

공시일	2020-01-29
기준일	2020-01-28

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

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

(단위:백만원)

14

공시일	2020-01-29
기준일	2020-01-28

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

1,128

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

650

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-29
기준일	2020-01-28

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)

807

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-29
기준일	2020-01-28

유로인덱스모(주식-파생형)

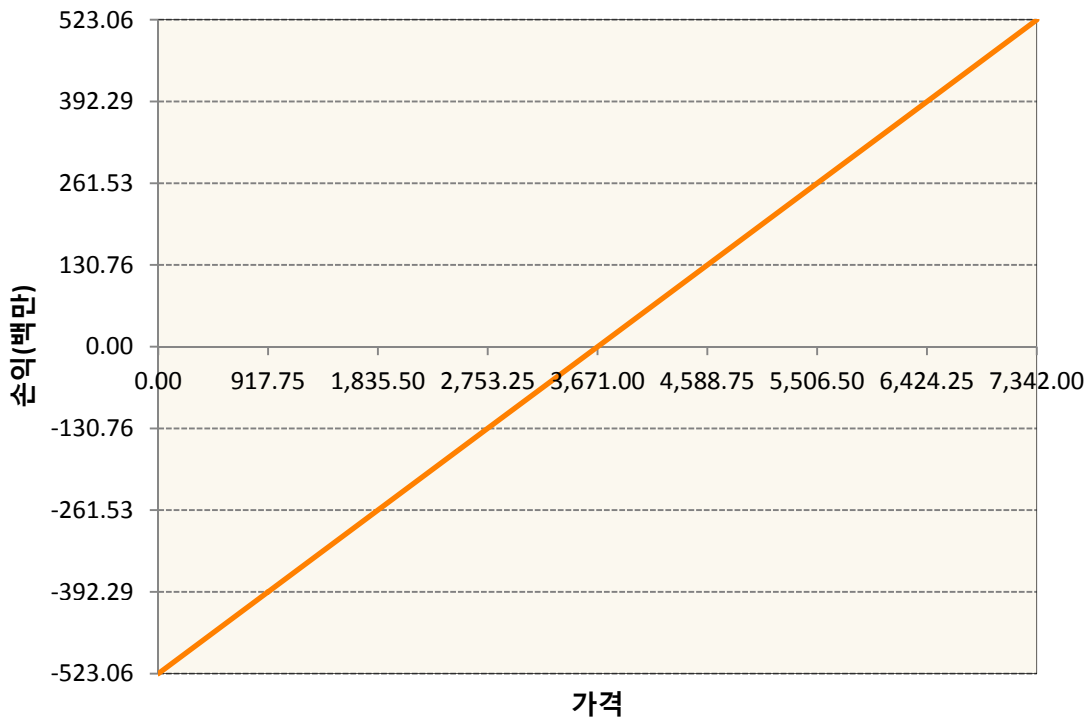
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	523	0	523	

2. 만기시점의 손익구조

VGH0-EURO STOXX 50 Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH0	EURO STOXX 50 Mar20	42
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

29

공시일	2020-01-29
기준일	2020-01-28

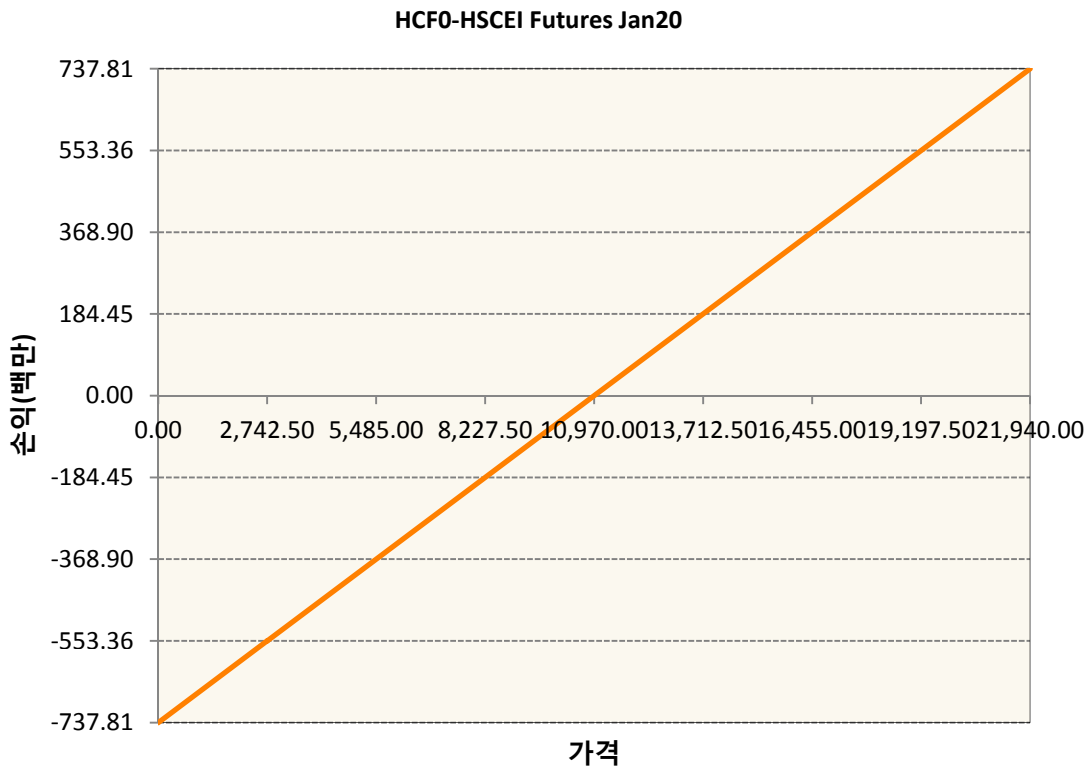
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	738	0	738	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

53

공시일	2020-01-29
기준일	2020-01-28

커버드콜모(주식혼합-파생형)

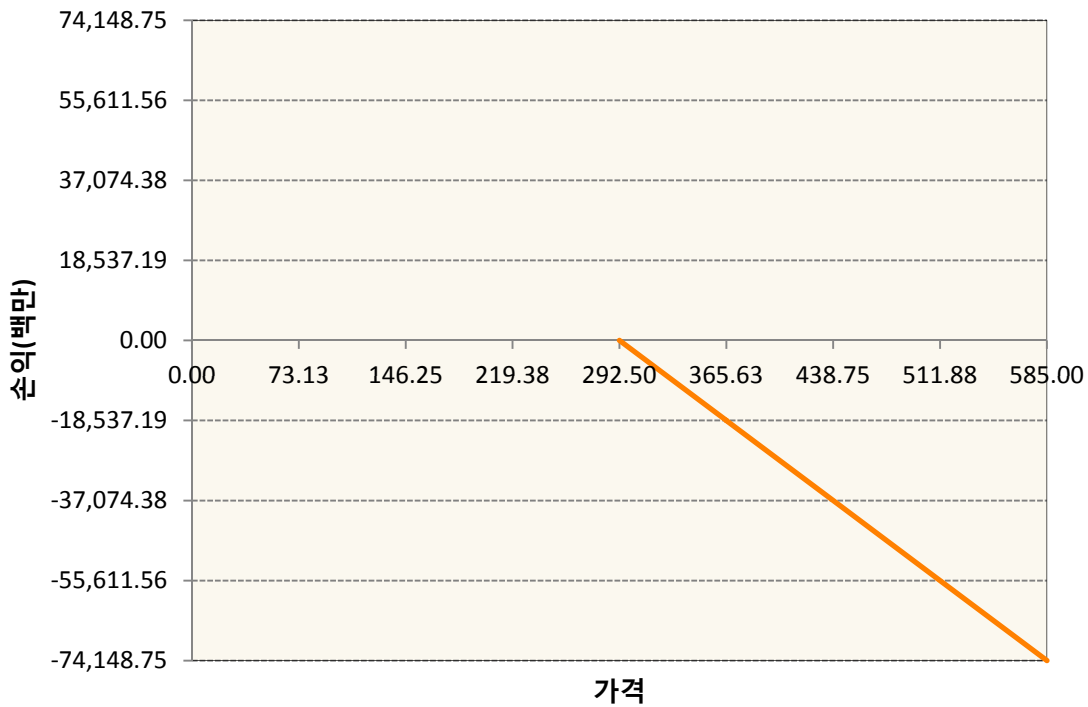
1. 계약금액

(단위:백만원)

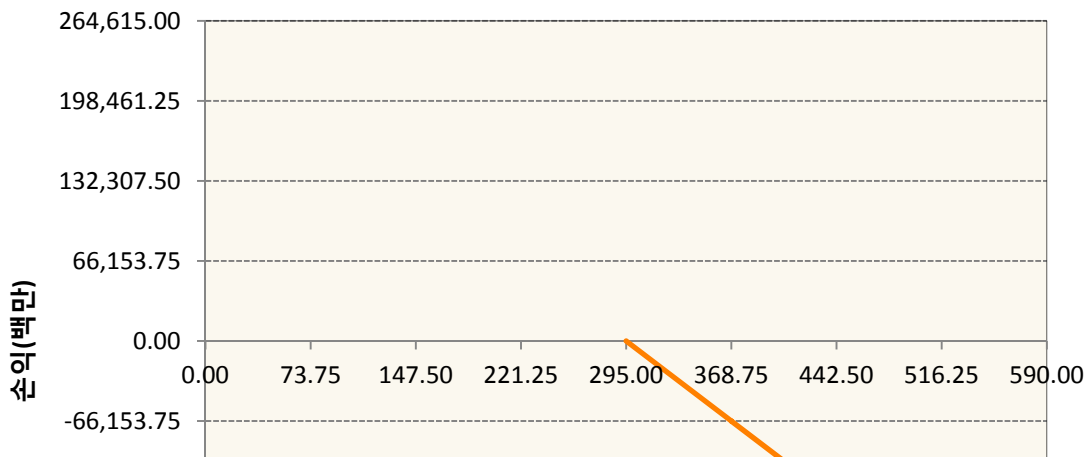
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	455,004	-455,004	장내

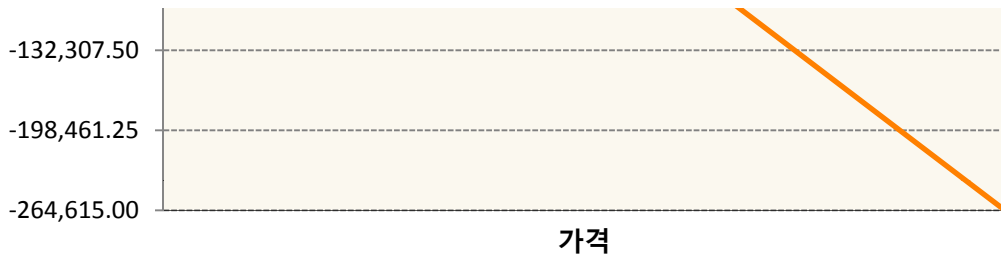
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q22927-2020-02 콜292.5

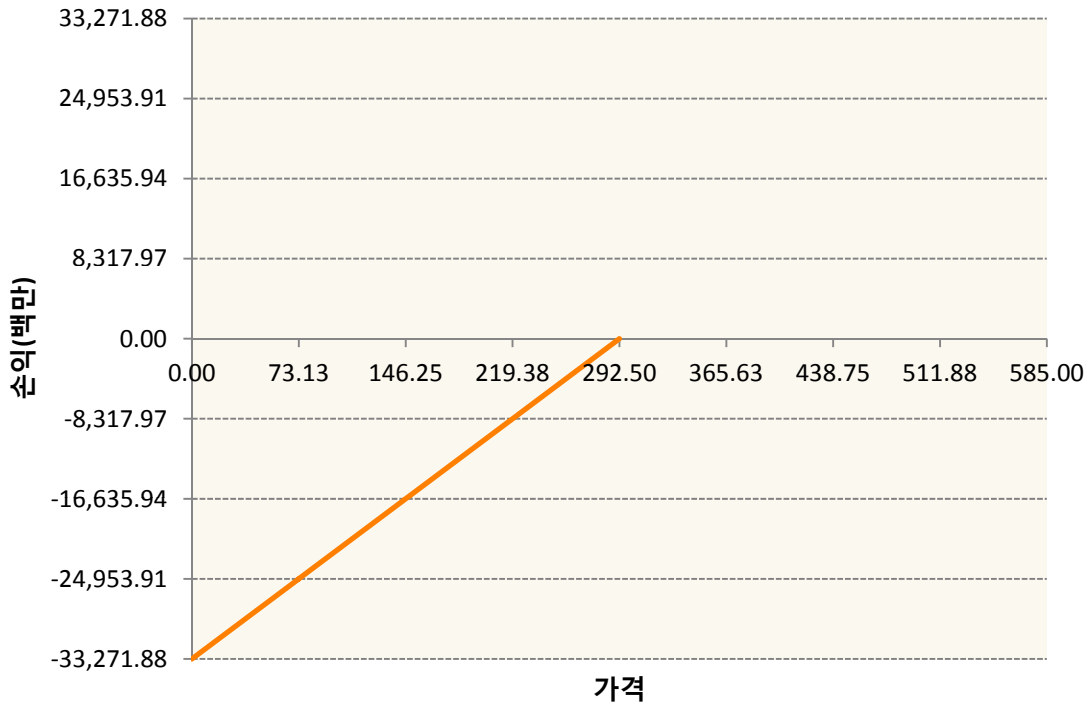


KR4201Q22950-2020-02 콜295

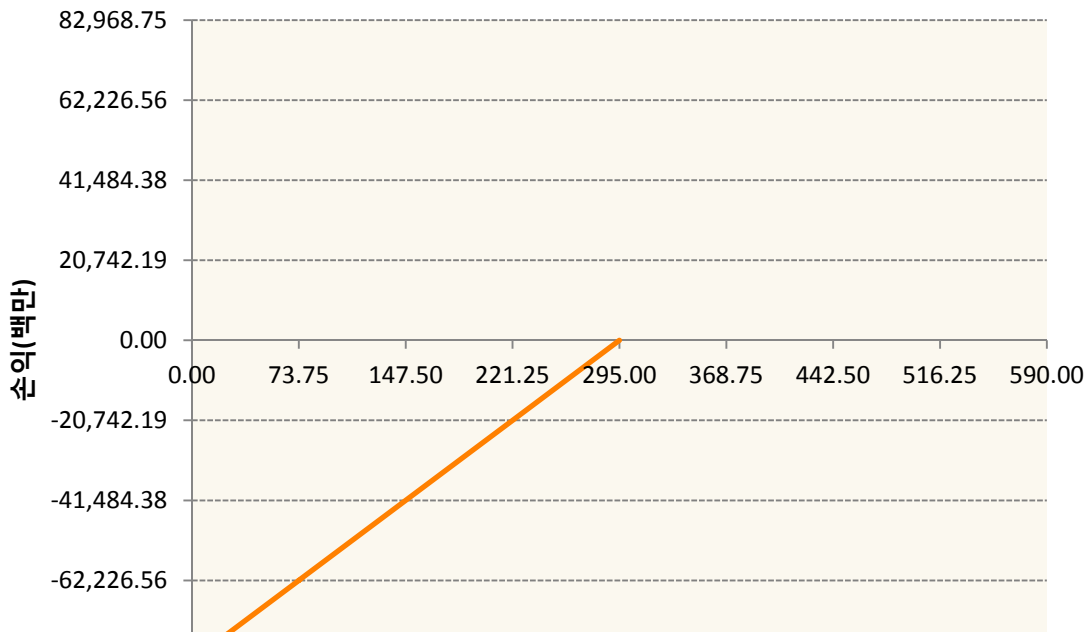




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



KR4301Q22958-2020-02 풋295



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q22927		2020-02 콜292.5						4,614
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,854	1,815	1,765	1,705	1,635	1,558	1,474	
-5.33%	1,690	1,604	1,509	1,406	1,296	1,182	1,063	
-2.67%	1,273	1,138	1,000	859	716	571	425	
0%	470	313	157	0	-157	-313	-470	
2.67%	-762	-900	-1,041	-1,184	-1,330	-1,478	-1,627	
5.33%	-2,350	-2,443	-2,546	-2,656	-2,773	-2,896	-3,023	
8.00%	-4,161	-4,211	-4,272	-4,344	-4,426	-4,516	-4,614	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						15,550
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5,589	5,485	5,345	5,170	4,962	4,725	4,460	
-5.33%	5,174	4,924	4,636	4,316	3,968	3,599	3,210	
-2.67%	4,030	3,597	3,145	2,678	2,199	1,711	1,215	
0%	1,655	1,104	552	0	-553	-1,107	-1,661	
2.67%	-2,228	-2,755	-3,288	-3,827	-4,369	-4,915	-5,462	
5.33%	-7,479	-7,867	-8,284	-8,723	-9,180	-9,652	-10,136	
8.00%	-13,673	-13,898	-14,164	-14,468	-14,803	-15,165	-15,550	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						2,187
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,168	-2,168	-2,170	-2,172	-2,176	-2,181	-2,187	
-5.33%	-1,288	-1,295	-1,304	-1,315	-1,329	-1,346	-1,364	
-2.67%	-472	-498	-526	-556	-587	-619	-652	
0%	120	80	40	0	-40	-80	-120	
2.67%	391	365	337	307	276	243	210	
5.33%	459	451	441	428	412	394	375	
8.00%	467	466	464	461	456	449	440	
KR4301Q22958		2020-02 풋295						5,709
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-5,679	-5,680	-5,681	-5,685	-5,690	-5,698	-5,709	
-5.33%	-3,493	-3,502	-3,516	-3,535	-3,560	-3,590	-3,625	
-2.67%	-1,396	-1,444	-1,498	-1,557	-1,622	-1,690	-1,762	
0%	290	194	97	0	-98	-195	-293	
2.67%	1,206	1,124	1,039	952	863	772	680	

