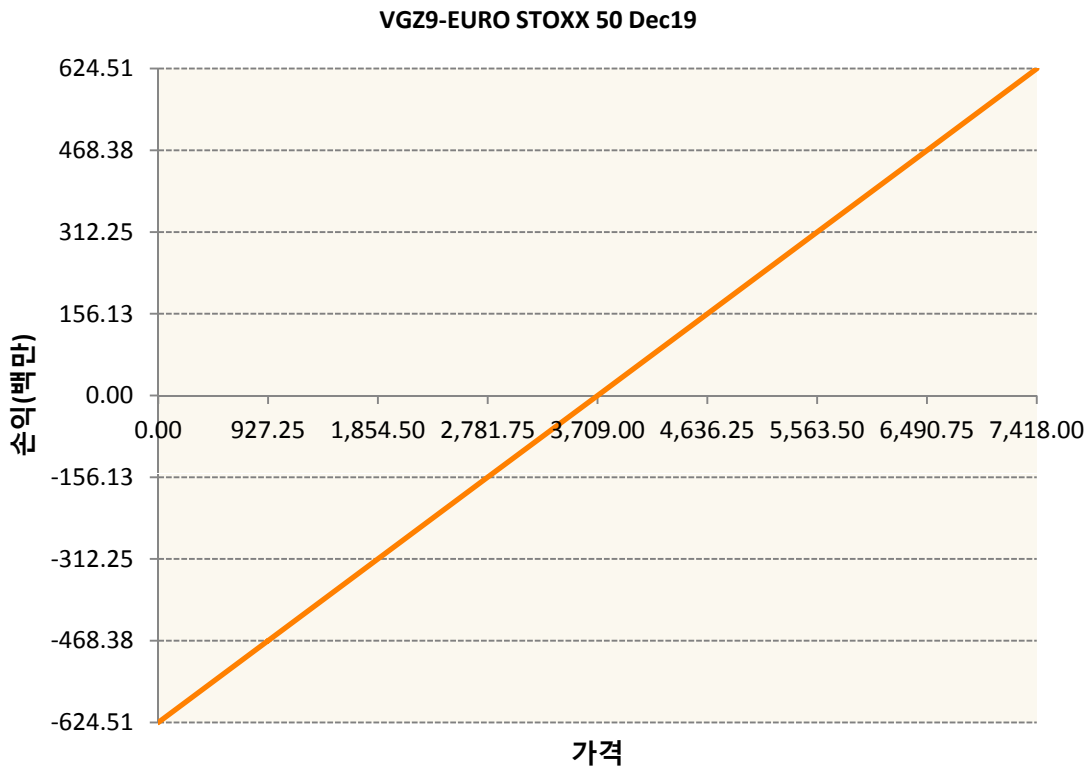
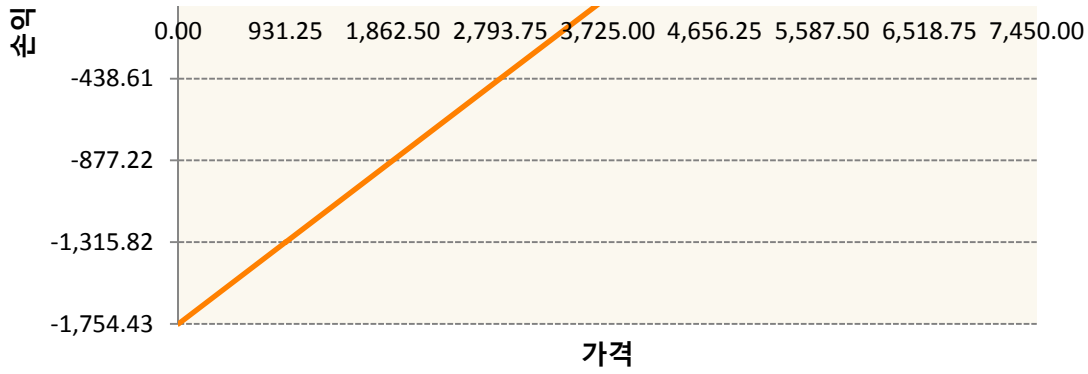
OESXZ9-C3700-EURO STOXX 50



OESXZ9-C3725-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	26
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E	492
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E	165
FX21019X02 EUR/KRW 27-12-19E	52
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	155
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	140
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	155
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	140
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19	50

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

(단위:백만원)

780

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

(단위:백만원)

943

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

(단위:백만원)

82

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

(단위:백만원)

128

공시일	2019-12-16
기준일	2019-12-13

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

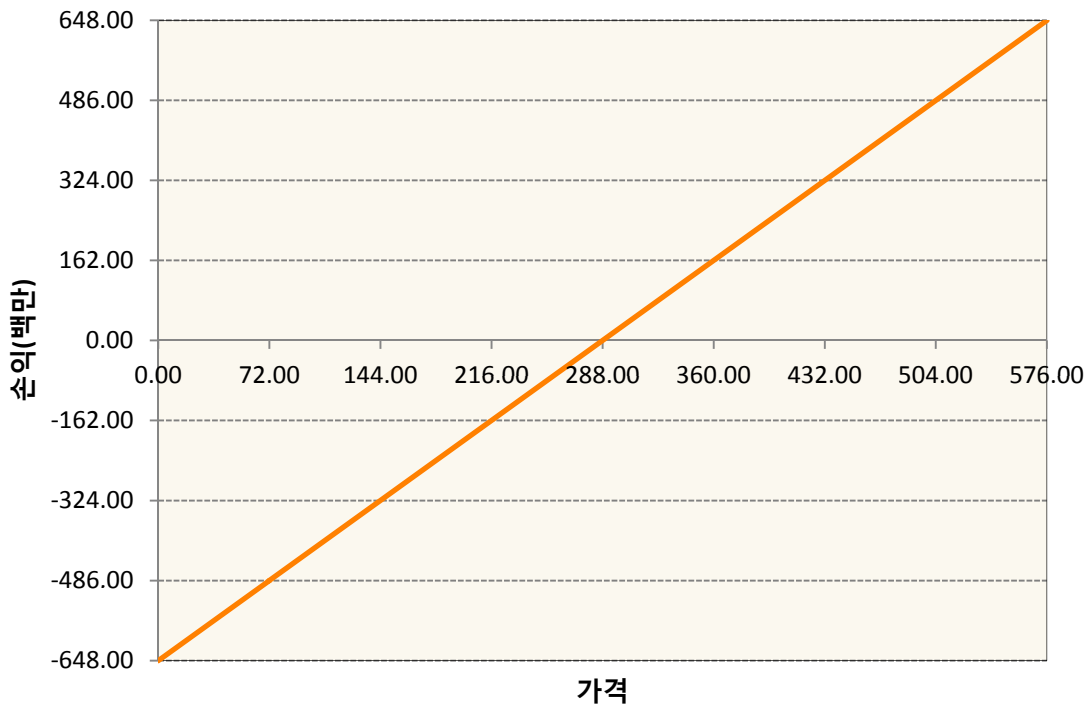
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	648	0	648	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						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%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
-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%	35	35	35	35	35	35	35	
8.00%	52	52	52	52	52	52	52	

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-12-16
기준일	2019-12-13

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

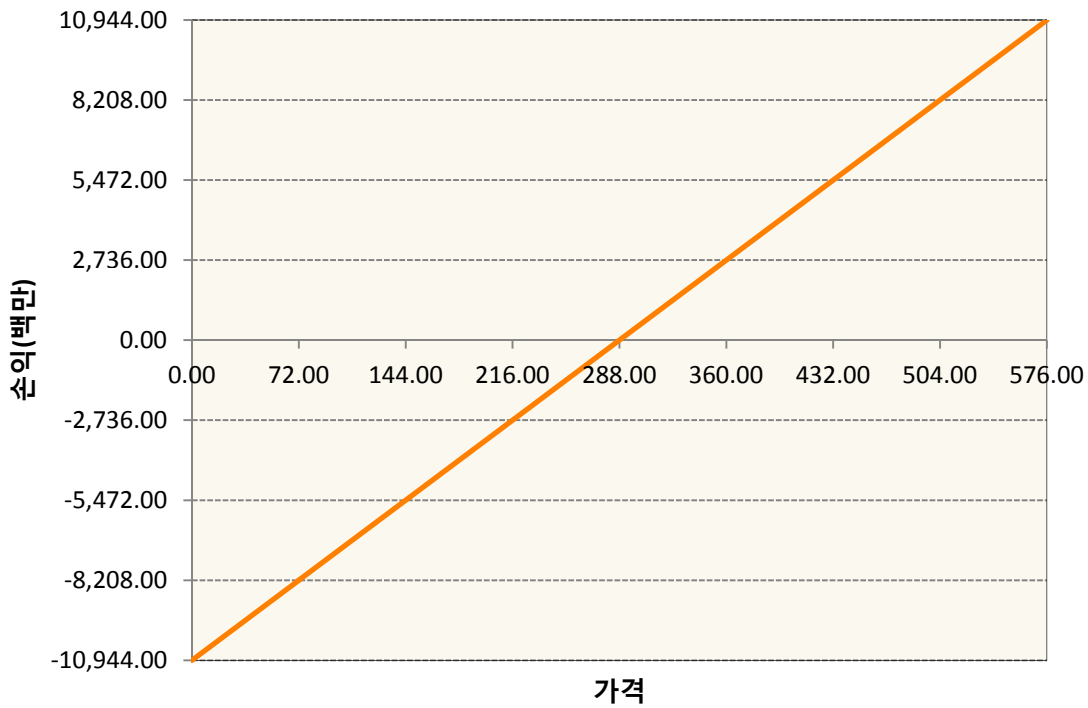
1. 계약금액

(단위:백만원)

