

공시일	2019-12-18
기준일	2019-12-17

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	2019-12-18
기준일	2019-12-17

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

1,119

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

646

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-18
기준일	2019-12-17

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)

401

SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)

147

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

765

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-18
기준일	2019-12-17

유로인덱스모(주식-파생형)

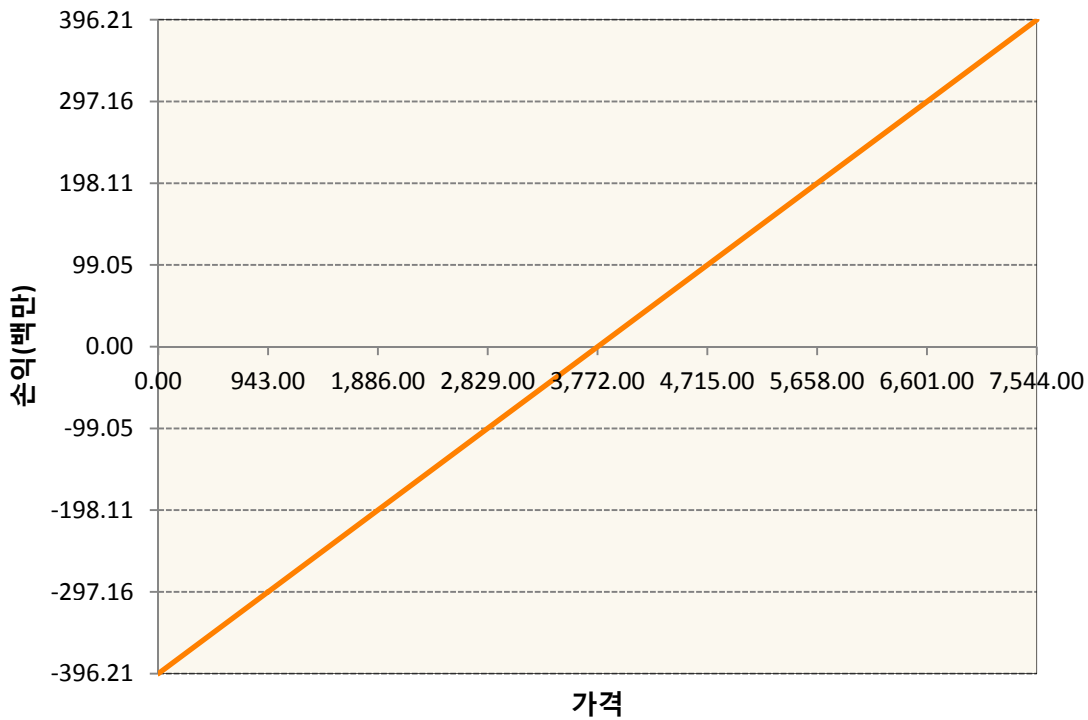
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	396	0	396	

2. 만기시점의 손익구조

VGZ9-EURO STOXX 50 Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ9	EURO STOXX 50 Dec19	32
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

22

공시일	2019-12-18
기준일	2019-12-17

차이나인덱스모(주식-파생형)

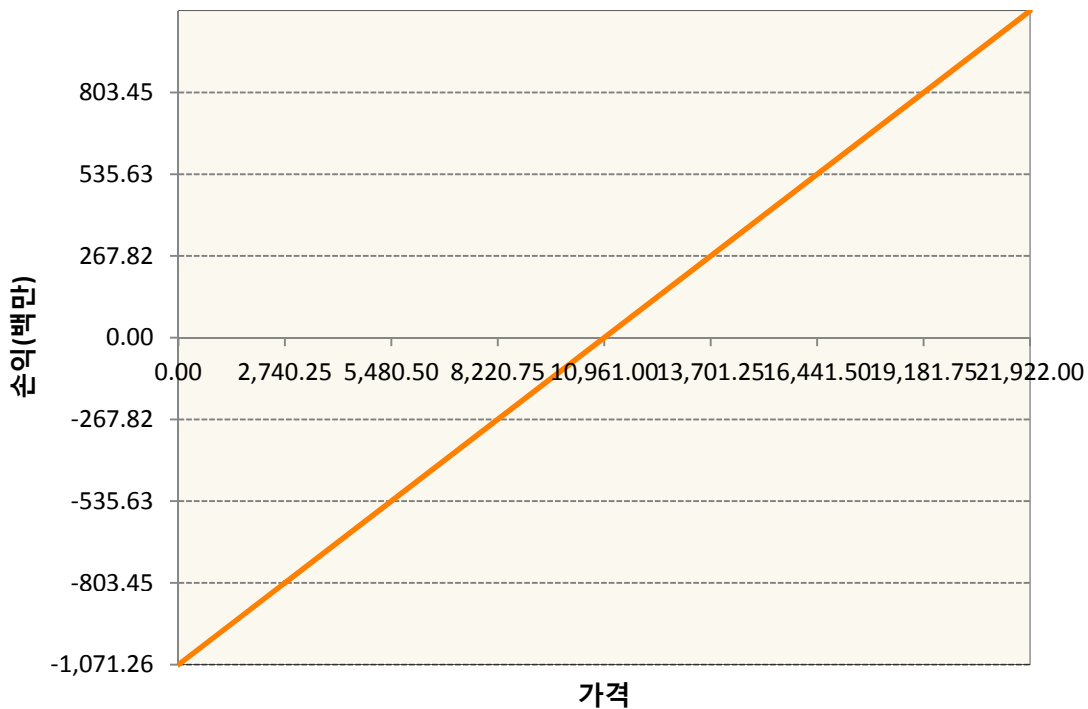
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,071	0	1,071	

2. 만기시점의 손익구조

HCZ9-HSCEI Futures Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ9	HSCEI Futures Dec19	86
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

77

공시일	2019-12-18
기준일	2019-12-17

커버드콜모(주식혼합-파생형)

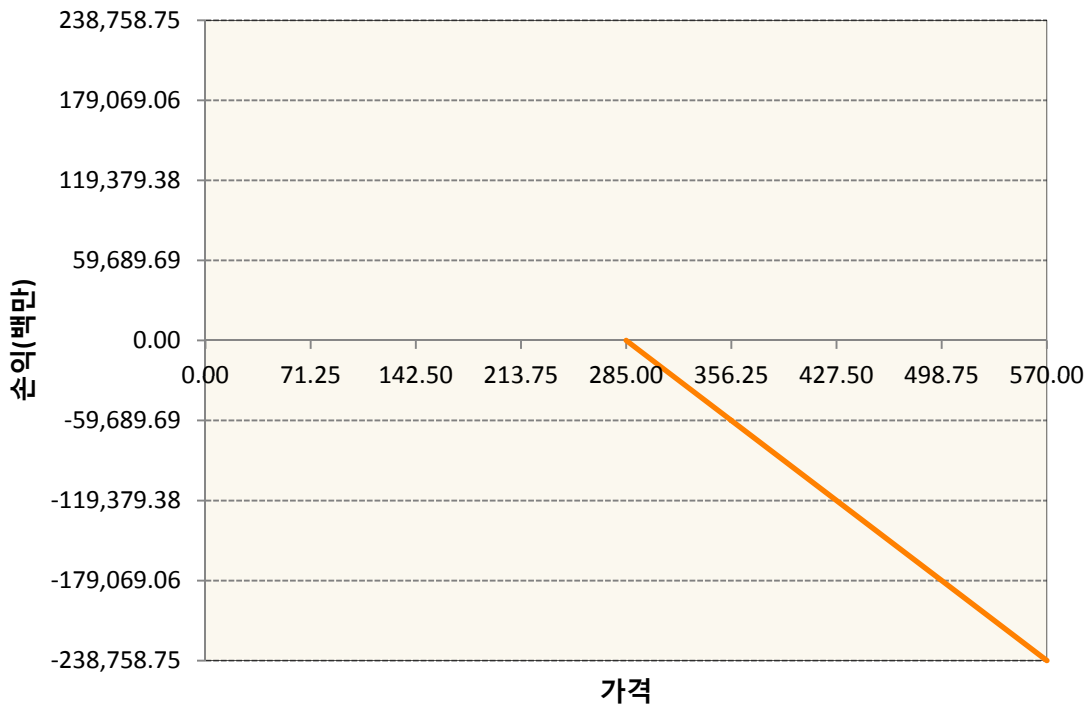
1. 계약금액

(단위:백만원)

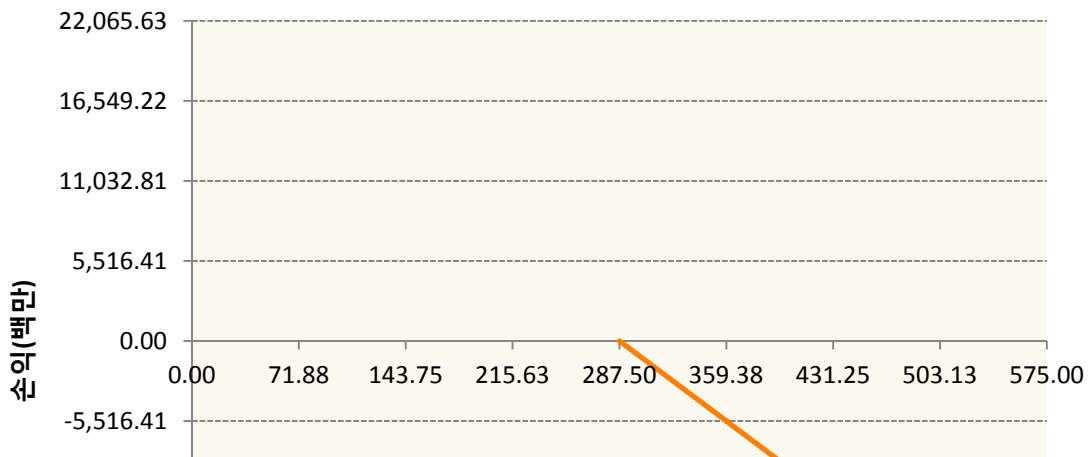
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	108,474	59,541	48,934	장내
누계	유가증권	옵션	38,119	475,786	-437,667	장내

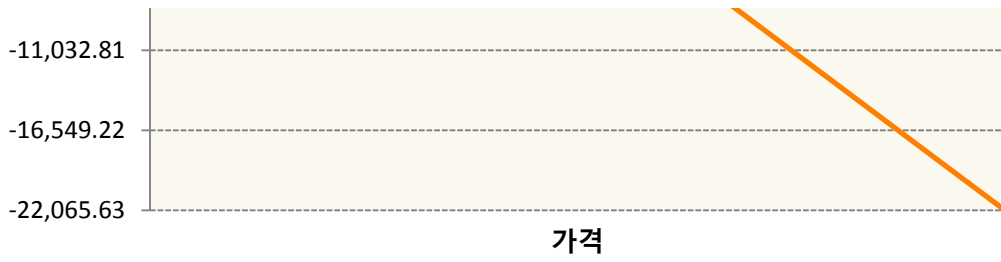
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q12852-2020-01 콜285

