

공시일	2020-01-30
기준일	2020-01-29

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	2020-01-30
기준일	2020-01-29

스마트인덱스모

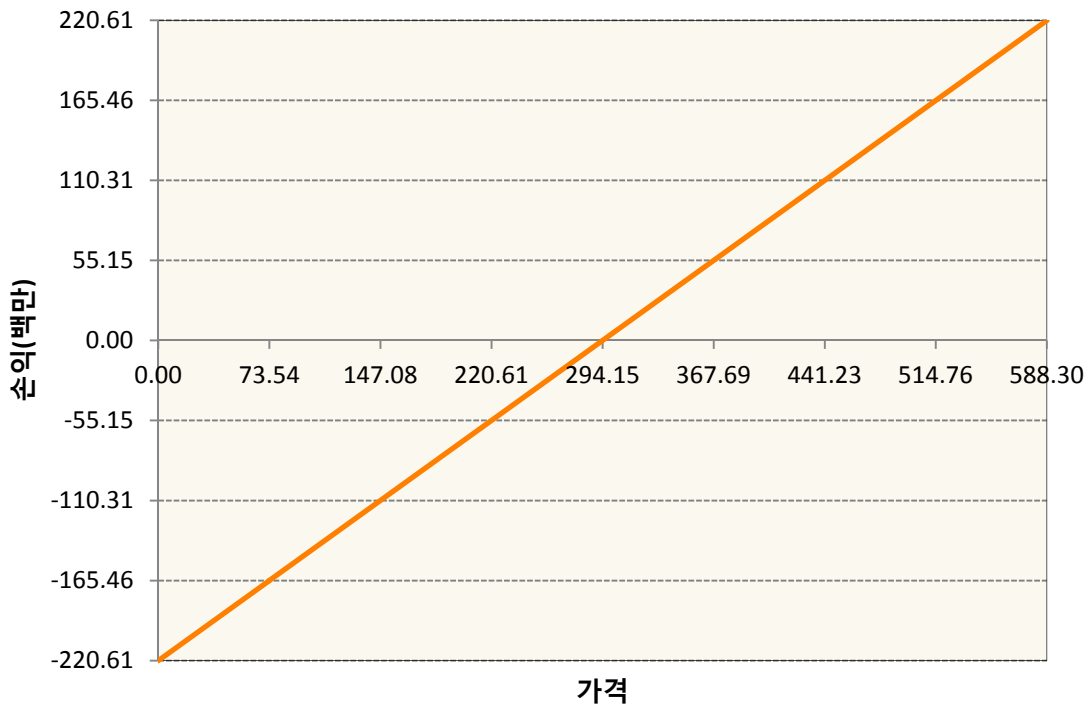
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	221	0	221	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	2020-01-30
기준일	2020-01-29

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

1,136

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

655

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-30
기준일	2020-01-29

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)

805

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-30
기준일	2020-01-29

유로인덱스모(주식-파생형)

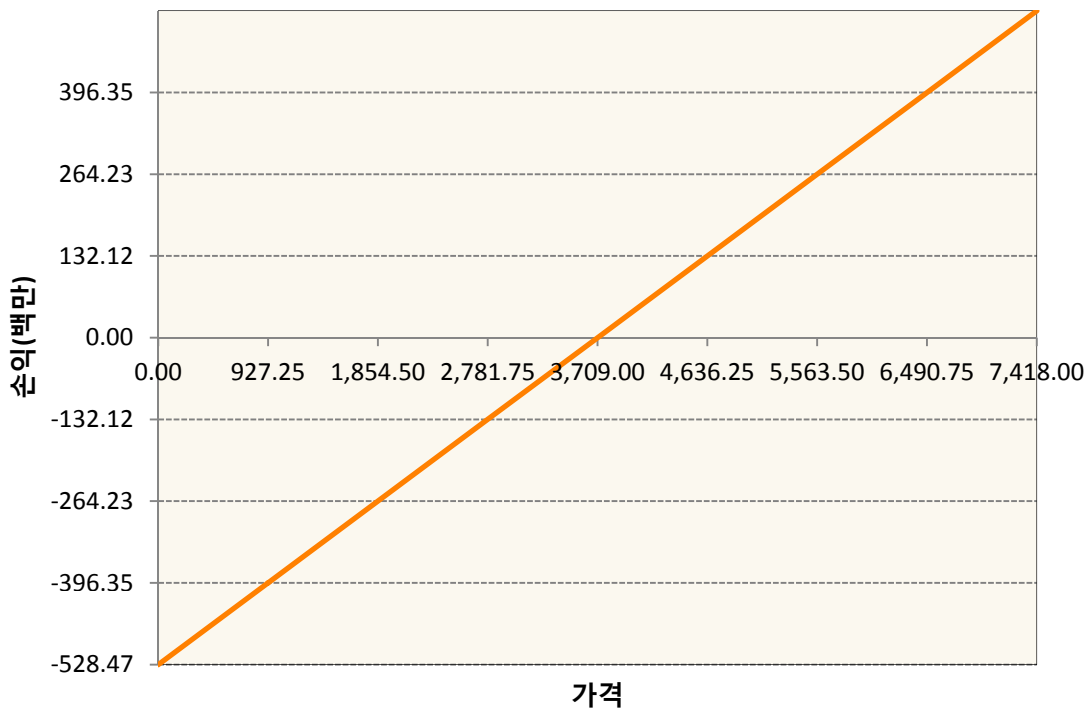
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	528	0	528	

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	2020-01-30
기준일	2020-01-29

차이나인덱스모(주식-파생형)

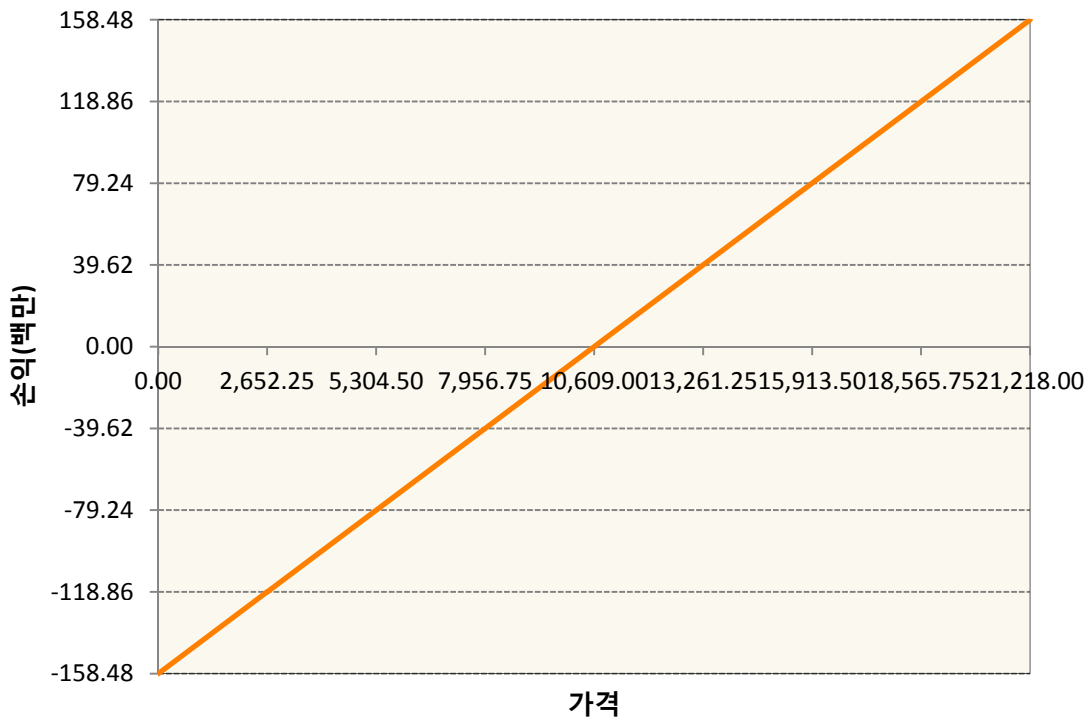
1. 계약금액

(단위:백만원)

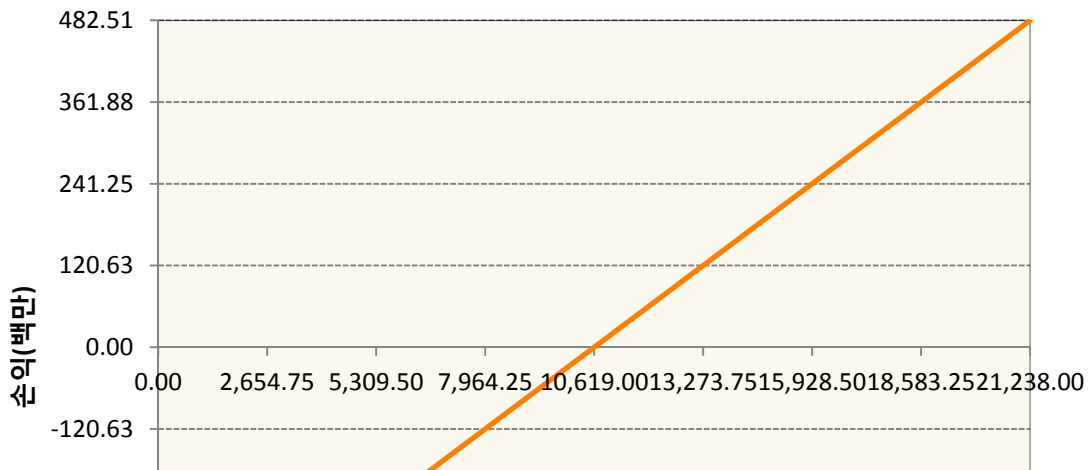
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	641	0	641	장내

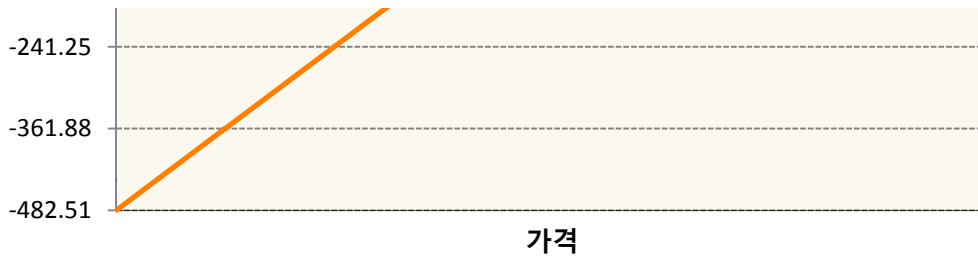
2. 만기시점의 손익구조

HCF0-HSCEI Futures Jan20



HCG0-HSCEI Futures Feb20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCF0	HSCEI Futures Jan20	13
HCG0	HSCEI Futures Feb20	39

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

46

공시일	2020-01-30
기준일	2020-01-29

커버드콜모(주식혼합-파생형)

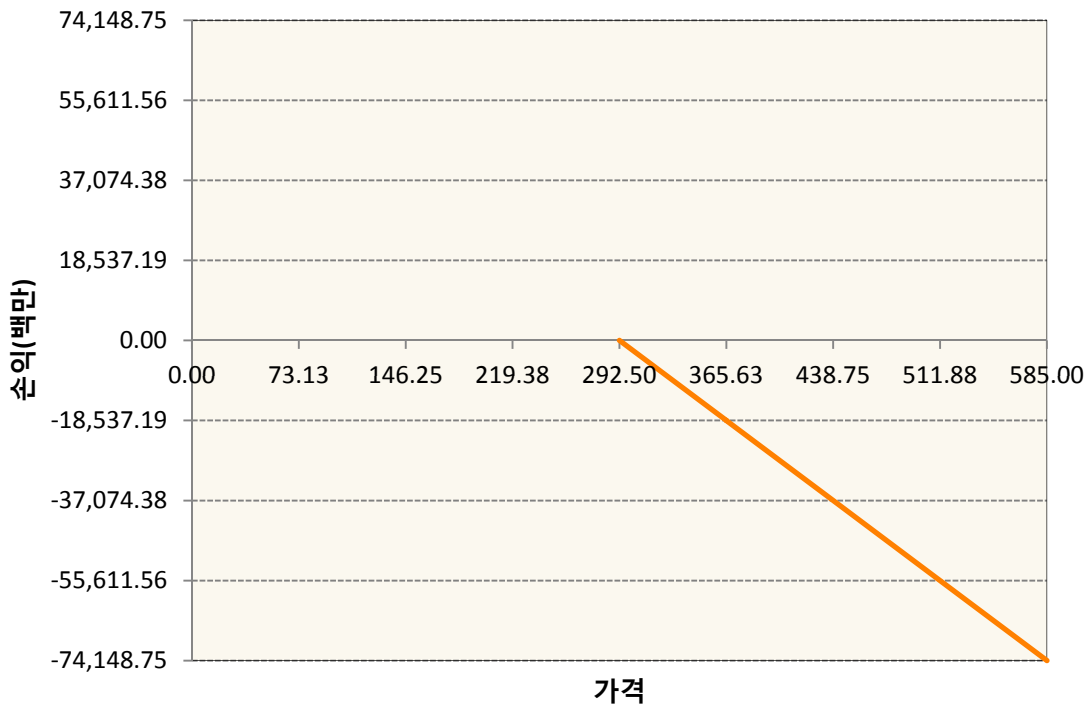
1. 계약금액

(단위:백만원)

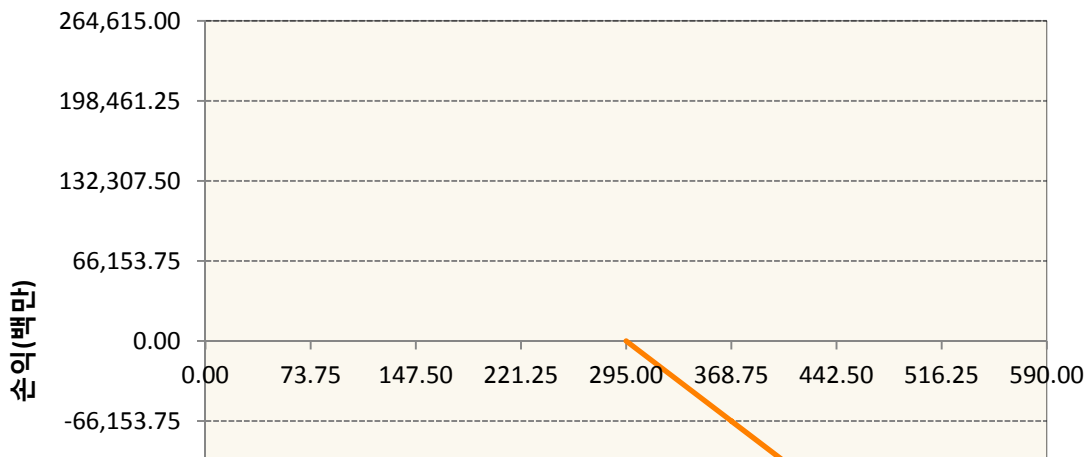
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	455,004	-455,004	장내

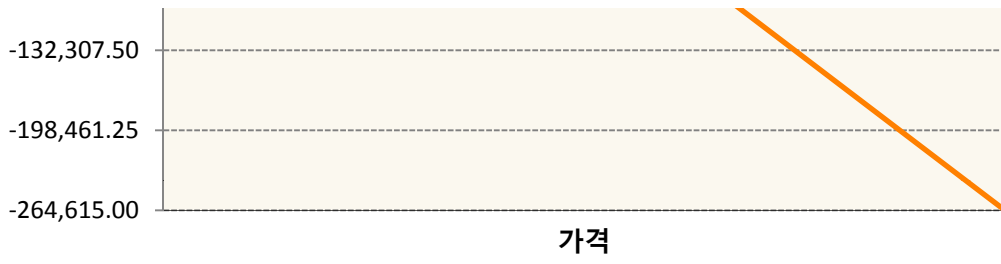
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q22927-2020-02 콜292.5

