

공시일	2019-12-23
기준일	2019-12-20

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	2019-12-23
기준일	2019-12-20

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

1,120

* 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	2019-12-23
기준일	2019-12-20

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)	398
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	146

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

753

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-23
기준일	2019-12-20

유로인덱스모(주식-파생형)

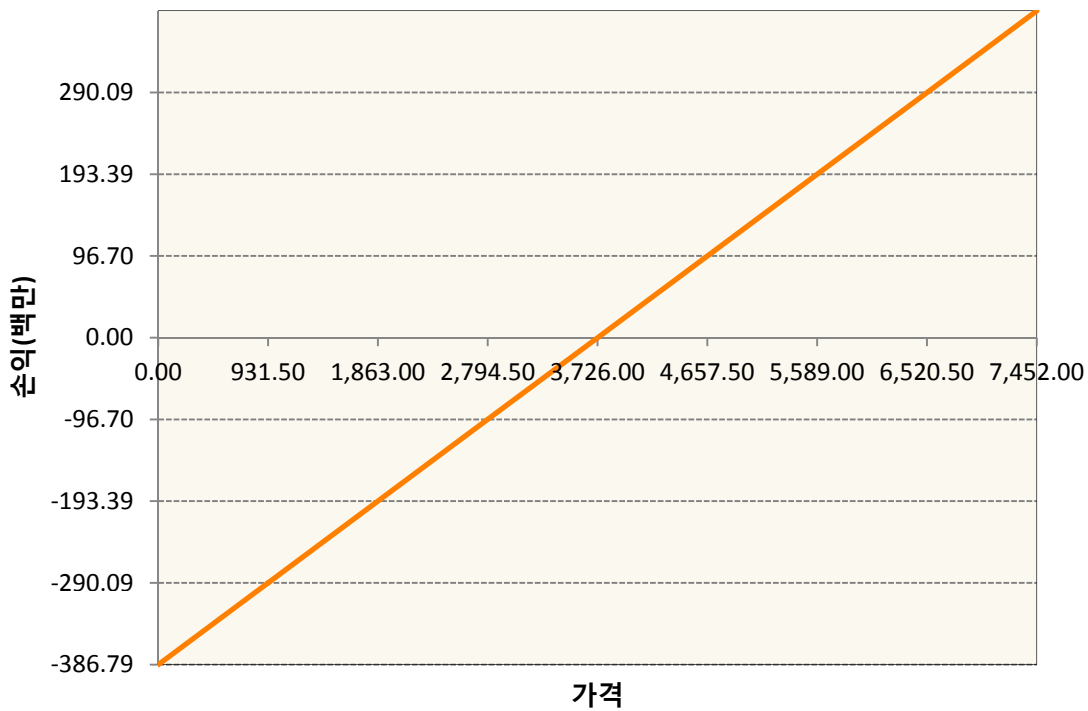
1. 계약금액

(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

VGH0-EURO STOXX 50 Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH0	EURO STOXX 50 Mar20	31
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

21

공시일	2019-12-23
기준일	2019-12-20

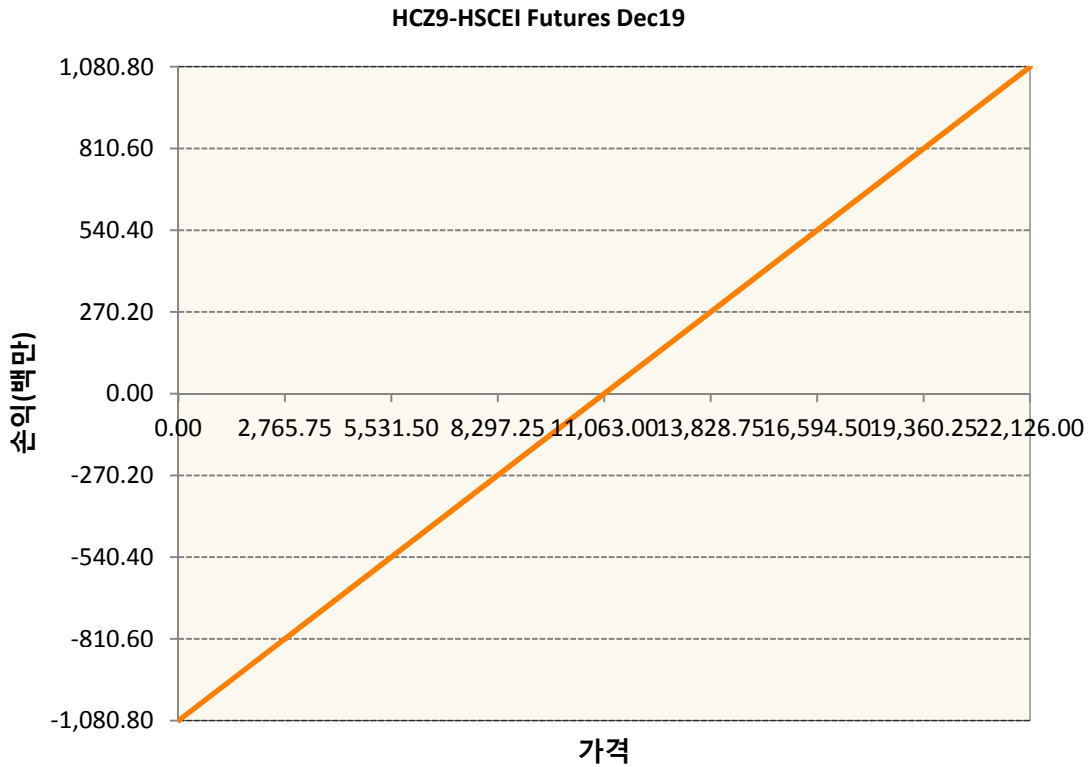
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,081	0	1,081	

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	2019-12-23
기준일	2019-12-20

커버드콜모(주식혼합-파생형)

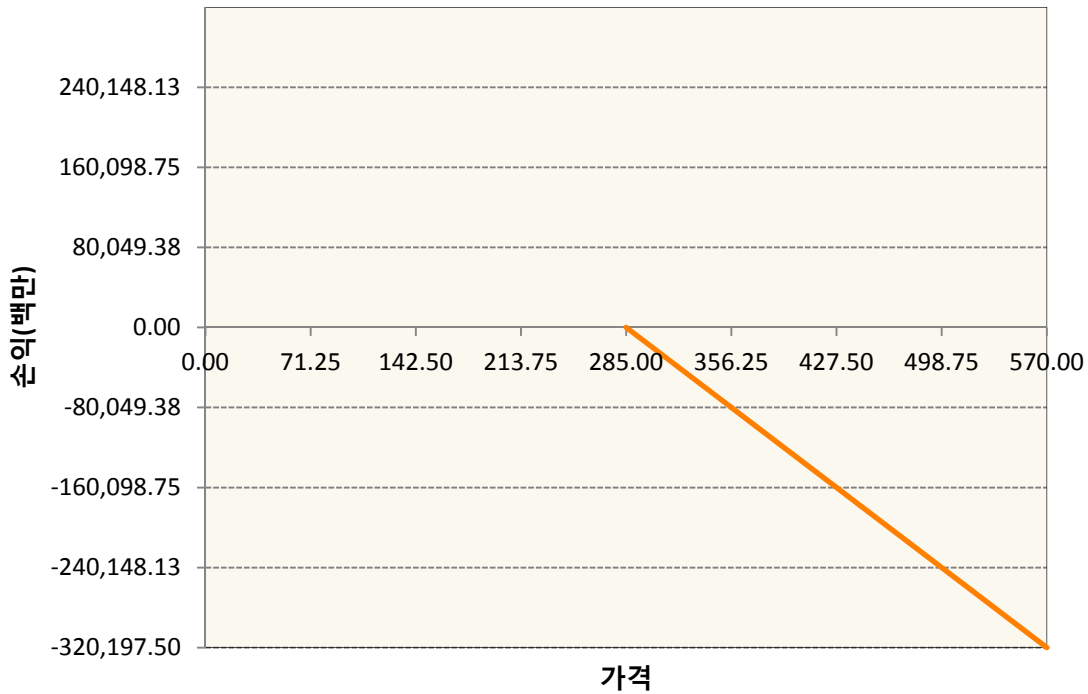
1. 계약금액

(단위:백만원)

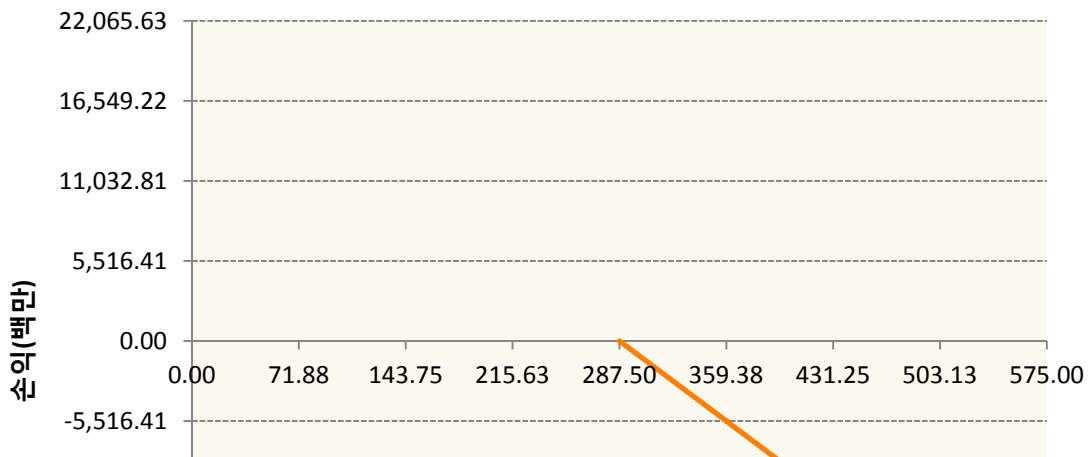
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	8,188	-8,188	장내
누계	유가증권	옵션	0	488,326	-488,326	장내

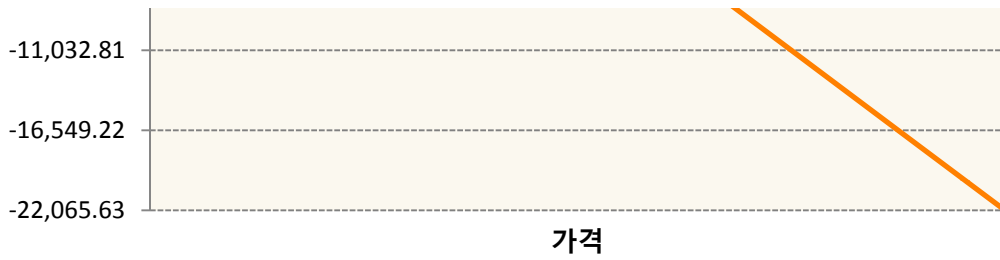
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q12852-2020-01 콜285

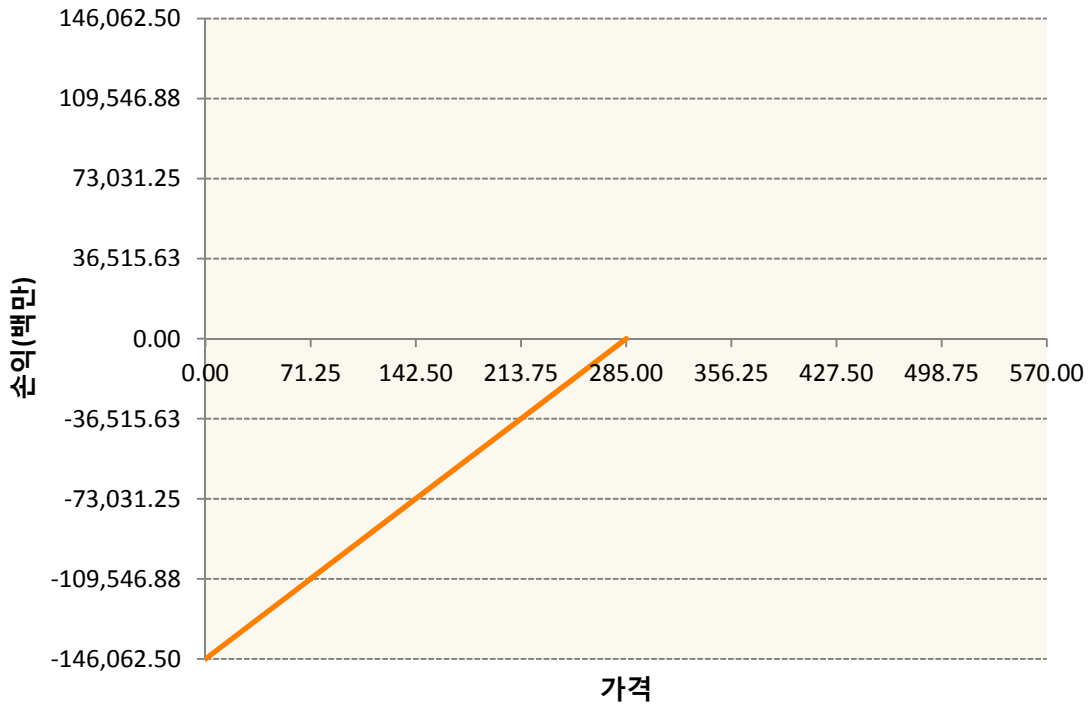


KR4201Q12878-2020-01 콜287.5





KR4301Q12850-2020-01 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q12852		2020-01 콜285					23,559
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	14,145	13,692	13,202	12,684	12,142	11,581	11,005
-5.33%	11,857	11,204	10,542	9,874	9,202	8,525	7,845
-2.67%	7,756	7,054	6,350	5,645	4,939	4,233	3,526
0%	1,797	1,220	619	0	-634	-1,279	-1,934
2.67%	-5,595	-5,965	-6,384	-6,843	-7,336	-7,858	-8,403
5.33%	-13,836	-14,025	-14,267	-14,559	-14,895	-15,271	-15,683
8.00%	-22,471	-22,549	-22,667	-22,828	-23,031	-23,275	-23,559
KR4201Q12878		2020-01 콜287.5					1,565
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	866	839	810	778	744	709	672

-5.33%	741	700	657	613	569	524	479
-2.67%	502	453	404	356	307	258	209
0%	134	90	45	0	-46	-92	-139
2.67%	-343	-374	-407	-443	-480	-519	-560
5.33%	-891	-908	-928	-952	-979	-1,008	-1,040
8.00%	-1,474	-1,482	-1,492	-1,506	-1,523	-1,543	-1,565
KR4301Q12850 2020-01 풋285							6,869
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,636	-6,654	-6,681	-6,716	-6,759	-6,810	-6,869
-5.33%	-2,929	-3,031	-3,140	-3,255	-3,373	-3,495	-3,620
-2.67%	-545	-683	-823	-964	-1,106	-1,249	-1,392
0%	183	132	71	0	-79	-166	-260
2.67%	266	261	251	235	213	184	147
5.33%	269	269	269	267	264	258	249
8.00%	270	270	270	269	269	268	267

