

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-12-26 |
| 기준일 | 2019-12-24 |

## 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 | 2019-12-26 |
| 기준일 | 2019-12-24 |

## 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

1,125

\* 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 | 2019-12-26 |
| 기준일 | 2019-12-24 |

## 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) | 396 |
| SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2) | 145 |

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 752 |
|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-12-26 |
| 기준일 | 2019-12-24 |

## 유로인덱스모(주식-파생형)

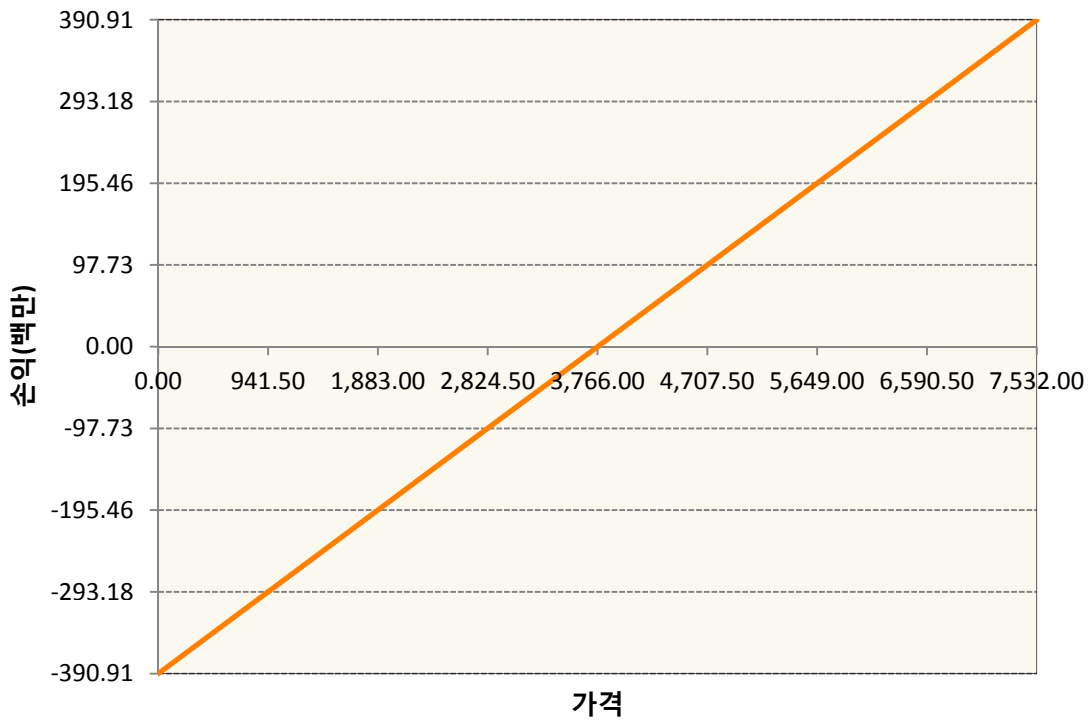
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 391   | 0     | 391       |    |

### 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)

|    |
|----|
| 22 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-12-26 |
| 기준일 | 2019-12-24 |

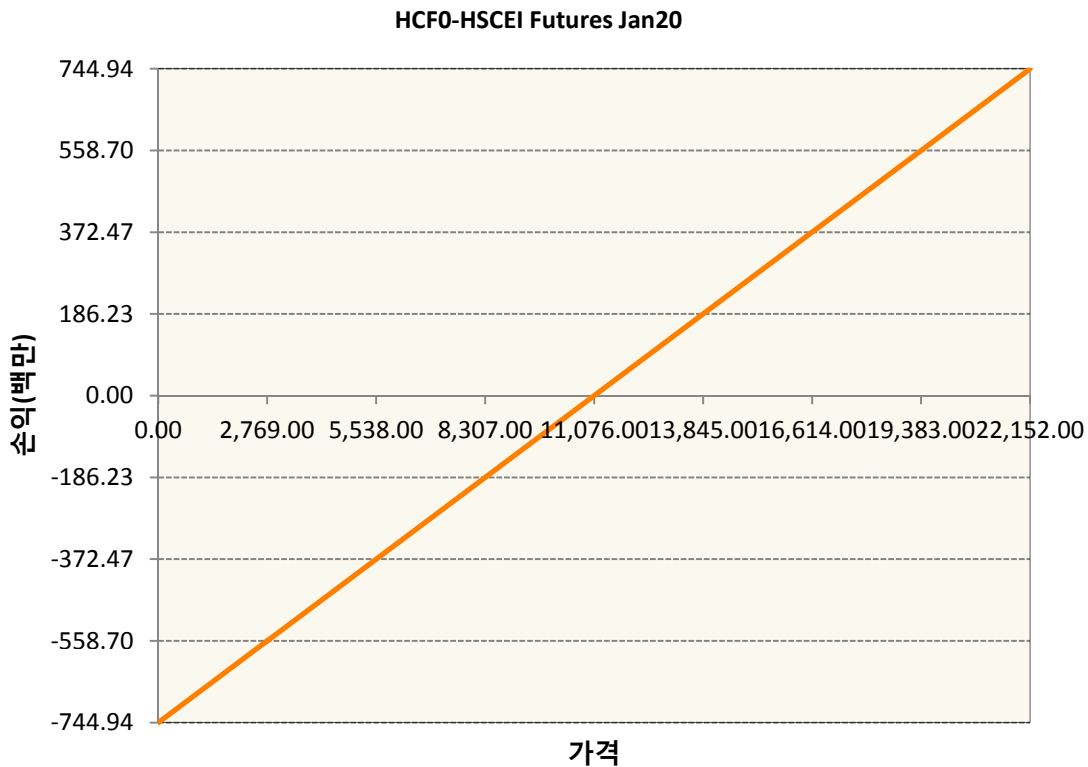
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 745   | 0     | 745       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| HCF0 | HSCEI Futures Jan20 | 60 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 52 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-12-26 |
| 기준일 | 2019-12-24 |

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

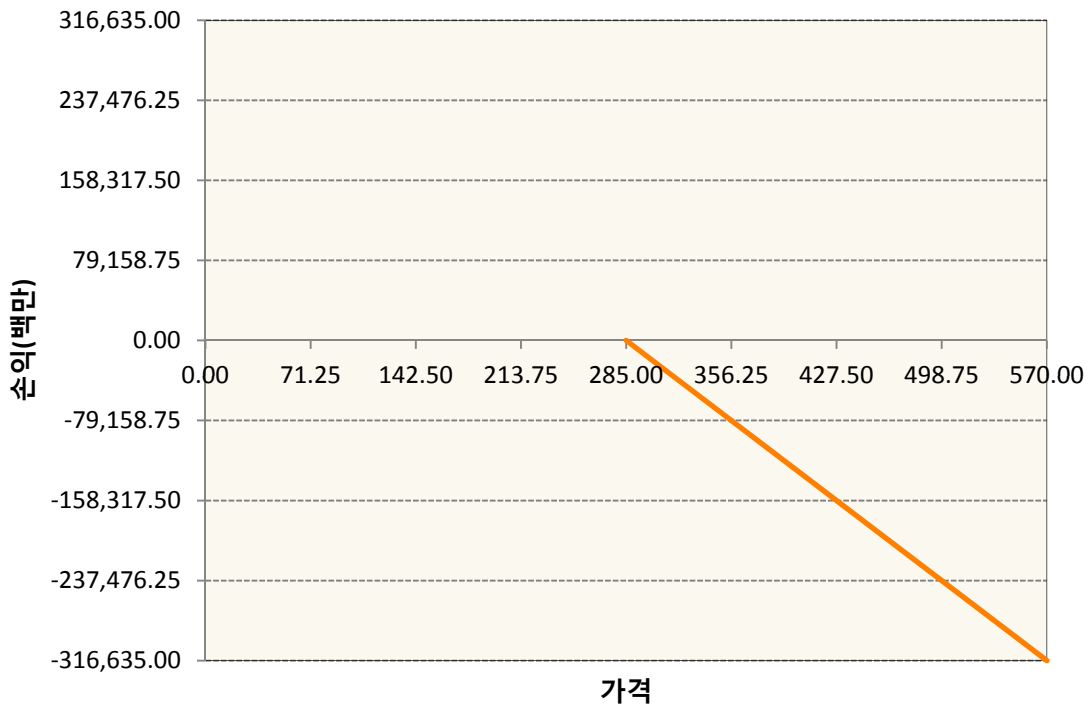
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

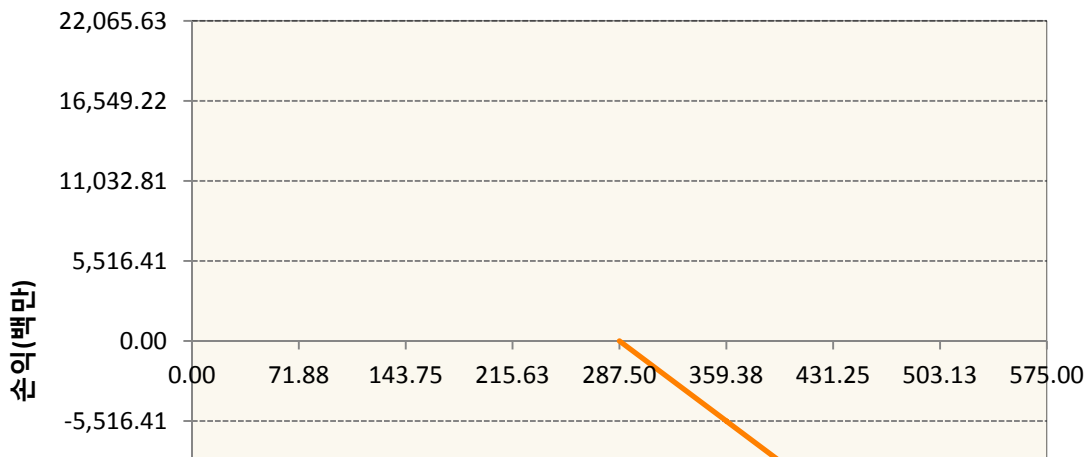
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)   | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 3,546 | 0       | 3,546     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 477,638 | -477,638  | 장내 |

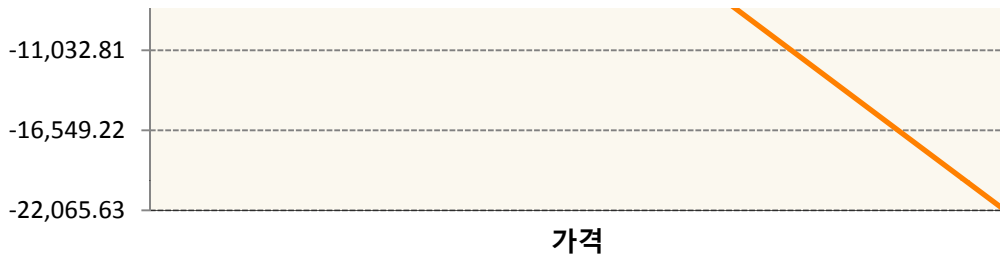
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q12852-2020-01 콜285

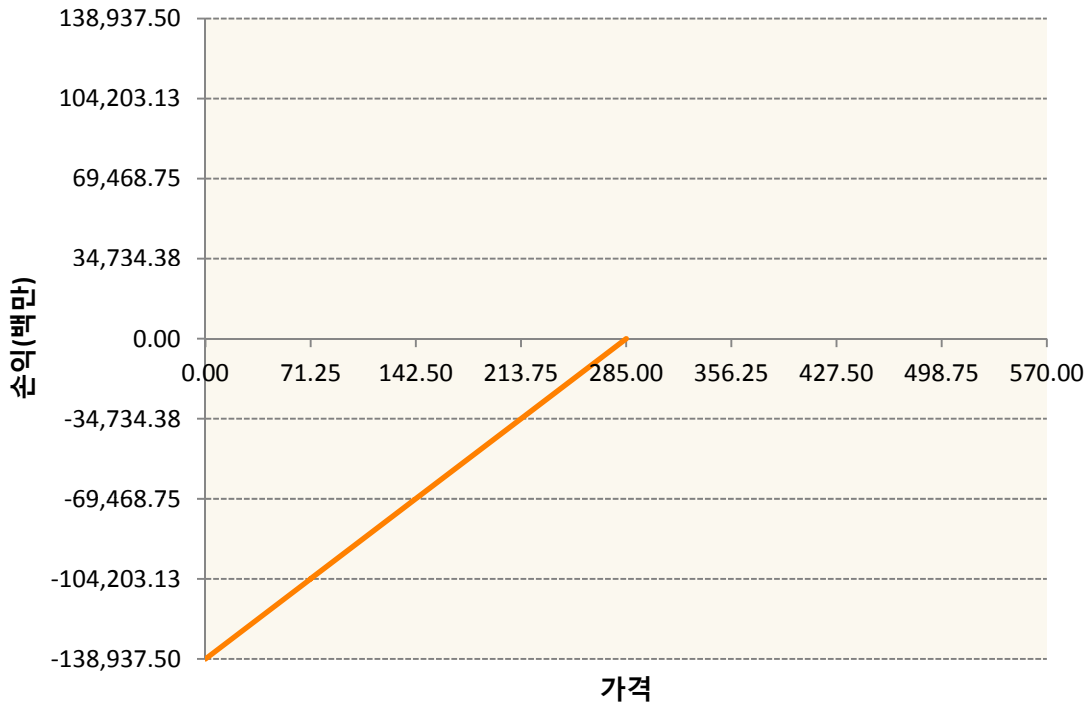


KR4201Q12878-2020-01 콜287.5





KR4301Q12850-2020-01 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4201Q12852 |         | 2020-01 콜285   |         |         |         |         | 22,854  |
|--------------|---------|----------------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 기초자산의 변동성    |         |                |         |         |         |         |         |
| 가격           | -25.00% | -16.67%        | -8.33%  | 0%      | 8.33%   | 16.67%  | 25.00%  |
| -8.00%       | 12,040  | 11,741         | 11,402  | 11,027  | 10,624  | 10,196  | 9,747   |
| -5.33%       | 10,451  | 9,931          | 9,395   | 8,845   | 8,286   | 7,718   | 7,144   |
| -2.67%       | 7,085   | 6,458          | 5,830   | 5,203   | 4,576   | 3,948   | 3,321   |
| 0%           | 1,666   | 1,125          | 569     | 0       | -579    | -1,165  | -1,758  |
| 2.67%        | -5,423  | -5,764         | -6,147  | -6,564  | -7,010  | -7,480  | -7,971  |
| 5.33%        | -13,491 | -13,653        | -13,861 | -14,112 | -14,404 | -14,731 | -15,089 |
| 8.00%        | -21,981 | -22,040        | -22,131 | -22,258 | -22,421 | -22,621 | -22,854 |
| KR4201Q12878 |         | 2020-01 콜287.5 |         |         |         |         | 1,528   |
| 기초자산의 변동성    |         |                |         |         |         |         |         |
| 가격           | -25.00% | -16.67%        | -8.33%  | 0%      | 8.33%   | 16.67%  | 25.00%  |
| -8.00%       | 726     | 710            | 690     | 668     | 644     | 617     | 589     |

|  |         |         |        |        |        |        |        |
|--|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| -5.33%   | 644     | 612     | 579    | 544    | 508    | 471    | 433    |
| -2.67%   | 454     | 411     | 368    | 325    | 282    | 239    | 196    |
| 0%   | 124     | 83      | 42     | 0      | -42    | -85    | -128   |
| 2.67%  | -332    | -361    | -392   | -425   | -460   | -495   | -532   |
| 5.33%  | -872    | -887    | -905   | -927   | -950   | -977   | -1,005 |
| 8.00%  | -1,451  | -1,457  | -1,466 | -1,478 | -1,492 | -1,509 | -1,528 |
| KR4301Q12850                      2020-01 풋285 |         |         |        |        |        |        | 7,352  |
| 기초자산의 변동성                                      |         |         |        |        |        |        |        |
| 가격   | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%   | -7,224  | -7,231  | -7,243 | -7,260 | -7,284 | -7,315 | -7,352 |
| -5.33%   | -3,562  | -3,627  | -3,701 | -3,783 | -3,871 | -3,964 | -4,062 |
| -2.67%   | -824    | -959    | -1,095 | -1,230 | -1,365 | -1,501 | -1,636 |
| 0%   | 236     | 166     | 87     | 0      | -93    | -191   | -294   |
| 2.67%  | 393     | 382     | 366    | 343    | 313    | 275    | 230    |
| 5.33%  | 400     | 400     | 399    | 396    | 391    | 383    | 371    |
| 8.00%  | 400     | 400     | 400    | 400    | 400    | 399    | 397    |

