

공시일	2020-01-06
기준일	2020-01-03

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	2020-01-06
기준일	2020-01-03

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

1,137

* 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	2020-01-06
기준일	2020-01-03

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)	415
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	152

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

791

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-06
기준일	2020-01-03

유로인덱스모(주식-파생형)

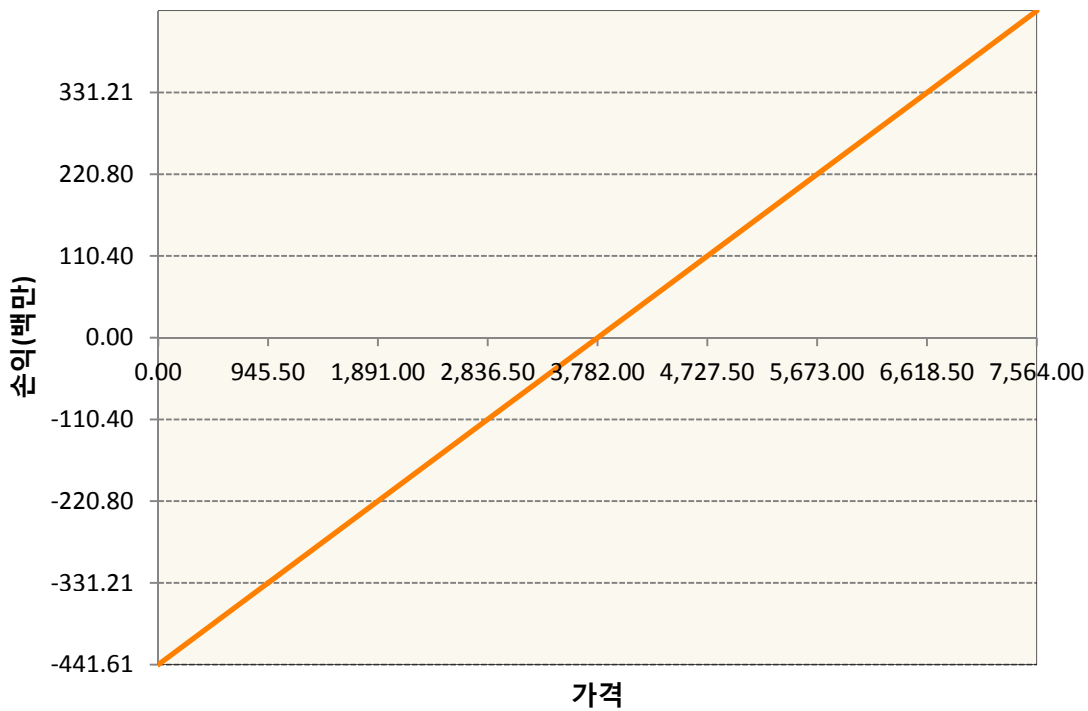
1. 계약금액

(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	2020-01-06
기준일	2020-01-03

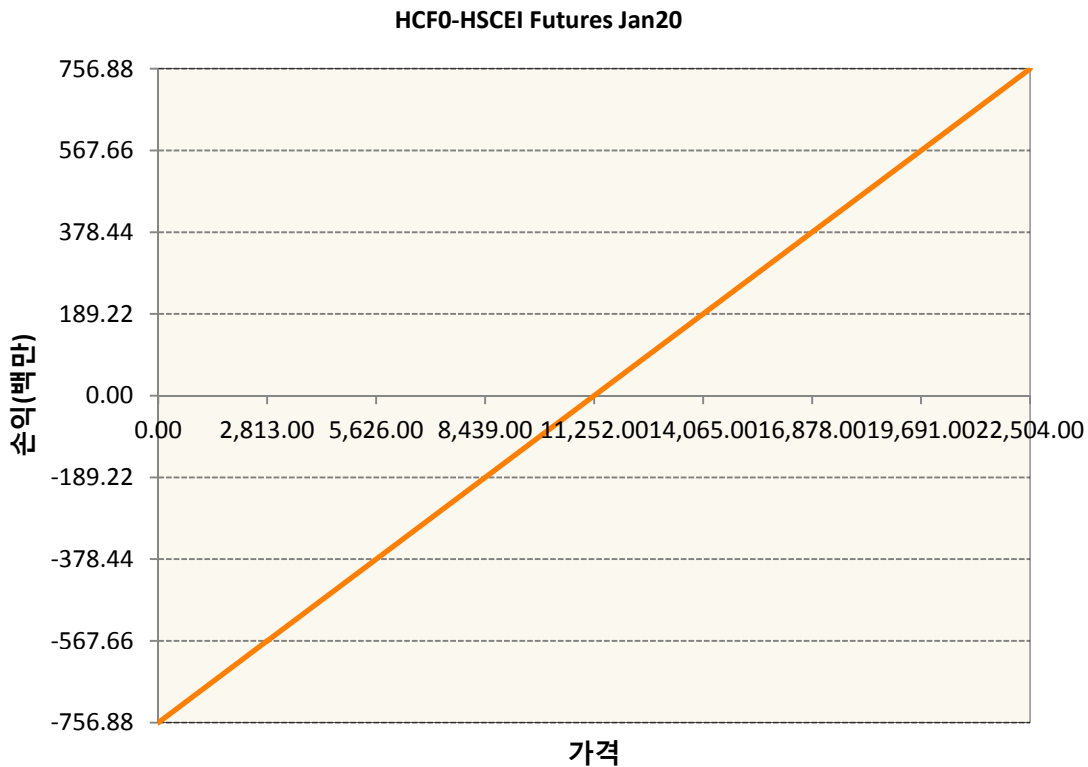
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	757	0	757	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

53

공시일	2020-01-06
기준일	2020-01-03

커버드콜모(주식혼합-파생형)

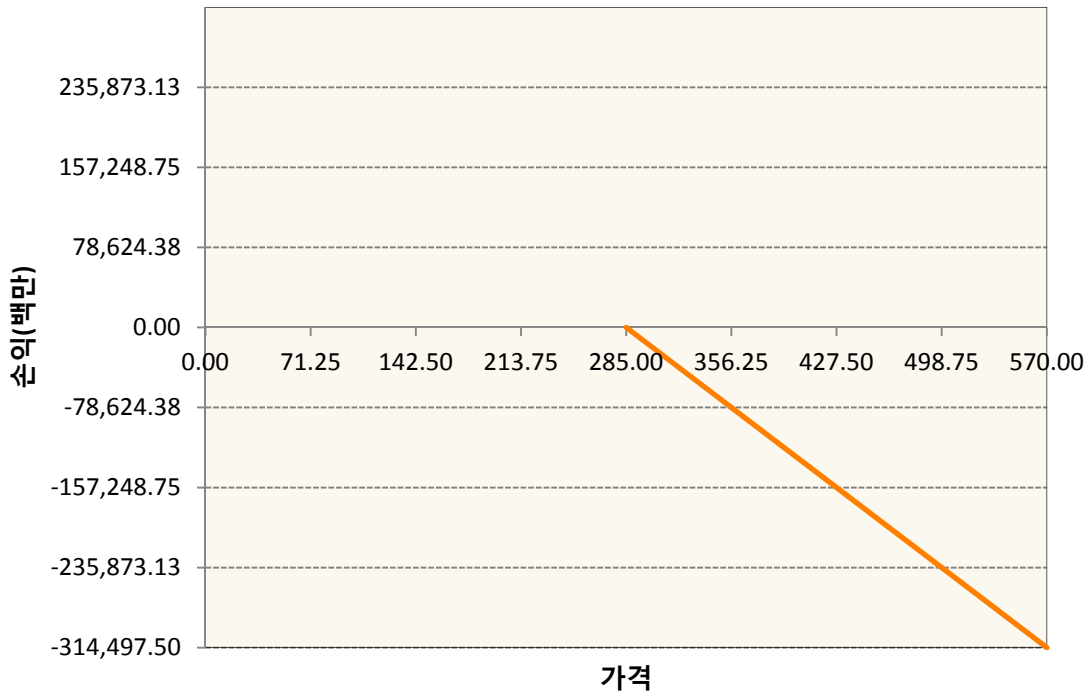
1. 계약금액

(단위:백만원)

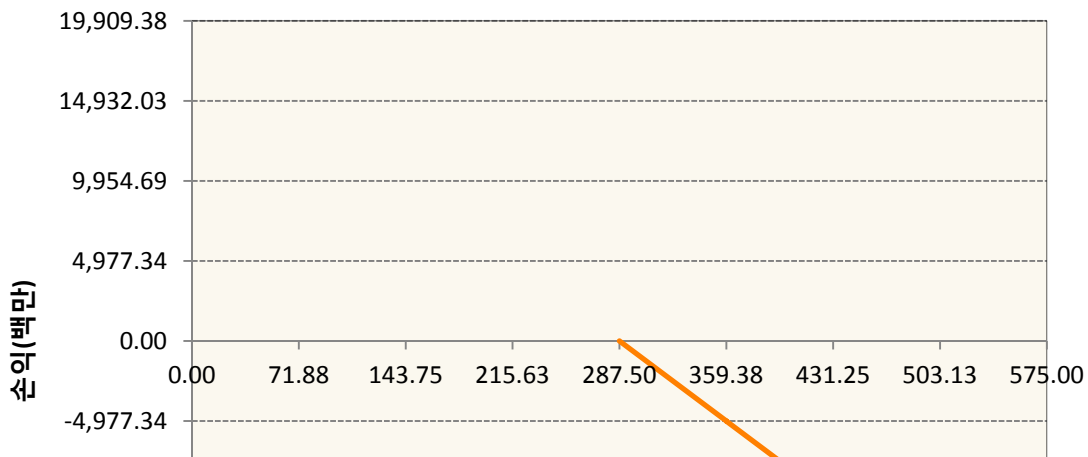
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	782	0	782	장내
누계	유가증권	옵션	0	470,423	-470,423	장내

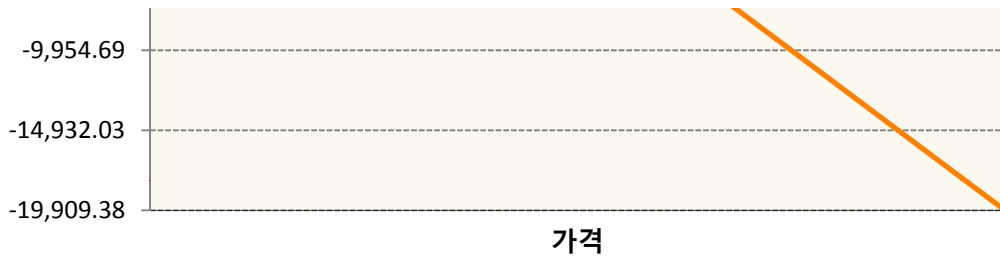
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q12852-2020-01 콜285

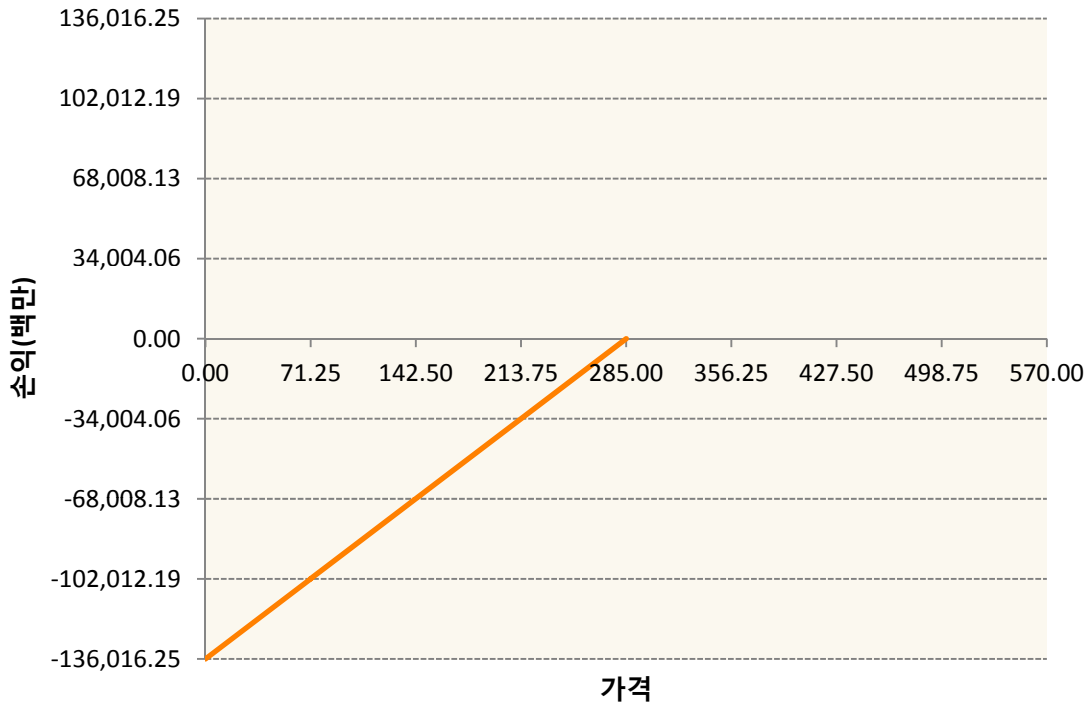


KR4201Q12878-2020-01 콜287.5





KR4301Q12850-2020-01 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q12852		2020-01 콜285					23,594	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	8,452	8,417	8,364	8,291	8,197	8,082	7,949	
-5.33%	8,066	7,883	7,673	7,443	7,194	6,930	6,653	
-2.67%	6,039	5,668	5,295	4,920	4,544	4,167	3,789	
0%	957	651	331	0	-339	-684	-1,035	
2.67%	-6,563	-6,674	-6,814	-6,980	-7,170	-7,380	-7,608	
5.33%	-14,958	-14,977	-15,010	-15,060	-15,128	-15,216	-15,323	
8.00%	-23,499	-23,501	-23,505	-23,514	-23,531	-23,557	-23,594	
KR4201Q12878		2020-01 콜287.5					1,425	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	418	417	415	412	408	403	397	

-5.33%	406	398	388	377	365	351	337
-2.67%	323	302	281	259	237	215	192
0%	69	46	23	0	-23	-47	-71
2.67%	-364	-375	-387	-401	-417	-433	-450
5.33%	-881	-883	-887	-892	-898	-906	-915
8.00%	-1,415	-1,416	-1,416	-1,417	-1,419	-1,422	-1,425
KR4301Q12850 2020-01 풋285							8,138
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,132	-8,132	-8,132	-8,133	-8,134	-8,135	-8,138
-5.33%	-4,440	-4,448	-4,460	-4,477	-4,499	-4,526	-4,557
-2.67%	-1,153	-1,234	-1,317	-1,401	-1,486	-1,572	-1,659
0%	143	101	53	0	-58	-120	-185
2.67%	231	230	227	222	214	203	188
5.33%	232	232	232	232	231	231	230
8.00%	232	232	232	232	232	232	232

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

(단위:백만원)