5.33%	1,490	1,459	1,420	1,375	1,323	1,267	1,205
8.00%	1,536	1,530	1,521	1,507	1,487	1,463	1,433

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

(단위:백만원)

28,311

공시일	2020-01-29
기준일	2020-01-28

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

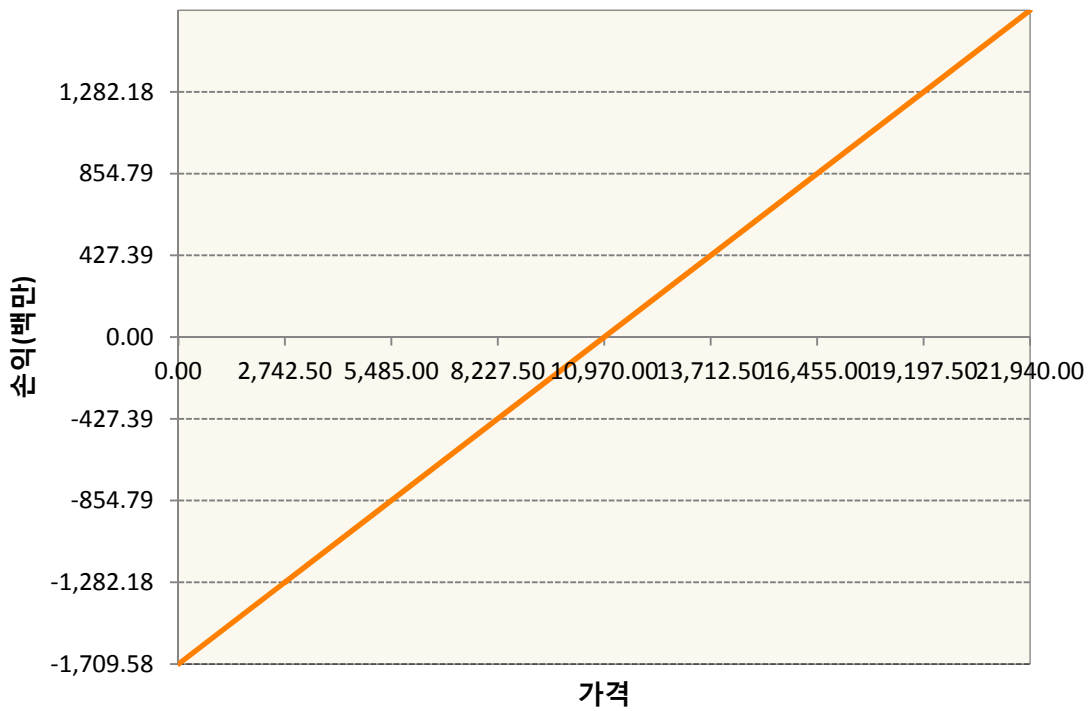
1. 계약금액

(단위:백만원)

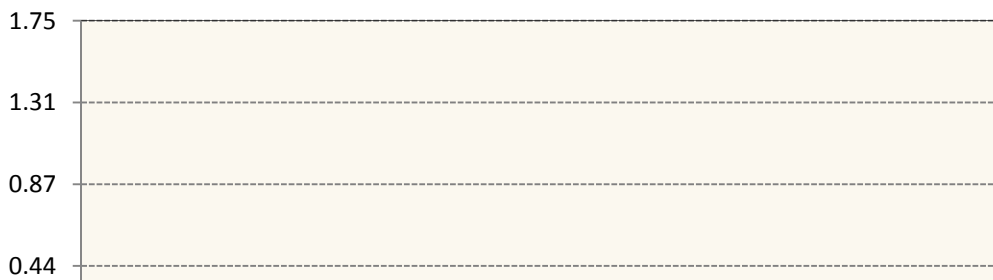
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,710	0	1,710	장내
누계	유가증권	옵션	0	60	-60	장내
누계	통화	선도	0	2,130	-2,130	장외

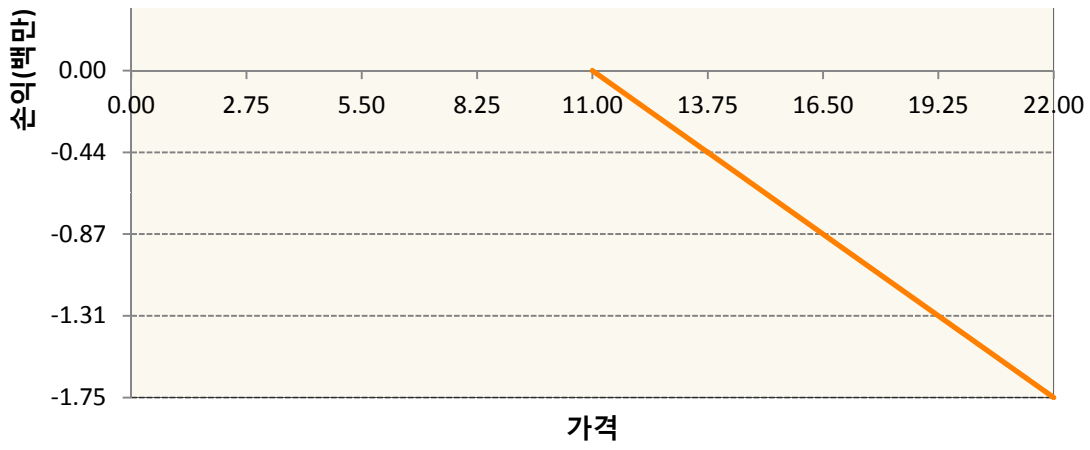
2. 만기시점의 손익구조

HCFO-HSCEI Futures Jan20

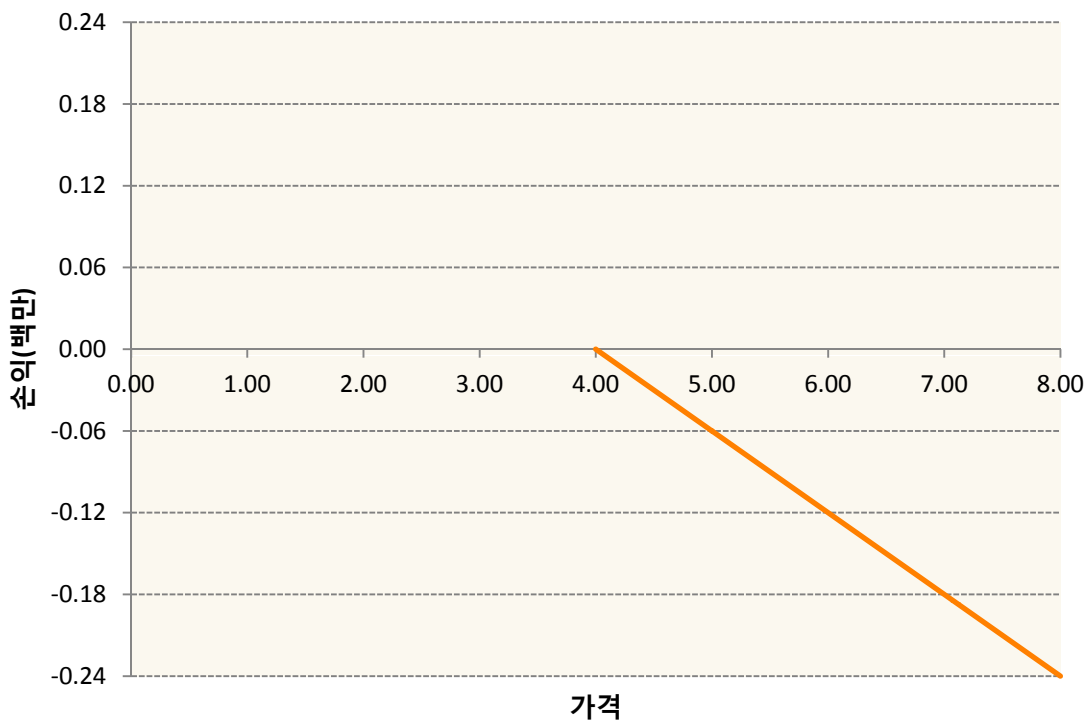


OHHIF0-C112-HSCEI

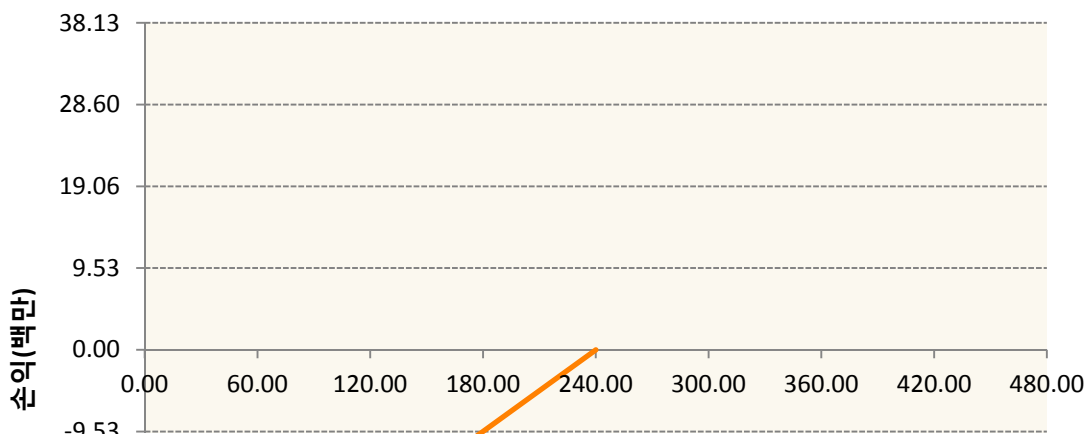


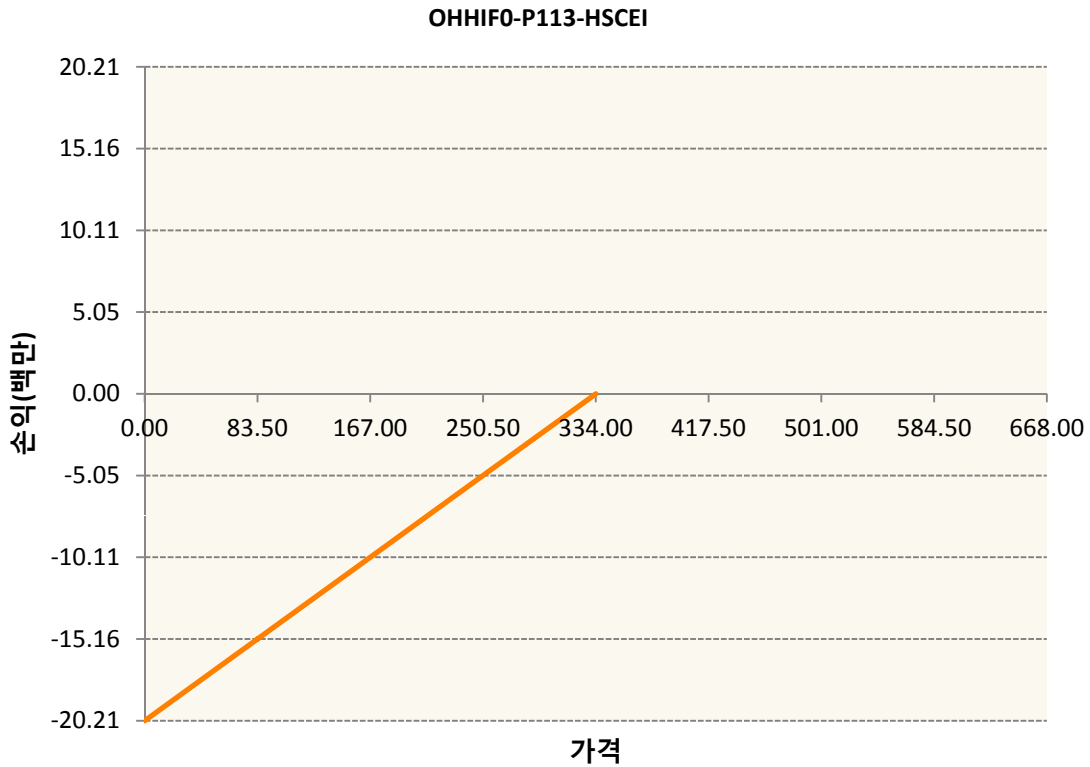
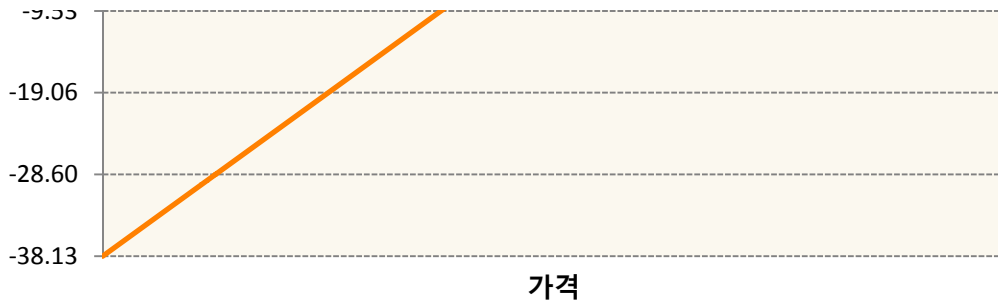


OHHIF0-C113-HSCEI



OHHIF0-P112-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	170
HCF0 HSCEI Futures Jan20	137
OHHIF0-C11 HSCEI	0.1
OHHIF0-C11 HSCEI	0
OHHIF0-P11 HSCEI	3
OHHIF0-P11 HSCEI	2