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

(단위:백만원)

**31,733**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-12-26 |
| 기준일 | 2019-12-24 |

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

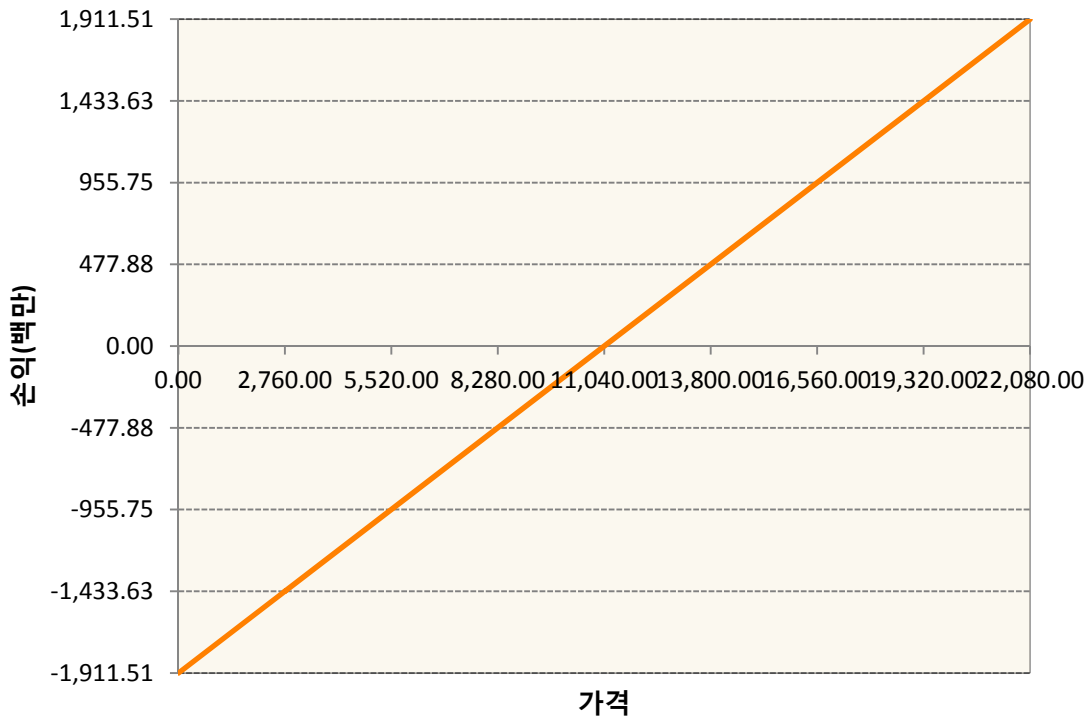
### 1. 계약금액

(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   | 1,912 | 0     | 1,912     |    |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 4,816 | -4,816    | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 2,105 | -2,105    | 장외 |

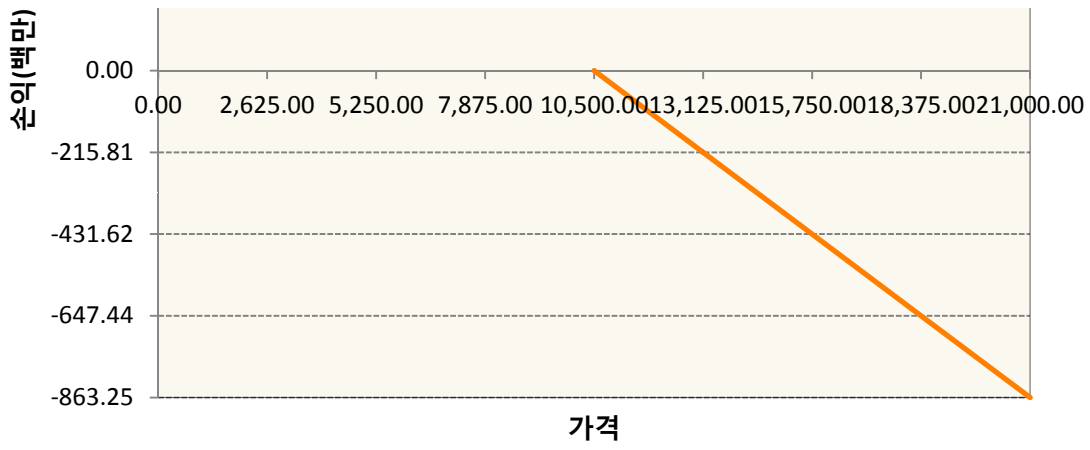
### 2. 만기시점의 손익구조

HCZ9-HSCEI Futures Dec19

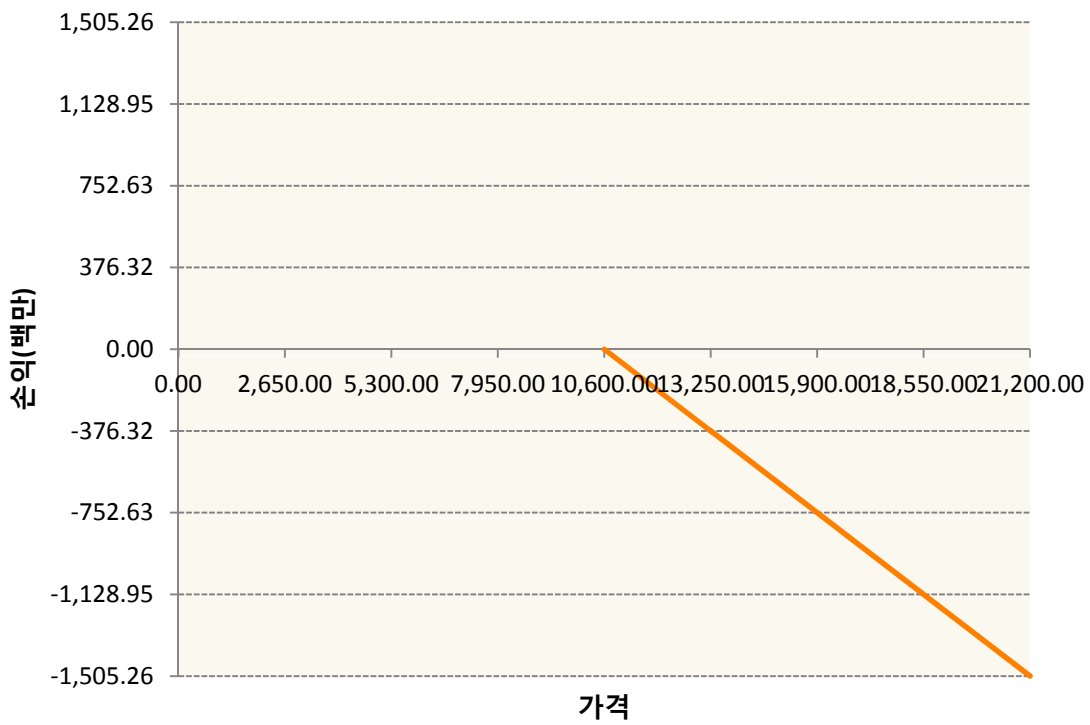


OHHIZ9-C105-HSCEI

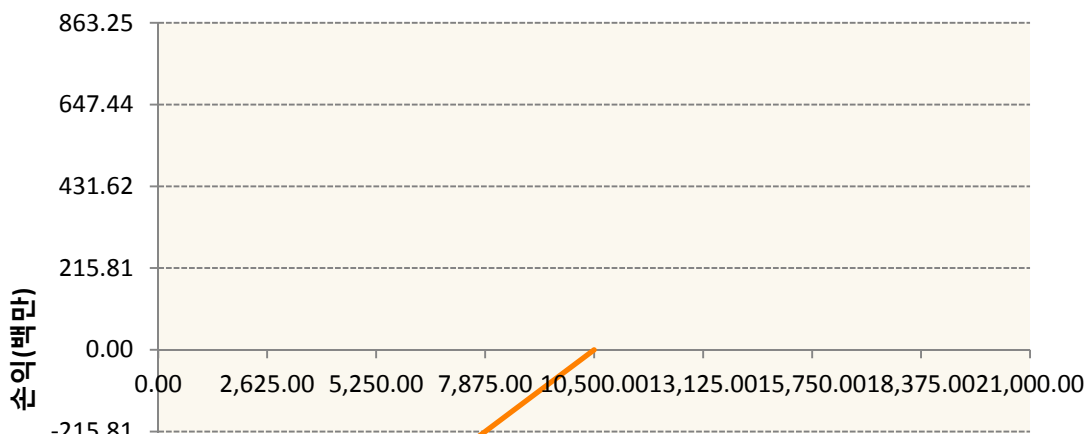


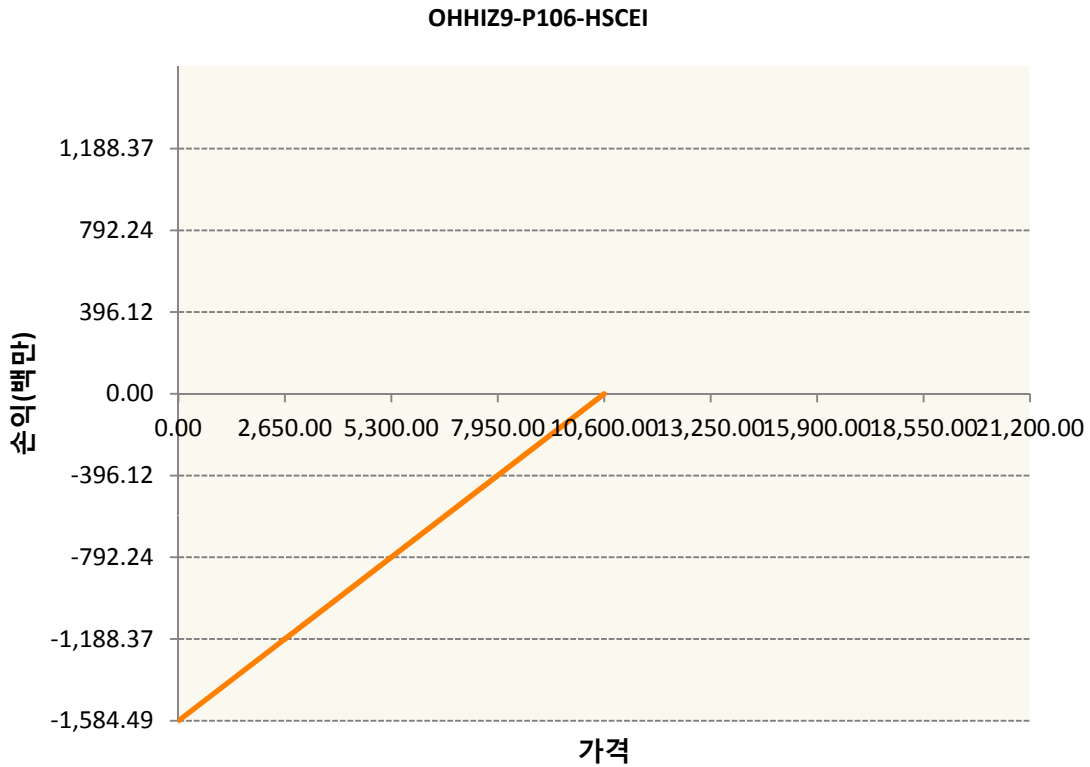
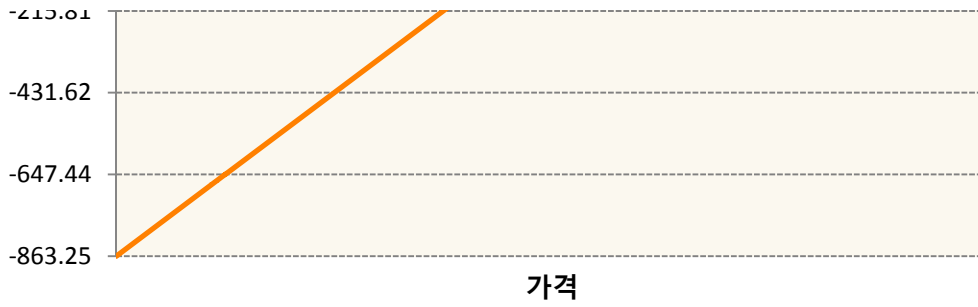


OHHIZ9-C106-HSCEI



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 | 2019-12-26 |
| 기준일 | 2019-12-24 |

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

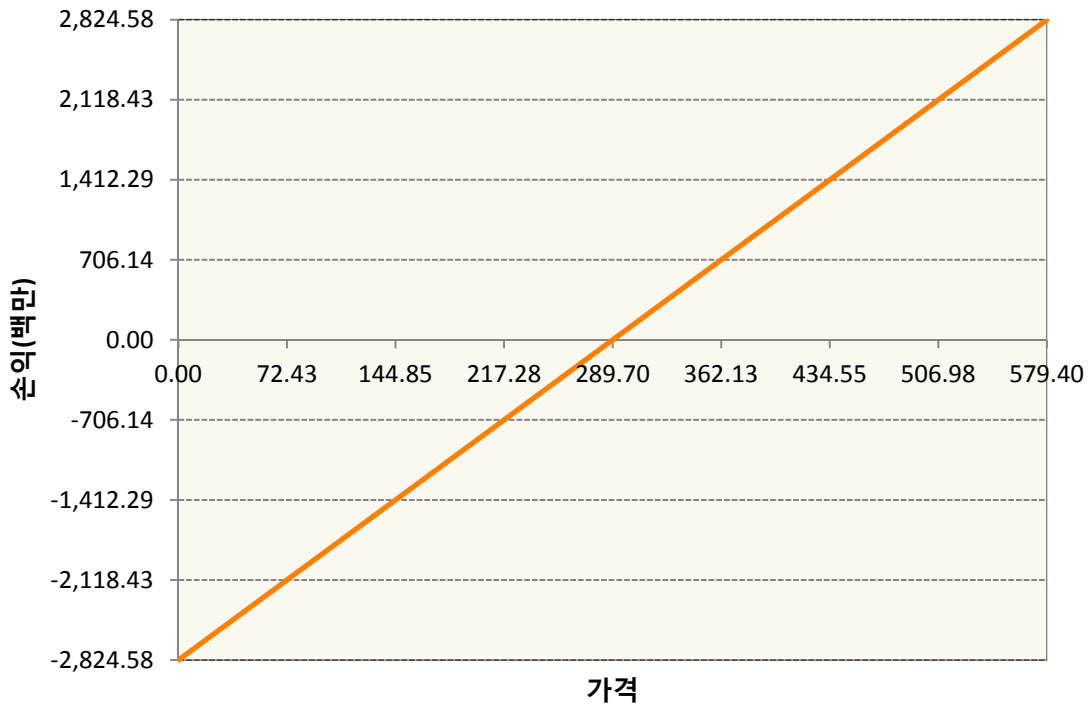
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

