

공시일	2020-01-31
기준일	2020-01-30

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	2020-01-31
기준일	2020-01-30

스마트인덱스모

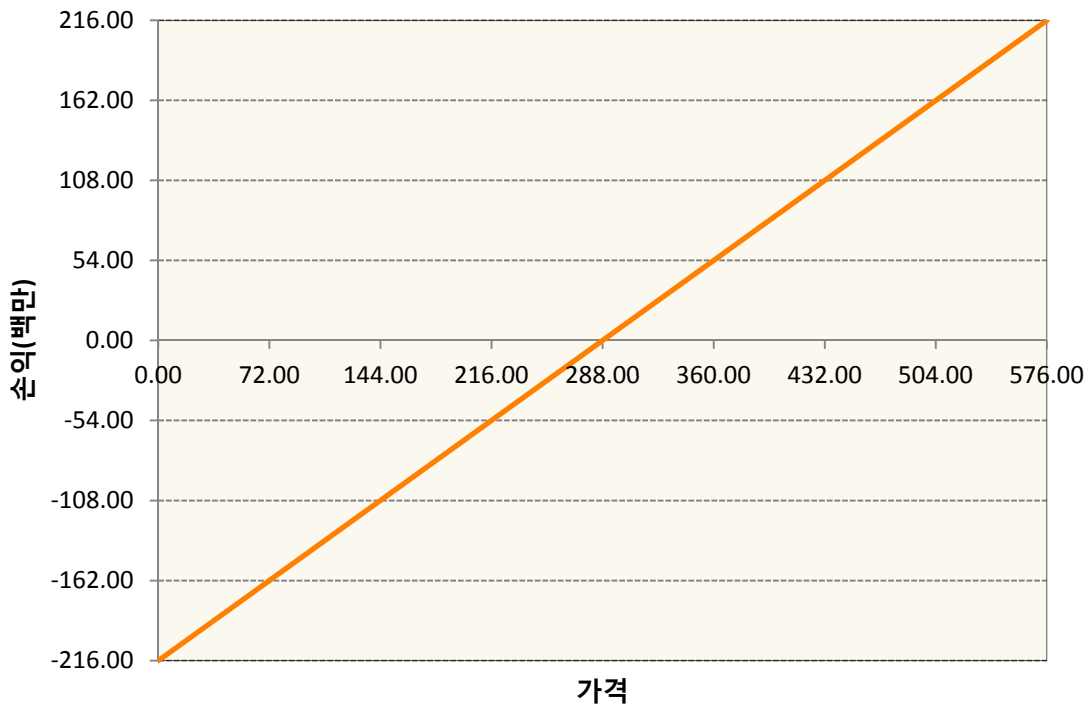
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	216	0	216	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						17
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
-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%	17	17	17	17	17	17	17	

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

(단위:백만원)

14

공시일	2020-01-31
기준일	2020-01-30

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

1,137

* 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	2020-01-31
기준일	2020-01-30

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)	419
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	153

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

806

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-01-31
기준일	2020-01-30

유로인덱스모(주식-파생형)

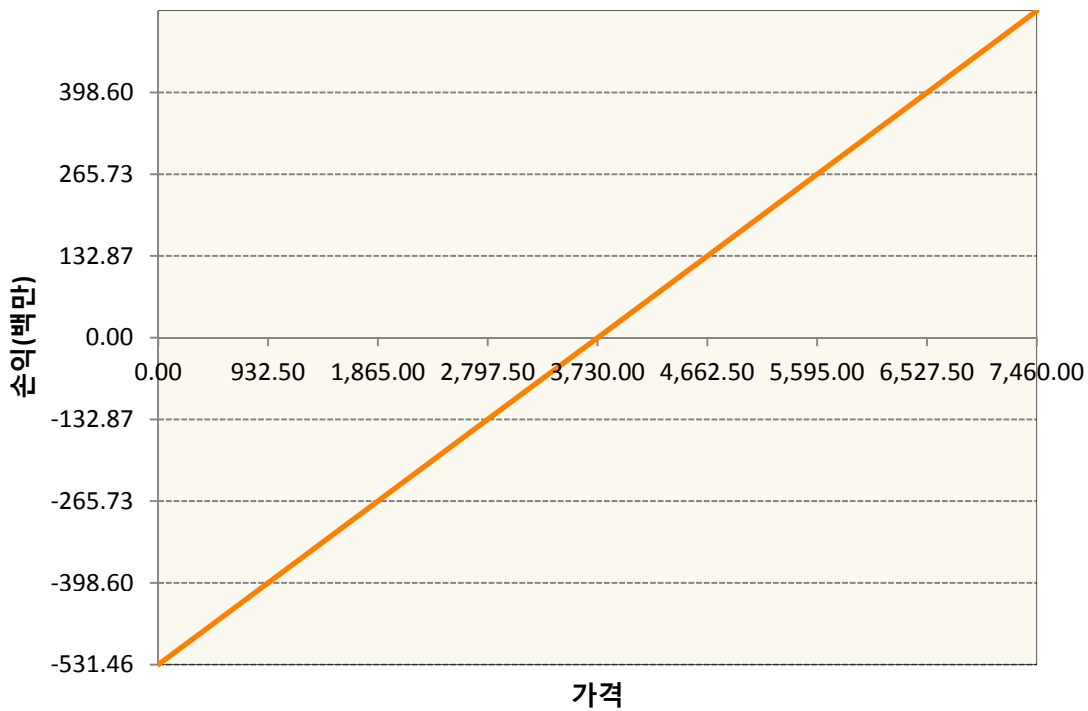
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	531	0	531	

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	2020-01-31
기준일	2020-01-30

차이나인덱스모(주식-파생형)

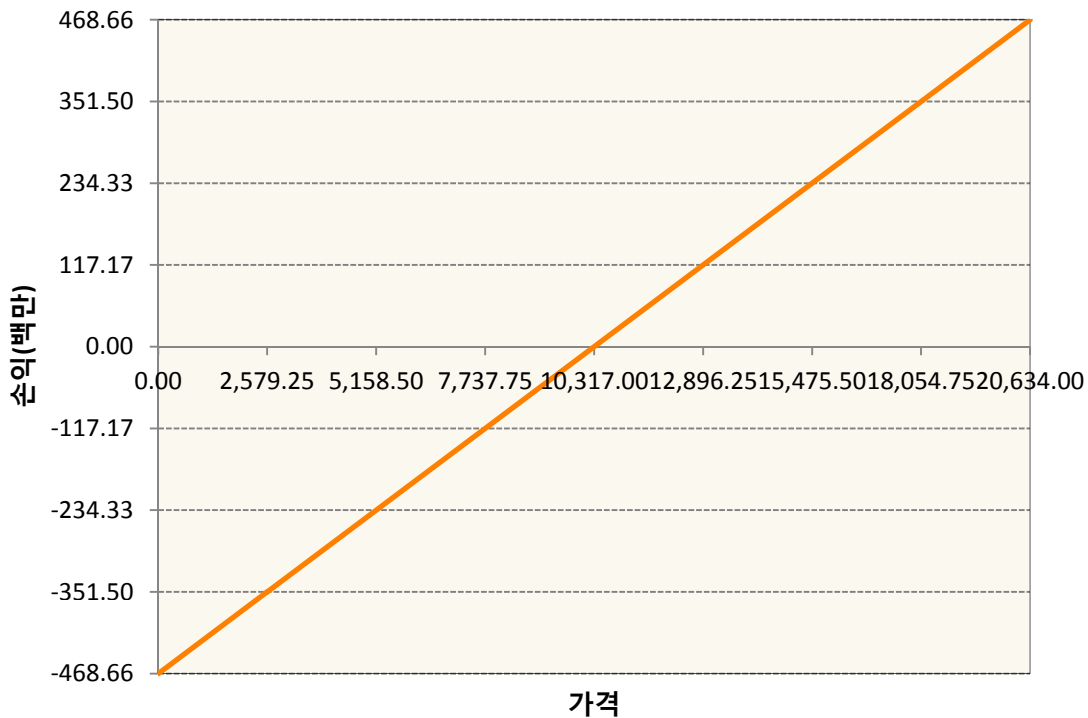
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	469	0	469	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCG0-HSCEI Futures Feb20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCG0	HSCEI Futures Feb20	37
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

34

공시일	2020-01-31
기준일	2020-01-30

커버드콜모(주식혼합-파생형)

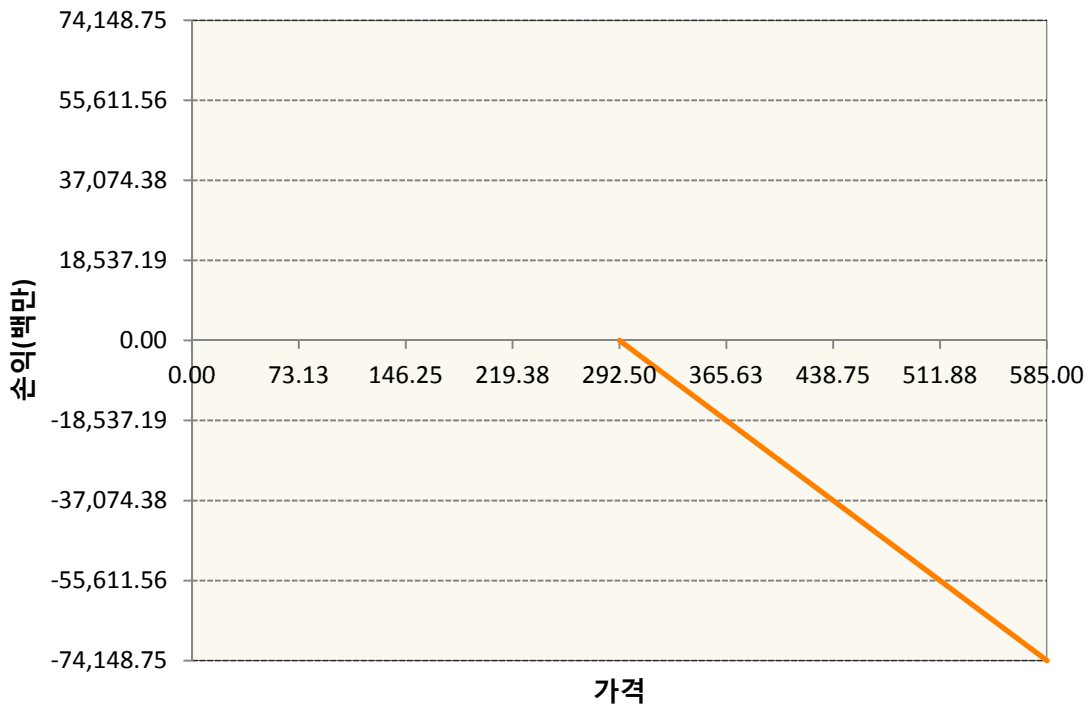
1. 계약금액

(단위:백만원)

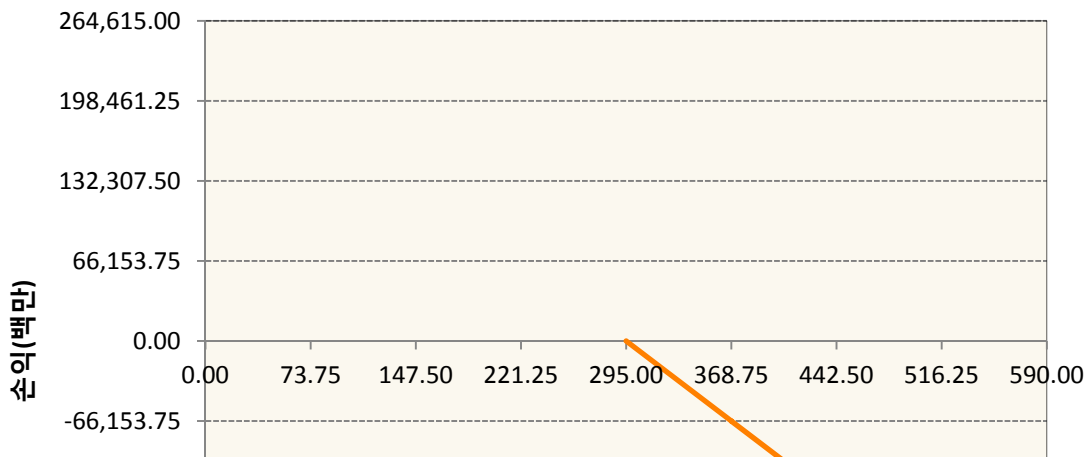
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	455,004	-455,004	장내

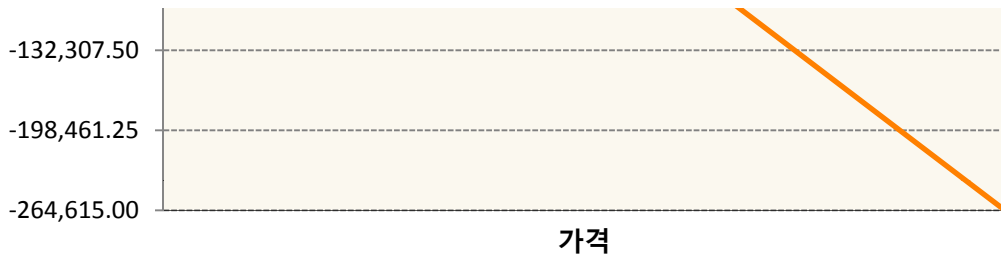
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q22927-2020-02 콜292.5

