

공시일	2019-12-20
기준일	2019-12-19

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	2019-12-20
기준일	2019-12-19

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

1,117

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

644

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-20
기준일	2019-12-19

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)

761

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-20
기준일	2019-12-19

유로인덱스모(주식-파생형)

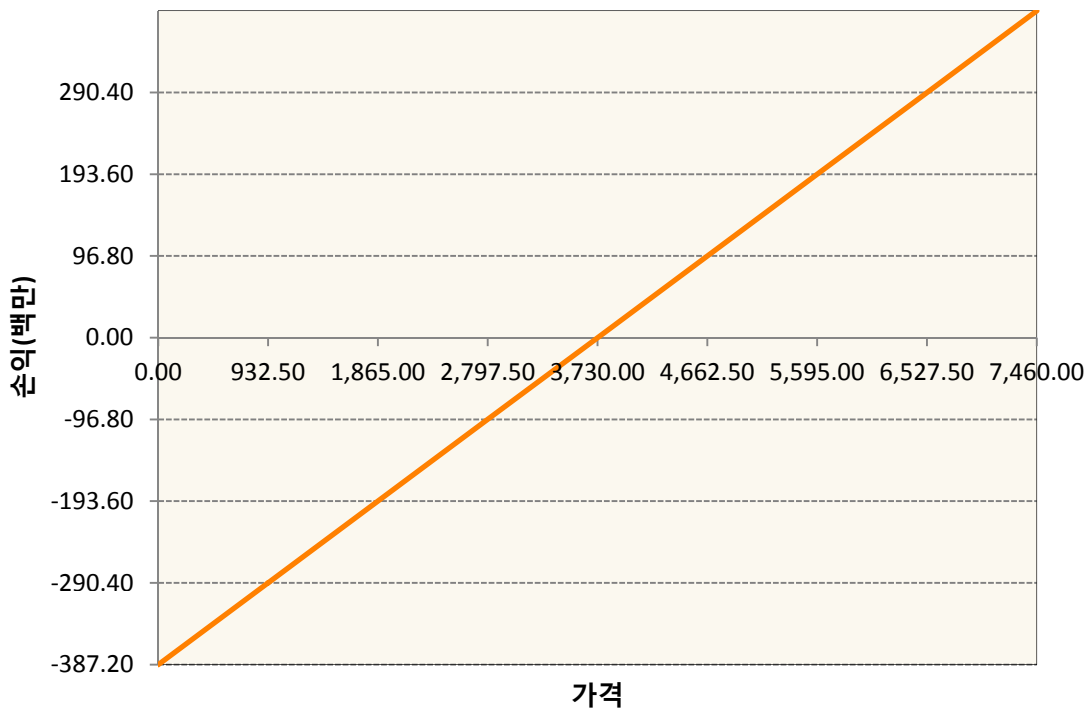
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	387	0	387	

2. 만기시점의 손익구조

VGHO-EURO STOXX 50 Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGHO	EURO STOXX 50 Mar20	31
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

21

공시일	2019-12-20
기준일	2019-12-19

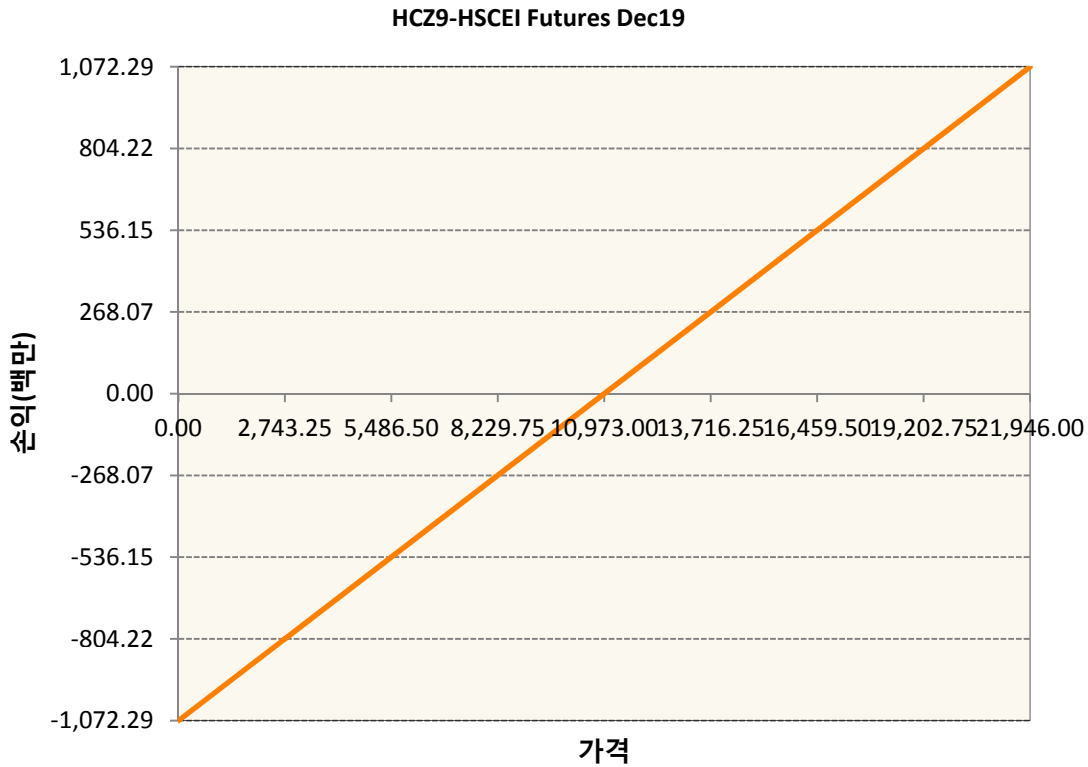
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,072	0	1,072	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

77

공시일	2019-12-20
기준일	2019-12-19

커버드콜모(주식혼합-파생형)

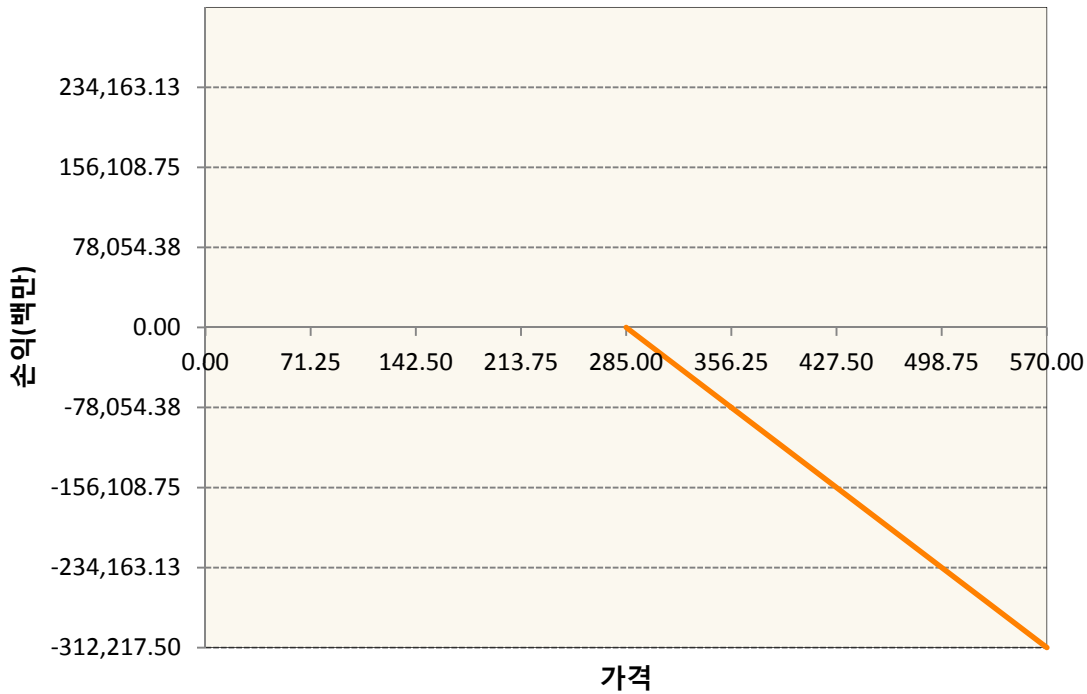
1. 계약금액

(단위:백만원)

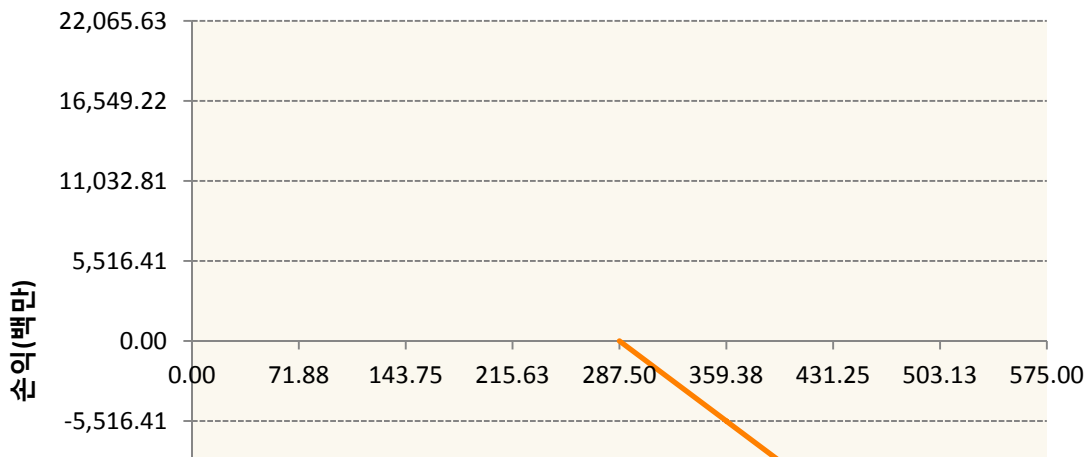
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	27,556	34,506	-6,950	장내
누계	유가증권	옵션	7,125	490,107	-482,982	장내

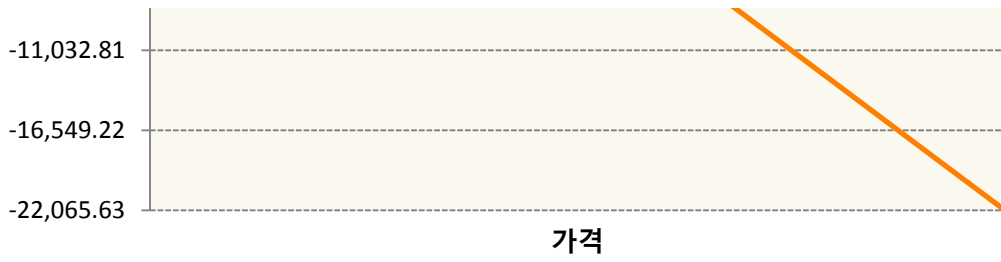
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q12852-2020-01 콜285