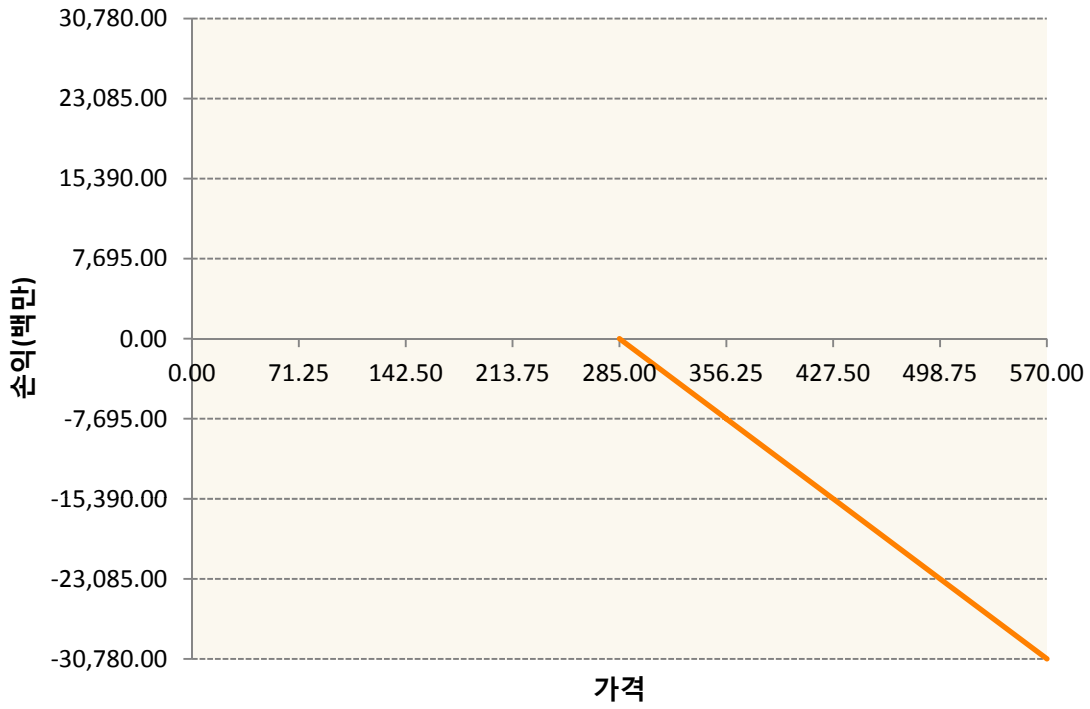


KR4201Q12878-2020-01 콜287.5

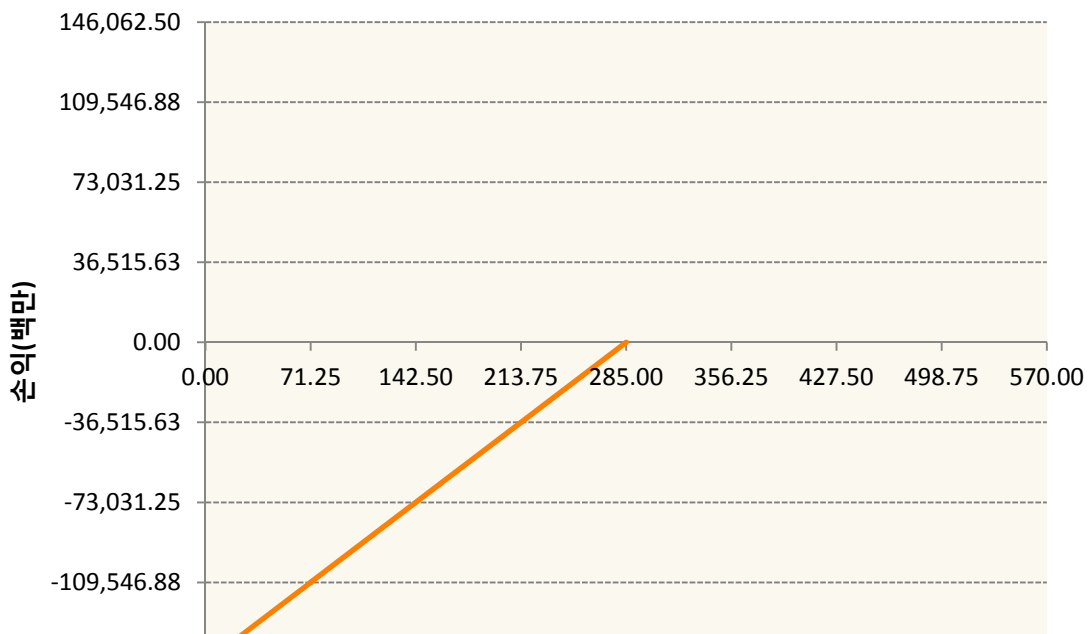




KR4201Q22851-2020-02 콜285



KR4301Q12850-2020-01 풋285



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q12852		2020-01 콜285						17,218
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	10,297	9,940	9,554	9,146	8,719	8,276	7,822	
-5.33%	8,638	8,129	7,612	7,089	6,562	6,031	5,497	
-2.67%	5,723	5,164	4,604	4,044	3,484	2,923	2,363	
0%	1,491	1,007	509	0	-518	-1,043	-1,574	
2.67%	-3,812	-4,147	-4,517	-4,916	-5,337	-5,778	-6,235	
5.33%	-9,803	-9,993	-10,225	-10,497	-10,802	-11,136	-11,497	
8.00%	-16,149	-16,238	-16,364	-16,526	-16,724	-16,956	-17,218	
KR4201Q12878		2020-01 콜287.5						1,533
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	848	820	789	755	719	681	642	
-5.33%	725	682	637	592	545	498	451	
-2.67%	496	445	393	342	290	239	187	
0%	146	98	49	0	-50	-100	-150	
2.67%	-311	-347	-385	-426	-468	-512	-557	
5.33%	-842	-864	-890	-919	-951	-985	-1,022	
8.00%	-1,415	-1,426	-1,441	-1,459	-1,481	-1,505	-1,533	
KR4201Q22851		2020-02 콜285						2,145
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,524	1,430	1,333	1,234	1,133	1,031	927	
-5.33%	1,235	1,126	1,016	905	794	683	572	
-2.67%	838	723	608	493	379	264	149	
0%	332	222	112	0	-112	-225	-339	
2.67%	-271	-367	-466	-569	-673	-780	-887	
5.33%	-954	-1,031	-1,115	-1,204	-1,297	-1,393	-1,492	
8.00%	-1,697	-1,755	-1,821	-1,894	-1,973	-2,057	-2,145	
KR4301Q12850		2020-01 풋285						7,196
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-6,960	-6,978	-7,005	-7,040	-7,084	-7,136	-7,196	
-5.33%	-3,227	-3,327	-3,434	-3,548	-3,667	-3,790	-3,916	
-2.67%	-673	-824	-975	-1,127	-1,279	-1,431	-1,583	
0%	238	169	89	0	-97	-201	-311	
2.67%	375	365	347	323	290	248	199	

5.33%	383	383	381	377	371	361	347
8.00%	383	383	383	383	382	381	378

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

(단위:백만원)

26,688

공시일	2019-12-18
기준일	2019-12-17

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

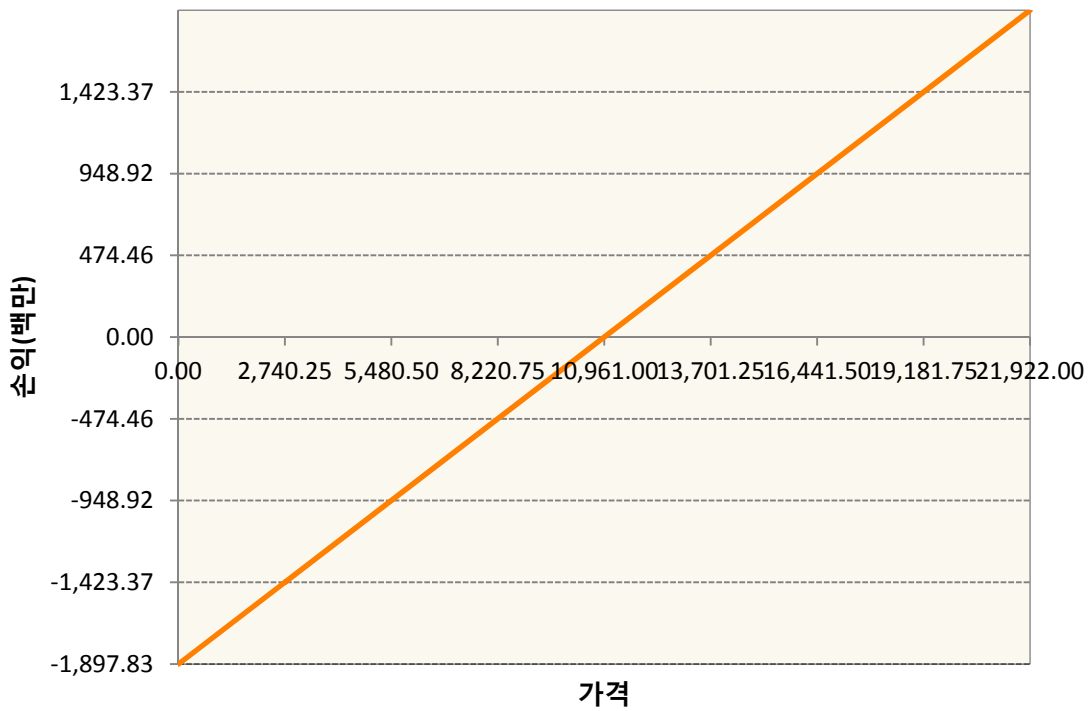
1. 계약금액

(단위:백만원)

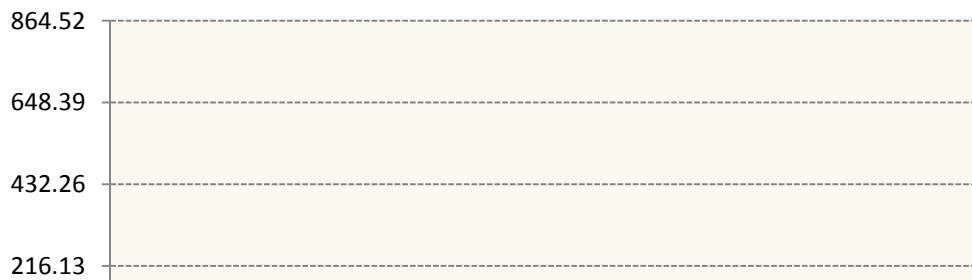
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,898	0	1,898	
누계	유가증권	옵션	0	4,903	-4,903	장내
누계	통화	선도	0	2,108	-2,108	장외

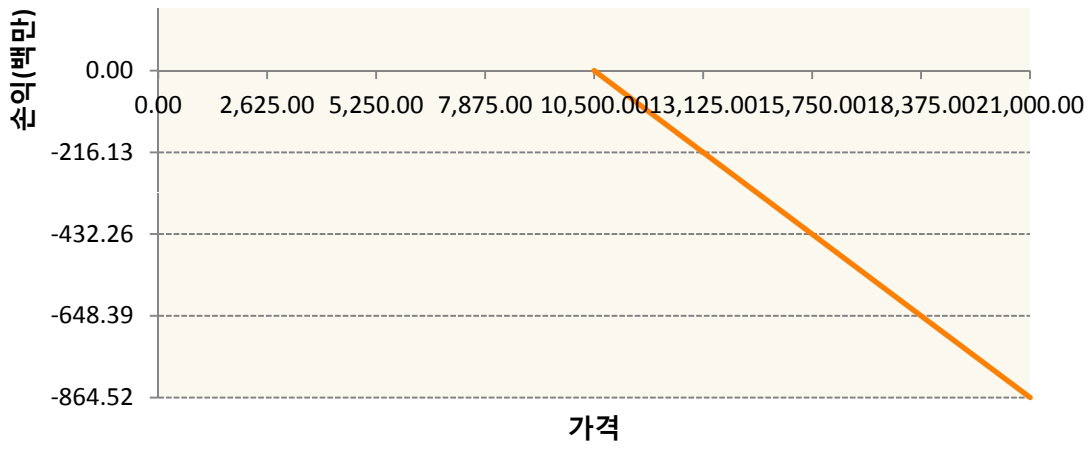
2. 만기시점의 손익구조

HCZ9-HSCEI Futures Dec19

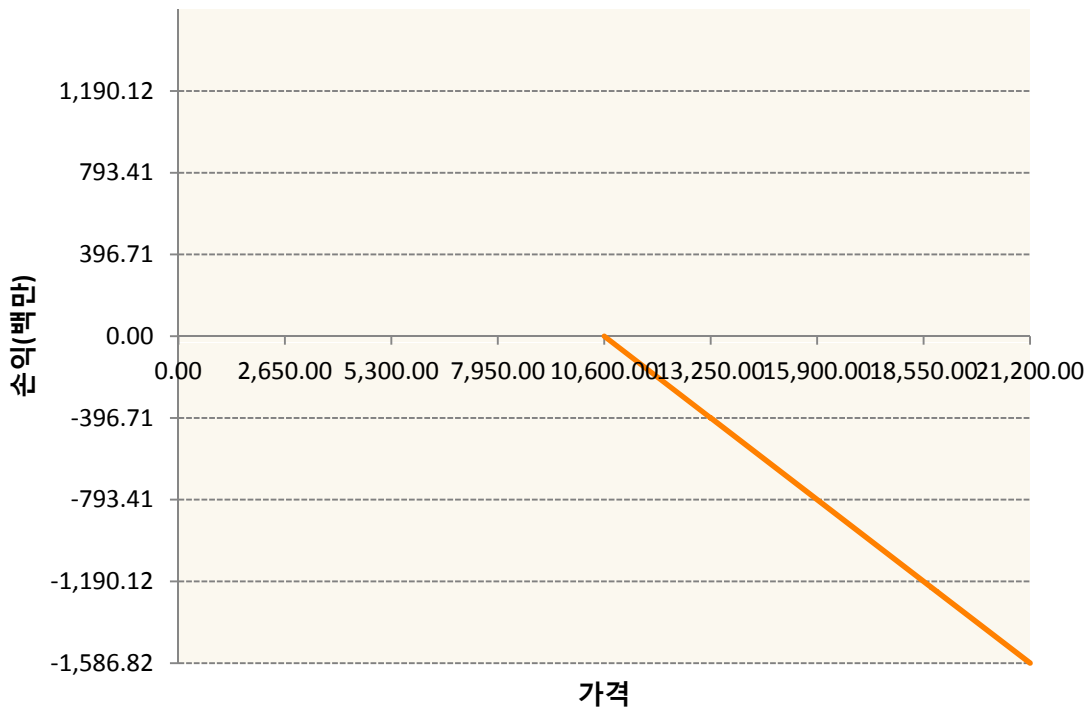


OHHIZ9-C105-HSCEI

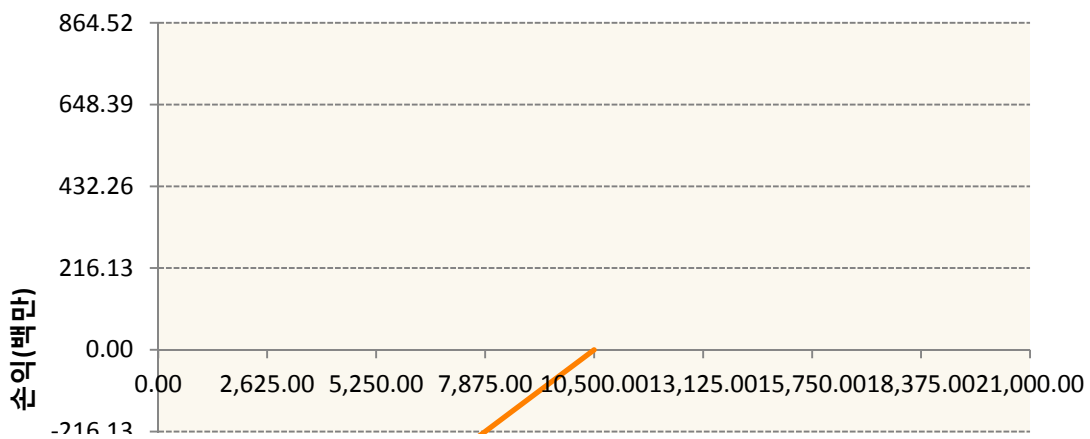


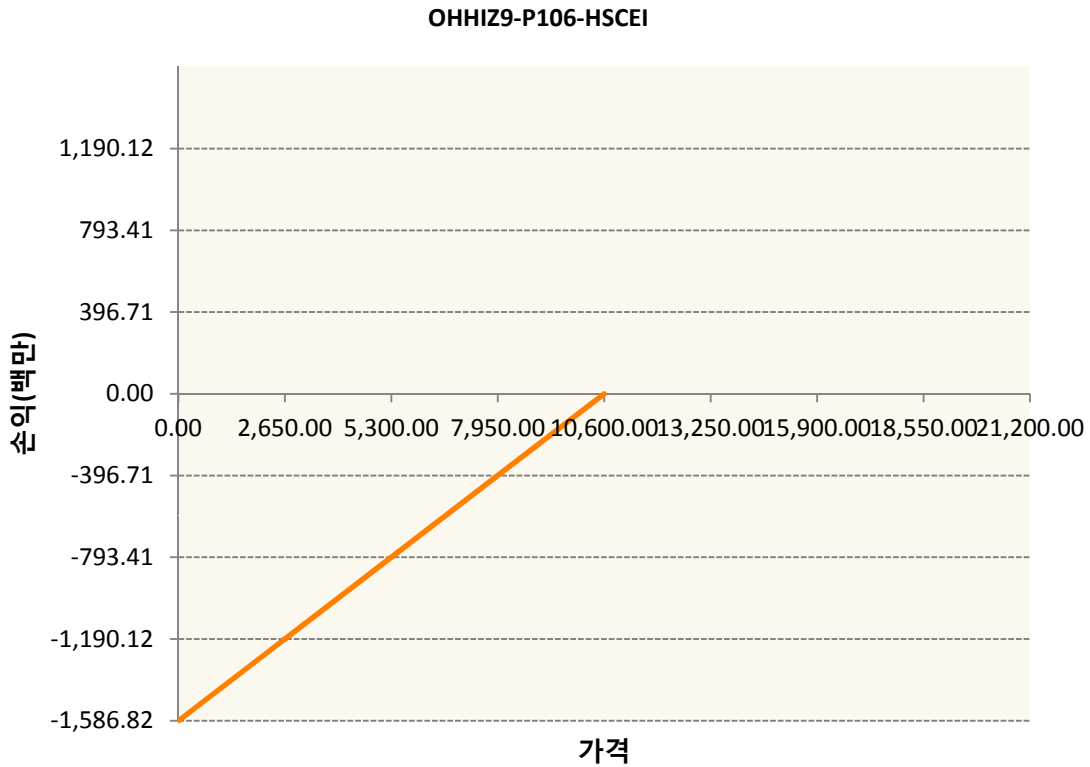
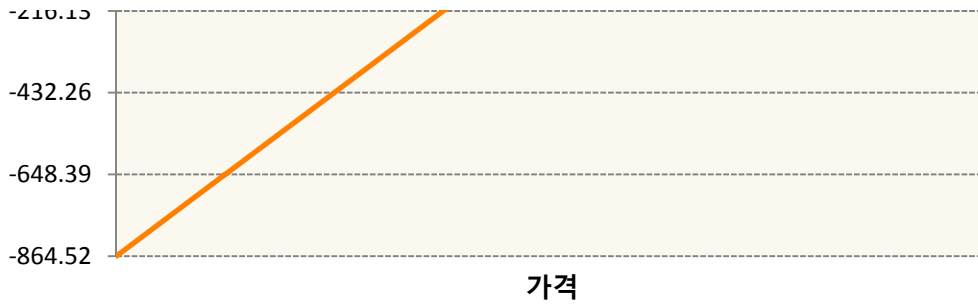


