

공시일	2020-02-03
기준일	2020-01-31

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	2020-02-03
기준일	2020-01-31

스마트인덱스모

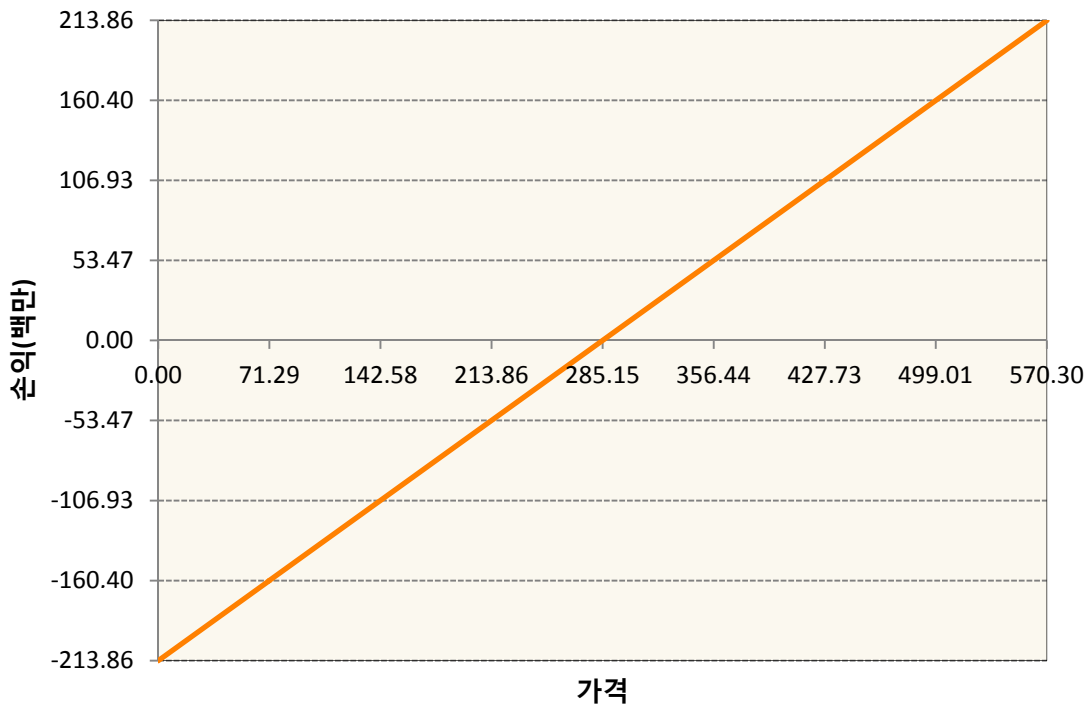
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	214	0	214	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%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11	
-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%	11	11	11	11	11	11	11	
8.00%	17	17	17	17	17	17	17	

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

(단위:백만원)

14

공시일	2020-02-03
기준일	2020-01-31

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	2020-02-03
기준일	2020-01-31

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	2020-02-03
기준일	2020-01-31

유로인덱스모(주식-파생형)

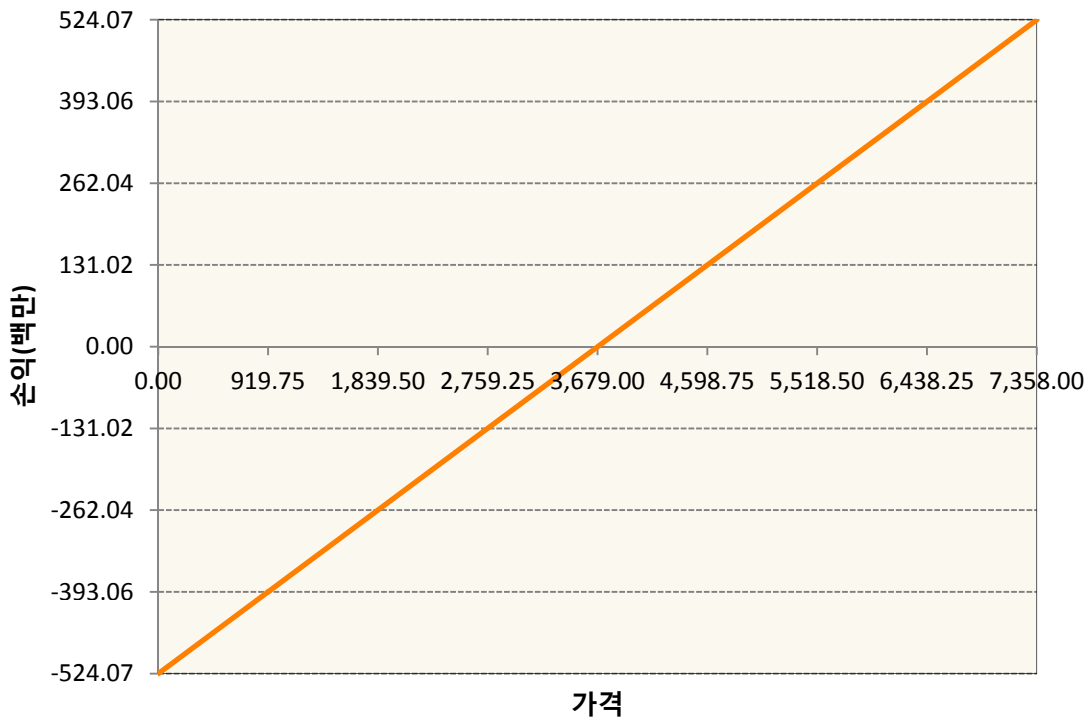
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	524	0	524	

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	2020-02-03
기준일	2020-01-31

차이나인덱스모(주식-파생형)

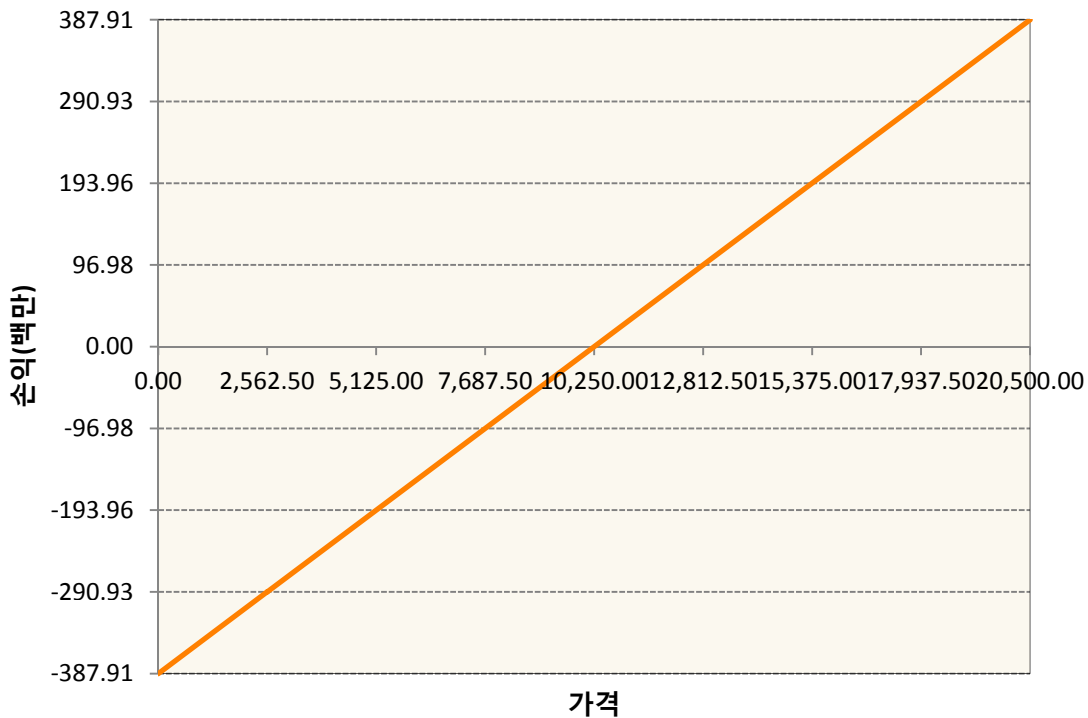
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	388	0	388	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCG0-HSCEI Futures Feb20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCG0	HSCEI Futures Feb20	31
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

28

공시일	2020-02-03
기준일	2020-01-31

커버드콜모(주식혼합-파생형)

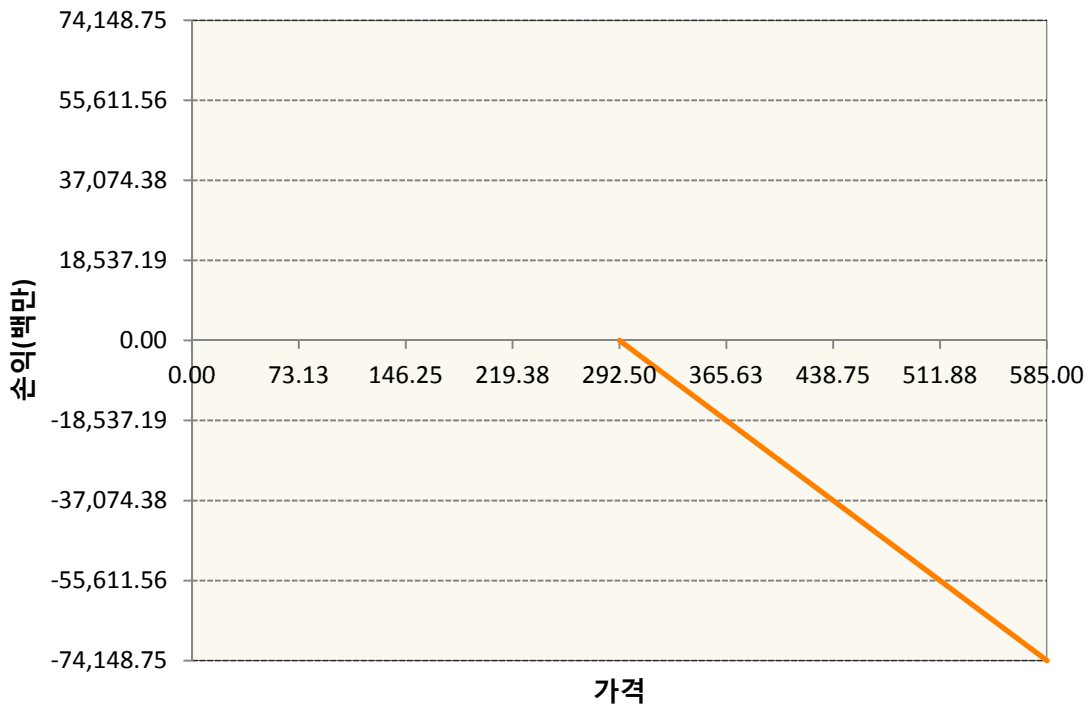
1. 계약금액

(단위:백만원)

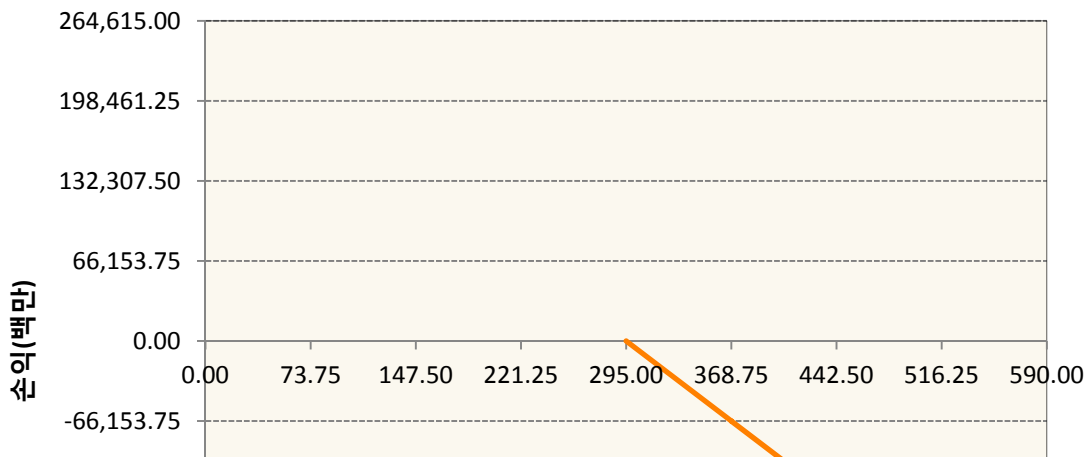
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	455,004	-455,004	장내

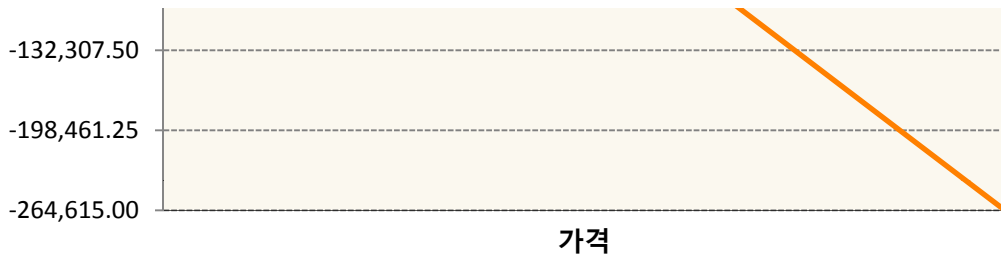
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q22927-2020-02 콜292.5

