

공시일	2019-12-27
기준일	2019-12-26

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	2019-12-27
기준일	2019-12-26

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	2019-12-27
기준일	2019-12-26

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)	401
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	147

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

762

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-27
기준일	2019-12-26

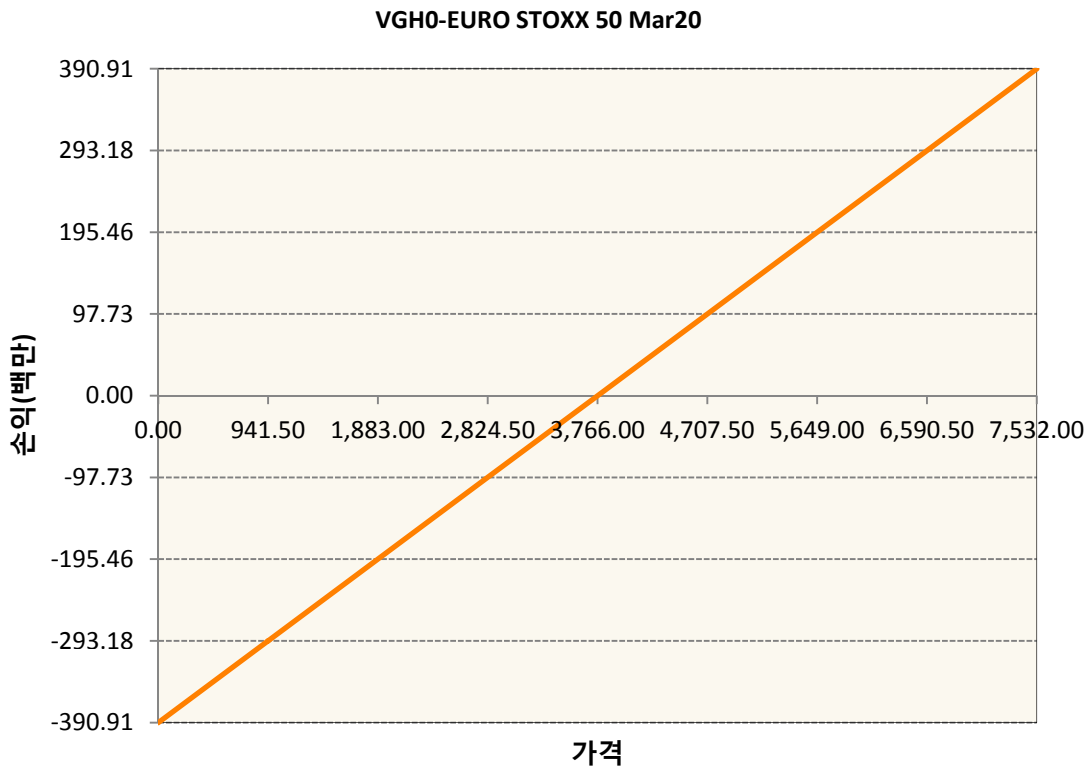
유로인덱스모(주식-파생형)

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



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

22

공시일	2019-12-27
기준일	2019-12-26

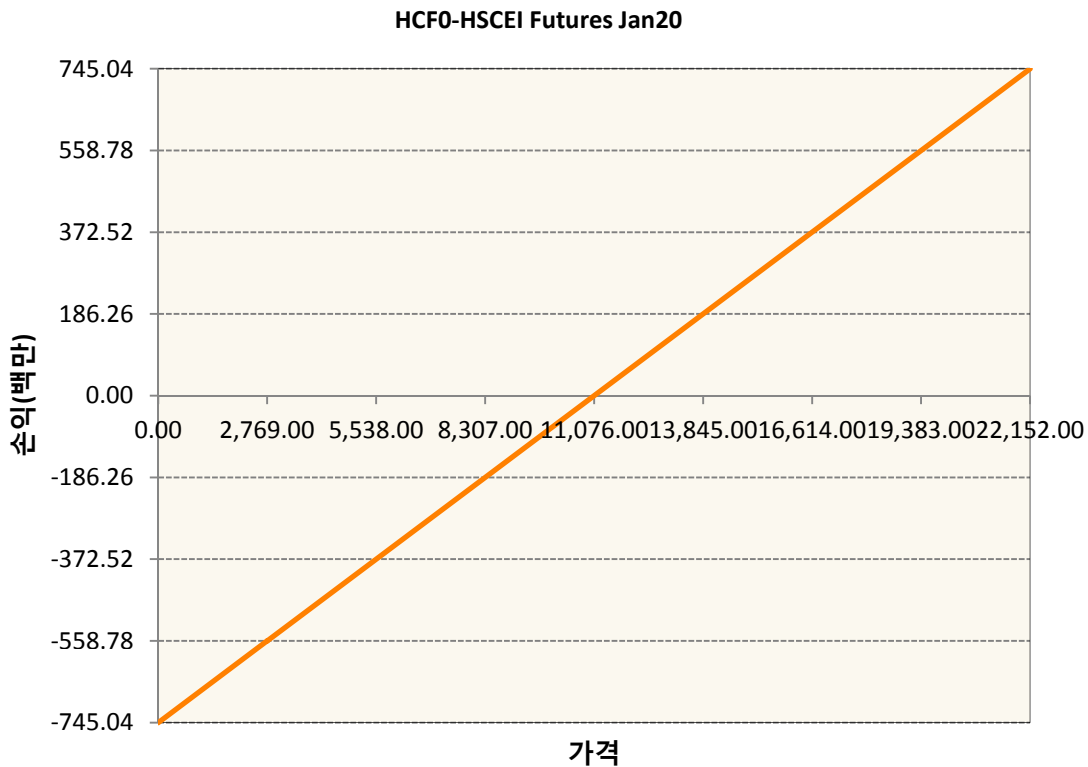
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2019-12-27
기준일	2019-12-26

커버드콜모(주식혼합-파생형)

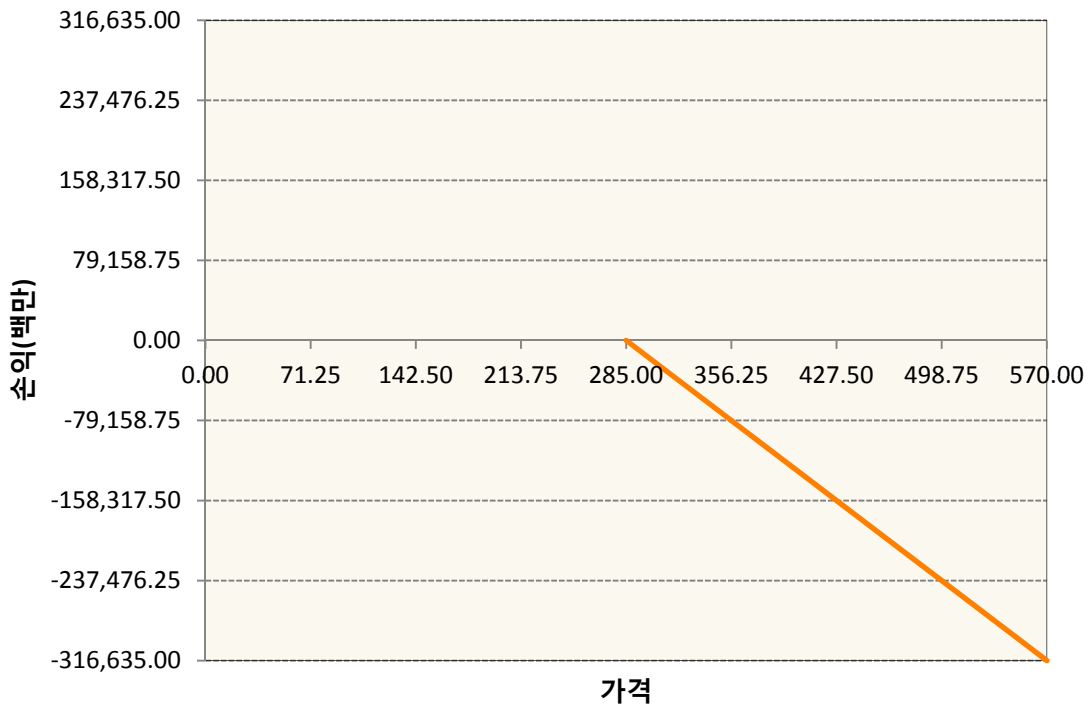
1. 계약금액

(단위:백만원)

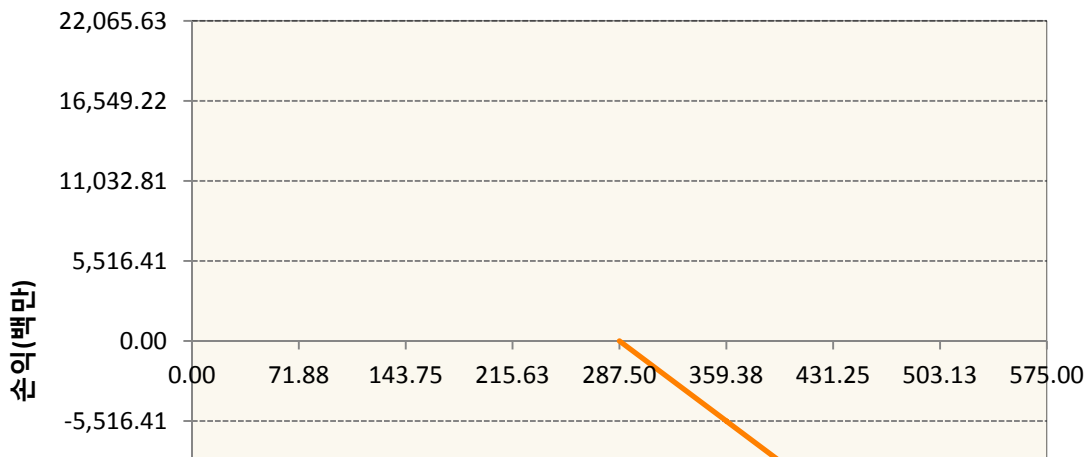
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	477,638	-477,638	장내

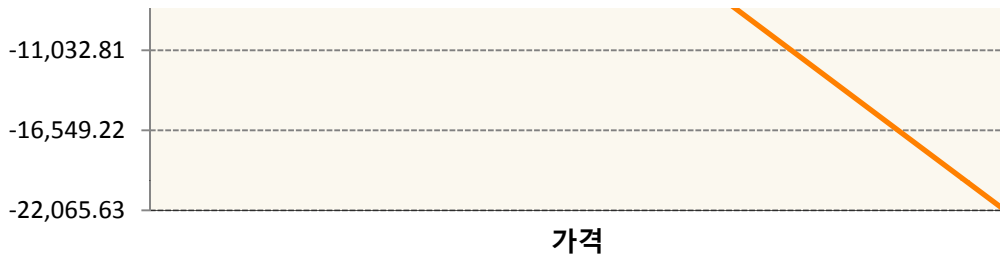
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q12852-2020-01 콜285

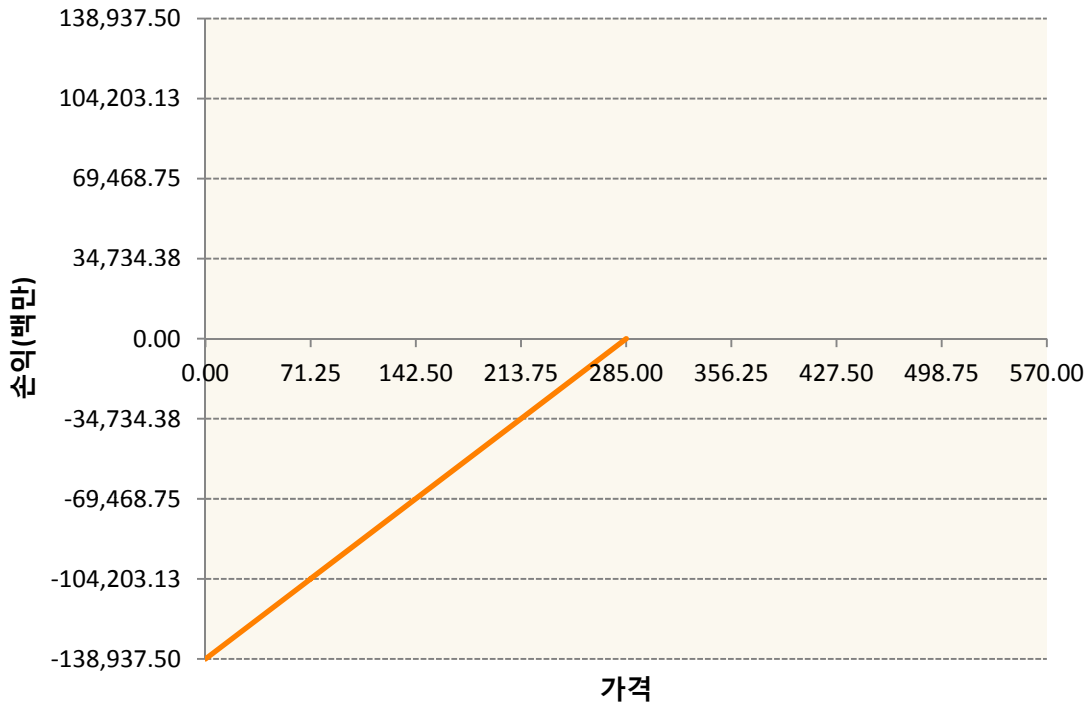


KR4201Q12878-2020-01 콜287.5





KR4301Q12850-2020-01 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q12852		2020-01 콜285					23,482
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12,542	12,261	11,942	11,591	11,213	10,812	10,391
-5.33%	10,880	10,381	9,868	9,345	8,814	8,277	7,734
-2.67%	7,260	6,676	6,092	5,507	4,922	4,337	3,752
0%	1,451	987	502	0	-515	-1,041	-1,575
2.67%	-5,998	-6,257	-6,558	-6,896	-7,265	-7,661	-8,080
5.33%	-14,295	-14,399	-14,542	-14,724	-14,943	-15,196	-15,481
8.00%	-22,900	-22,931	-22,984	-23,064	-23,173	-23,312	-23,482
KR4201Q12878		2020-01 콜287.5					1,574
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	753	738	720	700	677	653	627

-5.33%	669	639	607	573	539	504	468
-2.67%	466	425	385	344	304	263	223
0%	111	75	38	0	-38	-77	-116
2.67%	-372	-395	-420	-448	-477	-508	-540
5.33%	-931	-941	-954	-970	-989	-1,010	-1,033
8.00%	-1,521	-1,524	-1,529	-1,537	-1,547	-1,559	-1,574
KR4301Q12850 2020-01 풋285							6,968
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,843	-6,850	-6,862	-6,879	-6,903	-6,932	-6,968
-5.33%	-3,194	-3,263	-3,340	-3,424	-3,513	-3,606	-3,703
-2.67%	-641	-766	-892	-1,018	-1,144	-1,271	-1,398
0%	169	122	65	0	-72	-151	-235
2.67%	253	249	241	228	210	186	156
5.33%	255	255	255	254	252	248	242
8.00%	255	255	255	255	255	255	254

