

공시일	2019-12-30
기준일	2019-12-27

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	2019-12-30
기준일	2019-12-27

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

1,129

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

650

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-30
기준일	2019-12-27

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)

757

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-30
기준일	2019-12-27

유로인덱스모(주식-파생형)

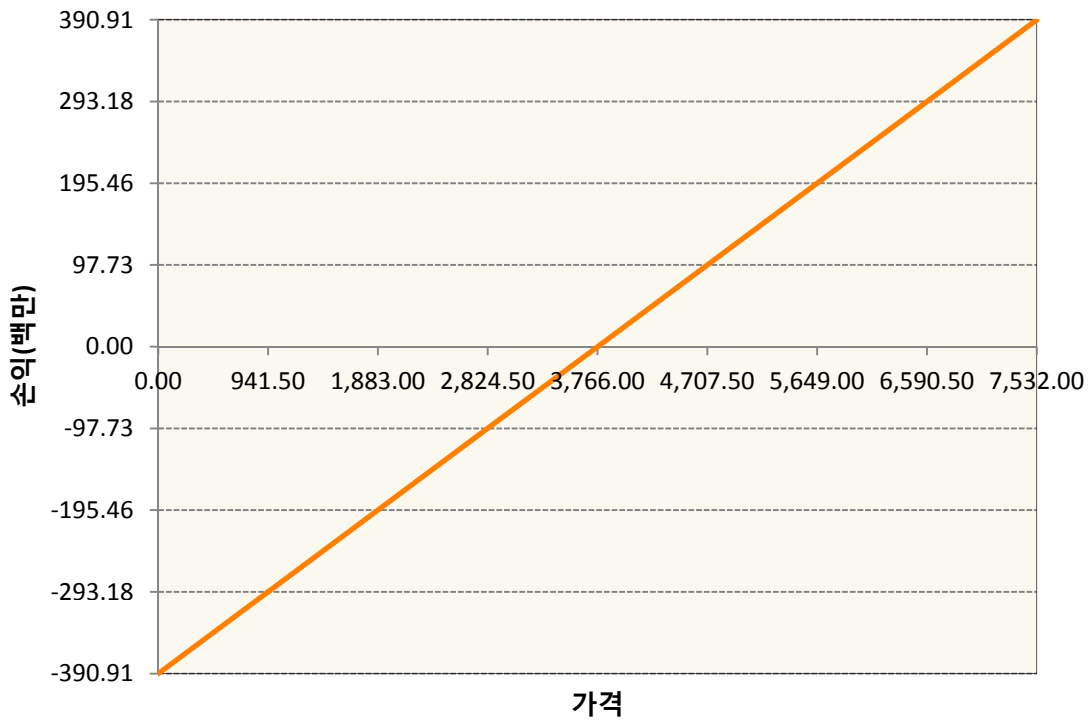
1. 계약금액

(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

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	2019-12-30
기준일	2019-12-27

차이나인덱스모(주식-파생형)

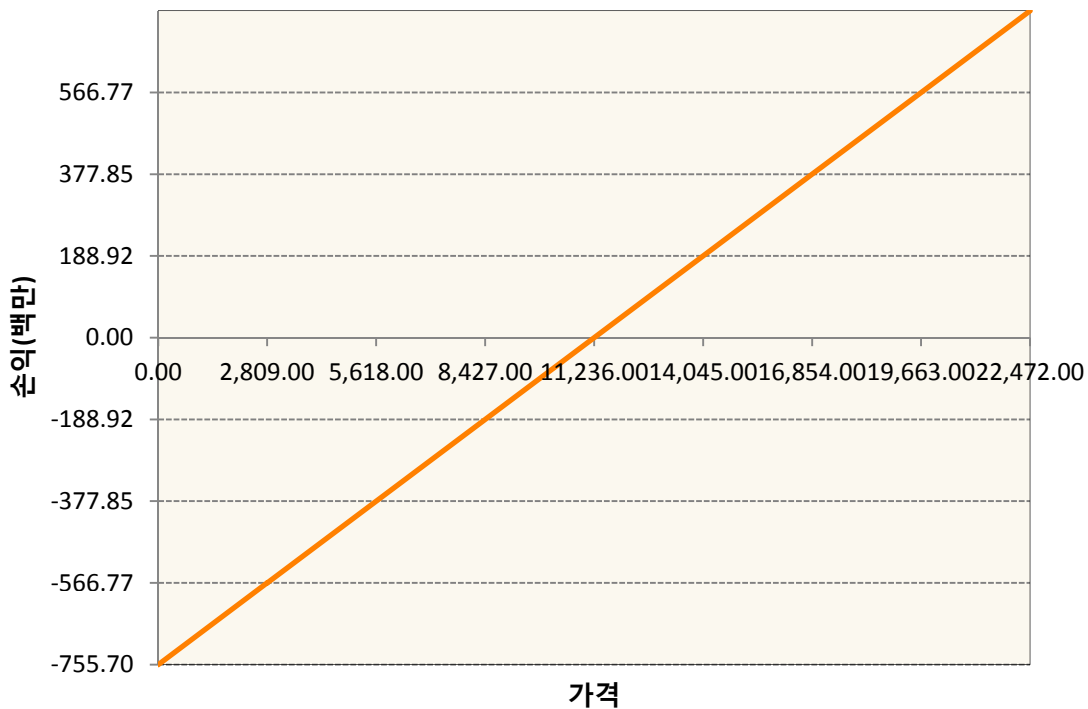
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	756	0	756	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCF0-HSCEI Futures Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

53

공시일	2019-12-30
기준일	2019-12-27

커버드콜모(주식혼합-파생형)

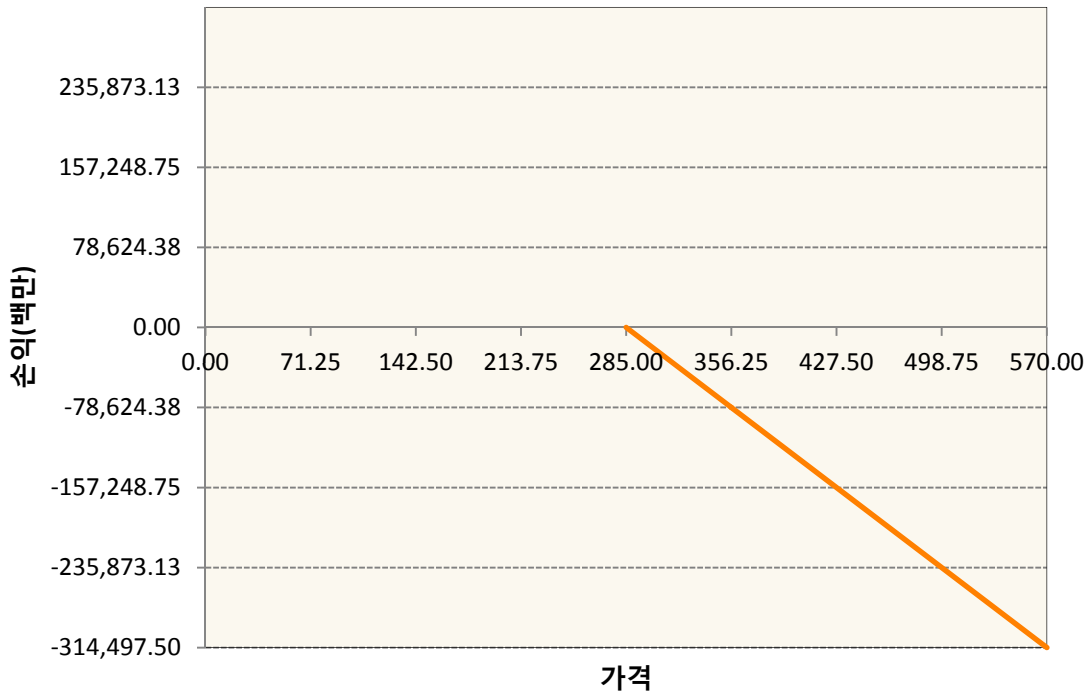
1. 계약금액

(단위:백만원)

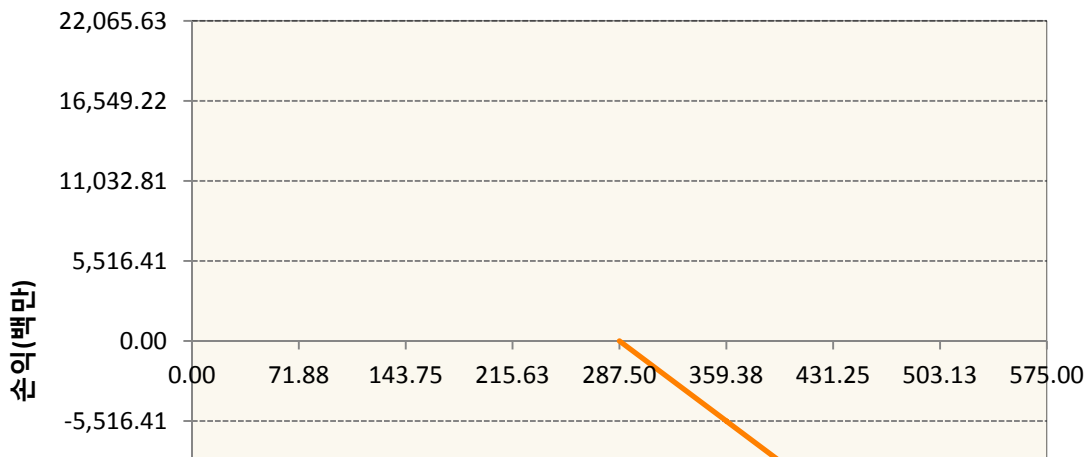
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	2,056	0	2,056	장내
누계	유가증권	옵션	0	475,501	-475,501	장내

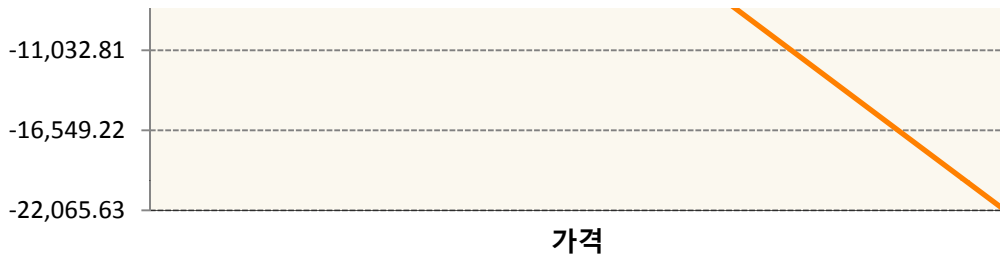
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q12852-2020-01 콜285

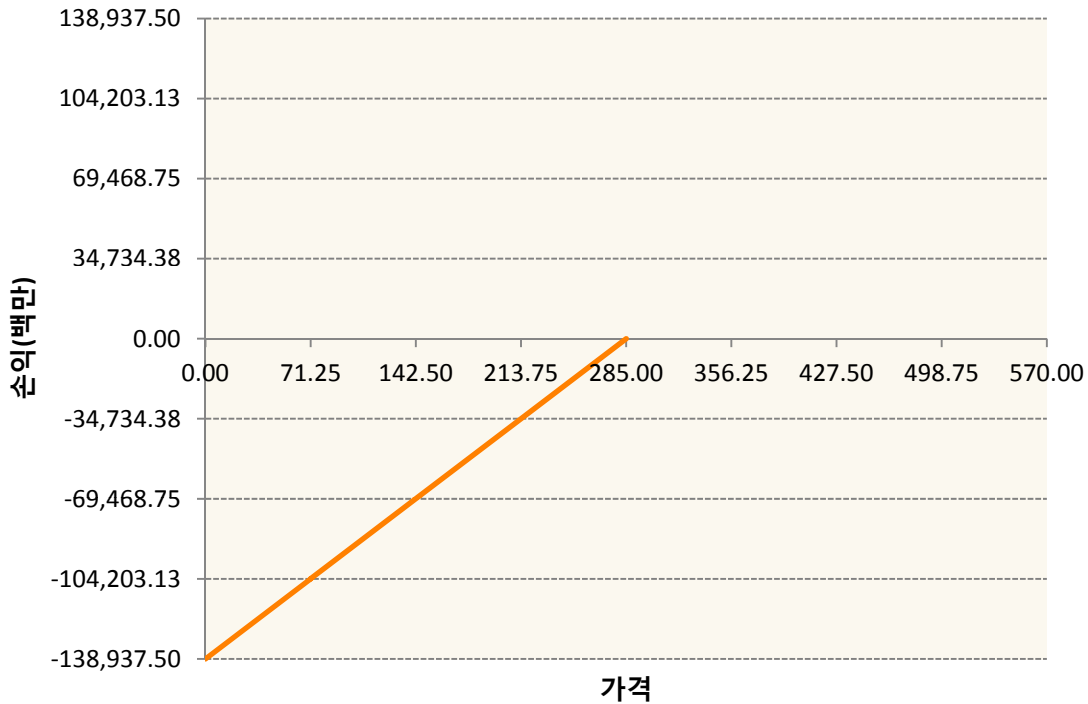


KR4201Q12878-2020-01 콜287.5





KR4301Q12850-2020-01 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q12852		2020-01 콜285					23,813
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13,132	12,847	12,527	12,176	11,801	11,406	10,992
-5.33%	11,323	10,826	10,320	9,805	9,284	8,759	8,230
-2.67%	7,421	6,867	6,312	5,756	5,199	4,641	4,083
0%	1,293	886	453	0	-469	-952	-1,446
2.67%	-6,377	-6,581	-6,829	-7,113	-7,431	-7,776	-8,146
5.33%	-14,764	-14,837	-14,943	-15,084	-15,259	-15,467	-15,706
8.00%	-23,382	-23,401	-23,436	-23,492	-23,572	-23,679	-23,813
KR4201Q12878		2020-01 콜287.5					1,611
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	796	780	762	741	719	695	669

-5.33%	703	672	640	607	573	539	503
-2.67%	482	442	403	364	324	285	246
0%	102	69	35	0	-36	-72	-109
2.67%	-403	-422	-443	-467	-493	-521	-550
5.33%	-975	-982	-992	-1,005	-1,021	-1,038	-1,058
8.00%	-1,571	-1,573	-1,577	-1,582	-1,590	-1,599	-1,611
KR4301Q12850 2020-01 풋285							6,556
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,406	-6,415	-6,430	-6,452	-6,480	-6,515	-6,556
-5.33%	-2,806	-2,887	-2,974	-3,066	-3,163	-3,264	-3,367
-2.67%	-490	-607	-727	-847	-968	-1,090	-1,213
0%	130	96	52	0	-60	-126	-199
2.67%	180	178	173	165	153	135	112
5.33%	182	182	181	181	180	177	173
8.00%	182	182	182	182	182	181	181

