

공시일	2020-01-16
기준일	2020-01-15

## 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	2020-01-16
기준일	2020-01-15

## 스마트인덱스모

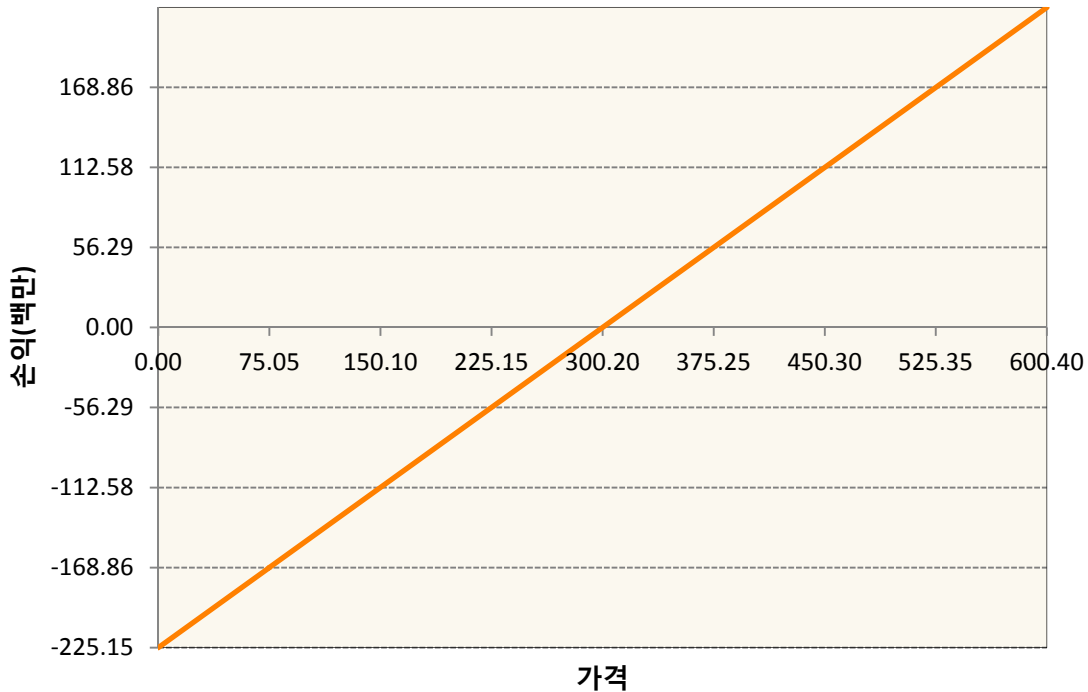
### 1. 계약금액

(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	2020-01-16
기준일	2020-01-15

## 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

1,143

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

654

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-16
기준일	2020-01-15

## 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)

<b>821</b>
------------

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-16
기준일	2020-01-15

## 유로인덱스모(주식-파생형)

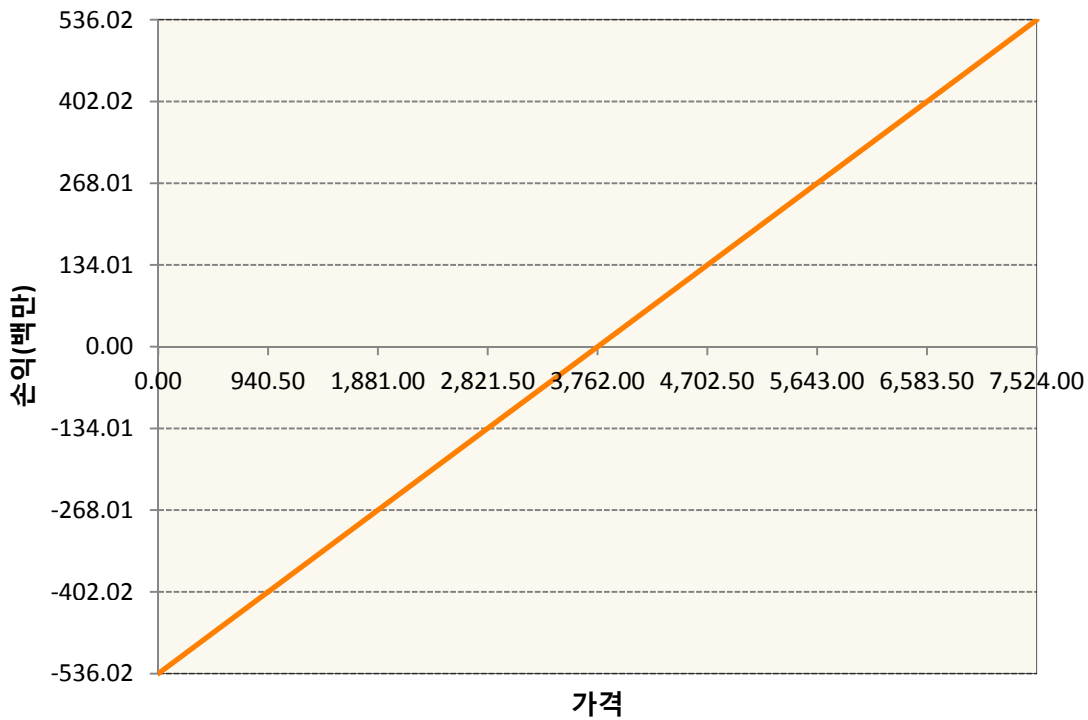
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	536	0	536	

### 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)

29
----

공시일	2020-01-16
기준일	2020-01-15

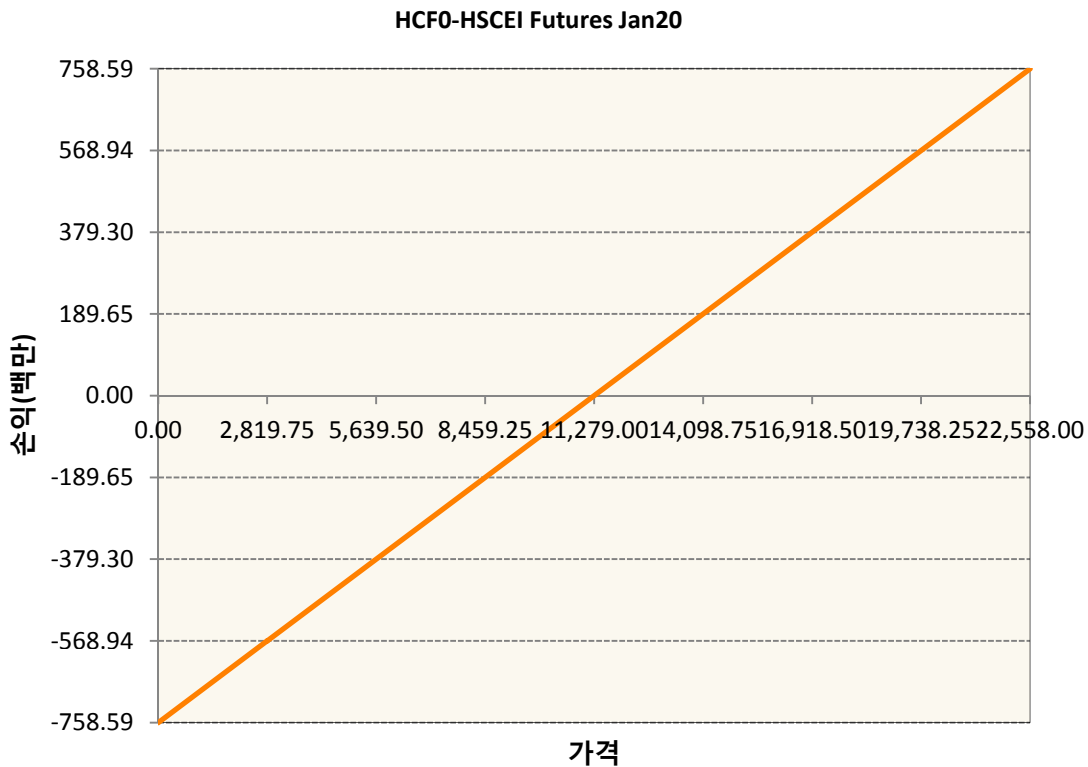
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	759	0	759	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

54
----

공시일	2020-01-16
기준일	2020-01-15

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

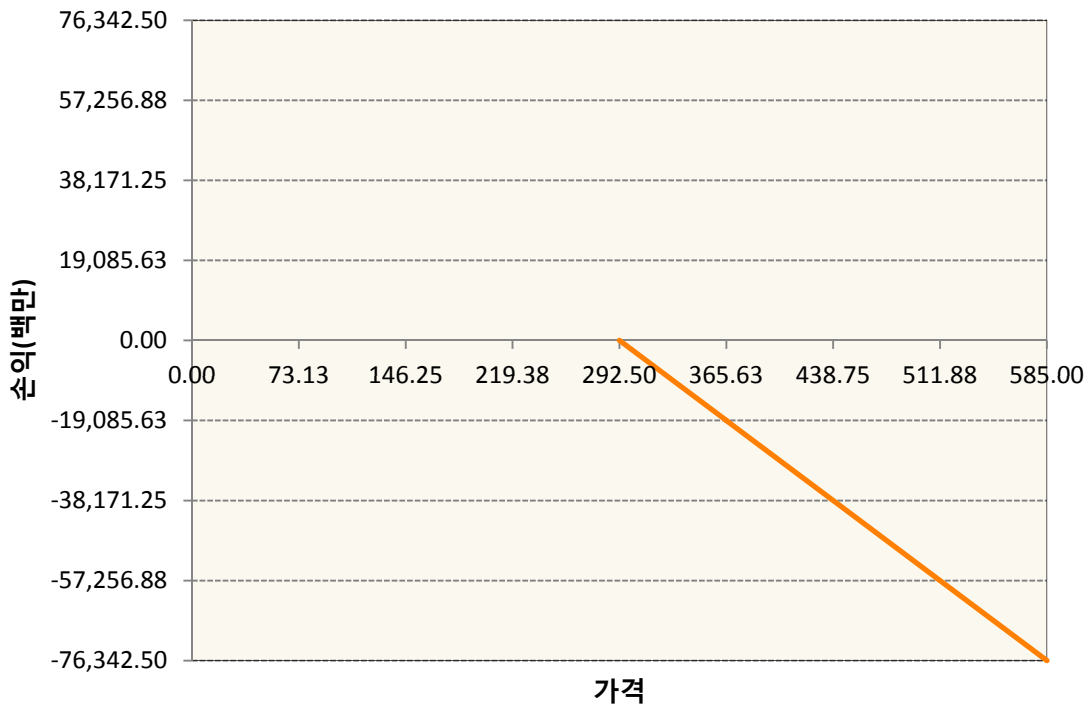
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

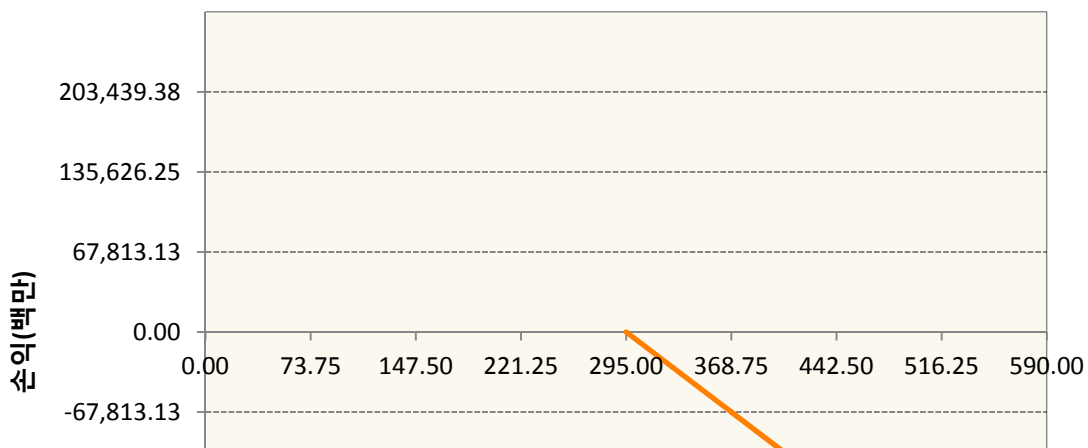
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	468,989	-468,989	장내

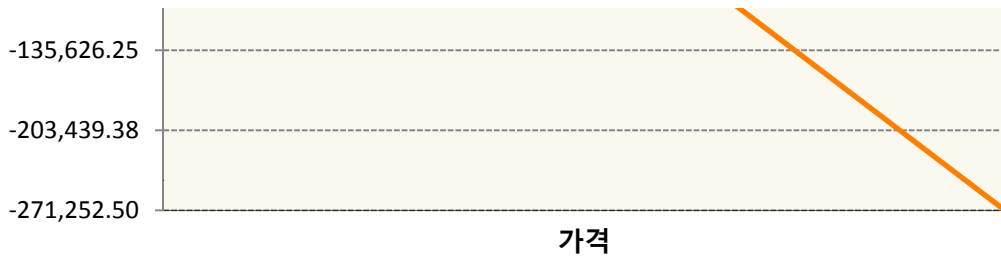
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q22927-2020-02 콜292.5

