

공시일	2020-01-22
기준일	2020-01-21

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	2020-01-22
기준일	2020-01-21

스마트인덱스모

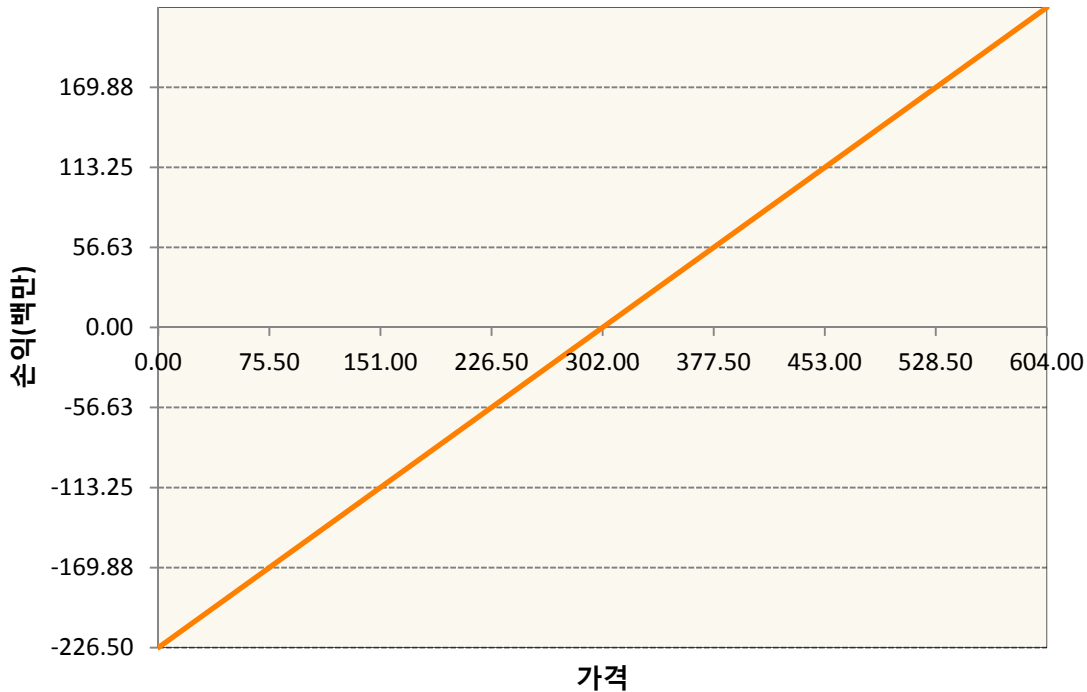
1. 계약금액

(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

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	2020-01-22
기준일	2020-01-21

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	2020-01-22
기준일	2020-01-21

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	2020-01-22
기준일	2020-01-21

유로인덱스모(주식-파생형)

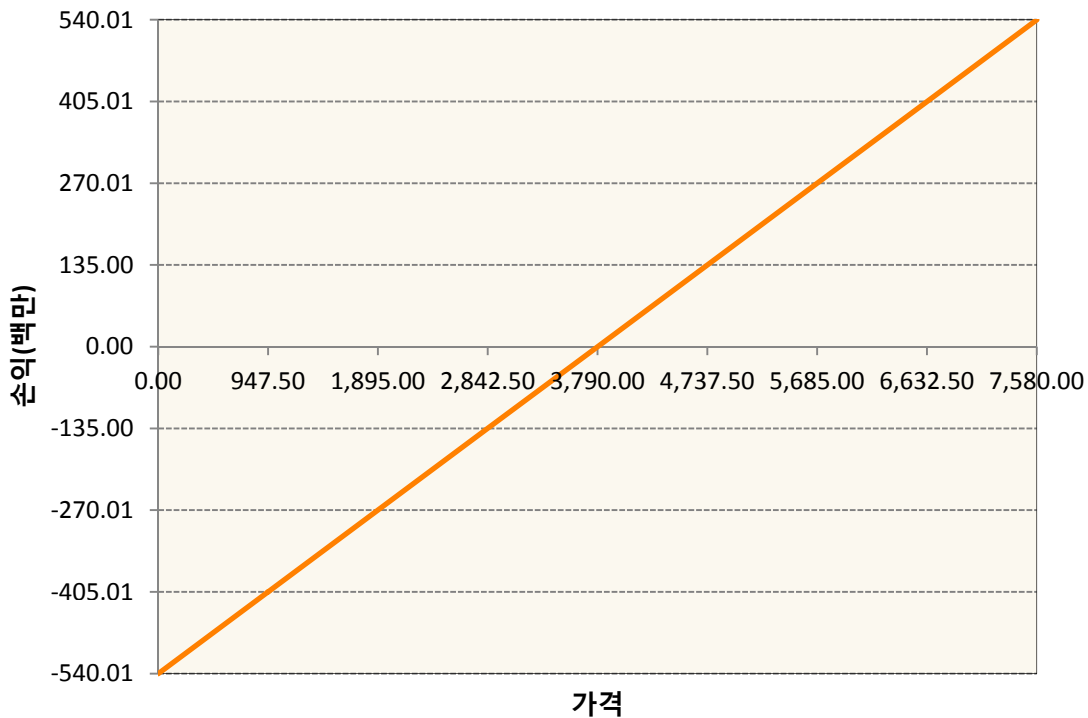
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	540	0	540	

2. 만기시점의 손익구조

VGHO-EURO STOXX 50 Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGHO	EURO STOXX 50 Mar20	43
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

29

공시일	2020-01-22
기준일	2020-01-21

차이나인덱스모(주식-파생형)

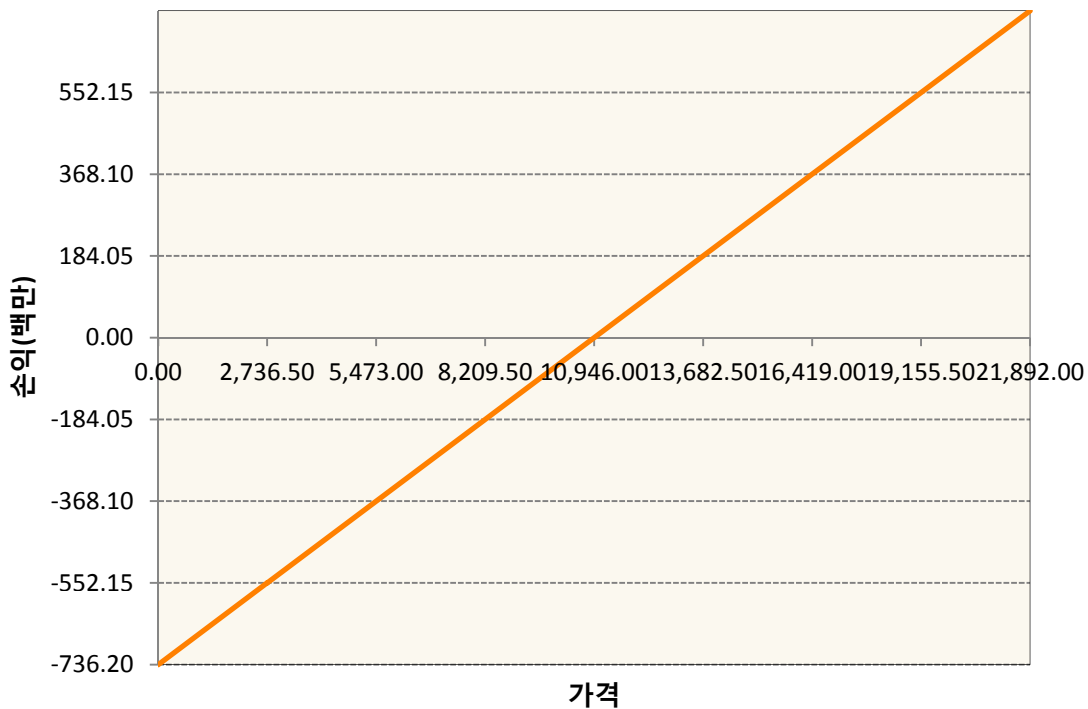
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	736	0	736	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCF0-HSCEI Futures Jan20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF0	HSCEI Futures Jan20	59
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

52

공시일	2020-01-22
기준일	2020-01-21

커버드콜모(주식혼합-파생형)

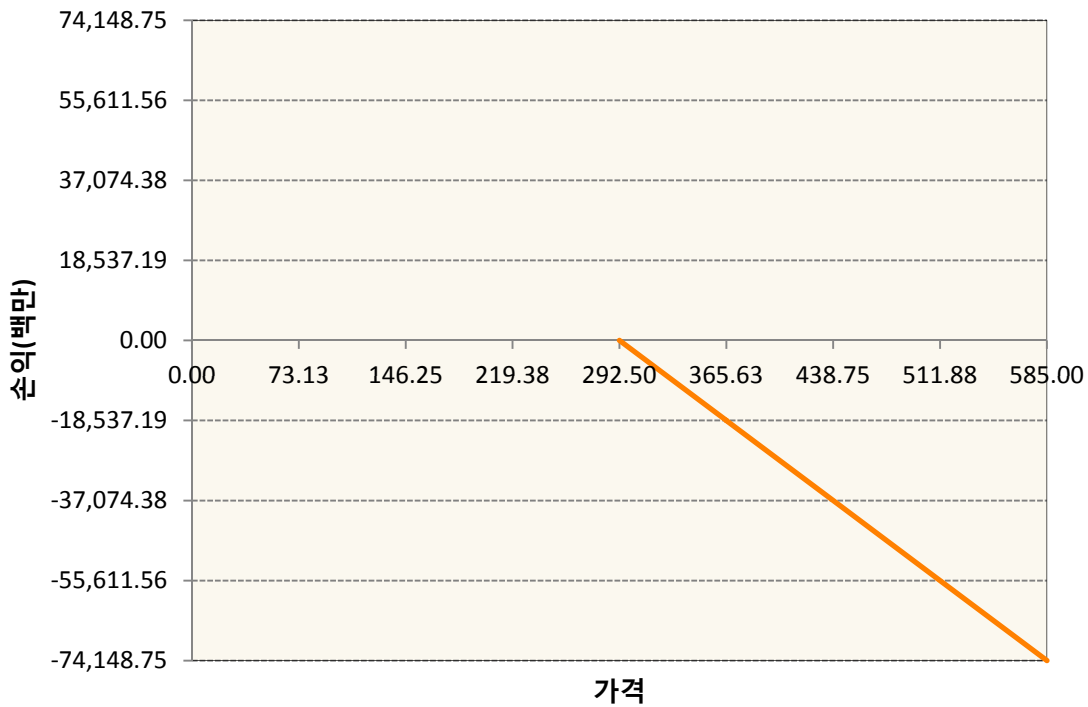
1. 계약금액

(단위:백만원)

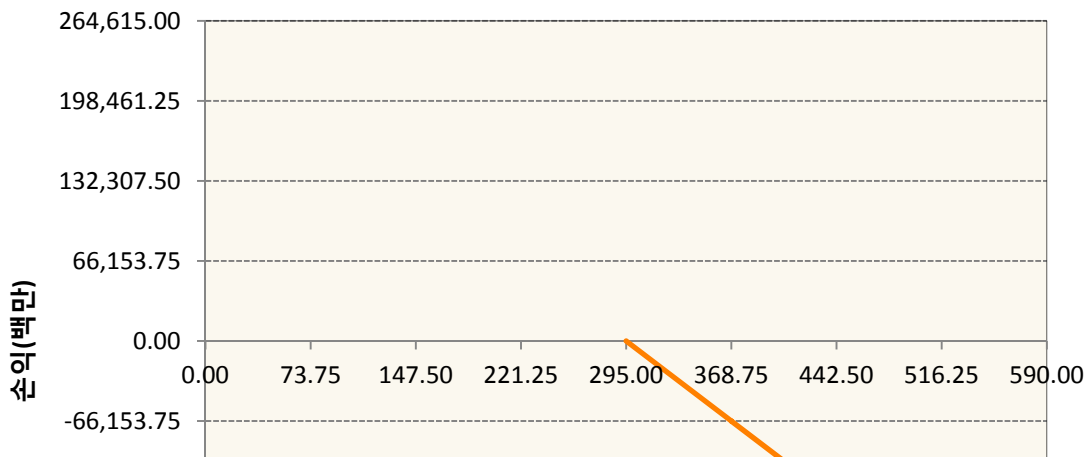
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	458,683	-458,683	장내

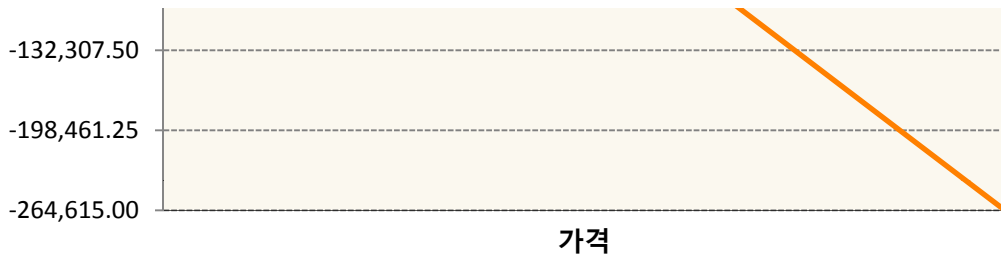
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q22927-2020-02 콜292.5