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

(단위:백만원)

31,774

공시일	2019-12-30
기준일	2019-12-27

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

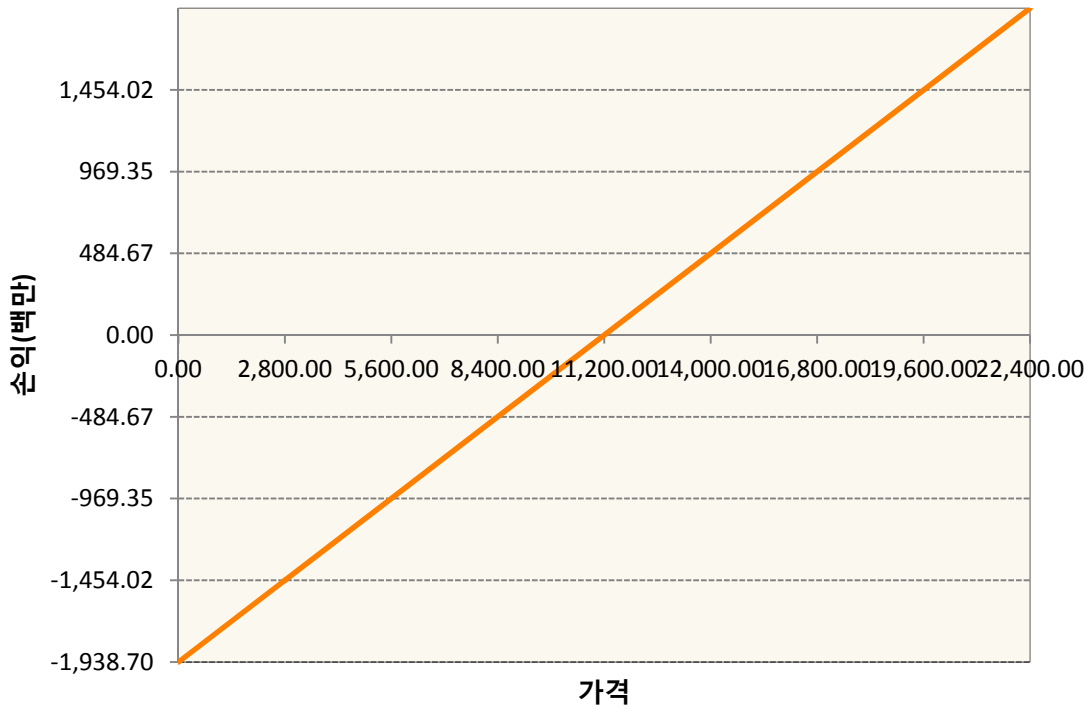
1. 계약금액

(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	1,939	0	1,939	
누계	유가증권	옵션	0	4,806	-4,806	장내
누계	통화	선도	0	2,100	-2,100	장외

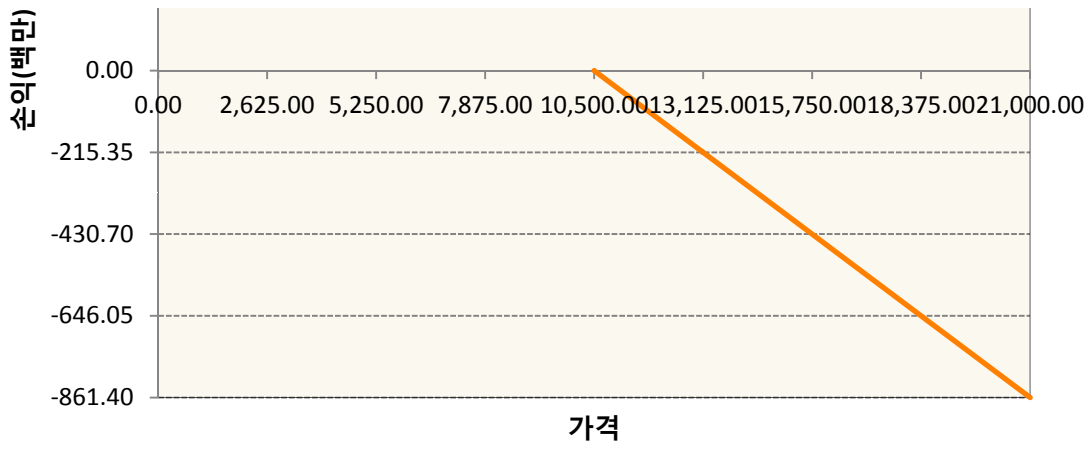
2. 만기시점의 손익구조

HCZ9-HSCEI Futures Dec19

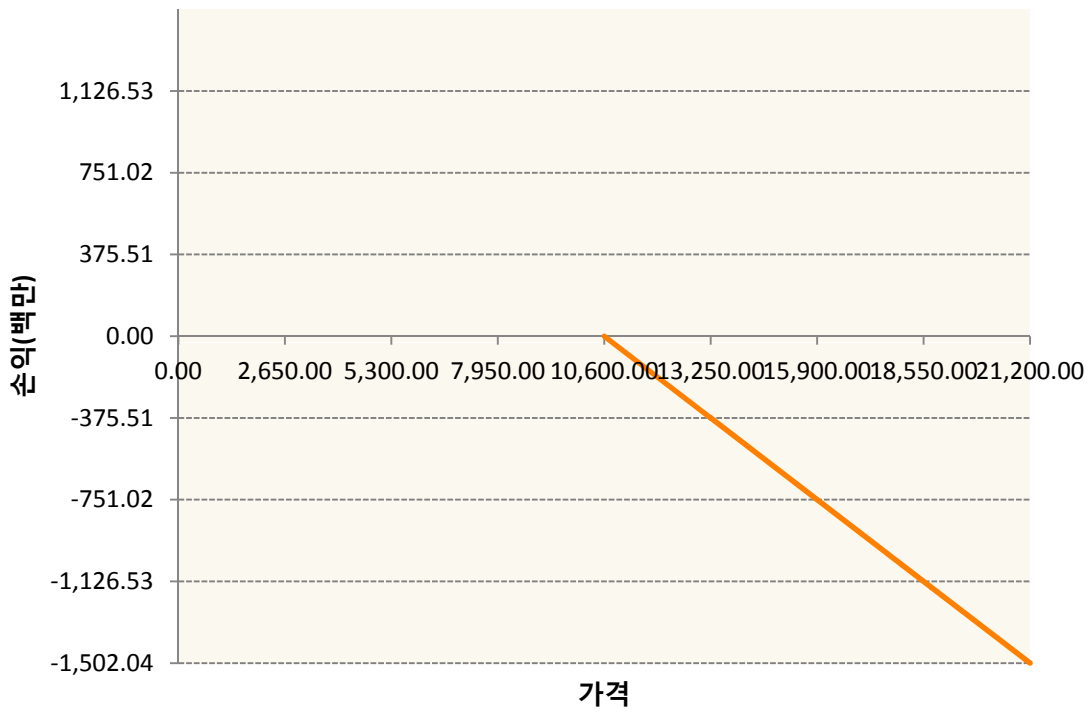


OHHIZ9-C105-HSCEI

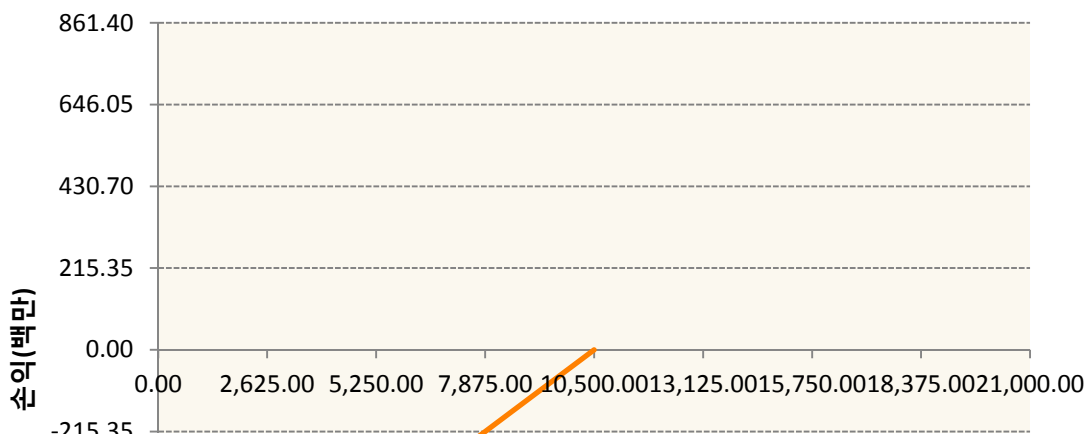


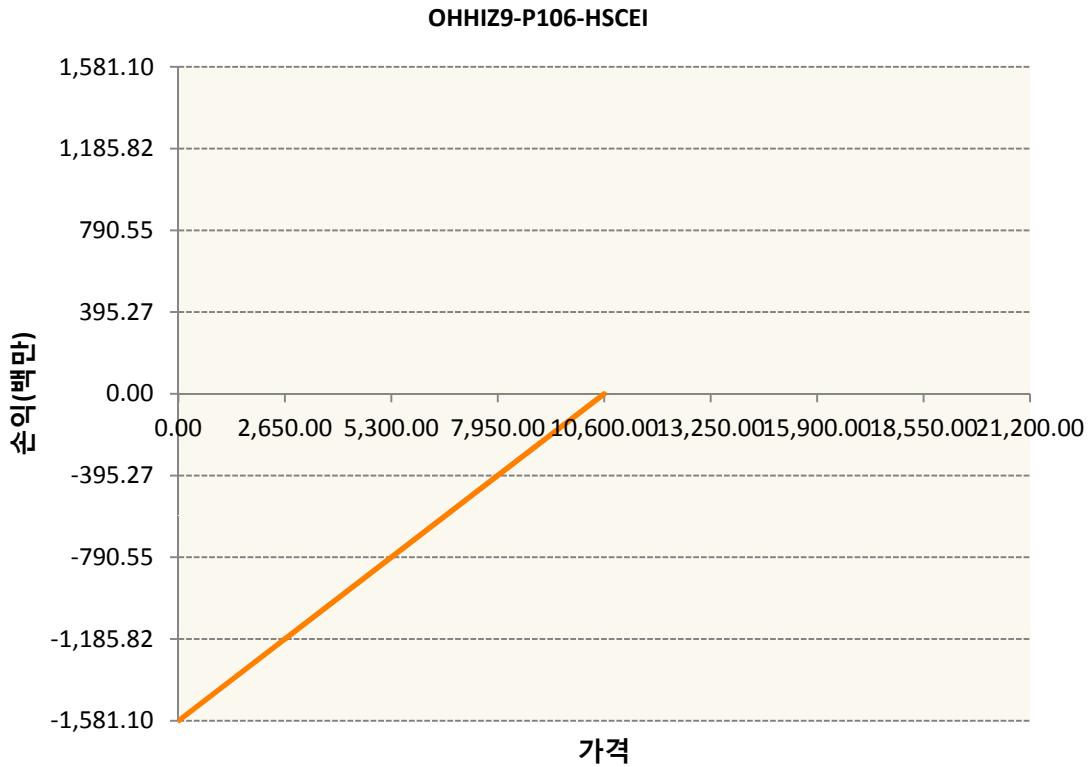


OHHIZ9-C106-HSCEI



OHHIZ9-P105-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	168
HCZ9 HSCEI Futures Dec19	155
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)

530

공시일	2019-12-30
기준일	2019-12-27

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

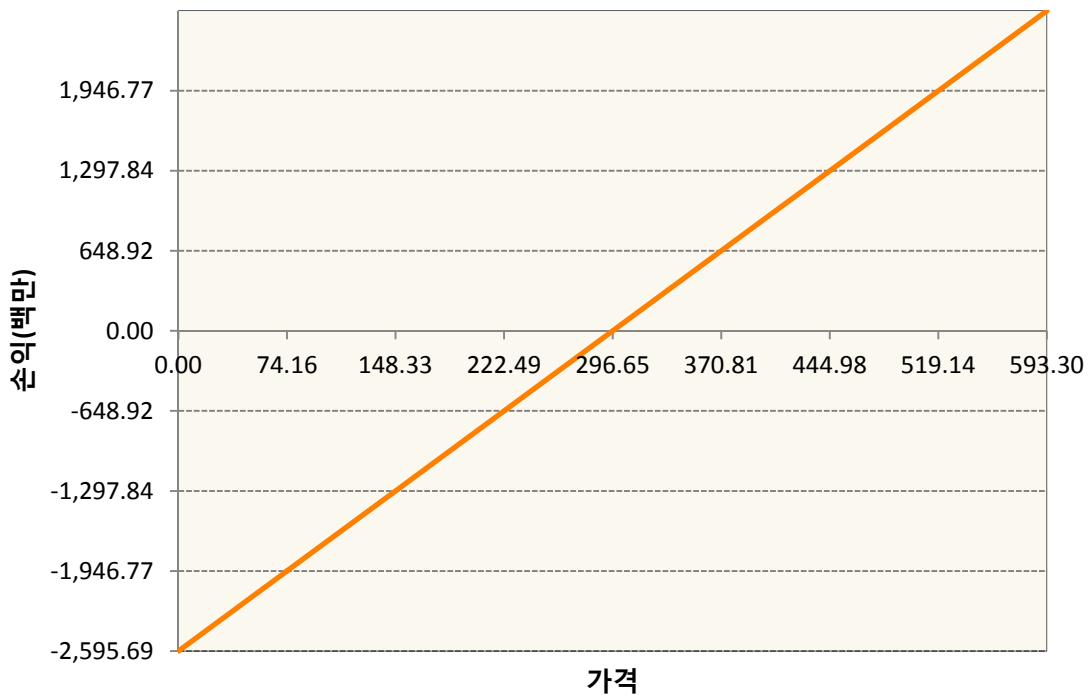
1. 계약금액

(단위:백만원)

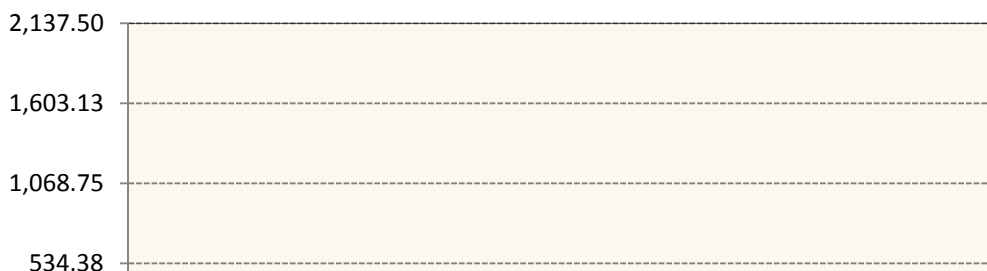
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	148	-148	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	280	0	280	장내
누계	유가증권	선물	2,596	0	2,596	장내
누계	유가증권	스왑	5,625	0	5,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,918	-4,918	장내

