

공시일	2019-12-17
기준일	2019-12-16

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	2019-12-17
기준일	2019-12-16

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

1,110

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

640

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-17
기준일	2019-12-16

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)	397
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	146

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

756

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-17
기준일	2019-12-16

유로인덱스모(주식-파생형)

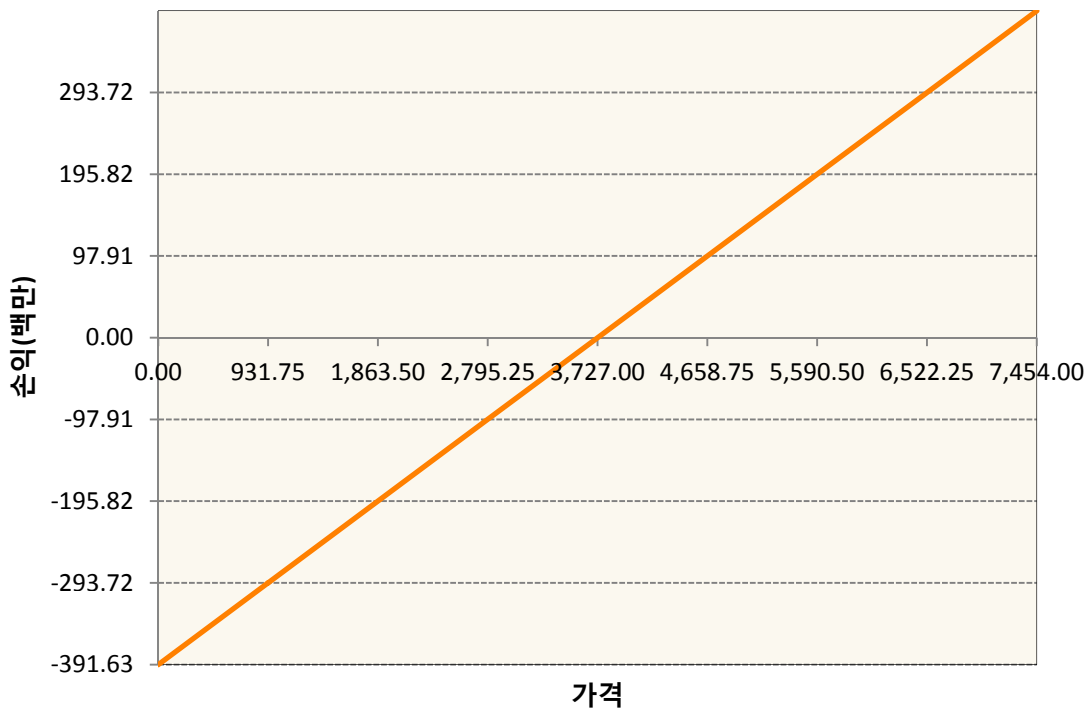
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	392	0	392	

2. 만기시점의 손익구조

VGZ9-EURO STOXX 50 Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	31
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

22

공시일	2019-12-17
기준일	2019-12-16

차이나인덱스모(주식-파생형)

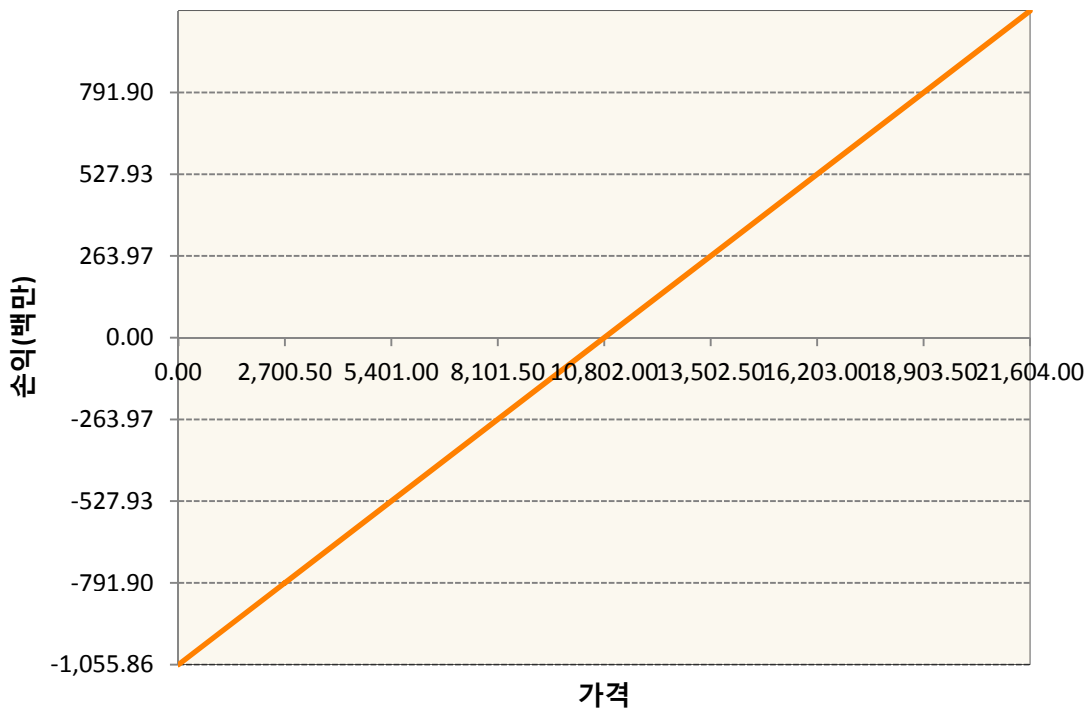
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,056	0	1,056	

2. 만기시점의 손익구조

HCZ9-HSCEI Futures Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ9	HSCEI Futures Dec19	84
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

76

공시일	2019-12-17
기준일	2019-12-16

커버드콜모(주식혼합-파생형)

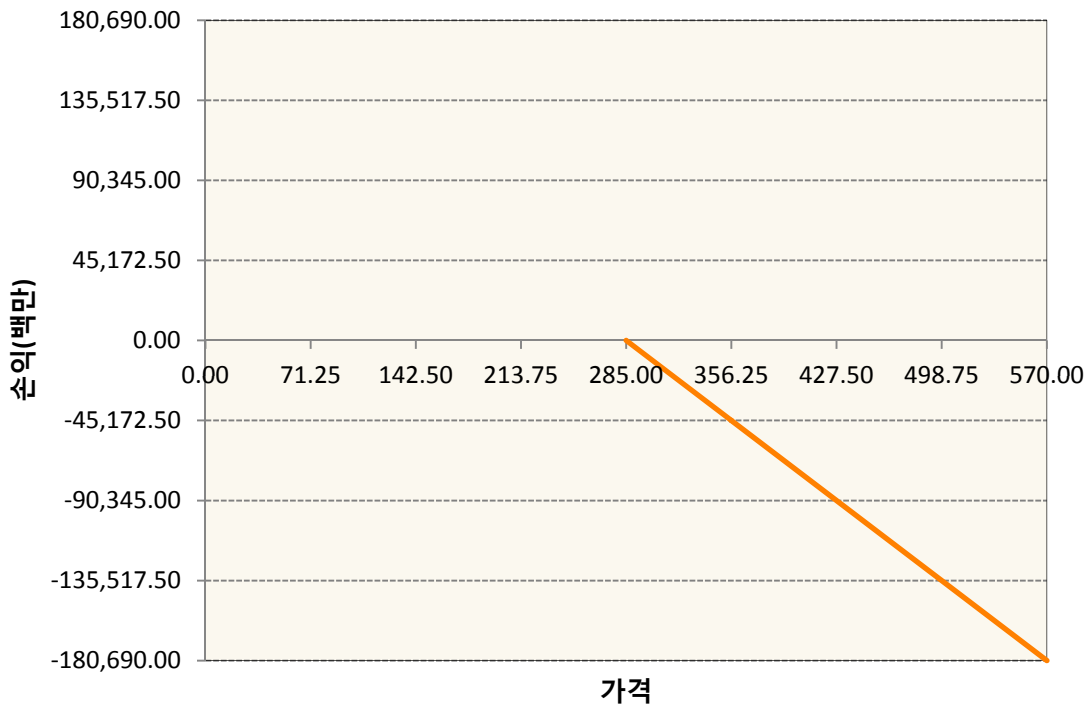
1. 계약금액

(단위:백만원)

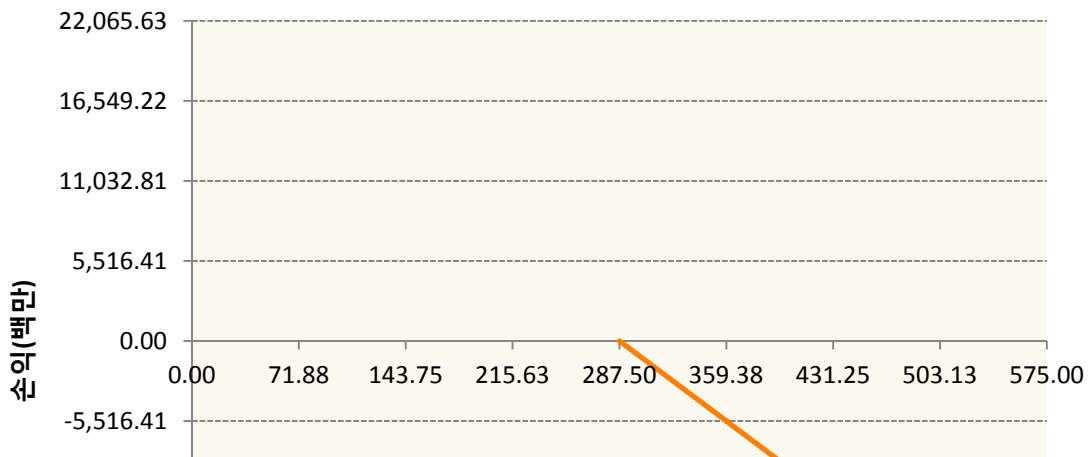
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	9,084	5,796	3,288	장내
누계	유가증권	옵션	0	491,817	-491,817	장내

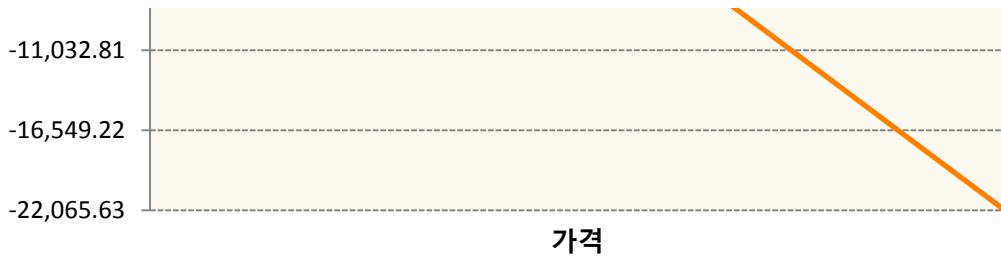
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q12852-2020-01 콜285