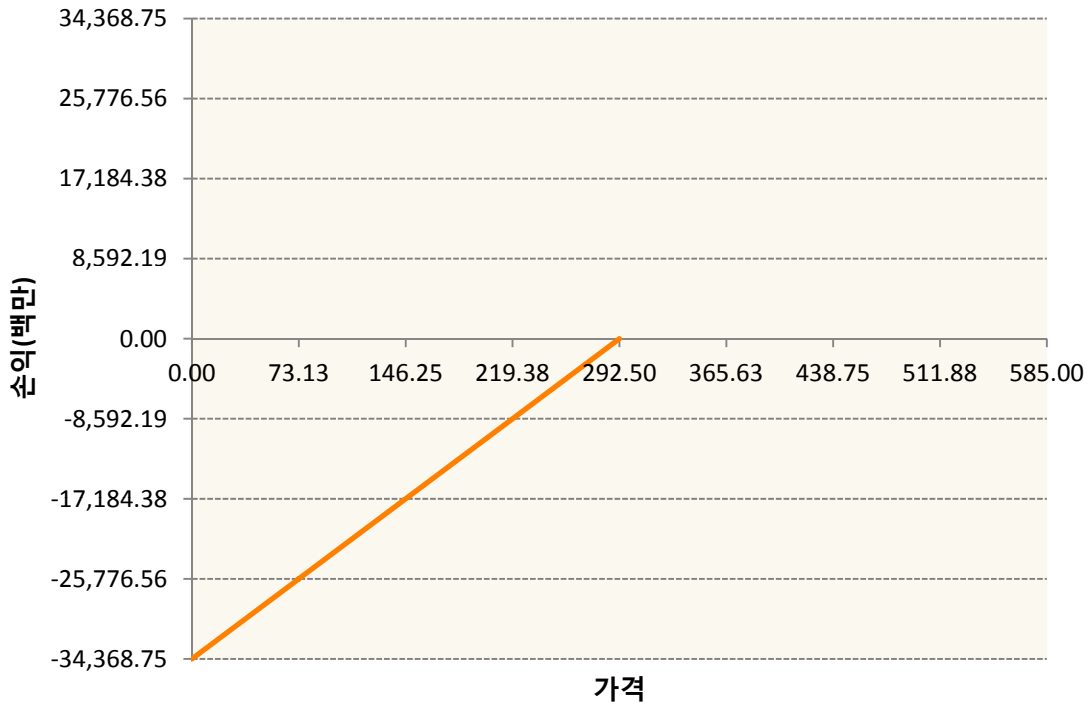


KR4201Q22950-2020-02 콜295

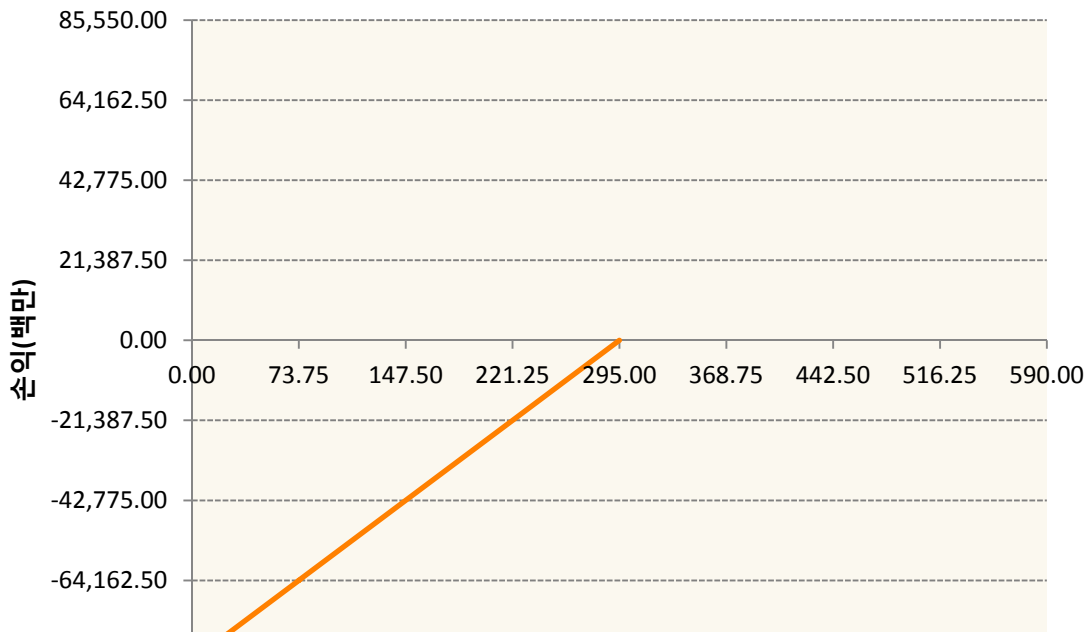




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



KR4301Q22958-2020-02 풋295



-85,550.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q22927		2020-02 콜292.5						5,315
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,277	3,151	3,017	2,876	2,729	2,578	2,423	
-5.33%	2,727	2,556	2,383	2,207	2,031	1,854	1,675	
-2.67%	1,806	1,621	1,435	1,249	1,063	877	691	
0%	502	339	171	0	-174	-349	-527	
2.67%	-1,120	-1,238	-1,367	-1,505	-1,650	-1,801	-1,957	
5.33%	-2,955	-3,027	-3,113	-3,211	-3,321	-3,439	-3,566	
8.00%	-4,908	-4,946	-4,996	-5,059	-5,133	-5,219	-5,315	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						18,301
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	10,535	10,144	9,716	9,258	8,775	8,272	7,752	
-5.33%	8,928	8,357	7,773	7,177	6,573	5,962	5,346	
-2.67%	6,090	5,429	4,767	4,105	3,444	2,782	2,120	
0%	1,886	1,266	636	0	-641	-1,287	-1,936	
2.67%	-3,528	-4,007	-4,518	-5,053	-5,609	-6,181	-6,766	
5.33%	-9,814	-10,123	-10,481	-10,879	-11,313	-11,776	-12,264	
8.00%	-16,616	-16,785	-17,004	-17,269	-17,576	-17,922	-18,301	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						1,681
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,595	-1,603	-1,614	-1,627	-1,643	-1,661	-1,681	
-5.33%	-743	-772	-804	-837	-871	-905	-941	
-2.67%	-161	-201	-242	-283	-324	-365	-406	
0%	74	52	27	0	-29	-59	-91	
2.67%	123	117	110	100	87	72	55	
5.33%	127	127	126	123	120	115	108	
8.00%	128	128	128	127	127	125	124	
KR4301Q22958		2020-02 풋295						4,634
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-4,483	-4,494	-4,511	-4,533	-4,561	-4,595	-4,634	
-5.33%	-2,280	-2,335	-2,397	-2,464	-2,536	-2,611	-2,689	
-2.67%	-590	-692	-794	-895	-997	-1,099	-1,201	
0%	233	160	82	0	-85	-172	-262	
2.67%	448	426	396	359	316	267	213	

5.33%	476	473	467	457	443	425	401
8.00%	478	478	477	475	472	468	460

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

(단위:백만원)

29,007

공시일	2020-01-22
기준일	2020-01-21

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

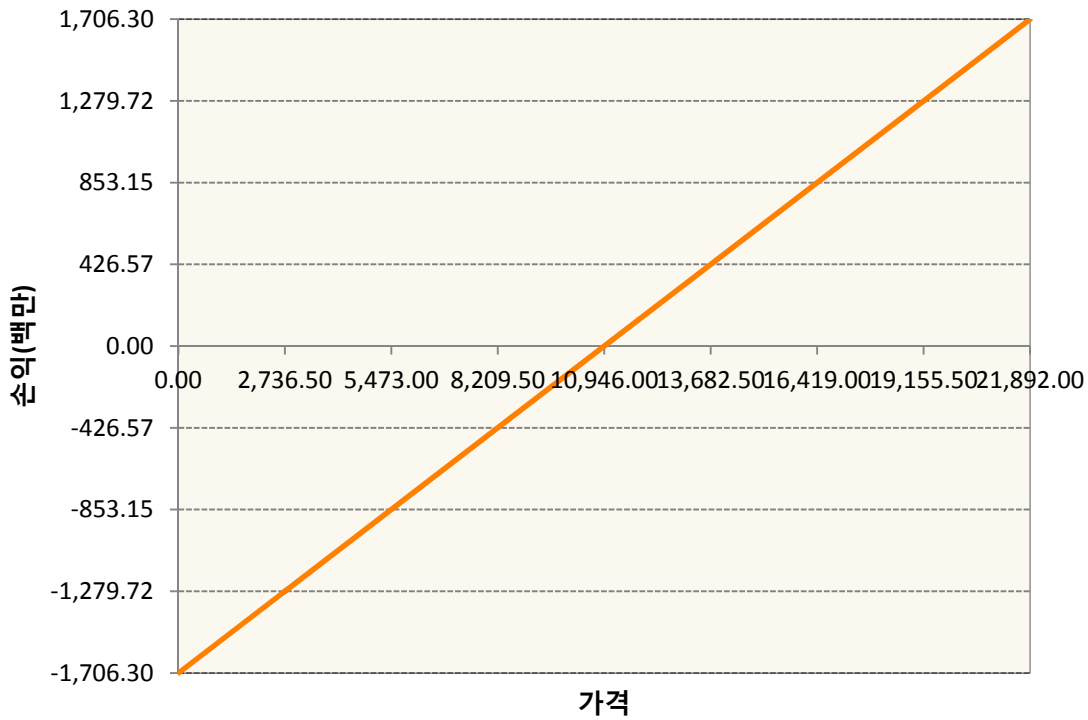
1. 계약금액

(단위:백만원)

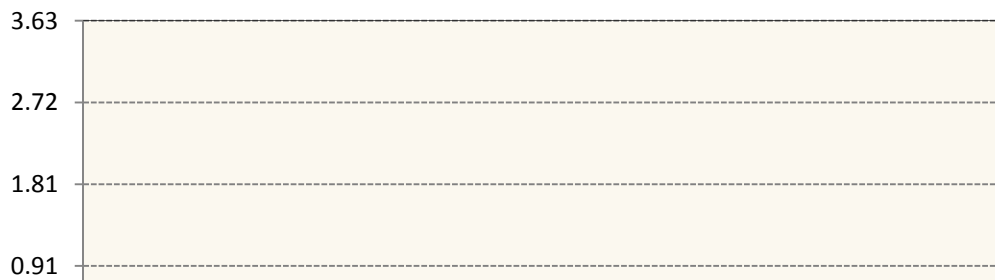
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,706	0	1,706	장내
누계	유가증권	옵션	0	69	-69	장내
누계	통화	선도	0	2,114	-2,114	장외

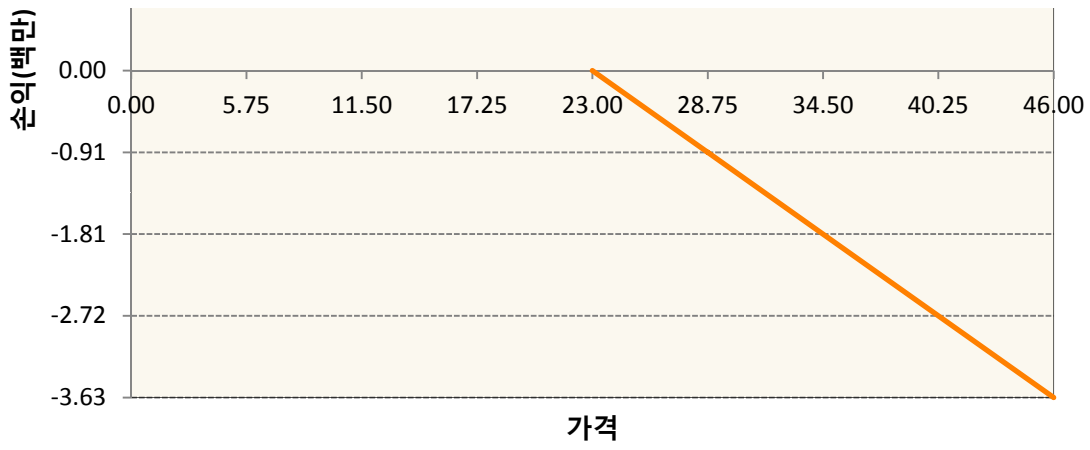
2. 만기시점의 손익구조

HCFO-HSCEI Futures Jan20

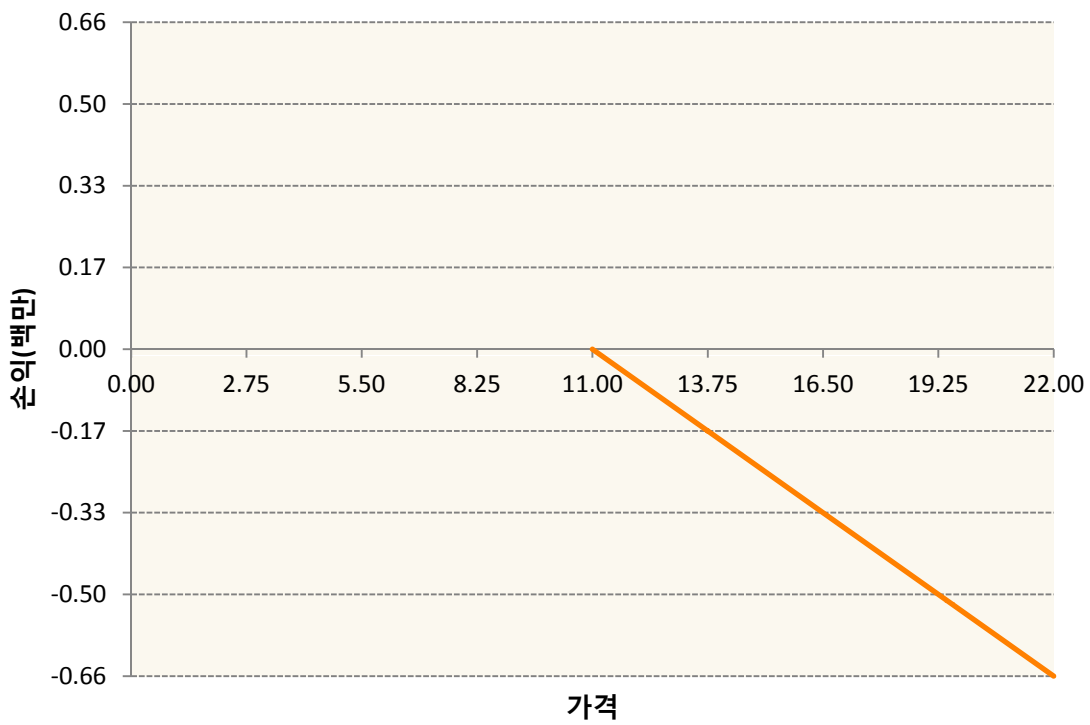


OHHIF0-C112-HSCEI

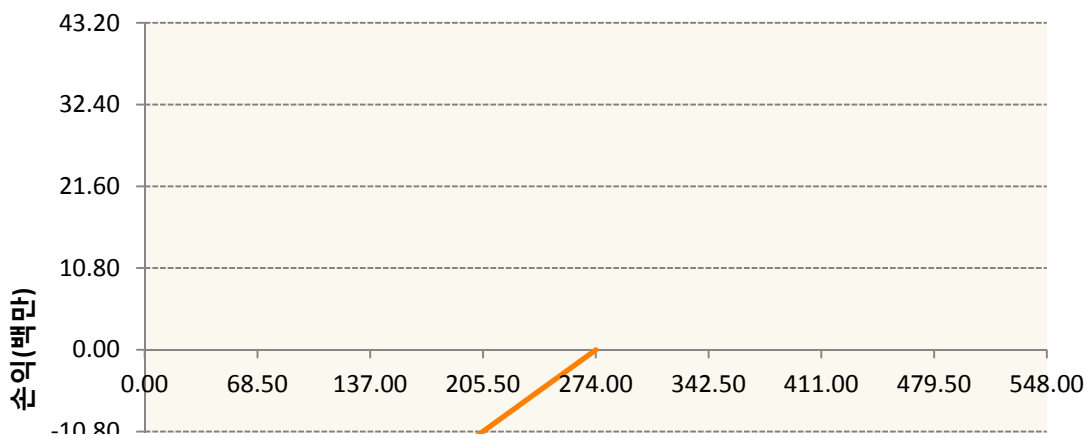


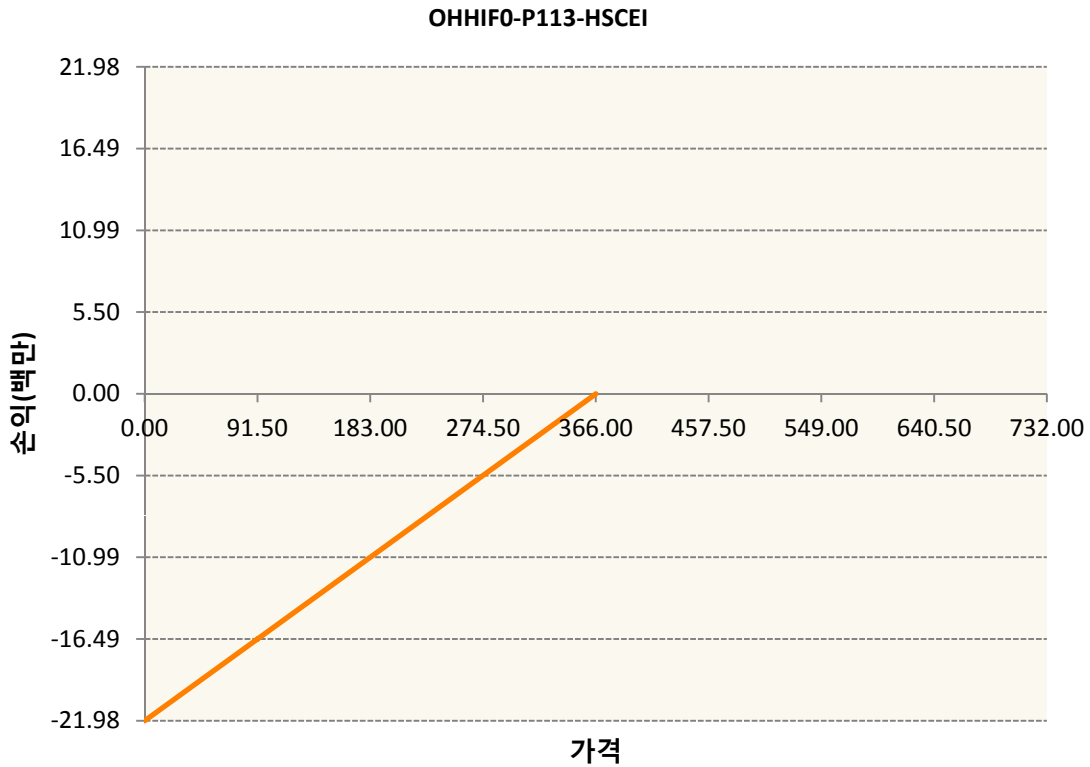
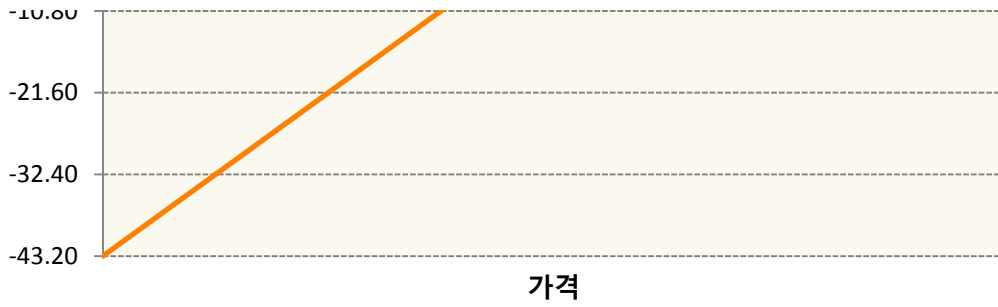


