

공시일	2019-12-19
기준일	2019-12-18

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	2019-12-19
기준일	2019-12-18

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

1,118

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

645

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-19
기준일	2019-12-18

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)	402
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	147

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

766

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-19
기준일	2019-12-18

유로인덱스모(주식-파생형)

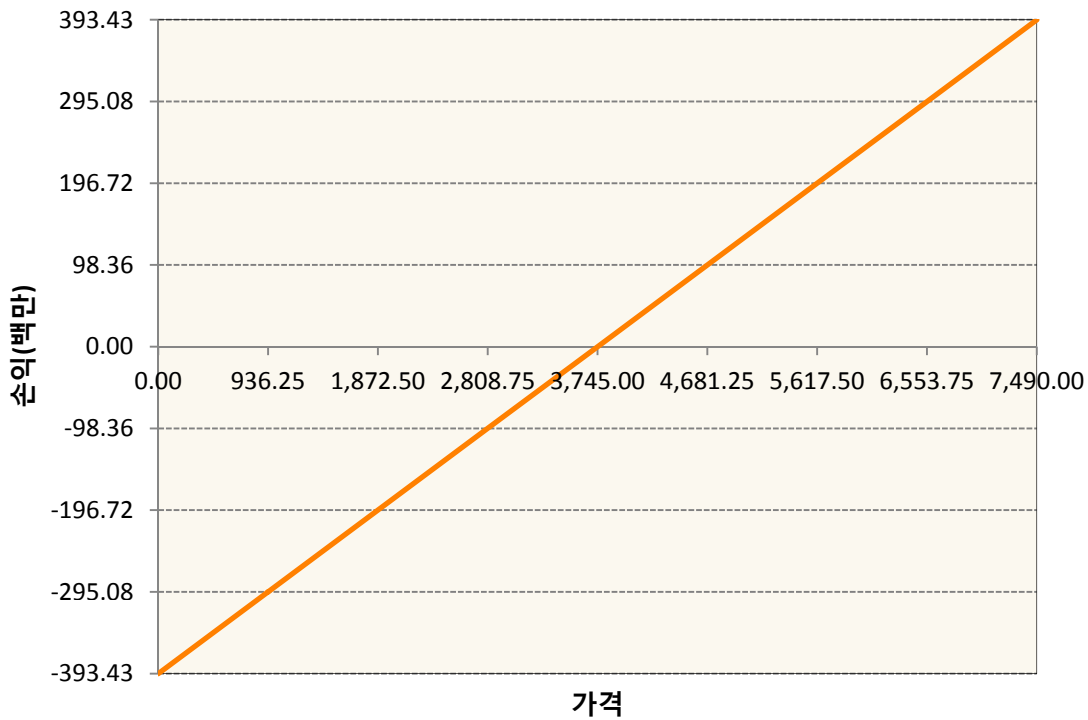
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	393	0	393	

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	2019-12-19
기준일	2019-12-18

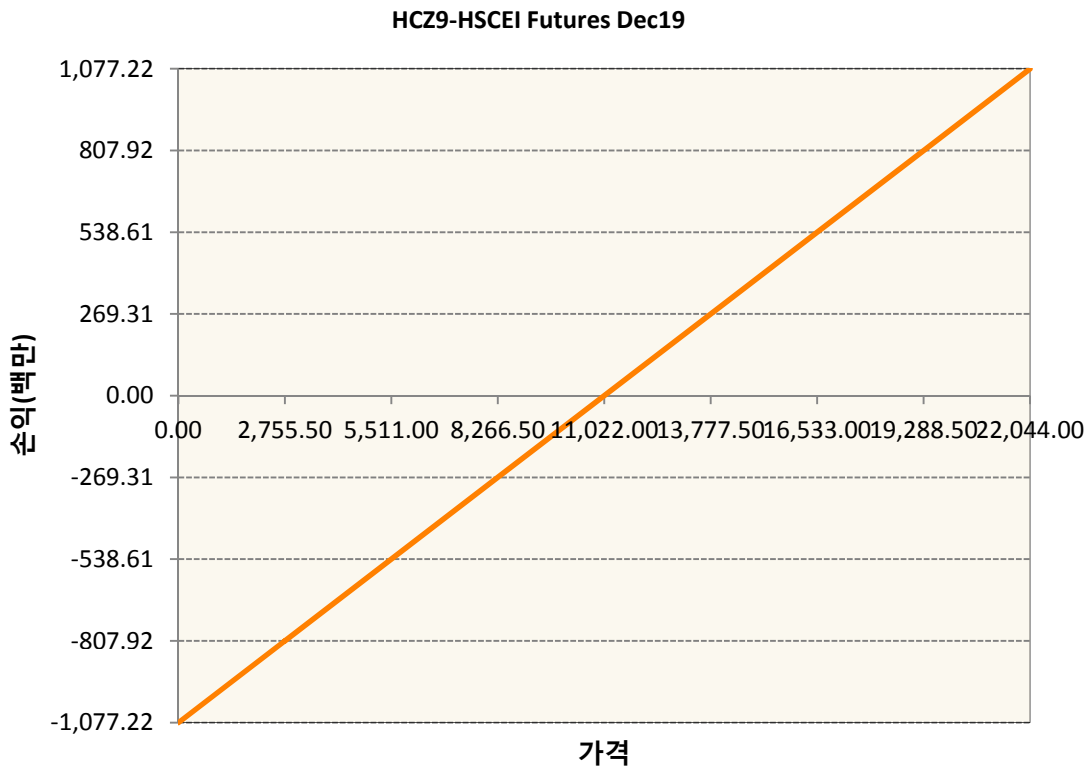
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,077	0	1,077	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

78

공시일	2019-12-19
기준일	2019-12-18

커버드콜모(주식혼합-파생형)

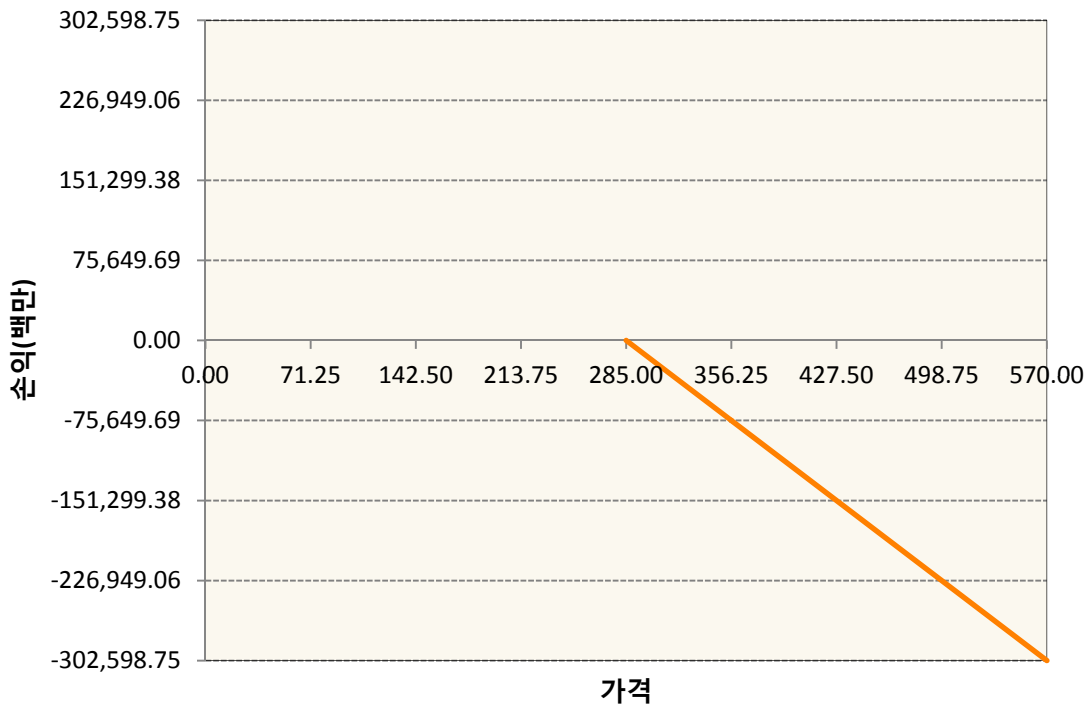
1. 계약금액

(단위:백만원)

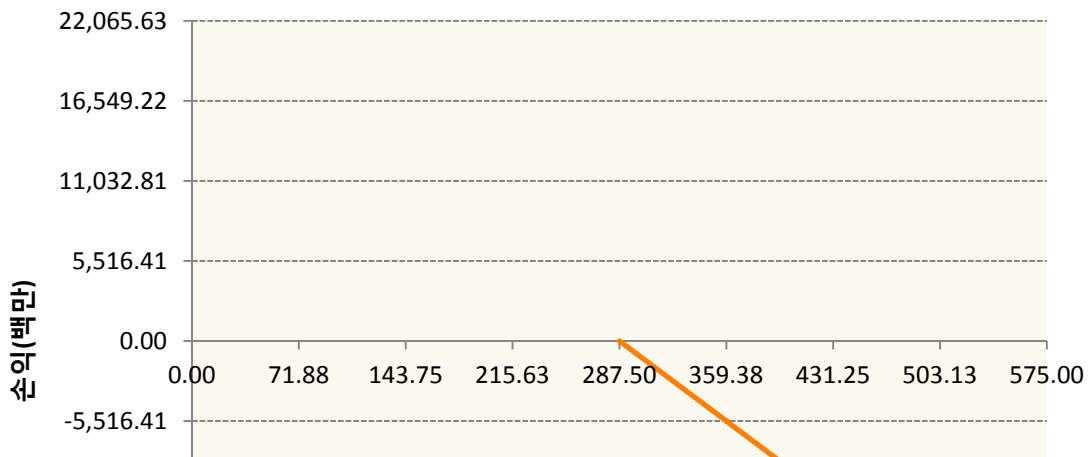
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	29,611	72,828	-43,216	장내
누계	유가증권	옵션	30,994	508,988	-477,994	장내

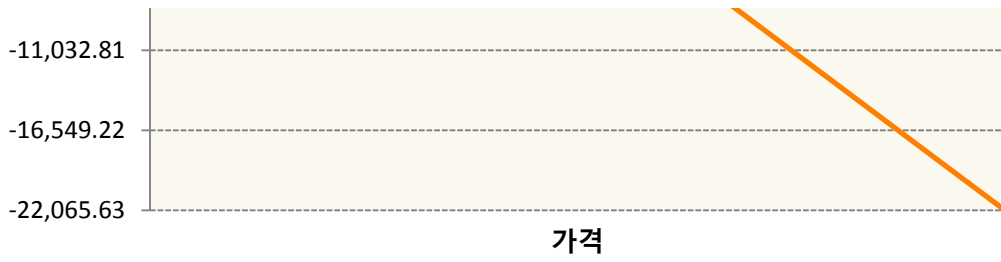
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q12852-2020-01 콜285