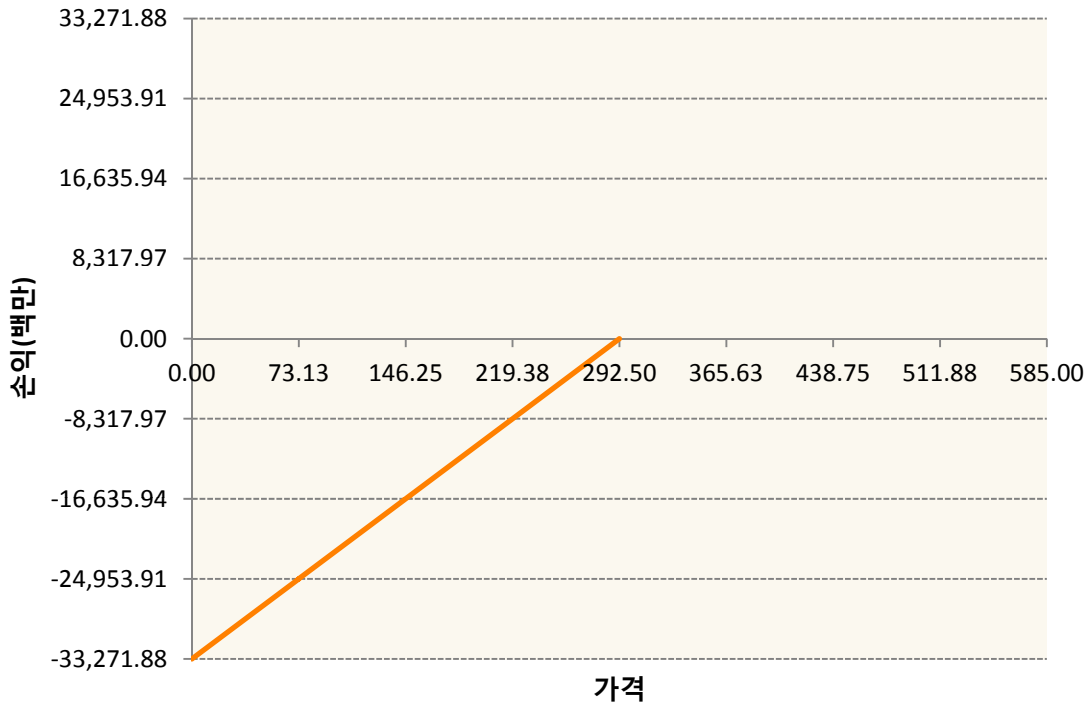


KR4201Q22950-2020-02 콜295

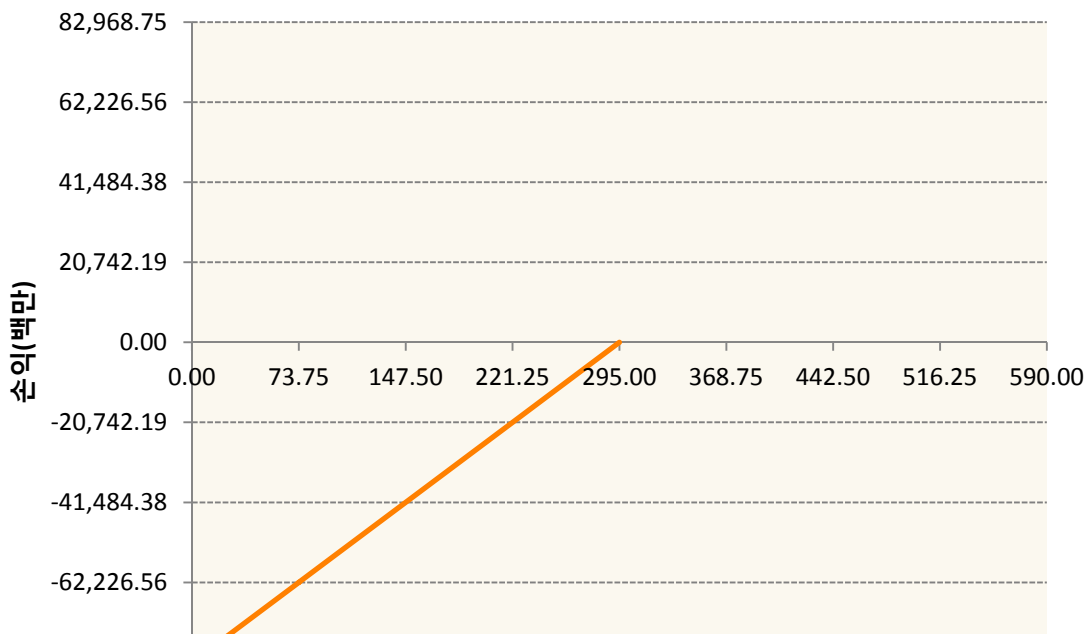




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



KR4301Q22958-2020-02 풋295



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q22927		2020-02 콜292.5						4,743
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,970	1,929	1,876	1,814	1,743	1,665	1,579	
-5.33%	1,787	1,698	1,600	1,494	1,383	1,267	1,147	
-2.67%	1,328	1,191	1,052	910	767	623	478	
0%	459	306	153	0	-153	-307	-460	
2.67%	-847	-975	-1,107	-1,242	-1,381	-1,522	-1,665	
5.33%	-2,497	-2,578	-2,669	-2,769	-2,876	-2,990	-3,108	
8.00%	-4,348	-4,388	-4,440	-4,502	-4,574	-4,655	-4,743	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						16,023
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5,951	5,840	5,694	5,513	5,300	5,057	4,789	
-5.33%	5,489	5,225	4,926	4,597	4,243	3,868	3,475	
-2.67%	4,223	3,778	3,318	2,846	2,364	1,874	1,378	
0%	1,635	1,090	545	0	-545	-1,091	-1,636	
2.67%	-2,509	-3,006	-3,514	-4,028	-4,549	-5,074	-5,602	
5.33%	-7,999	-8,345	-8,723	-9,126	-9,550	-9,992	-10,447	
8.00%	-14,361	-14,548	-14,777	-15,044	-15,343	-15,670	-16,023	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						2,155
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,138	-2,139	-2,140	-2,142	-2,145	-2,149	-2,155	
-5.33%	-1,255	-1,261	-1,270	-1,281	-1,294	-1,309	-1,326	
-2.67%	-443	-470	-497	-527	-557	-588	-620	
0%	110	74	37	0	-37	-74	-111	
2.67%	326	307	286	262	237	210	181	
5.33%	367	363	357	349	339	326	312	
8.00%	371	370	370	368	365	362	356	
KR4301Q22958		2020-02 풋295						5,663
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-5,639	-5,640	-5,641	-5,643	-5,647	-5,654	-5,663	
-5.33%	-3,443	-3,451	-3,464	-3,481	-3,504	-3,532	-3,564	
-2.67%	-1,345	-1,393	-1,446	-1,505	-1,567	-1,633	-1,702	
0%	276	184	92	0	-92	-185	-277	
2.67%	1,054	989	919	846	770	691	611	

5.33%	1,245	1,226	1,201	1,170	1,134	1,091	1,044
8.00%	1,266	1,264	1,260	1,252	1,242	1,227	1,208

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

(단위:백만원)

29,161

공시일	2020-01-30
기준일	2020-01-29

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

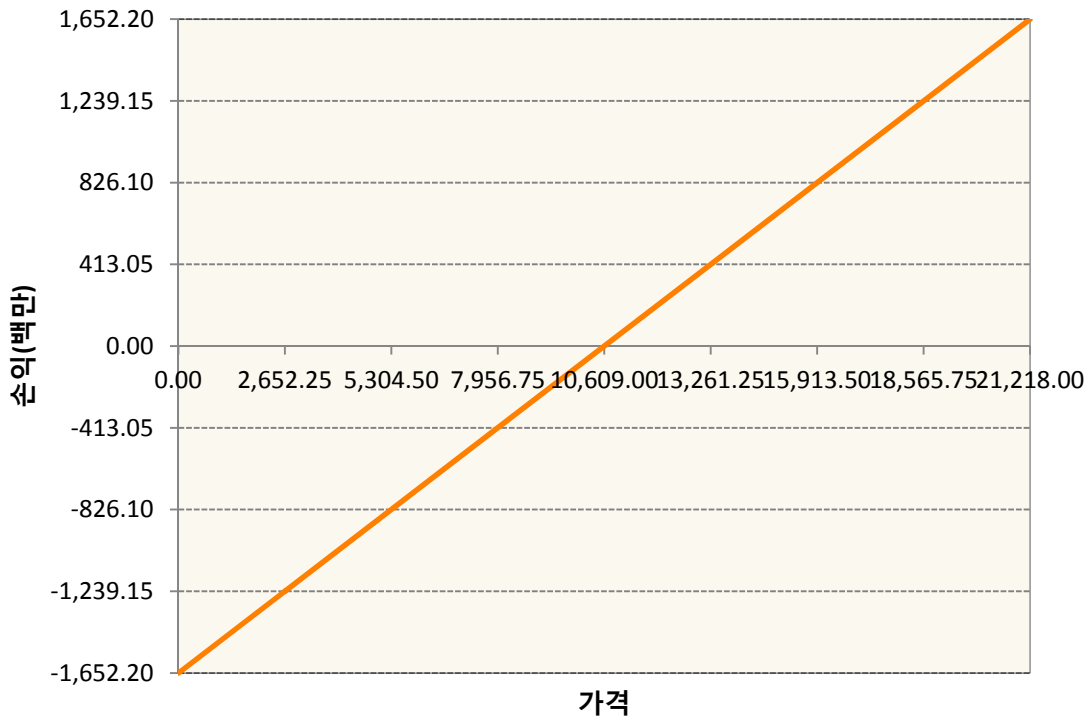
1. 계약금액

(단위:백만원)

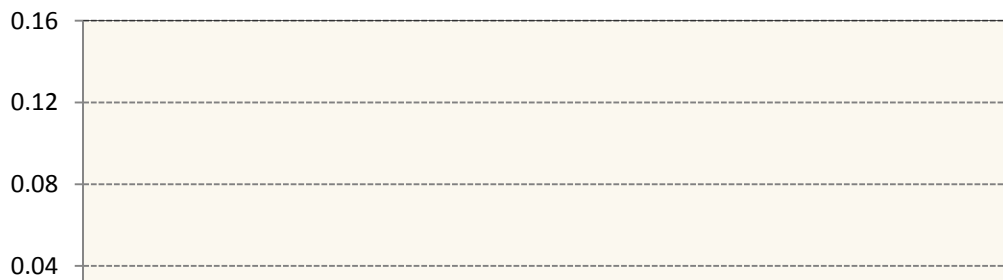
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,652	0	1,652	장내
누계	유가증권	옵션	0	136	-136	장내
누계	통화	선도	0	2,132	-2,132	장외