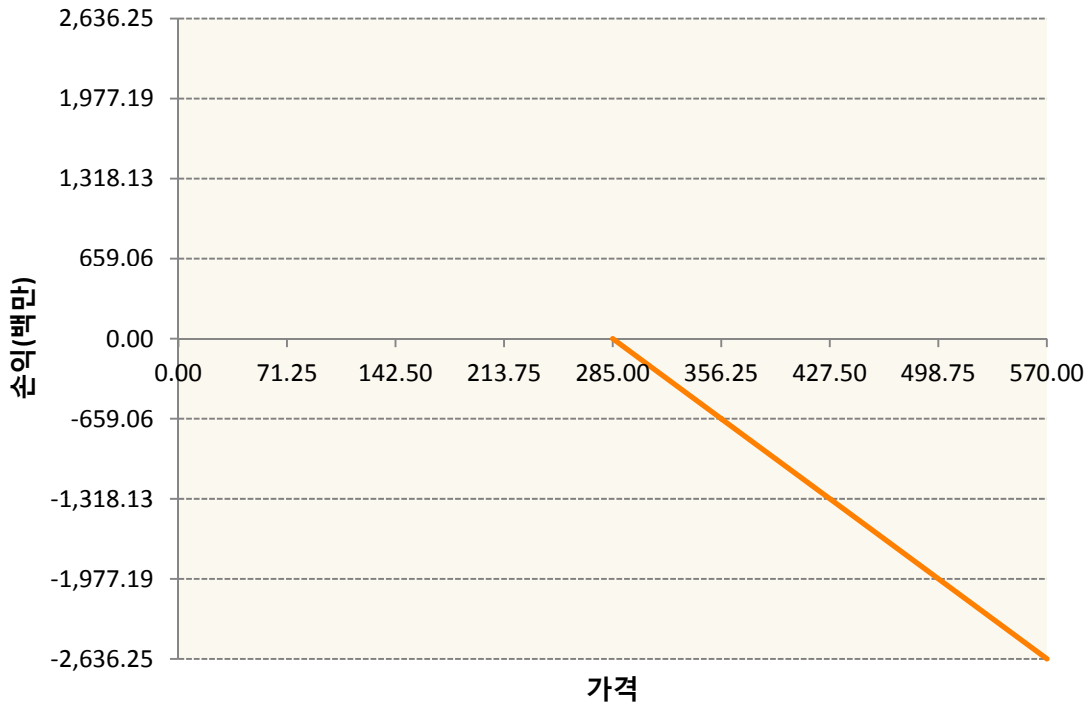


KR4201Q12878-2020-01 콜287.5

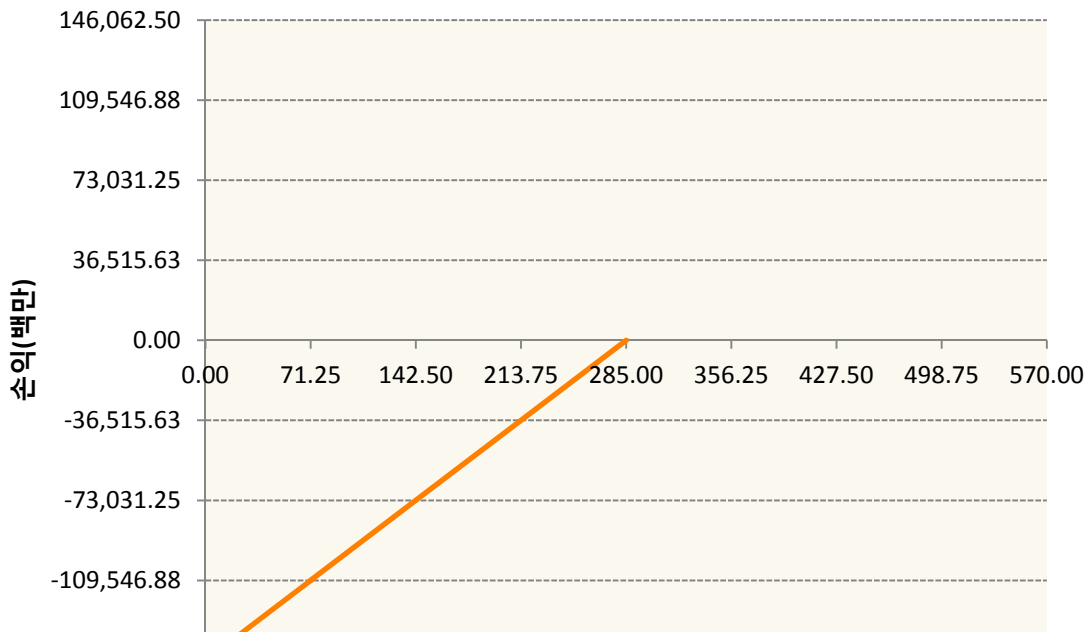




KR4201Q22851-2020-02 콜285



KR4301Q12850-2020-01 풋285



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q12852		2020-01 콜285						22,588
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	13,281	12,846	12,373	11,869	11,341	10,792	10,226	
-5.33%	11,193	10,556	9,907	9,251	8,588	7,920	7,248	
-2.67%	7,422	6,715	6,008	5,301	4,594	3,886	3,178	
0%	1,869	1,264	639	0	-651	-1,311	-1,978	
2.67%	-5,119	-5,528	-5,983	-6,474	-6,996	-7,543	-8,112	
5.33%	-13,006	-13,228	-13,505	-13,831	-14,200	-14,607	-15,048	
8.00%	-21,338	-21,437	-21,580	-21,768	-22,000	-22,275	-22,588	
KR4201Q12878		2020-01 콜287.5						1,537
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	832	807	778	746	712	677	640	
-5.33%	716	675	632	588	544	499	453	
-2.67%	491	441	391	342	292	242	192	
0%	141	95	48	0	-48	-96	-145	
2.67%	-320	-353	-390	-428	-469	-510	-553	
5.33%	-855	-875	-898	-925	-955	-987	-1,022	
8.00%	-1,431	-1,440	-1,453	-1,470	-1,489	-1,512	-1,537	
KR4201Q22851		2020-02 콜285						184
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	130	122	114	105	97	88	79	
-5.33%	105	96	87	77	68	59	49	
-2.67%	71	62	52	42	32	23	13	
0%	28	19	9	0	-10	-19	-29	
2.67%	-23	-32	-40	-49	-58	-67	-76	
5.33%	-82	-89	-96	-103	-111	-119	-128	
8.00%	-146	-151	-156	-162	-169	-176	-184	
KR4301Q12850		2020-01 풋285						7,224
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-6,997	-7,014	-7,039	-7,072	-7,115	-7,165	-7,224	
-5.33%	-3,254	-3,351	-3,456	-3,568	-3,685	-3,806	-3,931	
-2.67%	-681	-831	-982	-1,132	-1,283	-1,435	-1,586	
0%	237	168	89	0	-97	-200	-309	
2.67%	373	363	346	322	289	248	200	

5.33%	381	380	379	376	369	360	346
8.00%	381	381	381	381	380	379	376

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

(단위:백만원)

30,542

공시일	2019-12-20
기준일	2019-12-19

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

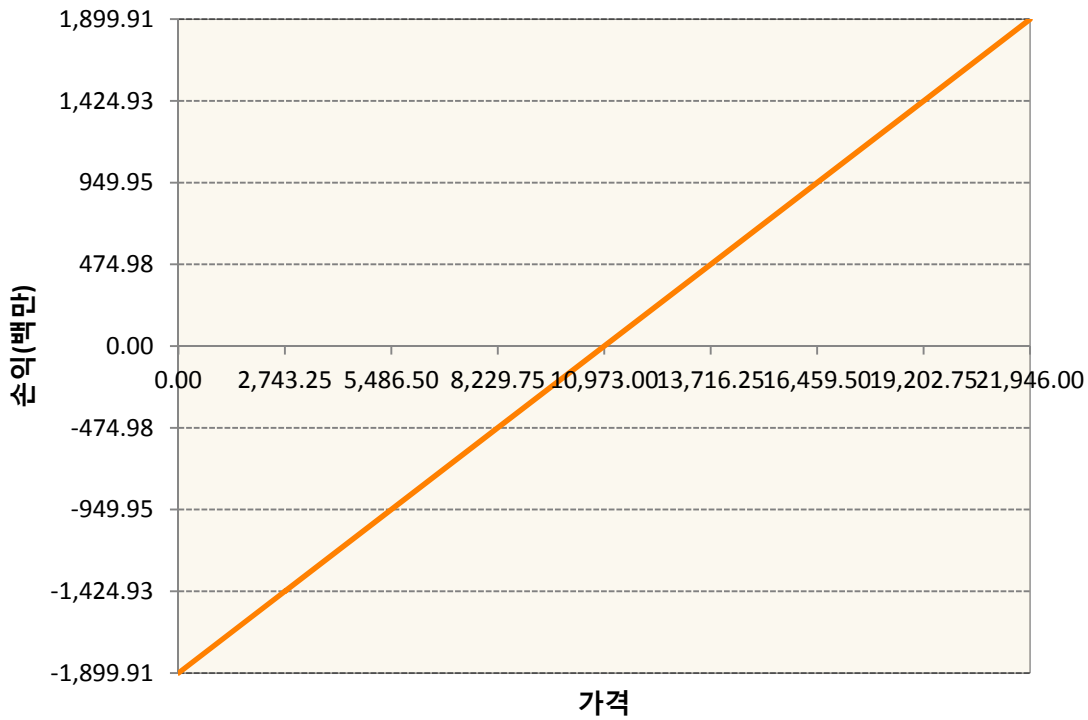
1. 계약금액

(단위:백만원)

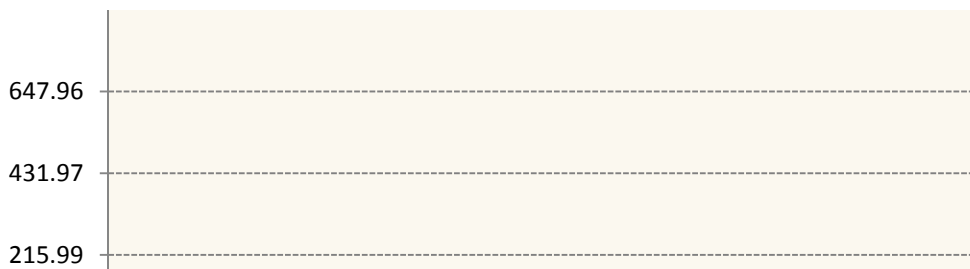
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,900	0	1,900	
누계	유가증권	옵션	0	4,820	-4,820	장내
누계	통화	선도	0	2,106	-2,106	장외

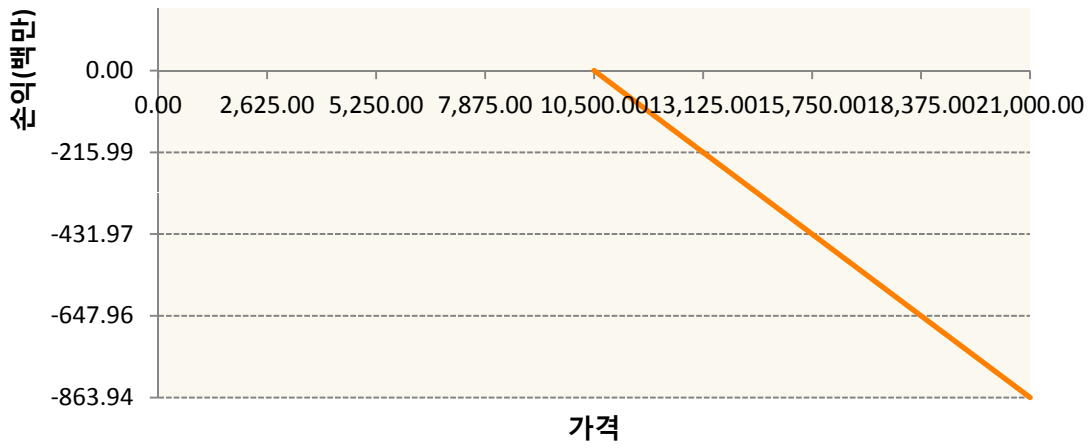
2. 만기시점의 손익구조

HCZ9-HSCEI Futures Dec19

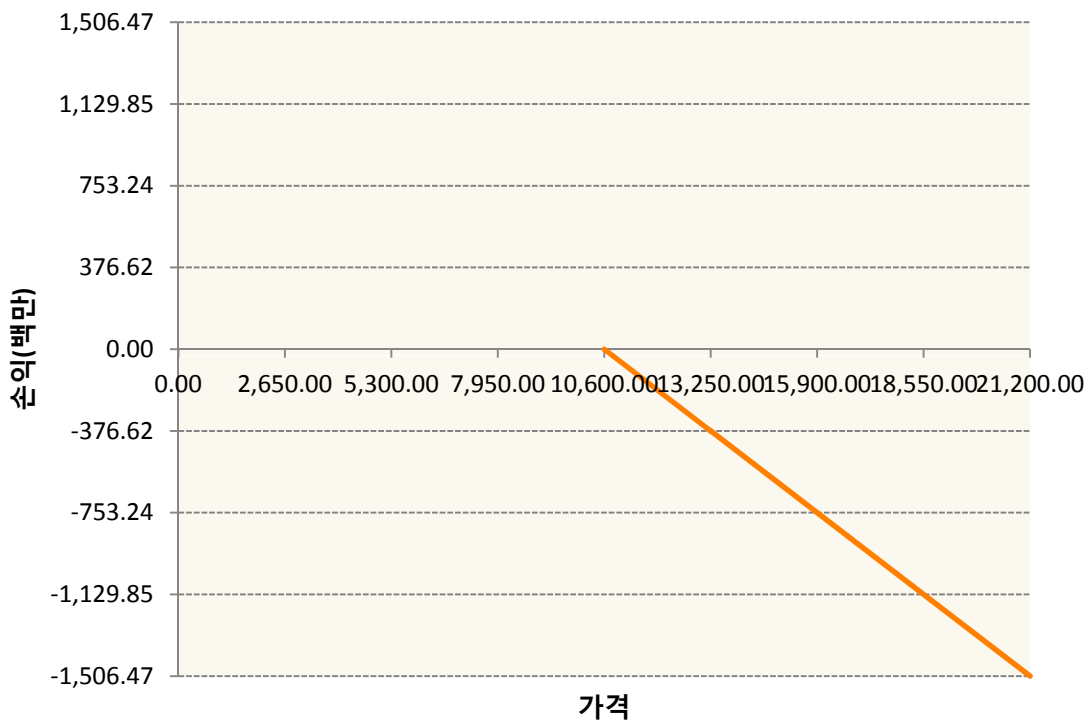


OHHIZ9-C105-HSCEI

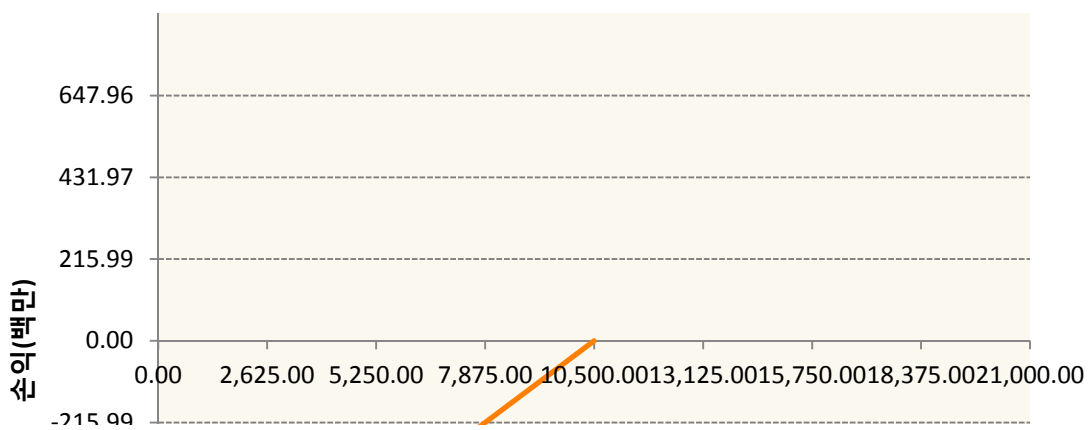


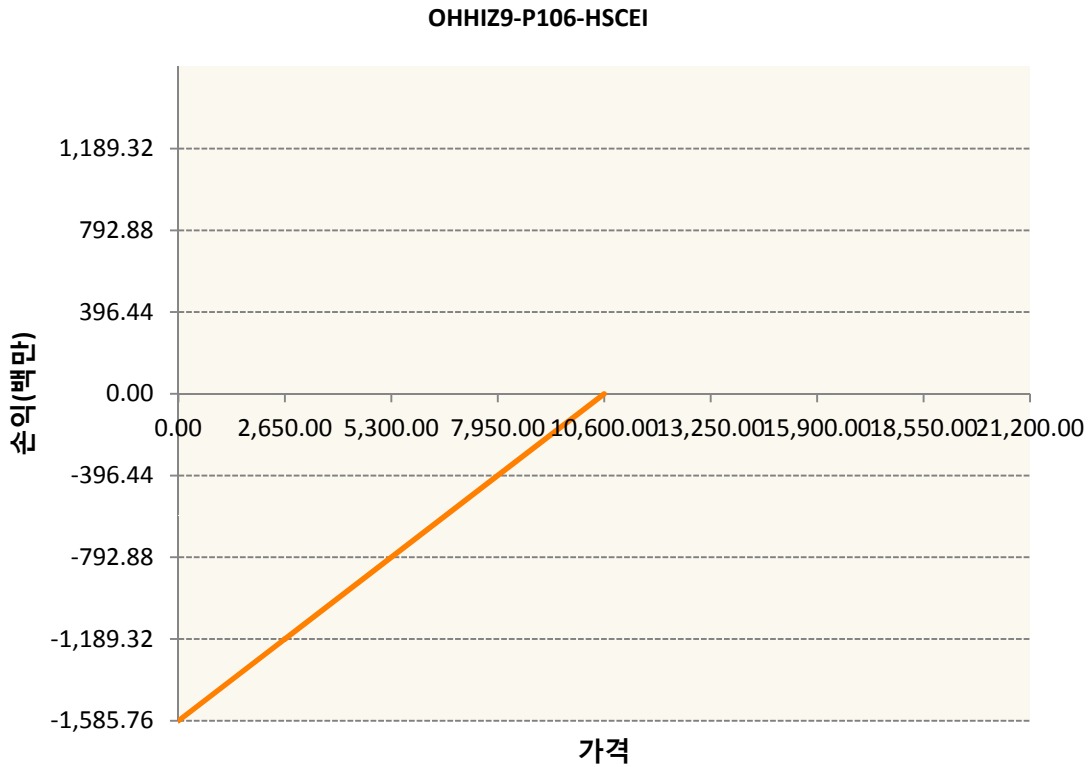
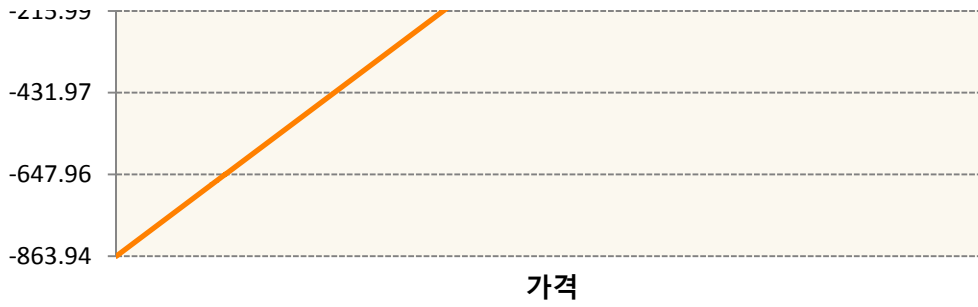


