

공시일	2020-01-28
기준일	2020-01-23

## 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	2020-01-28
기준일	2020-01-23

## 스마트인덱스모

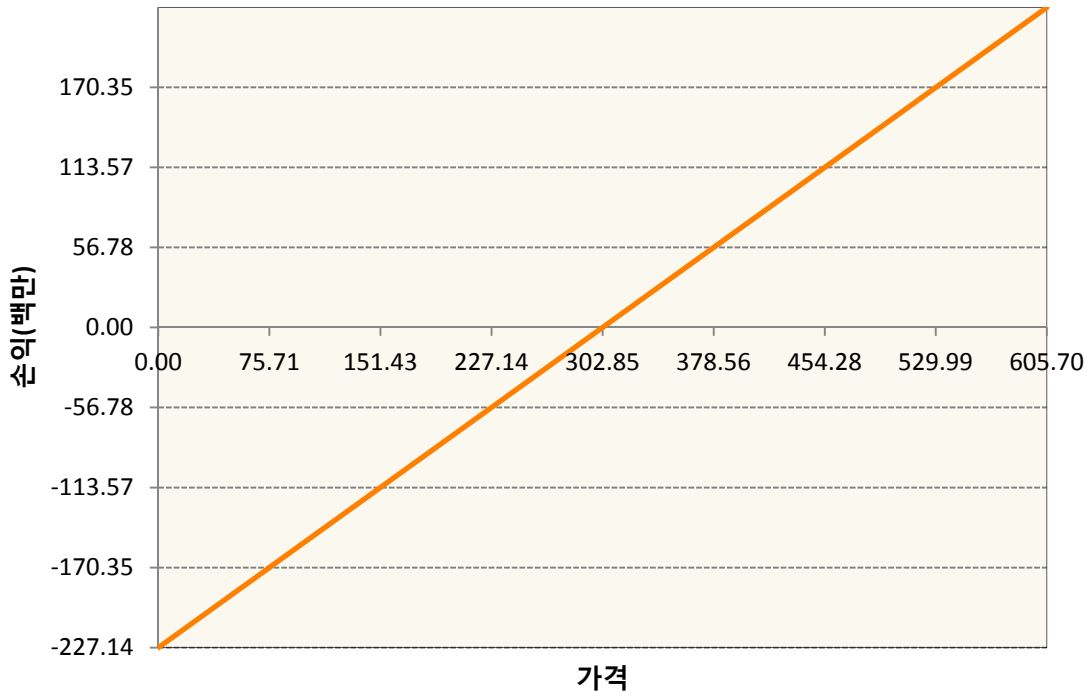
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	227	0	227	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						18
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
-5.33%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12	
-2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	6	6	6	6	6	6	6	
5.33%	12	12	12	12	12	12	12	
8.00%	18	18	18	18	18	18	18	

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

(단위:백만원)

14

공시일	2020-01-28
기준일	2020-01-23

## 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

1,154

\* 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	2020-01-28
기준일	2020-01-23

## 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)	418
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	153

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

795

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-28
기준일	2020-01-23

## 유로인덱스모(주식-파생형)

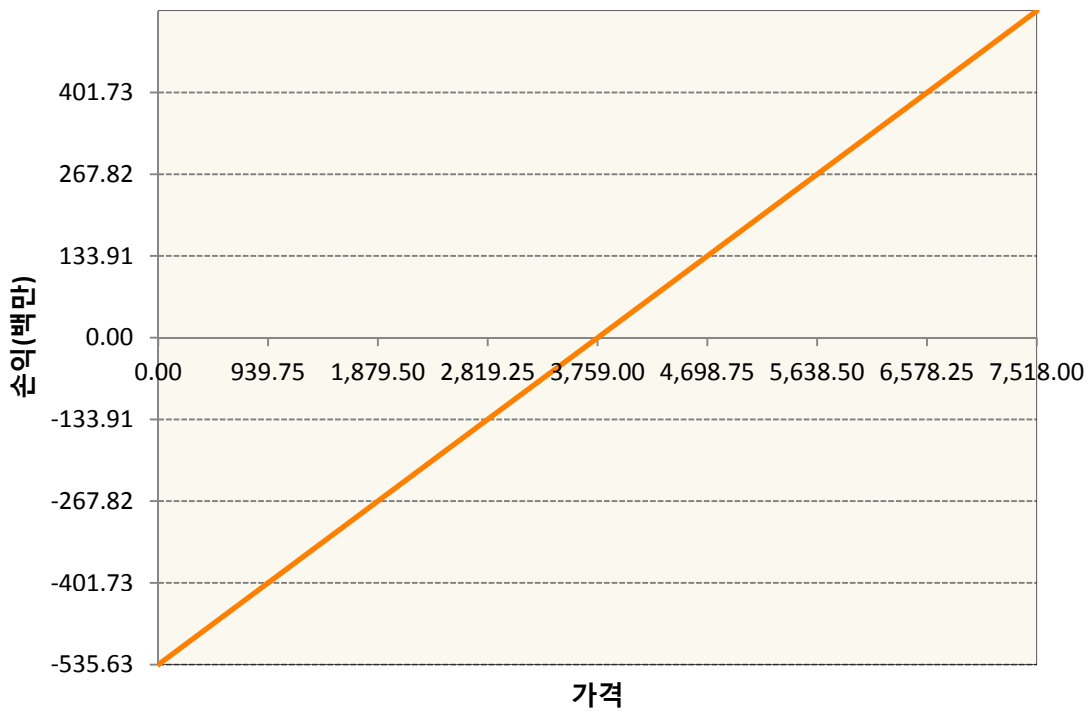
### 1. 계약금액

(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	2020-01-28
기준일	2020-01-23

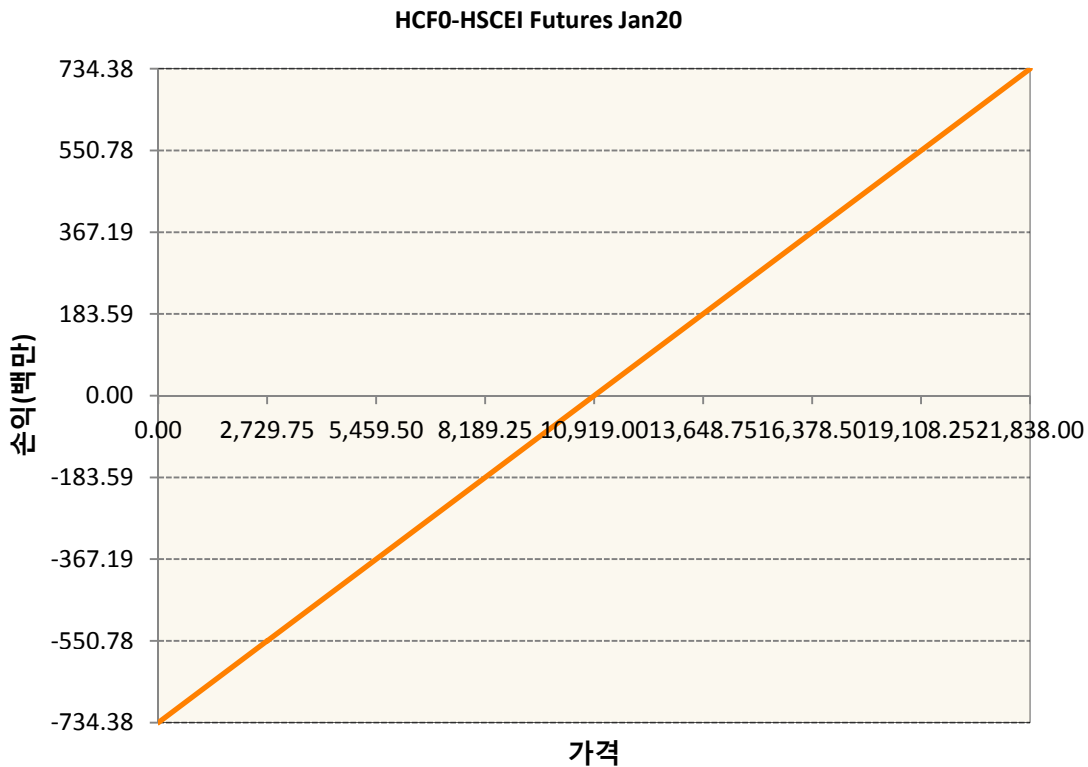
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	734	0	734	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

52
----

공시일	2020-01-28
기준일	2020-01-23

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

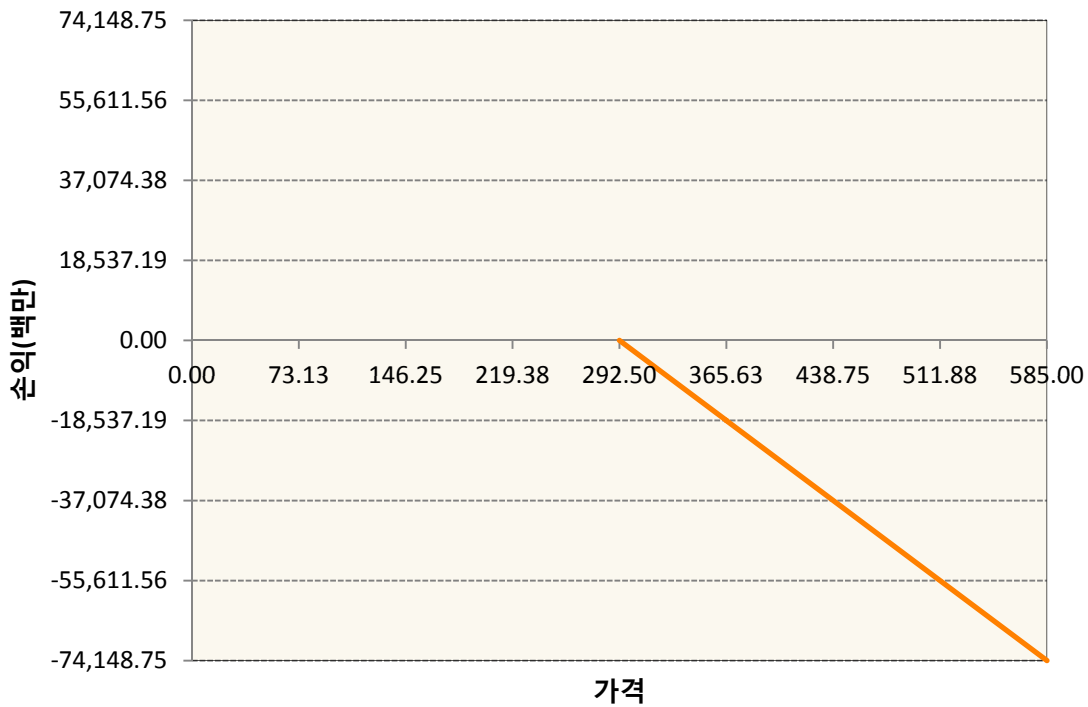
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

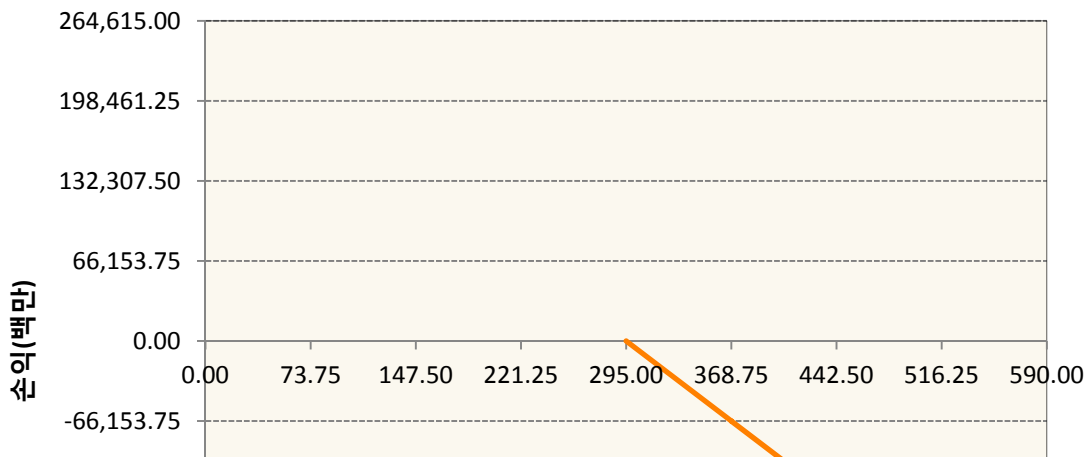
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	455,004	-455,004	장내

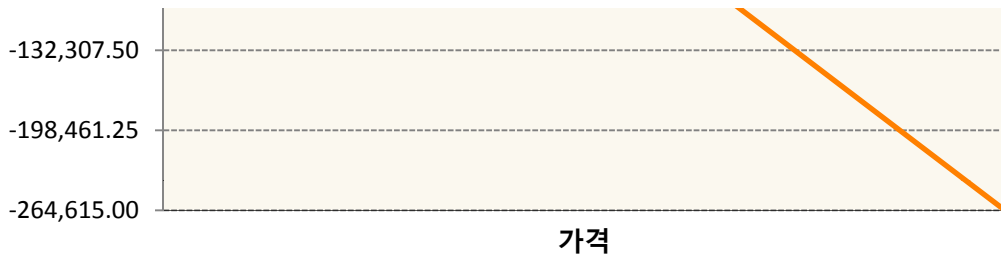
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q22927-2020-02 콜292.5

