

공시일	2020-01-20
기준일	2020-01-17

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	2020-01-20
기준일	2020-01-17

스마트인덱스모

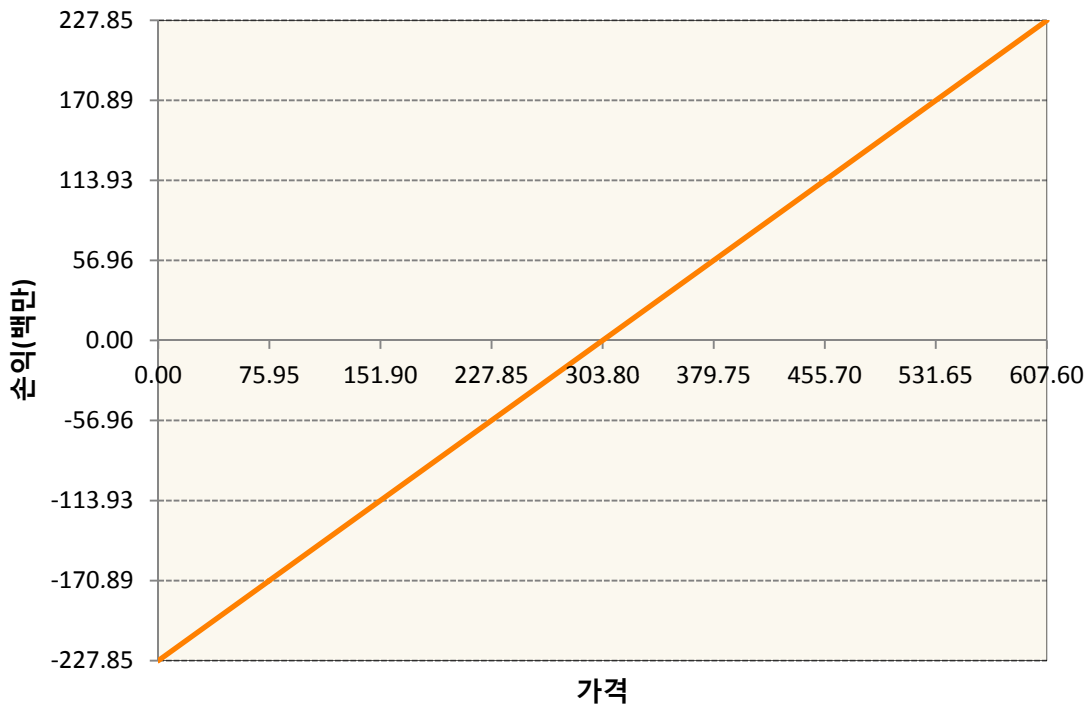
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	228	0	228	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	2020-01-20
기준일	2020-01-17

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

1,151

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

659

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-20
기준일	2020-01-17

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)

819

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-20
기준일	2020-01-17

유로인덱스모(주식-파생형)

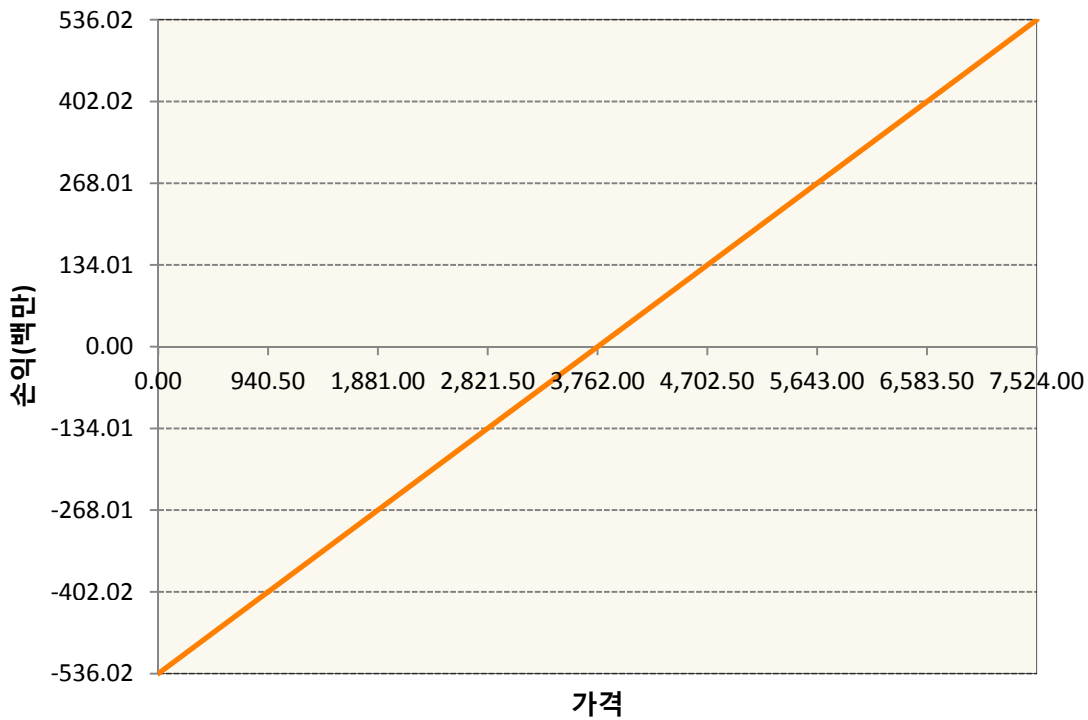
1. 계약금액

(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	2020-01-20
기준일	2020-01-17

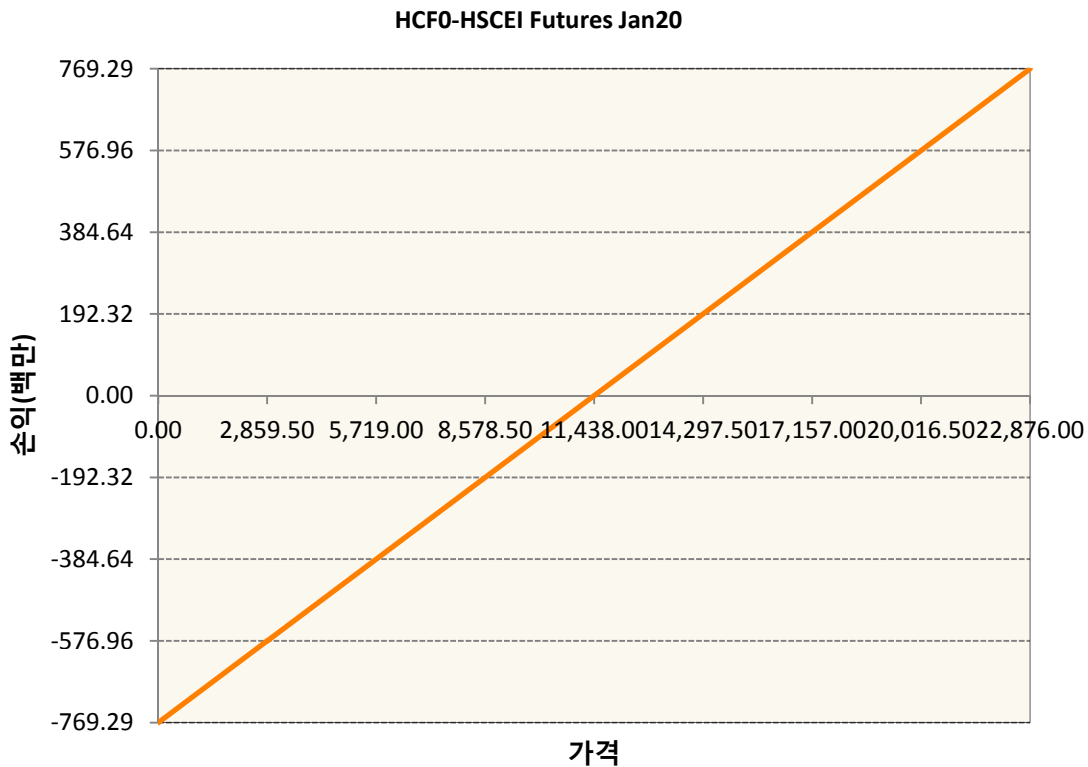
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	769	0	769	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF0	HSCEI Futures Jan20	62
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

54

공시일	2020-01-20
기준일	2020-01-17

커버드콜모(주식혼합-파생형)

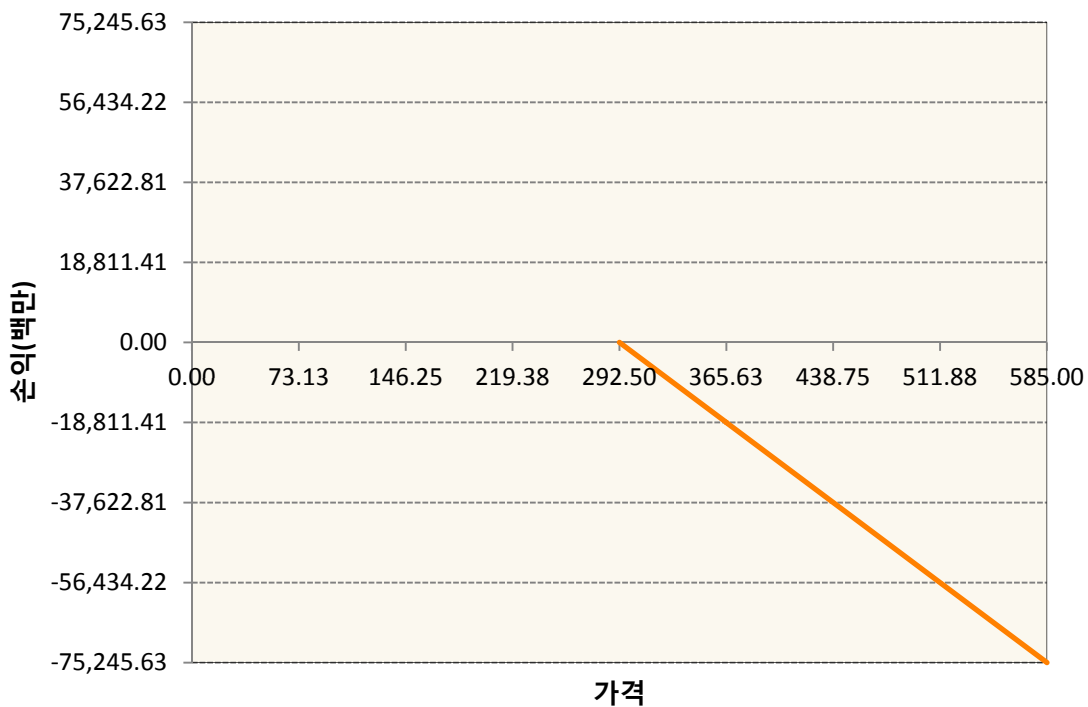
1. 계약금액

(단위:백만원)

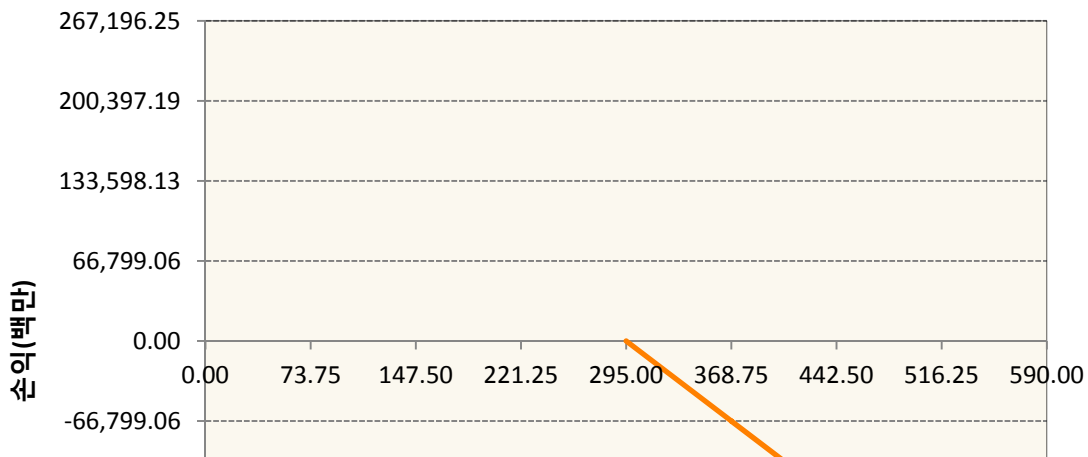
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	6,433	0	6,433	장내
누계	유가증권	옵션	0	462,361	-462,361	장내

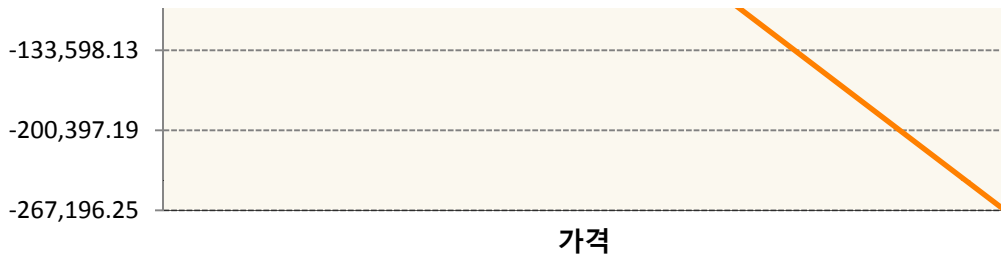
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q22927-2020-02 콜292.5

