

공시일	2020-01-23
기준일	2020-01-22

## 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	2020-01-23
기준일	2020-01-22

## 스마트인덱스모

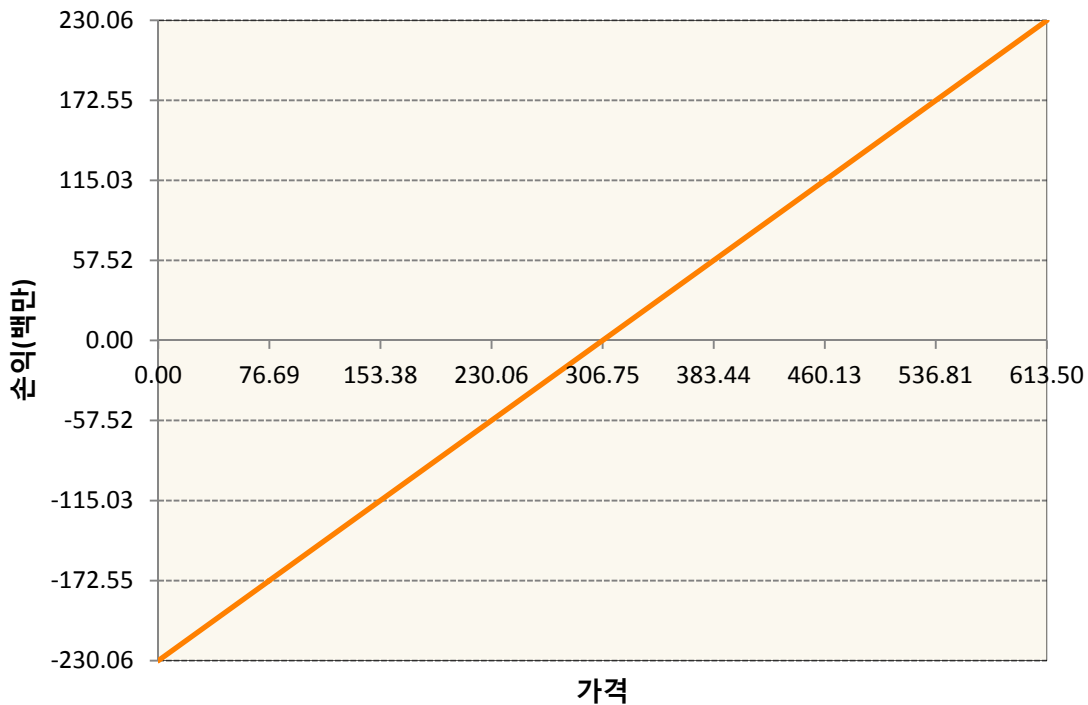
### 1. 계약금액

(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
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	2020-01-23
기준일	2020-01-22

## 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

1,153

\* 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	2020-01-23
기준일	2020-01-22

## 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)	435
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	159

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

827

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-23
기준일	2020-01-22

## 유로인덱스모(주식-파생형)

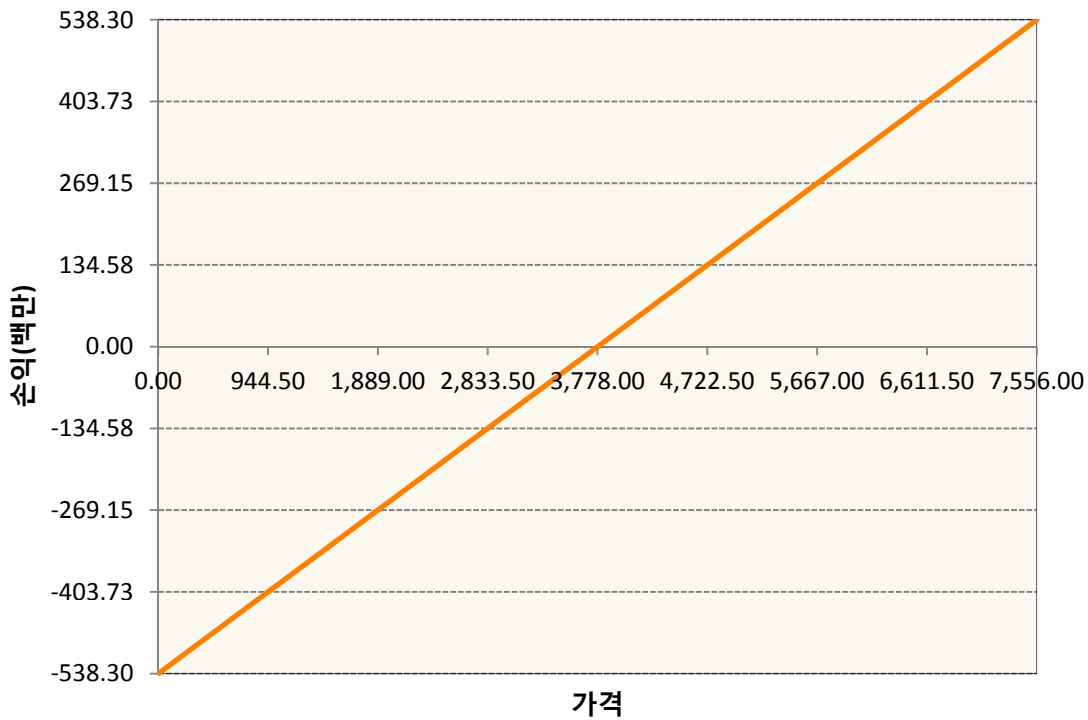
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	538	0	538	

### 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	2020-01-23
기준일	2020-01-22

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

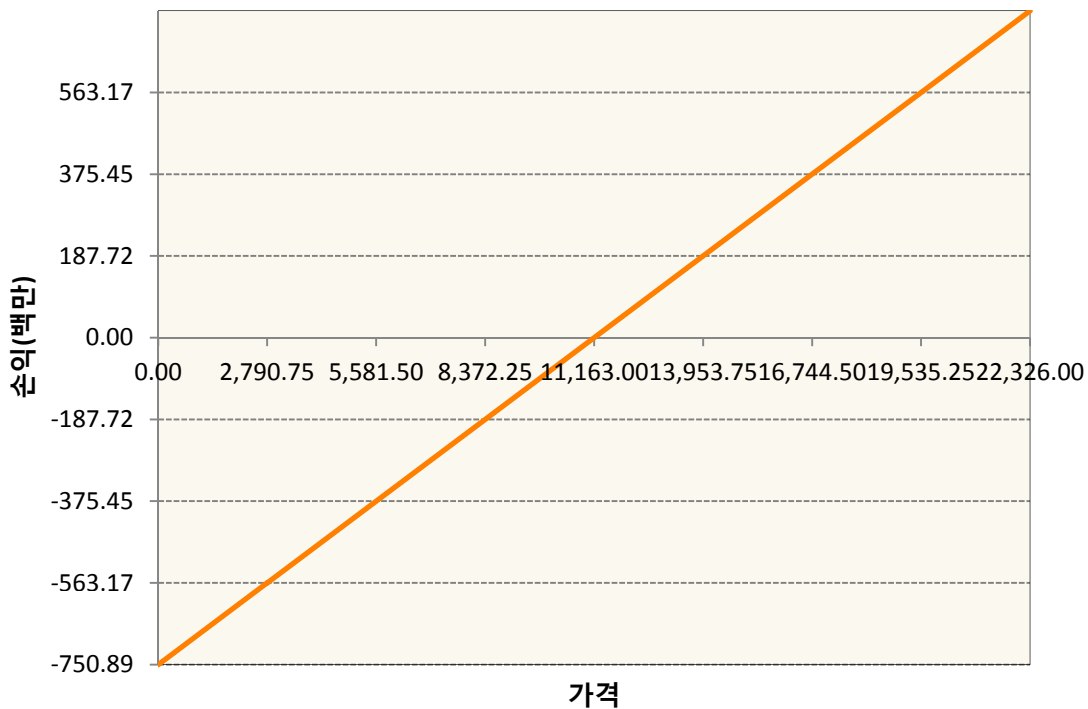
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	751	0	751	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCF0-HSCEI Futures Jan20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF0	HSCEI Futures Jan20	60
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

53
----

공시일	2020-01-23
기준일	2020-01-22

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

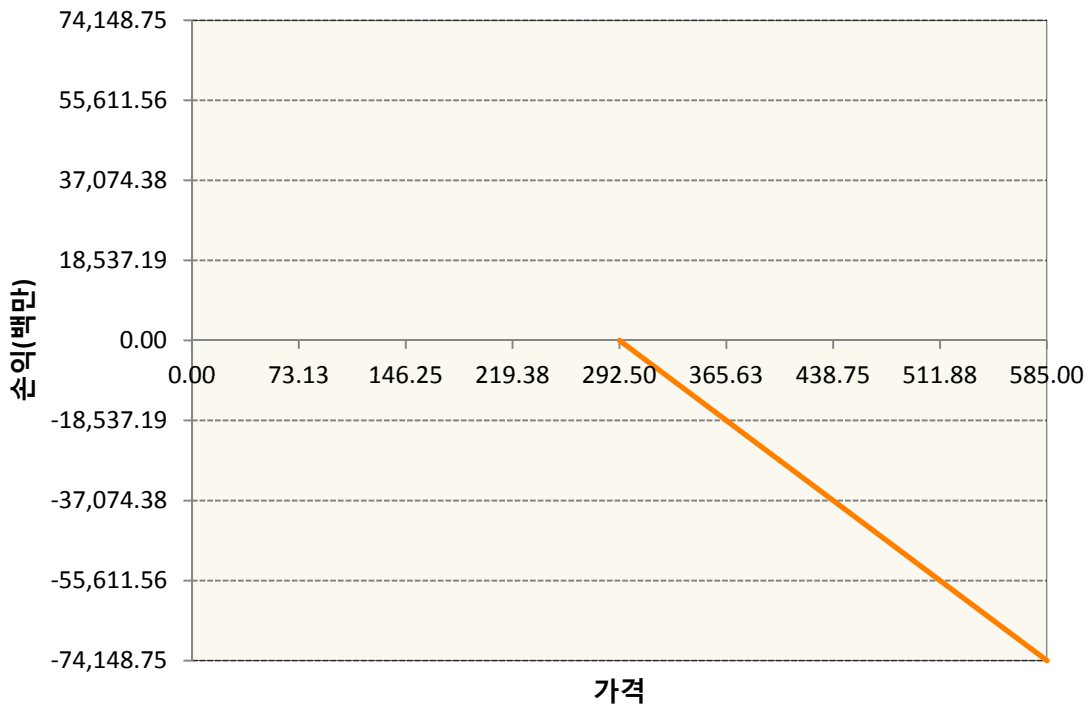
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

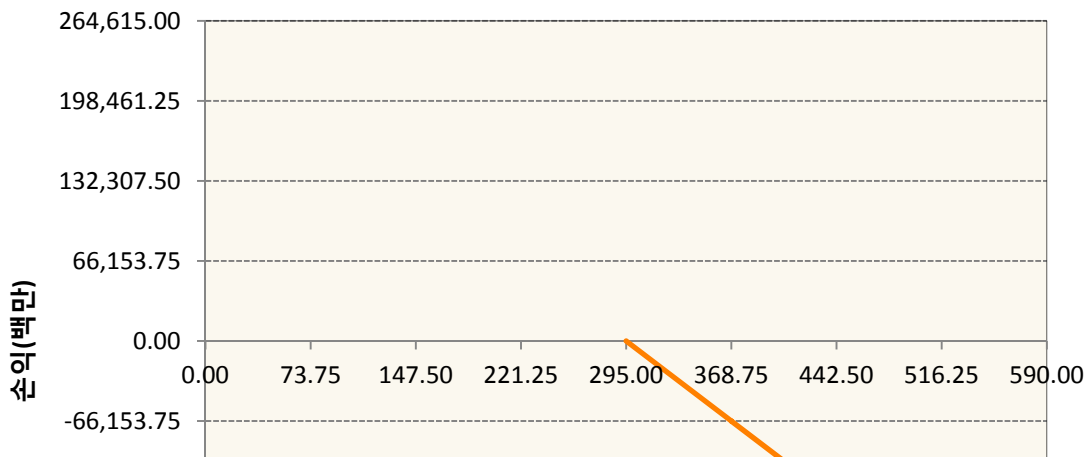
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	3,668	0	3,668	장내
누계	유가증권	옵션	0	455,004	-455,004	장내

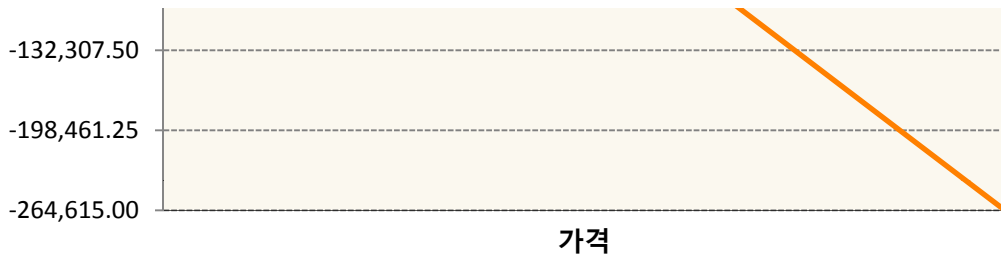
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q22927-2020-02 콜292.5