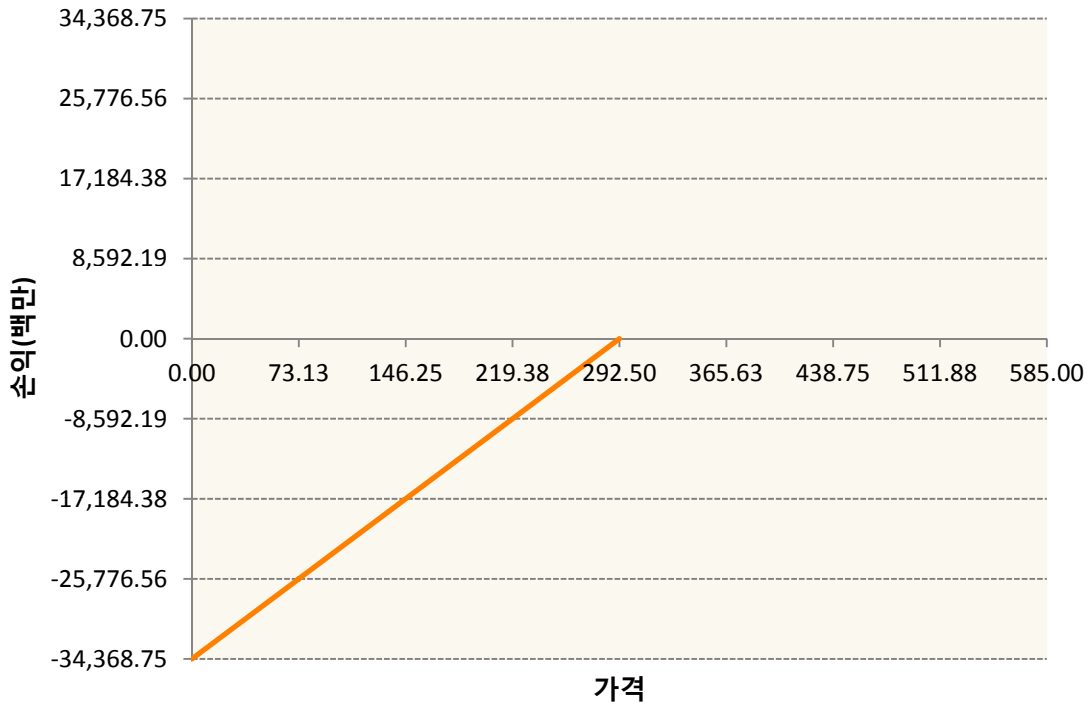


KR4201Q22950-2020-02 콜295

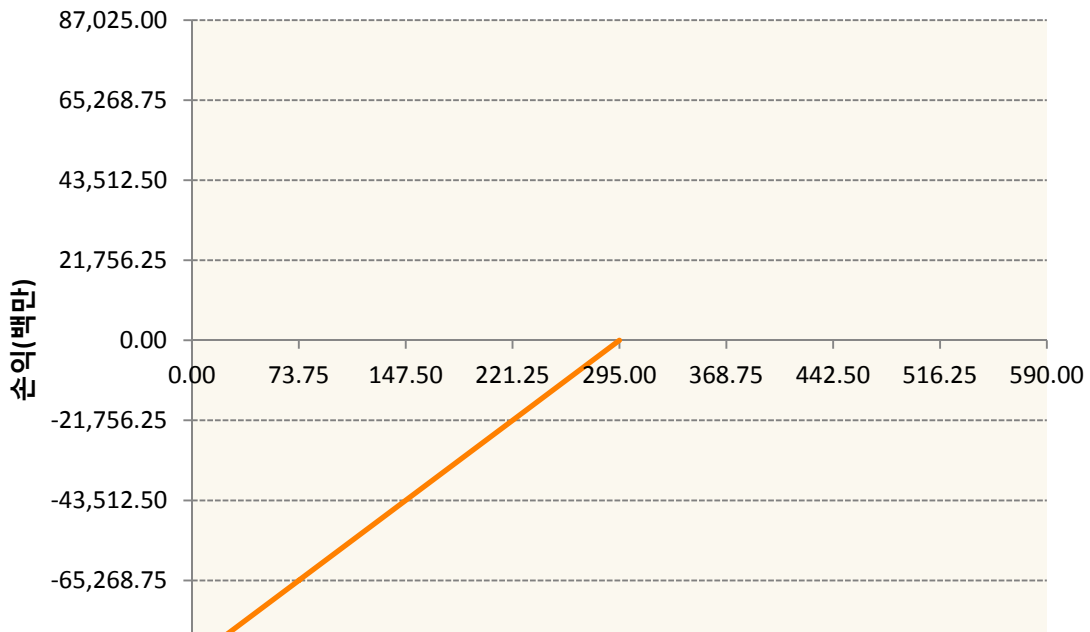




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



KR4301Q22958-2020-02 풋295



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q22927		2020-02 콜292.5						5,263
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,141	3,012	2,873	2,726	2,571	2,411	2,247	
-5.33%	2,640	2,460	2,278	2,092	1,904	1,715	1,523	
-2.67%	1,797	1,593	1,390	1,186	983	779	576	
0%	583	391	196	0	-198	-397	-597	
2.67%	-962	-1,114	-1,276	-1,444	-1,618	-1,797	-1,979	
5.33%	-2,751	-2,855	-2,972	-3,102	-3,242	-3,390	-3,546	
8.00%	-4,694	-4,754	-4,830	-4,921	-5,024	-5,139	-5,263	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						17,998
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	10,050	9,652	9,210	8,733	8,228	7,698	7,148	
-5.33%	8,586	7,998	7,388	6,763	6,126	5,479	4,824	
-2.67%	6,006	5,297	4,586	3,873	3,159	2,445	1,730	
0%	2,135	1,427	715	0	-717	-1,436	-2,156	
2.67%	-2,960	-3,554	-4,172	-4,809	-5,461	-6,125	-6,798	
5.33%	-9,016	-9,441	-9,913	-10,421	-10,962	-11,527	-12,115	
8.00%	-15,709	-15,972	-16,290	-16,658	-17,069	-17,517	-17,998	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						1,841
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,767	-1,773	-1,782	-1,793	-1,807	-1,823	-1,841	
-5.33%	-892	-918	-946	-976	-1,008	-1,041	-1,075	
-2.67%	-229	-273	-316	-359	-402	-445	-489	
0%	100	69	35	0	-36	-74	-112	
2.67%	194	183	169	152	132	110	86	
5.33%	208	206	202	197	190	181	170	
8.00%	209	209	208	207	205	203	199	
KR4301Q22958		2020-02 풋295						5,070
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-4,938	-4,946	-4,960	-4,979	-5,004	-5,034	-5,070	
-5.33%	-2,671	-2,717	-2,772	-2,832	-2,899	-2,970	-3,045	
-2.67%	-794	-896	-999	-1,103	-1,208	-1,314	-1,420	
0%	296	200	101	0	-102	-206	-310	
2.67%	671	629	579	522	458	389	315	

5.33%	742	733	719	698	672	640	602
8.00%	749	748	746	741	734	723	708

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

(단위:백만원)

**29,107**

공시일	2020-01-16
기준일	2020-01-15

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

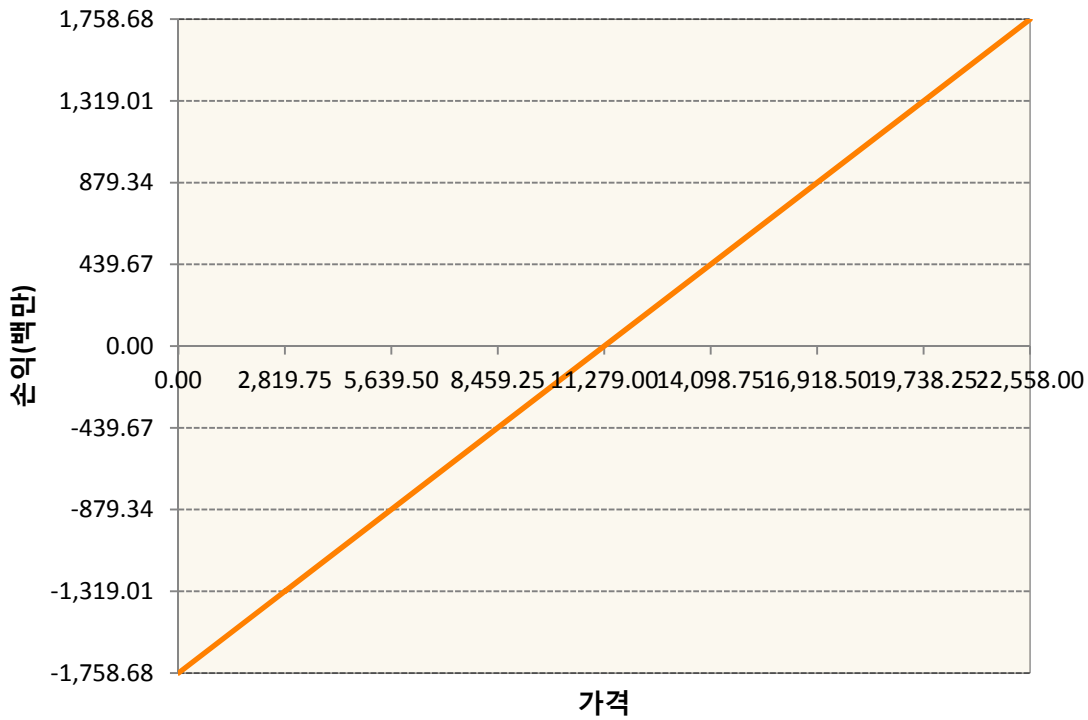
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

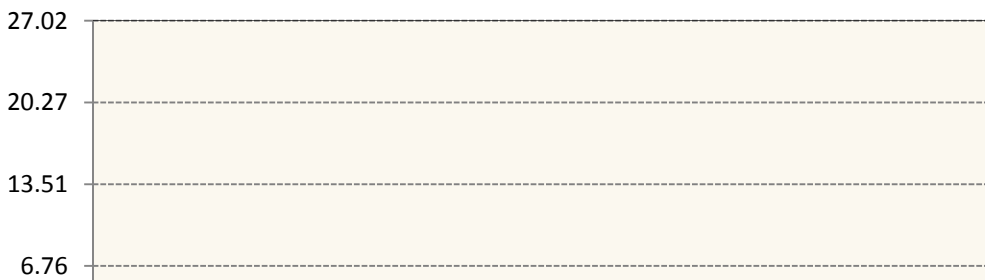
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,759	0	1,759	장내
누계	유가증권	옵션	0	57	-57	장내
누계	통화	선도	0	2,095	-2,095	장외

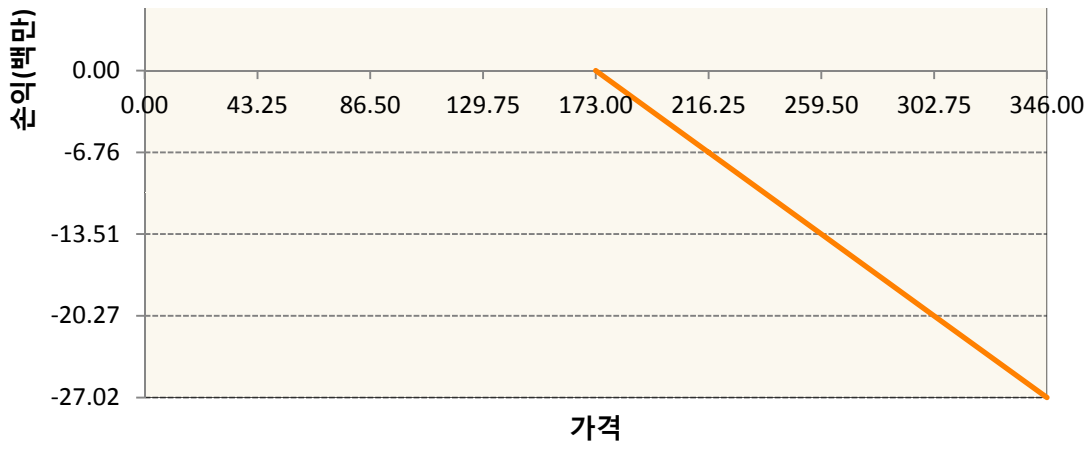
### 2. 만기시점의 손익구조

HCFO-HSCEI Futures Jan20

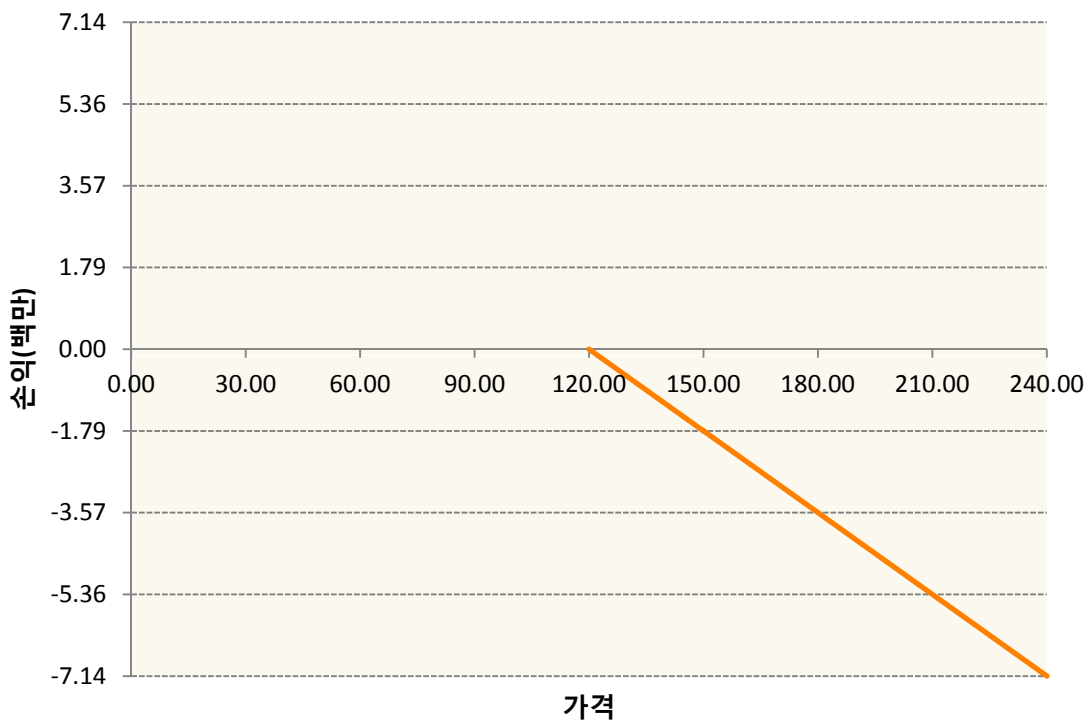


OHHIF0-C112-HSCEI

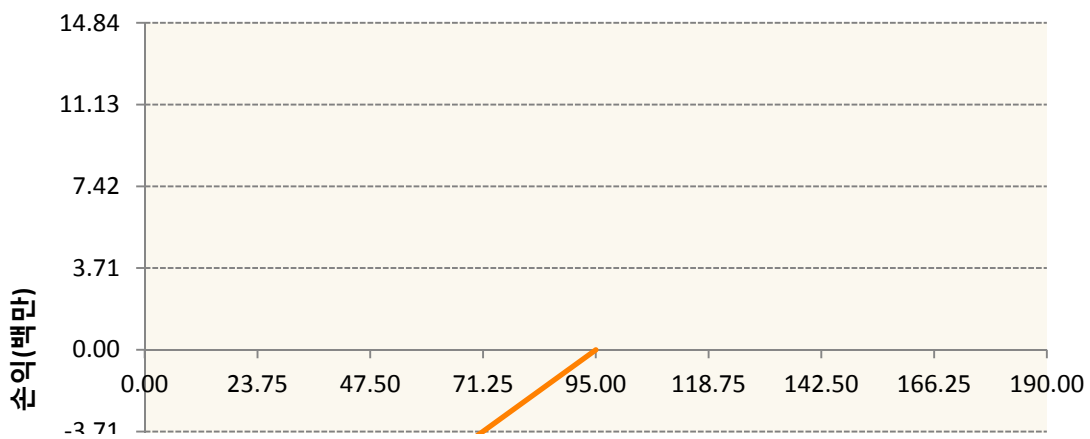


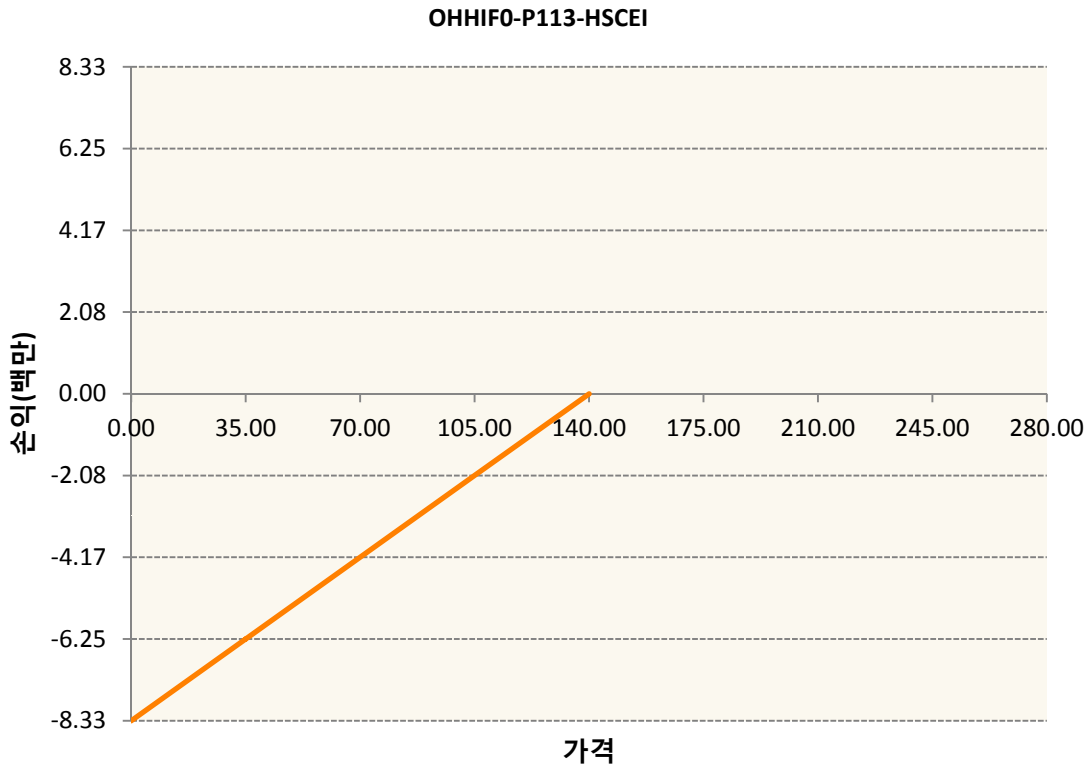
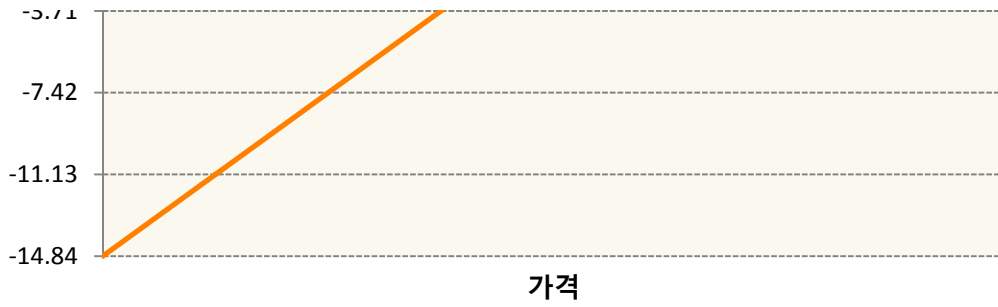