OHHIZ9-C106-HSCEI



OHHIZ9-P105-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	169
HCZ9 HSCEI Futures Dec19	152
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)
	536

공시일	2019-12-18
기준일	2019-12-17

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

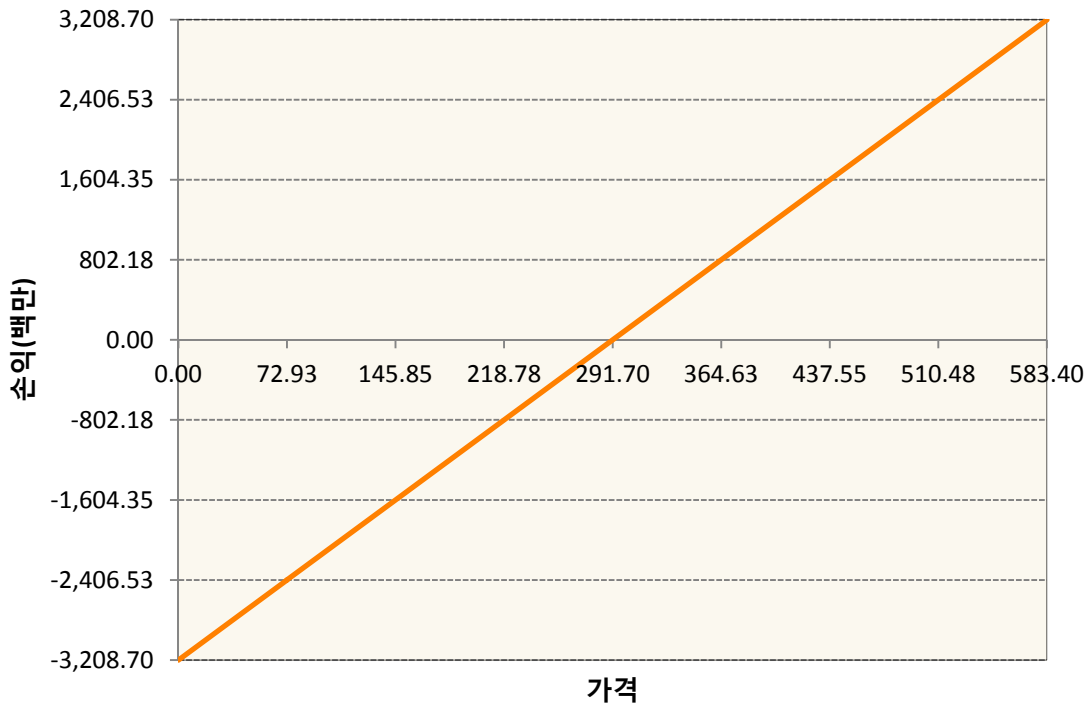
1. 계약금액

(단위:백만원)

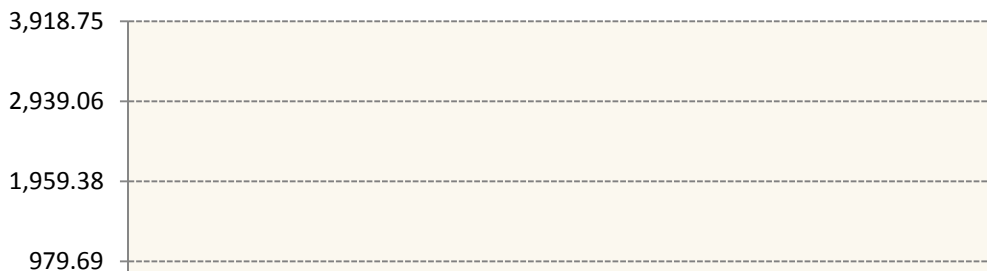
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	418	0	418	장내
누계	유가증권	선물	3,209	0	3,209	장내
누계	유가증권	스왑	8,625	0	8,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	8,839	-8,839	장내

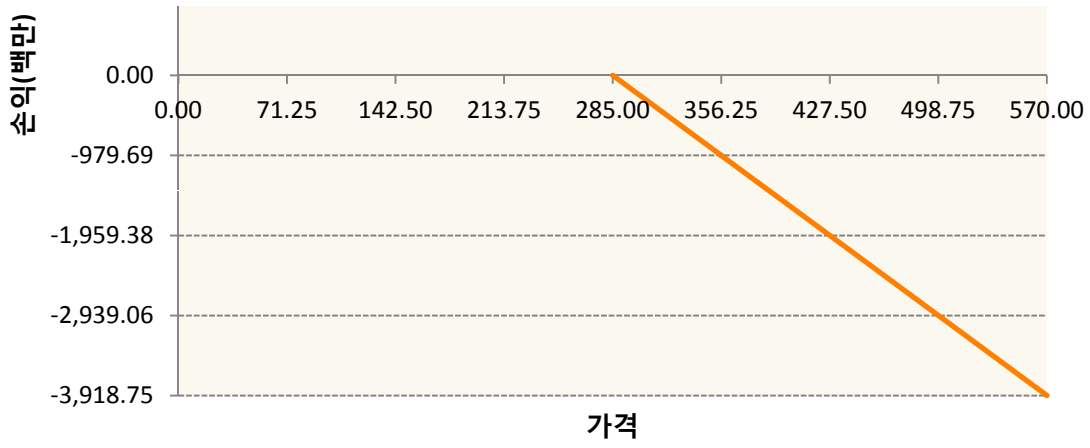
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

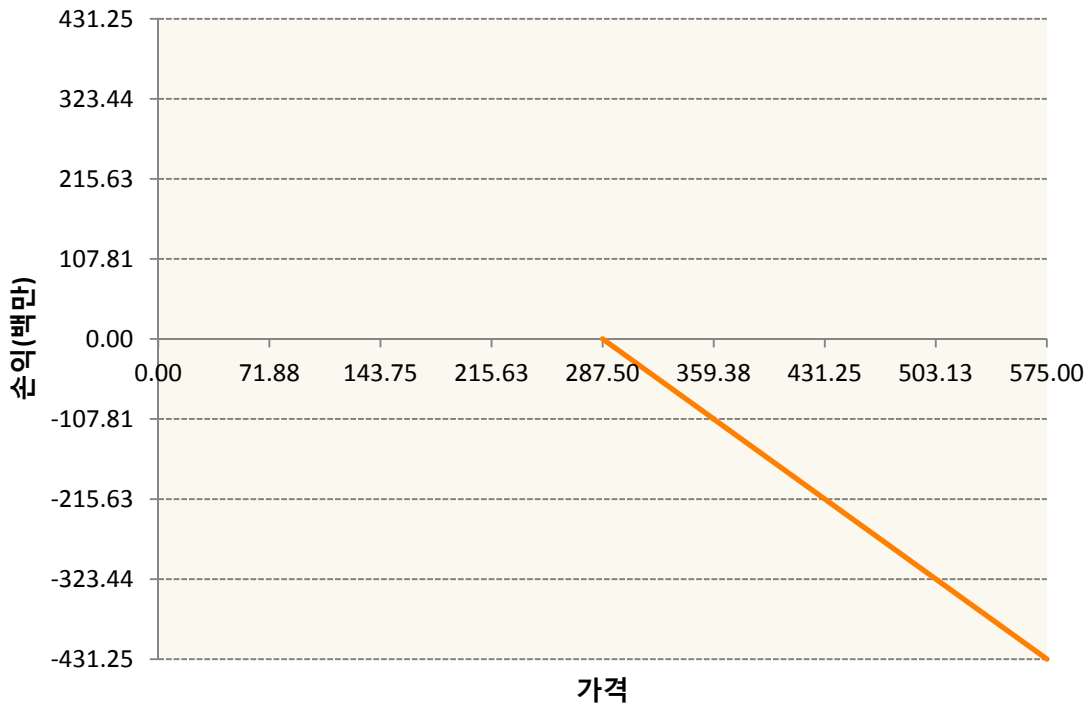


KR4201Q12852-2020-01 콜285

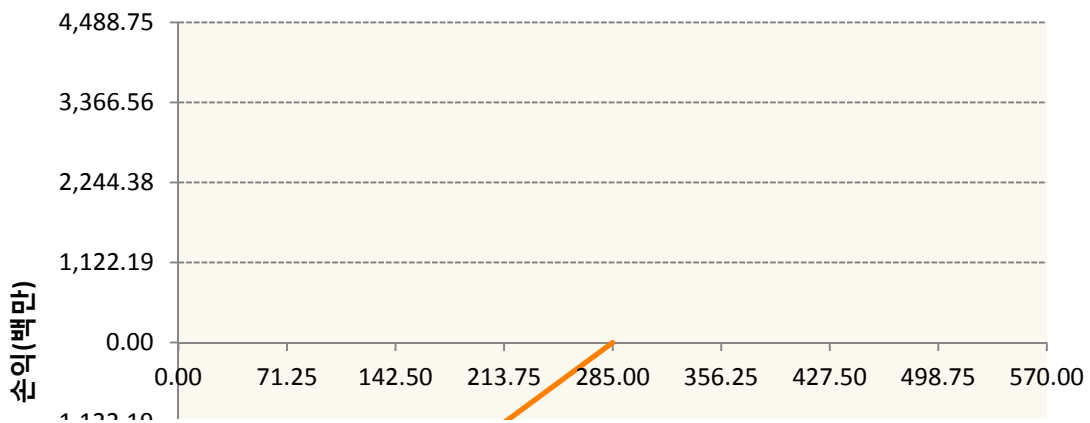




KR4201Q12878-2020-01 콜287.5



KR4301Q12850-2020-01 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						751
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-751	-751	-751	-751	-751	-751	-751	
-5.33%	-500	-500	-500	-500	-500	-500	-500	
-2.67%	-250	-250	-250	-250	-250	-250	-250	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	250	250	250	250	250	250	250	
5.33%	500	500	500	500	500	500	500	
8.00%	751	751	751	751	751	751	751	
KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						259
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-259	-259	-259	-259	-259	-259	-259	
-5.33%	-173	-173	-173	-173	-173	-173	-173	
-2.67%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	86	86	86	86	86	86	86	
5.33%	173	173	173	173	173	173	173	
8.00%	259	259	259	259	259	259	259	
KR4201Q12852		2020-01 콜285						283
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	169	163	157	150	143	136	128	
-5.33%	142	133	125	116	108	99	90	
-2.67%	94	85	76	66	57	48	39	
0%	24	17	8	0	-9	-17	-26	
2.67%	-63	-68	-74	-81	-88	-95	-102	
5.33%	-161	-164	-168	-172	-177	-183	-189	
8.00%	-265	-267	-269	-271	-274	-278	-283	
KR4201Q12878		2020-01 콜287.5						30
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	17	16	15	15	14	13	13
-5.33%	14	13	12	12	11	10	9
-2.67%	10	9	8	7	6	5	4
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-6	-7	-8	-8	-9	-10	-11
5.33%	-16	-17	-17	-18	-19	-19	-20
8.00%	-28	-28	-28	-29	-29	-29	-30
KR4301Q12850 2020-01 풋285							221
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-214	-214	-215	-216	-218	-219	-221
-5.33%	-99	-102	-106	-109	-113	-116	-120
-2.67%	-21	-25	-30	-35	-39	-44	-49
0%	7	5	3	0	-3	-6	-10
2.67%	12	11	11	10	9	8	6
5.33%	12	12	12	12	11	11	11
8.00%	12	12	12	12	12	12	12

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

(단위:백만원)

1,451

공시일	2019-12-18
기준일	2019-12-17

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

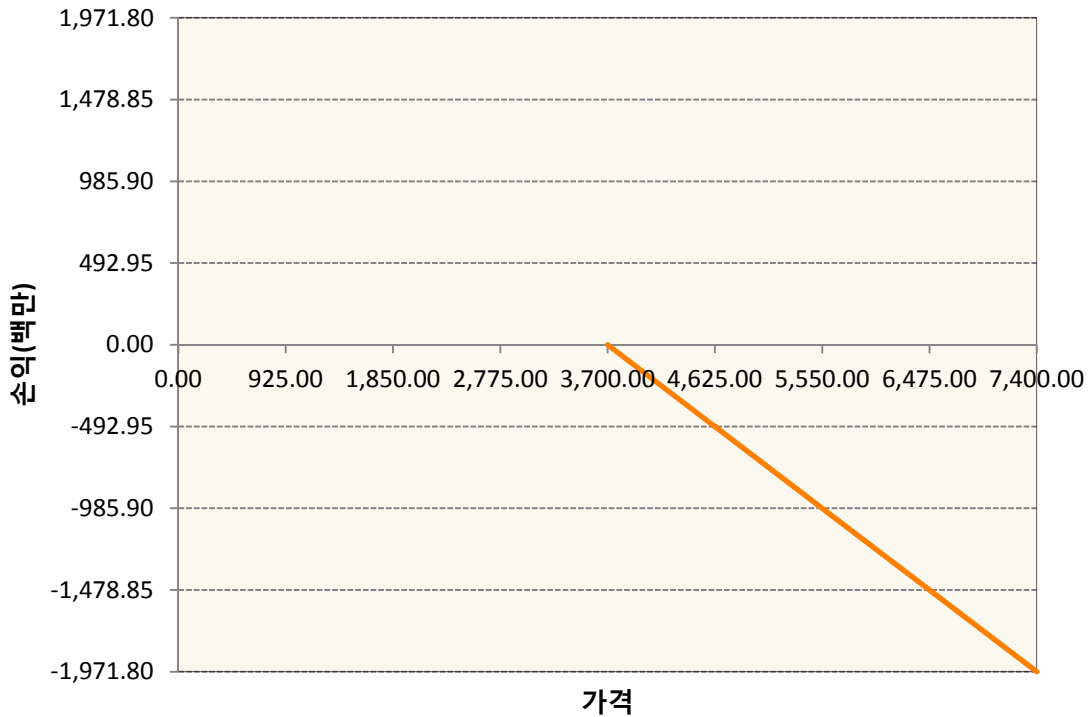
1. 계약금액

(단위:백만원)

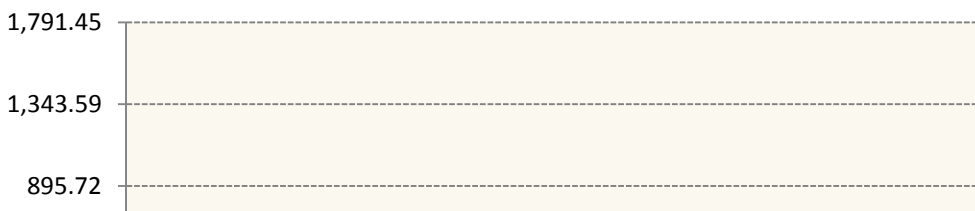
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	734	0	734	
누계	유가증권	스왑	17,773	0	17,773	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,526	-7,526	장내
누계	통화	선도	2,698	6,109	-3,411	장외