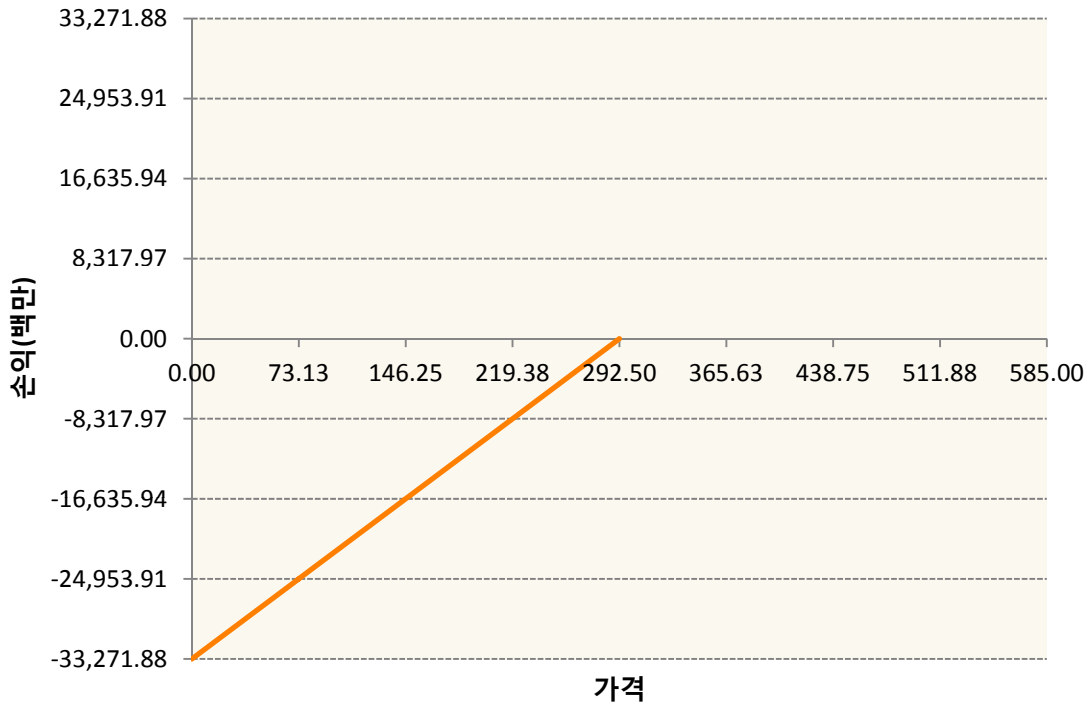


KR4201Q22950-2020-02 콜295

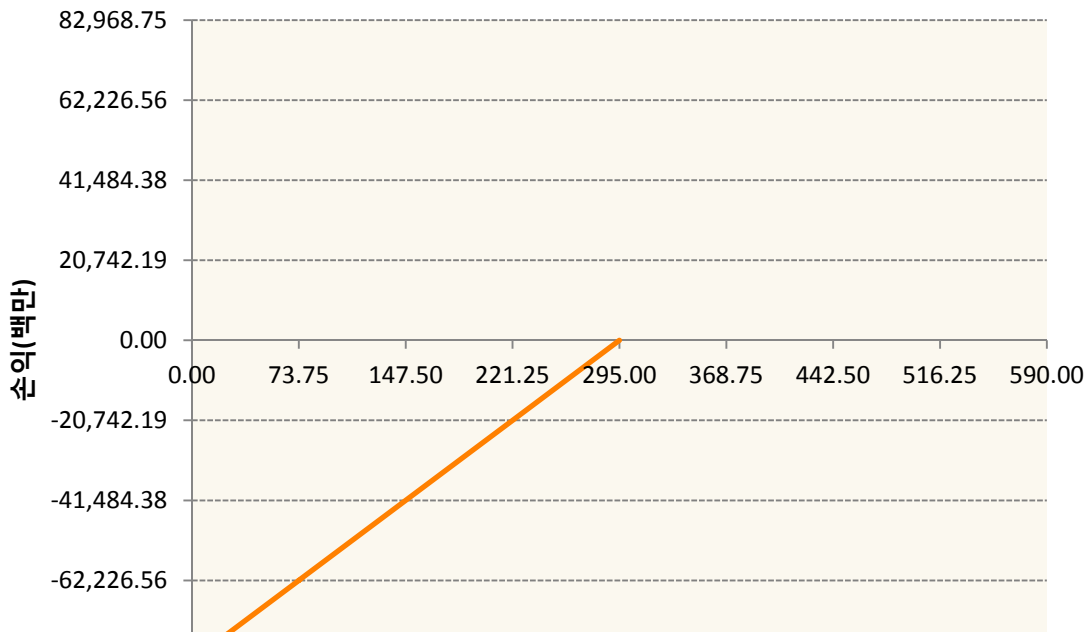




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



KR4301Q22958-2020-02 풋295



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q22927		2020-02 콜292.5						5,592
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,770	3,626	3,476	3,321	3,163	3,003	2,840	
-5.33%	3,054	2,876	2,697	2,517	2,338	2,158	1,978	
-2.67%	1,933	1,758	1,582	1,404	1,226	1,047	867	
0%	435	297	152	0	-156	-317	-480	
2.67%	-1,340	-1,429	-1,531	-1,644	-1,766	-1,896	-2,033	
5.33%	-3,280	-3,328	-3,389	-3,463	-3,549	-3,645	-3,751	
8.00%	-5,299	-5,321	-5,353	-5,397	-5,451	-5,517	-5,592	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						19,356
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	12,256	11,795	11,306	10,795	10,268	9,726	9,173	
-5.33%	10,121	9,508	8,889	8,267	7,641	7,013	6,383	
-2.67%	6,595	5,952	5,307	4,661	4,014	3,367	2,719	
0%	1,681	1,139	577	0	-589	-1,188	-1,795	
2.67%	-4,329	-4,703	-5,119	-5,568	-6,046	-6,548	-7,069	
5.33%	-11,039	-11,253	-11,517	-11,826	-12,175	-12,558	-12,972	
8.00%	-18,114	-18,218	-18,364	-18,553	-18,783	-19,052	-19,356	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						1,339
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,215	-1,230	-1,247	-1,268	-1,290	-1,314	-1,339	
-5.33%	-472	-508	-545	-582	-619	-657	-695	
-2.67%	-72	-104	-136	-170	-205	-240	-276	
0%	40	29	16	0	-18	-39	-61	
2.67%	55	53	50	46	40	33	23	
5.33%	55	55	55	54	53	51	48	
8.00%	56	56	56	55	55	55	54	
KR4301Q22958		2020-02 풋295						3,811
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,581	-3,604	-3,634	-3,670	-3,712	-3,760	-3,811	
-5.33%	-1,572	-1,650	-1,731	-1,814	-1,899	-1,985	-2,073	
-2.67%	-303	-394	-486	-580	-674	-768	-863	
0%	143	102	54	0	-59	-123	-191	
2.67%	219	212	199	182	160	132	99	

5.33%	225	225	223	220	214	206	195
8.00%	225	225	225	225	224	222	220

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

(단위:백만원)

**28,936**

공시일	2020-01-23
기준일	2020-01-22

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

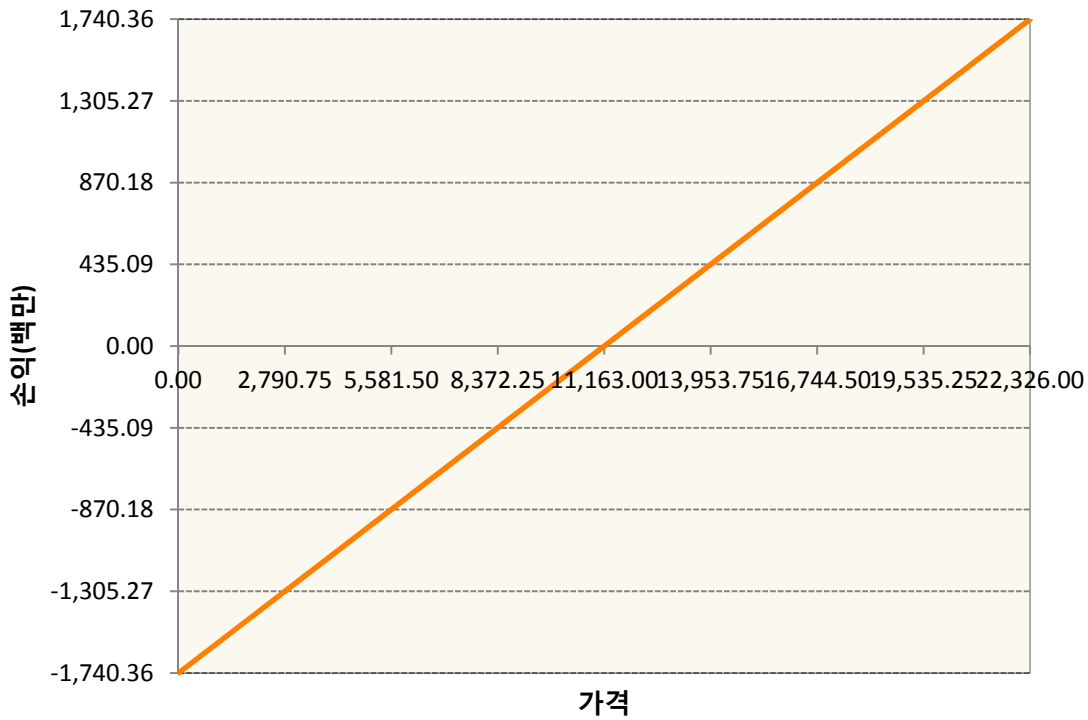
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

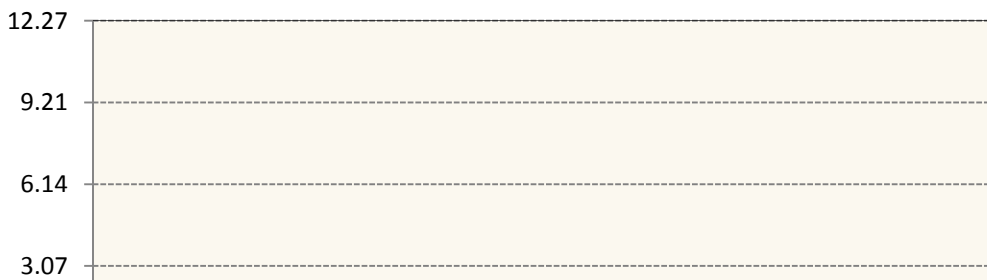
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,740	0	1,740	장내
누계	유가증권	옵션	0	43	-43	장내
누계	통화	선도	0	2,110	-2,110	장외

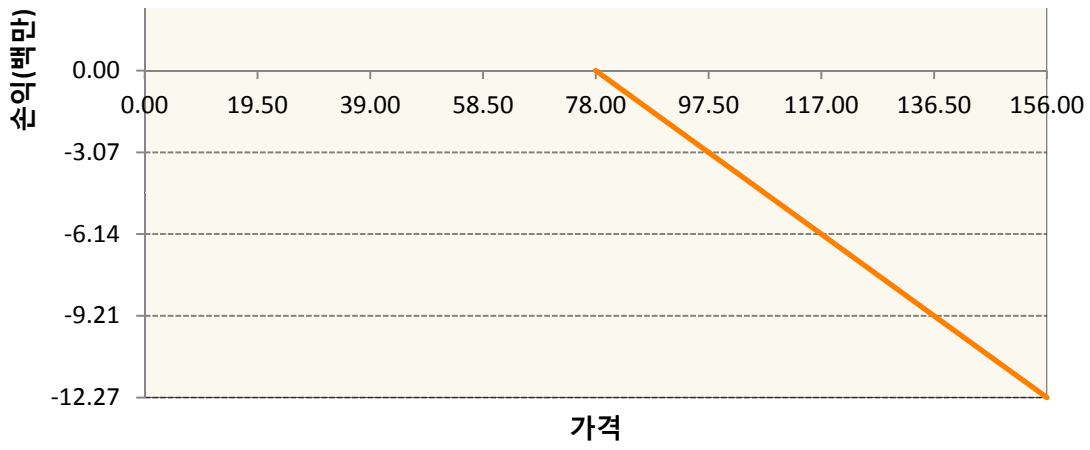
### 2. 만기시점의 손익구조

HCFO-HSCEI Futures Jan20

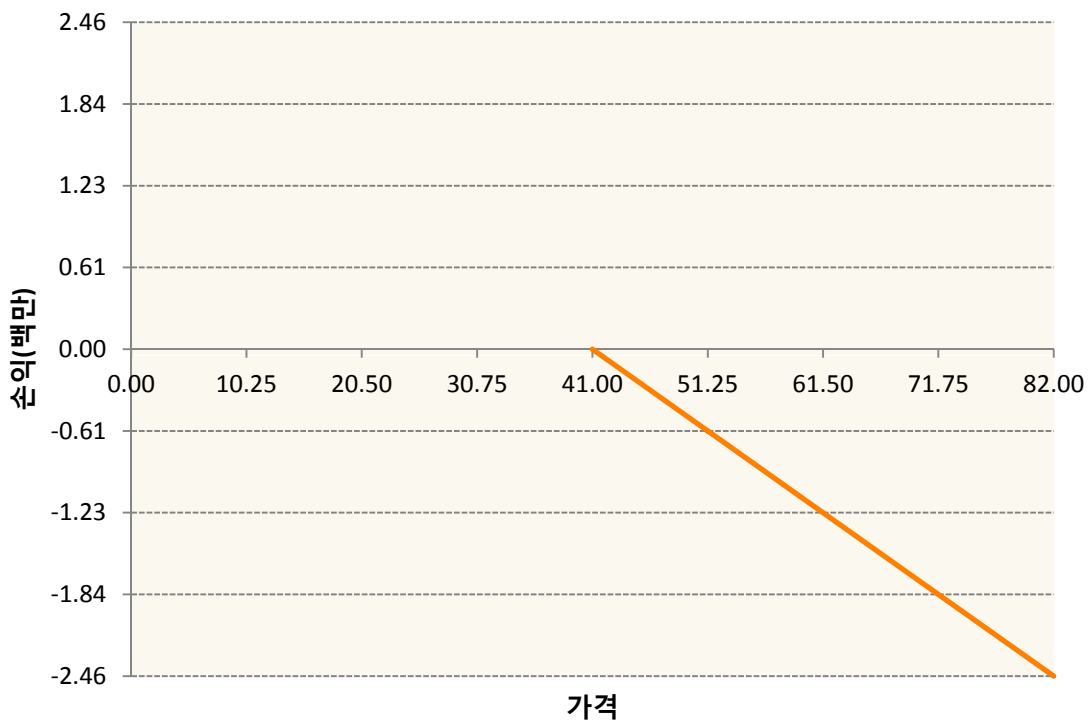


OHHIF0-C112-HSCEI

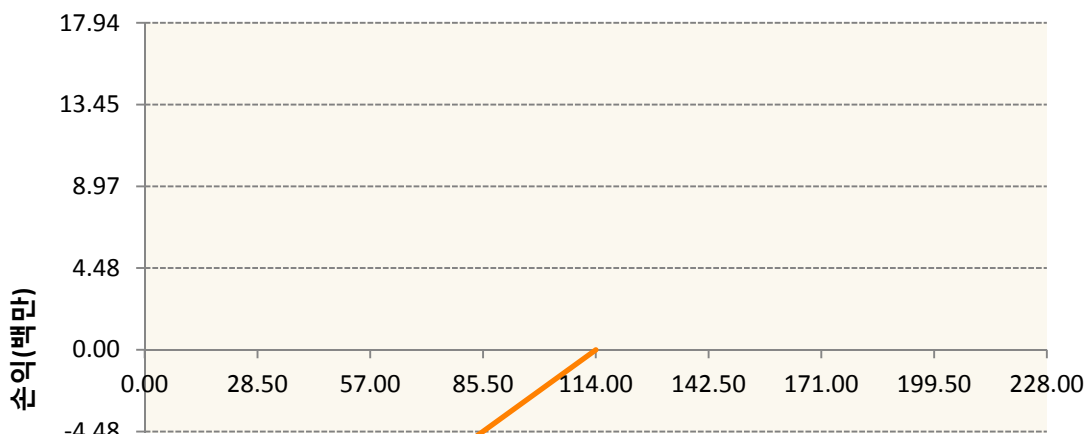


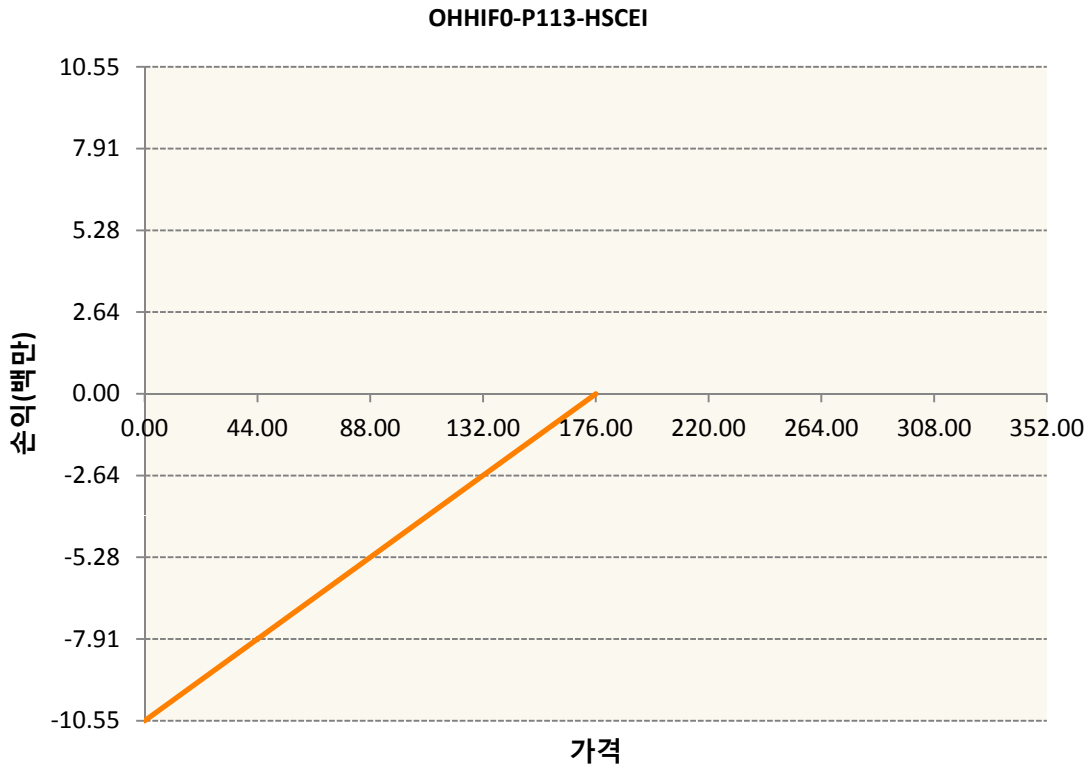
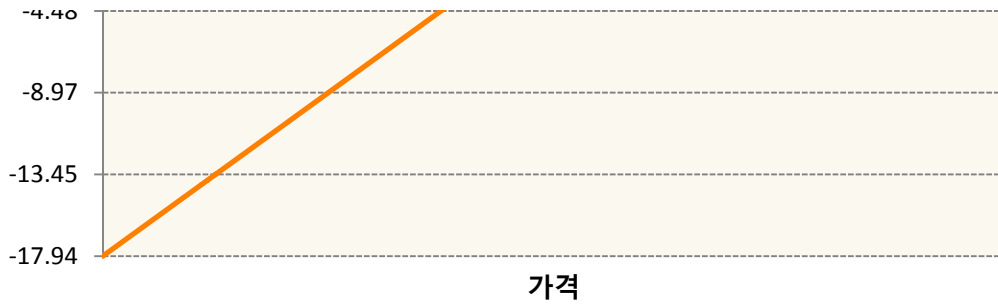