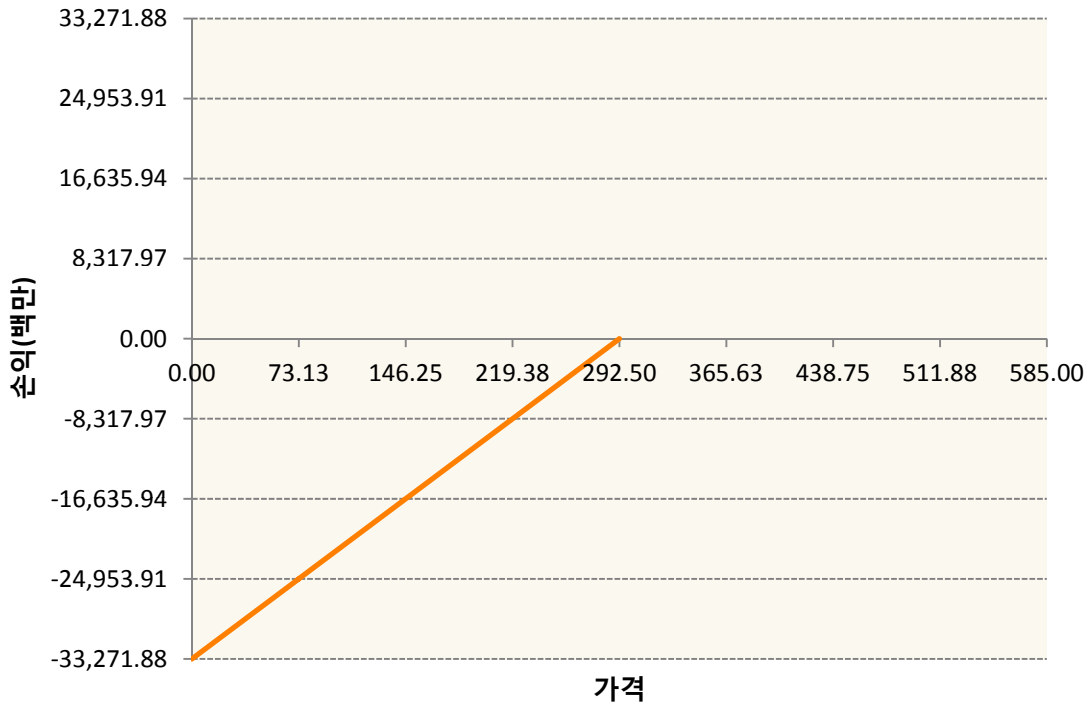


KR4201Q22950-2020-02 콜295

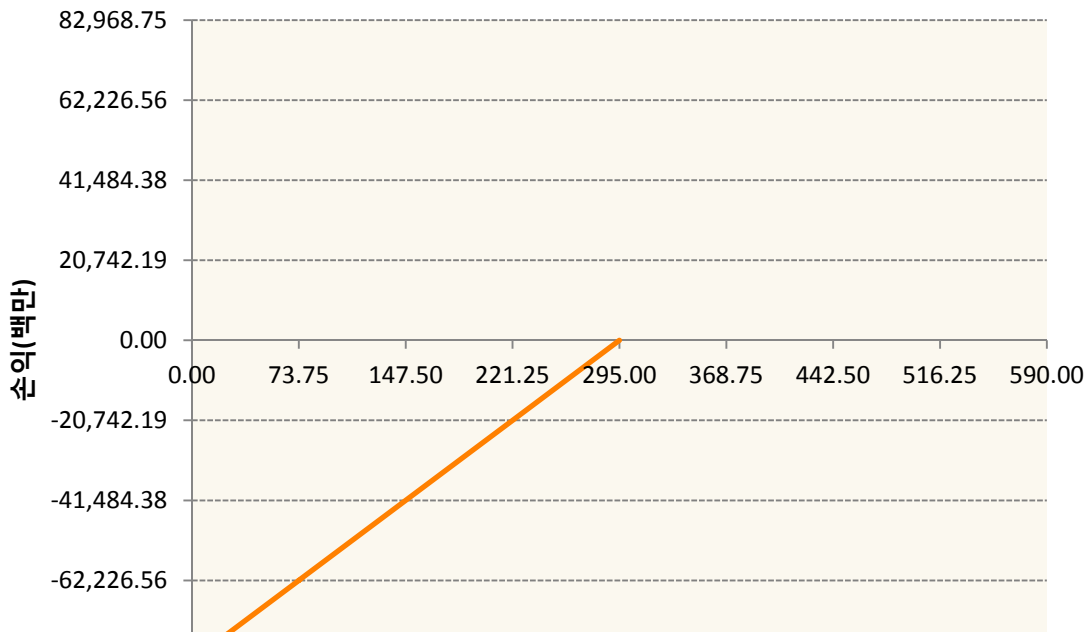




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



KR4301Q22958-2020-02 풋295



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q22927		2020-02 콜292.5						3,683
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	851	844	832	814	790	759	722	
-5.33%	823	796	761	716	663	603	536	
-2.67%	704	637	561	477	386	289	188	
0%	360	244	123	0	-126	-253	-383	
2.67%	-366	-508	-650	-792	-933	-1,075	-1,217	
5.33%	-1,539	-1,664	-1,793	-1,923	-2,056	-2,190	-2,325	
8.00%	-3,086	-3,167	-3,258	-3,356	-3,460	-3,569	-3,683	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						12,040
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,393	2,378	2,349	2,303	2,238	2,151	2,042	
-5.33%	2,333	2,267	2,173	2,049	1,896	1,715	1,510	
-2.67%	2,051	1,864	1,642	1,388	1,106	802	478	
0%	1,146	784	401	0	-414	-839	-1,273	
2.67%	-939	-1,431	-1,925	-2,421	-2,919	-3,417	-3,916	
5.33%	-4,574	-5,055	-5,542	-6,033	-6,526	-7,022	-7,520	
8.00%	-9,652	-10,000	-10,373	-10,768	-11,179	-11,604	-12,040	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						2,457
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,455	-2,455	-2,455	-2,455	-2,455	-2,456	-2,457	
-5.33%	-1,593	-1,593	-1,594	-1,595	-1,598	-1,602	-1,607	
-2.67%	-735	-740	-747	-756	-767	-781	-796	
0%	73	50	26	0	-28	-56	-86	
2.67%	679	641	603	565	527	489	451	
5.33%	964	938	911	881	851	819	787	
8.00%	1,036	1,028	1,018	1,005	990	973	954	
KR4301Q22958		2020-02 풋295						6,193
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-6,190	-6,190	-6,190	-6,190	-6,191	-6,191	-6,193	
-5.33%	-4,058	-4,058	-4,059	-4,061	-4,064	-4,070	-4,078	
-2.67%	-1,930	-1,936	-1,946	-1,960	-1,979	-2,003	-2,031	
0%	133	95	50	0	-55	-115	-178	
2.67%	1,843	1,755	1,666	1,577	1,486	1,395	1,304	

5.33%	2,809	2,728	2,645	2,560	2,473	2,385	2,296
8.00%	3,114	3,083	3,044	2,999	2,949	2,893	2,833

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

(단위:백만원)

23,537

공시일	2020-02-03
기준일	2020-01-31

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

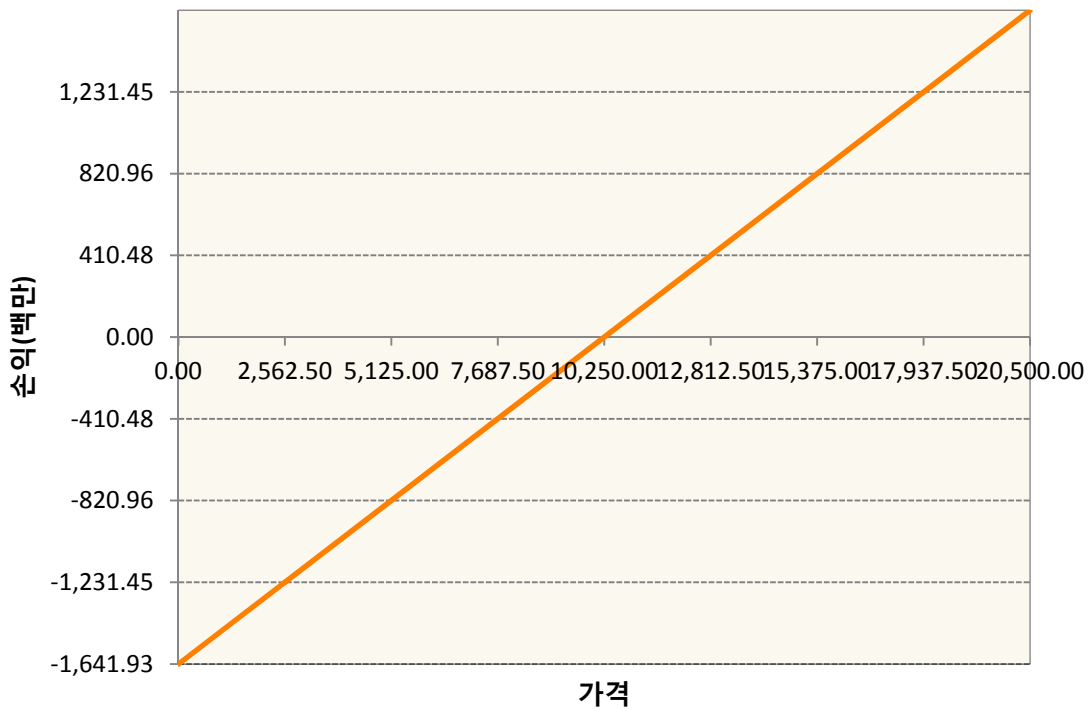
1. 계약금액

(단위:백만원)

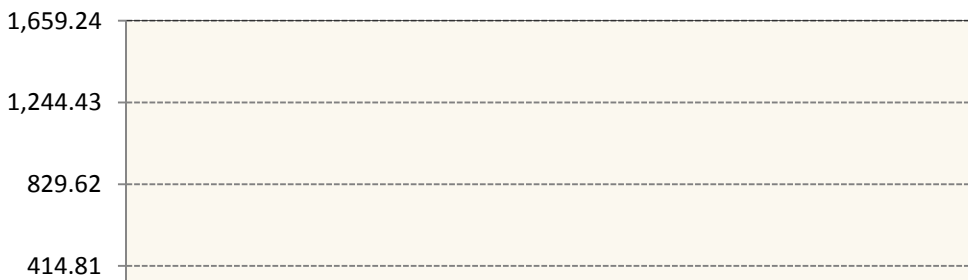
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,642	0	1,642	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,595	-4,595	장내
누계	통화	선도	0	2,160	-2,160	장외

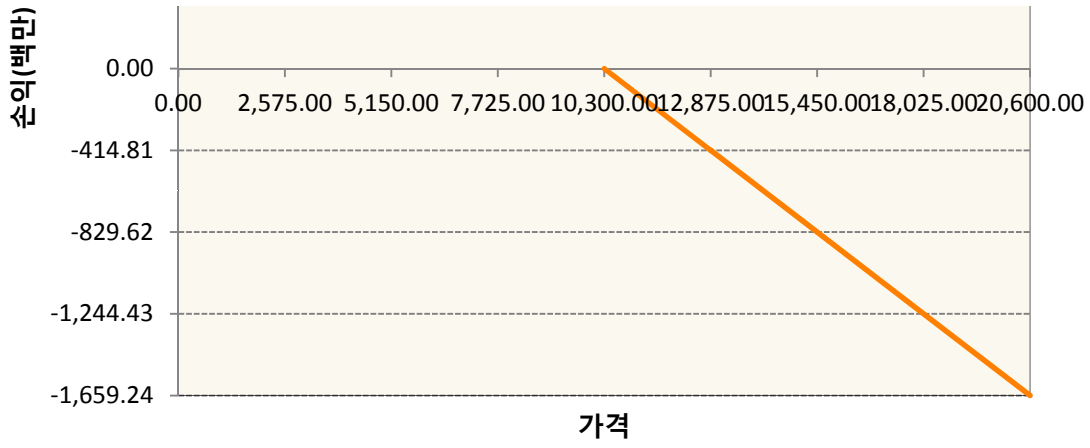
2. 만기시점의 손익구조

HCG0-HSCEI Futures Feb20

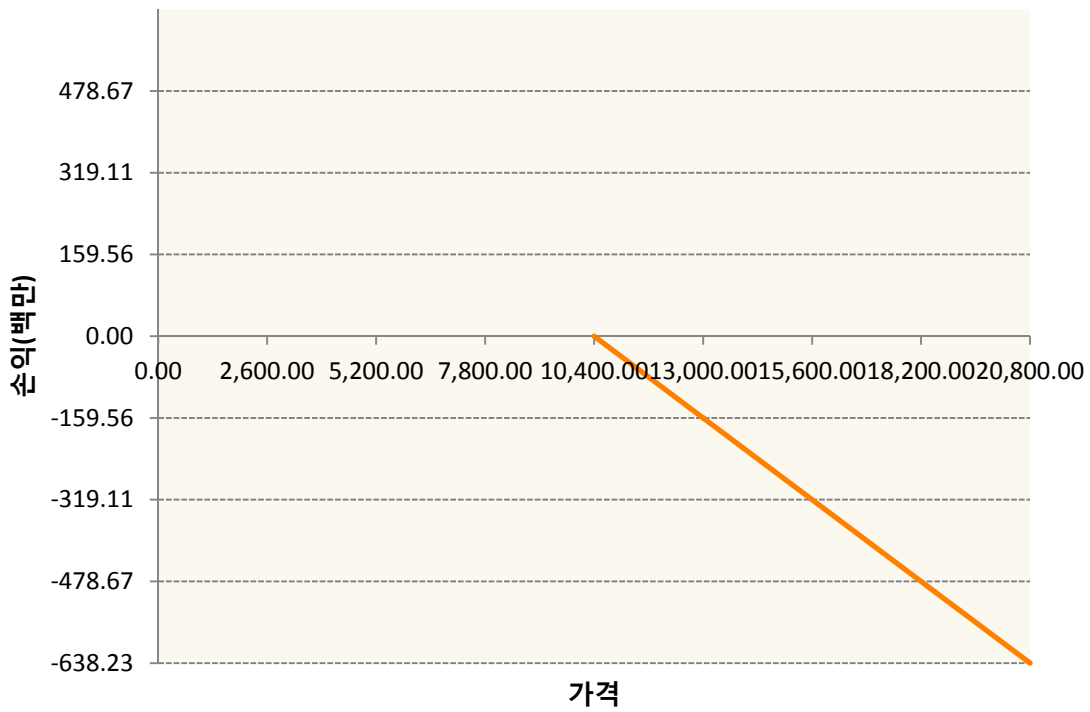


OHHIG0-C103-HSCEI

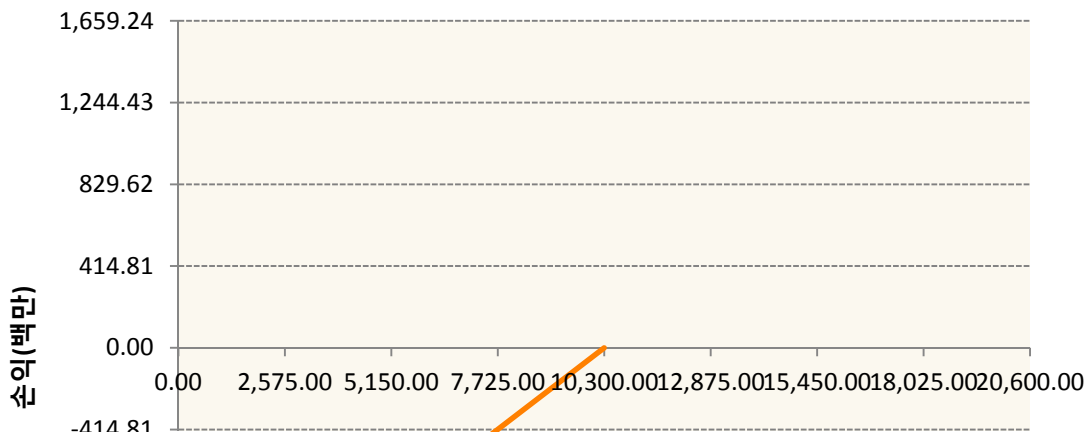


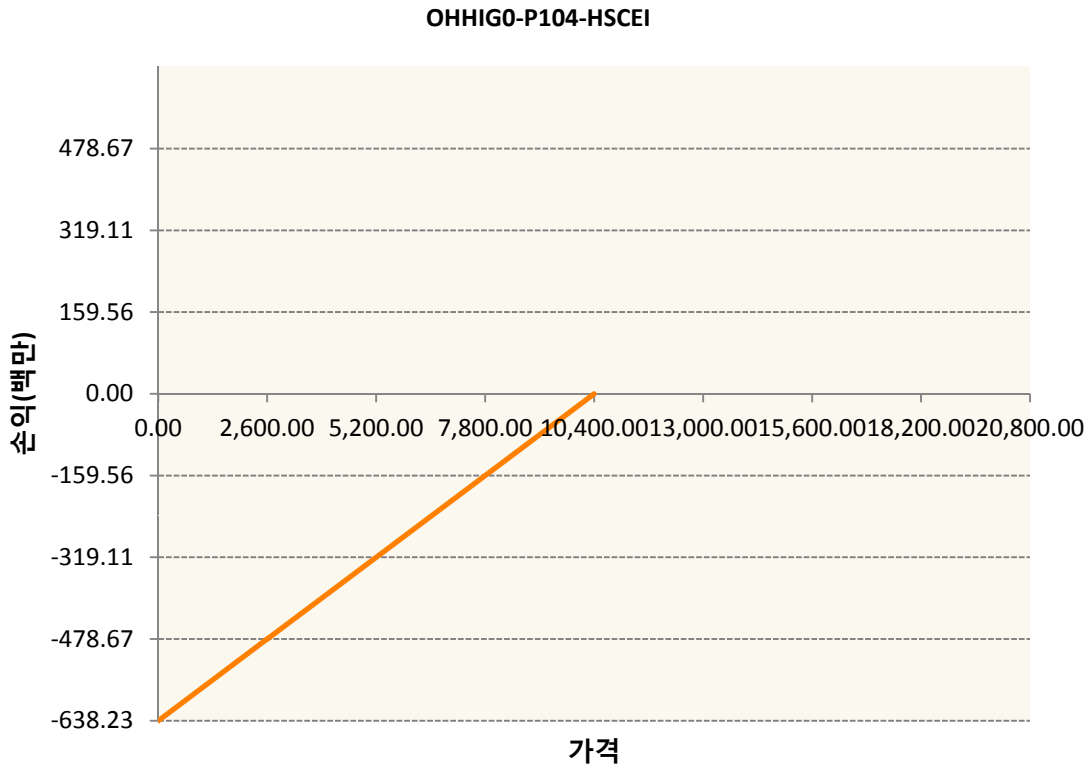


OHHIG0-C104-HSCEI



OHHIG0-P103-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	173
HCG0 HSCEI Futures Feb20	131
OHHIG0-C1(HSCEI	133
OHHIG0-C1(HSCEI	51
OHHIG0-P1(HSCEI	133
OHHIG0-P1(HSCEI	51