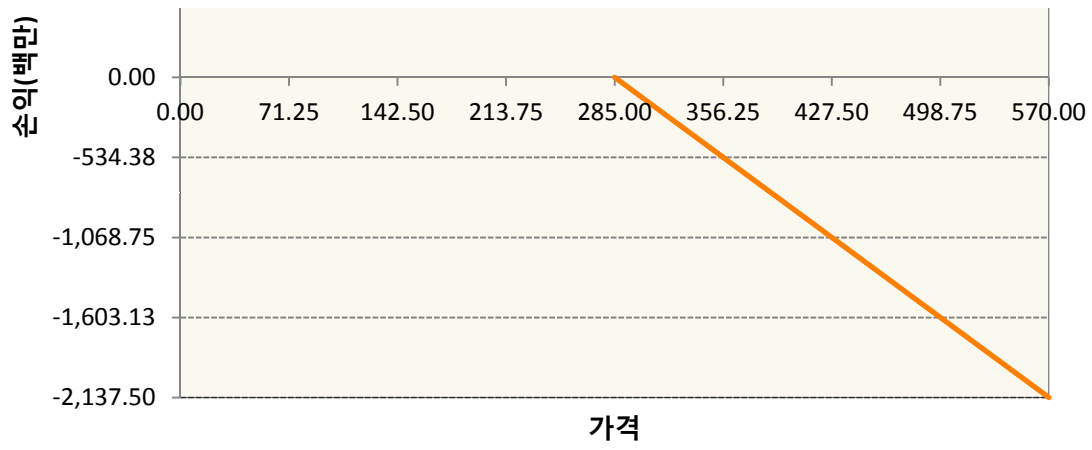
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

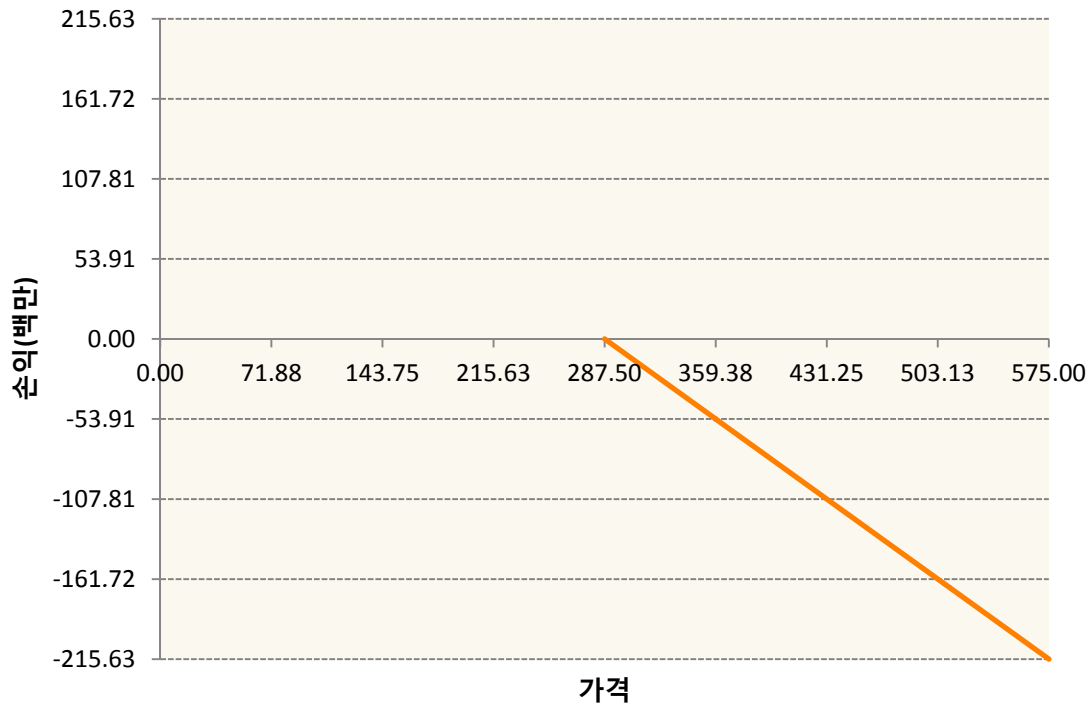


KR4201Q12852-2020-01 콜285

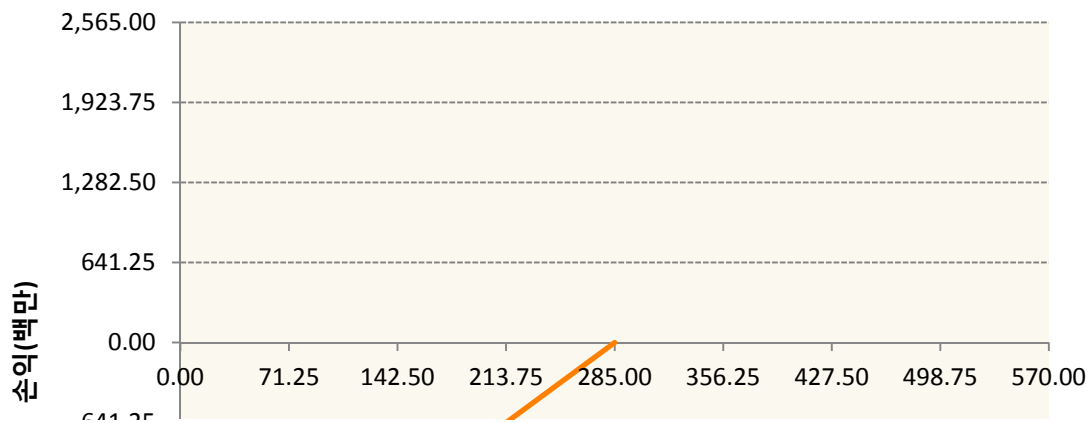


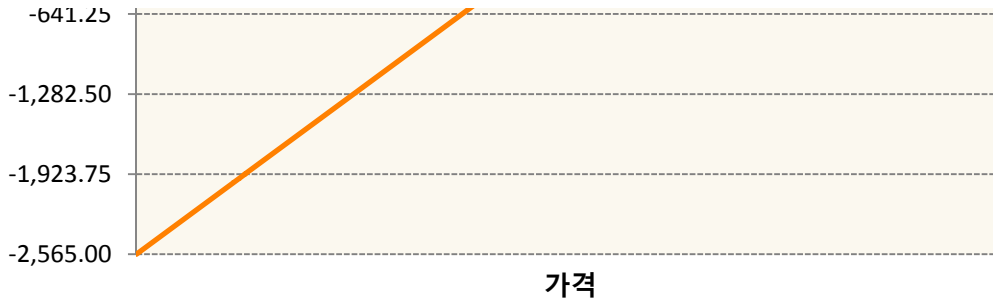


KR4201Q12878-2020-01 콜287.5



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						207
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-207	-207	-207	-207	-207	-207	-207	
-5.33%	-138	-138	-138	-138	-138	-138	-138	
-2.67%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	69	69	69	69	69	69	69	
5.33%	138	138	138	138	138	138	138	
8.00%	207	207	207	207	207	207	207	
KR4201Q12852		2020-01 콜285						162
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	89	87	85	83	80	78	75	
-5.33%	77	74	70	67	63	60	56	
-2.67%	50	47	43	39	35	32	28	
0%	9	6	3	0	-3	-6	-10	
2.67%	-43	-45	-46	-48	-51	-53	-55	
5.33%	-100	-101	-102	-103	-104	-105	-107	
8.00%	-159	-159	-159	-160	-160	-161	-162	
KR4201Q12878		2020-01 콜287.5						16
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	8	8	7	7	7	7	7
-5.33%	7	7	6	6	6	5	5
-2.67%	5	4	4	4	3	3	2
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	-4	-4	-4	-5	-5	-5	-5
5.33%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
8.00%	-15	-15	-15	-15	-16	-16	-16
KR4301Q12850 2020-01 풋285							121
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-118	-118	-119	-119	-120	-120	-121
-5.33%	-52	-53	-55	-57	-58	-60	-62
-2.67%	-9	-11	-13	-16	-18	-20	-22
0%	2	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	3	3	3	3	3	2	2
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

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

(단위:백만원)

917

공시일	2019-12-30
기준일	2019-12-27

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

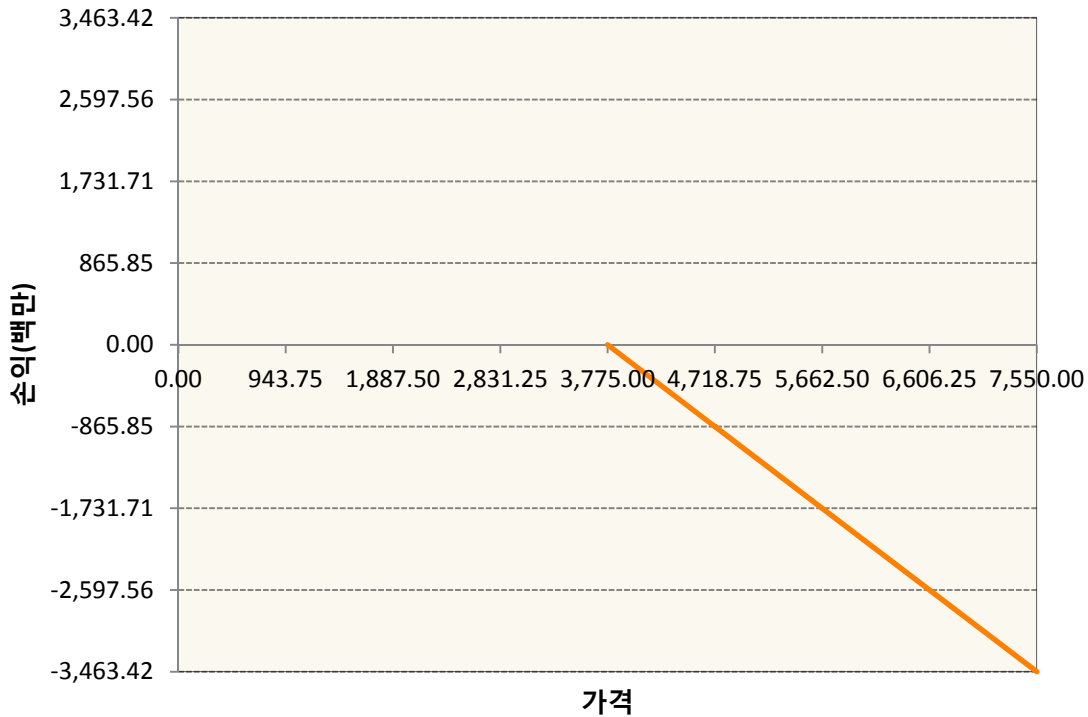
1. 계약금액

(단위:백만원)

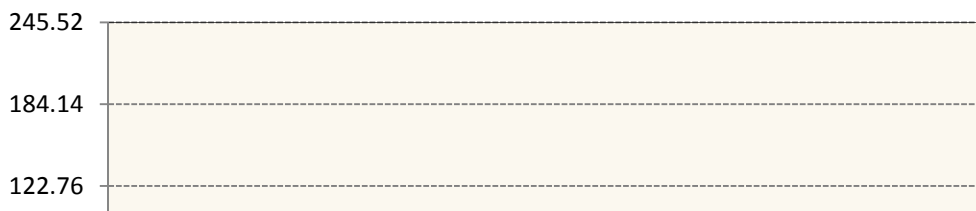
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	729	0	729	
누계	유가증권	스왑	17,668	0	17,668	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,418	-7,418	장내
누계	통화	선도	0	3,391	-3,391	장외

