

공시일	2019-12-24
기준일	2019-12-23

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	2019-12-24
기준일	2019-12-23

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

1,124

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

649

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-24
기준일	2019-12-23

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)	389
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	143

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

738

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-24
기준일	2019-12-23

유로인덱스모(주식-파생형)

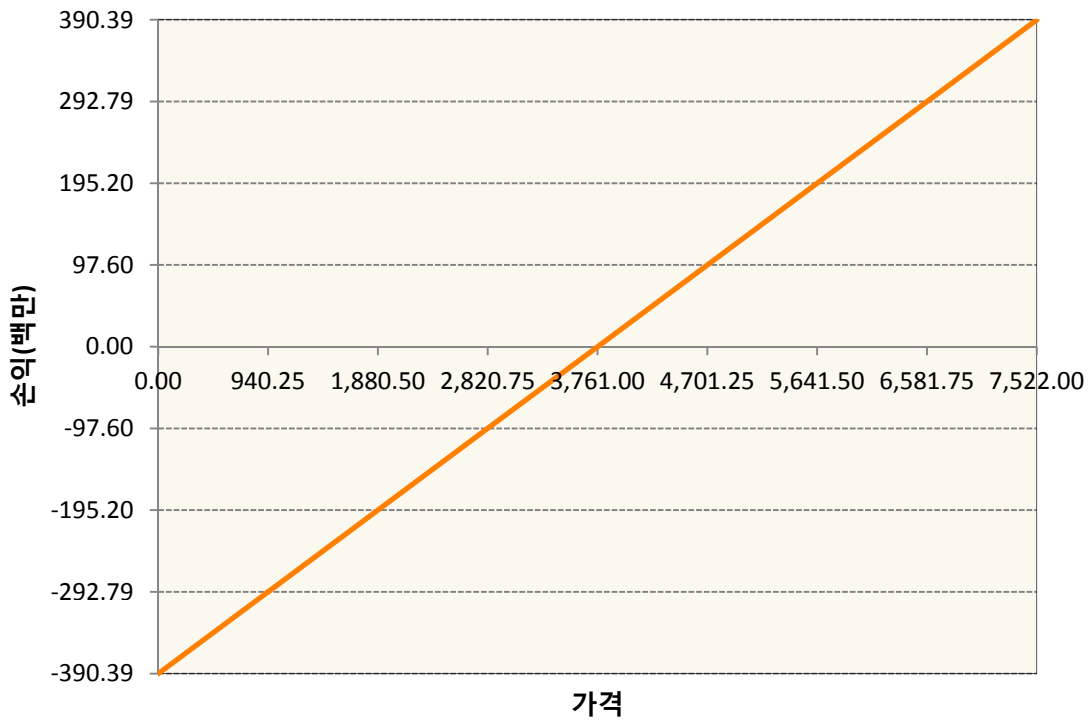
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	390	0	390	

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)

22

공시일	2019-12-24
기준일	2019-12-23

차이나인덱스모(주식-파생형)

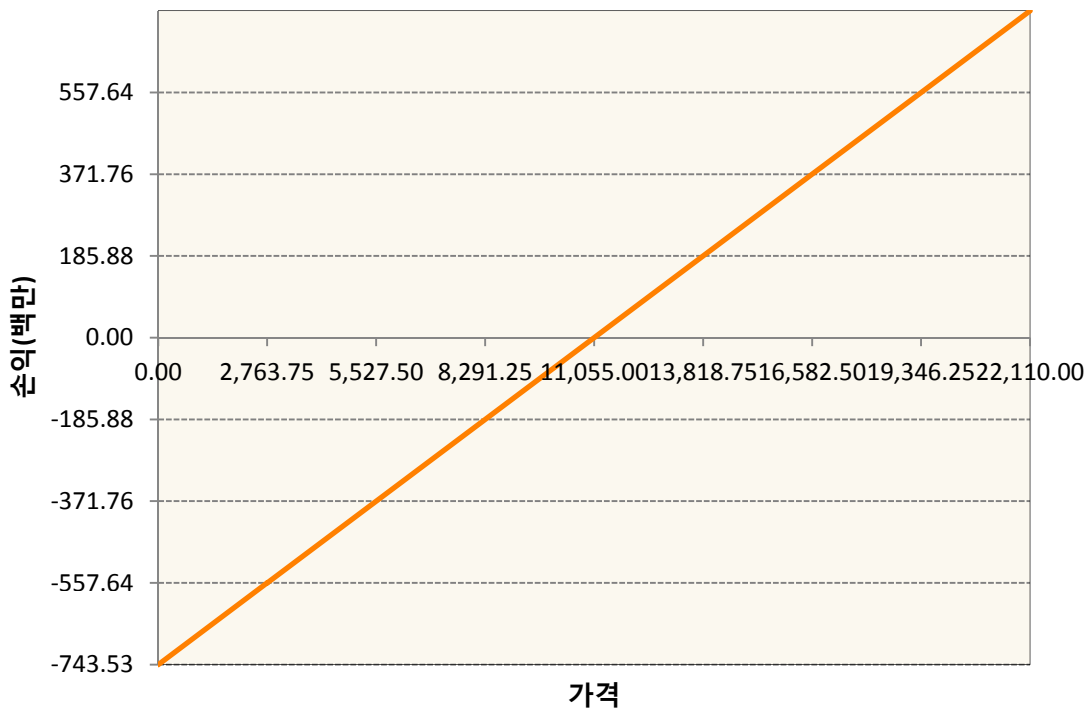
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

HCF0-HSCEI Futures Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF0	HSCEI Futures Jan20	59
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

52

공시일	2019-12-24
기준일	2019-12-23

커버드콜모(주식혼합-파생형)

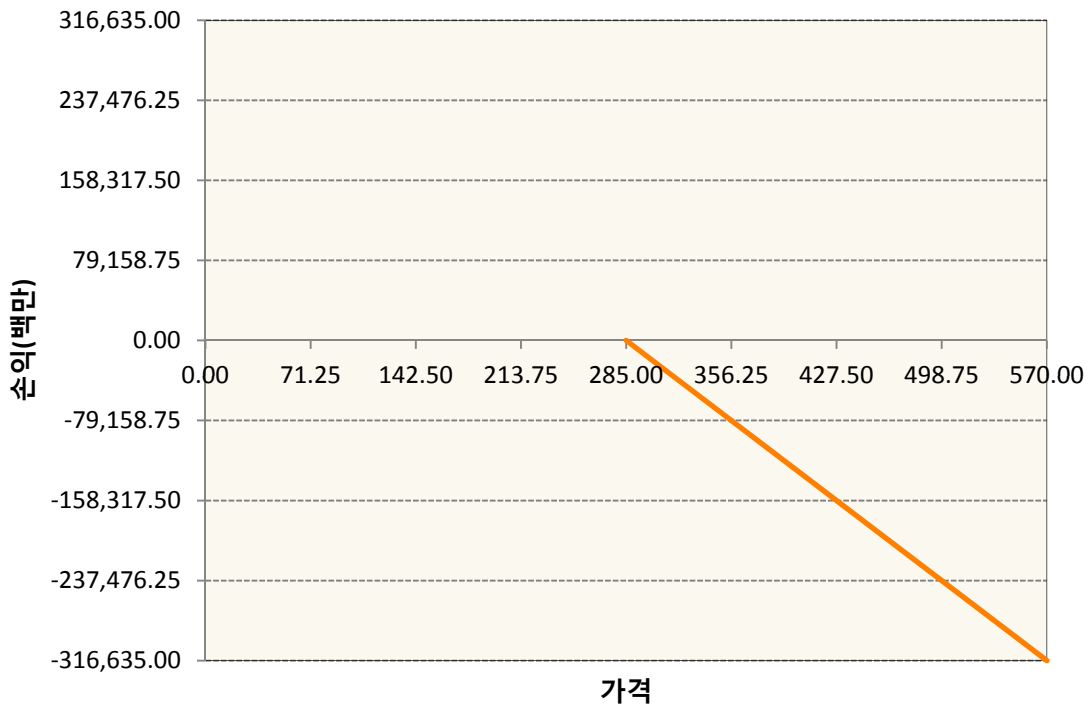
1. 계약금액

(단위:백만원)

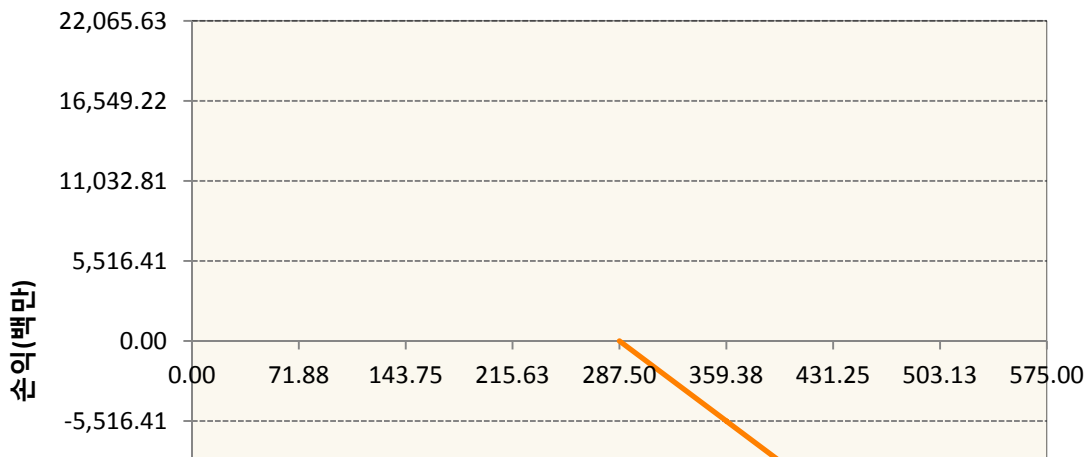
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	7,020	0	7,020	장내
누계	유가증권	옵션	0	481,201	-481,201	장내

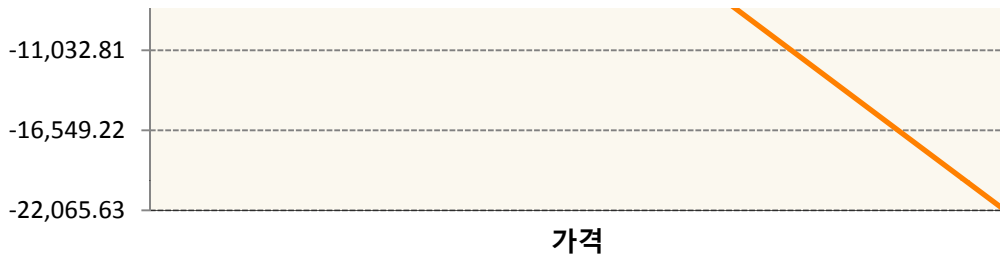
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q12852-2020-01 콜285

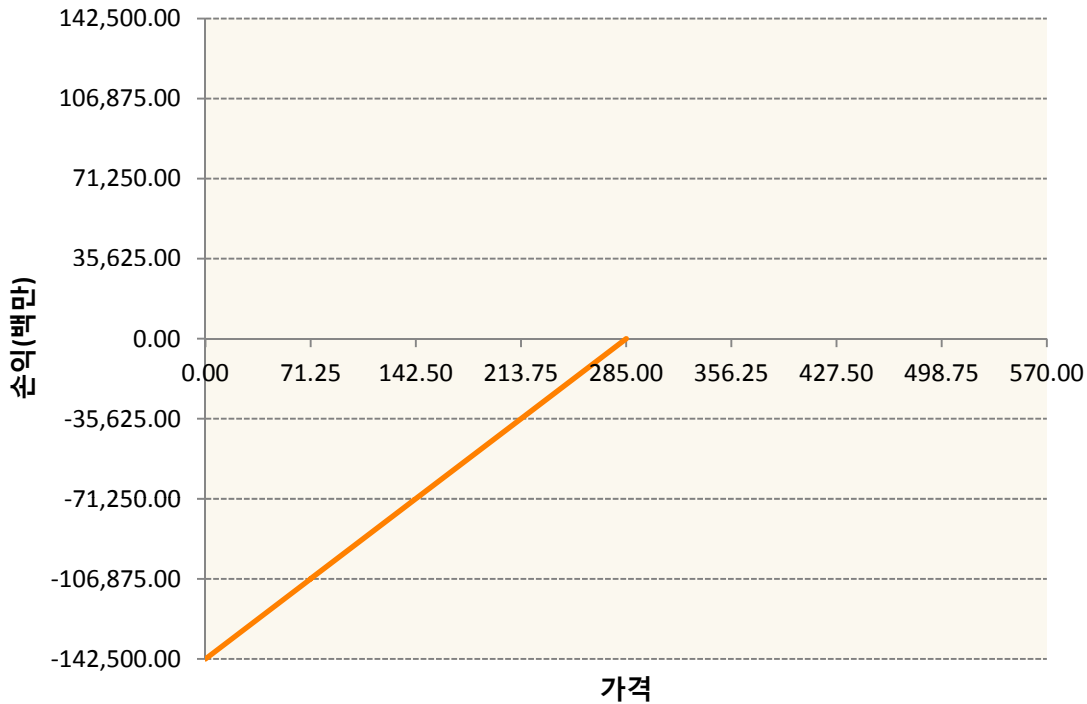


KR4201Q12878-2020-01 콜287.5





KR4301Q12850-2020-01 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q12852		2020-01 콜285					23,409
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13,440	13,066	12,655	12,213	11,746	11,259	10,755
-5.33%	11,416	10,834	10,241	9,641	9,035	8,425	7,810
-2.67%	7,509	6,866	6,222	5,577	4,931	4,285	3,639
0%	1,618	1,100	559	0	-573	-1,158	-1,751
2.67%	-5,775	-6,087	-6,446	-6,843	-7,273	-7,731	-8,212
5.33%	-14,005	-14,149	-14,340	-14,575	-14,852	-15,166	-15,514
8.00%	-22,585	-22,637	-22,721	-22,838	-22,993	-23,183	-23,409
KR4201Q12878		2020-01 콜287.5					1,571
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	822	801	776	750	721	690	658

