

공시일	2020-01-14
기준일	2020-01-13

## 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	2020-01-14
기준일	2020-01-13

## 스마트인덱스모

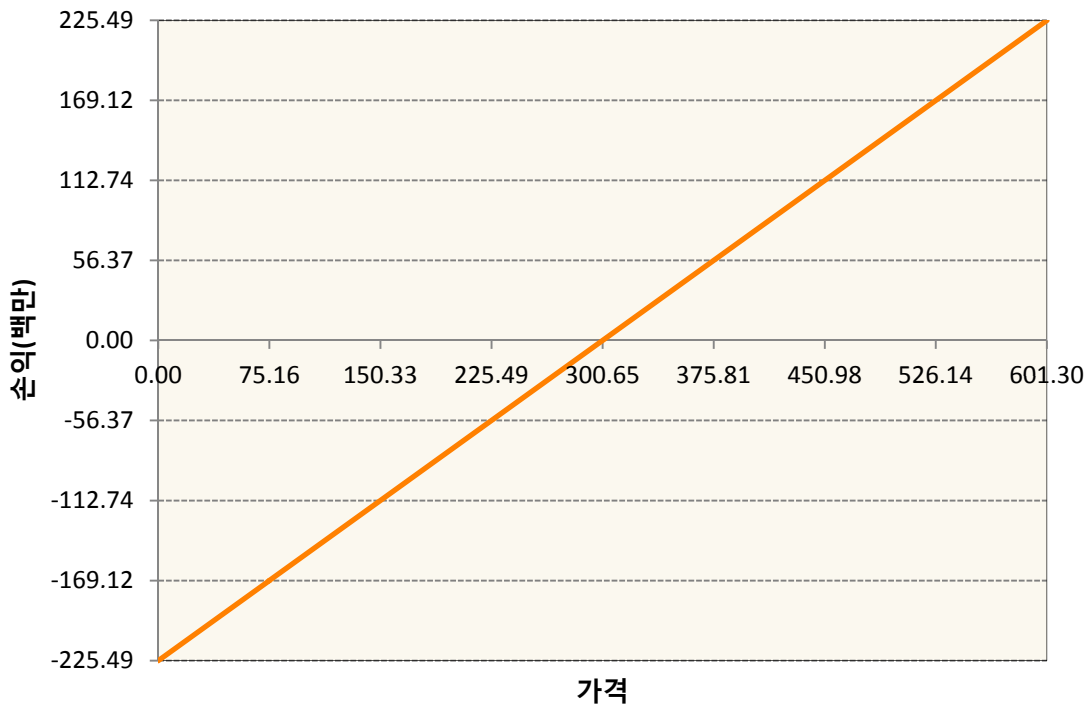
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	225	0	225	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						18
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
-5.33%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12	
-2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	6	6	6	6	6	6	6	
5.33%	12	12	12	12	12	12	12	
8.00%	18	18	18	18	18	18	18	

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

(단위:백만원)

14

공시일	2020-01-14
기준일	2020-01-13

## 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

1,138

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

651

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-14
기준일	2020-01-13

## 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)	432
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	158

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

**820**

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-14
기준일	2020-01-13

## 유로인덱스모(주식-파생형)

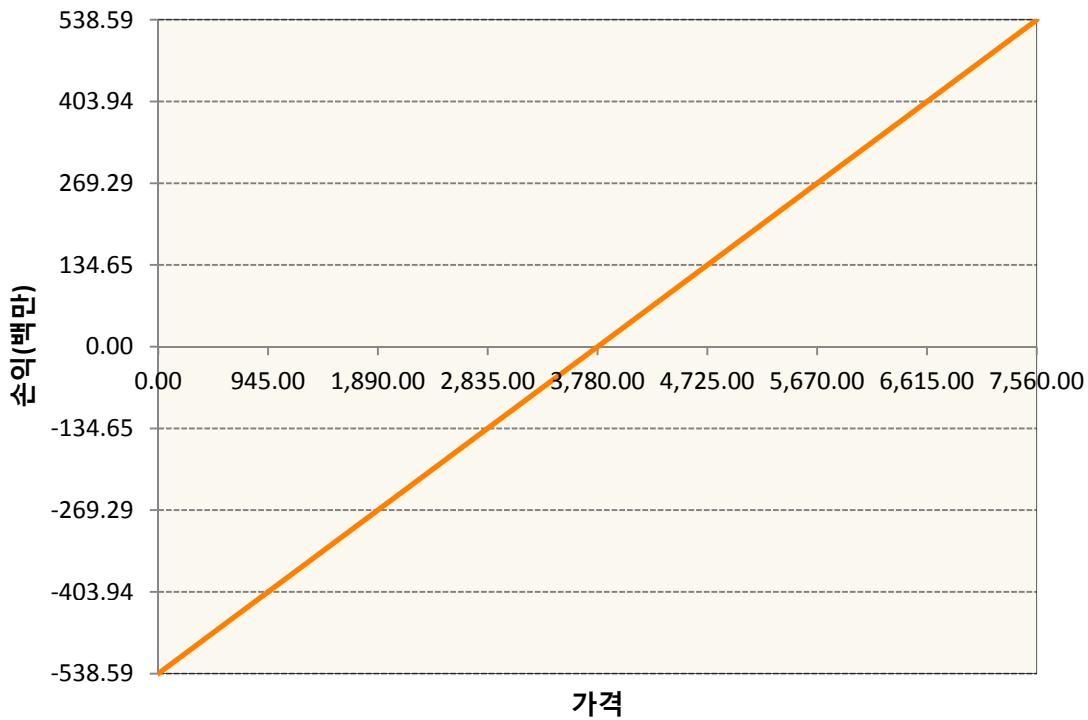
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	539	0	539	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGH0-EURO STOXX 50 Mar20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH0	EURO STOXX 50 Mar20	43
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

30
----

공시일	2020-01-14
기준일	2020-01-13

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

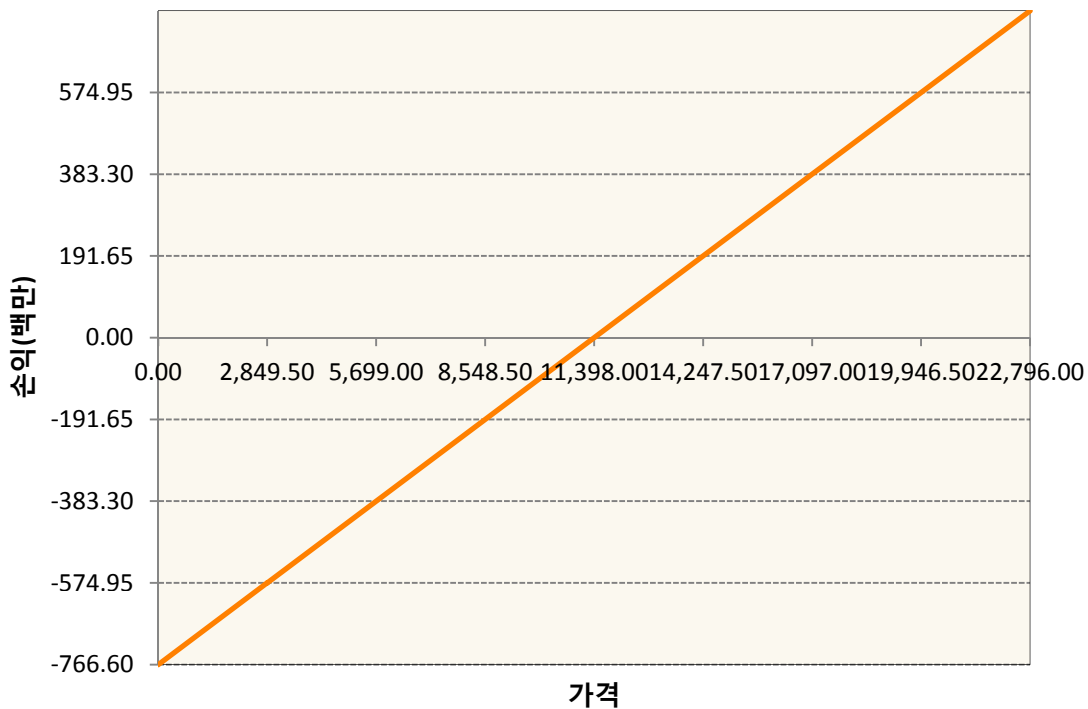
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	767	0	767	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)

54
----

공시일	2020-01-14
기준일	2020-01-13

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

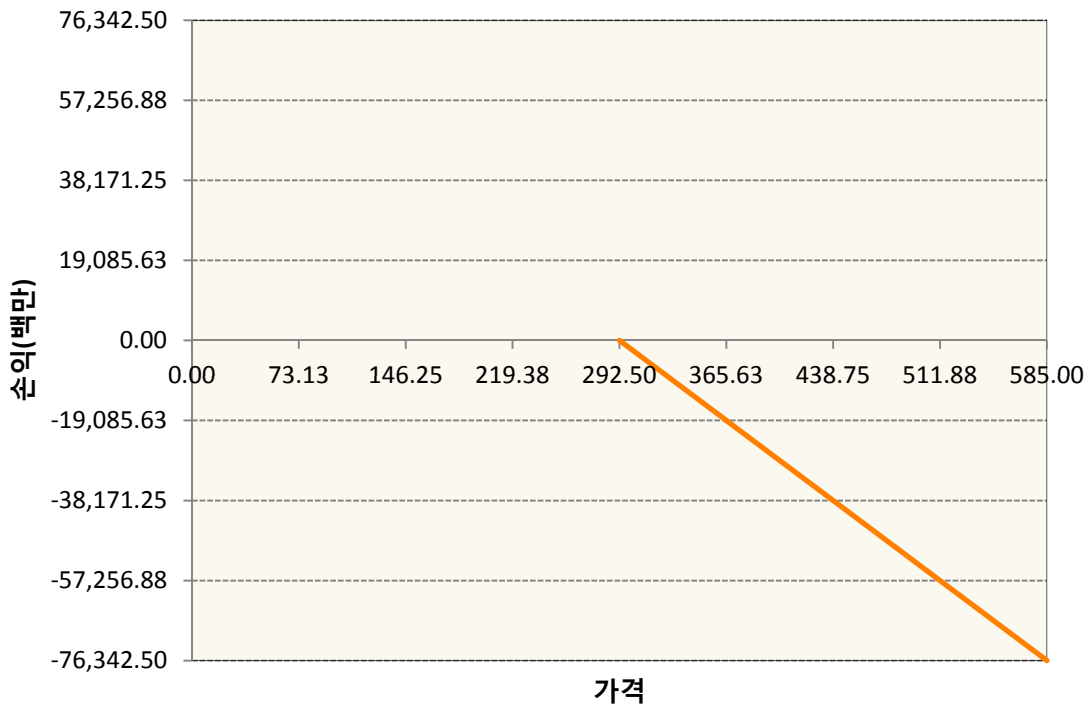
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

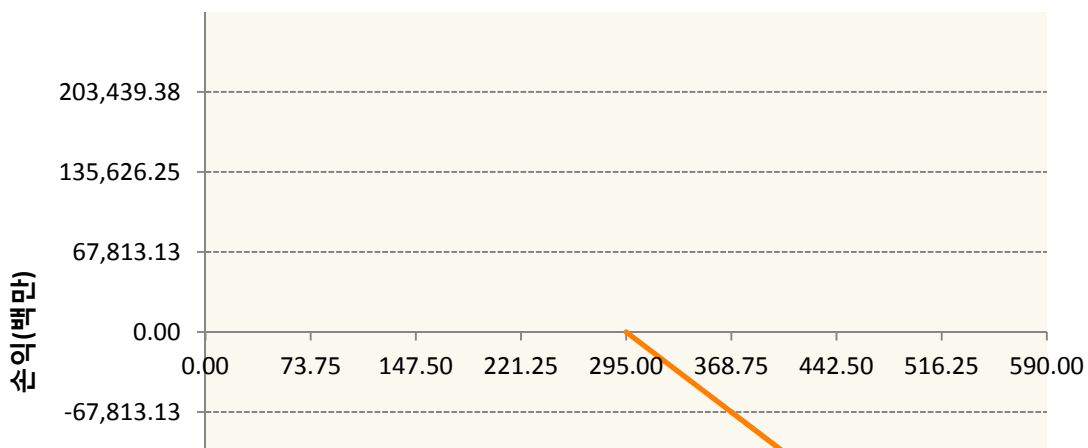
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	476,345	-476,345	장내

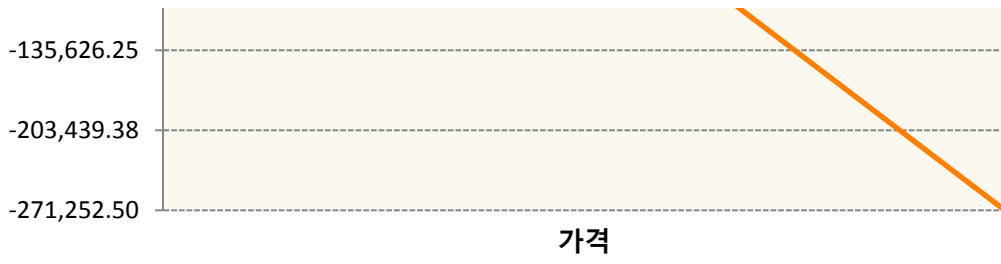
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q22927-2020-02 콜292.5

