

공시일	2020-01-03
기준일	2020-01-02

## 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	2020-01-03
기준일	2020-01-02

## 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)

646

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-03
기준일	2020-01-02

## 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)	414
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	151

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

786

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-03
기준일	2020-01-02

## 유로인덱스모(주식-파생형)

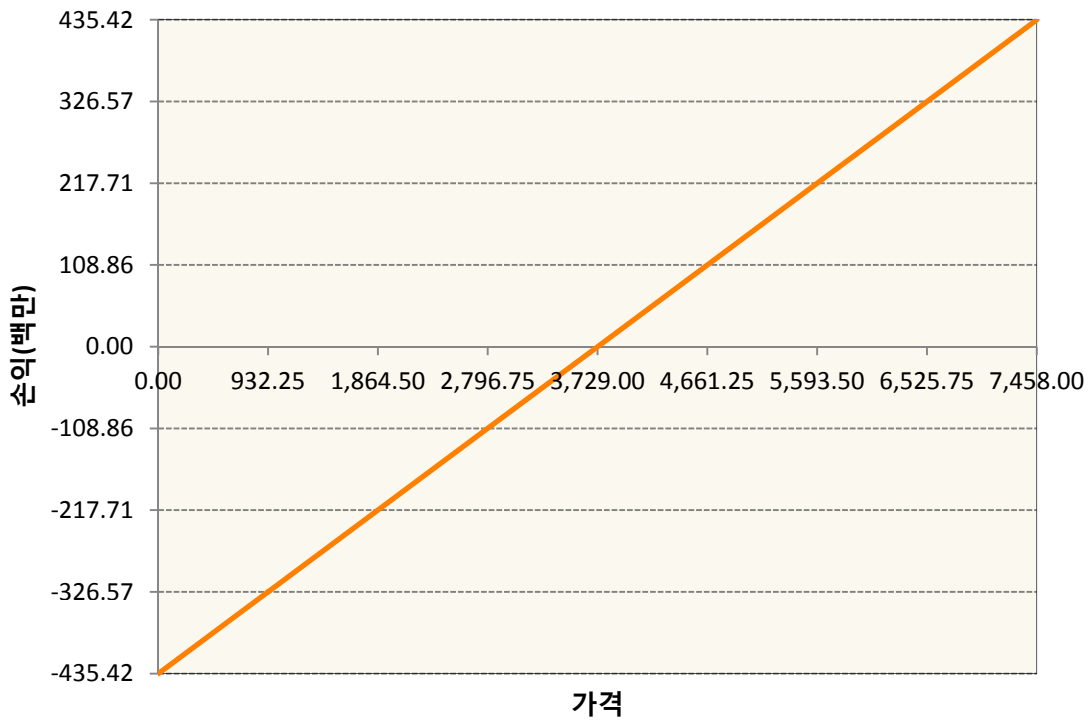
### 1. 계약금액

(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	2020-01-03
기준일	2020-01-02

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

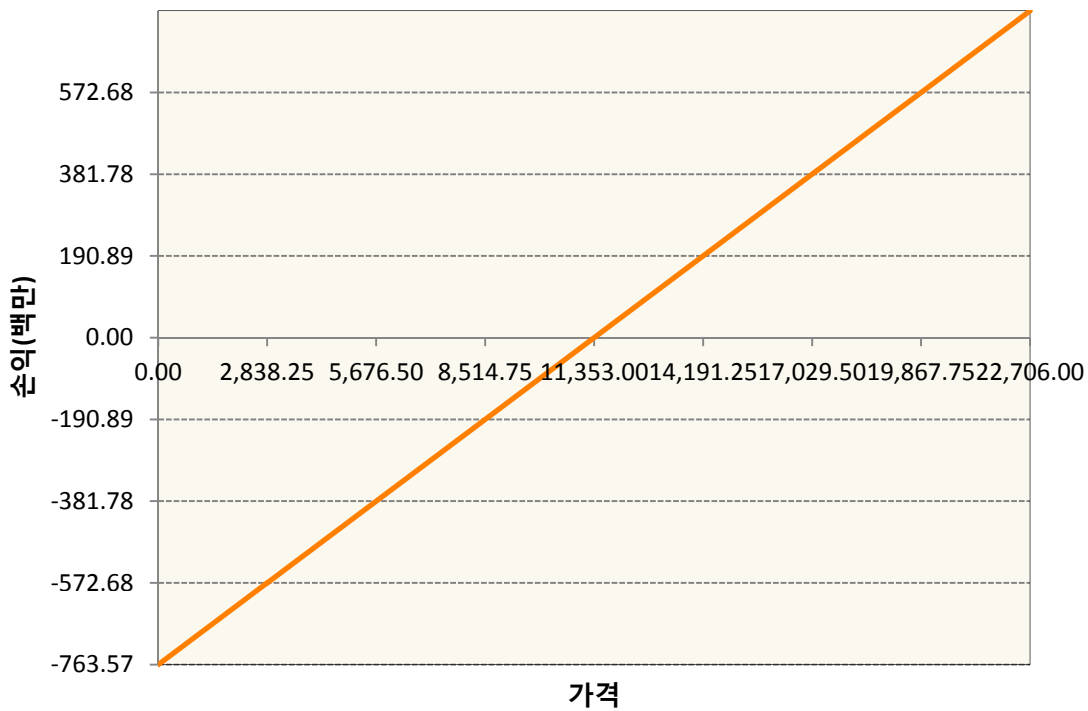
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	764	0	764	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCF0-HSCEI Futures Jan20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

60
----

공시일	2020-01-03
기준일	2020-01-02

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

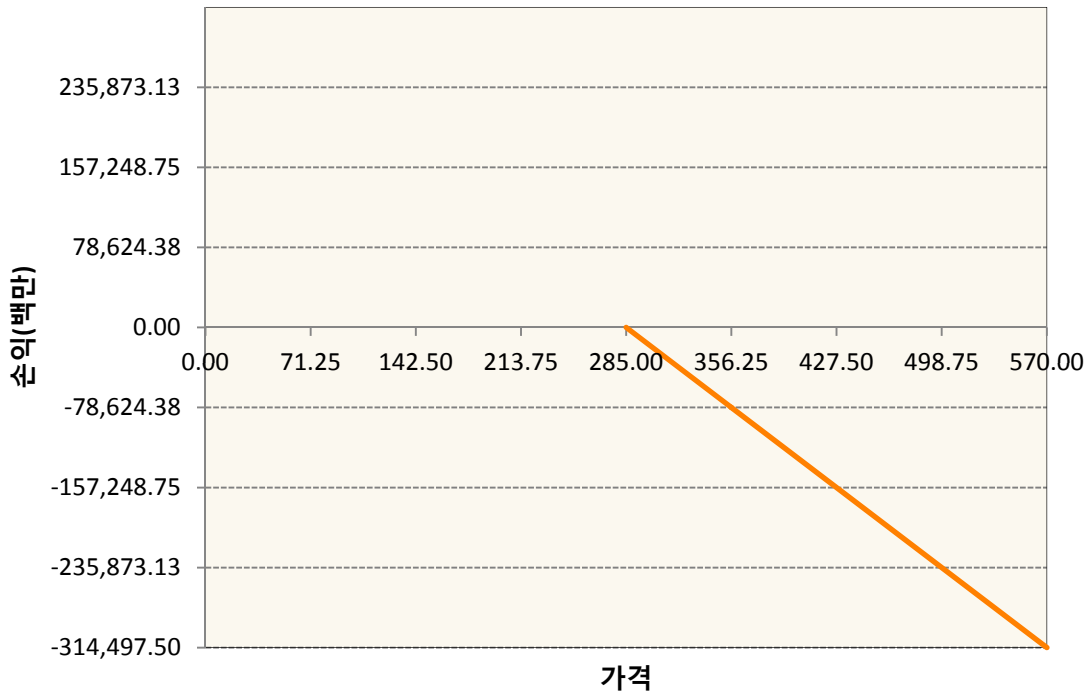
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

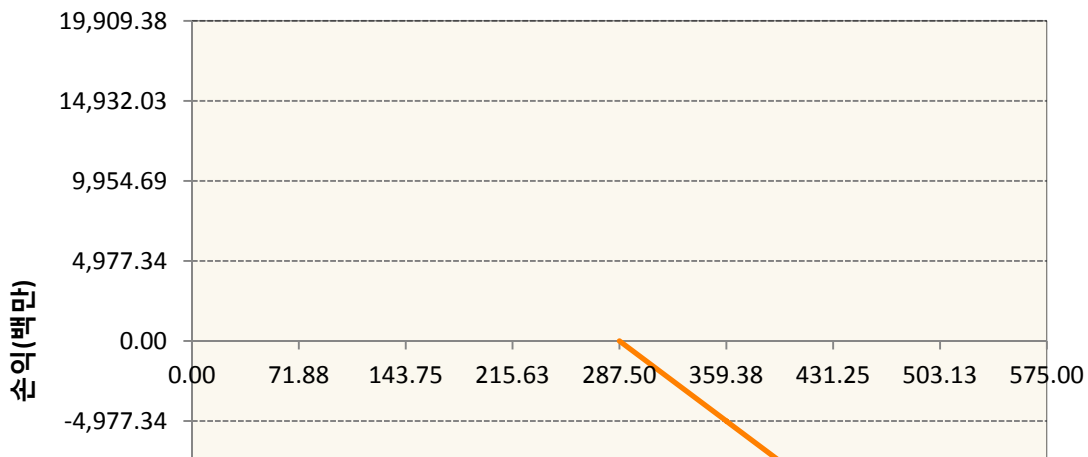
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	471,207	-471,207	장내

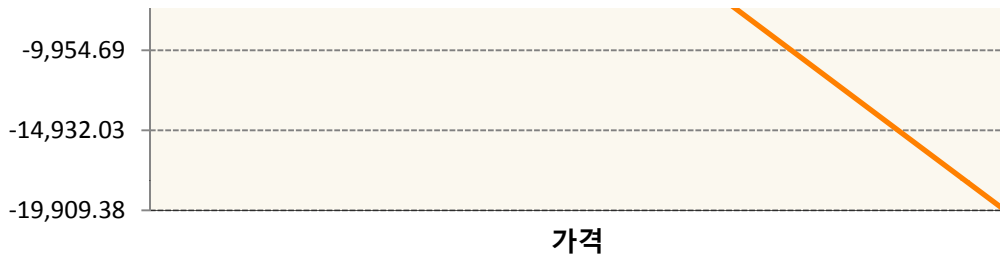
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q12852-2020-01 콜285

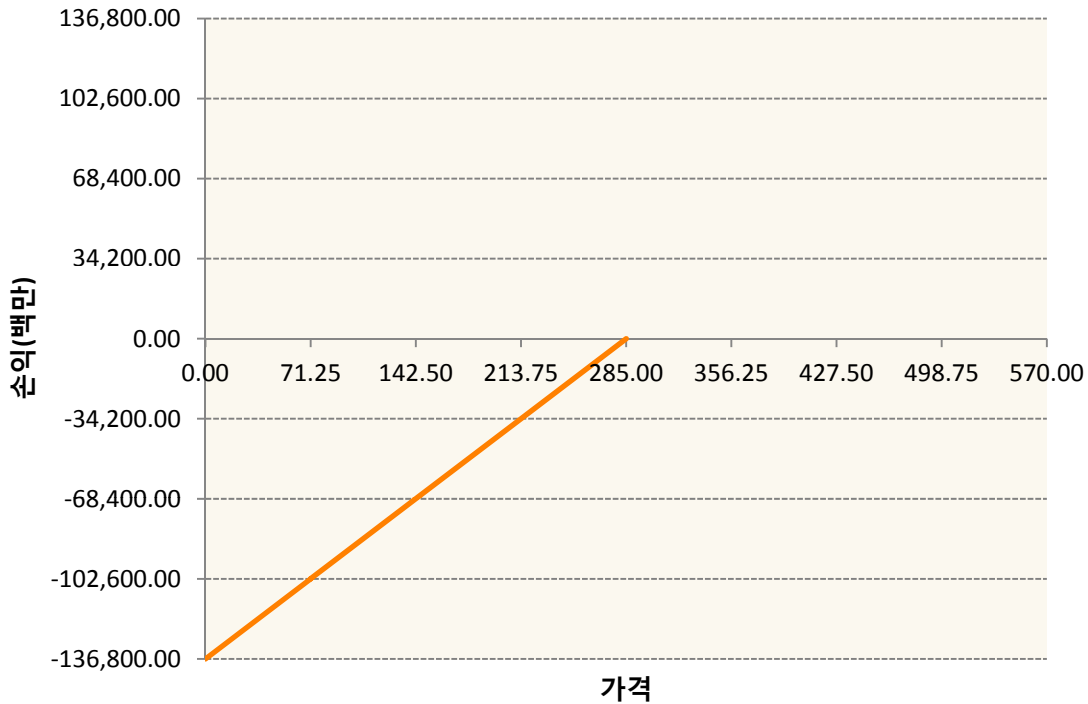


KR4201Q12878-2020-01 콜287.5





KR4301Q12850-2020-01 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q12852		2020-01 콜285					23,181
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,450	8,403	8,333	8,240	8,123	7,985	7,825
-5.33%	8,003	7,796	7,561	7,303	7,027	6,736	6,431
-2.67%	5,964	5,567	5,167	4,765	4,362	3,957	3,552
0%	1,083	732	371	0	-377	-760	-1,148
2.67%	-6,205	-6,356	-6,539	-6,749	-6,984	-7,238	-7,511
5.33%	-14,501	-14,536	-14,590	-14,666	-14,766	-14,888	-15,033
8.00%	-23,016	-23,020	-23,030	-23,049	-23,078	-23,122	-23,181
KR4201Q12878		2020-01 콜287.5					1,397
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	423	421	418	414	409	403	395

-5.33%	407	398	387	375	360	345	329
-2.67%	322	299	276	253	229	205	181
0%	76	51	25	0	-26	-51	-77
2.67%	-341	-355	-370	-387	-405	-425	-445
5.33%	-849	-853	-858	-865	-874	-884	-896
8.00%	-1,381	-1,382	-1,383	-1,385	-1,388	-1,392	-1,397
KR4301Q12850                      2020-01 풋285							8,295
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,288	-8,288	-8,288	-8,289	-8,290	-8,292	-8,295
-5.33%	-4,580	-4,589	-4,602	-4,620	-4,644	-4,672	-4,706
-2.67%	-1,254	-1,337	-1,423	-1,509	-1,597	-1,686	-1,776
0%	171	120	63	0	-67	-137	-211
2.67%	296	294	289	281	269	253	233
5.33%	298	298	298	298	297	296	294
8.00%	298	298	298	298	298	298	298

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

(단위:백만원)