**OHHIF0-C113-HSCEI**



**OHHIF0-P112-HSCEI**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	168
HCF0 HSCEI Futures Jan20	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)
	183

공시일	2020-01-16
기준일	2020-01-15

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

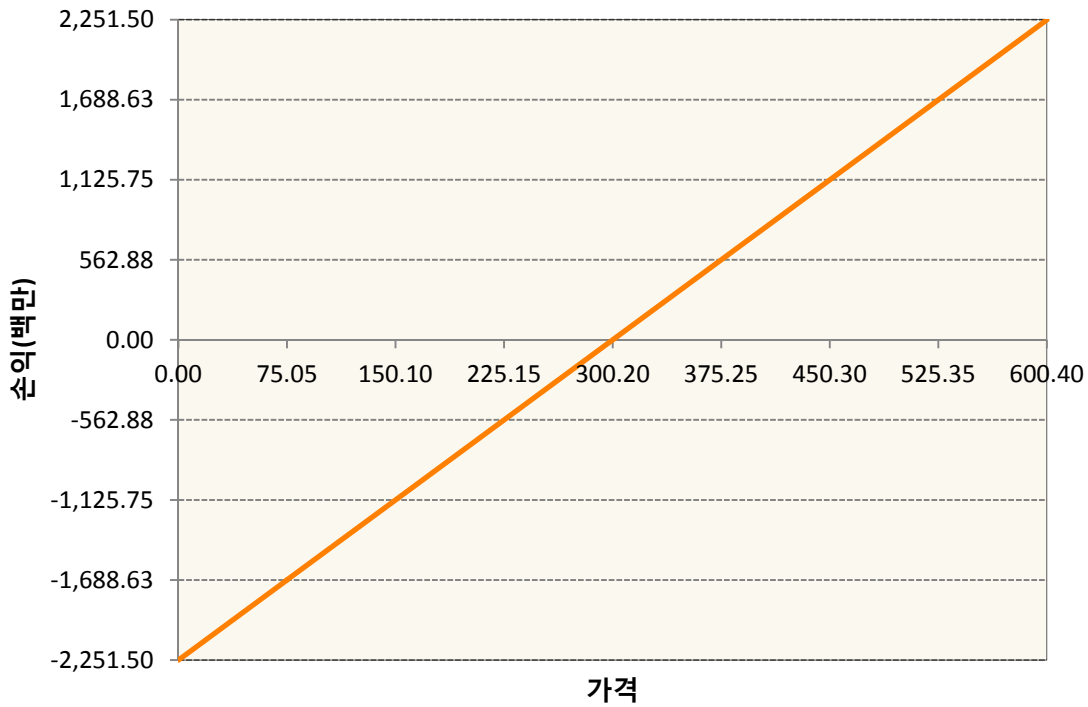
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

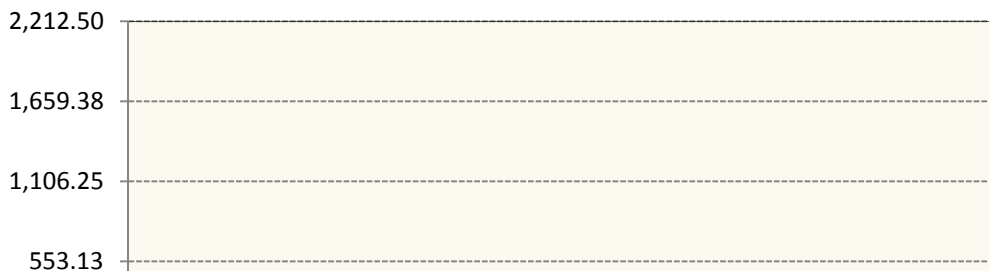
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	150	-150	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	435	0	435	장내
누계	유가증권	선물	2,252	0	2,252	장내
누계	유가증권	스왑	4,625	0	4,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,123	-4,123	장내

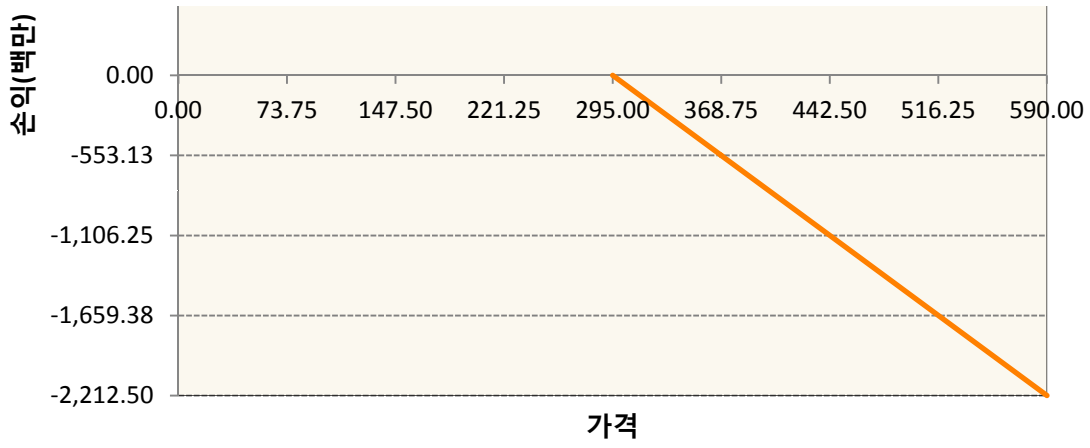
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

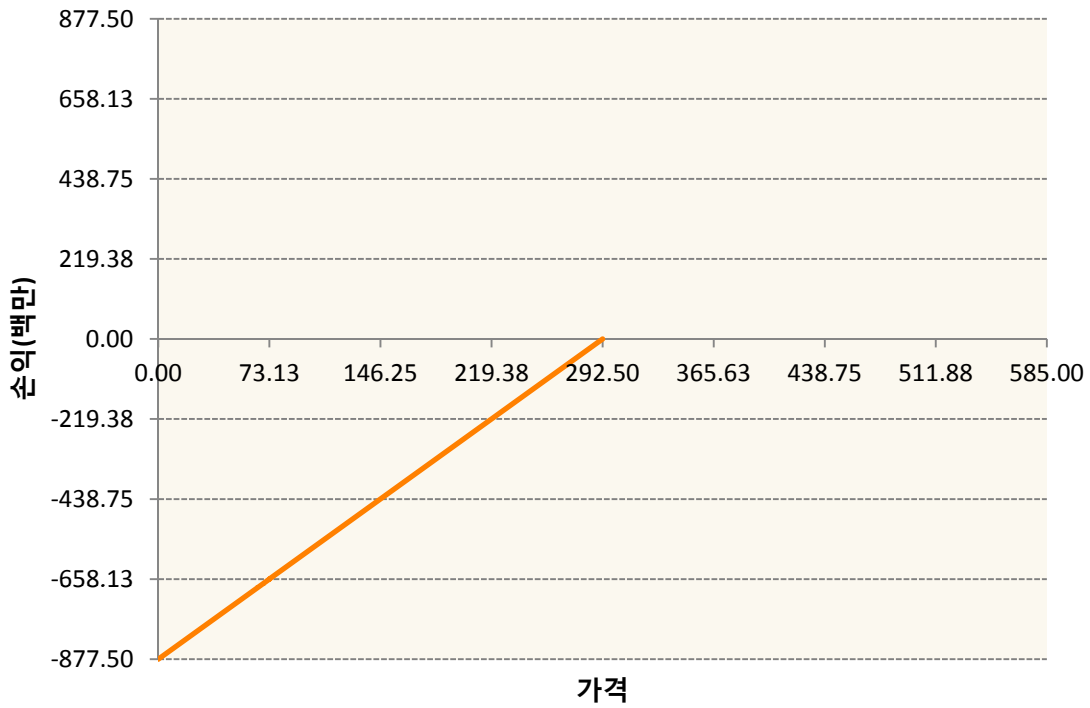


KR4201Q22950-2020-02 콜295

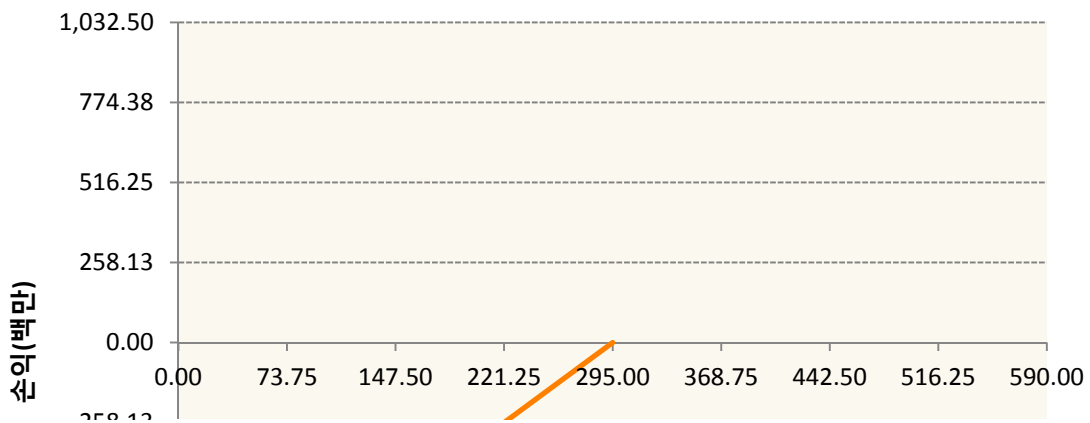




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



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						180
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-180	-180	-180	-180	-180	-180	-180	
-5.33%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120	
-2.67%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	60	60	60	60	60	60	60	
5.33%	120	120	120	120	120	120	120	
8.00%	180	180	180	180	180	180	180	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						147
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	82	79	75	71	67	63	58	
-5.33%	70	65	60	55	50	45	39	
-2.67%	49	43	37	32	26	20	14	
0%	17	12	6	0	-6	-12	-18	
2.67%	-24	-29	-34	-39	-45	-50	-55	
5.33%	-74	-77	-81	-85	-89	-94	-99	
8.00%	-128	-130	-133	-136	-139	-143	-147	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						47
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-45	-45	-45	-46	-46	-47	-47
-5.33%	-23	-23	-24	-25	-26	-27	-27
-2.67%	-6	-7	-8	-9	-10	-11	-12
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	5	5	4	4	3	3	2
5.33%	5	5	5	5	5	5	4
8.00%	5	5	5	5	5	5	5
KR4301Q22958                      2020-02 풋295							60
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-59	-59	-59	-59	-59	-60	-60
-5.33%	-32	-32	-33	-34	-34	-35	-36
-2.67%	-9	-11	-12	-13	-14	-16	-17
0%	4	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	8	7	7	6	5	5	4
5.33%	9	9	9	8	8	8	7
8.00%	9	9	9	9	9	9	8

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

(단위:백만원)

**777**

공시일	2020-01-16
기준일	2020-01-15

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

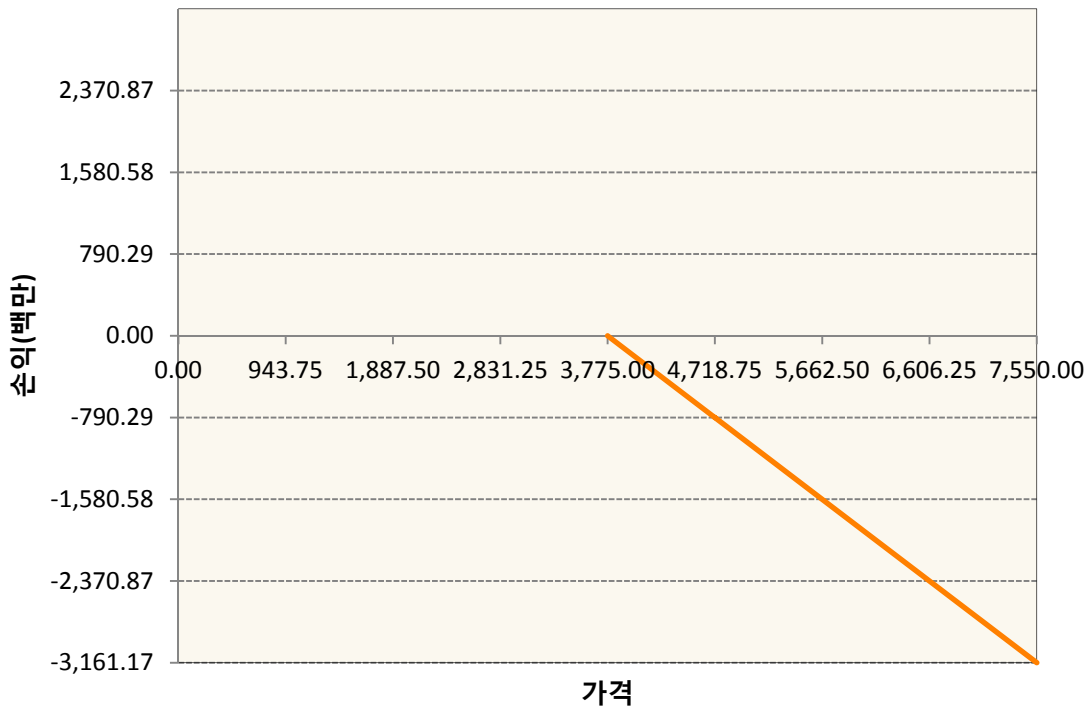
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

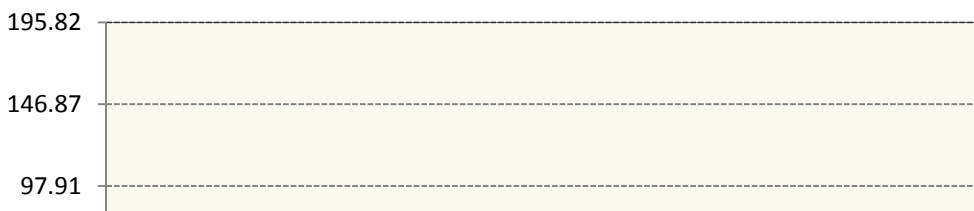
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	293	0	293	
누계	유가증권	스왑	15,647	0	15,647	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,714	-6,714	장내
누계	통화	선도	0	3,381	-3,381	장외

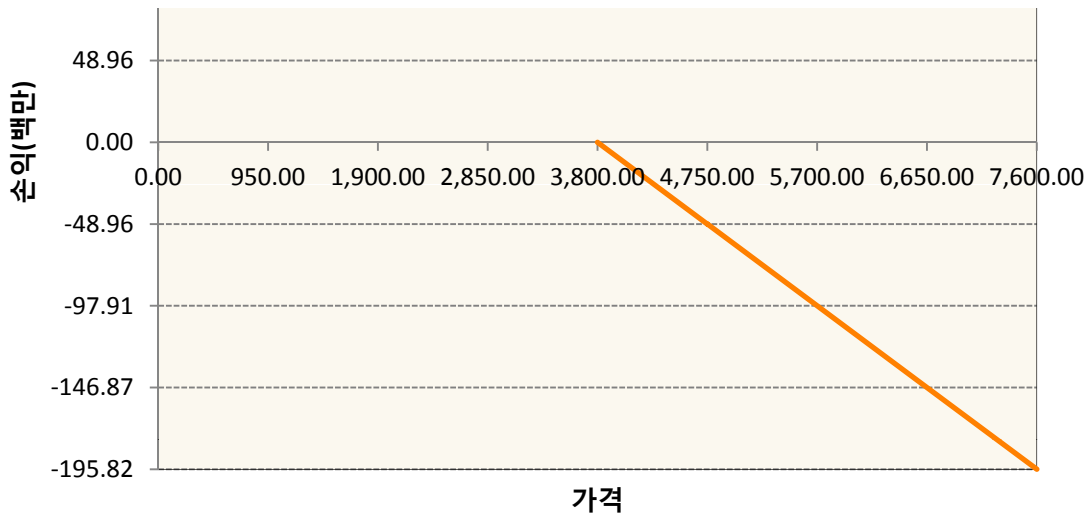
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXF0-C3775-EURO STOXX 50