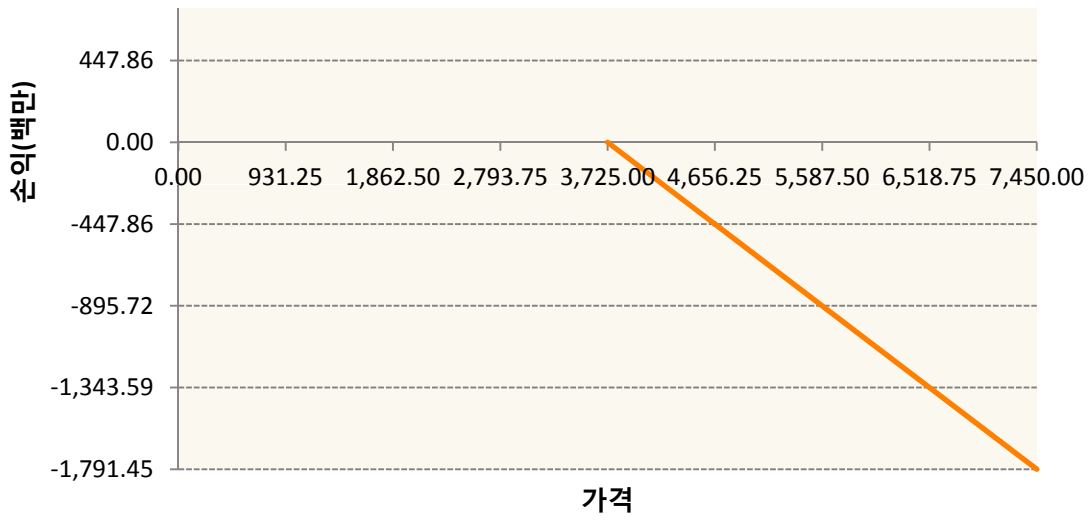
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ9-C3700-EURO STOXX 50

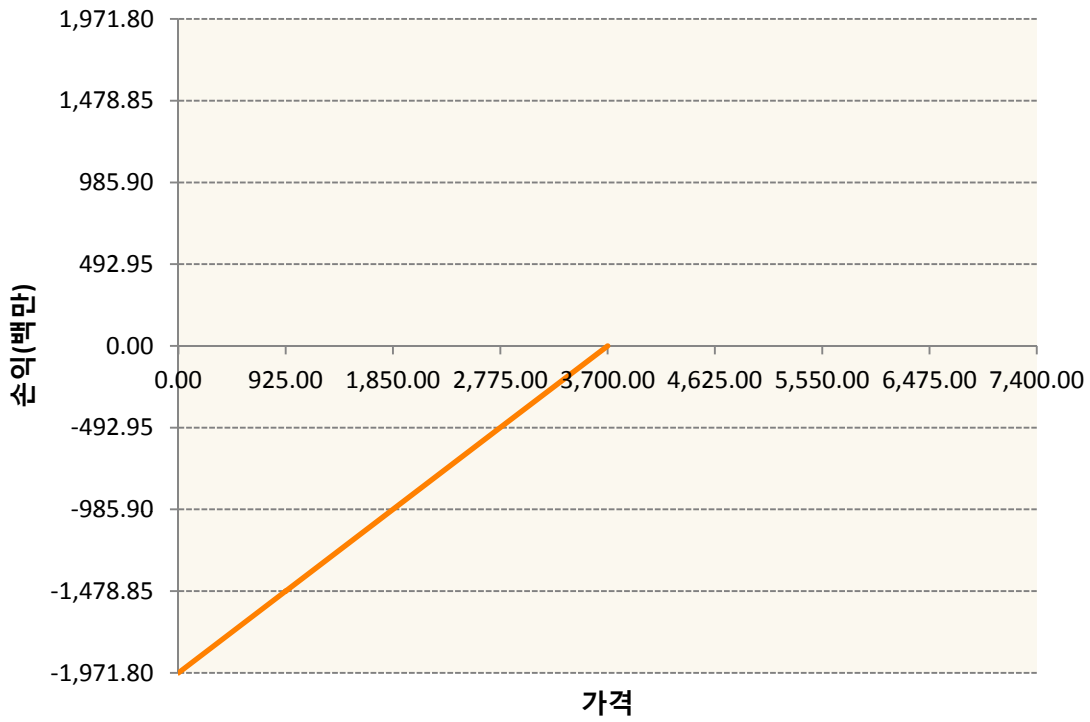


OESXZ9-C3725-EURO STOXX 50

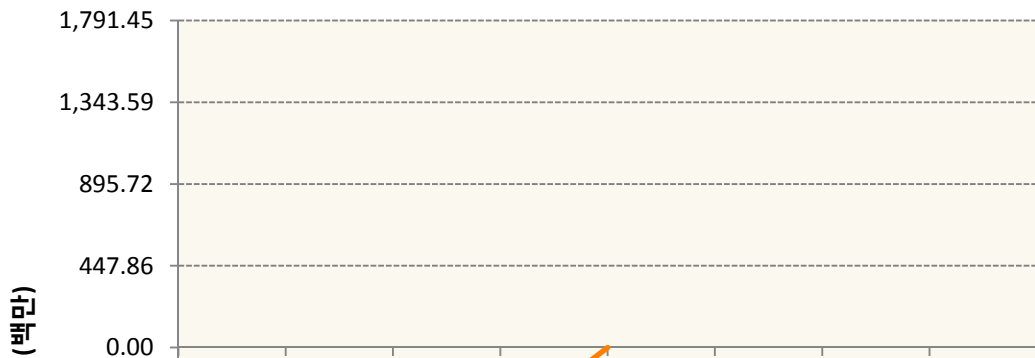


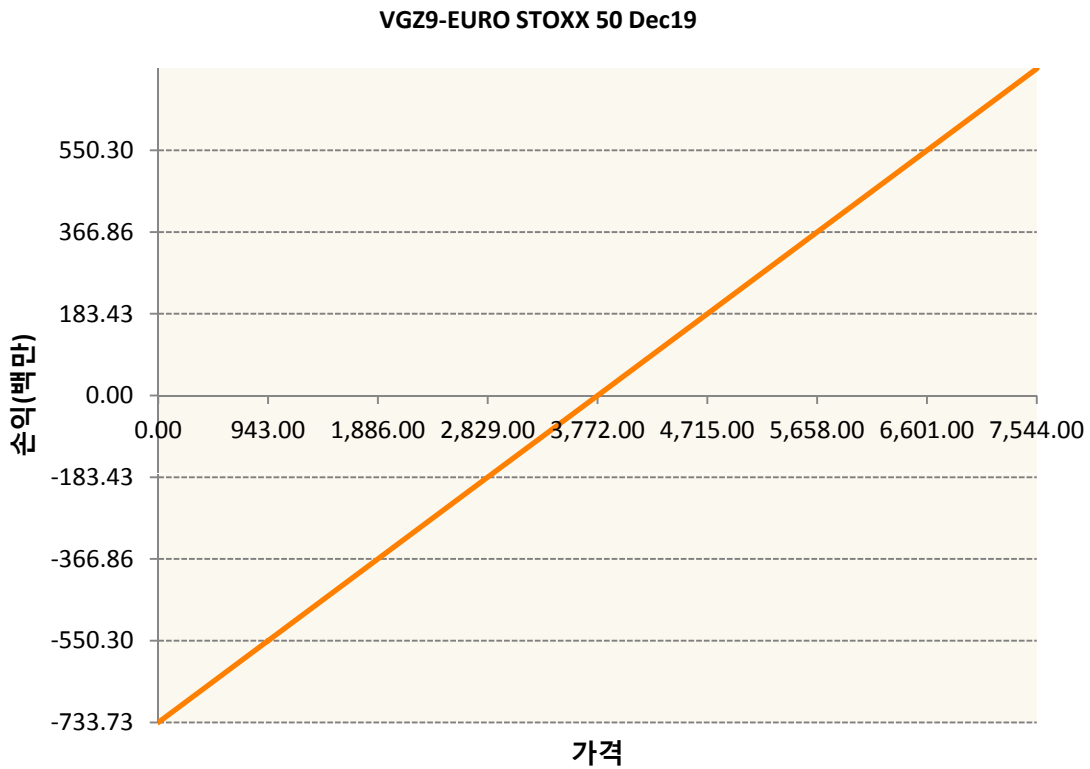
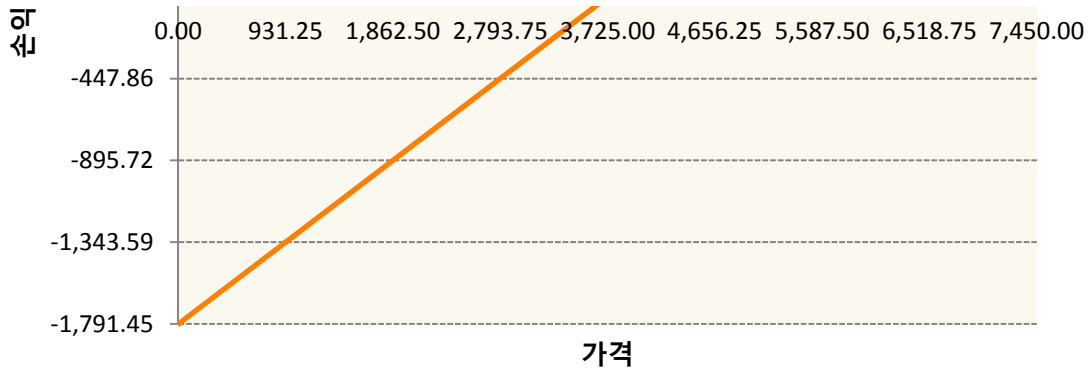


OESXZ9-P3700-EURO STOXX 50



OESXZ9-P3725-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	39
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E	489
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E	164
FX21019X02 EUR/KRW 27-12-19E	52
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	158
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	143
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	158
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	143
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19	59

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

(단위:백만원)

816

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

(단위:백만원)

949

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

(단위:백만원)

84

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

(단위:백만원)

130

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

(단위:백만원)

42

공시일	2019-12-18
기준일	2019-12-17

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

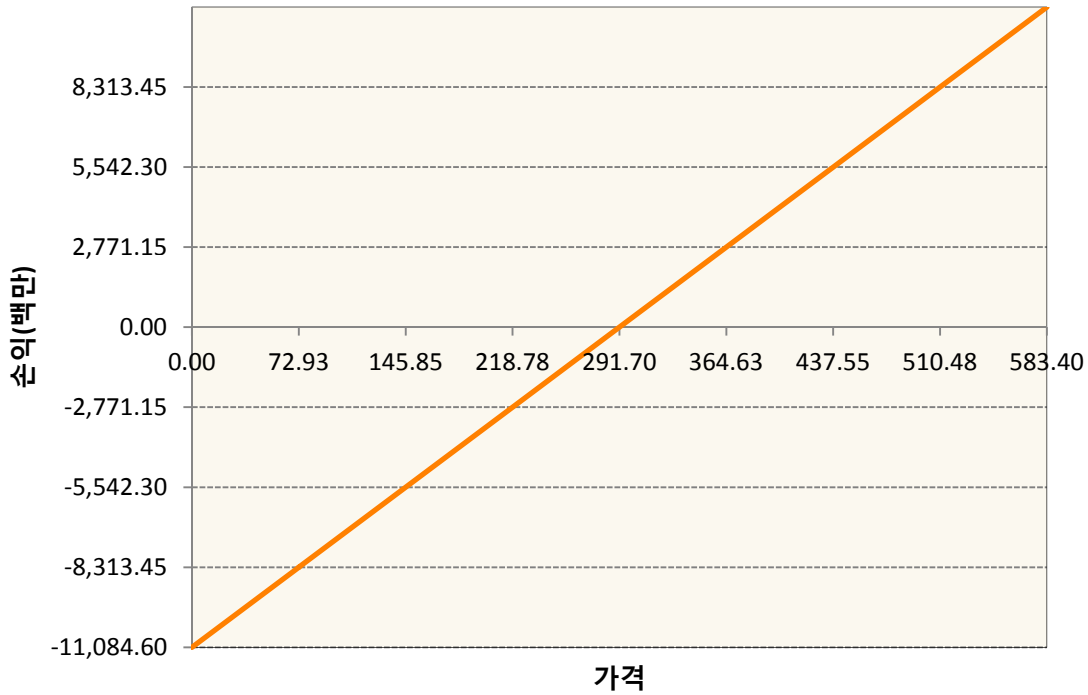
1. 계약금액

(단위:백만원)

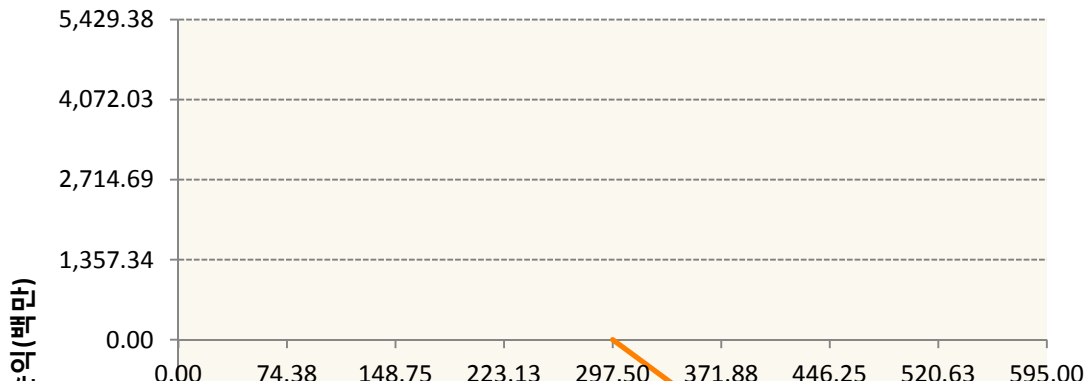
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,085	0	11,085	장내
누계	유가증권	옵션	499	21,254	-20,756	장내

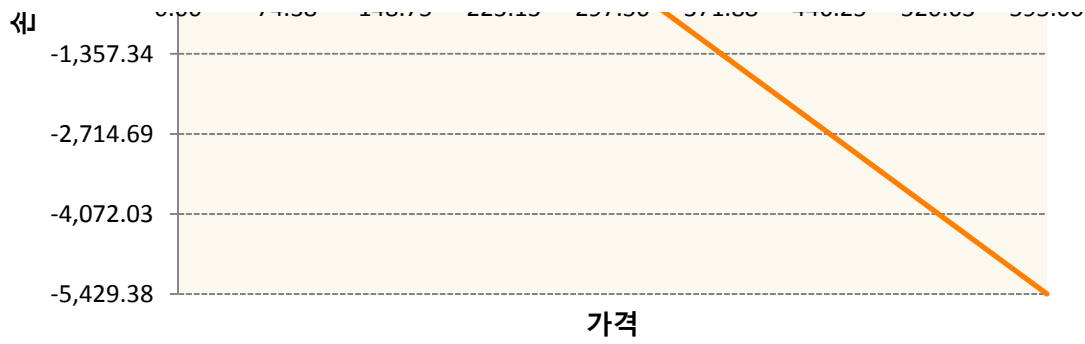
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

