

공시일	2020-01-02
기준일	2019-12-31

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	2020-01-02
기준일	2019-12-31

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

1,131

* 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	2020-01-02
기준일	2019-12-31

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	2020-01-02
기준일	2019-12-31

유로인덱스모(주식-파생형)

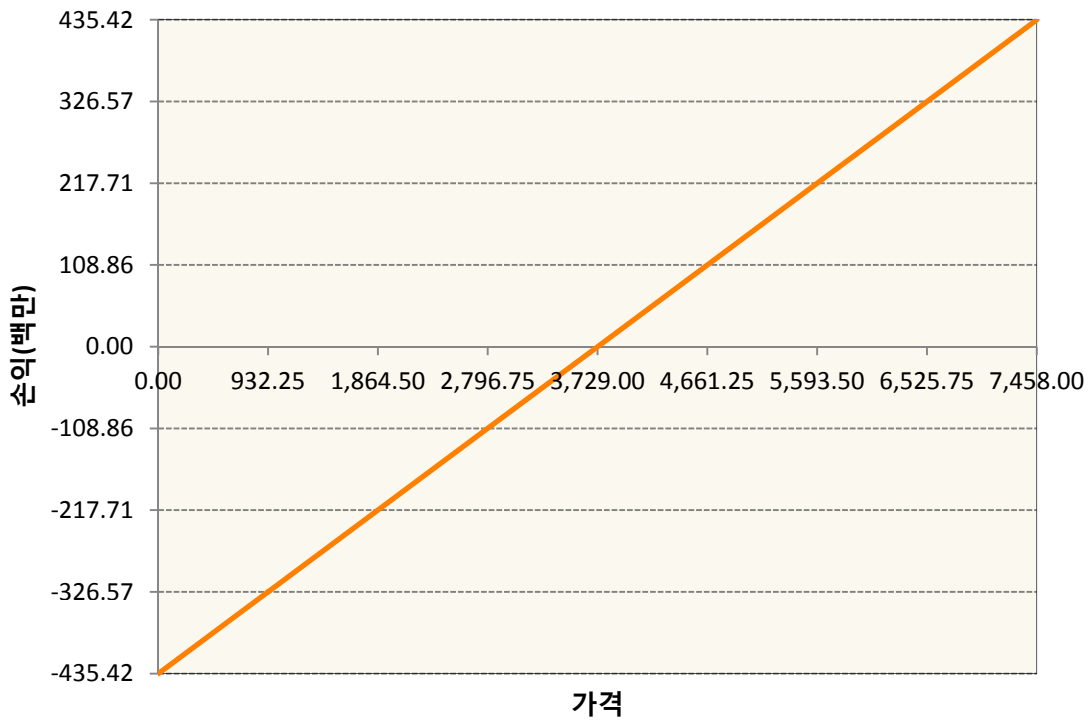
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

VGH0-EURO STOXX 50 Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH0	EURO STOXX 50 Mar20	35
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

24

공시일	2020-01-02
기준일	2019-12-31

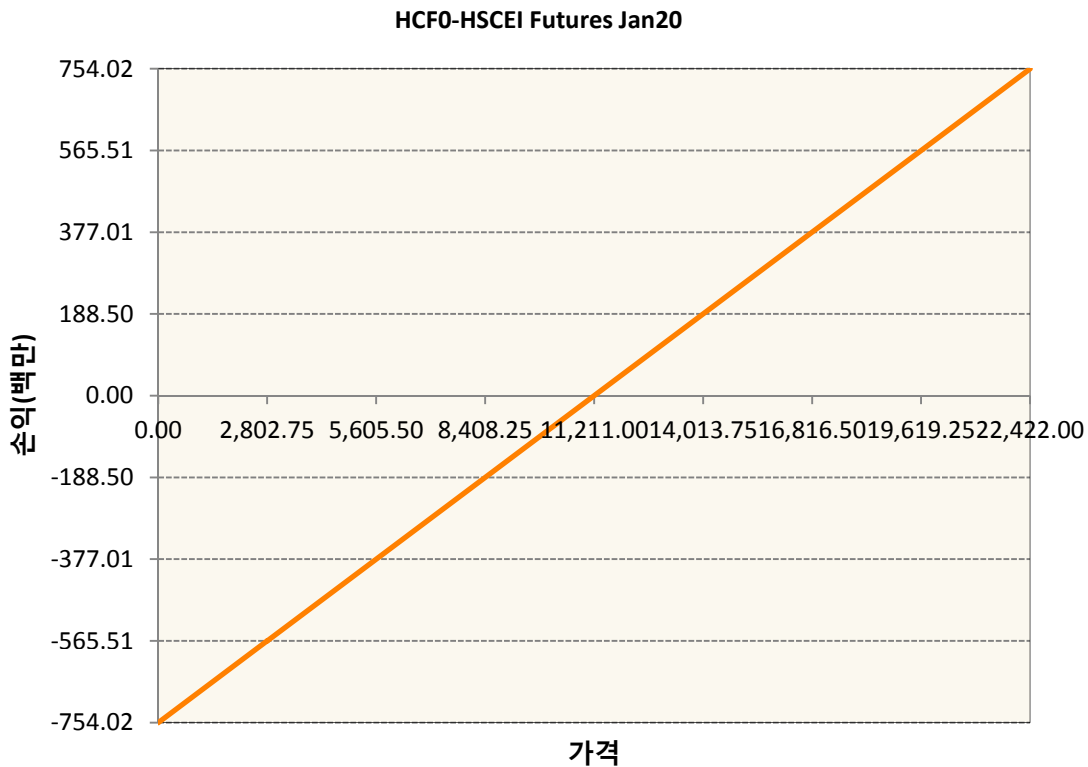
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	754	0	754	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

59

공시일	2020-01-02
기준일	2019-12-31

커버드콜모(주식혼합-파생형)

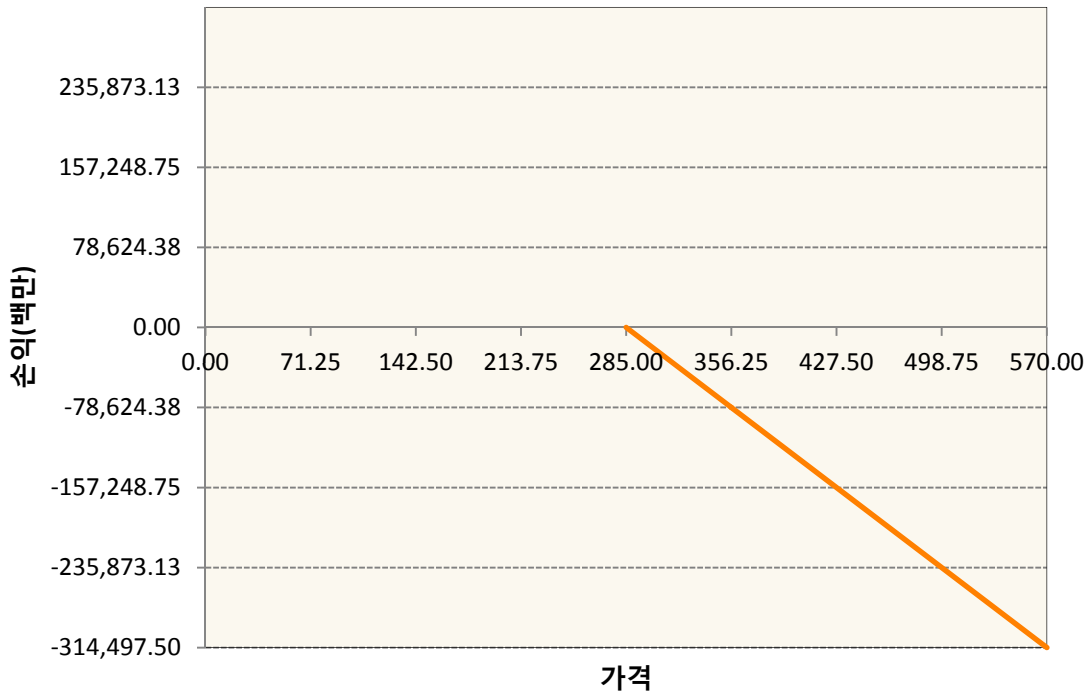
1. 계약금액

(단위:백만원)

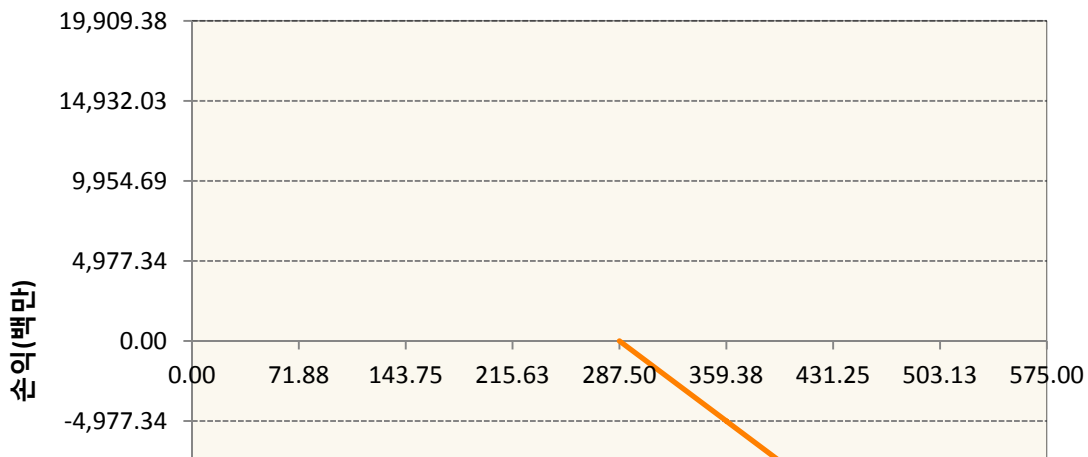
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	471,207	-471,207	장내

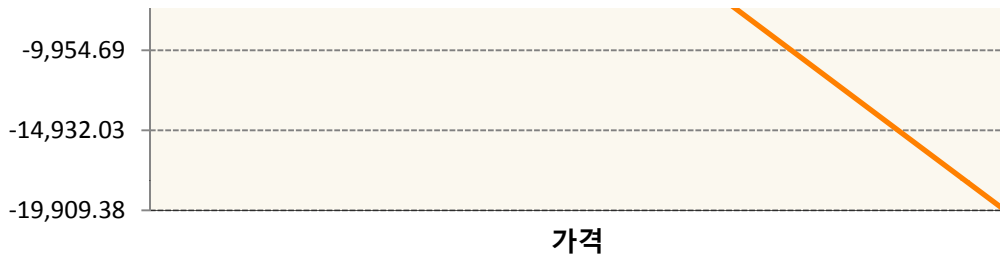
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q12852-2020-01 콜285

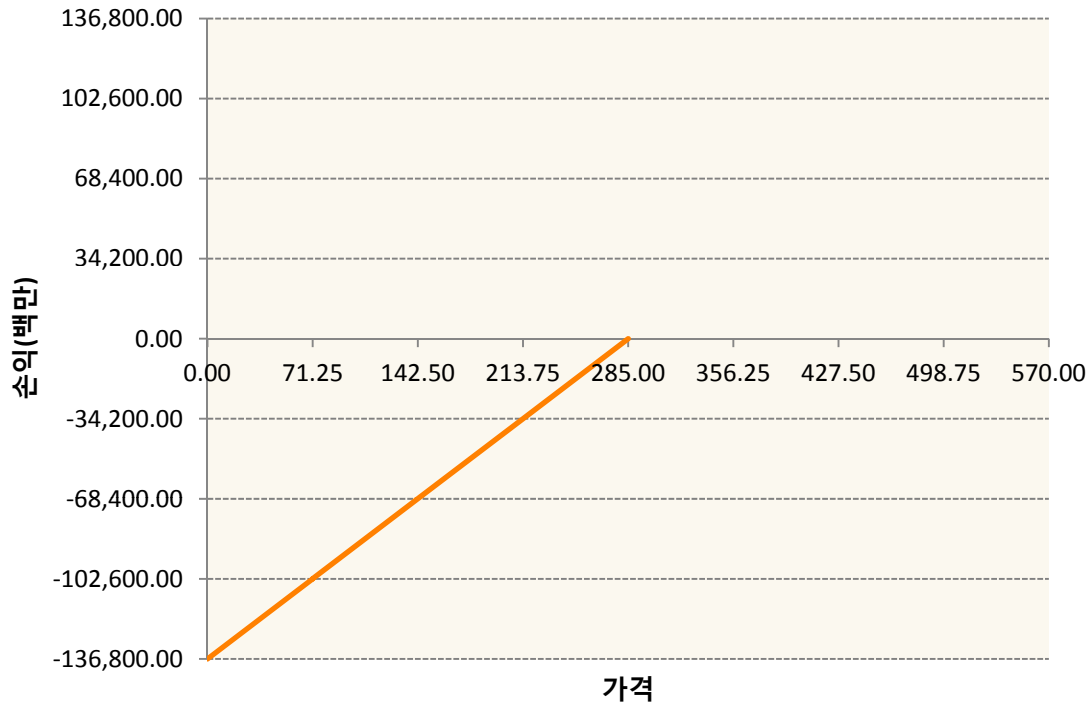


KR4201Q12878-2020-01 콜287.5





KR4301Q12850-2020-01 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q12852		2020-01 콜285					23,979
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11,523	11,374	11,192	10,980	10,741	10,480	10,198
-5.33%	10,360	9,996	9,616	9,223	8,820	8,409	7,991
-2.67%	7,033	6,565	6,097	5,629	5,160	4,691	4,223
0%	1,058	726	372	0	-386	-784	-1,192
2.67%	-6,707	-6,843	-7,014	-7,218	-7,450	-7,708	-7,988
5.33%	-15,164	-15,198	-15,253	-15,332	-15,437	-15,567	-15,722
8.00%	-23,781	-23,786	-23,798	-23,821	-23,857	-23,909	-23,979
KR4201Q12878		2020-01 콜287.5					1,461
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	608	601	593	583	571	557	542