OHHIF0-C113-HSCEI



OHHIF0-P112-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	169
HCF0 HSCEI Futures Jan20	139
OHHIF0-C11 HSCEI	1
OHHIF0-C11 HSCEI	0.2
OHHIF0-P11 HSCEI	1
OHHIF0-P11 HSCEI	1

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

공시일	2020-01-23
기준일	2020-01-22

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

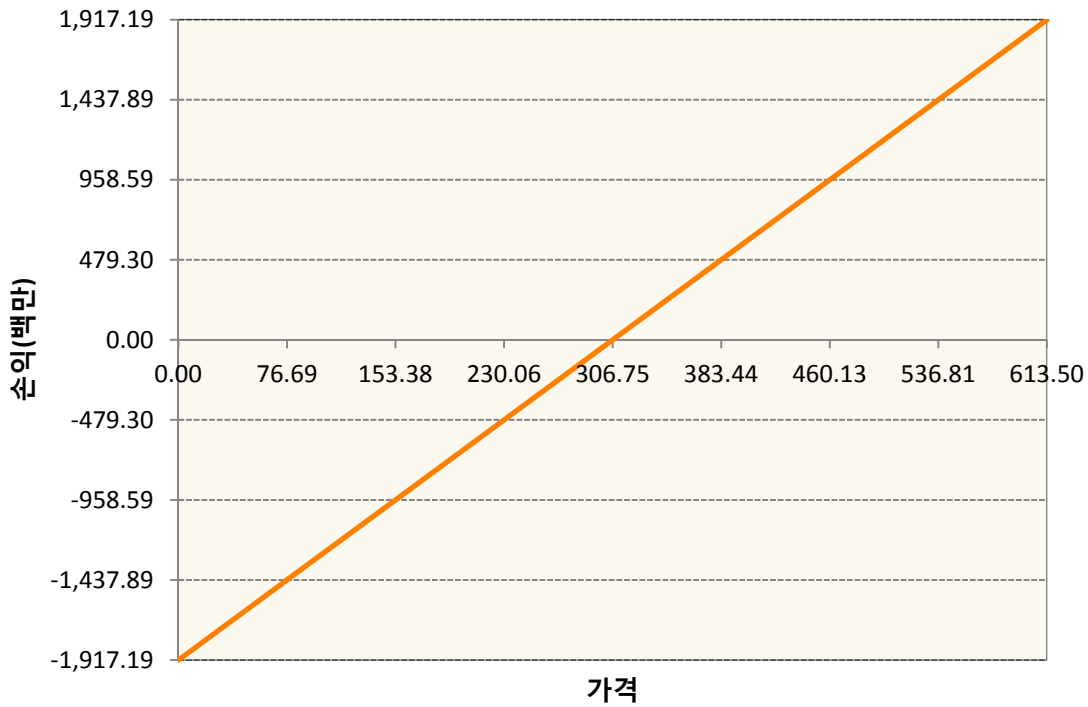
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

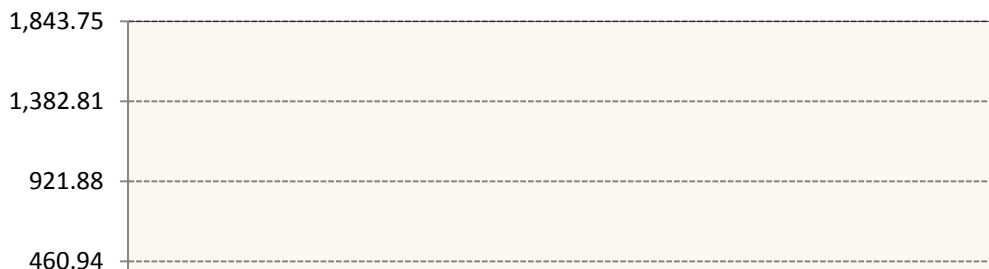
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	153	-153	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	214	0	214	장내
누계	유가증권	선물	1,917	0	1,917	장내
누계	유가증권	스왑	3,625	0	3,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,608	-3,608	장내

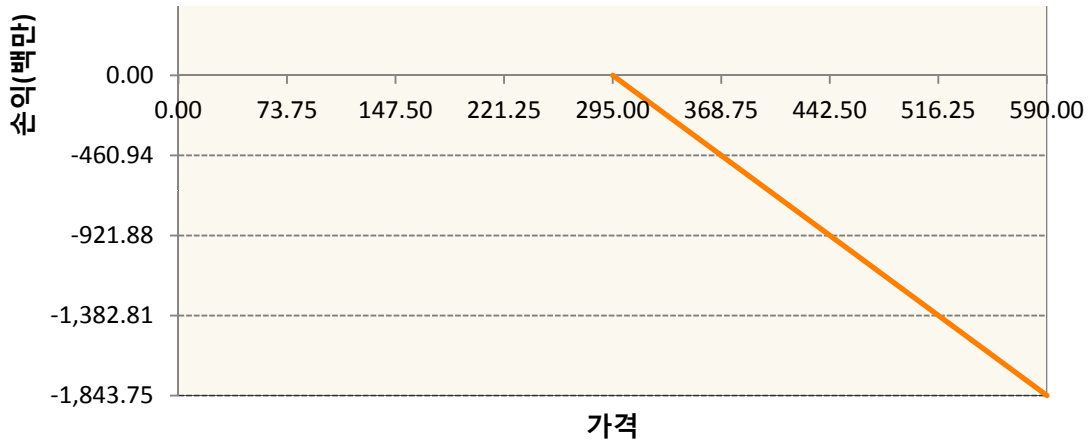
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

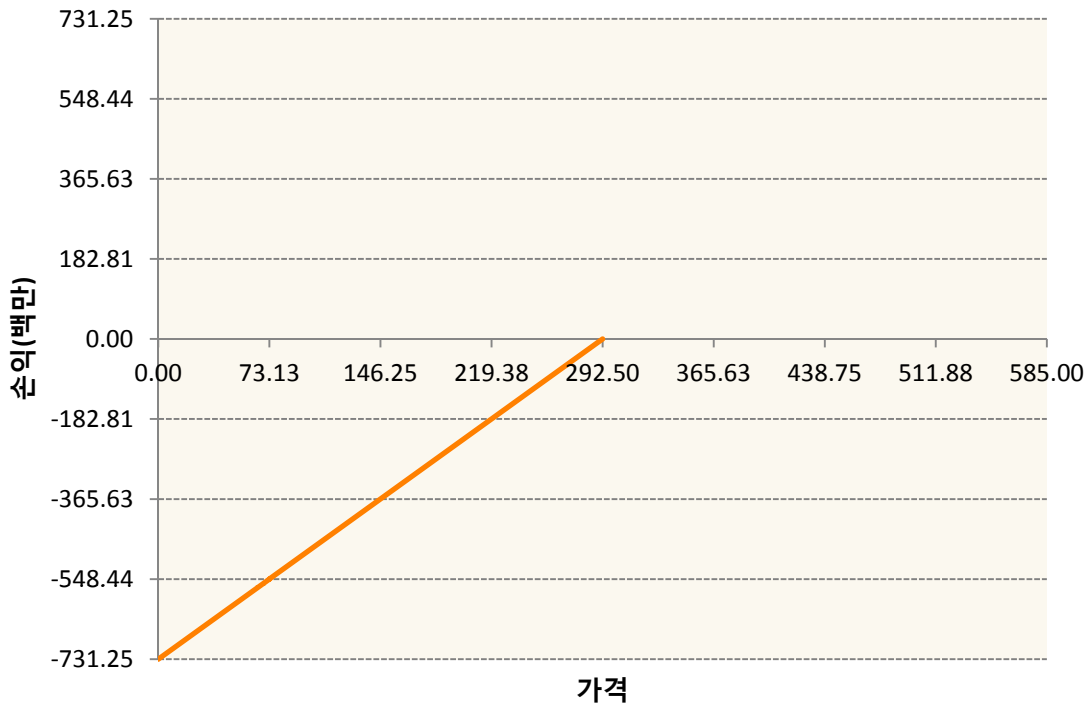


KR4201Q22950-2020-02 콜295

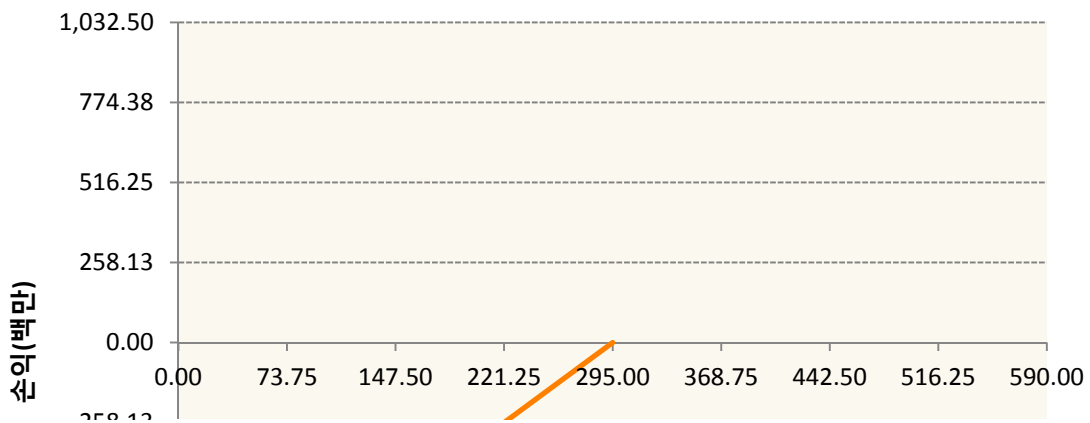




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



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						153
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-153	-153	-153	-153	-153	-153	-153	
-5.33%	-102	-102	-102	-102	-102	-102	-102	
-2.67%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	51	51	51	51	51	51	51	
5.33%	102	102	102	102	102	102	102	
8.00%	153	153	153	153	153	153	153	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						135
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	85	82	79	75	72	68	64	
-5.33%	71	66	62	58	53	49	44	
-2.67%	46	41	37	32	28	23	19	
0%	12	8	4	0	-4	-8	-13	
2.67%	-30	-33	-36	-39	-42	-46	-49	
5.33%	-77	-78	-80	-82	-85	-88	-90	
8.00%	-126	-127	-128	-129	-131	-133	-135	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						29
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-27	-27	-27	-28	-28	-29	-29
-5.33%	-10	-11	-12	-13	-14	-14	-15
-2.67%	-2	-2	-3	-4	-4	-5	-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							47
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-45	-45	-45	-46	-46	-47	-47
-5.33%	-20	-21	-22	-23	-24	-25	-26
-2.67%	-4	-5	-6	-7	-8	-10	-11
0%	2	1	1	0	-1	-2	-2
2.67%	3	3	2	2	2	2	1
5.33%	3	3	3	3	3	3	2
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

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

(단위:백만원)

**620**

공시일	2020-01-23
기준일	2020-01-22

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

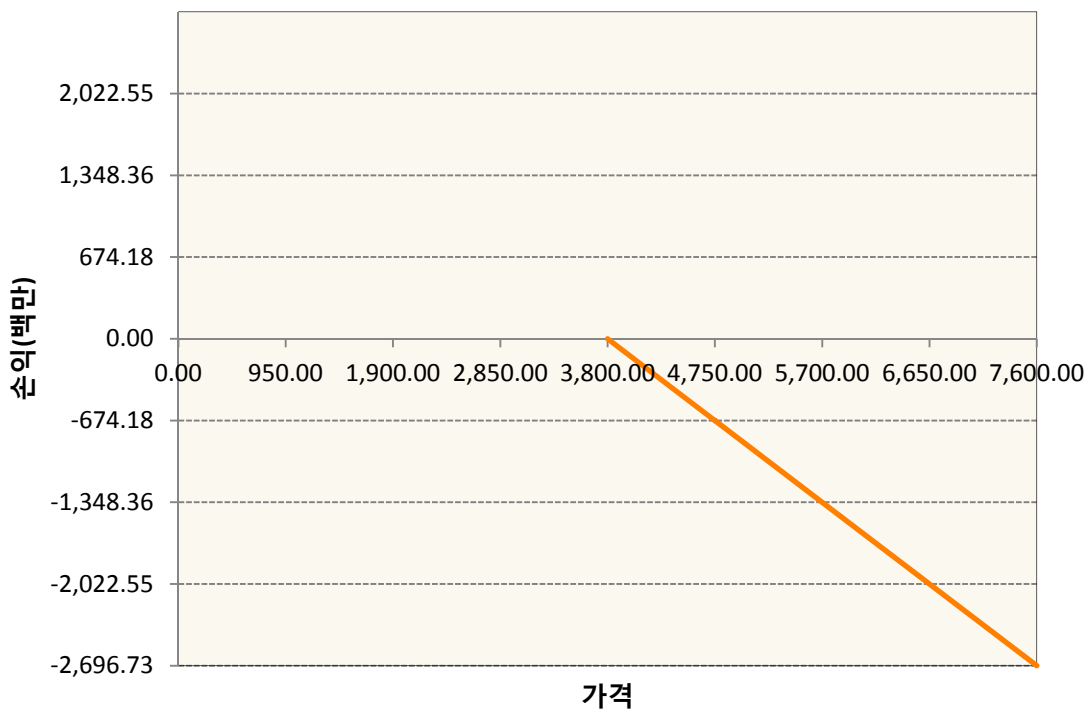
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

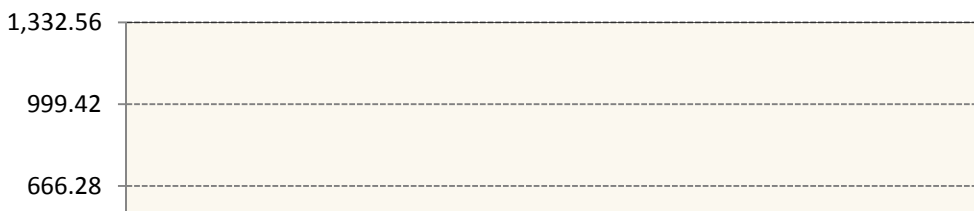
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	2	-2	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	927	0	927	
누계	유가증권	스왑	13,482	0	13,482	장외
누계	유가증권	옵션	0	8,059	-8,059	장내
누계	통화	선도	0	3,386	-3,386	장외

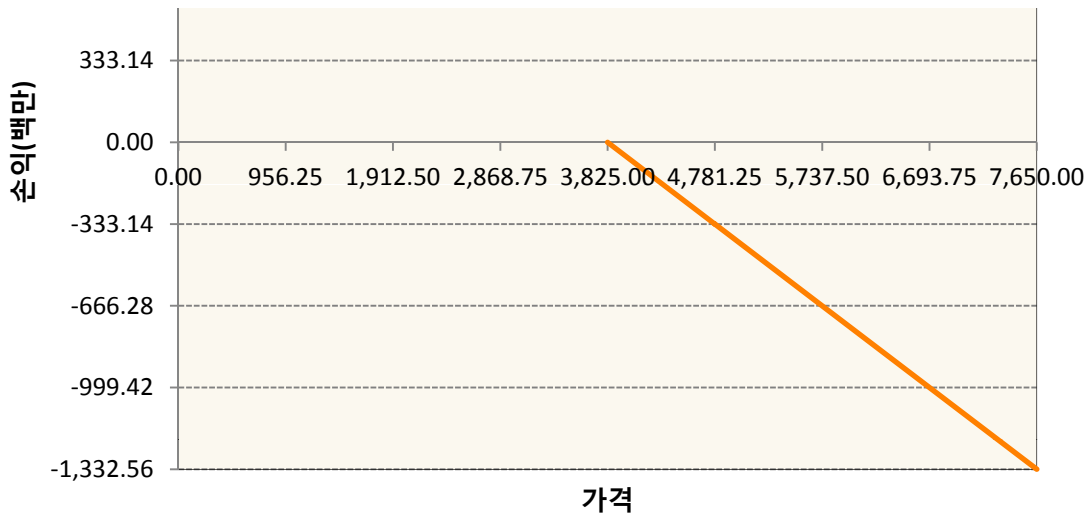
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXG0-C3800-EURO STOXX 50**