OHHIF0-C113-HSCEI



OHHIF0-P112-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	169
HCF0 HSCEI Futures Jan20	136
OHHIF0-C11 HSCEI	0.3
OHHIF0-C11 HSCEI	0.1
OHHIF0-P11 HSCEI	3
OHHIF0-P11 HSCEI	2

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

180

공시일	2020-01-22
기준일	2020-01-21

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

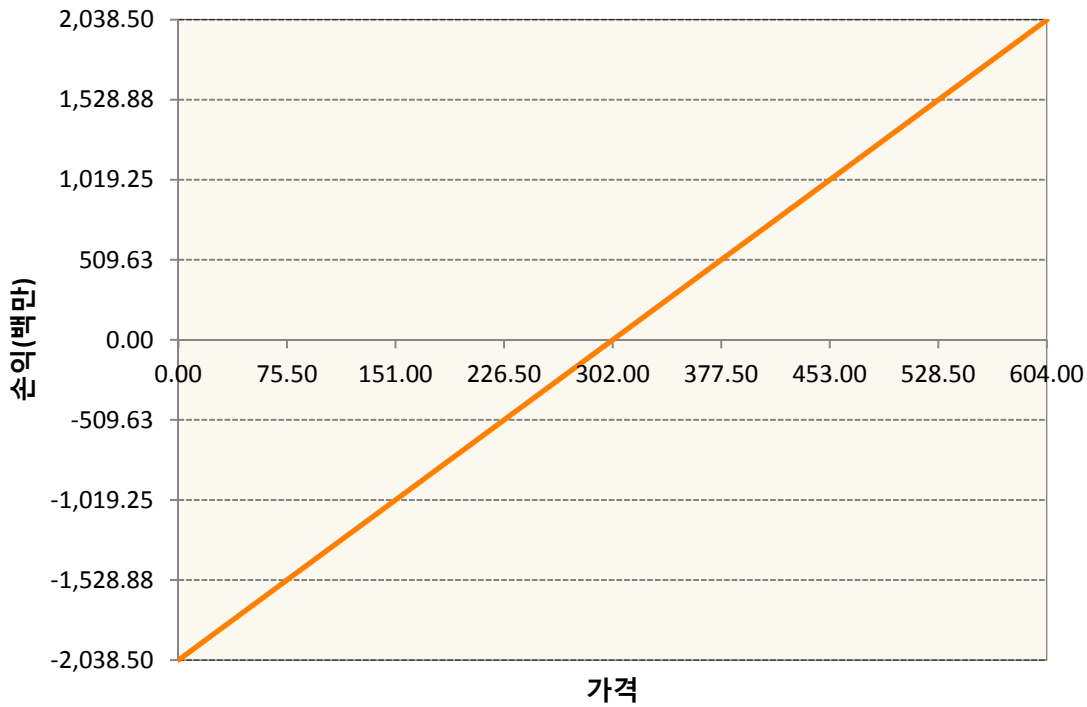
1. 계약금액

(단위:백만원)

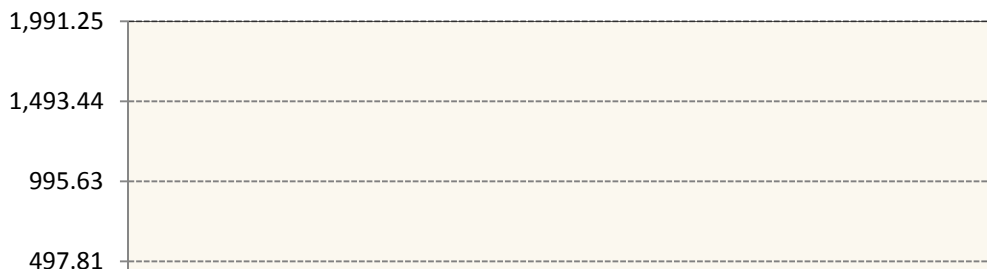
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	76	-76	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	71	0	71	장내
누계	유가증권	선물	2,039	0	2,039	장내
누계	유가증권	스왑	3,625	0	3,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,828	-3,828	장내

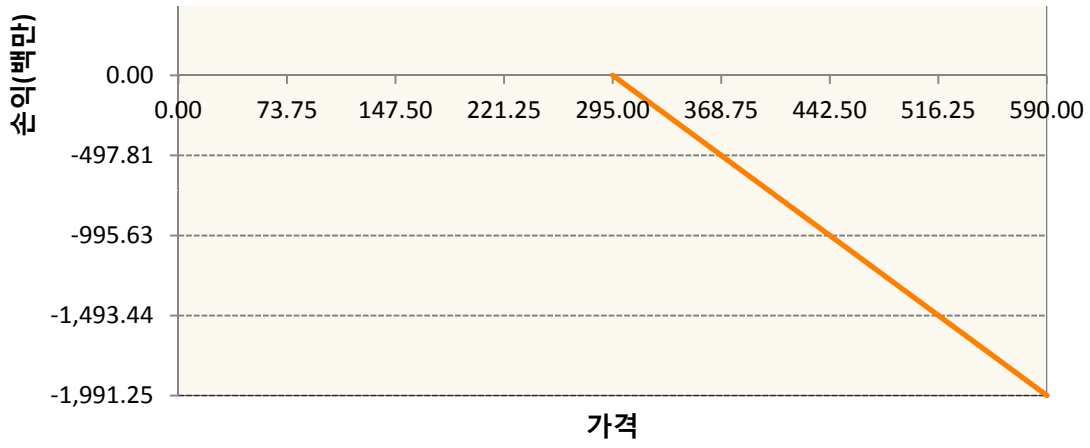
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

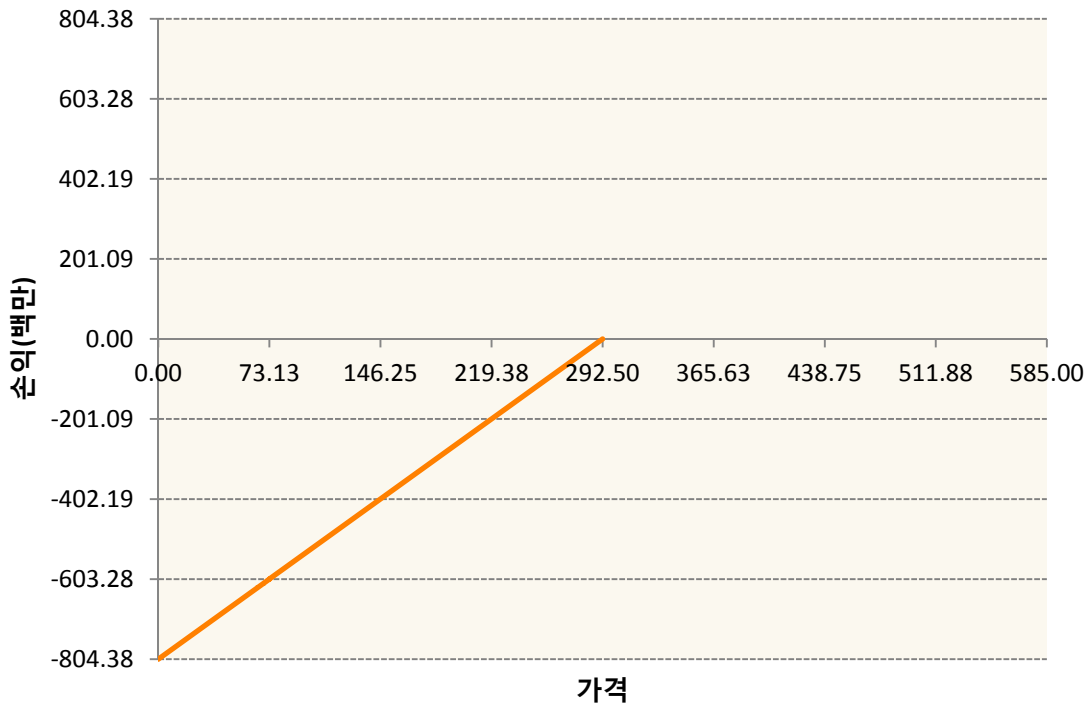


KR4201Q22950-2020-02 콜295

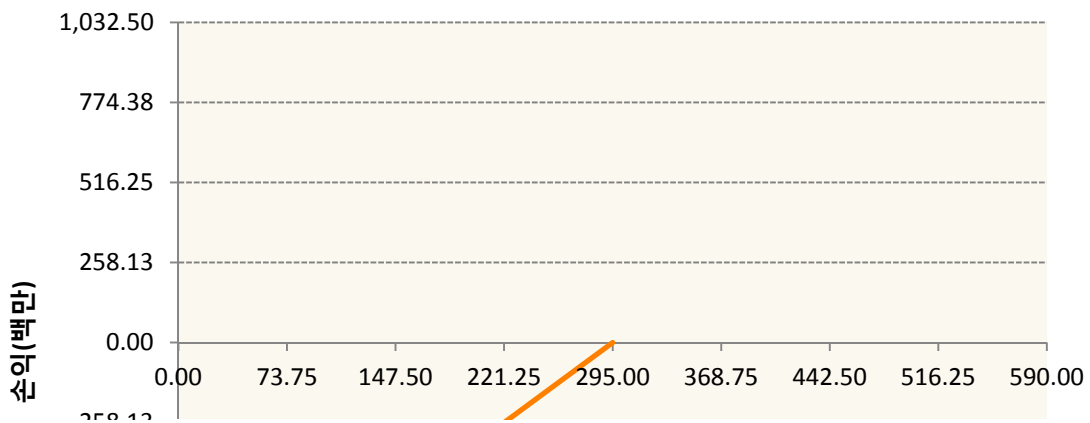




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



KR4301Q22958-2020-02 풋295





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						310
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-310	-310	-310	-310	-310	-310	-310	
-5.33%	-207	-207	-207	-207	-207	-207	-207	
-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%	207	207	207	207	207	207	207	
8.00%	310	310	310	310	310	310	310	
KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						163
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-163	-163	-163	-163	-163	-163	-163	
-5.33%	-109	-109	-109	-109	-109	-109	-109	
-2.67%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	54	54	54	54	54	54	54	
5.33%	109	109	109	109	109	109	109	
8.00%	163	163	163	163	163	163	163	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						138
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	79	76	73	70	66	62	58	
-5.33%	67	63	58	54	49	45	40	
-2.67%	46	41	36	31	26	21	16	
0%	14	10	5	0	-5	-10	-15	
2.67%	-27	-30	-34	-38	-42	-47	-51	
5.33%	-74	-76	-79	-82	-85	-89	-92	
8.00%	-125	-126	-128	-130	-132	-135	-138	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						39
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-37	-38	-38	-38	-38	-39	-39
-5.33%	-17	-18	-19	-20	-20	-21	-22
-2.67%	-4	-5	-6	-7	-8	-9	-9
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							56
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-54	-54	-54	-55	-55	-55	-56
-5.33%	-28	-28	-29	-30	-31	-32	-32
-2.67%	-7	-8	-10	-11	-12	-13	-14
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	5	5	5	4	4	3	3
5.33%	6	6	6	6	5	5	5
8.00%	6	6	6	6	6	6	6

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

(단위:백만원)

656

공시일	2020-01-22
기준일	2020-01-21

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

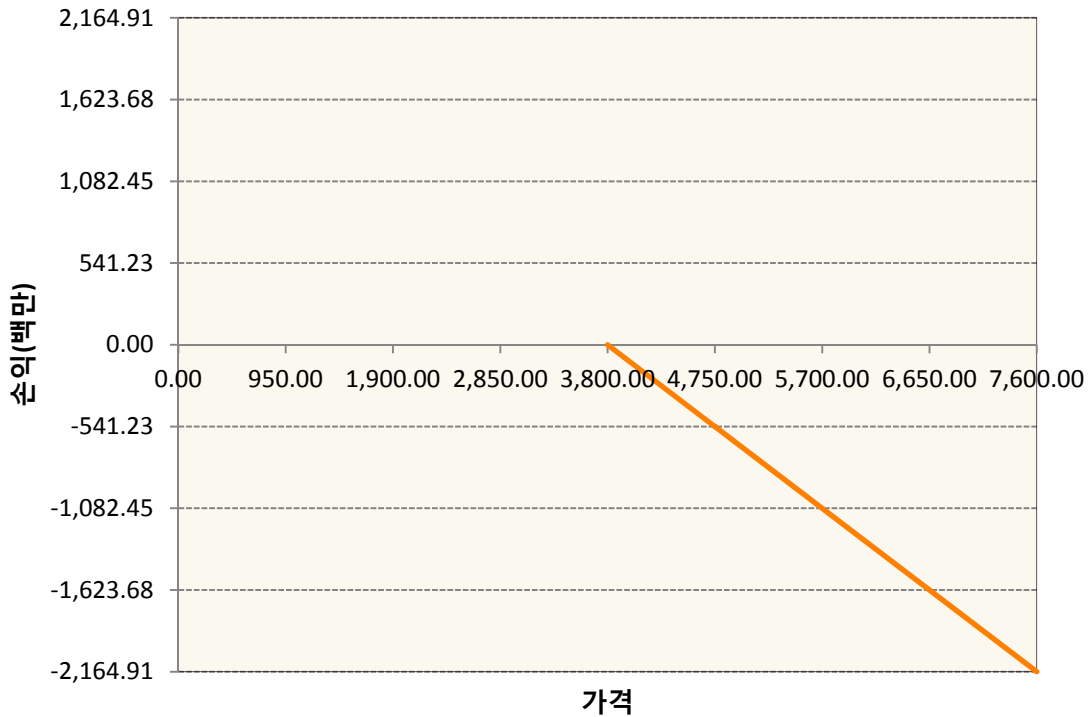
1. 계약금액

(단위:백만원)

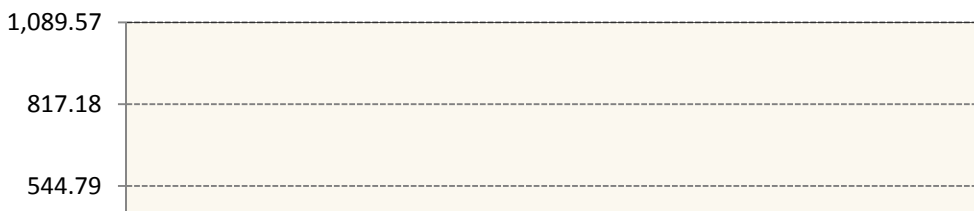
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	147	0	147	
누계	유가증권	스왑	16,343	0	16,343	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,509	-6,509	장내
누계	통화	선도	0	3,398	-3,398	장외