-5.33%	560	542	521	500	477	454	429
-2.67%	401	372	343	314	284	255	225
0%	77	52	26	0	-27	-54	-82
2.67%	-382	-394	-408	-425	-443	-462	-483
5.33%	-903	-907	-912	-919	-928	-939	-951
8.00%	-1,442	-1,443	-1,444	-1,447	-1,450	-1,455	-1,461
KR4301Q12850 2020-01 풋285							6,990
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,940	-6,942	-6,945	-6,951	-6,960	-6,973	-6,990
-5.33%	-3,265	-3,307	-3,357	-3,414	-3,476	-3,543	-3,614
-2.67%	-605	-709	-814	-919	-1,023	-1,128	-1,234
0%	106	78	43	0	-49	-104	-164
2.67%	147	146	144	139	132	121	107
5.33%	147	147	147	147	147	146	144
8.00%	147	147	147	147	147	147	147

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

(단위:백만원)

33,183

공시일	2020-01-02
기준일	2019-12-31

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

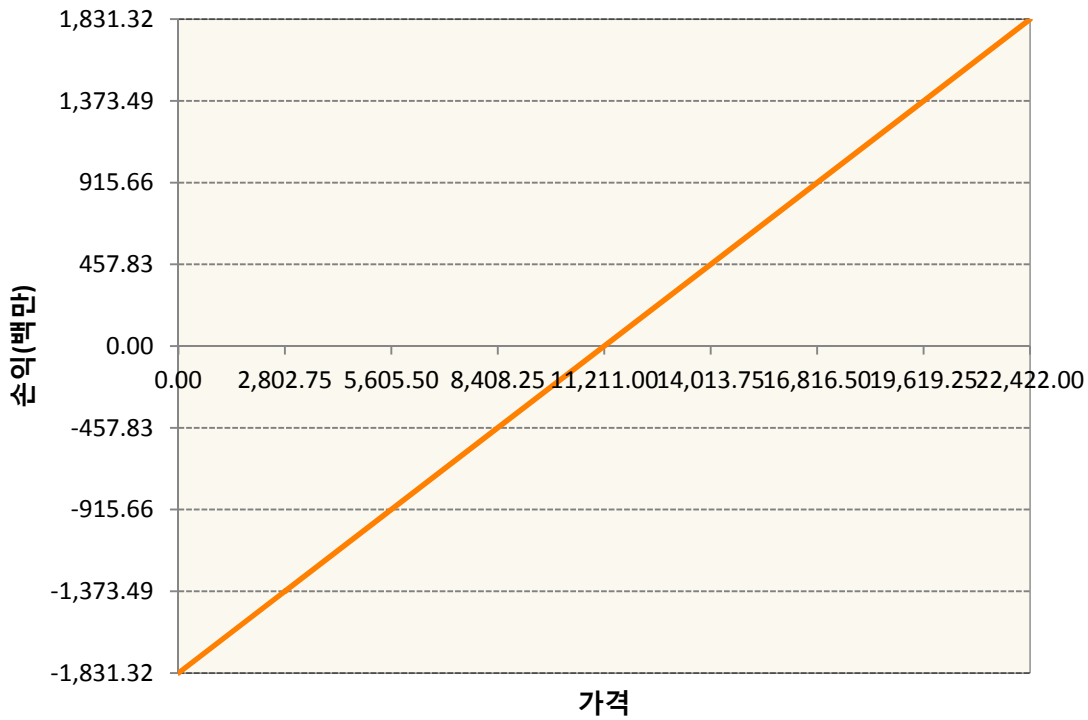
1. 계약금액

(단위:백만원)

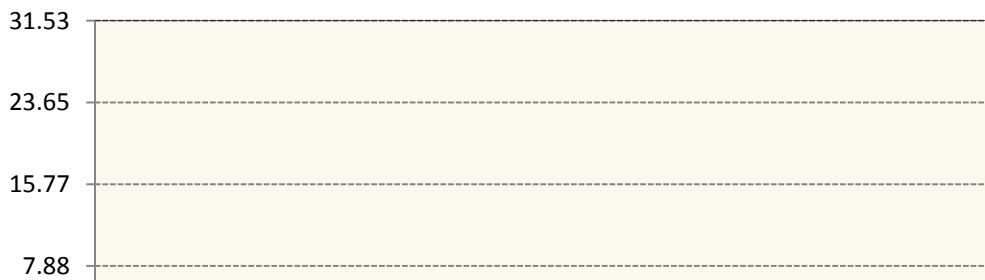
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,831	0	1,831	장내
누계	유가증권	옵션	0	84	-84	장내
누계	통화	선도	0	2,091	-2,091	장외

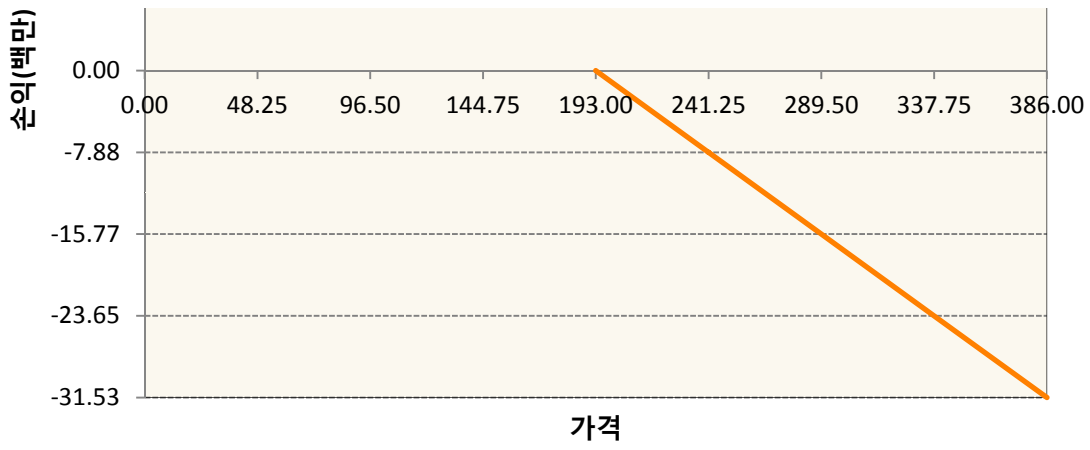
2. 만기시점의 손익구조

HCFO-HSCEI Futures Jan20

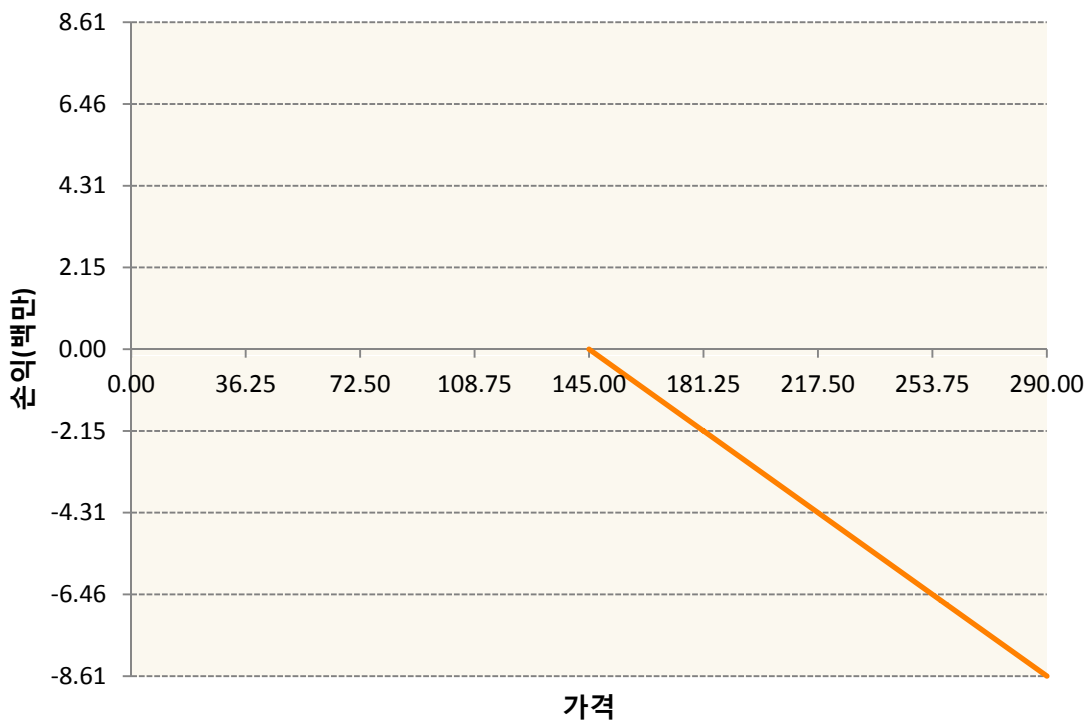


OHHIF0-C112-HSCEI

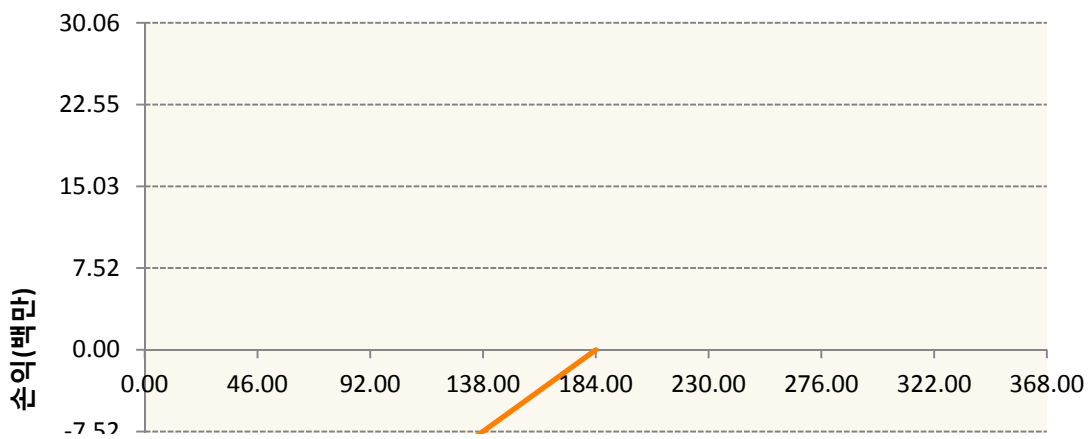


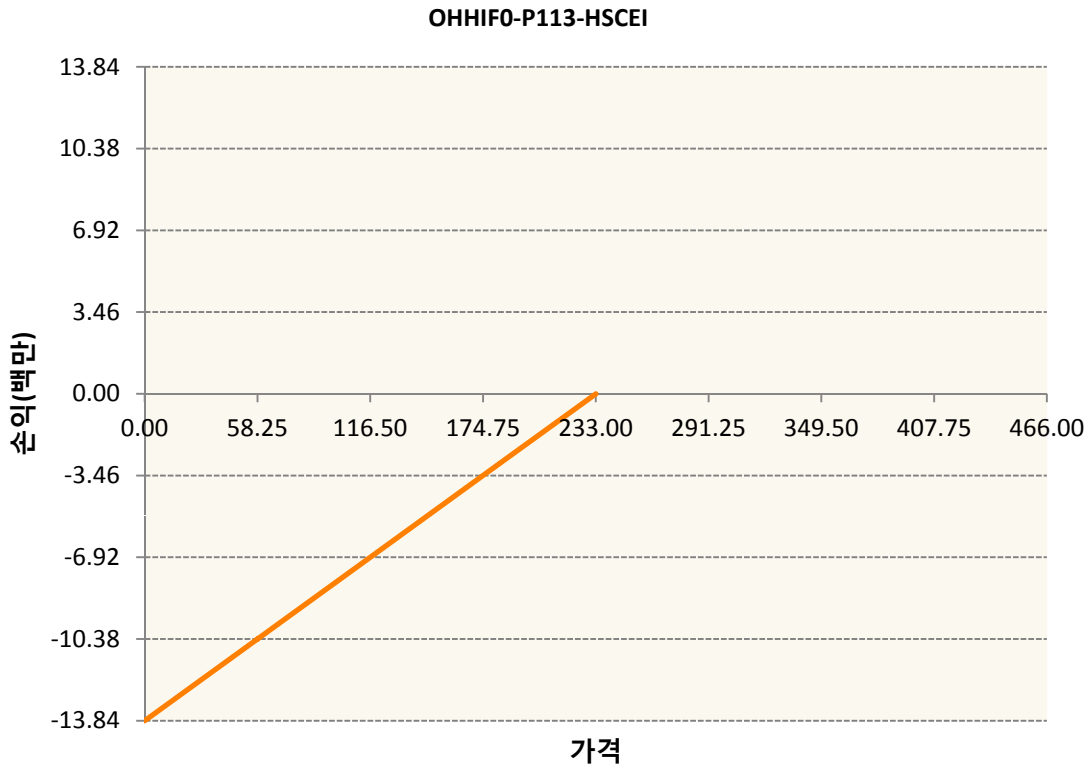
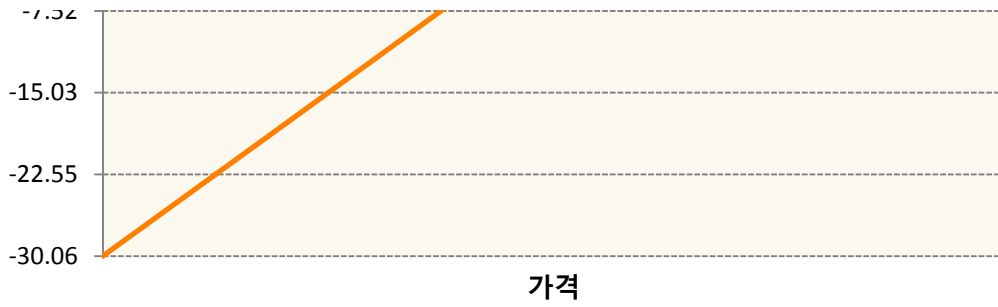


OHHIF0-C113-HSCEI



OHHIF0-P112-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	167
HCF0 HSCEI Futures Jan20	147
OHHIF0-C11 HSCEI	3
OHHIF0-C11 HSCEI	1
OHHIF0-P11 HSCEI	2
OHHIF0-P11 HSCEI	1

