

공시일	2020-01-13
기준일	2020-01-10

## 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



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

(단위:백만원)

14

공시일	2020-01-13
기준일	2020-01-10

## 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

1,139

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

653

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-13
기준일	2020-01-10

## 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)	426
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	156

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

**808**

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-13
기준일	2020-01-10

## 유로인덱스모(주식-파생형)

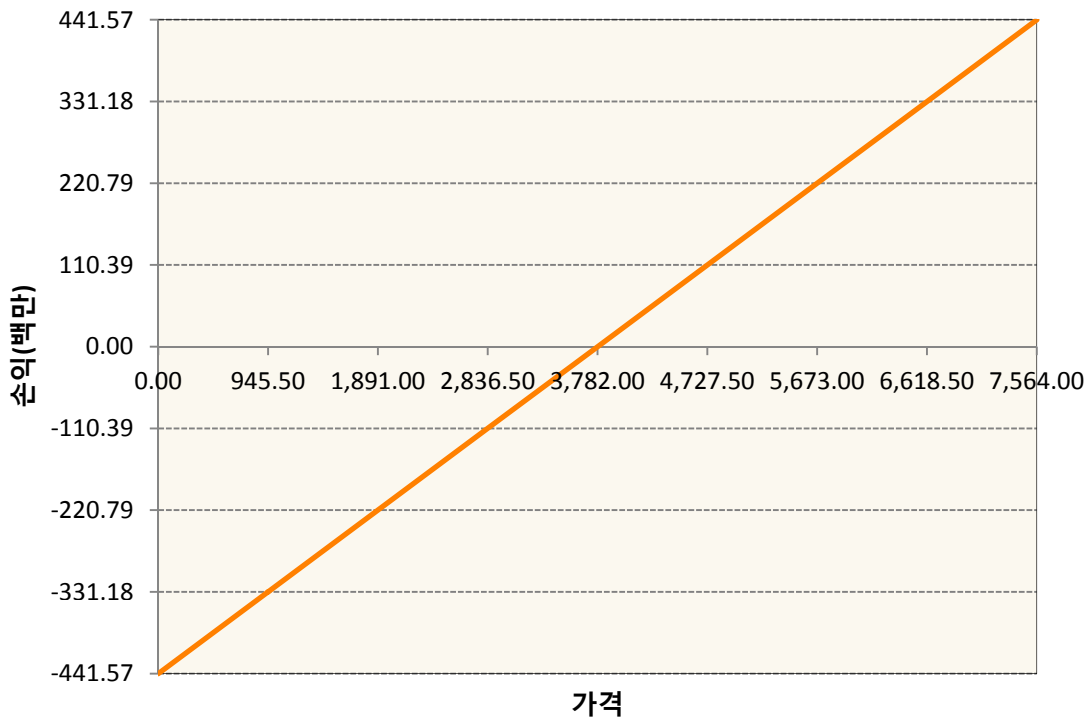
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	442	0	442	

### 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	2020-01-13
기준일	2020-01-10

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

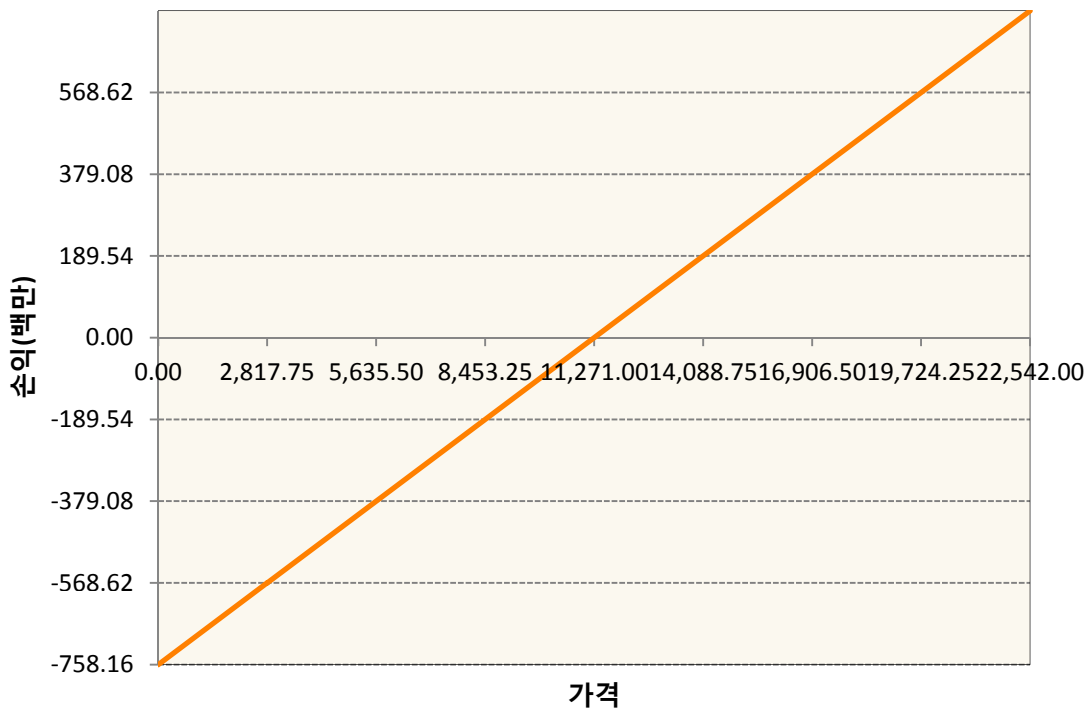
### 1. 계약금액

(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

HCF0-HSCEI Futures Jan20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

53
----

공시일	2020-01-13
기준일	2020-01-10

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

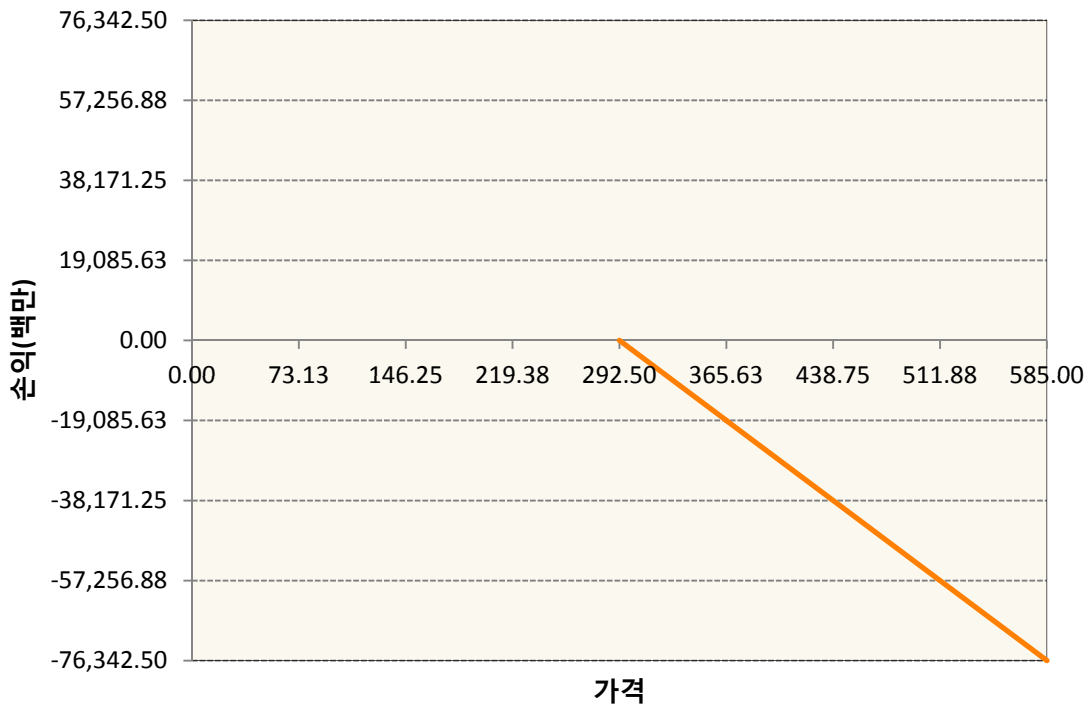
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

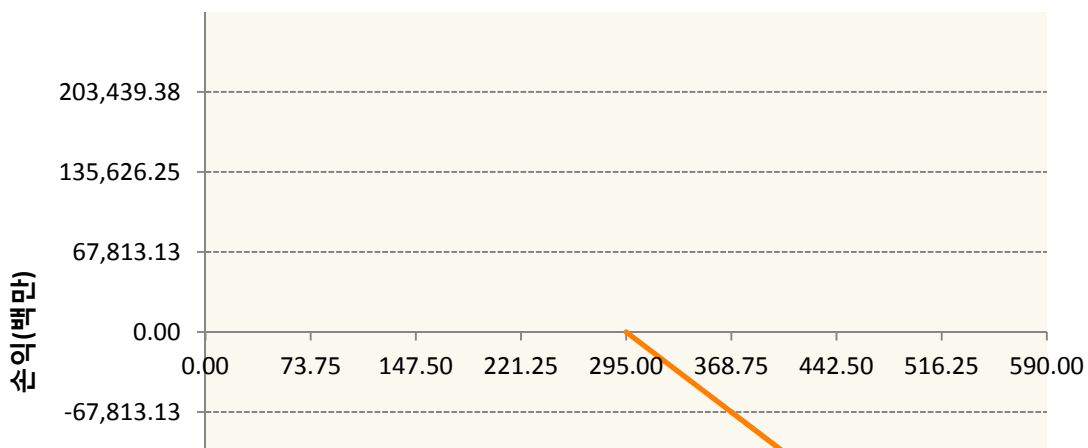
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	383,503	-383,503	장내
누계	유가증권	옵션	0	476,345	-476,345	장내

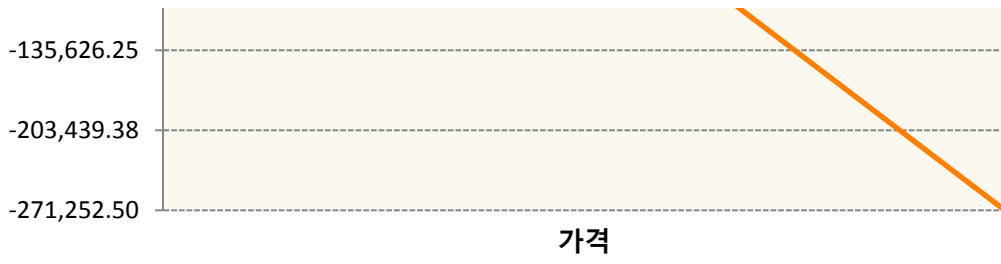
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q22927-2020-02 콜292.5