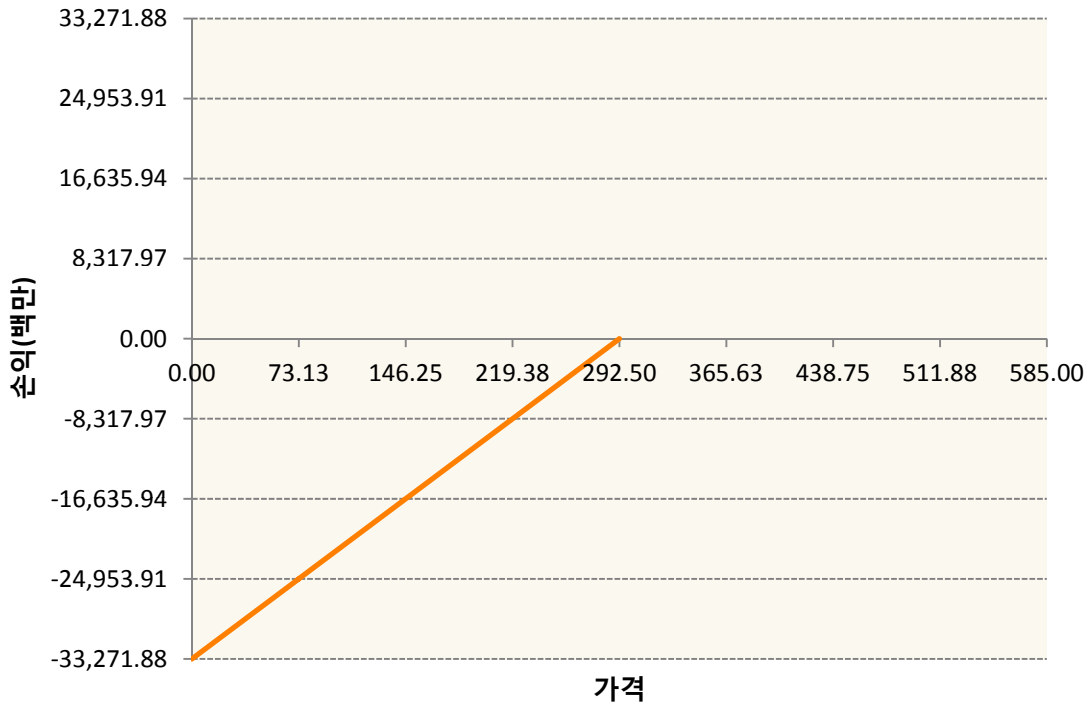


KR4201Q22950-2020-02 콜295

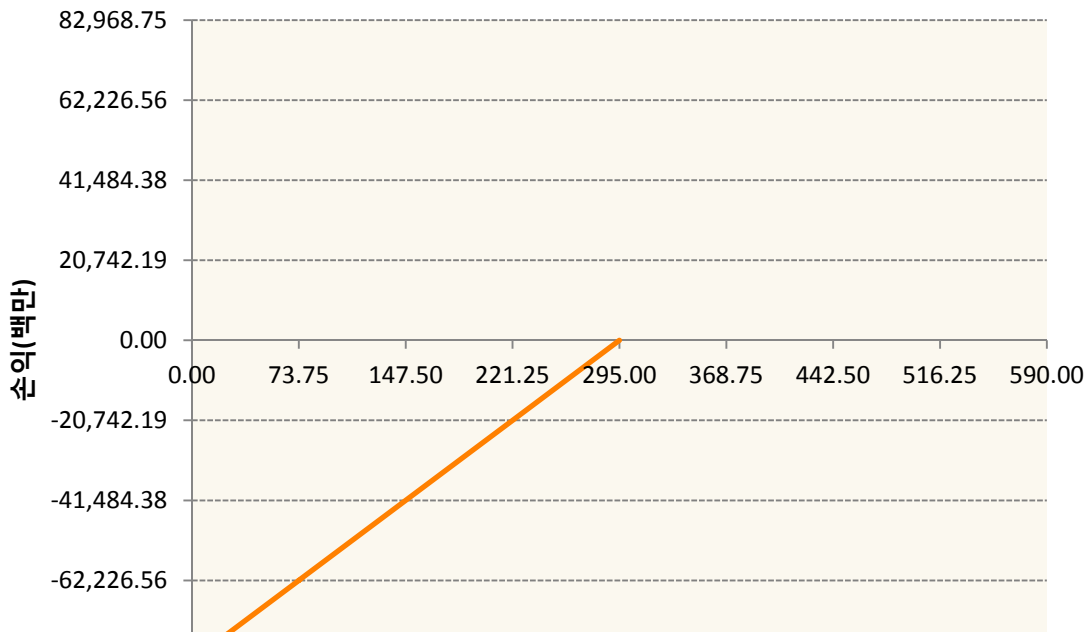




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



KR4301Q22958-2020-02 풋295



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q22927		2020-02 콜292.5						4,154
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,262	1,245	1,220	1,188	1,147	1,098	1,042	
-5.33%	1,193	1,144	1,084	1,016	939	855	765	
-2.67%	964	866	760	649	533	414	291	
0%	422	283	142	0	-142	-285	-429	
2.67%	-550	-693	-838	-983	-1,128	-1,274	-1,420	
5.33%	-1,943	-2,052	-2,168	-2,289	-2,414	-2,543	-2,674	
8.00%	-3,638	-3,701	-3,775	-3,859	-3,951	-4,049	-4,154	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						13,791
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,667	3,627	3,563	3,474	3,357	3,214	3,045	
-5.33%	3,508	3,376	3,208	3,006	2,773	2,514	2,230	
-2.67%	2,926	2,631	2,306	1,955	1,583	1,193	789	
0%	1,415	952	480	0	-486	-976	-1,471	
2.67%	-1,513	-2,038	-2,564	-3,090	-3,616	-4,141	-4,667	
5.33%	-5,984	-6,425	-6,882	-7,351	-7,829	-8,315	-8,807	
8.00%	-11,678	-11,959	-12,276	-12,621	-12,992	-13,383	-13,791	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						2,373
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,367	-2,367	-2,368	-2,368	-2,369	-2,370	-2,373	
-5.33%	-1,494	-1,495	-1,498	-1,502	-1,508	-1,515	-1,525	
-2.67%	-638	-650	-665	-681	-701	-722	-744	
0%	101	68	34	0	-35	-70	-106	
2.67%	548	514	478	442	406	370	333	
5.33%	701	686	668	648	626	601	576	
8.00%	727	724	719	713	704	694	681	
KR4301Q22958		2020-02 풋295						6,064
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-6,056	-6,056	-6,056	-6,057	-6,058	-6,060	-6,064	
-5.33%	-3,895	-3,897	-3,900	-3,906	-3,915	-3,927	-3,943	
-2.67%	-1,754	-1,772	-1,795	-1,825	-1,860	-1,900	-1,945	
0%	210	144	74	0	-77	-155	-236	
2.67%	1,583	1,489	1,394	1,300	1,205	1,110	1,016	

5.33%	2,161	2,107	2,046	1,981	1,912	1,840	1,764
8.00%	2,288	2,274	2,255	2,230	2,198	2,162	2,120

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

(단위:백만원)

26,382

공시일	2020-01-31
기준일	2020-01-30

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

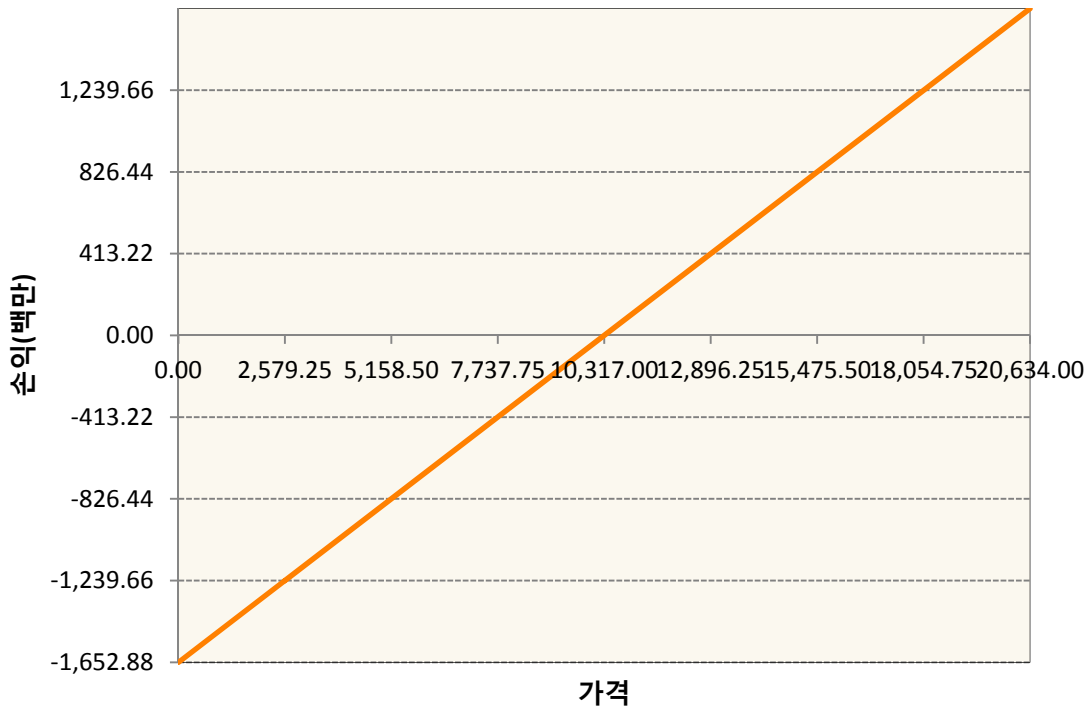
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,653	0	1,653	장내
누계	통화	선도	0	2,148	-2,148	장외

2. 만기시점의 손익구조

HCG0-HSCEI Futures Feb20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	172
HCG0 HSCEI Futures Feb20	132

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

(단위:백만원)

176

공시일	2020-01-31
기준일	2020-01-30

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

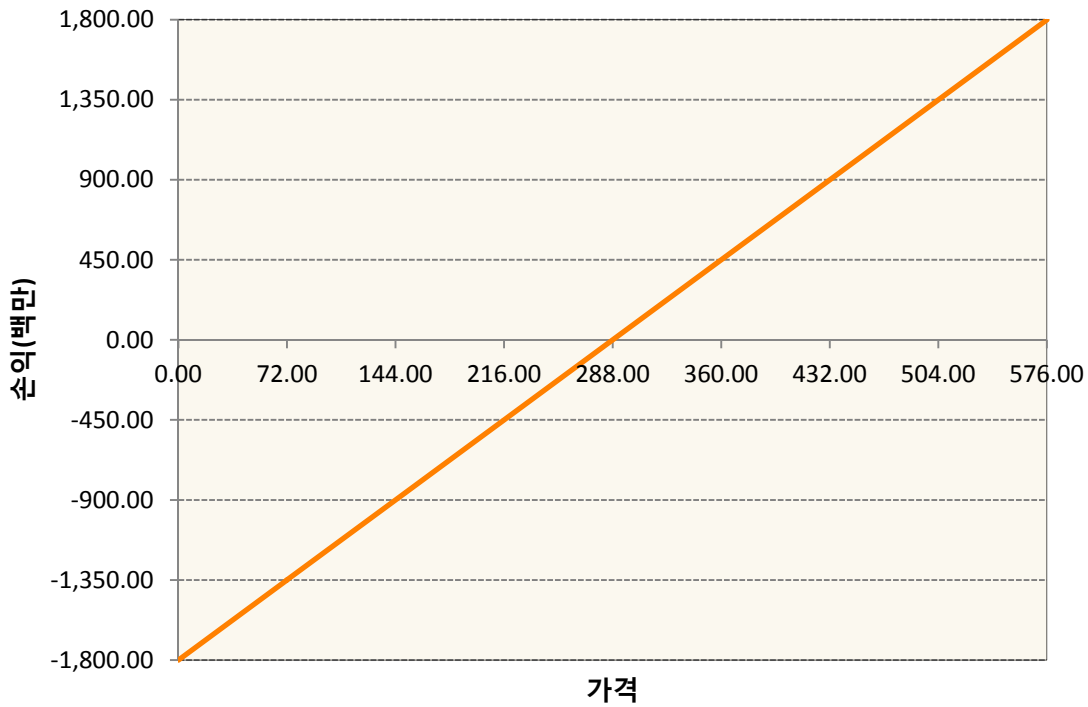
1. 계약금액

(단위:백만원)

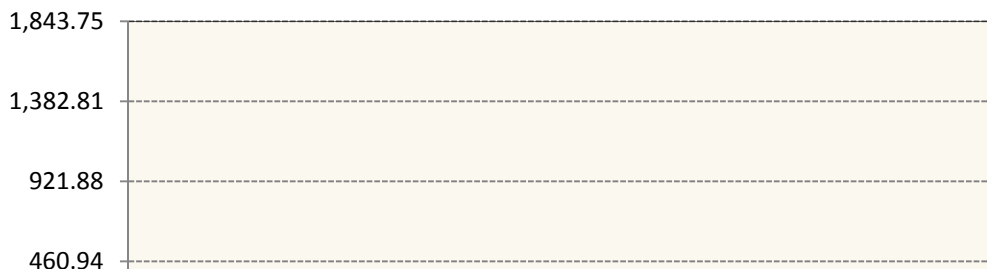
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,800	0	1,800	장내
누계	유가증권	스왑	3,625	0	3,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,608	-3,608	장내

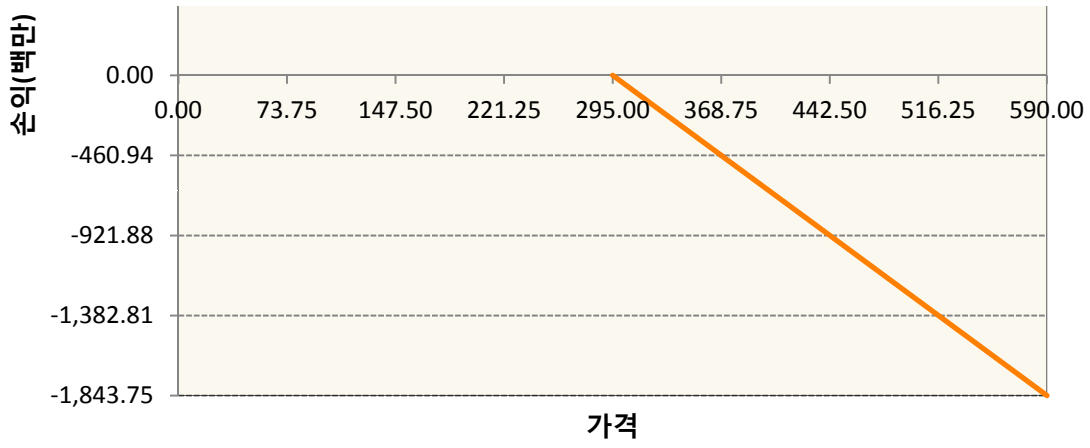
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