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

공시일	2020-01-29
기준일	2020-01-28

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

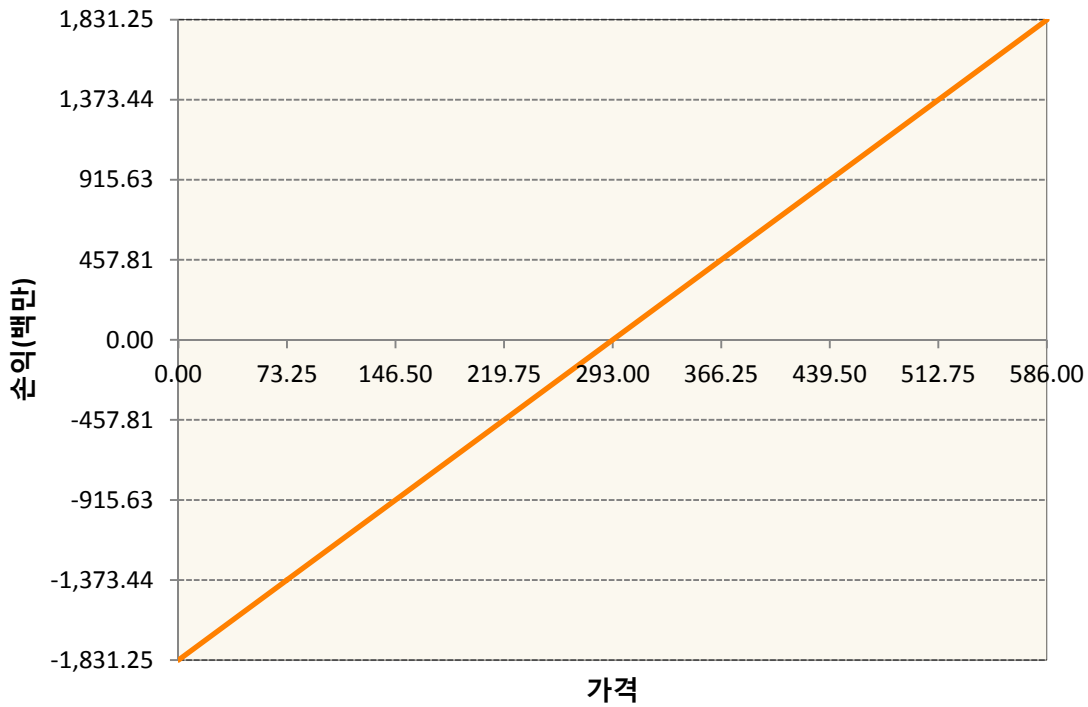
1. 계약금액

(단위:백만원)

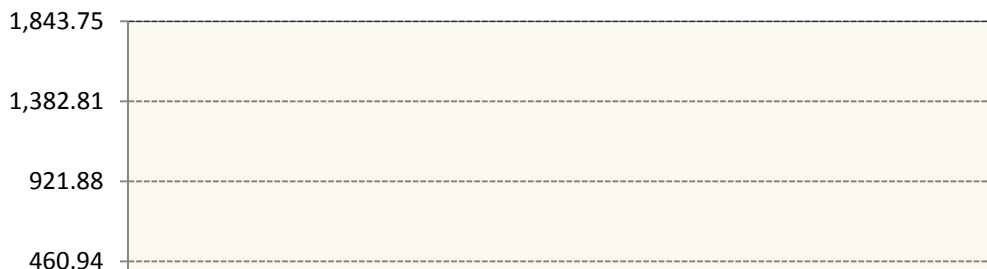
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,831	0	1,831	장내
누계	유가증권	스왑	3,625	0	3,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,608	-3,608	장내

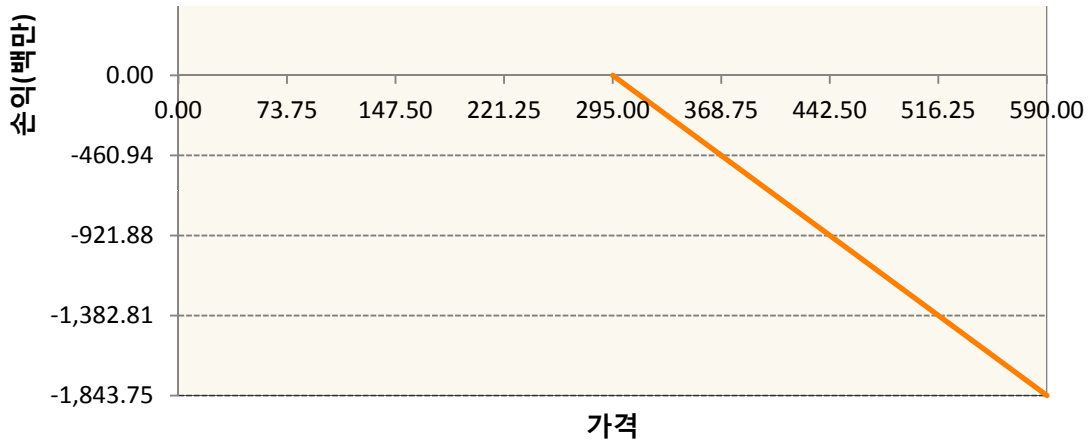
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

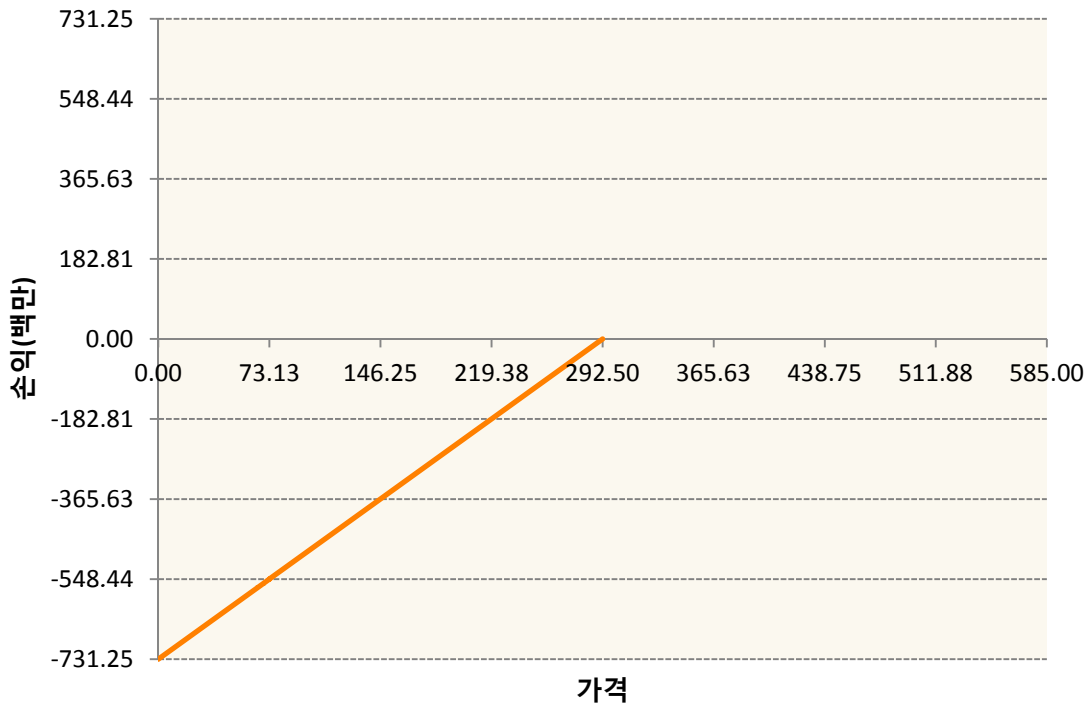


KR4201Q22950-2020-02 콜295

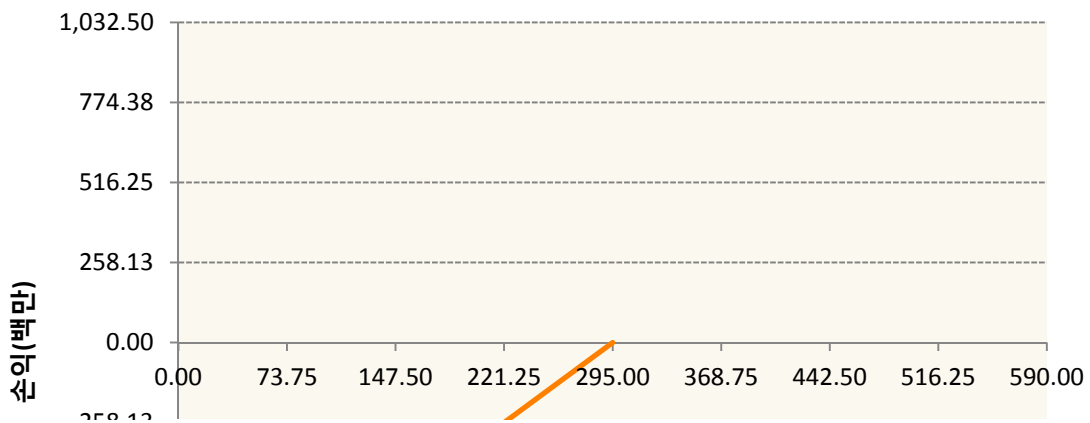




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



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						146
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-146	-146	-146	-146	-146	-146	-146	
-5.33%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98	
-2.67%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	49	49	49	49	49	49	49	
5.33%	98	98	98	98	98	98	98	
8.00%	146	146	146	146	146	146	146	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						108
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	39	38	37	36	35	33	31	
-5.33%	36	34	32	30	28	25	22	
-2.67%	28	25	22	19	15	12	8	
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12	
2.67%	-16	-19	-23	-27	-30	-34	-38	
5.33%	-52	-55	-58	-61	-64	-67	-71	
8.00%	-95	-97	-99	-101	-103	-106	-108	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						48
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
-5.33%	-28	-28	-29	-29	-29	-30	-30
-2.67%	-10	-11	-12	-12	-13	-14	-14
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	9	8	7	7	6	5	5
5.33%	10	10	10	9	9	9	8
8.00%	10	10	10	10	10	10	10
KR4301Q22958 2020-02 풋295							71
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
-5.33%	-43	-44	-44	-44	-44	-45	-45
-2.67%	-17	-18	-19	-19	-20	-21	-22
0%	4	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	15	14	13	12	11	10	8
5.33%	19	18	18	17	16	16	15
8.00%	19	19	19	19	19	18	18

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

(단위:백만원)

664

공시일	2020-01-29
기준일	2020-01-28

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

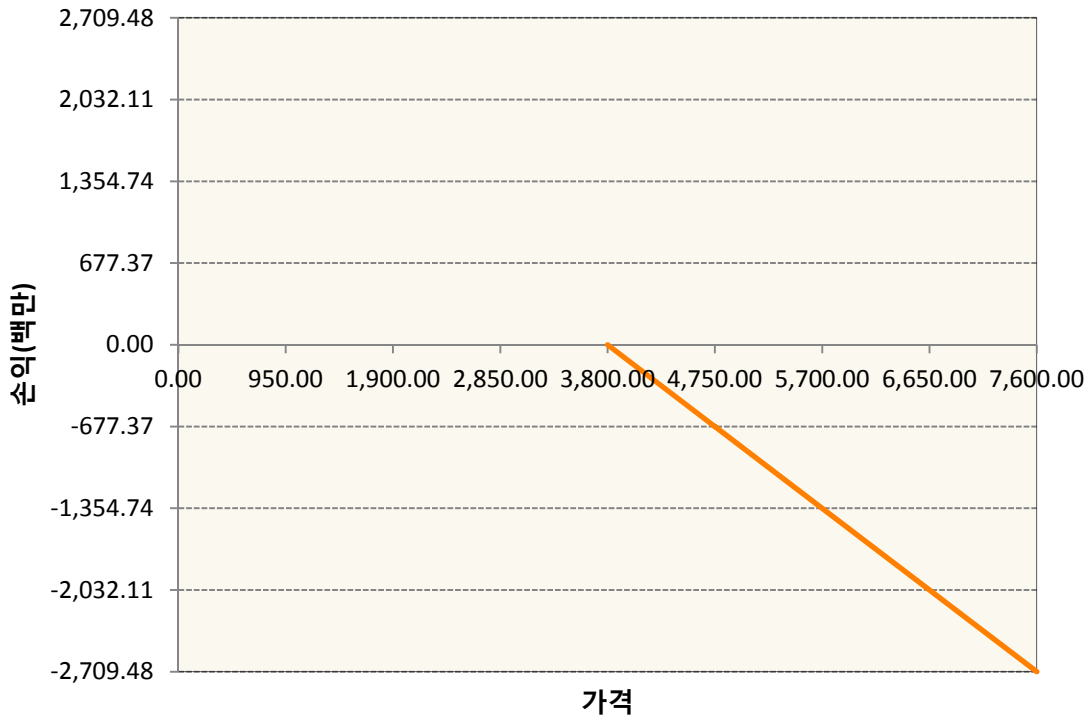
1. 계약금액

(단위:백만원)

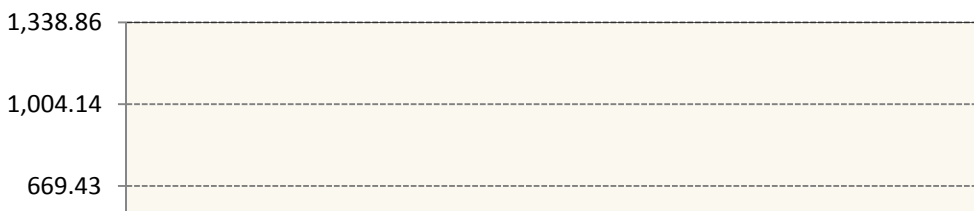
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	900	0	900	
누계	유가증권	스왑	13,546	0	13,546	장외
누계	유가증권	옵션	0	8,097	-8,097	장내
누계	통화	선도	0	3,402	-3,402	장외