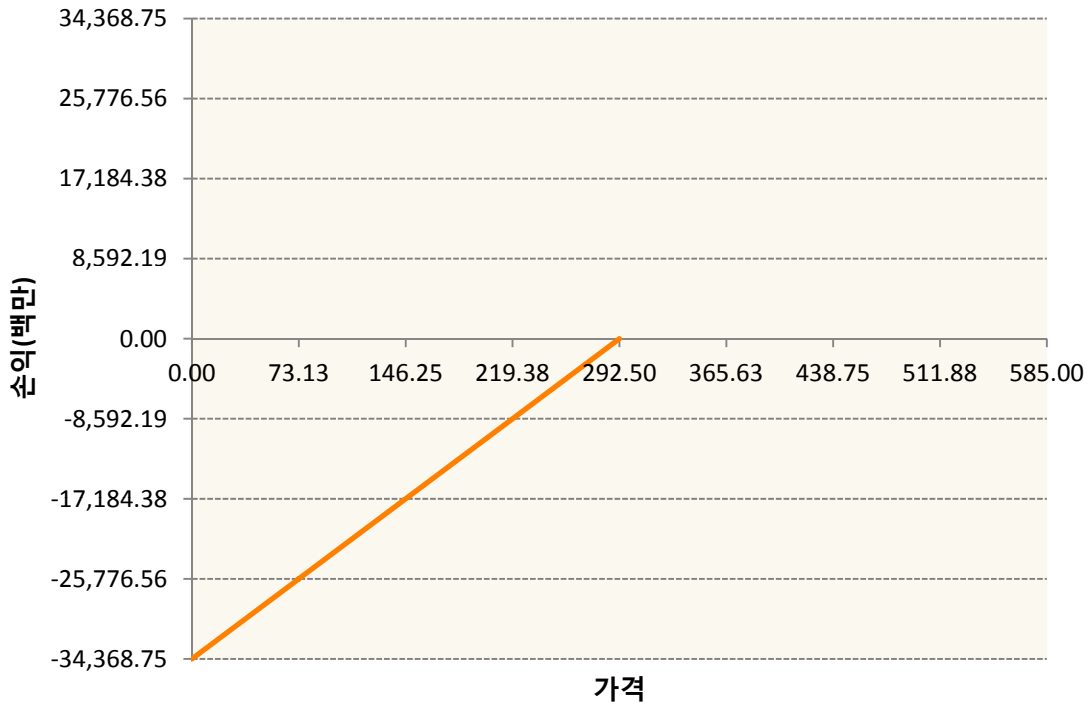


KR4201Q22950-2020-02 콜295

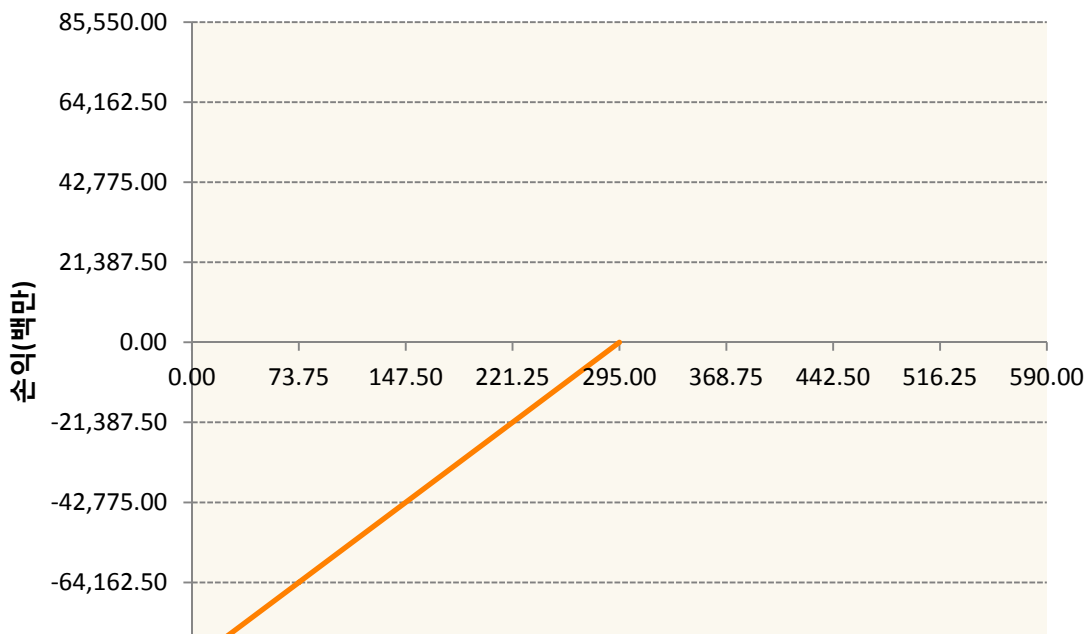




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



KR4301Q22958-2020-02 풋295



-85,550.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q22927		2020-02 콜292.5						5,432
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,551	3,398	3,237	3,071	2,900	2,725	2,547	
-5.33%	2,910	2,716	2,520	2,323	2,126	1,928	1,729	
-2.67%	1,908	1,705	1,502	1,298	1,094	890	686	
0%	548	370	187	0	-190	-382	-577	
2.67%	-1,108	-1,240	-1,384	-1,537	-1,698	-1,865	-2,038	
5.33%	-2,966	-3,051	-3,151	-3,264	-3,389	-3,524	-3,667	
8.00%	-4,944	-4,991	-5,053	-5,129	-5,219	-5,320	-5,432	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						18,656
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	11,497	11,010	10,490	9,942	9,373	8,786	8,185	
-5.33%	9,582	8,927	8,261	7,587	6,907	6,223	5,534	
-2.67%	6,454	5,729	5,003	4,278	3,552	2,827	2,102	
0%	2,045	1,373	691	0	-697	-1,400	-2,107	
2.67%	-3,483	-4,009	-4,570	-5,158	-5,767	-6,394	-7,036	
5.33%	-9,828	-10,182	-10,588	-11,038	-11,526	-12,045	-12,590	
8.00%	-16,678	-16,885	-17,147	-17,461	-17,820	-18,220	-18,656	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						1,596
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,485	-1,497	-1,512	-1,529	-1,549	-1,572	-1,596	
-5.33%	-663	-698	-734	-771	-808	-847	-885	
-2.67%	-133	-174	-215	-256	-298	-340	-382	
0%	70	50	26	0	-28	-58	-90	
2.67%	112	107	100	90	78	63	46	
5.33%	116	115	114	112	108	103	97	
8.00%	116	116	116	116	115	114	112	
KR4301Q22958		2020-02 풋295						4,421
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-4,220	-4,238	-4,262	-4,293	-4,330	-4,373	-4,421	
-5.33%	-2,066	-2,135	-2,209	-2,288	-2,370	-2,455	-2,543	
-2.67%	-497	-604	-710	-816	-923	-1,029	-1,135	
0%	225	155	80	0	-84	-171	-260	
2.67%	408	387	359	324	282	234	180	

5.33%	432	429	423	413	400	381	358
8.00%	433	433	432	431	428	422	415

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

(단위:백만원)

28,673

공시일	2020-01-20
기준일	2020-01-17

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

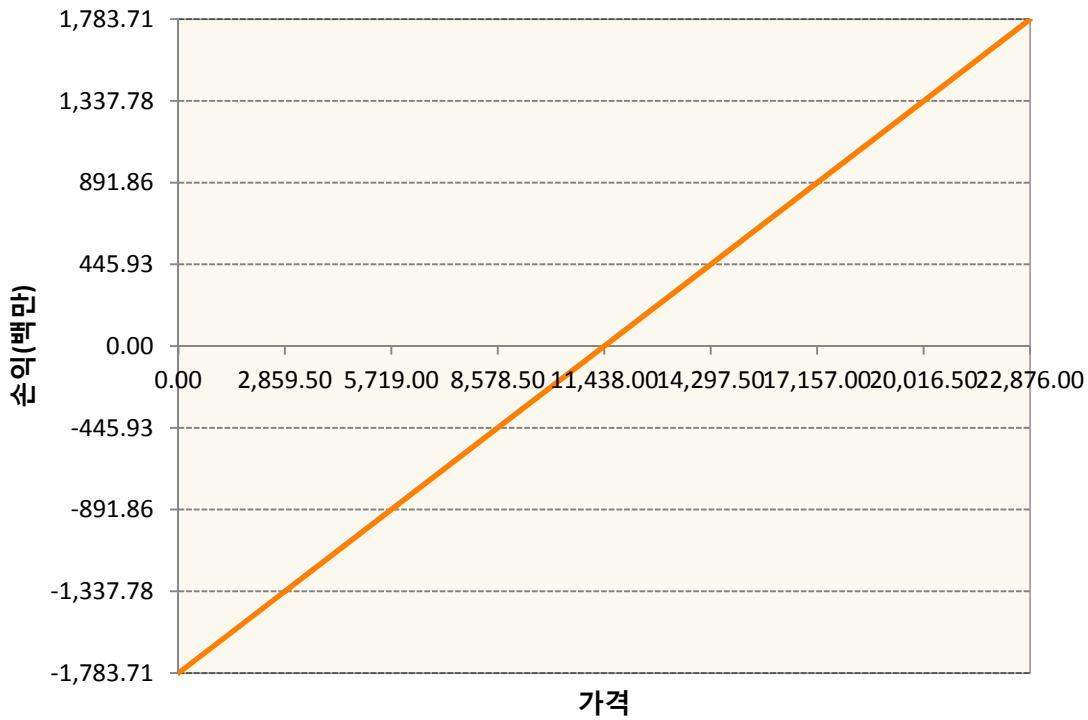
1. 계약금액

(단위:백만원)

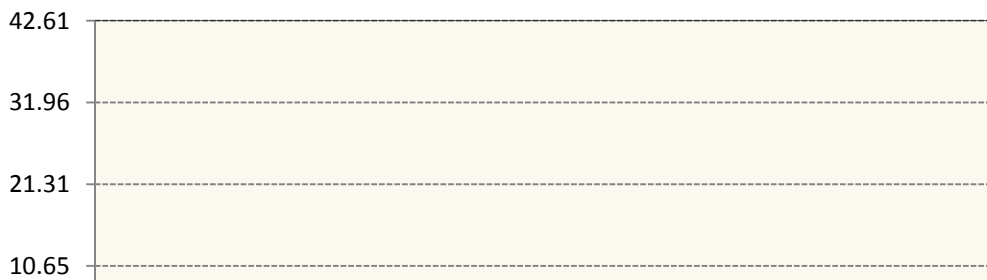
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,784	0	1,784	장내
누계	유가증권	옵션	0	63	-63	장내
누계	통화	선도	0	2,101	-2,101	장외

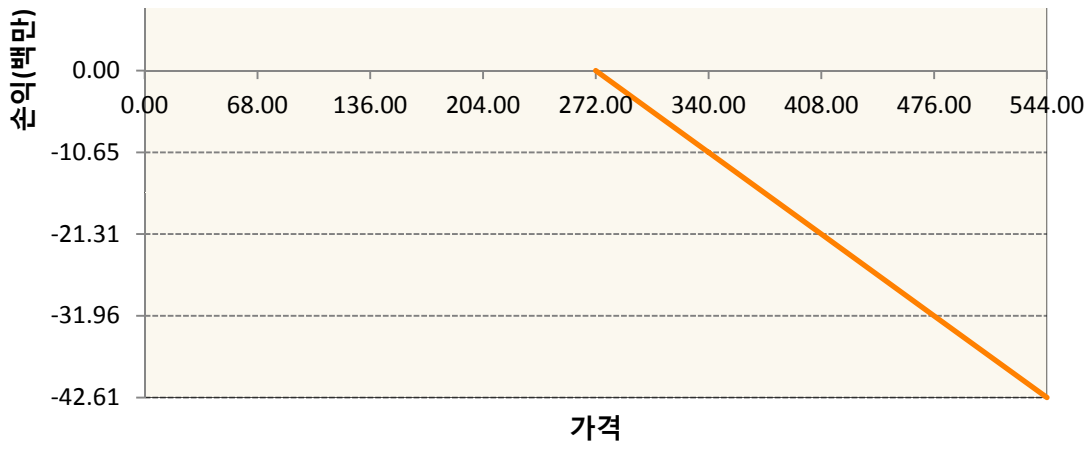
2. 만기시점의 손익구조

HCFO-HSCEI Futures Jan20

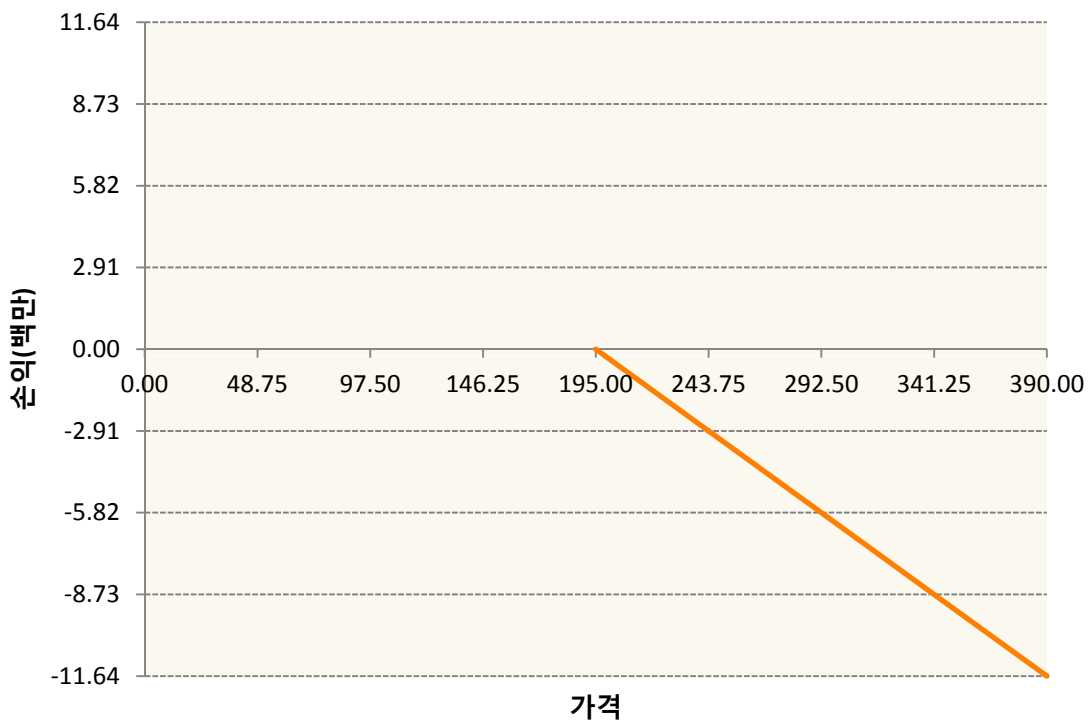


OHHIF0-C112-HSCEI

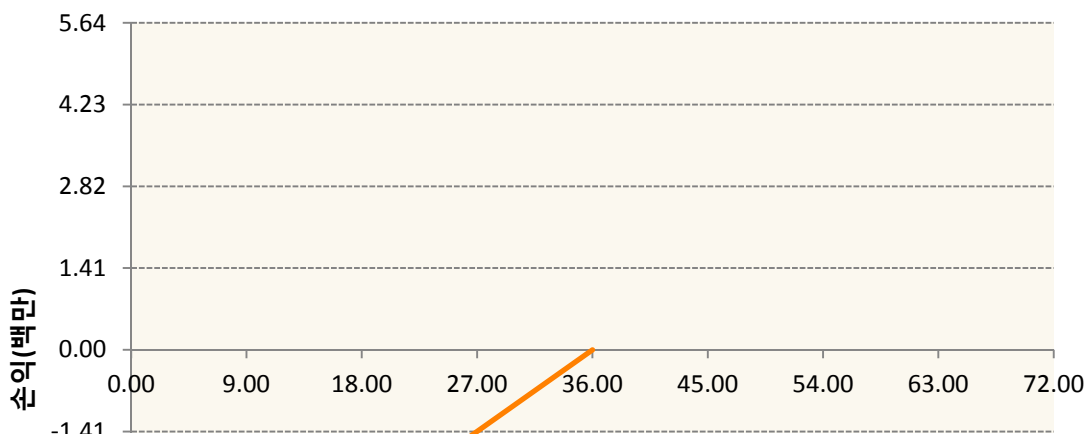


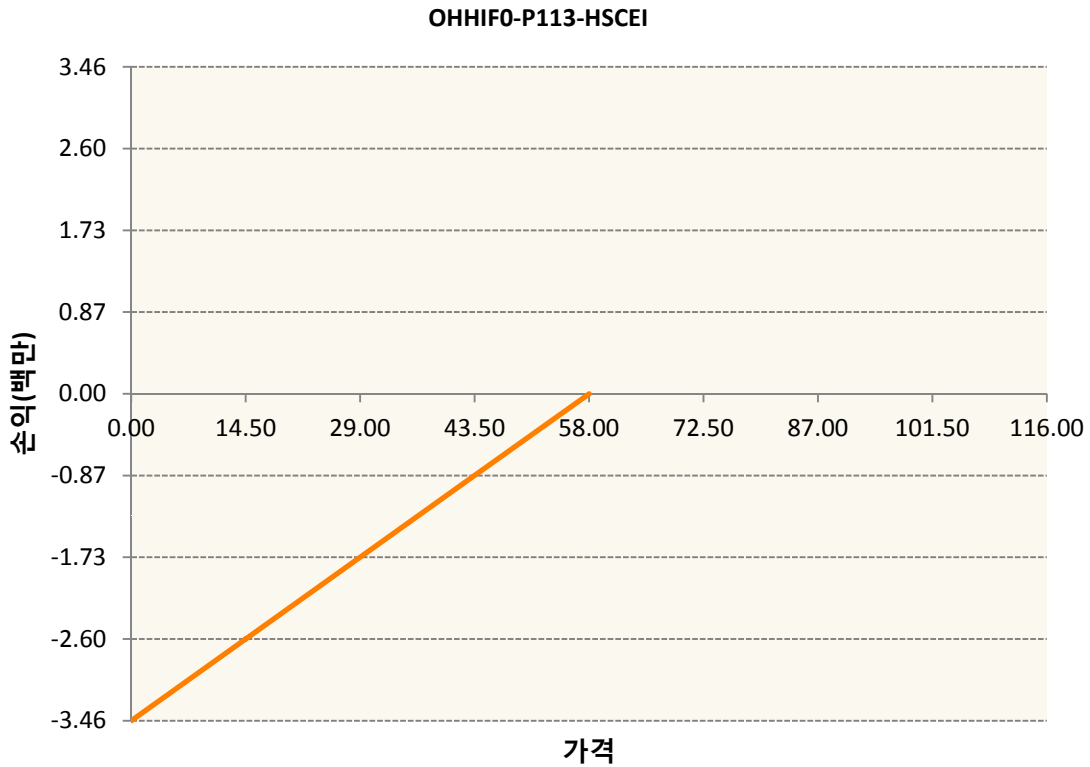
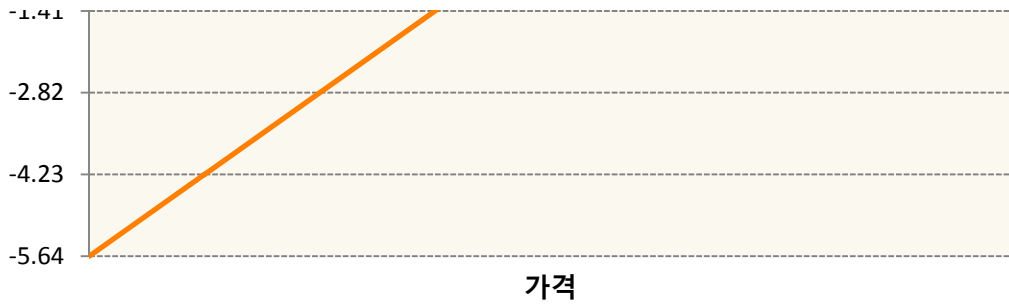


