

공시일	2020-01-17
기준일	2020-01-16

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	2020-01-17
기준일	2020-01-16

스마트인덱스모

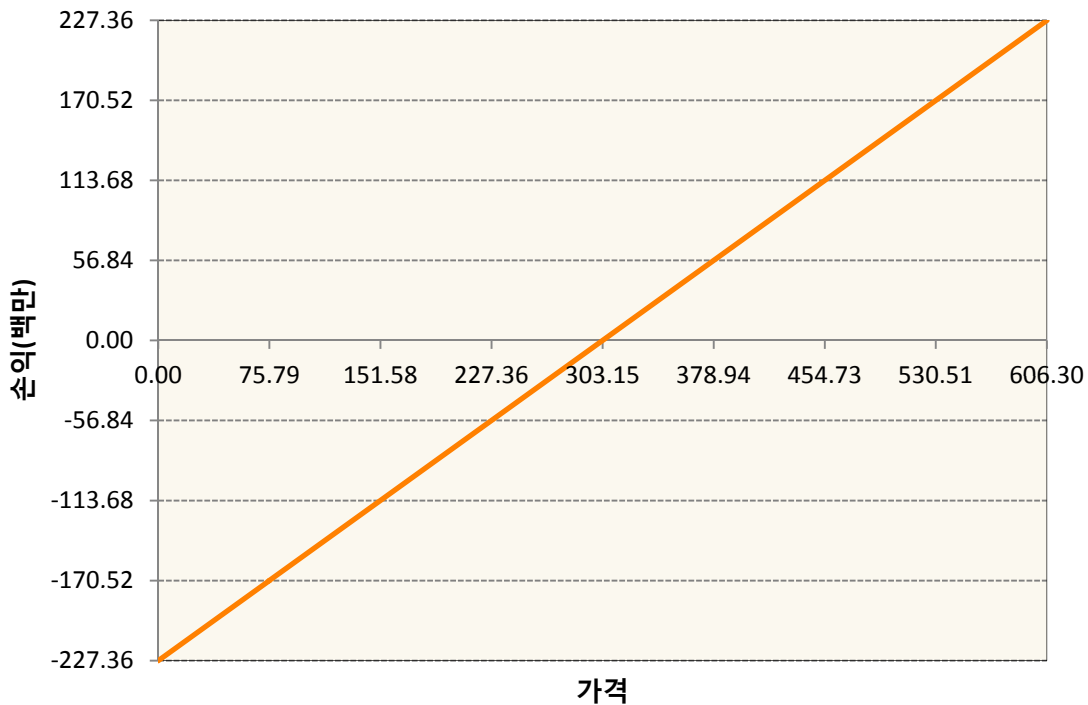
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	227	0	227	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	2020-01-17
기준일	2020-01-16

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

1,145

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

655

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-17
기준일	2020-01-16

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6,551	0	6,551	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(1)	432
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	158

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

820

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-17
기준일	2020-01-16

유로인덱스모(주식-파생형)

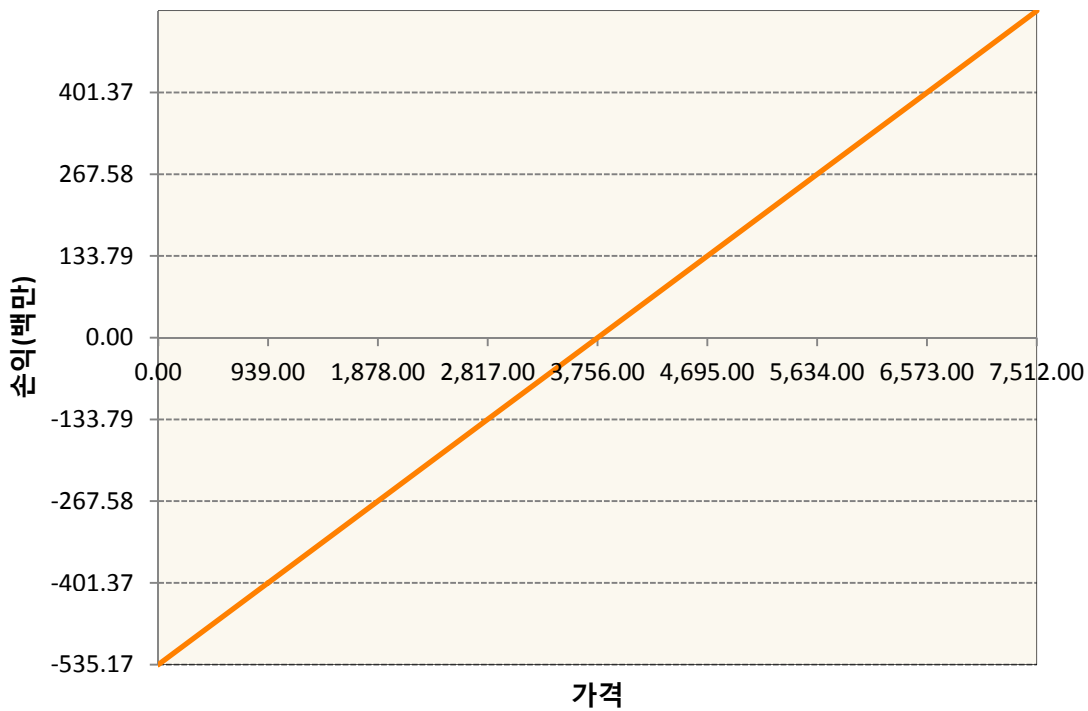
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	535	0	535	

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	2020-01-17
기준일	2020-01-16

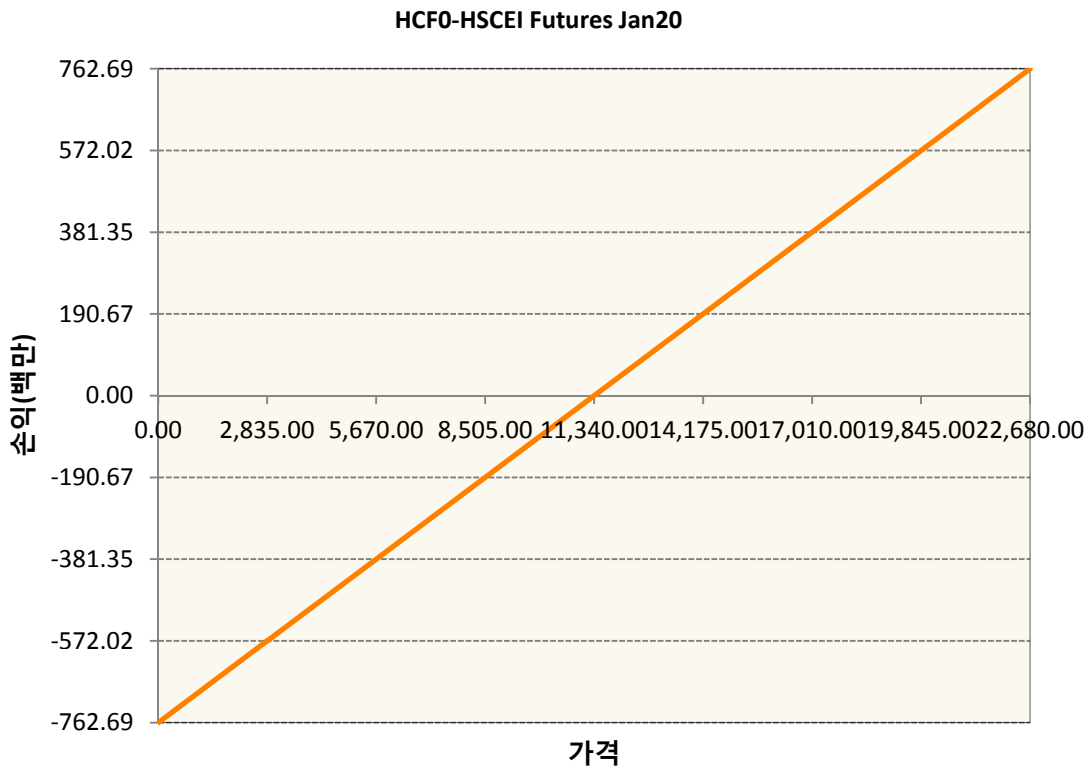
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	763	0	763	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	2020-01-17
기준일	2020-01-16

커버드콜모(주식혼합-파생형)

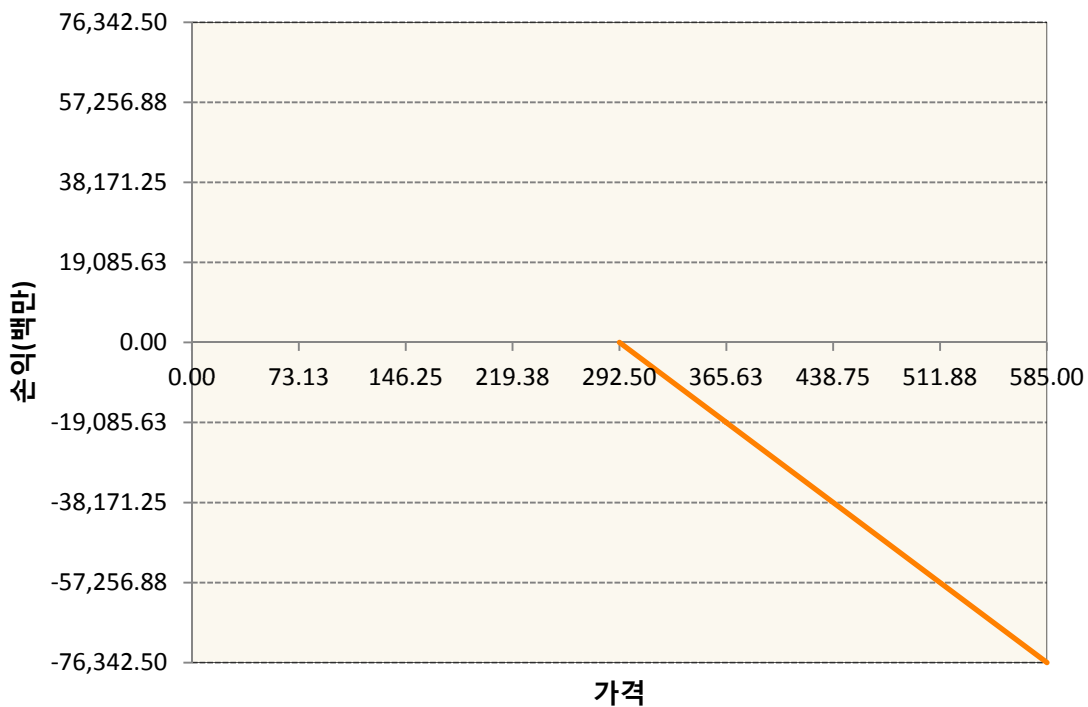
1. 계약금액

(단위:백만원)

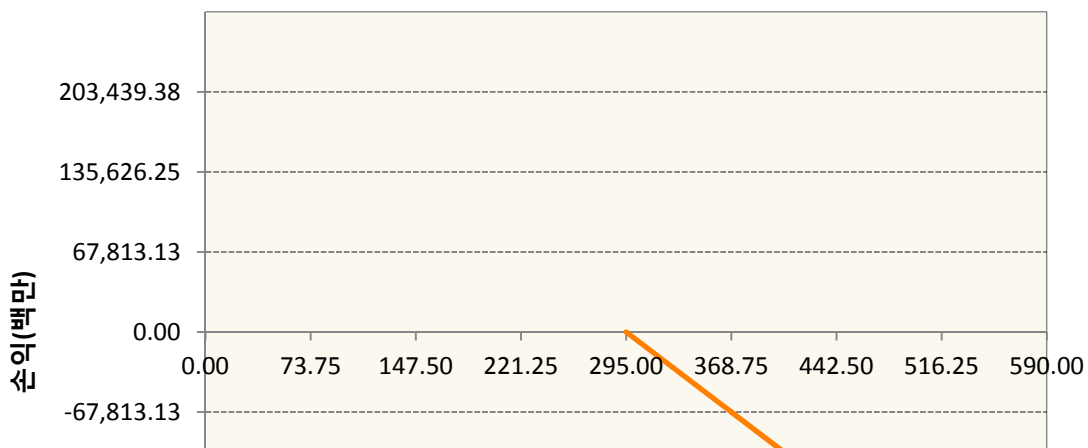
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	468,989	-468,989	장내

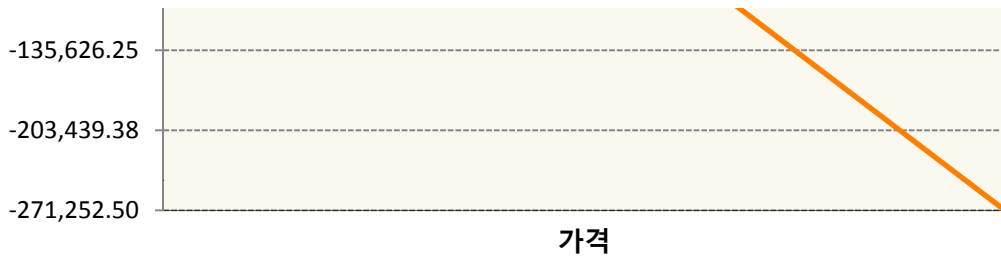
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q22927-2020-02 콜292.5