-5.33%	714	677	639	600	560	520	479
-2.67%	488	443	398	353	308	263	218
0%	123	83	42	0	-42	-85	-128
2.67%	-359	-385	-415	-447	-480	-515	-552
5.33%	-912	-926	-943	-963	-986	-1,011	-1,038
8.00%	-1,499	-1,505	-1,513	-1,523	-1,537	-1,553	-1,571
KR4301Q12850 2020-01 풋285							6,850
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,643	-6,658	-6,681	-6,712	-6,750	-6,797	-6,850
-5.33%	-2,994	-3,088	-3,189	-3,295	-3,407	-3,522	-3,640
-2.67%	-579	-716	-853	-992	-1,131	-1,270	-1,410
0%	188	135	72	0	-80	-168	-261
2.67%	280	274	263	247	224	194	157
5.33%	284	283	283	281	277	272	263
8.00%	284	284	284	283	283	282	281

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

(단위:백만원)

31,218

공시일	2019-12-24
기준일	2019-12-23

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

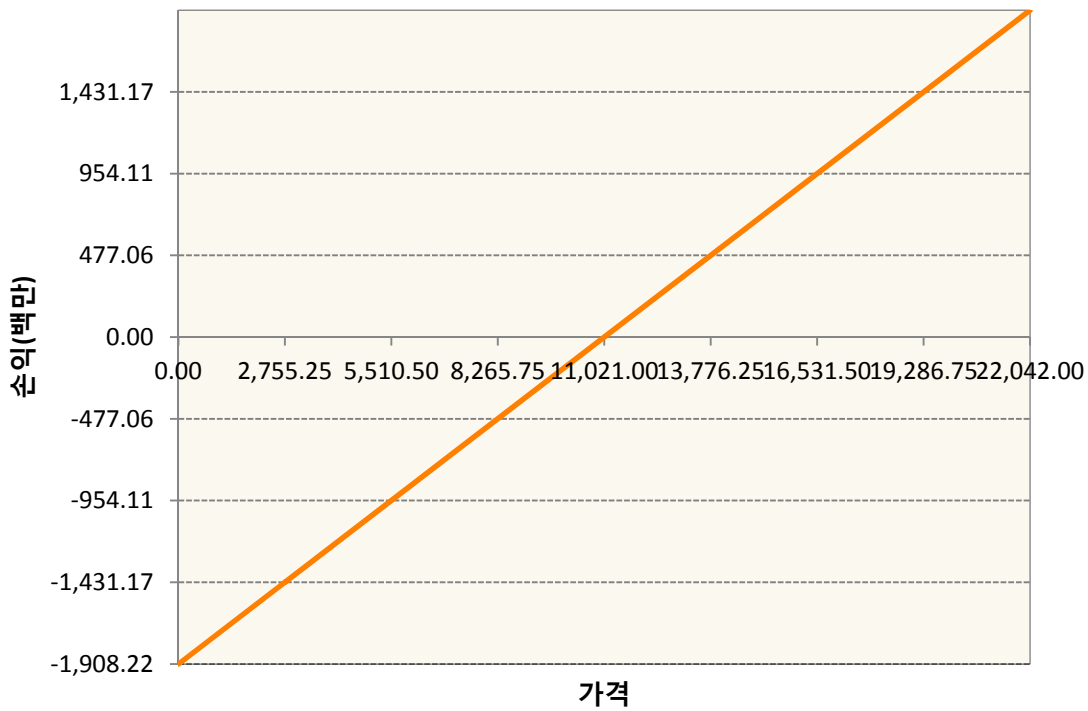
1. 계약금액

(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	1,908	0	1,908	
누계	유가증권	옵션	0	4,816	-4,816	장내
누계	통화	선도	0	2,105	-2,105	장외

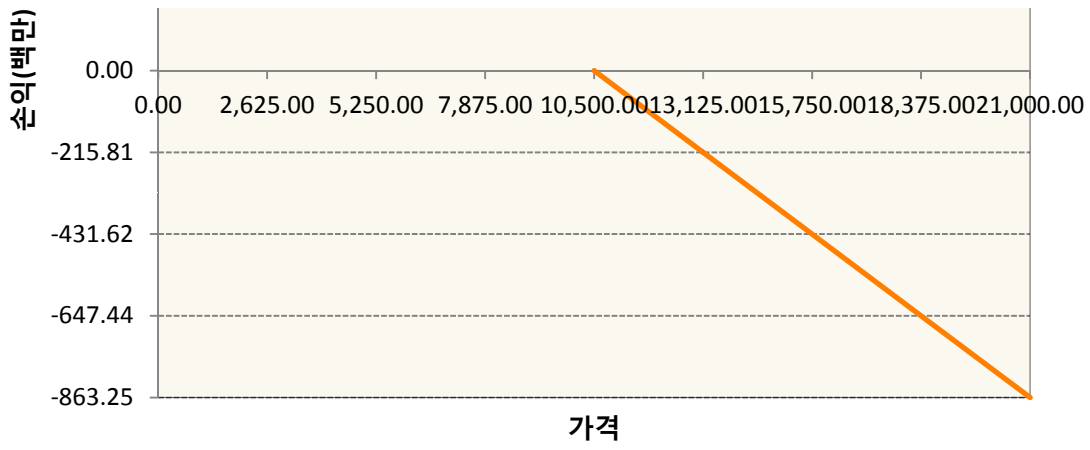
2. 만기시점의 손익구조

HCZ9-HSCEI Futures Dec19

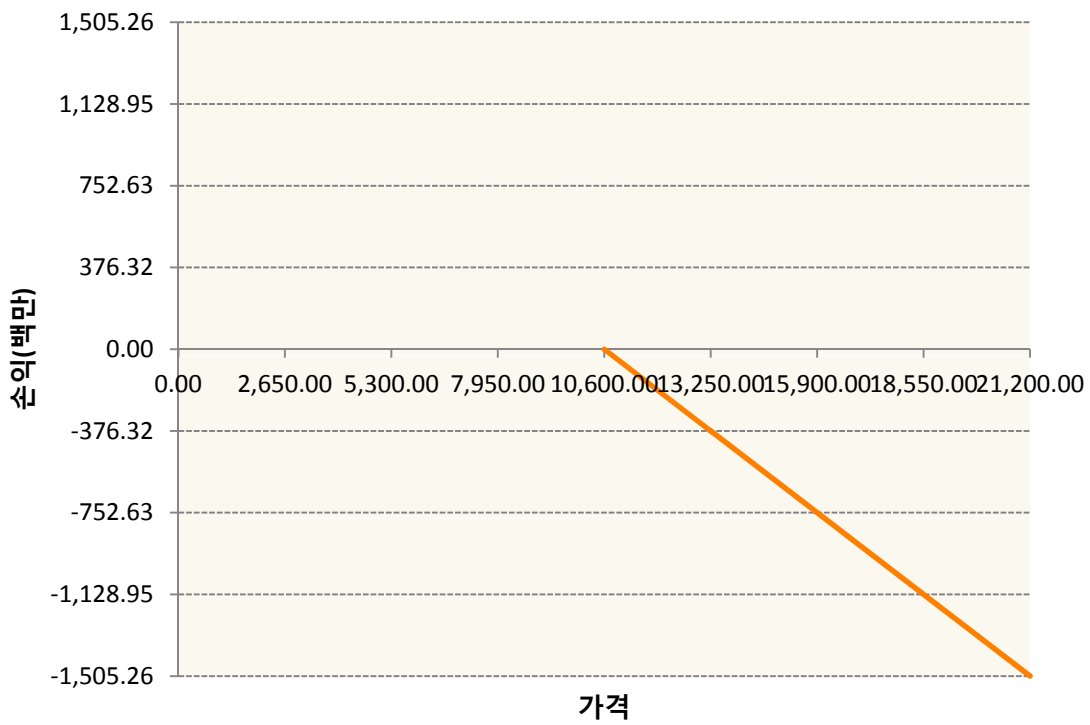


OHHIZ9-C105-HSCEI

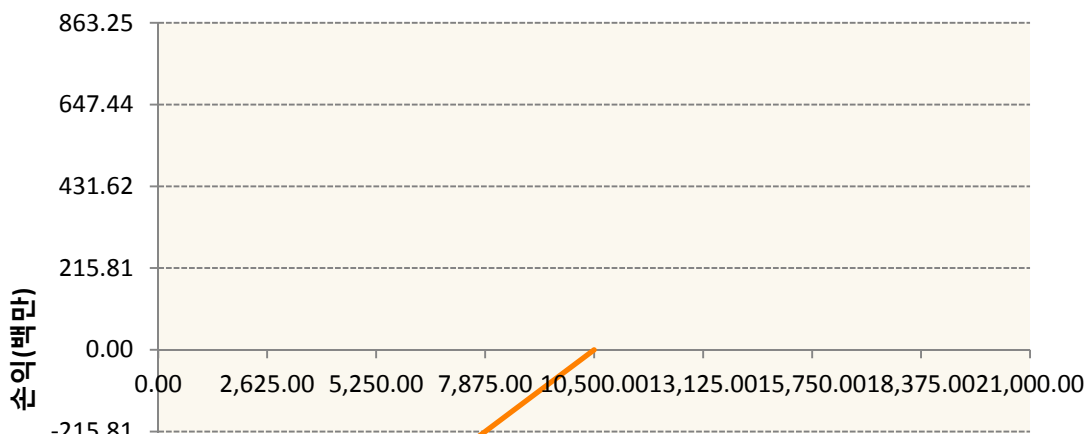


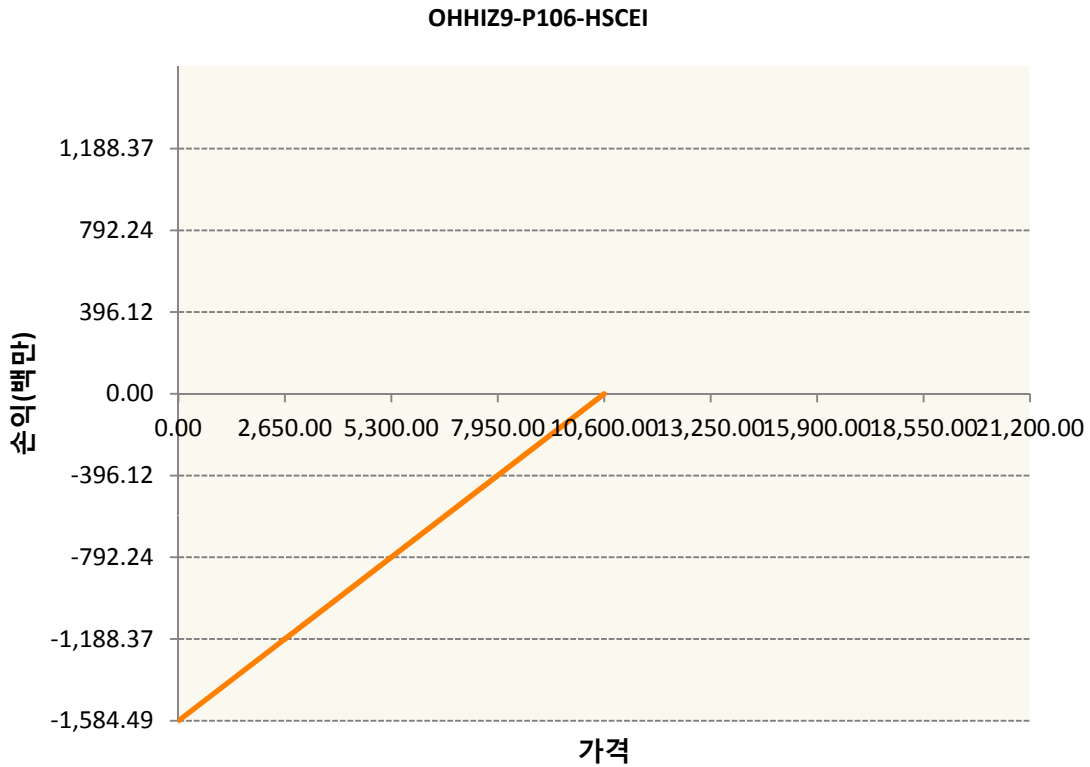
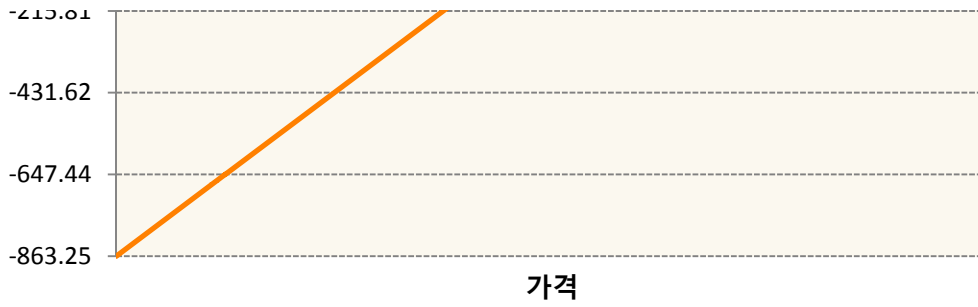