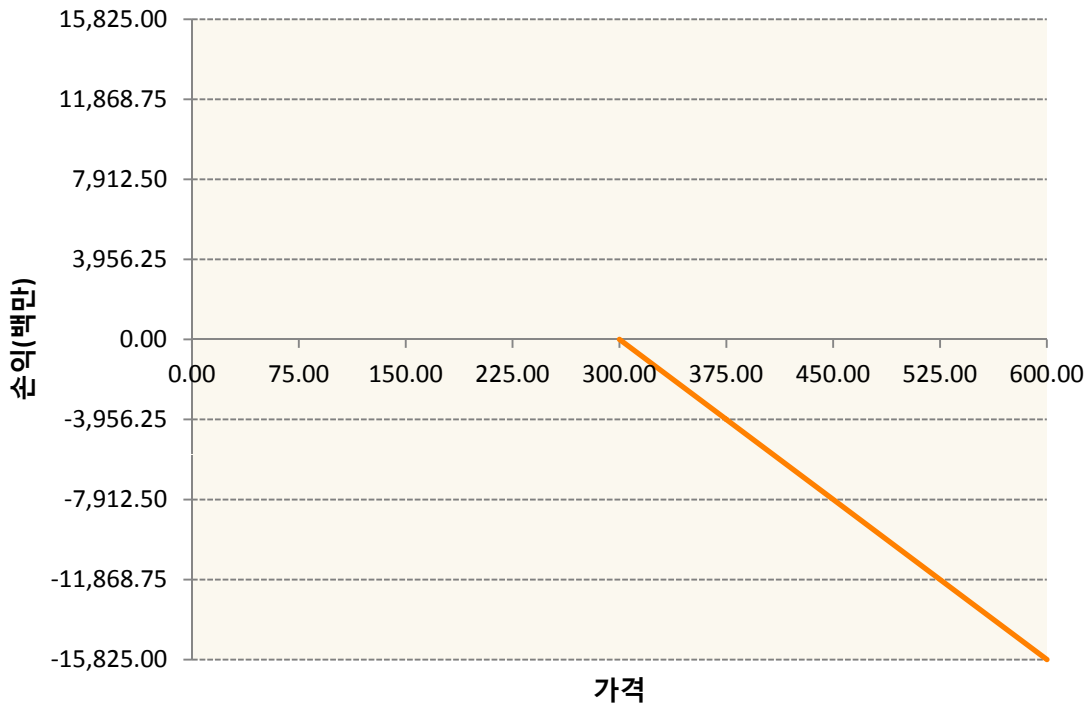


KR4201Q12977-2020-01 콜297.5

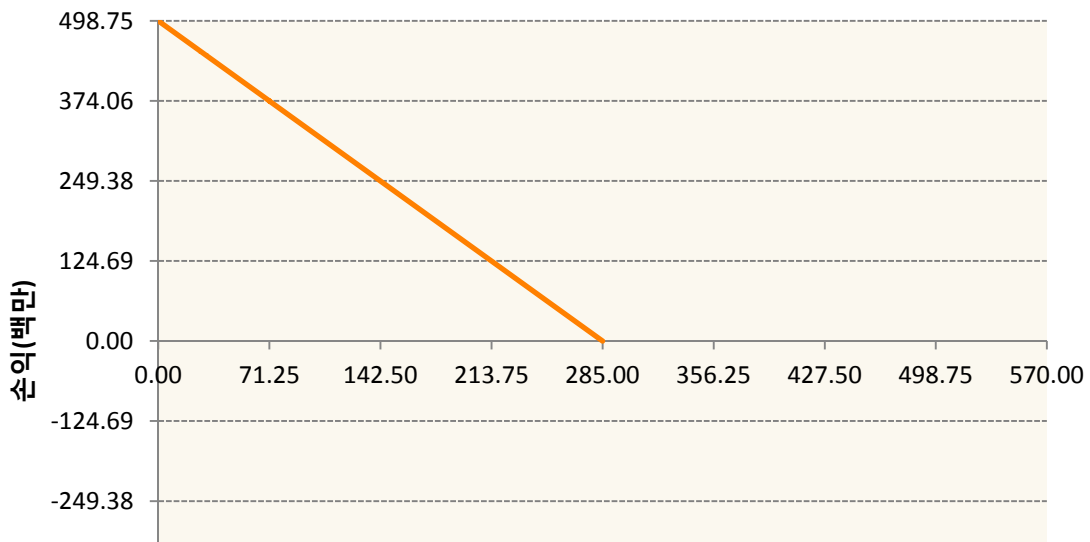


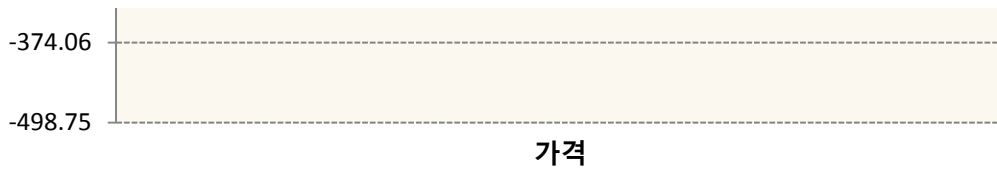


KR4201Q13009-2020-01 콜300



KR4301Q12850-2020-01 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						895
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-895	-895	-895	-895	-895	-895	-895	
-5.33%	-597	-597	-597	-597	-597	-597	-597	
-2.67%	-298	-298	-298	-298	-298	-298	-298	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	298	298	298	298	298	298	298	
5.33%	597	597	597	597	597	597	597	
8.00%	895	895	895	895	895	895	895	
KR4201Q12977		2020-01 콜297.5						311
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	120	117	113	109	103	97	91	
-5.33%	110	104	97	89	81	72	63	
-2.67%	85	75	65	54	43	32	21	
0%	37	25	12	0	-13	-25	-38	
2.67%	-38	-50	-63	-75	-88	-100	-113	
5.33%	-139	-149	-160	-171	-182	-193	-205	
8.00%	-261	-267	-275	-283	-292	-301	-311	
KR4201Q13009		2020-01 콜300						853
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	298	291	283	271	258	243	226	
-5.33%	276	262	244	225	203	180	155	
-2.67%	220	194	167	138	109	78	47	
0%	105	70	35	0	-36	-71	-107	
2.67%	-87	-124	-161	-198	-235	-272	-309	
5.33%	-358	-389	-422	-456	-490	-525	-560	
8.00%	-692	-714	-739	-765	-794	-823	-853	
KR4301Q12850		2020-01 풋285						25
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	24	24	24	24	24	24	25	
-5.33%	11	11	12	12	13	13	13	
-2.67%	2	3	3	4	4	5	5	

0%	-1	-1	0	0	0	1	1
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

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

(단위:백만원)

1,779

공시일	2019-12-18
기준일	2019-12-17

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	206,035	0	206,035	

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	2019-12-18
기준일	2019-12-17

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	215,065	0	215,065	

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	2019-12-18
기준일	2019-12-17

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	546,700	0	546,700	
누계	통화	선도	0	572,021	-572,021	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		4,758
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,399
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,502
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		466
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		933
FX21019X02 KRW/USD 18-12-19E		1,530
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		1,866
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		3,209
FX21019X02 KRW/USD 26-12-19E		4,702
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		4,758
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		187
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,799
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,799
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,332
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,519
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E		1,623
FX21019Z00 KRW/USD 10-01-20E		1,120
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E		1,530
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E		933
FX21019Z02 KRW/USD 16-01-20E		1,679
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		187
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		1,997
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		933

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

(단위:백만원)

14,724

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

(단위:백만원)

190

공시일	2019-12-18
기준일	2019-12-17

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

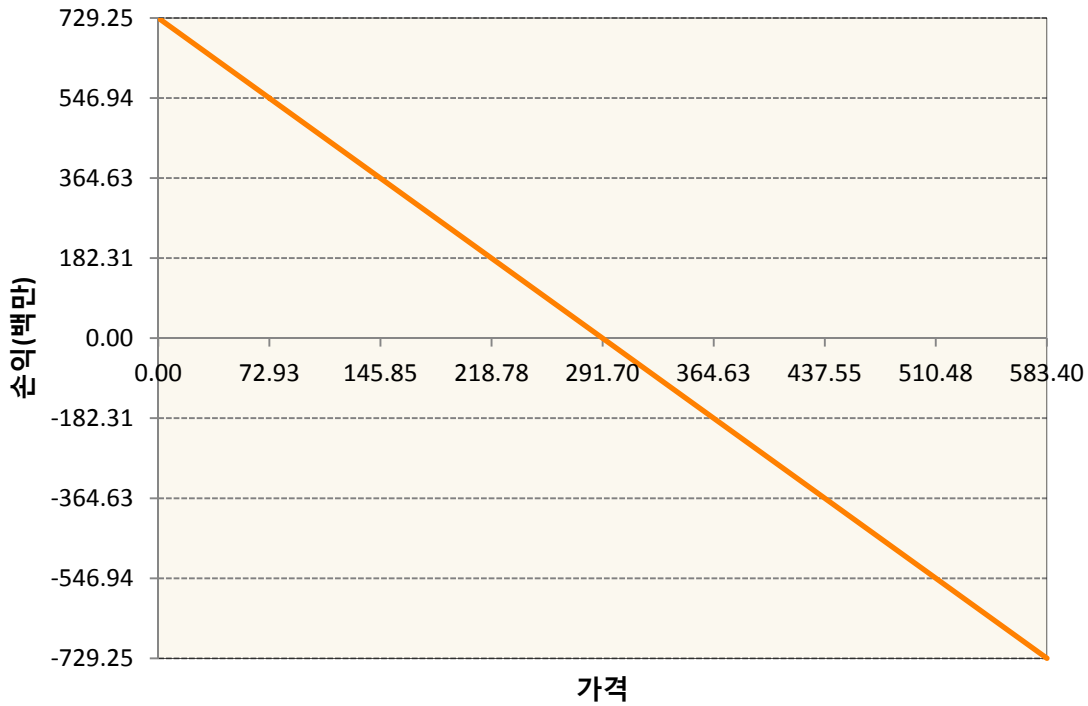
1. 계약금액

(단위:백만원)

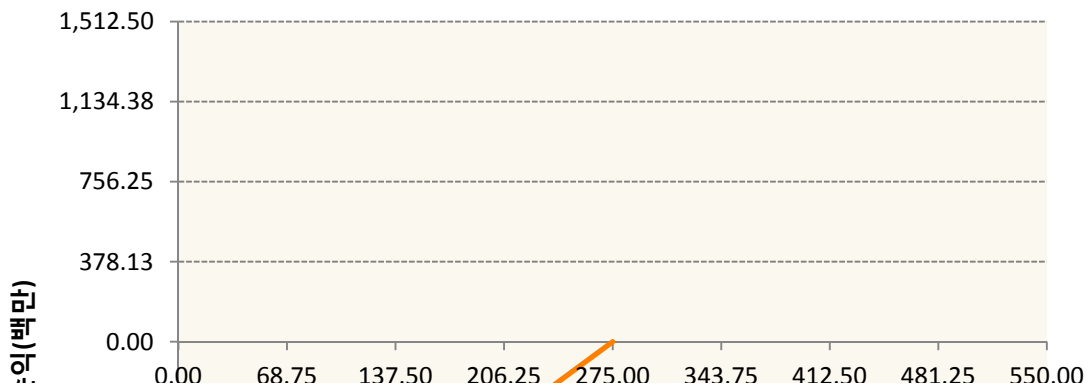
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	729	-729	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,010	-4,010	장내

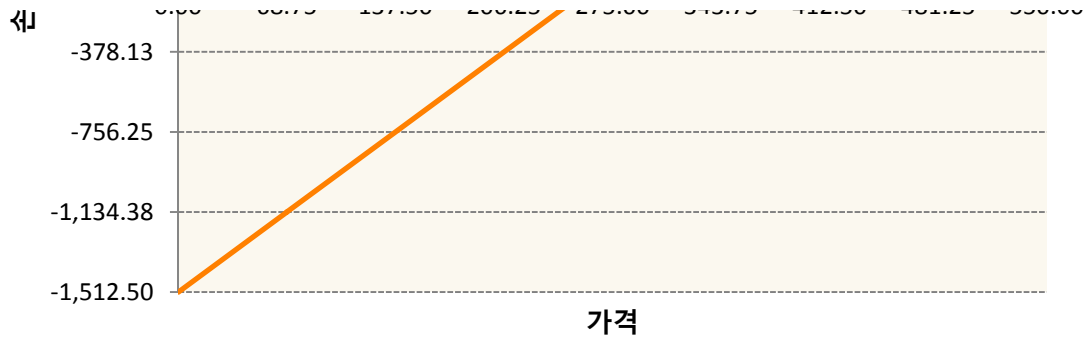
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

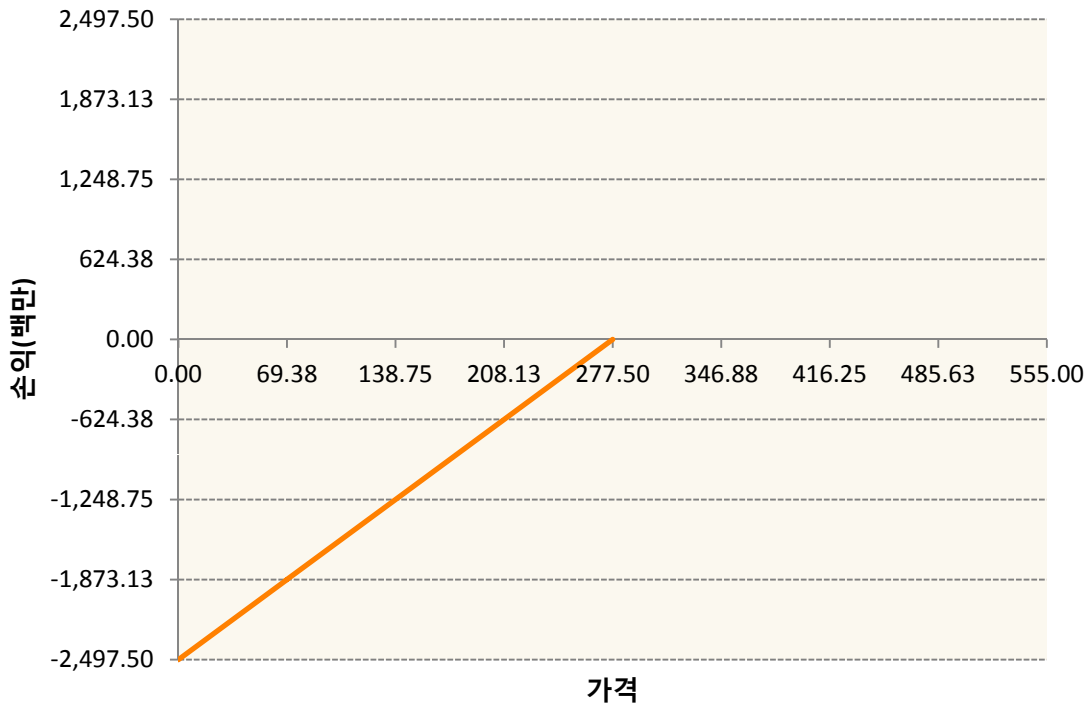


KR4301Q12751-2020-01 풋275





KR4301Q12777-2020-01 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						59
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	59	59	59	59	59	59	59	
-5.33%	39	39	39	39	39	39	39	
-2.67%	20	20	20	20	20	20	20	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20	
5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39	
8.00%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59	
KR4301Q12751		2020-01 풋275						37
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-29	-30	-31	-33	-34	-36	-37
-5.33%	-6	-8	-9	-11	-12	-14	-15
-2.67%	0	-1	-1	-2	-3	-4	-5
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