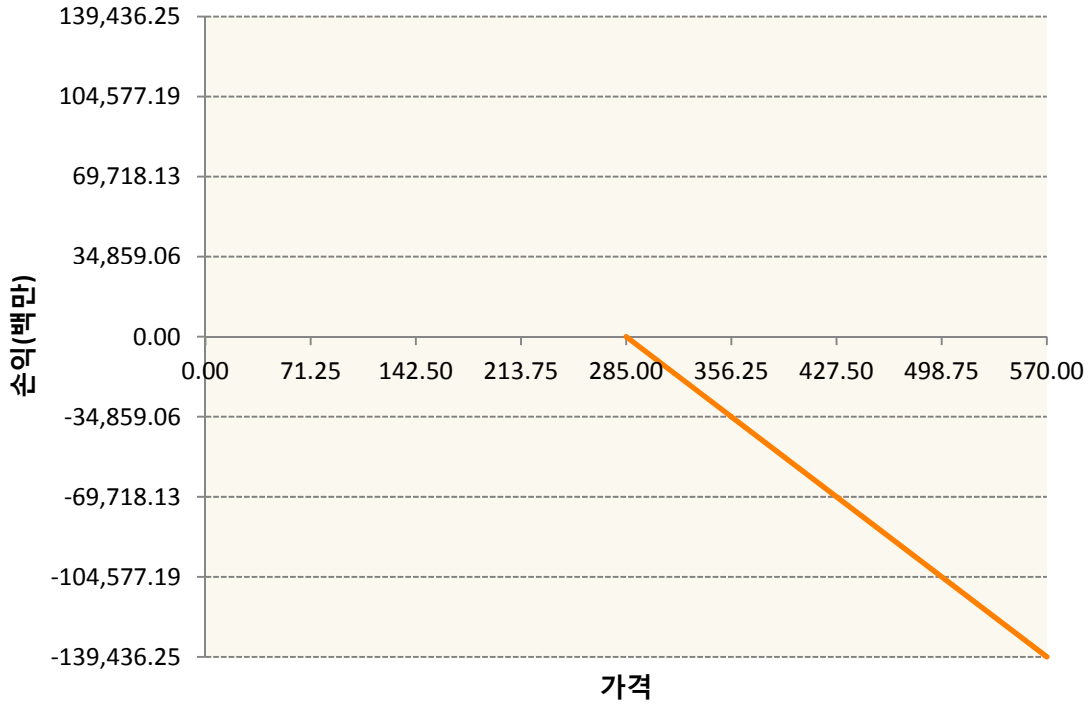


KR4201Q12878-2020-01 콜287.5

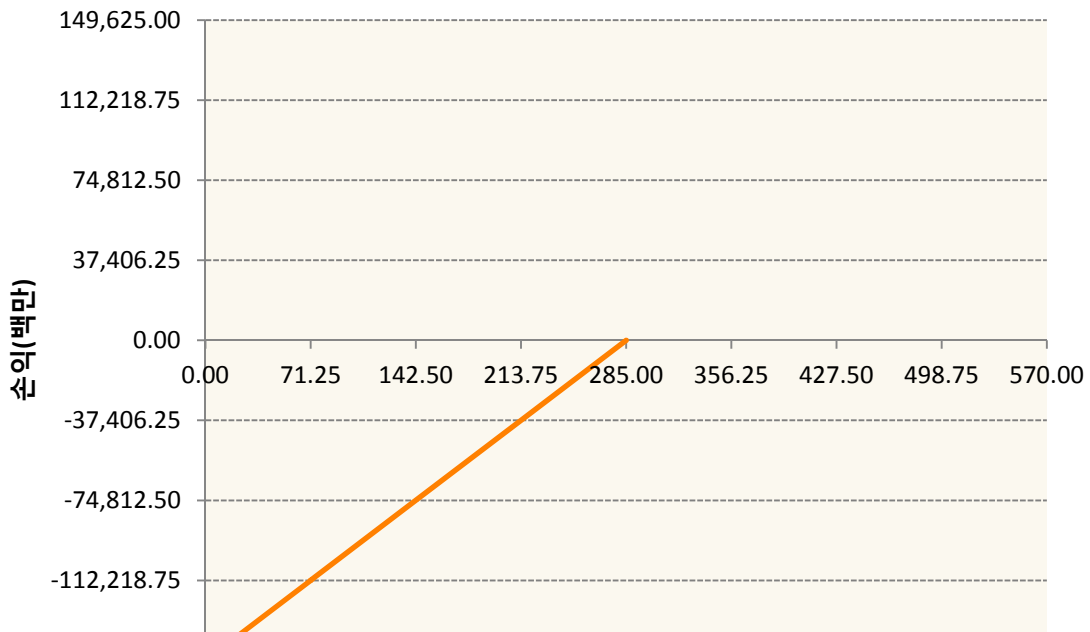




KR4201Q22851-2020-02 콜285



KR4301Q12850-2020-01 풋285



-149,625.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q12852		2020-01 콜285						12,099
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	6,341	6,131	5,894	5,633	5,352	5,055	4,744	
-5.33%	5,493	5,155	4,803	4,440	4,067	3,688	3,303	
-2.67%	3,857	3,433	3,008	2,583	2,156	1,729	1,301	
0%	1,270	849	426	0	-427	-856	-1,286	
2.67%	-2,213	-2,550	-2,905	-3,272	-3,651	-4,037	-4,431	
5.33%	-6,369	-6,591	-6,843	-7,120	-7,419	-7,735	-8,066	
8.00%	-10,932	-11,054	-11,208	-11,393	-11,605	-11,841	-12,099	
KR4201Q12878		2020-01 콜287.5						1,412
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	679	658	634	606	575	542	507	
-5.33%	599	562	523	483	440	397	352	
-2.67%	434	385	335	284	234	183	132	
0%	158	106	53	0	-53	-106	-159	
2.67%	-230	-275	-322	-370	-418	-468	-518	
5.33%	-709	-741	-776	-814	-854	-896	-939	
8.00%	-1,247	-1,266	-1,289	-1,315	-1,345	-1,377	-1,412	
KR4201Q22851		2020-02 콜285						9,169
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	6,088	5,708	5,308	4,892	4,463	4,024	3,577	
-5.33%	5,040	4,574	4,099	3,618	3,132	2,643	2,150	
-2.67%	3,542	3,025	2,508	1,989	1,471	952	433	
0%	1,567	1,046	523	0	-524	-1,049	-1,573	
2.67%	-864	-1,345	-1,836	-2,335	-2,838	-3,346	-3,857	
5.33%	-3,691	-4,102	-4,534	-4,983	-5,444	-5,917	-6,398	
8.00%	-6,835	-7,161	-7,518	-7,902	-8,308	-8,731	-9,169	
KR4301Q12850		2020-01 풋285						8,868
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-8,745	-8,751	-8,761	-8,777	-8,800	-8,831	-8,868	
-5.33%	-4,781	-4,834	-4,899	-4,974	-5,058	-5,151	-5,251	
-2.67%	-1,428	-1,576	-1,728	-1,881	-2,035	-2,191	-2,348	
0%	424	287	145	0	-148	-299	-451	
2.67%	940	895	838	770	691	604	509	

5.33%	1,004	998	988	971	947	915	875
8.00%	1,007	1,007	1,006	1,004	999	992	981

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

(단위:백만원)

30,281

공시일	2019-12-17
기준일	2019-12-16

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

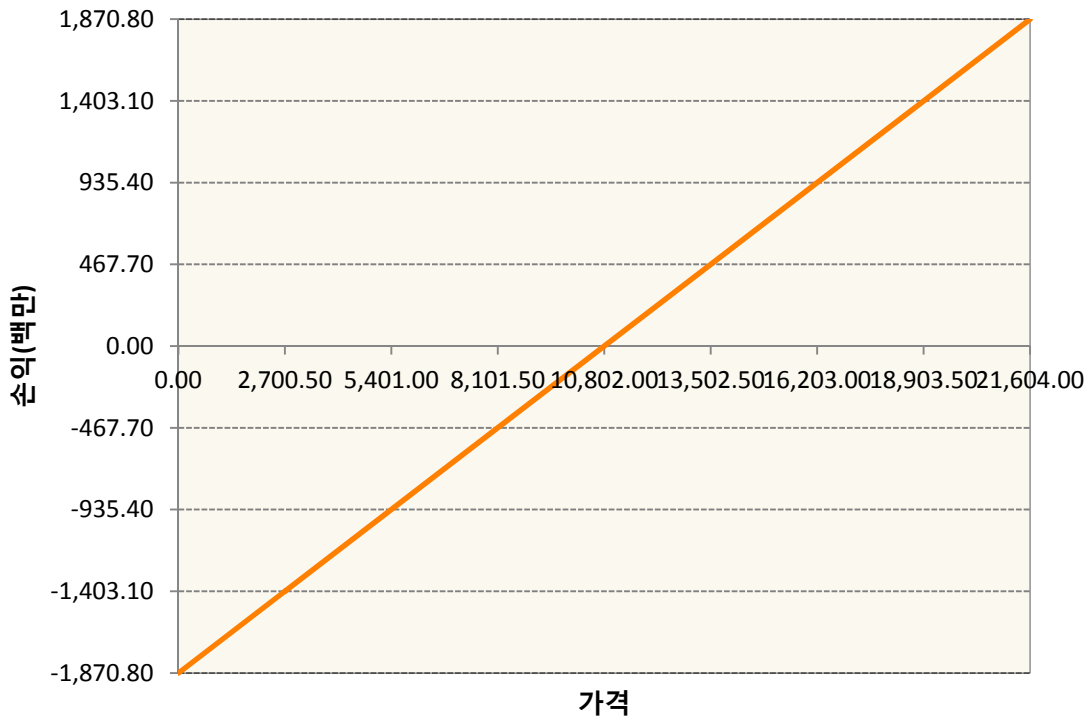
1. 계약금액

(단위:백만원)

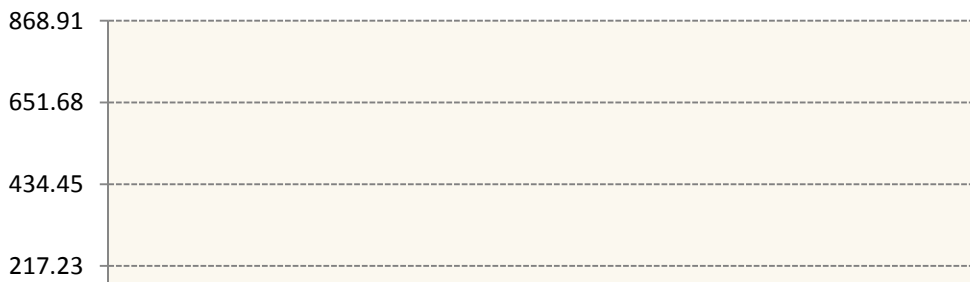
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,871	0	1,871	
누계	유가증권	옵션	0	4,928	-4,928	장내
누계	통화	선도	0	2,119	-2,119	장외

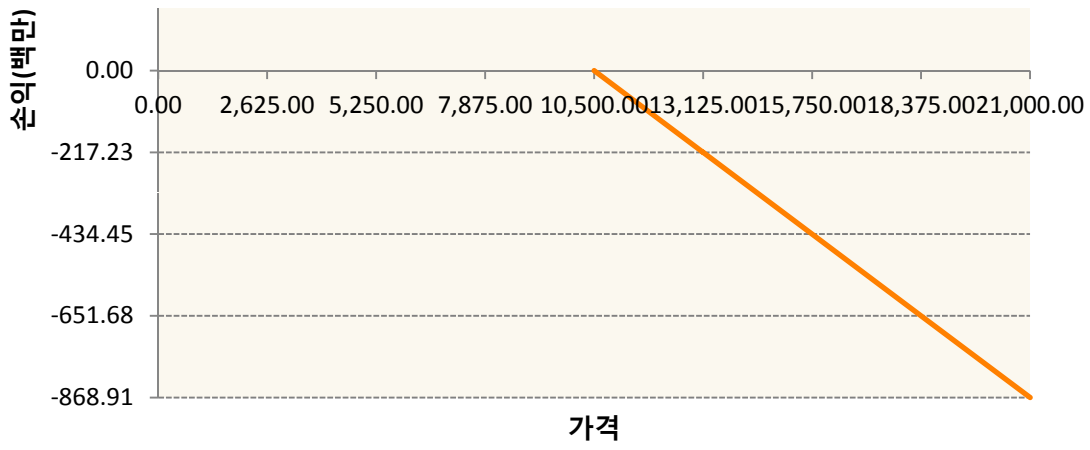
2. 만기시점의 손익구조

HCZ9-HSCEI Futures Dec19

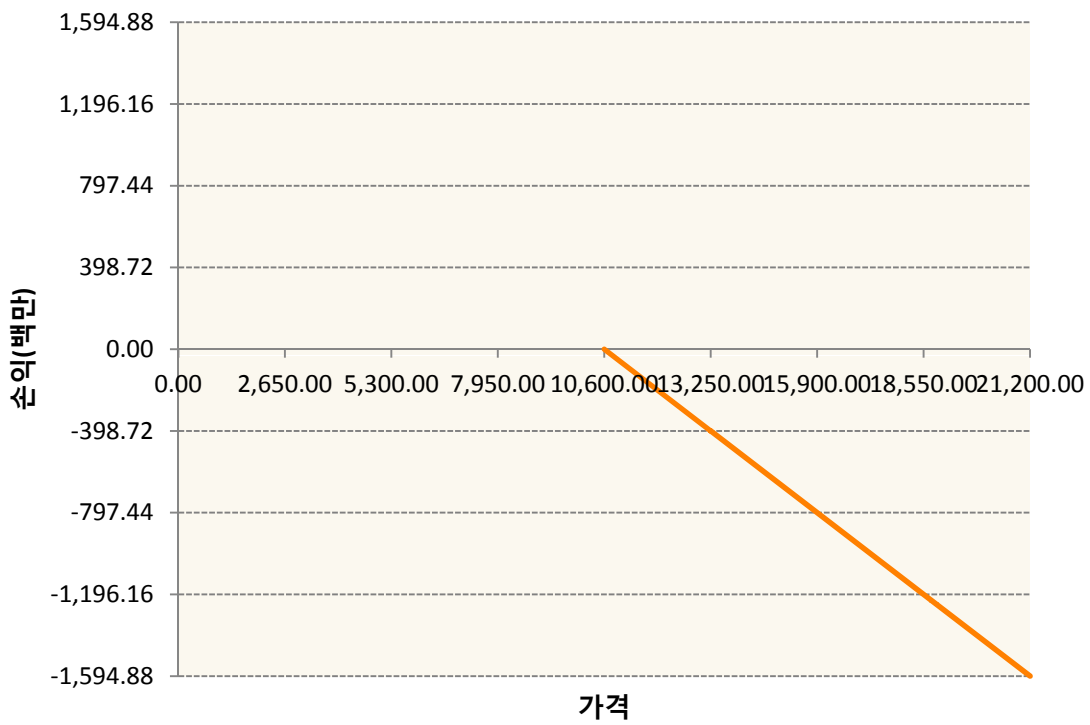


OHHIZ9-C105-HSCEI

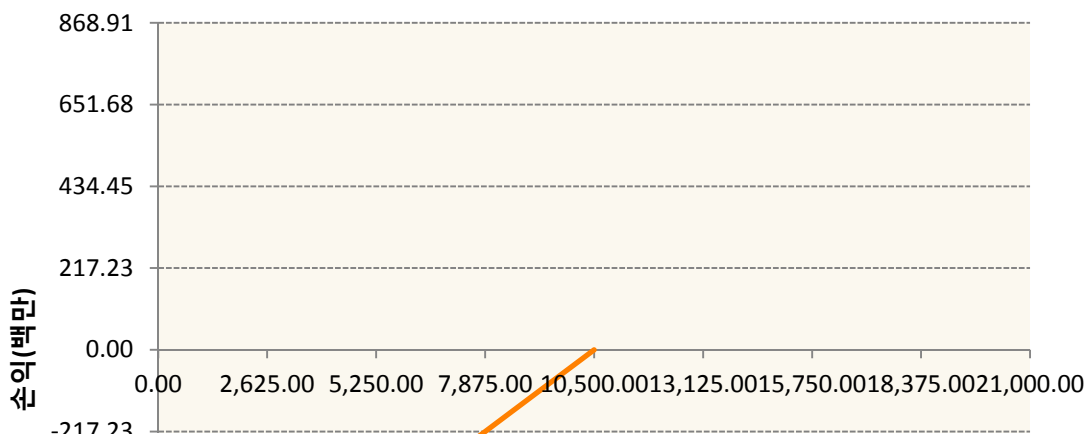


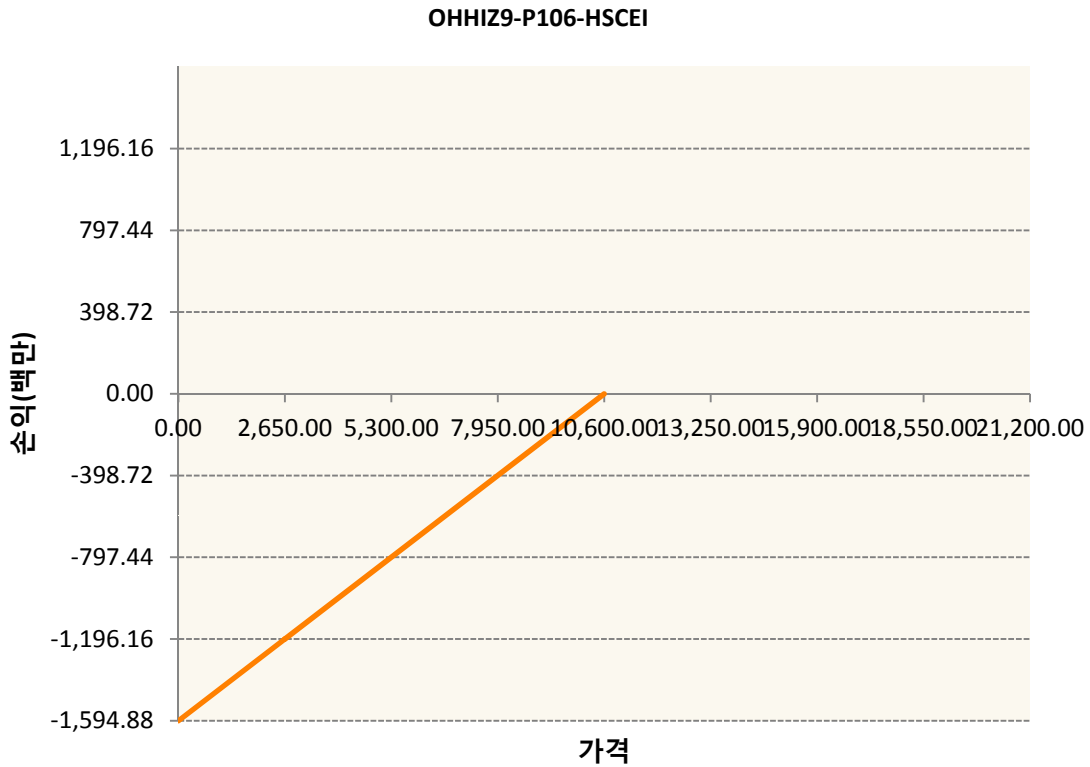
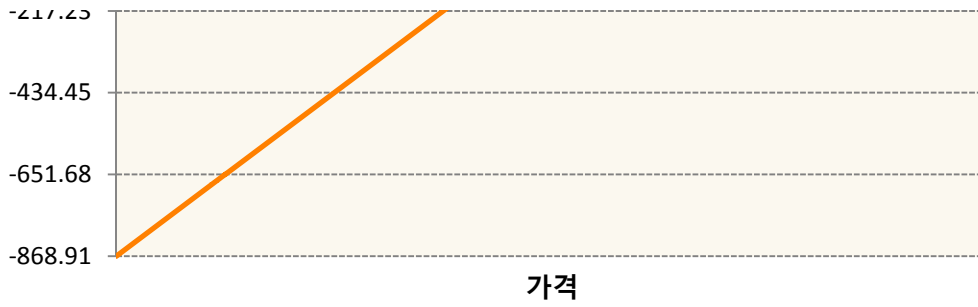