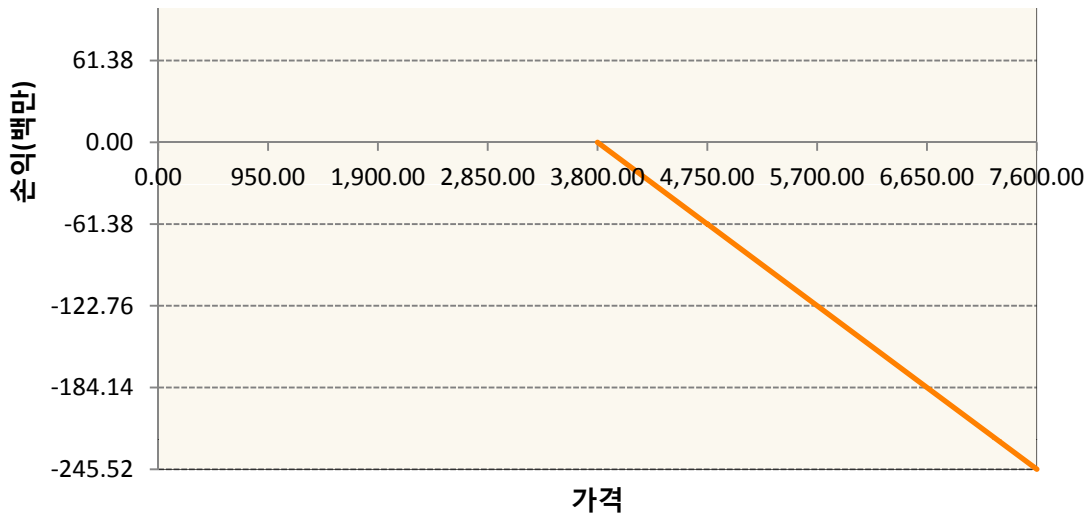
2. 만기시점의 손익구조

OESXF0-C3775-EURO STOXX 50

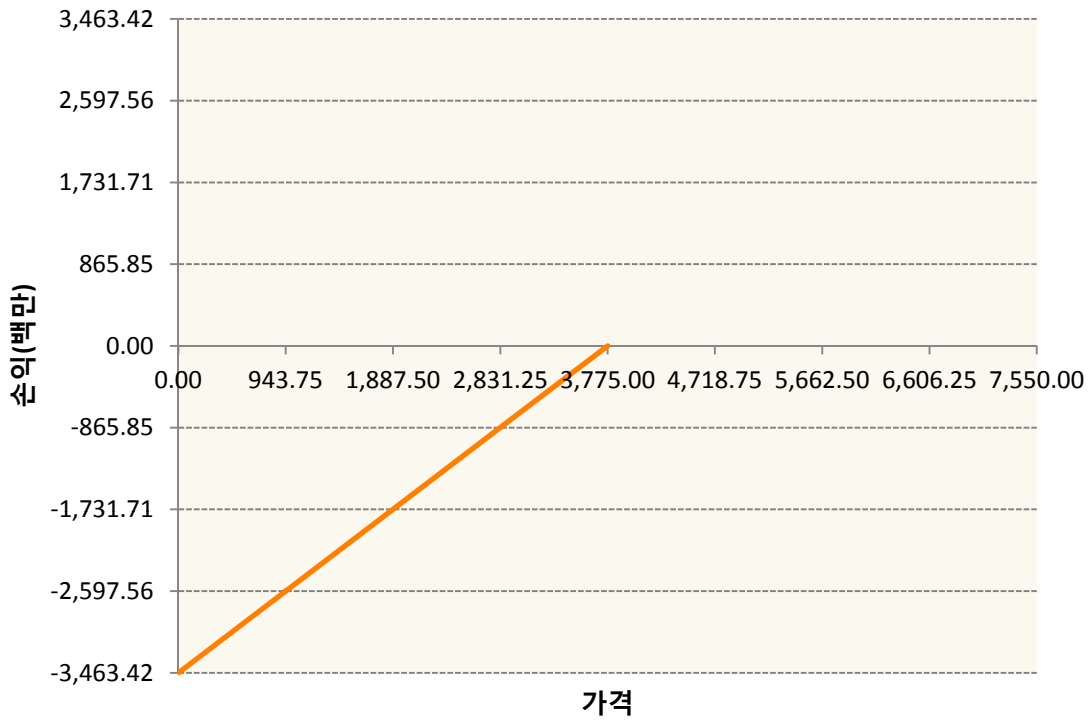


OESXF0-C3800-EURO STOXX 50

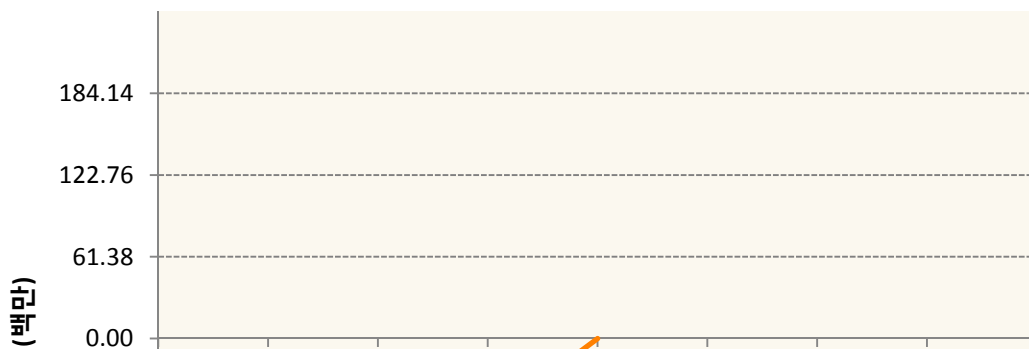


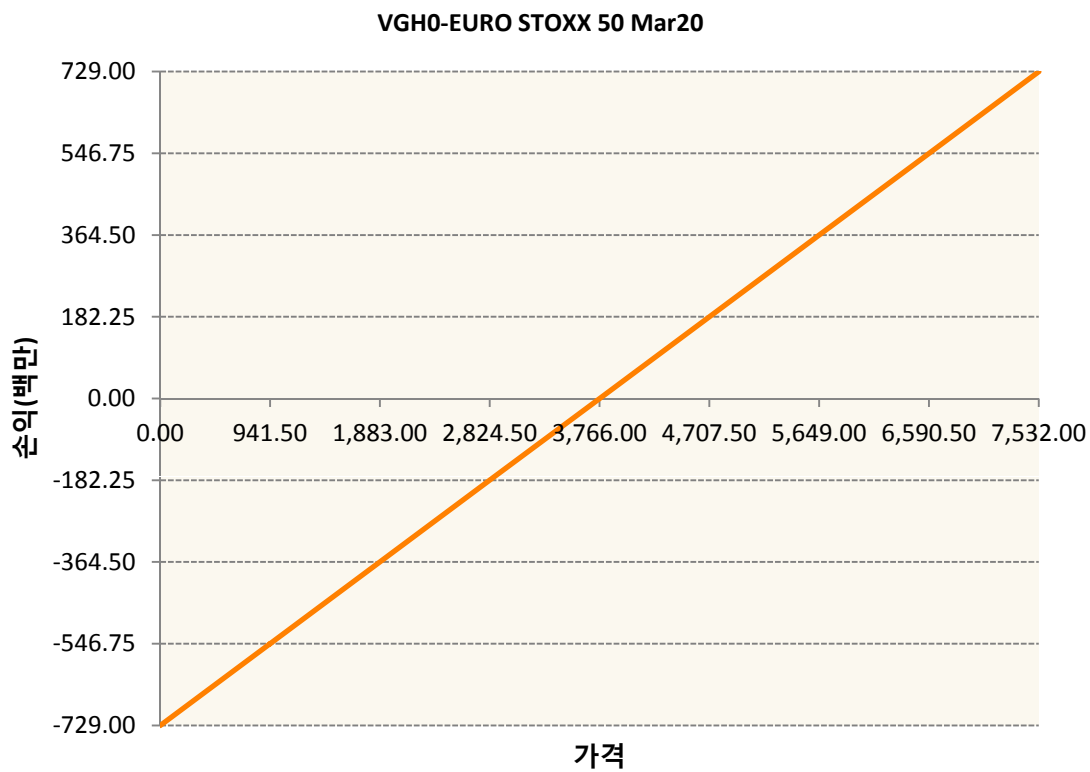
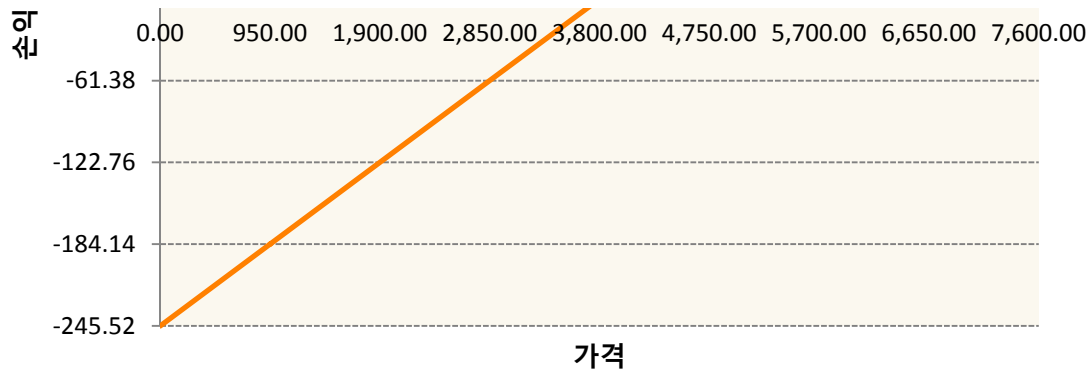


OESXF0-P3775-EURO STOXX 50



OESXF0-P3800-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	40
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	271
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)

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

(단위:백만원)

925

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	2019-12-30
기준일	2019-12-27

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

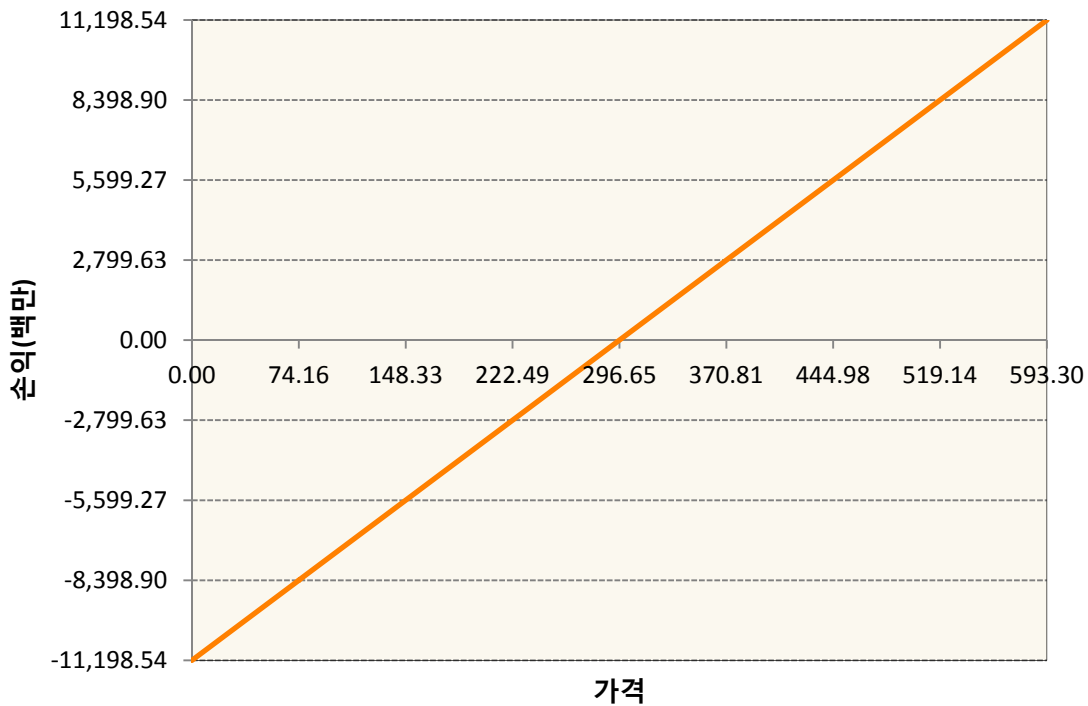
1. 계약금액

(단위:백만원)

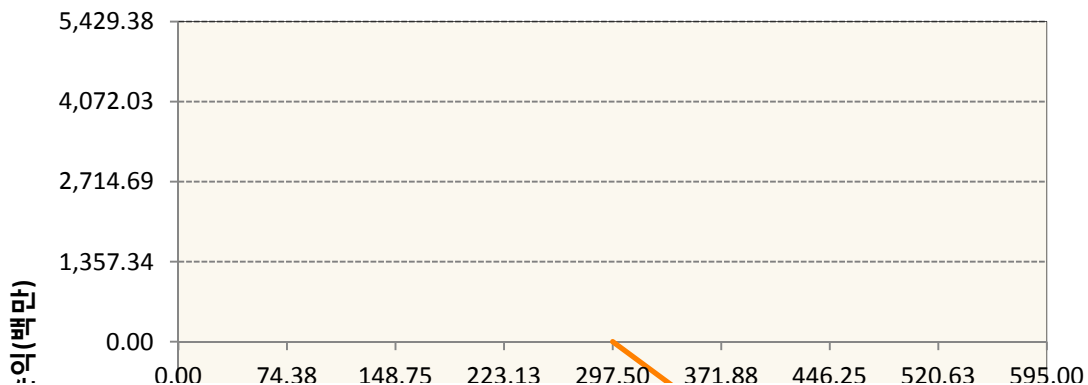
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,199	0	11,199	장내
누계	유가증권	옵션	499	21,179	-20,681	장내

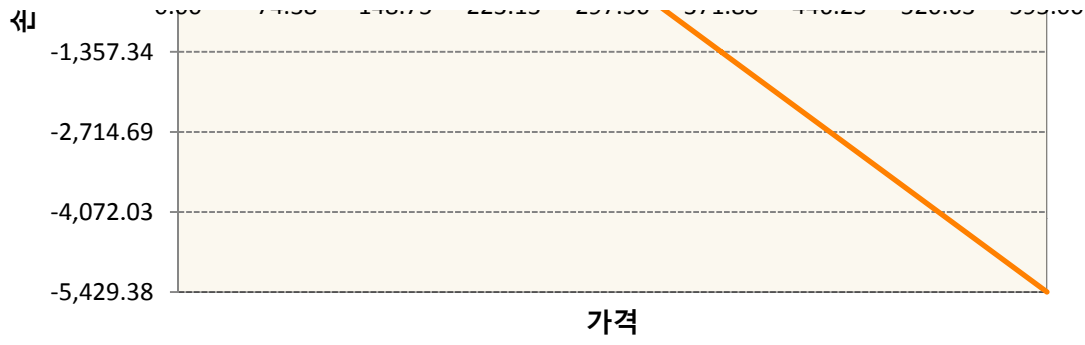
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