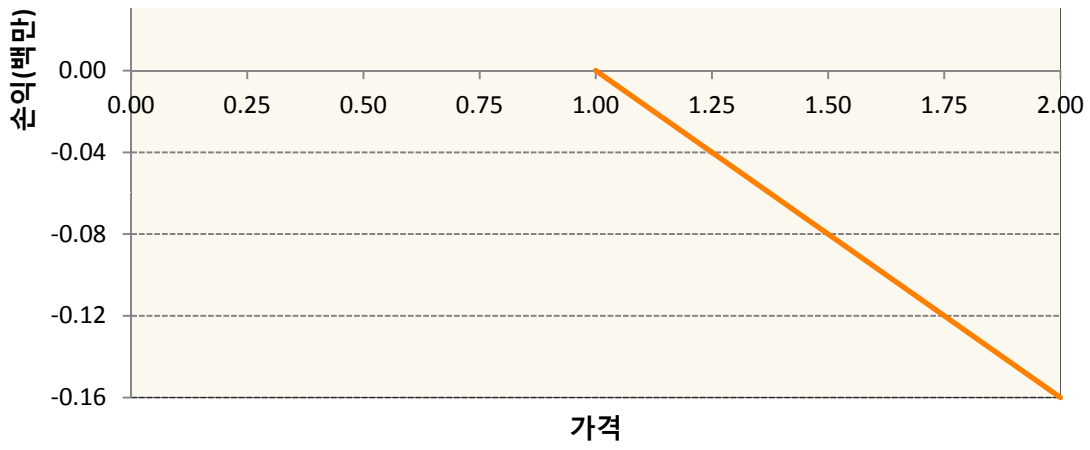
2. 만기시점의 손익구조

HCFO-HSCEI Futures Jan20

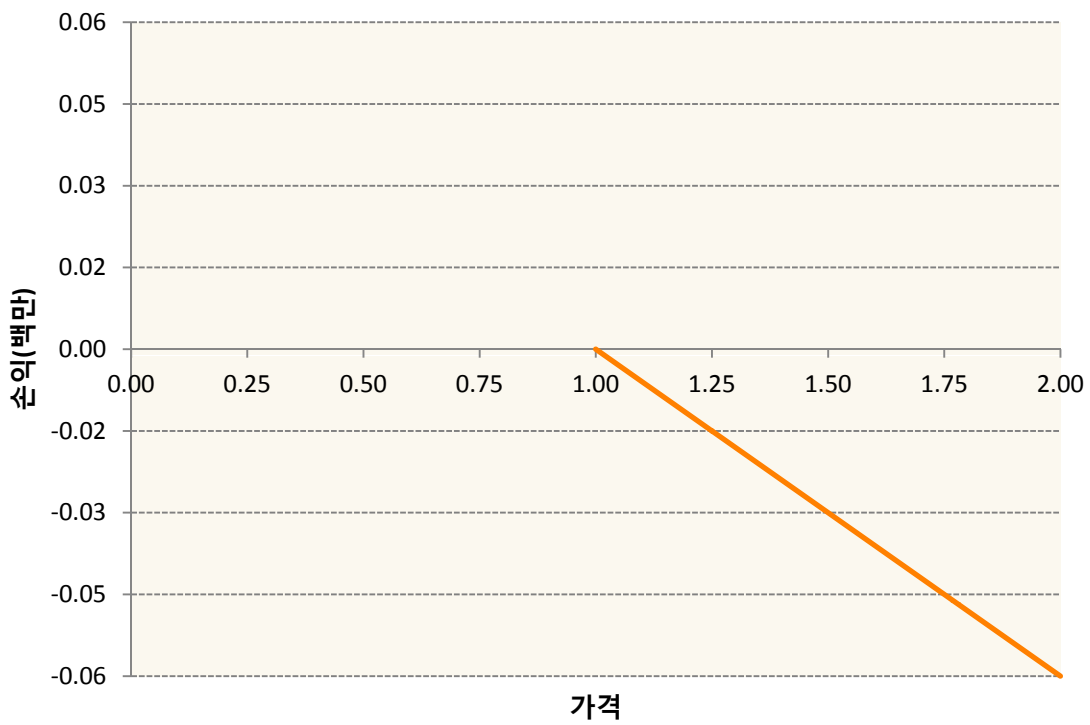


OHHIF0-C112-HSCEI

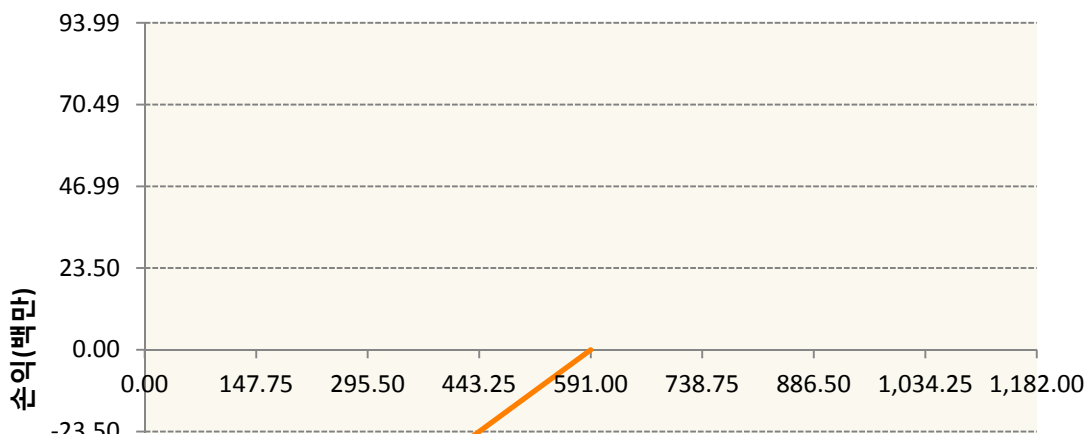


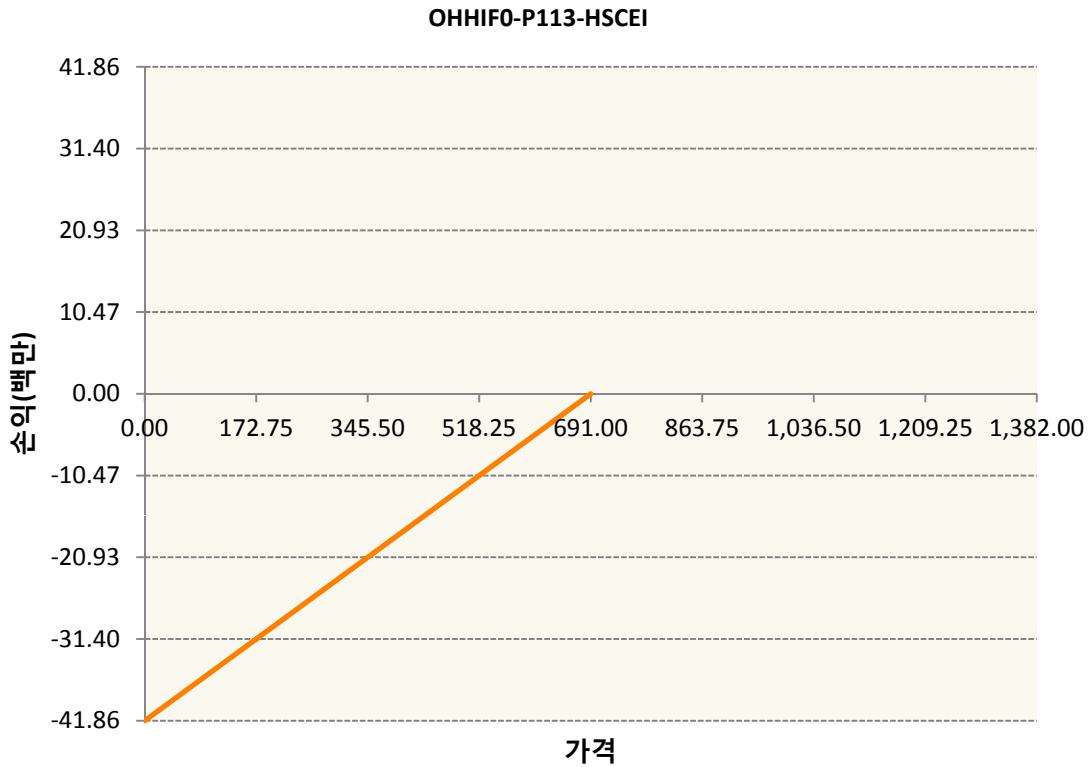
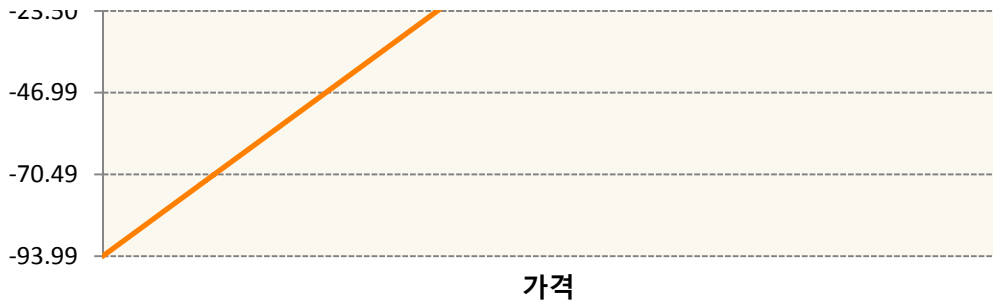


OHHIF0-C113-HSCEI



OHHIF0-P112-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	171
HCF0 HSCEI Futures Jan20	132
OHHIF0-C11 HSCEI	0
OHHIF0-C11 HSCEI	0
OHHIF0-P11 HSCEI	8
OHHIF0-P11 HSCEI	3

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	183

공시일	2020-01-30
기준일	2020-01-29

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

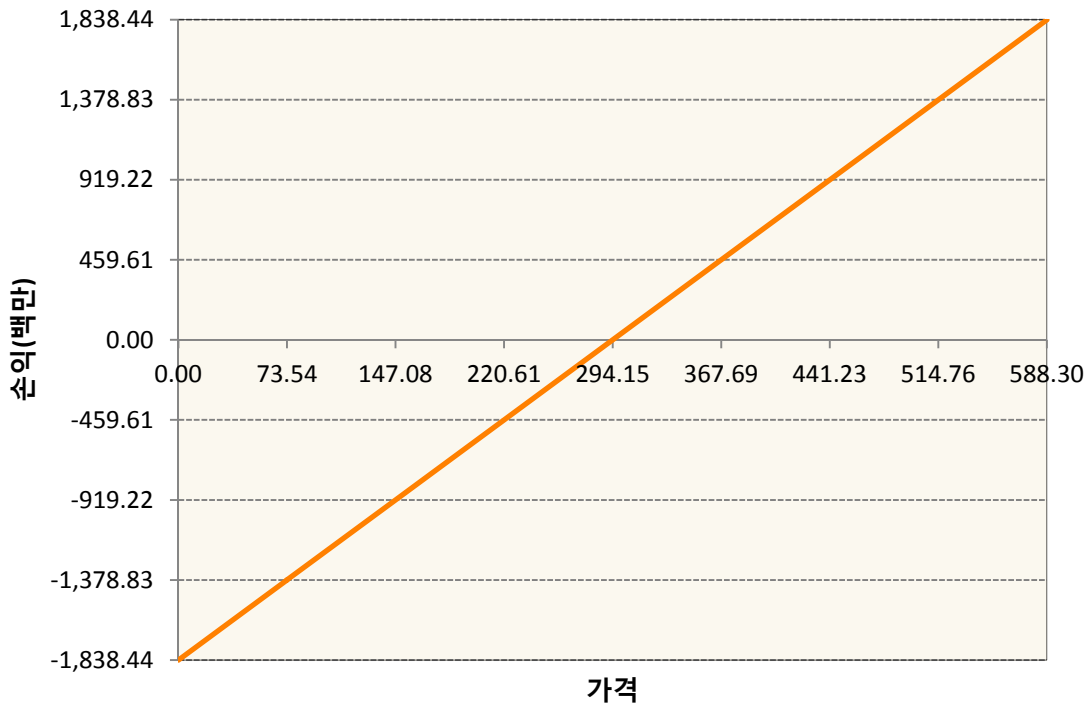
1. 계약금액

(단위:백만원)

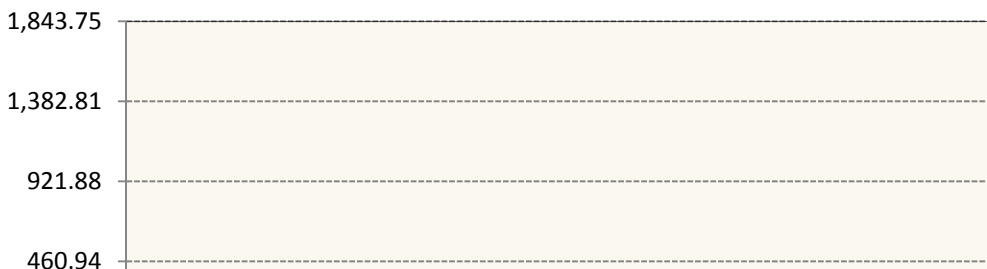
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,838	0	1,838	장내
누계	유가증권	스왑	3,625	0	3,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,608	-3,608	장내

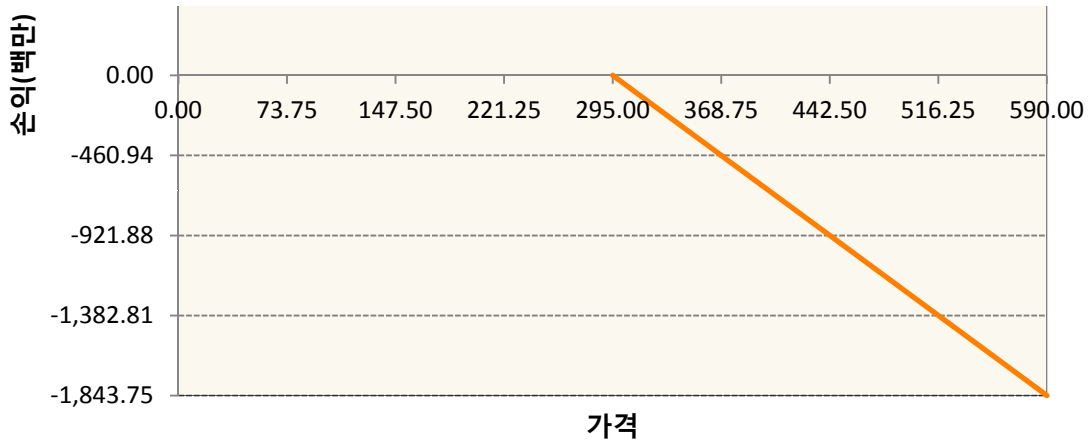
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

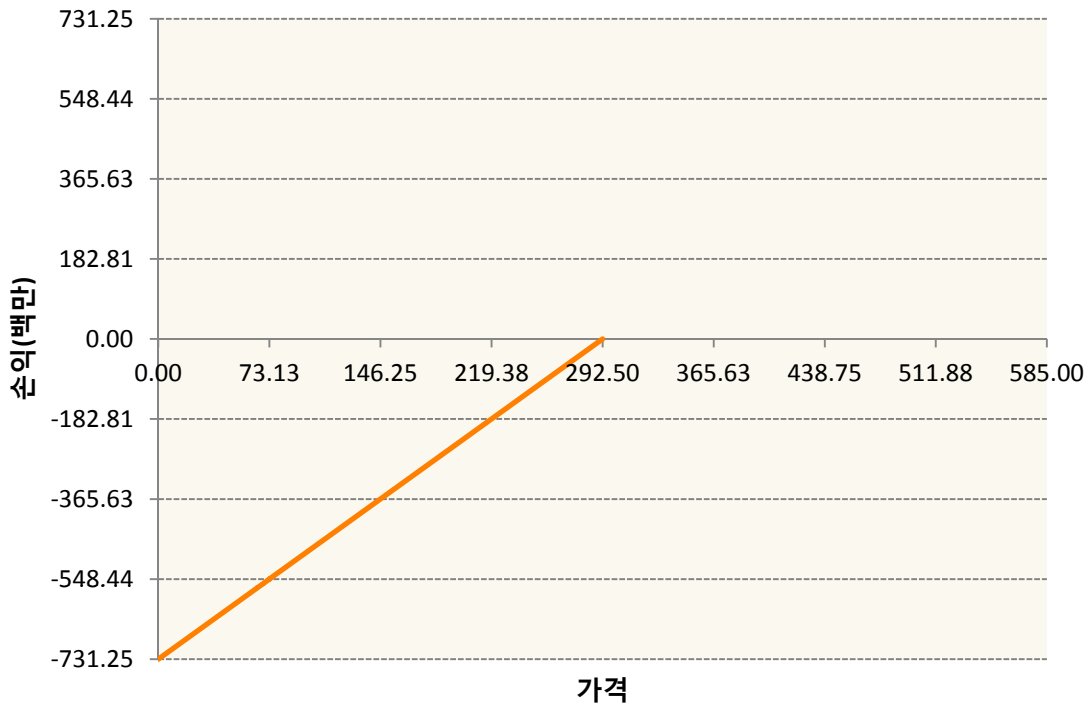


KR4201Q22950-2020-02 콜295

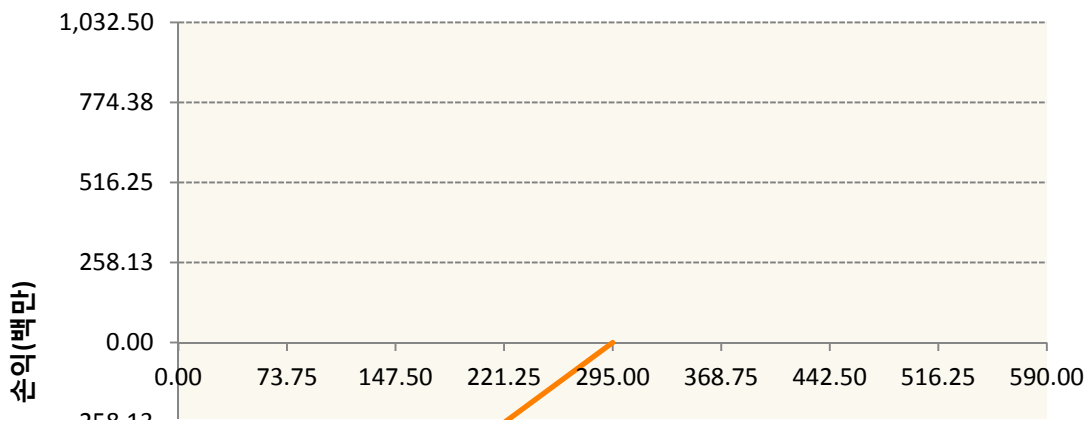




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



KR4301Q22958-2020-02 풋295





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						311
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-311	-311	-311	-311	-311	-311	-311	
-5.33%	-207	-207	-207	-207	-207	-207	-207	
-2.67%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	104	104	104	104	104	104	104	
5.33%	207	207	207	207	207	207	207	
8.00%	311	311	311	311	311	311	311	
KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						147
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-147	-147	-147	-147	-147	-147	-147	
-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%	147	147	147	147	147	147	147	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						112
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	41	41	40	38	37	35	33	
-5.33%	38	36	34	32	30	27	24	
-2.67%	29	26	23	20	16	13	10	
0%	11	8	4	0	-4	-8	-11	
2.67%	-17	-21	-24	-28	-32	-35	-39	
5.33%	-56	-58	-61	-64	-67	-70	-73	
8.00%	-100	-101	-103	-105	-107	-109	-112	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						47
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
-5.33%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-29
-2.67%	-10	-10	-11	-12	-12	-13	-14
0%	2	2	1	0	-1	-2	-2
2.67%	7	7	6	6	5	5	4
5.33%	8	8	8	8	7	7	7
8.00%	8	8	8	8	8	8	8
KR4301Q22958 2020-02 풋295							70
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70
-5.33%	-43	-43	-43	-43	-44	-44	-44
-2.67%	-17	-17	-18	-19	-20	-20	-21
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	13	12	11	11	10	9	8
5.33%	15	15	15	15	14	14	13
8.00%	16	16	16	16	15	15	15

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

(단위:백만원)

669

공시일	2020-01-30
기준일	2020-01-29

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

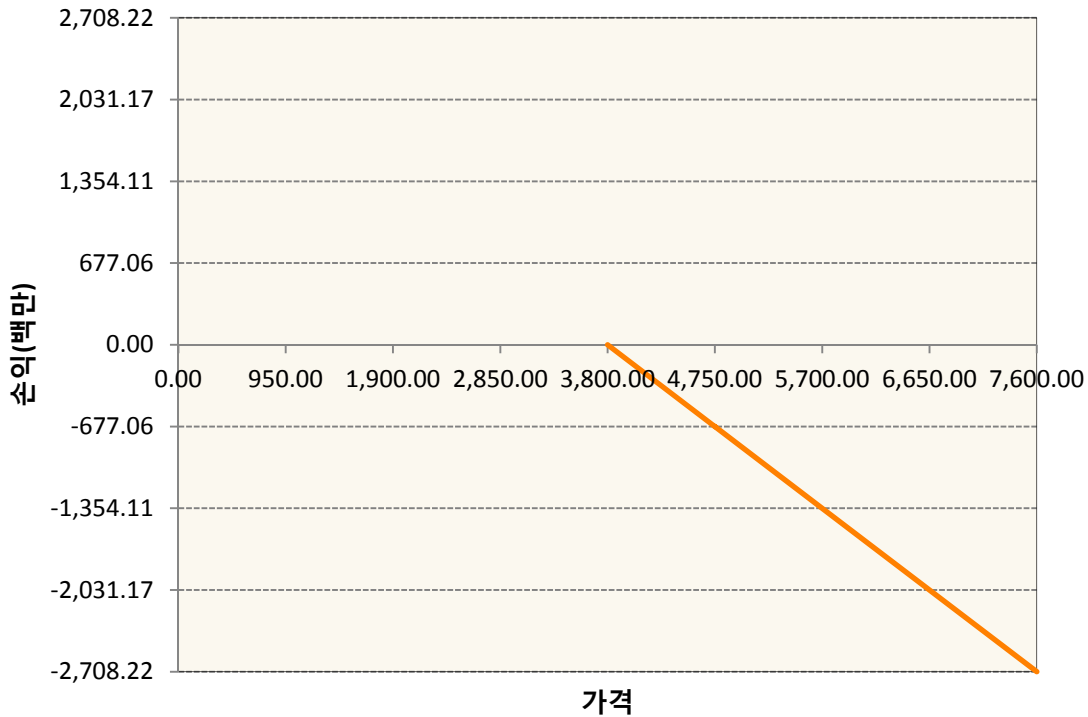
1. 계약금액

(단위:백만원)