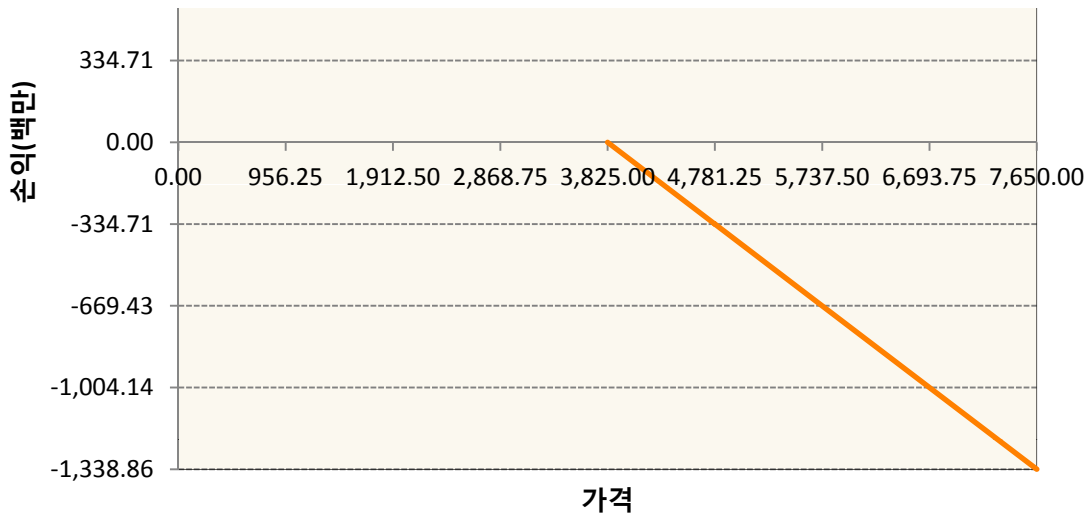
2. 만기시점의 손익구조

OESXG0-C3800-EURO STOXX 50

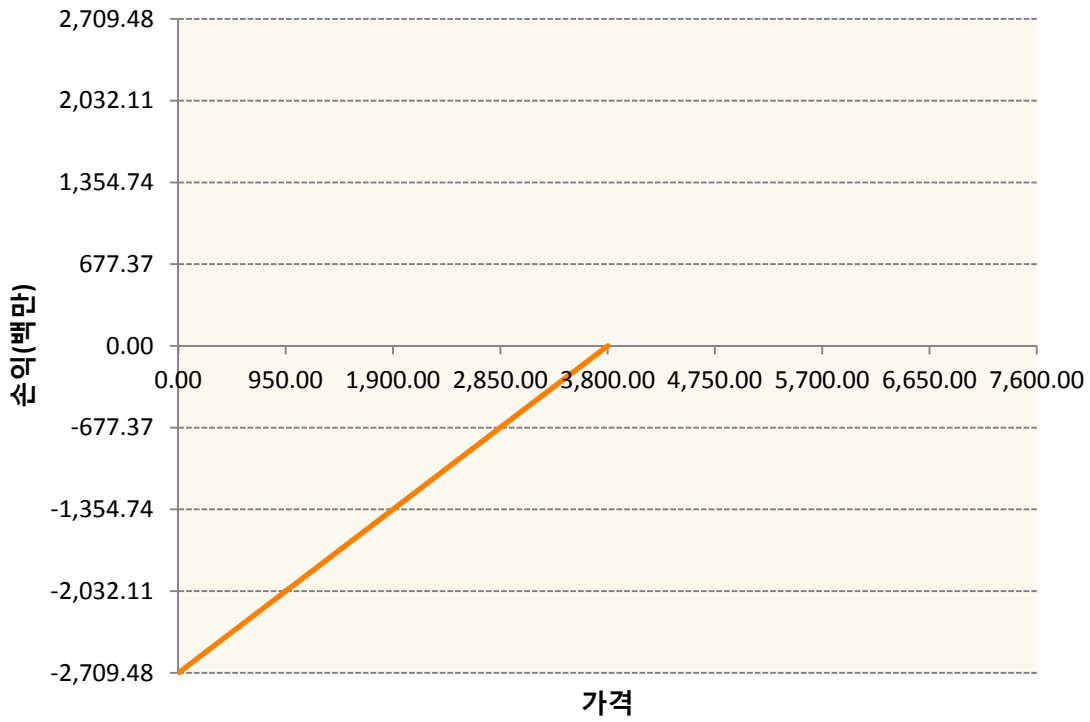


OESXG0-C3825-EURO STOXX 50

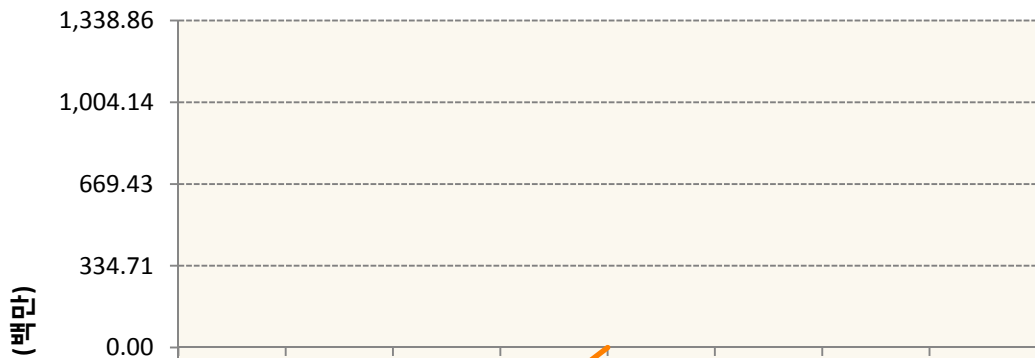


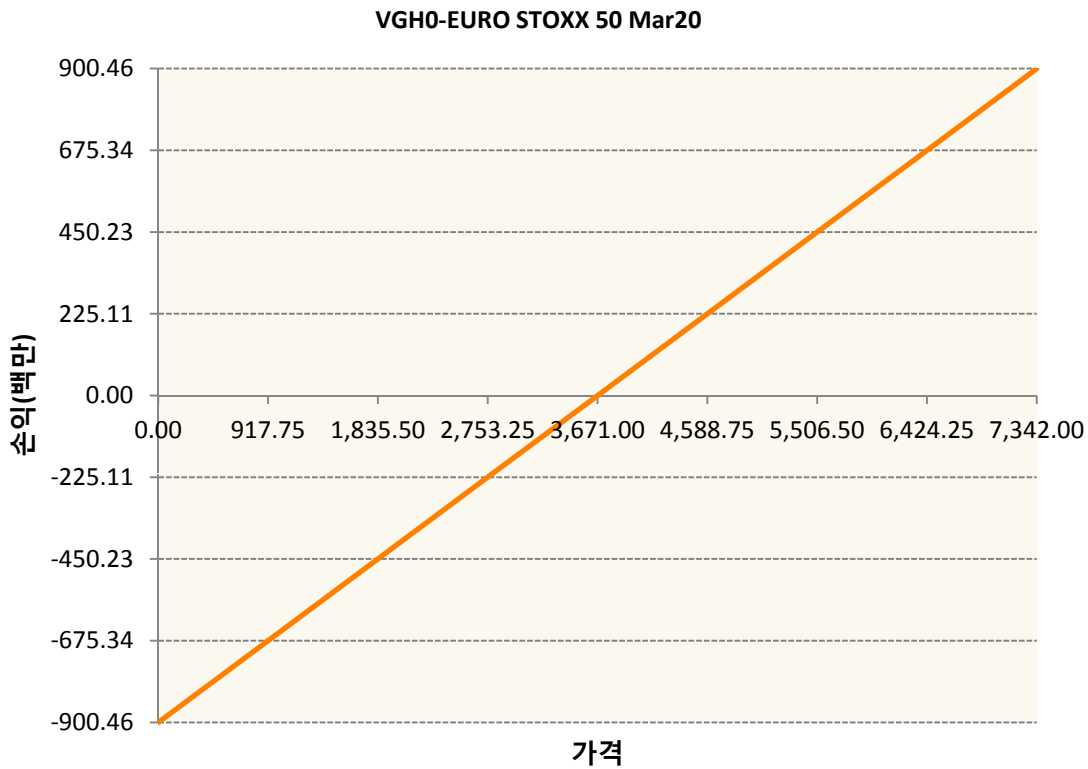
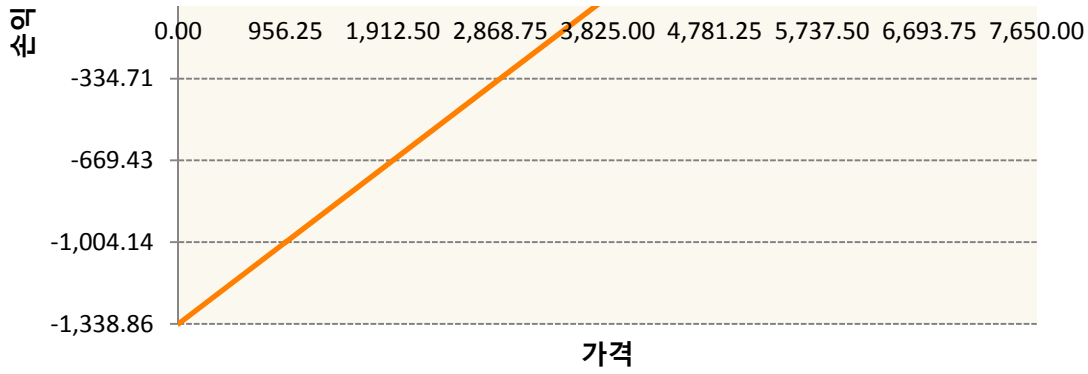


OESXG0-P3800-EURO STOXX 50



OESXG0-P3825-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	27
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	72

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

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

(단위:백만원)

902

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

(단위:백만원)

79

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

(단위:백만원)

117

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

(단위:백만원)

42

공시일	2020-01-29
기준일	2020-01-28

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

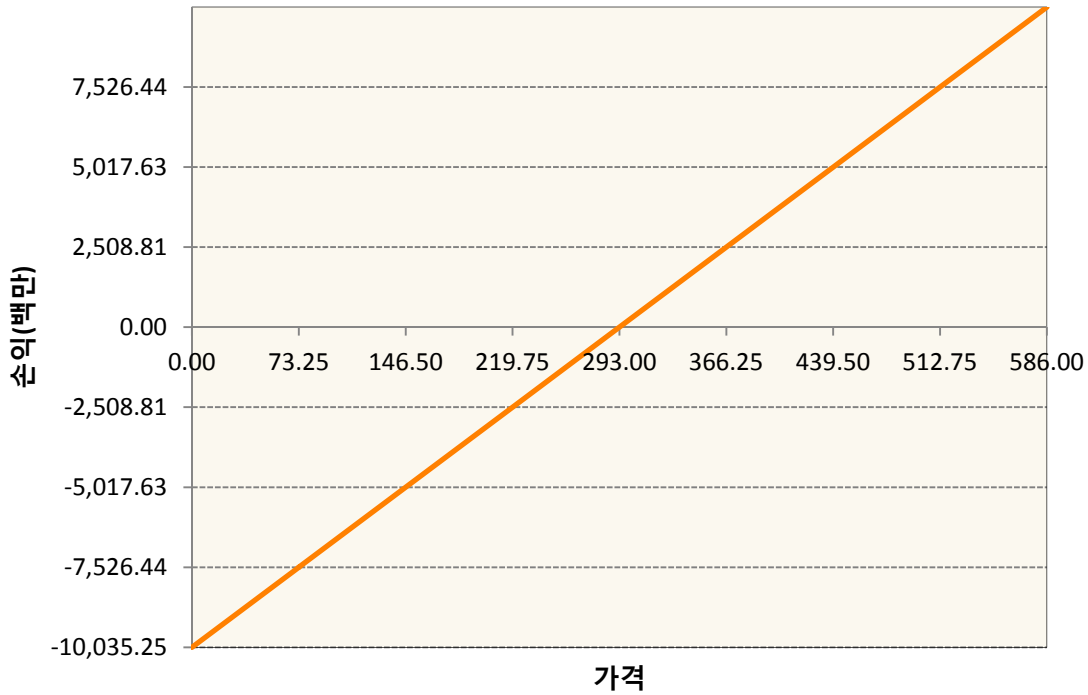
1. 계약금액

(단위:백만원)

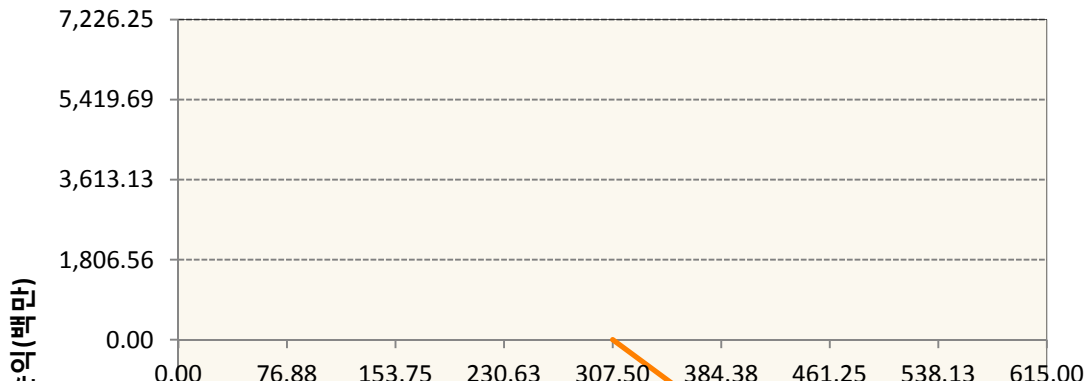
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,035	0	10,035	장내
누계	유가증권	옵션	2,944	20,789	-17,845	장내

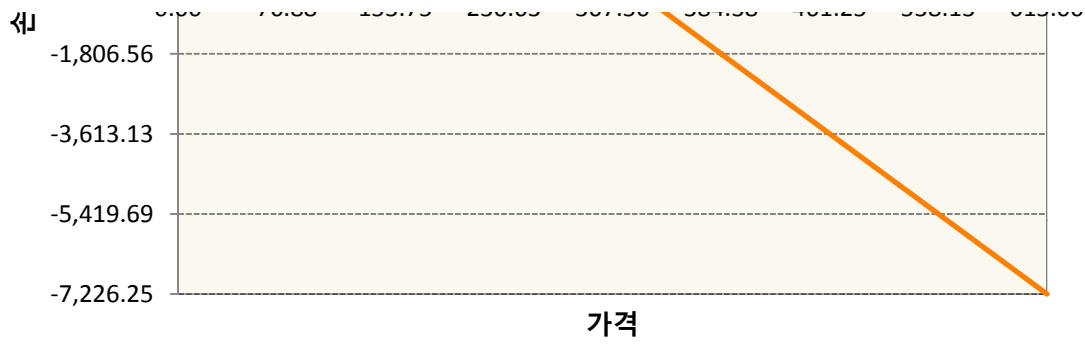
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