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

(단위:백만원)

31,984

공시일	2019-12-27
기준일	2019-12-26

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

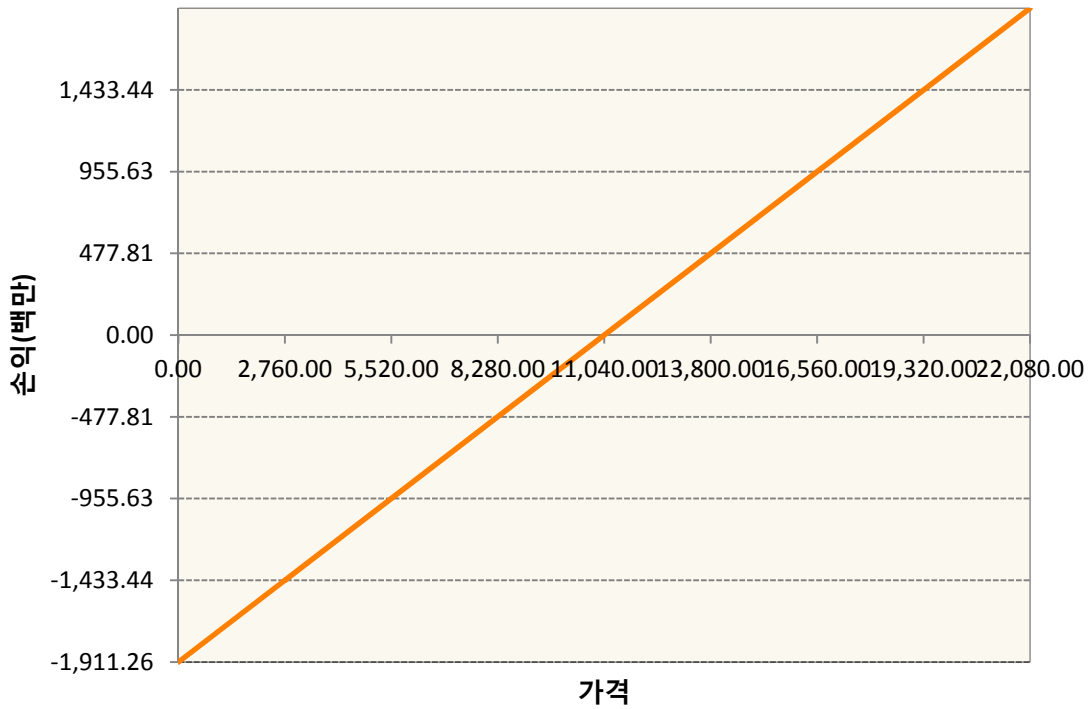
1. 계약금액

(단위:백만원)

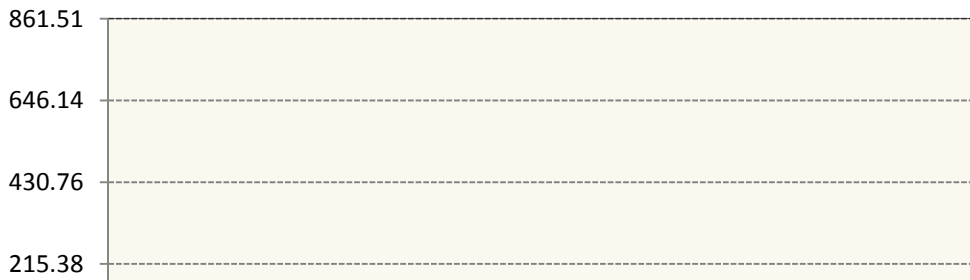
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,911	0	1,911	
누계	유가증권	옵션	0	4,807	-4,807	장내
누계	통화	선도	0	2,100	-2,100	장외

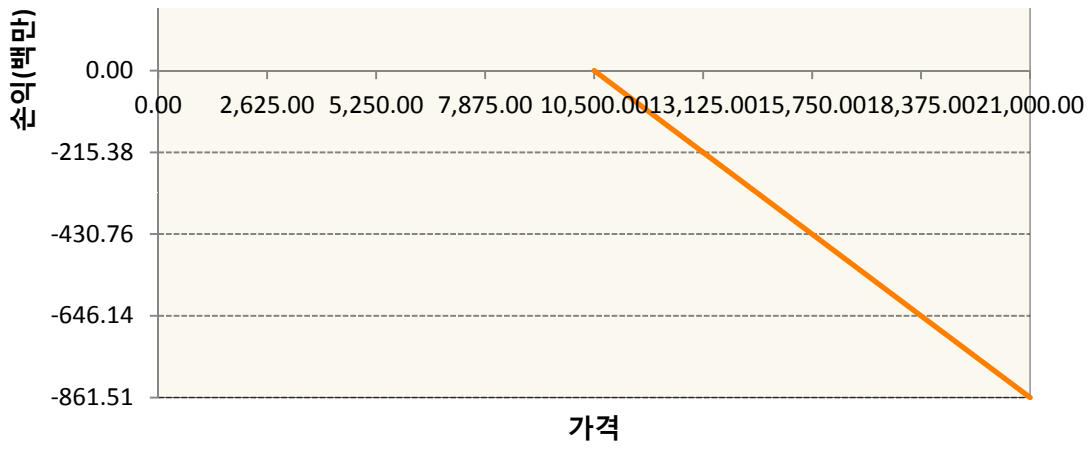
2. 만기시점의 손익구조

HCZ9-HSCEI Futures Dec19

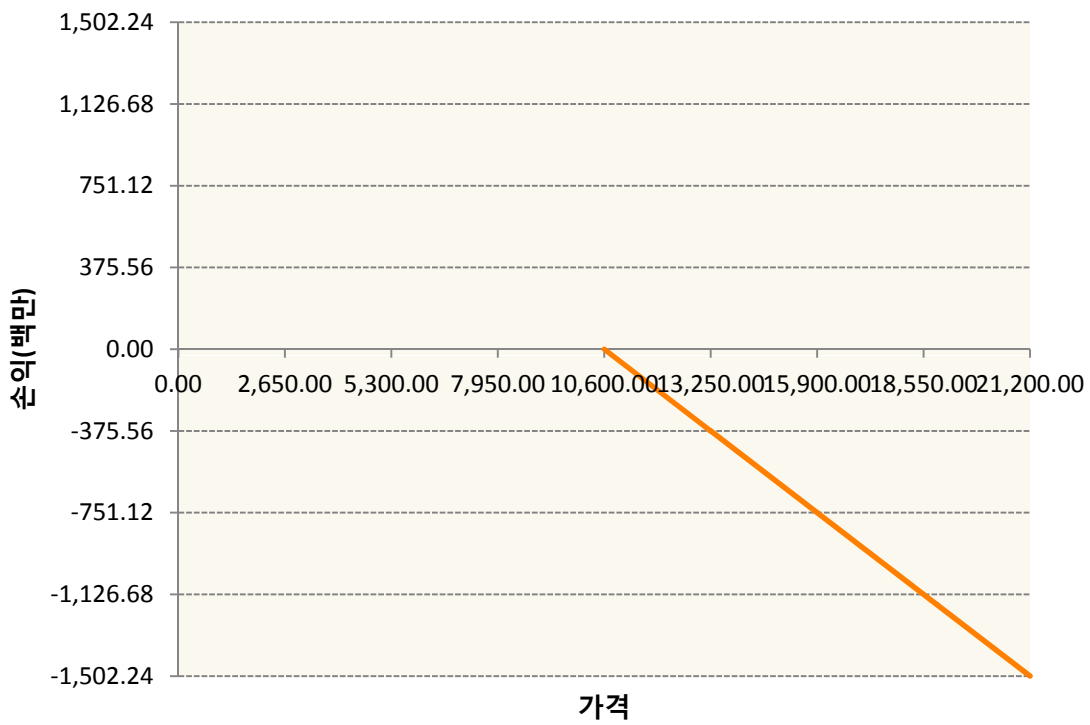


OHHIZ9-C105-HSCEI

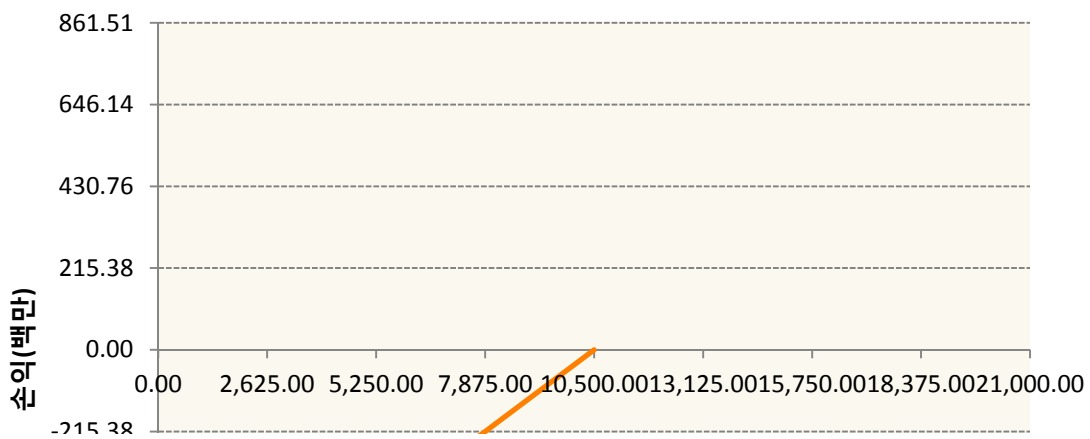


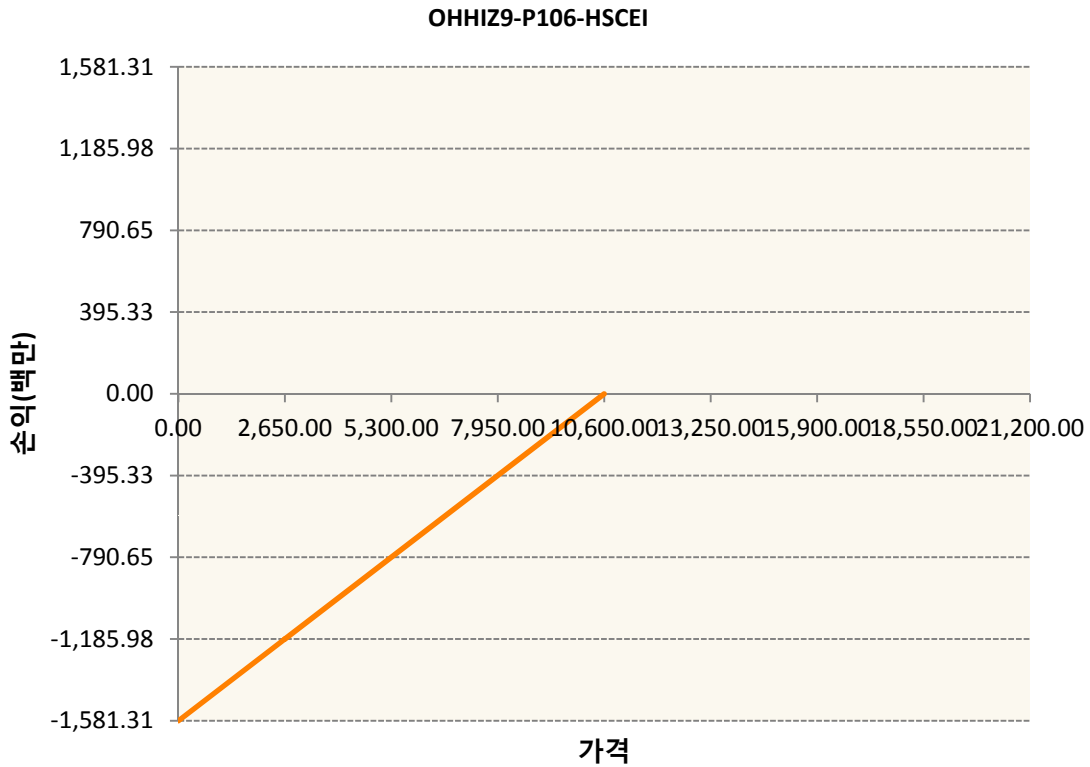


OHHIZ9-C106-HSCEI



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)
		528

공시일	2019-12-27
기준일	2019-12-26

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

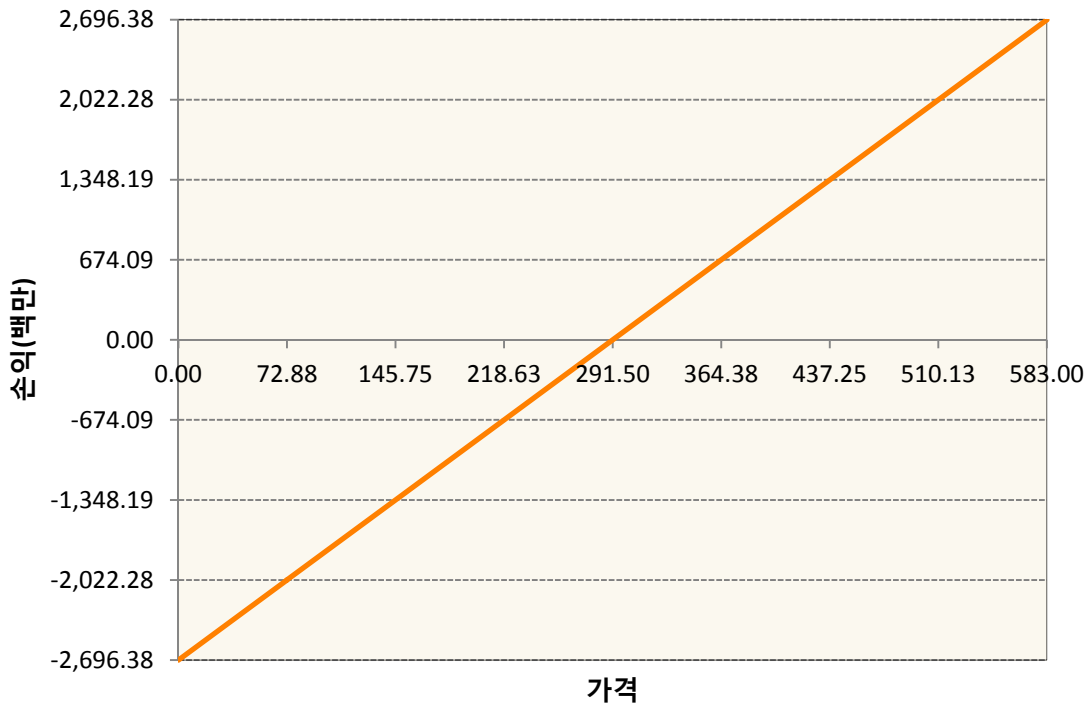
1. 계약금액

(단위:백만원)

