

공시일	2020-01-15
기준일	2020-01-14

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	2020-01-15
기준일	2020-01-14

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	2020-01-15
기준일	2020-01-14

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)	431
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	158

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

821

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-15
기준일	2020-01-14

유로인덱스모(주식-파생형)

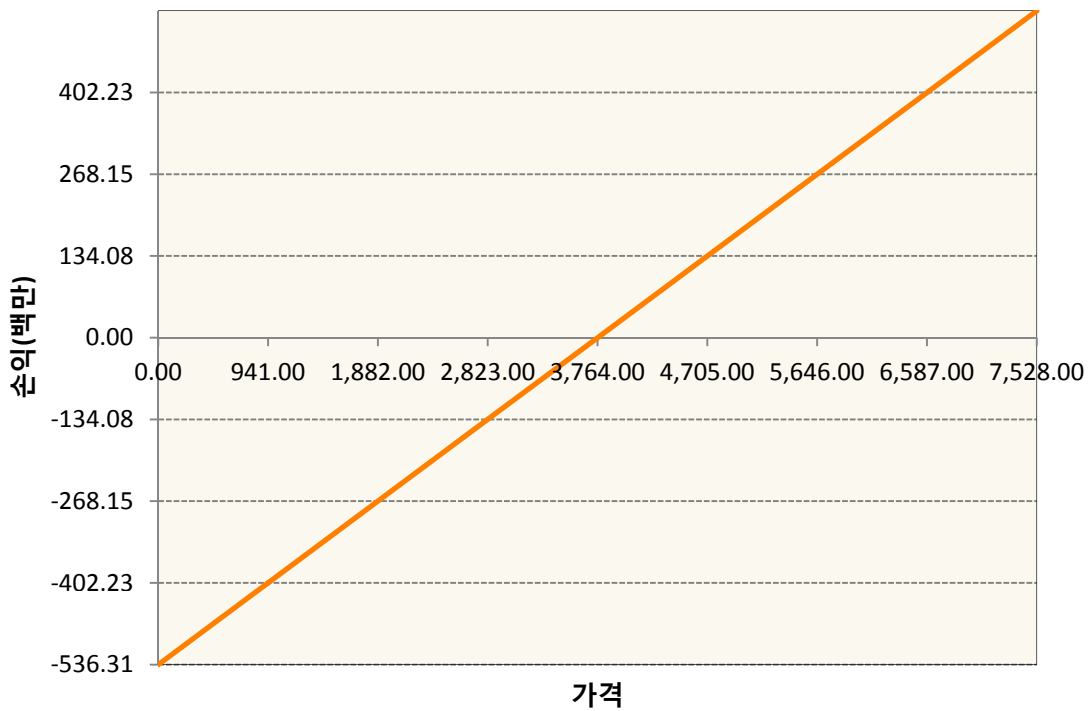
1. 계약금액

(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	2020-01-15
기준일	2020-01-14

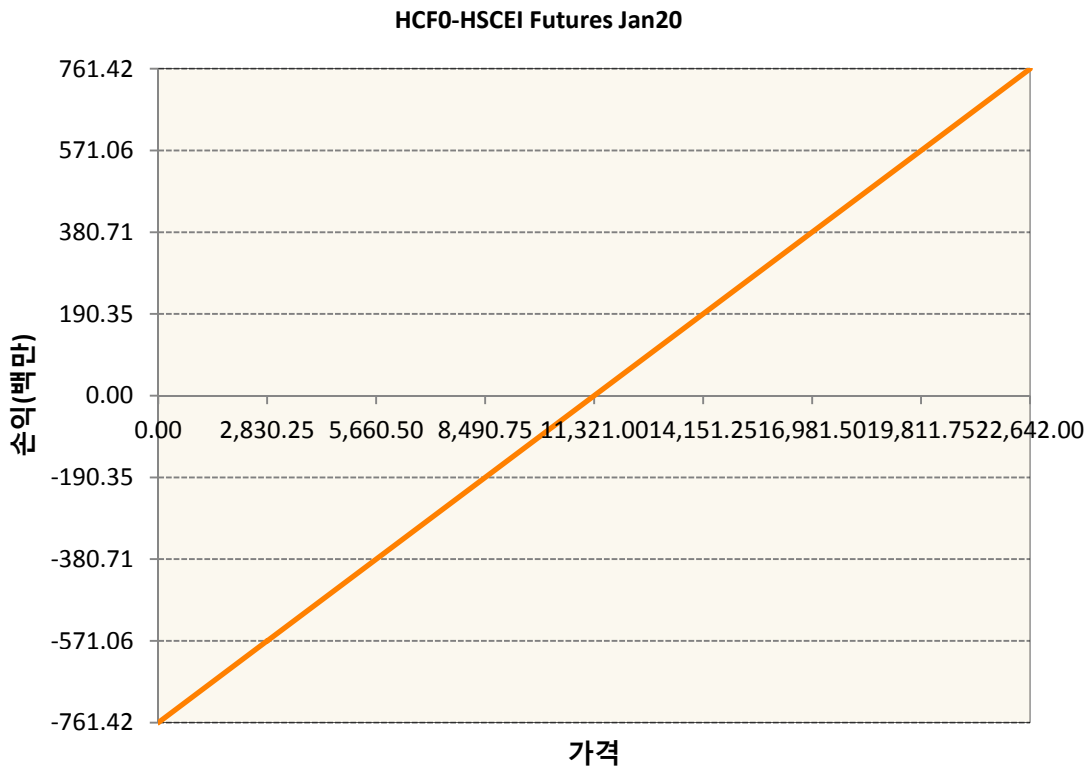
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	761	0	761	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	2020-01-15
기준일	2020-01-14

커버드콜모(주식혼합-파생형)

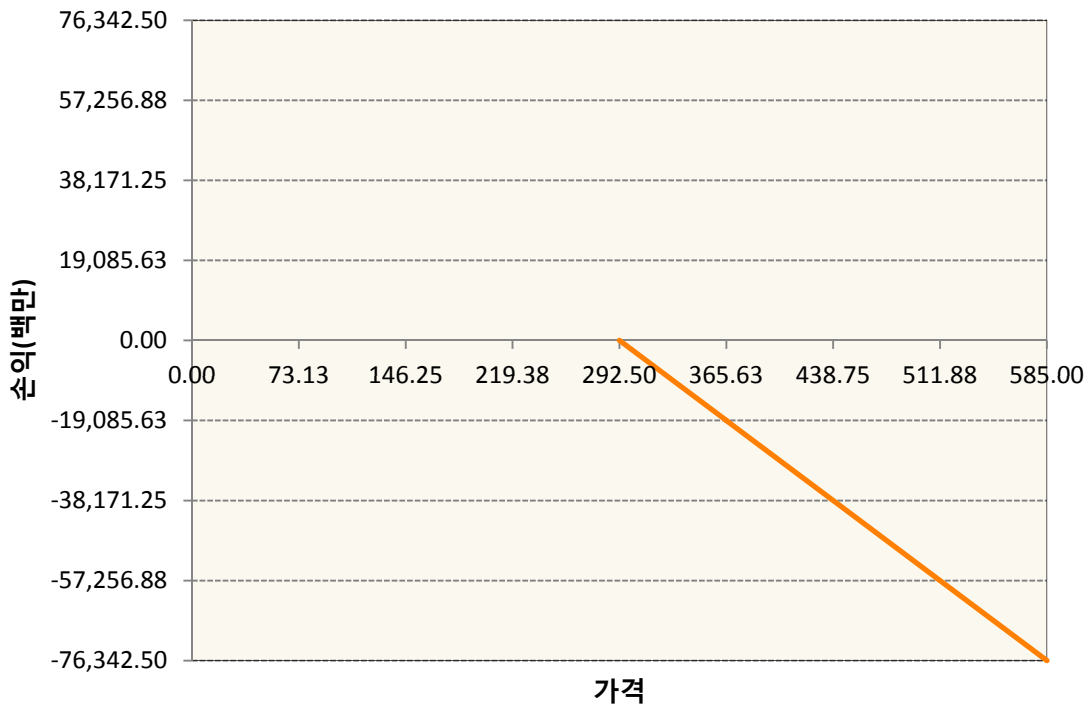
1. 계약금액

(단위:백만원)

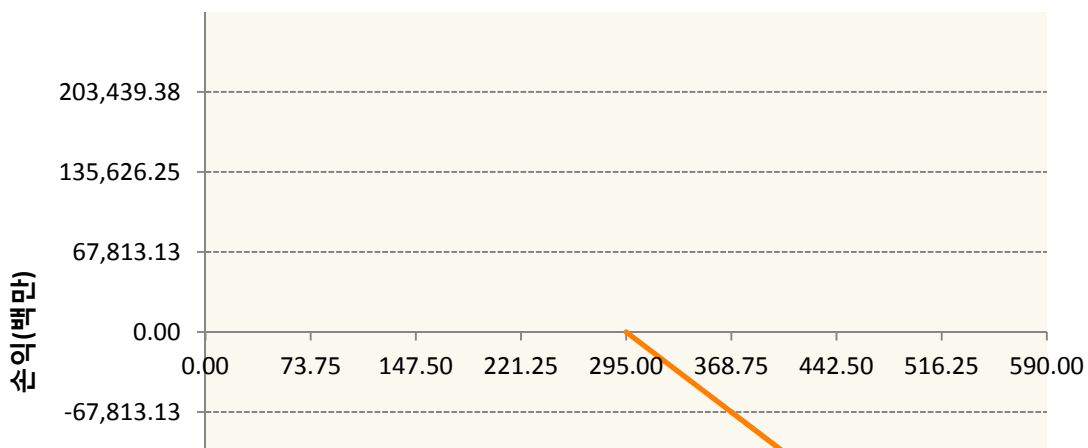
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	7,316	0	7,316	장내
누계	유가증권	옵션	0	468,989	-468,989	장내

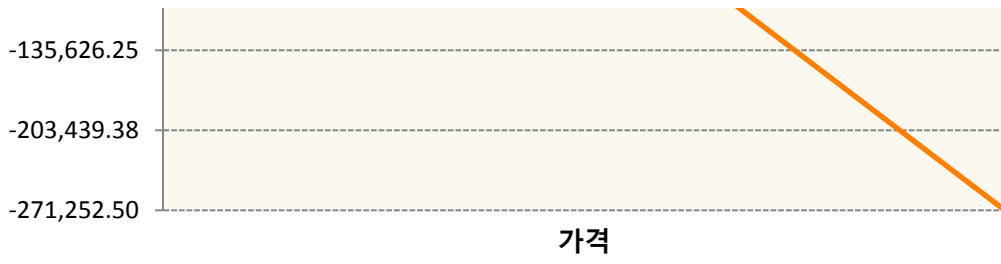
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q22927-2020-02 콜292.5

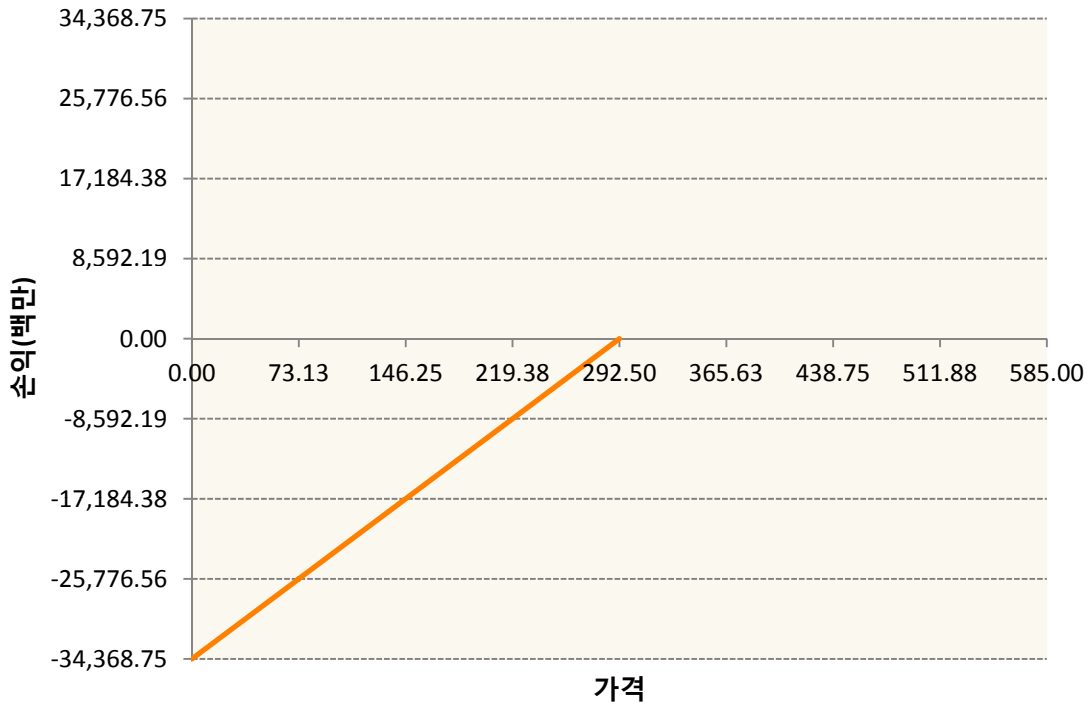


KR4201Q22950-2020-02 콜295

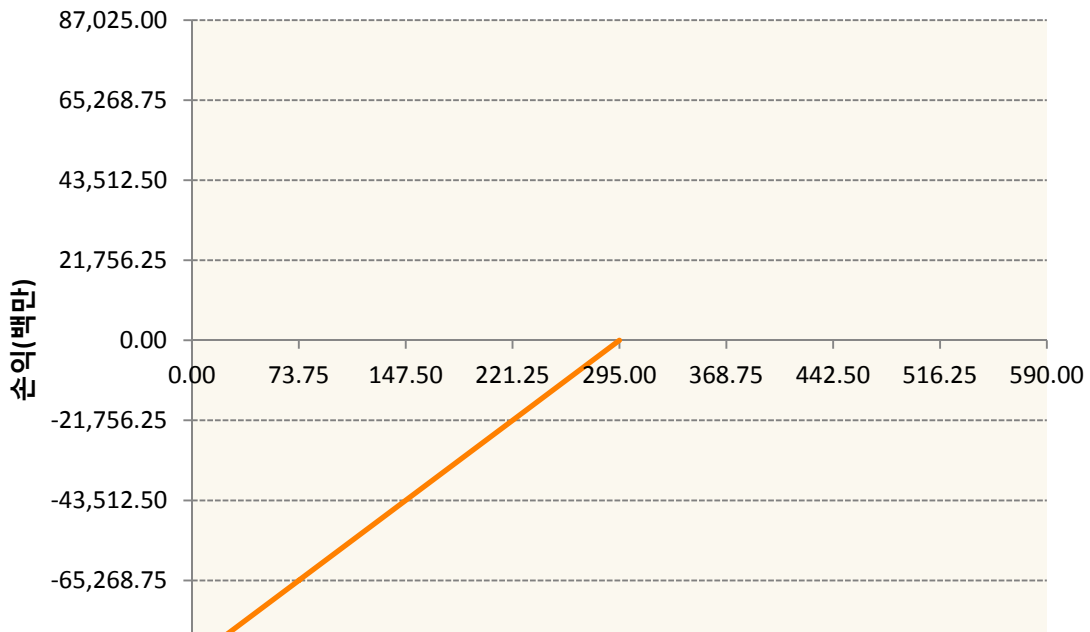




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



KR4301Q22958-2020-02 풋295



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q22927		2020-02 콜292.5						5,390
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,375	3,232	3,081	2,922	2,757	2,588	2,415	
-5.33%	2,800	2,611	2,419	2,226	2,031	1,835	1,638	
-2.67%	1,870	1,664	1,458	1,252	1,046	840	634	
0%	572	385	194	0	-196	-394	-593	
2.67%	-1,042	-1,186	-1,340	-1,503	-1,672	-1,847	-2,026	
5.33%	-2,881	-2,976	-3,086	-3,208	-3,342	-3,485	-3,636	
8.00%	-4,856	-4,911	-4,980	-5,064	-5,161	-5,271	-5,390	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						18,479
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	10,870	10,422	9,935	9,416	8,872	8,308	7,726	
-5.33%	9,170	8,539	7,894	7,236	6,570	5,896	5,217	
-2.67%	6,293	5,565	4,838	4,110	3,382	2,654	1,926	
0%	2,115	1,417	711	0	-715	-1,434	-2,155	
2.67%	-3,244	-3,810	-4,406	-5,025	-5,663	-6,315	-6,979	
5.33%	-9,498	-9,891	-10,334	-10,819	-11,338	-11,885	-12,458	
8.00%	-16,325	-16,562	-16,855	-17,198	-17,587	-18,016	-18,479	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						1,720
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,621	-1,631	-1,643	-1,659	-1,677	-1,697	-1,720	
-5.33%	-774	-806	-839	-874	-910	-948	-985	
-2.67%	-178	-222	-266	-310	-354	-398	-442	
0%	90	62	32	0	-34	-69	-105	
2.67%	157	149	138	124	107	87	65	
5.33%	166	165	163	159	153	145	135	
8.00%	167	167	167	166	165	162	159	
KR4301Q22958		2020-02 풋295						4,782
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-4,600	-4,615	-4,635	-4,663	-4,696	-4,736	-4,782	
-5.33%	-2,374	-2,435	-2,504	-2,577	-2,656	-2,738	-2,824	
-2.67%	-639	-749	-859	-969	-1,080	-1,191	-1,301	
0%	275	187	95	0	-98	-197	-299	
2.67%	557	523	481	432	376	314	246	