**35,919**

공시일	2020-01-03
기준일	2020-01-02

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

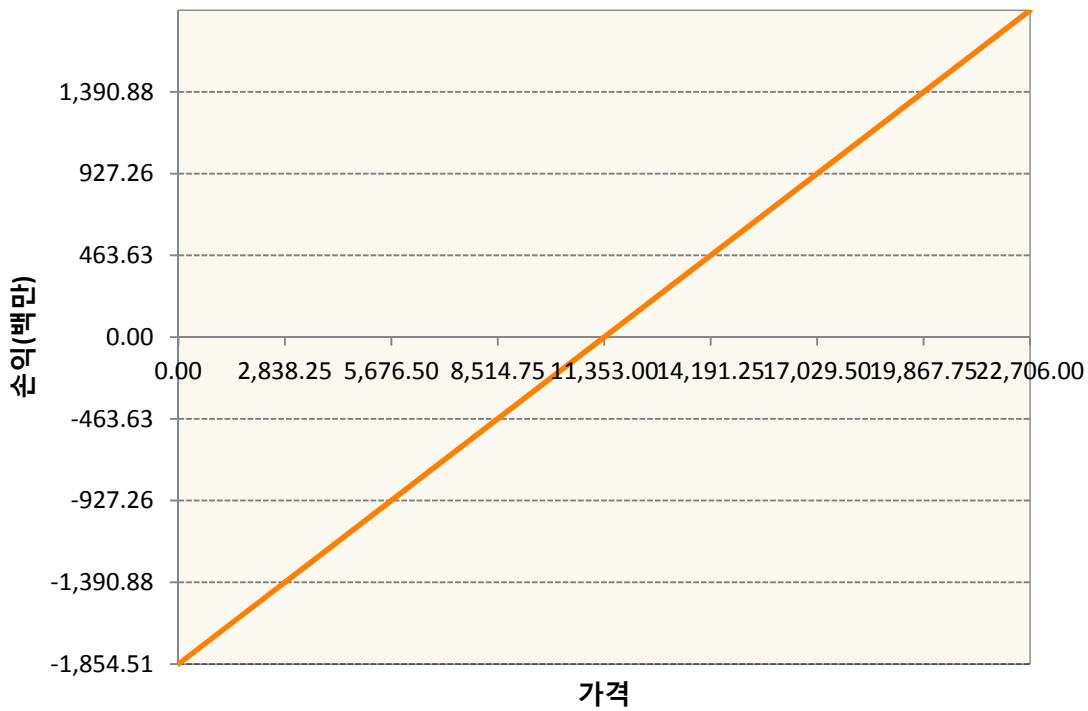
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

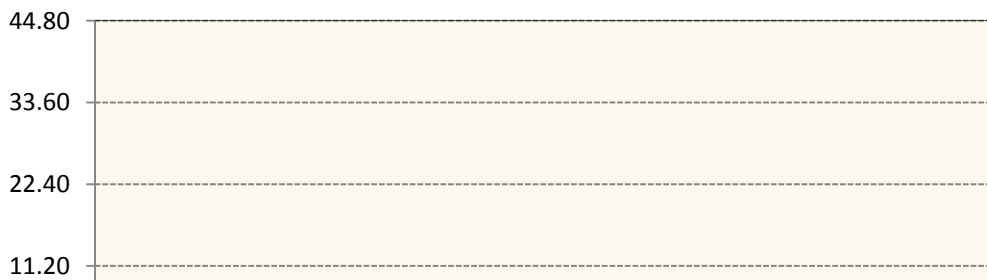
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,855	0	1,855	장내
누계	유가증권	옵션	0	88	-88	장내
누계	통화	선도	0	2,093	-2,093	장외

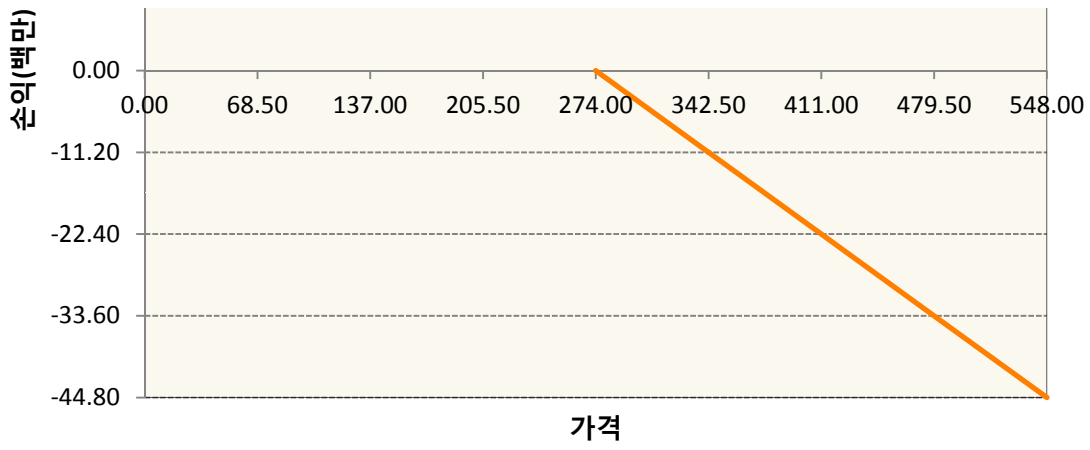
### 2. 만기시점의 손익구조

HCFO-HSCEI Futures Jan20

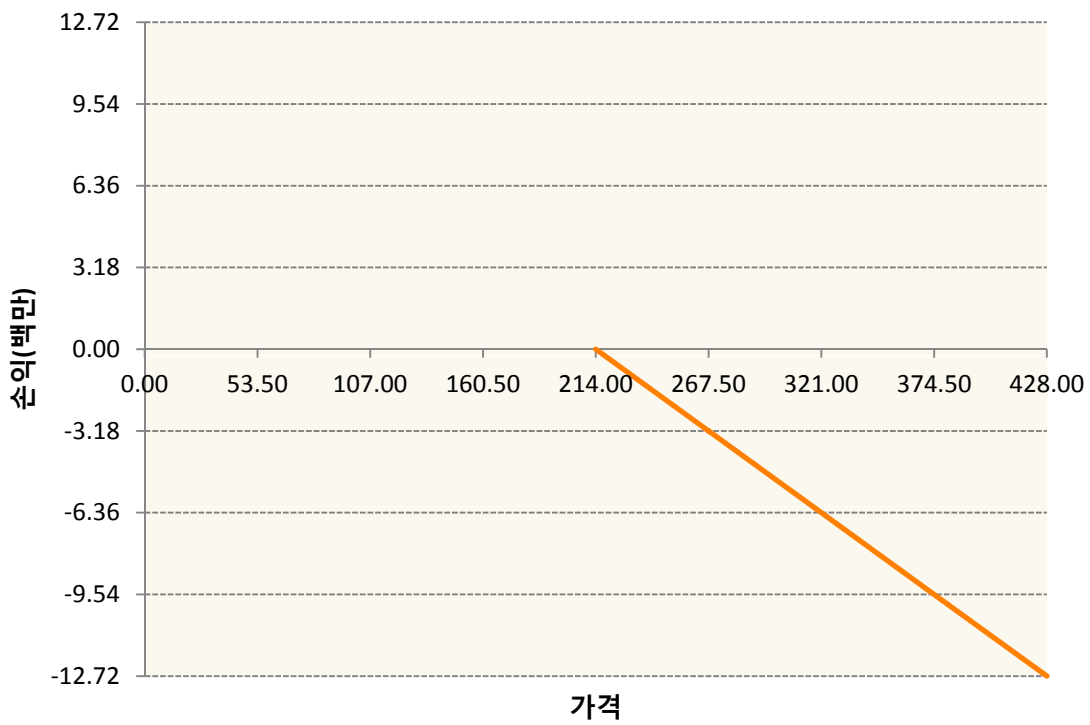


OHHIF0-C112-HSCEI

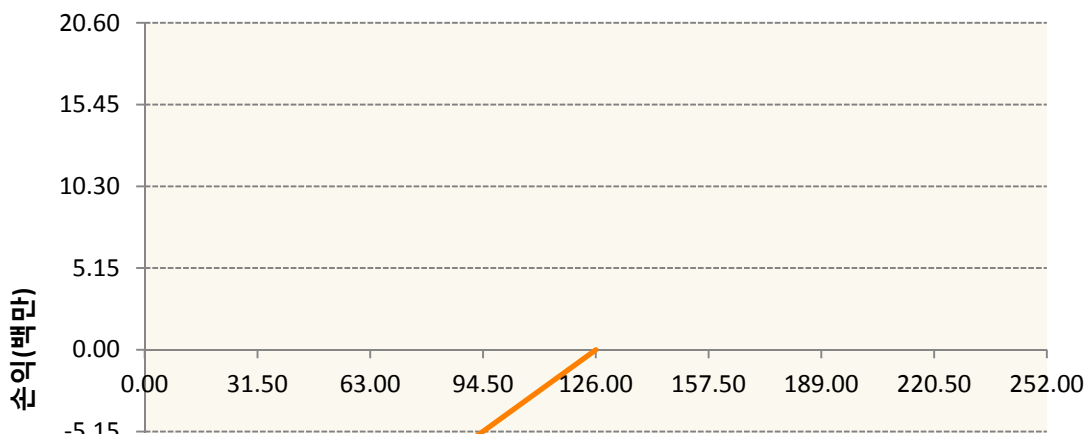


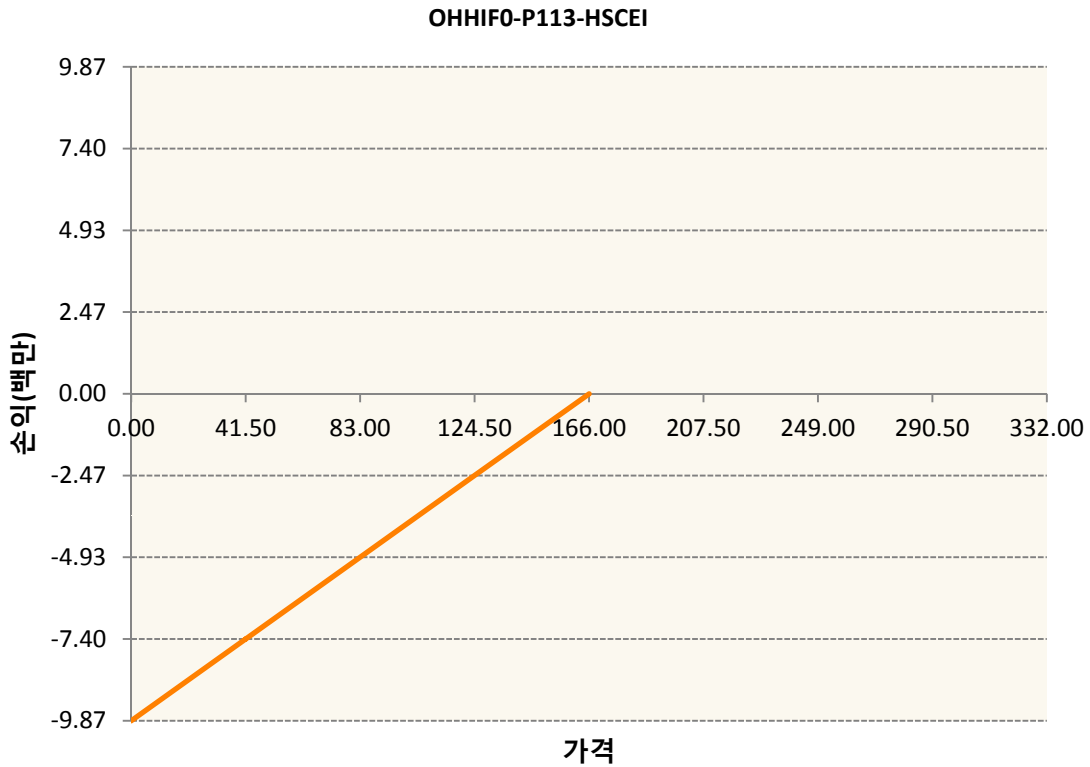
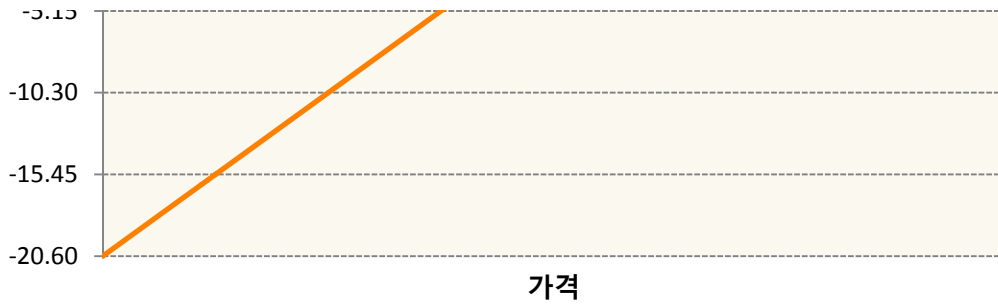


**OHHIF0-C113-HSCEI**



**OHHIF0-P112-HSCEI**





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

FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	167
HCF0 HSCEI Futures Jan20	148
OHHIF0-C11 HSCEI	4
OHHIF0-C11 HSCEI	1
OHHIF0-P11 HSCEI	2
OHHIF0-P11 HSCEI	1

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

**204**

공시일	2020-01-03
기준일	2020-01-02

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

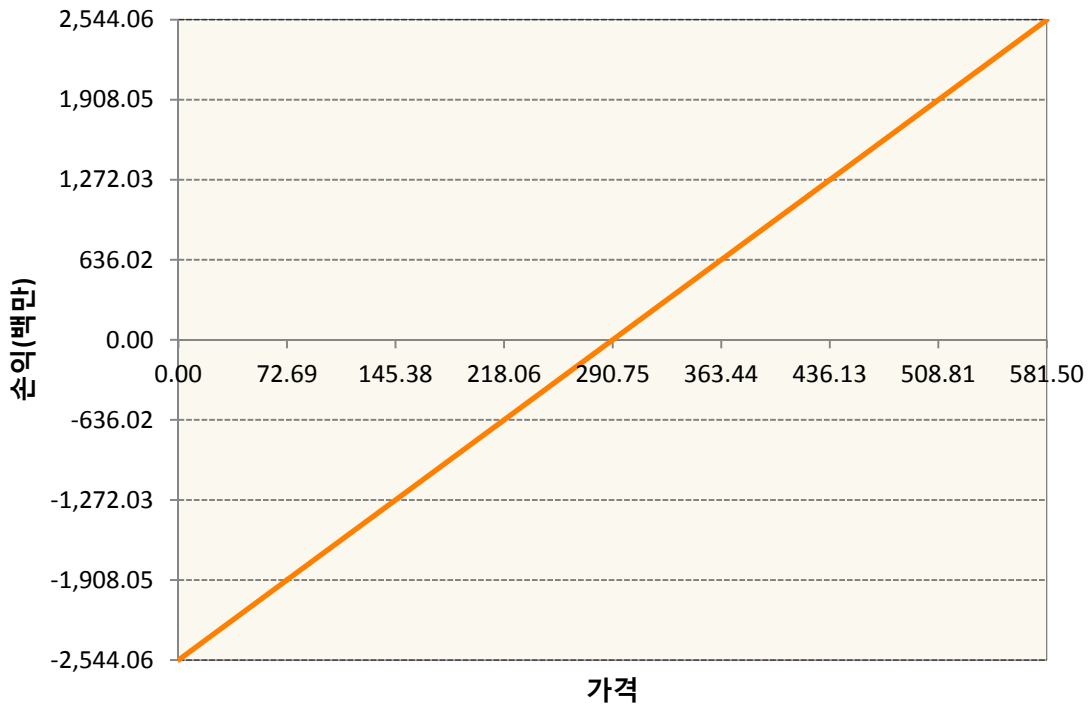
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