OHHIZ9-C106-HSCEI



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	127

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

공시일	2019-12-24
기준일	2019-12-23

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

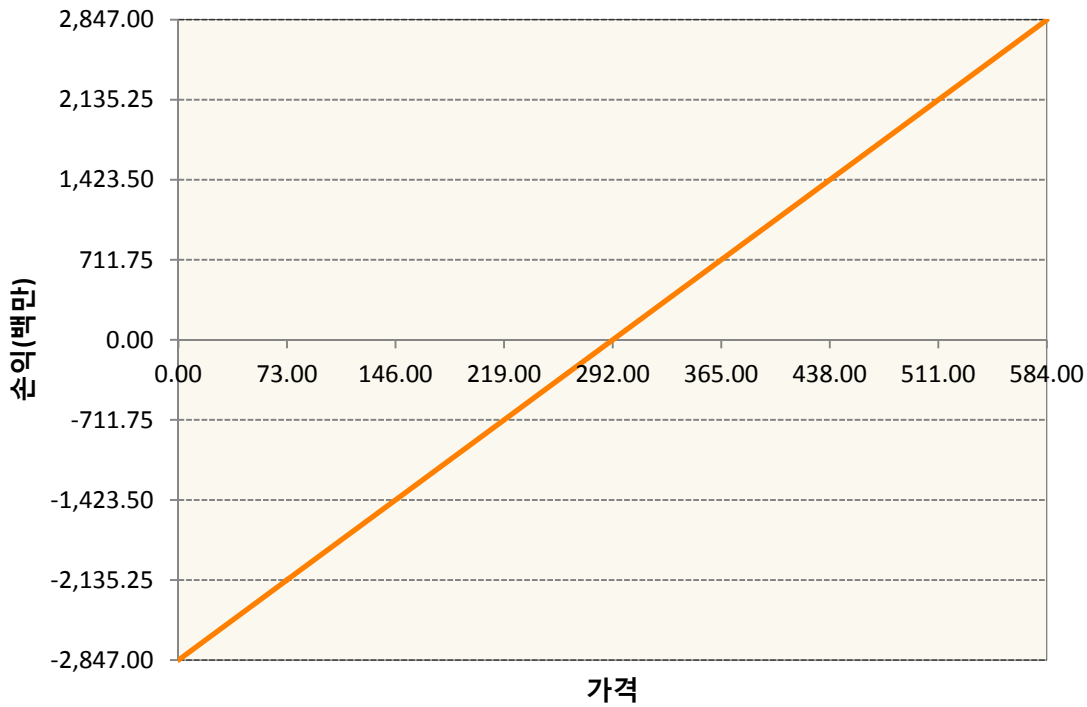
1. 계약금액

(단위:백만원)

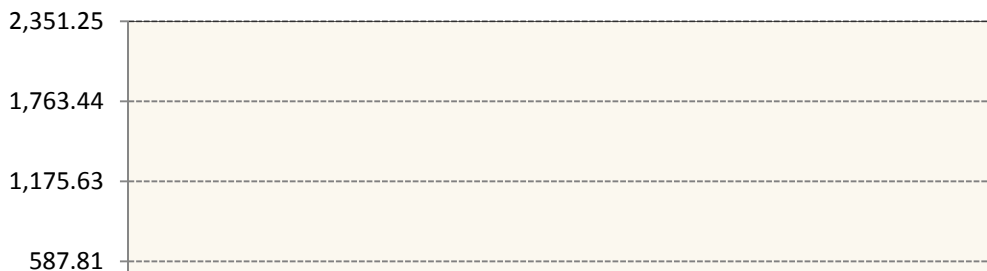
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	2,000	-2,000	장외
신규	유가증권	옵션	426	0	426	장내
누계	유가증권	선물	2,847	0	2,847	장내
누계	유가증권	스왑	6,625	0	6,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	5,631	-5,631	장내

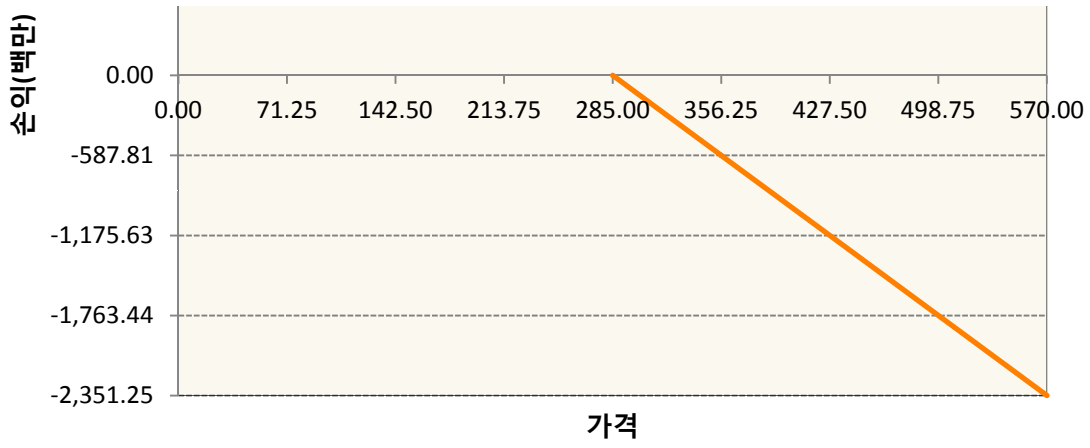
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

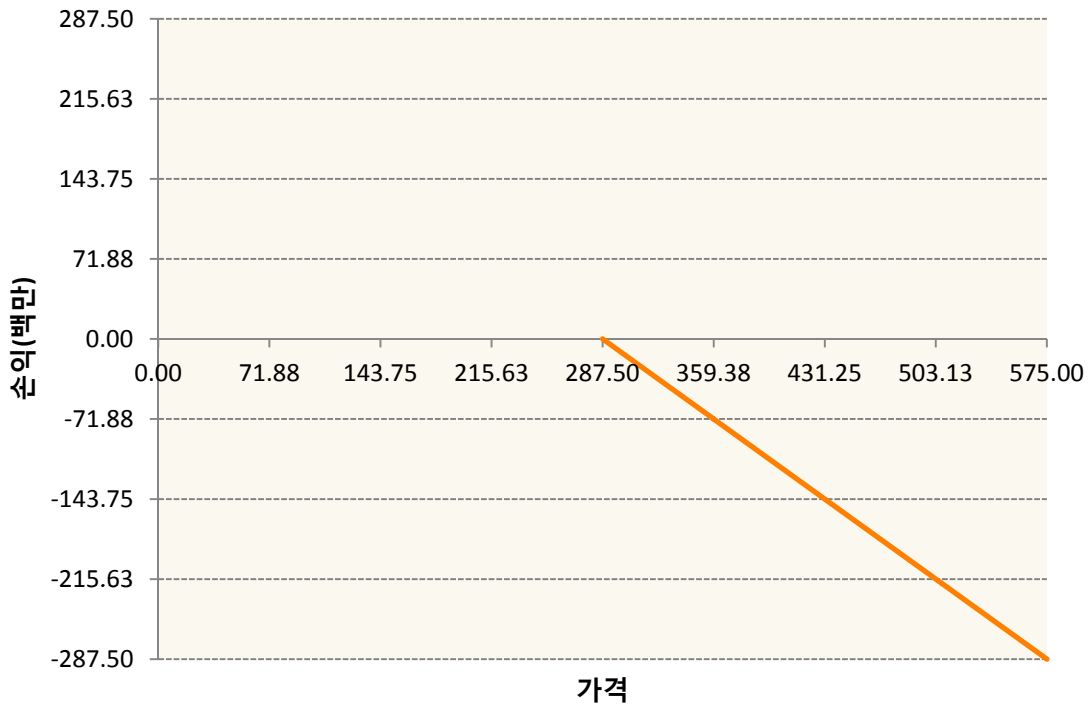


KR4201Q12852-2020-01 콜285

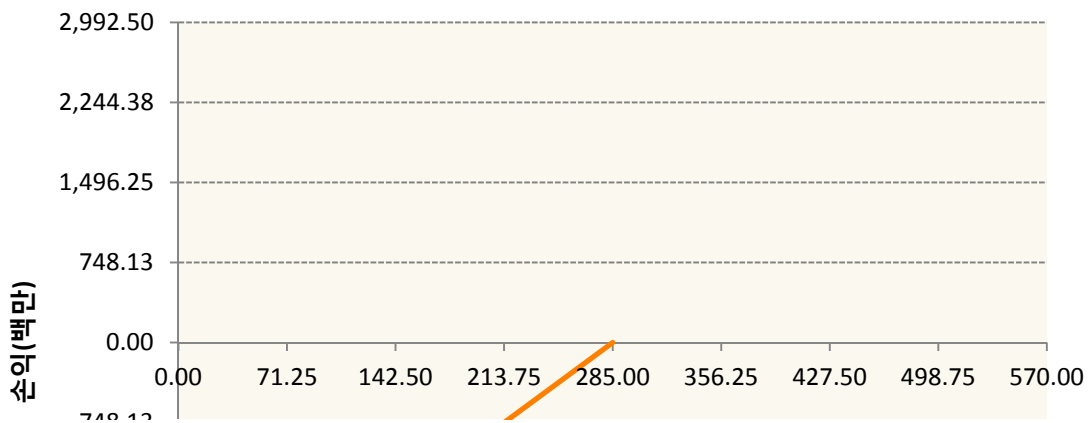




KR4201Q12878-2020-01 콜287.5



KR4301Q12850-2020-01 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						564
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-564	-564	-564	-564	-564	-564	-564	
-5.33%	-376	-376	-376	-376	-376	-376	-376	
-2.67%	-188	-188	-188	-188	-188	-188	-188	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	188	188	188	188	188	188	188	
5.33%	376	376	376	376	376	376	376	
8.00%	564	564	564	564	564	564	564	
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%	-153	-153	-153	-153	-153	-153	-153	
-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%	153	153	153	153	153	153	153	
8.00%	230	230	230	230	230	230	230	
KR4201Q12852		2020-01 콜285						174
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	100	97	94	91	87	84	80	
-5.33%	85	80	76	72	67	63	58	
-2.67%	56	51	46	41	37	32	27	
0%	12	8	4	0	-4	-9	-13	
2.67%	-43	-45	-48	-51	-54	-57	-61	
5.33%	-104	-105	-106	-108	-110	-113	-115	
8.00%	-168	-168	-169	-170	-171	-172	-174	
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	10	10	10	9	9	9
-5.33%	9	9	8	8	7	7	6
-2.67%	6	6	5	5	4	3	3
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	-5	-5	-5	-6	-6	-7	-7
5.33%	-12	-12	-12	-13	-13	-13	-14
8.00%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
KR4301Q12850 2020-01 풋285							144
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-140	-140	-140	-141	-142	-143	-144
-5.33%	-63	-65	-67	-69	-72	-74	-76
-2.67%	-12	-15	-18	-21	-24	-27	-30
0%	4	3	2	0	-2	-4	-5
2.67%	6	6	6	5	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)

1,058

공시일	2019-12-24
기준일	2019-12-23

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

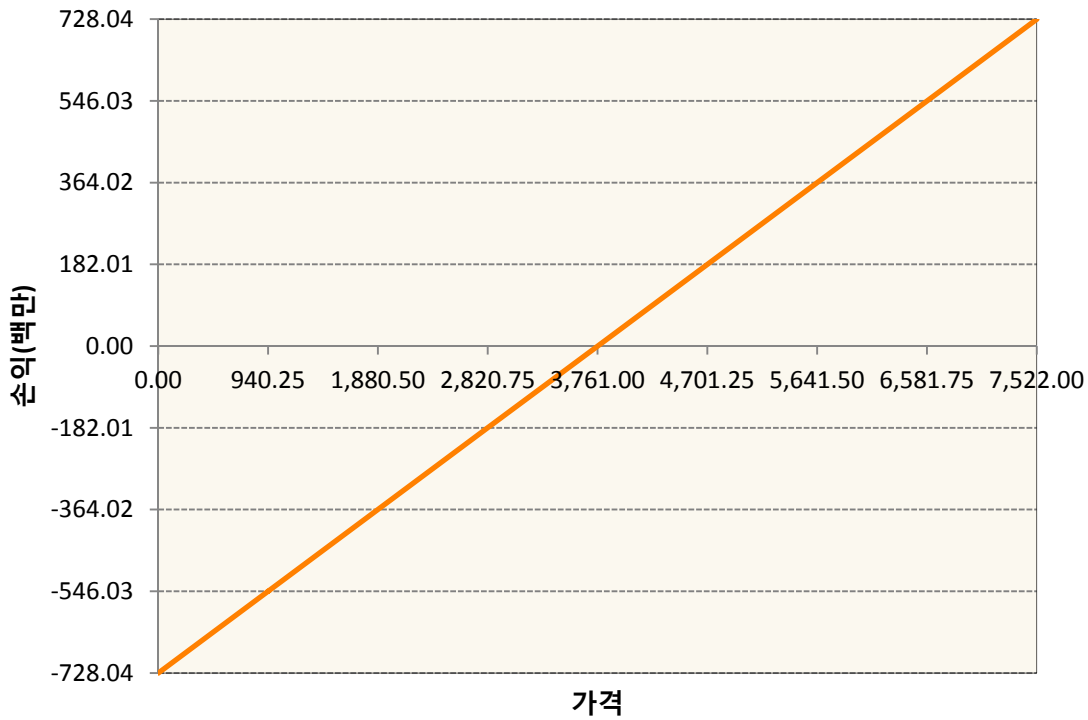
1. 계약금액

(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	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	728	0	728	
누계	유가증권	스왑	17,646	0	17,646	장외
누계	통화	선도	2,679	6,065	-3,386	장외