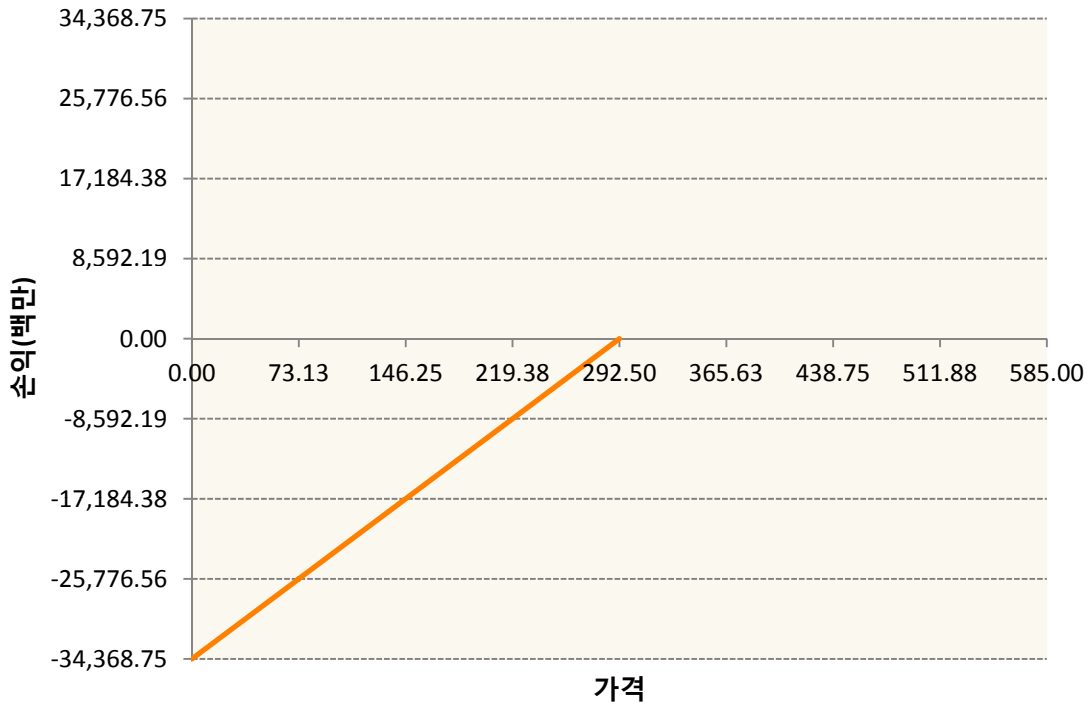


KR4201Q22950-2020-02 콜295

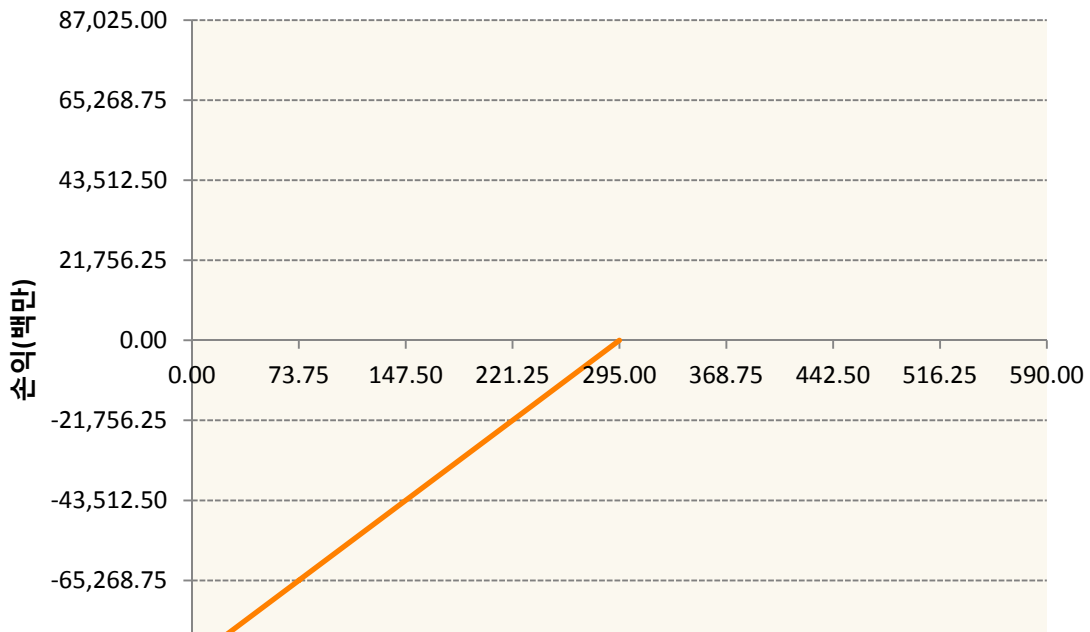




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



KR4301Q22958-2020-02 풋295



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q22927		2020-02 콜292.5						5,466
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,558	3,401	3,237	3,065	2,889	2,709	2,526	
-5.33%	2,921	2,721	2,520	2,317	2,114	1,909	1,704	
-2.67%	1,928	1,717	1,506	1,294	1,083	871	660	
0%	576	388	196	0	-199	-400	-603	
2.67%	-1,075	-1,217	-1,372	-1,535	-1,705	-1,882	-2,064	
5.33%	-2,937	-3,031	-3,141	-3,264	-3,398	-3,543	-3,696	
8.00%	-4,927	-4,981	-5,051	-5,136	-5,234	-5,344	-5,466	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						18,774
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	11,534	11,034	10,498	9,934	9,348	8,743	8,122	
-5.33%	9,625	8,952	8,267	7,573	6,873	6,167	5,456	
-2.67%	6,520	5,770	5,019	4,268	3,517	2,767	2,016	
0%	2,141	1,437	722	0	-728	-1,460	-2,196	
2.67%	-3,367	-3,931	-4,528	-5,150	-5,794	-6,454	-7,128	
5.33%	-9,718	-10,107	-10,549	-11,035	-11,558	-12,111	-12,690	
8.00%	-16,605	-16,840	-17,133	-17,479	-17,871	-18,305	-18,774	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						1,632
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,534	-1,544	-1,556	-1,572	-1,590	-1,610	-1,632	
-5.33%	-697	-730	-763	-798	-834	-871	-908	
-2.67%	-144	-185	-226	-267	-308	-350	-391	
0%	71	50	26	0	-28	-58	-90	
2.67%	115	110	103	93	81	67	50	
5.33%	120	119	118	116	112	108	101	
8.00%	120	120	120	120	119	118	116	
KR4301Q22958		2020-02 풋295						4,592
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-4,412	-4,427	-4,448	-4,475	-4,508	-4,548	-4,592	
-5.33%	-2,197	-2,260	-2,330	-2,405	-2,483	-2,565	-2,650	
-2.67%	-546	-652	-758	-864	-970	-1,076	-1,182	
0%	231	159	82	0	-85	-174	-264	
2.67%	430	408	379	343	300	251	197	

5.33%	455	452	446	437	423	404	381
8.00%	457	457	456	454	451	446	439

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

(단위:백만원)

28,939

공시일	2020-01-17
기준일	2020-01-16

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

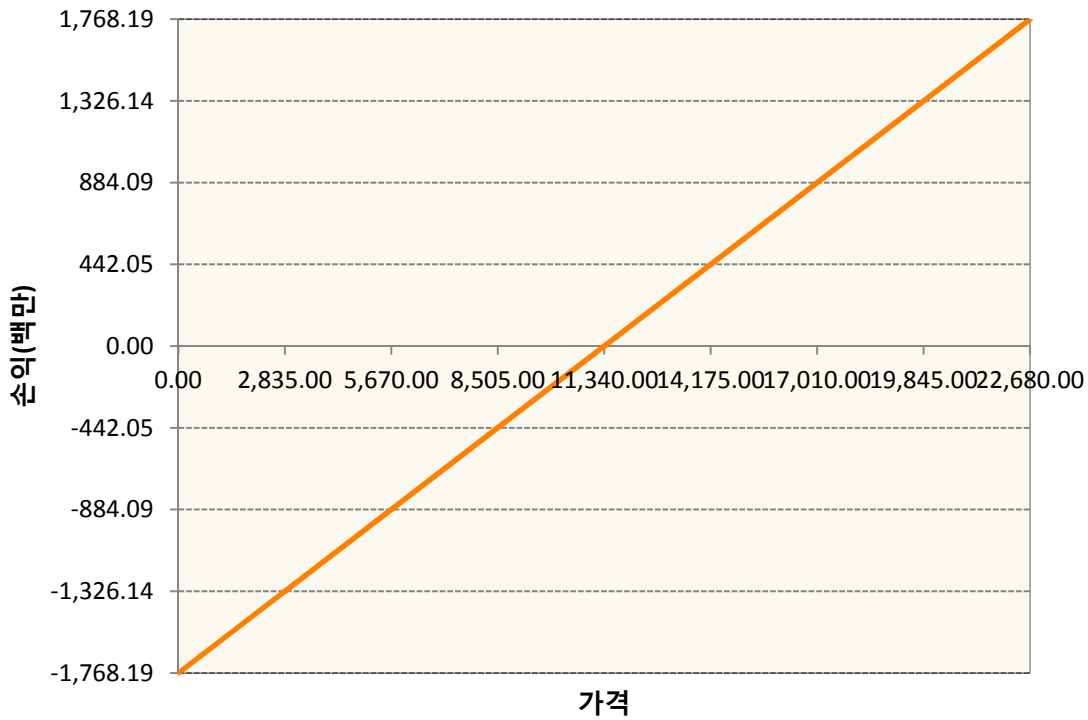
1. 계약금액

(단위:백만원)

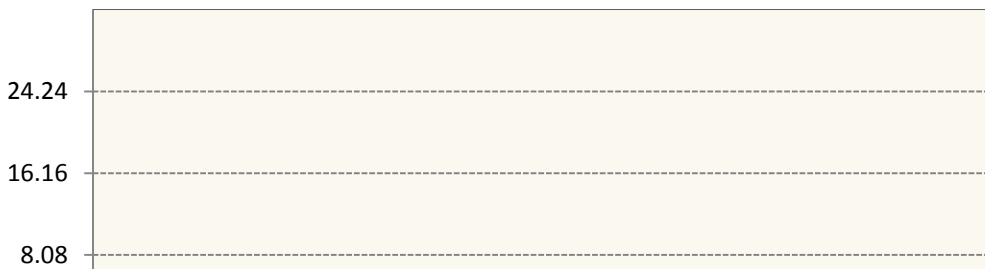
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,768	0	1,768	장내
누계	유가증권	옵션	0	58	-58	장내
누계	통화	선도	0	2,104	-2,104	장외

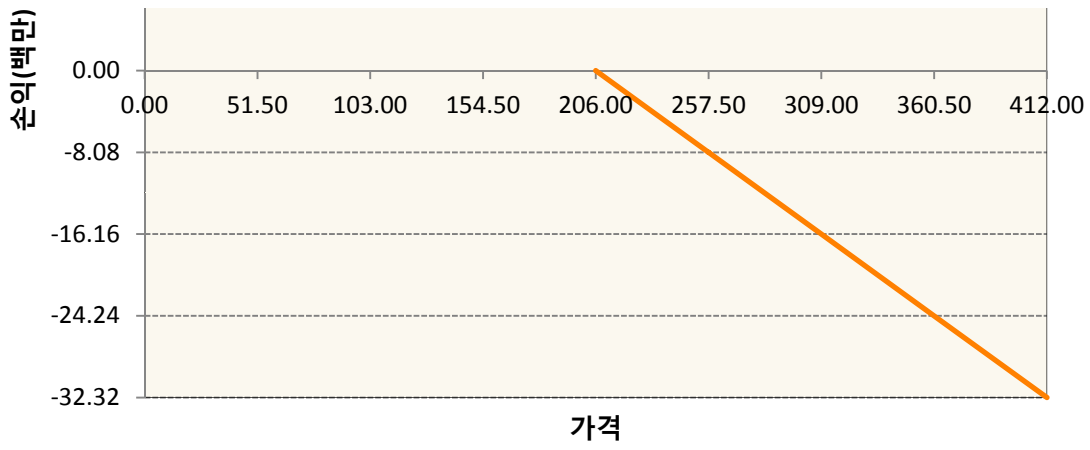
2. 만기시점의 손익구조

HCFO-HSCEI Futures Jan20

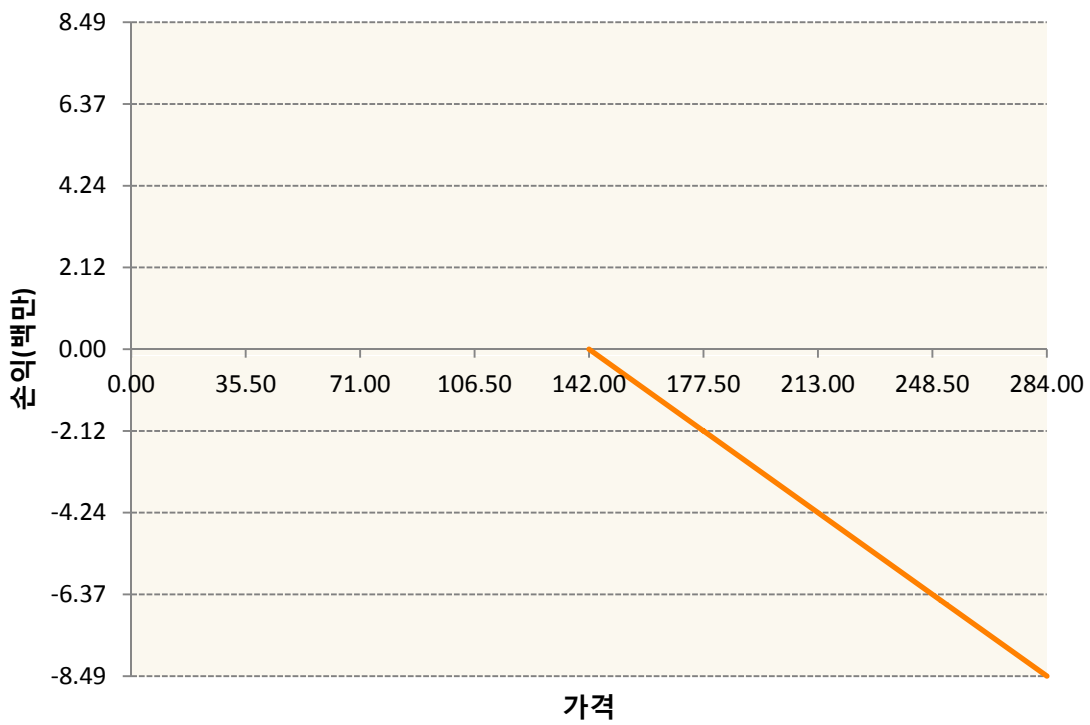


OHHIF0-C112-HSCEI

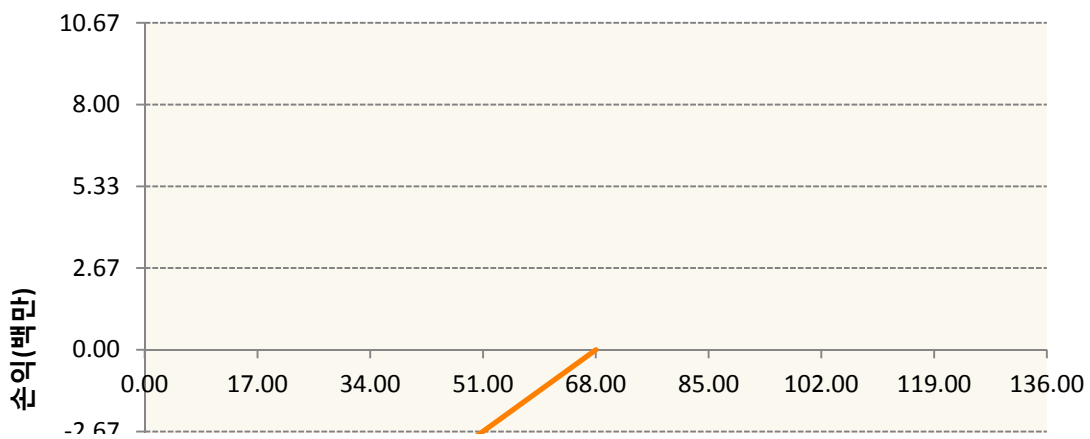


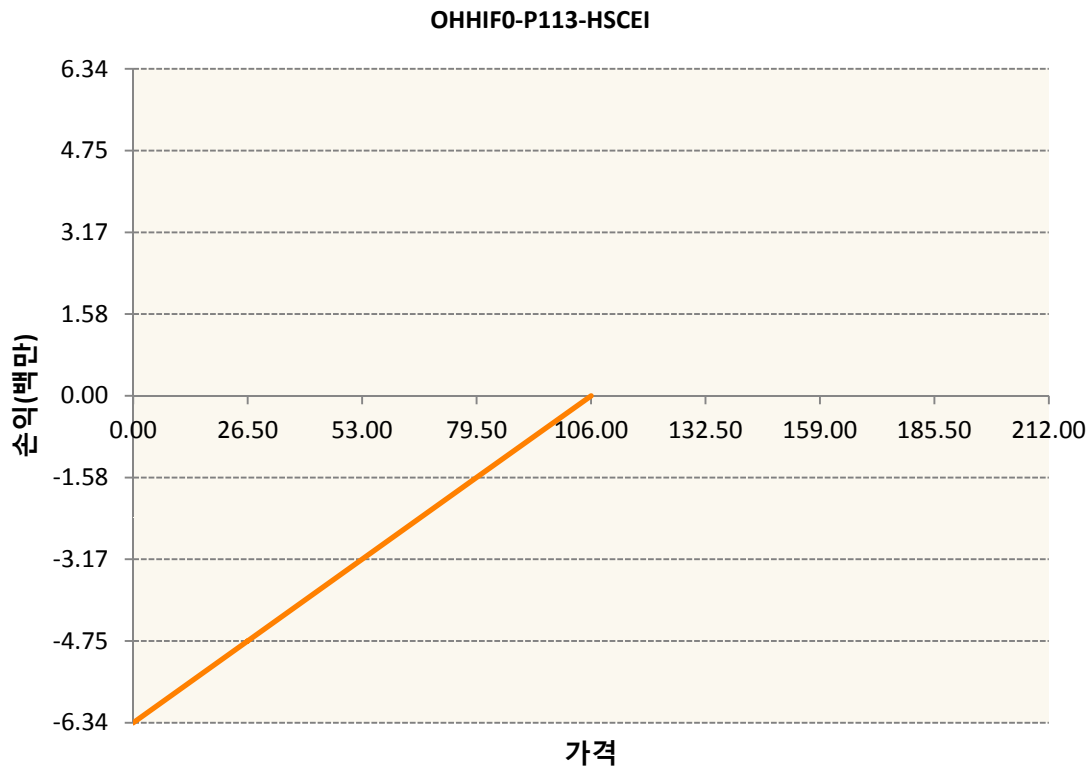
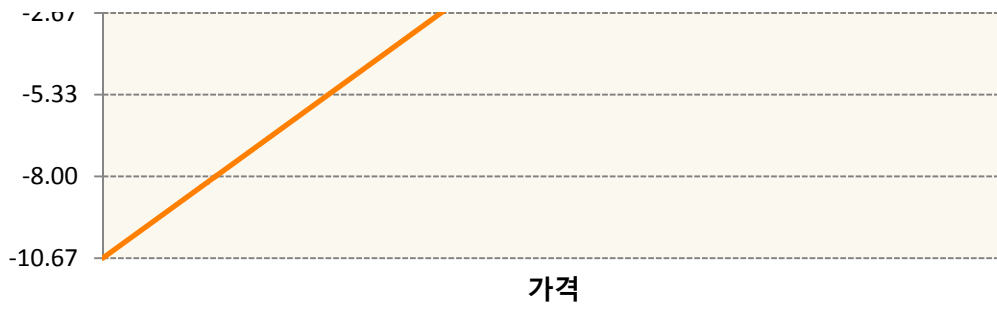