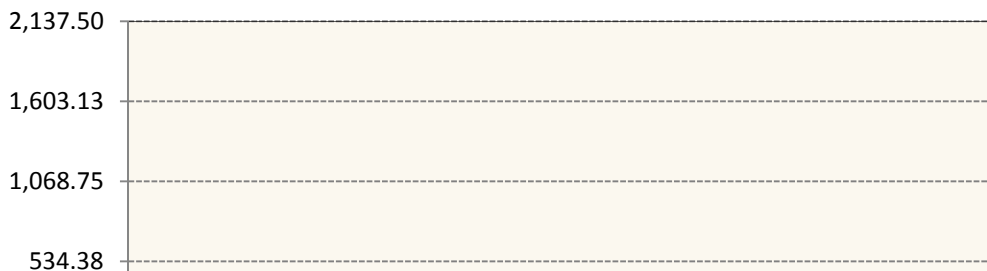
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	71	0	71	장내
누계	유가증권	선물	2,544	0	2,544	장내
누계	유가증권	스왑	5,625	0	5,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,847	-4,847	장내

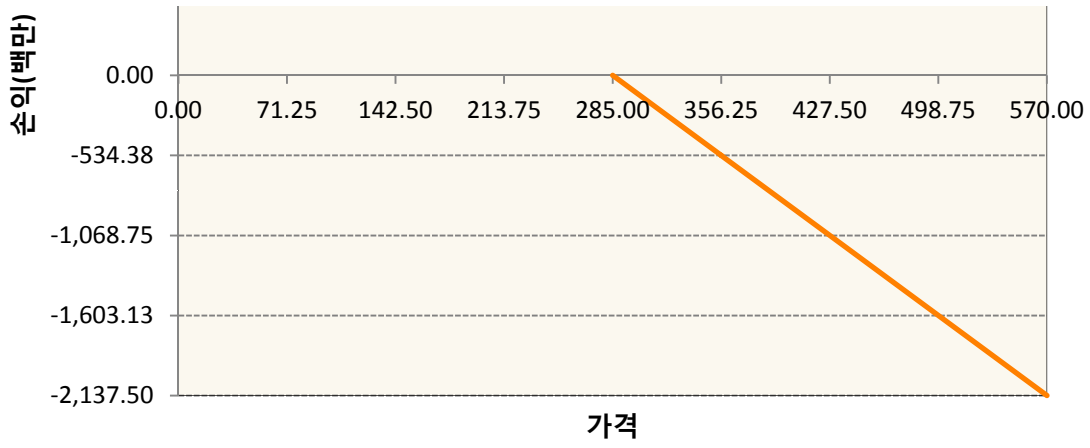
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

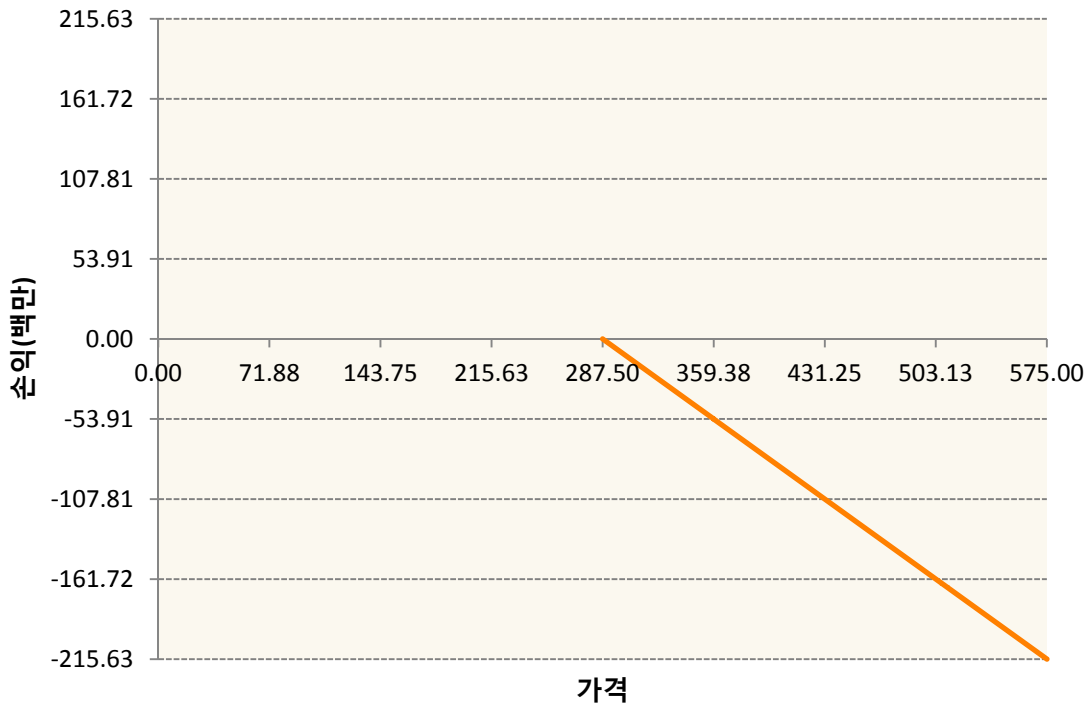


KR4201Q12852-2020-01 콜285

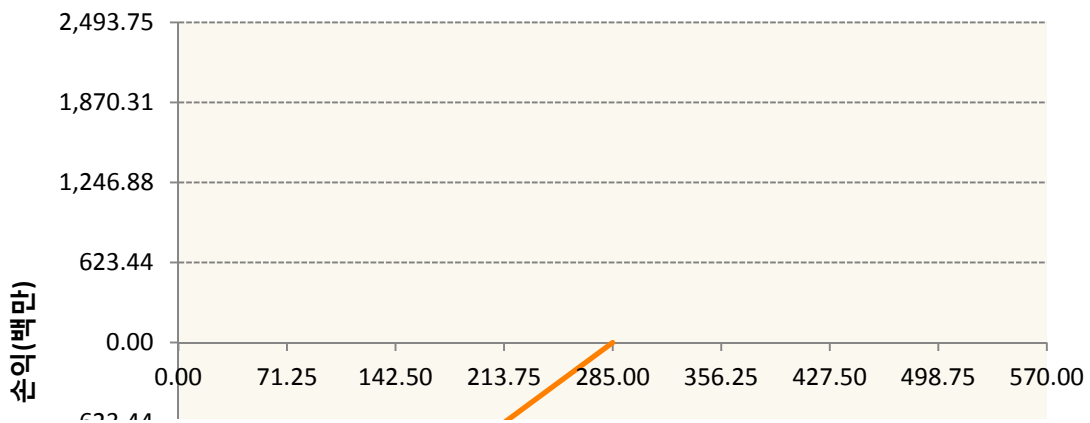


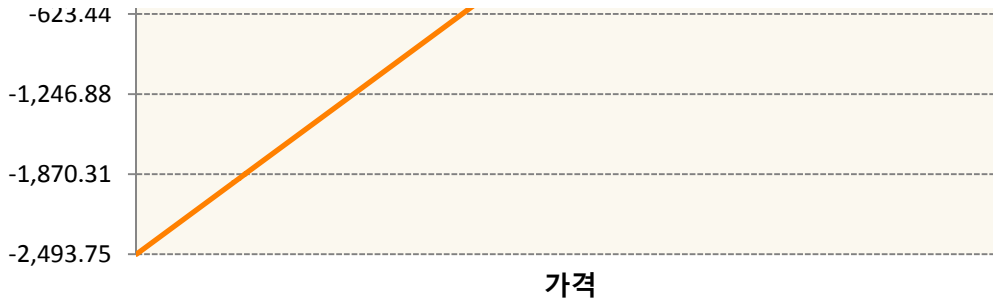


KR4201Q12878-2020-01 콜287.5



KR4301Q12850-2020-01 풋285





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						478
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-478	-478	-478	-478	-478	-478	-478	
-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%	478	478	478	478	478	478	478	
KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						203
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-203	-203	-203	-203	-203	-203	-203	
-5.33%	-135	-135	-135	-135	-135	-135	-135	
-2.67%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	68	68	68	68	68	68	68	
5.33%	135	135	135	135	135	135	135	
8.00%	203	203	203	203	203	203	203	
KR4201Q12852		2020-01 콜285						158
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	57	57	57	56	55	54	53	
-5.33%	54	53	51	50	48	46	44	
-2.67%	41	38	35	32	30	27	24	
0%	7	5	3	0	-3	-5	-8	
2.67%	-42	-43	-44	-46	-47	-49	-51	
5.33%	-99	-99	-99	-100	-100	-101	-102	
8.00%	-156	-156	-157	-157	-157	-157	-158	
KR4201Q12878		2020-01 콜287.5						15
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	5	5	5	4	4	4	4
-5.33%	4	4	4	4	4	4	4
-2.67%	3	3	3	3	2	2	2
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-5	-5
5.33%	-9	-9	-9	-9	-9	-10	-10
8.00%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
KR4301Q12850      2020-01 풋285							151
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-151	-151	-151	-151	-151	-151	-151
-5.33%	-83	-84	-84	-84	-85	-85	-86
-2.67%	-23	-24	-26	-28	-29	-31	-32
0%	3	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	5	5	5	5	5	5	4
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)

**982**

공시일	2020-01-03
기준일	2020-01-02

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

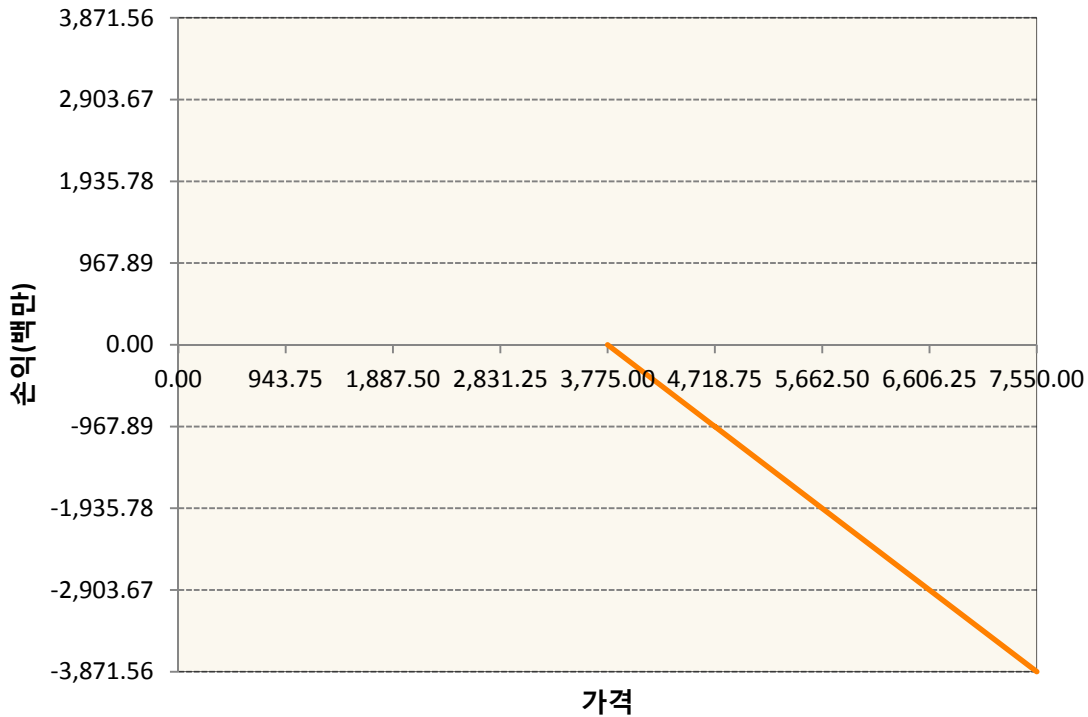
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

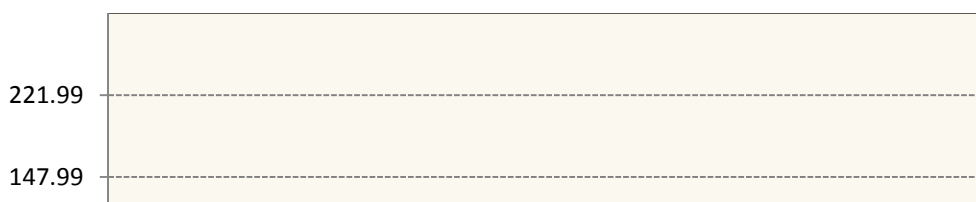
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,158	0	1,158	
누계	유가증권	스왑	15,767	0	15,767	장외
누계	유가증권	옵션	0	8,335	-8,335	장내
누계	통화	선도	0	3,407	-3,407	장외

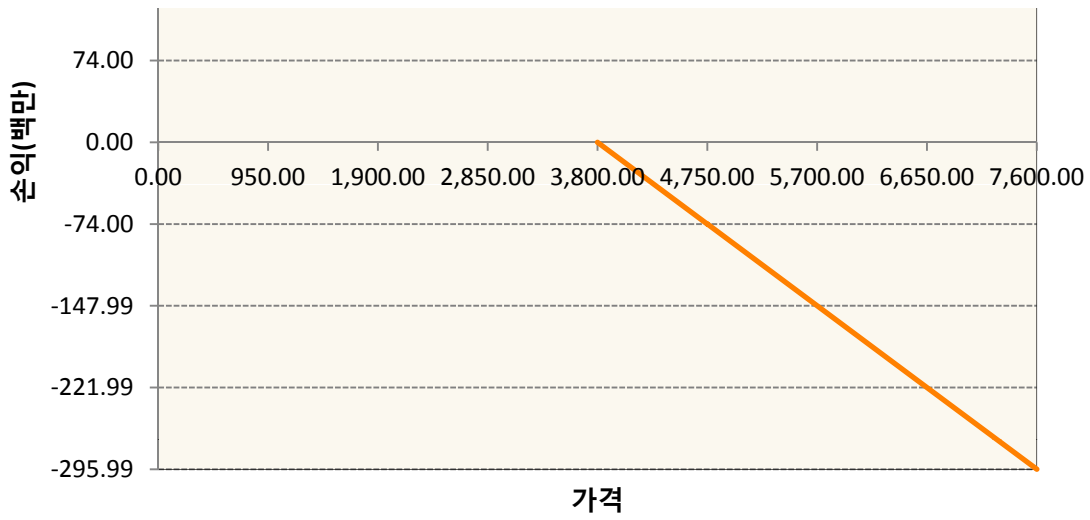
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXF0-C3775-EURO STOXX 50**