2. 만기시점의 손익구조

VGHO-EURO STOXX 50 Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	40
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E	485
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E	163
FX21019X02 EUR/KRW 27-12-19E	52
VGHO EURO STOXX 50 Mar20	58

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

(단위:백만원)

398

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

(단위:백만원)

944

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	2019-12-24
기준일	2019-12-23

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

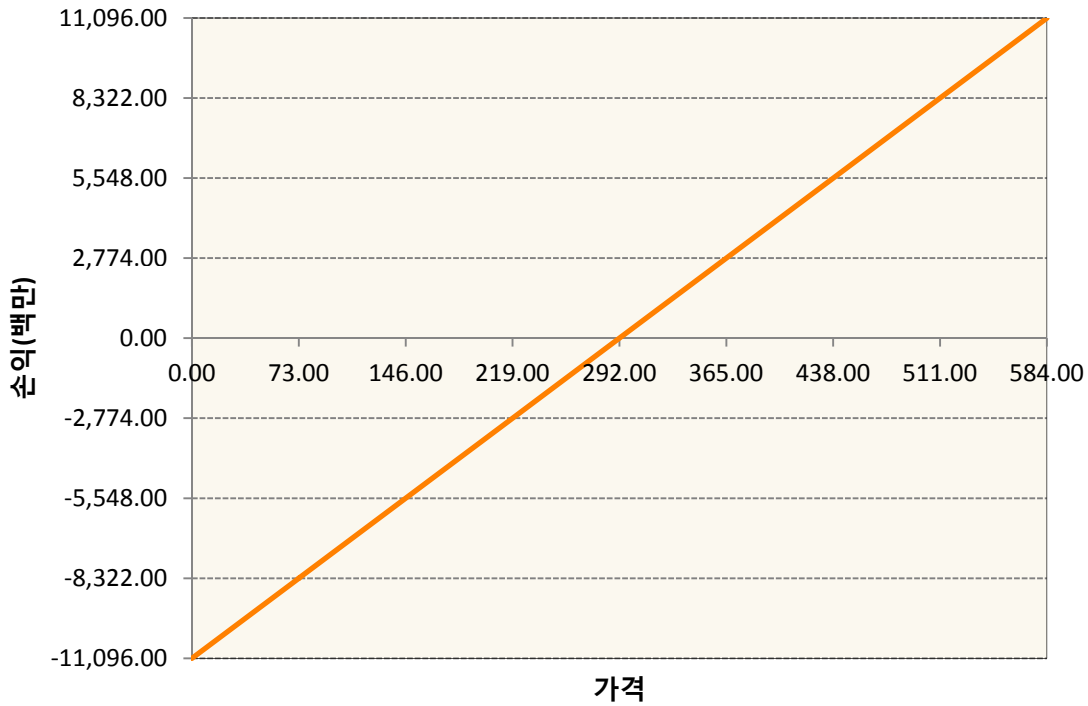
1. 계약금액

(단위:백만원)

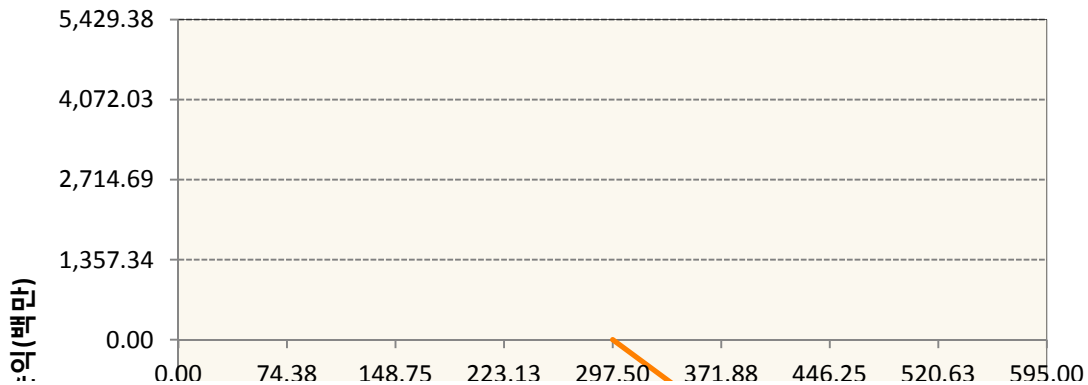
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,096	0	11,096	장내
누계	유가증권	옵션	499	21,254	-20,756	장내

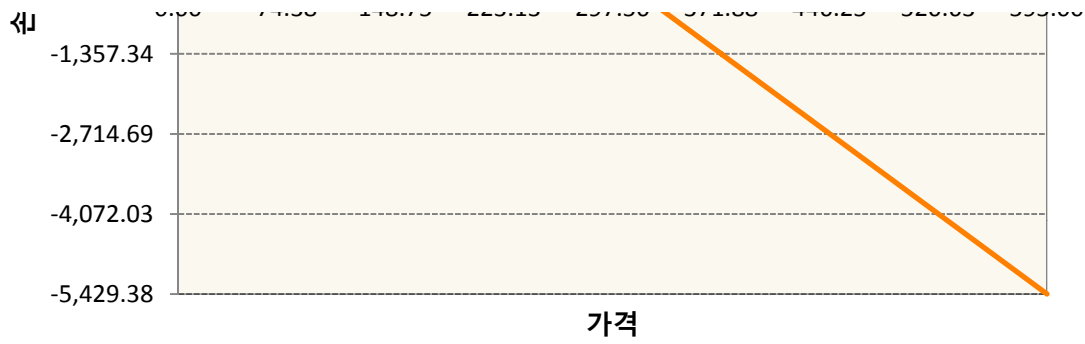
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

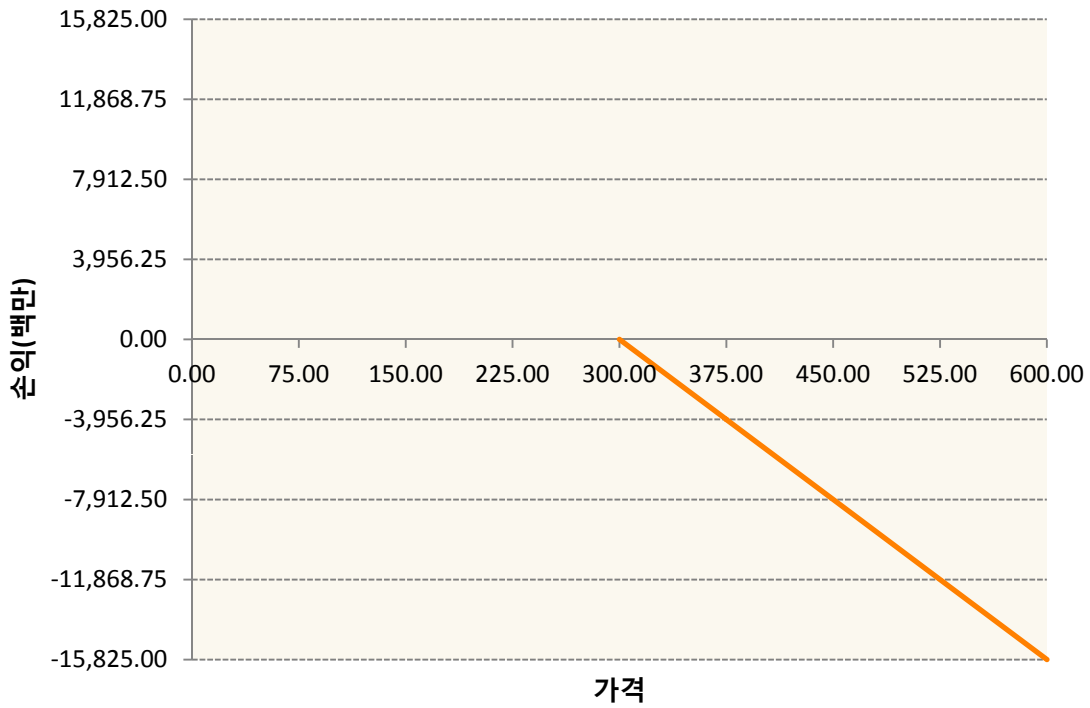


KR4201Q12977-2020-01 콜297.5

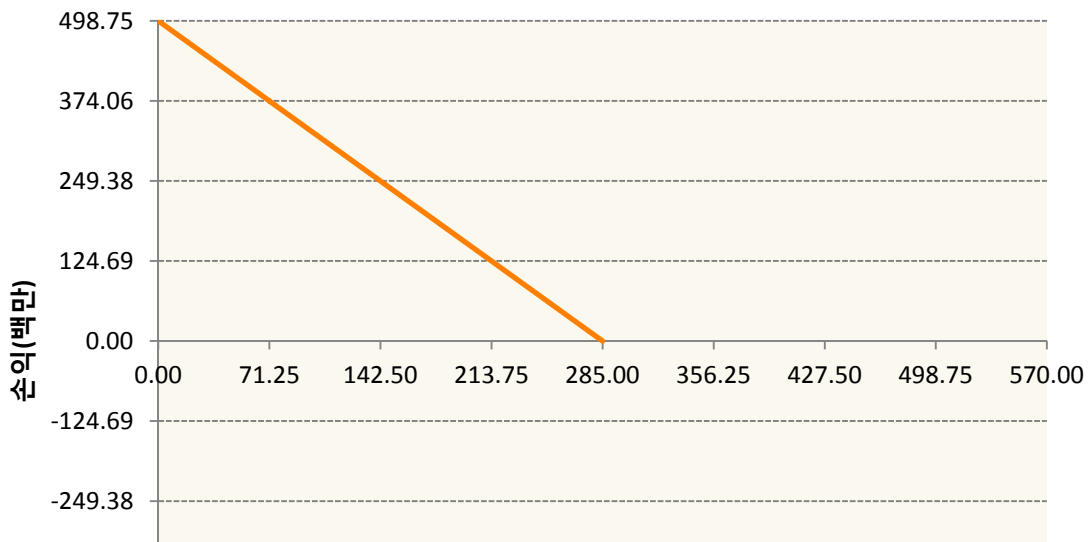


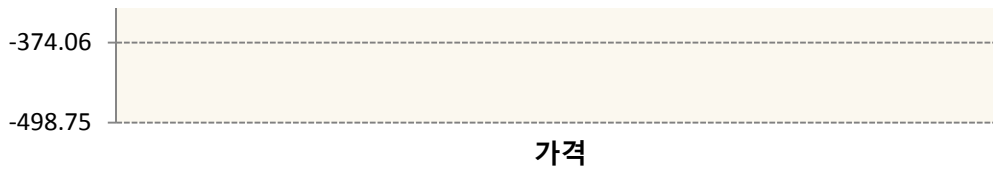


KR4201Q13009-2020-01 콜300



KR4301Q12850-2020-01 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						896
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-896	-896	-896	-896	-896	-896	-896	
-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%	896	896	896	896	896	896	896	
KR4201Q12977		2020-01 콜297.5						316
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	107	105	103	100	96	92	87	
-5.33%	100	95	90	84	78	71	63	
-2.67%	79	70	62	53	44	34	24	
0%	33	22	11	0	-11	-22	-33	
2.67%	-45	-56	-66	-77	-88	-99	-110	
5.33%	-152	-160	-168	-177	-186	-195	-205	
8.00%	-279	-283	-289	-295	-301	-308	-316	
KR4201Q13009		2020-01 콜300						863
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	259	255	250	243	234	223	211	
-5.33%	244	234	222	207	191	172	153	
-2.67%	199	178	156	132	107	82	55	
0%	91	61	31	0	-31	-62	-93	
2.67%	-104	-136	-168	-200	-233	-265	-297	
5.33%	-388	-414	-441	-469	-497	-526	-556	
8.00%	-739	-755	-773	-794	-815	-838	-863	
KR4301Q12850		2020-01 풋285						24
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	23	23	23	23	24	24	24	
-5.33%	10	11	11	12	12	12	13	
-2.67%	2	3	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)

1,821

공시일	2019-12-24
기준일	2019-12-23

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	204,925	0	204,925	

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	2019-12-24
기준일	2019-12-23

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	213,904	0	213,904	

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	2019-12-24
기준일	2019-12-23

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	11,167	-11,167	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	527,945	0	527,945	
누계	통화	선도	0	569,925	-569,925	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 23-01-20E		1,397
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,500
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		1,863
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		3,204
FX21019X02 KRW/USD 26-12-19E		4,694
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		4,750
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		186
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,794
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,794
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,329
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,515
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E		1,621
FX21019Z00 KRW/USD 10-01-20E		1,118
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E		1,528
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E		931
FX21019Z02 KRW/USD 16-01-20E		1,677
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		186
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		1,993
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		931
FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E		3,726
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E		1,863
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E		1,993