5.33%	604	598	587	571	549	522	488
8.00%	609	608	606	603	597	588	575

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

(단위:백만원)

29,111

공시일	2020-01-15
기준일	2020-01-14

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

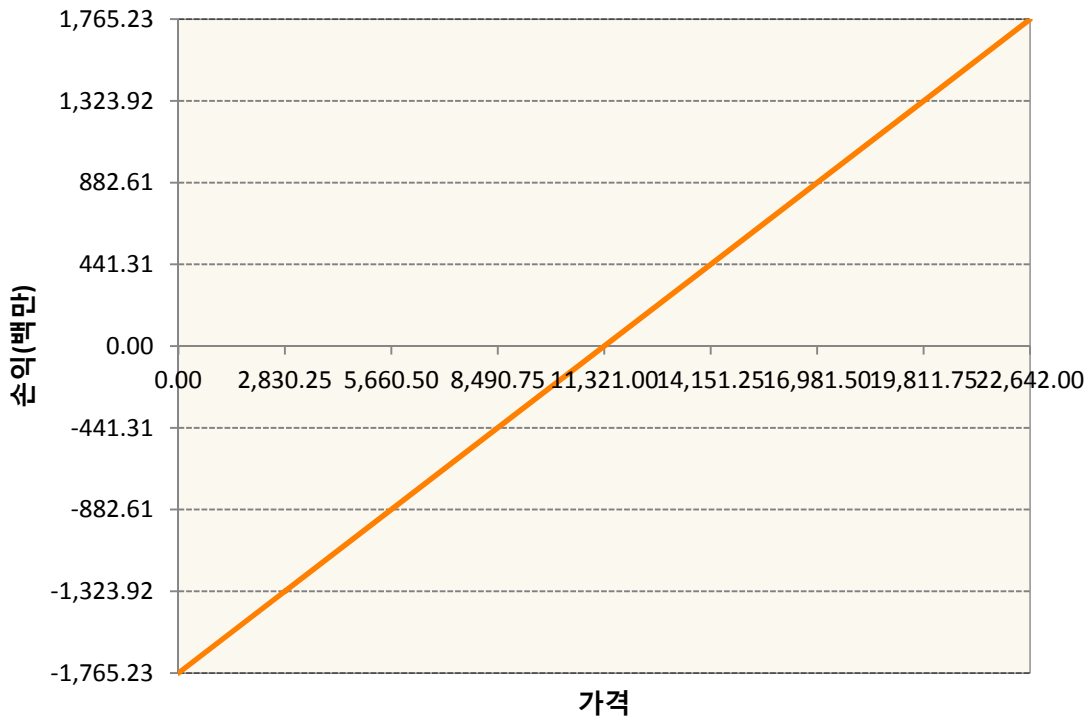
1. 계약금액

(단위:백만원)

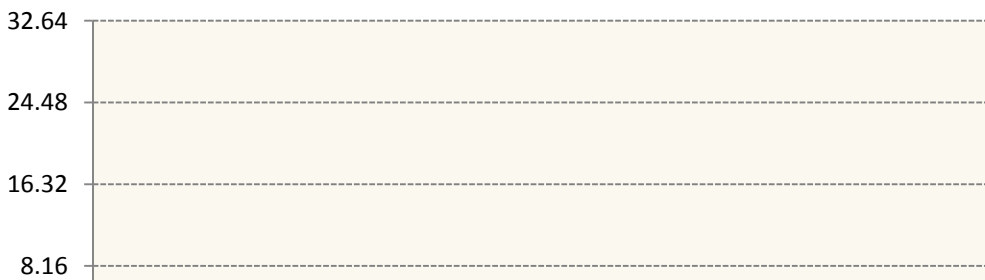
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,765	0	1,765	장내
누계	유가증권	옵션	0	63	-63	장내
누계	통화	선도	0	2,094	-2,094	장외

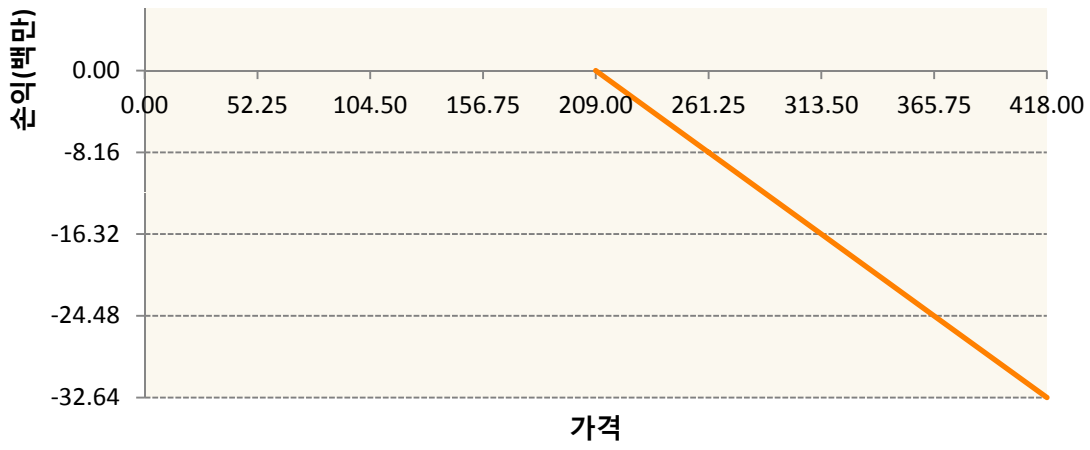
2. 만기시점의 손익구조

HCFO-HSCEI Futures Jan20

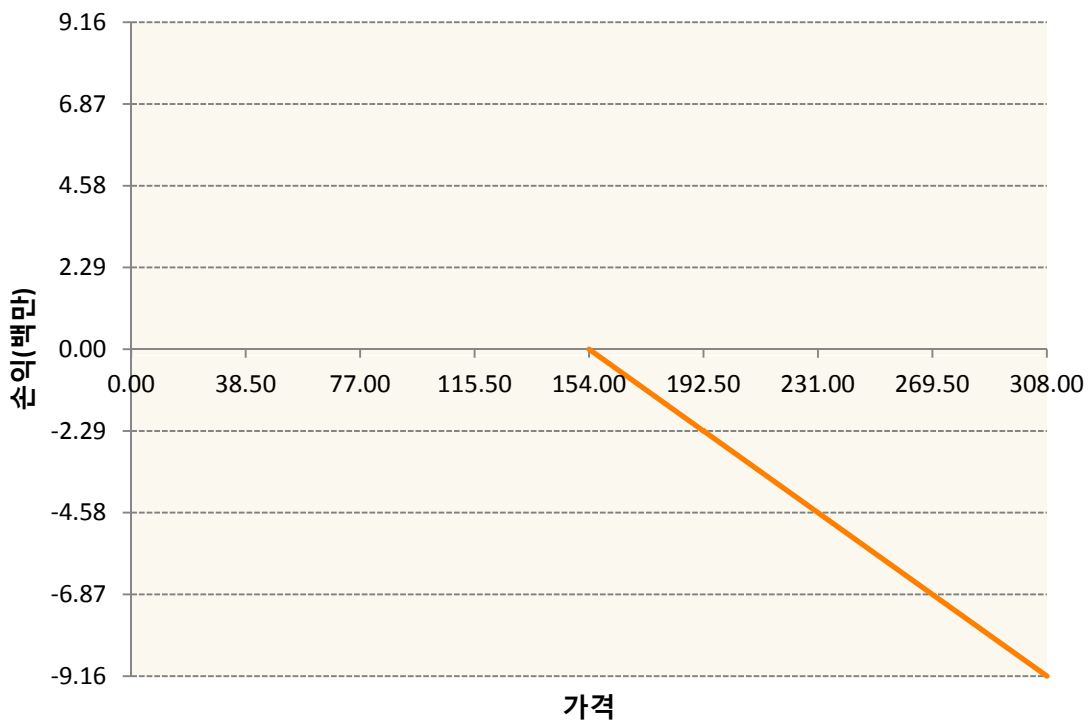


OHHIF0-C112-HSCEI

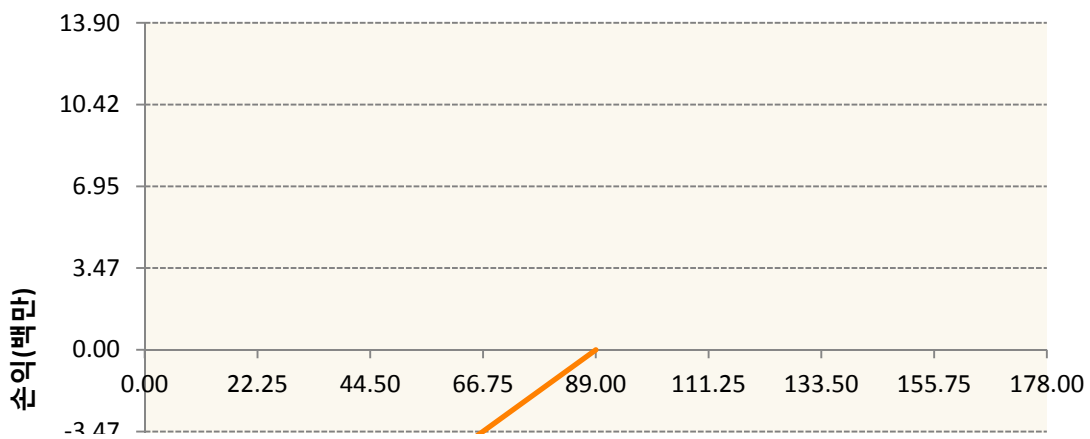


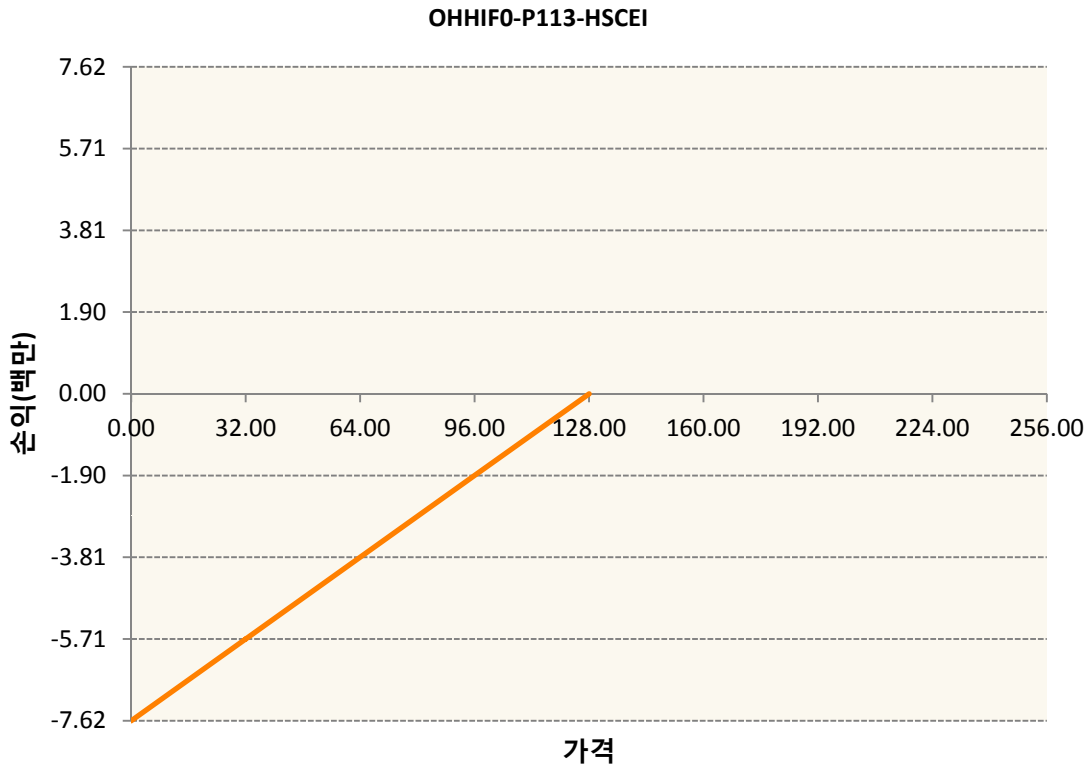
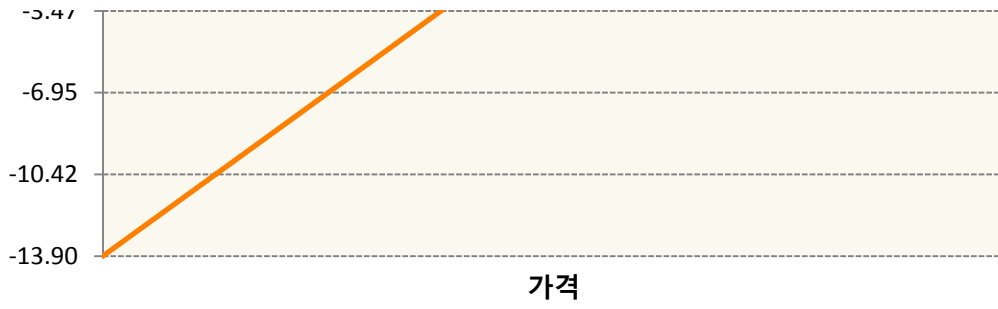