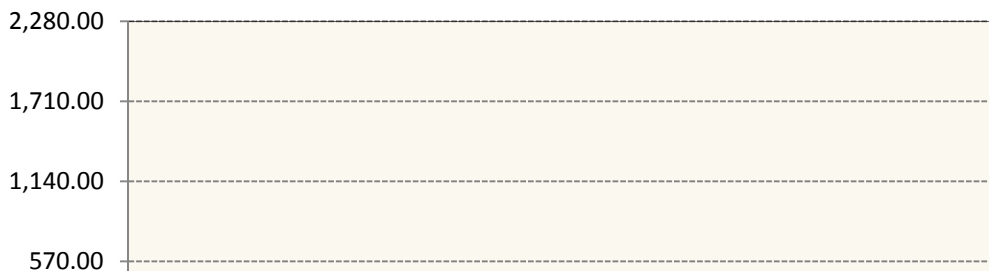
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	145	-145	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	354	0	354	장내
누계	유가증권	선물	2,696	0	2,696	장내
누계	유가증권	스왑	5,625	0	5,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	5,203	-5,203	장내

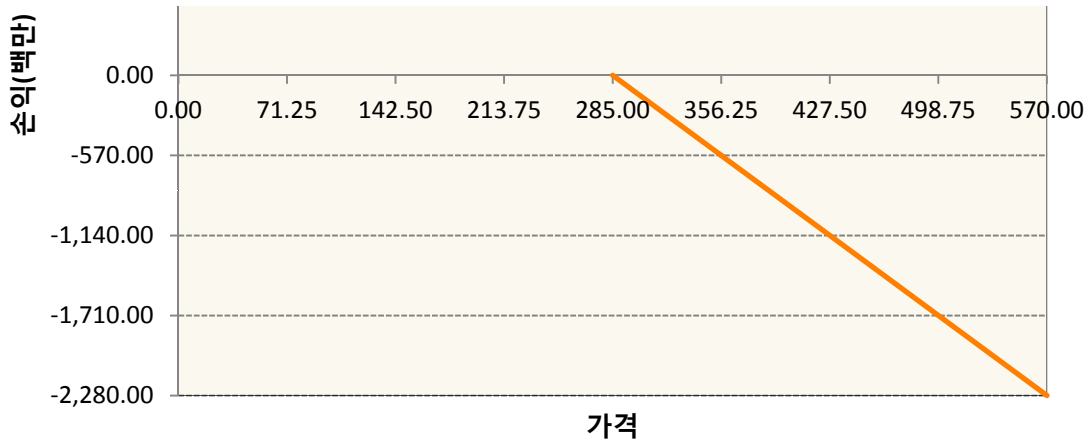
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

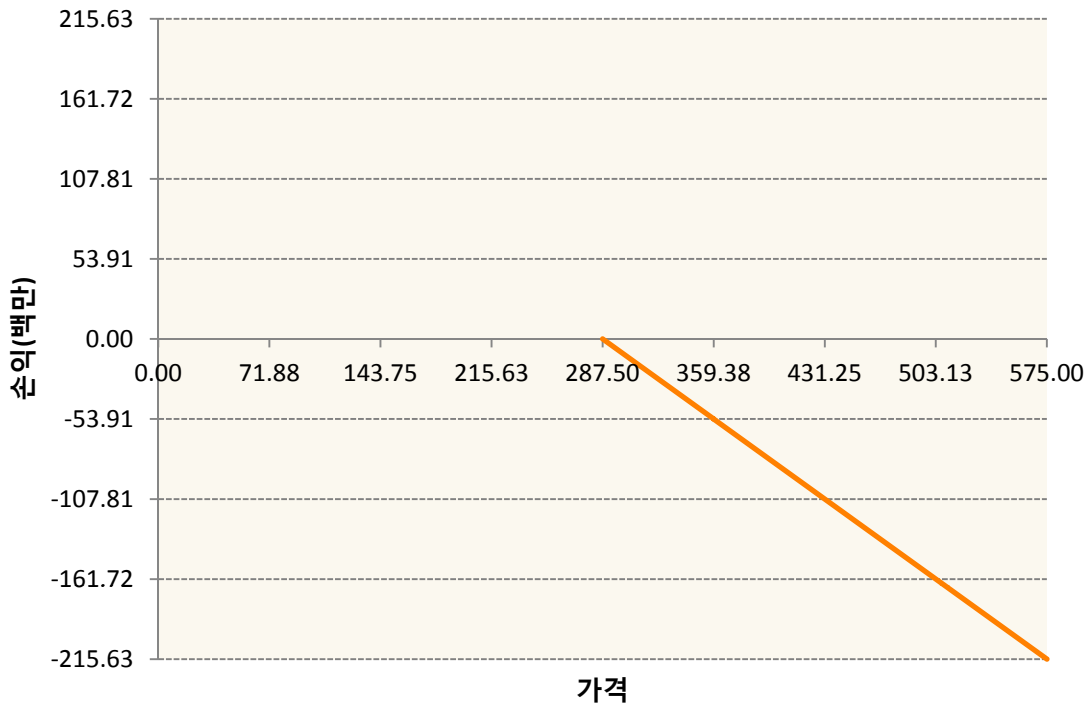


KR4201Q12852-2020-01 콜285

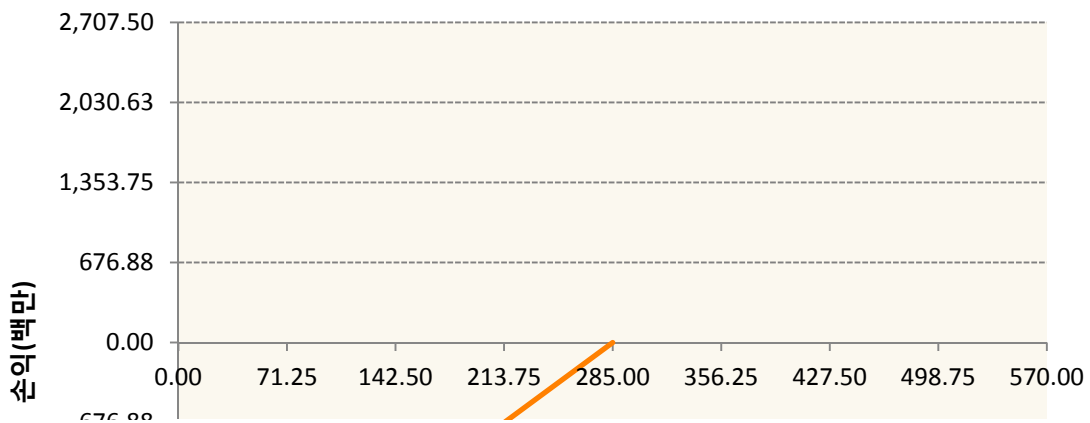




KR4201Q12878-2020-01 콜287.5



KR4301Q12850-2020-01 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						479
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-479	-479	-479	-479	-479	-479	-479	
-5.33%	-319	-319	-319	-319	-319	-319	-319	
-2.67%	-160	-160	-160	-160	-160	-160	-160	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	160	160	160	160	160	160	160	
5.33%	319	319	319	319	319	319	319	
8.00%	479	479	479	479	479	479	479	
KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						218
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-218	-218	-218	-218	-218	-218	-218	
-5.33%	-145	-145	-145	-145	-145	-145	-145	
-2.67%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	73	73	73	73	73	73	73	
5.33%	145	145	145	145	145	145	145	
8.00%	218	218	218	218	218	218	218	
KR4201Q12852		2020-01 콜285						169
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	90	88	86	83	81	78	75	
-5.33%	78	75	71	67	63	60	56	
-2.67%	52	48	44	40	35	31	27	
0%	10	7	4	0	-4	-7	-11	
2.67%	-43	-45	-47	-50	-52	-55	-58	
5.33%	-103	-104	-105	-106	-108	-109	-111	
8.00%	-165	-165	-165	-166	-167	-168	-169	
KR4201Q12878		2020-01 콜287.5						15
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	7	7	7	7	7	6	6
-5.33%	7	6	6	6	5	5	5
-2.67%	5	4	4	3	3	3	2
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	-4	-4	-4	-4	-5	-5	-5
5.33%	-9	-9	-9	-9	-10	-10	-10
8.00%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
KR4301Q12850 2020-01 풋285							136
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-133	-133	-134	-134	-135	-135	-136
-5.33%	-62	-64	-65	-67	-68	-70	-72
-2.67%	-12	-15	-17	-20	-22	-25	-27
0%	3	2	1	0	-1	-3	-5
2.67%	5	5	5	4	4	4	3
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

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

(단위:백만원)

952

공시일	2019-12-27
기준일	2019-12-26

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

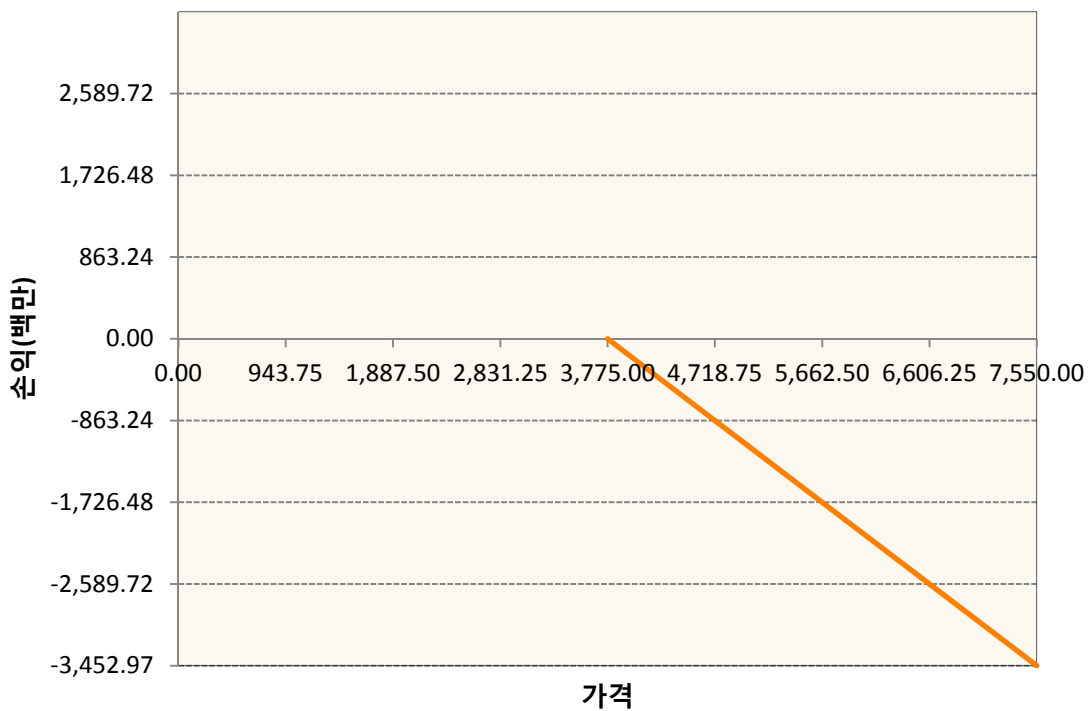
1. 계약금액

(단위:백만원)

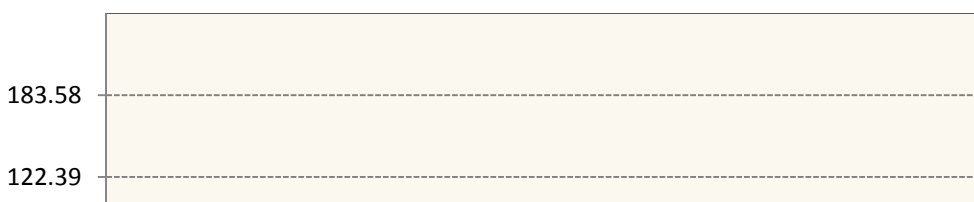
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	729	0	729	
누계	유가증권	스왑	17,615	0	17,615	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,395	-7,395	장내
누계	통화	선도	2,674	6,055	-3,380	장외