OHHIF0-C113-HSCEI



OHHIF0-P112-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	168
HCF0 HSCEI Futures Jan20	143
OHHIF0-C11 HSCEI	3
OHHIF0-C11 HSCEI	1
OHHIF0-P11 HSCEI	0.5
OHHIF0-P11 HSCEI	0.3

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	184

공시일	2020-01-20
기준일	2020-01-17

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

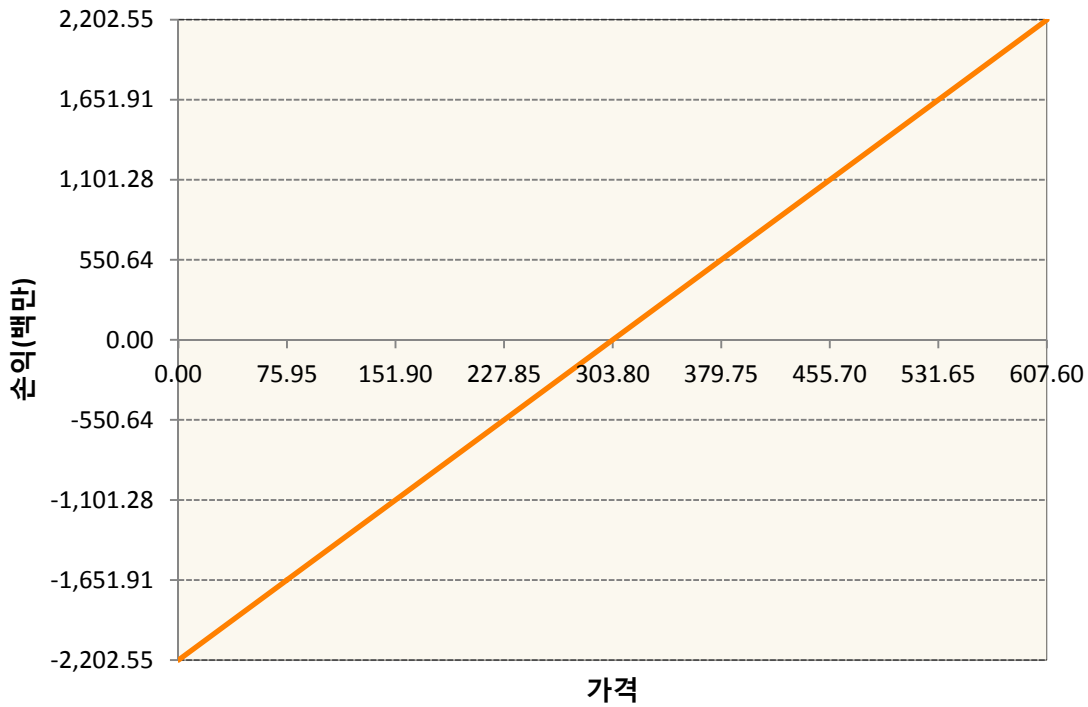
1. 계약금액

(단위:백만원)

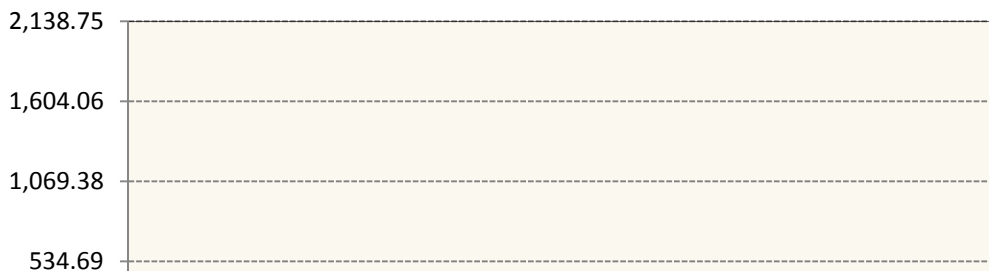
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	76	-76	장내
신규	유가증권	스왑	0	1,000	-1,000	장외
신규	유가증권	옵션	144	0	144	장내
누계	유가증권	선물	2,203	0	2,203	장내
누계	유가증권	스왑	3,625	0	3,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,976	-3,976	장내

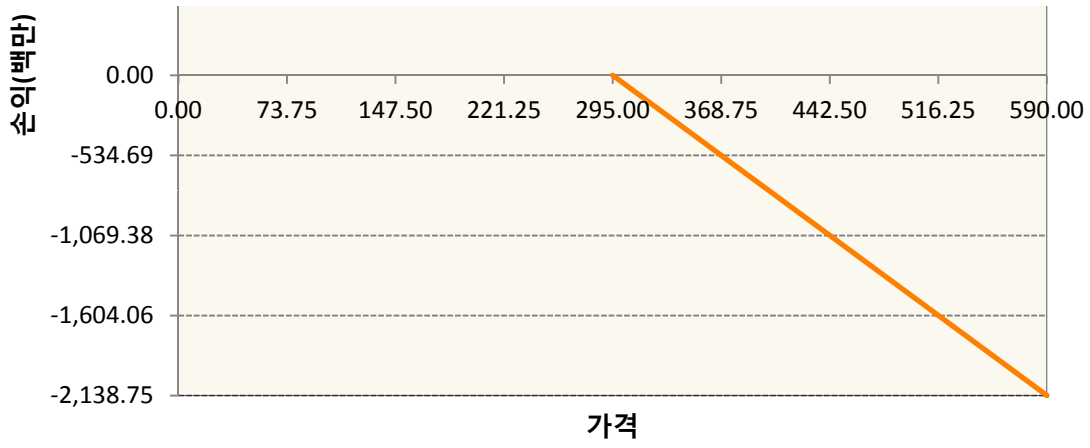
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

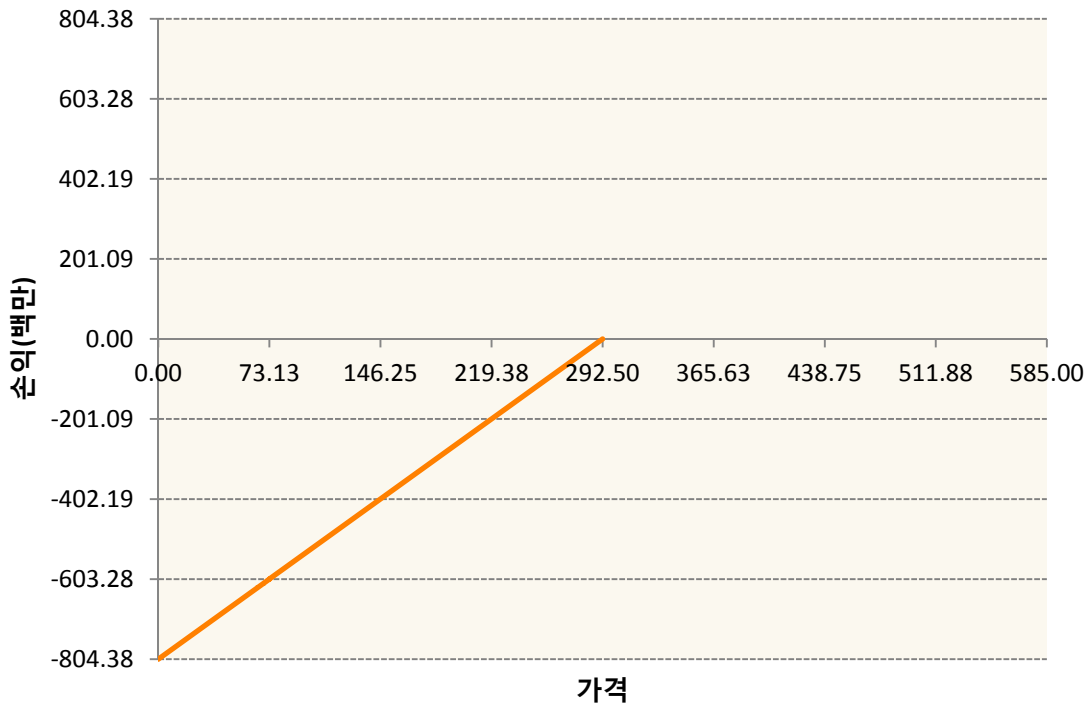


KR4201Q22950-2020-02 콜295

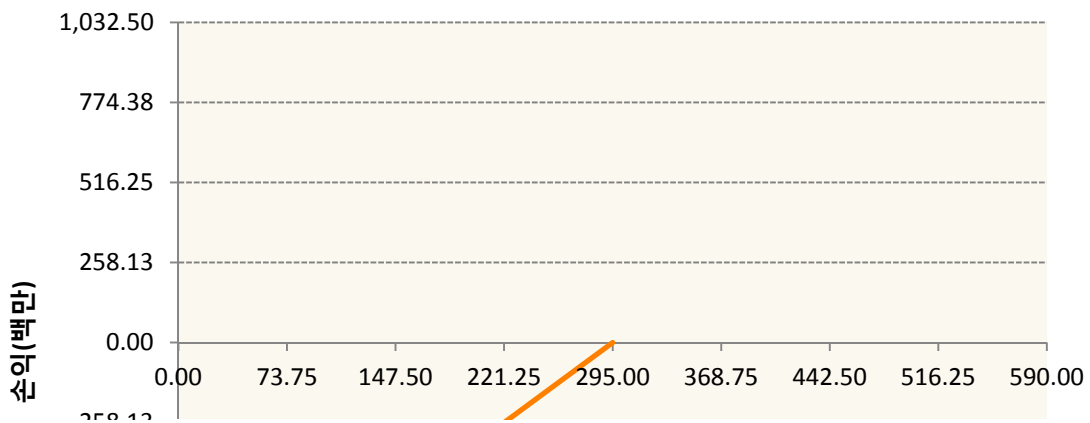




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



KR4301Q22958-2020-02 풋295





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						309
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-309	-309	-309	-309	-309	-309	-309	
-5.33%	-206	-206	-206	-206	-206	-206	-206	
-2.67%	-103	-103	-103	-103	-103	-103	-103	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	103	103	103	103	103	103	103	
5.33%	206	206	206	206	206	206	206	
8.00%	309	309	309	309	309	309	309	
KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						176
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-176	-176	-176	-176	-176	-176	-176	
-5.33%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117	
-2.67%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	59	59	59	59	59	59	59	
5.33%	117	117	117	117	117	117	117	
8.00%	176	176	176	176	176	176	176	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						149
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	92	88	84	80	75	70	66	
-5.33%	77	71	66	61	55	50	44	
-2.67%	52	46	40	34	28	23	17	
0%	16	11	6	0	-6	-11	-17	
2.67%	-28	-32	-37	-41	-46	-51	-56	
5.33%	-79	-82	-85	-88	-92	-96	-101	
8.00%	-133	-135	-137	-140	-143	-146	-149	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						37
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-35	-35	-35	-36	-36	-37	-37
-5.33%	-16	-16	-17	-18	-19	-20	-21
-2.67%	-3	-4	-5	-6	-7	-8	-9
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	3	2	2	2	2	1	1
5.33%	3	3	3	3	3	2	2
8.00%	3	3	3	3	3	3	3
KR4301Q22958 2020-02 풋295							53
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-51	-51	-51	-52	-52	-53	-53
-5.33%	-25	-26	-27	-28	-29	-30	-31
-2.67%	-6	-7	-9	-10	-11	-12	-14
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	5	5	4	4	3	3	2
5.33%	5	5	5	5	5	5	4
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

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

(단위:백만원)

668

공시일	2020-01-20
기준일	2020-01-17

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

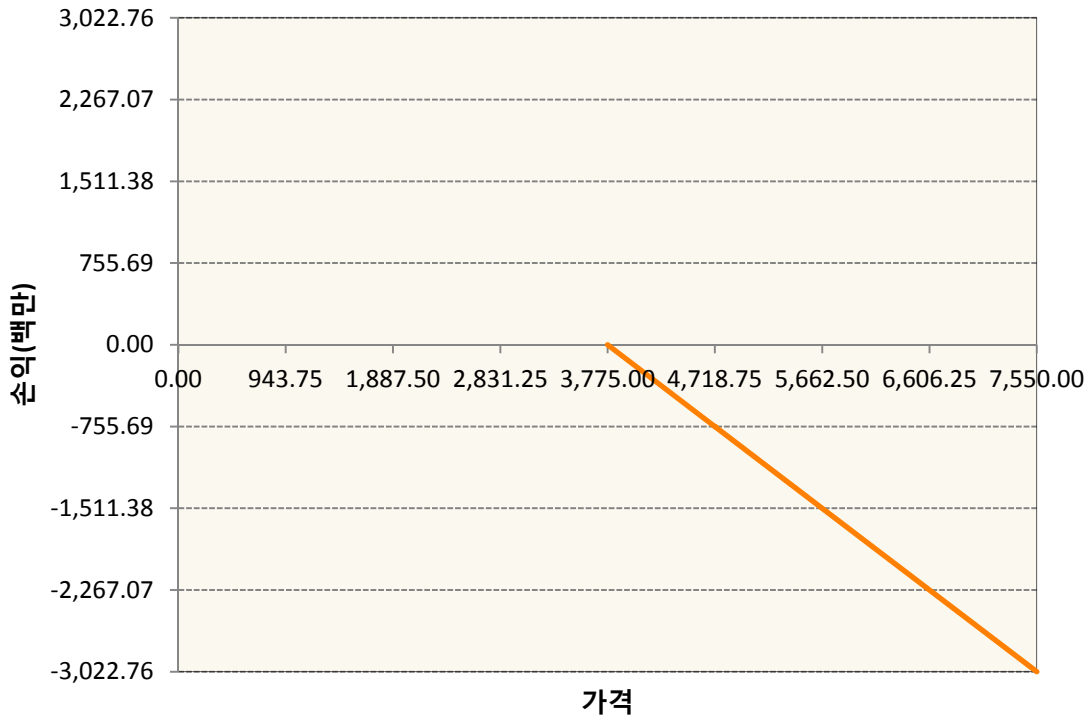
1. 계약금액

(단위:백만원)

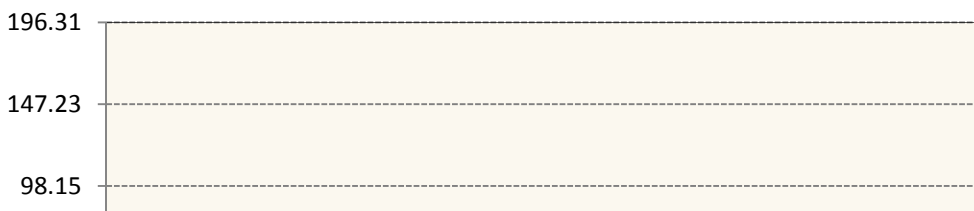
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	146	0	146	
누계	유가증권	스왑	15,685	0	15,685	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,438	-6,438	장내
누계	통화	선도	0	3,389	-3,389	장외