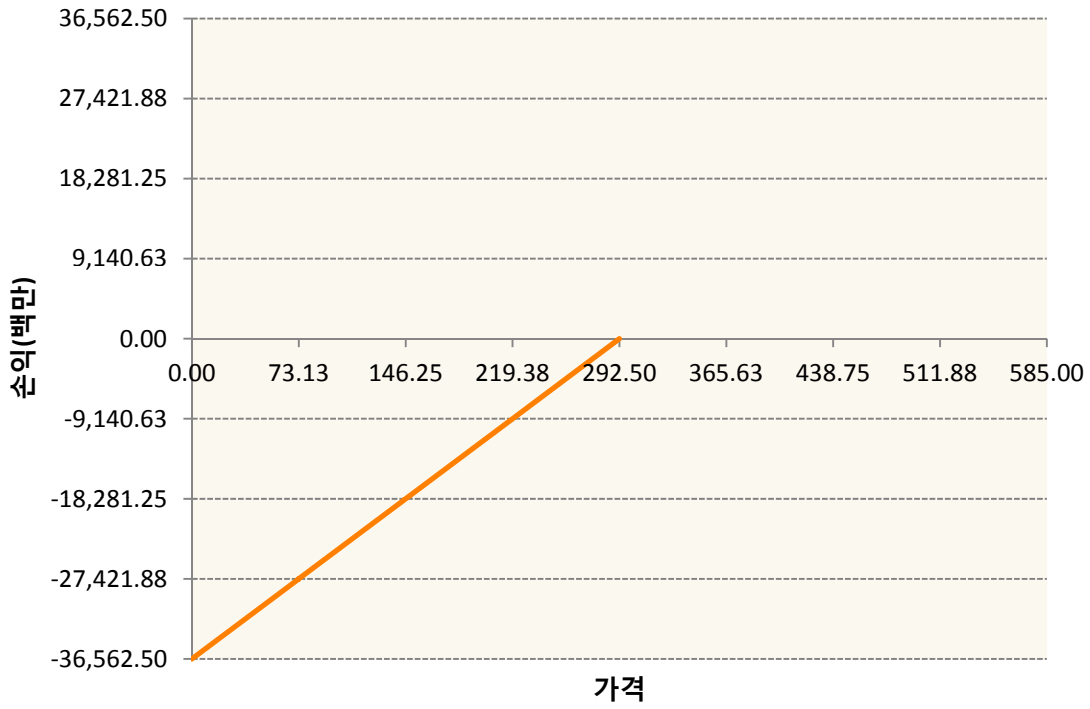


KR4201Q22950-2020-02 콜295

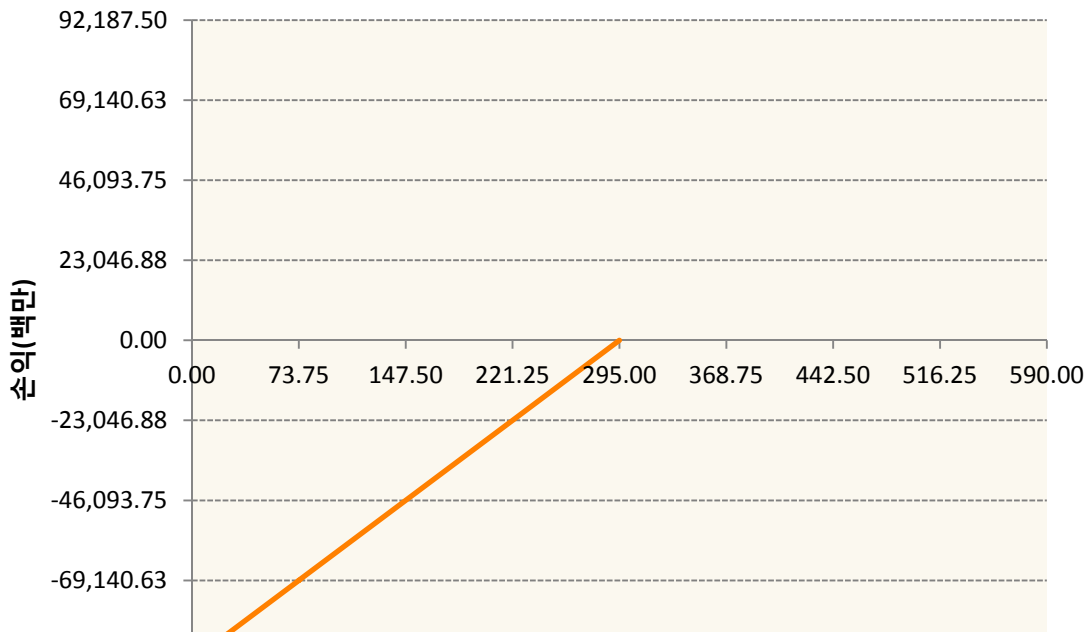




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



KR4301Q22958-2020-02 풋295



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q22927		2020-02 콜292.5						5,033
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,918	2,789	2,647	2,496	2,337	2,172	2,001	
-5.33%	2,474	2,292	2,105	1,913	1,718	1,520	1,320	
-2.67%	1,731	1,516	1,301	1,085	869	653	437	
0%	649	433	217	0	-218	-435	-654	
2.67%	-756	-942	-1,134	-1,332	-1,532	-1,736	-1,943	
5.33%	-2,422	-2,562	-2,715	-2,878	-3,049	-3,227	-3,411	
8.00%	-4,271	-4,363	-4,472	-4,596	-4,731	-4,878	-5,033	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						17,174
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	9,342	8,942	8,493	8,005	7,483	6,934	6,362	
-5.33%	8,041	7,447	6,826	6,184	5,525	4,852	4,169	
-2.67%	5,768	5,031	4,287	3,539	2,788	2,035	1,279	
0%	2,334	1,556	778	0	-779	-1,557	-2,336	
2.67%	-2,267	-2,971	-3,690	-4,421	-5,160	-5,907	-6,659	
5.33%	-7,863	-8,418	-9,010	-9,634	-10,281	-10,949	-11,633	
8.00%	-14,189	-14,573	-15,012	-15,499	-16,026	-16,586	-17,174	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						2,127
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,062	-2,067	-2,074	-2,083	-2,095	-2,110	-2,127	
-5.33%	-1,115	-1,137	-1,162	-1,190	-1,220	-1,252	-1,285	
-2.67%	-333	-378	-423	-469	-515	-561	-608	
0%	132	89	45	0	-45	-91	-138	
2.67%	304	283	259	232	202	170	136	
5.33%	341	335	328	317	304	288	269	
8.00%	345	344	343	340	336	330	322	
KR4301Q22958		2020-02 풋295						5,732
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-5,619	-5,625	-5,635	-5,651	-5,672	-5,699	-5,732	
-5.33%	-3,203	-3,241	-3,286	-3,340	-3,401	-3,468	-3,540	
-2.67%	-1,074	-1,172	-1,273	-1,378	-1,485	-1,594	-1,704	
0%	360	240	120	0	-121	-241	-362	
2.67%	986	915	836	751	661	567	469	

5.33%	1,148	1,126	1,096	1,058	1,012	959	899
8.00%	1,172	1,168	1,161	1,150	1,133	1,111	1,083

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

(단위:백만원)

**28,774**

공시일	2020-01-13
기준일	2020-01-10

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

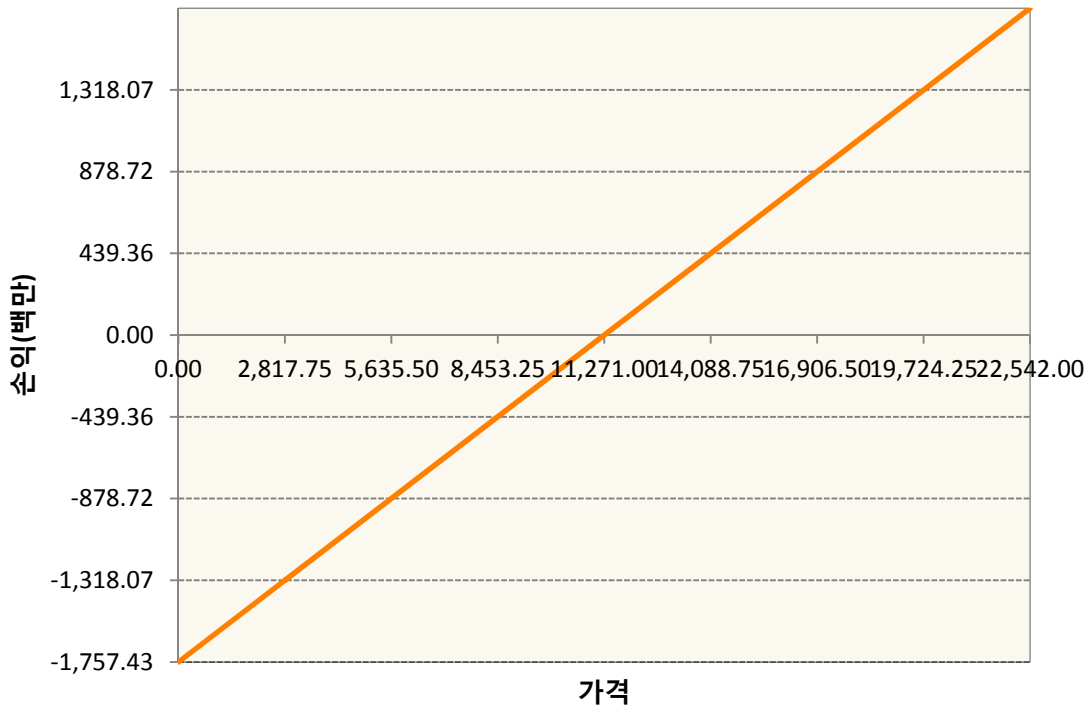
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

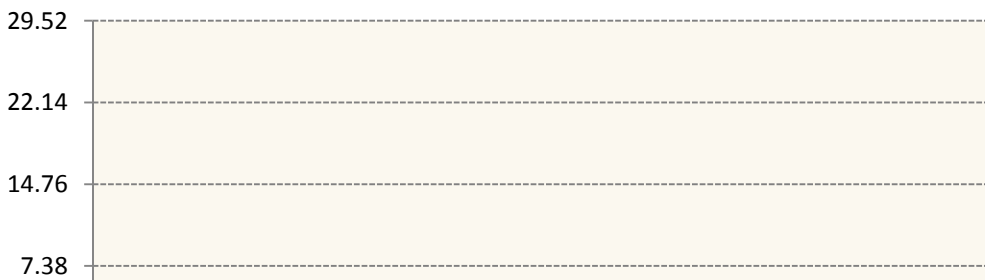
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,757	0	1,757	장내
누계	유가증권	옵션	0	65	-65	장내
누계	통화	선도	0	2,105	-2,105	장외

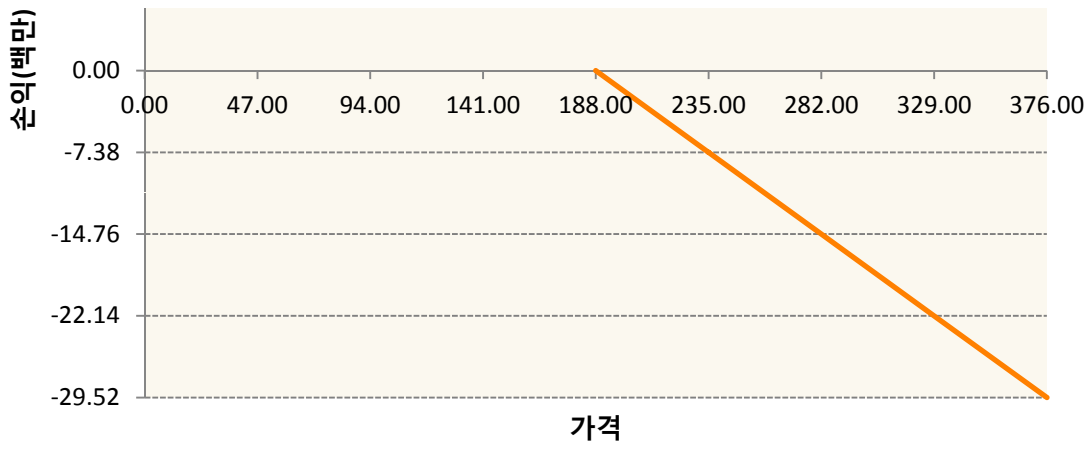
### 2. 만기시점의 손익구조

HCFO-HSCEI Futures Jan20

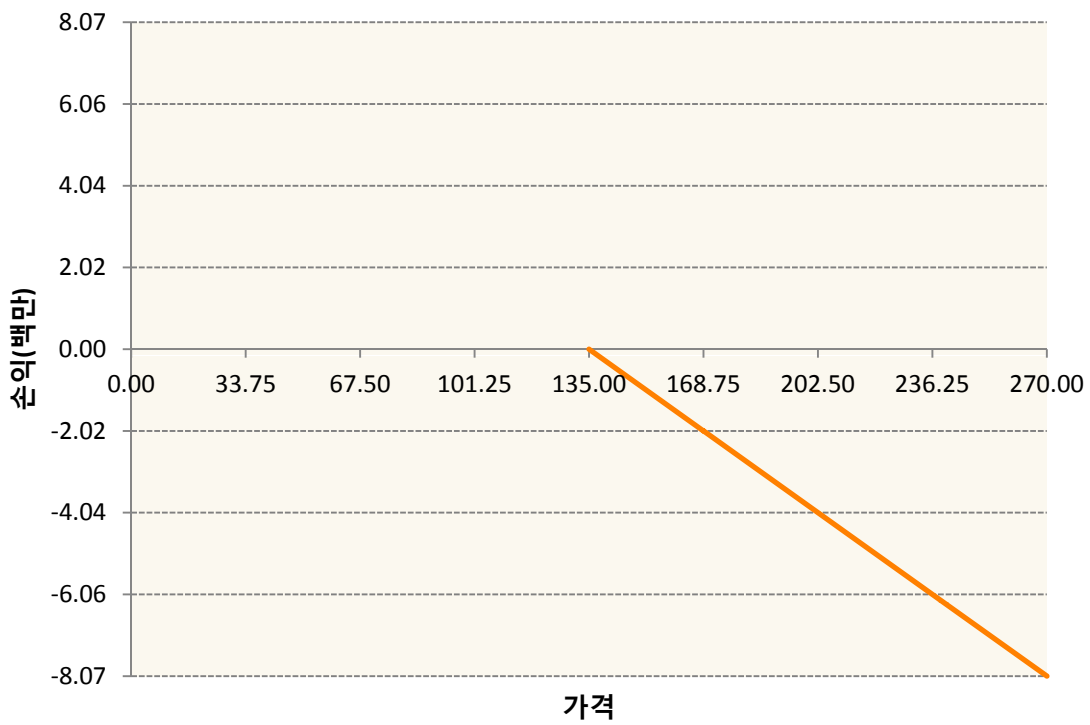


OHHIF0-C112-HSCEI

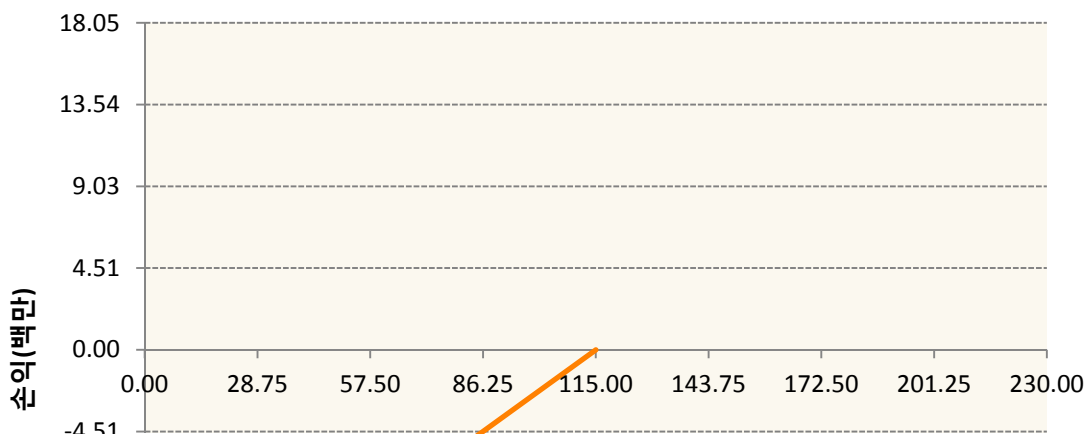


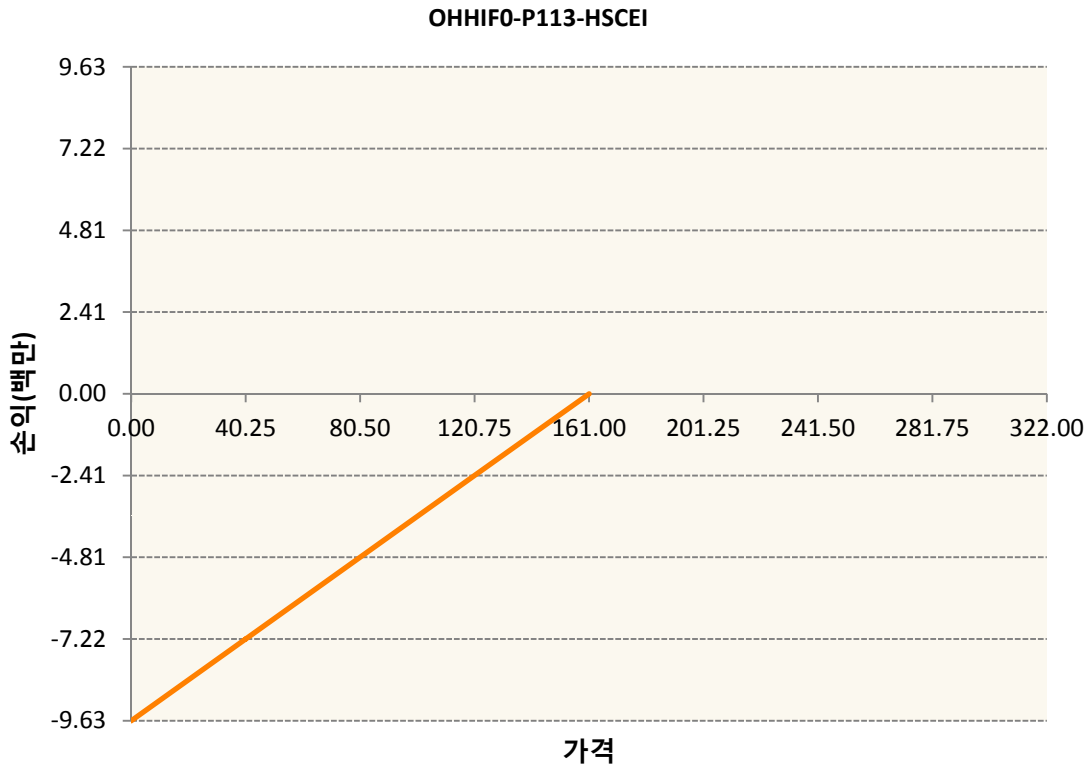
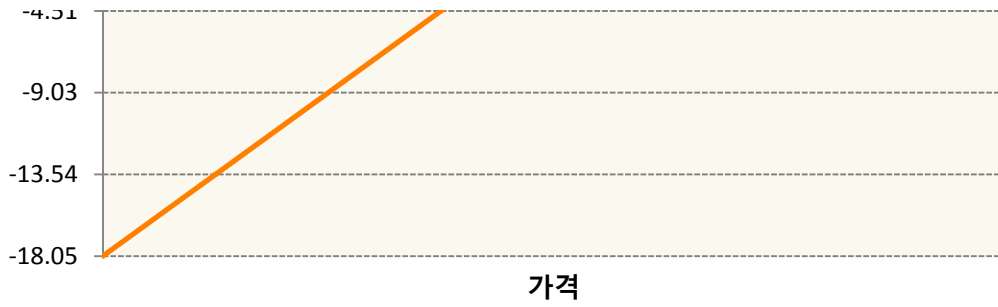