OHHIZ9-C106-HSCEI



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		121
OHHIZ9-P10 HSCEI		69
OHHIZ9-P10 HSCEI		127

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		529

공시일	2019-12-20
기준일	2019-12-19

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

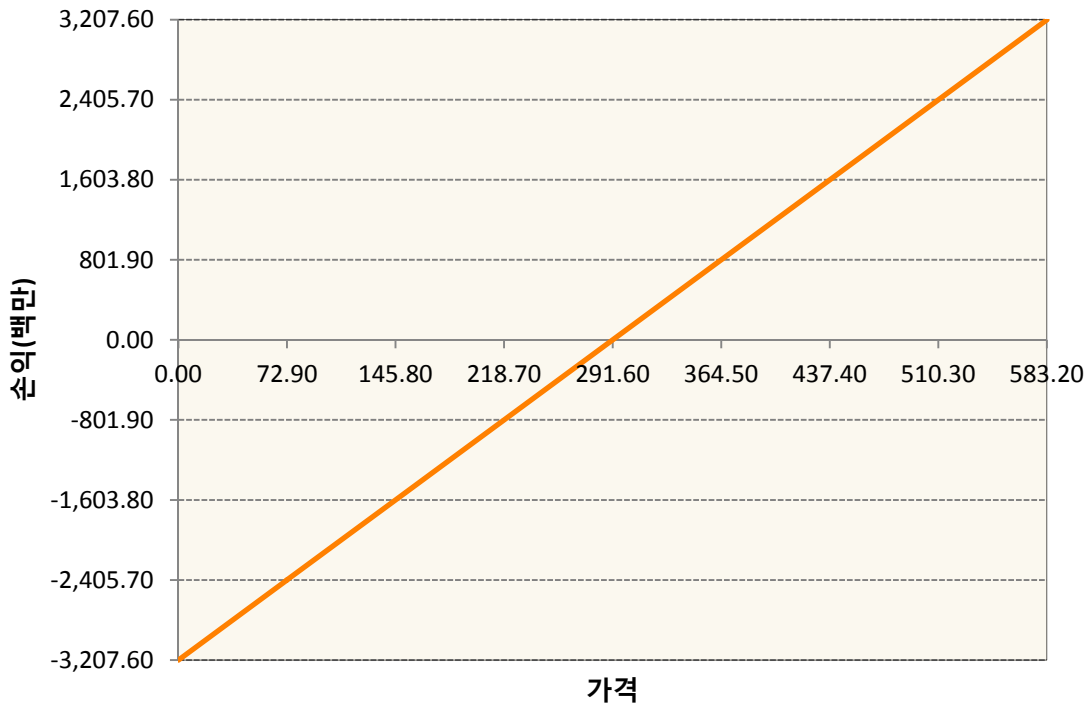
1. 계약금액

(단위:백만원)

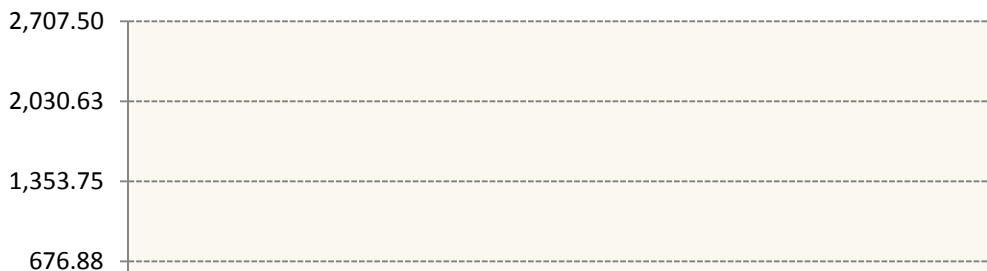
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	2,032	0	2,032	장내
누계	유가증권	선물	3,208	0	3,208	장내
누계	유가증권	스왑	8,625	0	8,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,771	-6,771	장내

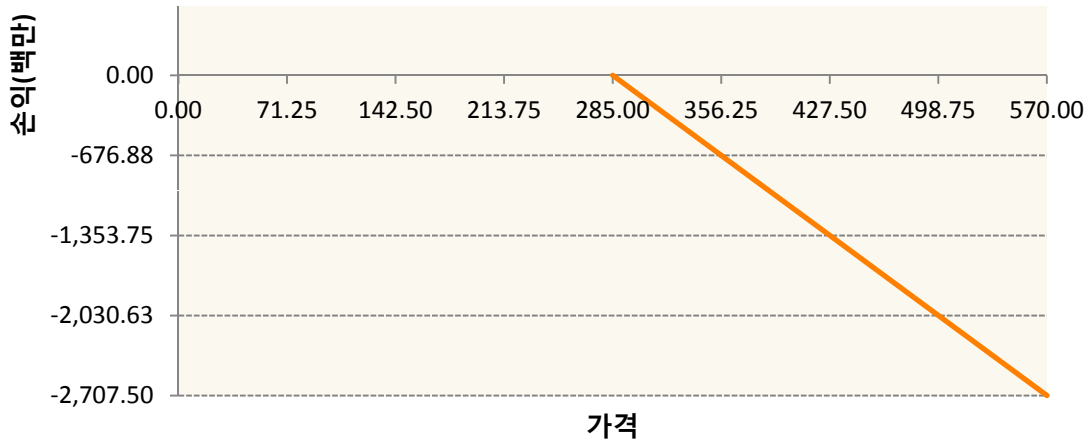
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

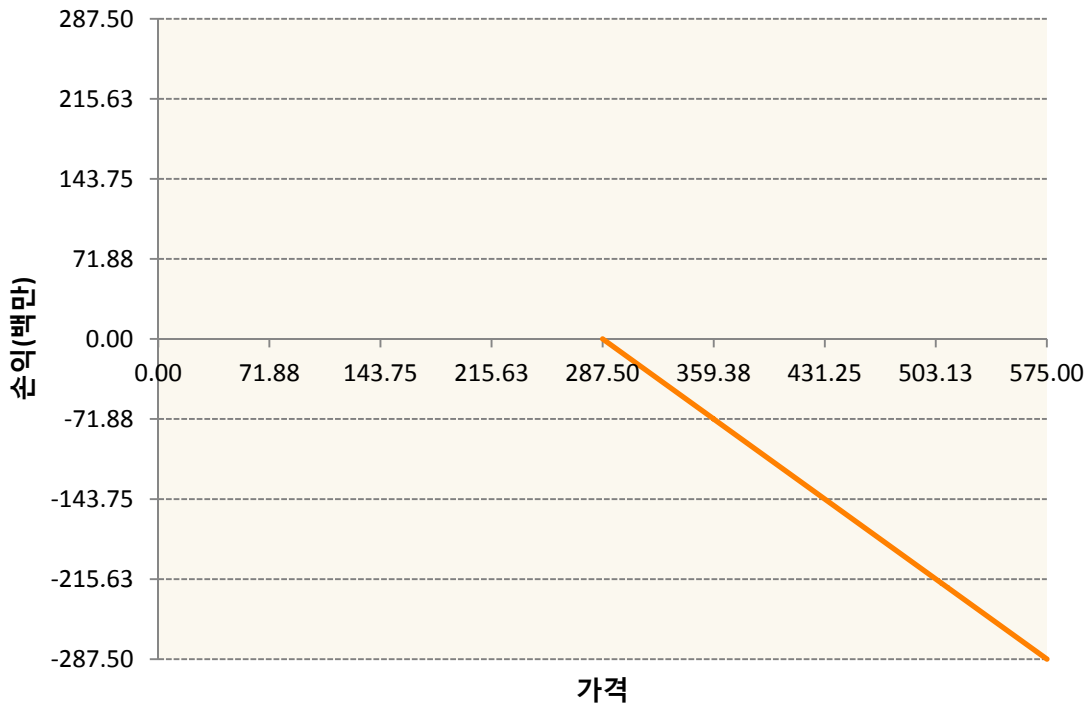


KR4201Q12852-2020-01 콜285

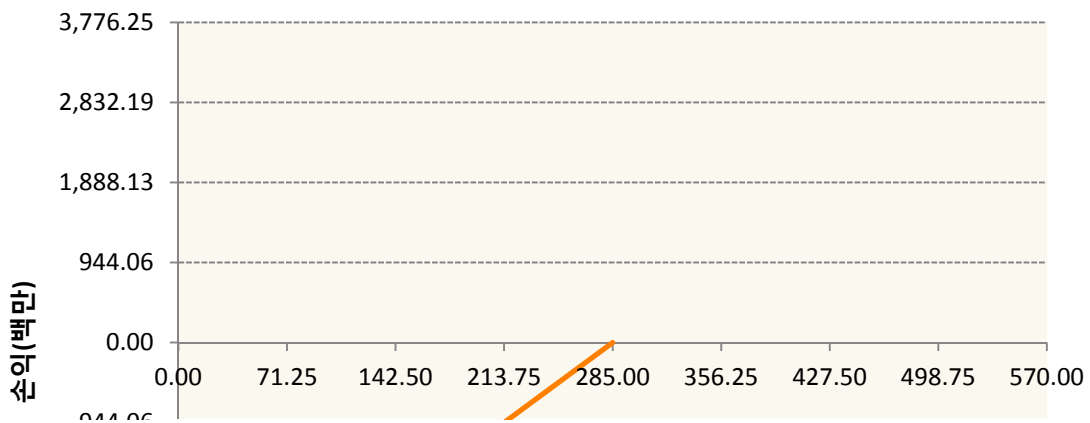


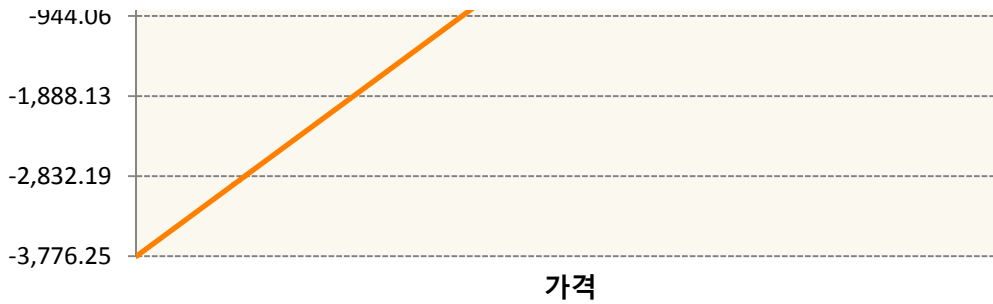


KR4201Q12878-2020-01 콜287.5



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						196
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	115	111	107	103	98	94	89	
-5.33%	97	92	86	80	74	69	63	
-2.67%	64	58	52	46	40	34	28	
0%	16	11	6	0	-6	-11	-17	
2.67%	-44	-48	-52	-56	-61	-65	-70	
5.33%	-113	-115	-117	-120	-123	-127	-130	
8.00%	-185	-186	-187	-189	-191	-193	-196	
KR4201Q12878		2020-01 콜287.5						20
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	11	11	10	10	9	9	8
-5.33%	9	9	8	8	7	6	6
-2.67%	6	6	5	4	4	3	3
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	-4	-5	-5	-6	-6	-7	-7
5.33%	-11	-11	-12	-12	-12	-13	-13
8.00%	-19	-19	-19	-19	-19	-20	-20
KR4301Q12850 2020-01 풋285							187
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-181	-181	-182	-183	-184	-185	-187
-5.33%	-84	-87	-89	-92	-95	-98	-102
-2.67%	-18	-21	-25	-29	-33	-37	-41
0%	6	4	2	0	-2	-5	-8
2.67%	10	9	9	8	7	6	5
5.33%	10	10	10	10	10	9	9
8.00%	10	10	10	10	10	10	10

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

(단위:백만원)

1,313

공시일	2019-12-20
기준일	2019-12-19

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

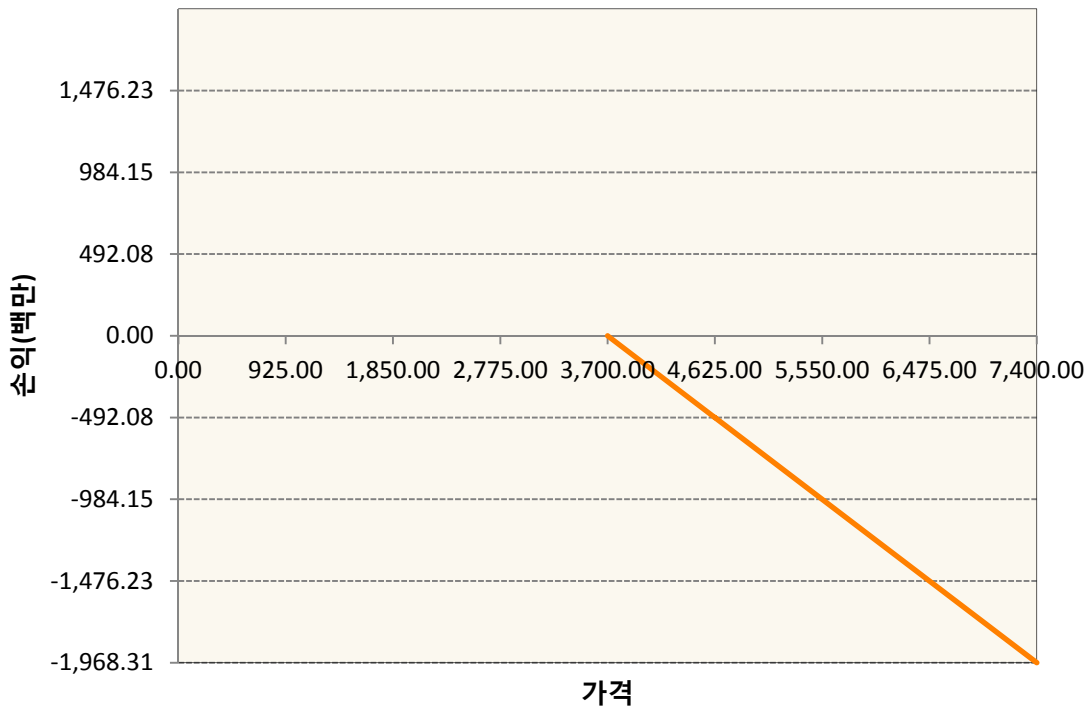
1. 계약금액

(단위:백만원)