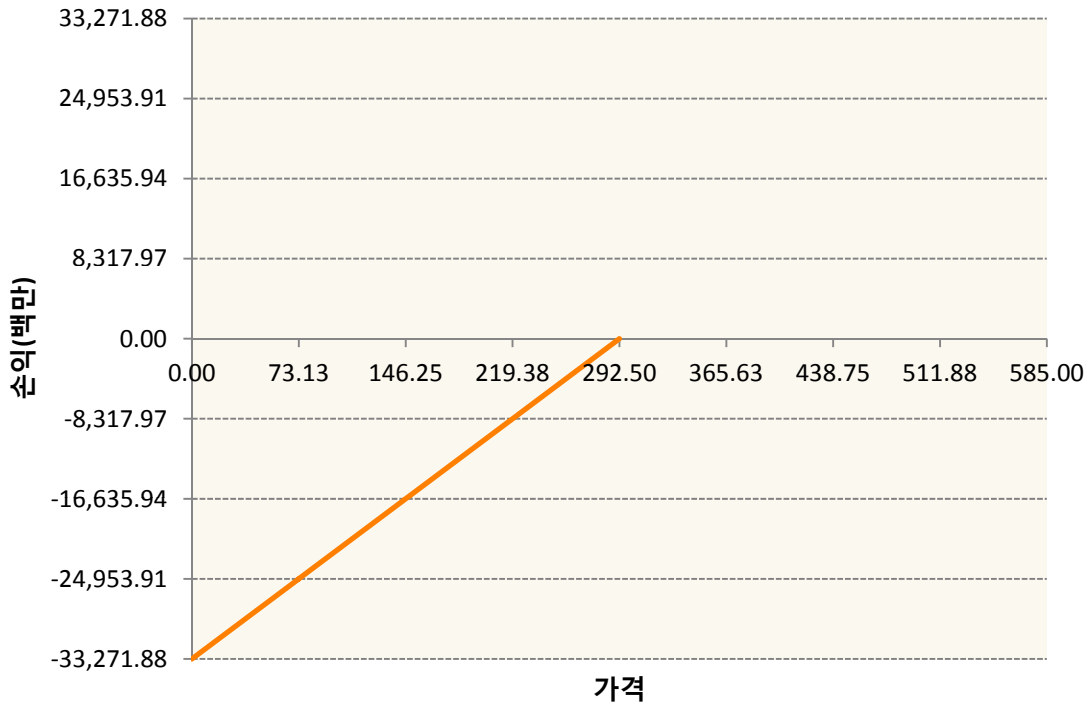


KR4201Q22950-2020-02 콜295

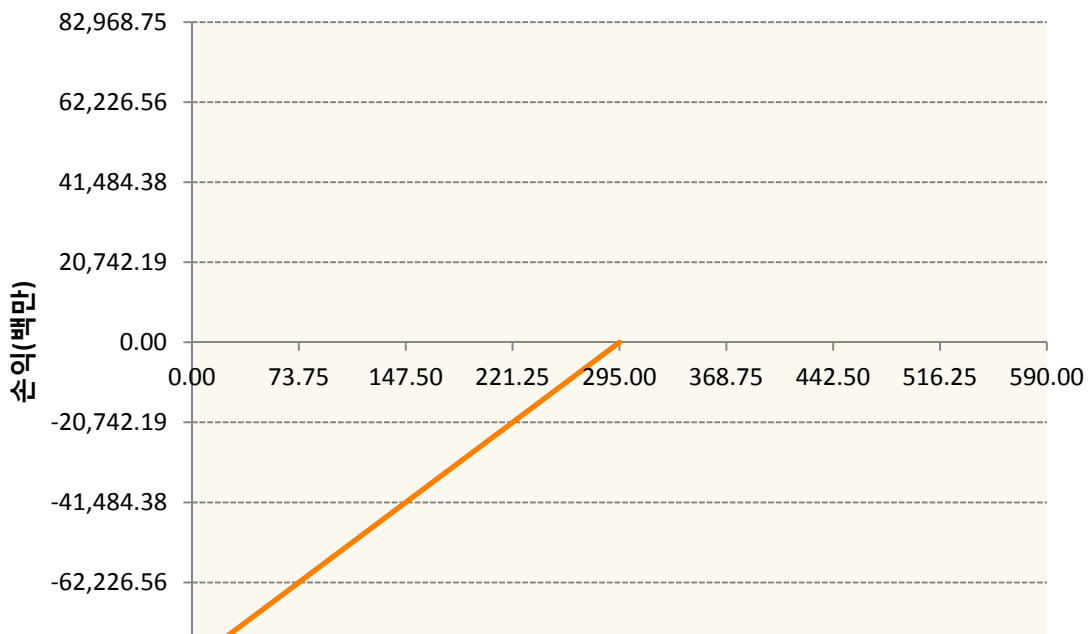




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



KR4301Q22958-2020-02 풋295



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q22927		2020-02 콜292.5						5,356
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,264	3,146	3,019	2,886	2,747	2,604	2,457	
-5.33%	2,724	2,560	2,394	2,227	2,058	1,888	1,717	
-2.67%	1,798	1,621	1,443	1,265	1,087	908	730	
0%	474	320	162	0	-165	-331	-500	
2.67%	-1,176	-1,283	-1,401	-1,529	-1,663	-1,804	-1,950	
5.33%	-3,035	-3,097	-3,172	-3,260	-3,359	-3,467	-3,582	
8.00%	-5,004	-5,034	-5,076	-5,130	-5,195	-5,270	-5,356	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						18,439
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	10,451	10,088	9,687	9,257	8,803	8,328	7,836	
-5.33%	8,889	8,345	7,787	7,218	6,640	6,056	5,467	
-2.67%	6,052	5,417	4,783	4,148	3,513	2,879	2,244	
0%	1,790	1,202	605	0	-611	-1,226	-1,845	
2.67%	-3,718	-4,158	-4,631	-5,130	-5,650	-6,187	-6,737	
5.33%	-10,095	-10,366	-10,685	-11,045	-11,441	-11,866	-12,317	
8.00%	-16,964	-17,104	-17,289	-17,519	-17,790	-18,098	-18,439	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						1,612
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,524	-1,532	-1,544	-1,557	-1,574	-1,592	-1,612	
-5.33%	-704	-734	-766	-798	-832	-867	-902	
-2.67%	-151	-190	-230	-270	-310	-350	-390	
0%	71	50	26	0	-28	-58	-89	
2.67%	118	113	105	95	83	69	52	
5.33%	122	122	121	118	115	110	104	
8.00%	123	123	123	122	122	120	119	
KR4301Q22958		2020-02 풋295						4,456
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-4,299	-4,311	-4,329	-4,352	-4,381	-4,416	-4,456	
-5.33%	-2,171	-2,228	-2,290	-2,358	-2,430	-2,505	-2,583	
-2.67%	-555	-655	-755	-855	-955	-1,055	-1,155	
0%	226	155	80	0	-83	-168	-255	
2.67%	430	408	379	344	302	254	201	

5.33%	457	454	448	438	425	406	383
8.00%	459	459	458	456	453	448	441

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

(단위:백만원)

**29,162**

공시일	2020-01-28
기준일	2020-01-23

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

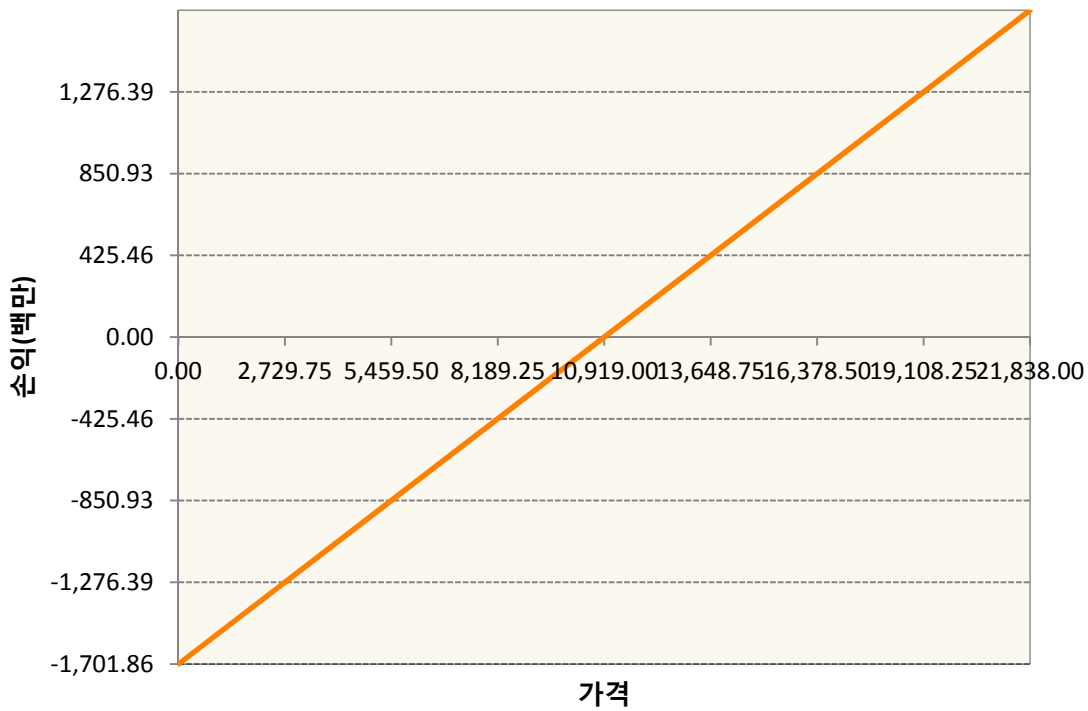
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

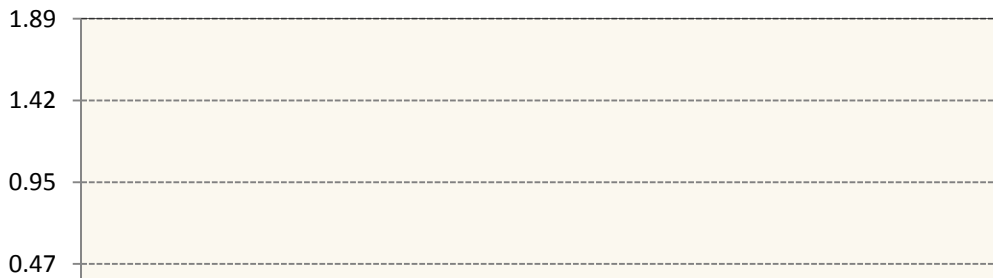
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,702	0	1,702	장내
누계	유가증권	옵션	0	72	-72	장내
누계	통화	선도	0	2,117	-2,117	장외

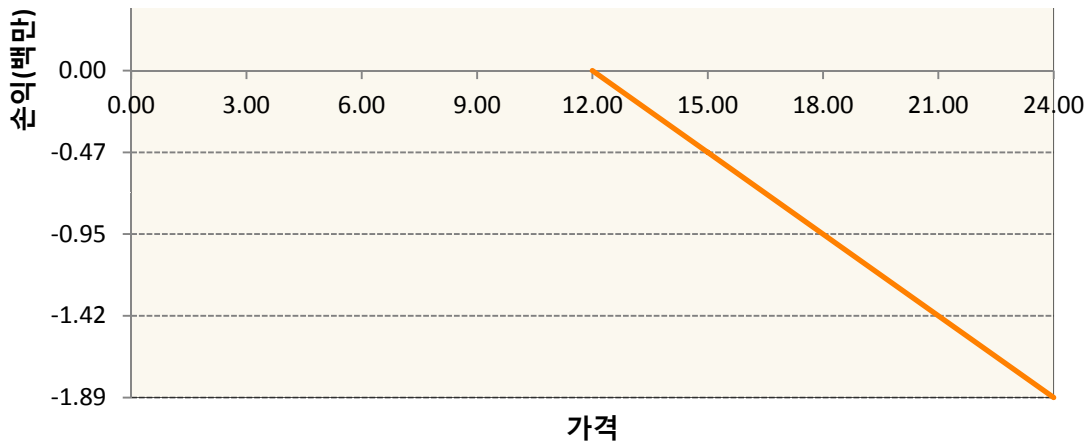
### 2. 만기시점의 손익구조

HCFO-HSCEI Futures Jan20

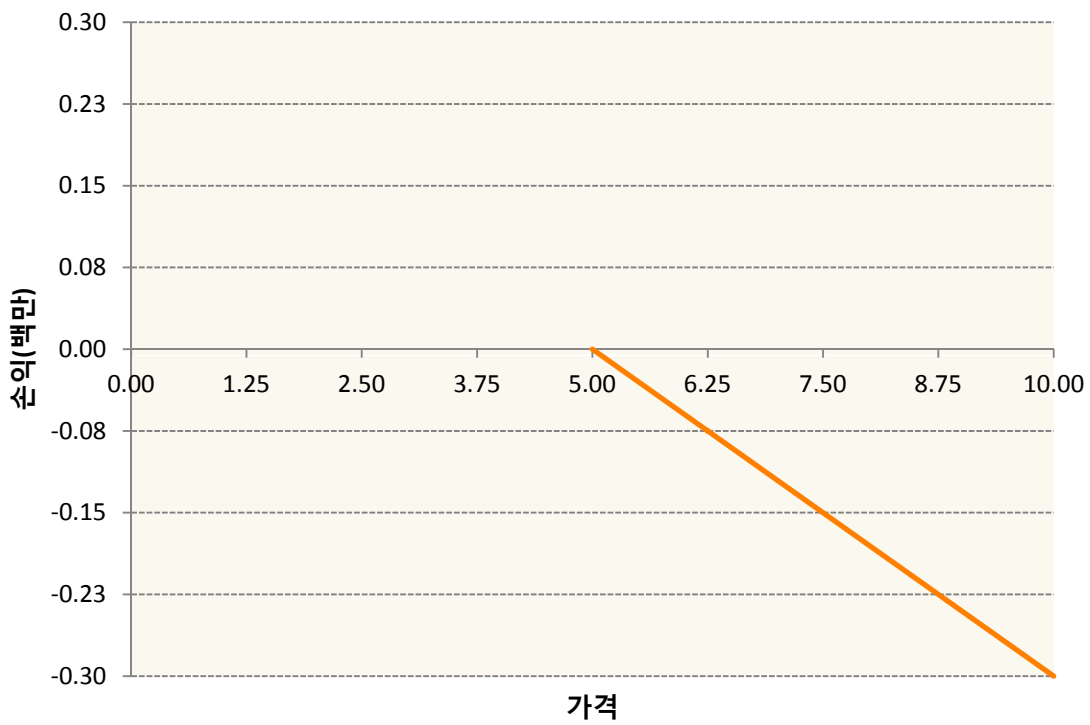


OHHIF0-C112-HSCEI

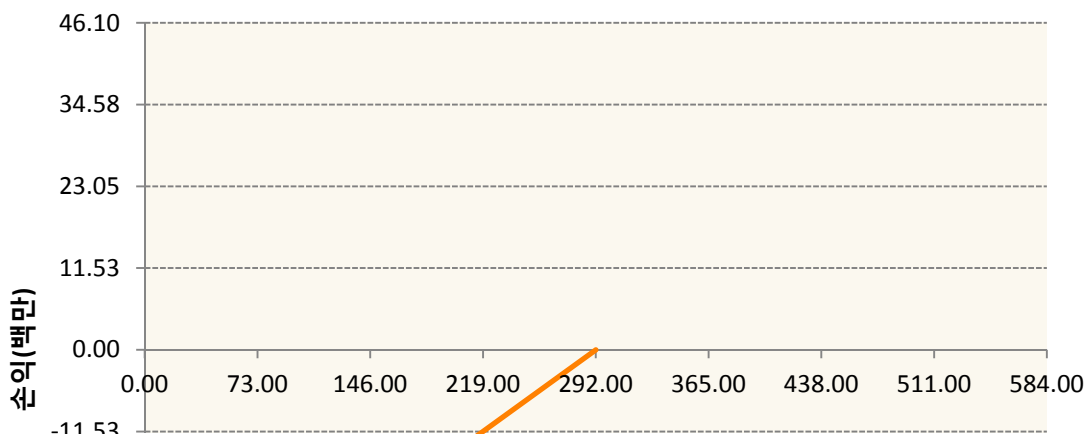


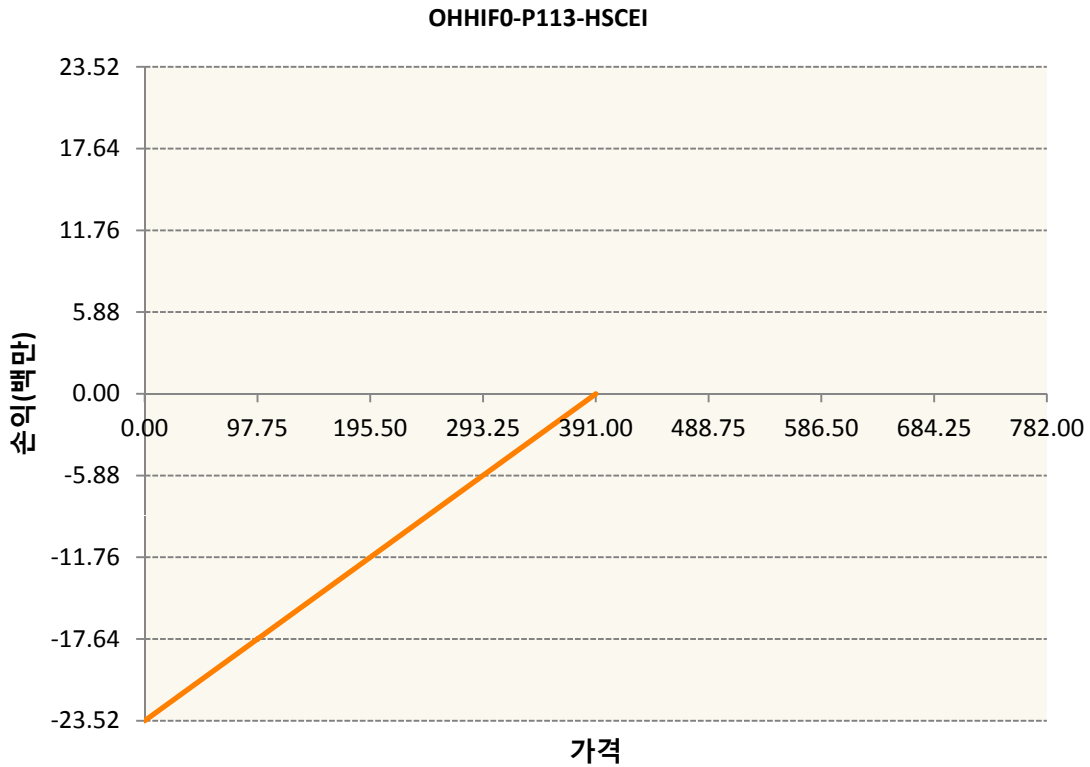


**OHHIF0-C113-HSCEI**



**OHHIF0-P112-HSCEI**





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

FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	169
HCF0 HSCEI Futures Jan20	136
OHHIF0-C11 HSCEI	0.2
OHHIF0-C11 HSCEI	0
OHHIF0-P11 HSCEI	4
OHHIF0-P11 HSCEI	2