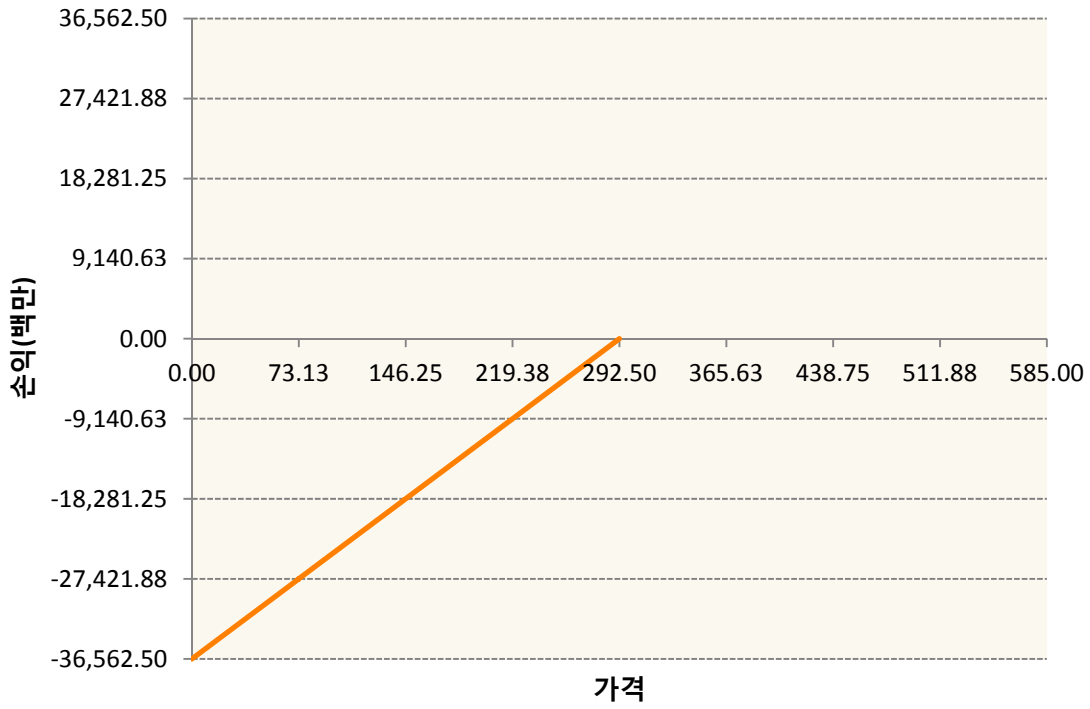


KR4201Q22950-2020-02 콜295

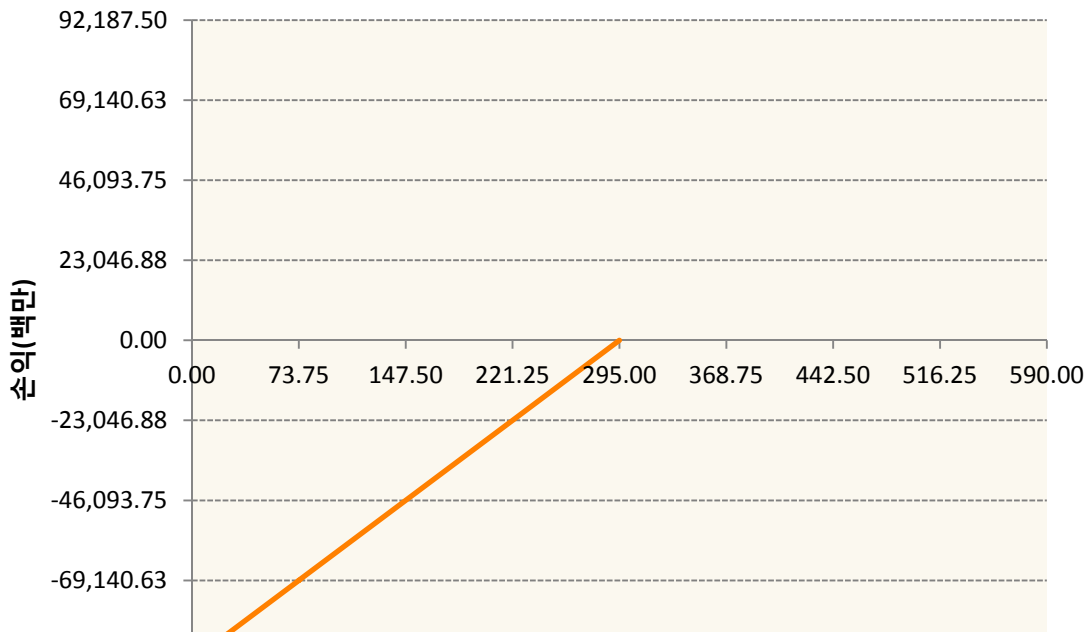




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



KR4301Q22958-2020-02 풋295



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q22927		2020-02 콜292.5						5,280
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,224	3,086	2,938	2,782	2,619	2,451	2,279	
-5.33%	2,695	2,507	2,317	2,124	1,928	1,732	1,534	
-2.67%	1,827	1,617	1,408	1,198	989	779	570	
0%	598	401	202	0	-203	-408	-613	
2.67%	-951	-1,109	-1,275	-1,449	-1,628	-1,812	-2,000	
5.33%	-2,739	-2,847	-2,970	-3,105	-3,251	-3,405	-3,566	
8.00%	-4,679	-4,744	-4,825	-4,920	-5,029	-5,149	-5,280	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						18,073
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	10,363	9,931	9,456	8,948	8,412	7,852	7,274	
-5.33%	8,801	8,182	7,543	6,890	6,225	5,552	4,871	
-2.67%	6,128	5,395	4,660	3,924	3,188	2,451	1,713	
0%	2,192	1,465	734	0	-737	-1,476	-2,216	
2.67%	-2,930	-3,542	-4,178	-4,833	-5,504	-6,187	-6,880	
5.33%	-8,987	-9,430	-9,919	-10,447	-11,006	-11,592	-12,200	
8.00%	-15,670	-15,949	-16,285	-16,672	-17,102	-17,571	-18,073	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						1,927
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,832	-1,840	-1,852	-1,867	-1,884	-1,904	-1,927	
-5.33%	-914	-945	-978	-1,013	-1,050	-1,088	-1,127	
-2.67%	-230	-278	-326	-374	-422	-470	-518	
0%	110	76	39	0	-40	-81	-123	
2.67%	210	198	182	163	140	115	88	
5.33%	227	224	220	214	206	195	181	
8.00%	228	228	227	226	224	220	215	
KR4301Q22958		2020-02 풋295						5,283
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-5,111	-5,123	-5,142	-5,167	-5,199	-5,238	-5,283	
-5.33%	-2,731	-2,788	-2,854	-2,926	-3,004	-3,087	-3,174	
-2.67%	-793	-908	-1,023	-1,140	-1,257	-1,374	-1,492	
0%	324	218	110	0	-112	-225	-340	
2.67%	717	670	614	550	479	402	320	

5.33%	797	786	769	745	714	676	632
8.00%	806	804	801	795	786	772	754

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

(단위:백만원)

**29,285**

공시일	2020-01-14
기준일	2020-01-13

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

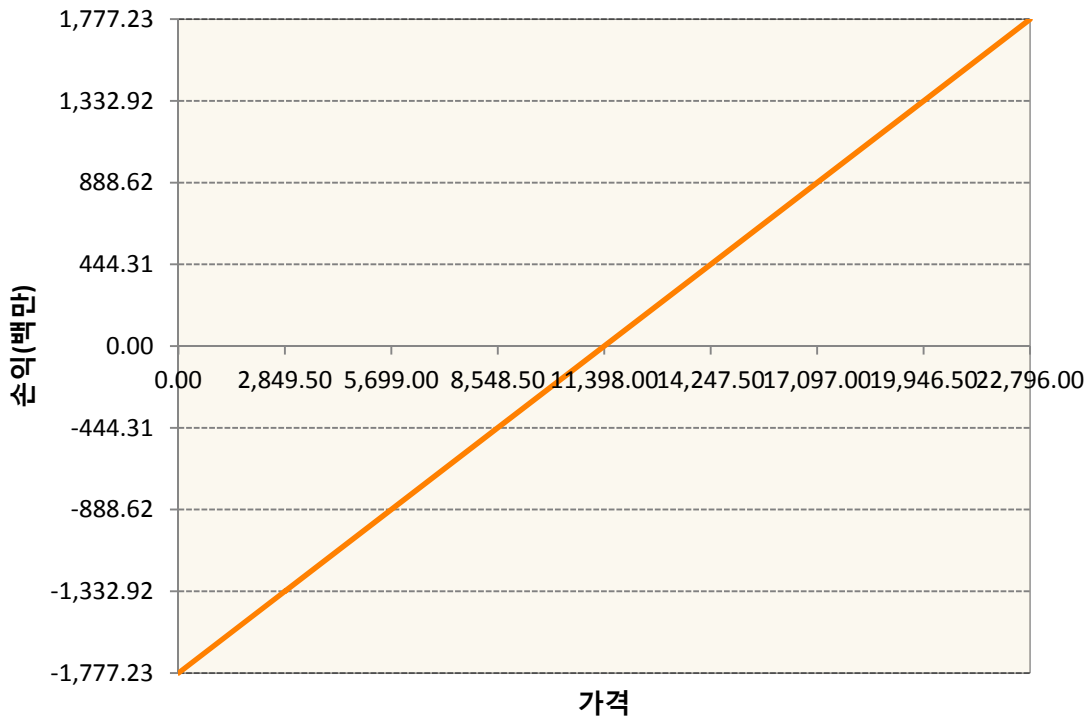
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

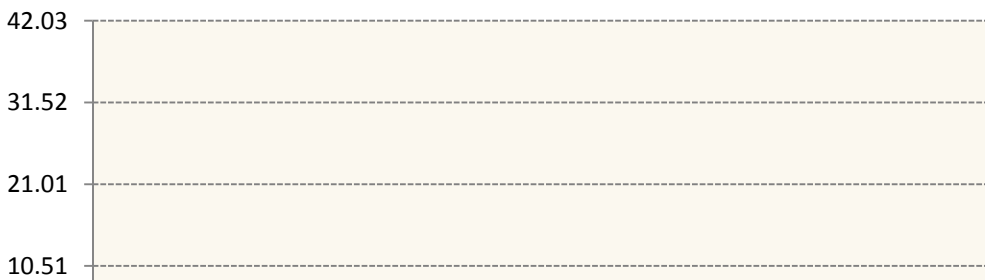
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,777	0	1,777	장내
누계	유가증권	옵션	0	71	-71	장내
누계	통화	선도	0	2,095	-2,095	장외

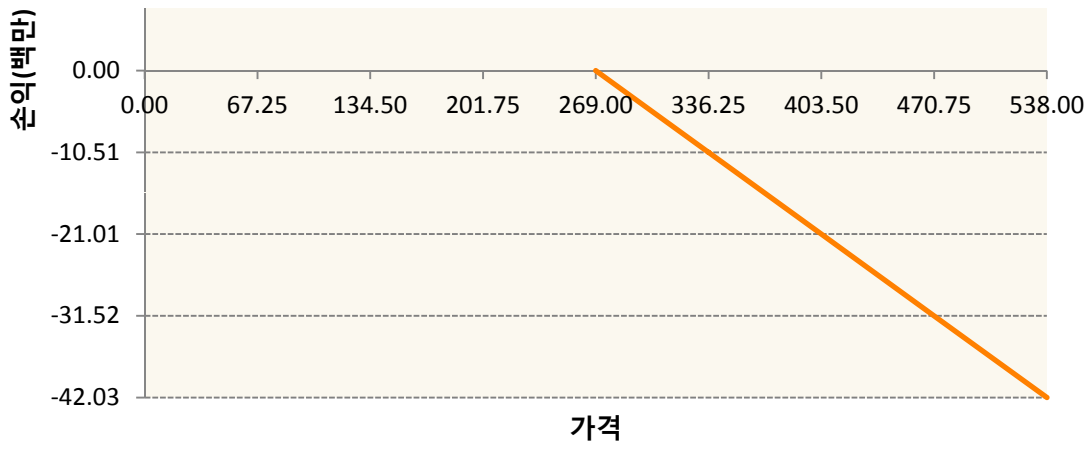
### 2. 만기시점의 손익구조

HCFO-HSCEI Futures Jan20

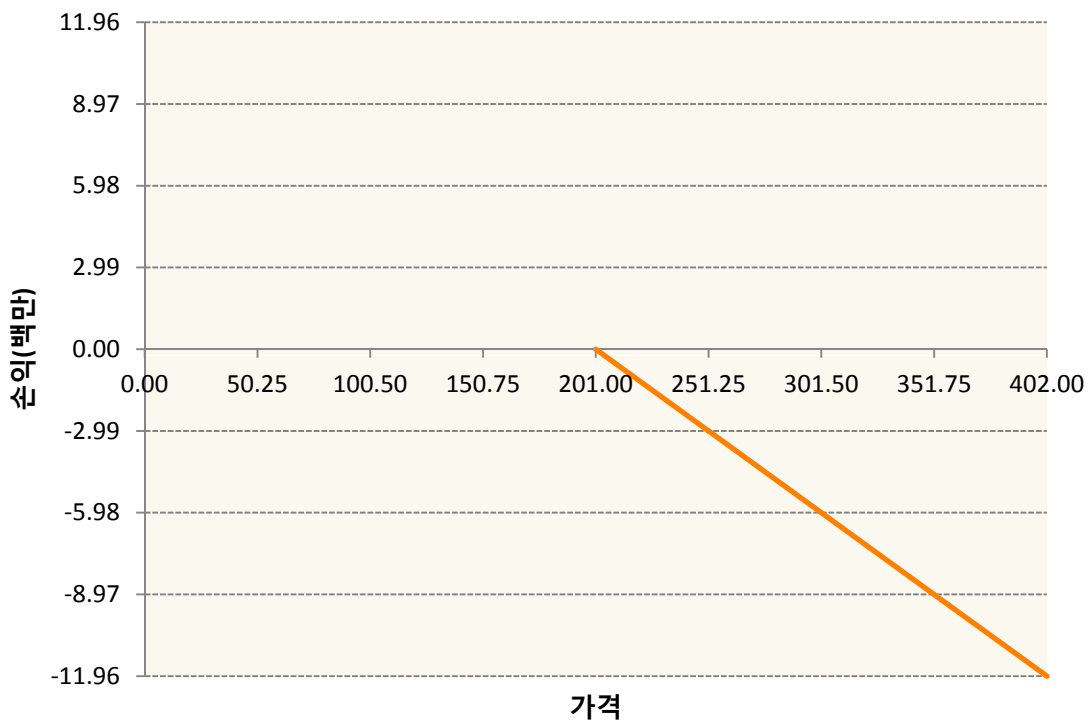


OHHIF0-C112-HSCEI

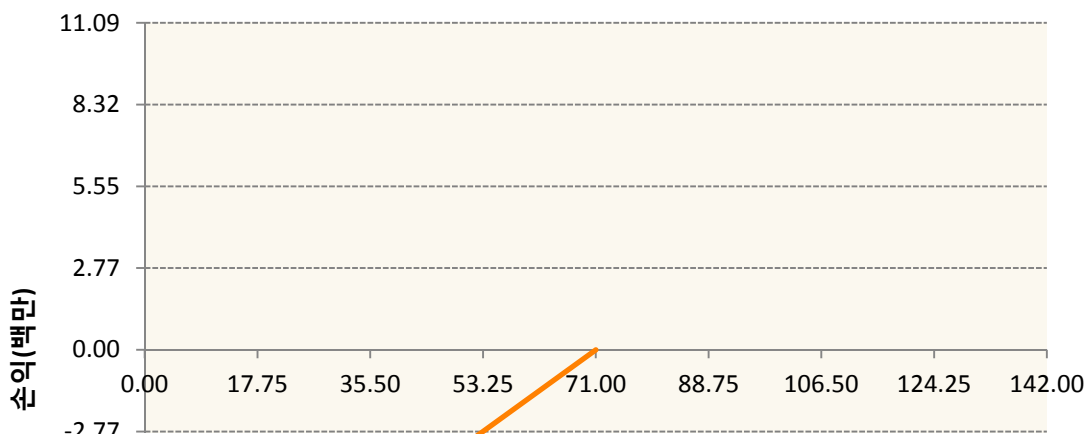


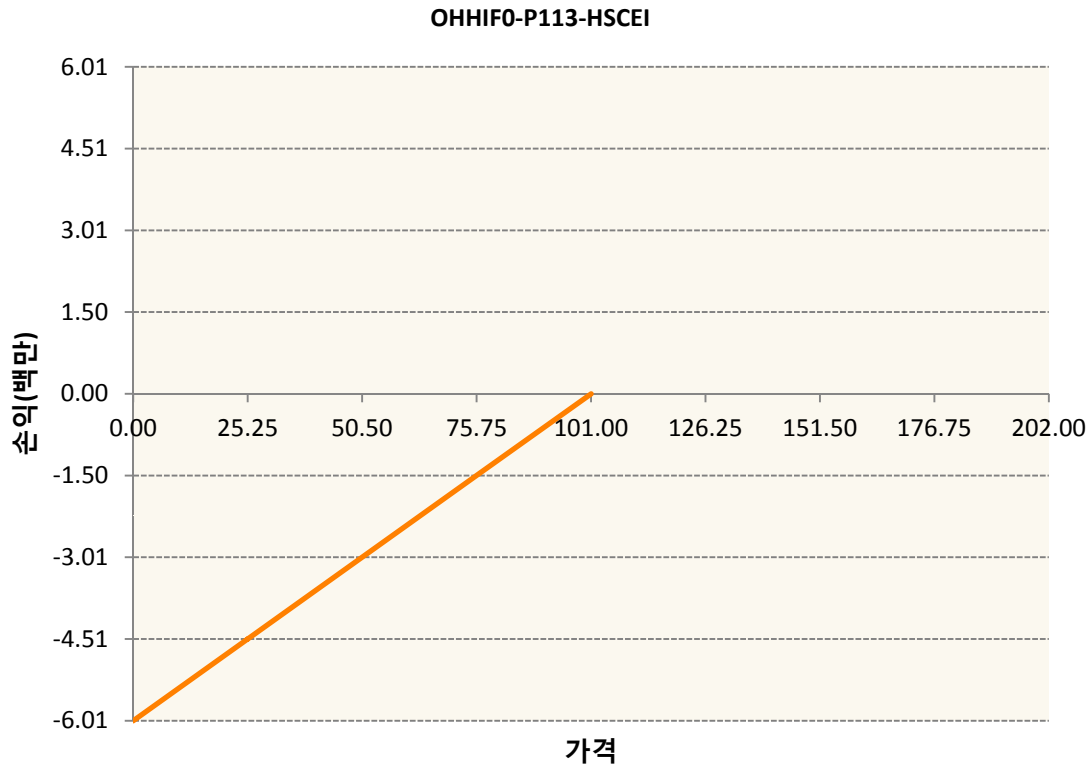
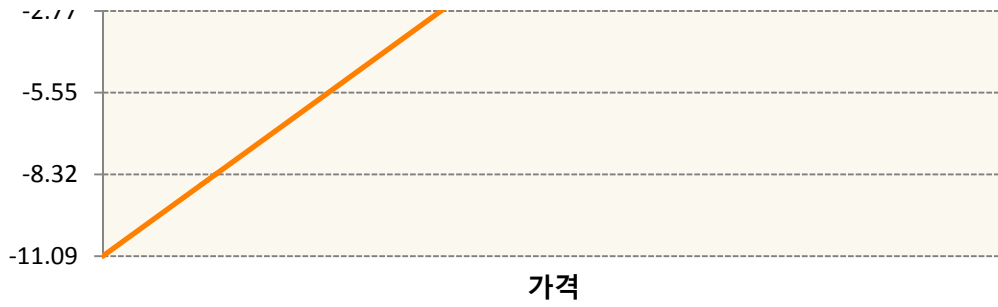


