

공시일	2020-02-04
기준일	2020-02-03

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	2020-02-04
기준일	2020-02-03

스마트인덱스모

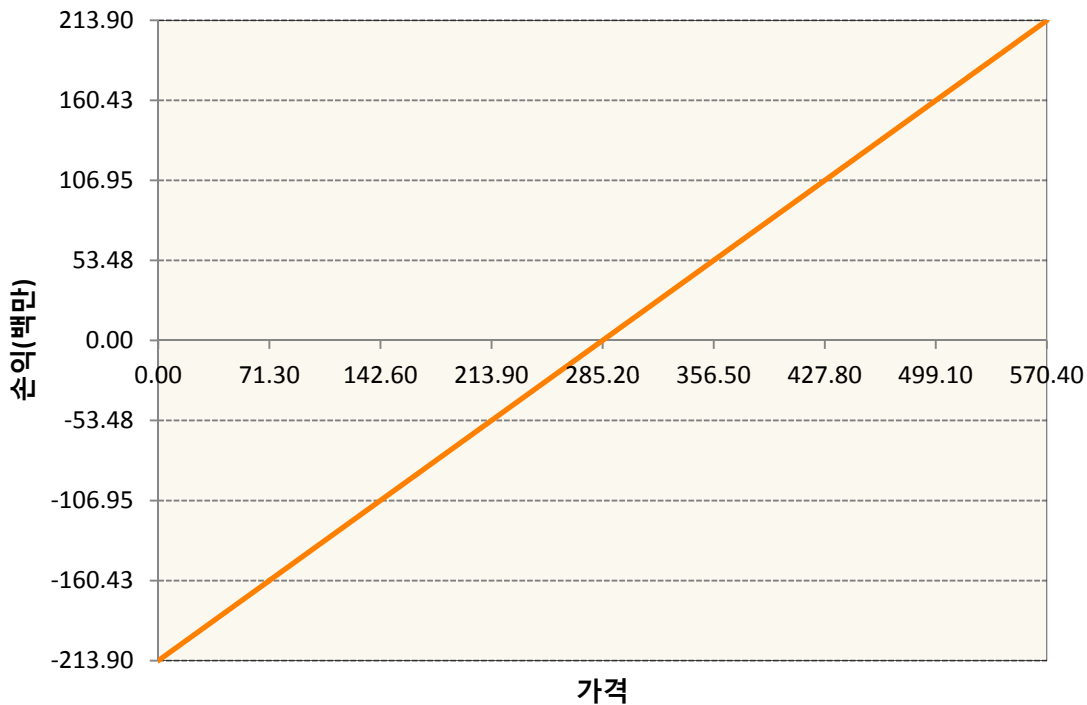
1. 계약금액

(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	2020-02-04
기준일	2020-02-03

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

1,122

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

649

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-04
기준일	2020-02-03

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)	377
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	138

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

725

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-04
기준일	2020-02-03

유로인덱스모(주식-파생형)

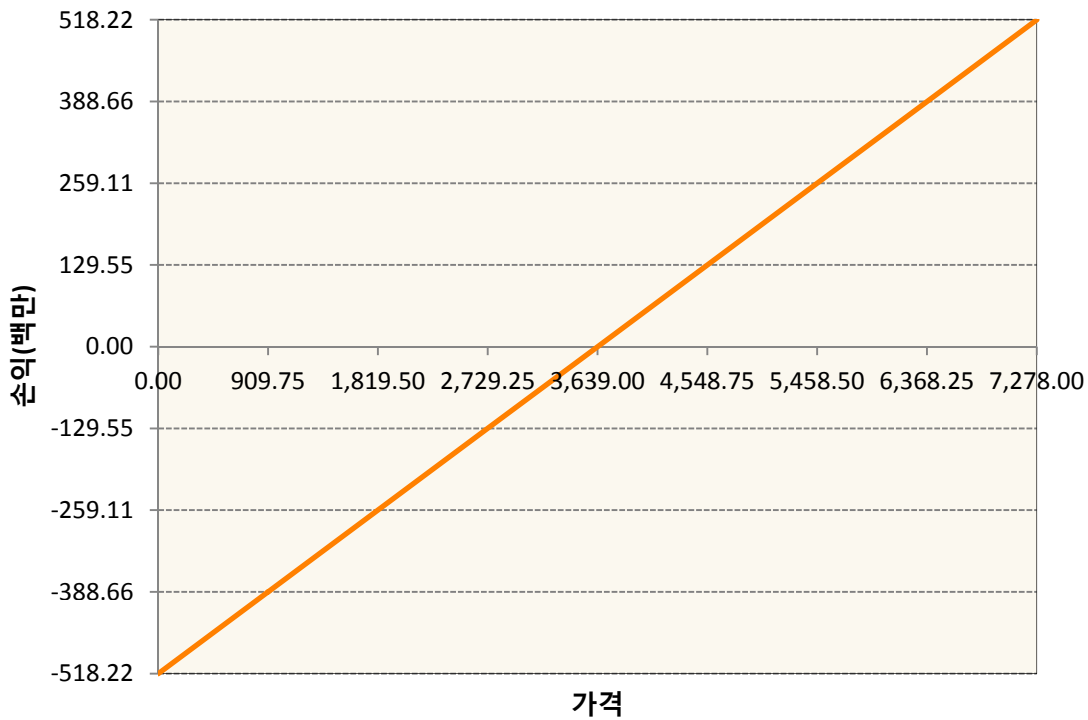
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	518	0	518	

2. 만기시점의 손익구조

VGH0-EURO STOXX 50 Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH0	EURO STOXX 50 Mar20	41
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

29

공시일	2020-02-04
기준일	2020-02-03

차이나인덱스모(주식-파생형)

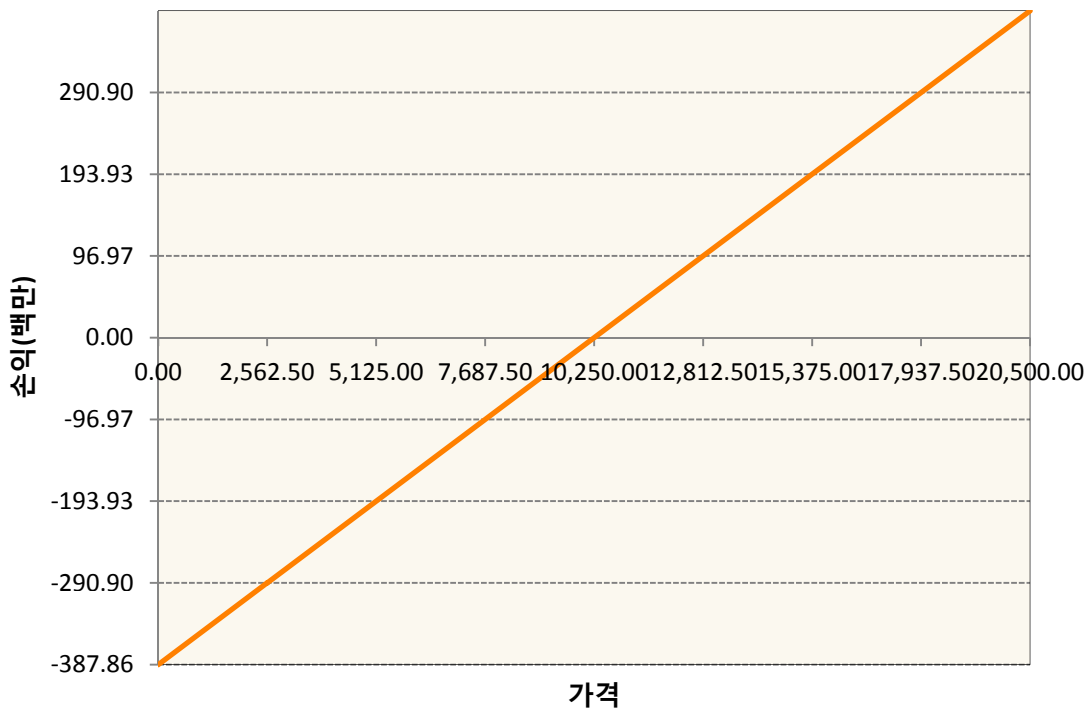
1. 계약금액

(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	2020-02-04
기준일	2020-02-03

커버드콜모(주식혼합-파생형)

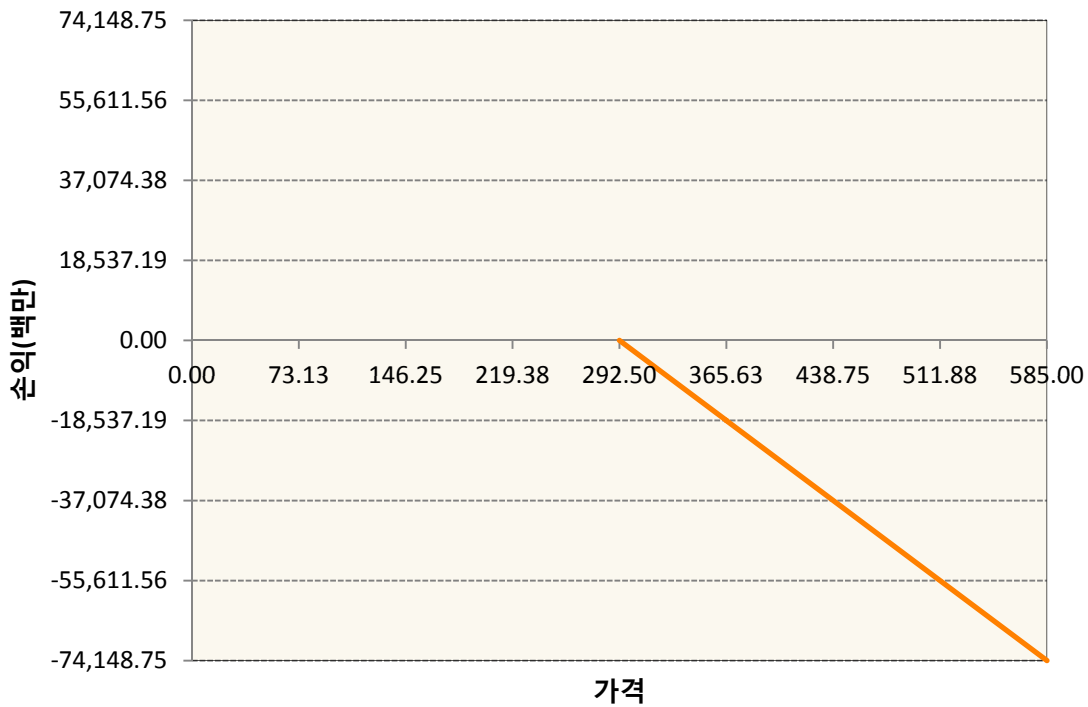
1. 계약금액

(단위:백만원)