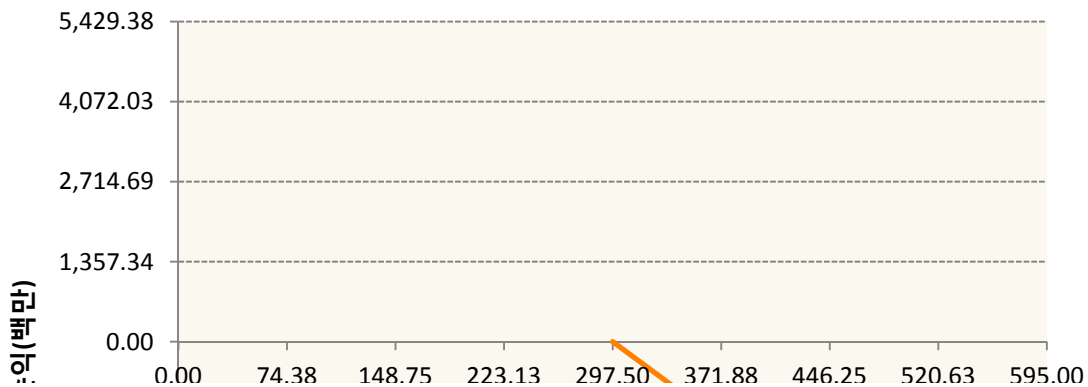
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	215	-215	장내
신규	유가증권	옵션	3,630	3,378	252	장내
누계	유가증권	선물	10,944	0	10,944	장내
누계	유가증권	옵션	499	21,254	-20,756	장내

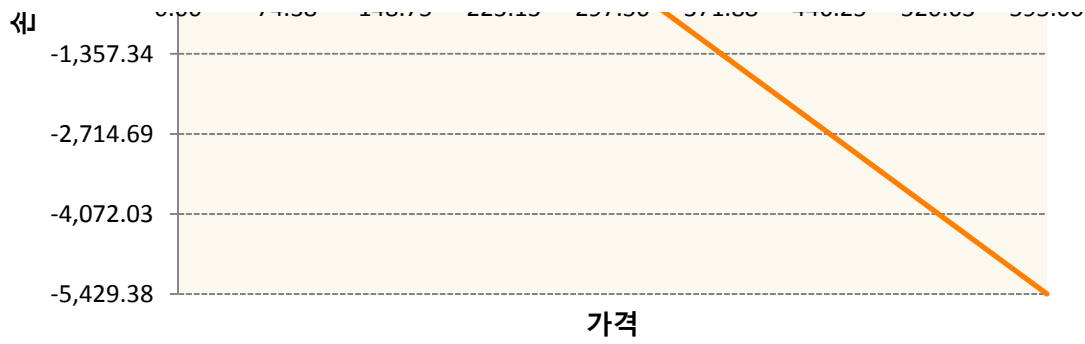
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

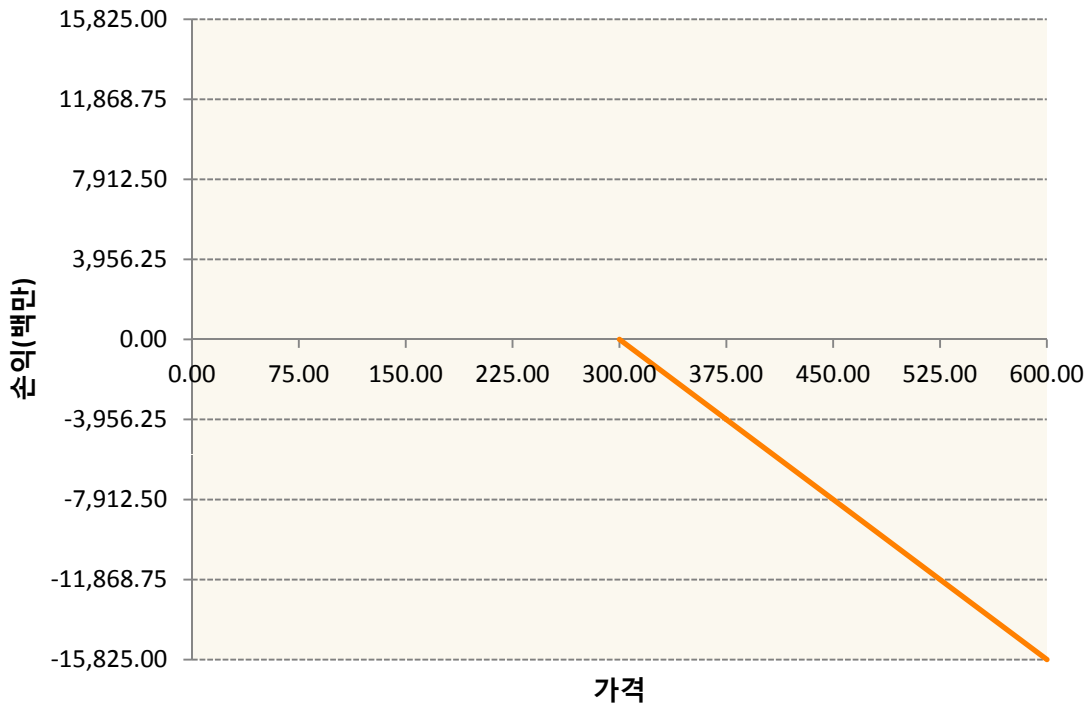


KR4201Q12977-2020-01 콜297.5

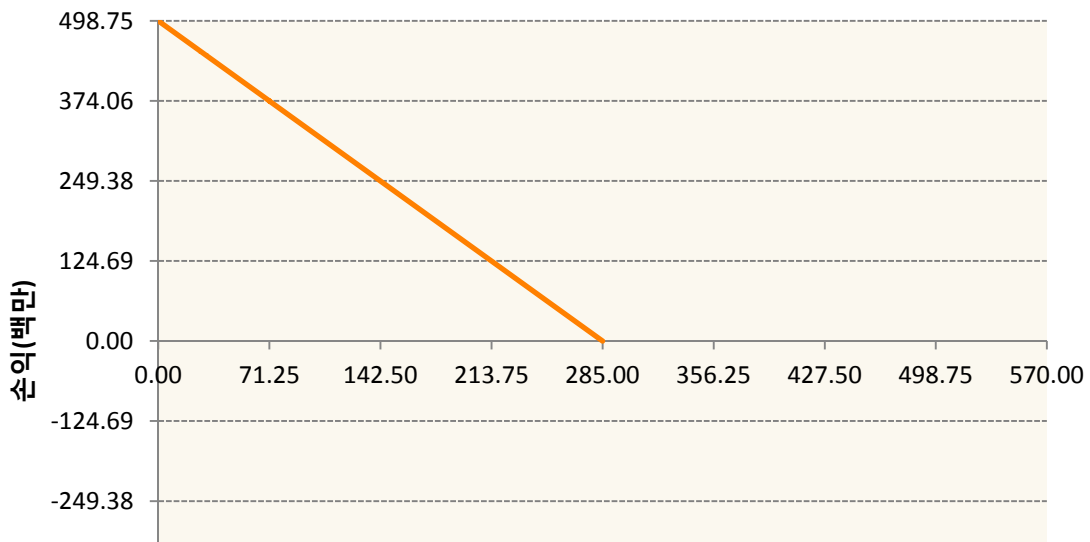


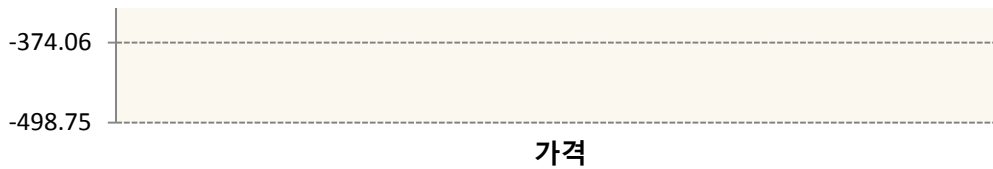


KR4201Q13009-2020-01 콜300



KR4301Q12850-2020-01 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						882
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-882	-882	-882	-882	-882	-882	-882	
-5.33%	-588	-588	-588	-588	-588	-588	-588	
-2.67%	-294	-294	-294	-294	-294	-294	-294	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	294	294	294	294	294	294	294	
5.33%	588	588	588	588	588	588	588	
8.00%	882	882	882	882	882	882	882	
KR4201Q12977		2020-01 콜297.5						280
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	99	97	93	89	84	79	72	
-5.33%	92	87	80	73	65	57	48	
-2.67%	74	65	55	45	34	23	12	
0%	38	25	13	0	-13	-26	-39	
2.67%	-22	-36	-50	-63	-77	-91	-104	
5.33%	-107	-120	-133	-146	-159	-172	-185	
8.00%	-214	-224	-234	-245	-257	-268	-280	
KR4201Q13009		2020-01 콜300						766
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	246	241	233	222	210	195	179	
-5.33%	230	218	202	184	164	141	118	
-2.67%	189	166	141	114	85	55	24	
0%	103	70	35	0	-36	-72	-109	
2.67%	-47	-87	-126	-166	-205	-245	-284	
5.33%	-269	-308	-347	-386	-425	-465	-504	
8.00%	-559	-591	-624	-658	-693	-729	-766	
KR4301Q12850		2020-01 풋285						29
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	28	28	28	29	29	29	29	
-5.33%	15	16	16	16	16	17	17	
-2.67%	4	5	6	6	7	7	8	