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

<b>182</b>
------------

공시일	2020-01-28
기준일	2020-01-23

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

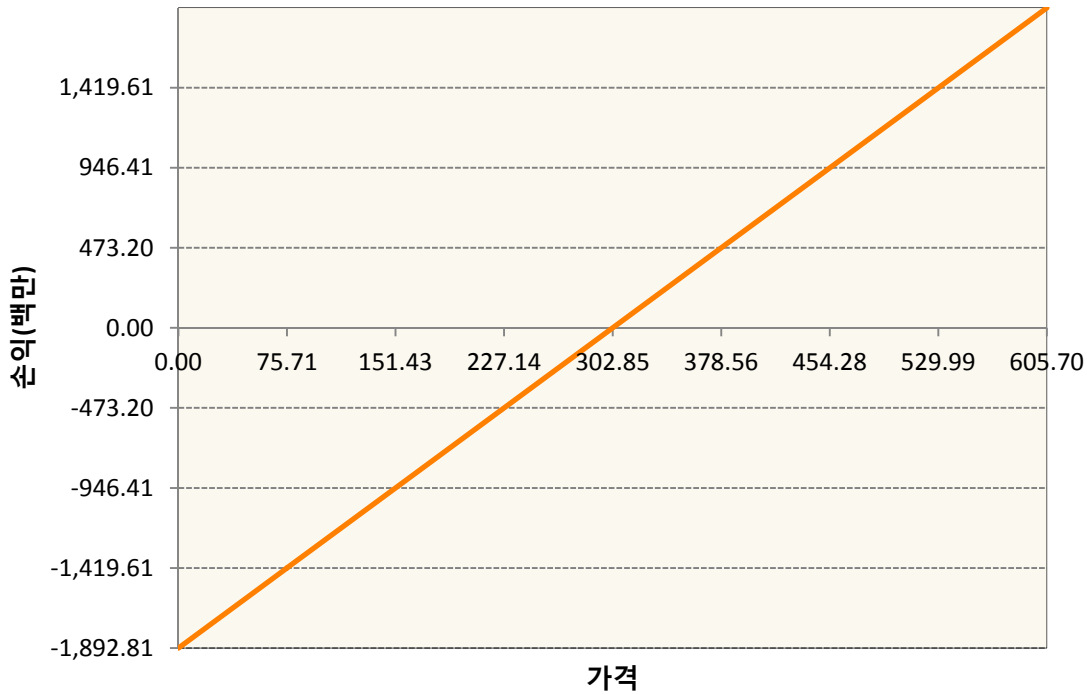
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

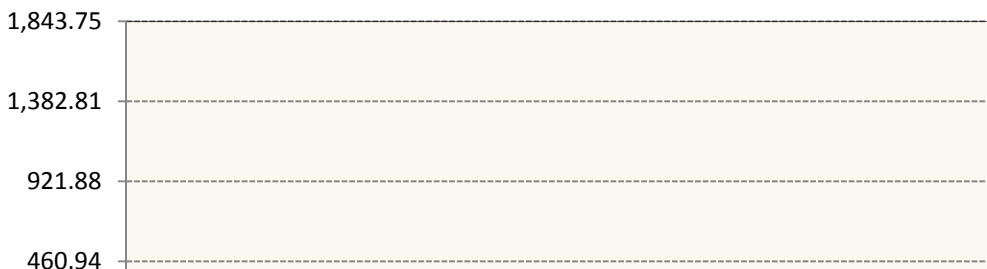
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,893	0	1,893	장내
누계	유가증권	스왑	3,625	0	3,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,608	-3,608	장내

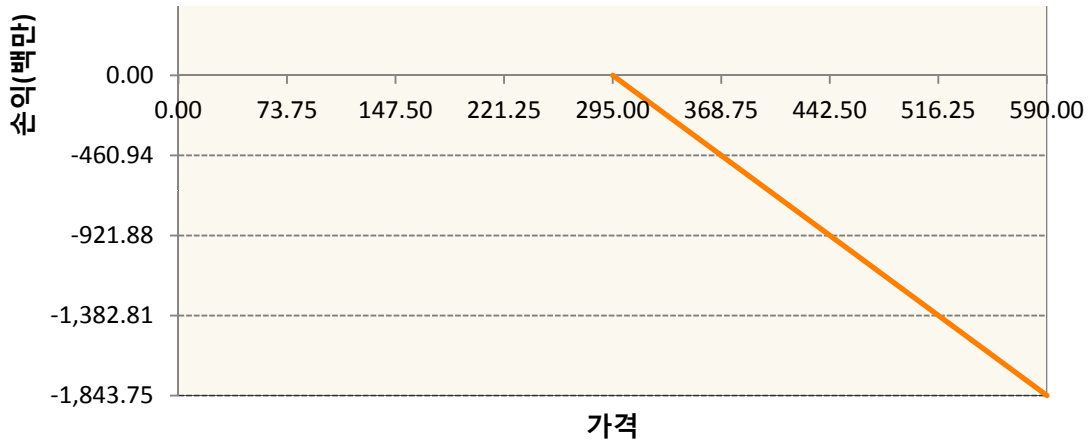
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

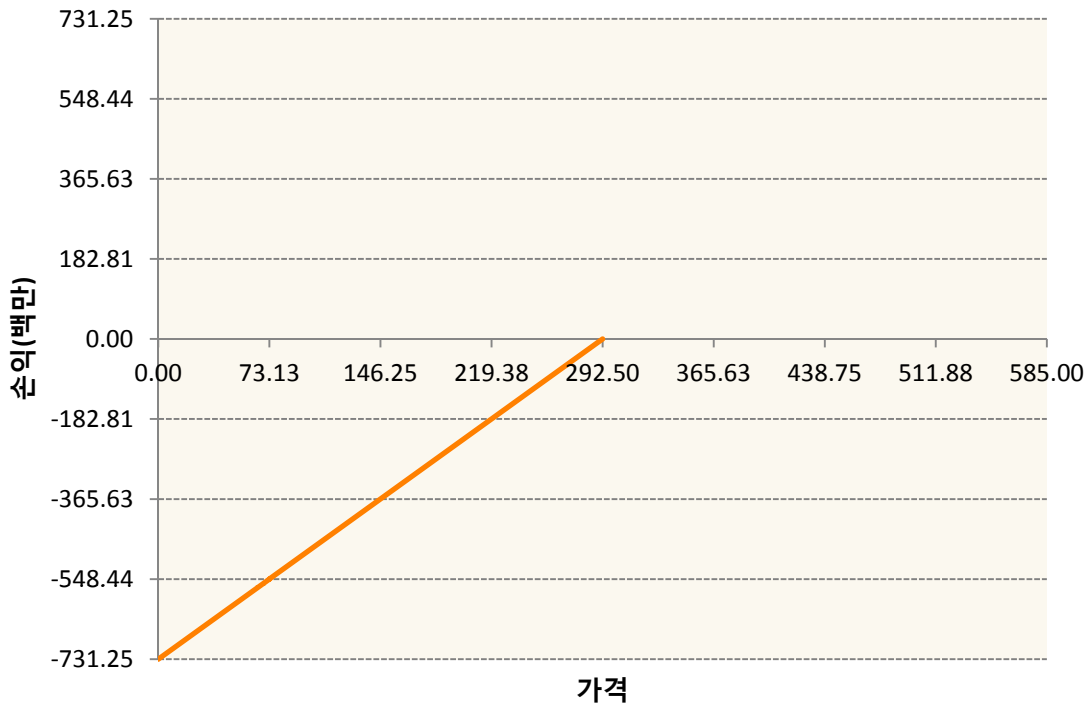


KR4201Q22950-2020-02 콜295

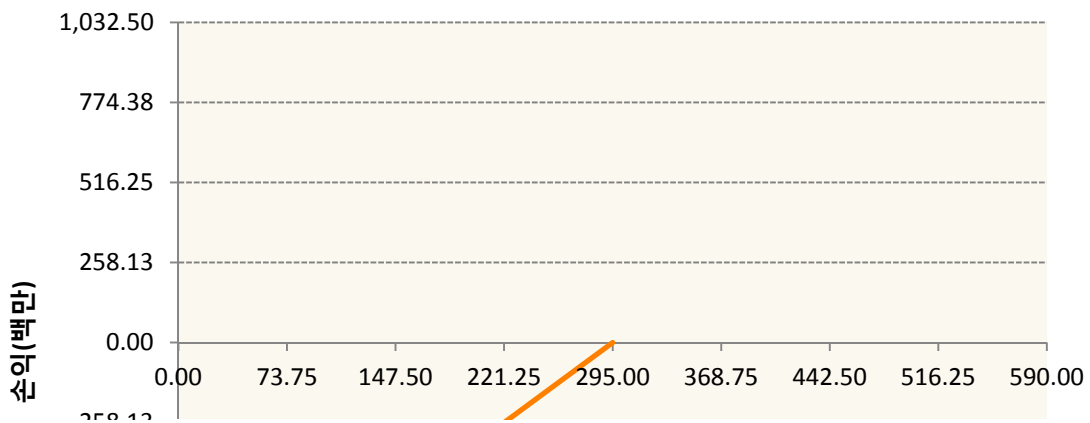




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



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						151
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-151	-151	-151	-151	-151	-151	-151	
-5.33%	-101	-101	-101	-101	-101	-101	-101	
-2.67%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	50	50	50	50	50	50	50	
5.33%	101	101	101	101	101	101	101	
8.00%	151	151	151	151	151	151	151	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						128
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	73	70	67	65	61	58	55	
-5.33%	62	58	54	50	46	42	38	
-2.67%	42	38	33	29	24	20	16	
0%	12	8	4	0	-4	-9	-13	
2.67%	-26	-29	-32	-36	-39	-43	-47	
5.33%	-70	-72	-74	-77	-80	-83	-86	
8.00%	-118	-119	-120	-122	-124	-126	-128	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						35
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-33	-34	-34	-34	-35	-35	-35
-5.33%	-15	-16	-17	-18	-18	-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							55
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-53	-54	-54	-54	-55	-55	-55
-5.33%	-27	-28	-29	-29	-30	-31	-32
-2.67%	-7	-8	-9	-11	-12	-13	-14
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	5	5	5	4	4	3	2
5.33%	6	6	6	5	5	5	5
8.00%	6	6	6	6	6	6	5

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

(단위:백만원)

**636**

공시일	2020-01-28
기준일	2020-01-23

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

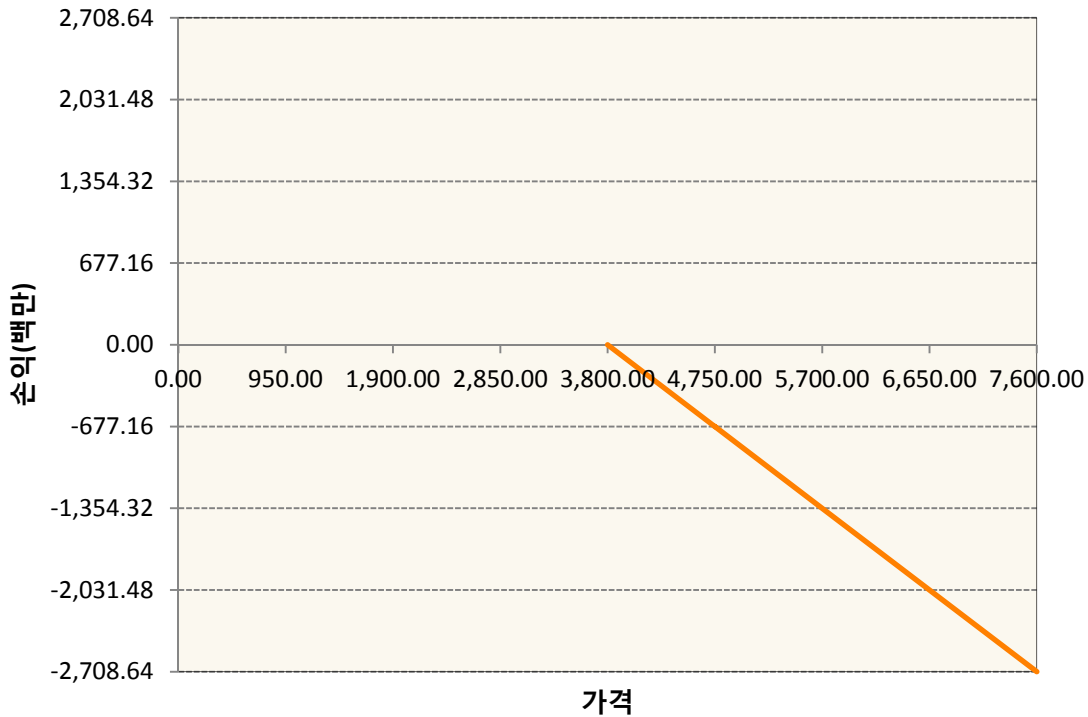
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

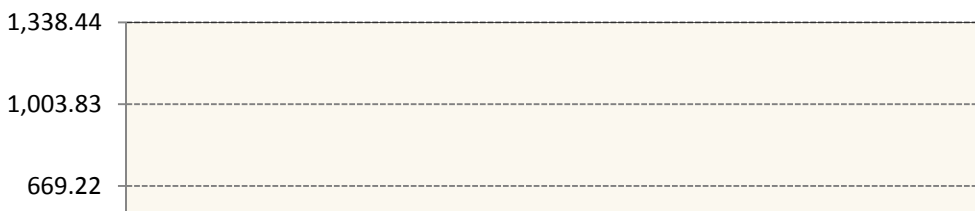
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	922	0	922	
누계	유가증권	스왑	13,542	0	13,542	장외
누계	유가증권	옵션	0	8,094	-8,094	장내
누계	통화	선도	0	3,401	-3,401	장외

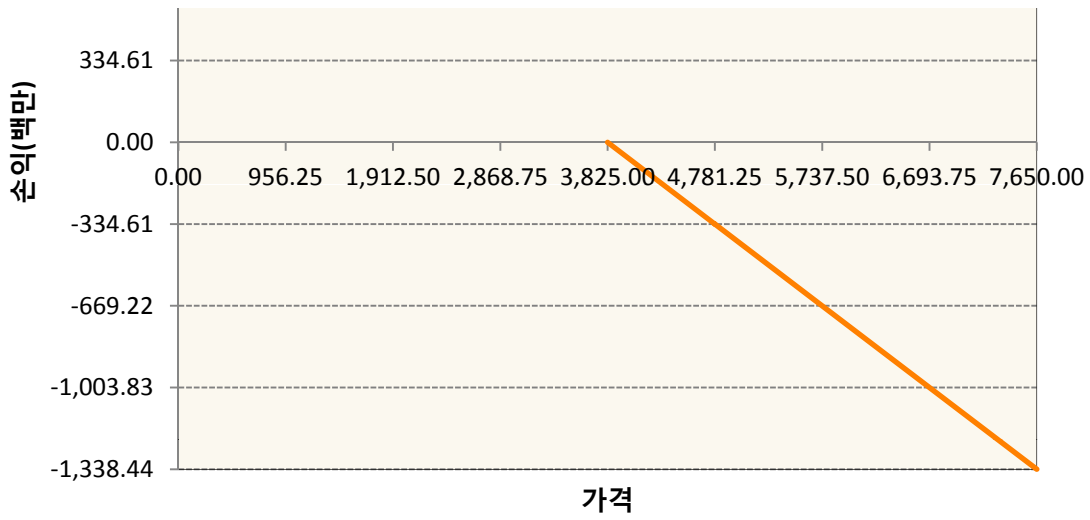
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXG0-C3800-EURO STOXX 50**