OHHIF0-C113-HSCEI



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)
	184

공시일	2020-01-17
기준일	2020-01-16

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

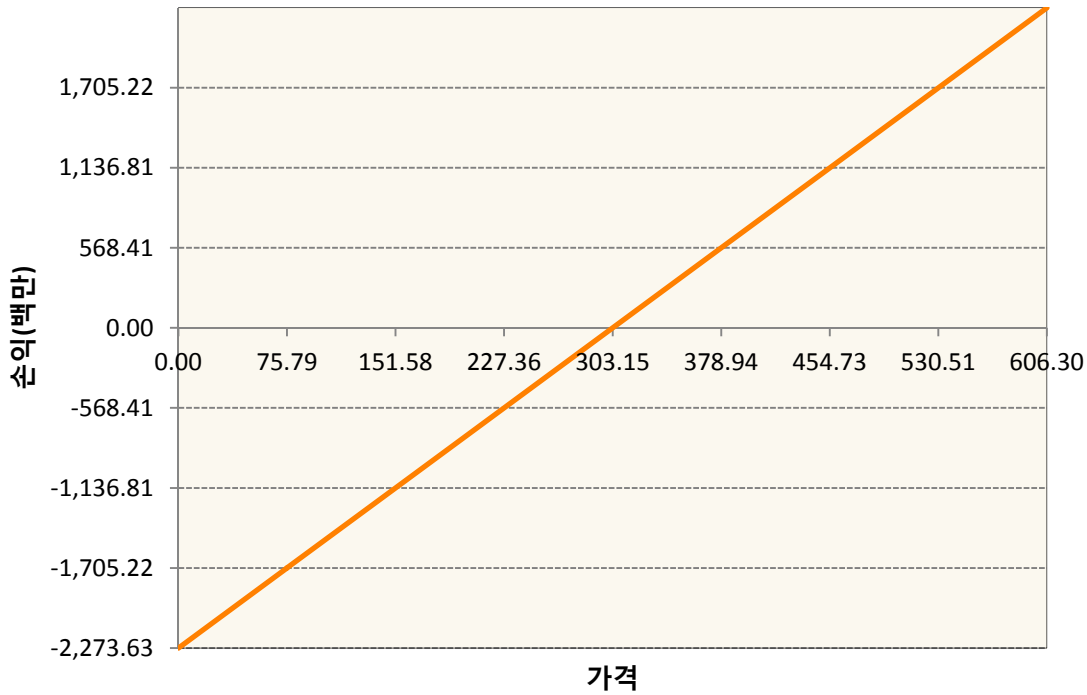
1. 계약금액

(단위:백만원)

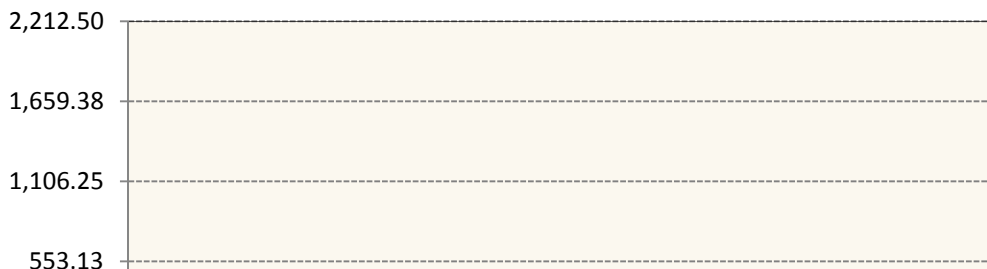
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,274	0	2,274	장내
누계	유가증권	스왑	4,625	0	4,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,123	-4,123	장내

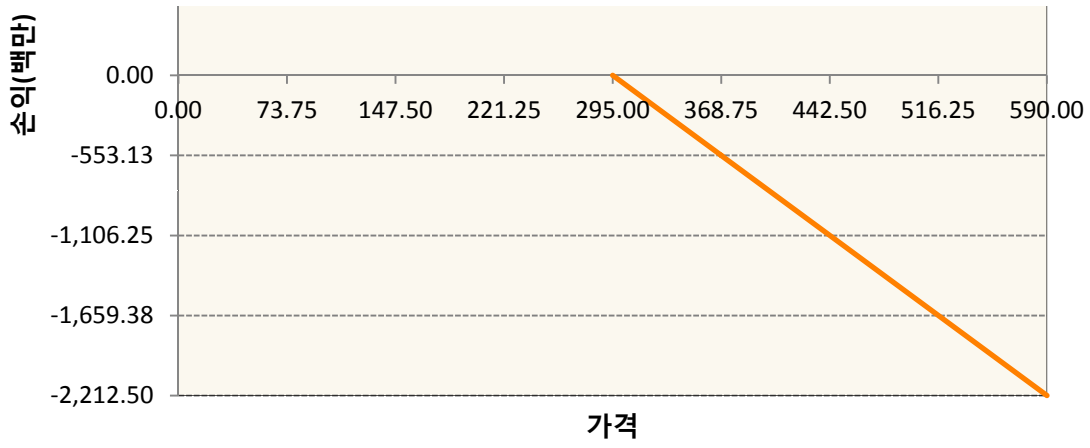
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

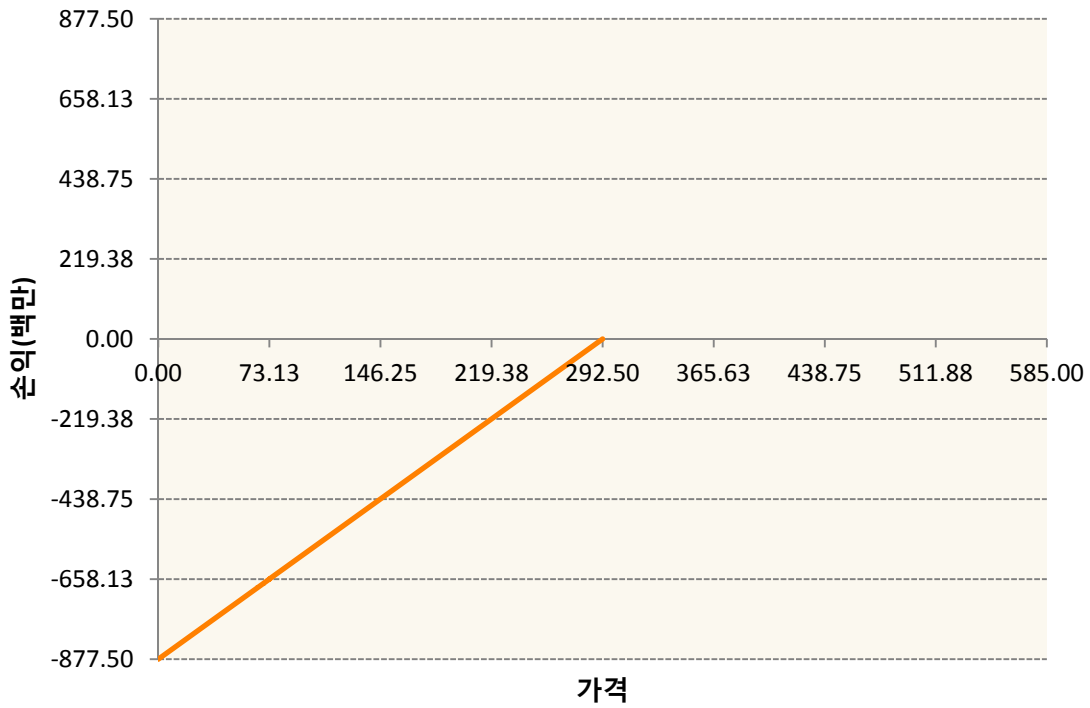


KR4201Q22950-2020-02 콜295

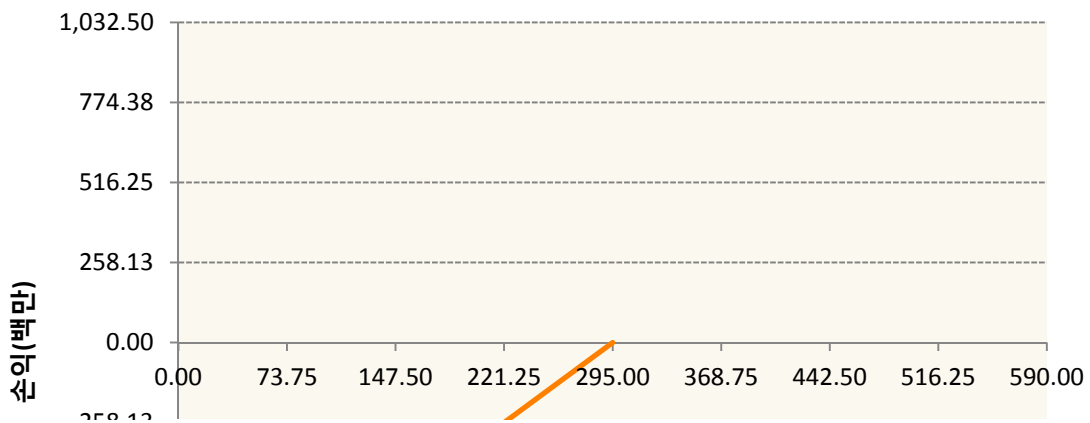




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



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						182
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182	
-5.33%	-121	-121	-121	-121	-121	-121	-121	
-2.67%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	61	61	61	61	61	61	61	
5.33%	121	121	121	121	121	121	121	
8.00%	182	182	182	182	182	182	182	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						153
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	94	90	86	81	76	71	66	
-5.33%	79	73	67	62	56	50	45	
-2.67%	53	47	41	35	29	23	16	
0%	17	12	6	0	-6	-12	-18	
2.67%	-27	-32	-37	-42	-47	-53	-58	
5.33%	-79	-82	-86	-90	-94	-99	-104	
8.00%	-135	-137	-140	-143	-146	-149	-153	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						42
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-39	-39	-40	-40	-41	-41	-42
-5.33%	-18	-19	-19	-20	-21	-22	-23
-2.67%	-4	-5	-6	-7	-8	-9	-10
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	3	3	3	2	2	2	1
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3
KR4301Q22958 2020-02 풋295							54
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-52	-53	-53	-53	-53	-54	-54
-5.33%	-26	-27	-28	-29	-29	-30	-31
-2.67%	-6	-8	-9	-10	-12	-13	-14
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	5	5	4	4	4	3	2
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

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

(단위:백만원)

766

공시일	2020-01-17
기준일	2020-01-16

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

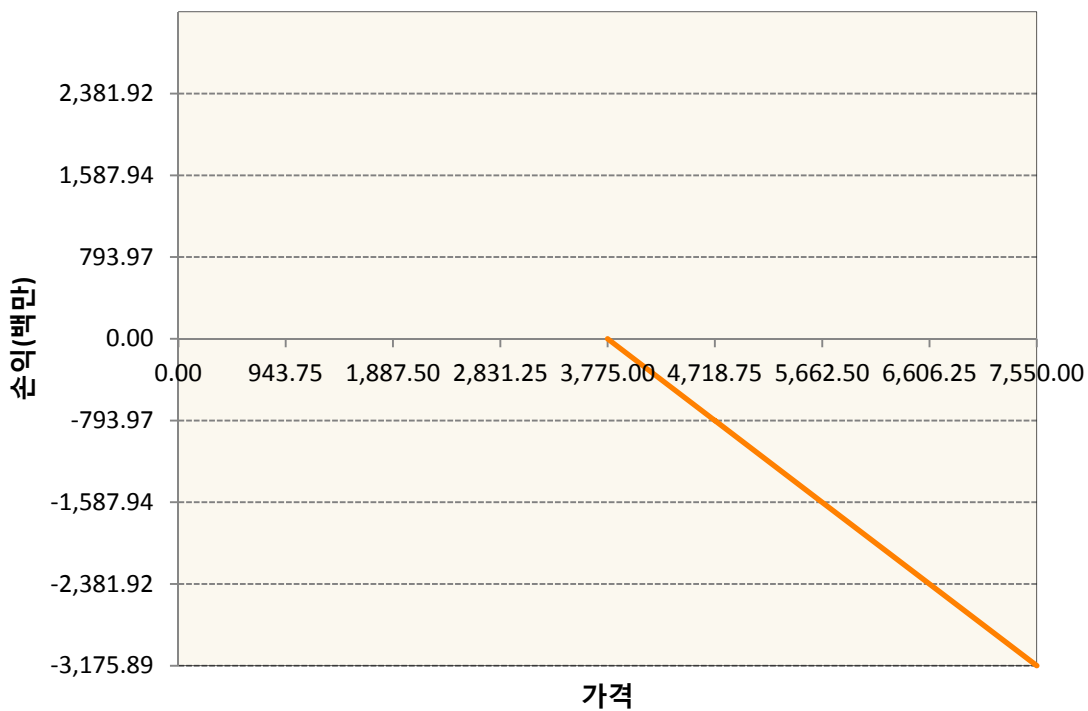
1. 계약금액

(단위:백만원)

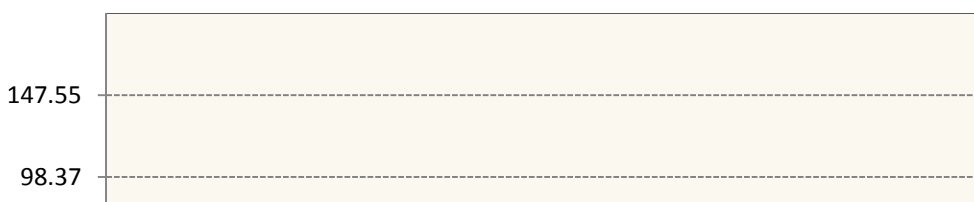
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	292	0	292	
누계	유가증권	스왑	15,720	0	15,720	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,745	-6,745	장내
누계	통화	선도	0	3,396	-3,396	장외