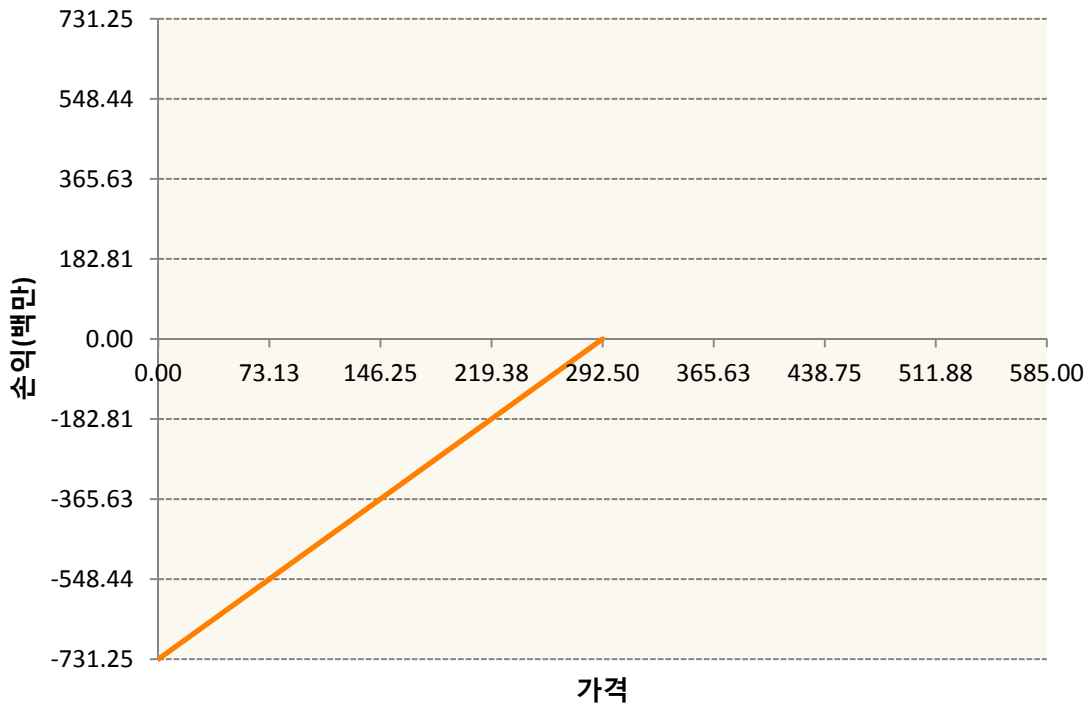


KR4201Q22950-2020-02 콜295

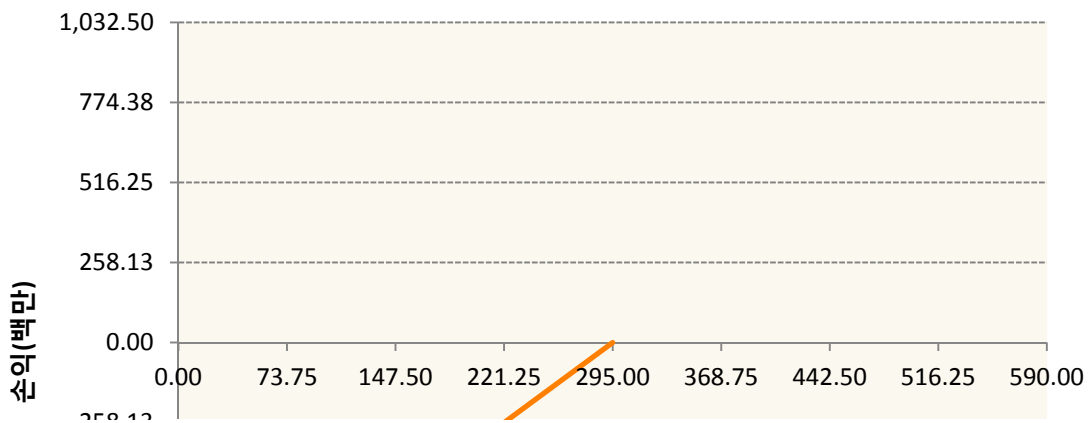


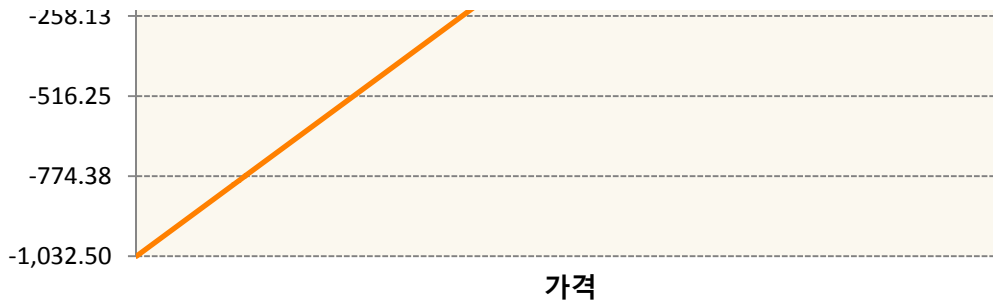


KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



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						144
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-144	-144	-144	-144	-144	-144	-144	
-5.33%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96	
-2.67%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	48	48	48	48	48	48	48	
5.33%	96	96	96	96	96	96	96	
8.00%	144	144	144	144	144	144	144	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						96
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	26	25	25	24	23	22	21	
-5.33%	24	24	22	21	19	18	16	
-2.67%	20	18	16	14	11	8	6	
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10	
2.67%	-11	-14	-18	-22	-25	-29	-33	
5.33%	-42	-45	-48	-51	-55	-58	-61	
8.00%	-81	-83	-86	-88	-91	-93	-96	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						52
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-34
-2.67%	-14	-14	-15	-15	-15	-16	-16
0%	2	1	1	0	-1	-2	-2
2.67%	12	11	11	10	9	8	7
5.33%	15	15	15	14	14	13	13
8.00%	16	16	16	16	15	15	15
KR4301Q22958 2020-02 풋295							75
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-5.33%	-48	-48	-49	-49	-49	-49	-49
-2.67%	-22	-22	-22	-23	-23	-24	-24
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	20	19	17	16	15	14	13
5.33%	27	26	25	25	24	23	22
8.00%	28	28	28	28	27	27	26

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

(단위:백만원)

663

공시일	2020-01-31
기준일	2020-01-30

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

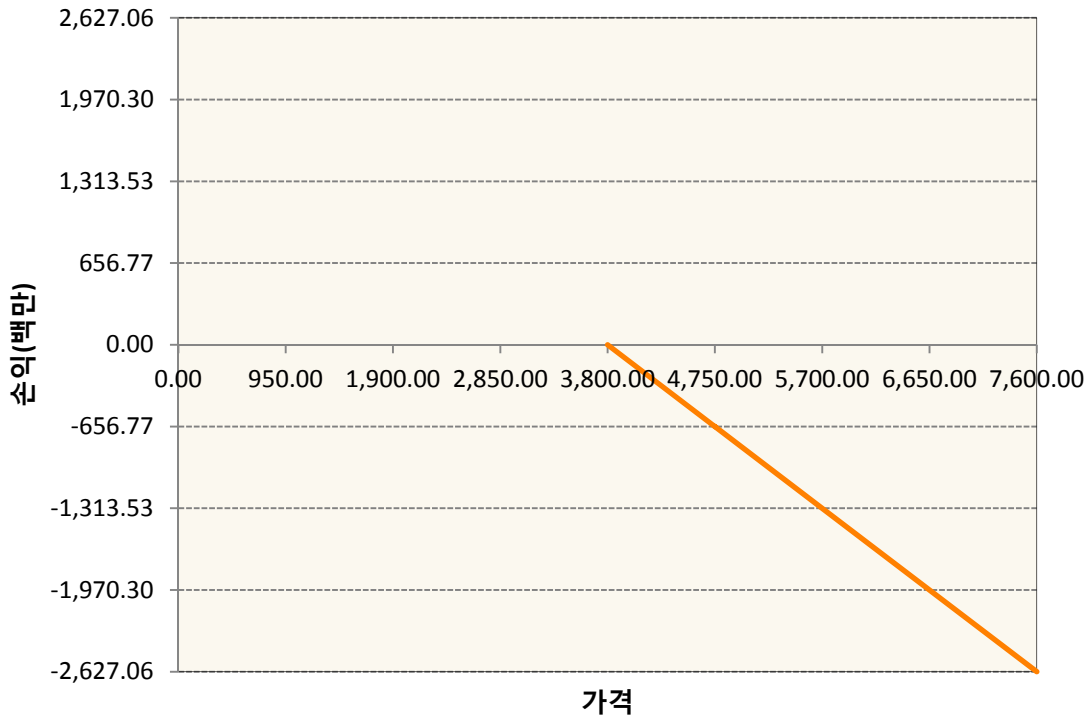
1. 계약금액

(단위:백만원)

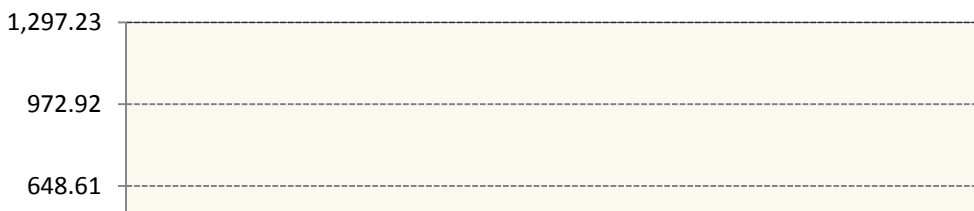
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	770	0	770	
누계	유가증권	스왑	13,630	0	13,630	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,849	-7,849	장내
누계	통화	선도	0	3,423	-3,423	장외