**OHHIF0-C113-HSCEI**



**OHHIF0-P112-HSCEI**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	168
HCF0 HSCEI Futures Jan20	142
OHHIF0-C11 HSCEI	3
OHHIF0-C11 HSCEI	1
OHHIF0-P11 HSCEI	1
OHHIF0-P11 HSCEI	0.5

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	185

공시일	2020-01-14
기준일	2020-01-13

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

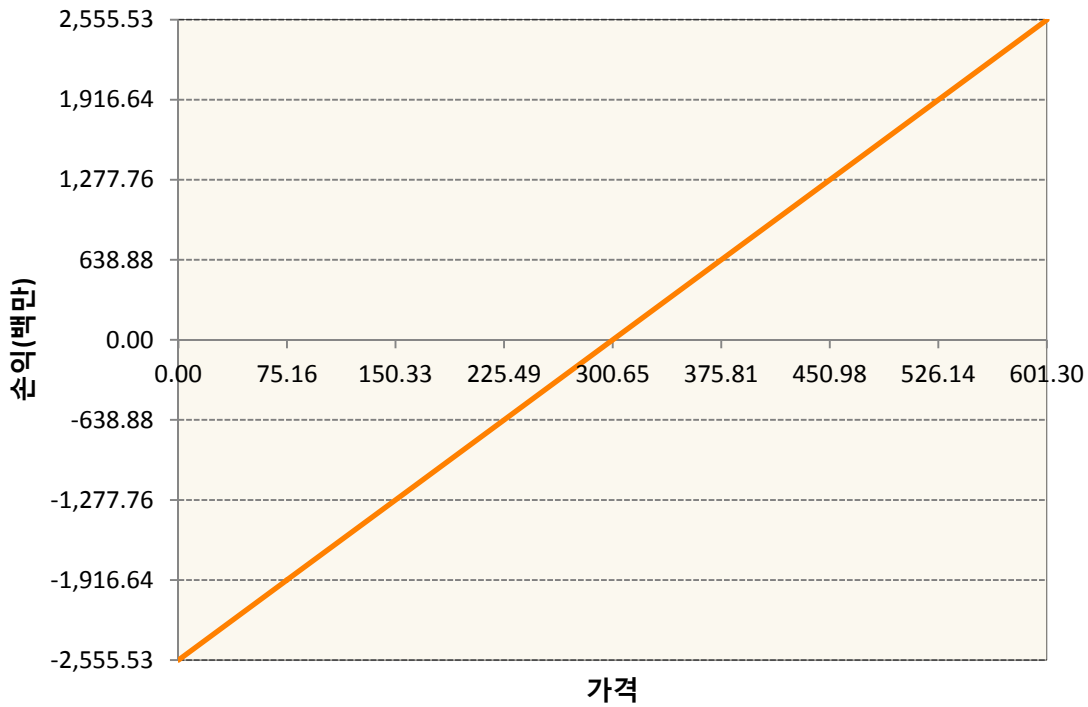
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

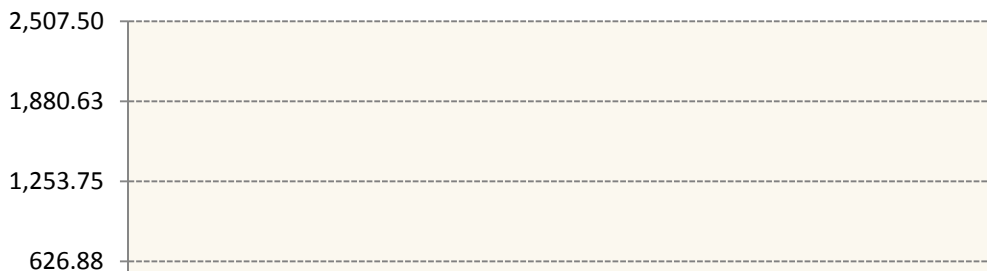
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,556	0	2,556	장내
누계	유가증권	스왑	4,625	0	4,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,858	-4,858	장내

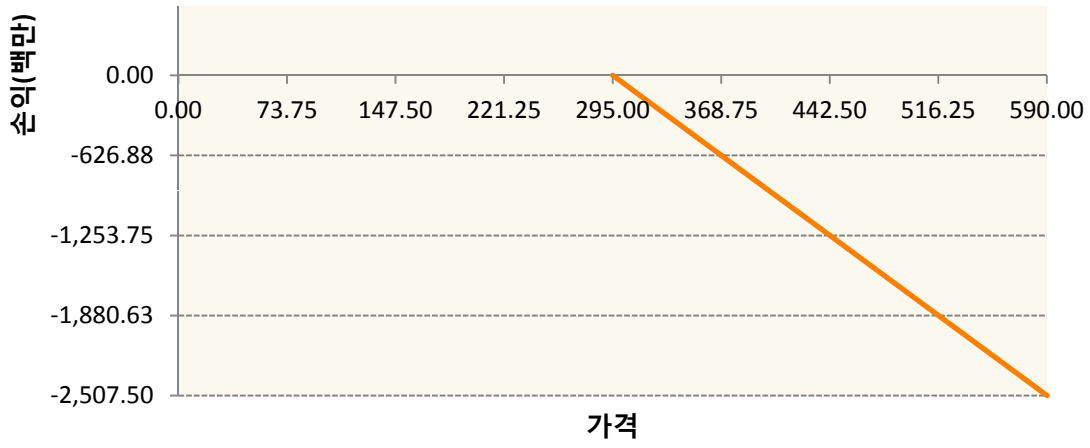
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

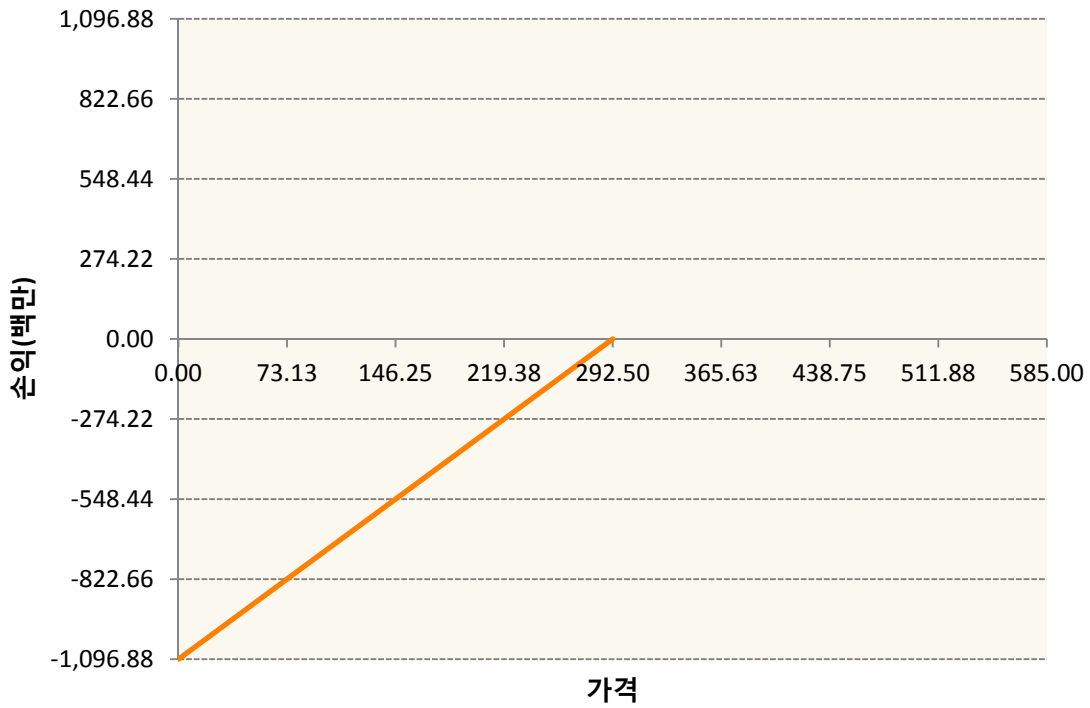


KR4201Q22950-2020-02 콜295

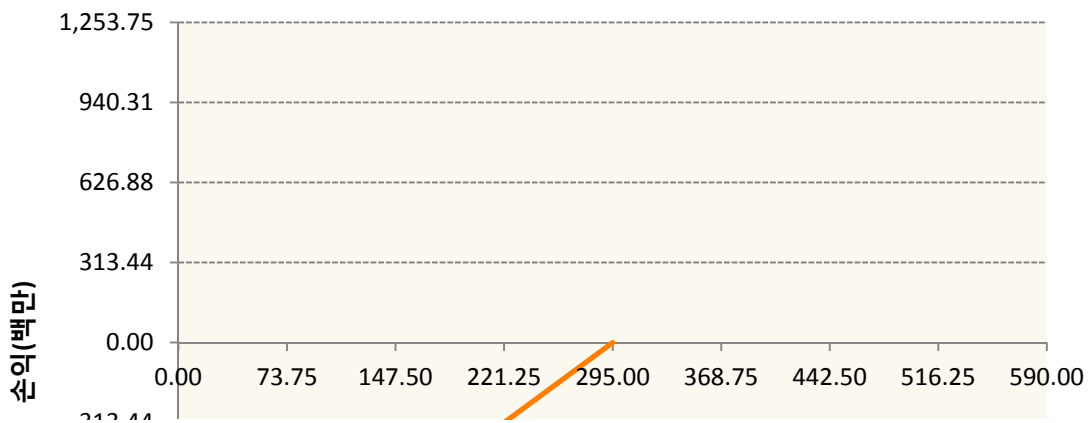




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



KR4301Q22958-2020-02 풋295





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						393
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-393	-393	-393	-393	-393	-393	-393	
-5.33%	-262	-262	-262	-262	-262	-262	-262	
-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%	262	262	262	262	262	262	262	
8.00%	393	393	393	393	393	393	393	
KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						204
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-204	-204	-204	-204	-204	-204	-204	
-5.33%	-136	-136	-136	-136	-136	-136	-136	
-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%	136	136	136	136	136	136	136	
8.00%	204	204	204	204	204	204	204	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						167
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	96	92	87	83	78	73	67	
-5.33%	81	76	70	64	58	51	45	
-2.67%	57	50	43	36	29	23	16	
0%	20	14	7	0	-7	-14	-20	
2.67%	-27	-33	-39	-45	-51	-57	-64	
5.33%	-83	-87	-92	-97	-102	-107	-113	
8.00%	-145	-147	-151	-154	-158	-162	-167	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						58
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-55	-55	-56	-56	-57	-57	-58
-5.33%	-27	-28	-29	-30	-31	-33	-34
-2.67%	-7	-8	-10	-11	-13	-14	-16
0%	3	2	1	0	-1	-2	-4
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							72
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-70	-70	-70	-70	-71	-71	-72
-5.33%	-37	-38	-39	-40	-41	-42	-43
-2.67%	-11	-12	-14	-15	-17	-19	-20
0%	4	3	1	0	-2	-3	-5
2.67%	10	9	8	7	7	5	4
5.33%	11	11	10	10	10	9	9
8.00%	11	11	11	11	11	11	10

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

(단위:백만원)

**836**

공시일	2020-01-14
기준일	2020-01-13

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

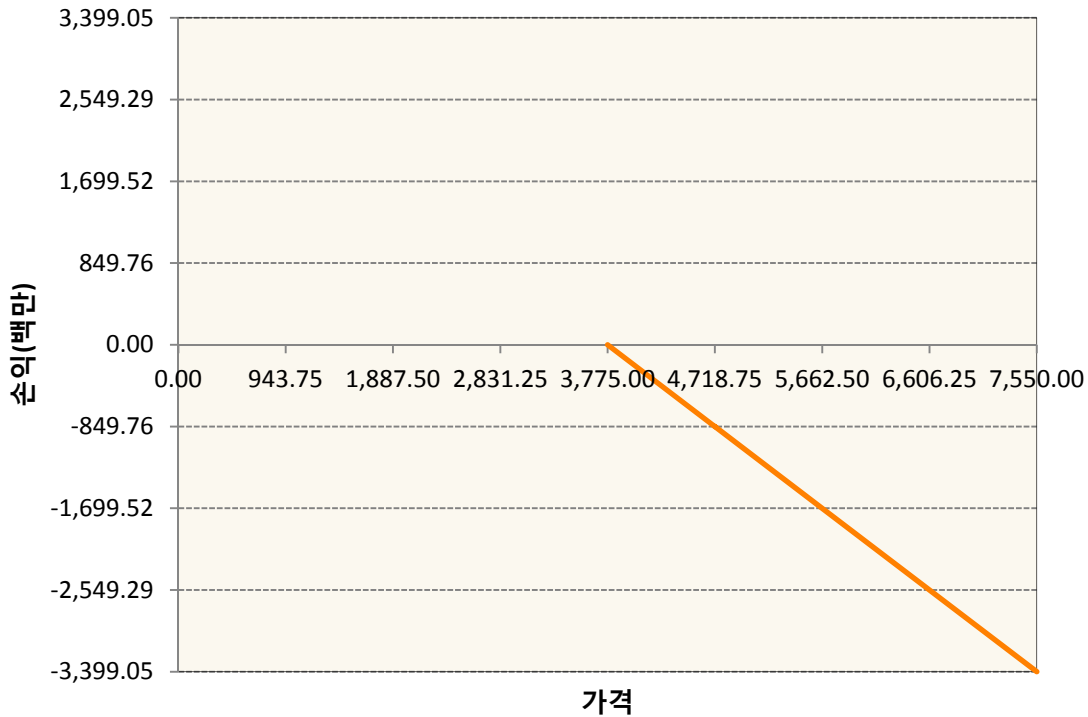
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