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

(단위:백만원)

30,869

공시일	2019-12-23
기준일	2019-12-20

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

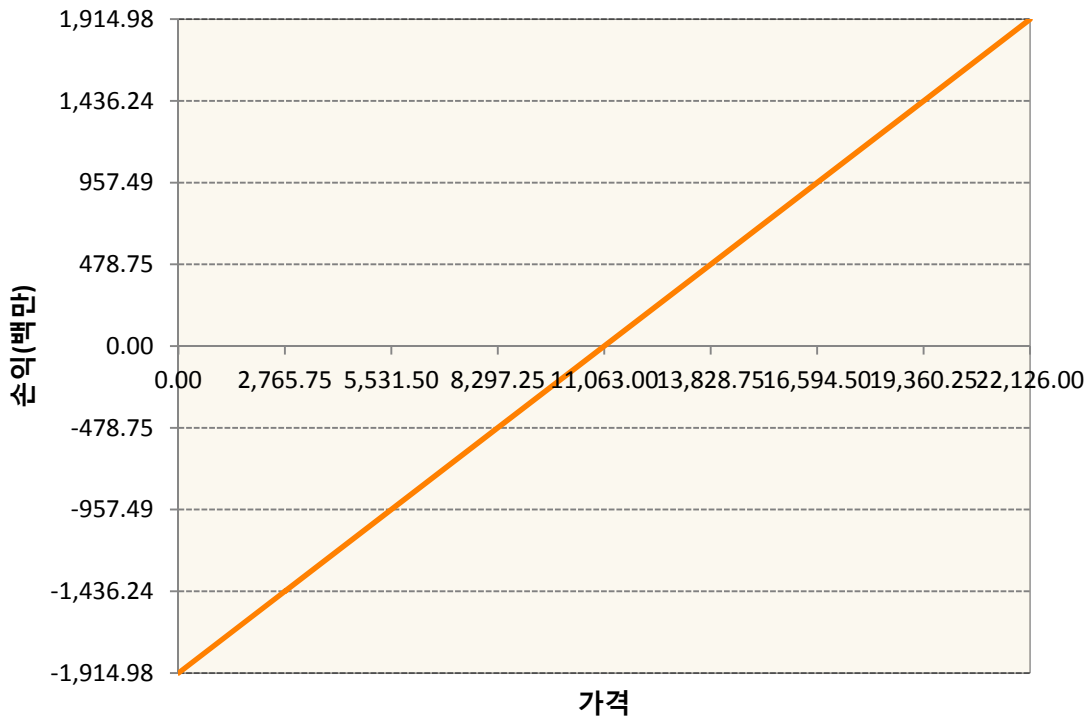
1. 계약금액

(단위:백만원)

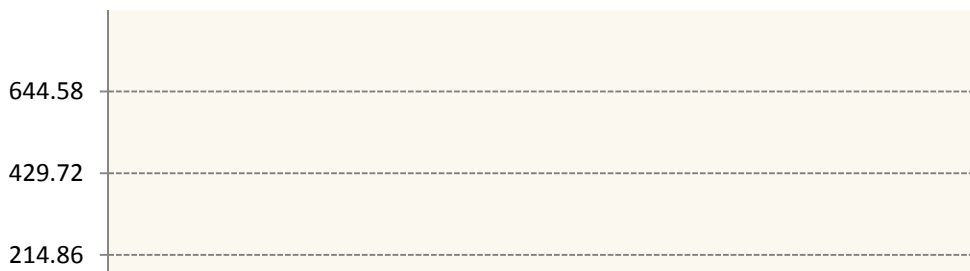
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,915	0	1,915	
누계	유가증권	옵션	0	4,795	-4,795	장내
누계	통화	선도	0	2,095	-2,095	장외

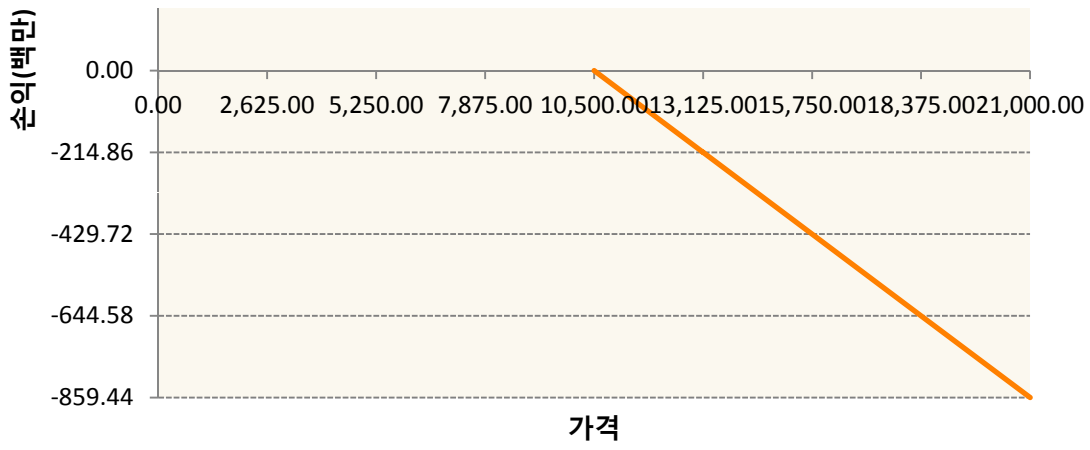
2. 만기시점의 손익구조

HCZ9-HSCEI Futures Dec19

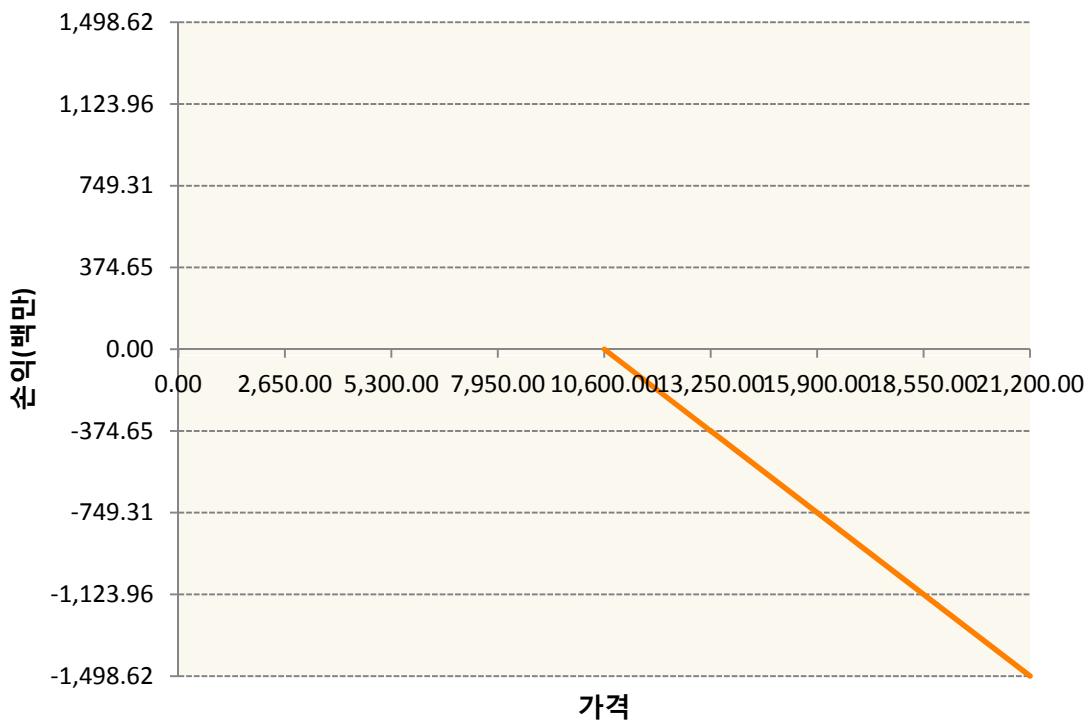


OHHIZ9-C105-HSCEI

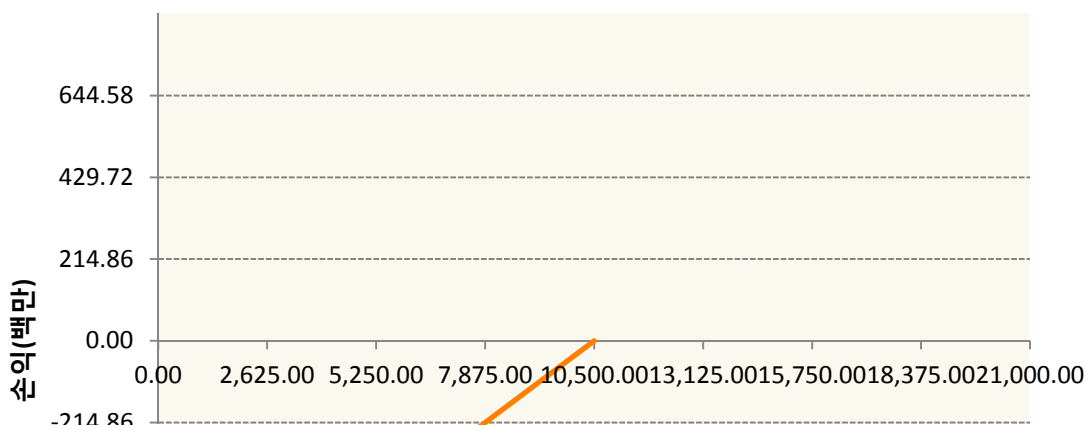


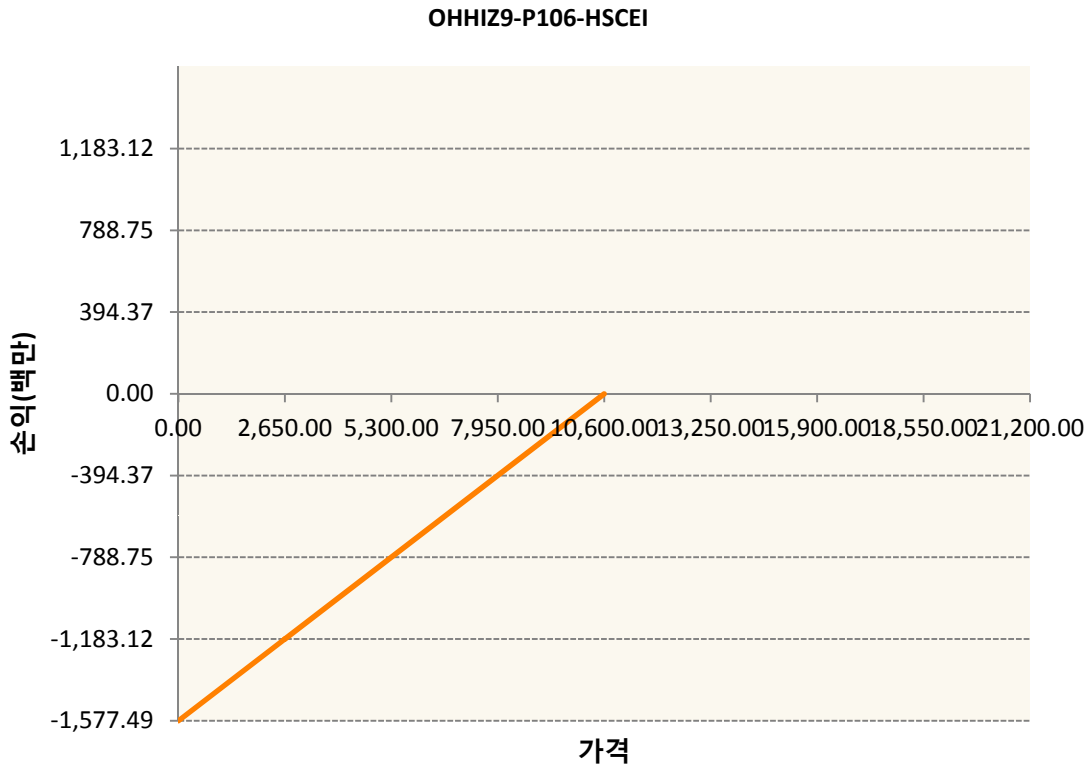


OHHIZ9-C106-HSCEI



OHHIZ9-P105-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E		168
HCZ9 HSCEI Futures Dec19		153
OHHIZ9-C1C HSCEI		69
OHHIZ9-C1C HSCEI		120
OHHIZ9-P10 HSCEI		69
OHHIZ9-P10 HSCEI		126

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		528

공시일	2019-12-23
기준일	2019-12-20

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

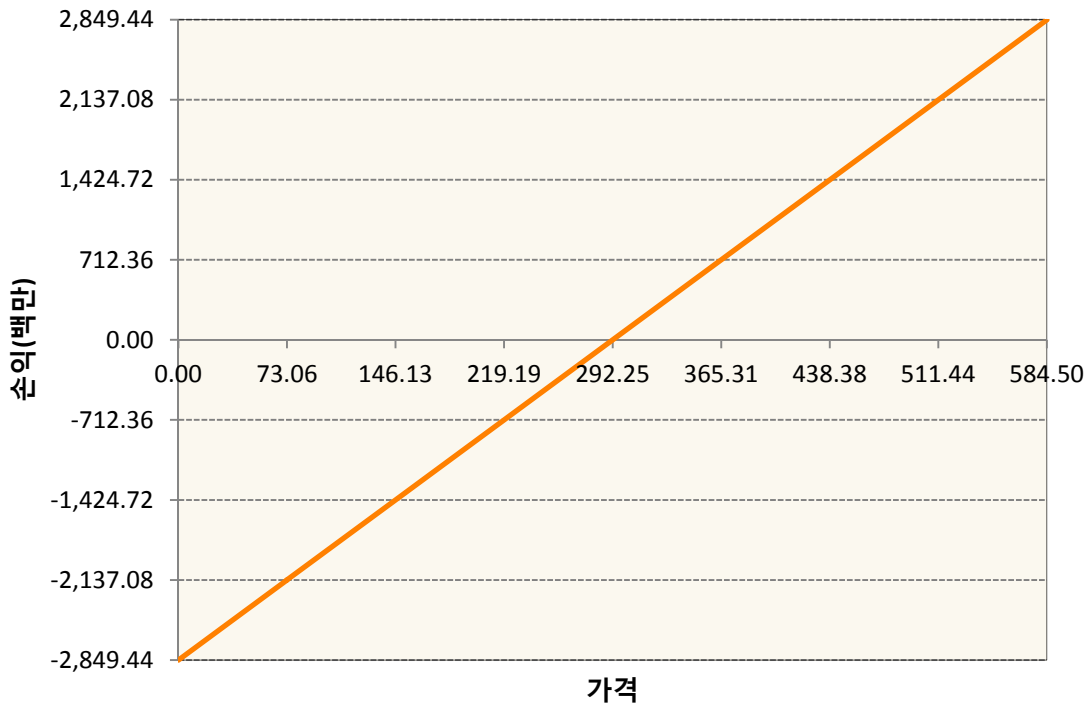
1. 계약금액

(단위:백만원)