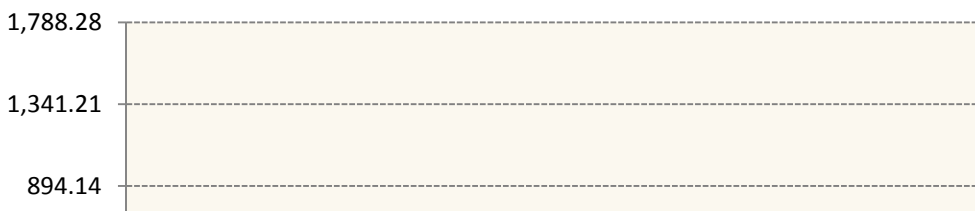
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	728	0	728	
누계	유가증권	스왑	17,742	0	17,742	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,513	-7,513	장내
누계	통화	선도	2,694	6,098	-3,405	장외

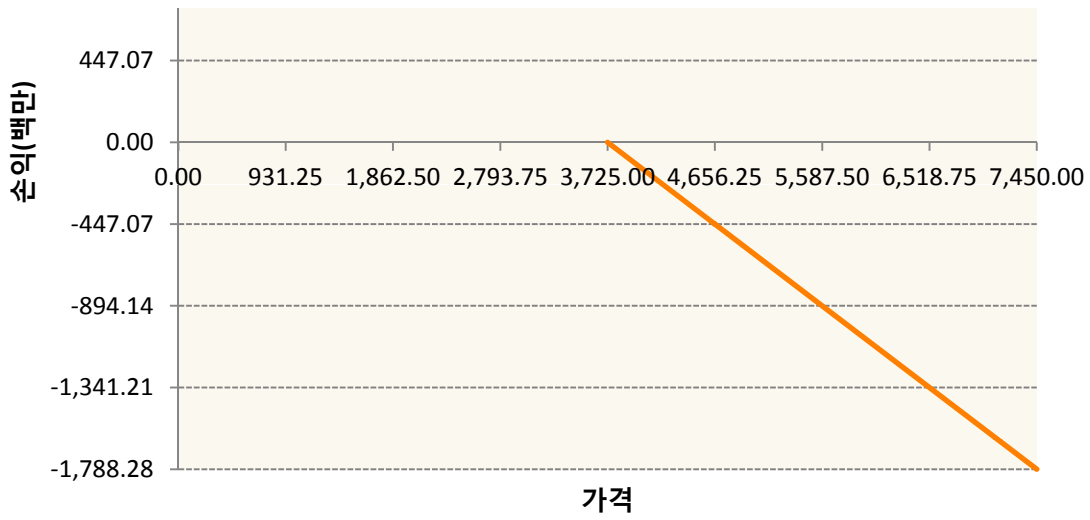
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ9-C3700-EURO STOXX 50

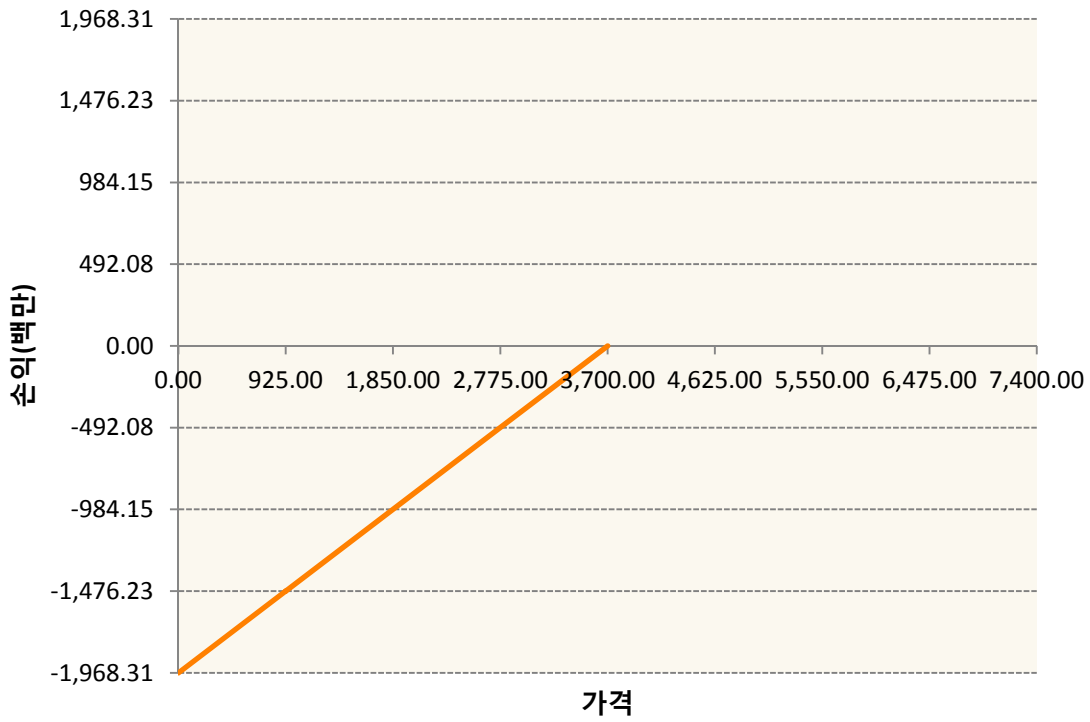


OESXZ9-C3725-EURO STOXX 50

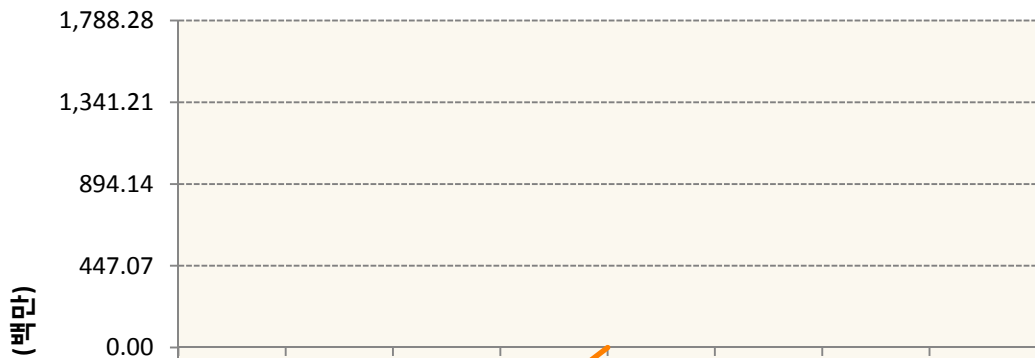


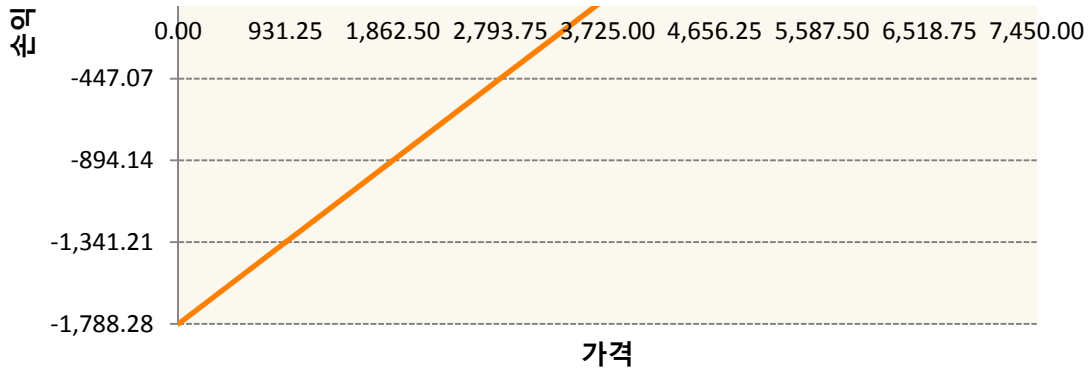


OESXZ9-P3700-EURO STOXX 50

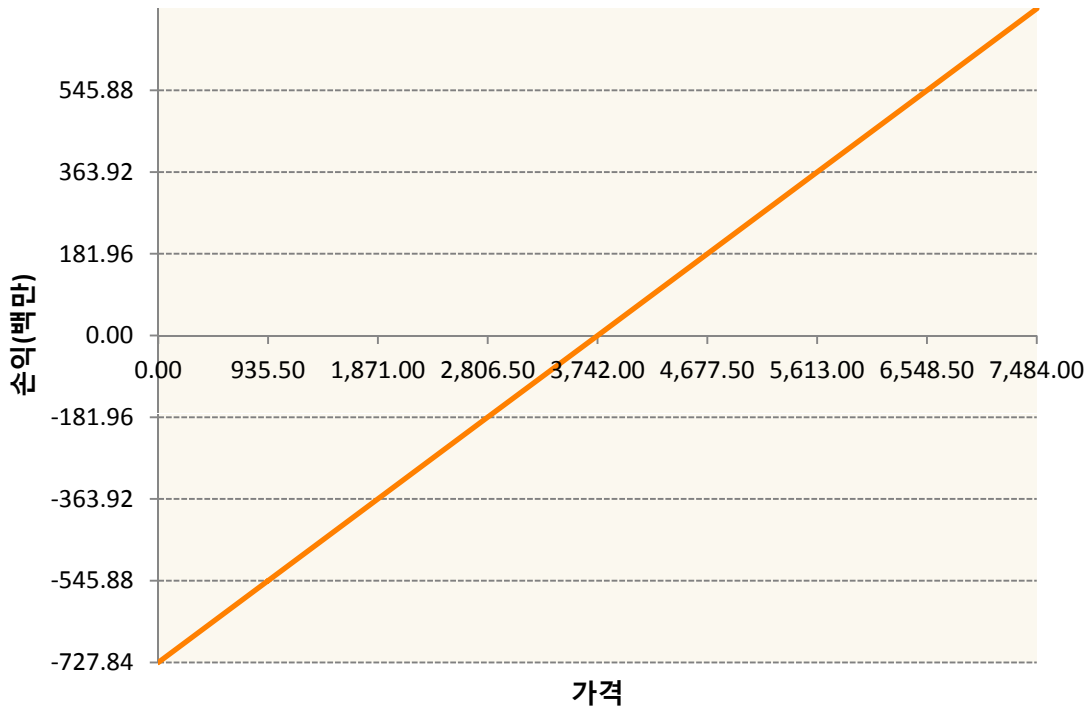


OESXZ9-P3725-EURO STOXX 50





VGZ9-EURO STOXX 50 Dec19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	38
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E	488
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E	164
FX21019X02 EUR/KRW 27-12-19E	52
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	157
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	143
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	157
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	143
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)

943

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

(단위:백만원)

83

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

(단위:백만원)

116

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

(단위:백만원)

42

공시일	2019-12-20
기준일	2019-12-19

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

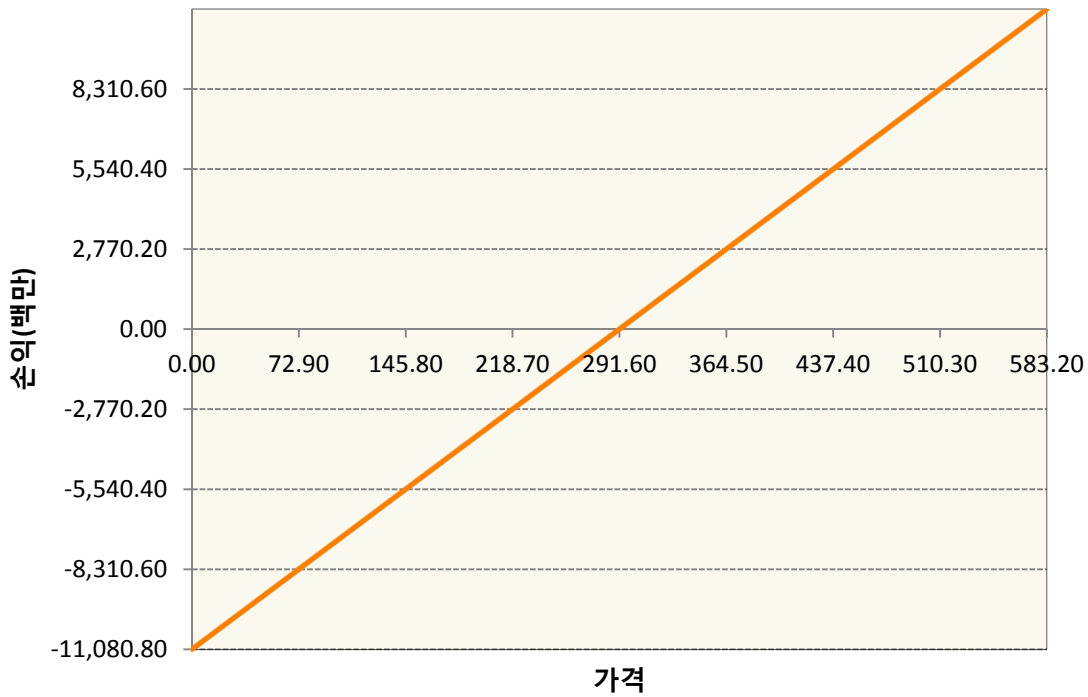
1. 계약금액

(단위:백만원)

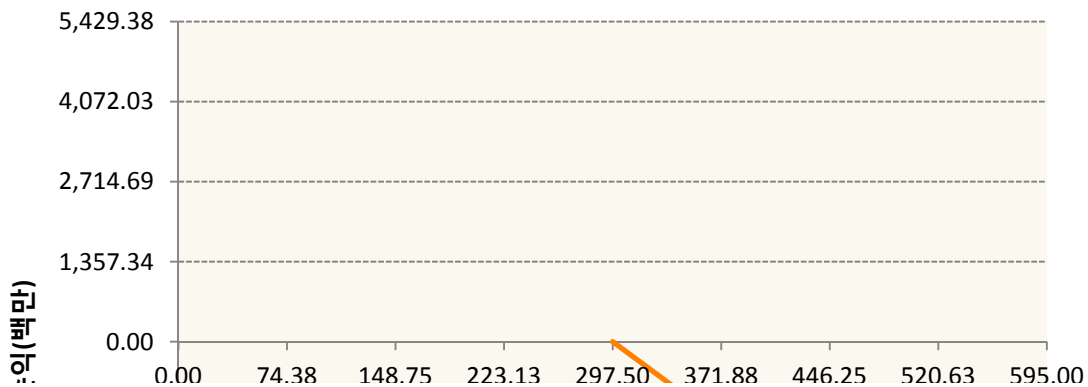
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,081	0	11,081	장내
누계	유가증권	옵션	499	21,254	-20,756	장내