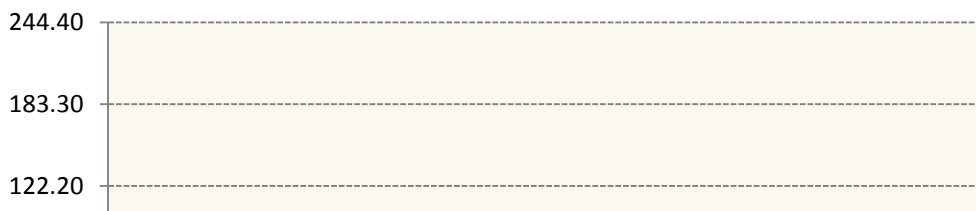
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	588	0	588	
누계	유가증권	스왑	15,623	0	15,623	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,287	-7,287	장내
누계	통화	선도	0	3,375	-3,375	장외

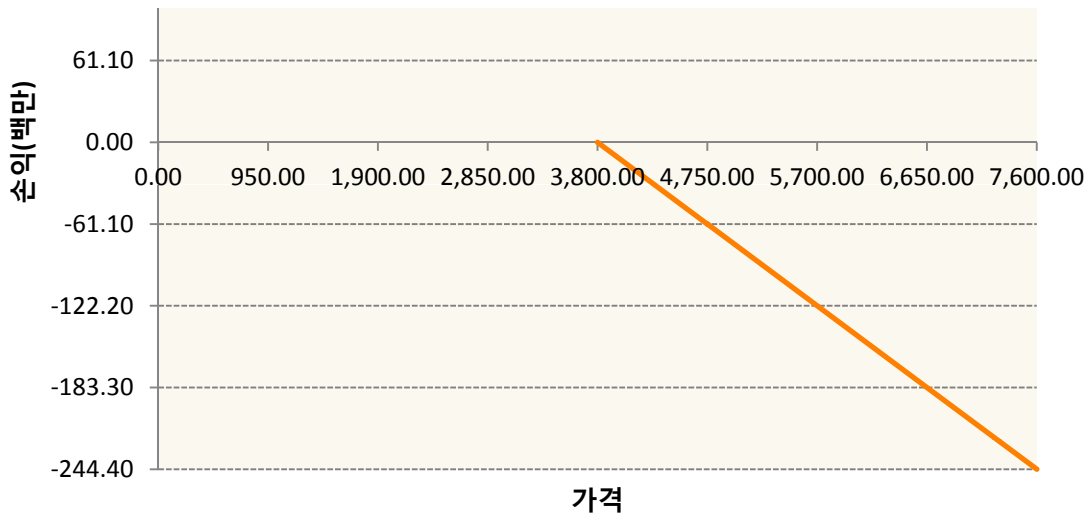
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXF0-C3775-EURO STOXX 50**

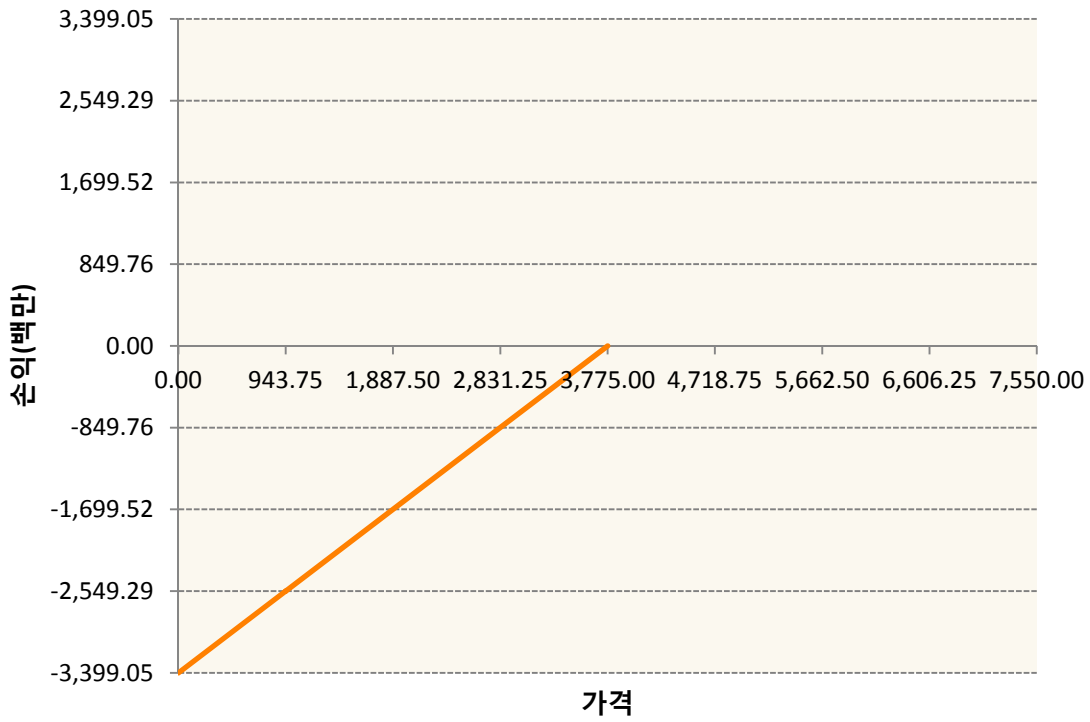


**OESXF0-C3800-EURO STOXX 50**

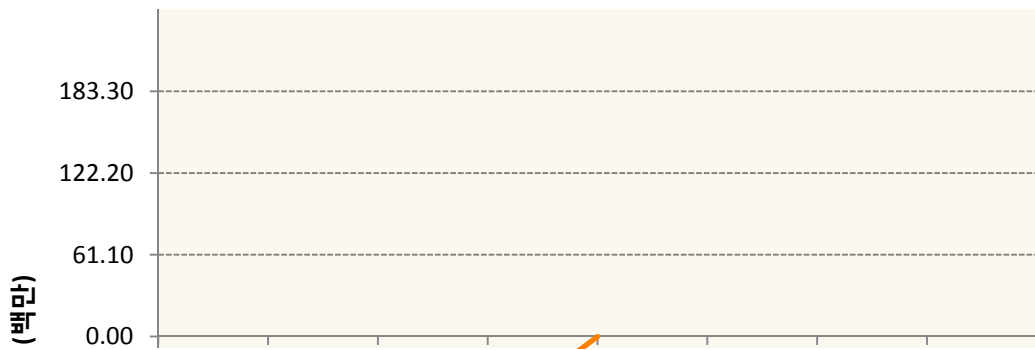


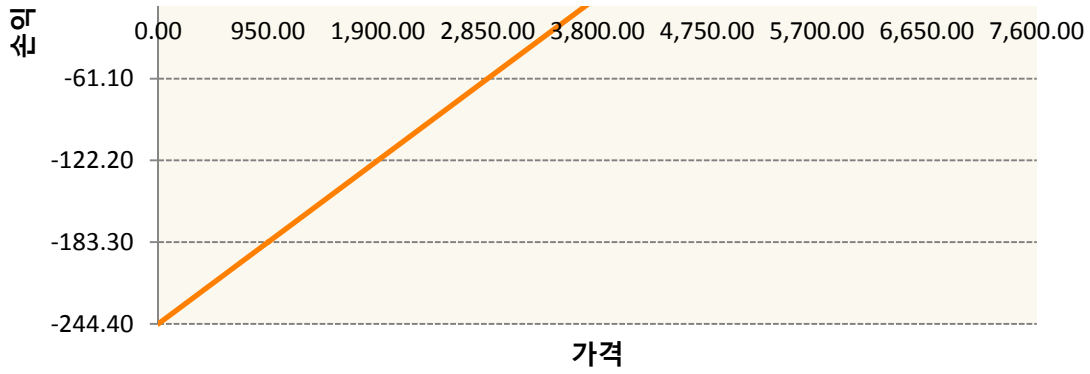


**OESXF0-P3775-EURO STOXX 50**

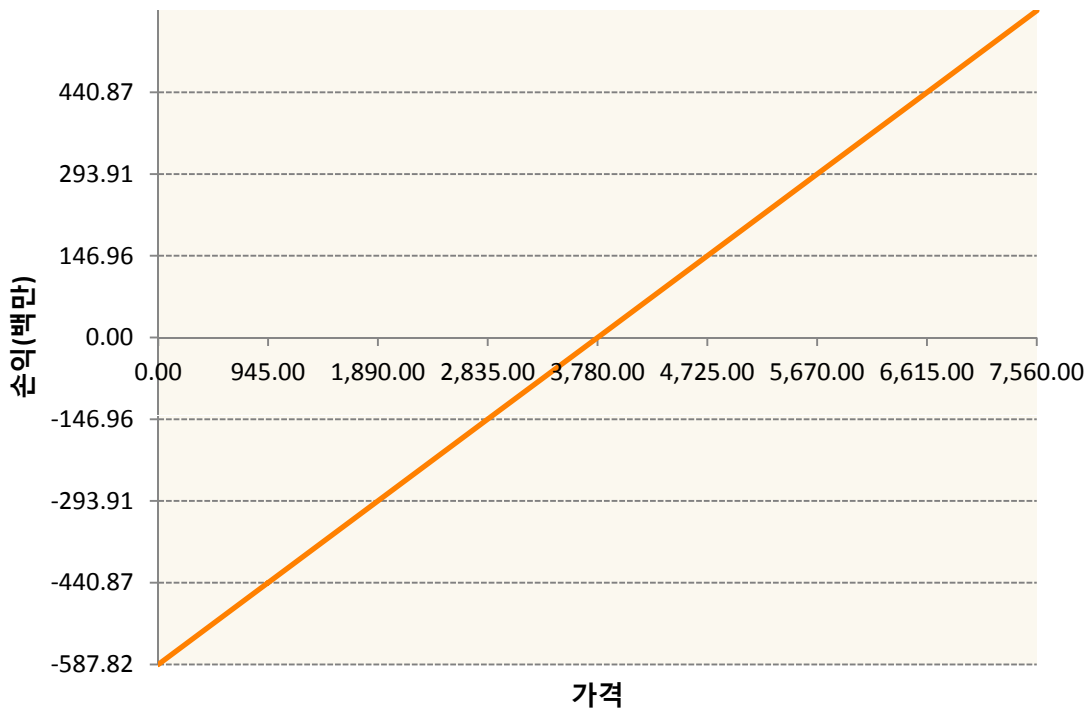


**OESXF0-P3800-EURO STOXX 50**





VGH0-EURO STOXX 50 Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		43
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E		270
OESXF0-C37 EURO STOXX 50		272
OESXF0-C38 EURO STOXX 50		20
OESXF0-P37 EURO STOXX 50		272
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)

935



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

(단위:백만원)

80



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

(단위:백만원)

117



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

(단위:백만원)

42

공시일	2020-01-14
기준일	2020-01-13

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

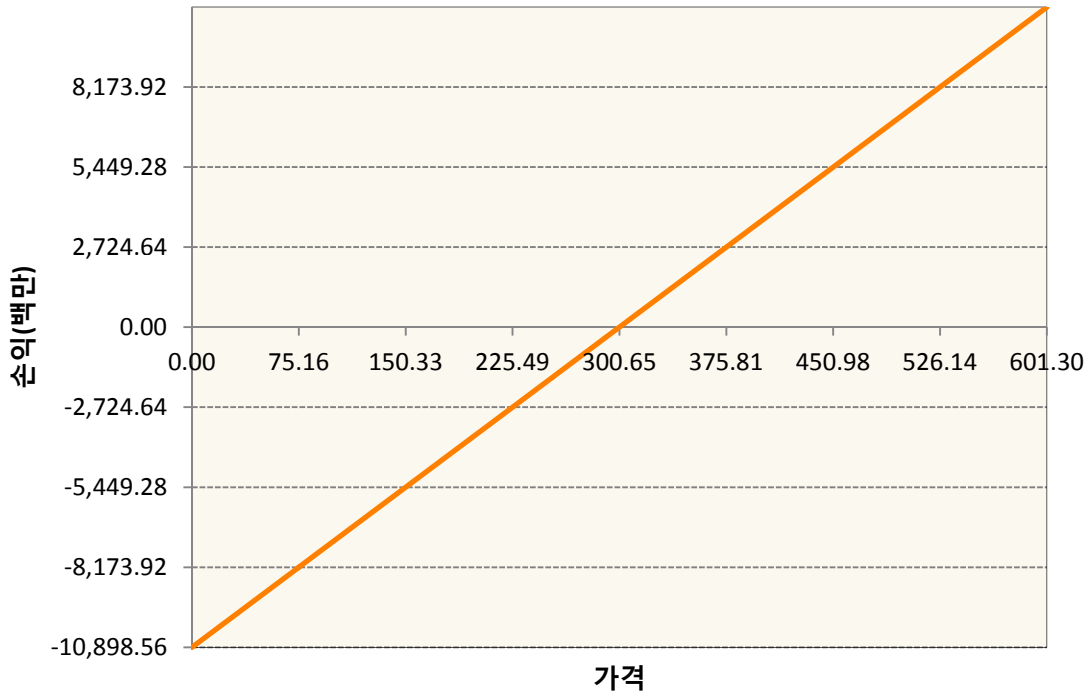
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

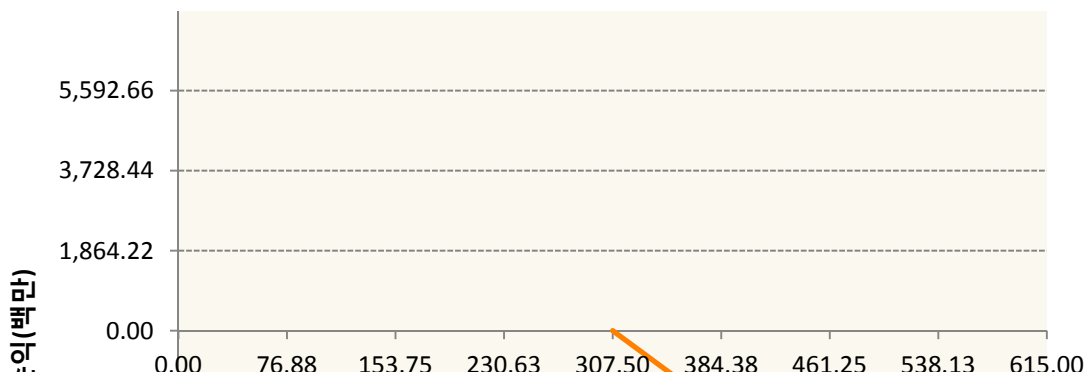
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,899	0	10,899	장내
누계	유가증권	옵션	3,018	21,407	-18,389	장내

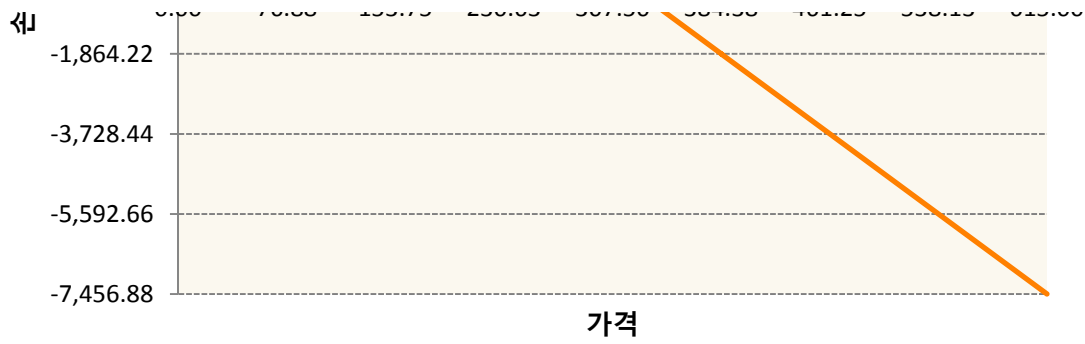
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