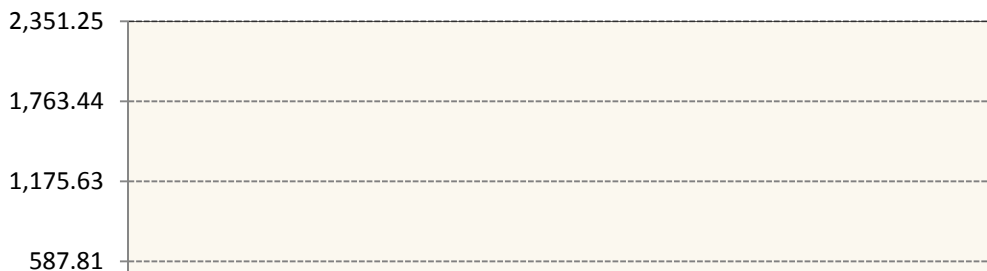
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑   | 0     | 1,000 | -1,000    | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 71    | 0     | 71        | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,825 | 0     | 2,825     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 5,625 | 0     | 5,625     | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 5,560 | -5,560    | 장내 |

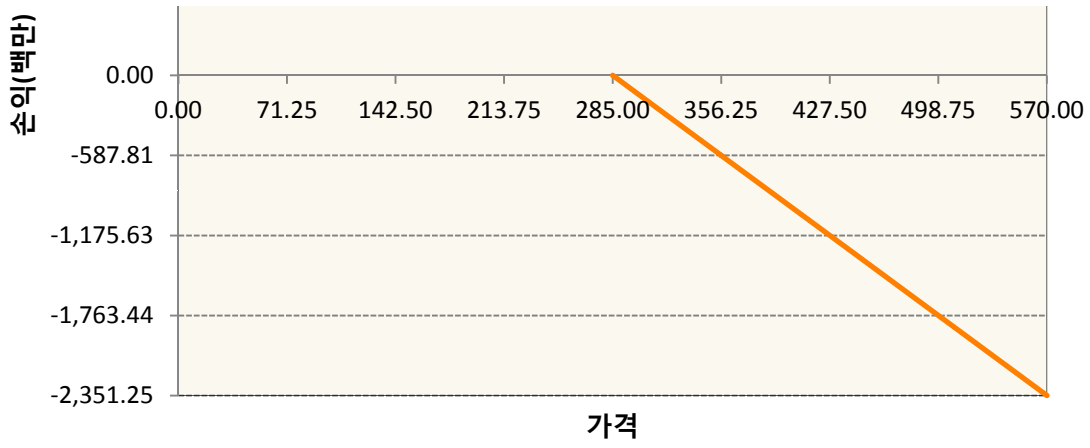
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

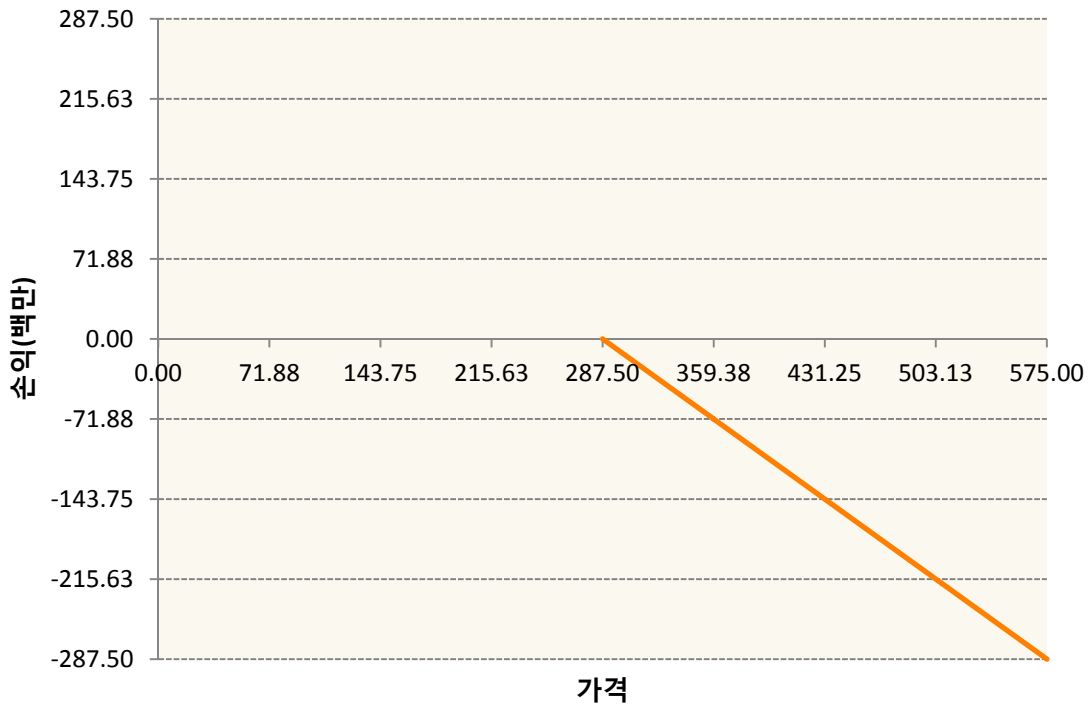


KR4201Q12852-2020-01 콜285

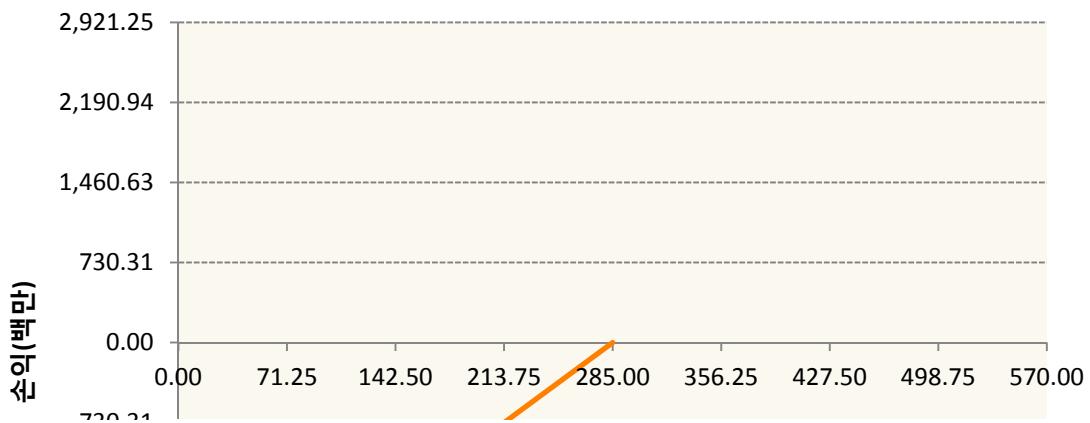




KR4201Q12878-2020-01 콜287.5



KR4301Q12850-2020-01 풋285





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| 2.529E+11    |         | UBCSFXC1 INDEX_16  |        |      |       |        |        | 482 |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | -482    | -482               | -482   | -482 | -482  | -482   | -482   |     |
| -5.33%       | -321    | -321               | -321   | -321 | -321  | -321   | -321   |     |
| -2.67%       | -161    | -161               | -161   | -161 | -161  | -161   | -161   |     |
| 0%           | 0       | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |     |
| 2.67%        | 161     | 161                | 161    | 161  | 161   | 161    | 161    |     |
| 5.33%        | 321     | 321                | 321    | 321  | 321   | 321    | 321    |     |
| 8.00%        | 482     | 482                | 482    | 482  | 482   | 482    | 482    |     |
| KR4101Q30005 |         | 2020-03 코스피200지수선물 |        |      |       |        |        | 228 |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | -228    | -228               | -228   | -228 | -228  | -228   | -228   |     |
| -5.33%       | -152    | -152               | -152   | -152 | -152  | -152   | -152   |     |
| -2.67%       | -76     | -76                | -76    | -76  | -76   | -76    | -76    |     |
| 0%           | 0       | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |     |
| 2.67%        | 76      | 76                 | 76     | 76   | 76    | 76     | 76     |     |
| 5.33%        | 152     | 152                | 152    | 152  | 152   | 152    | 152    |     |
| 8.00%        | 228     | 228                | 228    | 228  | 228   | 228    | 228    |     |
| KR4201Q12852 |         | 2020-01 콜285       |        |      |       |        |        | 170 |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | 89      | 87                 | 85     | 82   | 79    | 76     | 72     |     |
| -5.33%       | 78      | 74                 | 70     | 66   | 62    | 57     | 53     |     |
| -2.67%       | 53      | 48                 | 43     | 39   | 34    | 29     | 25     |     |
| 0%           | 12      | 8                  | 4      | 0    | -4    | -9     | -13    |     |
| 2.67%        | -40     | -43                | -46    | -49  | -52   | -56    | -59    |     |
| 5.33%        | -100    | -101               | -103   | -105 | -107  | -109   | -112   |     |
| 8.00%        | -163    | -164               | -164   | -165 | -166  | -168   | -170   |     |
| KR4201Q12878 |         | 2020-01 콜287.5     |        |      |       |        |        | 20  |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |

|                                |         |         |        |      |       |        |        |
|--------------------------------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| -8.00%                         | 9       | 9       | 9      | 9    | 8     | 8      | 8      |
| -5.33%                         | 8       | 8       | 8      | 7    | 7     | 6      | 6      |
| -2.67%                         | 6       | 5       | 5      | 4    | 4     | 3      | 3      |
| 0%                             | 2       | 1       | 1      | 0    | -1    | -1     | -2     |
| 2.67%                          | -4      | -5      | -5     | -6   | -6    | -6     | -7     |
| 5.33%                          | -11     | -12     | -12    | -12  | -12   | -13    | -13    |
| 8.00%                          | -19     | -19     | -19    | -19  | -19   | -20    | -20    |
| KR4301Q12850      2020-01 풋285 |         |         |        |      |       |        | 155    |
| 기초자산의 변동성                      |         |         |        |      |       |        |        |
| 가격                             | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                         | -152    | -152    | -152   | -153 | -153  | -154   | -155   |
| -5.33%                         | -75     | -76     | -78    | -80  | -81   | -83    | -85    |
| -2.67%                         | -17     | -20     | -23    | -26  | -29   | -32    | -34    |
| 0%                             | 5       | 3       | 2      | 0    | -2    | -4     | -6     |
| 2.67%                          | 8       | 8       | 8      | 7    | 7     | 6      | 5      |
| 5.33%                          | 8       | 8       | 8      | 8    | 8     | 8      | 8      |
| 8.00%                          | 8       | 8       | 8      | 8    | 8     | 8      | 8      |

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

(단위:백만원)

**993**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-12-26 |
| 기준일 | 2019-12-24 |

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

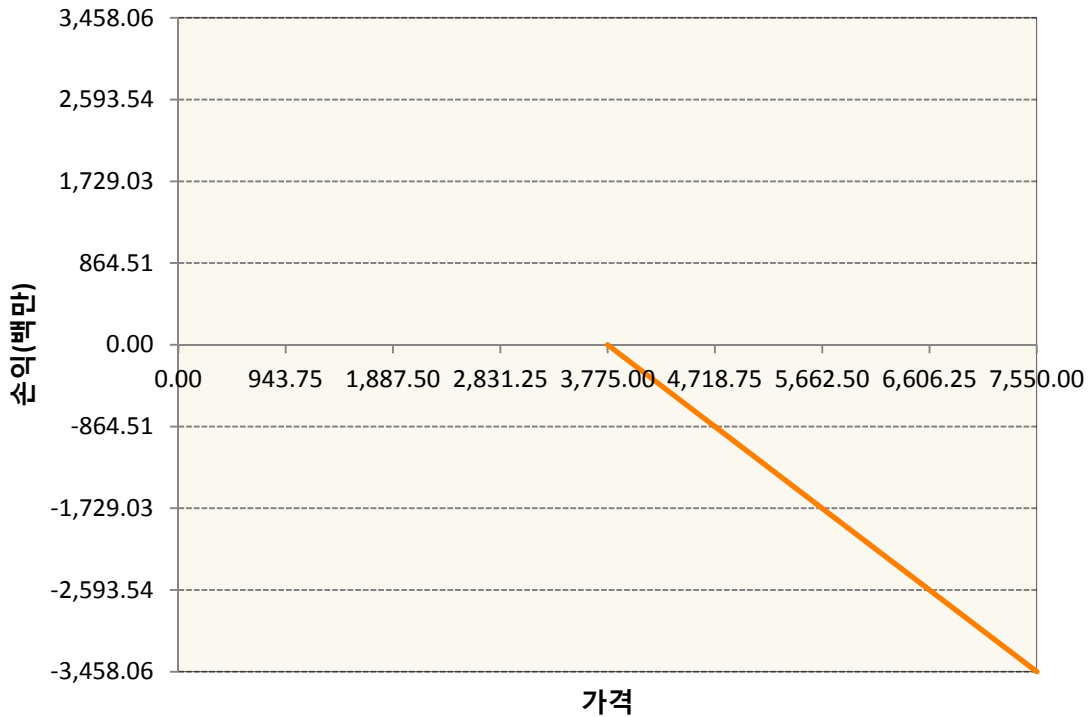
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

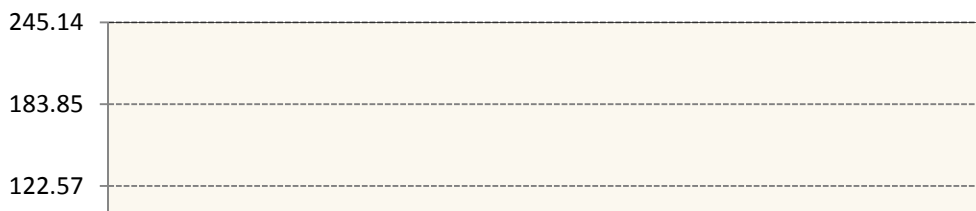
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 스왑   | 0      | 0     | 0         | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0      | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 729    | 0     | 729       |    |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 17,642 | 0     | 17,642    | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 7,406 | -7,406    | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 2,679  | 6,064 | -3,386    | 장외 |