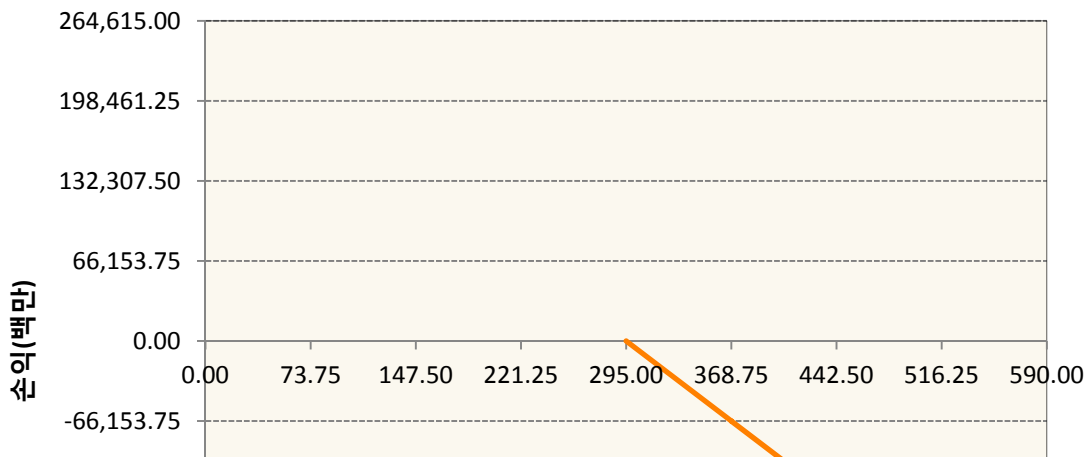
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	455,004	-455,004	장내

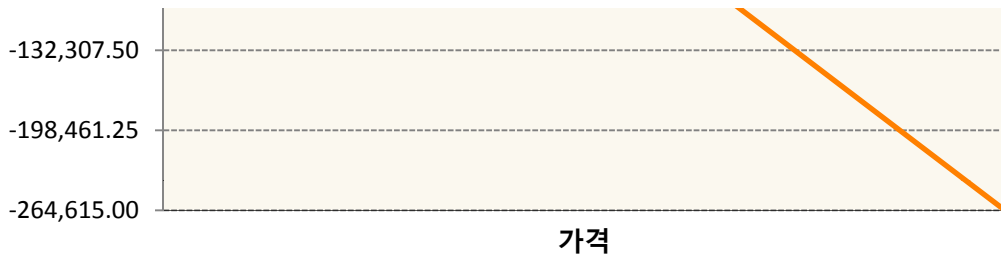
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q22927-2020-02 콜292.5

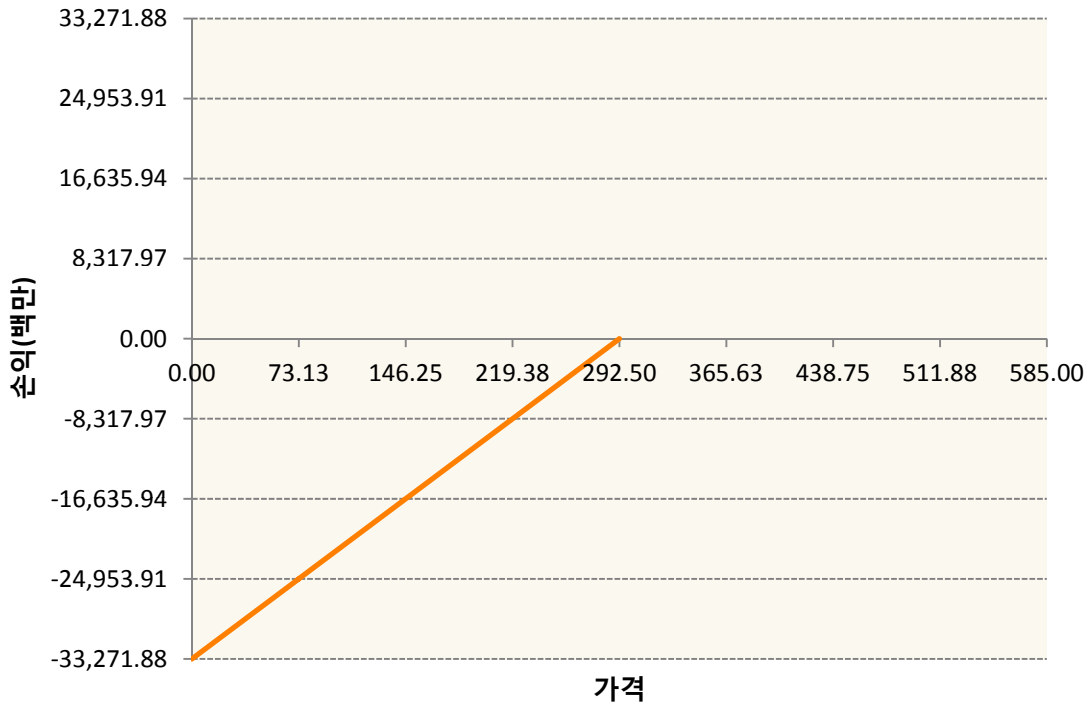


KR4201Q22950-2020-02 콜295

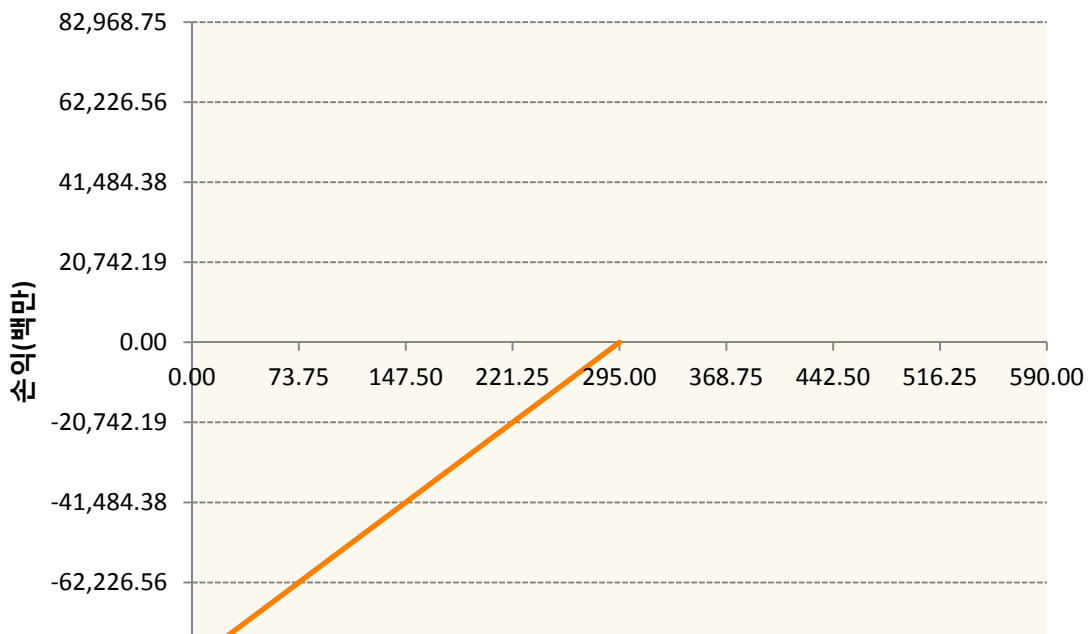




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



KR4301Q22958-2020-02 풋295



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q22927		2020-02 콜292.5						3,735
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	749	745	739	728	712	691	665	
-5.33%	732	714	689	656	615	568	515	
-2.67%	639	585	522	451	374	291	204	
0%	321	217	110	0	-112	-227	-343	
2.67%	-413	-541	-669	-797	-925	-1,053	-1,181	
5.33%	-1,642	-1,748	-1,858	-1,971	-2,086	-2,204	-2,322	
8.00%	-3,258	-3,319	-3,389	-3,467	-3,551	-3,640	-3,735	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						12,133
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,045	2,037	2,022	1,996	1,956	1,900	1,826	
-5.33%	2,011	1,970	1,906	1,819	1,708	1,572	1,414	
-2.67%	1,805	1,660	1,483	1,277	1,046	792	518	
0%	1,004	689	353	0	-366	-743	-1,128	
2.67%	-1,058	-1,504	-1,951	-2,400	-2,849	-3,299	-3,750	
5.33%	-4,839	-5,260	-5,687	-6,120	-6,557	-6,997	-7,440	
8.00%	-10,165	-10,438	-10,739	-11,063	-11,405	-11,763	-12,133	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						2,479
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,478	-2,478	-2,478	-2,478	-2,478	-2,478	-2,479	
-5.33%	-1,613	-1,614	-1,614	-1,615	-1,616	-1,619	-1,622	
-2.67%	-752	-755	-760	-767	-776	-787	-799	
0%	64	45	23	0	-25	-50	-77	
2.67%	664	630	596	561	527	492	458	
5.33%	916	896	874	850	825	798	771	
8.00%	964	960	954	945	935	923	909	
KR4301Q22958		2020-02 풋295						6,241
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-6,240	-6,240	-6,240	-6,240	-6,240	-6,240	-6,241	
-5.33%	-4,103	-4,103	-4,104	-4,105	-4,106	-4,110	-4,114	
-2.67%	-1,969	-1,973	-1,979	-1,989	-2,002	-2,020	-2,042	
0%	112	81	43	0	-48	-99	-155	
2.67%	1,830	1,749	1,668	1,586	1,503	1,420	1,337	

5.33%	2,726	2,659	2,589	2,516	2,441	2,365	2,288
8.00%	2,955	2,936	2,910	2,878	2,841	2,799	2,753

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

(단위:백만원)

24,069

공시일	2020-02-04
기준일	2020-02-03

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

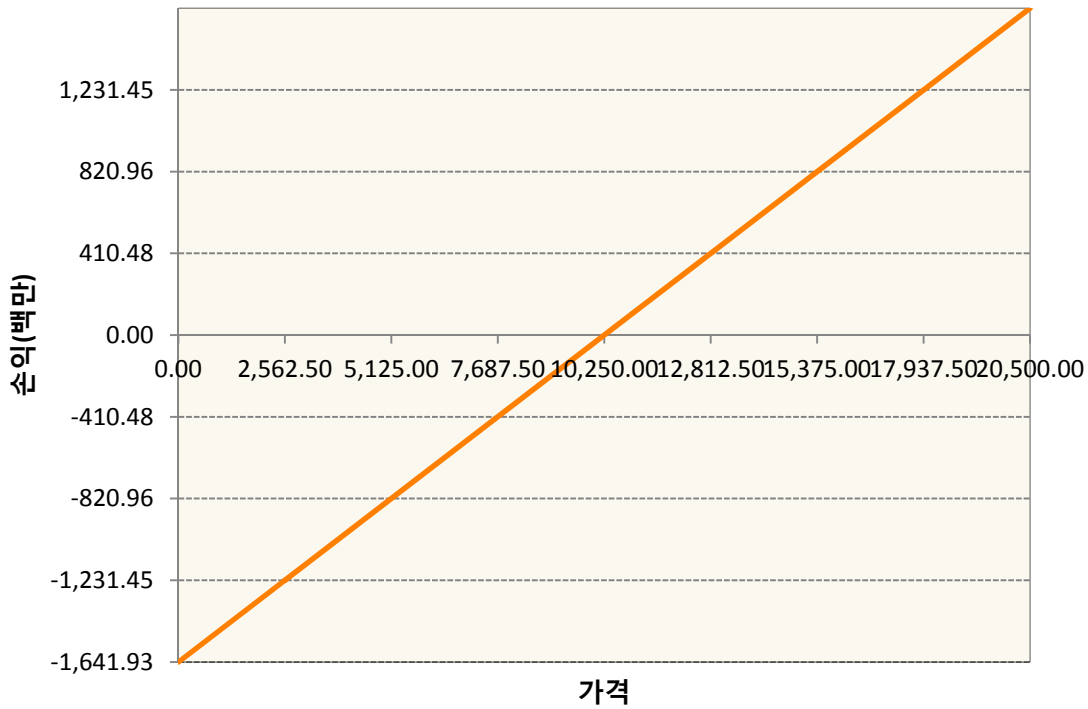
1. 계약금액

(단위:백만원)

