

공시일	2020-01-21
기준일	2020-01-20

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	2020-01-21
기준일	2020-01-20

스마트인덱스모

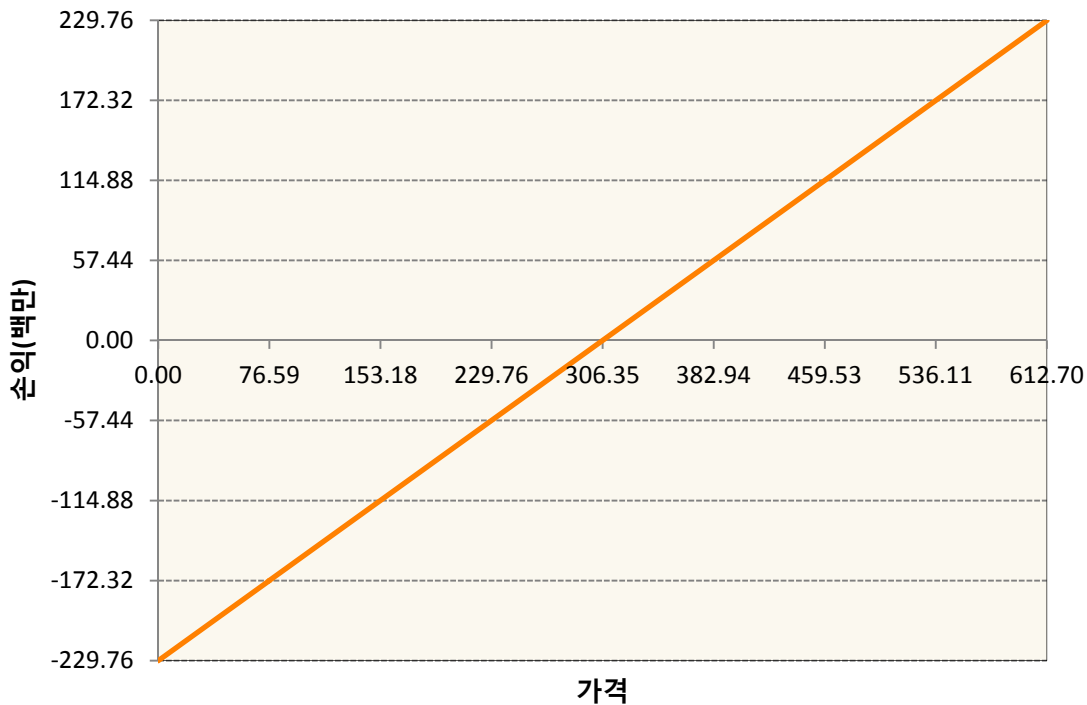
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	230	0	230	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						18
가격	기초자산의 변동성							
	-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	2020-01-21
기준일	2020-01-20

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

1,156

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

661

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-21
기준일	2020-01-20

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)	438
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	160

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

829

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-21
기준일	2020-01-20

유로인덱스모(주식-파생형)

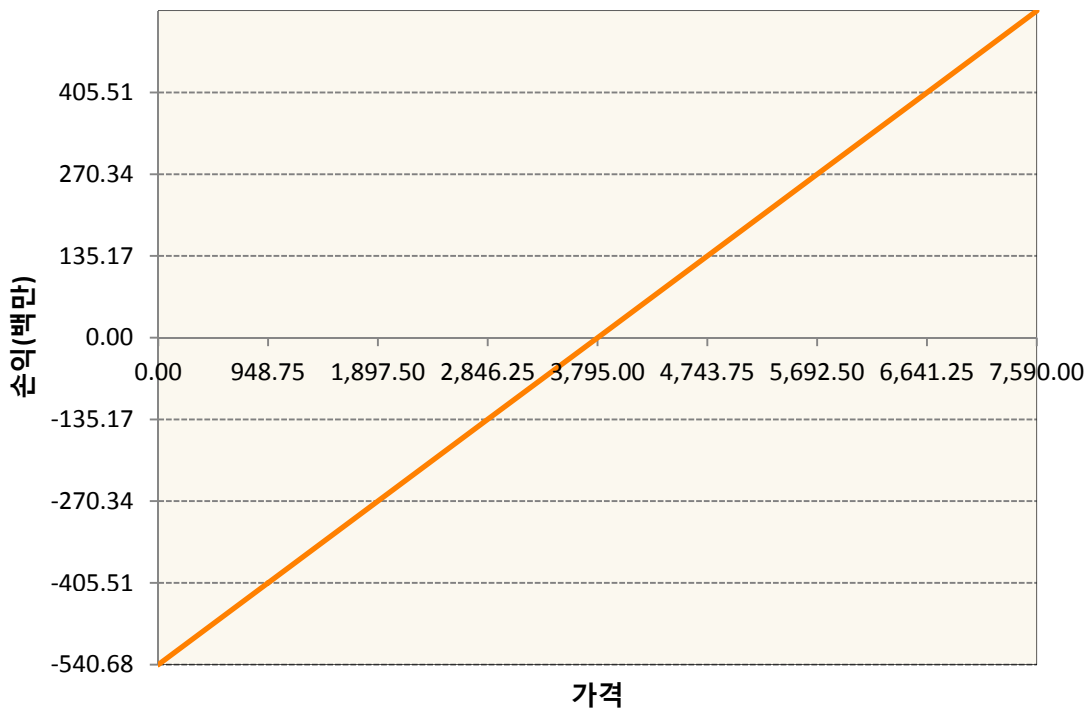
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	541	0	541	

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	2020-01-21
기준일	2020-01-20

차이나인덱스모(주식-파생형)

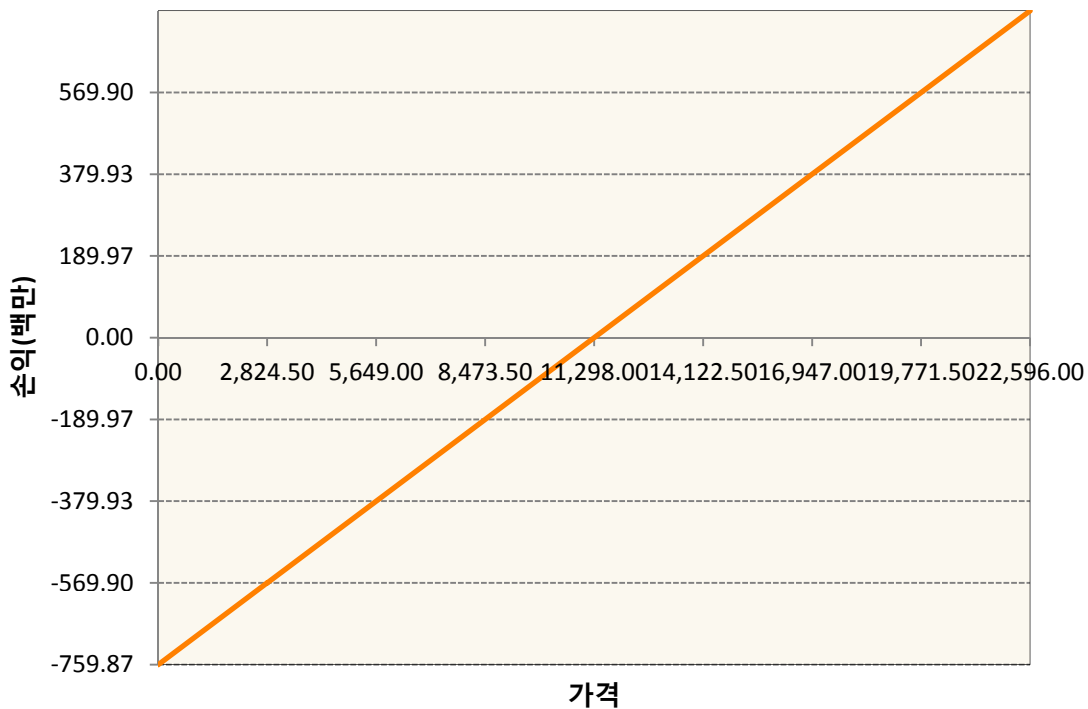
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	760	0	760	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCF0-HSCEI Futures Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

53

공시일	2020-01-21
기준일	2020-01-20

커버드콜모(주식혼합-파생형)

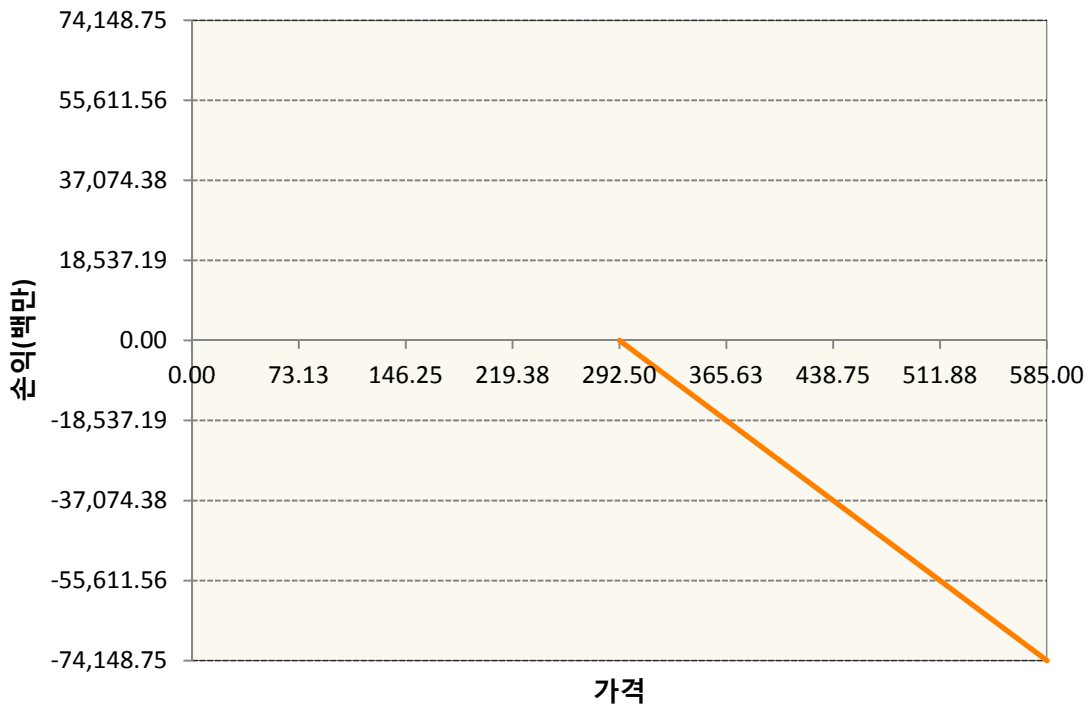
1. 계약금액

(단위:백만원)

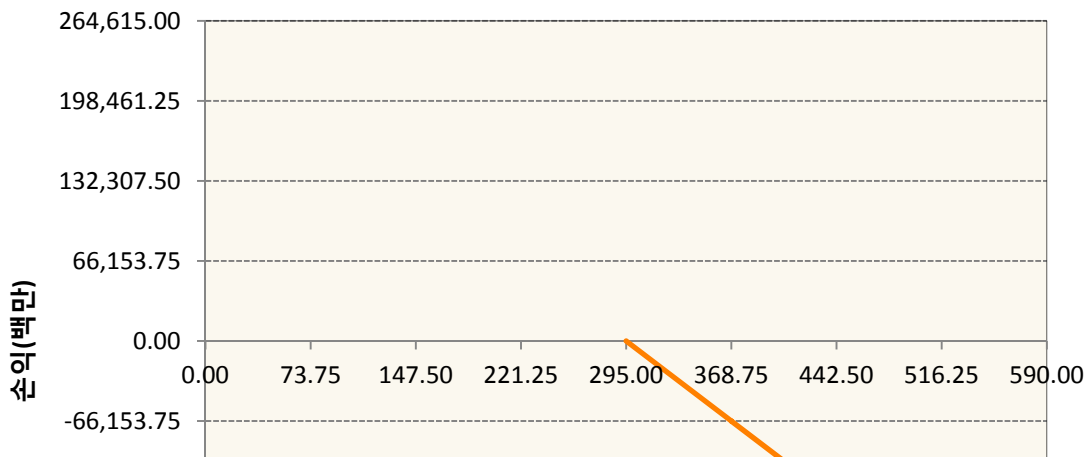
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	3,511	0	3,511	장내
누계	유가증권	옵션	0	458,683	-458,683	장내

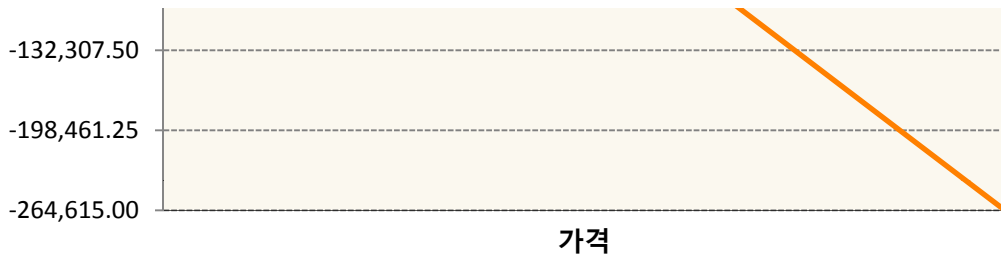
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q22927-2020-02 콜292.5