OHHIF0-C113-HSCEI



OHHIF0-P112-HSCEI





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

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

공시일	2020-01-15
기준일	2020-01-14

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

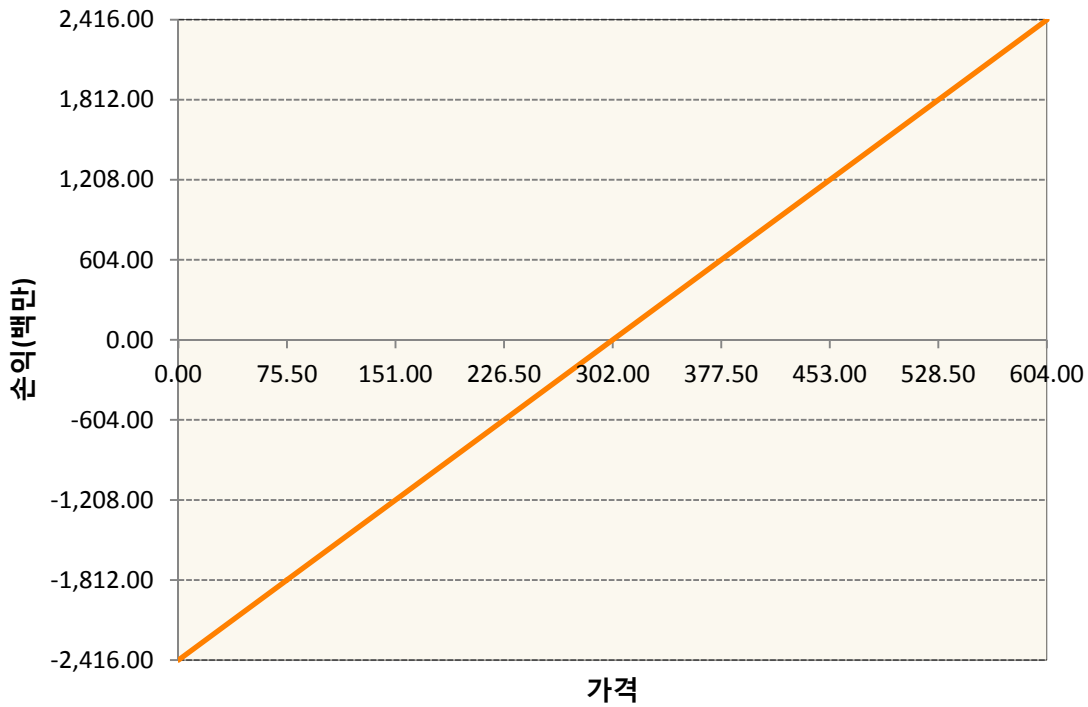
1. 계약금액

(단위:백만원)

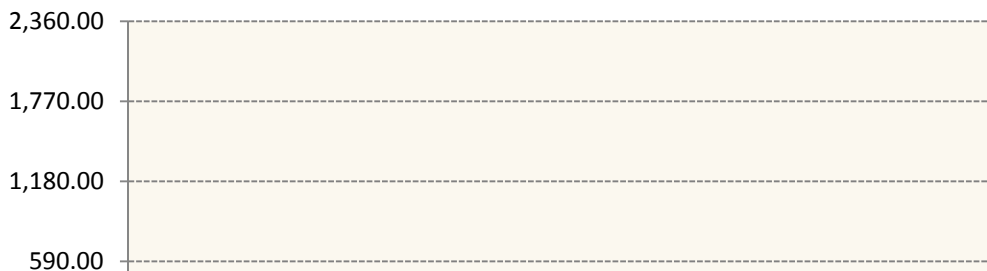
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	151	-151	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	289	0	289	장내
누계	유가증권	선물	2,416	0	2,416	장내
누계	유가증권	스왑	4,625	0	4,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,564	-4,564	장내

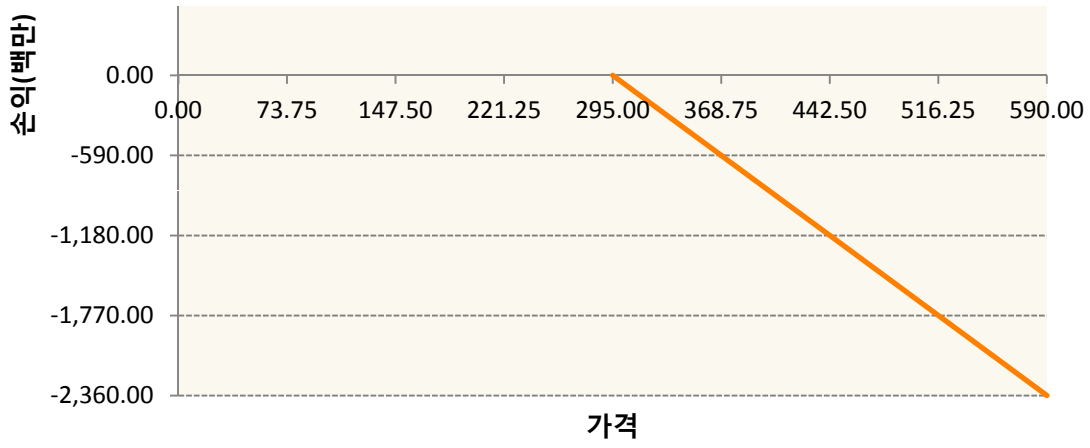
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

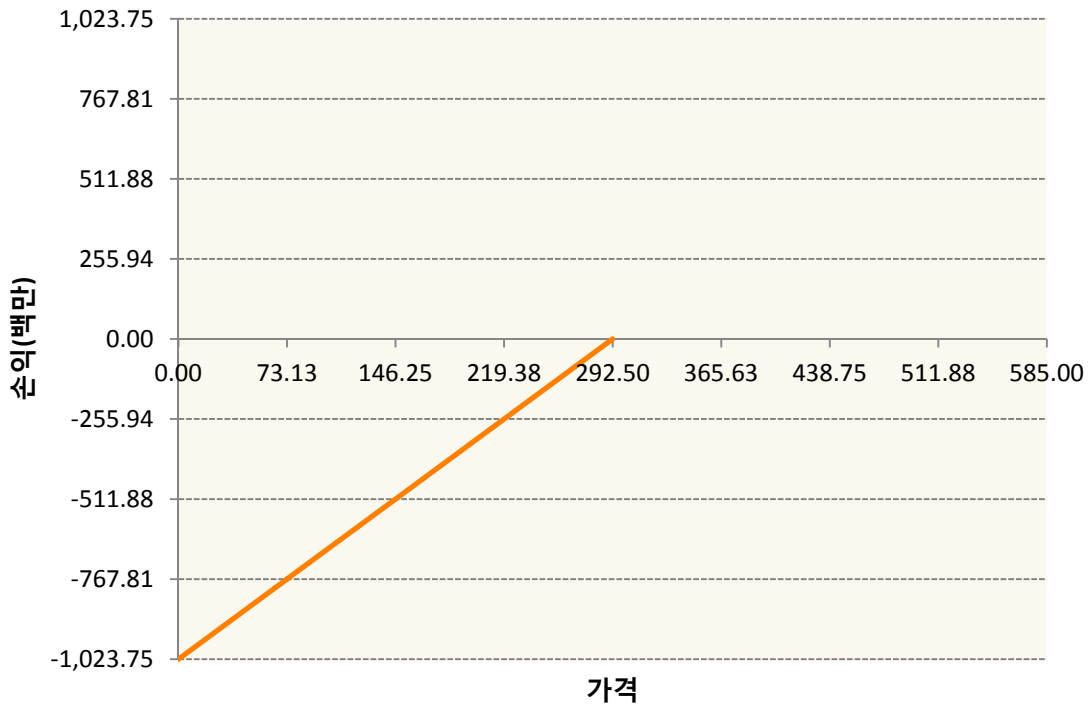


KR4201Q22950-2020-02 콜295

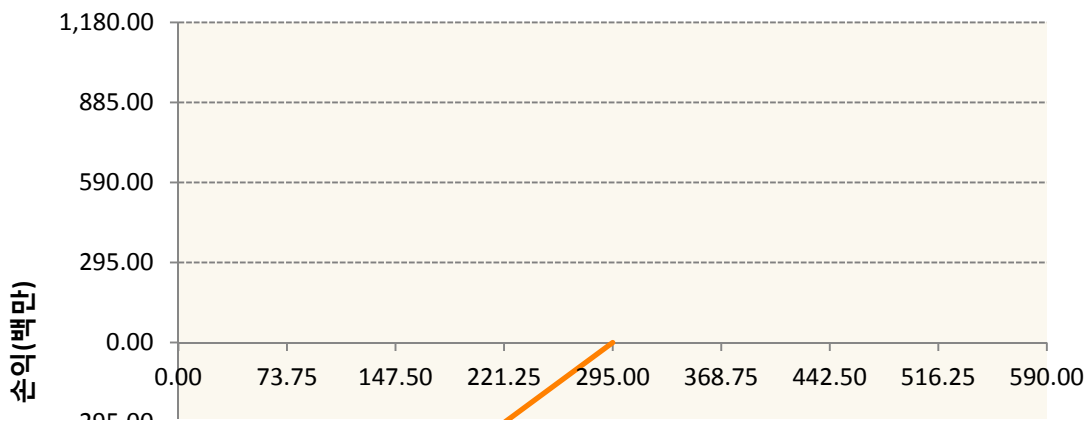




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



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						193
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-193	-193	-193	-193	-193	-193	-193	
-5.33%	-129	-129	-129	-129	-129	-129	-129	
-2.67%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	64	64	64	64	64	64	64	
5.33%	129	129	129	129	129	129	129	
8.00%	193	193	193	193	193	193	193	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						161
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	95	91	86	82	77	72	67	
-5.33%	80	74	69	63	57	51	45	
-2.67%	55	48	42	36	29	23	17	
0%	18	12	6	0	-6	-12	-19	
2.67%	-28	-33	-38	-44	-49	-55	-61	
5.33%	-83	-86	-90	-94	-99	-103	-108	
8.00%	-142	-144	-147	-150	-153	-157	-161	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						51
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-48	-49	-49	-49	-50	-51	-51
-5.33%	-23	-24	-25	-26	-27	-28	-29
-2.67%	-5	-7	-8	-9	-11	-12	-13
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	5	4	4	4	3	3	2
5.33%	5	5	5	5	5	4	4
8.00%	5	5	5	5	5	5	5
KR4301Q22958 2020-02 풋295							65
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-62	-63	-63	-63	-64	-64	-65
-5.33%	-32	-33	-34	-35	-36	-37	-38
-2.67%	-9	-10	-12	-13	-15	-16	-18
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4
2.67%	8	7	7	6	5	4	3
5.33%	8	8	8	8	7	7	7
8.00%	8	8	8	8	8	8	8

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

(단위:백만원)

803

공시일	2020-01-15
기준일	2020-01-14

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

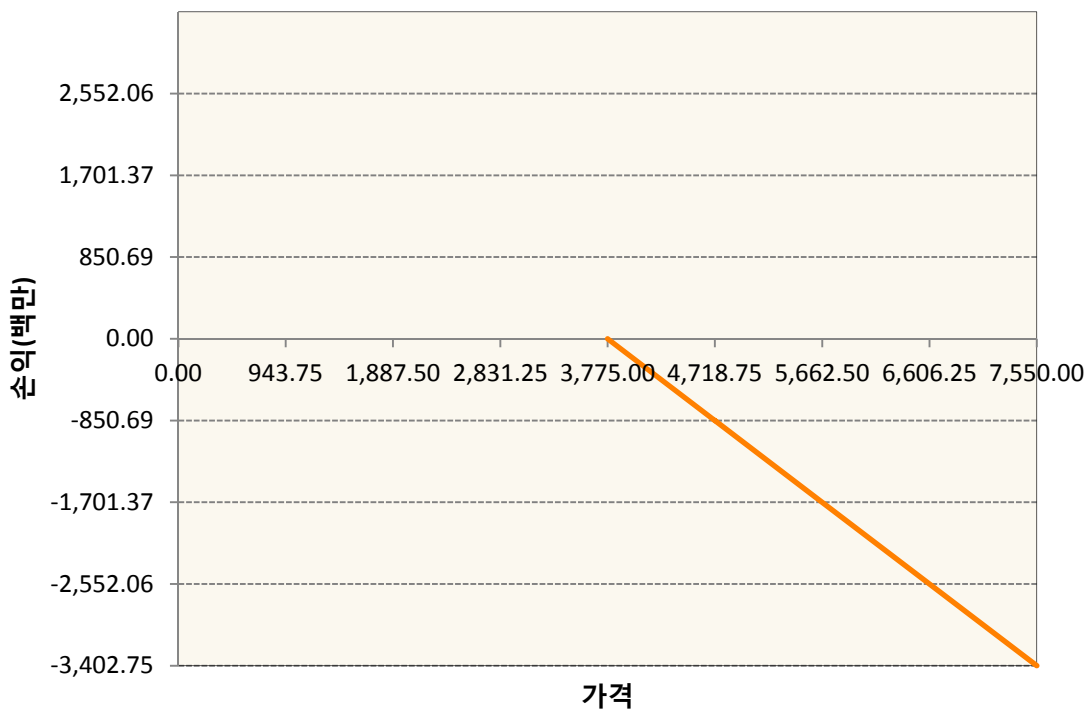
1. 계약금액

(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	585	0	585	
누계	유가증권	스왑	15,639	0	15,639	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,295	-7,295	장내
누계	통화	선도	0	3,379	-3,379	장외