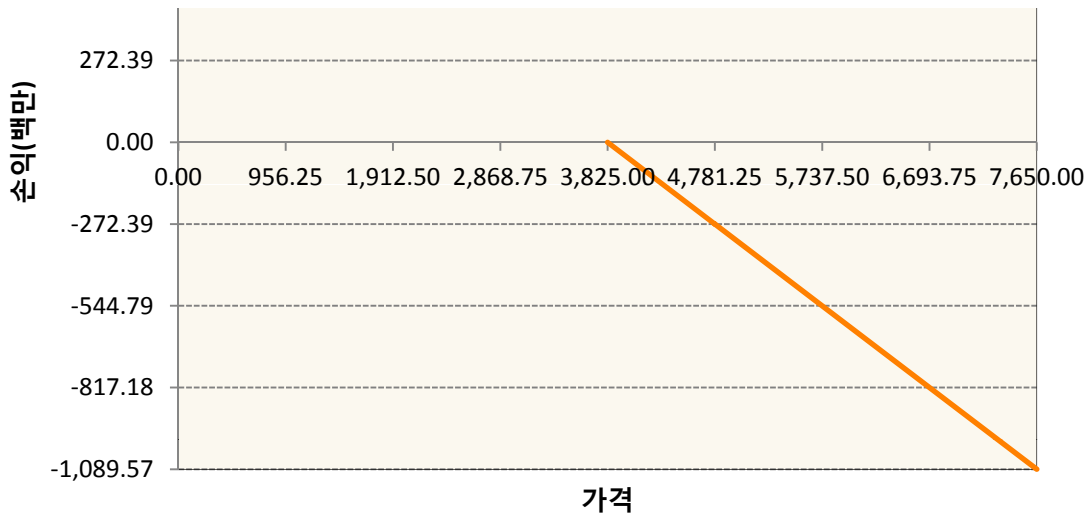
2. 만기시점의 손익구조

OESXG0-C3800-EURO STOXX 50

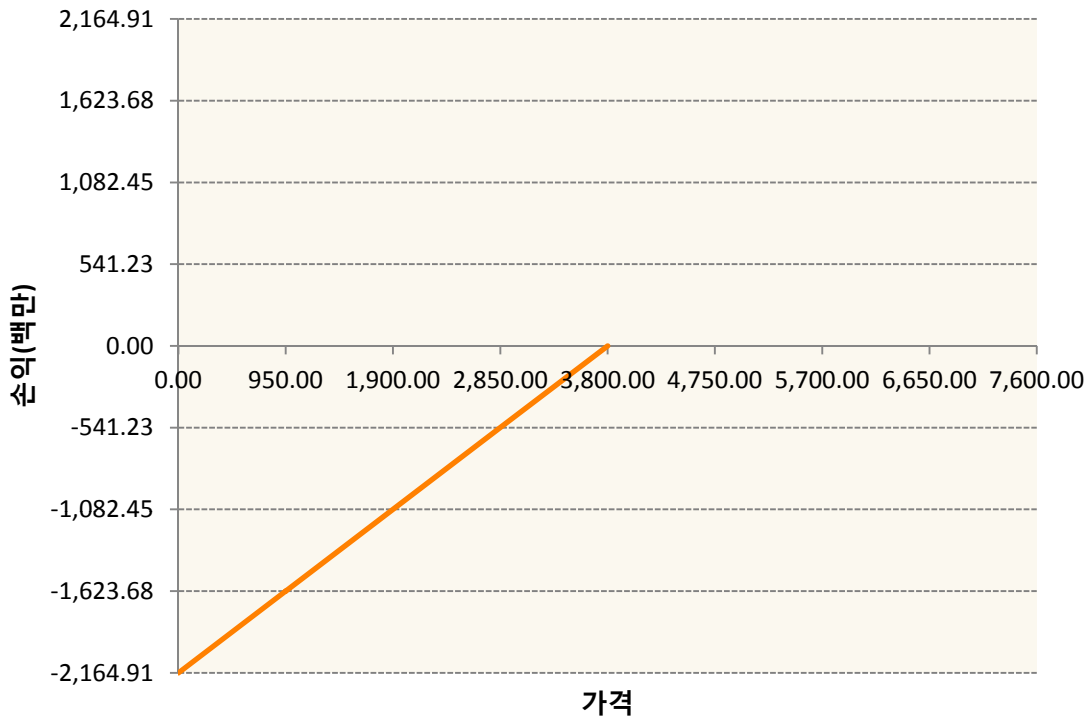


OESXG0-C3825-EURO STOXX 50

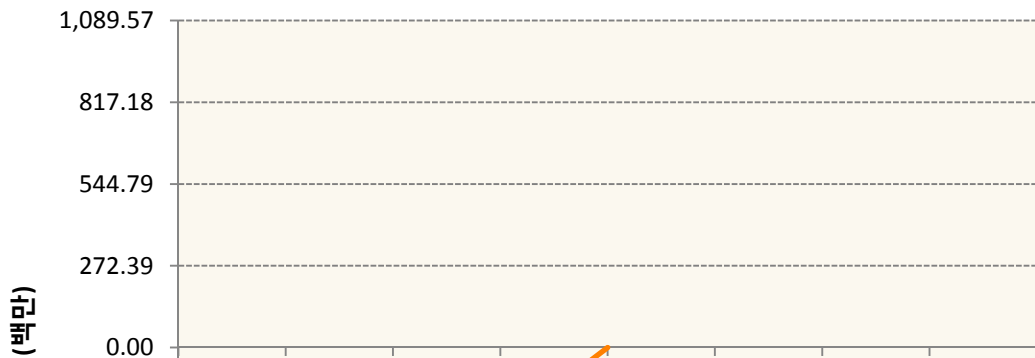


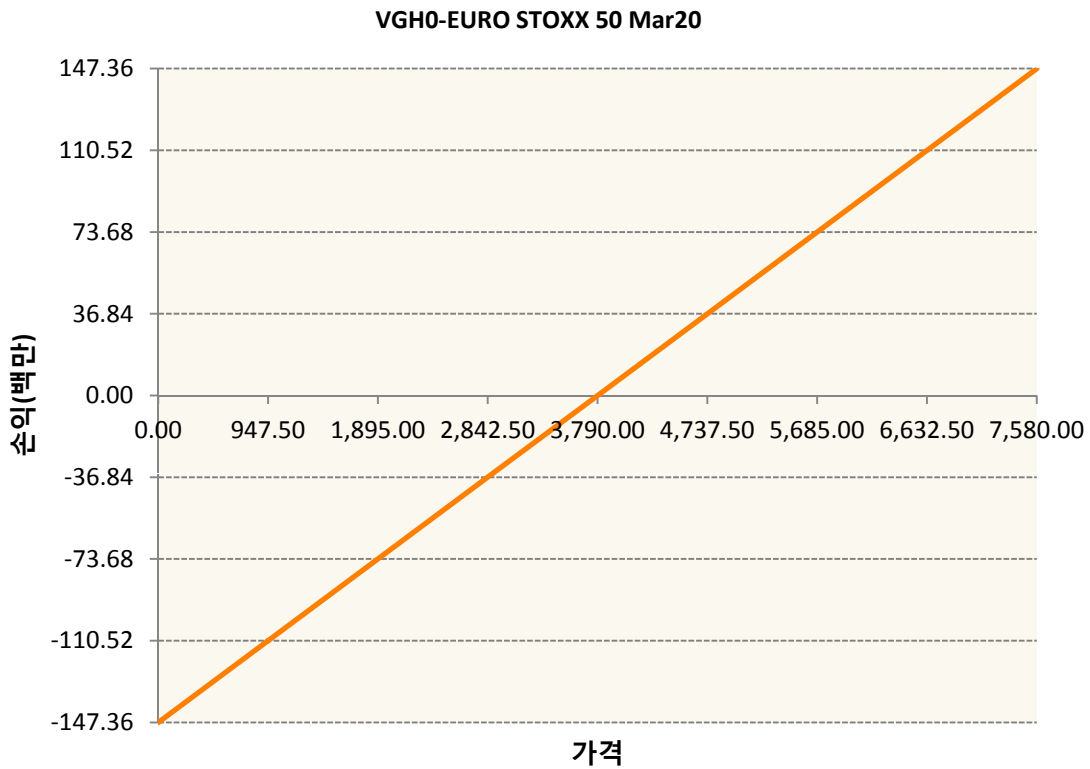
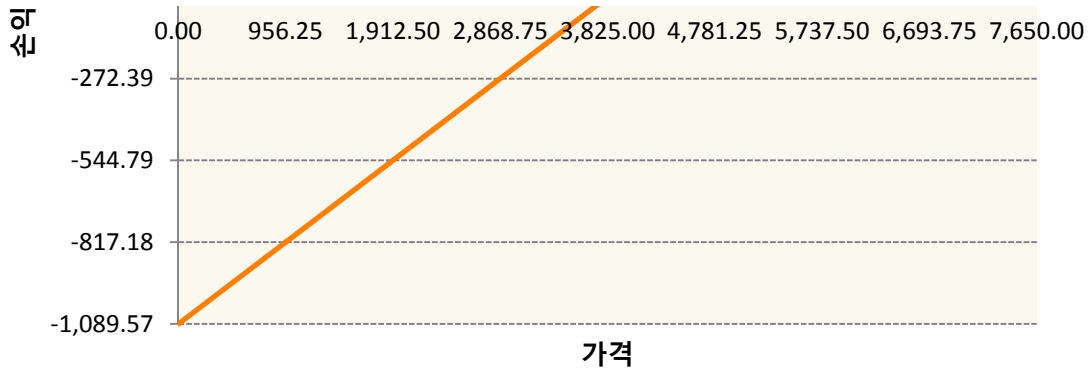


OESXG0-P3800-EURO STOXX 50



OESXG0-P3825-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	1
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	272
OESXG0-C3& EURO STOXX 50	173
OESXG0-C3& EURO STOXX 50	87
OESXG0-P3& EURO STOXX 50	173
OESXG0-P3& EURO STOXX 50	87
VGHO EURO STOXX 50 Mar20	12

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

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

(단위:백만원)

916

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

(단위:백만원)

79

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

(단위:백만원)

116

공시일	2020-01-22
기준일	2020-01-21

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

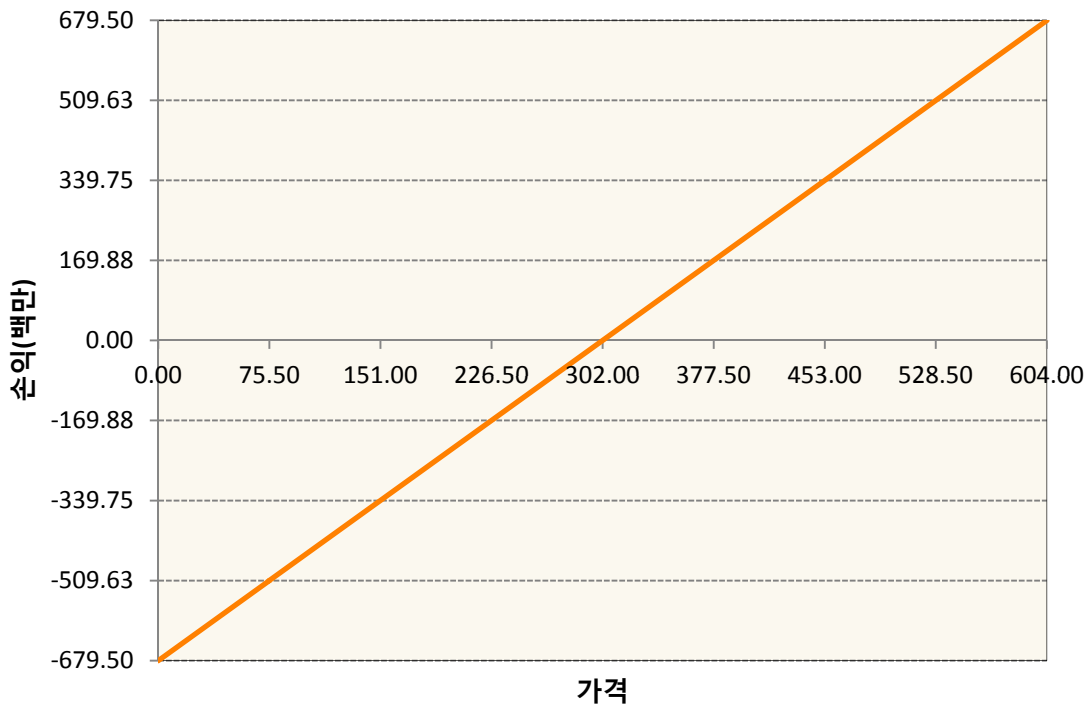
1. 계약금액

(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	2020-01-22
기준일	2020-01-21

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

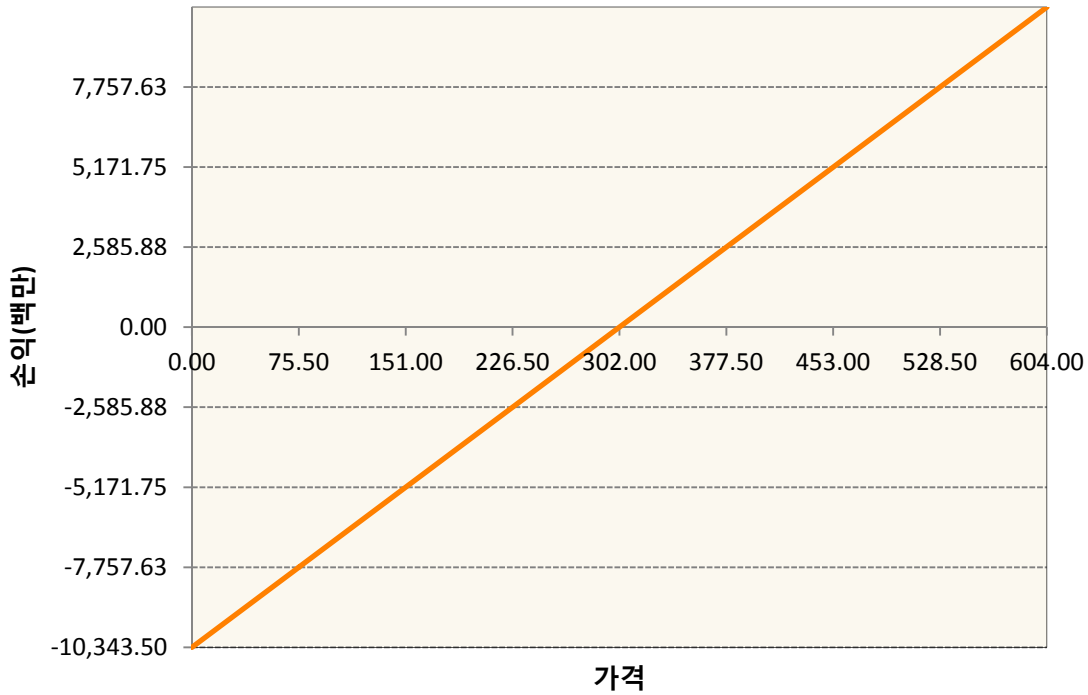
1. 계약금액

(단위:백만원)

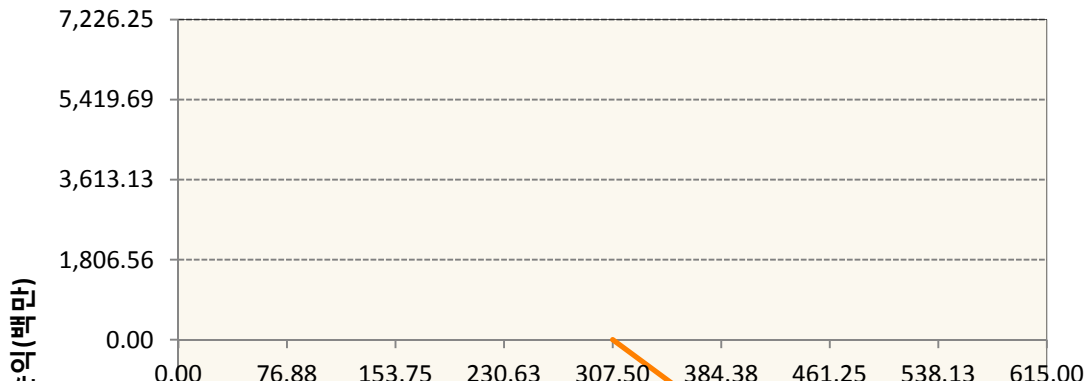
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,344	0	10,344	장내
누계	유가증권	옵션	2,944	20,789	-17,845	장내

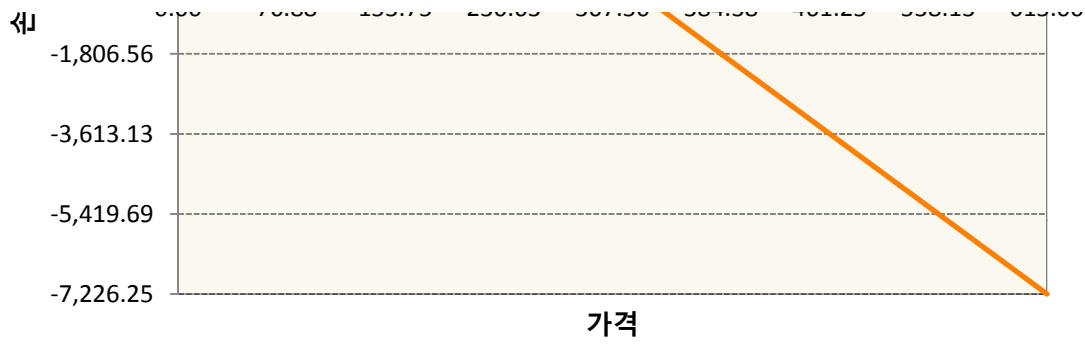
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