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	509

공시일	2020-02-03
기준일	2020-01-31

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

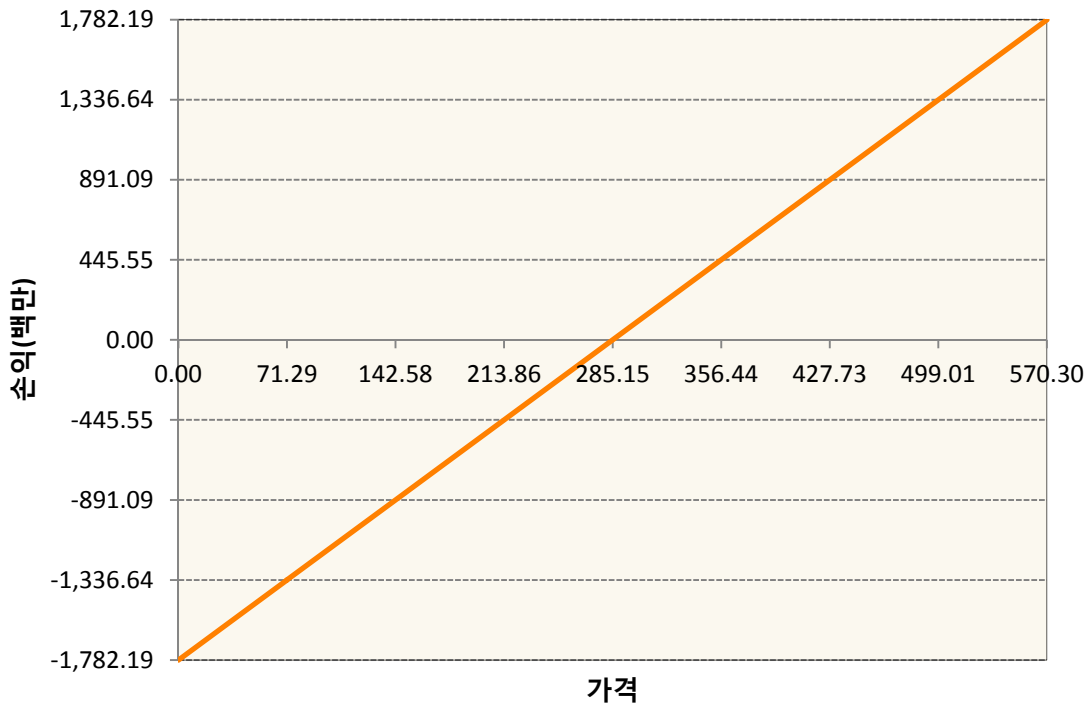
1. 계약금액

(단위:백만원)

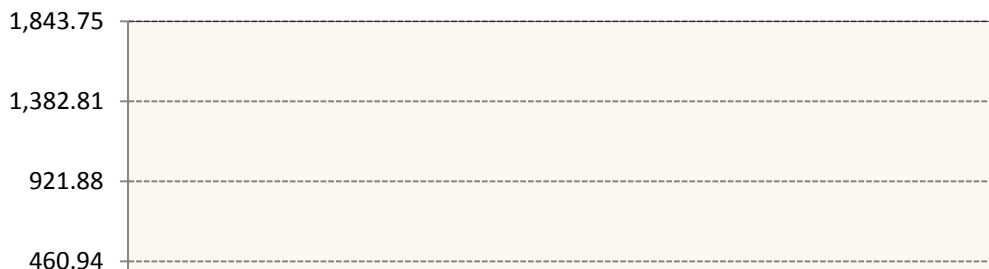
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,782	0	1,782	장내
누계	유가증권	스왑	3,625	0	3,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,608	-3,608	장내

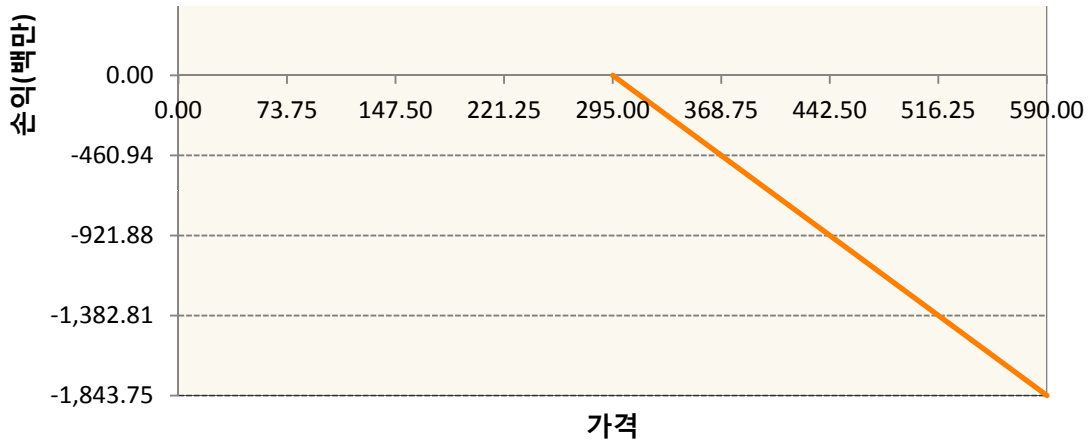
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

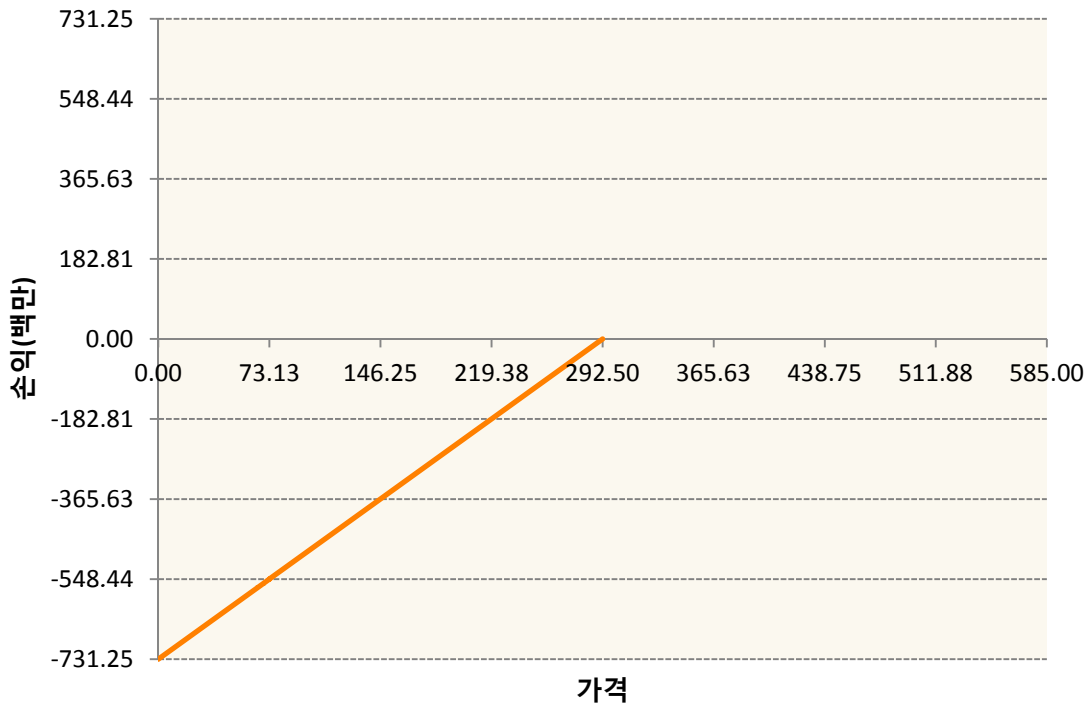


KR4201Q22950-2020-02 콜295

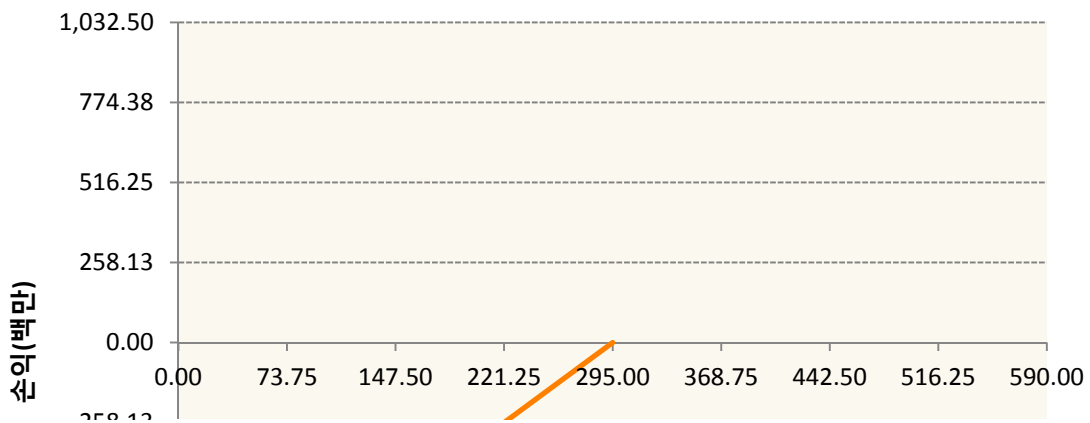




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



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						142
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-142	-142	-142	-142	-142	-142	-142	
-5.33%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-95	
-2.67%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	47	47	47	47	47	47	47	
5.33%	95	95	95	95	95	95	95	
8.00%	142	142	142	142	142	142	142	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						84
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	17	17	16	16	16	15	14	
-5.33%	16	16	15	14	13	12	11	
-2.67%	14	13	11	10	8	6	3	
0%	8	5	3	0	-3	-6	-9	
2.67%	-7	-10	-13	-17	-20	-24	-27	
5.33%	-32	-35	-39	-42	-45	-49	-52	
8.00%	-67	-70	-72	-75	-78	-81	-84	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						54
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-2.67%	-16	-16	-16	-17	-17	-17	-17
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	15	14	13	12	12	11	10
5.33%	21	21	20	19	19	18	17
8.00%	23	23	22	22	22	21	21
KR4301Q22958 2020-02 풋295							77
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
-5.33%	-50	-50	-51	-51	-51	-51	-51
-2.67%	-24	-24	-24	-24	-25	-25	-25
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	23	22	21	20	18	17	16
5.33%	35	34	33	32	31	30	29
8.00%	39	38	38	37	37	36	35

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

(단위:백만원)

648

공시일	2020-02-03
기준일	2020-01-31

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

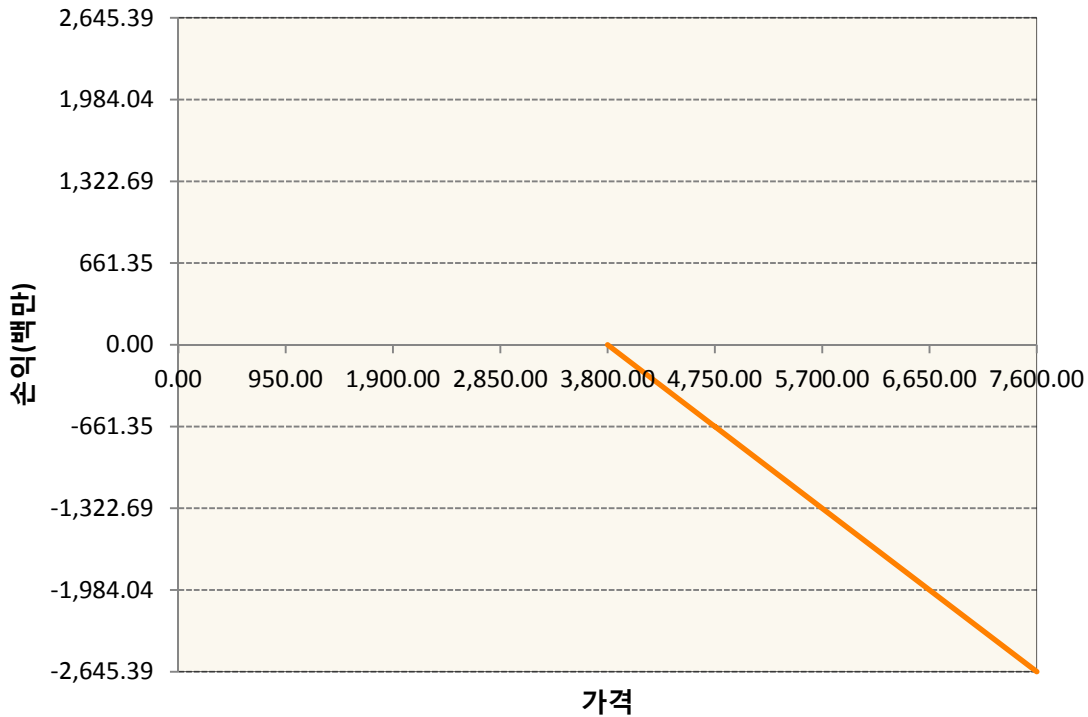
1. 계약금액

(단위:백만원)

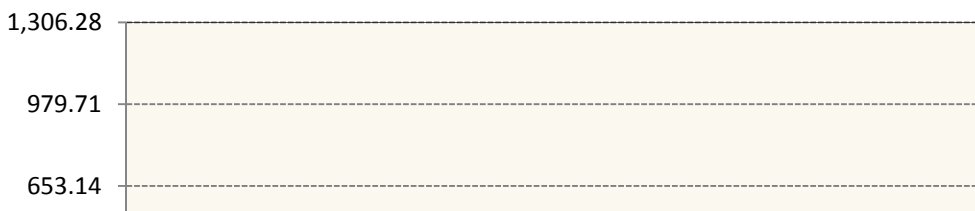
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	759	0	759	
누계	유가증권	스왑	13,725	0	13,725	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,903	-7,903	장내
누계	통화	선도	0	3,447	-3,447	장외