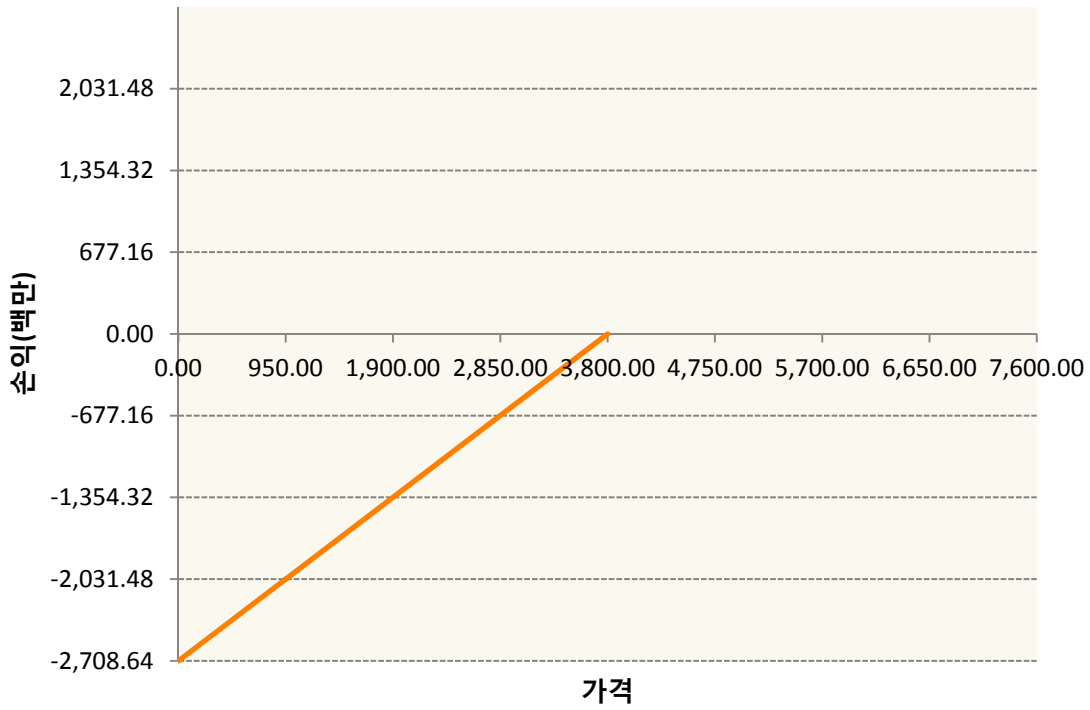


**OESXG0-C3825-EURO STOXX 50**

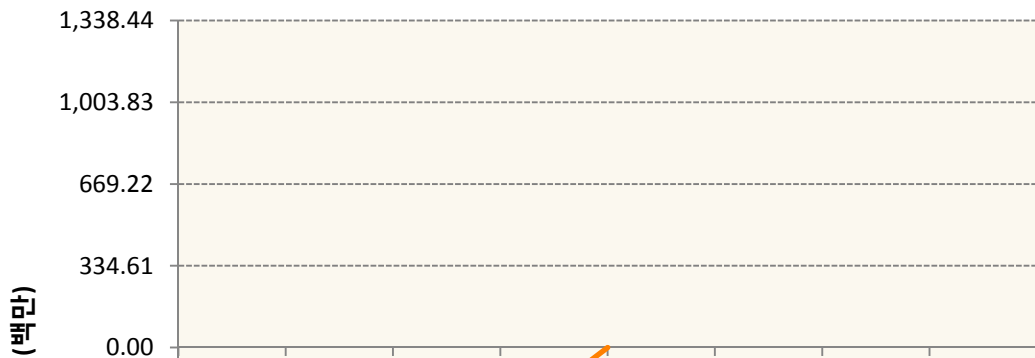


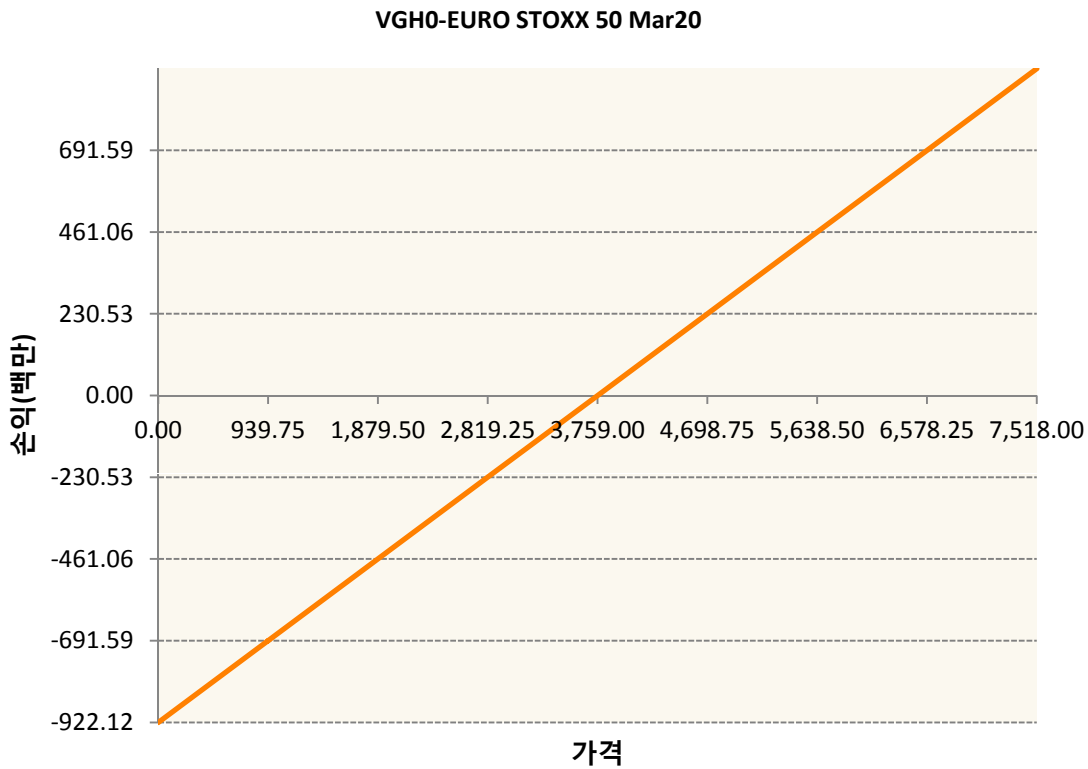
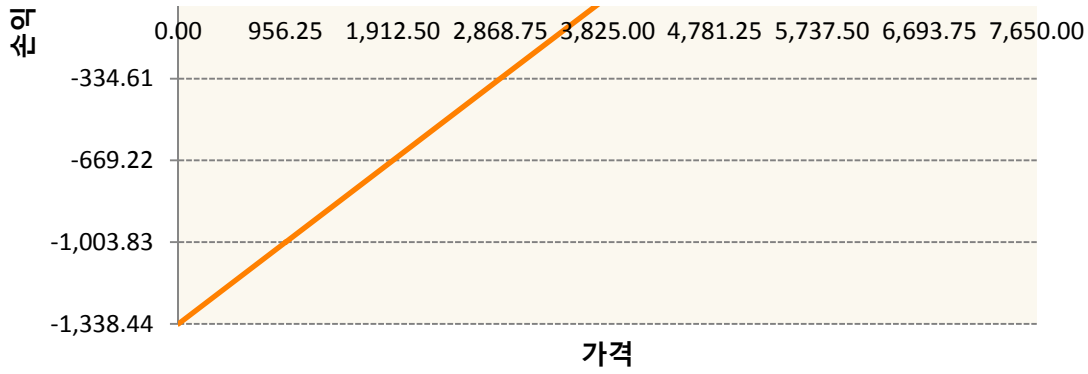


OESXG0-P3800-EURO STOXX 50



OESXG0-P3825-EURO STOXX 50





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	6
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	272
OESXG0-C3& EURO STOXX 50	217
OESXG0-C3& EURO STOXX 50	107
OESXG0-P3& EURO STOXX 50	217
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)

905



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

(단위:백만원)

80



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

(단위:백만원)

117

공시일	2020-01-28
기준일	2020-01-23

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

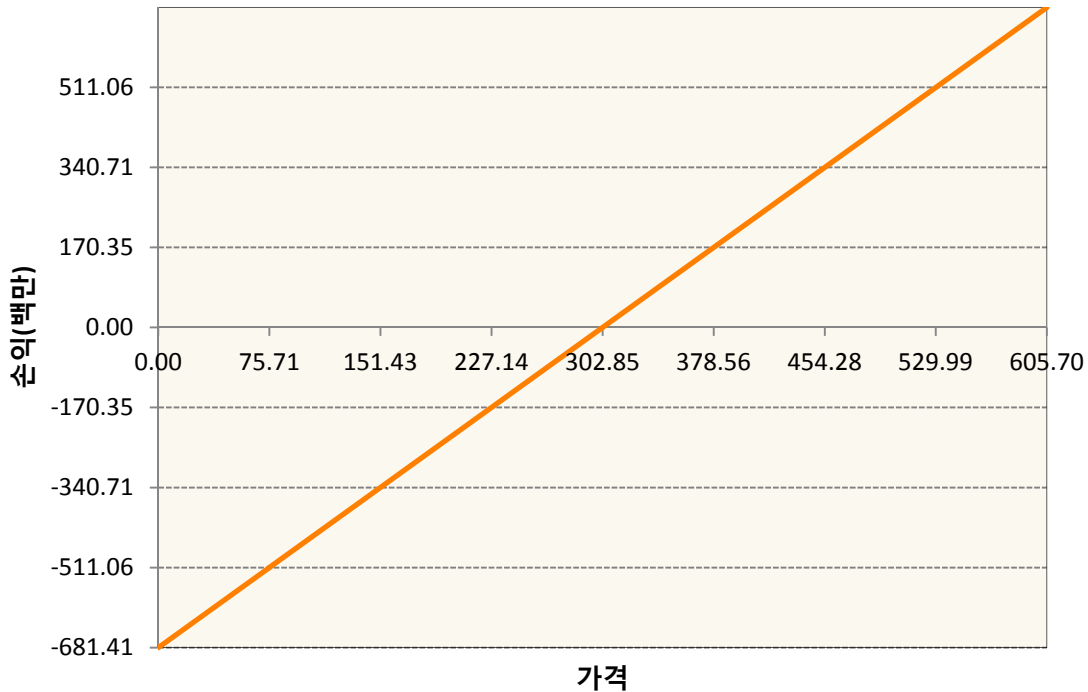
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	681	0	681	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	2020-01-28
기준일	2020-01-23

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

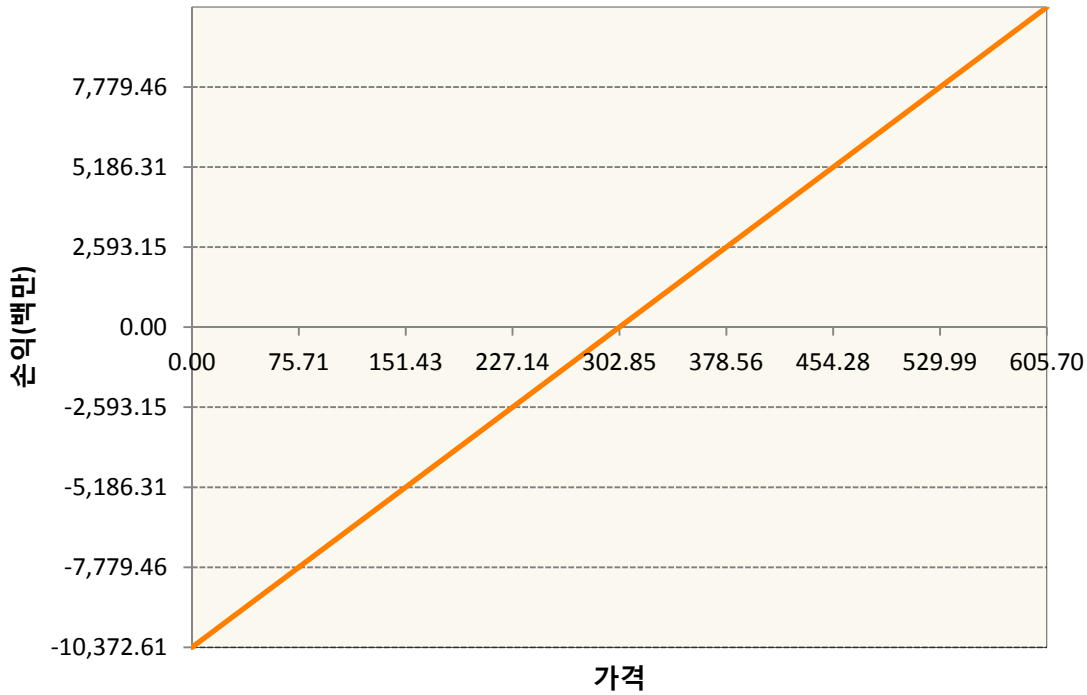
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

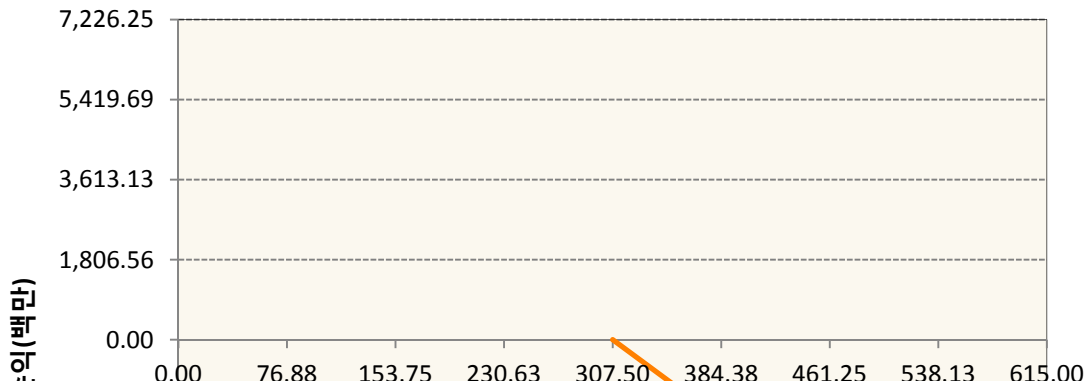
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,373	0	10,373	장내
누계	유가증권	옵션	2,944	20,789	-17,845	장내

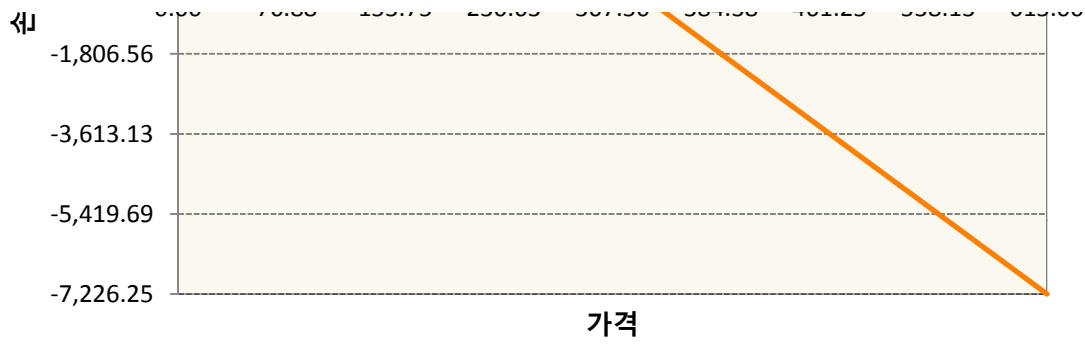
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