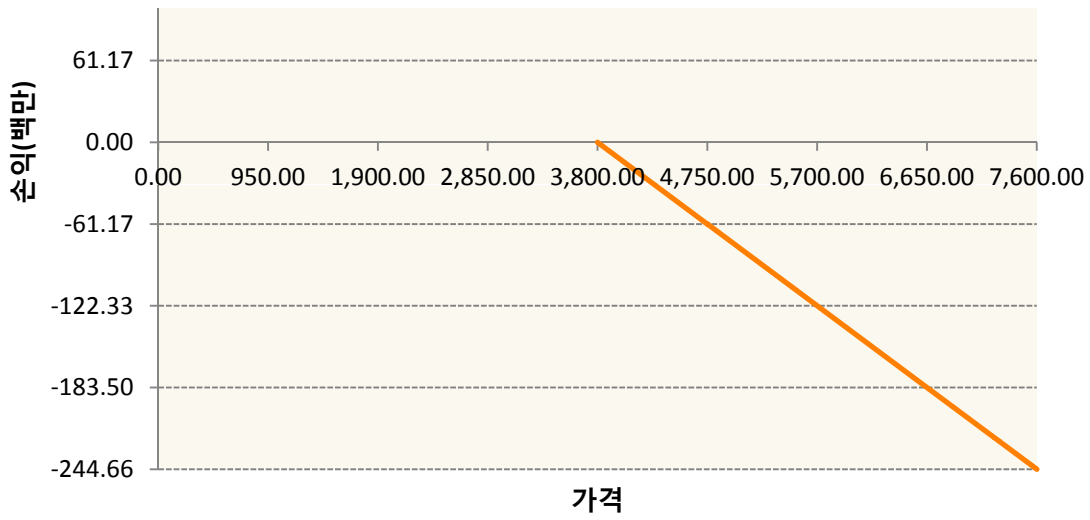
2. 만기시점의 손익구조

OESXF0-C3775-EURO STOXX 50

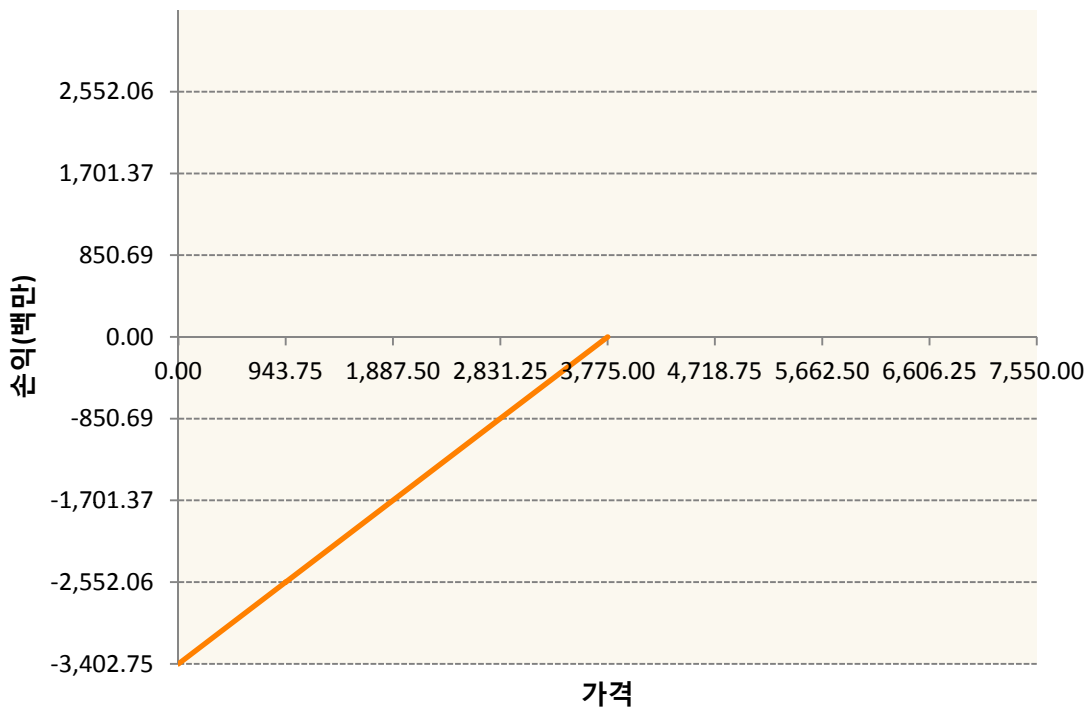


OESXF0-C3800-EURO STOXX 50

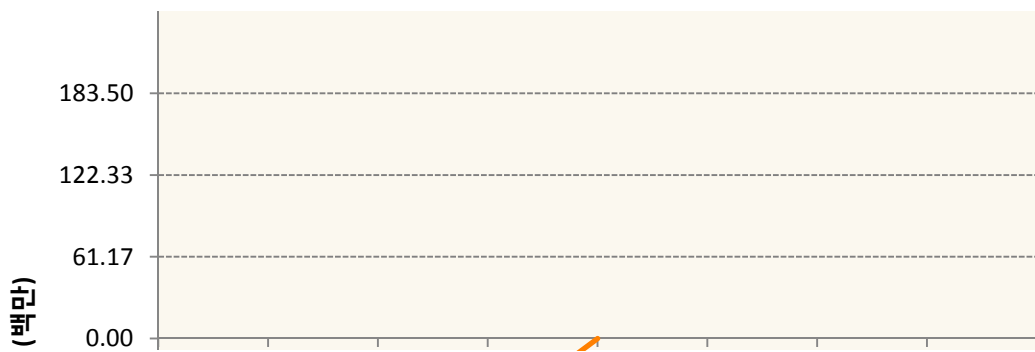


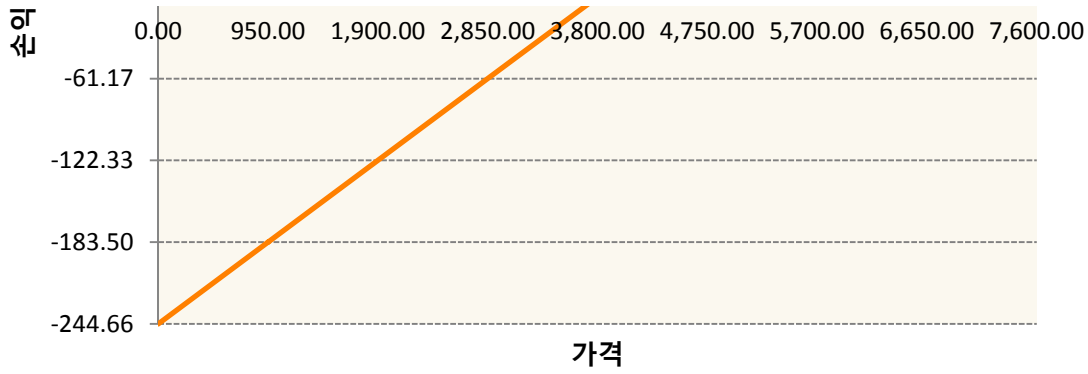


OESXF0-P3775-EURO STOXX 50

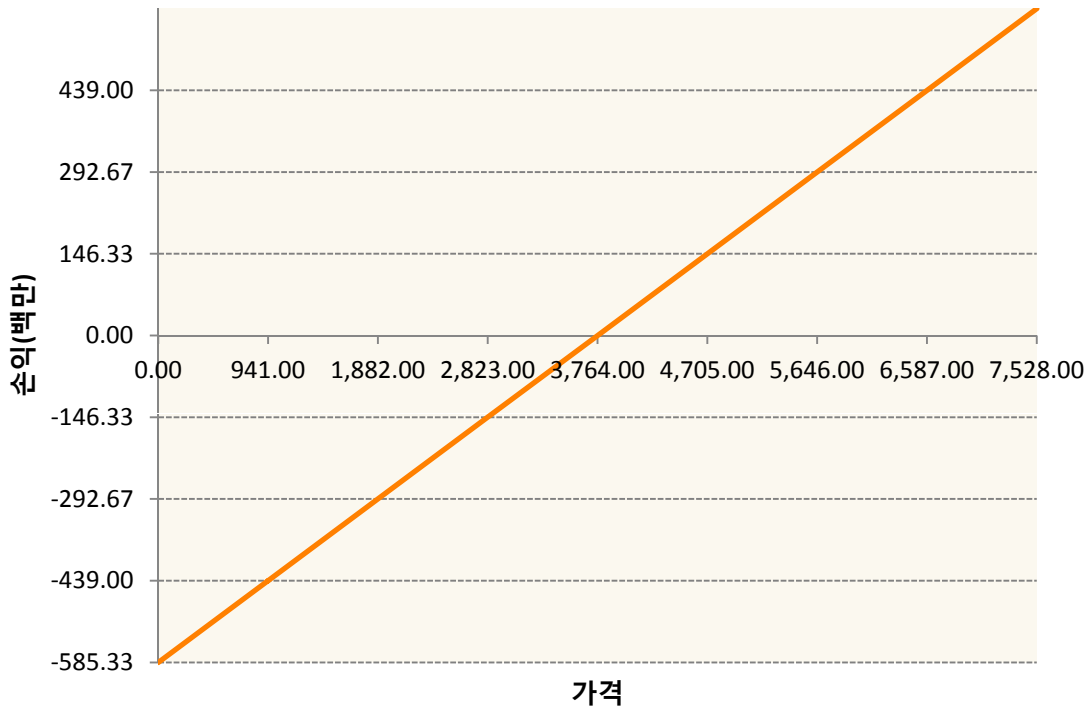


OESXF0-P3800-EURO STOXX 50





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)

927

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

(단위:백만원)

79

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

(단위:백만원)

116

공시일	2020-01-15
기준일	2020-01-14

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

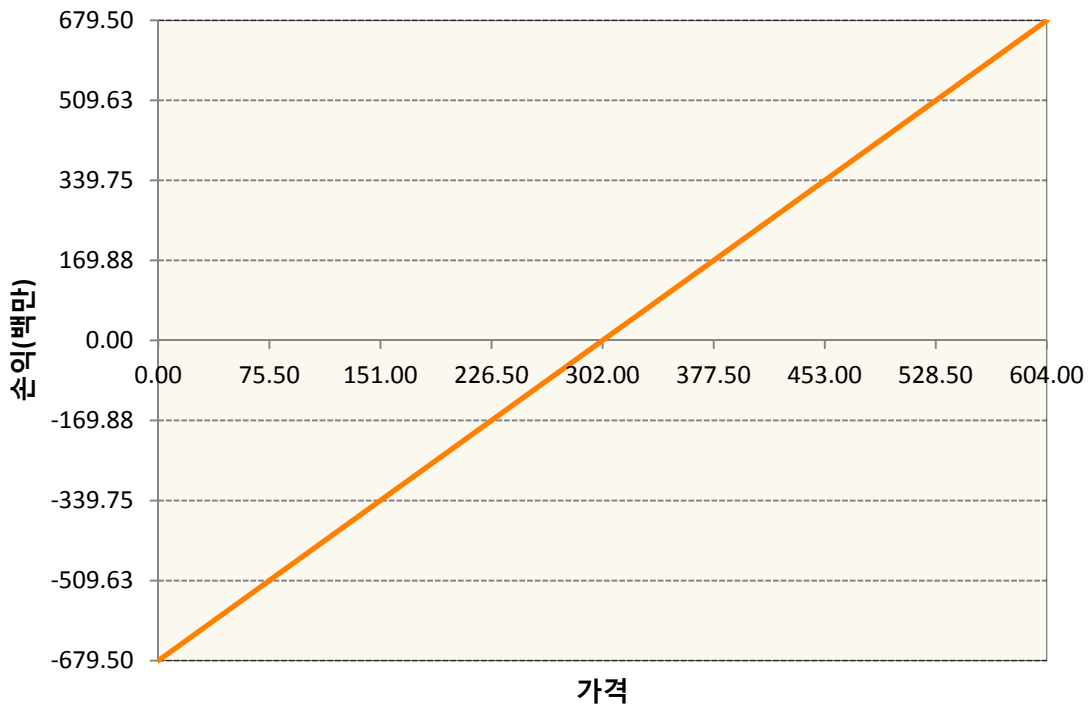
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	680	0	680	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	2020-01-15
기준일	2020-01-14

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

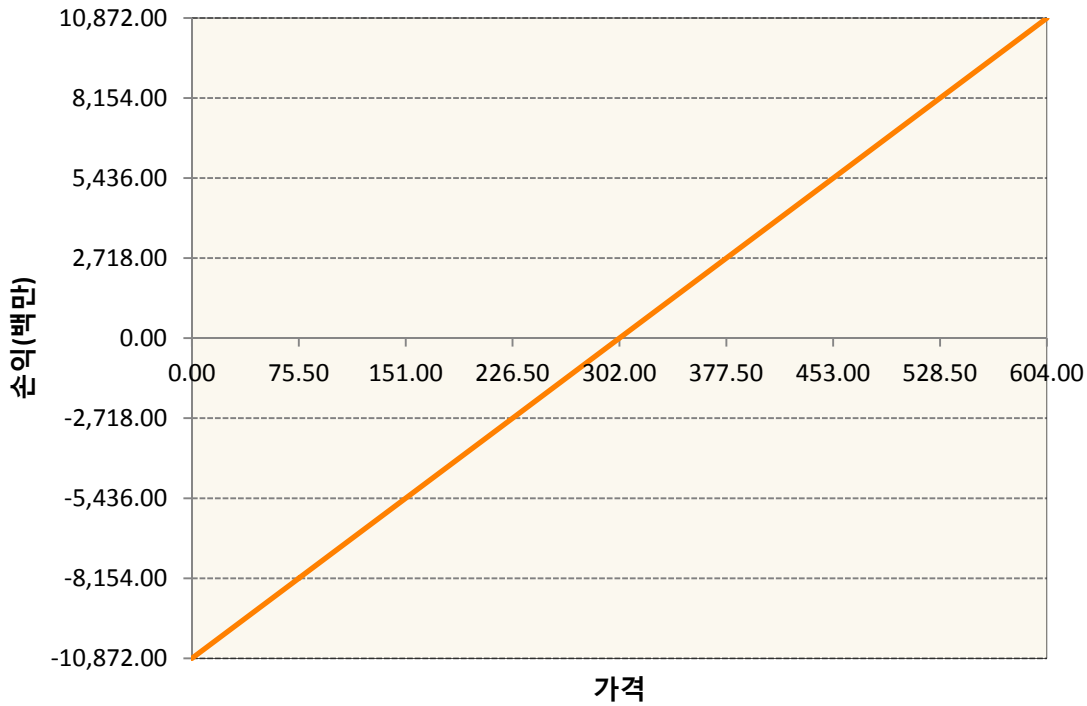
1. 계약금액

(단위:백만원)

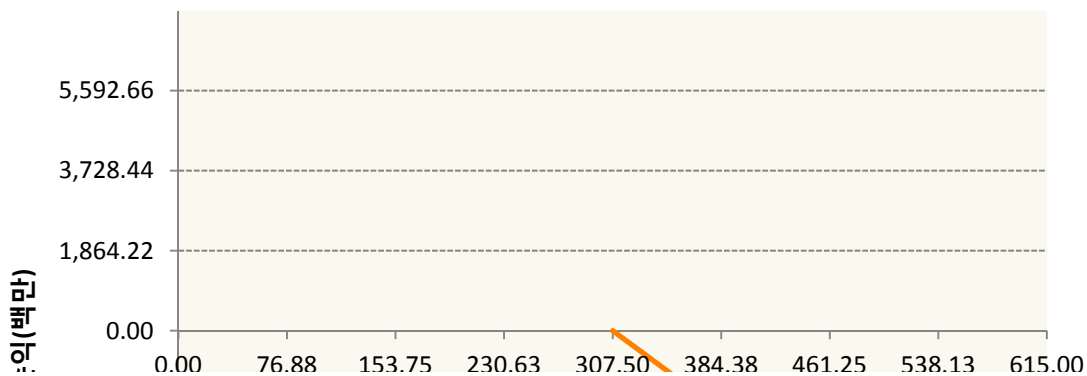
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	76	-76	장내
신규	유가증권	옵션	77	74	3	장내
누계	유가증권	선물	10,872	0	10,872	장내
누계	유가증권	옵션	2,944	21,329	-18,386	장내

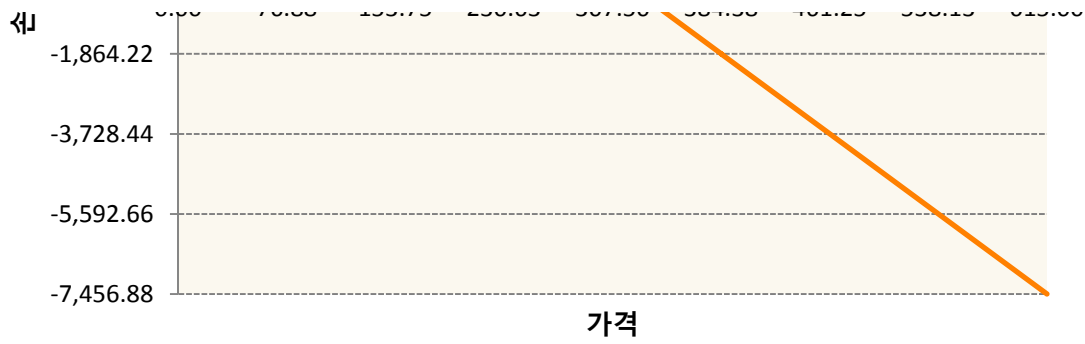
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