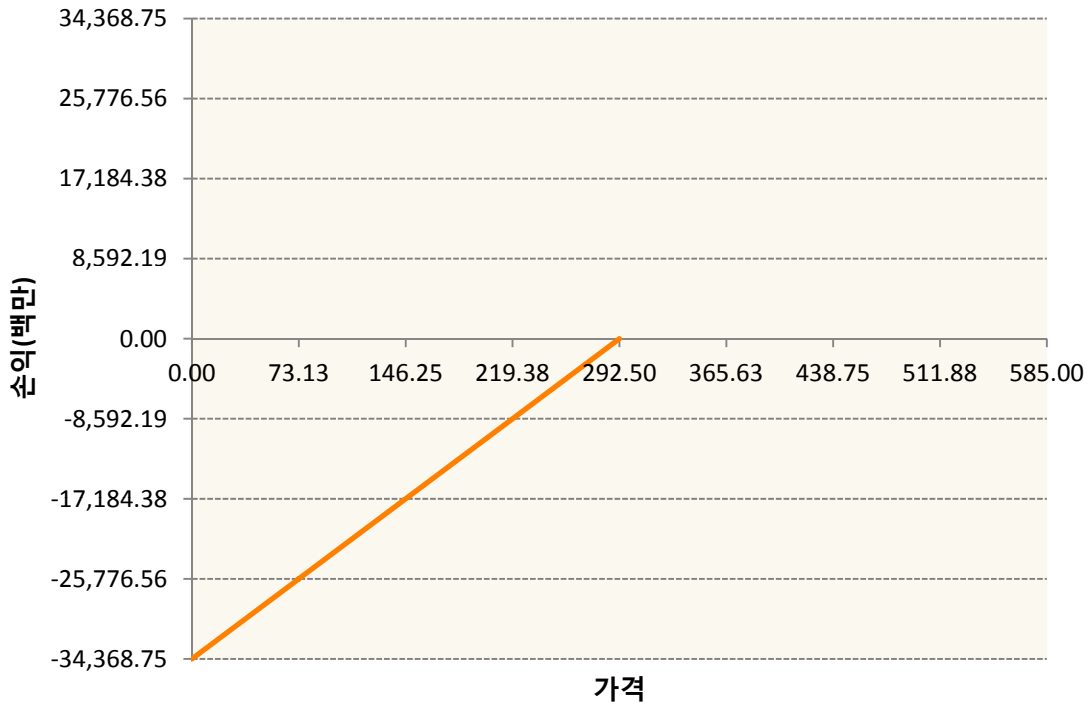


KR4201Q22950-2020-02 콜295

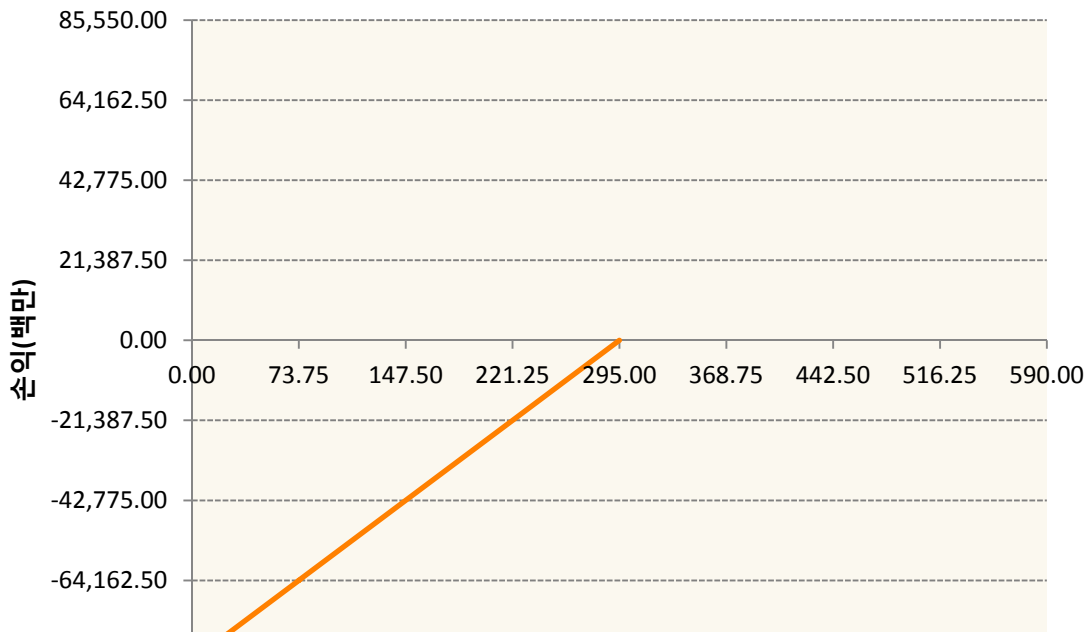




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



KR4301Q22958-2020-02 풋295



-85,550.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q22927		2020-02 콜292.5						5,534
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,733	3,582	3,426	3,265	3,100	2,933	2,763	
-5.33%	3,026	2,840	2,654	2,467	2,280	2,093	1,906	
-2.67%	1,931	1,746	1,561	1,374	1,187	999	811	
0%	470	320	163	0	-167	-338	-512	
2.67%	-1,268	-1,370	-1,485	-1,610	-1,744	-1,886	-2,034	
5.33%	-3,180	-3,238	-3,311	-3,397	-3,495	-3,604	-3,721	
8.00%	-5,182	-5,211	-5,252	-5,305	-5,370	-5,447	-5,534	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						19,145
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	12,164	11,680	11,168	10,634	10,082	9,515	8,937	
-5.33%	10,040	9,403	8,760	8,113	7,462	6,808	6,153	
-2.67%	6,589	5,915	5,240	4,564	3,887	3,210	2,533	
0%	1,801	1,217	615	0	-626	-1,261	-1,902	
2.67%	-4,074	-4,495	-4,956	-5,450	-5,970	-6,513	-7,075	
5.33%	-10,675	-10,930	-11,238	-11,590	-11,983	-12,410	-12,866	
8.00%	-17,678	-17,811	-17,991	-18,217	-18,487	-18,798	-19,145	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						1,422
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,298	-1,313	-1,330	-1,350	-1,372	-1,396	-1,422	
-5.33%	-518	-555	-593	-631	-670	-708	-747	
-2.67%	-83	-118	-153	-189	-226	-263	-301	
0%	46	33	18	0	-21	-43	-68	
2.67%	64	62	59	54	47	38	27	
5.33%	65	65	65	64	62	60	56	
8.00%	65	65	65	65	65	64	64	
KR4301Q22958		2020-02 풋295						4,022
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,794	-3,816	-3,845	-3,881	-3,923	-3,970	-4,022	
-5.33%	-1,703	-1,781	-1,862	-1,947	-2,033	-2,121	-2,211	
-2.67%	-343	-439	-537	-635	-734	-833	-932	
0%	160	114	60	0	-65	-134	-208	
2.67%	252	243	228	208	182	151	114	

5.33%	260	259	257	253	247	237	224
8.00%	260	260	260	260	259	257	253

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

(단위:백만원)

28,752

공시일	2020-01-21
기준일	2020-01-20

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

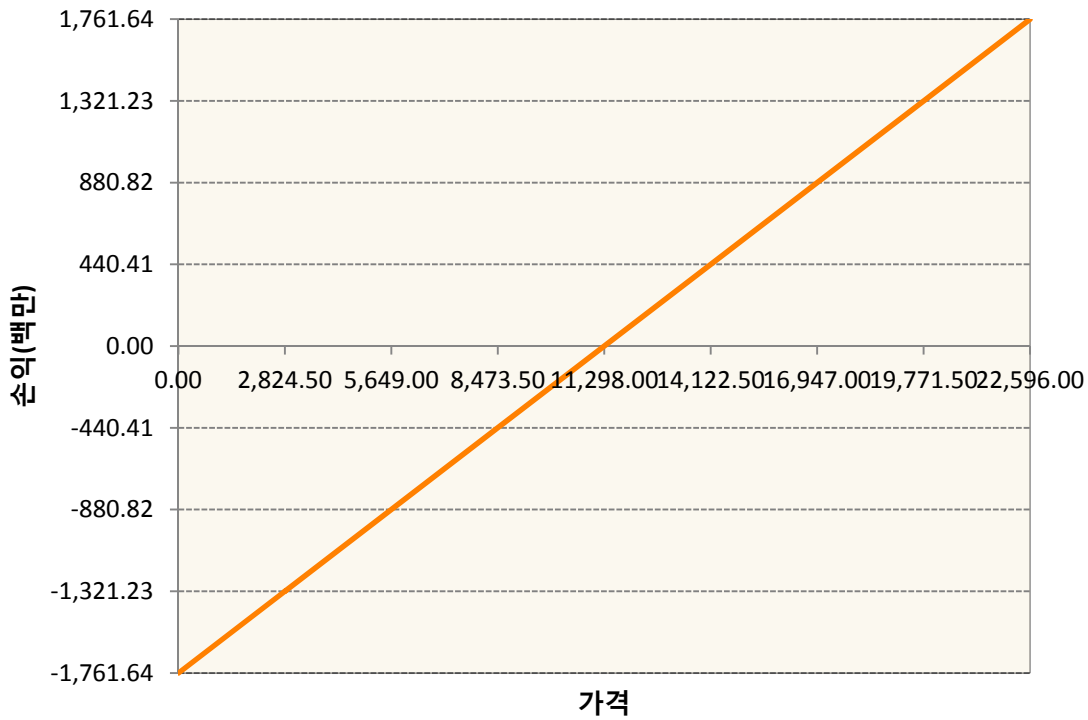
1. 계약금액

(단위:백만원)

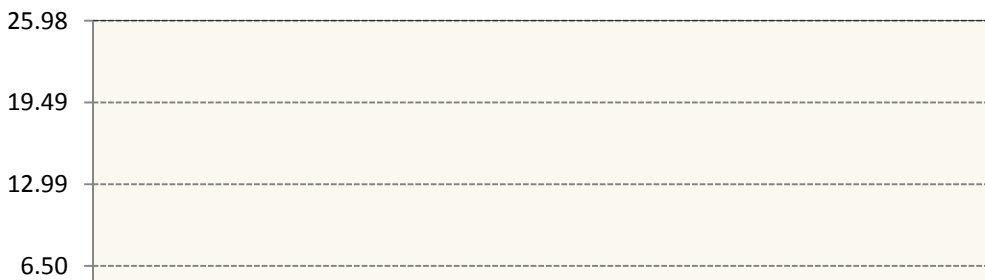
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,762	0	1,762	장내
누계	유가증권	옵션	0	49	-49	장내
누계	통화	선도	0	2,099	-2,099	장외