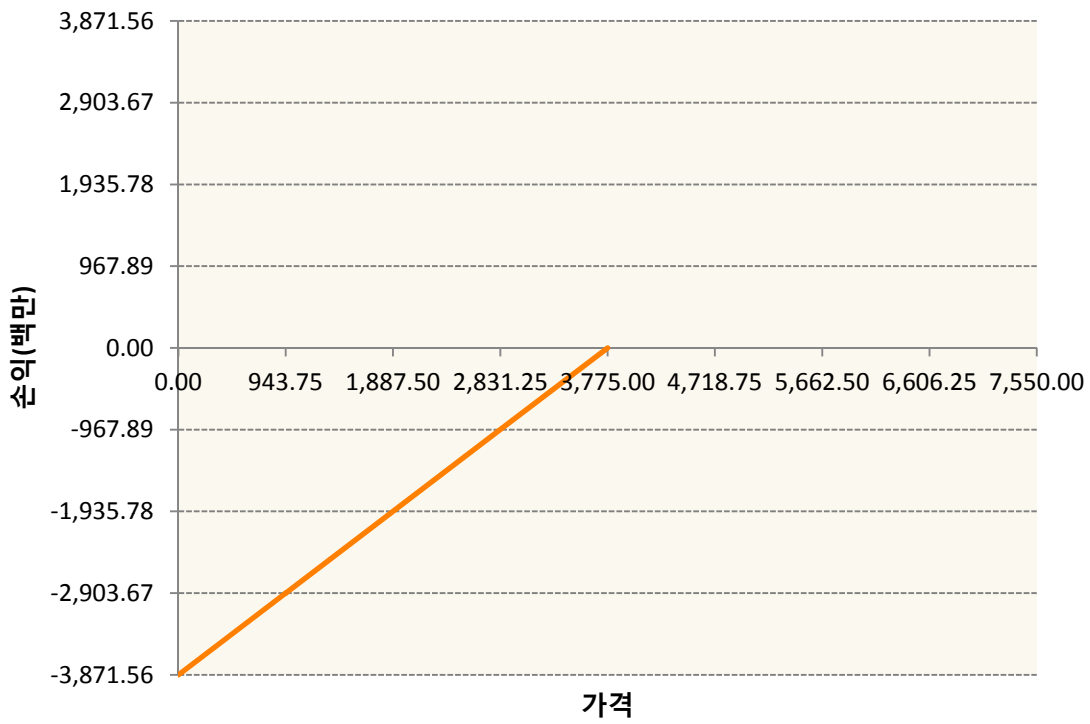


**OESXF0-C3800-EURO STOXX 50**

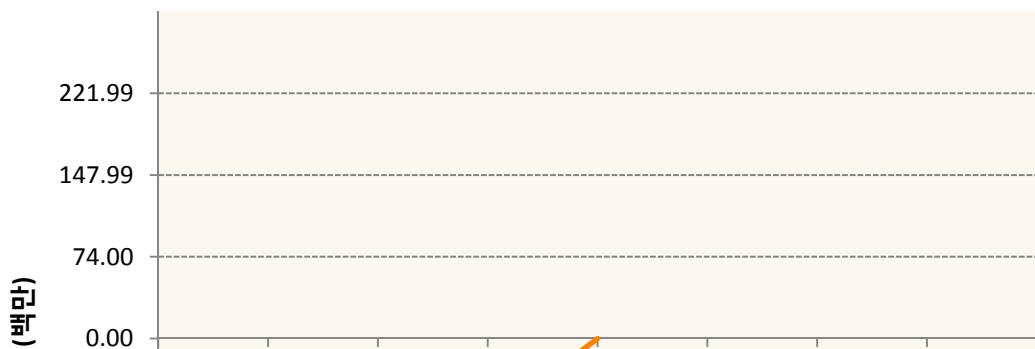


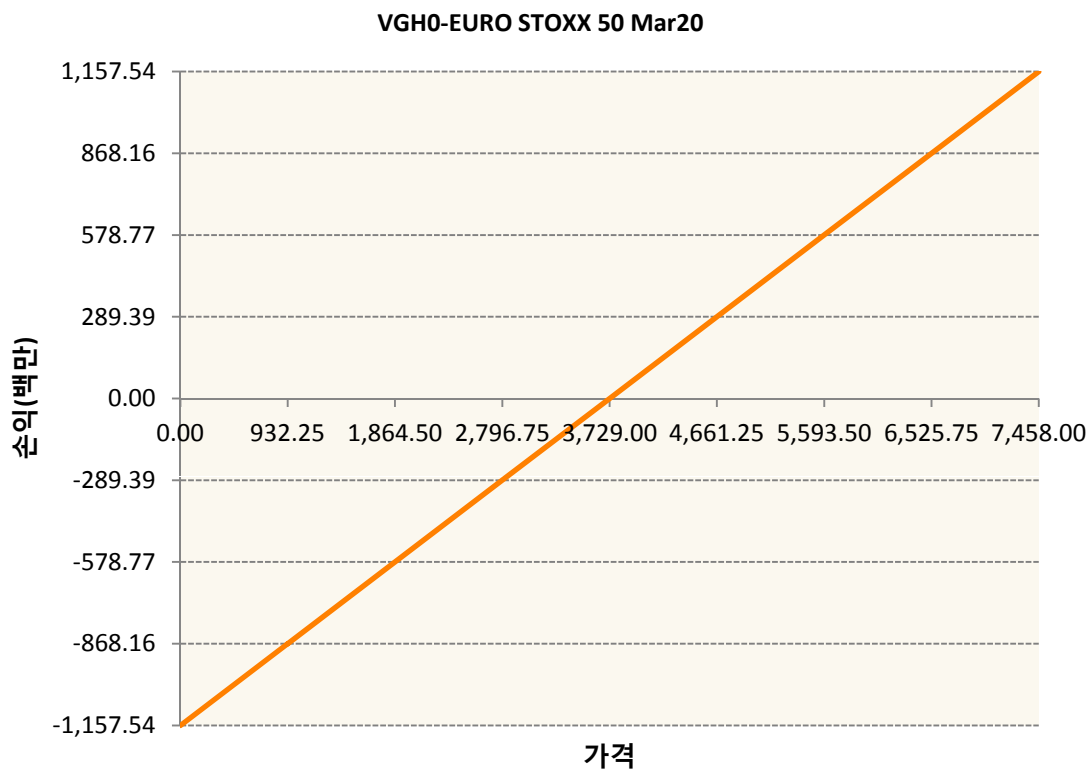
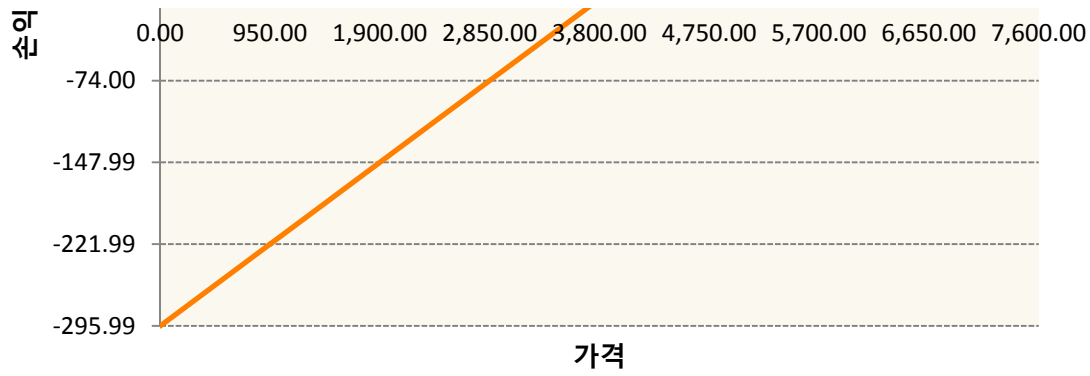


**OESXF0-P3775-EURO STOXX 50**



**OESXF0-P3800-EURO STOXX 50**





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

260105SQP\SG EURO Covered CALL STRATEGY	31
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	273
OESXF0-C37 EURO STOXX 50	310
OESXF0-C38 EURO STOXX 50	24
OESXF0-P37 EURO STOXX 50	310
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)

909



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

(단위:백만원)

77



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

(단위:백만원)

114



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

(단위:백만원)

41

공시일	2020-01-03
기준일	2020-01-02

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

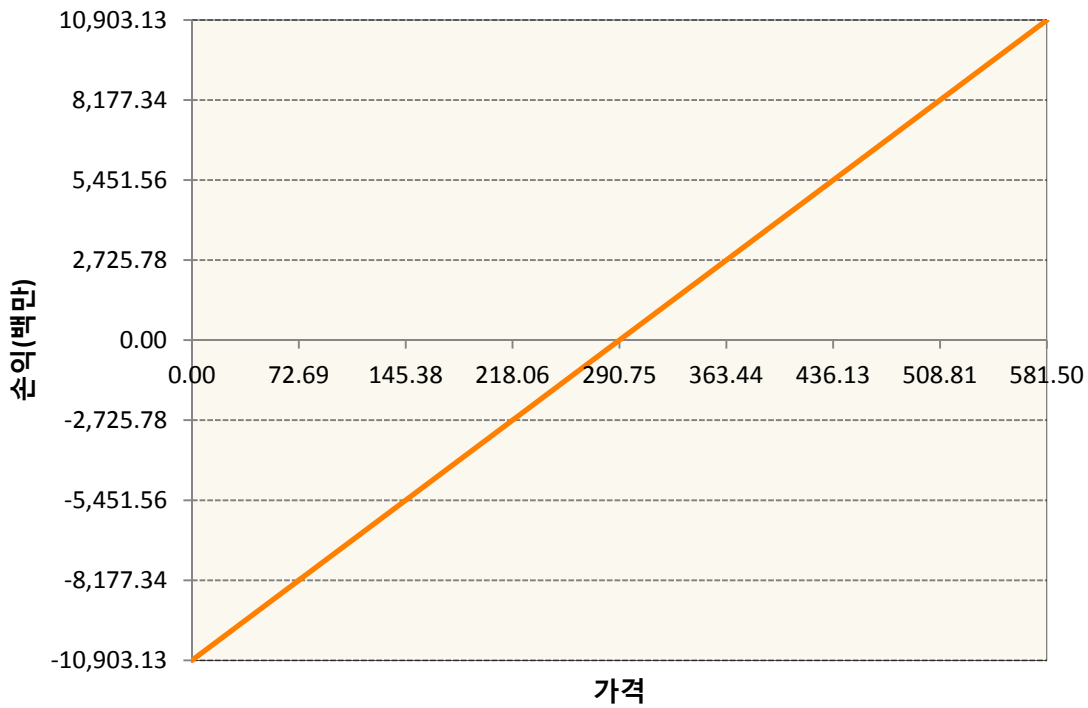
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

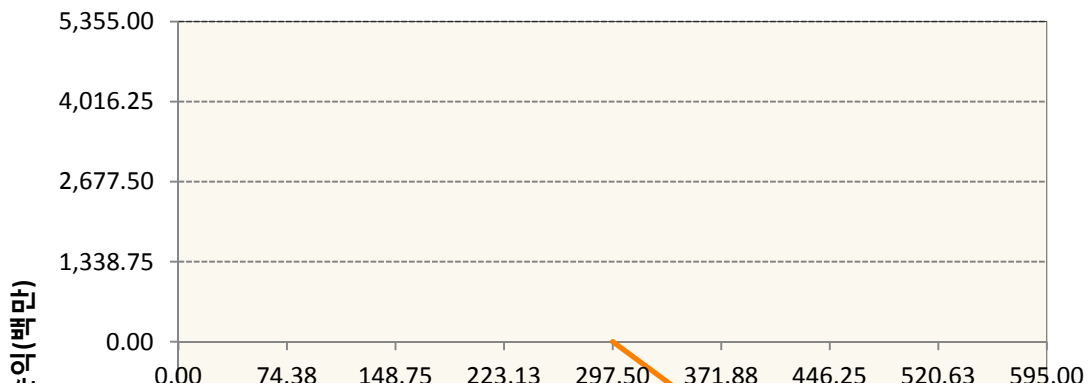
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,903	0	10,903	장내
누계	유가증권	옵션	499	21,105	-20,606	장내

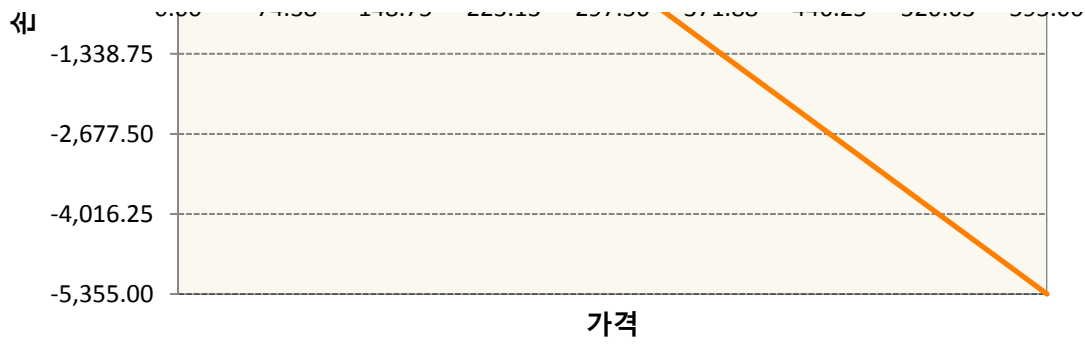
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