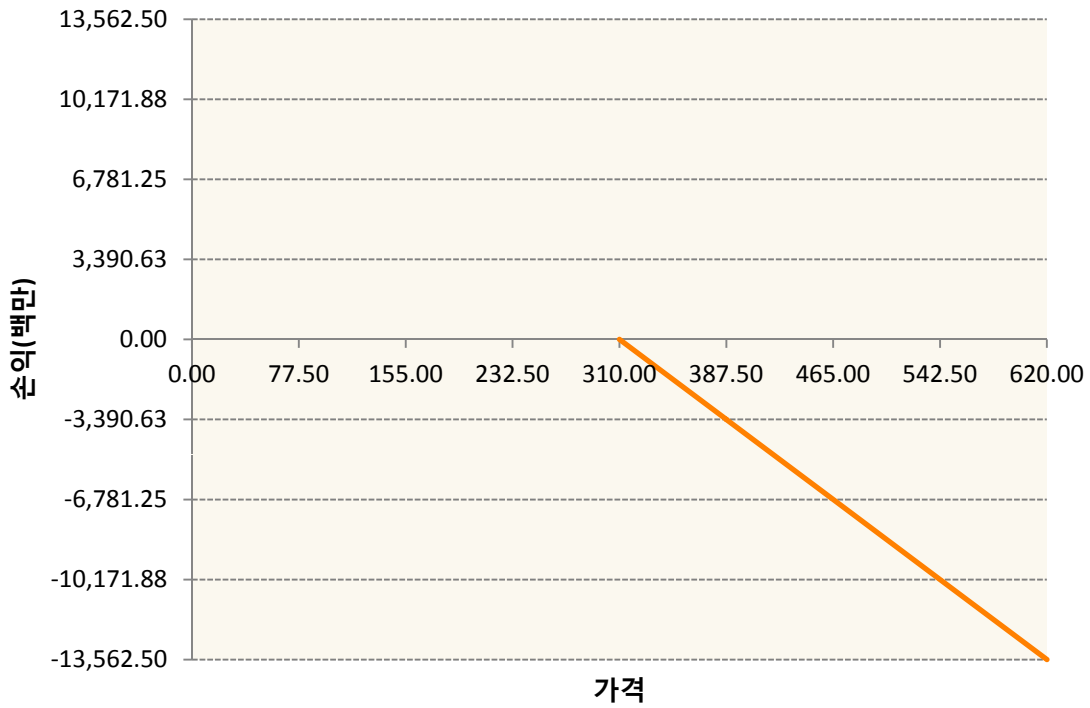


KR4201Q23073-2020-02 콜307.5

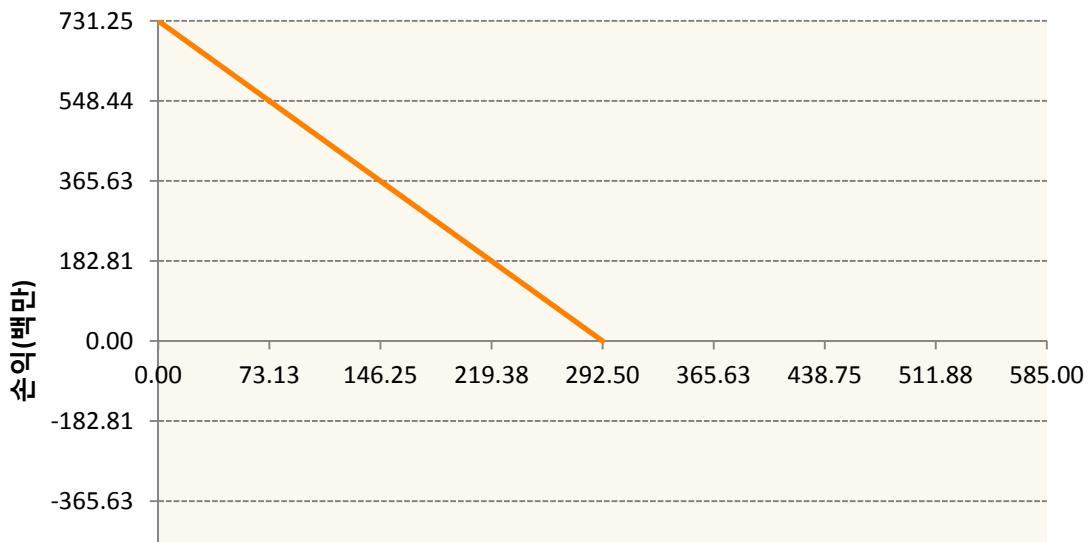


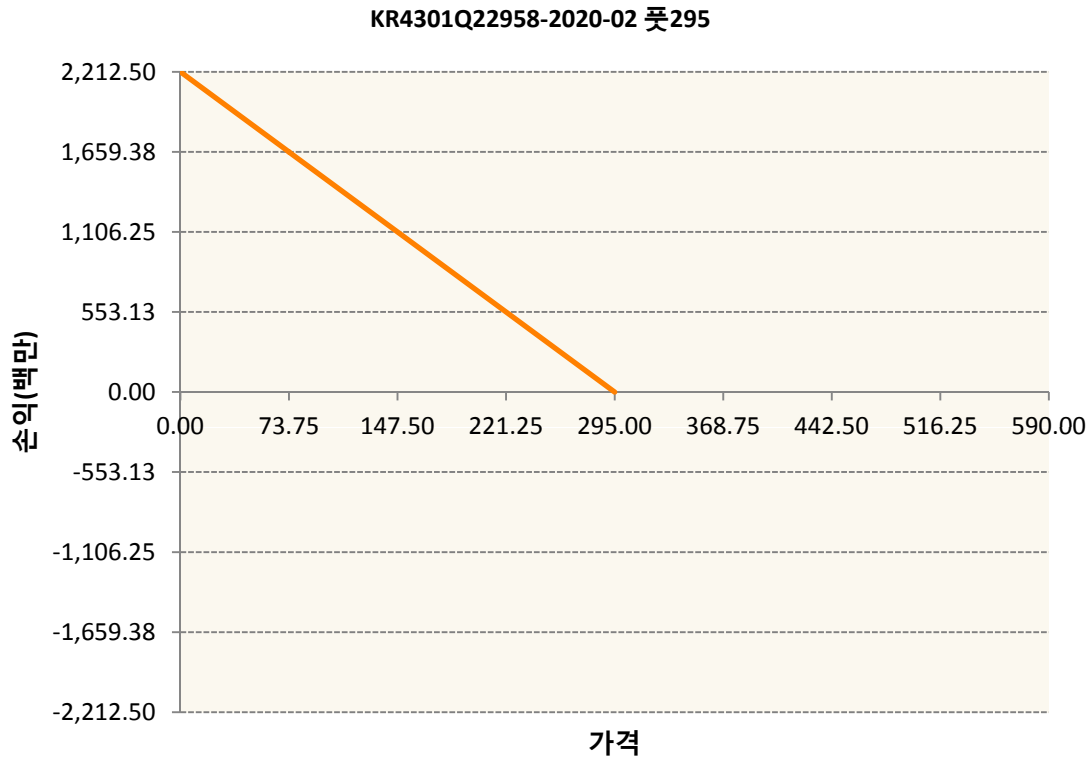
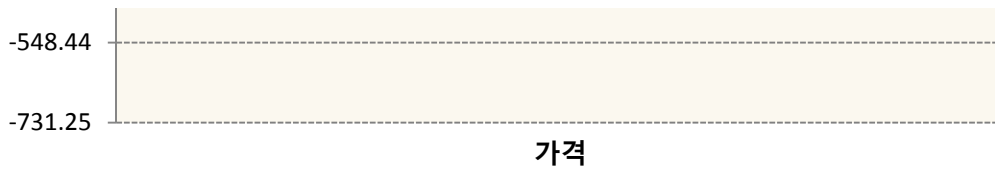


KR4201Q23107-2020-02 콜310



KR4301Q22925-2020-02 풋292.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						828
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-828	-828	-828	-828	-828	-828	-828	
-5.33%	-552	-552	-552	-552	-552	-552	-552	
-2.67%	-276	-276	-276	-276	-276	-276	-276	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	276	276	276	276	276	276	276	
5.33%	552	552	552	552	552	552	552	
8.00%	828	828	828	828	828	828	828	
KR4201Q23073		2020-02 콜307.5						396
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	152	148	143	136	129	120	111	
-5.33%	139	131	121	111	99	87	75	
-2.67%	109	96	82	67	52	37	21	

0%	52	35	17	0	-18	-35	-53
2.67%	-39	-57	-75	-93	-111	-129	-147
5.33%	-163	-179	-195	-211	-228	-245	-262
8.00%	-315	-326	-338	-352	-366	-380	-396
KR4201Q23107 2020-02 콜310							700
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	246	240	232	221	209	195	179
-5.33%	228	215	199	182	162	142	119
-2.67%	183	160	136	111	85	57	29
0%	93	63	31	0	-32	-64	-96
2.67%	-56	-90	-124	-158	-192	-226	-260
5.33%	-268	-300	-331	-364	-396	-429	-462
8.00%	-536	-560	-586	-613	-641	-670	-700
KR4301Q22925 2020-02 풋292.5							36
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	34	34	34	35	35	35	36
-5.33%	16	16	17	18	19	19	20
-2.67%	3	4	5	6	7	8	9
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-3	-2	-2	-2	-2	-2	-1
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-2	-2
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
KR4301Q22958 2020-02 풋295							120
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	116	116	117	117	118	119	120
-5.33%	59	60	62	64	66	68	70
-2.67%	15	18	21	23	26	28	31
0%	-6	-4	-2	0	2	4	7
2.67%	-12	-11	-10	-9	-8	-7	-5
5.33%	-12	-12	-12	-12	-11	-11	-10
8.00%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12

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

(단위:백만원)

1,671

공시일	2020-01-22
기준일	2020-01-21

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	207,518	0	207,518	

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	2020-01-22
기준일	2020-01-21

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	216,613	0	216,613	

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	2020-01-22
기준일	2020-01-21

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	532,086	0	532,086	
누계	통화	선도	0	556,892	-556,892	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E	1,400
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E	1,503
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E	4,761
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	187
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,801
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,801
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,334
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,521
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	1,624
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	1,531
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	934
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	187
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	1,998
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	934
FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E	3,734
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,867
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,998
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	187
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	187
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	1,120
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	1,680
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	280
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E	1,867
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E	3,212
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,503
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,400

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

14,638

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

(단위:백만원)

212

공시일	2020-01-22
기준일	2020-01-21

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

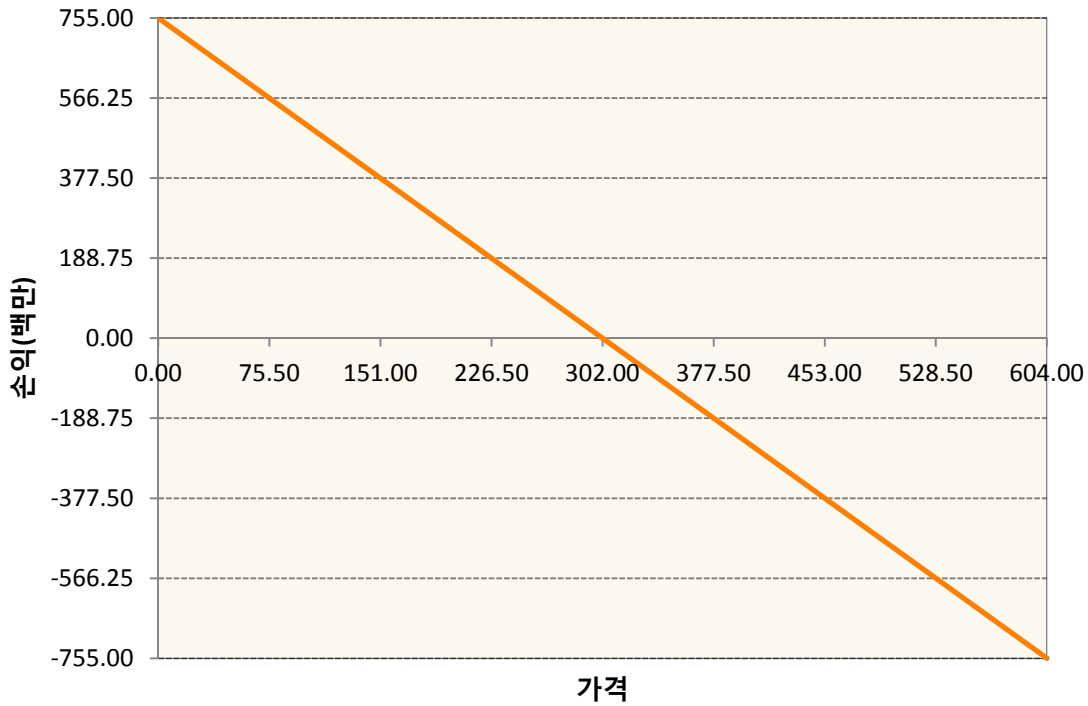
1. 계약금액

(단위:백만원)

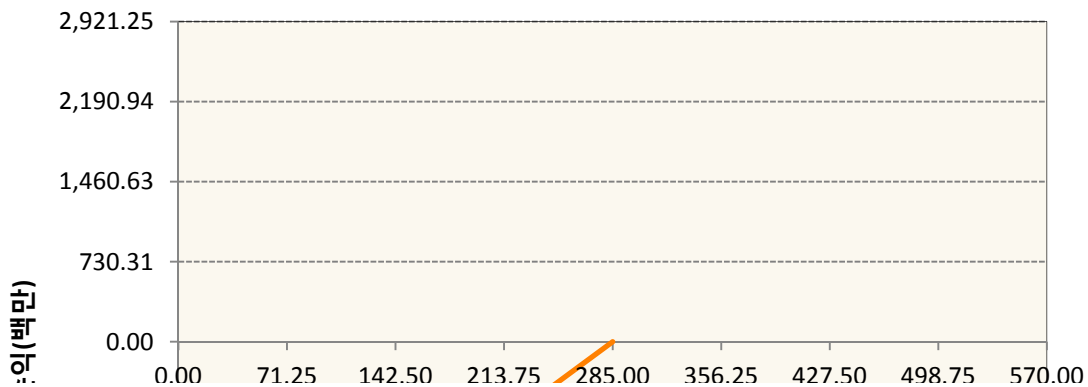
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	755	-755	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,784	-3,784	장내

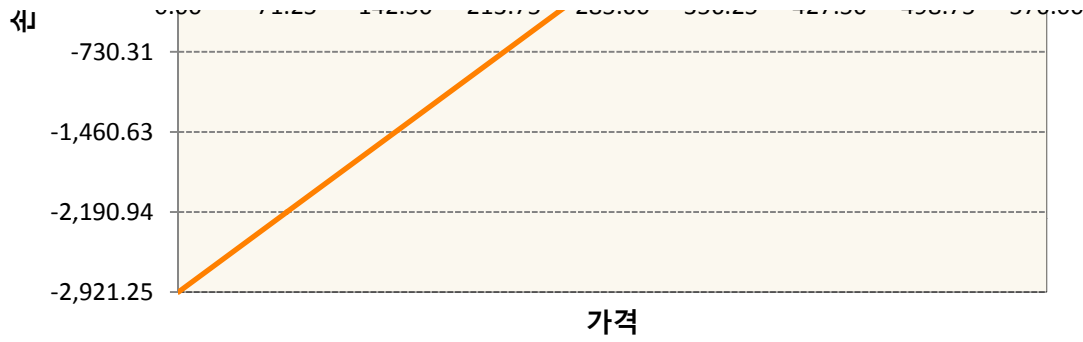
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