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

202

공시일	2020-01-02
기준일	2019-12-31

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

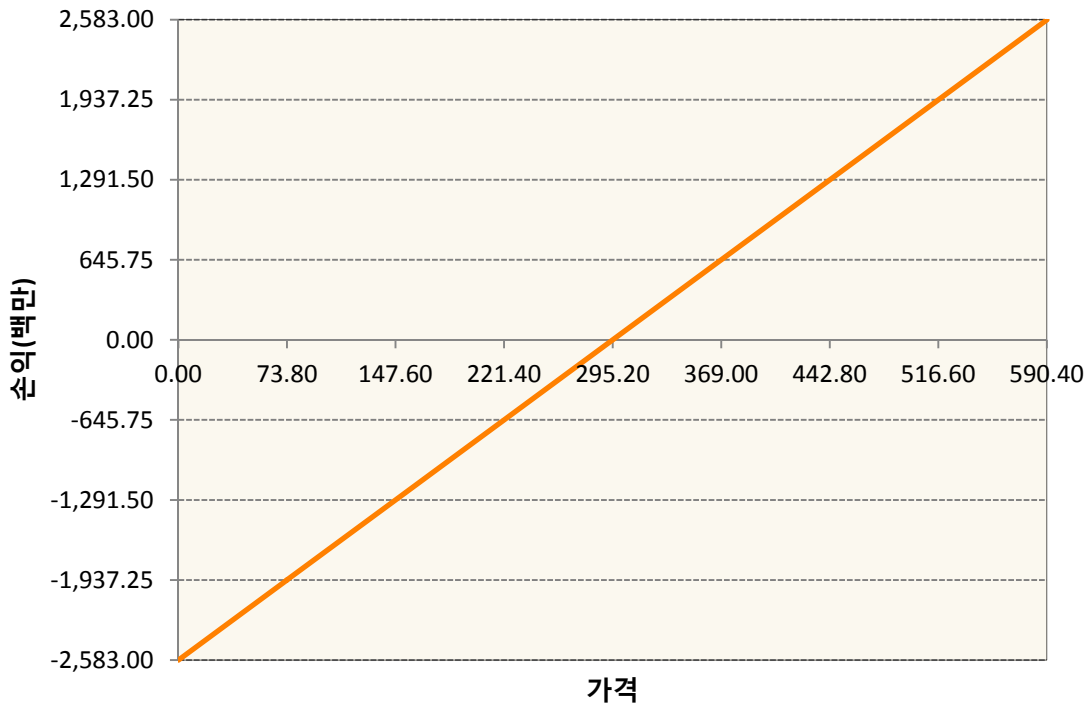
1. 계약금액

(단위:백만원)

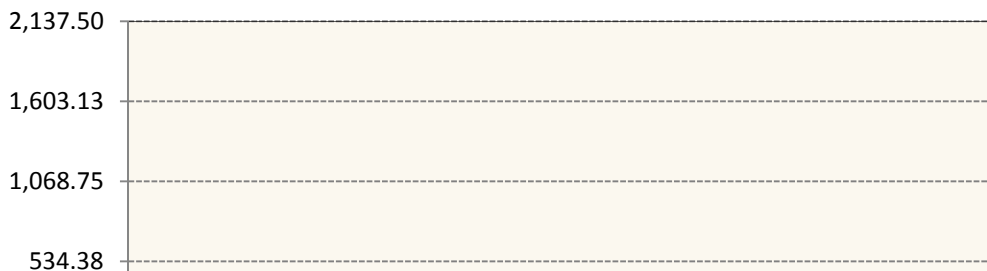
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,583	0	2,583	장내
누계	유가증권	스왑	5,625	0	5,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,918	-4,918	장내

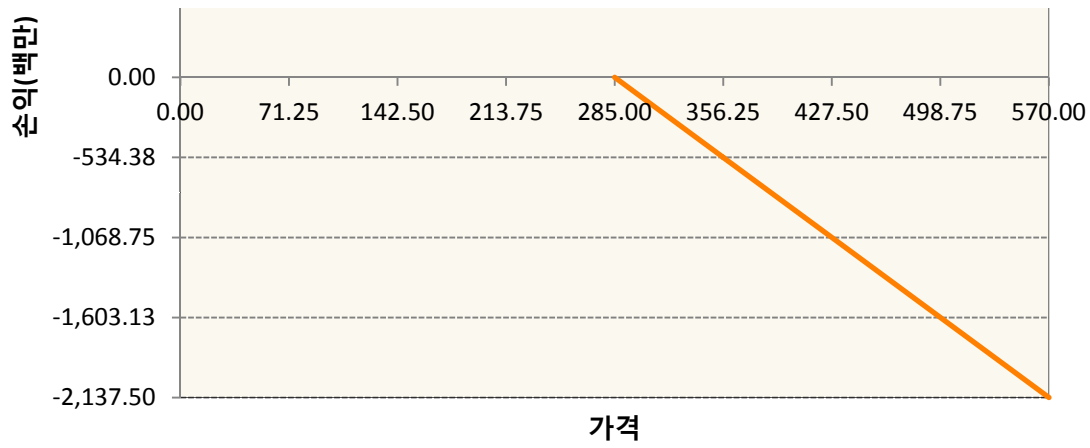
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

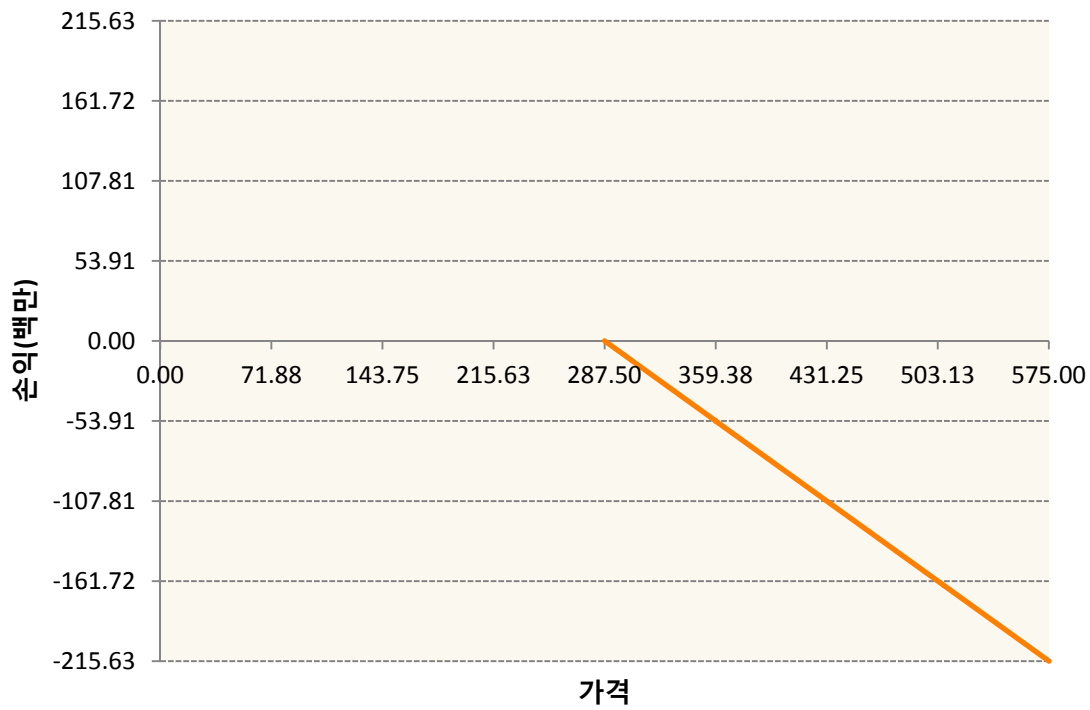


KR4201Q12852-2020-01 콜285

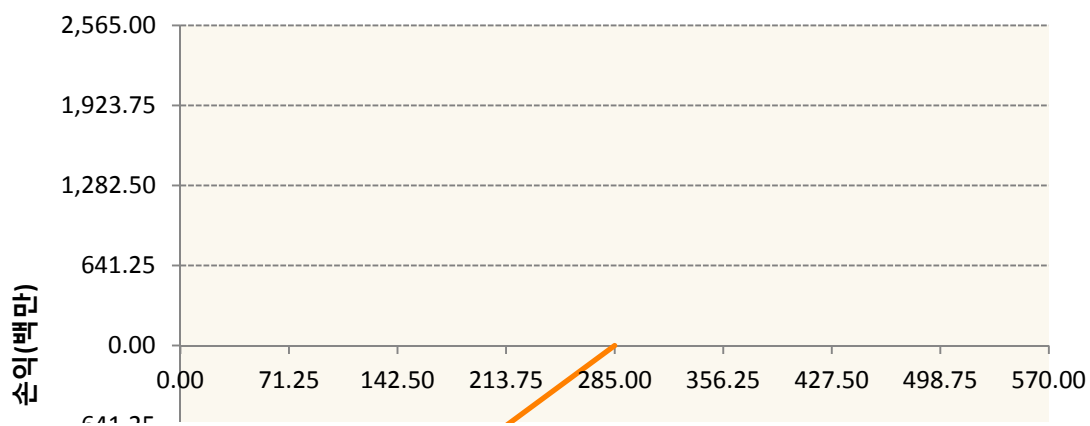




KR4201Q12878-2020-01 콜287.5



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						163
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	78	77	76	75	73	71	69	
-5.33%	70	68	65	63	60	57	54	
-2.67%	48	45	41	38	35	32	29	
0%	7	5	3	0	-3	-5	-8	
2.67%	-46	-47	-48	-49	-51	-52	-54	
5.33%	-103	-103	-104	-104	-105	-106	-107	
8.00%	-162	-162	-162	-162	-162	-162	-163	
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	6	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%	-16	-16	-16	-16	-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	-131	-131	-131
-5.33%	-61	-62	-63	-64	-65	-66	-68
-2.67%	-11	-13	-15	-17	-19	-21	-23
0%	2	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	3	3	3	3	2	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)

932

공시일	2020-01-02
기준일	2019-12-31

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

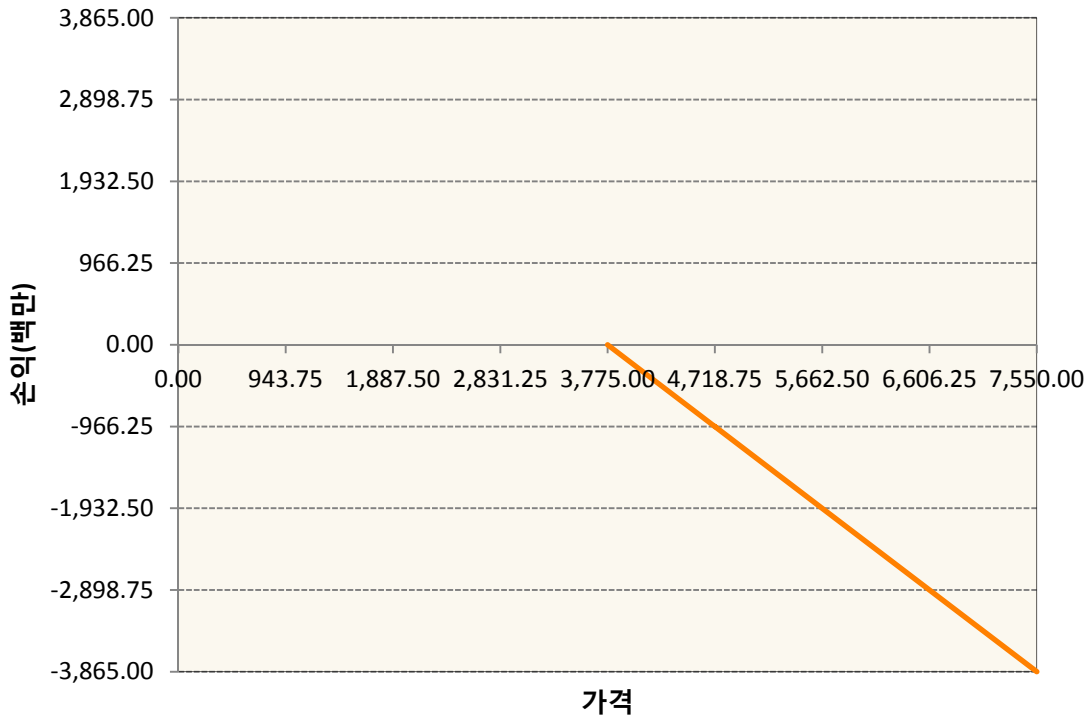
1. 계약금액

(단위:백만원)

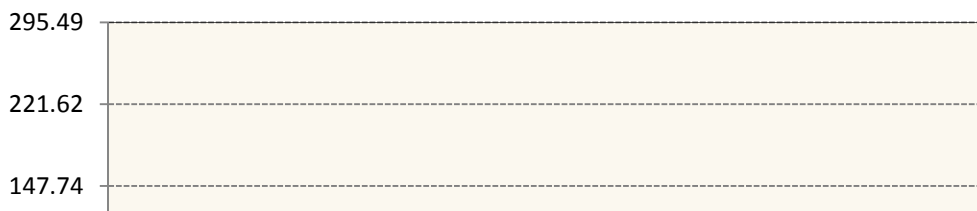
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	2	-2	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,158	0	1,158	
누계	유가증권	스왑	15,740	0	15,740	장외
누계	유가증권	옵션	0	8,321	-8,321	장내
누계	통화	선도	0	3,401	-3,401	장외