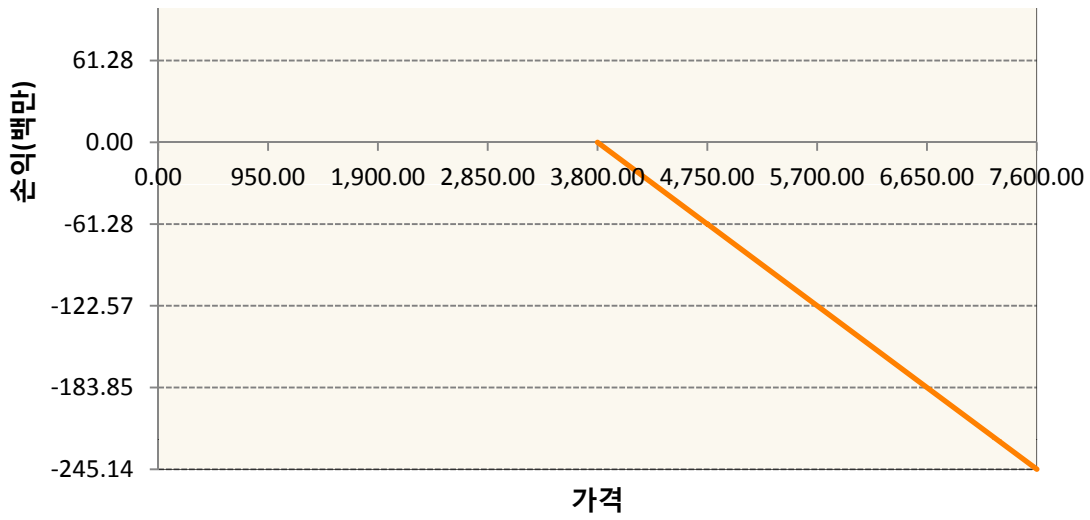
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXF0-C3775-EURO STOXX 50**

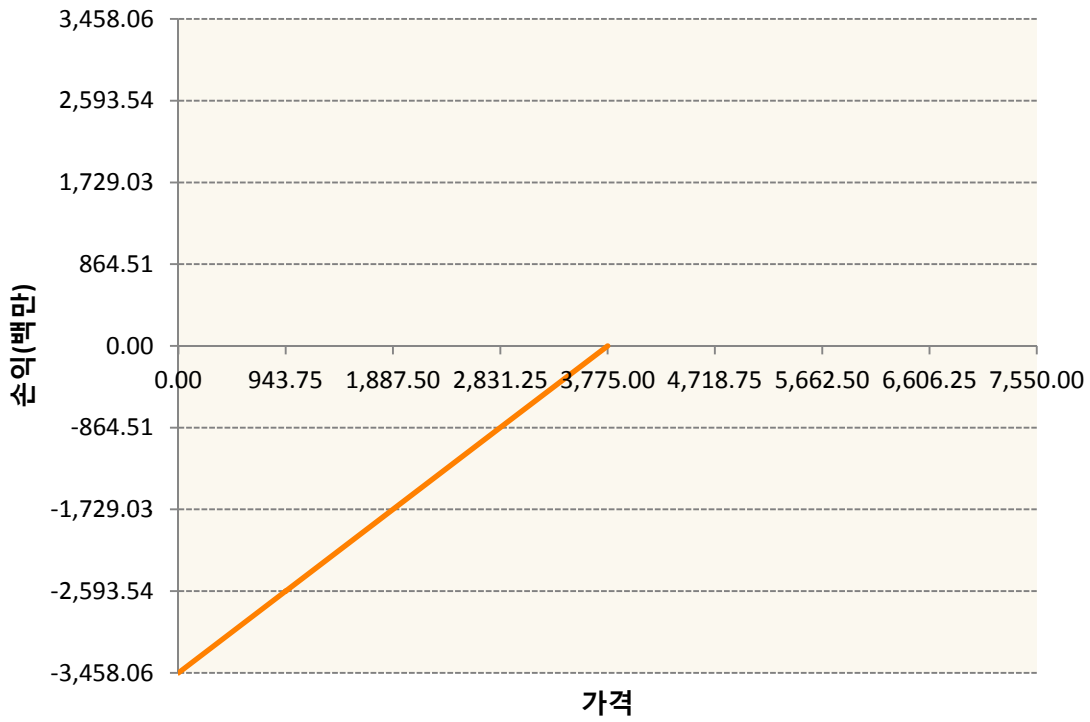


**OESXF0-C3800-EURO STOXX 50**

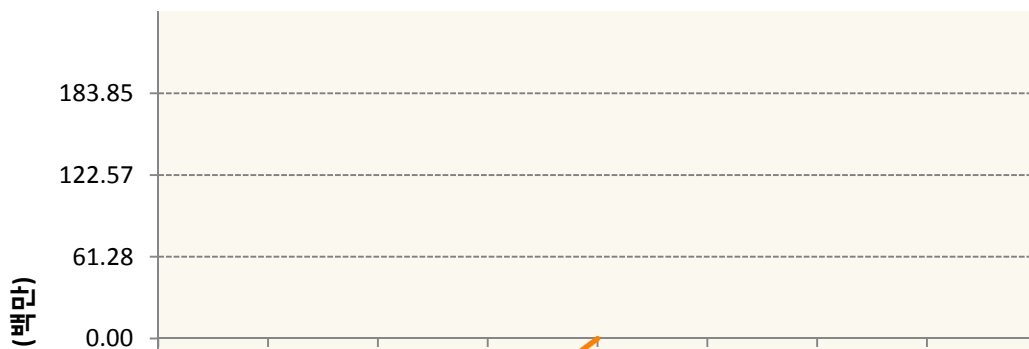


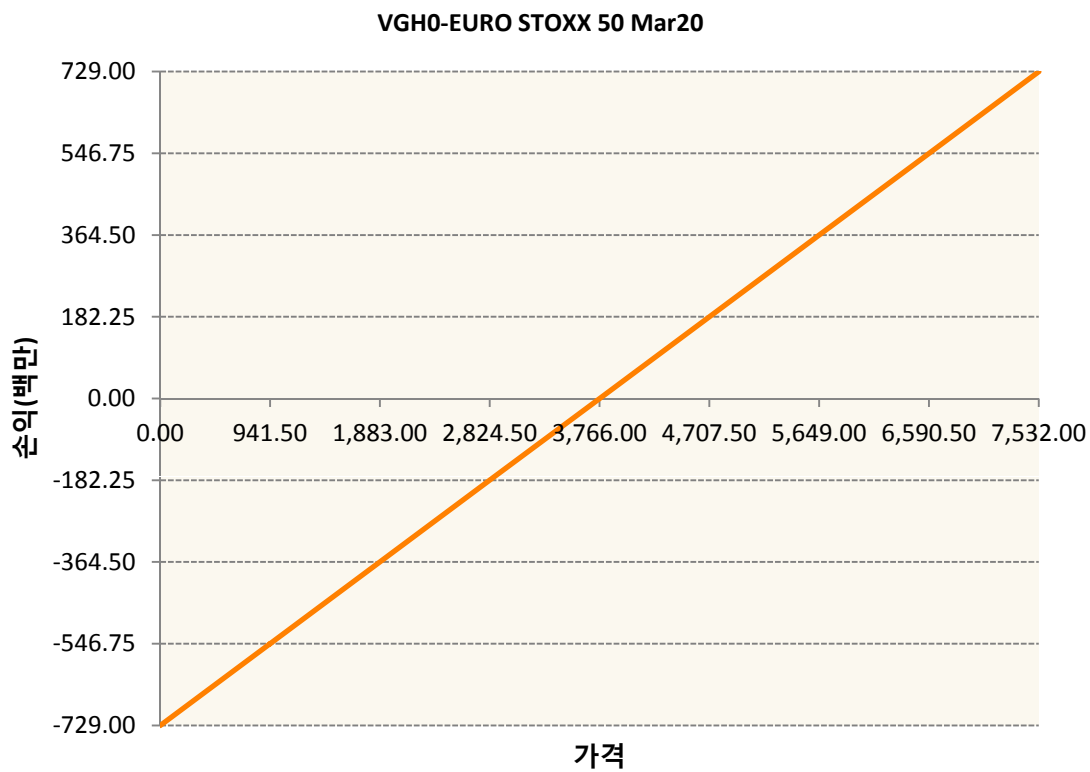
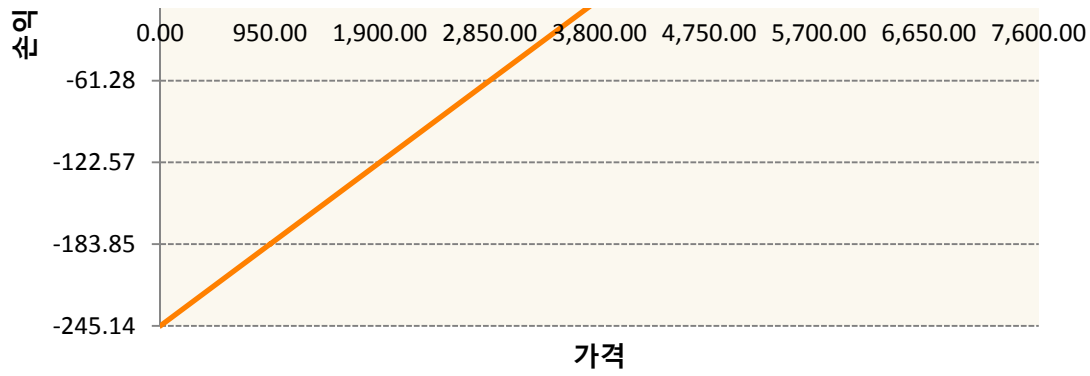


OESXF0-P3775-EURO STOXX 50



OESXF0-P3800-EURO STOXX 50





**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  |
| OESXF0-C37 EURO STOXX 50                | 277 |
| OESXF0-C38 EURO STOXX 50                | 20  |
| OESXF0-P37 EURO STOXX 50                | 277 |
| OESXF0-P38 EURO STOXX 50                | 20  |
| VGHO EURO STOXX 50 Mar20                | 58  |

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

(단위:백만원)

807



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

(단위:백만원)

938



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

(단위:백만원)

83



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

(단위:백만원)

115



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

(단위:백만원)

41

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-12-26 |
| 기준일 | 2019-12-24 |

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

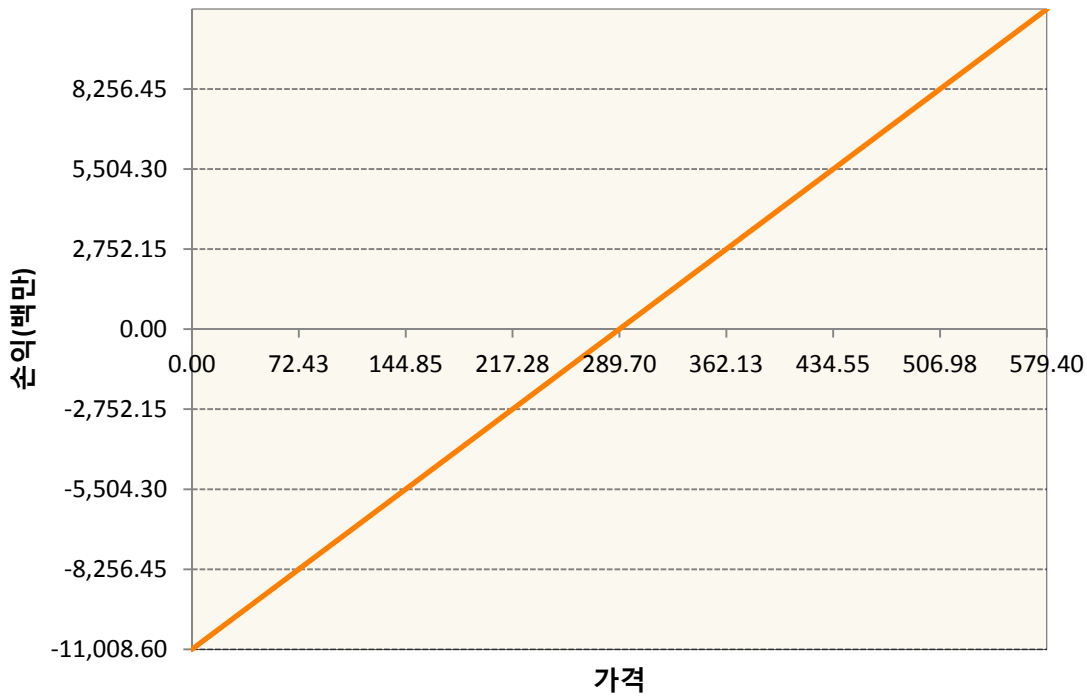
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

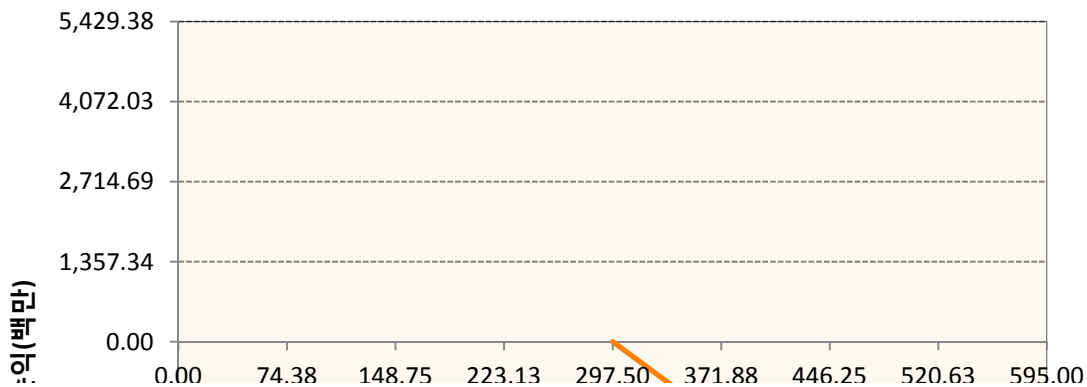
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0      | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 11,009 | 0      | 11,009    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 499    | 21,254 | -20,756   | 장내 |

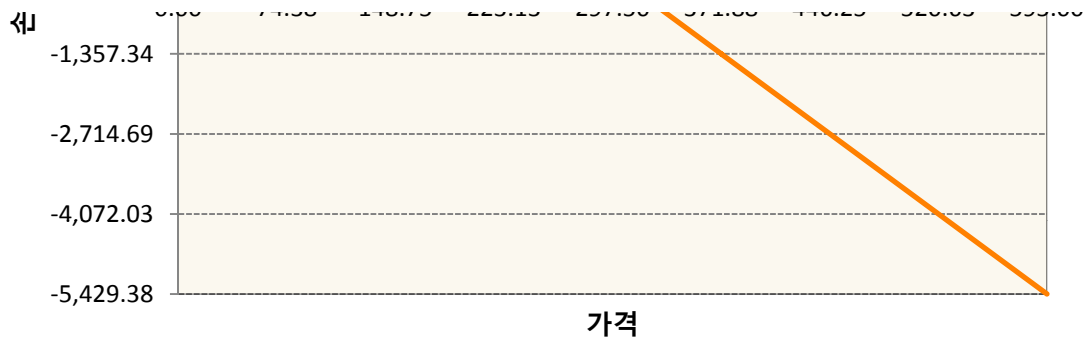
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