OHHIZ9-C106-HSCEI



OHHIZ9-P105-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	169
HCZ9 HSCEI Futures Dec19	150
OHHIZ9-C1C HSCEI	70
OHHIZ9-C1C HSCEI	128
OHHIZ9-P10 HSCEI	70
OHHIZ9-P10 HSCEI	128

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

공시일	2019-12-17
기준일	2019-12-16

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

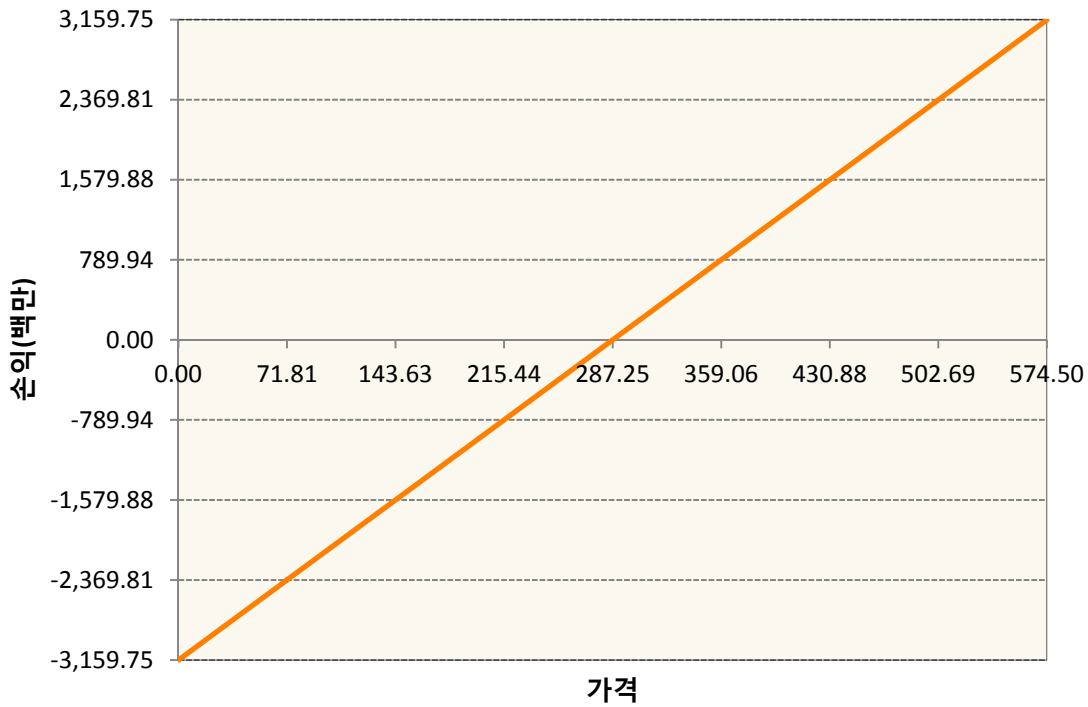
1. 계약금액

(단위:백만원)

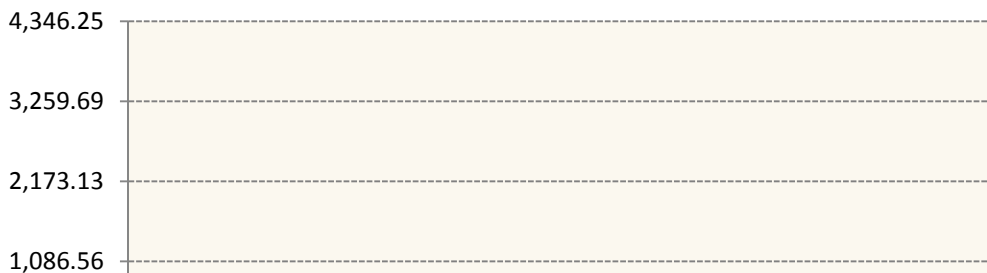
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,160	0	3,160	장내
누계	유가증권	스왑	8,625	0	8,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,266	-9,266	장내

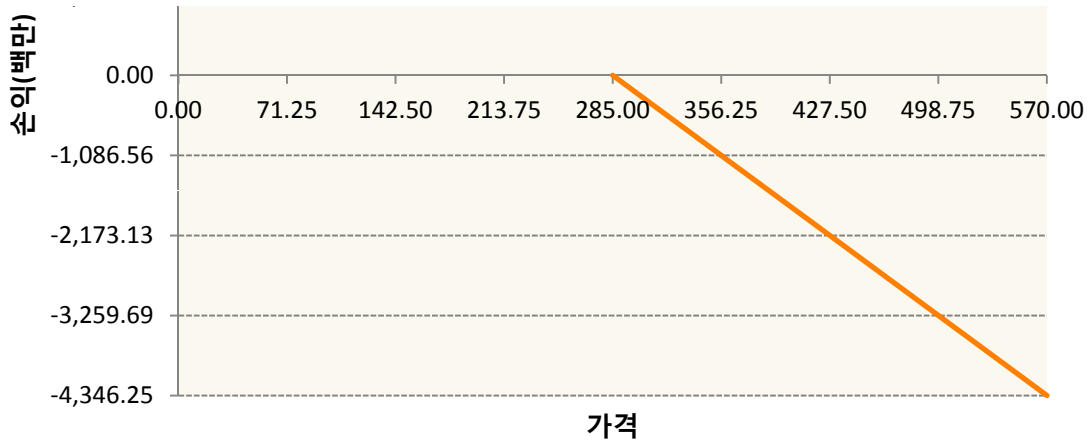
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

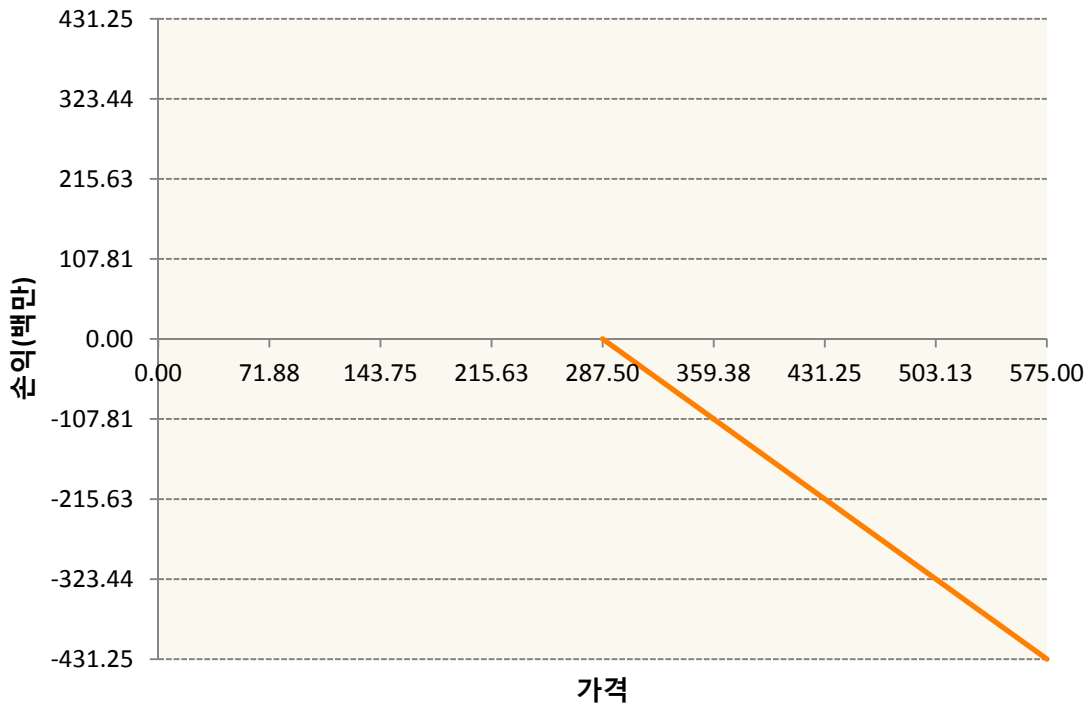


KR4201Q12852-2020-01 콜285

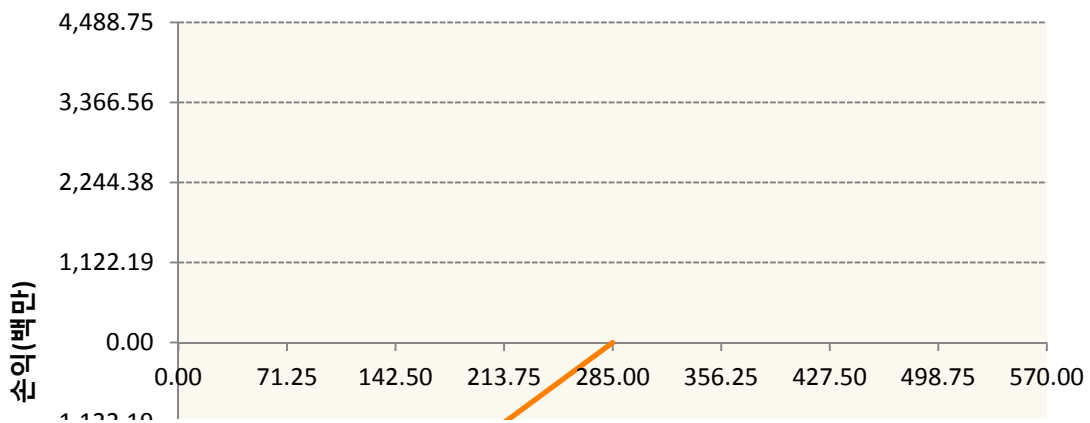




KR4201Q12878-2020-01 콜287.5



KR4301Q12850-2020-01 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						752
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-752	-752	-752	-752	-752	-752	-752	
-5.33%	-501	-501	-501	-501	-501	-501	-501	
-2.67%	-251	-251	-251	-251	-251	-251	-251	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	251	251	251	251	251	251	251	
5.33%	501	501	501	501	501	501	501	
8.00%	752	752	752	752	752	752	752	
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%	153	147	142	135	129	122	114	
-5.33%	132	124	116	107	98	89	79	
-2.67%	93	83	72	62	52	42	31	
0%	31	20	10	0	-10	-21	-31	
2.67%	-53	-61	-70	-79	-88	-97	-107	
5.33%	-153	-159	-165	-171	-178	-186	-194	
8.00%	-263	-266	-270	-274	-279	-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%	13	13	12	12	11	11	10
-5.33%	12	11	10	9	9	8	7
-2.67%	8	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							266
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-262	-263	-263	-263	-264	-265	-266
-5.33%	-143	-145	-147	-149	-152	-155	-158
-2.67%	-43	-47	-52	-56	-61	-66	-70
0%	13	9	4	0	-4	-9	-14
2.67%	28	27	25	23	21	18	15
5.33%	30	30	30	29	28	27	26
8.00%	30	30	30	30	30	30	29

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

(단위:백만원)

1,535

공시일	2019-12-17
기준일	2019-12-16

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

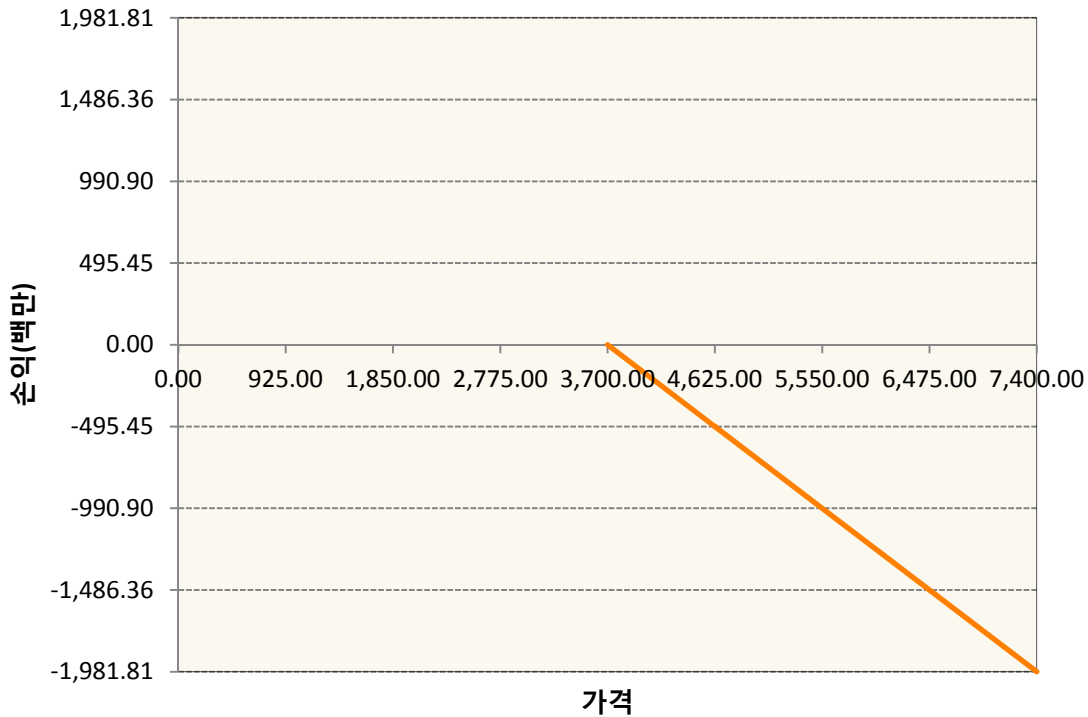
1. 계약금액

(단위:백만원)

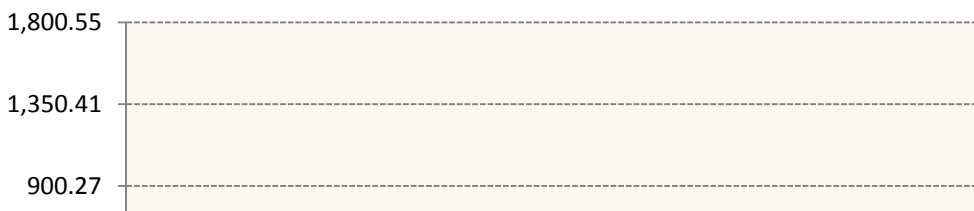
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	725	0	725	
누계	유가증권	스왑	17,863	0	17,863	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,565	-7,565	장내
누계	통화	선도	2,712	6,140	-3,428	장외

