

공시일	2020-01-07
기준일	2020-01-06

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	2020-01-07
기준일	2020-01-06

스마트인덱스모

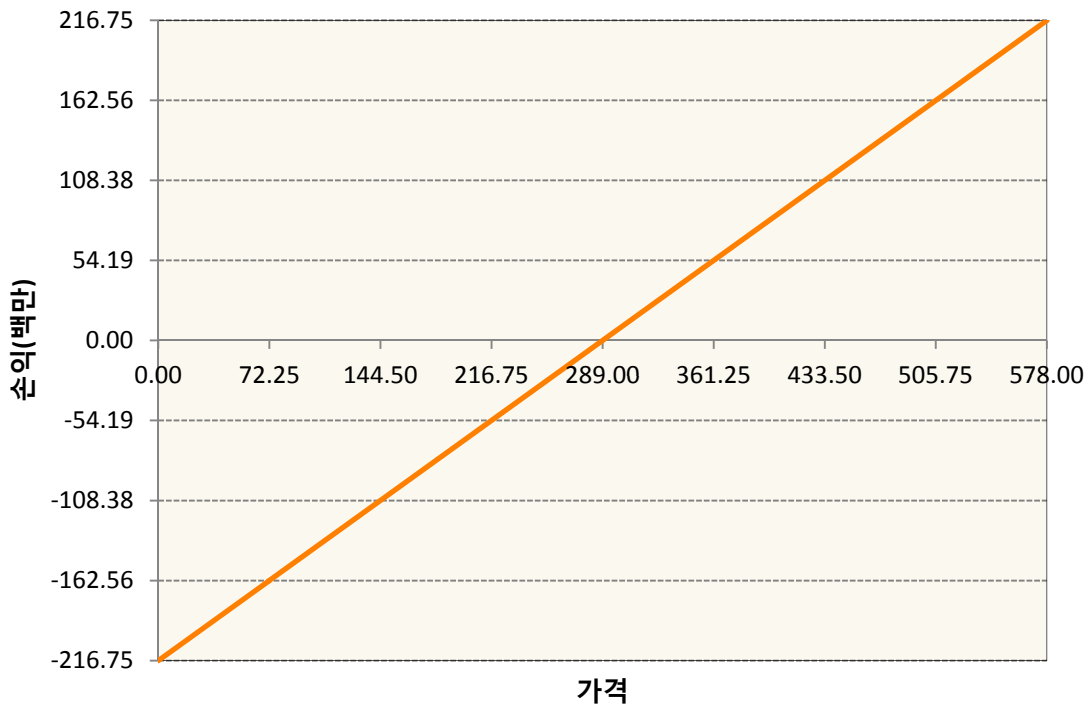
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	217	0	217	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						17
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
-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%	17	17	17	17	17	17	17	

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

(단위:백만원)

14

공시일	2020-01-07
기준일	2020-01-06

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

1,131

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

649

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-07
기준일	2020-01-06

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)	419
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	153

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

798

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-07
기준일	2020-01-06

유로인덱스모(주식-파생형)

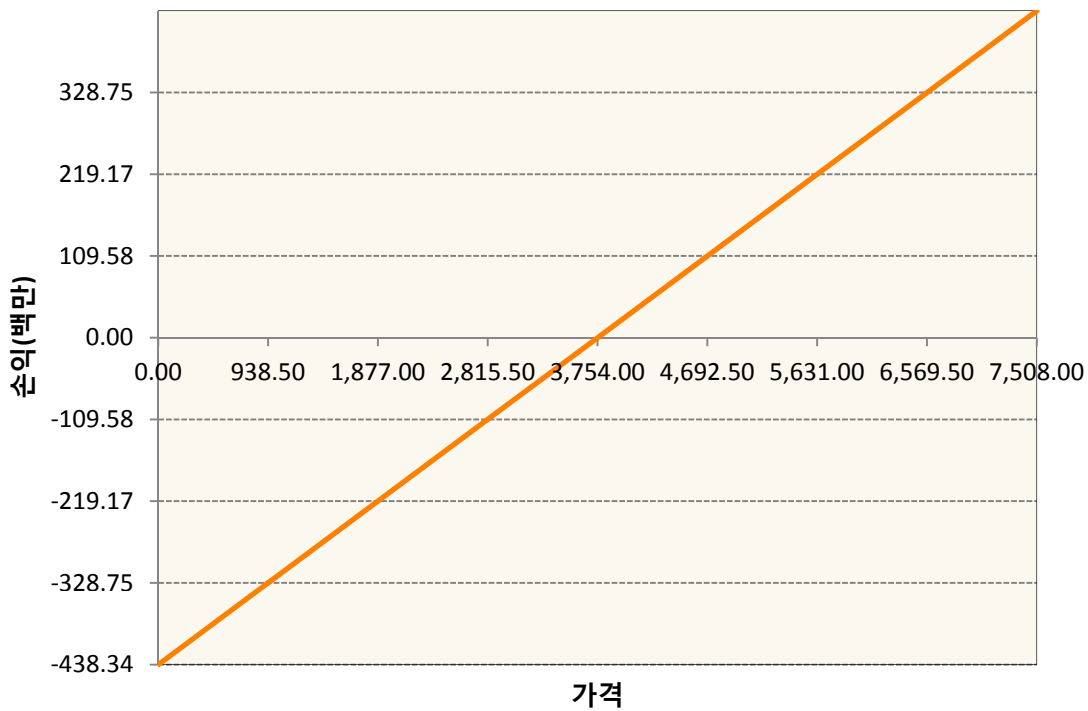
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	438	0	438	

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	2020-01-07
기준일	2020-01-06

차이나인덱스모(주식-파생형)

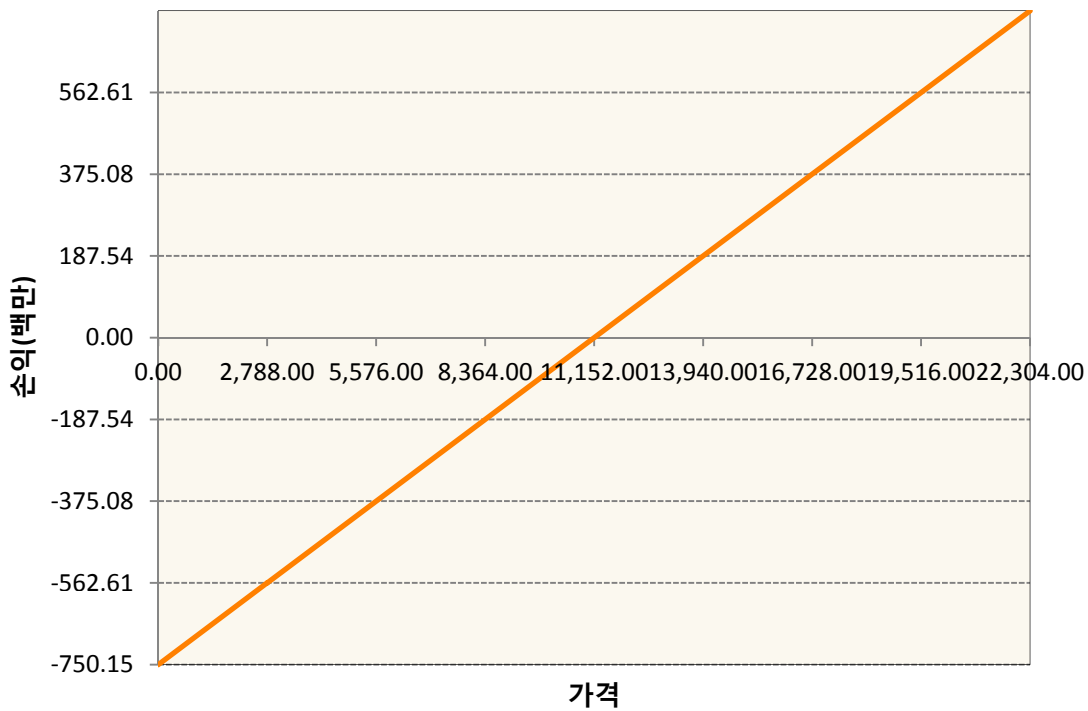
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	750	0	750	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCF0-HSCEI Futures Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF0	HSCEI Futures Jan20	60
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

53

공시일	2020-01-07
기준일	2020-01-06

커버드콜모(주식혼합-파생형)

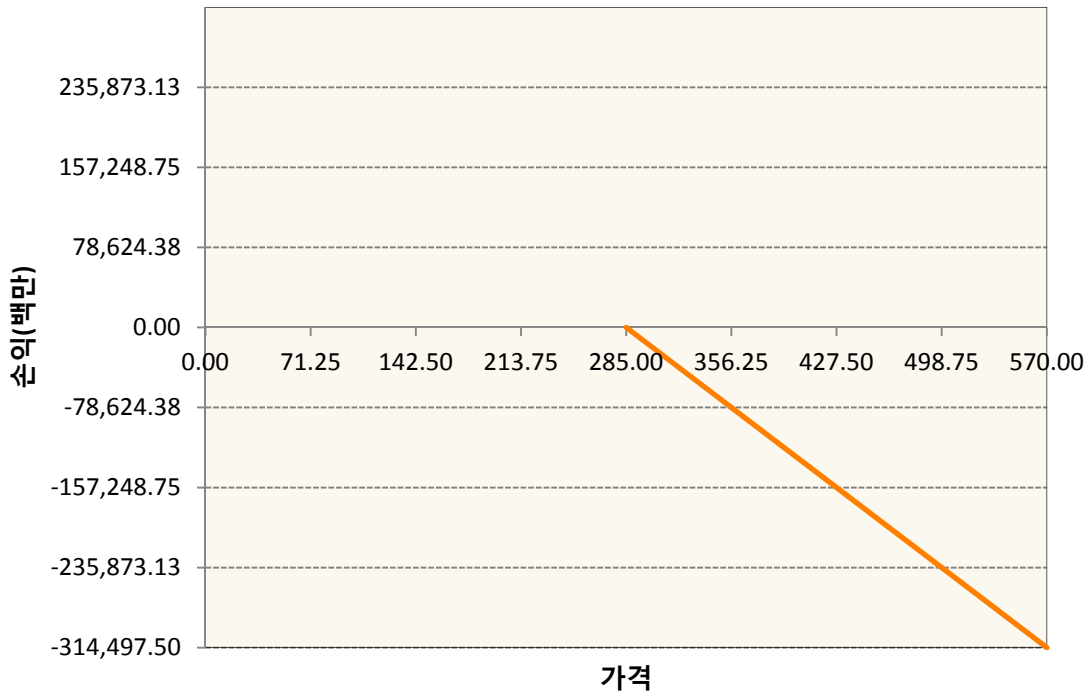
1. 계약금액

(단위:백만원)

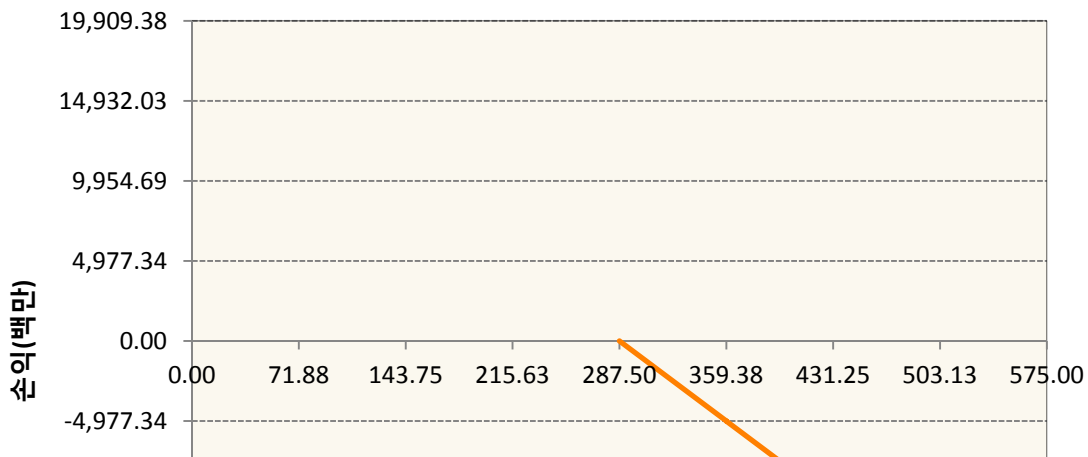
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	2,201	0	2,201	장내
누계	유가증권	옵션	0	468,214	-468,214	장내

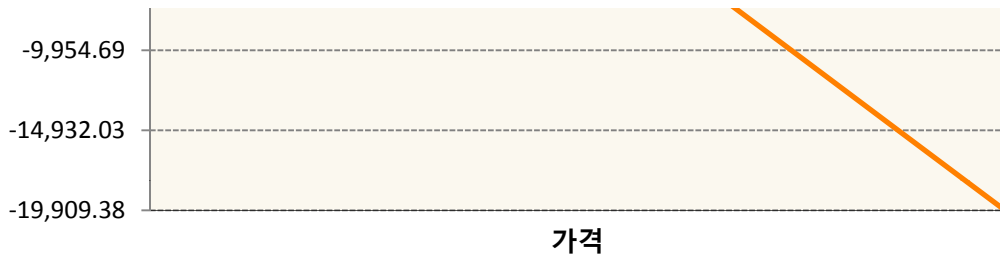
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q12852-2020-01 콜285

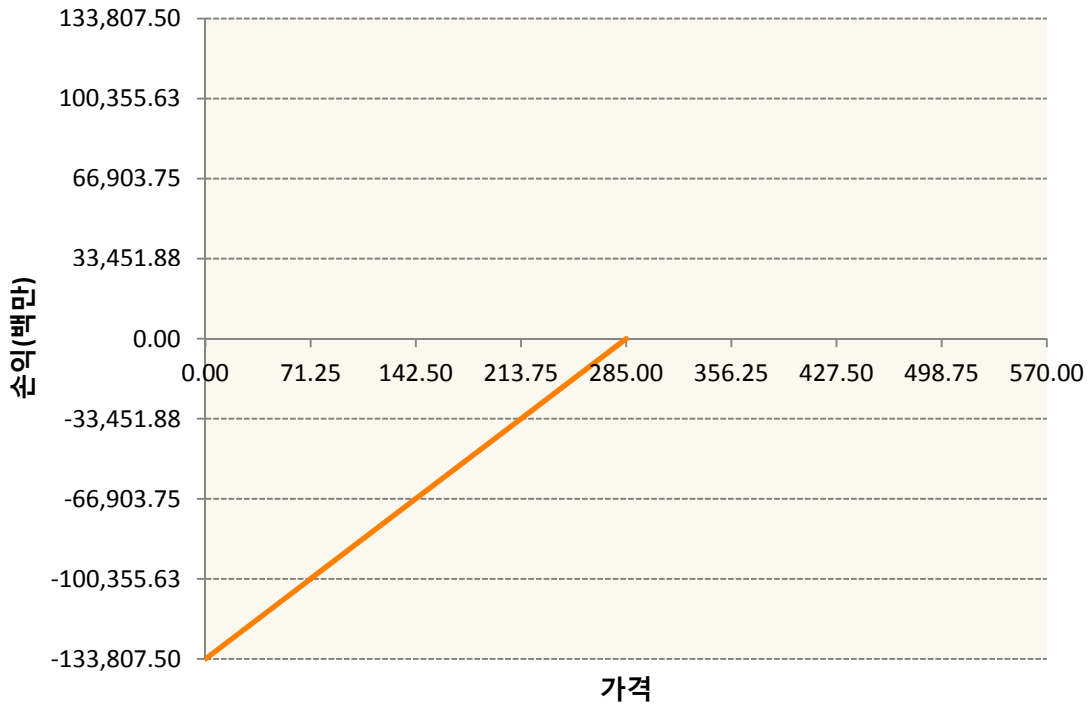


KR4201Q12878-2020-01 콜287.5





KR4301Q12850-2020-01 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q12852		2020-01 콜285					23,734
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,514	5,513	5,511	5,507	5,499	5,485	5,465
-5.33%	5,484	5,454	5,408	5,347	5,271	5,180	5,075
-2.67%	4,746	4,539	4,322	4,098	3,866	3,630	3,389
0%	714	483	244	0	-248	-500	-755
2.67%	-6,810	-6,859	-6,927	-7,012	-7,115	-7,233	-7,365
5.33%	-15,238	-15,240	-15,246	-15,256	-15,274	-15,300	-15,336
8.00%	-23,723	-23,723	-23,724	-23,724	-23,725	-23,728	-23,734
KR4201Q12878		2020-01 콜287.5					1,423
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	241	241	241	240	240	240	239