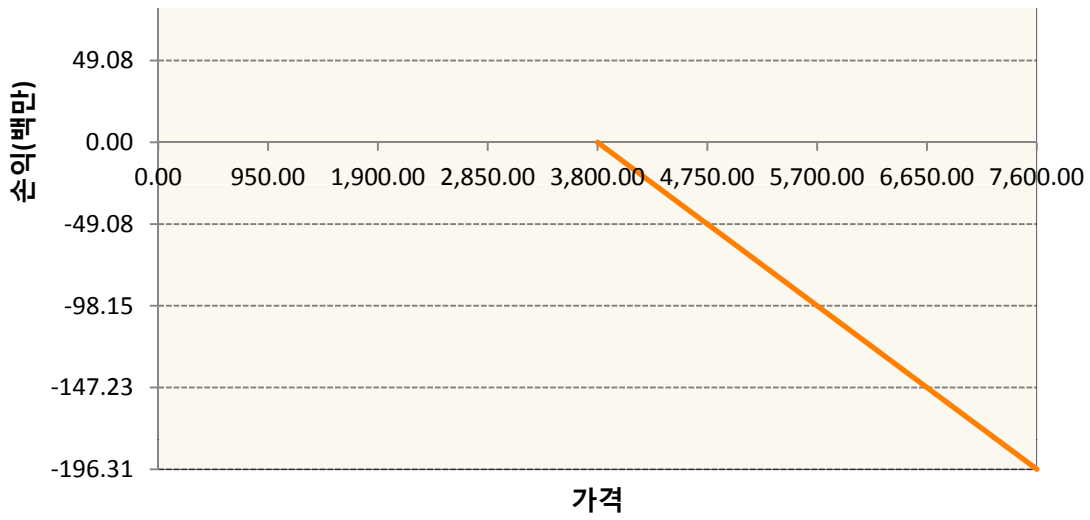
2. 만기시점의 손익구조

OESXF0-C3775-EURO STOXX 50

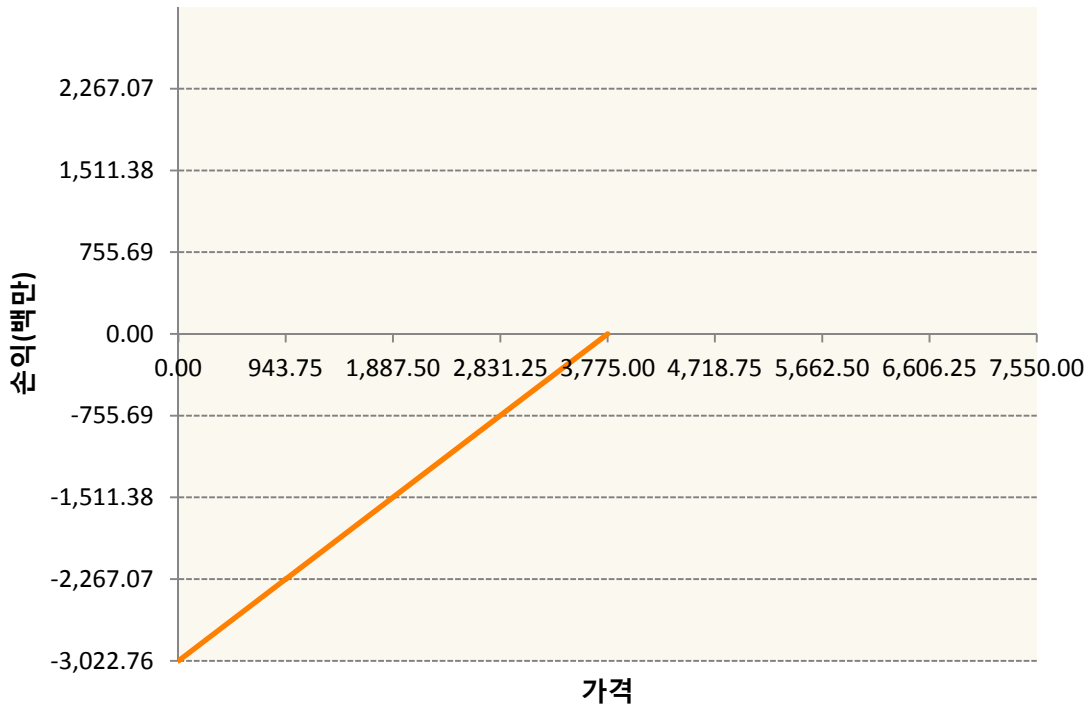


OESXF0-C3800-EURO STOXX 50

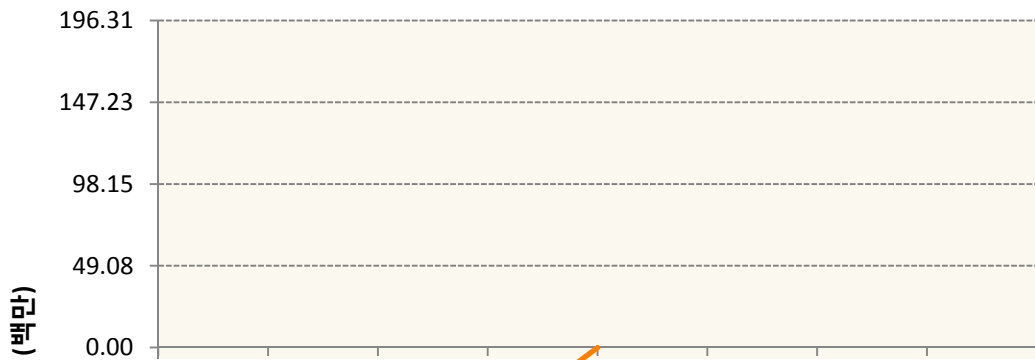


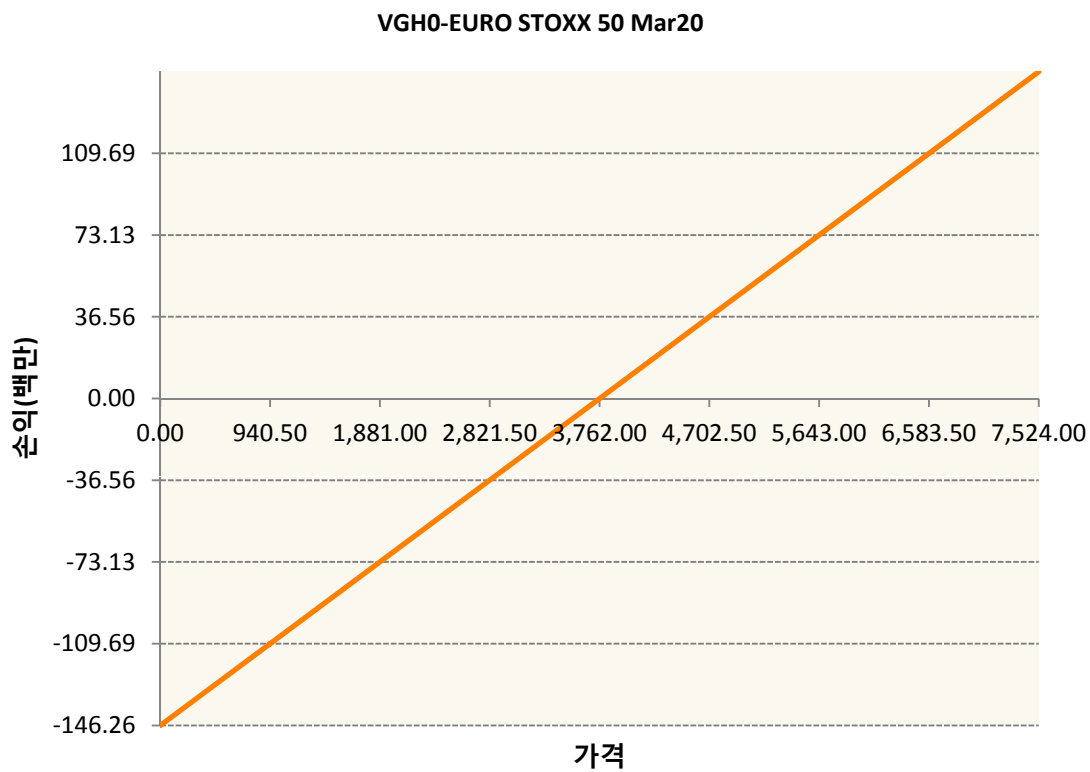
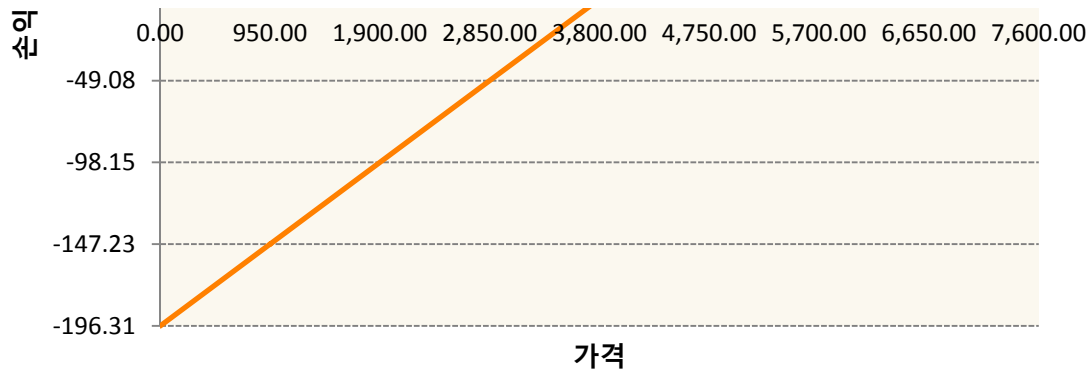


OESXF0-P3775-EURO STOXX 50



OESXF0-P3800-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	46
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	271
OESXF0-C37 EURO STOXX 50	242
OESXF0-C38 EURO STOXX 50	16
OESXF0-P37 EURO STOXX 50	242
OESXF0-P38 EURO STOXX 50	16
VGHO EURO STOXX 50 Mar20	12

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

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

(단위:백만원)

928

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

(단위:백만원)

80

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

(단위:백만원)

117

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

(단위:백만원)

42

공시일	2020-01-20
기준일	2020-01-17

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

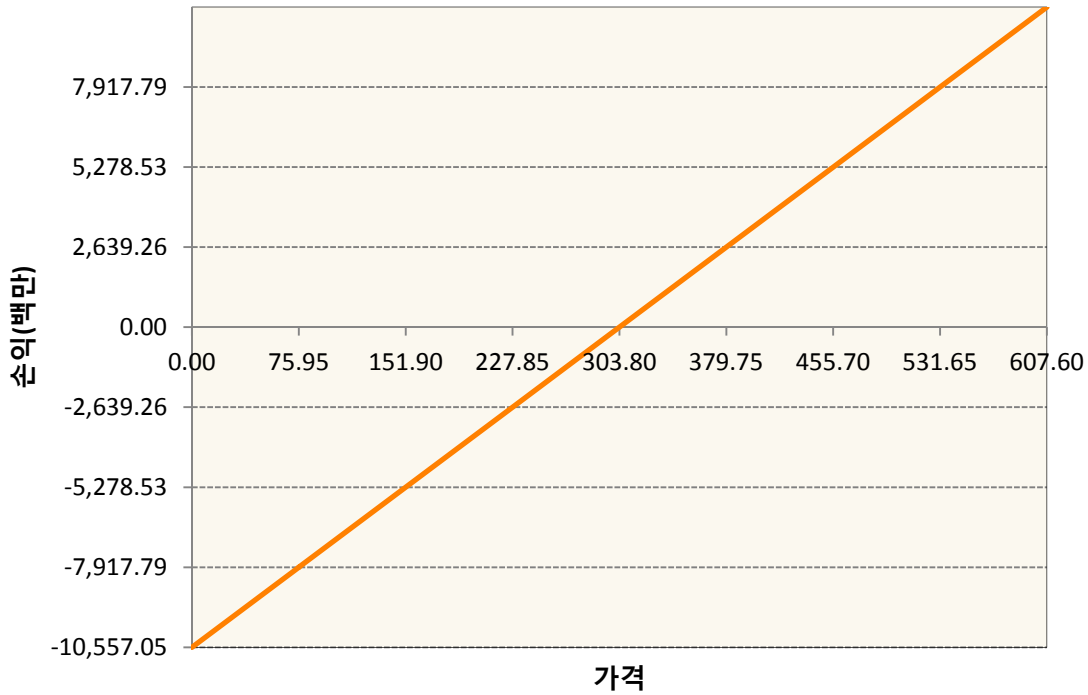
1. 계약금액

(단위:백만원)

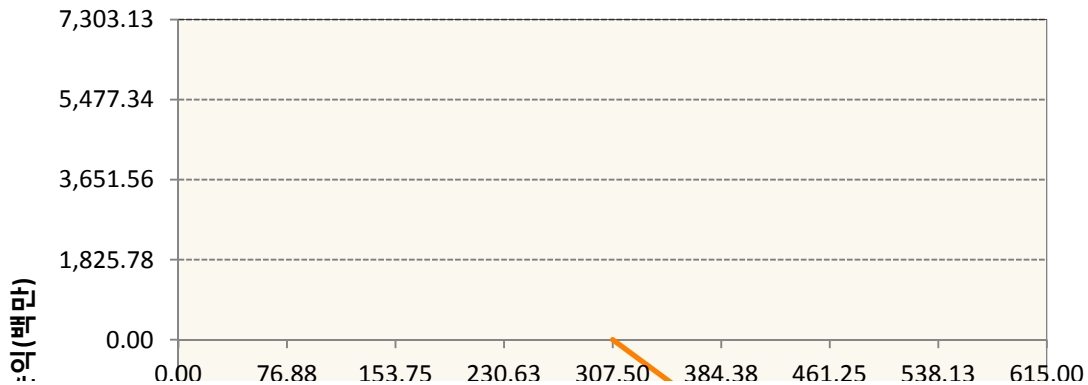
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	228	-228	장내
신규	유가증권	옵션	230	0	230	장내
누계	유가증권	선물	10,557	0	10,557	장내
누계	유가증권	옵션	2,944	20,943	-17,999	장내

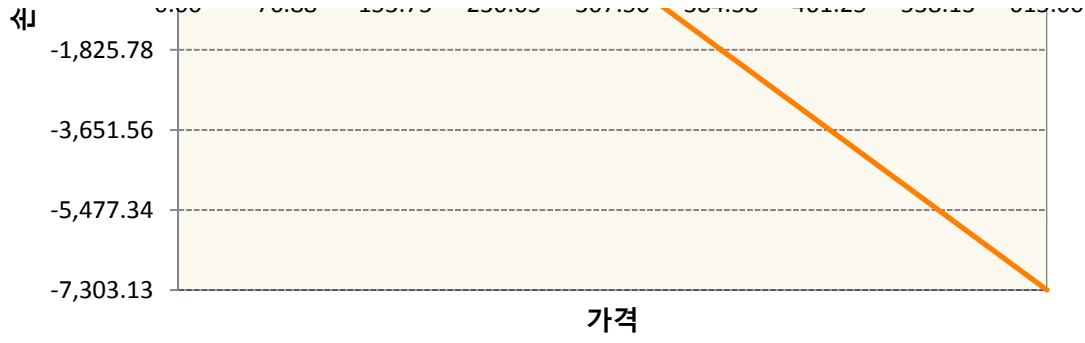
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