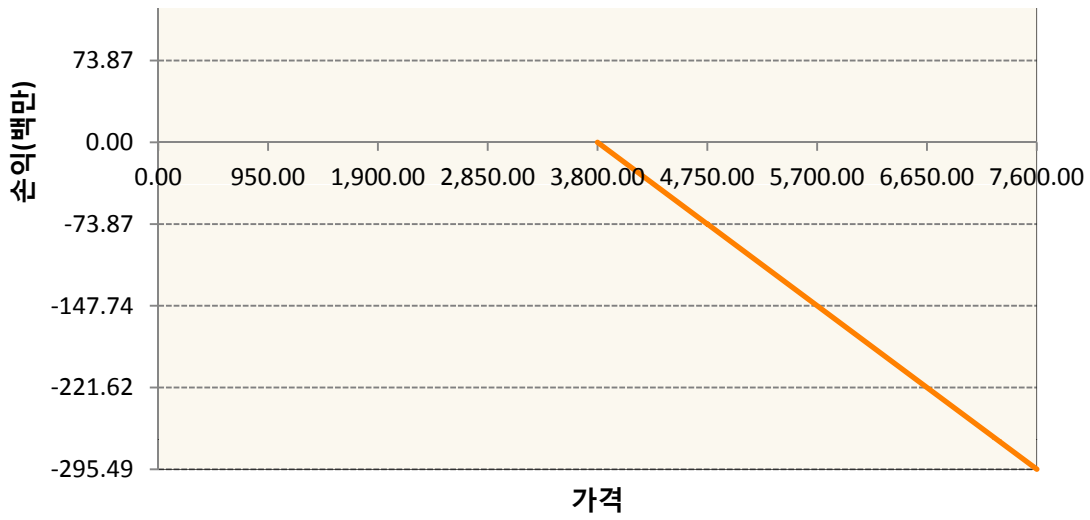
2. 만기시점의 손익구조

OESXF0-C3775-EURO STOXX 50

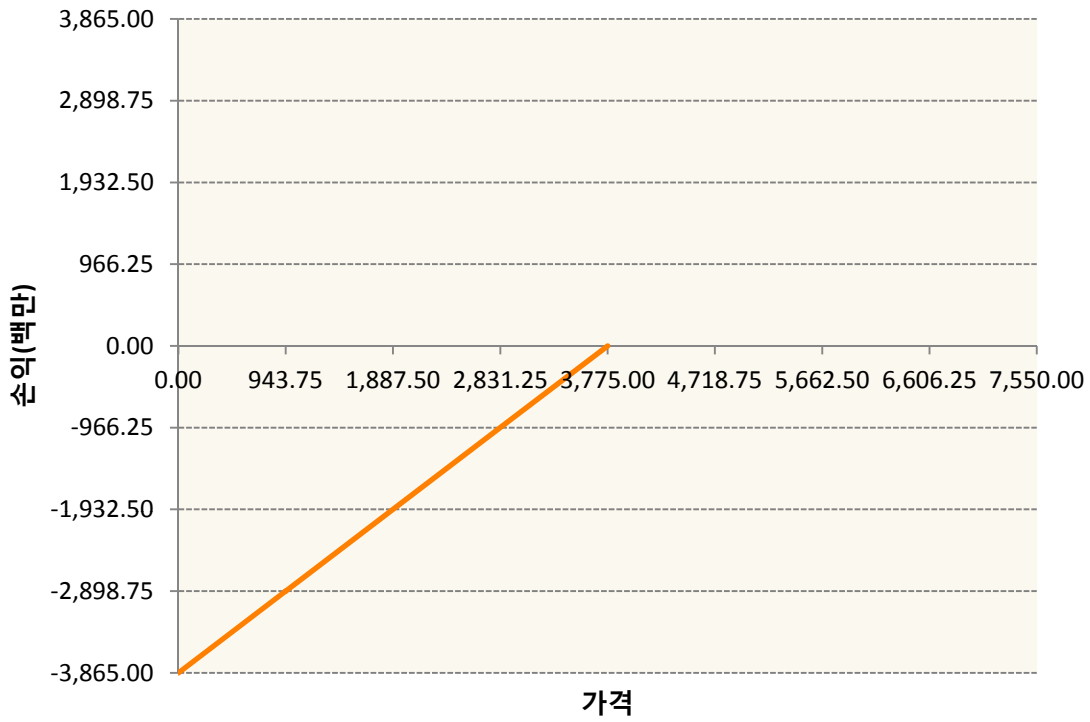


OESXF0-C3800-EURO STOXX 50

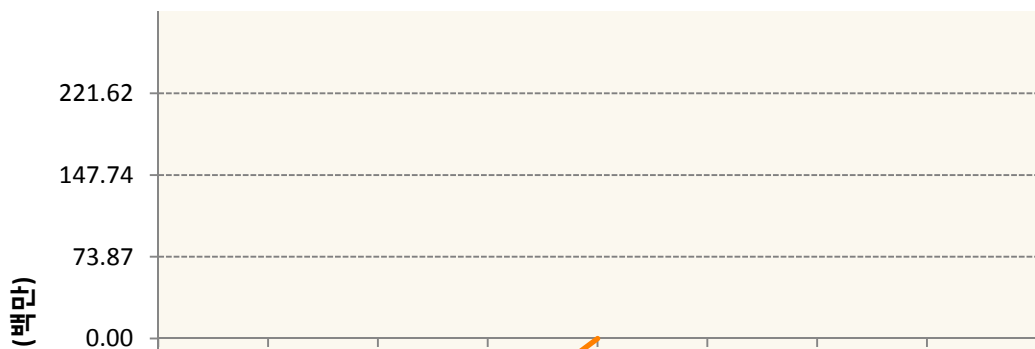


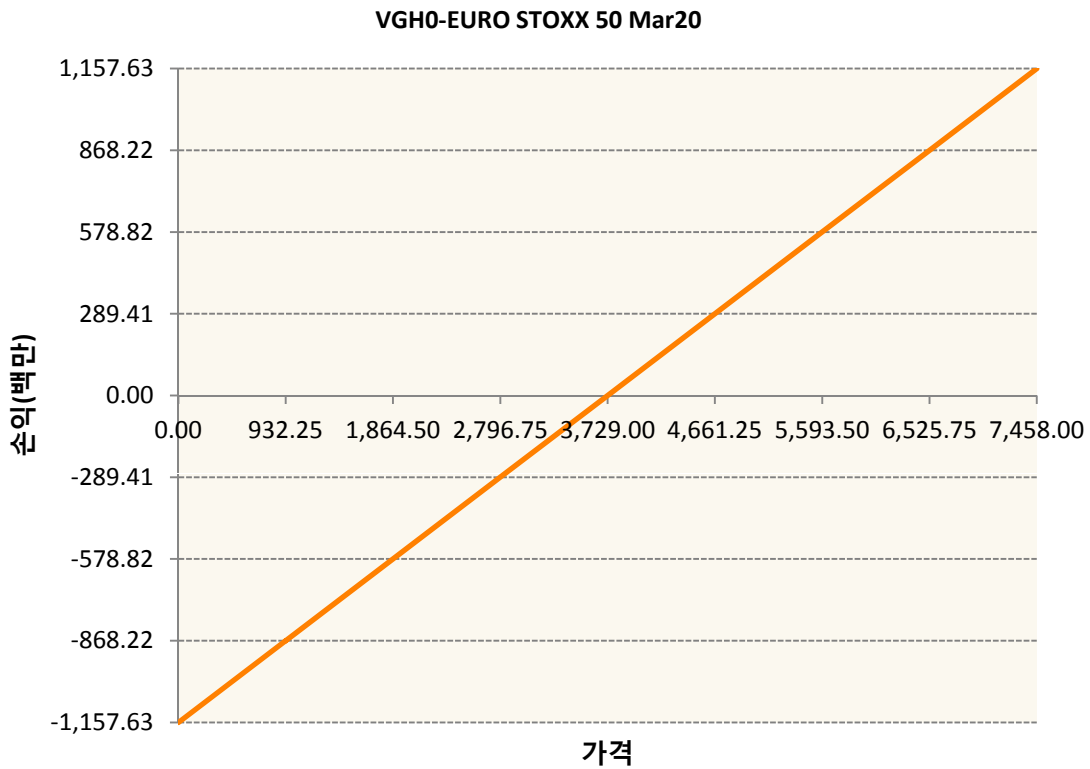
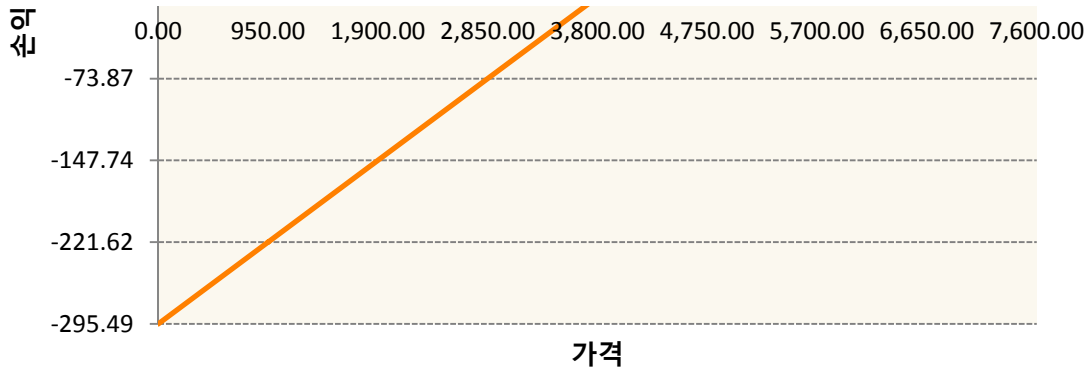


OESXF0-P3775-EURO STOXX 50



OESXF0-P3800-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	31
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	272
OESXF0-C37 EURO STOXX 50	309
OESXF0-C38 EURO STOXX 50	24
OESXF0-P37 EURO STOXX 50	309
OESXF0-P38 EURO STOXX 50	24
VGH0 EURO STOXX 50 Mar20	93

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

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

(단위:백만원)

916

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

(단위:백만원)

82

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

(단위:백만원)

115

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

(단위:백만원)

41

공시일	2020-01-02
기준일	2019-12-31

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

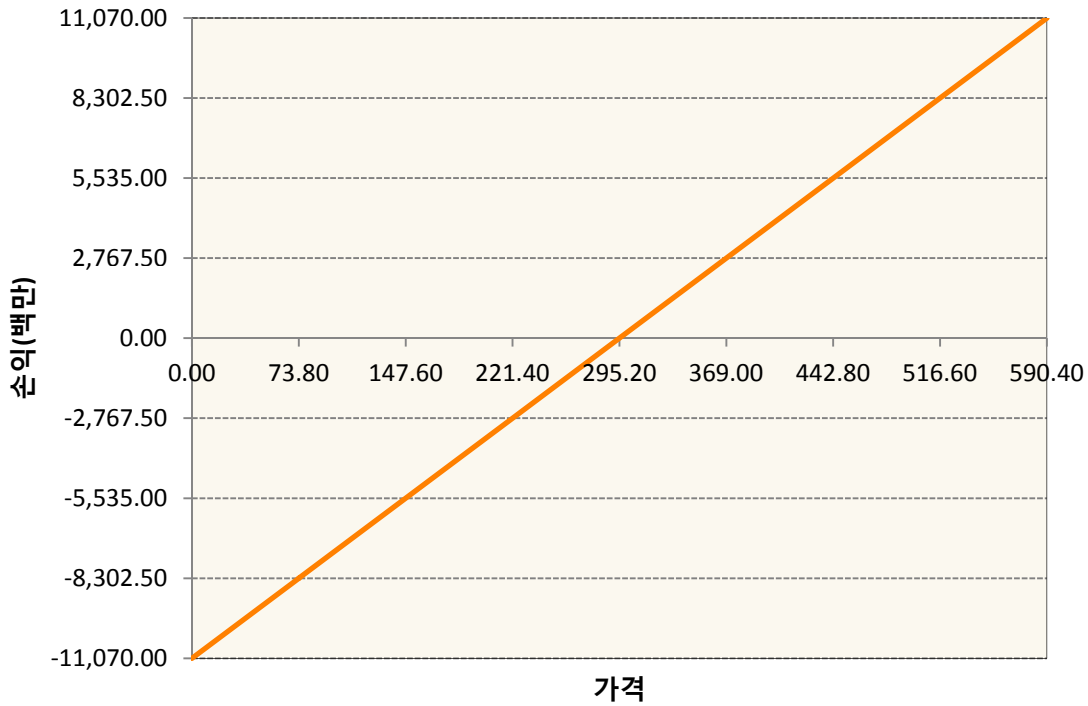
1. 계약금액

(단위:백만원)

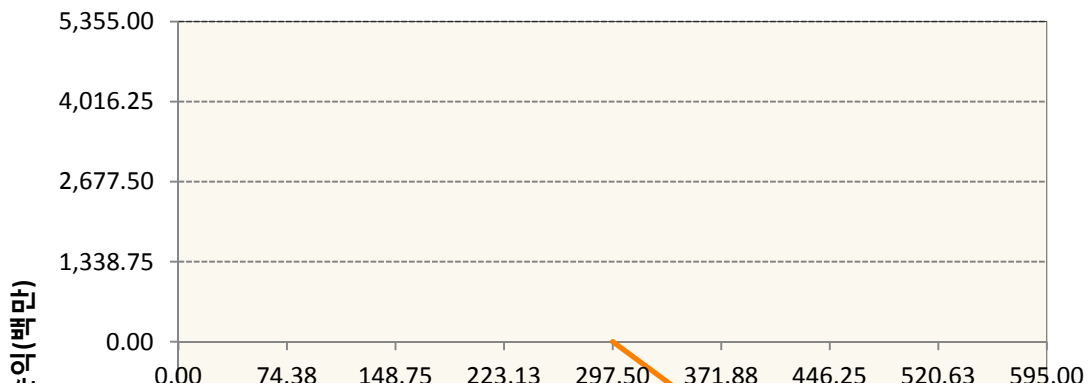
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,070	0	11,070	장내
누계	유가증권	옵션	499	21,105	-20,606	장내

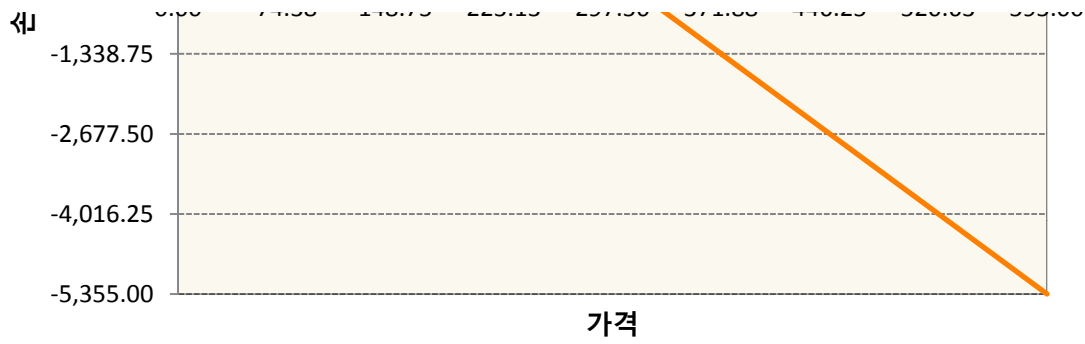
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