**OHHIF0-C113-HSCEI**



**OHHIF0-P112-HSCEI**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	168
HCF0 HSCEI Futures Jan20	141
OHHIF0-C11 HSCEI	2
OHHIF0-C11 HSCEI	1
OHHIF0-P11 HSCEI	1
OHHIF0-P11 HSCEI	1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	<b>183</b>

공시일	2020-01-13
기준일	2020-01-10

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

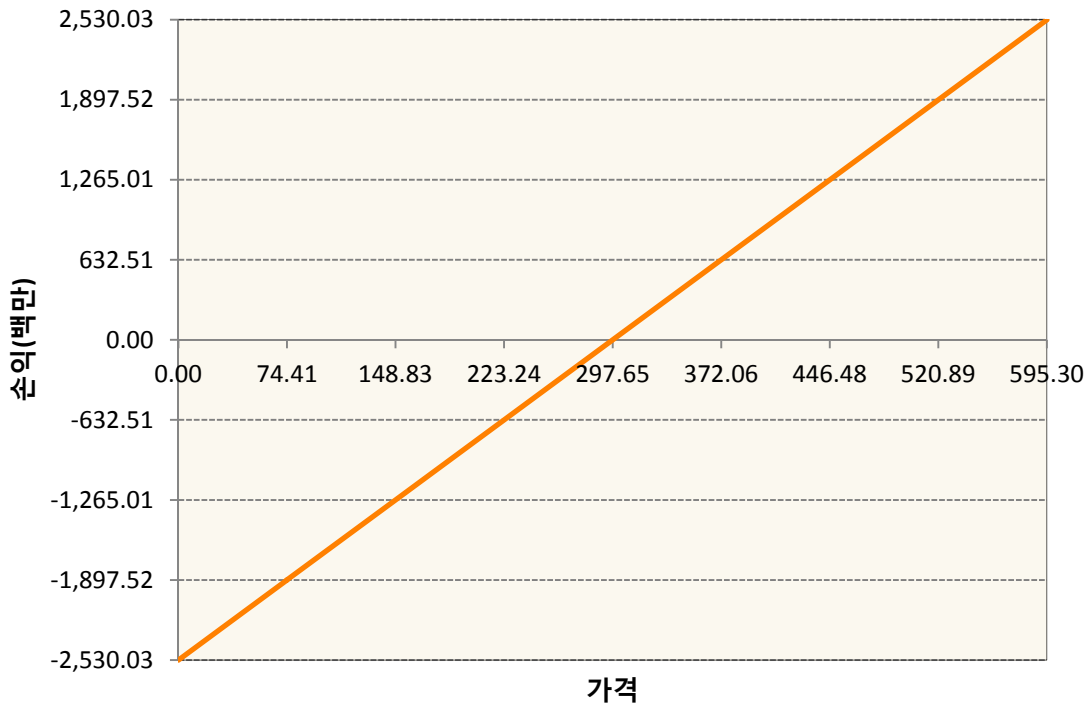
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

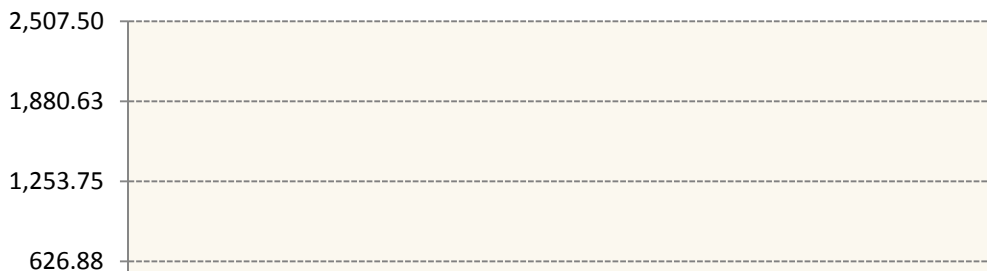
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	145	5,077	-4,932	장내
누계	유가증권	선물	2,530	0	2,530	장내
누계	유가증권	스왑	4,625	0	4,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,858	-4,858	장내

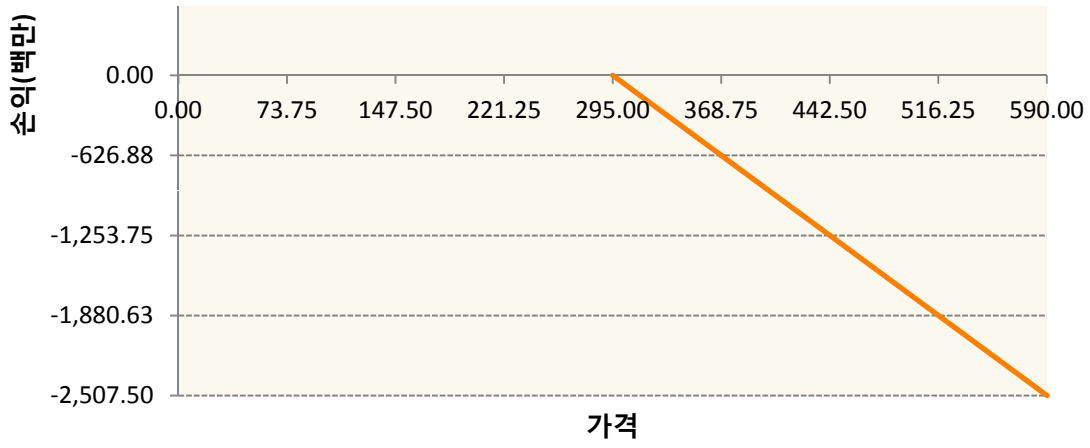
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

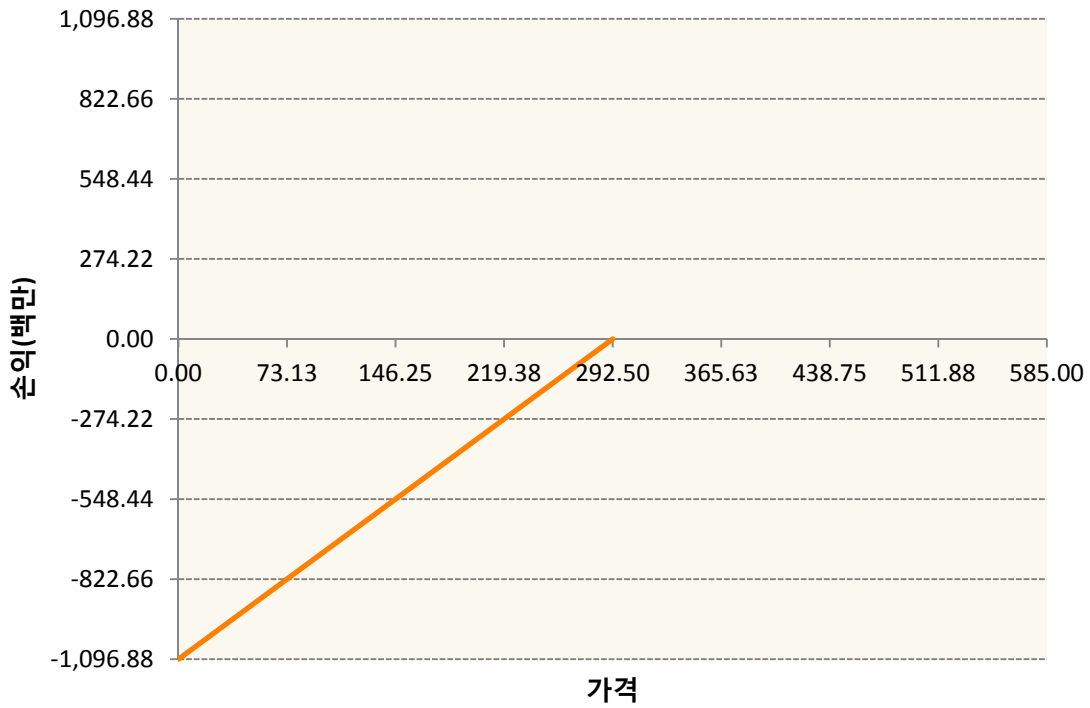


KR4201Q22950-2020-02 콜295

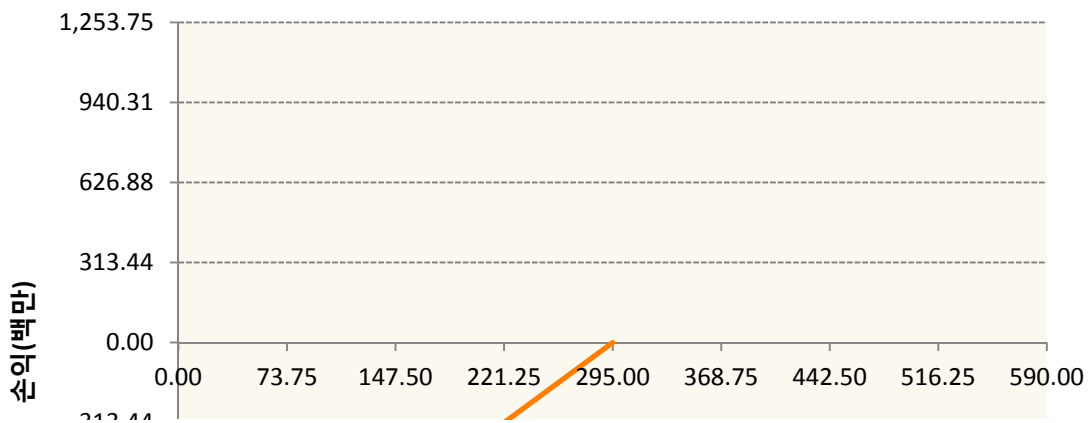




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



KR4301Q22958-2020-02 풋295





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						394
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-394	-394	-394	-394	-394	-394	-394	
-5.33%	-263	-263	-263	-263	-263	-263	-263	
-2.67%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	131	131	131	131	131	131	131	
5.33%	263	263	263	263	263	263	263	
8.00%	394	394	394	394	394	394	394	
KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						202
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-202	-202	-202	-202	-202	-202	-202	
-5.33%	-135	-135	-135	-135	-135	-135	-135	
-2.67%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	67	67	67	67	67	67	67	
5.33%	135	135	135	135	135	135	135	
8.00%	202	202	202	202	202	202	202	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						159
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	86	83	79	74	69	64	59	
-5.33%	74	69	63	57	51	45	39	
-2.67%	53	47	40	33	26	19	12	
0%	22	14	7	0	-7	-14	-22	
2.67%	-21	-27	-34	-41	-48	-55	-62	
5.33%	-73	-78	-83	-89	-95	-101	-108	
8.00%	-131	-135	-139	-143	-148	-153	-159	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						64
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-62	-62	-62	-62	-63	-63	-64
-5.33%	-33	-34	-35	-36	-37	-38	-39
-2.67%	-10	-11	-13	-14	-15	-17	-18
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4
2.67%	9	9	8	7	6	5	4
5.33%	10	10	10	10	9	9	8
8.00%	10	10	10	10	10	10	10
KR4301Q22958                      2020-02 풋295							78
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-76	-76	-77	-77	-77	-78	-78
-5.33%	-44	-44	-45	-45	-46	-47	-48
-2.67%	-15	-16	-17	-19	-20	-22	-23
0%	5	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	13	12	11	10	9	8	6
5.33%	16	15	15	14	14	13	12
8.00%	16	16	16	16	15	15	15

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

(단위:백만원)

**844**

공시일	2020-01-13
기준일	2020-01-10

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

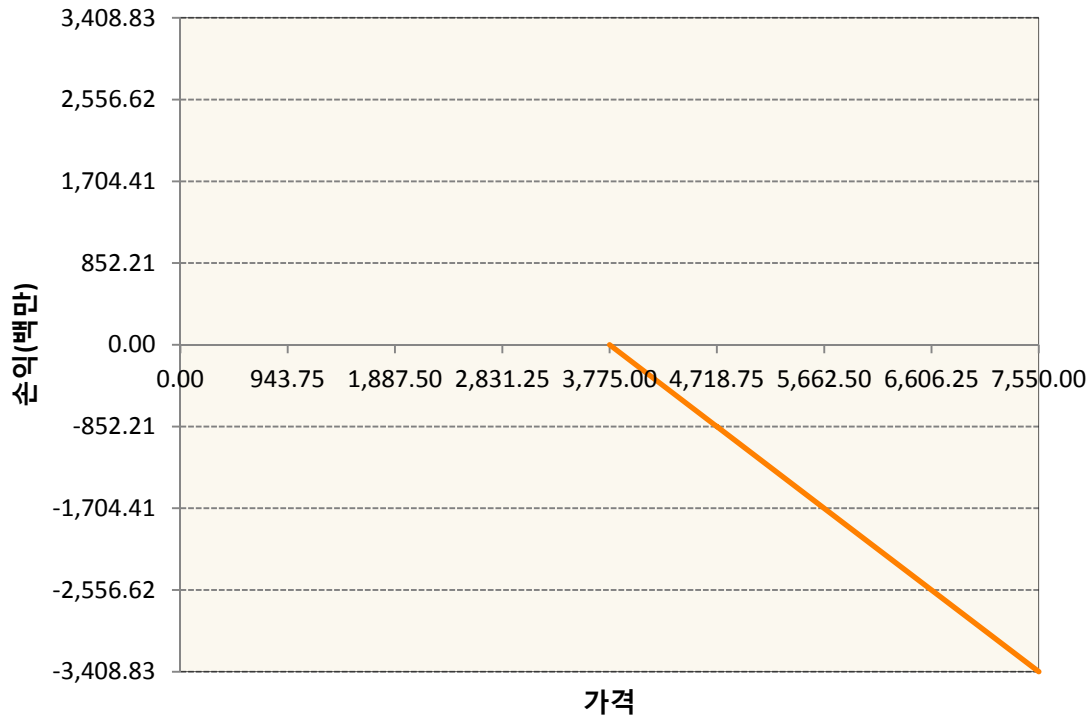
### 1. 계약금액

(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	588	0	588	
누계	유가증권	스왑	15,667	0	15,667	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,308	-7,308	장내
누계	통화	선도	0	3,385	-3,385	장외

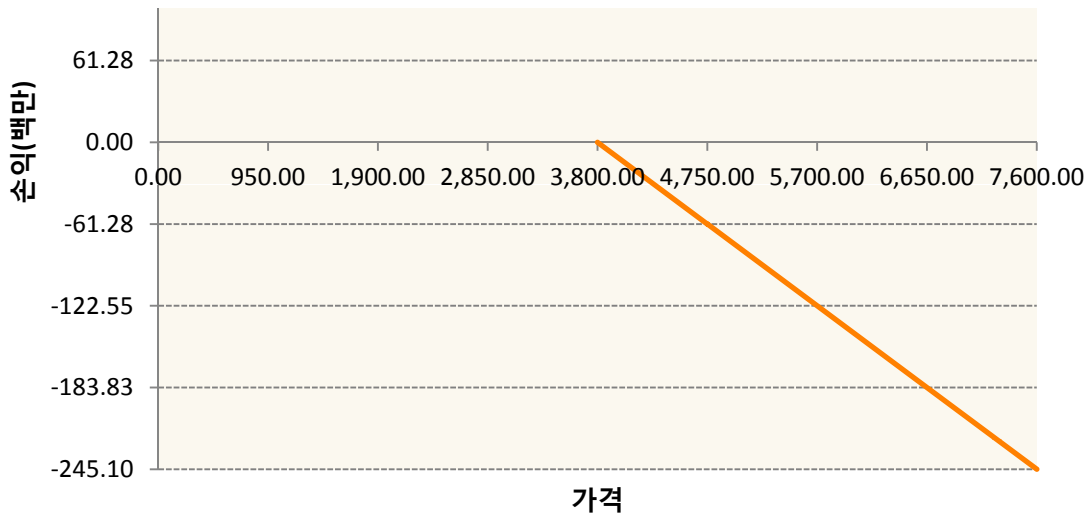
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXF0-C3775-EURO STOXX 50**