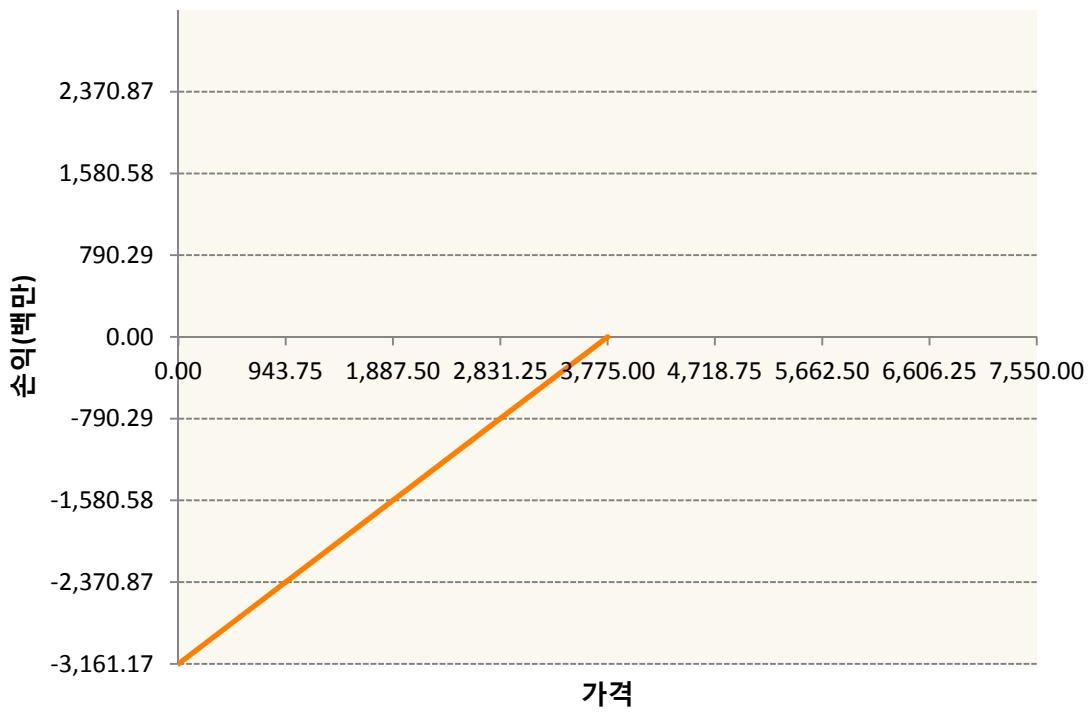


OESXF0-C3800-EURO STOXX 50

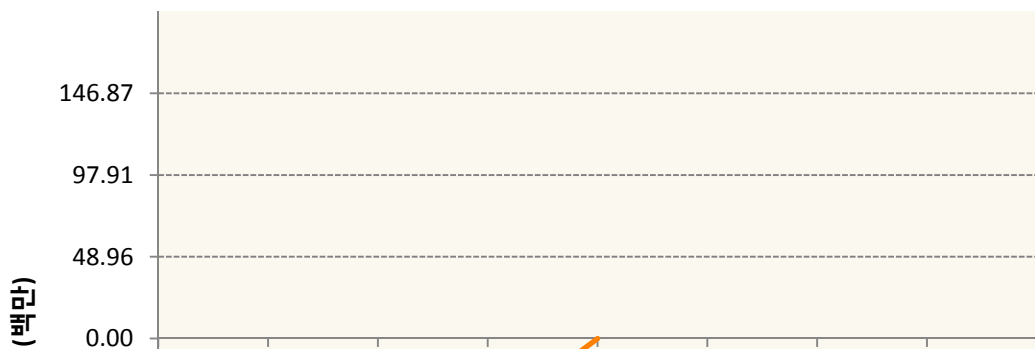


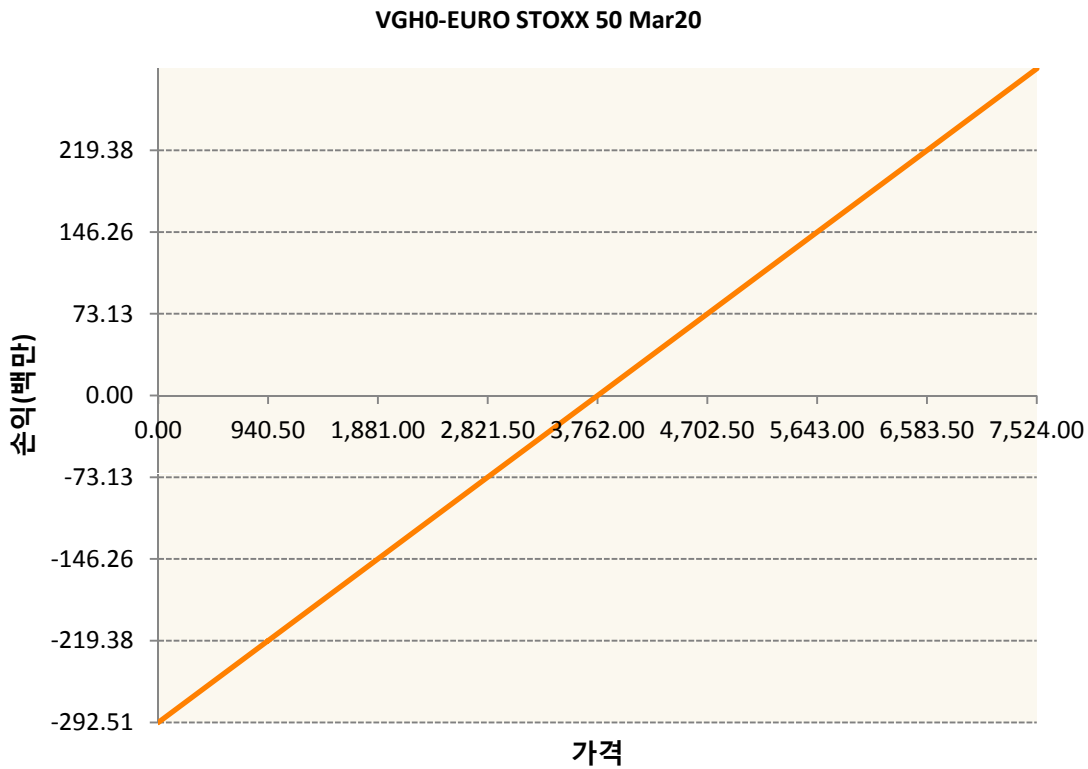
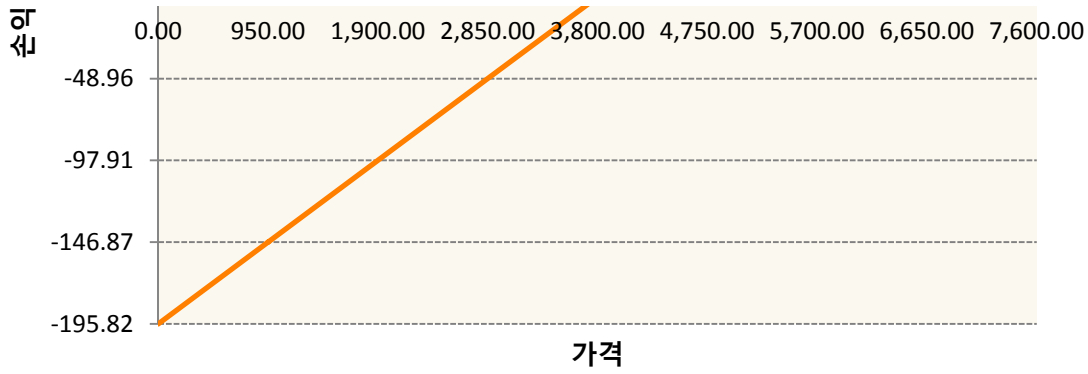


**OESXF0-P3775-EURO STOXX 50**



**OESXF0-P3800-EURO STOXX 50**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		43
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E		270
OESXF0-C37 EURO STOXX 50		253
OESXF0-C38 EURO STOXX 50		16
OESXF0-P37 EURO STOXX 50		253
OESXF0-P38 EURO STOXX 50		16
VGHO	EURO STOXX 50 Mar20	23

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





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

(단위:백만원)

922



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

(단위:백만원)

79



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

(단위:백만원)

116

공시일	2020-01-16
기준일	2020-01-15

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

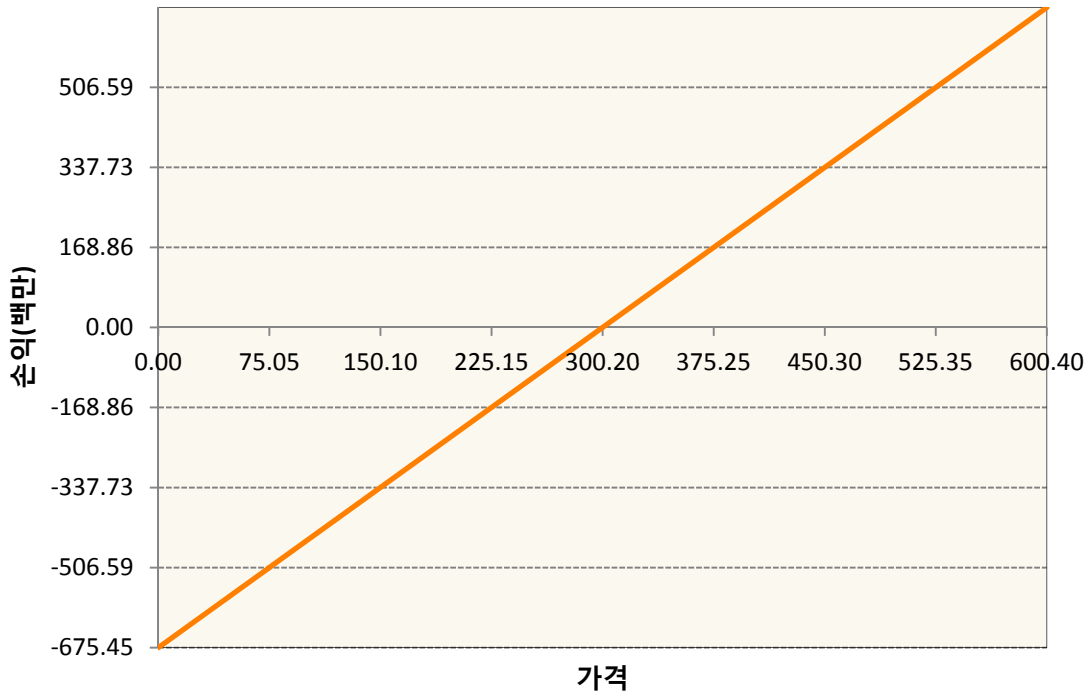
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	675	0	675	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005      2020-03 코스피200지수선물      54

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	18	18	18	18	18	18	18
5.33%	36	36	36	36	36	36	36
8.00%	54	54	54	54	54	54	54

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

(단위:백만원)

42

공시일	2020-01-16
기준일	2020-01-15

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

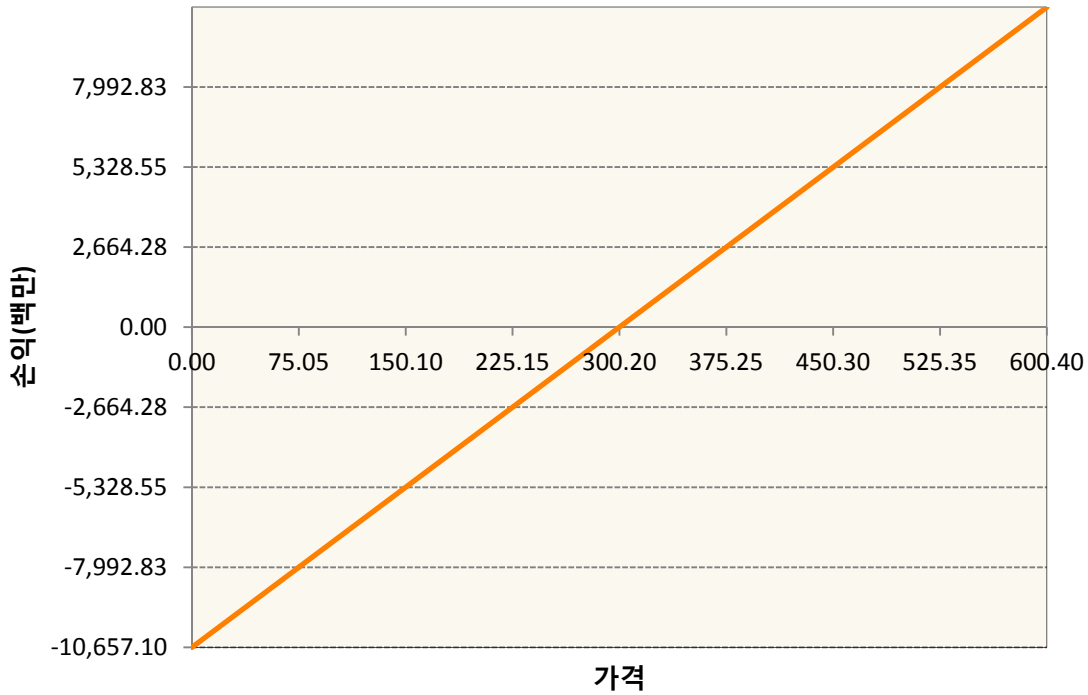
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

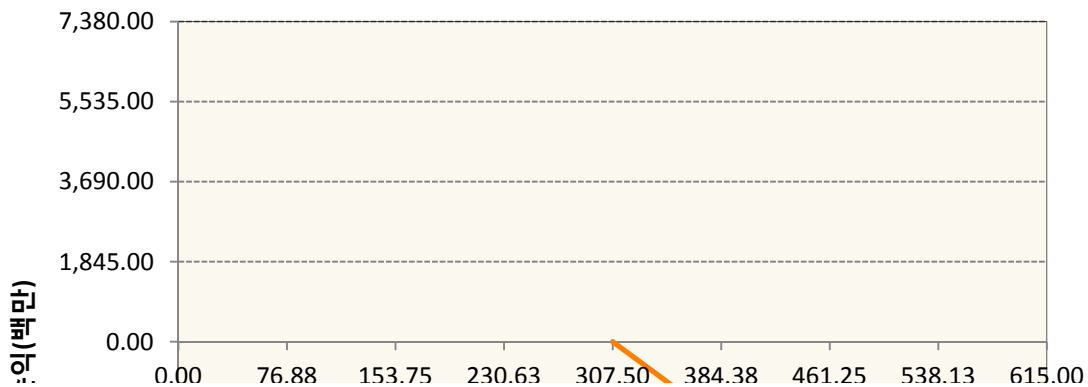
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	150	-150	장내
신규	유가증권	옵션	154	0	154	장내
누계	유가증권	선물	10,657	0	10,657	장내
누계	유가증권	옵션	2,944	21,175	-18,231	장내

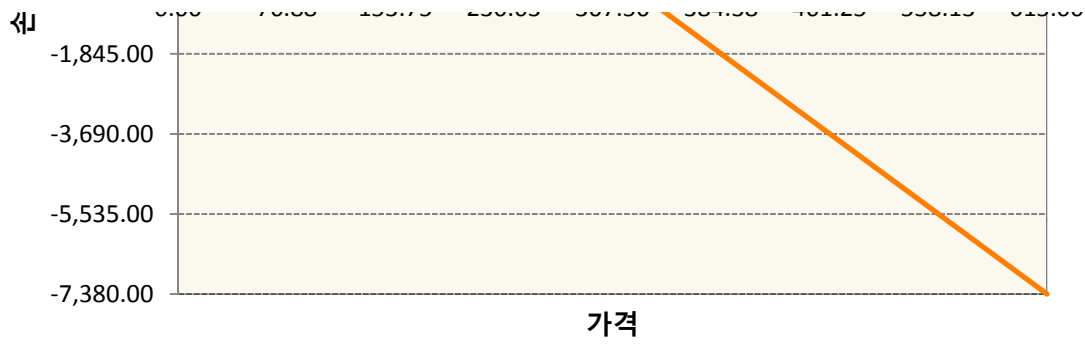
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