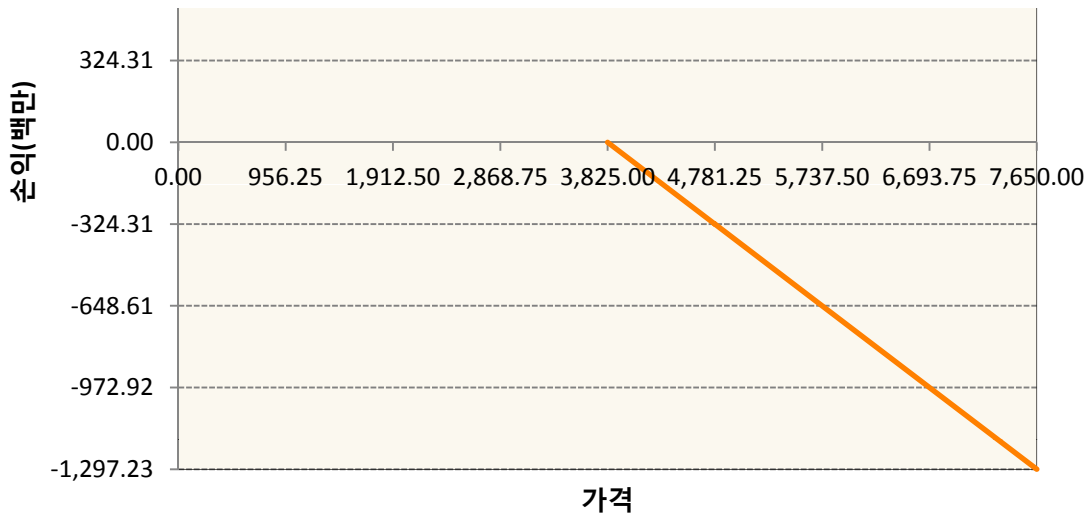
2. 만기시점의 손익구조

OESXG0-C3800-EURO STOXX 50

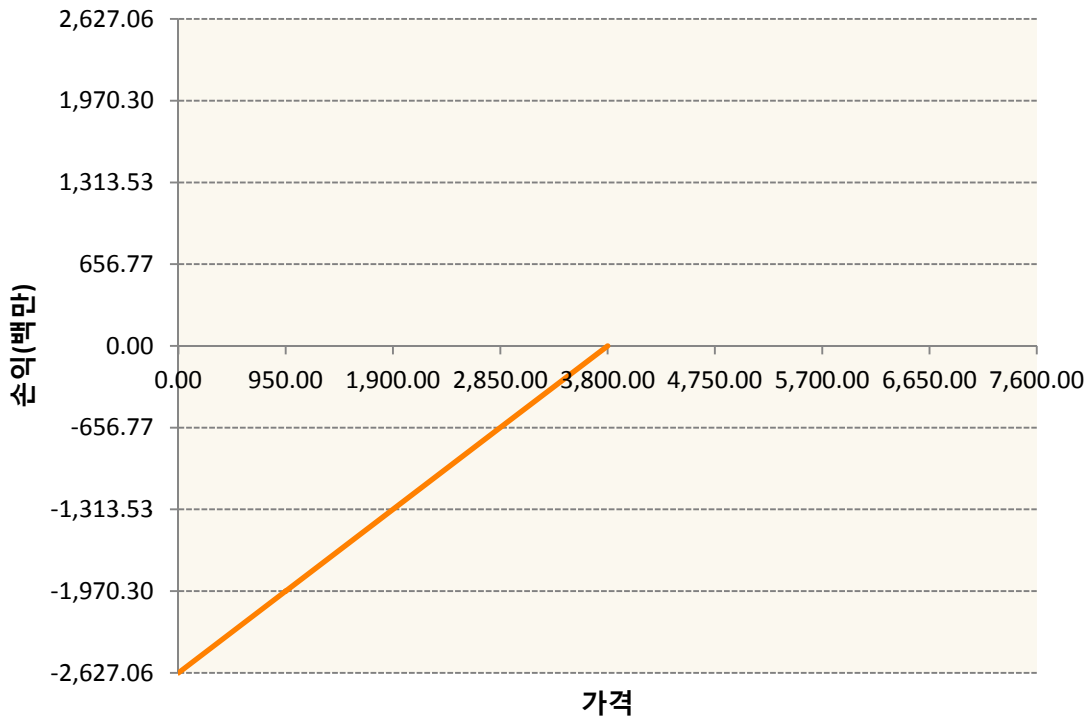


OESXG0-C3825-EURO STOXX 50

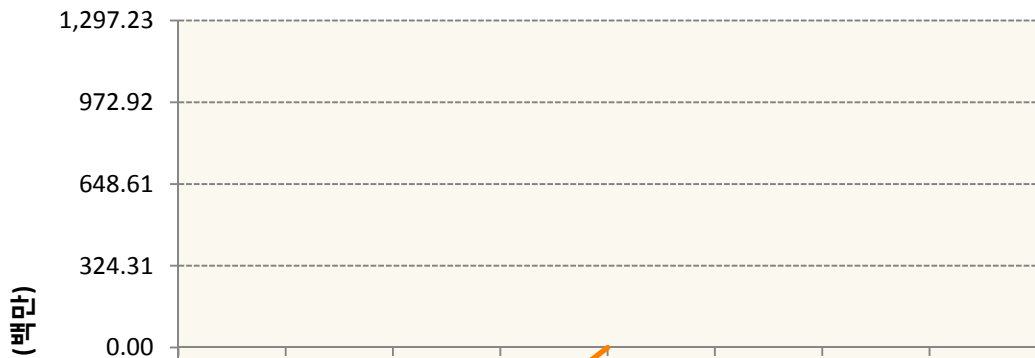


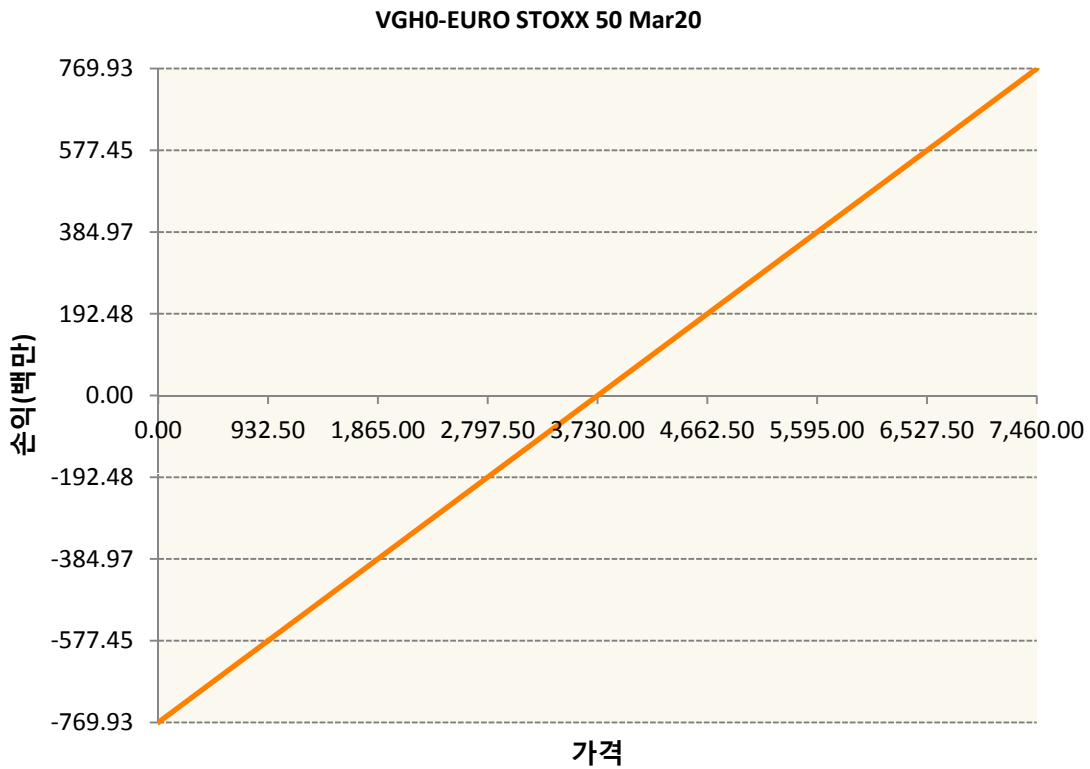
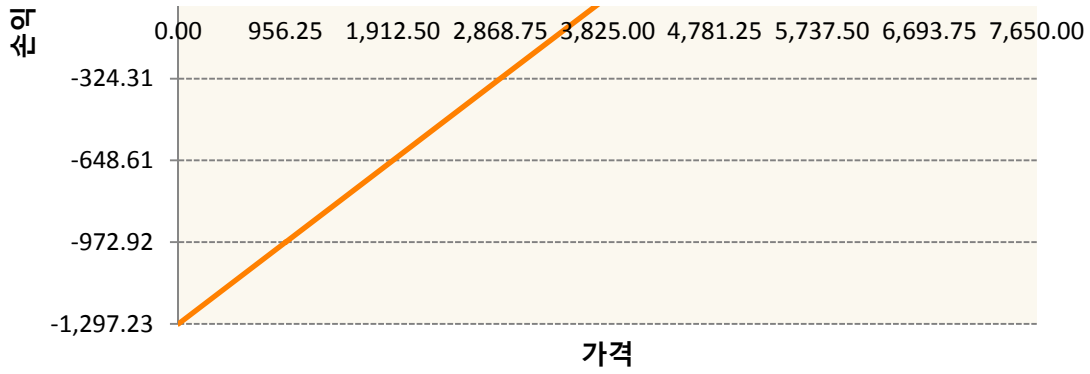


OESXG0-P3800-EURO STOXX 50



OESXG0-P3825-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		13
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E		274
OESXG0-C3& EURO STOXX 50		210
OESXG0-C3& EURO STOXX 50		104
OESXG0-P3& EURO STOXX 50		210
OESXG0-P3& EURO STOXX 50		104
VGHO EURO STOXX 50 Mar20		62

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

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

(단위:백만원)

897

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

(단위:백만원)

79

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

(단위:백만원)

116

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

(단위:백만원)

42

공시일	2020-01-31
기준일	2020-01-30

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

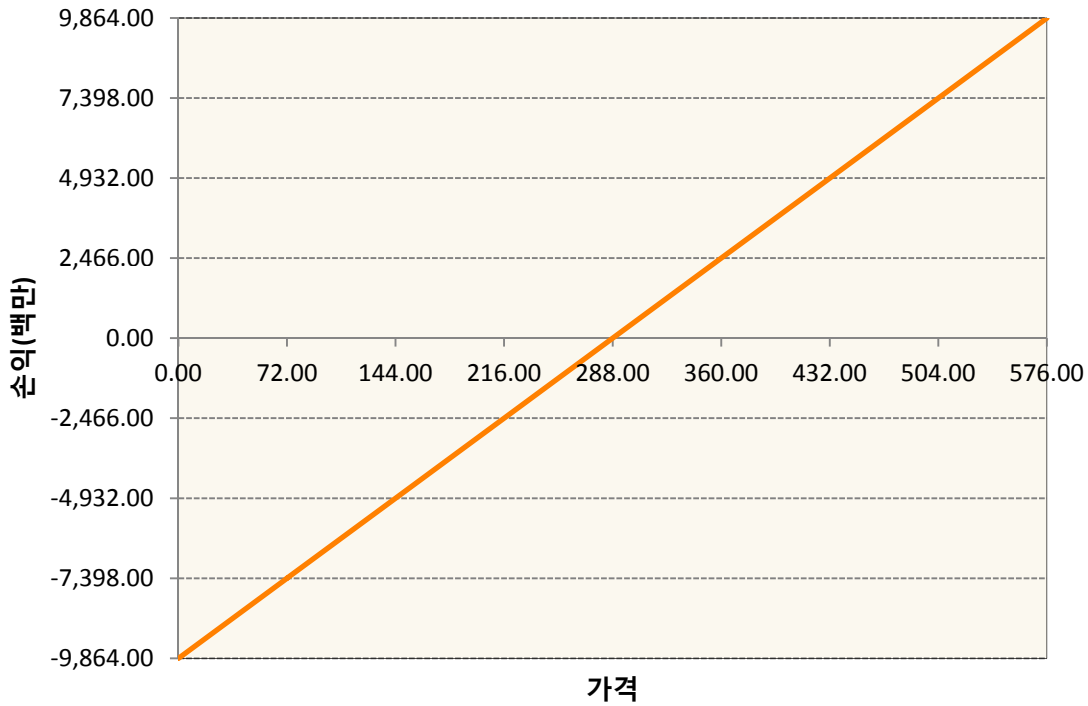
1. 계약금액

(단위:백만원)

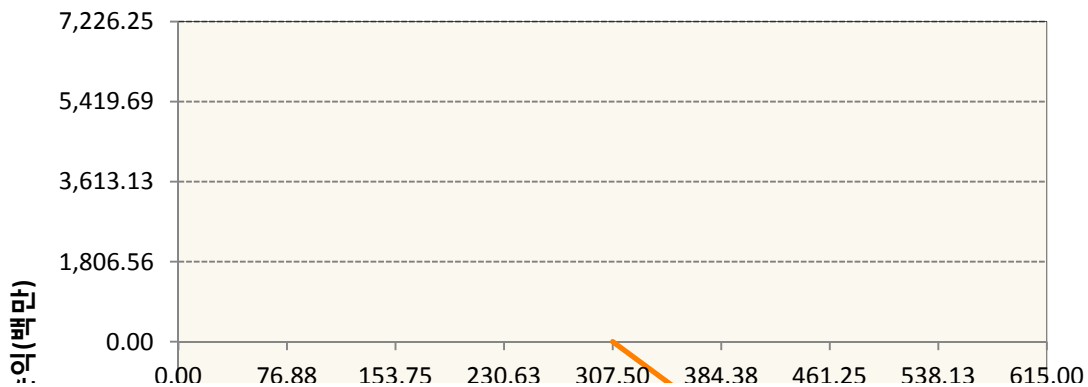
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,864	0	9,864	장내
누계	유가증권	옵션	2,944	20,789	-17,845	장내

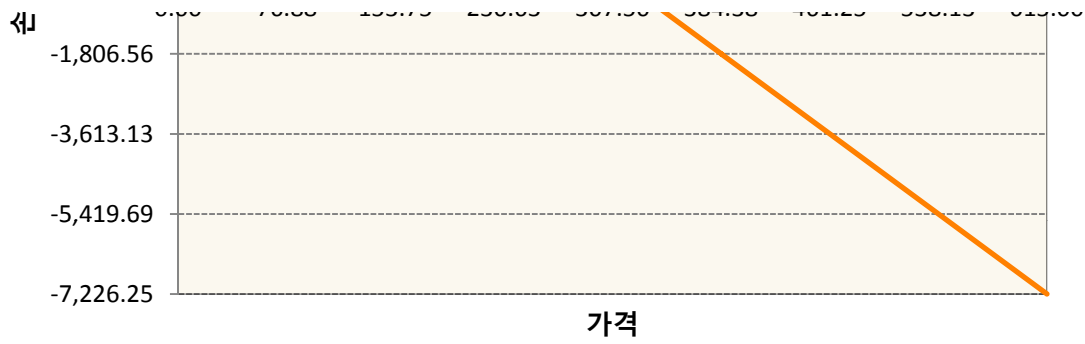
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

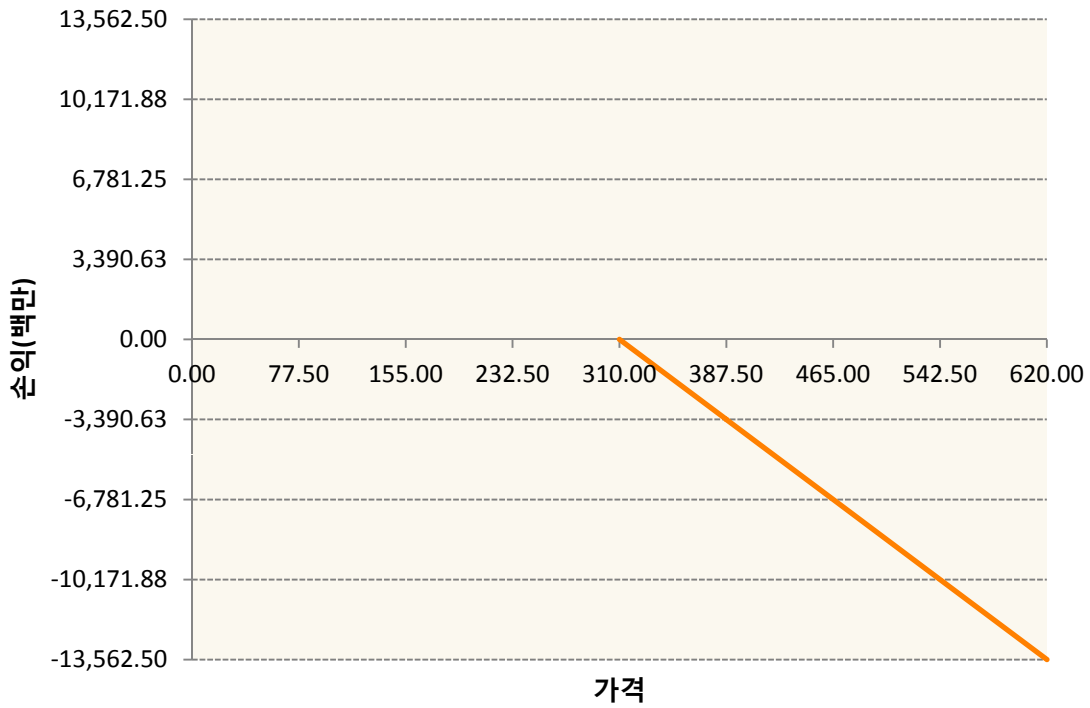


KR4201Q23073-2020-02 콜307.5

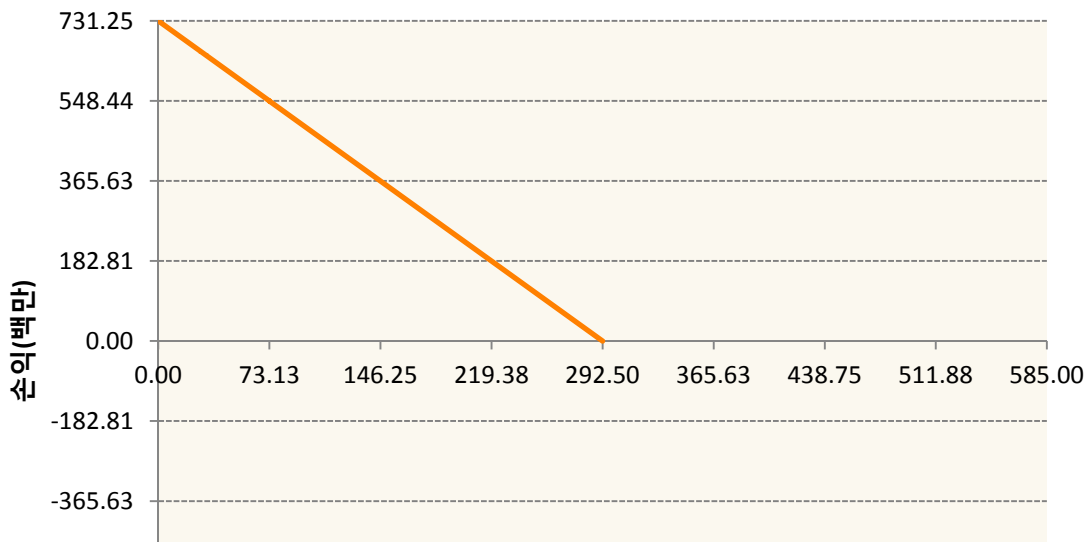


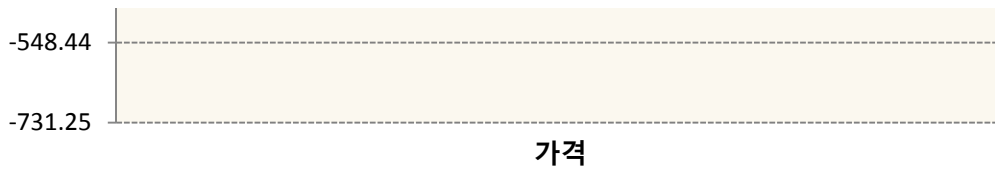


KR4201Q23107-2020-02 콜310

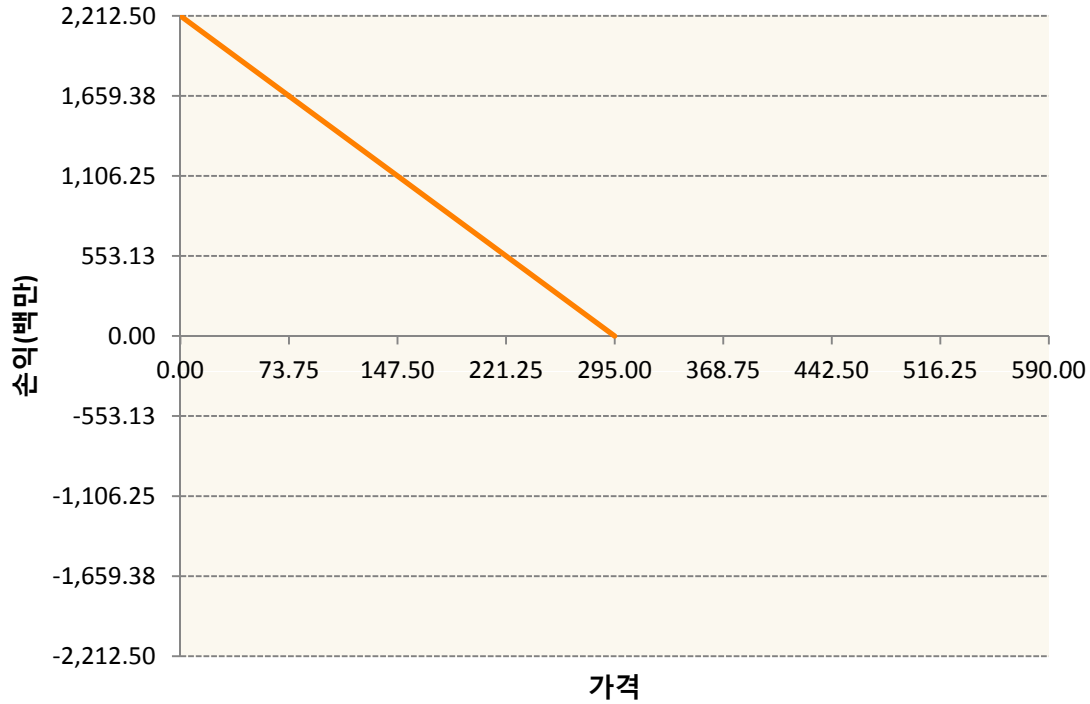


KR4301Q22925-2020-02 풋292.5





KR4301Q22958-2020-02 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						790
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-790	-790	-790	-790	-790	-790	-790	
-5.33%	-527	-527	-527	-527	-527	-527	-527	
-2.67%	-263	-263	-263	-263	-263	-263	-263	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	263	263	263	263	263	263	263	
5.33%	527	527	527	527	527	527	527	
8.00%	790	790	790	790	790	790	790	
KR4201Q23073		2020-02 콜307.5						236
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	30	30	30	29	28	27	26	
-5.33%	30	29	28	27	24	22	18	
-2.67%	28	26	23	19	14	9	2	

