

공시일	2019-12-31
기준일	2019-12-30

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	2019-12-31
기준일	2019-12-30

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

1,132

* 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	2019-12-31
기준일	2019-12-30

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)	403
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	148

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

767

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2019-12-31
기준일	2019-12-30

유로인덱스모(주식-파생형)

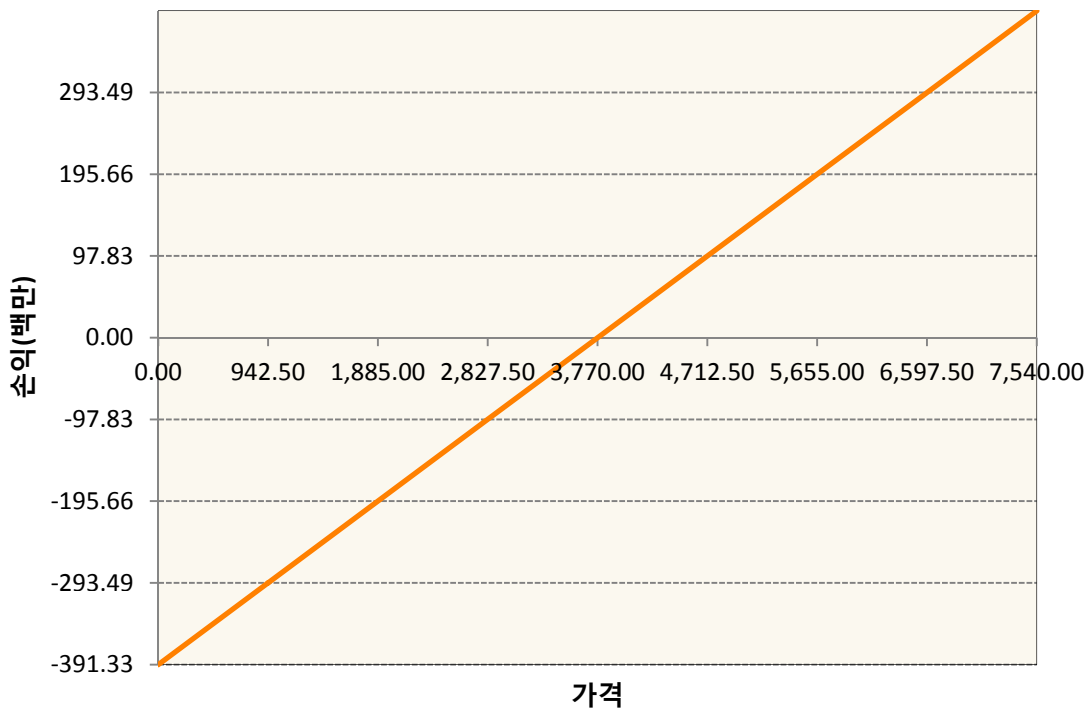
1. 계약금액

(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	2019-12-31
기준일	2019-12-30

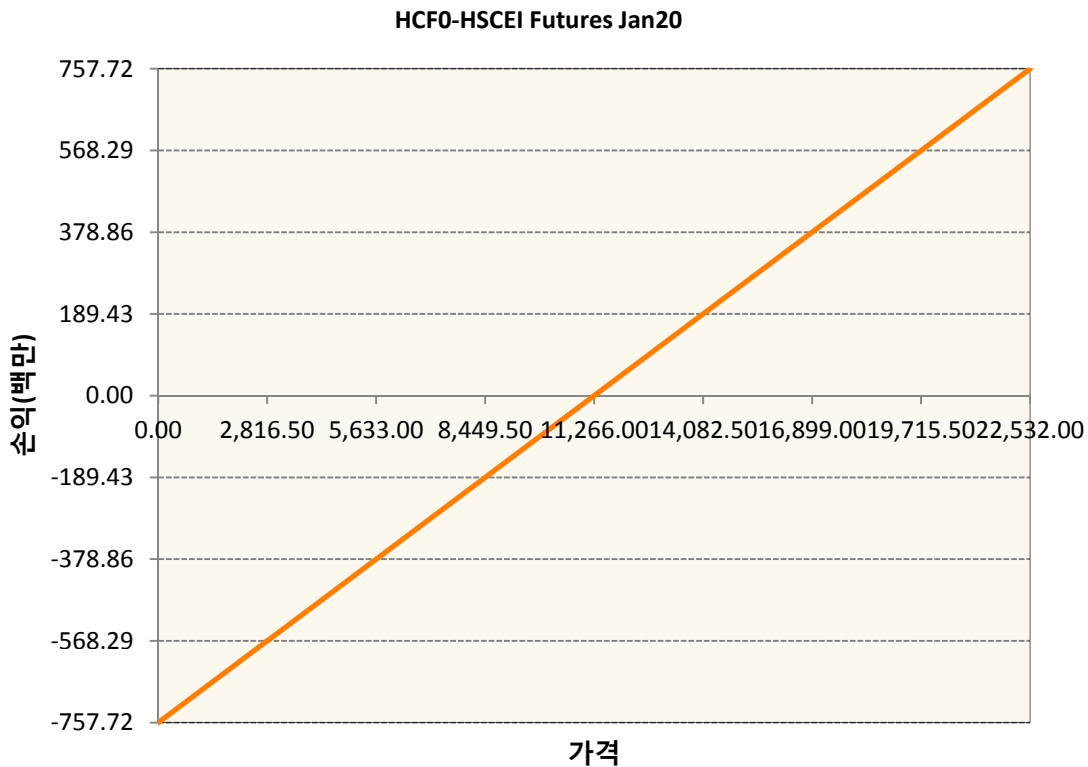
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	758	0	758	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF0	HSCEI Futures Jan20	61
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

53

공시일	2019-12-31
기준일	2019-12-30

커버드콜모(주식혼합-파생형)

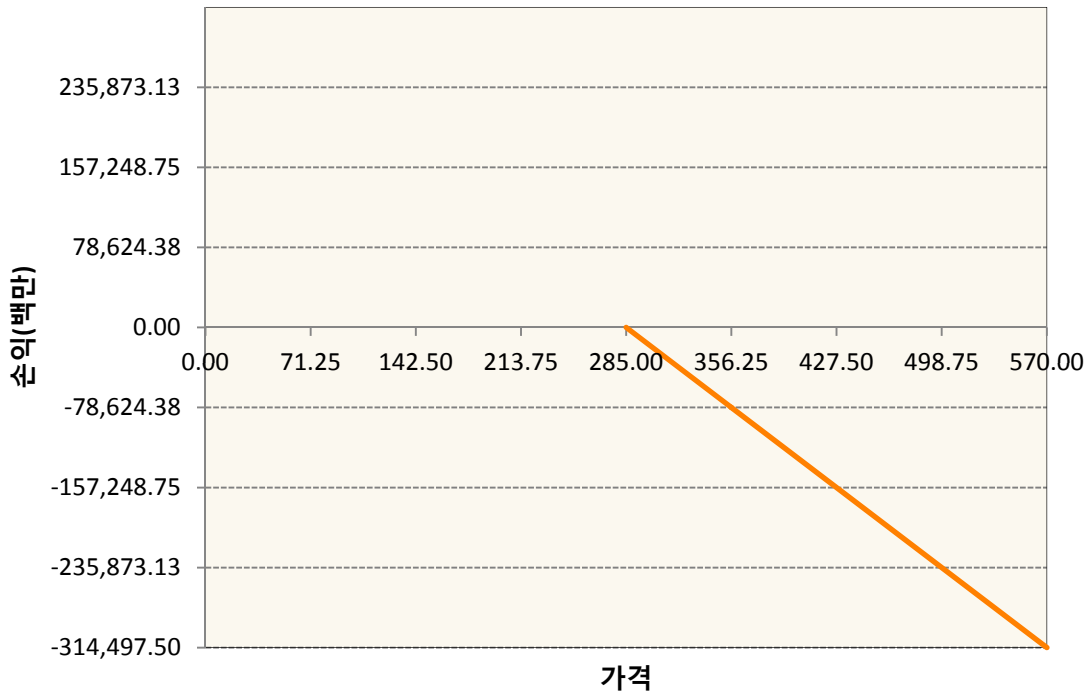
1. 계약금액

(단위:백만원)

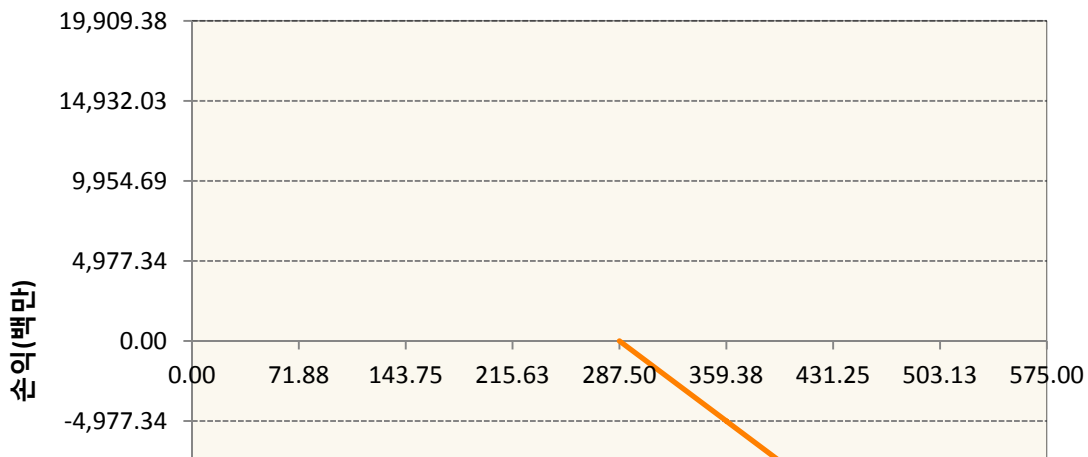
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	4,231	0	4,231	장내
누계	유가증권	옵션	0	471,207	-471,207	장내

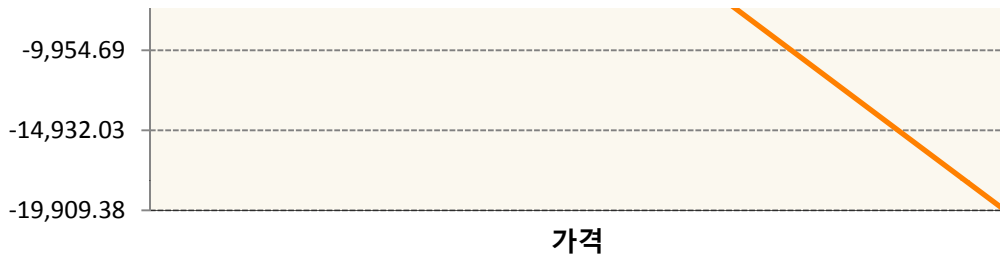
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q12852-2020-01 콜285

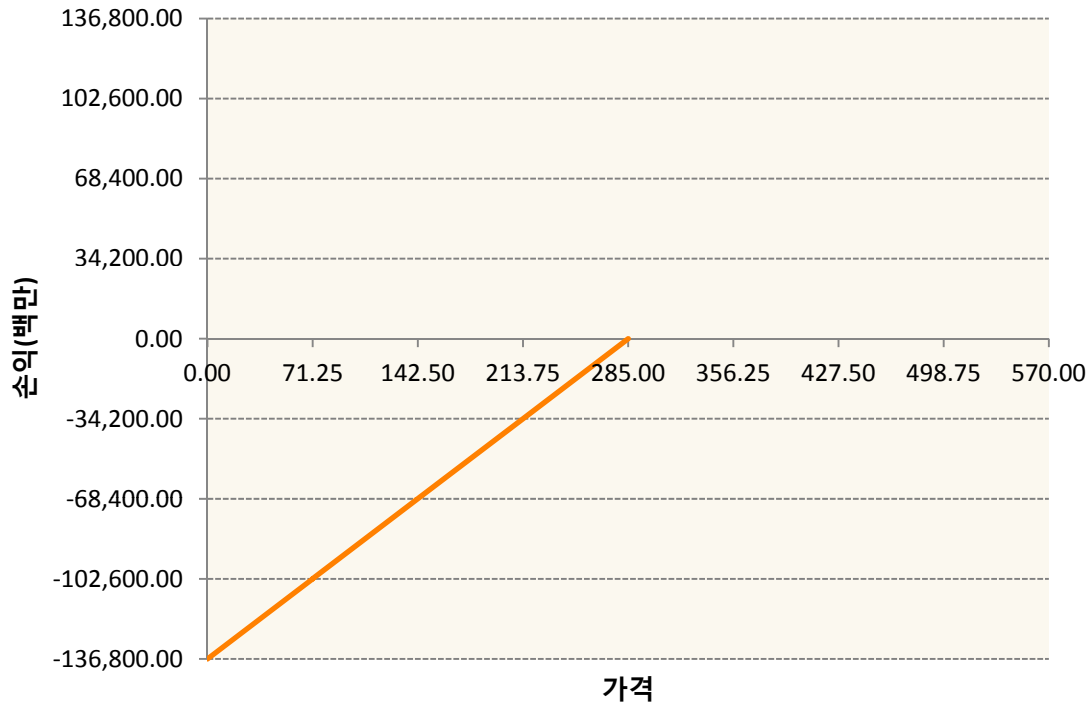


KR4201Q12878-2020-01 콜287.5





KR4301Q12850-2020-01 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q12852		2020-01 콜285					23,793
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,706	11,530	11,319	11,077	10,808	10,515	10,202
-5.33%	10,434	10,040	9,630	9,208	8,777	8,338	7,892
-2.67%	7,054	6,560	6,065	5,571	5,076	4,581	4,086
0%	1,152	788	403	0	-417	-845	-1,282
2.67%	-6,512	-6,676	-6,877	-7,112	-7,376	-7,666	-7,979
5.33%	-14,920	-14,967	-15,039	-15,140	-15,269	-15,426	-15,611
8.00%	-23,523	-23,532	-23,551	-23,583	-23,633	-23,702	-23,793
KR4201Q12878		2020-01 콜287.5					1,449
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	623	615	605	593	579	564	547