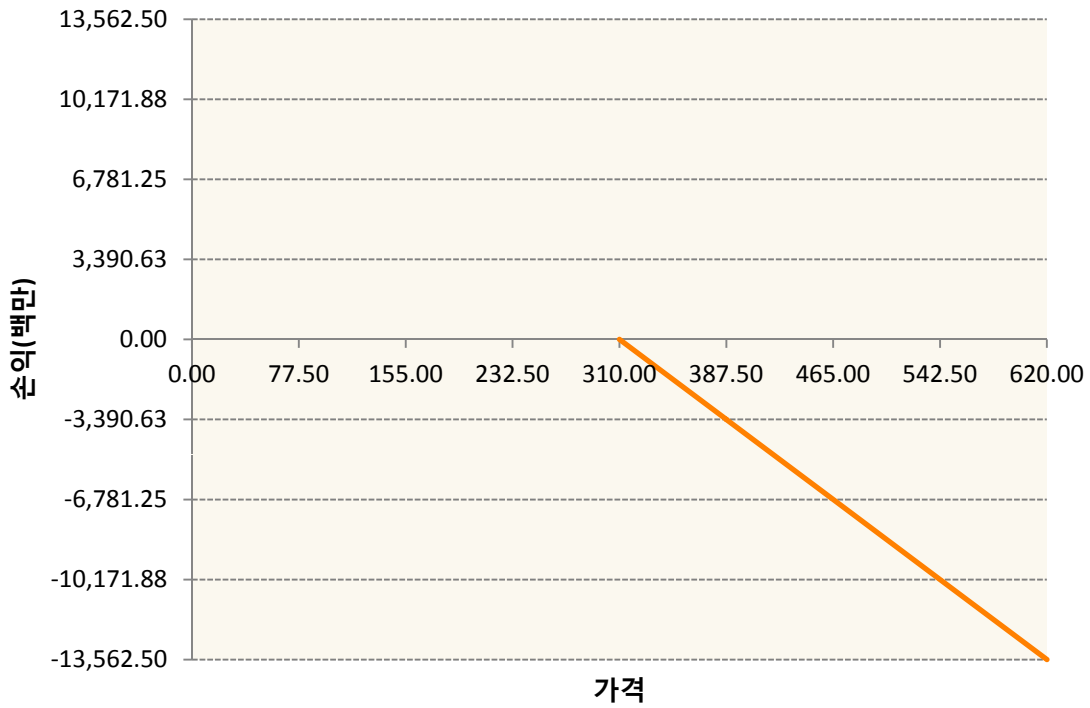


KR4201Q23073-2020-02 콜307.5

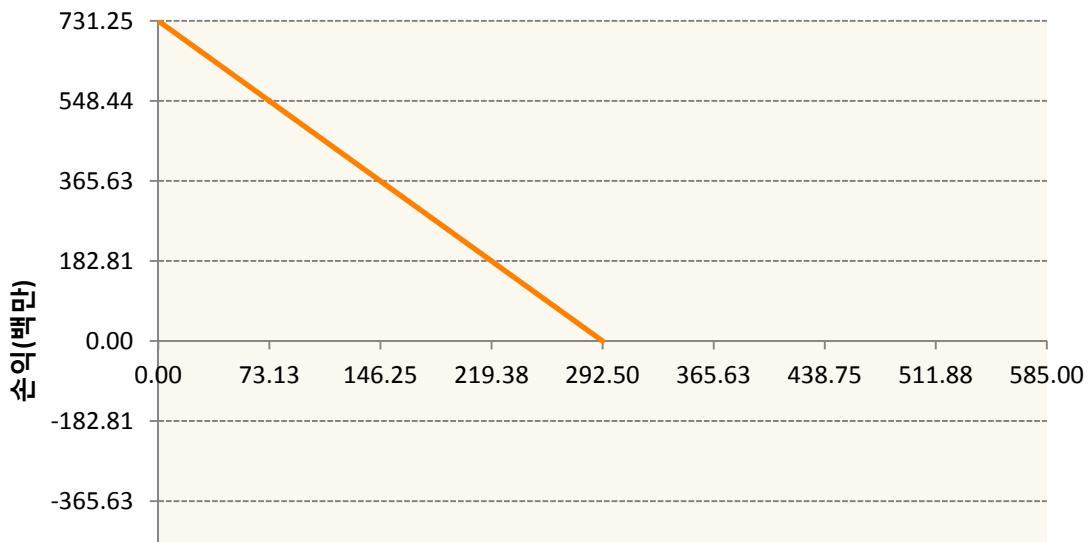


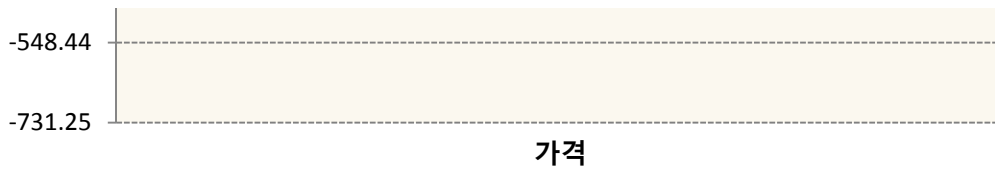


KR4201Q23107-2020-02 콜310

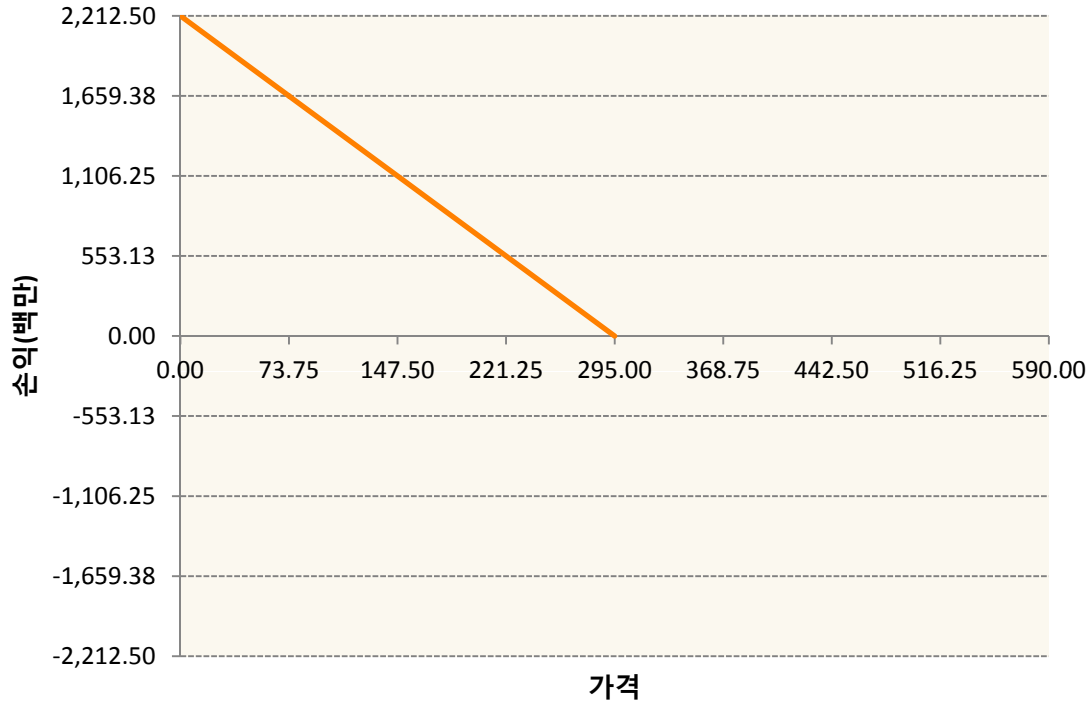


KR4301Q22925-2020-02 풋292.5





KR4301Q22958-2020-02 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						802
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-802	-802	-802	-802	-802	-802	-802	
-5.33%	-535	-535	-535	-535	-535	-535	-535	
-2.67%	-267	-267	-267	-267	-267	-267	-267	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	267	267	267	267	267	267	267	
5.33%	535	535	535	535	535	535	535	
8.00%	802	802	802	802	802	802	802	
KR4201Q23073		2020-02 콜307.5						291
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	56	56	55	54	52	49	46	
-5.33%	55	53	50	47	43	38	32	
-2.67%	49	44	38	32	24	16	7	

0%	30	21	11	0	-11	-23	-35
2.67%	-13	-27	-41	-55	-69	-83	-98
5.33%	-91	-107	-122	-137	-152	-168	-183
8.00%	-208	-221	-234	-248	-263	-277	-291
KR4201Q23107 2020-02 콜310							498
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	84	83	82	80	77	74	69
-5.33%	82	80	76	71	65	57	47
-2.67%	74	68	59	48	36	22	7
0%	49	34	18	0	-19	-39	-60
2.67%	-15	-38	-63	-87	-113	-138	-164
5.33%	-139	-167	-196	-224	-253	-281	-310
8.00%	-333	-360	-387	-414	-442	-470	-498
KR4301Q22925 2020-02 풋292.5							48
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	48	48	48	48	48	48	48
-5.33%	28	28	29	29	29	30	30
-2.67%	10	11	12	12	13	14	14
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-9	-8	-7	-7	-6	-5	-5
5.33%	-10	-10	-10	-9	-9	-9	-8
8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
KR4301Q22958 2020-02 풋295							152
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	151	151	152	152	152	152	152
-5.33%	93	93	94	94	95	96	97
-2.67%	37	38	40	42	43	45	47
0%	-8	-5	-3	0	3	5	8
2.67%	-32	-30	-28	-25	-23	-21	-18
5.33%	-40	-39	-38	-37	-35	-34	-32
8.00%	-41	-41	-41	-40	-40	-39	-38

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

(단위:백만원)

1,384

공시일	2020-01-29
기준일	2020-01-28

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	209,658	0	209,658	

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	2020-01-29
기준일	2020-01-28

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	218,841	0	218,841	

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	2020-01-29
기준일	2020-01-28

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	537,418	0	537,418	
누계	통화	선도	0	524,926	-524,926	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	188
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,824
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,824
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,353
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,542
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	1,638
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	1,544
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	941
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	188
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	2,015
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	941
FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E	3,765
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,883
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	2,015
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	188
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	188
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	1,130
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	1,694
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	282
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E	1,883
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E	3,238
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,516
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,412
FX21020F02 KRW/USD 28-02-20E	1,883
FX21020F03 KRW/USD 28-02-20E	2,918

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

13,850

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

(단위:백만원)

119

공시일	2020-01-29
기준일	2020-01-28

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

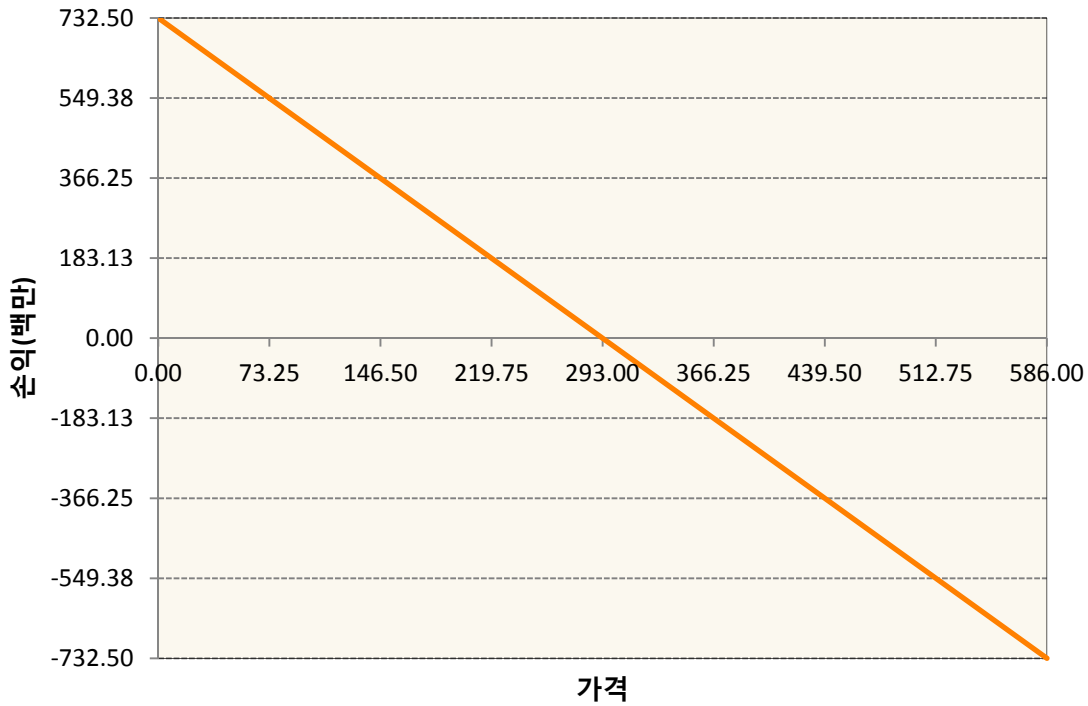
1. 계약금액

(단위:백만원)

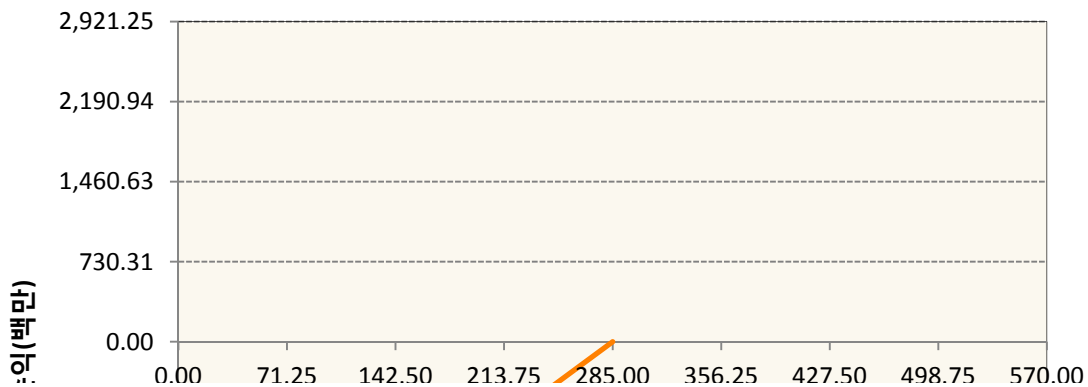
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	733	-733	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,784	-3,784	장내

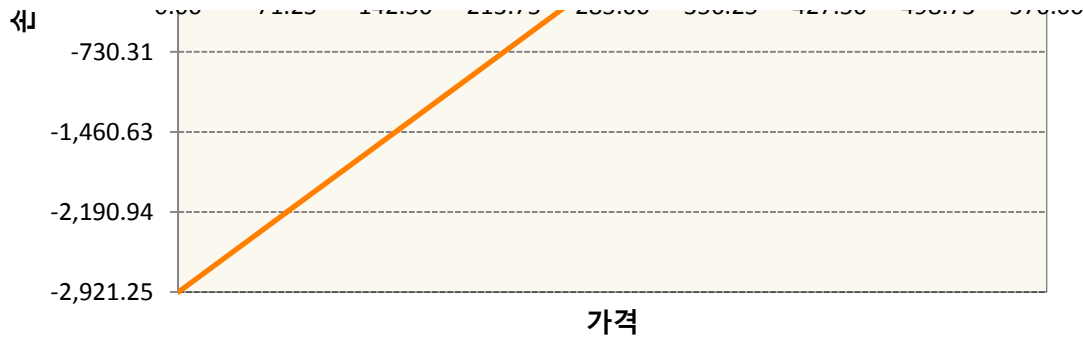
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

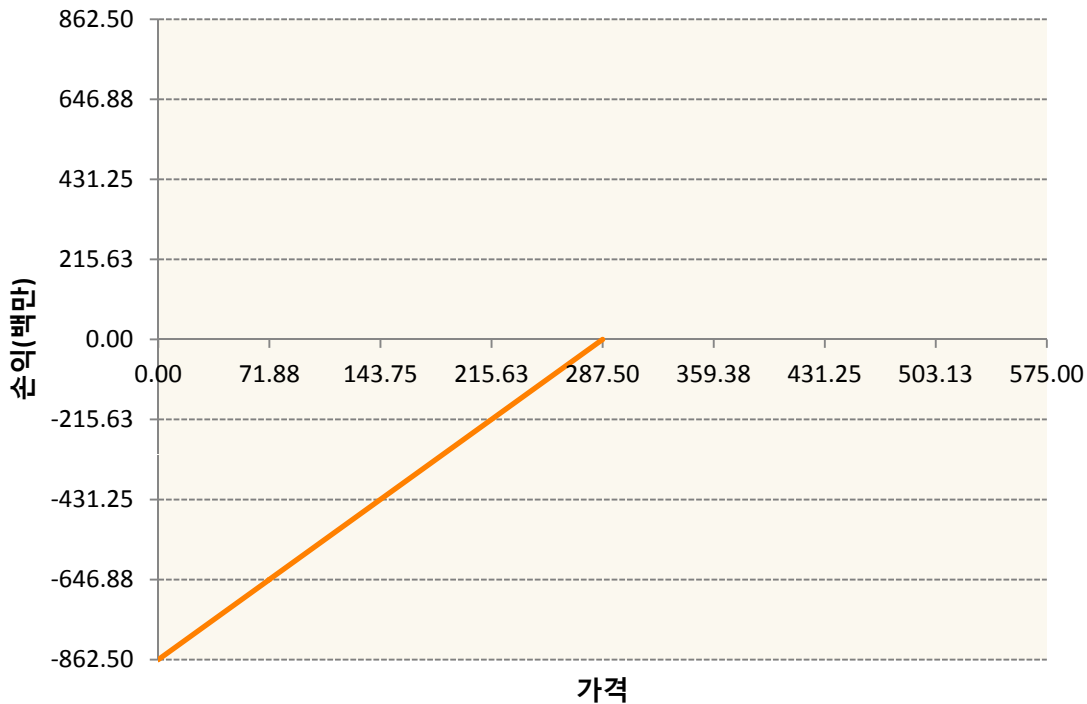


KR4301Q22859-2020-02 풋285





KR4301Q22875-2020-02 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						59
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	59	59	59	59	59	59	59	
-5.33%	39	39	39	39	39	39	39	
-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%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39	
8.00%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59	
KR4301Q22859		2020-02 풋285						153
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-147	-147	-148	-149	-150	-151	-153
-5.33%	-72	-75	-77	-79	-82	-85	-88
-2.67%	-18	-21	-25	-28	-32	-35	-39
0%	7	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	14	13	12	11	10	8	6
5.33%	14	14	14	14	13	13	12
8.00%	14	14	14	14	14	14	14

KR4301Q22875 2020-02 풋287.5 50

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-48	-48	-49	-49	-49	-49	-50
-5.33%	-26	-26	-27	-27	-28	-29	-29
-2.67%	-7	-8	-9	-10	-11	-12	-13
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	6	5	5	5	4	3	3
5.33%	6	6	6	6	6	5	5
8.00%	6	6	6	6	6	6	6