0%	19	14	7	0	-8	-17	-26
2.67%	-5	-15	-26	-37	-49	-61	-73
5.33%	-59	-73	-86	-100	-114	-128	-142
8.00%	-151	-165	-179	-193	-207	-221	-236
KR4201Q23107 2020-02 콜310							394
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	43	43	42	42	41	39	37
-5.33%	42	42	40	38	35	31	26
-2.67%	40	37	33	27	20	12	2
0%	30	22	12	0	-13	-28	-43
2.67%	-4	-20	-38	-57	-77	-98	-120
5.33%	-84	-109	-133	-158	-184	-209	-235
8.00%	-232	-259	-286	-313	-340	-367	-394
KR4301Q22925 2020-02 풋292.5							52
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	52	52	52	52	52	52	52
-5.33%	33	33	33	33	33	33	34
-2.67%	14	14	15	15	15	16	16
0%	-2	-1	-1	0	1	2	2
2.67%	-12	-11	-11	-10	-9	-8	-7
5.33%	-15	-15	-15	-14	-14	-13	-13
8.00%	-16	-16	-16	-16	-15	-15	-15
KR4301Q22958 2020-02 풋295							162
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	161	161	162	162	162	162	162
-5.33%	104	104	104	104	104	105	105
-2.67%	47	47	48	49	50	51	52
0%	-6	-4	-2	0	2	4	6
2.67%	-42	-40	-37	-35	-32	-30	-27
5.33%	-58	-56	-55	-53	-51	-49	-47
8.00%	-61	-61	-60	-59	-59	-58	-57

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

(단위:백만원)

1,230

공시일	2020-01-31
기준일	2020-01-30

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	211,958	0	211,958	

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	2020-01-31
기준일	2020-01-30

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	221,242	0	221,242	

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	2020-01-31
기준일	2020-01-30

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	543,306	0	543,306	
누계	통화	선도	0	604,469	-604,469	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	190
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,844
FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	2,844
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,370
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,560
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	1,650
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	1,555
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	948
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	190
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	2,029
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	948
FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E	3,792
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,896
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	2,029
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	190
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	190
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	1,138
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	1,706
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	284
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E	1,896
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E	3,261
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,526
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,422
FX21020F02 KRW/USD 28-02-20E	1,896
FX21020F03 KRW/USD 28-02-20E	2,939
FX21020F03 KRW/USD 31-03-20E	3,034
FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E	2,844
FX21020F04 KRW/USD 28-02-20E	190

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

16,033

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

(단위:백만원)

119

공시일	2020-01-31
기준일	2020-01-30

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

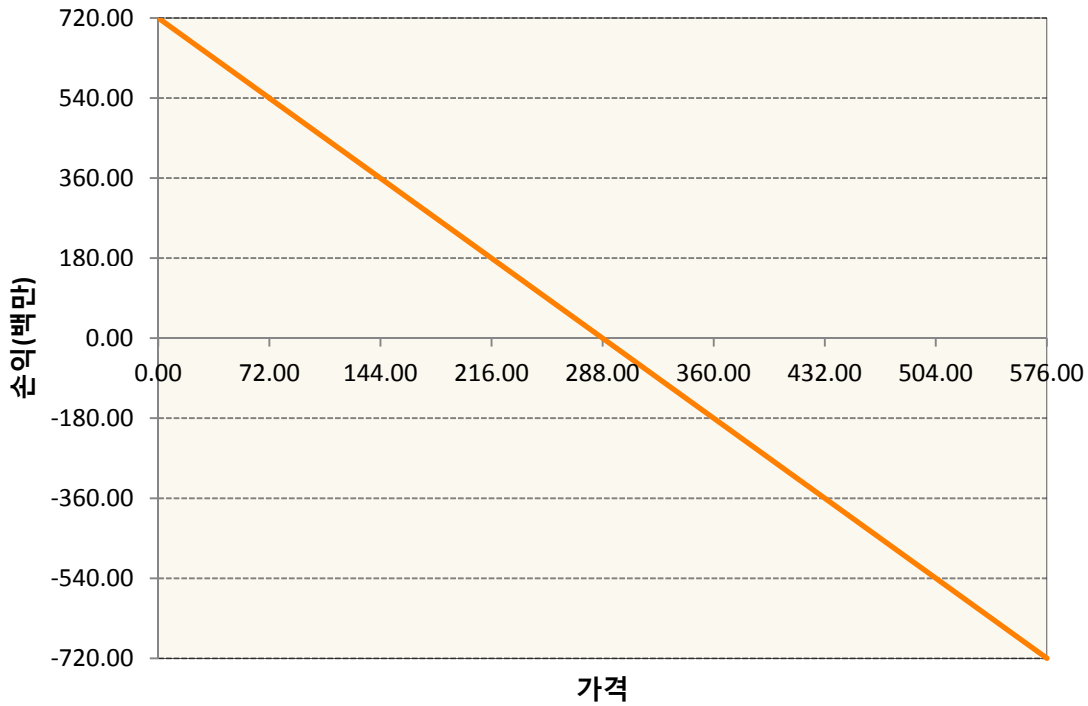
1. 계약금액

(단위:백만원)

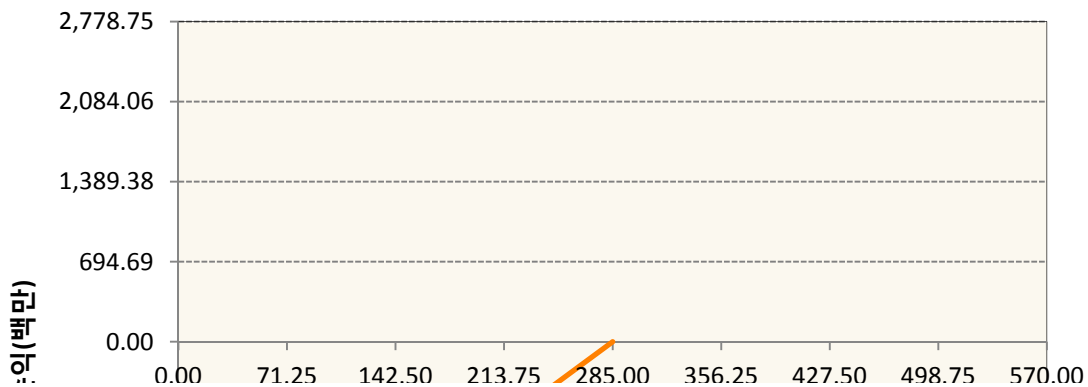
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	720	-720	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,569	-3,569	장내

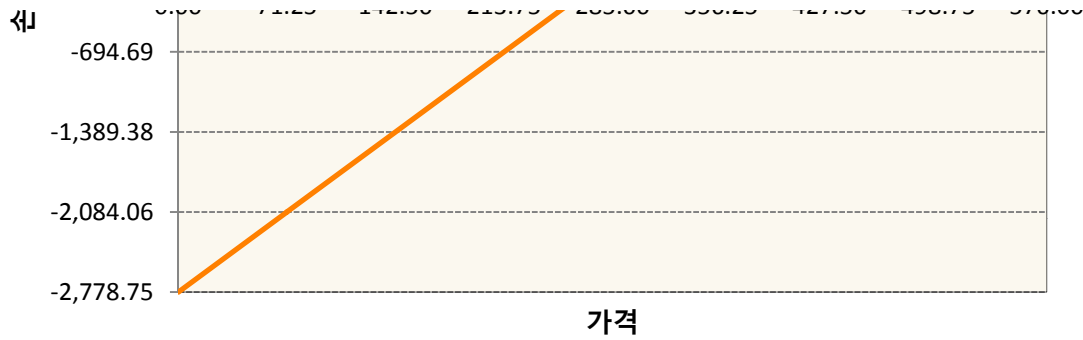
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

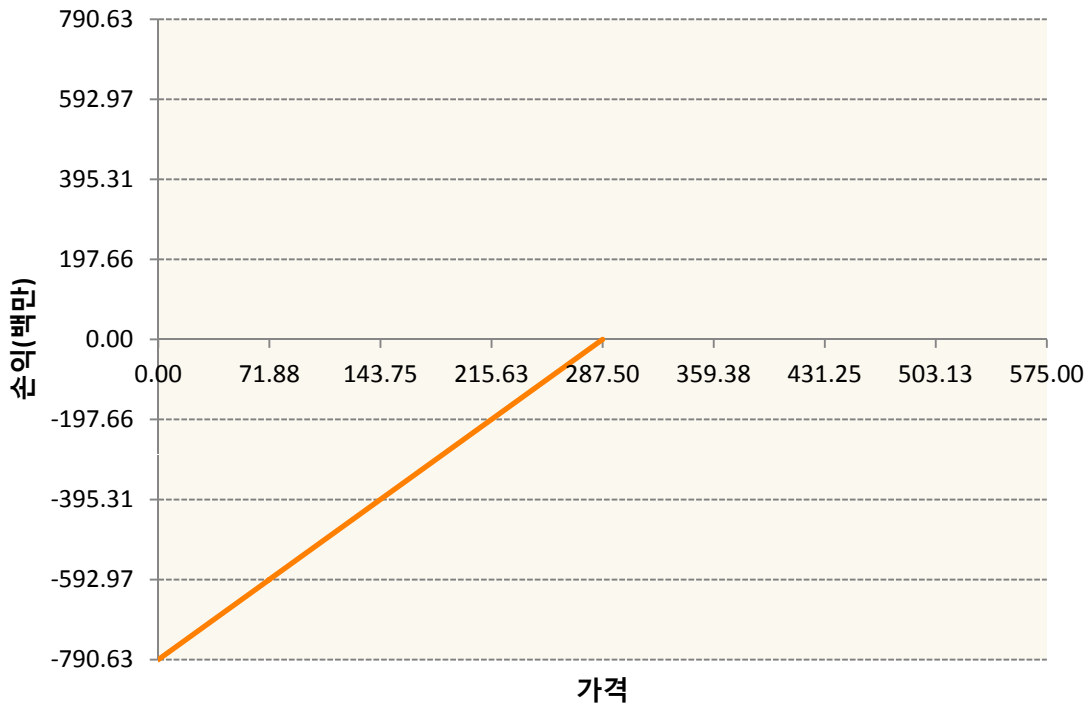


KR4301Q22859-2020-02 풋285





KR4301Q22875-2020-02 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						58
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	58	58	58	58	58	58	58	
-5.33%	38	38	38	38	38	38	38	
-2.67%	19	19	19	19	19	19	19	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
5.33%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38	
8.00%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58	
KR4301Q22859		2020-02 풋285						170
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-168	-168	-168	-169	-169	-170	-170
-5.33%	-94	-95	-96	-98	-99	-101	-103
-2.67%	-30	-33	-36	-39	-41	-44	-47
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	22	21	19	18	16	14	12
5.33%	24	24	24	23	22	22	20
8.00%	24	24	24	24	24	24	23
KR4301Q22875 2020-02 풋287.5							52
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-51	-51	-51	-51	-52	-52	-52
-5.33%	-30	-31	-31	-31	-31	-32	-32
-2.67%	-11	-12	-12	-13	-14	-14	-15
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	8	8	7	7	6	5	5
5.33%	10	10	9	9	9	8	8
8.00%	10	10	10	10	10	9	9

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

(단위:백만원)

282

공시일	2020-01-31
기준일	2020-01-30

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	12,554	0	12,554	
누계	통화	선도	0	15,926	-15,926	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019X03 KRW/USD 31-01-20E	295
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	351
FX21020F00(KRW/USD 13-02-20E	127
FX21020F03(KRW/USD 28-02-20E	207
FX21020F04(KRW/USD 28-02-20E	295
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

422

공시일	2020-01-31
기준일	2020-01-30

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

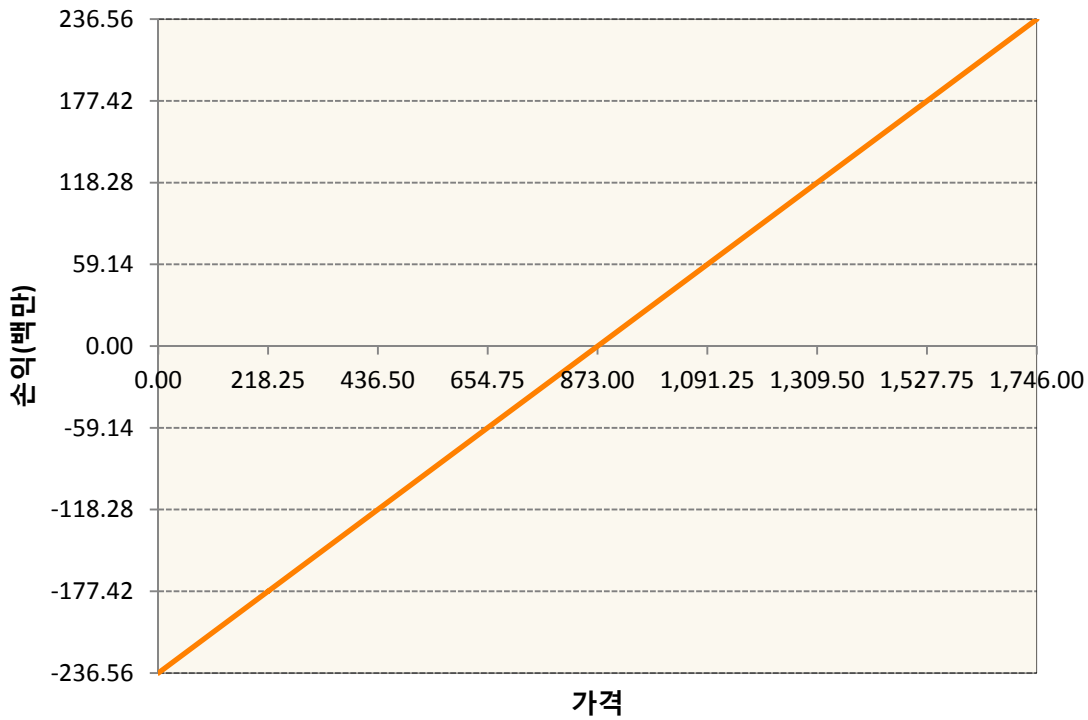
1. 계약금액

(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	237	0	237	
누계	유가증권	스왑	1,076	0	1,076	장외
누계	통화	선도	313	900	-587	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	19