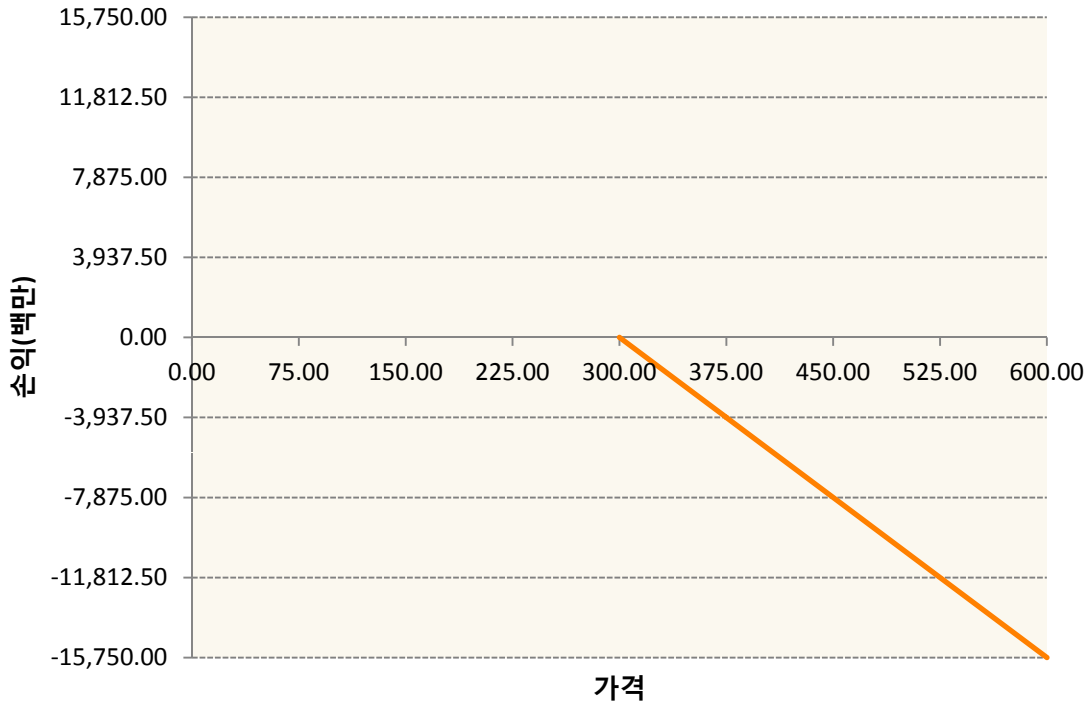


KR4201Q12977-2020-01 콜297.5

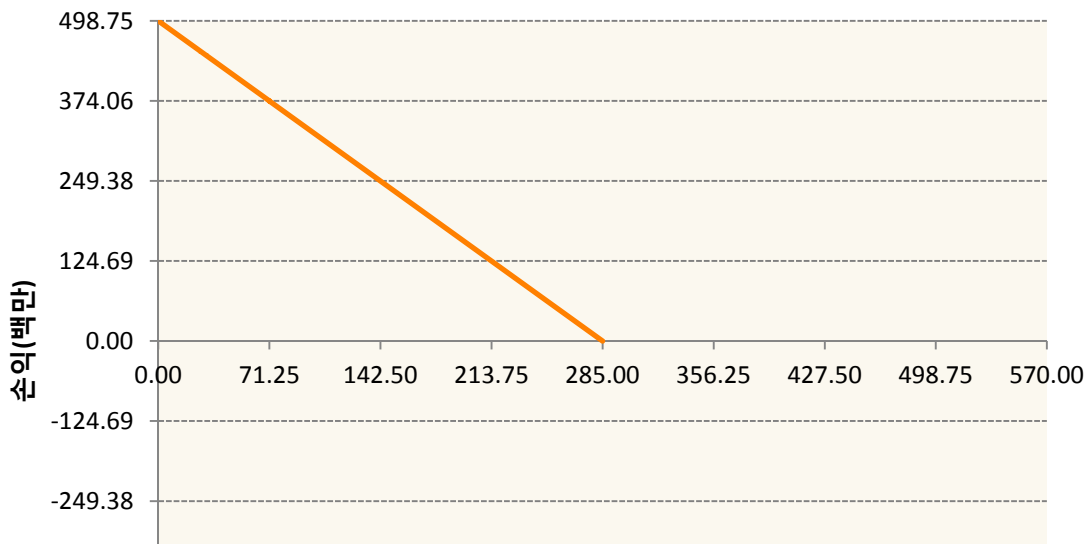


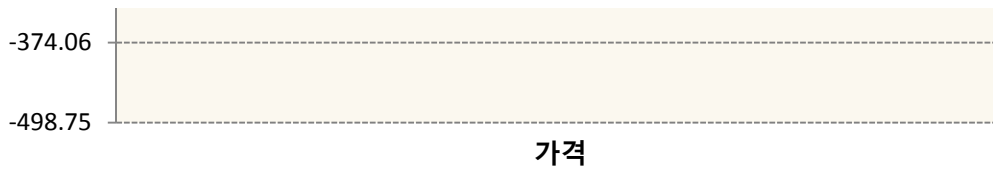


KR4201Q13009-2020-01 콜300



KR4301Q12850-2020-01 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						892
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-892	-892	-892	-892	-892	-892	-892	
-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%	892	892	892	892	892	892	892	
KR4201Q12977		2020-01 콜297.5						322
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	94	93	92	90	88	85	81	
-5.33%	90	87	83	78	73	68	62	
-2.67%	72	66	59	51	43	35	27	
0%	28	19	10	0	-10	-19	-29	
2.67%	-52	-60	-70	-79	-88	-97	-107	
5.33%	-164	-170	-176	-183	-190	-198	-206	
8.00%	-296	-299	-302	-306	-311	-316	-322	
KR4201Q13009		2020-01 콜300						870
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	220	218	216	212	206	199	191	
-5.33%	212	205	197	186	174	161	146	
-2.67%	177	161	143	124	104	82	60	
0%	78	53	26	0	-27	-53	-80	
2.67%	-118	-146	-173	-201	-229	-257	-285	
5.33%	-415	-435	-456	-479	-502	-526	-551	
8.00%	-780	-790	-803	-817	-833	-851	-870	
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	23	23	24	
-5.33%	10	10	11	11	11	12	12	
-2.67%	2	2	3	3	3	4	4	

0%	0	0	0	0	0	0	1
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)

1,858

공시일	2019-12-30
기준일	2019-12-27

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	204,761	0	204,761	

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	2019-12-30
기준일	2019-12-27

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	213,732	0	213,732	

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	2019-12-30
기준일	2019-12-27

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	527,517	0	527,517	
누계	통화	선도	0	512,338	-512,338	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		1,858
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		3,196
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		4,739
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		2,323
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		1,988
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		929
FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E		3,717
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E		1,858
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E		1,988
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)

210

공시일	2019-12-30
기준일	2019-12-27

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

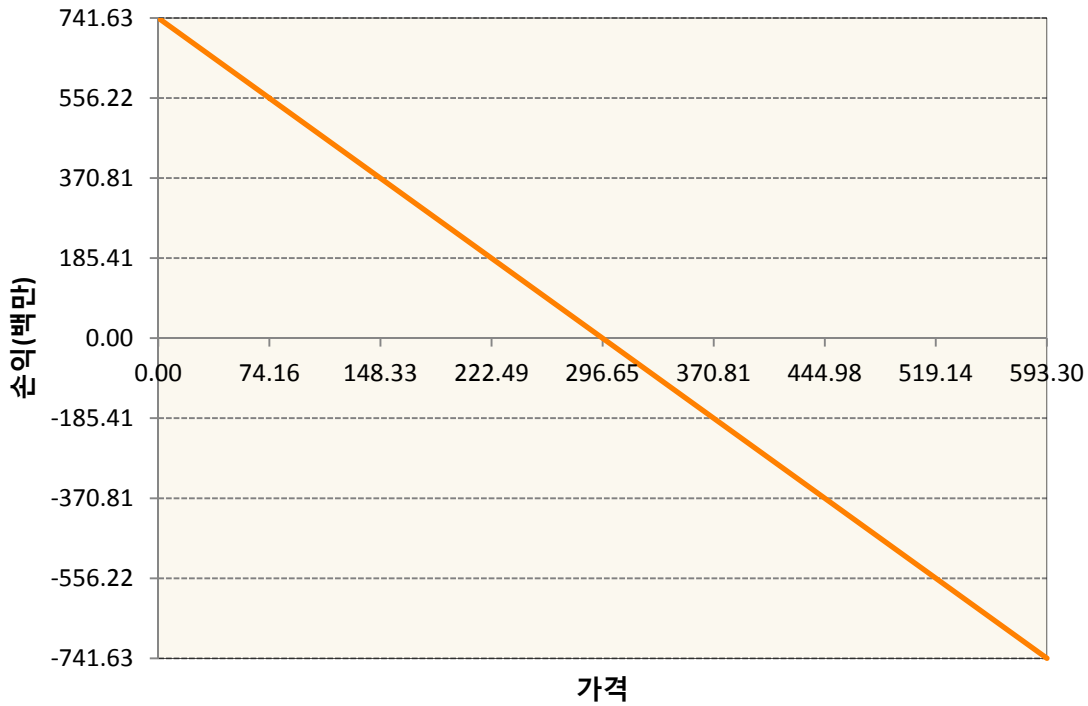
1. 계약금액

(단위:백만원)

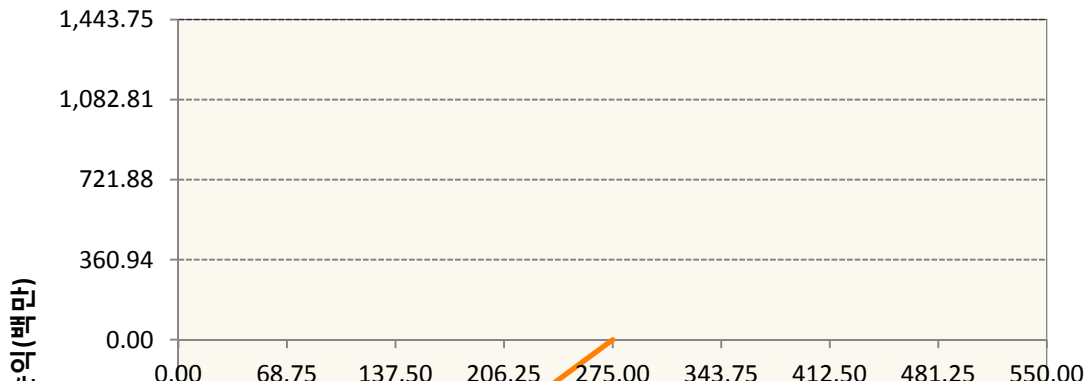
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	69	0	69	장내
누계	유가증권	선물	0	742	-742	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,872	-3,872	장내

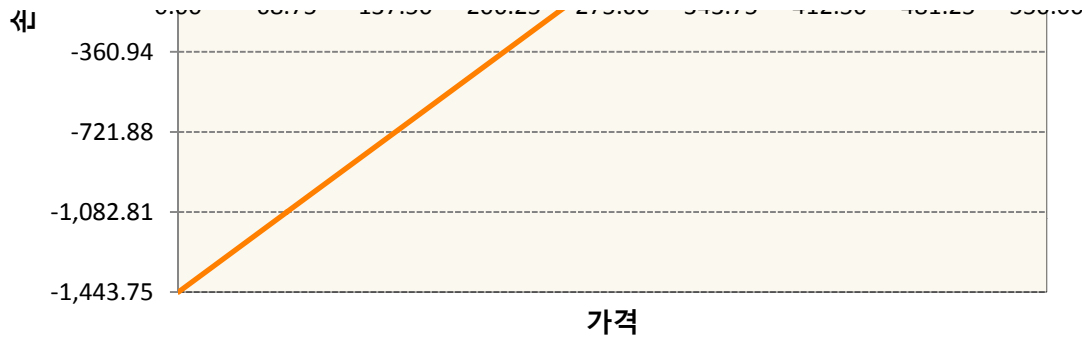
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

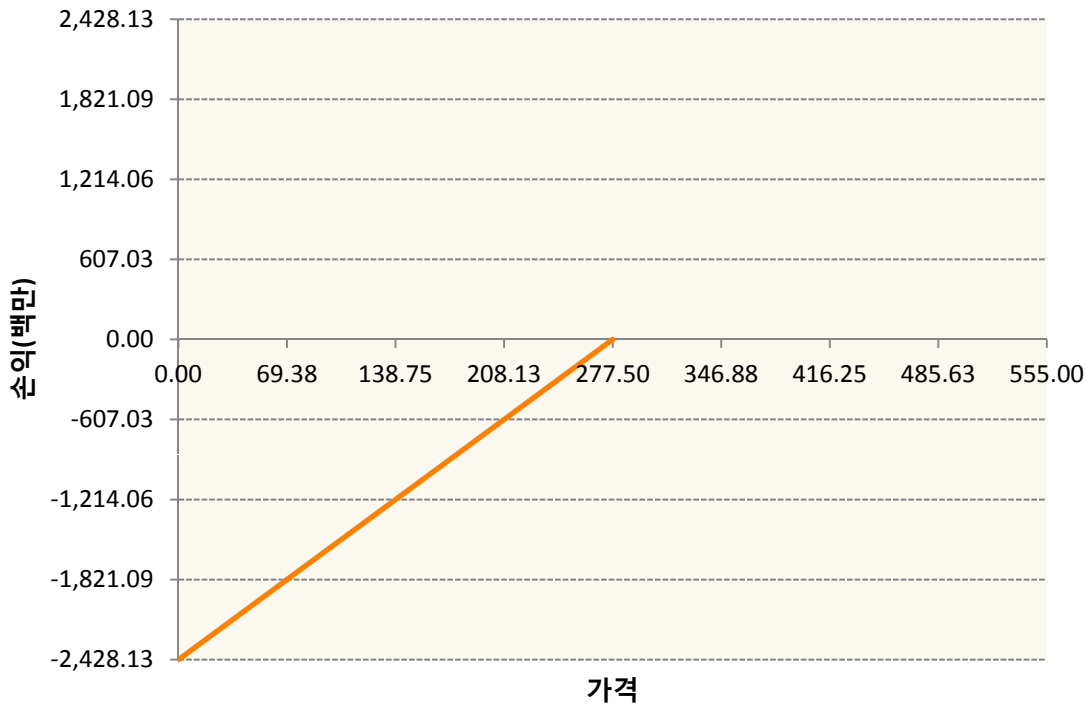


KR4301Q12751-2020-01 풋275





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						30
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-23	-24	-25	-26	-28	-29	-30
-5.33%	-4	-5	-6	-7	-8	-9	-10
-2.67%	0	0	-1	-1	-1	-2	-2
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 65

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-56	-57	-58	-60	-62	-63	-65
-5.33%	-12	-15	-17	-19	-21	-23	-25
-2.67%	-1	-1	-2	-3	-4	-5	-7
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)

71

공시일	2019-12-30
기준일	2019-12-27

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	13,549	0	13,549	
누계	통화	선도	941	14,356	-13,415	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	2019-12-30
기준일	2019-12-27

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	1	0	1	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	2,013	0	2,013	장외
누계	통화	선도	310	504	-194	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	37
2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	18
2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	25
2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	82
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)

135

공시일	2019-12-30
기준일	2019-12-27

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

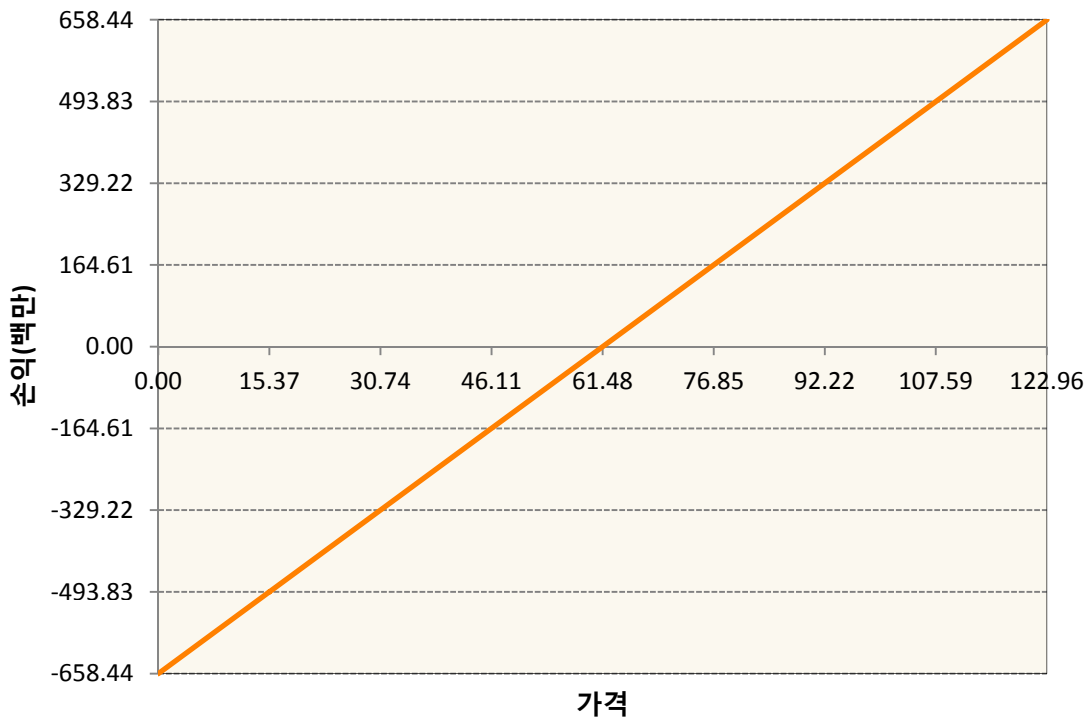
1. 계약금액

(단위:백만원)