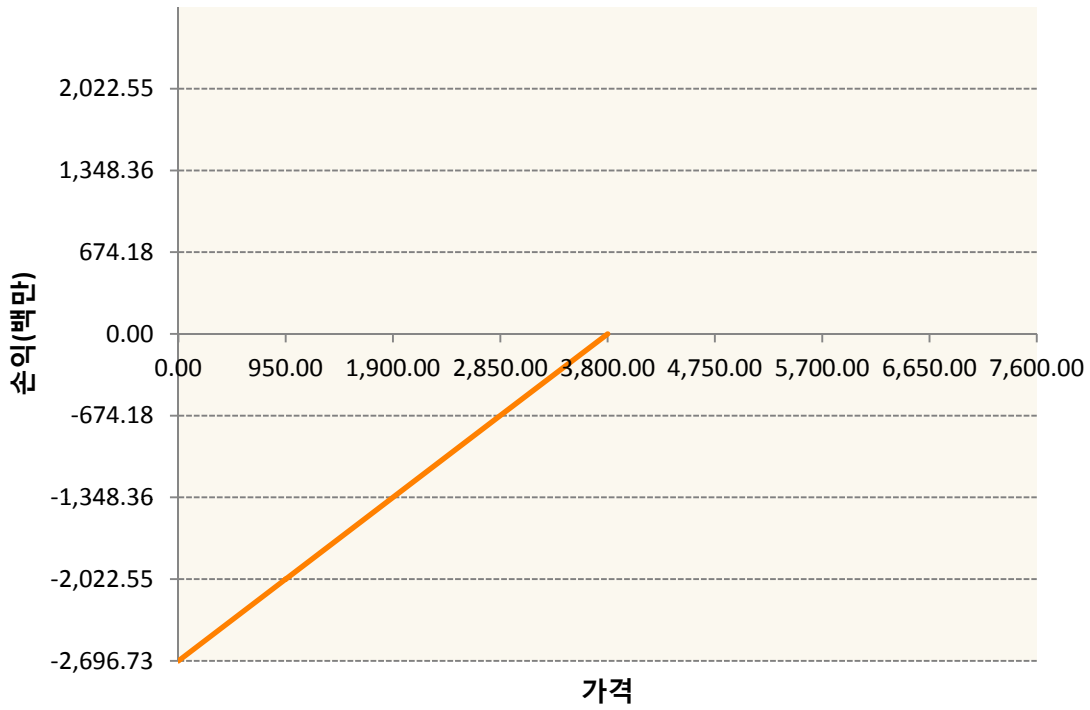


**OESXG0-C3825-EURO STOXX 50**

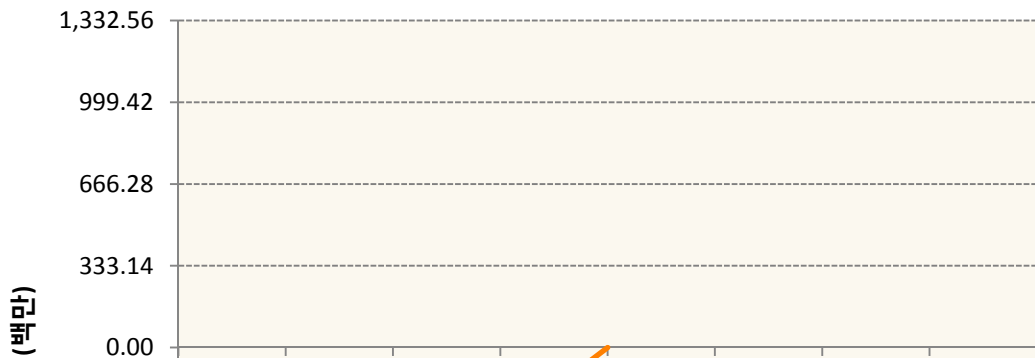


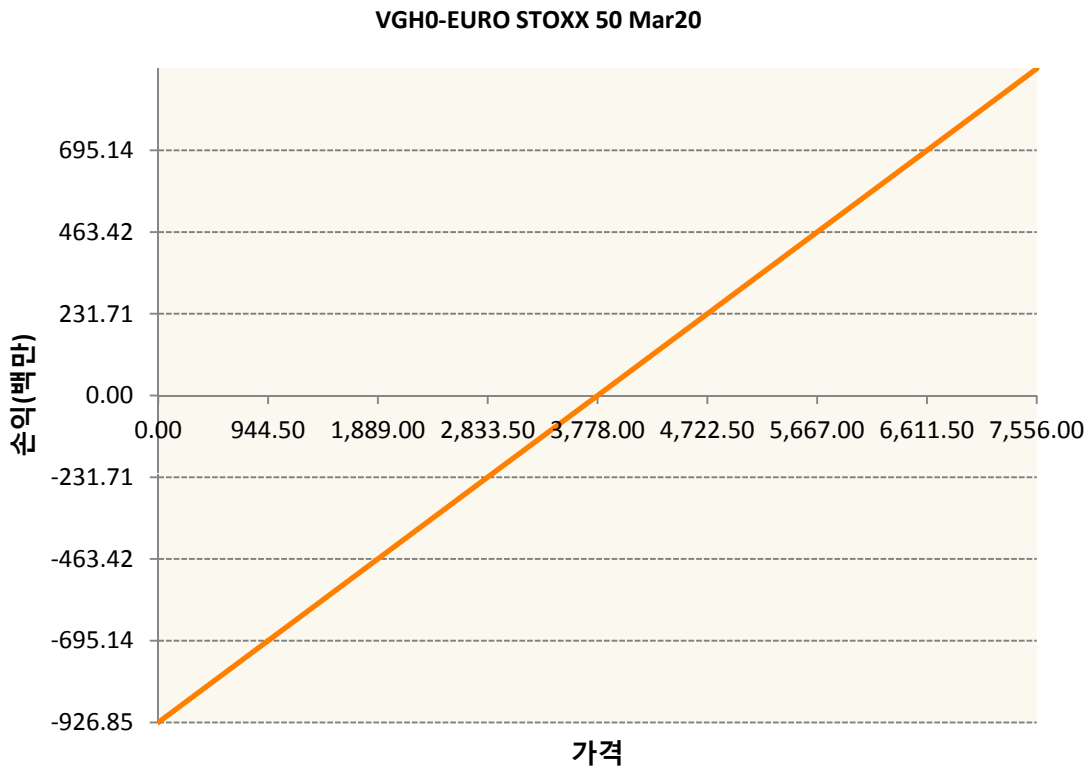
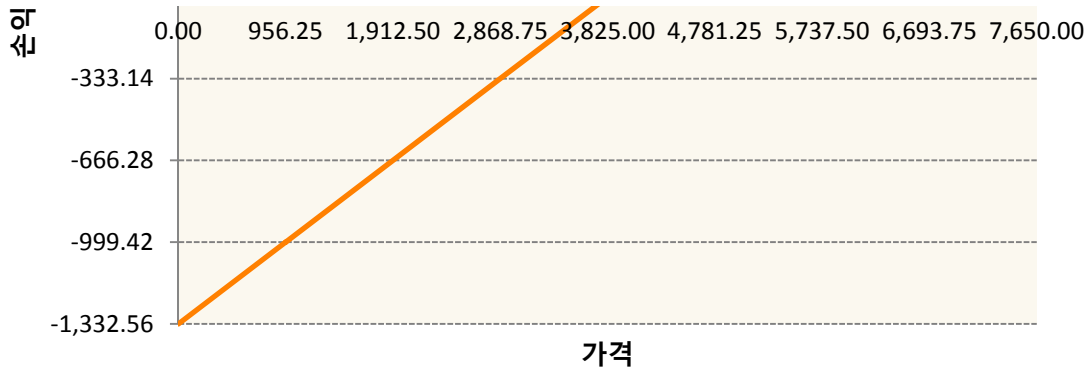


OESXG0-P3800-EURO STOXX 50



OESXG0-P3825-EURO STOXX 50





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)**

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	2
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	271
OESXG0-C3& EURO STOXX 50	216
OESXG0-C3& EURO STOXX 50	107
OESXG0-P3& EURO STOXX 50	216
OESXG0-P3& EURO STOXX 50	107
VGHO EURO STOXX 50 Mar20	74

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





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

(단위:백만원)

927



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

(단위:백만원)

80



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

(단위:백만원)

118

공시일	2020-01-23
기준일	2020-01-22

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

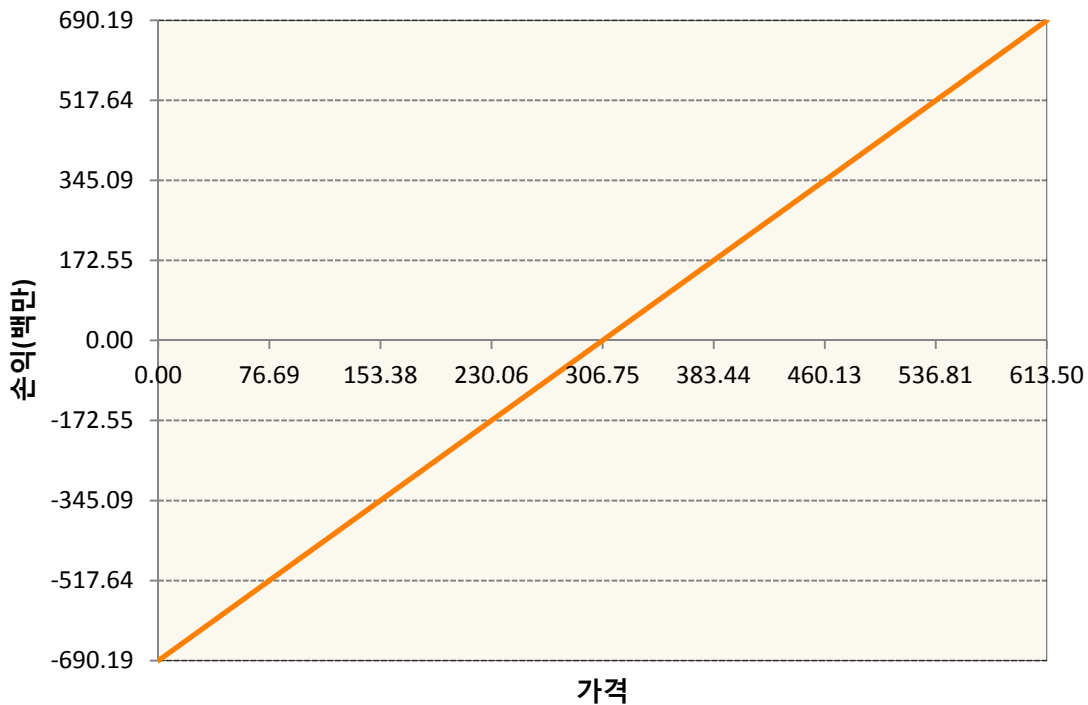
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	690	0	690	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						55
기초자산의 변동성								
가격	-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)

43

공시일	2020-01-23
기준일	2020-01-22

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

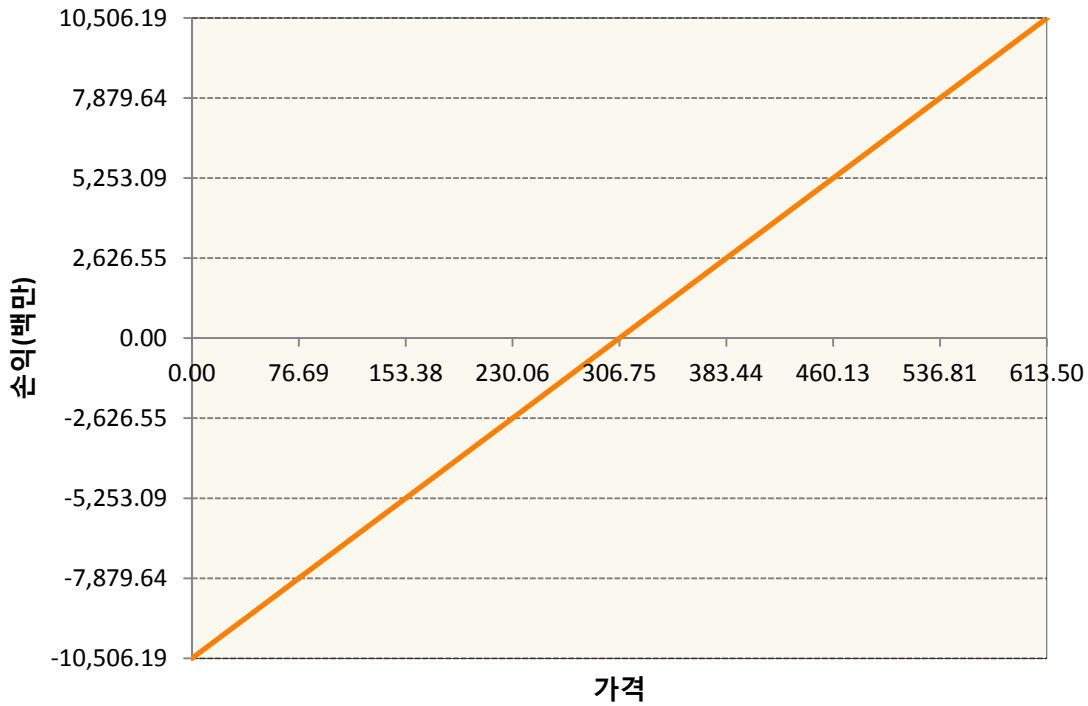
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

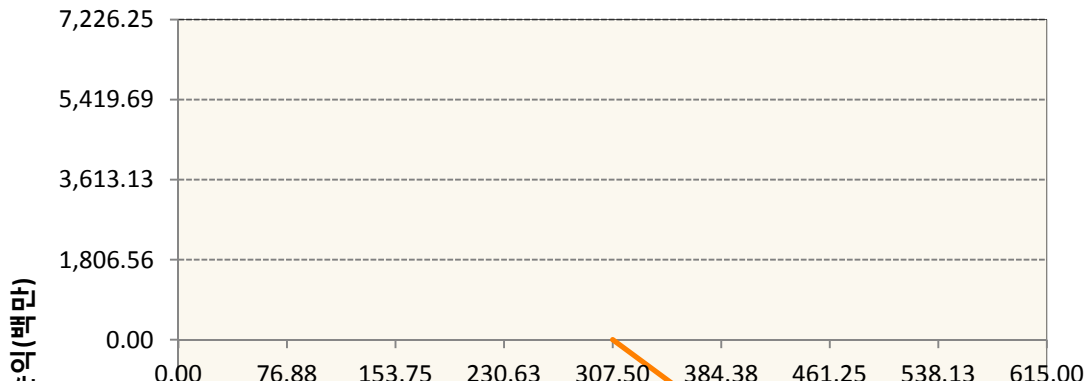
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,506	0	10,506	장내
누계	유가증권	옵션	2,944	20,789	-17,845	장내

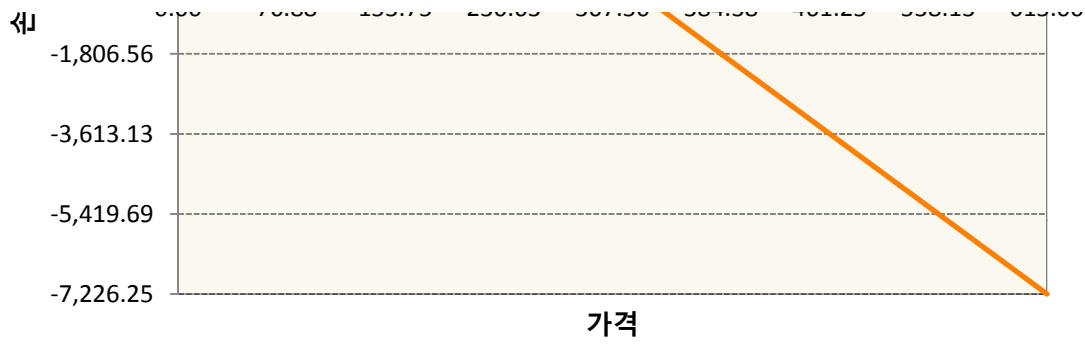
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