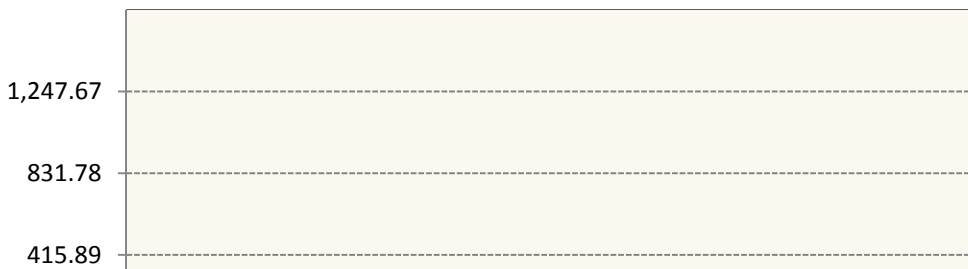
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,642	0	1,642	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,607	-4,607	장내
누계	통화	선도	0	2,166	-2,166	장외

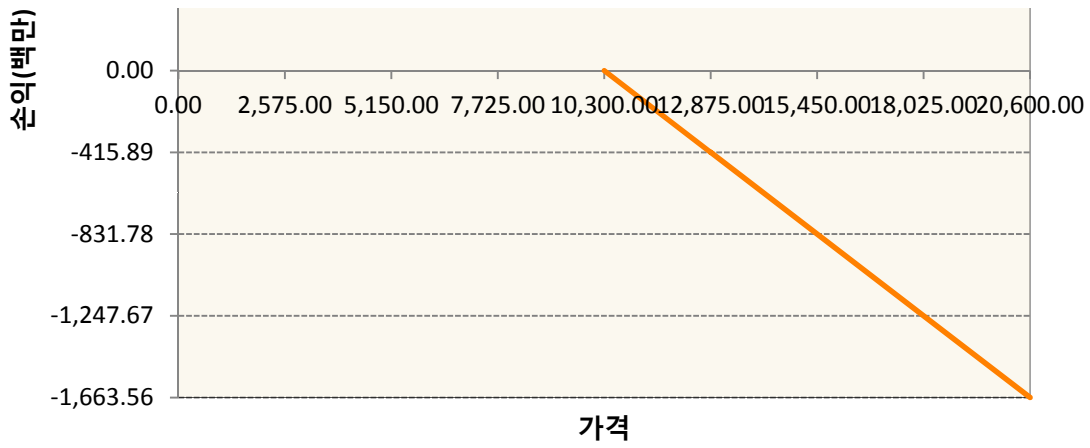
2. 만기시점의 손익구조

HCG0-HSCEI Futures Feb20

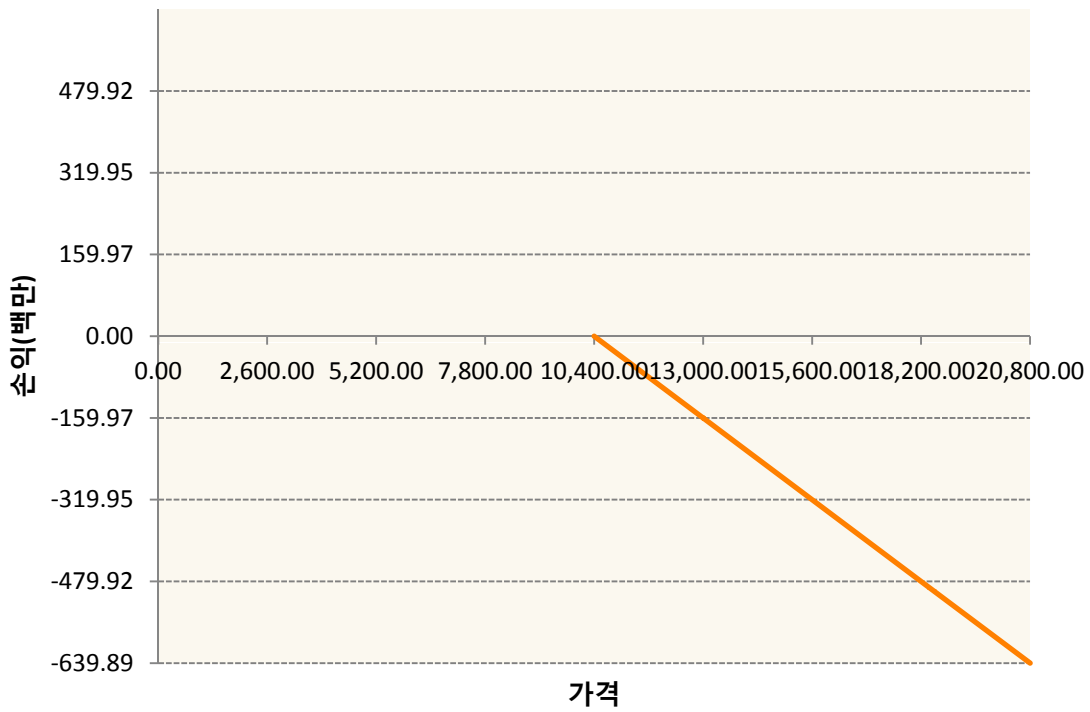


OHHIG0-C103-HSCEI

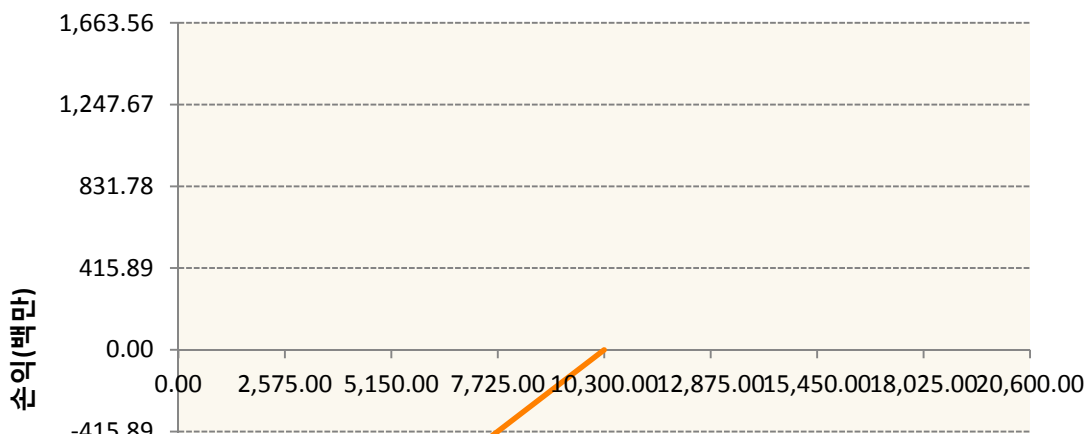


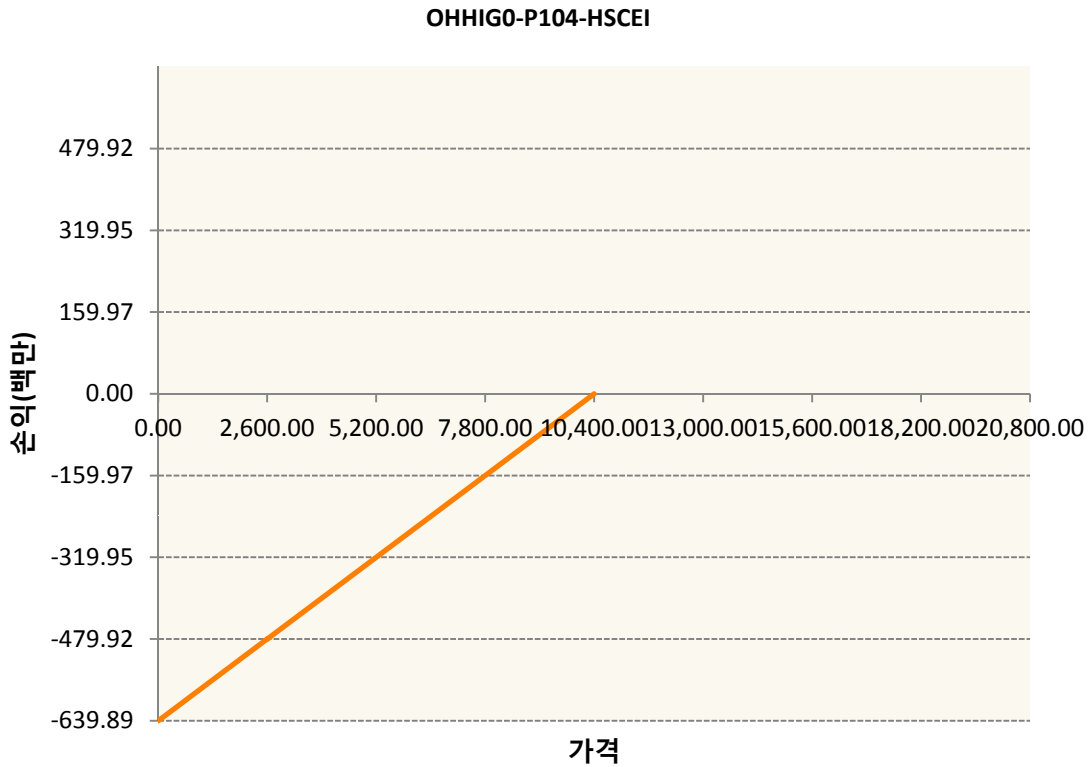


OHHIG0-C104-HSCEI



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	2020-02-04
기준일	2020-02-03

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

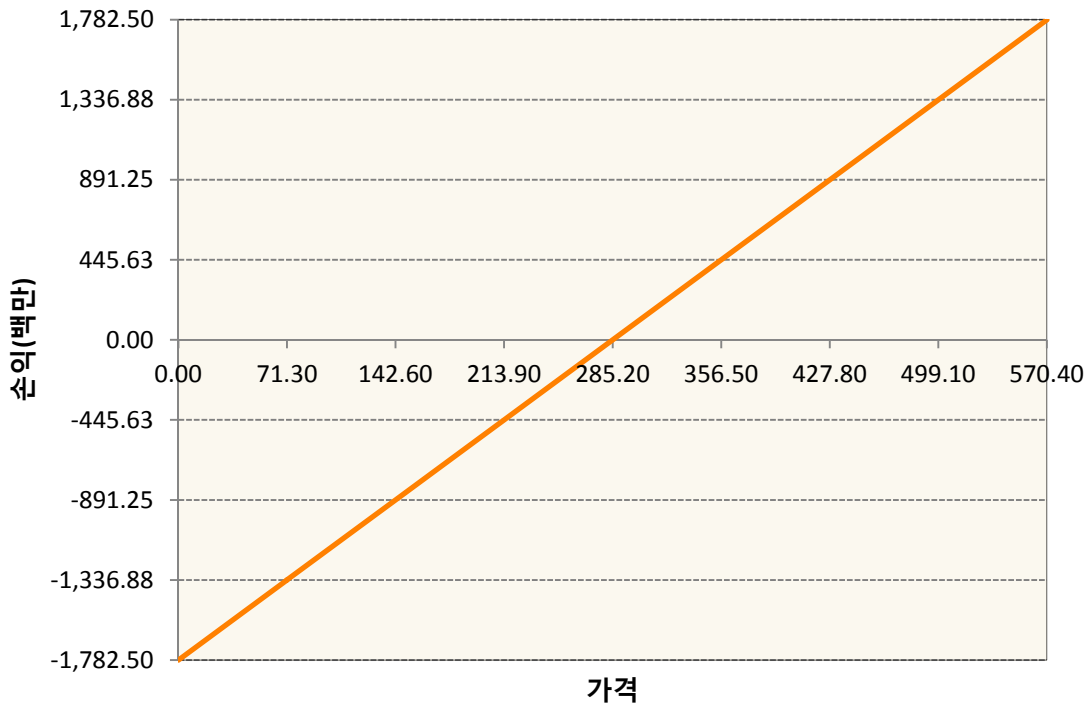
1. 계약금액

(단위:백만원)