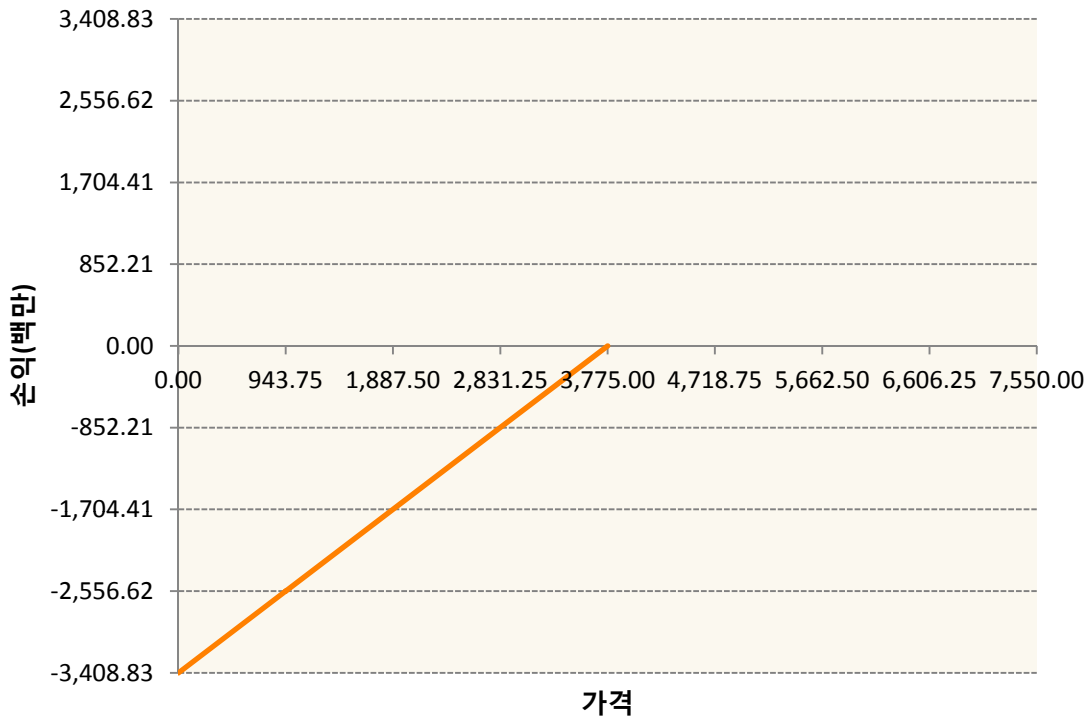


**OESXF0-C3800-EURO STOXX 50**

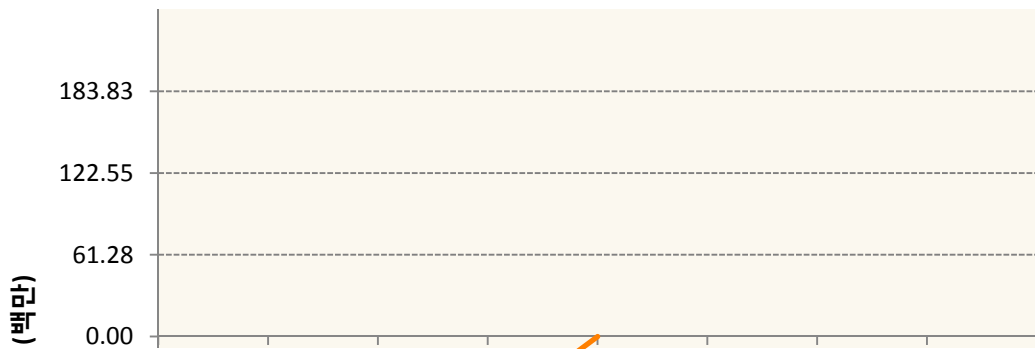


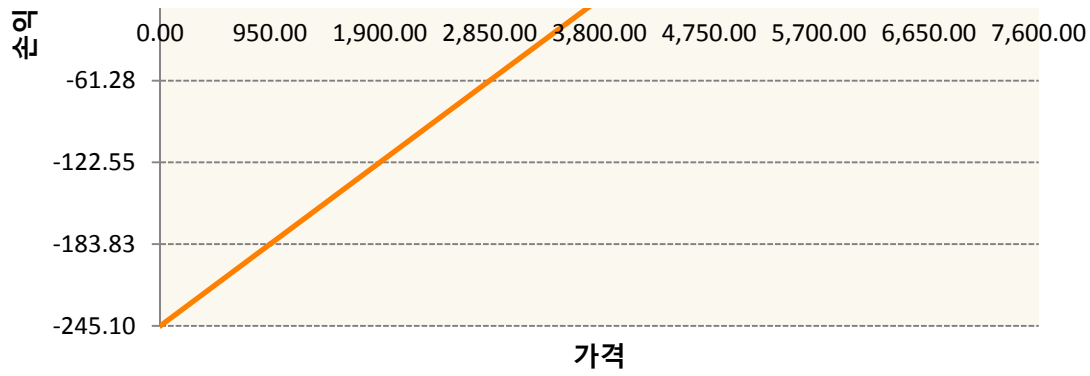


**OESXF0-P3775-EURO STOXX 50**

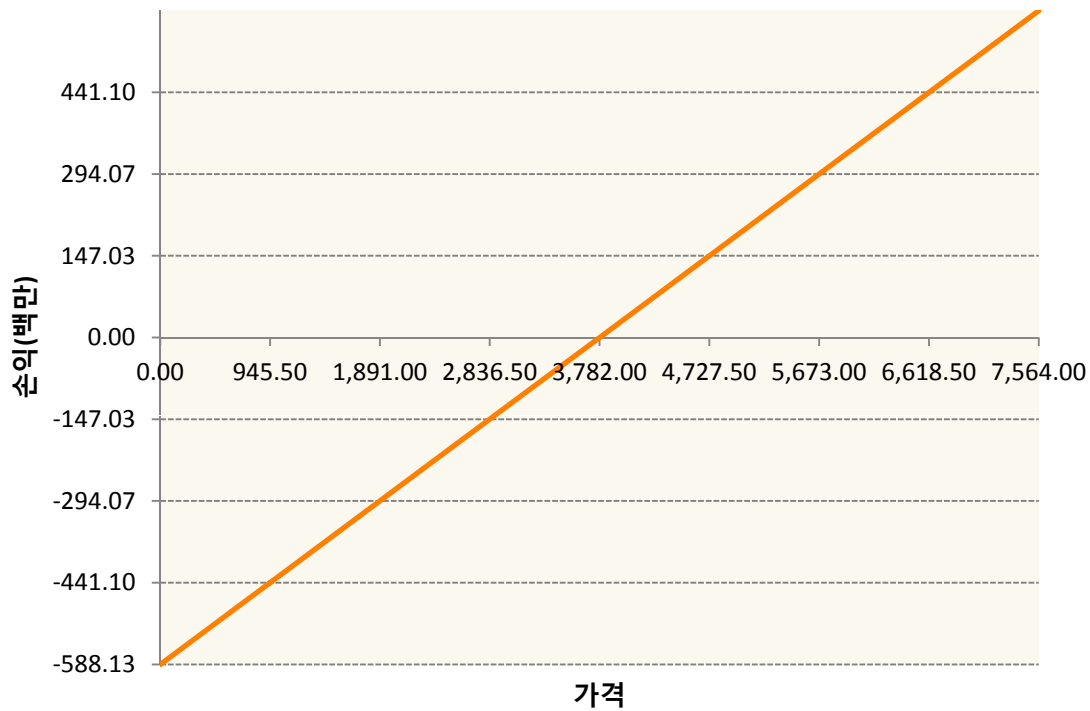


**OESXF0-P3800-EURO STOXX 50**





VGH0-EURO STOXX 50 Mar20



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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	43
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	271
OESXF0-C37 EURO STOXX 50	273
OESXF0-C38 EURO STOXX 50	20
OESXF0-P37 EURO STOXX 50	273
OESXF0-P38 EURO STOXX 50	20
VGH0 EURO STOXX 50 Mar20	47

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





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

(단위:백만원)

924



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

(단위:백만원)

79



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

(단위:백만원)

116



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

(단위:백만원)

42

공시일	2020-01-13
기준일	2020-01-10

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

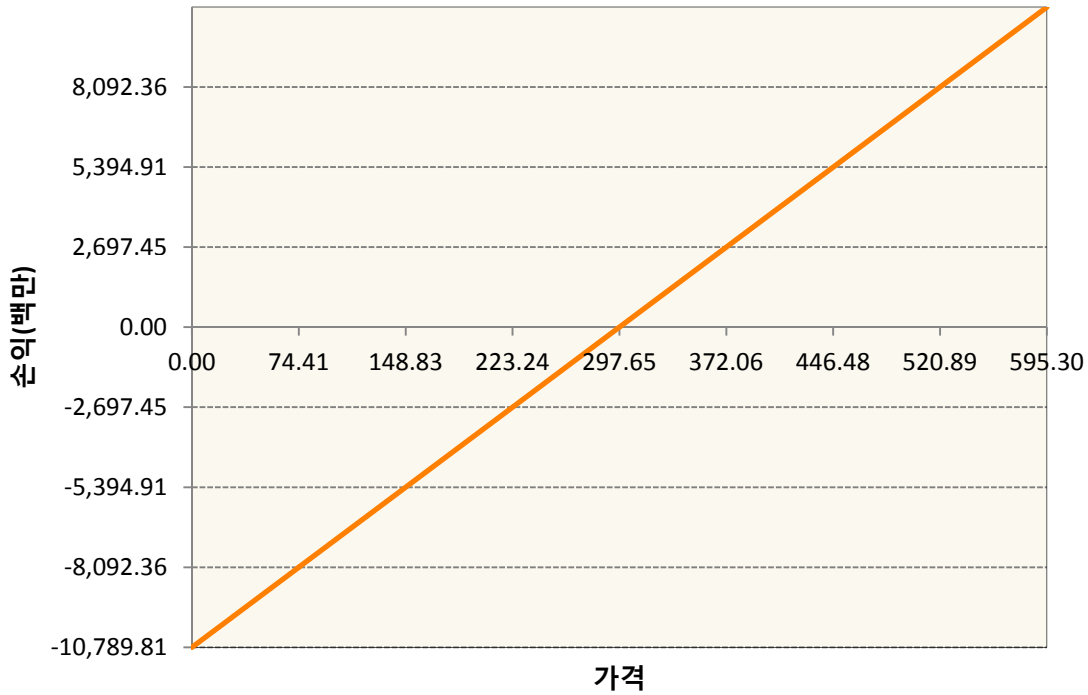
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

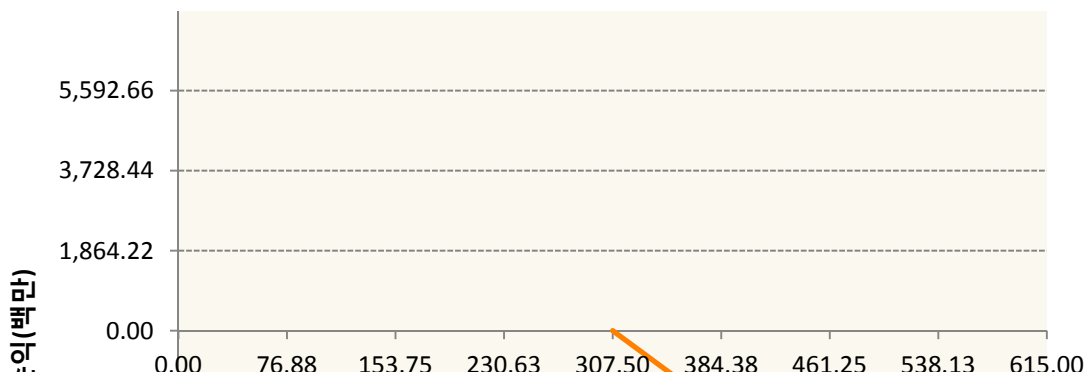
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	222	-222	장내
신규	유가증권	옵션	14,317	14,128	189	장내
누계	유가증권	선물	10,790	0	10,790	장내
누계	유가증권	옵션	3,018	21,407	-18,389	장내

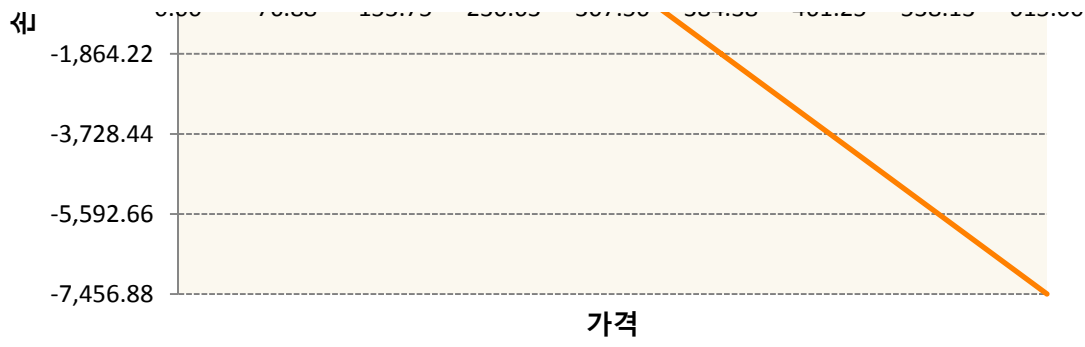
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