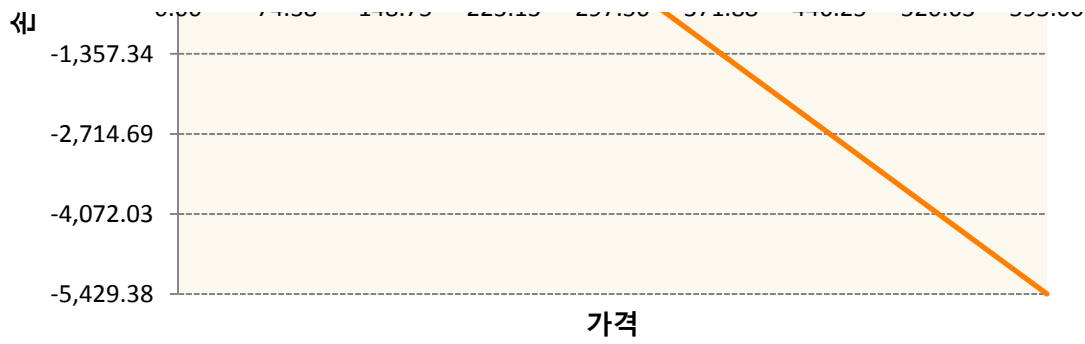
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

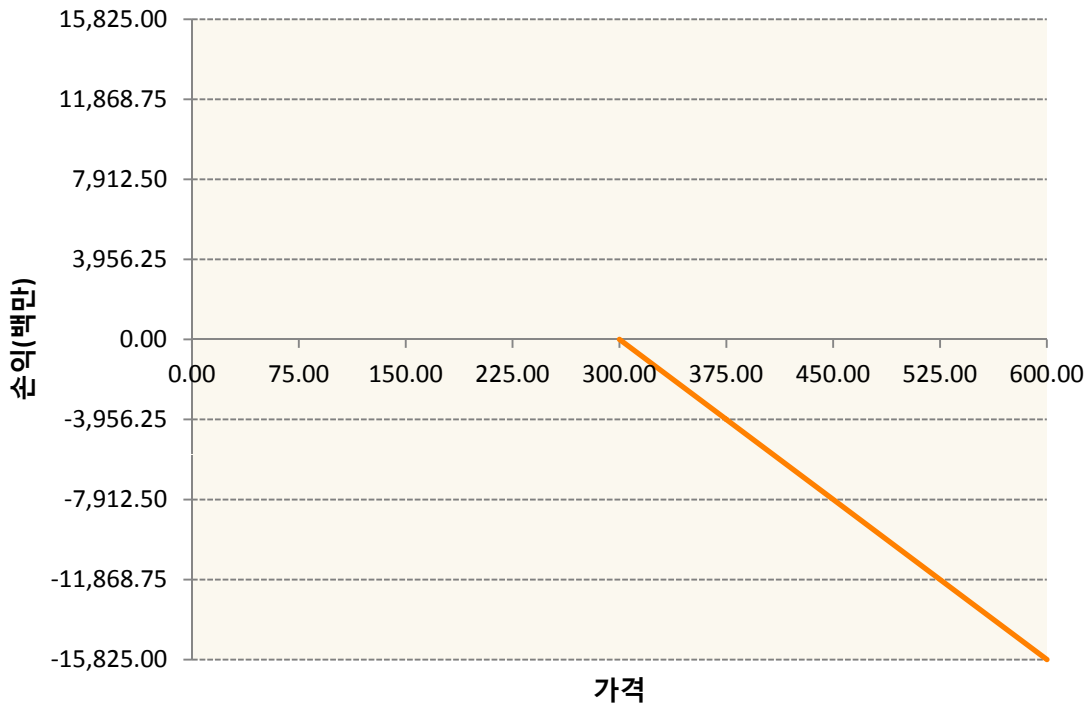


KR4201Q12977-2020-01 콜297.5

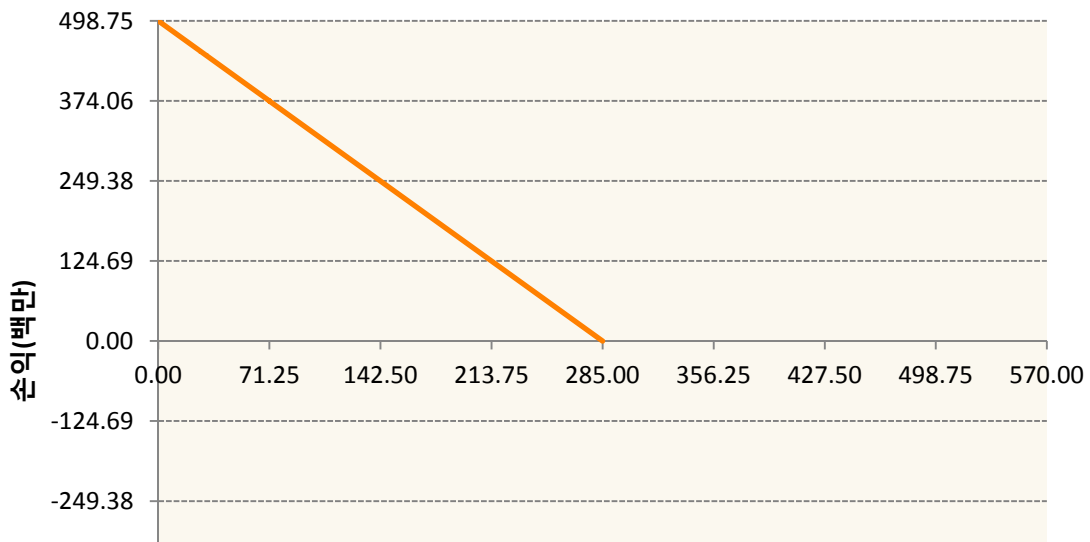


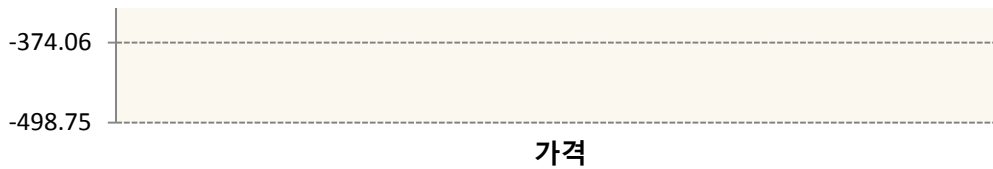


KR4201Q13009-2020-01 콜300



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%	-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%	895	895	895	895	895	895	895	
KR4201Q12977		2020-01 콜297.5						310
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	115	112	109	105	100	95	89	
-5.33%	106	100	94	87	79	71	62	
-2.67%	83	73	63	53	43	32	21	
0%	36	24	12	0	-12	-24	-36	
2.67%	-39	-51	-63	-75	-87	-99	-112	
5.33%	-141	-151	-161	-171	-182	-192	-204	
8.00%	-263	-269	-276	-284	-292	-301	-310	
KR4201Q13009		2020-01 콜300						851
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	283	278	270	260	249	235	219	
-5.33%	264	251	235	217	197	176	153	
-2.67%	212	188	162	135	107	78	48	
0%	101	68	34	0	-34	-69	-103	
2.67%	-90	-125	-161	-197	-233	-268	-304	
5.33%	-361	-391	-423	-455	-488	-521	-555	
8.00%	-698	-719	-742	-767	-794	-822	-851	
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)

1,777

공시일	2019-12-20
기준일	2019-12-19

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	205,974	0	205,974	

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	2019-12-20
기준일	2019-12-19

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	215,003	0	215,003	

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	2019-12-20
기준일	2019-12-19

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	4,568	-4,568	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	542,012	0	542,012	
누계	통화	선도	0	535,127	-535,127	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		4,756
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,399
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,501
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		1,865
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		3,208
FX21019X02 KRW/USD 26-12-19E		4,700
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		4,756
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		186
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,797
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,797
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,331
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,518
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E		1,623
FX21019Z00 KRW/USD 10-01-20E		1,119
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E		1,529
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E		932
FX21019Z02 KRW/USD 16-01-20E		1,678
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		186
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		1,996
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		932

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

(단위:백만원)

13,813

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

(단위:백만원)

188

공시일	2019-12-20
기준일	2019-12-19

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

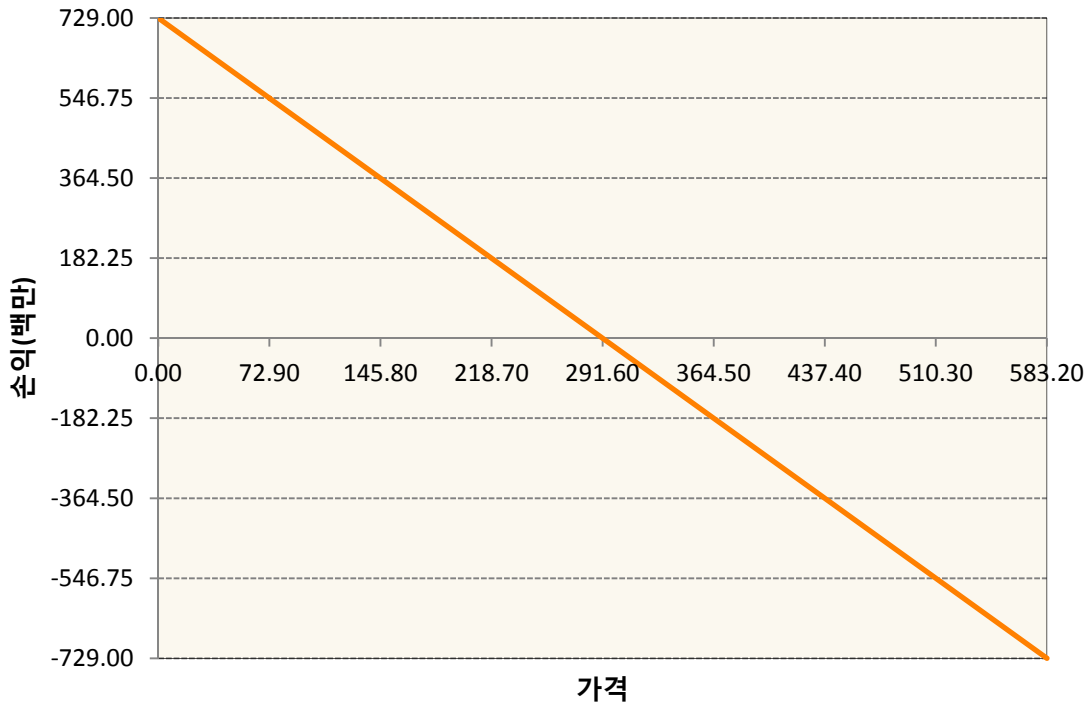
1. 계약금액

(단위:백만원)

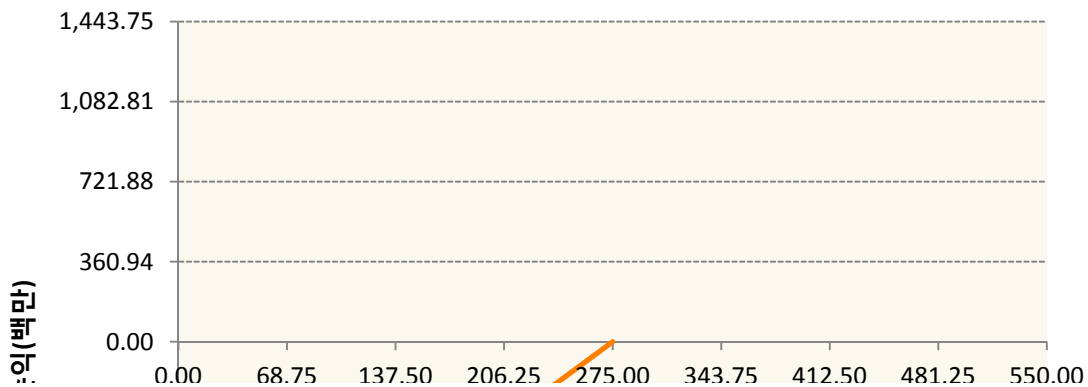
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	729	-729	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,941	-3,941	장내

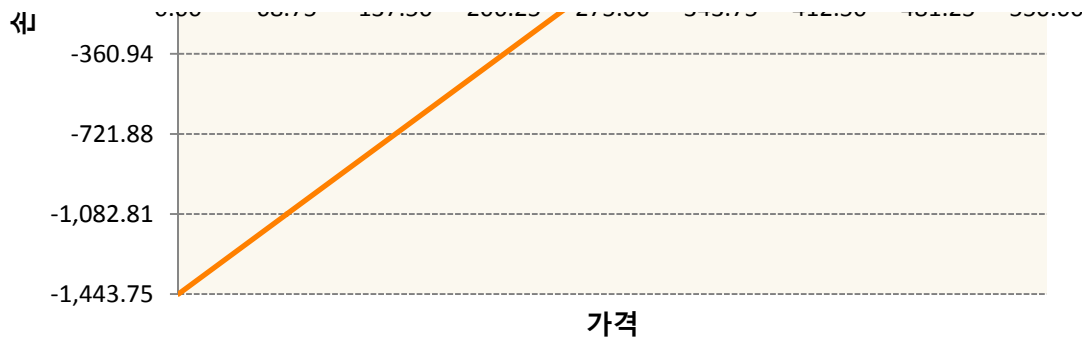
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

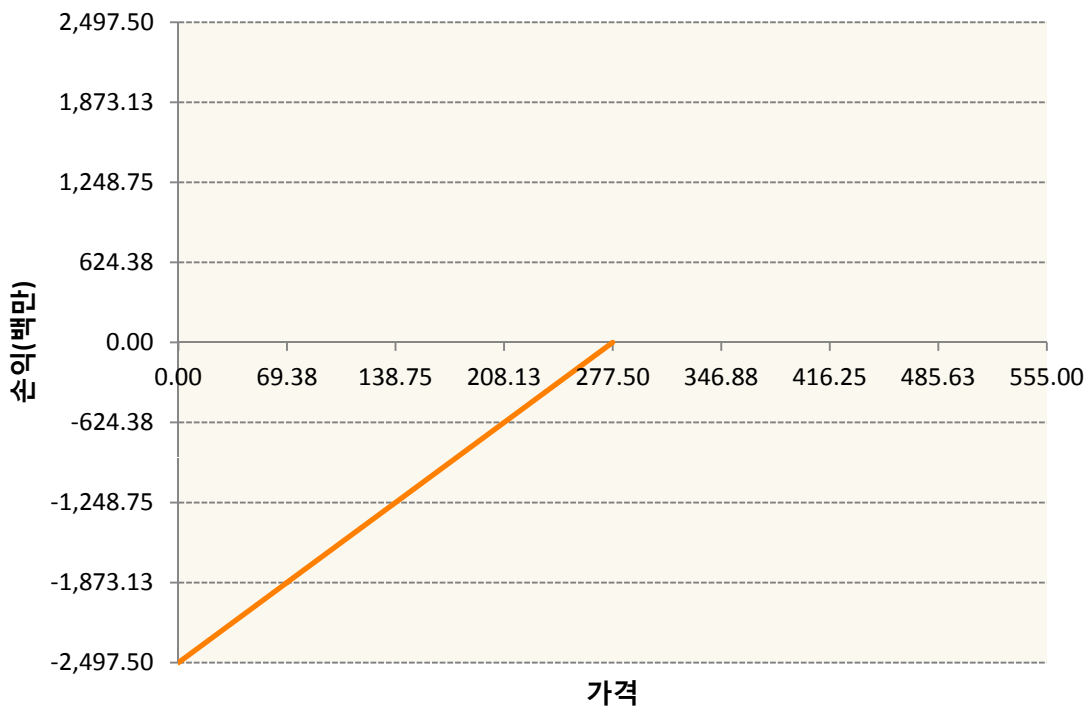


KR4301Q12751-2020-01 풋275





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						35
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-28	-29	-30	-31	-33	-34	-35
-5.33%	-6	-7	-9	-10	-12	-13	-14
-2.67%	0	-1	-1	-2	-3	-3	-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 76