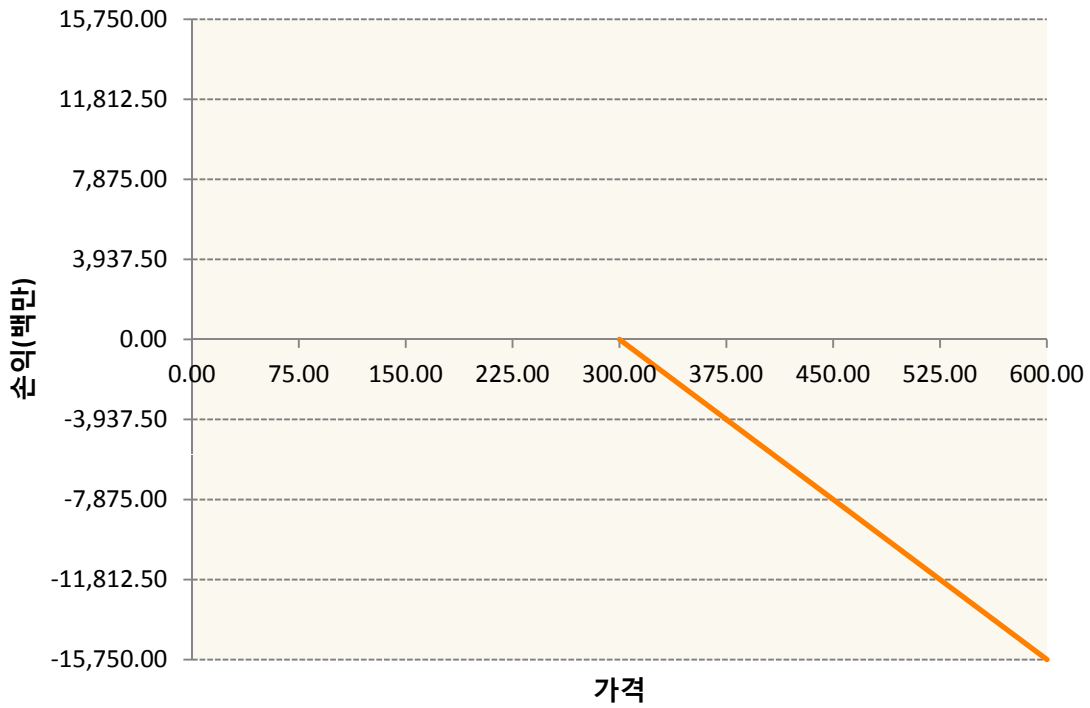


KR4201Q12977-2020-01 콜297.5

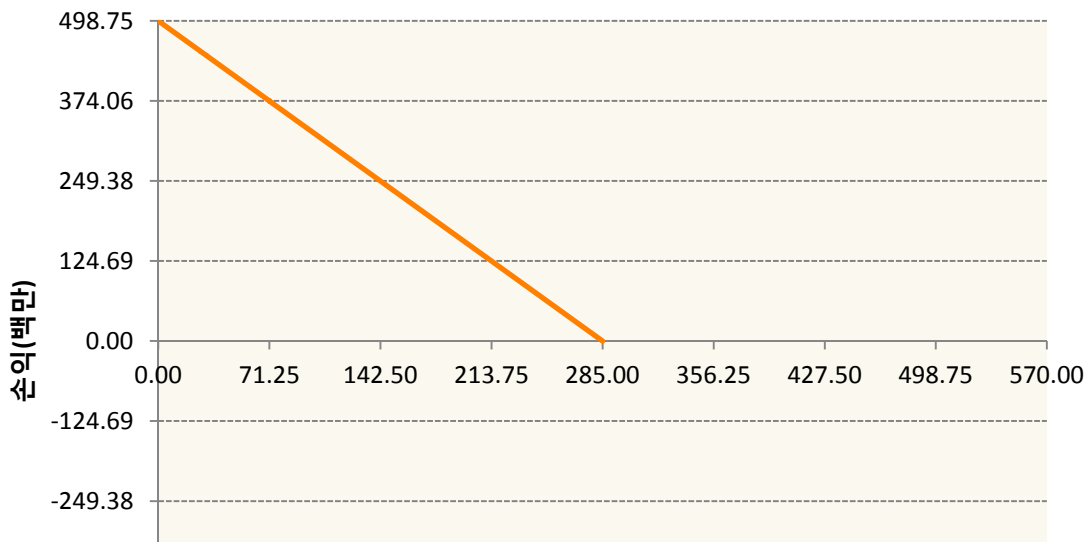


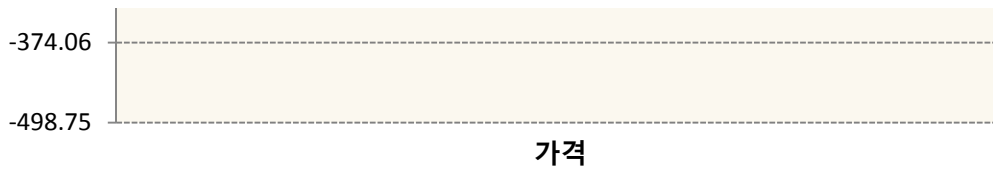


KR4201Q13009-2020-01 콜300



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						309
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	65	65	64	64	63	62	60	
-5.33%	64	62	61	58	56	53	49	
-2.67%	55	51	46	41	35	30	24	
0%	23	15	8	0	-8	-15	-23	
2.67%	-50	-57	-65	-72	-80	-88	-96	
5.33%	-160	-164	-169	-175	-180	-186	-193	
8.00%	-292	-294	-296	-298	-302	-305	-309	
KR4201Q13009		2020-01 콜300						836
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	145	144	144	142	141	138	134	
-5.33%	143	140	137	132	126	119	110	
-2.67%	127	118	107	95	81	67	51	
0%	60	41	21	0	-21	-42	-64	
2.67%	-111	-134	-157	-181	-204	-228	-251	
5.33%	-401	-417	-435	-453	-472	-492	-512	
8.00%	-770	-778	-786	-797	-808	-822	-836	
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	4	

0%	0	0	0	0	0	0	1
2.67%	-1	-1	-1	-1	0	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)

1,805

공시일	2020-01-02
기준일	2019-12-31

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	203,855	0	203,855	

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	2020-01-02
기준일	2019-12-31

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	212,785	0	212,785	

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	2020-01-02
기준일	2019-12-31

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	525,146	0	525,146	
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)

208

공시일	2020-01-02
기준일	2019-12-31

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

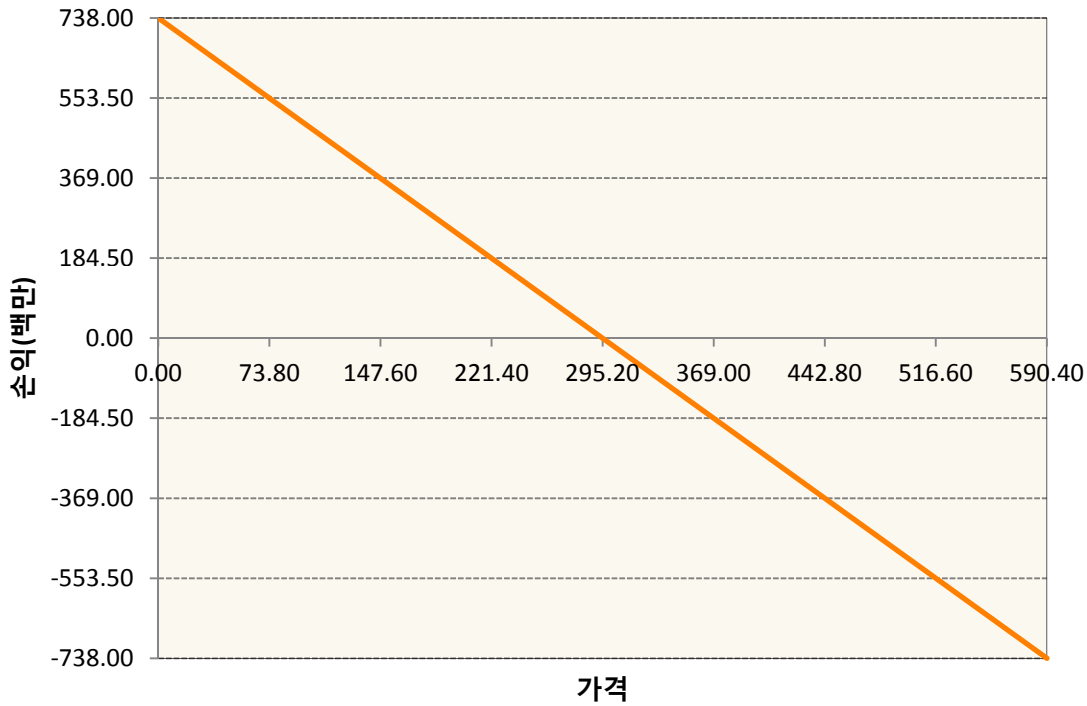
1. 계약금액

(단위:백만원)

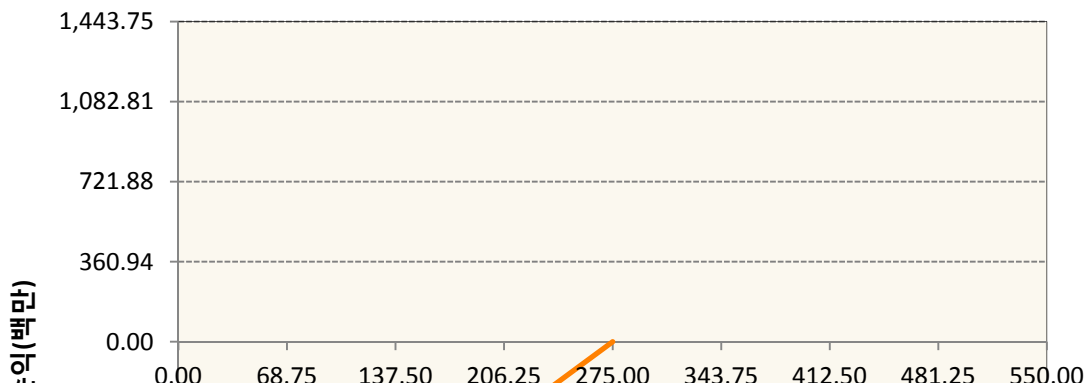
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	738	-738	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,872	-3,872	장내

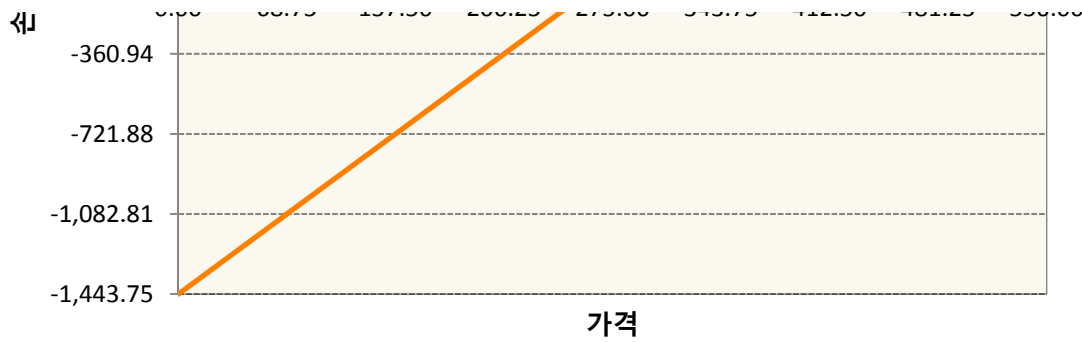
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

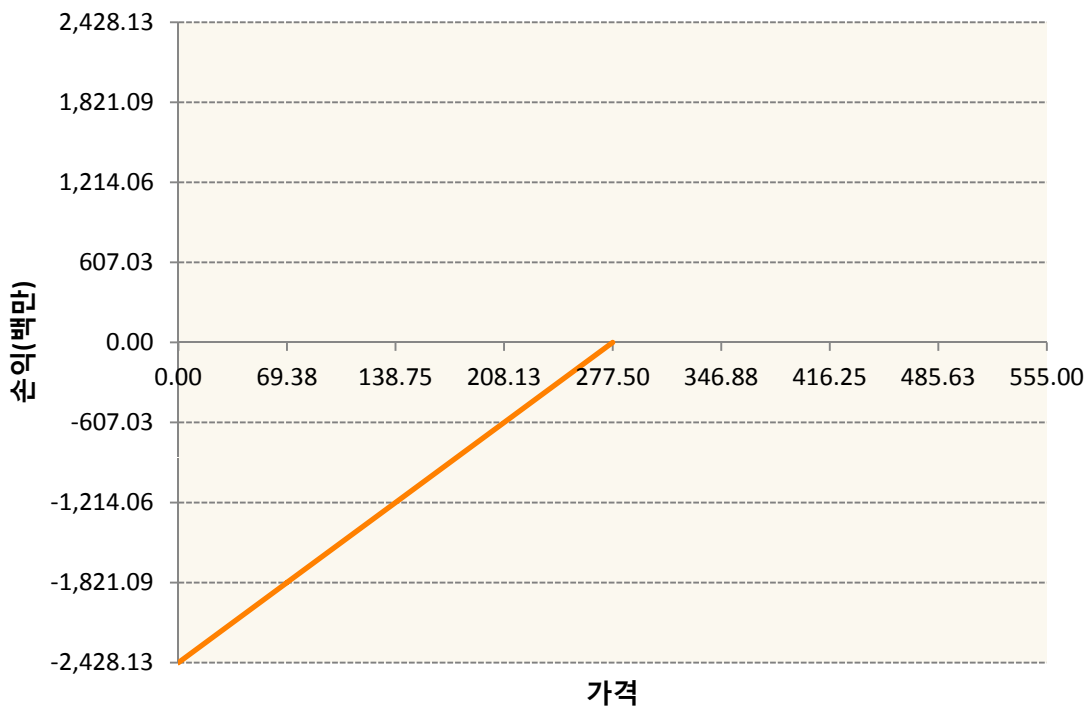


KR4301Q12751-2020-01 풋275





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						32
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-27	-28	-29	-29	-30	-31	-32
-5.33%	-4	-5	-6	-7	-8	-9	-10
-2.67%	0	0	0	-1	-1	-1	-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 70

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-65	-65	-66	-67	-68	-69	-70
-5.33%	-14	-16	-18	-20	-22	-24	-26
-2.67%	-1	-1	-2	-3	-3	-4	-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)

67

공시일	2020-01-02
기준일	2019-12-31

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	13,488	0	13,488	
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	2020-01-02
기준일	2019-12-31

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	2,019	0	2,019	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	2020-01-02
기준일	2019-12-31