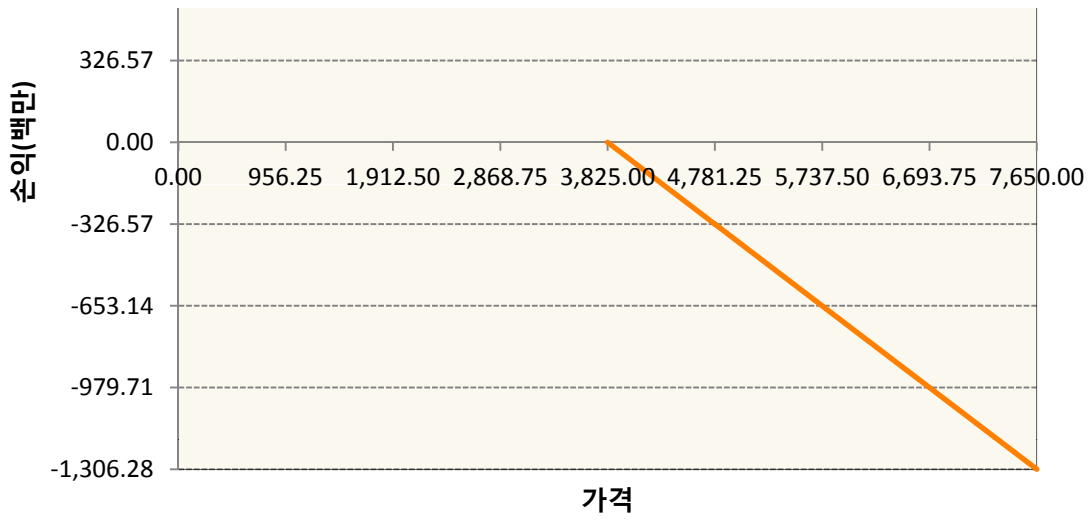
2. 만기시점의 손익구조

OESXG0-C3800-EURO STOXX 50

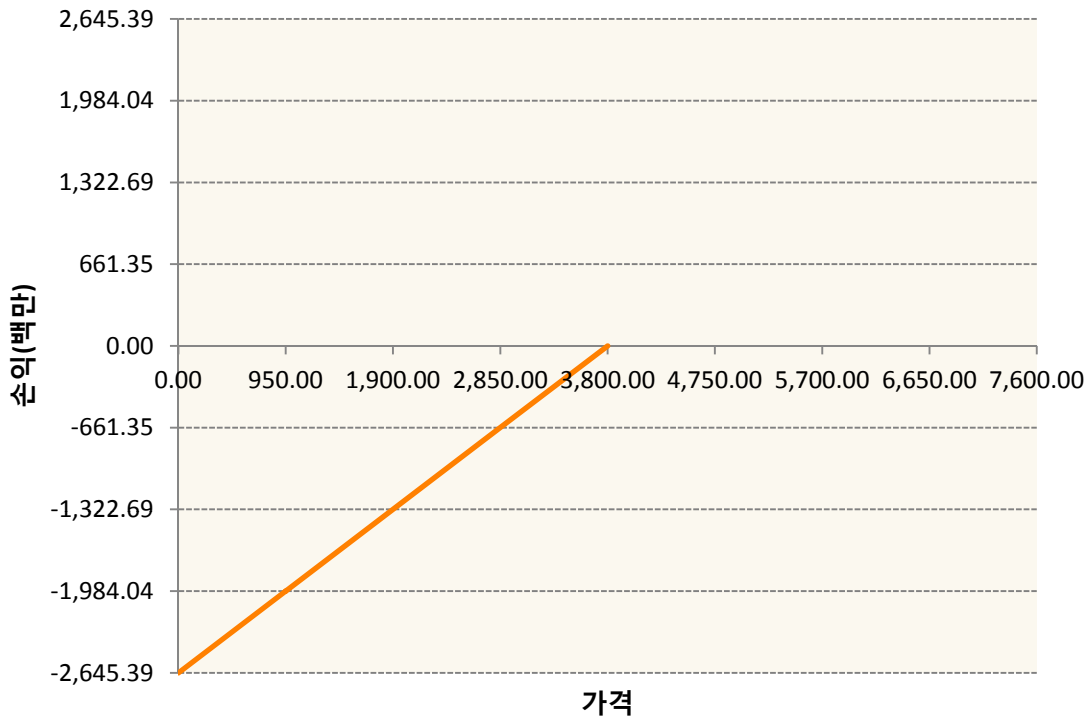


OESXG0-C3825-EURO STOXX 50

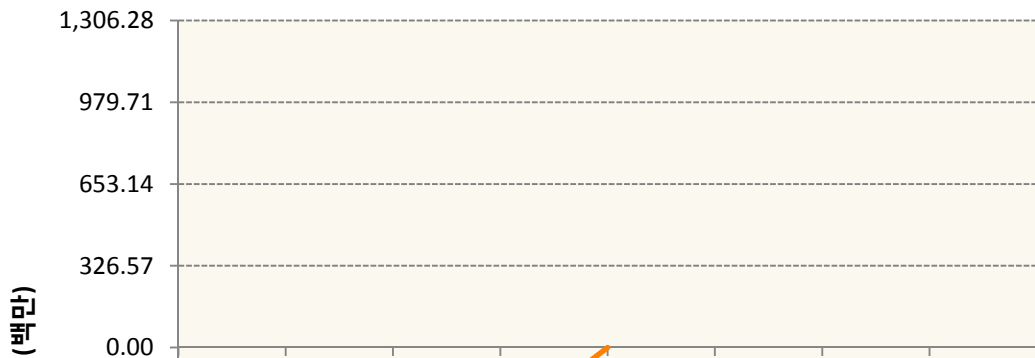


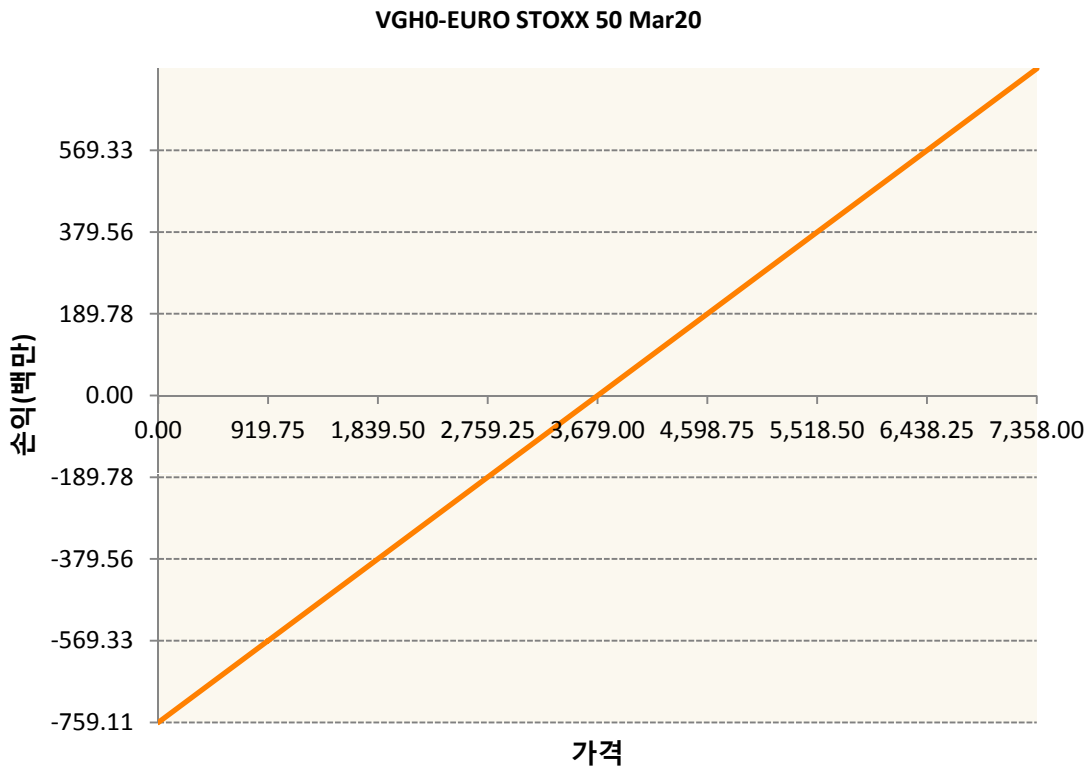
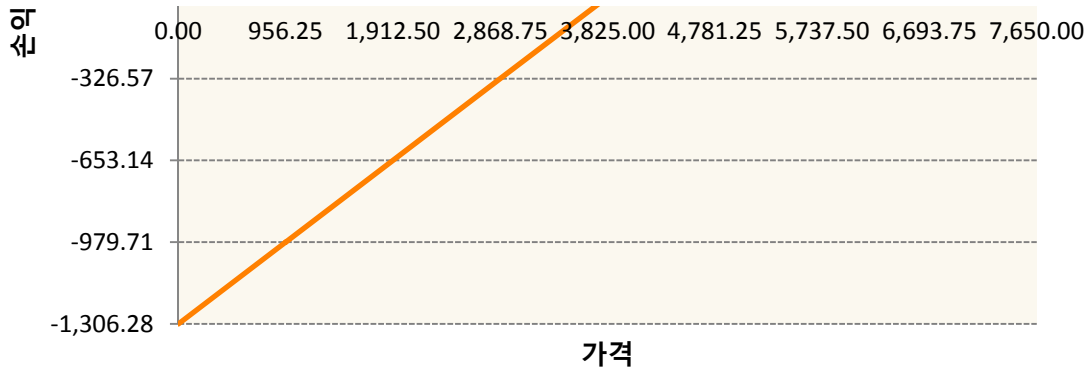


OESXG0-P3800-EURO STOXX 50



OESXG0-P3825-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP\SG EURO Covered CALL STRATEGY		24
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E		276
OESXG0-C3\ EURO STOXX 50		212
OESXG0-C3\ EURO STOXX 50		105
OESXG0-P3\ EURO STOXX 50		212
OESXG0-P3\ EURO STOXX 50		105
VGHO EURO STOXX 50 Mar20		61

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

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

(단위:백만원)

887

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

(단위:백만원)

78

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

(단위:백만원)

115

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

(단위:백만원)

41

공시일	2020-02-03
기준일	2020-01-31

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

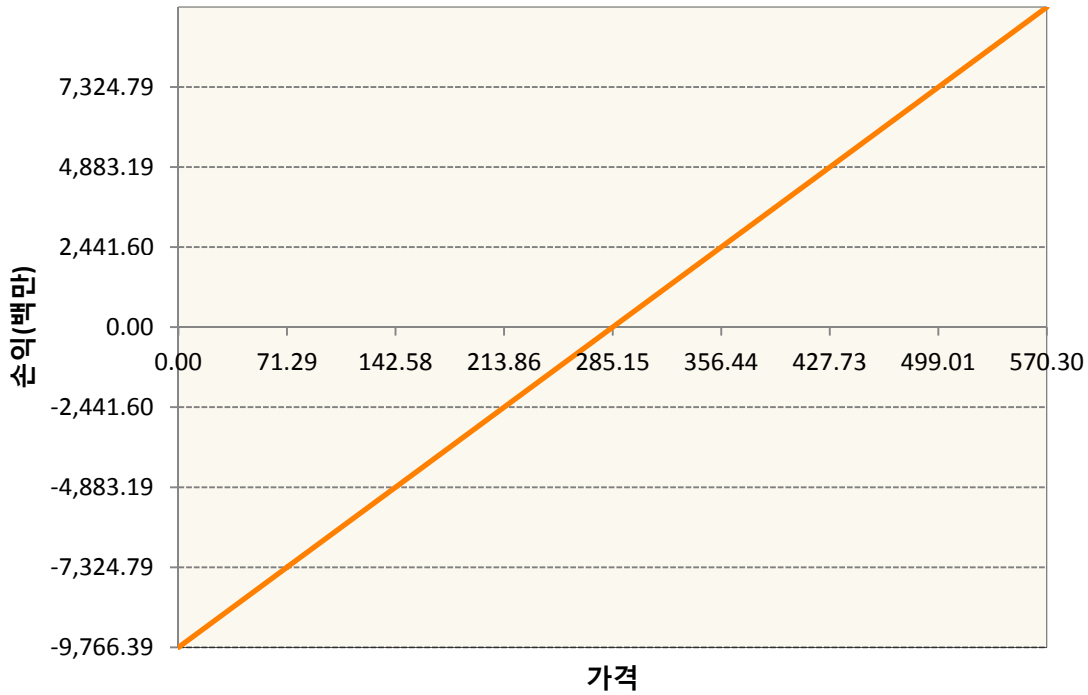
1. 계약금액

(단위:백만원)

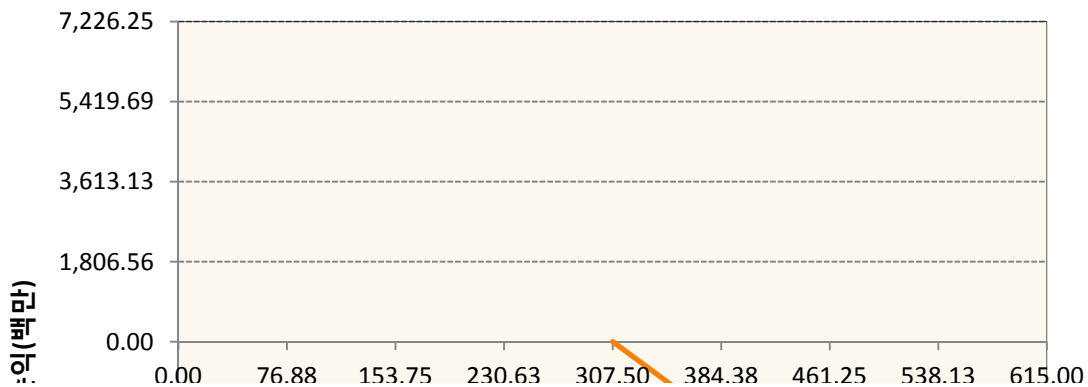
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,766	0	9,766	장내
누계	유가증권	옵션	2,944	20,789	-17,845	장내

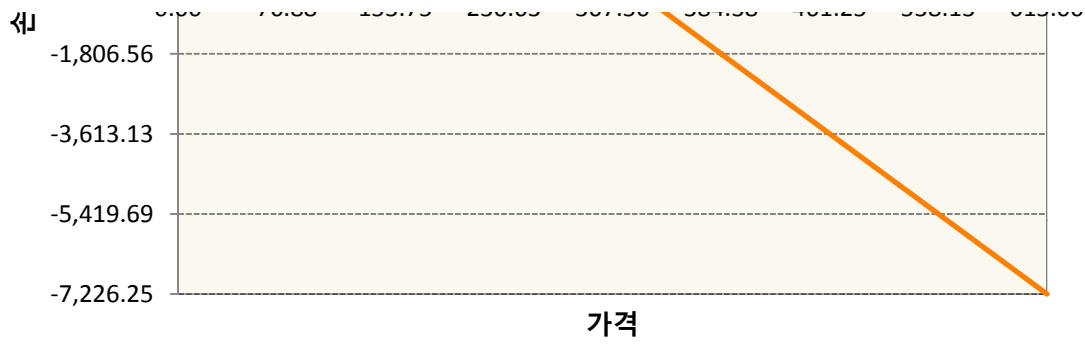
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