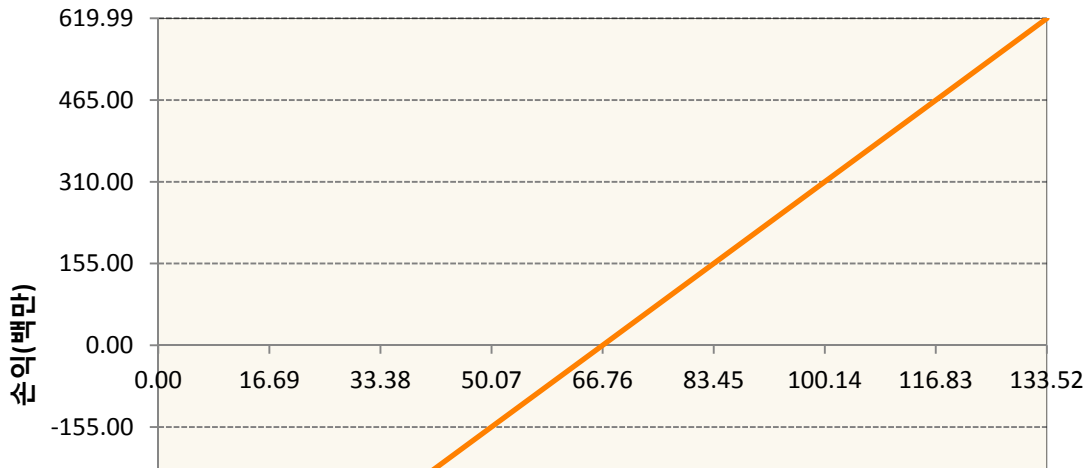
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,469	290	2,179	

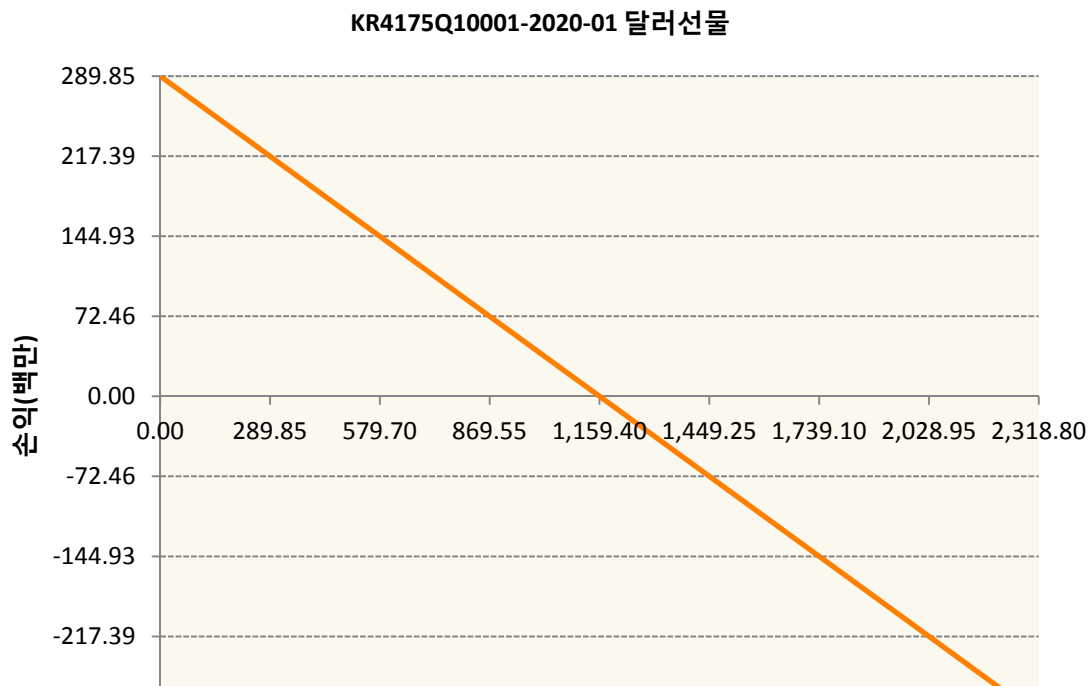
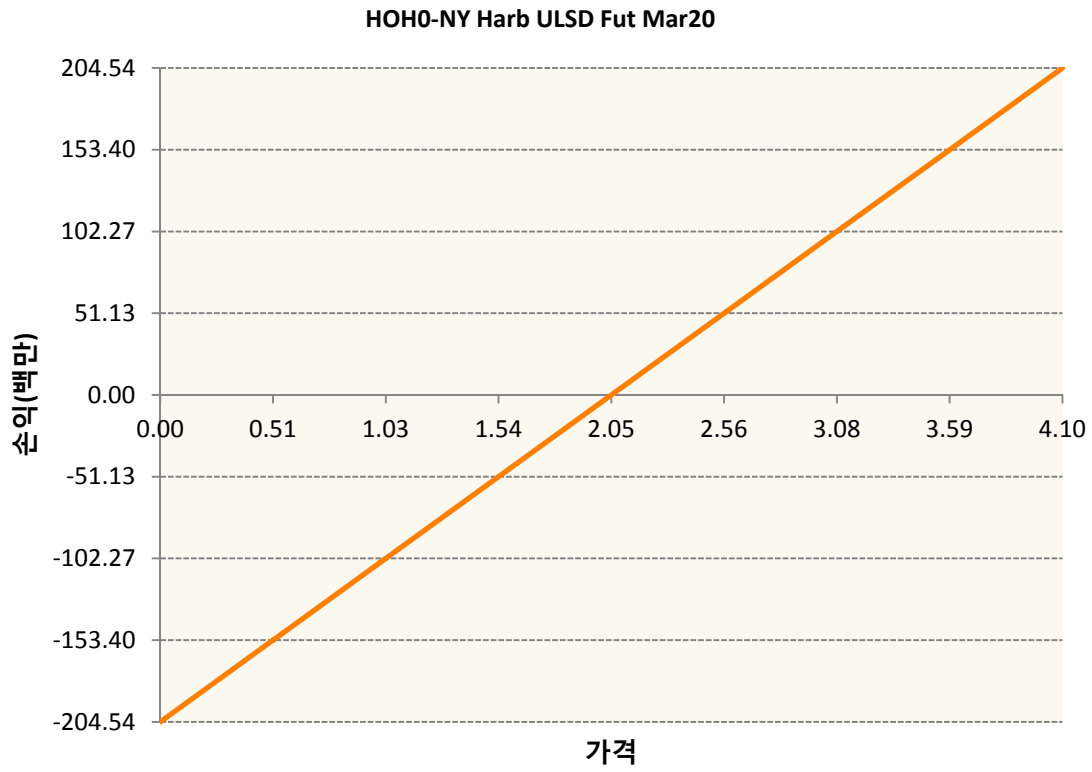
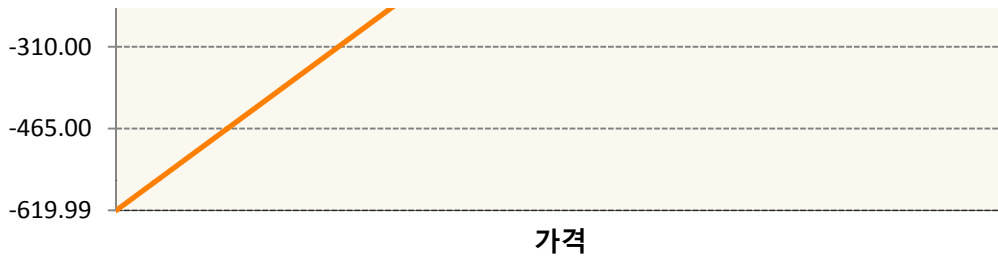
2. 만기시점의 손익구조

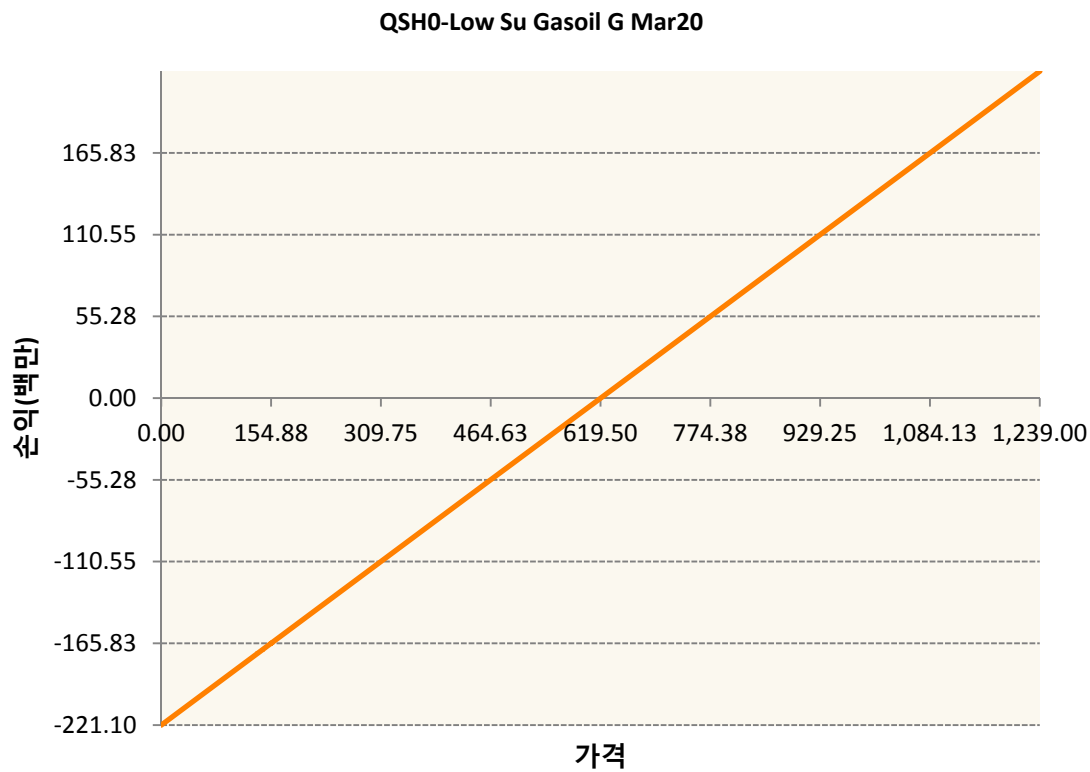
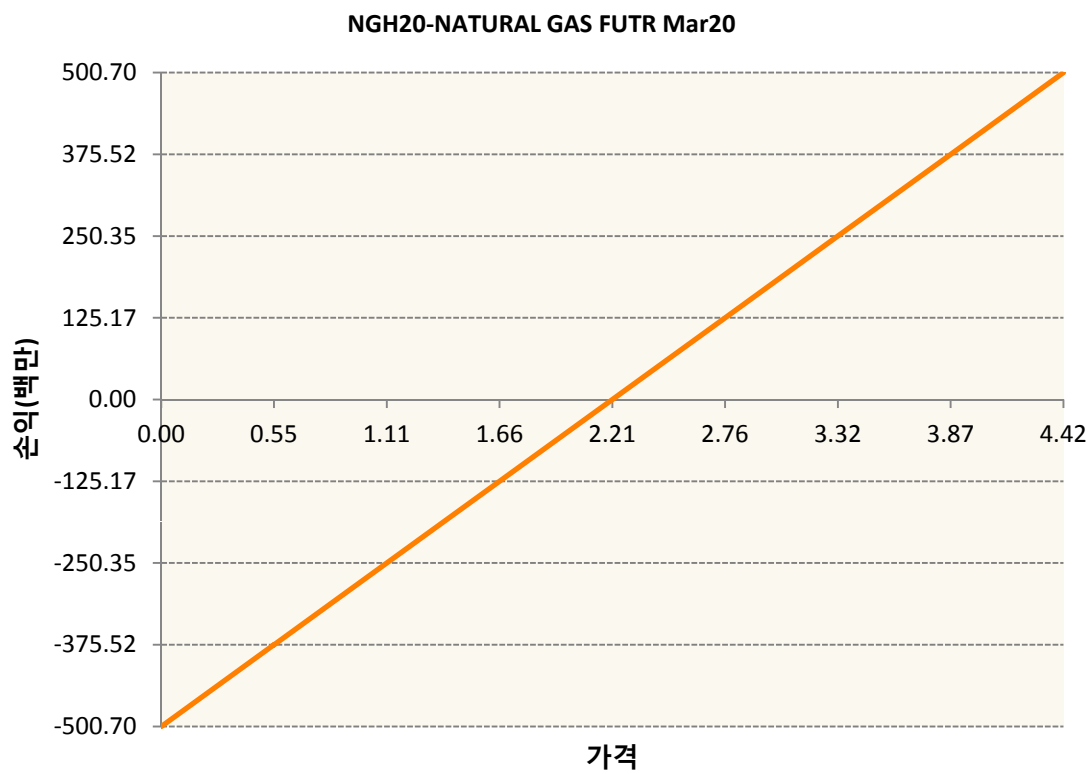
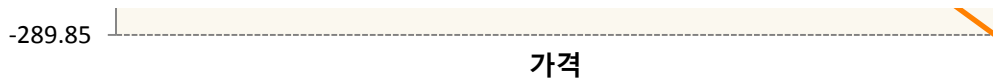
CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20