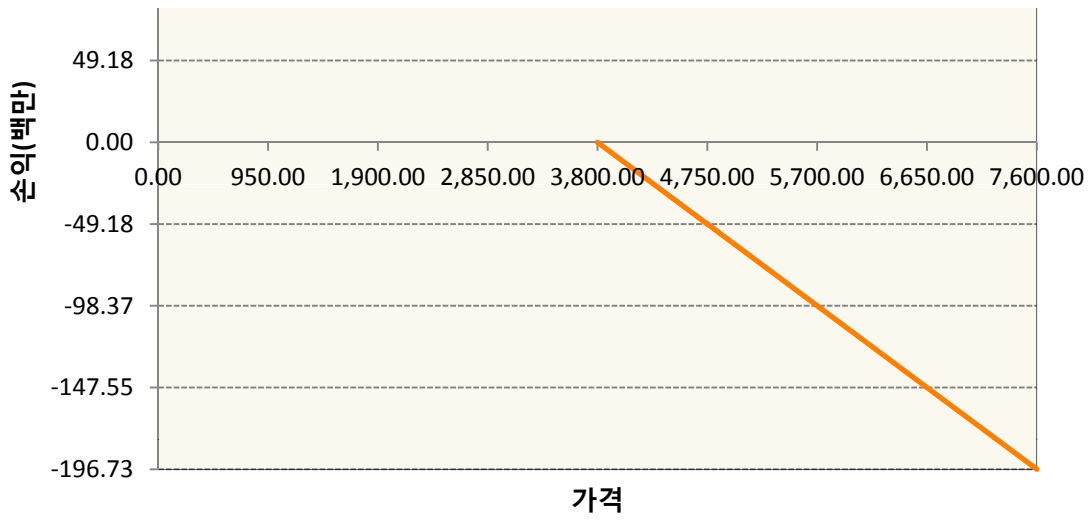
2. 만기시점의 손익구조

OESXF0-C3775-EURO STOXX 50

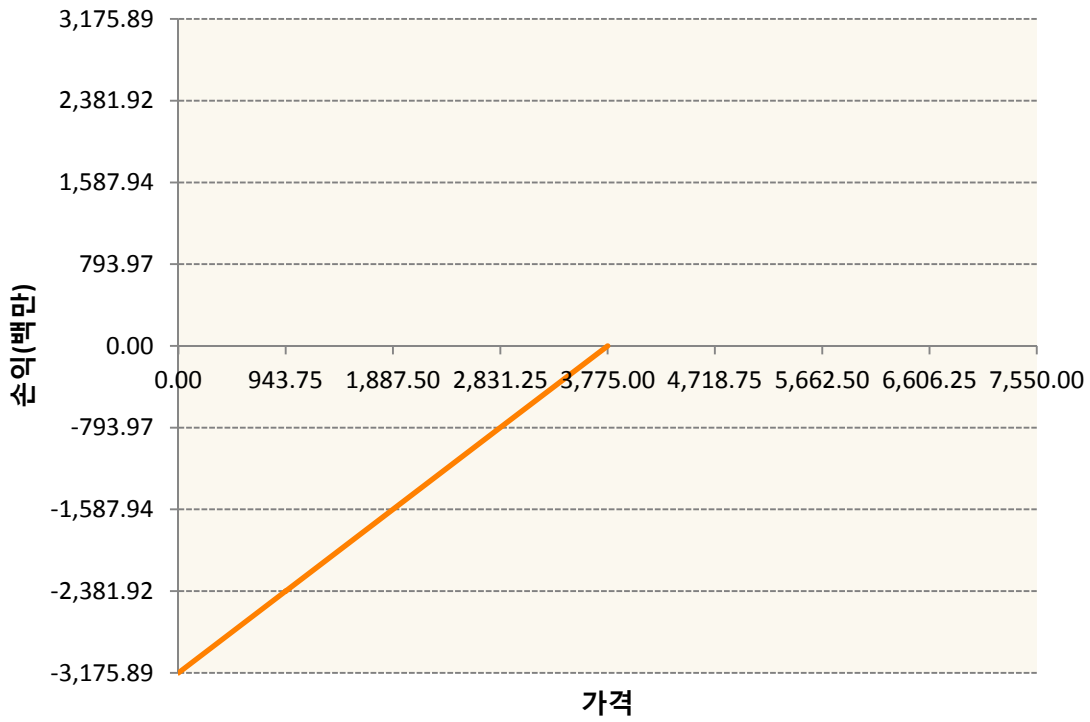


OESXF0-C3800-EURO STOXX 50

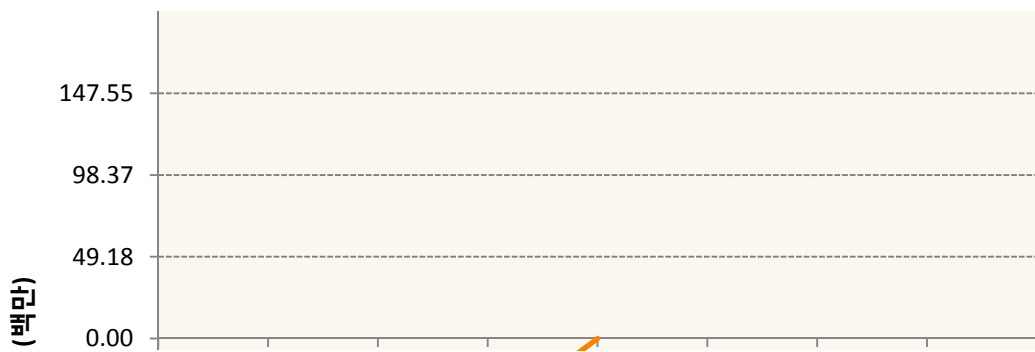


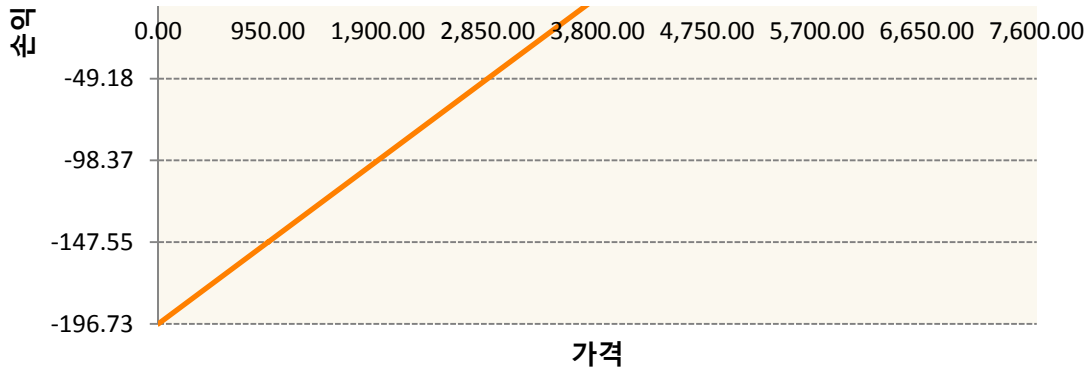


OESXF0-P3775-EURO STOXX 50

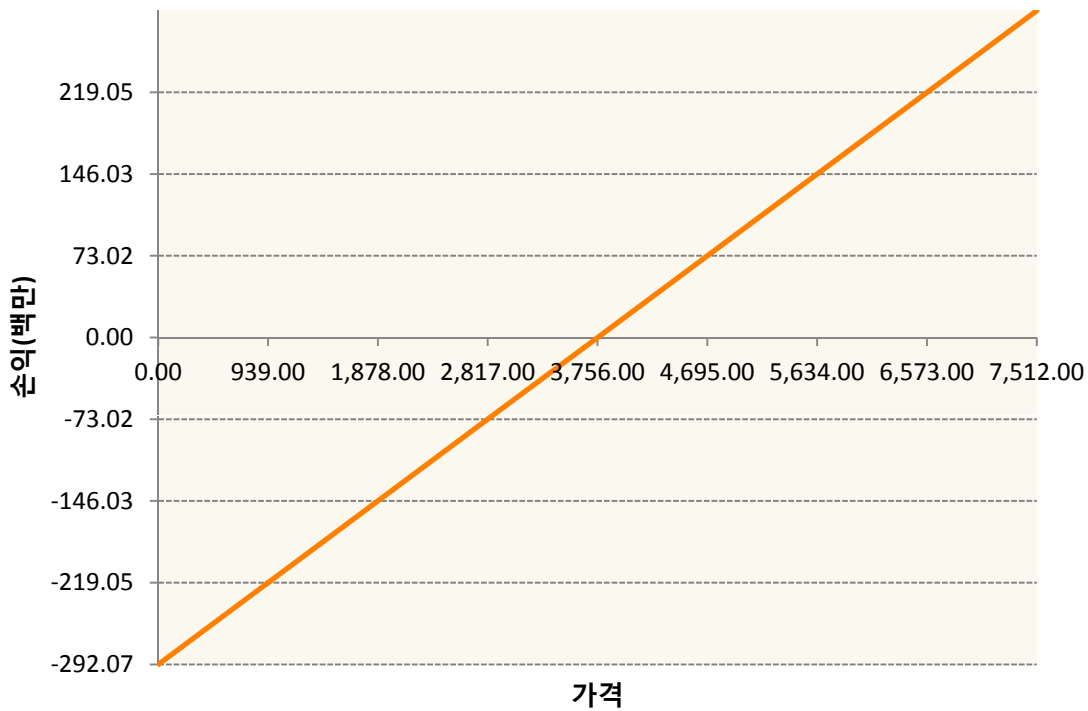


OESXF0-P3800-EURO STOXX 50





VGH0-EURO STOXX 50 Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		43
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E		272
OESXF0-C37 EURO STOXX 50		254
OESXF0-C38 EURO STOXX 50		16
OESXF0-P37 EURO STOXX 50		254
OESXF0-P38 EURO STOXX 50		16
VGH0	EURO STOXX 50 Mar20	23

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

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

(단위:백만원)

933

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

(단위:백만원)

80

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

(단위:백만원)

117

공시일	2020-01-17
기준일	2020-01-16

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

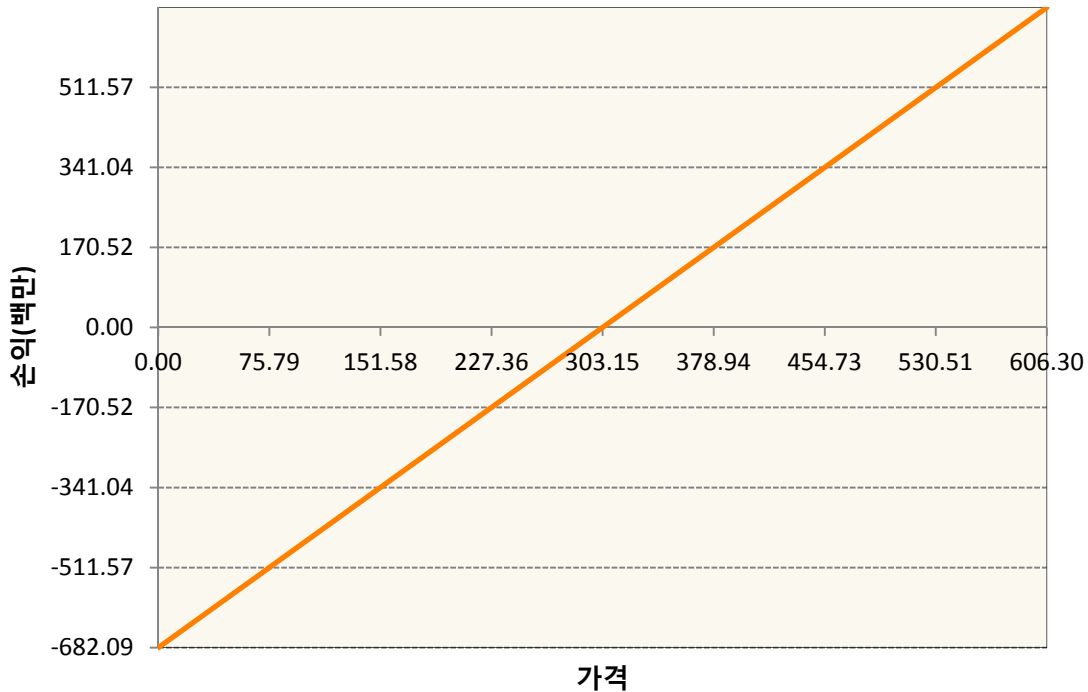
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	682	0	682	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005 2020-03 코스피200지수선물 55

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-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%	55	55	55	55	55	55	55

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

(단위:백만원)

42

공시일	2020-01-17
기준일	2020-01-16

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

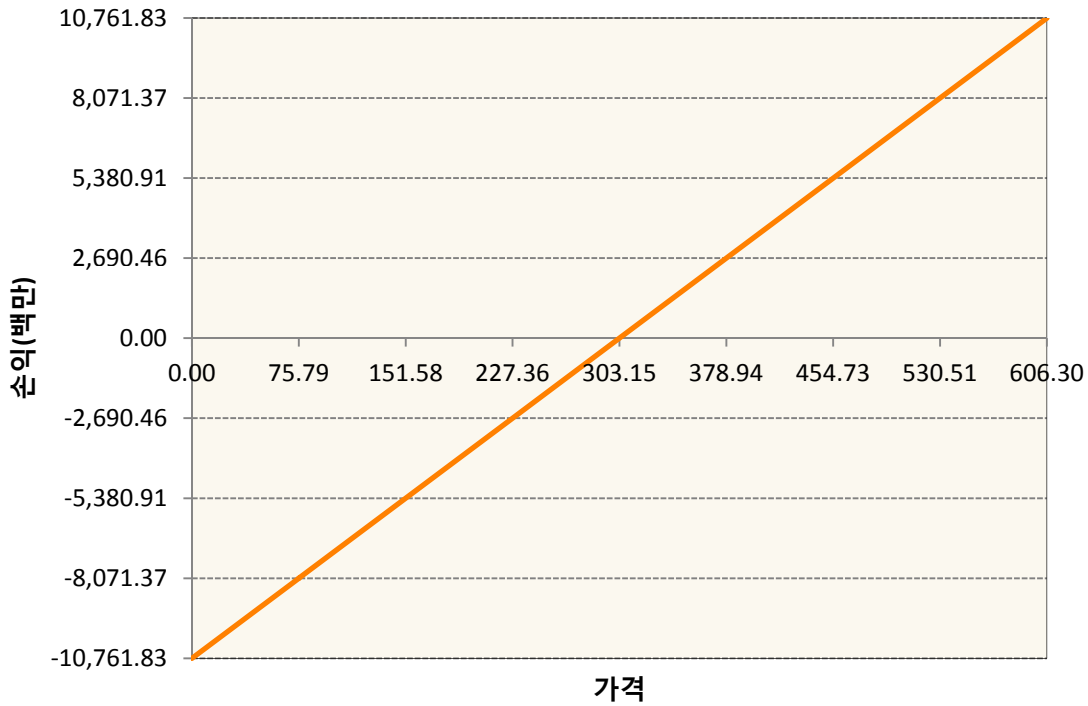
1. 계약금액

(단위:백만원)

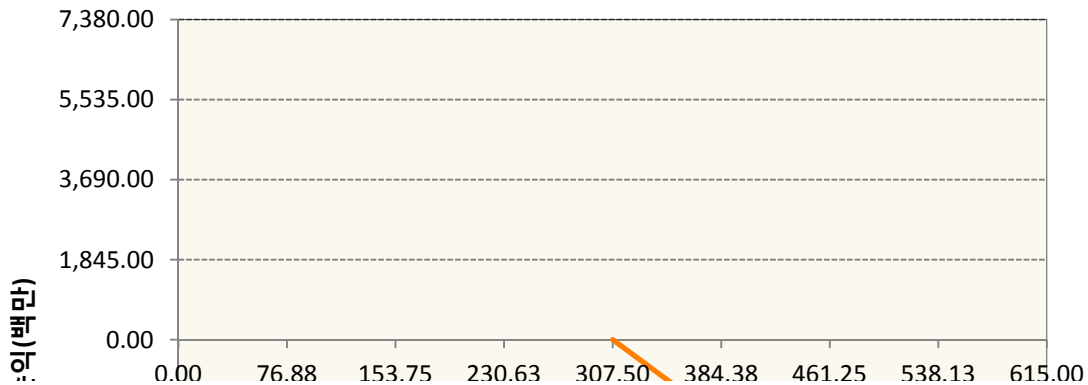
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,762	0	10,762	장내
누계	유가증권	옵션	2,944	21,175	-18,231	장내

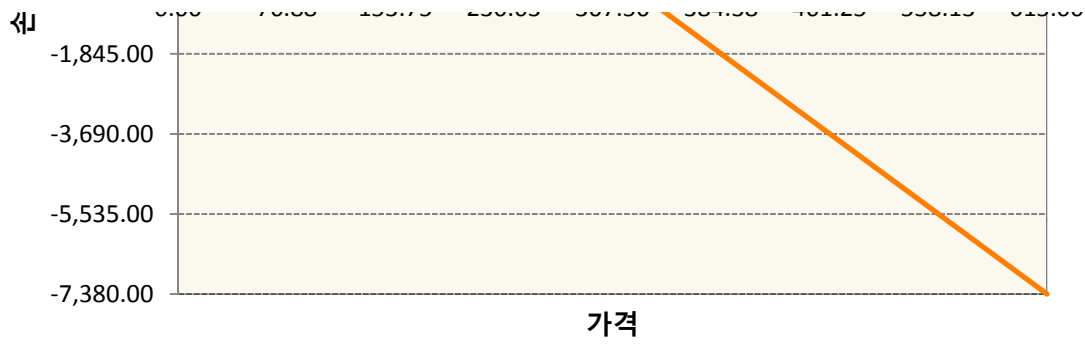
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