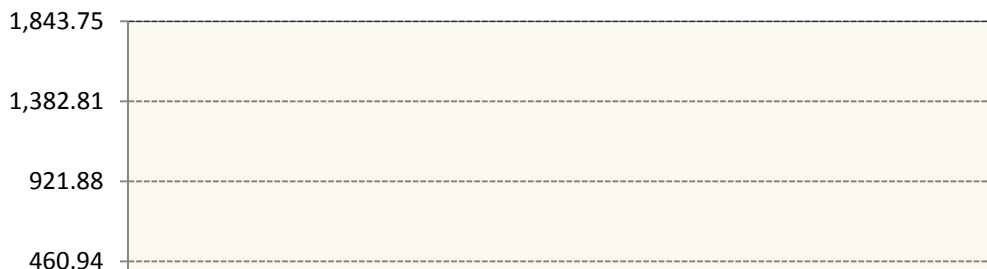
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,783	0	1,783	장내
누계	유가증권	스왑	3,625	0	3,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,608	-3,608	장내

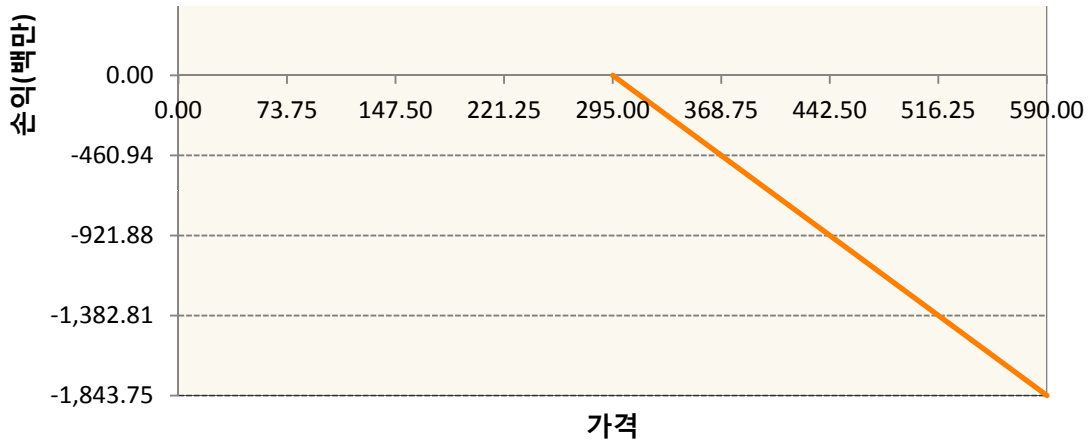
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

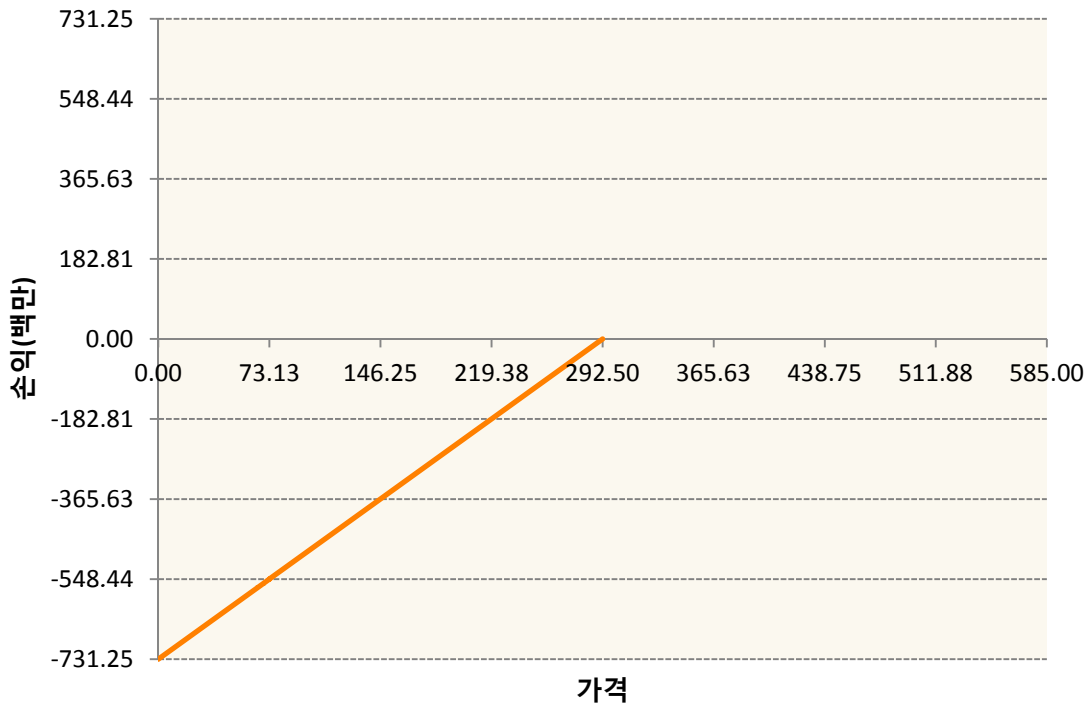


KR4201Q22950-2020-02 콜295

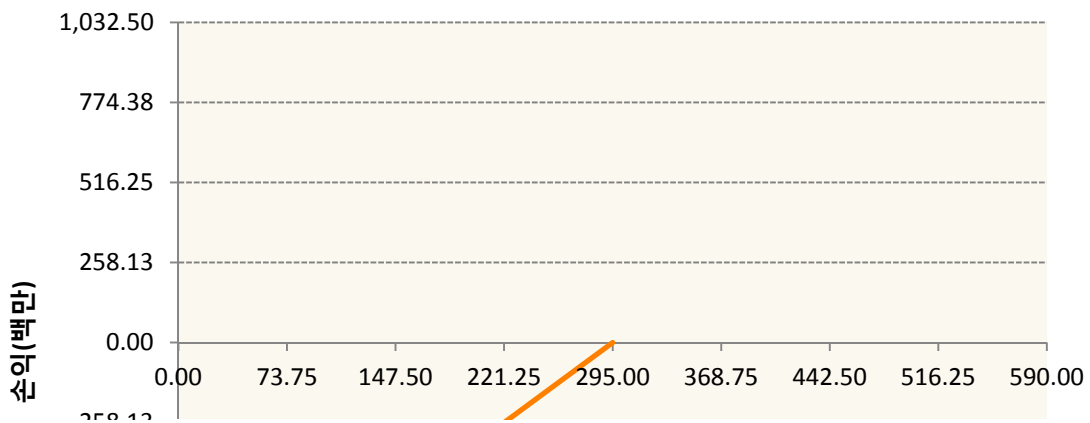




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



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%	-208	-208	-208	-208	-208	-208	-208	
-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%	208	208	208	208	208	208	208	
8.00%	311	311	311	311	311	311	311	
KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						143
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-143	-143	-143	-143	-143	-143	-143	
-5.33%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-95	
-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%	95	95	95	95	95	95	95	
8.00%	143	143	143	143	143	143	143	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						85
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	14	14	14	14	14	13	13	
-5.33%	14	14	13	13	12	11	10	
-2.67%	13	12	10	9	7	6	4	
0%	7	5	2	0	-3	-5	-8	
2.67%	-7	-10	-14	-17	-20	-23	-26	
5.33%	-34	-37	-40	-43	-46	-49	-52	
8.00%	-71	-73	-75	-77	-79	-82	-85	
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	-36	-36	-36
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-18
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	15	14	13	12	12	11	10
5.33%	20	20	19	19	18	18	17
8.00%	21	21	21	21	21	20	20
KR4301Q22958 2020-02 풋295							78
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
-5.33%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	23	22	21	20	19	18	17
5.33%	34	33	32	31	30	29	28
8.00%	37	37	36	36	35	35	34

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

(단위:백만원)

652

공시일	2020-02-04
기준일	2020-02-03

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

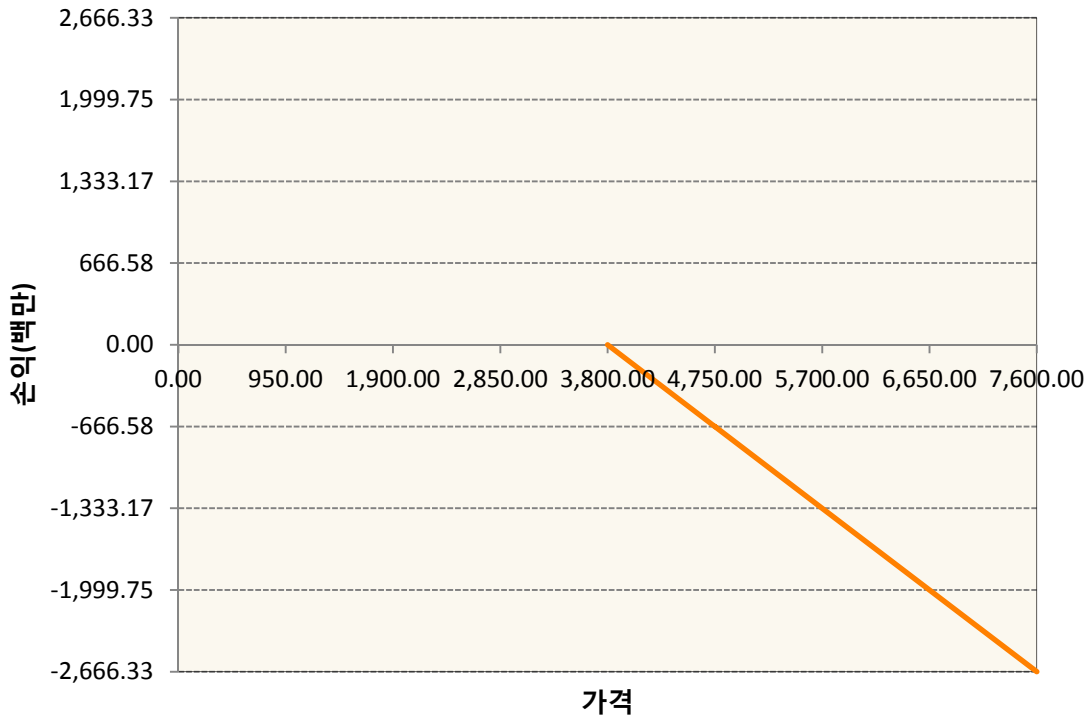
1. 계약금액

(단위:백만원)

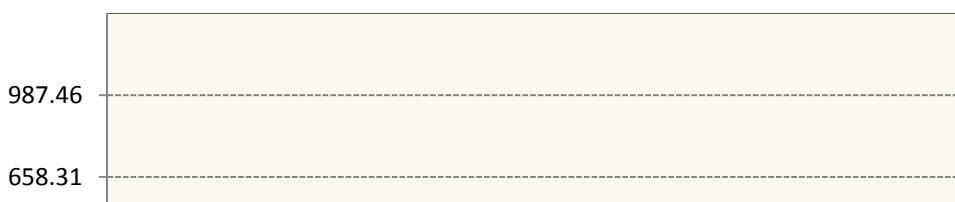
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	751	0	751	
누계	유가증권	스왑	13,834	0	13,834	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,966	-7,966	장내
누계	통화	선도	0	3,474	-3,474	장외