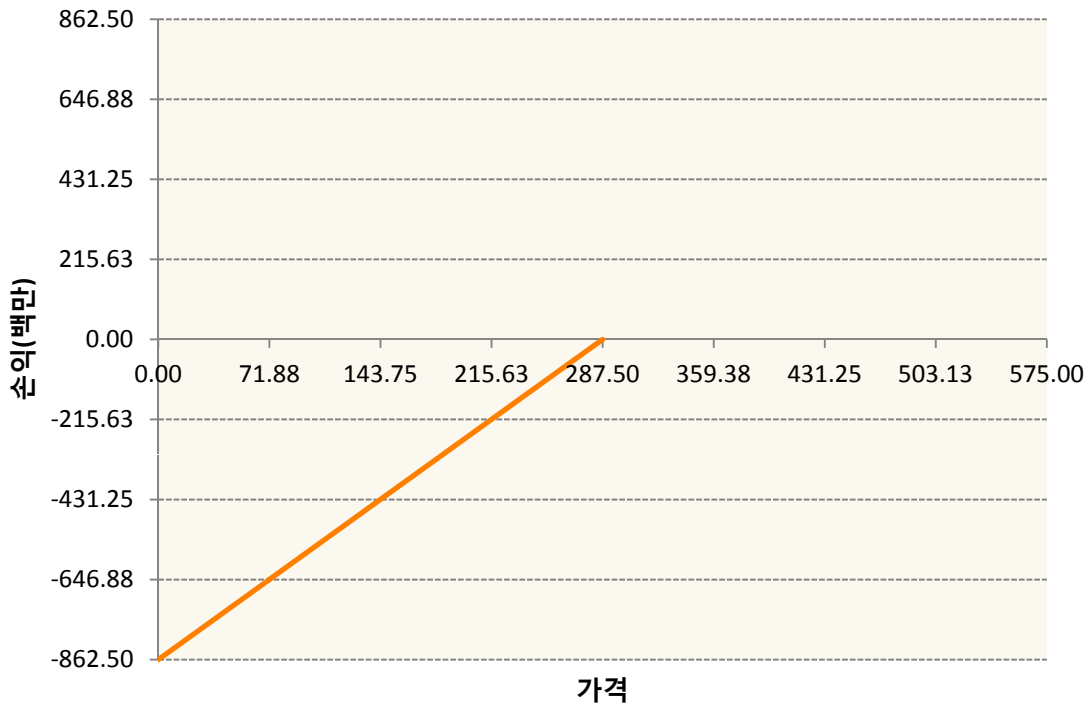


KR4301Q22859-2020-02 풋285





KR4301Q22875-2020-02 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						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						94
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-78	-80	-82	-85	-88	-91	-94
-5.33%	-24	-28	-31	-35	-38	-42	-45
-2.67%	-3	-4	-7	-9	-12	-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 32

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-29	-29	-30	-30	-31	-32	-32
-5.33%	-11	-12	-13	-14	-15	-16	-17
-2.67%	-1	-2	-3	-4	-5	-6	-7
0%	1	1	0	0	0	-1	-2
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)

117

공시일	2020-01-22
기준일	2020-01-21

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	195	-195	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	12,740	0	12,740	
누계	통화	선도	446	13,575	-13,129	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E	289
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	290
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	345
FX21020F00! KRW/USD 13-02-20E	125
FX21020F02! USD/KRW 28-01-20E	36
FX21020F02! KRW/USD 22-01-20E	36
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

369

공시일	2020-01-22
기준일	2020-01-21

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

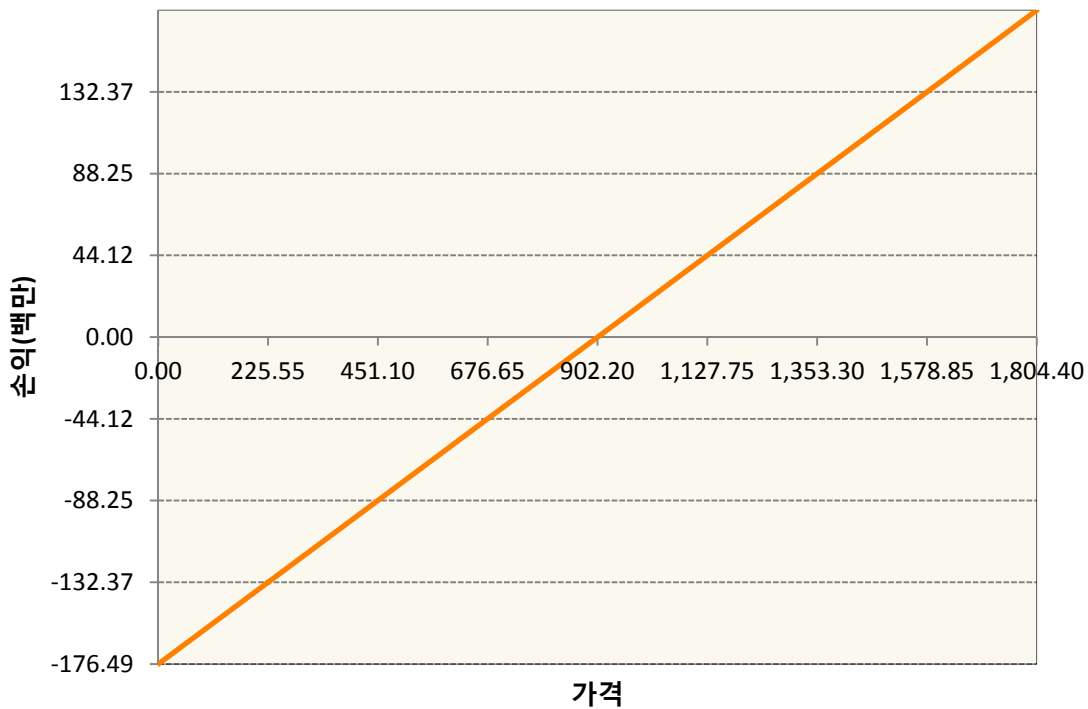
1. 계약금액

(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	176	0	176	
누계	유가증권	스왑	1,023	0	1,023	장외
누계	통화	선도	311	816	-505	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCG0-VN30 Index Future Feb20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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	14

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

(단위:백만원)

103

공시일	2020-01-22
기준일	2020-01-21

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

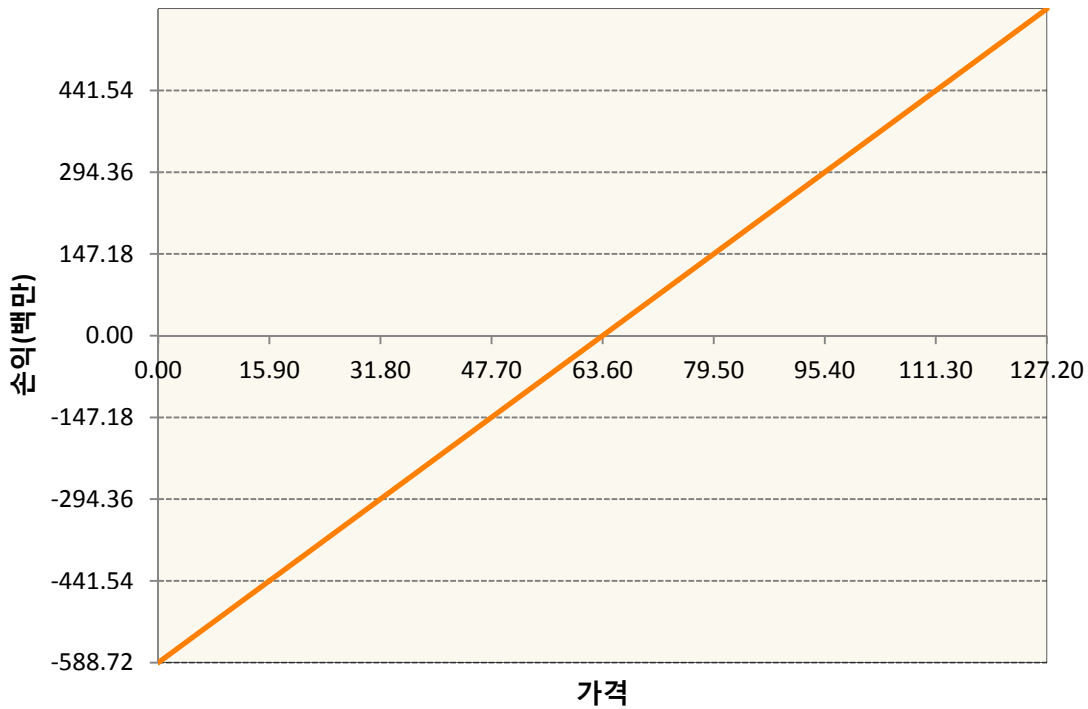
1. 계약금액

(단위:백만원)

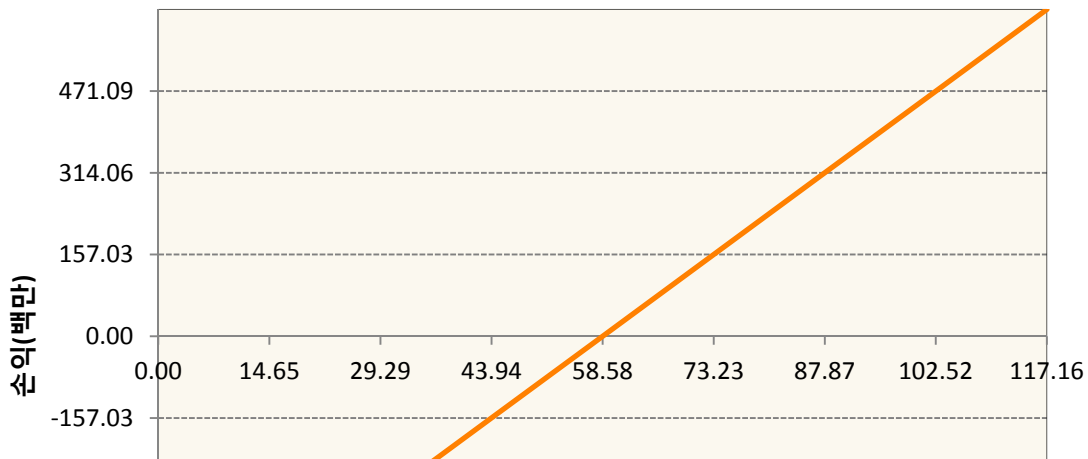
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,378	292	2,086	

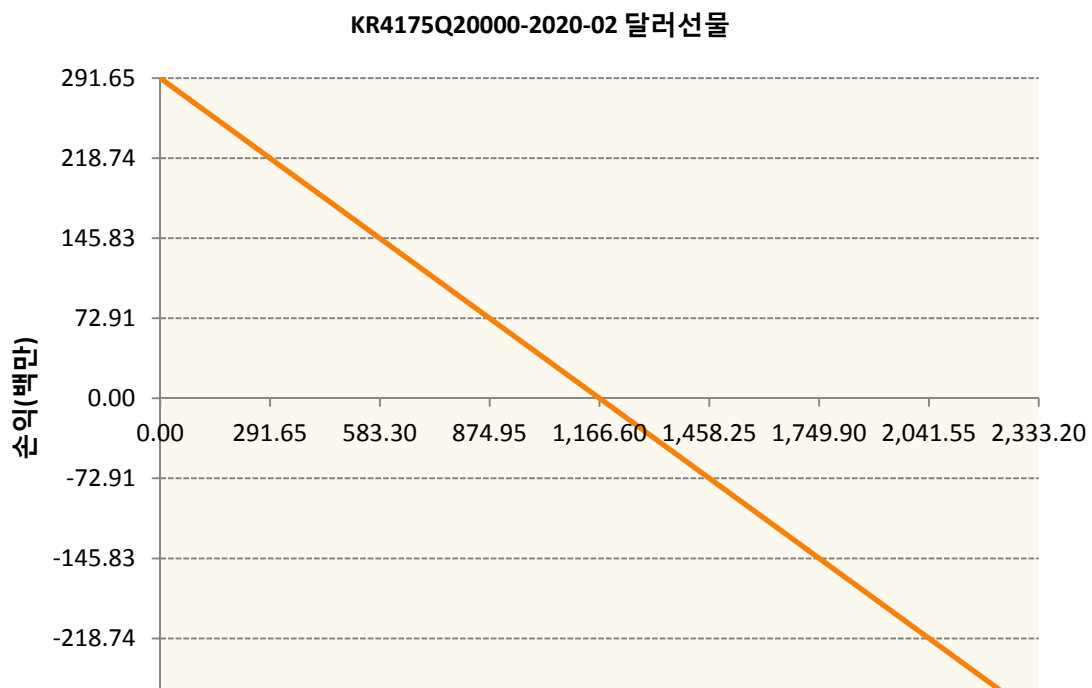
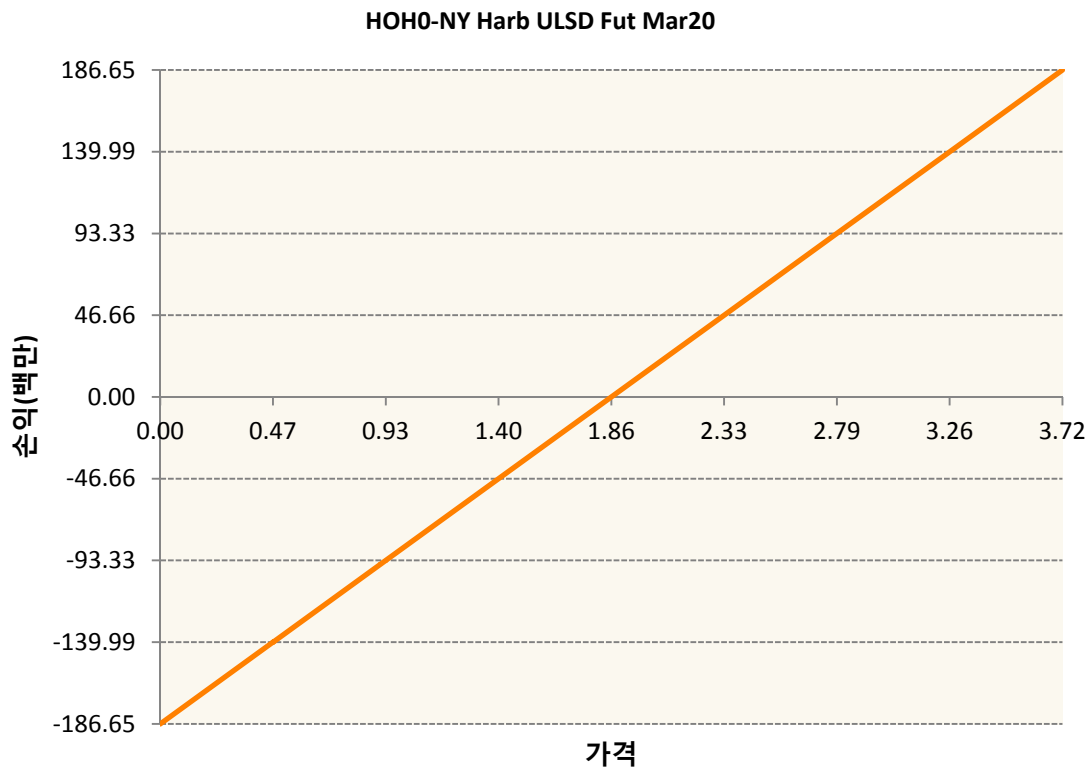
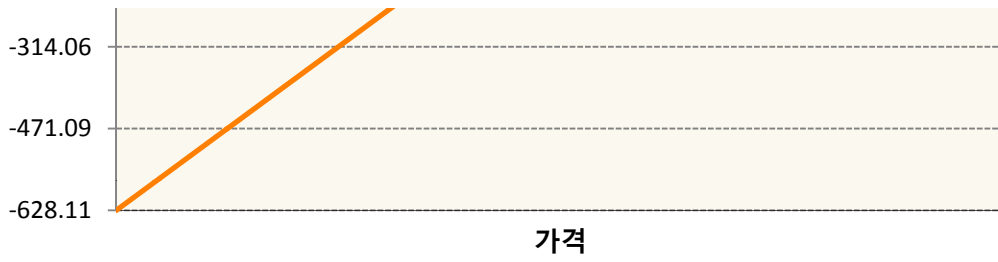
2. 만기시점의 손익구조