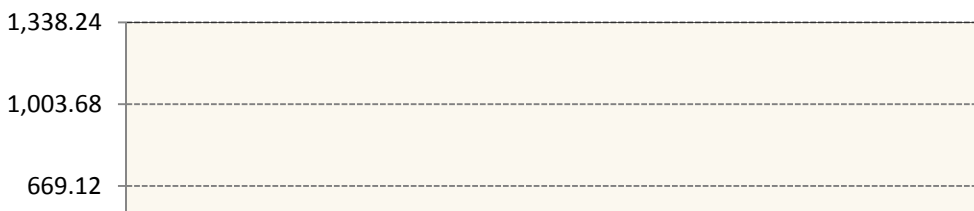
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	910	0	910	
누계	유가증권	스왑	13,540	0	13,540	장외
누계	유가증권	옵션	0	8,093	-8,093	장내
누계	통화	선도	0	3,400	-3,400	장외

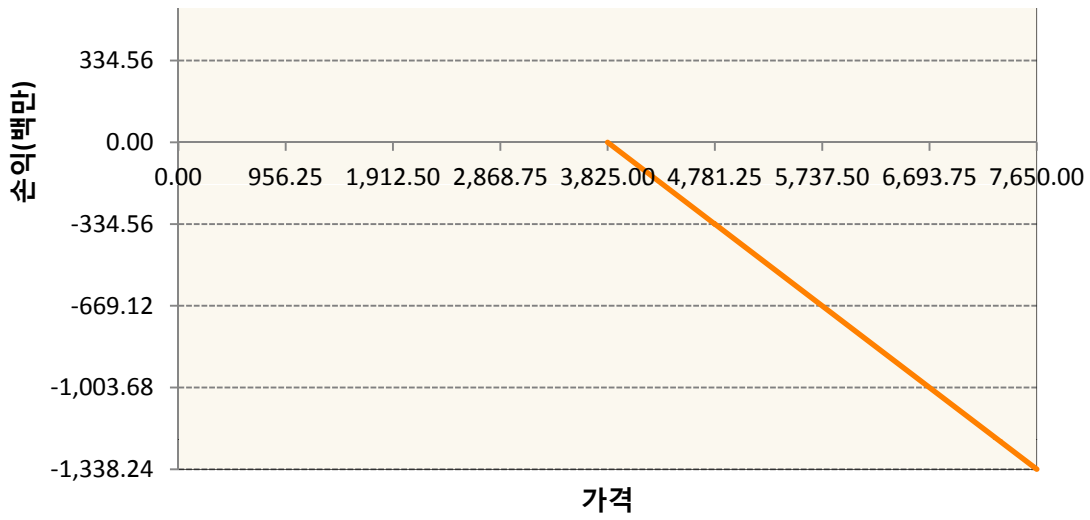
2. 만기시점의 손익구조

OESXG0-C3800-EURO STOXX 50

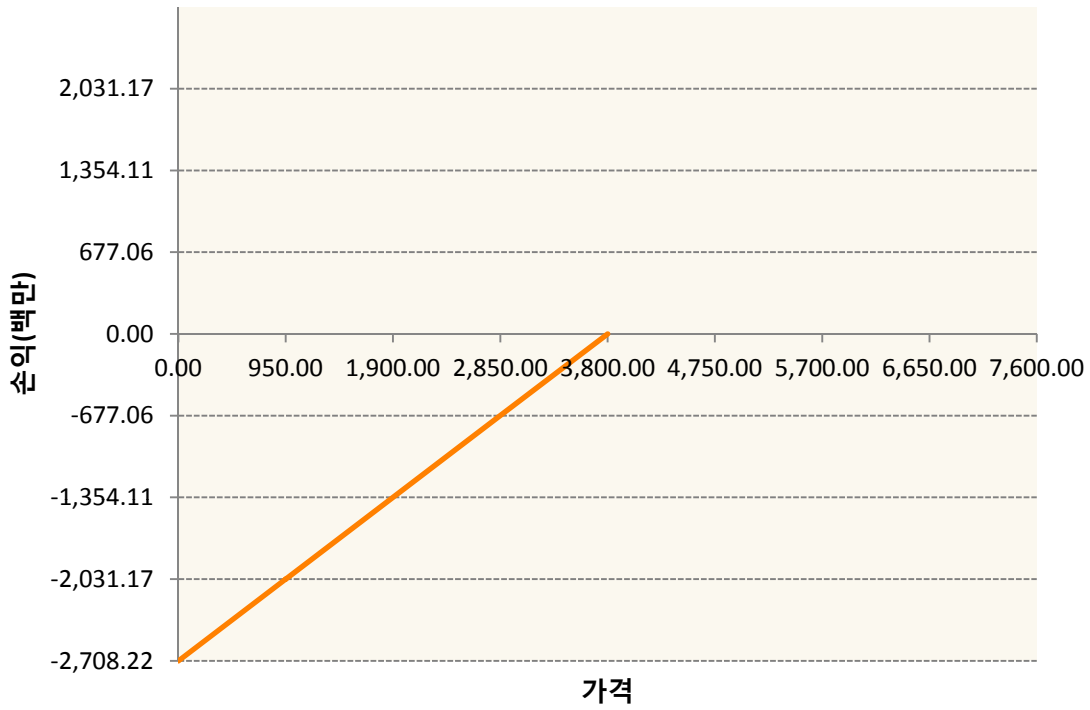


OESXG0-C3825-EURO STOXX 50

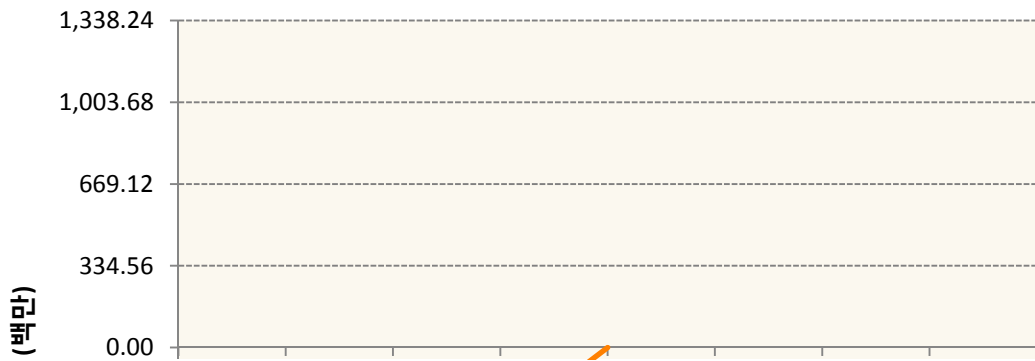


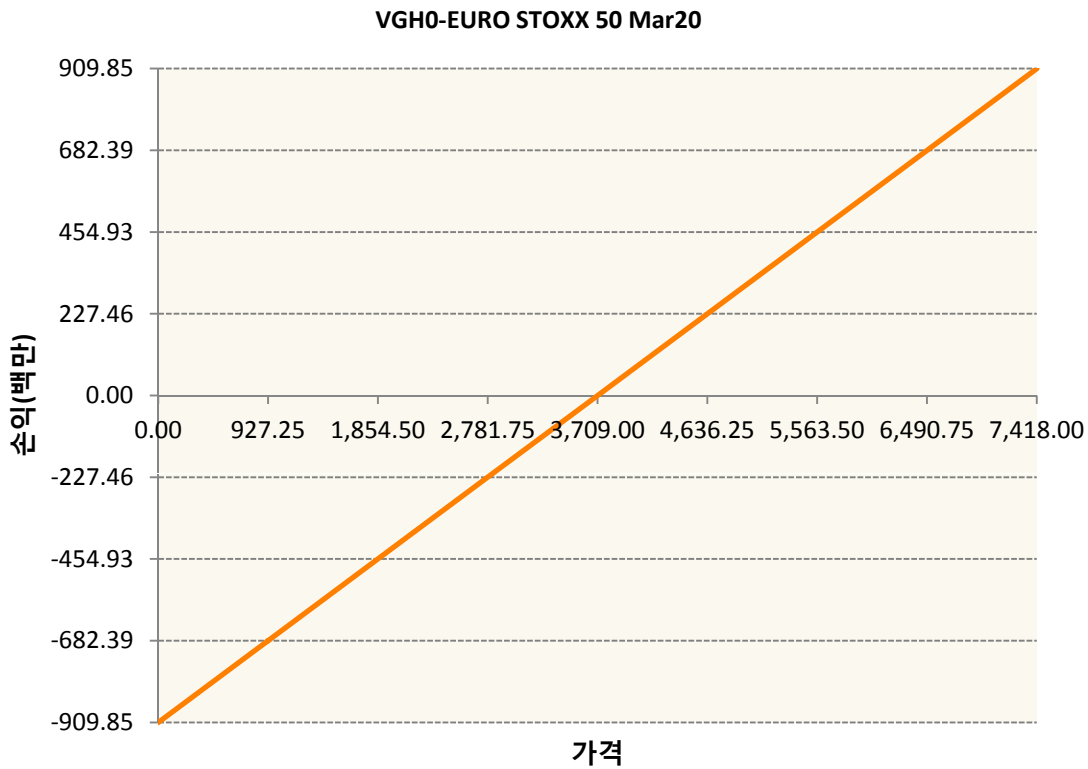
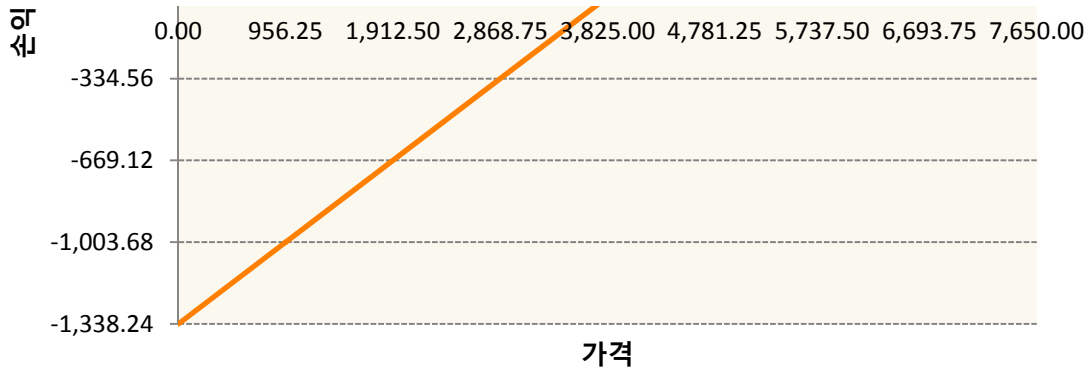


OESXG0-P3800-EURO STOXX 50



OESXG0-P3825-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	17
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	73

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

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

(단위:백만원)

42

공시일	2020-01-30
기준일	2020-01-29

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

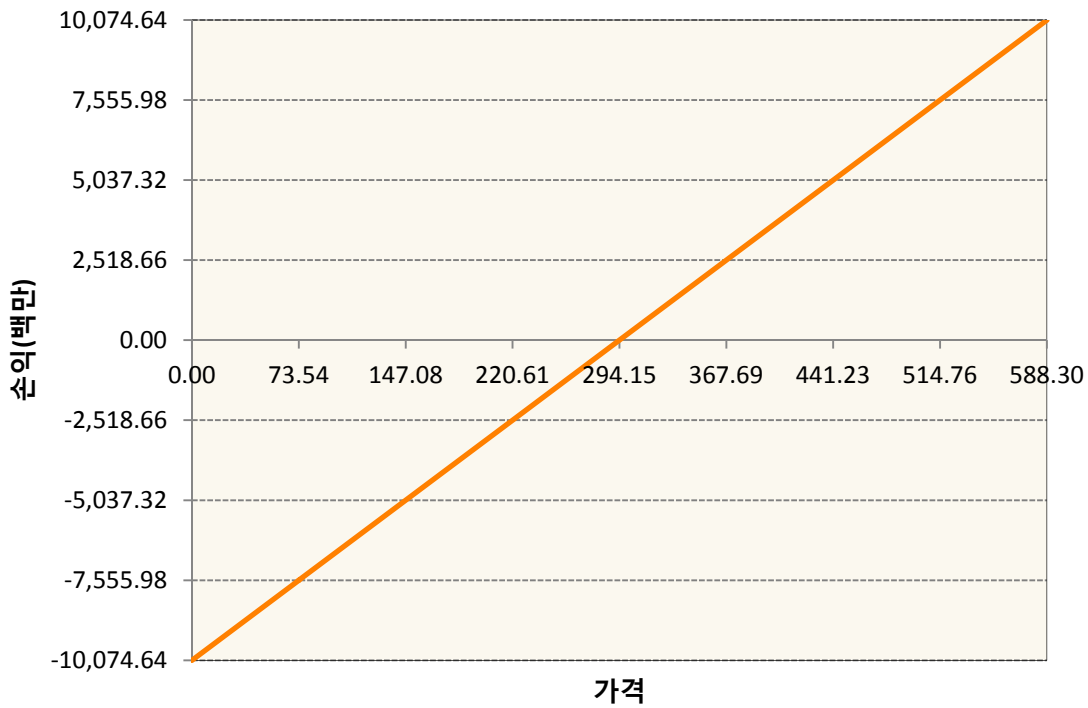
1. 계약금액

(단위:백만원)

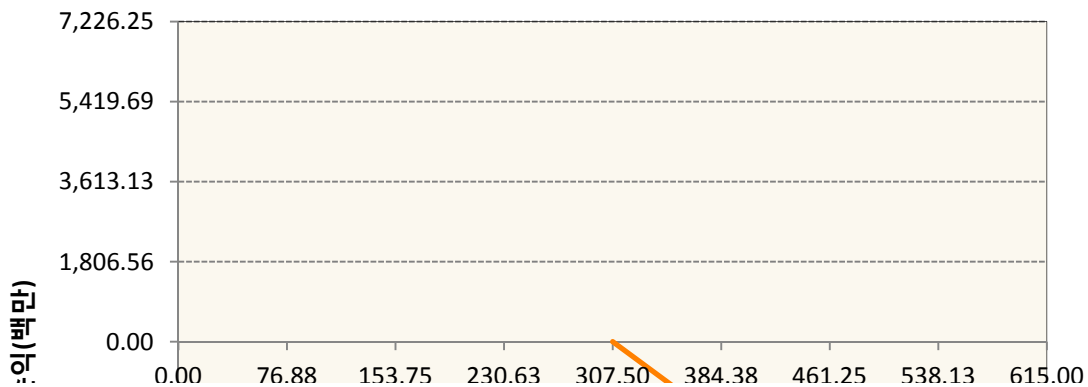
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,075	0	10,075	장내
누계	유가증권	옵션	2,944	20,789	-17,845	장내

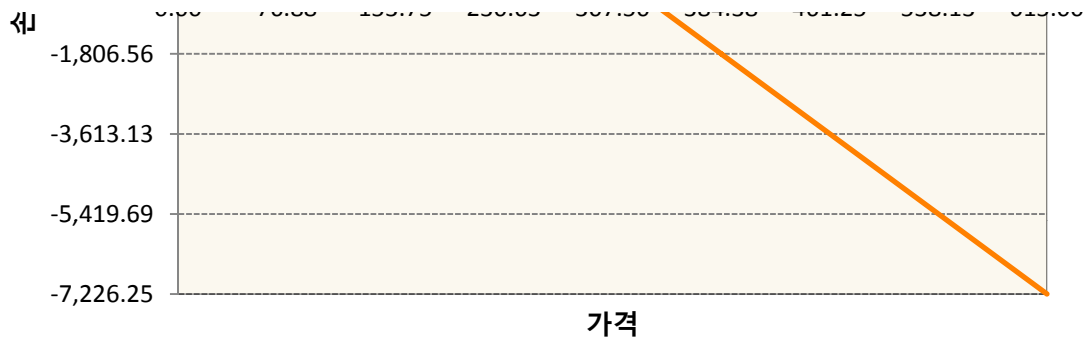
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