-5.33%	240	239	238	236	233	230	225
-2.67%	220	211	201	191	179	167	154
0%	51	34	17	0	-17	-34	-51
2.67%	-367	-373	-381	-390	-399	-410	-421
5.33%	-889	-889	-890	-892	-894	-897	-901
8.00%	-1,421	-1,421	-1,421	-1,421	-1,421	-1,422	-1,423
KR4301Q12850 2020-01 풋285							9,008
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,008	-9,008	-9,008	-9,008	-9,008	-9,008	-9,008
-5.33%	-5,397	-5,397	-5,397	-5,398	-5,399	-5,401	-5,403
-2.67%	-1,838	-1,864	-1,894	-1,928	-1,966	-2,007	-2,050
0%	121	84	44	0	-46	-95	-145
2.67%	217	217	216	215	212	208	203
5.33%	217	217	217	217	217	217	217
8.00%	217	217	217	217	217	217	217

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

(단위:백만원)

42,063

공시일	2020-01-07
기준일	2020-01-06

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

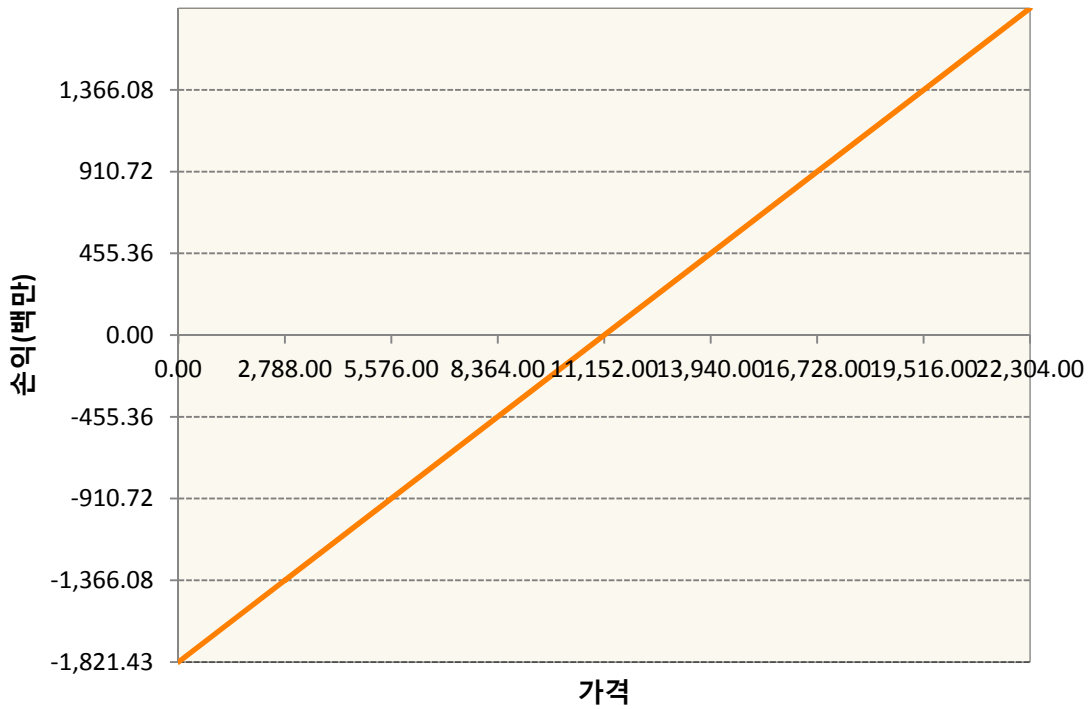
1. 계약금액

(단위:백만원)

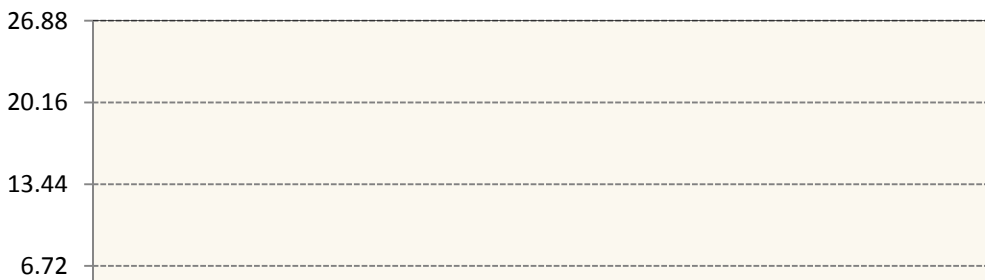
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,821	0	1,821	장내
누계	유가증권	옵션	0	82	-82	장내
누계	통화	선도	0	2,124	-2,124	장외

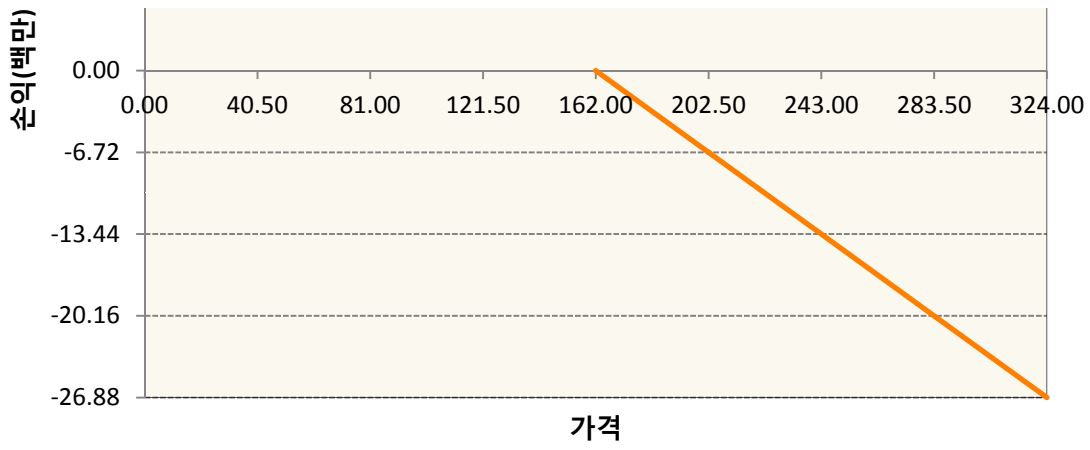
2. 만기시점의 손익구조

HCFO-HSCEI Futures Jan20

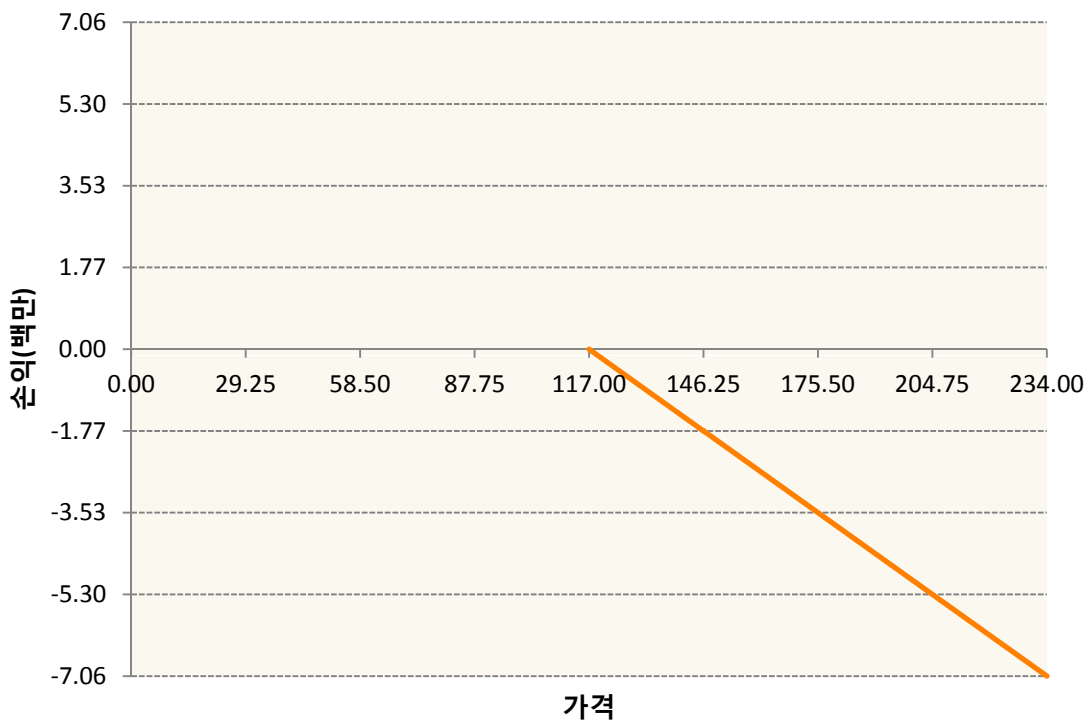


OHHIF0-C112-HSCEI

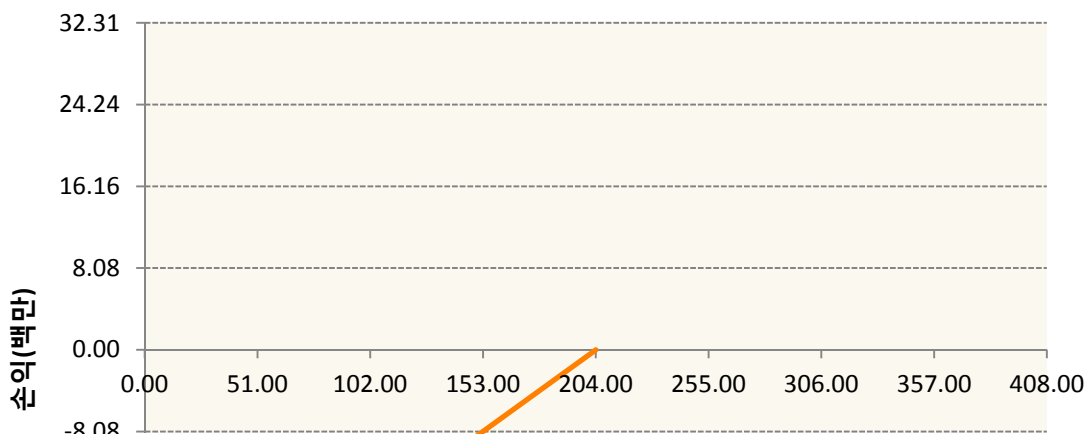


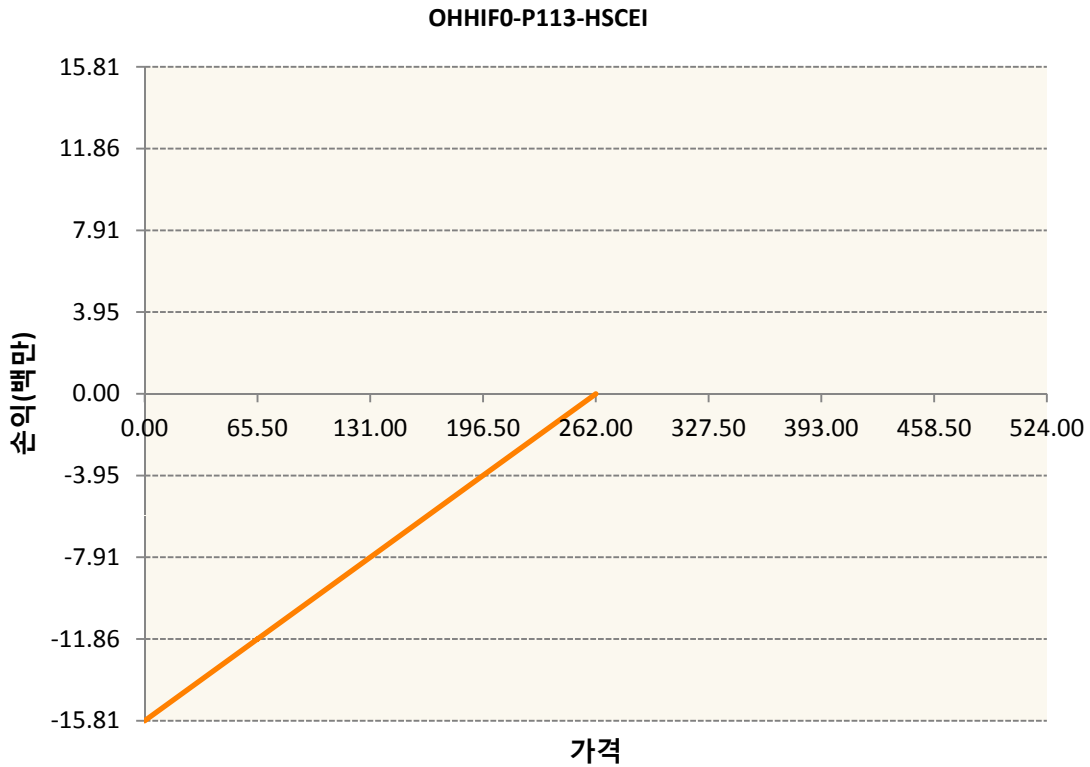
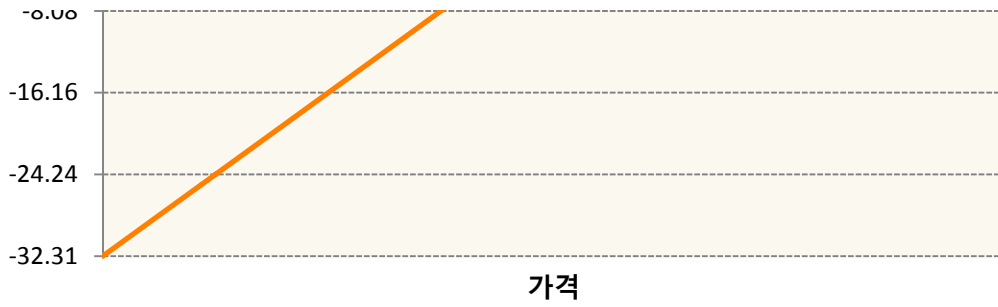


OHHIF0-C113-HSCEI



OHHIF0-P112-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	170
HCF0 HSCEI Futures Jan20	146
OHHIF0-C11 HSCEI	2
OHHIF0-C11 HSCEI	1
OHHIF0-P11 HSCEI	3
OHHIF0-P11 HSCEI	1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	188