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

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

189

공시일	2019-12-24
기준일	2019-12-23

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

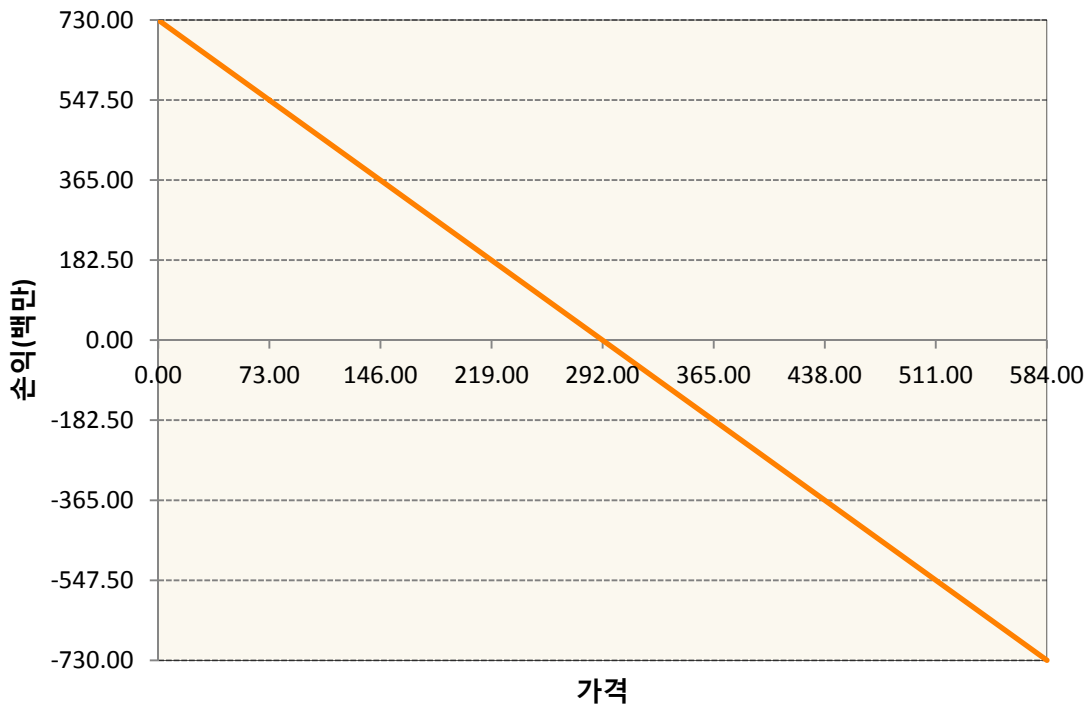
1. 계약금액

(단위:백만원)

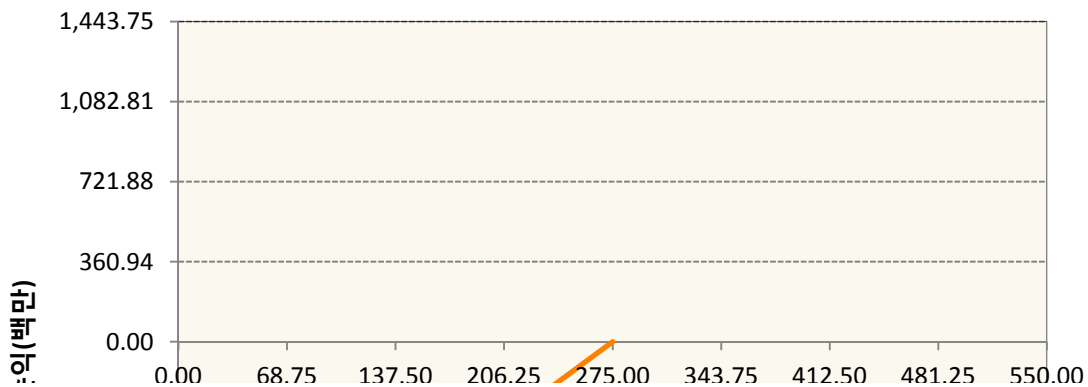
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	730	-730	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,941	-3,941	장내

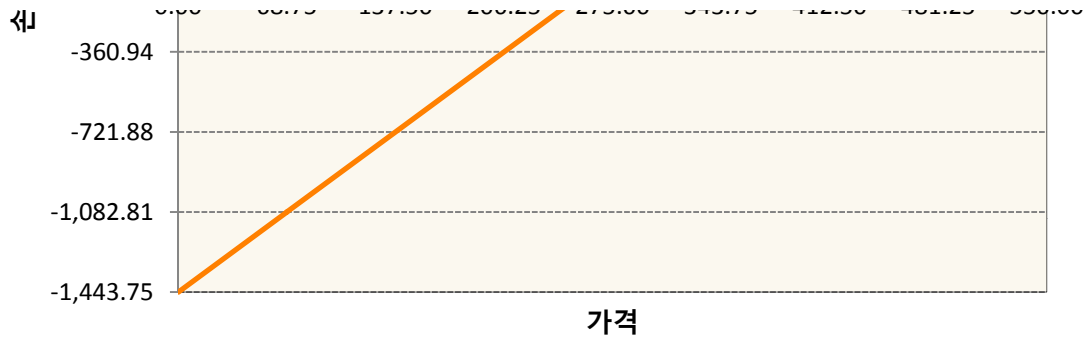
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

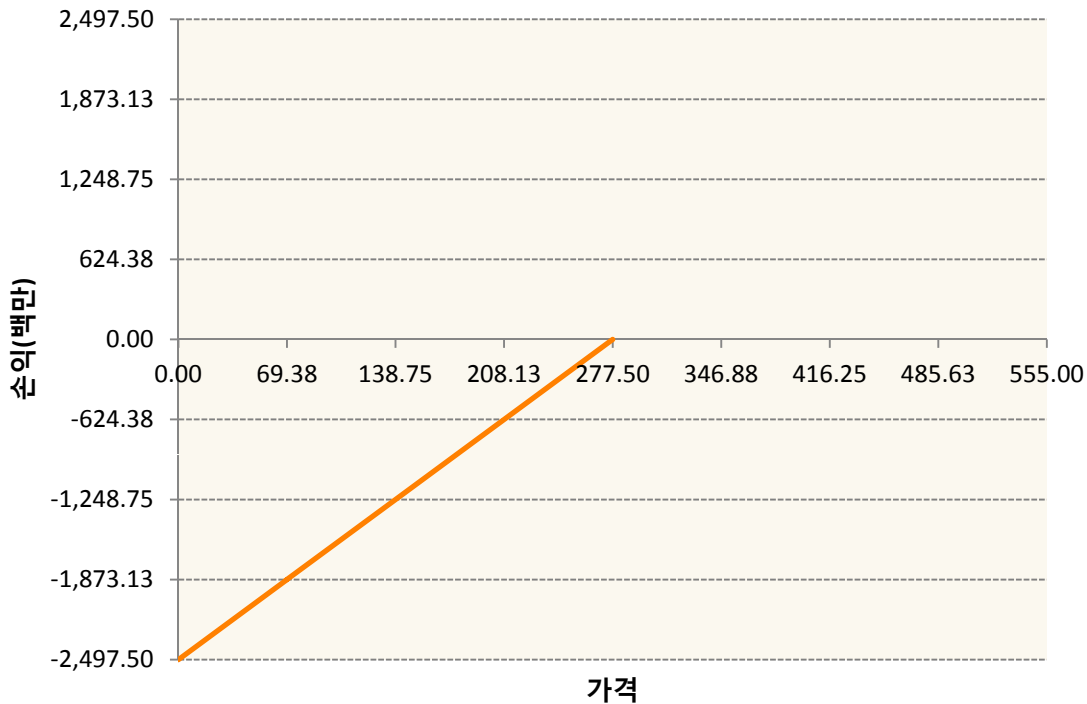


KR4301Q12751-2020-01 풋275





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						33
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-25	-26	-28	-29	-30	-31	-33
-5.33%	-5	-6	-7	-9	-10	-11	-13
-2.67%	0	-1	-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 71

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-61	-62	-64	-66	-68	-69	-71
-5.33%	-16	-18	-20	-23	-25	-28	-30
-2.67%	-1	-2	-3	-4	-6	-7	-9
0%	1	0	0	0	0	-1	-2
2.67%	1	1	1	1	1	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)

82

공시일	2019-12-24
기준일	2019-12-23

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	439	-439	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	13,560	0	13,560	
누계	통화	선도	943	14,391	-13,448	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
FX21019Z03 USD/KRW 13-01-20E		20
FX21019Z04 USD/KRW 13-01-20E		28

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

(단위:백만원)

394

공시일	2019-12-24
기준일	2019-12-23

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	991	0	991	장외
누계	통화	선도	310	426	-116	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
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	3

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

(단위:백만원)

79

공시일	2019-12-24
기준일	2019-12-23

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

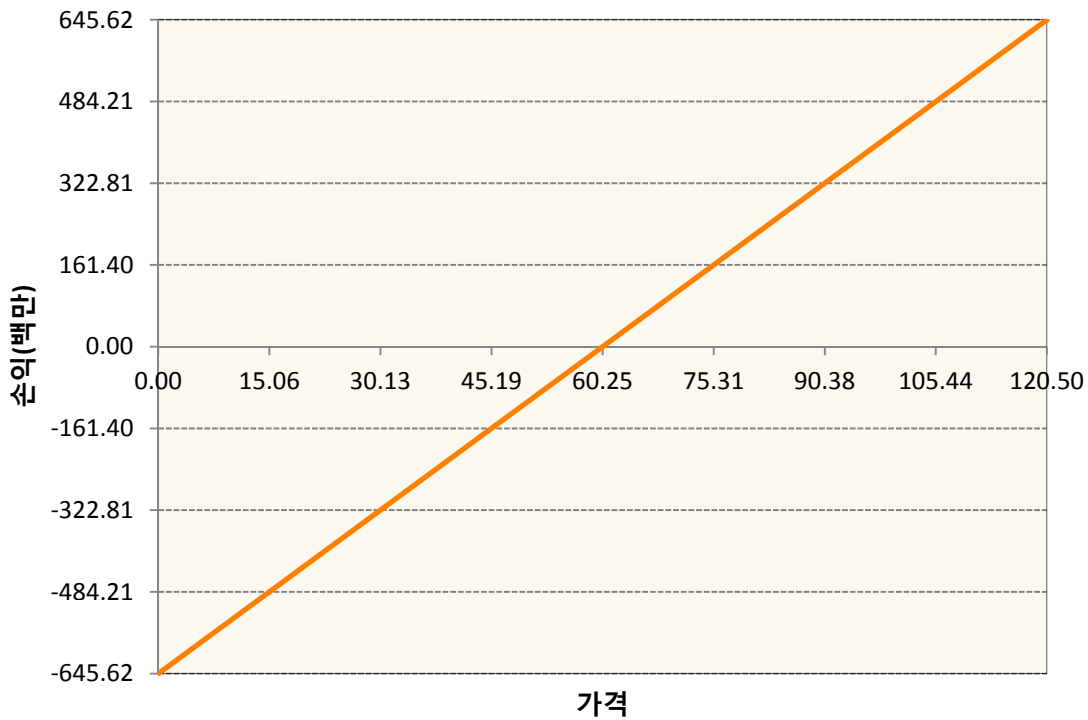
1. 계약금액

(단위:백만원)

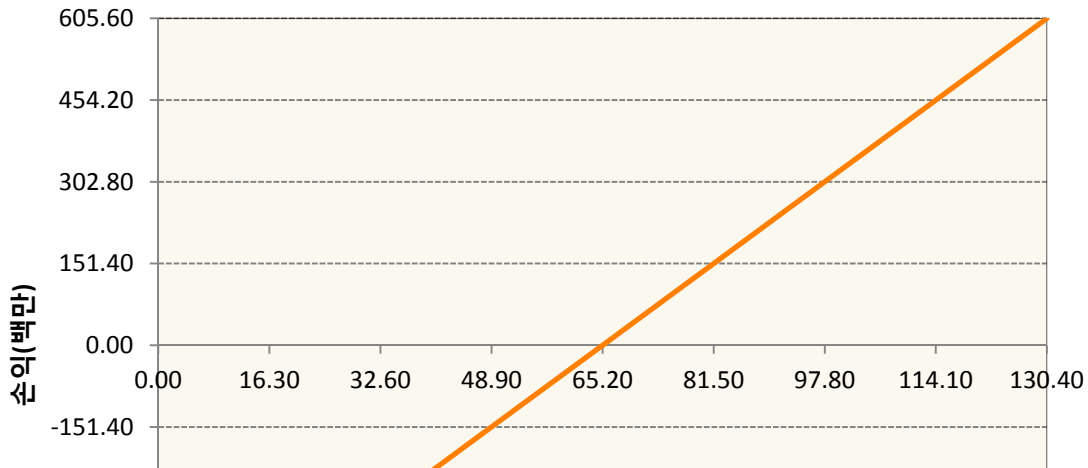
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,435	291	2,144	