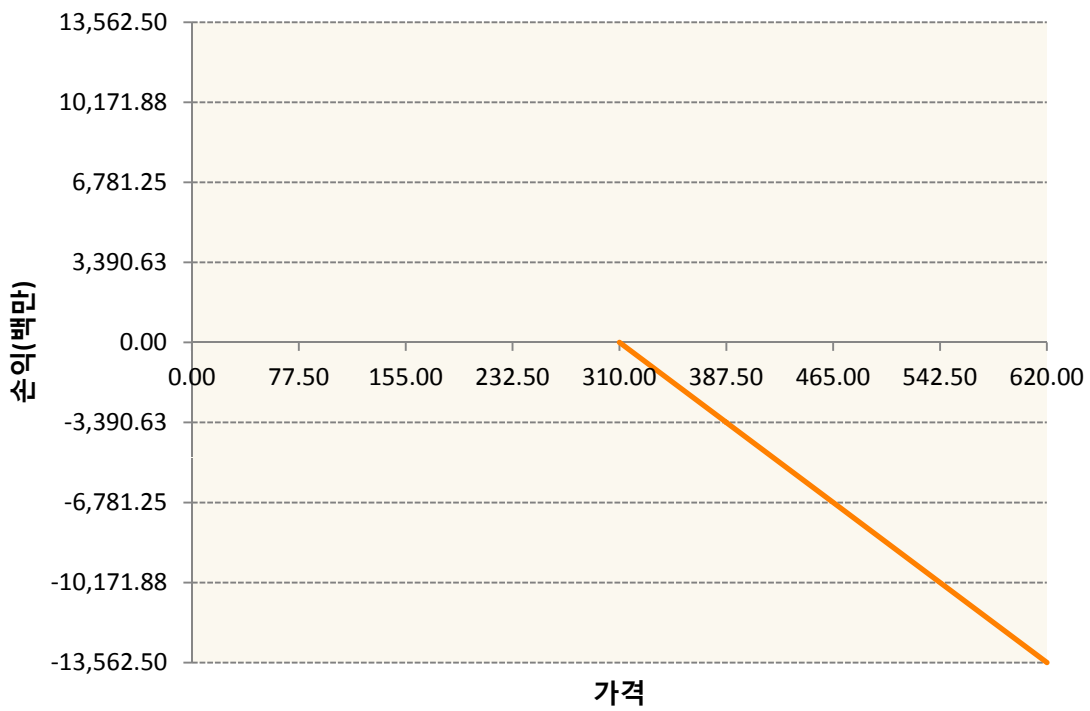


KR4201Q23073-2020-02 콜307.5

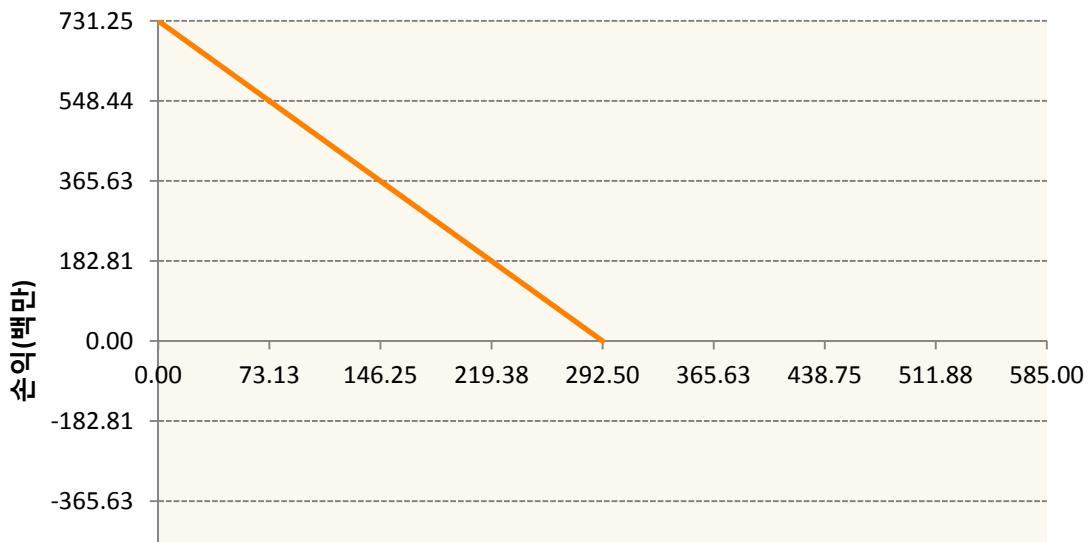


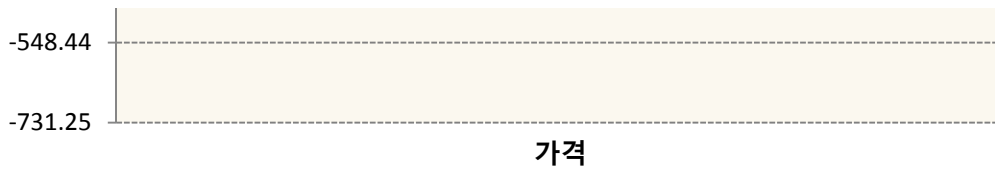


KR4201Q23107-2020-02 콜310

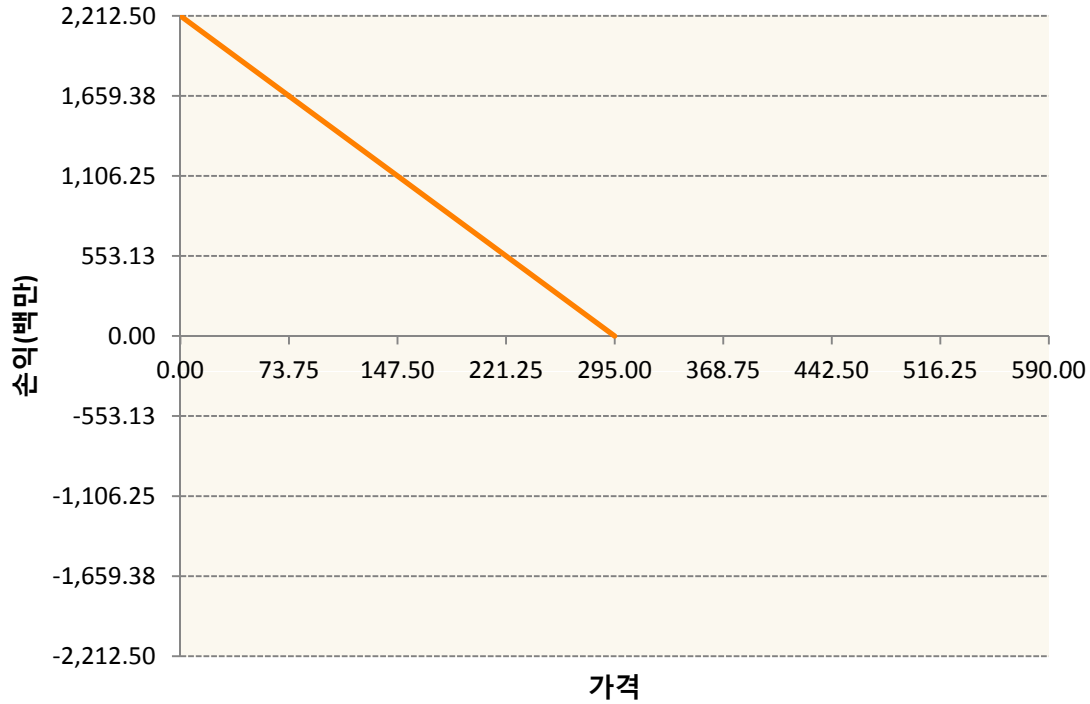


KR4301Q22925-2020-02 풋292.5





KR4301Q22958-2020-02 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						780
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-780	-780	-780	-780	-780	-780	-780	
-5.33%	-520	-520	-520	-520	-520	-520	-520	
-2.67%	-260	-260	-260	-260	-260	-260	-260	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	260	260	260	260	260	260	260	
5.33%	520	520	520	520	520	520	520	
8.00%	780	780	780	780	780	780	780	
KR4201Q23073		2020-02 콜307.5						188
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	16	16	16	16	16	15	14	
-5.33%	16	16	16	15	14	12	10	
-2.67%	16	15	13	11	8	5	0	

0%	12	9	5	0	-6	-12	-19
2.67%	-1	-8	-16	-25	-34	-44	-54
5.33%	-36	-47	-59	-72	-84	-97	-109
8.00%	-105	-119	-133	-146	-160	-174	-188
KR4201Q23107 2020-02 콜310							308
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	22	22	22	22	22	21	20
-5.33%	22	22	22	21	19	17	14
-2.67%	22	20	18	15	11	6	-1
0%	17	13	7	0	-9	-19	-31
2.67%	1	-10	-23	-37	-52	-69	-86
5.33%	-49	-68	-88	-109	-131	-153	-176
8.00%	-155	-180	-206	-231	-257	-282	-308
KR4301Q22925 2020-02 풋292.5							54
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	54	54	54	54	54	54	54
-5.33%	35	35	35	35	35	35	35
-2.67%	16	16	16	17	17	17	17
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-15	-14	-13	-12	-12	-11	-10
5.33%	-21	-21	-20	-19	-19	-18	-17
8.00%	-23	-23	-22	-22	-22	-21	-21
KR4301Q22958 2020-02 풋295							165
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	165	165	165	165	165	165	165
-5.33%	108	108	108	108	108	109	109
-2.67%	51	52	52	52	53	53	54
0%	-4	-3	-1	0	1	3	5
2.67%	-49	-47	-44	-42	-40	-37	-35
5.33%	-75	-73	-71	-68	-66	-64	-61
8.00%	-83	-82	-81	-80	-79	-77	-76

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

(단위:백만원)

1,108

공시일	2020-02-03
기준일	2020-01-31

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	213,856	0	213,856	

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	2020-02-03
기준일	2020-01-31

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	223,224	0	223,224	

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	2020-02-03
기준일	2020-01-31

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	548,198	0	548,198	
누계	통화	선도	0	534,046	-534,046	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,384
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,574
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	1,659
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	1,564
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	953
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	191
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	2,040
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	953
FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E	3,814
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,907
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	2,040
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	191
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	191
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	1,144
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	1,716
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	286
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E	1,907
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E	3,280
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,535
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,430
FX21020F02 KRW/USD 28-02-20E	1,907
FX21020F03 KRW/USD 28-02-20E	2,956
FX21020F03 KRW/USD 31-03-20E	3,051
FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E	2,860
FX21020F04 KRW/USD 28-02-20E	191

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

14,240

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

(단위:백만원)

117

공시일	2020-02-03
기준일	2020-01-31

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

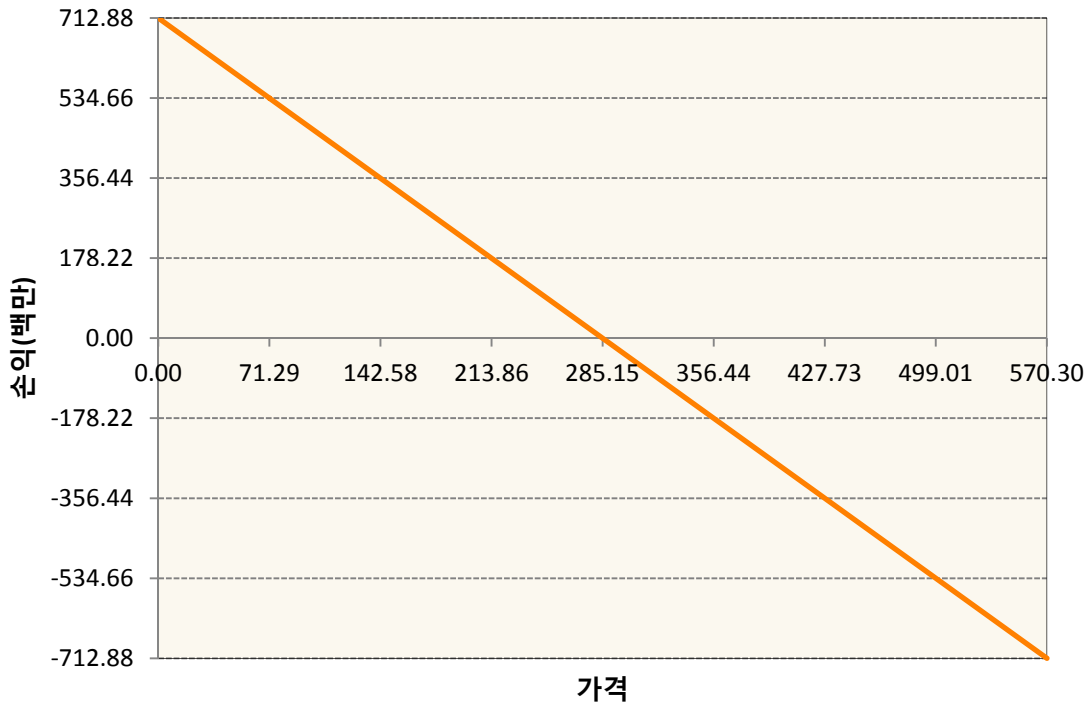
1. 계약금액

(단위:백만원)

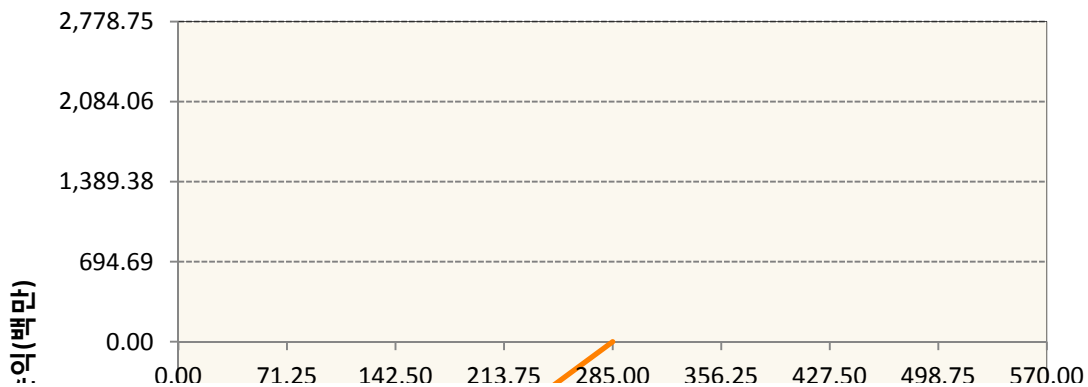
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	713	-713	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,569	-3,569	장내

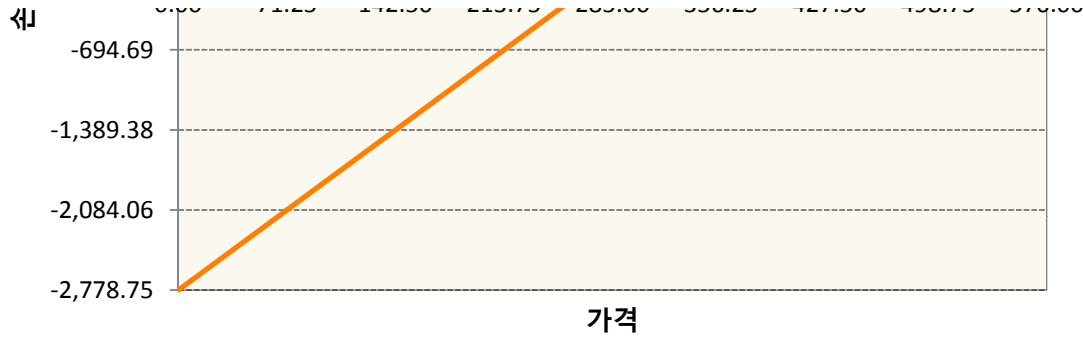
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

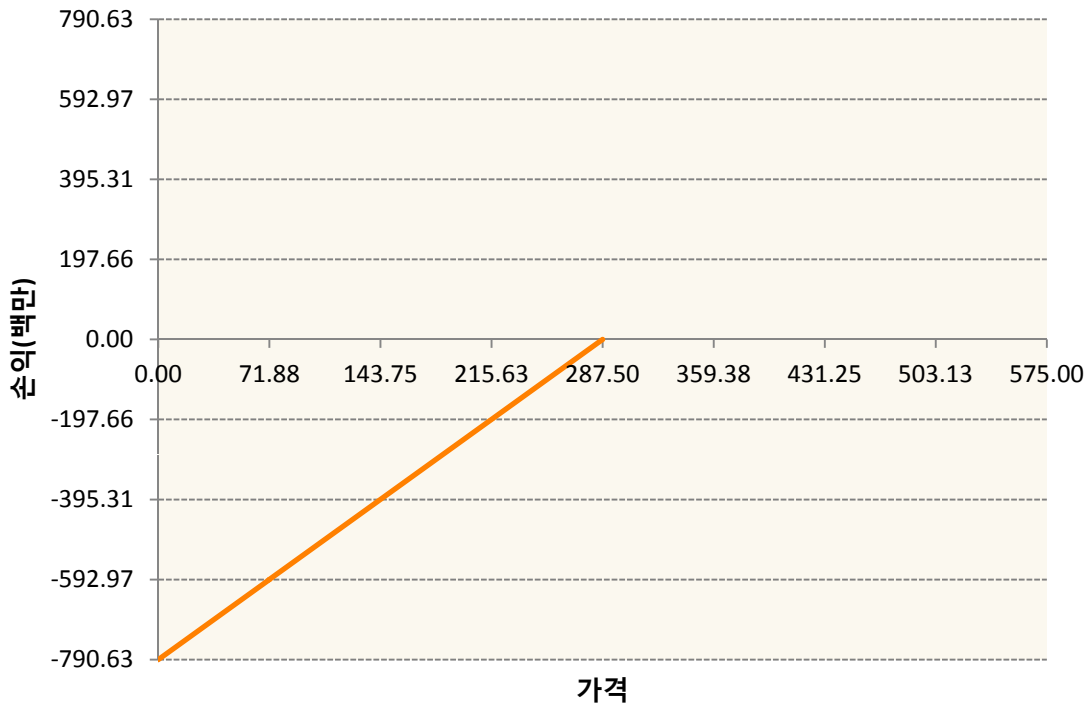


KR4301Q22859-2020-02 풋285





KR4301Q22875-2020-02 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						57
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	57	57	57	57	57	57	57	
-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%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57	
KR4301Q22859		2020-02 풋285						187
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-186	-186	-186	-187	-187	-187	-187
-5.33%	-113	-113	-114	-114	-115	-116	-117
-2.67%	-43	-45	-47	-49	-51	-54	-56
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	34	32	30	27	25	22	19
5.33%	40	39	38	37	36	35	33
8.00%	41	40	40	40	40	39	39
KR4301Q22875 2020-02 풋287.5							56
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-55	-55	-55	-55	-56	-56	-56
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-36
-2.67%	-14	-15	-15	-16	-16	-17	-17
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	12	11	10	10	9	8	7
5.33%	15	15	14	14	13	13	12
8.00%	15	15	15	15	15	15	15