공시일	2020-01-07
기준일	2020-01-06

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

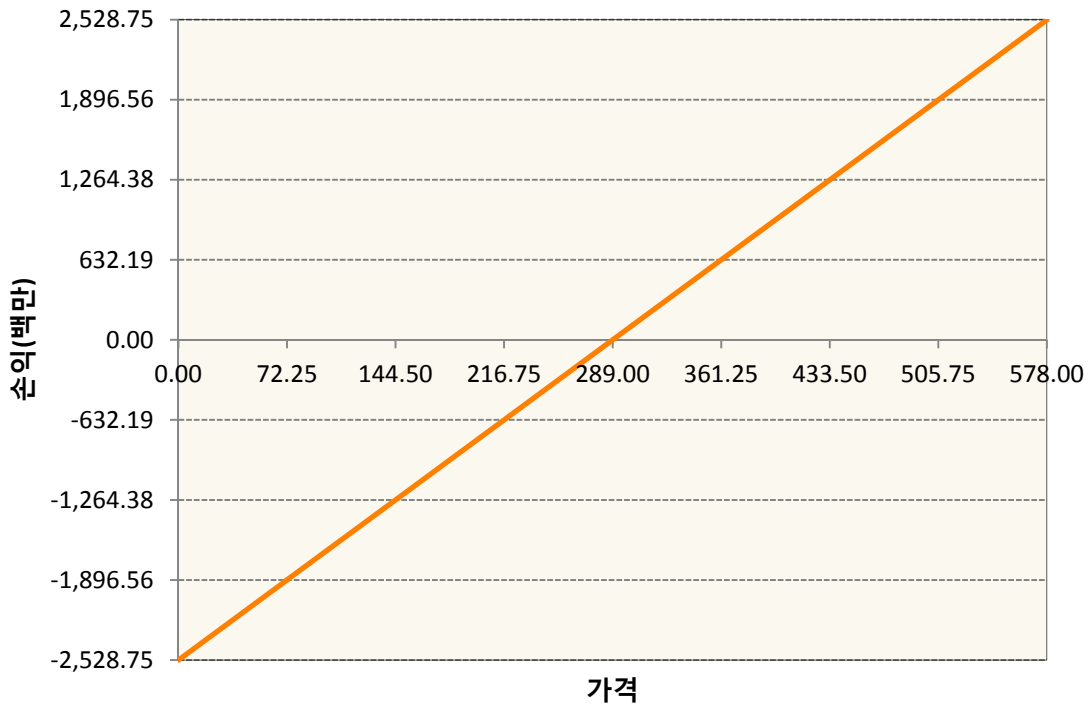
1. 계약금액

(단위:백만원)

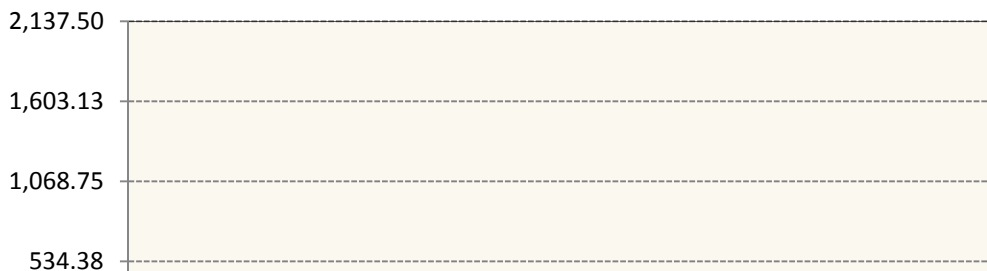
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,529	0	2,529	장내
누계	유가증권	스왑	5,625	0	5,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,847	-4,847	장내

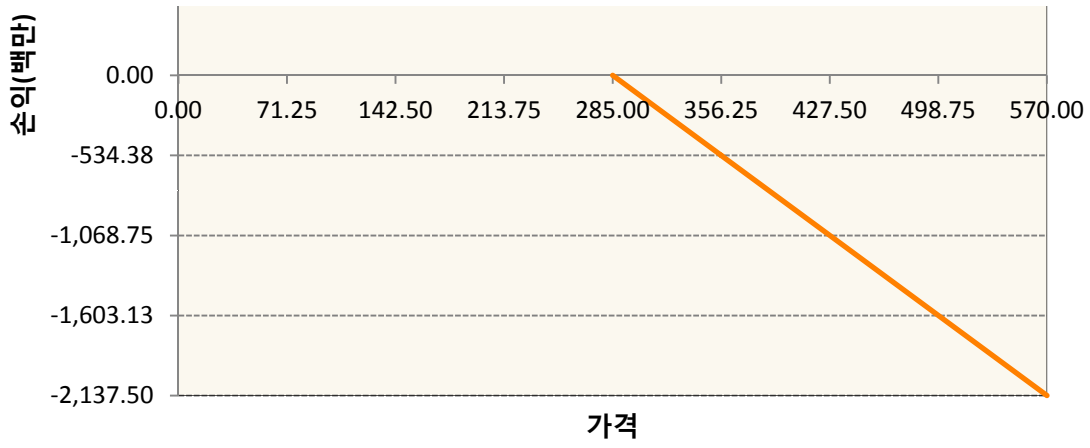
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

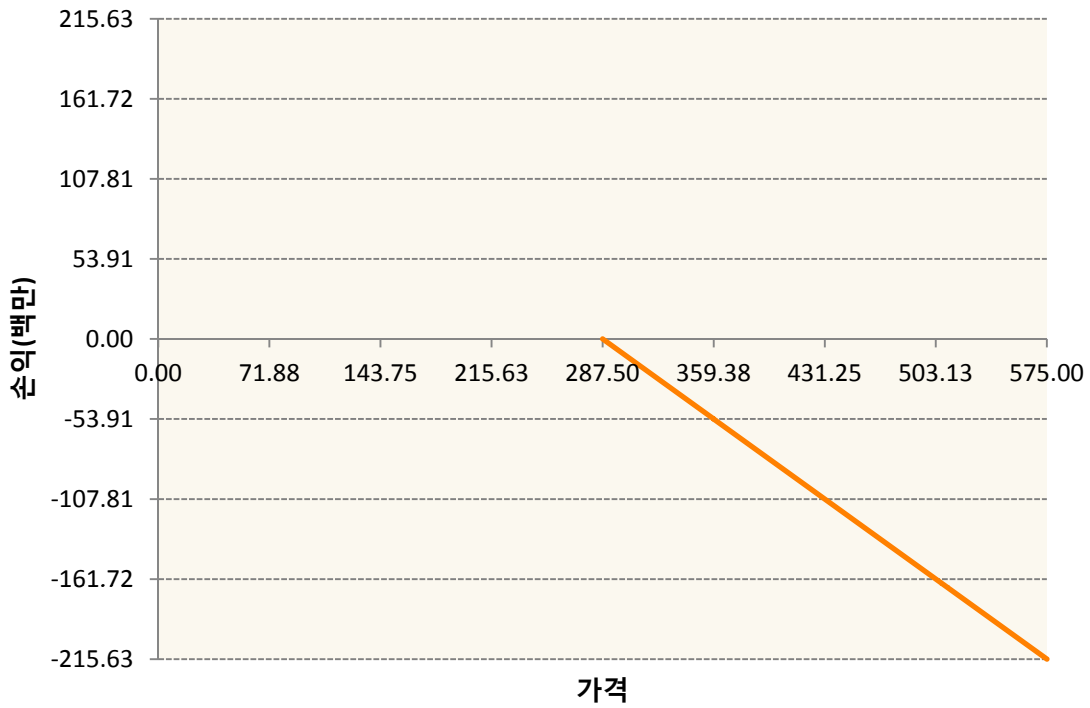


KR4201Q12852-2020-01 콜285

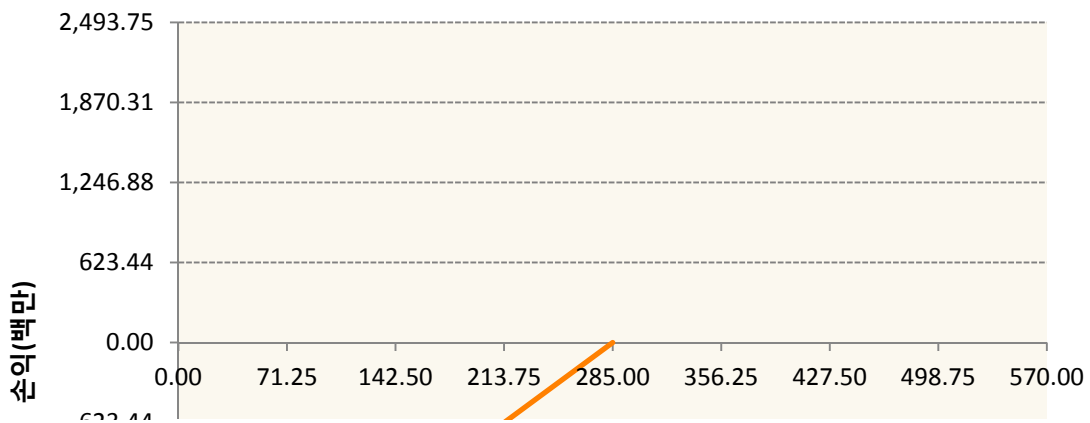


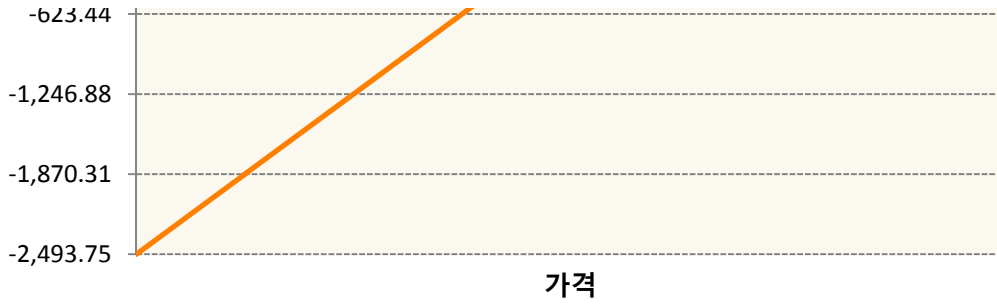


KR4201Q12878-2020-01 콜287.5



KR4301Q12850-2020-01 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						487
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-487	-487	-487	-487	-487	-487	-487	
-5.33%	-325	-325	-325	-325	-325	-325	-325	
-2.67%	-162	-162	-162	-162	-162	-162	-162	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	162	162	162	162	162	162	162	
5.33%	325	325	325	325	325	325	325	
8.00%	487	487	487	487	487	487	487	
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	
KR4201Q12852		2020-01 콜285						161
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	37	37	37	37	37	37	37	
-5.33%	37	37	37	36	36	35	34	
-2.67%	32	31	29	28	26	25	23	
0%	5	3	2	0	-2	-3	-5	
2.67%	-46	-47	-47	-48	-48	-49	-50	
5.33%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104	
8.00%	-161	-161	-161	-161	-161	-161	-161	
KR4201Q12878		2020-01 콜287.5						15
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	3	3	3	3	3	3	3
-5.33%	3	3	3	3	3	3	2
-2.67%	2	2	2	2	2	2	2
0%	1	0	0	0	0	0	-1
2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
5.33%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
8.00%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
KR4301Q12850 2020-01 풋285							168
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168
-5.33%	-101	-101	-101	-101	-101	-101	-101
-2.67%	-34	-35	-35	-36	-37	-37	-38
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	4	4	4	4	4	4	4
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)

1,067

공시일	2020-01-07
기준일	2020-01-06

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

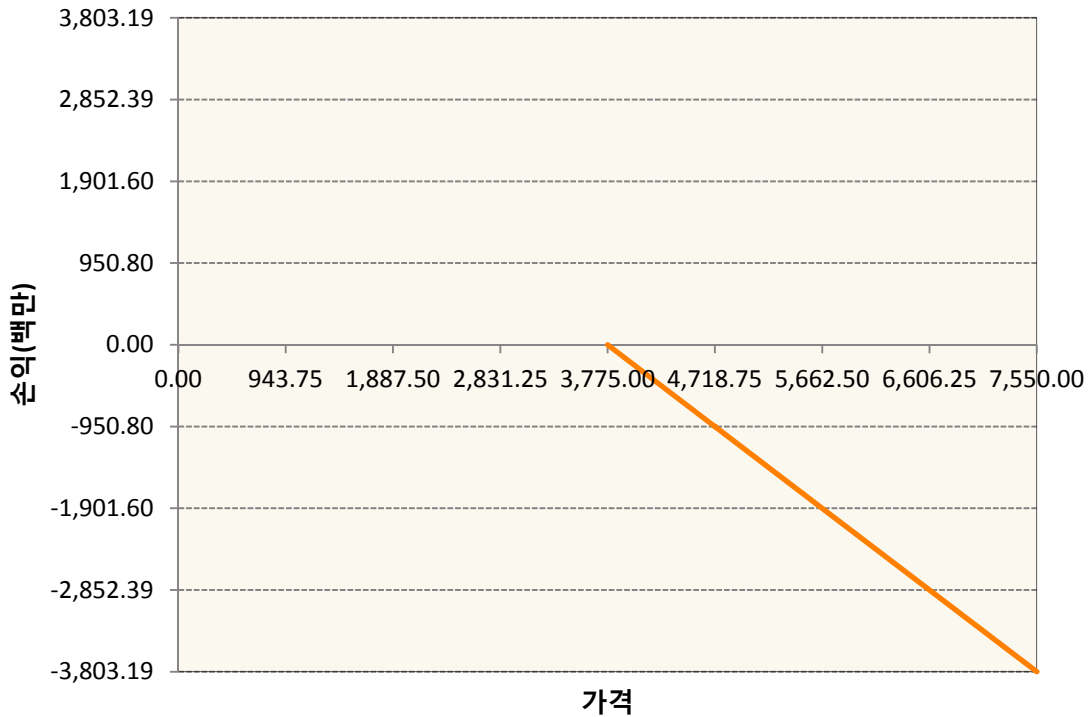
1. 계약금액

(단위:백만원)

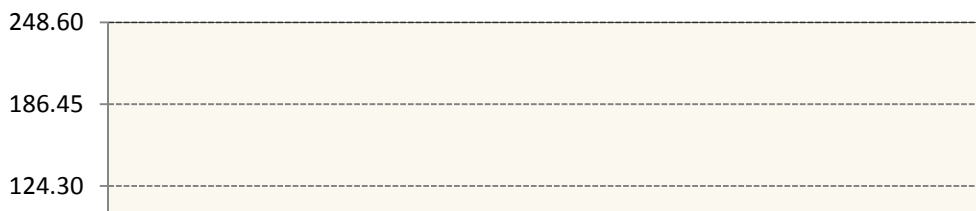
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	923	0	923	
누계	유가증권	스왑	15,891	0	15,891	장외
누계	유가증권	옵션	0	8,104	-8,104	장내
누계	통화	선도	0	3,433	-3,433	장외