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-65	-67	-68	-70	-72	-74	-76
-5.33%	-18	-21	-24	-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)

91

공시일	2019-12-20
기준일	2019-12-19

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	265	-265	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	14,076	0	14,076	
누계	통화	선도	350	14,407	-14,057	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019X01 KRW/USD 13-01-20E		228
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)

381

공시일	2019-12-20
기준일	2019-12-19

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	996	0	996	장외
누계	통화	선도	311	389	-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)

78

공시일	2019-12-20
기준일	2019-12-19

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

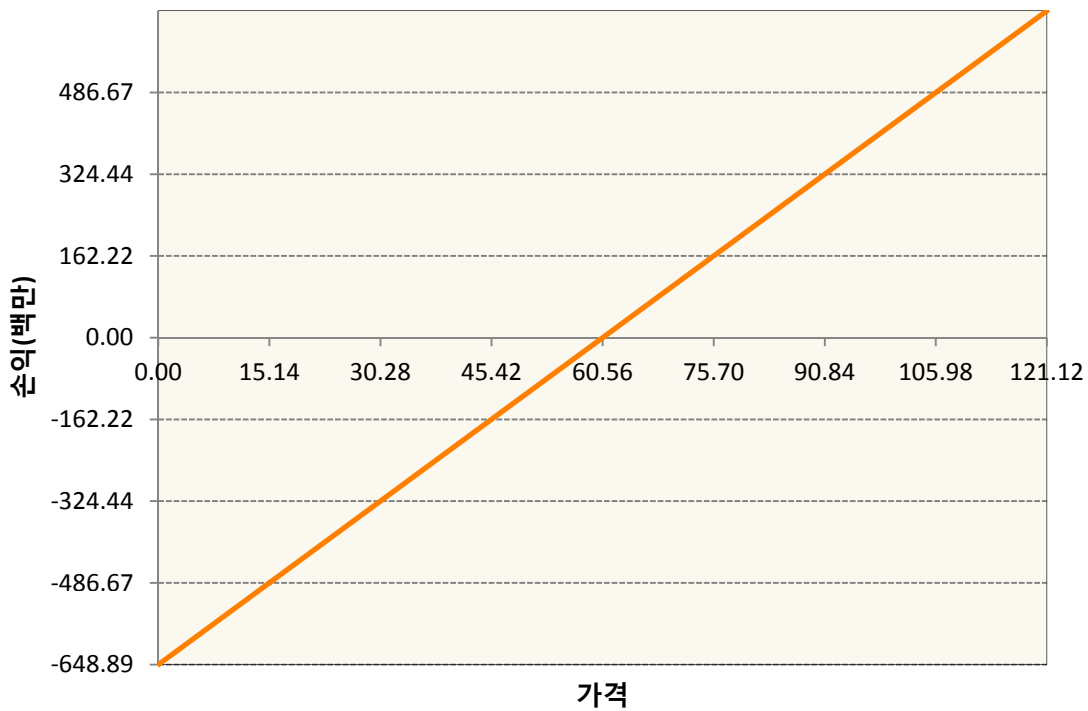
1. 계약금액

(단위:백만원)

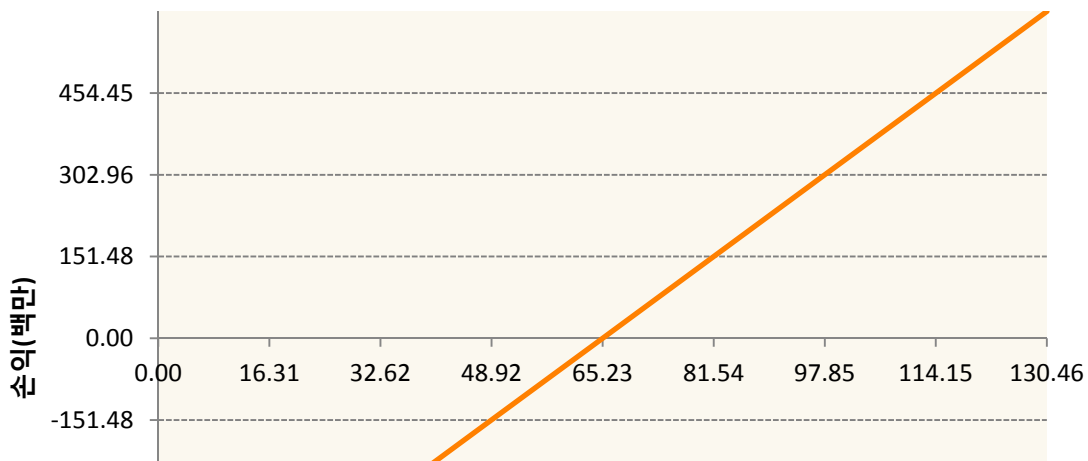
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,428	291	2,137	

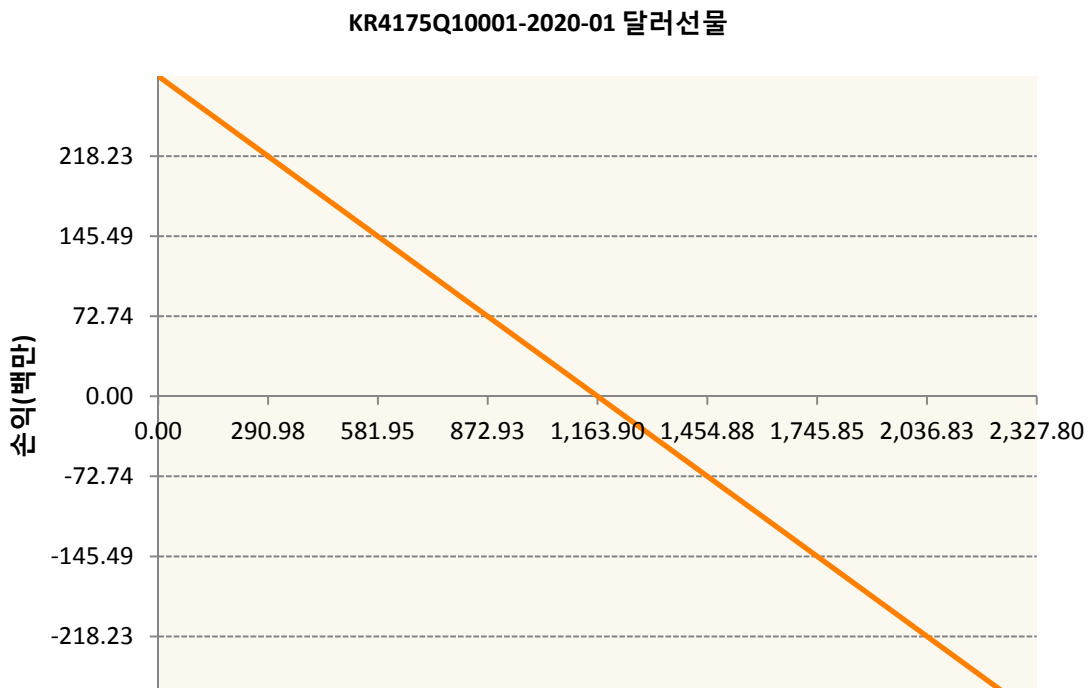
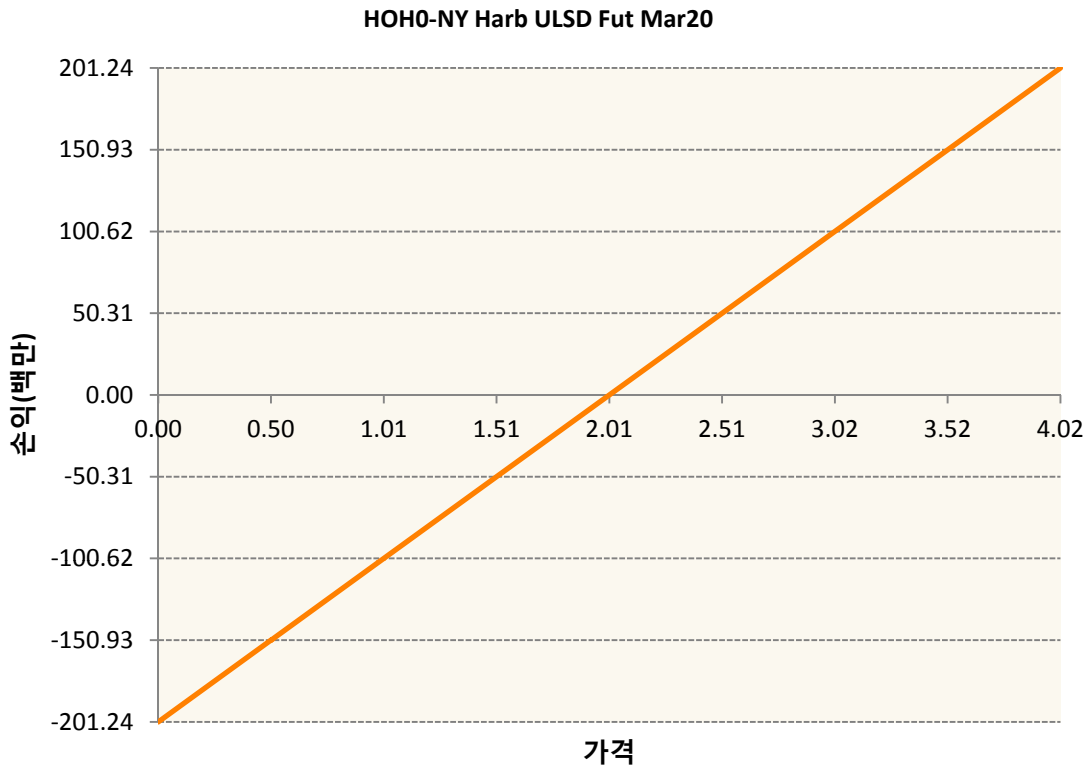
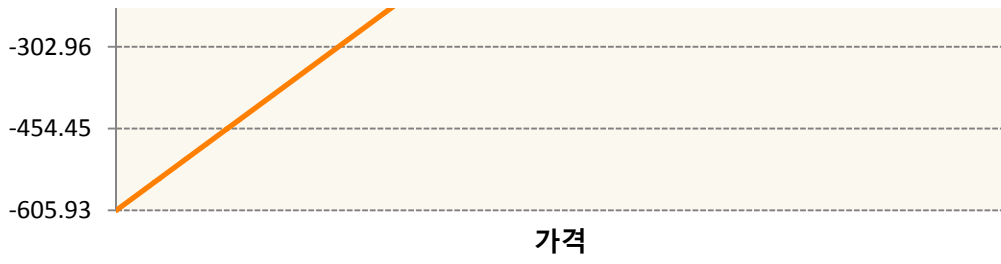
2. 만기시점의 손익구조

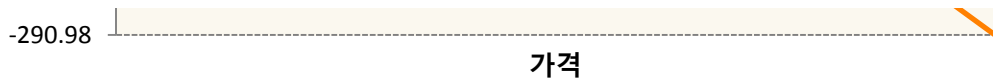
CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20



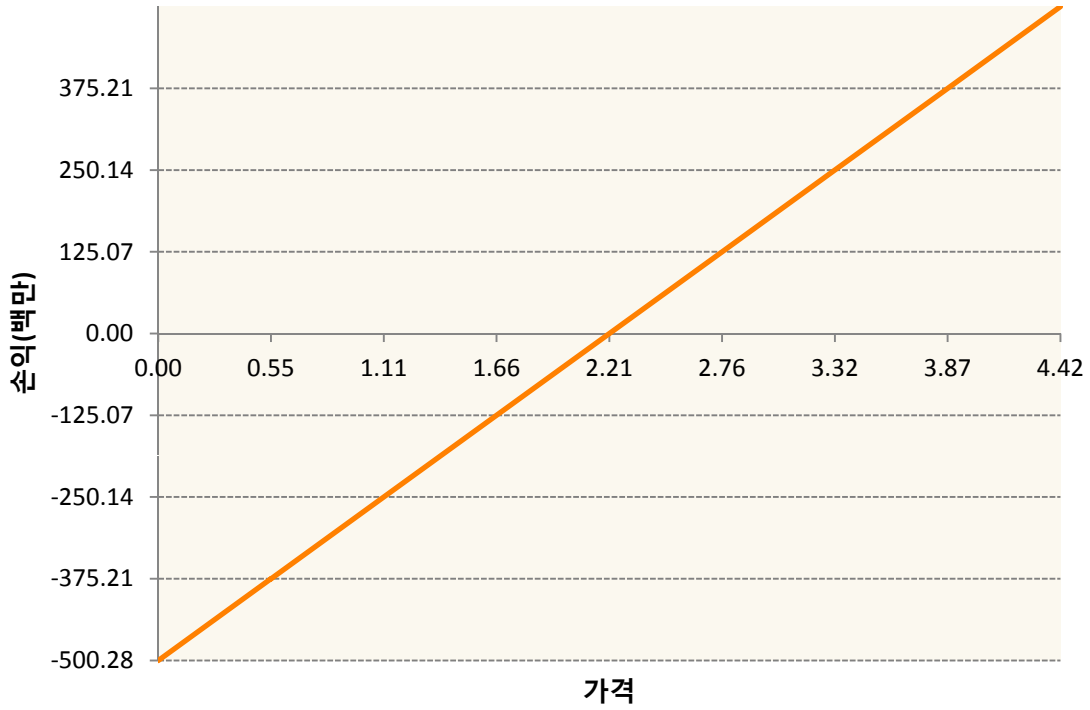
COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20