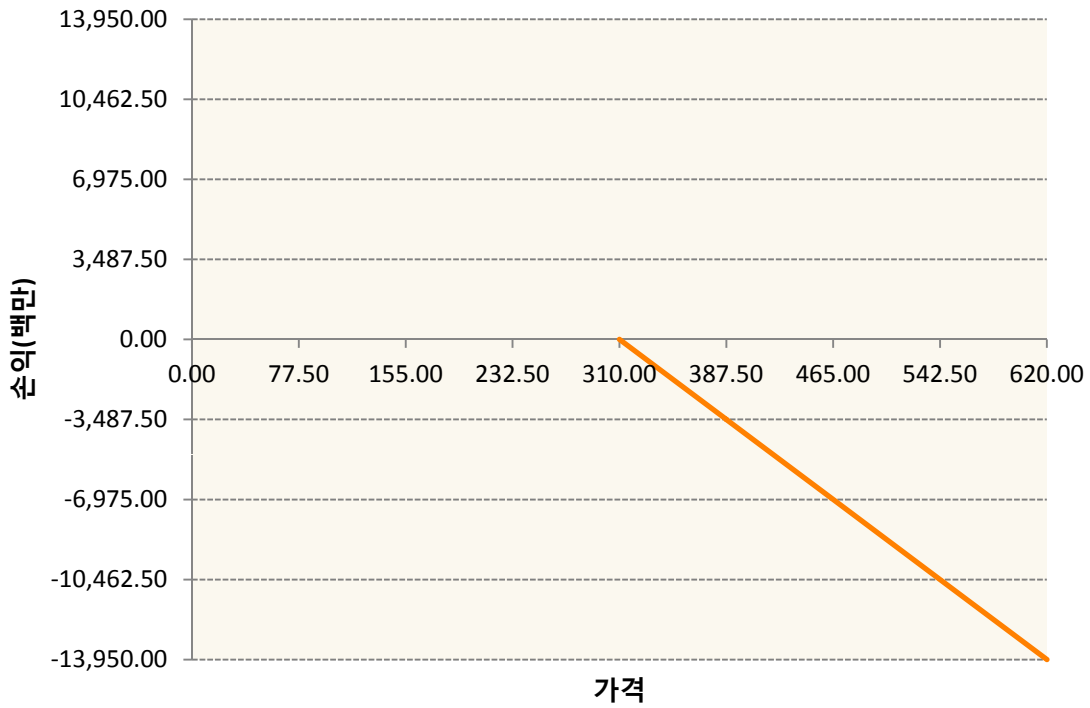


KR4201Q23073-2020-02 콜307.5

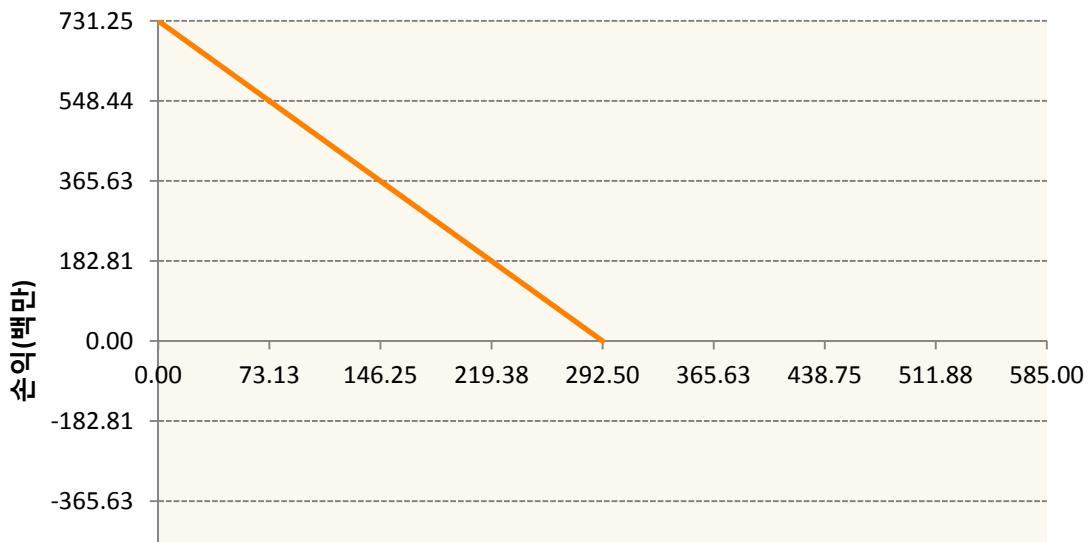


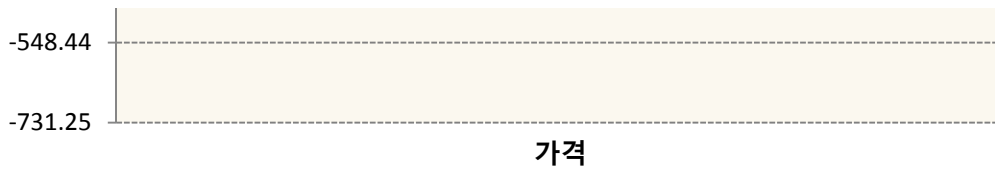


**KR4201Q23107-2020-02 콜310**

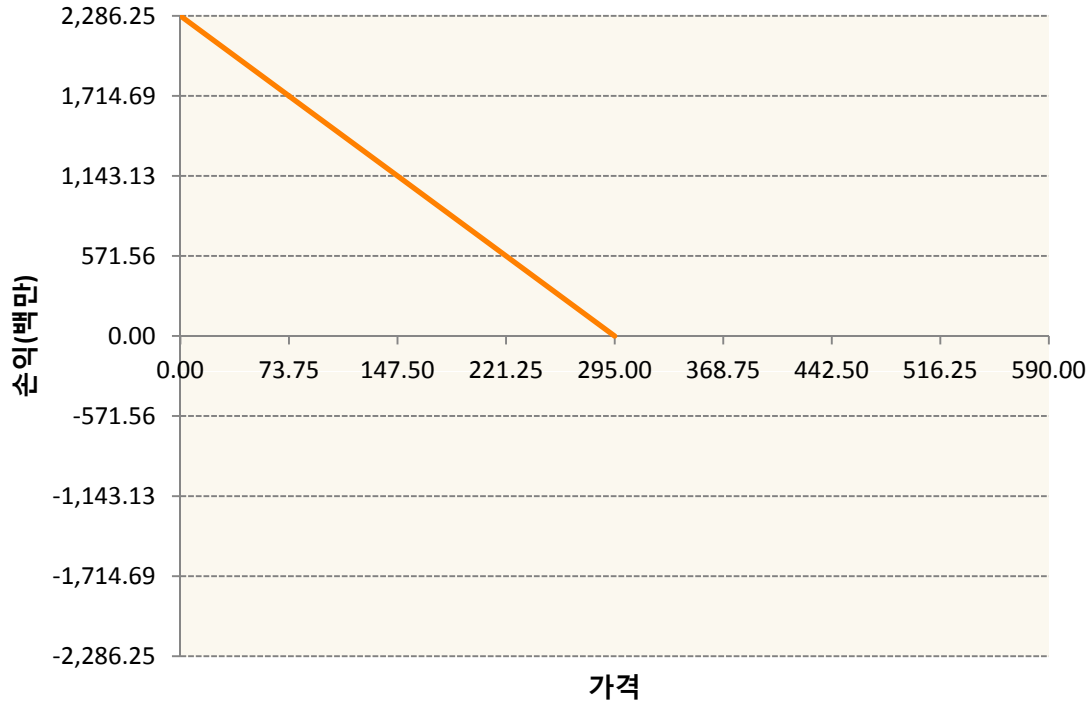


**KR4301Q22925-2020-02 풋292.5**





KR4301Q22958-2020-02 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						861
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-861	-861	-861	-861	-861	-861	-861	
-5.33%	-574	-574	-574	-574	-574	-574	-574	
-2.67%	-287	-287	-287	-287	-287	-287	-287	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	287	287	287	287	287	287	287	
5.33%	574	574	574	574	574	574	574	
8.00%	861	861	861	861	861	861	861	
KR4201Q23073		2020-02 콜307.5						368
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	139	135	129	122	113	103	93	
-5.33%	128	119	109	98	85	72	58	
-2.67%	103	89	74	58	42	25	8	

0%	57	38	19	0	-20	-39	-59
2.67%	-17	-38	-59	-80	-102	-123	-144
5.33%	-120	-141	-162	-184	-205	-226	-247
8.00%	-252	-270	-289	-308	-328	-348	-368
KR4201Q23107                      2020-02 콜310							648
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	227	220	210	199	185	168	150
-5.33%	210	196	180	161	140	116	92
-2.67%	172	149	124	97	68	39	8
0%	100	68	34	0	-35	-71	-107
2.67%	-20	-59	-97	-136	-175	-214	-254
5.33%	-195	-235	-275	-315	-355	-395	-435
8.00%	-423	-459	-496	-534	-571	-610	-648
KR4301Q22925                      2020-02 풋292.5							43
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	41	41	41	42	42	42	43
-5.33%	22	23	23	24	24	25	26
-2.67%	7	8	8	9	10	11	12
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-6	-6	-5	-5	-4	-3	-3
5.33%	-7	-7	-7	-6	-6	-6	-5
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-6
KR4301Q22958                      2020-02 풋295							142
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	139	139	140	140	141	141	142
-5.33%	79	80	82	83	84	86	88
-2.67%	27	29	32	34	37	40	42
0%	-9	-6	-3	0	3	6	9
2.67%	-24	-23	-21	-19	-16	-14	-12
5.33%	-28	-28	-27	-26	-25	-24	-22
8.00%	-29	-29	-29	-29	-28	-28	-27

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

(단위:백만원)

1,610

공시일	2020-01-13
기준일	2020-01-10

## 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	204,959	0	204,959	

### 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	2020-01-13
기준일	2020-01-10

## 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	213,937	0	213,937	

### 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	2020-01-13
기준일	2020-01-10

## 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	527,997	0	527,997	
누계	통화	선도	0	514,572	-514,572	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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	4,738
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	186
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,787
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,787
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,323
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,508
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	1,617
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	1,524
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	929
FX21019Z02 KRW/USD 16-01-20E	1,672
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	3,716
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,858
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,988
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	186
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	186
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	1,115
IE00BD8RGM75	*
IE00BHNZKL13	*

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

13,568



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

(단위:백만원)

212

공시일	2020-01-13
기준일	2020-01-10

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

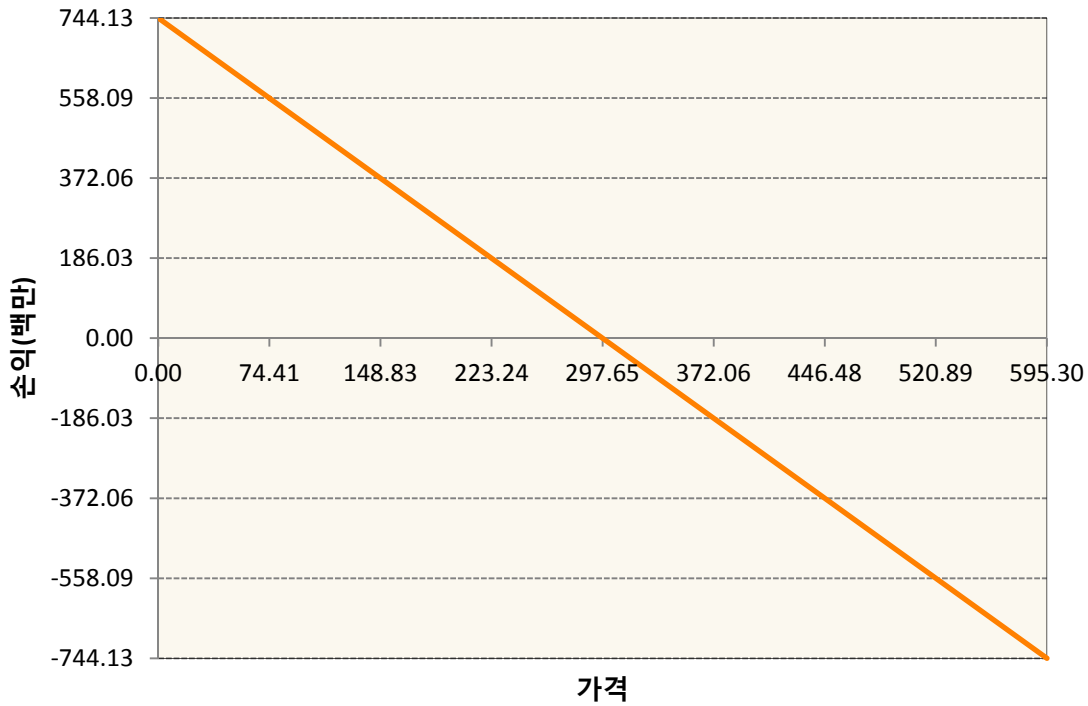
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

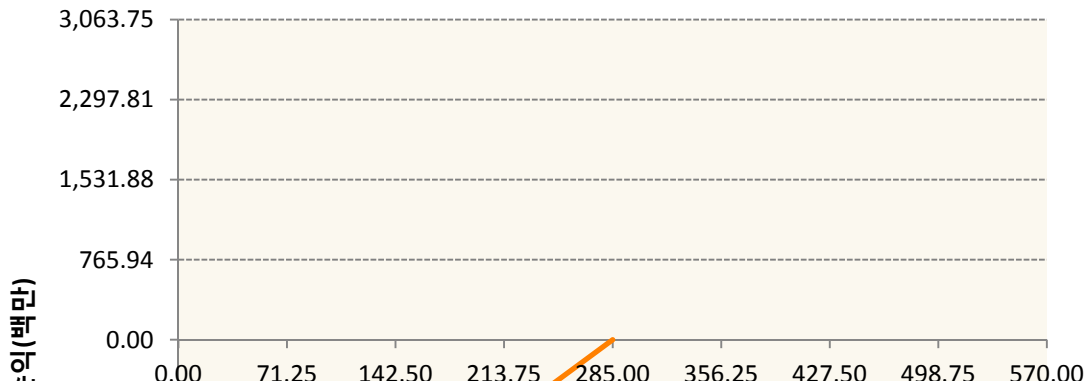
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	1,368	-1,368	장내
누계	유가증권	선물	0	744	-744	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,926	-3,926	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

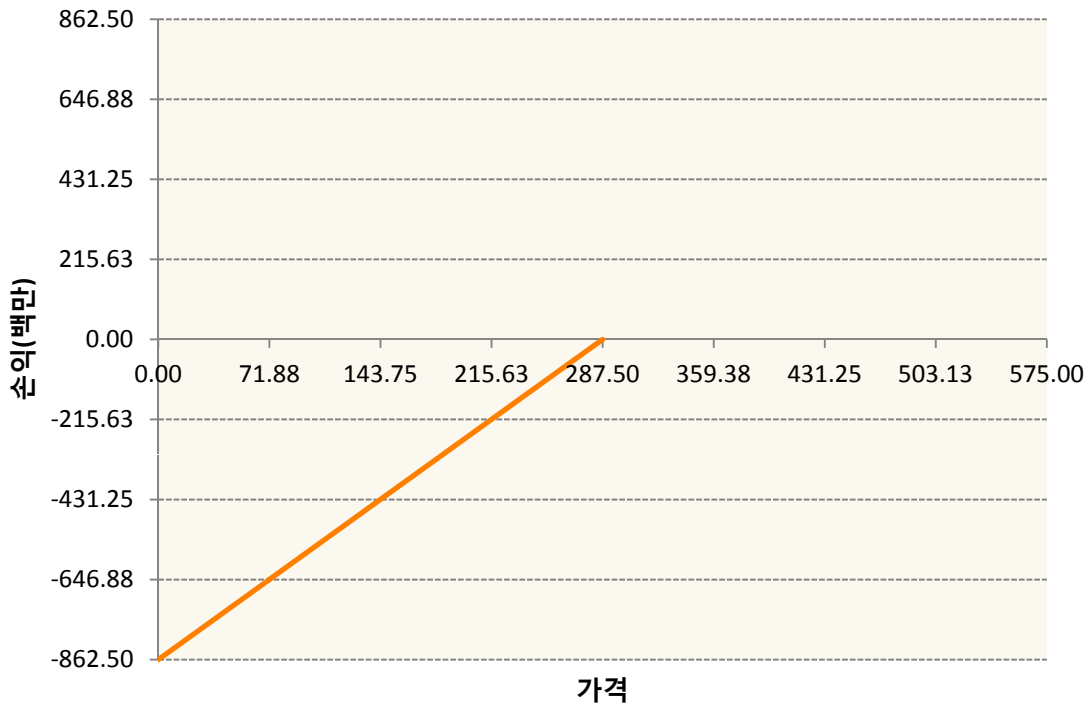


KR4301Q22859-2020-02 풋285





KR4301Q22875-2020-02 풋287.5



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%	40	40	40	40	40	40	40	
-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%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40	
8.00%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59	
KR4301Q22859		2020-02 풋285						133
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-120	-121	-123	-125	-128	-130	-133
-5.33%	-51	-54	-58	-62	-66	-70	-73
-2.67%	-9	-13	-17	-20	-24	-28	-32
0%	6	4	2	0	-3	-5	-8
2.67%	9	9	8	7	6	5	3
5.33%	10	10	9	9	9	8	8
8.00%	10	10	10	10	10	9	9
KR4301Q22875                      2020-02 풋287.5							42
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-39	-39	-40	-40	-41	-41	-42
-5.33%	-18	-19	-20	-21	-22	-23	-24
-2.67%	-4	-5	-6	-7	-9	-10	-11
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	4	4	3	3	3	2	1
5.33%	4	4	4	4	4	3	3
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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