0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-3	-3	-3	-3	-2	-2	-2
5.33%	-4	-4	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-3

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

(단위:백만원)

1,609

공시일	2019-12-16
기준일	2019-12-13

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	206,319	0	206,319	

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	2019-12-16
기준일	2019-12-13

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	215,351	0	215,351	

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	2019-12-16
기준일	2019-12-13

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	547,168	0	547,168	
누계	통화	선도	0	556,675	-556,675	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		1,687
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,781
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,406
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,509
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		469
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		937
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		1,537
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		1,875
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		3,225
FX21019X02 KRW/USD 26-12-19E		4,724
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		4,781
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		187
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,812
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,812
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,343
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,531
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E		1,631
FX21019Z00 KRW/USD 10-01-20E		1,125
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E		1,537
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E		937
FX21019Z02 KRW/USD 16-01-20E		1,687

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

(단위:백만원)

13,938

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

(단위:백만원)

187

공시일	2019-12-16
기준일	2019-12-13

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

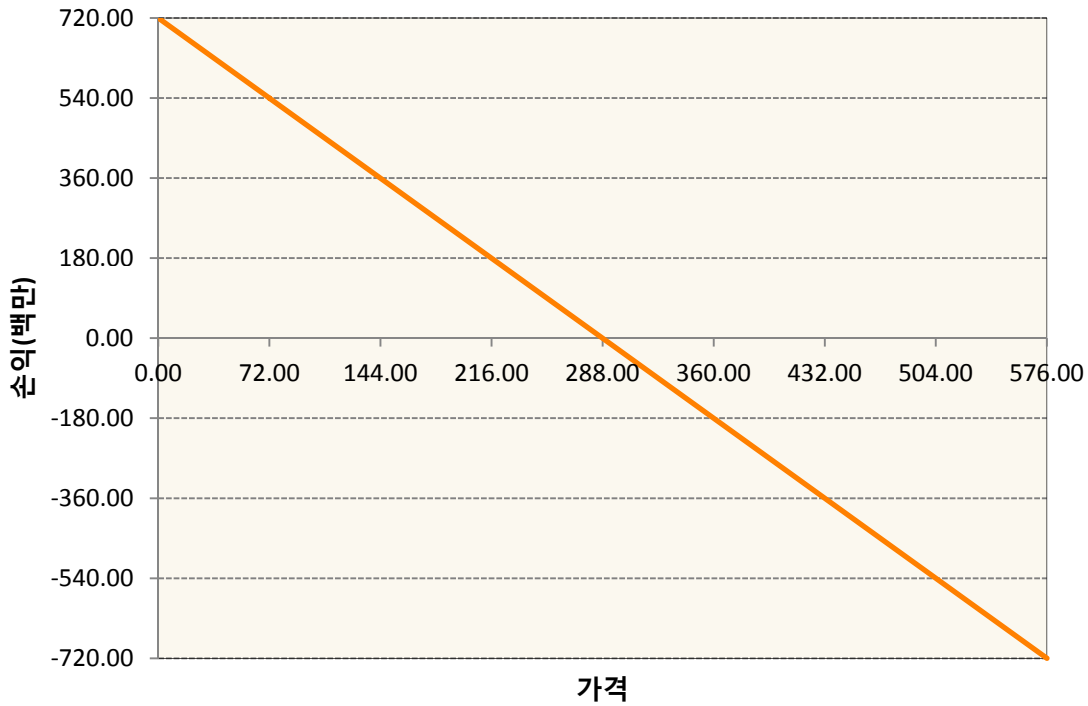
1. 계약금액

(단위:백만원)

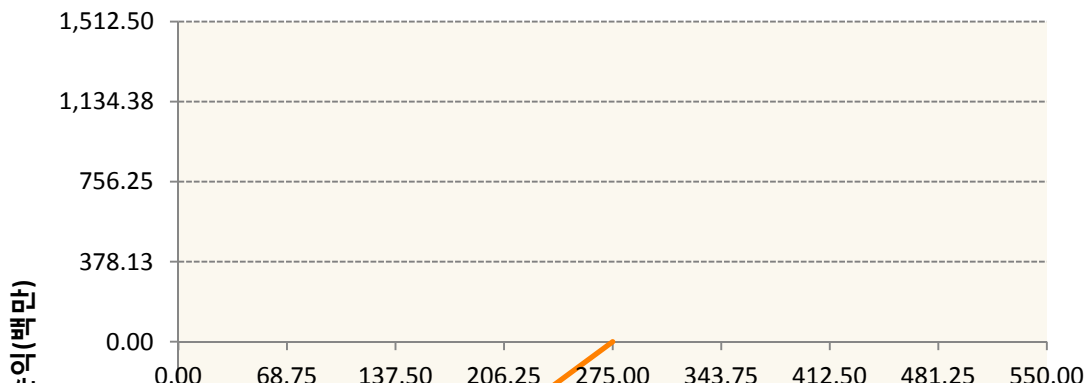
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	617	627	-11	장내
누계	유가증권	선물	0	720	-720	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,010	-4,010	장내

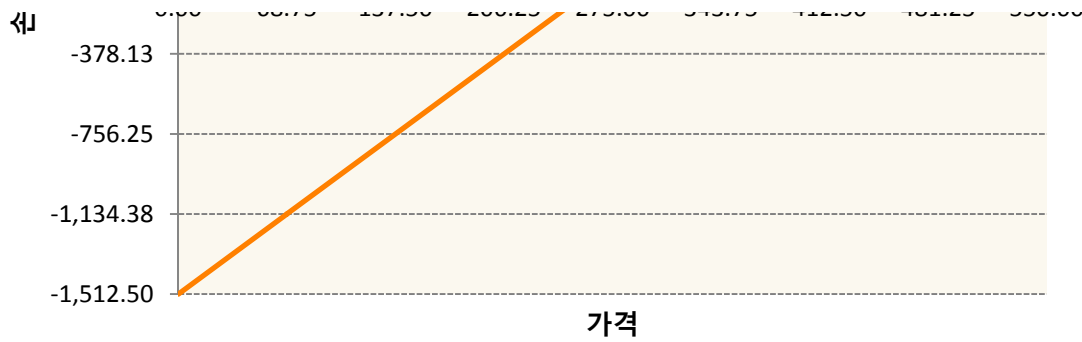
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

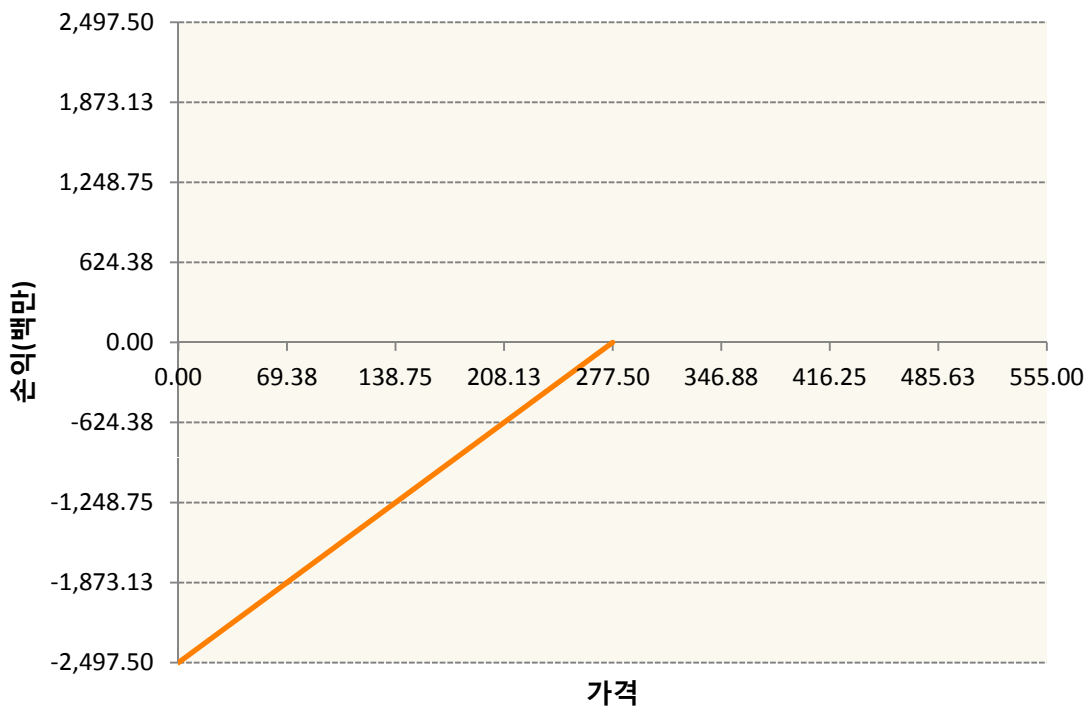


KR4301Q12751-2020-01 풋275





KR4301Q12777-2020-01 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						58
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	58	58	58	58	58	58	58	
-5.33%	39	39	39	39	39	39	39	
-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%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39	
8.00%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58	
KR4301Q12751		2020-01 풋275						53
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-46	-47	-48	-49	-51	-52	-53
-5.33%	-16	-18	-19	-21	-23	-25	-26
-2.67%	-2	-3	-4	-6	-7	-9	-10
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	2	2	1	1	1	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	1	1
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