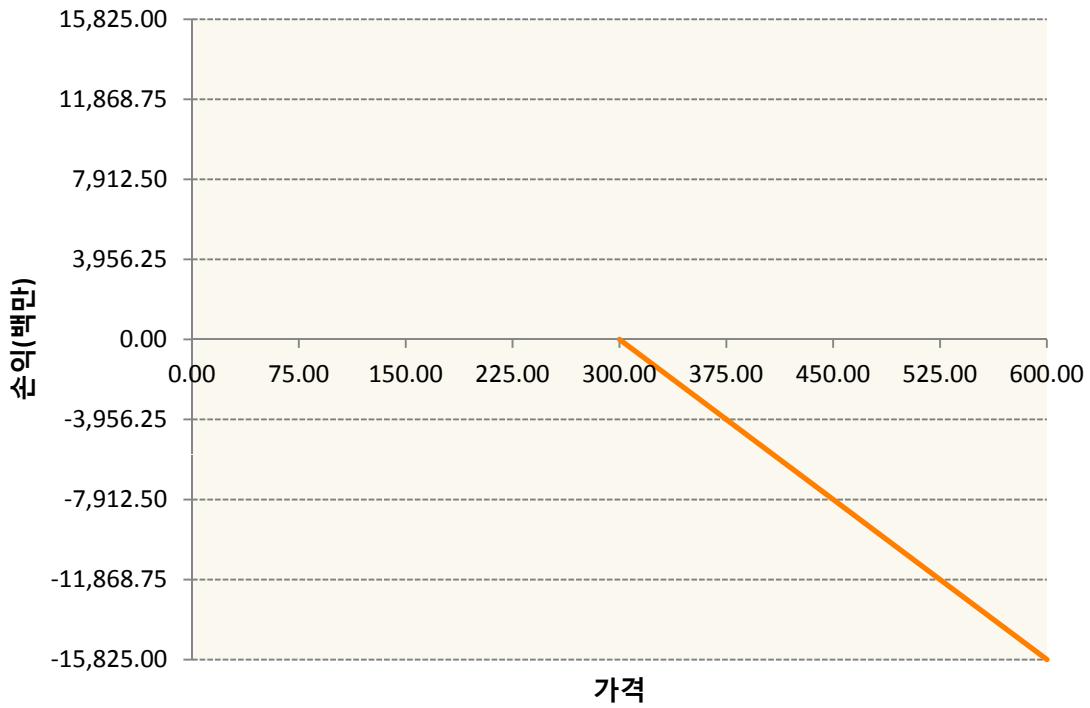


KR4201Q12977-2020-01 콜297.5

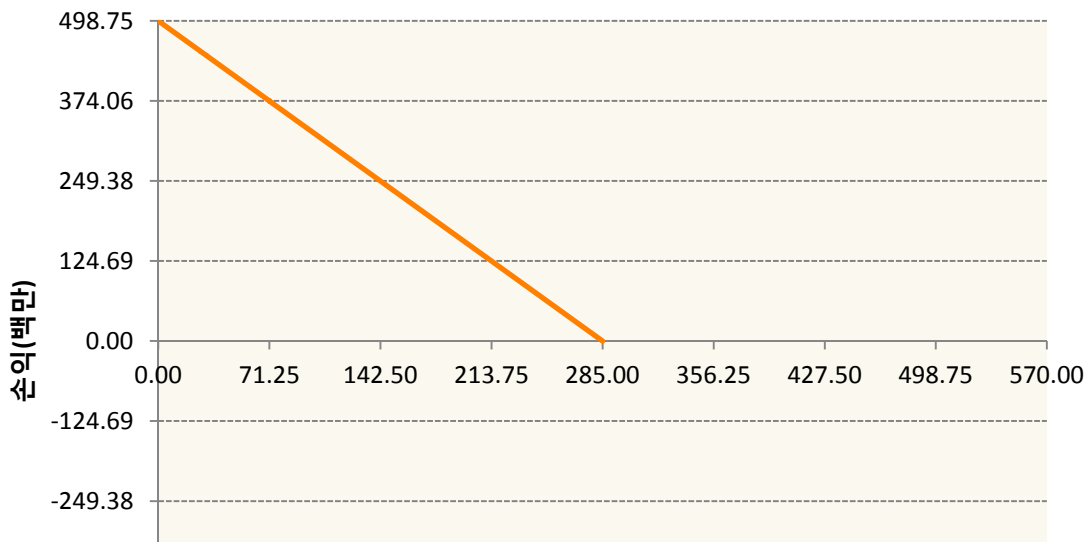


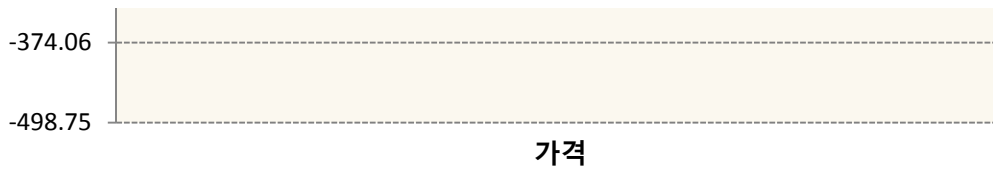


KR4201Q13009-2020-01 콜300



KR4301Q12850-2020-01 풋285





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| KR4101Q30005 |         | 2020-03 코스피200지수선물 |        |      |       |        |        | 890 |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | -890    | -890               | -890   | -890 | -890  | -890   | -890   |     |
| -5.33%       | -594    | -594               | -594   | -594 | -594  | -594   | -594   |     |
| -2.67%       | -297    | -297               | -297   | -297 | -297  | -297   | -297   |     |
| 0%           | 0       | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |     |
| 2.67%        | 297     | 297                | 297    | 297  | 297   | 297    | 297    |     |
| 5.33%        | 594     | 594                | 594    | 594  | 594   | 594    | 594    |     |
| 8.00%        | 890     | 890                | 890    | 890  | 890   | 890    | 890    |     |
| KR4201Q12977 |         | 2020-01 콜297.5     |        |      |       |        |        | 300 |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | 89      | 87                 | 86     | 84   | 81    | 77     | 73     |     |
| -5.33%       | 84      | 81                 | 76     | 72   | 66    | 60     | 54     |     |
| -2.67%       | 68      | 61                 | 54     | 46   | 38    | 29     | 20     |     |
| 0%           | 31      | 20                 | 10     | 0    | -10   | -21    | -31    |     |
| 2.67%        | -38     | -49                | -60    | -70  | -81   | -92    | -102   |     |
| 5.33%        | -139    | -147               | -155   | -164 | -174  | -183   | -193   |     |
| 8.00%        | -261    | -266               | -272   | -278 | -285  | -292   | -300   |     |
| KR4201Q13009 |         | 2020-01 콜300       |        |      |       |        |        | 814 |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | 210     | 208                | 205    | 200  | 193   | 185    | 175    |     |
| -5.33%       | 202     | 194                | 185    | 173  | 160   | 145    | 128    |     |
| -2.67%       | 169     | 152                | 133    | 113  | 91    | 69     | 45     |     |
| 0%           | 83      | 56                 | 28     | 0    | -29   | -58    | -87    |     |
| 2.67%        | -86     | -118               | -149   | -180 | -212  | -243   | -274   |     |
| 5.33%        | -348    | -375               | -403   | -431 | -460  | -489   | -519   |     |
| 8.00%        | -685    | -702               | -722   | -743 | -765  | -789   | -814   |     |
| KR4301Q12850 |         | 2020-01 풋285       |        |      |       |        |        | 26  |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | 26      | 26                 | 26     | 26   | 26    | 26     | 26     |     |
| -5.33%       | 13      | 13                 | 13     | 14   | 14    | 14     | 15     |     |
| -2.67%       | 3       | 3                  | 4      | 4    | 5     | 5      | 6      |     |

|       |    |    |    |    |    |    |    |
|-------|----|----|----|----|----|----|----|
| 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)

**1,735**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-12-26 |
| 기준일 | 2019-12-24 |

## 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 | 205,673 | 0     | 205,673   |    |

### 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 | 2019-12-26 |
| 기준일 | 2019-12-24 |

## 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 | 214,685 | 0     | 214,685   |    |

### 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 | 2019-12-26 |
| 기준일 | 2019-12-24 |

## 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 | 529,916 | 0       | 529,916   |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0       | 569,729 | -569,729  | 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 |                                 | 1,499 |
| FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E |                                 | 1,862 |
| FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E |                                 | 3,203 |
| FX21019X02 KRW/USD 26-12-19E |                                 | 4,693 |
| FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E |                                 | 4,749 |
| FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E |                                 | 186   |
| FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E |                                 | 2,793 |
| FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E |                                 | 2,793 |
| FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E |                                 | 2,328 |
| FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E |                                 | 2,514 |
| FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E |                                 | 1,620 |
| FX21019Z00 KRW/USD 10-01-20E |                                 | 1,117 |
| FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E |                                 | 1,527 |
| FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E |                                 | 931   |
| FX21019Z02 KRW/USD 16-01-20E |                                 | 1,676 |
| 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 |                                 | 3,724 |
| FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E |                                 | 1,862 |
| 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)

187

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-12-26 |
| 기준일 | 2019-12-24 |

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

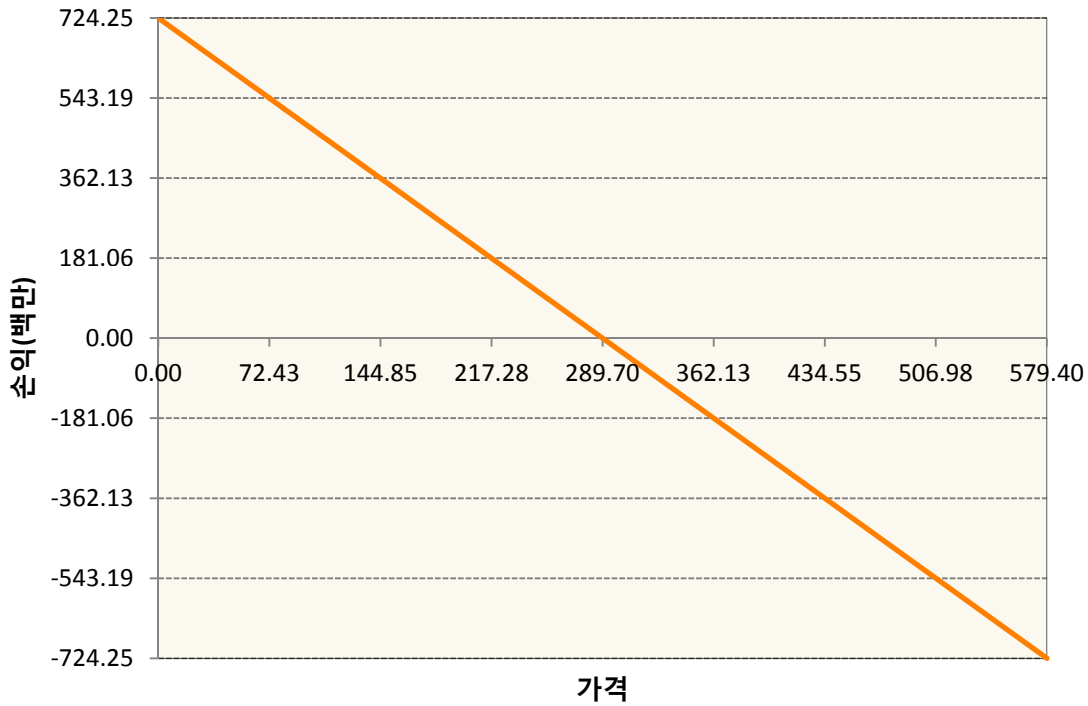
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

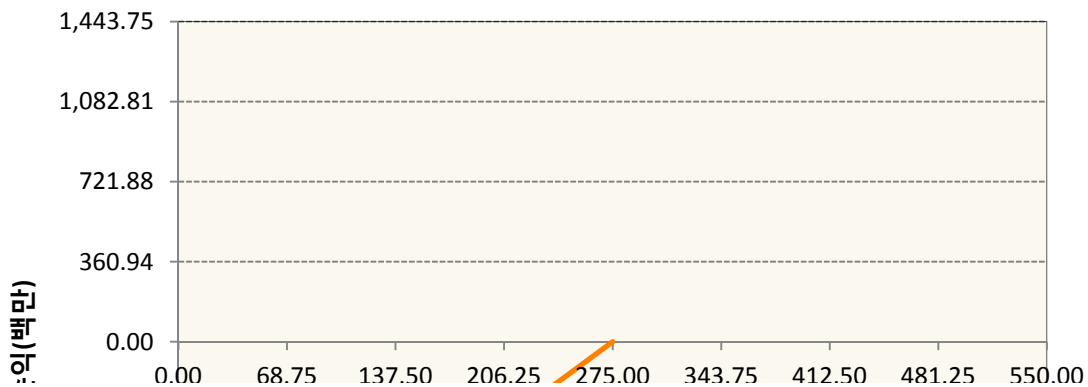
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 0     | 724   | -724      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 3,941 | -3,941    | 장내 |

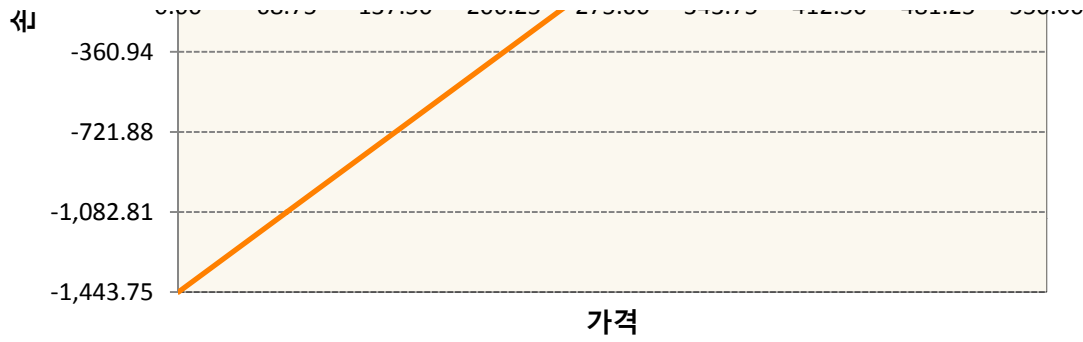
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

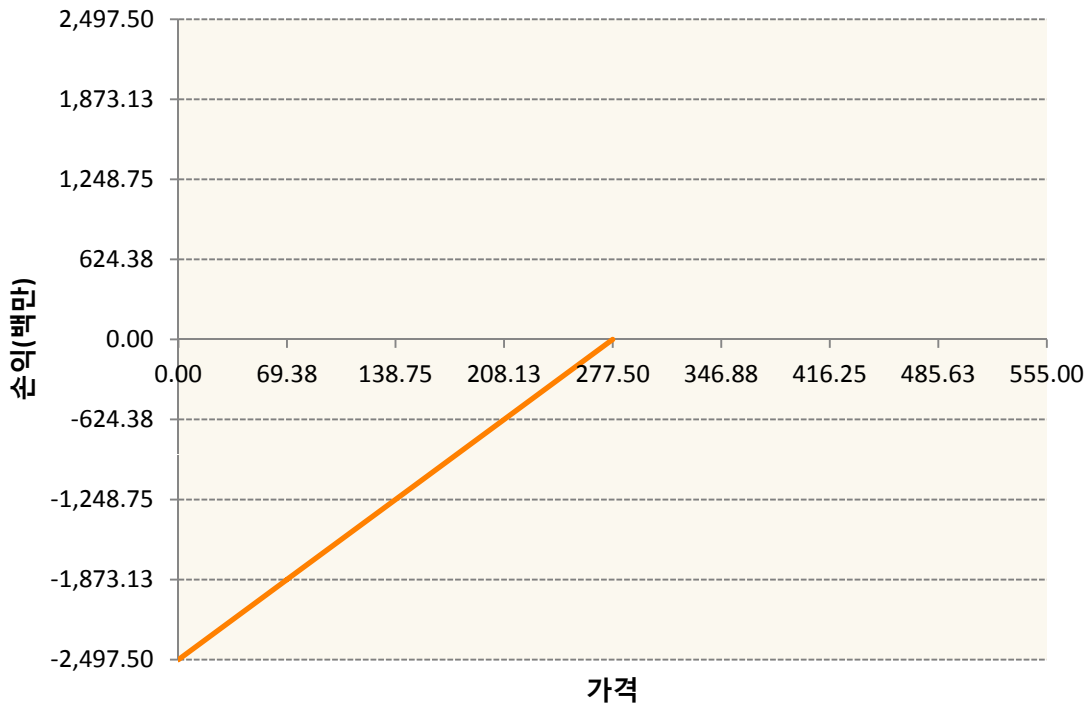


KR4301Q12751-2020-01 풋275





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       |        |     |       |        |        | 39 |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |     |       |        |        |    |

|        |         |         |        |     |       |        |        |
|--------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격     | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -32     | -33     | -34    | -35 | -36   | -38    | -39    |
| -5.33% | -8      | -9      | -10    | -12 | -13   | -14    | -16    |
| -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                      83