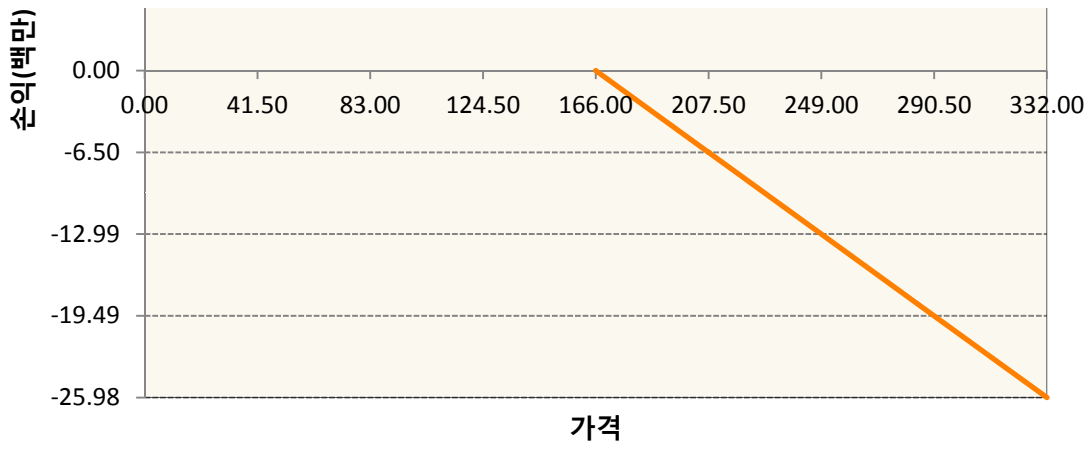
2. 만기시점의 손익구조

HCFO-HSCEI Futures Jan20

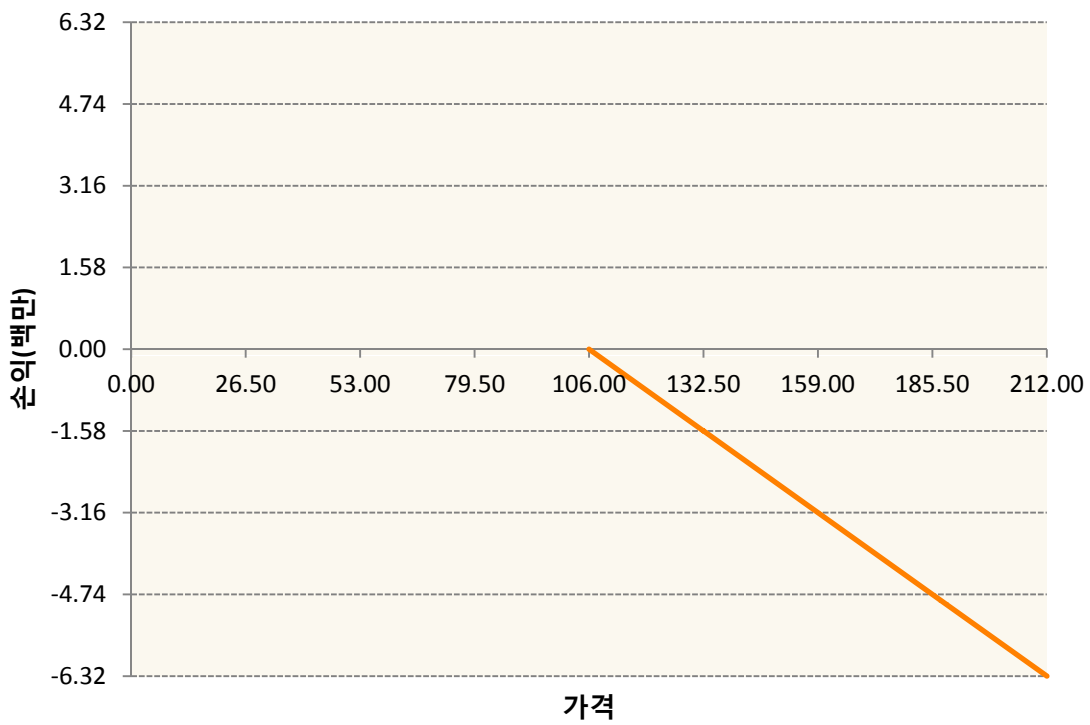


OHHIF0-C112-HSCEI

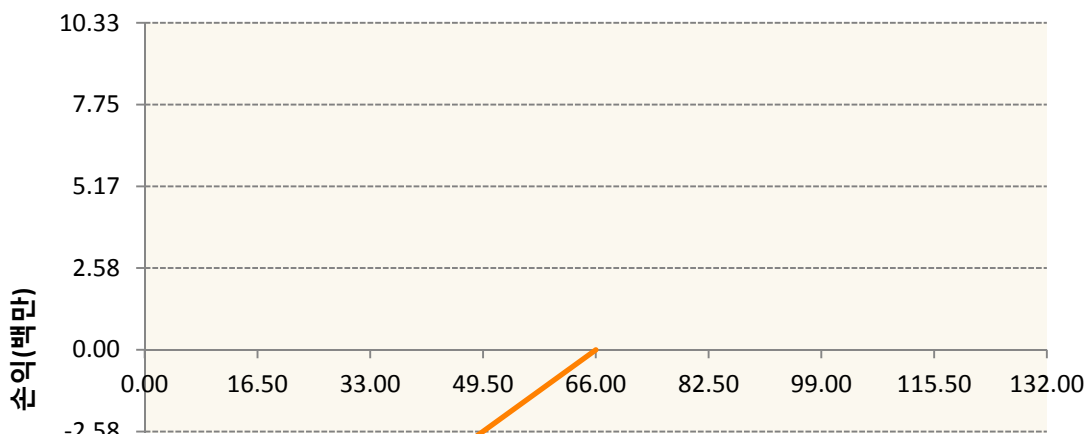


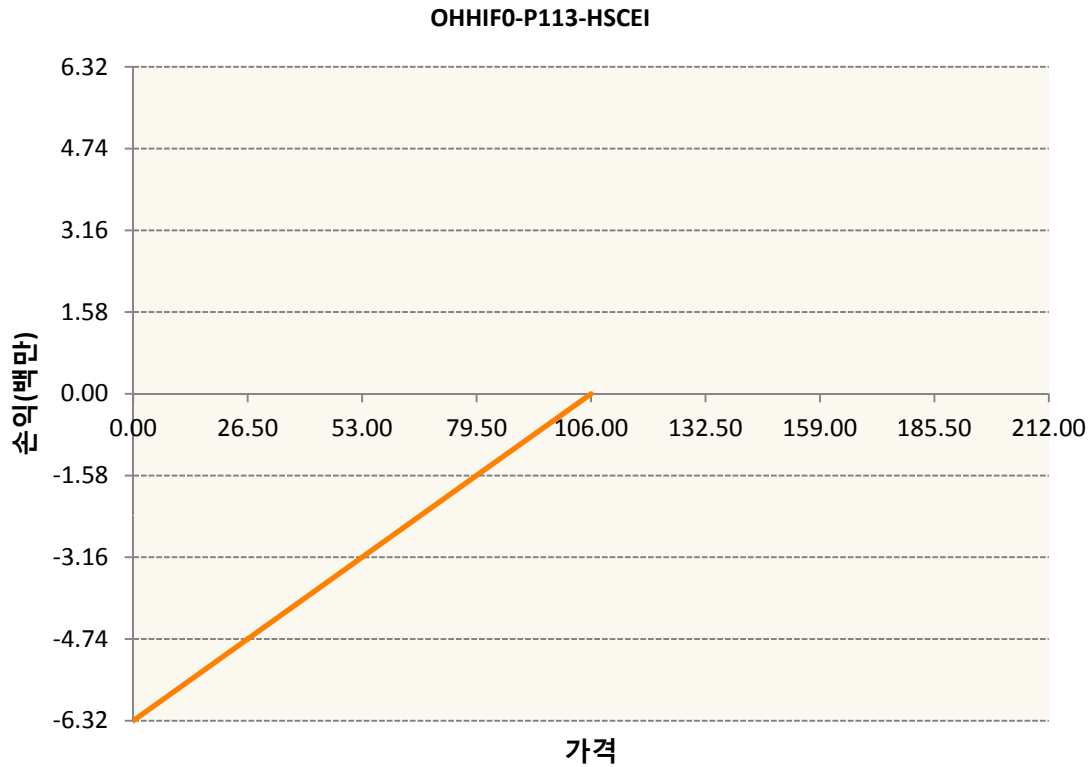
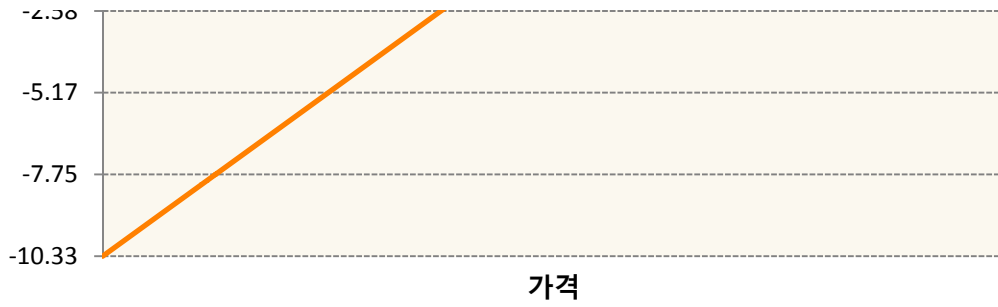


OHHIF0-C113-HSCEI



OHHIF0-P112-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	168
HCF0 HSCEI Futures Jan20	141
OHHIF0-C11 HSCEI	2
OHHIF0-C11 HSCEI	1
OHHIF0-P11 HSCEI	1
OHHIF0-P11 HSCEI	1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	182

공시일	2020-01-21
기준일	2020-01-20

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

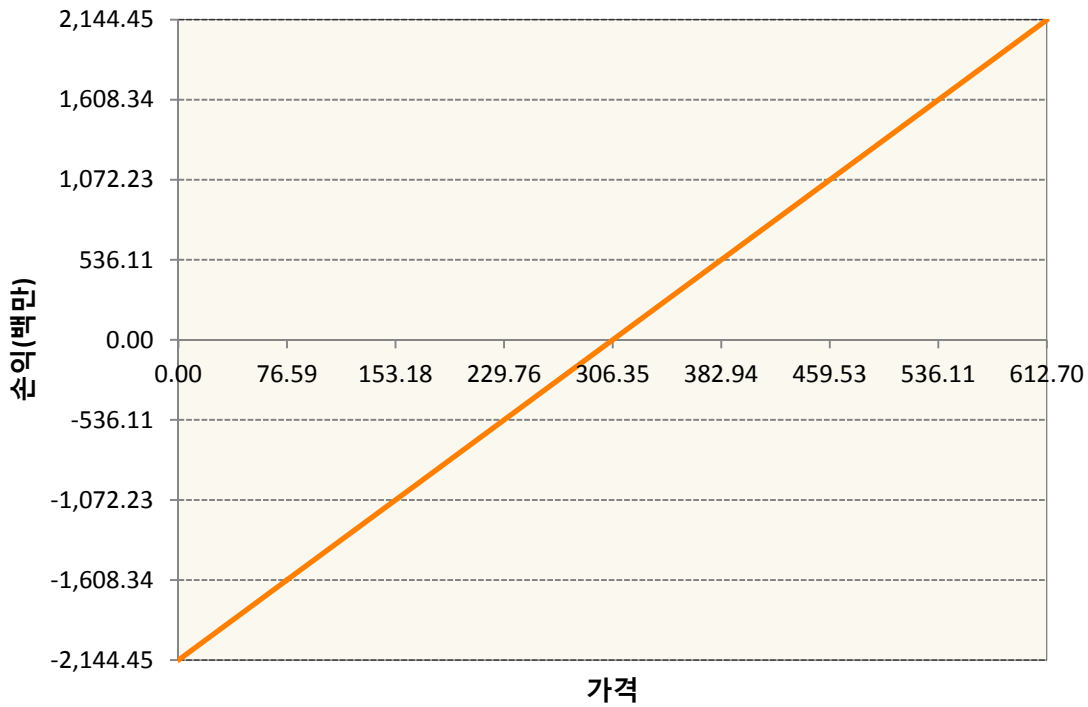
1. 계약금액

(단위:백만원)

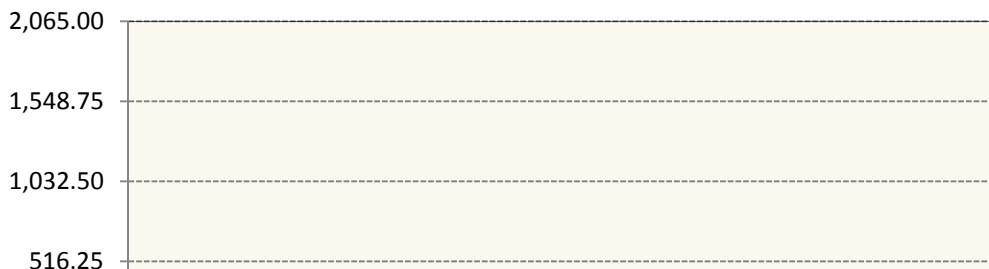
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	76	-76	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	71	0	71	장내
누계	유가증권	선물	2,144	0	2,144	장내
누계	유가증권	스왑	3,625	0	3,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,902	-3,902	장내

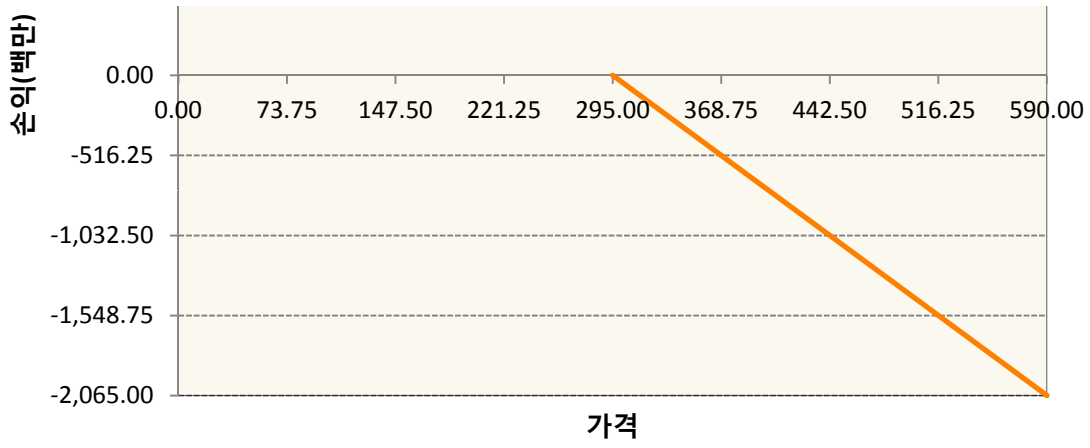
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

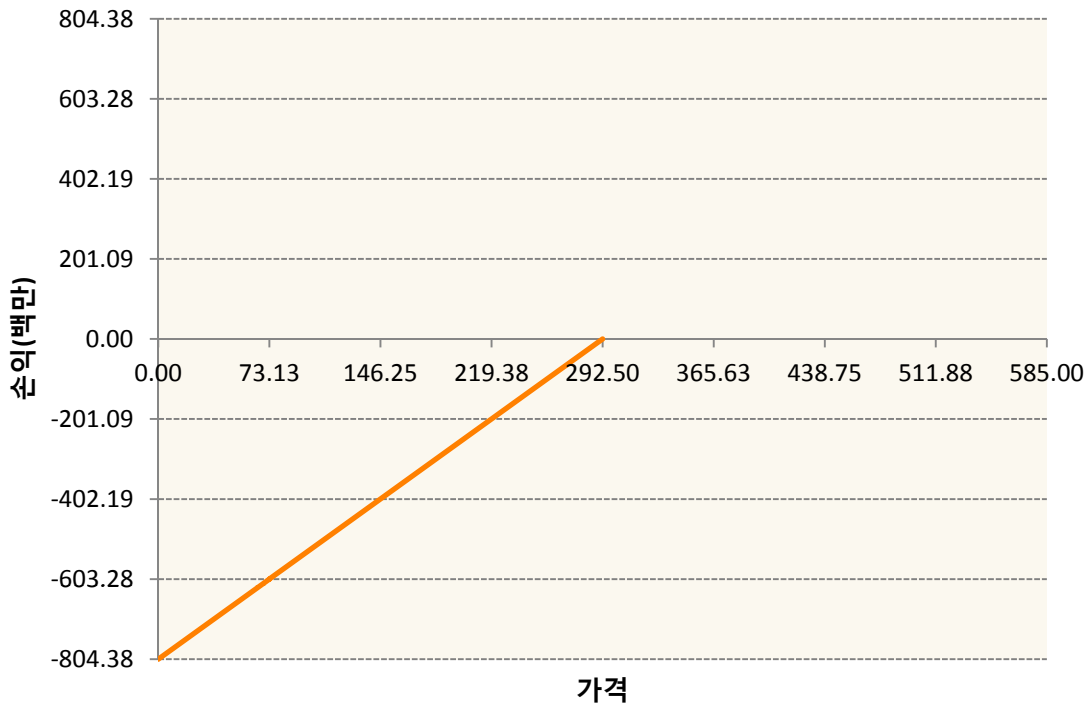


KR4201Q22950-2020-02 콜295

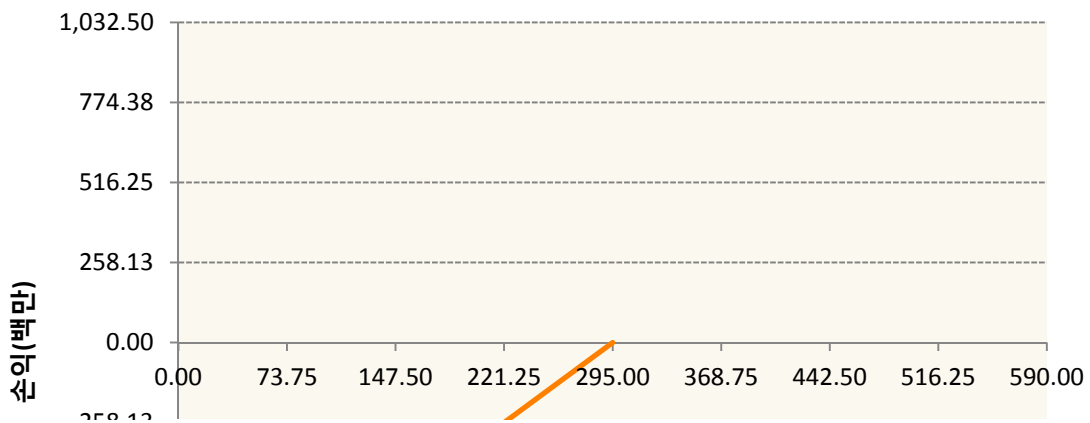




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



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						171
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-171	-171	-171	-171	-171	-171	-171	
-5.33%	-114	-114	-114	-114	-114	-114	-114	
-2.67%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	57	57	57	57	57	57	57	
5.33%	114	114	114	114	114	114	114	
8.00%	171	171	171	171	171	171	171	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						149
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	95	91	87	83	79	74	70	
-5.33%	78	73	68	63	58	53	48	
-2.67%	51	46	41	36	30	25	20	
0%	14	9	5	0	-5	-10	-15	
2.67%	-32	-35	-39	-43	-47	-51	-55	
5.33%	-83	-85	-88	-90	-94	-97	-100	
8.00%	-138	-139	-140	-142	-144	-147	-149	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						33
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-30	-31	-31	-32	-32	-33	-33
-5.33%	-12	-13	-14	-15	-16	-17	-17
-2.67%	-2	-3	-4	-4	-5	-6	-7
0%	1	1	0	0	0	-1	-2
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	2	2	2	1	1	1	1
8.00%	2	2	2	2	2	2	1
KR4301Q22958 2020-02 풋295							49
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-46	-46	-46	-47	-47	-48	-49
-5.33%	-21	-21	-22	-23	-25	-26	-27
-2.67%	-4	-5	-6	-8	-9	-10	-11
0%	2	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	3	3	3	3	2	2	1
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

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

(단위:백만원)