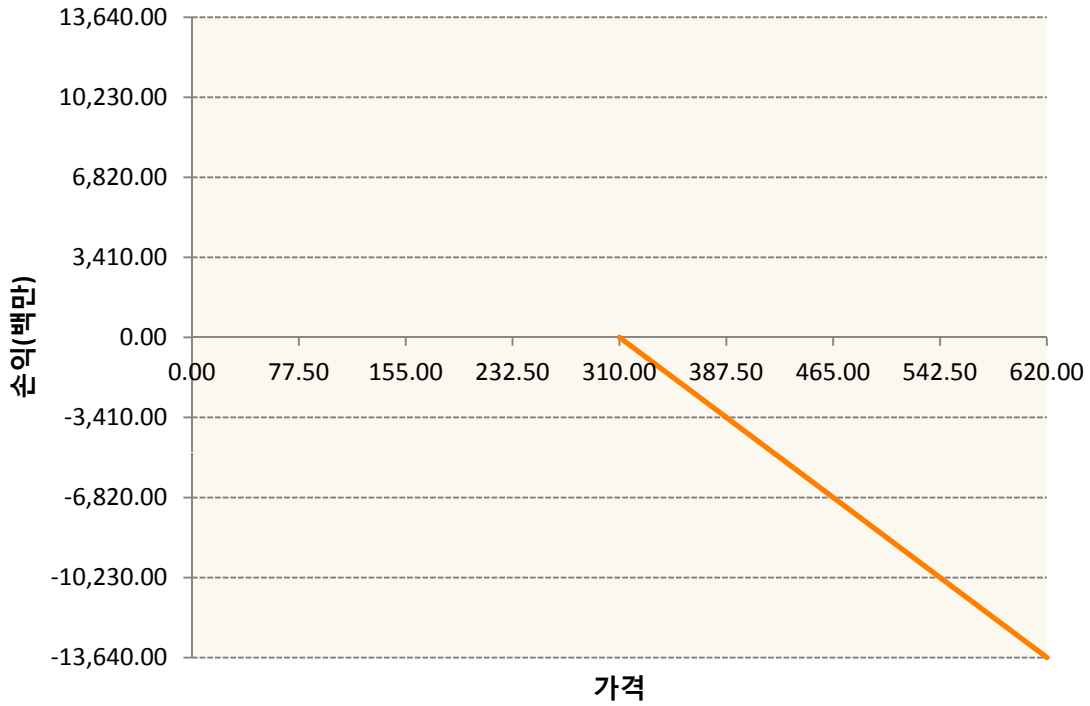


KR4201Q23073-2020-02 콜307.5

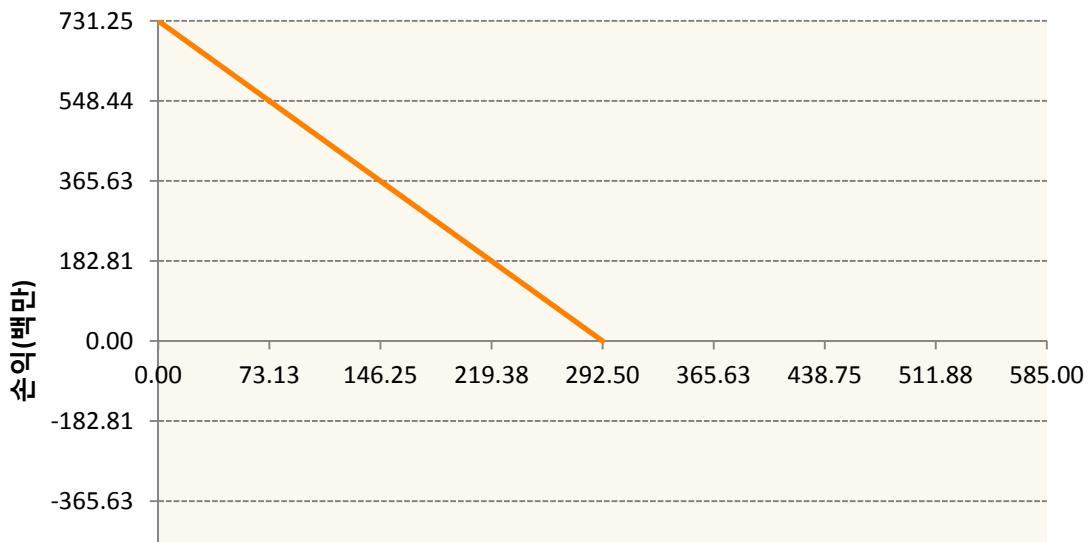


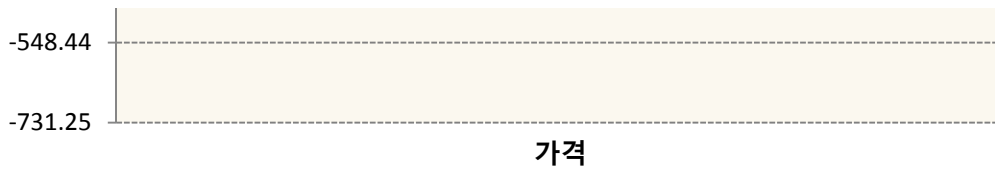


KR4201Q23107-2020-02 콜310

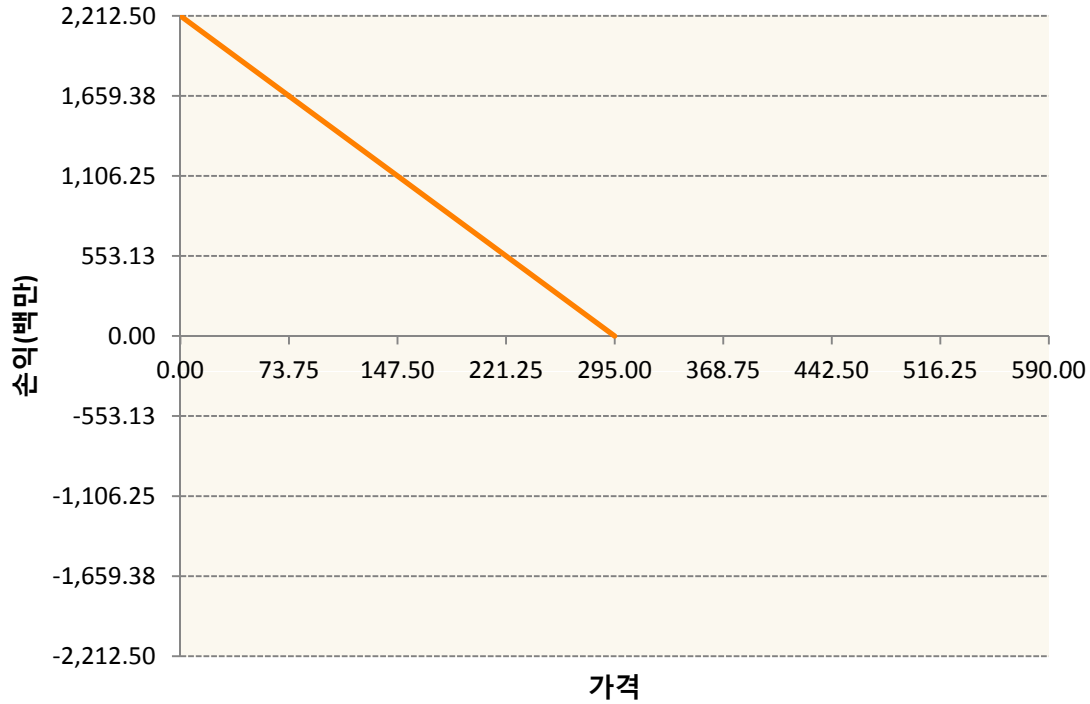


KR4301Q22925-2020-02 풋292.5





KR4301Q22958-2020-02 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						843
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-843	-843	-843	-843	-843	-843	-843	
-5.33%	-562	-562	-562	-562	-562	-562	-562	
-2.67%	-281	-281	-281	-281	-281	-281	-281	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	281	281	281	281	281	281	281	
5.33%	562	562	562	562	562	562	562	
8.00%	843	843	843	843	843	843	843	
KR4201Q23073		2020-02 콜307.5						412
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	179	173	166	157	147	136	125	
-5.33%	161	150	138	125	111	97	82	
-2.67%	123	107	91	74	57	39	21	

0%	58	39	19	0	-19	-39	-58
2.67%	-40	-59	-79	-98	-118	-138	-158
5.33%	-168	-185	-203	-221	-239	-257	-276
8.00%	-322	-335	-349	-364	-379	-395	-412
KR4201Q23107 2020-02 콜310							730
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	294	284	272	258	242	224	204
-5.33%	267	249	229	207	183	158	132
-2.67%	209	182	154	124	93	62	30
0%	105	70	35	0	-35	-71	-107
2.67%	-57	-94	-131	-168	-206	-243	-280
5.33%	-278	-312	-346	-381	-417	-452	-488
8.00%	-550	-576	-605	-634	-665	-697	-730
KR4301Q22925 2020-02 풋292.5							34
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	32	32	32	33	33	33	34
-5.33%	14	15	16	16	17	18	19
-2.67%	3	4	5	5	6	7	8
0%	-1	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-1	-1
5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
KR4301Q22958 2020-02 풋295							114
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	109	110	110	111	112	113	114
-5.33%	53	55	57	59	61	63	66
-2.67%	13	16	18	21	24	27	29
0%	-6	-4	-2	0	2	4	7
2.67%	-11	-10	-9	-8	-7	-6	-5
5.33%	-11	-11	-11	-11	-10	-10	-9
8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11

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

(단위:백만원)

1,718

공시일	2020-01-20
기준일	2020-01-17

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	205,851	0	205,851	

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	2020-01-20
기준일	2020-01-17

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	214,869	0	214,869	

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	2020-01-20
기준일	2020-01-17

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	2,609	-2,609	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	527,696	0	527,696	
누계	통화	선도	0	580,280	-580,280	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,391
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E		1,493
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		1,855
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E		3,191
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		4,730
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		186
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,783
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		2,783
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,319
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E		2,504
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E		1,614
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E		1,521
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E		928
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		186
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		1,985
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E		928
FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E		3,710
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E		1,855
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E		1,985
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E		186
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E		186
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E		1,113
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E		1,670
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E		278
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E		1,855
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E		3,191

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

(단위:백만원)

15,280

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

(단위:백만원)

214

공시일	2020-01-20
기준일	2020-01-17

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

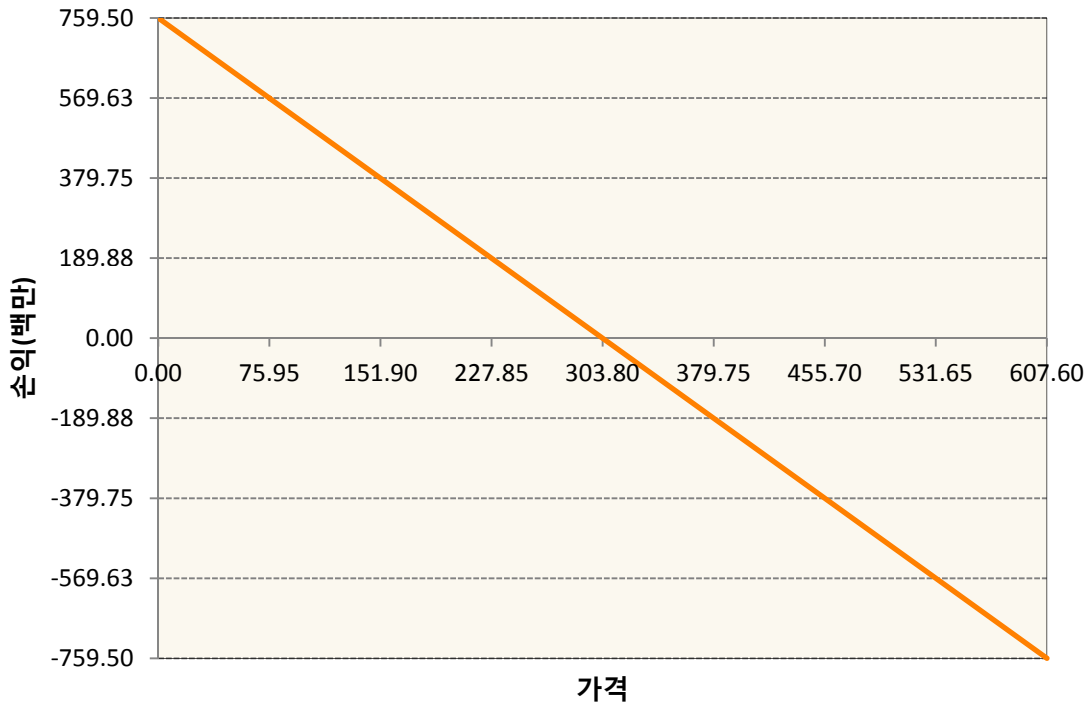
1. 계약금액

(단위:백만원)

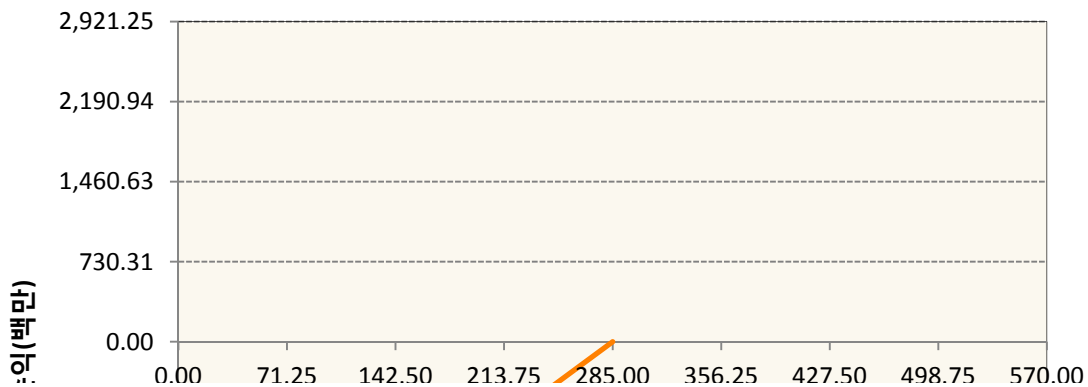
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	71	0	71	장내
누계	유가증권	선물	0	760	-760	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,784	-3,784	장내

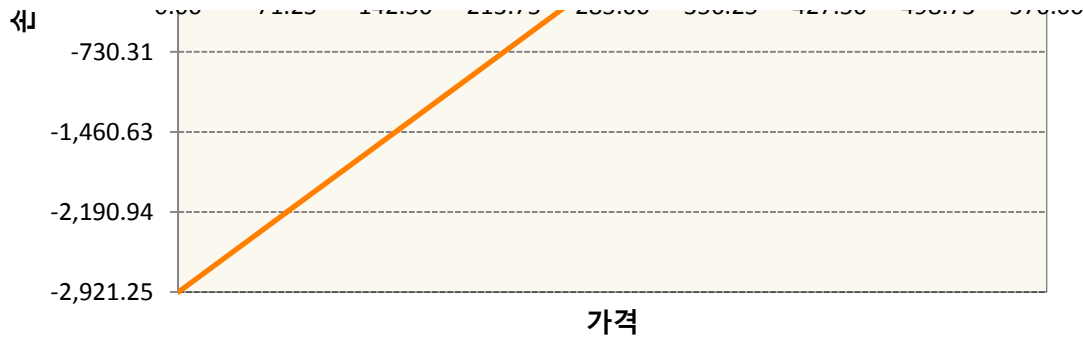
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

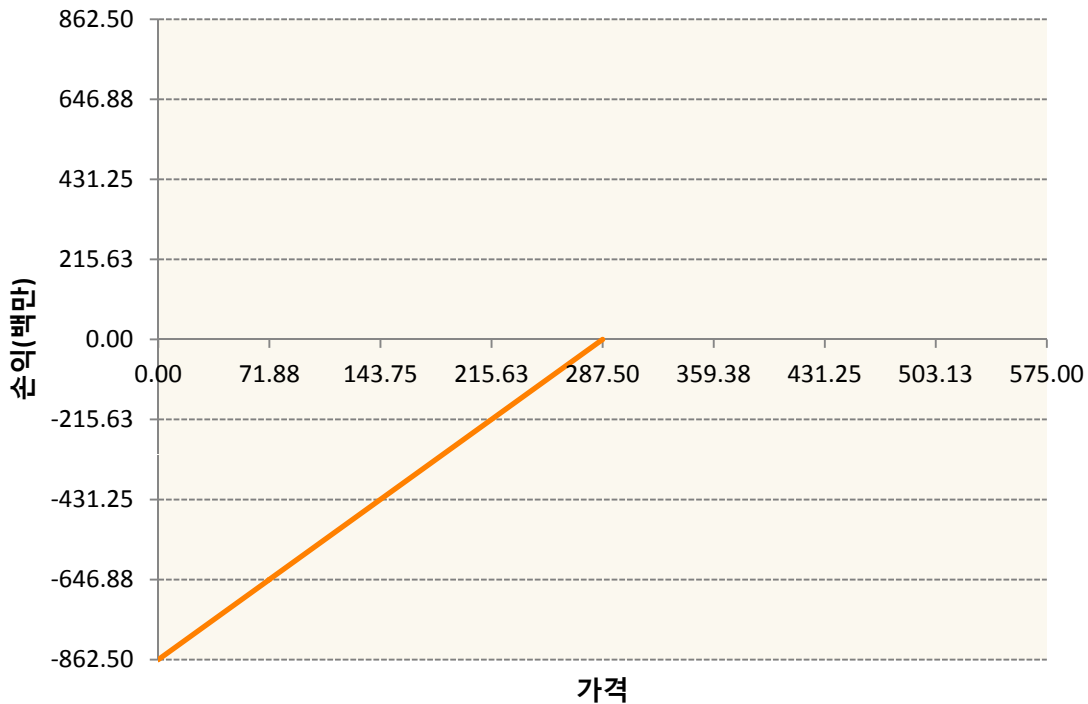


KR4301Q22859-2020-02 풋285





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						88
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-70	-72	-75	-78	-81	-85	-88
-5.33%	-21	-24	-28	-32	-35	-39	-42
-2.67%	-2	-4	-6	-8	-11	-13	-16
0%	2	1	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%	-26	-27	-27	-28	-29	-30	-31
-5.33%	-9	-10	-11	-12	-13	-14	-16
-2.67%	-1	-2	-3	-3	-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)