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |     |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | -74     | -75     | -77    | -78 | -80   | -81    | -83    |
| -5.33%    | -22     | -25     | -27    | -30 | -32   | -35    | -37    |
| -2.67%    | -2      | -3      | -5     | -6  | -8    | -10    | -12    |
| 0%        | 1       | 1       | 0      | 0   | -1    | -1     | -2     |
| 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)

**96**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-12-26 |
| 기준일 | 2019-12-24 |

## 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 | 13,612 | 0      | 13,612    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 943    | 14,386 | -13,443   | 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)

|            |
|------------|
| <b>394</b> |
|------------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-12-26 |
| 기준일 | 2019-12-24 |

## 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   | 464   | -155      | 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  |
| FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E | 3  |

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

(단위:백만원)

|           |
|-----------|
| <b>80</b> |
|-----------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-12-26 |
| 기준일 | 2019-12-24 |

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

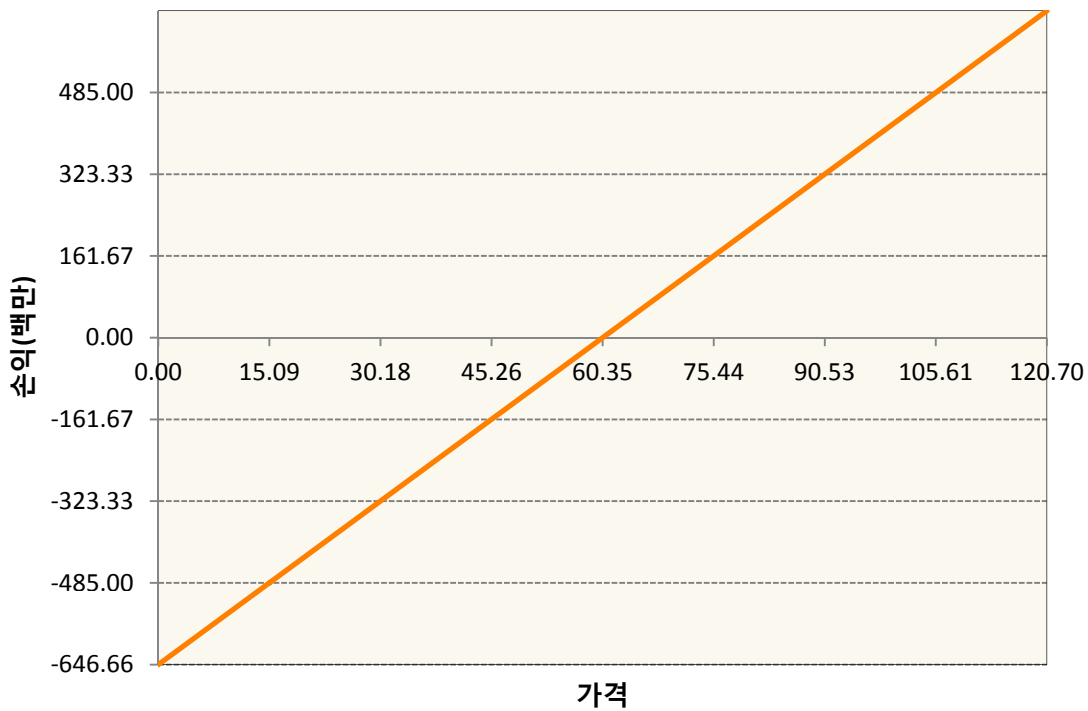
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

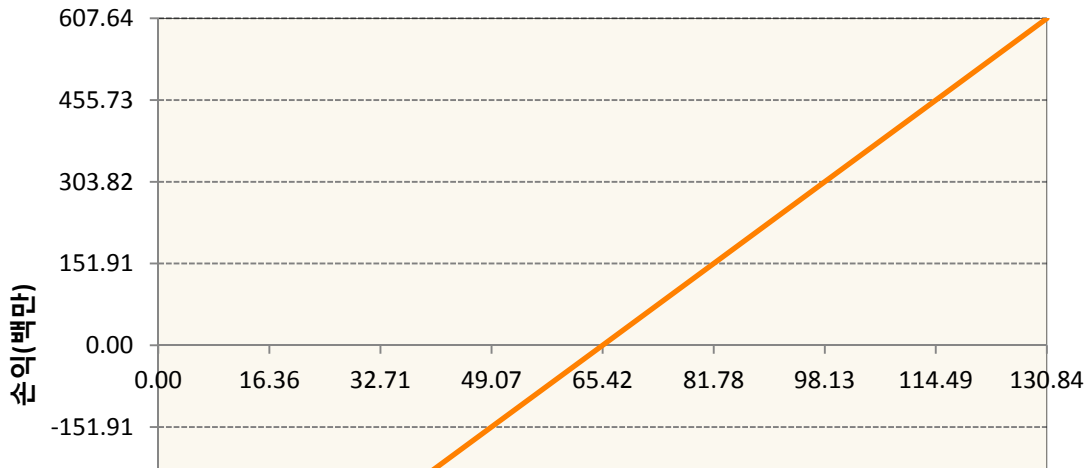
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,421 | 291   | 2,131     |    |

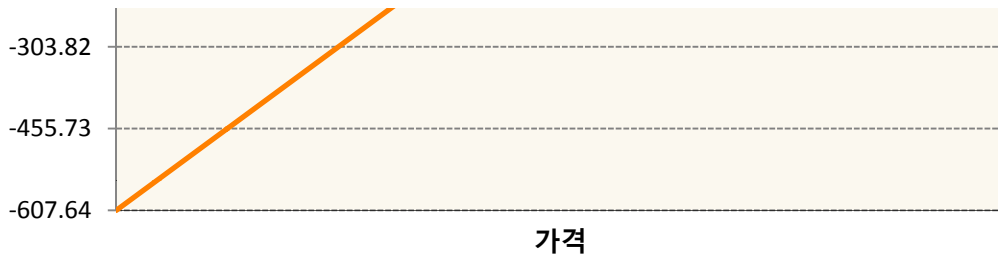
### 2. 만기시점의 손익구조

CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20

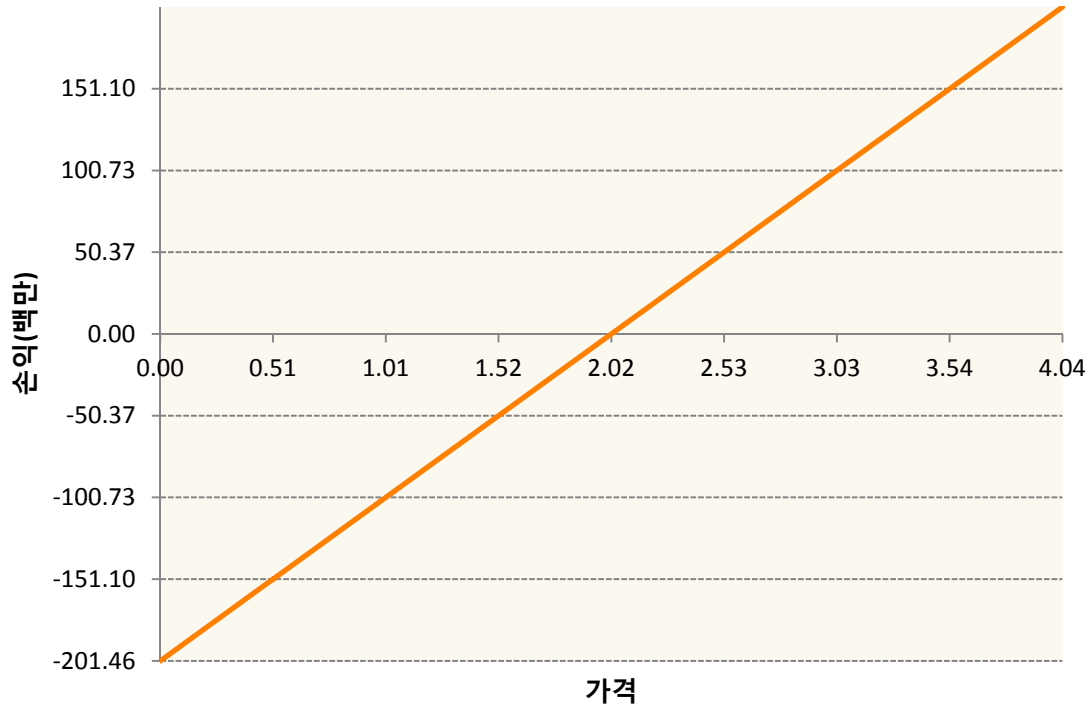


COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20

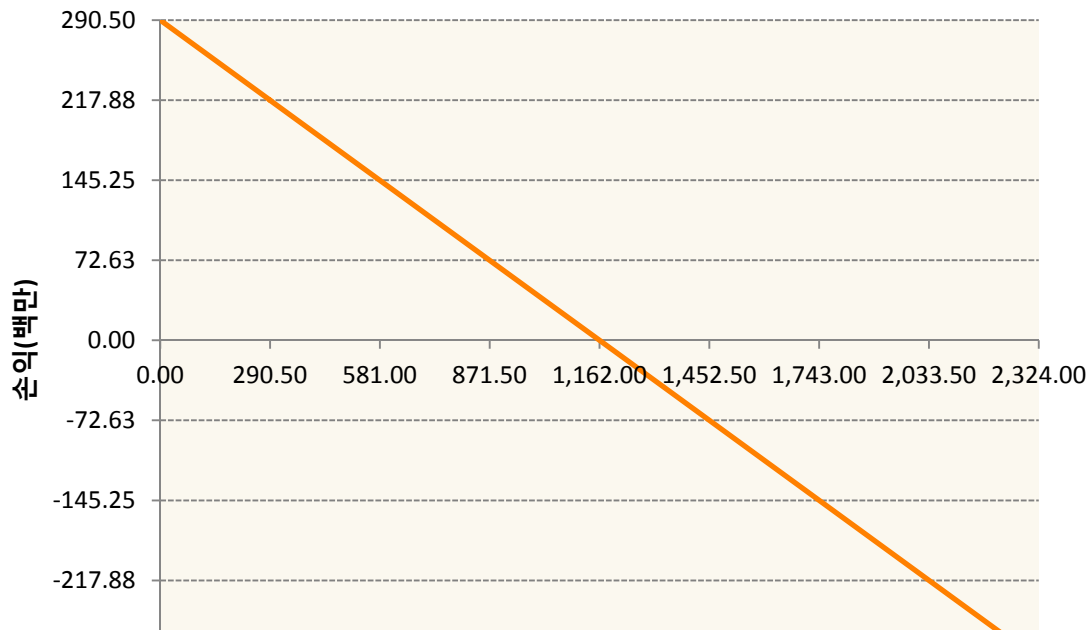


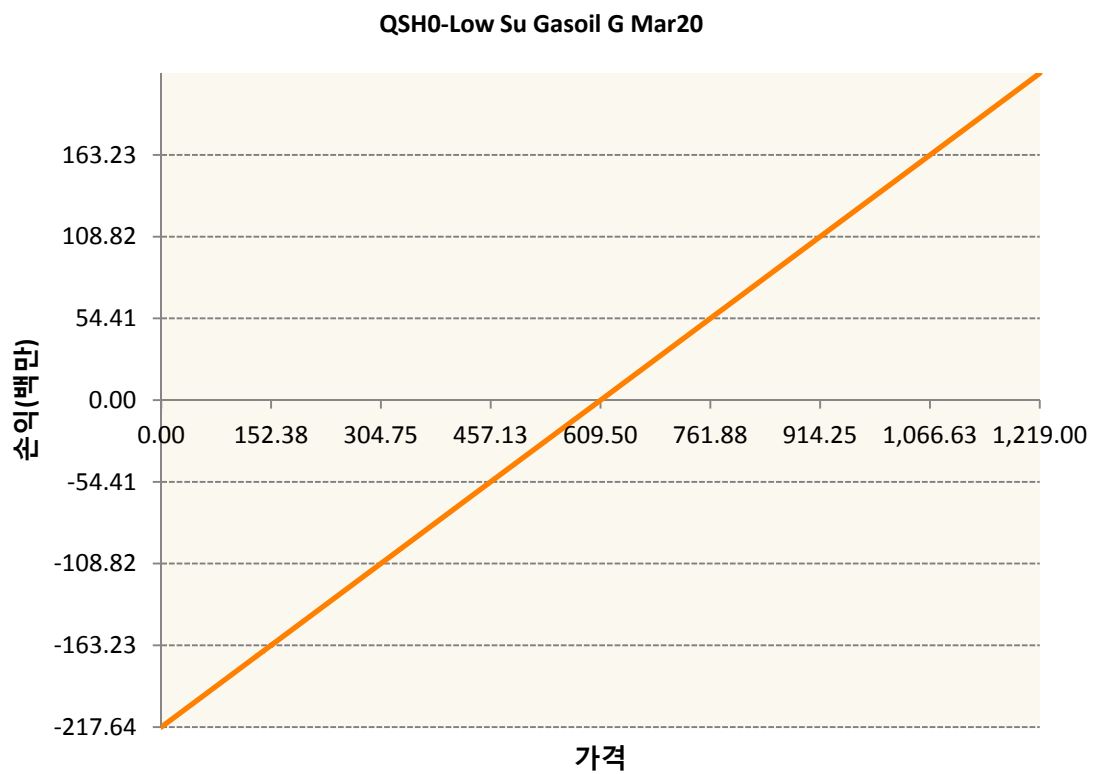
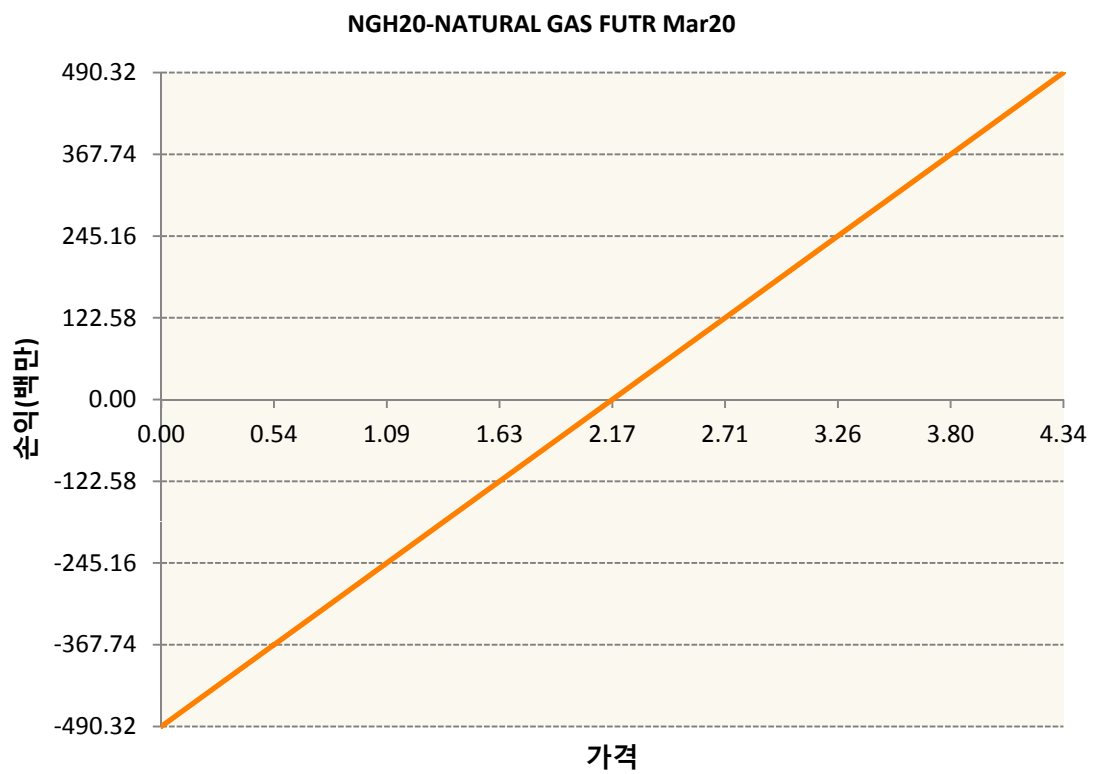
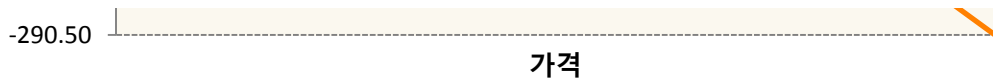