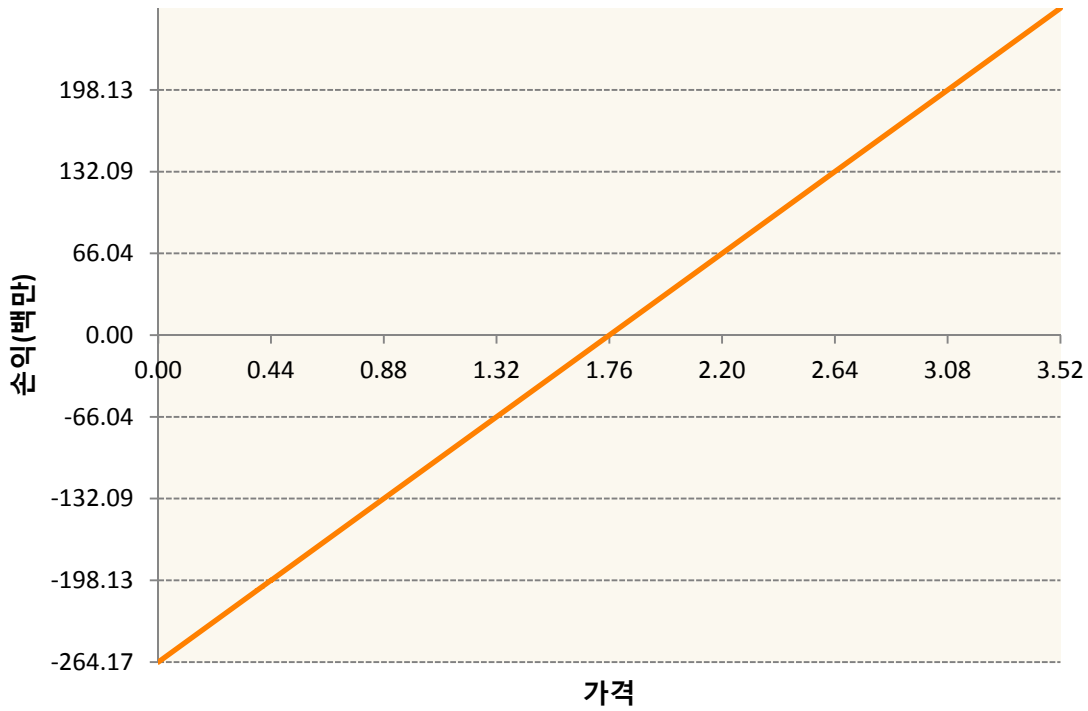
COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20







XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	53
COH0	BRENT CRUDE FUTR Mar20	50
HOH0	NY Harb ULSD Fut Mar20	16
KR4175Q10C	2020-01 달러선물	23
NGH20	NATURAL GAS FUTR Mar20	40
QSH0	Low Su Gasoil G Mar20	18
XBH0	GASOLINE RBOB FUT Mar20	21

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

(단위:백만원)

391

공시일	2019-12-30
기준일	2019-12-27

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

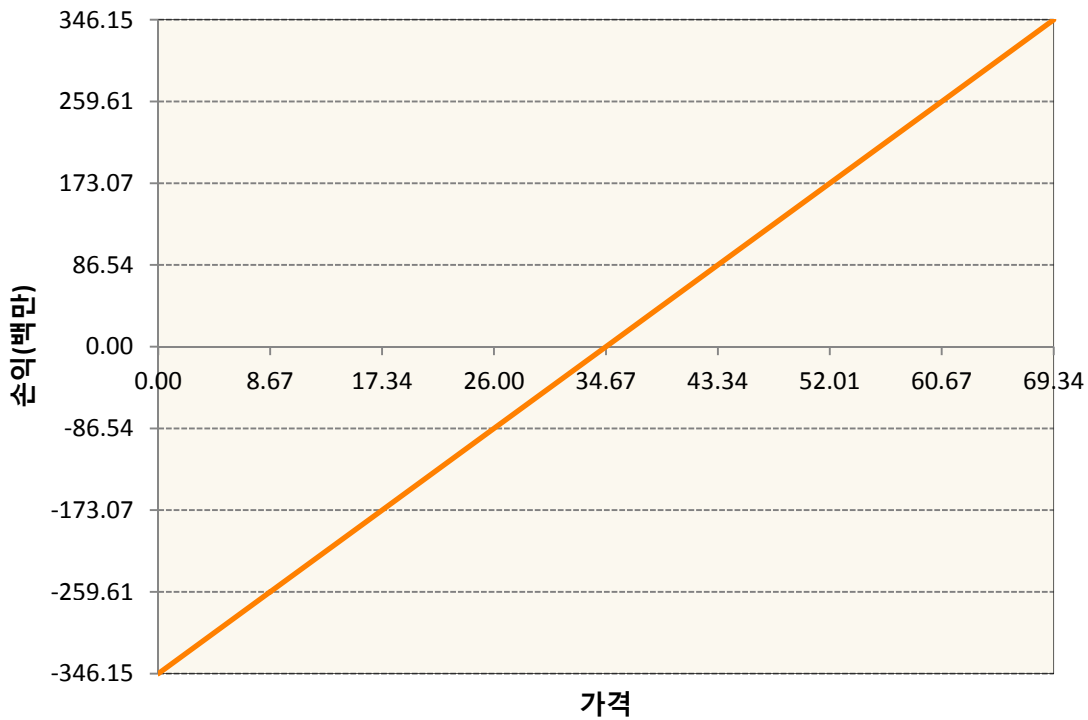
1. 계약금액

(단위:백만원)

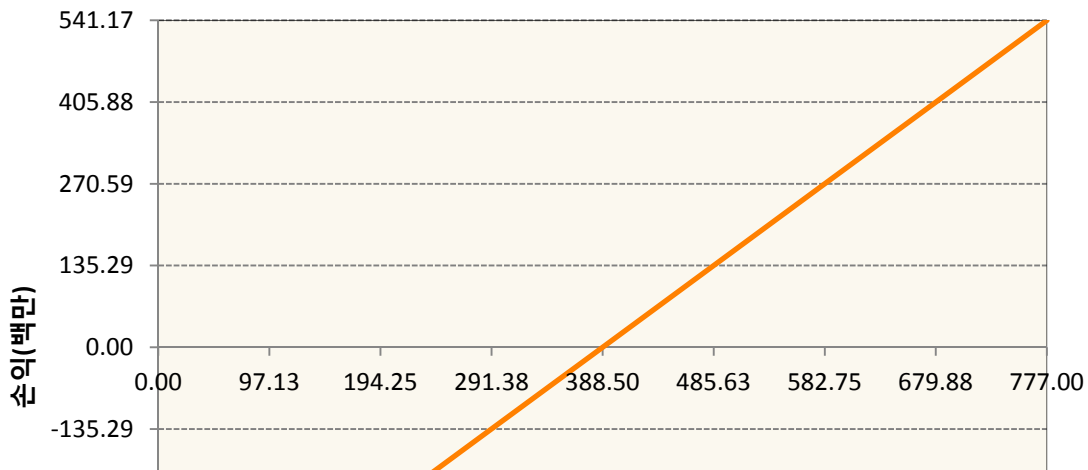
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,855	151	2,704	

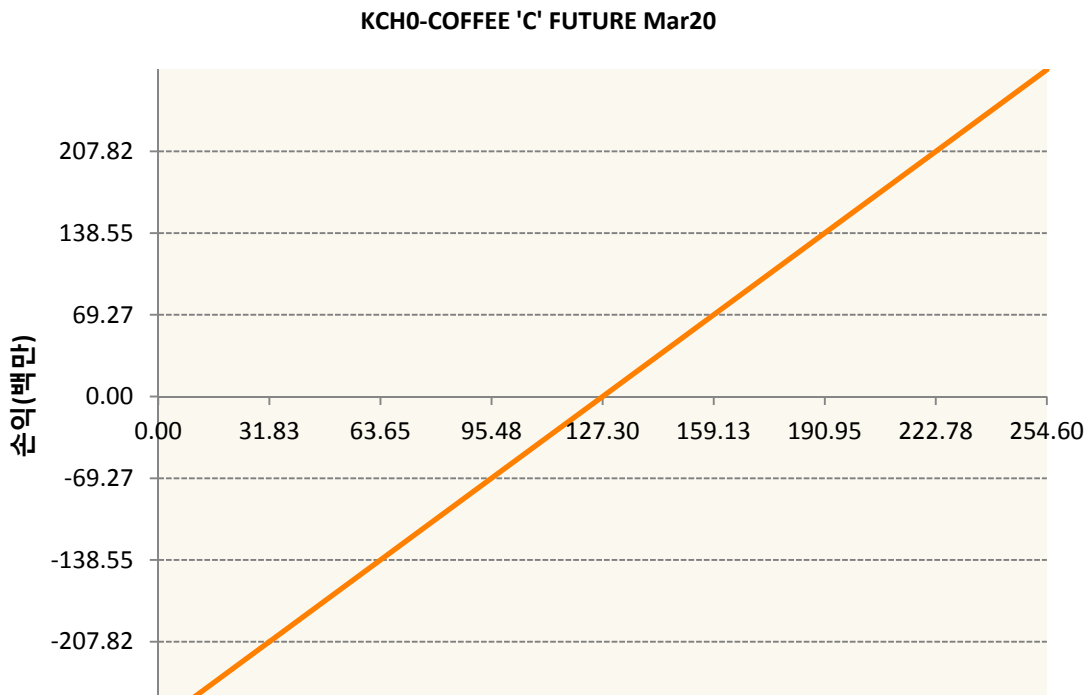
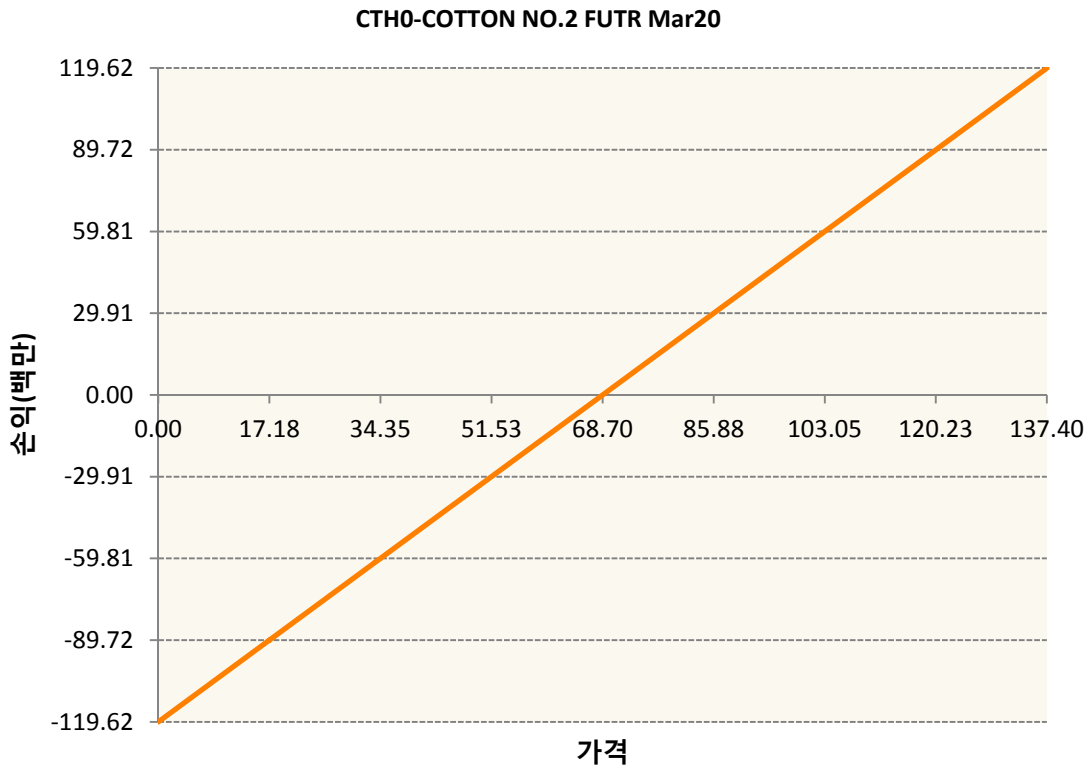
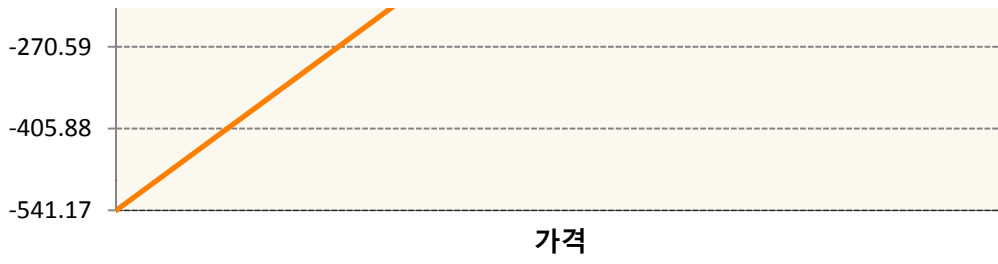
2. 만기시점의 손익구조