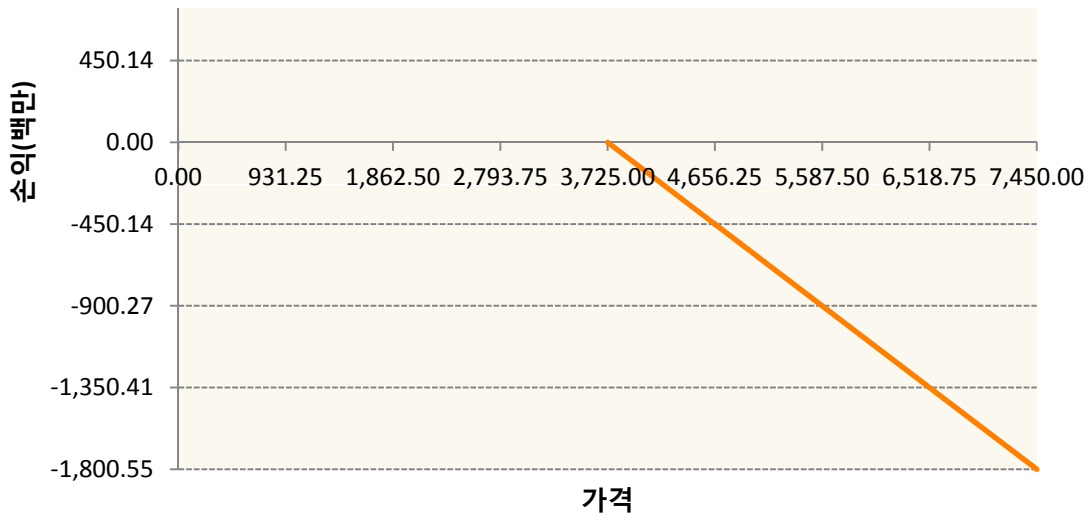
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ9-C3700-EURO STOXX 50

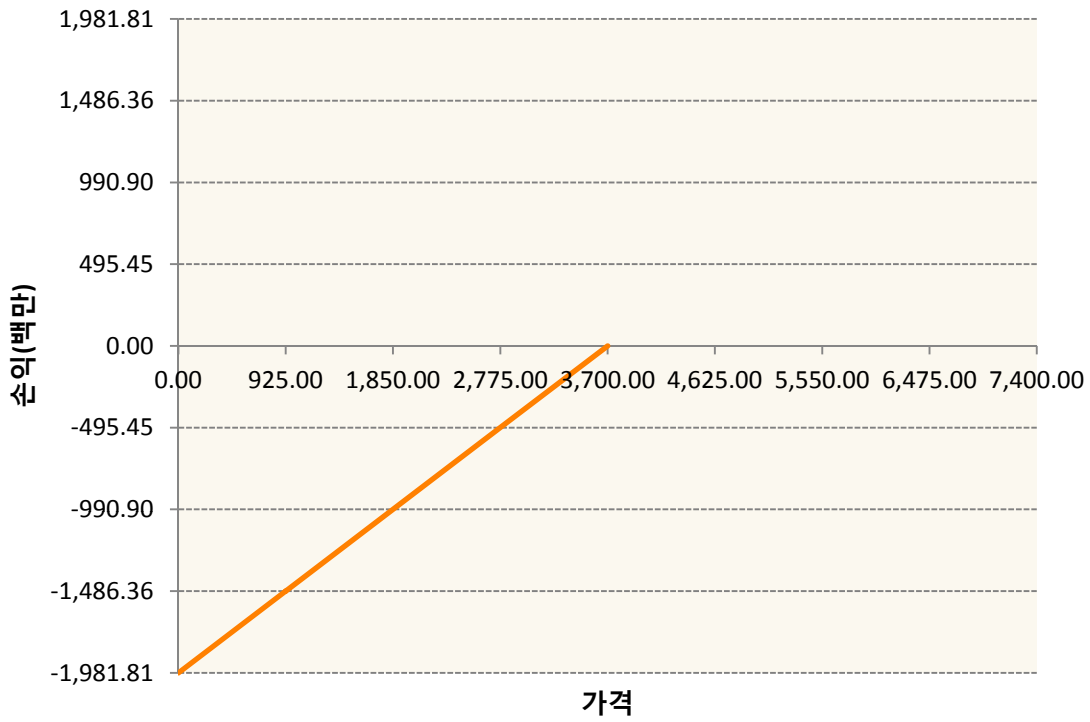


OESXZ9-C3725-EURO STOXX 50

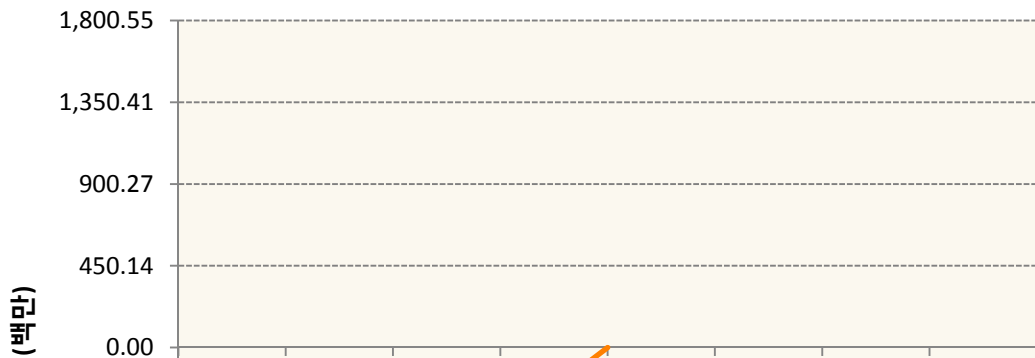


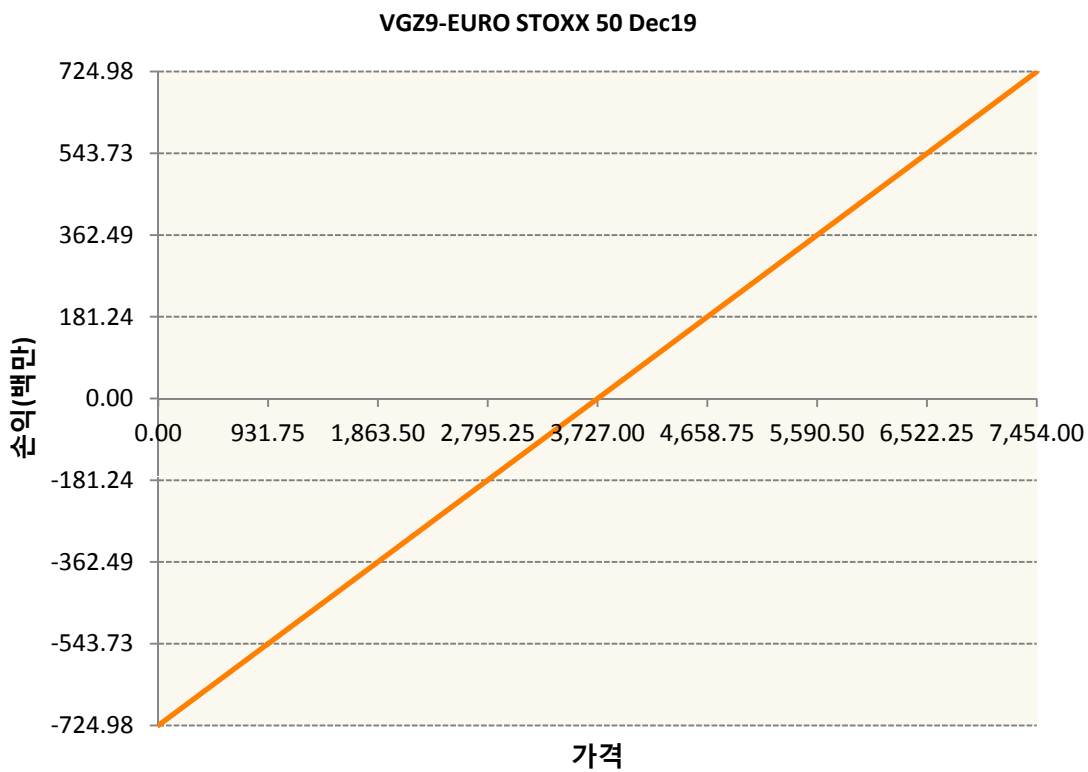
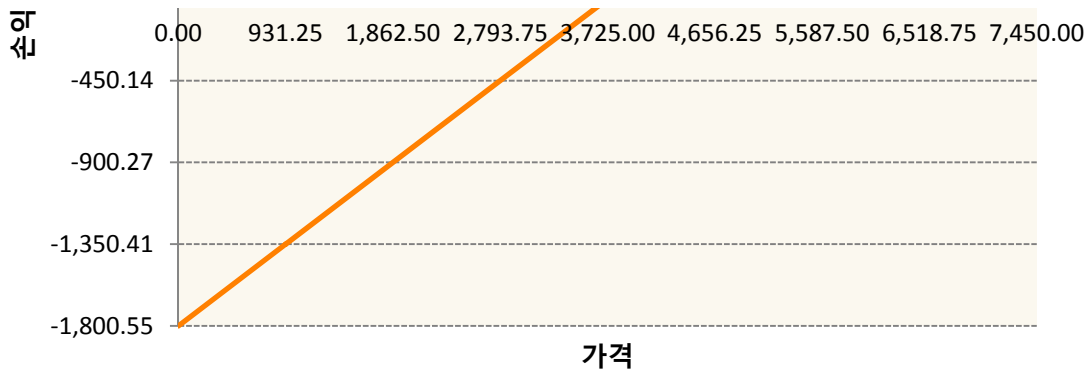


OESXZ9-P3700-EURO STOXX 50



OESXZ9-P3725-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	33
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E	491
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E	165
FX21019X02 EUR/KRW 27-12-19E	52
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	159
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	144
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	159
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	144
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19	58

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

(단위:백만원)

813

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

(단위:백만원)

937

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

(단위:백만원)

82

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

(단위:백만원)

128

공시일	2019-12-17
기준일	2019-12-16

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

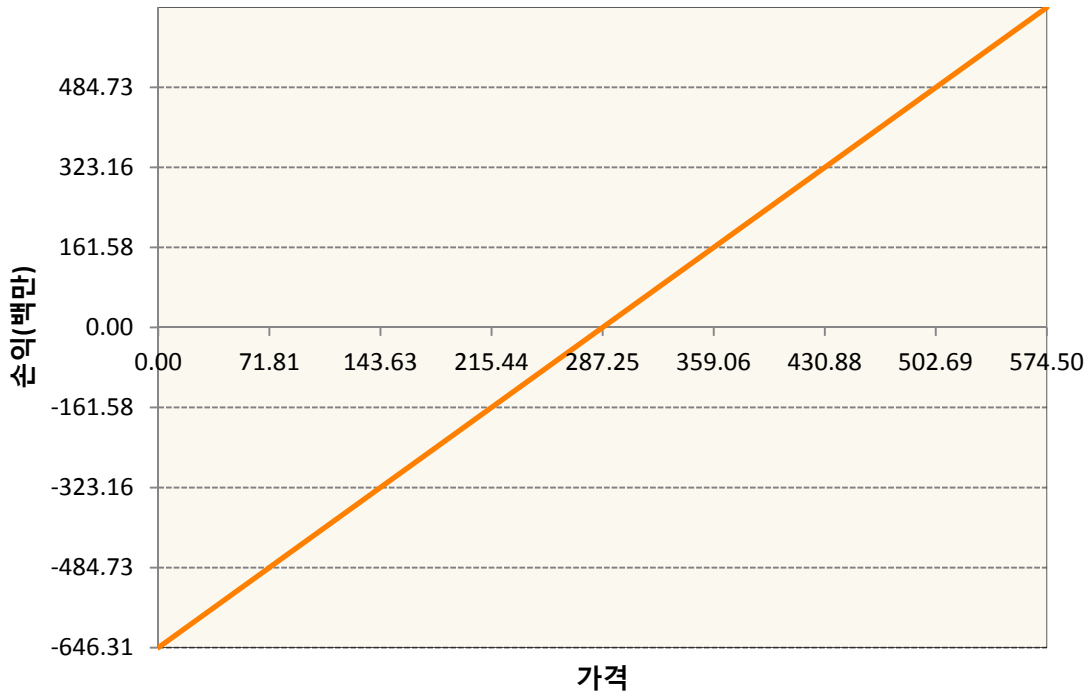
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	646	0	646	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005 2020-03 코스피200지수선물 52

가격	기초자산의 변동성						
	-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	2019-12-17
기준일	2019-12-16

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

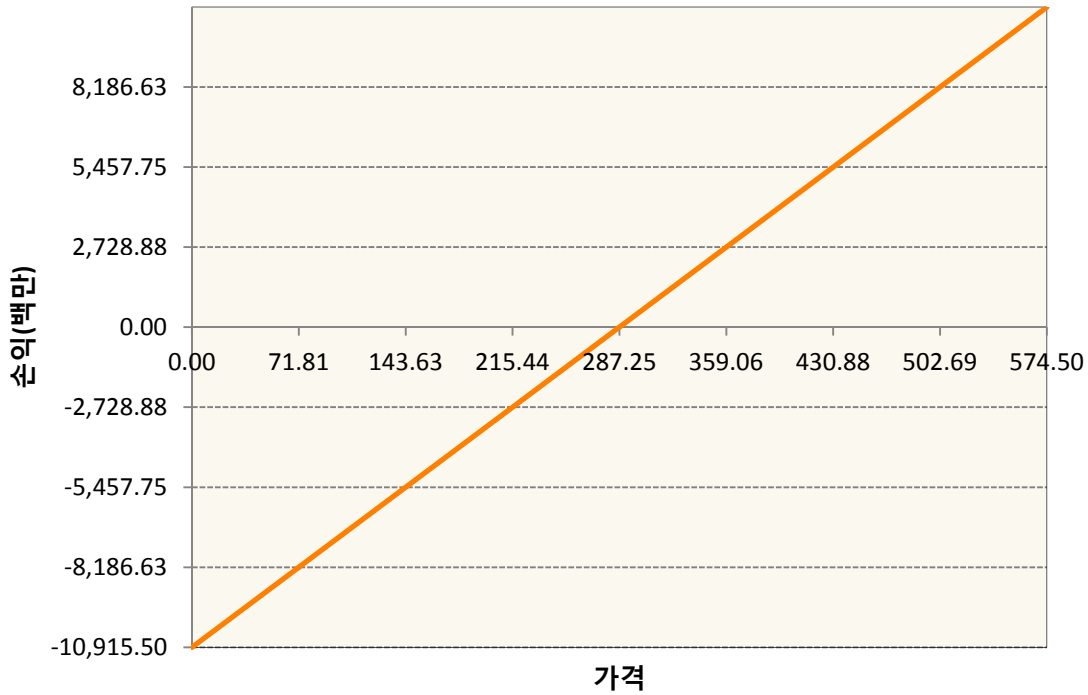
1. 계약금액

(단위:백만원)

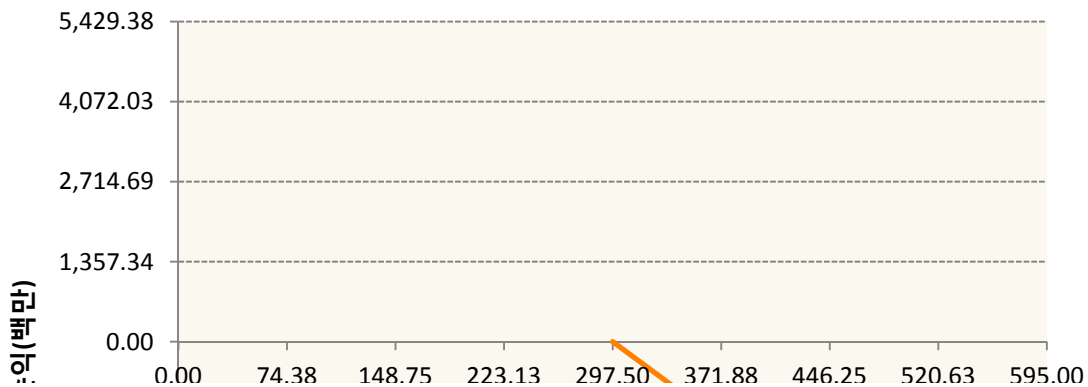
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,916	0	10,916	장내
누계	유가증권	옵션	499	21,254	-20,756	장내