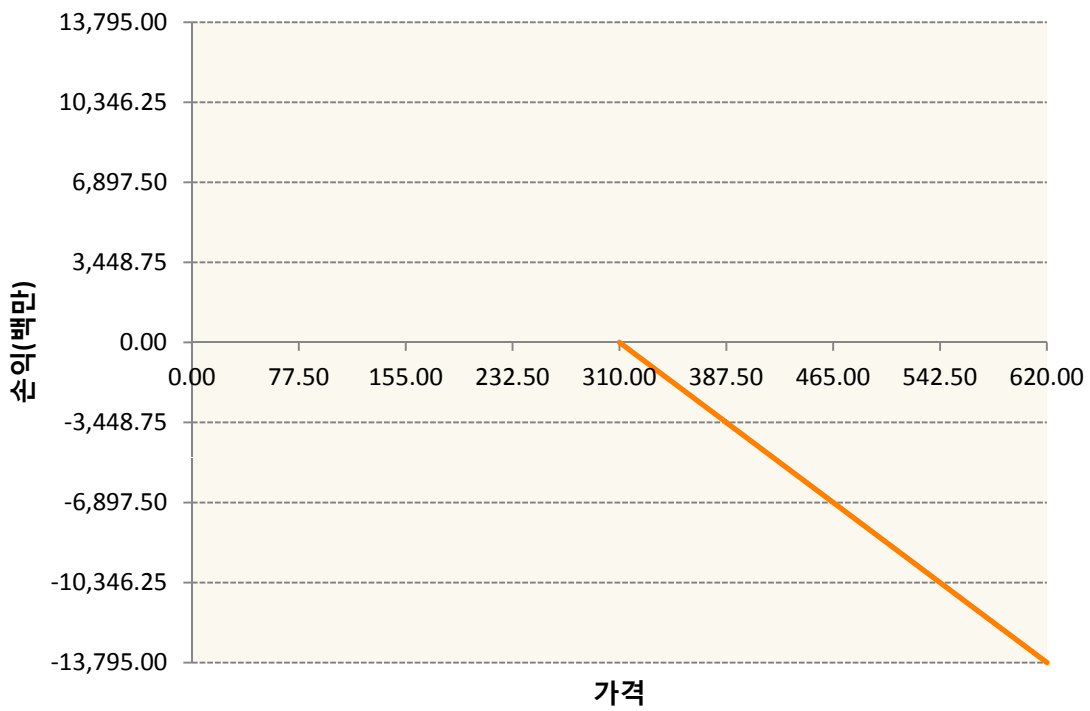


KR4201Q23073-2020-02 콜307.5

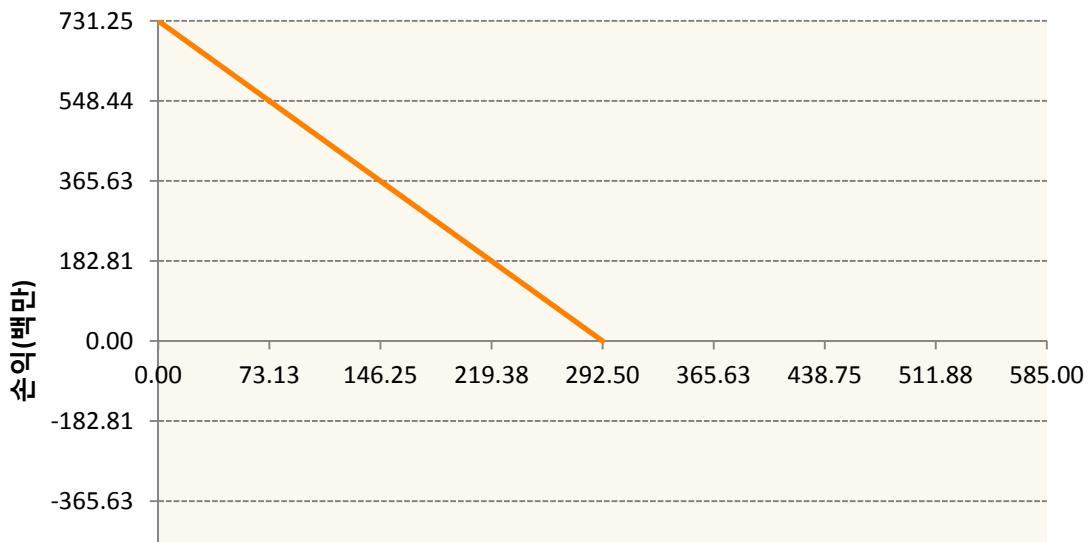


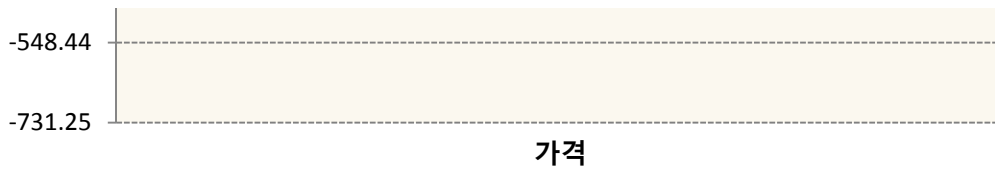


KR4201Q23107-2020-02 콜310

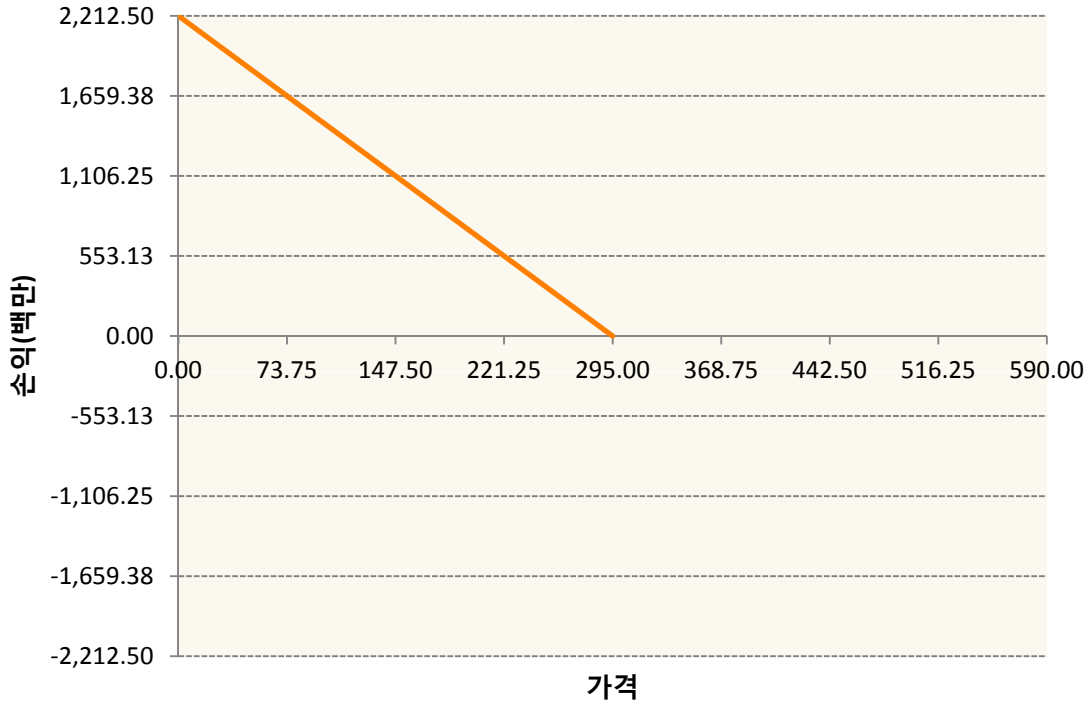


KR4301Q22925-2020-02 풋292.5





KR4301Q22958-2020-02 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						851
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-851	-851	-851	-851	-851	-851	-851	
-5.33%	-568	-568	-568	-568	-568	-568	-568	
-2.67%	-284	-284	-284	-284	-284	-284	-284	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	284	284	284	284	284	284	284	
5.33%	568	568	568	568	568	568	568	
8.00%	851	851	851	851	851	851	851	
KR4201Q23073		2020-02 콜307.5						384
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	146	142	136	129	121	112	102	
-5.33%	134	125	115	104	93	80	66	
-2.67%	106	93	78	63	47	31	14	

0%	55	37	18	0	-19	-37	-56
2.67%	-28	-48	-67	-87	-107	-127	-146
5.33%	-143	-161	-180	-199	-218	-237	-256
8.00%	-286	-301	-316	-333	-349	-366	-384
KR4201Q23107                      2020-02 콜310							676
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	236	230	221	210	197	182	165
-5.33%	219	205	189	171	151	129	106
-2.67%	178	155	130	104	77	48	19
0%	97	65	33	0	-33	-67	-101
2.67%	-38	-74	-111	-147	-184	-221	-257
5.33%	-232	-268	-304	-340	-377	-413	-449
8.00%	-483	-512	-544	-576	-609	-642	-676
KR4301Q22925                      2020-02 풋292.5							39
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	38	38	38	38	38	39	39
-5.33%	19	20	20	21	21	22	23
-2.67%	5	6	7	8	9	9	10
0%	-2	-1	-1	0	1	2	2
2.67%	-4	-4	-4	-3	-3	-2	-2
5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
KR4301Q22958                      2020-02 풋295							129
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	126	126	126	127	127	128	129
-5.33%	68	69	70	72	74	76	77
-2.67%	20	23	25	28	31	33	36
0%	-8	-5	-3	0	3	5	8
2.67%	-17	-16	-15	-13	-12	-10	-8
5.33%	-19	-19	-18	-18	-17	-16	-15
8.00%	-19	-19	-19	-19	-19	-18	-18

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

(단위:백만원)

1,645

공시일	2020-01-16
기준일	2020-01-15

## 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	205,317	0	205,317	

### 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	2020-01-16
기준일	2020-01-15

## 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	214,315	0	214,315	

### 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	2020-01-16
기준일	2020-01-15

## 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	529,026	0	529,026	
누계	통화	선도	0	536,964	-536,964	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E	1,388
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E	1,490
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E	1,851
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E	3,184
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E	4,721
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	185
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,777
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,777
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,314
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,499
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	1,611
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	1,518
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	926
FX21019Z02 KRW/USD 16-01-20E	1,666
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	185
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	1,981
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	926
FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E	3,702
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,851
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,981
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	185
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	185
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	1,111
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	1,666
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	278

IE00BD8RGM75

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

14,106



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

(단위:백만원)

211

공시일	2020-01-16
기준일	2020-01-15

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

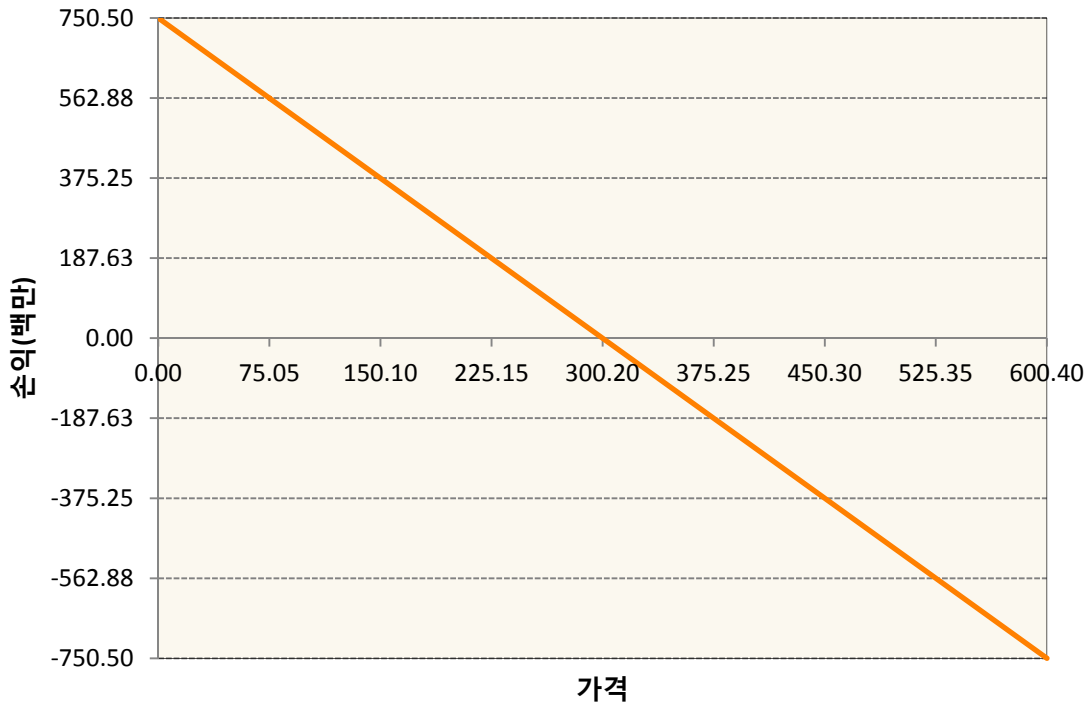
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

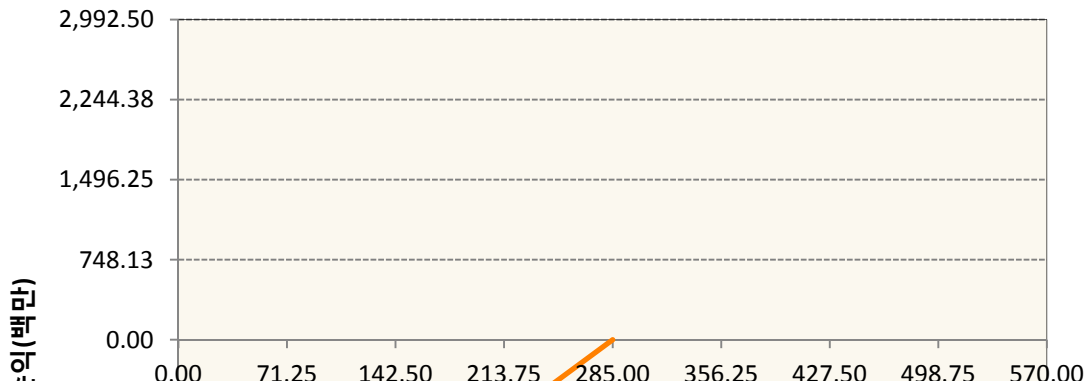
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	751	-751	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,855	-3,855	장내

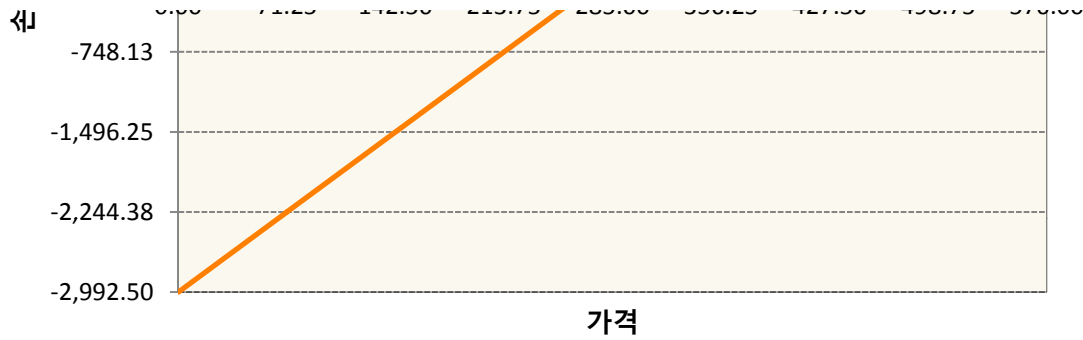
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