-5.33%	569	548	526	502	478	453	427
-2.67%	405	374	343	312	281	250	219
0%	83	56	28	0	-29	-58	-88
2.67%	-369	-384	-400	-419	-439	-460	-483
5.33%	-887	-892	-898	-907	-918	-930	-945
8.00%	-1,424	-1,425	-1,427	-1,431	-1,435	-1,441	-1,449
KR4301Q12850 2020-01 풋285							6,977
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,911	-6,914	-6,919	-6,927	-6,939	-6,956	-6,977
-5.33%	-3,255	-3,303	-3,360	-3,423	-3,492	-3,566	-3,644
-2.67%	-625	-735	-846	-956	-1,067	-1,177	-1,288
0%	125	91	49	0	-56	-118	-185
2.67%	178	176	173	166	156	142	124
5.33%	179	179	179	178	178	176	174
8.00%	179	179	179	179	179	179	178

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

(단위:백만원)

32,824

공시일	2019-12-31
기준일	2019-12-30

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

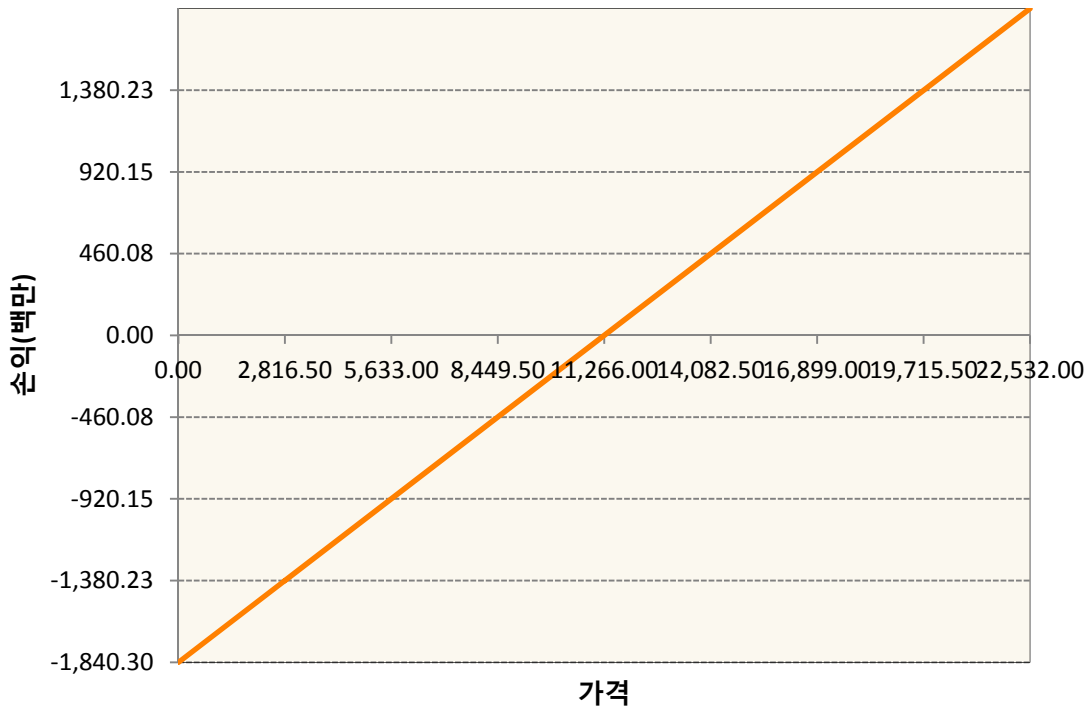
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,840	0	1,840	장내
누계	통화	선도	0	2,091	-2,091	장외

2. 만기시점의 손익구조

HCF0-HSCEI Futures Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	167
HCF0 HSCEI Futures Jan20	147

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

(단위:백만원)

182

공시일	2019-12-31
기준일	2019-12-30

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

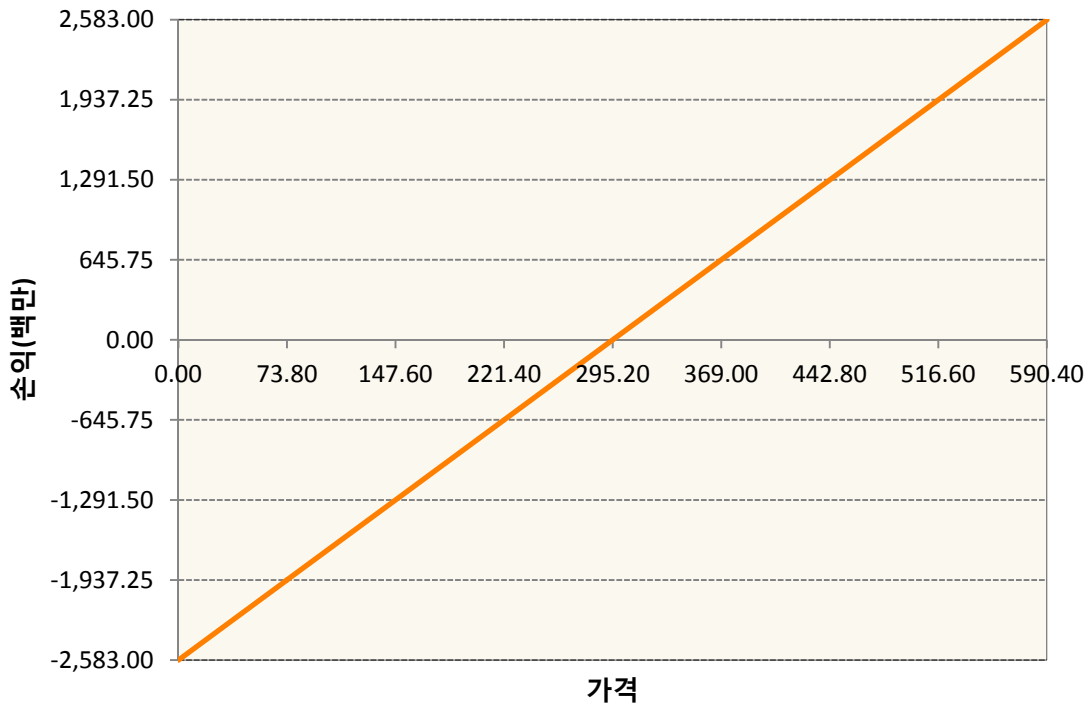
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,583	0	2,583	장내
누계	유가증권	스왑	5,625	0	5,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,918	-4,918	장내

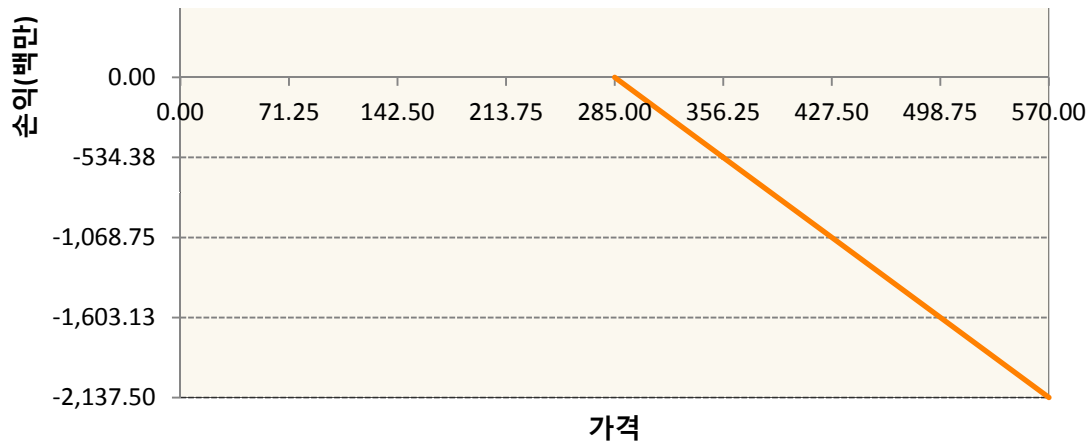
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

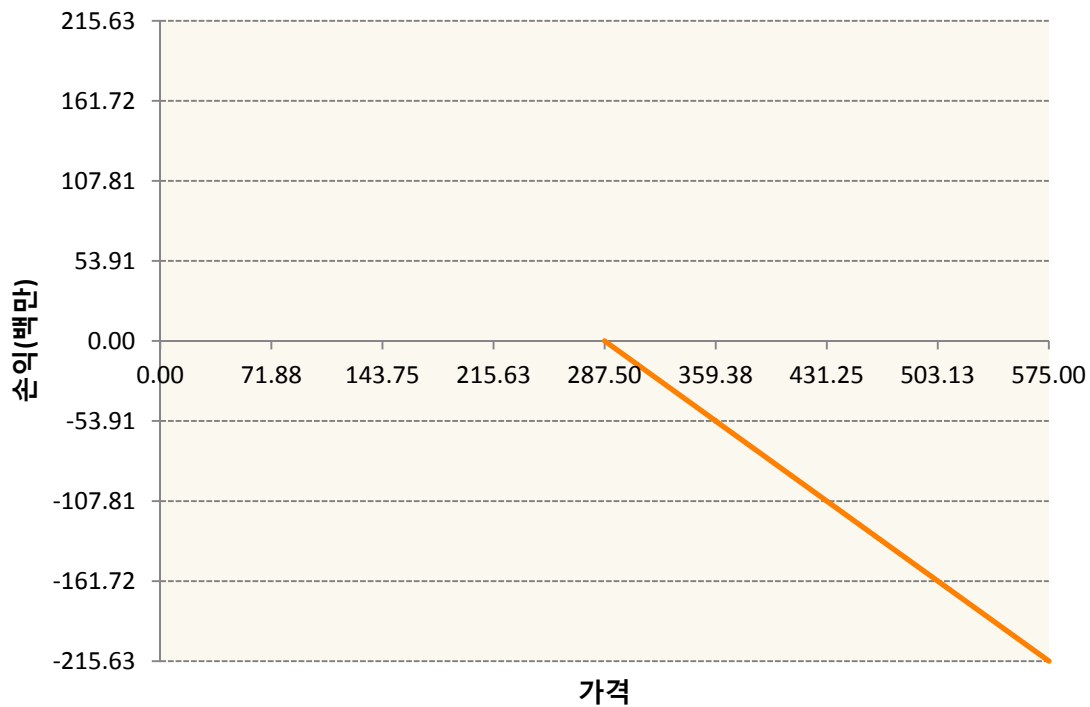


KR4201Q12852-2020-01 콜285

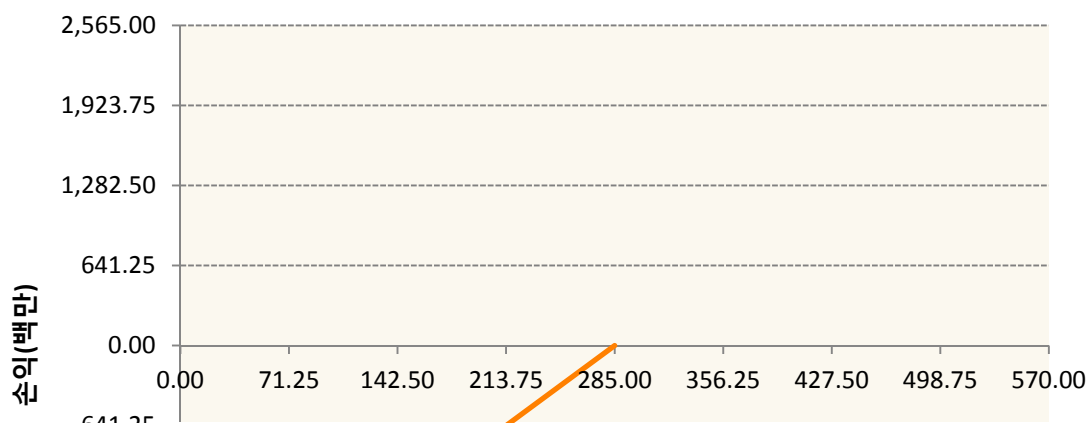




KR4201Q12878-2020-01 콜287.5



KR4301Q12850-2020-01 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						477
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-477	-477	-477	-477	-477	-477	-477	
-5.33%	-318	-318	-318	-318	-318	-318	-318	
-2.67%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	159	159	159	159	159	159	159	
5.33%	318	318	318	318	318	318	318	
8.00%	477	477	477	477	477	477	477	
KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						206
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-206	-206	-206	-206	-206	-206	-206	
-5.33%	-137	-137	-137	-137	-137	-137	-137	
-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%	137	137	137	137	137	137	137	
8.00%	206	206	206	206	206	206	206	
KR4201Q12852		2020-01 콜285						162
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	80	78	77	75	73	71	69	
-5.33%	71	68	65	63	60	57	54	
-2.67%	48	45	41	38	34	31	28	
0%	8	5	3	0	-3	-6	-9	
2.67%	-44	-45	-47	-48	-50	-52	-54	
5.33%	-101	-102	-102	-103	-104	-105	-106	
8.00%	-160	-160	-160	-160	-161	-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%	7	7	7	6	6	6	6
-5.33%	6	6	6	5	5	5	5
-2.67%	4	4	4	3	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							131
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-131
-5.33%	-61	-62	-63	-64	-65	-67	-68
-2.67%	-12	-14	-16	-18	-20	-22	-24
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	3	3	3	3	3	3	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)