651

공시일	2020-01-21
기준일	2020-01-20

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

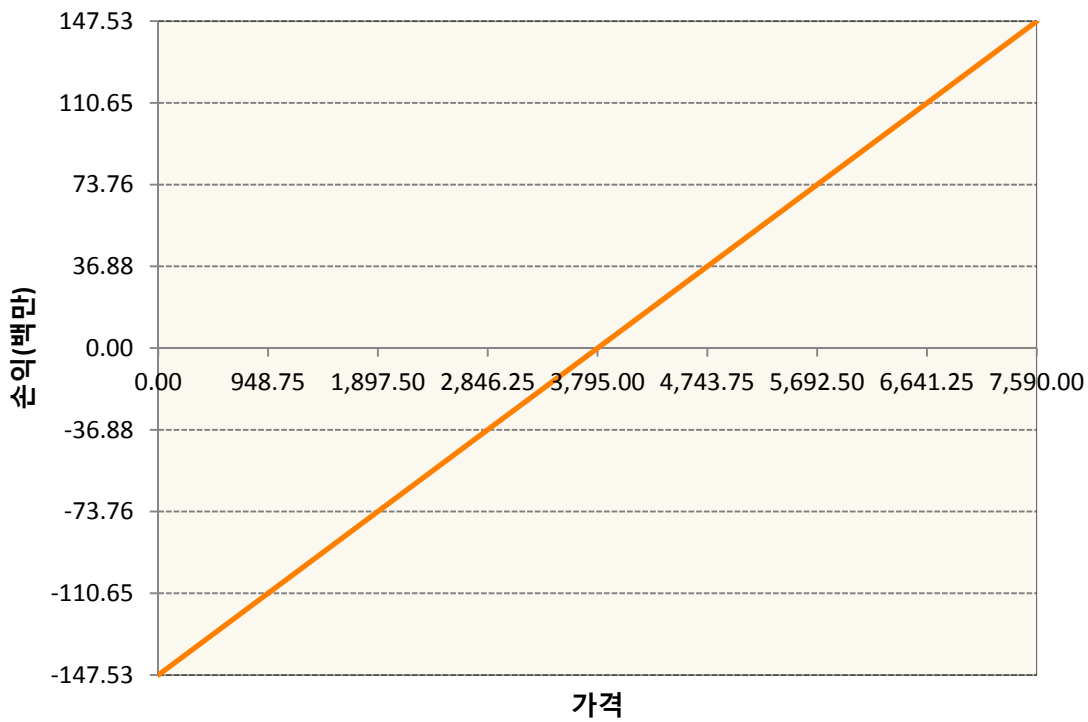
1. 계약금액

(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	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	148	0	148	
누계	유가증권	스왑	16,223	0	16,223	장외
누계	통화	선도	0	3,373	-3,373	장외

2. 만기시점의 손익구조

VGHO-EURO STOXX 50 Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	0
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	270
VGHO EURO STOXX 50 Mar20	12

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

(단위:백만원)

923

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

(단위:백만원)

80

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

(단위:백만원)

117

공시일	2020-01-21
기준일	2020-01-20

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

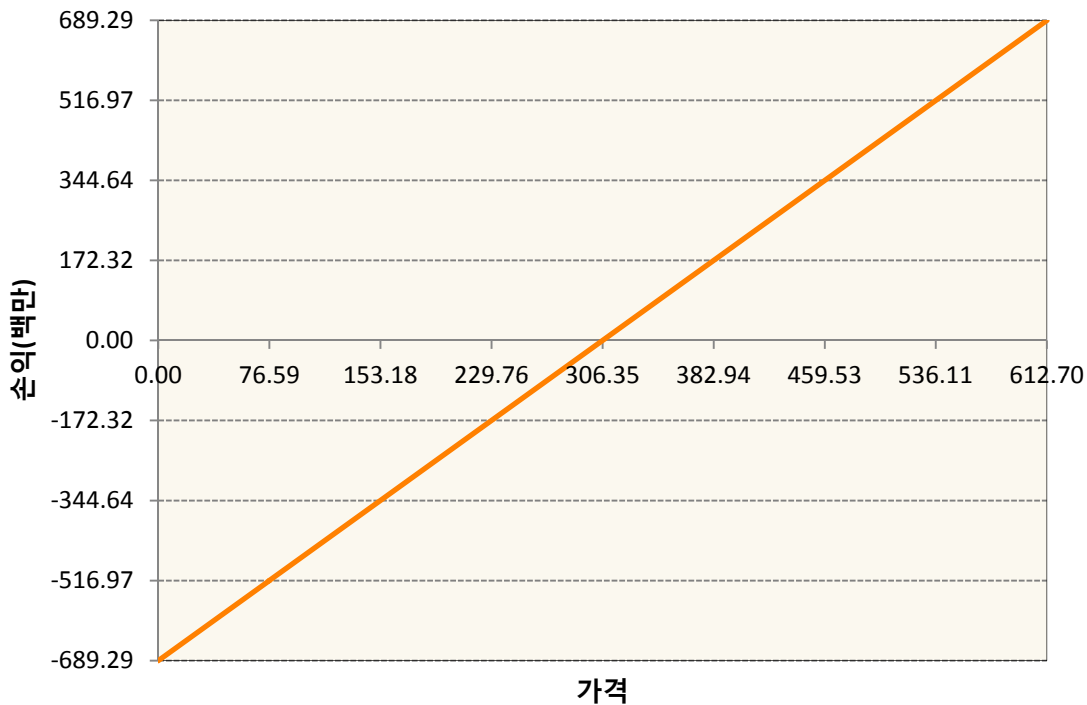
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	689	0	689	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%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-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%	37	37	37	37	37	37	37
8.00%	55	55	55	55	55	55	55

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

(단위:백만원)

42

공시일	2020-01-21
기준일	2020-01-20

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

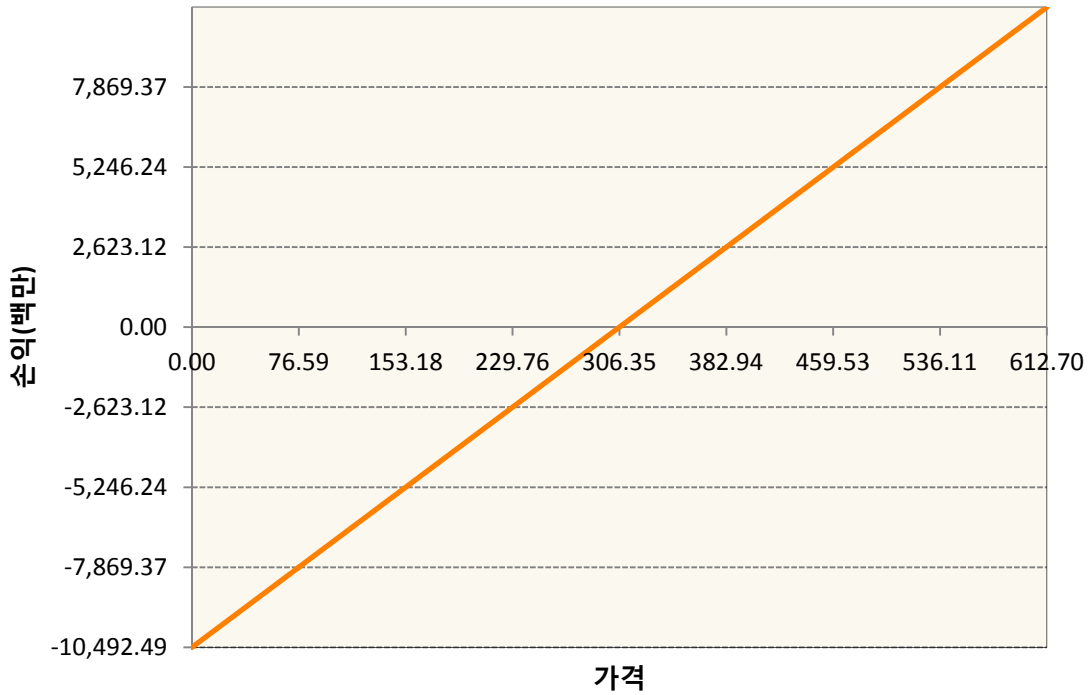
1. 계약금액

(단위:백만원)

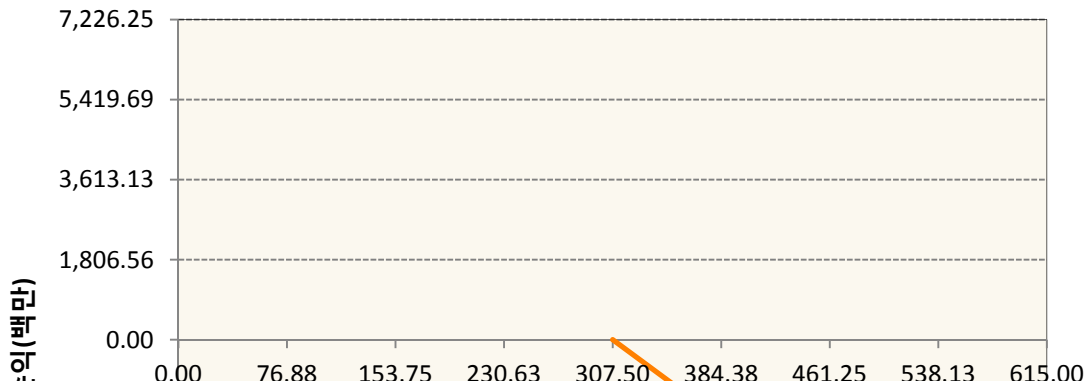
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	153	-153	장내
신규	유가증권	옵션	153	0	153	장내
누계	유가증권	선물	10,492	0	10,492	장내
누계	유가증권	옵션	2,944	20,789	-17,845	장내

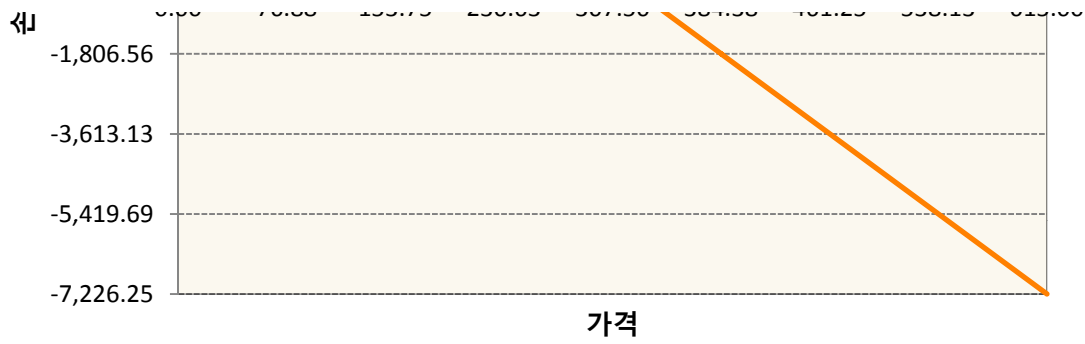
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