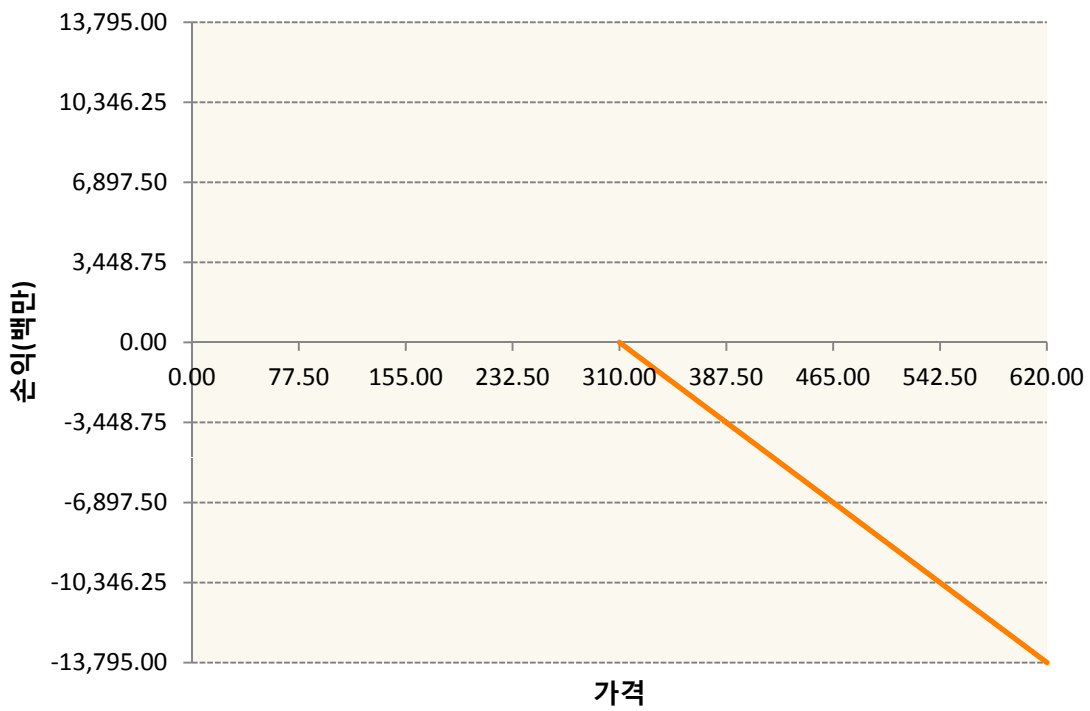


KR4201Q23073-2020-02 콜307.5

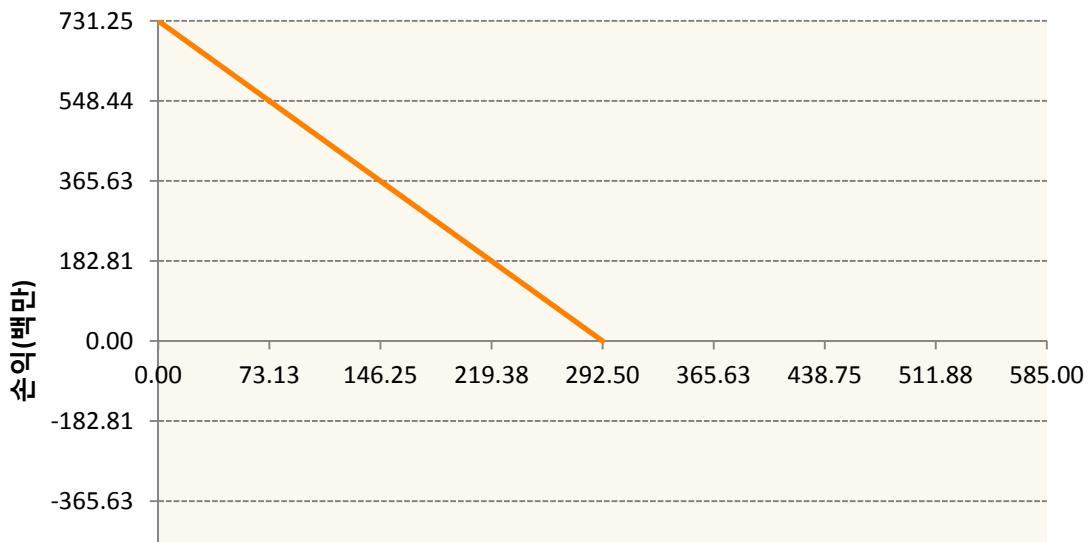


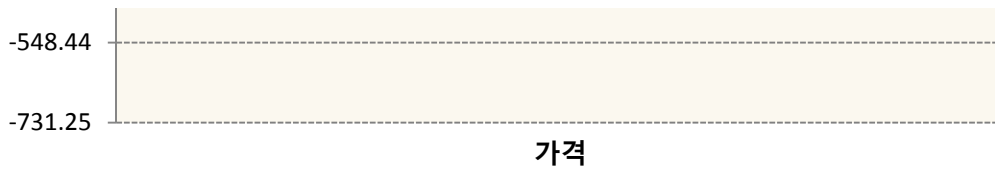


KR4201Q23107-2020-02 콜310

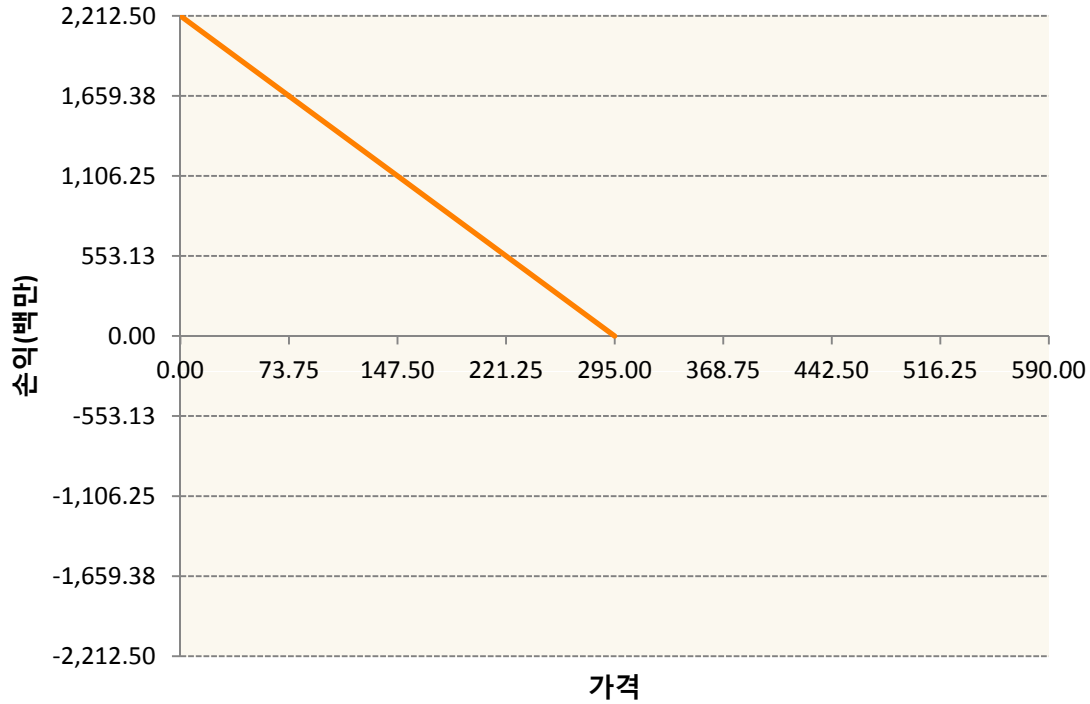


KR4301Q22925-2020-02 풋292.5





KR4301Q22958-2020-02 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						860
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-860	-860	-860	-860	-860	-860	-860	
-5.33%	-573	-573	-573	-573	-573	-573	-573	
-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%	573	573	573	573	573	573	573	
8.00%	860	860	860	860	860	860	860	
KR4201Q23073		2020-02 콜307.5						412
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	180	174	166	157	147	136	124	
-5.33%	162	150	138	125	110	96	80	
-2.67%	124	108	91	74	56	38	20	

0%	59	40	20	0	-20	-40	-60
2.67%	-37	-57	-77	-98	-118	-139	-159
5.33%	-164	-182	-200	-219	-238	-258	-277
8.00%	-317	-331	-346	-361	-378	-395	-412
KR4201Q23107 2020-02 콜310							731
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	296	286	274	259	242	223	202
-5.33%	269	251	230	207	183	157	130
-2.67%	211	183	154	124	92	60	27
0%	107	72	36	0	-36	-73	-110
2.67%	-53	-91	-129	-168	-206	-244	-282
5.33%	-272	-307	-343	-379	-416	-453	-490
8.00%	-541	-570	-600	-631	-664	-697	-731
KR4301Q22925 2020-02 풋292.5							35
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	33	33	33	33	34	34	35
-5.33%	15	16	16	17	18	19	19
-2.67%	3	4	5	6	7	7	8
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-1	-1
5.33%	-3	-3	-3	-2	-2	-2	-2
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-2
KR4301Q22958 2020-02 풋295							117
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	112	113	113	114	115	116	117
-5.33%	56	57	59	61	63	65	67
-2.67%	14	17	19	22	25	27	30
0%	-6	-4	-2	0	2	4	7
2.67%	-11	-10	-10	-9	-8	-6	-5
5.33%	-12	-11	-11	-11	-11	-10	-10
8.00%	-12	-12	-12	-12	-11	-11	-11

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

(단위:백만원)

1,727

공시일	2020-01-17
기준일	2020-01-16

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	206,175	0	206,175	

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	2020-01-17
기준일	2020-01-16

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	215,211	0	215,211	

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	2020-01-17
기준일	2020-01-16

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	531,246	0	531,246	
누계	통화	선도	0	517,967	-517,967	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E	1,393
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E	1,495
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E	1,858
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E	3,195
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E	4,737
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	186
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,787
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,787
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,322
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,508
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	1,616
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	1,523
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	929
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	186
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	1,988
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	929
FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E	3,716
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,858
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,988
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	186
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	186
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	1,115
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	1,672
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	279

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

13,642

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

(단위:백만원)

214

공시일	2020-01-17
기준일	2020-01-16

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

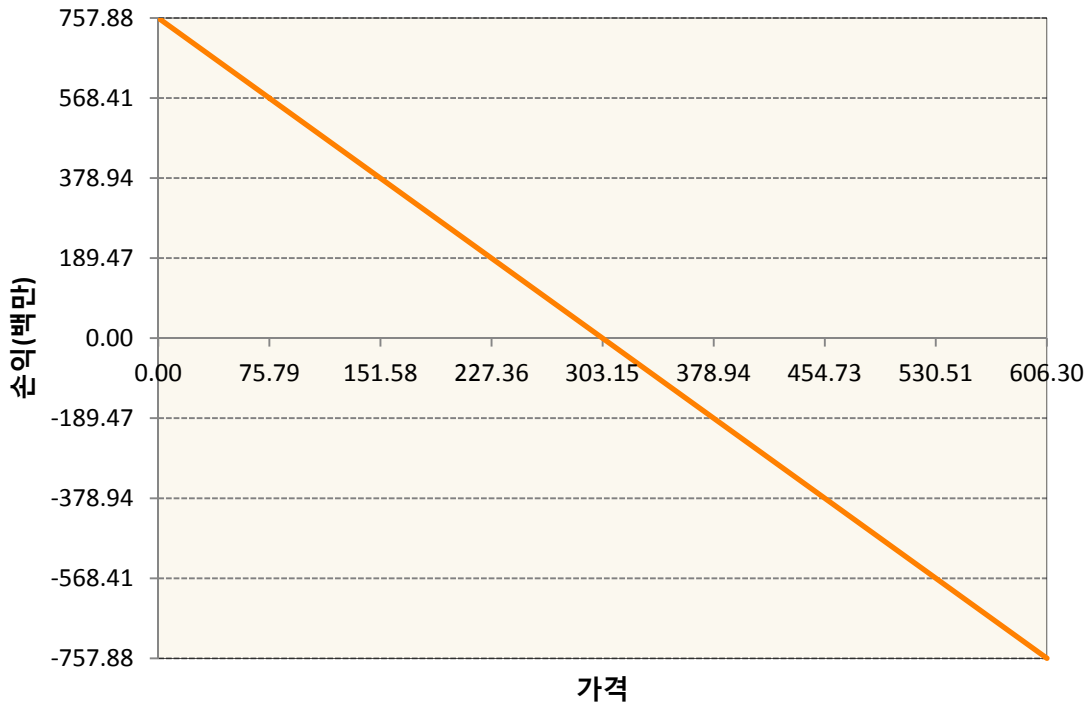
1. 계약금액

(단위:백만원)

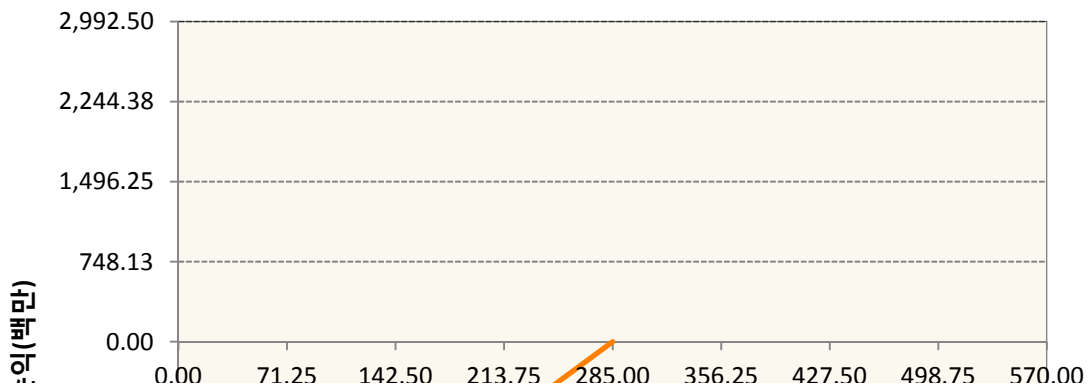
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	758	-758	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,855	-3,855	장내

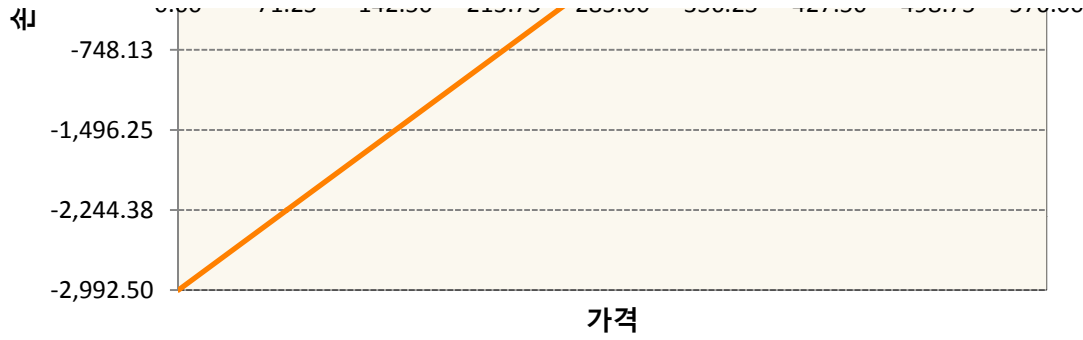
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