36,442

공시일	2020-01-06
기준일	2020-01-03

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

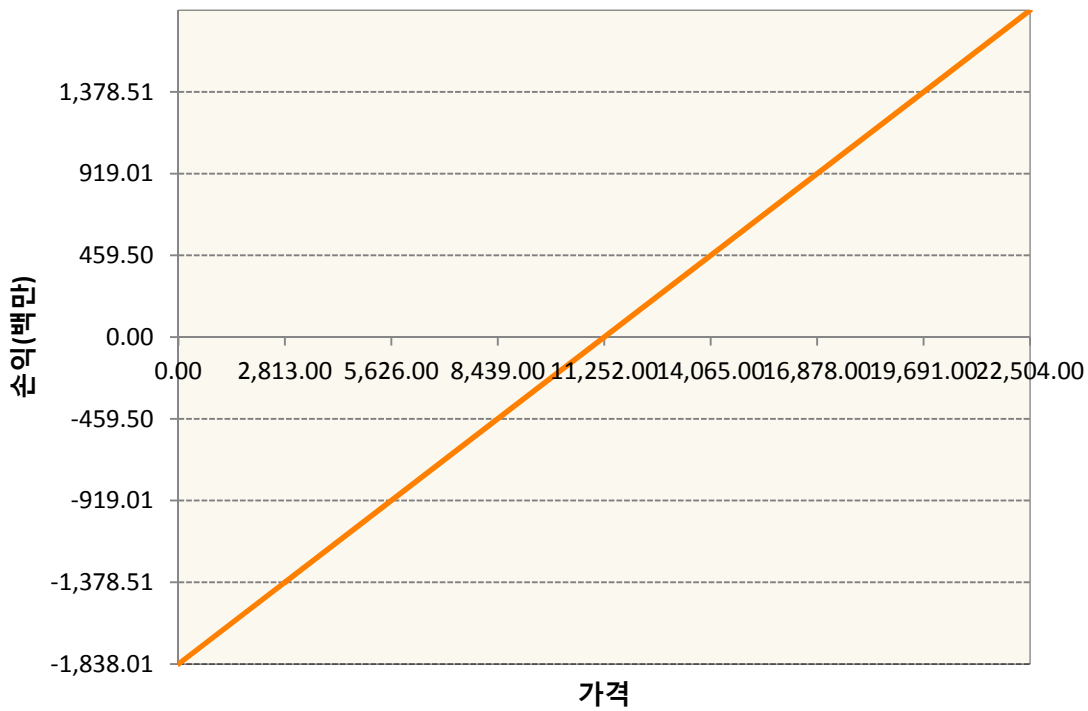
1. 계약금액

(단위:백만원)

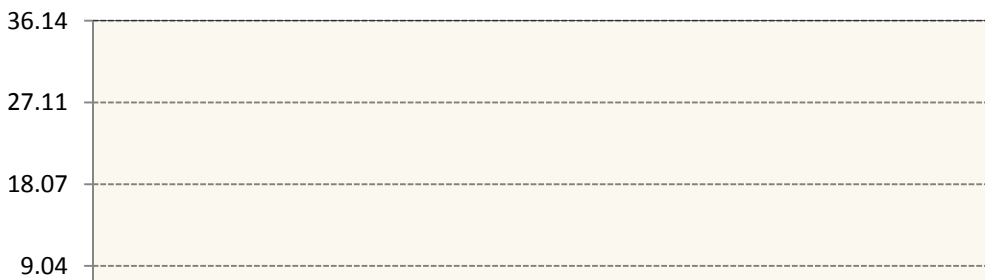
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,838	0	1,838	장내
누계	유가증권	옵션	0	86	-86	장내
누계	통화	선도	0	2,112	-2,112	장외

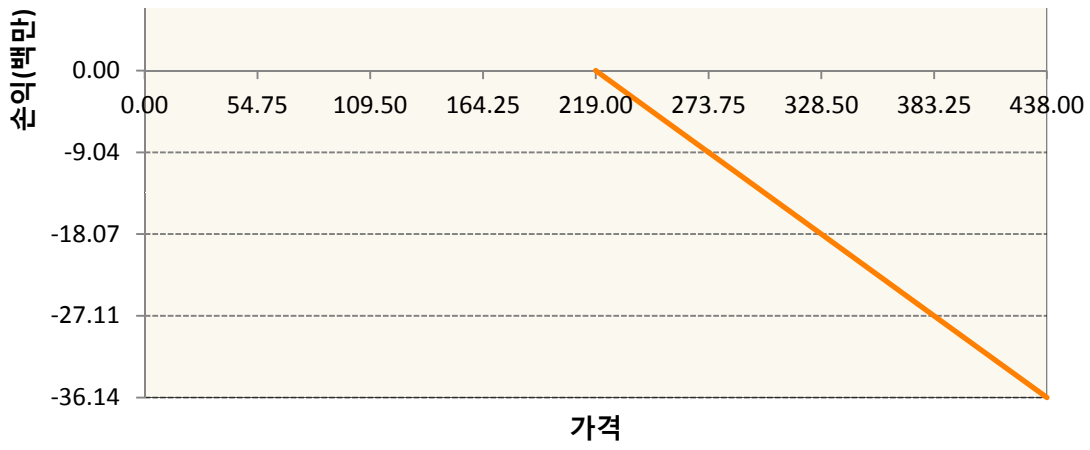
2. 만기시점의 손익구조

HCFO-HSCEI Futures Jan20

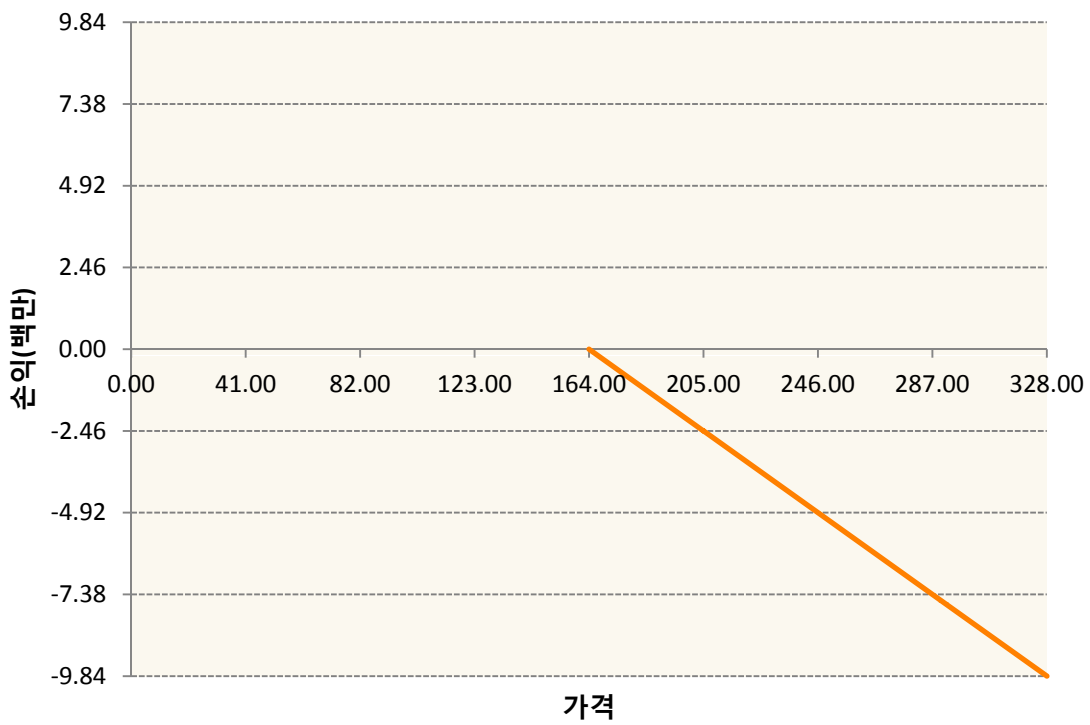


OHHIF0-C112-HSCEI

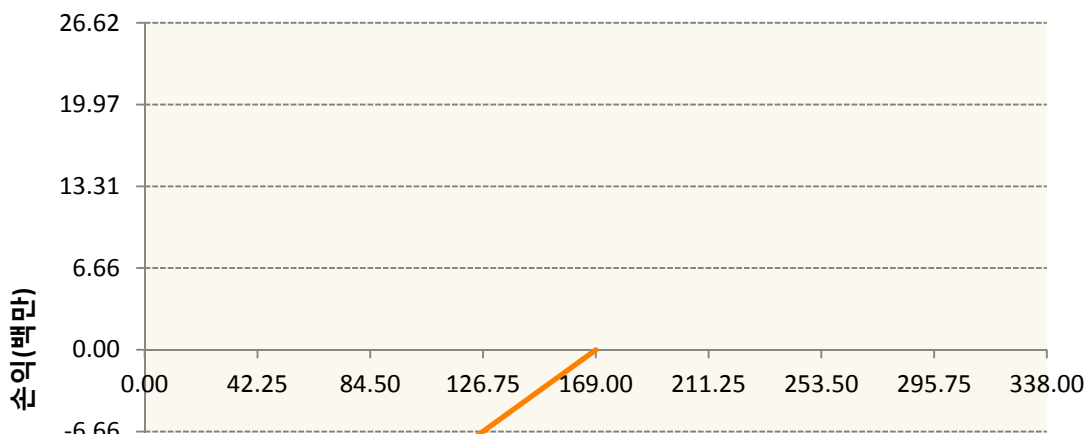


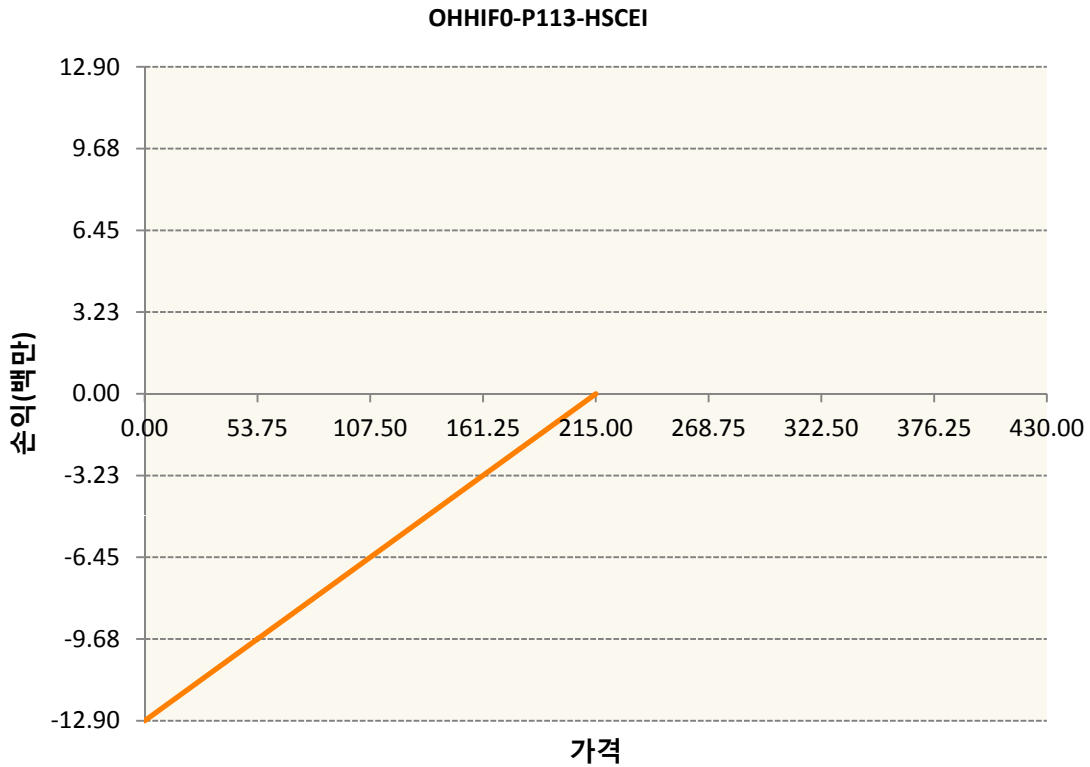


OHHIF0-C113-HSCEI



OHHIF0-P112-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	169
HCF0 HSCEI Futures Jan20	147
OHHIF0-C11 HSCEI	3
OHHIF0-C11 HSCEI	1
OHHIF0-P11 HSCEI	2
OHHIF0-P11 HSCEI	1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	189

공시일	2020-01-06
기준일	2020-01-03

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

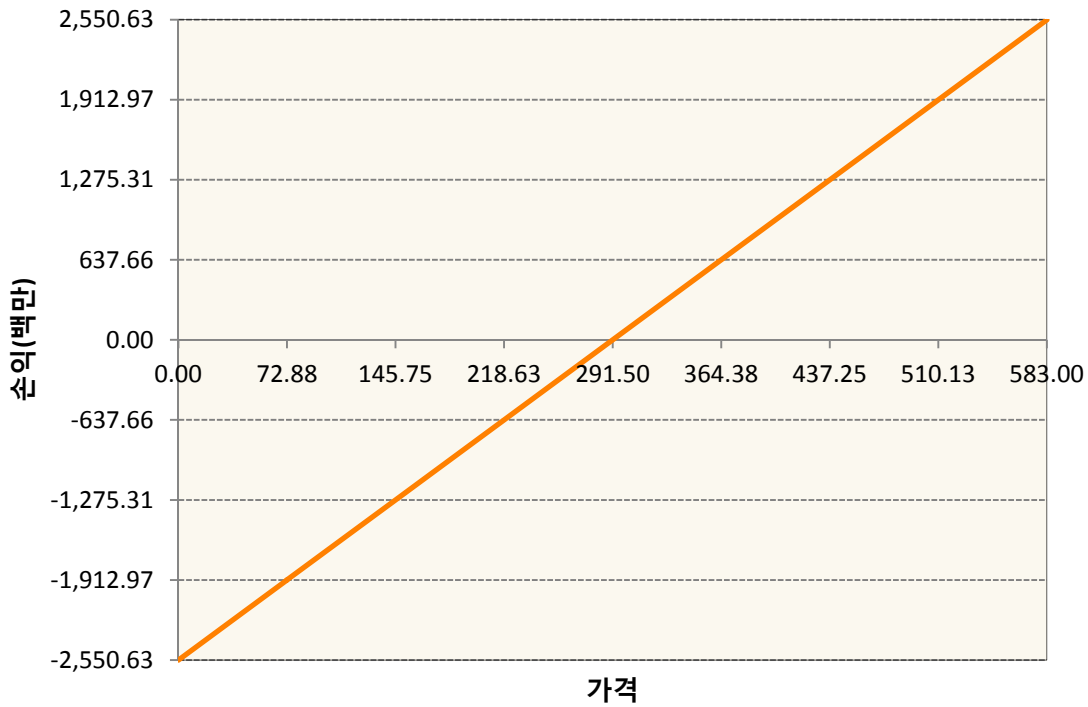
1. 계약금액

(단위:백만원)