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

(단위:백만원)

321

공시일	2020-02-03
기준일	2020-01-31

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	12,667	0	12,667	
누계	통화	선도	0	12,371	-12,371	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	353
FX21020F00 KRW/USD 13-02-20E	128
FX21020F03 KRW/USD 28-02-20E	208
FX21020F04 KRW/USD 28-02-20E	297
FX21020F04 KRW/USD 28-02-20E	5
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

330

공시일	2020-02-03
기준일	2020-01-31

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

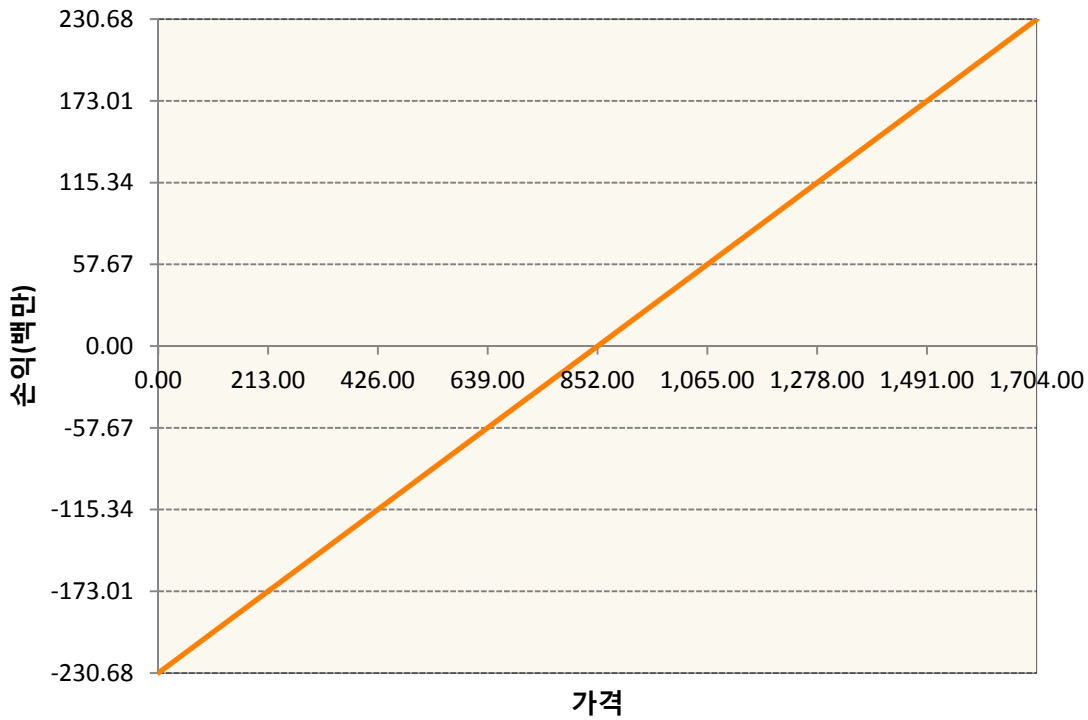
1. 계약금액

(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	231	0	231	
누계	유가증권	스왑	1,084	0	1,084	장외
누계	통화	선도	66	630	-565	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCG0-VN30 Index Future Feb20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	87
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
FX21020F04 EUR/KRW 24-04-20E	2
VNCG0 VN30 Index Future Feb20	18

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

(단위:백만원)

96

공시일	2020-02-03
기준일	2020-01-31

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

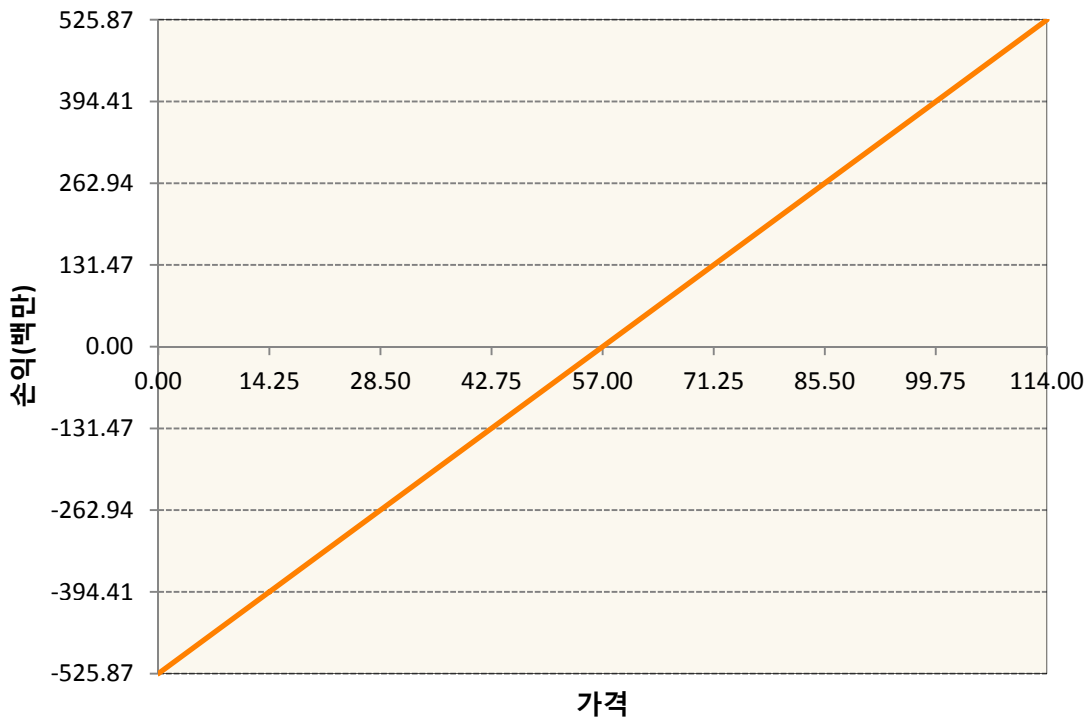
1. 계약금액

(단위:백만원)

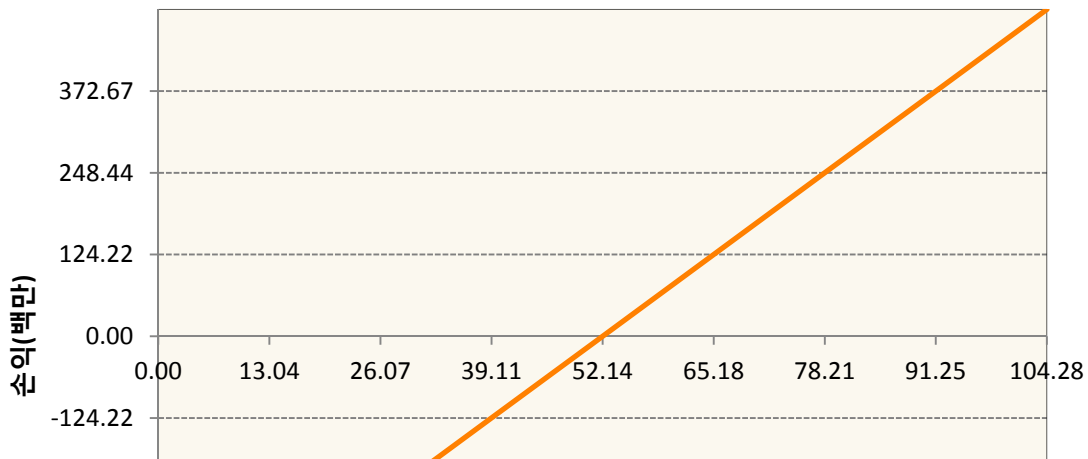
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,073	191	1,882	

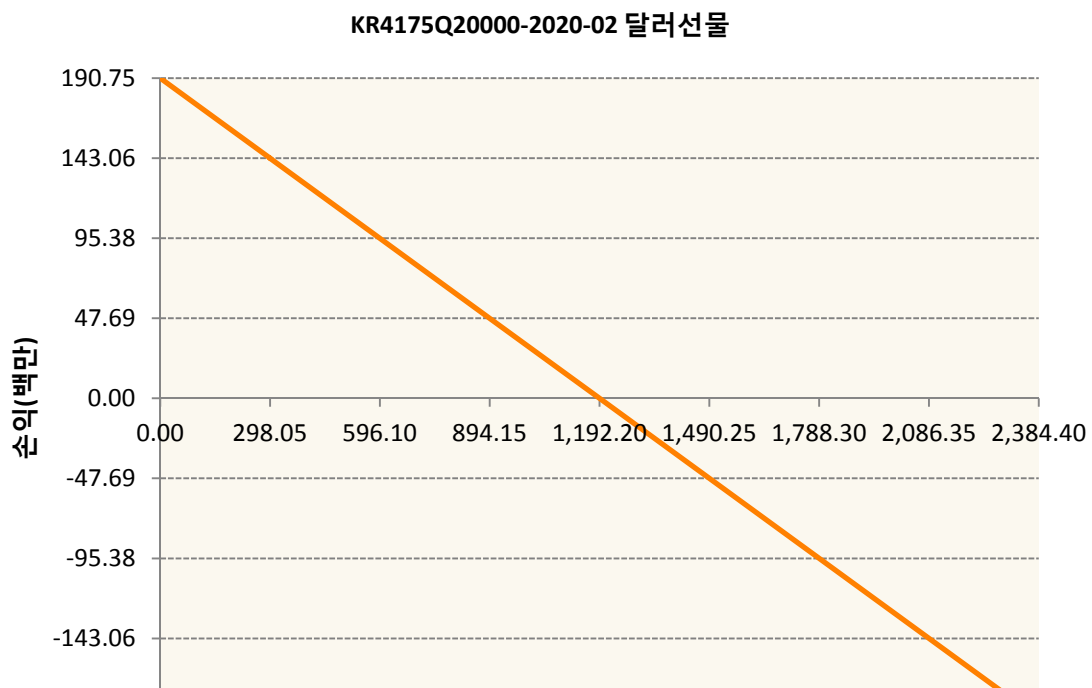
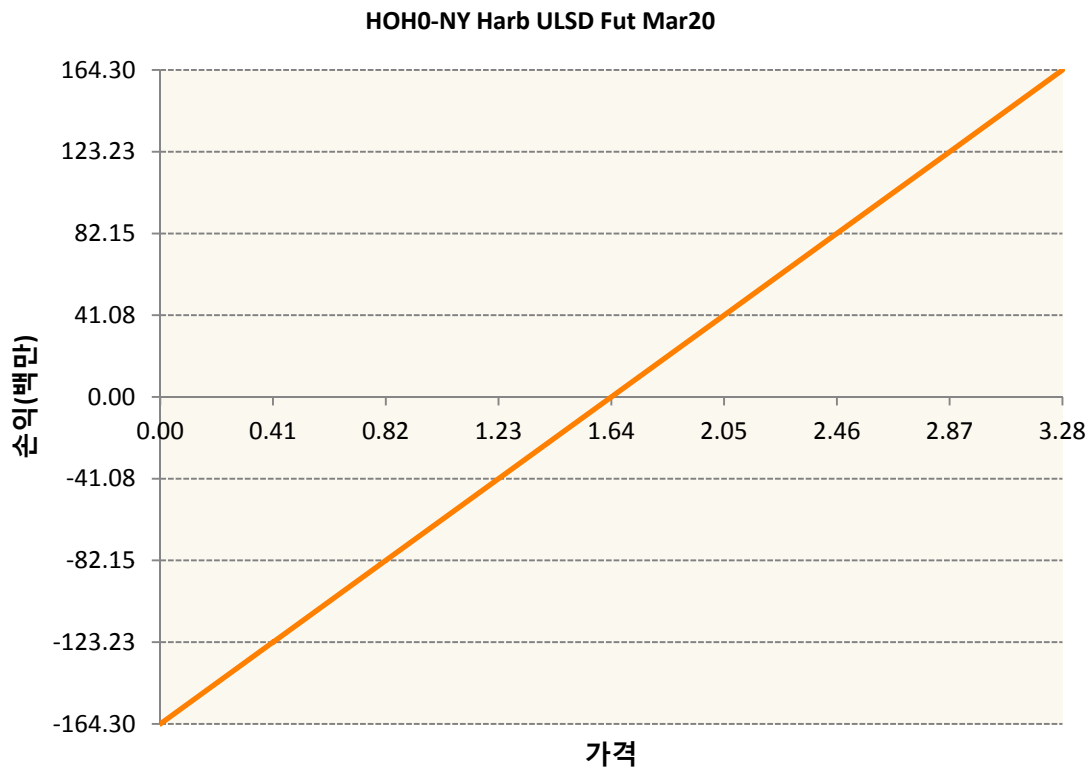
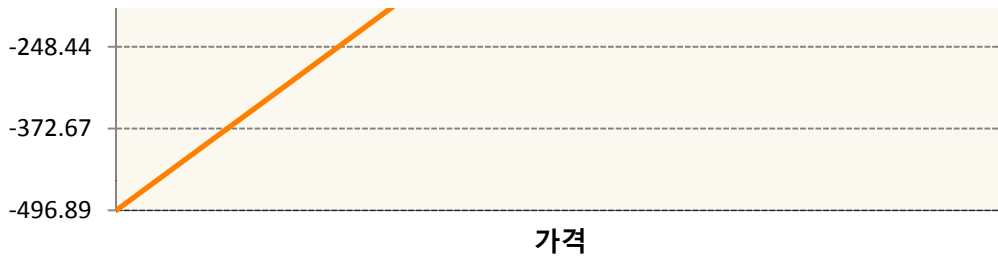
2. 만기시점의 손익구조

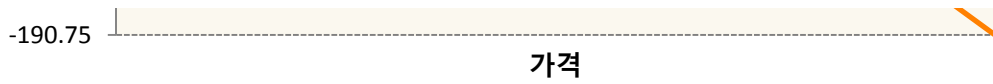
COKO-BRENT CRUDE FUTR May20



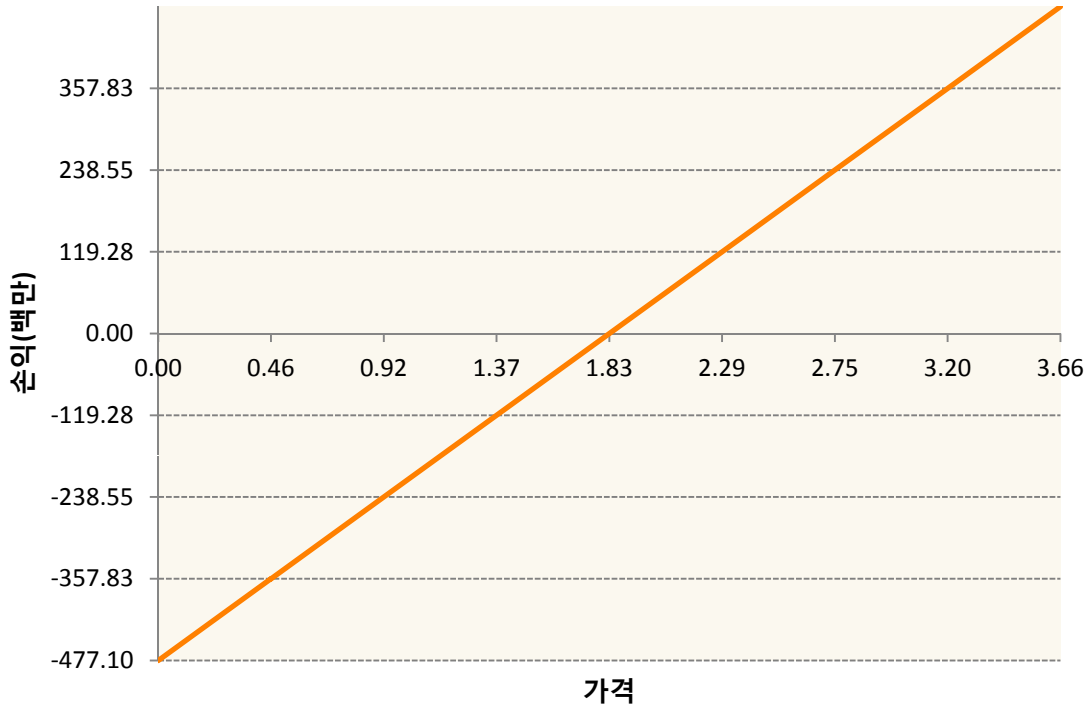
CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20