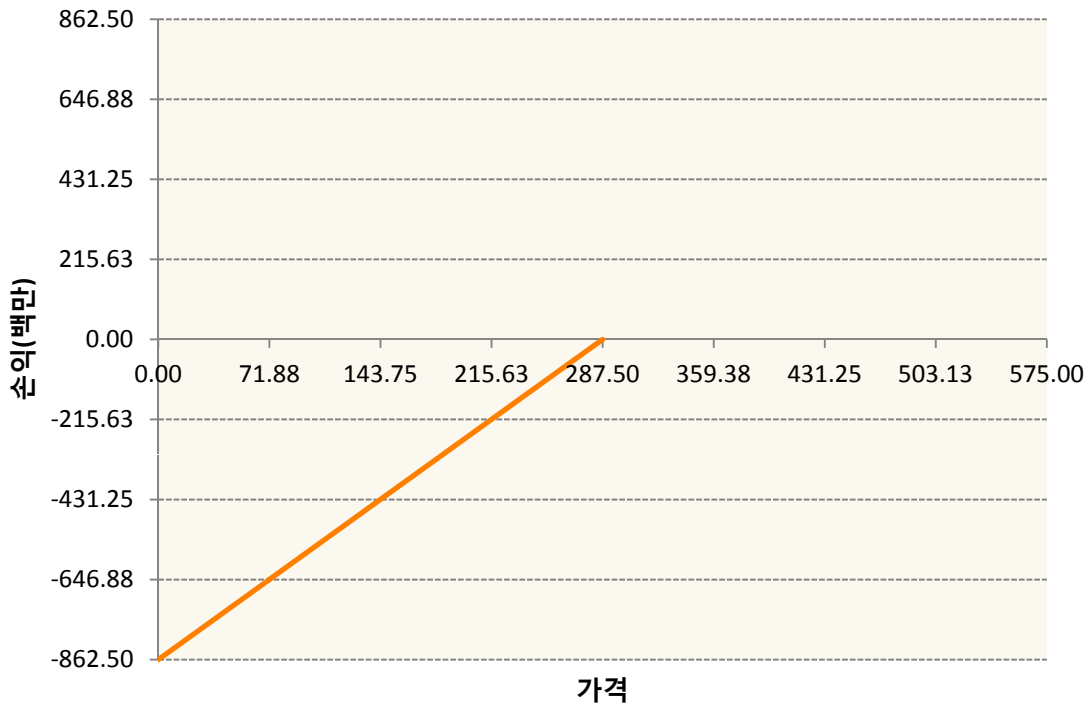


KR4301Q22859-2020-02 풋285





KR4301Q22875-2020-02 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						61
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	61	61	61	61	61	61	61	
-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%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61	
KR4301Q22859		2020-02 풋285						92
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-75	-77	-80	-83	-86	-89	-92
-5.33%	-23	-26	-30	-34	-37	-41	-45
-2.67%	-2	-4	-6	-9	-11	-14	-17
0%	2	2	1	0	-1	-2	-4
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

KR4301Q22875 2020-02 풋287.5 31

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-27	-28	-28	-29	-30	-31	-31
-5.33%	-10	-11	-12	-13	-14	-15	-16
-2.67%	-1	-2	-3	-4	-4	-5	-6
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	1	1	1	1	1	1	0
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)

114

공시일	2020-01-17
기준일	2020-01-16

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	13,293	0	13,293	
누계	통화	선도	0	13,062	-13,062	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E	288
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	289
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	344
FX21020F00! KRW/USD 13-02-20E	124
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

344

공시일	2020-01-17
기준일	2020-01-16

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

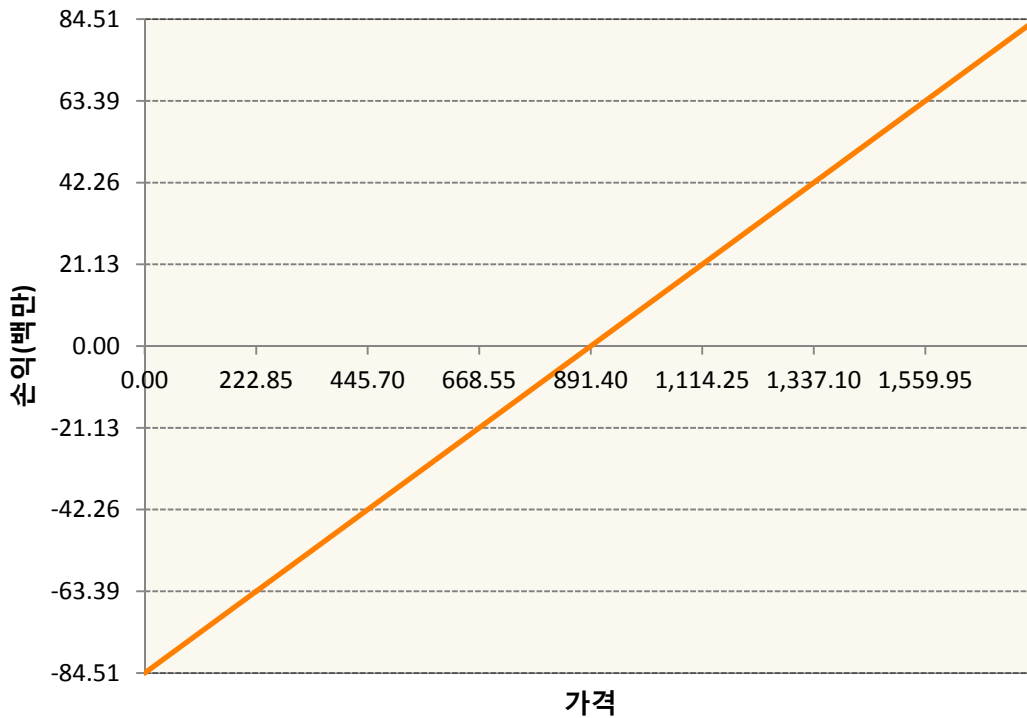
1. 계약금액

(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	85	0	85	
누계	유가증권	스왑	2,016	0	2,016	장외
누계	통화	선도	311	815	-505	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCG0-VN30 Index Future Feb20



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
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)

151

공시일	2020-01-17
기준일	2020-01-16

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

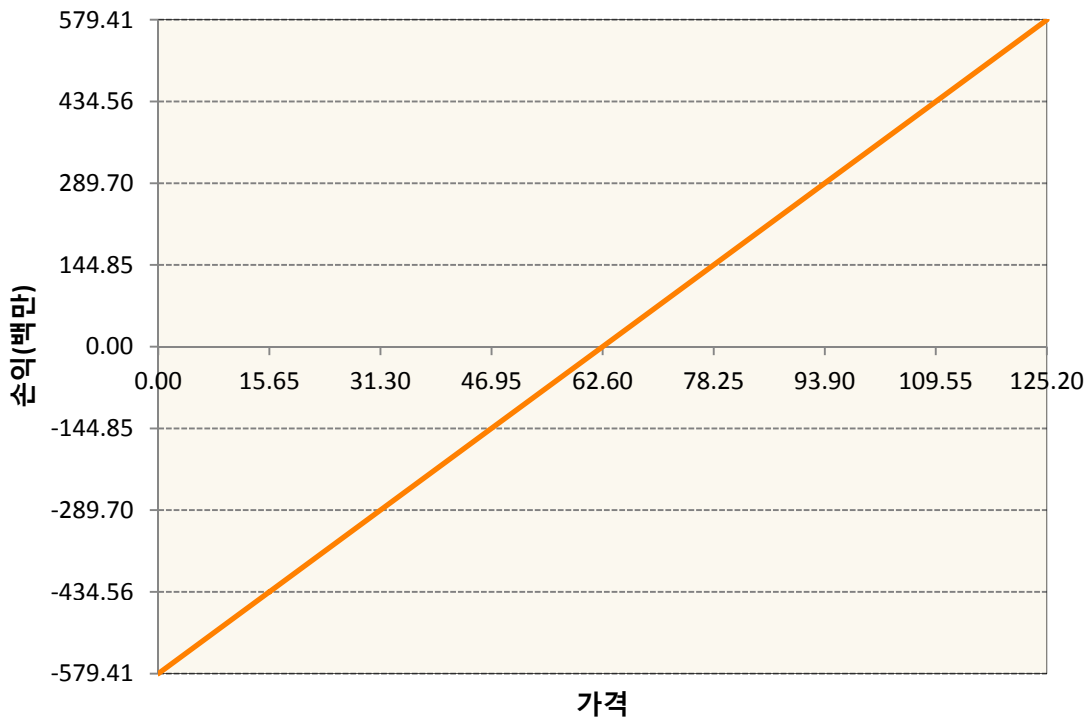
1. 계약금액

(단위:백만원)

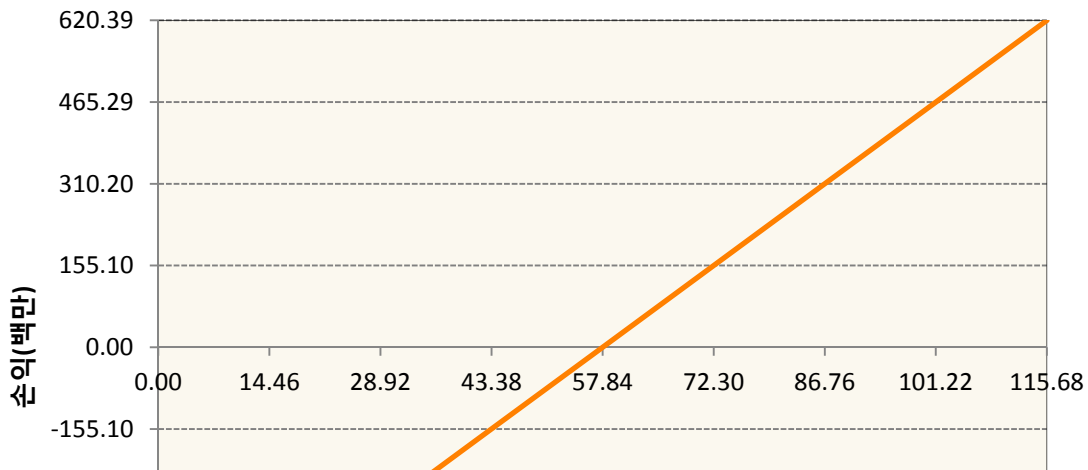
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,386	290	2,096	

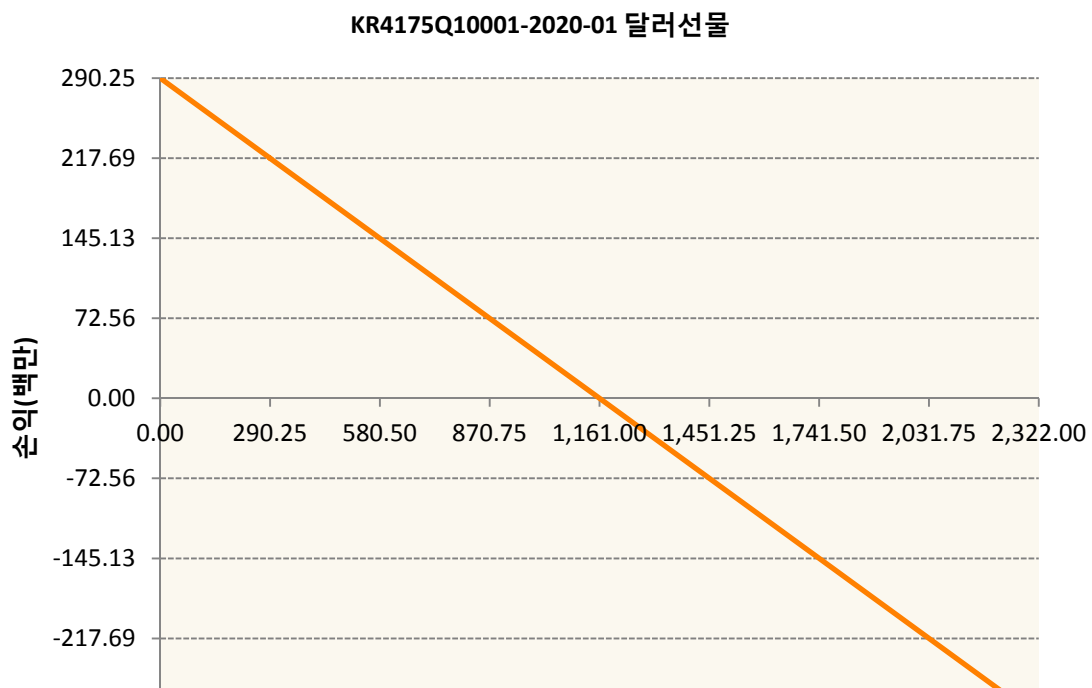
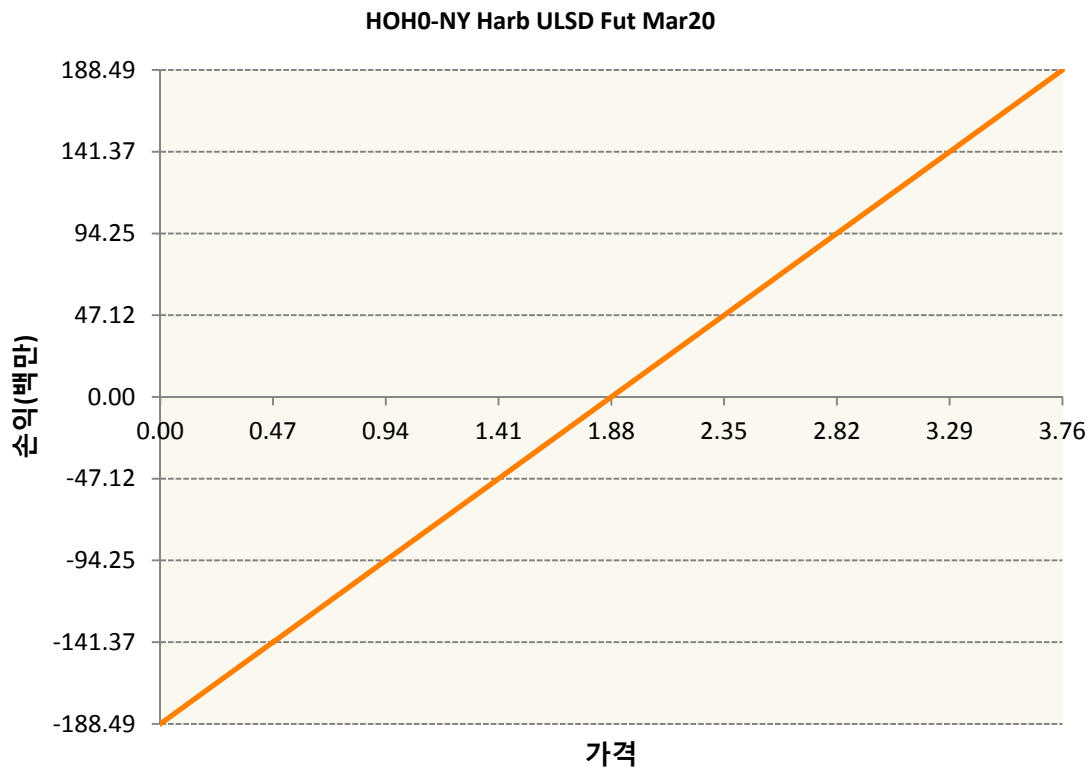
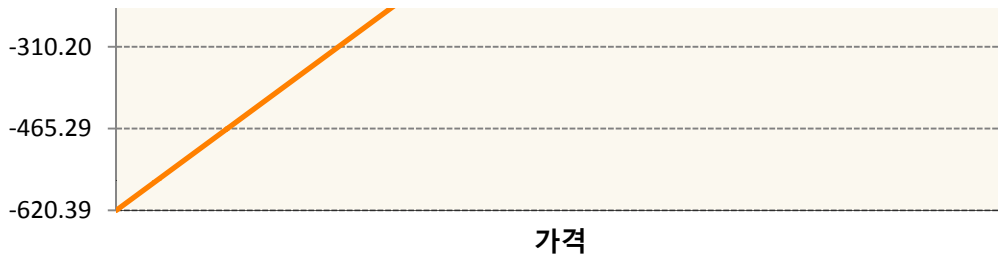
2. 만기시점의 손익구조