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

(단위:백만원)

233

공시일	2020-01-29
기준일	2020-01-28

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	12,418	0	12,418	
누계	통화	선도	0	12,579	-12,579	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	293
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	348
FX21020F00(KRW/USD 13-02-20E	126
FX21020F03(KRW/USD 29-01-20E	34
FX21020F03(KRW/USD 28-02-20E	205
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

332

공시일	2020-01-29
기준일	2020-01-28

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

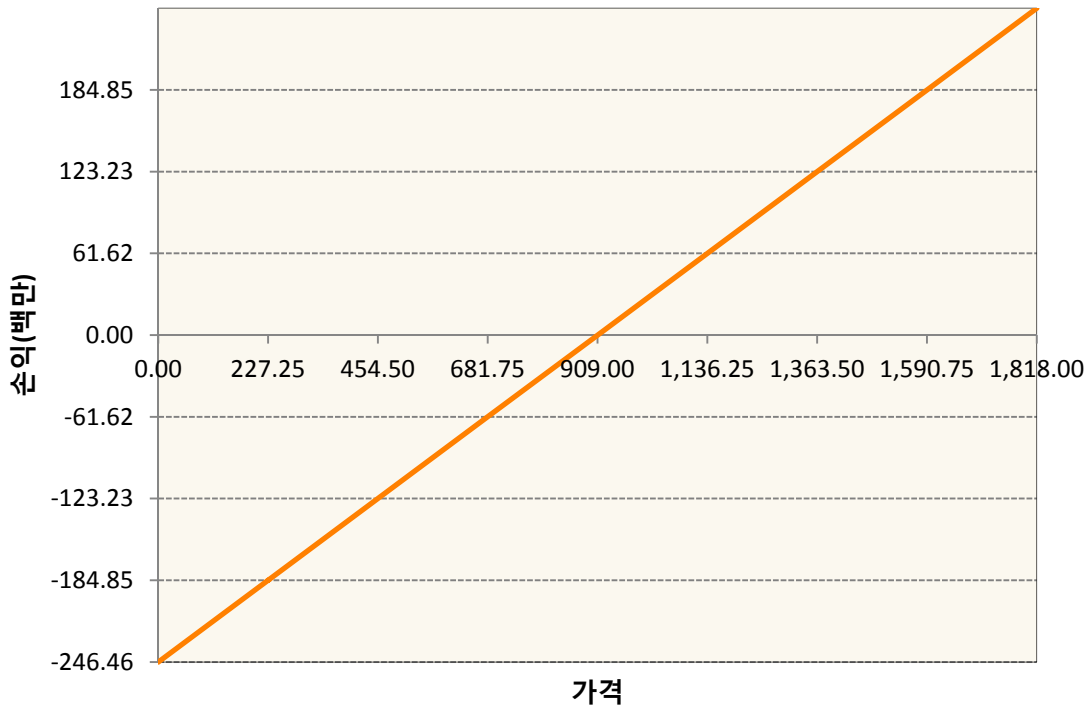
1. 계약금액

(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	2020-01-29
기준일	2020-01-28

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

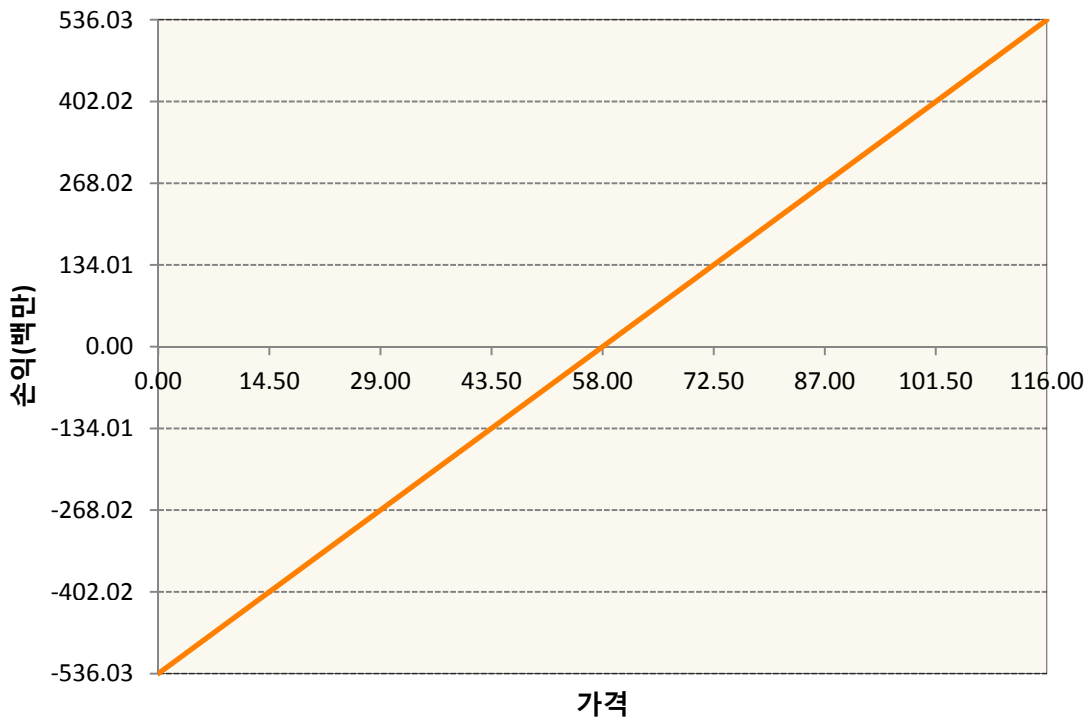
1. 계약금액

(단위:백만원)

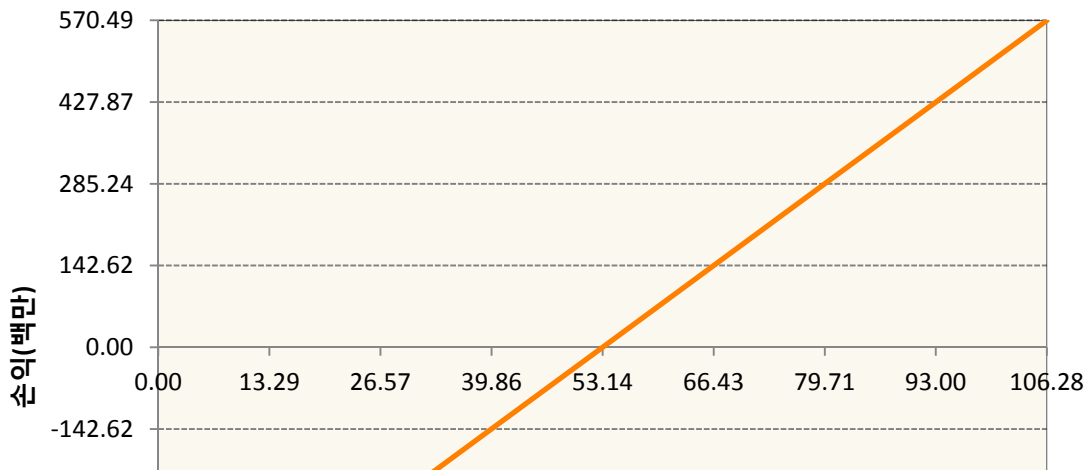
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,175	188	1,986	

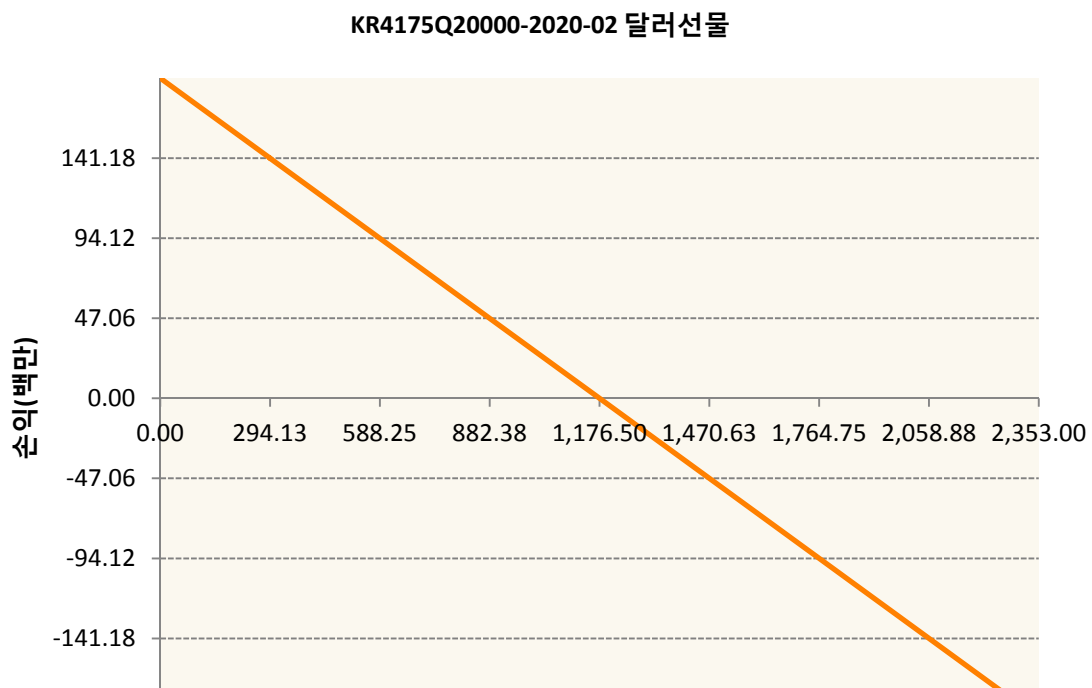
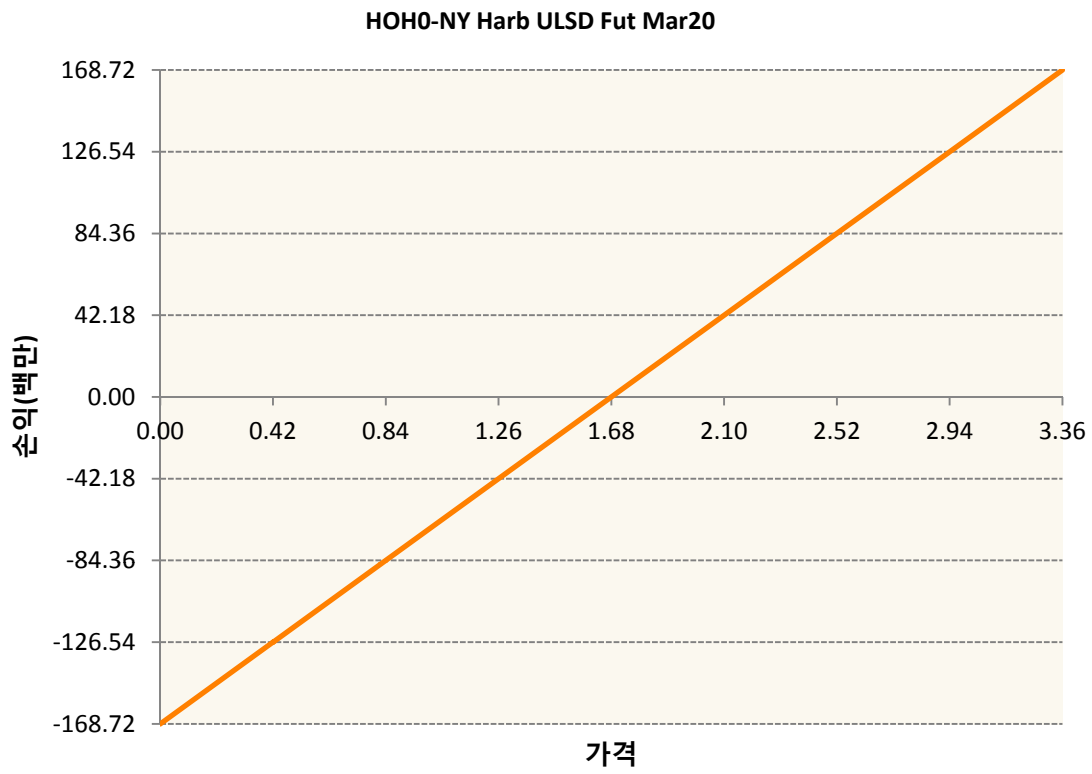
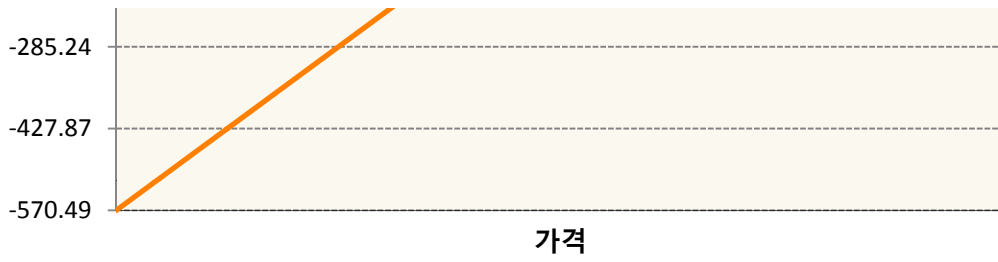
2. 만기시점의 손익구조