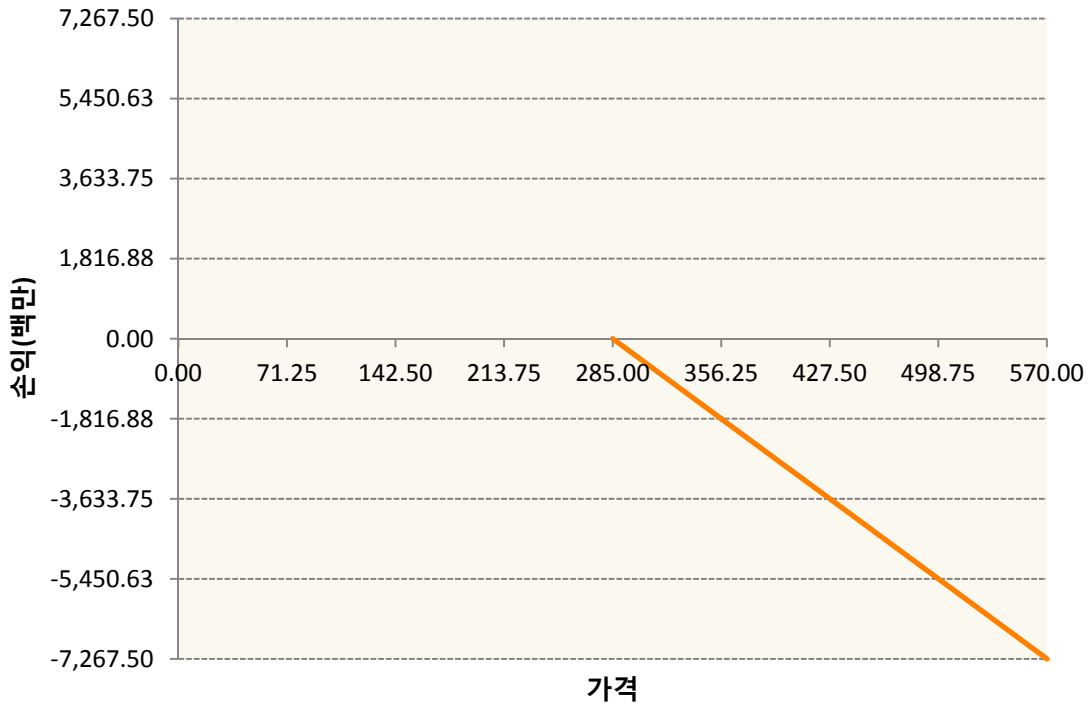


KR4201Q12878-2020-01 콜287.5

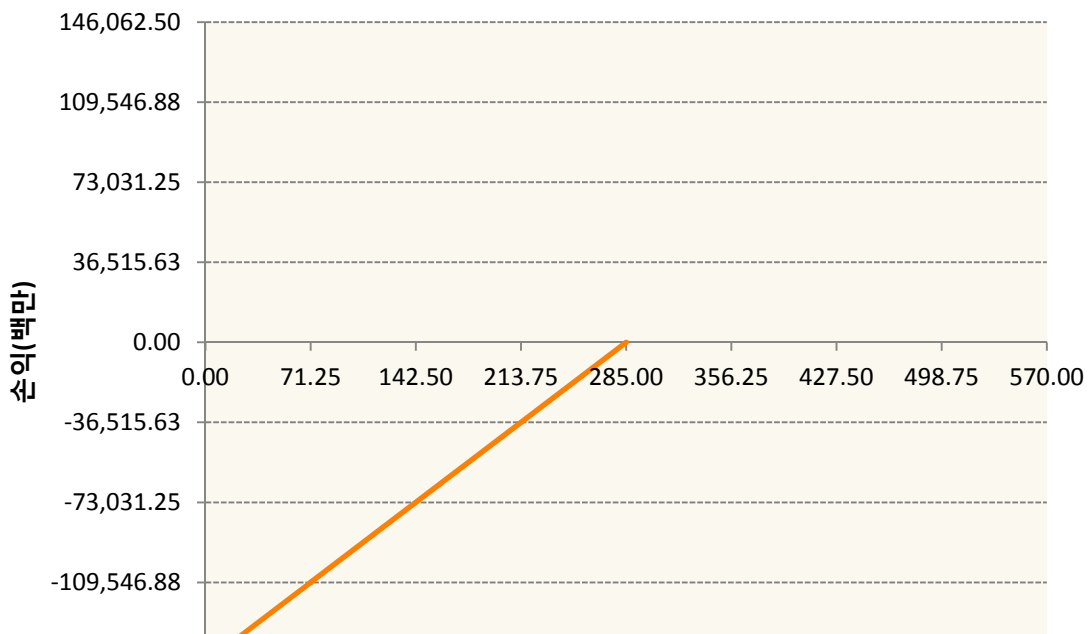




KR4201Q22851-2020-02 콜285



KR4301Q12850-2020-01 풋285



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q12852		2020-01 콜285						21,824
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	12,871	12,441	11,973	11,475	10,954	10,412	9,855	
-5.33%	10,838	10,212	9,574	8,929	8,278	7,621	6,961	
-2.67%	7,196	6,501	5,806	5,110	4,415	3,719	3,024	
0%	1,850	1,250	632	0	-643	-1,294	-1,952	
2.67%	-4,880	-5,292	-5,747	-6,237	-6,757	-7,301	-7,865	
5.33%	-12,489	-12,718	-12,999	-13,329	-13,701	-14,110	-14,551	
8.00%	-20,543	-20,648	-20,796	-20,990	-21,228	-21,507	-21,824	
KR4201Q12878		2020-01 콜287.5						1,532
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	834	807	777	745	711	674	637	
-5.33%	716	674	631	587	541	496	449	
-2.67%	491	441	391	340	290	239	189	
0%	143	96	48	0	-49	-98	-147	
2.67%	-314	-349	-386	-426	-467	-510	-554	
5.33%	-846	-867	-892	-920	-951	-984	-1,019	
8.00%	-1,420	-1,431	-1,444	-1,462	-1,482	-1,506	-1,532	
KR4201Q22851		2020-02 콜285						505
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	357	335	313	290	266	242	218	
-5.33%	290	264	239	213	187	161	135	
-2.67%	197	170	143	116	89	62	35	
0%	78	52	26	0	-26	-53	-79	
2.67%	-64	-87	-110	-134	-159	-183	-209	
5.33%	-225	-243	-263	-284	-306	-328	-351	
8.00%	-401	-414	-430	-447	-465	-485	-505	
KR4301Q12850		2020-01 풋285						7,256
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-7,026	-7,043	-7,069	-7,103	-7,146	-7,197	-7,256	
-5.33%	-3,283	-3,381	-3,486	-3,598	-3,716	-3,838	-3,963	
-2.67%	-696	-847	-999	-1,151	-1,304	-1,456	-1,609	
0%	245	173	91	0	-99	-205	-316	
2.67%	389	378	360	334	300	257	207	

5.33%	398	397	395	392	385	375	360
8.00%	398	398	398	398	397	395	392

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

(단위:백만원)

30,049

공시일	2019-12-19
기준일	2019-12-18

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

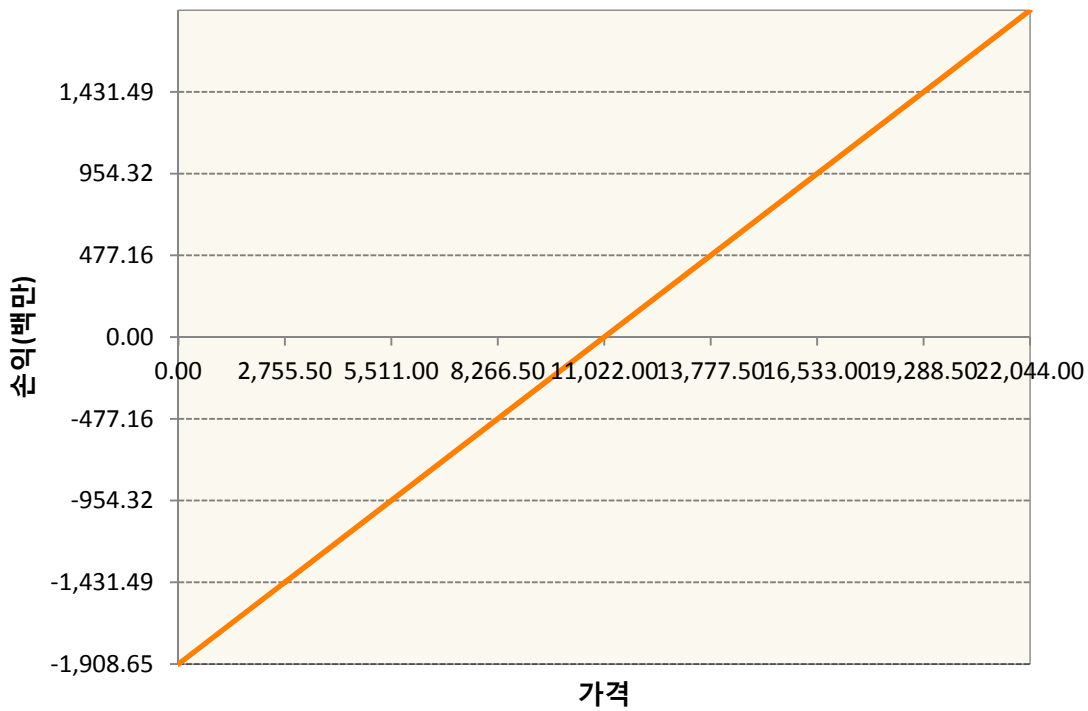
1. 계약금액

(단위:백만원)

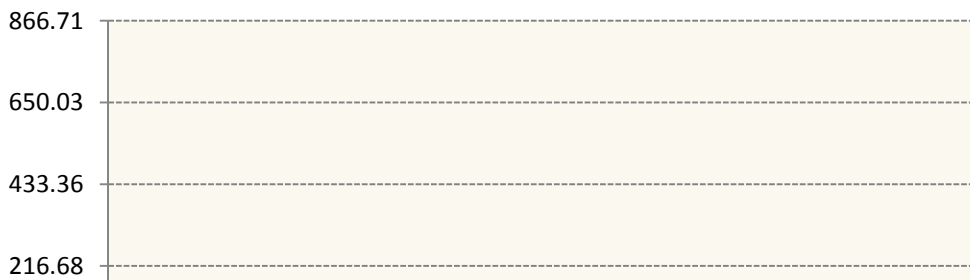
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,909	0	1,909	
누계	유가증권	옵션	0	4,915	-4,915	장내
누계	통화	선도	0	2,113	-2,113	장외

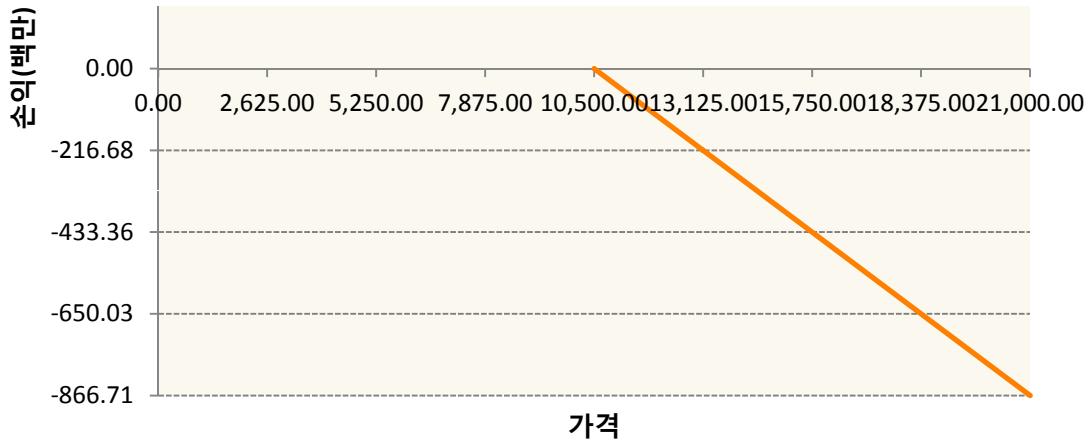
2. 만기시점의 손익구조

HCZ9-HSCEI Futures Dec19

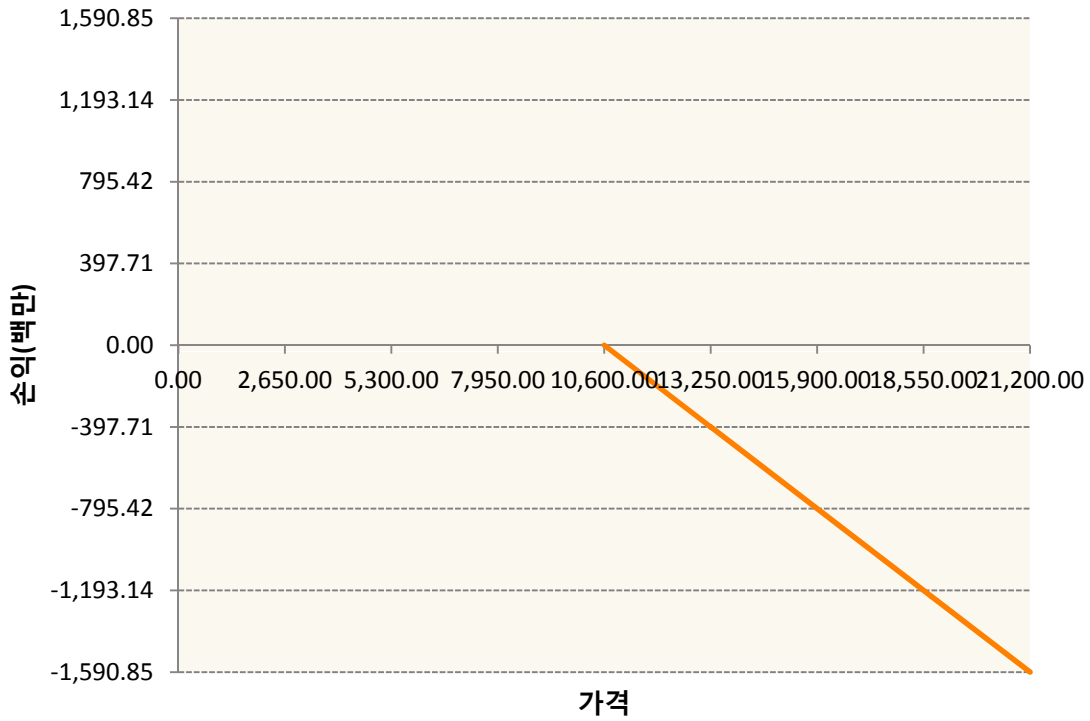


OHHIZ9-C105-HSCEI

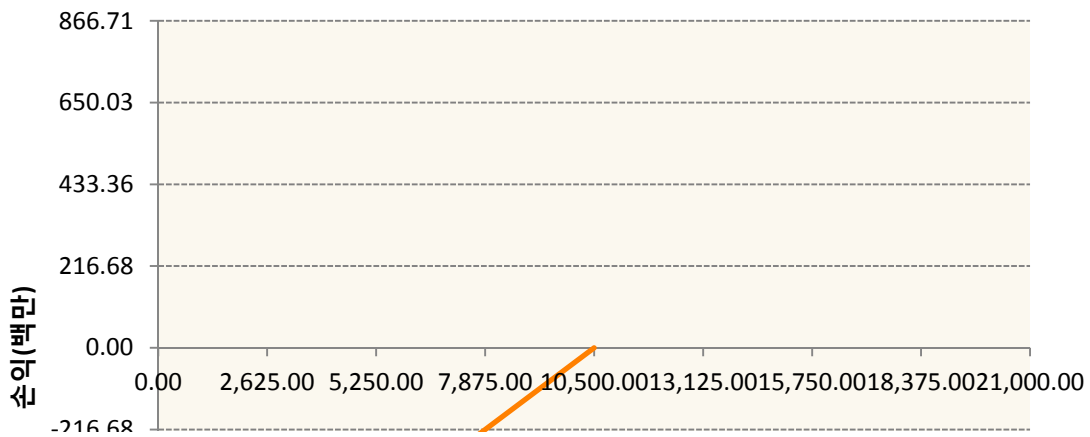


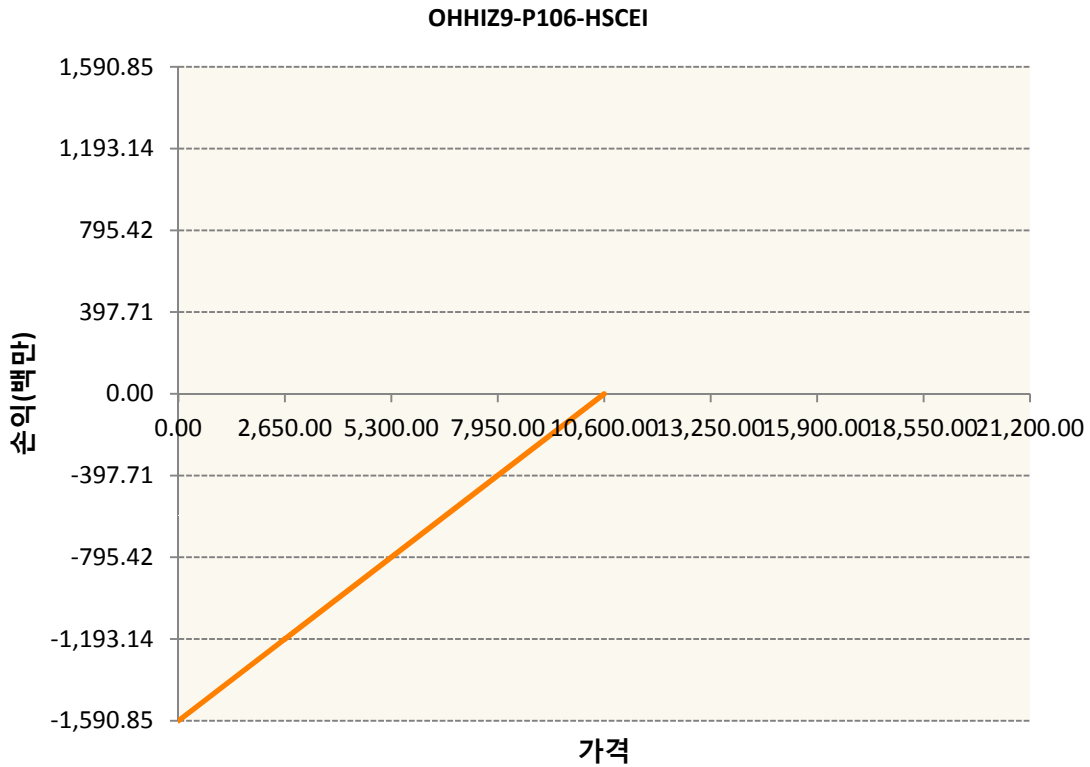


OHHIZ9-C106-HSCEI



OHHIZ9-P105-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	169
HCZ9 HSCEI Futures Dec19	153
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)
	539