932

공시일	2019-12-31
기준일	2019-12-30

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

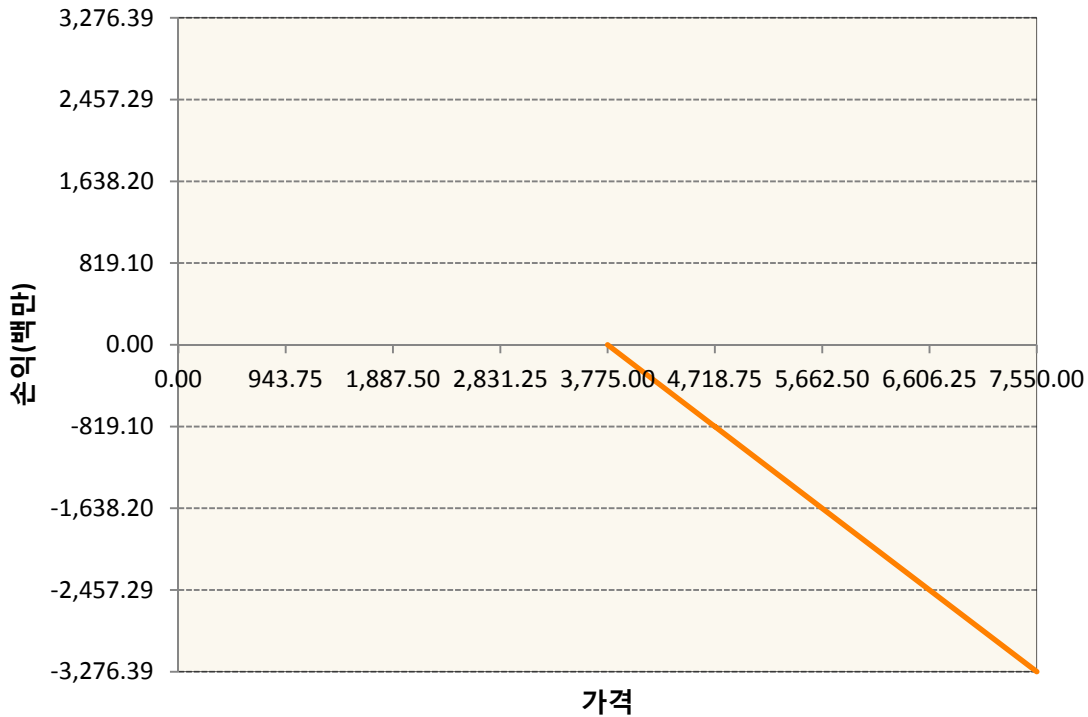
1. 계약금액

(단위:백만원)

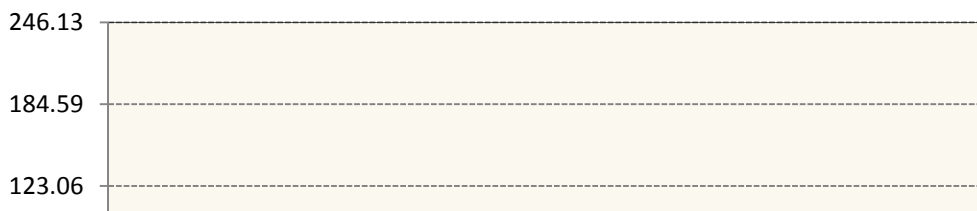
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	535	0	535	
누계	유가증권	스왑	17,713	0	17,713	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,045	-7,045	장내
누계	통화	선도	0	3,399	-3,399	장외

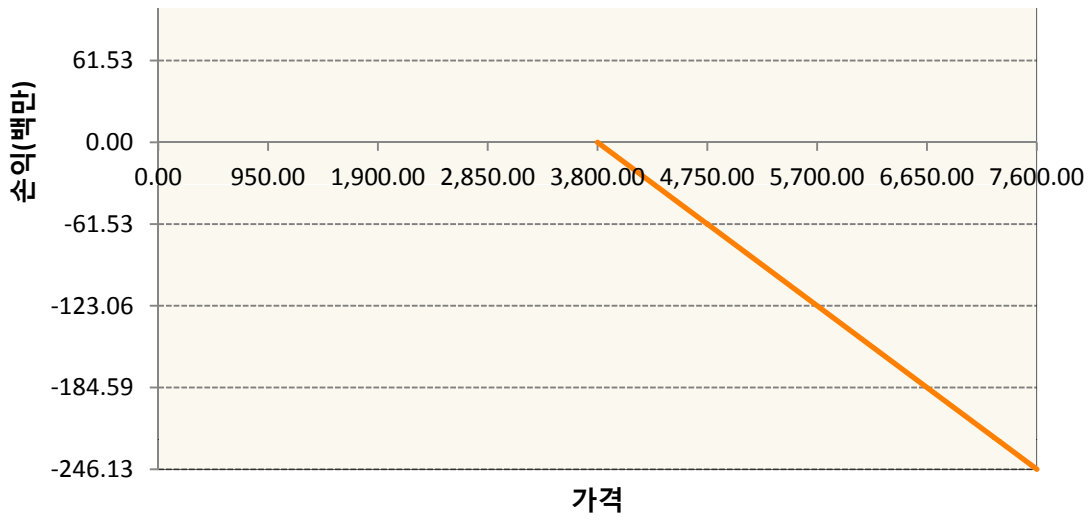
2. 만기시점의 손익구조

OESXF0-C3775-EURO STOXX 50

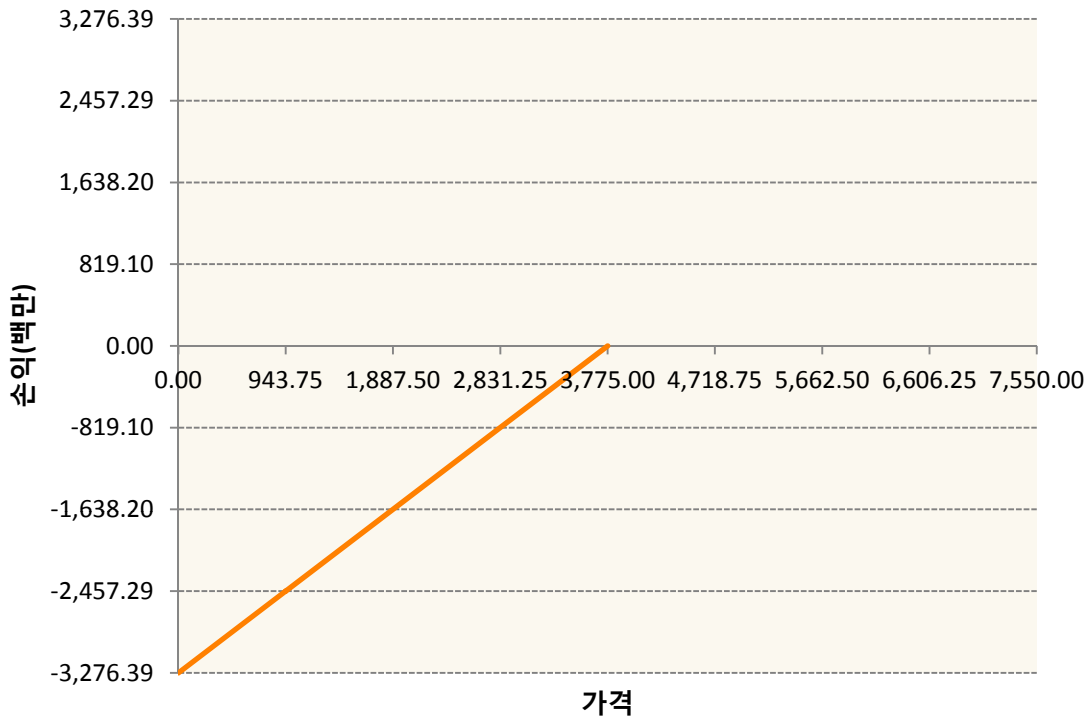


OESXF0-C3800-EURO STOXX 50

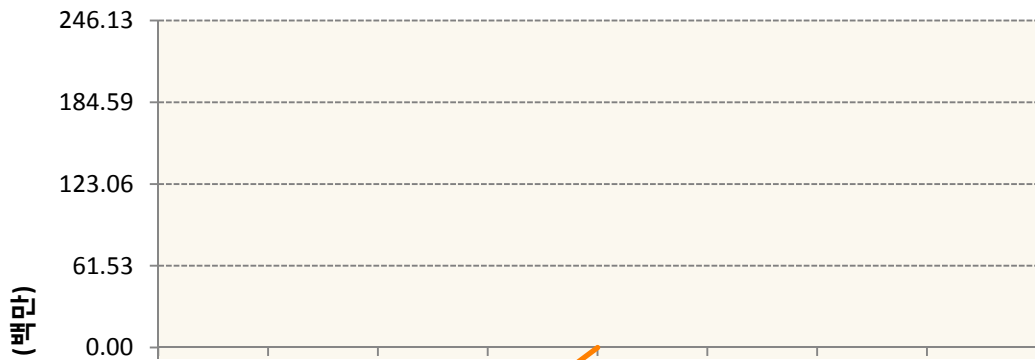


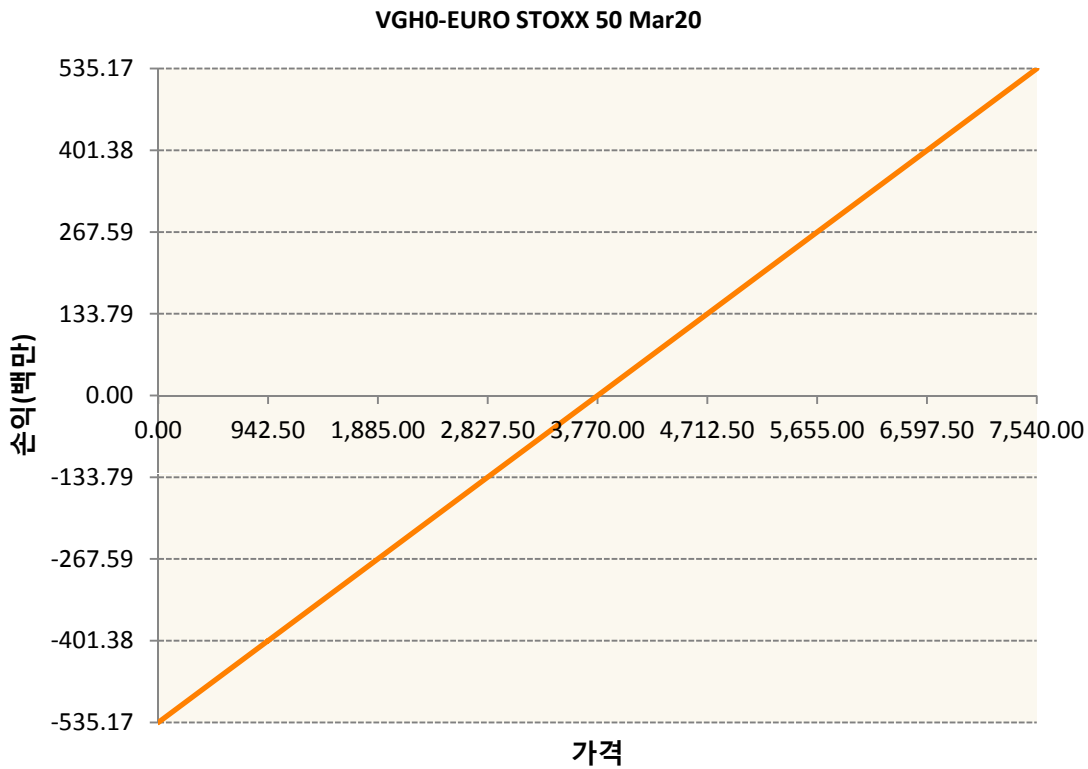
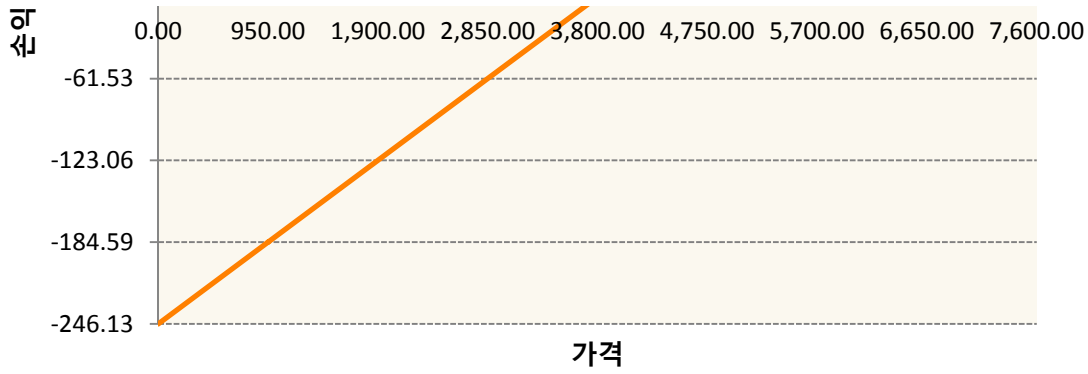