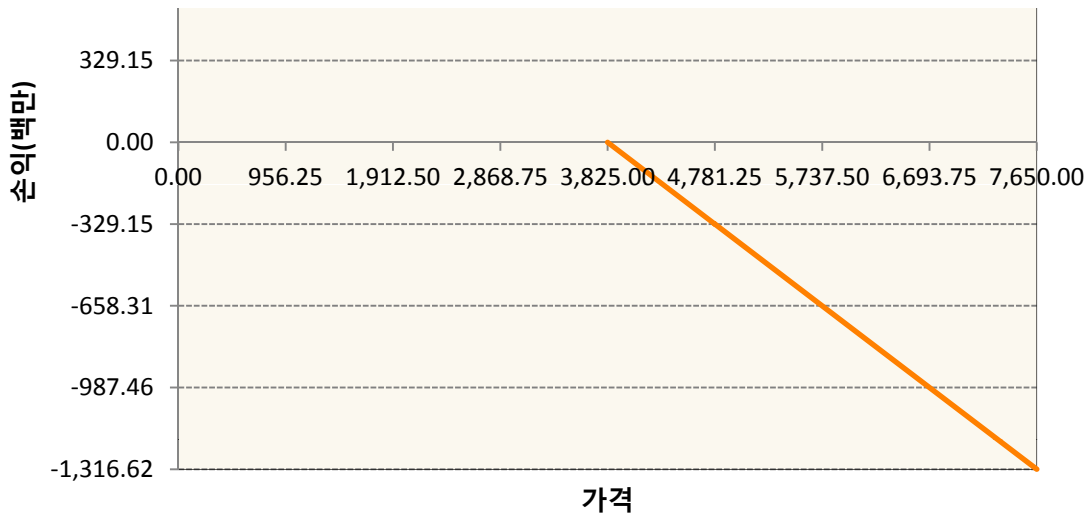
2. 만기시점의 손익구조

OESXG0-C3800-EURO STOXX 50

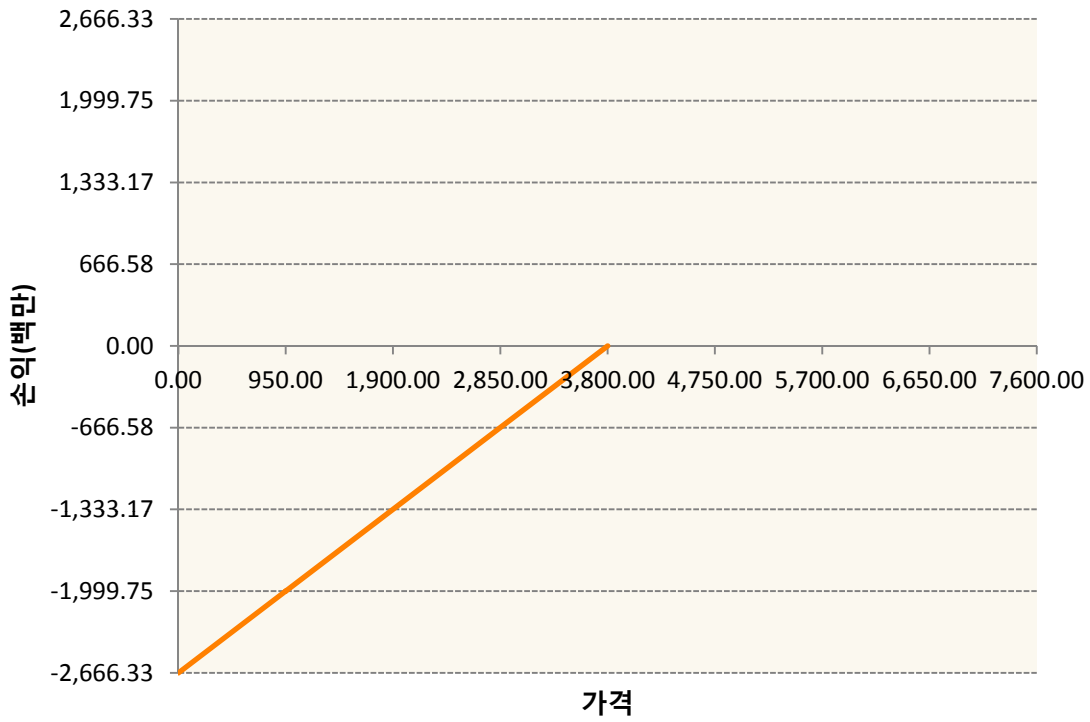


OESXG0-C3825-EURO STOXX 50

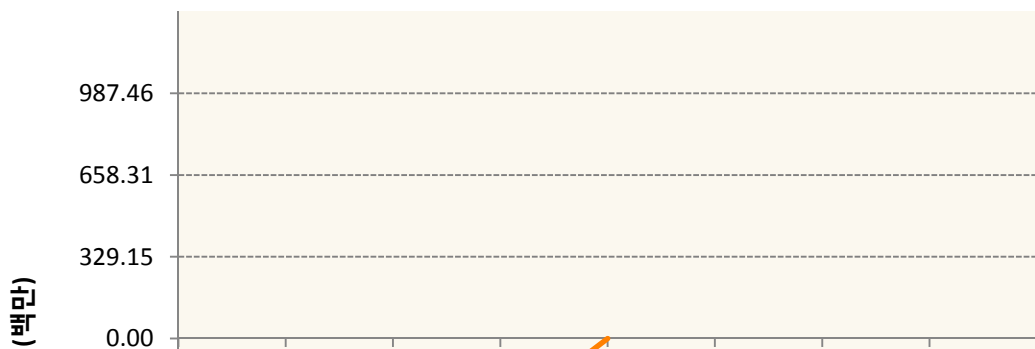


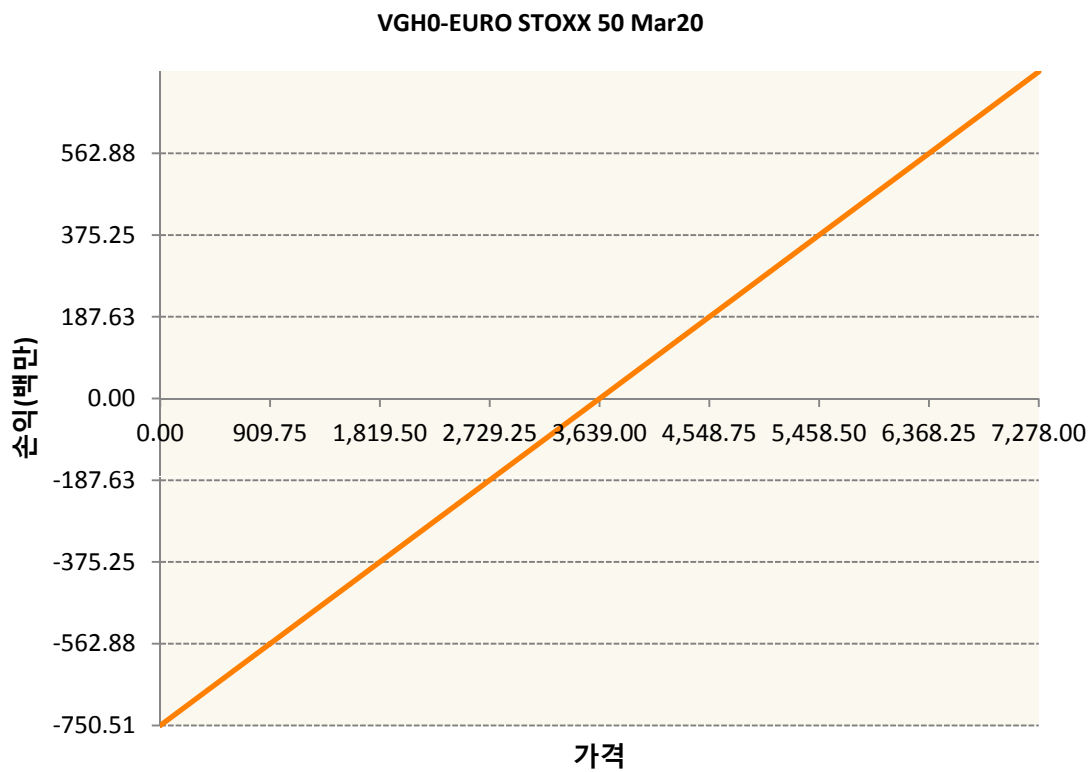
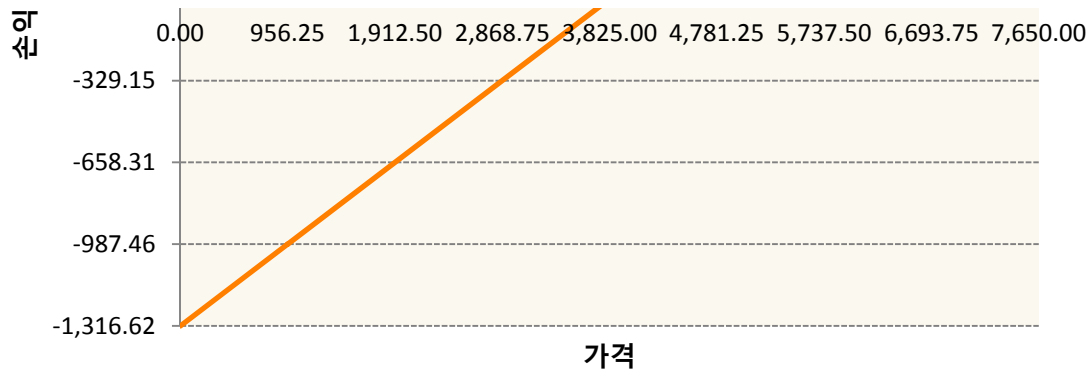


OESXG0-P3800-EURO STOXX 50



OESXG0-P3825-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		37
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E		278
OESXG0-C3& EURO STOXX 50		213
OESXG0-C3& EURO STOXX 50		105
OESXG0-P3& EURO STOXX 50		213
OESXG0-P3& EURO STOXX 50		105
VGHO EURO STOXX 50 Mar20		60

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

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

(단위:백만원)

881

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

(단위:백만원)

78

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

(단위:백만원)

114

공시일	2020-02-04
기준일	2020-02-03

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

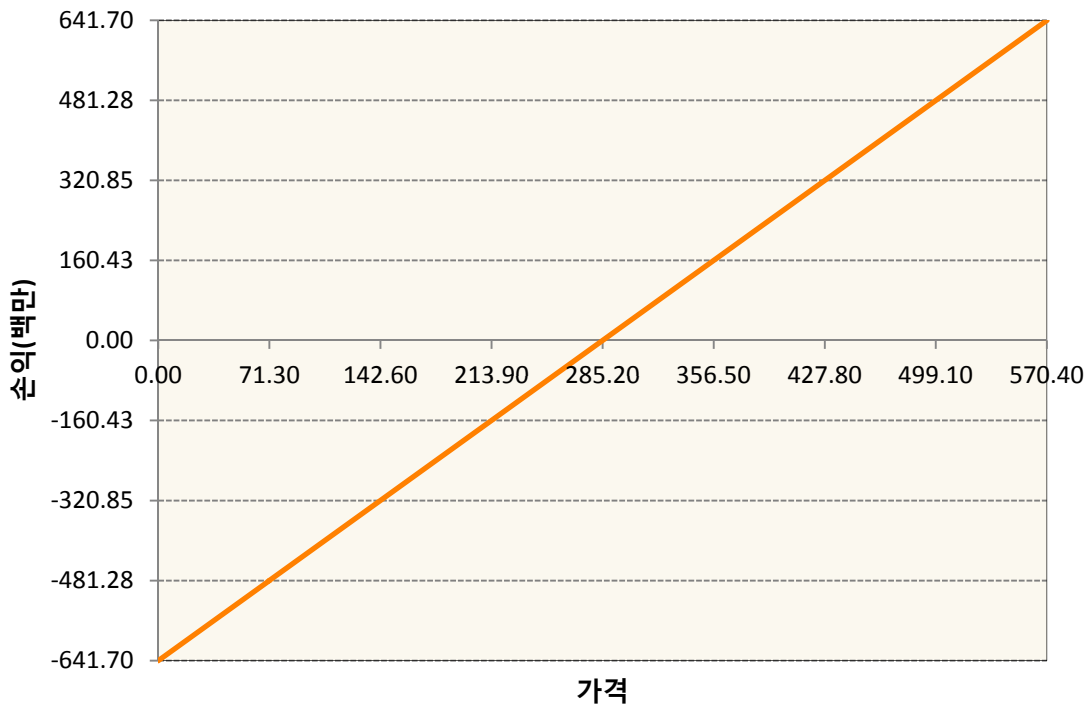
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	642	0	642	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						51
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51	
-5.33%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	17	17	17	17	17	17	17	
5.33%	34	34	34	34	34	34	34	
8.00%	51	51	51	51	51	51	51	