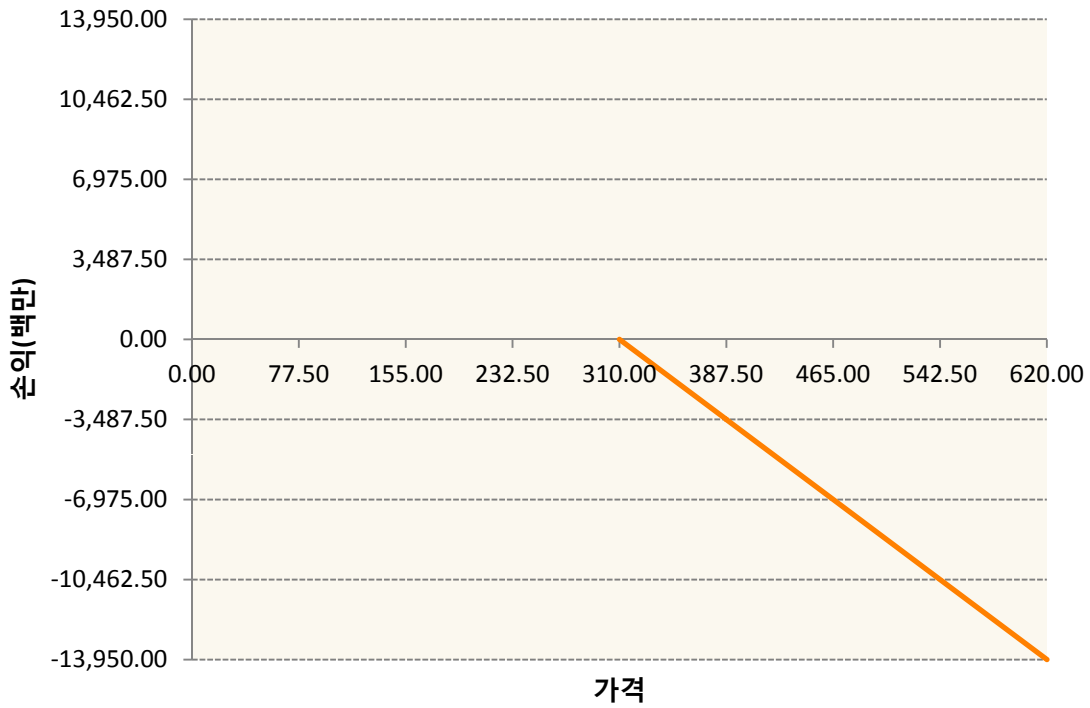


KR4201Q23073-2020-02 콜307.5

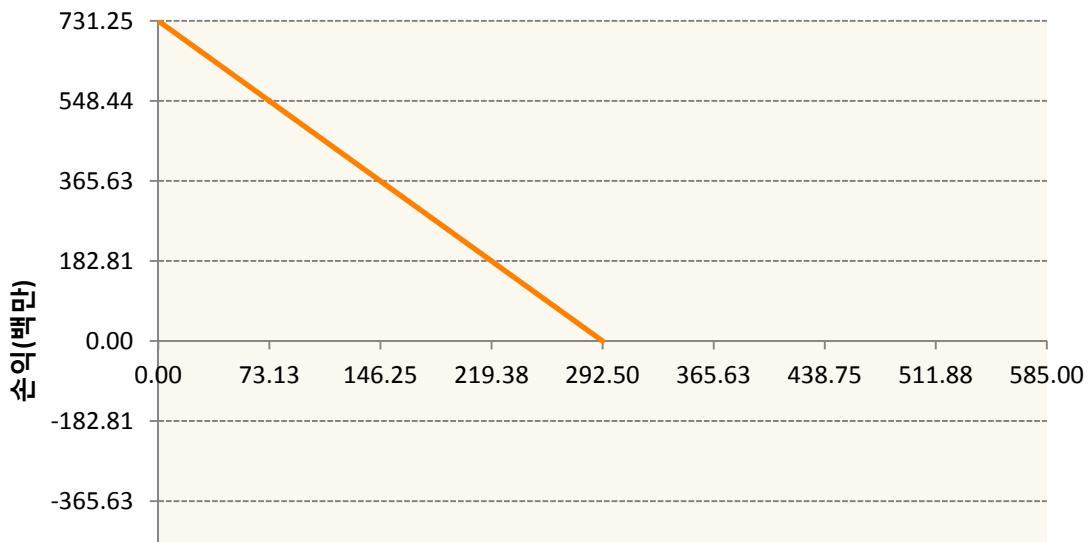


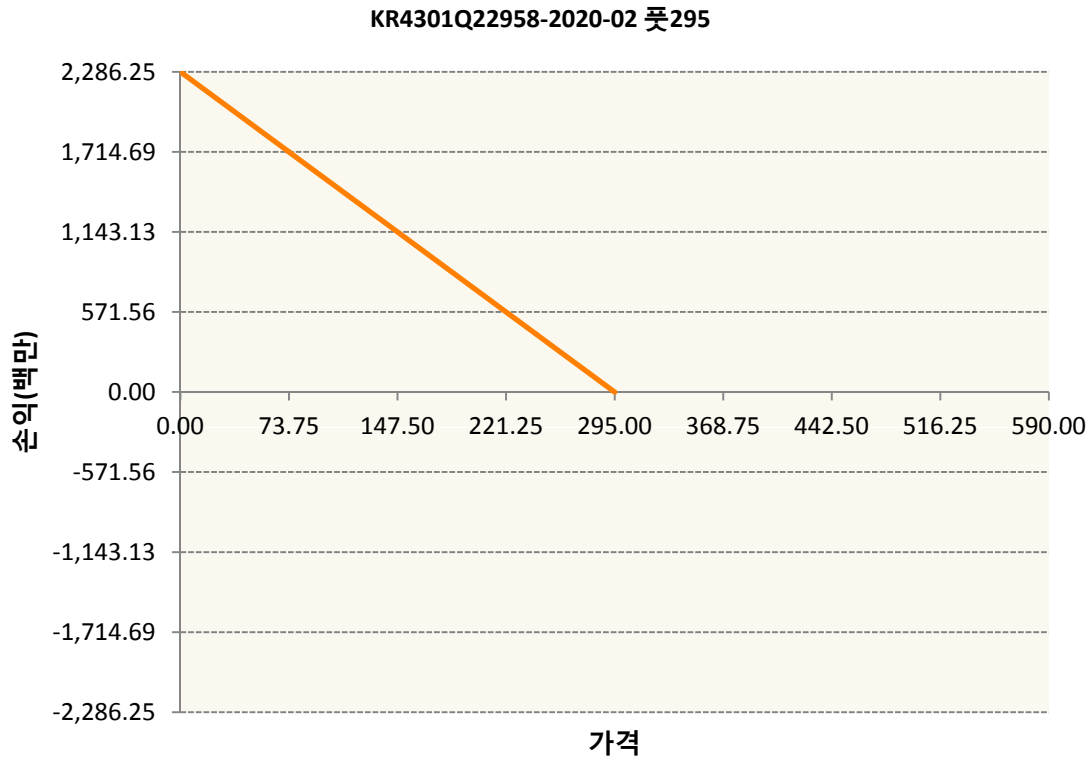
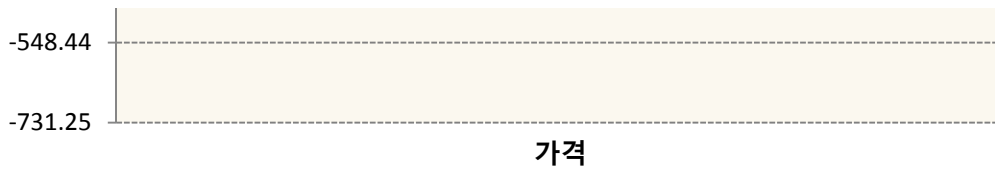


**KR4201Q23107-2020-02 콜310**



**KR4301Q22925-2020-02 풋292.5**





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

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						870
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-870	-870	-870	-870	-870	-870	-870	
-5.33%	-580	-580	-580	-580	-580	-580	-580	
-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%	580	580	580	580	580	580	580	
8.00%	870	870	870	870	870	870	870	
KR4201Q23073		2020-02 콜307.5						393
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	156	151	145	137	128	118	108	
-5.33%	142	133	122	110	97	84	69	
-2.67%	112	97	82	66	49	32	14	

0%	57	38	19	0	-19	-39	-59
2.67%	-28	-49	-69	-90	-110	-131	-151
5.33%	-146	-165	-184	-203	-223	-243	-263
8.00%	-291	-306	-322	-339	-357	-375	-393
KR4201Q23107 2020-02 콜310							694
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	255	247	237	225	210	193	175
-5.33%	234	219	202	182	160	136	111
-2.67%	189	164	138	110	80	50	19
0%	102	69	35	0	-35	-71	-106
2.67%	-38	-76	-115	-153	-191	-229	-267
5.33%	-238	-275	-312	-350	-388	-426	-463
8.00%	-492	-523	-556	-589	-624	-658	-694
KR4301Q22925 2020-02 풋292.5							39
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	37	37	37	37	38	38	39
-5.33%	18	19	20	20	21	22	23
-2.67%	5	6	7	7	8	9	10
0%	-2	-2	-1	0	1	2	2
2.67%	-4	-4	-4	-3	-3	-2	-2
5.33%	-5	-4	-4	-4	-4	-4	-4
8.00%	-5	-5	-5	-5	-4	-4	-4
KR4301Q22958 2020-02 풋295							131
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	127	127	128	128	129	130	131
-5.33%	68	69	71	73	75	77	79
-2.67%	20	23	25	28	31	34	37
0%	-8	-5	-3	0	3	6	8
2.67%	-18	-17	-15	-14	-12	-10	-8
5.33%	-20	-19	-19	-18	-18	-17	-16
8.00%	-20	-20	-20	-20	-19	-19	-19

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

(단위:백만원)

1,691

공시일	2020-01-14
기준일	2020-01-13

## 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	204,686	0	204,686	

### 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	2020-01-14
기준일	2020-01-13

## 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	213,657	0	213,657	

### 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	2020-01-14
기준일	2020-01-13

## 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	527,415	0	527,415	
누계	통화	선도	0	512,224	-512,224	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E	1,387
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E	1,489
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E	1,850
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E	3,181
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E	4,716
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	185
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,774
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,774
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,312
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,497
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	1,609
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	1,979
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	925
FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E	3,699
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,850
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,979
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	185
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	185
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	1,110

IE00BD8RGM75

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

13,416



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

(단위:백만원)

0

공시일	2020-01-14
기준일	2020-01-13

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

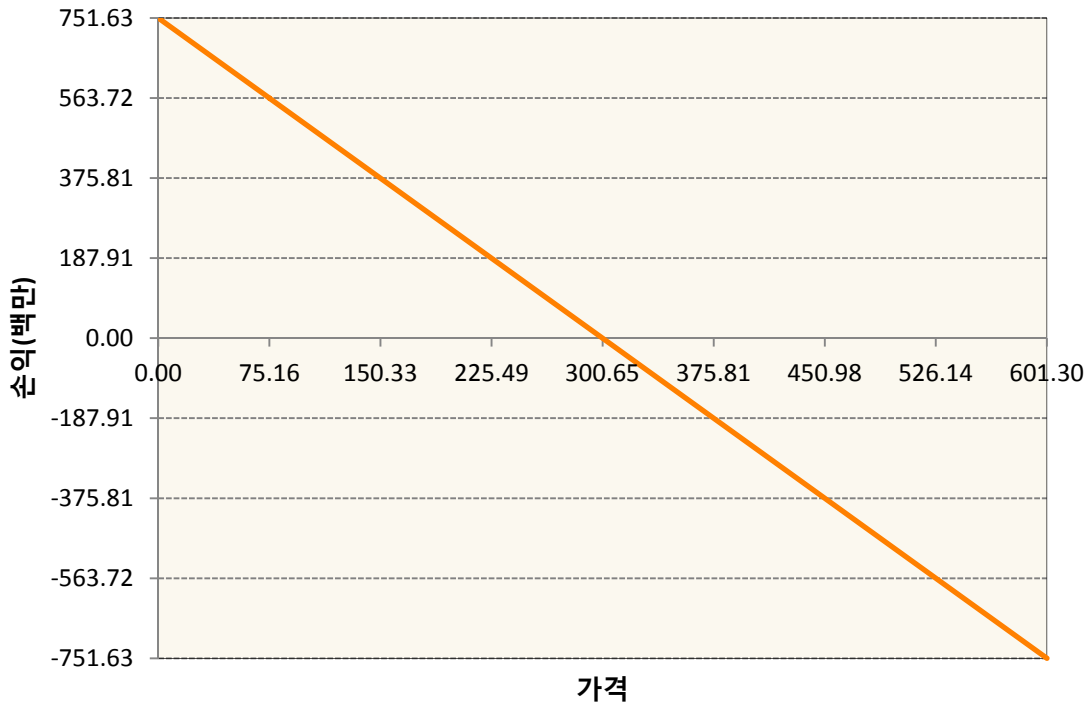
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

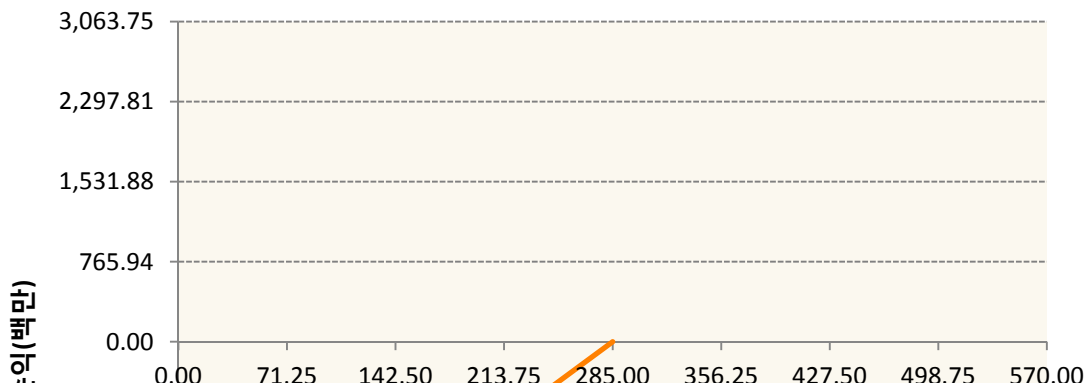
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	752	-752	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,926	-3,926	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