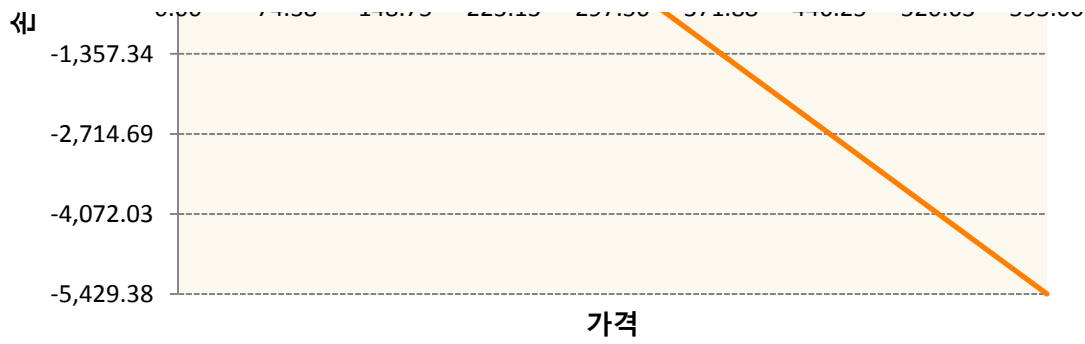
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

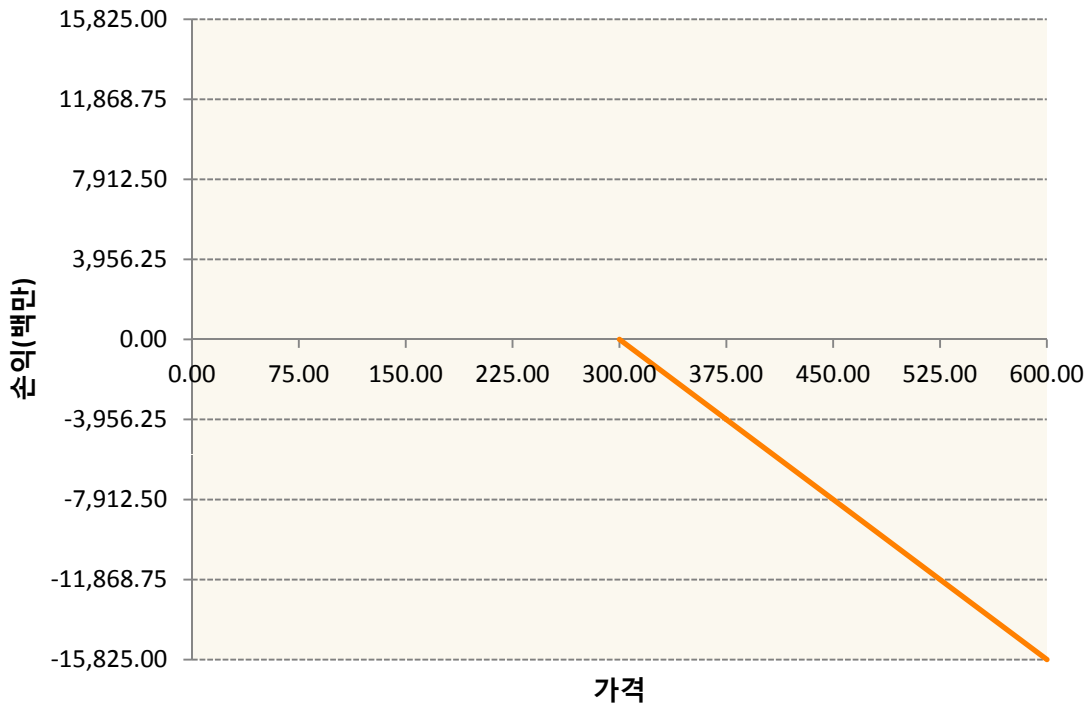


KR4201Q12977-2020-01 콜297.5

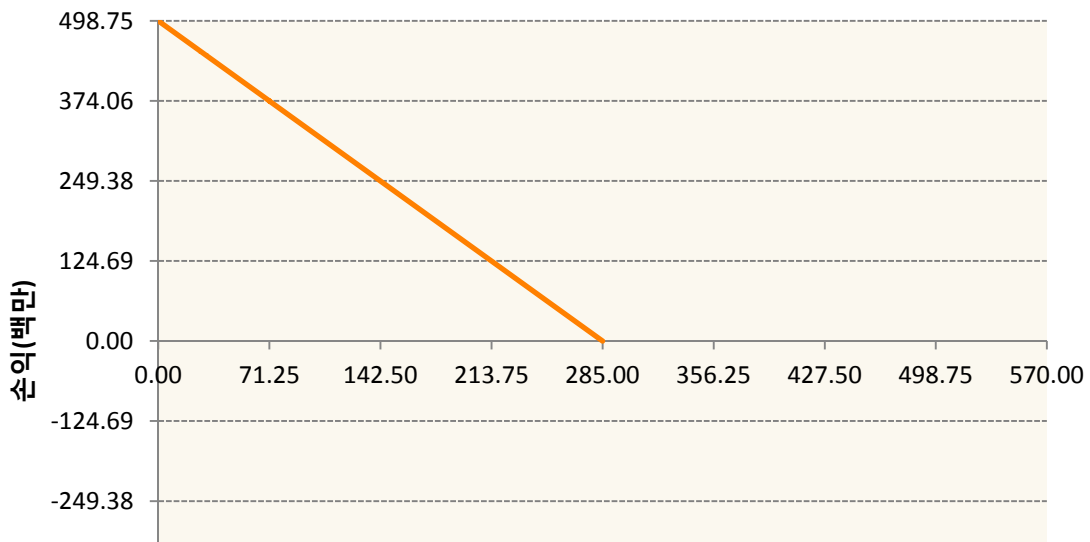


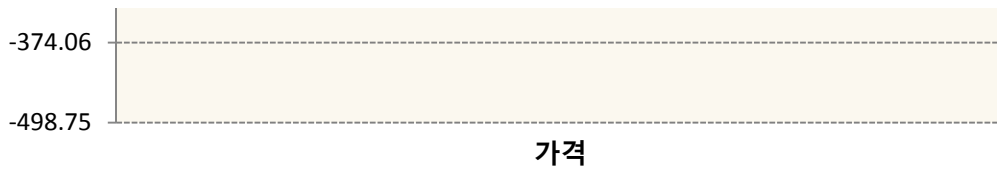


KR4201Q13009-2020-01 콜300



KR4301Q12850-2020-01 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						881
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-881	-881	-881	-881	-881	-881	-881	
-5.33%	-587	-587	-587	-587	-587	-587	-587	
-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%	587	587	587	587	587	587	587	
8.00%	881	881	881	881	881	881	881	
KR4201Q12977		2020-01 콜297.5						277
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	91	89	86	83	78	73	68	
-5.33%	85	80	75	69	62	54	46	
-2.67%	69	61	52	42	33	22	12	
0%	35	24	12	0	-12	-24	-36	
2.67%	-23	-36	-49	-62	-75	-88	-101	
5.33%	-107	-119	-131	-144	-156	-169	-181	
8.00%	-214	-223	-233	-244	-254	-265	-277	
KR4201Q13009		2020-01 콜300						753
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	222	218	212	203	193	181	166	
-5.33%	210	199	186	170	153	133	112	
-2.67%	174	154	131	107	81	53	25	
0%	96	65	33	0	-33	-67	-102	
2.67%	-48	-85	-123	-160	-198	-236	-273	
5.33%	-267	-304	-341	-378	-416	-453	-491	
8.00%	-557	-587	-618	-651	-684	-718	-753	
KR4301Q12850		2020-01 풋285						30
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	29	29	29	29	29	29	30	
-5.33%	16	16	16	17	17	17	18	
-2.67%	5	5	6	6	7	7	8	

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

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

(단위:백만원)

1,596

공시일	2019-12-17
기준일	2019-12-16

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	206,815	0	206,815	

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	2019-12-17
기준일	2019-12-16

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	215,880	0	215,880	

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	2019-12-17
기준일	2019-12-16

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	548,764	0	548,764	
누계	통화	선도	0	575,013	-575,013	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019V02 KRW/USD 23-12-19E		4,783
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,407
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,510
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		469
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		938
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		1,538
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		1,876
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		3,226
FX21019X02 KRW/USD 26-12-19E		4,727
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		4,783
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		188
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,814
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,814
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,345
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,532
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E		1,632
FX21019Z00 KRW/USD 10-01-20E		1,125
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E		1,538
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E		938
FX21019Z02 KRW/USD 16-01-20E		1,688
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		188
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		2,007
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		938

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

(단위:백만원)

14,838

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

(단위:백만원)

187

공시일	2019-12-17
기준일	2019-12-16

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

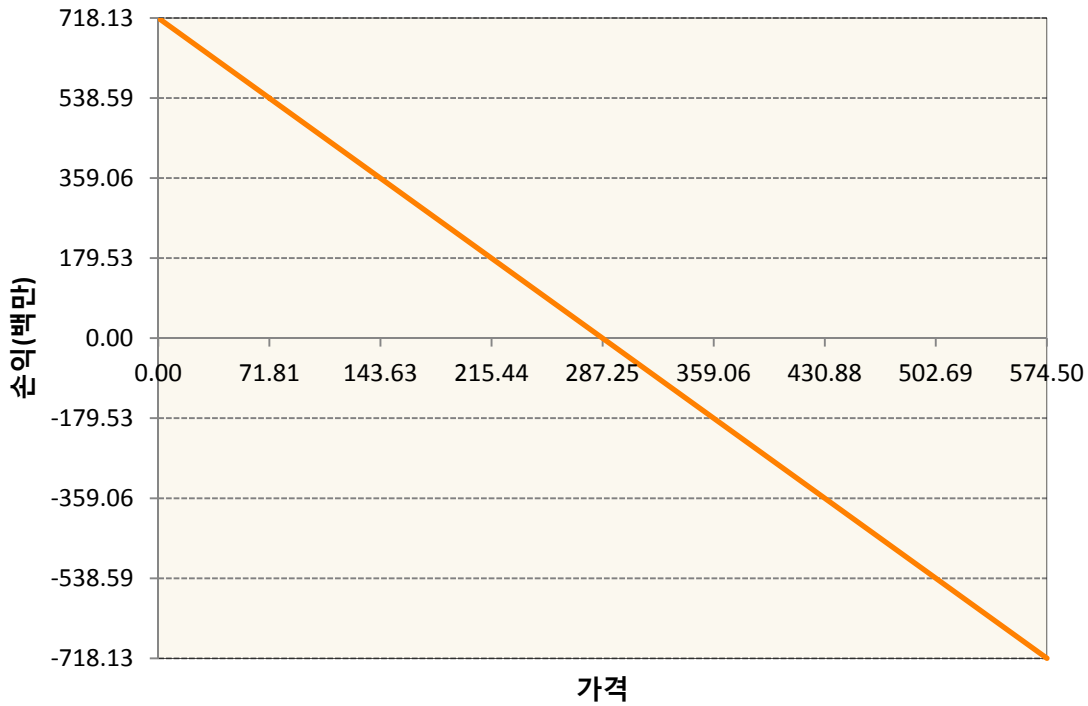
1. 계약금액

(단위:백만원)

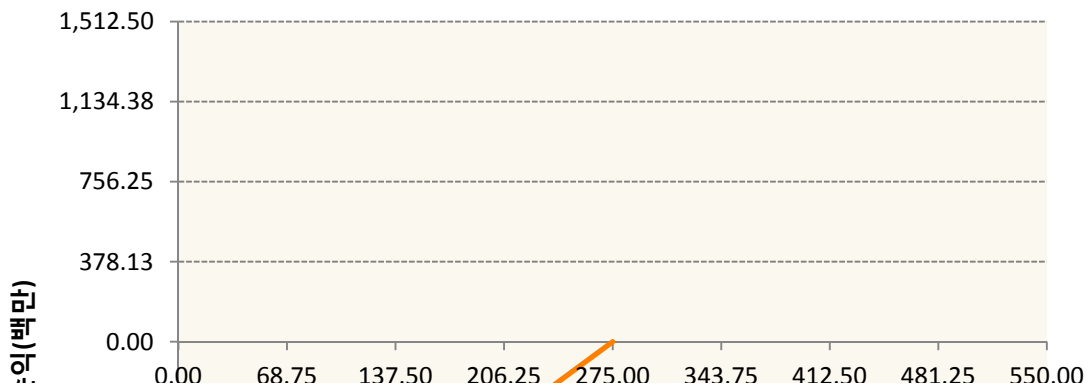
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	718	-718	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,010	-4,010	장내

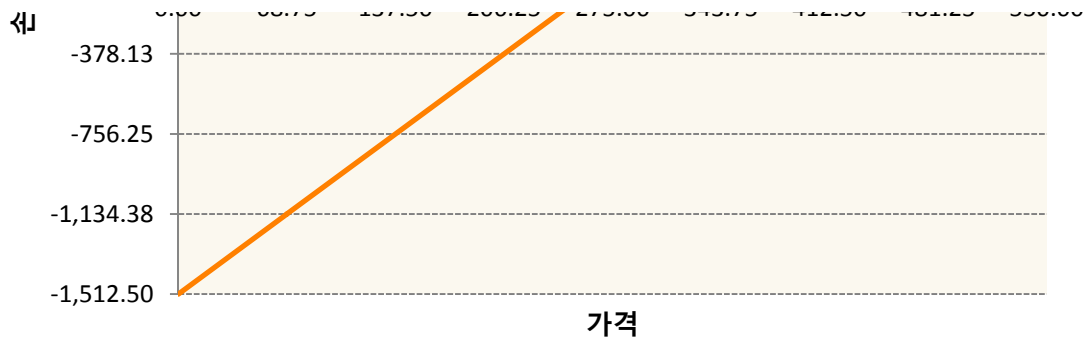
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

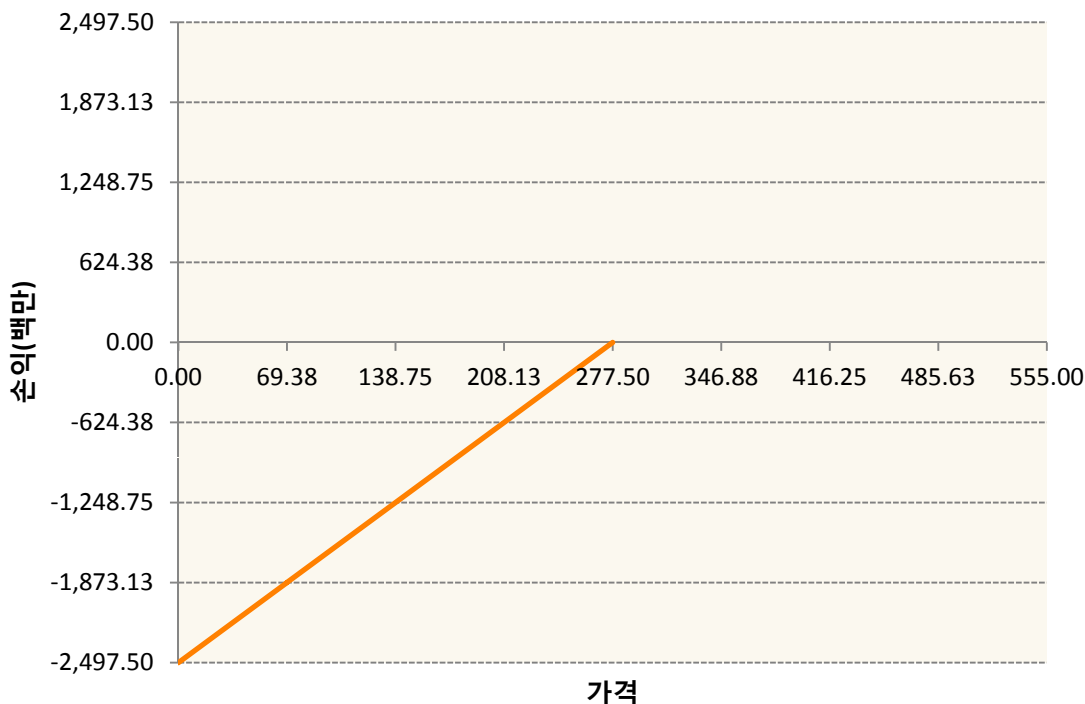


KR4301Q12751-2020-01 풋275





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						54
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-48	-48	-49	-50	-51	-52	-54
-5.33%	-16	-18	-19	-21	-23	-24	-26
-2.67%	-2	-3	-4	-5	-7	-8	-9
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