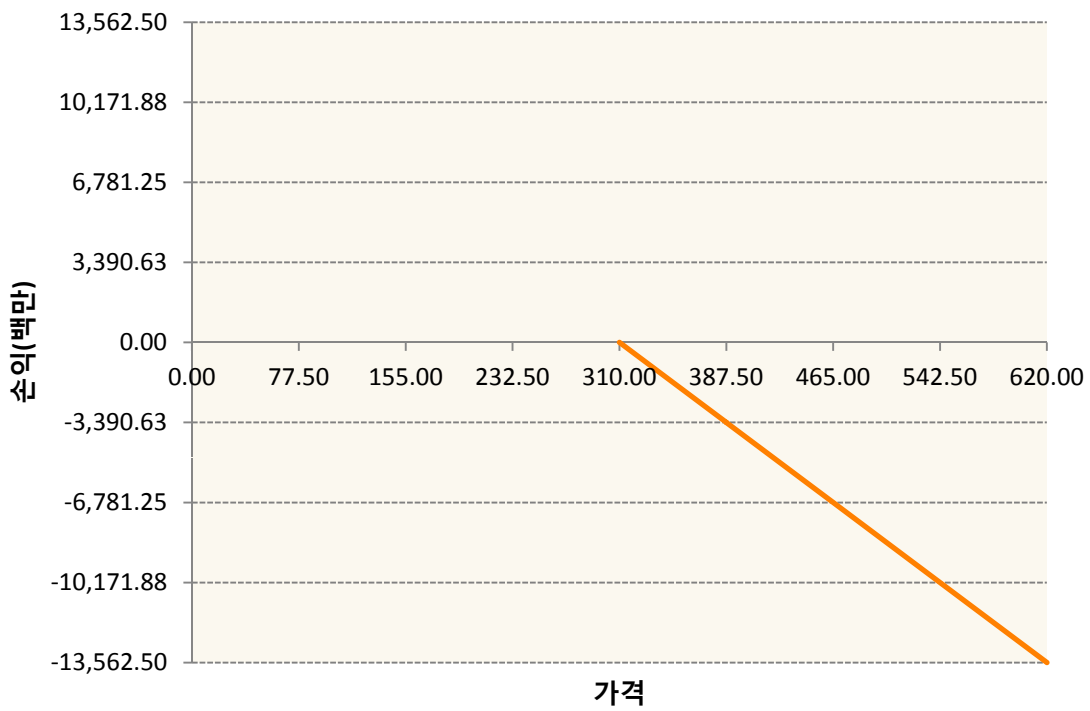


KR4201Q23073-2020-02 콜307.5

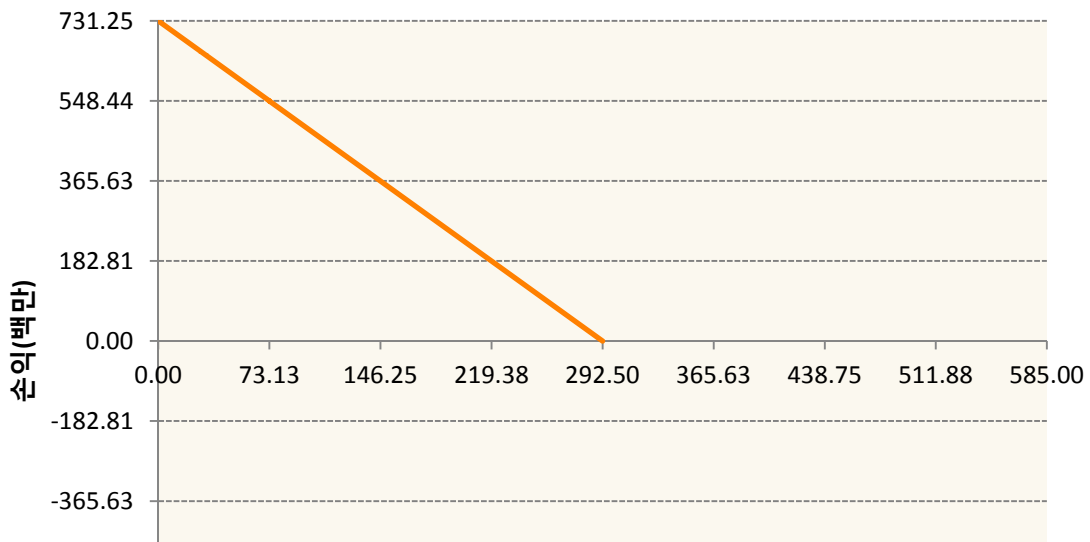


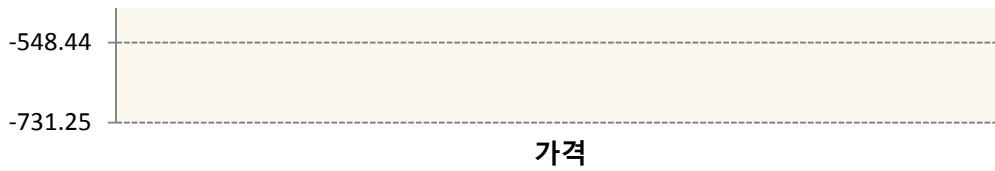


KR4201Q23107-2020-02 콜310

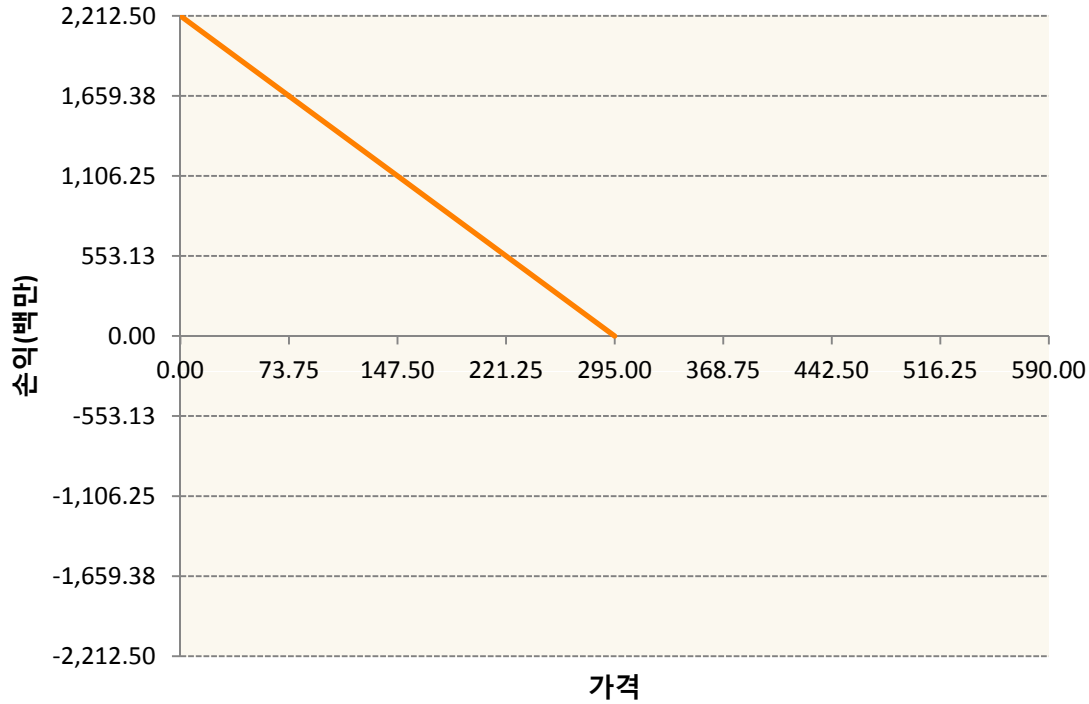


KR4301Q22925-2020-02 풋292.5





KR4301Q22958-2020-02 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						806
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-806	-806	-806	-806	-806	-806	-806	
-5.33%	-537	-537	-537	-537	-537	-537	-537	
-2.67%	-269	-269	-269	-269	-269	-269	-269	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	269	269	269	269	269	269	269	
5.33%	537	537	537	537	537	537	537	
8.00%	806	806	806	806	806	806	806	
KR4201Q23073		2020-02 콜307.5						303
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	60	60	59	57	55	53	49	
-5.33%	58	57	54	50	46	41	35	
-2.67%	52	47	41	34	26	18	8	

0%	31	21	11	0	-11	-23	-36
2.67%	-16	-30	-44	-58	-72	-87	-101
5.33%	-101	-116	-131	-146	-161	-176	-190
8.00%	-224	-236	-249	-262	-276	-289	-303
KR4201Q23107 2020-02 콜310							519
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	89	89	88	86	83	79	74
-5.33%	88	85	81	76	70	62	52
-2.67%	79	72	63	52	39	25	10
0%	51	35	18	0	-20	-40	-61
2.67%	-20	-44	-68	-93	-119	-144	-170
5.33%	-155	-183	-211	-239	-267	-295	-323
8.00%	-361	-387	-412	-439	-465	-492	-519
KR4301Q22925 2020-02 풋292.5							47
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	47	47	47	47	47	47	47
-5.33%	28	28	28	28	28	29	29
-2.67%	10	10	11	12	12	13	14
0%	-2	-2	-1	0	1	2	2
2.67%	-7	-7	-6	-6	-5	-5	-4
5.33%	-8	-8	-8	-8	-7	-7	-7
8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
KR4301Q22958 2020-02 풋295							151
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	150	150	150	150	151	151	151
-5.33%	92	92	92	93	93	94	95
-2.67%	36	37	39	40	42	44	45
0%	-7	-5	-2	0	2	5	7
2.67%	-28	-26	-25	-23	-21	-18	-16
5.33%	-33	-33	-32	-31	-30	-29	-28
8.00%	-34	-34	-34	-33	-33	-33	-32

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

(단위:백만원)

1,418

공시일	2020-01-30
기준일	2020-01-29

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	210,063	0	210,063	

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	2020-01-30
기준일	2020-01-29

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	219,264	0	219,264	

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	2020-01-30
기준일	2020-01-29

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	538,457	0	538,457	
누계	통화	선도	0	600,490	-600,490	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	188
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,825
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,825
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,354
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,543
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	1,639
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	1,544
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	942
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	188
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	2,015
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	942
FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E	3,767
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,884
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	1,695
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	283
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E	1,884
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E	3,240
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,516
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,413
FX21020F02 KRW/USD 28-02-20E	1,884
FX21020F03 KRW/USD 28-02-20E	2,919
FX21020F03 KRW/USD 31-03-20E	3,014
FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E	2,825
FX21020F04 KRW/USD 28-02-20E	188

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

15,950

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

(단위:백만원)

120

공시일	2020-01-30
기준일	2020-01-29

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

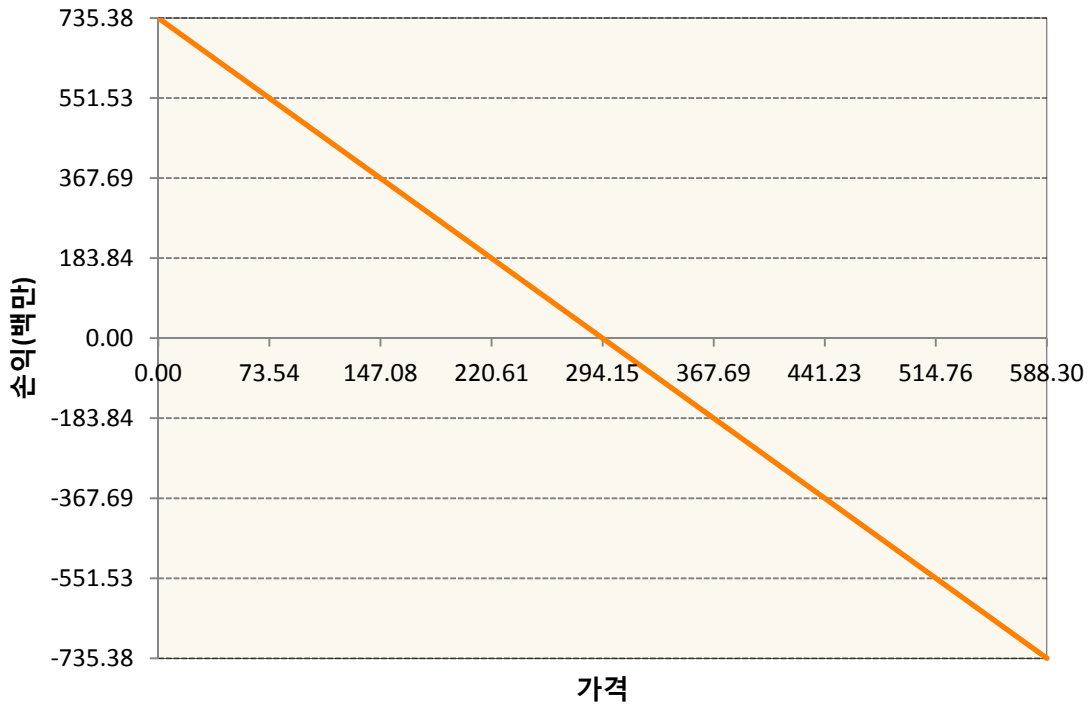
1. 계약금액

(단위:백만원)

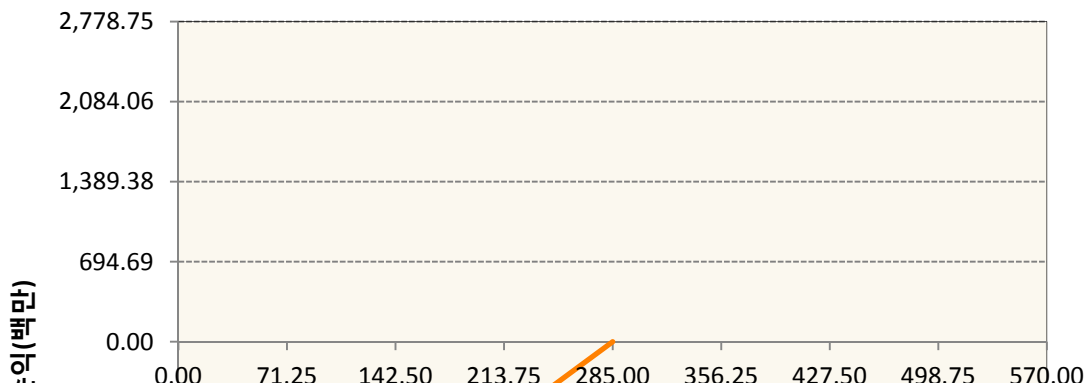
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	213	0	213	장내
누계	유가증권	선물	0	735	-735	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,569	-3,569	장내

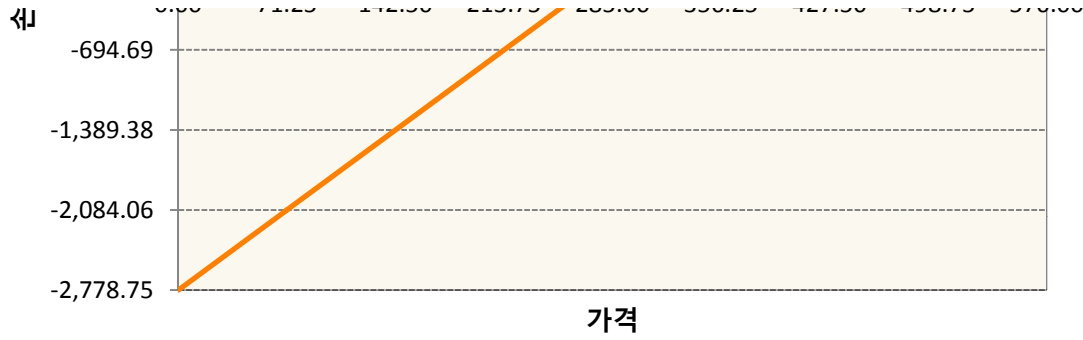
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