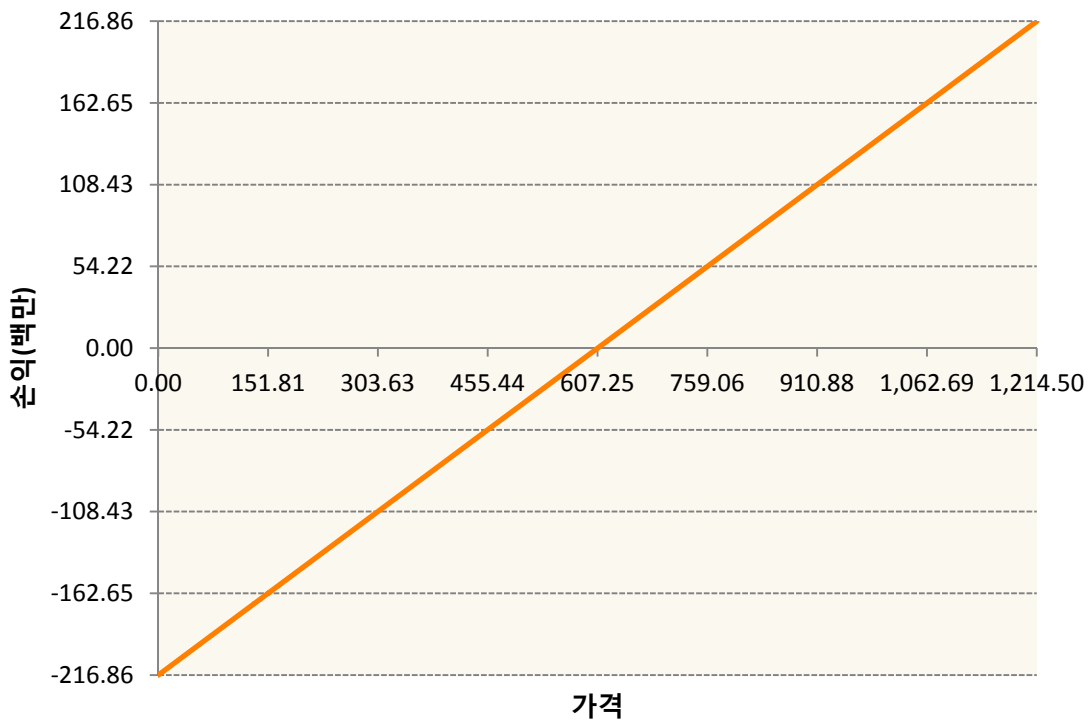




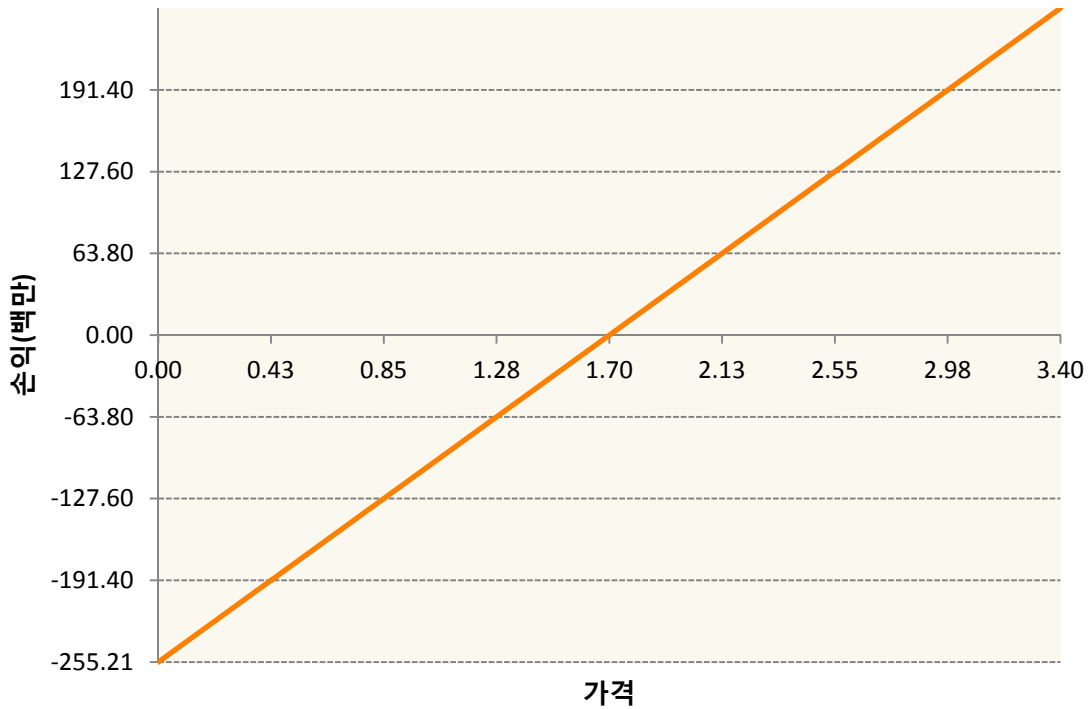
NGH20-NATURAL GAS FUTR Mar20



QSH0-Low Su Gasoil G Mar20



XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	52
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)

390

공시일	2019-12-20
기준일	2019-12-19

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

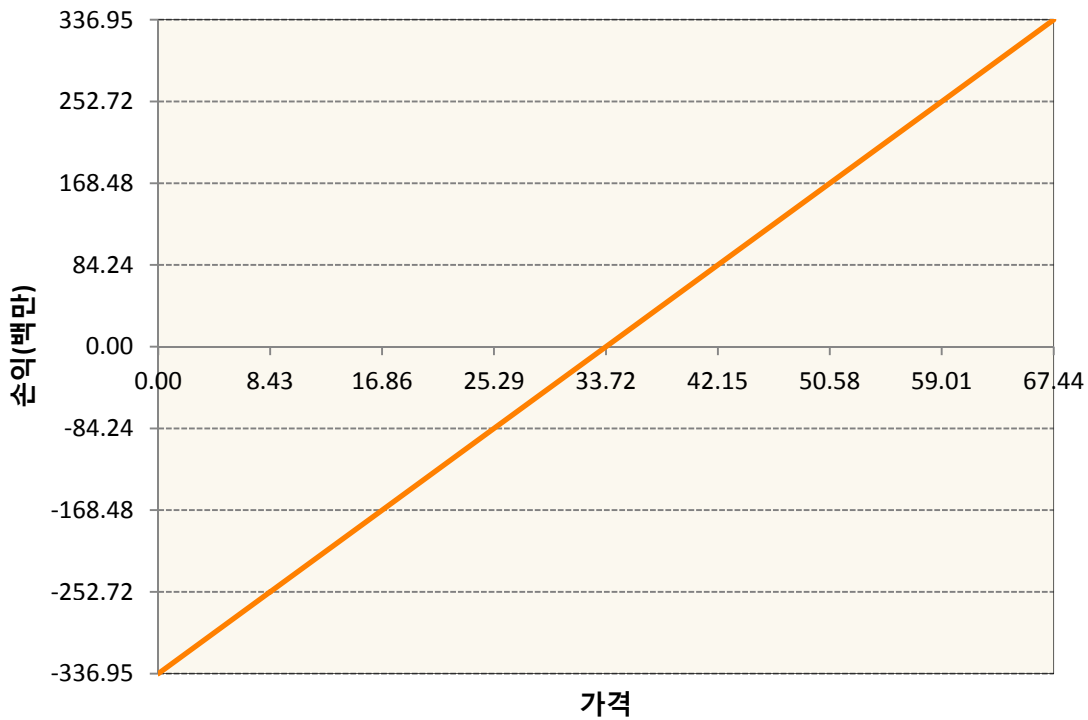
1. 계약금액

(단위:백만원)

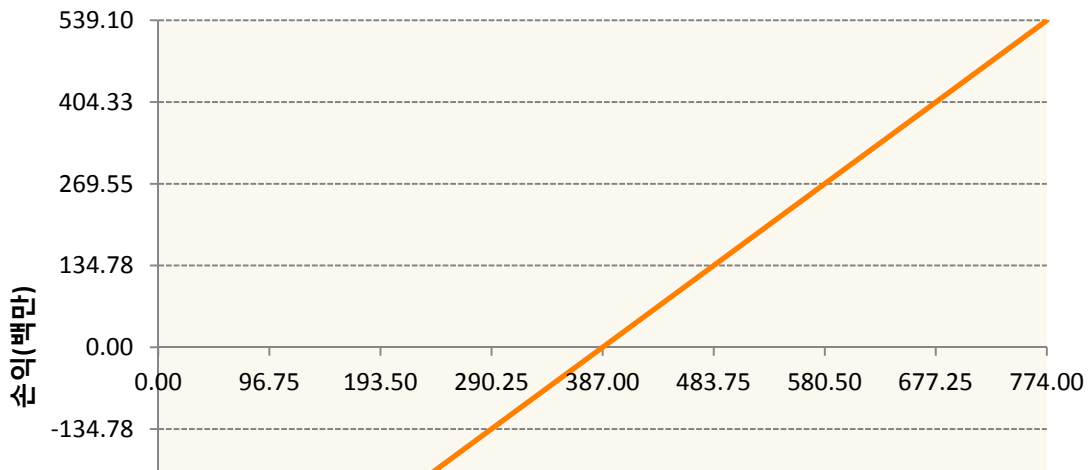
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,851	116	2,734	

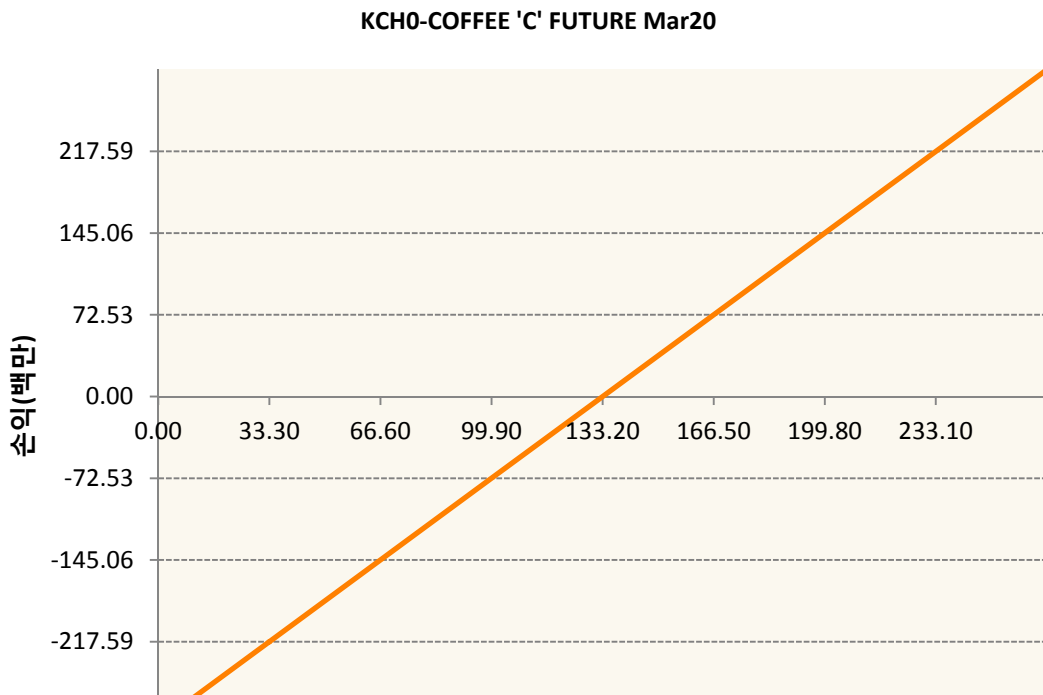
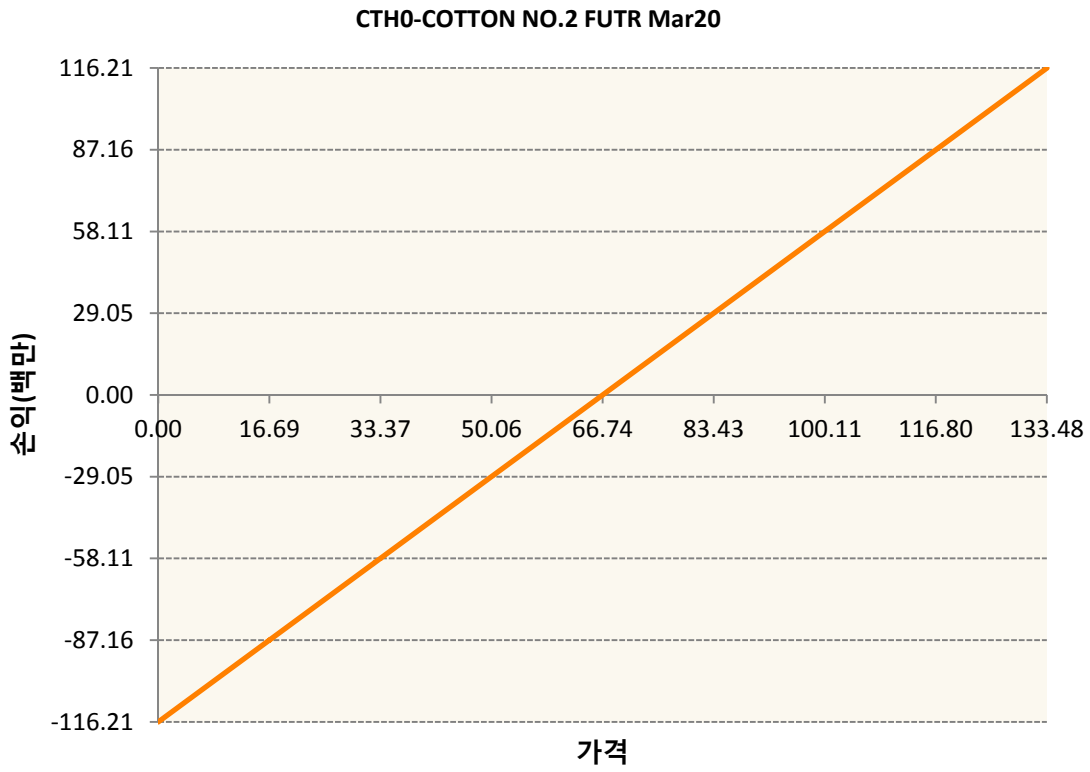
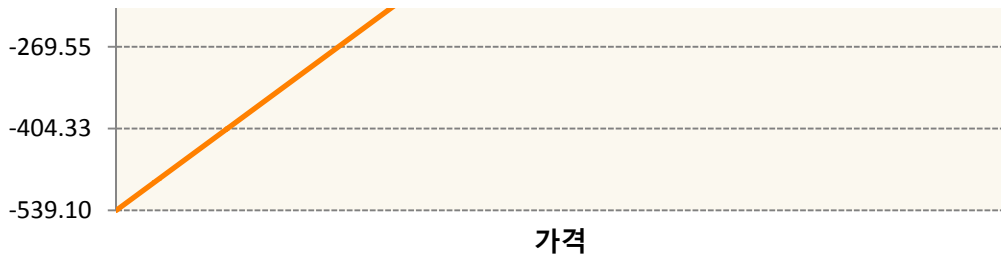
2. 만기시점의 손익구조

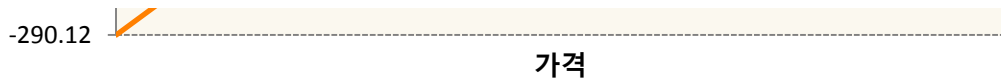
BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20