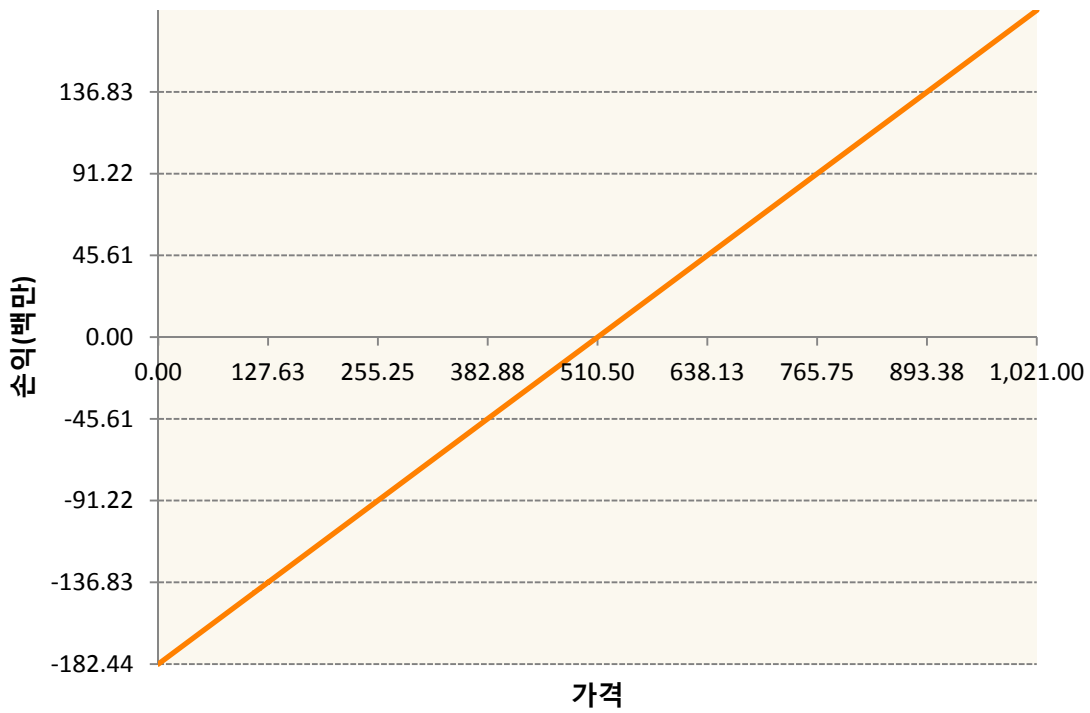




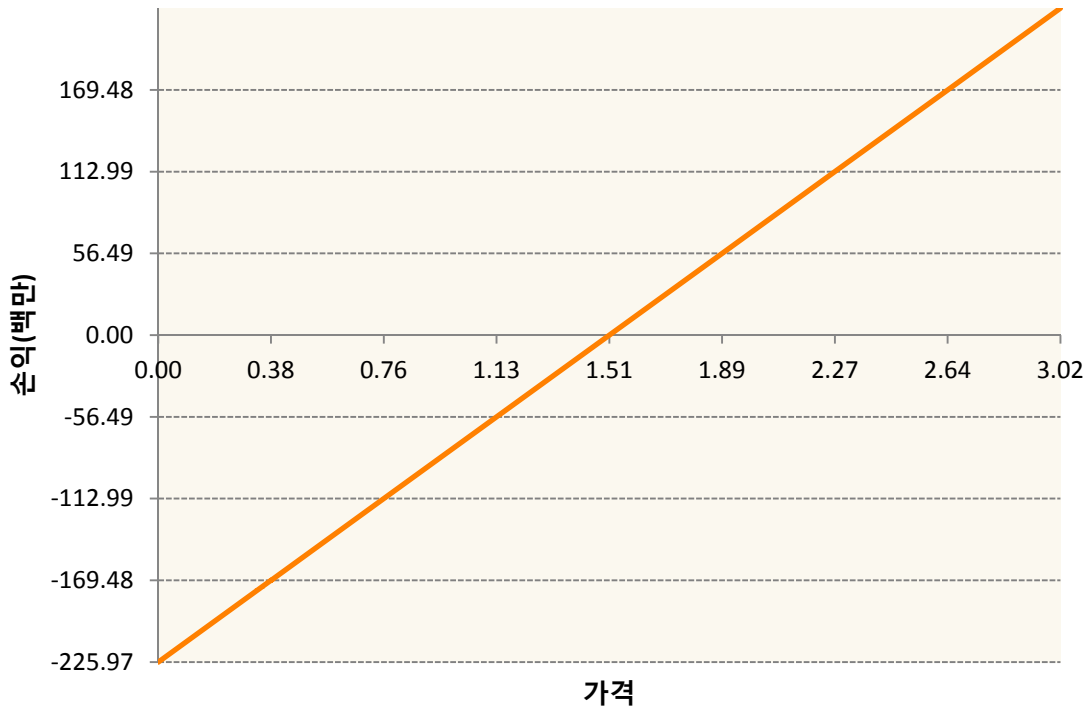
NGH20-NATURAL GAS FUTR Mar20



QSH0-Low Su Gasoil G Mar20



XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	42
CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	40
HOH0	NY Harb ULSD Fut Mar20	13
KR4175Q20C	2020-02 달러선물	15
NGH20	NATURAL GAS FUTR Mar20	38
QSH0	Low Su Gasoil G Mar20	15
XBH0	GASOLINE RBOB FUT Mar20	18

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

323

공시일	2020-02-03
기준일	2020-01-31

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

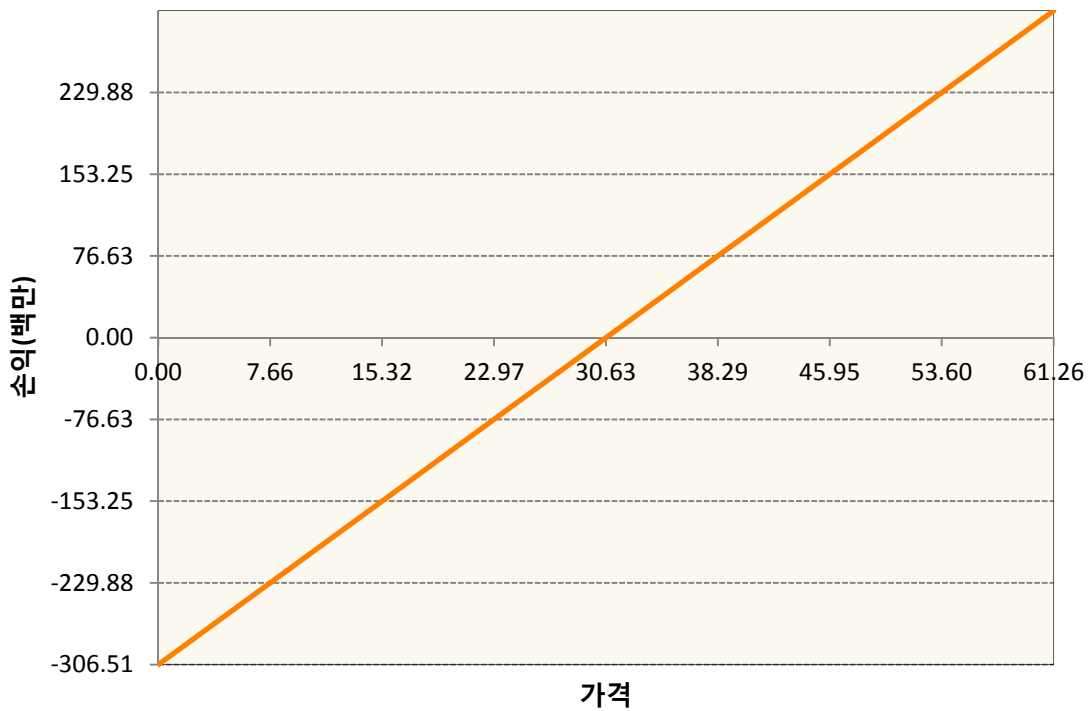
1. 계약금액

(단위:백만원)

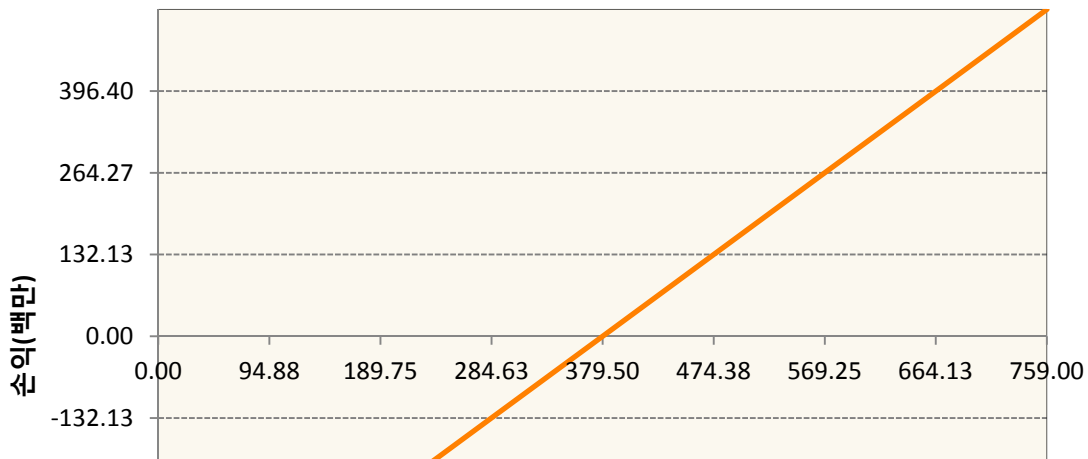
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,729	155	2,574	

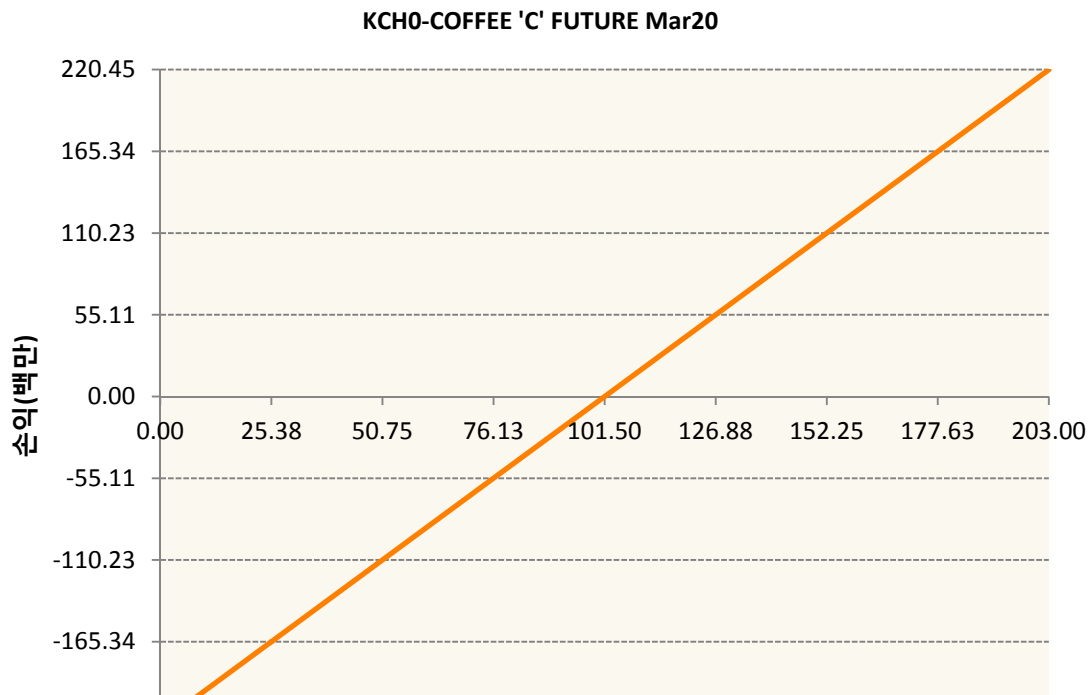
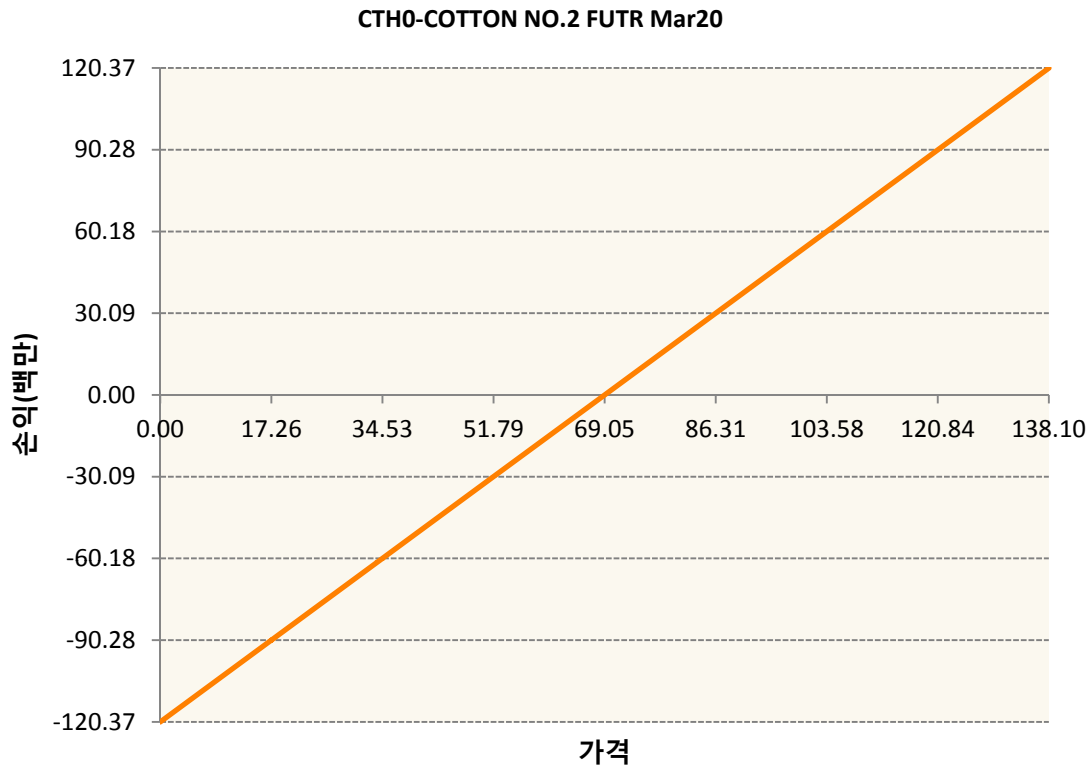
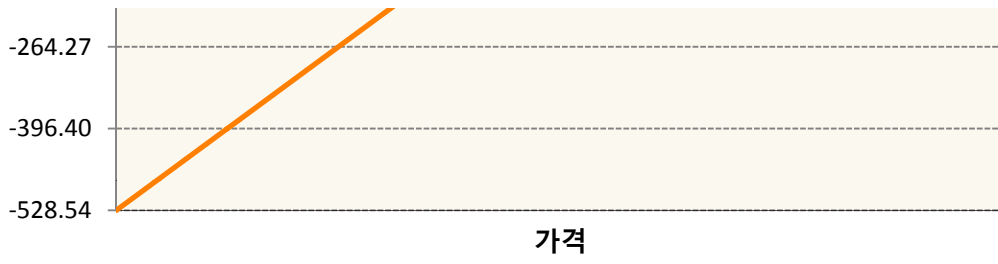
2. 만기시점의 손익구조