KR4301Q12777 2020-01 풋277.5 76

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-65	-66	-68	-70	-72	-74	-76
-5.33%	-18	-21	-23	-26	-29	-31	-34
-2.67%	-2	-3	-4	-6	-7	-9	-11
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	1	1	1	1	1	1	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

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

(단위:백만원)

92

공시일	2019-12-18
기준일	2019-12-17

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	14,343	0	14,343	
누계	통화	선도	350	14,414	-14,064	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019X01 KRW/USD 13-01-20E		229
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		289
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		290
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E		345
FX21019Z02 USD/KRW 13-01-20E		28

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

(단위:백만원)

380

공시일	2019-12-18
기준일	2019-12-17

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	998	0	998	장외
누계	통화	선도	312	390	-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)	18
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	2019-12-18
기준일	2019-12-17

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

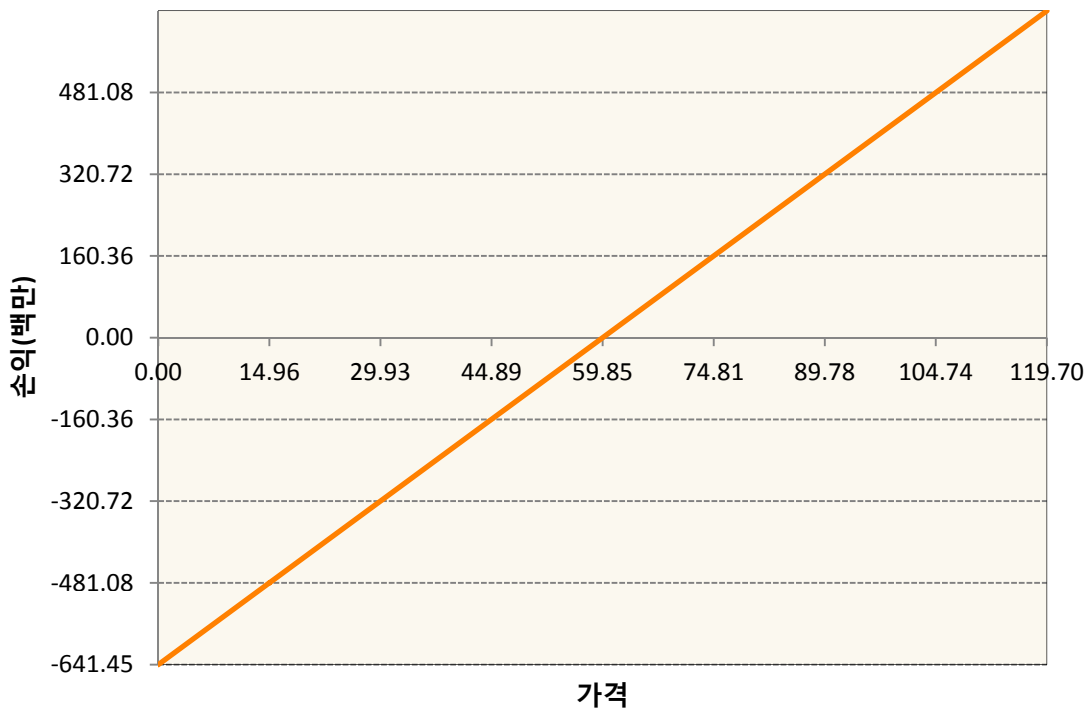
1. 계약금액

(단위:백만원)

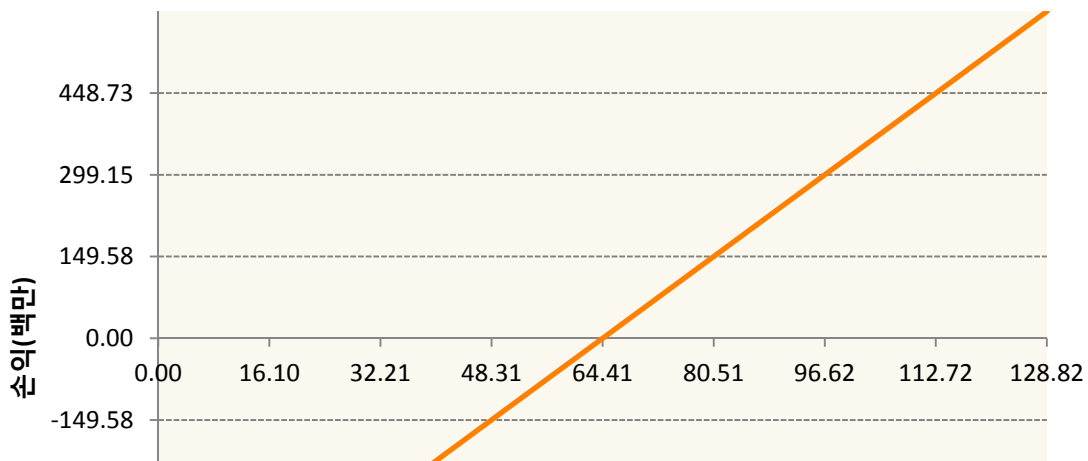
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,419	291	2,128	

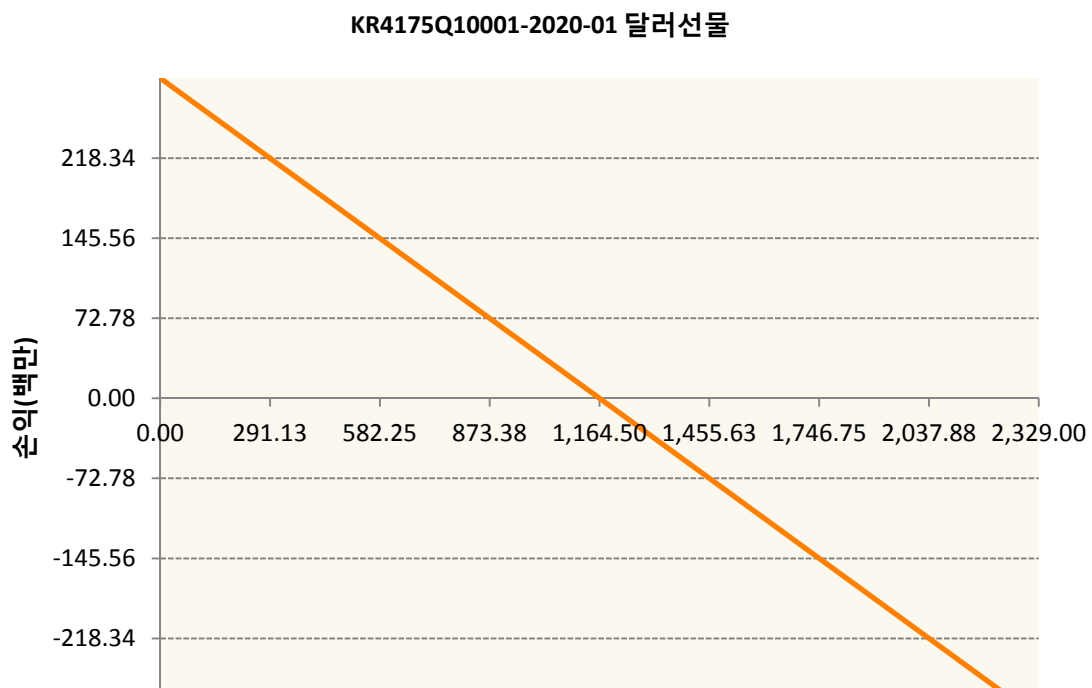
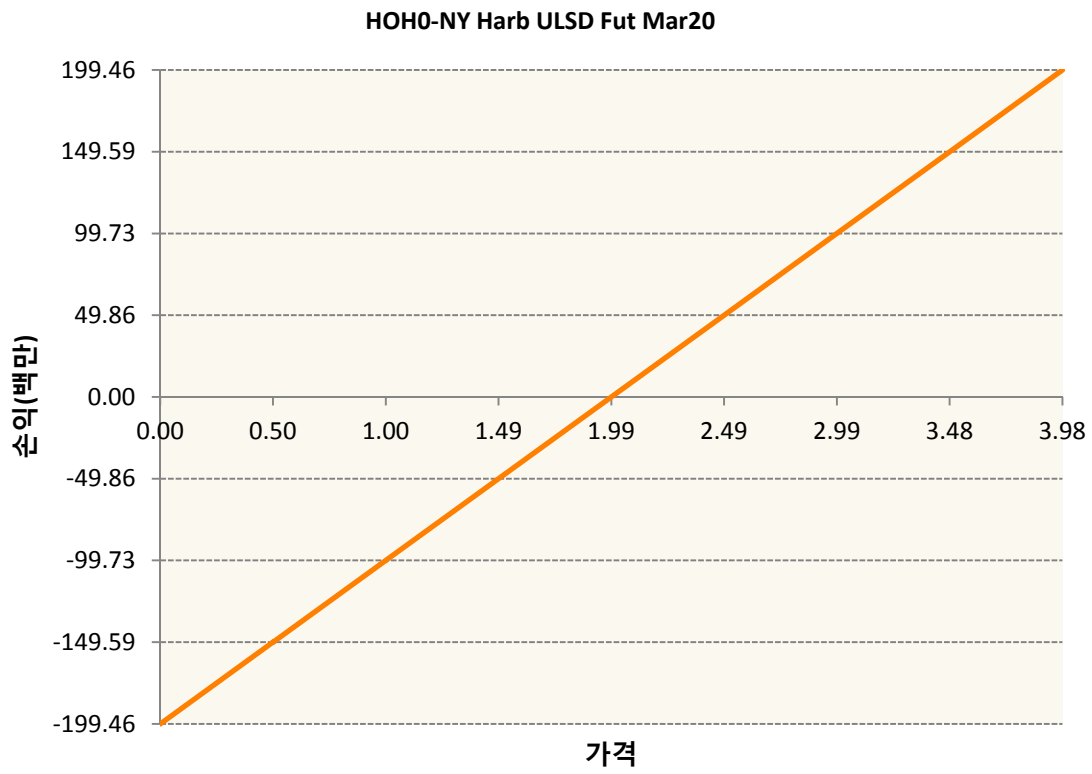
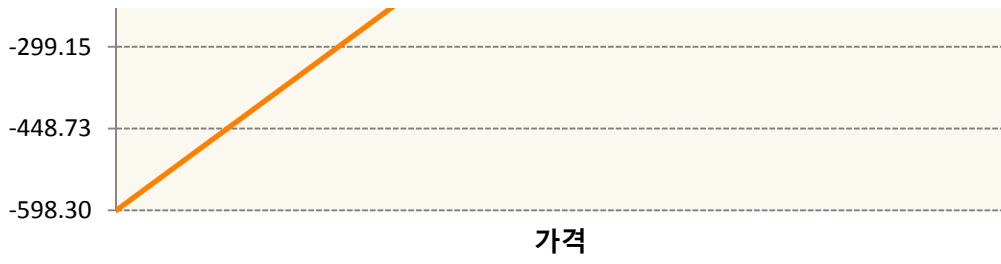
2. 만기시점의 손익구조

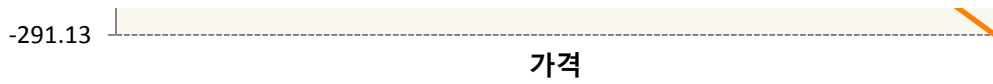
CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20



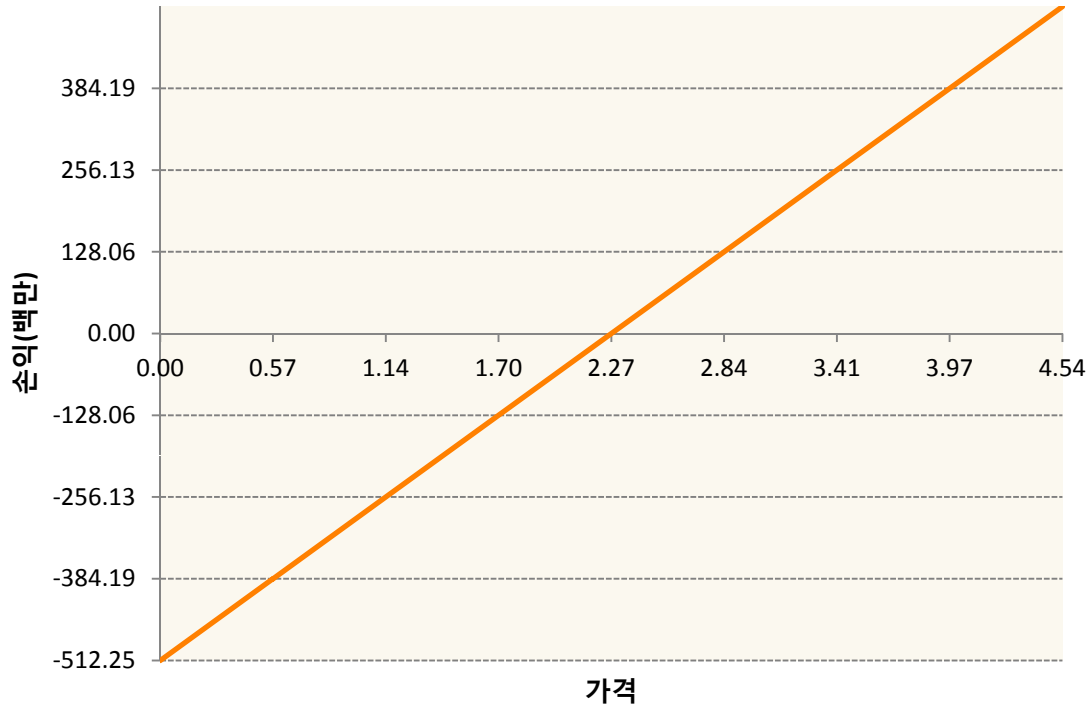
COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20