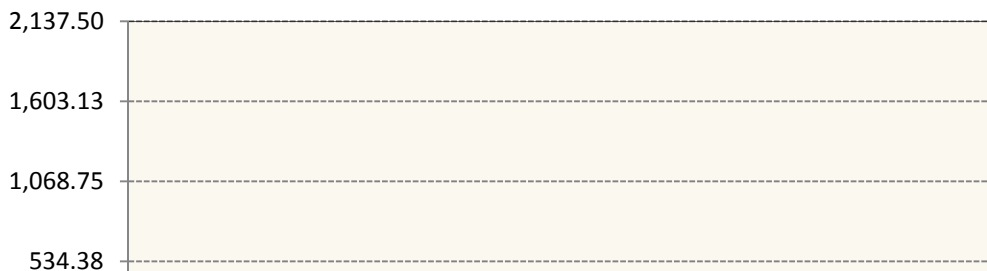
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,551	0	2,551	장내
누계	유가증권	스왑	5,625	0	5,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,847	-4,847	장내

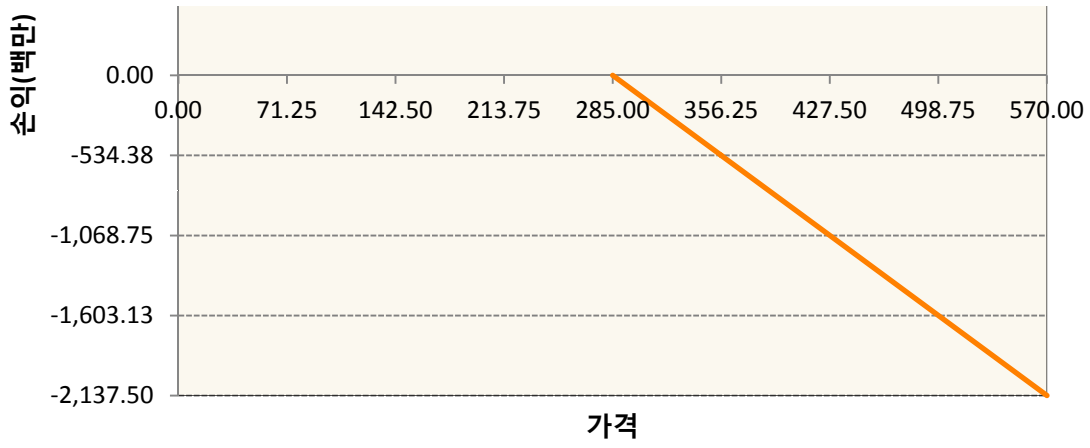
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

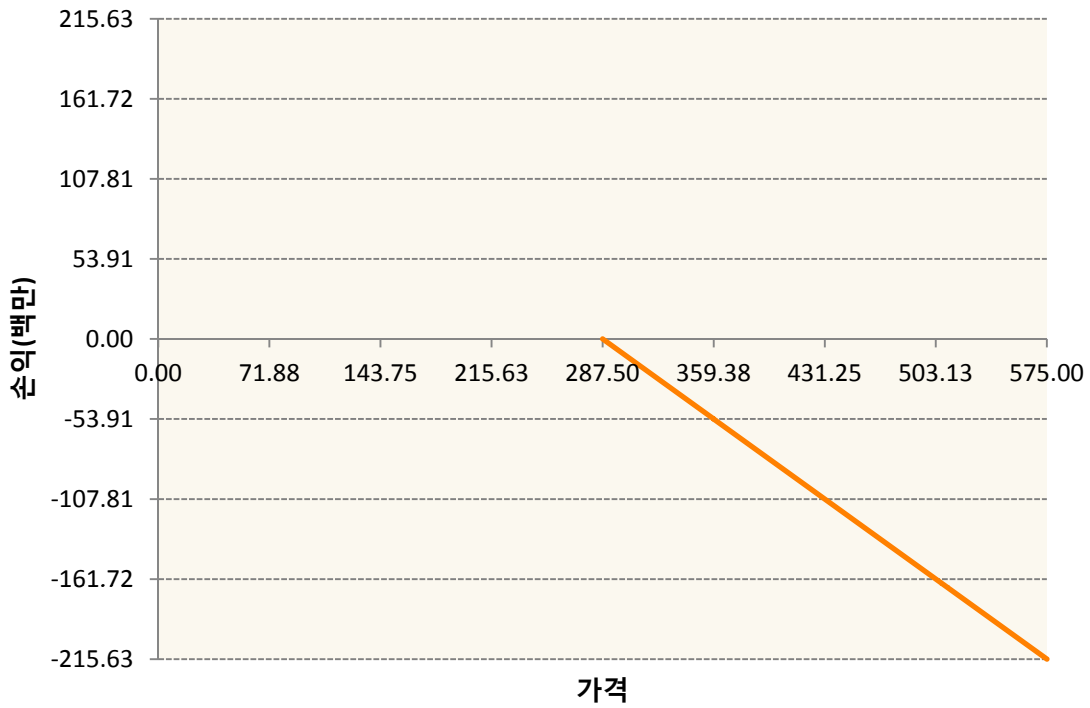


KR4201Q12852-2020-01 콜285

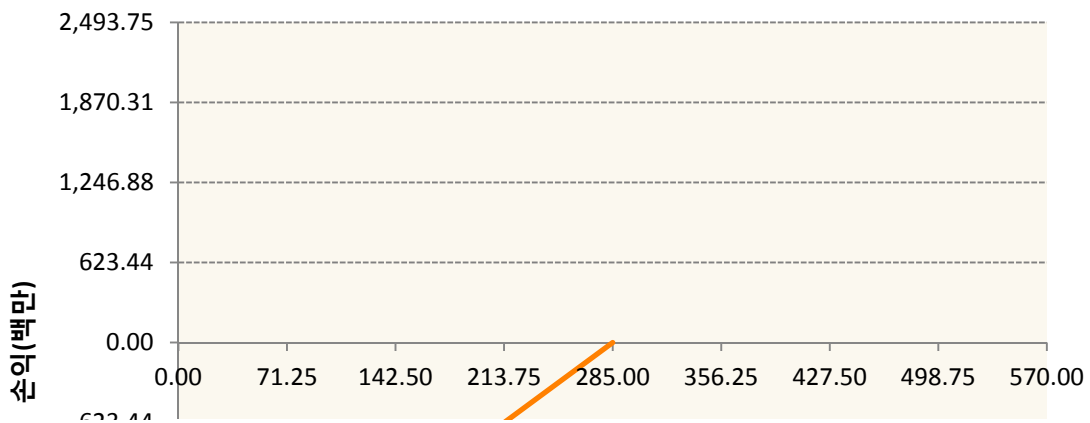


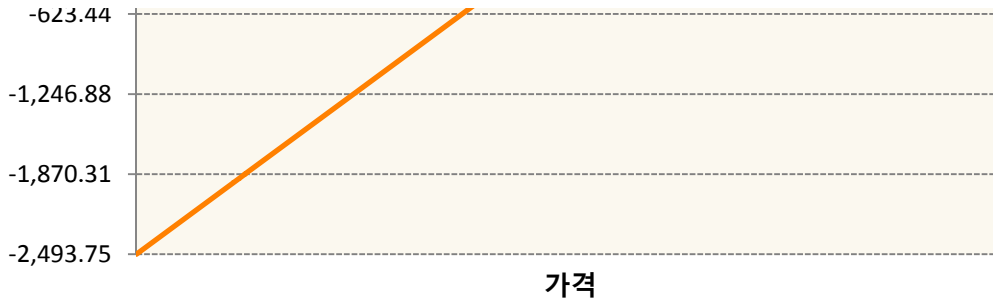


KR4201Q12878-2020-01 콜287.5



KR4301Q12850-2020-01 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						480
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-480	-480	-480	-480	-480	-480	-480	
-5.33%	-320	-320	-320	-320	-320	-320	-320	
-2.67%	-160	-160	-160	-160	-160	-160	-160	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	160	160	160	160	160	160	160	
5.33%	320	320	320	320	320	320	320	
8.00%	480	480	480	480	480	480	480	
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	
KR4201Q12852		2020-01 콜285						160
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	57	57	57	56	56	55	54	
-5.33%	55	54	52	51	49	47	45	
-2.67%	41	39	36	33	31	28	26	
0%	7	4	2	0	-2	-5	-7	
2.67%	-45	-45	-46	-47	-49	-50	-52	
5.33%	-102	-102	-102	-102	-103	-103	-104	
8.00%	-160	-160	-160	-160	-160	-160	-160	
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	4	4	4	4	4
-5.33%	4	4	4	4	4	4	4
-2.67%	3	3	3	3	3	2	2
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	-4	-4	-4	-4	-5	-5	-5
5.33%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
8.00%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
KR4301Q12850 2020-01 풋285							149
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-149	-149	-149	-149	-149	-149	-149
-5.33%	-81	-82	-82	-82	-82	-83	-84
-2.67%	-21	-23	-24	-26	-27	-29	-30
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	4	4	4	4	4	4	3
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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

(단위:백만원)

984

공시일	2020-01-06
기준일	2020-01-03

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

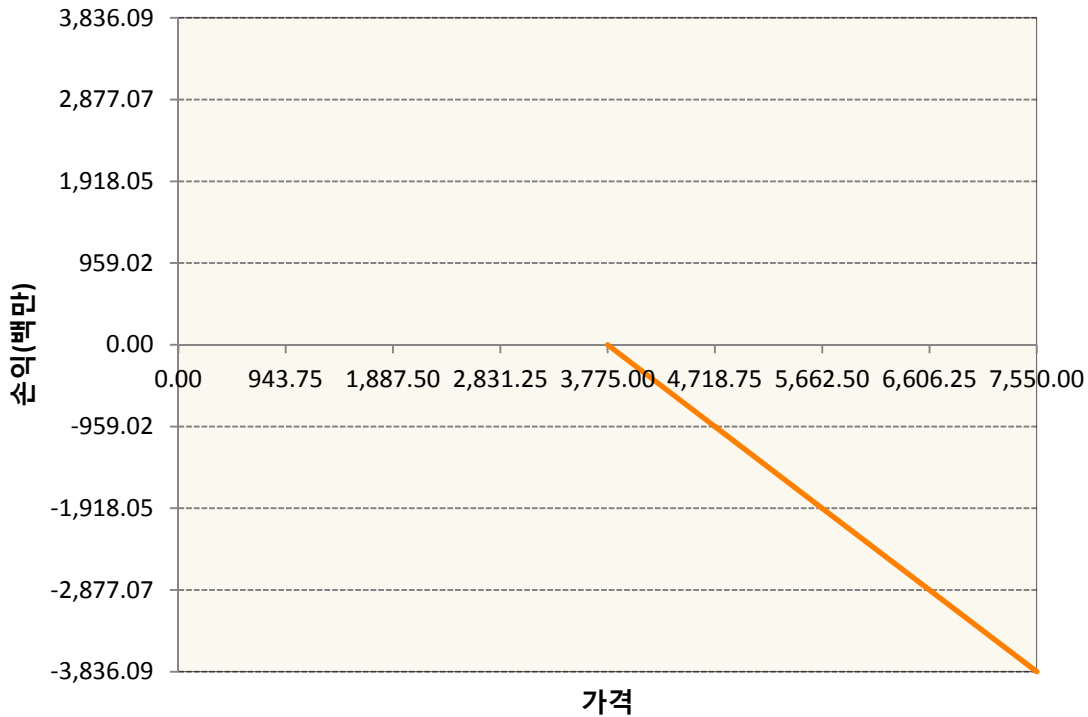
1. 계약금액

(단위:백만원)

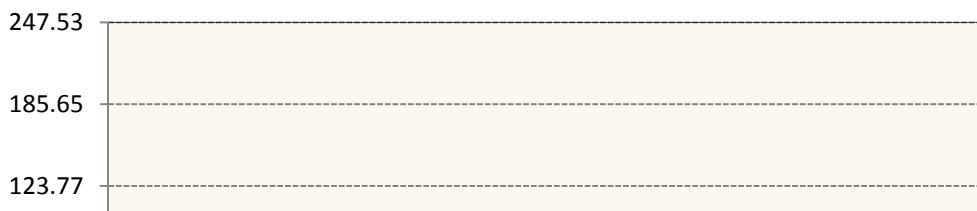
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	979	0	979	
누계	유가증권	스왑	15,823	0	15,823	장외
누계	유가증권	옵션	0	8,167	-8,167	장내
누계	통화	선도	0	3,419	-3,419	장외