OESXF0-P3775-EURO STOXX 50



OESXF0-P3800-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		42
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E		272
OESXF0-C37 EURO STOXX 50		262
OESXF0-C38 EURO STOXX 50		20
OESXF0-P37 EURO STOXX 50		262
OESXF0-P38 EURO STOXX 50		20
VGHO EURO STOXX 50 Mar20		43

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

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	2019-12-31
기준일	2019-12-30

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

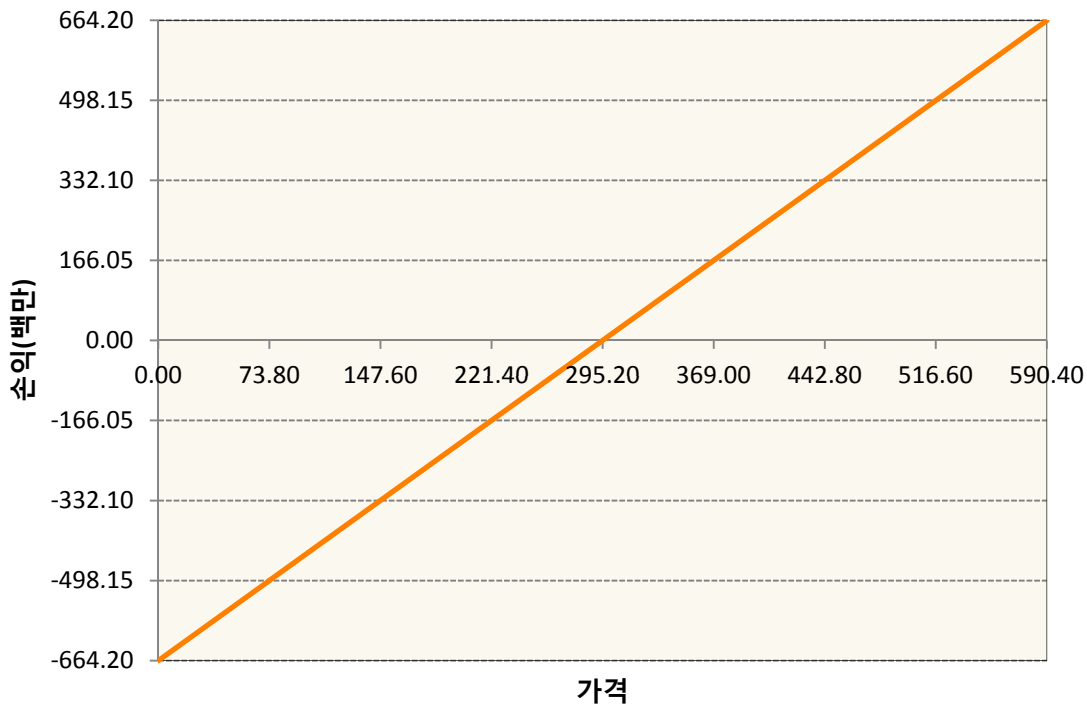
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	664	0	664	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	2019-12-31
기준일	2019-12-30

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

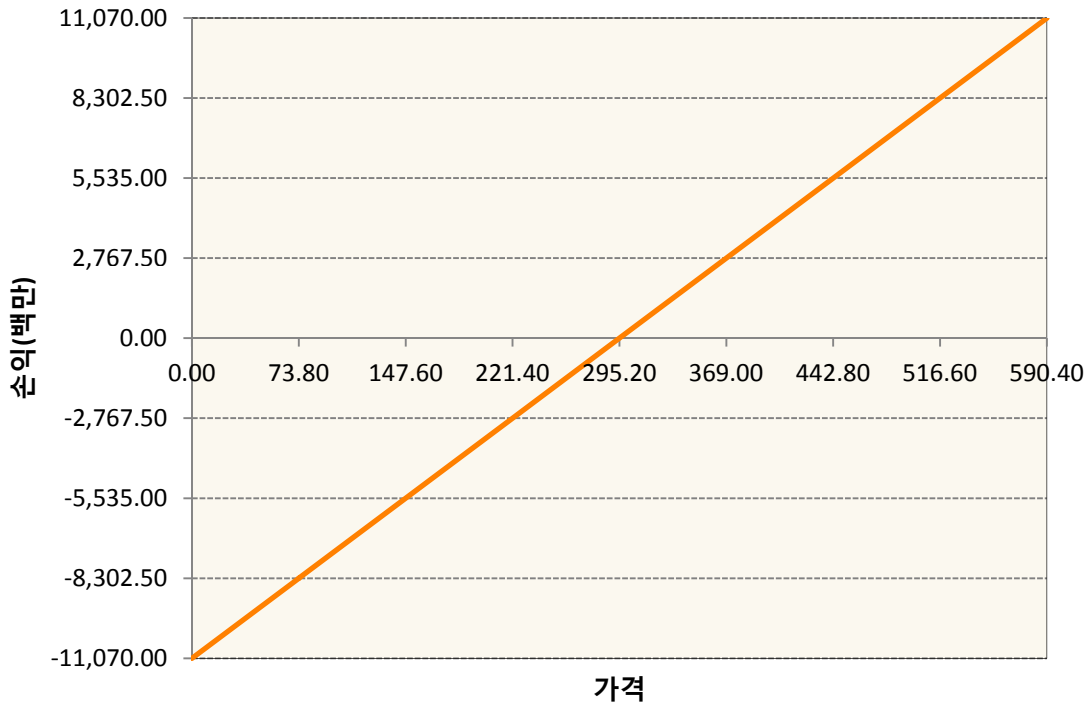
1. 계약금액

(단위:백만원)

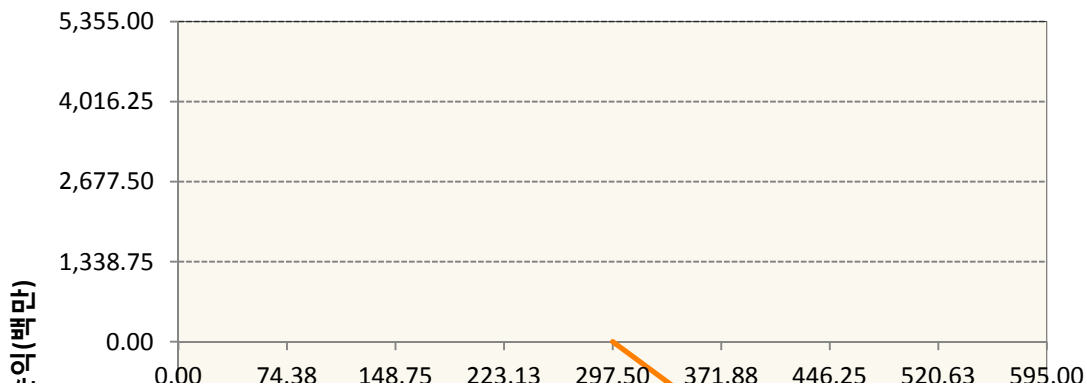
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	74	-74	장내
신규	유가증권	옵션	74	0	74	장내
누계	유가증권	선물	11,070	0	11,070	장내
누계	유가증권	옵션	499	21,105	-20,606	장내

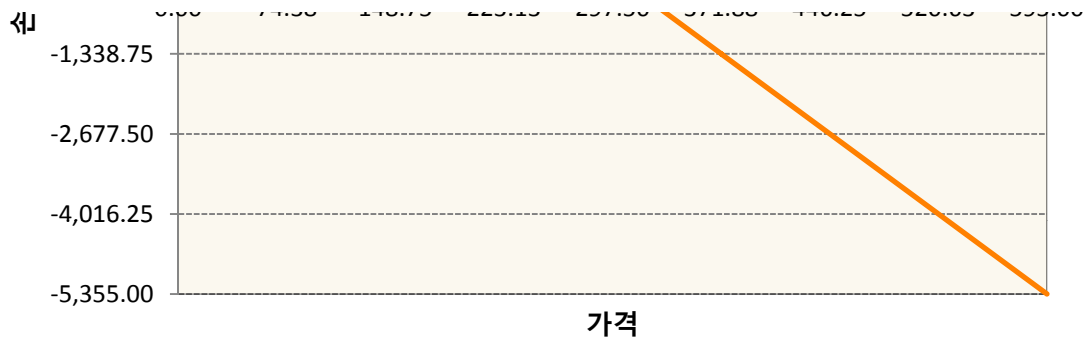
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

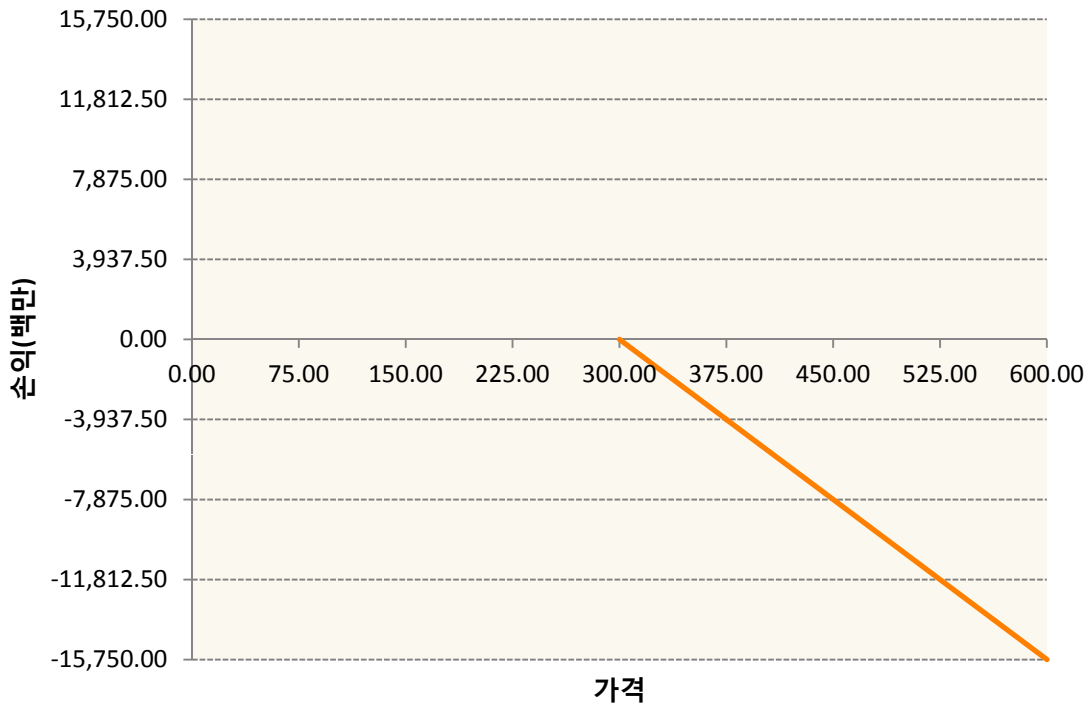


KR4201Q12977-2020-01 콜297.5

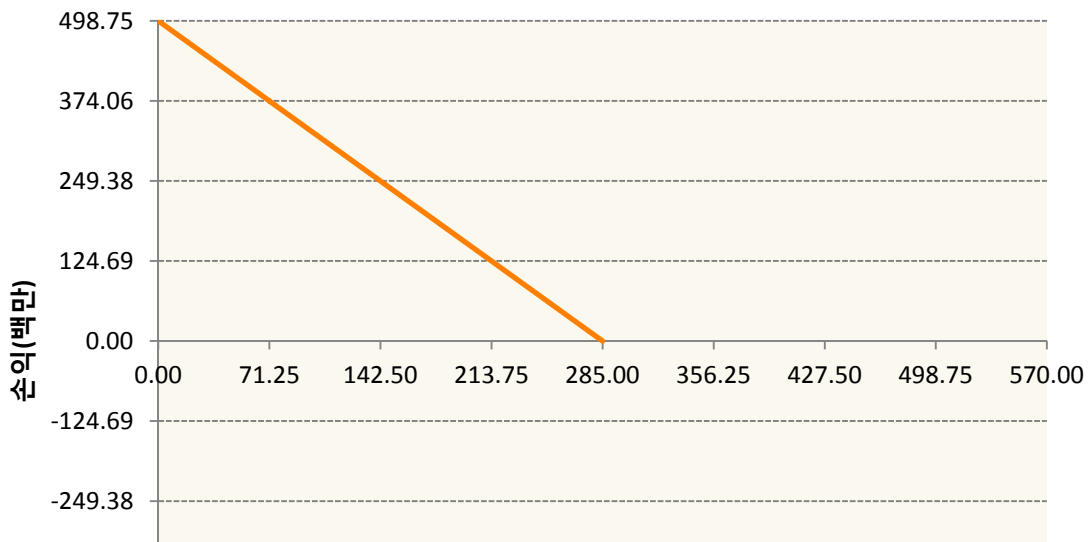


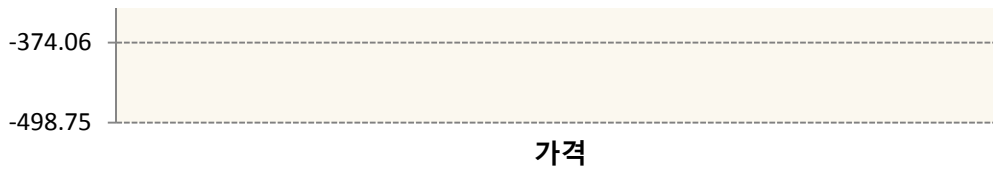


KR4201Q13009-2020-01 콜300



KR4301Q12850-2020-01 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						881
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-881	-881	-881	-881	-881	-881	-881	
-5.33%	-588	-588	-588	-588	-588	-588	-588	
-2.67%	-294	-294	-294	-294	-294	-294	-294	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	294	294	294	294	294	294	294	
5.33%	588	588	588	588	588	588	588	
8.00%	881	881	881	881	881	881	881	
KR4201Q12977		2020-01 콜297.5						308
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	70	70	69	68	67	66	64	
-5.33%	68	67	64	62	59	55	51	
-2.67%	58	53	48	42	36	30	24	
0%	24	16	8	0	-8	-16	-24	
2.67%	-48	-56	-64	-72	-80	-89	-97	
5.33%	-157	-162	-167	-173	-180	-186	-193	
8.00%	-287	-289	-292	-295	-299	-303	-308	
KR4201Q13009		2020-01 콜300						834
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	158	158	157	155	153	149	145	
-5.33%	155	152	148	142	135	126	116	
-2.67%	137	126	114	100	85	69	52	
0%	64	44	22	0	-22	-45	-68	
2.67%	-108	-133	-158	-182	-207	-232	-257	
5.33%	-395	-413	-432	-452	-472	-494	-516	
8.00%	-760	-768	-778	-790	-804	-818	-834	
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%	12	12	12	12	13	13	13	
-2.67%	2	3	3	3	4	4	5	