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

(단위:백만원)

112

공시일	2020-01-31
기준일	2020-01-30

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

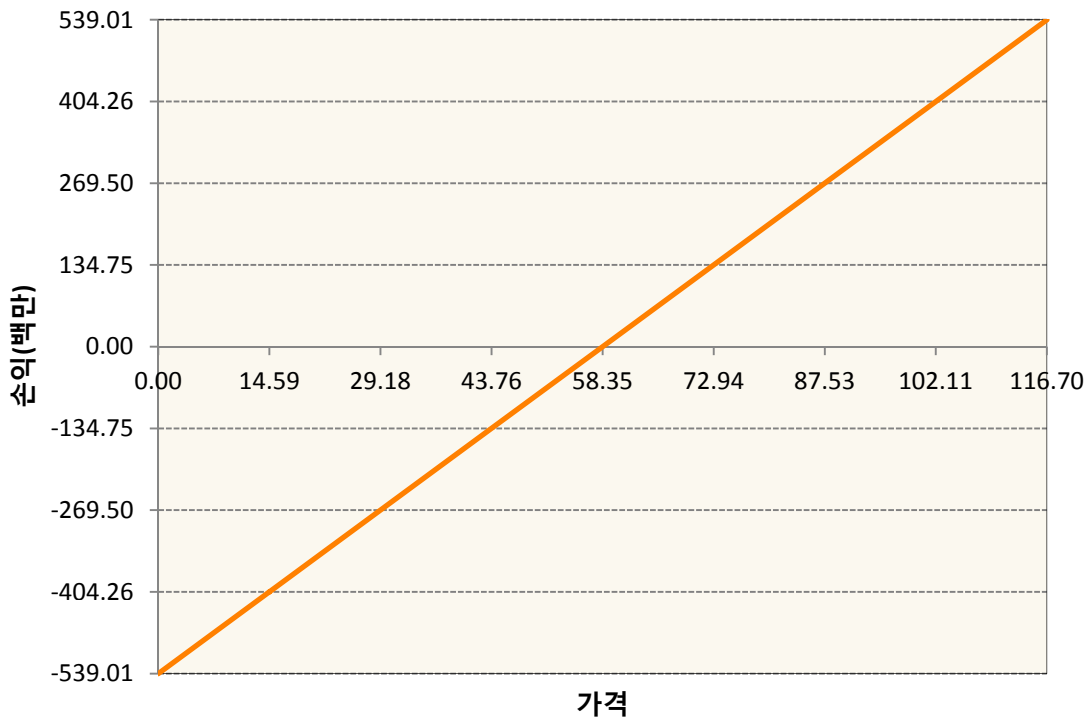
1. 계약금액

(단위:백만원)

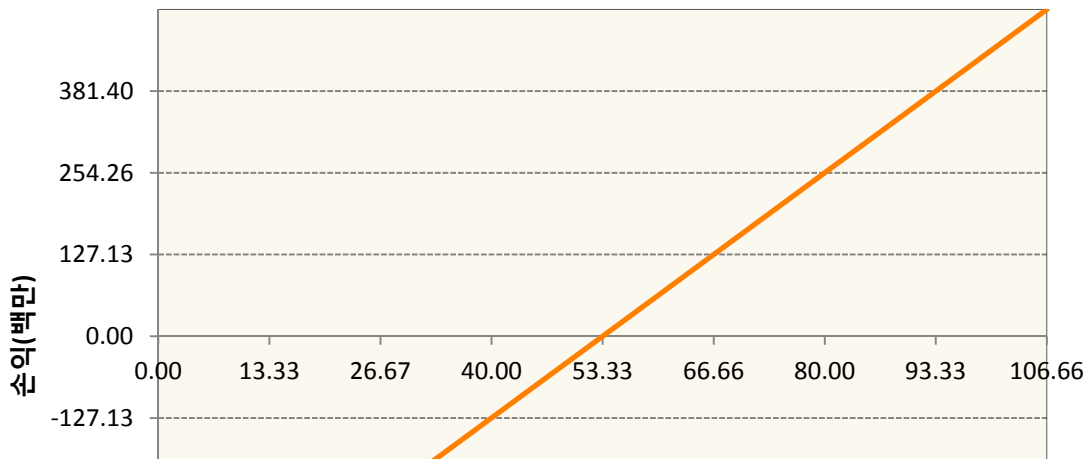
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,124	190	1,935	