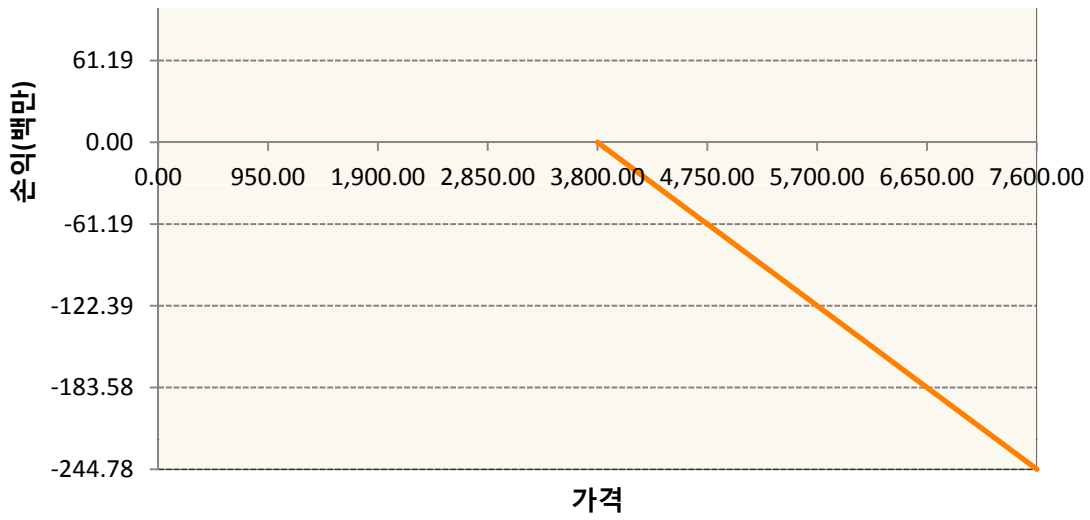
2. 만기시점의 손익구조

OESXF0-C3775-EURO STOXX 50

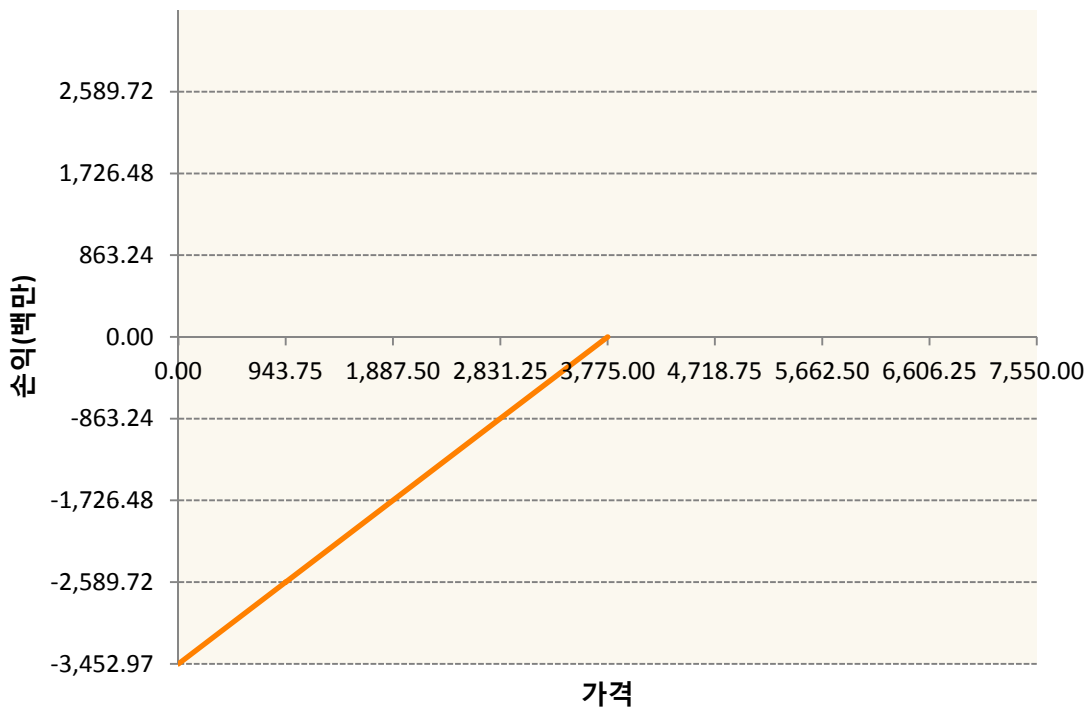


OESXF0-C3800-EURO STOXX 50

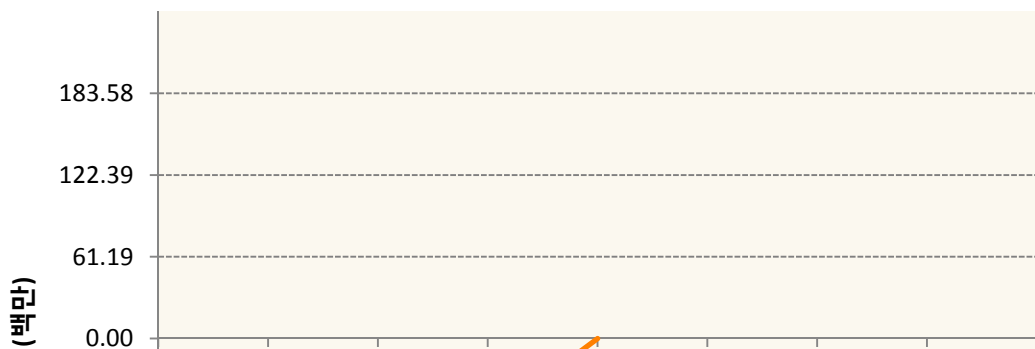


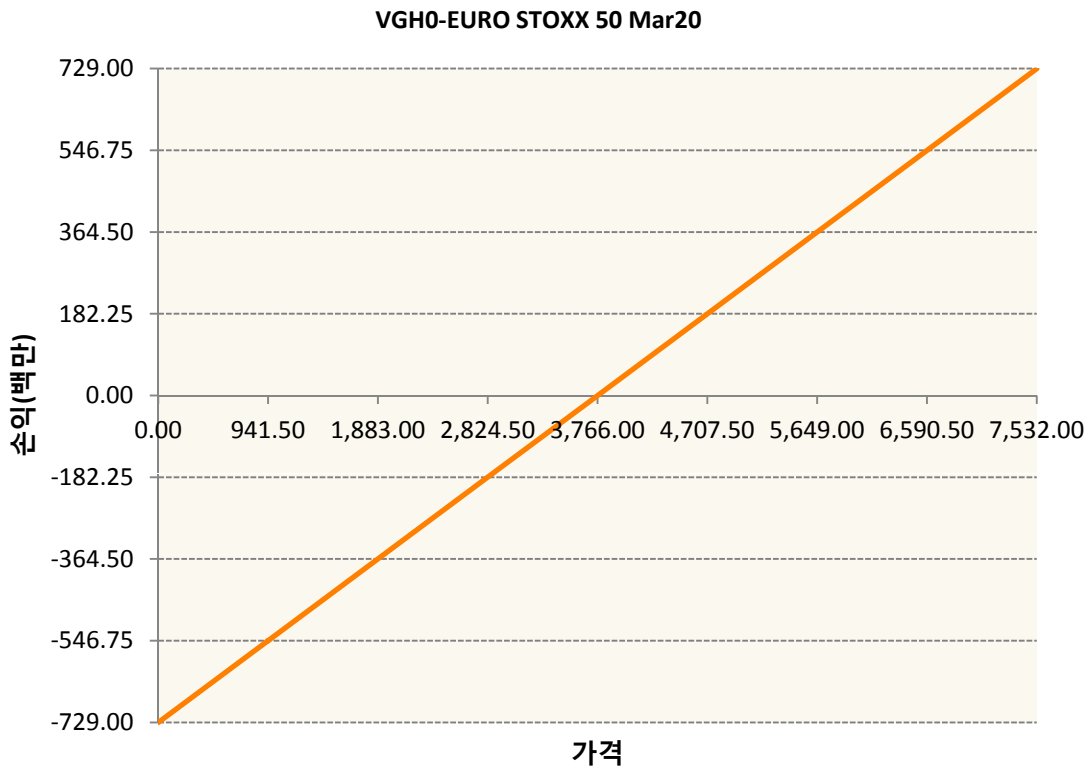
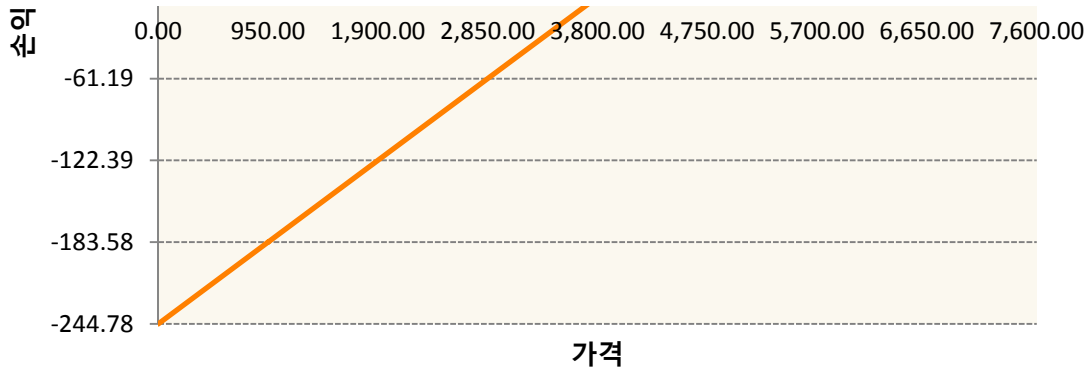


OESXF0-P3775-EURO STOXX 50



OESXF0-P3800-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	40
FX21019U04 KRW/EUR 27-12-19E	484
FX21019V04 EUR/KRW 27-12-19E	162
FX21019X02 EUR/KRW 27-12-19E	52
OESXF0-C37 EURO STOXX 50	276
OESXF0-C38 EURO STOXX 50	20
OESXF0-P37 EURO STOXX 50	276
OESXF0-P38 EURO STOXX 50	20
VGHO EURO STOXX 50 Mar20	58

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

(단위:백만원)

805

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

(단위:백만원)

921

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

(단위:백만원)

83

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

(단위:백만원)

115

공시일	2019-12-27
기준일	2019-12-26

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

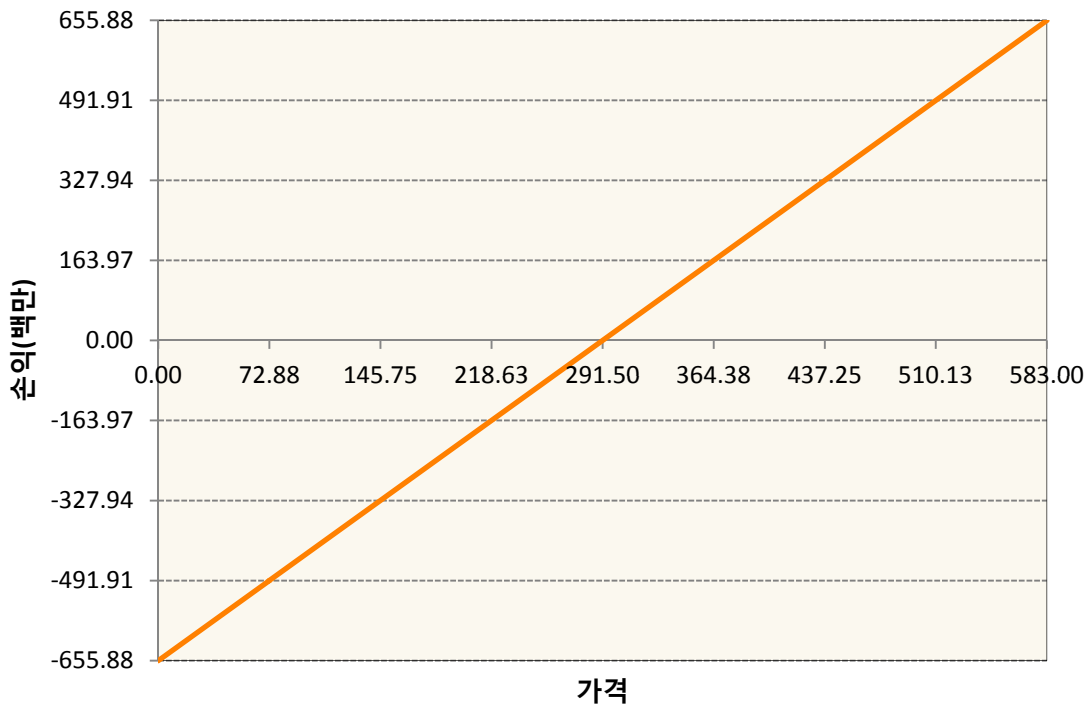
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	656	0	656	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						53
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53	
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	18	18	18	18	18	18	18	
5.33%	35	35	35	35	35	35	35	
8.00%	53	53	53	53	53	53	53	

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

(단위:백만원)

41

공시일	2019-12-27
기준일	2019-12-26

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

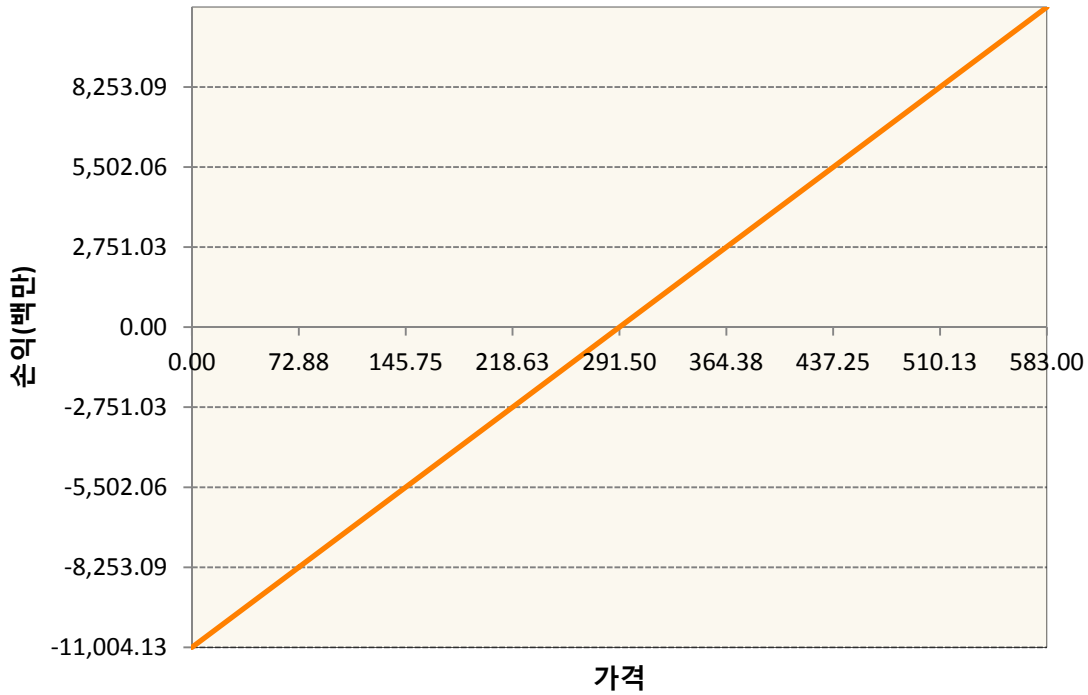
1. 계약금액

(단위:백만원)

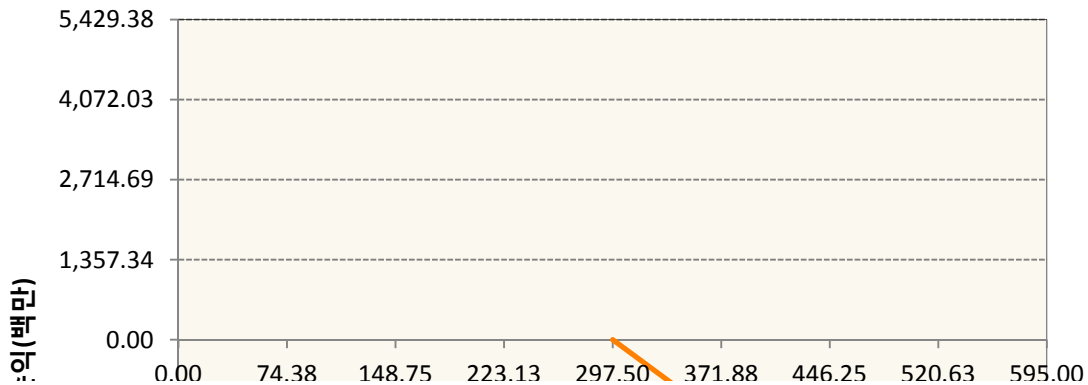
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	73	-73	장내
신규	유가증권	옵션	75	0	75	장내
누계	유가증권	선물	11,004	0	11,004	장내
누계	유가증권	옵션	499	21,179	-20,681	장내

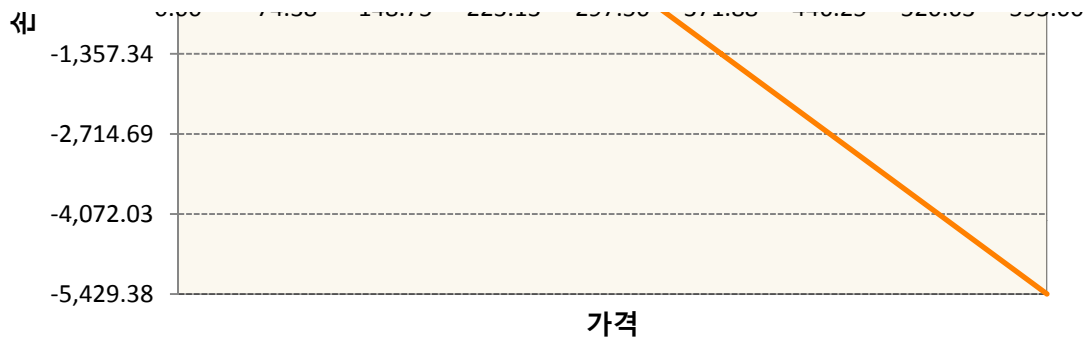
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