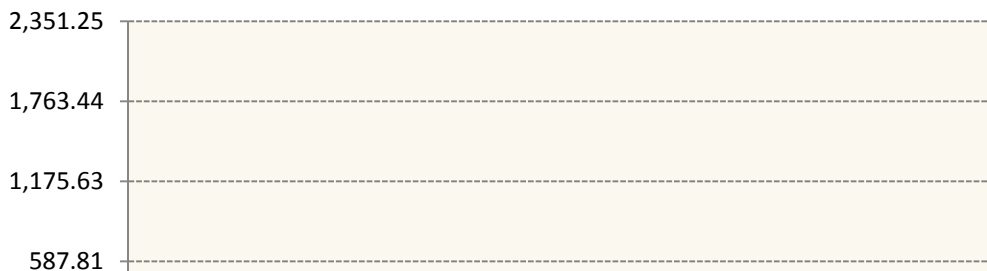
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	365	-365	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	702	0	702	장내
누계	유가증권	선물	2,849	0	2,849	장내
누계	유가증권	스왑	8,625	0	8,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,059	-6,059	장내

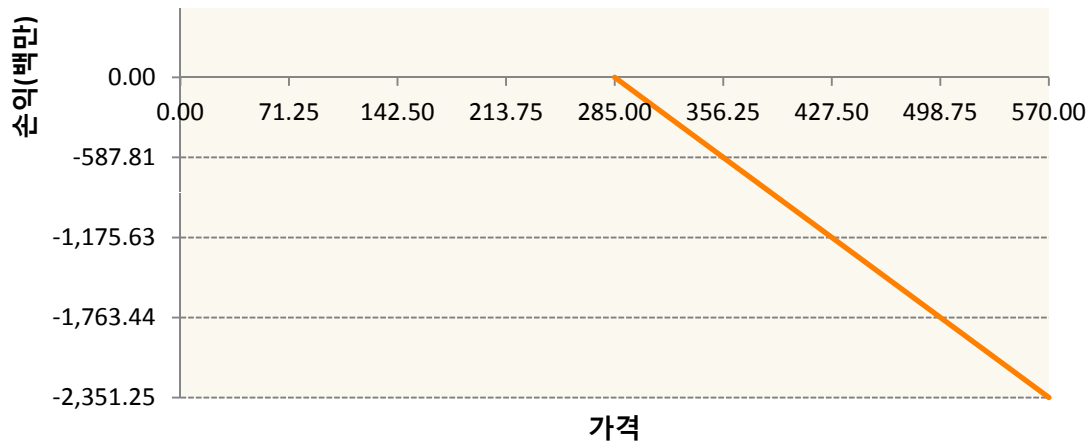
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

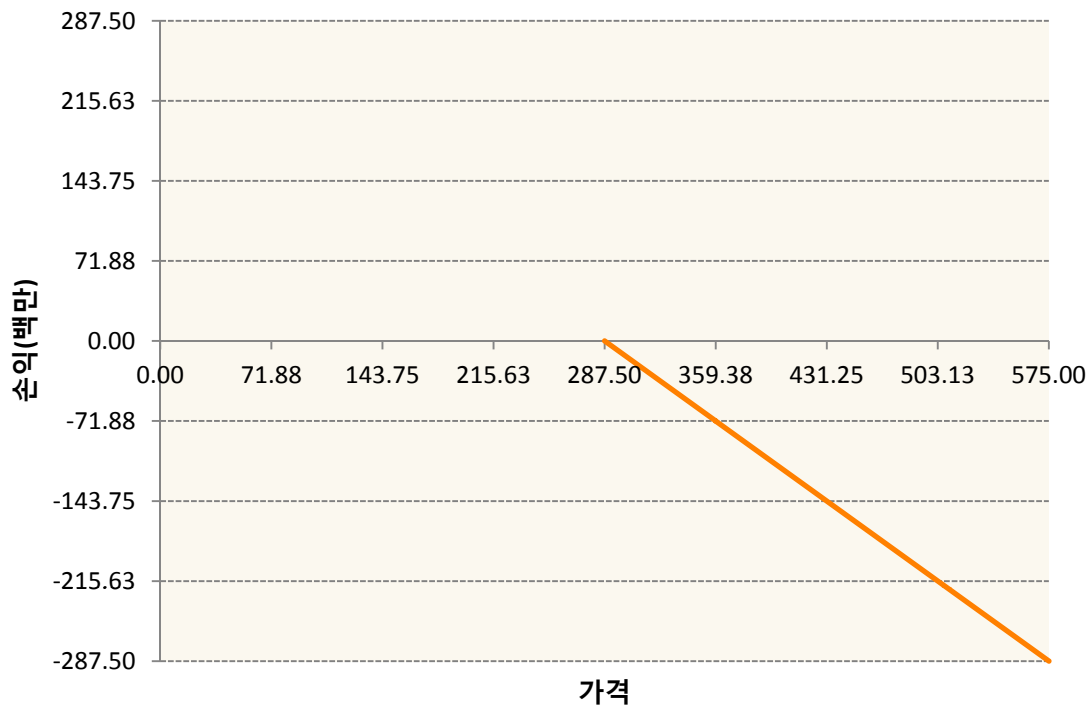


KR4201Q12852-2020-01 콜285

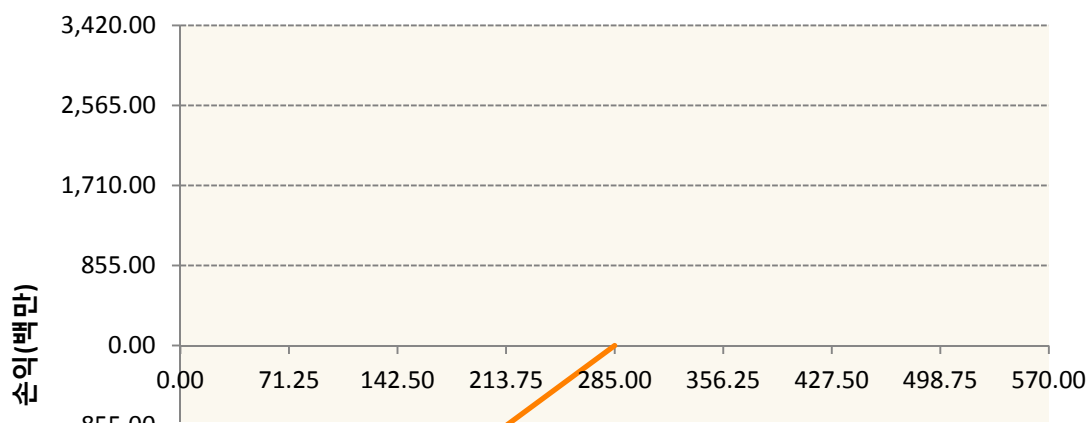




KR4201Q12878-2020-01 콜287.5



KR4301Q12850-2020-01 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						737
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-737	-737	-737	-737	-737	-737	-737	
-5.33%	-491	-491	-491	-491	-491	-491	-491	
-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%	491	491	491	491	491	491	491	
8.00%	737	737	737	737	737	737	737	
KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						230
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-230	-230	-230	-230	-230	-230	-230	
-5.33%	-154	-154	-154	-154	-154	-154	-154	
-2.67%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	77	77	77	77	77	77	77	
5.33%	154	154	154	154	154	154	154	
8.00%	230	230	230	230	230	230	230	
KR4201Q12852		2020-01 콜285						173
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	104	101	97	93	89	85	81	
-5.33%	87	82	77	73	68	63	58	
-2.67%	57	52	47	41	36	31	26	
0%	13	9	5	0	-5	-9	-14	
2.67%	-41	-44	-47	-50	-54	-58	-62	
5.33%	-102	-103	-105	-107	-109	-112	-115	
8.00%	-165	-166	-166	-168	-169	-171	-173	
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	11	10	10	9	9
-5.33%	10	9	9	8	7	7	6
-2.67%	7	6	5	5	4	3	3
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	-4	-5	-5	-6	-6	-7	-7
5.33%	-12	-12	-12	-12	-13	-13	-14
8.00%	-19	-19	-19	-20	-20	-20	-20
KR4301Q12850 2020-01 풋285							161
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-155	-156	-156	-157	-158	-159	-161
-5.33%	-69	-71	-74	-76	-79	-82	-85
-2.67%	-13	-16	-19	-23	-26	-29	-33
0%	4	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	6	6	6	6	5	4	3
5.33%	6	6	6	6	6	6	6
8.00%	6	6	6	6	6	6	6

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

(단위:백만원)

1,237

공시일	2019-12-23
기준일	2019-12-20

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

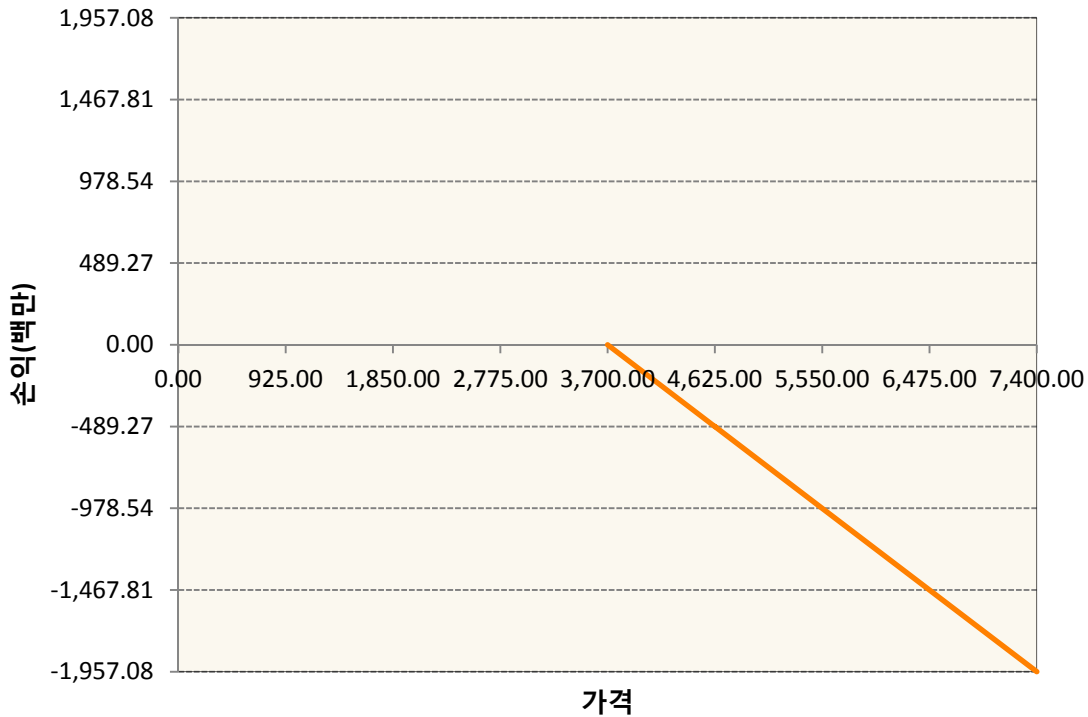
1. 계약금액

(단위:백만원)

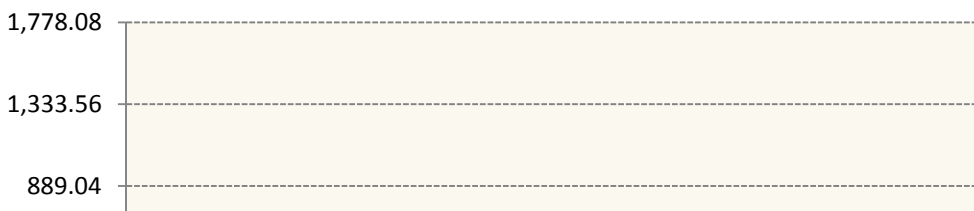
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	726	0	726	
누계	유가증권	스왑	17,640	0	17,640	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,470	-7,470	장내
누계	통화	선도	2,678	6,063	-3,385	장외

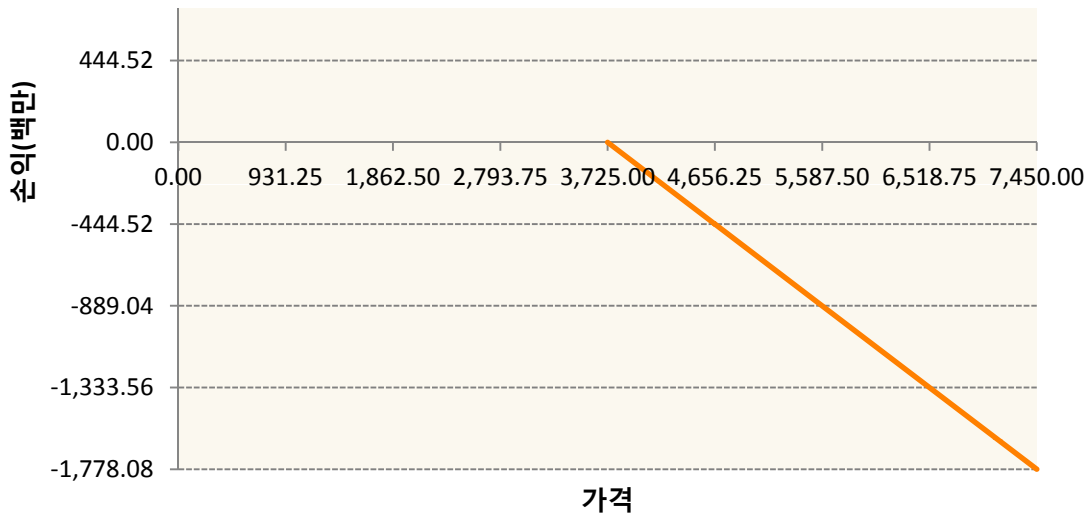
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ9-C3700-EURO STOXX 50