KR4301Q12777 2020-01 풋277.5 104

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-97	-98	-99	-100	-101	-103	-104
-5.33%	-39	-41	-44	-46	-49	-51	-54
-2.67%	-6	-8	-11	-13	-16	-18	-21
0%	3	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	4	4	4	3	3	2	2
5.33%	4	4	4	4	4	4	3
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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

(단위:백만원)

147

공시일	2019-12-17
기준일	2019-12-16

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	14,397	0	14,397	
누계	통화	선도	352	14,490	-14,138	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)

383

공시일	2019-12-17
기준일	2019-12-16

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	1,003	0	1,003	장외
누계	통화	선도	314	392	-78	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
FX21019Z02 KRW/EUR 28-02-20E	3

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

(단위:백만원)

79

공시일	2019-12-17
기준일	2019-12-16

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

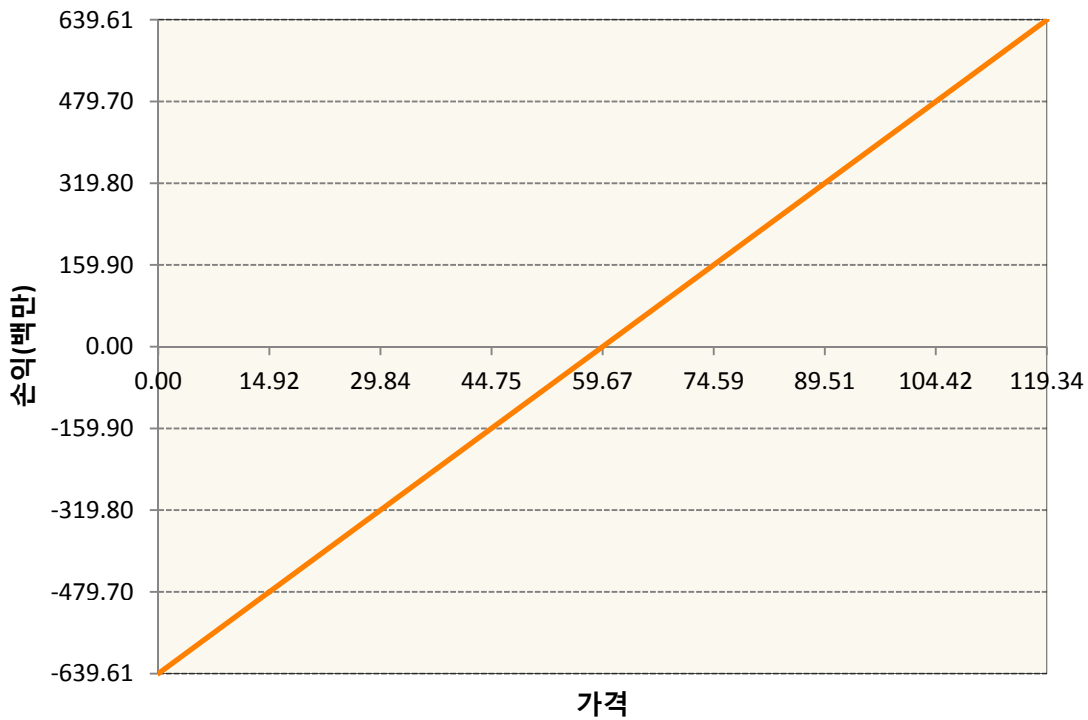
1. 계약금액

(단위:백만원)

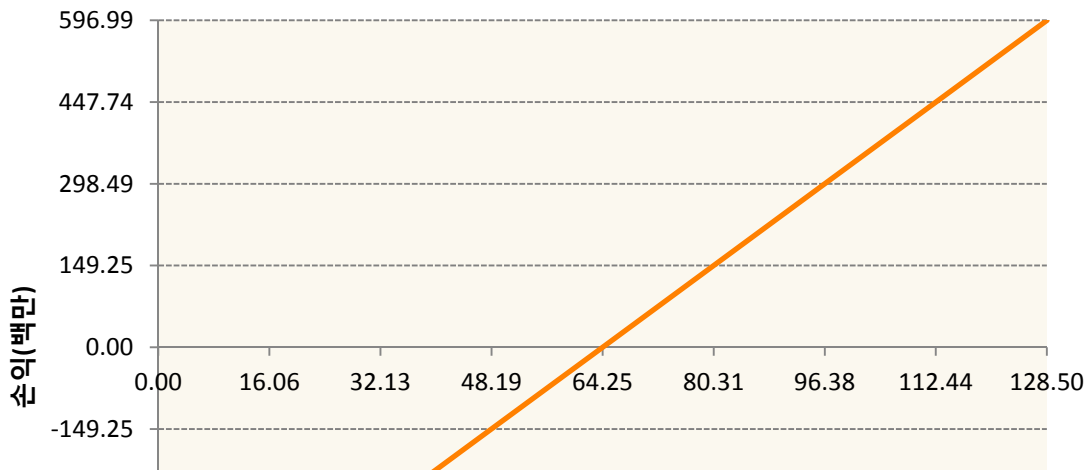
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,403	293	2,110	

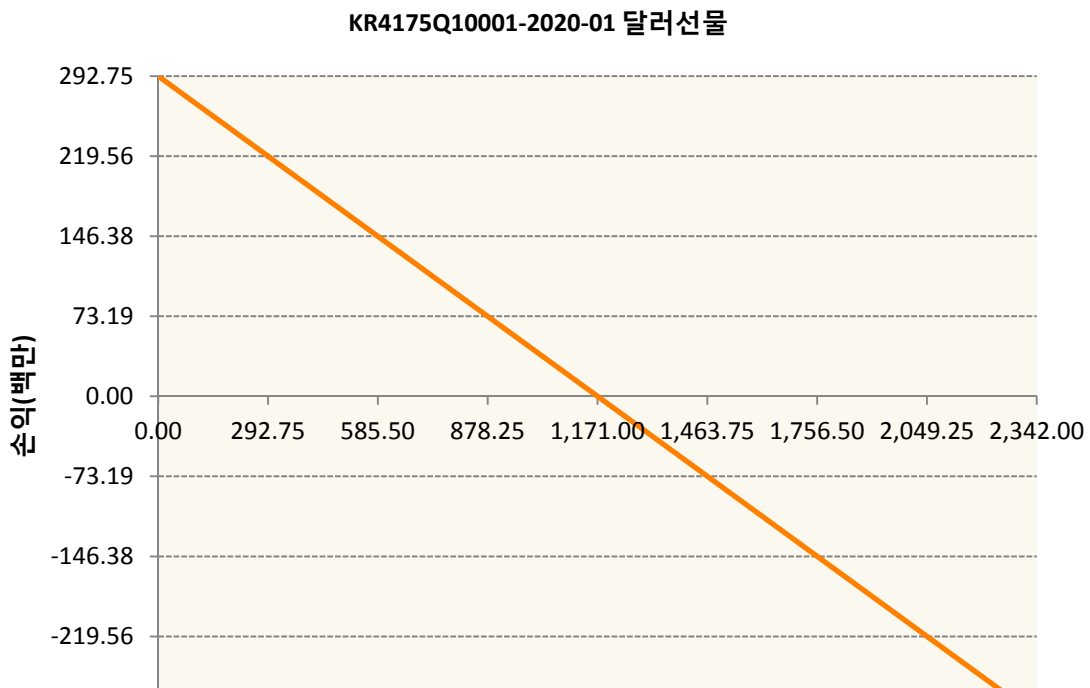
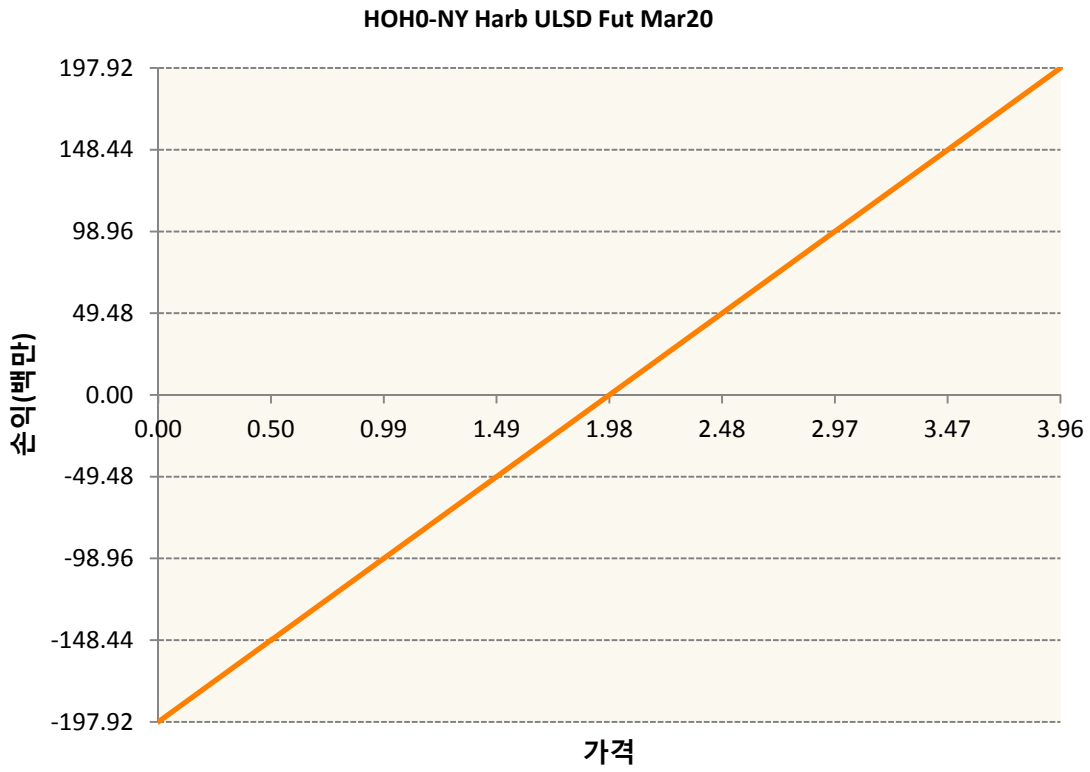
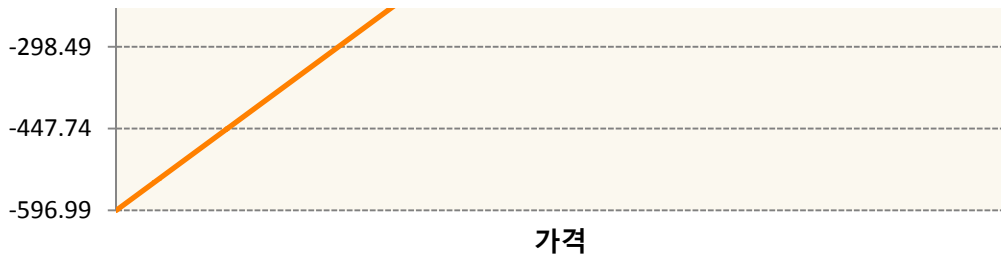
2. 만기시점의 손익구조

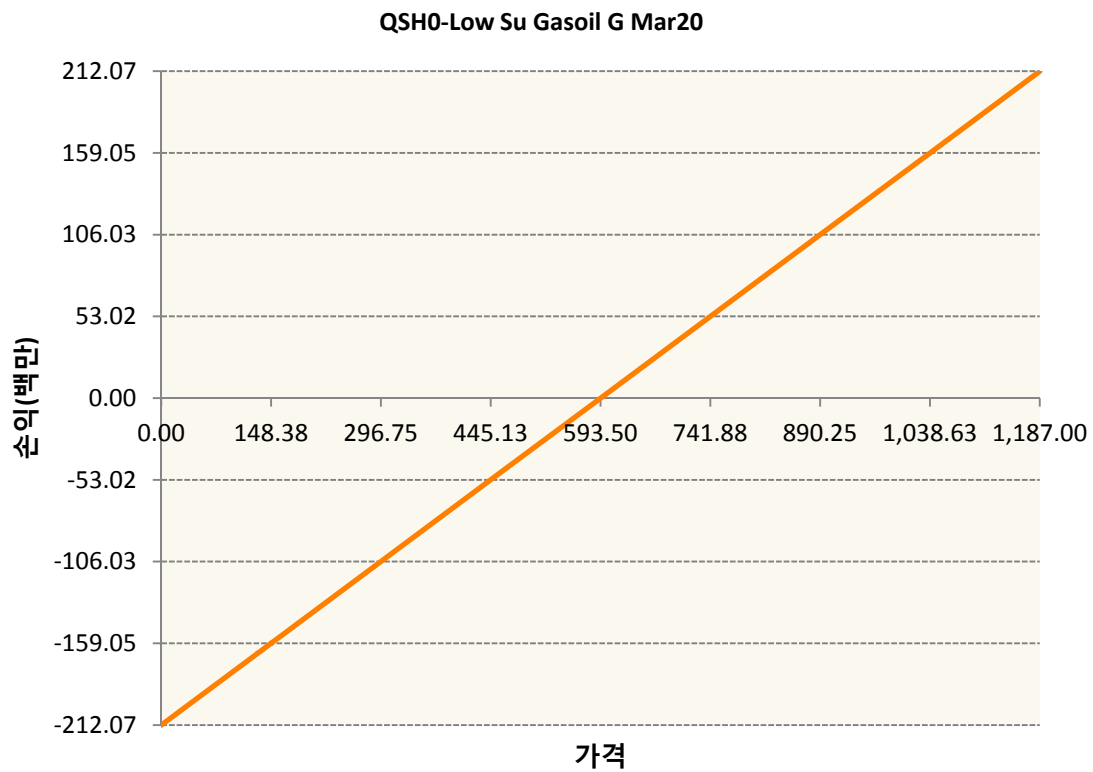
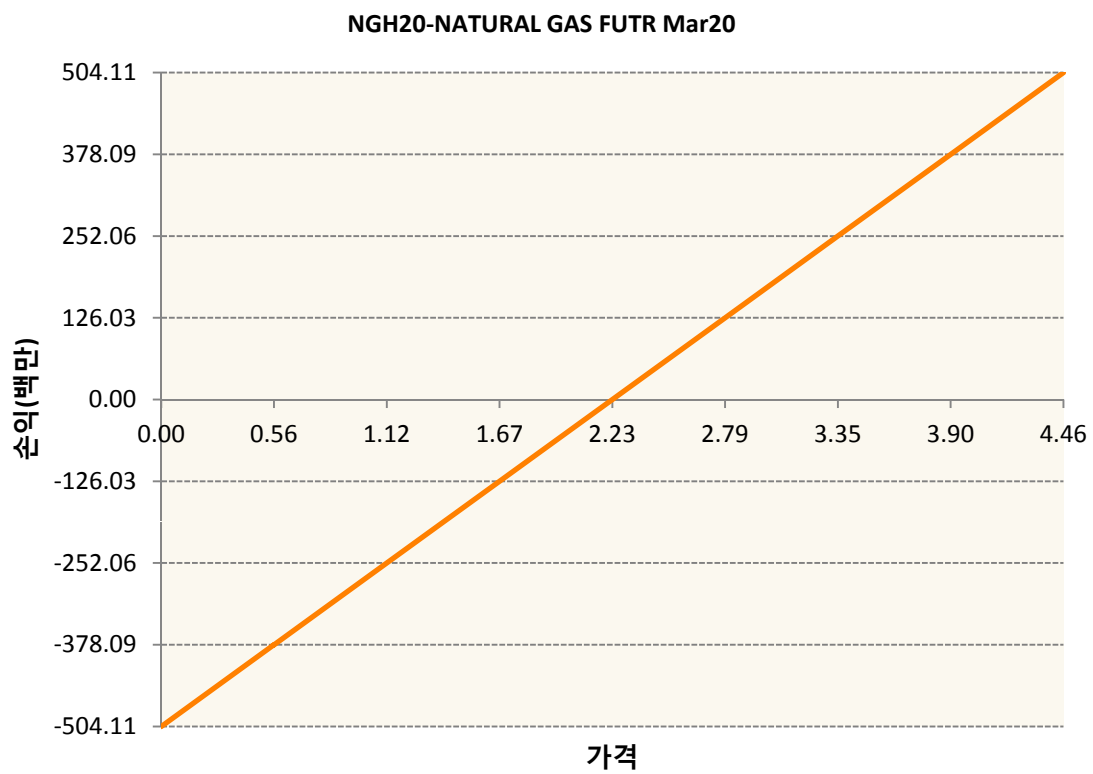
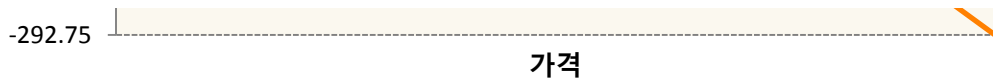
CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20