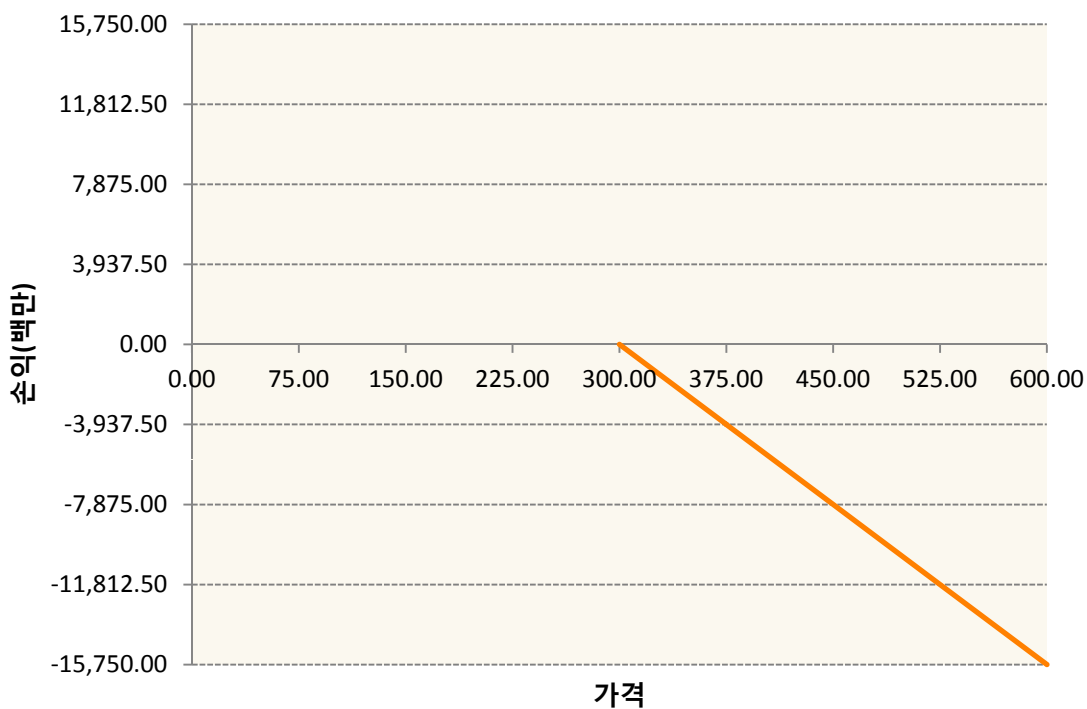


KR4201Q12977-2020-01 콜297.5

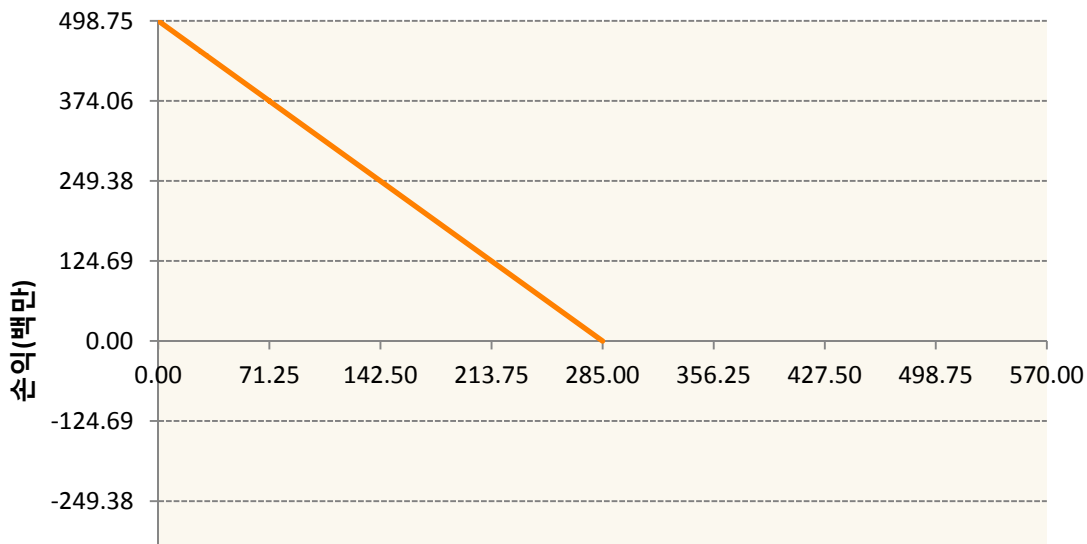


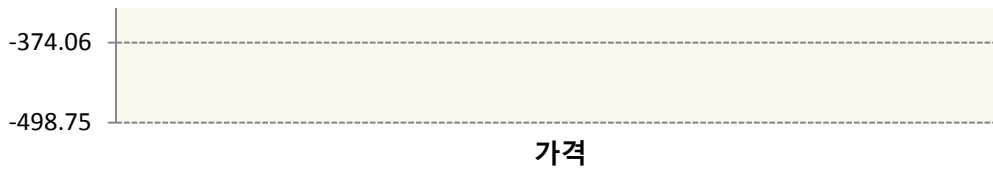


KR4201Q13009-2020-01 콜300



KR4301Q12850-2020-01 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						888
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-888	-888	-888	-888	-888	-888	-888	
-5.33%	-592	-592	-592	-592	-592	-592	-592	
-2.67%	-296	-296	-296	-296	-296	-296	-296	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	296	296	296	296	296	296	296	
5.33%	592	592	592	592	592	592	592	
8.00%	888	888	888	888	888	888	888	
KR4201Q12977		2020-01 콜297.5						311
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	89	88	87	85	83	80	76	
-5.33%	85	82	78	74	69	63	57	
-2.67%	69	63	55	48	40	32	24	
0%	29	19	10	0	-10	-20	-29	
2.67%	-45	-55	-65	-74	-84	-94	-104	
5.33%	-152	-159	-166	-174	-182	-190	-199	
8.00%	-280	-284	-288	-293	-298	-304	-311	
KR4201Q13009		2020-01 콜300						839
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	209	207	204	200	195	188	179	
-5.33%	201	195	186	176	164	150	135	
-2.67%	169	153	136	116	96	75	53	
0%	79	53	27	0	-27	-54	-82	
2.67%	-102	-131	-160	-189	-218	-247	-277	
5.33%	-382	-405	-429	-453	-479	-505	-531	
8.00%	-734	-747	-762	-779	-798	-818	-839	
KR4301Q12850		2020-01 풋285						25
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	25	25	25	25	25	25	25	
-5.33%	11	12	12	12	13	13	13	
-2.67%	2	3	3	4	4	5	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)

1,792

공시일	2019-12-27
기준일	2019-12-26

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	204,814	0	204,814	

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	2019-12-27
기준일	2019-12-26

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	213,787	0	213,787	

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	2019-12-27
기준일	2019-12-26

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	527,653	0	527,653	
누계	통화	선도	0	512,470	-512,470	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		1,394
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,496
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		1,859
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		3,197
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		4,740
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		186
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,788
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,788
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,324
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,509
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E		1,617
FX21019Z00 KRW/USD 10-01-20E		1,115
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E		1,524
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E		929
FX21019Z02 KRW/USD 16-01-20E		1,673
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		186
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		1,989
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		929
FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E		3,718
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E		1,859
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E		1,989
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E		186

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

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

188

공시일	2019-12-27
기준일	2019-12-26

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

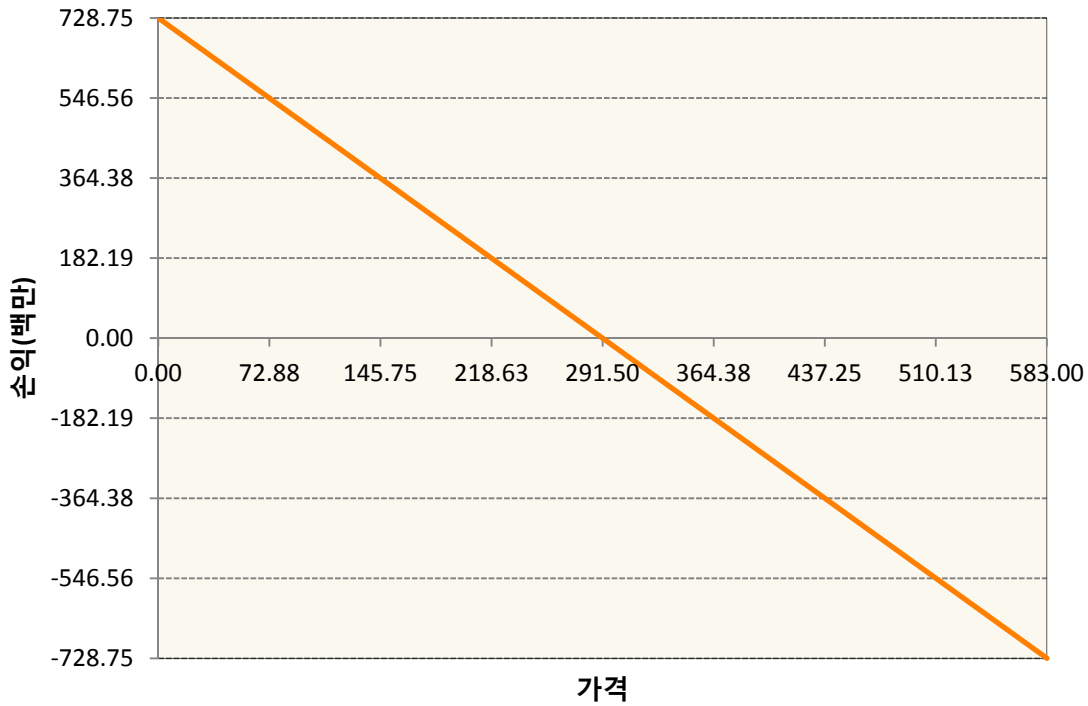
1. 계약금액

(단위:백만원)

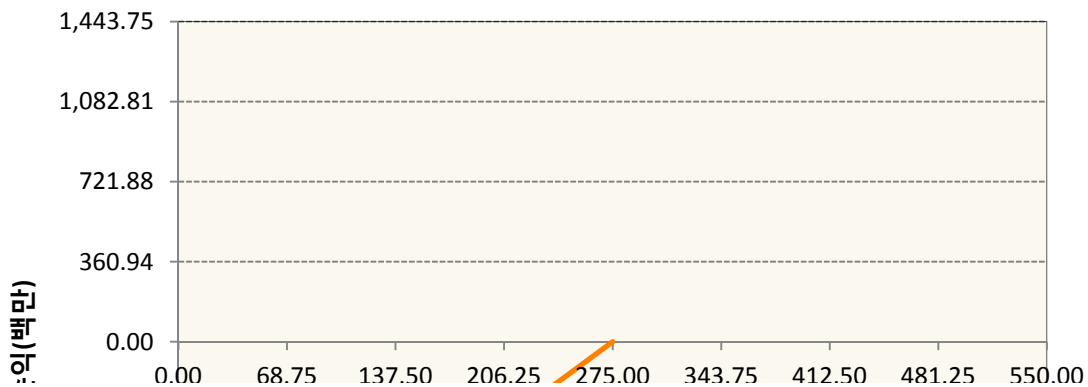
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	729	-729	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,941	-3,941	장내

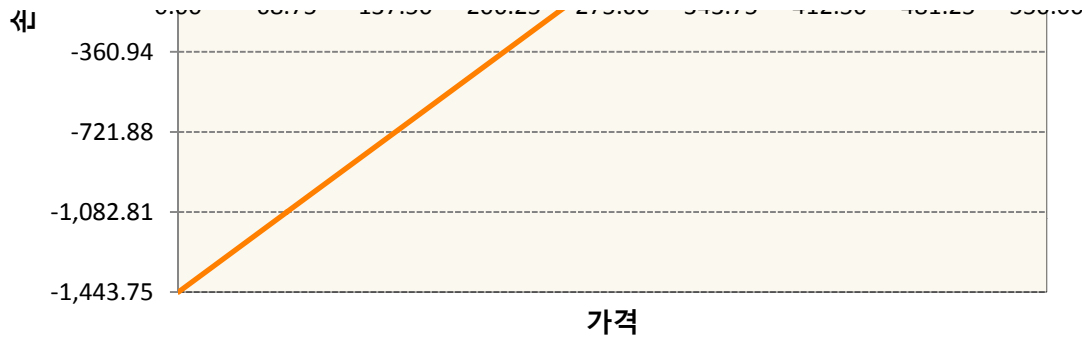
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

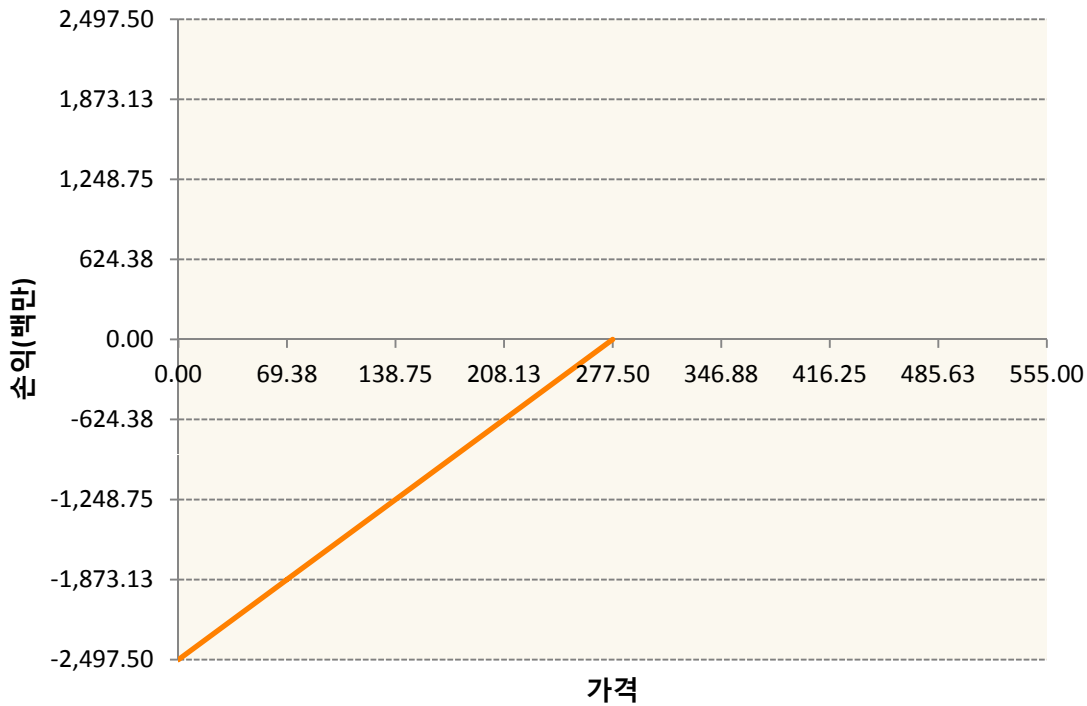


KR4301Q12751-2020-01 풋275





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						34
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-27	-28	-29	-30	-32	-33	-34
-5.33%	-5	-6	-8	-9	-10	-11	-12
-2.67%	0	0	-1	-1	-2	-2	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
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 74