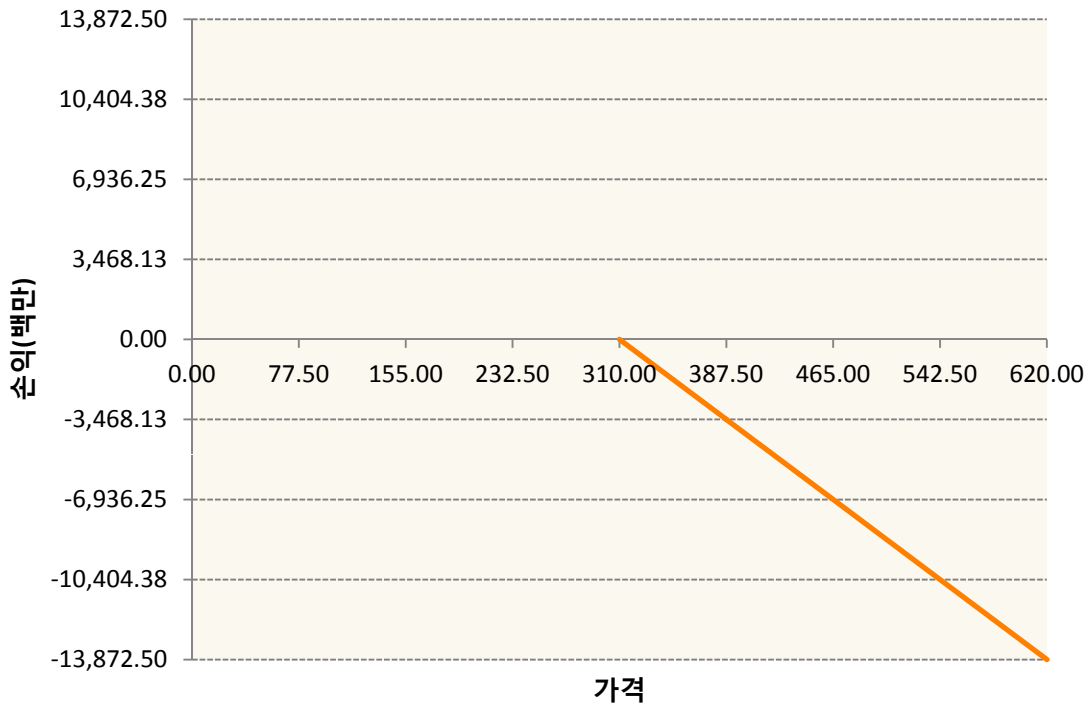


KR4201Q23073-2020-02 콜307.5

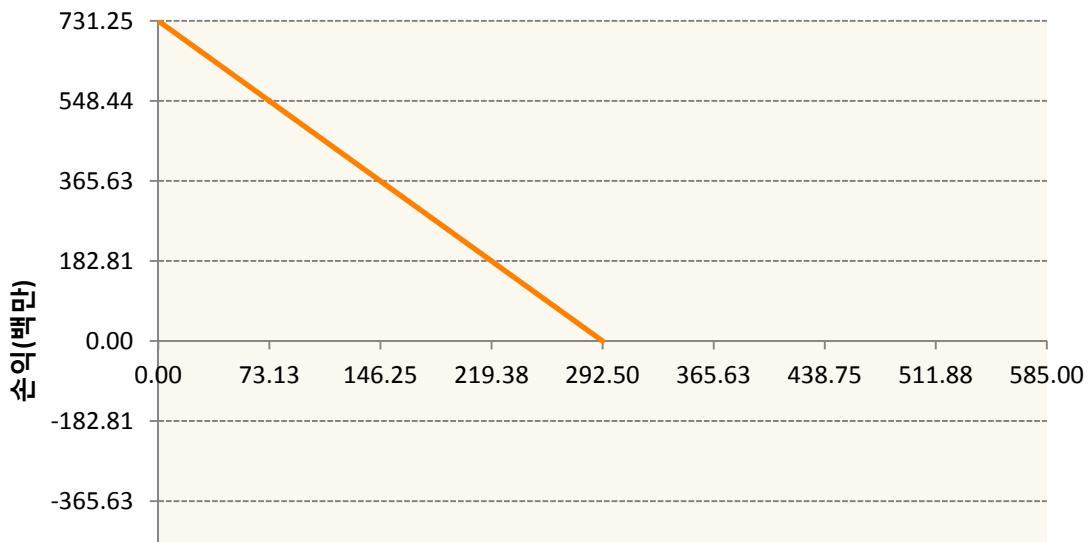


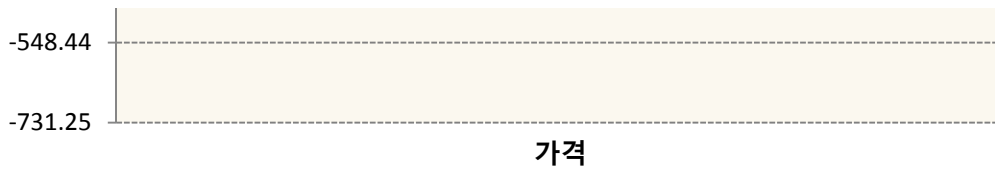


KR4201Q23107-2020-02 콜310

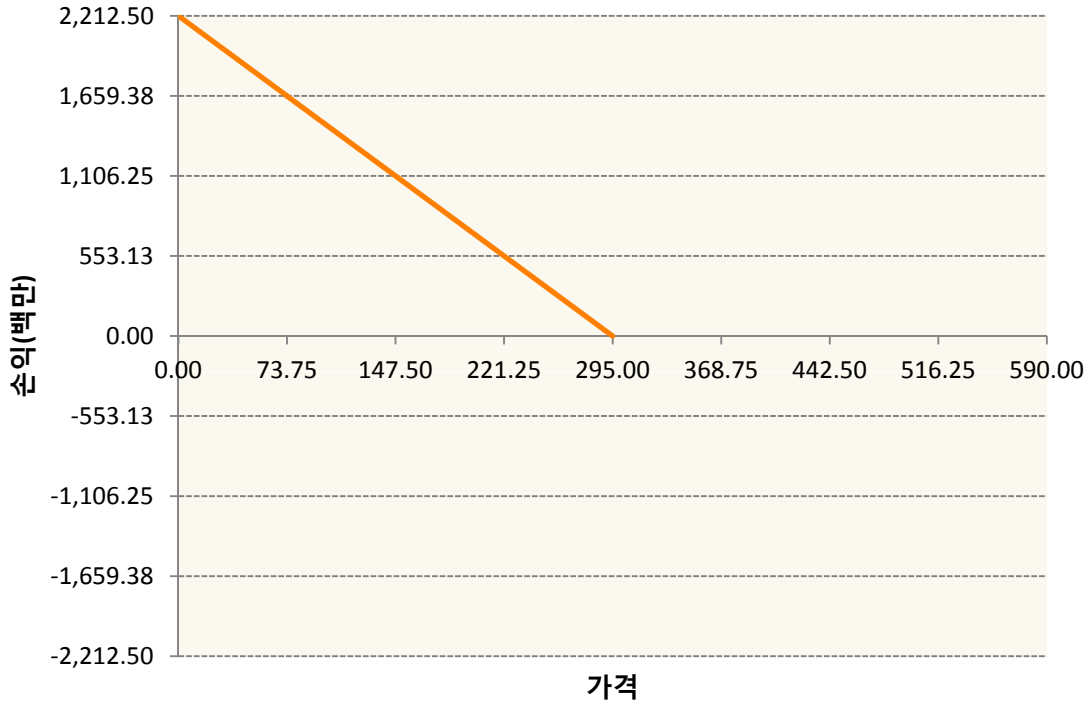


KR4301Q22925-2020-02 풋292.5





KR4301Q22958-2020-02 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						868
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-868	-868	-868	-868	-868	-868	-868	
-5.33%	-579	-579	-579	-579	-579	-579	-579	
-2.67%	-289	-289	-289	-289	-289	-289	-289	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	289	289	289	289	289	289	289	
5.33%	579	579	579	579	579	579	579	
8.00%	868	868	868	868	868	868	868	
KR4201Q23073		2020-02 콜307.5						405
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	165	160	153	145	136	126	115	
-5.33%	150	140	129	117	103	90	75	
-2.67%	117	102	86	70	53	35	18	

0%	57	38	19	0	-19	-39	-58
2.67%	-34	-54	-74	-94	-114	-135	-155
5.33%	-158	-176	-194	-213	-232	-251	-271
8.00%	-309	-323	-338	-354	-370	-387	-405
KR4201Q23107 2020-02 콜310							712
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	268	260	249	237	222	205	186
-5.33%	246	230	212	191	169	145	120
-2.67%	196	171	144	115	86	55	24
0%	102	69	35	0	-35	-70	-106
2.67%	-48	-85	-123	-160	-197	-235	-272
5.33%	-258	-293	-329	-365	-402	-438	-475
8.00%	-522	-551	-581	-612	-645	-678	-712
KR4301Q22925 2020-02 풋292.5							37
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	34	35	35	35	36	36	37
-5.33%	16	17	18	19	19	20	21
-2.67%	4	5	6	7	8	8	9
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-3	-3	-3	-3	-2	-2	-1
5.33%	-4	-4	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-3	-3
KR4301Q22958 2020-02 풋295							122
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	117	117	118	119	119	120	122
-5.33%	60	62	64	66	68	70	72
-2.67%	16	19	22	25	27	30	33
0%	-7	-5	-2	0	2	5	8
2.67%	-14	-13	-12	-11	-10	-8	-6
5.33%	-15	-15	-15	-15	-14	-13	-12
8.00%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15

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

(단위:백만원)

1,711

공시일	2020-01-15
기준일	2020-01-14

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	205,168	0	205,168	

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	2020-01-15
기준일	2020-01-14

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	214,161	0	214,161	

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	2020-01-15
기준일	2020-01-14

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	528,696	0	528,696	
누계	통화	선도	0	536,546	-536,546	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	3,182
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E	4,717
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	185
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,775
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,775
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	3,700
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
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	1,665
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	277

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

14,082

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

(단위:백만원)

212

공시일	2020-01-15
기준일	2020-01-14

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

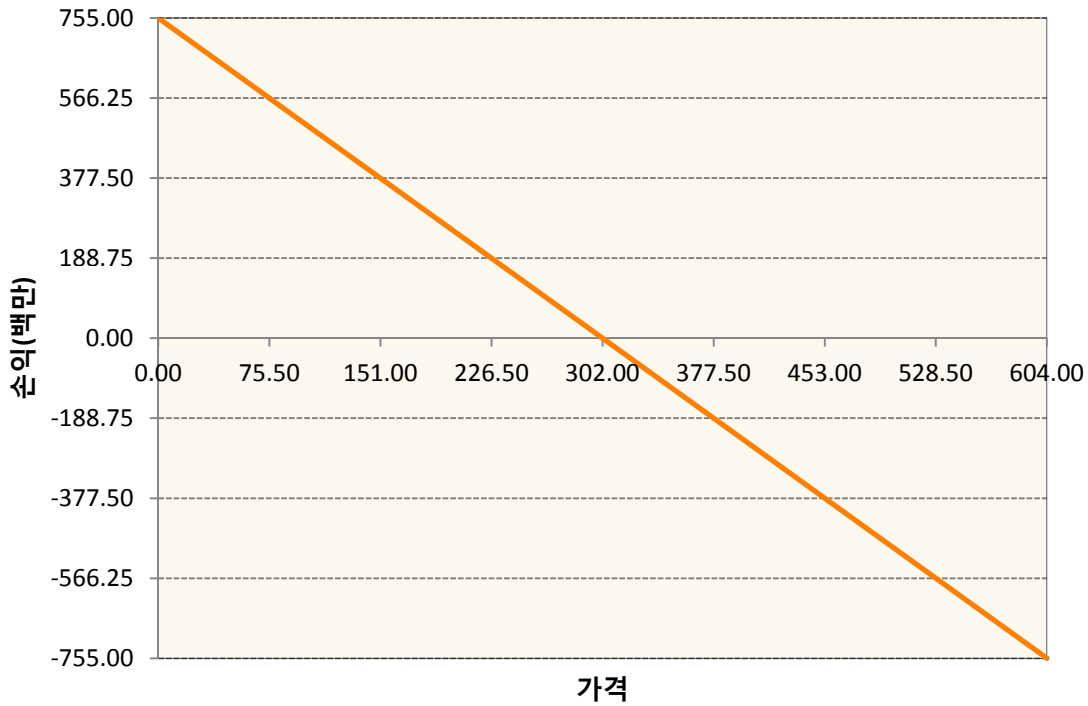
1. 계약금액

(단위:백만원)

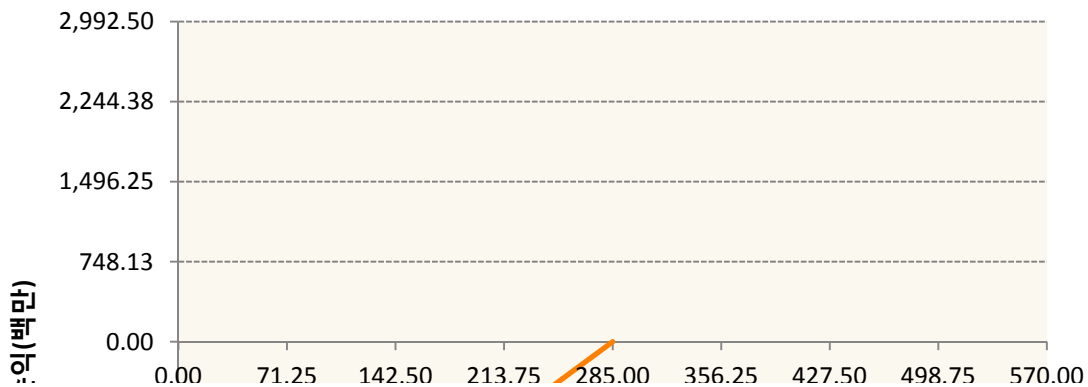
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	71	0	71	장내
누계	유가증권	선물	0	755	-755	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,855	-3,855	장내

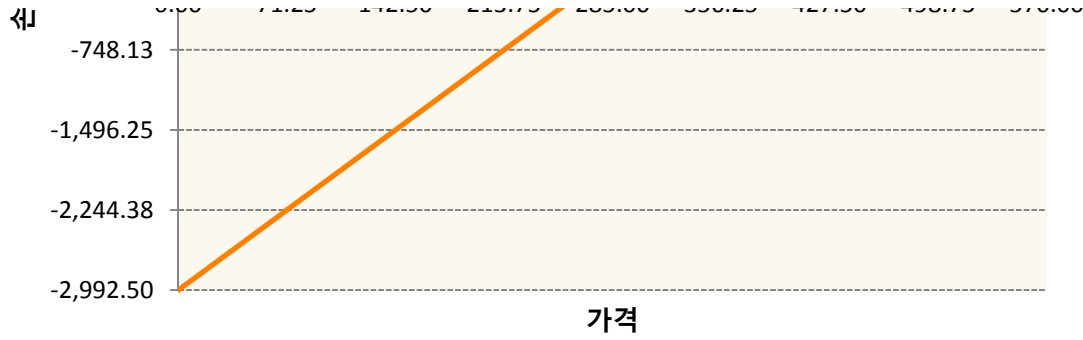
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