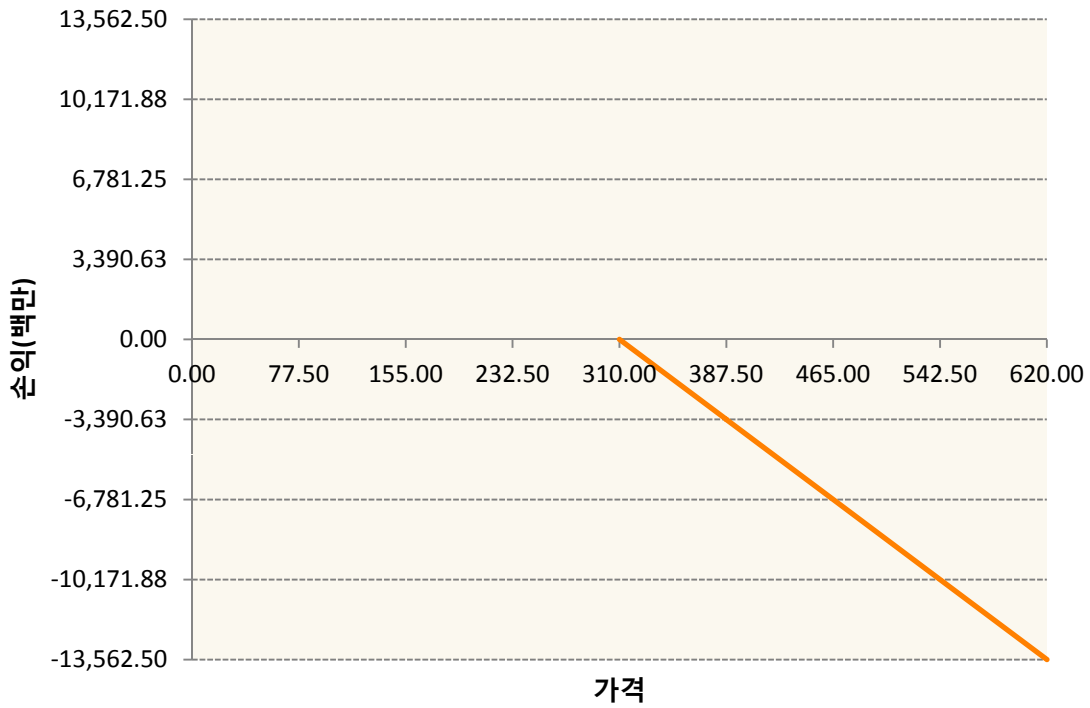


KR4201Q23073-2020-02 콜307.5

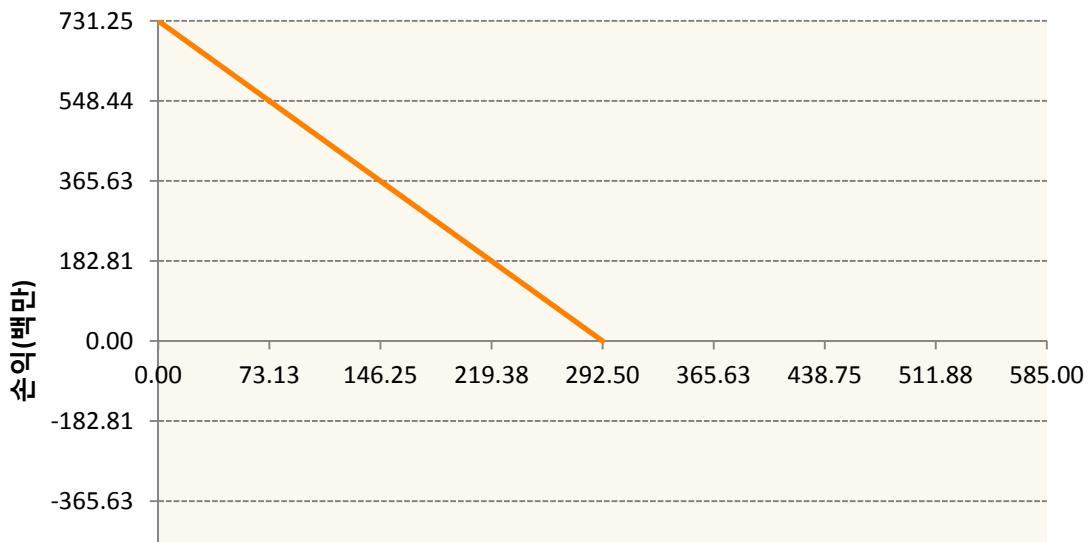


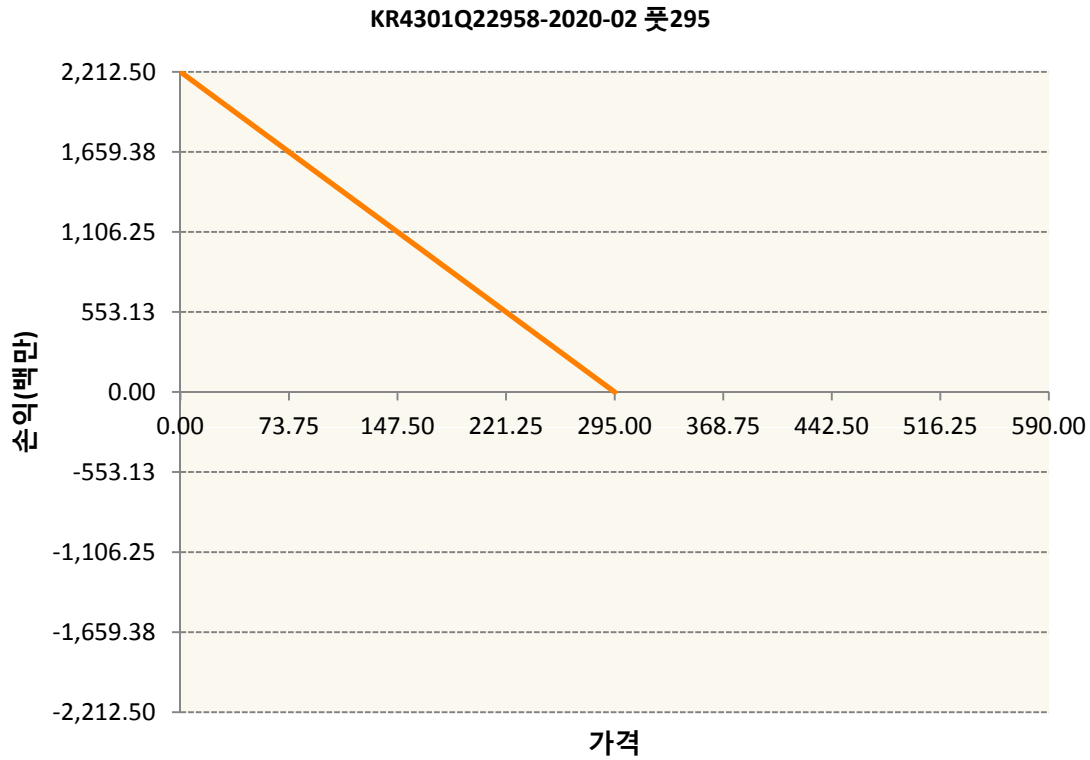
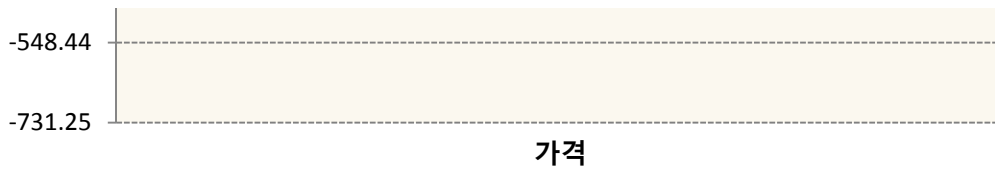


KR4201Q23107-2020-02 콜310



KR4301Q22925-2020-02 풋292.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						839
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-839	-839	-839	-839	-839	-839	-839	
-5.33%	-559	-559	-559	-559	-559	-559	-559	
-2.67%	-280	-280	-280	-280	-280	-280	-280	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	280	280	280	280	280	280	280	
5.33%	559	559	559	559	559	559	559	
8.00%	839	839	839	839	839	839	839	
KR4201Q23073		2020-02 콜307.5						431
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	187	181	174	167	158	148	138	
-5.33%	168	157	146	134	121	108	94	
-2.67%	126	111	96	80	64	48	31	

0%	53	35	18	0	-18	-35	-53
2.67%	-57	-73	-90	-107	-125	-142	-159
5.33%	-198	-212	-225	-240	-255	-270	-286
8.00%	-364	-373	-382	-393	-405	-418	-431
KR4201Q23107                      2020-02 콜310							768
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	305	296	286	273	259	243	225
-5.33%	277	261	242	222	200	177	153
-2.67%	215	189	162	134	106	76	47
0%	97	65	33	0	-33	-65	-98
2.67%	-86	-119	-152	-184	-217	-250	-284
5.33%	-333	-360	-388	-417	-447	-477	-508
8.00%	-629	-648	-669	-691	-716	-741	-768
KR4301Q22925                      2020-02 풋292.5							29
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	27	27	27	28	28	29	29
-5.33%	10	11	12	13	14	14	15
-2.67%	2	2	3	4	4	5	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							102
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	95	96	97	98	99	100	102
-5.33%	42	44	46	48	51	53	55
-2.67%	8	11	13	15	18	20	23
0%	-4	-3	-1	0	2	3	5
2.67%	-6	-6	-5	-5	-4	-4	-3
5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-5
8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6

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

(단위:백만원)

**1,796**

공시일	2020-01-23
기준일	2020-01-22

## 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	207,302	0	207,302	

### 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	2020-01-23
기준일	2020-01-22

## 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	216,389	0	216,389	

### 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	2020-01-23
기준일	2020-01-22

## 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	531,568	0	531,568	
누계	통화	선도	0	615,142	-615,142	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E	1,398
FX21019V02 KRW/USD 23-01-20E	1,500
FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E	4,752
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	186
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,795
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,795
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,329
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,516
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	1,621
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	1,528
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	932
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	186
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	1,994
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	932
FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E	3,727
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,863
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,994
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	186
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	186
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	1,118
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	1,677
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	280
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E	1,863
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E	3,205
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,500
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,398
FX21020F02 KRW/USD 28-02-20E	1,863
FX21020F03 KRW/USD 28-02-20E	2,888

IE00BD8RGM75

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

**16,224**



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

(단위:백만원)

216

공시일	2020-01-23
기준일	2020-01-22

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

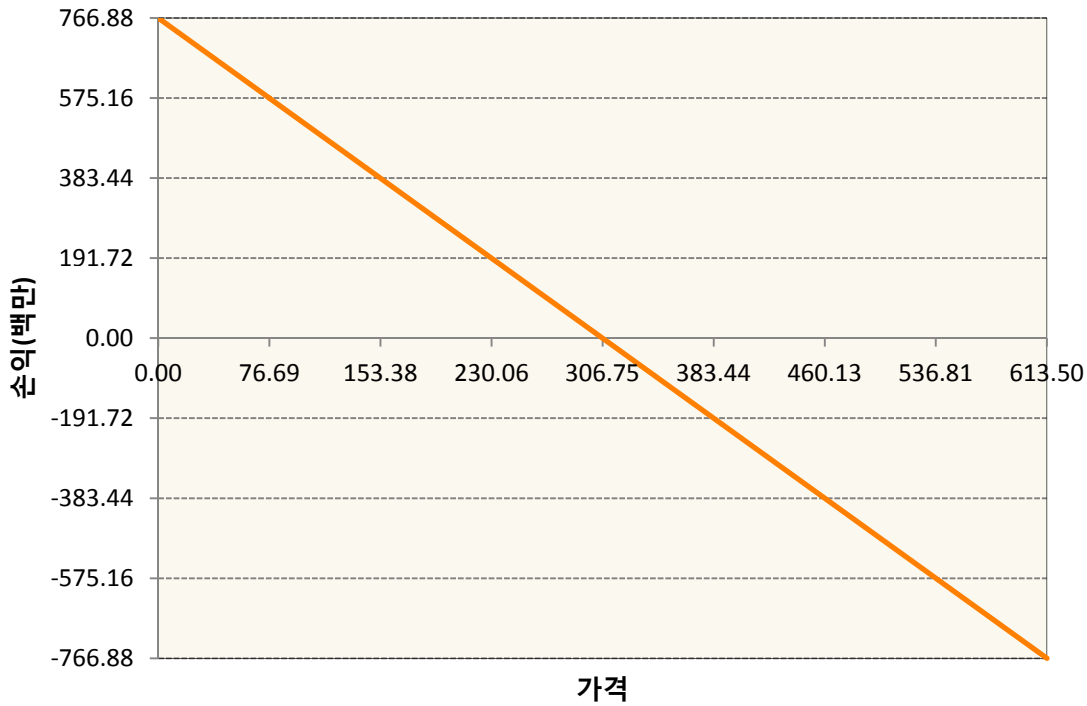
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

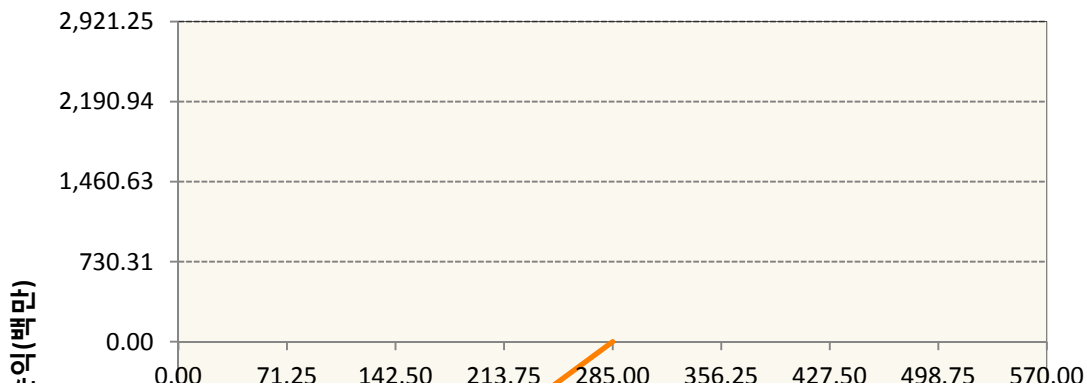
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	767	-767	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,784	-3,784	장내

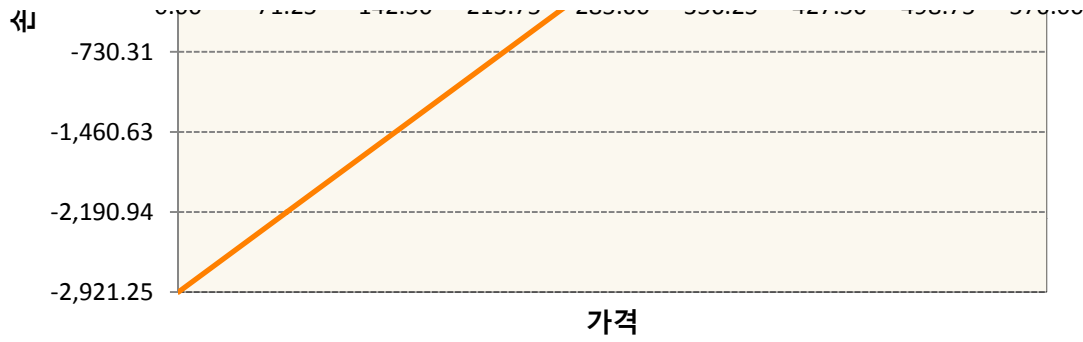
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