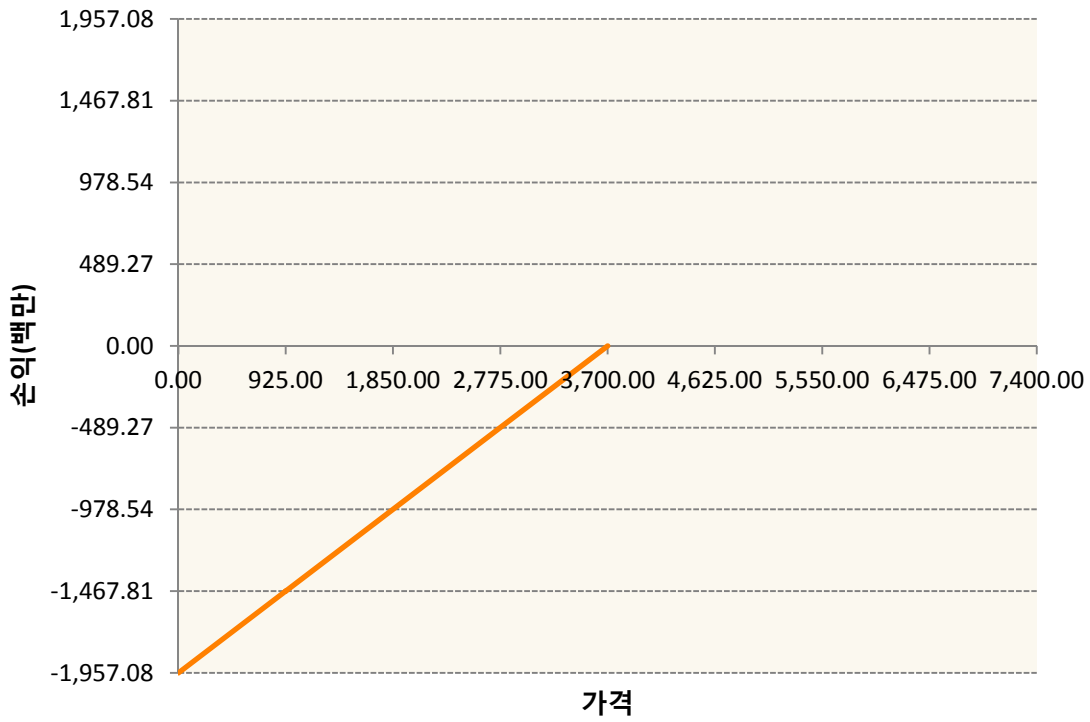


OESXZ9-C3725-EURO STOXX 50

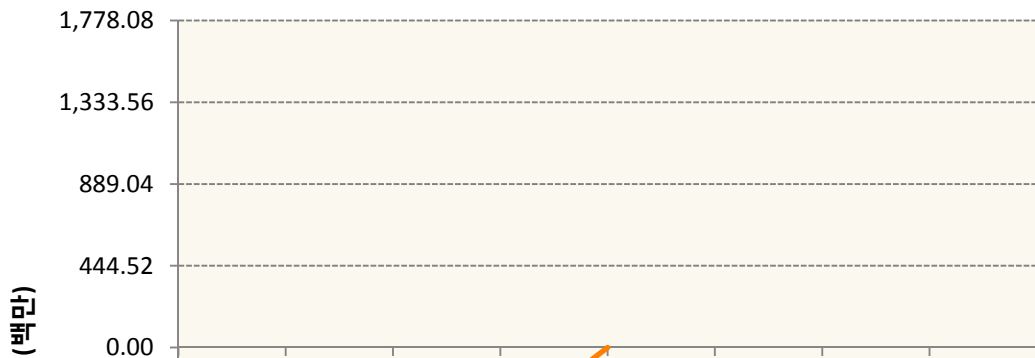


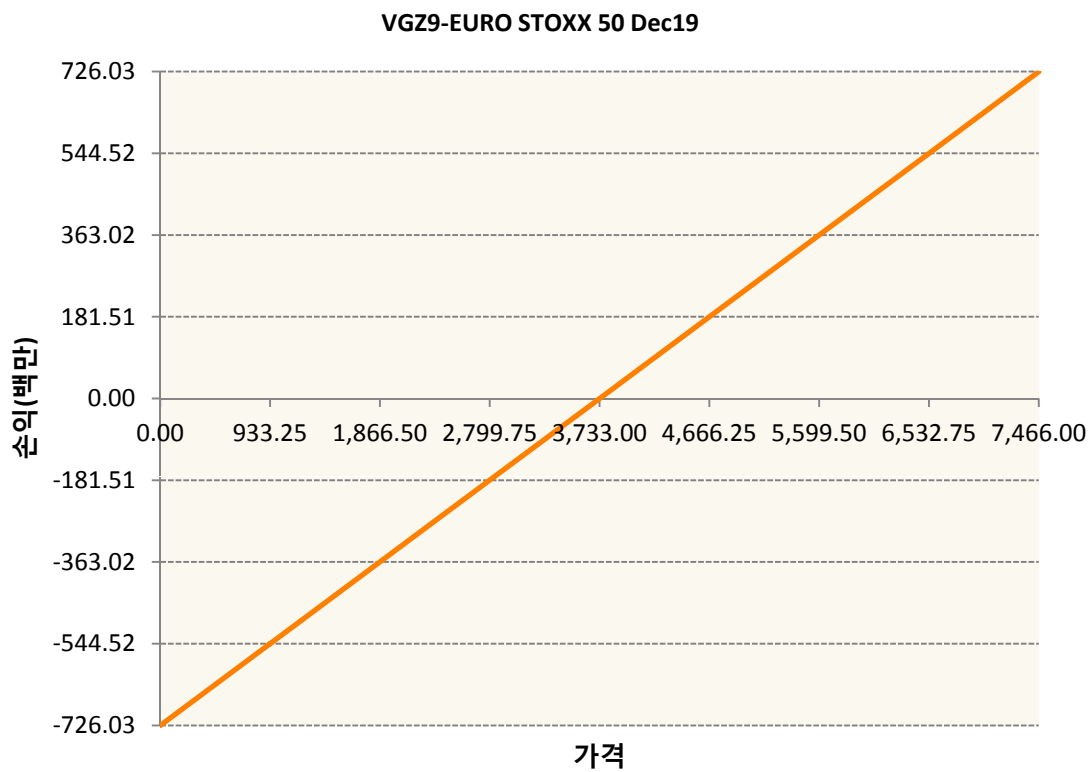
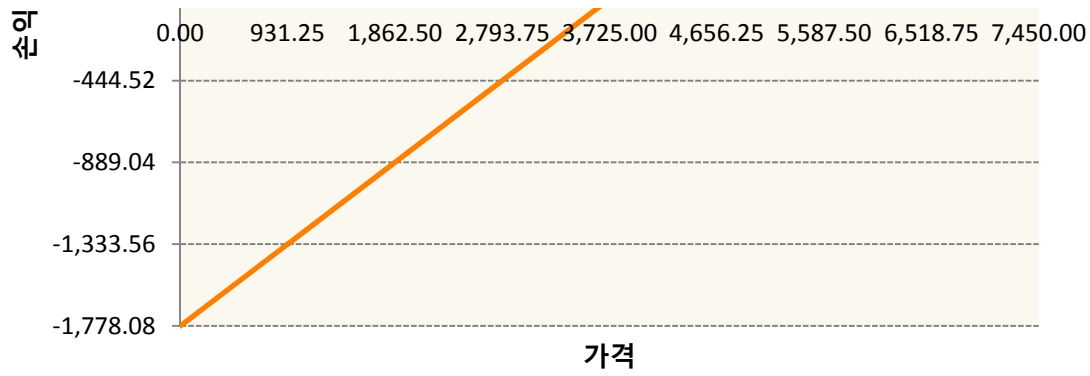


OESXZ9-P3700-EURO STOXX 50



OESXZ9-P3725-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	39
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E	485
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E	163
FX21019X02 EUR/KRW 27-12-19E	52
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	157
OESXZ9-C37 EURO STOXX 50	142
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	157
OESXZ9-P37 EURO STOXX 50	142
VGZ9 EURO STOXX 50 Dec19	58

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

(단위:백만원)

809

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

(단위:백만원)

946

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	2019-12-23
기준일	2019-12-20

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

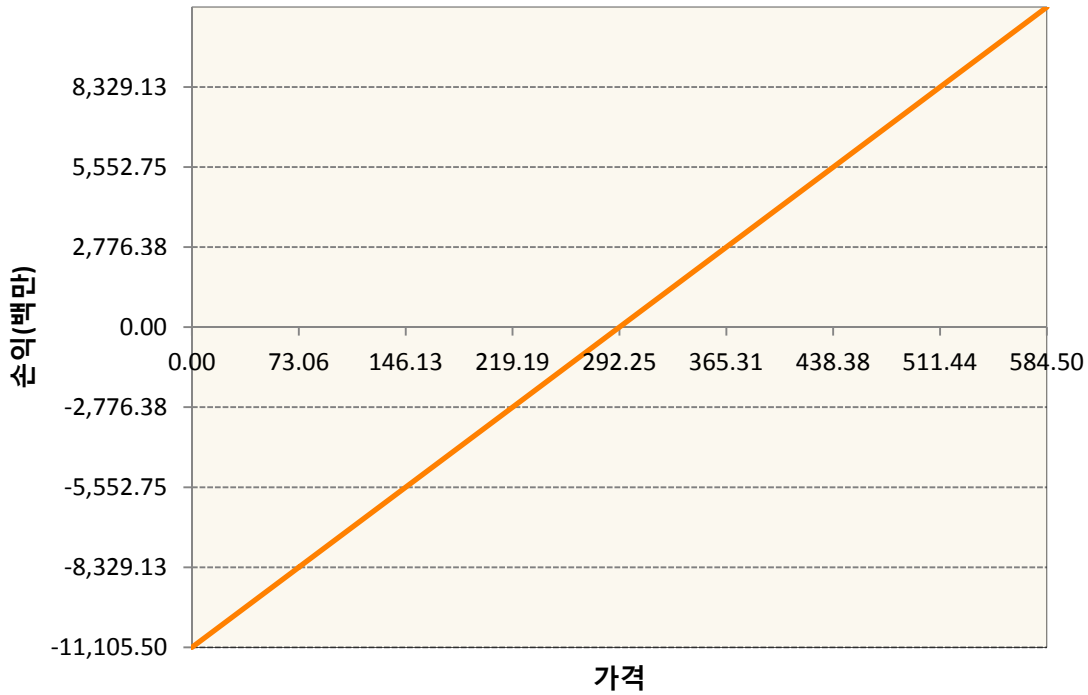
1. 계약금액

(단위:백만원)

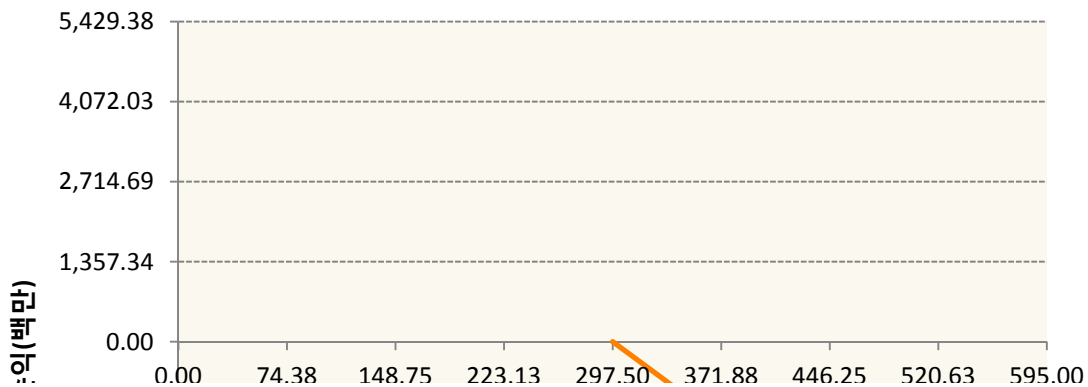
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,106	0	11,106	장내
누계	유가증권	옵션	499	21,254	-20,756	장내

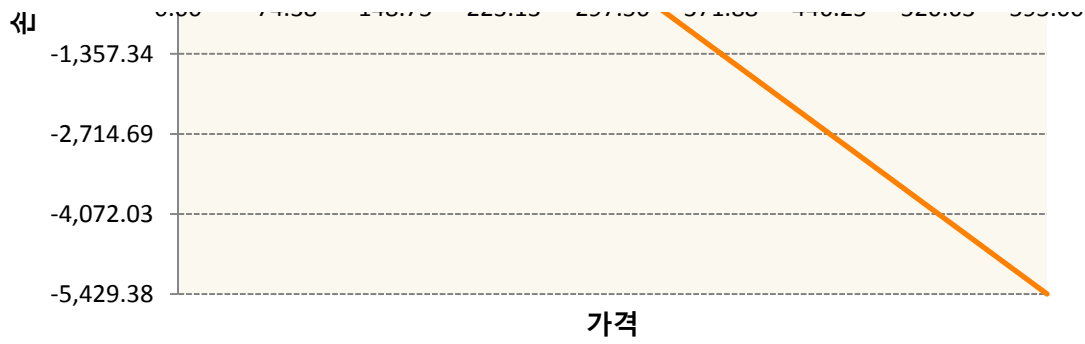
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