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

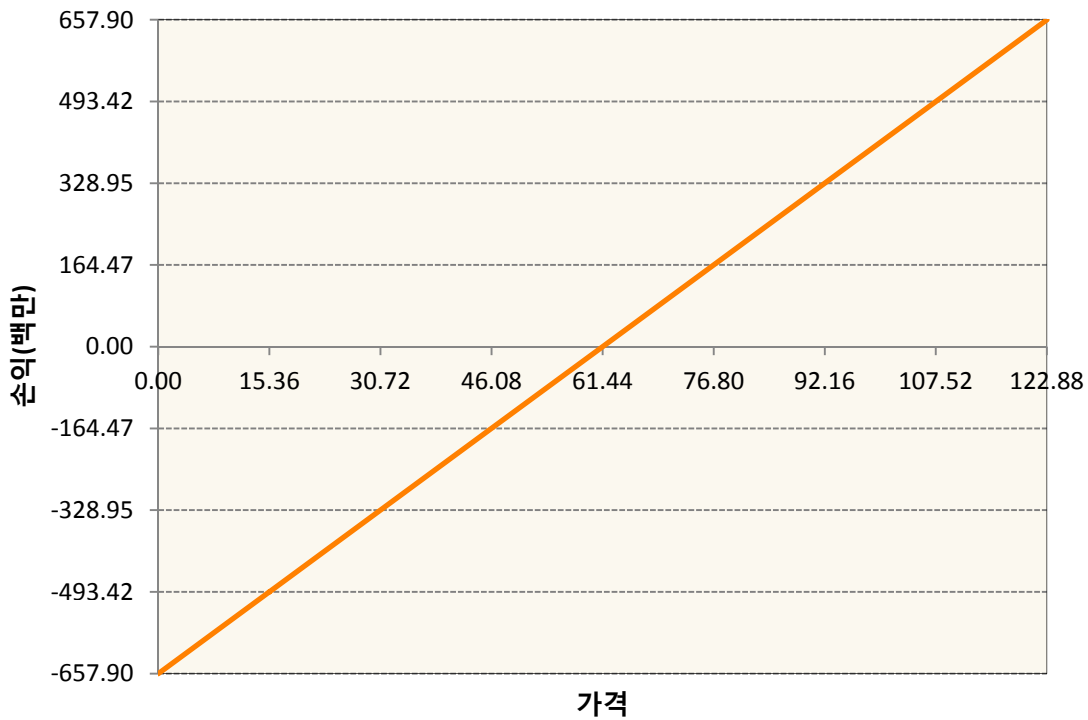
1. 계약금액

(단위:백만원)

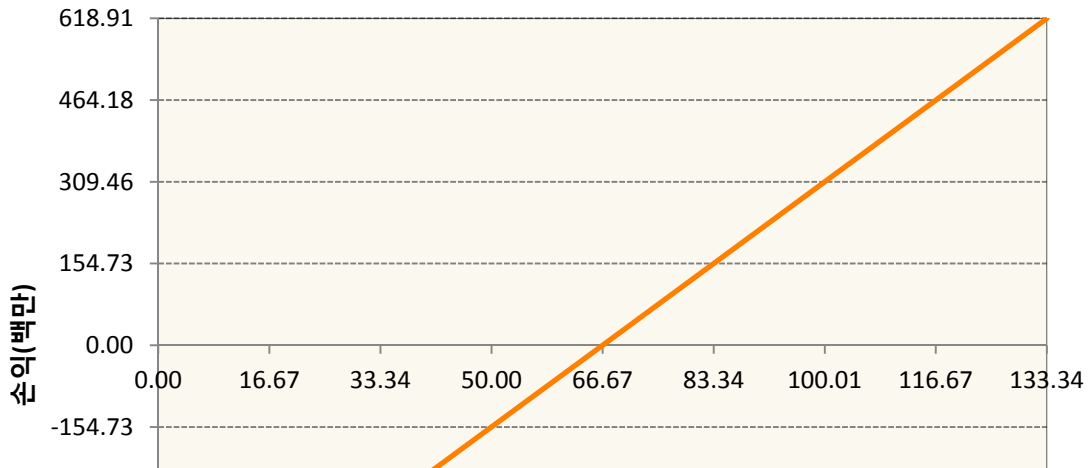
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,450	289	2,161	

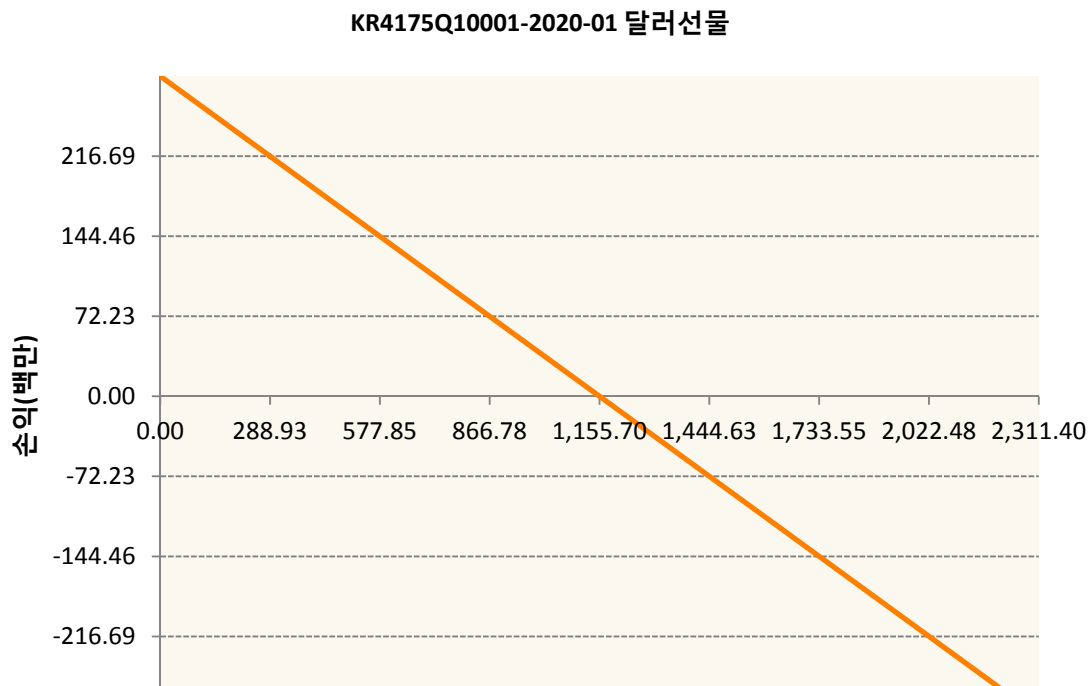
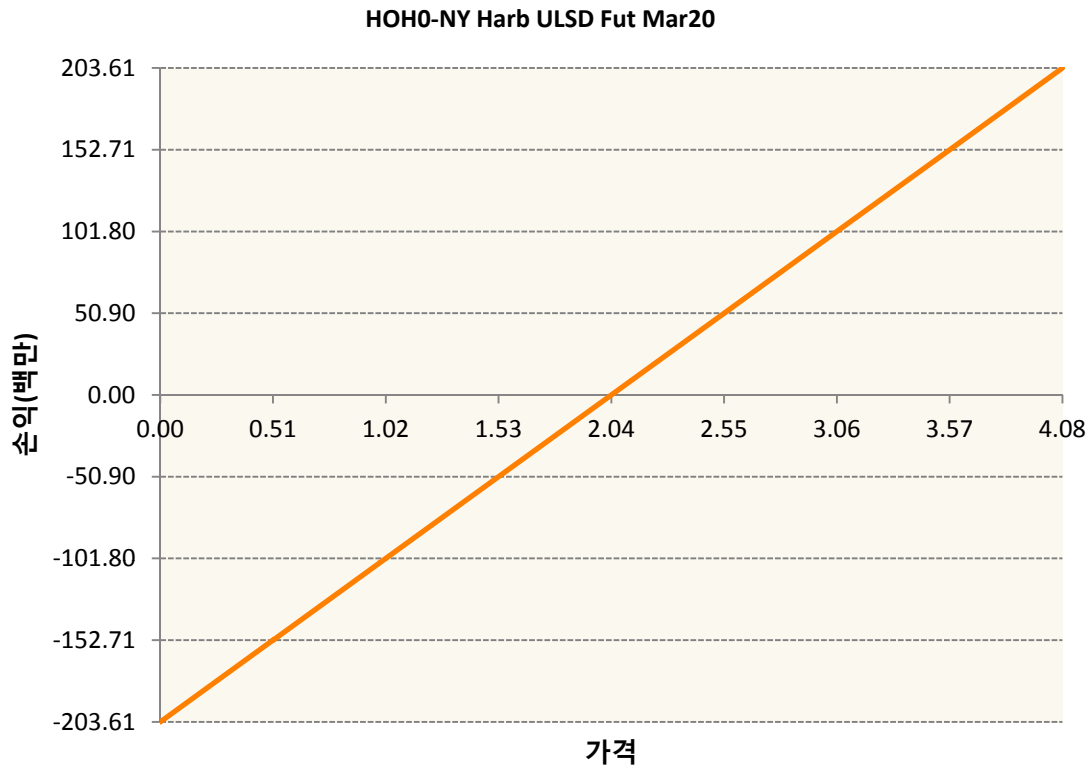
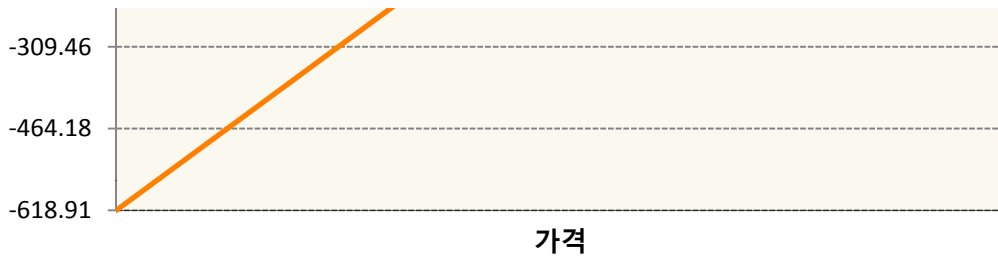
2. 만기시점의 손익구조

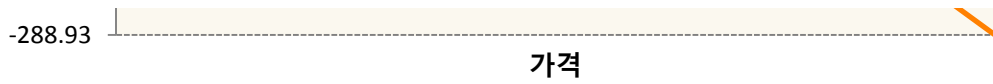
CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20



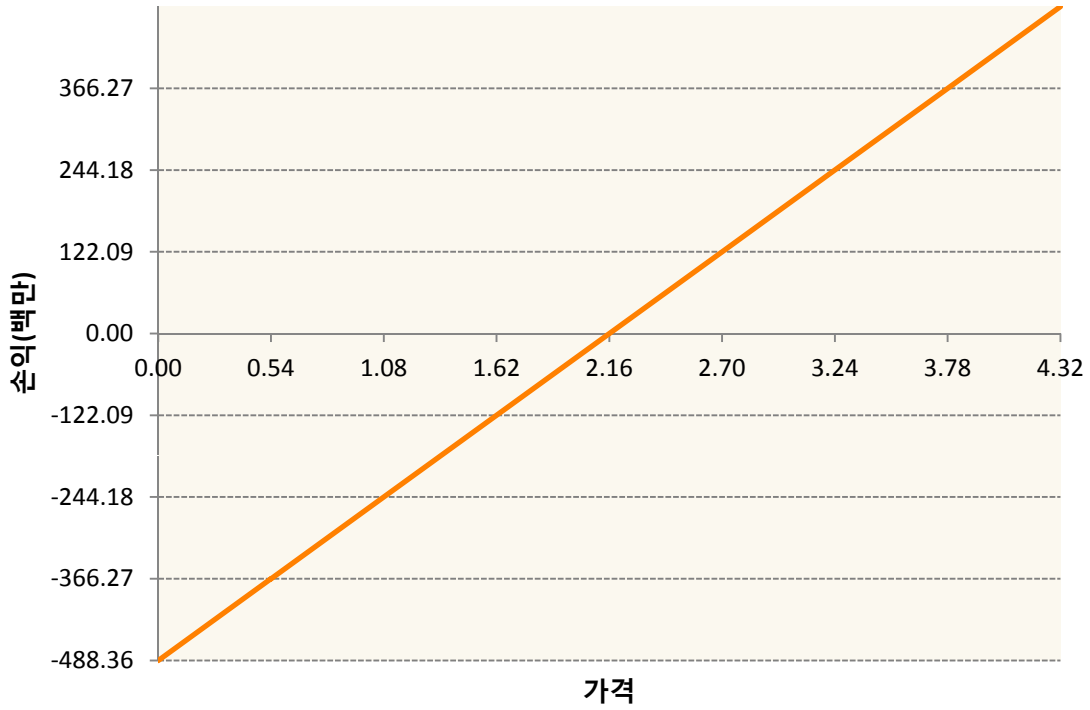
COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20