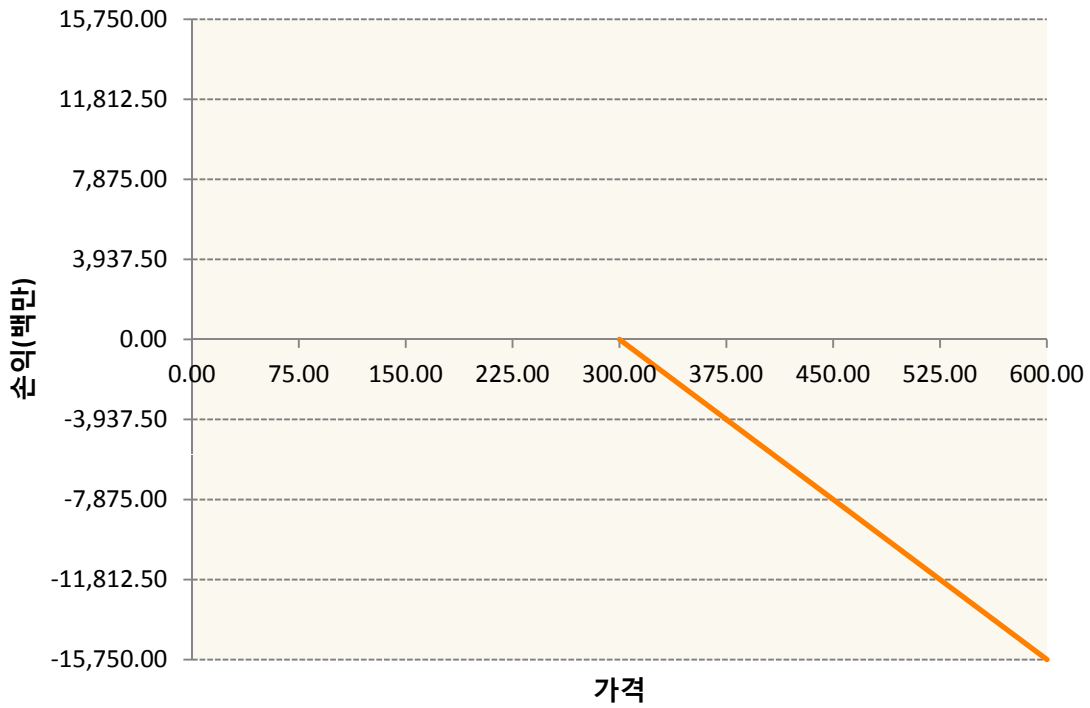


KR4201Q12977-2020-01 콜297.5

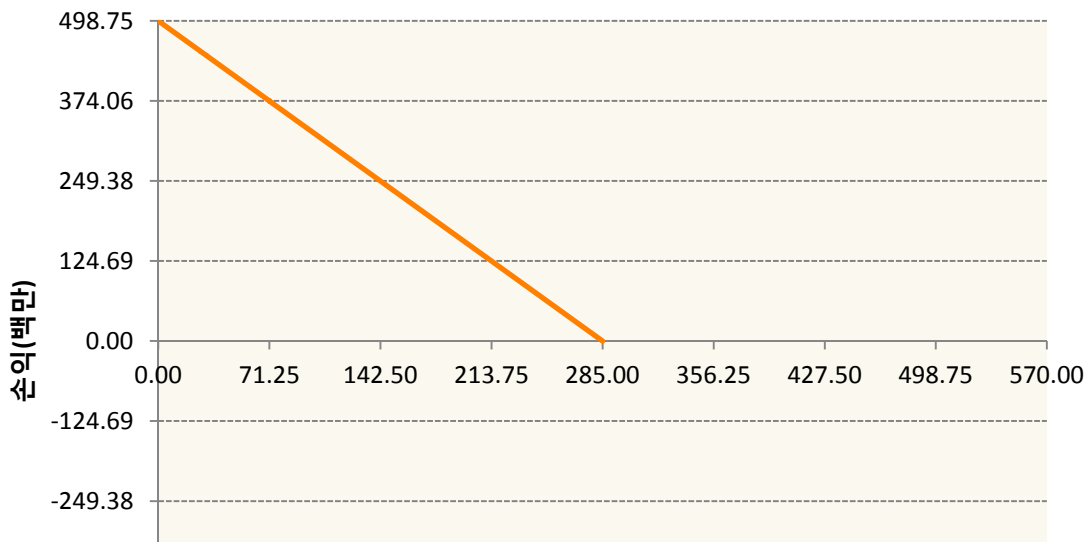


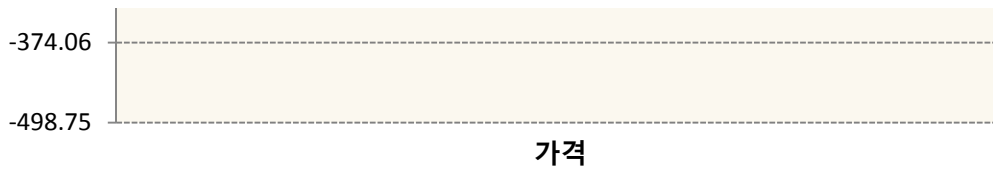


KR4201Q13009-2020-01 콜300



KR4301Q12850-2020-01 풋285





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

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						871
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-871	-871	-871	-871	-871	-871	-871	
-5.33%	-581	-581	-581	-581	-581	-581	-581	
-2.67%	-290	-290	-290	-290	-290	-290	-290	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	290	290	290	290	290	290	290	
5.33%	581	581	581	581	581	581	581	
8.00%	871	871	871	871	871	871	871	
KR4201Q12977		2020-01 콜297.5						275
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	34	34	34	34	34	34	33	
-5.33%	34	34	33	33	32	30	29	
-2.67%	32	30	28	25	22	18	14	
0%	16	11	6	0	-6	-12	-18	
2.67%	-34	-41	-48	-56	-63	-70	-77	
5.33%	-131	-135	-141	-146	-152	-158	-164	
8.00%	-257	-259	-261	-264	-267	-271	-275	
KR4201Q13009		2020-01 콜300						723
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	70	70	70	70	70	69	68	
-5.33%	70	70	69	67	65	62	59	
-2.67%	67	63	59	53	46	38	29	
0%	39	27	14	0	-15	-30	-47	
2.67%	-70	-90	-110	-130	-151	-171	-192	
5.33%	-309	-326	-344	-363	-381	-400	-420	
8.00%	-656	-664	-673	-684	-696	-709	-723	
KR4301Q12850		2020-01 풋285						30
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	30	30	30	30	30	30	30	
-5.33%	17	17	17	17	17	17	17	
-2.67%	5	5	5	6	6	6	6	

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)

**1,578**

공시일	2020-01-03
기준일	2020-01-02

## 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	204,791	0	204,791	

### 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	2020-01-03
기준일	2020-01-02

## 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	213,764	0	213,764	

### 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	2020-01-03
기준일	2020-01-02

## 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	527,630	0	527,630	
누계	통화	선도	0	510,838	-510,838	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		1,390
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,492
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		1,853
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		3,187
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		4,725
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		185
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,779
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,779
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,316
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,501
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E		1,612
FX21019Z00 KRW/USD 10-01-20E		1,112
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E		1,519
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E		926
FX21019Z02 KRW/USD 16-01-20E		1,668
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		185
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		1,983
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		926
FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E		3,706
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E		1,853
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E		1,983
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)

207

공시일	2020-01-03
기준일	2020-01-02

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

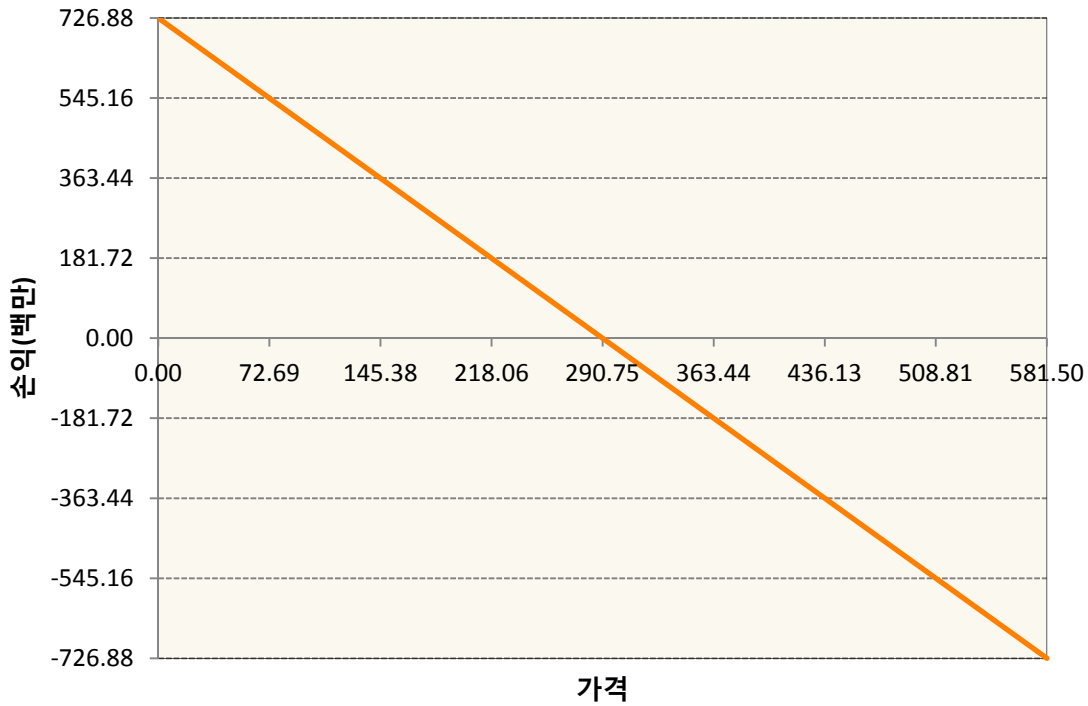
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

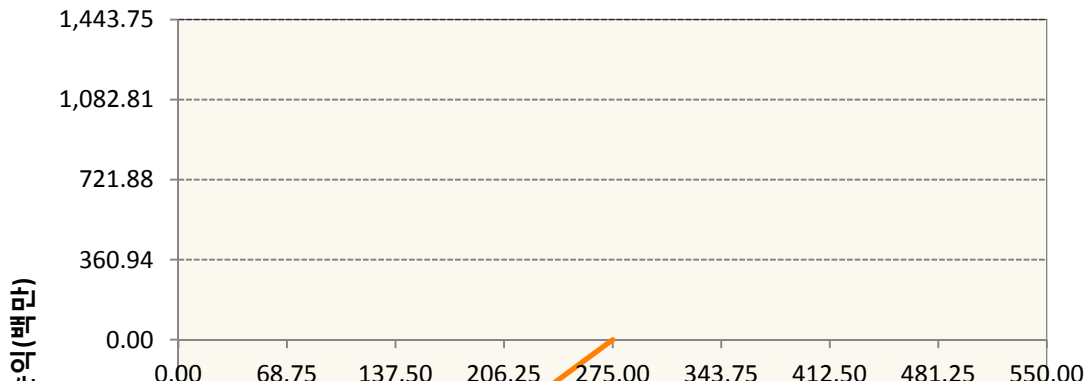
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	727	-727	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,872	-3,872	장내

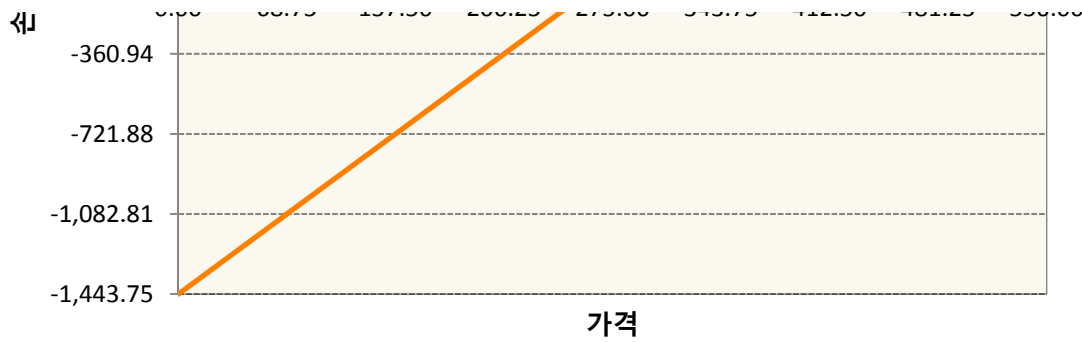
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

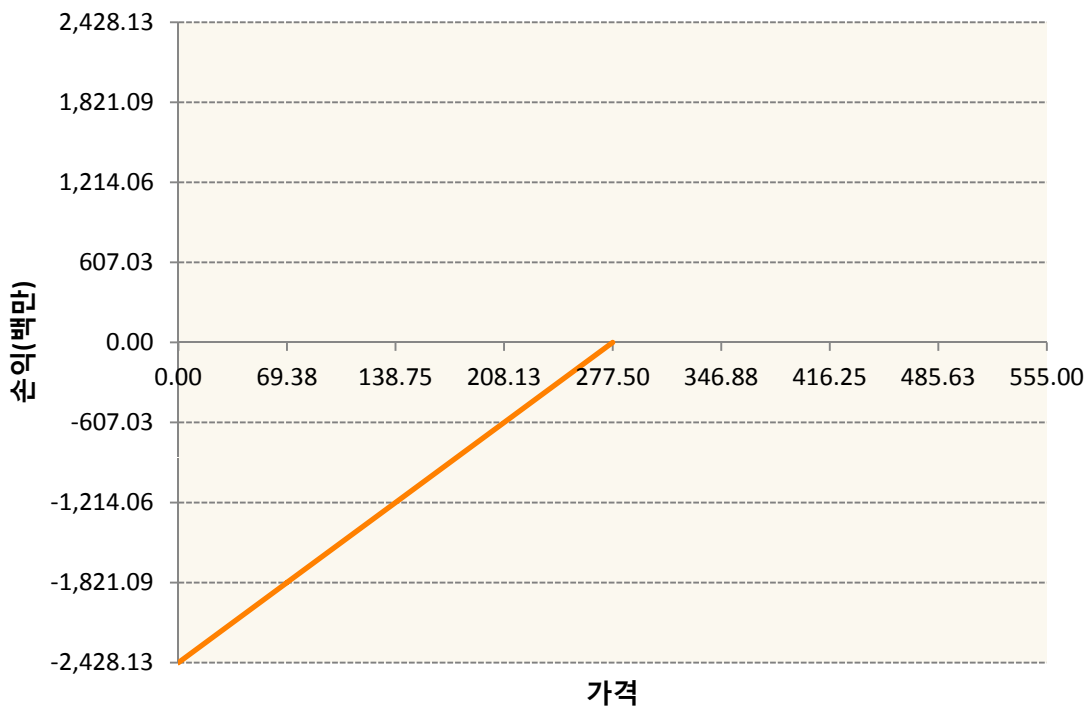


KR4301Q12751-2020-01 풋275





KR4301Q12777-2020-01 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						58
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	58	58	58	58	58	58	58	
-5.33%	39	39	39	39	39	39	39	
-2.67%	19	19	19	19	19	19	19	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39	
8.00%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58	
KR4301Q12751		2020-01 풋275						44
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-42	-42	-42	-42	-43	-43	-44
-5.33%	-9	-10	-11	-12	-13	-14	-15
-2.67%	0	-1	-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                      93