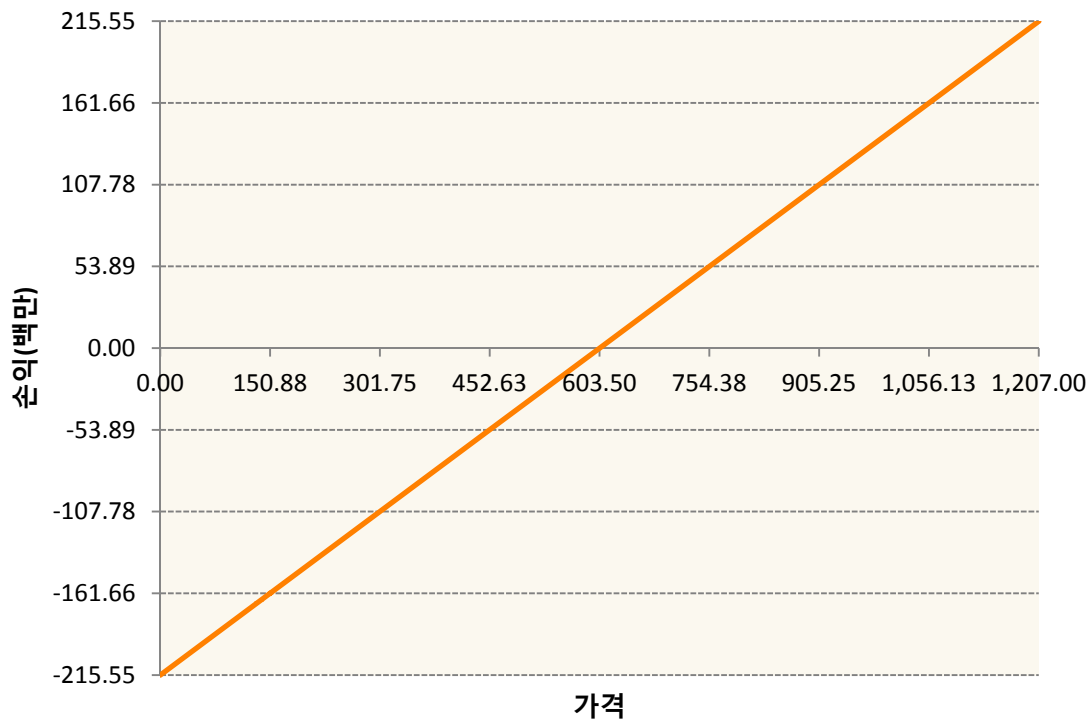




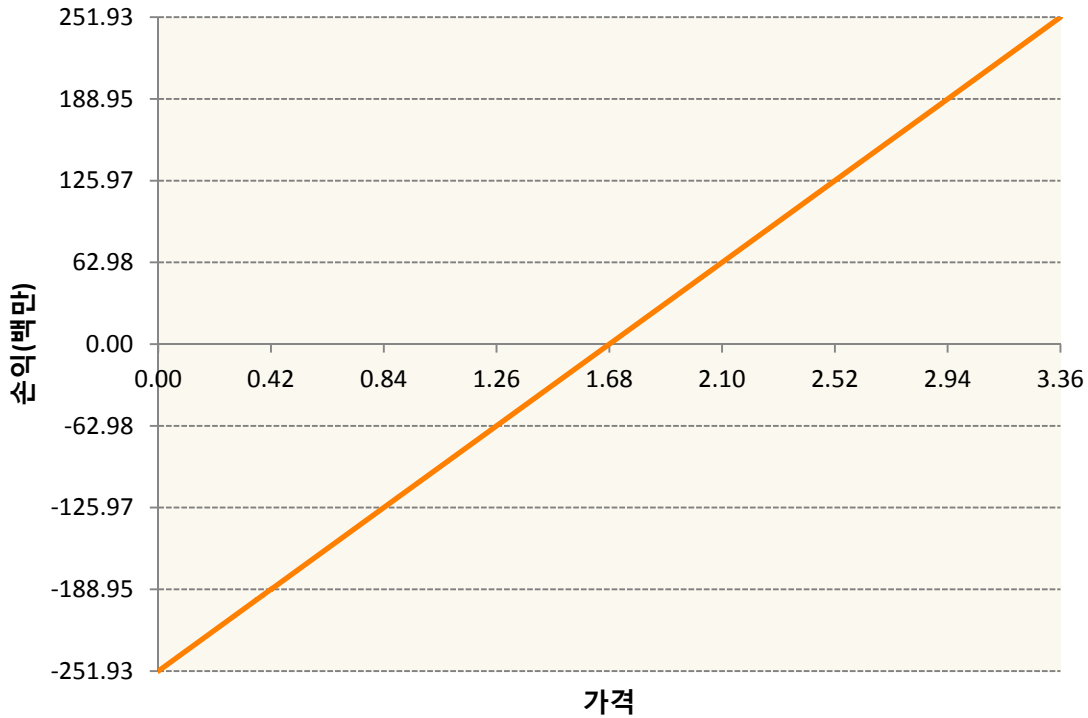
NGH20-NATURAL GAS FUTR Mar20



QSH0-Low Su Gasoil G Mar20



XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	51
COH0	BRENT CRUDE FUTR Mar20	48
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)

390

공시일	2019-12-18
기준일	2019-12-17

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

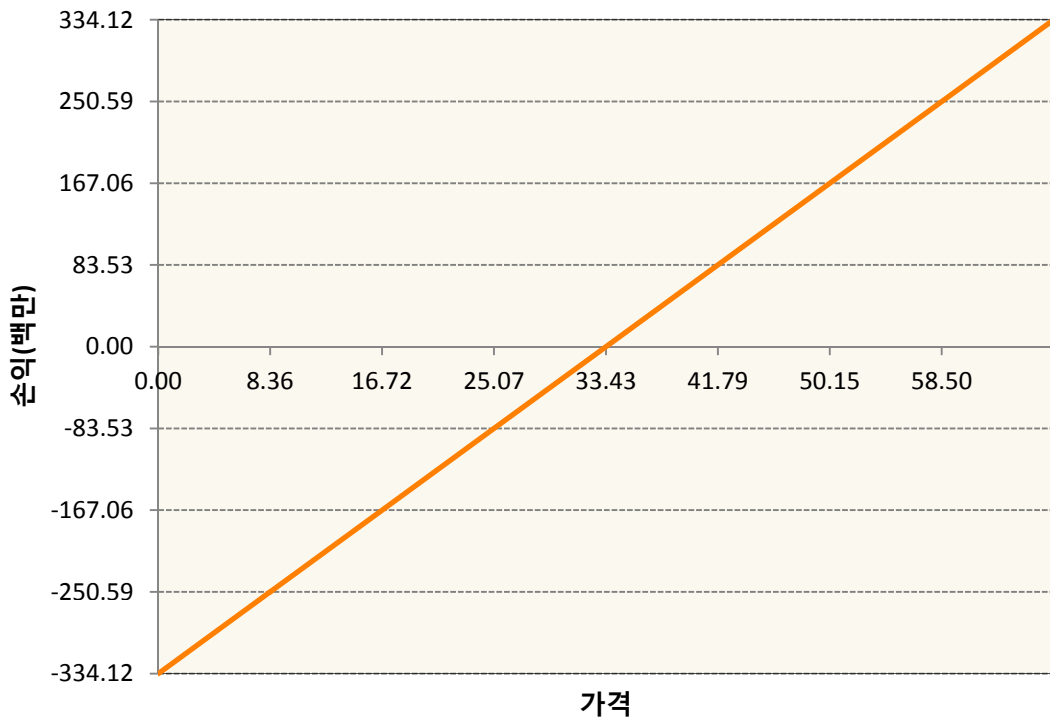
1. 계약금액

(단위:백만원)

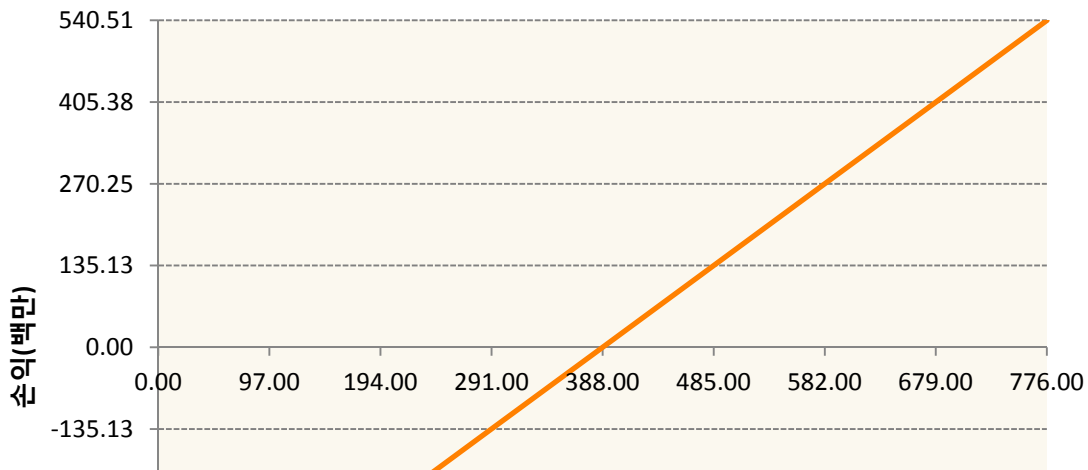
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,856	116	2,739	

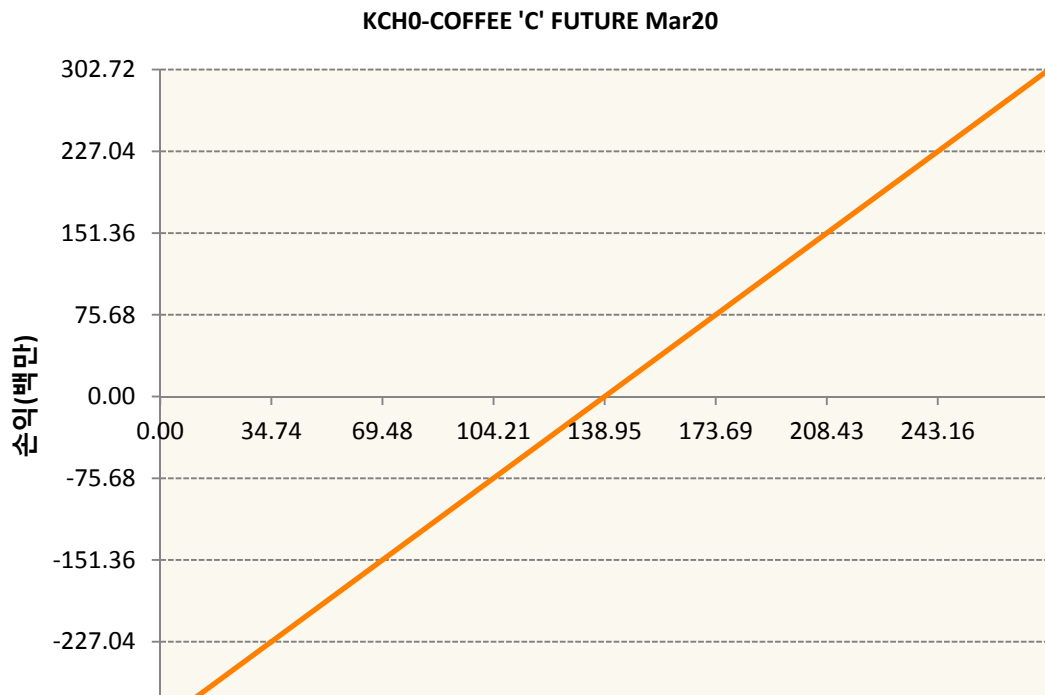
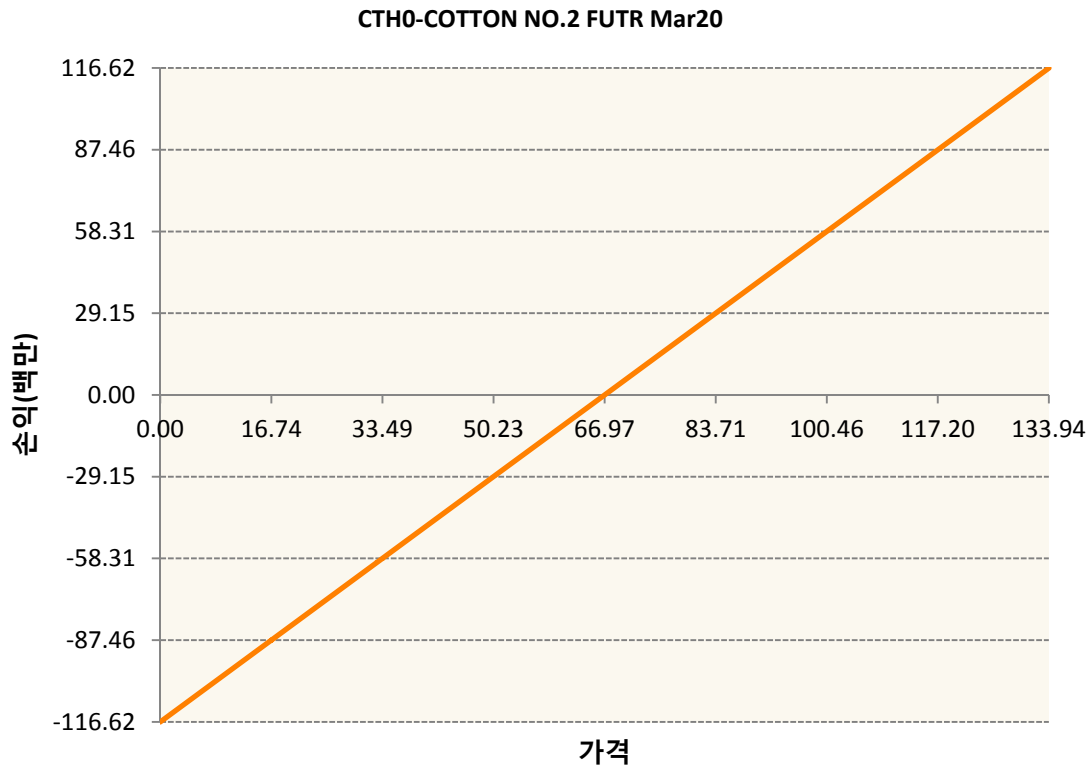
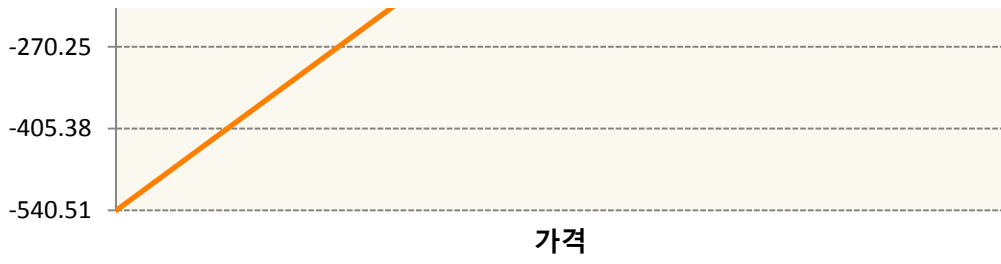
2. 만기시점의 손익구조