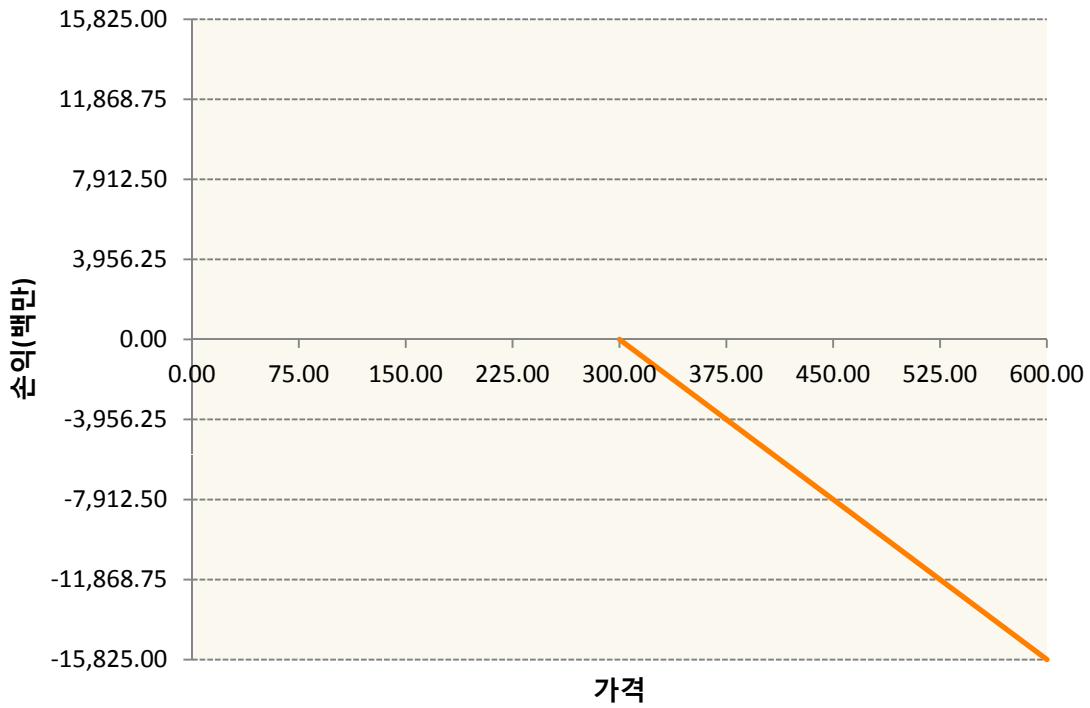


KR4201Q12977-2020-01 콜297.5

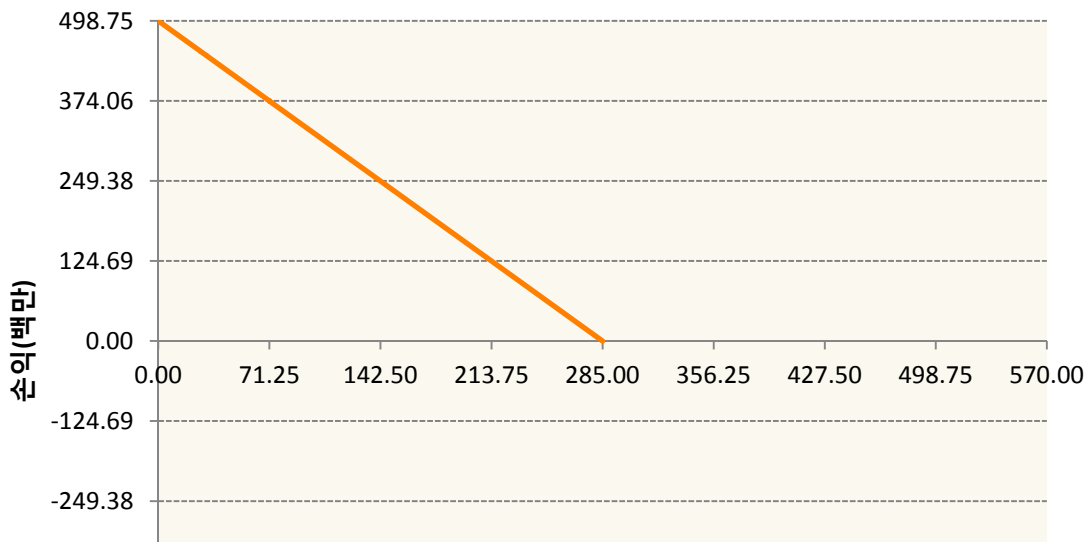


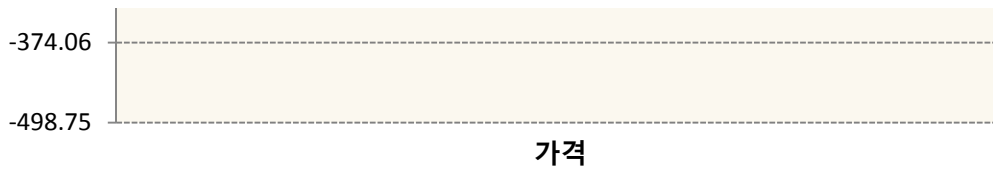


KR4201Q13009-2020-01 콜300



KR4301Q12850-2020-01 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						898
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-898	-898	-898	-898	-898	-898	-898	
-5.33%	-598	-598	-598	-598	-598	-598	-598	
-2.67%	-299	-299	-299	-299	-299	-299	-299	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	299	299	299	299	299	299	299	
5.33%	598	598	598	598	598	598	598	
8.00%	898	898	898	898	898	898	898	
KR4201Q12977		2020-01 콜297.5						318
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	120	117	114	110	105	99	93	
-5.33%	110	104	98	91	83	75	66	
-2.67%	85	76	66	56	45	35	24	
0%	36	24	12	0	-12	-24	-36	
2.67%	-44	-55	-67	-78	-90	-102	-113	
5.33%	-150	-159	-168	-177	-188	-198	-208	
8.00%	-275	-281	-287	-294	-301	-309	-318	
KR4201Q13009		2020-01 콜300						873
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	295	289	282	272	260	246	231	
-5.33%	275	261	245	227	207	186	163	
-2.67%	219	195	169	141	113	84	55	
0%	100	67	34	0	-34	-68	-102	
2.67%	-102	-136	-171	-205	-240	-275	-310	
5.33%	-385	-414	-443	-474	-505	-537	-569	
8.00%	-733	-751	-772	-795	-820	-845	-873	
KR4301Q12850		2020-01 풋285						23
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	23	23	23	23	23	23	23	
-5.33%	10	10	11	11	12	12	12	
-2.67%	2	2	3	3	4	4	5	

0%	-1	0	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)

1,823

공시일	2019-12-23
기준일	2019-12-20

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	205,406	0	205,406	

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	2019-12-23
기준일	2019-12-20

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	214,411	0	214,411	

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	2019-12-23
기준일	2019-12-20

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	540,534	0	540,534	
누계	통화	선도	0	579,255	-579,255	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		4,735
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,393
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,495
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		1,857
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		3,194
FX21019X02 KRW/USD 26-12-19E		4,680
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		4,735
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		186
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,785
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,785
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,321
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,507
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E		1,616
FX21019Z00 KRW/USD 10-01-20E		1,114
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E		1,523
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E		928
FX21019Z02 KRW/USD 16-01-20E		1,671
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		186
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		1,987
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		928
FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E		3,714

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

(단위:백만원)

14,905

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

(단위:백만원)

189

공시일	2019-12-23
기준일	2019-12-20

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

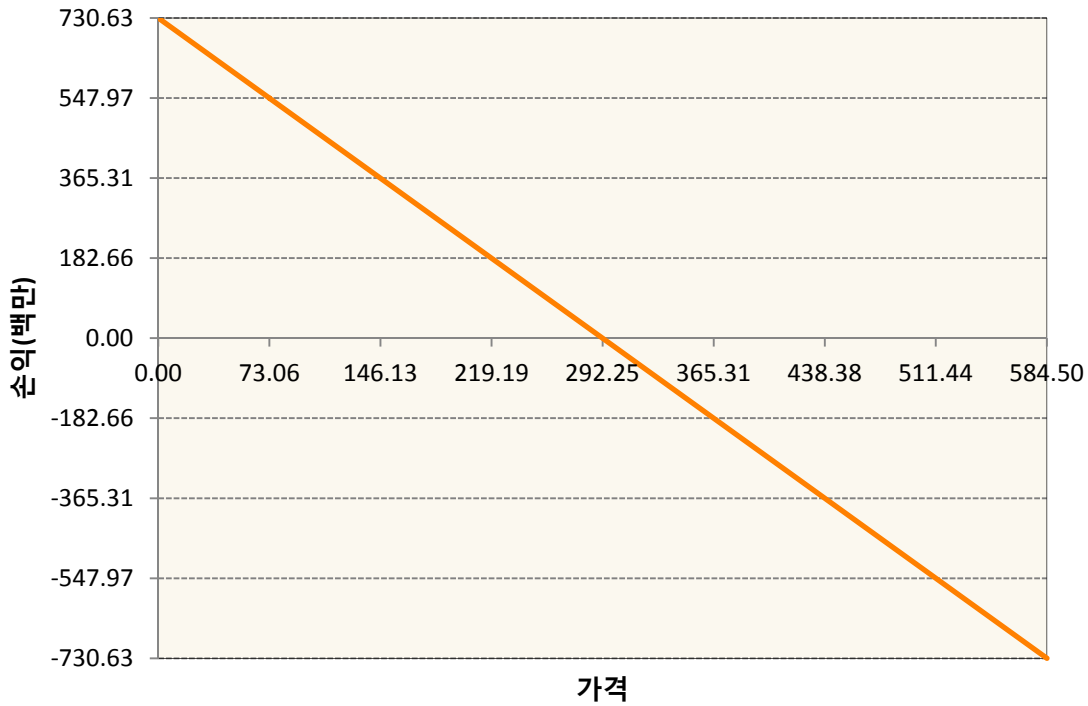
1. 계약금액

(단위:백만원)

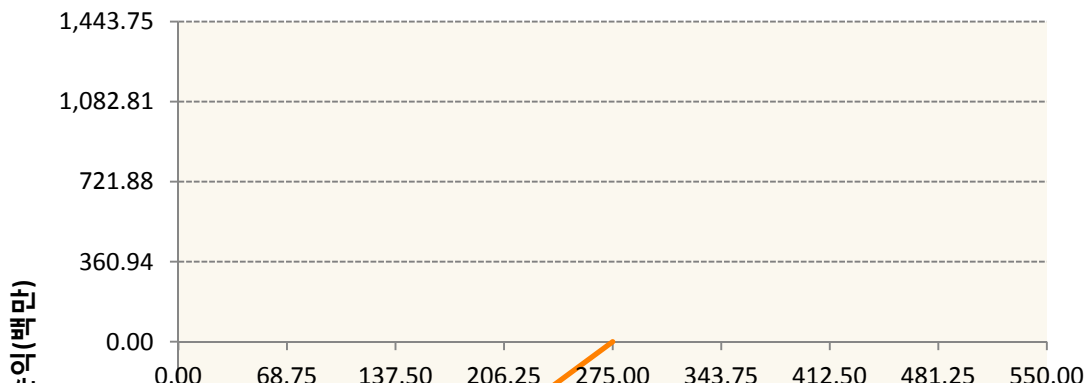
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	731	-731	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,941	-3,941	장내

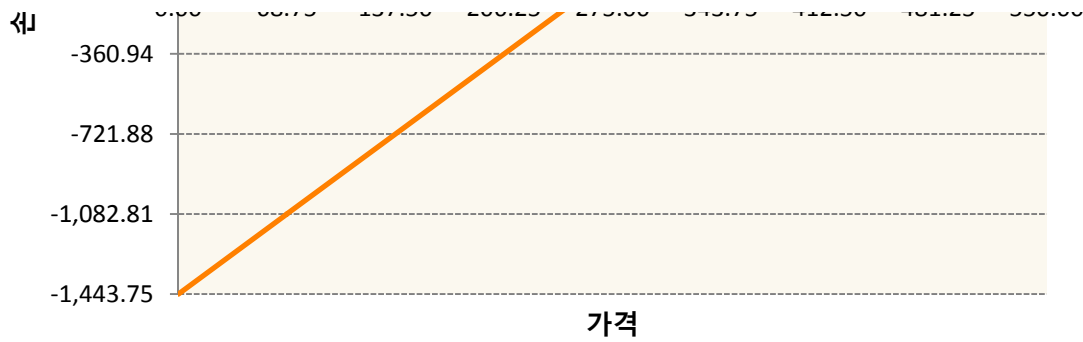
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

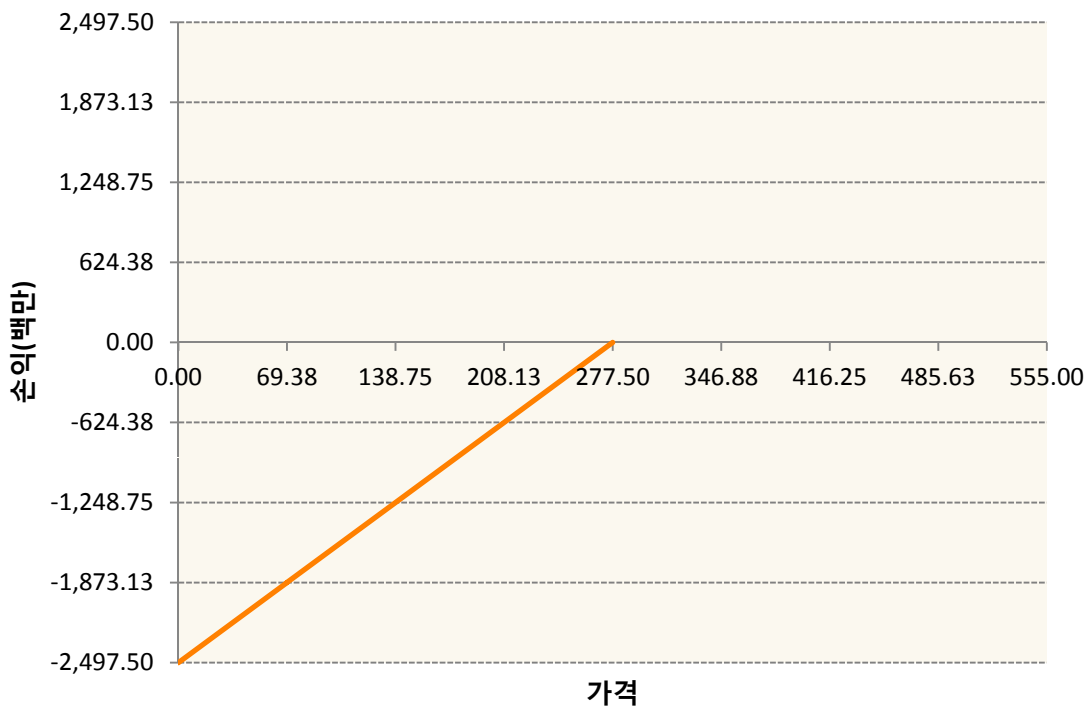


KR4301Q12751-2020-01 풋275





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						32
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-24	-25	-26	-28	-29	-30	-32
-5.33%	-4	-6	-7	-8	-9	-11	-12
-2.67%	0	0	-1	-1	-2	-3	-3
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 69

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-58	-60	-61	-63	-65	-67	-69
-5.33%	-14	-17	-19	-22	-24	-27	-29
-2.67%	-1	-2	-3	-4	-6	-7	-9
0%	1	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	1	1	1	1	0	0	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)

79

공시일	2019-12-23
기준일	2019-12-20

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	14,038	0	14,038	
누계	통화	선도	592	14,345	-13,753	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019X01 KRW/USD 13-01-20E		227
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		288
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		289
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E		344
FX21019Z02 USD/KRW 13-01-20E		28
FX21019Z03 USD/KRW 13-01-20E		19

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

(단위:백만원)