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-91	-91	-91	-91	-92	-92	-93
-5.33%	-29	-31	-32	-34	-35	-37	-38
-2.67%	-2	-3	-4	-5	-6	-8	-9
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)

**88**

공시일	2020-01-03
기준일	2020-01-02

## 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	938	14,314	-13,376	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		343
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)

<b>390</b>
------------

공시일	2020-01-03
기준일	2020-01-02

## 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	2,022	0	2,022	장외
누계	통화	선도	312	506	-195	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	2020-01-03
기준일	2020-01-02

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

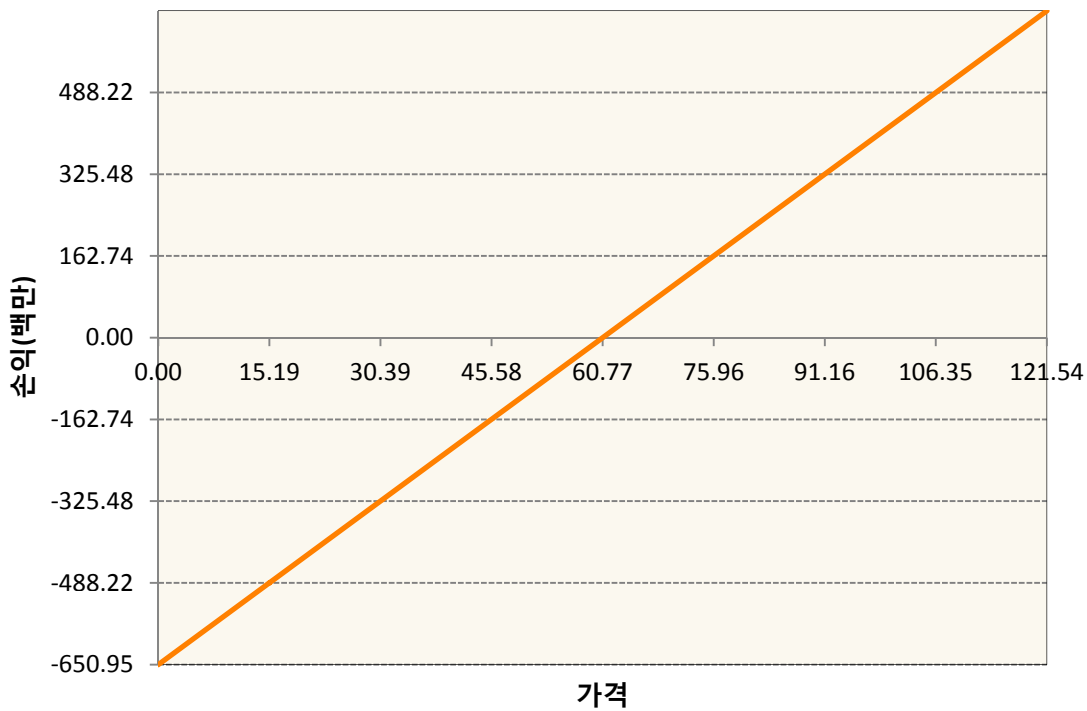
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

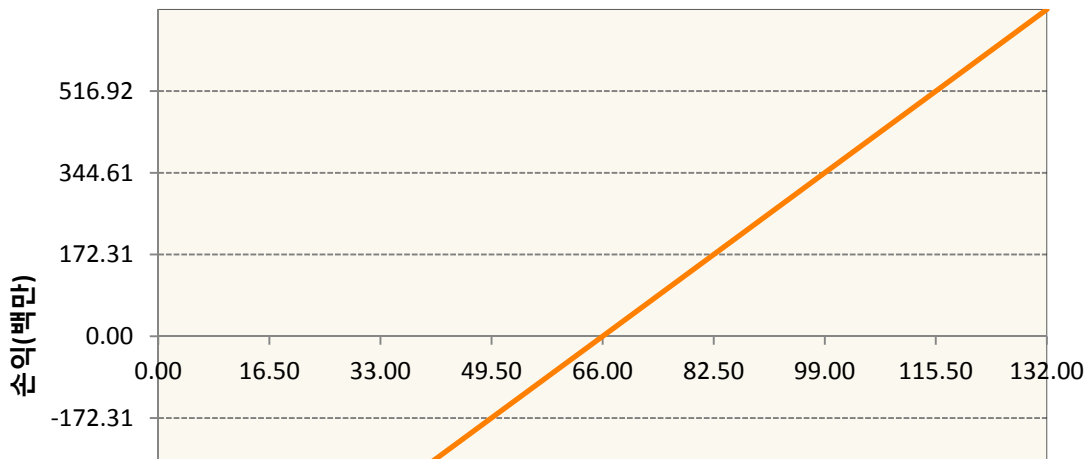
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,504	290	2,214	