공시일	2019-12-19
기준일	2019-12-18

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

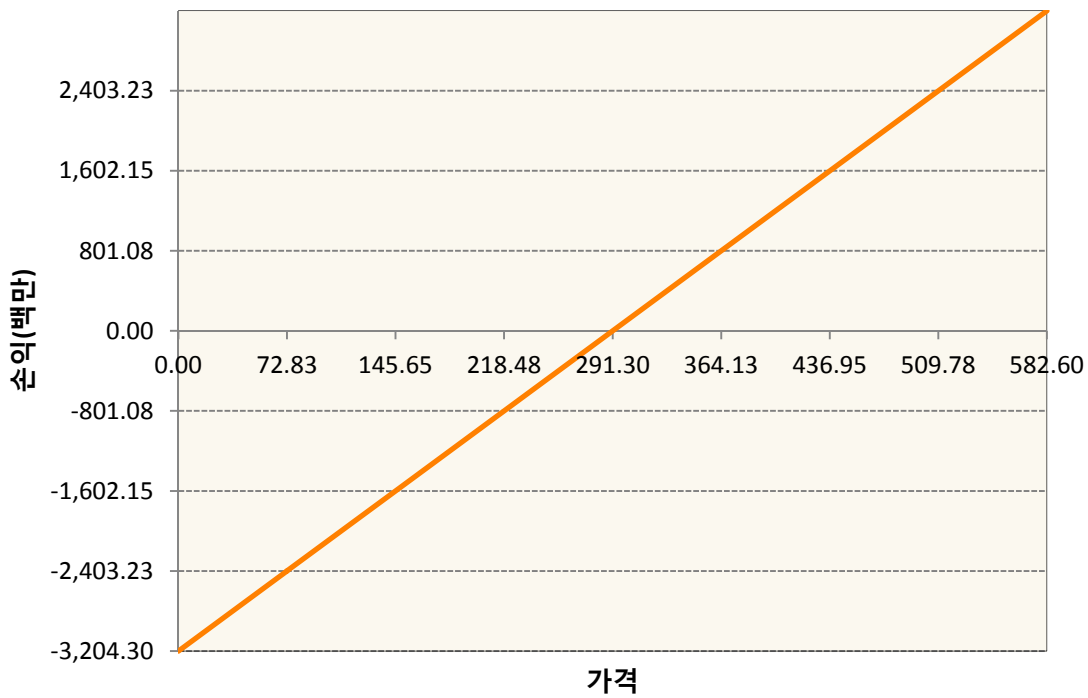
1. 계약금액

(단위:백만원)

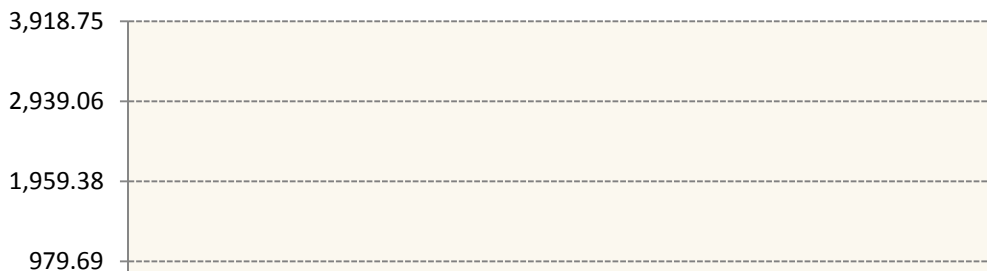
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,204	0	3,204	장내
누계	유가증권	스왑	8,625	0	8,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	8,839	-8,839	장내

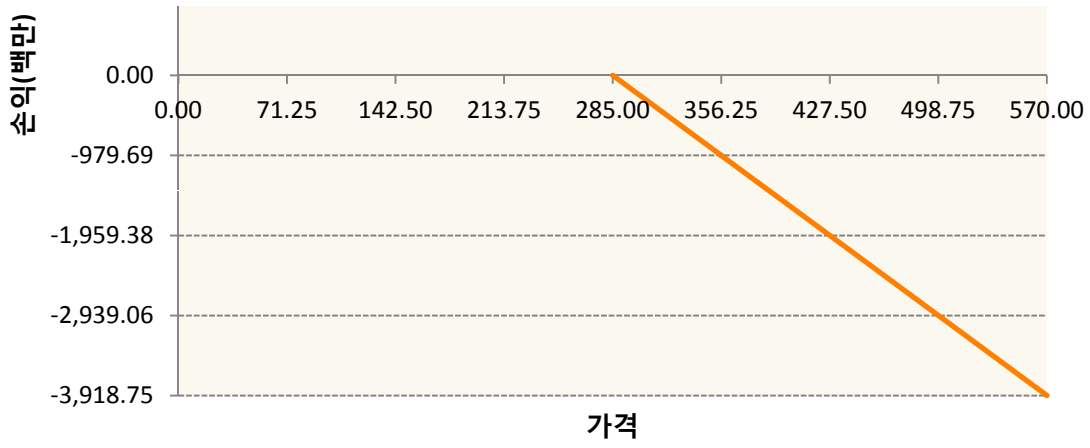
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

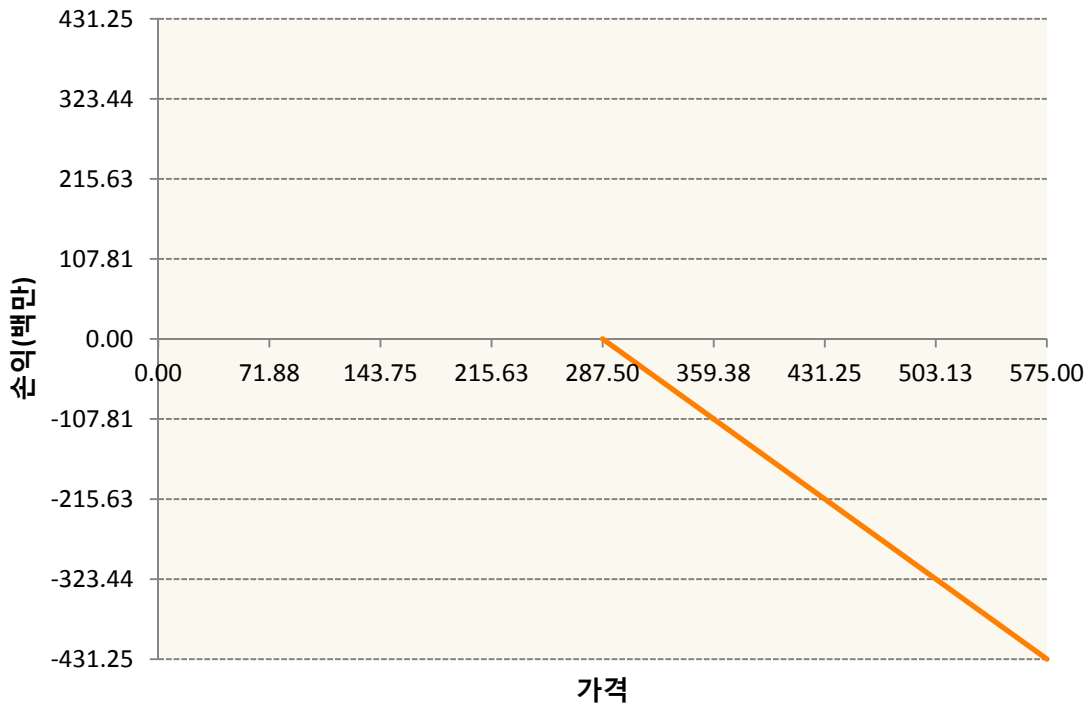


KR4201Q12852-2020-01 콜285

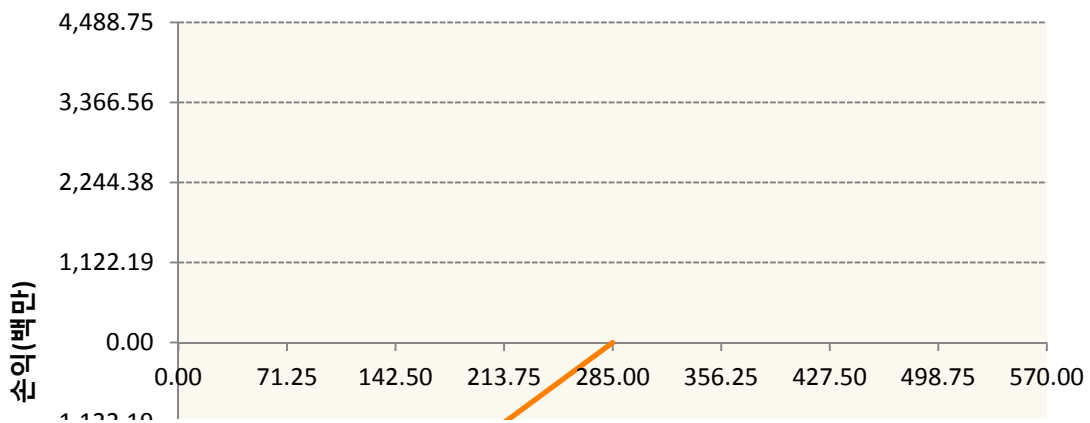




KR4201Q12878-2020-01 콜287.5



KR4301Q12850-2020-01 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						738
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-738	-738	-738	-738	-738	-738	-738	
-5.33%	-492	-492	-492	-492	-492	-492	-492	
-2.67%	-246	-246	-246	-246	-246	-246	-246	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	246	246	246	246	246	246	246	
5.33%	492	492	492	492	492	492	492	
8.00%	738	738	738	738	738	738	738	
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%	167	161	155	149	142	135	128	
-5.33%	140	132	124	116	107	99	90	
-2.67%	93	84	75	66	57	48	39	
0%	24	16	8	0	-8	-17	-25	
2.67%	-63	-69	-74	-81	-88	-95	-102	
5.33%	-162	-165	-168	-173	-177	-183	-188	
8.00%	-266	-267	-269	-272	-275	-279	-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%	16	16	15	15	14	13	12
-5.33%	14	13	12	11	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%	-17	-17	-17	-18	-19	-19	-20
8.00%	-28	-28	-28	-29	-29	-29	-30
KR4301Q12850 2020-01 풋285							223
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-216	-216	-217	-218	-220	-221	-223
-5.33%	-101	-104	-107	-111	-114	-118	-122
-2.67%	-21	-26	-31	-35	-40	-45	-49
0%	8	5	3	0	-3	-6	-10
2.67%	12	12	11	10	9	8	6
5.33%	12	12	12	12	12	12	11
8.00%	12	12	12	12	12	12	12

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

(단위:백만원)

1,442

공시일	2019-12-19
기준일	2019-12-18

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

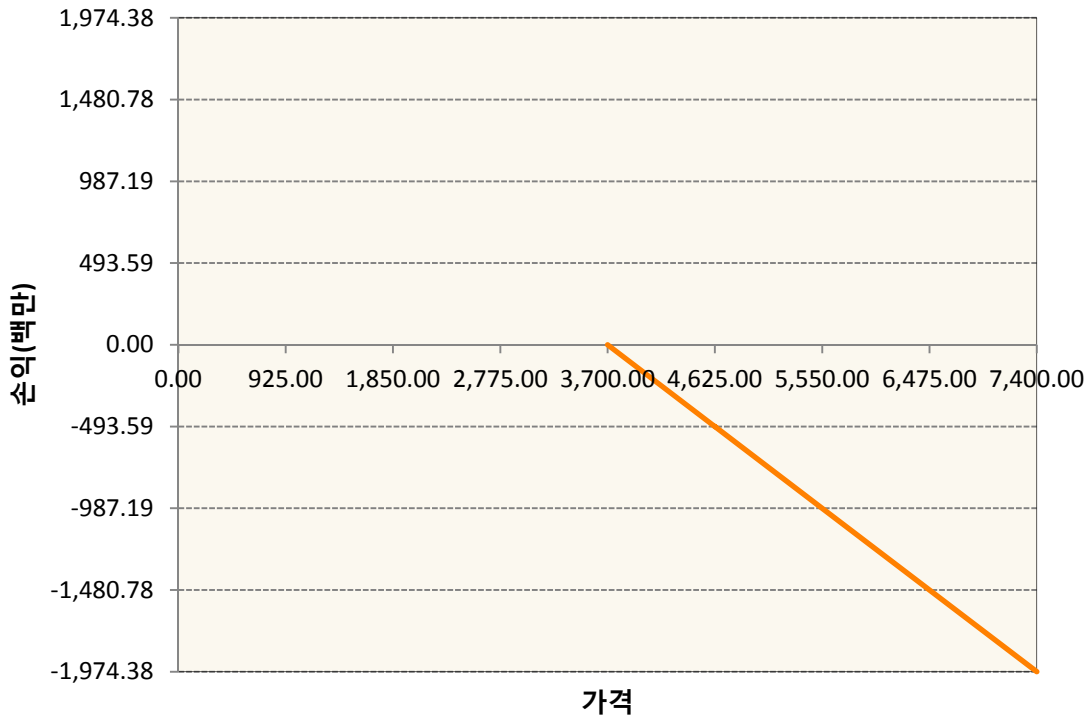
1. 계약금액

(단위:백만원)

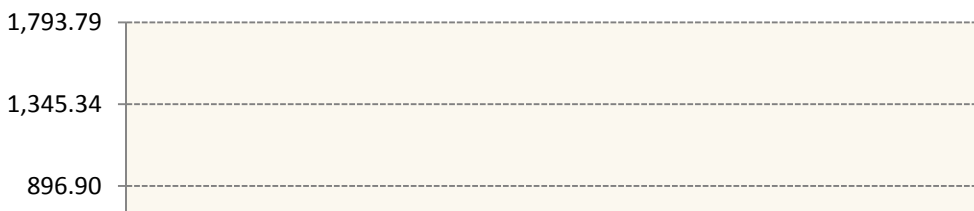
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	728	0	728	
누계	유가증권	스왑	17,796	0	17,796	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,536	-7,536	장내
누계	통화	선도	2,702	6,117	-3,415	장외