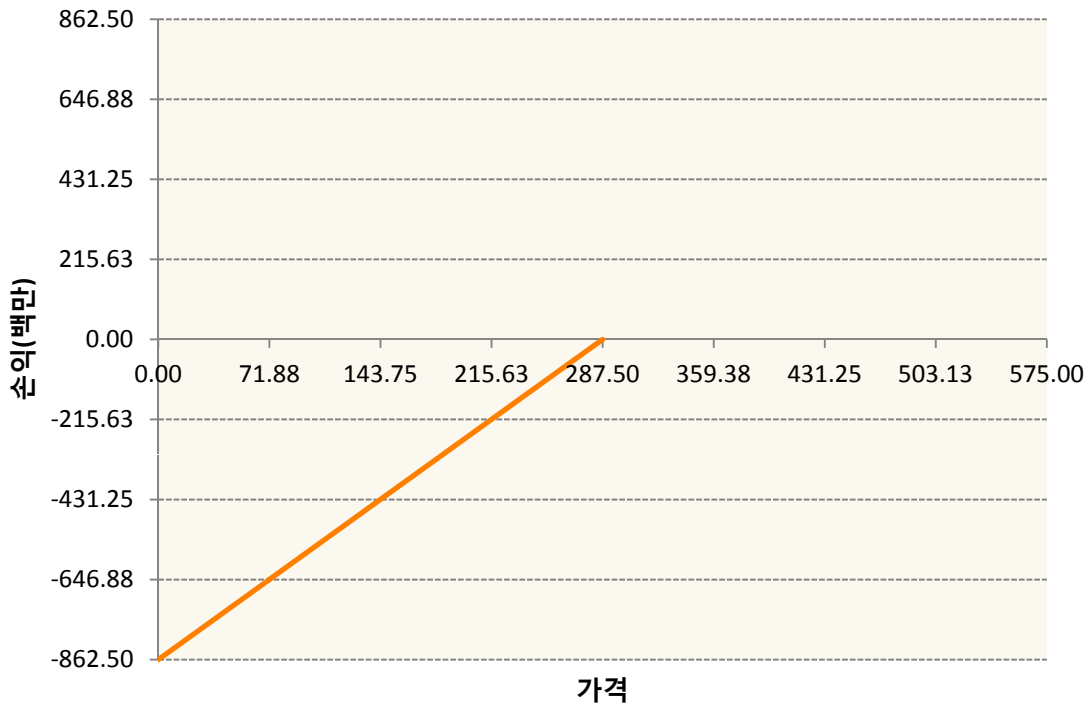


KR4301Q22859-2020-02 풋285





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						102
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-84	-87	-90	-92	-95	-99	-102
-5.33%	-29	-32	-36	-40	-44	-48	-52
-2.67%	-3	-6	-9	-11	-14	-17	-21
0%	3	2	1	0	-1	-3	-5
2.67%	4	4	3	3	3	2	1
5.33%	4	4	4	4	4	3	3
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

KR4301Q22875 2020-02 풋287.5 34

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-30	-30	-31	-32	-32	-33	-34
-5.33%	-12	-13	-14	-15	-16	-17	-18
-2.67%	-2	-3	-4	-5	-6	-7	-8
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	2	2	2	1	1	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	1
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

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

(단위:백만원)

130

공시일	2020-01-15
기준일	2020-01-14

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	13,230	0	13,230	
누계	통화	선도	0	13,006	-13,006	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)

341

공시일	2020-01-15
기준일	2020-01-14

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	2,006	0	2,006	장외
누계	통화	선도	309	734	-425	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	2020-01-15
기준일	2020-01-14

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

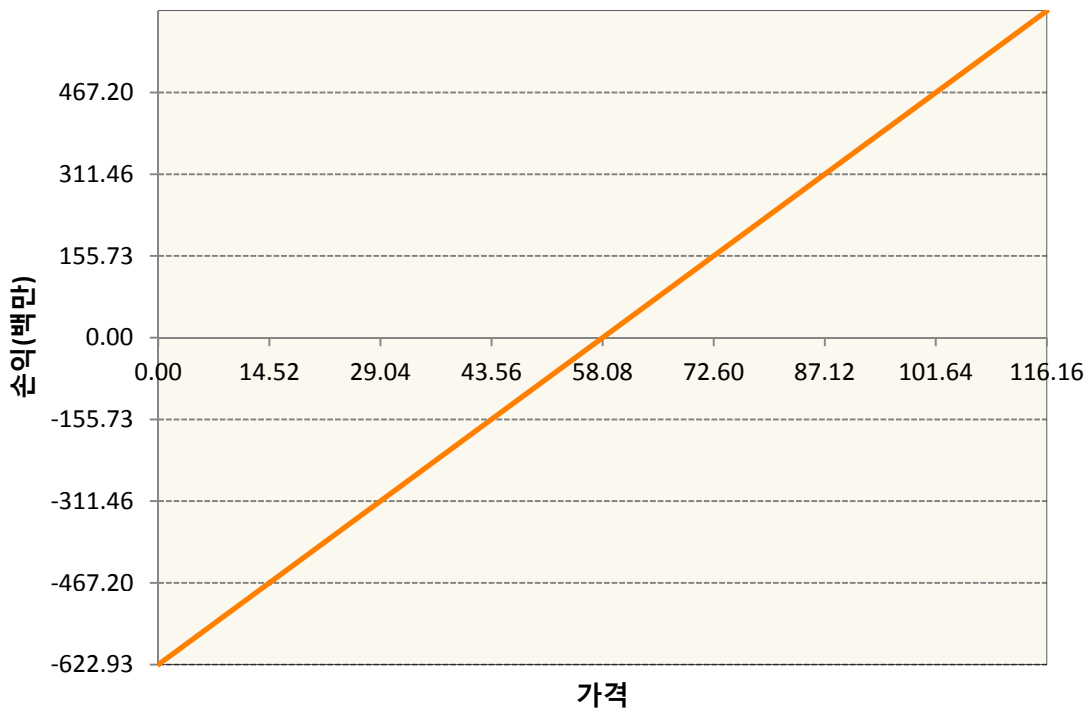
1. 계약금액

(단위:백만원)

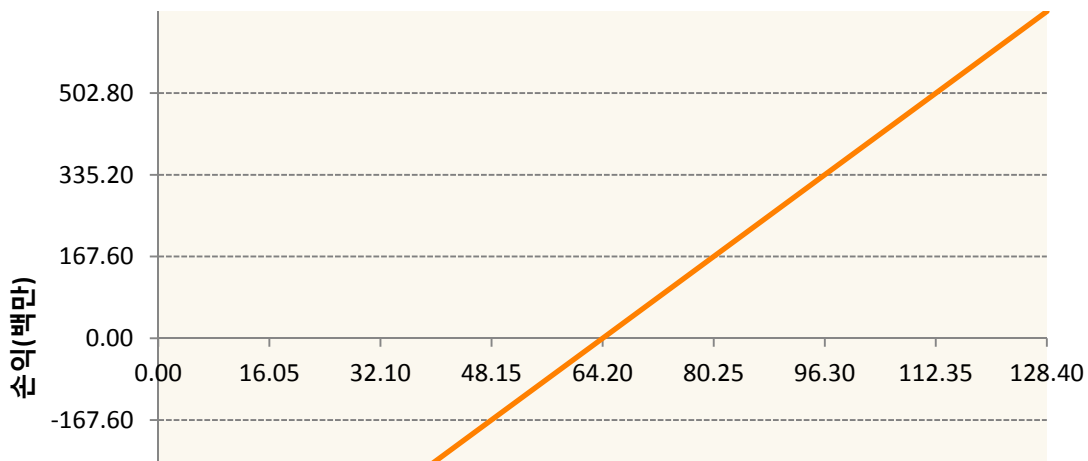
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,428	289	2,140	

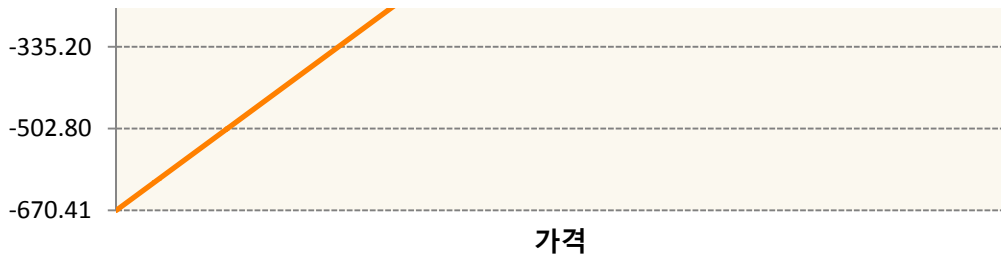
2. 만기시점의 손익구조

CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20

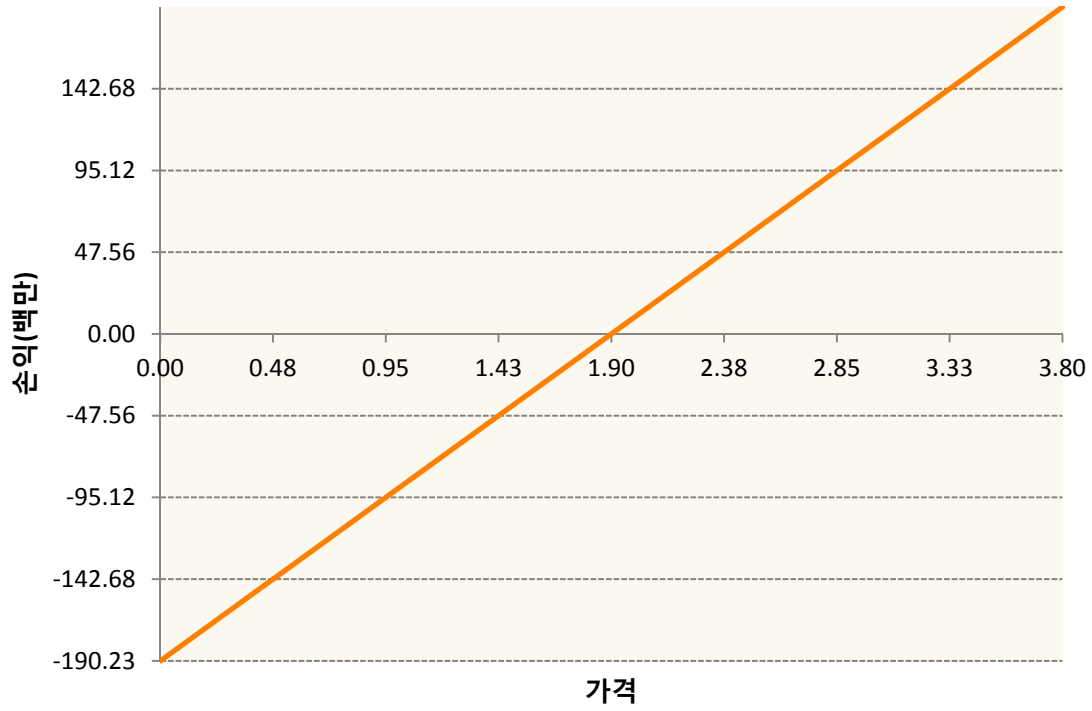


COH0-BRENT CRUDE FUTR Mar20

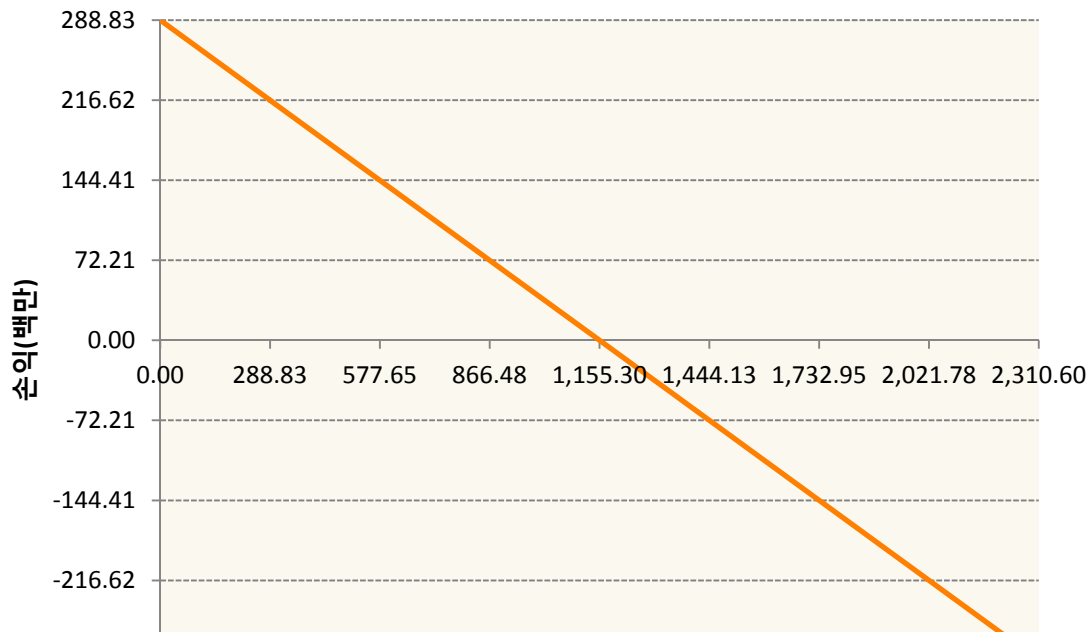


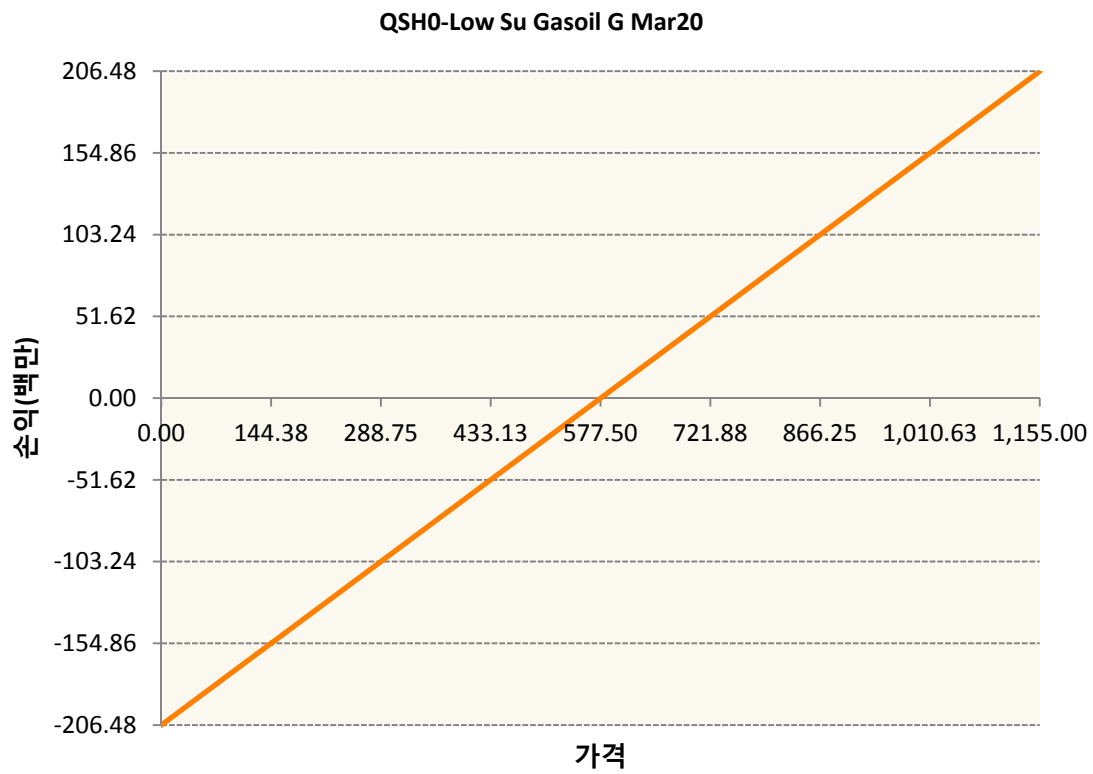
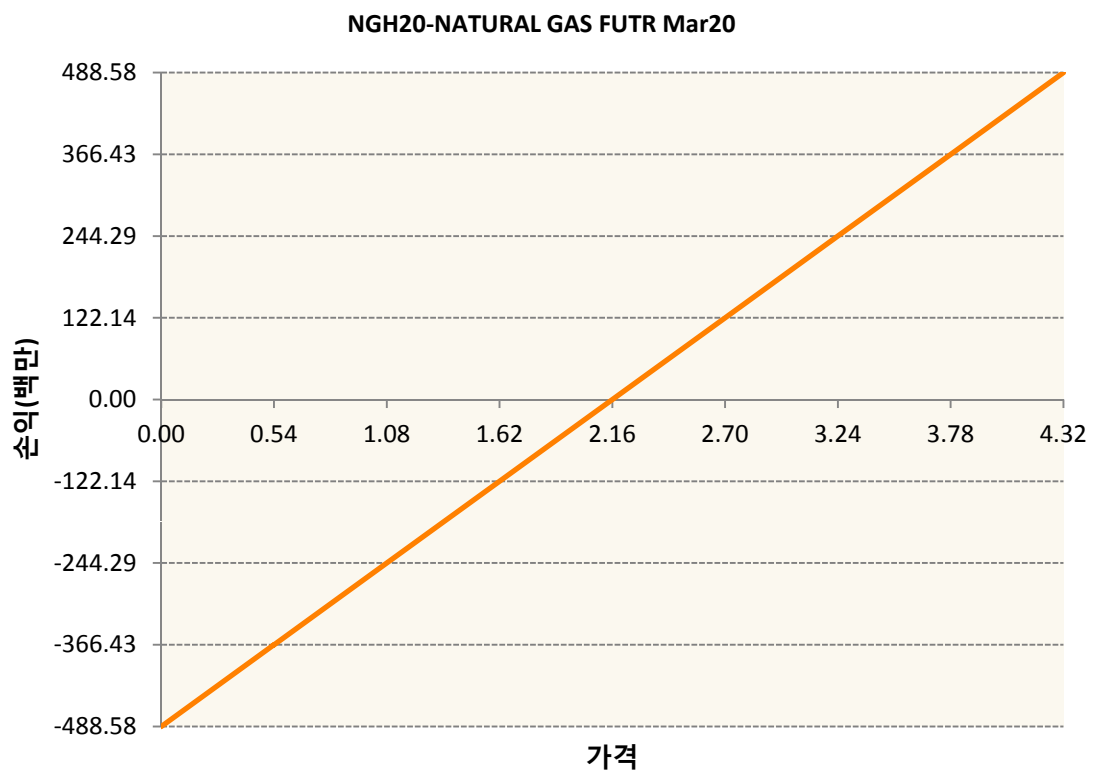
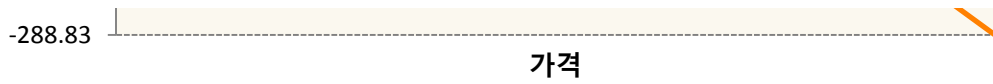