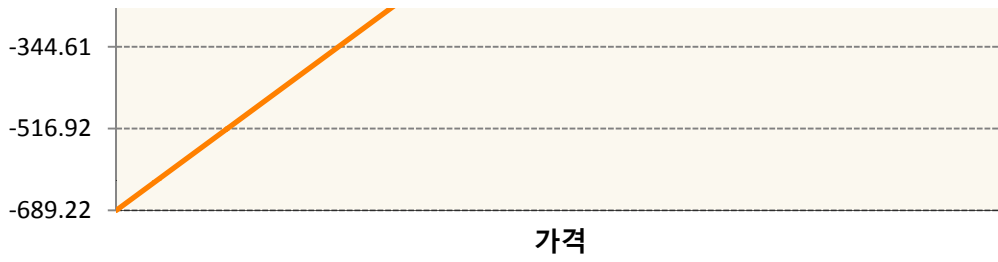
### 2. 만기시점의 손익구조

CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20

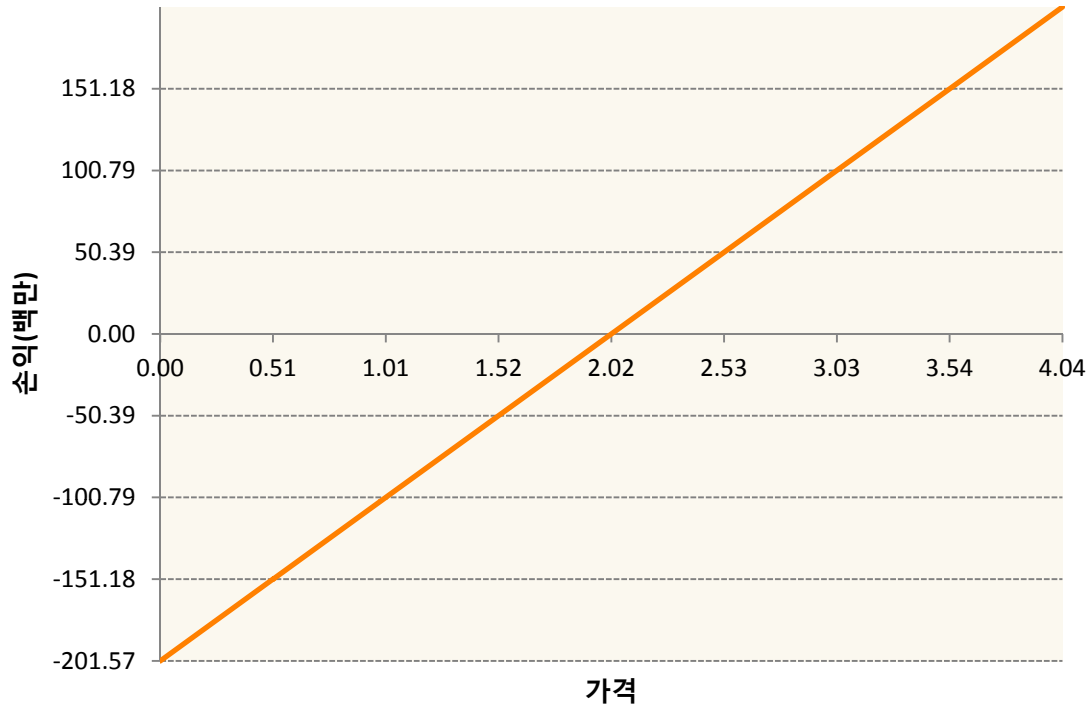


COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20

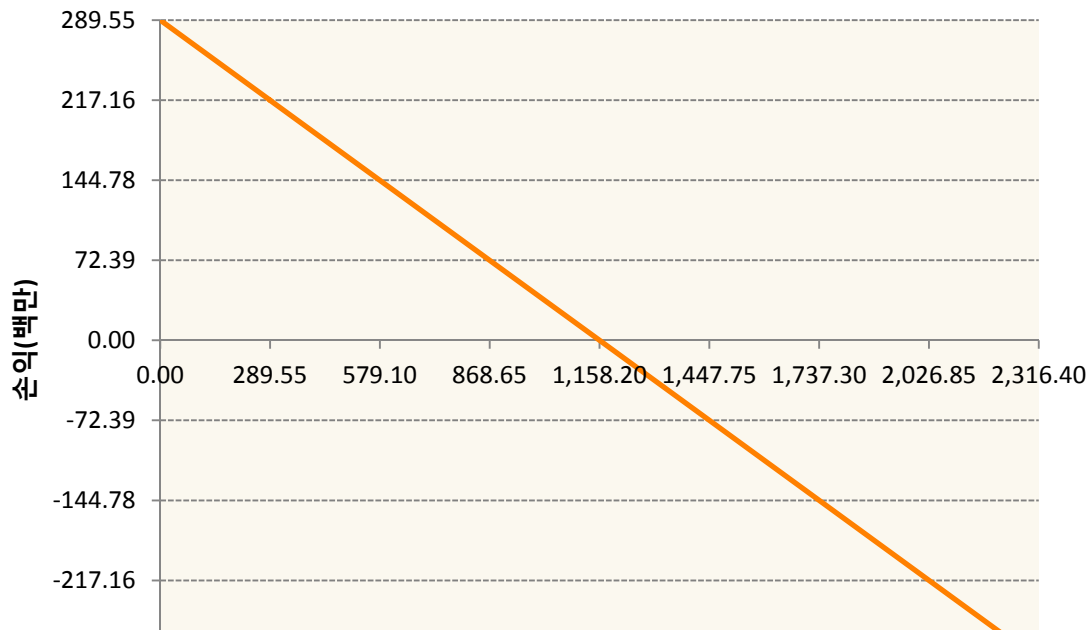


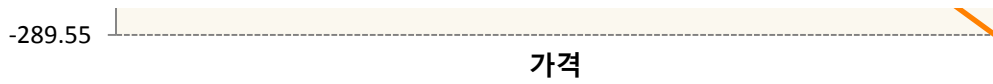


**HOH0-NY Harb ULSD Fut Mar20**

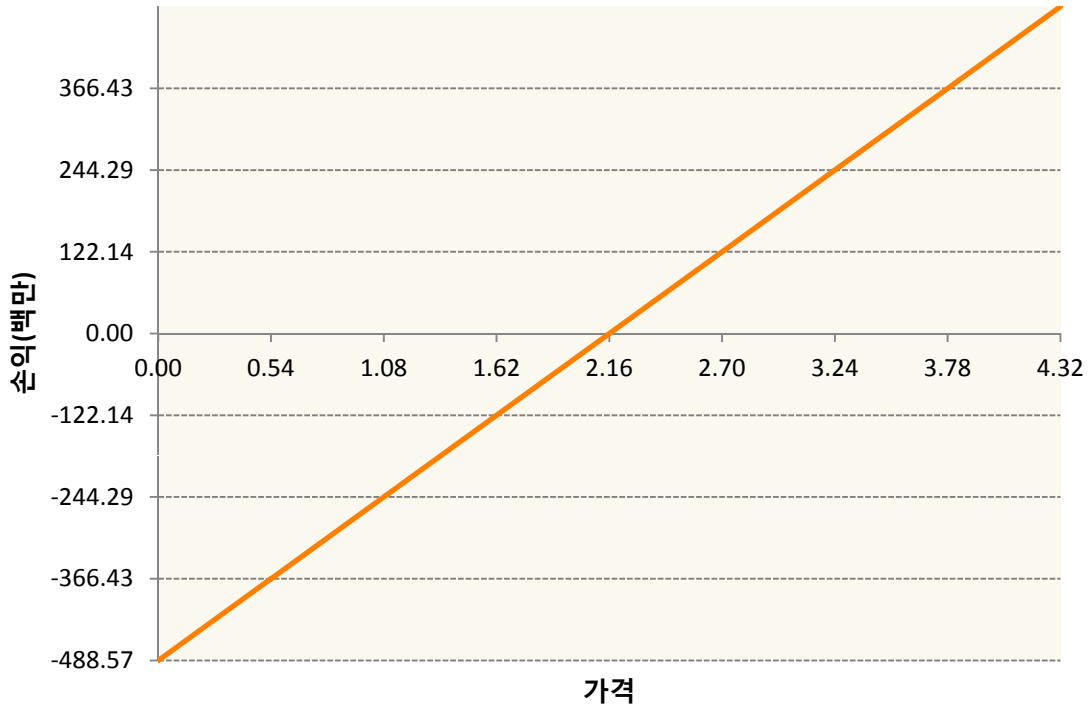


**KR4175Q10001-2020-01 달러선물**

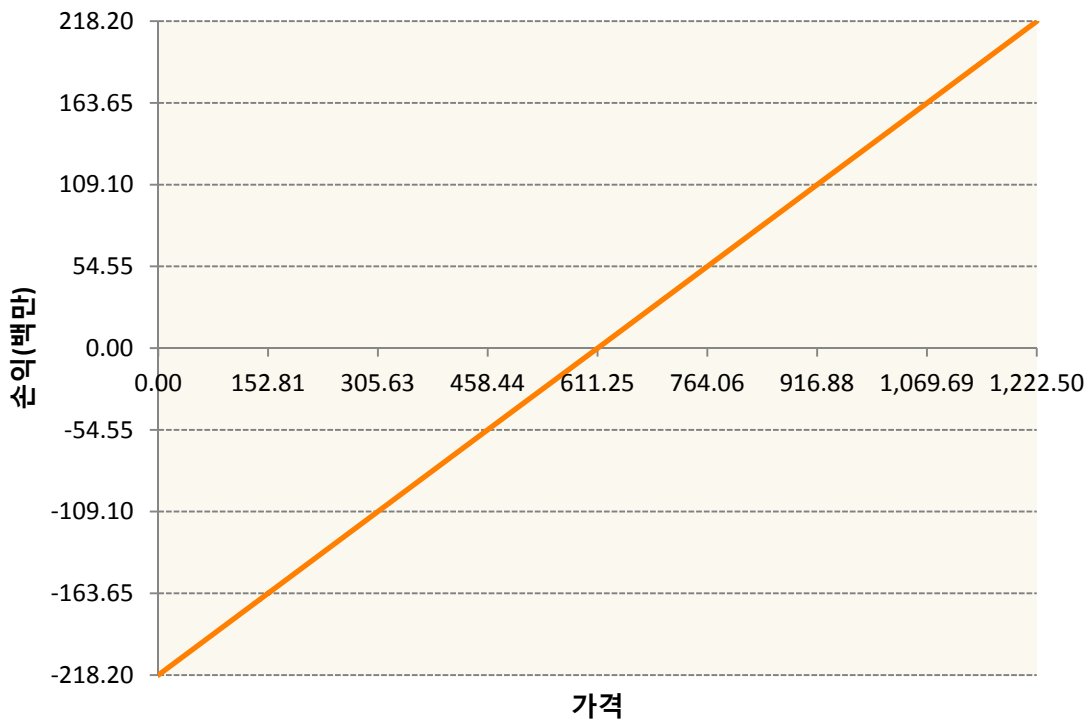




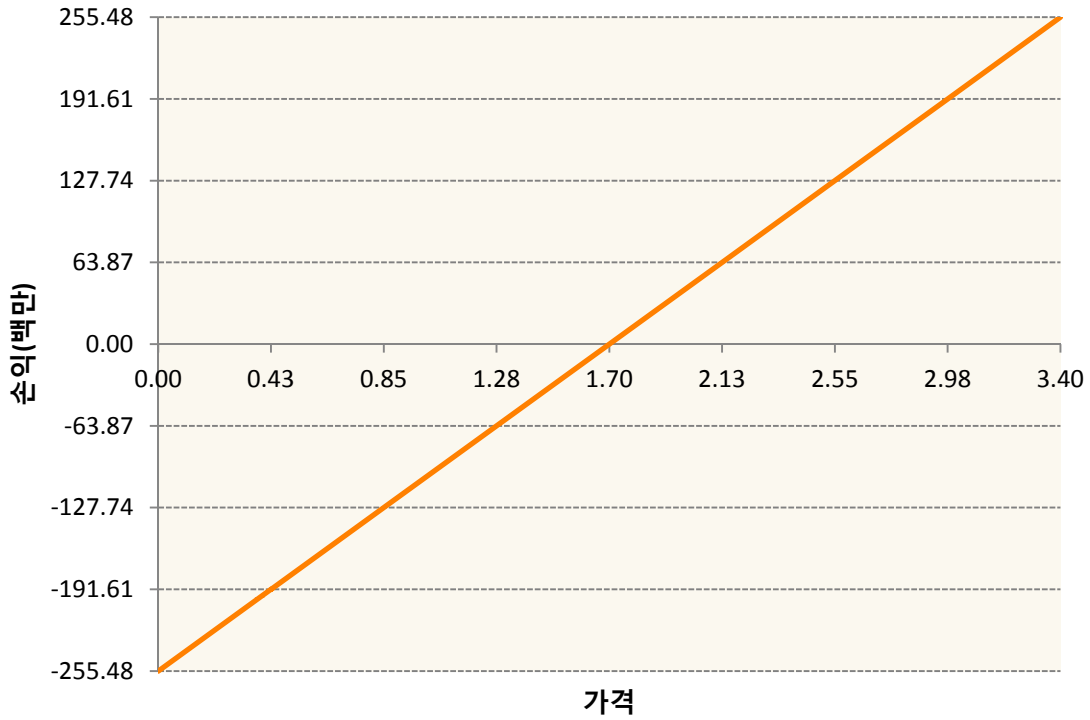
NGH20-NATURAL GAS FUTR Mar20



QSH0-Low Su Gasoil G Mar20



**XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20**



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	52
COH0	BRENT CRUDE FUTR Mar20	55
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	20

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

(단위:백만원)

**385**

공시일	2020-01-03
기준일	2020-01-02

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

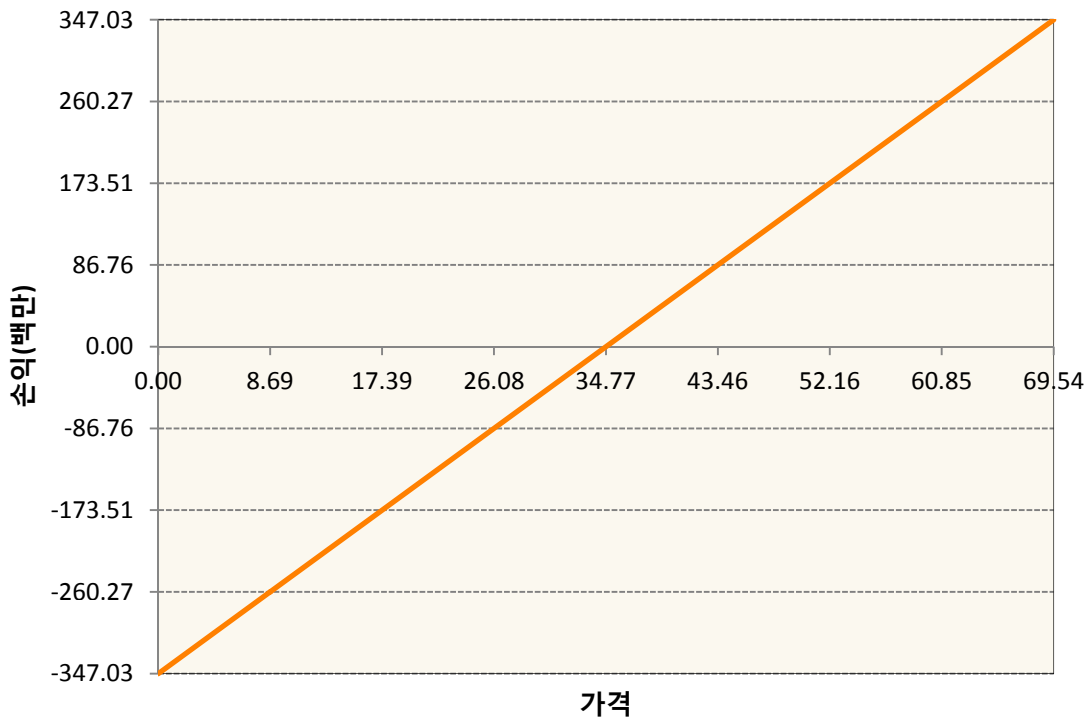
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

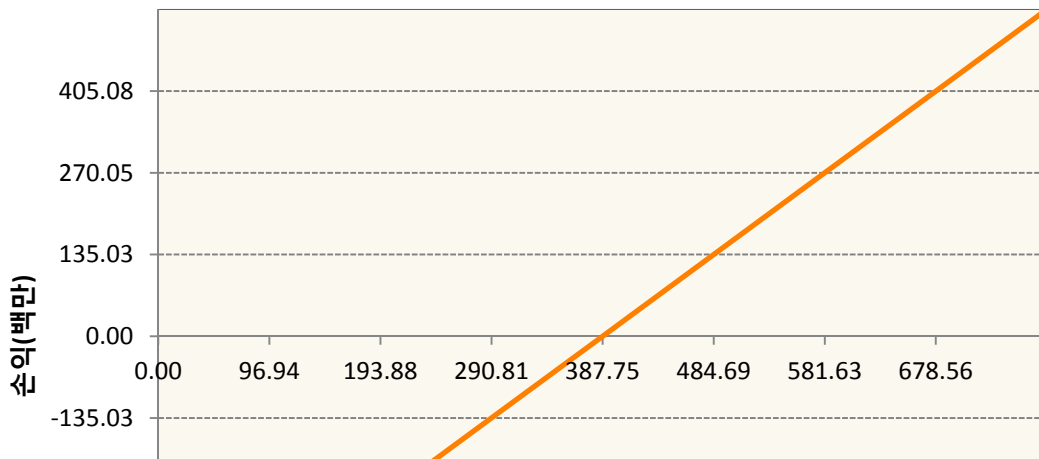
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,874	151	2,724	

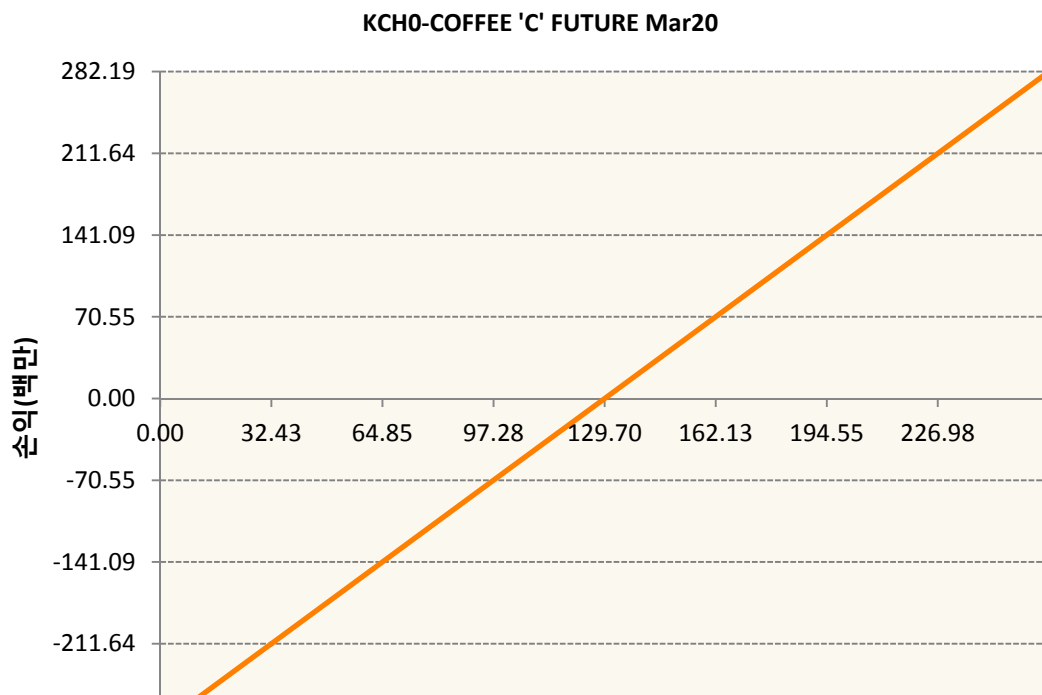
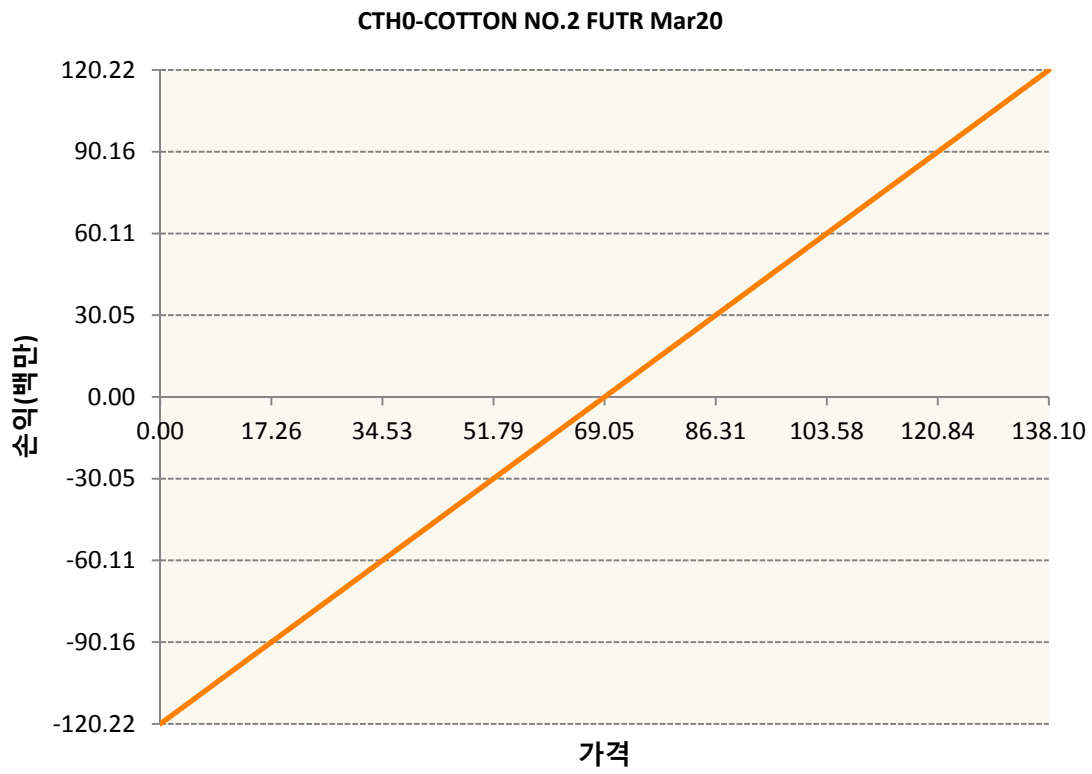
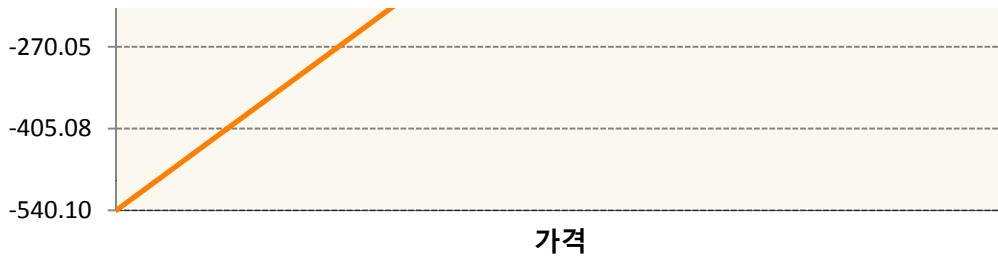
### 2. 만기시점의 손익구조