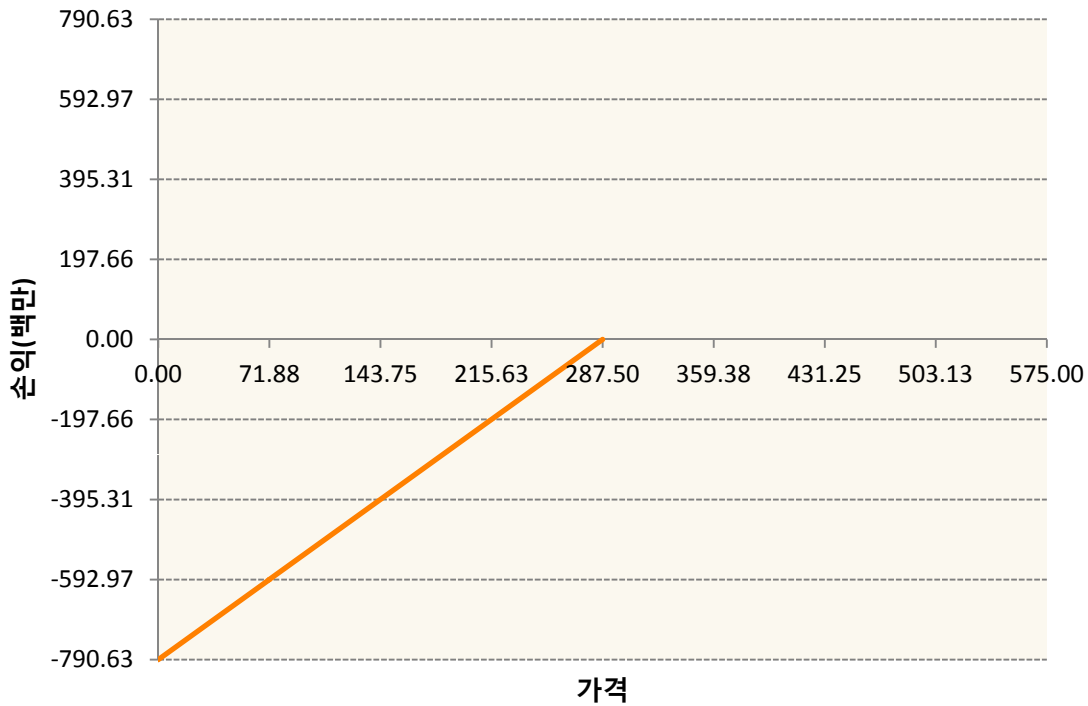


KR4301Q22859-2020-02 풋285





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						139
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-133	-134	-134	-135	-136	-137	-139
-5.33%	-63	-65	-67	-69	-72	-74	-77
-2.67%	-14	-17	-20	-23	-26	-29	-32
0%	5	4	2	0	-2	-4	-7
2.67%	9	9	8	7	7	6	4
5.33%	9	9	9	9	9	9	8
8.00%	9	9	9	9	9	9	9
KR4301Q22875 2020-02 풋287.5							44
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-43	-43	-43	-43	-43	-44	-44
-5.33%	-22	-23	-23	-24	-24	-25	-25
-2.67%	-6	-7	-8	-8	-9	-10	-11
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	4	4	4	3	3	2	2
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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

(단위:백만원)

205

공시일	2020-01-30
기준일	2020-01-29

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	12,442	0	12,442	
누계	통화	선도	0	15,822	-15,822	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 28-02-20E	205
FX21020F04 KRW/USD 28-02-20E	293
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

420

공시일	2020-01-30
기준일	2020-01-29

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

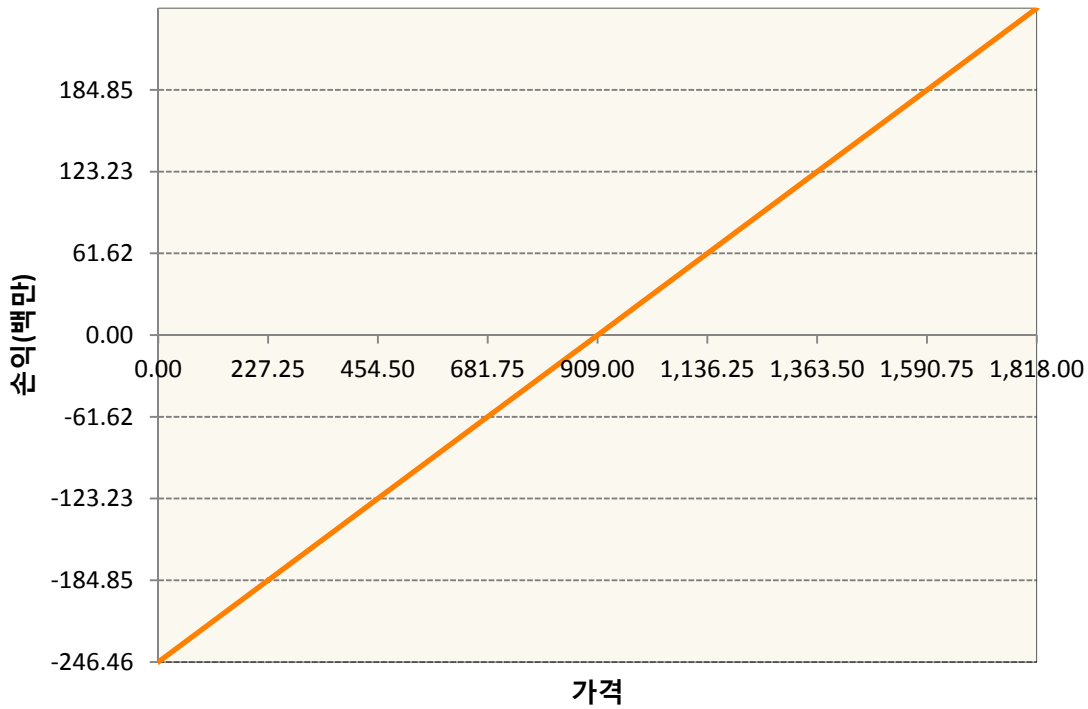
1. 계약금액

(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	2020-01-30
기준일	2020-01-29

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

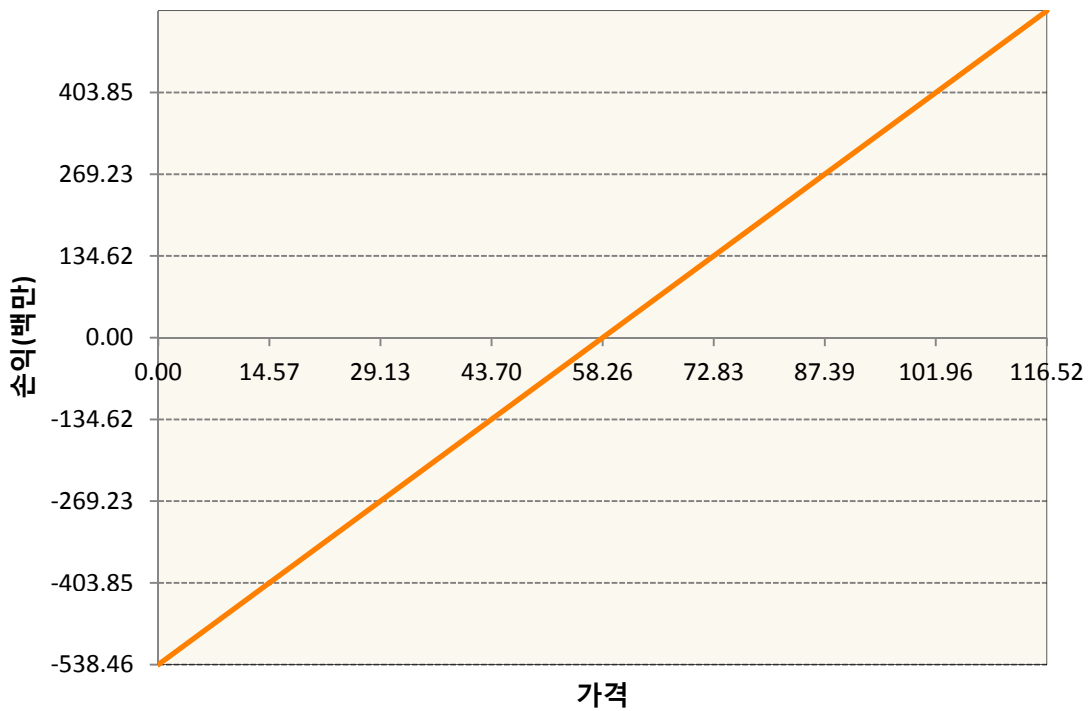
1. 계약금액

(단위:백만원)

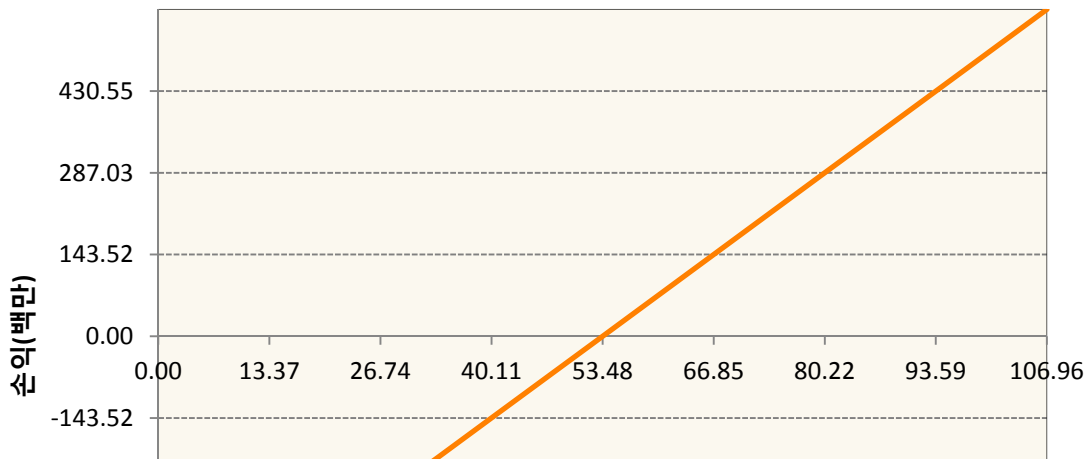
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,199	188	2,011	

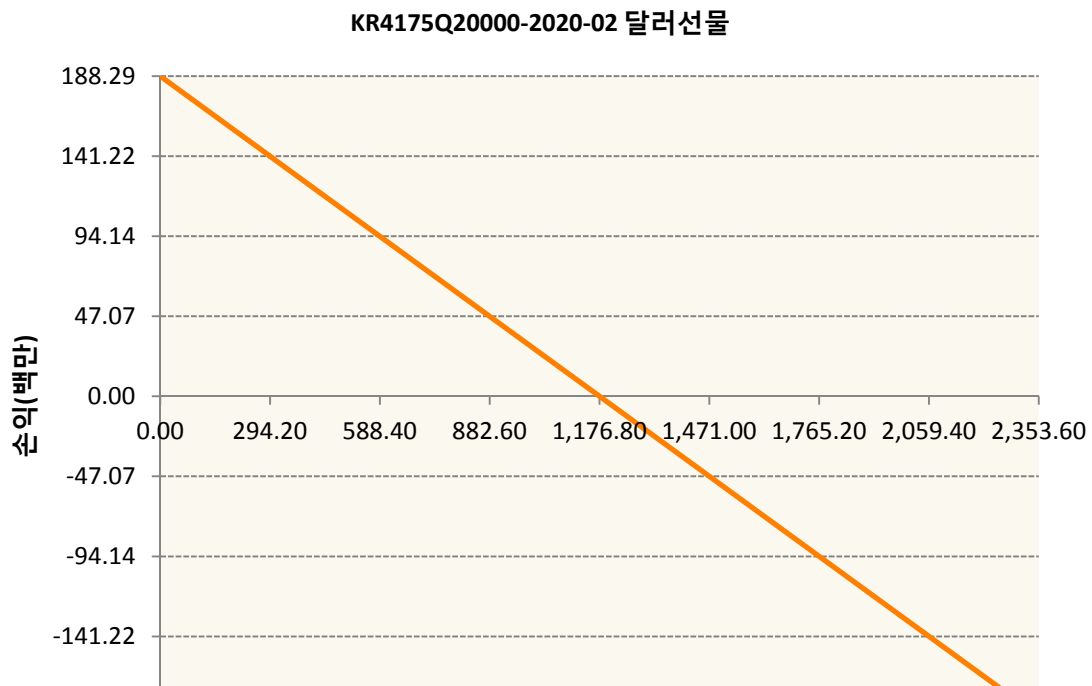
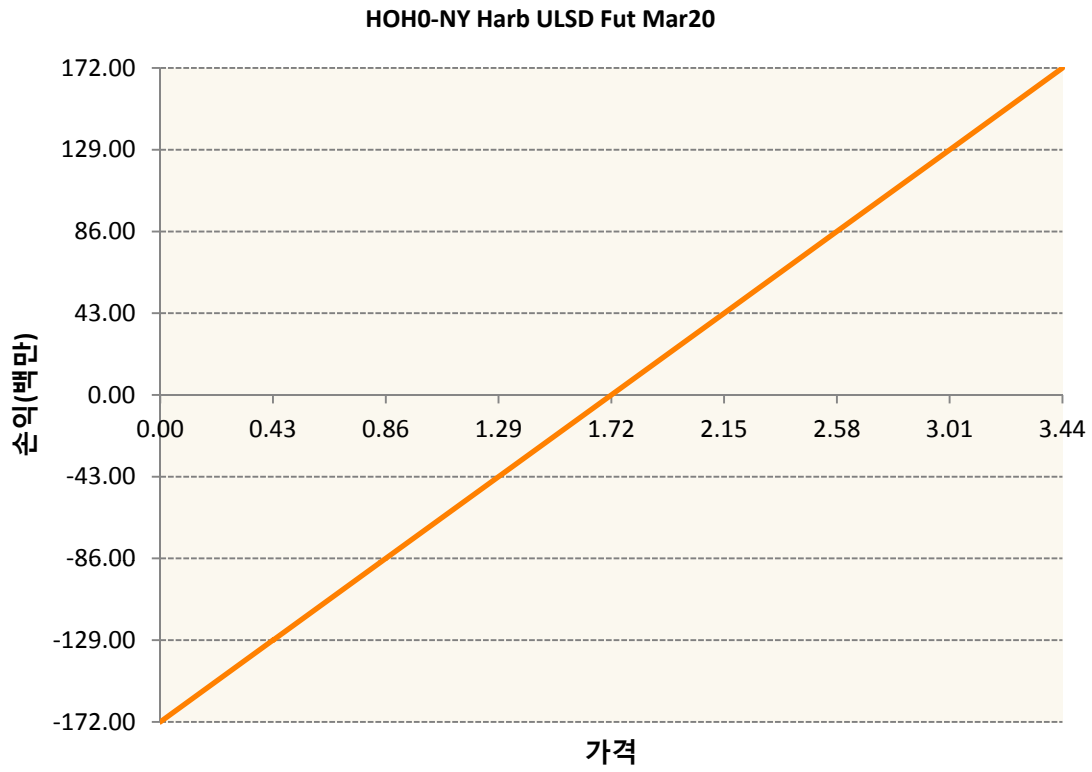
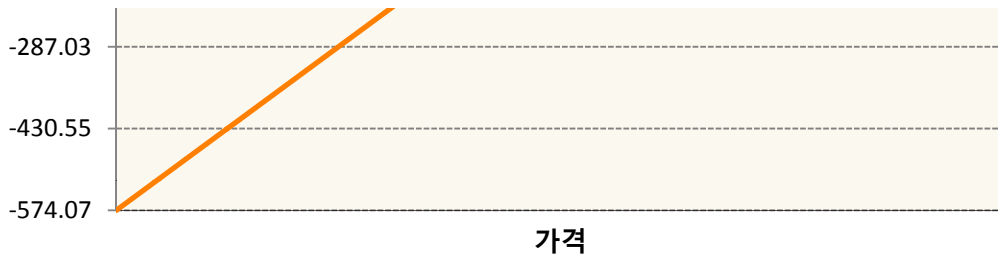
2. 만기시점의 손익구조