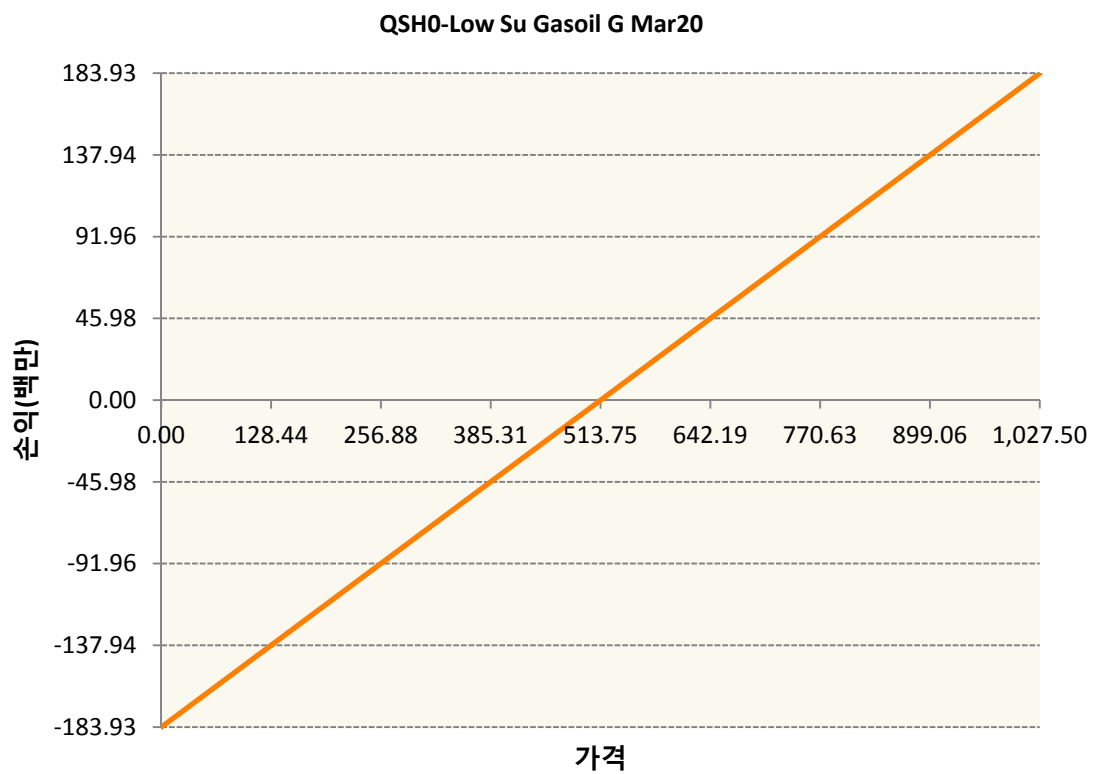
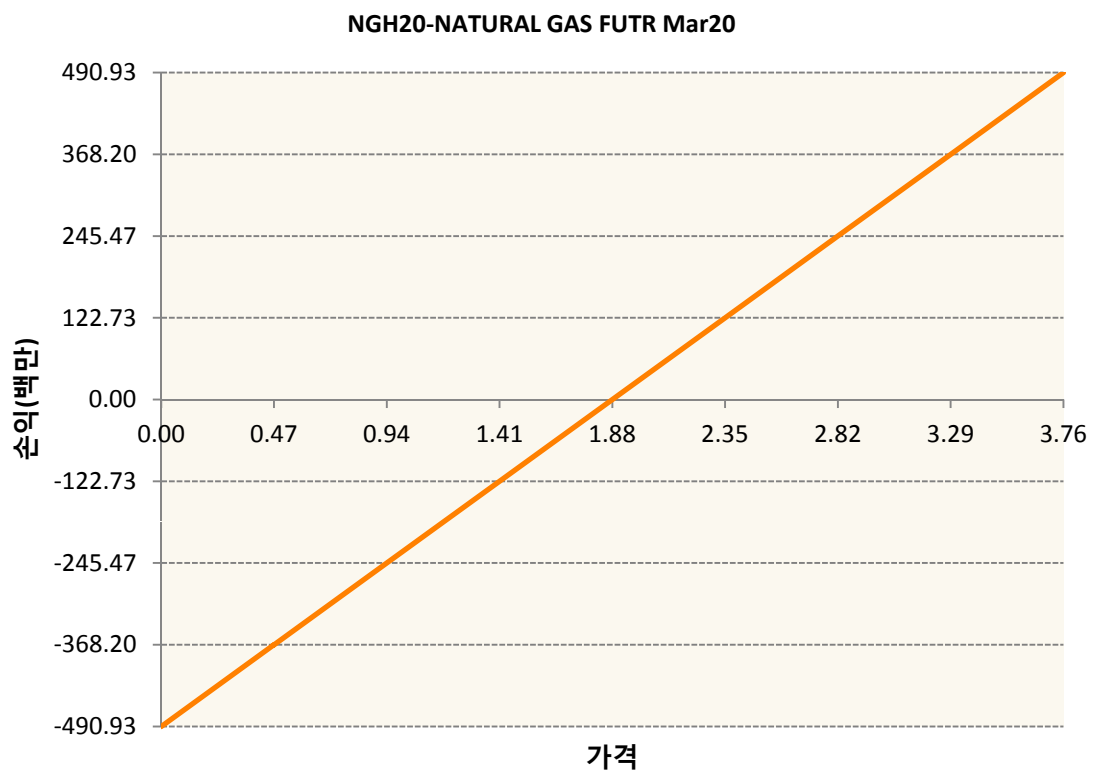
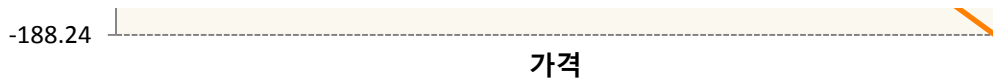
COKO-BRENT CRUDE FUTR May20



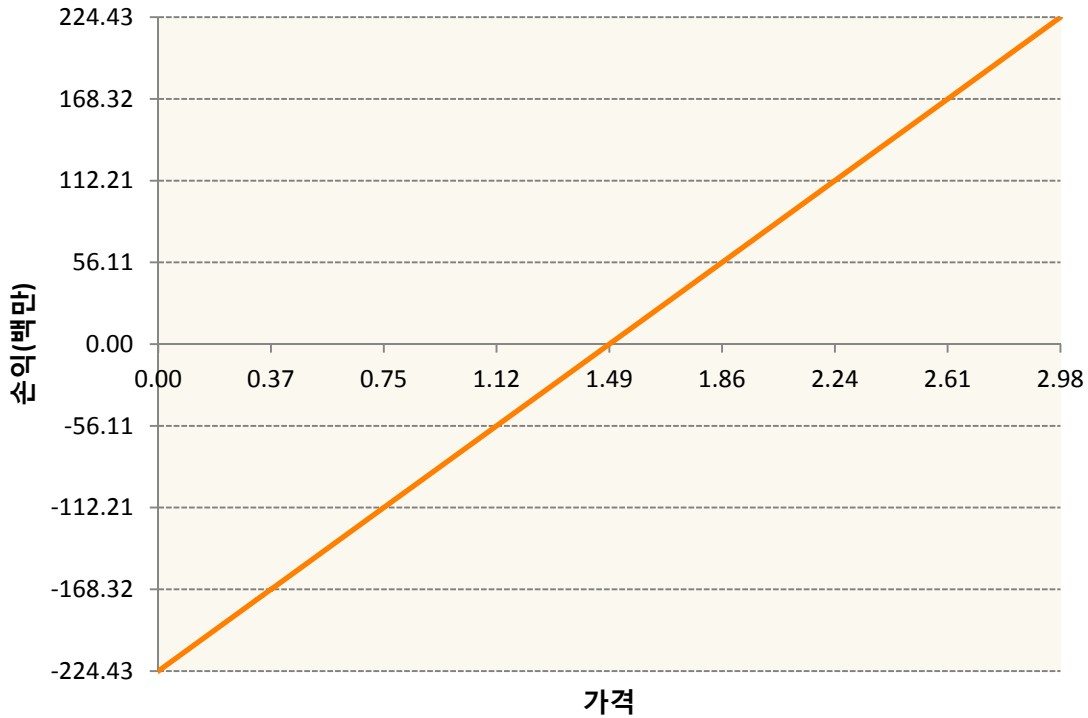
CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20







XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	43
CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	46
HOH0	NY Harb ULSD Fut Mar20	13
KR4175Q20C	2020-02 달러선물	15
NGH20	NATURAL GAS FUTR Mar20	39
QSH0	Low Su Gasoil G Mar20	15
XBH0	GASOLINE RBOB FUT Mar20	18

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

337

공시일	2020-01-29
기준일	2020-01-28

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

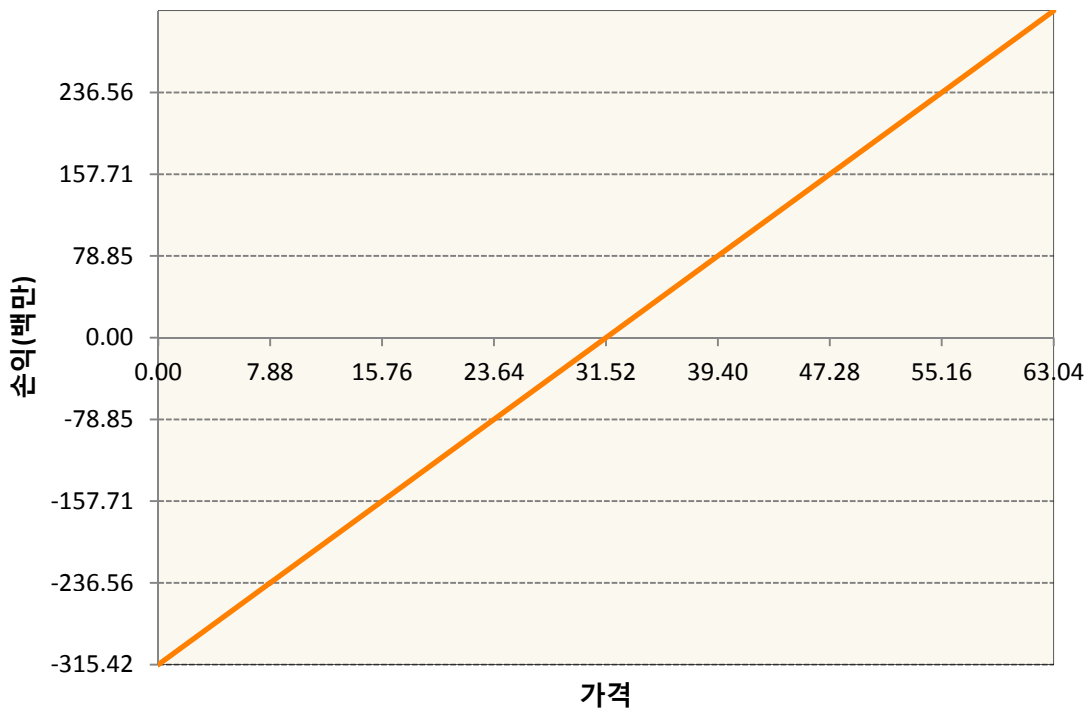
1. 계약금액

(단위:백만원)

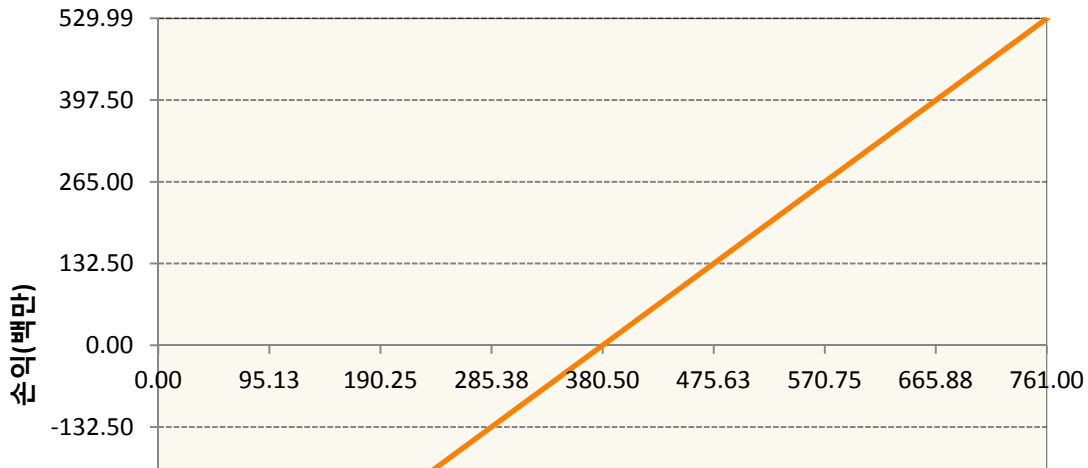
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,770	153	2,617	

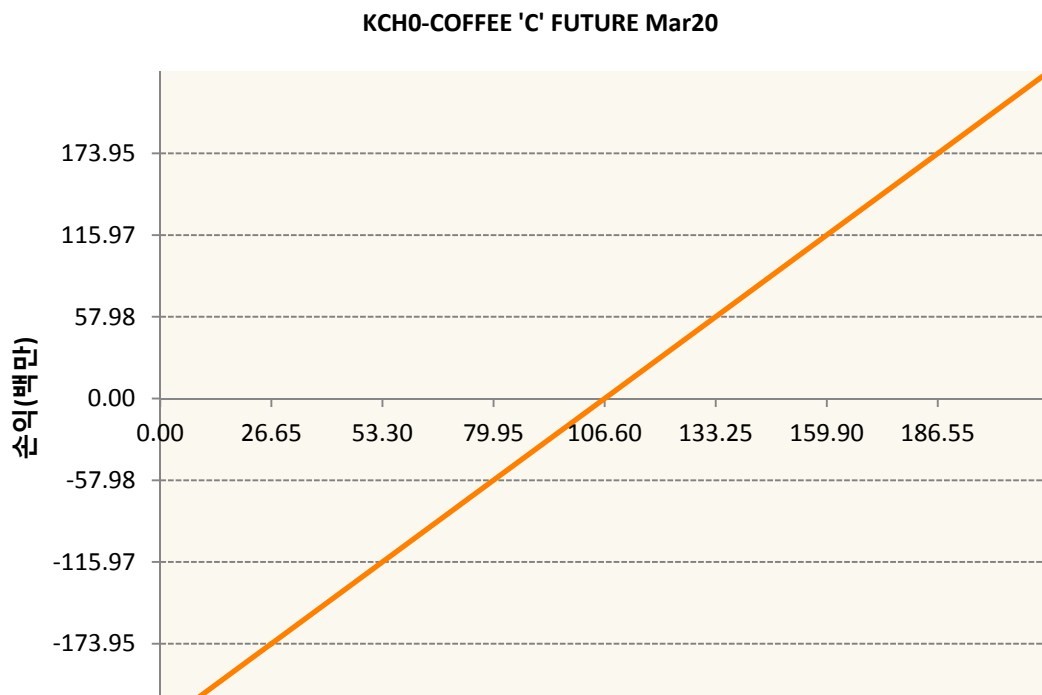
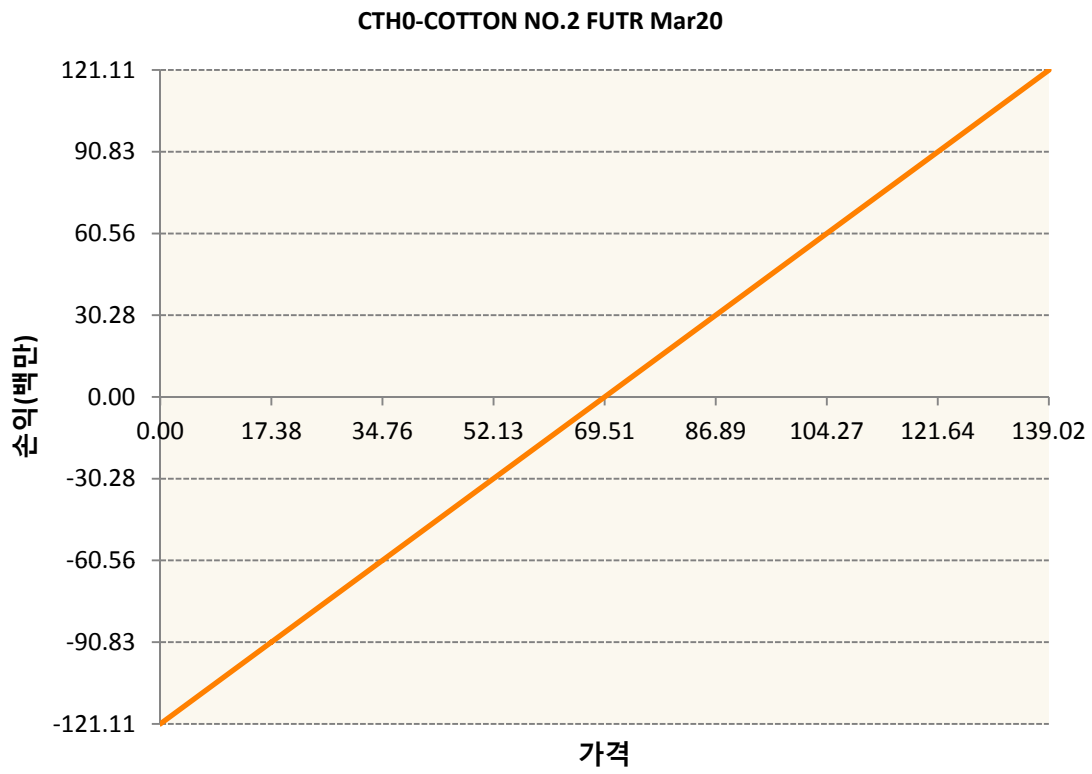
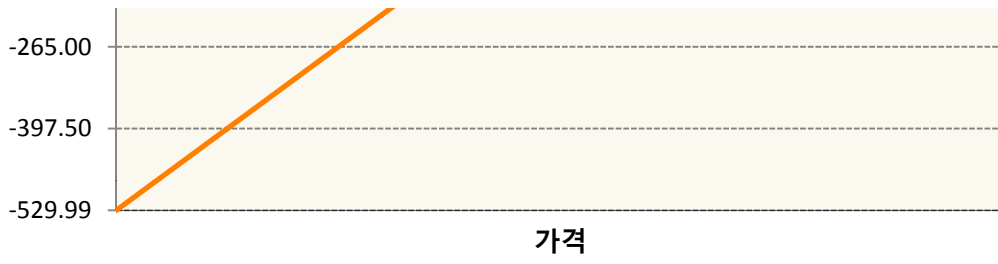
2. 만기시점의 손익구조