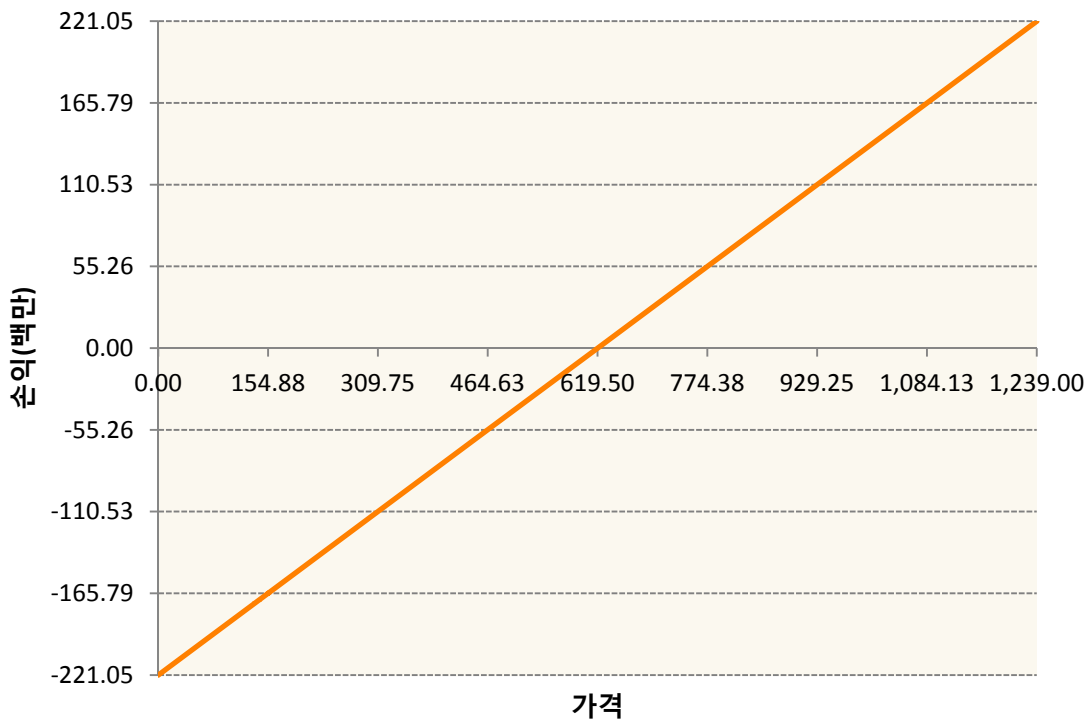




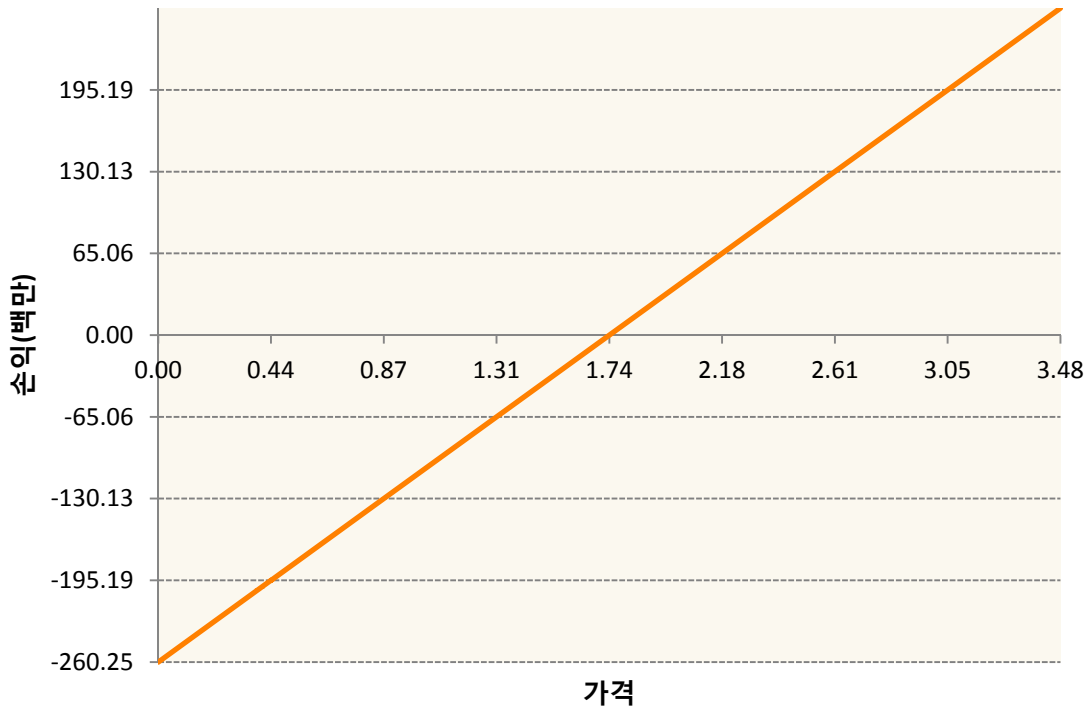
NGH20-NATURAL GAS FUTR Mar20



QSH0-Low Su Gasoil G Mar20



XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	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)

378

공시일	2020-01-02
기준일	2019-12-31

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

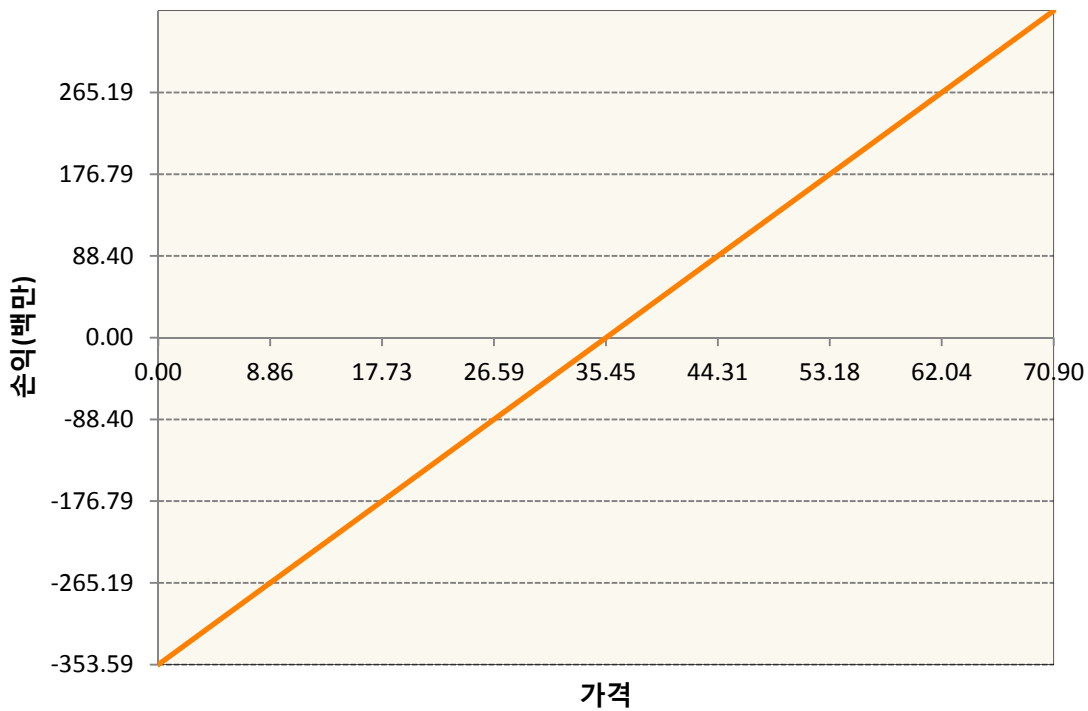
1. 계약금액

(단위:백만원)

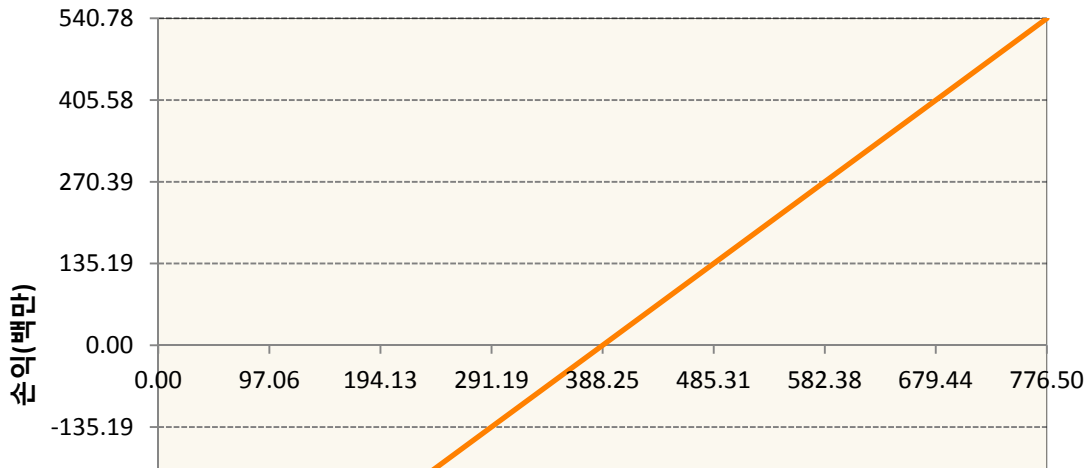
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,883	150	2,733	

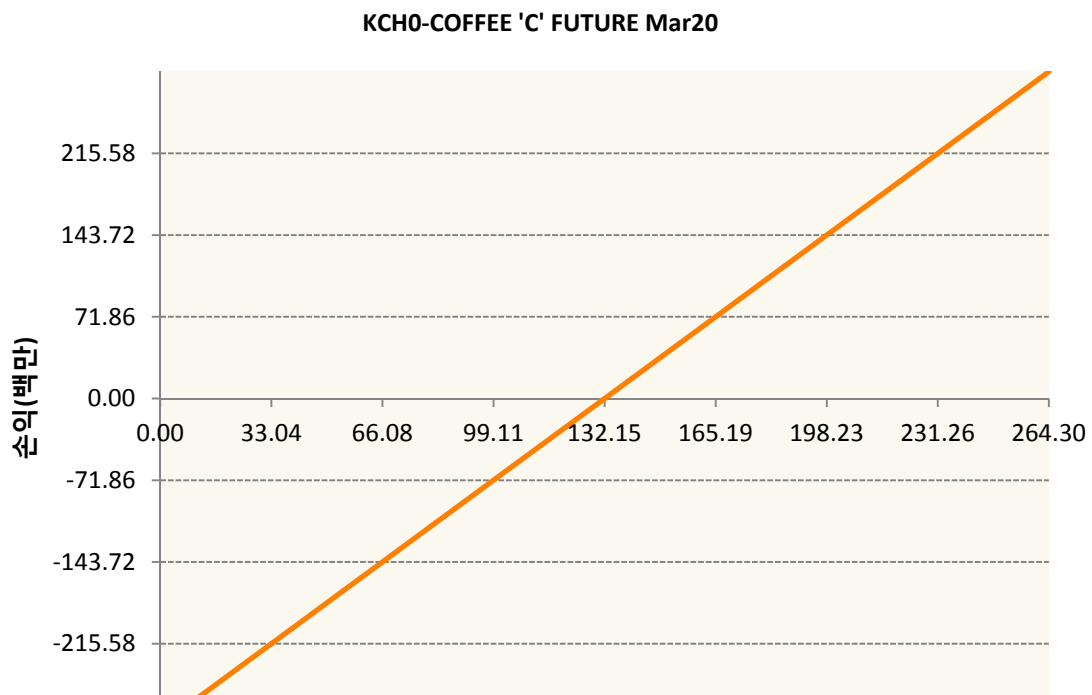
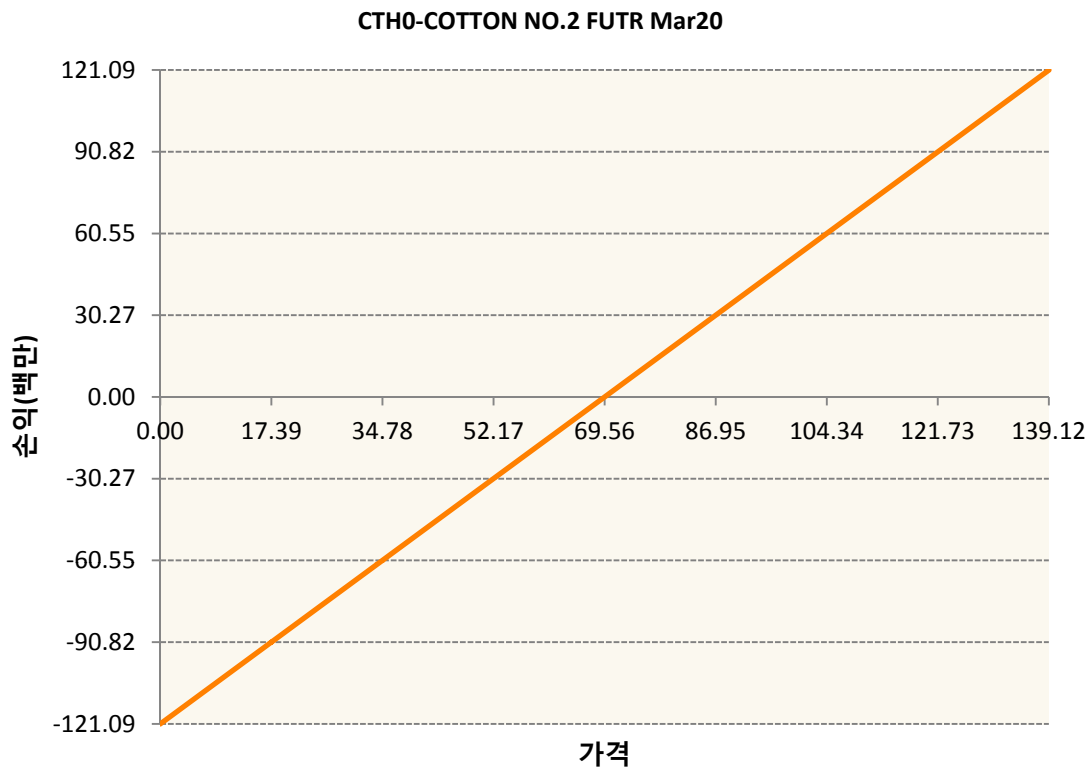
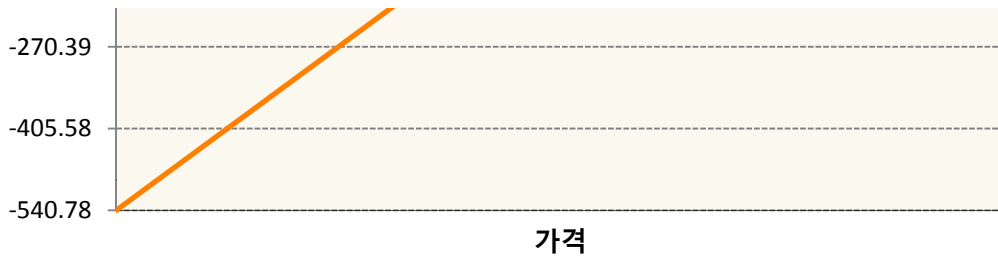
2. 만기시점의 손익구조

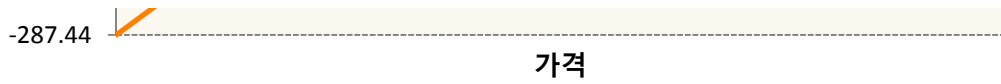
BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20