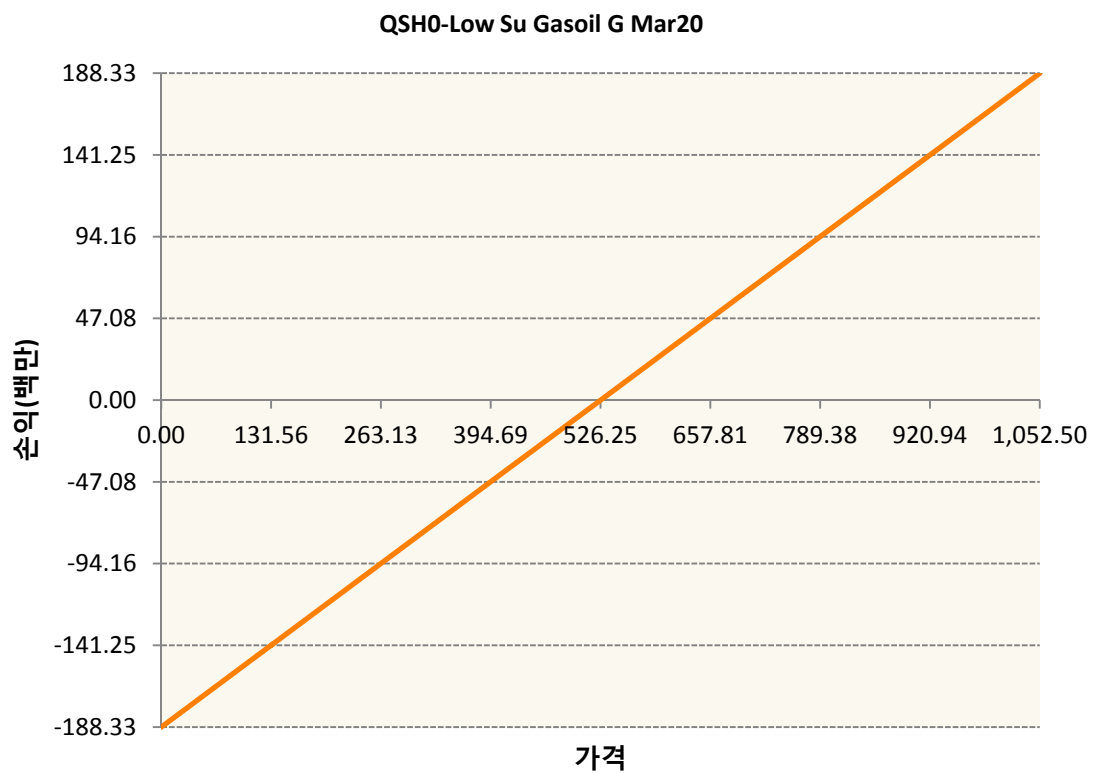
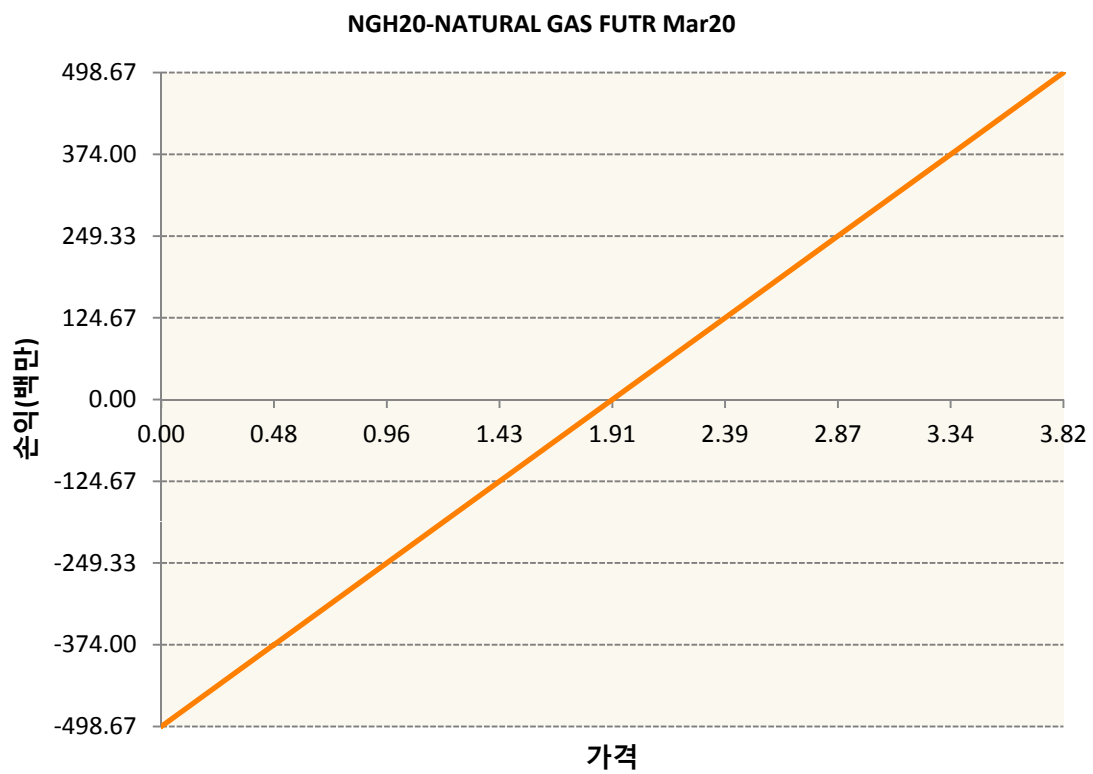
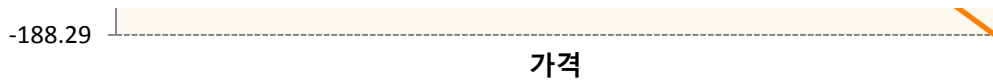
COKO-BRENT CRUDE FUTR May20



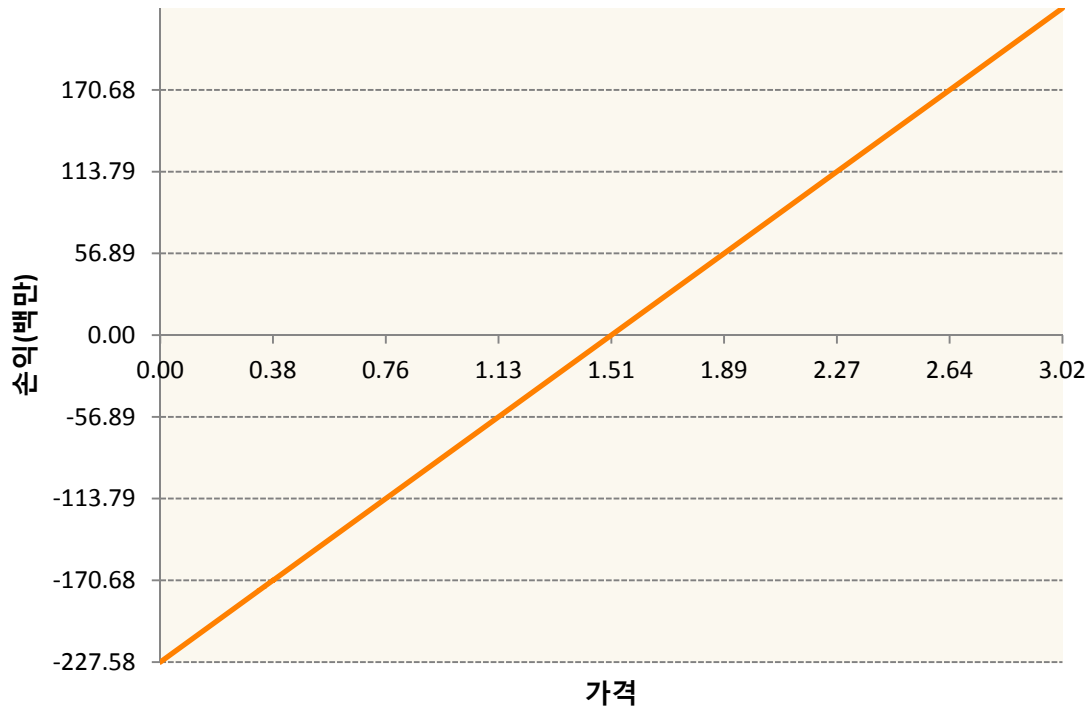
CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20







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	14
KR4175Q20C	2020-02 달러선물	15
NGH20	NATURAL GAS FUTR Mar20	40
QSH0	Low Su Gasoil G Mar20	15
XBH0	GASOLINE RBOB FUT Mar20	18

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

(단위:백만원)

342

공시일	2020-01-30
기준일	2020-01-29

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

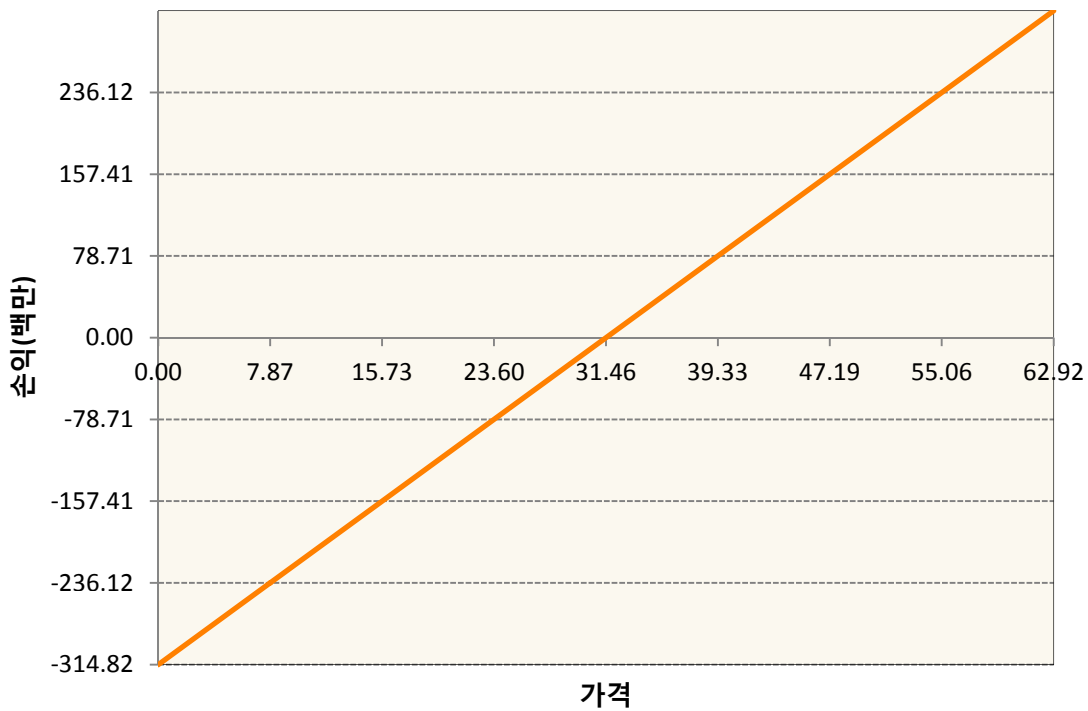
1. 계약금액

(단위:백만원)

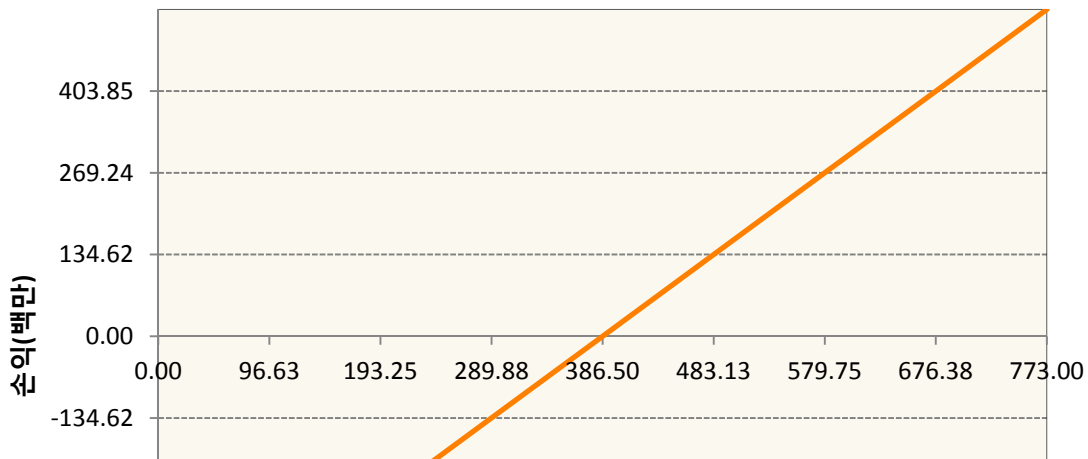
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,780	153	2,627	