110

공시일	2020-01-20
기준일	2020-01-17

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	440	-440	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	12,828	0	12,828	
누계	통화	선도	443	13,486	-13,043	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E		288
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E		288
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E		343
FX21020F00! KRW/USD 13-02-20E		124
FX21020F02! USD/KRW 28-01-20E		35
FX21020F02! KRW/USD 22-01-20E		35

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

(단위:백만원)

367

공시일	2020-01-20
기준일	2020-01-17

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

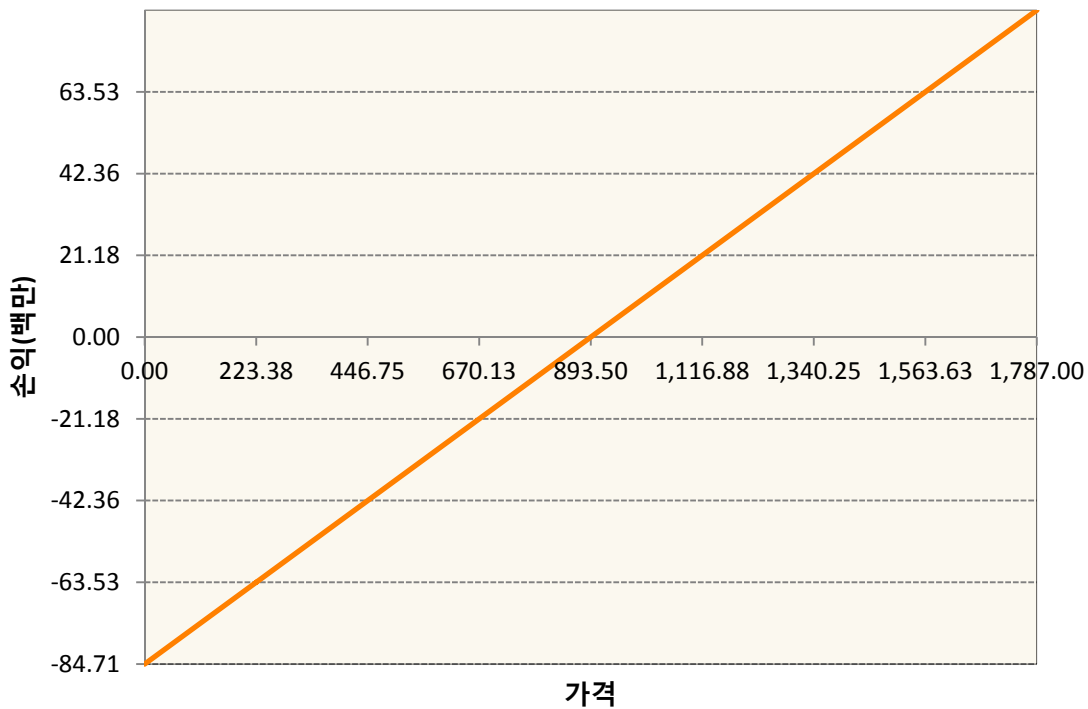
1. 계약금액

(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	2,012	0	2,012	장외
누계	통화	선도	310	814	-504	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)	24
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)

150

공시일	2020-01-20
기준일	2020-01-17

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

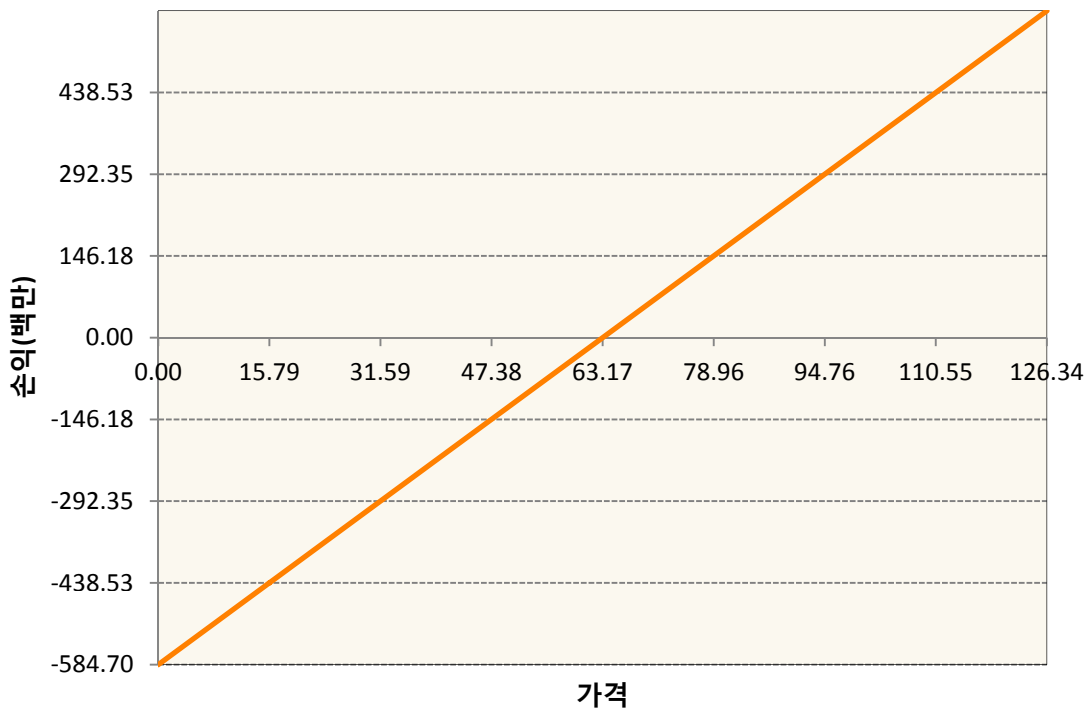
1. 계약금액

(단위:백만원)

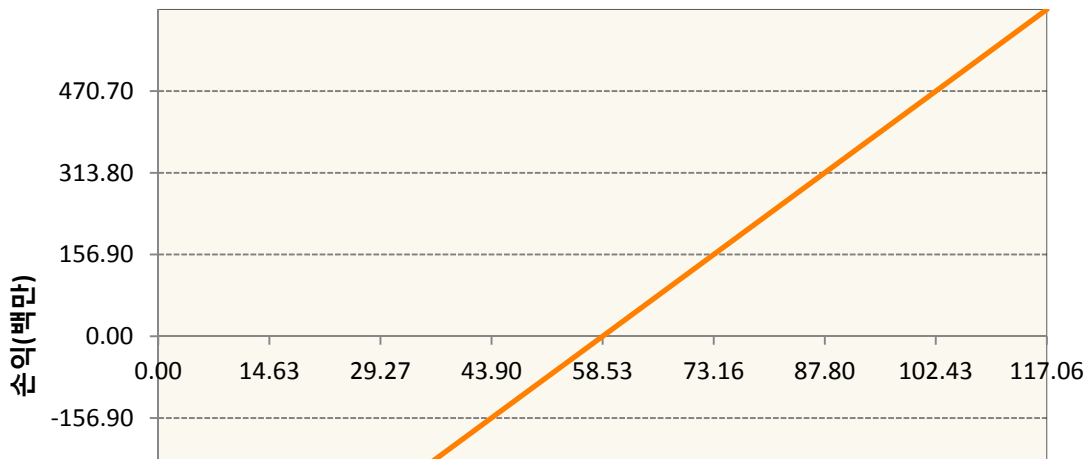
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,391	290	2,101	

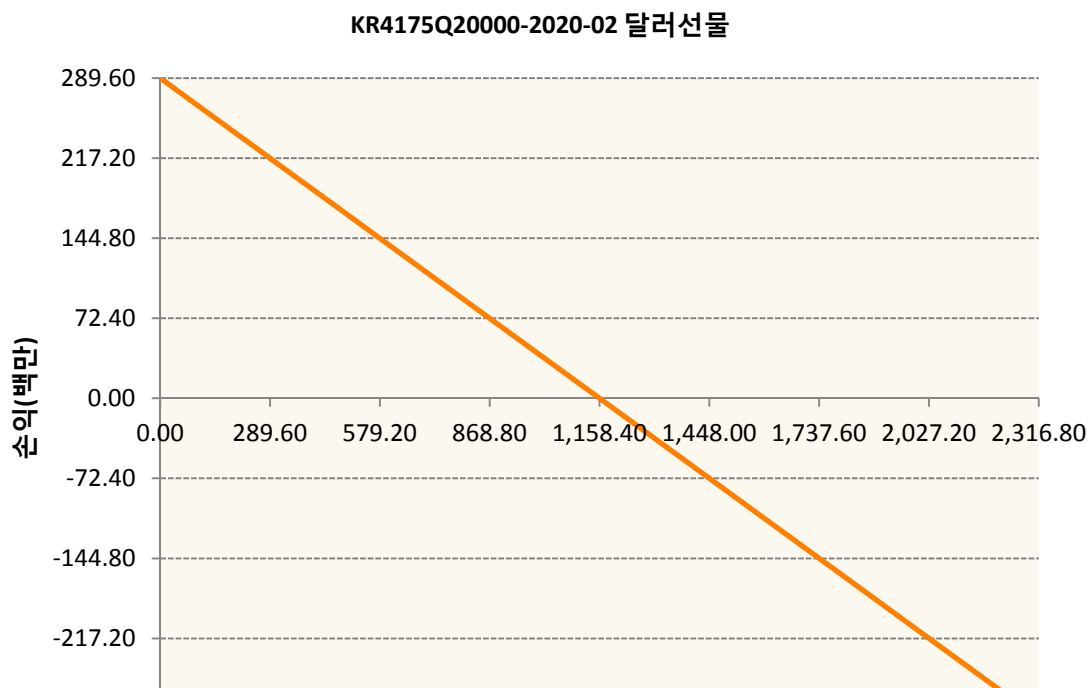
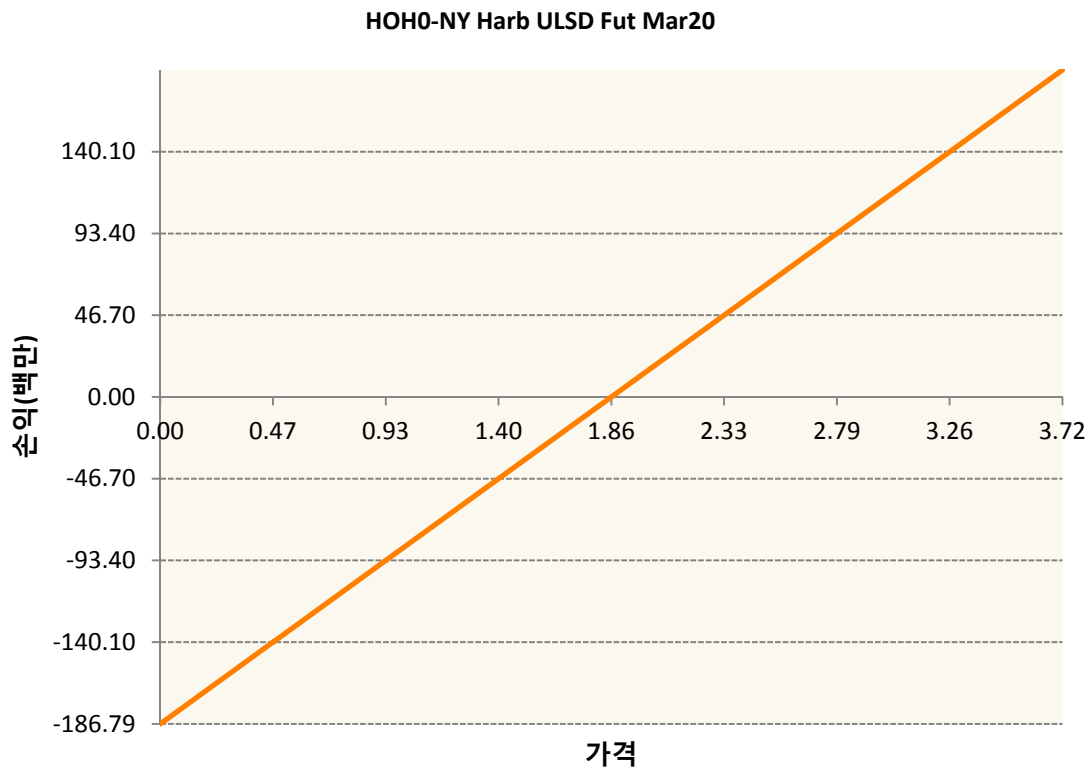
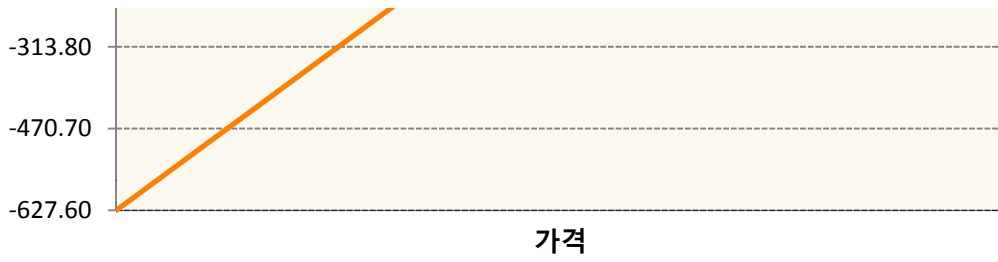
2. 만기시점의 손익구조

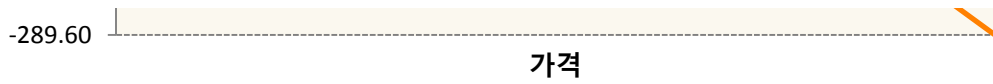
COKO-BRENT CRUDE FUTR May20



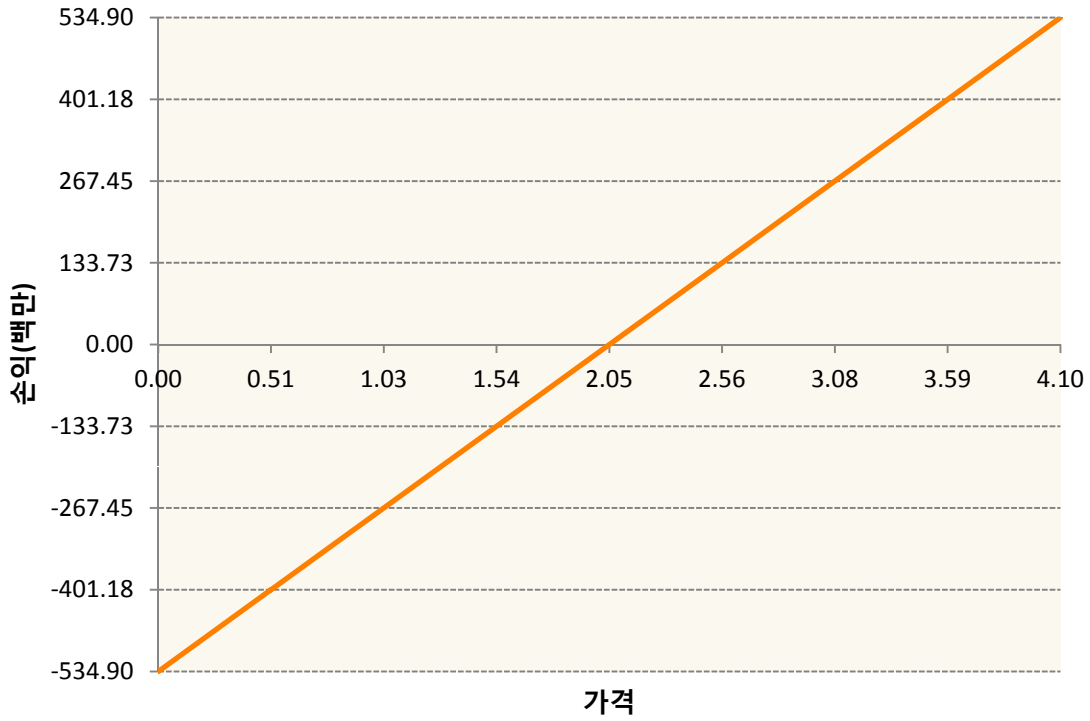
CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20