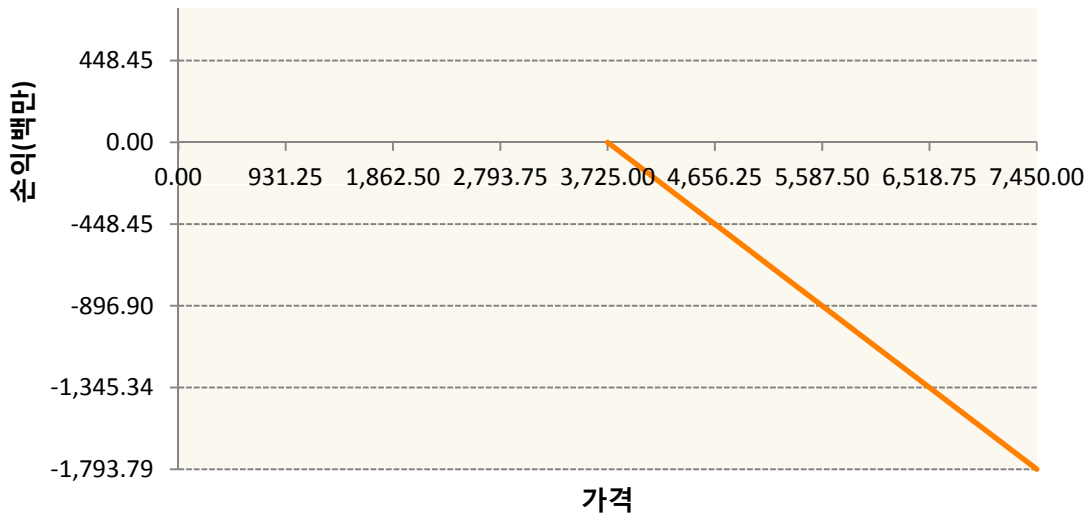
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ9-C3700-EURO STOXX 50

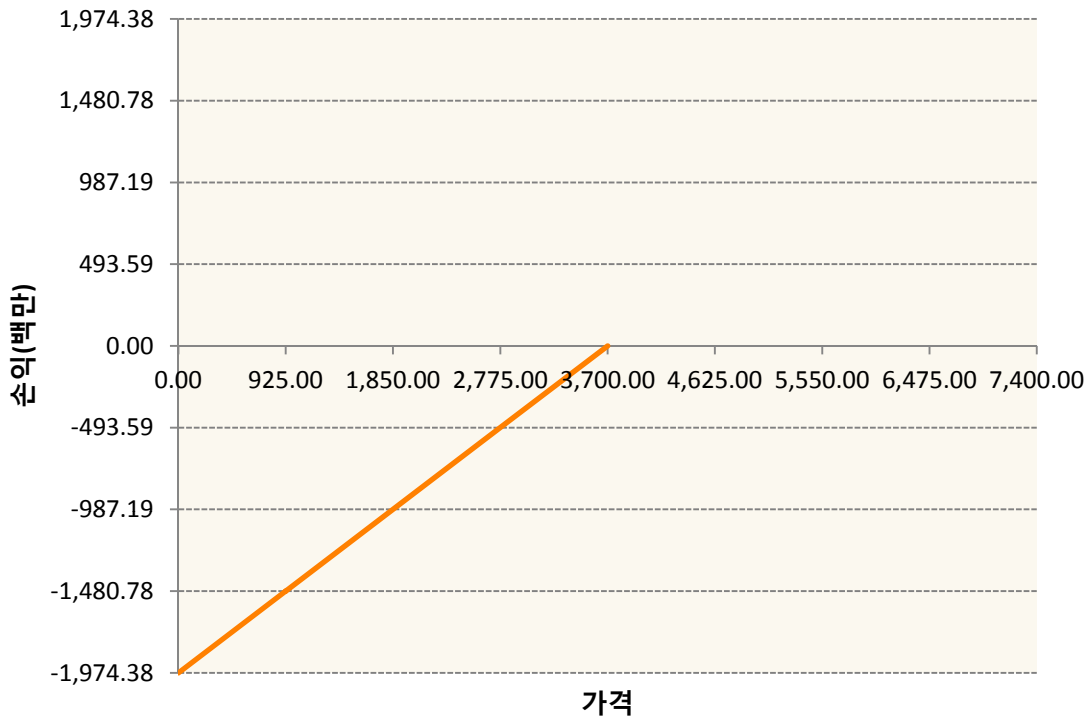


OESXZ9-C3725-EURO STOXX 50

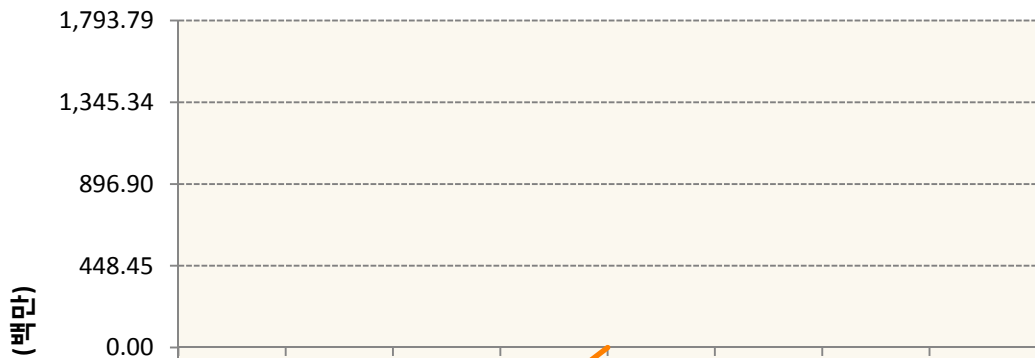


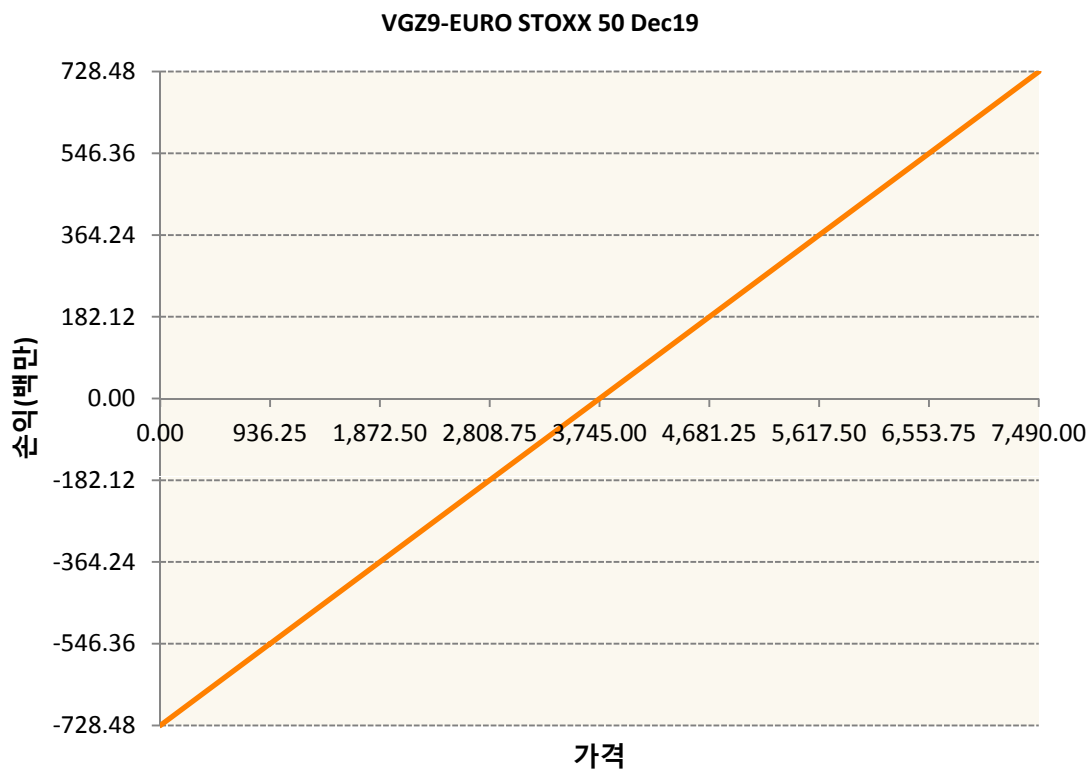
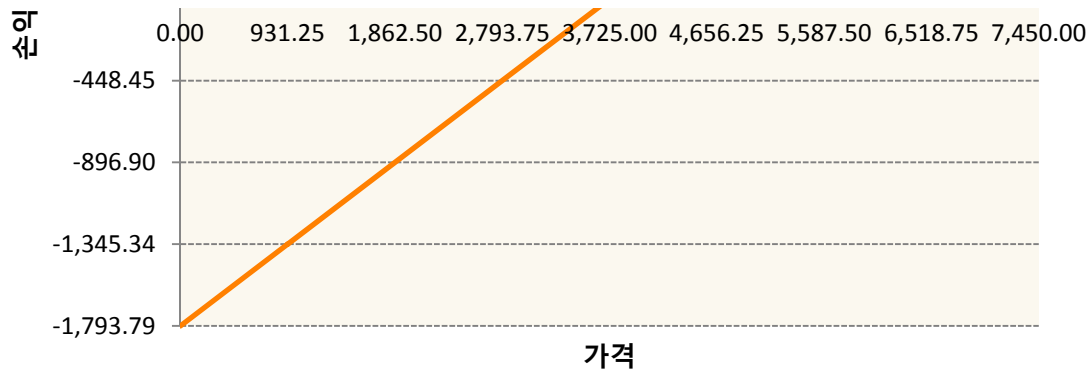


OESXZ9-P3700-EURO STOXX 50



OESXZ9-P3725-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	37
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	144
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	158
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	144
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19	58

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

(단위:백만원)

816

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

(단위:백만원)

948

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	2019-12-19
기준일	2019-12-18

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

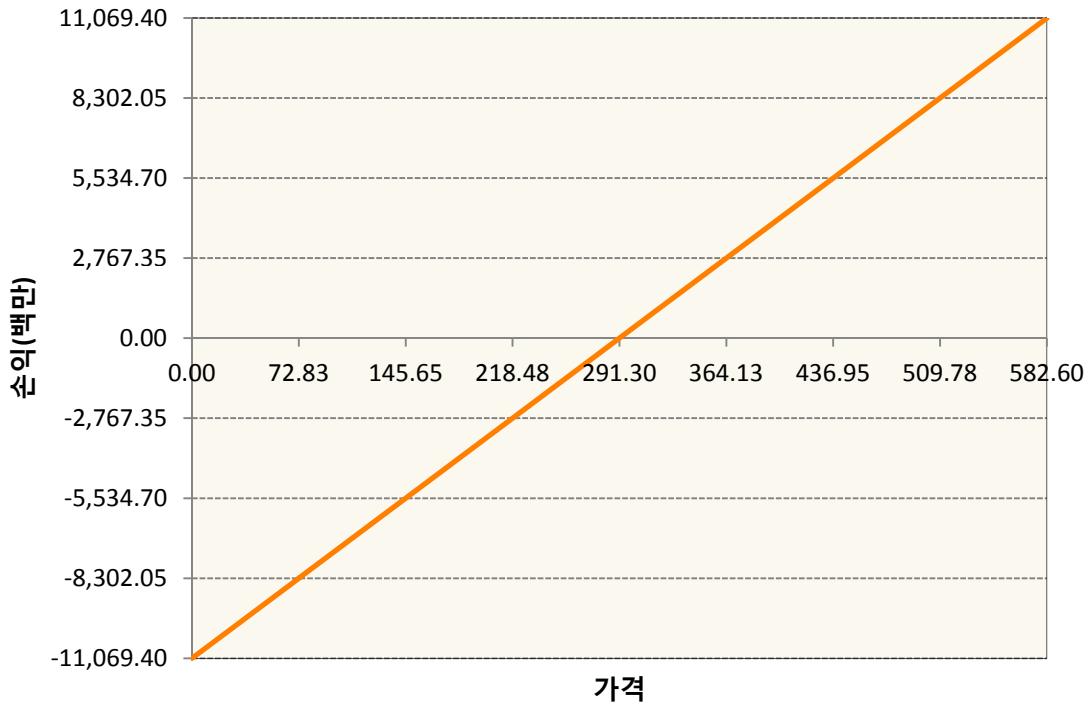
1. 계약금액

(단위:백만원)

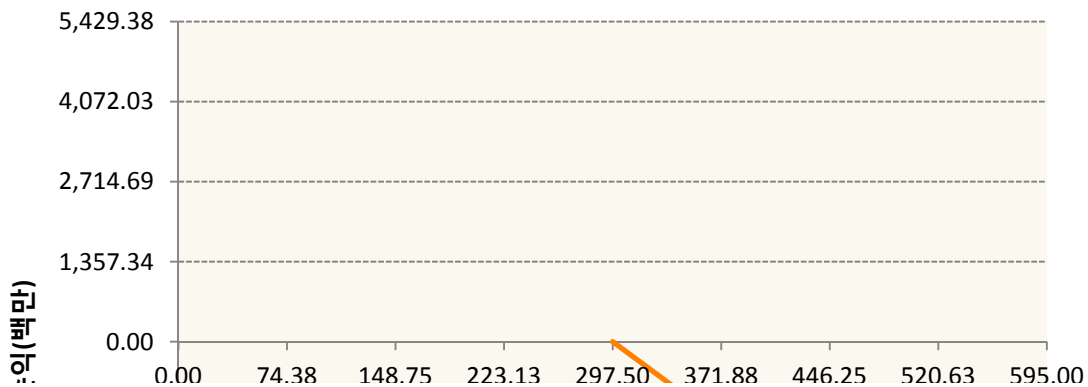
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,069	0	11,069	장내
누계	유가증권	옵션	499	21,254	-20,756	장내

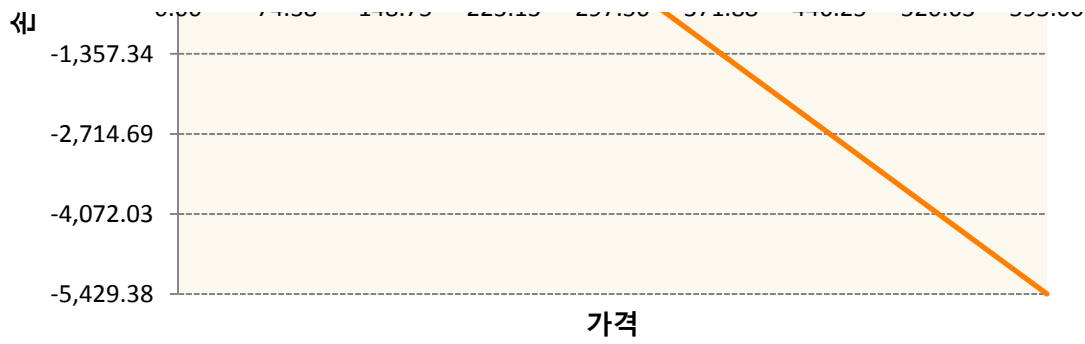
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