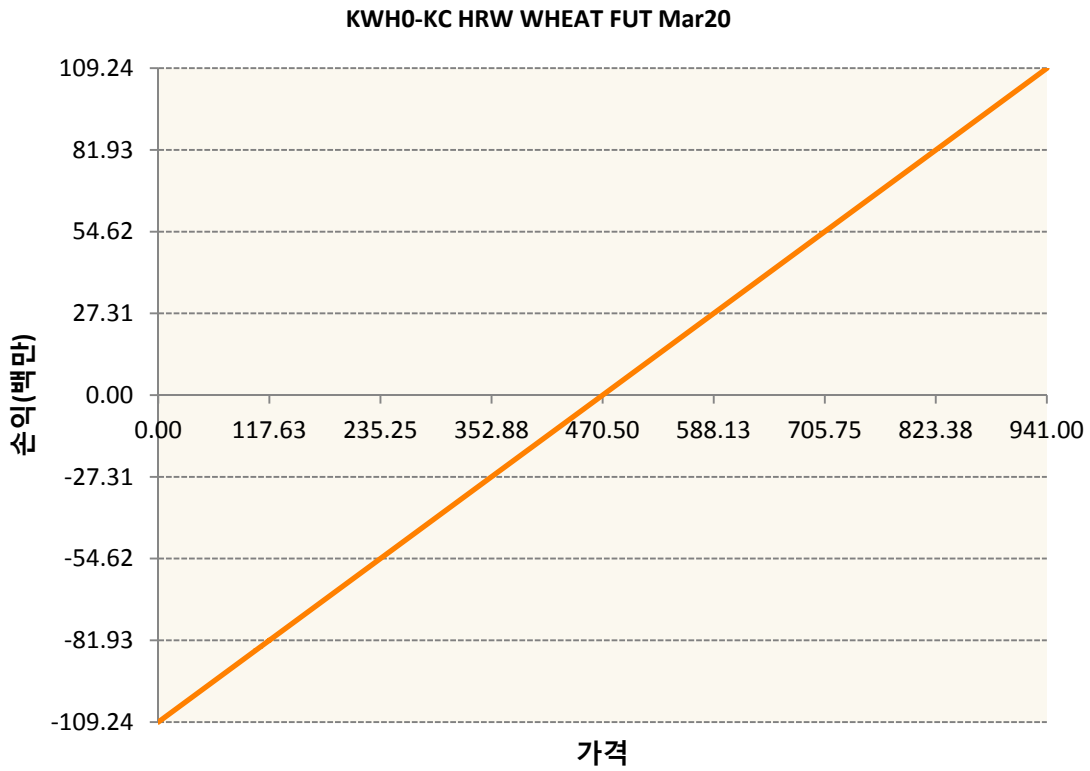
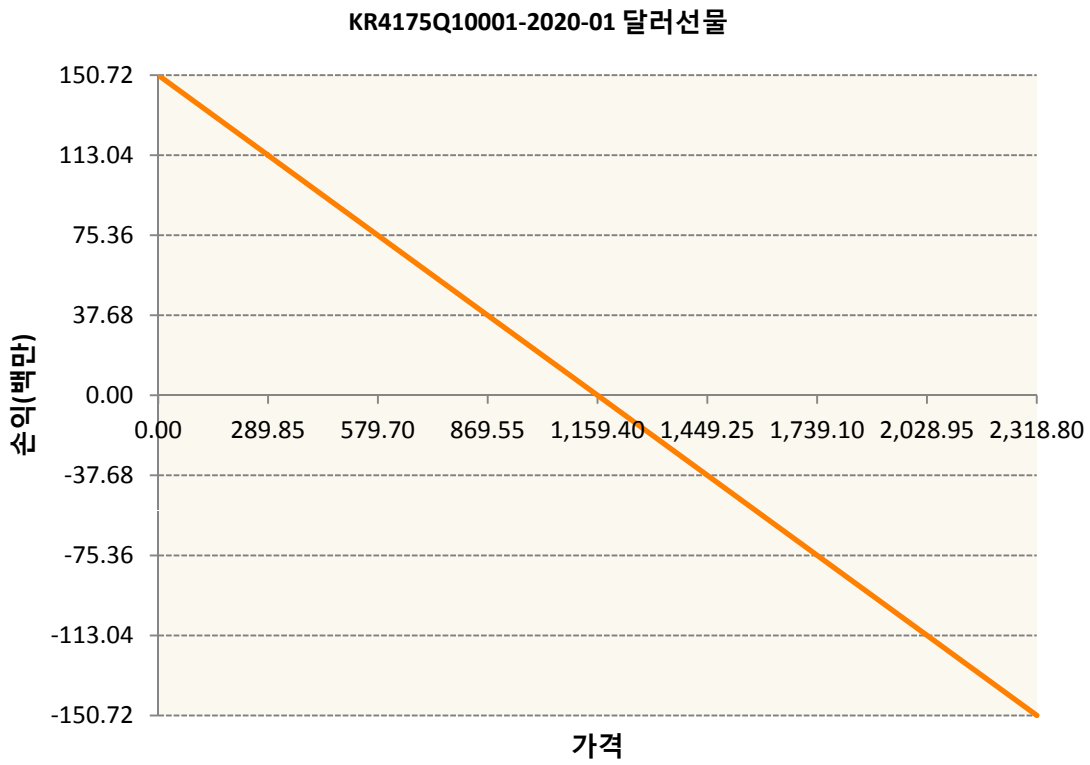
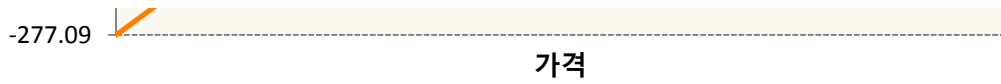
BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20



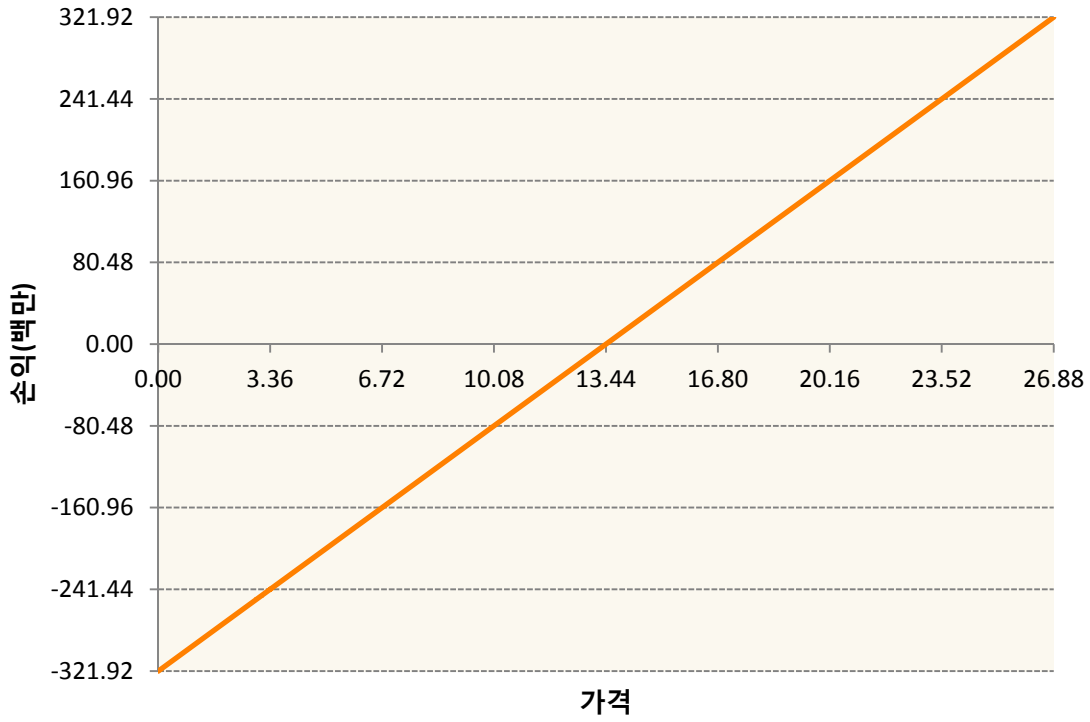
CH0-CORN FUTURE Mar20



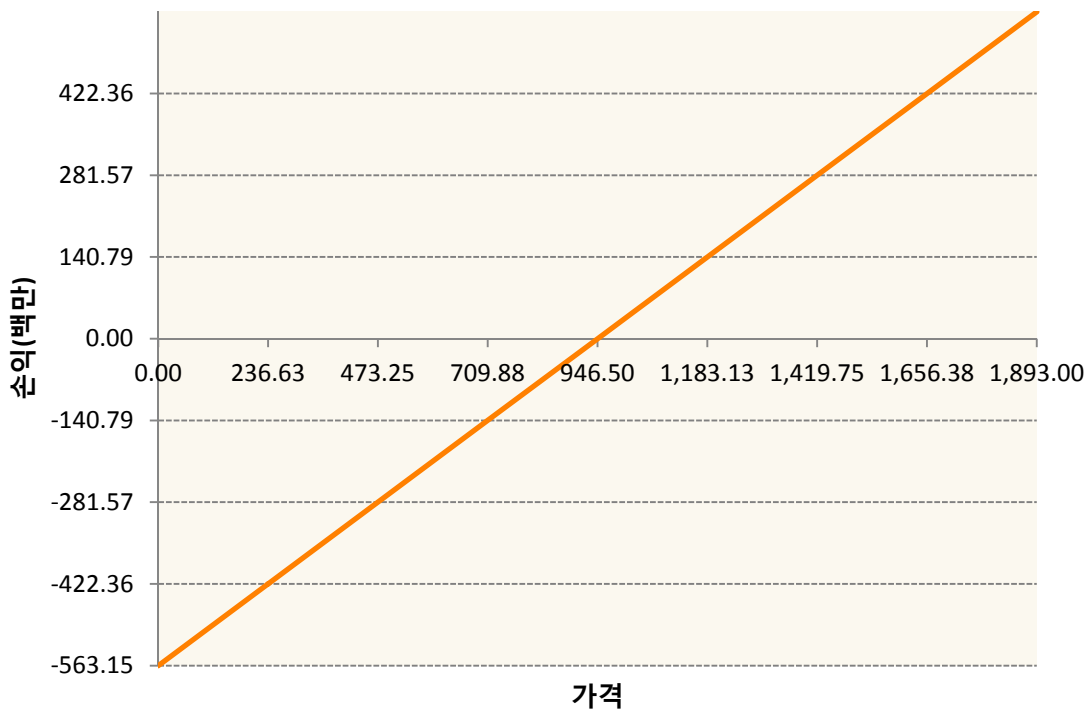




SBH0-Sugar Mar20

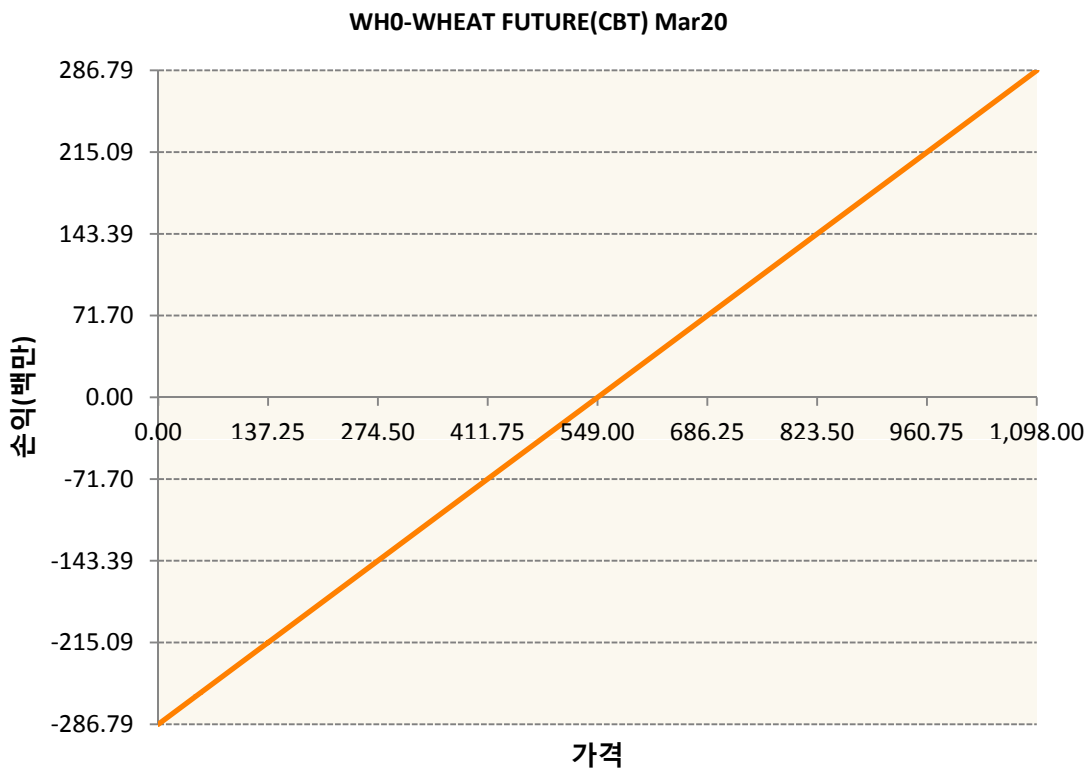
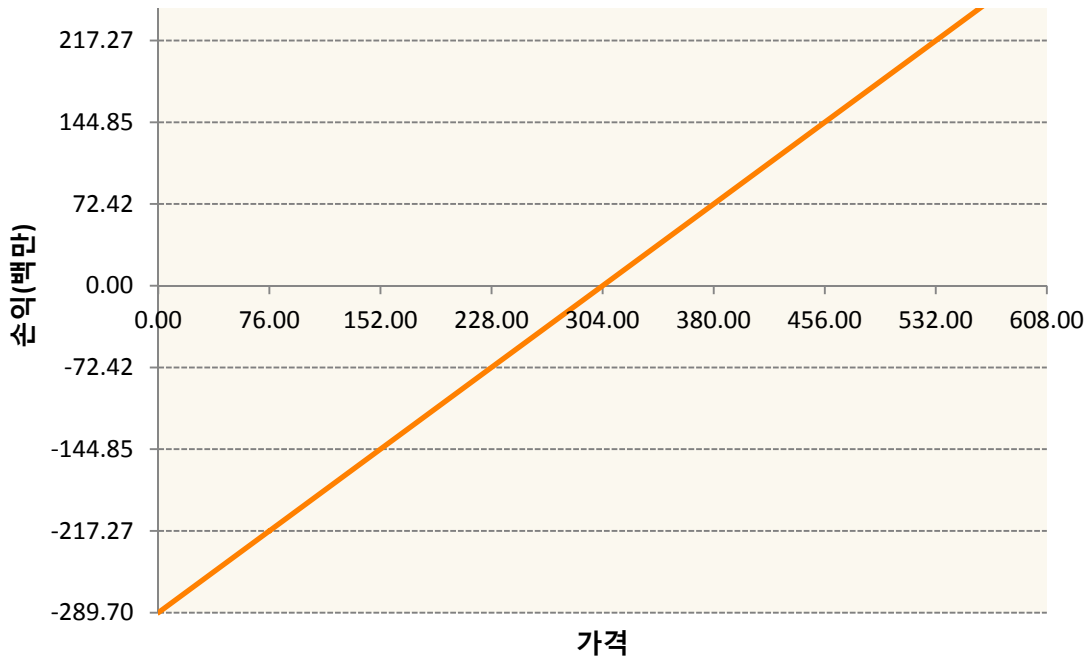


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20



SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH0	SOYBEAN OIL FUTR Mar20	28
CH0	CORN FUTURE Mar20	43
CTH0	COTTON NO.2 FUTR Mar20	10
KCH0	COFFEE 'C' FUTURE Mar20	22
KR4175Q10C	2020-01 달러선물	12

KWH0	KC HRW WHEAT FUT Mar20	9
SBH0	Sugar Mar20	26
SH0	SOYBEAN FUTURE Mar20	45
SMH0	SOYBEAN MEAL FUTR Mar20	23
WH0	WHEAT FUTURE(CBT) Mar20	23

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

(단위:백만원)

250