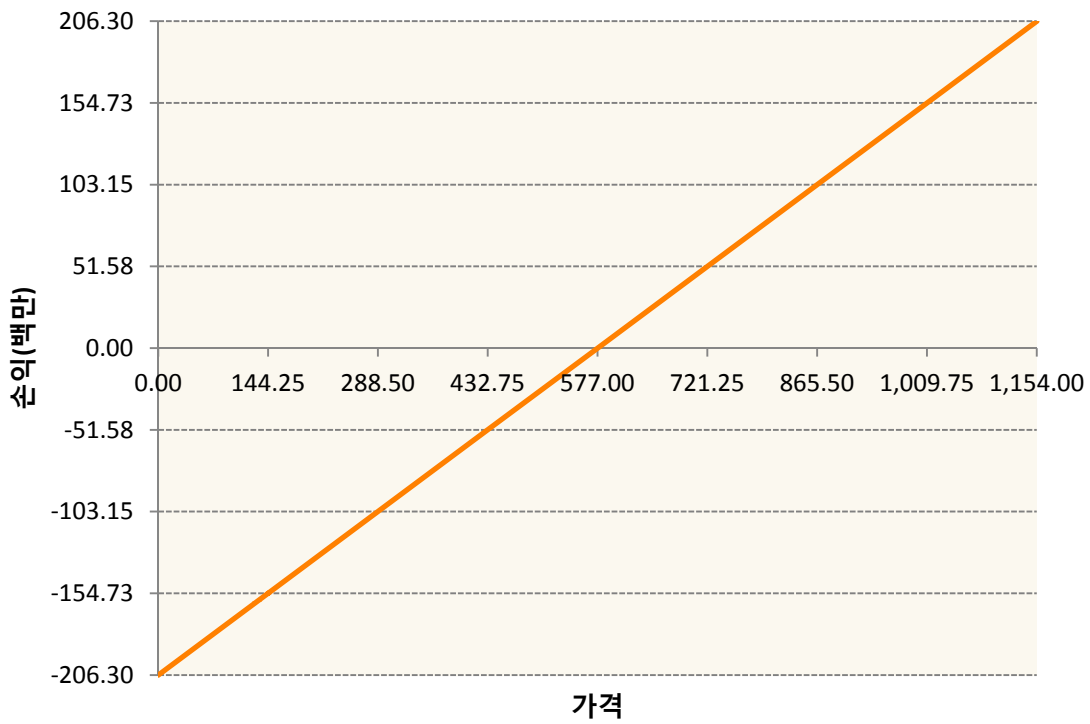




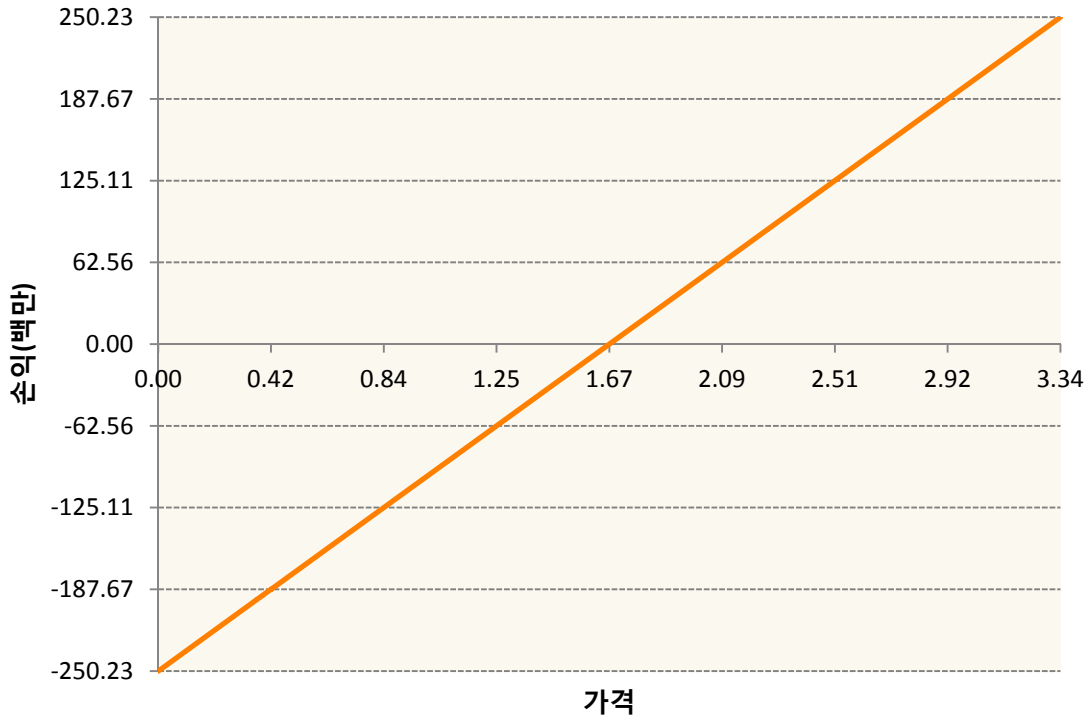
NGH20-NATURAL GAS FUTR Mar20



QSH0-Low Su Gasoil G Mar20



XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	47
CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	50
HOH0	NY Harb ULSD Fut Mar20	15
KR4175Q20C	2020-02 달러선물	23
NGH20	NATURAL GAS FUTR Mar20	43
QSH0	Low Su Gasoil G Mar20	17
XBH0	GASOLINE RBOB FUT Mar20	20

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

371

공시일	2020-01-20
기준일	2020-01-17

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

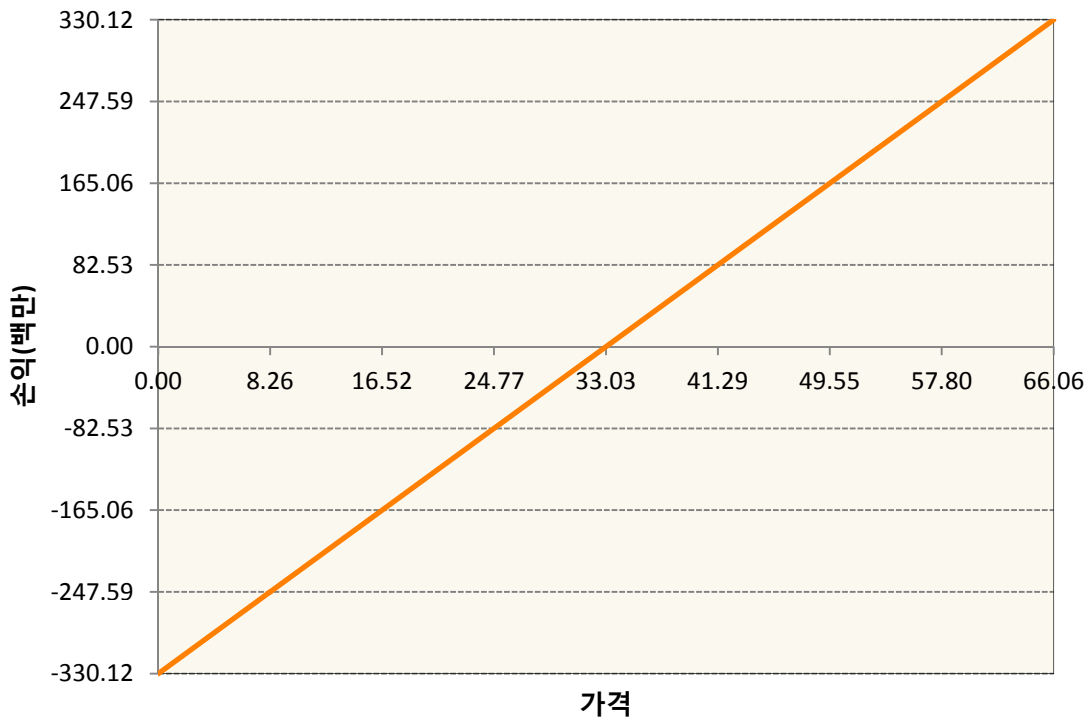
1. 계약금액

(단위:백만원)

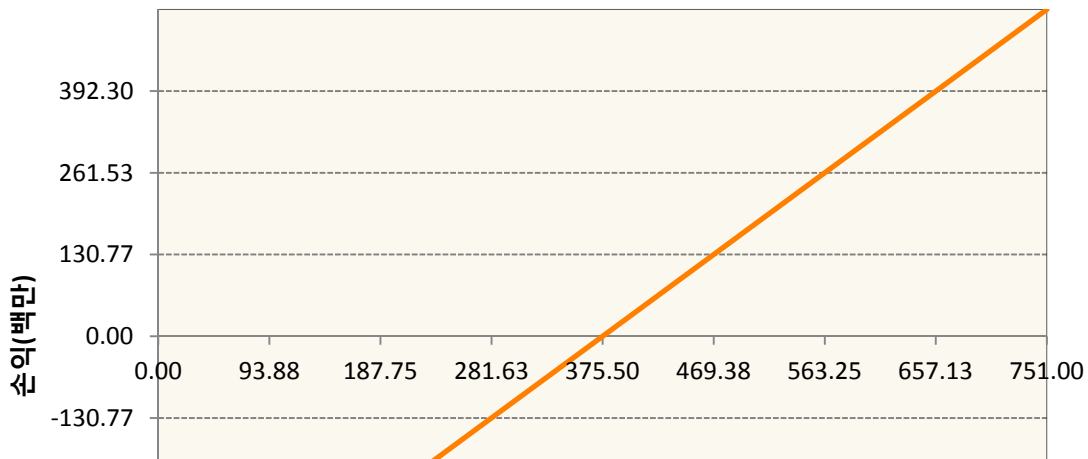
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,811	151	2,660	

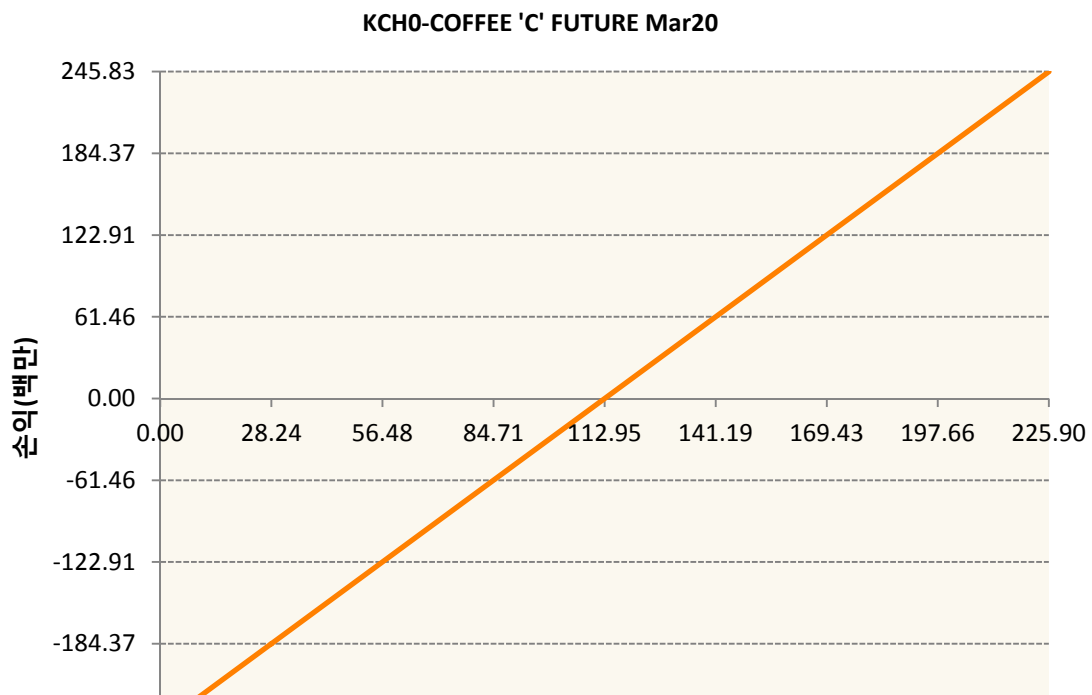
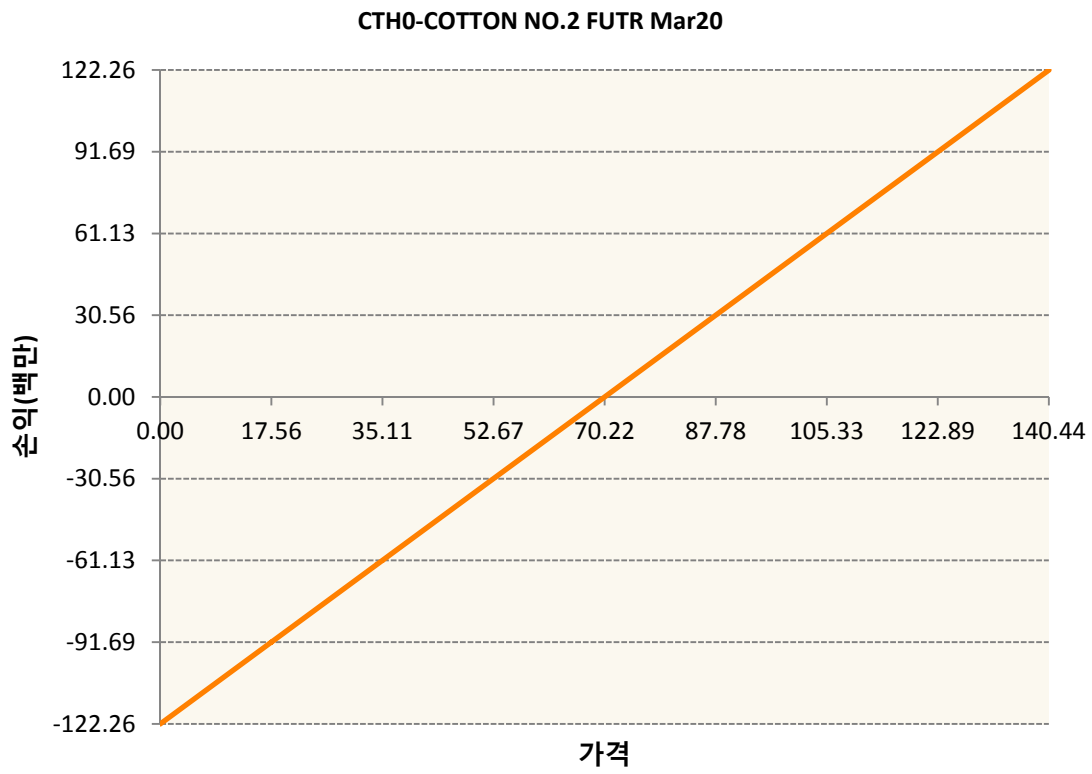
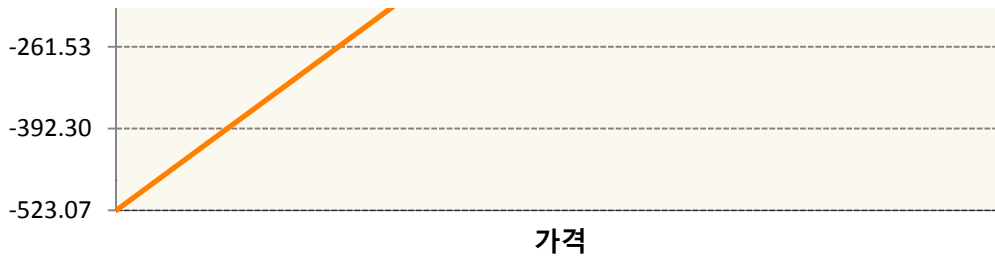
2. 만기시점의 손익구조