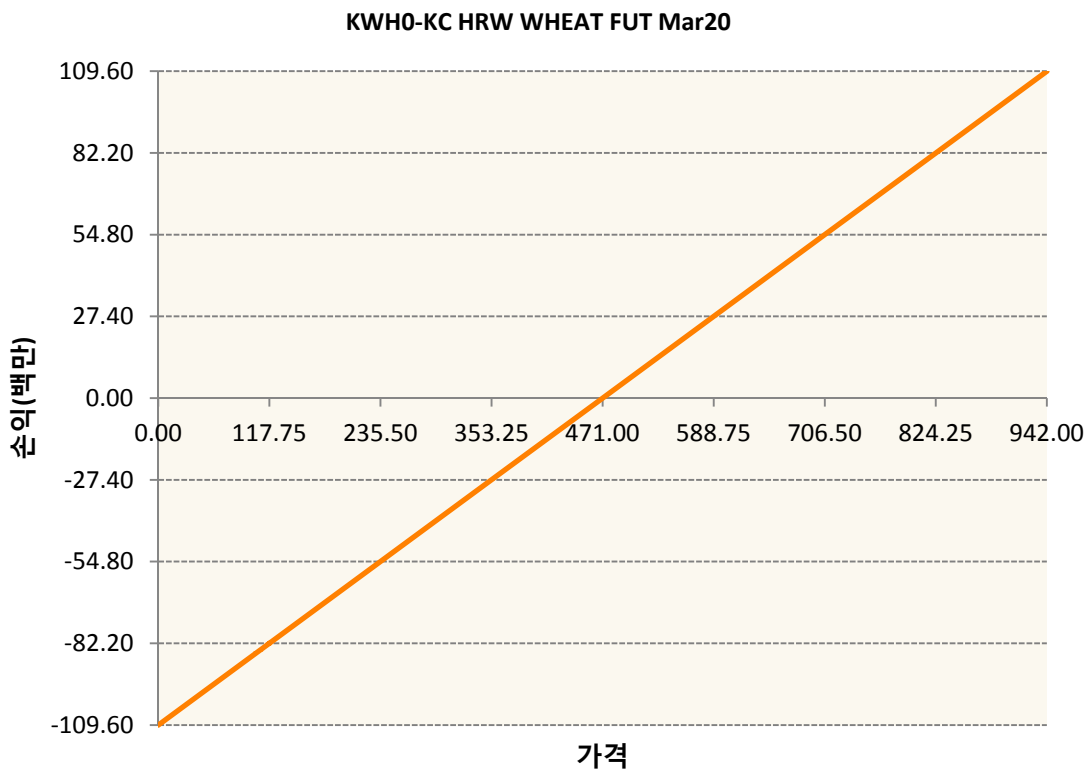
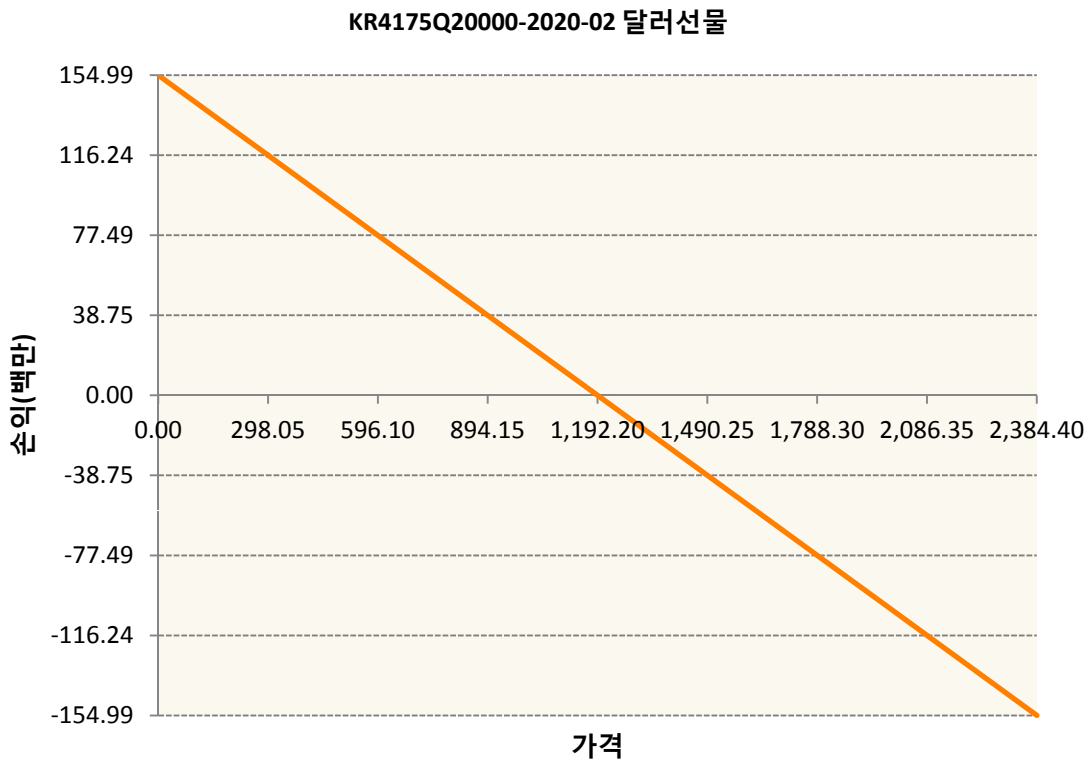
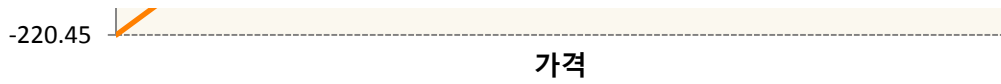
BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20



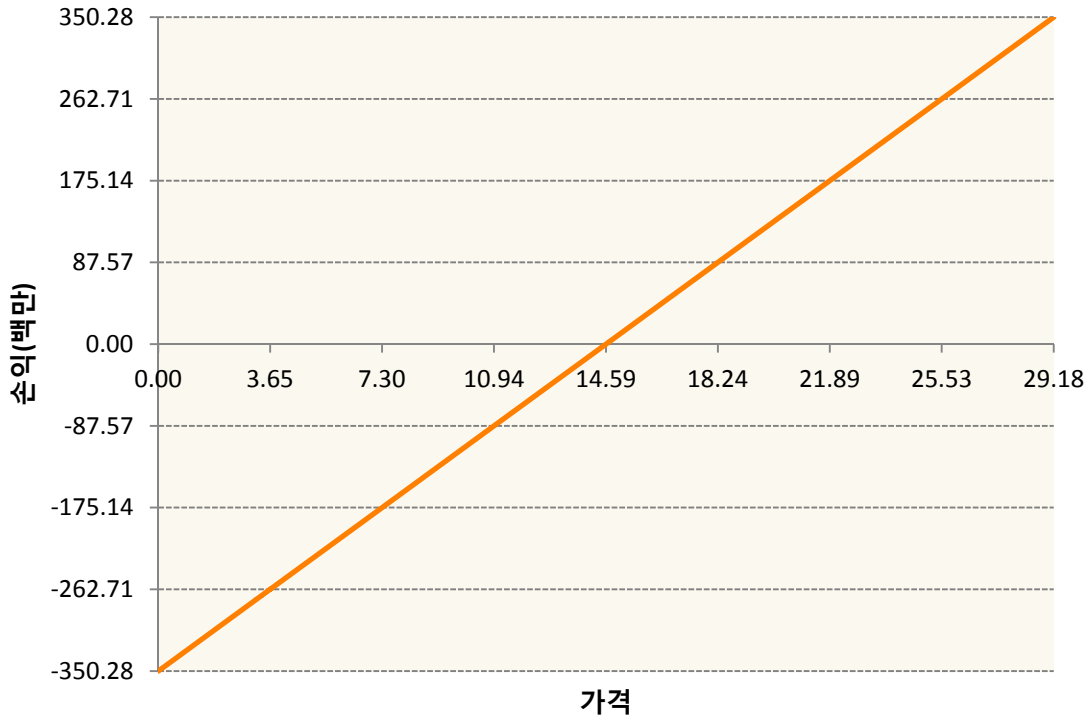
CH0-CORN FUTURE Mar20



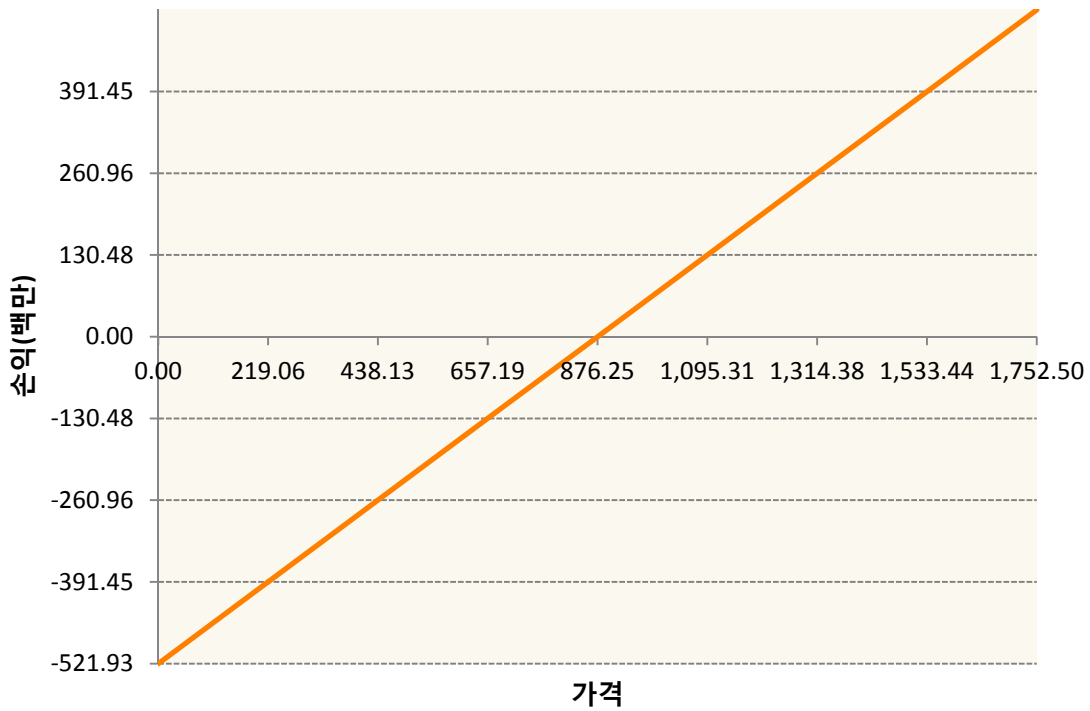




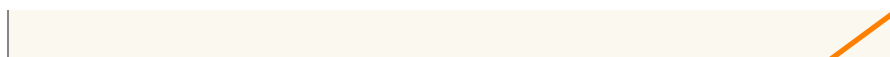
SBH0-Sugar Mar20

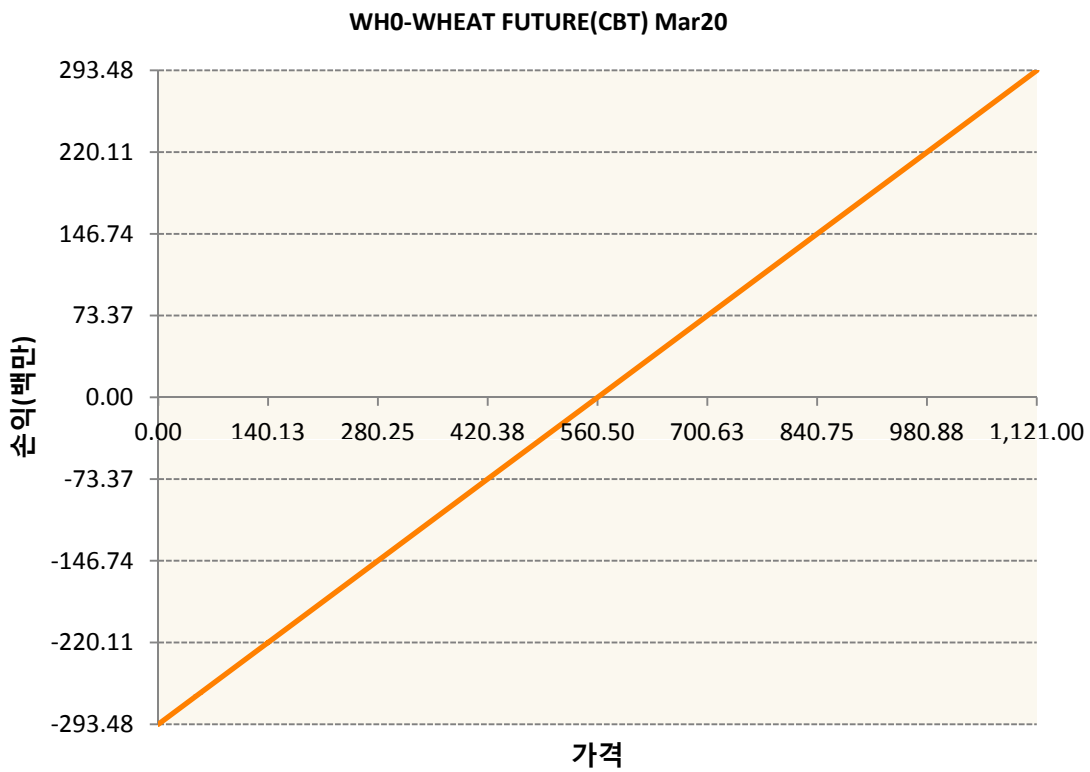
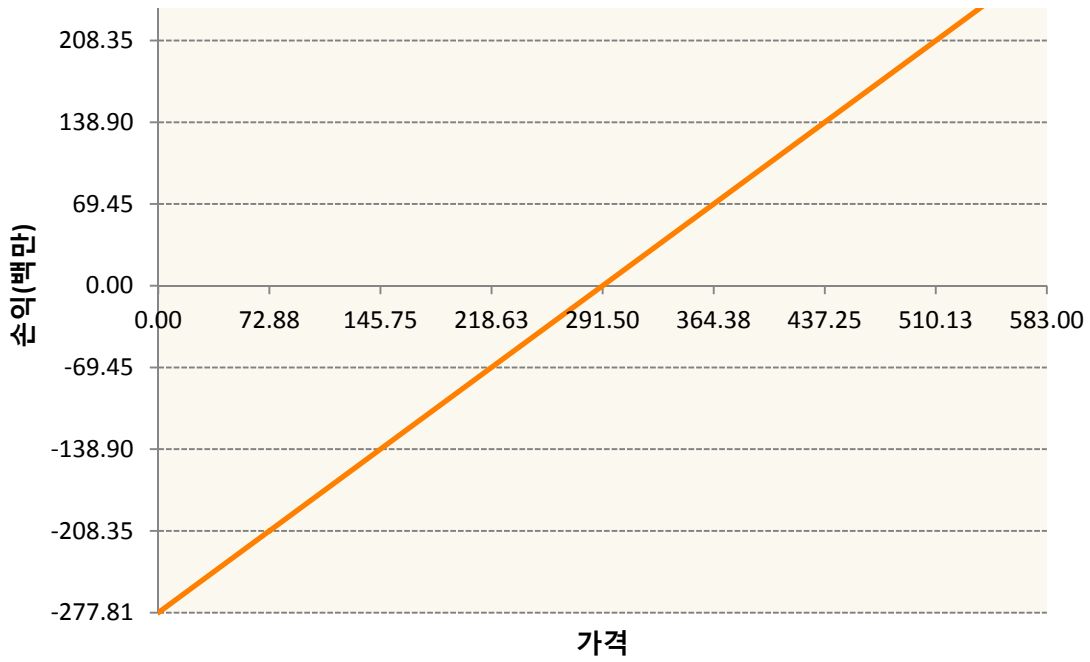


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20



SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH0	SOYBEAN OIL FUTR Mar20	25
CH0	CORN FUTURE Mar20	42
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	42
SMH0	SOYBEAN MEAL FUTR Mar20	22
WH0	WHEAT FUTURE(CBT) Mar20	23

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

(단위:백만원)

237