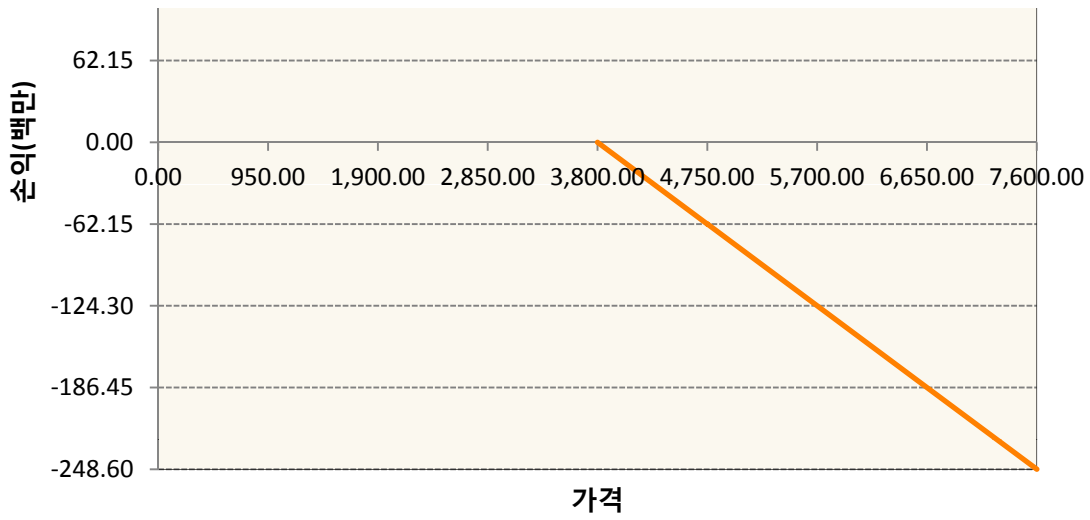
2. 만기시점의 손익구조

OESXF0-C3775-EURO STOXX 50

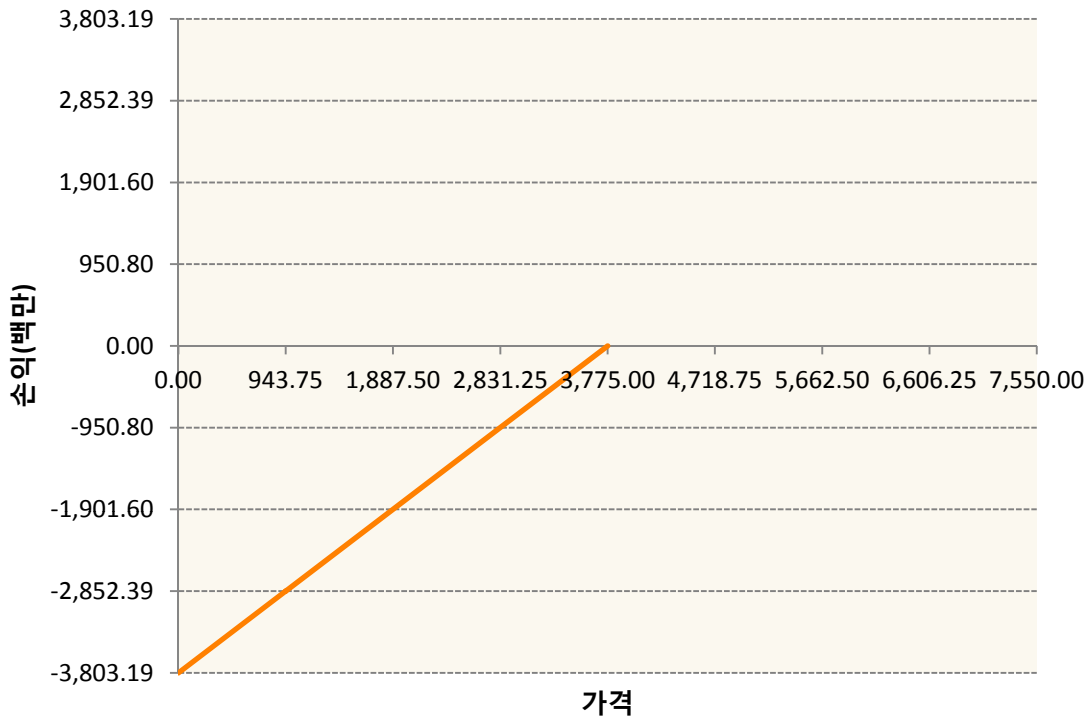


OESXF0-C3800-EURO STOXX 50

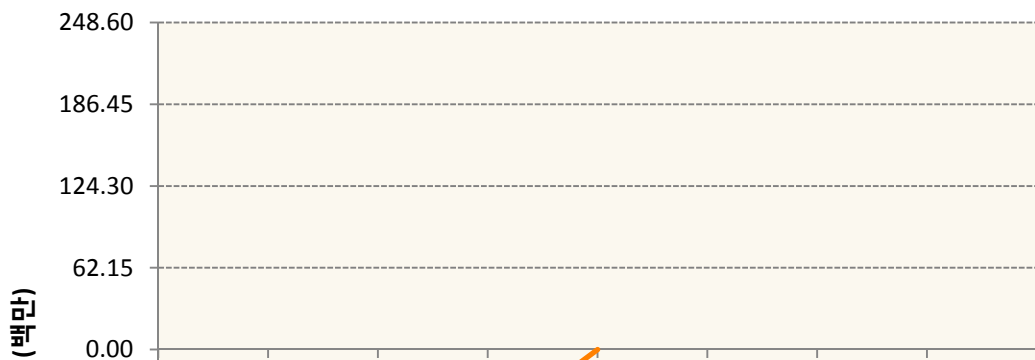


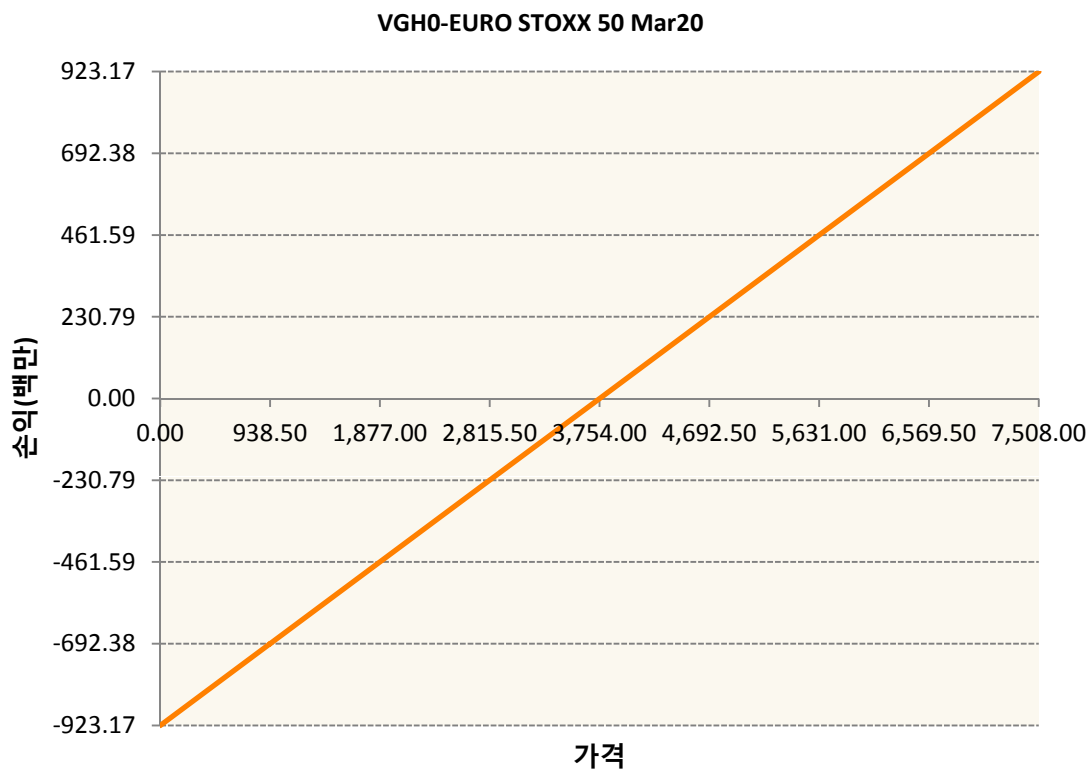
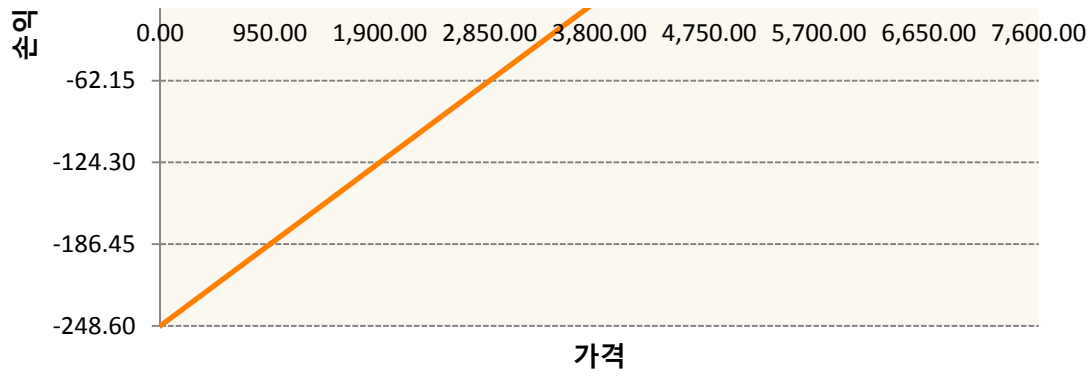


OESXF0-P3775-EURO STOXX 50



OESXF0-P3800-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	37
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	275
OESXF0-C37 EURO STOXX 50	304
OESXF0-C38 EURO STOXX 50	20
OESXF0-P37 EURO STOXX 50	304
OESXF0-P38 EURO STOXX 50	20
VGHO EURO STOXX 50 Mar20	74

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

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

(단위:백만원)

904

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

(단위:백만원)

77

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

(단위:백만원)

113

공시일	2020-01-07
기준일	2020-01-06

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

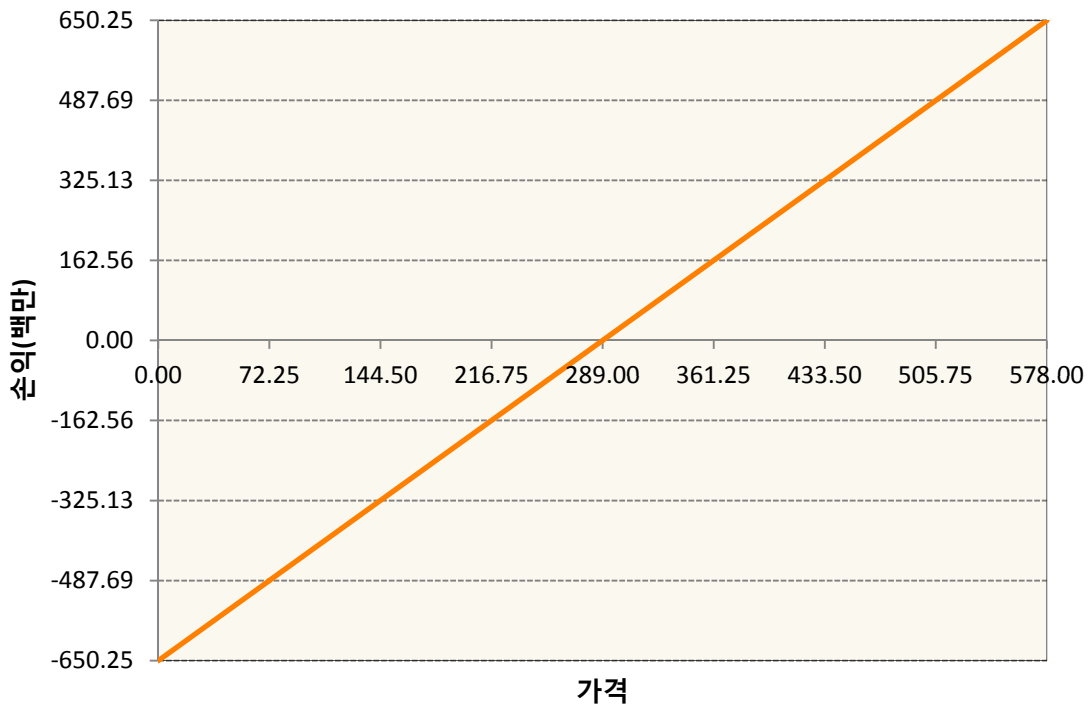
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	650	0	650	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	2020-01-07
기준일	2020-01-06

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

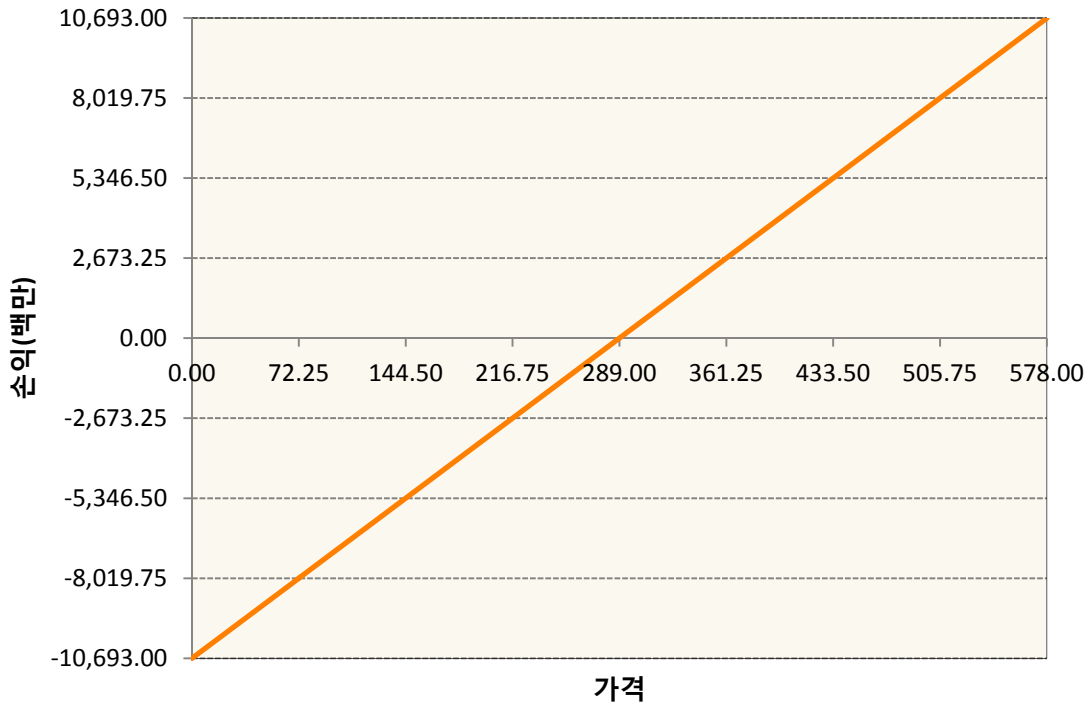
1. 계약금액

(단위:백만원)