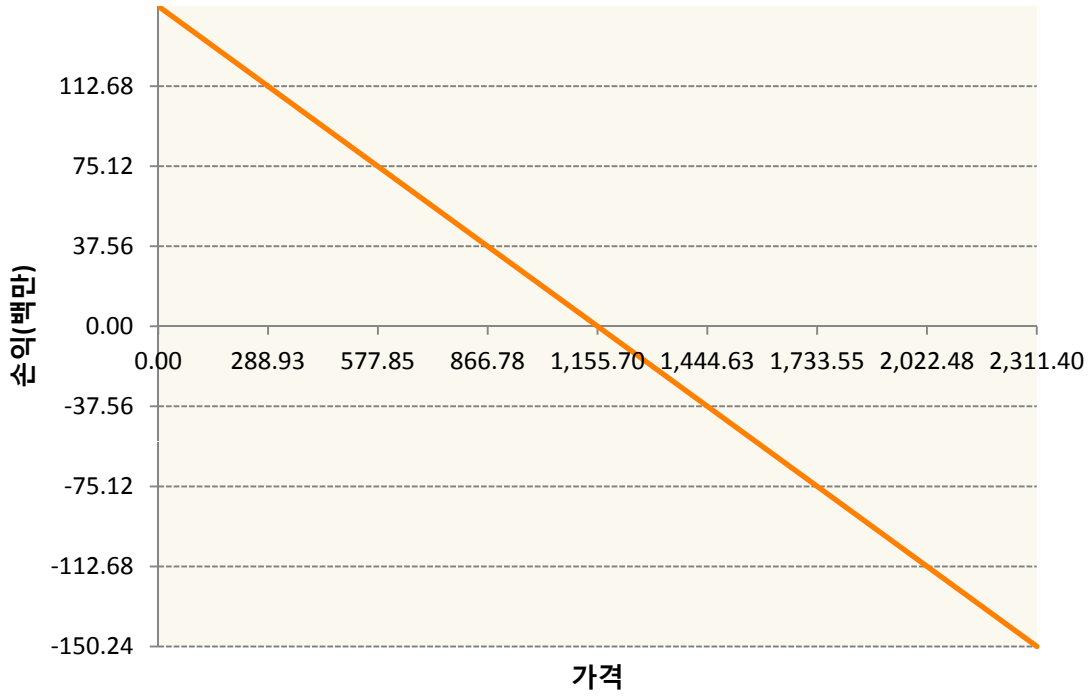
CH0-CORN FUTURE Mar20



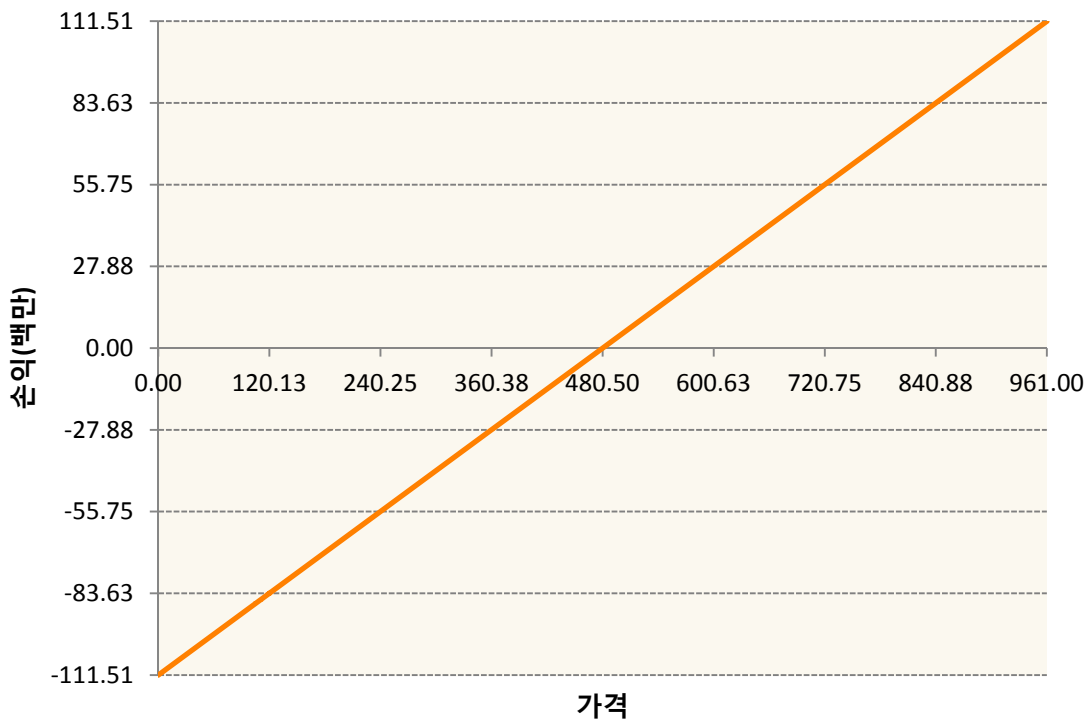




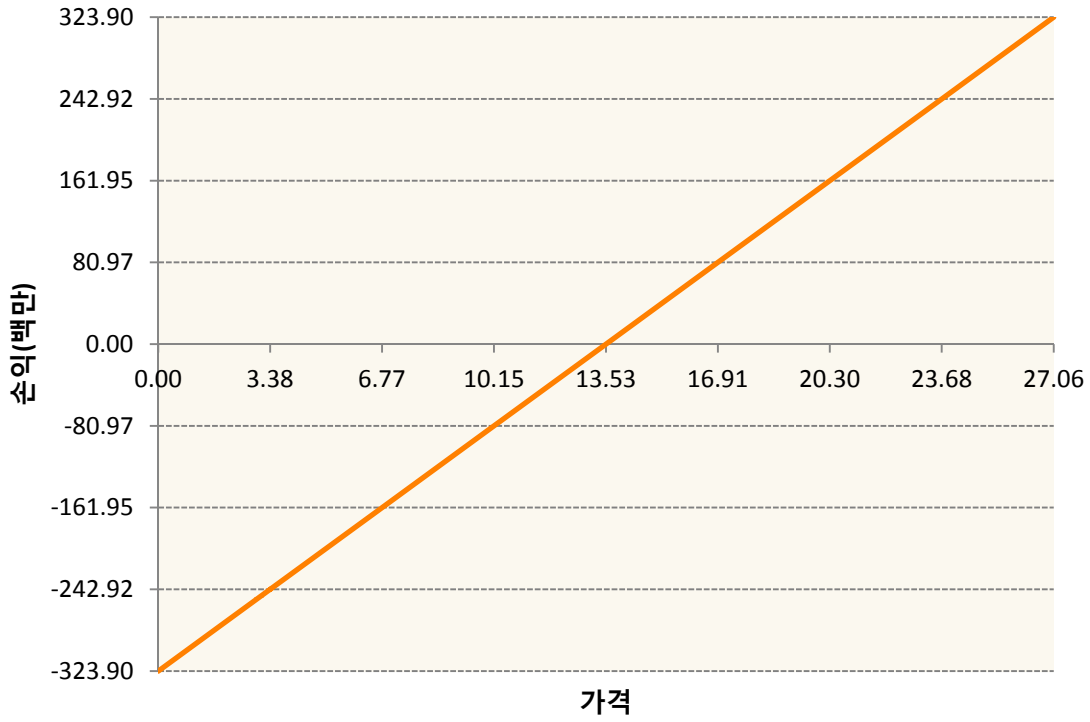
KR4175Q10001-2020-01 달러선물



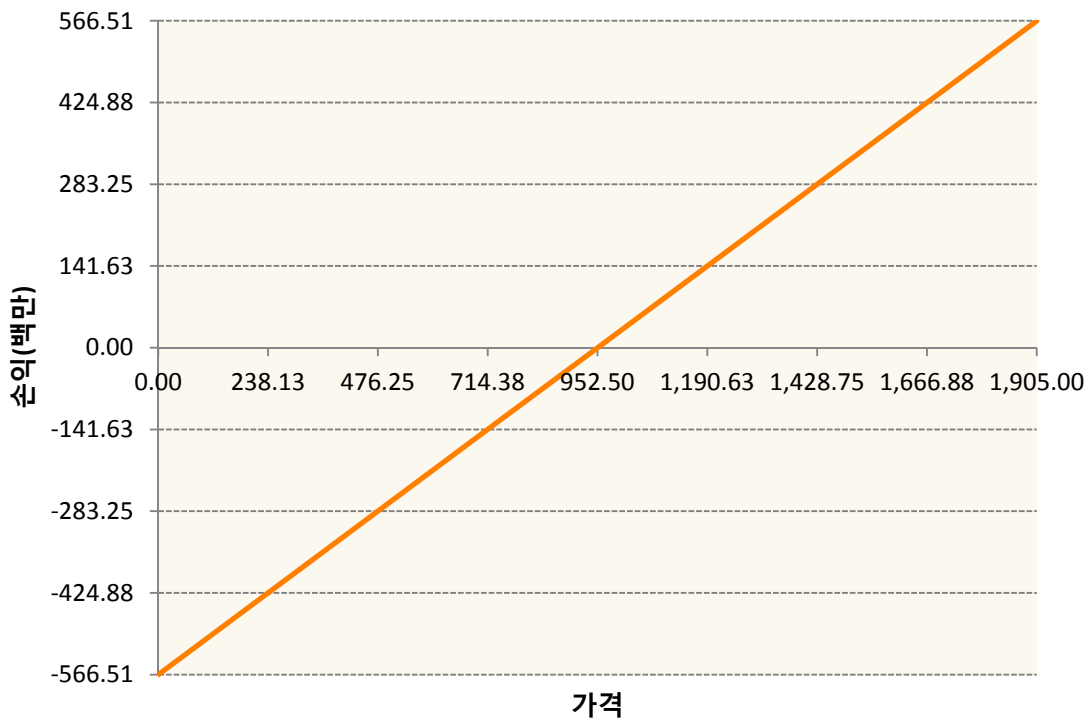
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

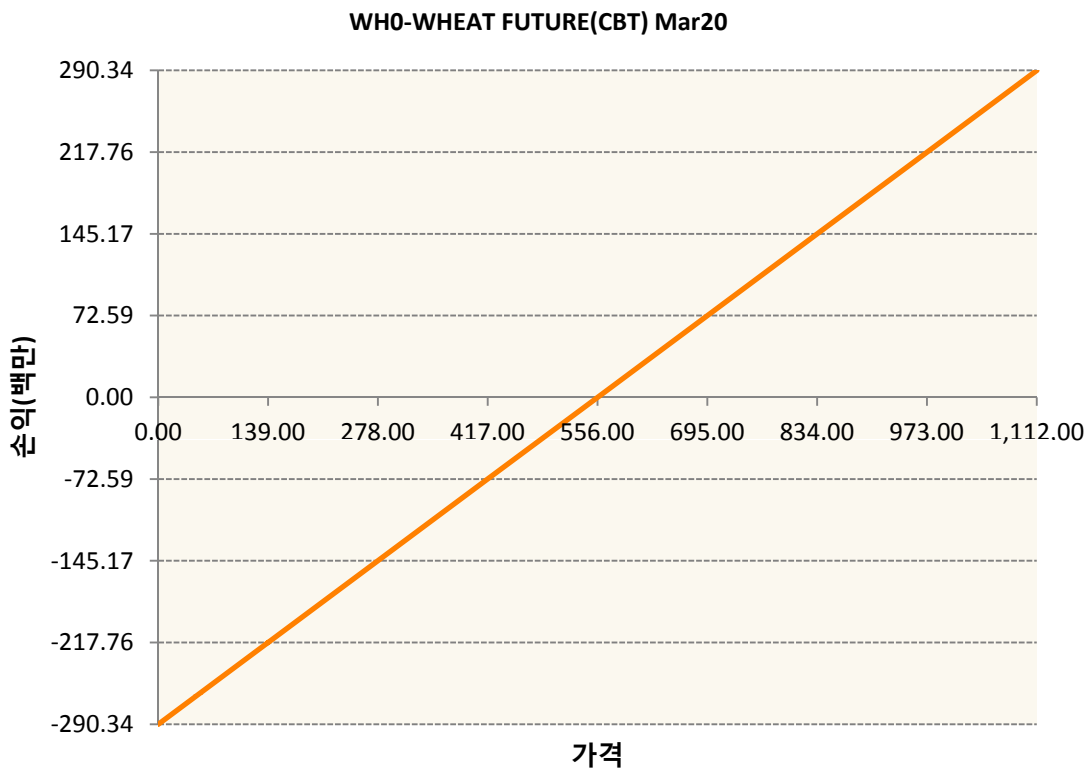
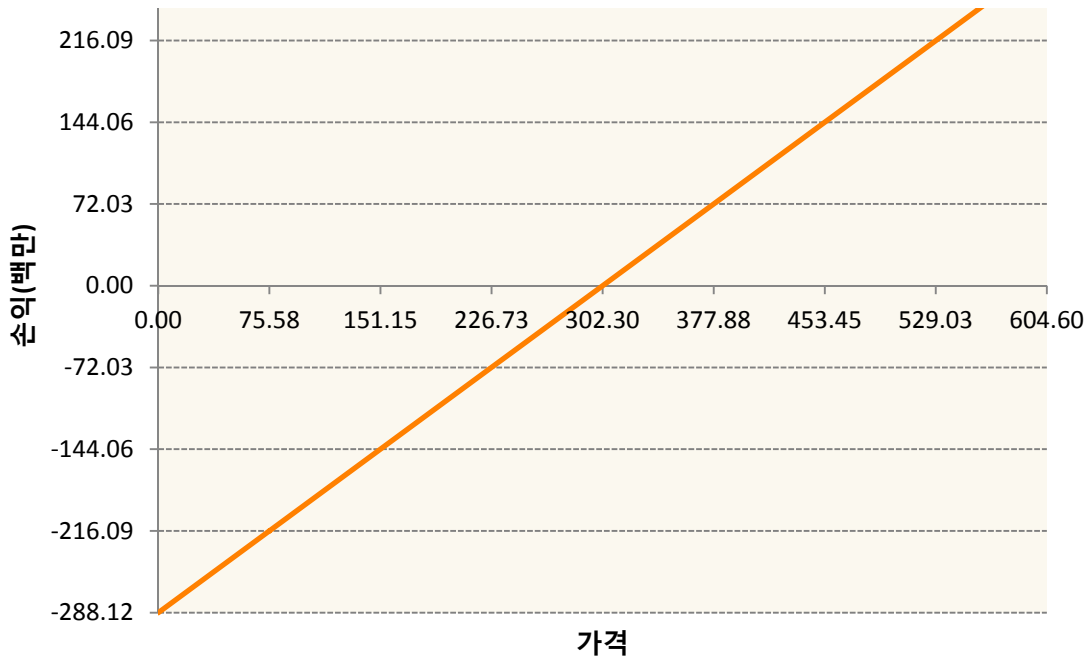


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20



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