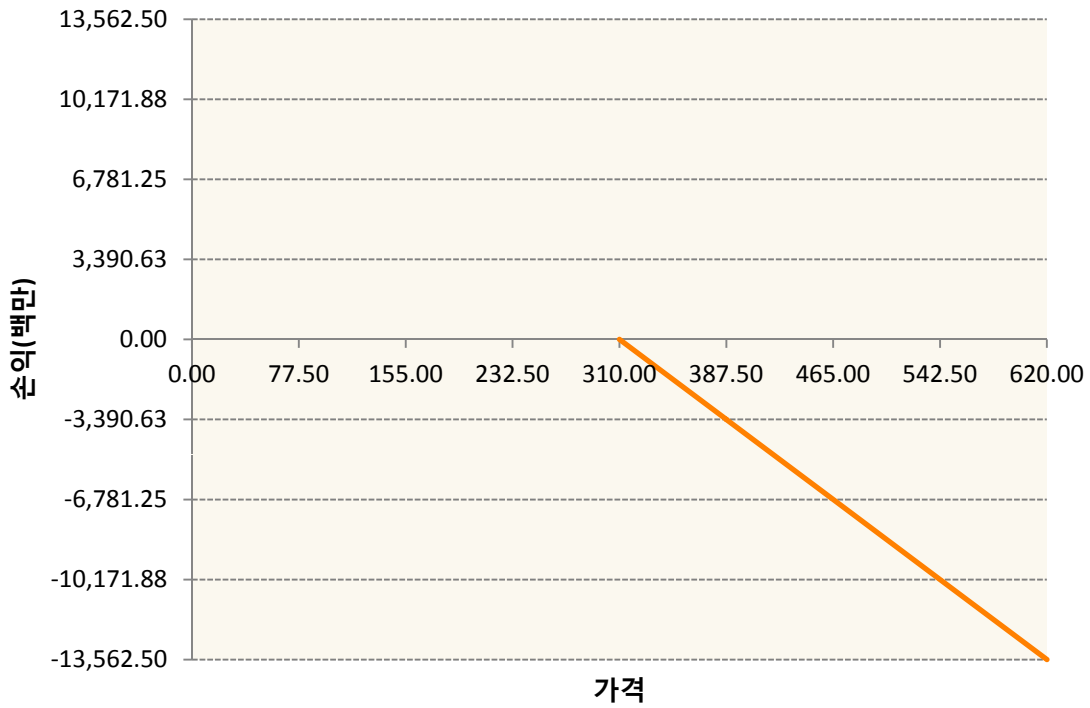


KR4201Q23073-2020-02 콜307.5

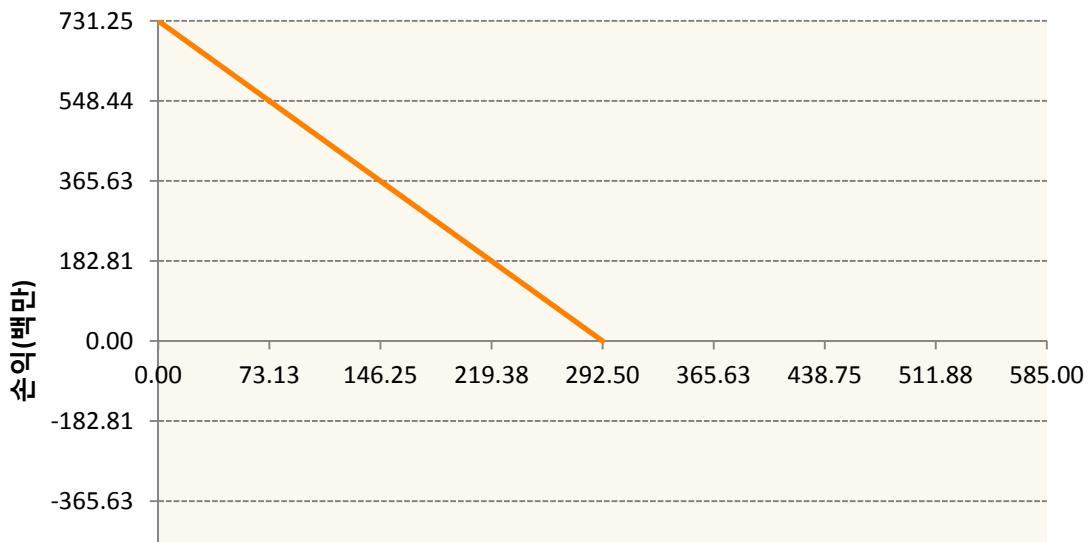


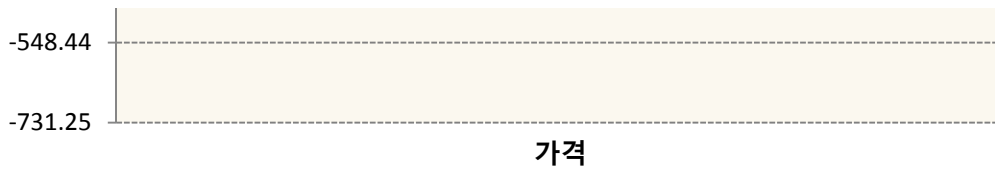


KR4201Q23107-2020-02 콜310

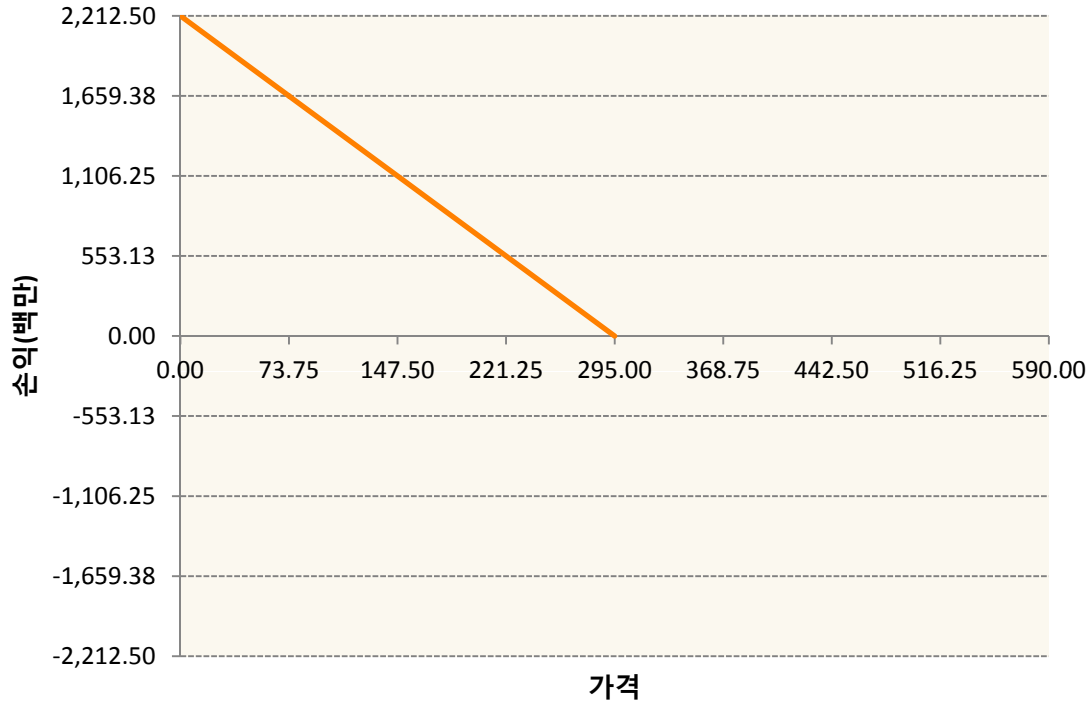


KR4301Q22925-2020-02 풋292.5





KR4301Q22958-2020-02 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						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						397
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	147	143	138	133	126	118	110	
-5.33%	135	127	119	109	98	87	75	
-2.67%	106	94	80	66	52	37	22	

0%	50	33	17	0	-17	-34	-51
2.67%	-42	-59	-76	-93	-111	-128	-145
5.33%	-168	-182	-198	-213	-229	-245	-262
8.00%	-322	-332	-344	-356	-369	-383	-397
KR4201Q23107                      2020-02 콜310							701
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	235	230	223	214	203	190	176
-5.33%	219	207	193	177	159	140	119
-2.67%	177	156	133	109	84	59	32
0%	89	60	30	0	-30	-61	-92
2.67%	-60	-93	-126	-158	-191	-223	-256
5.33%	-276	-305	-336	-366	-397	-429	-460
8.00%	-548	-570	-594	-619	-646	-673	-701
KR4301Q22925                      2020-02 풋292.5							35
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	33	34	34	34	35	35	35
-5.33%	15	16	17	18	18	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							119
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	115	115	115	116	117	118	119
-5.33%	58	59	61	63	65	67	69
-2.67%	15	17	20	23	25	28	31
0%	-6	-4	-2	0	2	4	7
2.67%	-11	-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)

1,687

공시일	2020-01-28
기준일	2020-01-23

## 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	207,867	0	207,867	

### 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	2020-01-28
기준일	2020-01-23

## 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	216,973	0	216,973	

### 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	2020-01-28
기준일	2020-01-23

## 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	532,847	0	532,847	
누계	통화	선도	0	580,961	-580,961	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E	4,768
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	187
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,805
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,805
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,337
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,524
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	1,627
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	1,533
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	935
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	187
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	2,001
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	935
FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E	3,740
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,870
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	2,001
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	187
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	187
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	1,122
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	1,683
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	280
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E	1,870
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E	3,216
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,505
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,402
FX21020F02 KRW/USD 28-02-20E	1,870
FX21020F03 KRW/USD 28-02-20E	2,898

IE00BD8RGM75

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

15,322



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

(단위:백만원)

214

공시일	2020-01-28
기준일	2020-01-23

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

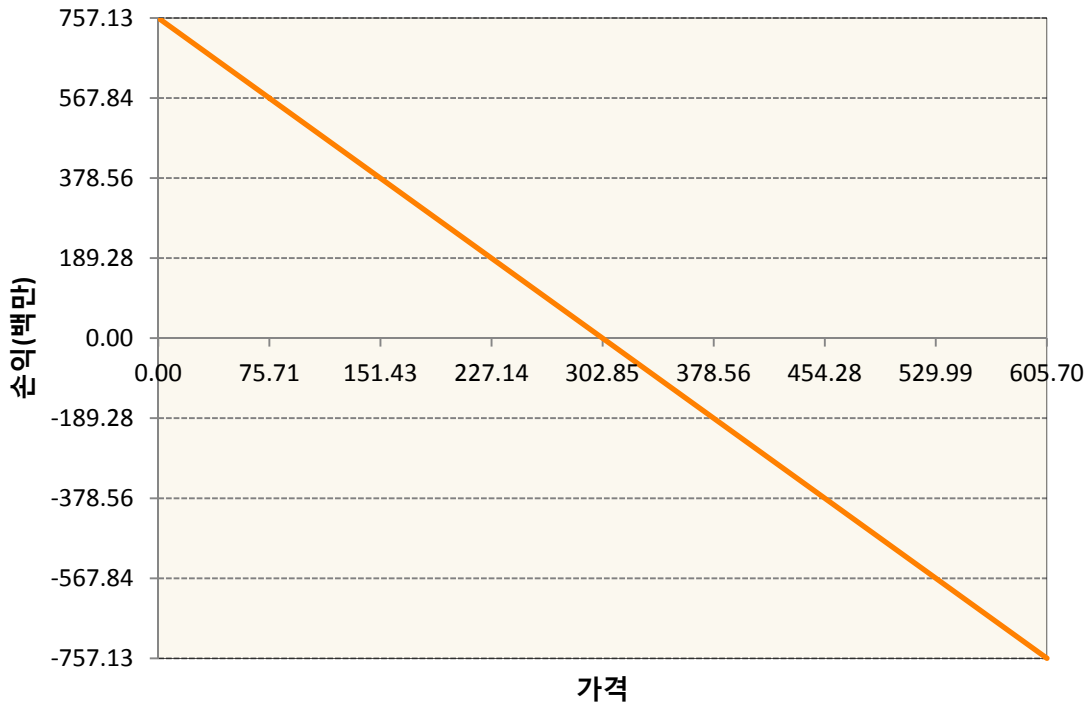
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

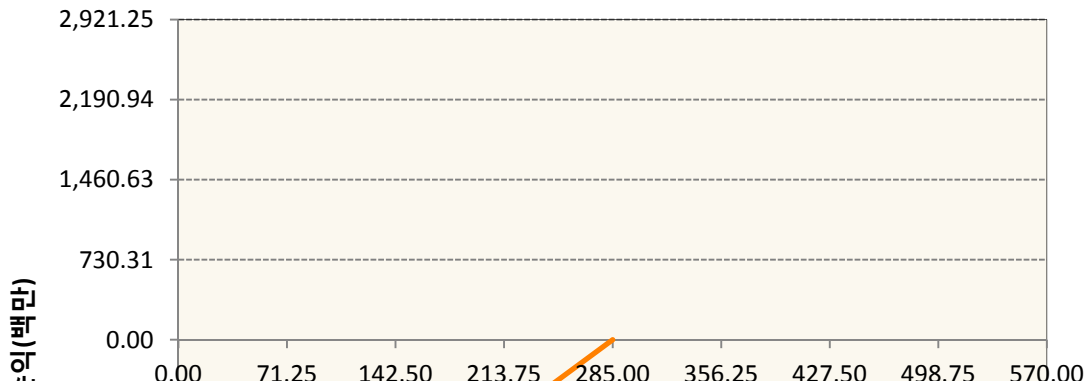
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	757	-757	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,784	-3,784	장내

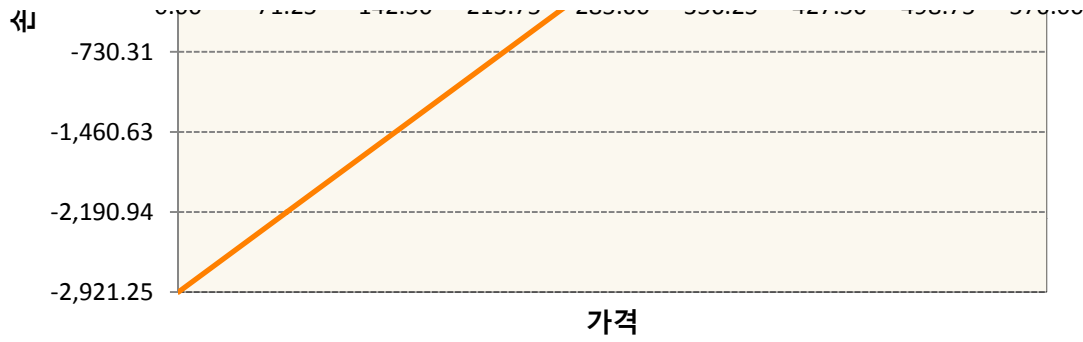
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