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

(단위:백만원)

41

공시일	2020-02-04
기준일	2020-02-03

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

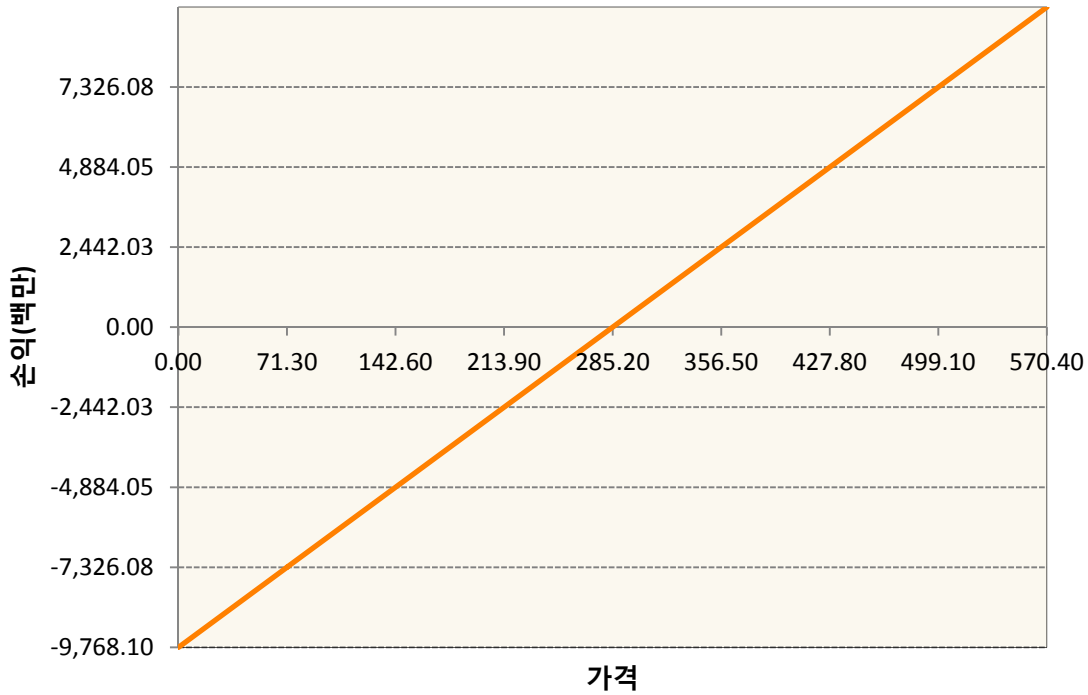
1. 계약금액

(단위:백만원)

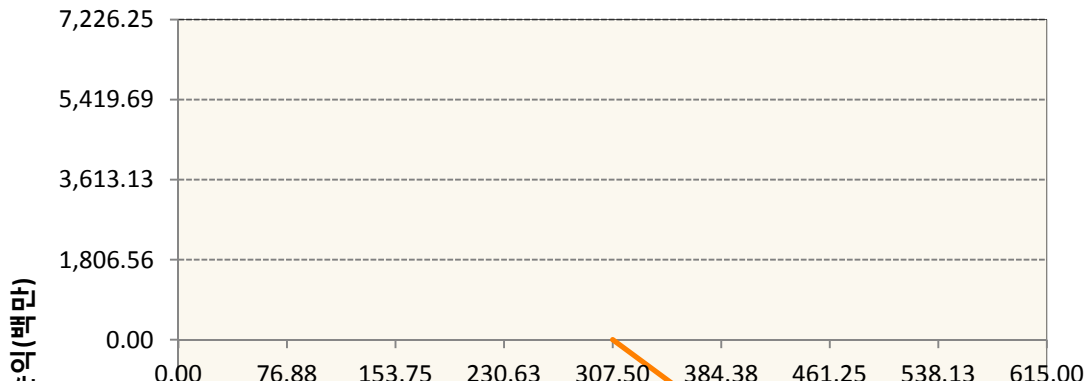
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,768	0	9,768	장내
누계	유가증권	옵션	2,944	20,789	-17,845	장내

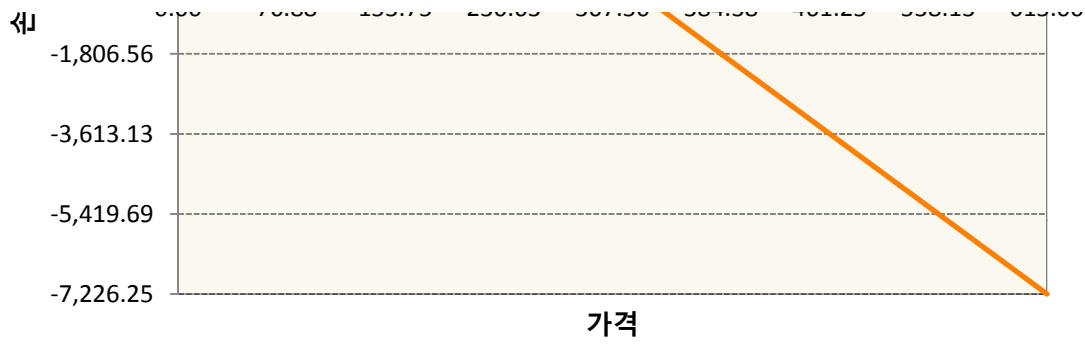
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