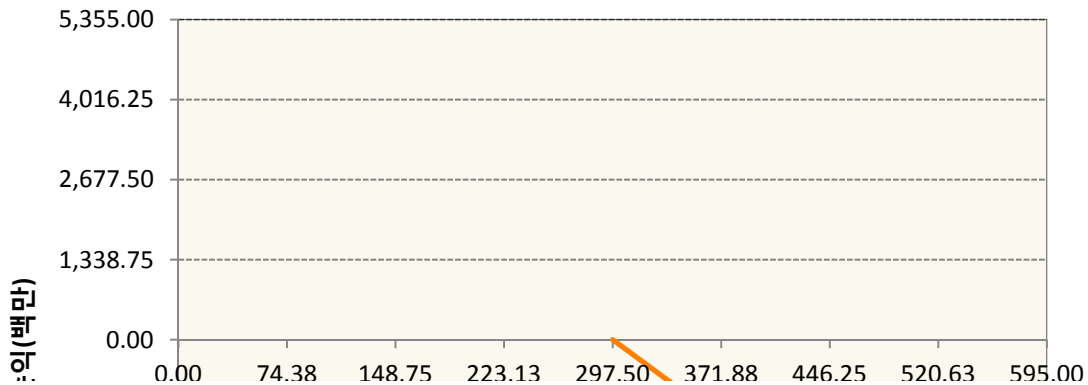
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,693	0	10,693	장내
누계	유가증권	옵션	499	20,955	-20,456	장내

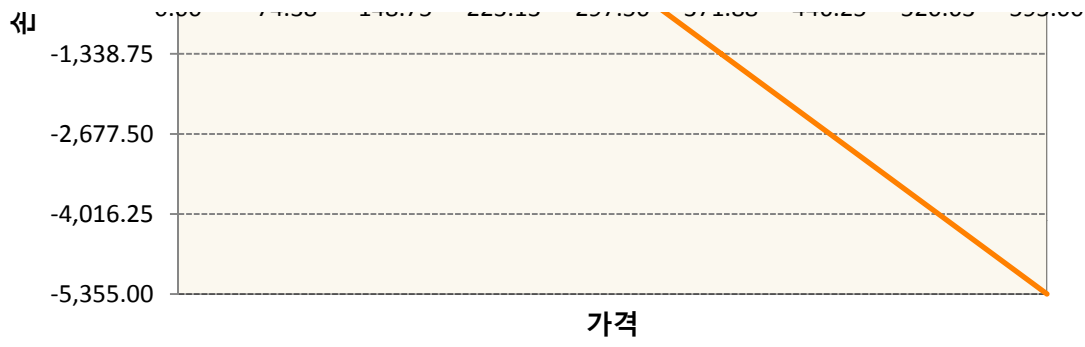
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

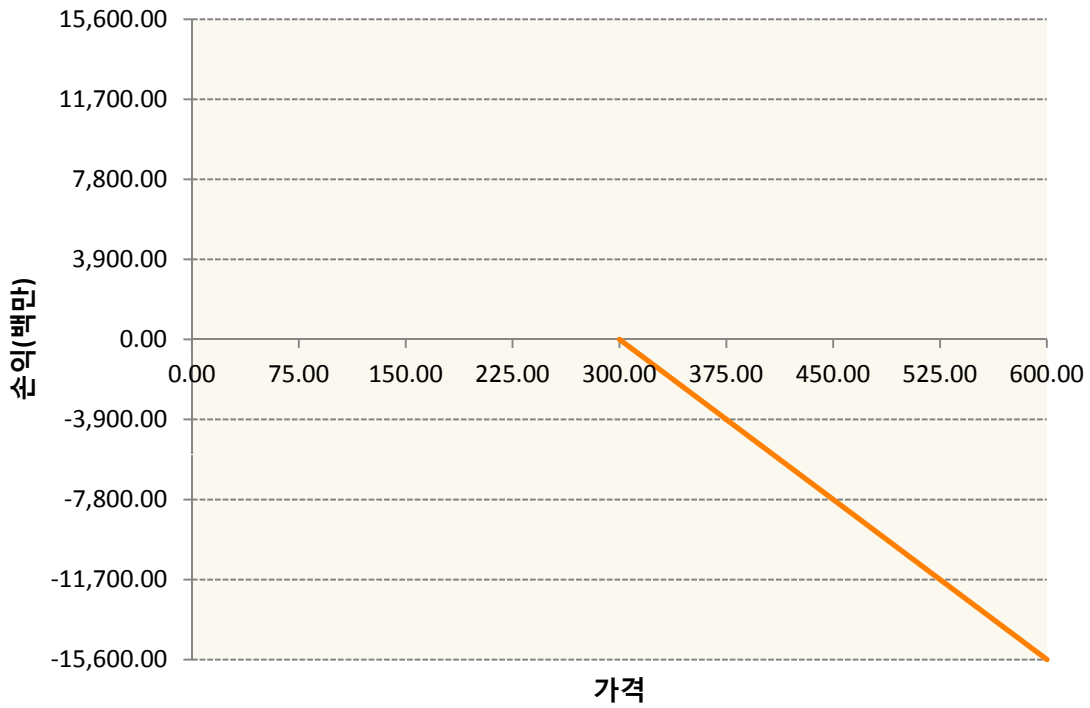


KR4201Q12977-2020-01 콜297.5

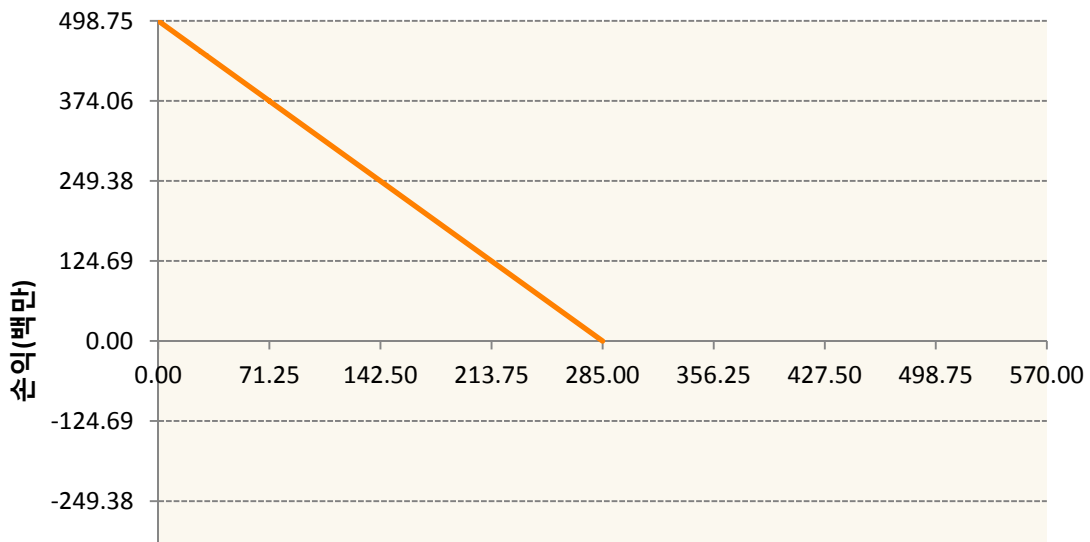


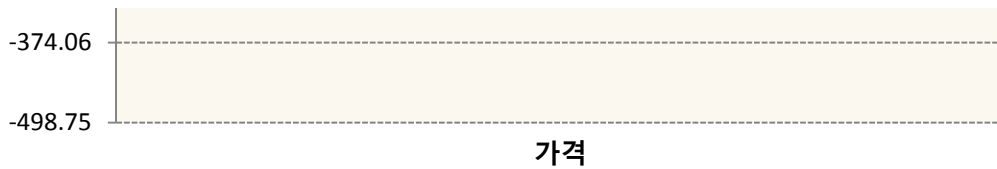


KR4201Q13009-2020-01 콜300



KR4301Q12850-2020-01 풋285





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						854
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-854	-854	-854	-854	-854	-854	-854	
-5.33%	-569	-569	-569	-569	-569	-569	-569	
-2.67%	-285	-285	-285	-285	-285	-285	-285	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	285	285	285	285	285	285	285	
5.33%	569	569	569	569	569	569	569	
8.00%	854	854	854	854	854	854	854	
KR4201Q12977		2020-01 콜297.5						250
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	8	8	8	8	8	8	8	
-5.33%	8	8	8	8	8	8	8	
-2.67%	8	8	8	7	7	6	5	
0%	5	4	2	0	-2	-5	-8	
2.67%	-22	-27	-32	-36	-41	-45	-50	
5.33%	-113	-116	-119	-122	-126	-130	-133	
8.00%	-244	-245	-245	-246	-247	-249	-250	
KR4201Q13009		2020-01 콜300						618
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	11	11	11	11	11	11	11	
-5.33%	11	11	11	11	11	11	11	
-2.67%	11	11	11	11	10	9	8	
0%	9	7	4	0	-5	-10	-16	
2.67%	-34	-45	-57	-68	-80	-92	-105	
5.33%	-235	-246	-257	-269	-282	-294	-306	
8.00%	-590	-592	-596	-600	-605	-611	-618	
KR4301Q12850		2020-01 풋285						34
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	34	34	34	34	34	34	34	
-5.33%	20	20	20	20	20	20	20	
-2.67%	7	7	7	7	7	7	8	

0%	0	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)

1,272

공시일	2020-01-07
기준일	2020-01-06

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	206,733	0	206,733	

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	2020-01-07
기준일	2020-01-06

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	215,789	0	215,789	

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	2020-01-07
기준일	2020-01-06

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	532,559	0	532,559	
누계	통화	선도	0	519,358	-519,358	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E	1,407
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E	1,510
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E	1,875
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E	3,226
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E	4,782
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	188
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,813
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,813
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,344
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,532
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	1,632
FX21019Z00 KRW/USD 10-01-20E	1,125
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	1,538
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	938
FX21019Z02 KRW/USD 16-01-20E	1,688
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	188
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	2,007
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	938
FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E	3,751
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,875
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	2,007
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	188
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	188

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

13,278

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

(단위:백만원)

205

공시일	2020-01-07
기준일	2020-01-06

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

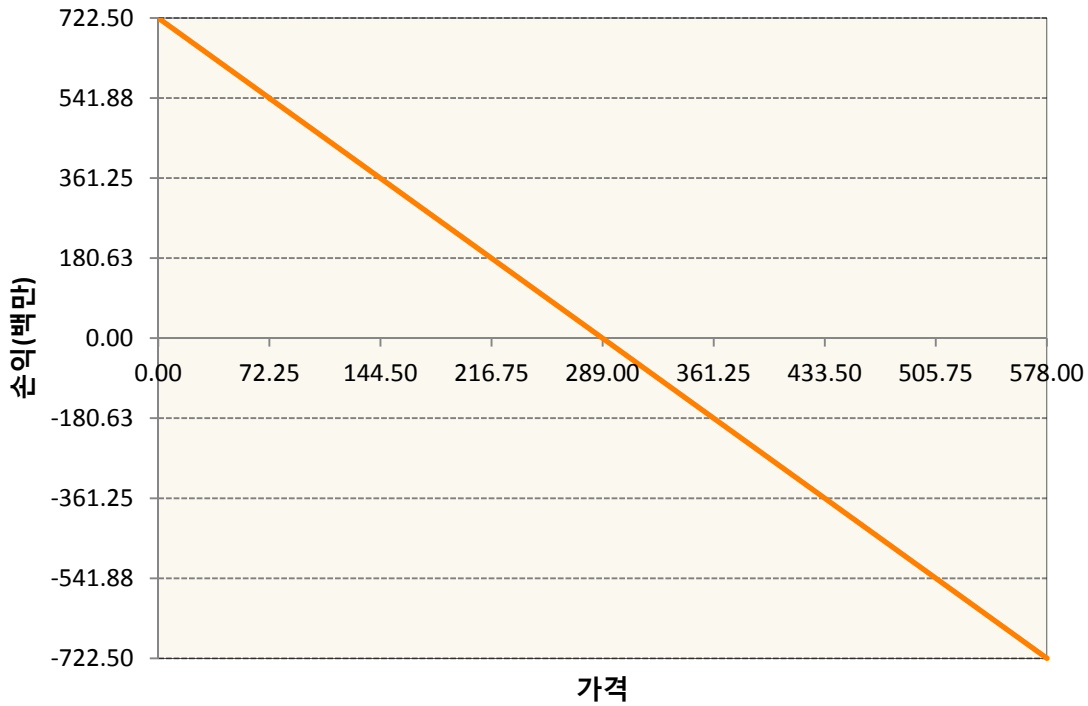
1. 계약금액

(단위:백만원)

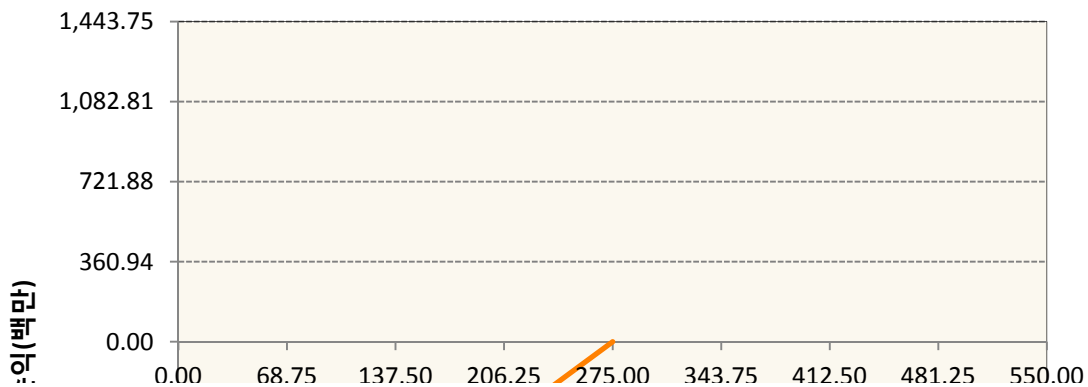
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	723	-723	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,872	-3,872	장내

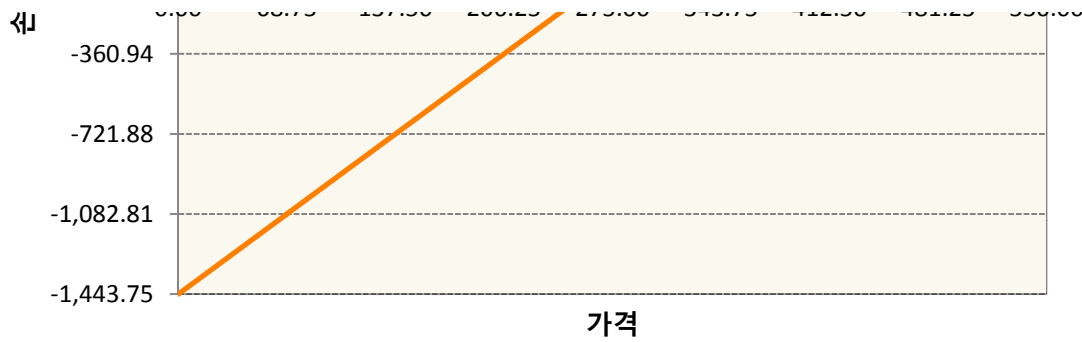
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