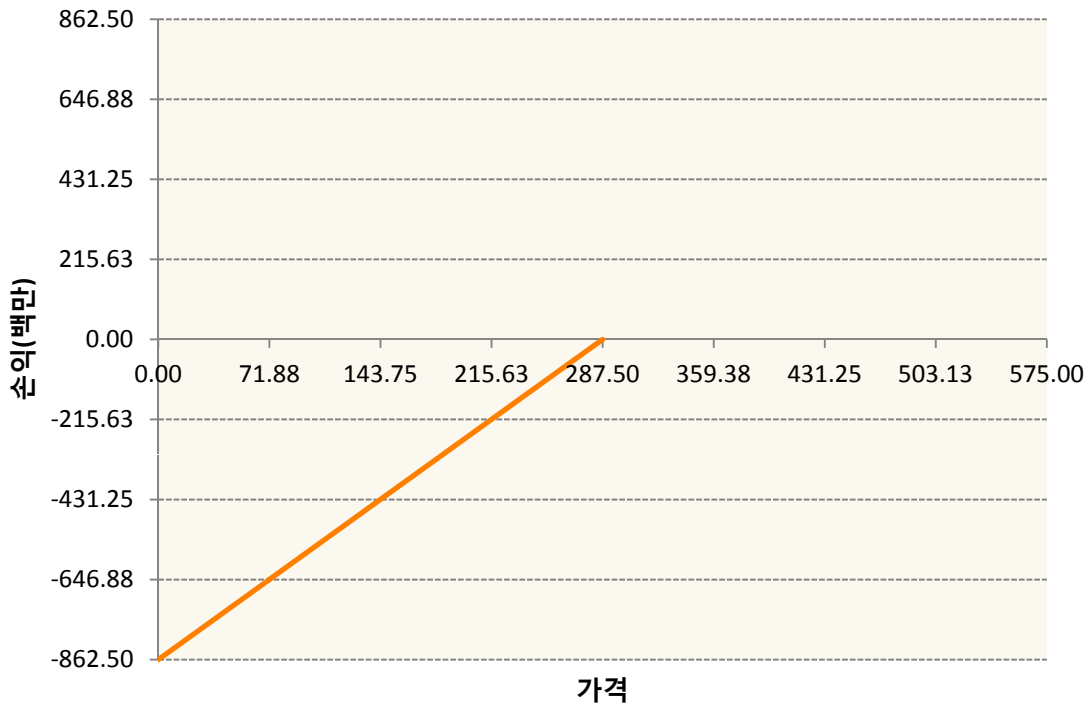


KR4301Q22859-2020-02 풋285





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						93
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-76	-79	-81	-84	-87	-90	-93
-5.33%	-24	-27	-31	-34	-38	-41	-45
-2.67%	-2	-4	-7	-9	-11	-14	-17
0%	2	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	2	2	2	2	2	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

KR4301Q22875                      2020-02 풋287.5                      32

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-28	-29	-29	-30	-31	-31	-32
-5.33%	-10	-11	-12	-13	-14	-15	-16
-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)

**116**

공시일	2020-01-28
기준일	2020-01-23

## H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	445	-445	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	12,312	0	12,312	
누계	통화	선도	446	16,116	-15,670	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019X02 KRW/USD 28-01-20E	290
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	291
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	346
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	204
IE00BD8RGM75	

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

437
-----

공시일	2020-01-28
기준일	2020-01-23

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

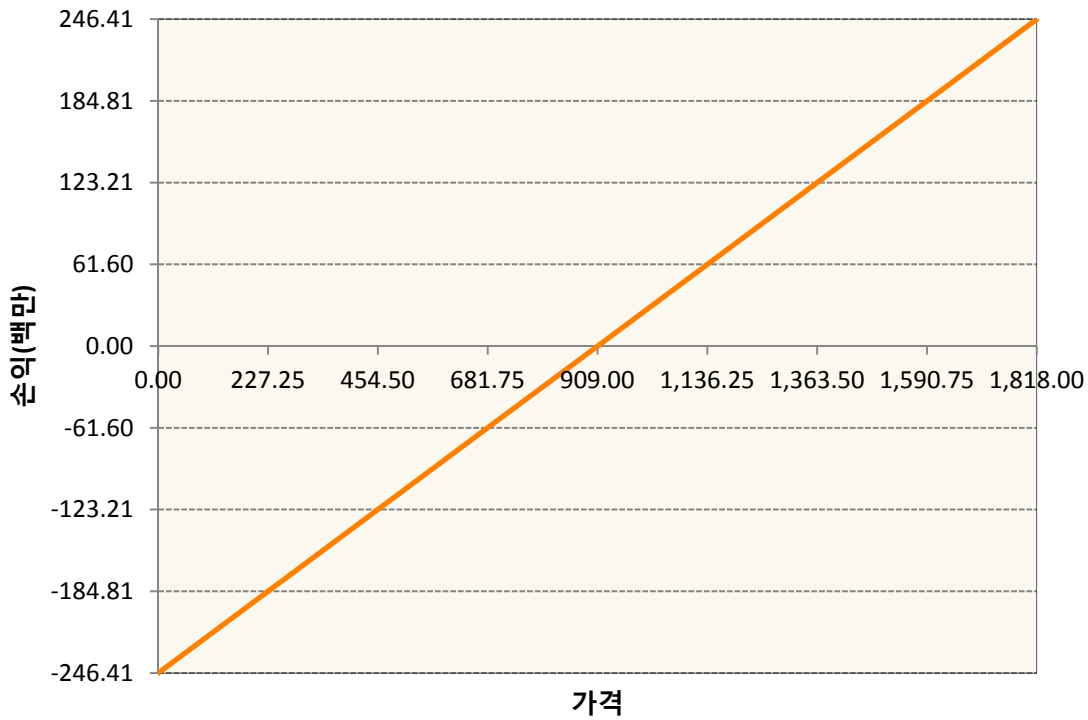
### 1. 계약금액

(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	1,069	0	1,069	장외
누계	통화	선도	311	894	-583	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

VNCG0-VN30 Index Future Feb20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	86
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)

**112**

공시일	2020-01-28
기준일	2020-01-23

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

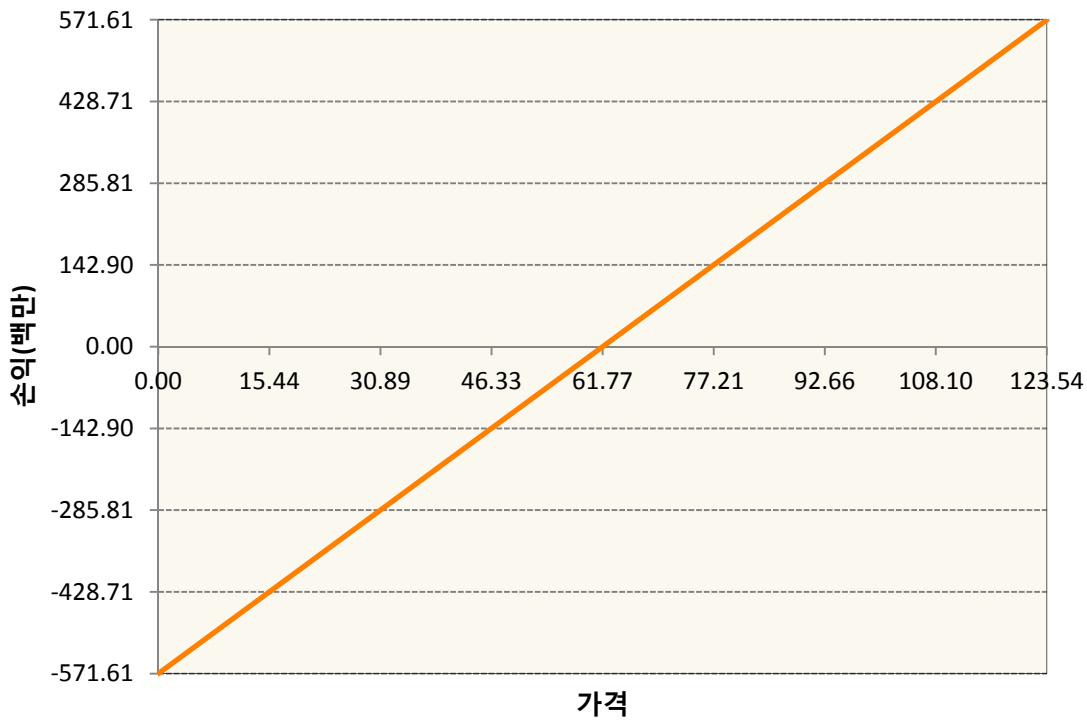
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

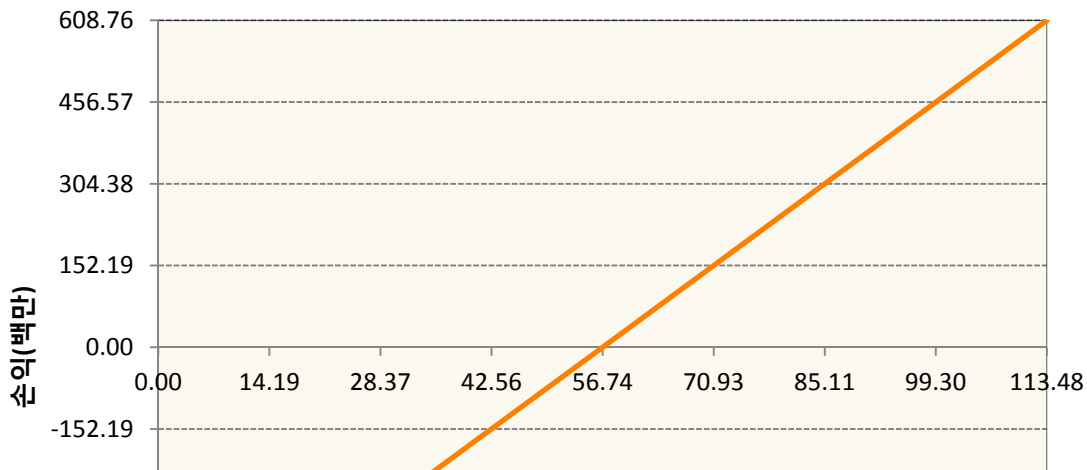
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,296	292	2,004	