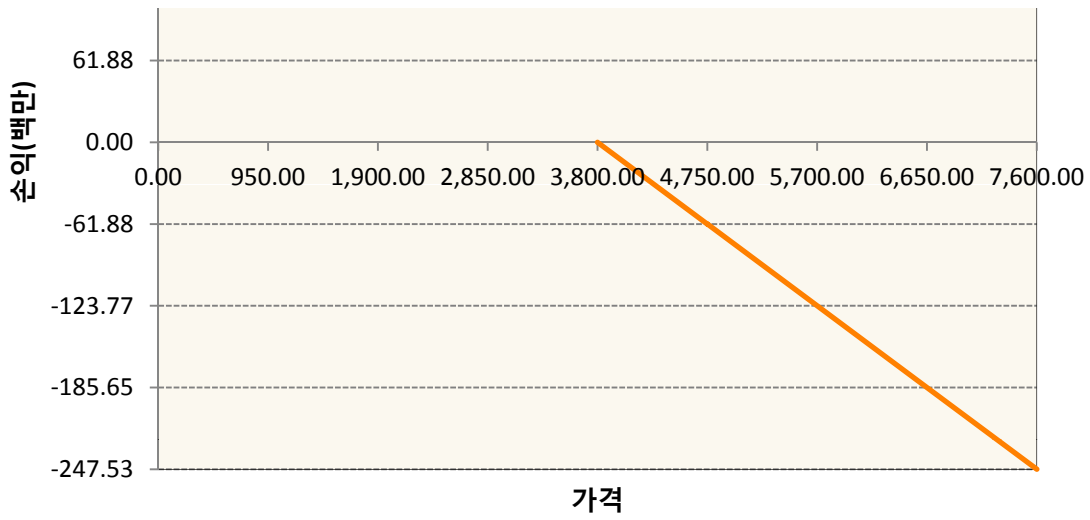
2. 만기시점의 손익구조

OESXF0-C3775-EURO STOXX 50

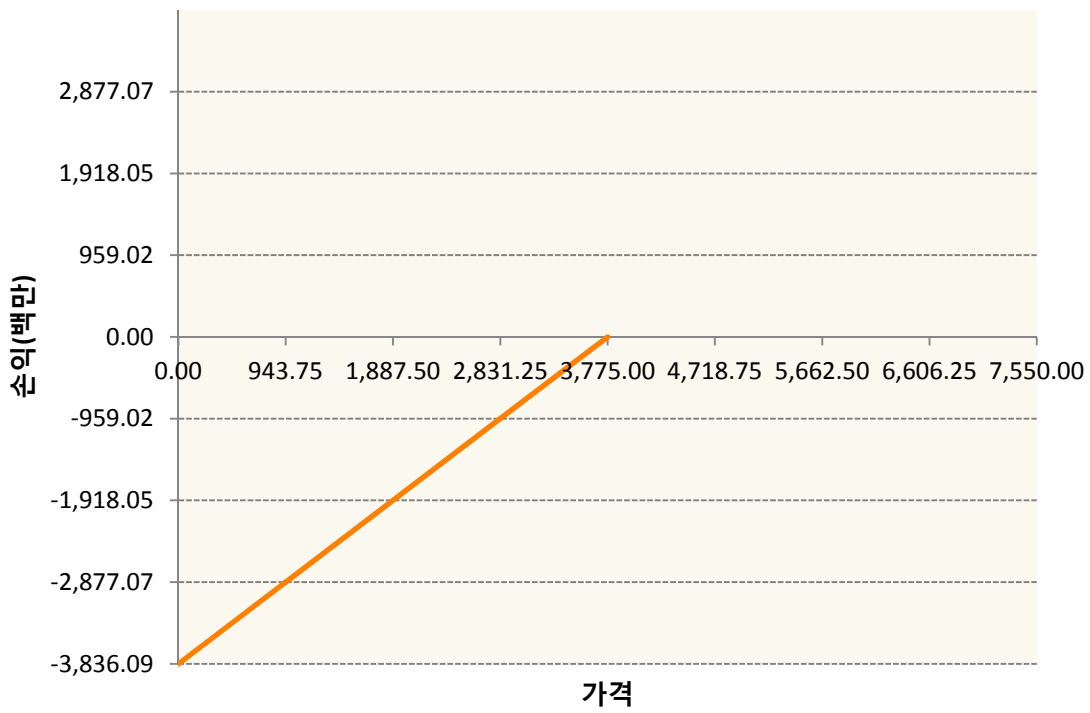


OESXF0-C3800-EURO STOXX 50

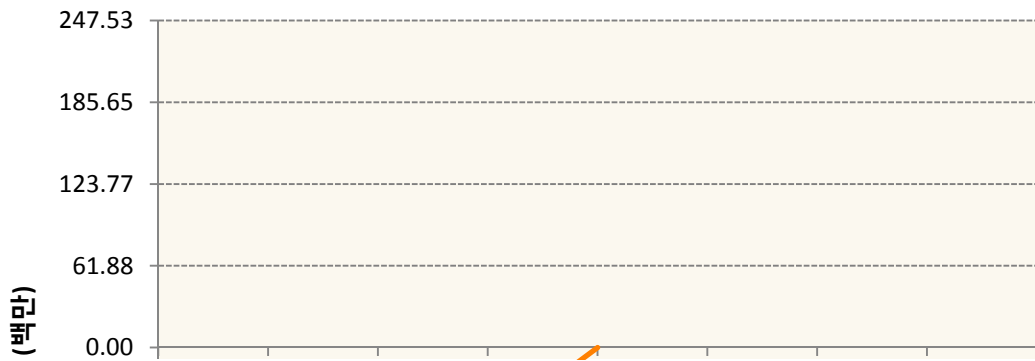


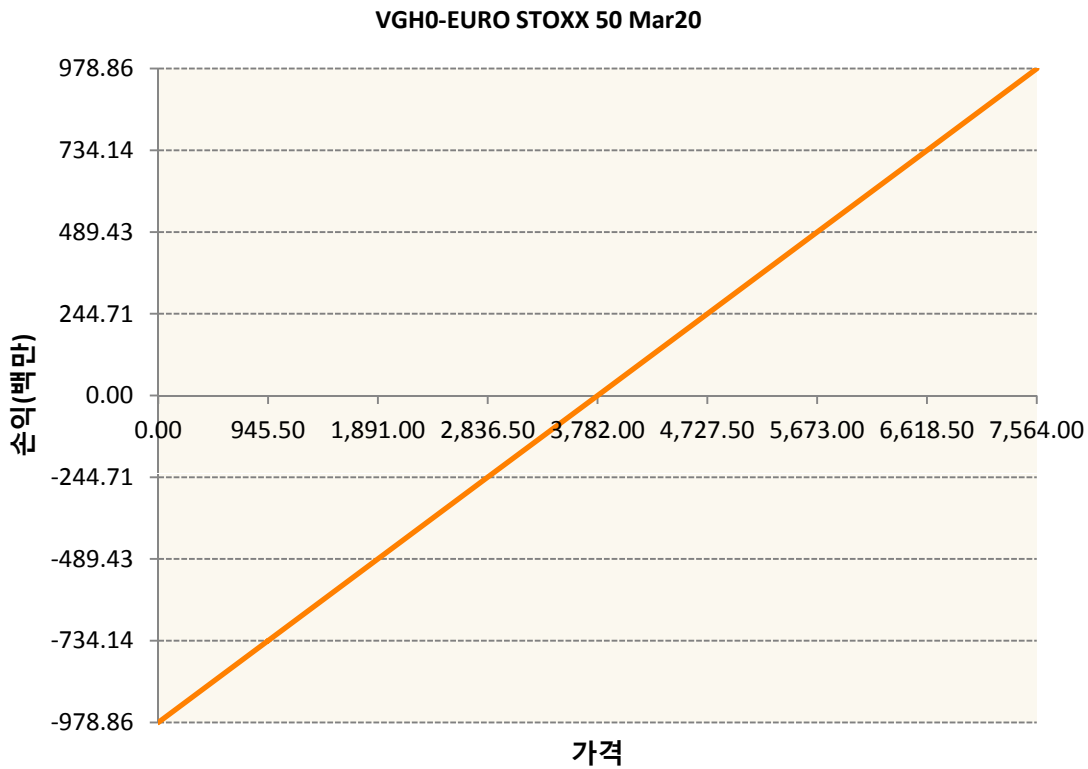
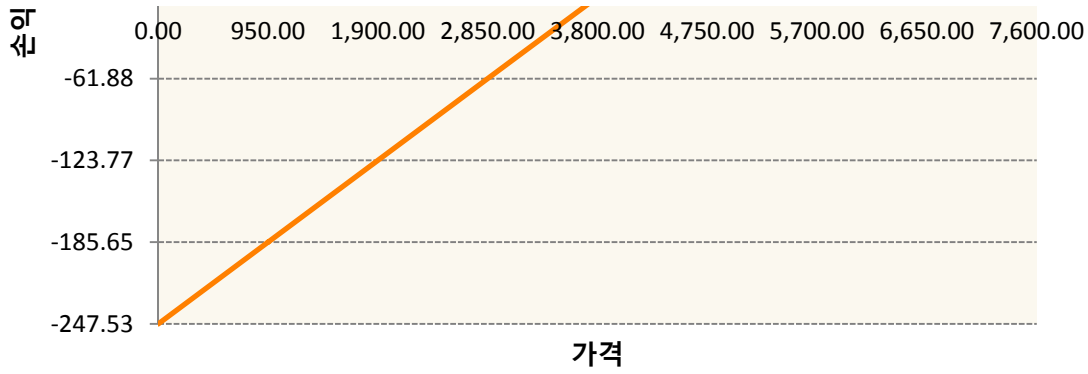


OESXF0-P3775-EURO STOXX 50



OESXF0-P3800-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	41
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	273
OESXF0-C37 EURO STOXX 50	307
OESXF0-C38 EURO STOXX 50	20
OESXF0-P37 EURO STOXX 50	307
OESXF0-P38 EURO STOXX 50	20
VGHO EURO STOXX 50 Mar20	78

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

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

(단위:백만원)

910

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

(단위:백만원)

77

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

(단위:백만원)

114

공시일	2020-01-06
기준일	2020-01-03

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

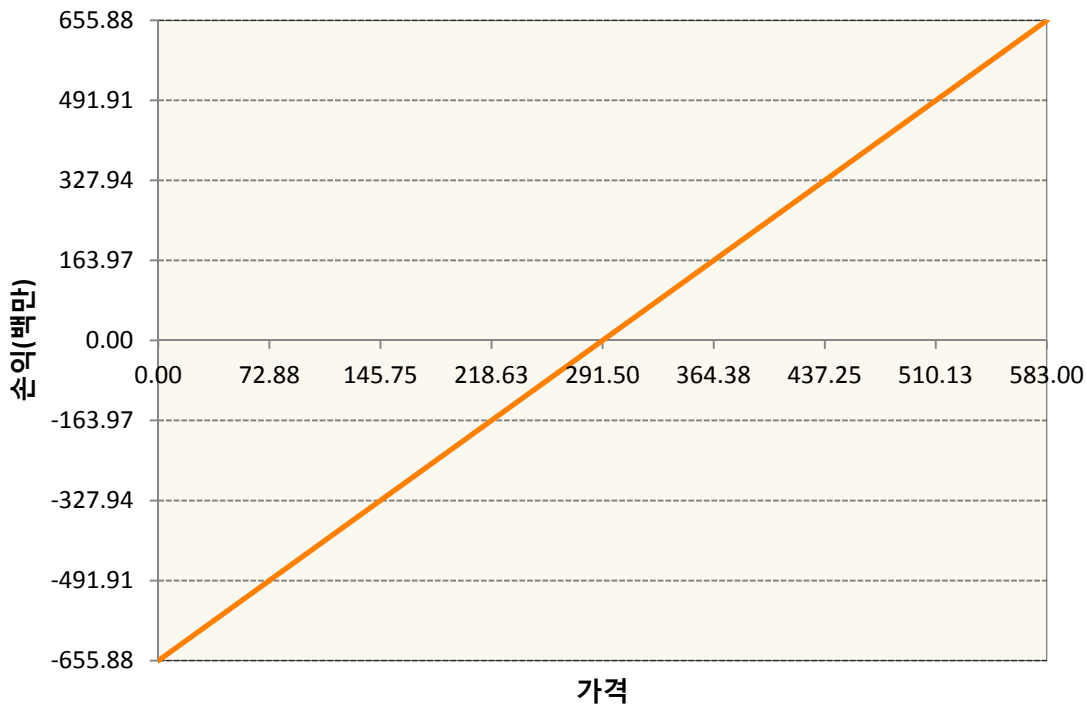
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	656	0	656	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						52
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52	
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	17	17	17	17	17	17	17	
5.33%	35	35	35	35	35	35	35	
8.00%	52	52	52	52	52	52	52	

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

(단위:백만원)

41

공시일	2020-01-06
기준일	2020-01-03

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

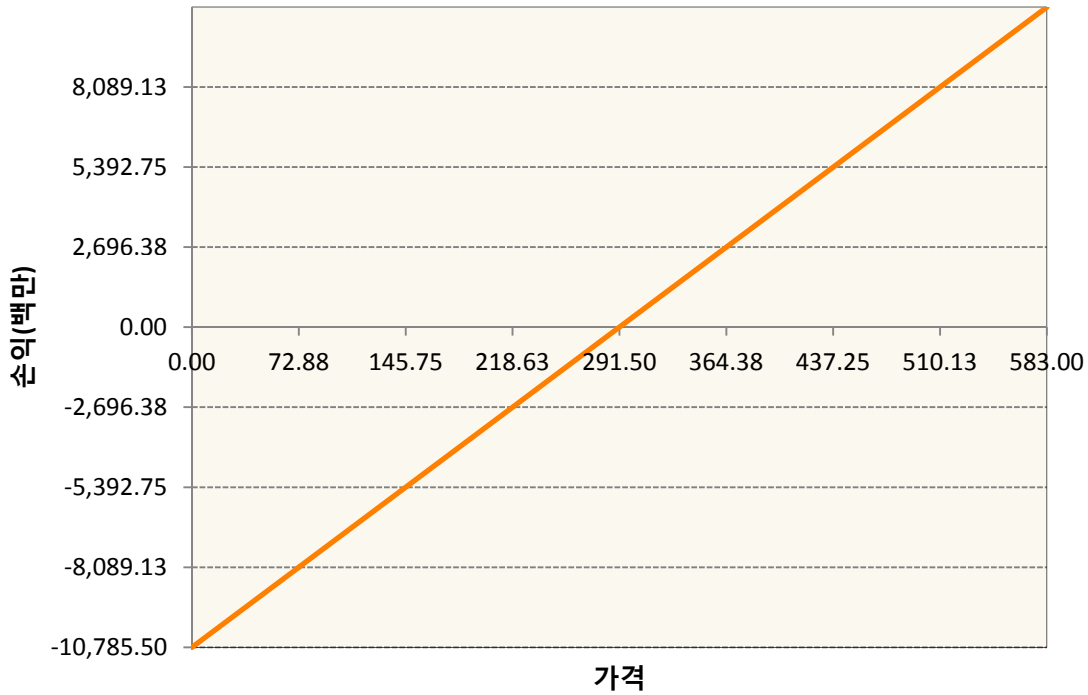
1. 계약금액

(단위:백만원)

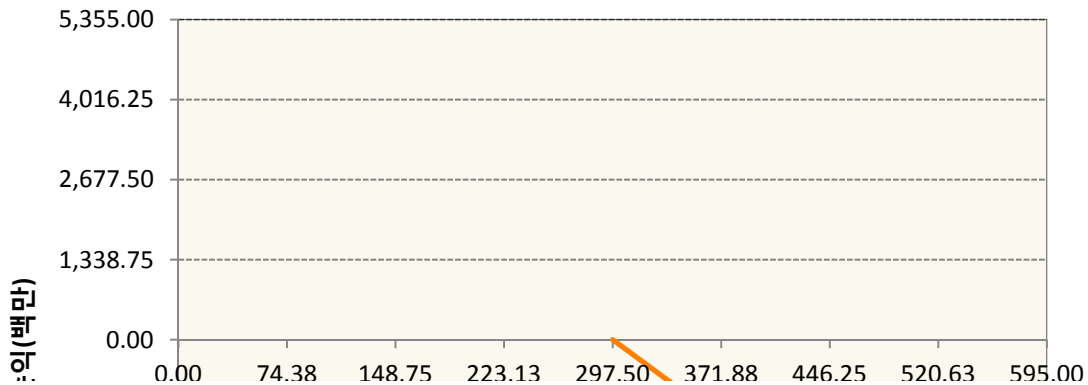
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	146	-146	장내
신규	유가증권	옵션	150	0	150	장내
누계	유가증권	선물	10,786	0	10,786	장내
누계	유가증권	옵션	499	20,955	-20,456	장내

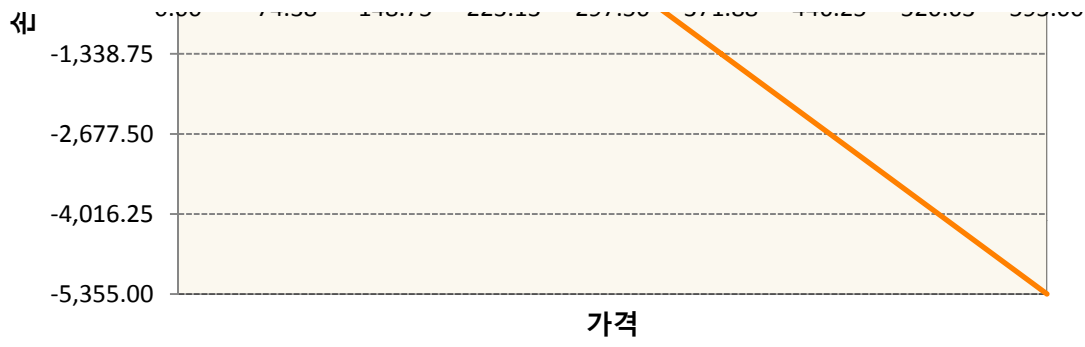
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