384

공시일	2019-12-23
기준일	2019-12-20

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	990	0	990	장외
누계	통화	선도	310	387	-77	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)	24
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	2019-12-23
기준일	2019-12-20

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

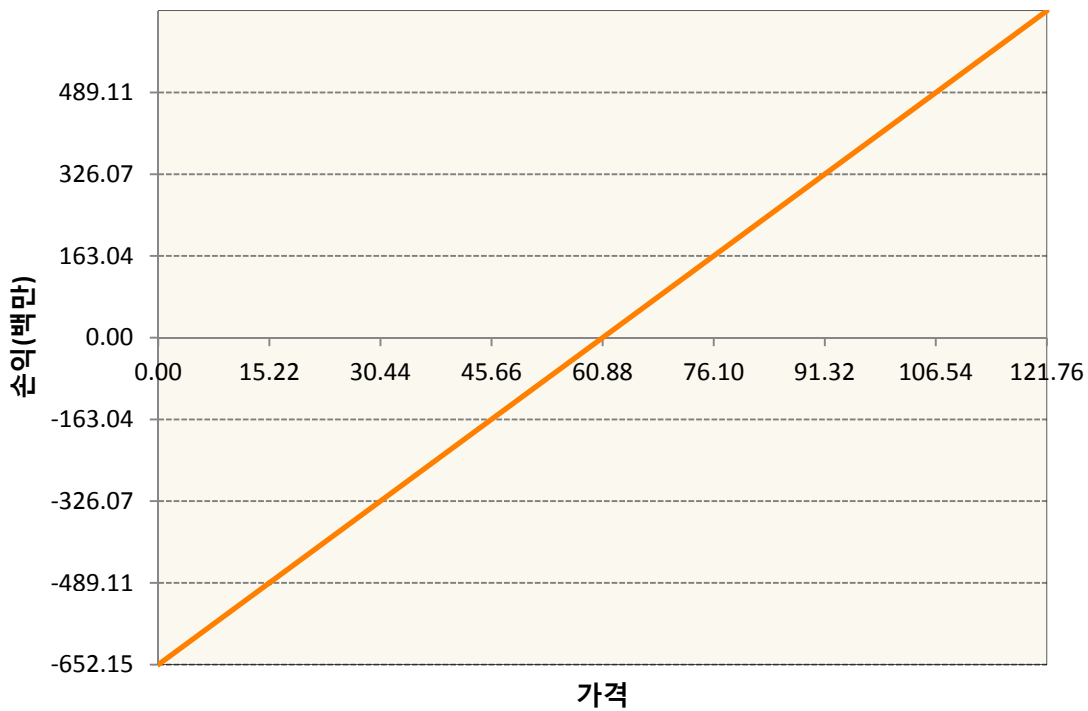
1. 계약금액

(단위:백만원)

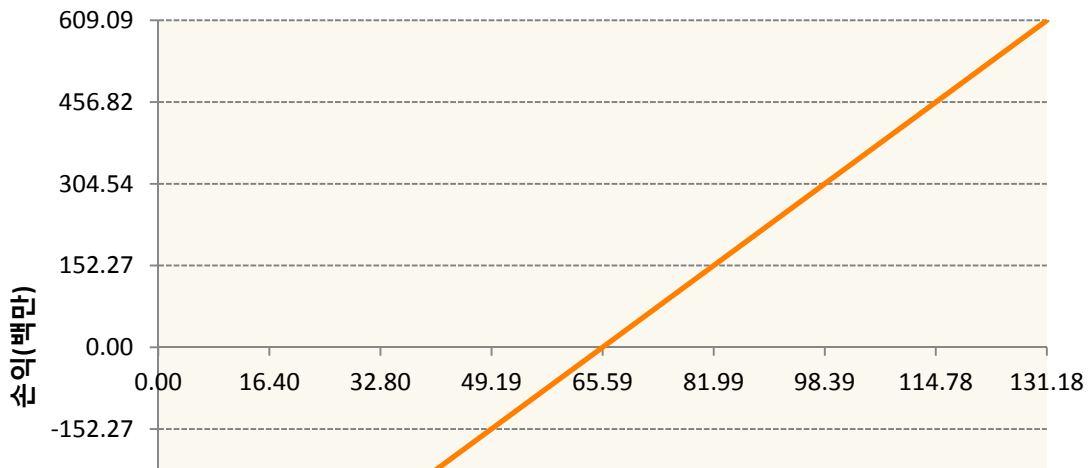
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,439	290	2,149	

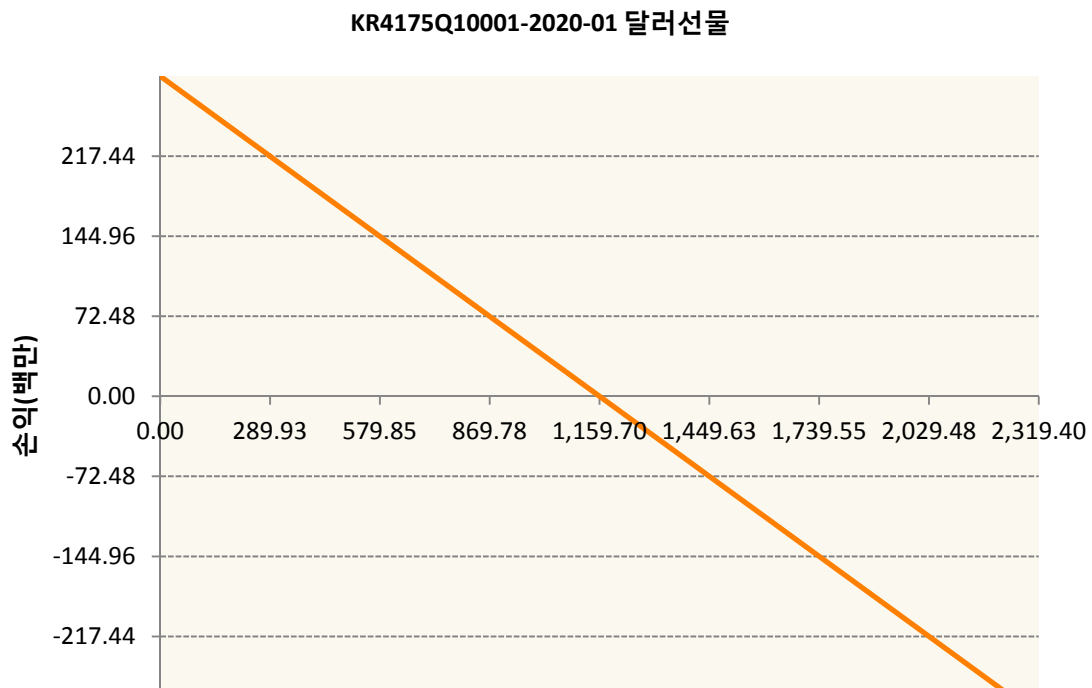
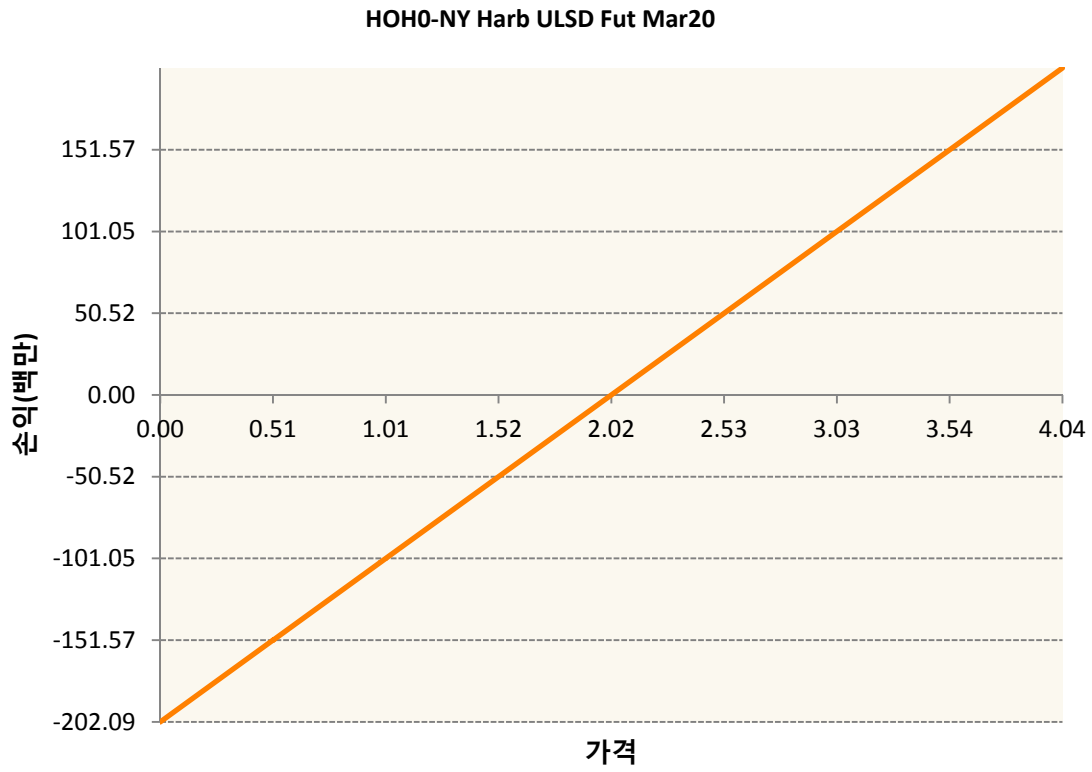
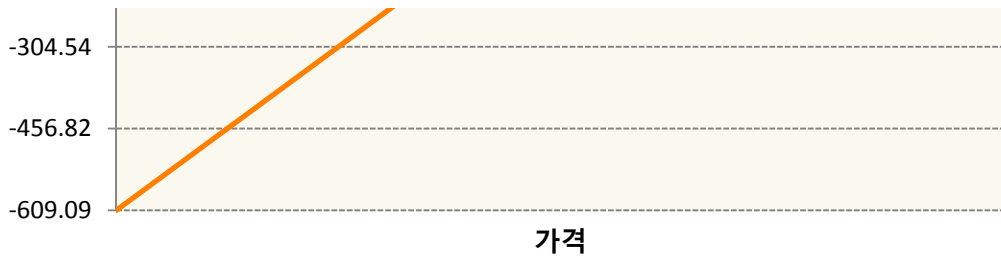
2. 만기시점의 손익구조

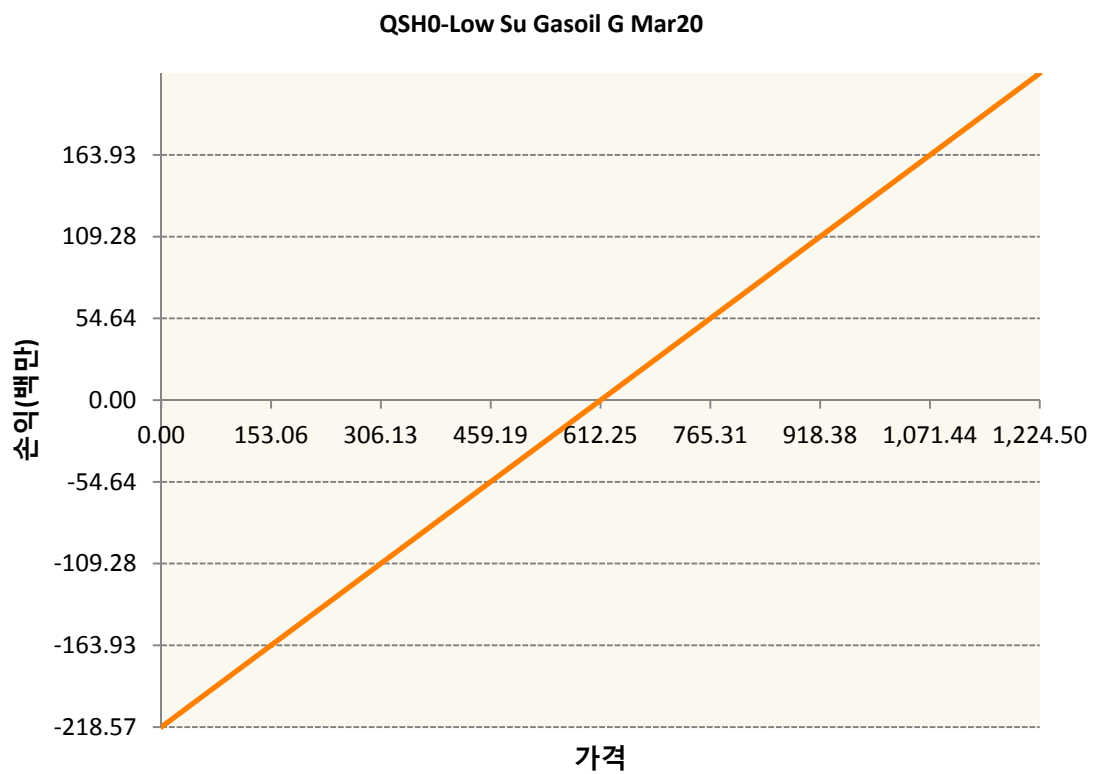
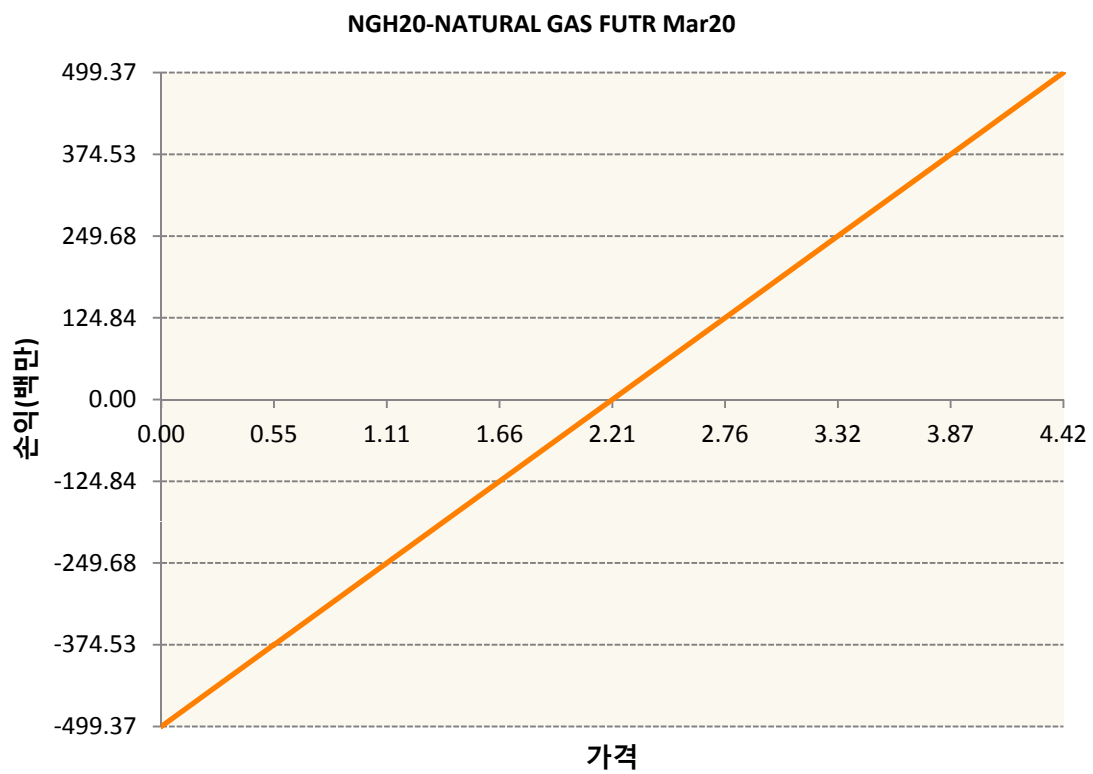
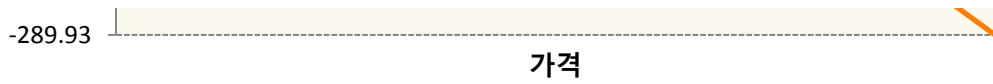
CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20