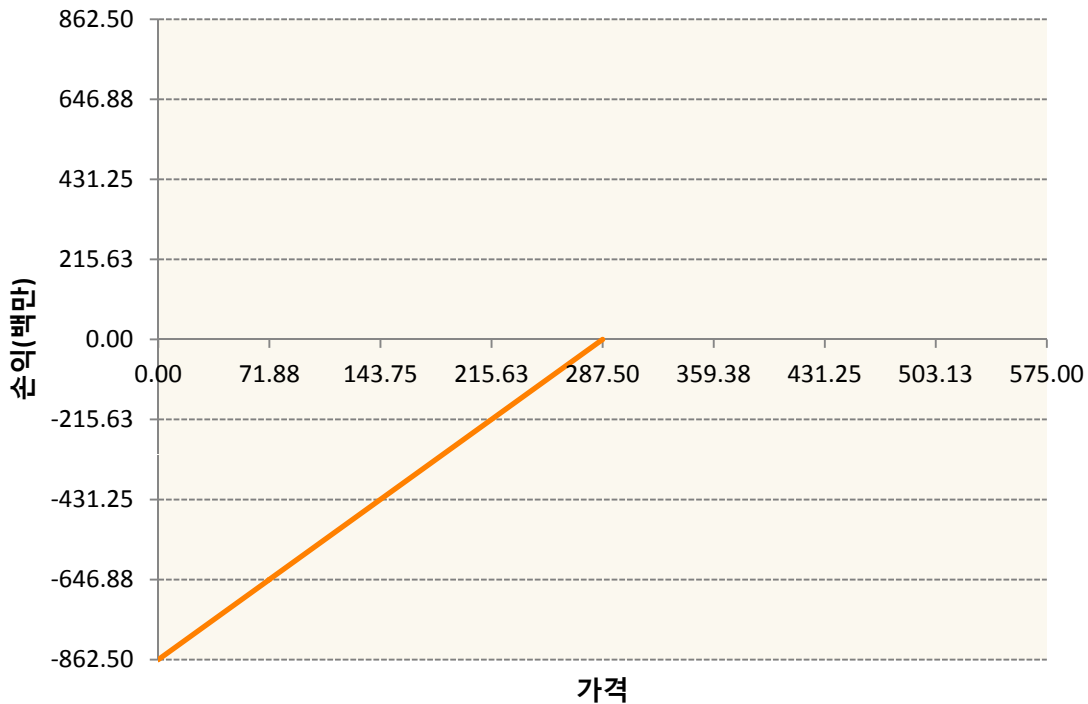


KR4301Q22859-2020-02 풋285





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						112
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-97	-99	-102	-104	-107	-109	-112
-5.33%	-36	-40	-43	-47	-51	-55	-58
-2.67%	-5	-8	-11	-14	-17	-20	-24
0%	4	3	1	0	-2	-4	-6
2.67%	5	5	5	4	3	3	2
5.33%	5	5	5	5	5	5	4
8.00%	5	5	5	5	5	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%	-34	-34	-35	-35	-36	-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)

**147**

공시일	2020-01-16
기준일	2020-01-15

## 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	13,237	0	13,237	
누계	통화	선도	0	13,016	-13,016	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
IE00BD8RGM75	

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

342
-----

공시일	2020-01-16
기준일	2020-01-15

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

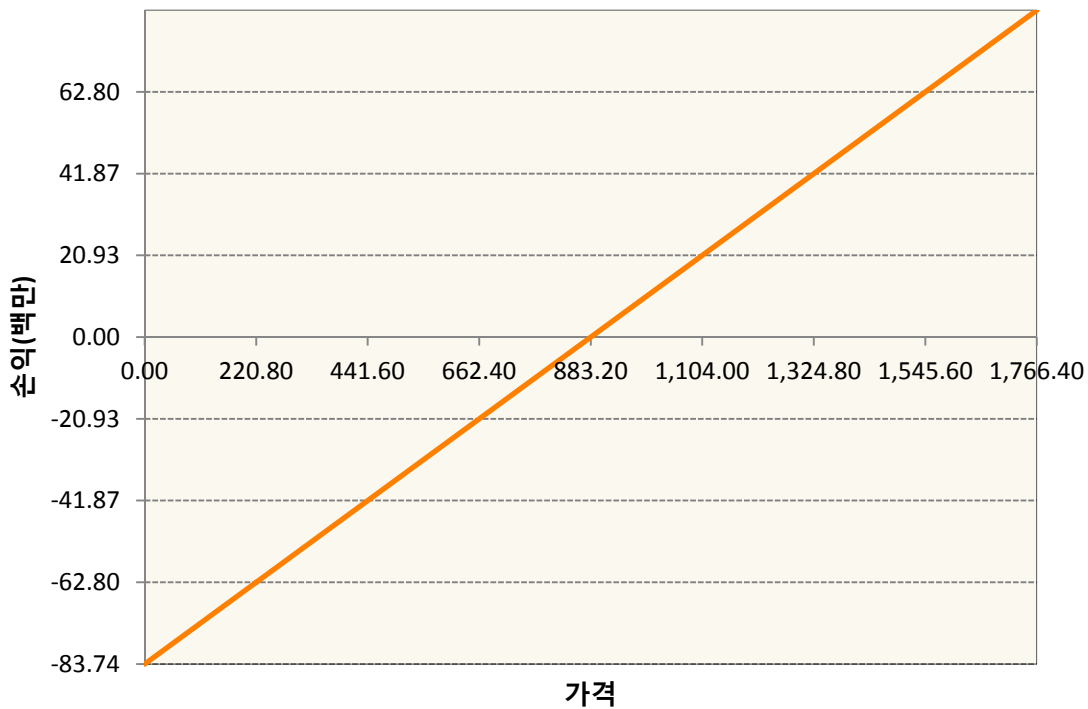
### 1. 계약금액

(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	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	84	0	84	
누계	유가증권	스왑	2,007	0	2,007	장외
누계	통화	선도	309	812	-502	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

VNCG0-VN30 Index Future Feb20



### 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
FX21020F01 KRW/EUR 27-03-20E	6
VNCG0 VN30 Index Future Feb20	7

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

(단위:백만원)

**150**

공시일	2020-01-16
기준일	2020-01-15

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

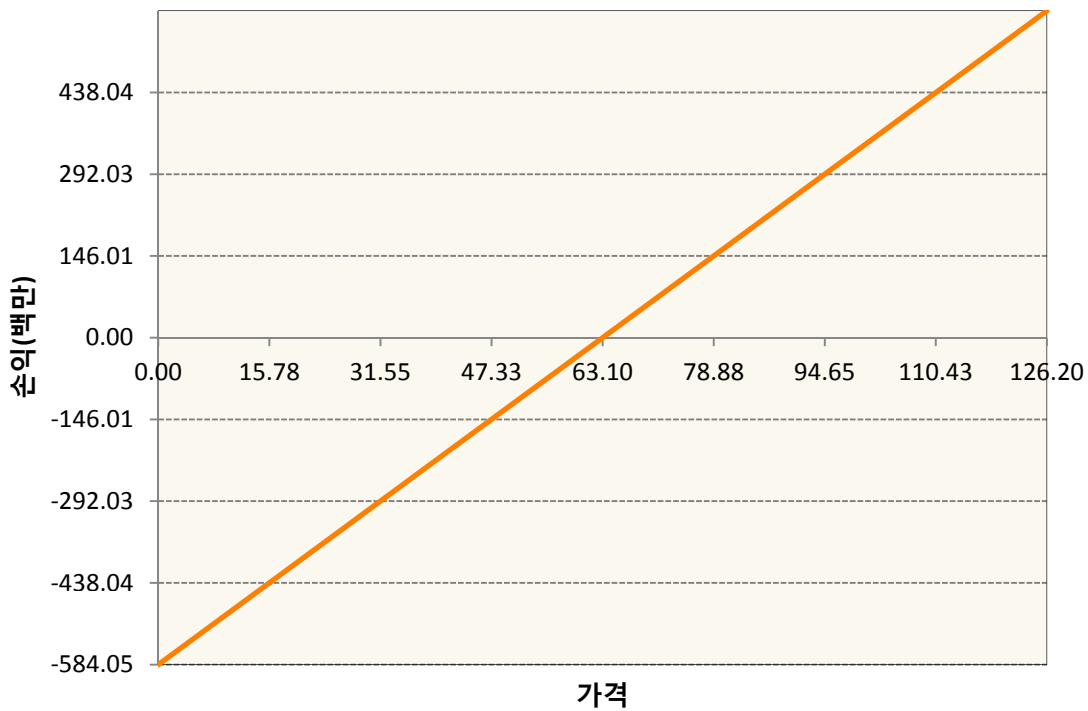
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

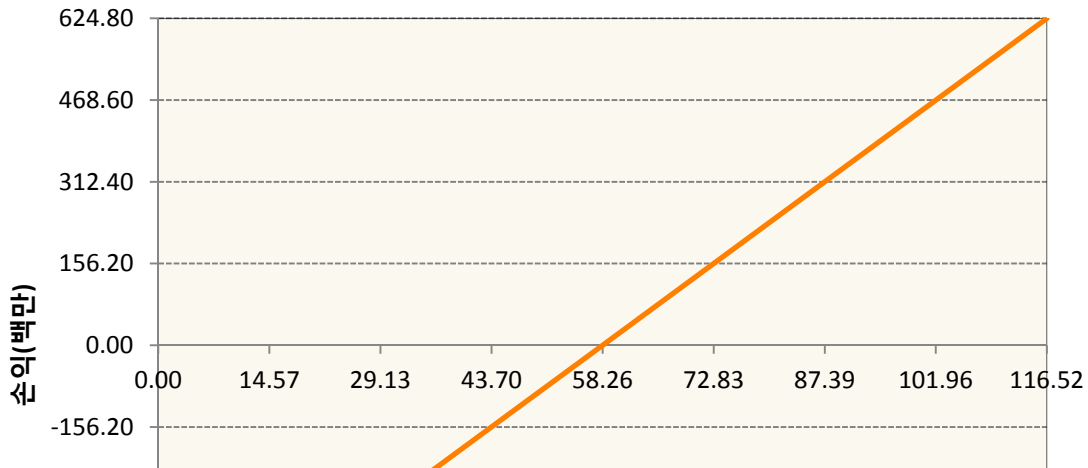
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,419	289	2,130	

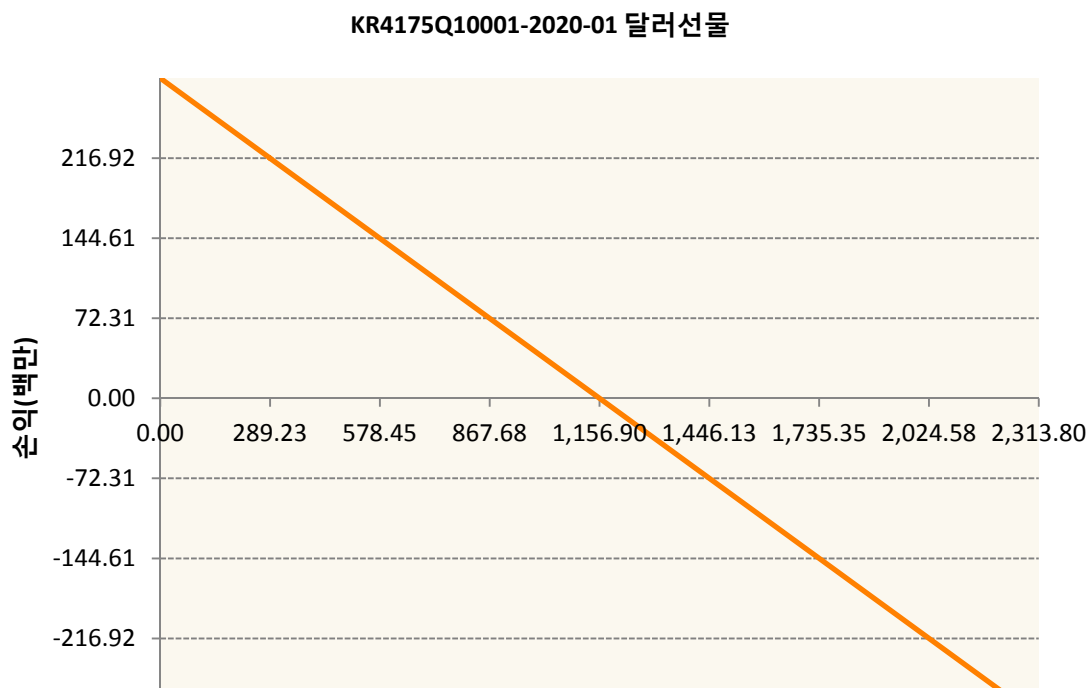
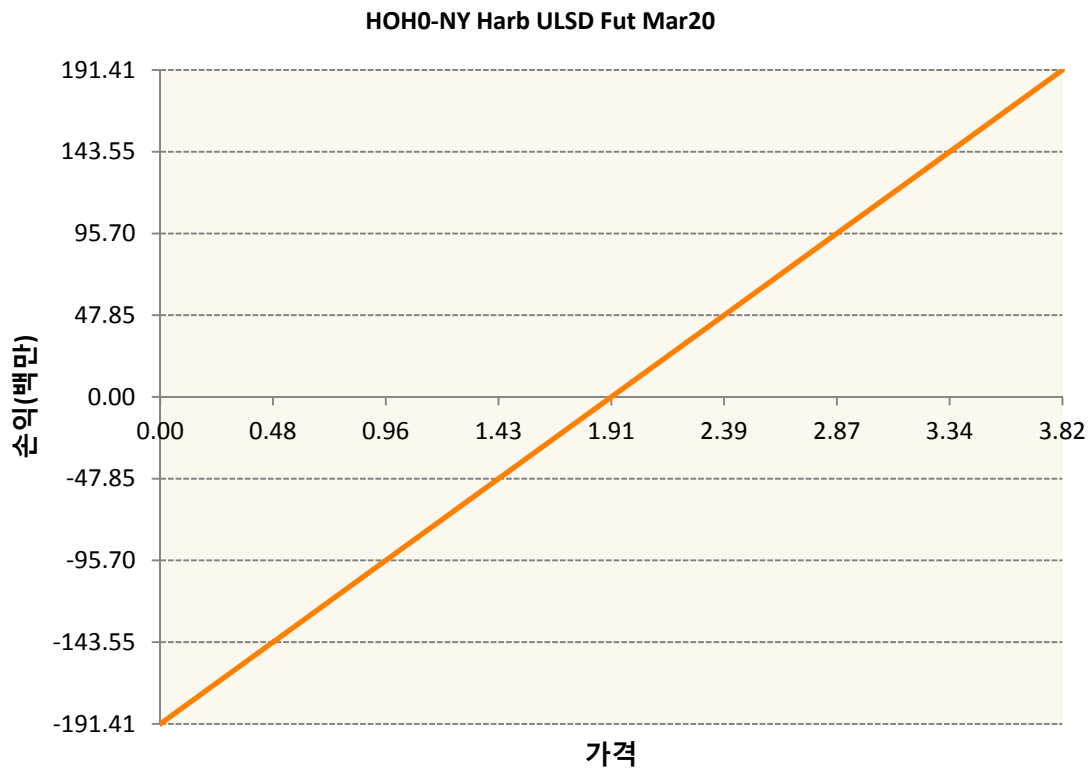
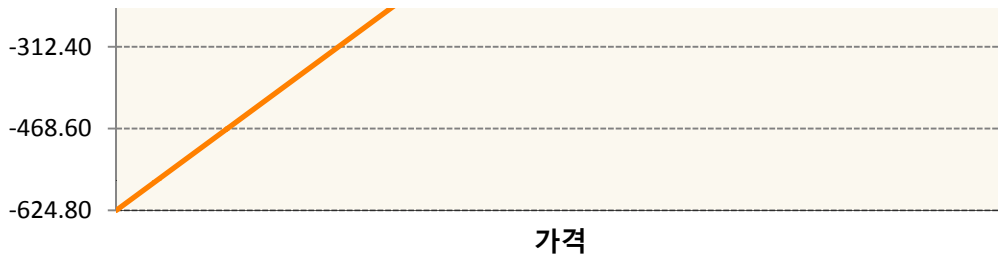
### 2. 만기시점의 손익구조