KR4301Q12777

2020-01 풋277.5

103

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-94	-95	-97	-98	-100	-101	-103
-5.33%	-38	-40	-43	-46	-48	-51	-54
-2.67%	-6	-8	-11	-14	-16	-19	-22
0%	3	2	1	0	-1	-3	-5
2.67%	5	4	4	4	3	3	2
5.33%	5	5	5	5	4	4	4
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

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

(단위:백만원)

148

공시일	2019-12-16
기준일	2019-12-13

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	14,352	0	14,352	
누계	통화	선도	352	14,482	-14,131	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019X01 KRW/USD 13-01-20E		230
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		291
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		292
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E		347
FX21019Z02 USD/KRW 13-01-20E		28

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

(단위:백만원)

371

공시일	2019-12-16
기준일	2019-12-13

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	1,004	0	1,004	장외
누계	통화	선도	314	353	-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)

77

공시일	2019-12-16
기준일	2019-12-13

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

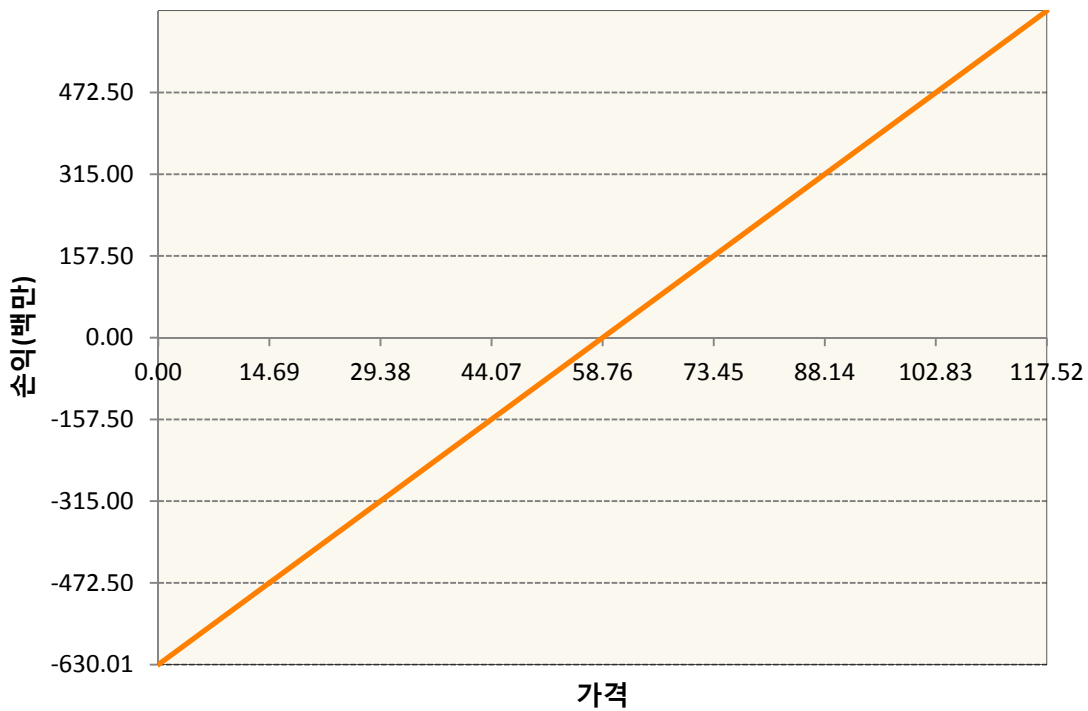
1. 계약금액

(단위:백만원)

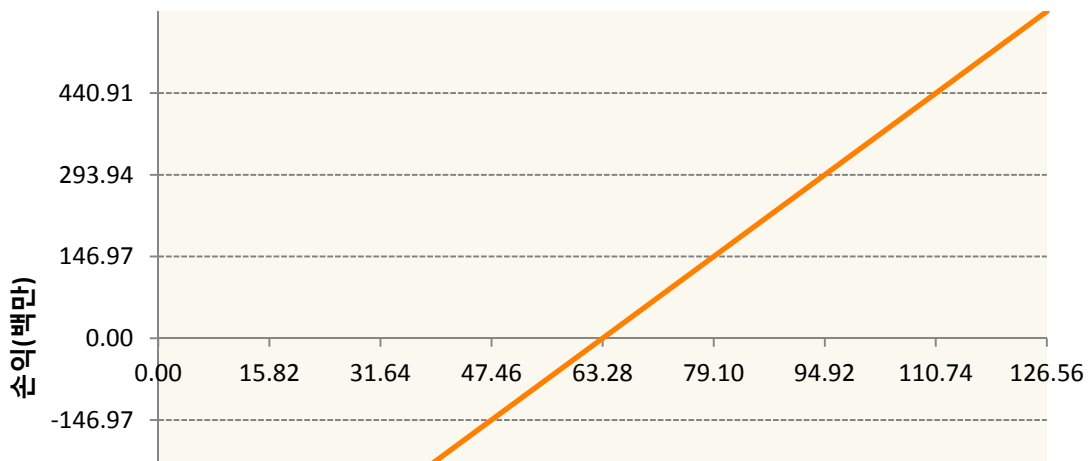
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,383	292	2,090	

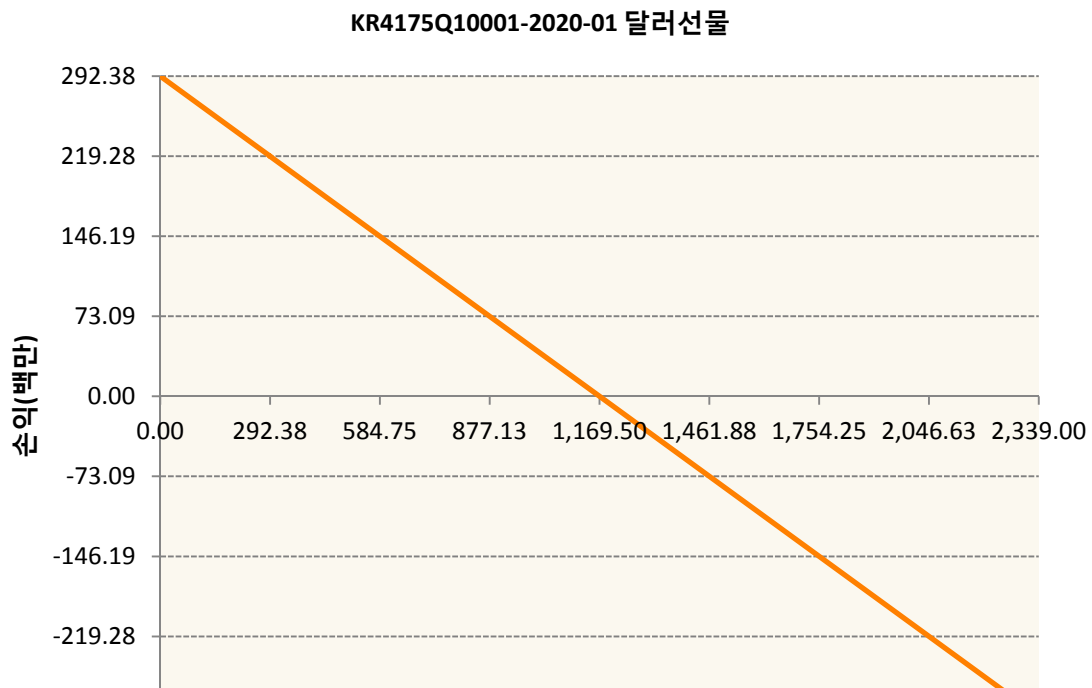
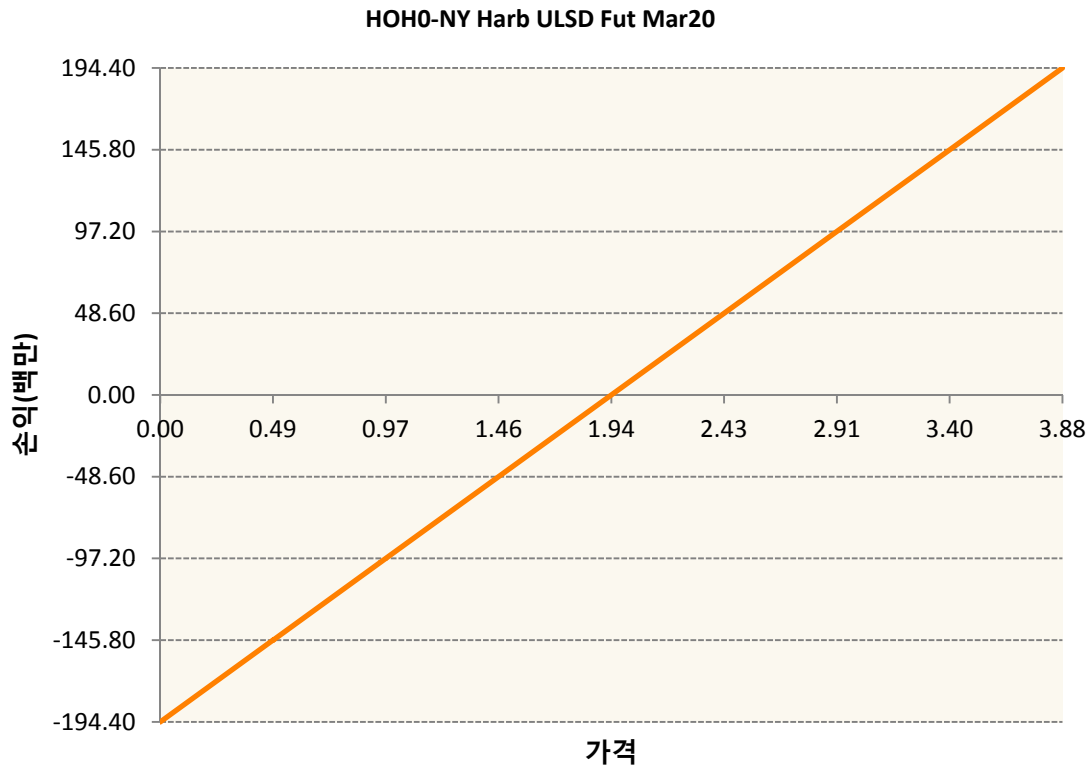
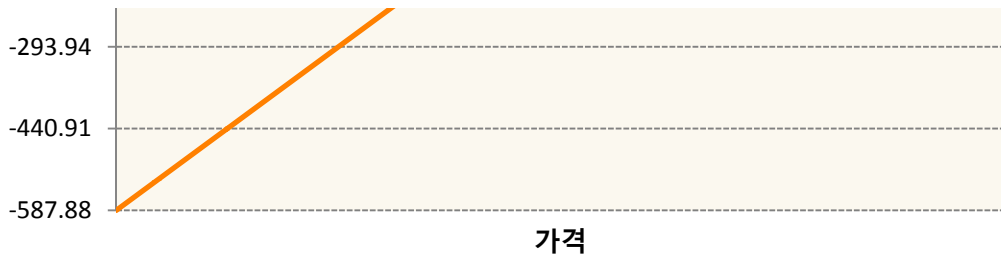
2. 만기시점의 손익구조