(단위:백만원)

**184**

공시일	2020-01-13
기준일	2020-01-10

## H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	351	-351	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	13,211	0	13,211	
누계	통화	선도	941	16,258	-15,318	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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
FX21020F00! KRW/USD 13-02-20E	124
FX21020F00! KRW/USD 14-01-20E	28
IE00BD8RGM75	

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

<b>453</b>
------------

공시일	2020-01-13
기준일	2020-01-10

## 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	2,009	0	2,009	장외
누계	통화	선도	310	735	-426	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	36
2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	18
2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	24
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
FX21020F00 KRW/EUR 27-03-20E	6
FX21020F00 KRW/EUR 27-03-20E	6
FX21020F01 KRW/EUR 27-03-20E	6

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

(단위:백만원)

143

공시일	2020-01-13
기준일	2020-01-10

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

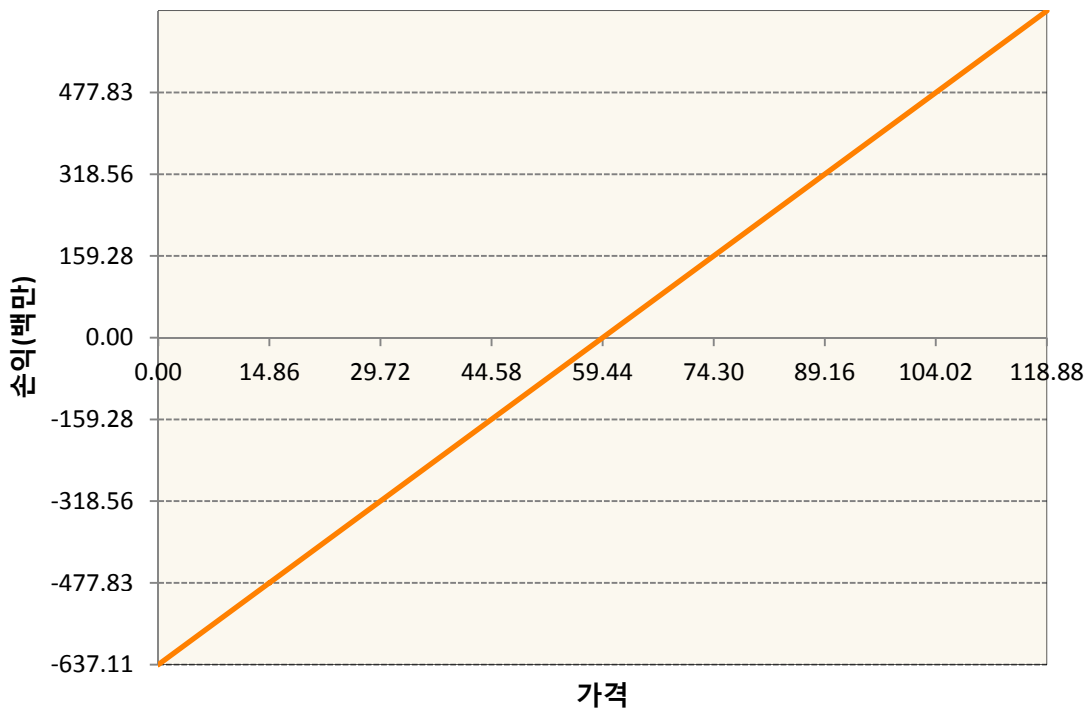
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

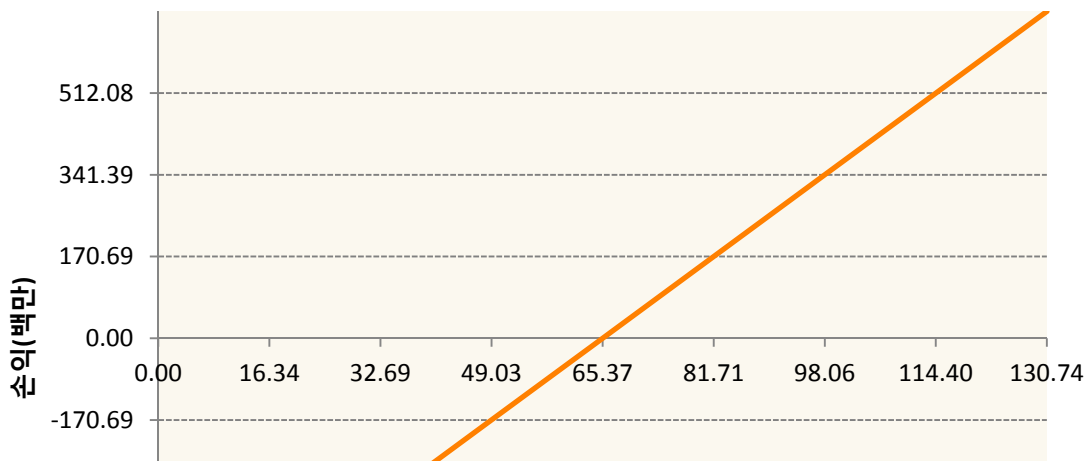
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,463	290	2,173	