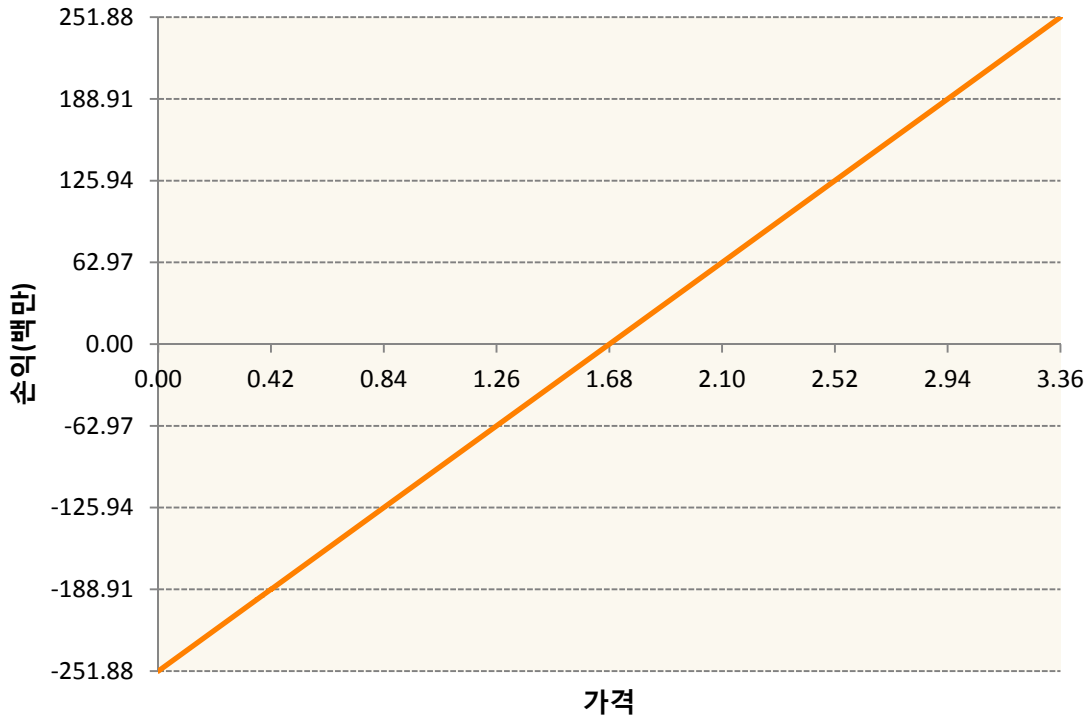
COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20







XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	51
COH0	BRENT CRUDE FUTR Mar20	48
HOH0	NY Harb ULSD Fut Mar20	16
KR4175Q10C	2020-01 달러선물	23
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)

388

공시일	2019-12-17
기준일	2019-12-16

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

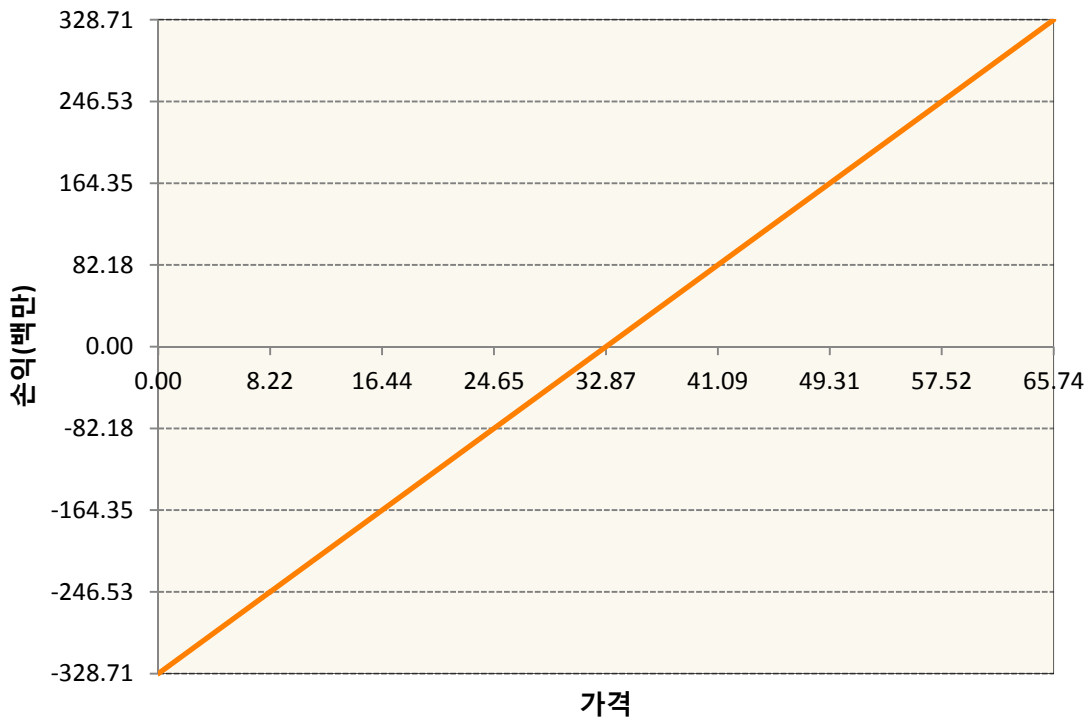
1. 계약금액

(단위:백만원)

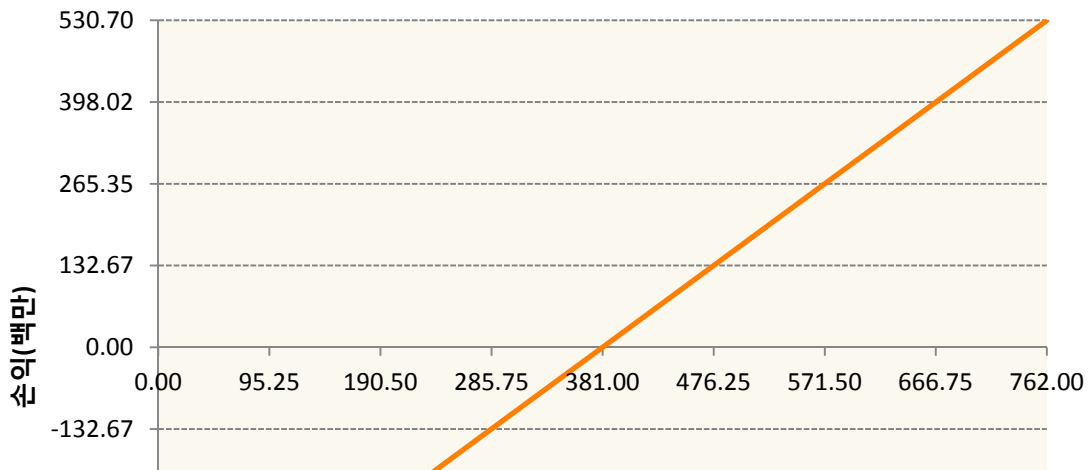
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,802	117	2,685	

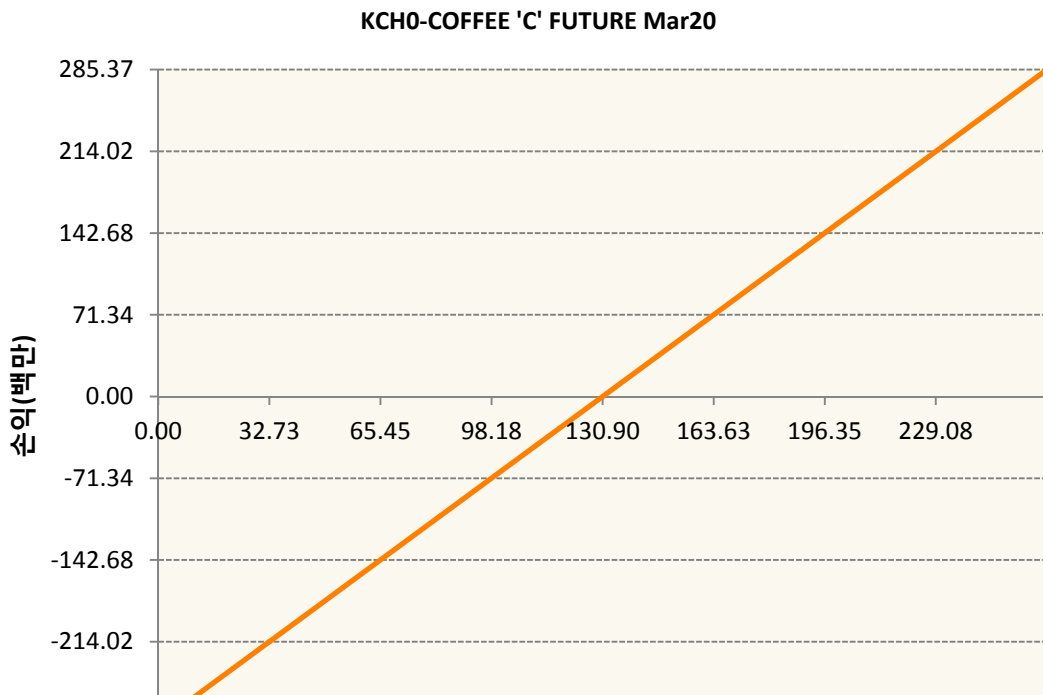
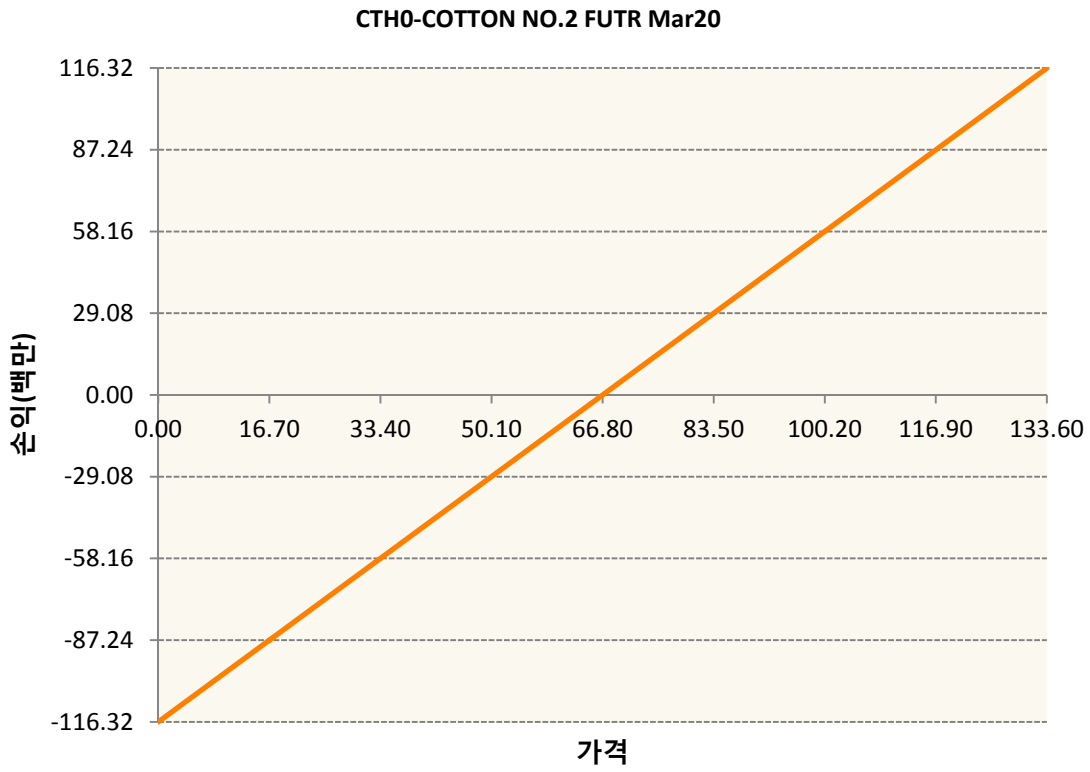
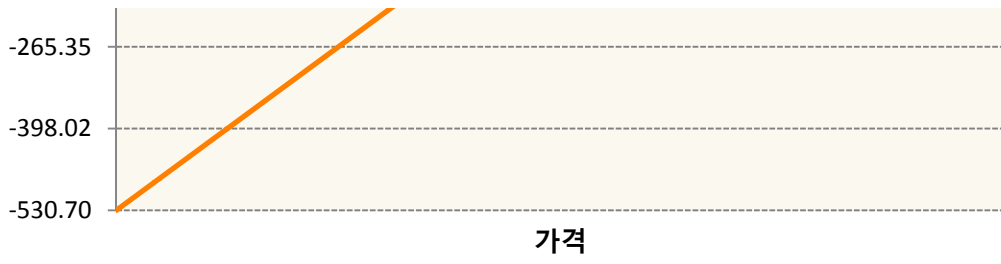
2. 만기시점의 손익구조

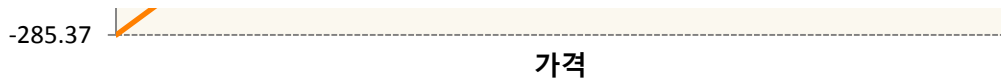
BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20