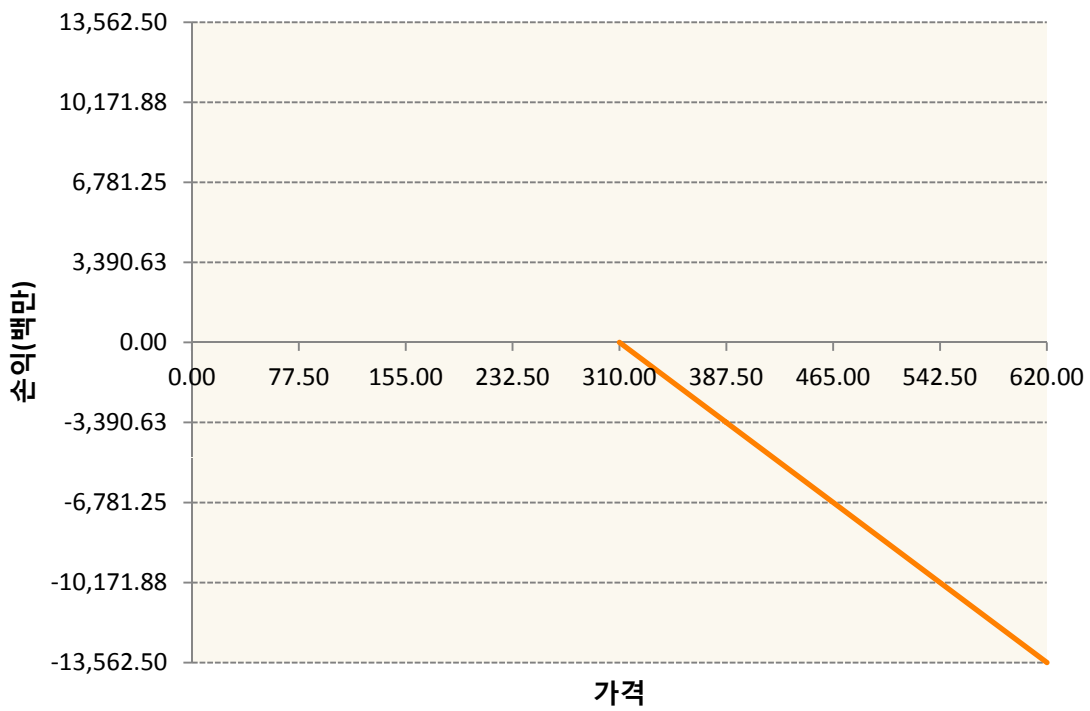


KR4201Q23073-2020-02 콜307.5

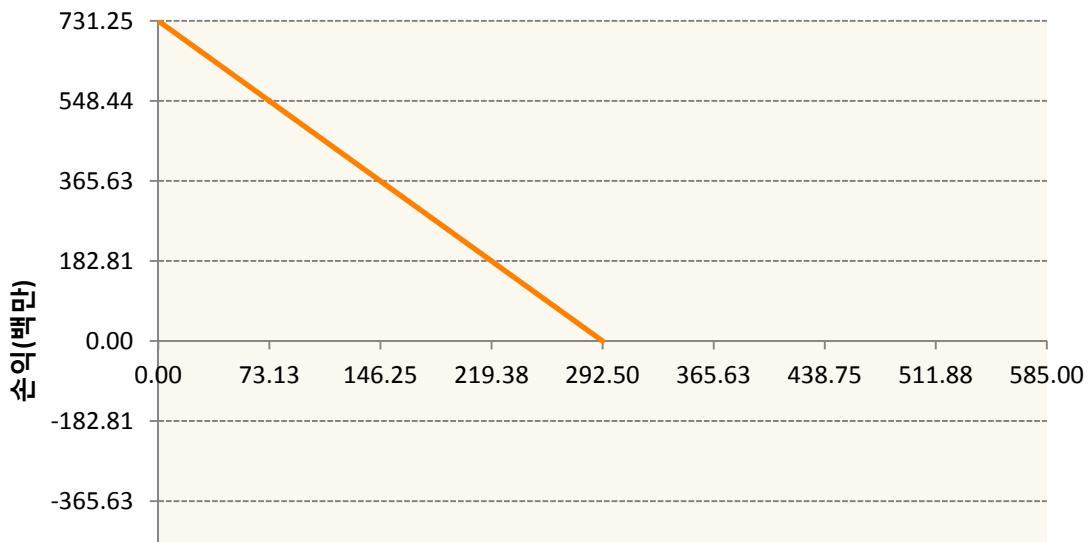


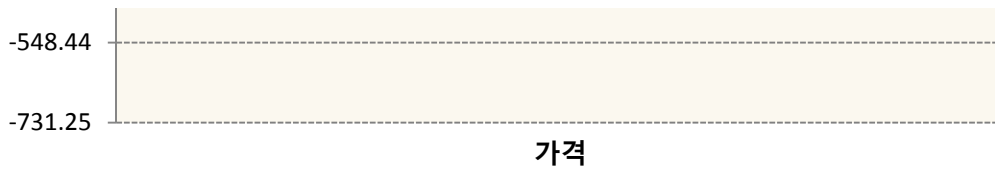


KR4201Q23107-2020-02 콜310

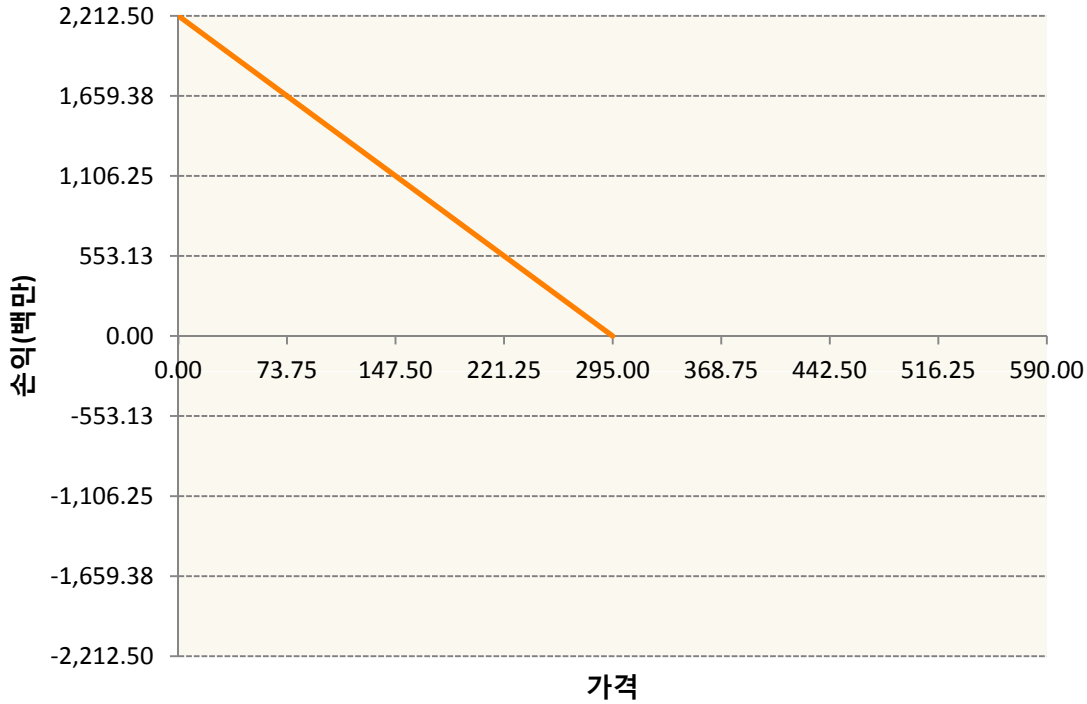


KR4301Q22925-2020-02 풋292.5





KR4301Q22958-2020-02 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물					781
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-781	-781	-781	-781	-781	-781	-781
-5.33%	-521	-521	-521	-521	-521	-521	-521
-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%	521	521	521	521	521	521	521
8.00%	781	781	781	781	781	781	781
KR4201Q23073		2020-02 콜307.5					179
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11	11	11	11	11	11	10
-5.33%	11	11	11	11	10	9	8
-2.67%	11	11	10	8	6	4	1

0%	9	7	4	0	-4	-10	-15
2.67%	-2	-8	-14	-22	-30	-38	-47
5.33%	-34	-44	-55	-66	-77	-89	-100
8.00%	-104	-117	-129	-142	-154	-167	-179
KR4201Q23107 2020-02 콜310							289
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15	15	15	15	15	14	14
-5.33%	15	15	15	14	13	12	10
-2.67%	15	14	13	11	8	5	0
0%	12	9	5	0	-7	-15	-24
2.67%	-1	-9	-19	-31	-44	-58	-72
5.33%	-45	-62	-80	-98	-118	-137	-158
8.00%	-150	-173	-196	-219	-242	-266	-289
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	36	36	36
-2.67%	17	17	17	17	17	17	18
0%	-1	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-15	-14	-13	-12	-12	-11	-10
5.33%	-20	-20	-19	-19	-18	-18	-17
8.00%	-21	-21	-21	-21	-21	-20	-20
KR4301Q22958 2020-02 풋295							166
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	166	166	166	166	166	166	166
-5.33%	109	109	109	109	110	110	110
-2.67%	53	53	53	53	53	54	54
0%	-3	-2	-1	0	1	3	4
2.67%	-49	-47	-44	-42	-40	-38	-36
5.33%	-73	-71	-69	-67	-65	-63	-61
8.00%	-79	-78	-78	-77	-76	-75	-73

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

(단위:백만원)

1,071

공시일	2020-02-04
기준일	2020-02-03

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	213,955	0	213,955	

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	2020-02-04
기준일	2020-02-03

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	223,326	0	223,326	

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	2020-02-04
기준일	2020-02-03

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	548,427	0	548,427	
누계	통화	선도	0	535,480	-535,480	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,390
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,581
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	1,663
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	1,568
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	956
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	191
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	2,046
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	956
FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E	3,824
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,912
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	2,046
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	191
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	191
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	1,147
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	1,721
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	287
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E	1,912
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E	3,289
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,539
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,434
FX21020F02 KRW/USD 28-02-20E	1,912
FX21020F03 KRW/USD 28-02-20E	2,964
FX21020F03 KRW/USD 31-03-20E	3,059
FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E	2,868
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)

14,303

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

(단위:백만원)

117

공시일	2020-02-04
기준일	2020-02-03

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

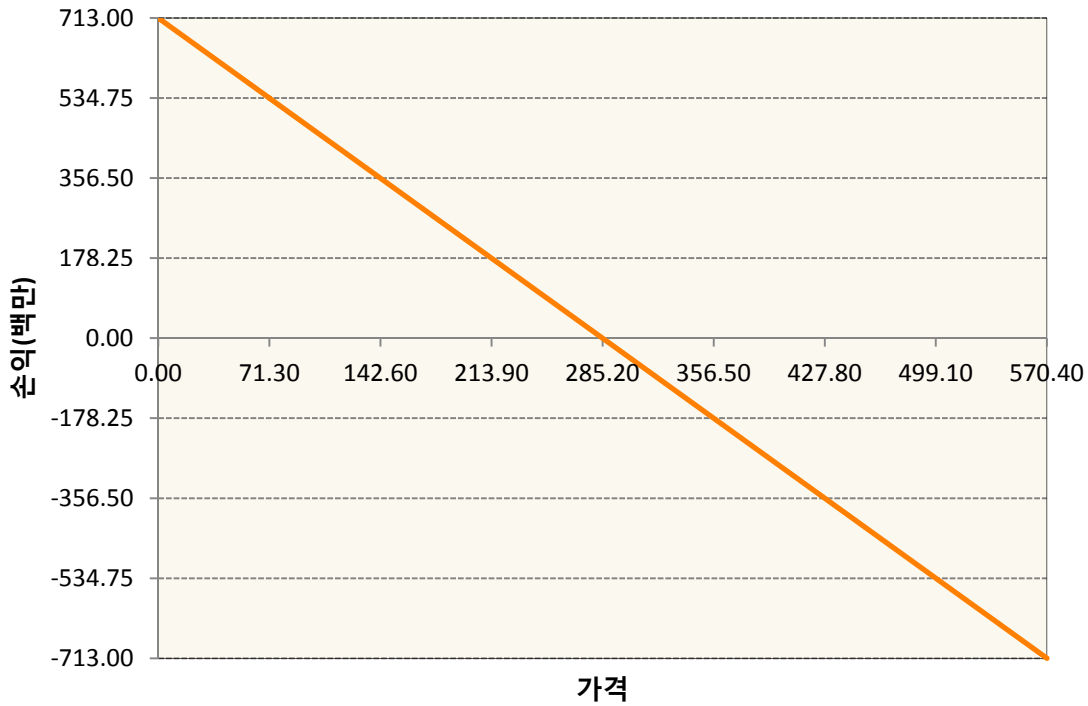
1. 계약금액

(단위:백만원)

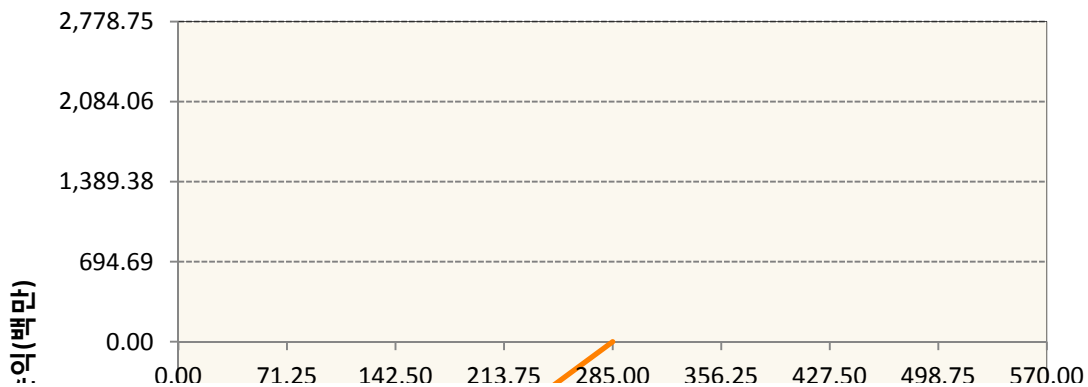
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	713	-713	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,569	-3,569	장내

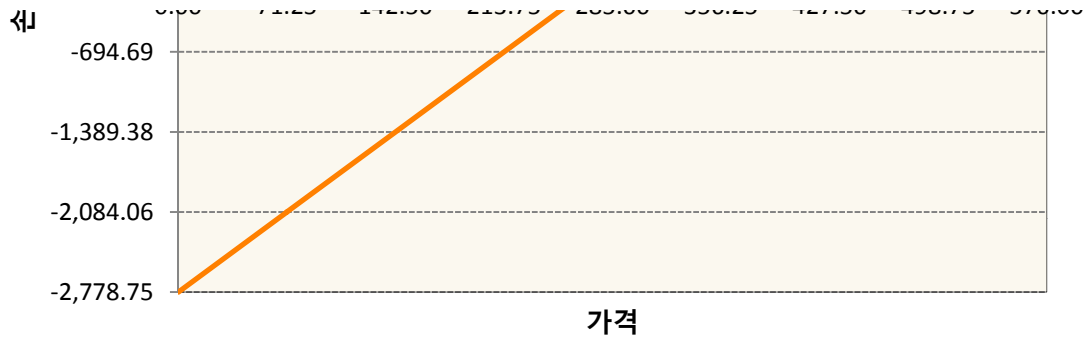
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