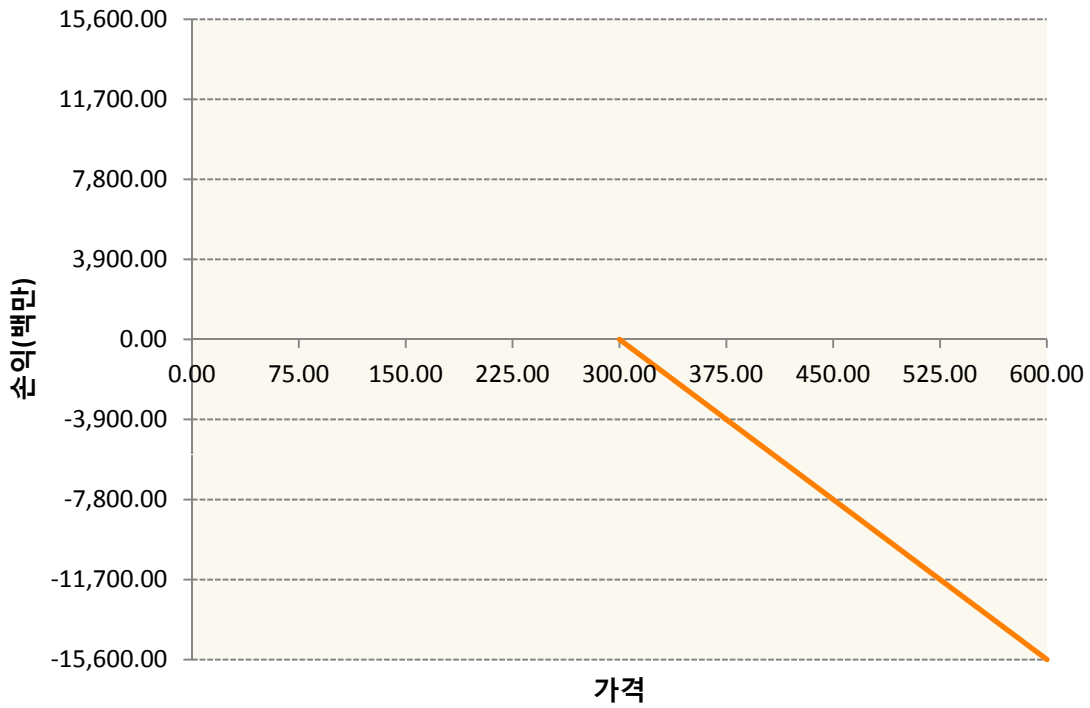


KR4201Q12977-2020-01 콜297.5

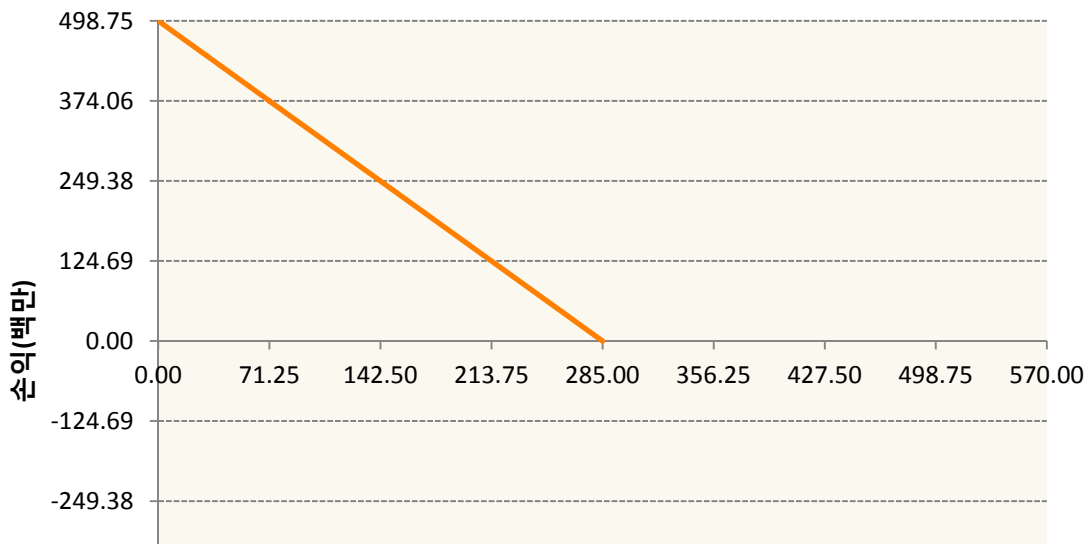


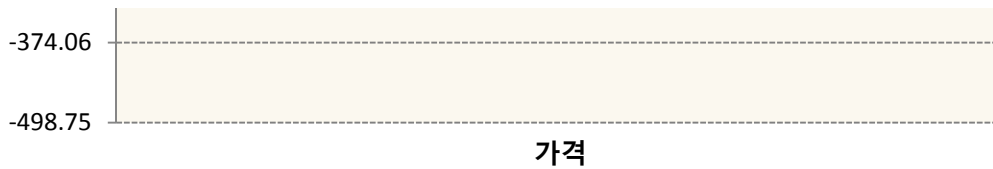


KR4201Q13009-2020-01 콜300



KR4301Q12850-2020-01 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						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	
KR4201Q12977		2020-01 콜297.5						280
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	31	31	31	31	31	31	31	
-5.33%	31	31	31	30	29	28	27	
-2.67%	29	28	26	24	21	18	15	
0%	15	10	5	0	-5	-11	-17	
2.67%	-37	-43	-50	-56	-63	-69	-76	
5.33%	-137	-141	-146	-150	-155	-160	-166	
8.00%	-267	-268	-270	-272	-274	-277	-280	
KR4201Q13009		2020-01 콜300						728
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	62	62	62	61	61	61	60	
-5.33%	61	61	61	60	58	56	54	
-2.67%	59	57	53	48	43	36	28	
0%	35	24	13	0	-13	-27	-42	
2.67%	-73	-92	-110	-129	-148	-167	-186	
5.33%	-320	-335	-351	-367	-383	-400	-418	
8.00%	-675	-680	-687	-696	-705	-716	-728	
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%	16	16	16	16	16	17	17	
-2.67%	4	5	5	5	5	6	6	

0%	-1	0	0	0	0	0	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)

1,584

공시일	2020-01-06
기준일	2020-01-03

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	205,838	0	205,838	

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	2020-01-06
기준일	2020-01-03

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	214,855	0	214,855	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2020-01-06
기준일	2020-01-03

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	530,277	0	530,277	
누계	통화	선도	0	517,142	-517,142	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E	1,401
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E	1,503
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E	1,867
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E	3,212
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E	4,762
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	187
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,801
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,801
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,334
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,521
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	1,625
FX21019Z00 KRW/USD 10-01-20E	1,120
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	1,531
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	934
FX21019Z02 KRW/USD 16-01-20E	1,681
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	187
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	1,998
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	934
FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E	3,735
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,867
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,998
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	187
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	187
IE00BD8RGM75	*
IE00BHNZKL13	*

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

13,189

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

(단위:백만원)

207

공시일	2020-01-06
기준일	2020-01-03

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

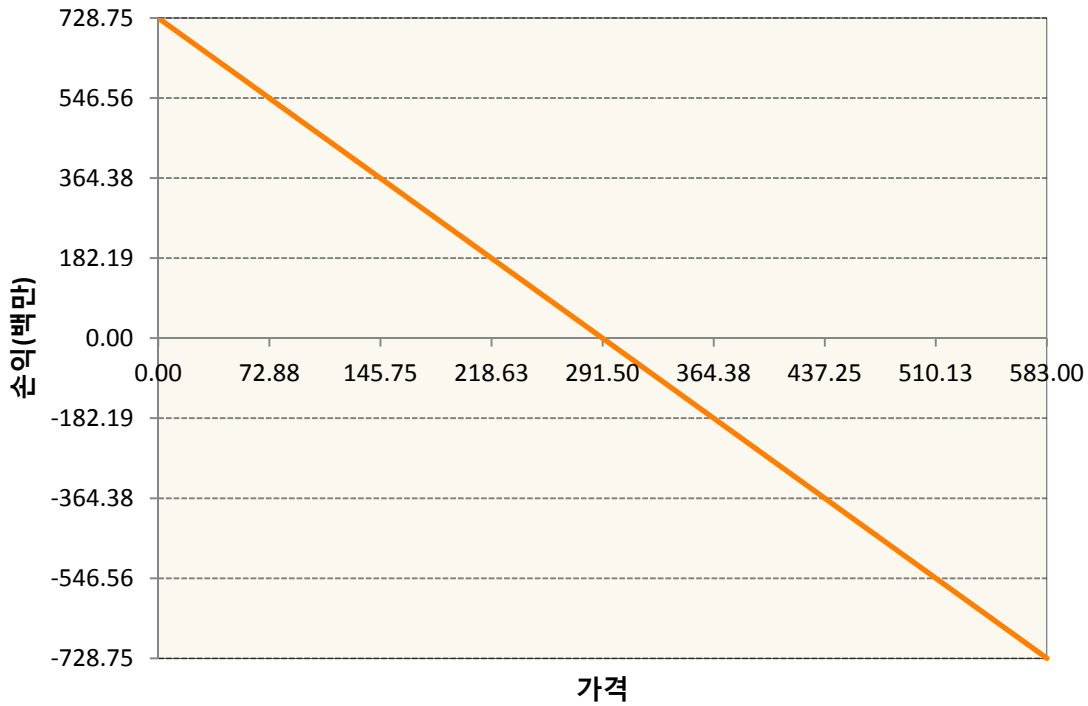
1. 계약금액

(단위:백만원)

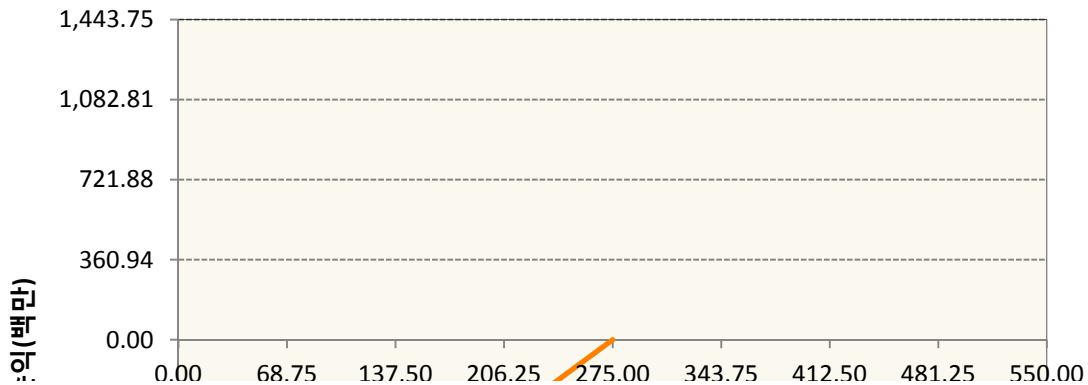
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	729	-729	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,872	-3,872	장내

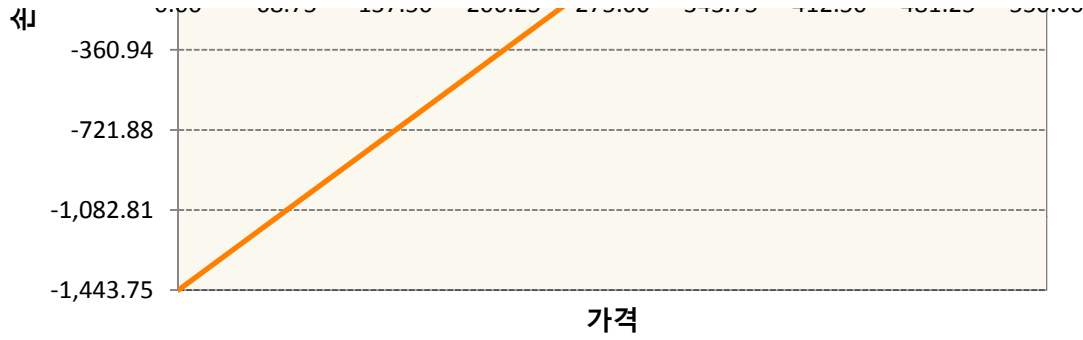
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

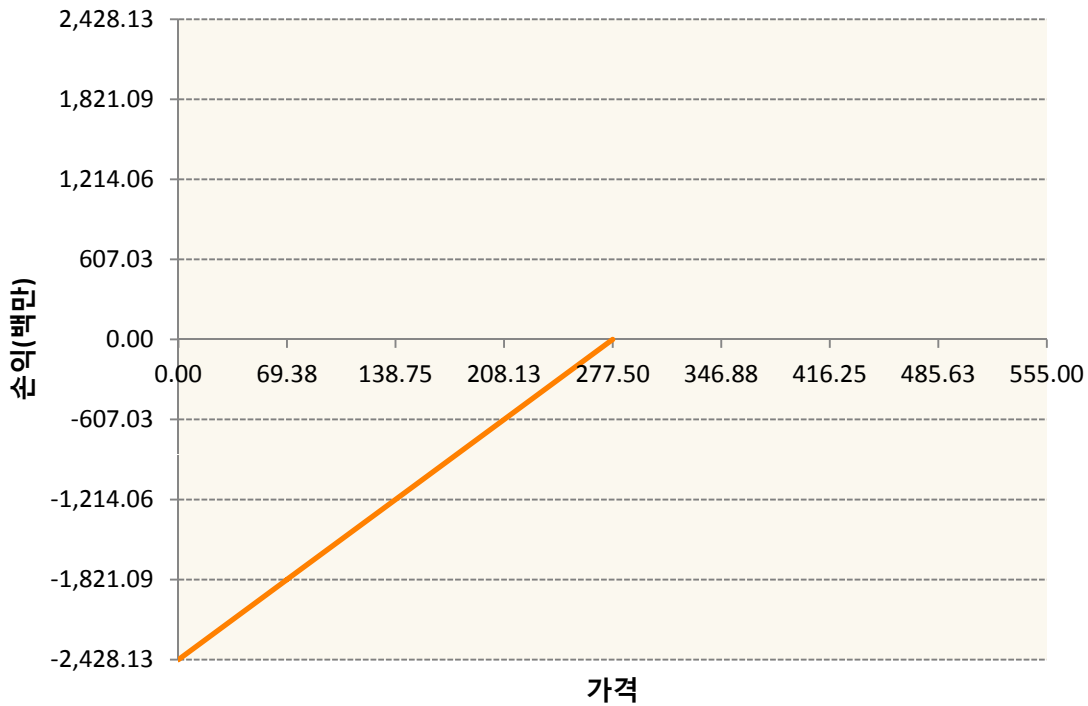


KR4301Q12751-2020-01 풋275





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						42
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-40	-40	-40	-41	-41	-41	-42
-5.33%	-8	-9	-10	-11	-12	-13	-14
-2.67%	0	0	-1	-1	-1	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