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-66	-67	-68	-69	-71	-73	-74
-5.33%	-17	-19	-21	-24	-26	-28	-31
-2.67%	-1	-2	-3	-4	-6	-7	-9
0%	0	0	0	0	0	-1	-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

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

(단위:백만원)

80

공시일	2019-12-27
기준일	2019-12-26

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	13,553	0	13,553	
누계	통화	선도	941	14,360	-13,419	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		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		20
FX21019Z04 USD/KRW 13-01-20E		28

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

(단위:백만원)

392

공시일	2019-12-27
기준일	2019-12-26

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	989	0	989	장외
누계	통화	선도	309	502	-193	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	36
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
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	3

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

(단위:백만원)

81

공시일	2019-12-27
기준일	2019-12-26

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

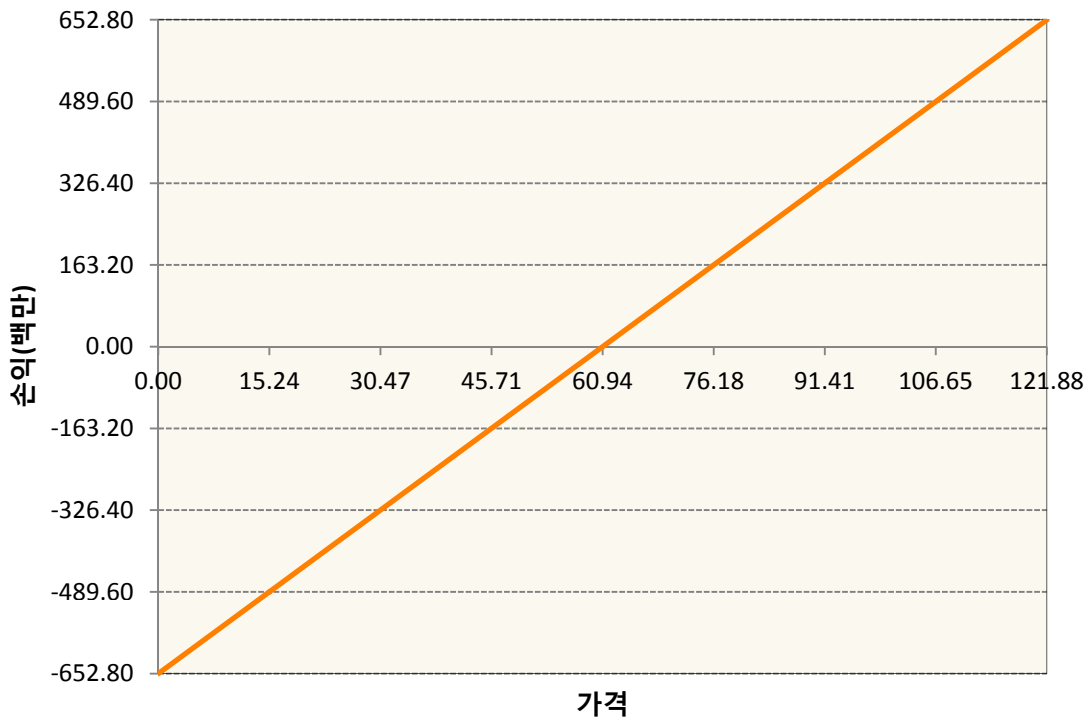
1. 계약금액

(단위:백만원)

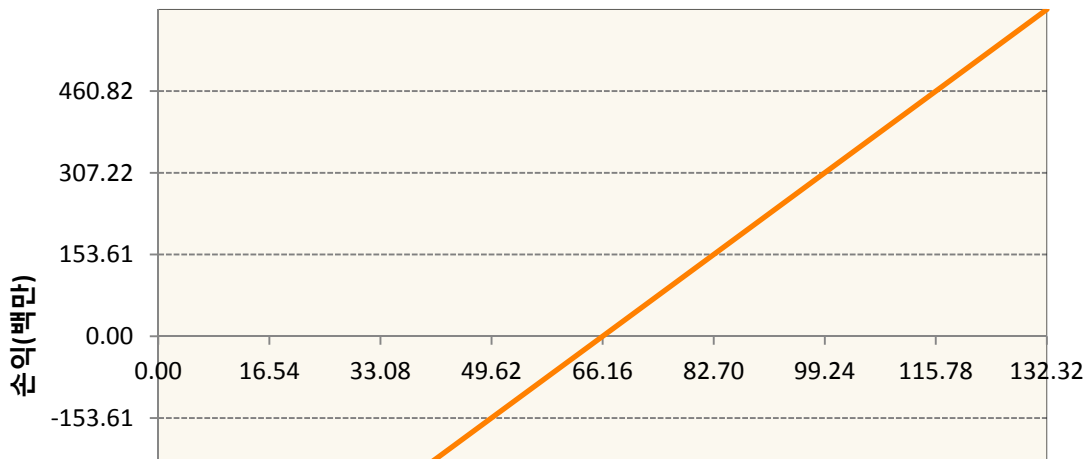
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,433	290	2,143	

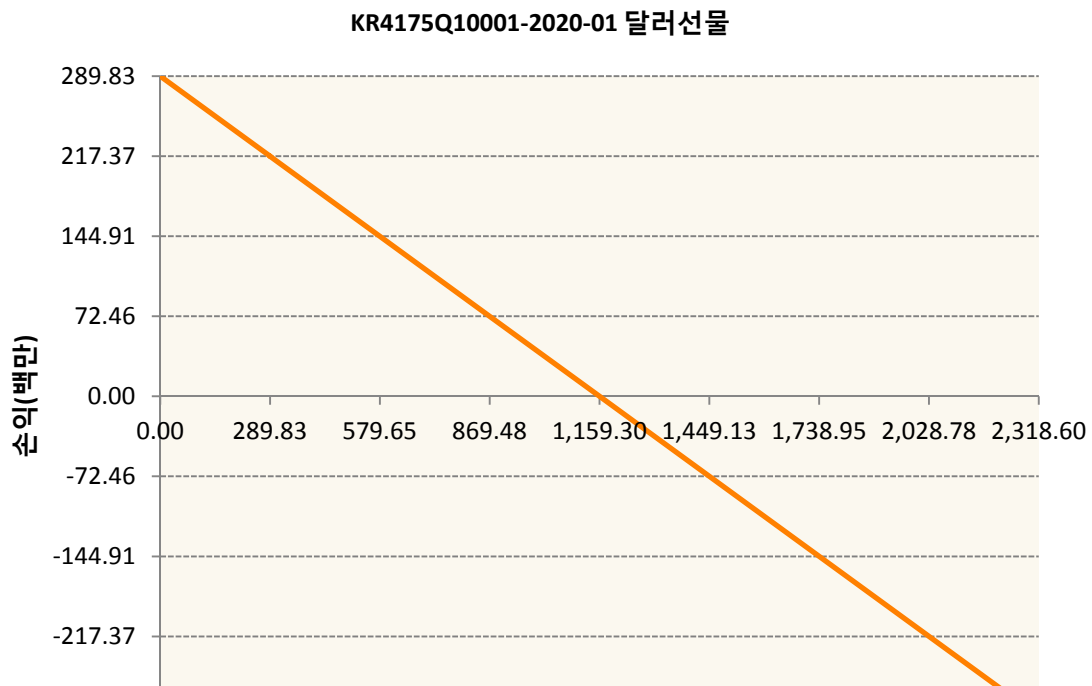
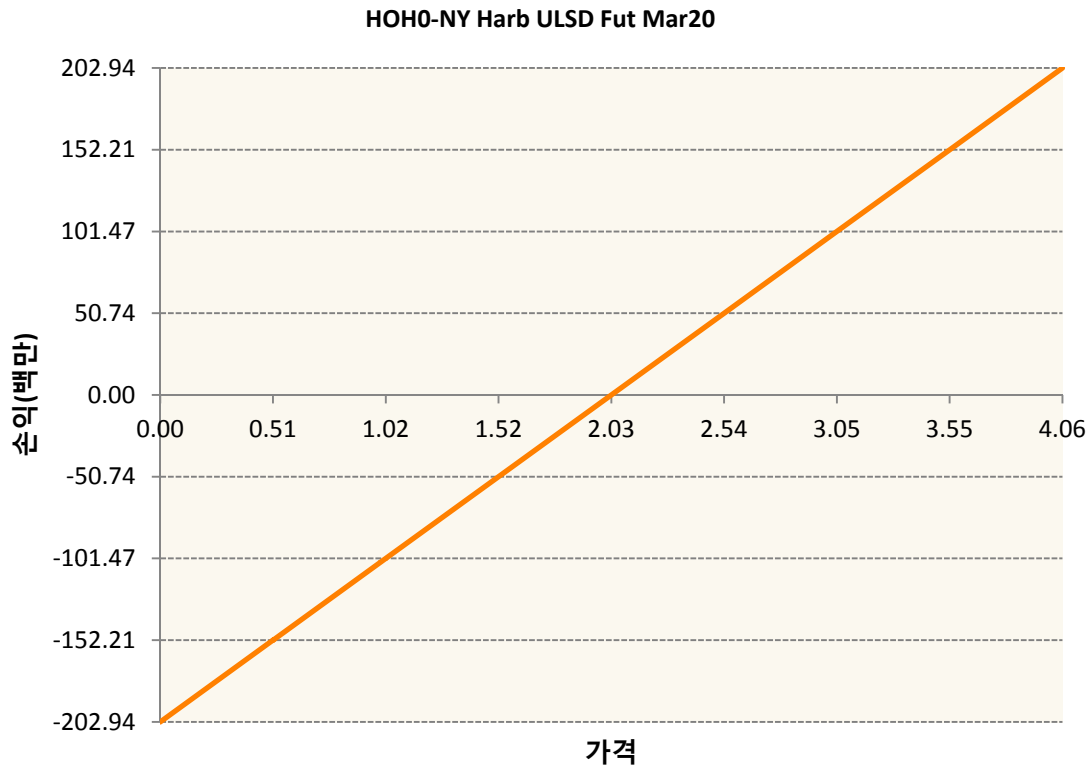
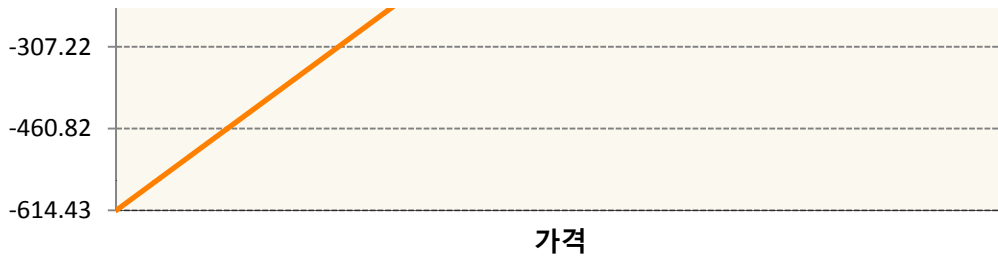
2. 만기시점의 손익구조

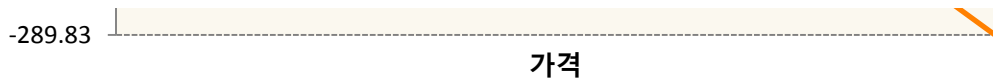
CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20



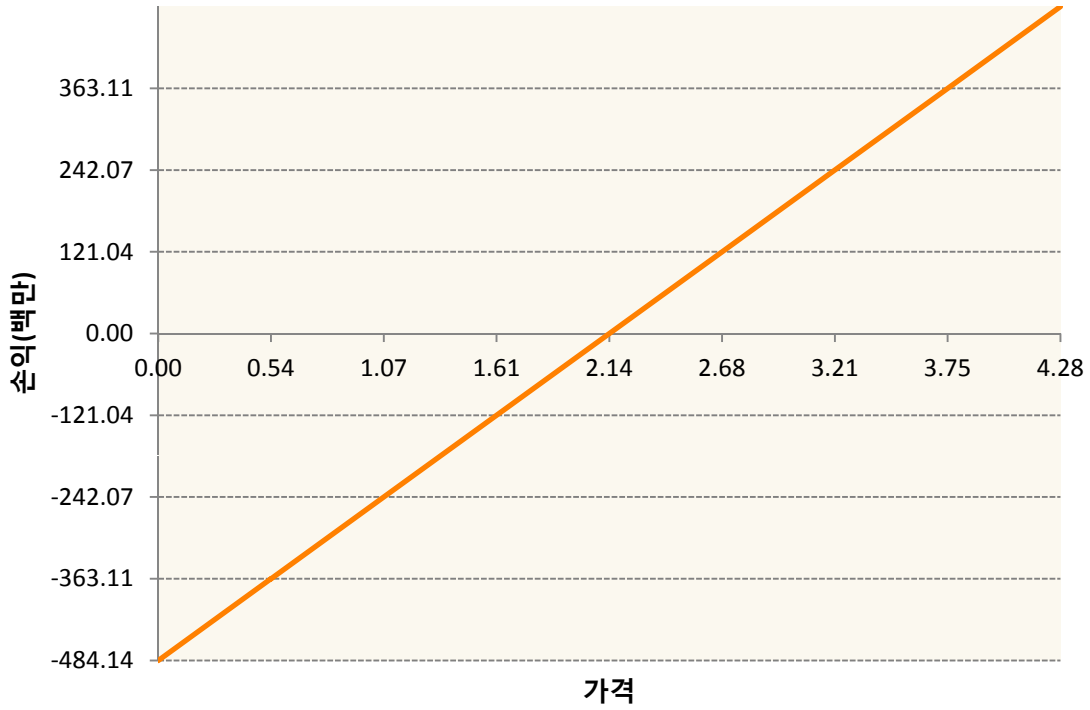
COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20