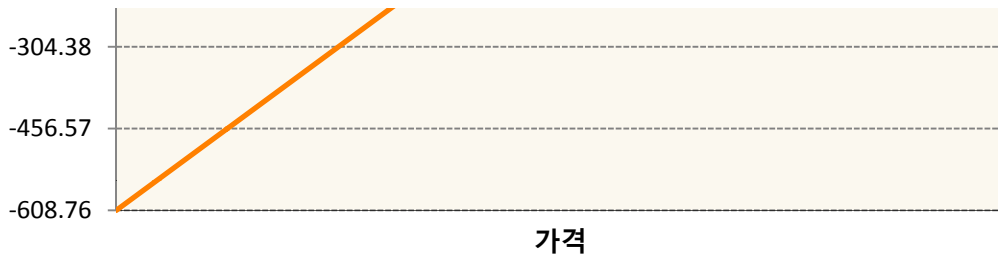
### 2. 만기시점의 손익구조

**COKO-BRENT CRUDE FUTR May20**

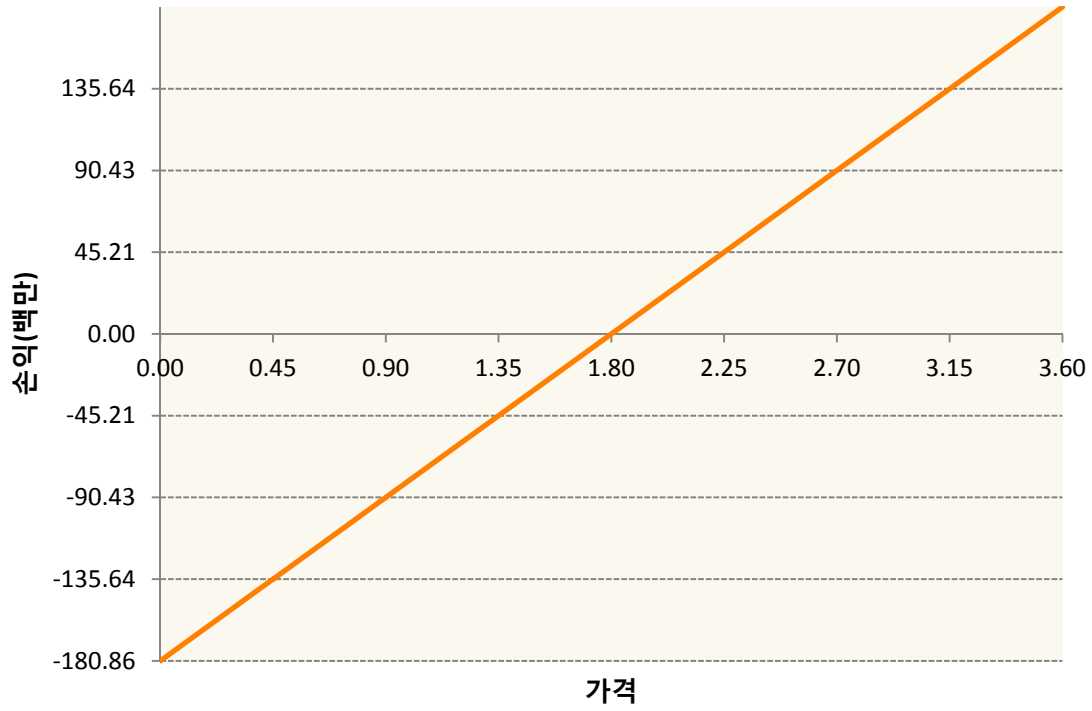


**CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20**

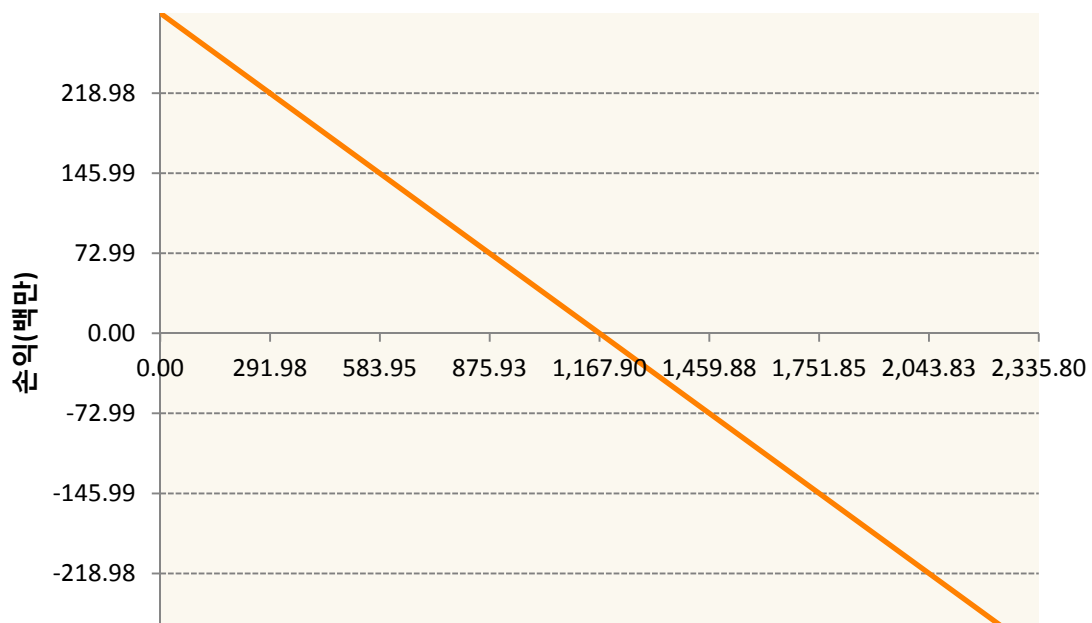


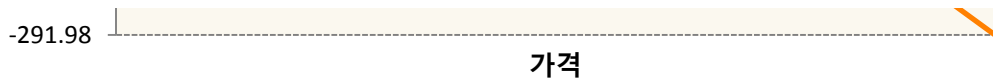


**HOH0-NY Harb ULSD Fut Mar20**

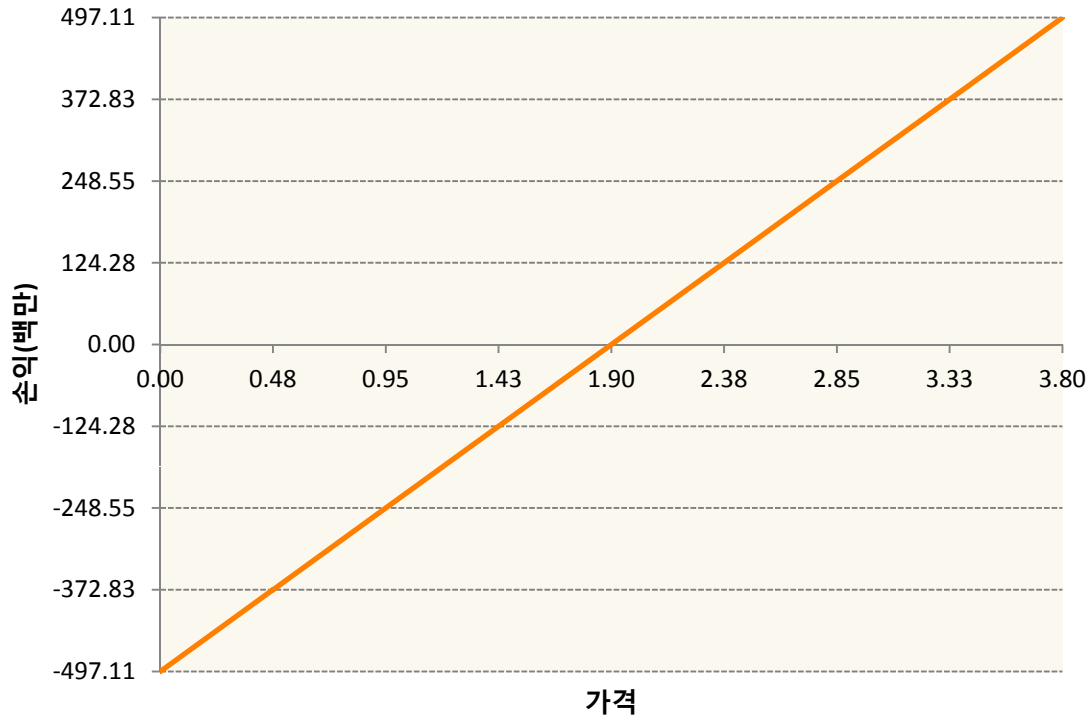


**KR4175Q20000-2020-02 달러선물**

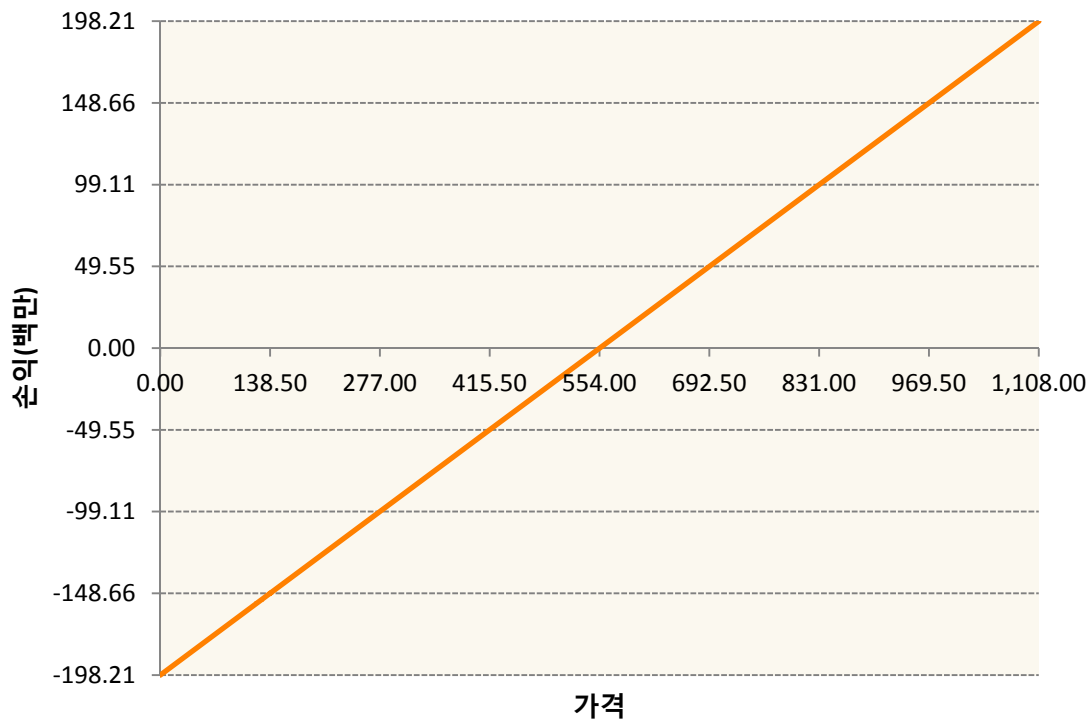




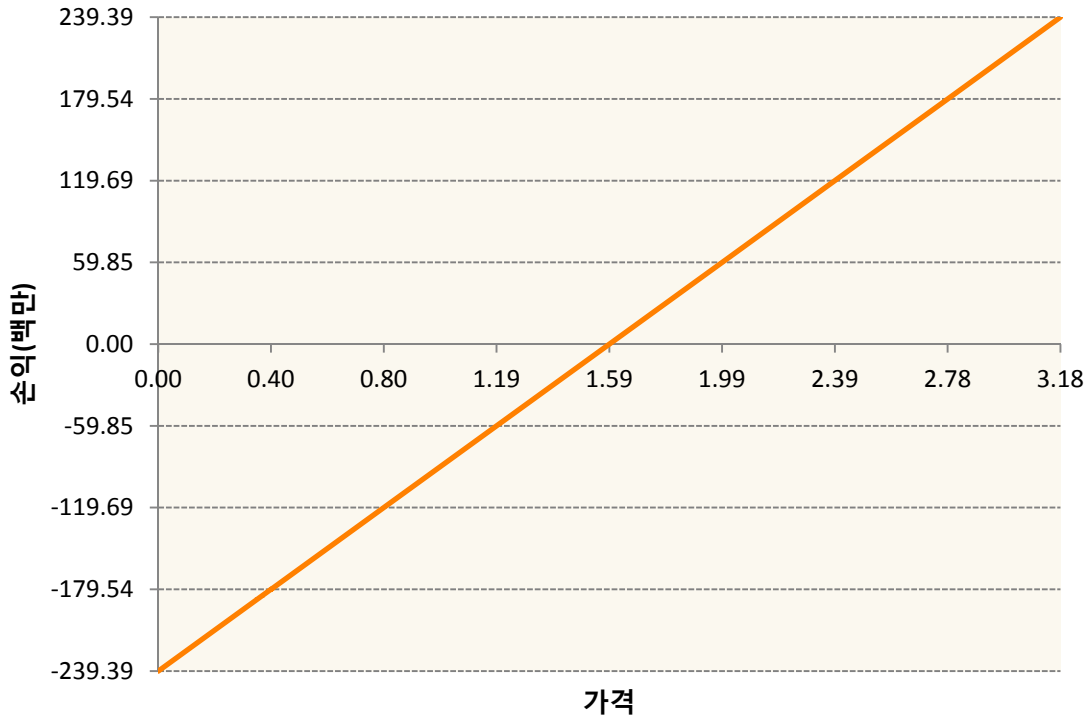
NGH20-NATURAL GAS FUTR Mar20



QSH0-Low Su Gasoil G Mar20



XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	46
CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	49
HOH0	NY Harb ULSD Fut Mar20	14
KR4175Q20C	2020-02 달러선물	23
NGH20	NATURAL GAS FUTR Mar20	40
QSH0	Low Su Gasoil G Mar20	16
XBH0	GASOLINE RBOB FUT Mar20	19

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

356

공시일	2020-01-28
기준일	2020-01-23

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

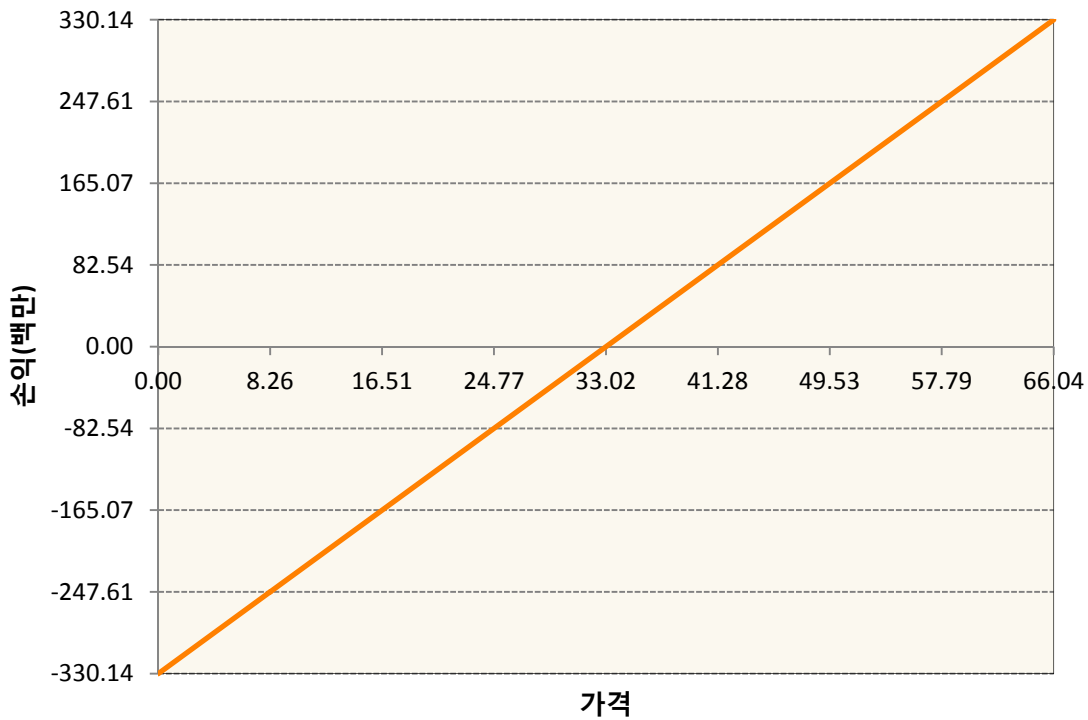
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

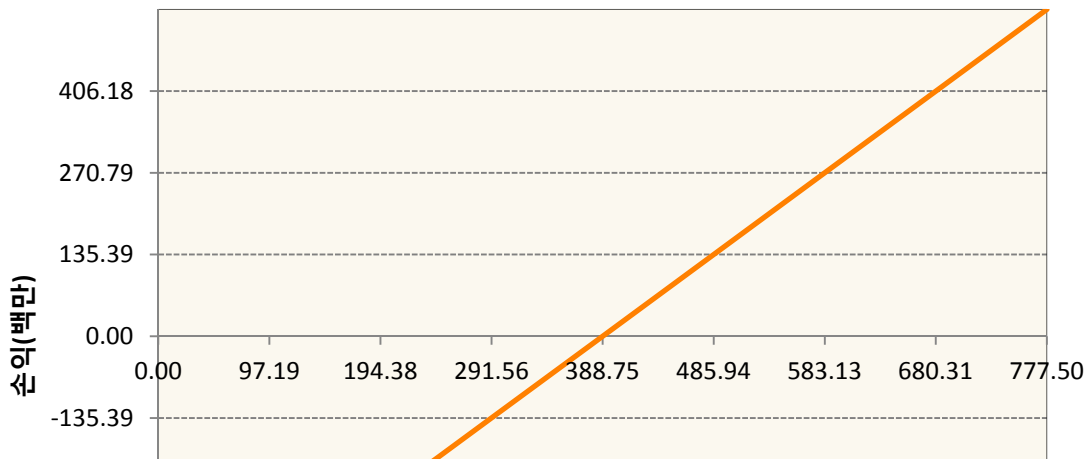
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,833	152	2,681	

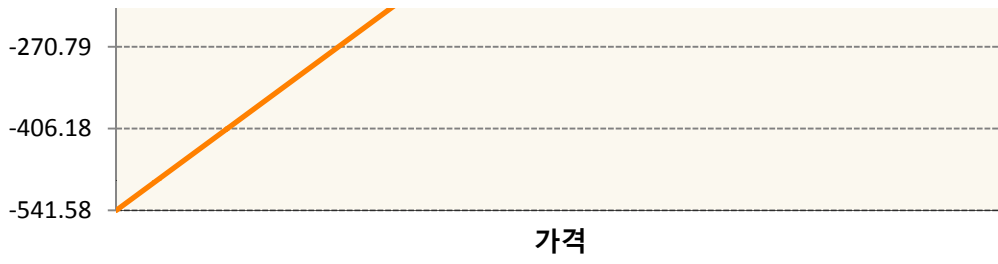
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20**