0%	0	0	0	0	0	0	0	1
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	0
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1

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

(단위:백만원)

1,799

공시일	2019-12-31
기준일	2019-12-30

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	203,862	0	203,862	

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	2019-12-31
기준일	2019-12-30

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	212,794	0	212,794	

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	2019-12-31
기준일	2019-12-30

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	525,200	0	525,200	
누계	통화	선도	0	510,088	-510,088	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		1,388
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,489
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		1,850
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		3,182
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		4,718
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		185
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,775
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,775
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,313
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,498
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E		1,610
FX21019Z00 KRW/USD 10-01-20E		1,110
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E		1,517
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E		925
FX21019Z02 KRW/USD 16-01-20E		1,665
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		185
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		1,980
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		925
FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E		3,700
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E		1,850
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E		1,980
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E		185

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

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

209

공시일	2019-12-31
기준일	2019-12-30

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

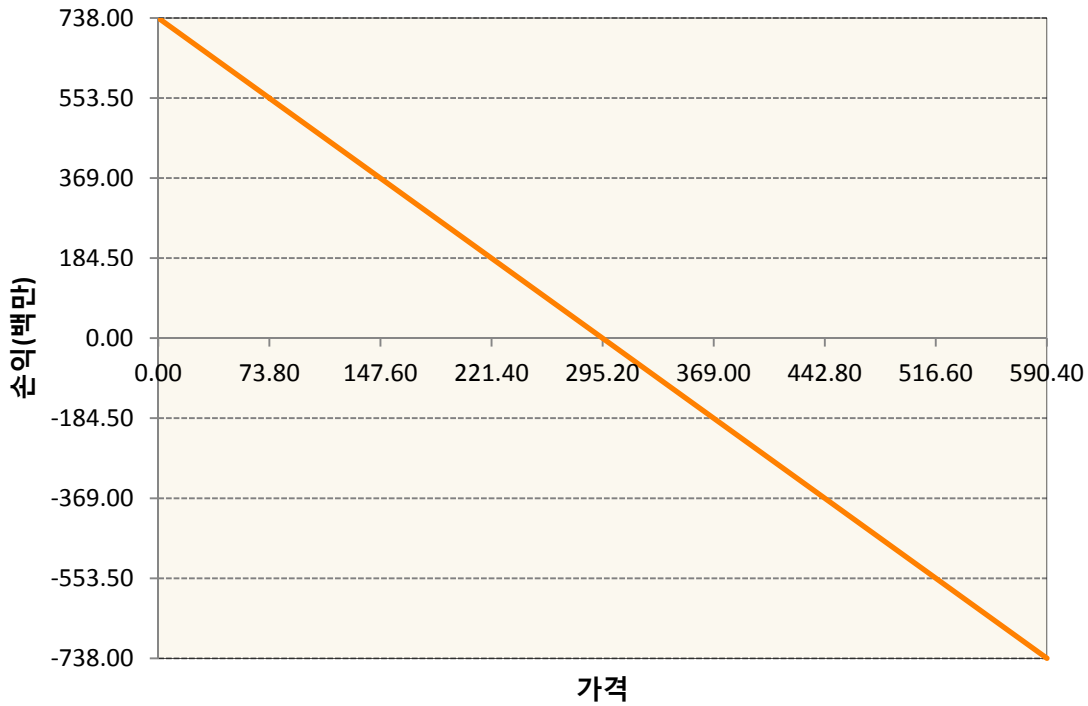
1. 계약금액

(단위:백만원)

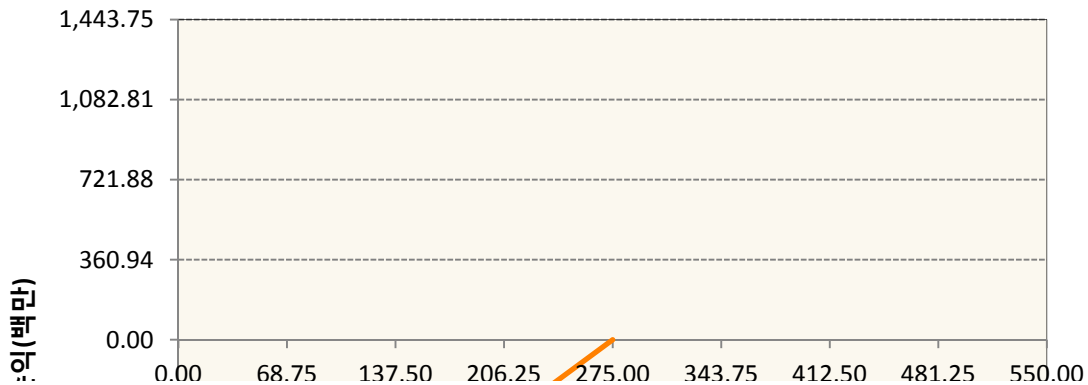
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	738	-738	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,872	-3,872	장내

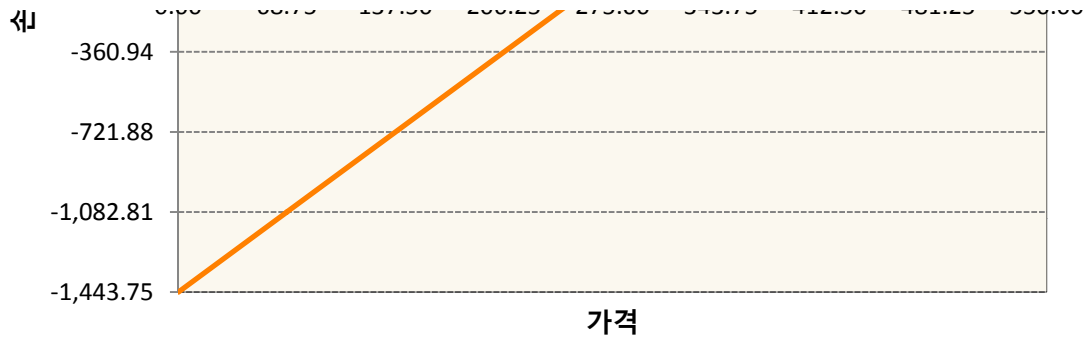
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

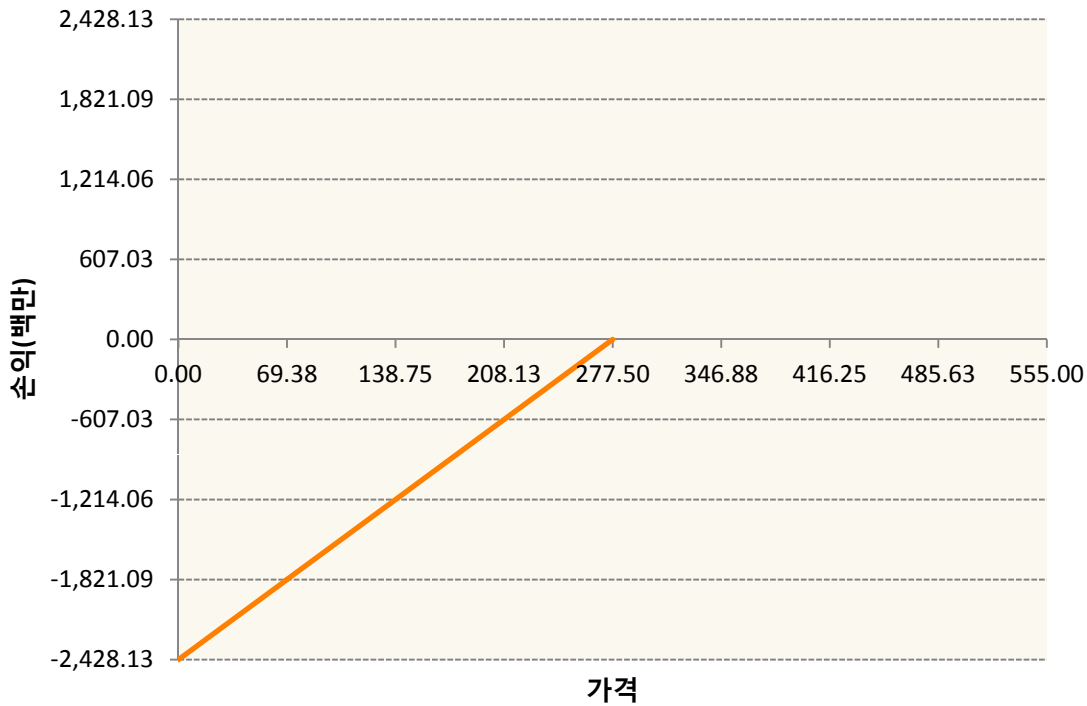


KR4301Q12751-2020-01 풋275





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						33
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-27	-28	-29	-30	-31	-32	-33
-5.33%	-4	-5	-6	-8	-9	-10	-11
-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 71

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-65	-66	-67	-68	-69	-70	-71
-5.33%	-15	-17	-19	-21	-23	-25	-27
-2.67%	-1	-1	-2	-3	-4	-5	-6
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

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

(단위:백만원)

71

공시일	2019-12-31
기준일	2019-12-30

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	13,490	0	13,490	
누계	통화	선도	937	14,293	-13,356	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019X01 KRW/USD 13-01-20E		227
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		287
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		288
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E		342
FX21019Z02 USD/KRW 13-01-20E		28
FX21019Z03 USD/KRW 13-01-20E		19
FX21019Z04 USD/KRW 13-01-20E		28

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

(단위:백만원)

389

공시일	2019-12-31
기준일	2019-12-30

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	2,018	0	2,018	장외
누계	통화	선도	311	505	-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	2019-12-31
기준일	2019-12-30

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

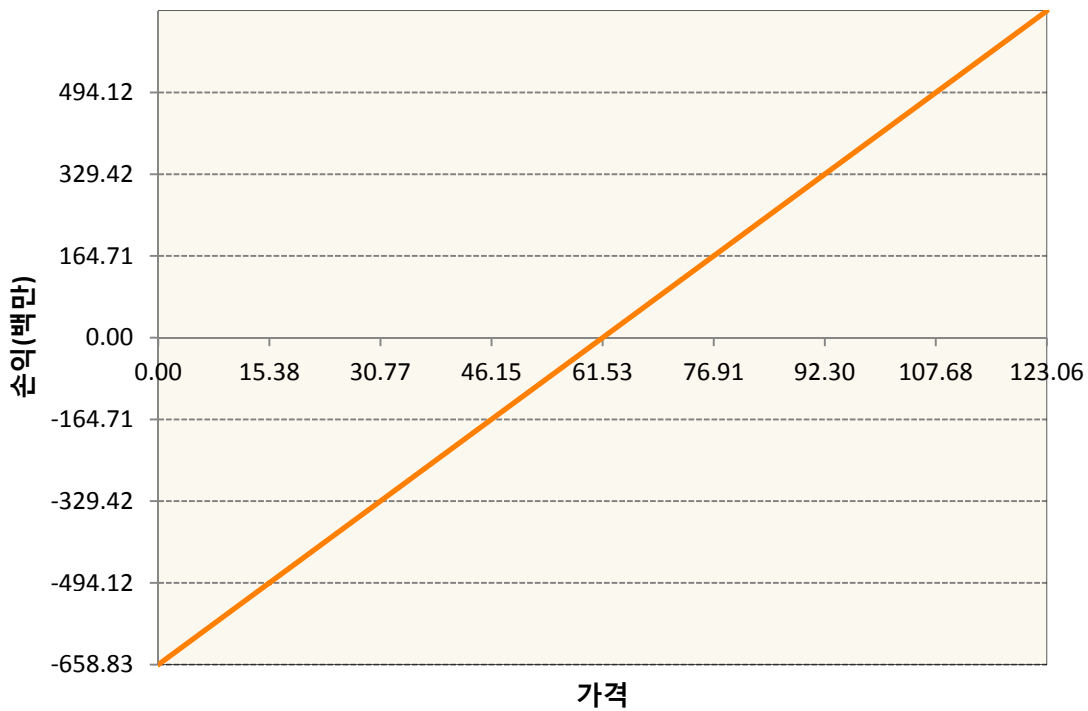
1. 계약금액

(단위:백만원)