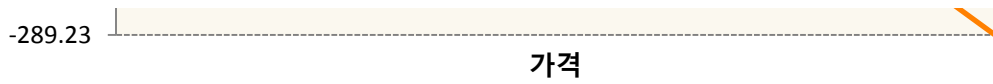
**COKO-BRENT CRUDE FUTR May20**



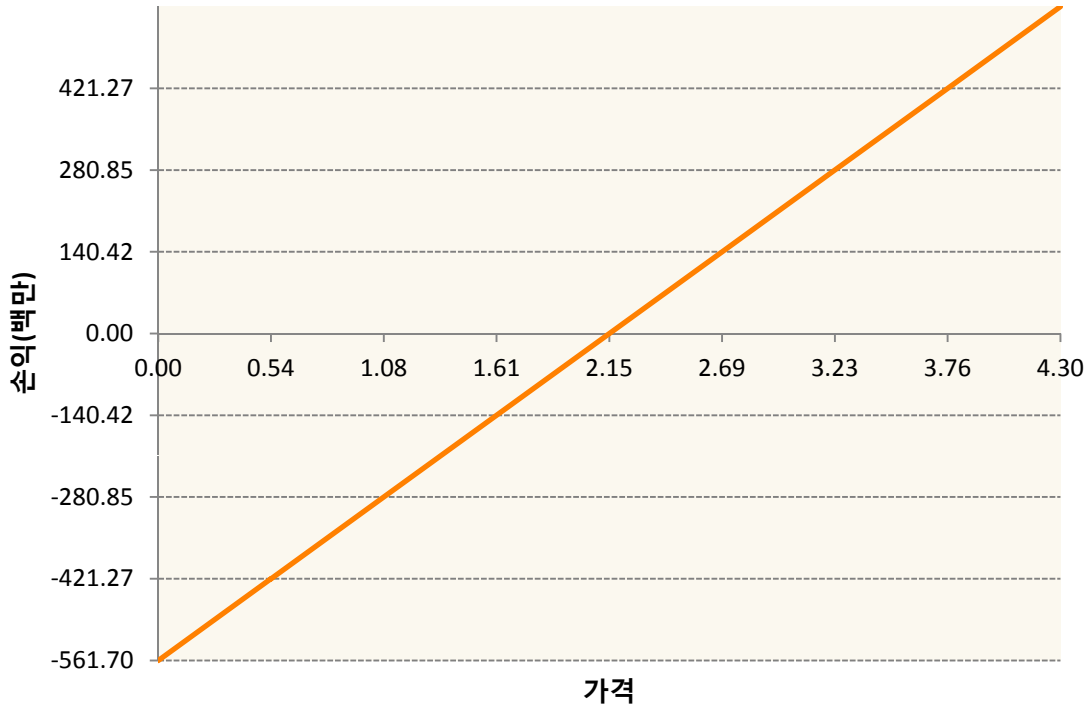
**CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20**



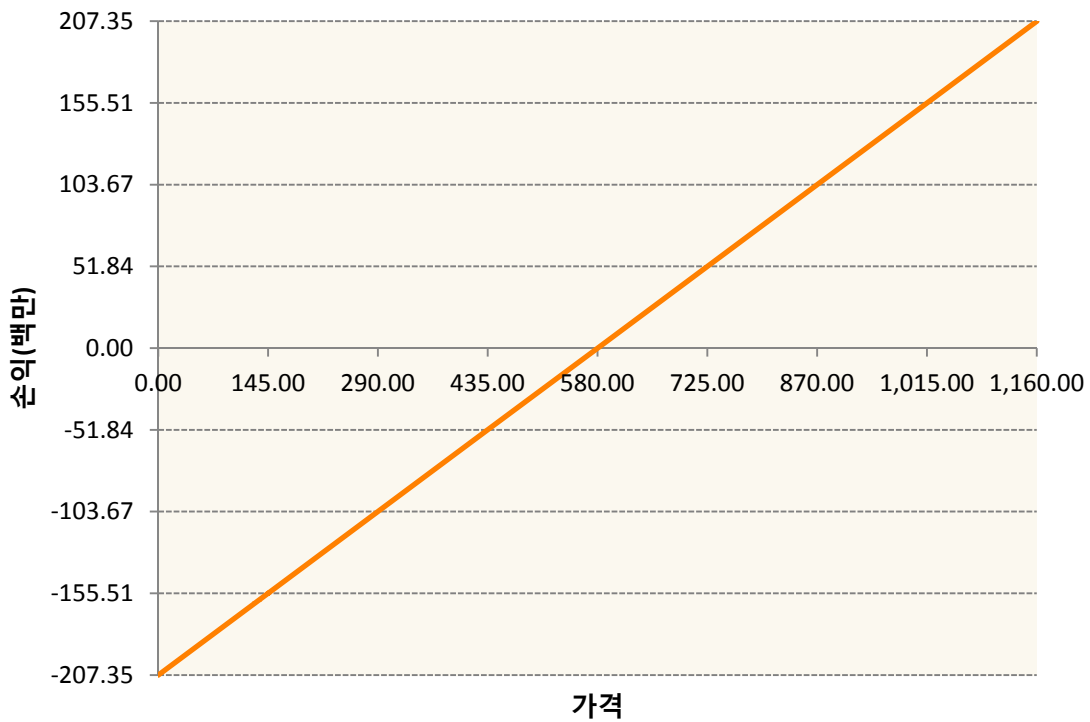




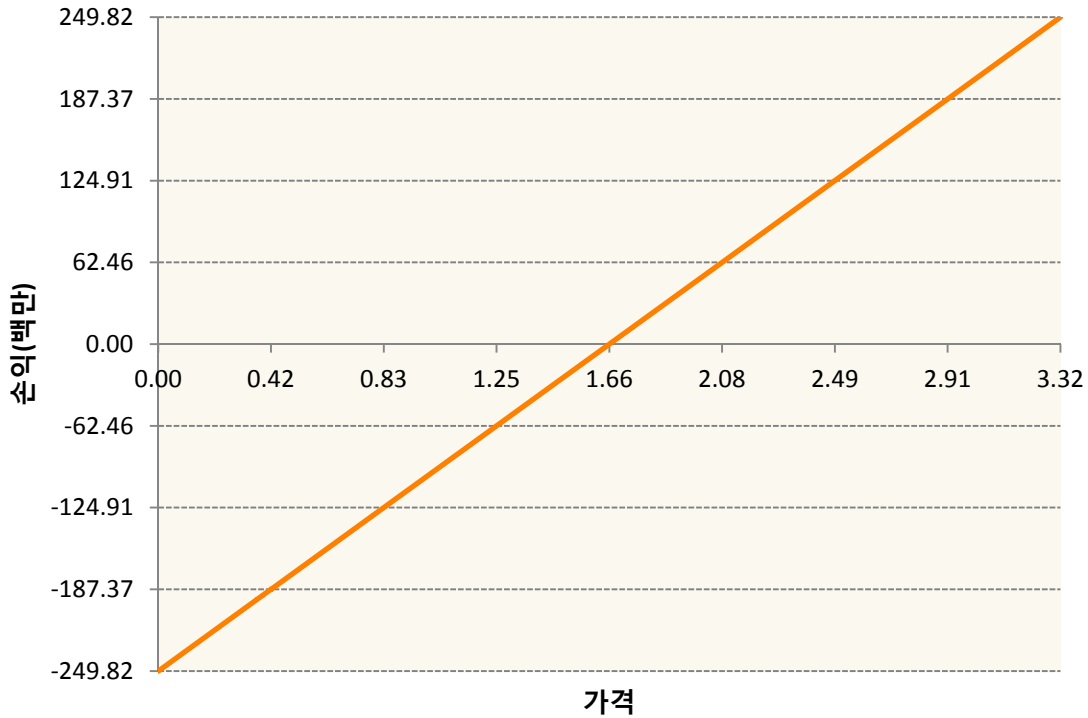
NGH20-NATURAL GAS FUTR Mar20



QSH0-Low Su Gasoil G Mar20



XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	47
CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	50
HOH0	NY Harb ULSD Fut Mar20	15
KR4175Q10C	2020-01 달러선물	23
NGH20	NATURAL GAS FUTR Mar20	45
QSH0	Low Su Gasoil G Mar20	17
XBH0	GASOLINE RBOB FUT Mar20	20

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

377

공시일	2020-01-16
기준일	2020-01-15

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

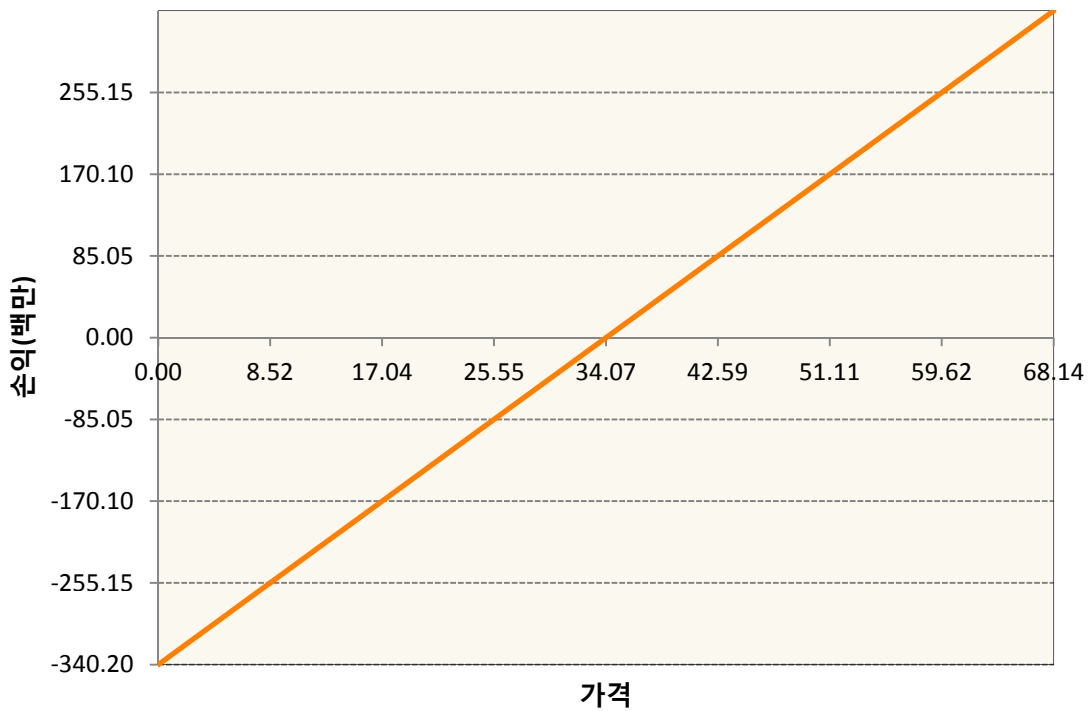
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

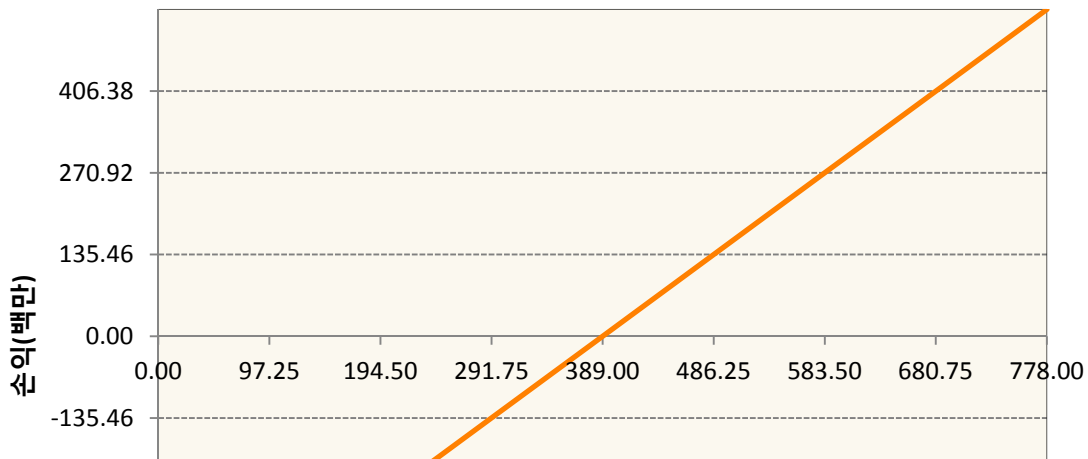
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,859	150	2,709	

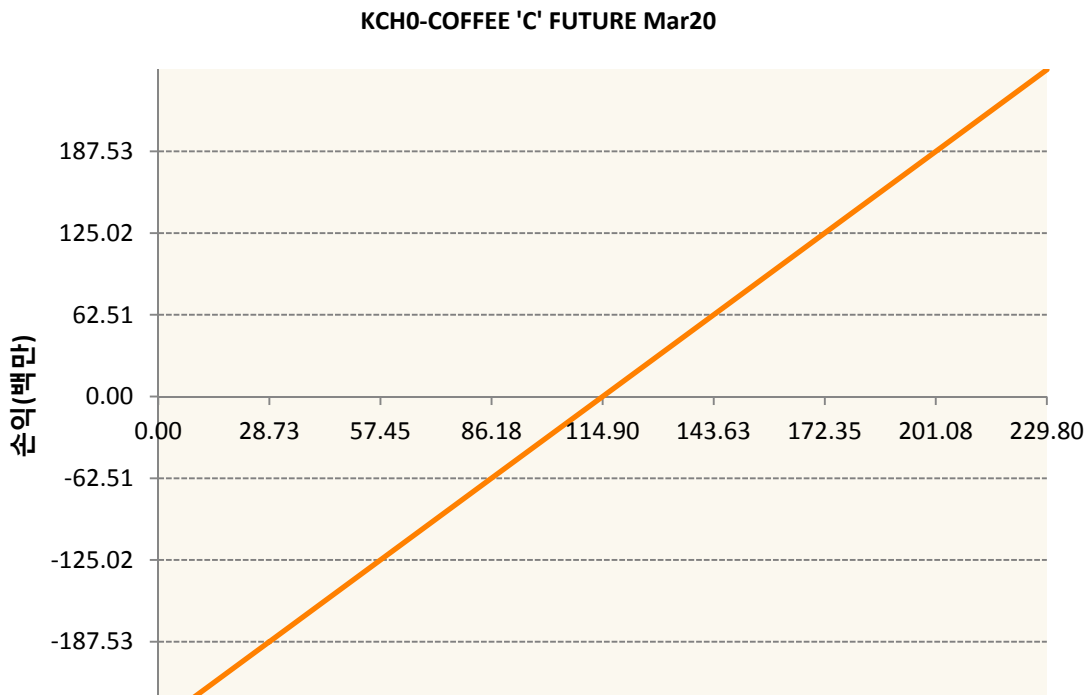
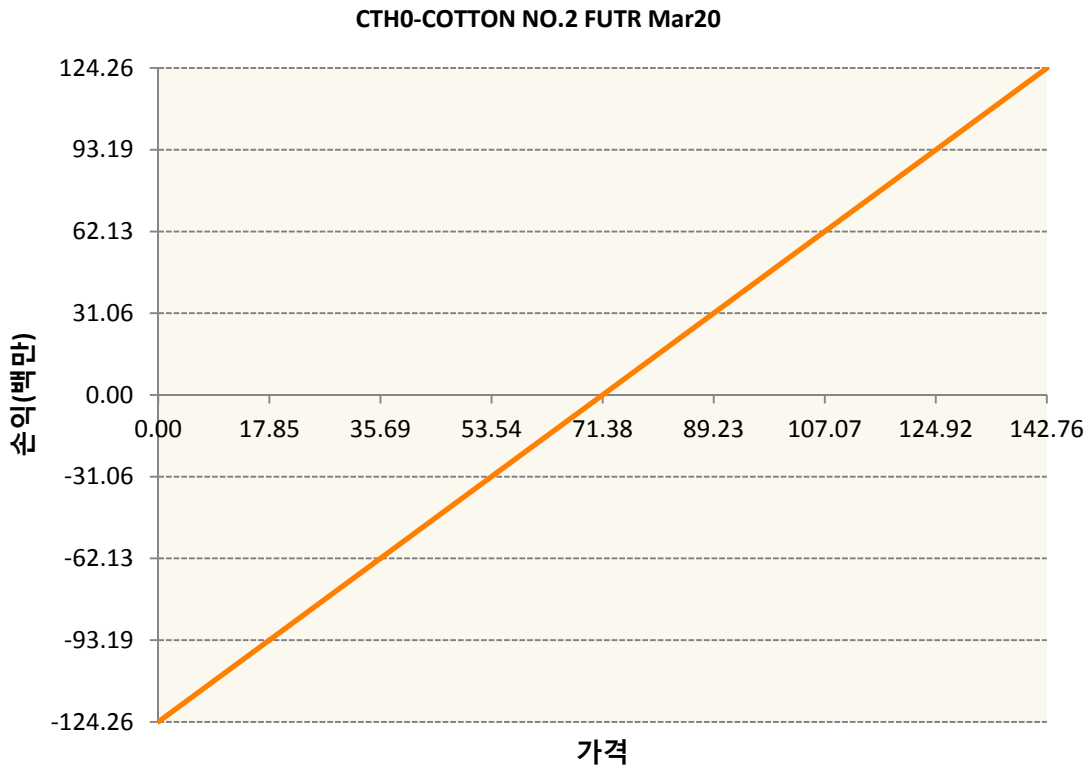
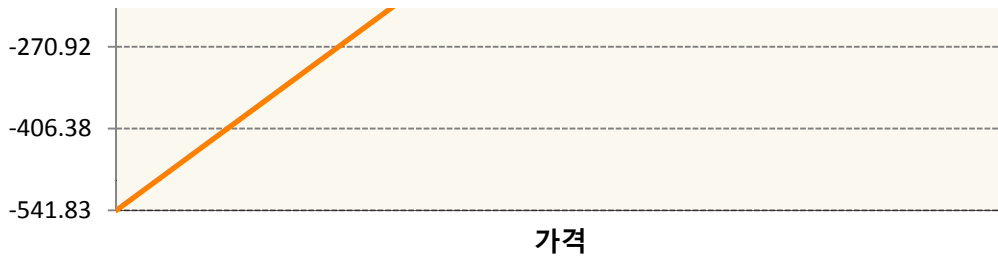
### 2. 만기시점의 손익구조