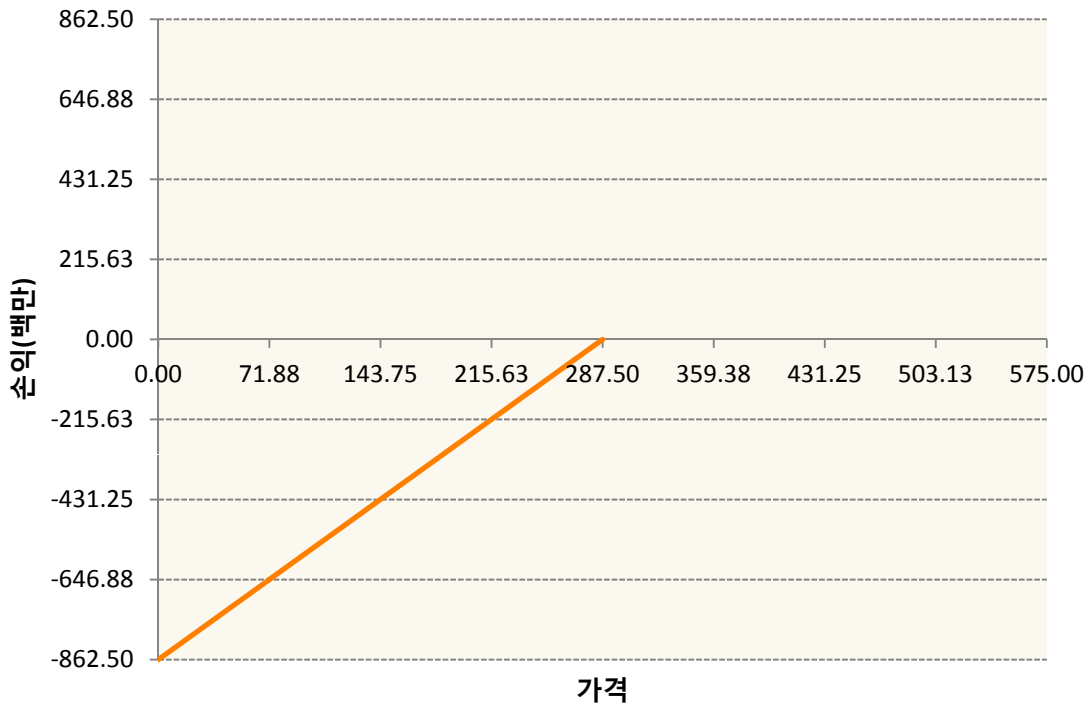


KR4301Q22859-2020-02 풋285





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						69
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-50	-53	-57	-60	-63	-66	-69
-5.33%	-12	-15	-18	-21	-24	-27	-30
-2.67%	-1	-2	-3	-4	-6	-8	-10
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	1	1	1	1	1	0	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

KR4301Q22875                      2020-02 풋287.5                      25

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20	-21	-22	-22	-23	-24	-25
-5.33%	-6	-7	-8	-9	-10	-11	-12
-2.67%	0	-1	-1	-2	-3	-3	-4
0%	0	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

**84**

공시일	2020-01-23
기준일	2020-01-22

## 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	12,728	0	12,728	
누계	통화	선도	445	16,060	-15,615	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
FX21020F03 KRW/USD 29-01-20E	34
FX21020F03 KRW/USD 28-02-20E	203
IE00BD8RGM75	

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

435
-----

공시일	2020-01-23
기준일	2020-01-22

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

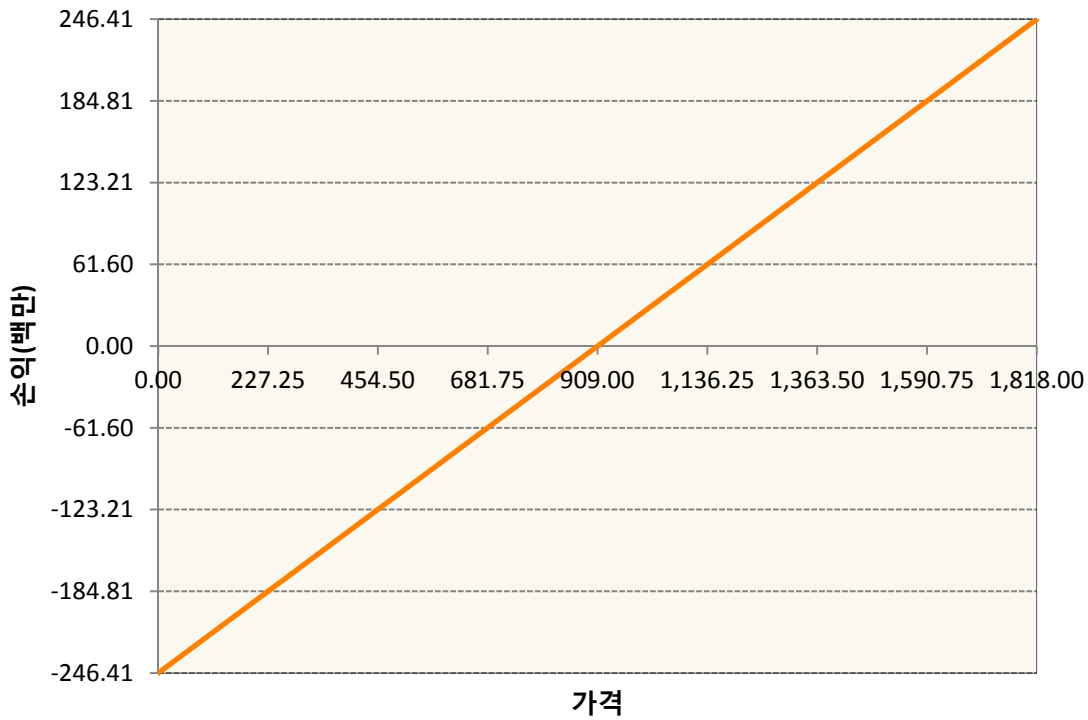
### 1. 계약금액

(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	246	0	246	
누계	유가증권	스왑	1,019	0	1,019	장외
누계	통화	선도	310	890	-581	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
FX21020F03 KRW/EUR 24-04-20E	6
VNCG0 VN30 Index Future Feb20	20

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

(단위:백만원)

**109**

공시일	2020-01-23
기준일	2020-01-22

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

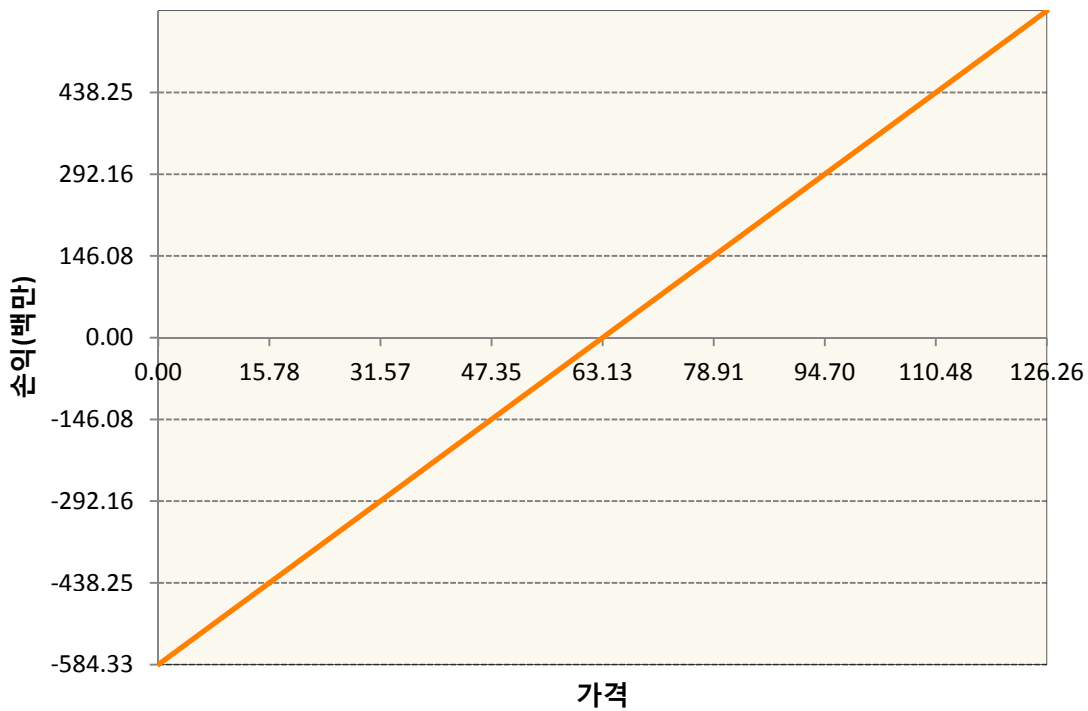
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

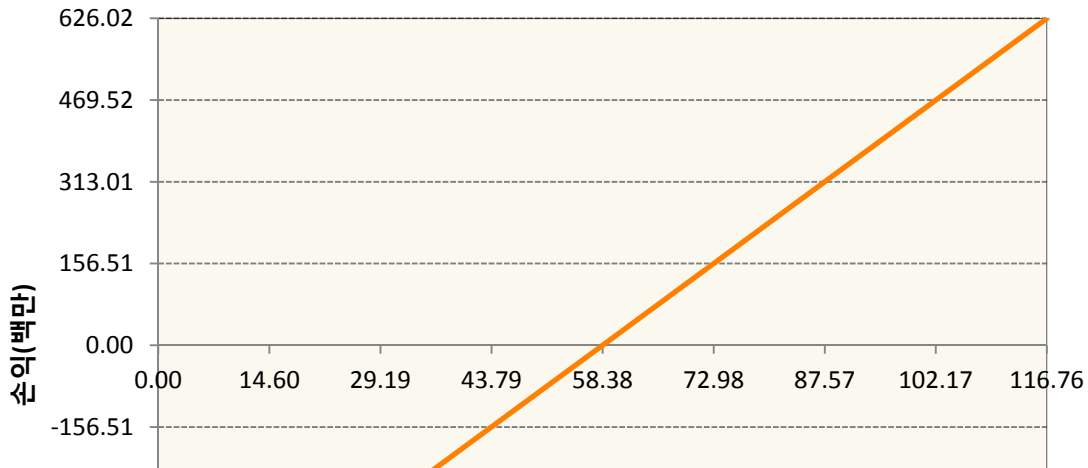
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,341	291	2,050	

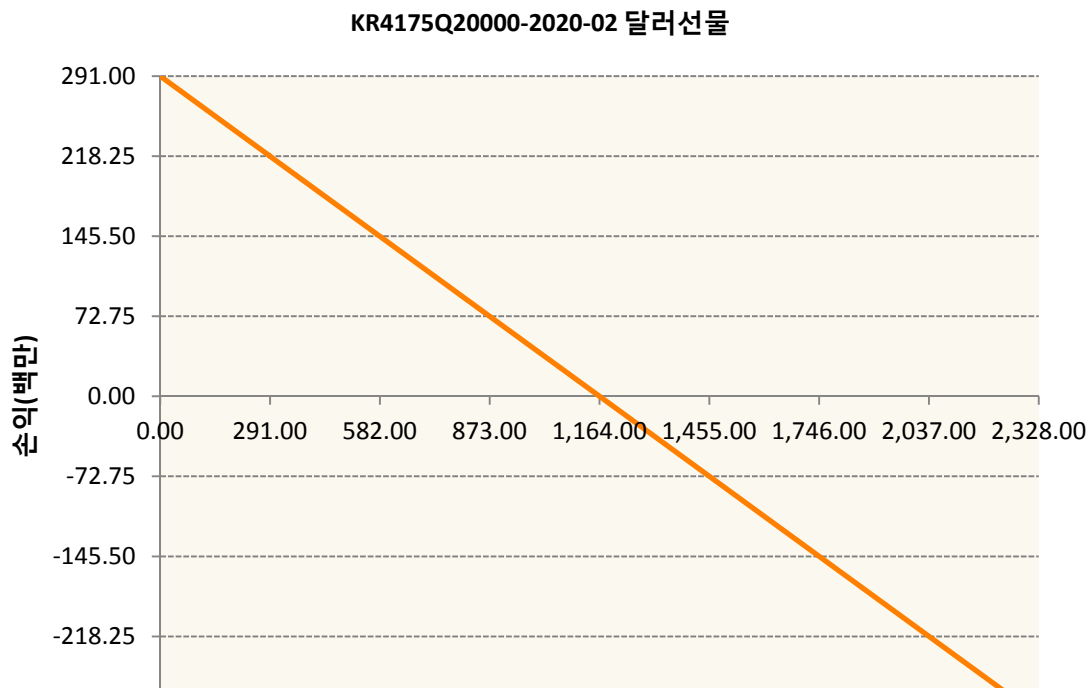
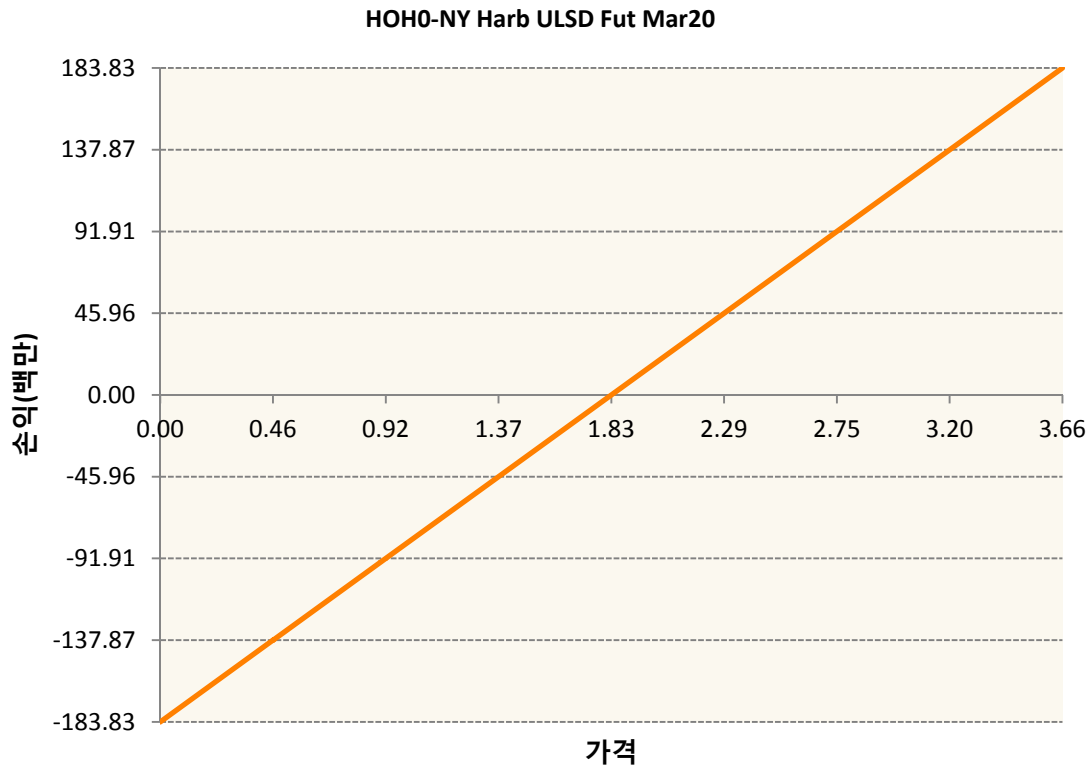
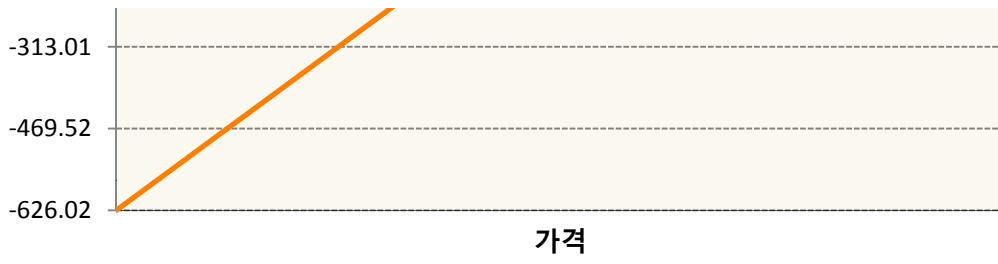
### 2. 만기시점의 손익구조