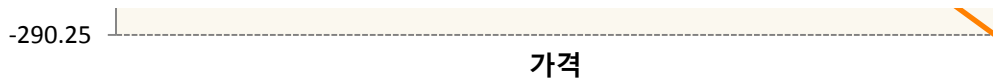
COKO-BRENT CRUDE FUTR May20



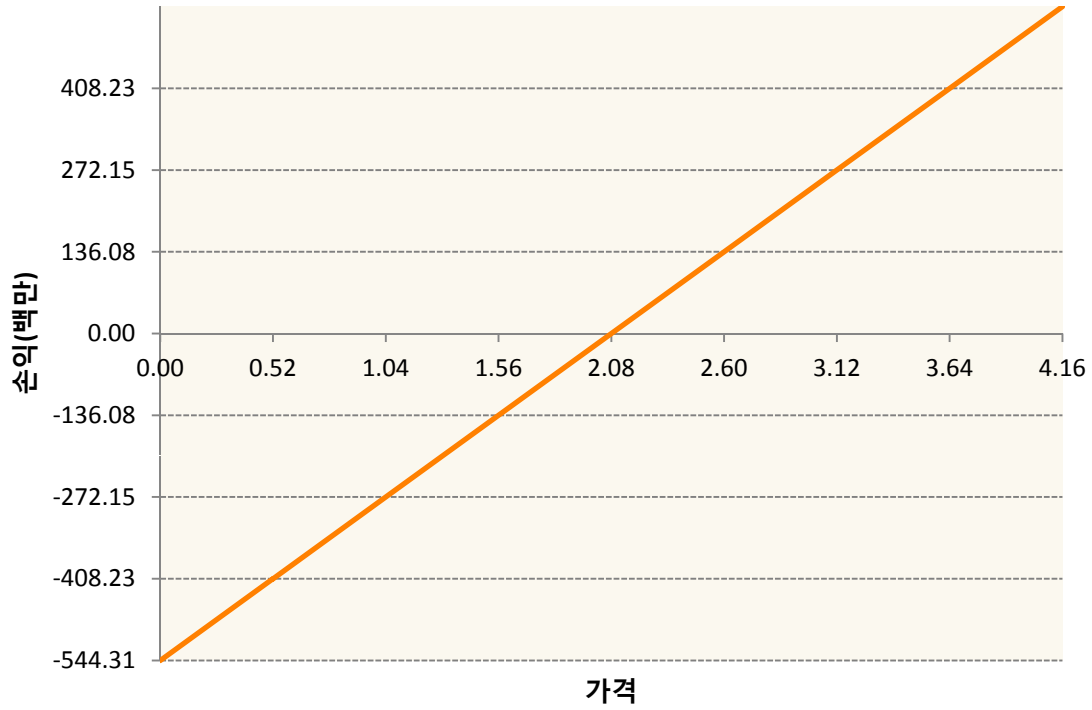
CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20



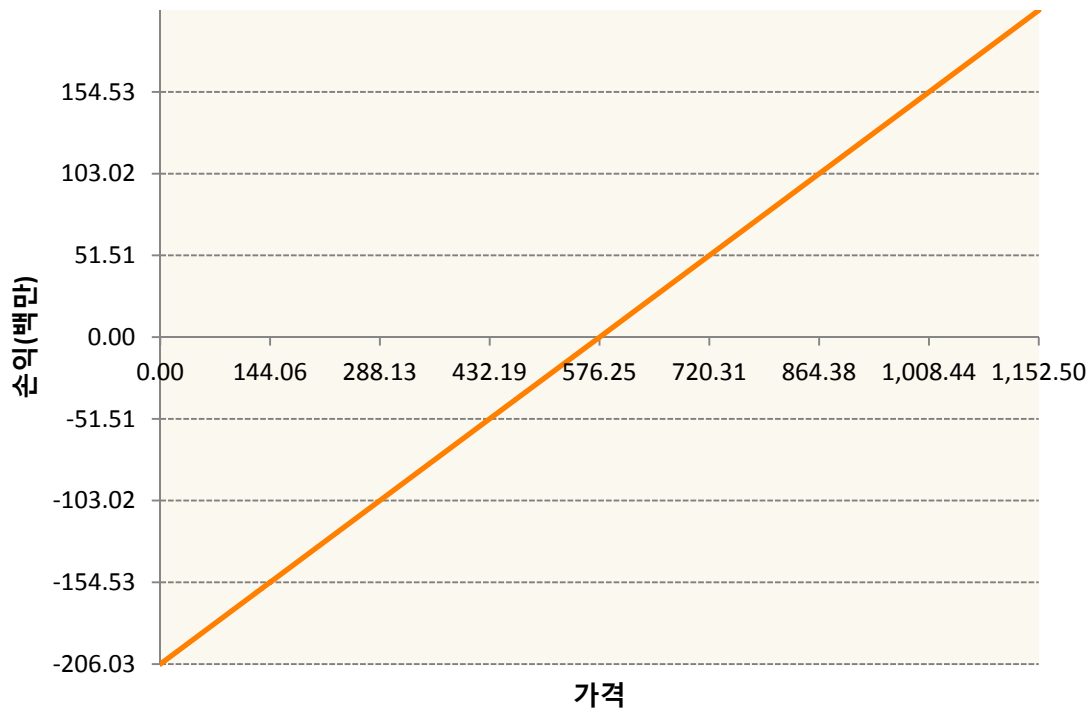




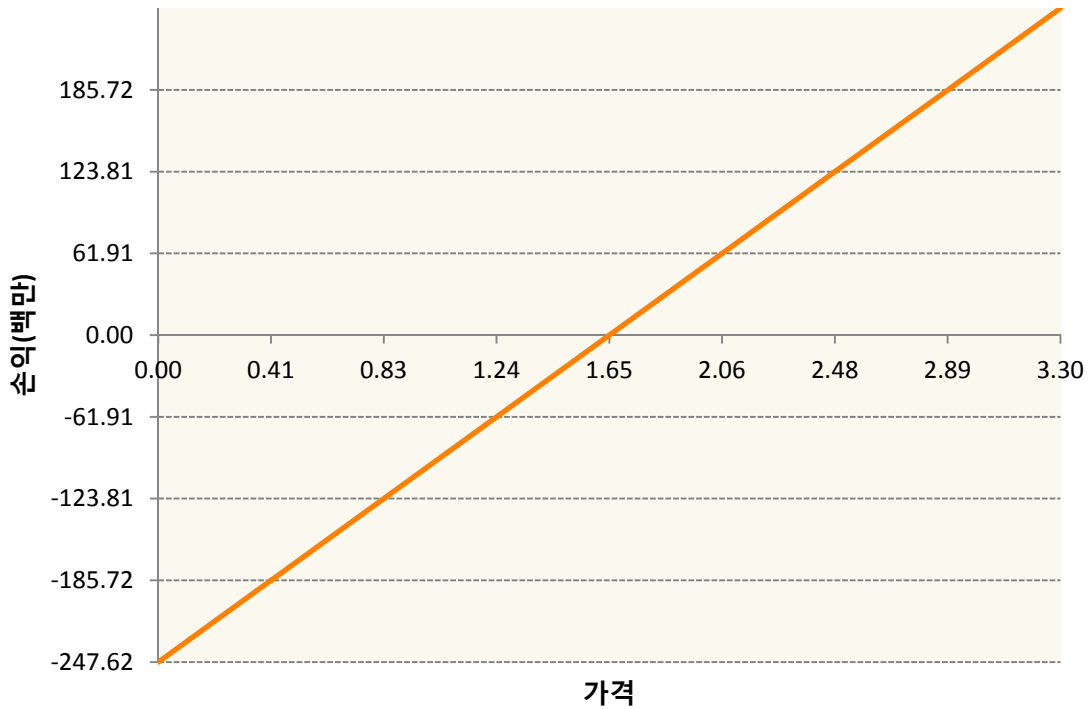
NGH20-NATURAL GAS FUTR Mar20



QSH0-Low Su Gasoil G Mar20



XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	46
CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	50
HOH0	NY Harb ULSD Fut Mar20	15
KR4175Q10C	2020-01 달러선물	23
NGH20	NATURAL GAS FUTR Mar20	44
QSH0	Low Su Gasoil G Mar20	16
XBH0	GASOLINE RBOB FUT Mar20	20

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

372

공시일	2020-01-17
기준일	2020-01-16

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

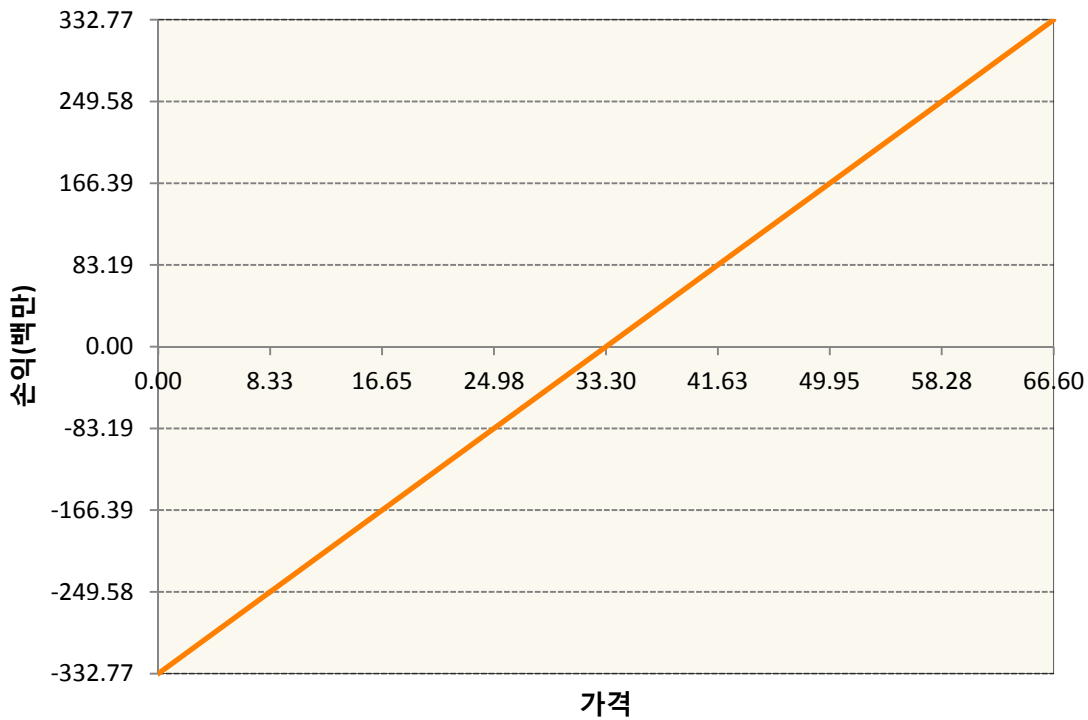
1. 계약금액

(단위:백만원)

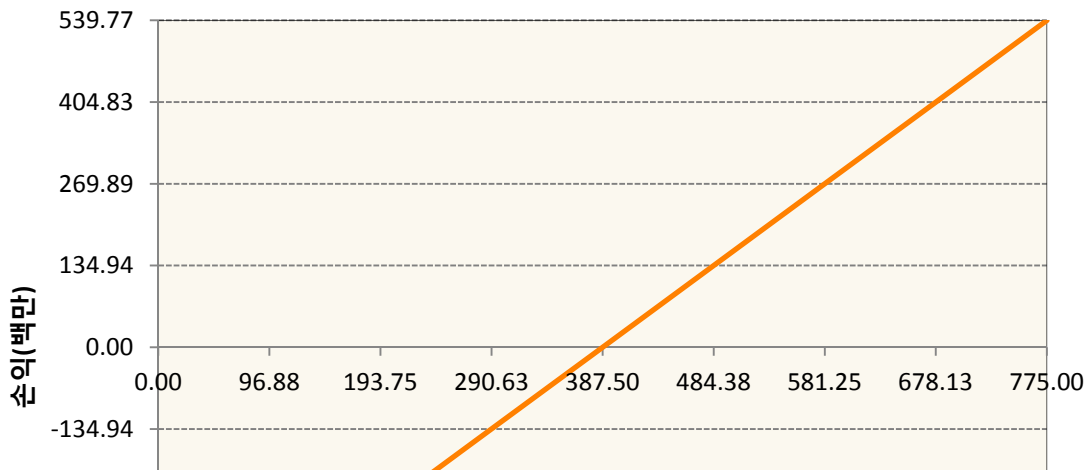
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,845	151	2,694	

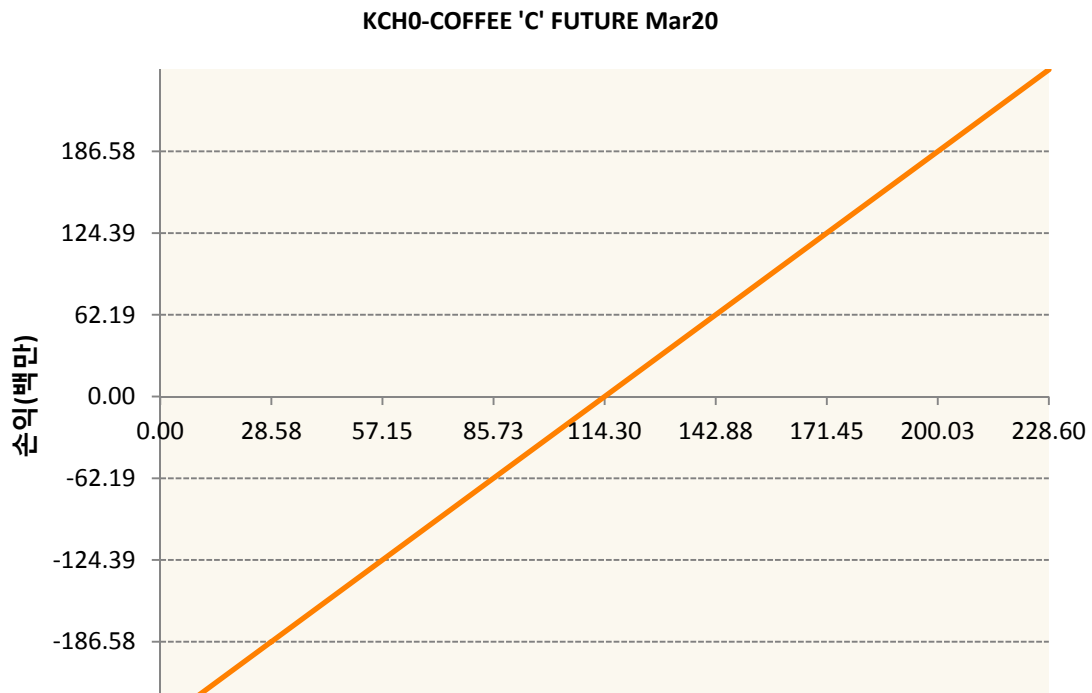
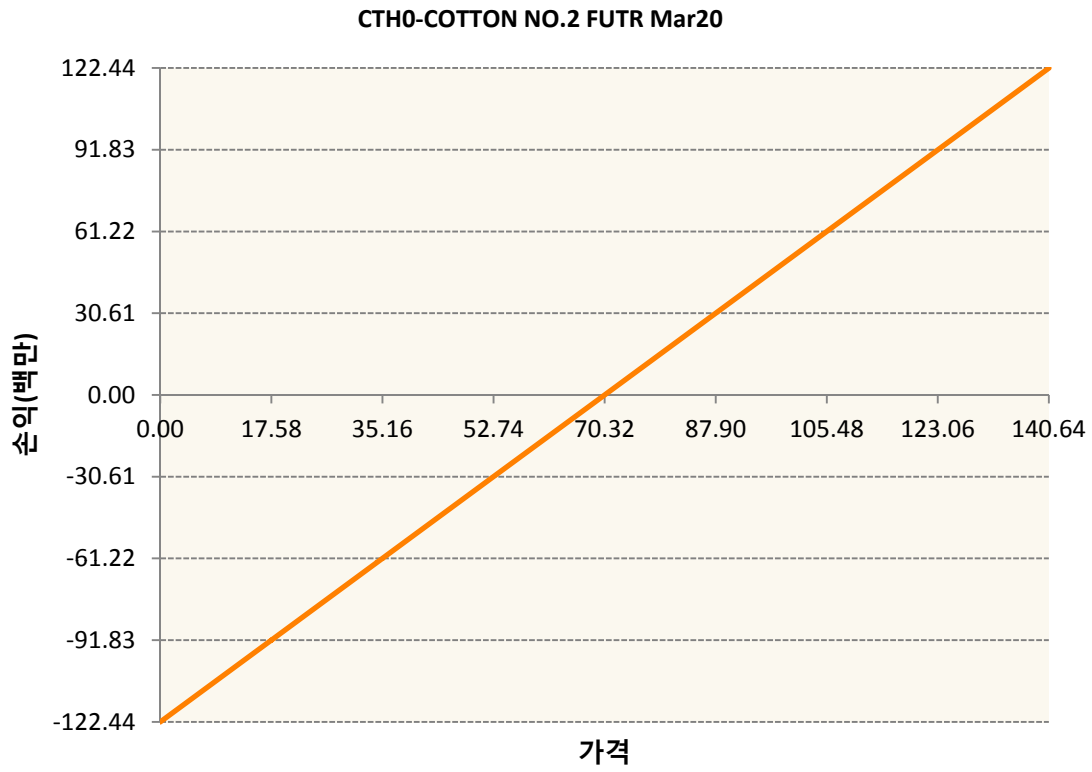
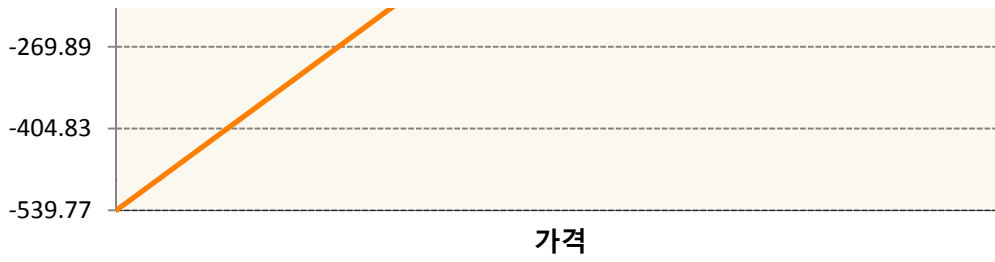
2. 만기시점의 손익구조