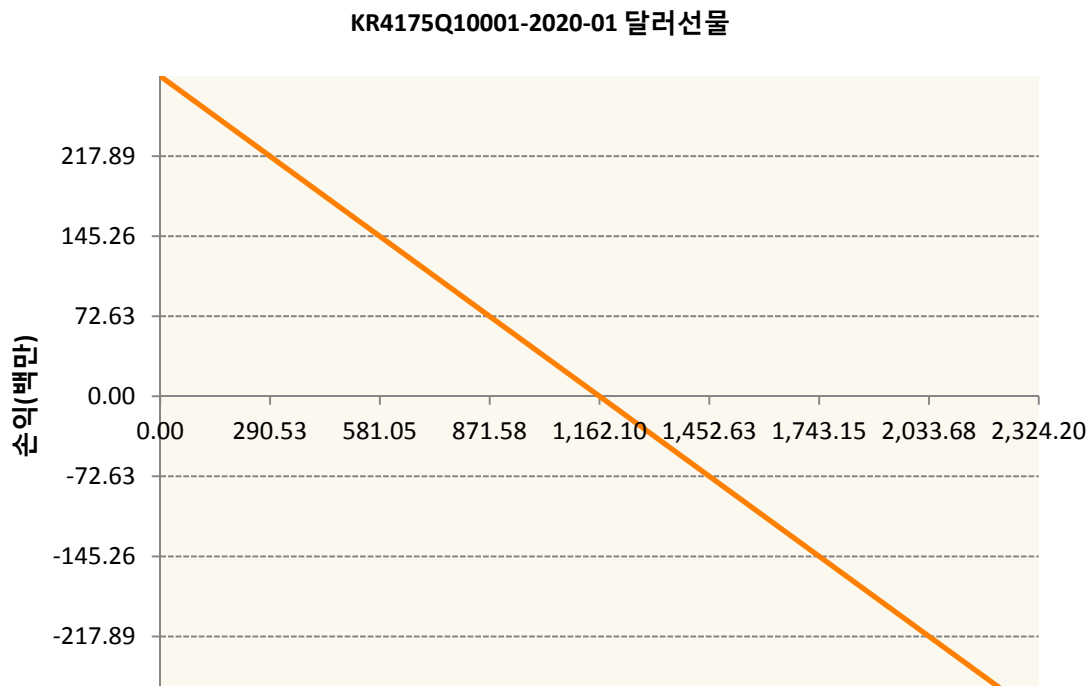
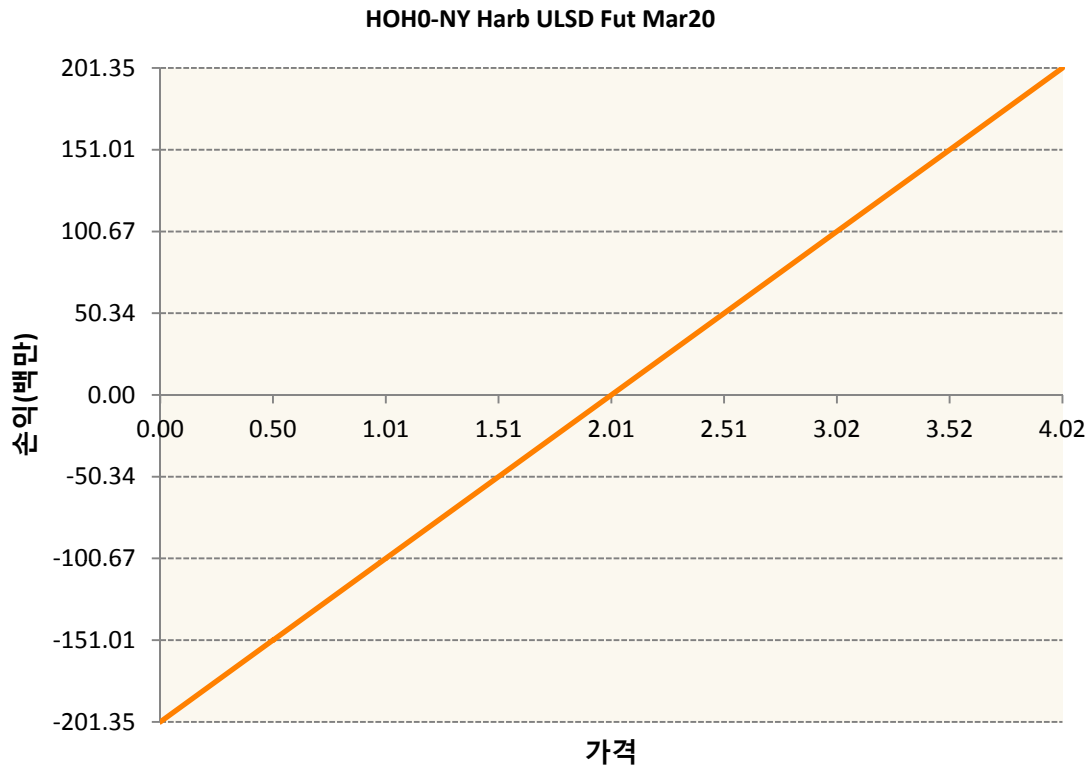
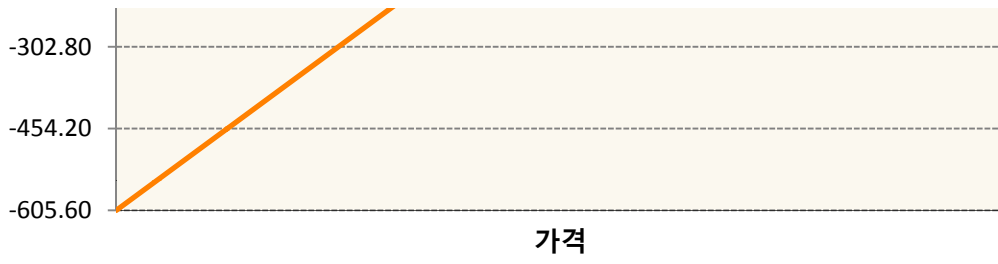
2. 만기시점의 손익구조

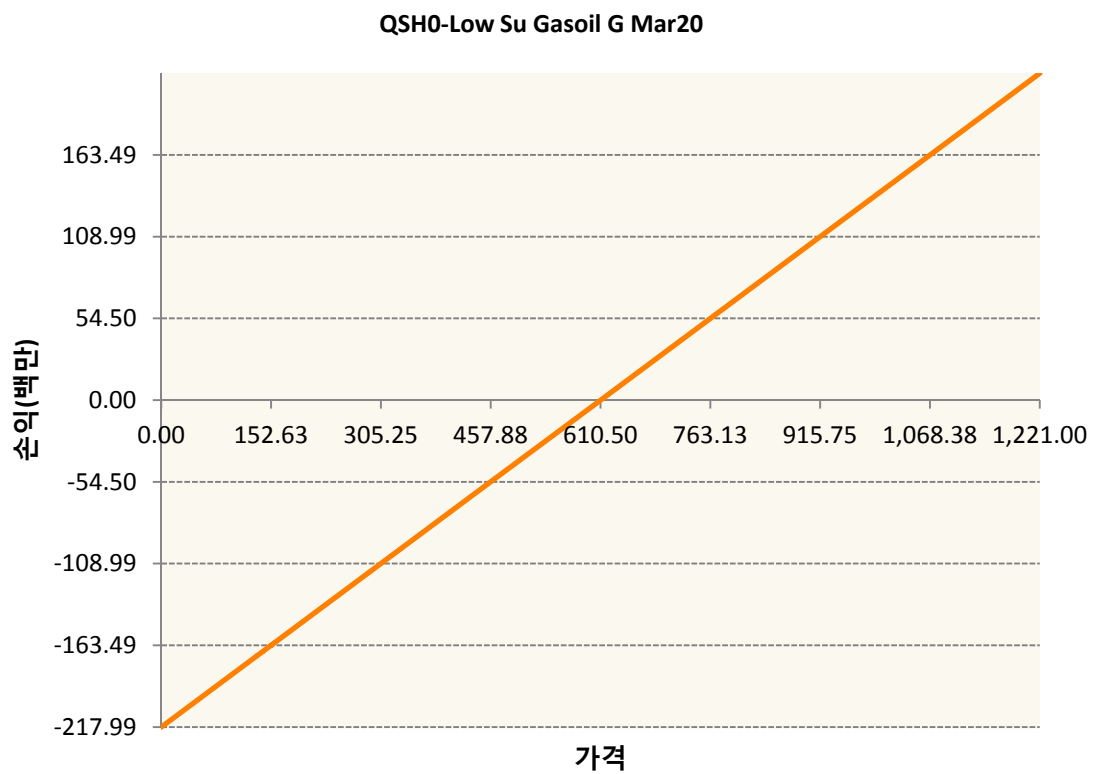
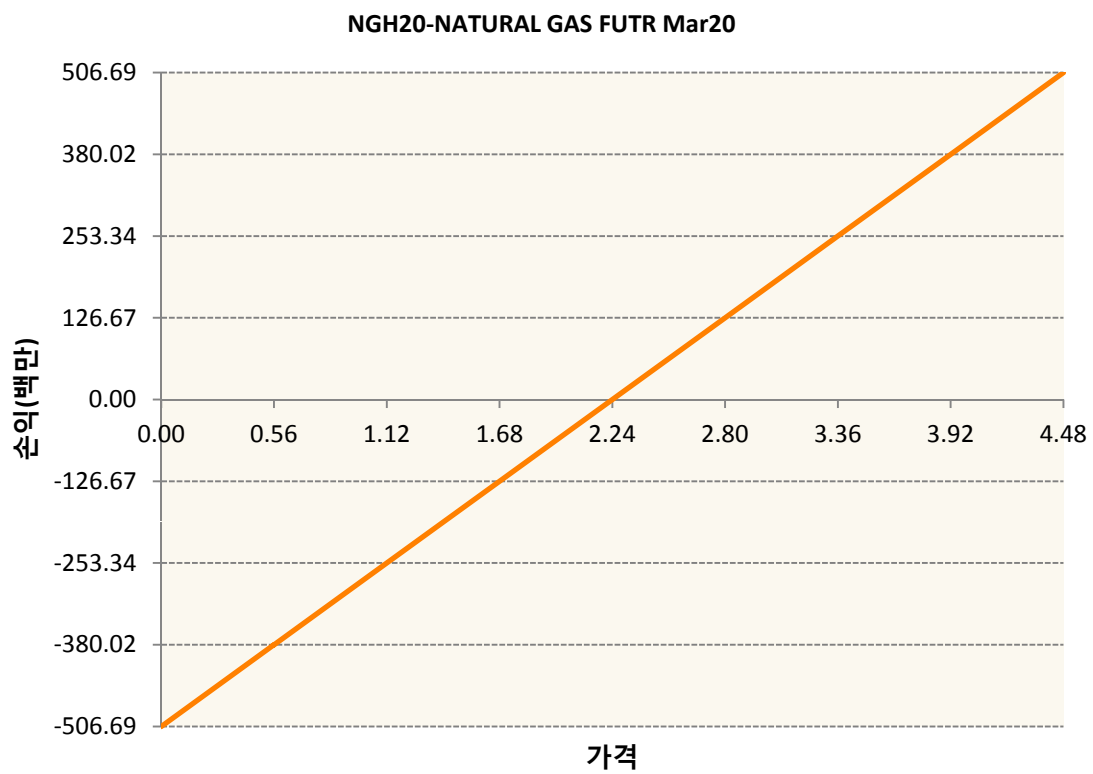
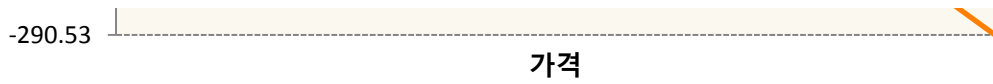
CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20



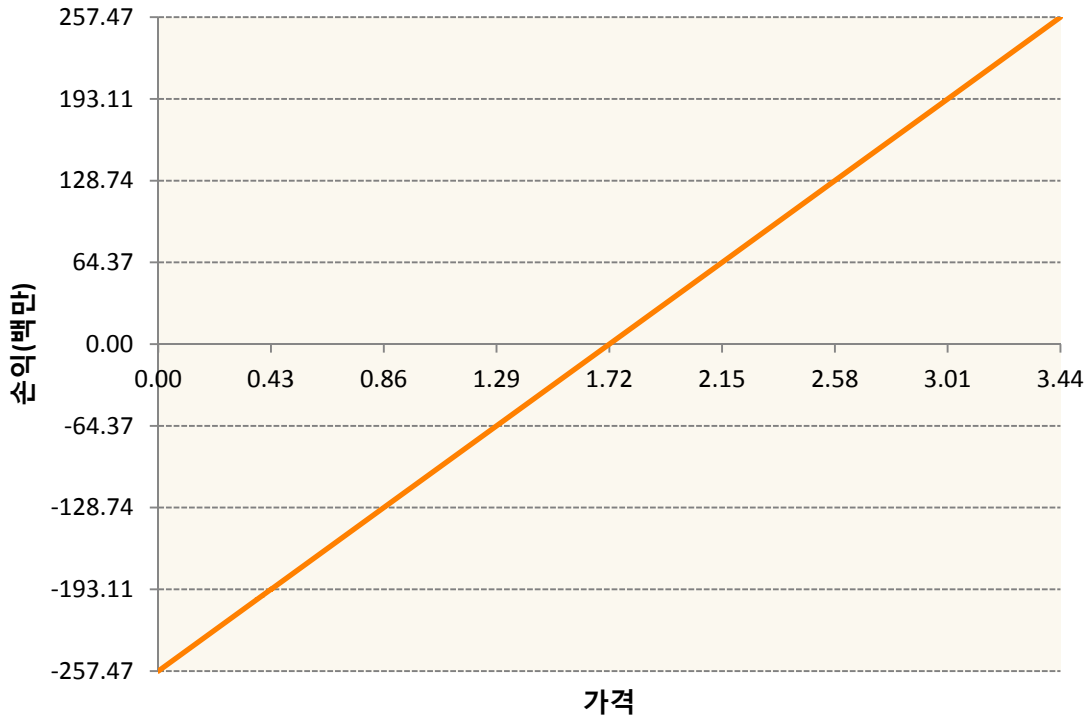
COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20







XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

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

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

387

공시일	2019-12-24
기준일	2019-12-23

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

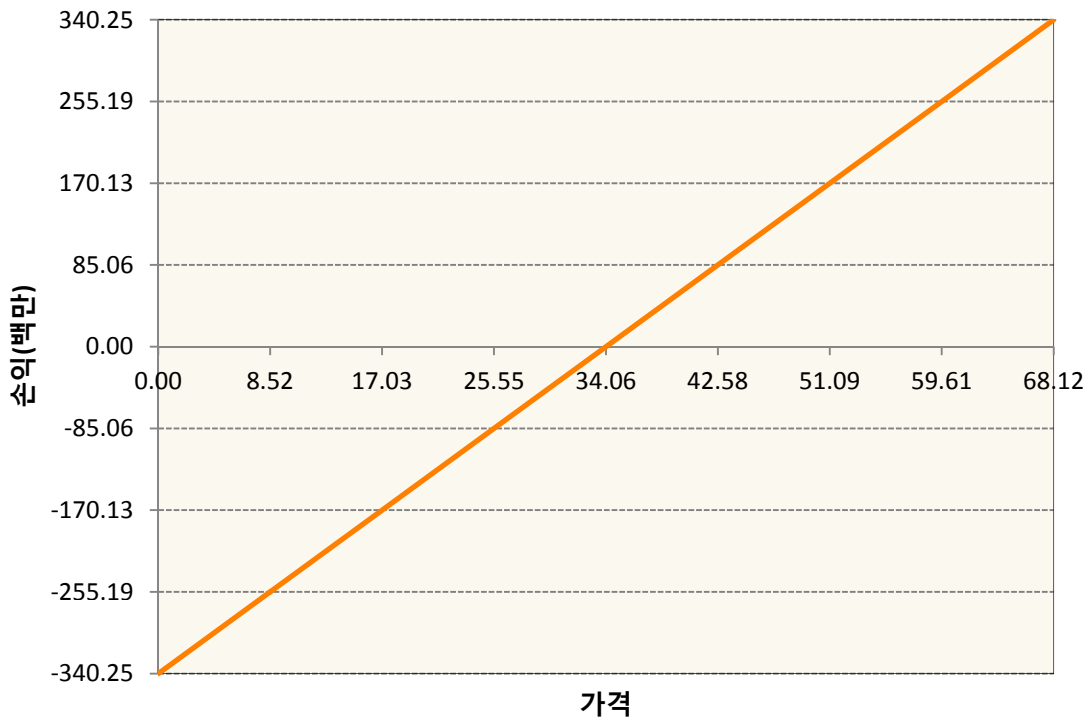
1. 계약금액

(단위:백만원)

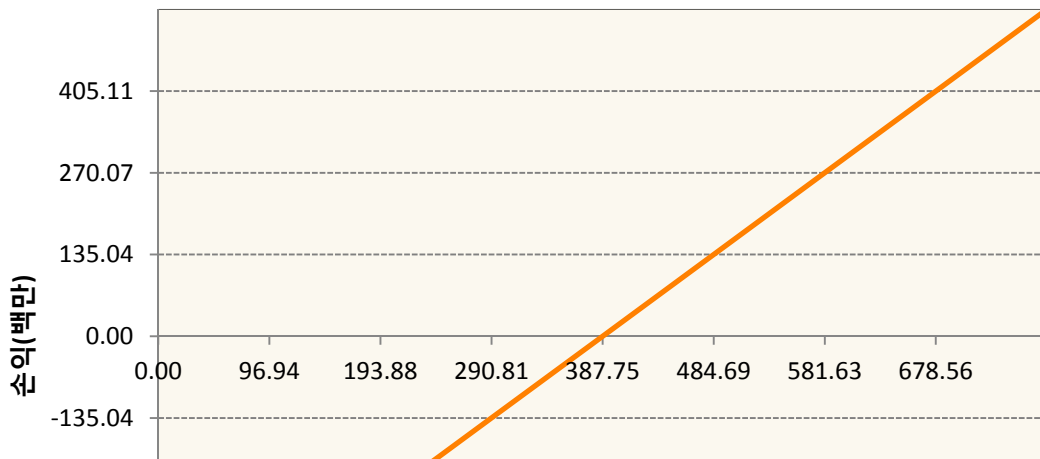
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,845	116	2,729	

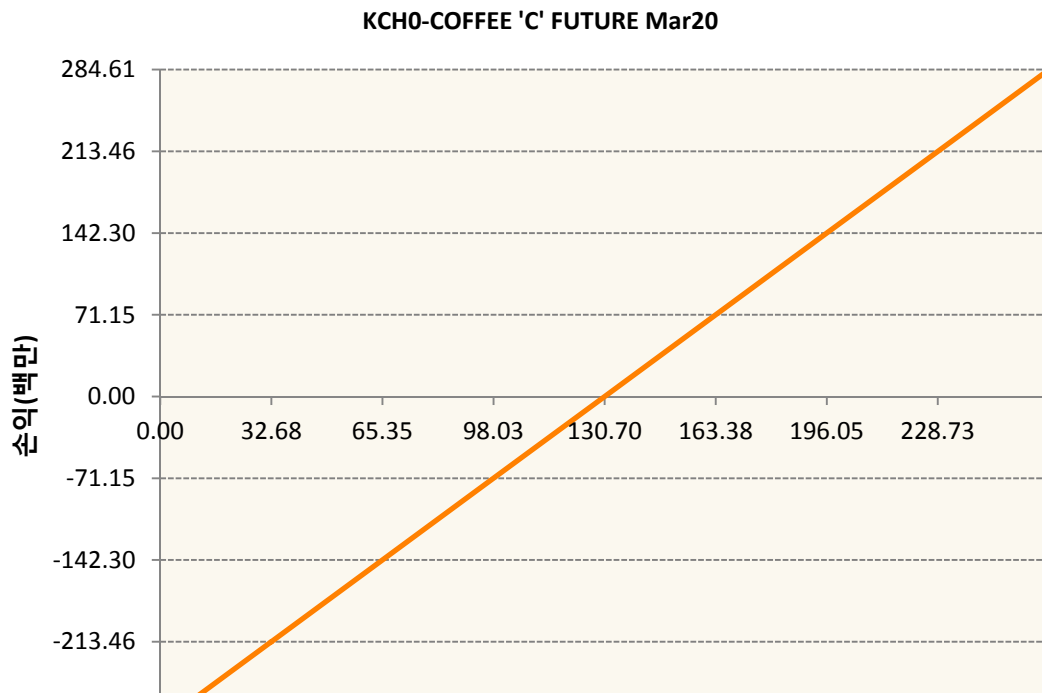
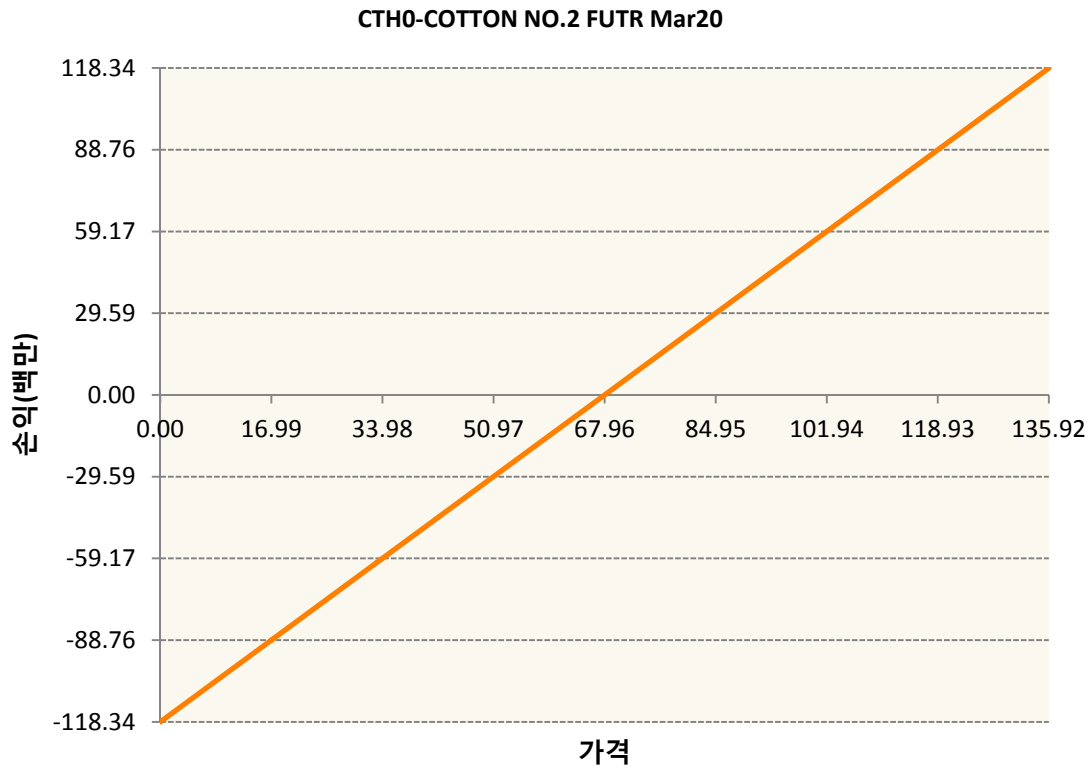
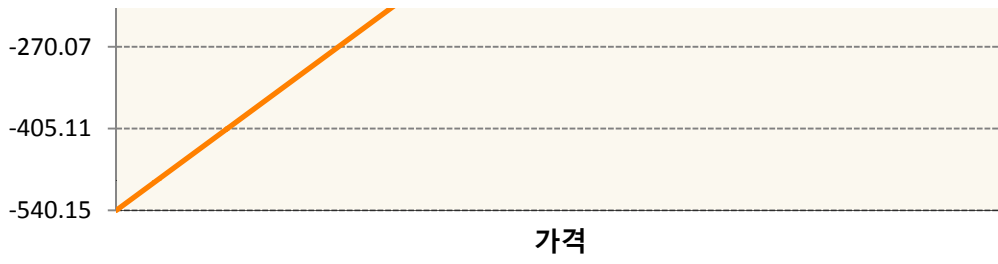
2. 만기시점의 손익구조