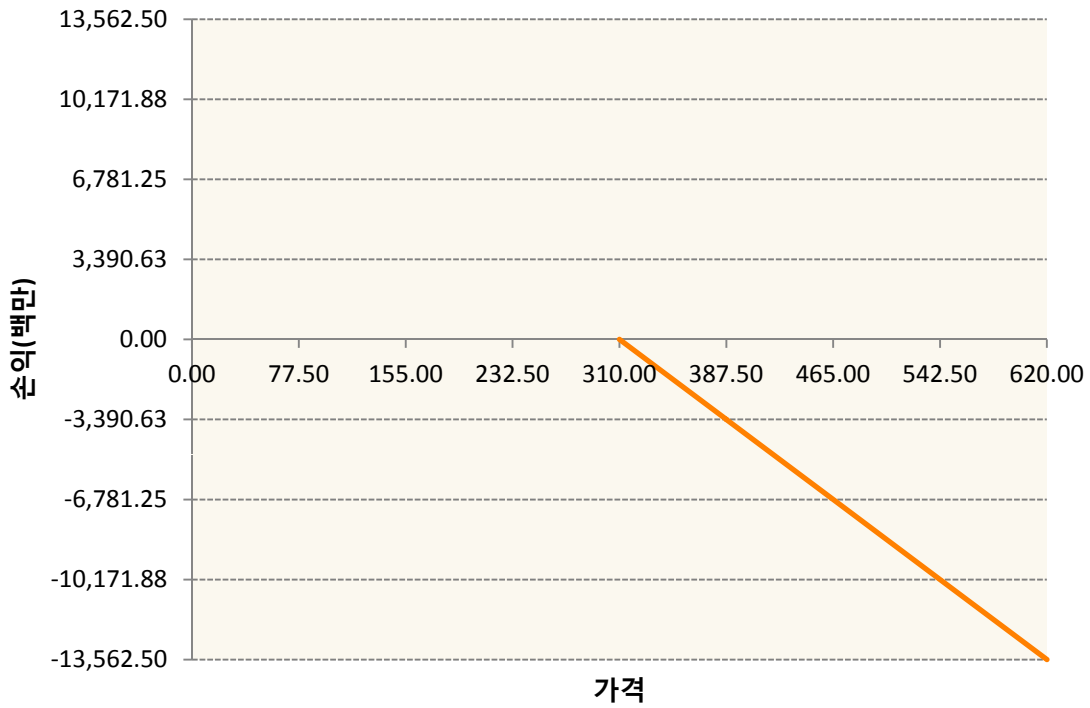


KR4201Q23073-2020-02 콜307.5

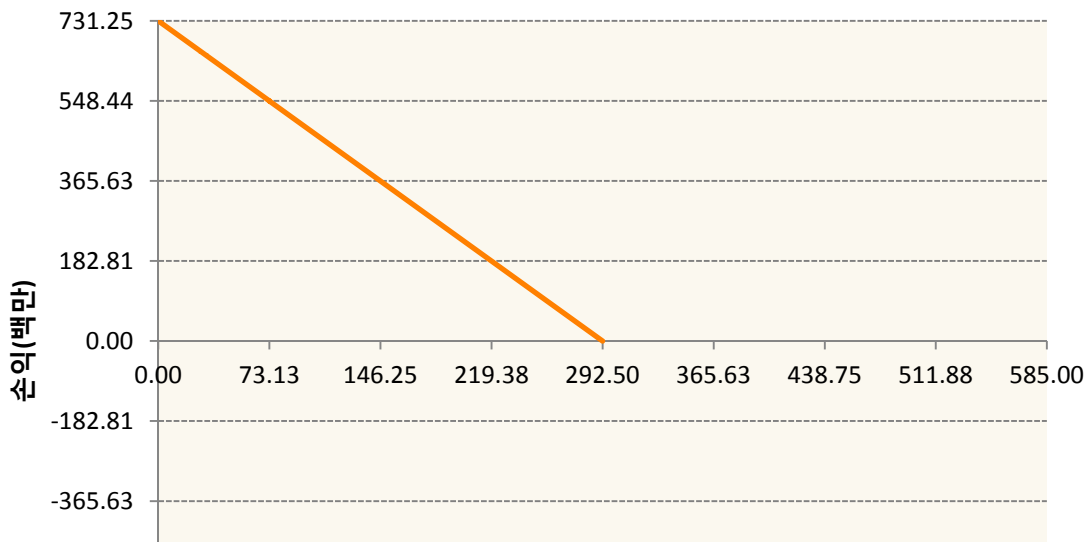


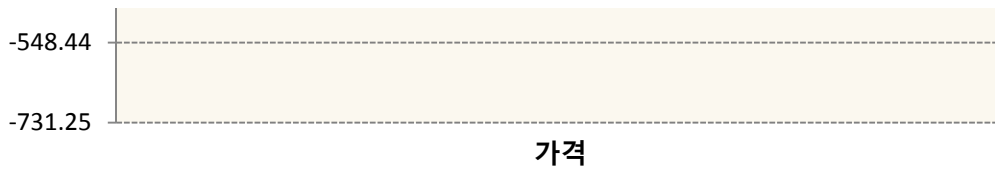


KR4201Q23107-2020-02 콜310

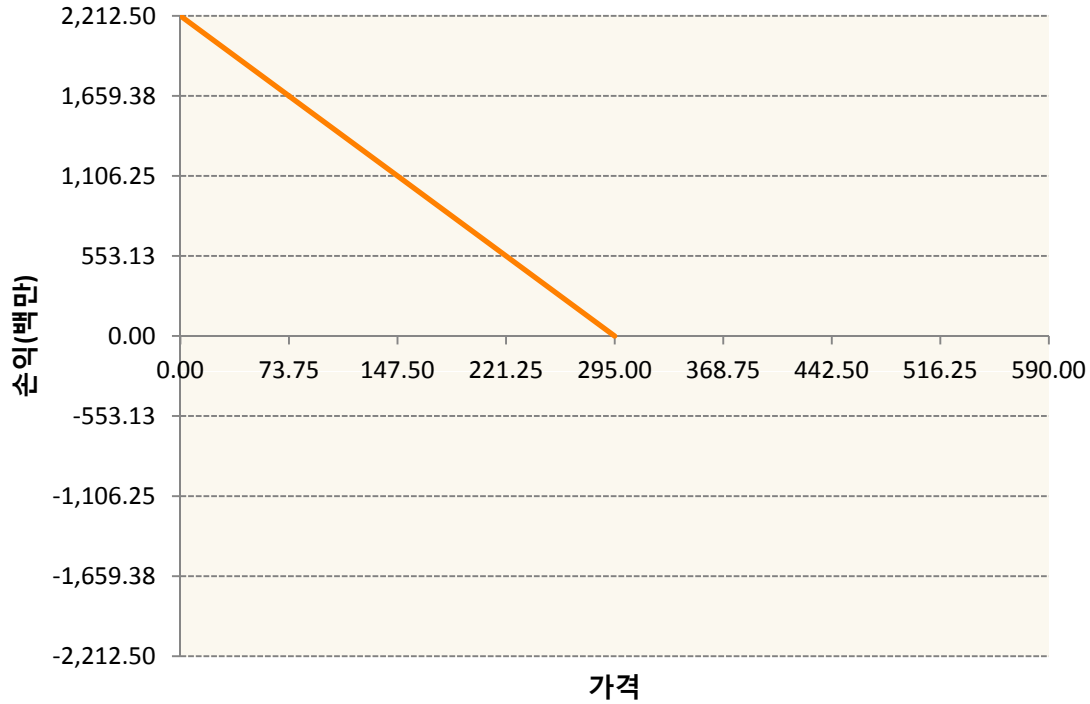


KR4301Q22925-2020-02 풋292.5





KR4301Q22958-2020-02 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						837
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-837	-837	-837	-837	-837	-837	-837	
-5.33%	-558	-558	-558	-558	-558	-558	-558	
-2.67%	-279	-279	-279	-279	-279	-279	-279	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	279	279	279	279	279	279	279	
5.33%	558	558	558	558	558	558	558	
8.00%	837	837	837	837	837	837	837	
KR4201Q23073		2020-02 콜307.5						426
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	189	183	176	167	158	147	136	
-5.33%	169	158	146	134	120	106	92	
-2.67%	127	112	96	79	63	46	29	

0%	55	37	18	0	-18	-37	-55
2.67%	-52	-69	-87	-105	-123	-142	-160
5.33%	-190	-204	-219	-235	-251	-268	-284
8.00%	-352	-362	-373	-385	-398	-412	-426
KR4201Q23107 2020-02 콜310							760
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	310	301	289	276	260	242	223
-5.33%	281	264	244	222	199	175	149
-2.67%	217	190	162	133	103	73	42
0%	101	67	34	0	-34	-68	-102
2.67%	-78	-112	-147	-181	-216	-250	-285
5.33%	-319	-348	-378	-409	-441	-473	-506
8.00%	-608	-629	-652	-678	-704	-732	-760
KR4301Q22925 2020-02 풋292.5							30
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	28	28	28	29	29	30	30
-5.33%	11	12	13	13	14	15	16
-2.67%	2	3	3	4	5	6	6
0%	-1	-1	0	0	0	1	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
KR4301Q22958 2020-02 풋295							104
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	98	99	99	100	101	103	104
-5.33%	44	46	48	50	53	55	57
-2.67%	9	11	14	16	19	22	24
0%	-4	-3	-2	0	2	3	5
2.67%	-7	-6	-6	-5	-5	-4	-3
5.33%	-7	-7	-7	-7	-6	-6	-6
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7

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

(단위:백만원)

1,767

공시일	2020-01-21
기준일	2020-01-20

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	205,583	0	205,583	

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	2020-01-21
기준일	2020-01-20

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	214,588	0	214,588	

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	2020-01-21
기준일	2020-01-20

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	527,003	0	527,003	
누계	통화	선도	0	579,629	-579,629	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E	1,390
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E	1,492
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E	1,853
FX21019X02 KRW/USD 21-01-20E	3,187
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E	4,725
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	185
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,779
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,779
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,316
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,501
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	1,612
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	1,519
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	926
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	185
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	1,983
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	926
FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E	3,706
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,853
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,983
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	185
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	185
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	1,112
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	1,668
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	278
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E	1,853
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E	3,187

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

15,239

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

(단위:백만원)

213

공시일	2020-01-21
기준일	2020-01-20

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

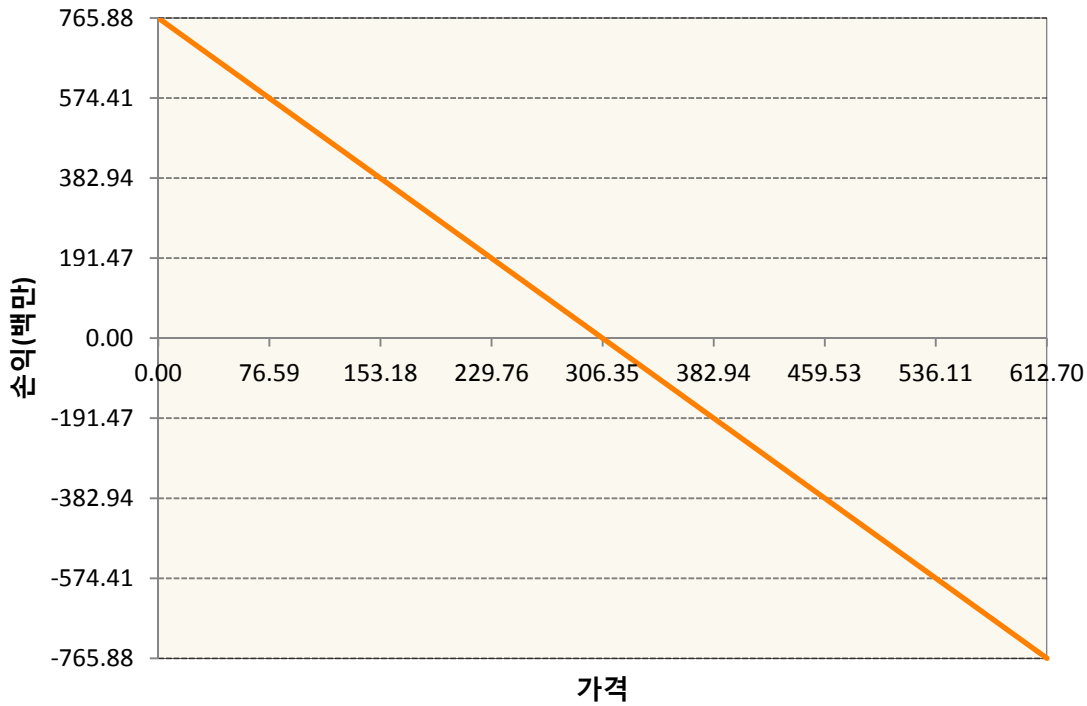
1. 계약금액

(단위:백만원)

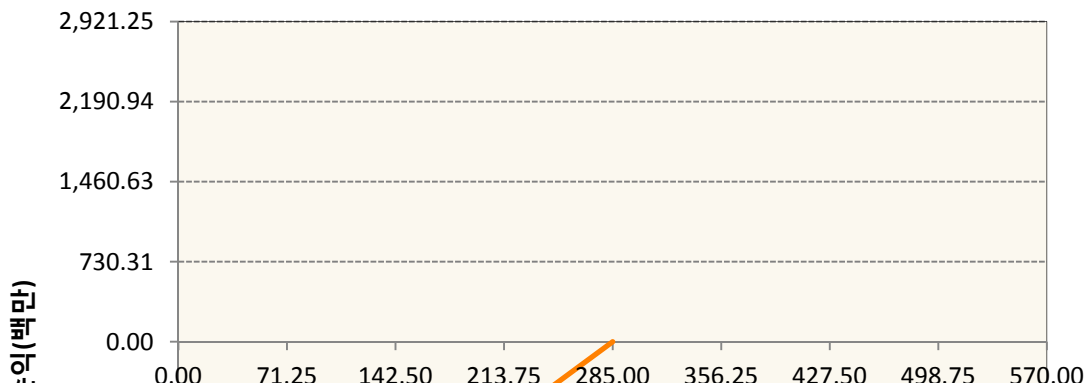
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	766	-766	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,784	-3,784	장내

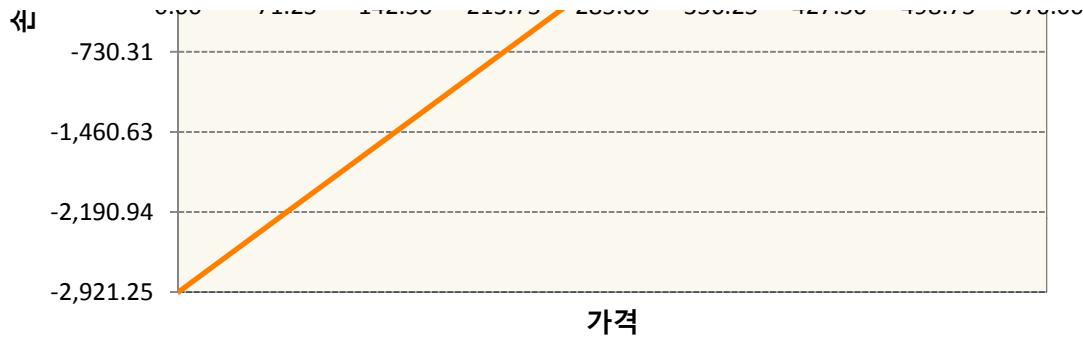
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

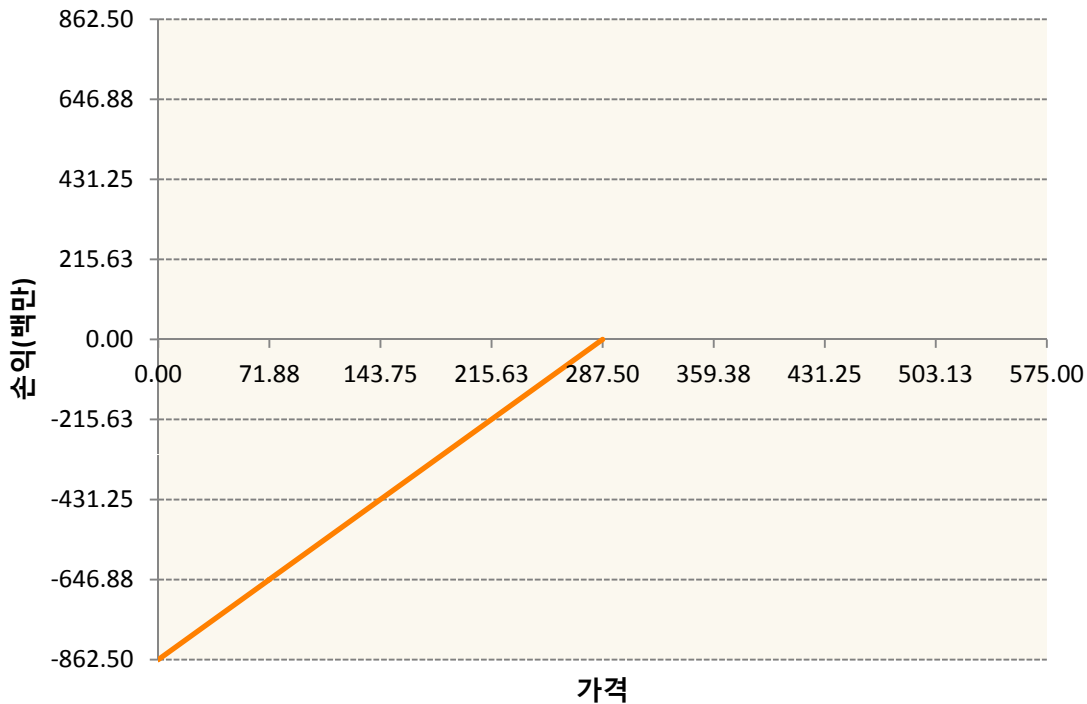


KR4301Q22859-2020-02 풋285





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%	41	41	41	41	41	41	41	
-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%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41	
8.00%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61	
KR4301Q22859		2020-02 풋285						73
기초자산의 변동성								

공시일	2020-01-21
기준일	2020-01-20

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	12,811	0	12,811	
누계	통화	선도	442	13,471	-13,029	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	343
FX21020F00! KRW/USD 13-02-20E	124
FX21020F02! USD/KRW 28-01-20E	35
FX21020F02! KRW/USD 22-01-20E	35
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