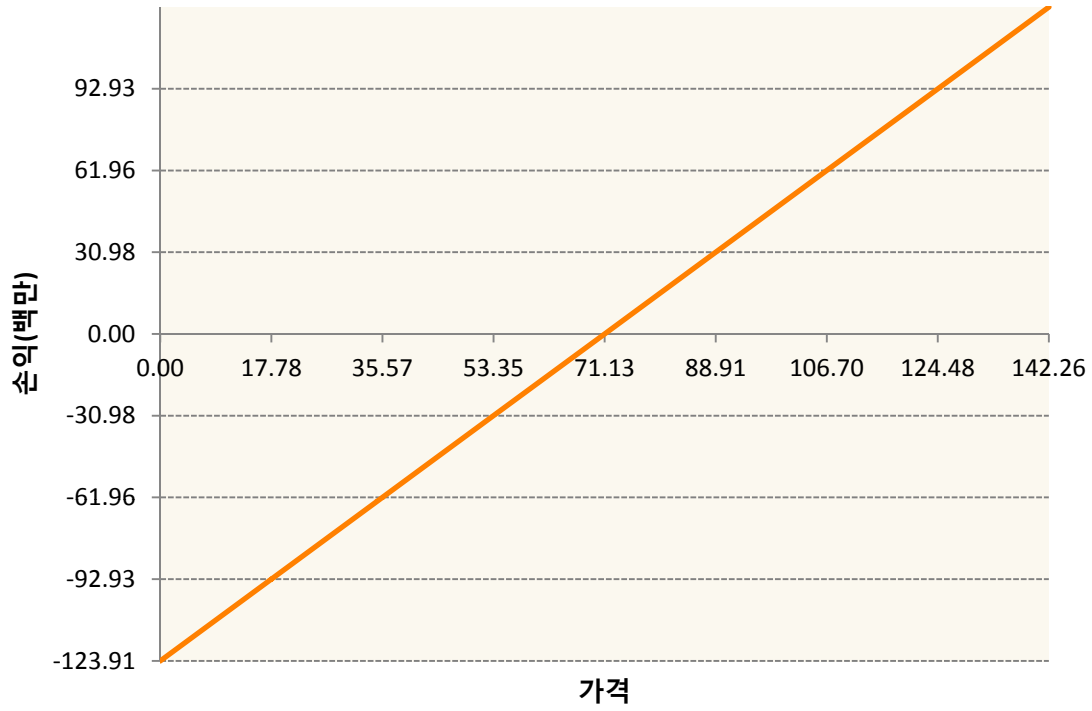


**CH0-CORN FUTURE Mar20**

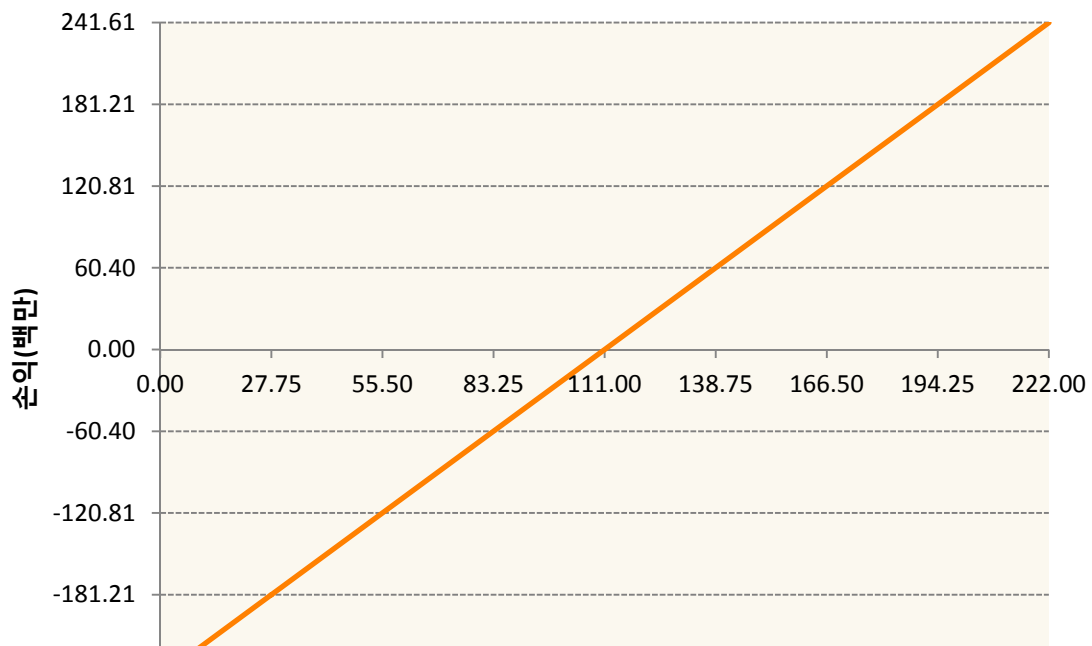


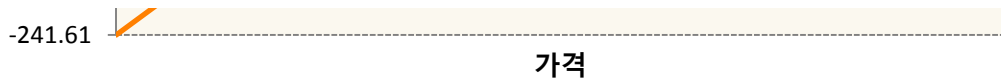


CTH0-COTTON NO.2 FUTR Mar20

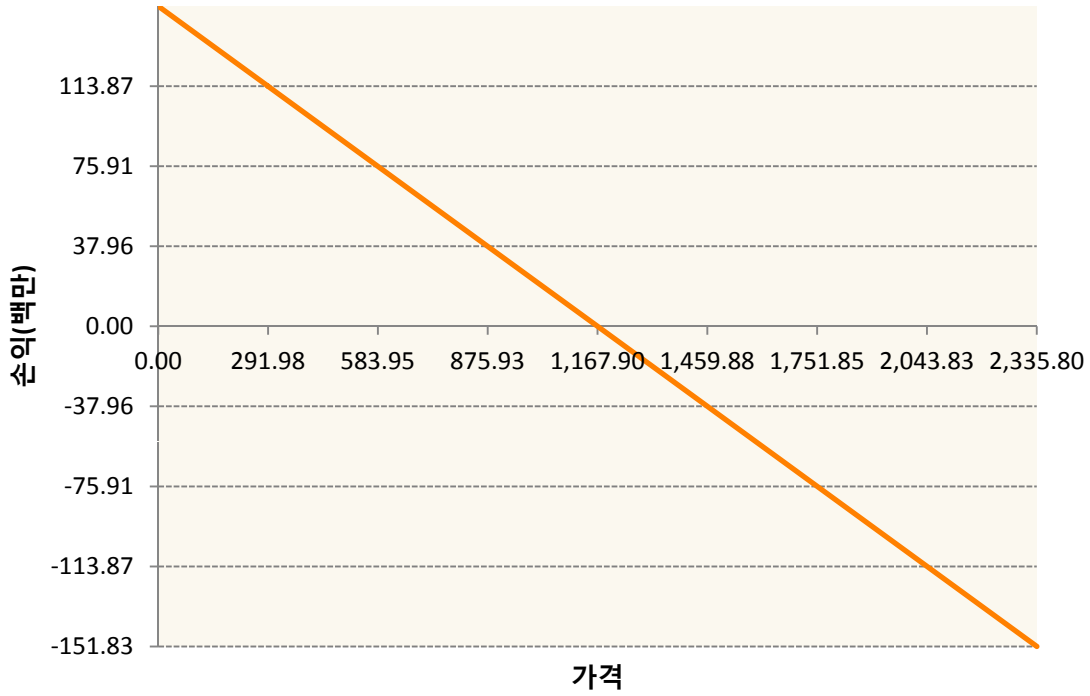


KCH0-COFFEE 'C' FUTURE Mar20

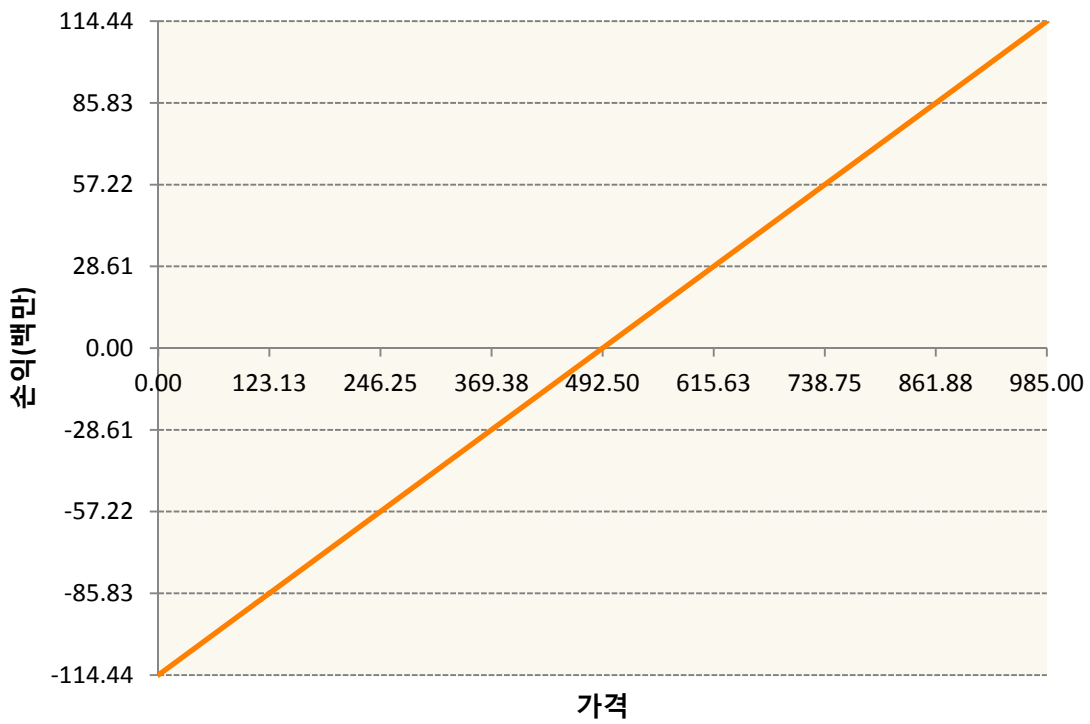




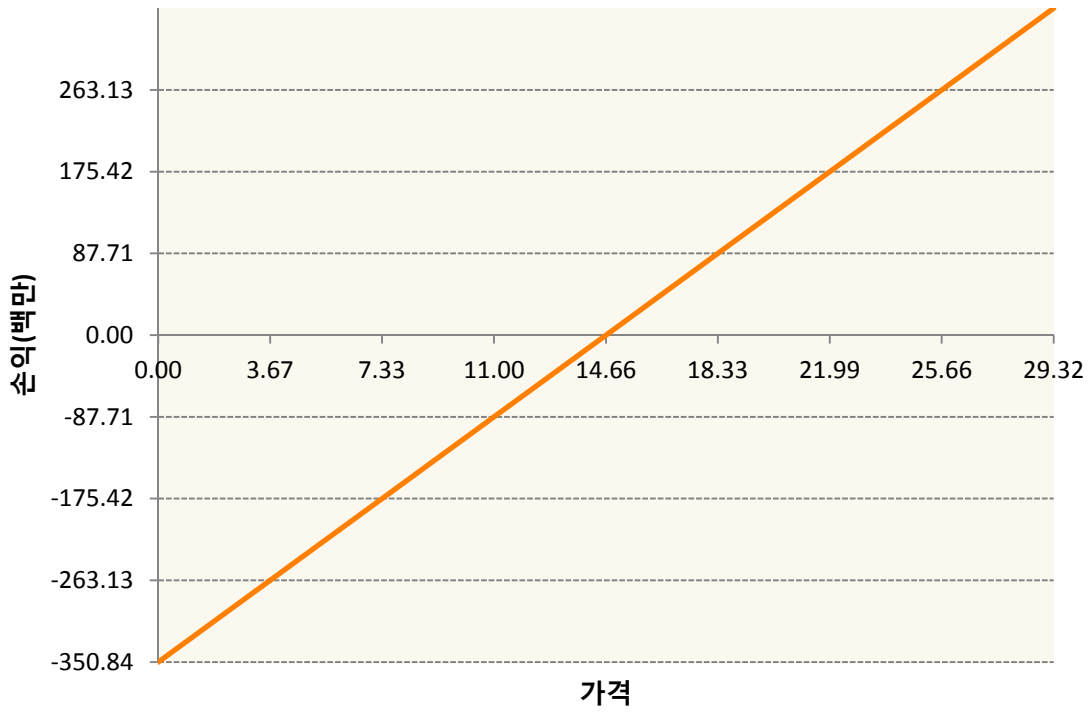
KR4175Q20000-2020-02 달러선물



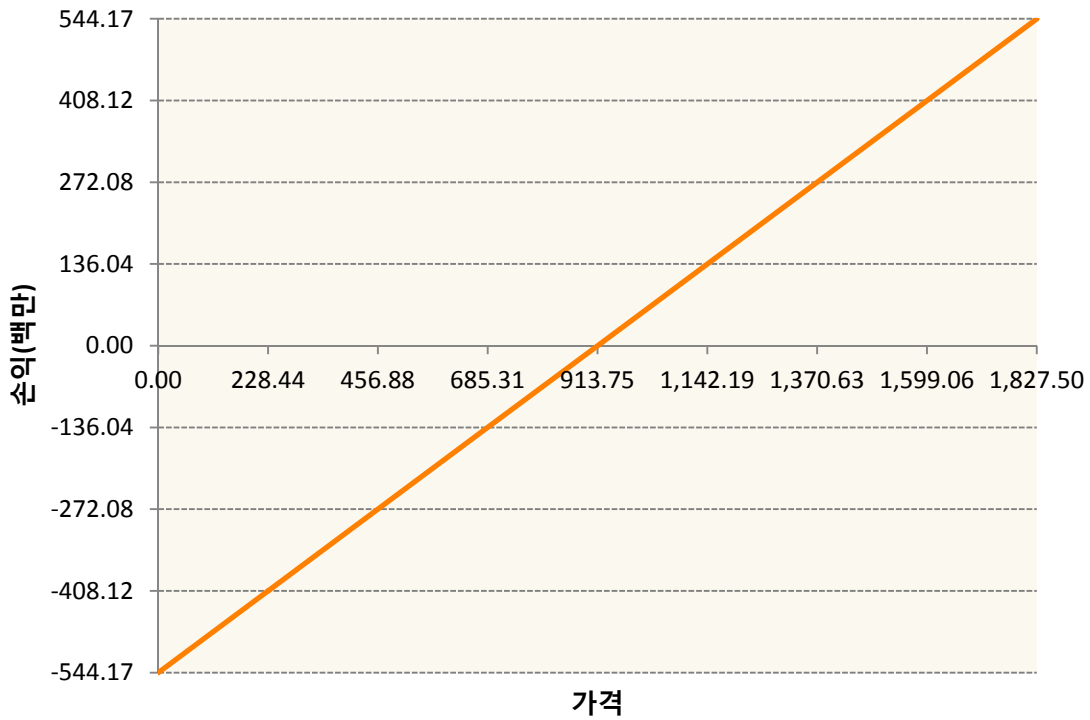
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

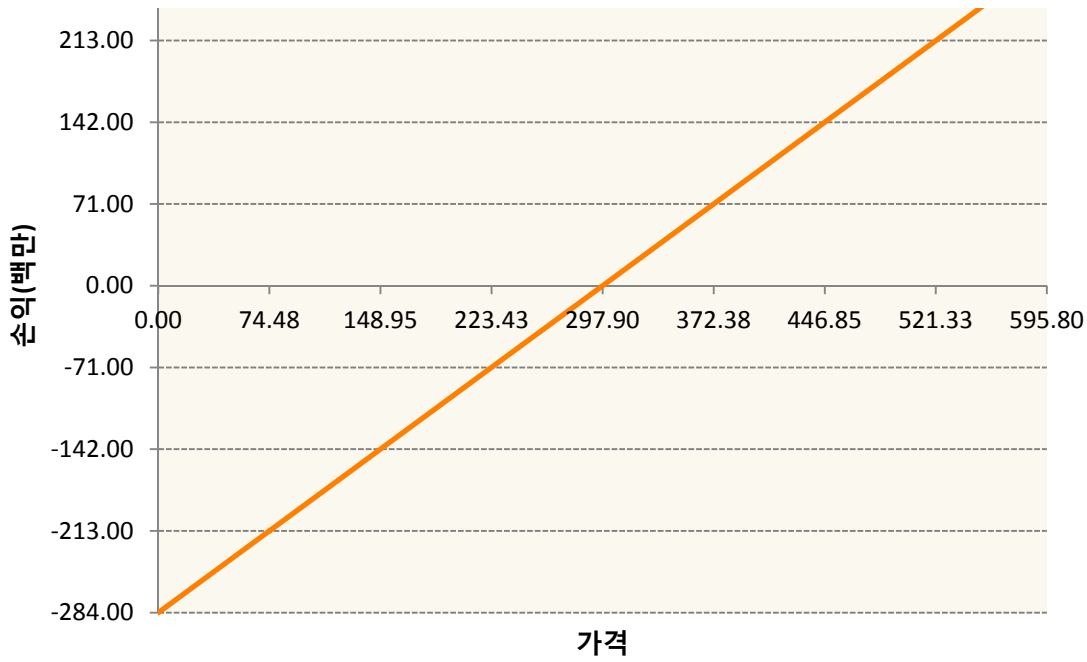


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20

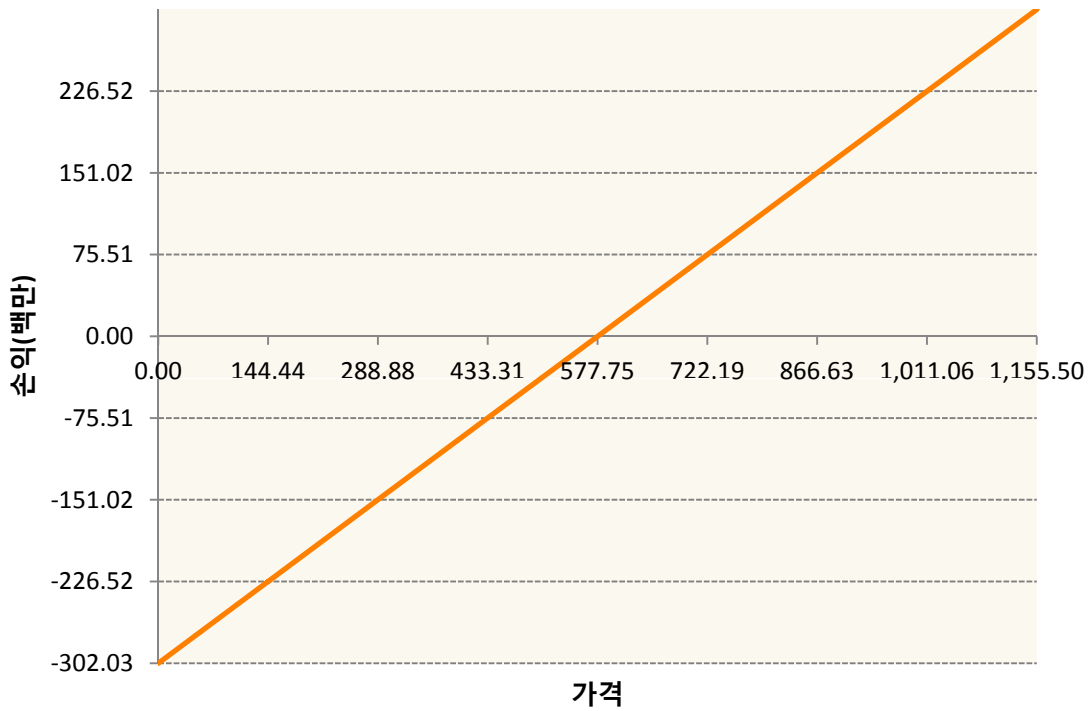


SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





WHO-WHEAT FUTURE(CBT) Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH0	SOYBEAN OIL FUTR Mar20	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**