**HOH0-NY Harb ULSD Fut Mar20**

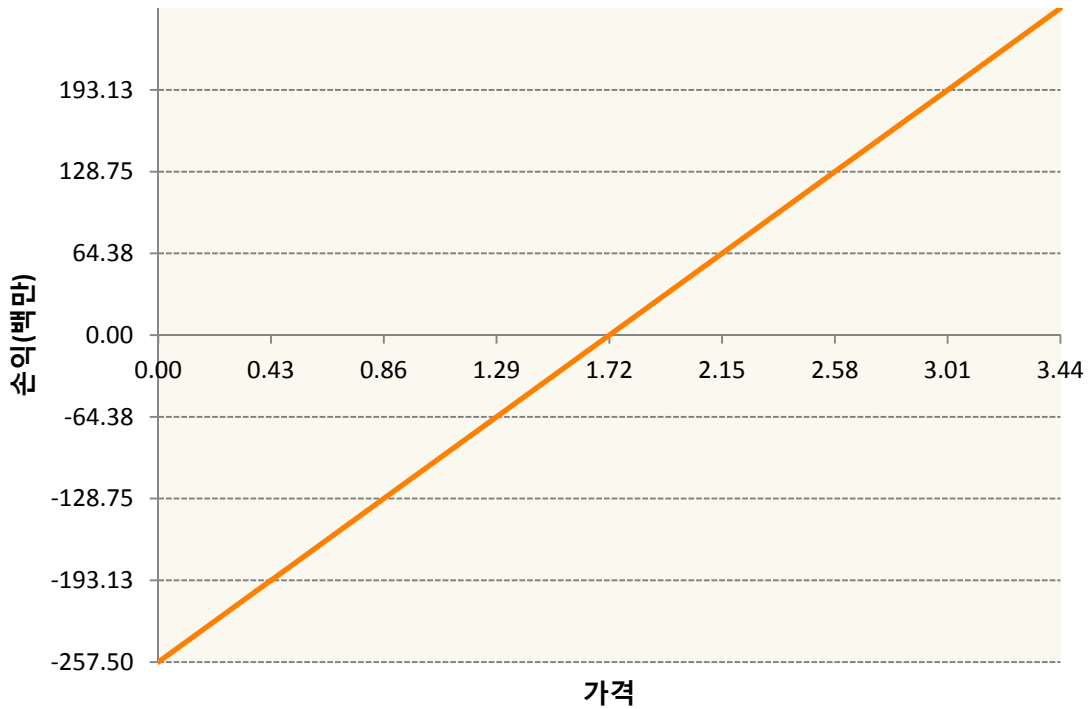


**KR4175Q10001-2020-01 달러선물**





**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  | 39 |
| QSH0       | Low Su Gasoil G Mar20   | 17 |
| XBH0       | GASOLINE RBOB FUT Mar20 | 21 |

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

**385**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2019-12-26 |
| 기준일 | 2019-12-24 |

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

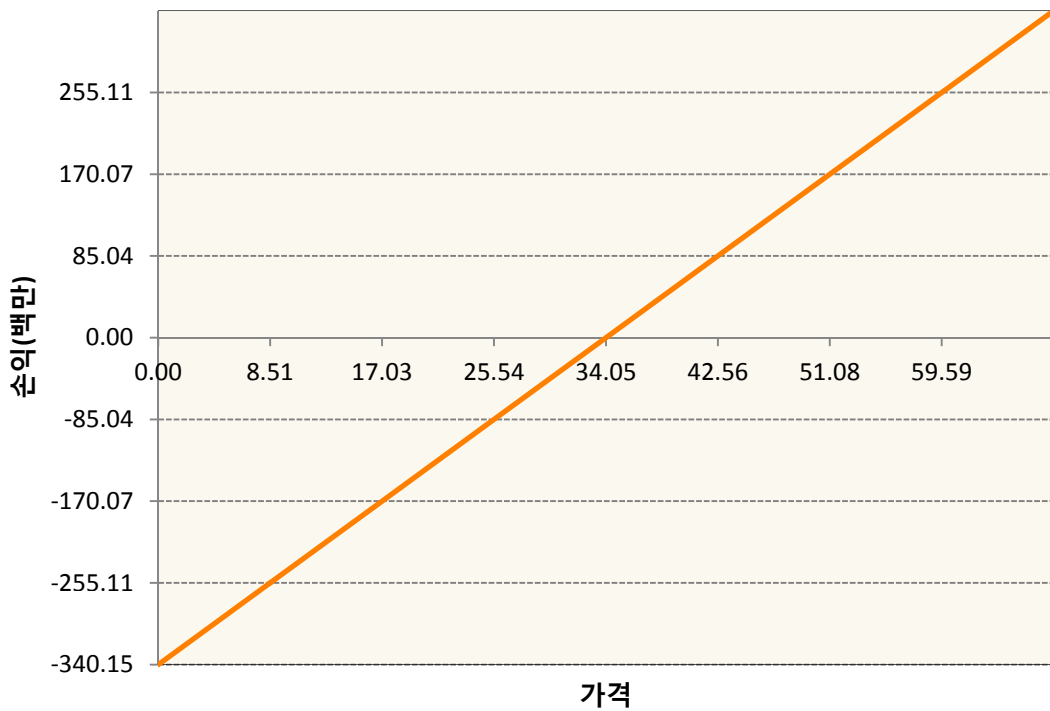
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

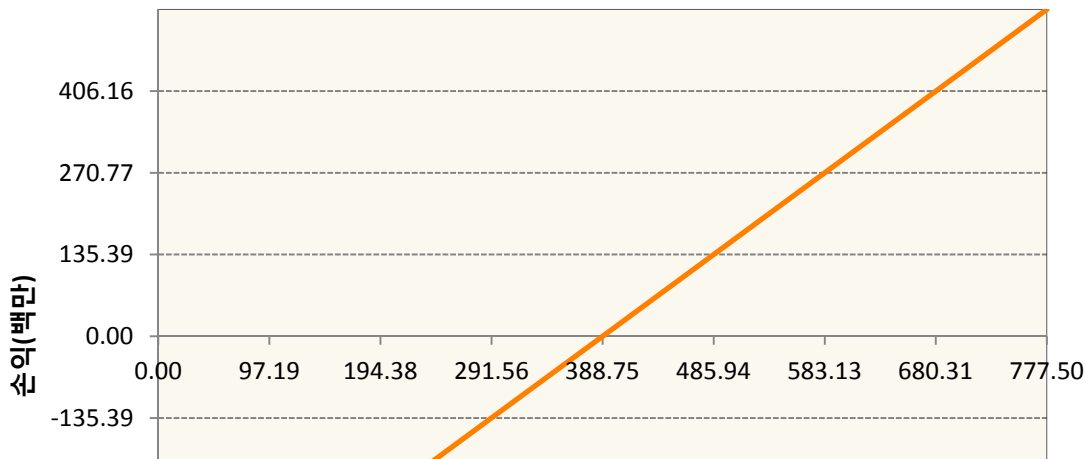
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,837 | 116   | 2,720     |    |

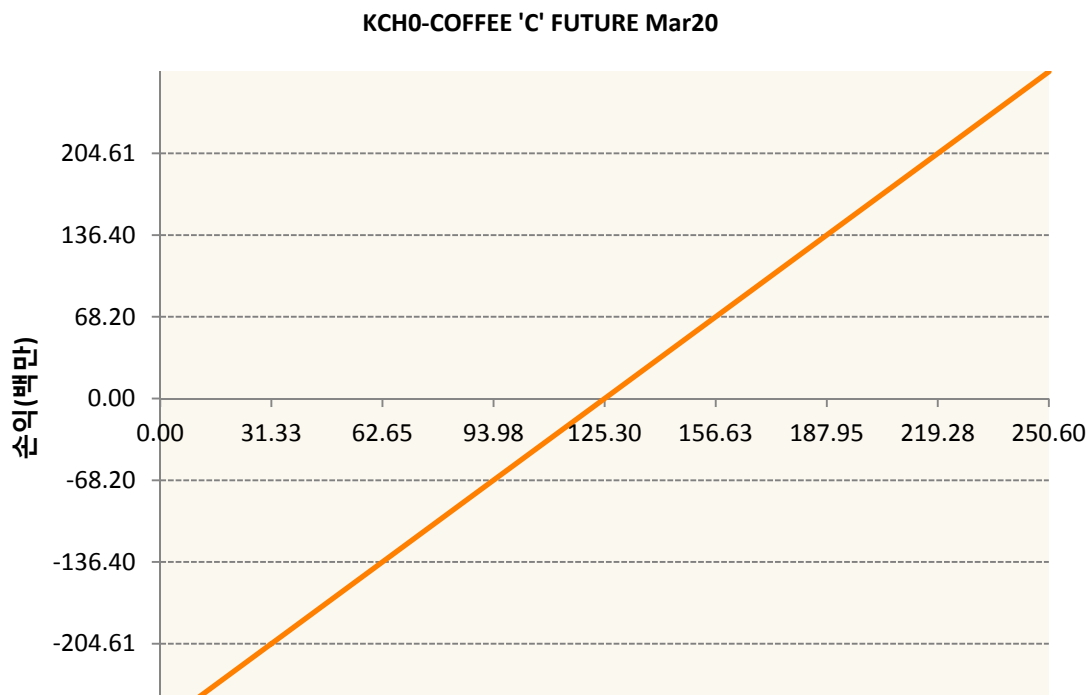
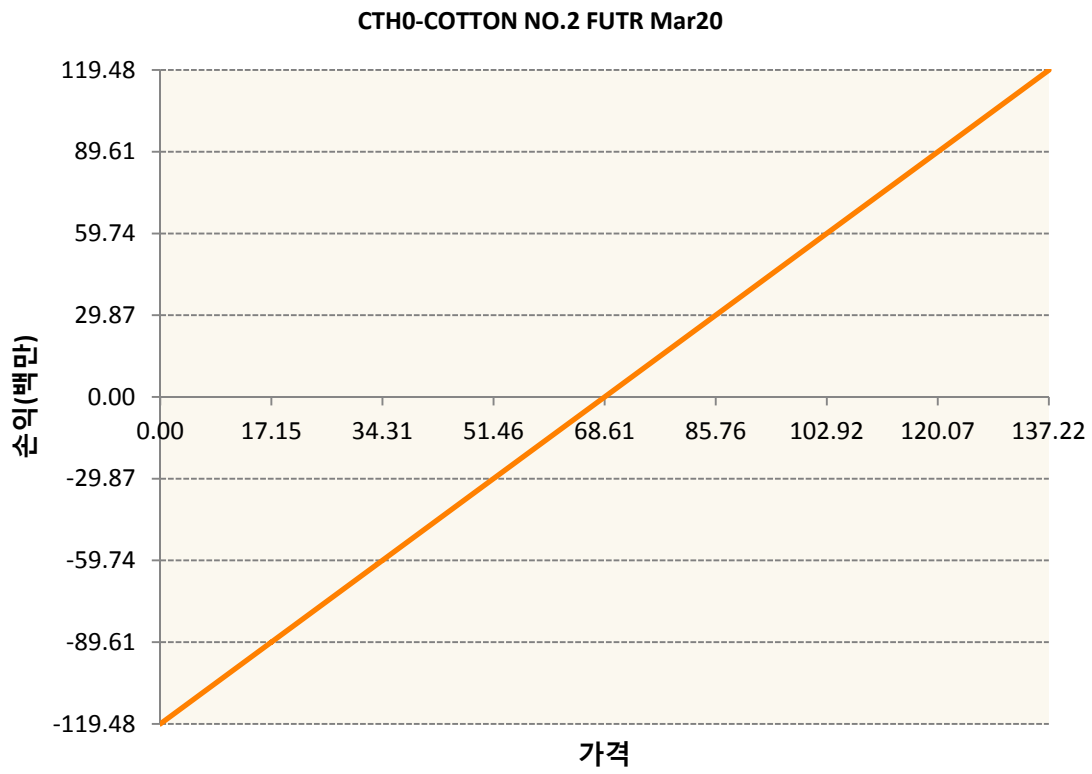
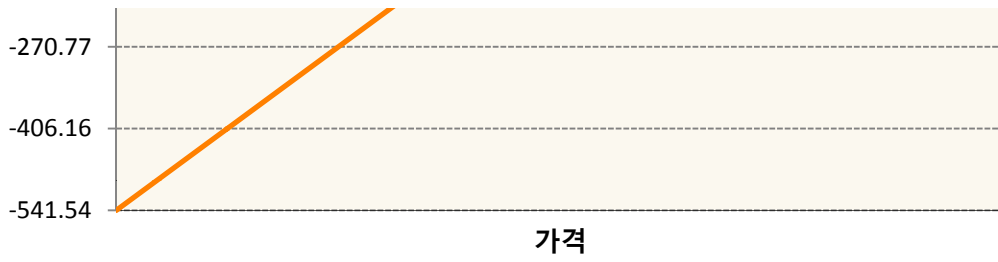
### 2. 만기시점의 손익구조