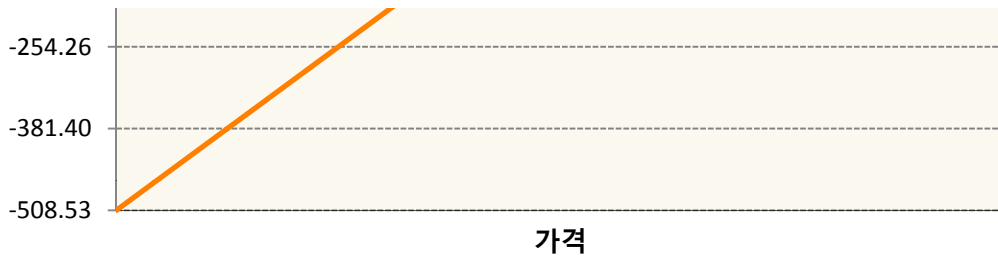
2. 만기시점의 손익구조

COKO-BRENT CRUDE FUTR May20

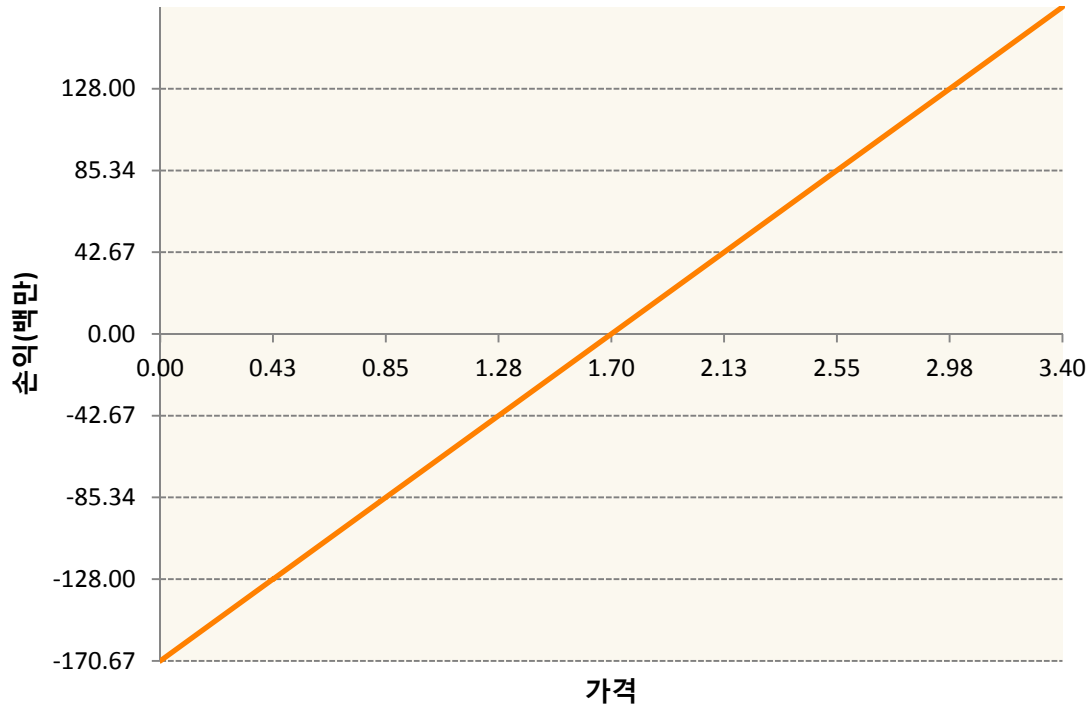


CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20

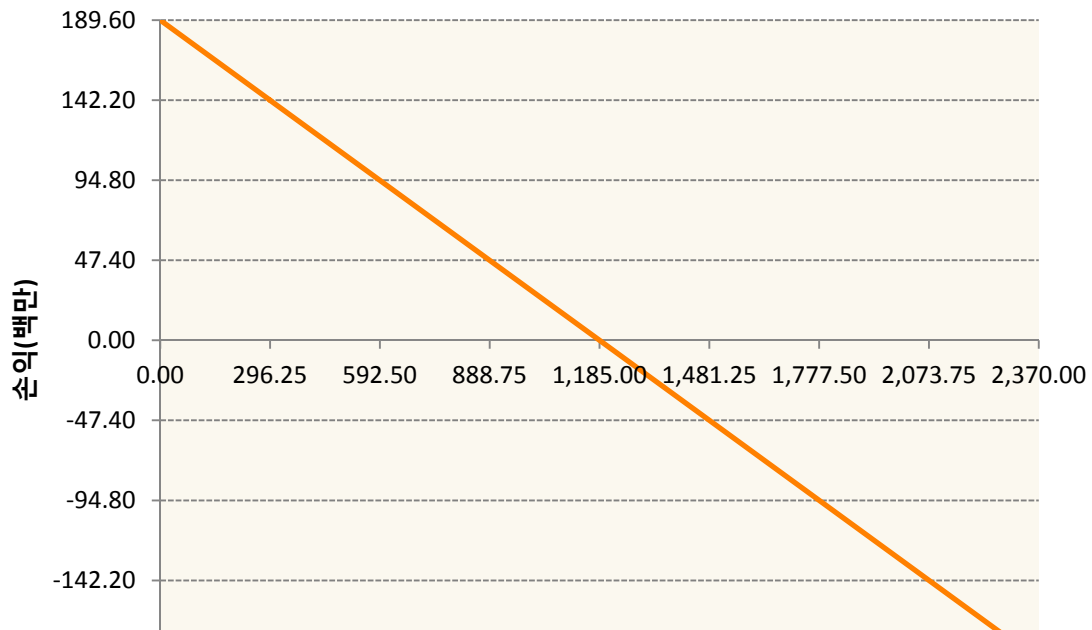


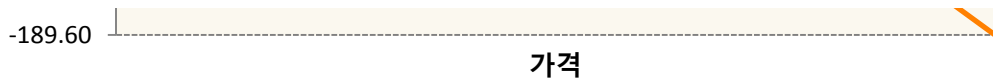


HOH0-NY Harb ULSD Fut Mar20

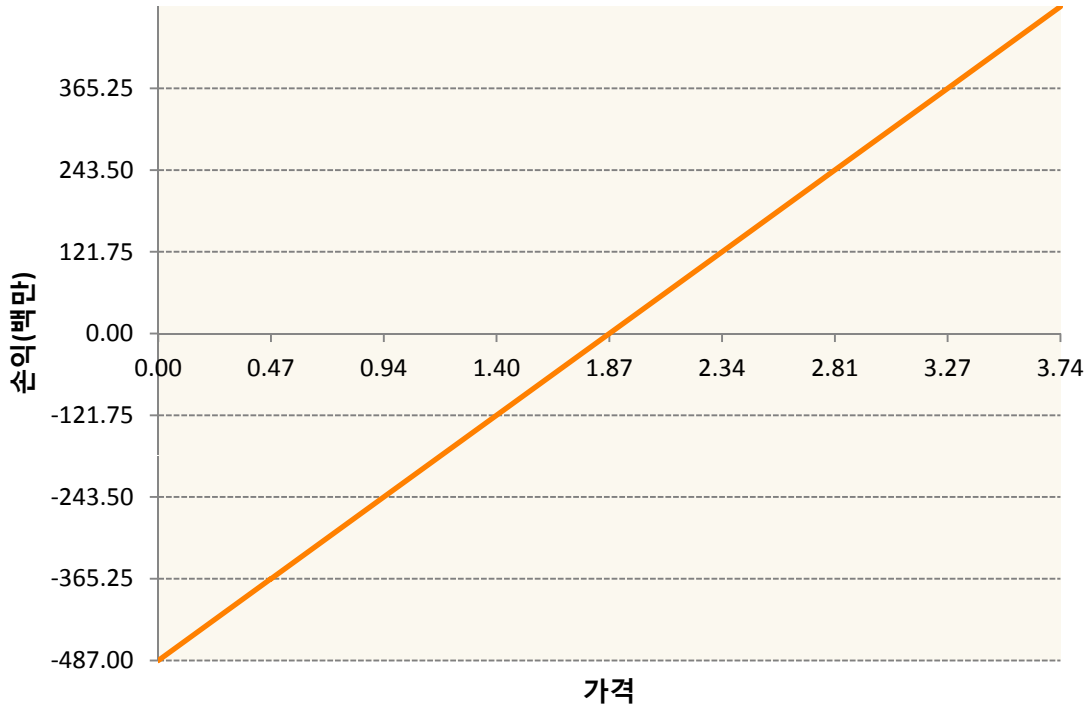


KR4175Q20000-2020-02 달러선물

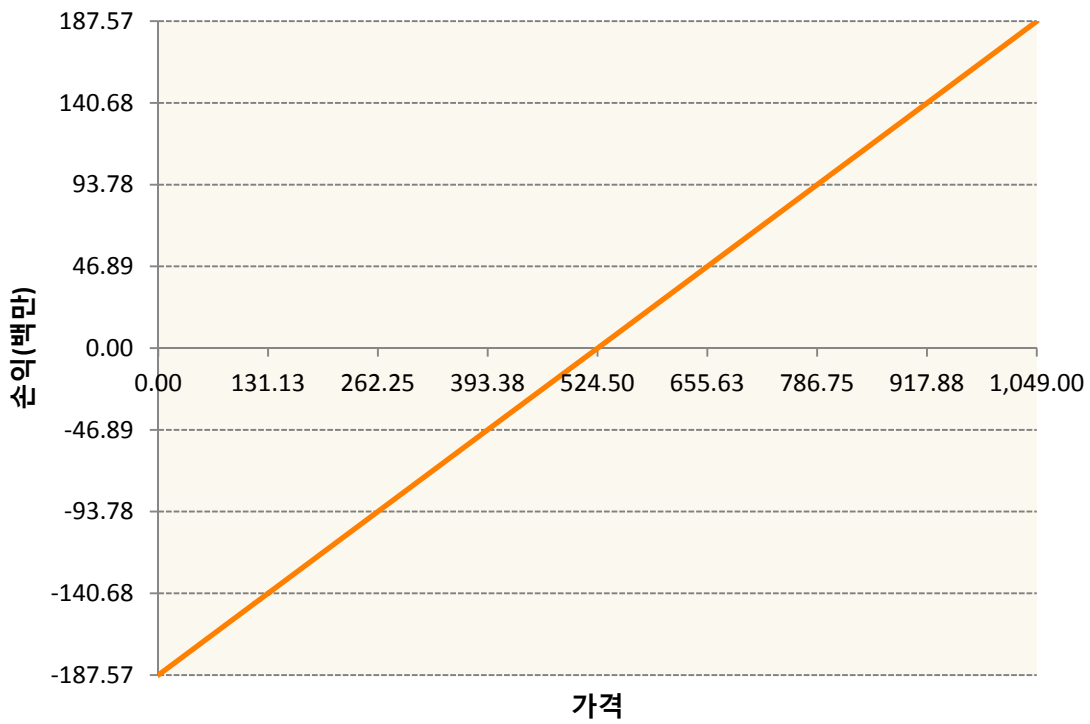




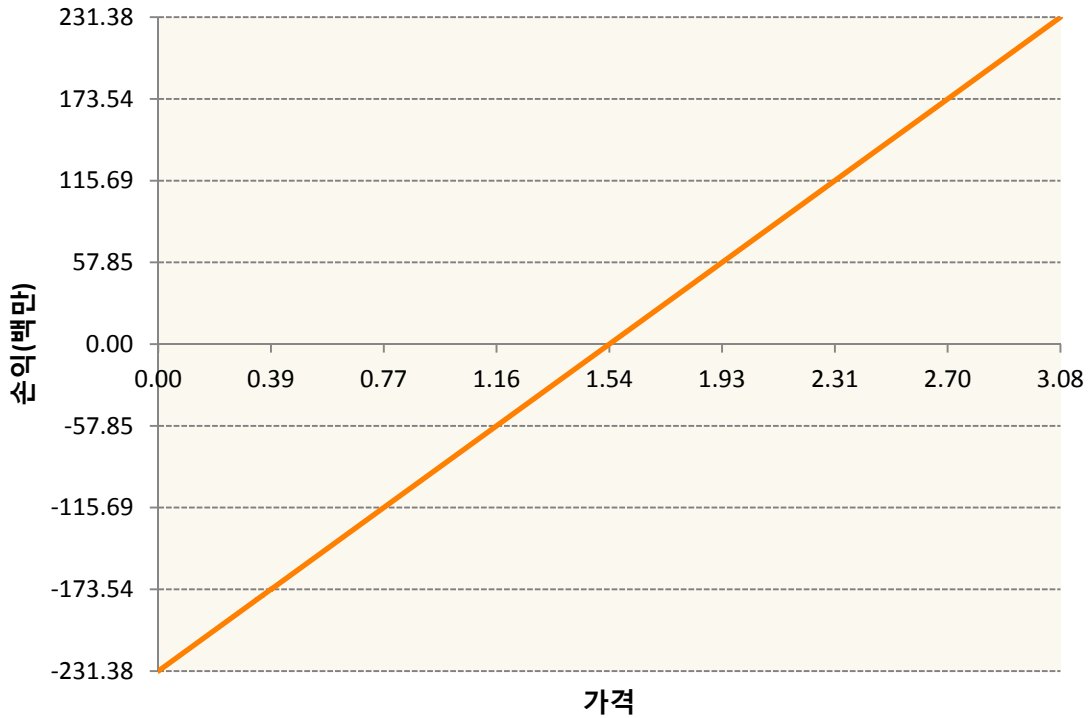
NGH20-NATURAL GAS FUTR Mar20



QSH0-Low Su Gasoil G Mar20



XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	43
CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	41
HOH0	NY Harb ULSD Fut Mar20	14
KR4175Q20C	2020-02 달러선물	15
NGH20	NATURAL GAS FUTR Mar20	39
QSH0	Low Su Gasoil G Mar20	15
XBH0	GASOLINE RBOB FUT Mar20	19

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

330

공시일	2020-01-31
기준일	2020-01-30

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

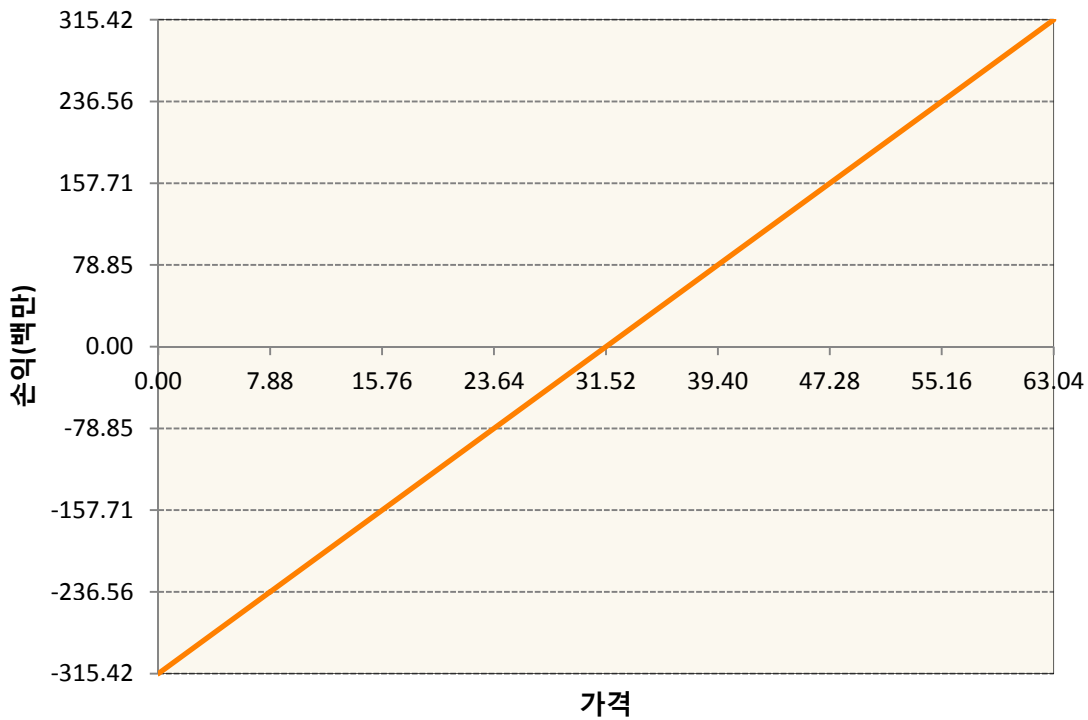
1. 계약금액

(단위:백만원)

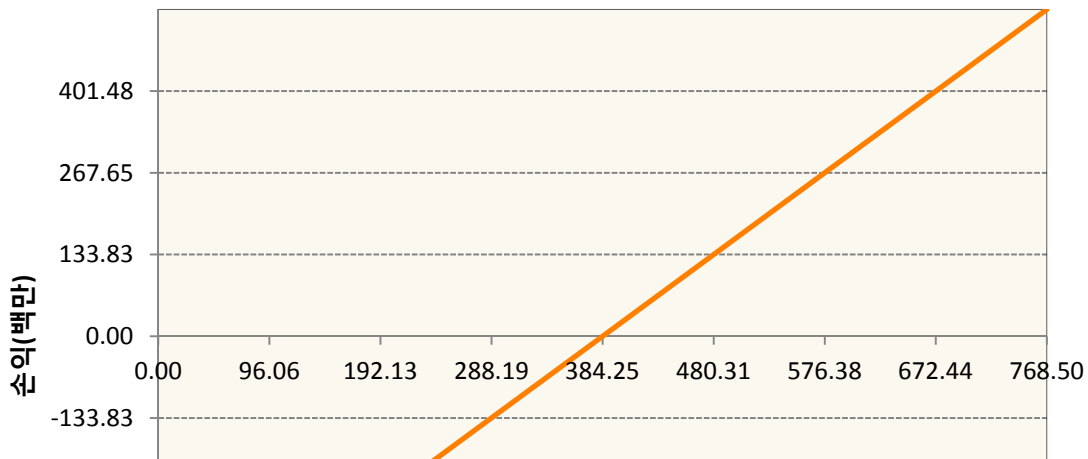
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,760	154	2,606	

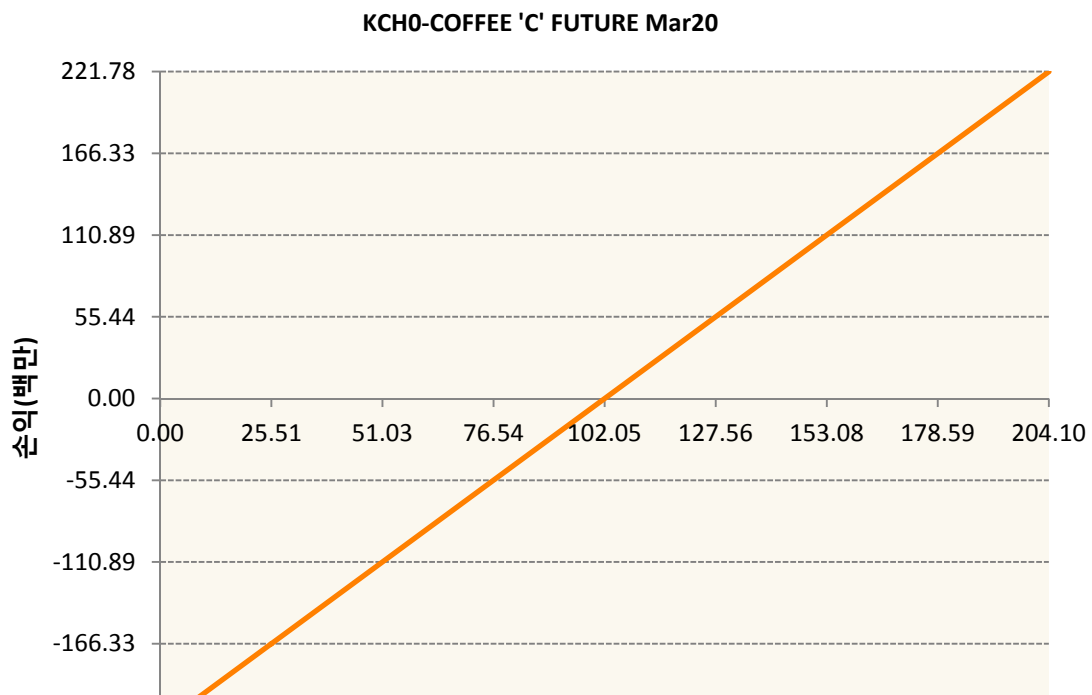
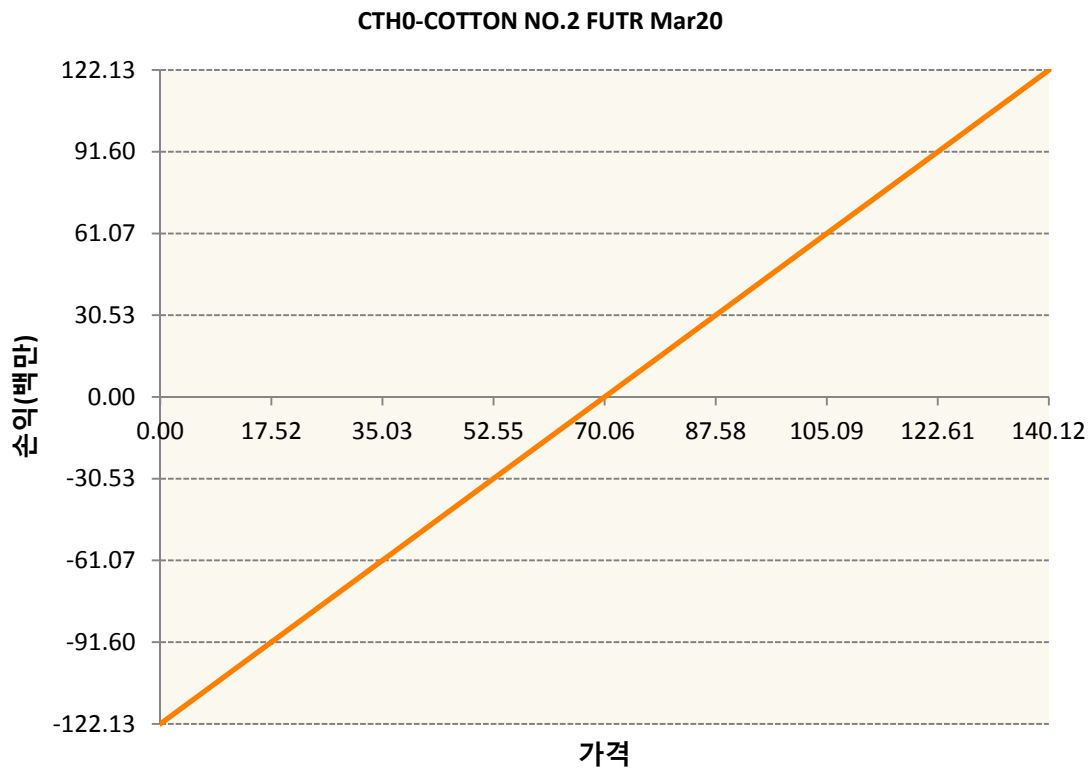
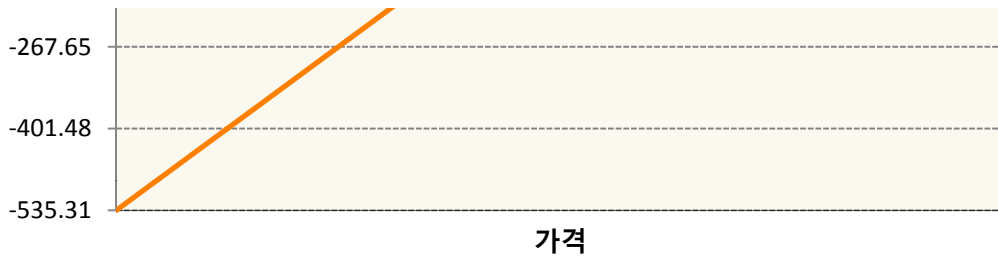
2. 만기시점의 손익구조