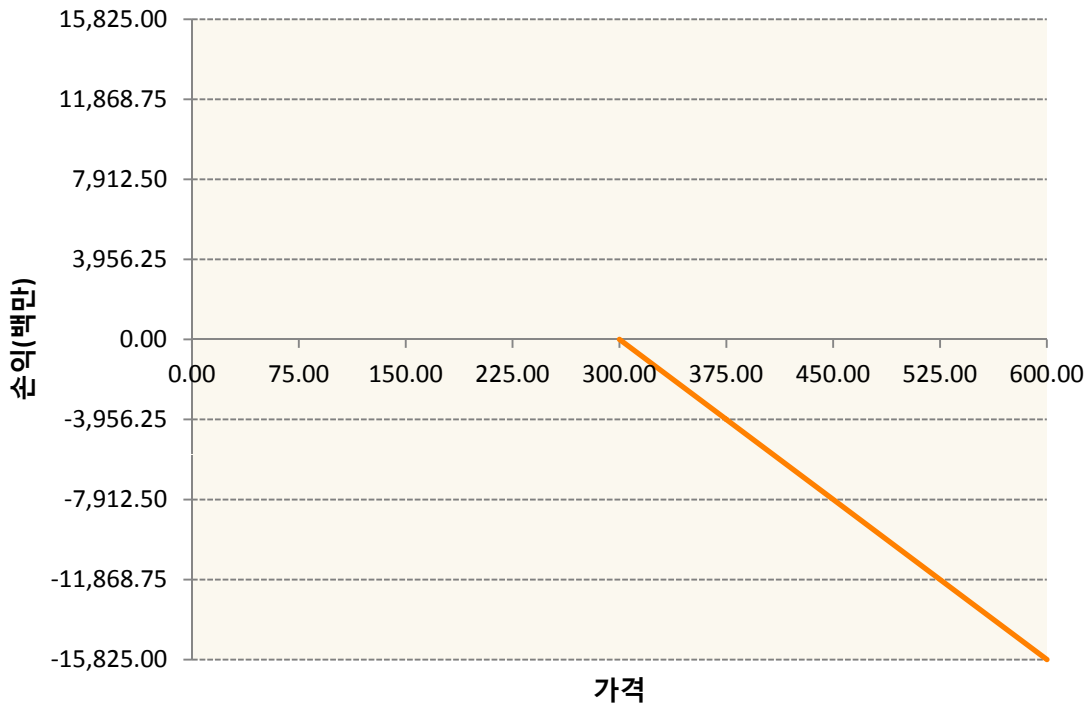


KR4201Q12977-2020-01 콜297.5

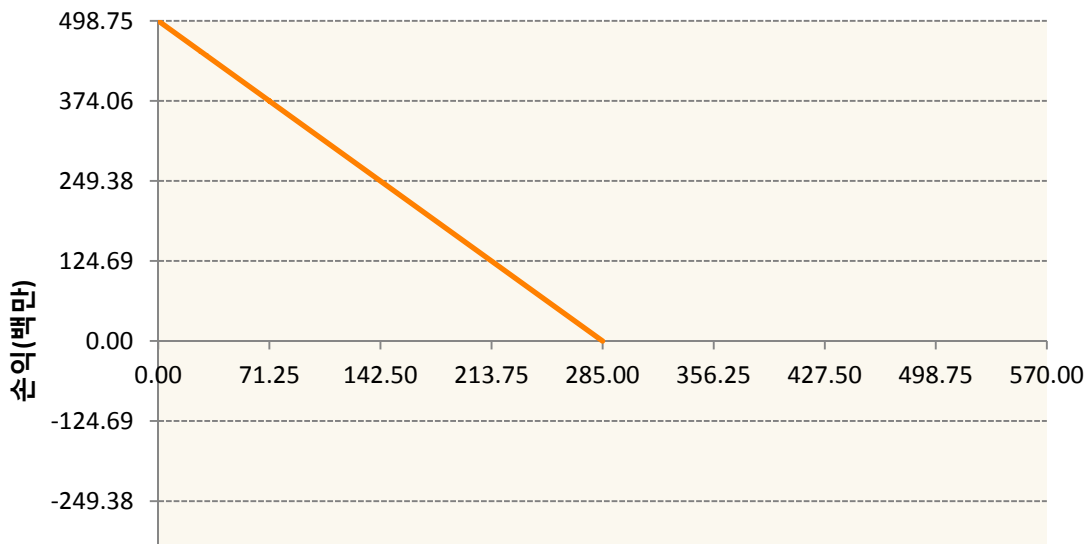


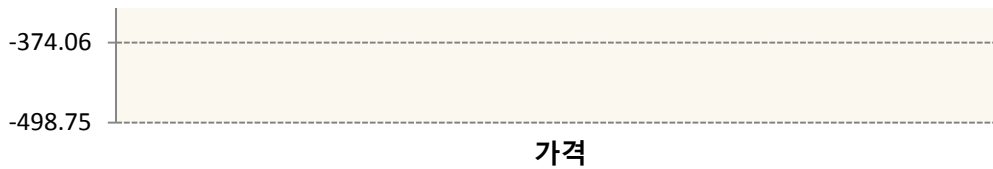


KR4201Q13009-2020-01 콜300



KR4301Q12850-2020-01 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						894
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-894	-894	-894	-894	-894	-894	-894	
-5.33%	-596	-596	-596	-596	-596	-596	-596	
-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%	596	596	596	596	596	596	596	
8.00%	894	894	894	894	894	894	894	
KR4201Q12977		2020-01 콜297.5						310
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	116	113	110	106	101	95	89	
-5.33%	107	101	94	87	79	71	62	
-2.67%	83	74	64	53	43	32	21	
0%	37	24	12	0	-12	-25	-37	
2.67%	-38	-50	-62	-75	-87	-99	-112	
5.33%	-140	-149	-159	-170	-181	-192	-203	
8.00%	-261	-267	-275	-283	-291	-300	-310	
KR4201Q13009		2020-01 콜300						849
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	287	281	273	263	250	236	220	
-5.33%	267	253	237	218	198	176	152	
-2.67%	214	189	163	135	107	77	47	
0%	102	68	34	0	-35	-69	-104	
2.67%	-87	-124	-160	-196	-233	-269	-305	
5.33%	-357	-388	-420	-453	-487	-521	-555	
8.00%	-692	-713	-737	-763	-791	-819	-849	
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	25	25	
-5.33%	11	12	12	12	13	13	14	
-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)

1,775

공시일	2019-12-19
기준일	2019-12-18

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	207,024	0	207,024	

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	2019-12-19
기준일	2019-12-18

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	216,103	0	216,103	

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	2019-12-19
기준일	2019-12-18

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	549,474	0	549,474	
누계	통화	선도	0	536,596	-536,596	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		4,769
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,403
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,505
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		1,870
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		3,217
FX21019X02 KRW/USD 26-12-19E		4,713
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		4,769
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		187
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,805
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,805
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,338
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,525
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E		1,627
FX21019Z00 KRW/USD 10-01-20E		1,122
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E		1,533
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E		935
FX21019Z02 KRW/USD 16-01-20E		1,683
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		187
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		2,001
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		935

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

(단위:백만원)

13,872

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

(단위:백만원)

190

공시일	2019-12-19
기준일	2019-12-18

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

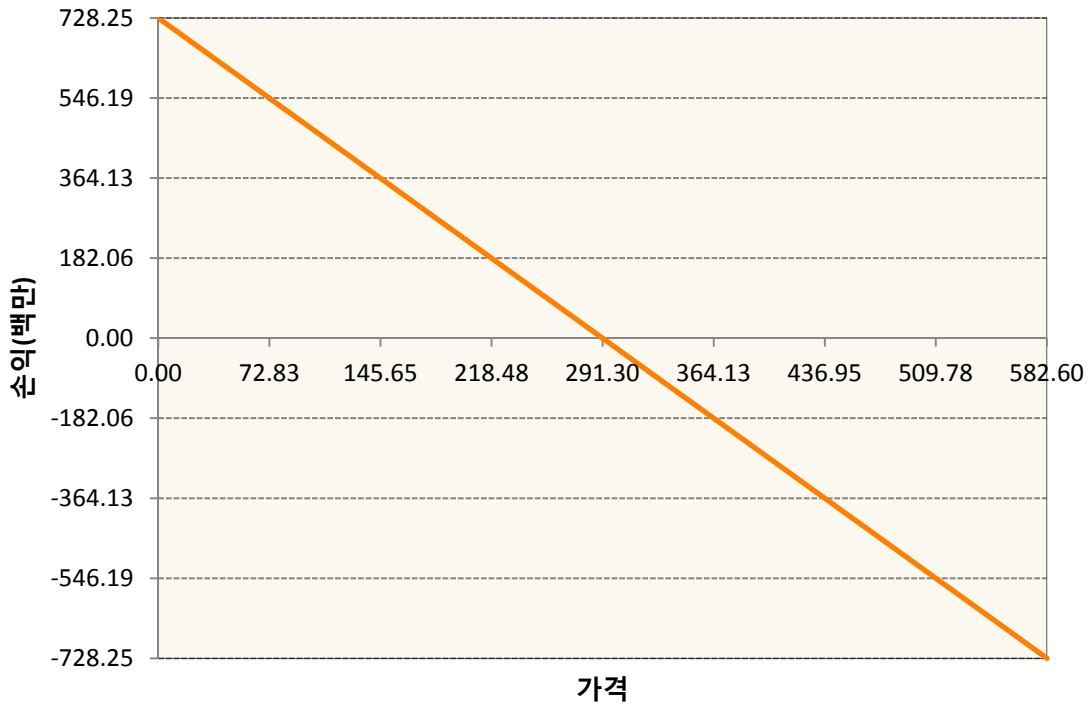
1. 계약금액

(단위:백만원)

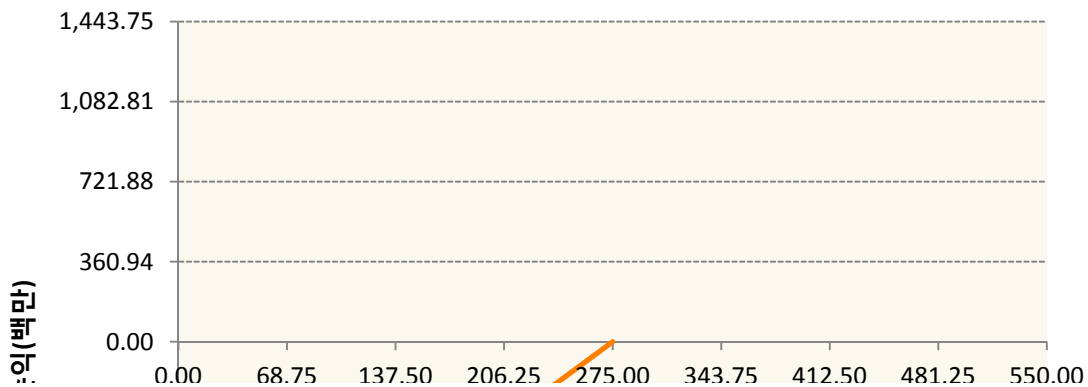
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	69	0	69	장내
누계	유가증권	선물	0	728	-728	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,941	-3,941	장내

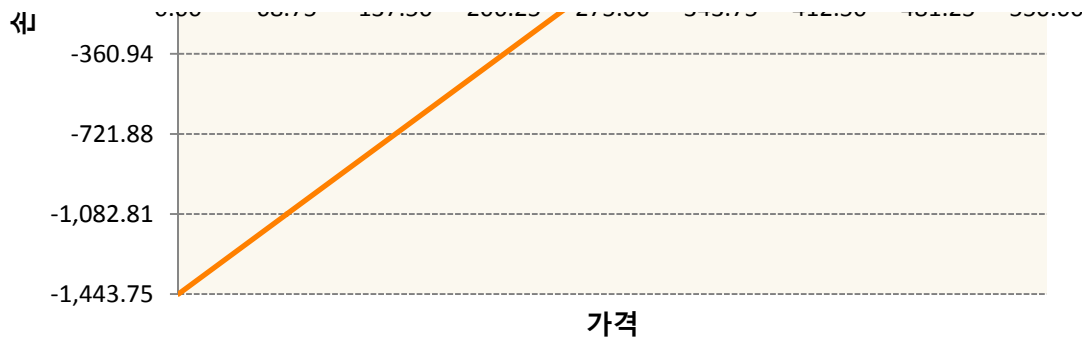
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

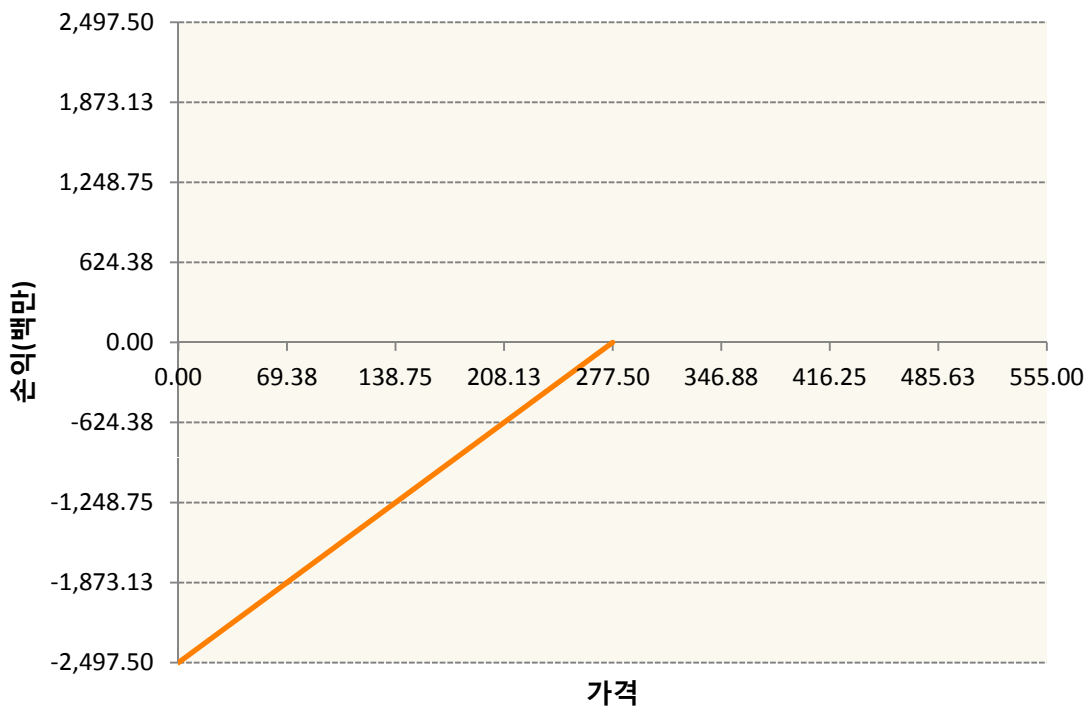


KR4301Q12751-2020-01 풋275





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						36
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-28	-29	-31	-32	-33	-35	-36
-5.33%	-6	-8	-9	-11	-12	-13	-15
-2.67%	0	-1	-1	-2	-3	-4	-4
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