KR4301Q12777 2020-01 풋277.5 89

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-88	-88	-88	-88	-89	-89	-89
-5.33%	-26	-28	-29	-31	-32	-34	-35
-2.67%	-2	-2	-3	-4	-5	-6	-7
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)

80

공시일	2020-01-06
기준일	2020-01-03

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	13,620	0	13,620	
누계	통화	선도	945	14,425	-13,480	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019X01 KRW/USD 13-01-20E	229
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E	289
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	290
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	345
FX21019Z02 USD/KRW 13-01-20E	28
FX21019Z03 USD/KRW 13-01-20E	20
FX21019Z04 USD/KRW 13-01-20E	28
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

392

공시일	2020-01-06
기준일	2020-01-03

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	2,029	0	2,029	장외
누계	통화	선도	313	586	-274	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
FX21020F00 KRW/EUR 27-03-20E	6

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

(단위:백만원)

138

공시일	2020-01-06
기준일	2020-01-03

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

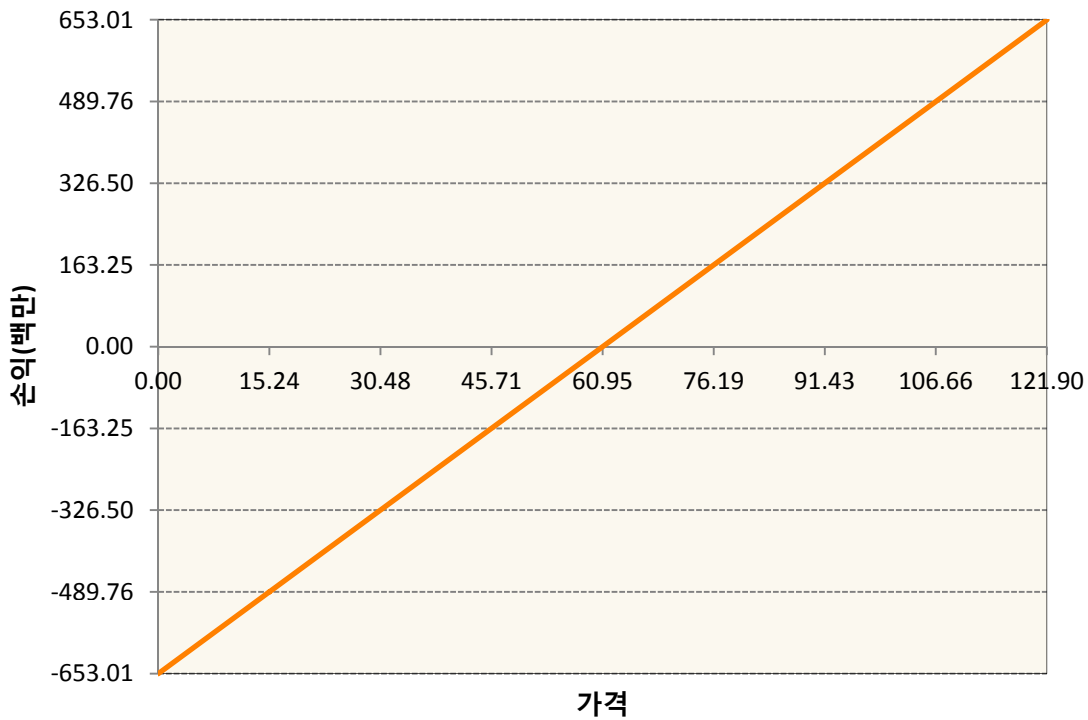
1. 계약금액

(단위:백만원)

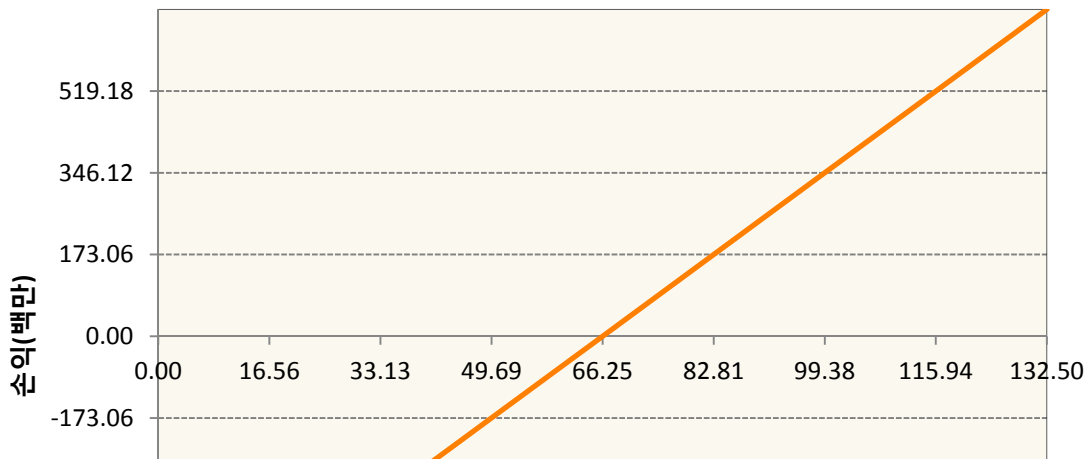
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,497	292	2,206	

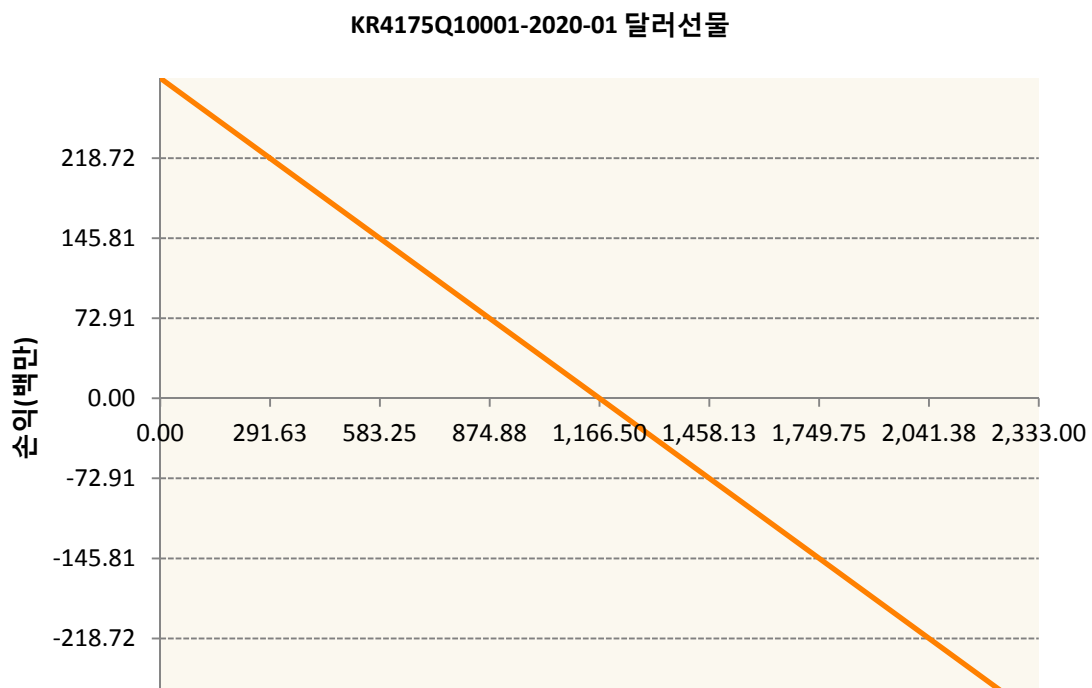
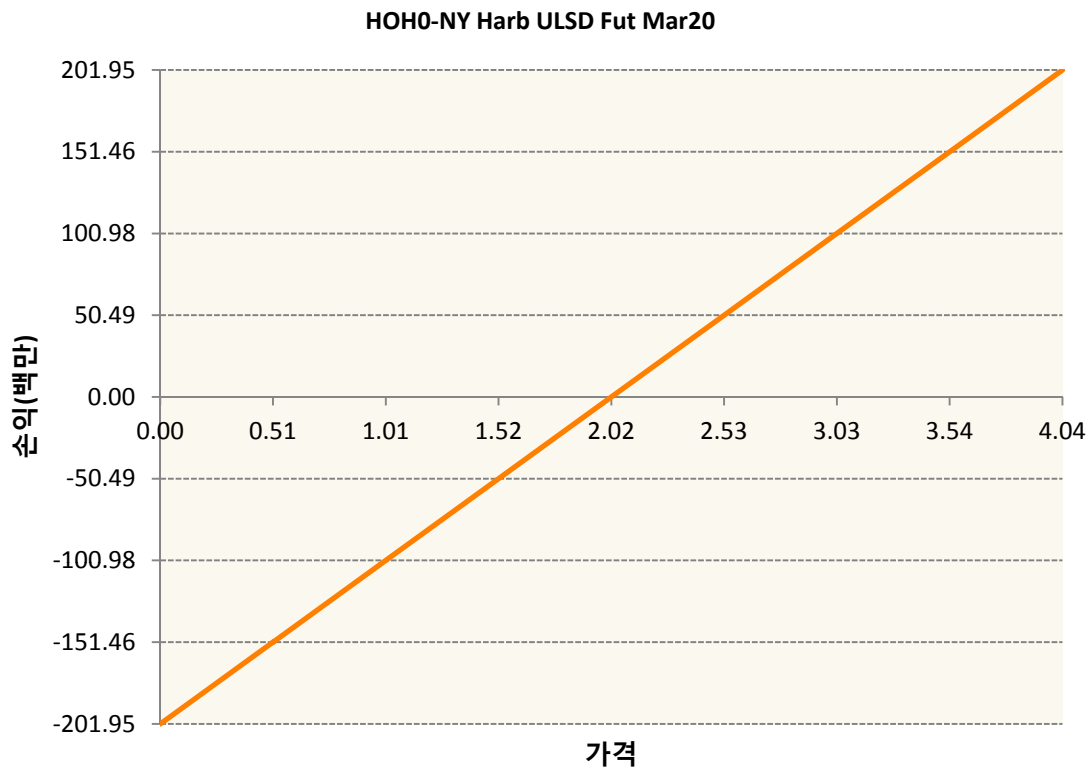
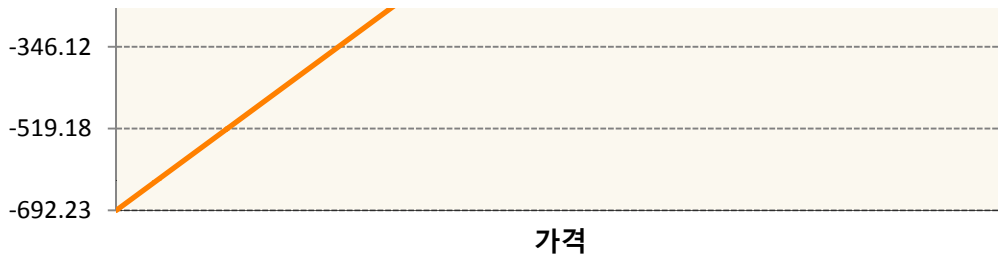
2. 만기시점의 손익구조

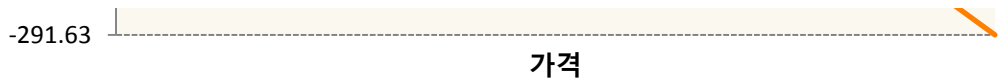
CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20



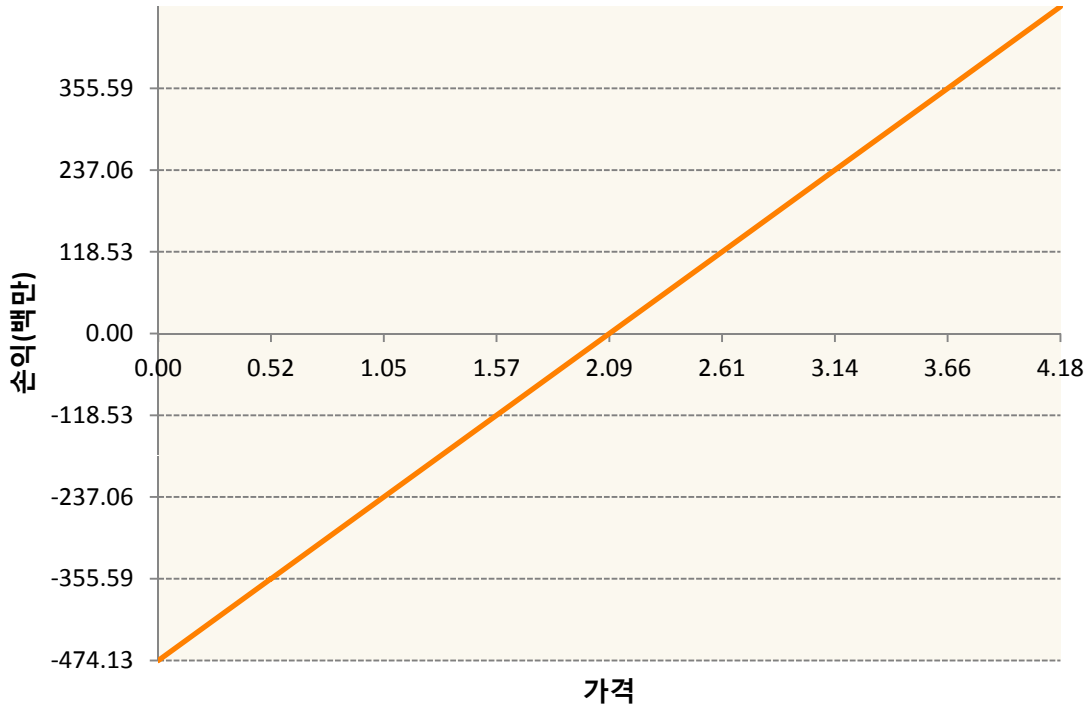
COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20