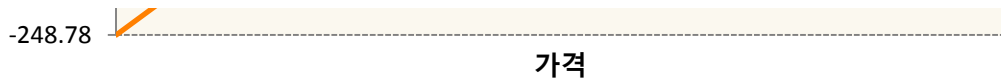
BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20



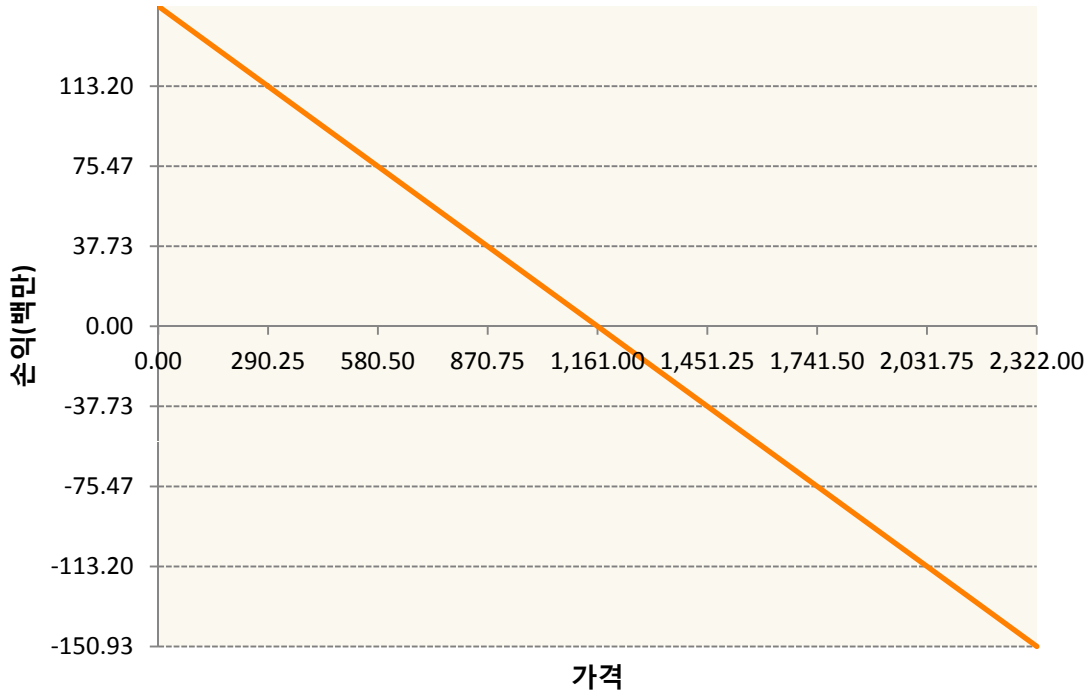
CH0-CORN FUTURE Mar20



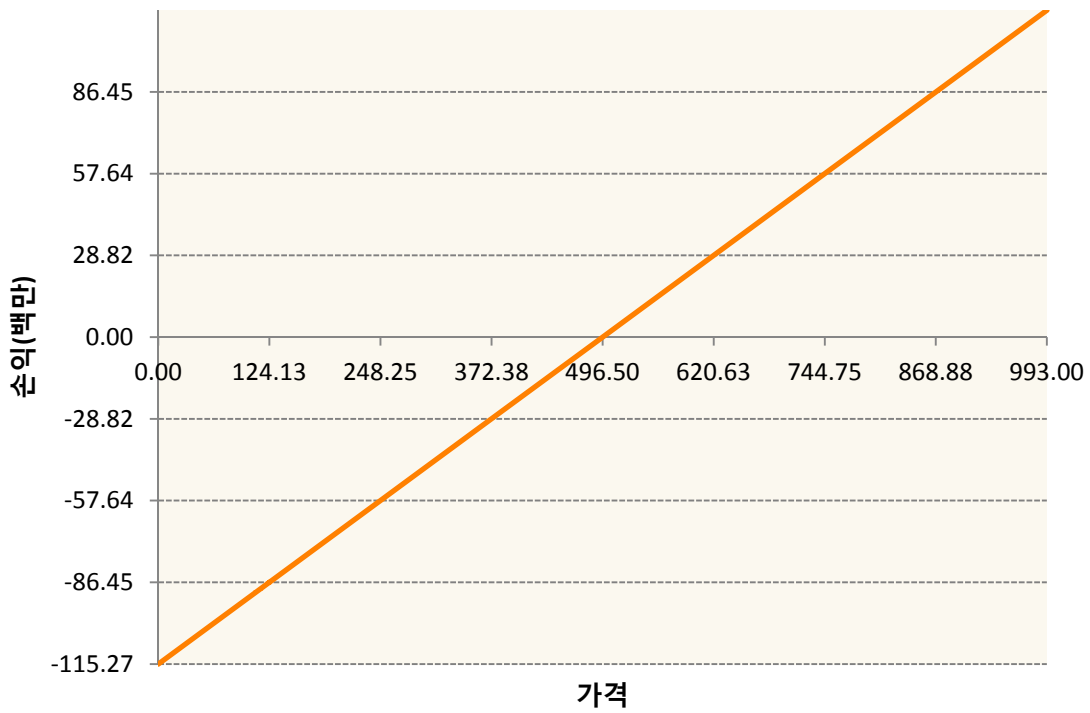




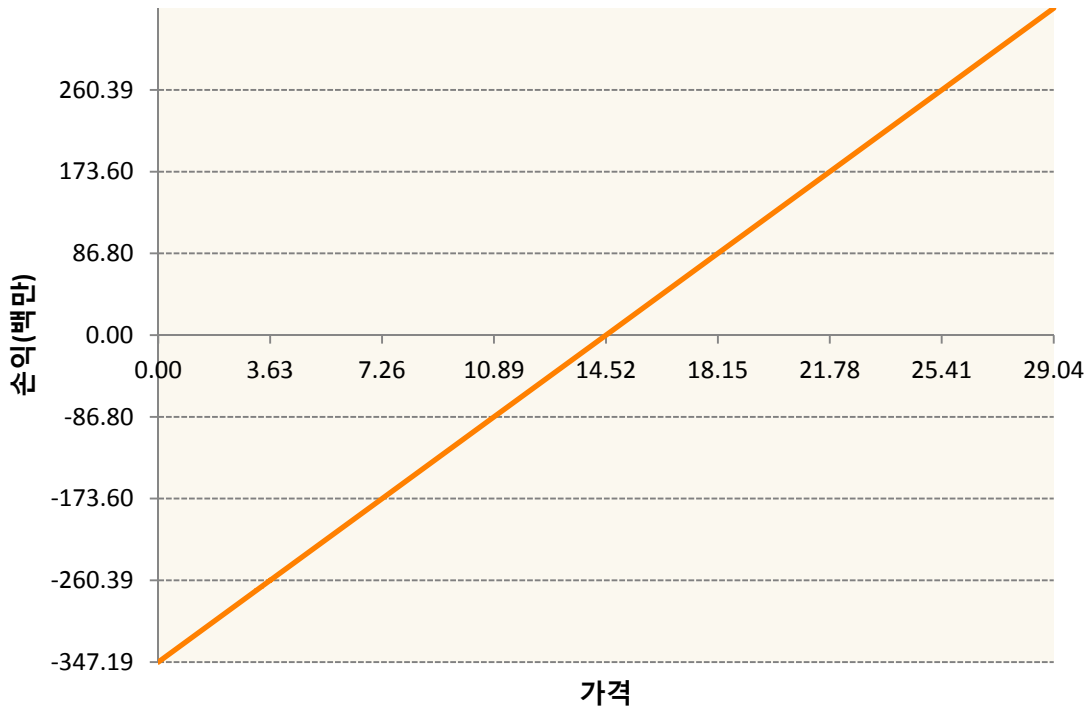
KR4175Q10001-2020-01 달러선물



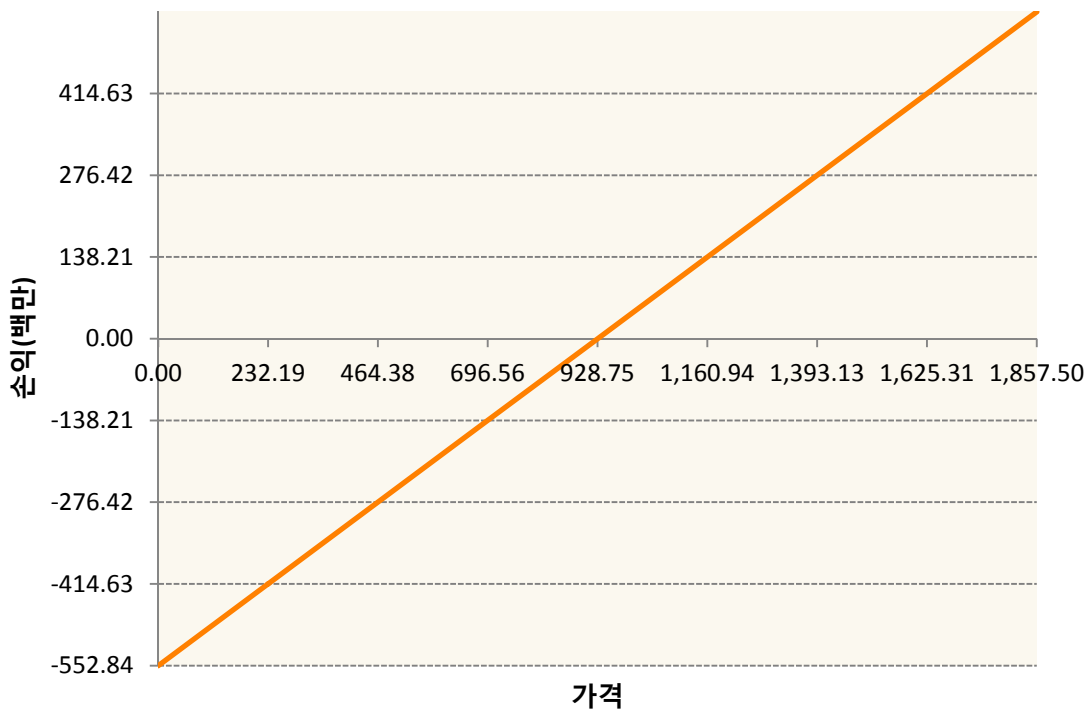
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



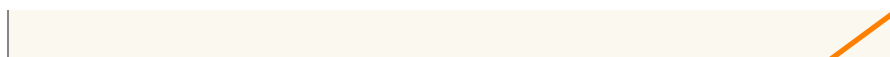
SBH0-Sugar Mar20

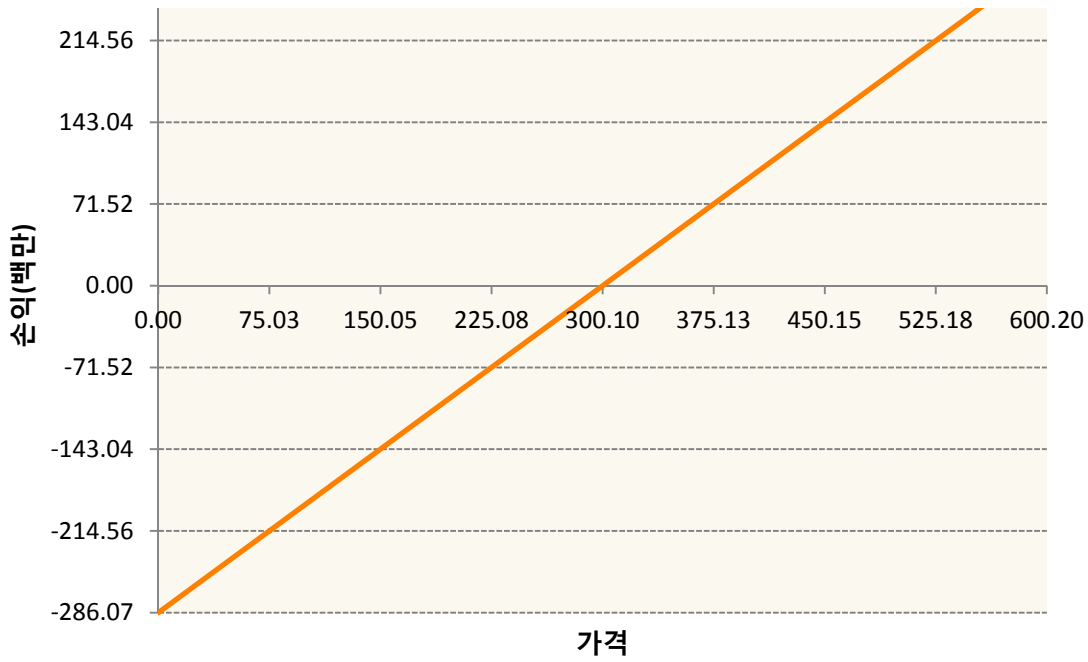


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20

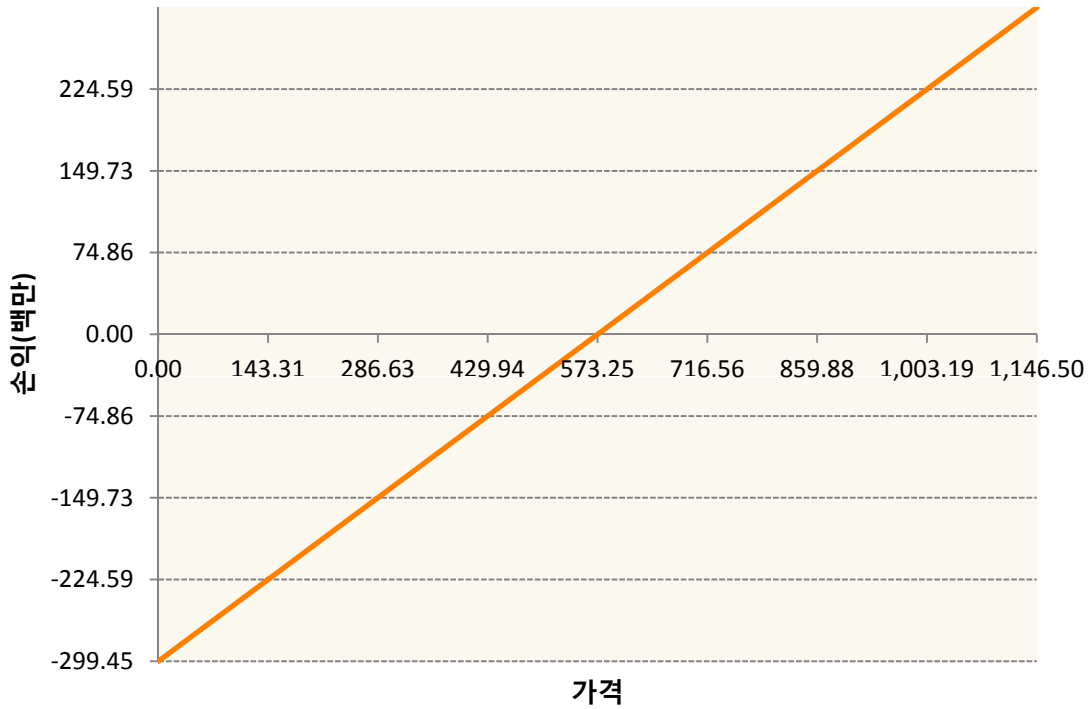


SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





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	28
SH0	SOYBEAN FUTURE Mar20	44
SMH0	SOYBEAN MEAL FUTR Mar20	23
WH0	WHEAT FUTURE(CBT) Mar20	24

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

(단위:백만원)

247