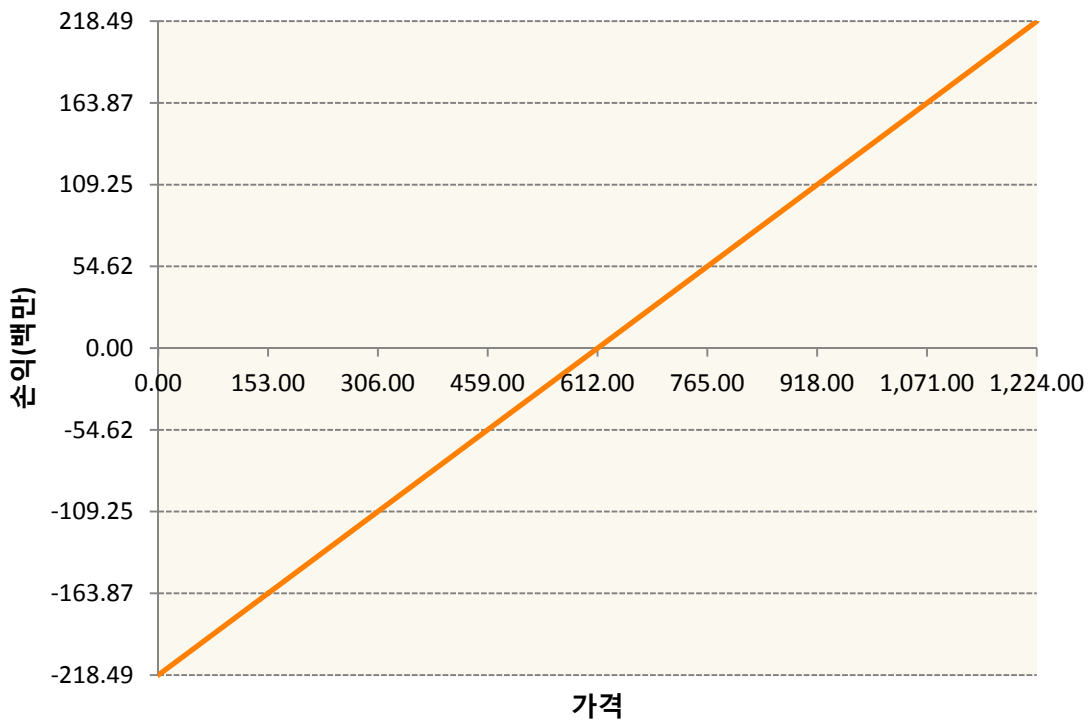




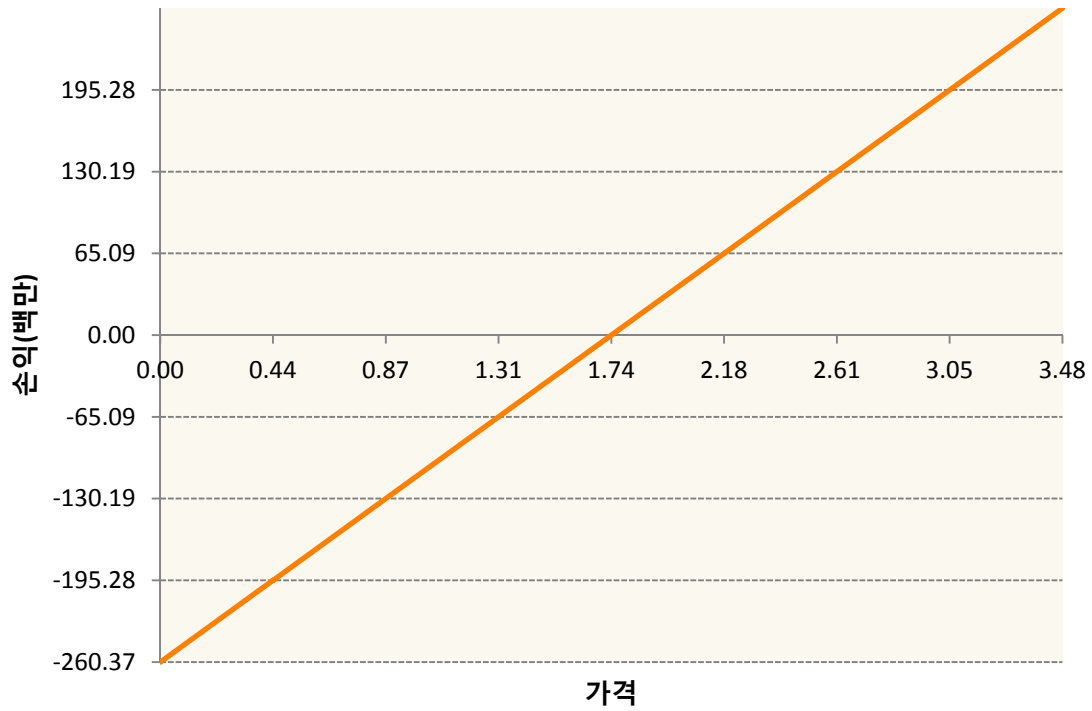
NGH20-NATURAL GAS FUTR Mar20



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	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	2019-12-27
기준일	2019-12-26

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

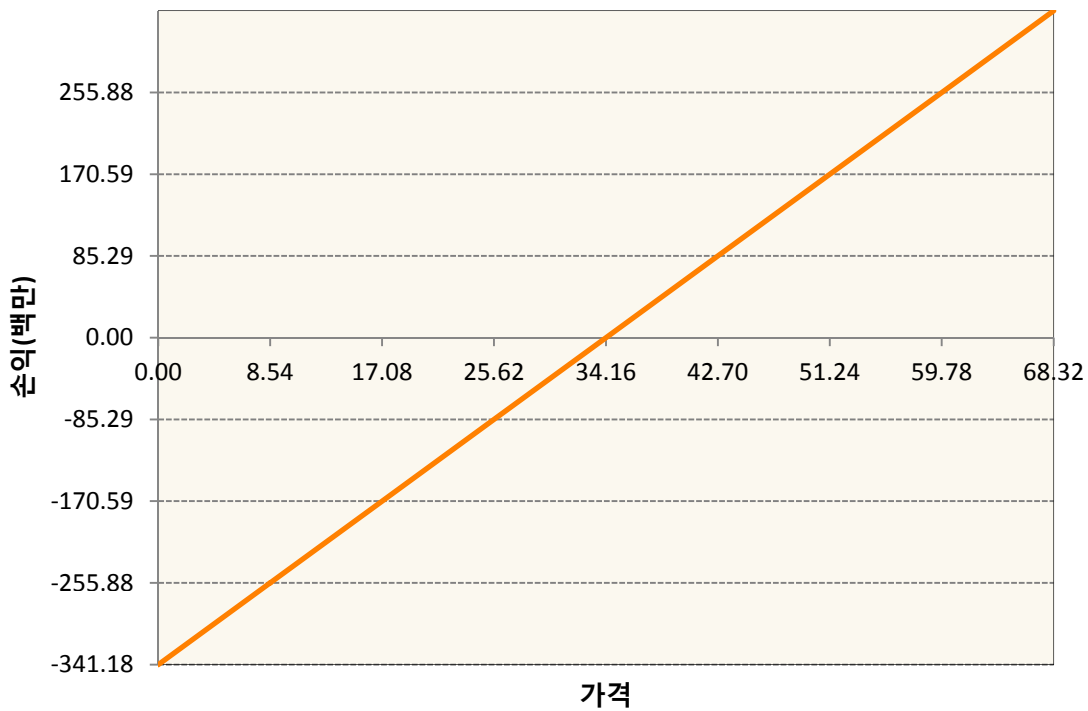
1. 계약금액

(단위:백만원)

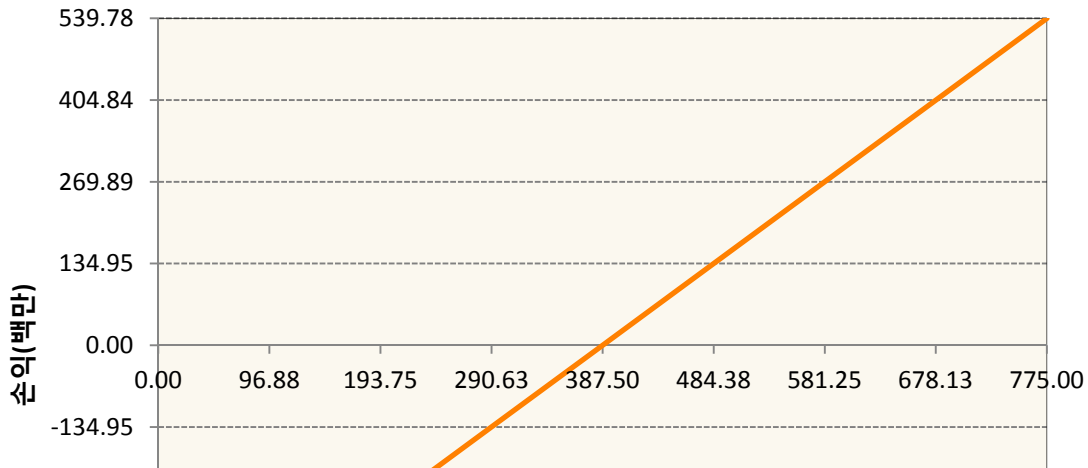
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,846	116	2,730	

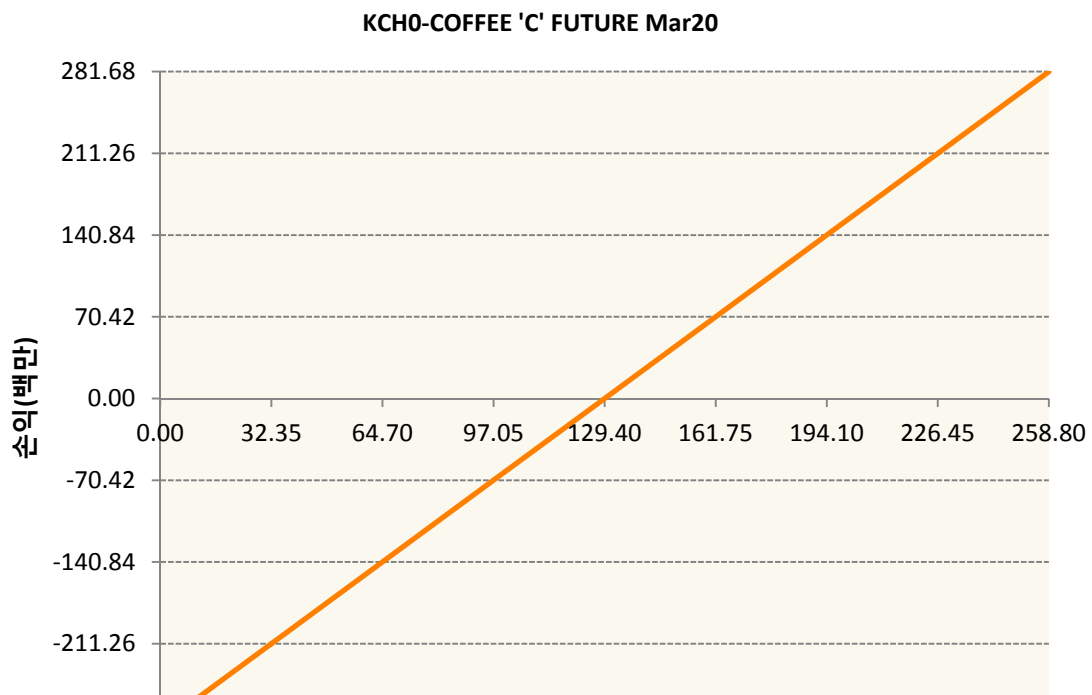
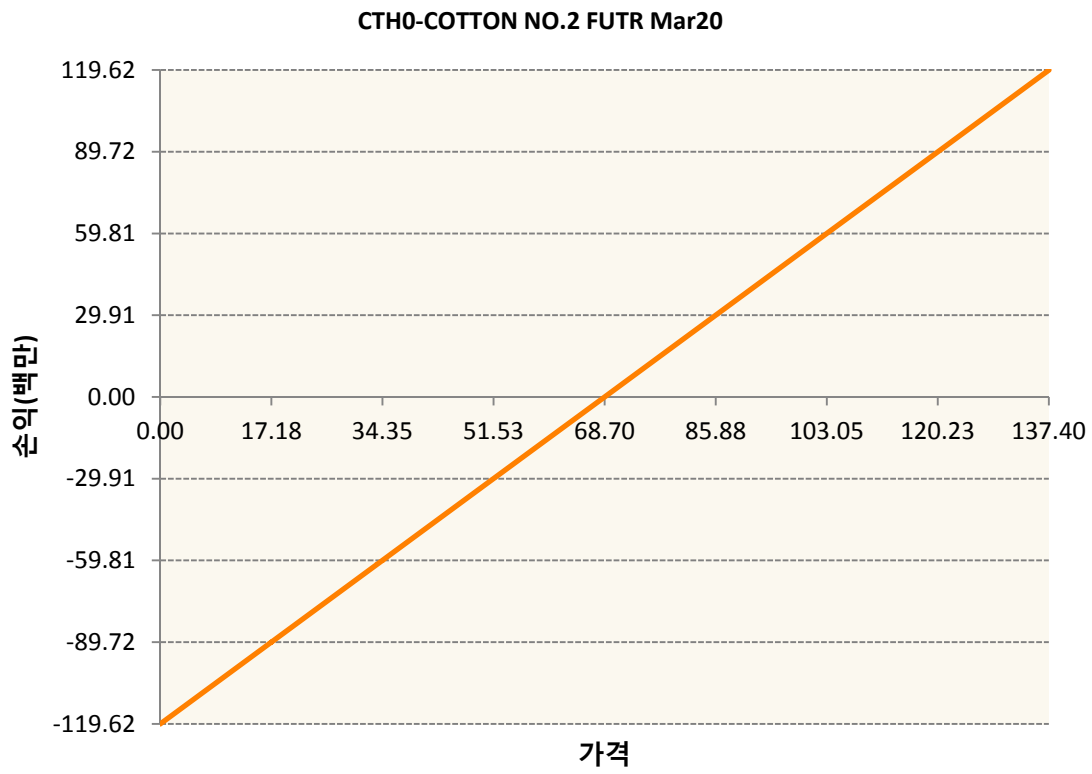
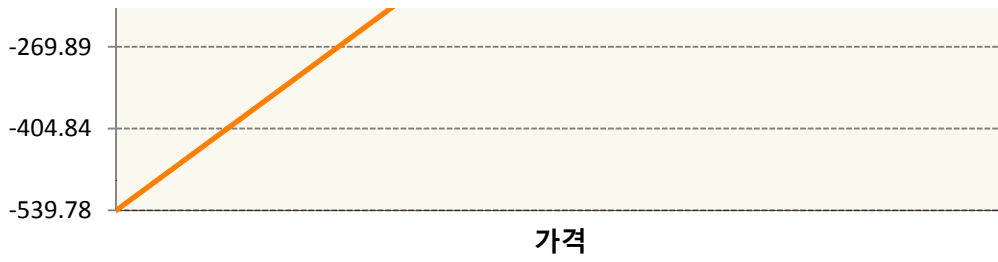
2. 만기시점의 손익구조

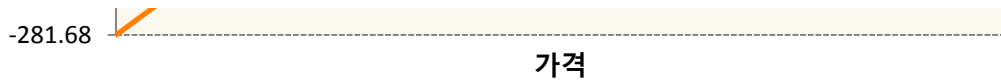
BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20