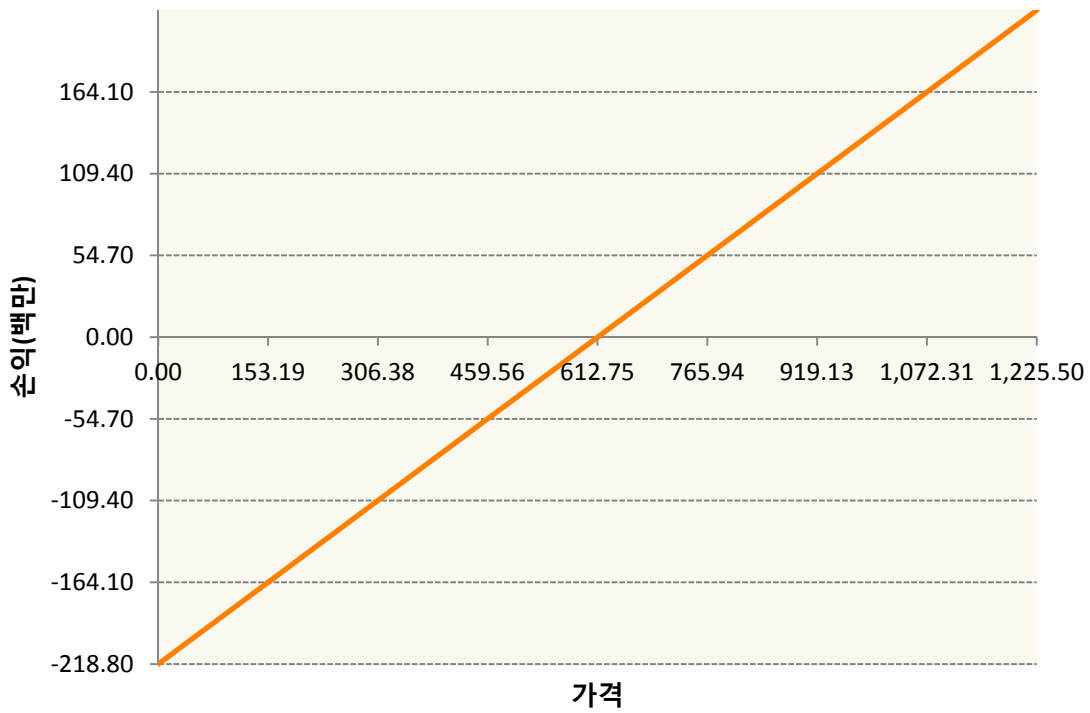




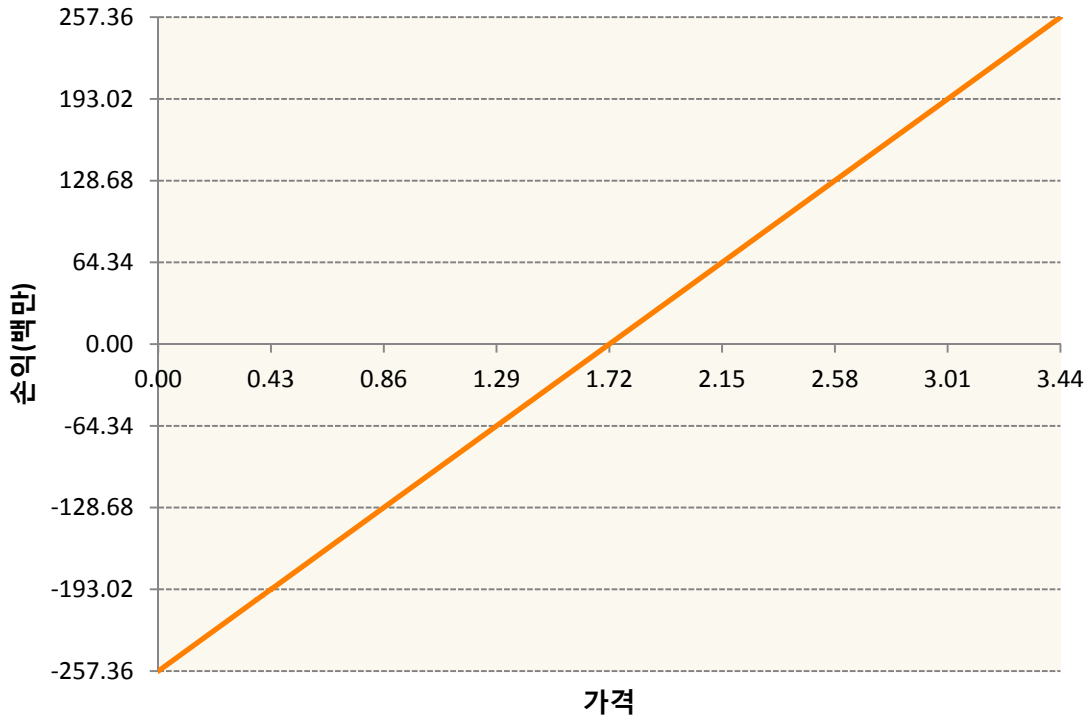
NGH20-NATURAL GAS FUTR Mar20



QSH0-Low Su Gasoil G Mar20



XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	52
COH0	BRENT CRUDE FUTR Mar20	55
HOH0	NY Harb ULSD Fut Mar20	16
KR4175Q10C	2020-01 달러선물	23
NGH20	NATURAL GAS FUTR Mar20	38
QSH0	Low Su Gasoil G Mar20	18
XBH0	GASOLINE RBOB FUT Mar20	21

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

384

공시일	2020-01-06
기준일	2020-01-03

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

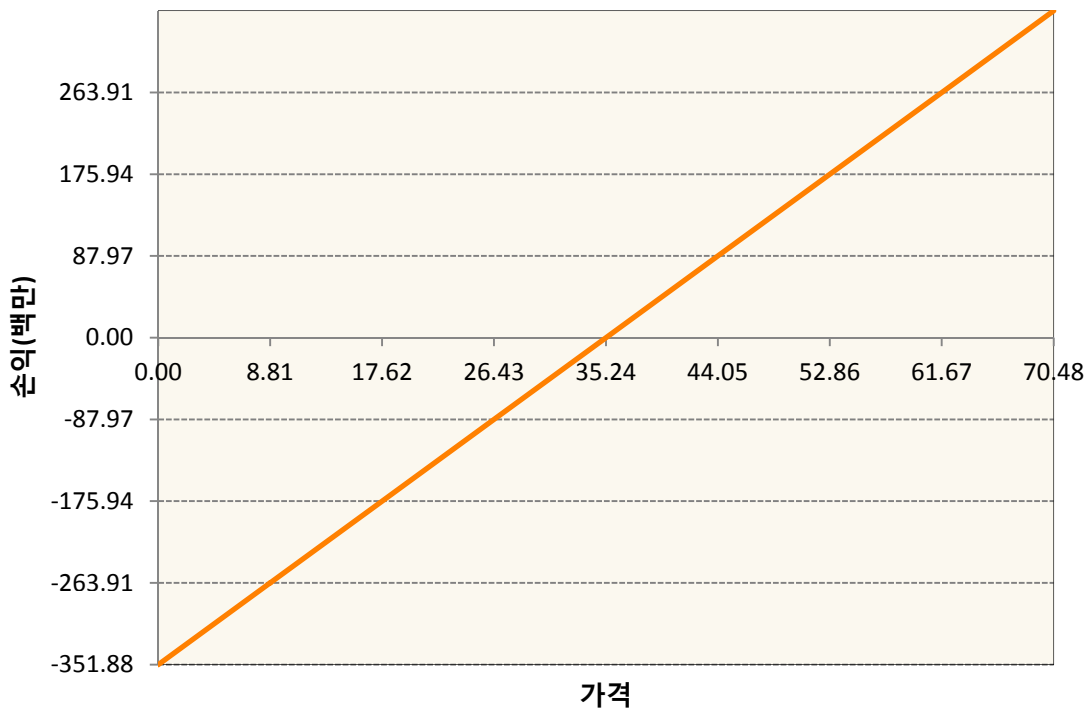
1. 계약금액

(단위:백만원)

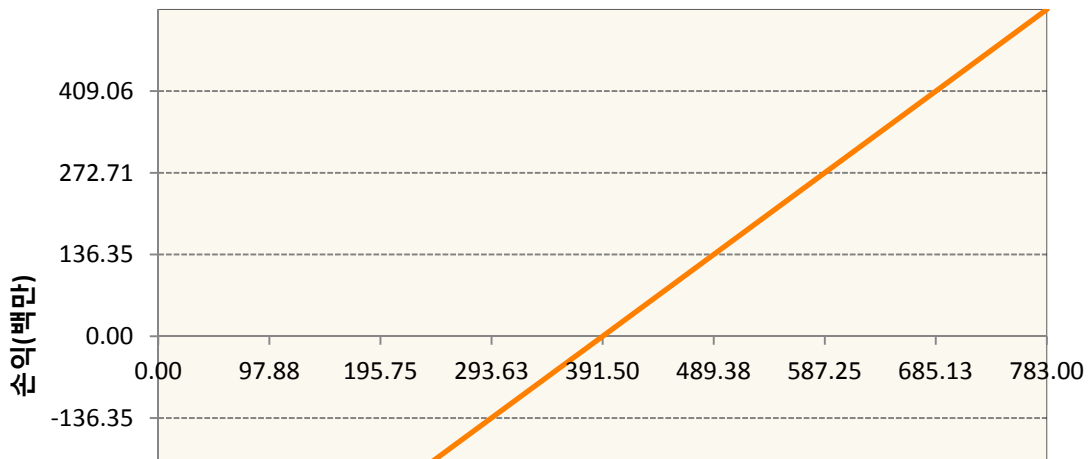
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,875	152	2,724	