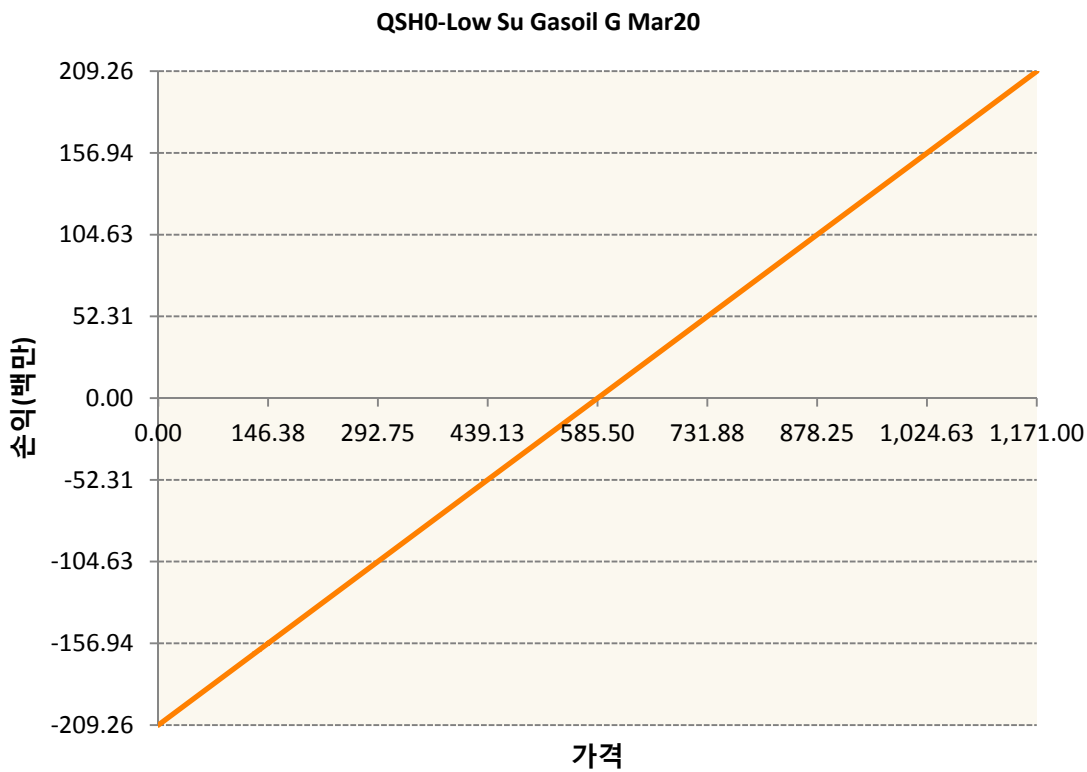
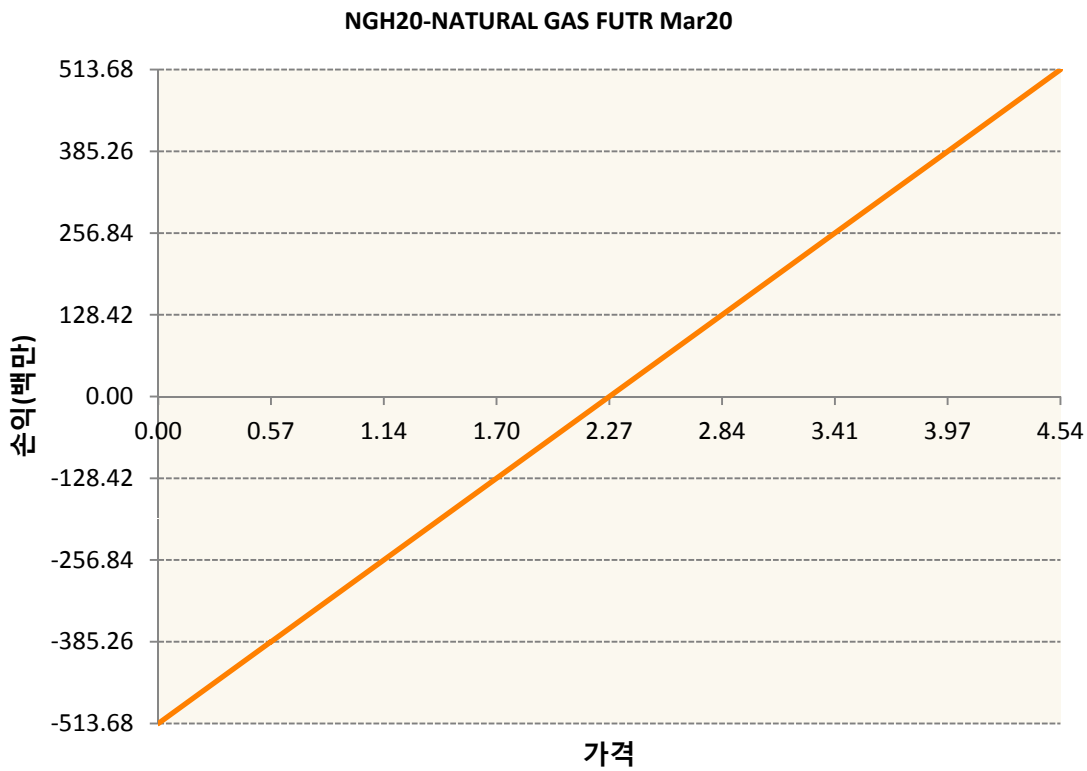
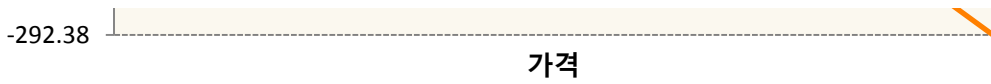
CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20



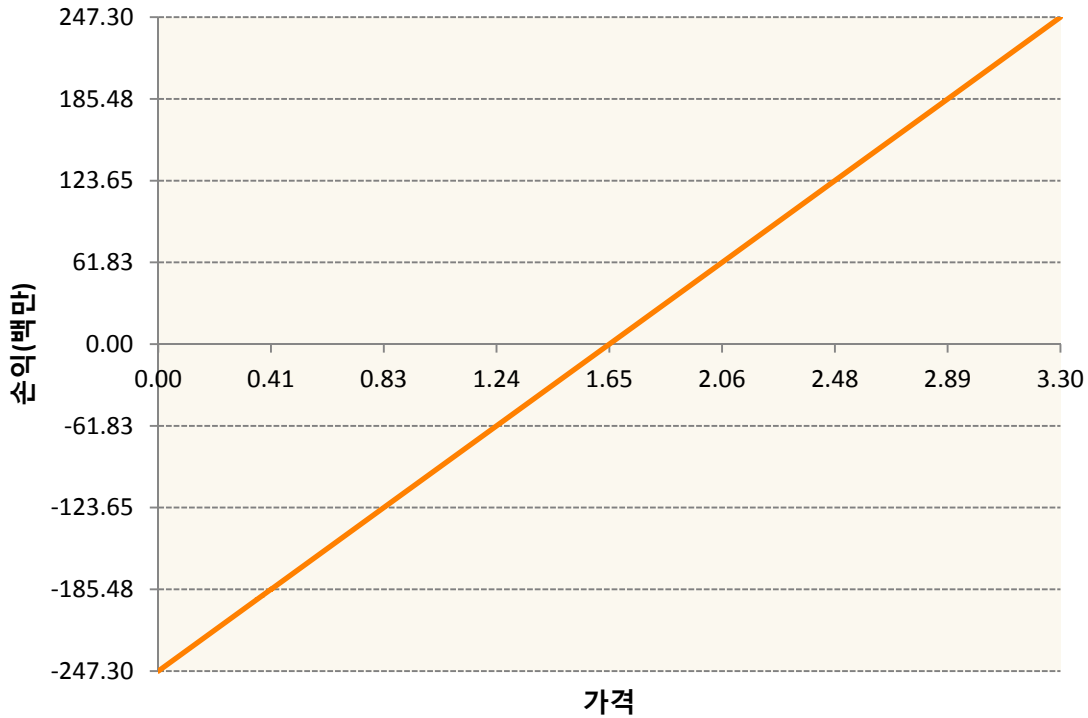
COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20







XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	50
COH0	BRENT CRUDE FUTR Mar20	47
HOH0	NY Harb ULSD Fut Mar20	16
KR4175Q10C	2020-01 달러선물	23
NGH20	NATURAL GAS FUTR Mar20	41
QSH0	Low Su Gasoil G Mar20	17
XBH0	GASOLINE RBOB FUT Mar20	20

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

385

공시일	2019-12-16
기준일	2019-12-13

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

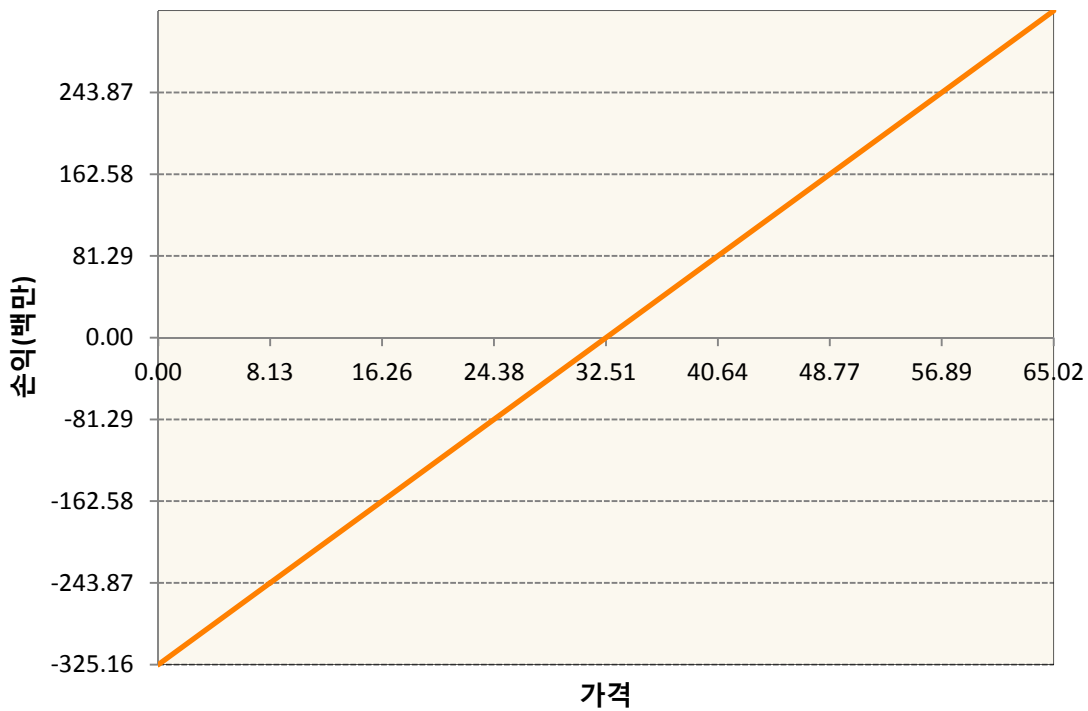
1. 계약금액

(단위:백만원)

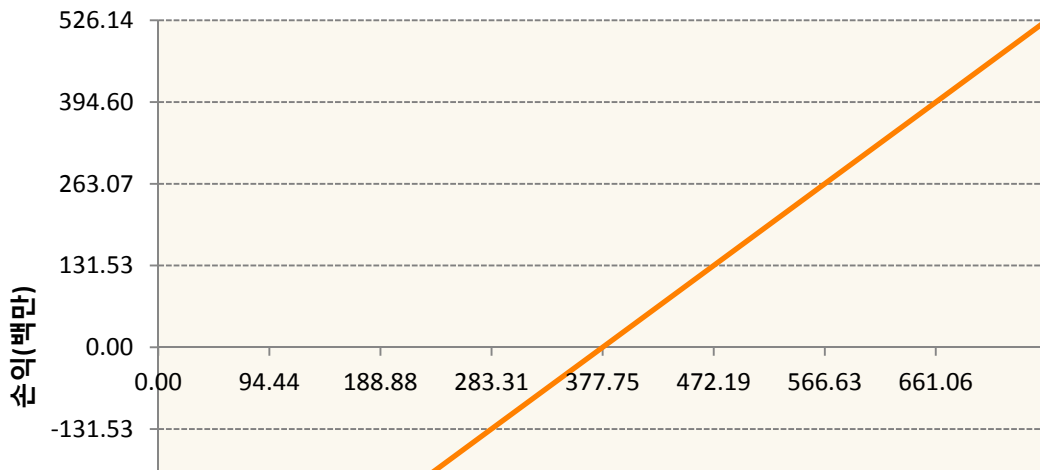
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,800	117	2,683	

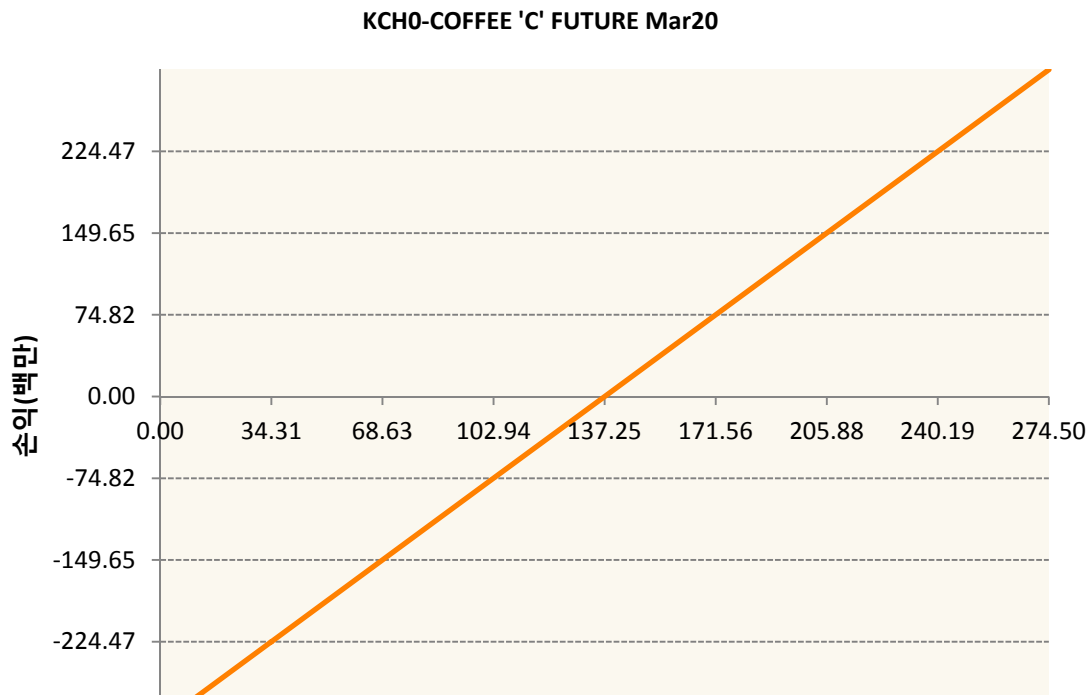
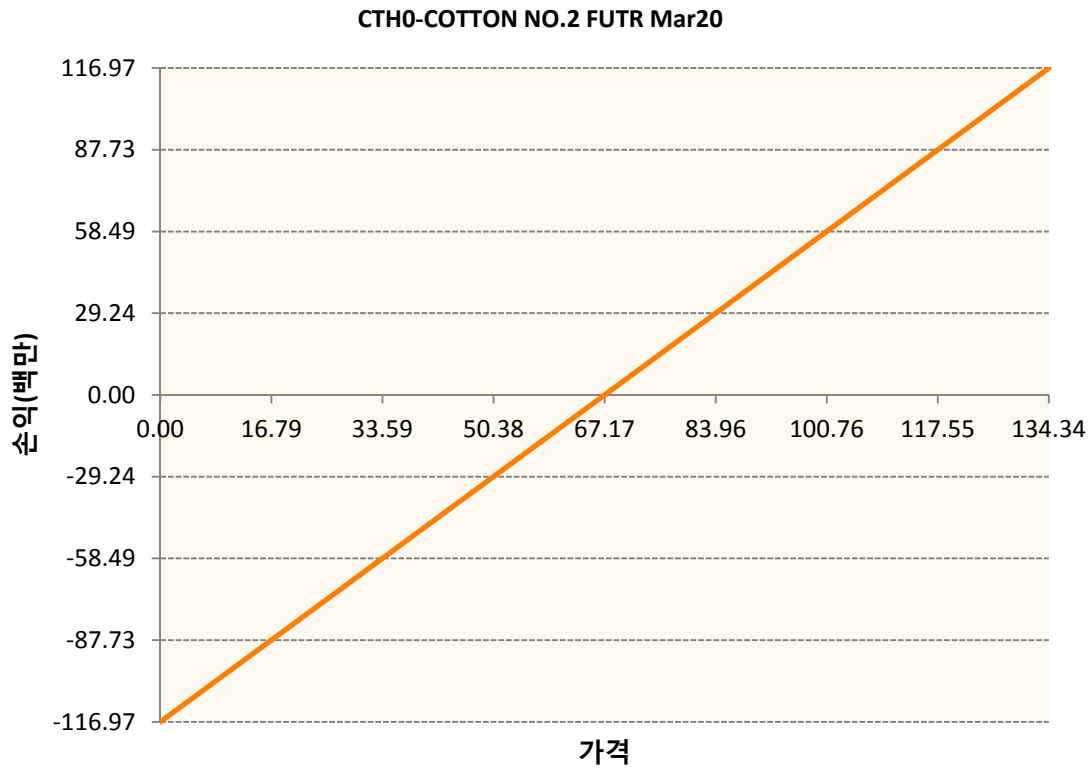
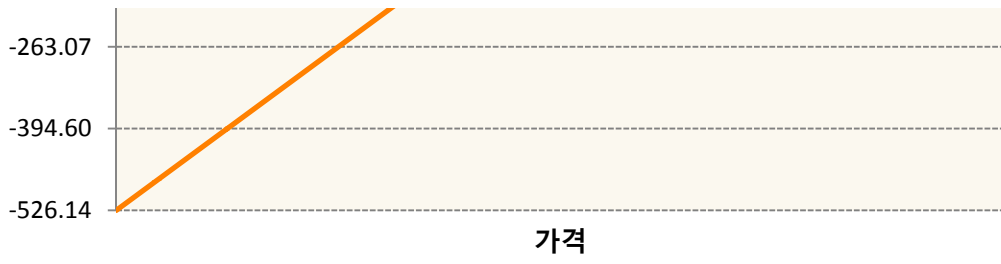
2. 만기시점의 손익구조