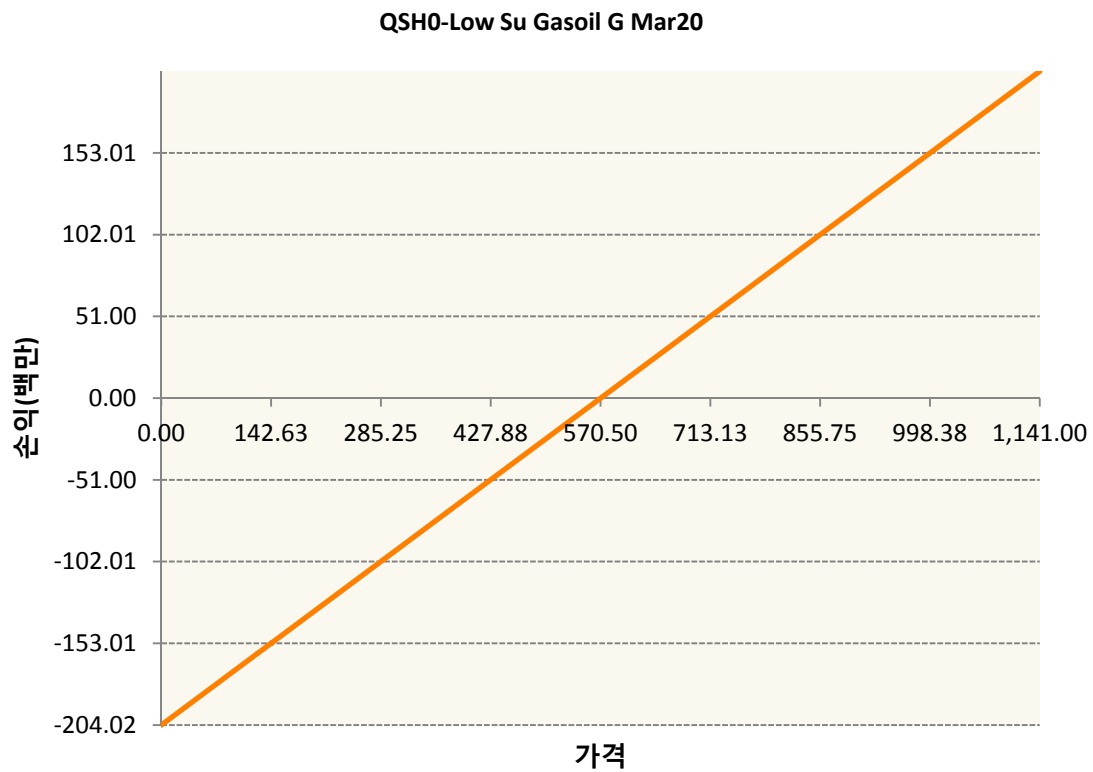
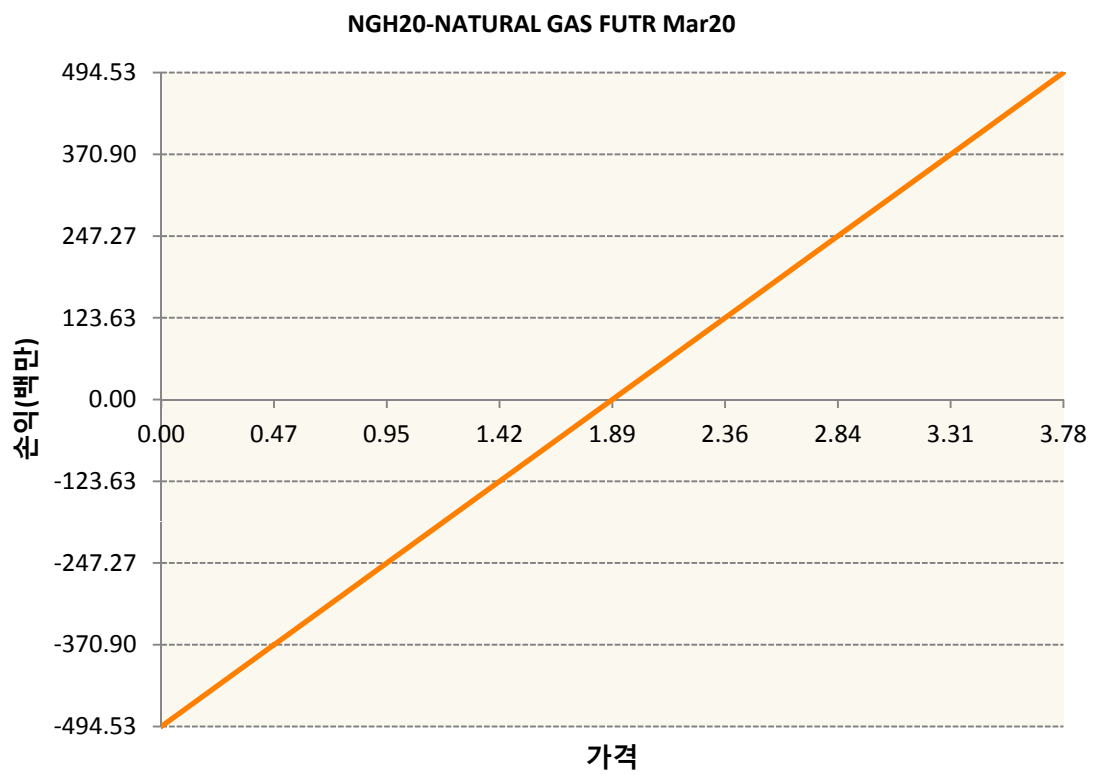
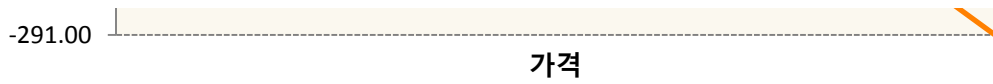
**COKO-BRENT CRUDE FUTR May20**



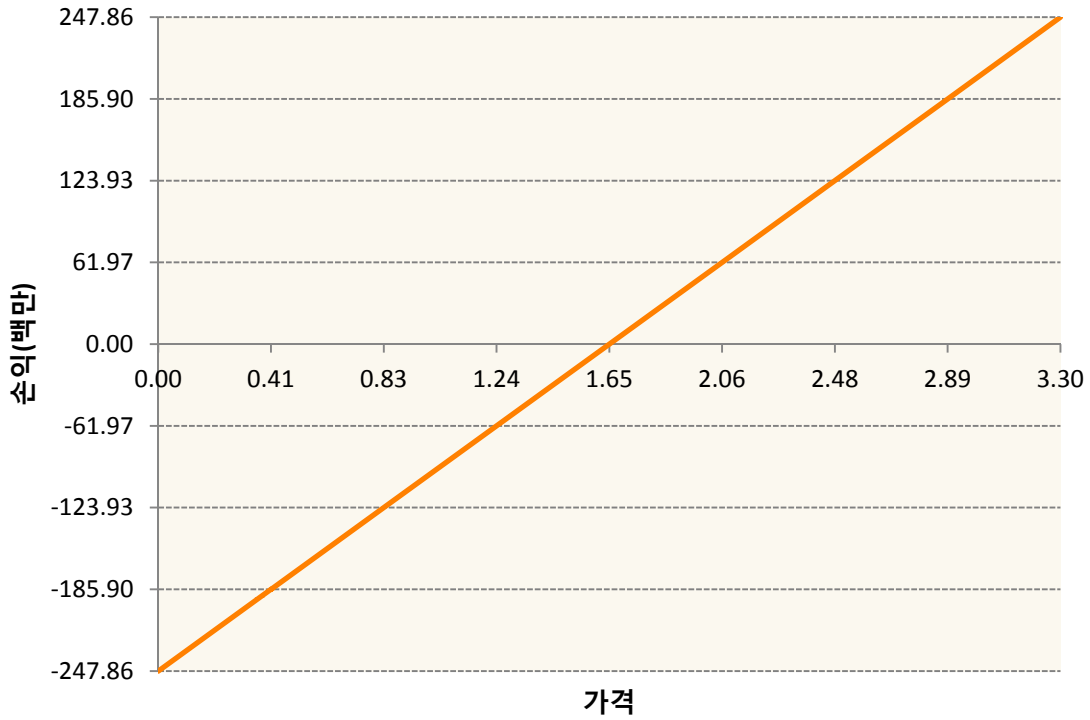
**CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20**







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	40
QSH0	Low Su Gasoil G Mar20	16
XBH0	GASOLINE RBOB FUT Mar20	20

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

362

공시일	2020-01-23
기준일	2020-01-22

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

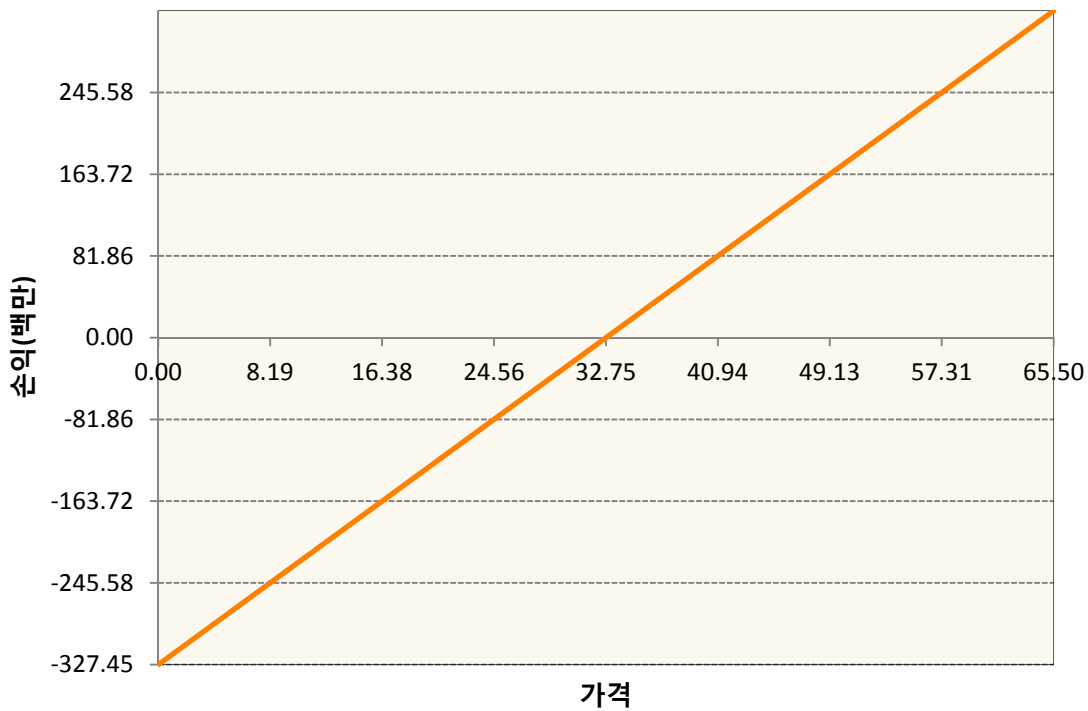
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

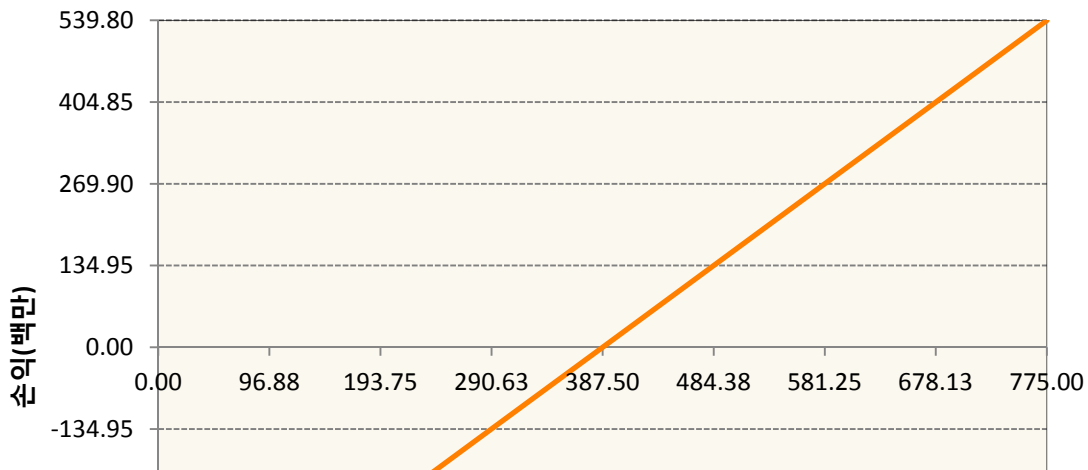
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,828	151	2,677	

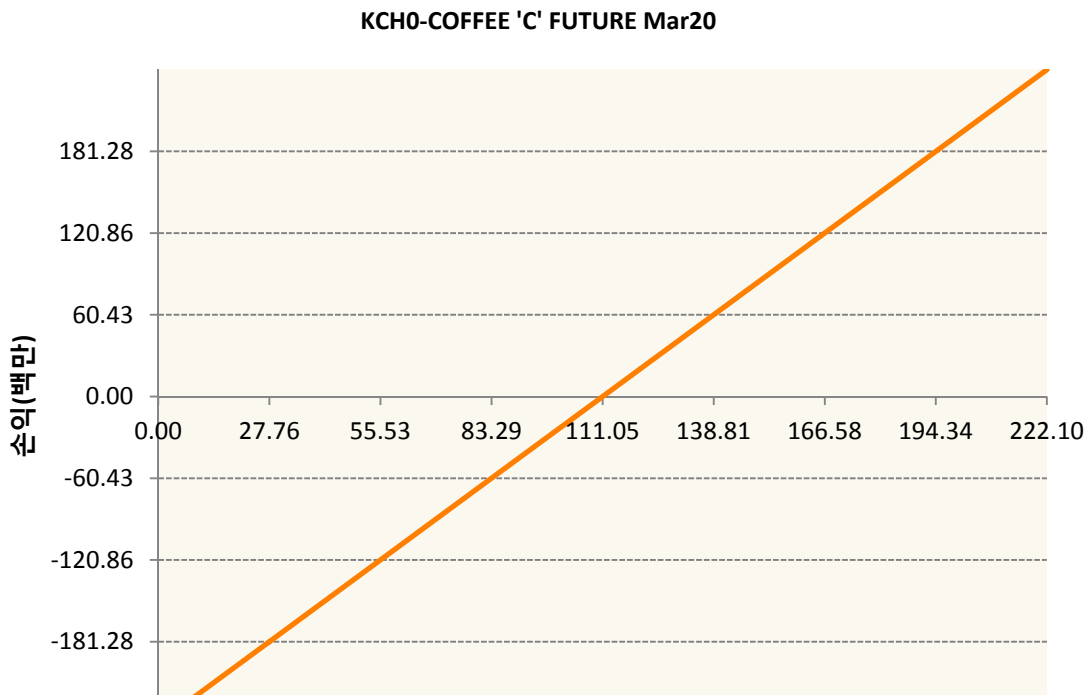
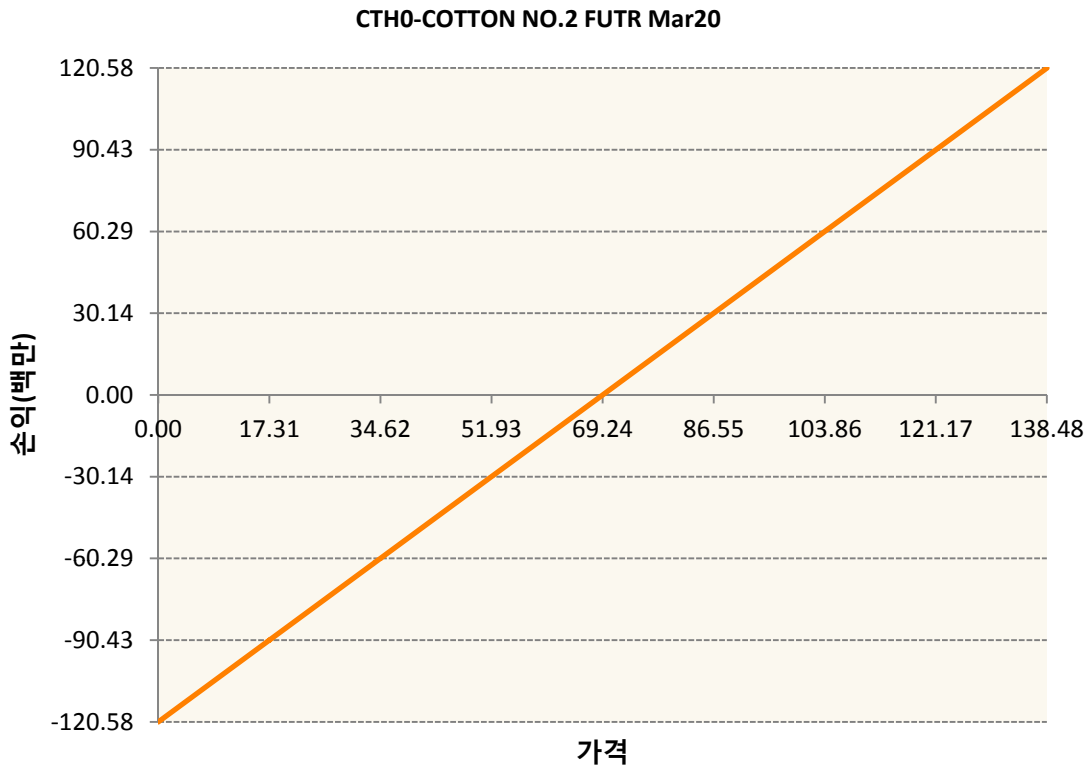
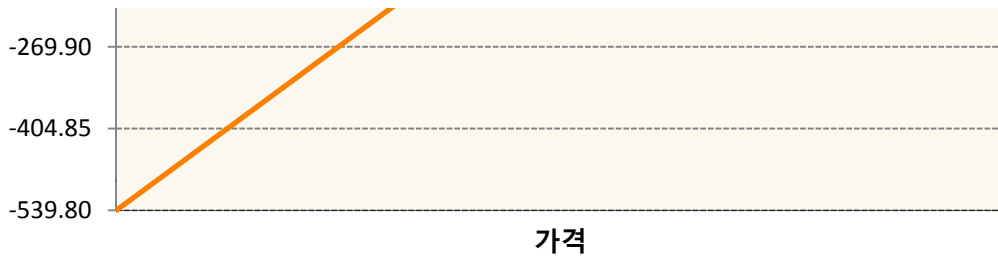
### 2. 만기시점의 손익구조