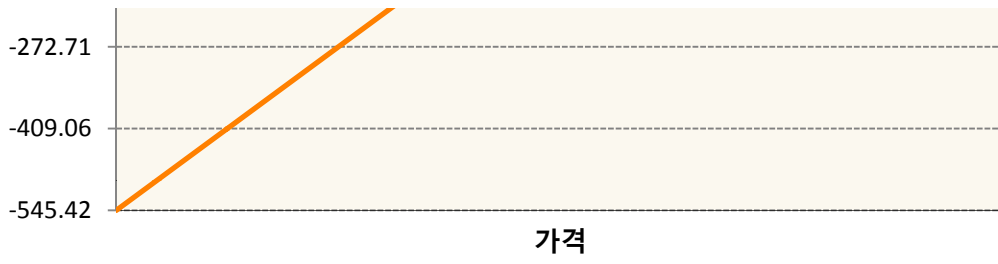
2. 만기시점의 손익구조

BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20

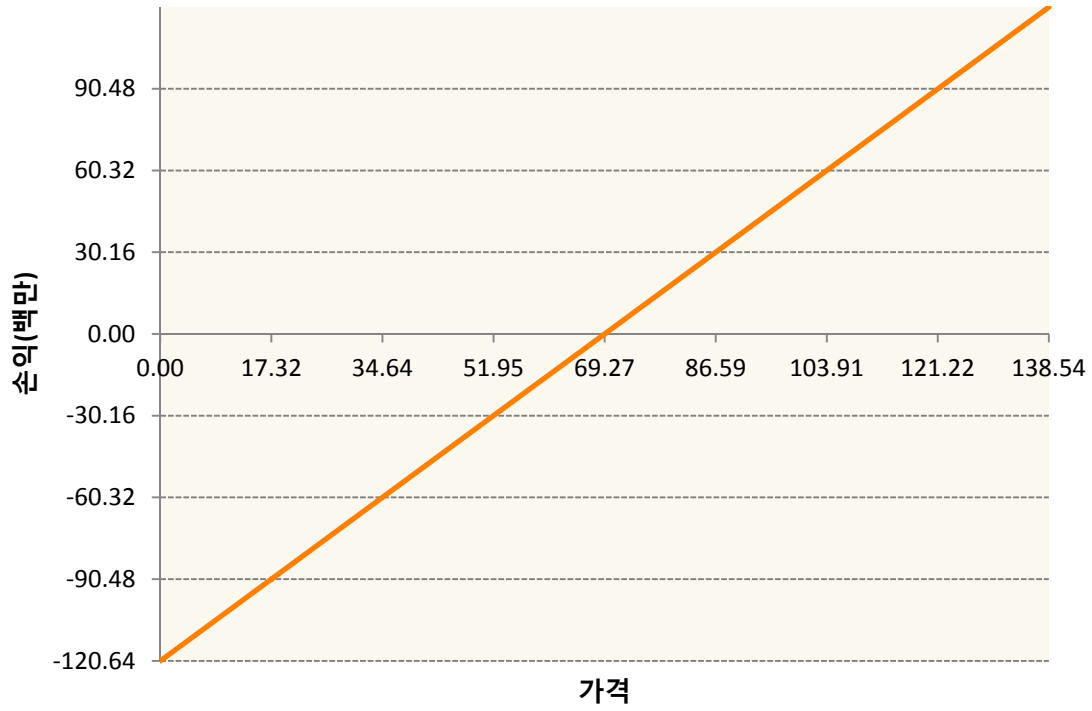


CH0-CORN FUTURE Mar20

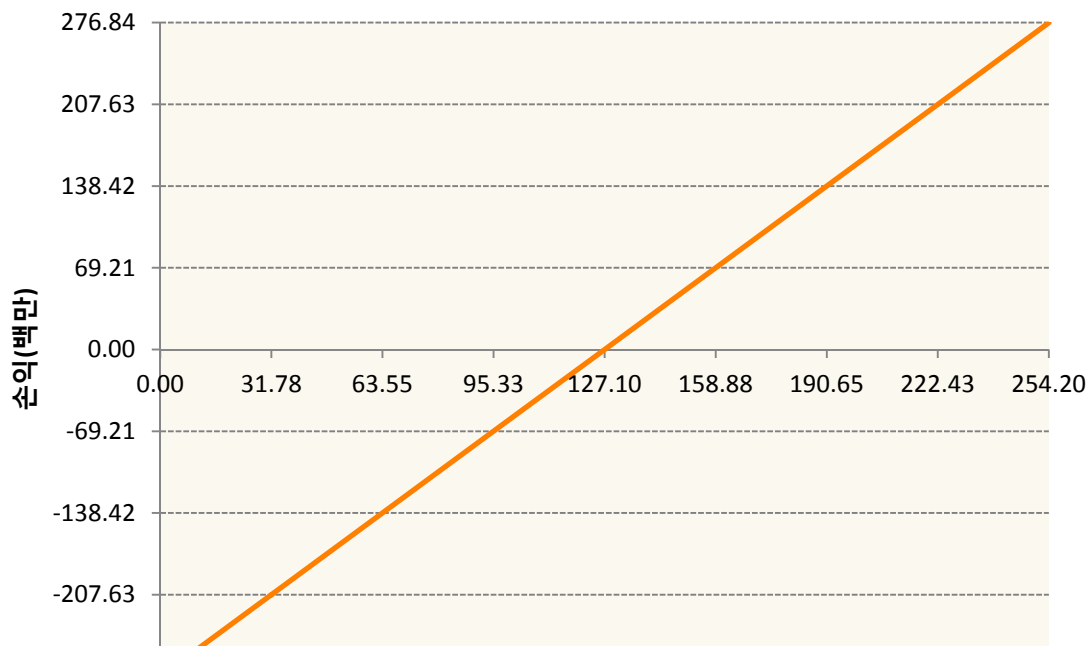


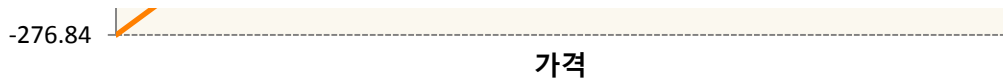


CTH0-COTTON NO.2 FUTR Mar20

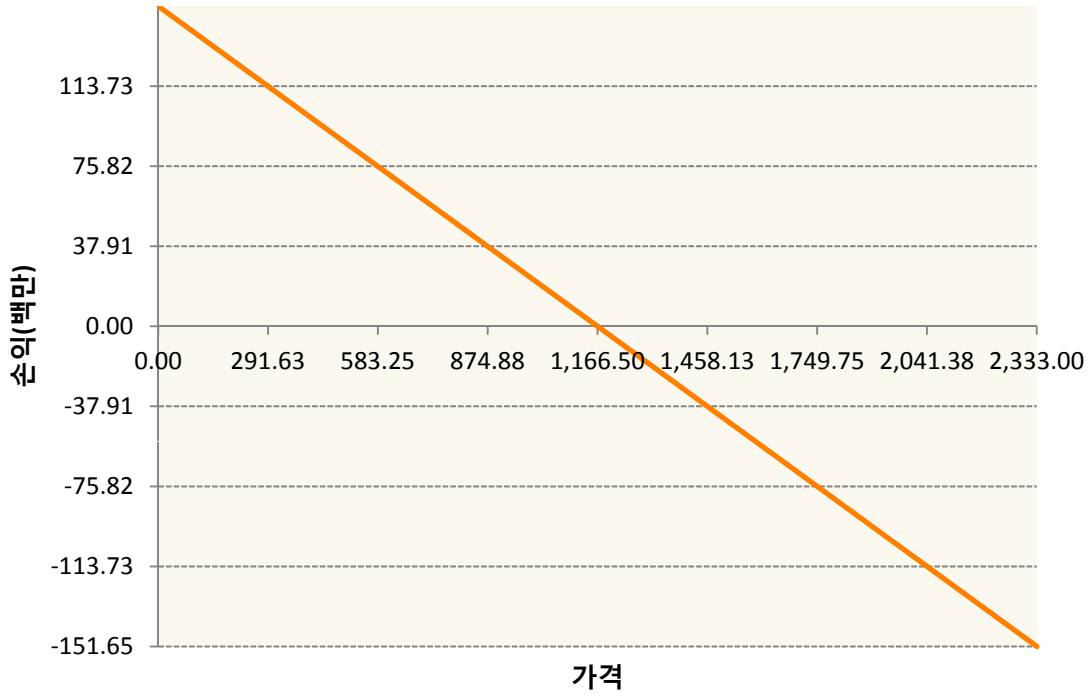


KCH0-COFFEE 'C' FUTURE Mar20

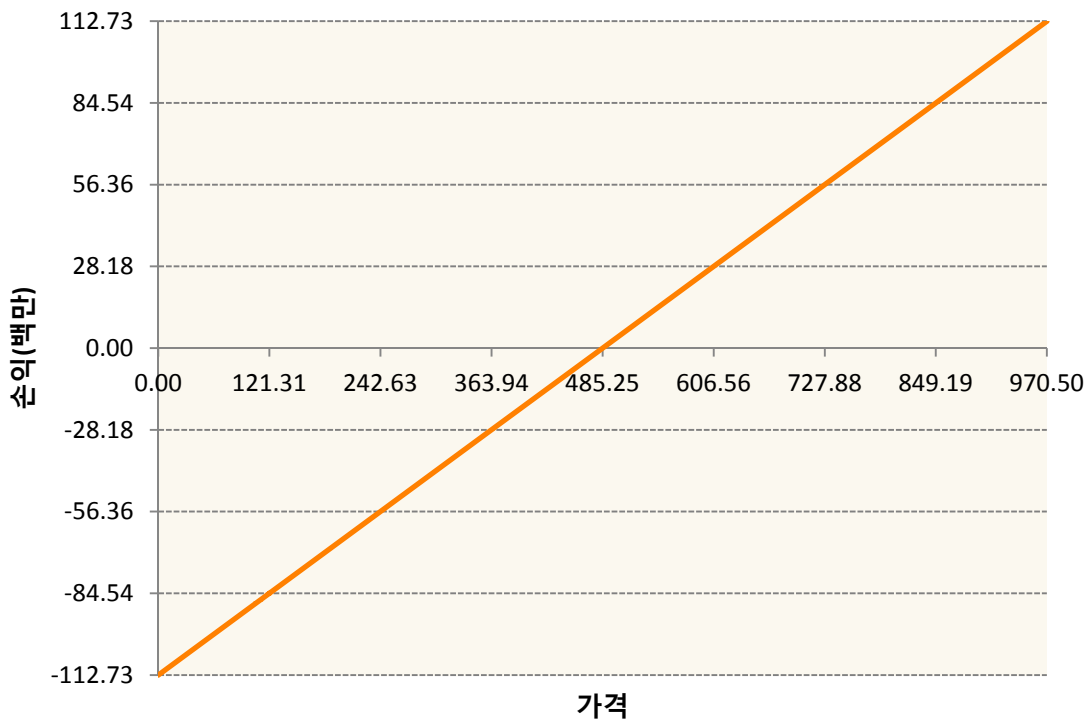




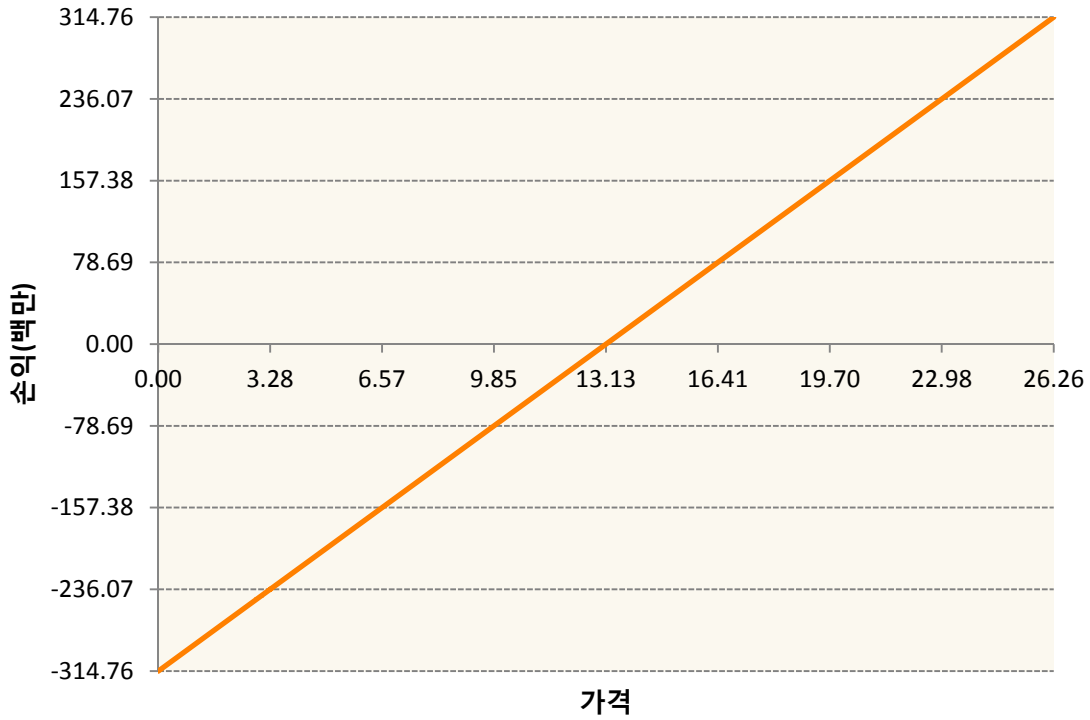
KR4175Q10001-2020-01 달러선물



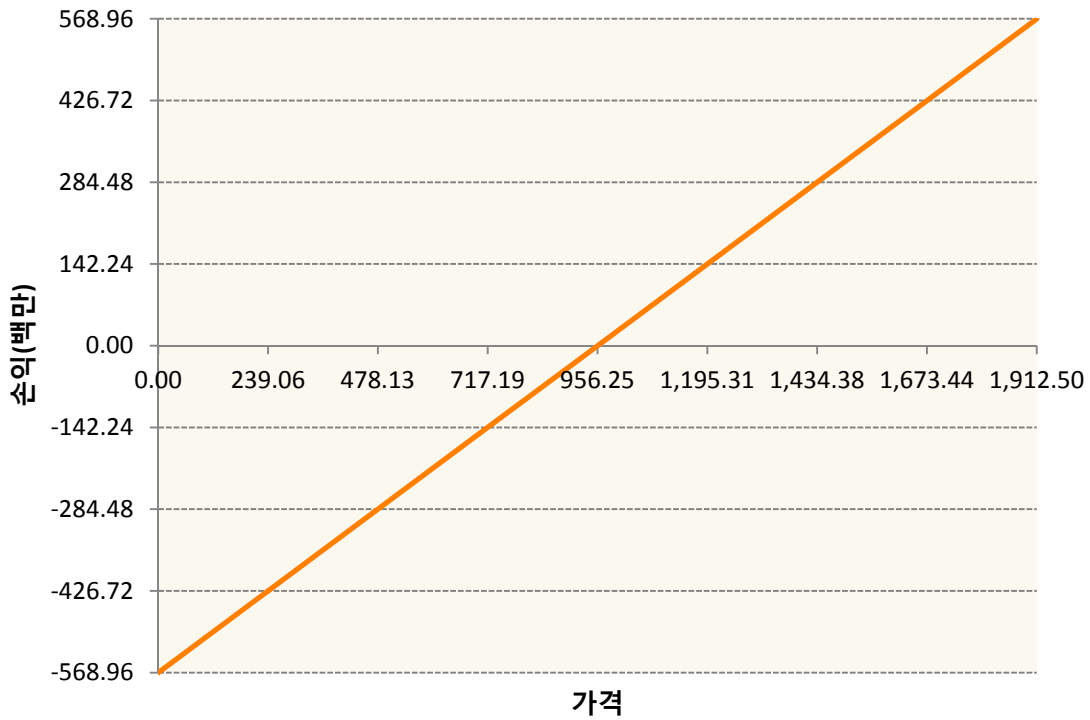
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

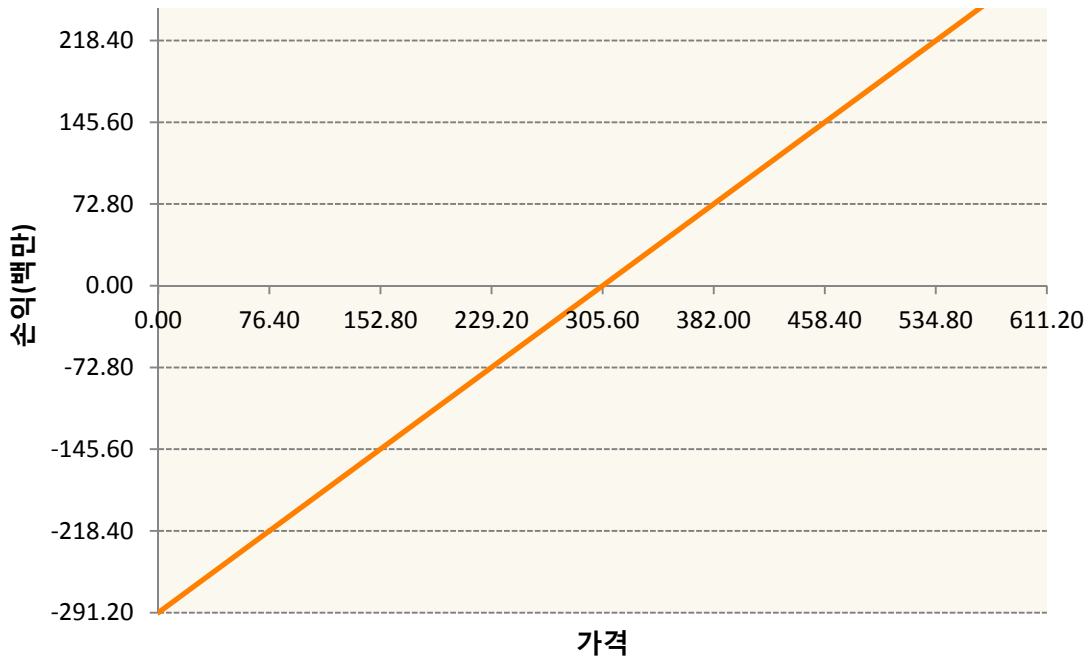


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20

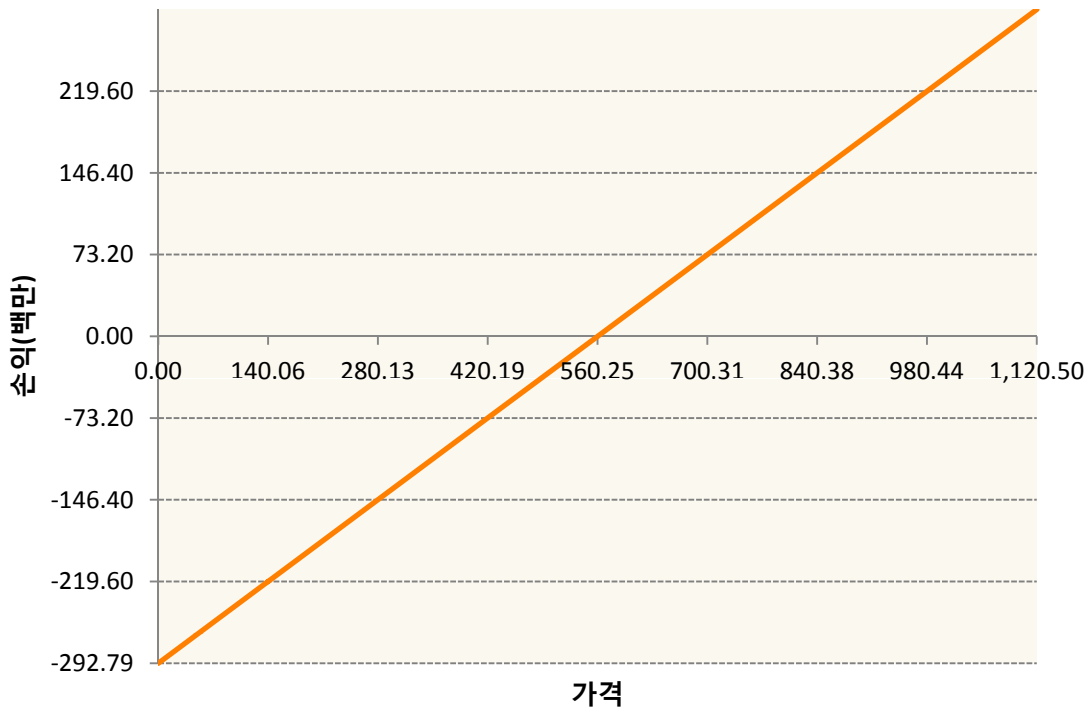


SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





WHO-WHEAT FUTURE(CBT) Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH0	SOYBEAN OIL FUTR Mar20	28
CH0	CORN FUTURE Mar20	44
CTH0	COTTON NO.2 FUTR Mar20	10
KCH0	COFFEE 'C' FUTURE Mar20	22
KR4175Q10C	2020-01 달러선물	12

KWH0	KC HRW WHEAT FUT Mar20	9
SBH0	Sugar Mar20	25
SH0	SOYBEAN FUTURE Mar20	46
SMH0	SOYBEAN MEAL FUTR Mar20	23
WH0	WHEAT FUTURE(CBT) Mar20	23

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

(단위:백만원)

251