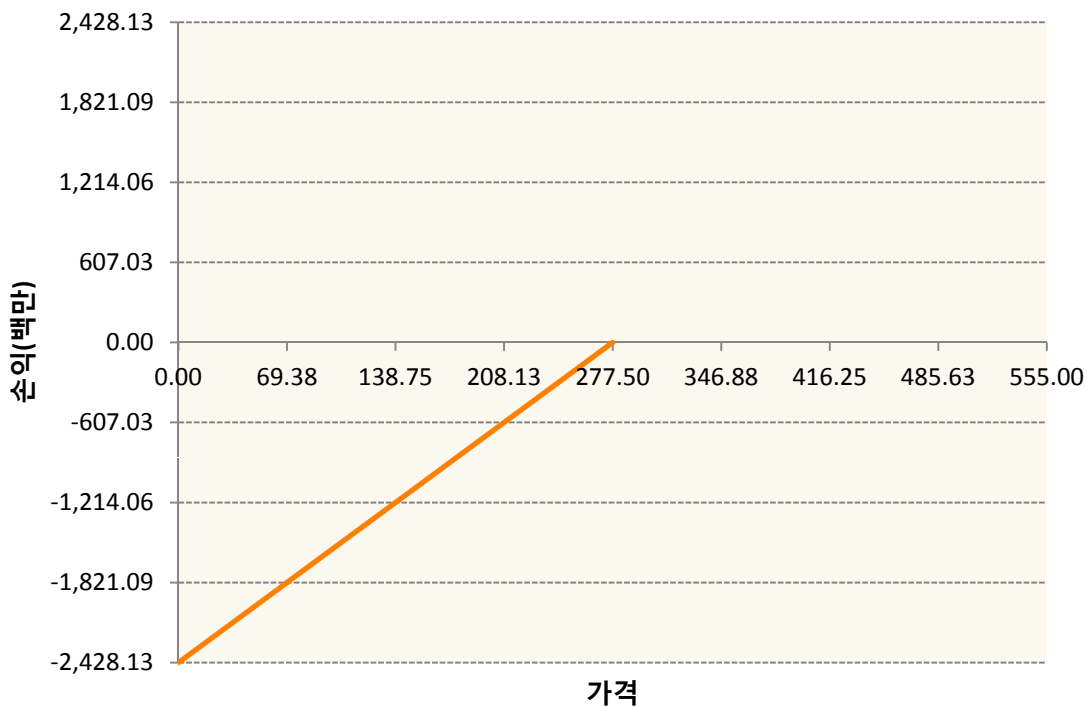


KR4301Q12751-2020-01 풋275





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%	38	38	38	38	38	38	38	
-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%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38	
8.00%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58	
KR4301Q12751		2020-01 풋275						51
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-5.33%	-13	-13	-14	-14	-15	-16	-16
-2.67%	0	0	0	-1	-1	-1	-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 풋277.5 106

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106
-5.33%	-40	-40	-41	-41	-42	-42	-43
-2.67%	-2	-3	-3	-4	-5	-6	-7
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

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

(단위:백만원)

81

공시일	2020-01-07
기준일	2020-01-06

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	13,678	0	13,678	
누계	통화	선도	949	14,487	-13,538	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019X01 KRW/USD 13-01-20E	230
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E	291
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	292
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	347
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)

395

공시일	2020-01-07
기준일	2020-01-06

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	2,038	0	2,038	장외
누계	통화	선도	314	589	-275	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)	19
2.55E+11 E1VFN30 VN ETF(EUR)	25
2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	83
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	2020-01-07
기준일	2020-01-06

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

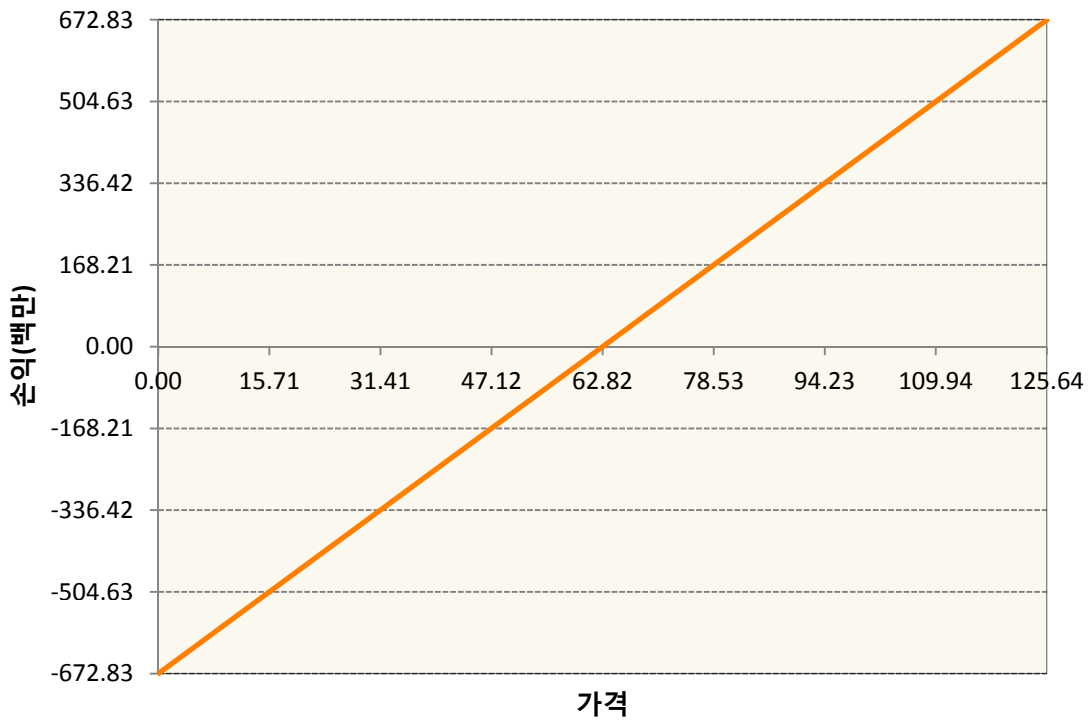
1. 계약금액

(단위:백만원)

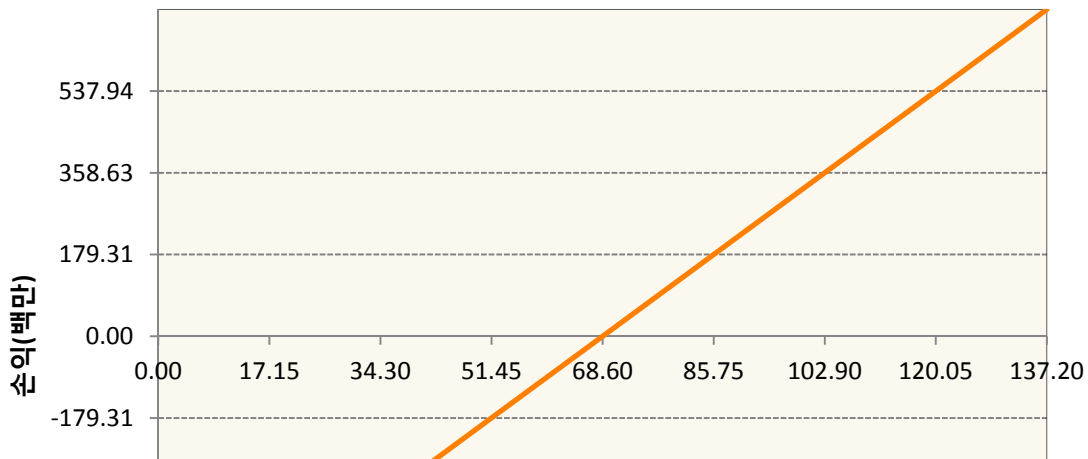
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,561	293	2,268	

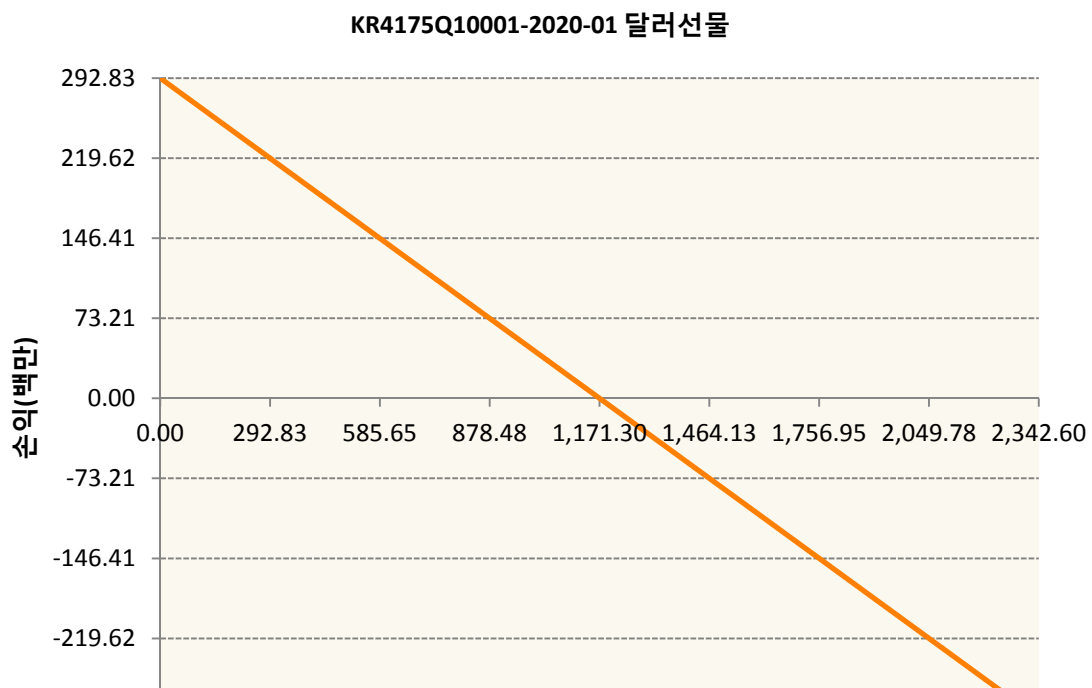
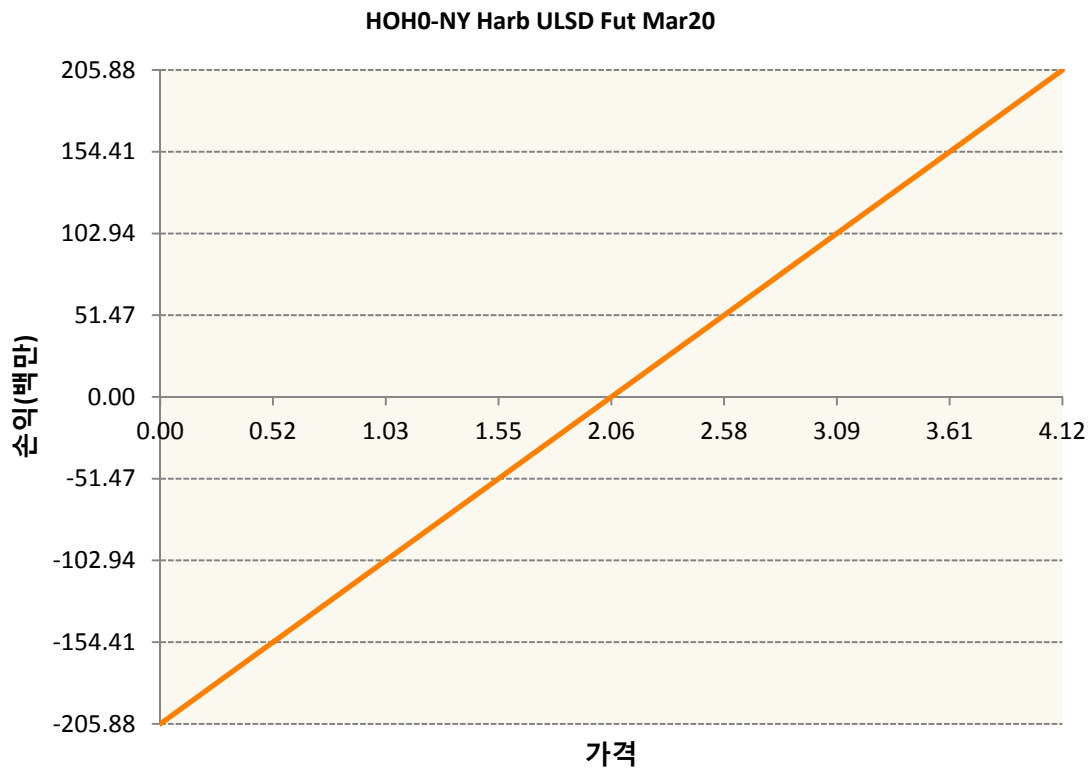
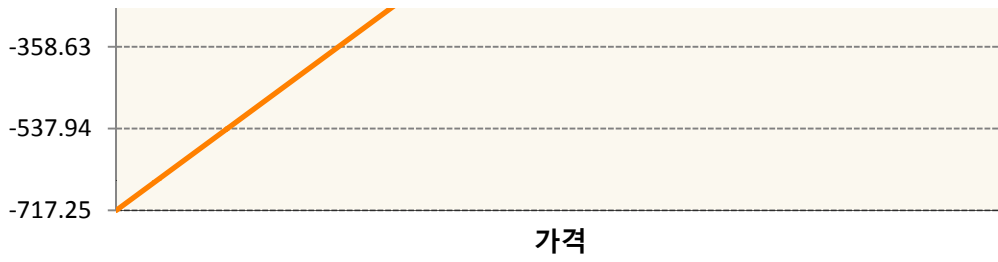
2. 만기시점의 손익구조

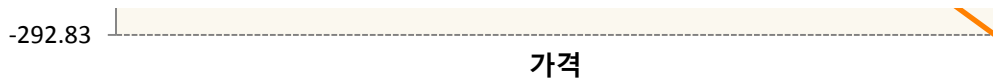
CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20



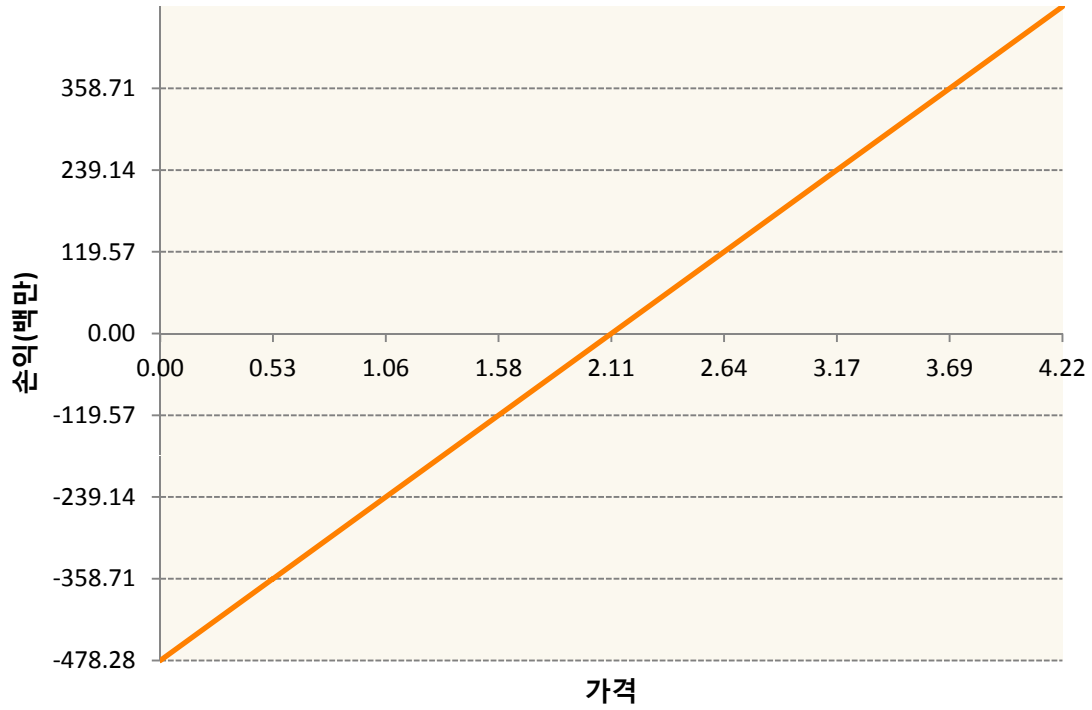
COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20