77

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-66	-67	-69	-71	-73	-75	-77
-5.33%	-19	-21	-24	-27	-29	-32	-35
-2.67%	-2	-3	-4	-6	-8	-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	2019-12-19
기준일	2019-12-18

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	14,418	0	14,418	
누계	통화	선도	351	14,446	-14,096	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		290
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		291
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E		346
FX21019Z02 USD/KRW 13-01-20E		28

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

(단위:백만원)

383

공시일	2019-12-19
기준일	2019-12-18

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	999	0	999	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	2019-12-19
기준일	2019-12-18

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

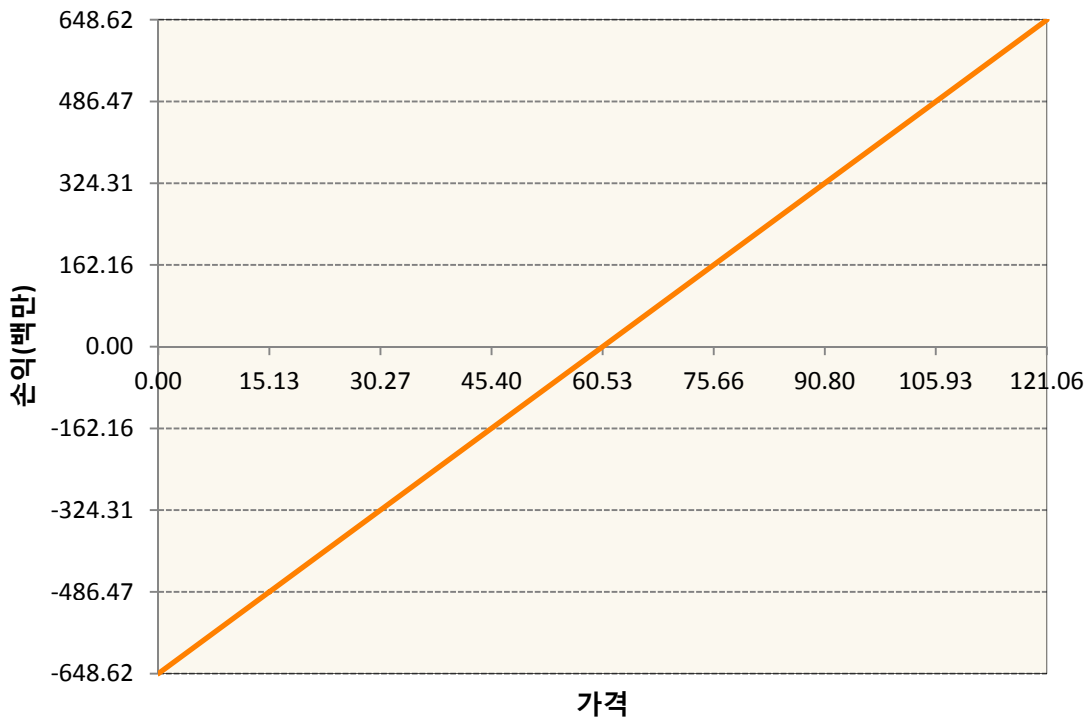
1. 계약금액

(단위:백만원)

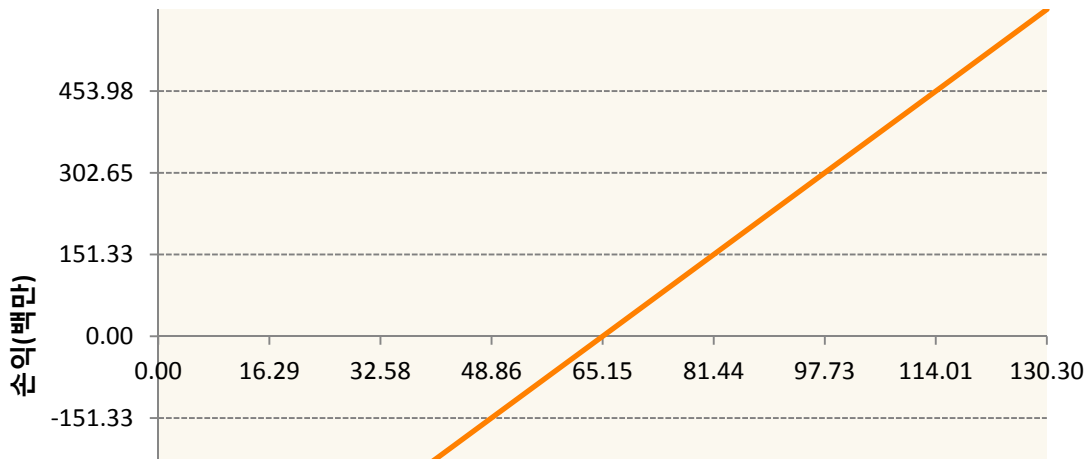
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,437	292	2,145	