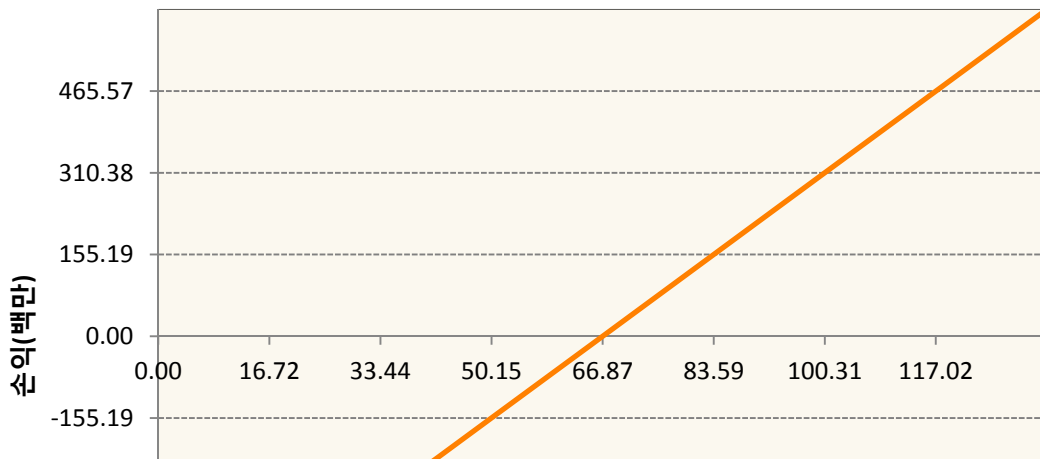
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,461	289	2,172	

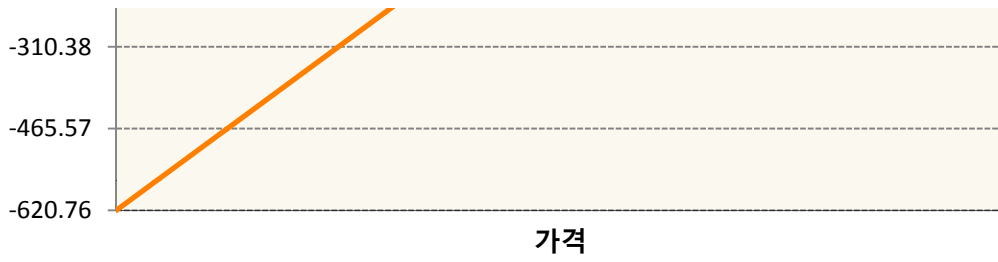
2. 만기시점의 손익구조

CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20

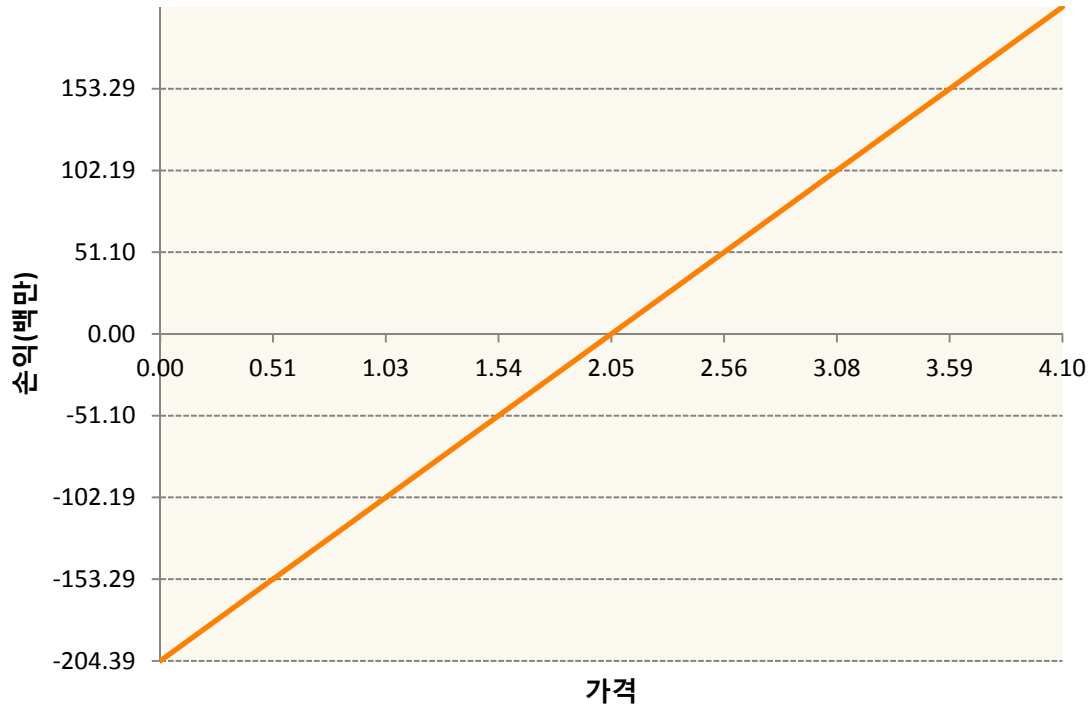


COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20

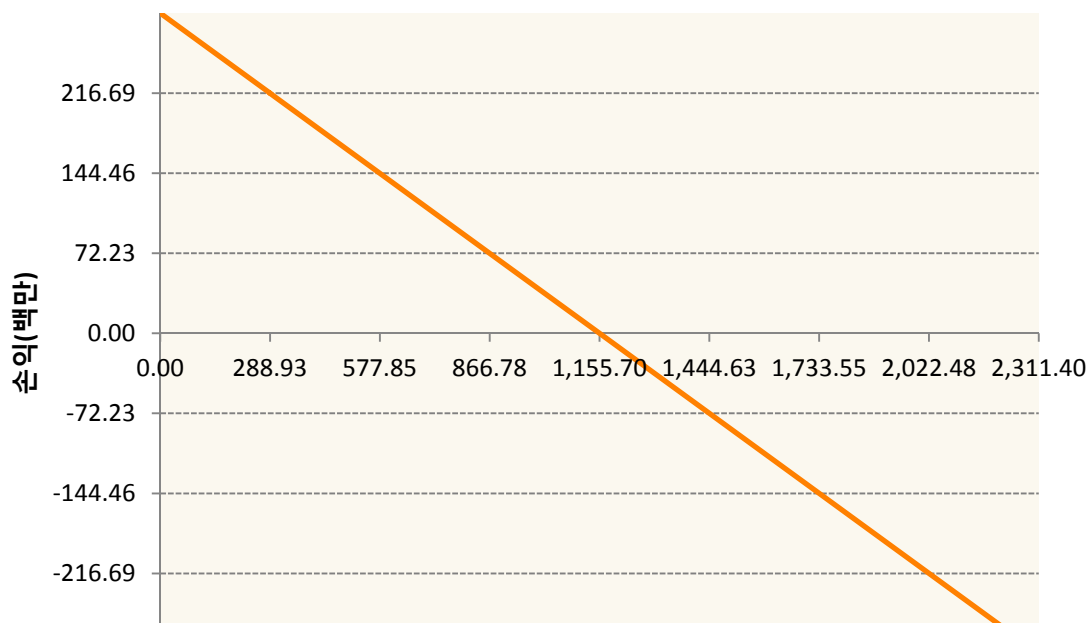


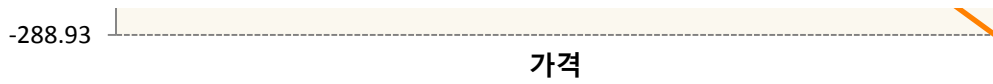


HOH0-NY Harb ULSD Fut Mar20

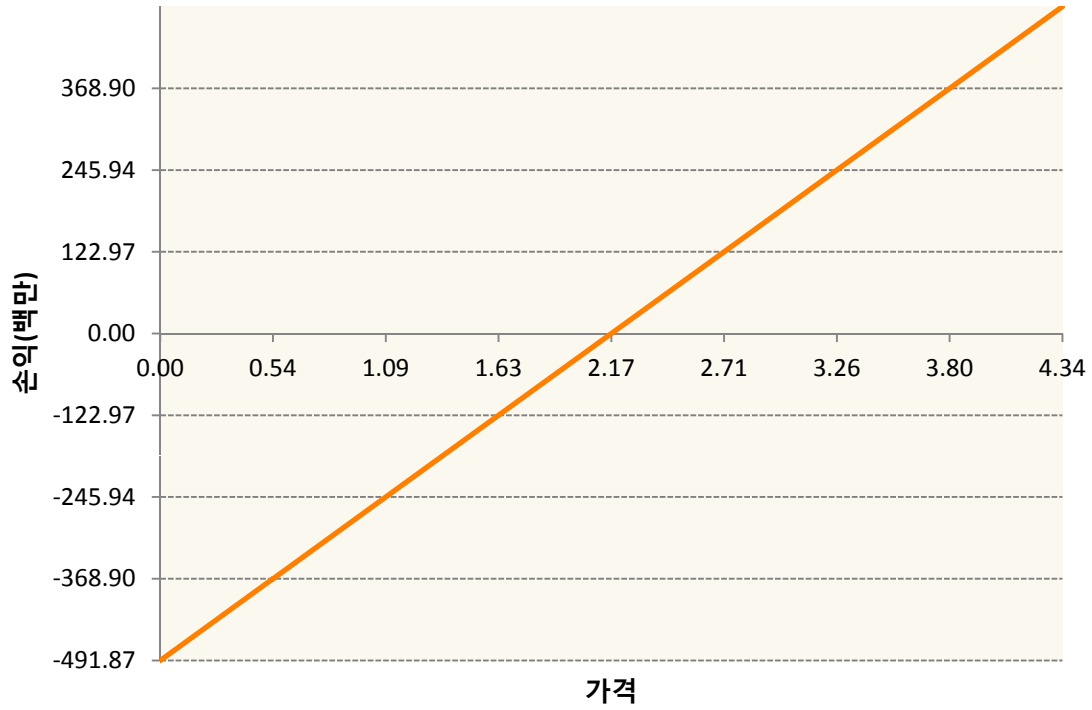


KR4175Q10001-2020-01 달러선물

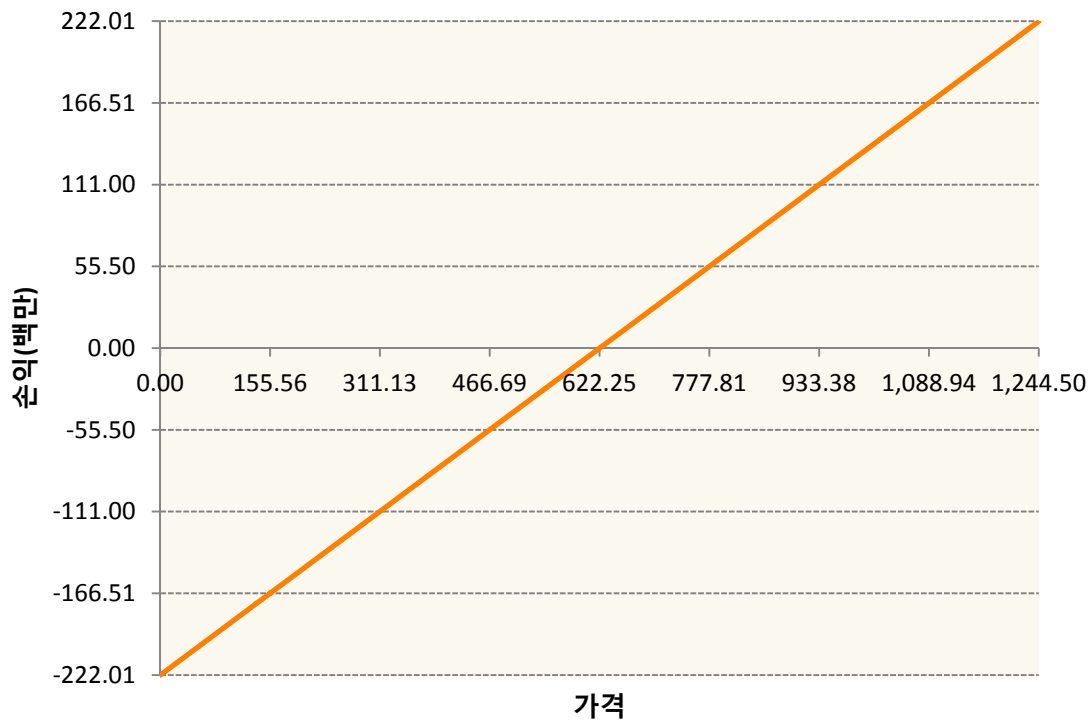




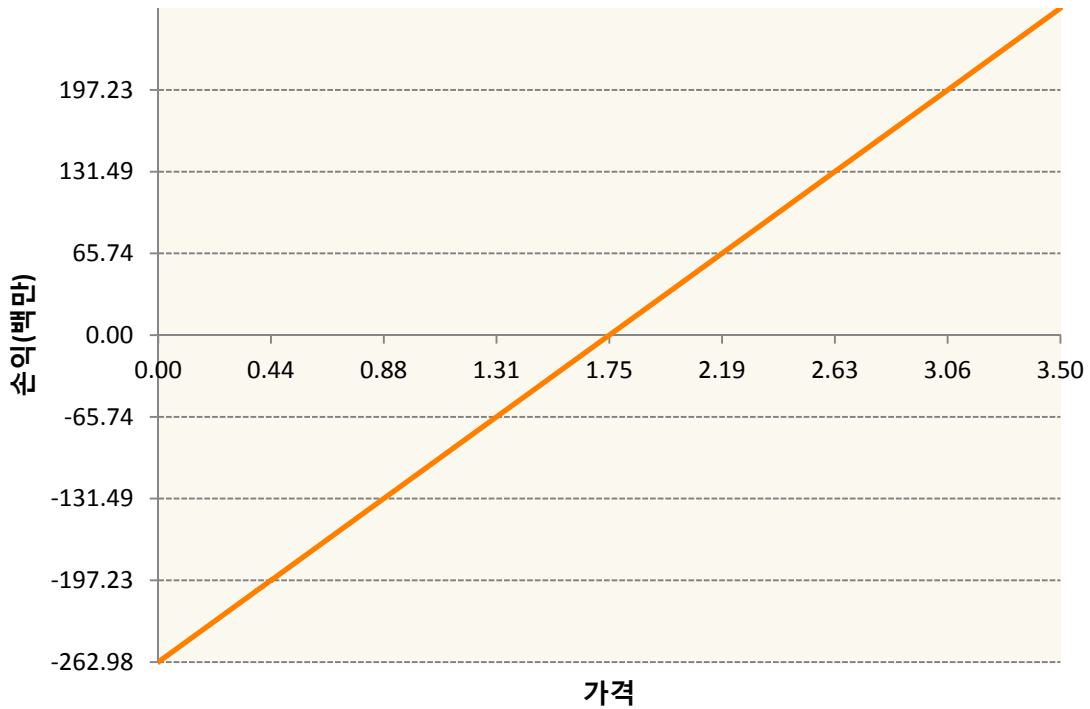
NGH20-NATURAL GAS FUTR Mar20



QSH0-Low Su Gasoil G Mar20



XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	53
COH0	BRENT CRUDE FUTR Mar20	50
HOH0	NY Harb ULSD Fut Mar20	16
KR4175Q10C	2020-01 달러선물	23
NGH20	NATURAL GAS FUTR Mar20	39
QSH0	Low Su Gasoil G Mar20	18
XBH0	GASOLINE RBOB FUT Mar20	21