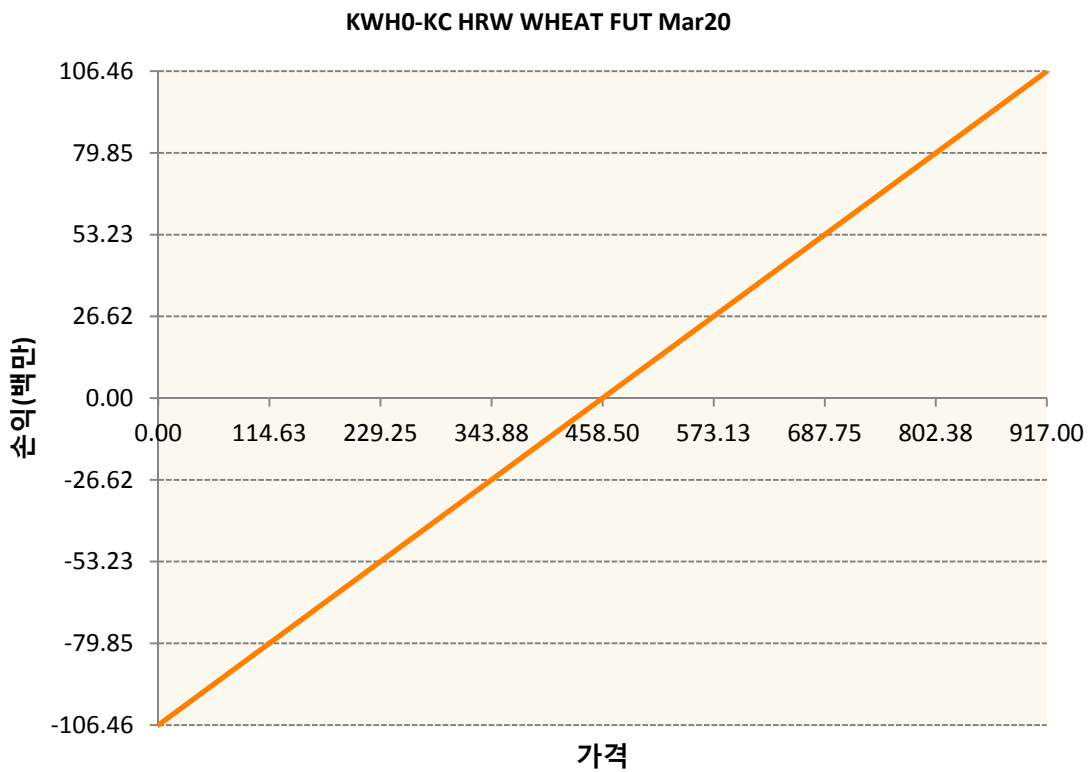
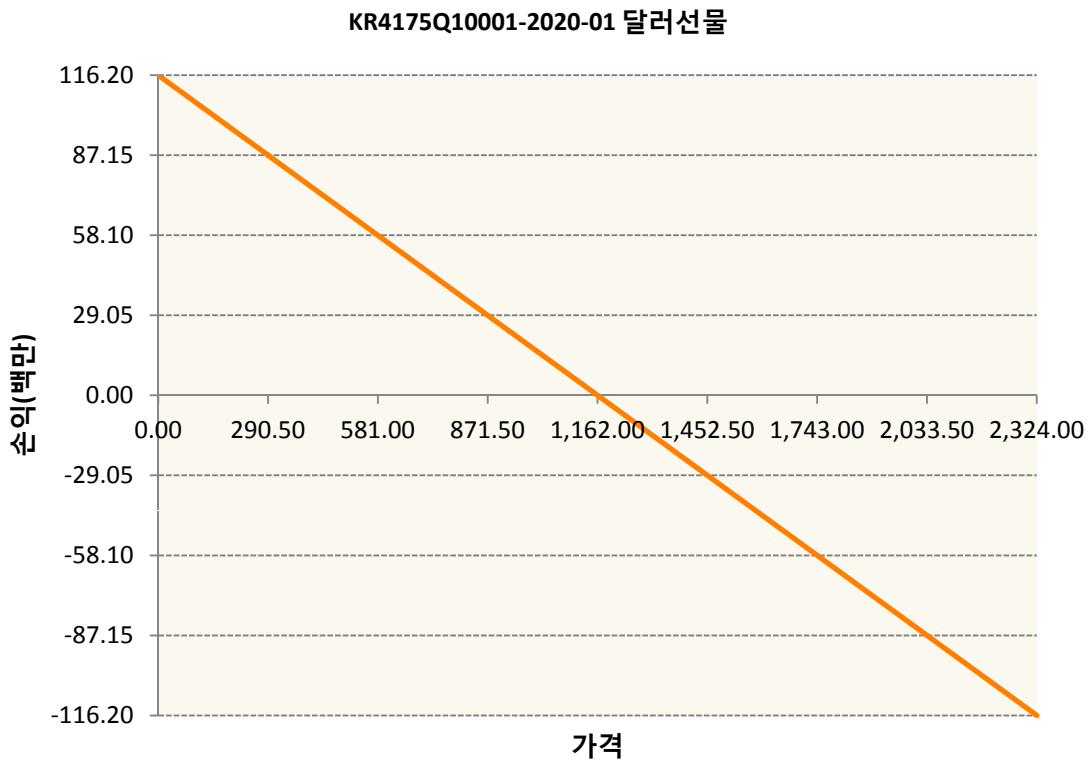
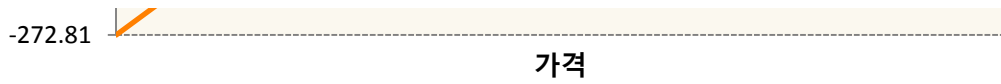
**BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20**



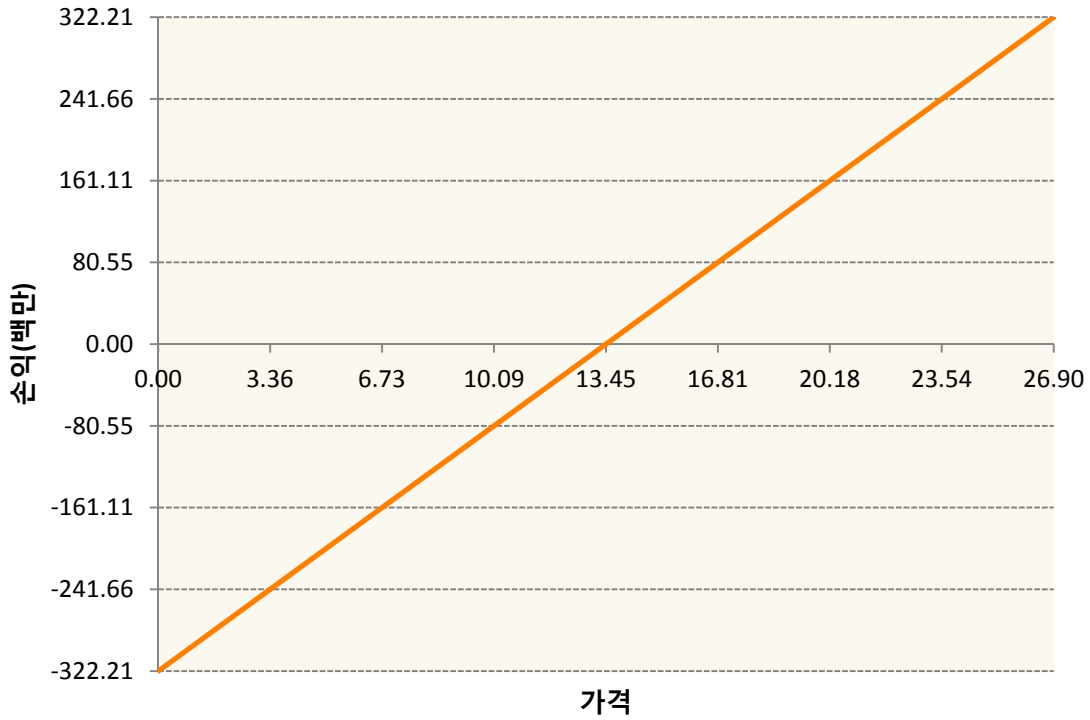
**CH0-CORN FUTURE Mar20**



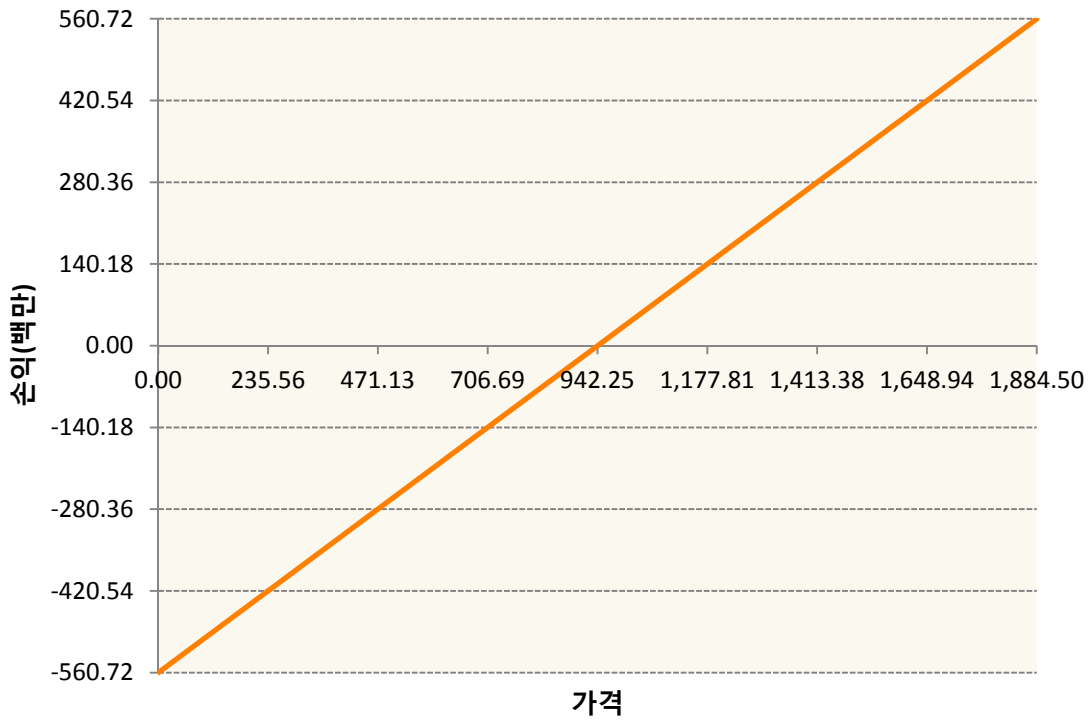




SBH0-Sugar Mar20

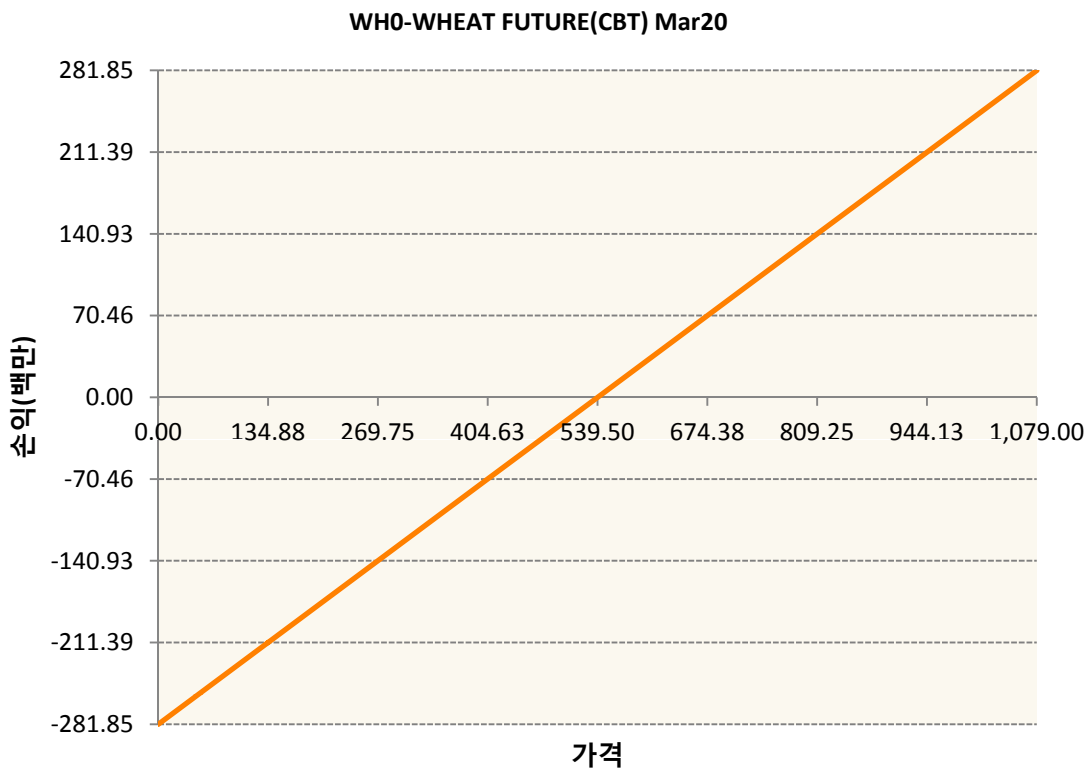
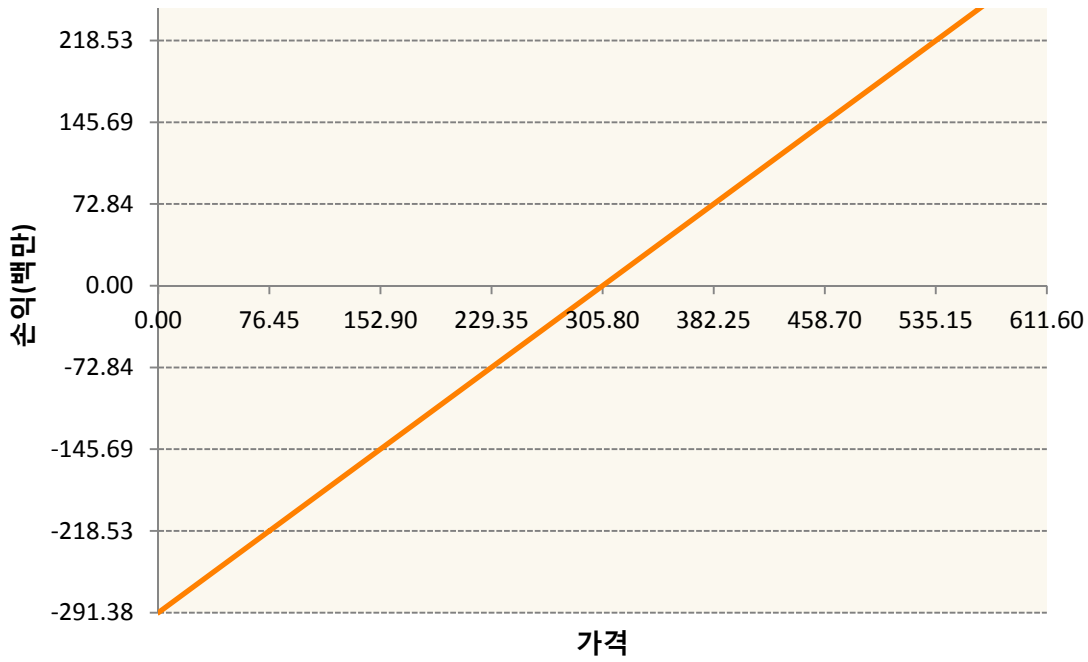


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20



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  | 10 |
| 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)

**248**