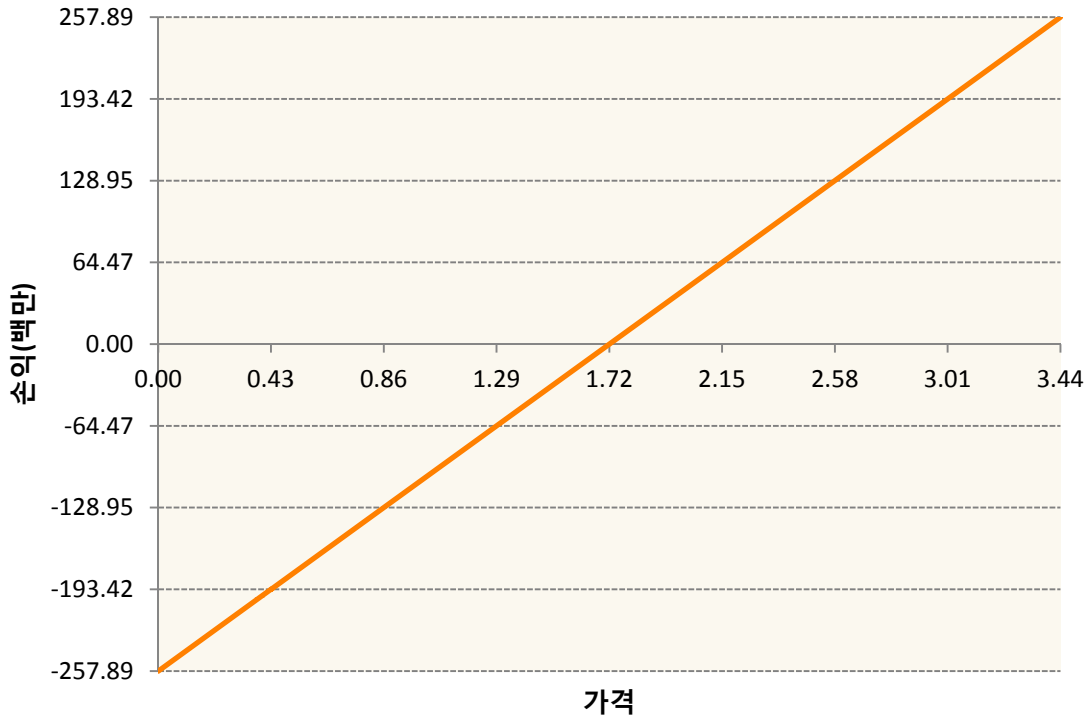
COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20







XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	52
COH0	BRENT CRUDE FUTR Mar20	49
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	21

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

(단위:백만원)

392

공시일	2019-12-23
기준일	2019-12-20

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

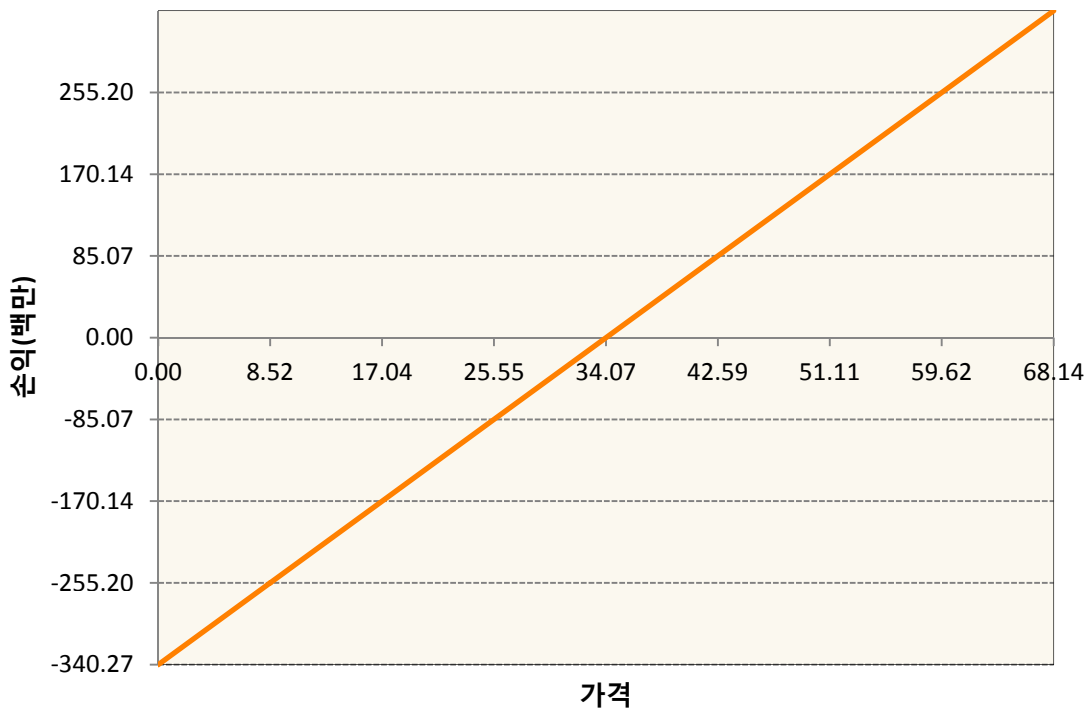
1. 계약금액

(단위:백만원)

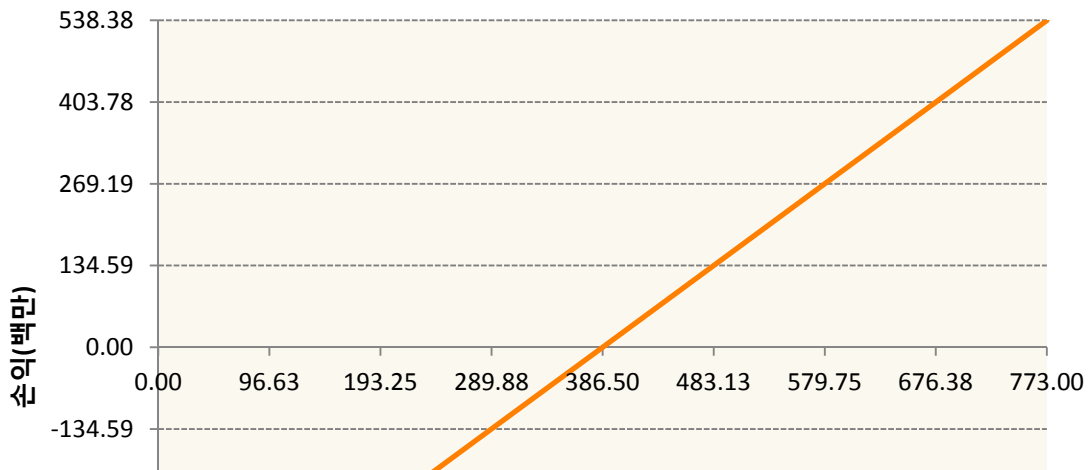
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,835	116	2,719	