HOH0-NY Harb ULSD Fut Mar20

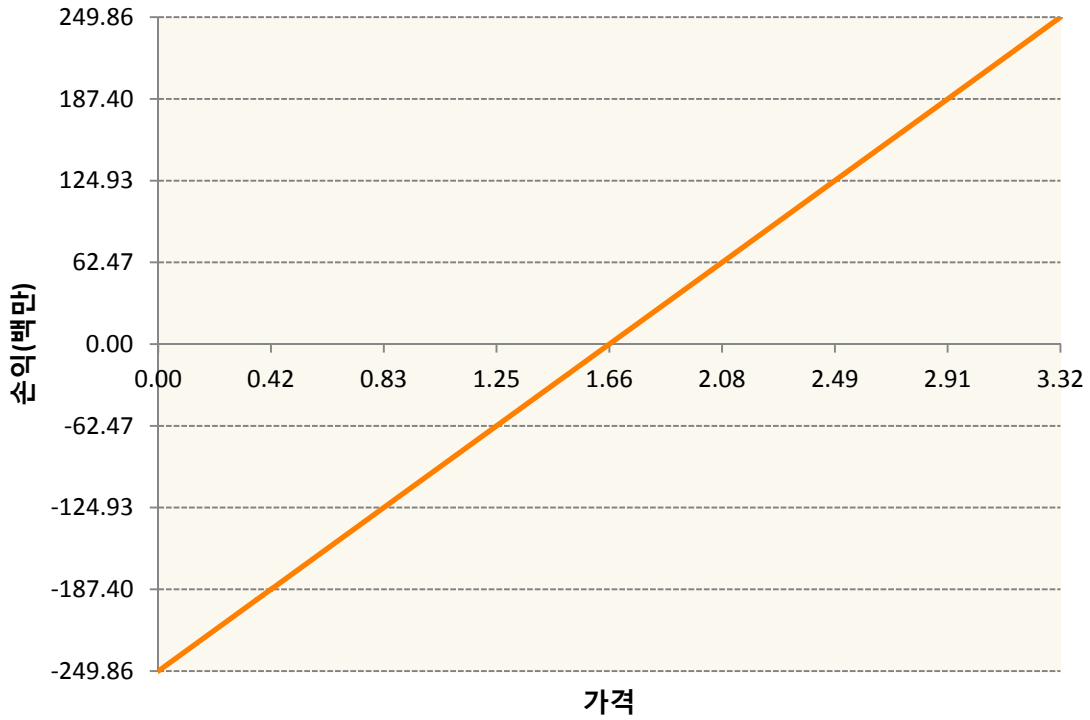


KR4175Q10001-2020-01 달러선물





XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	50
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)

375

공시일	2020-01-15
기준일	2020-01-14

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

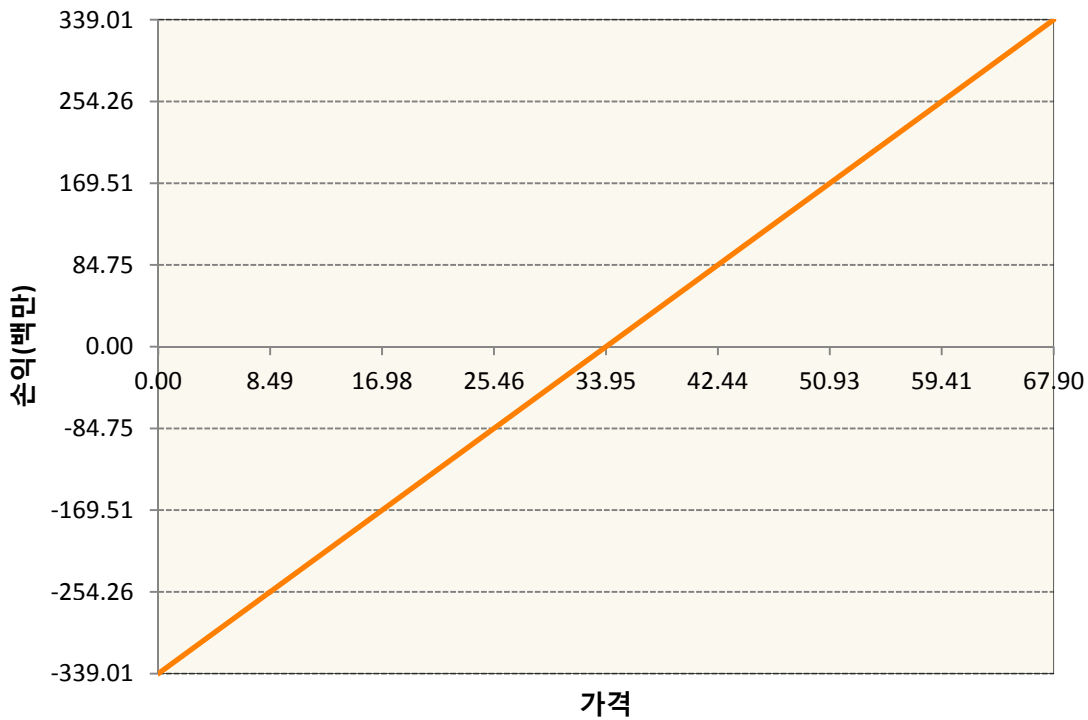
1. 계약금액

(단위:백만원)

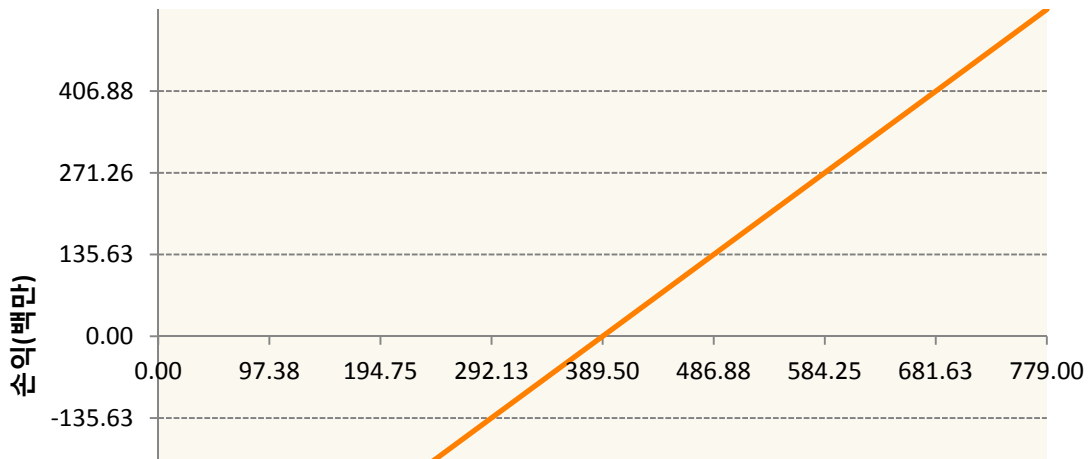
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,852	150	2,702	

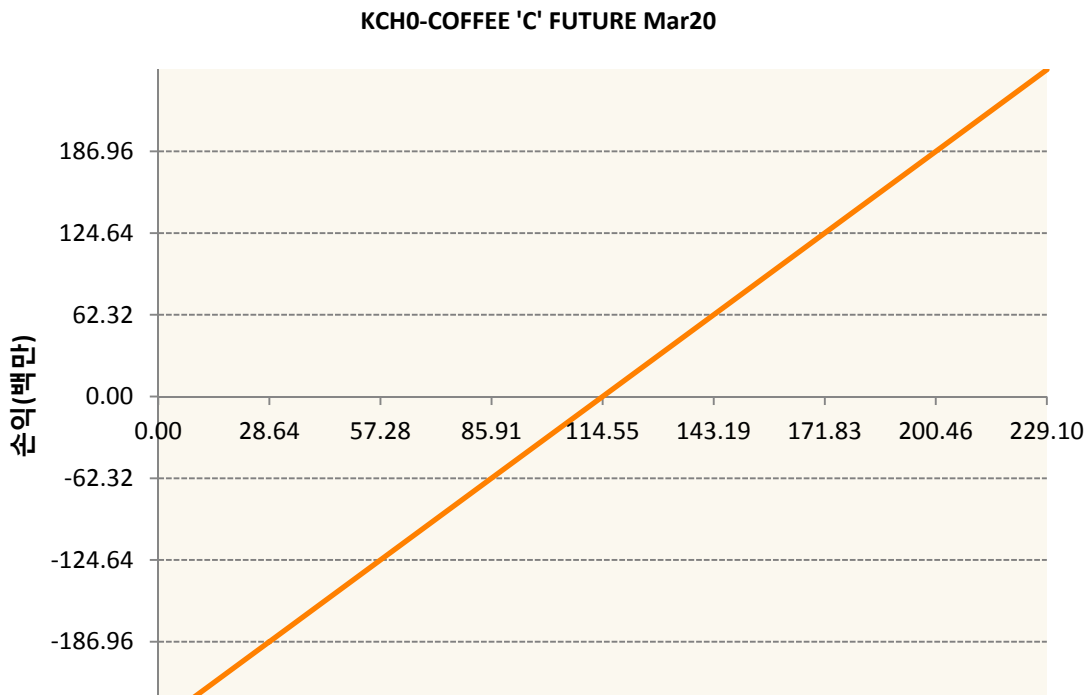
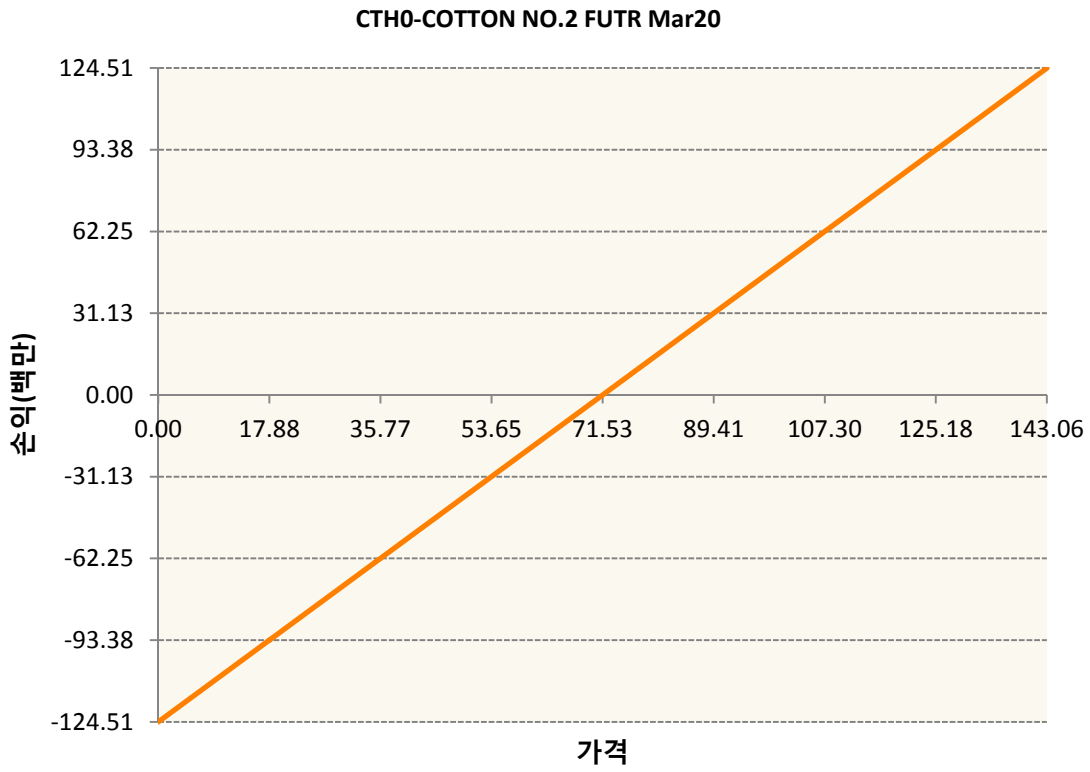
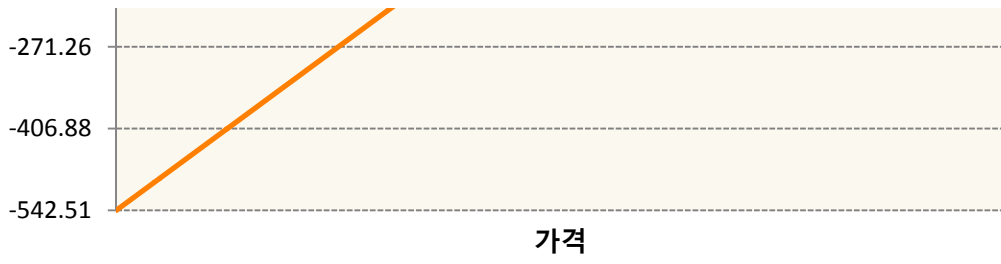
2. 만기시점의 손익구조