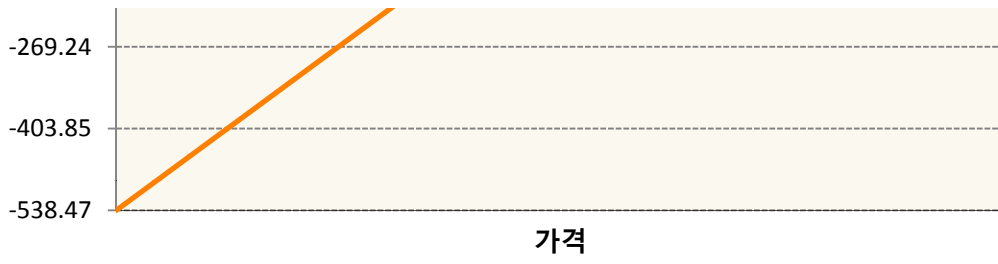
2. 만기시점의 손익구조

BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20

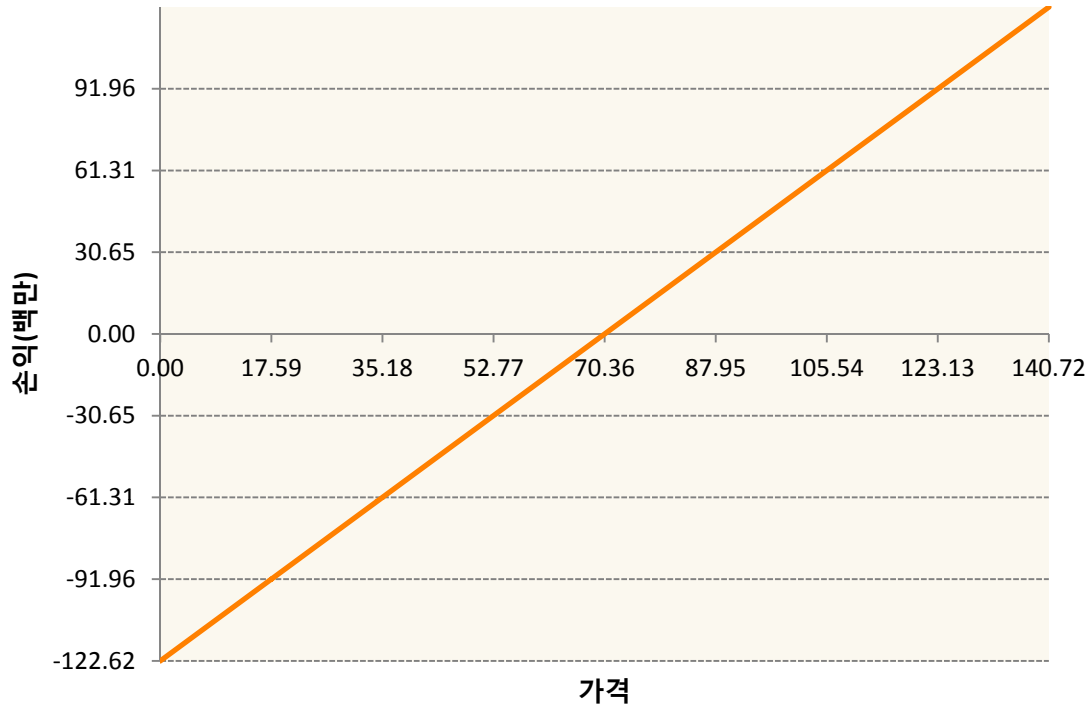


CH0-CORN FUTURE Mar20

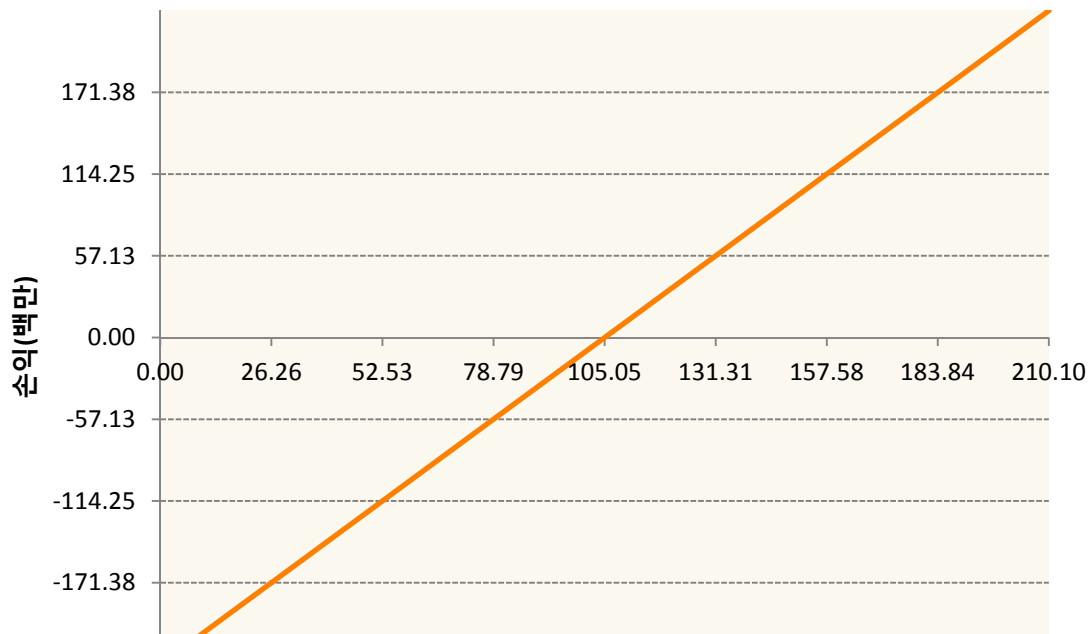


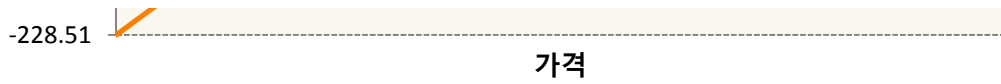


CTH0-COTTON NO.2 FUTR Mar20

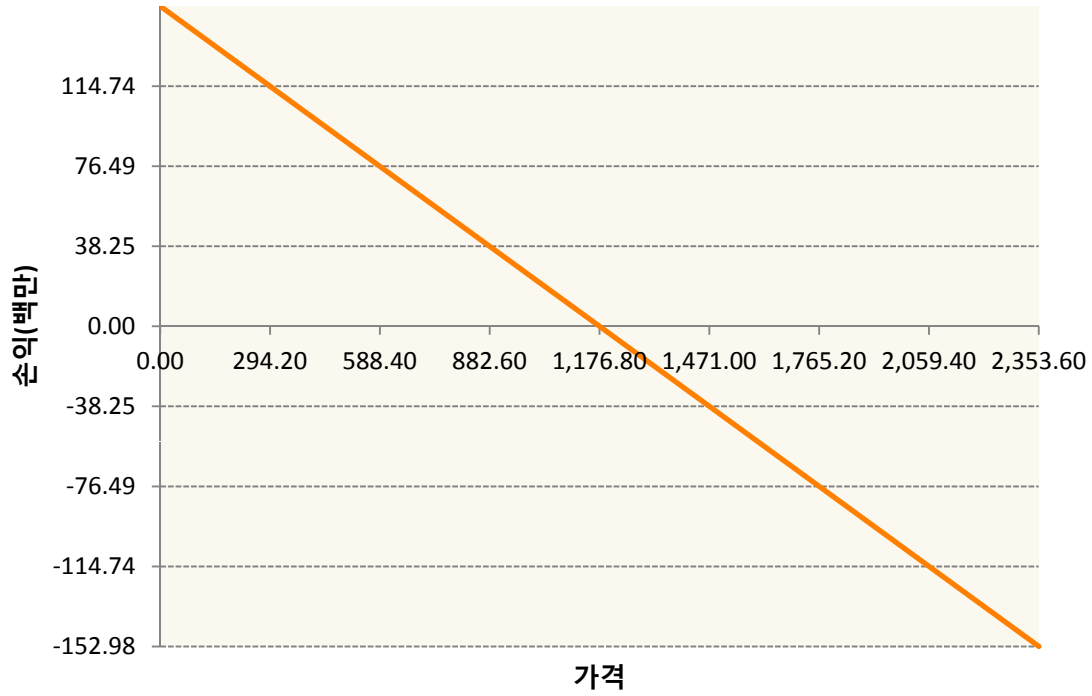


KCH0-COFFEE 'C' FUTURE Mar20

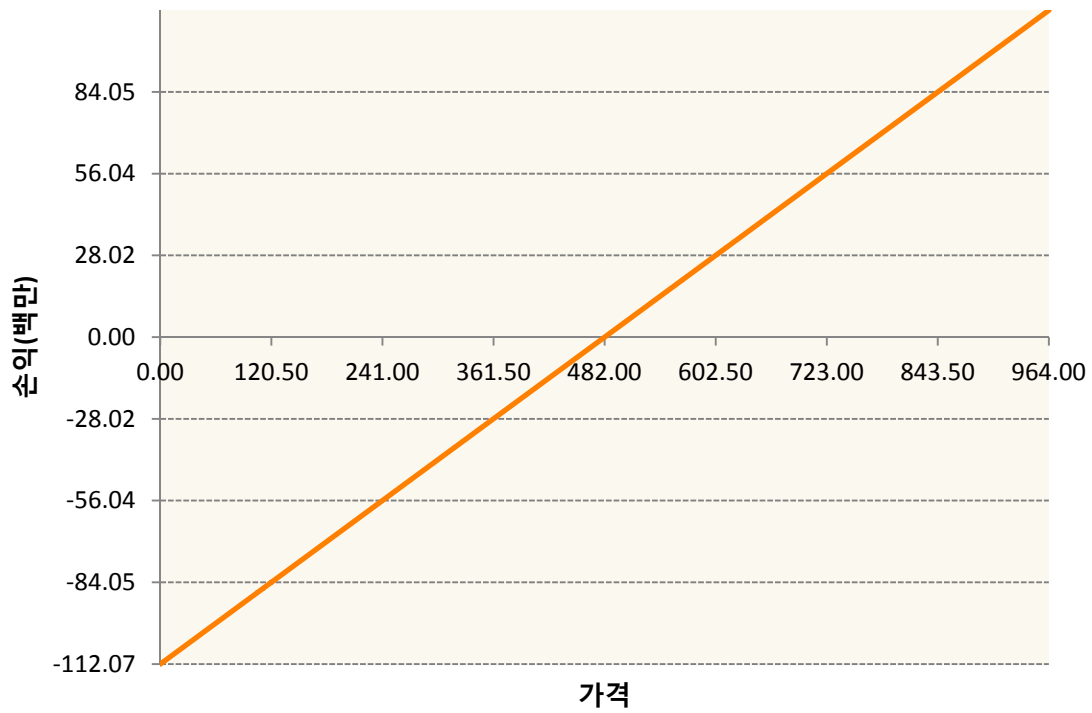




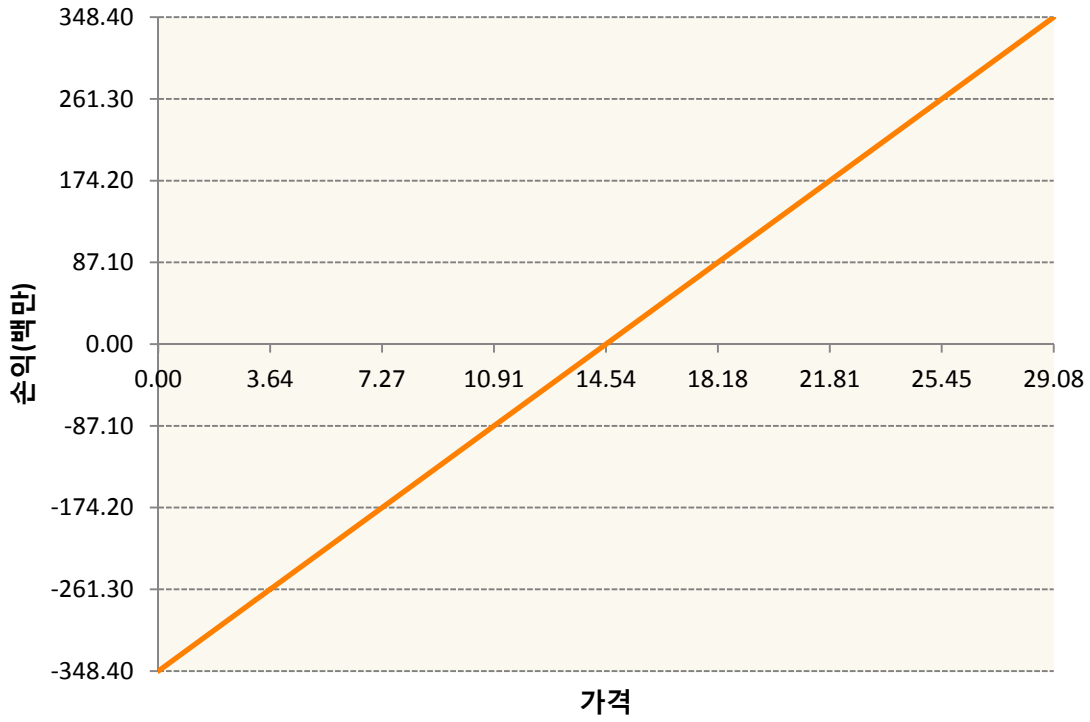
KR4175Q20000-2020-02 달러선물



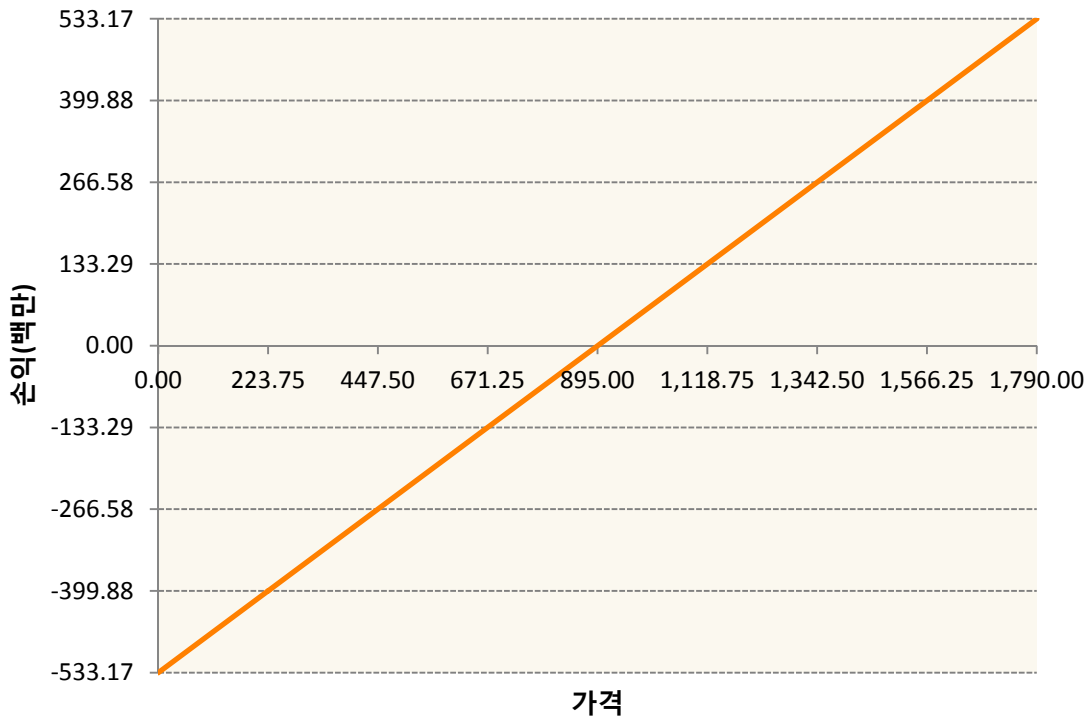
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

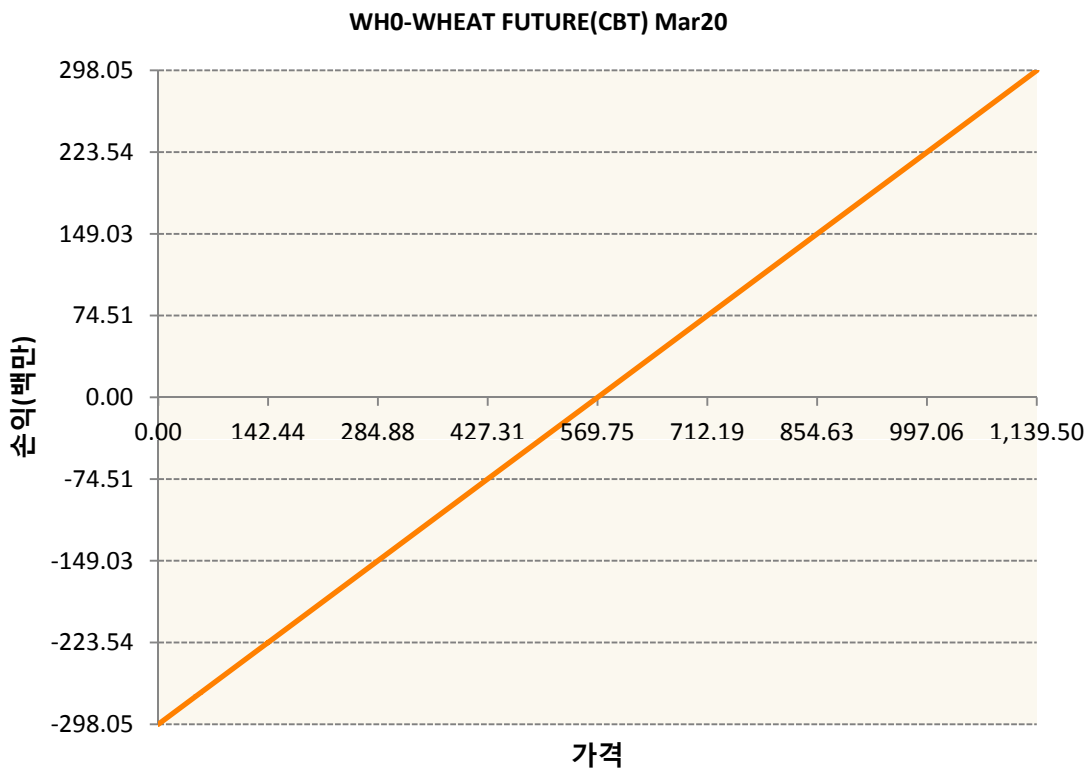
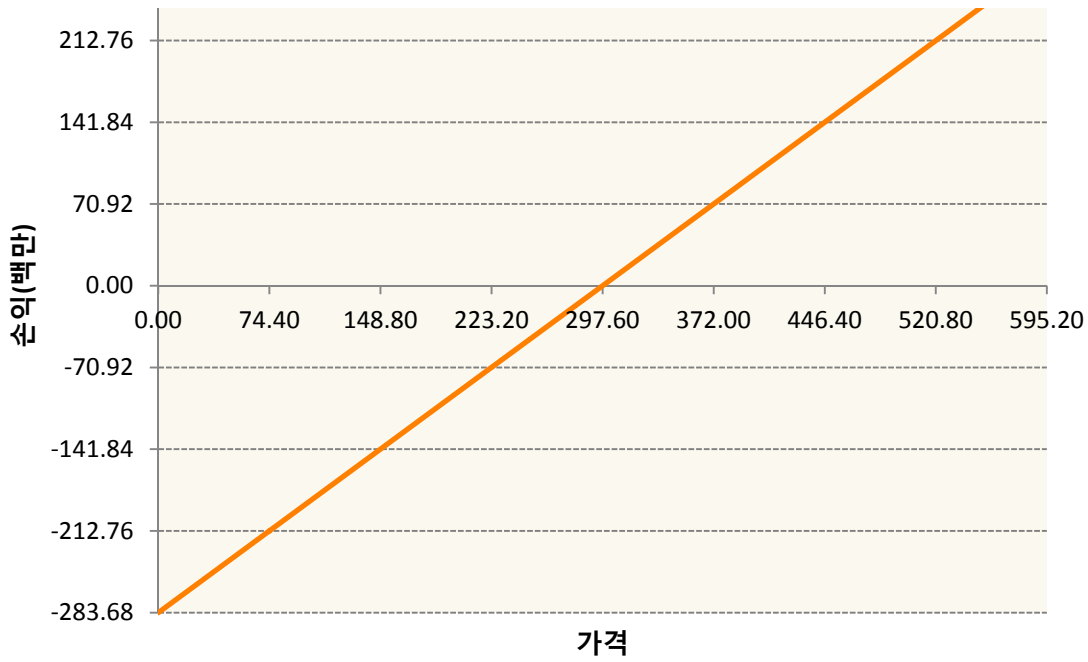


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20



SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH0	SOYBEAN OIL FUTR Mar20	25
CH0	CORN FUTURE Mar20	43
CTH0	COTTON NO.2 FUTR Mar20	10
KCH0	COFFEE 'C' FUTURE Mar20	18
KR4175Q20C	2020-02 달러선물	12

KWH0	KC HRW WHEAT FUT Mar20	9
SBH0	Sugar Mar20	28
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)

241