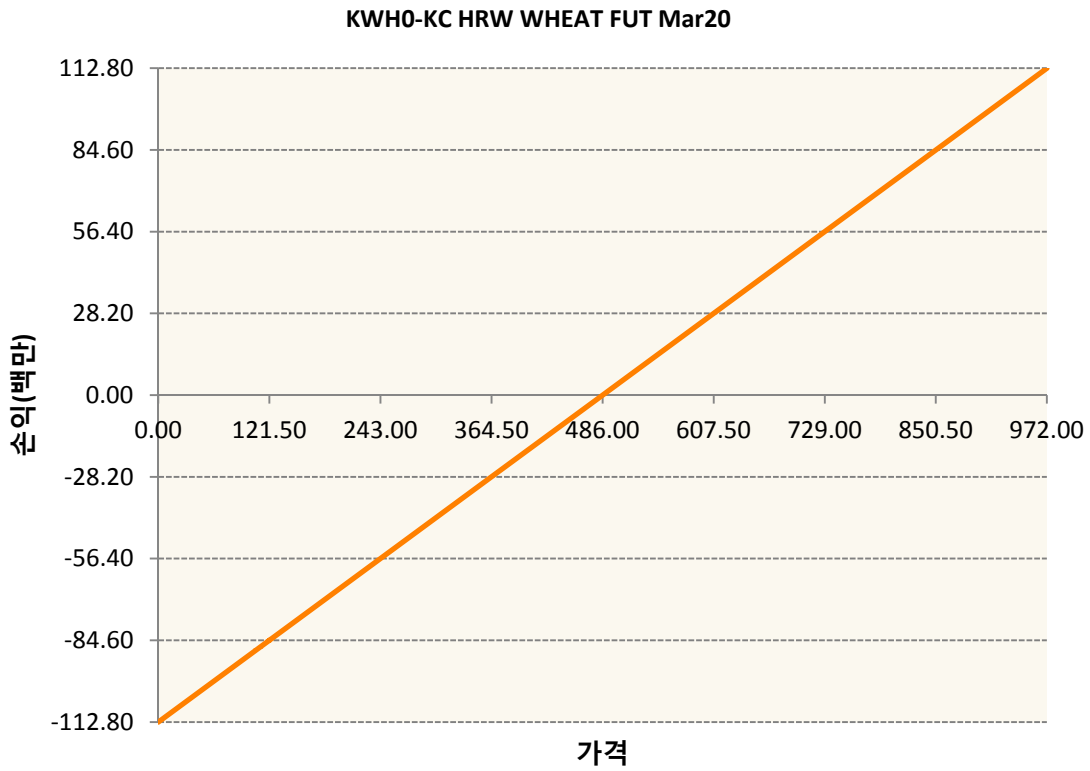
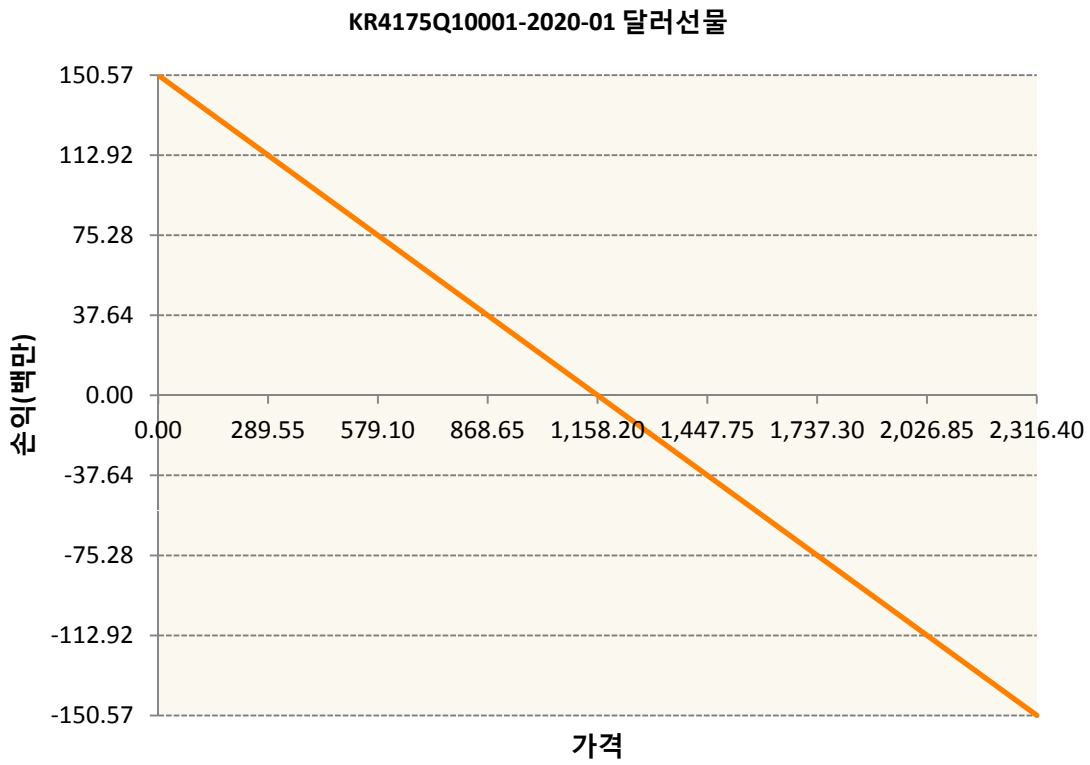
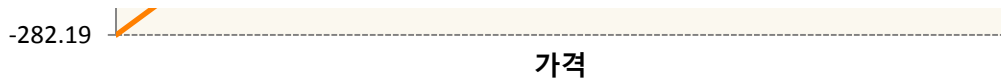
**BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20**



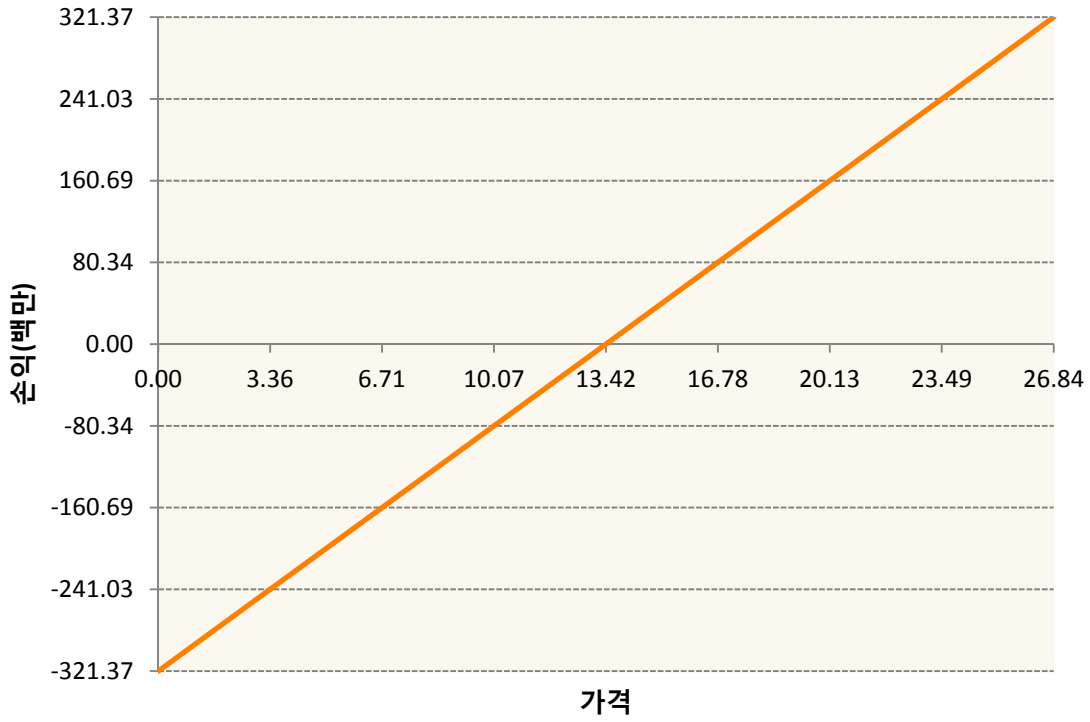
**CH0-CORN FUTURE Mar20**



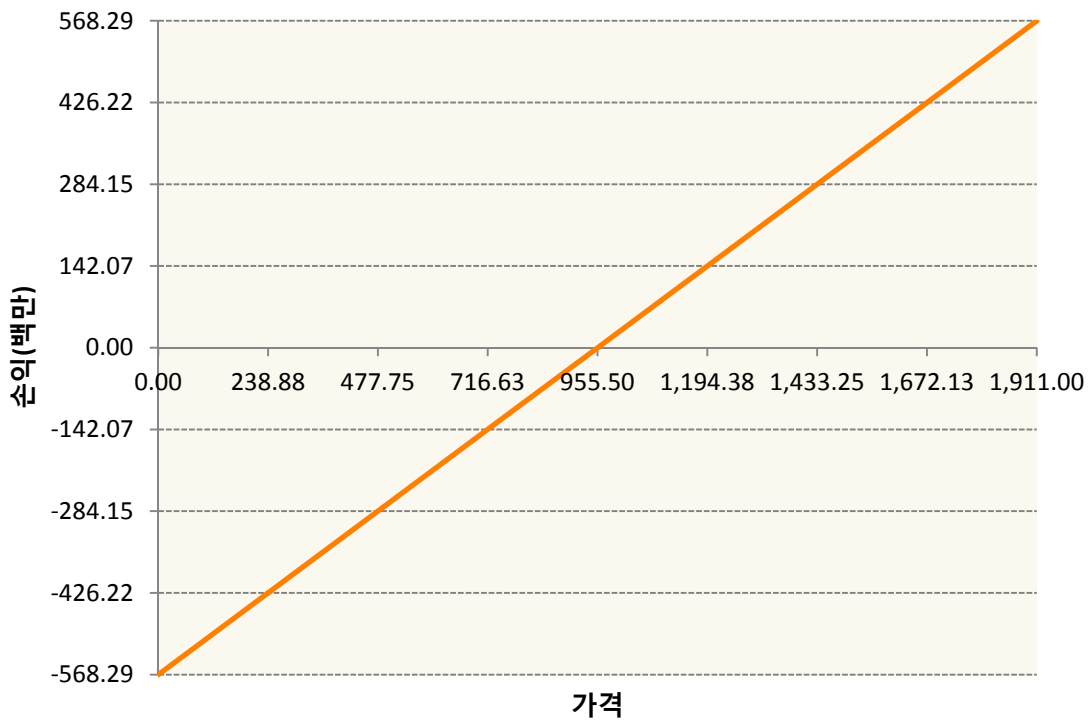




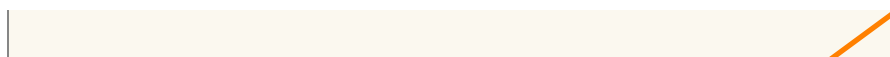
SBH0-Sugar Mar20

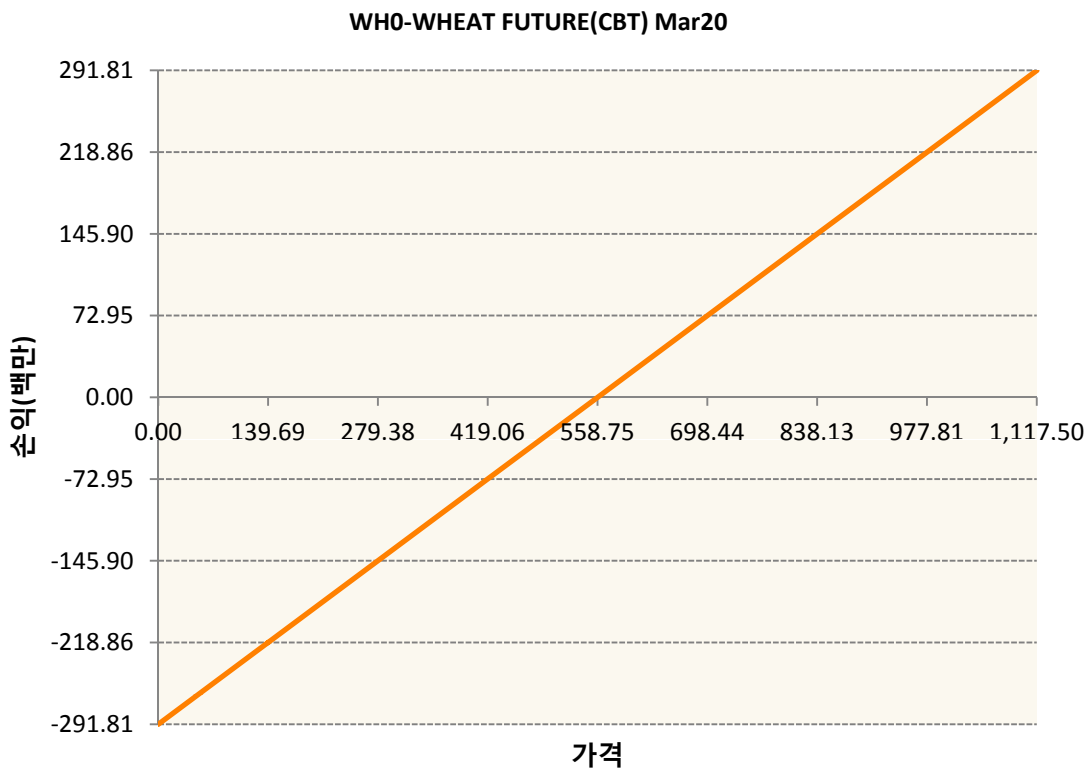
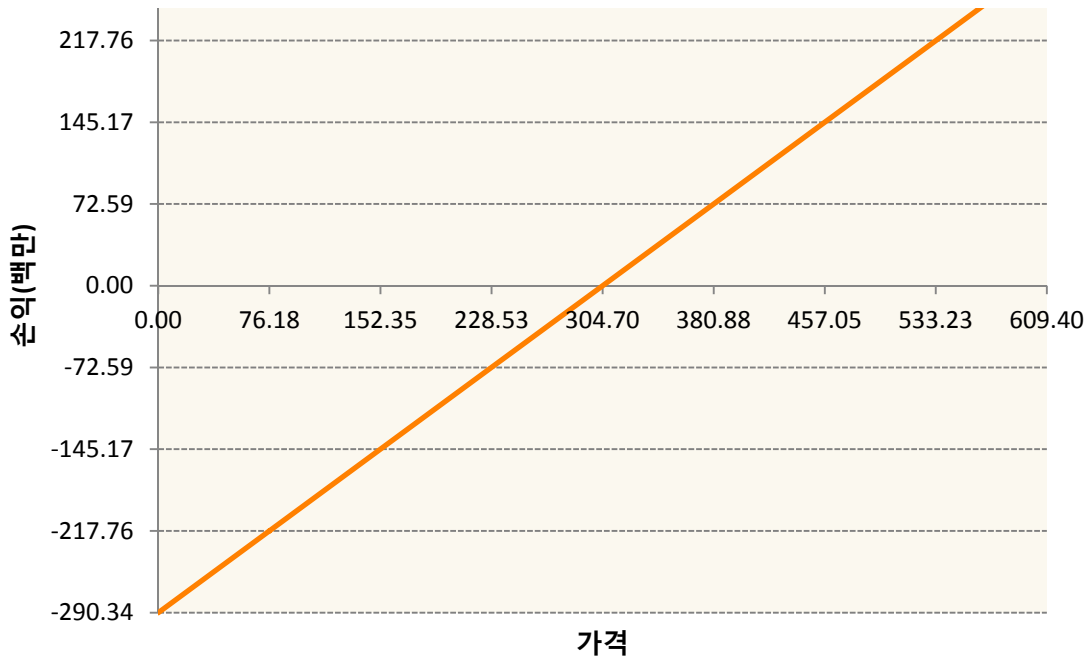


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20



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	23
KR4175Q10( 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)

**252**