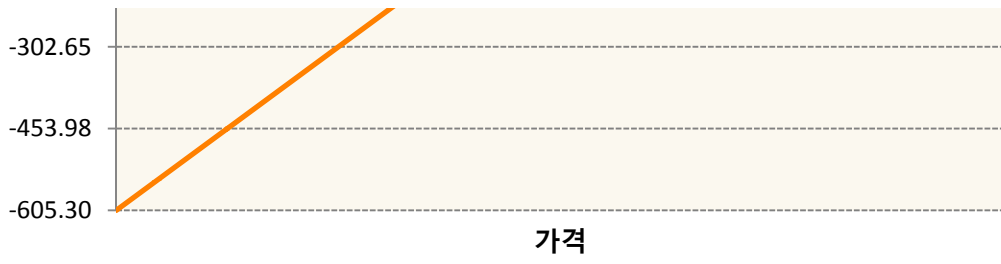
2. 만기시점의 손익구조

CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20

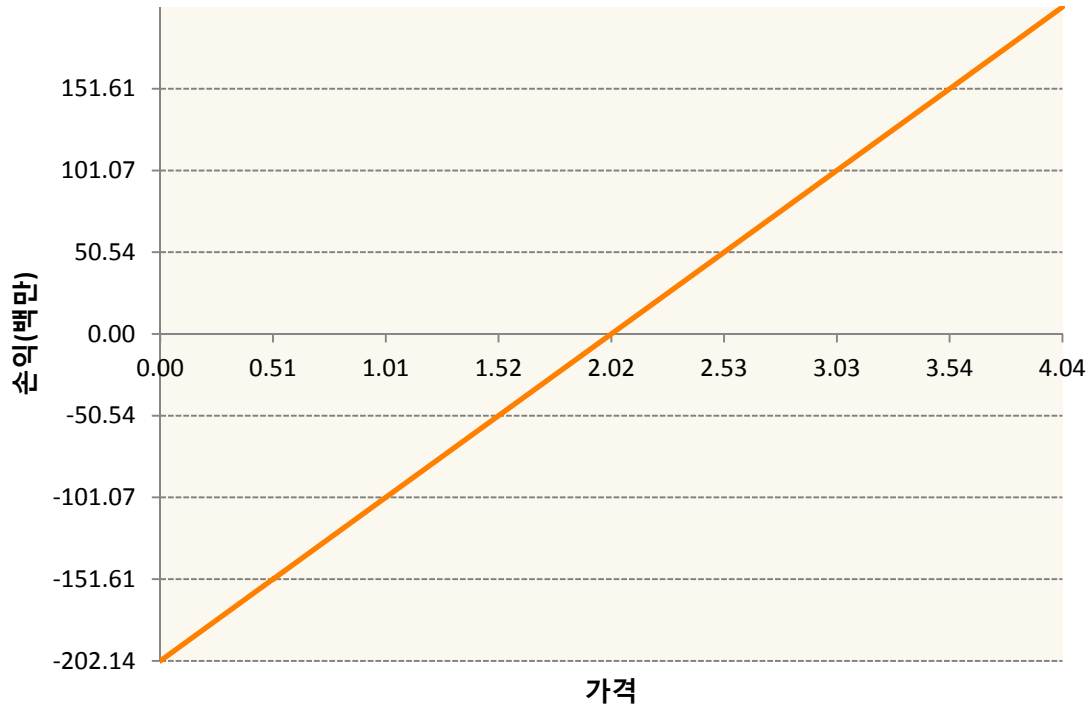


COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20

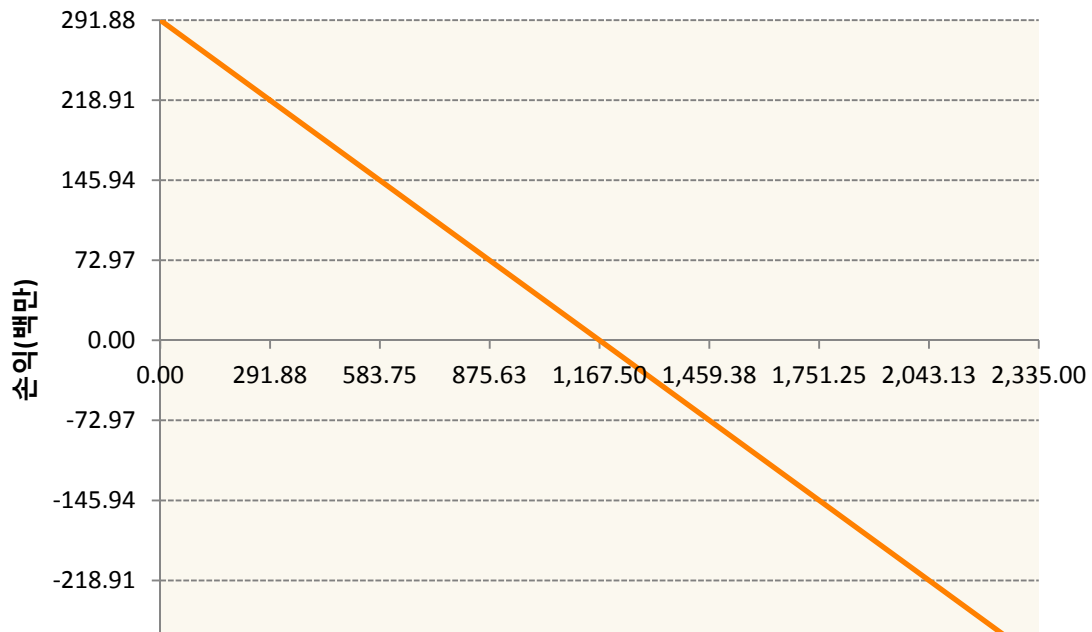


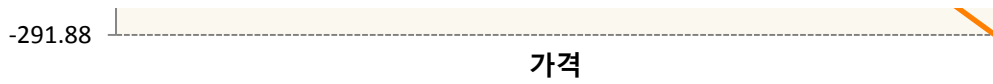


HOH0-NY Harb ULSD Fut Mar20

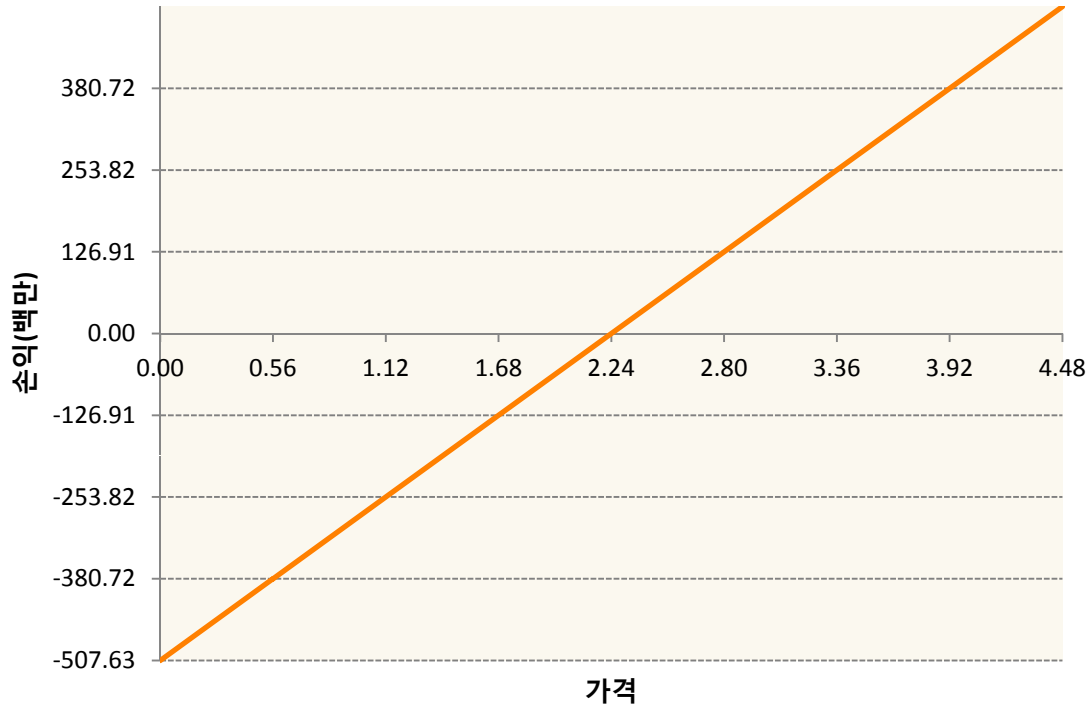


KR4175Q10001-2020-01 달러선물

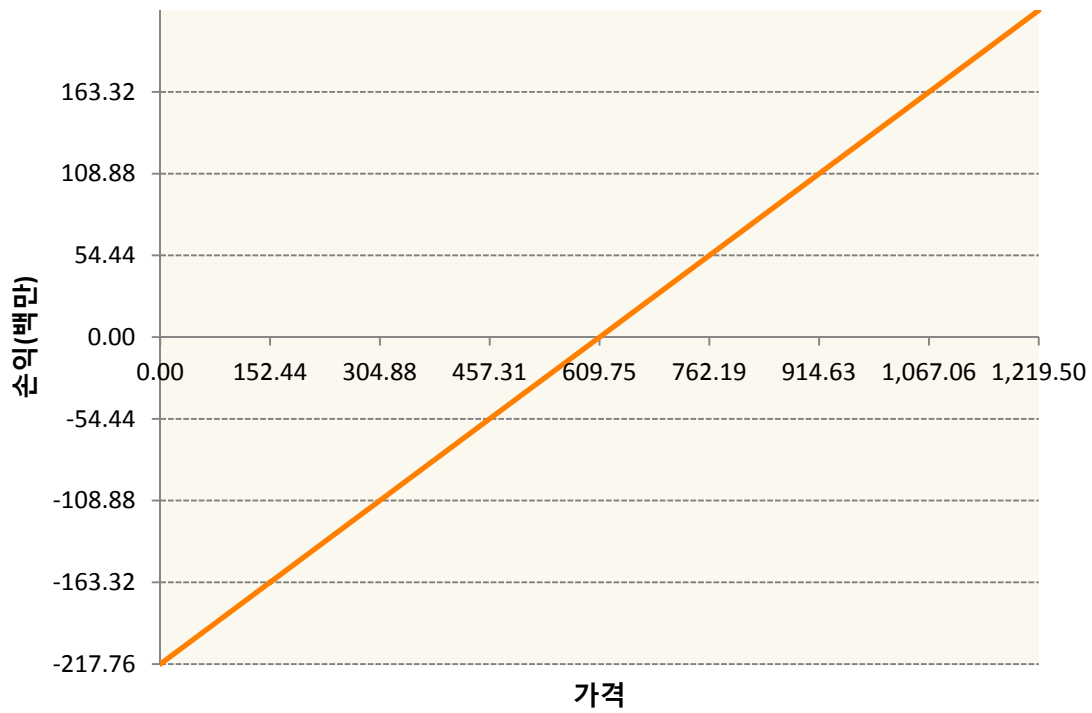




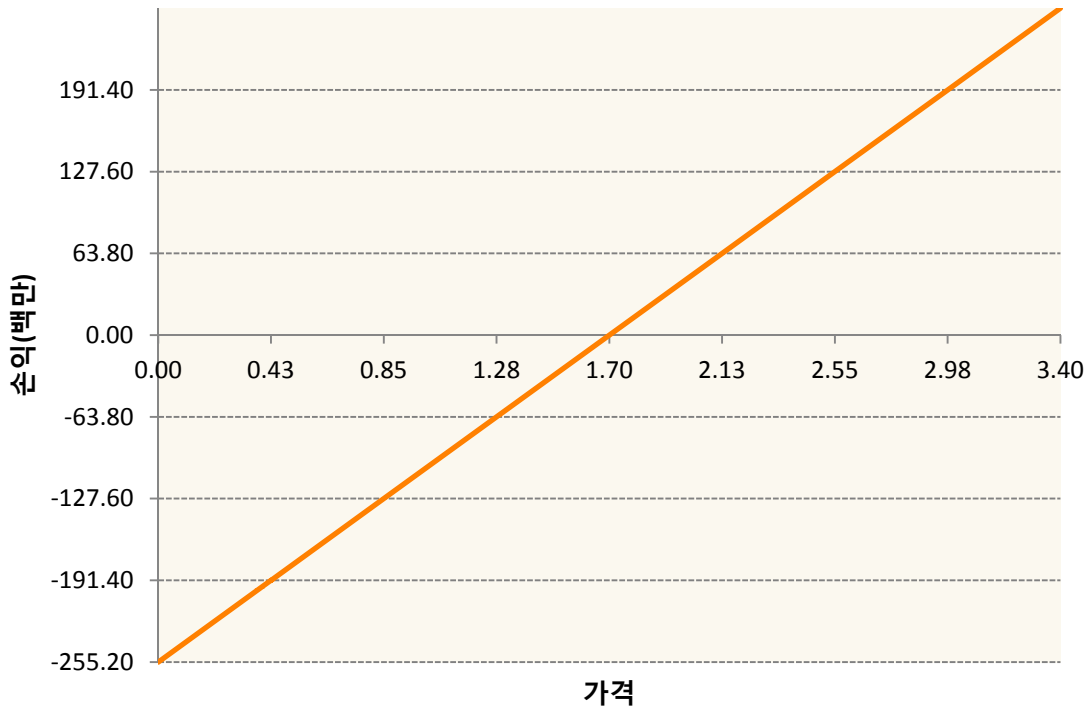
NGH20-NATURAL GAS FUTR Mar20



QSH0-Low Su Gasoil G Mar20



XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	52
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)

392

공시일	2019-12-19
기준일	2019-12-18

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

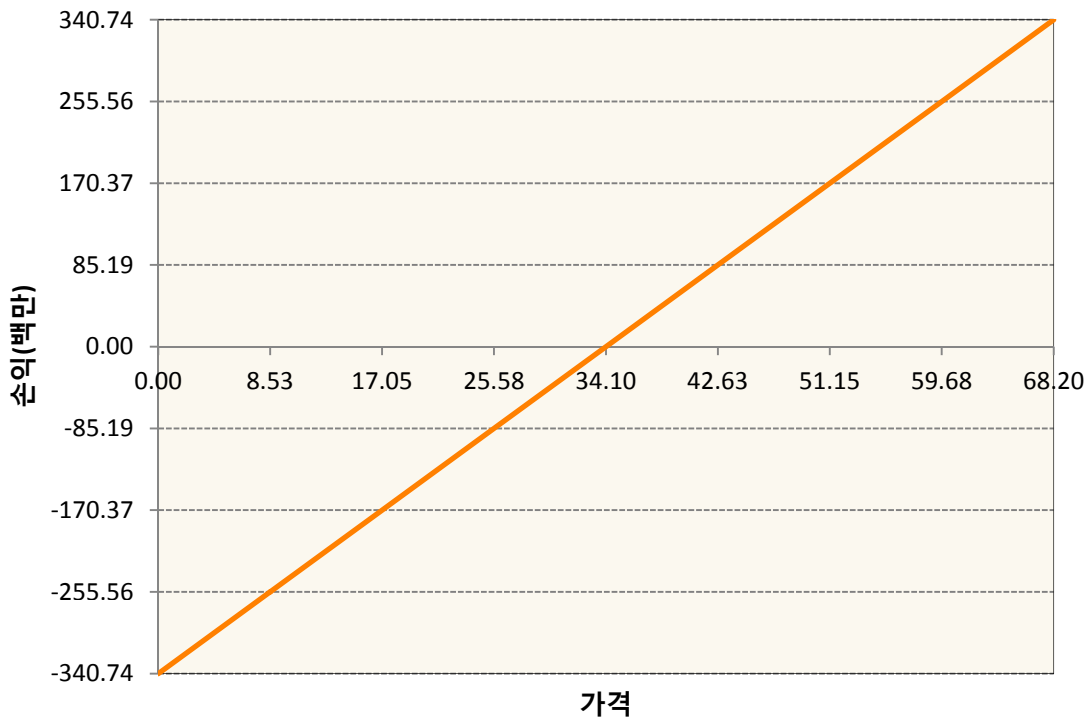
1. 계약금액

(단위:백만원)

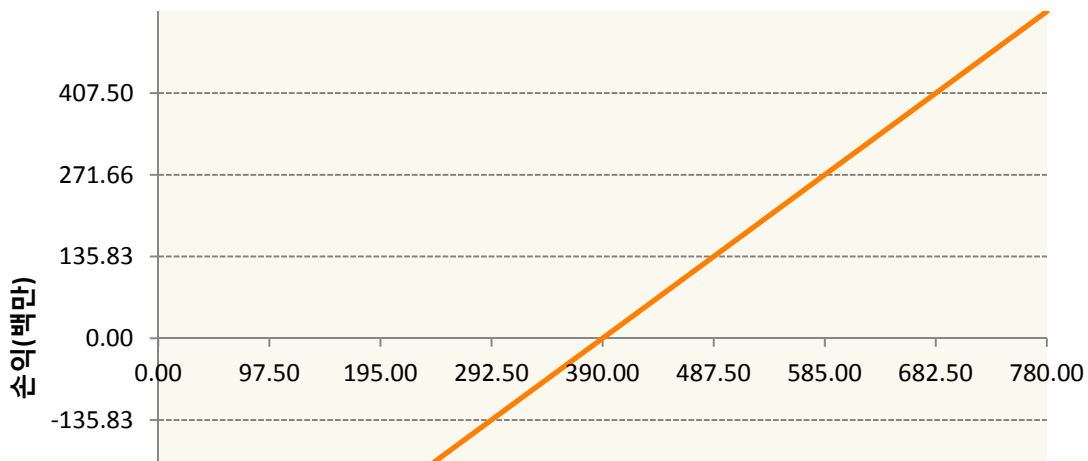
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,860	117	2,744	

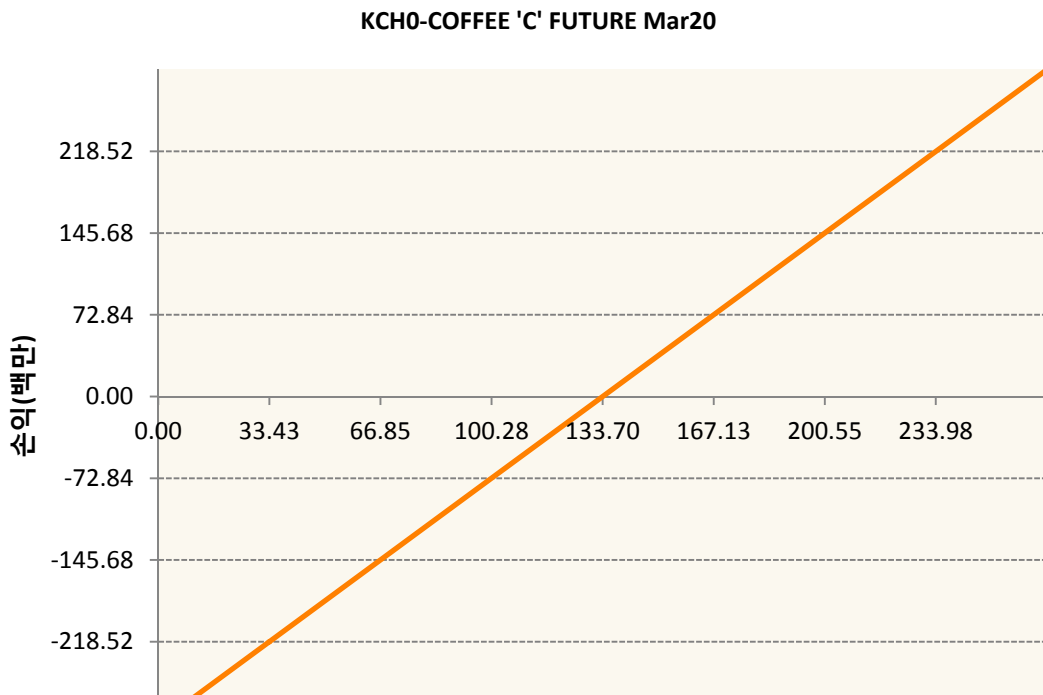
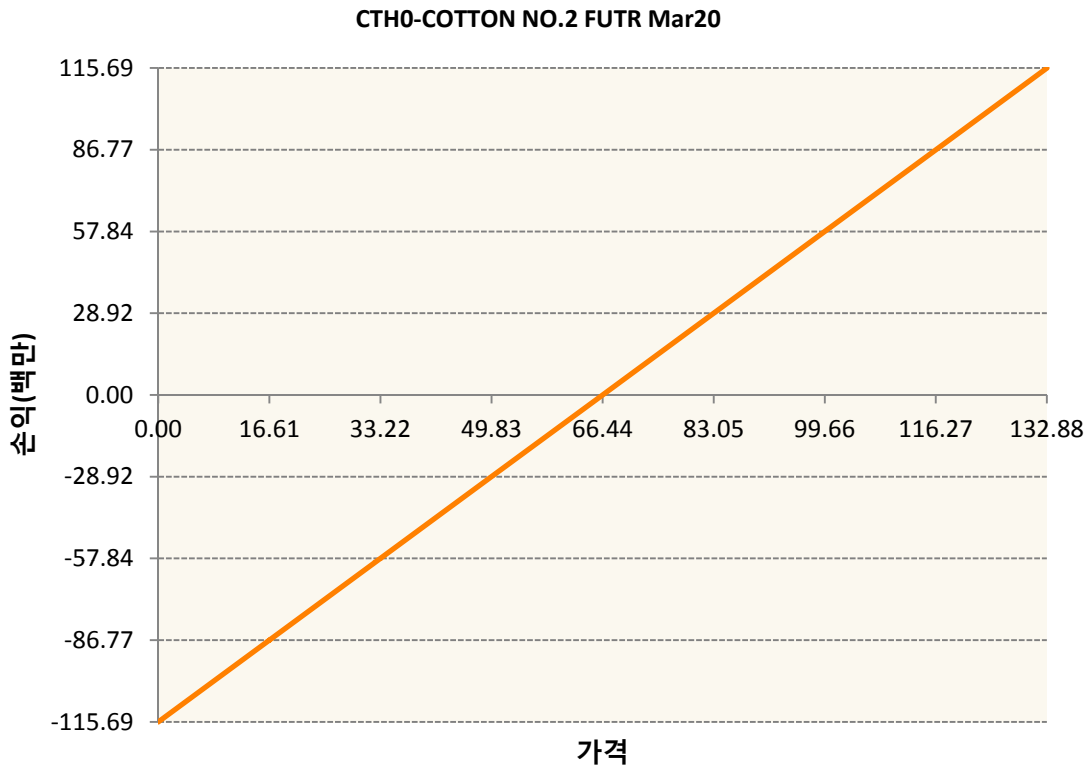
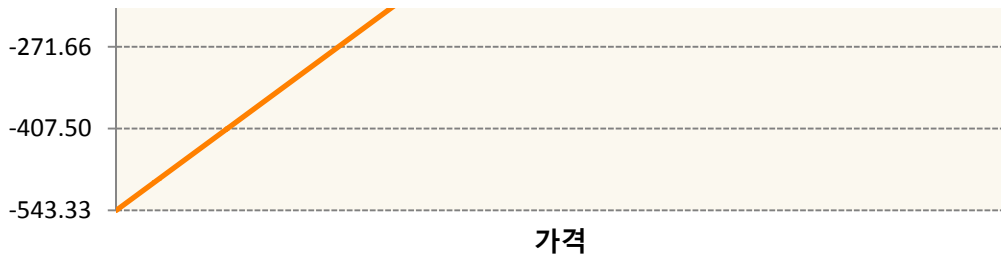
2. 만기시점의 손익구조