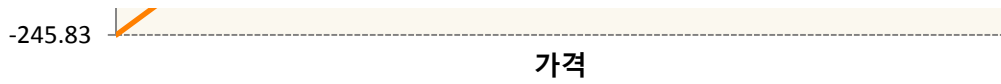
BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20



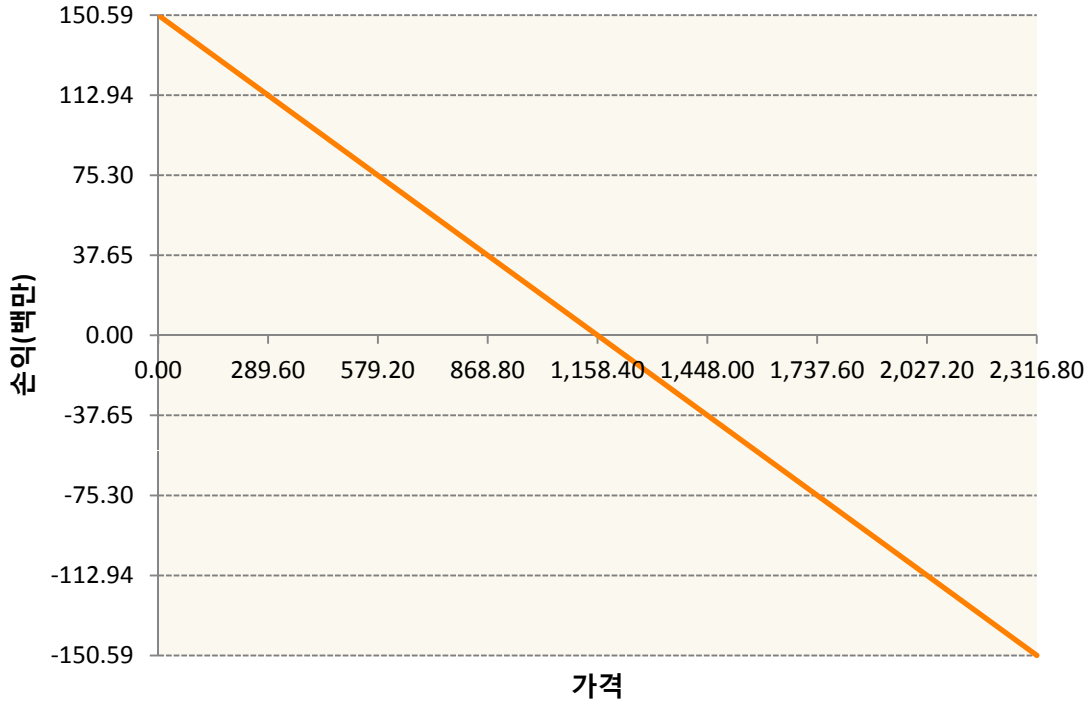
CH0-CORN FUTURE Mar20



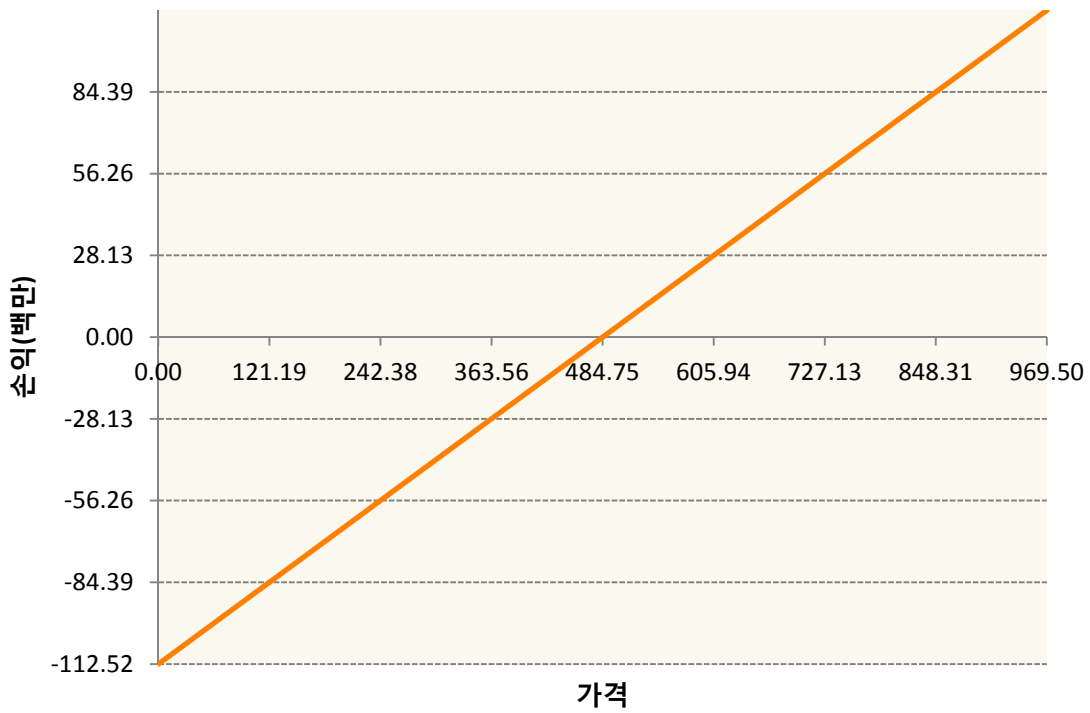




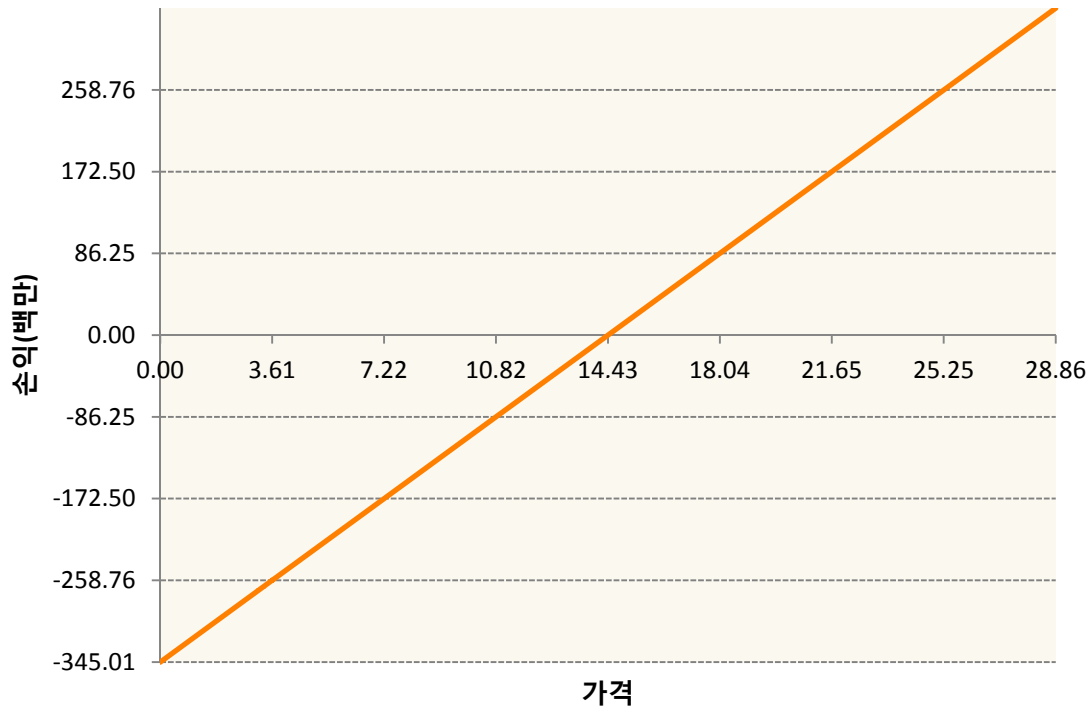
KR4175Q20000-2020-02 달러선물



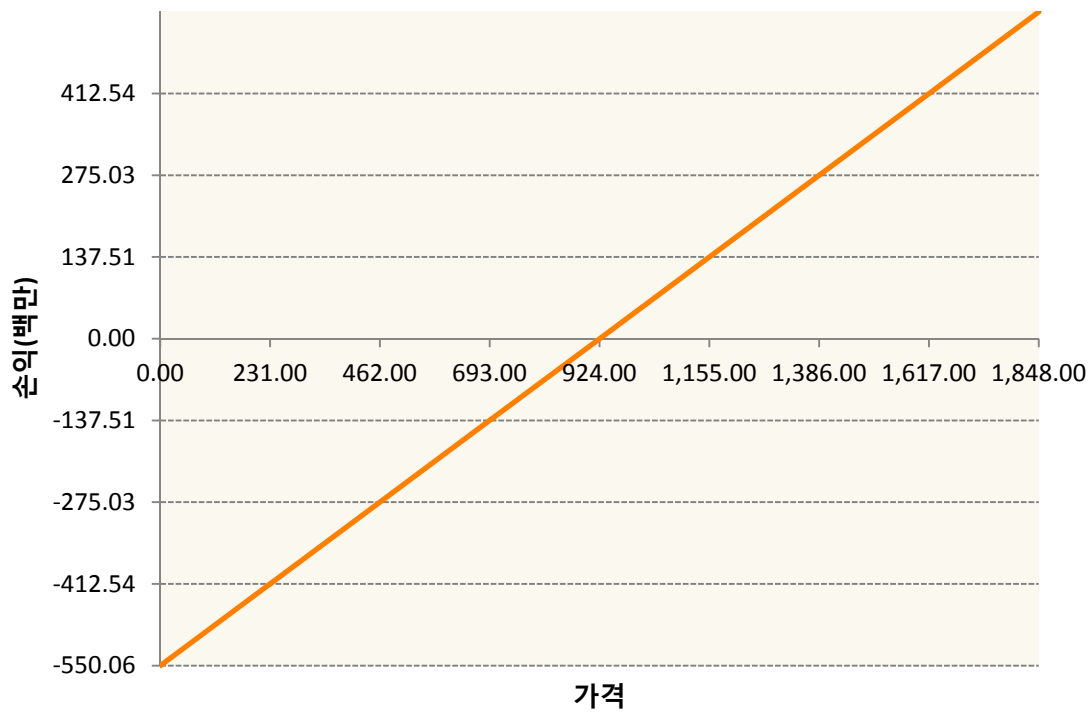
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

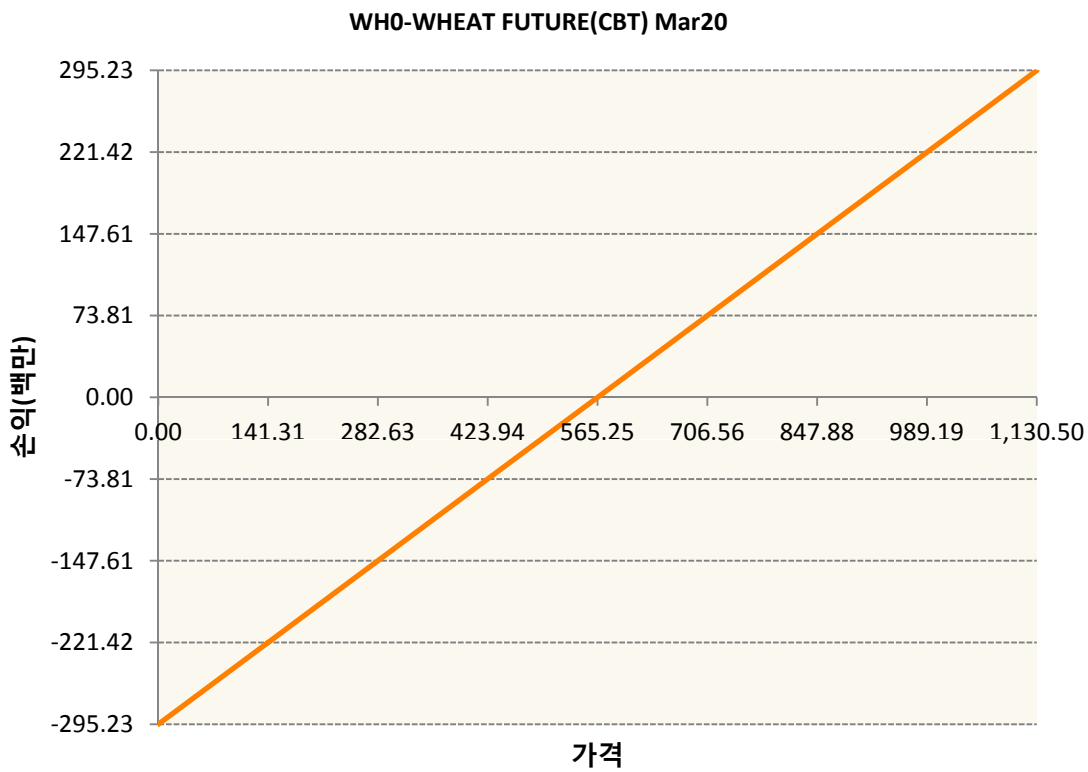
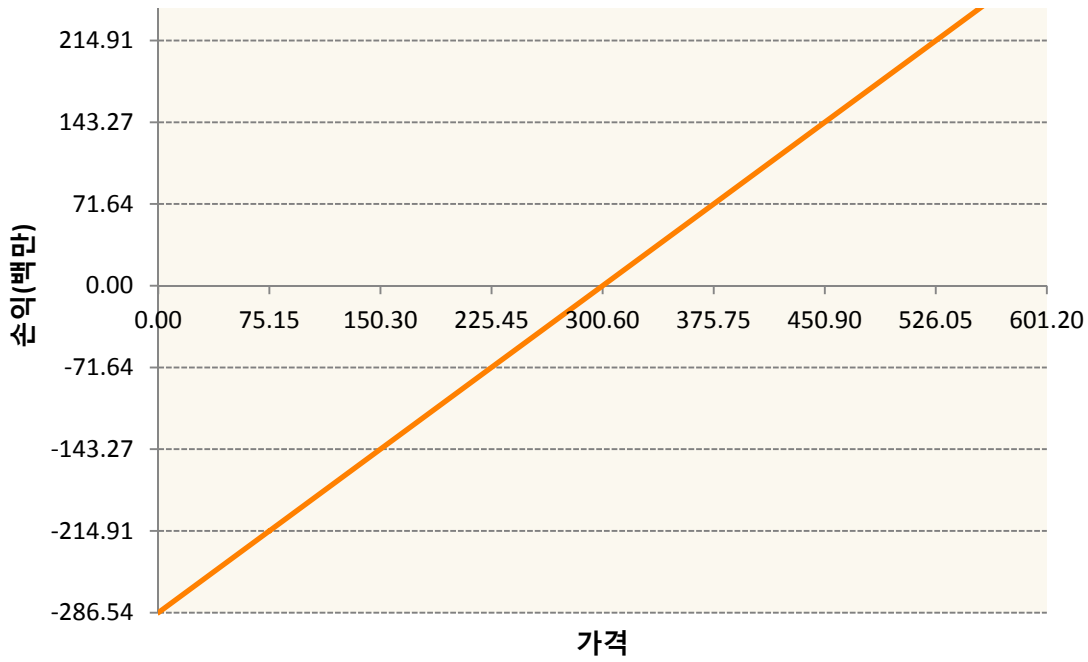


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20



SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH0	SOYBEAN OIL FUTR Mar20	26
CH0	CORN FUTURE Mar20	42
CTH0	COTTON NO.2 FUTR Mar20	10
KCH0	COFFEE 'C' FUTURE Mar20	20
KR4175Q20C	2020-02 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)

244