366

공시일	2020-01-21
기준일	2020-01-20

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

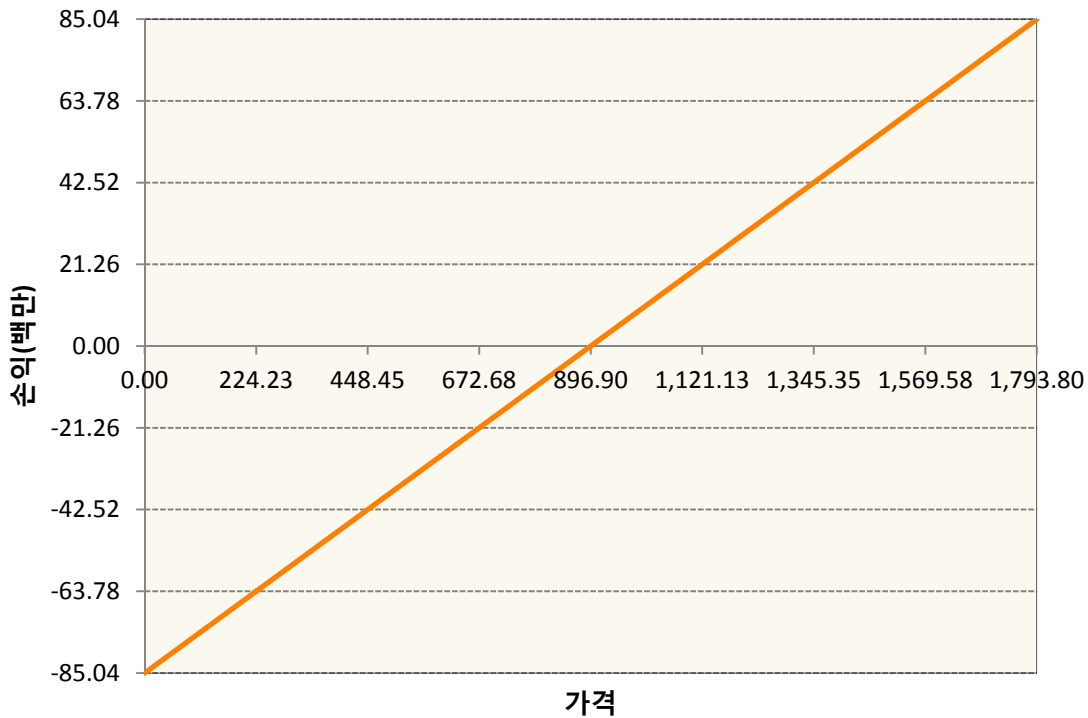
1. 계약금액

(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	1,015	0	1,015	장외
누계	통화	선도	308	810	-501	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCG0-VN30 Index Future Feb20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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
FX21020F01 KRW/EUR 27-03-20E	6
VNCG0 VN30 Index Future Feb20	7

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

(단위:백만원)

98

공시일	2020-01-21
기준일	2020-01-20

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

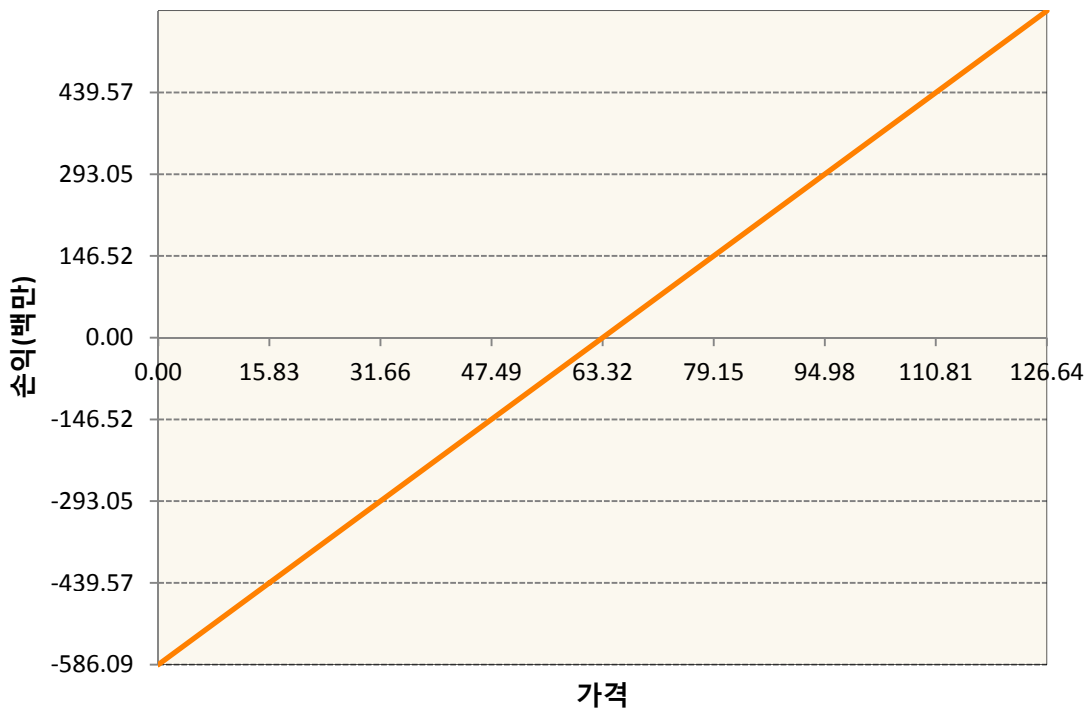
1. 계약금액

(단위:백만원)

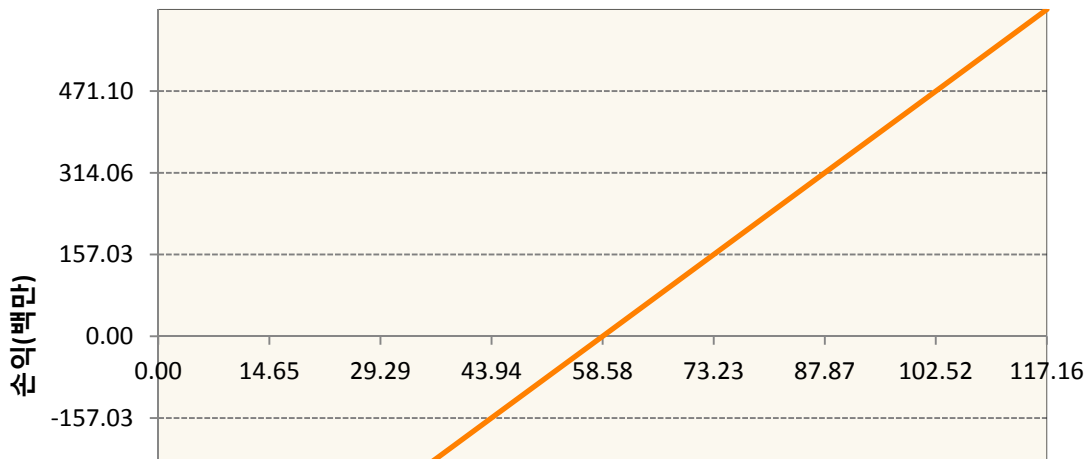
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,373	290	2,083	

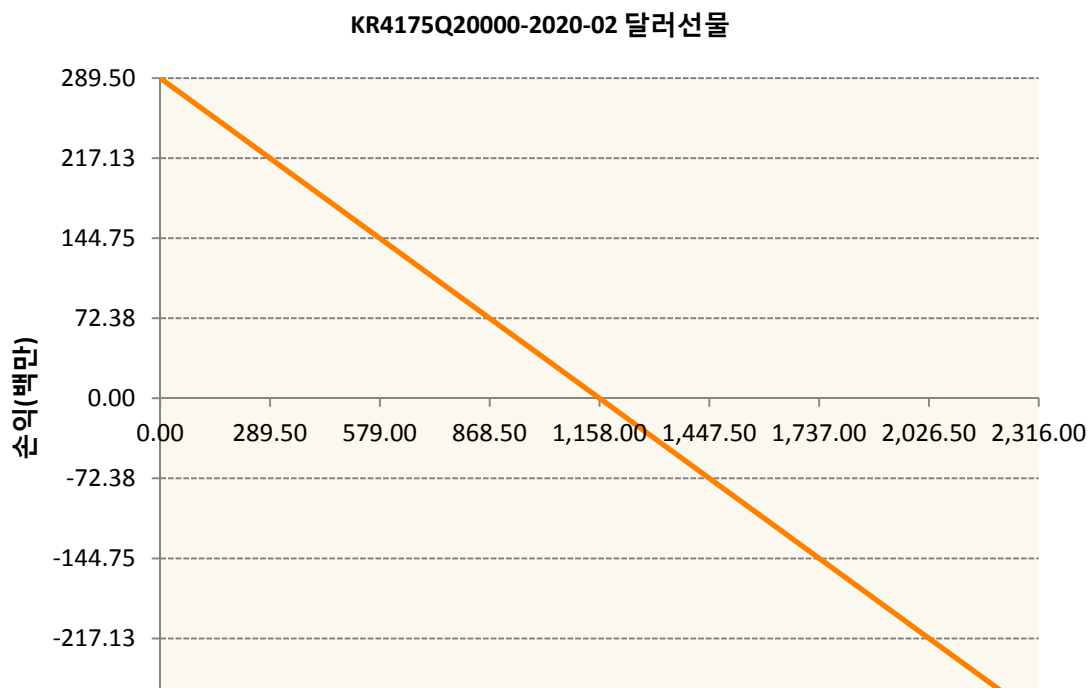
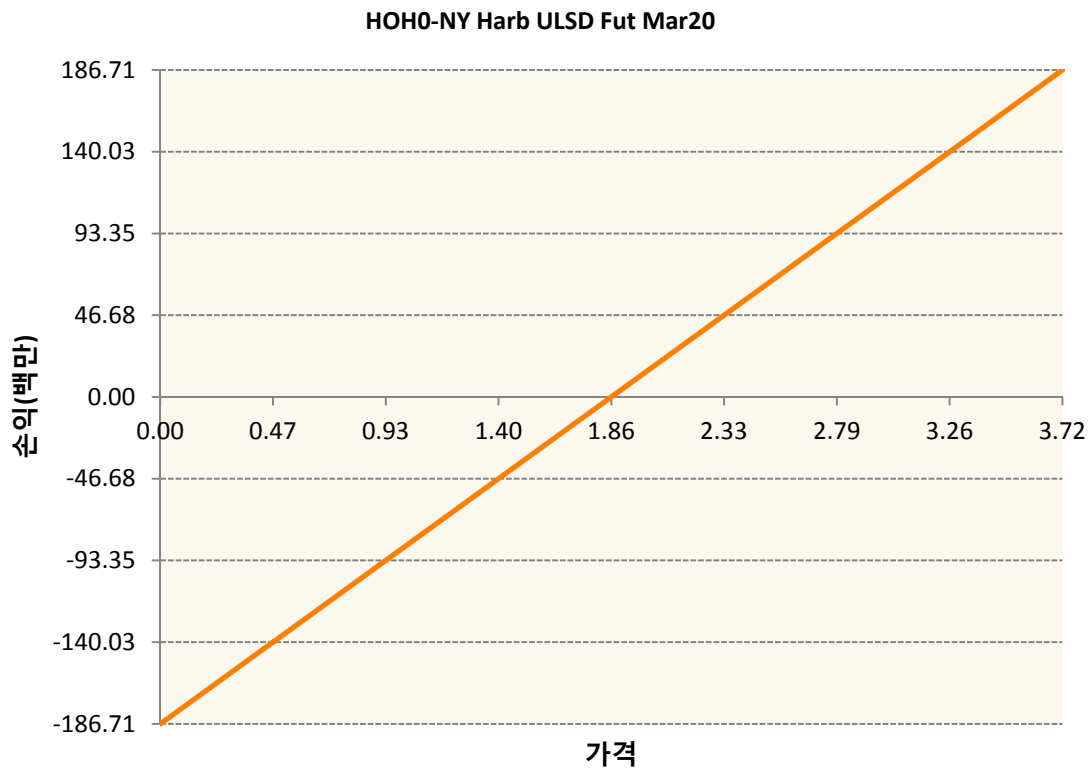
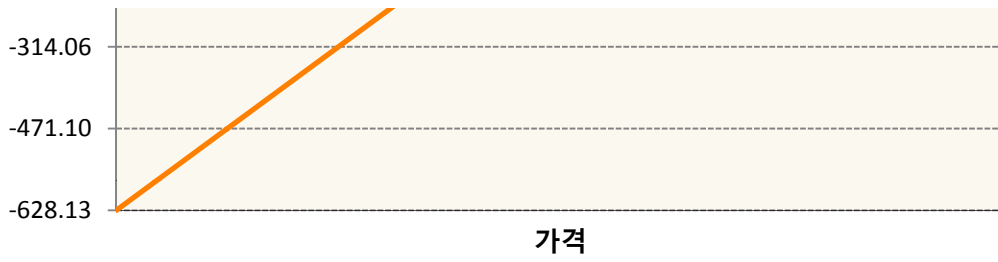
2. 만기시점의 손익구조

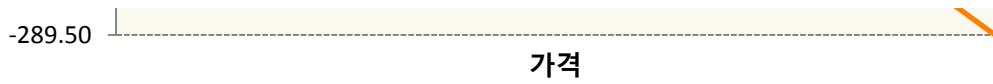
COKO-BRENT CRUDE FUTR May20



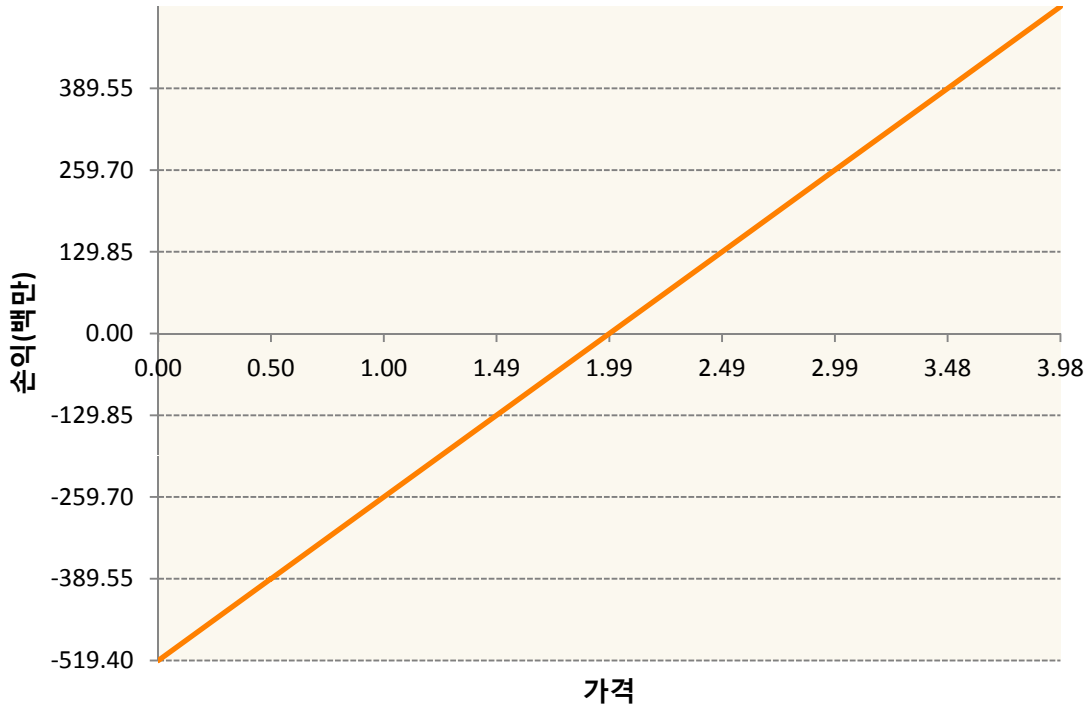
CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20