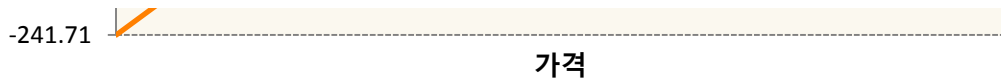
**BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20**



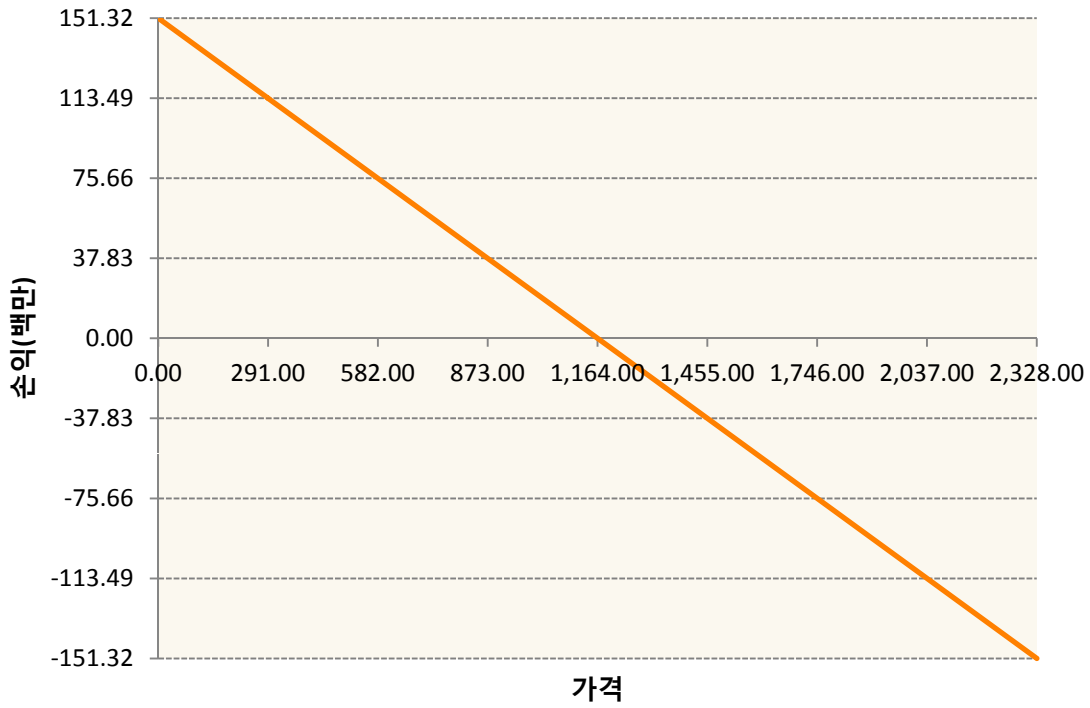
**CH0-CORN FUTURE Mar20**



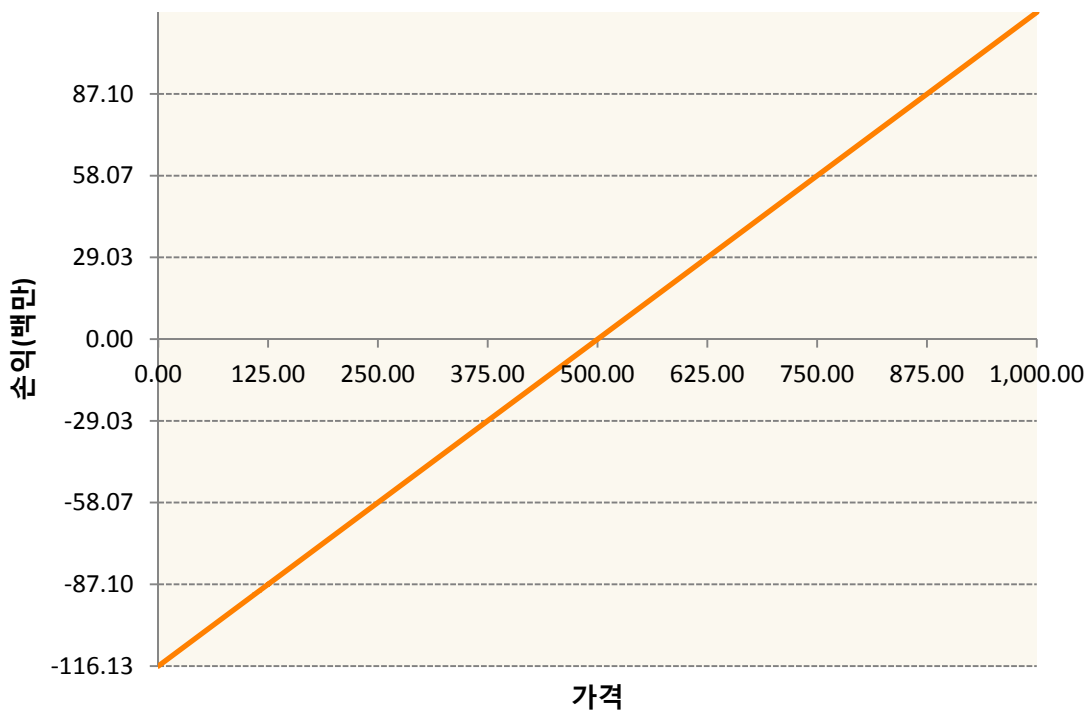




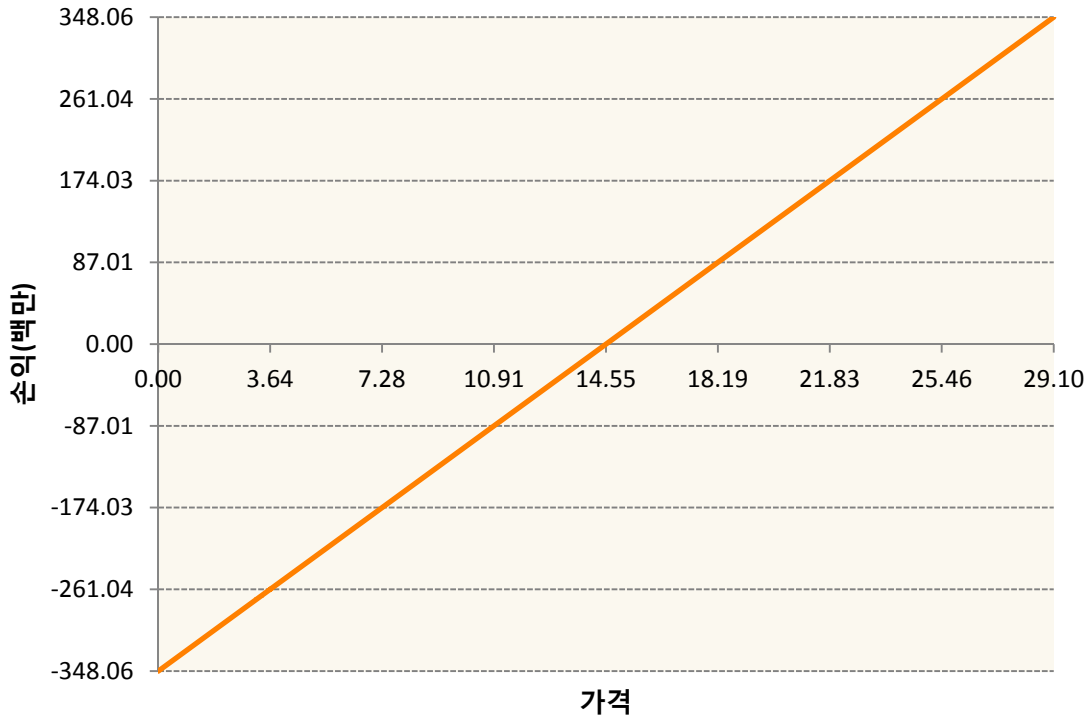
KR4175Q20000-2020-02 달러선물



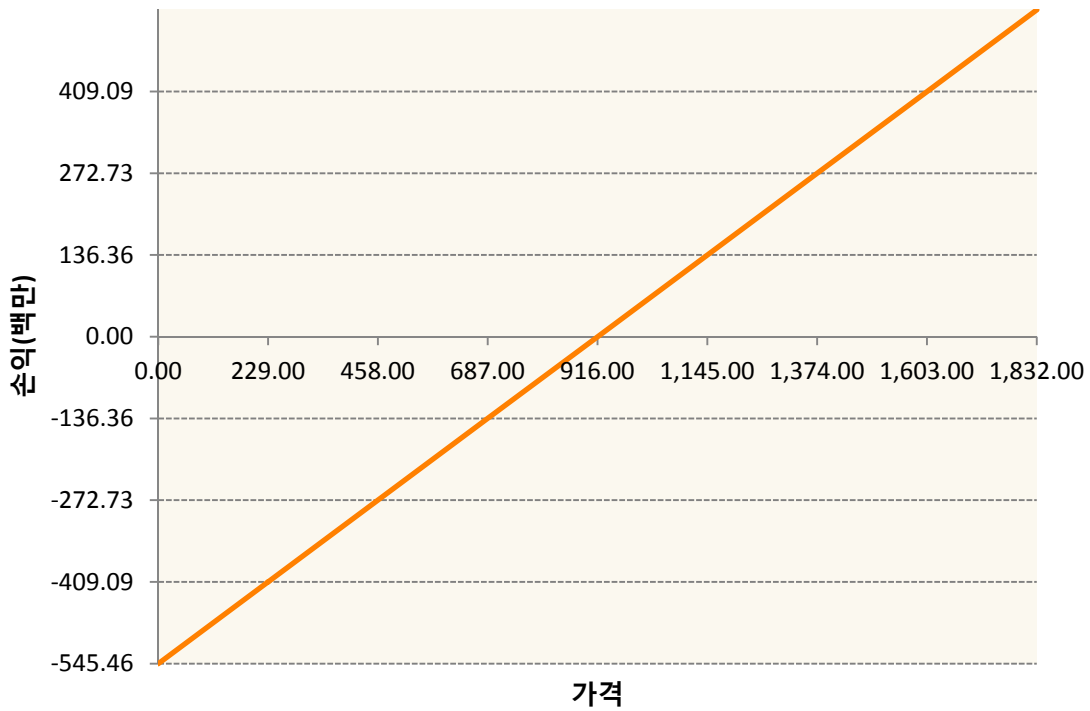
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



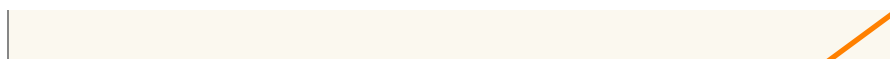
SBH0-Sugar Mar20

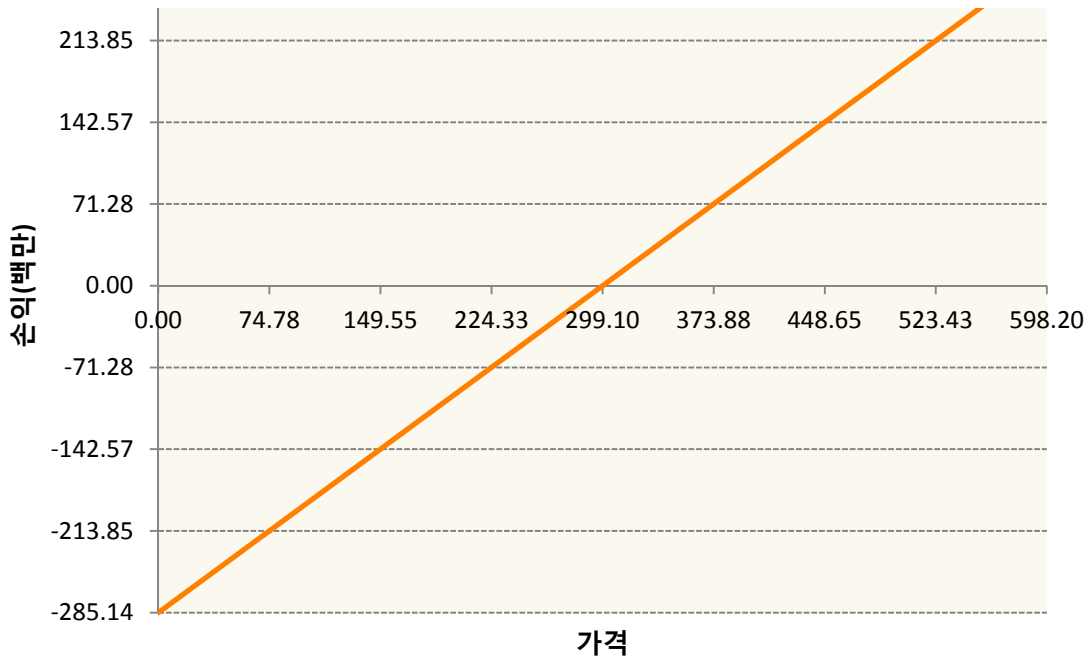


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20

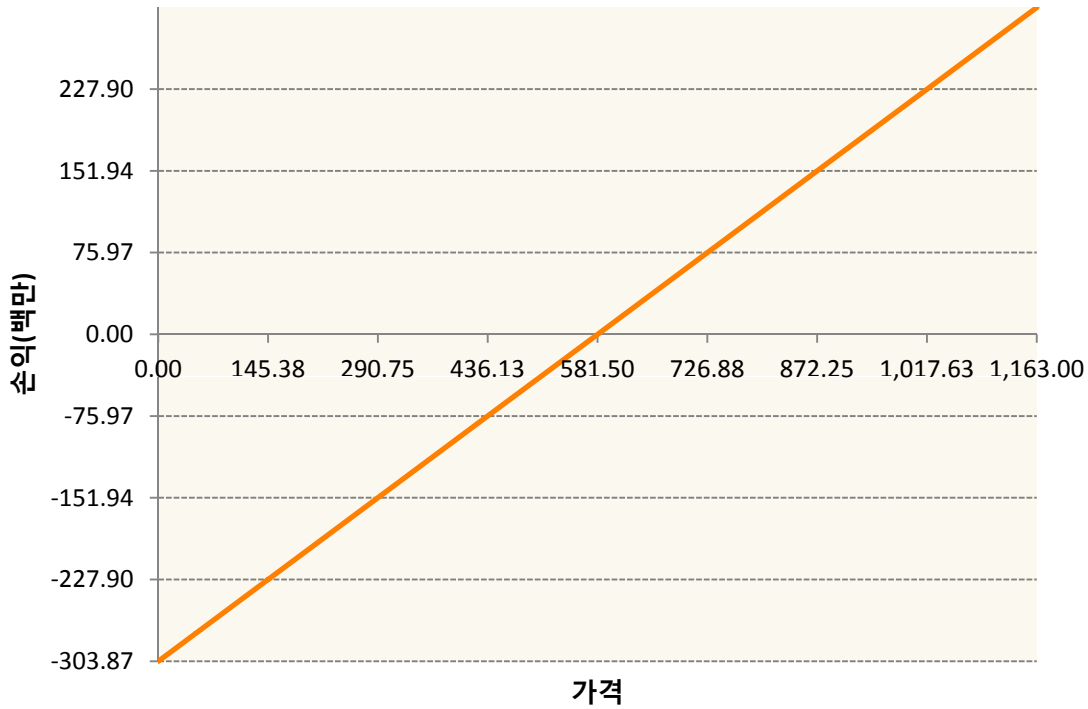


SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





WHO-WHEAT FUTURE(CBT) Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH0	SOYBEAN OIL FUTR Mar20	26
CH0	CORN FUTURE Mar20	43
CTH0	COTTON NO.2 FUTR Mar20	10
KCH0	COFFEE 'C' FUTURE Mar20	19
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)

**246**