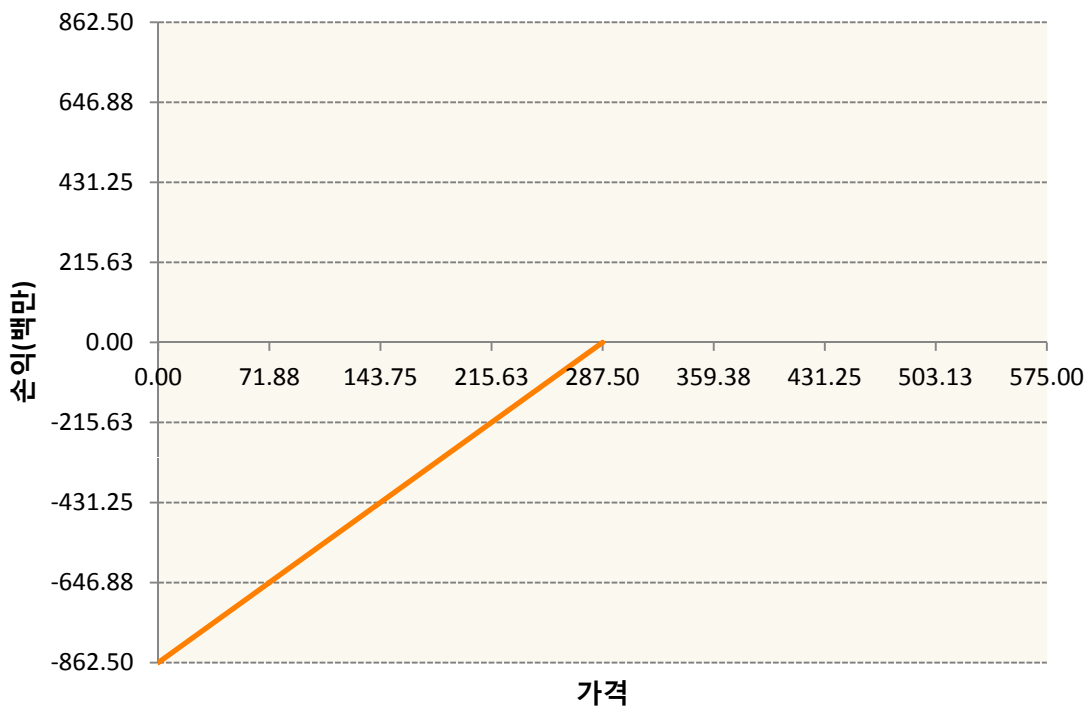


KR4301Q22859-2020-02 풋285





KR4301Q22875-2020-02 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						60
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	60	60	60	60	60	60	60	
-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%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60	
KR4301Q22859		2020-02 풋285						114
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-97	-99	-102	-104	-107	-110	-114
-5.33%	-36	-40	-44	-48	-52	-56	-60
-2.67%	-5	-8	-11	-14	-18	-21	-25
0%	4	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	5	5	5	4	4	3	2
5.33%	6	6	6	5	5	5	5
8.00%	6	6	6	6	6	5	5

KR4301Q22875                      2020-02 풋287.5                      37

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-33	-33	-34	-34	-35	-36	-37
-5.33%	-14	-15	-16	-17	-18	-19	-20
-2.67%	-2	-3	-4	-5	-7	-8	-9
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	2	2	2	2	2	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

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

(단위:백만원)

**149**

공시일	2020-01-14
기준일	2020-01-13

## 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	13,197	0	13,197	
누계	통화	선도	0	13,352	-13,352	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E	287
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	288
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	342
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)

350
-----

공시일	2020-01-14
기준일	2020-01-13

## 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	2,004	0	2,004	장외
누계	통화	선도	309	733	-424	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)	81
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	2020-01-14
기준일	2020-01-13

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

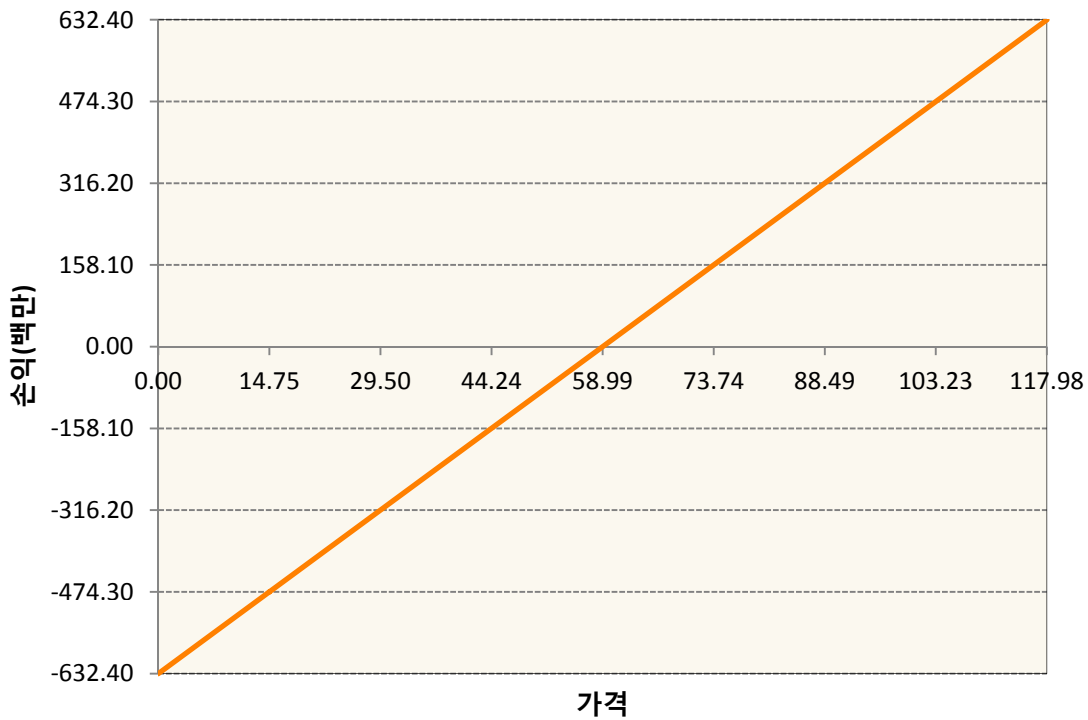
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

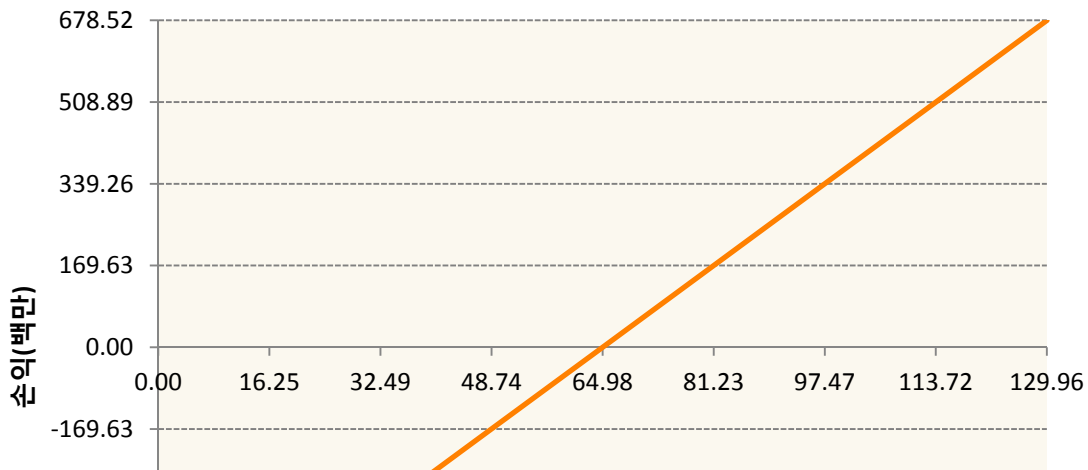
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,457	289	2,168	