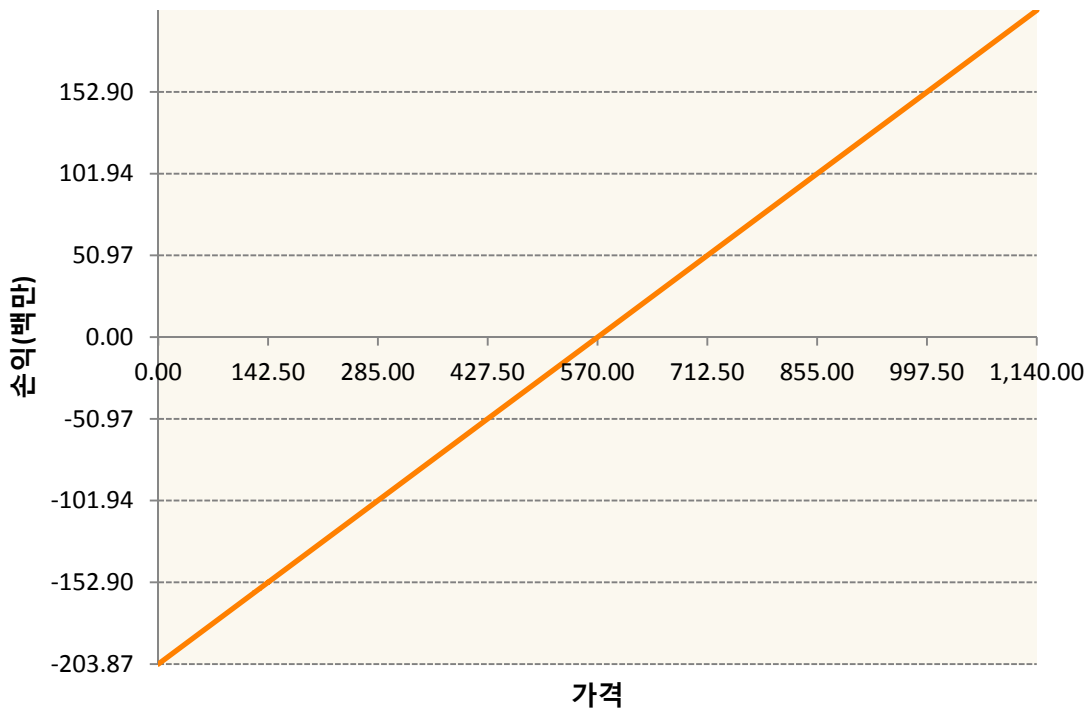




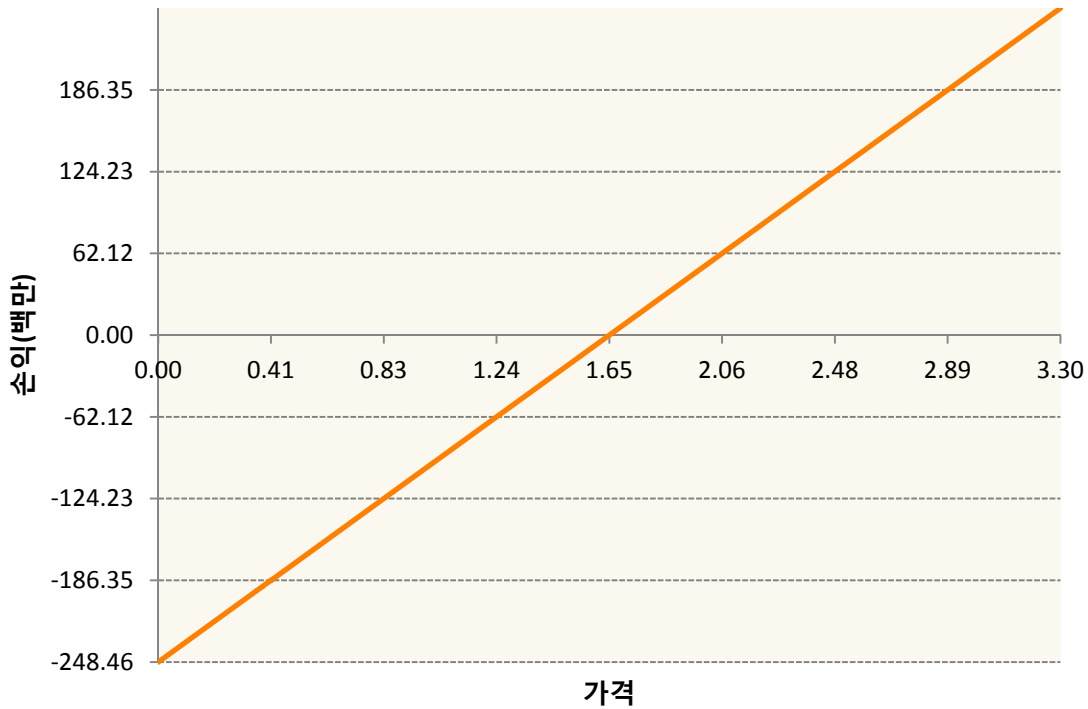
NGH20-NATURAL GAS FUTR Mar20



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	42
QSH0	Low Su Gasoil G Mar20	16
XBH0	GASOLINE RBOB FUT Mar20	20

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

367

공시일	2020-01-21
기준일	2020-01-20

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

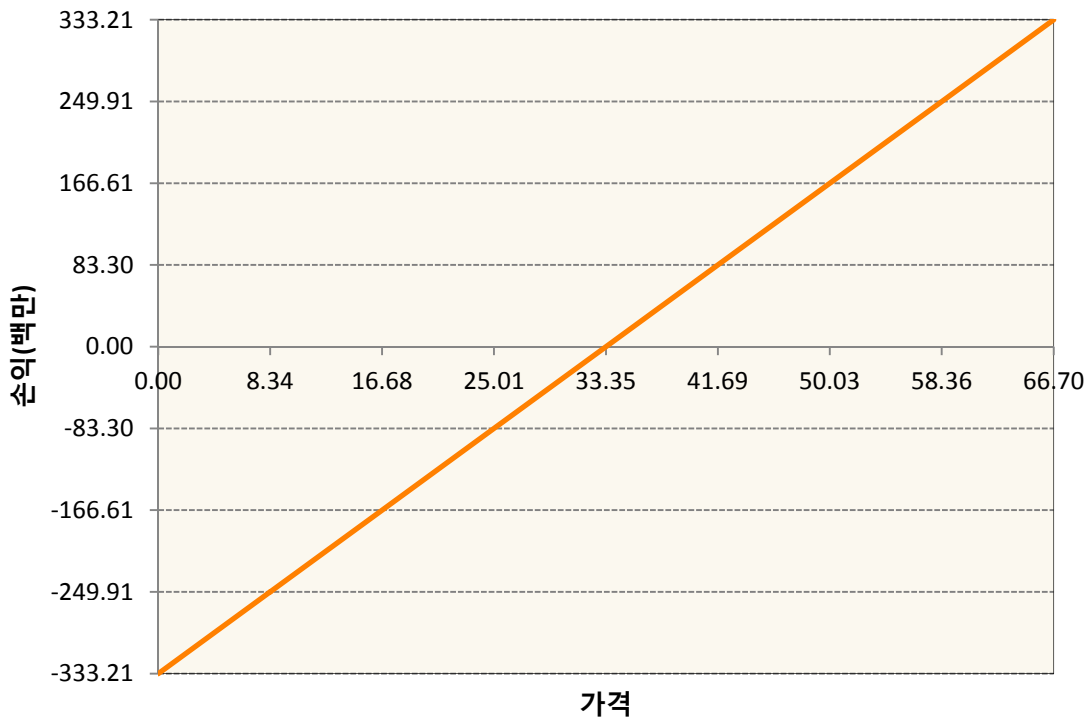
1. 계약금액

(단위:백만원)

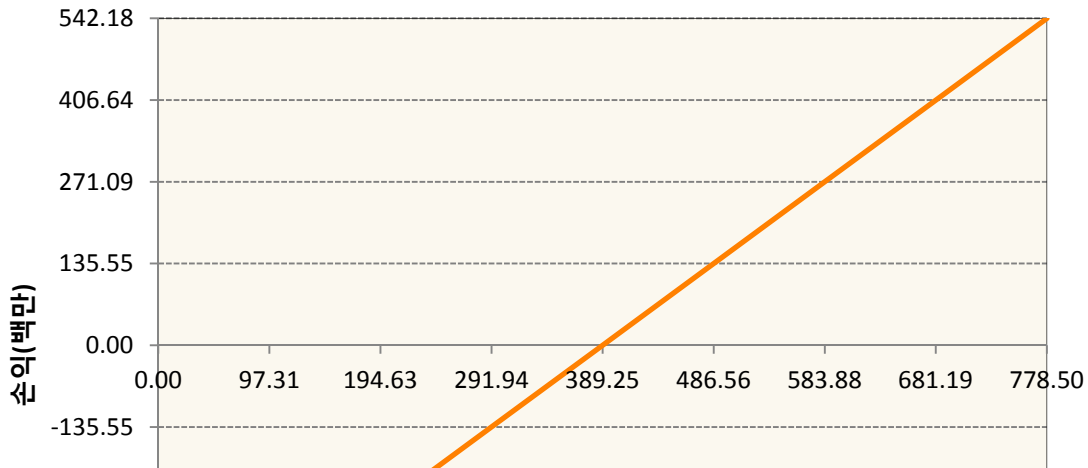
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,842	151	2,691	