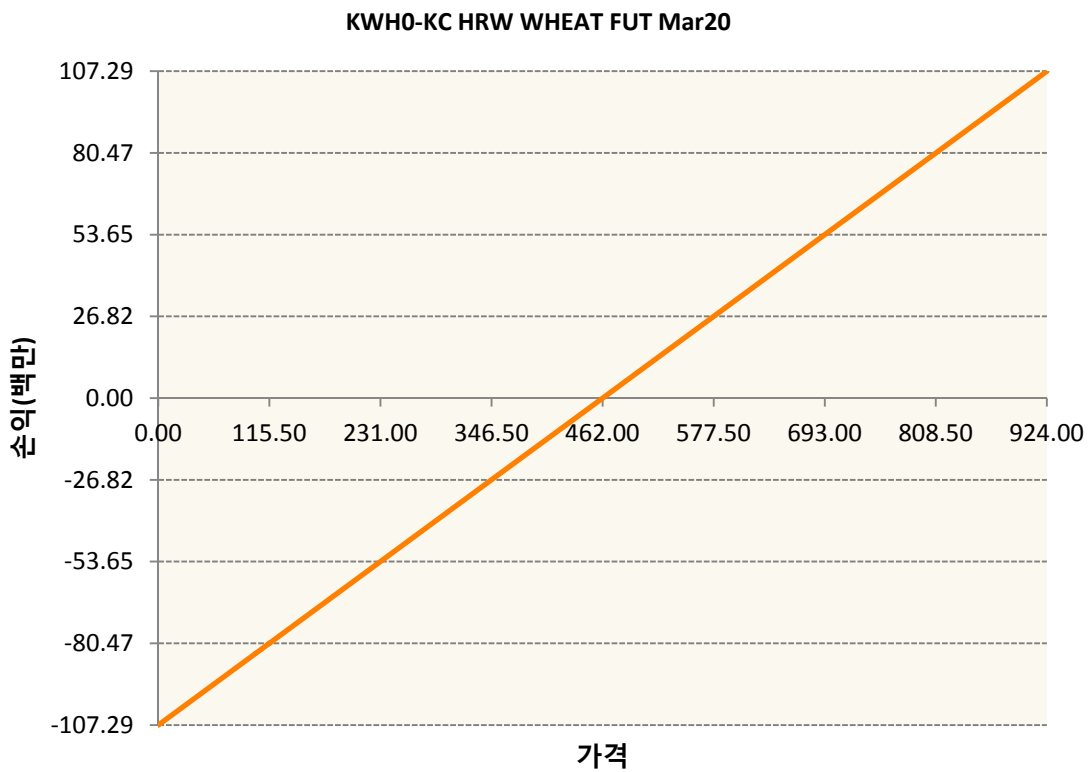
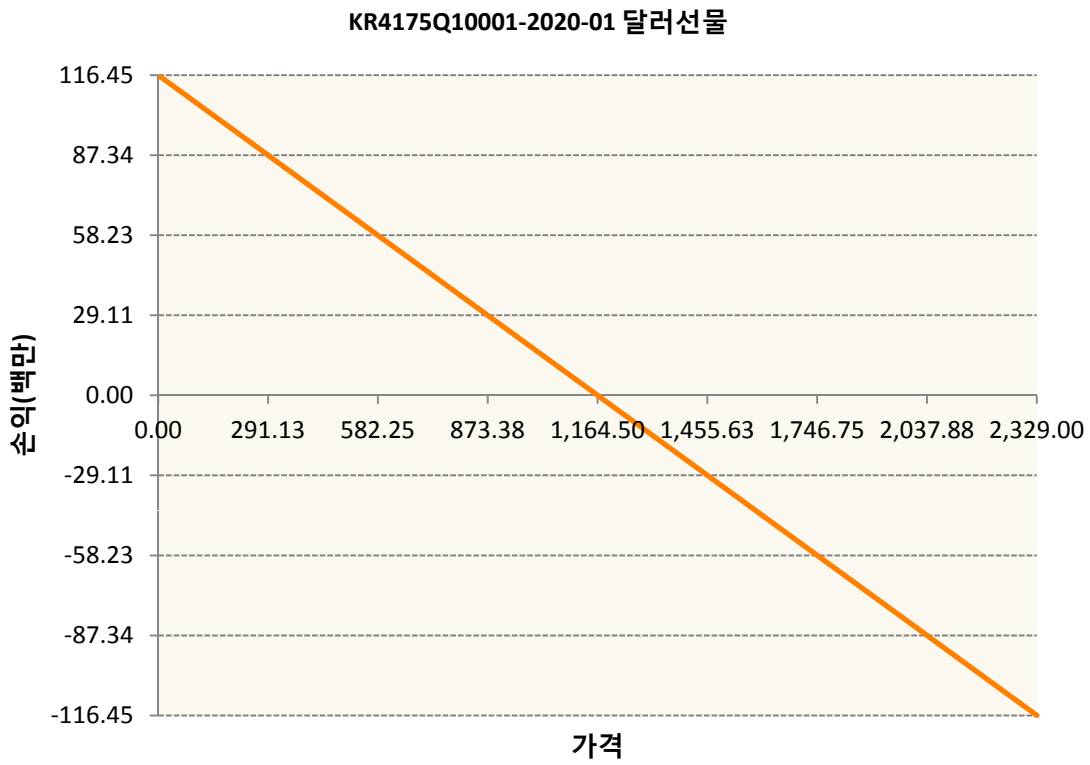
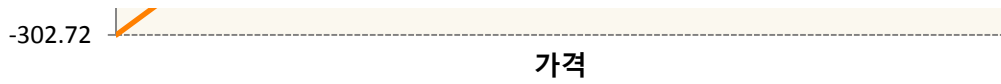
BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20



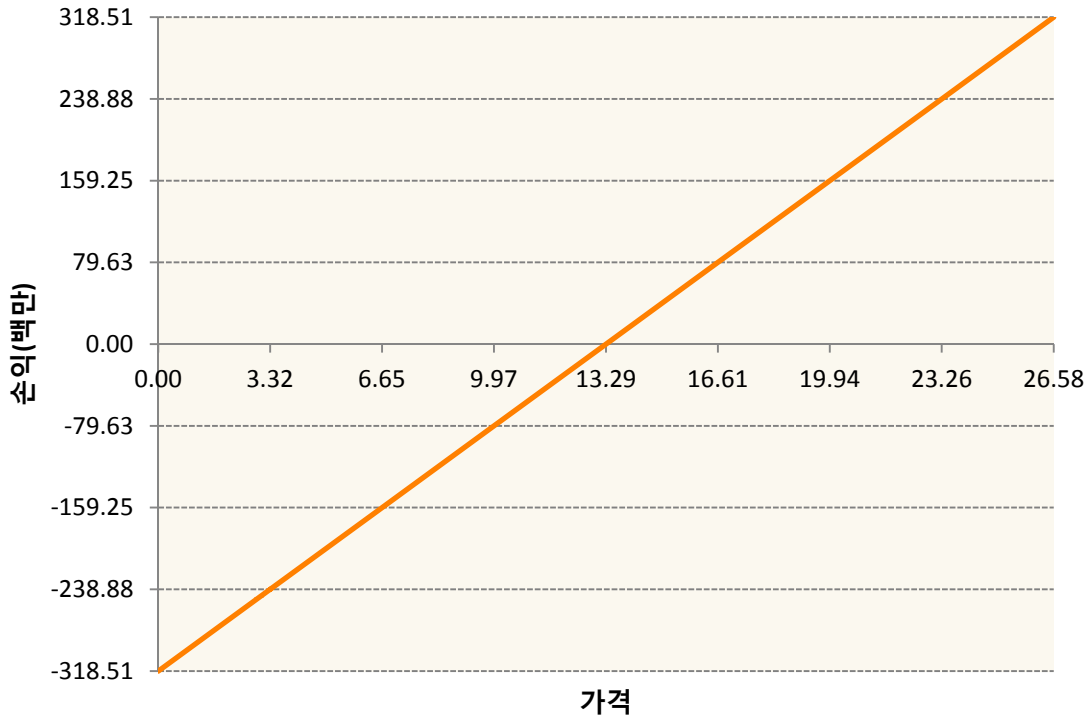
CH0-CORN FUTURE Mar20



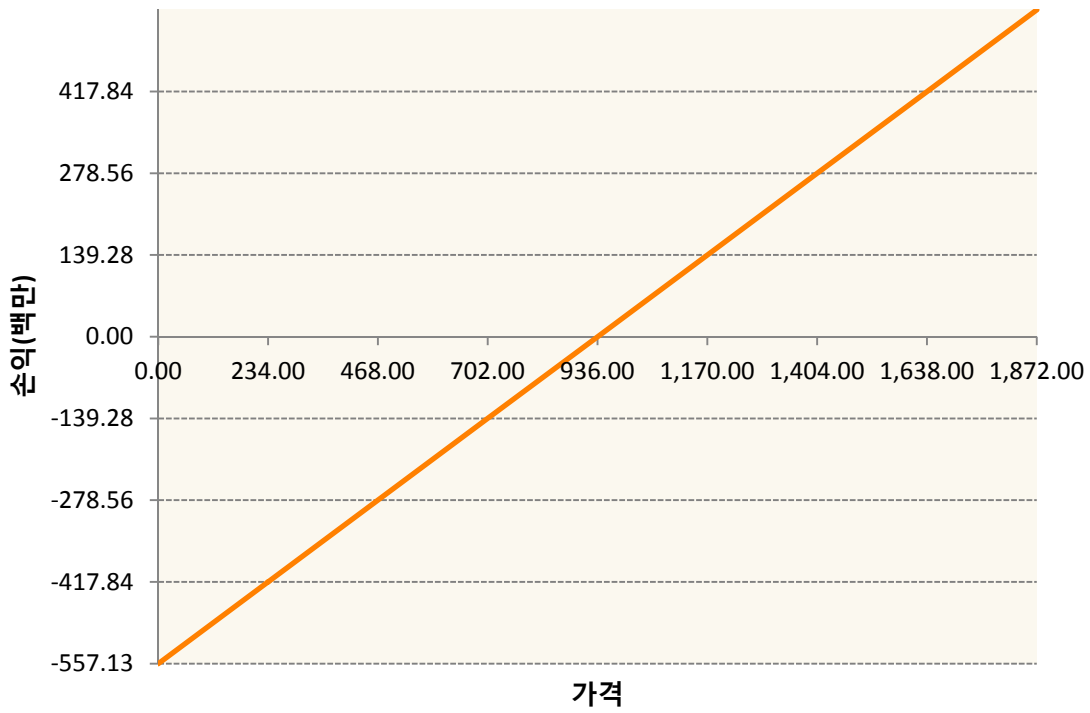




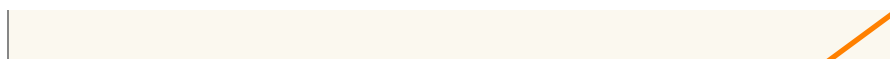
SBH0-Sugar Mar20

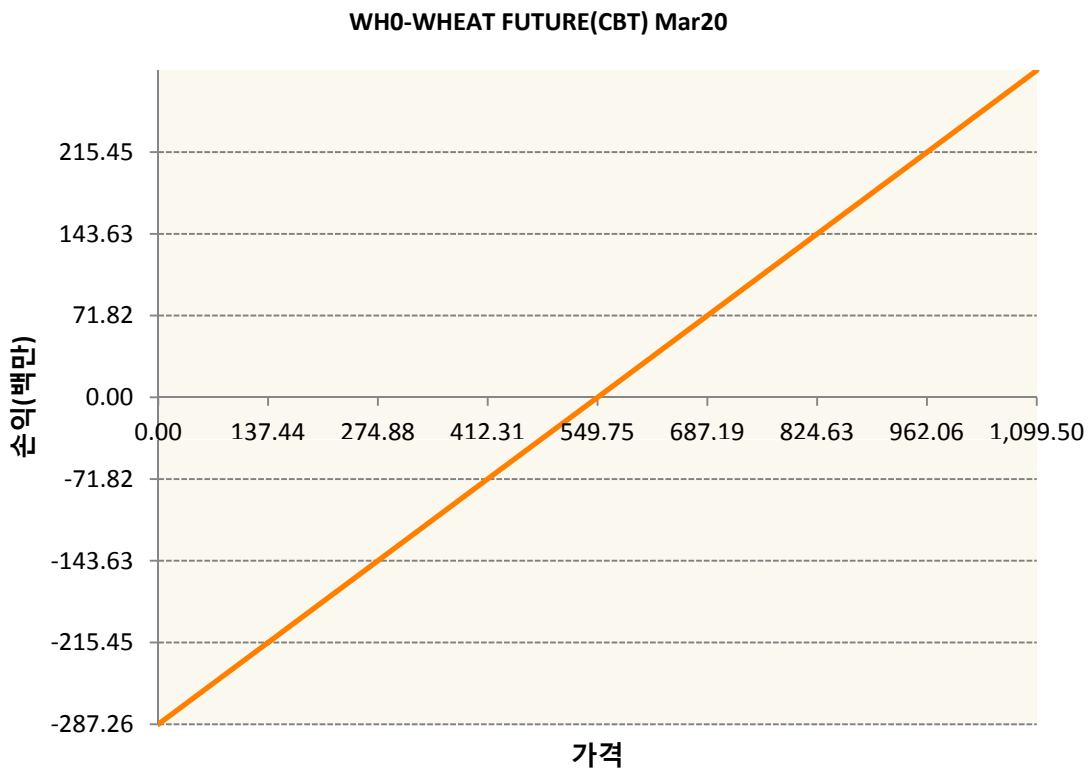
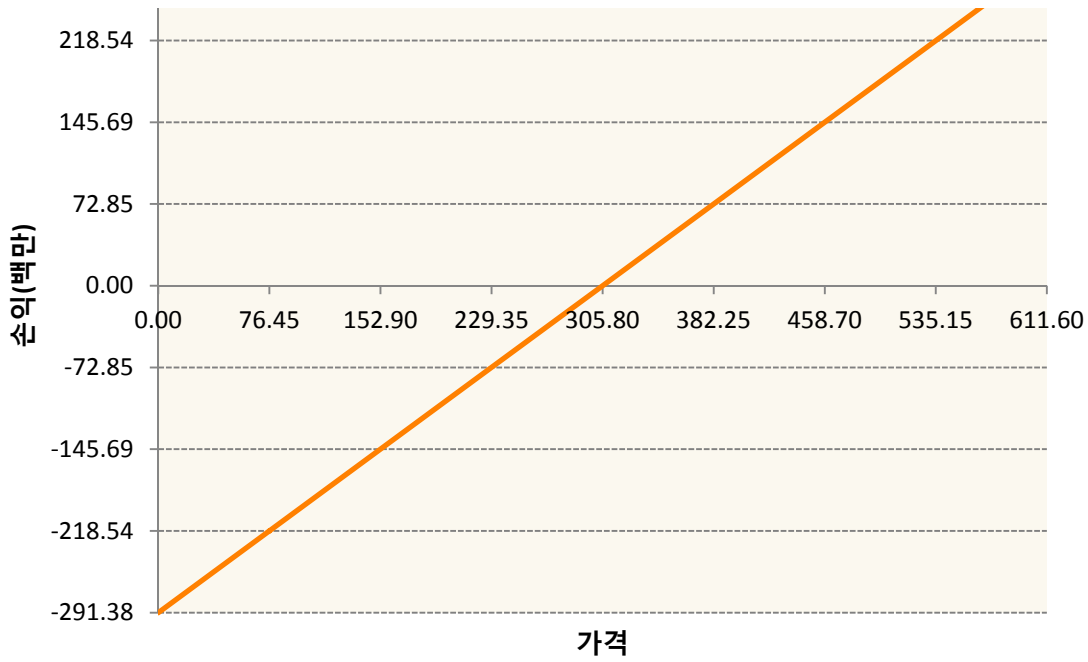


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20



SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH0	SOYBEAN OIL FUTR Mar20	27
CH0	CORN FUTURE Mar20	43
CTH0	COTTON NO.2 FUTR Mar20	9
KCH0	COFFEE 'C' FUTURE Mar20	24
KR4175Q10C	2020-01 달러선물	9

KWH0	KC HRW WHEAT FUT Mar20	9
SBH0	Sugar Mar20	25
SH0	SOYBEAN FUTURE Mar20	45
SMH0	SOYBEAN MEAL FUTR Mar20	23
WH0	WHEAT FUTURE(CBT) Mar20	23

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

(단위:백만원)

251