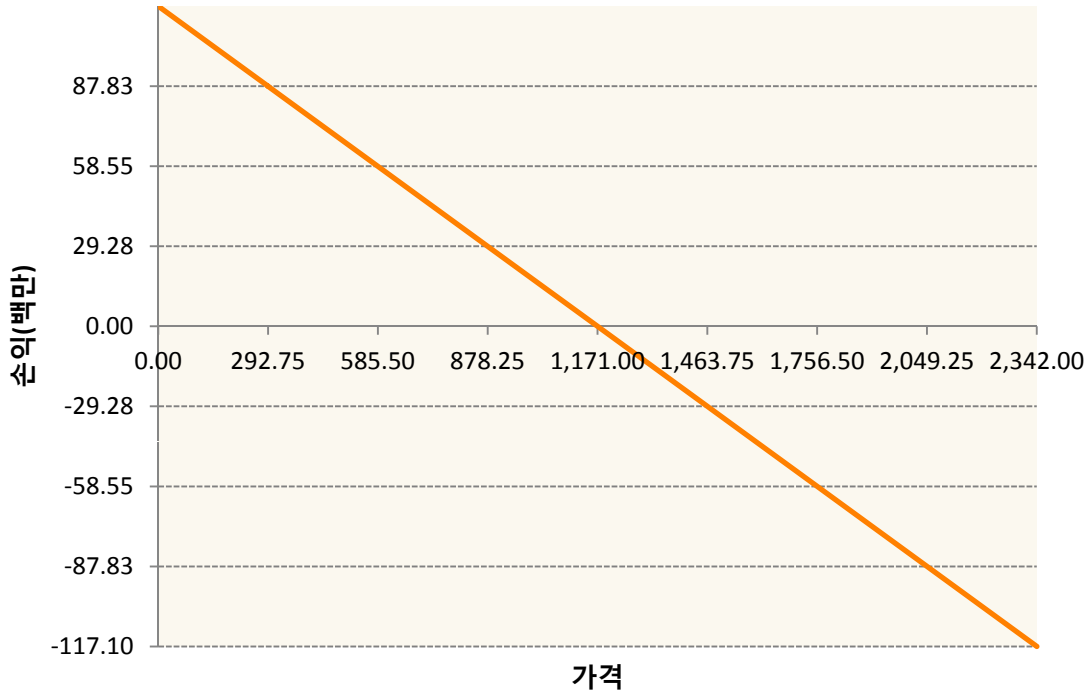
CH0-CORN FUTURE Mar20



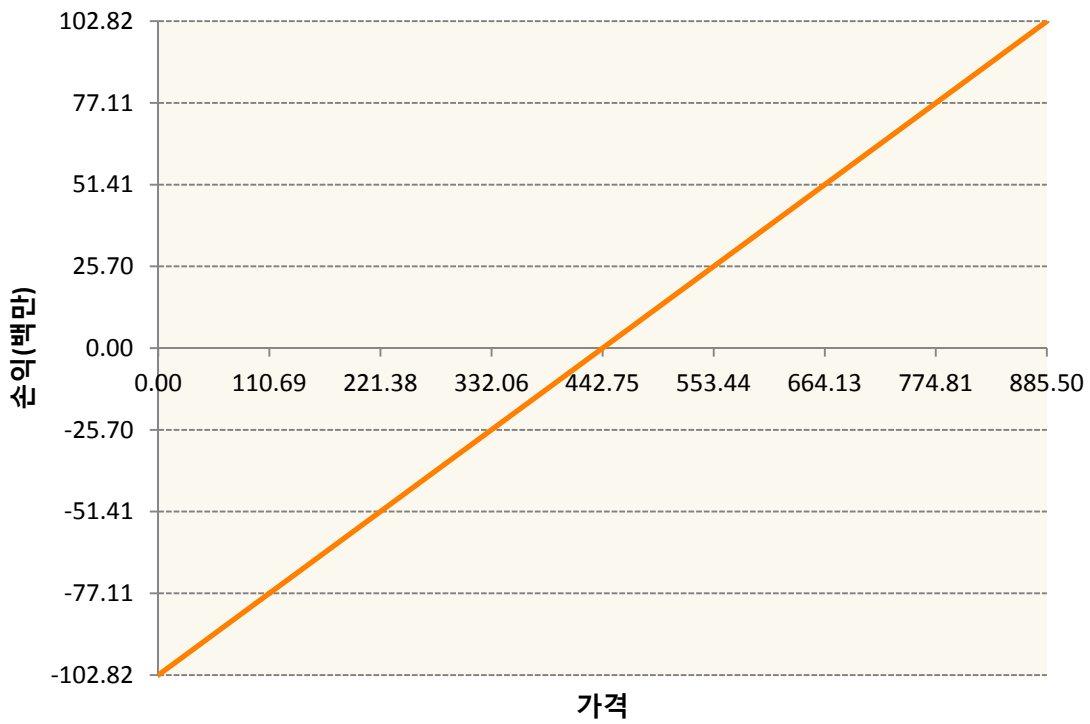




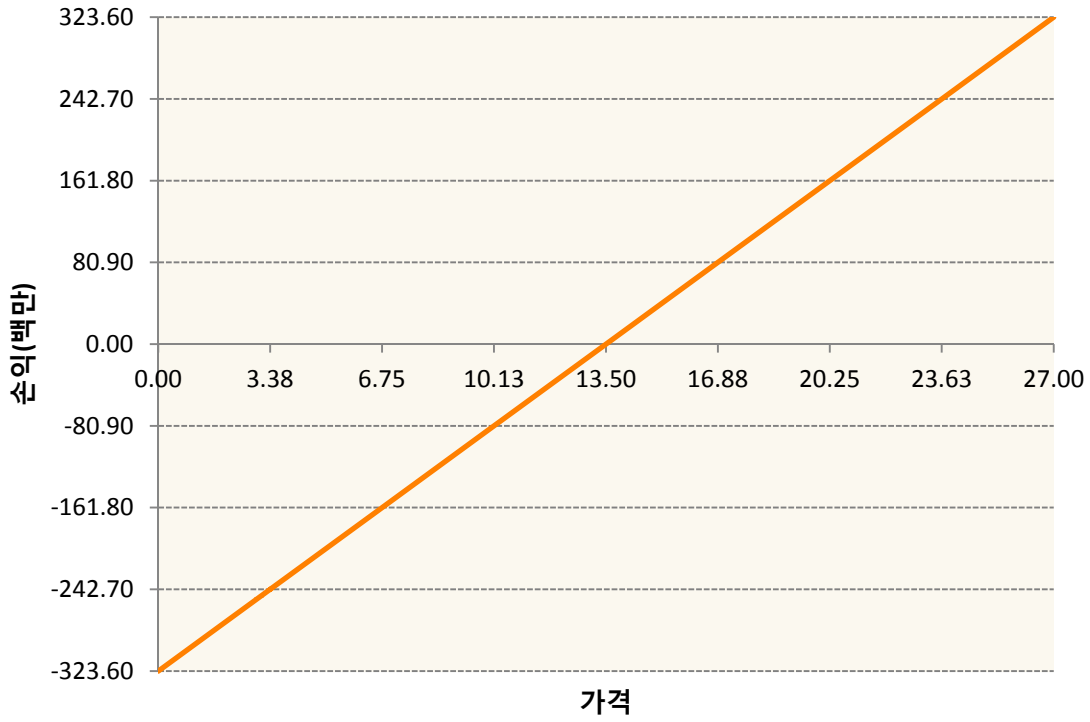
KR4175Q10001-2020-01 달러선물



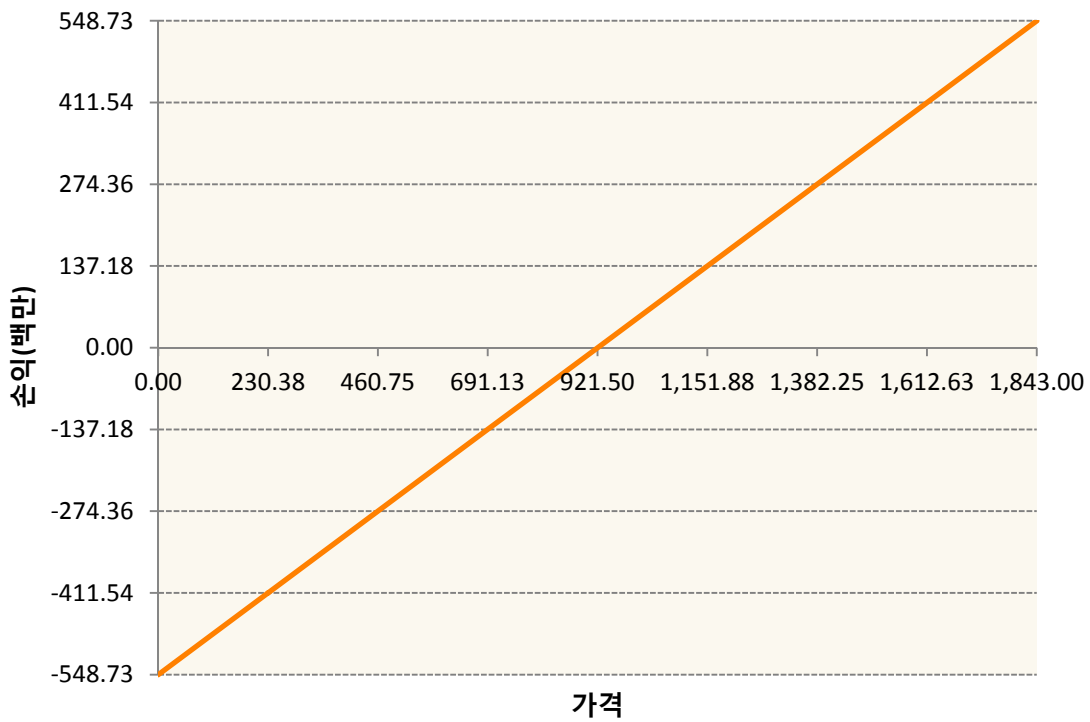
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



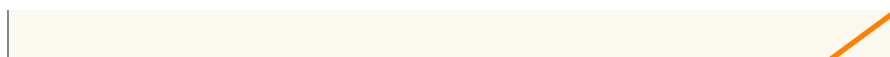
SBH0-Sugar Mar20

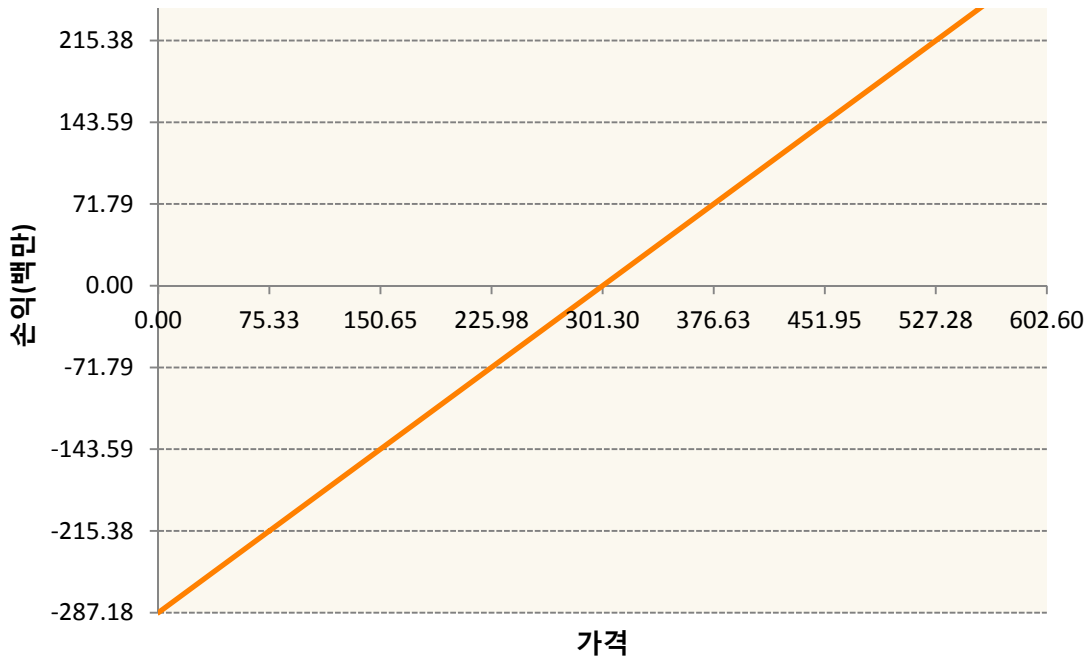


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20

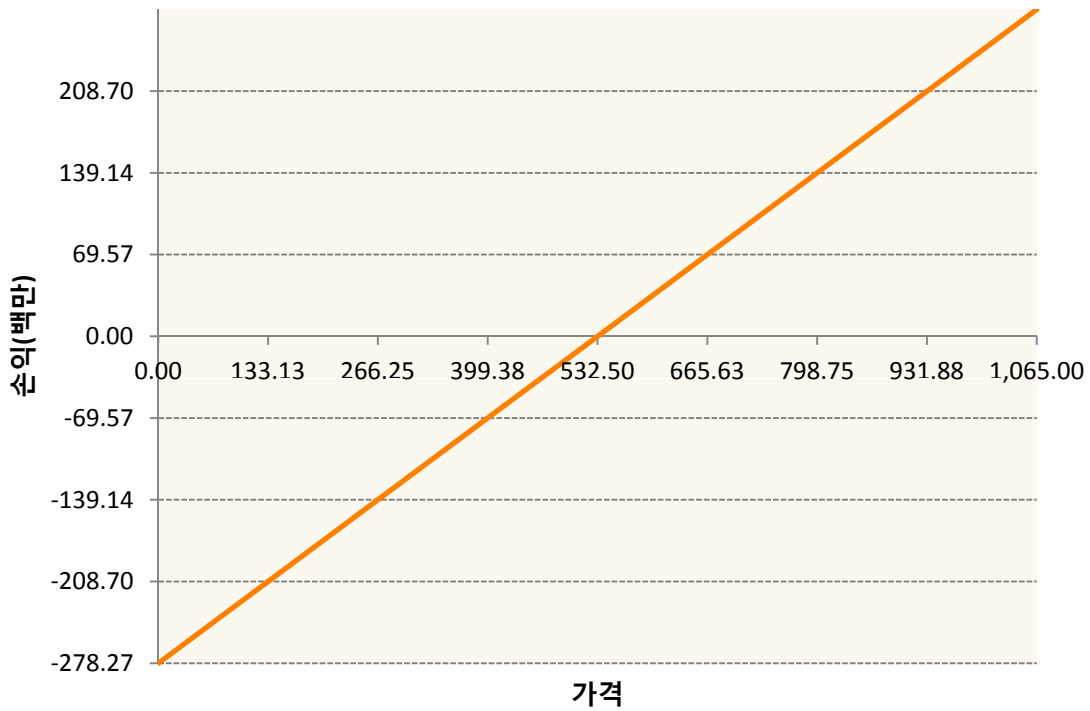


SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





WHO-WHEAT FUTURE(CBT) Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH0	SOYBEAN OIL FUTR Mar20	26
CH0	CORN FUTURE Mar20	42
CTH0	COTTON NO.2 FUTR Mar20	9
KCH0	COFFEE 'C' FUTURE Mar20	23
KR4175Q10C	2020-01 달러선물	9

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)

245