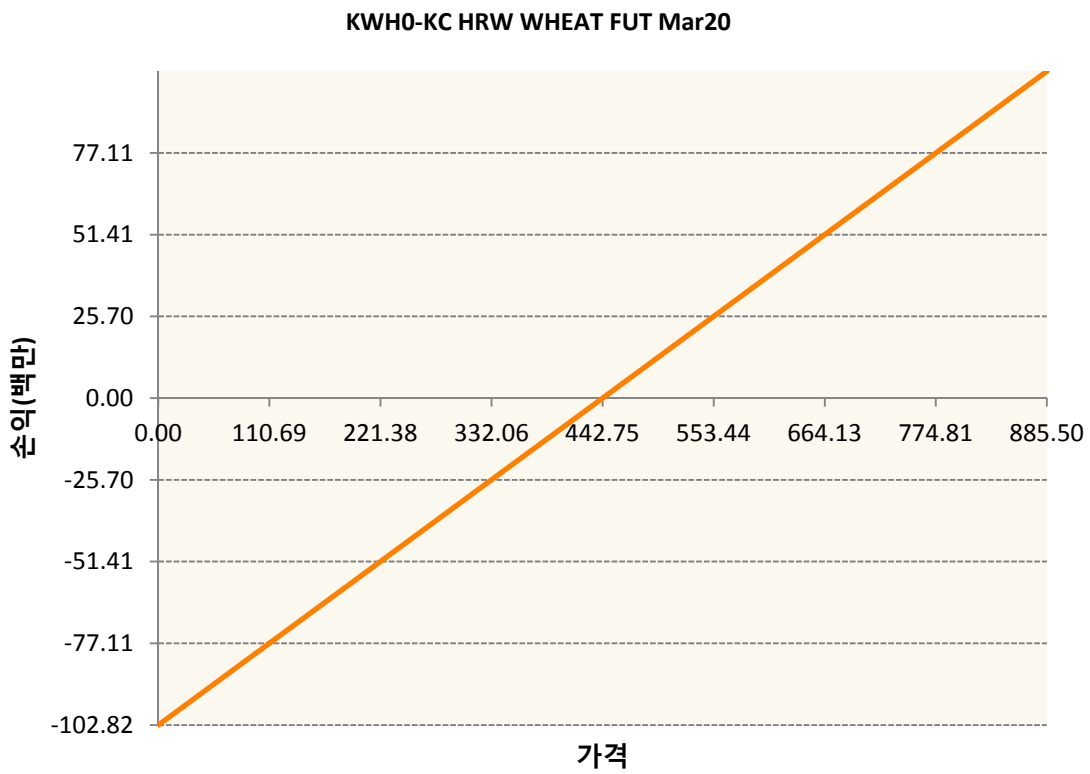
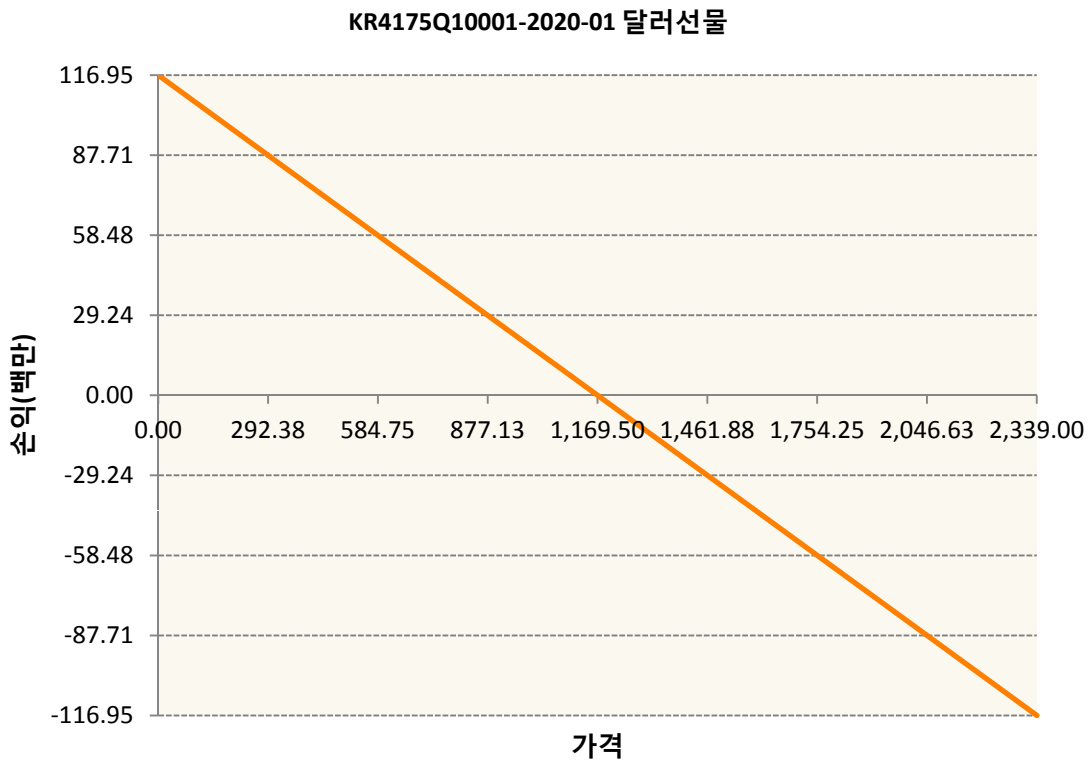
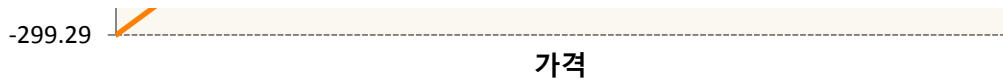
BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20