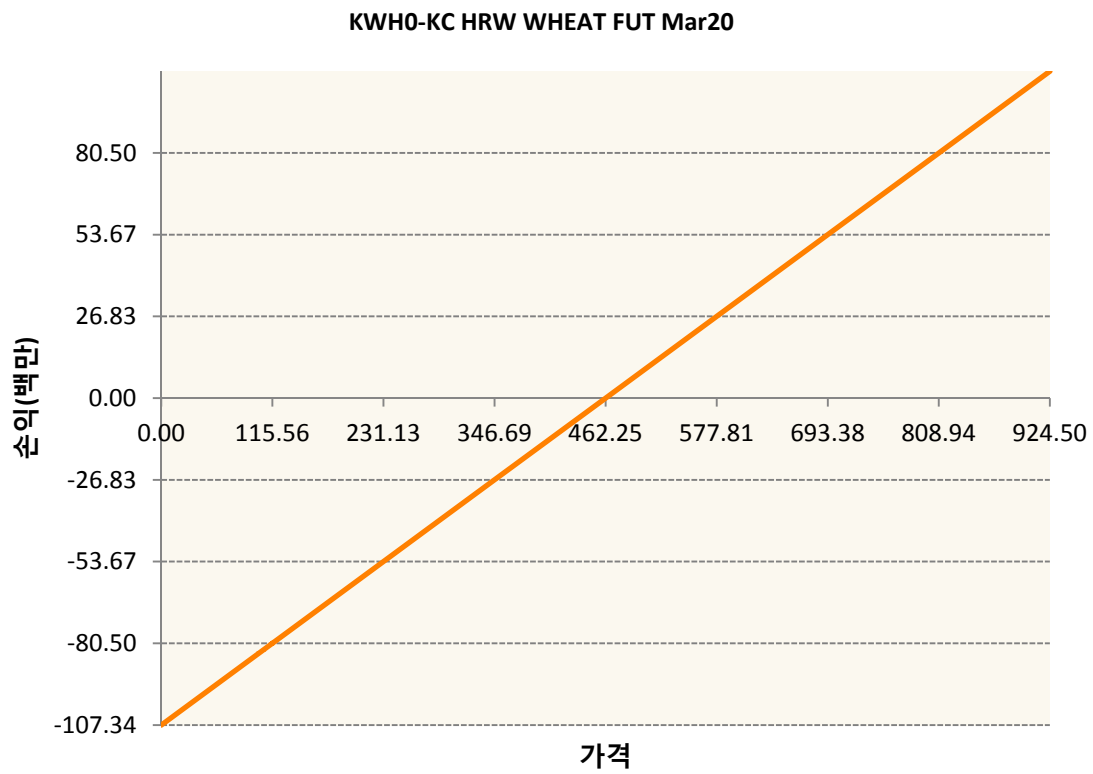
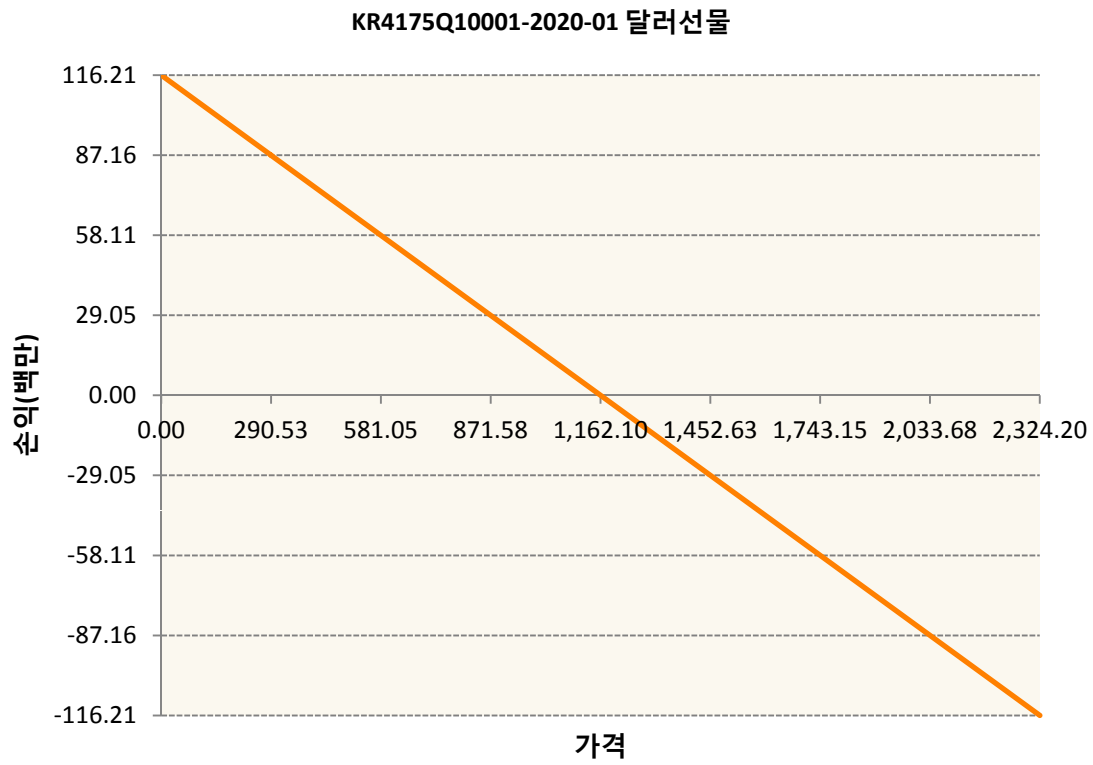
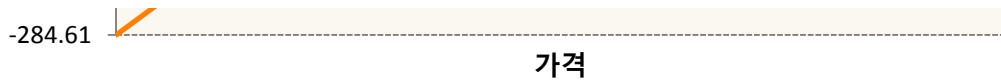
BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20



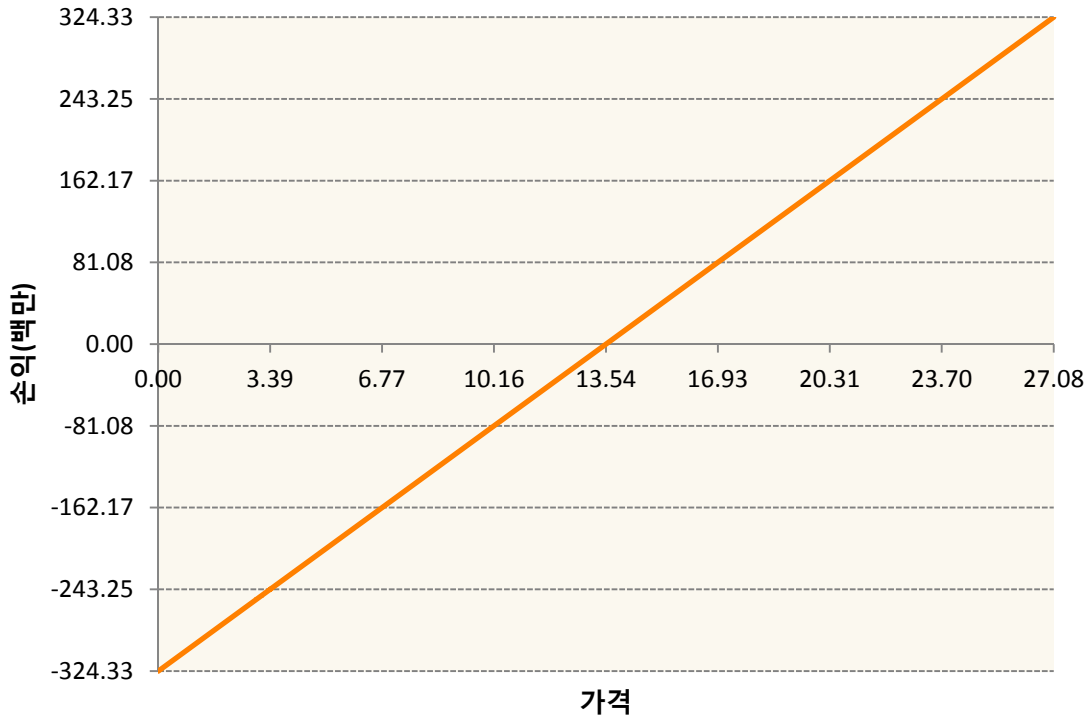
CH0-CORN FUTURE Mar20



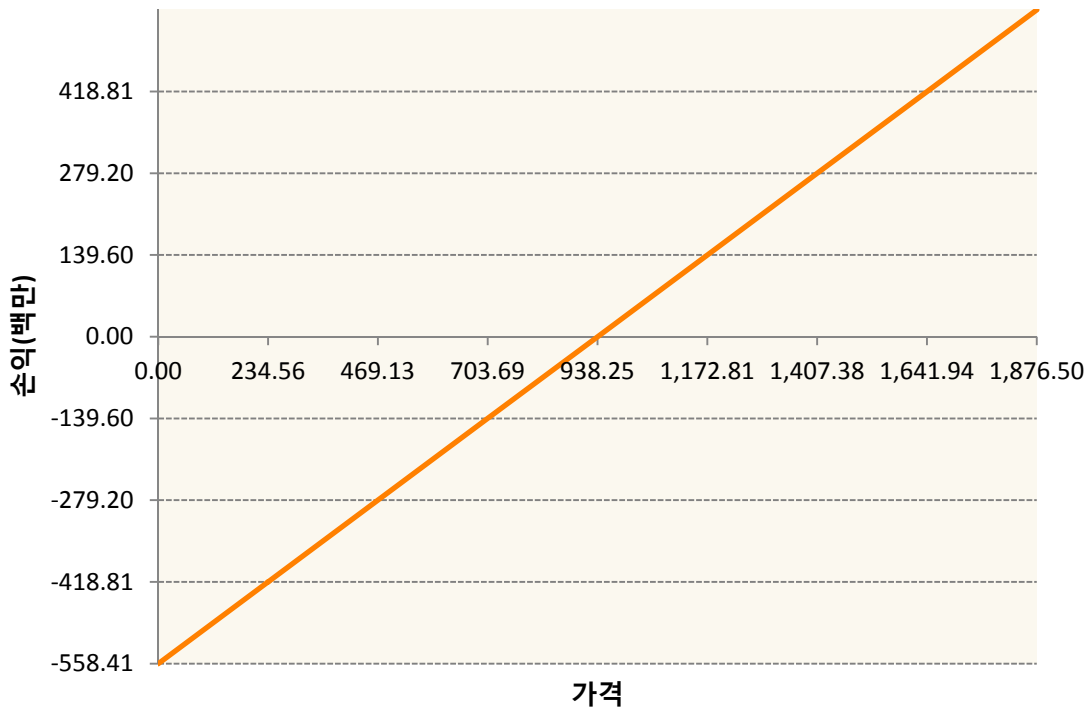




SBH0-Sugar Mar20

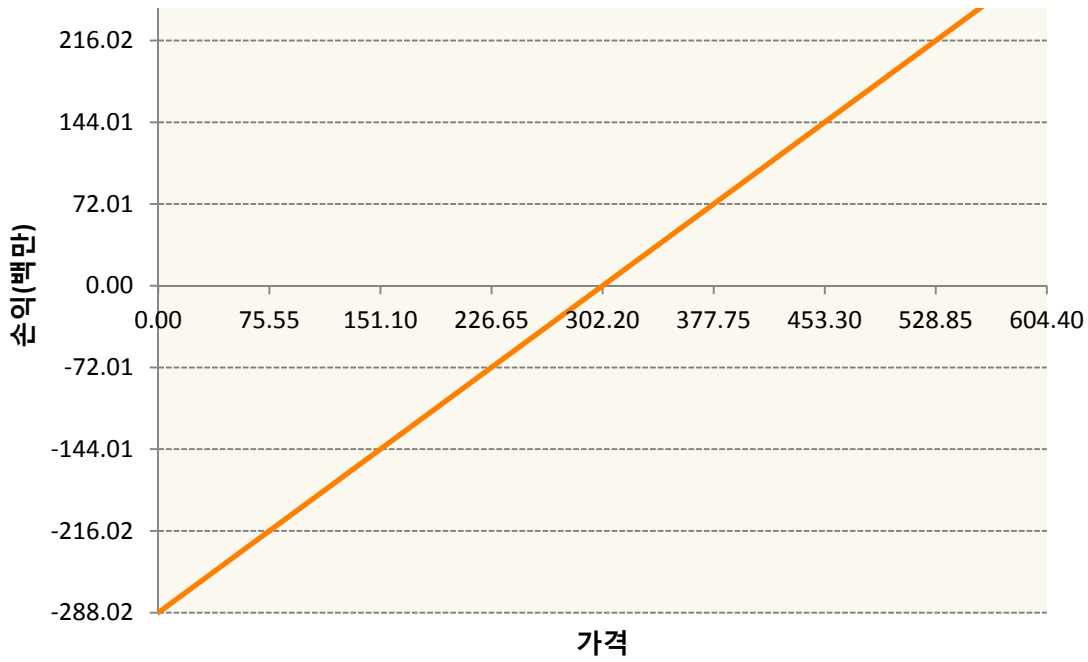


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20

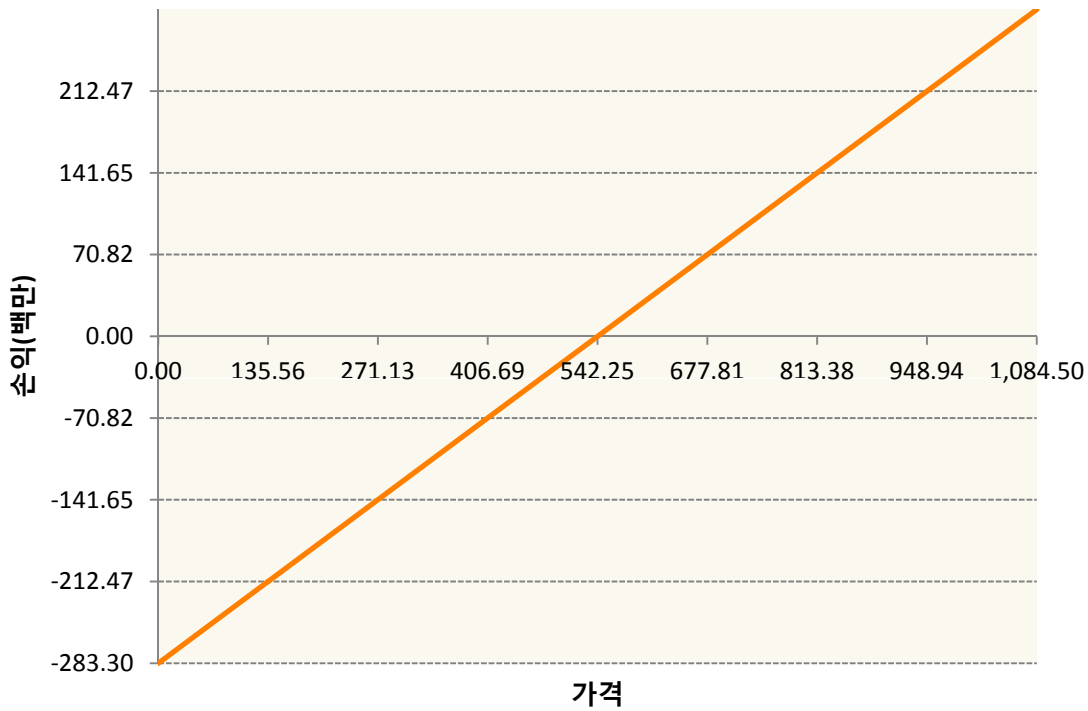


SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





WHO-WHEAT FUTURE(CBT) Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH0	SOYBEAN OIL FUTR Mar20	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)

249