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

386

공시일	2019-12-31
기준일	2019-12-30

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

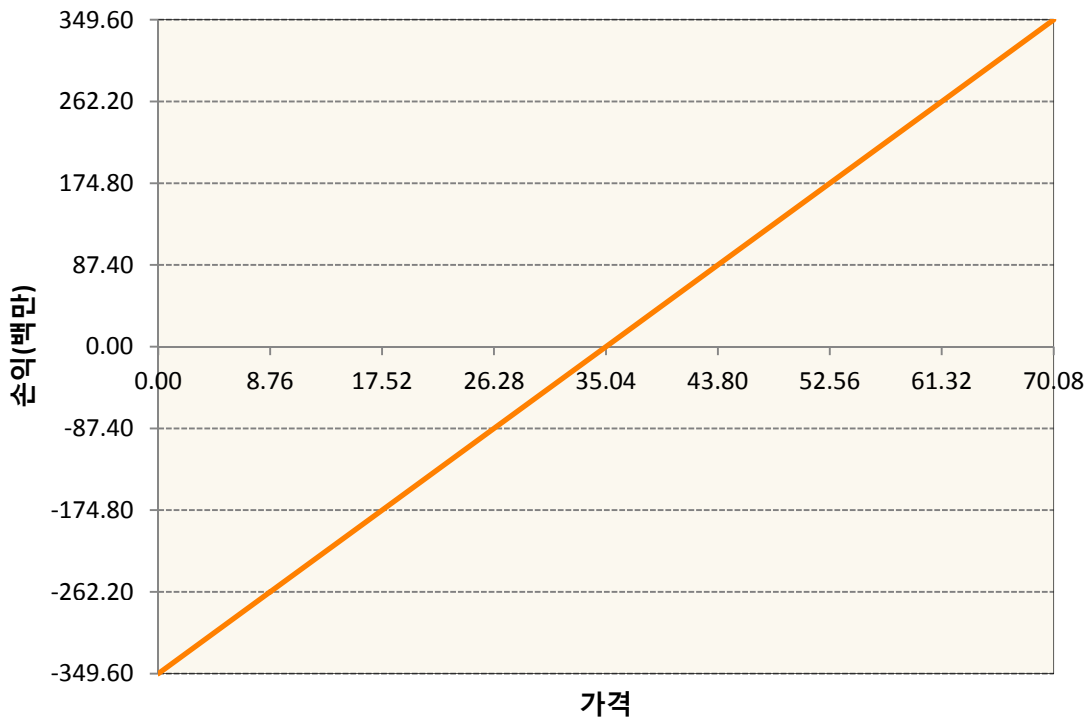
1. 계약금액

(단위:백만원)

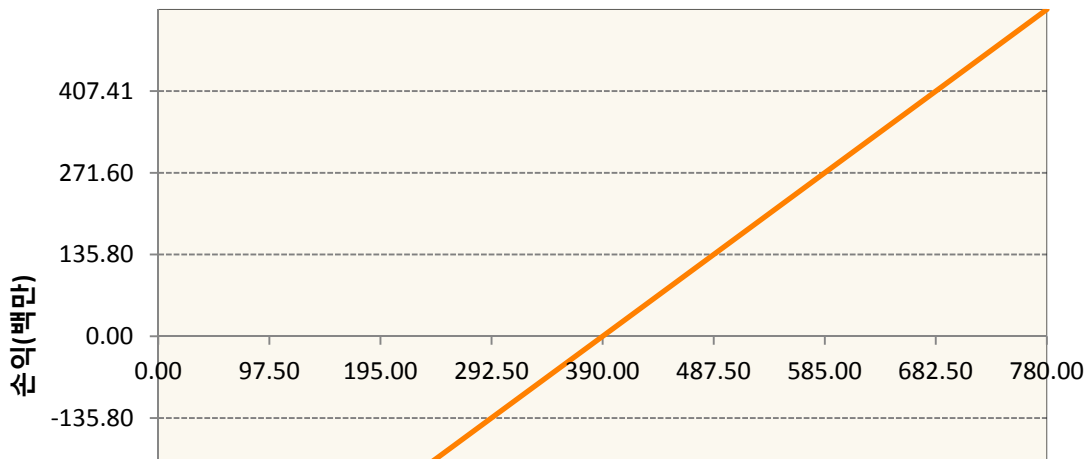
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,873	150	2,723	

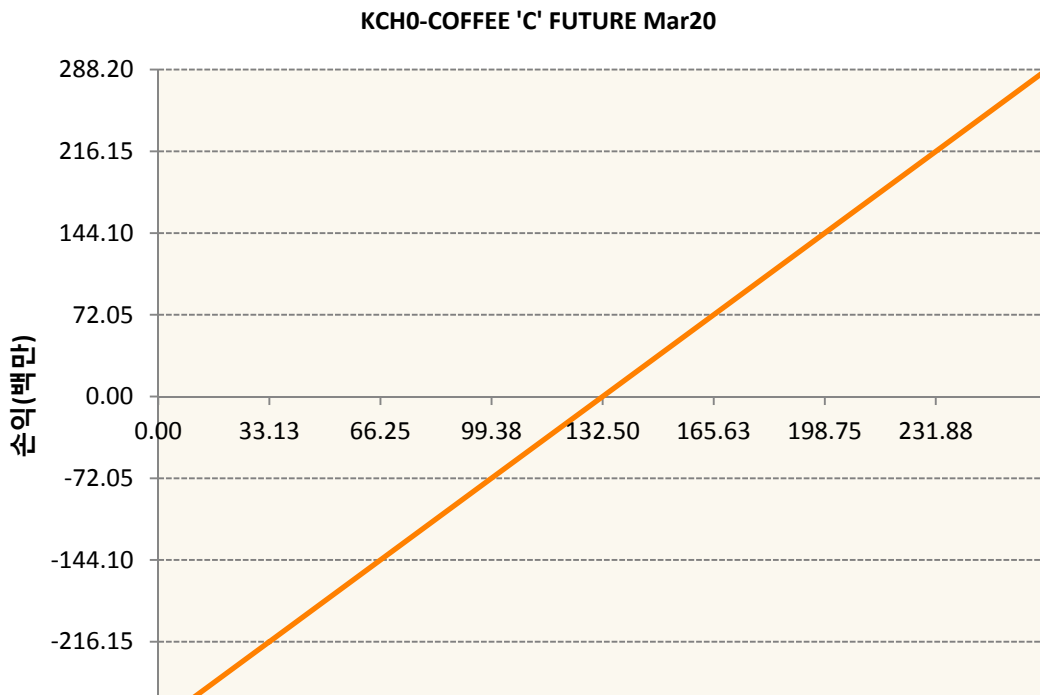
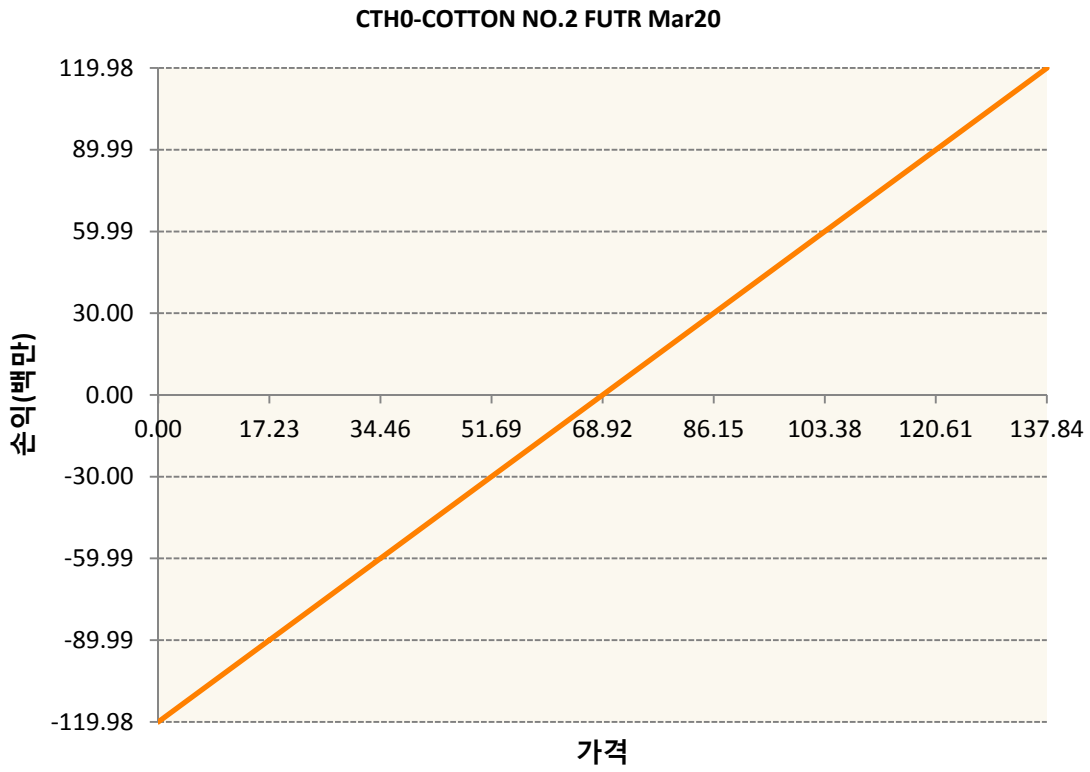
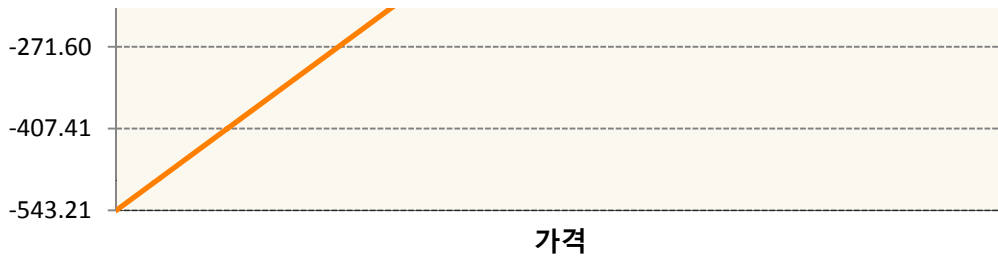
2. 만기시점의 손익구조

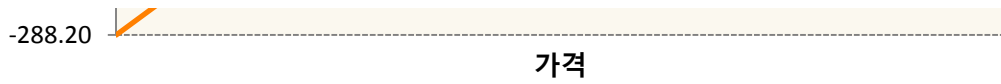
BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20