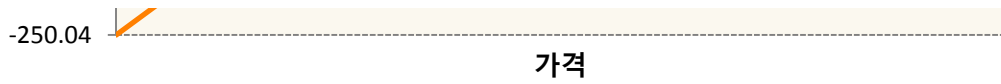
**BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20**



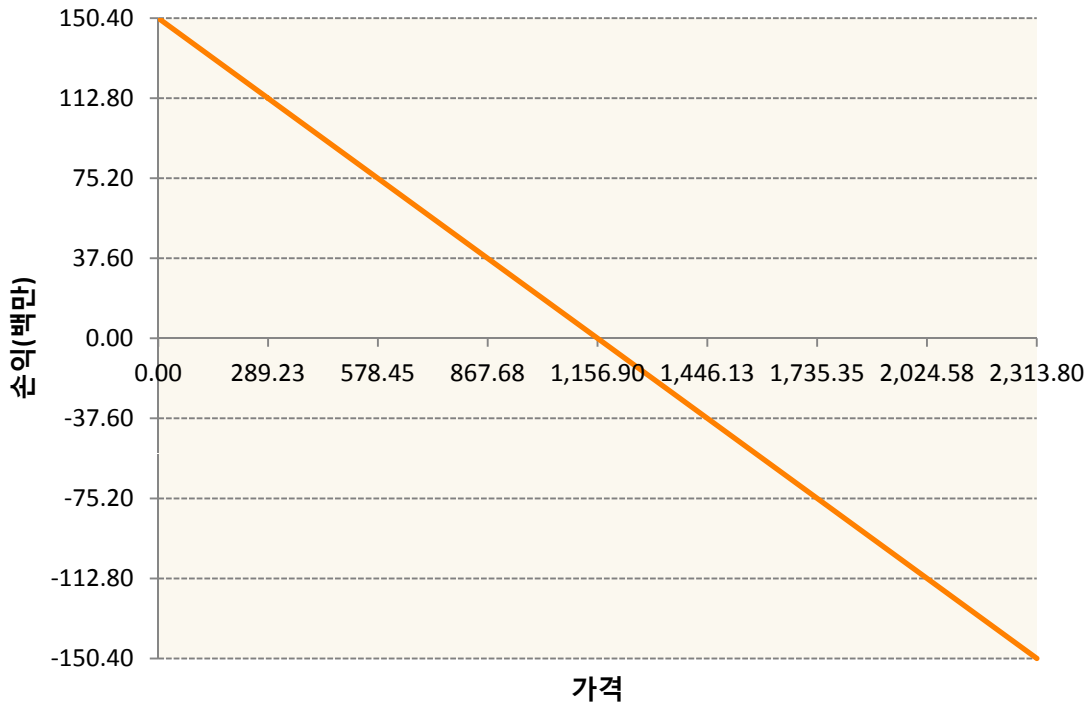
**CH0-CORN FUTURE Mar20**



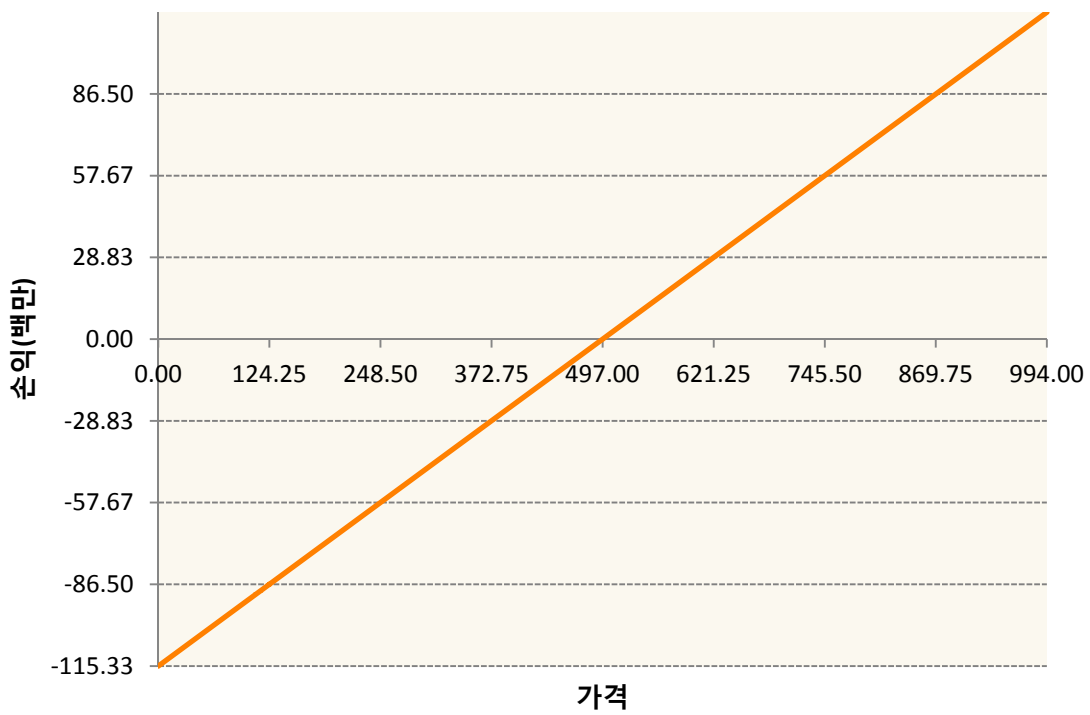




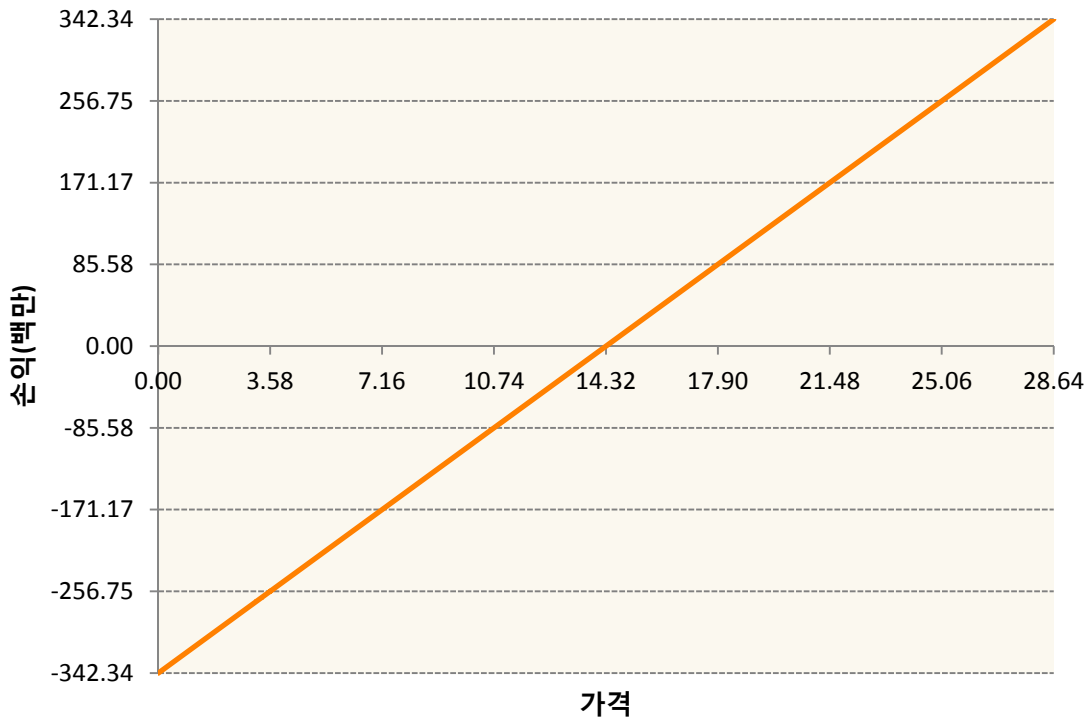
KR4175Q10001-2020-01 달러선물



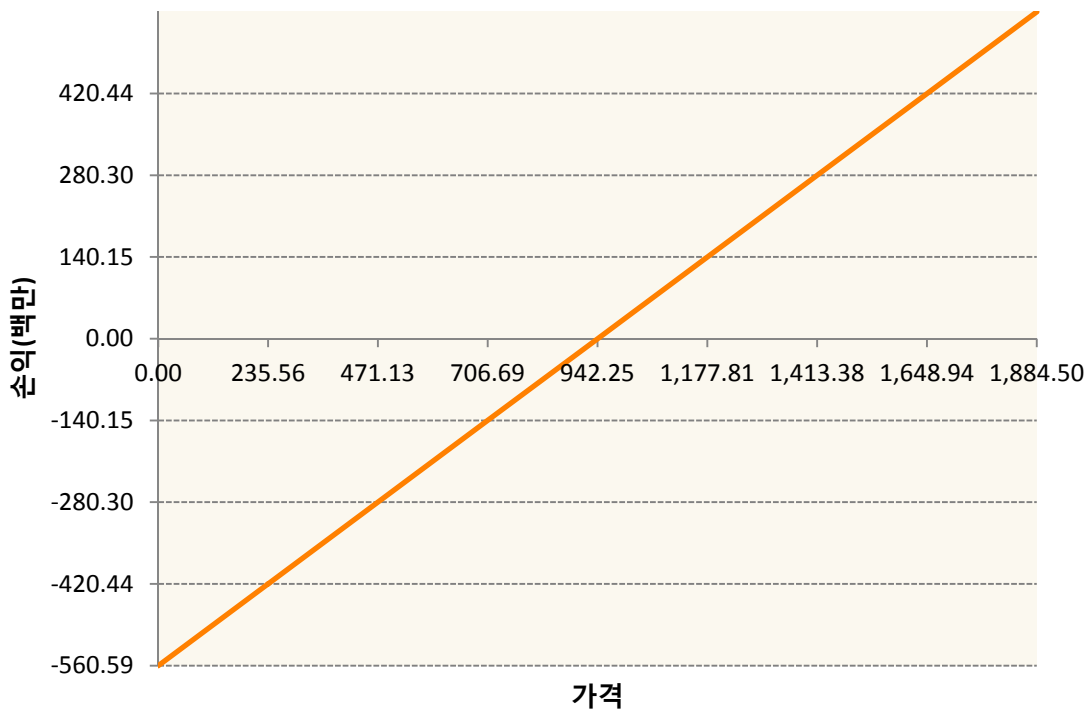
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



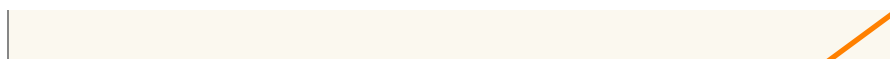
SBH0-Sugar Mar20

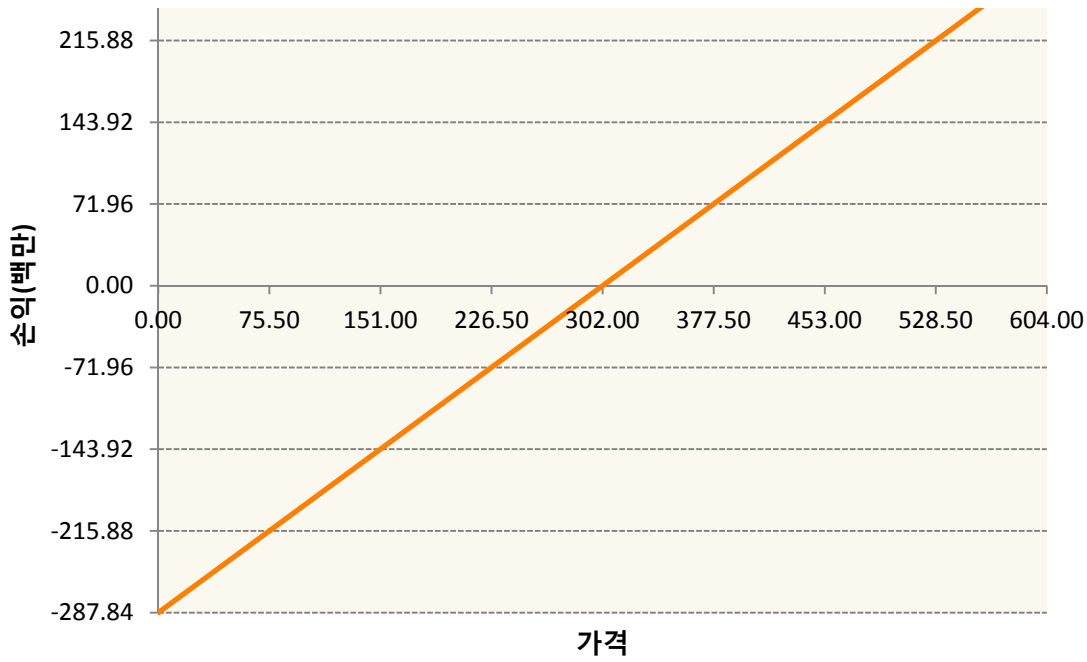


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20

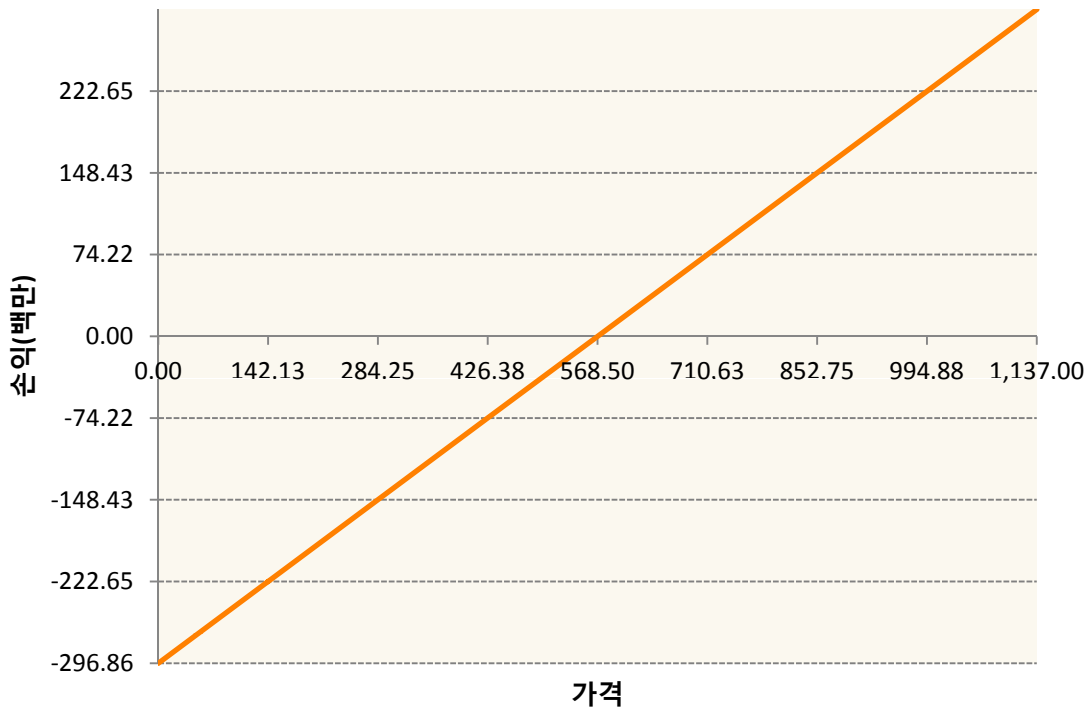


SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





WHO-WHEAT FUTURE(CBT) 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	20
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)

**248**