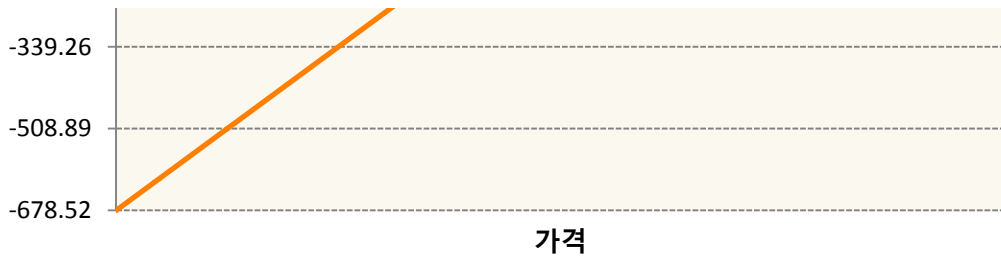
### 2. 만기시점의 손익구조

CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20

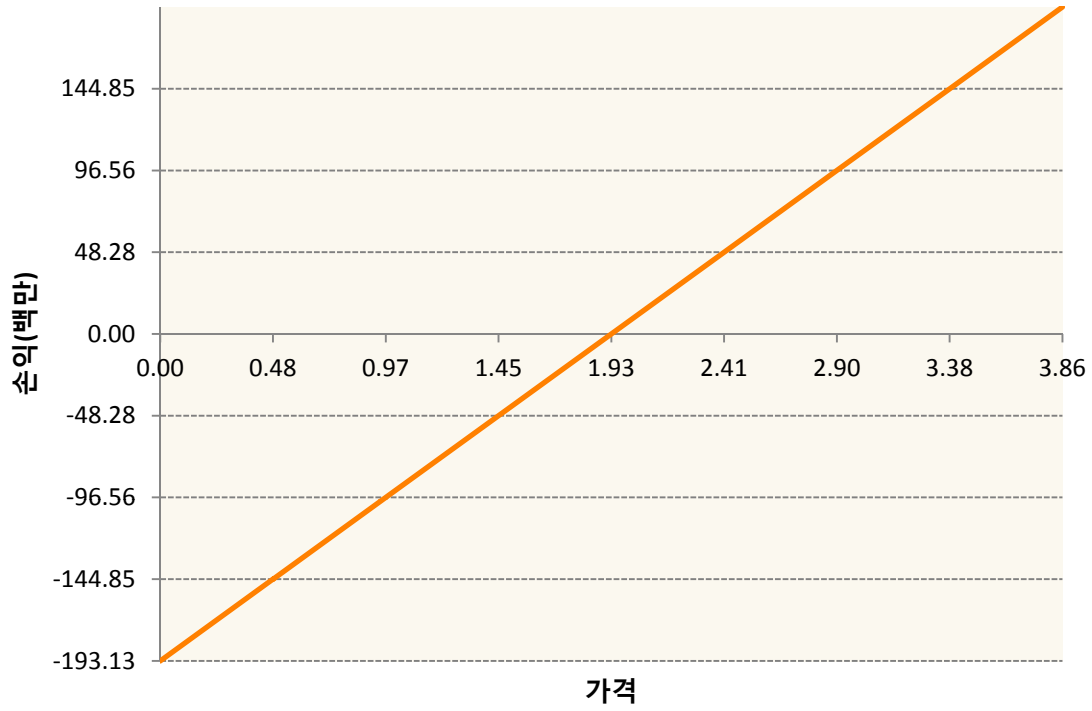


COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20

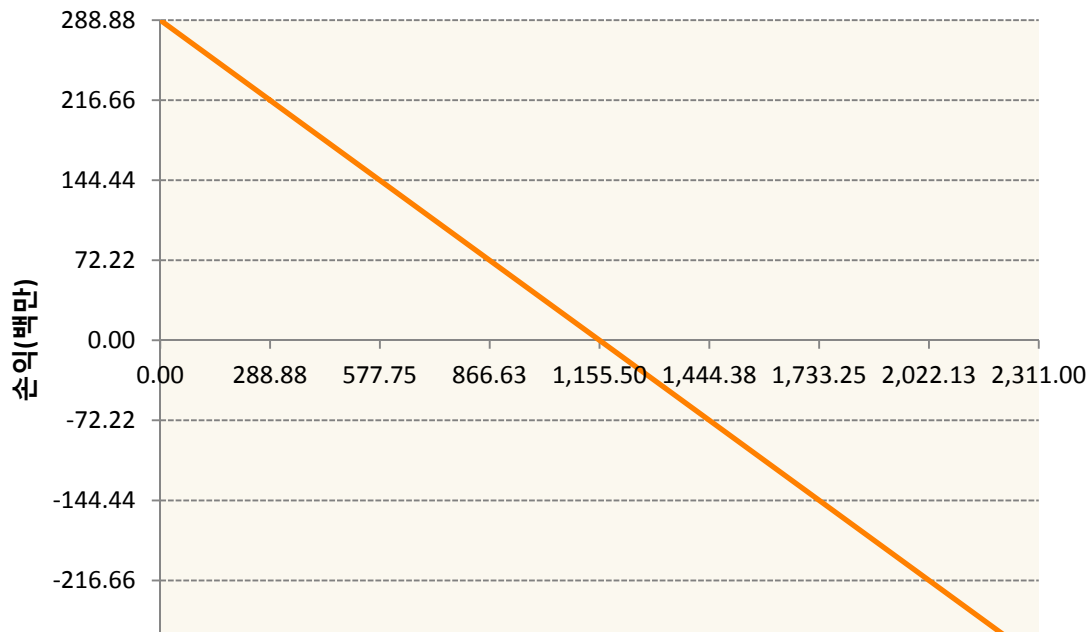


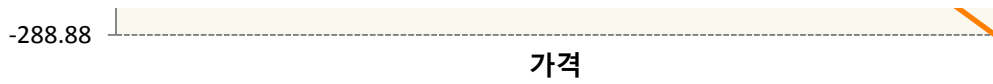


**HOH0-NY Harb ULSD Fut Mar20**

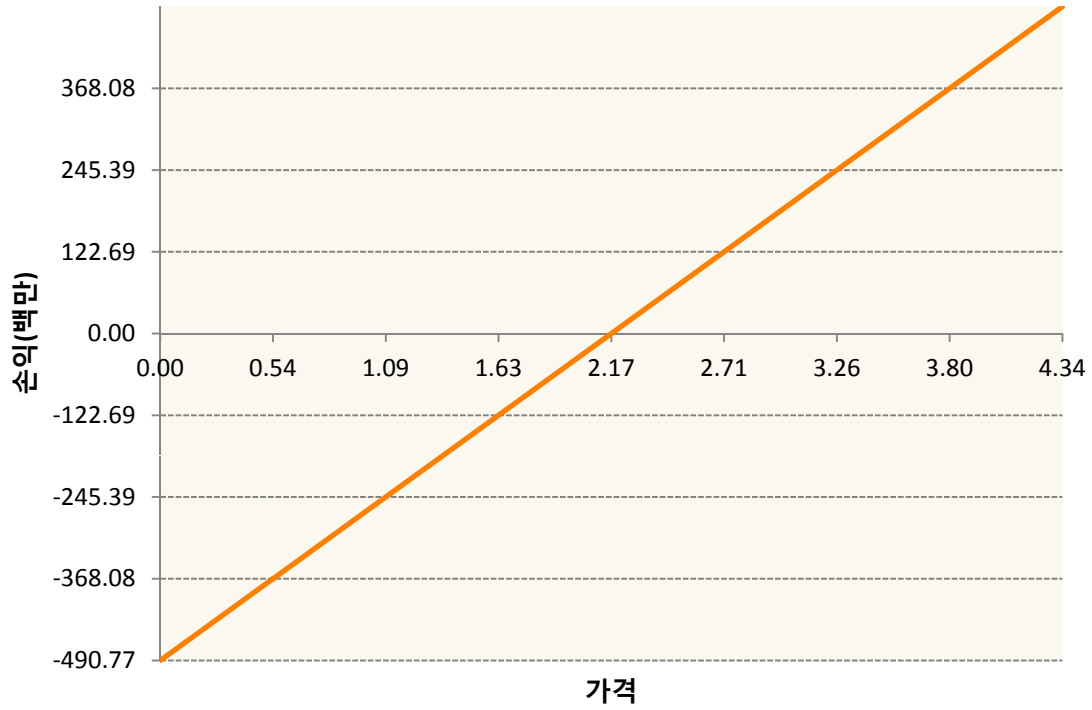


**KR4175Q10001-2020-01 달러선물**

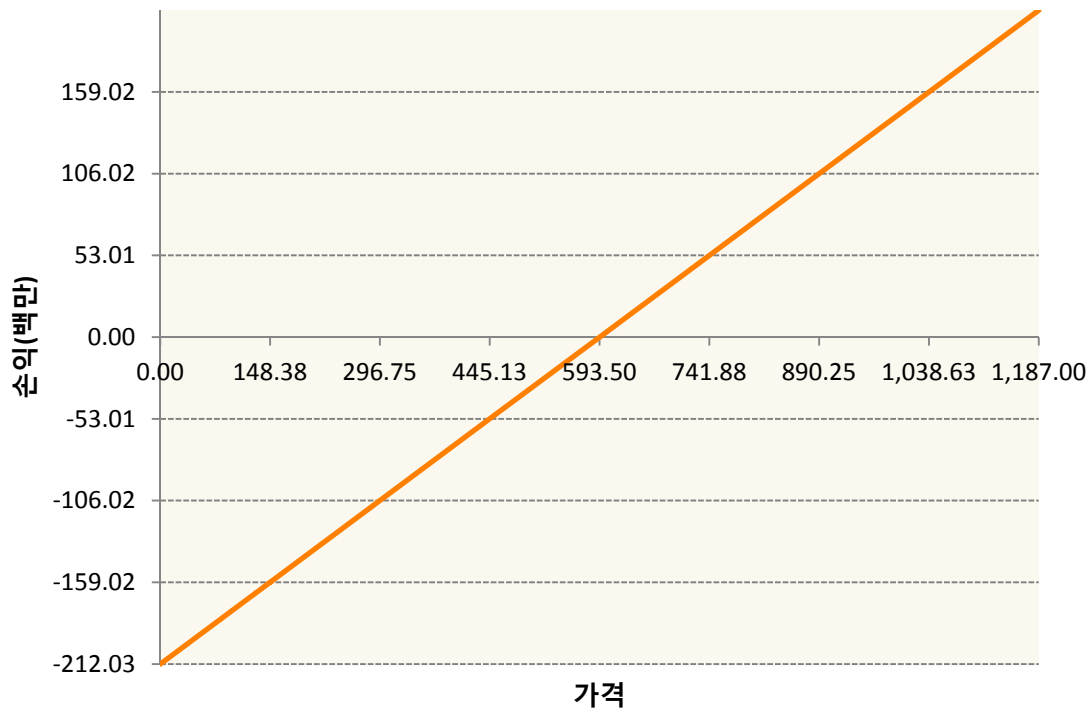




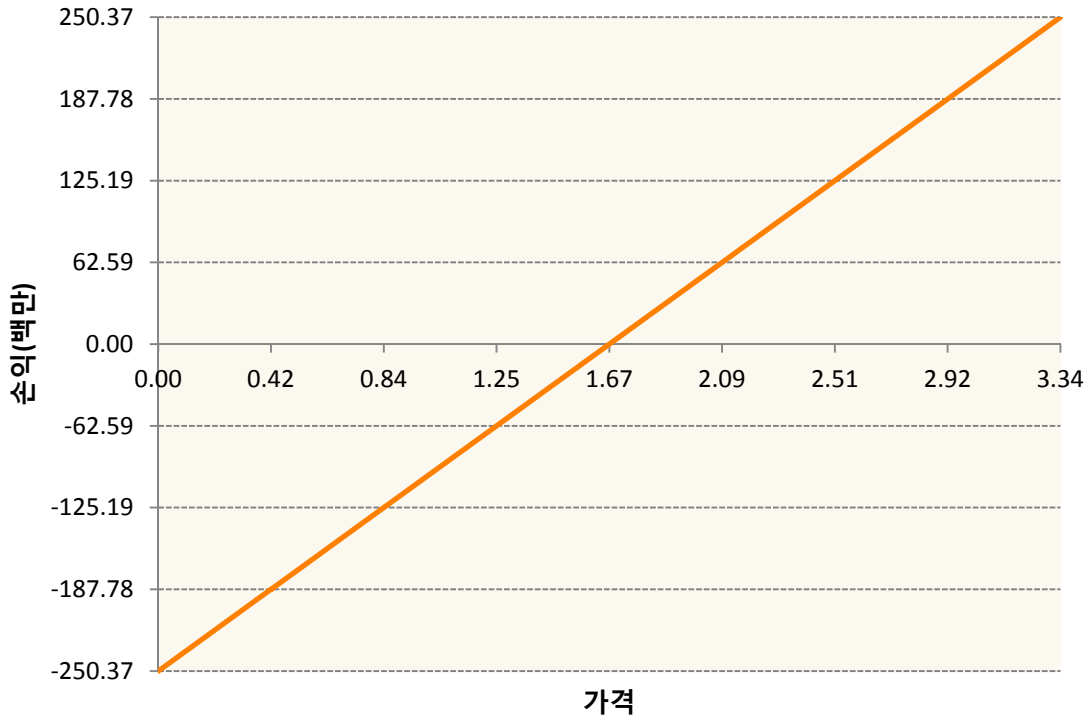
NGH20-NATURAL GAS FUTR Mar20



QSH0-Low Su Gasoil G Mar20



**XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20**



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

CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	51
COH0	BRENT CRUDE FUTR Mar20	54
HOH0	NY Harb ULSD Fut Mar20	15
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)**

**380**

공시일	2020-01-14
기준일	2020-01-13

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

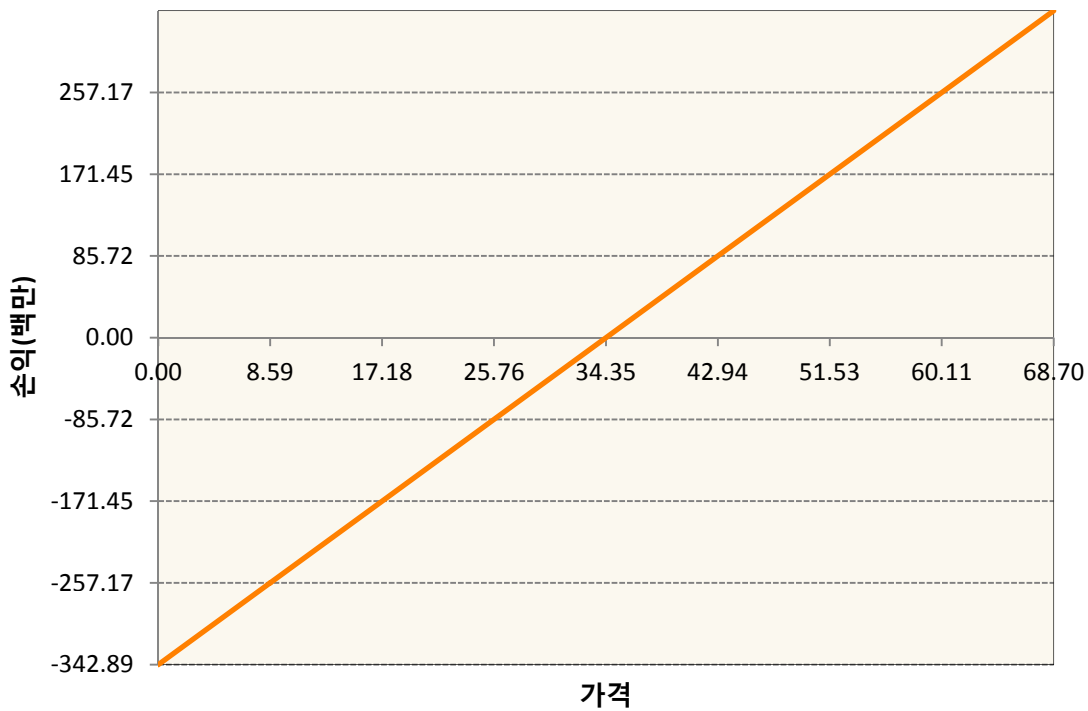
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

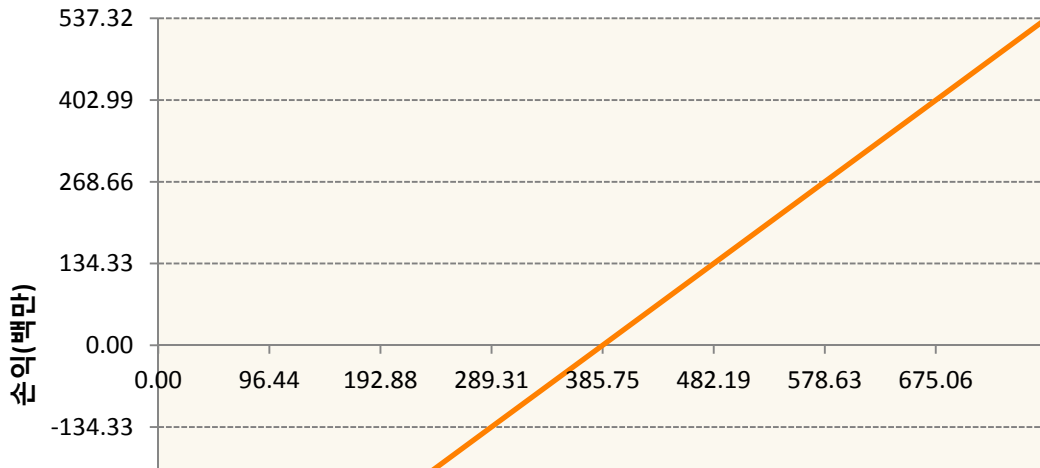
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,861	150	2,711	

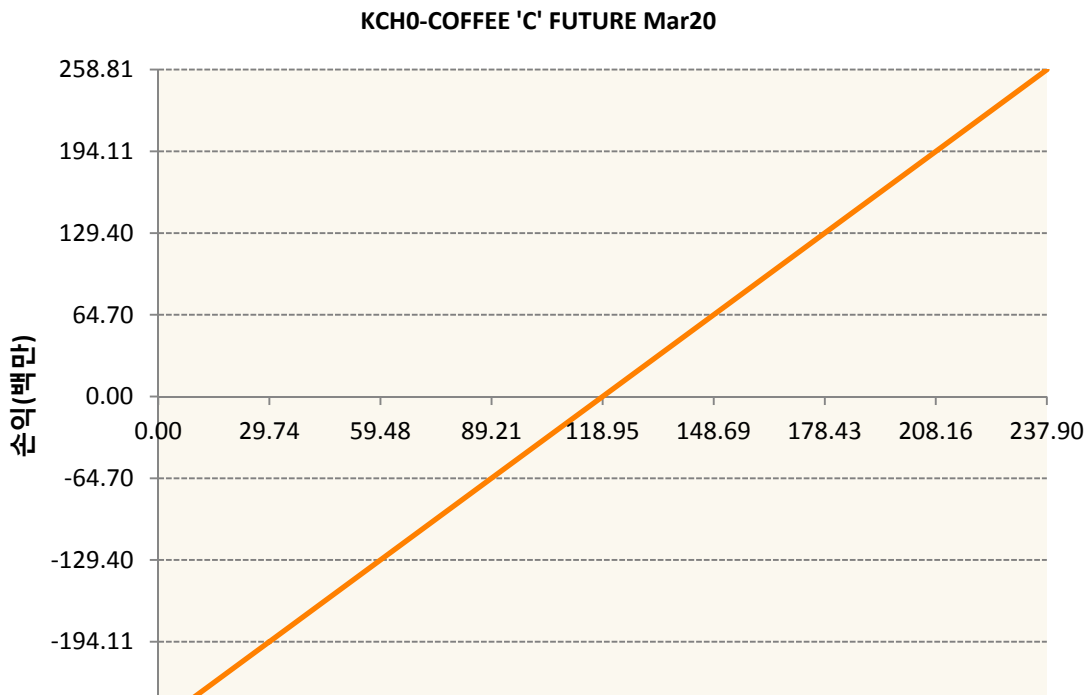
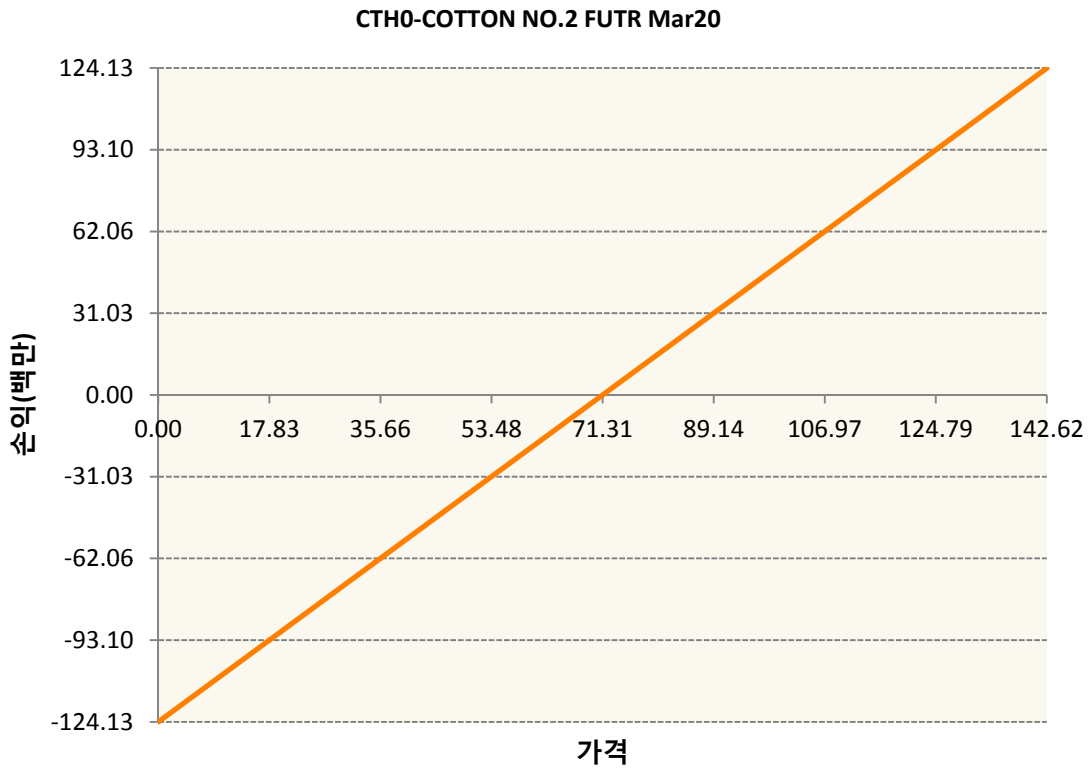
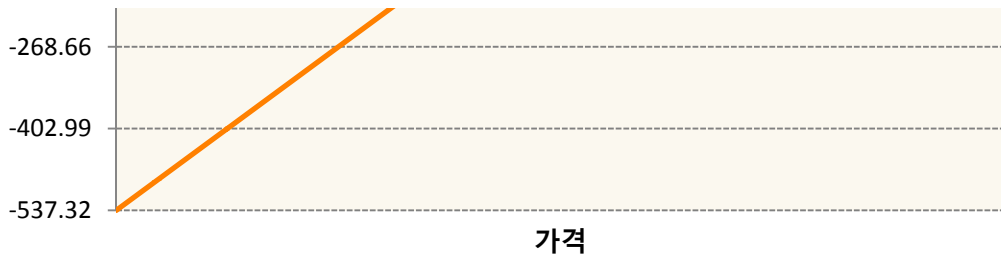
### 2. 만기시점의 손익구조

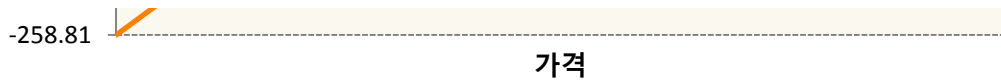
**BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20**