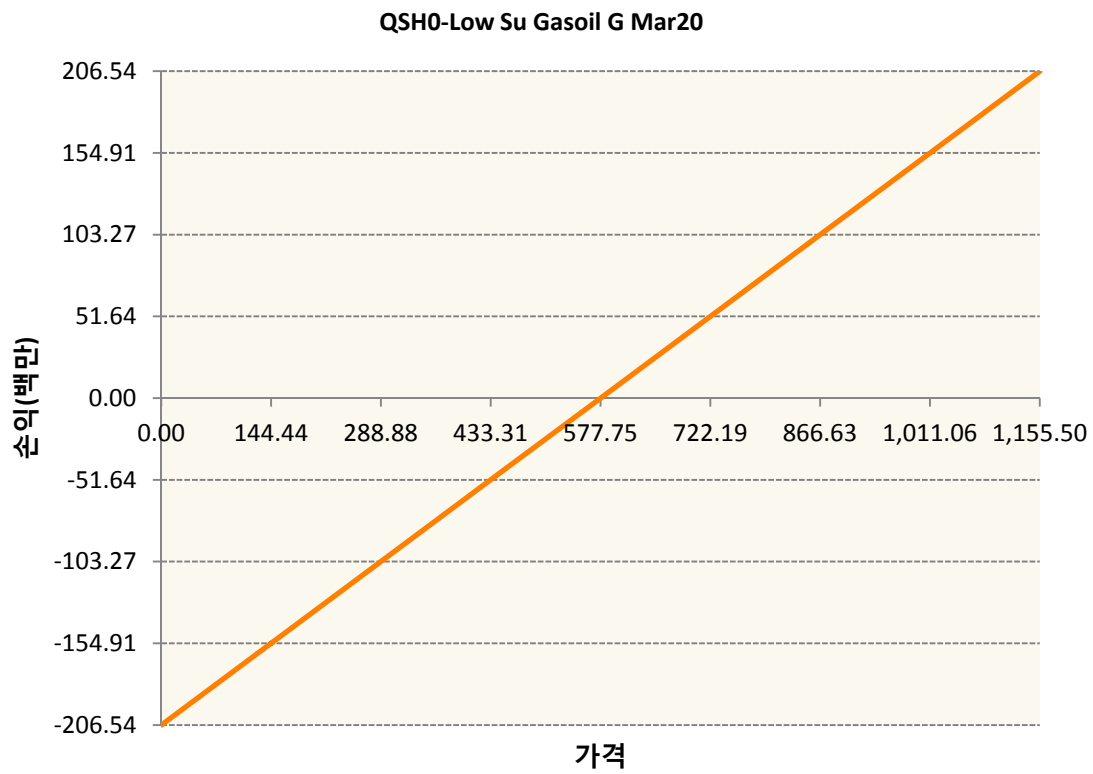
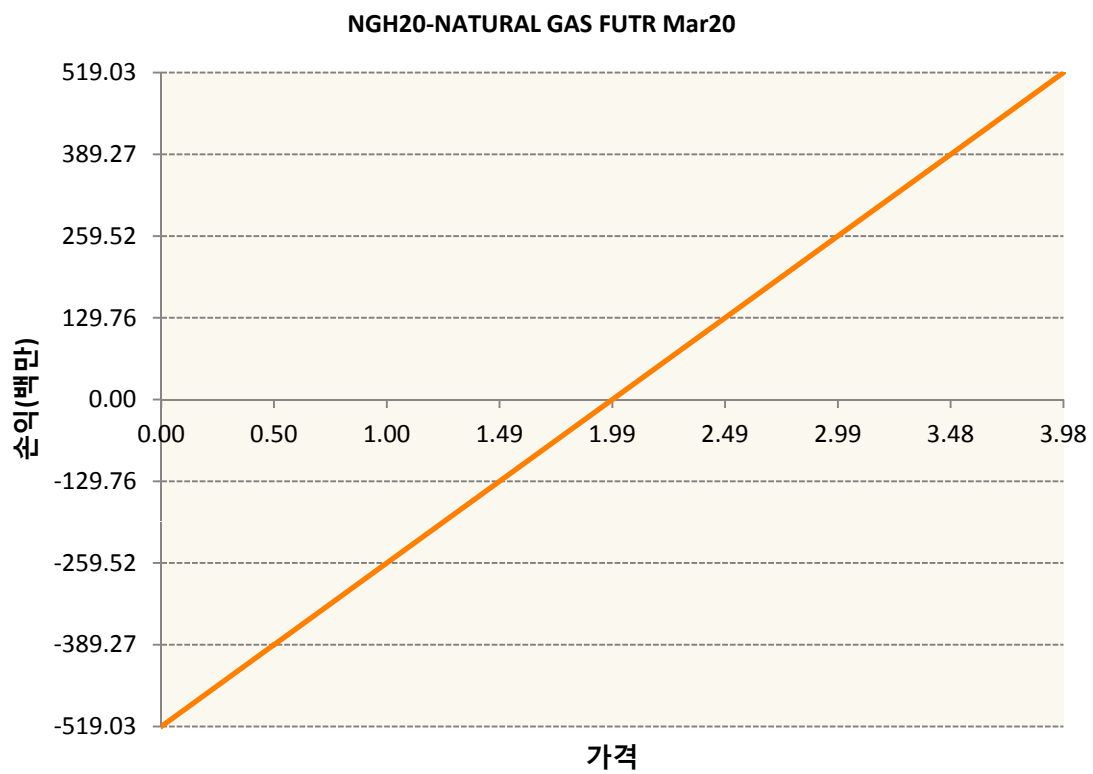
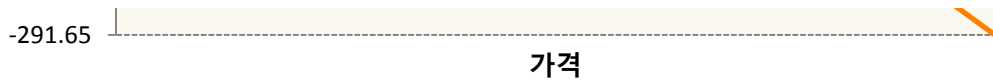
COKO-BRENT CRUDE FUTR May20



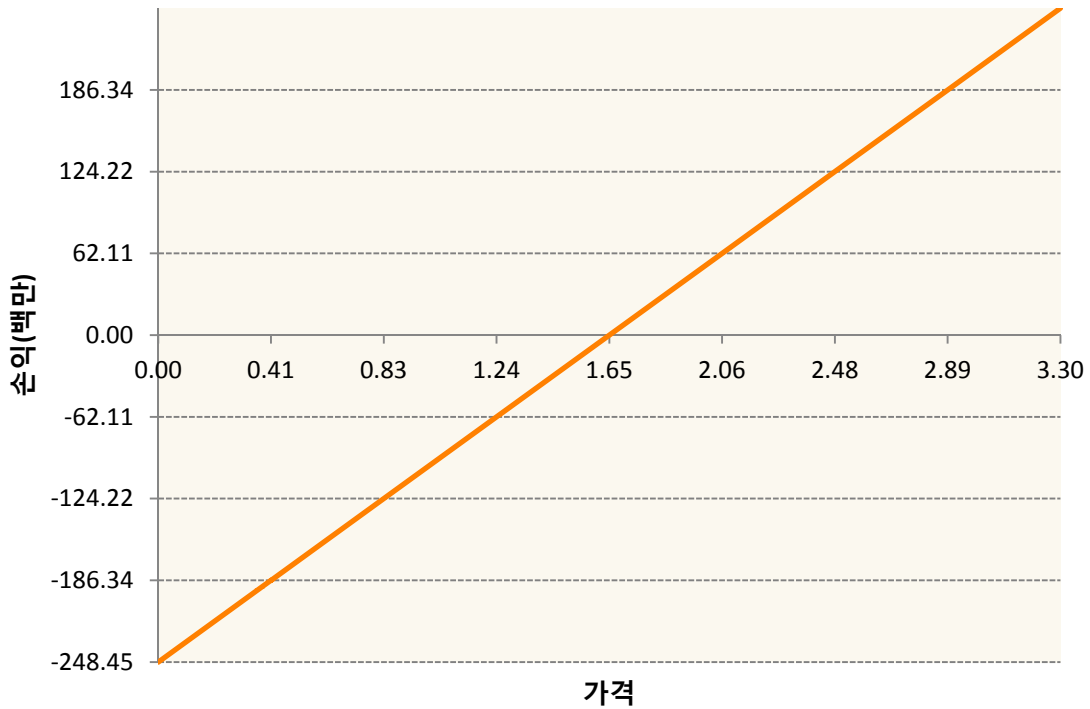
CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20







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	17
XBH0	GASOLINE RBOB FUT Mar20	20

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

368

공시일	2020-01-22
기준일	2020-01-21

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

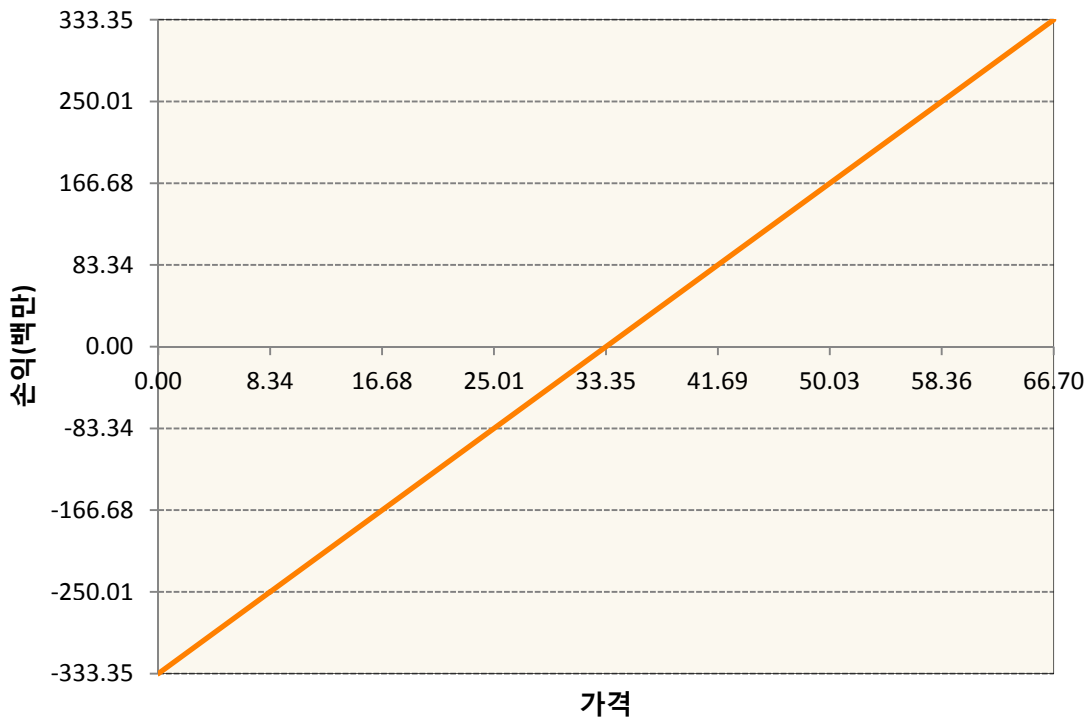
1. 계약금액

(단위:백만원)

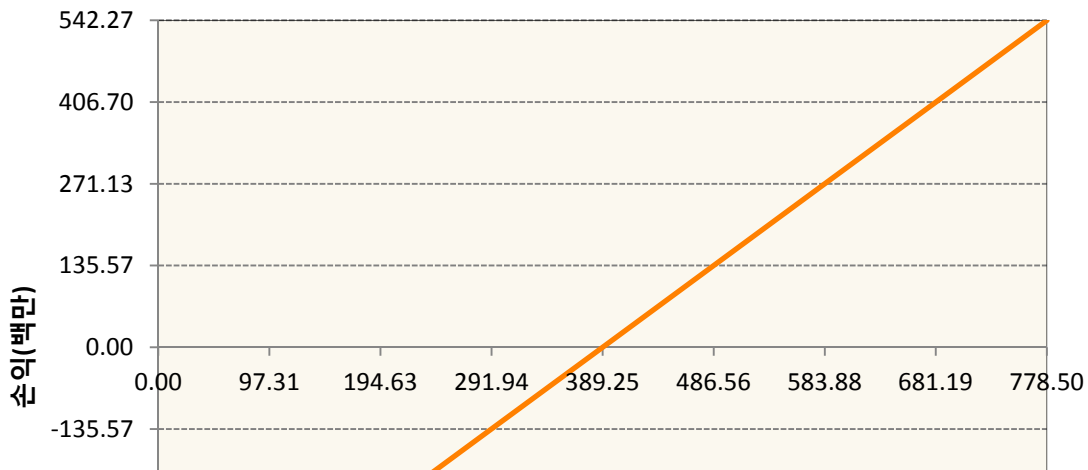
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,843	152	2,691	

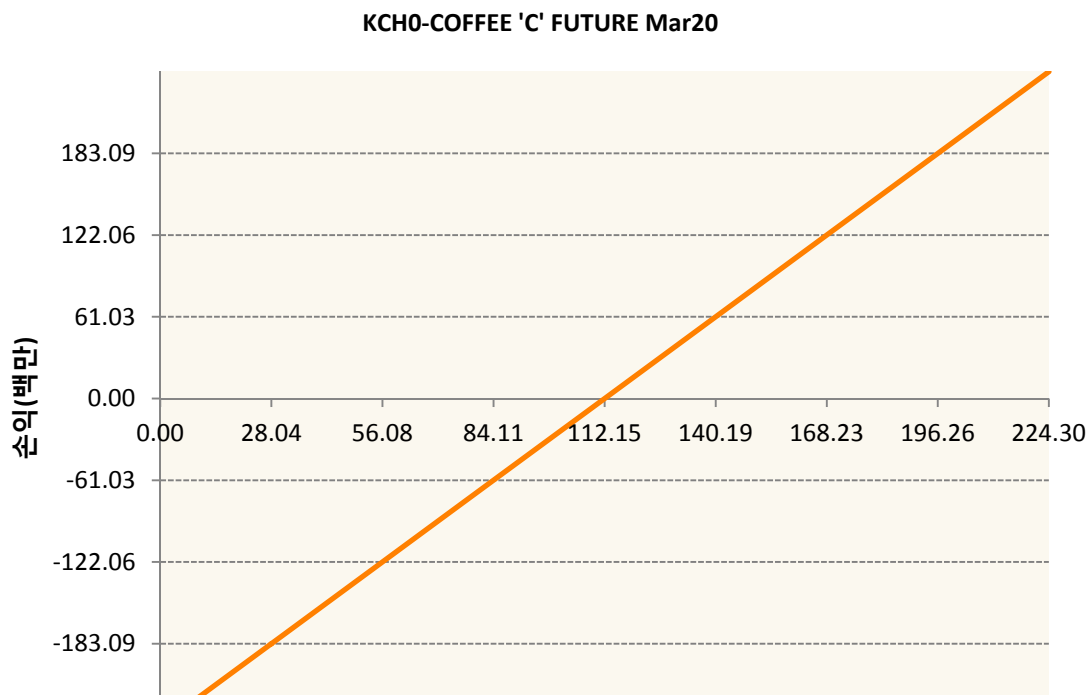
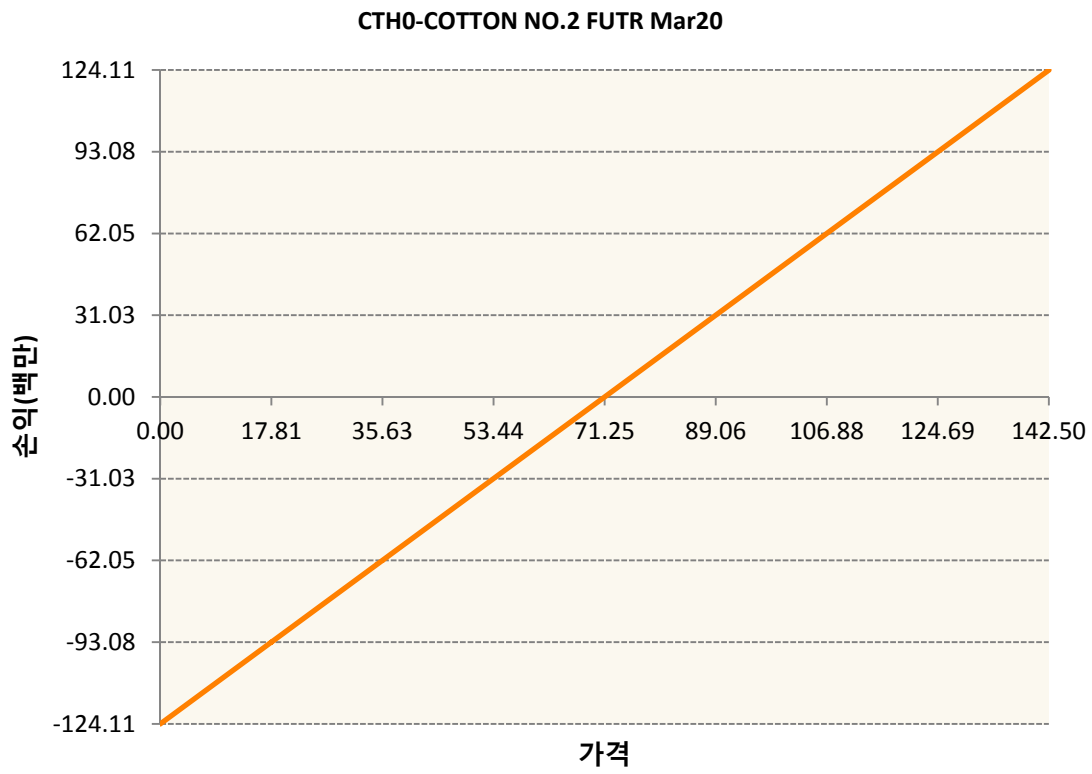
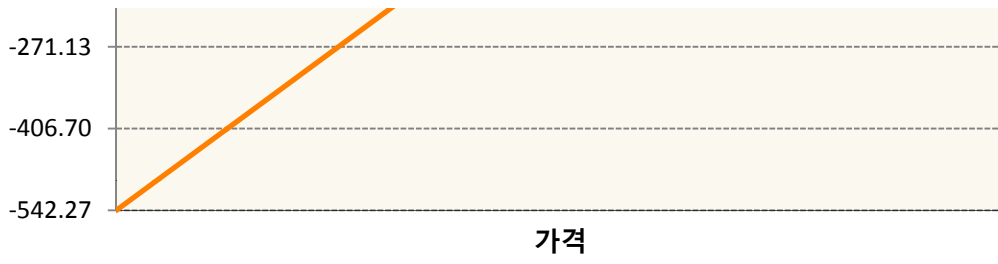
2. 만기시점의 손익구조