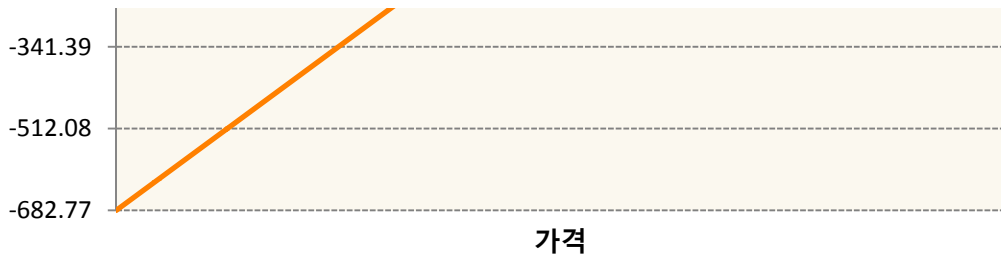
### 2. 만기시점의 손익구조

CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20

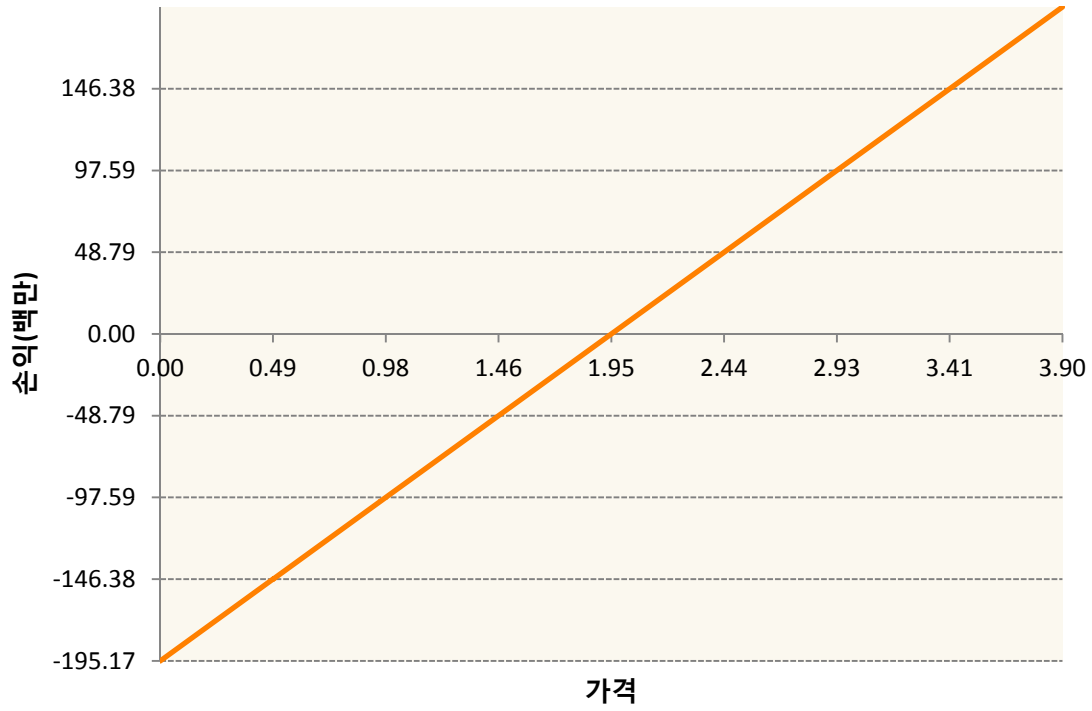


COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20

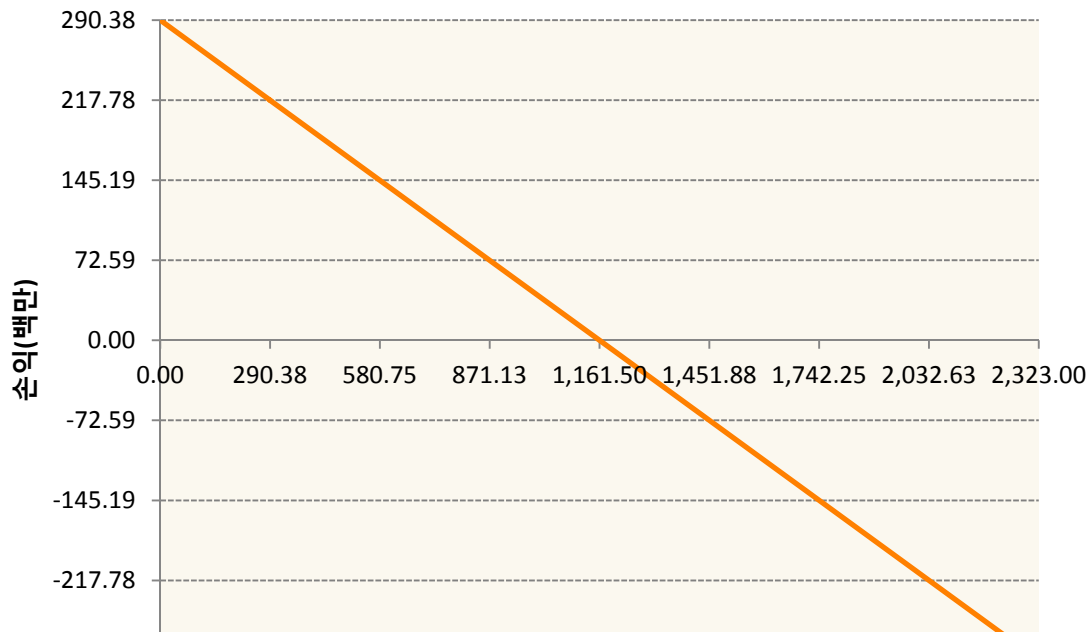


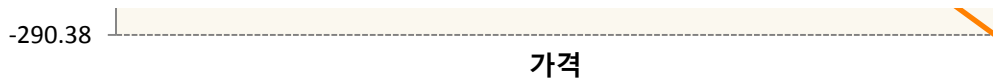


**HOH0-NY Harb ULSD Fut Mar20**

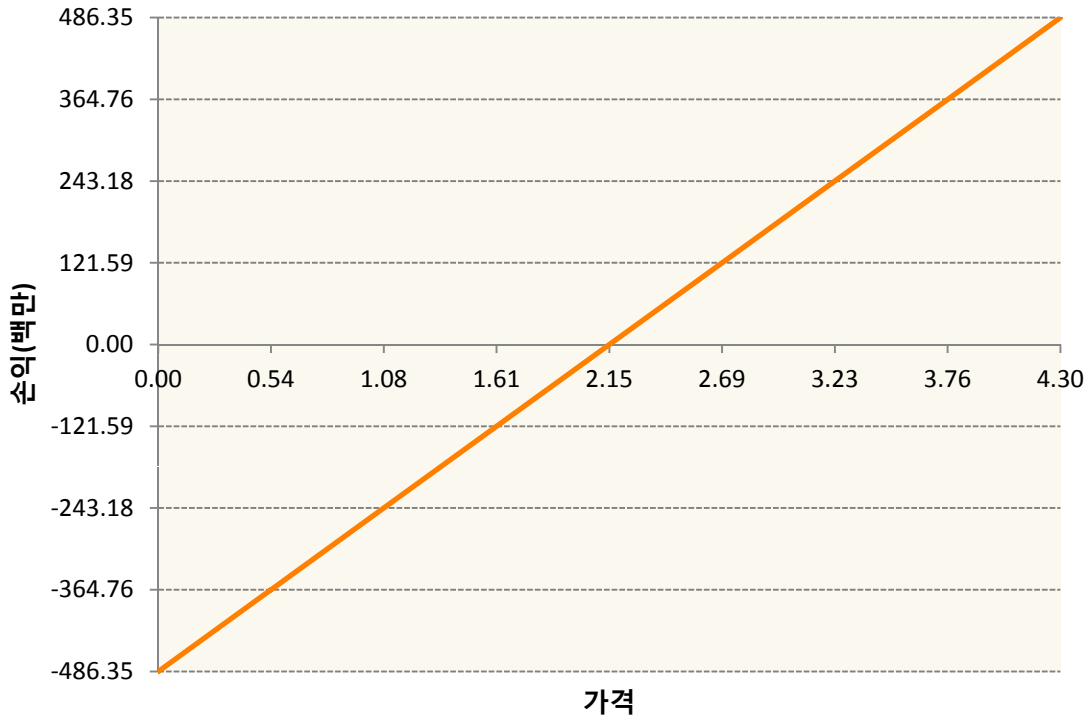


**KR4175Q10001-2020-01 달러선물**

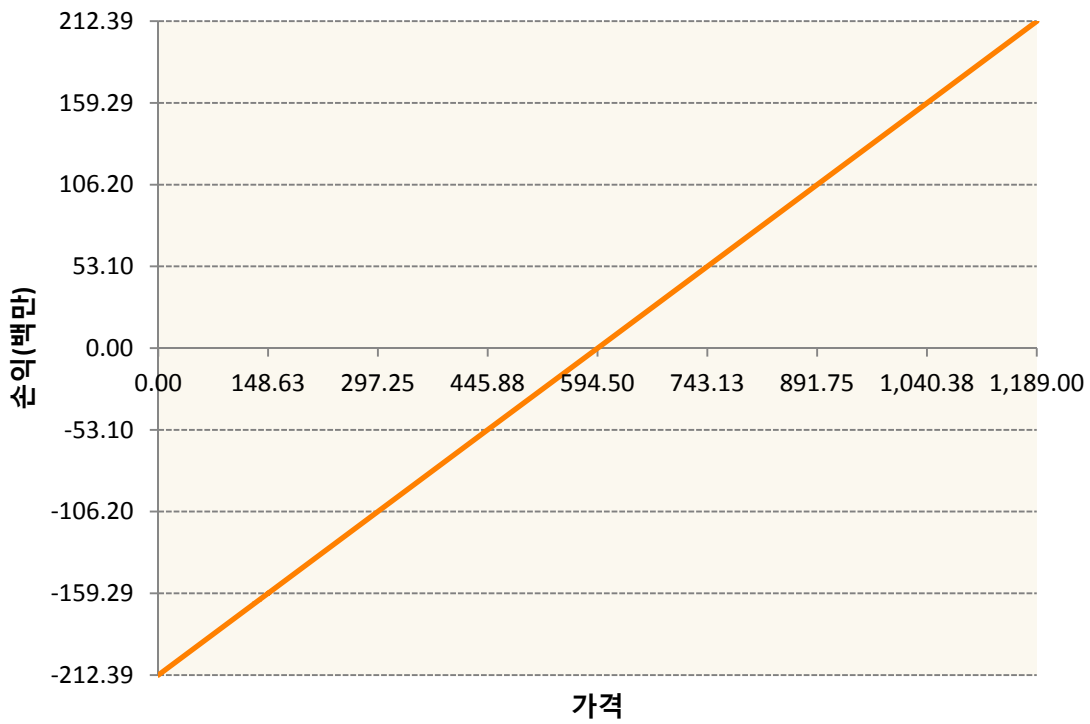


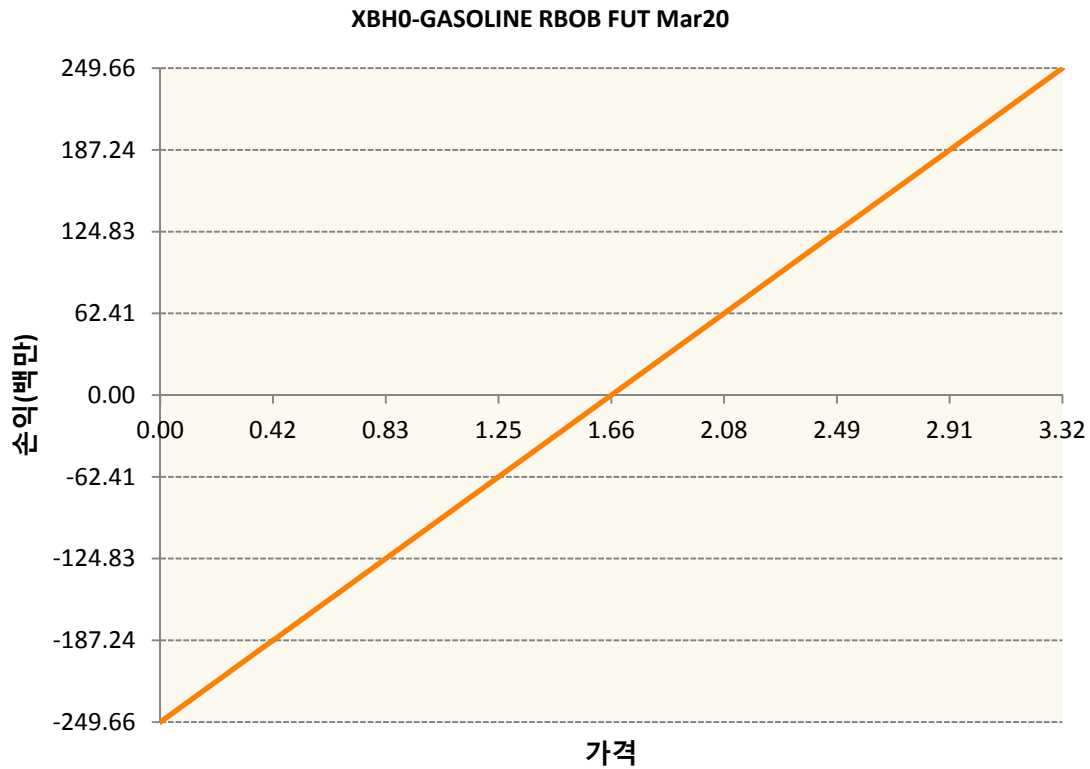


NGH20-NATURAL GAS FUTR Mar20



QSH0-Low Su Gasoil G Mar20





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

CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	51
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)

**382**

공시일	2020-01-13
기준일	2020-01-10

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

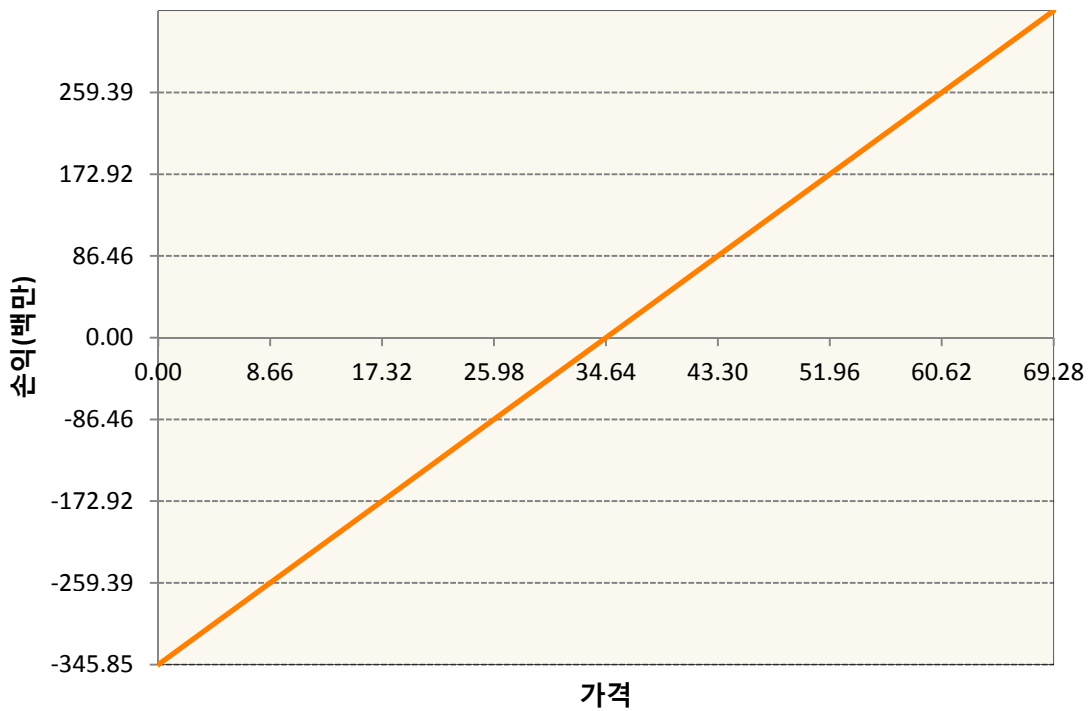
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

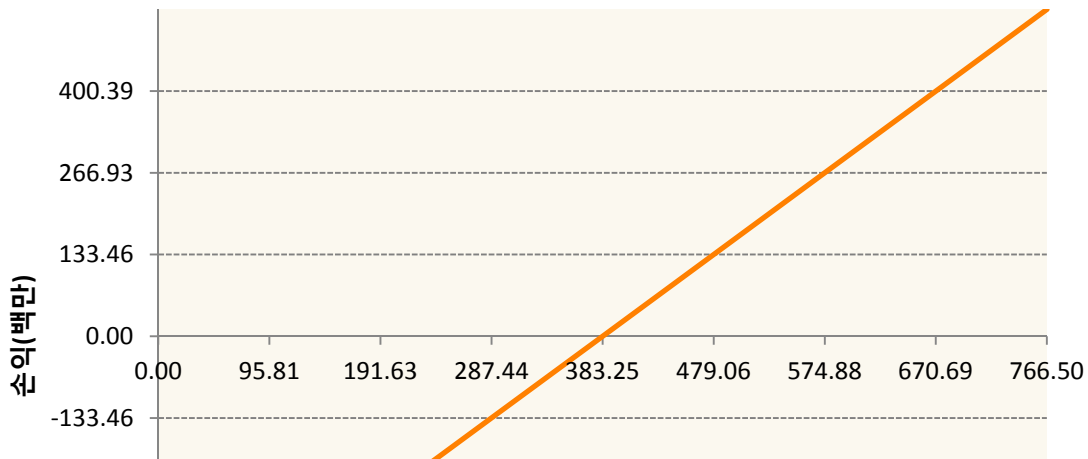
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,842	151	2,691	