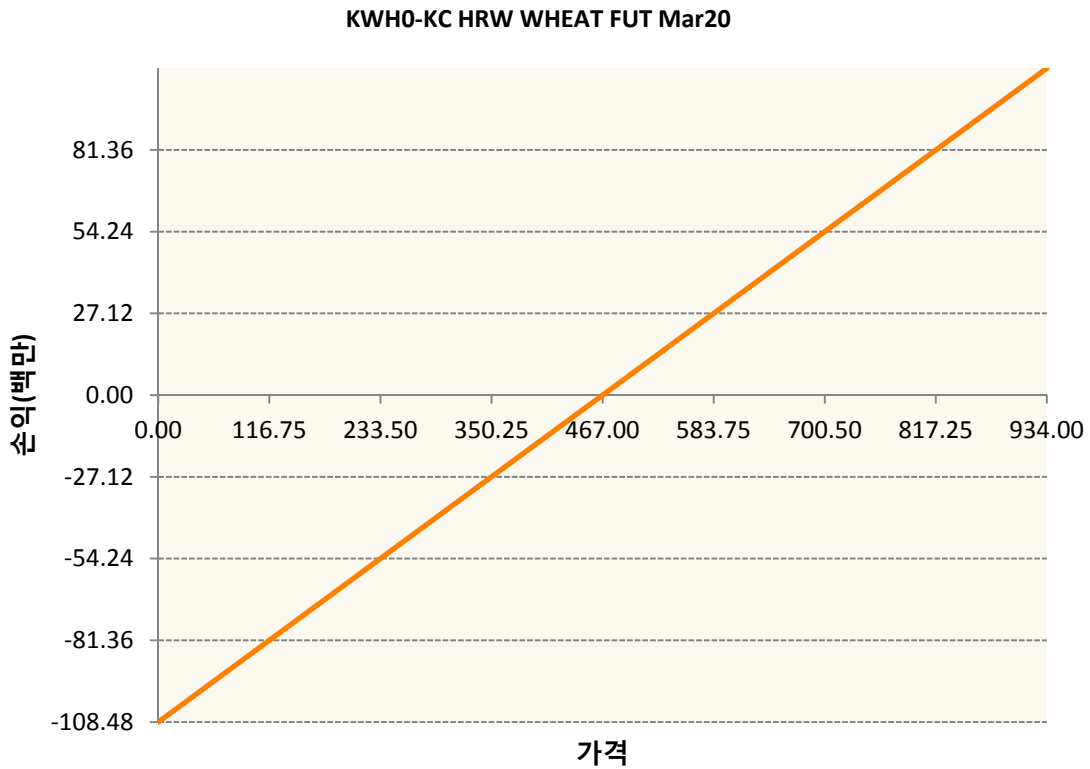
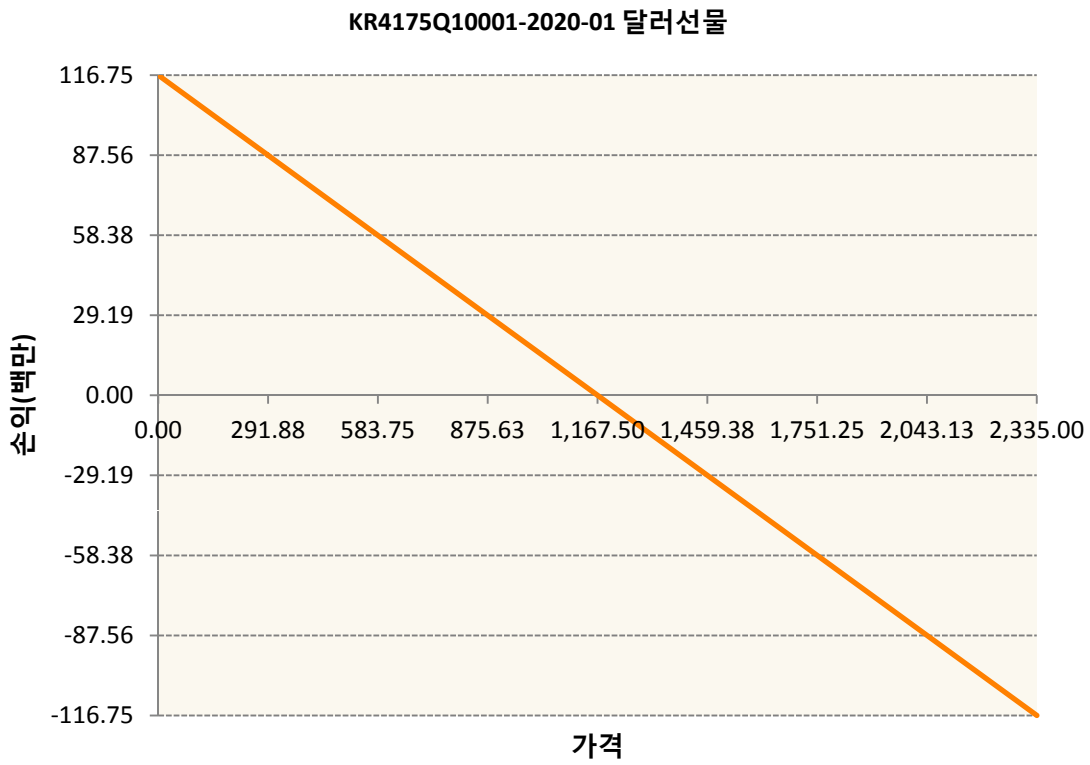
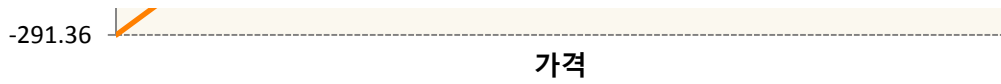
BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20



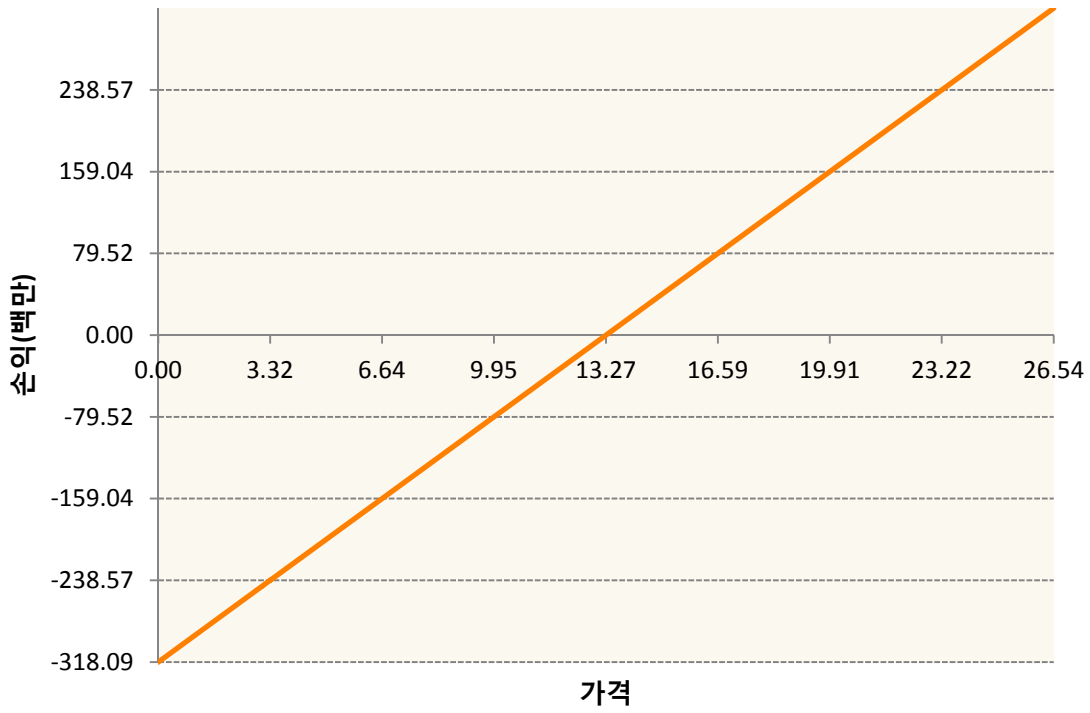
CH0-CORN FUTURE Mar20



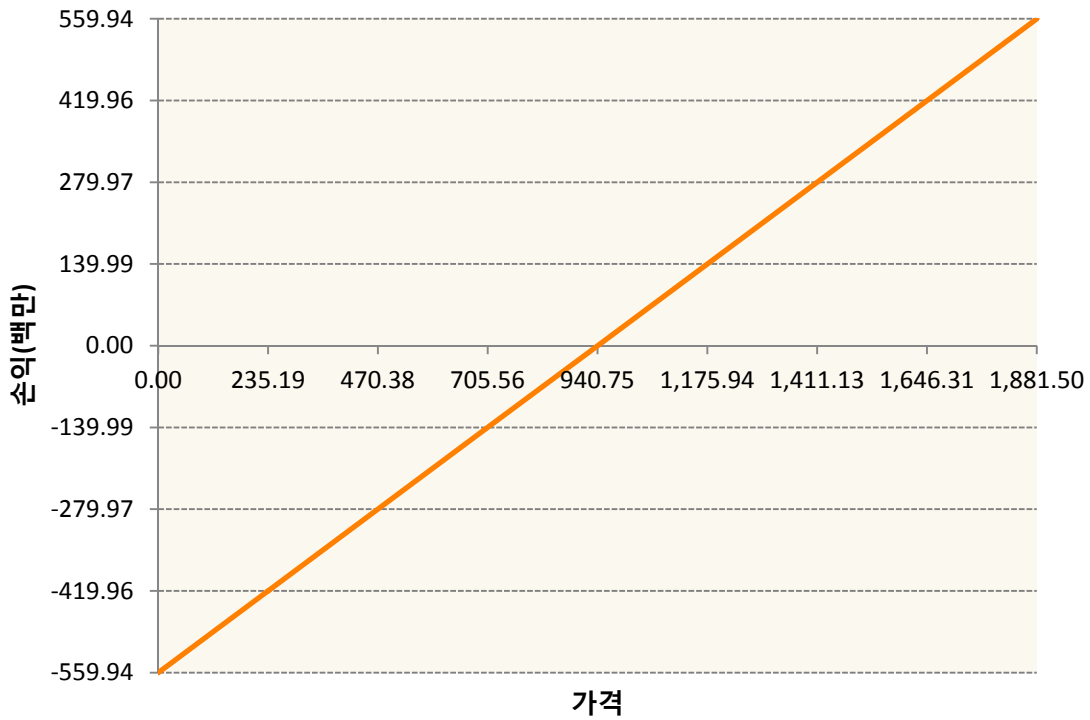




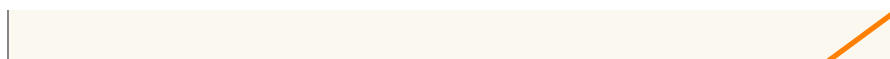
SBH0-Sugar Mar20

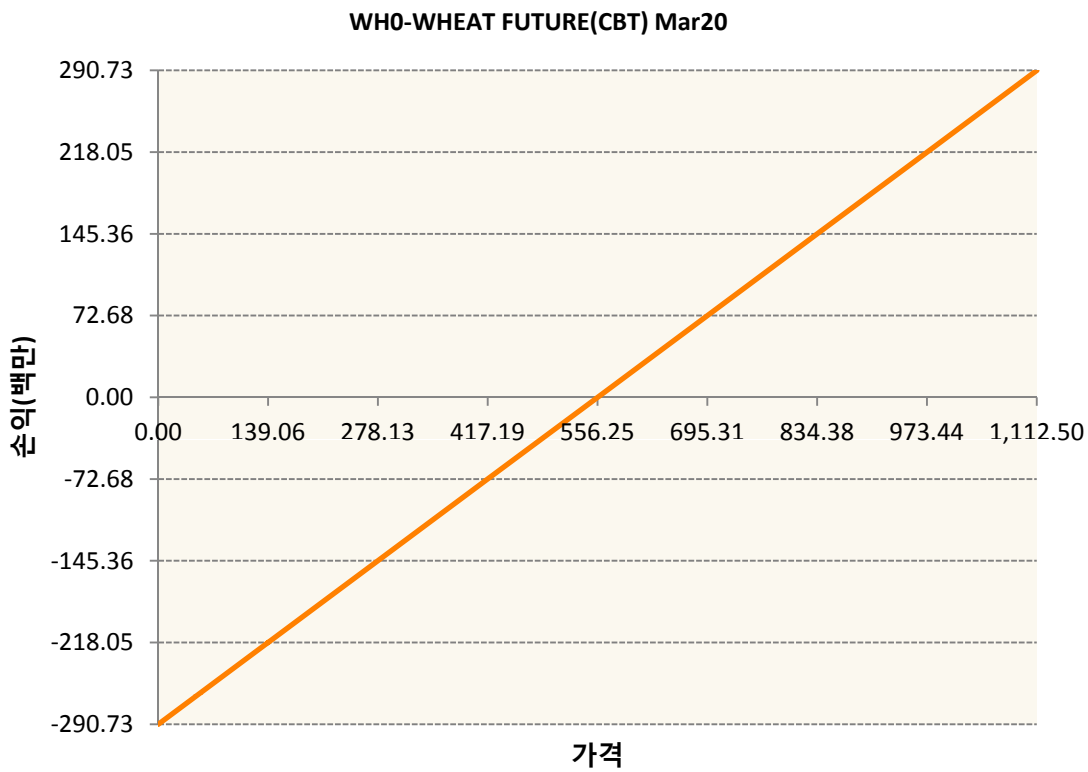
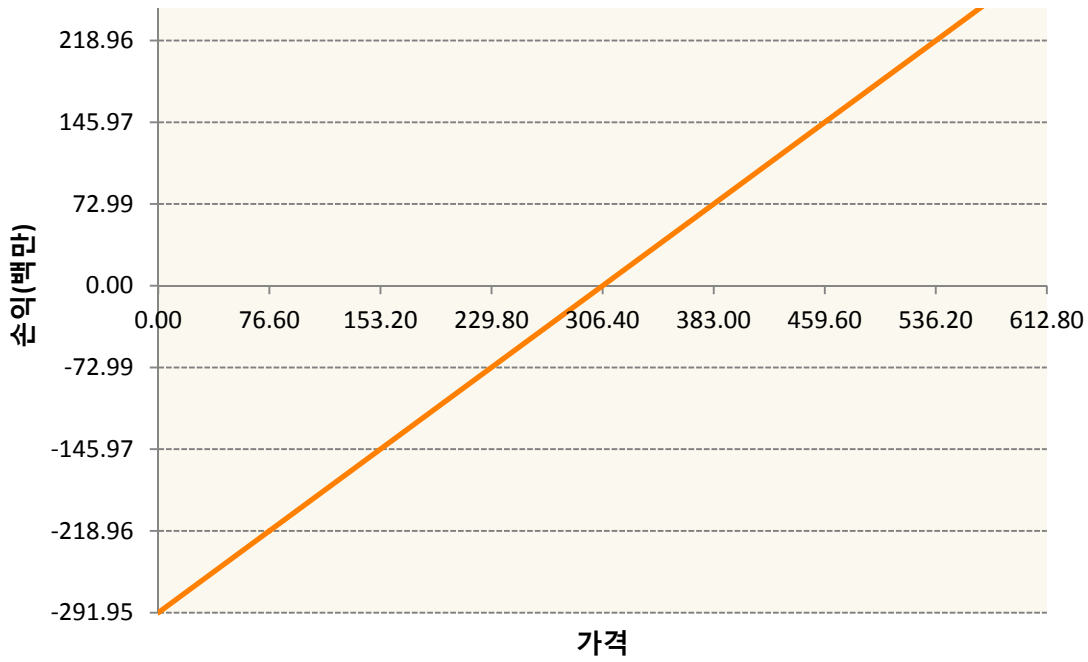


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20



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	23
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