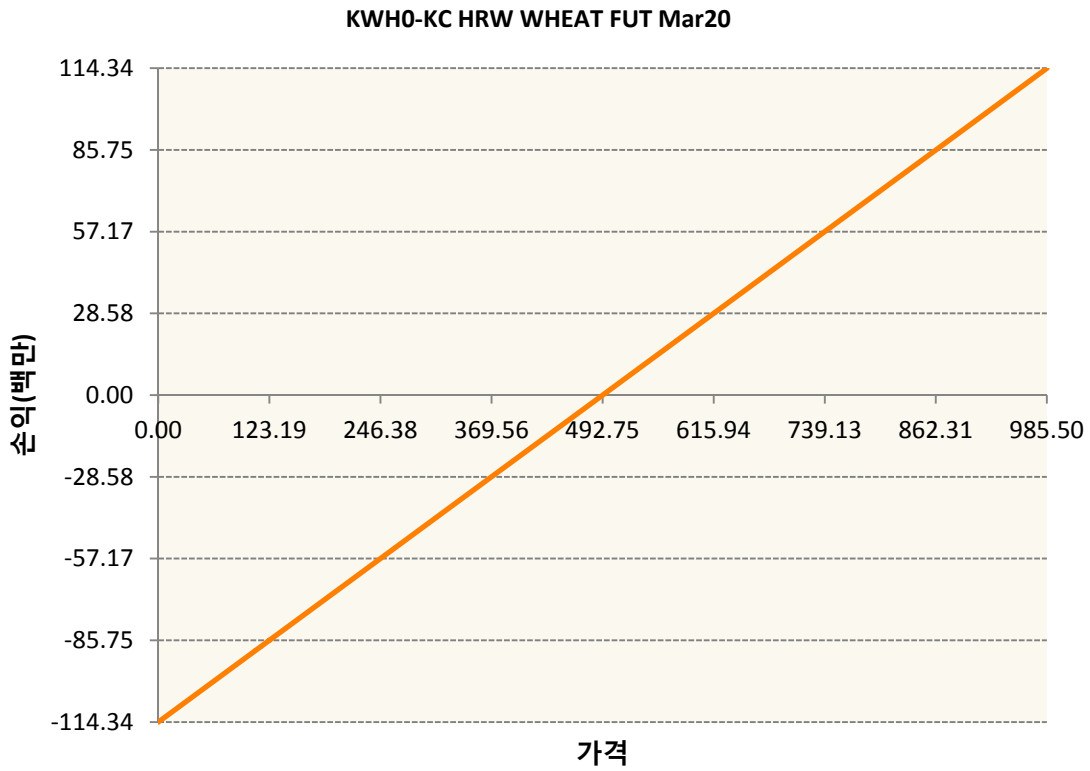
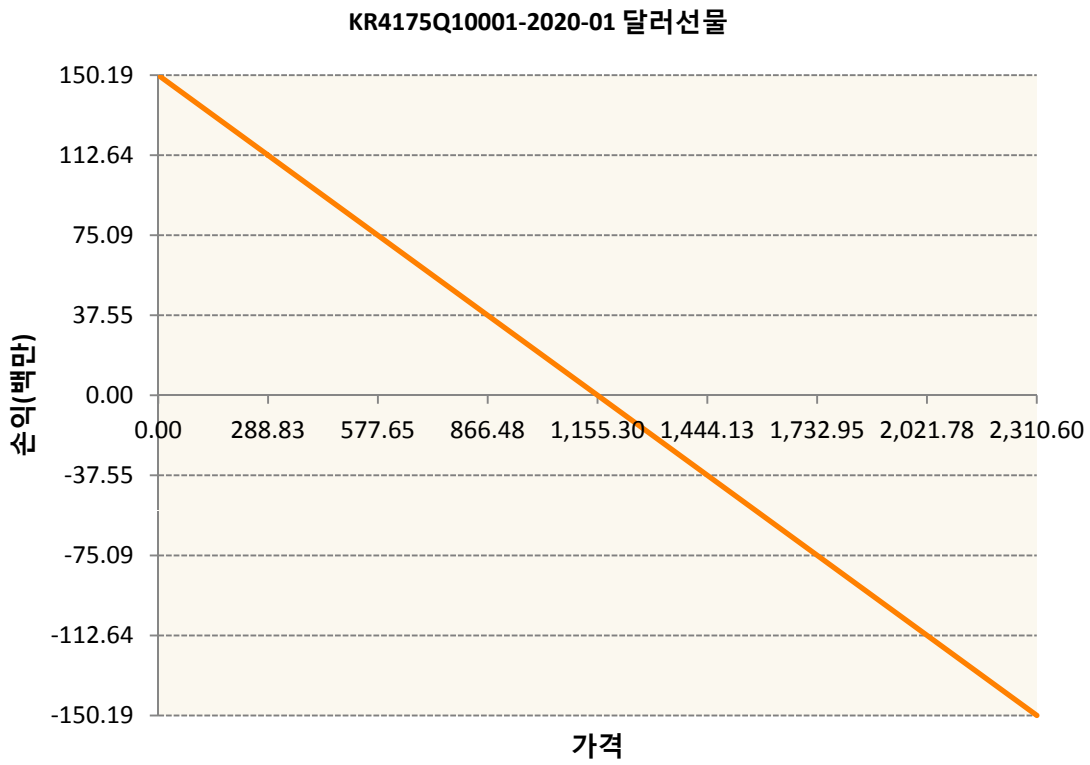
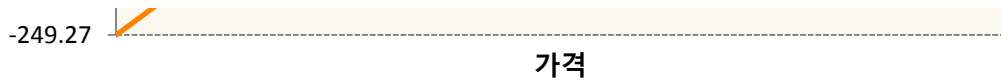
BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20



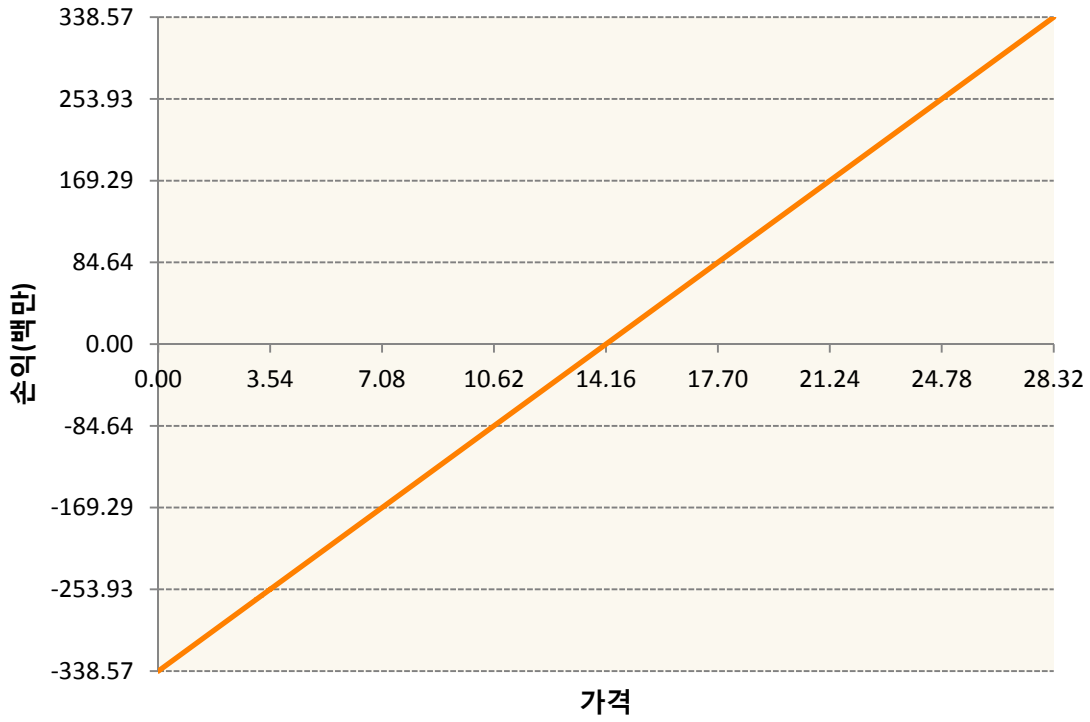
CH0-CORN FUTURE Mar20



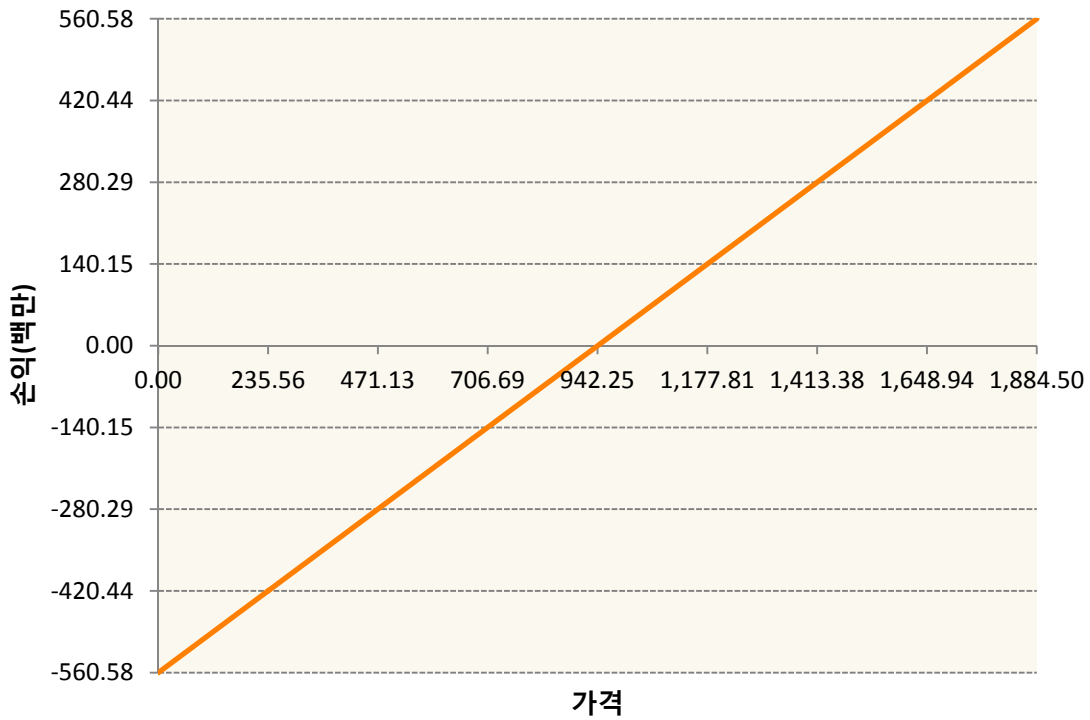




SBH0-Sugar Mar20

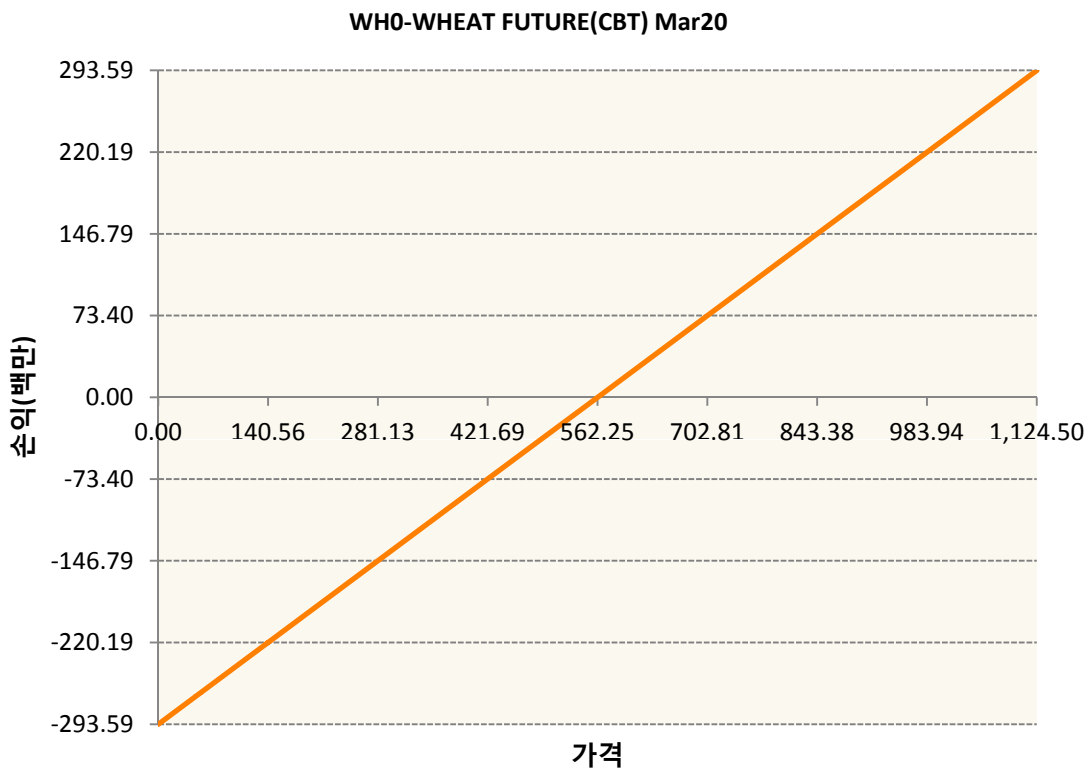
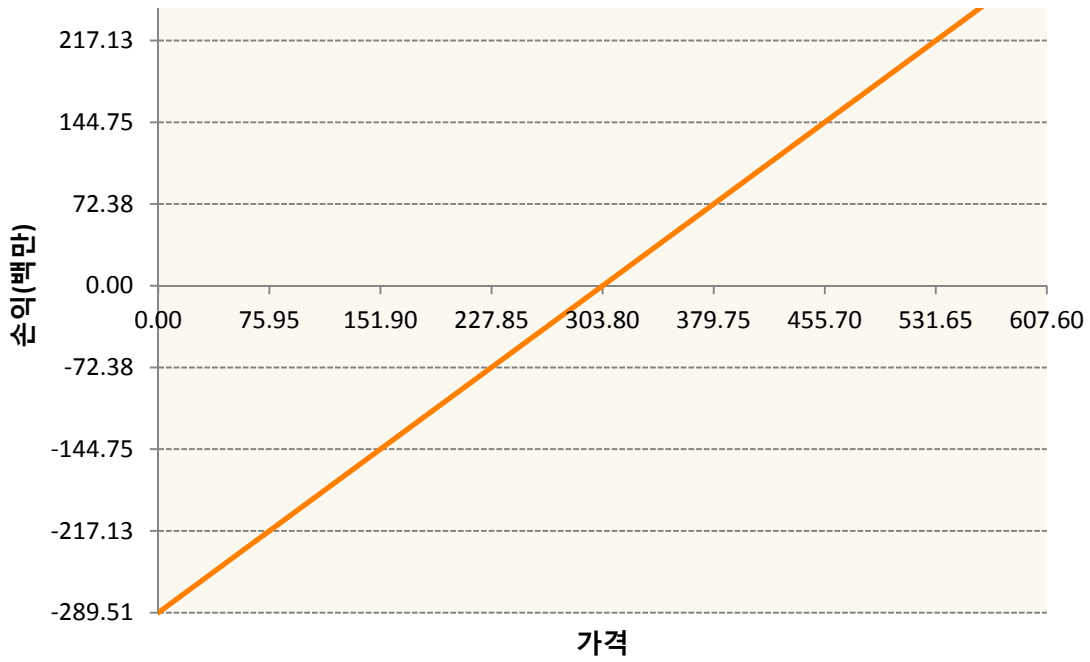


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20



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	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	23

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

(단위:백만원)

249