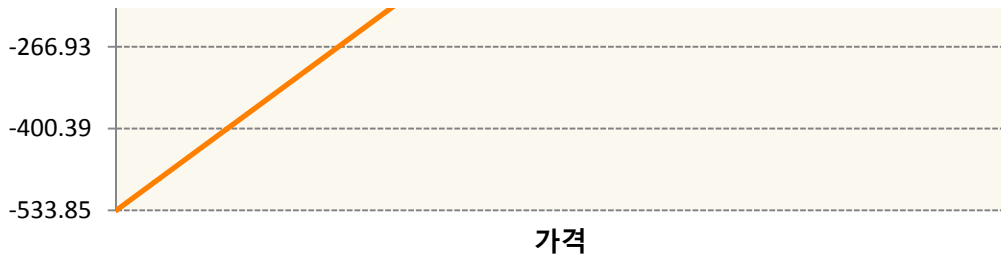
### 2. 만기시점의 손익구조

BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20

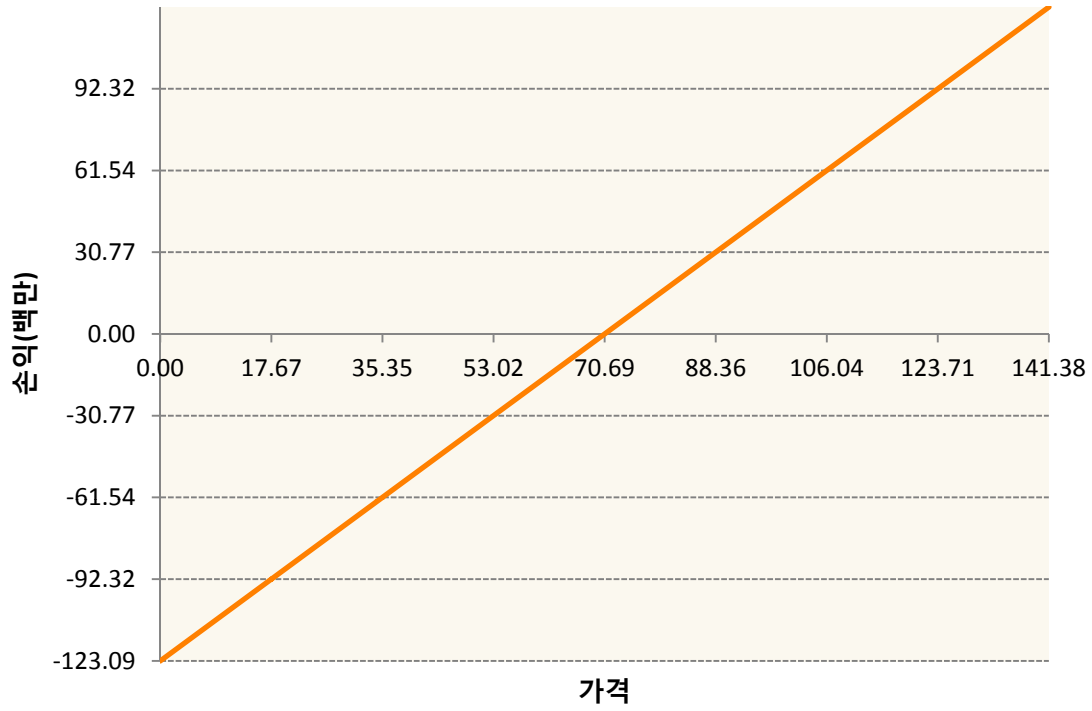


CH0-CORN FUTURE Mar20

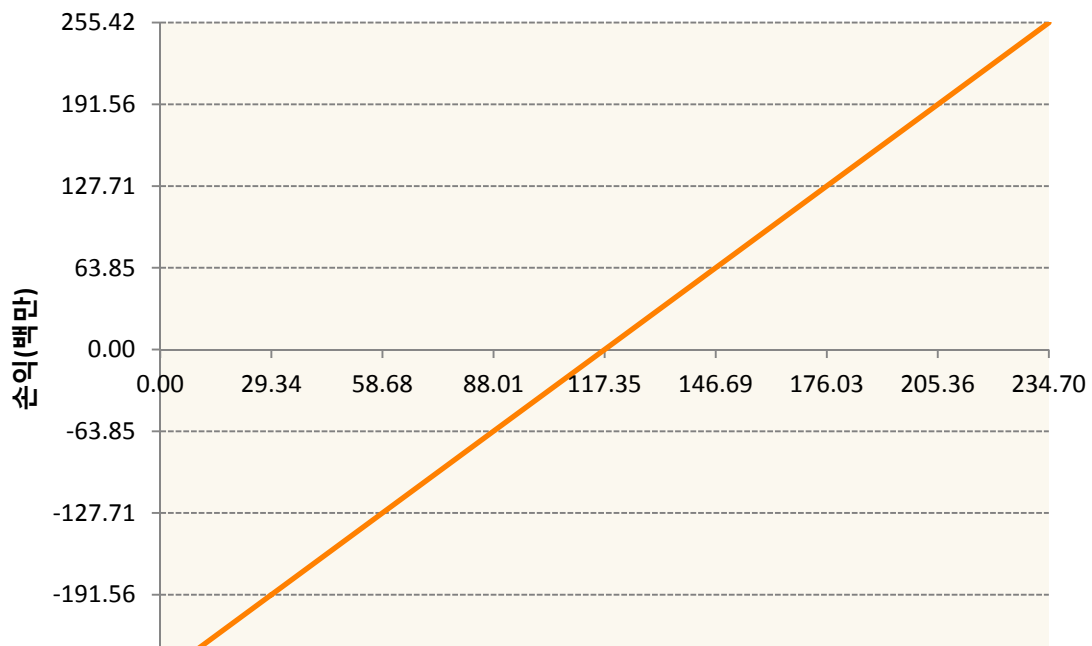


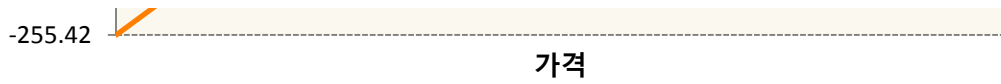


CTH0-COTTON NO.2 FUTR Mar20

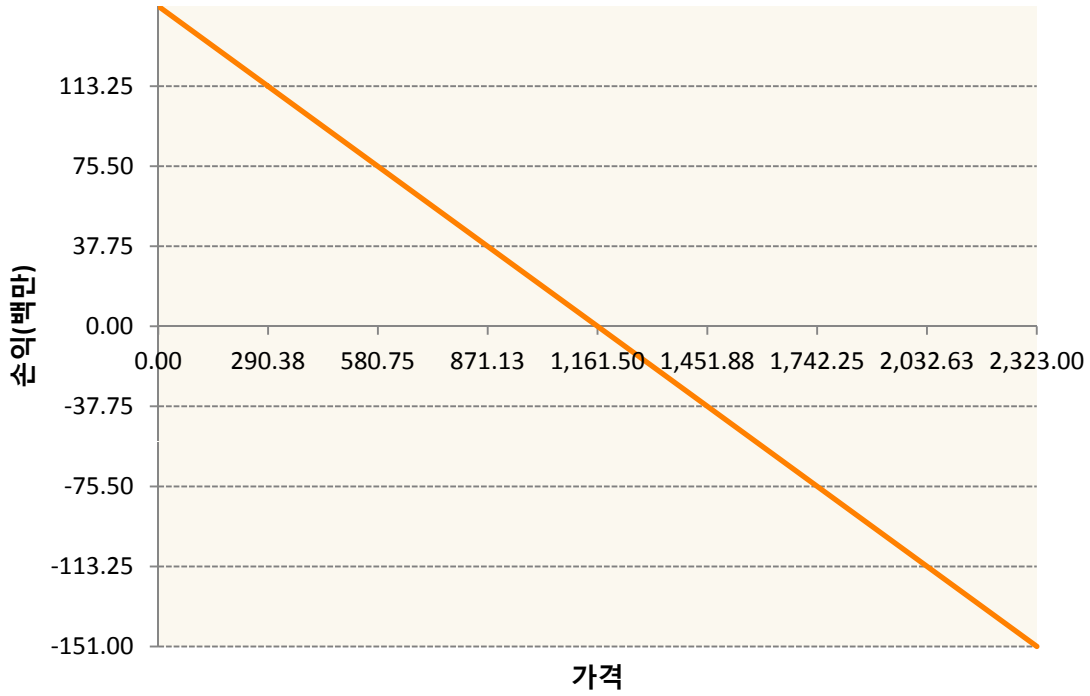


KCH0-COFFEE 'C' FUTURE Mar20

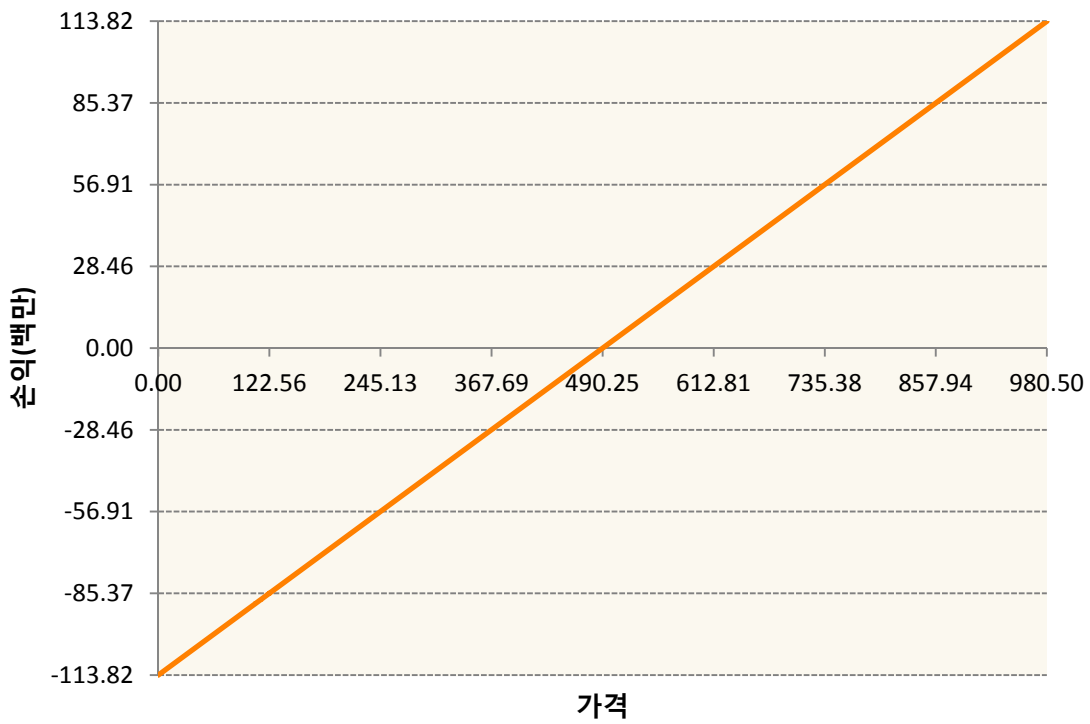




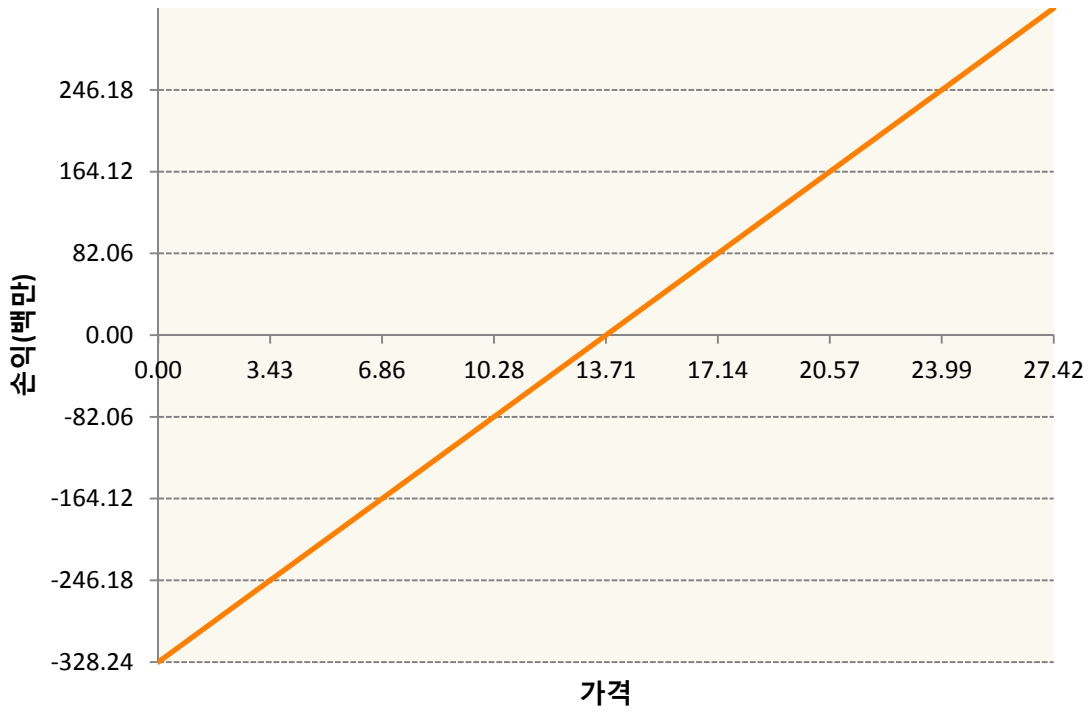
KR4175Q10001-2020-01 달러선물



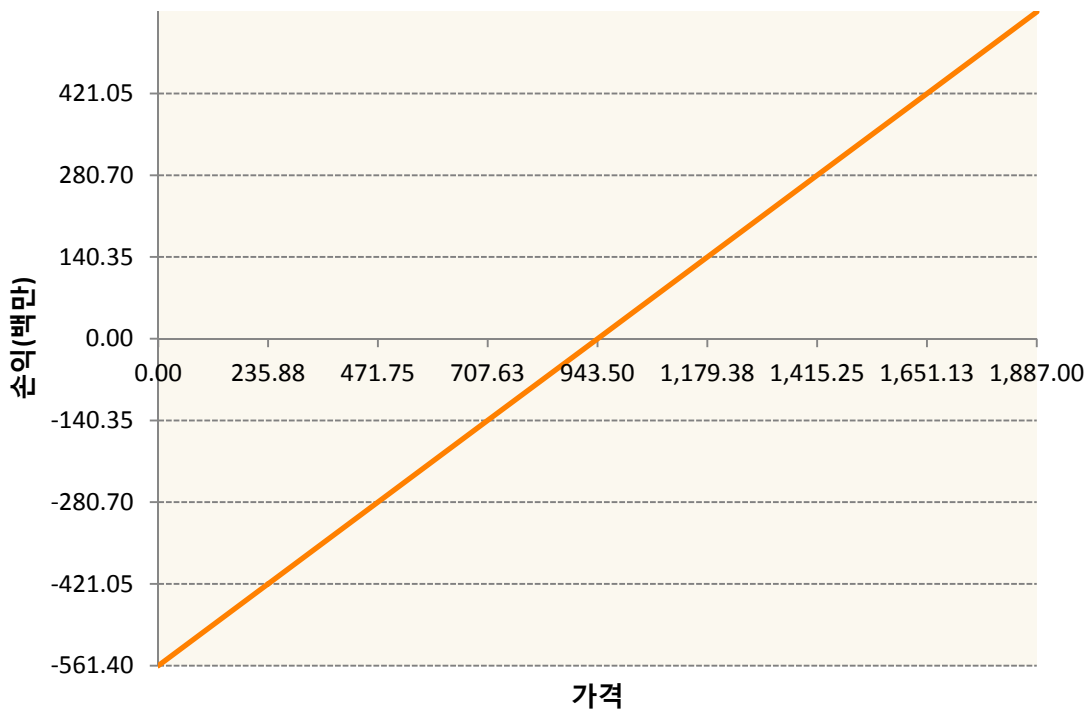
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



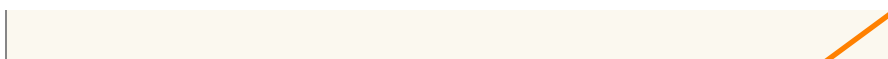
SBH0-Sugar Mar20

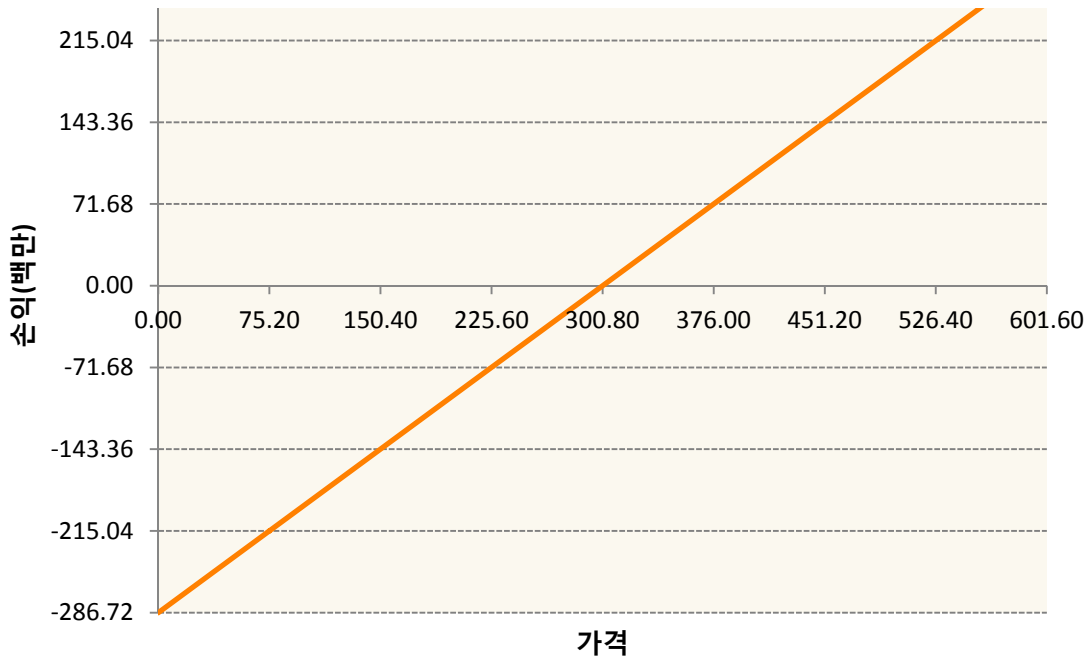


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20

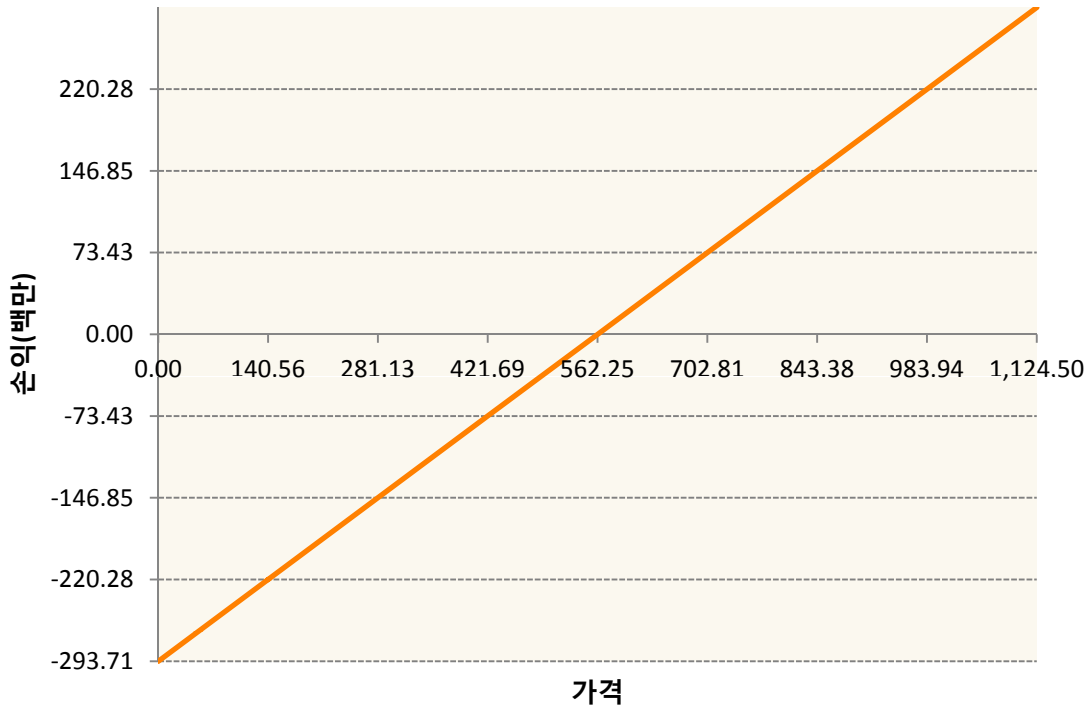


SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





WHO-WHEAT FUTURE(CBT) 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	20
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)

**248**