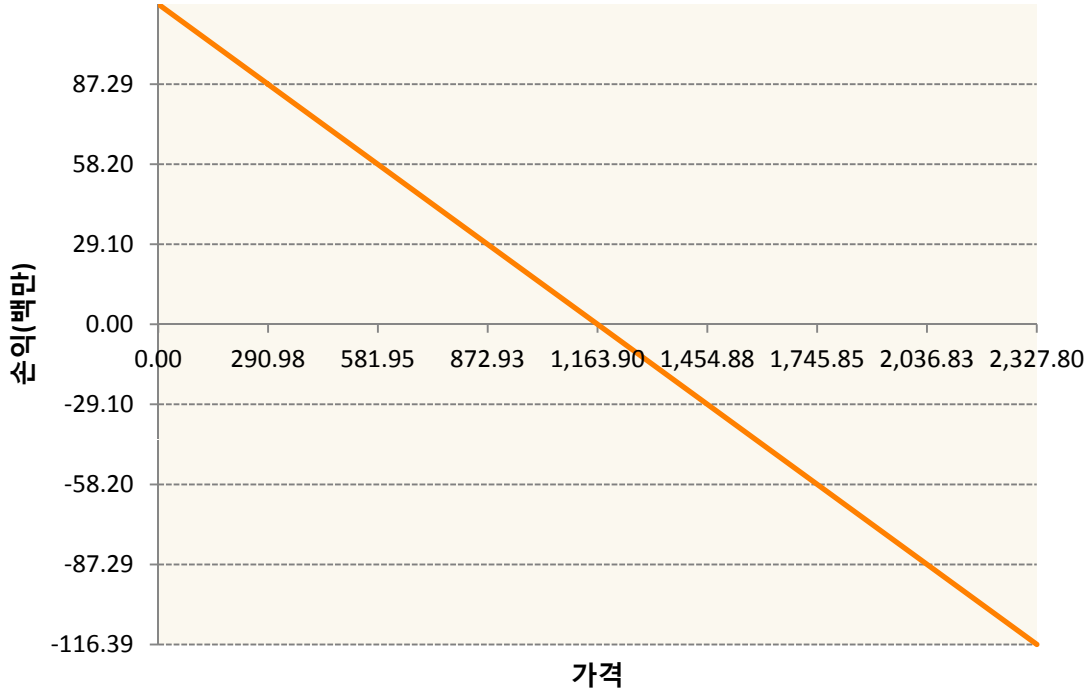
CH0-CORN FUTURE Mar20



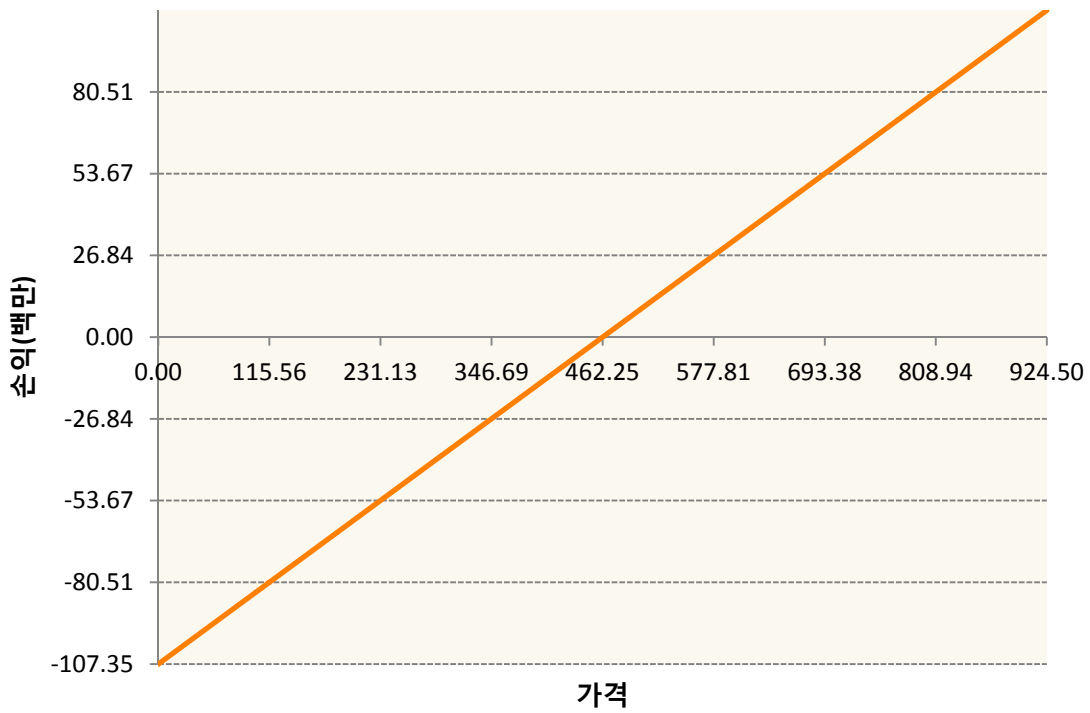




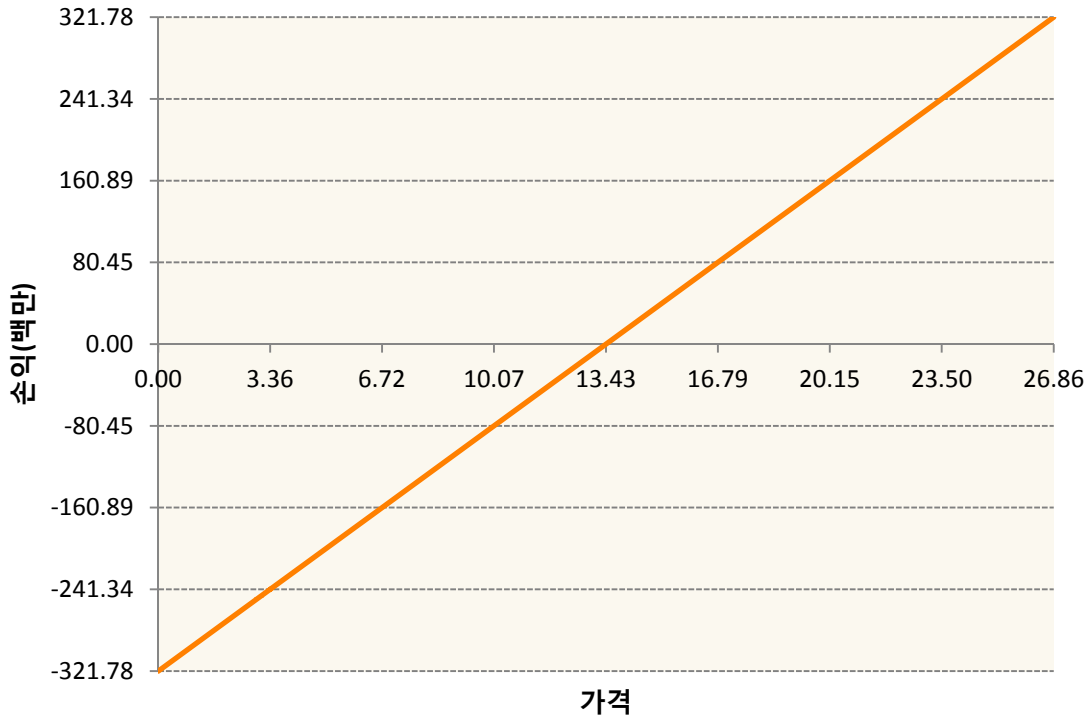
KR4175Q10001-2020-01 달러선물



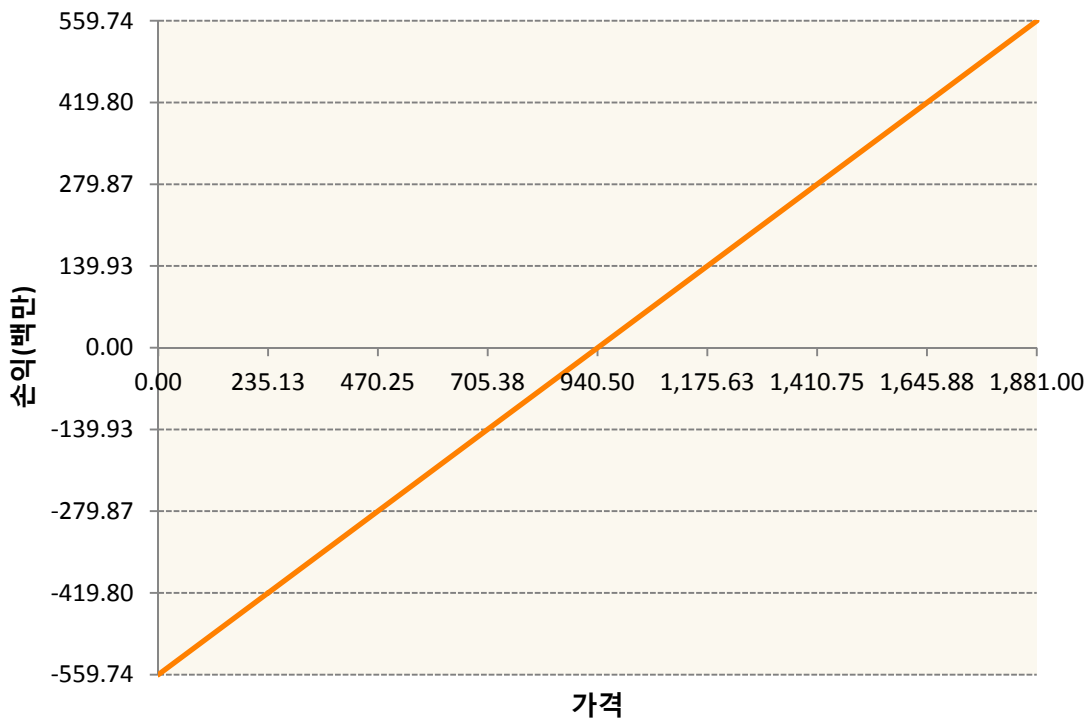
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



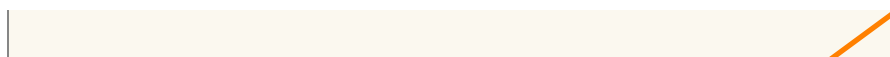
SBH0-Sugar Mar20

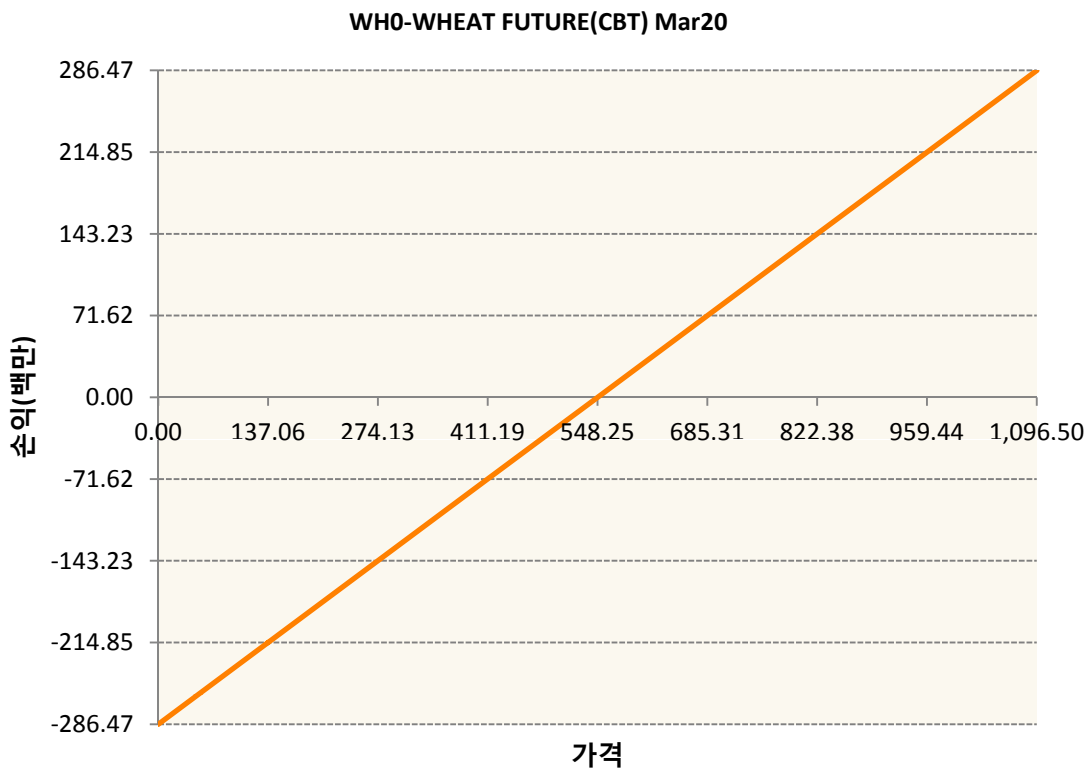
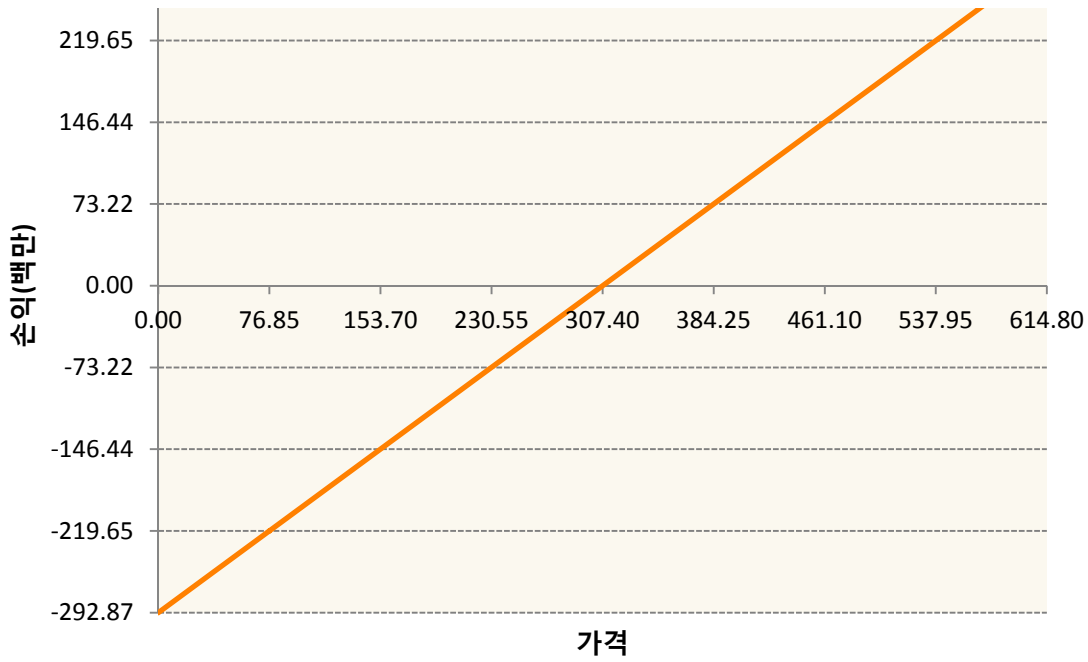


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20



SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





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	26
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)

250