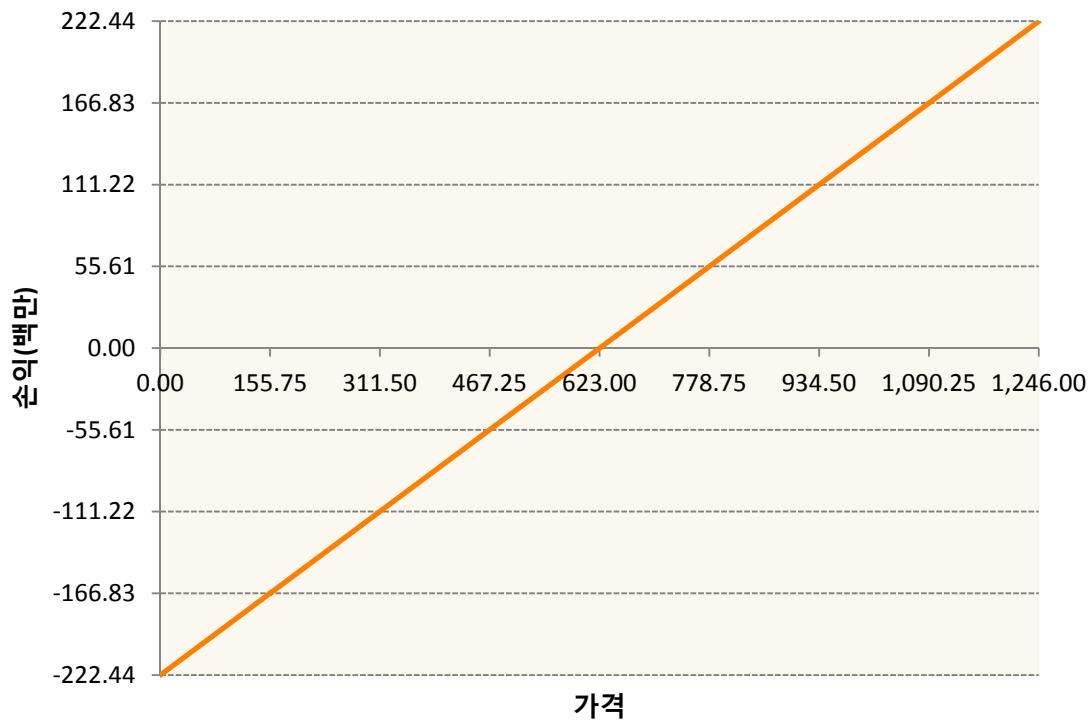




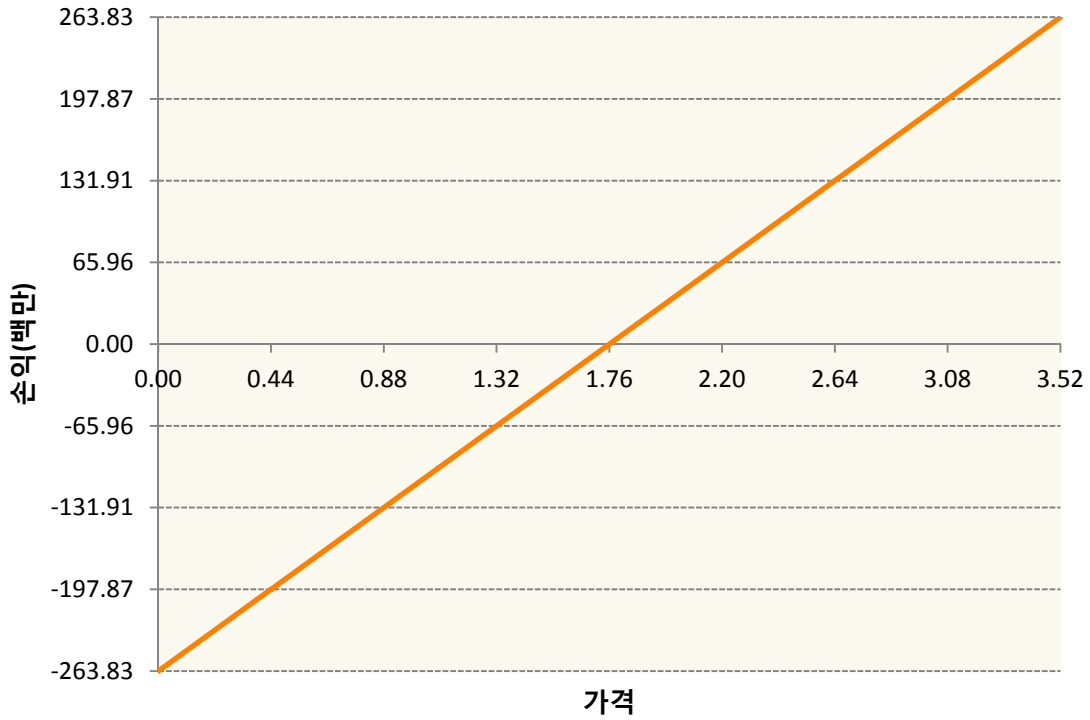
NGH20-NATURAL GAS FUTR Mar20



QSH0-Low Su Gasoil G Mar20



XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	54
COH0	BRENT CRUDE FUTR Mar20	57
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)

393

공시일	2020-01-07
기준일	2020-01-06

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

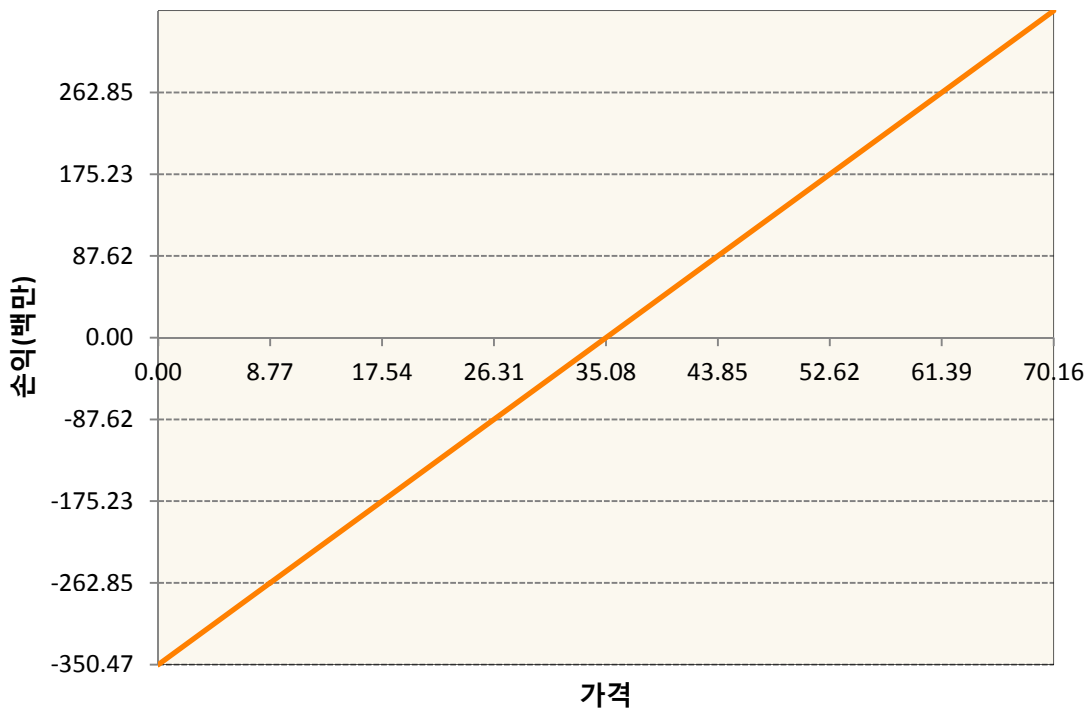
1. 계약금액

(단위:백만원)

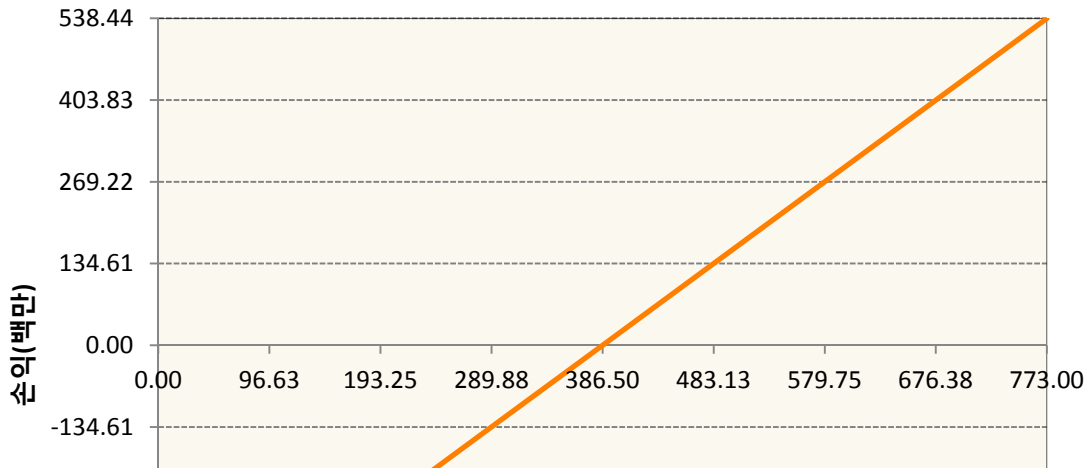
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,852	152	2,699	

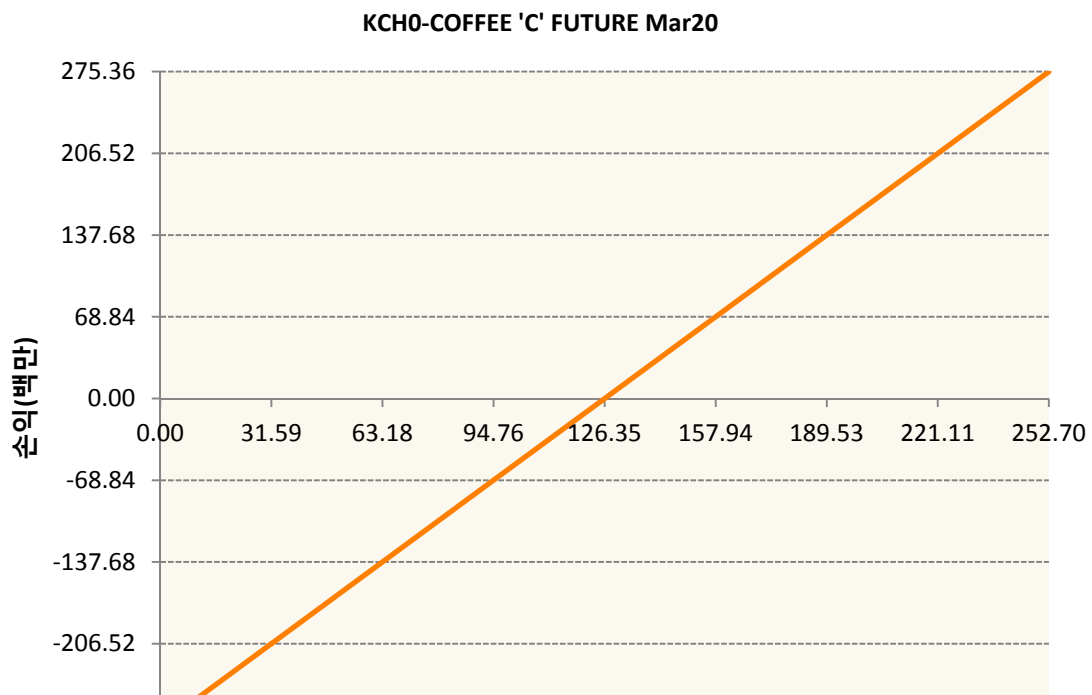
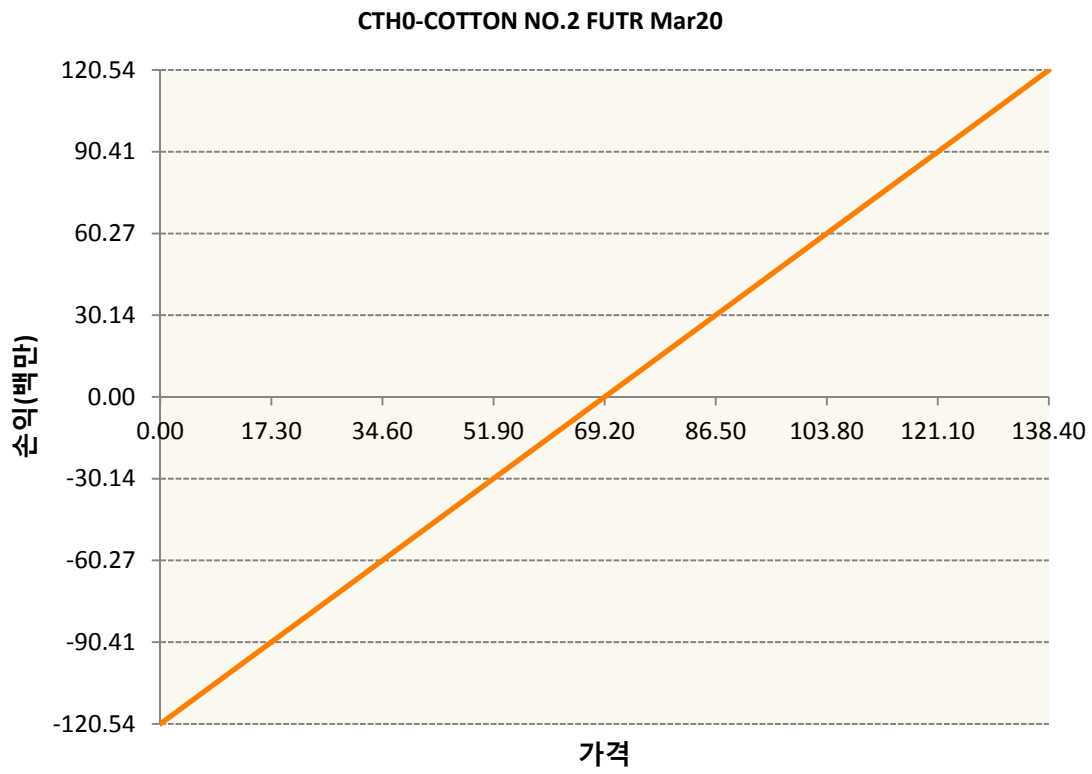
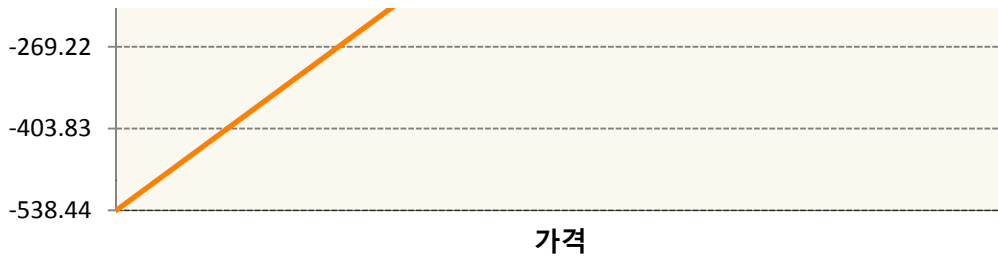
2. 만기시점의 손익구조