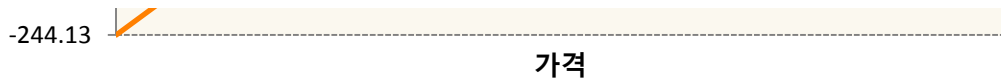
BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20



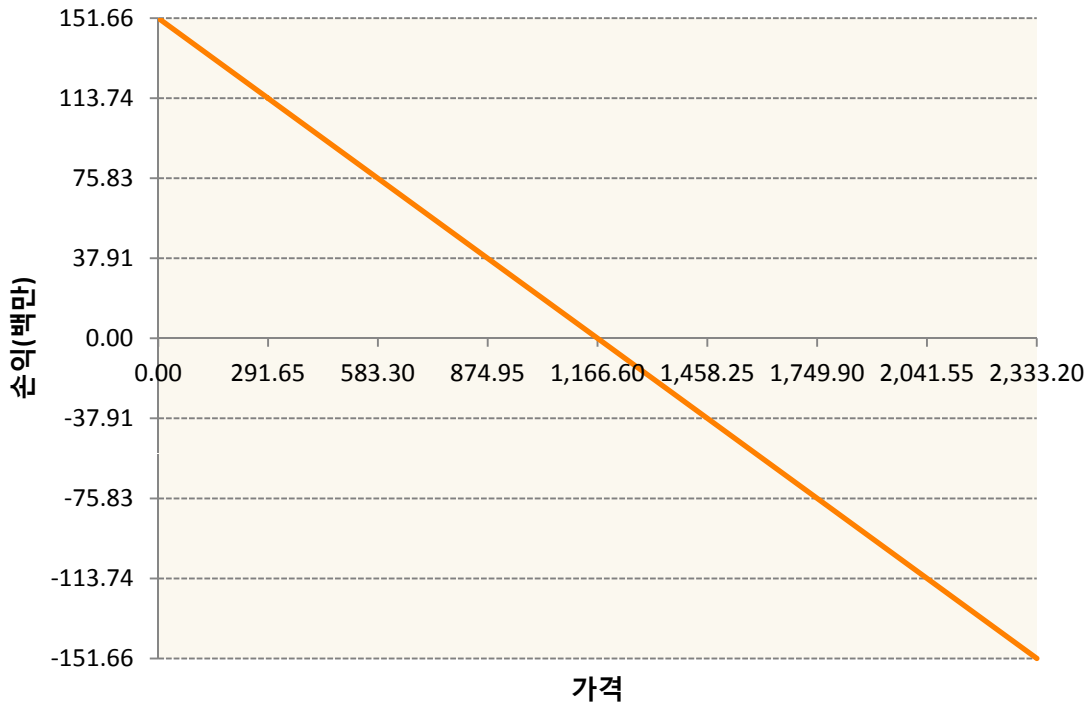
CH0-CORN FUTURE Mar20



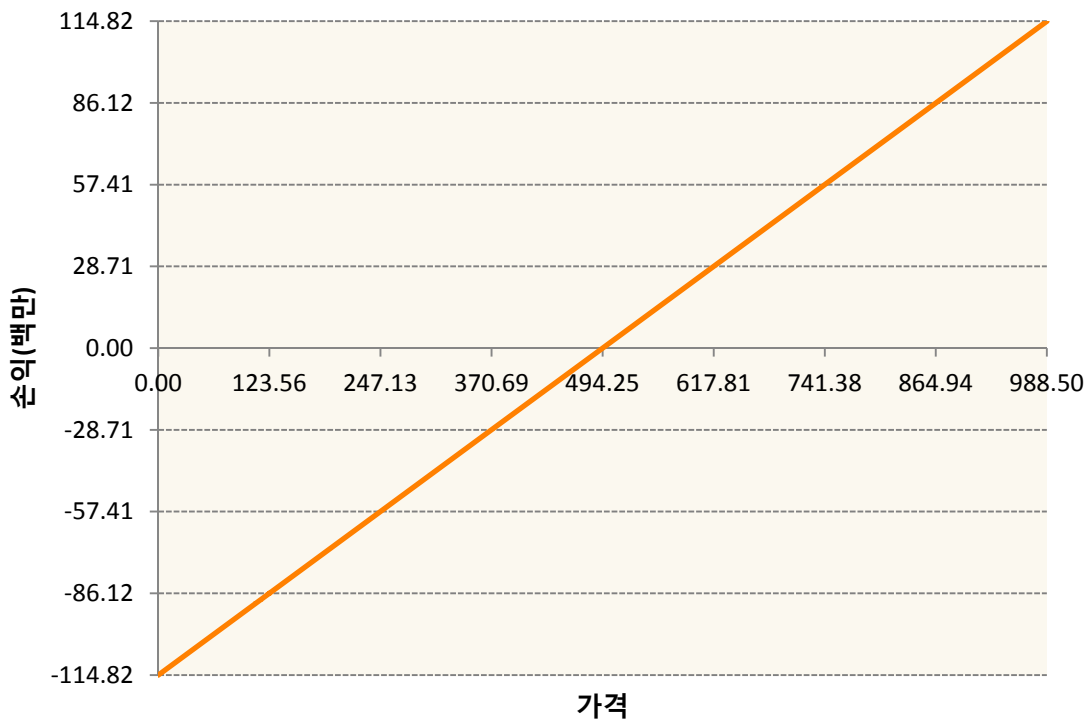




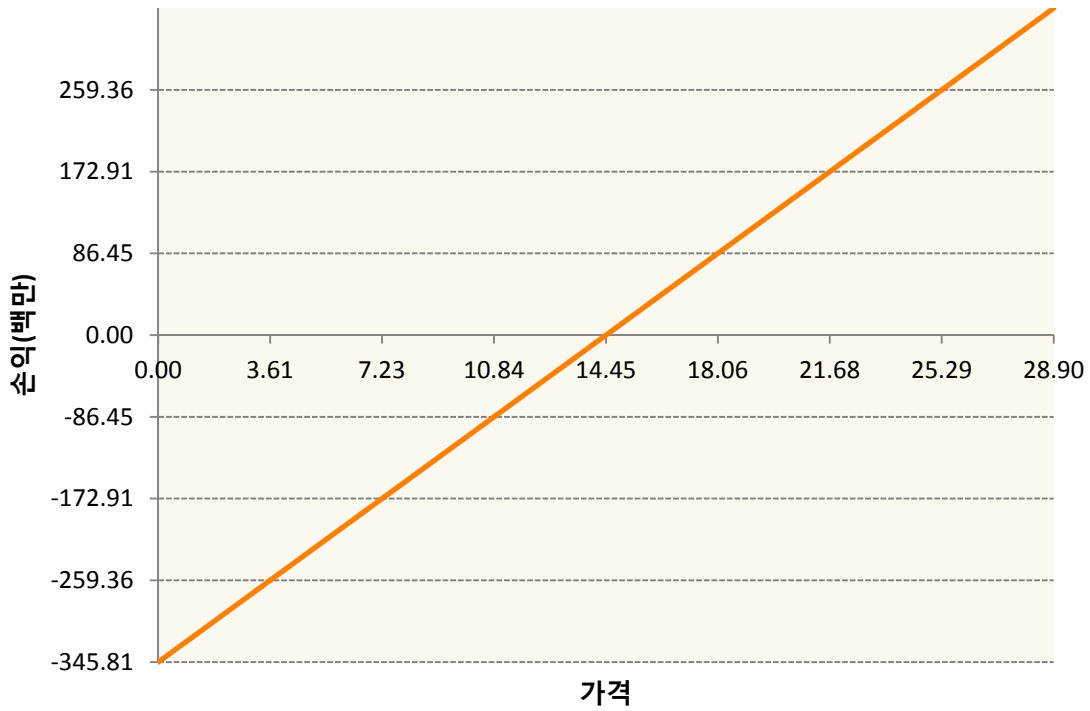
KR4175Q20000-2020-02 달러선물



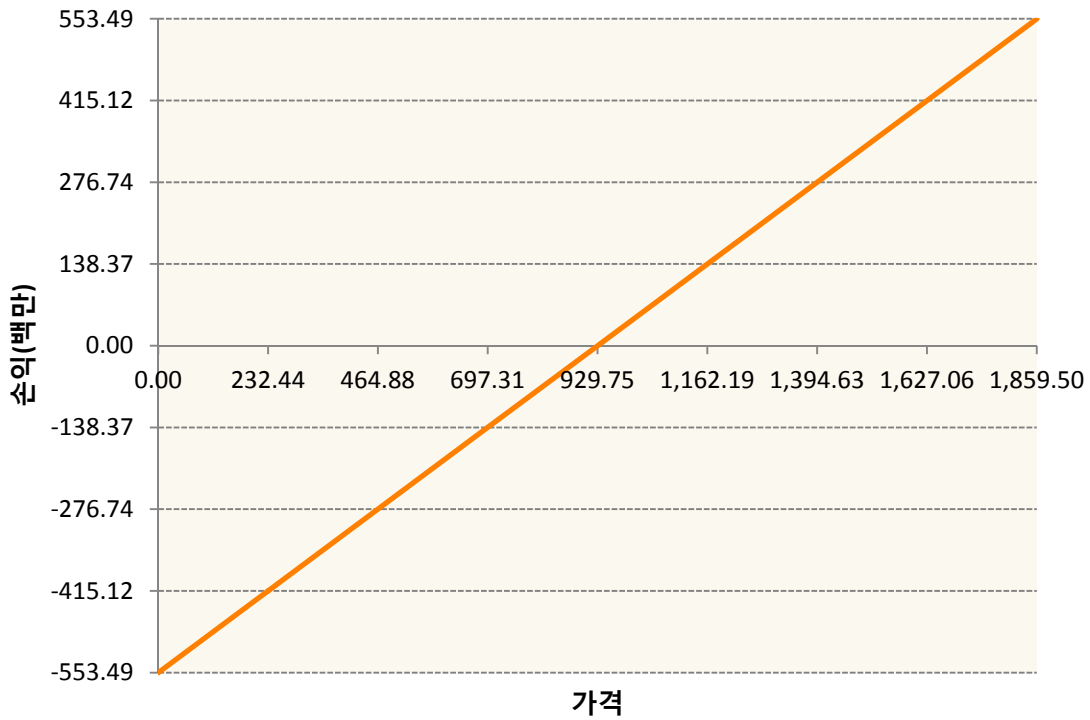
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

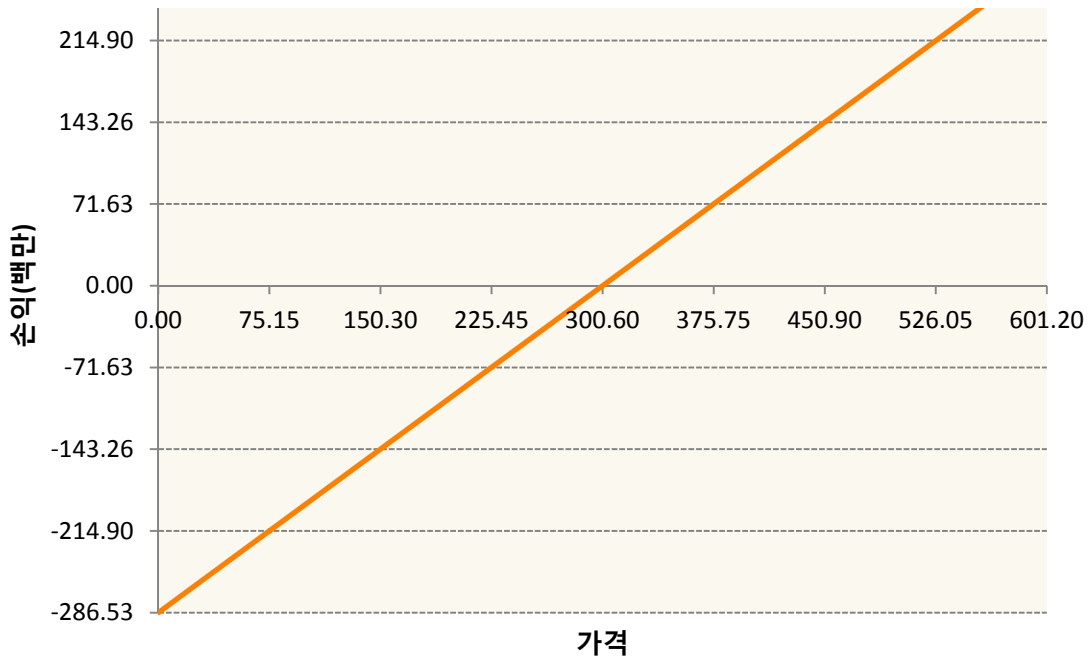


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20

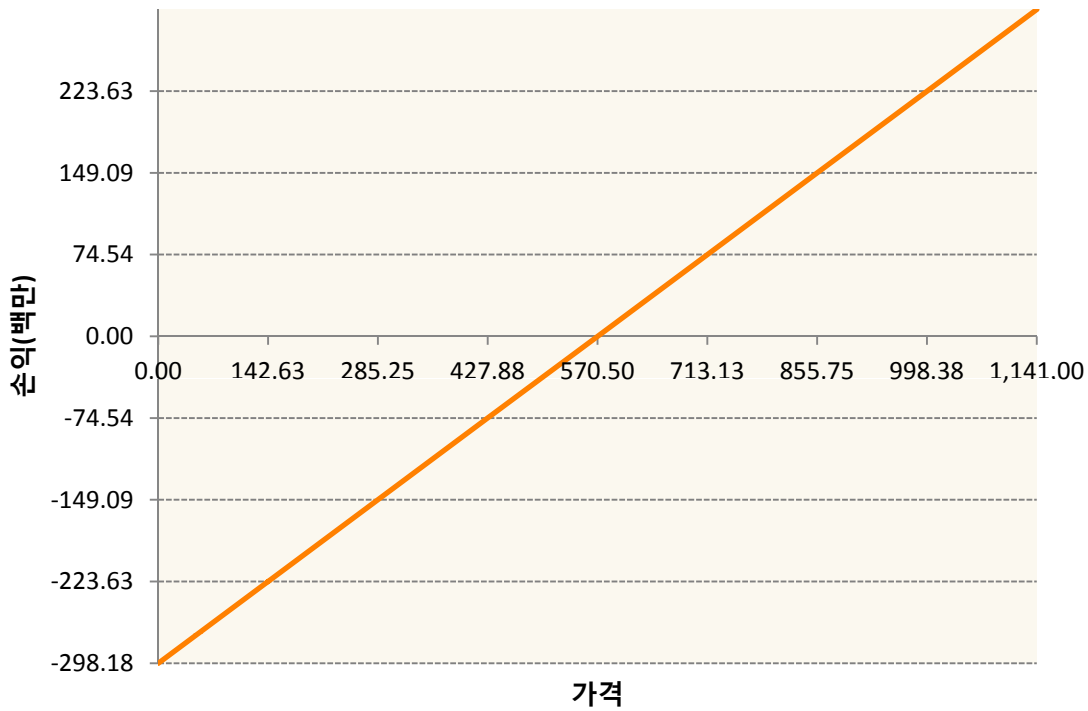


SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





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