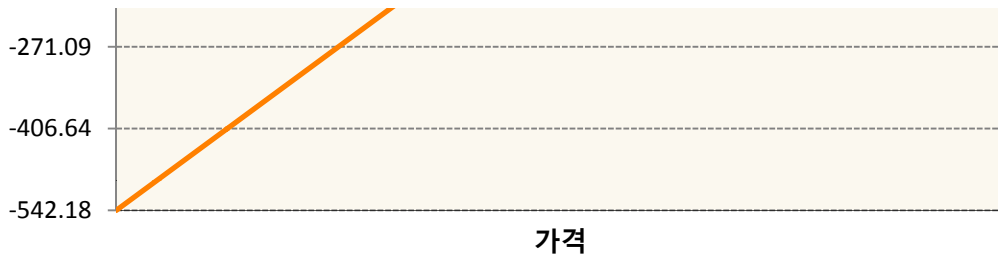
2. 만기시점의 손익구조

BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20

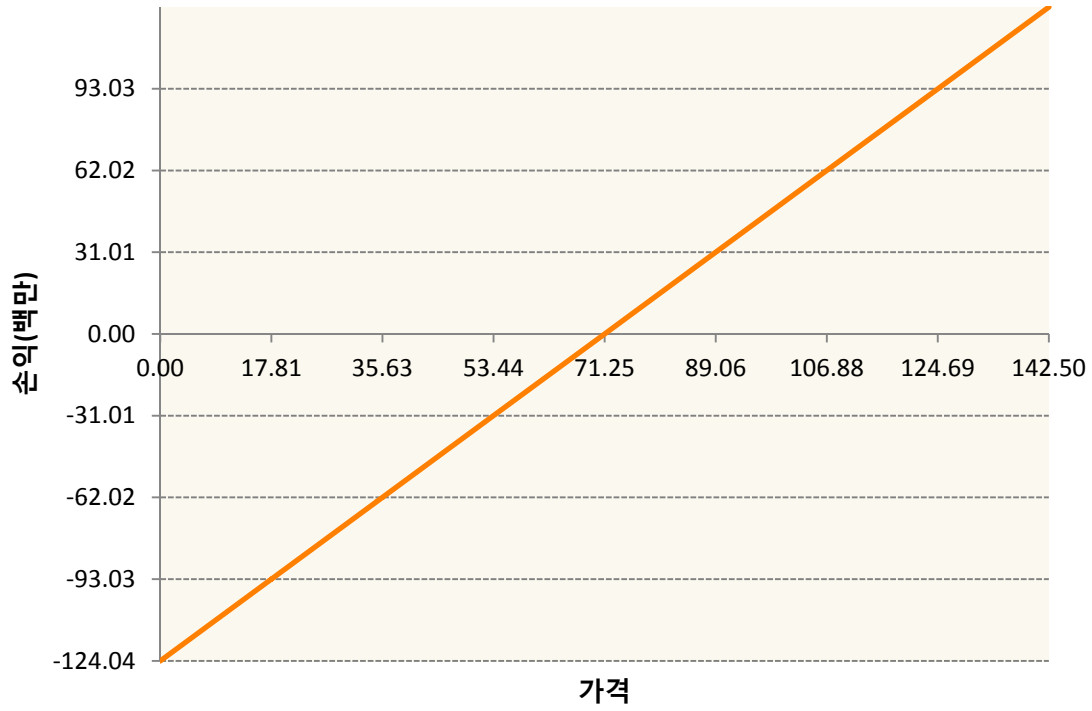


CH0-CORN FUTURE Mar20

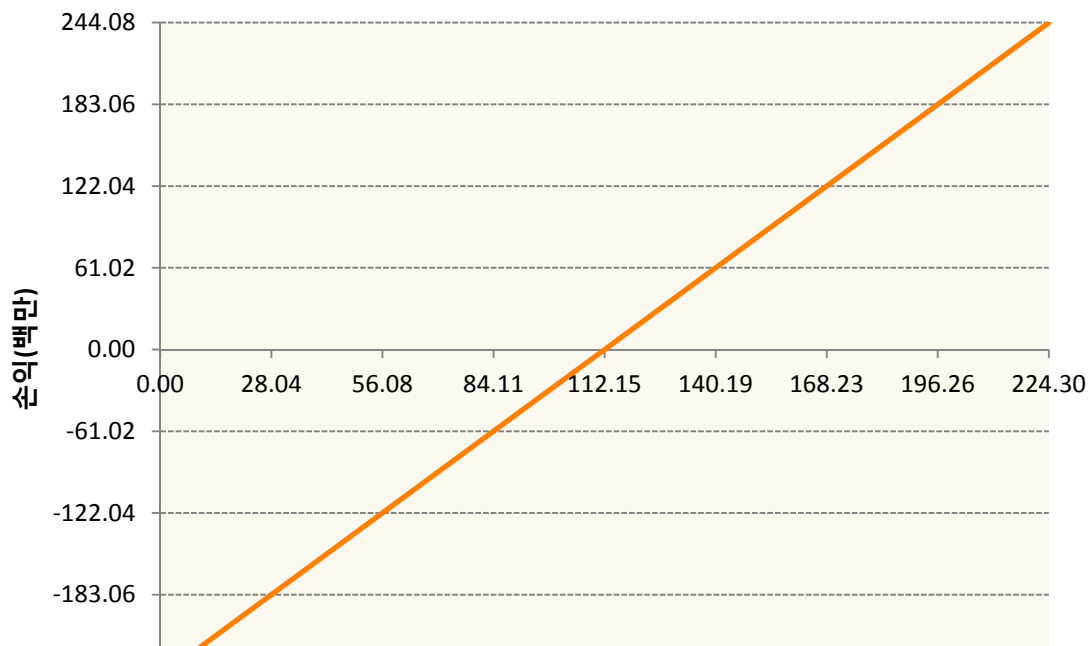


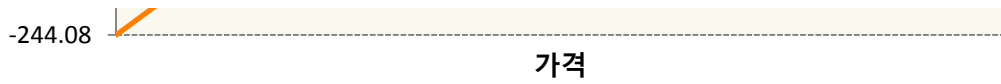


CTH0-COTTON NO.2 FUTR Mar20

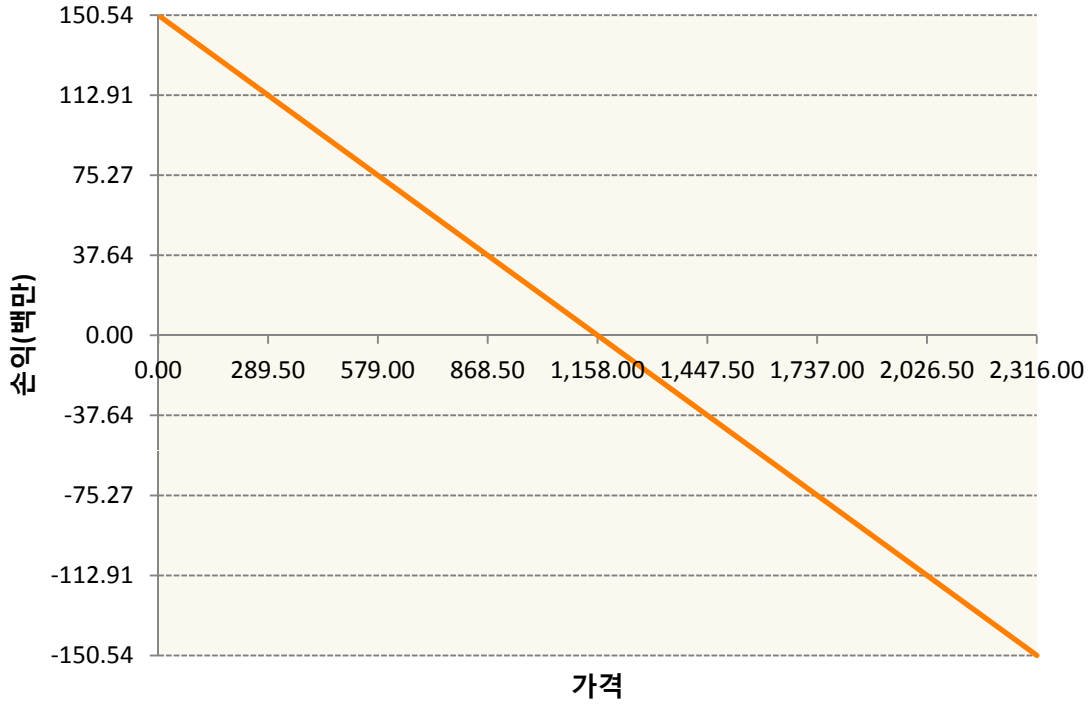


KCH0-COFFEE 'C' FUTURE Mar20

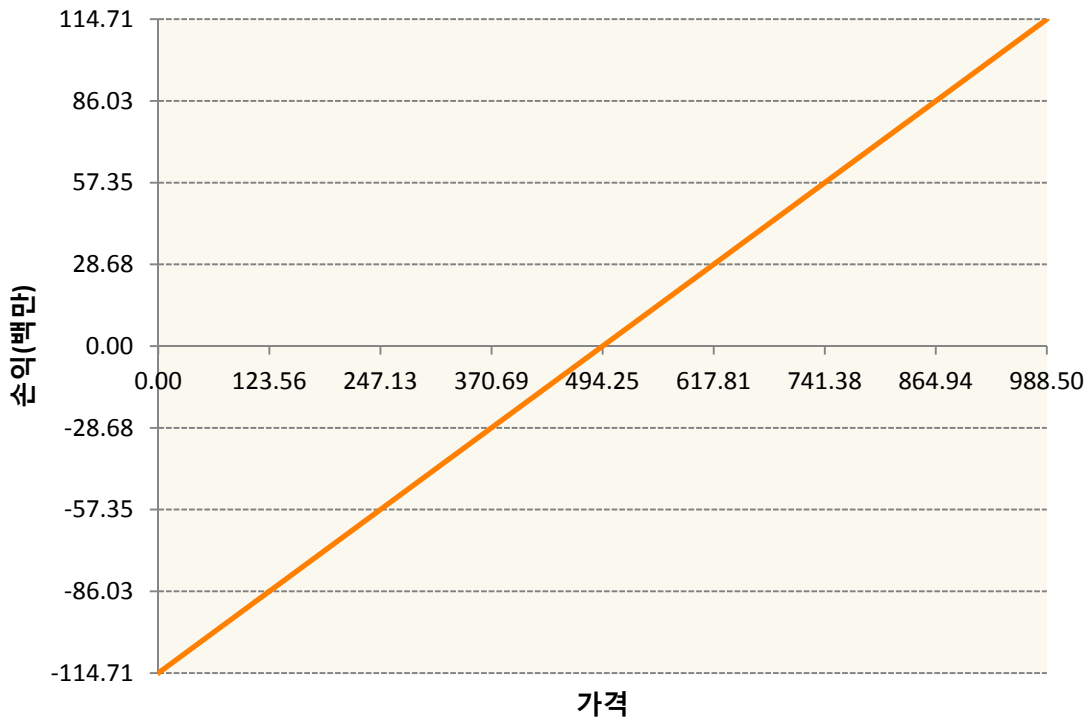




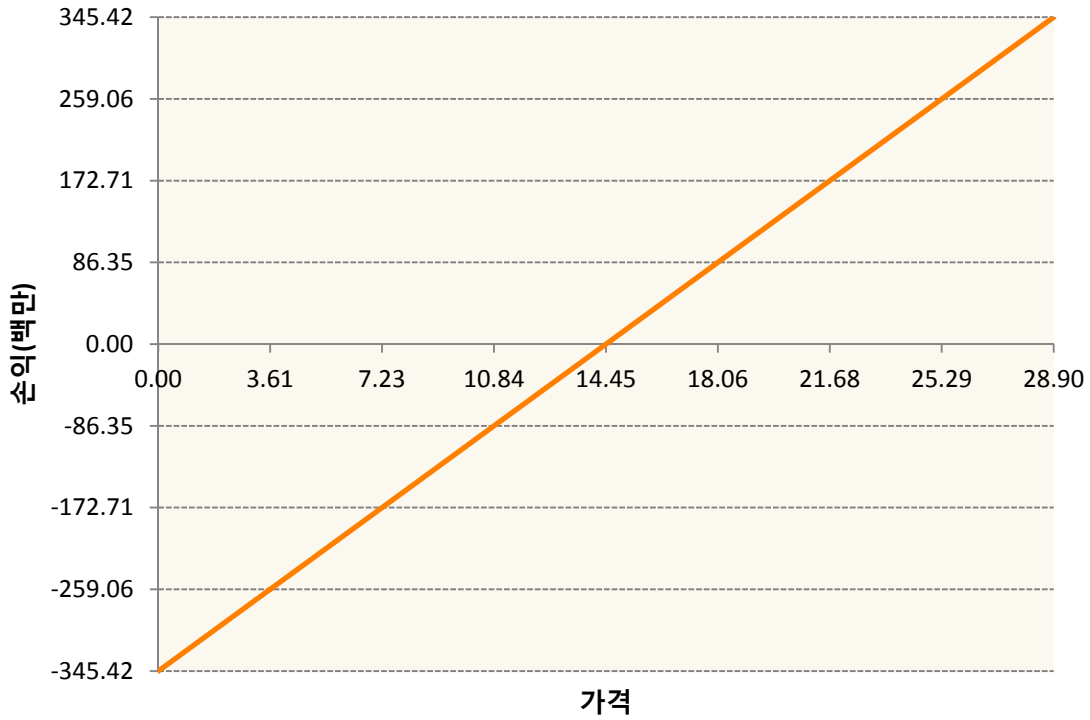
KR4175Q20000-2020-02 달러선물



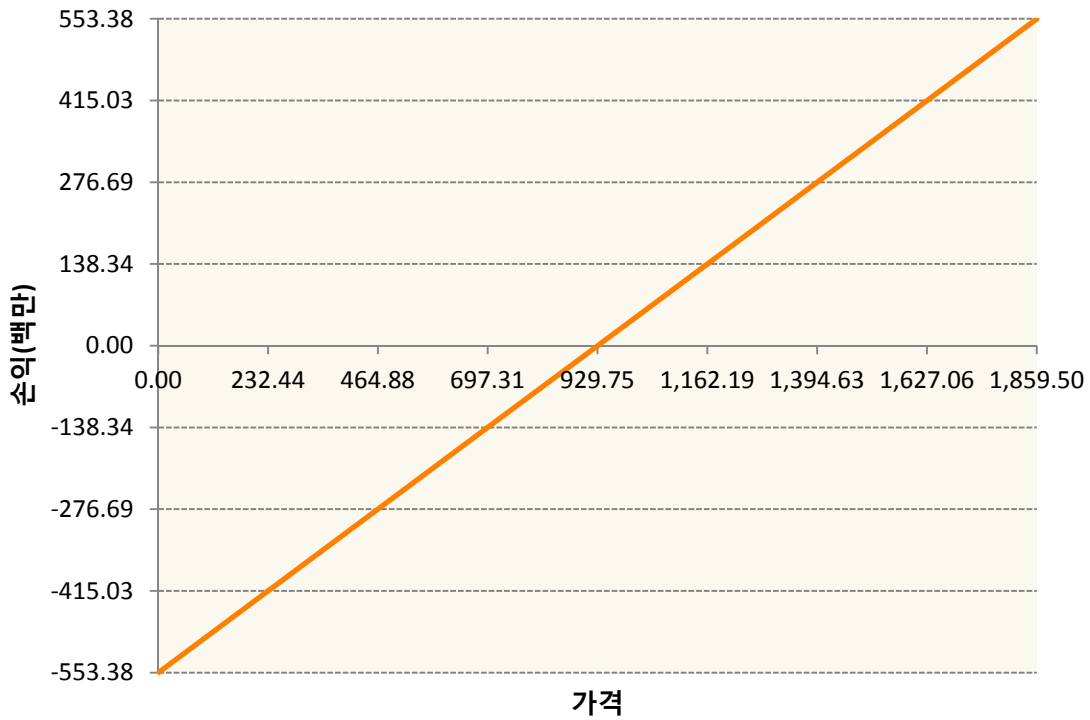
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

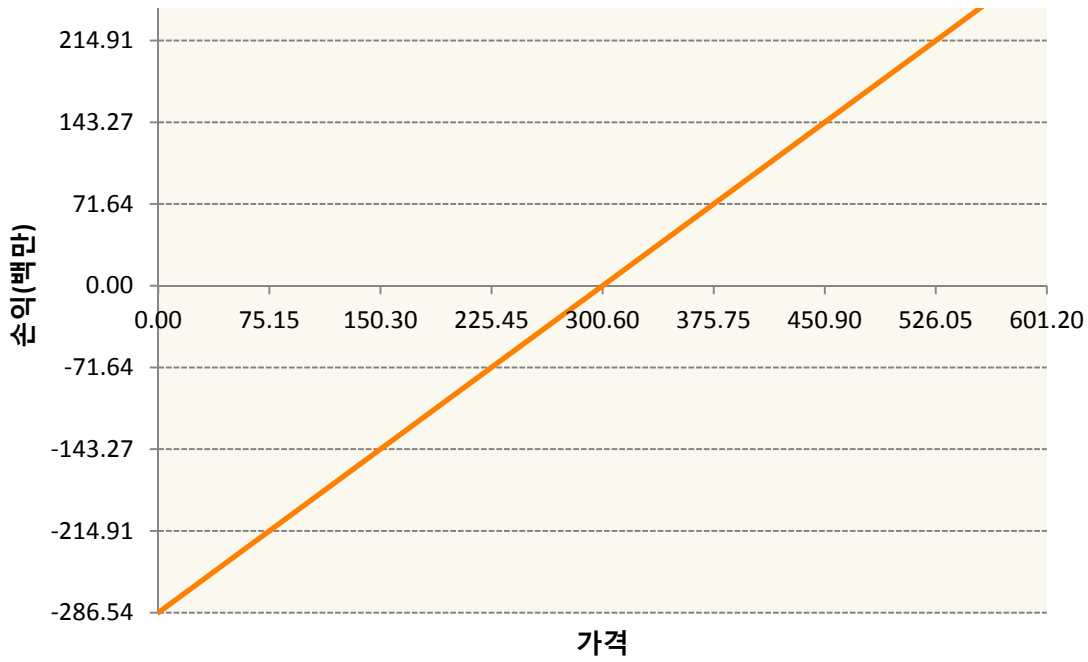


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20

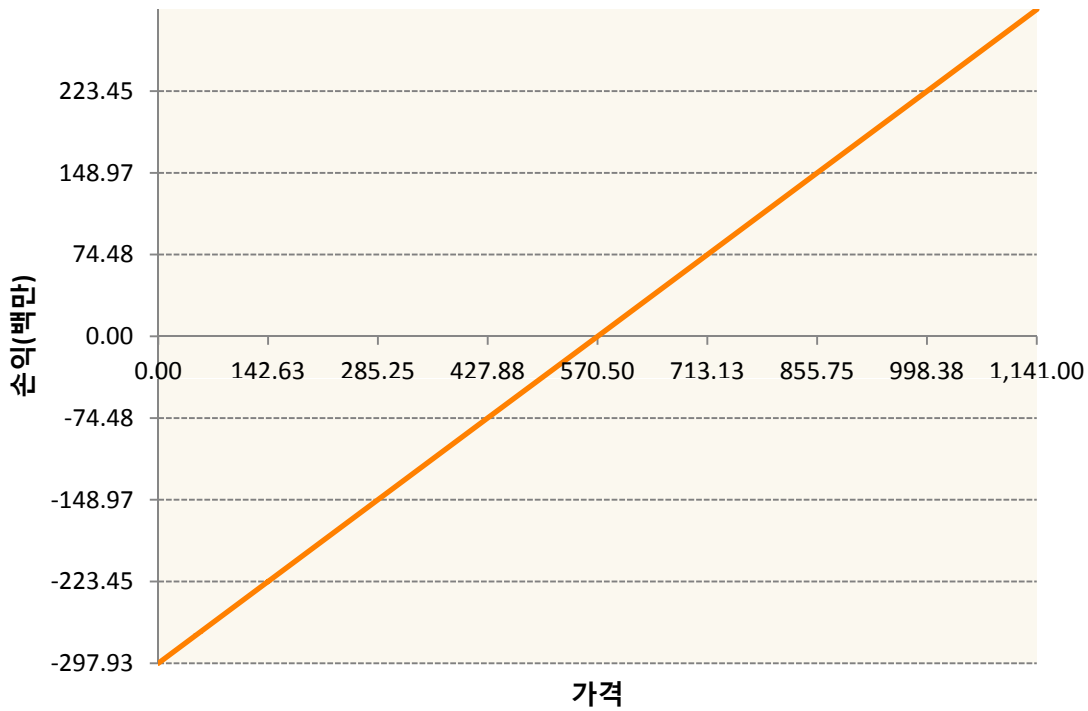


SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





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
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)

247