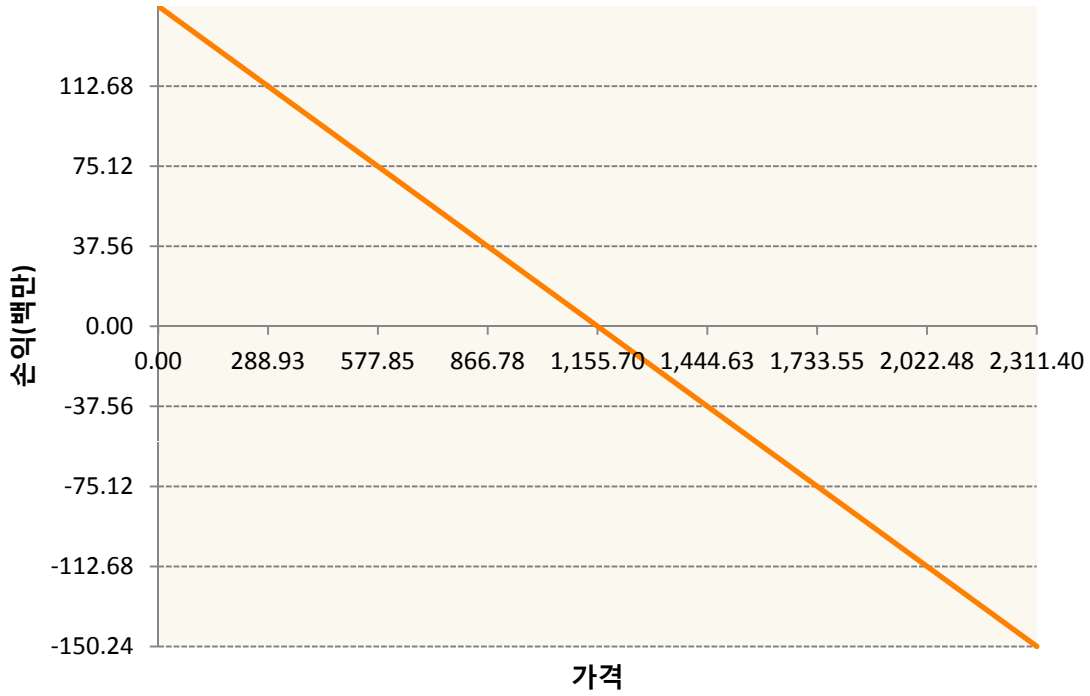
CH0-CORN FUTURE Mar20



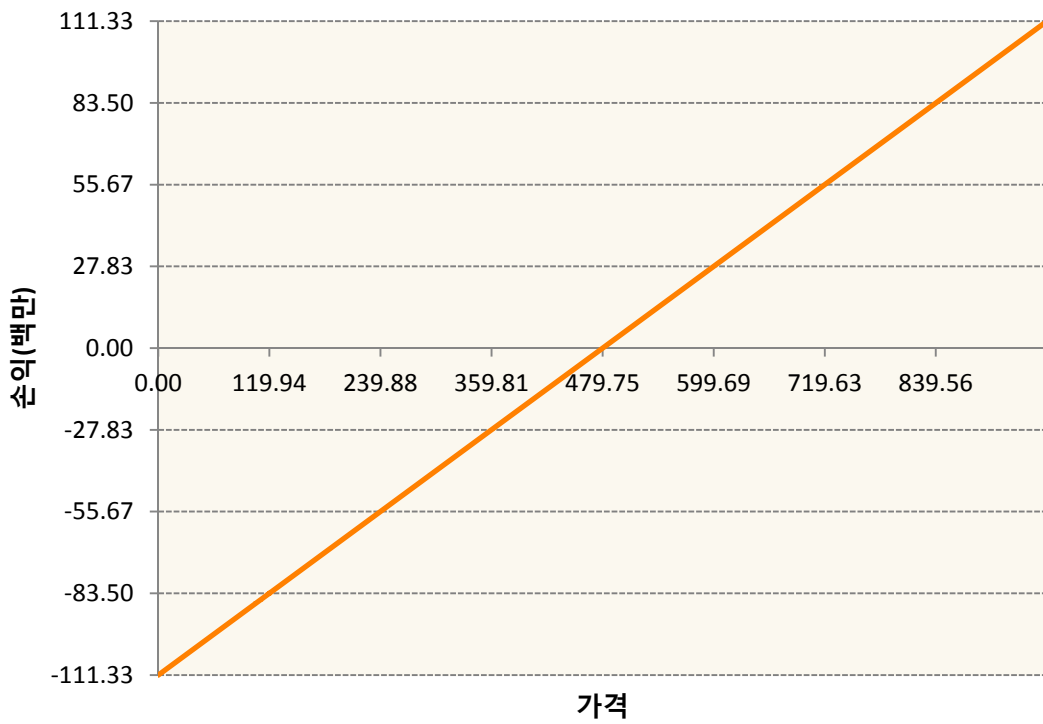




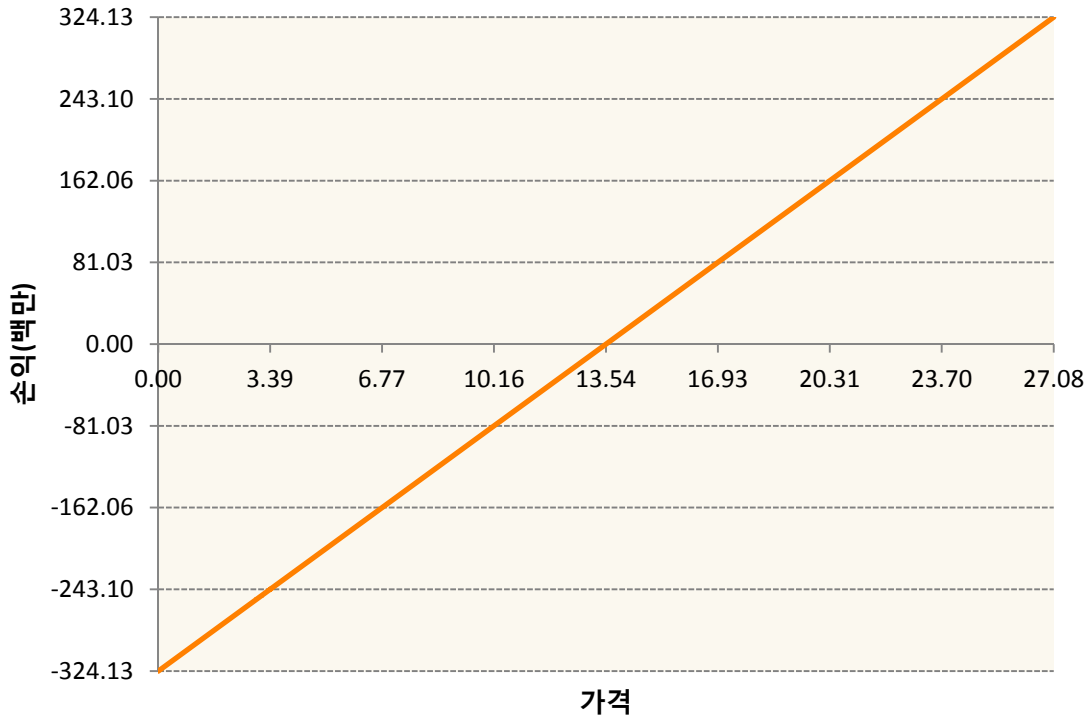
KR4175Q10001-2020-01 달러선물



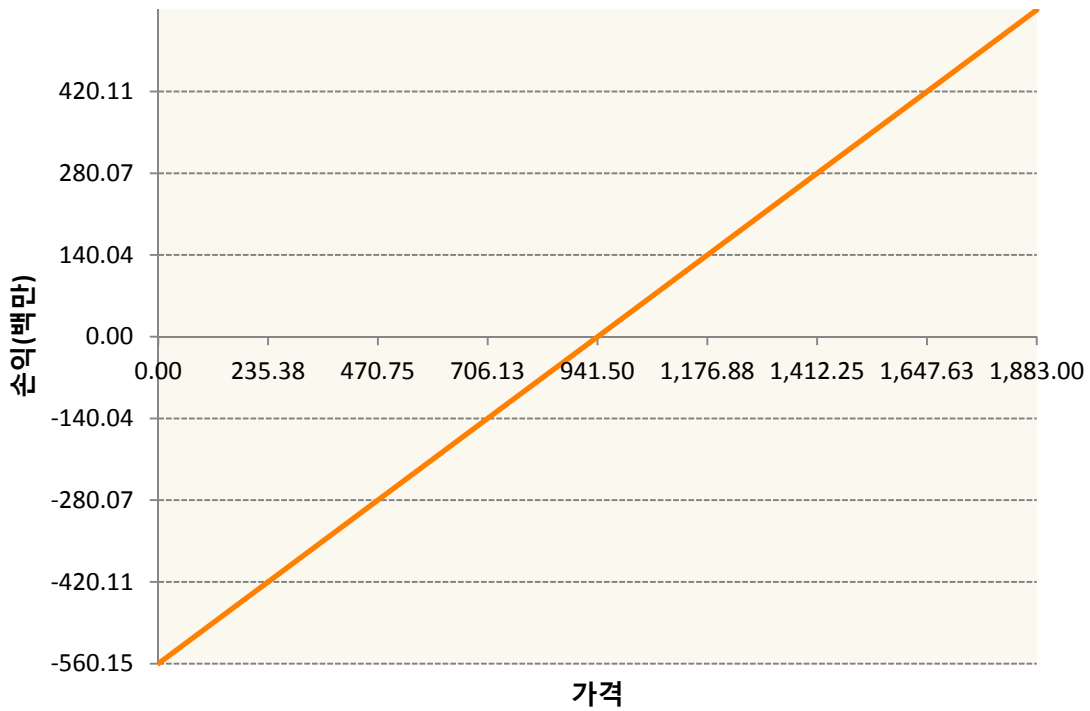
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

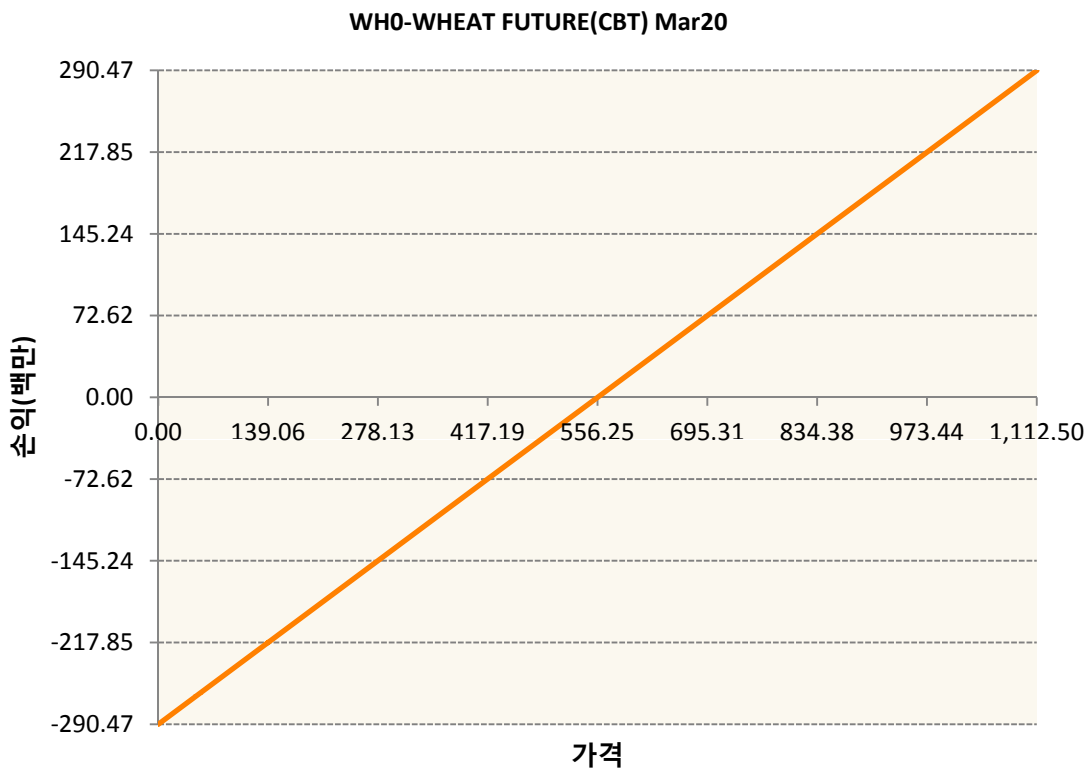
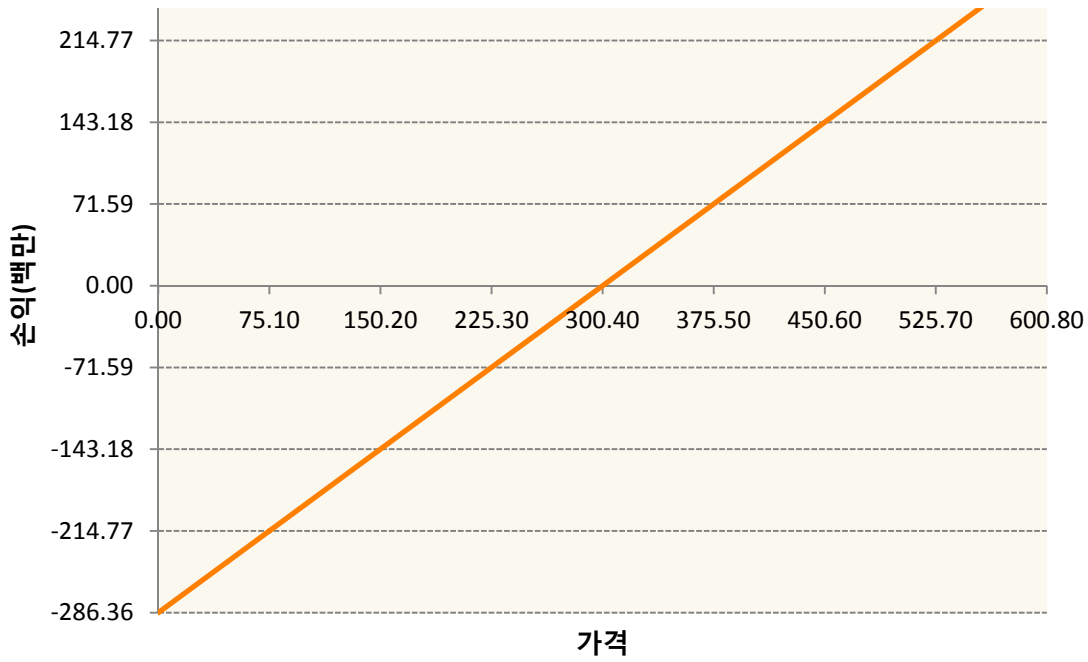


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20



SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH0	SOYBEAN OIL FUTR Mar20	28
CH0	CORN FUTURE Mar20	43
CTH0	COTTON NO.2 FUTR Mar20	10
KCH0	COFFEE 'C' FUTURE Mar20	23
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)

253