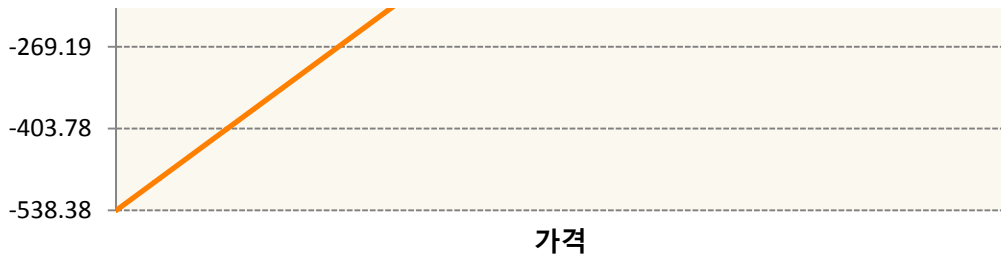
2. 만기시점의 손익구조

BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20

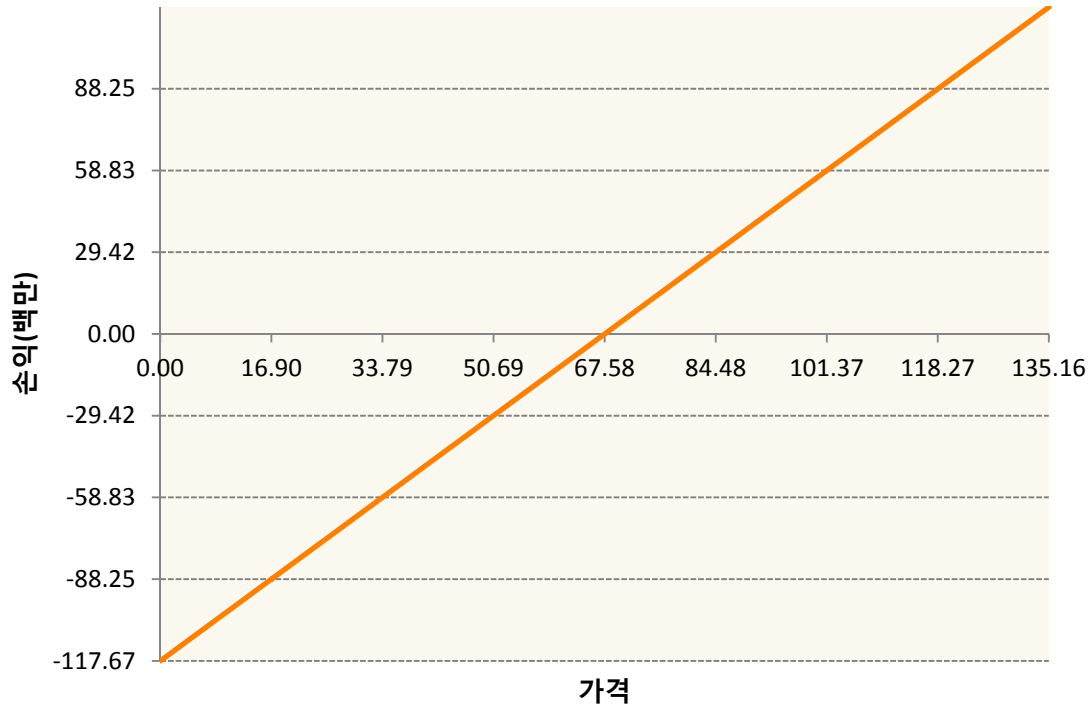


CH0-CORN FUTURE Mar20

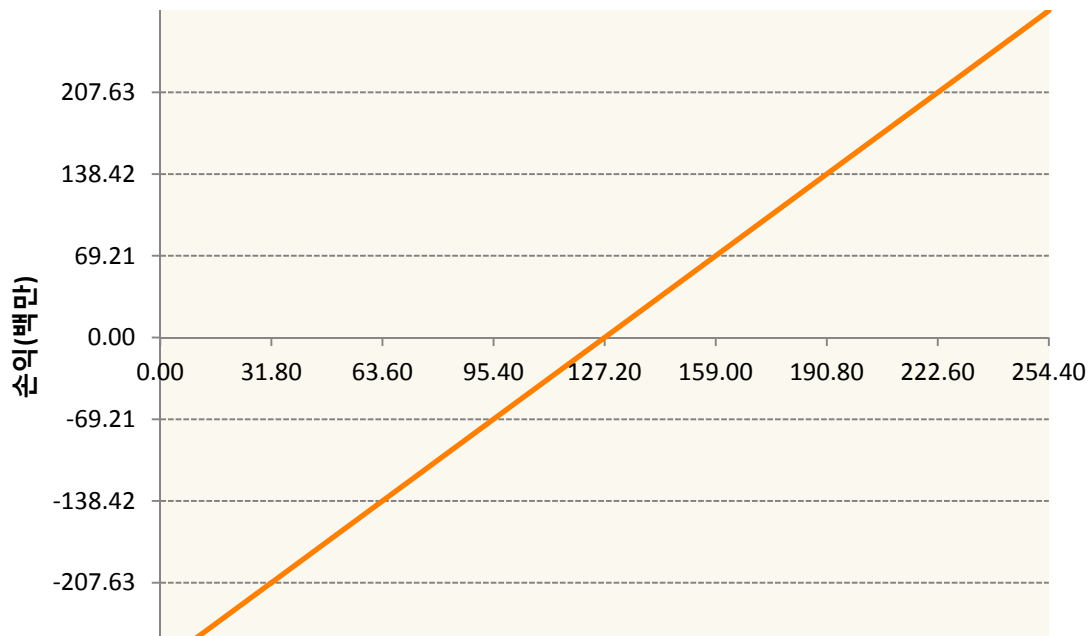


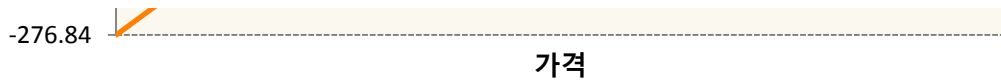


CTH0-COTTON NO.2 FUTR Mar20

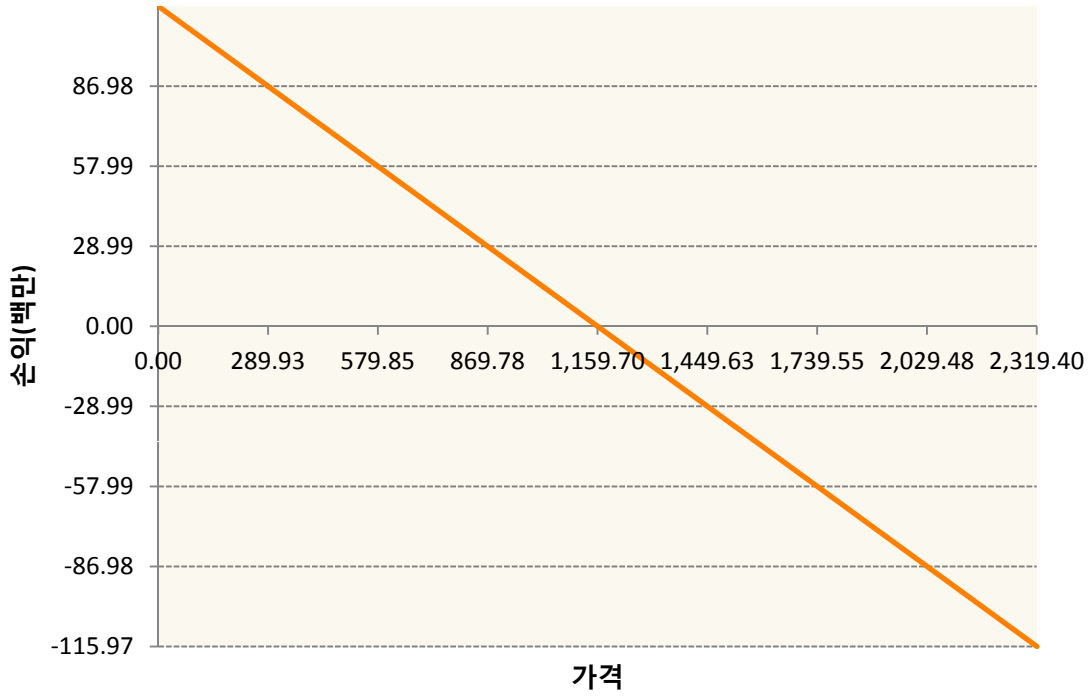


KCH0-COFFEE 'C' FUTURE Mar20

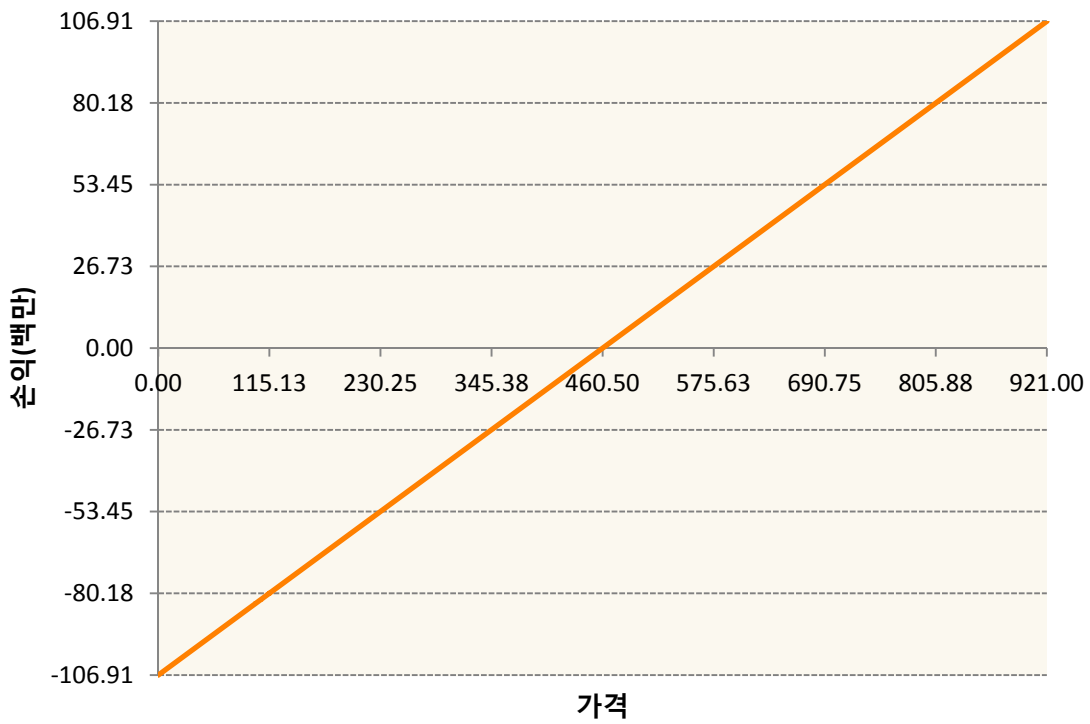




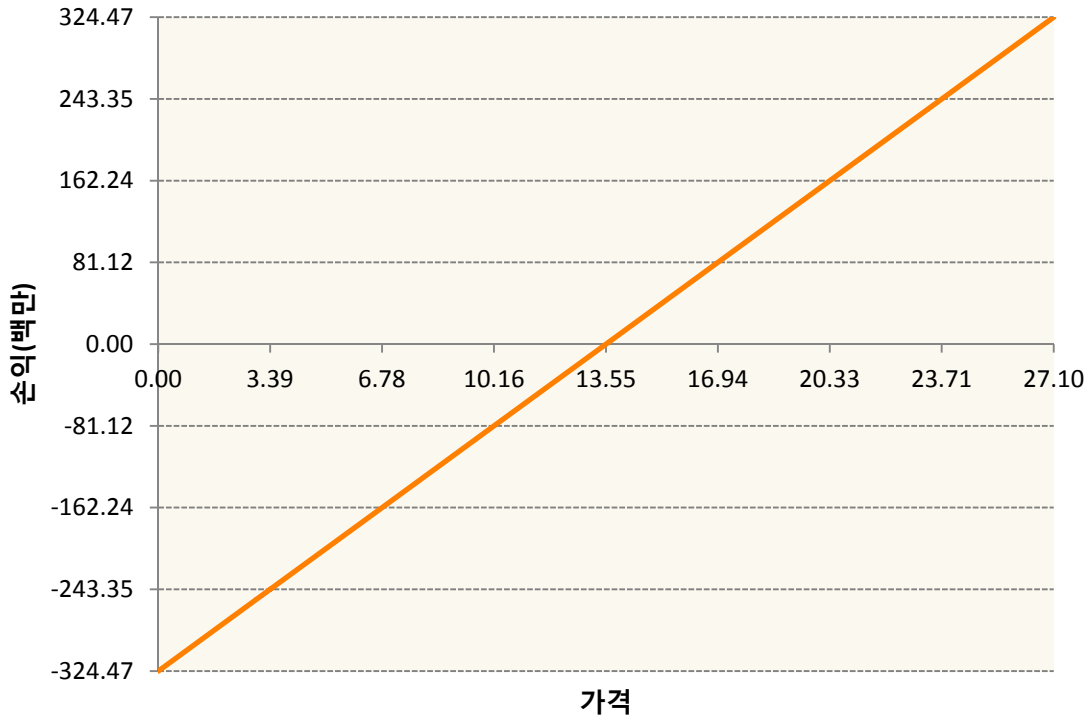
KR4175Q10001-2020-01 달러선물



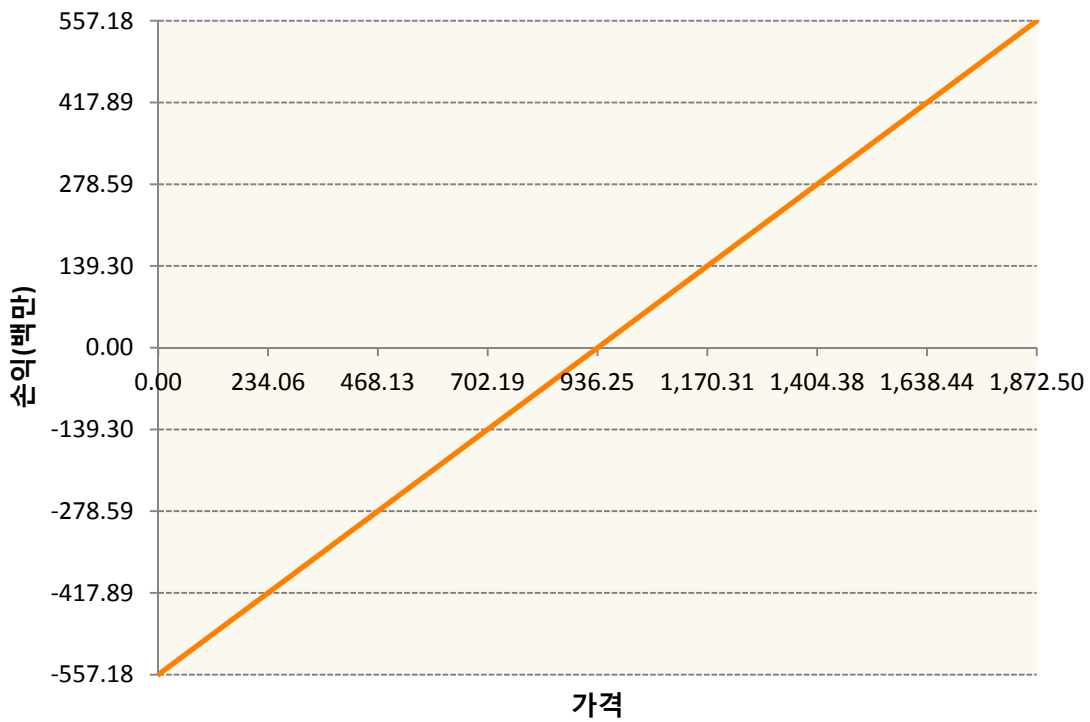
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

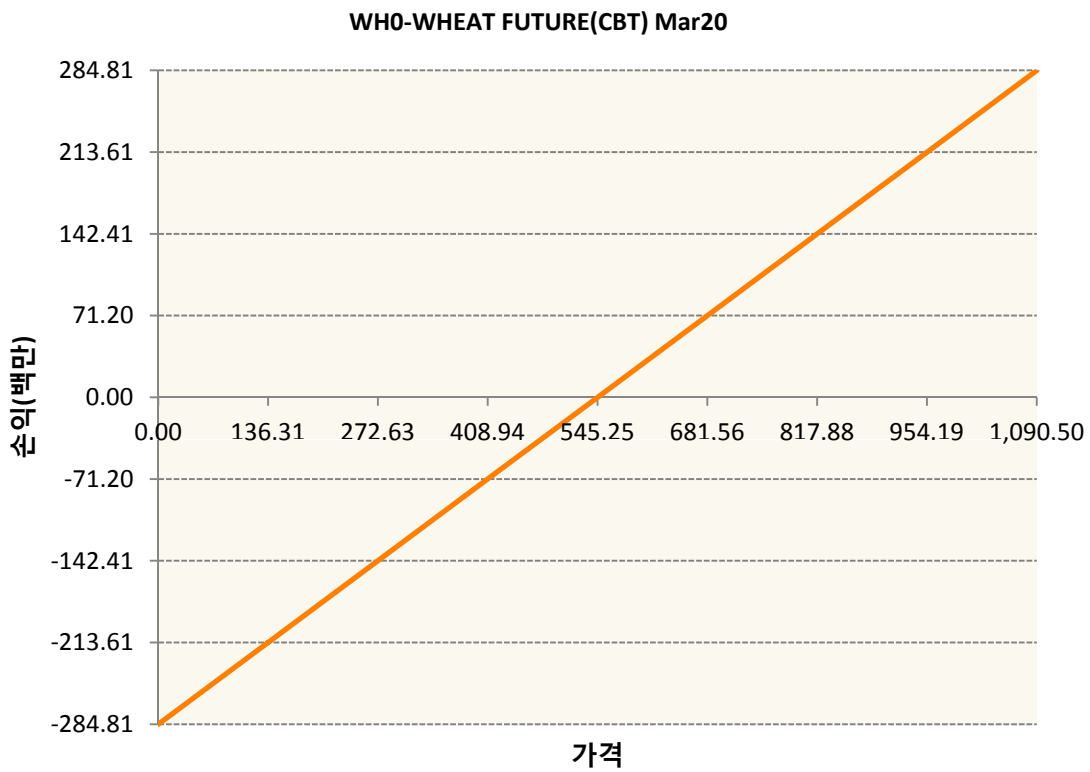
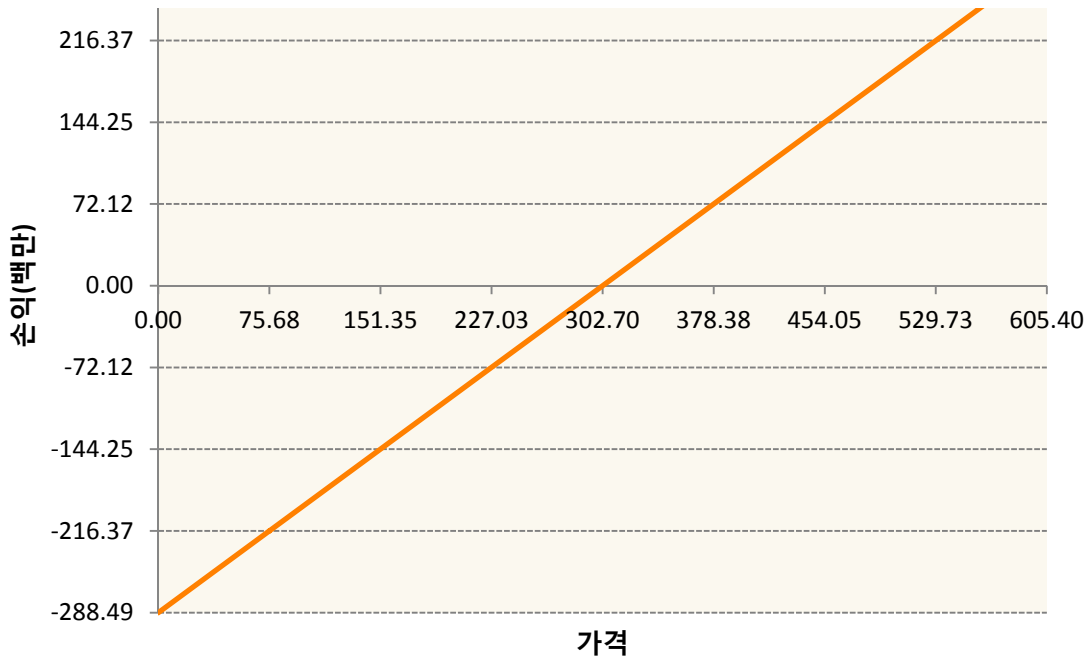


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20



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	22
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)

249