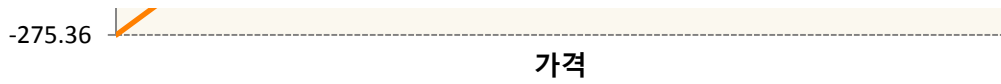
BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20



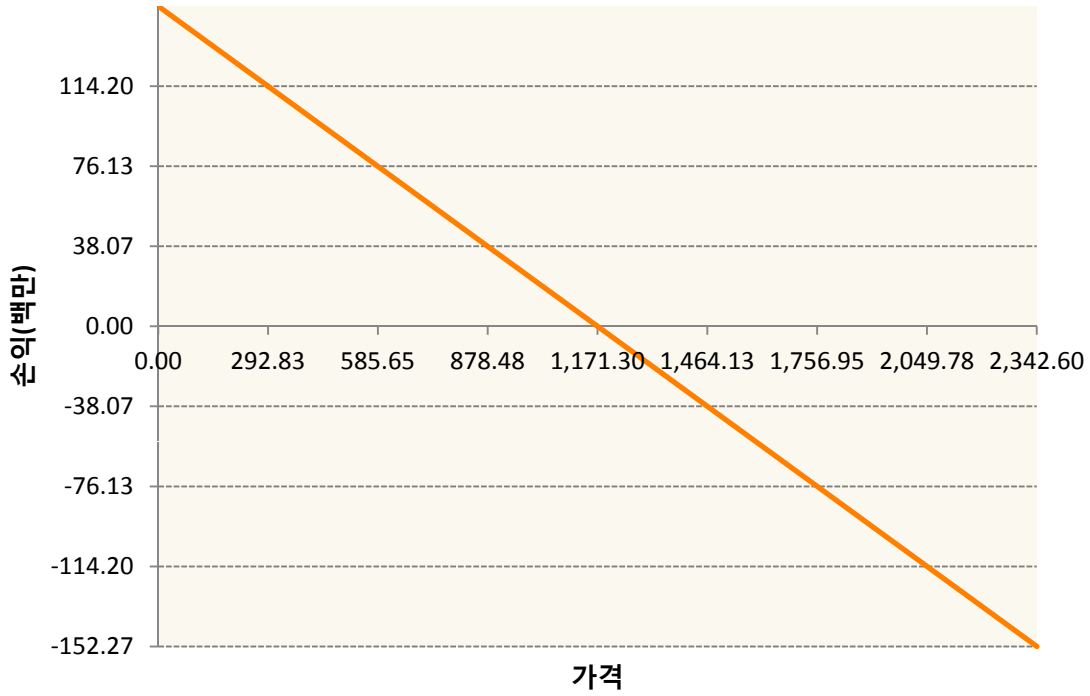
CH0-CORN FUTURE Mar20



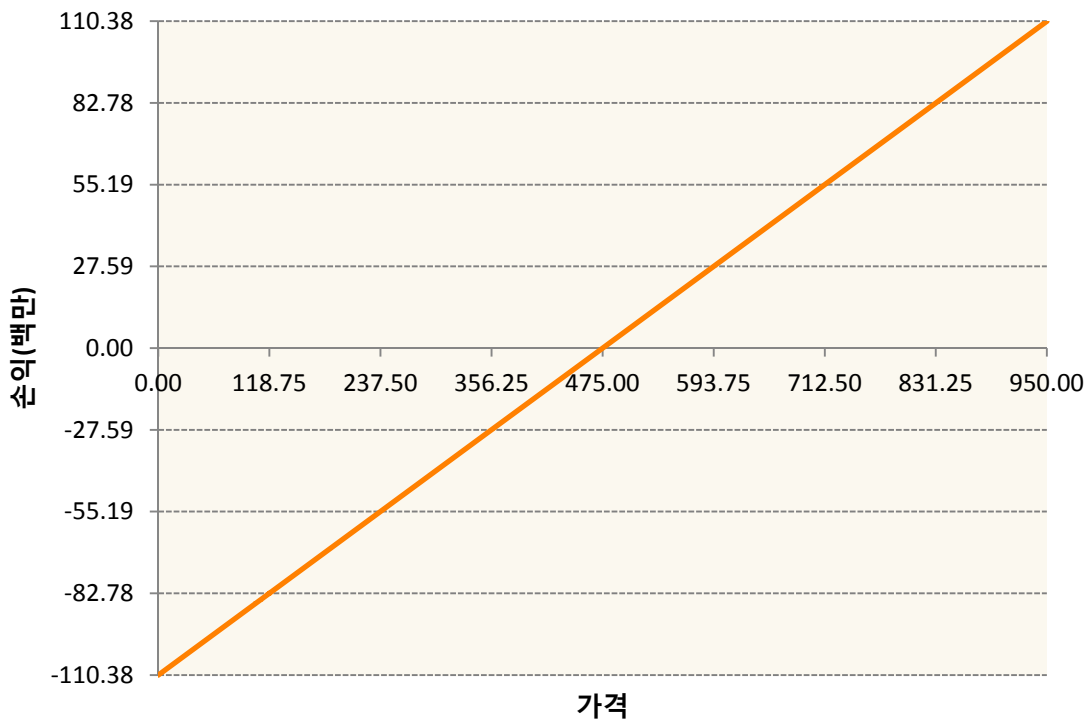




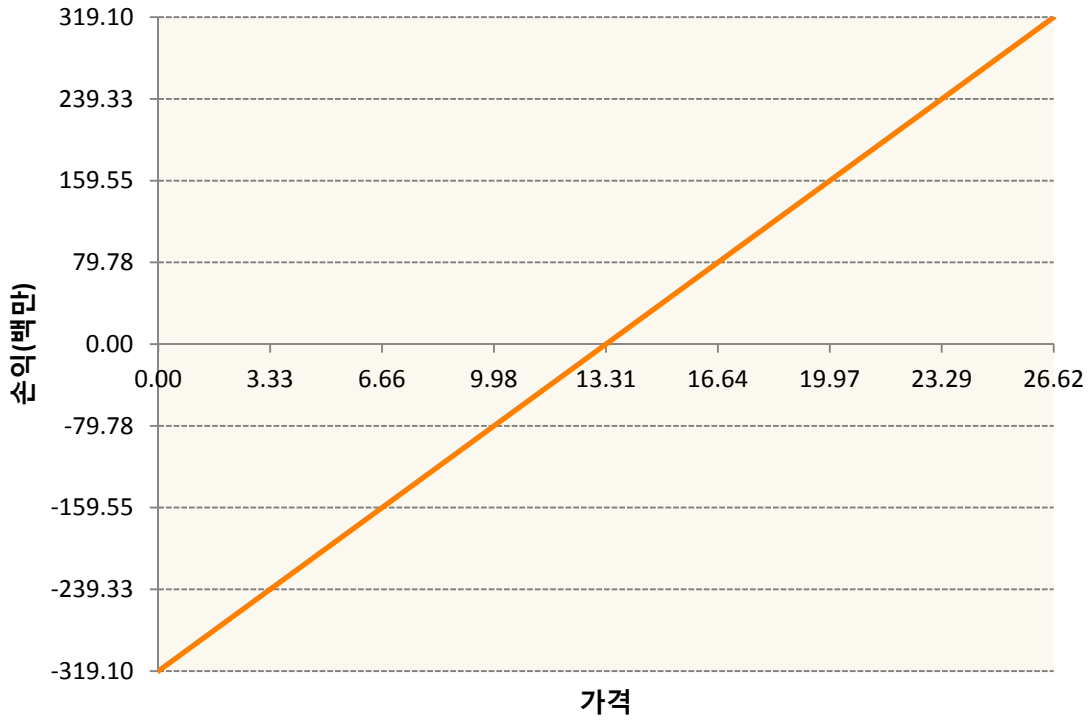
KR4175Q10001-2020-01 달러선물



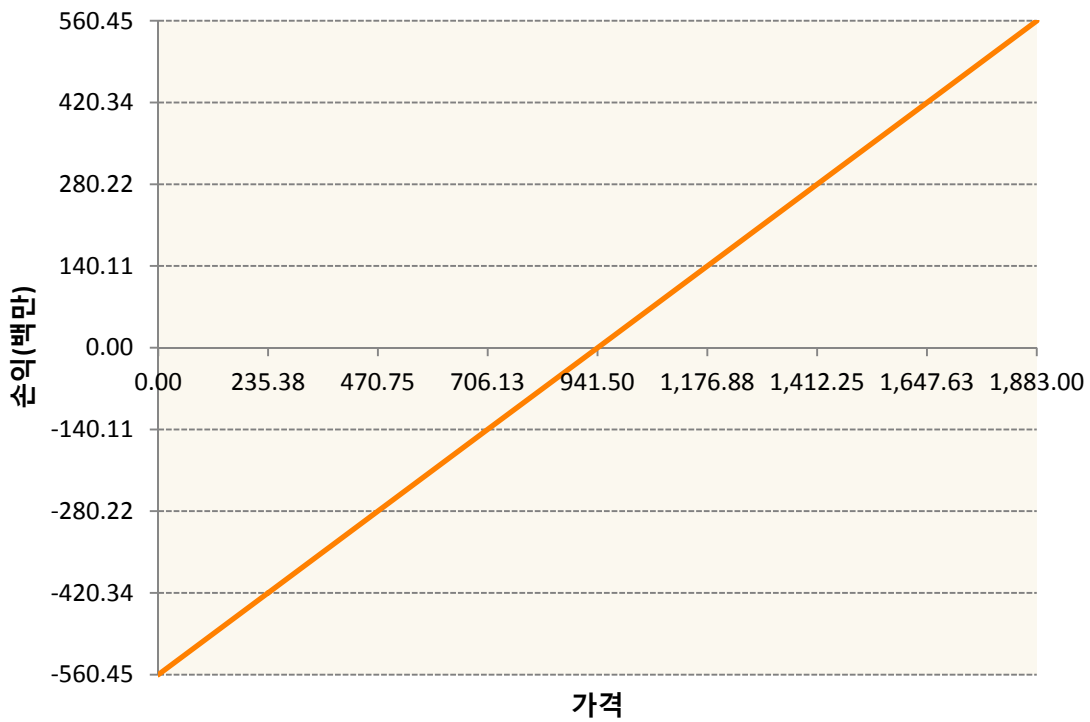
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

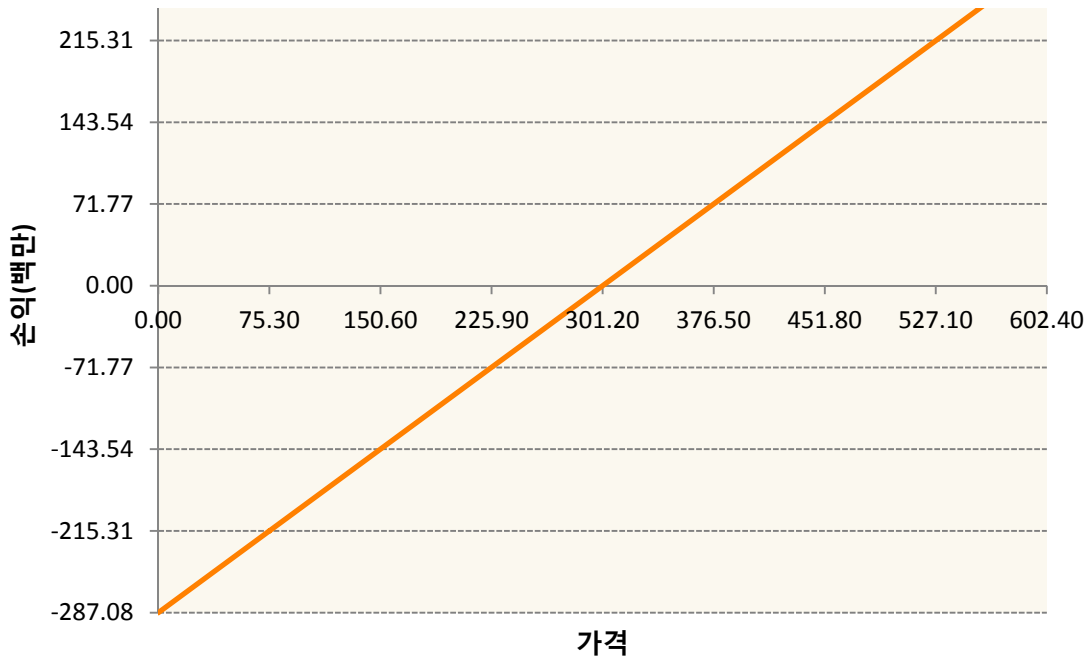


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20

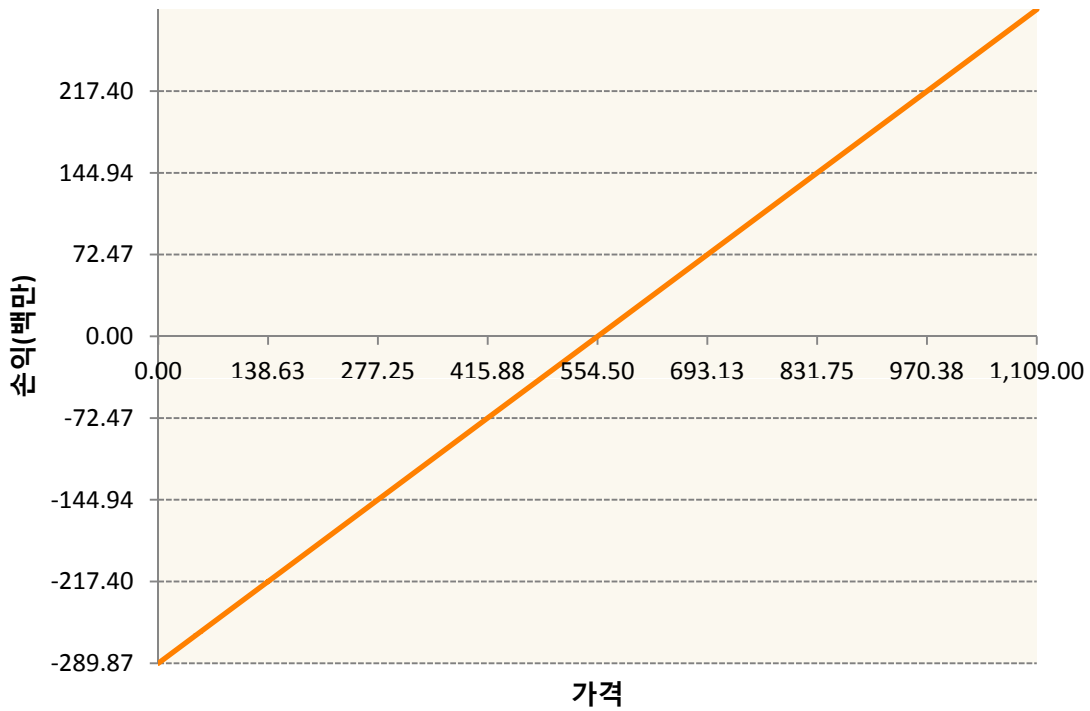


SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





WHO-WHEAT FUTURE(CBT) Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH0	SOYBEAN OIL FUTR Mar20	28
CH0	CORN FUTURE Mar20	43
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	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)

249