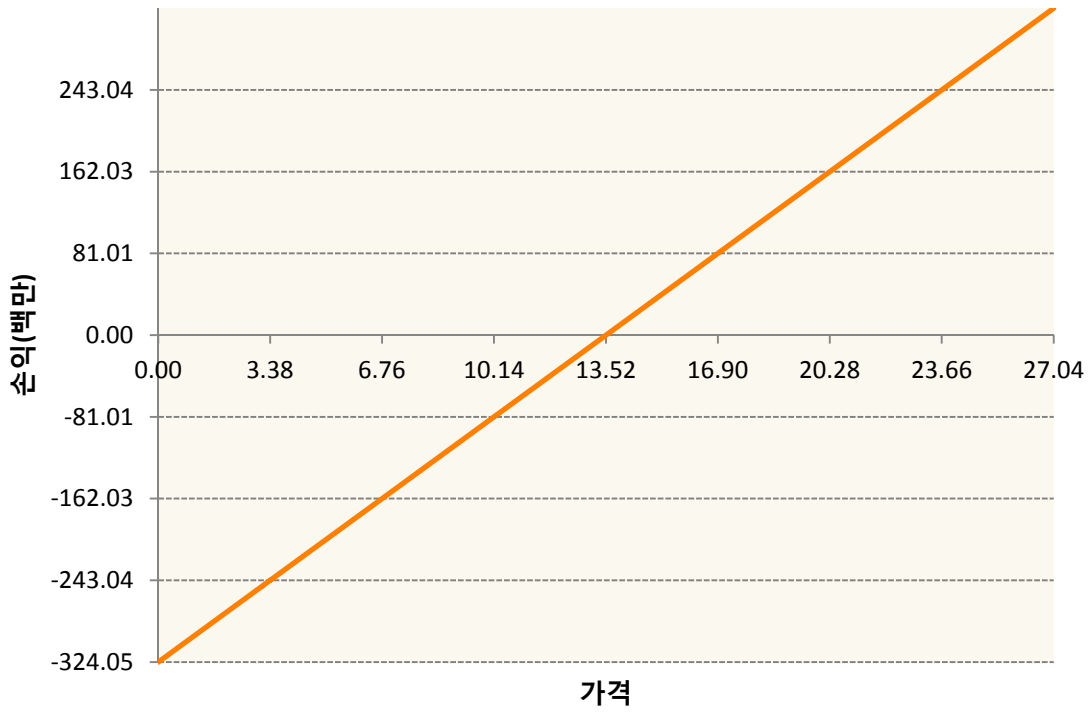
CH0-CORN FUTURE Mar20



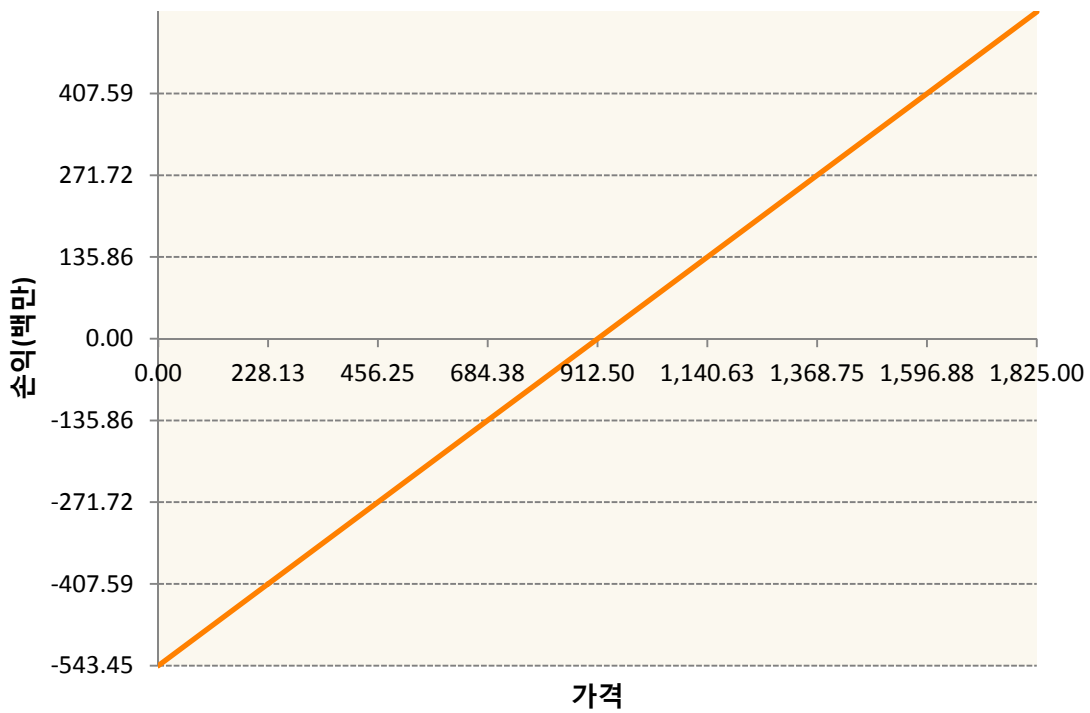




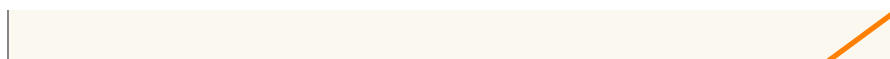
SBH0-Sugar Mar20

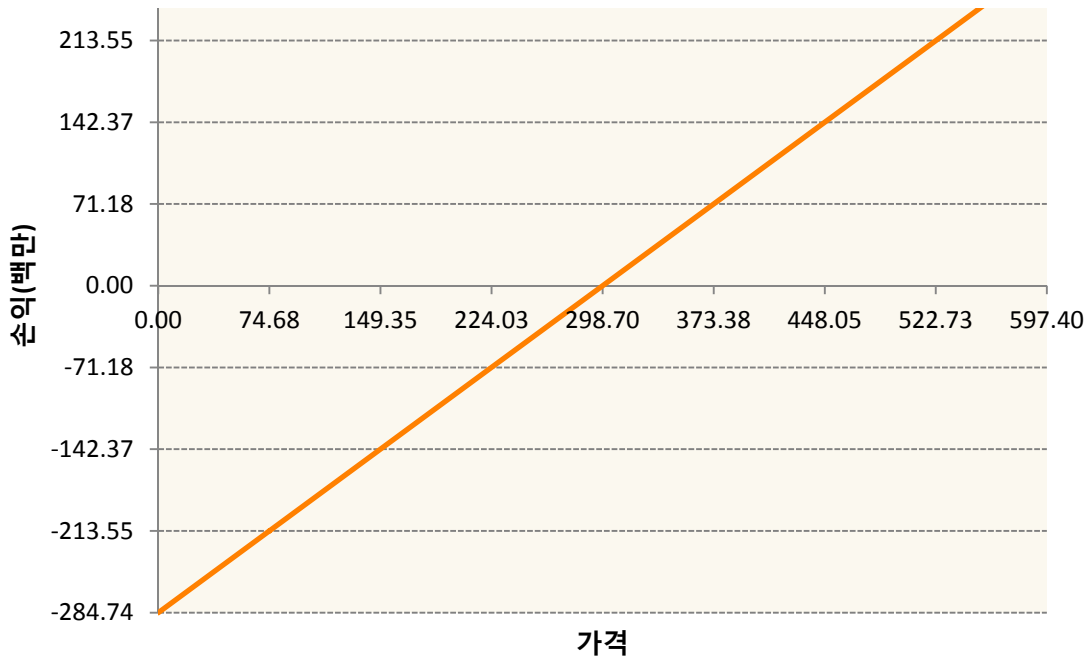


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20

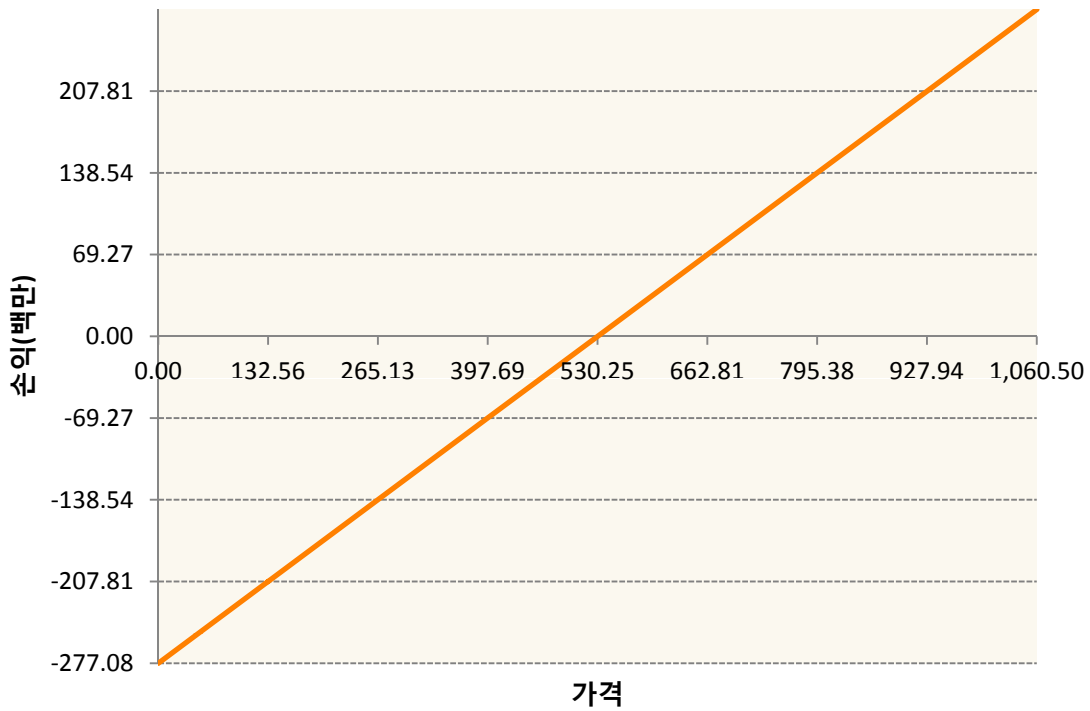


SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





WHO-WHEAT FUTURE(CBT) Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH0	SOYBEAN OIL FUTR Mar20	26
CH0	CORN FUTURE Mar20	42
CTH0	COTTON NO.2 FUTR Mar20	9
KCH0	COFFEE 'C' FUTURE Mar20	24
KR4175Q10C	2020-01 달러선물	9

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)

245