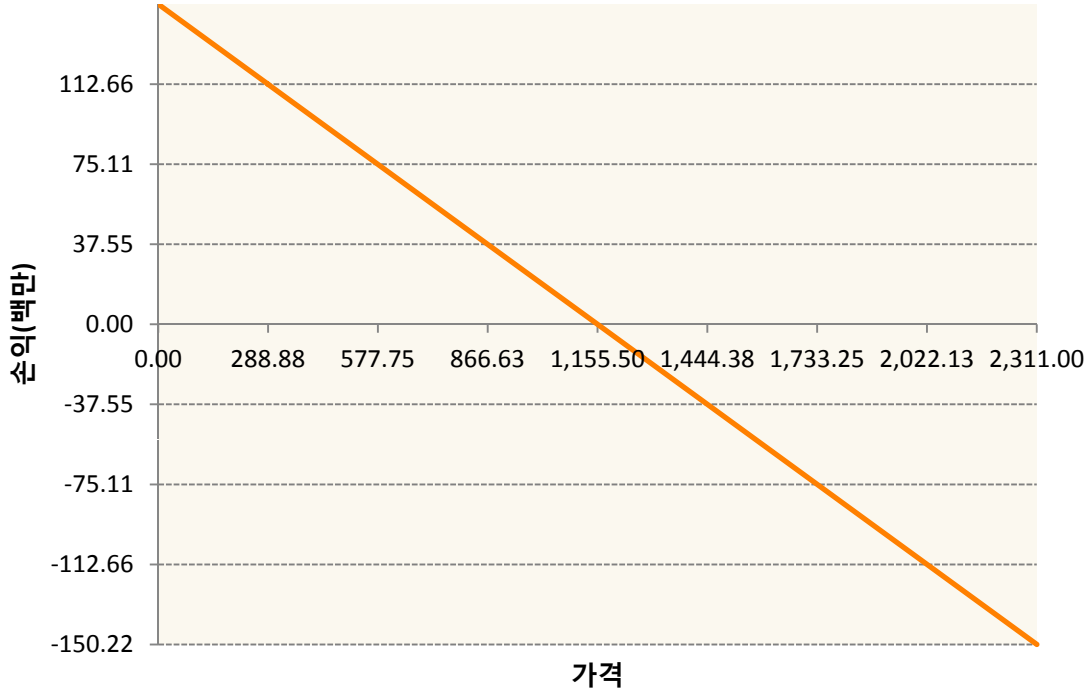
**CH0-CORN FUTURE Mar20**



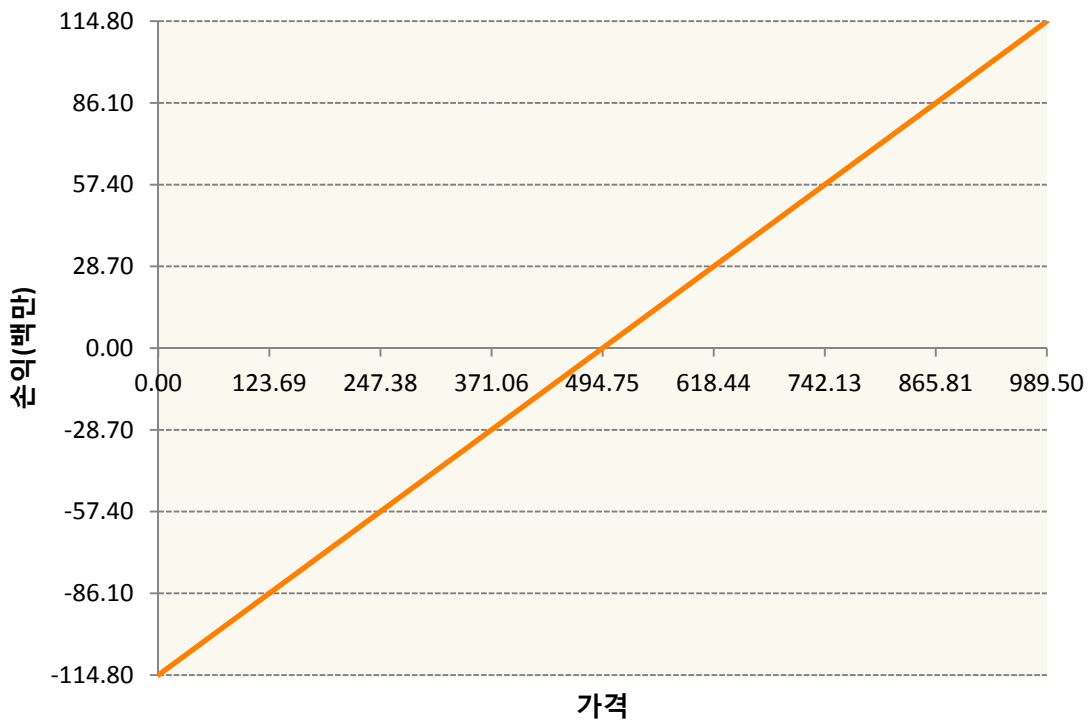




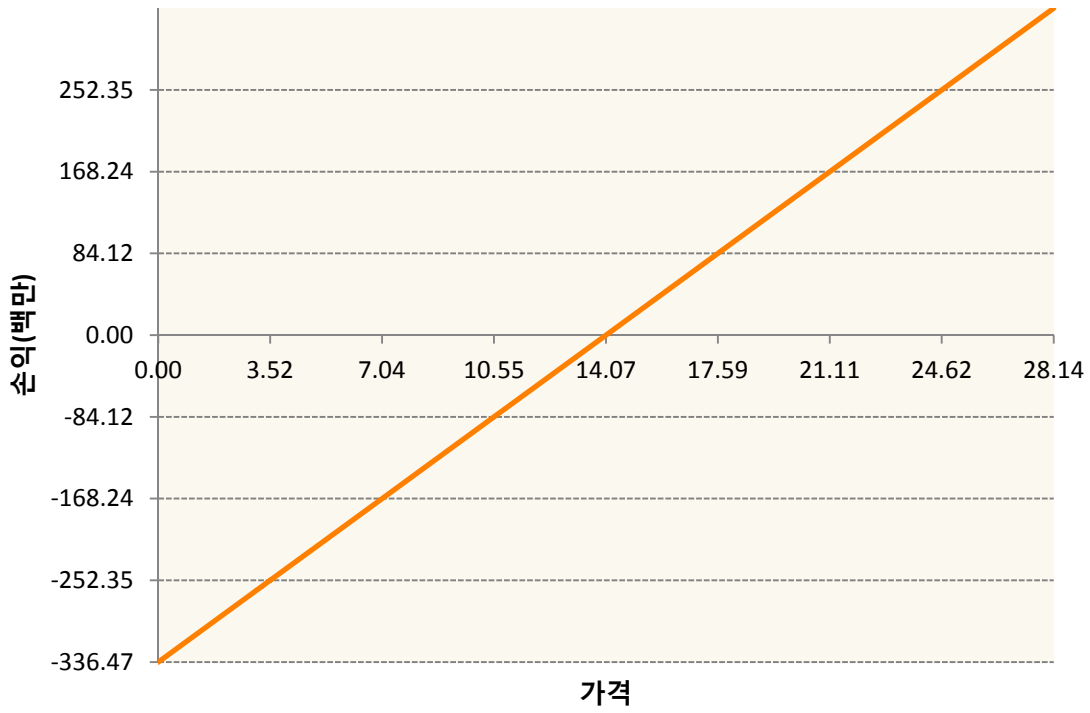
KR4175Q10001-2020-01 달러선물



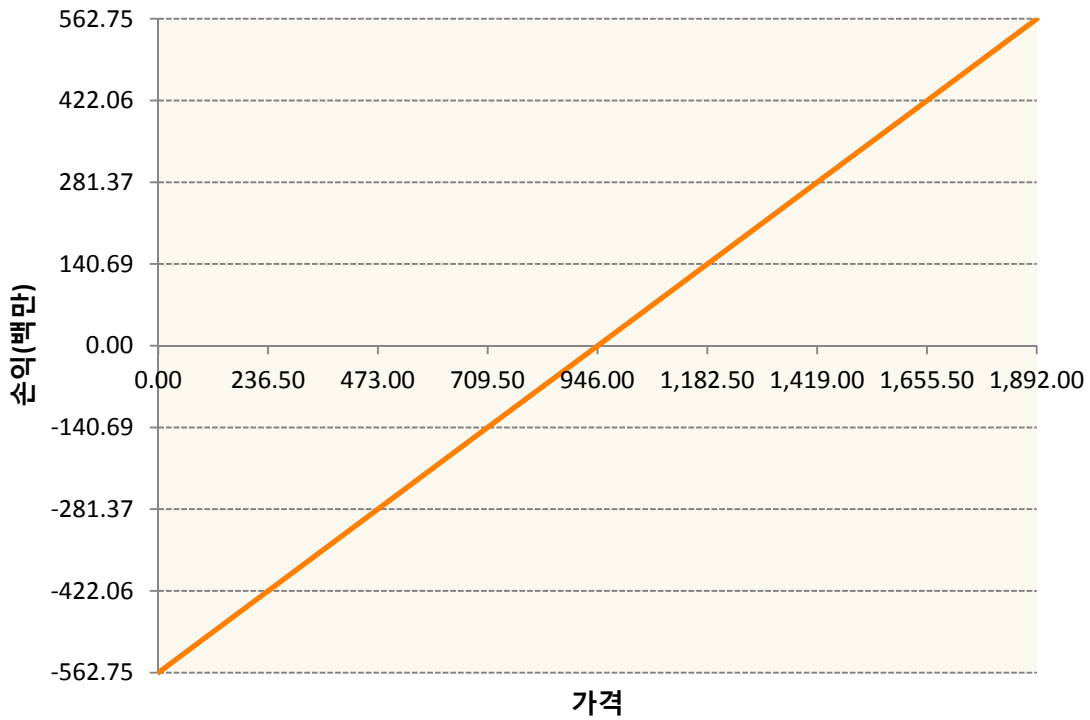
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

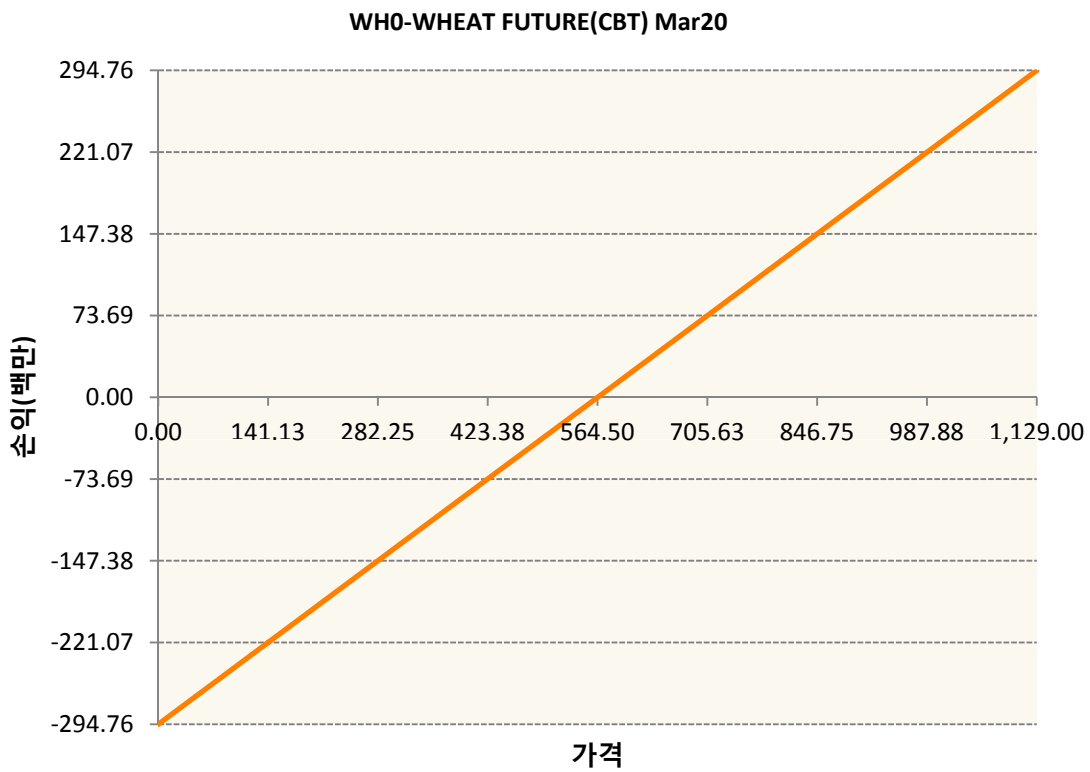
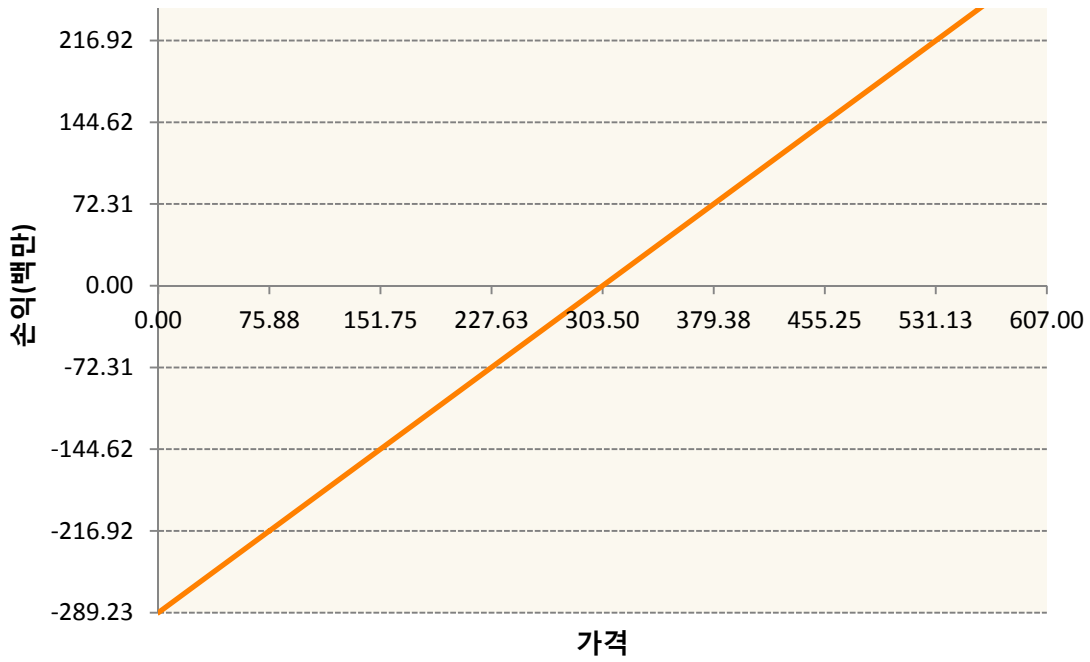


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20



SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BOH0	SOYBEAN OIL FUTR Mar20	27
CH0	CORN FUTURE Mar20	43
CTH0	COTTON NO.2 FUTR Mar20	10
KCH0	COFFEE 'C' FUTURE Mar20	21
KR4175Q10C	2020-01 달러선물	12

KWH0	KC HRW WHEAT FUT Mar20	9
SBH0	Sugar Mar20	27
SH0	SOYBEAN FUTURE Mar20	45
SMH0	SOYBEAN MEAL FUTR Mar20	23
WH0	WHEAT FUTURE(CBT) Mar20	24

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

(단위:백만원)

**250**