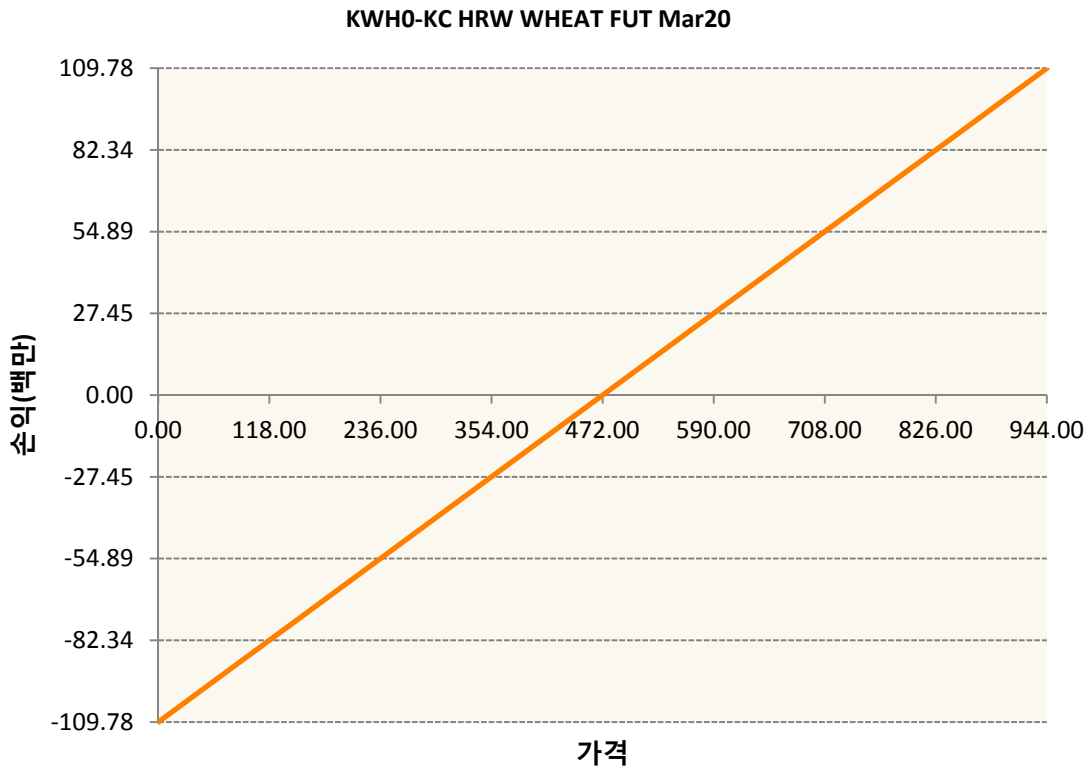
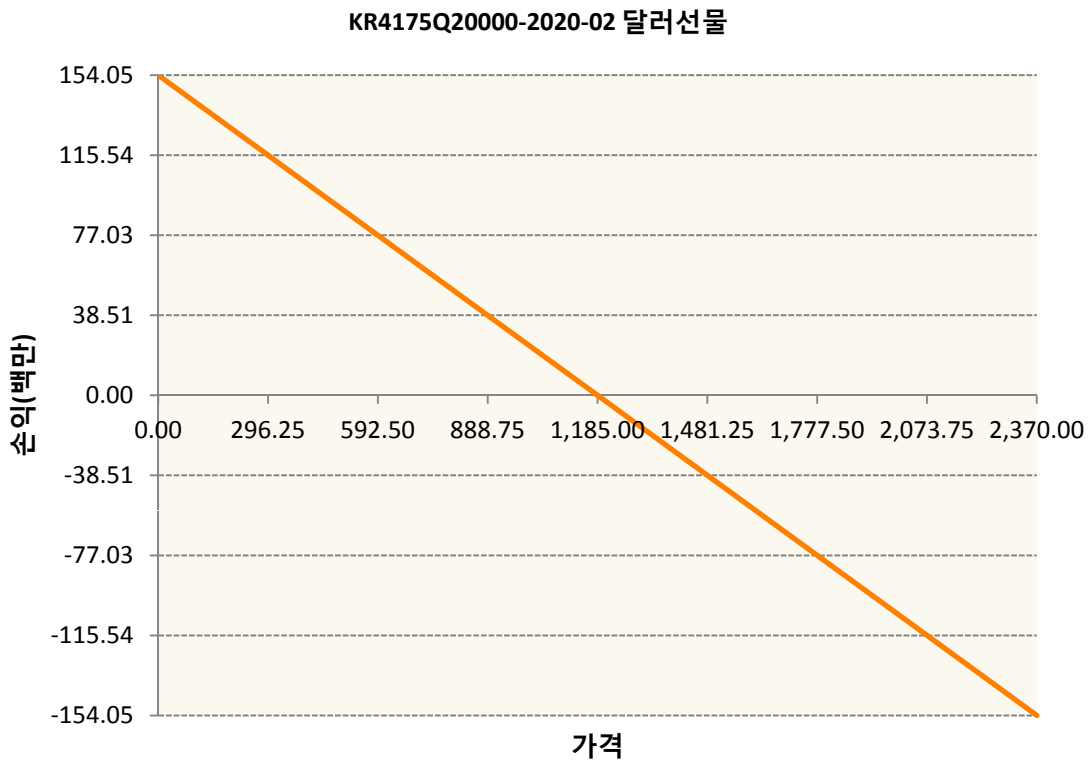
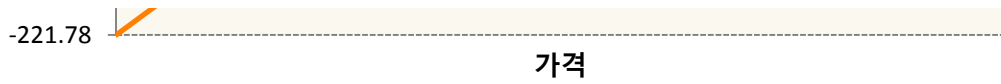
BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20



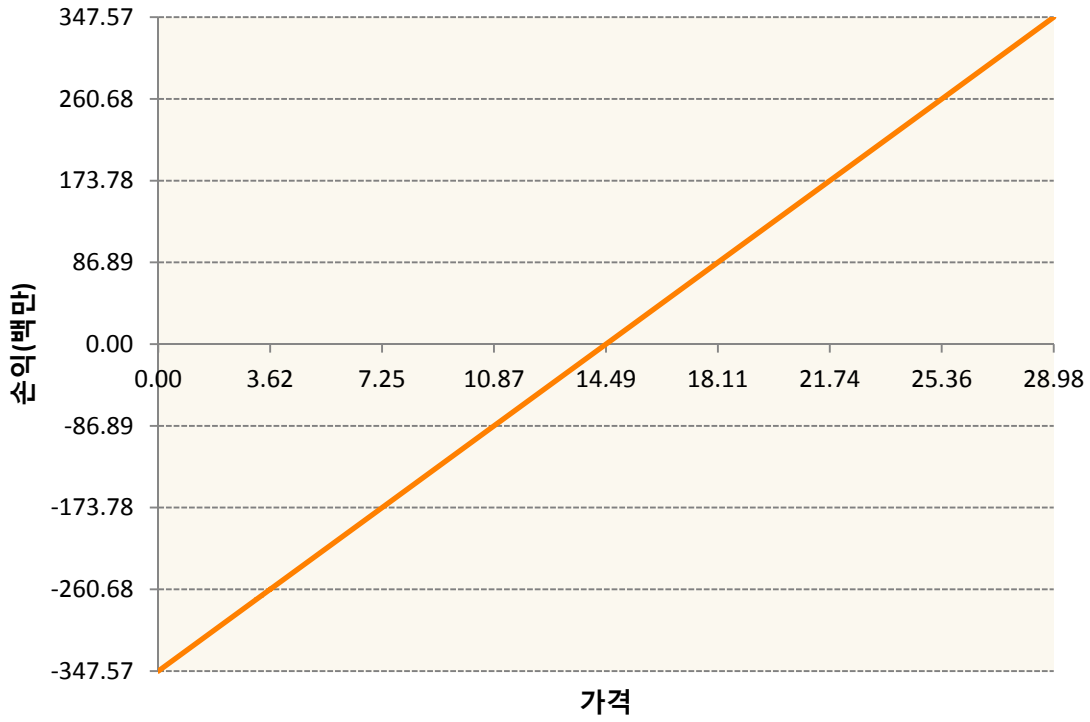
CH0-CORN FUTURE Mar20



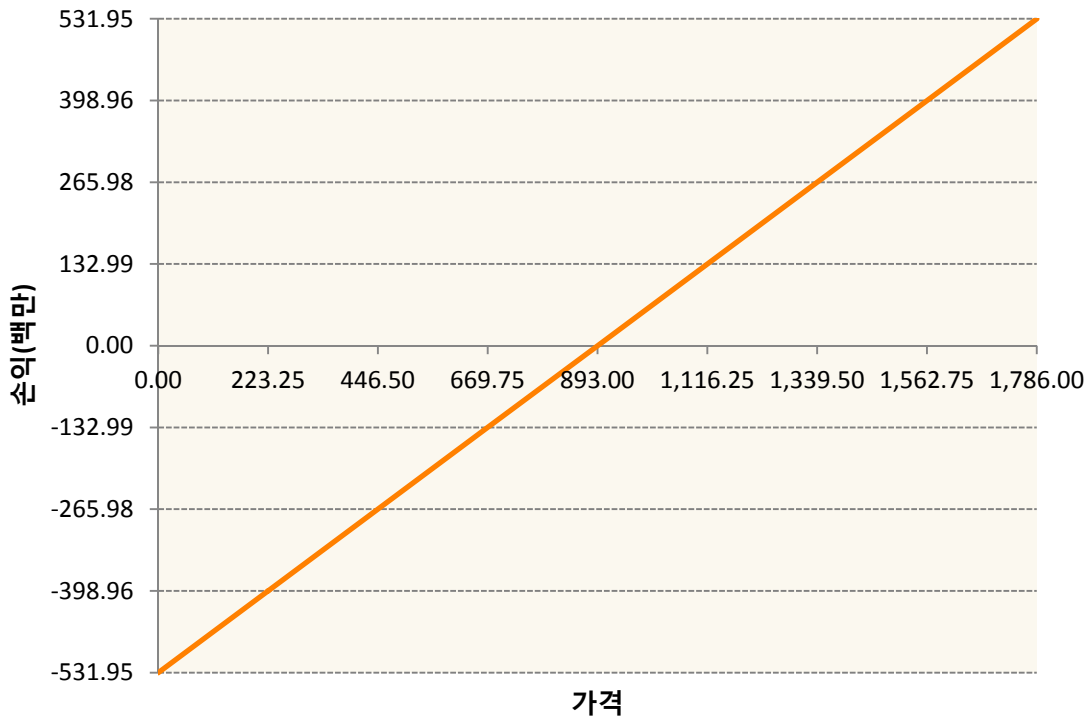




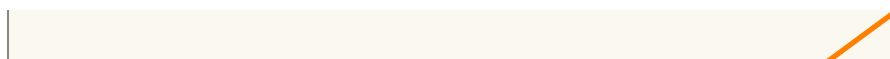
SBH0-Sugar Mar20

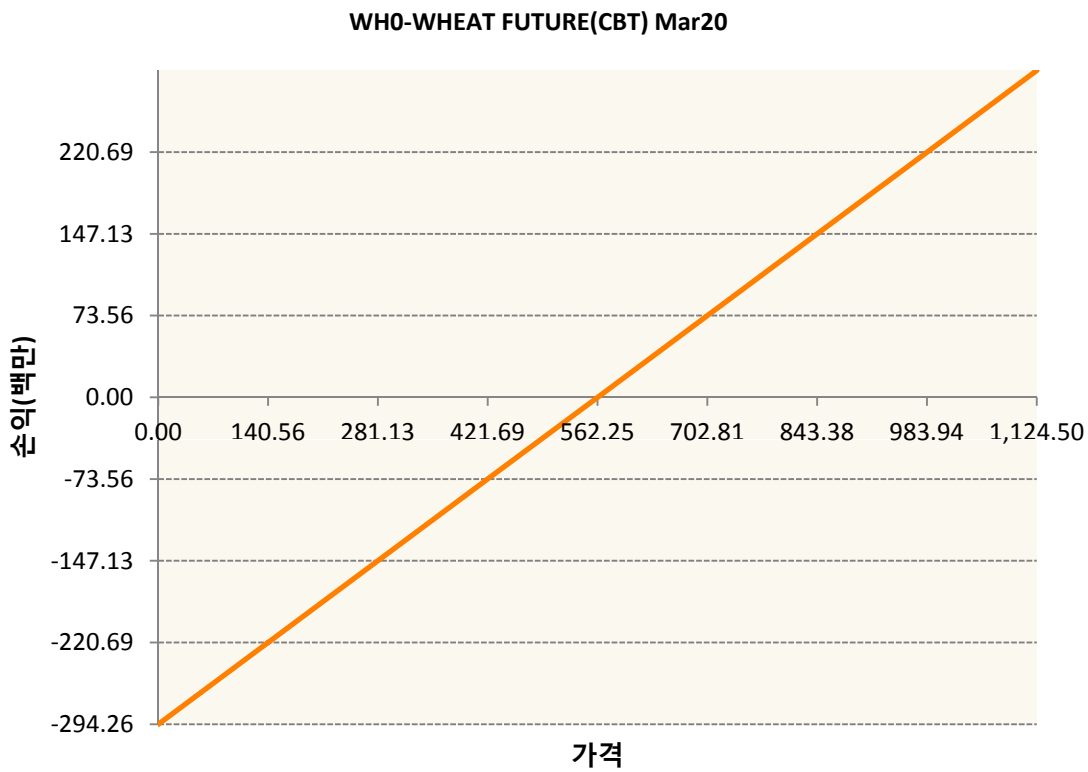
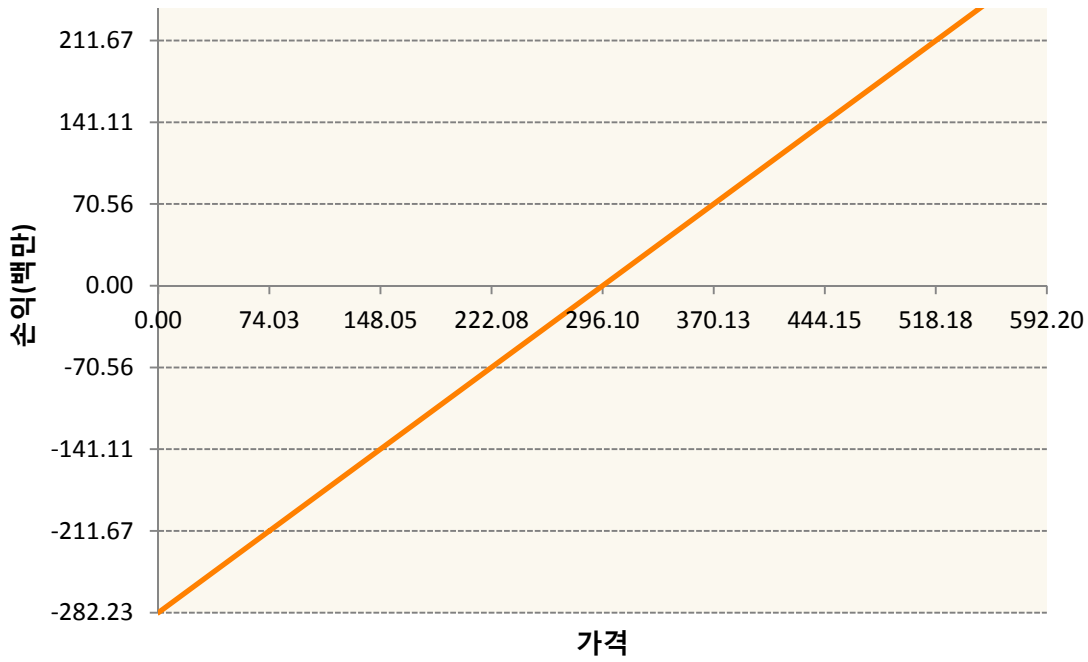


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20



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)

239