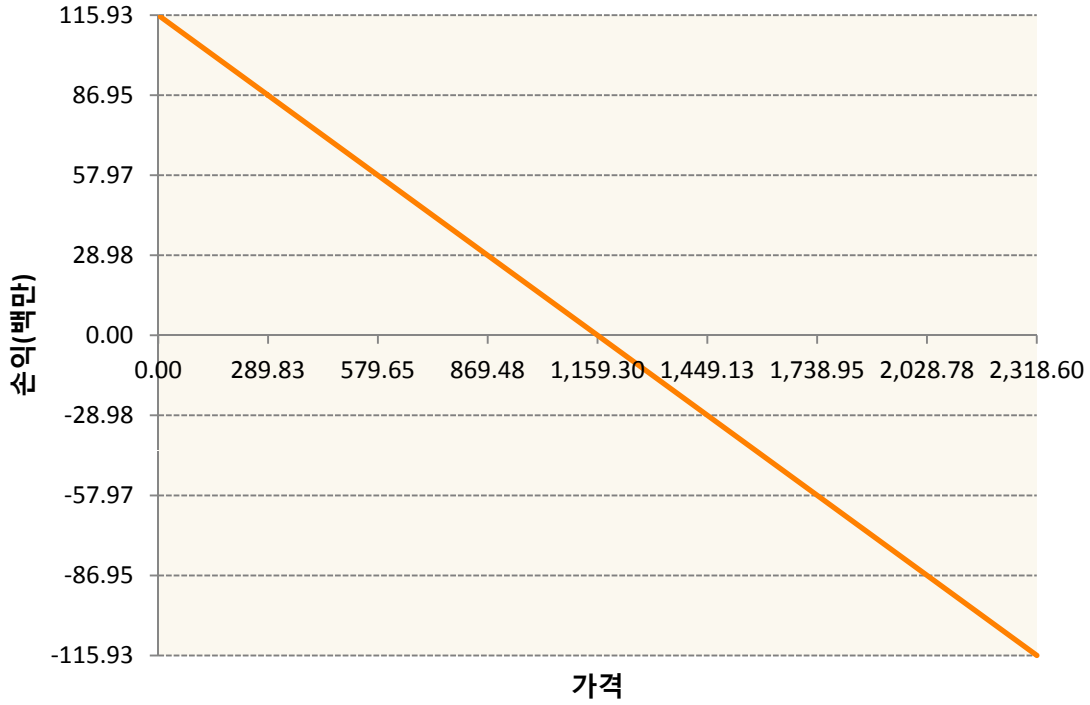
CH0-CORN FUTURE Mar20



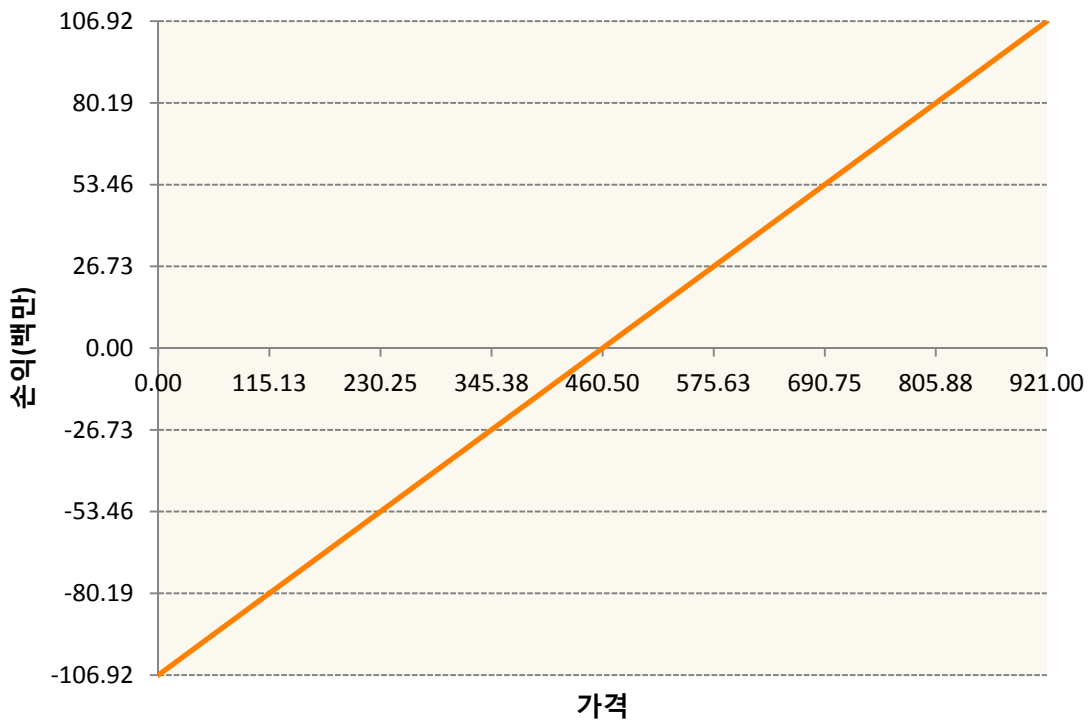




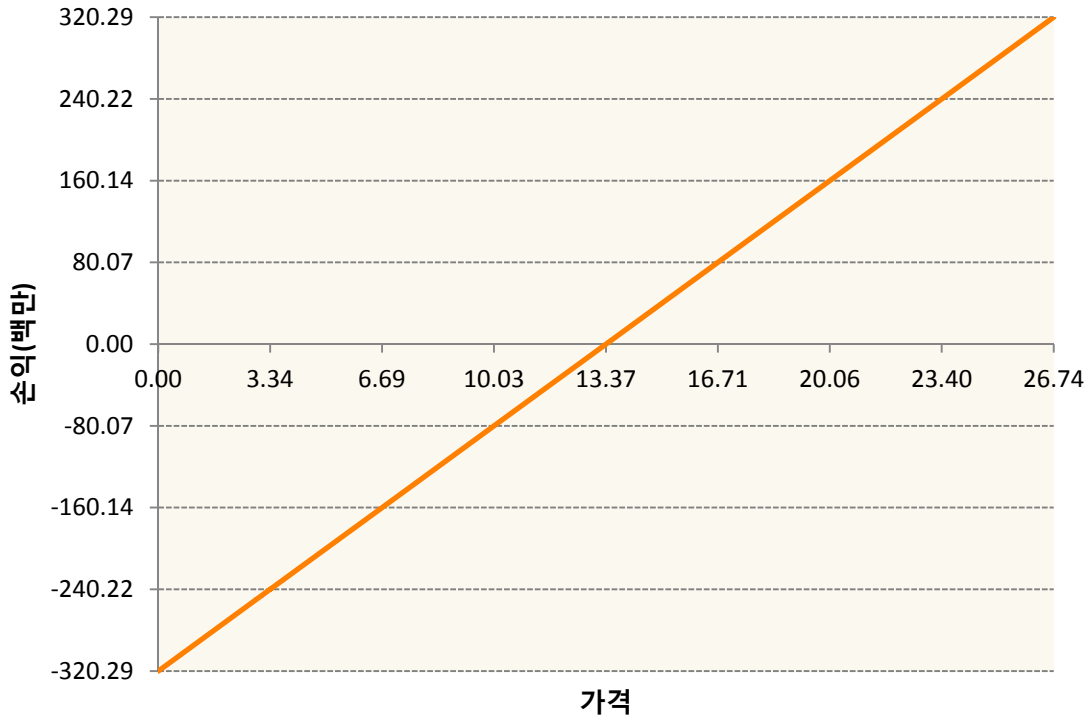
KR4175Q10001-2020-01 달러선물



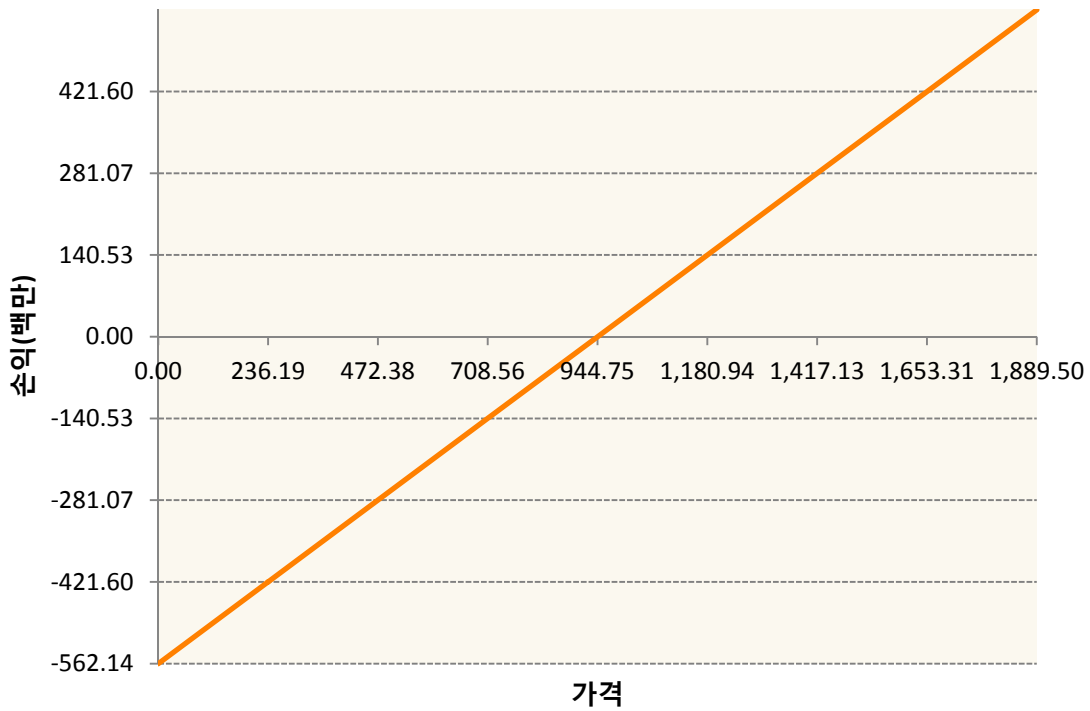
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

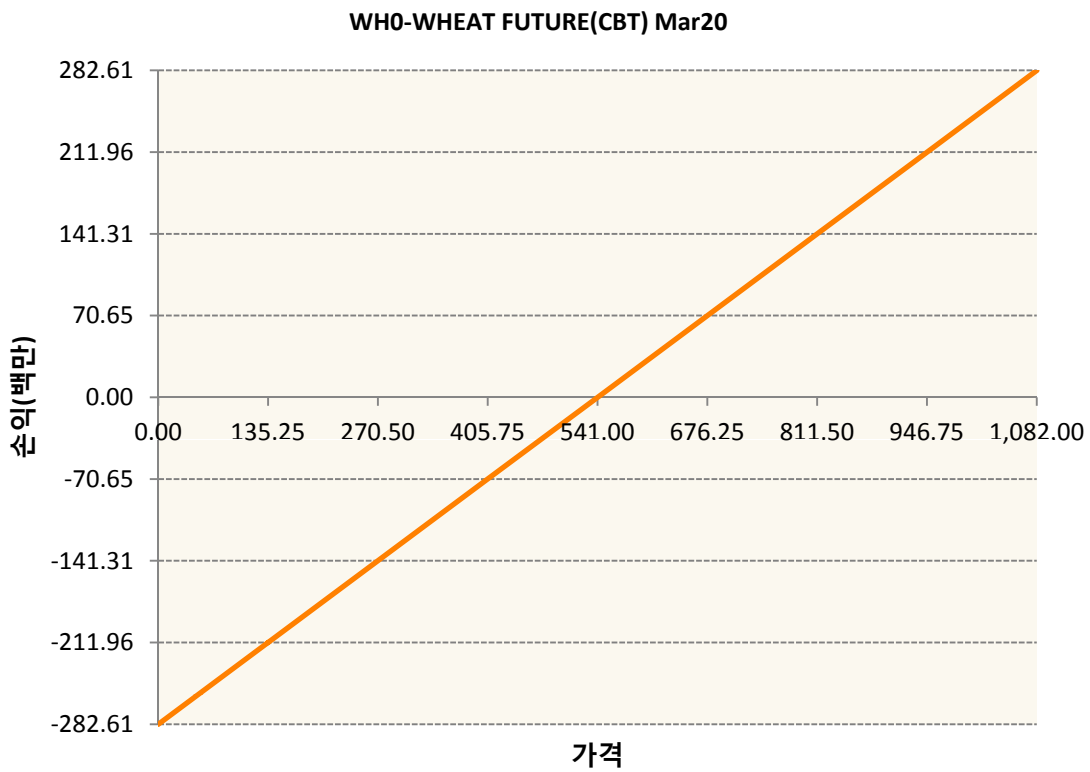
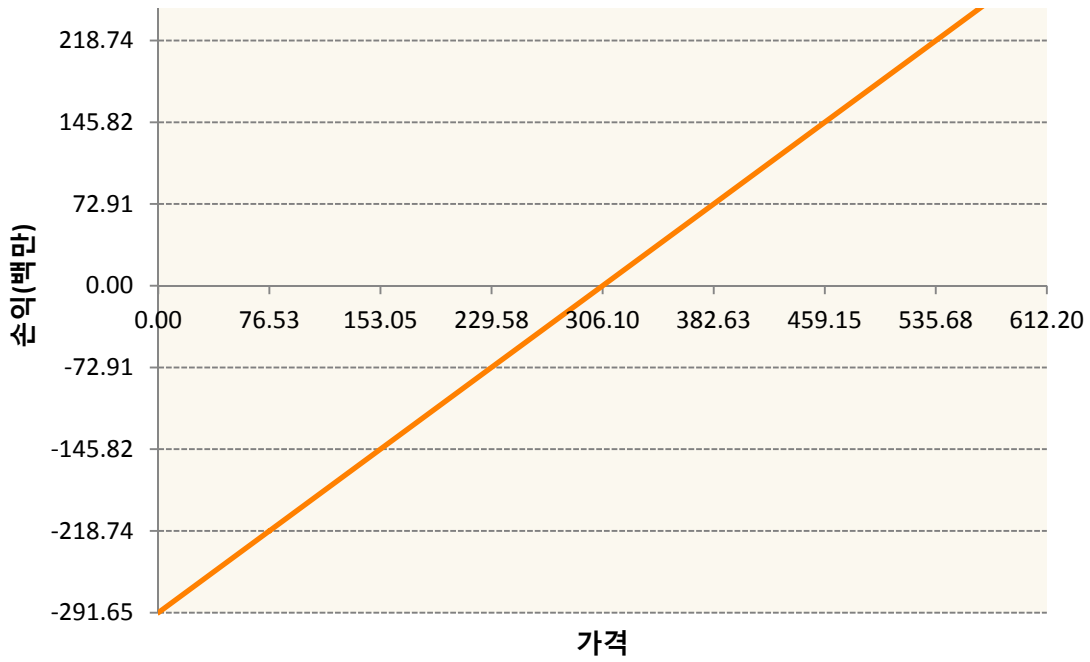


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20



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	10
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