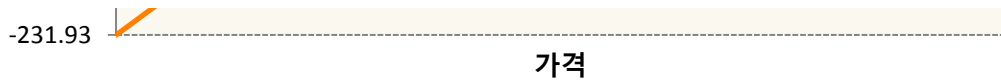
BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20



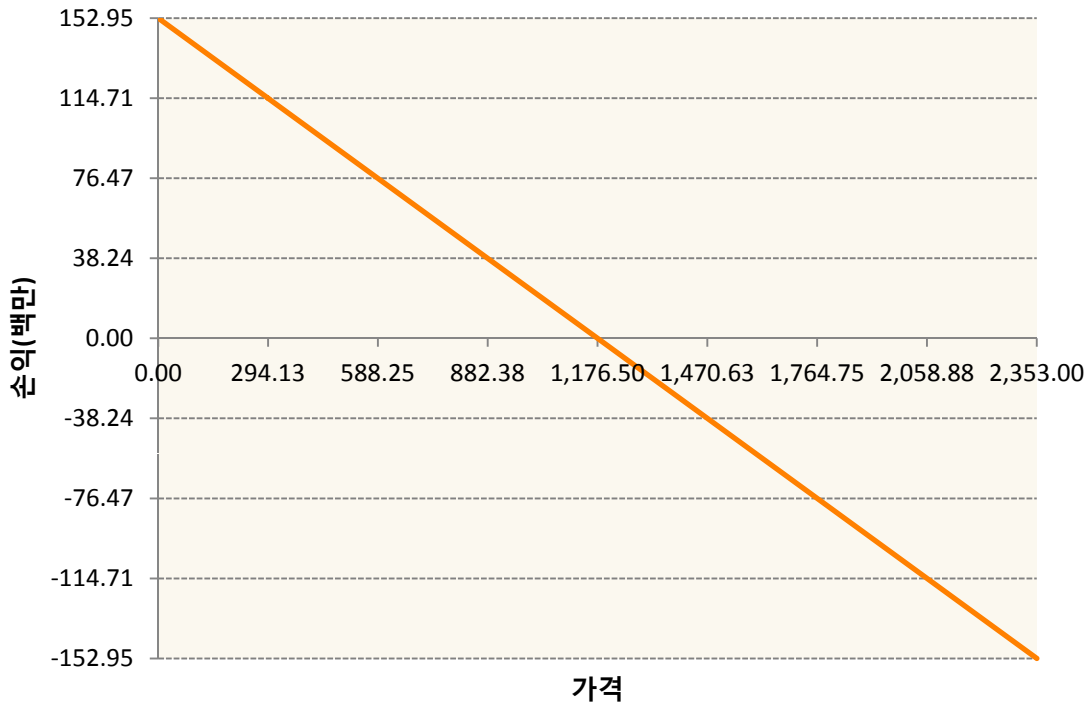
CH0-CORN FUTURE Mar20



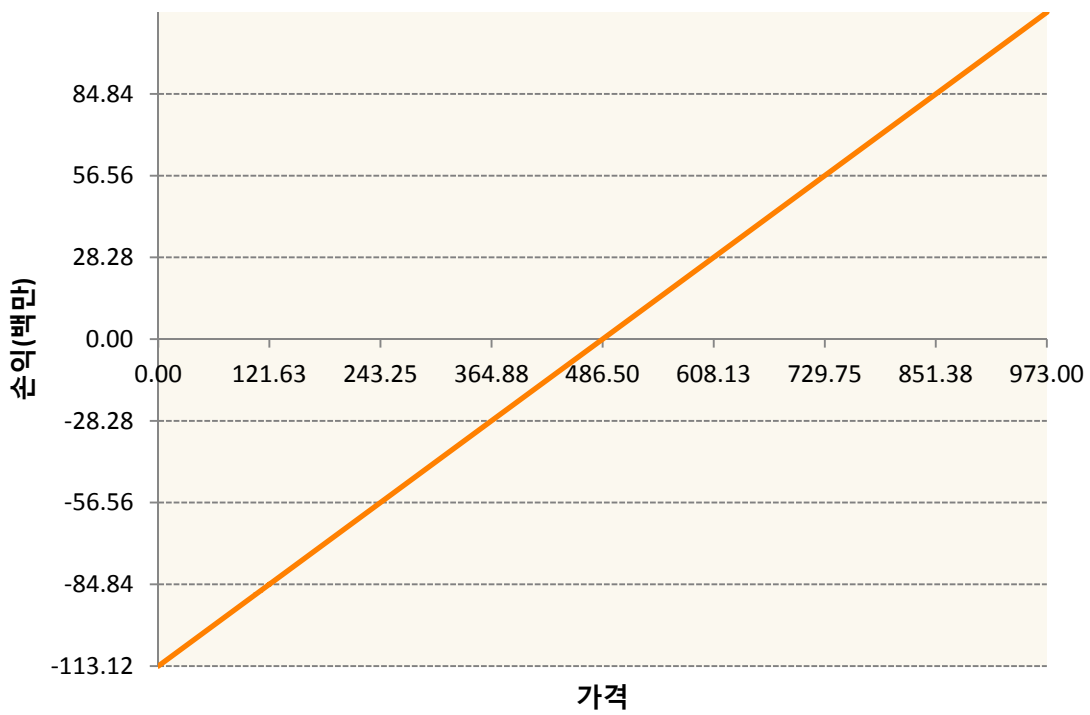




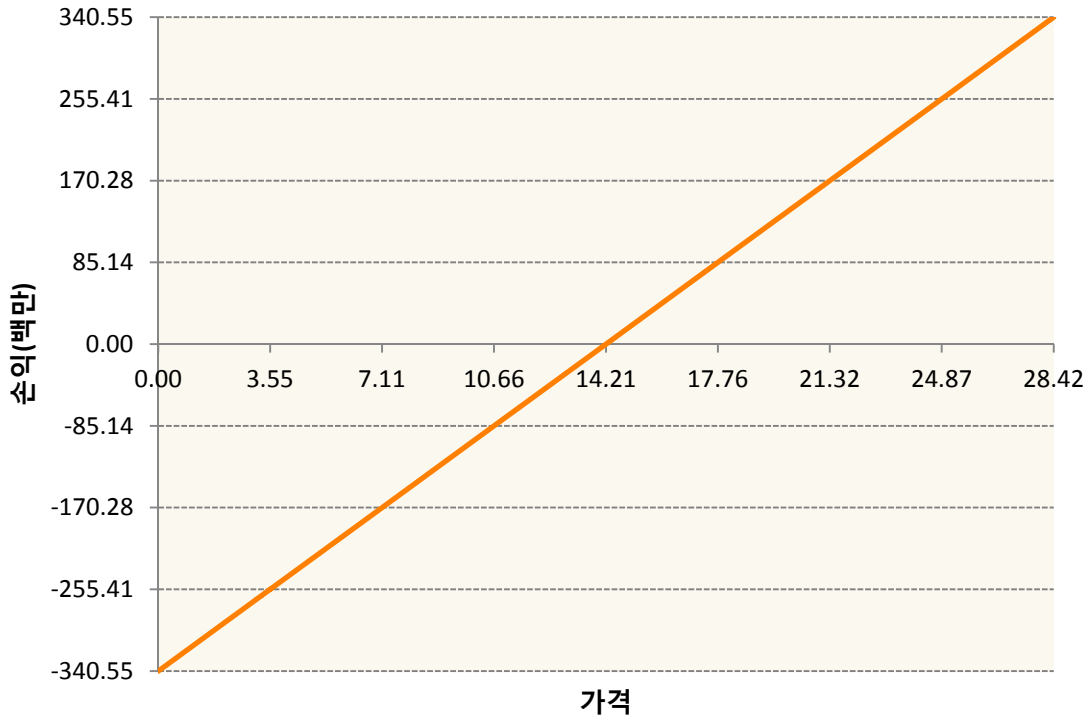
KR4175Q20000-2020-02 달러선물



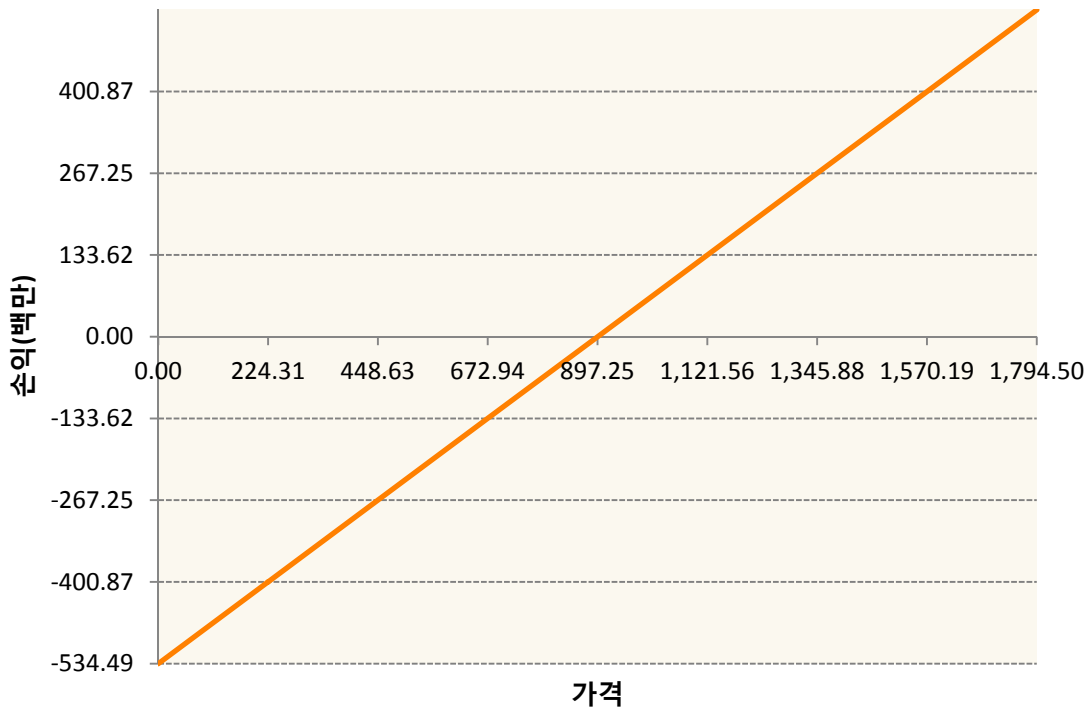
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

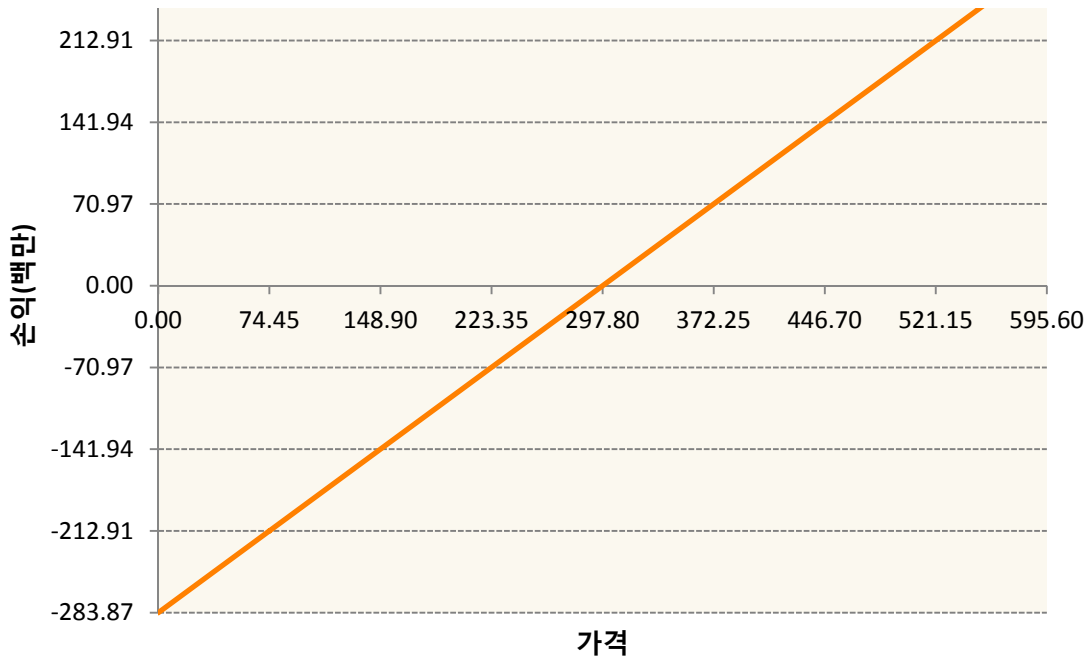


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20

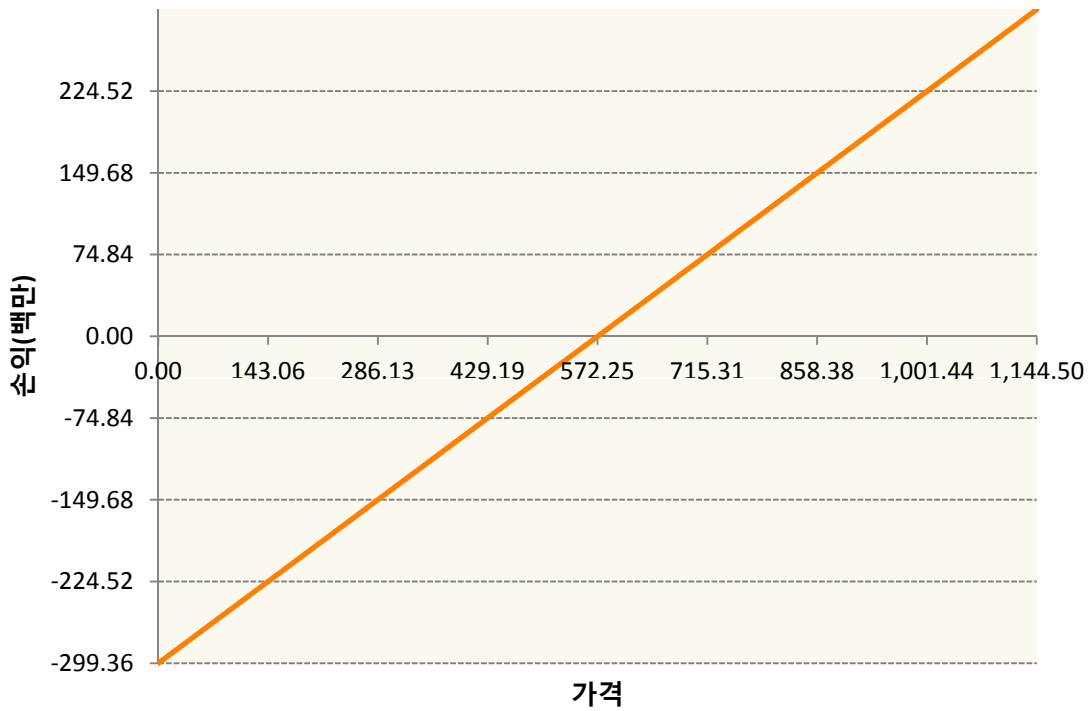


SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





WHO-WHEAT FUTURE(CBT) Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH0	SOYBEAN OIL FUTR Mar20	25
CH0	CORN FUTURE Mar20	42
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	27
SH0	SOYBEAN FUTURE Mar20	43
SMH0	SOYBEAN MEAL FUTR Mar20	23
WH0	WHEAT FUTURE(CBT) Mar20	24

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

(단위:백만원)

240