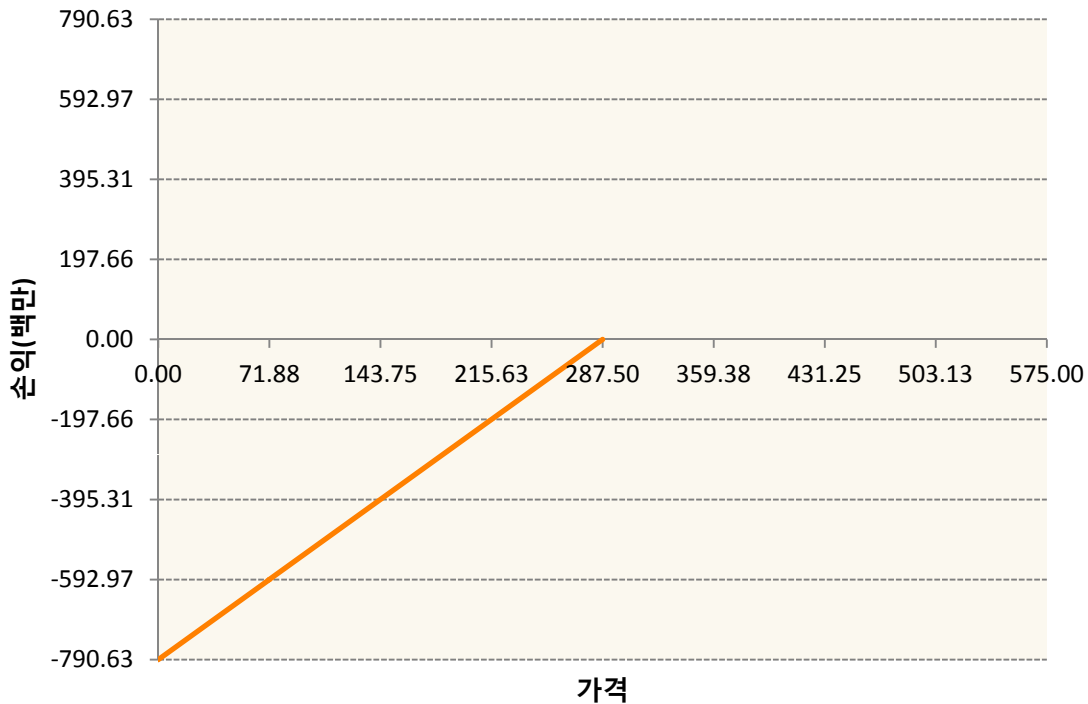


KR4301Q22859-2020-02 풋285





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						188
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-188	-188	-188	-188	-188	-188	-188
-5.33%	-114	-114	-115	-115	-116	-117	-117
-2.67%	-44	-45	-47	-49	-51	-53	-55
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	30	29	27	25	23	20	18
5.33%	34	34	33	33	32	31	30
8.00%	34	34	34	34	34	34	33
KR4301Q22875 2020-02 풋287.5							56
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-36	-36
-2.67%	-15	-15	-15	-16	-16	-17	-17
0%	2	2	1	0	-1	-2	-2
2.67%	11	11	10	9	8	8	7
5.33%	13	13	13	13	12	12	11
8.00%	14	14	14	13	13	13	13

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

(단위:백만원)

328

공시일	2020-02-04
기준일	2020-02-03

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	12,672	0	12,672	
누계	통화	선도	0	12,404	-12,404	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	354
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)

331

공시일	2020-02-04
기준일	2020-02-03

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

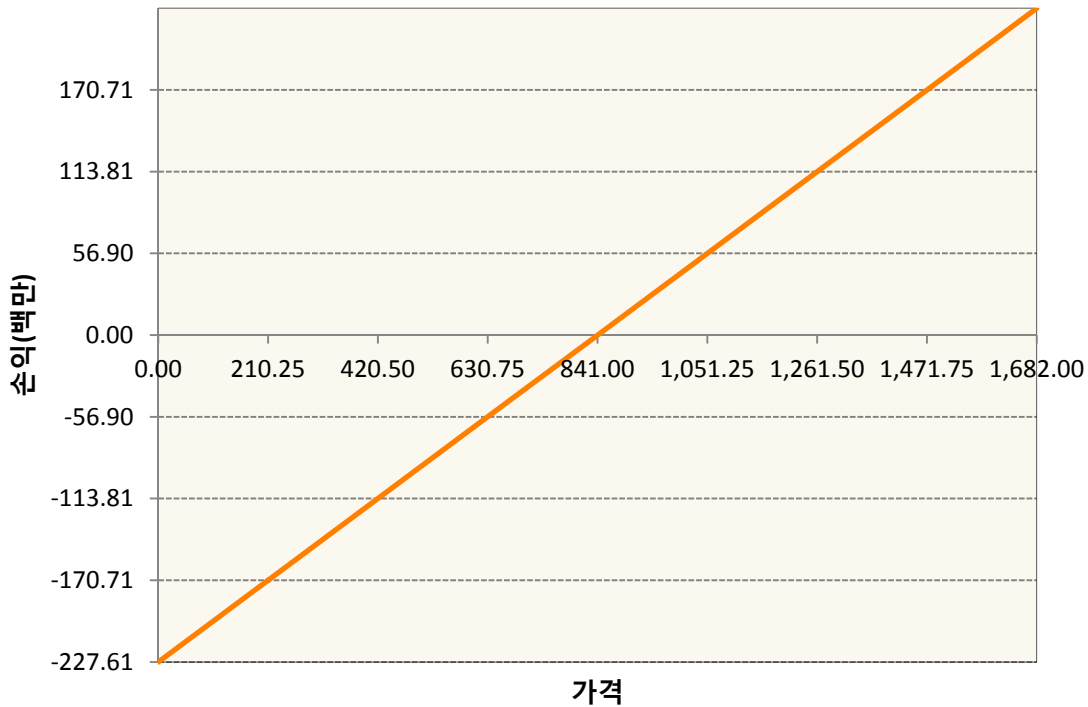
1. 계약금액

(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	228	0	228	
누계	유가증권	스왑	1,092	0	1,092	장외
누계	통화	선도	66	635	-569	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)

97

공시일	2020-02-04
기준일	2020-02-03

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

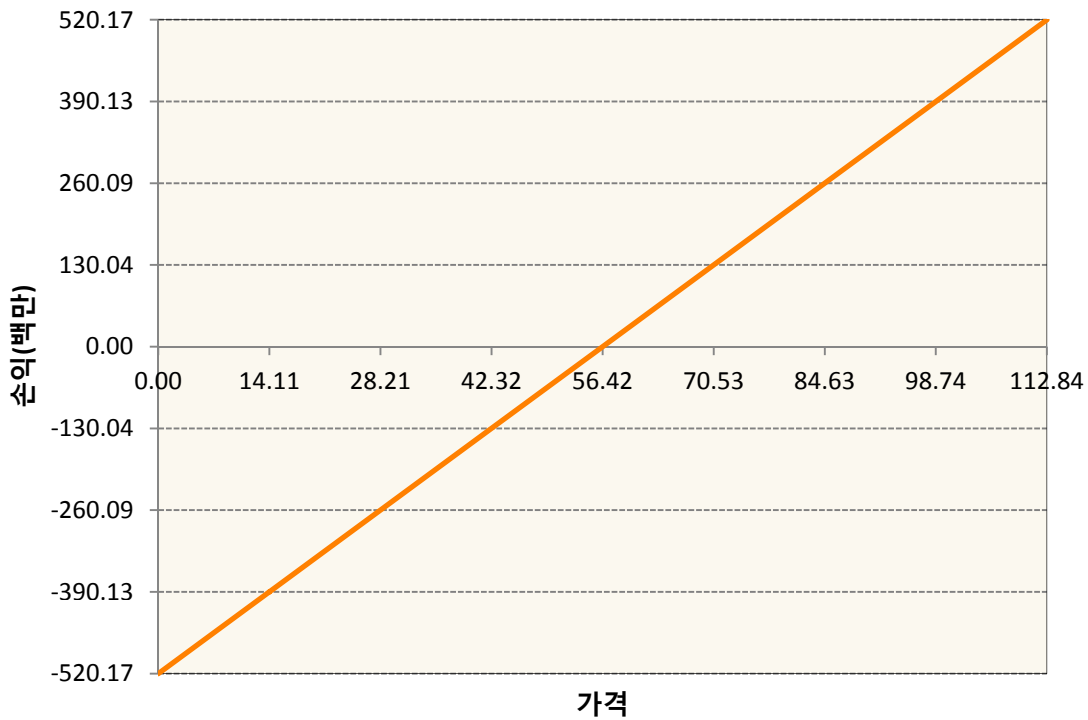
1. 계약금액

(단위:백만원)

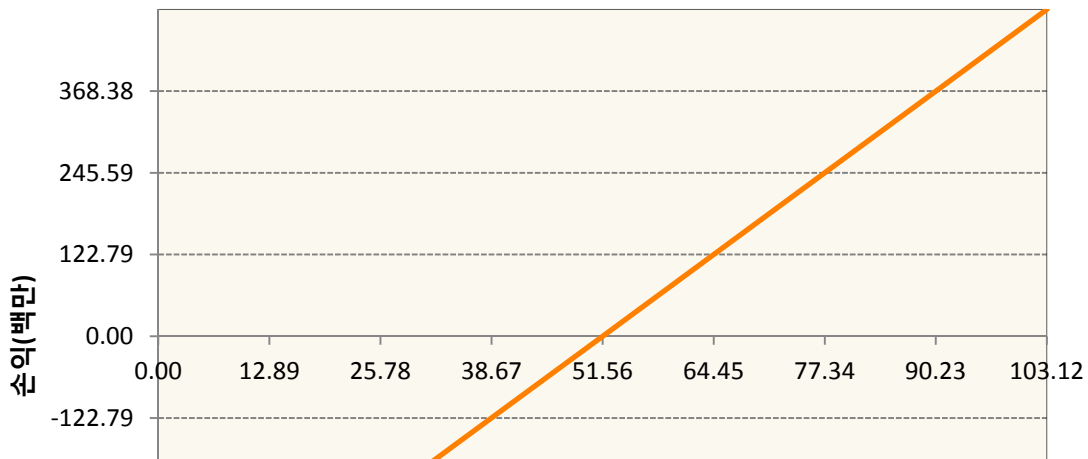
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,059	191	1,868	

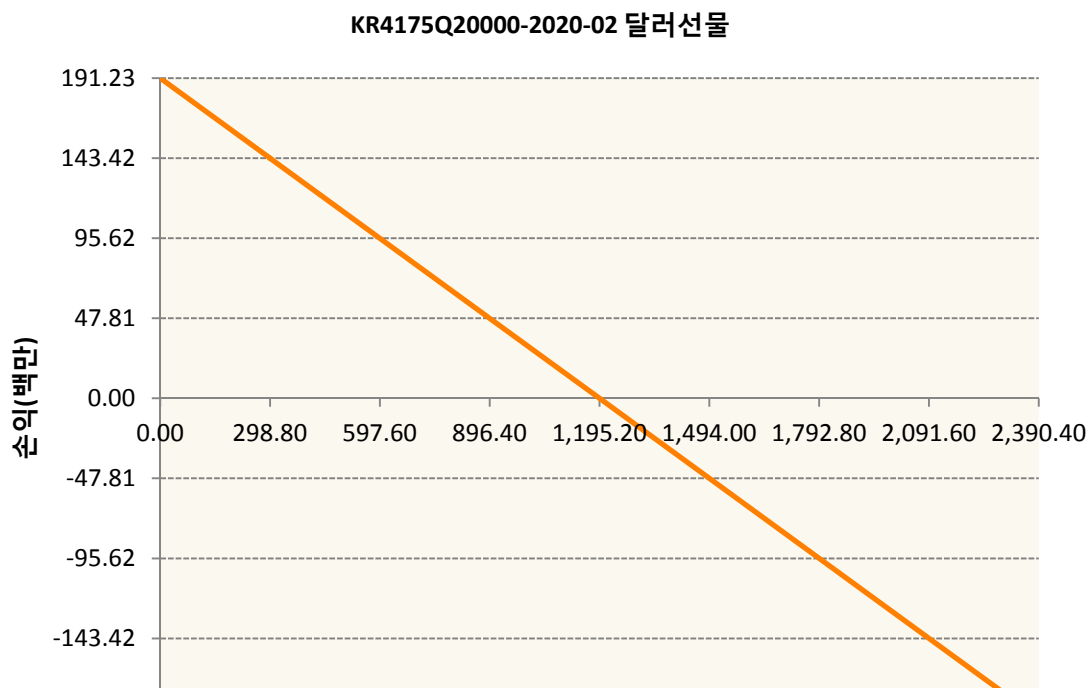
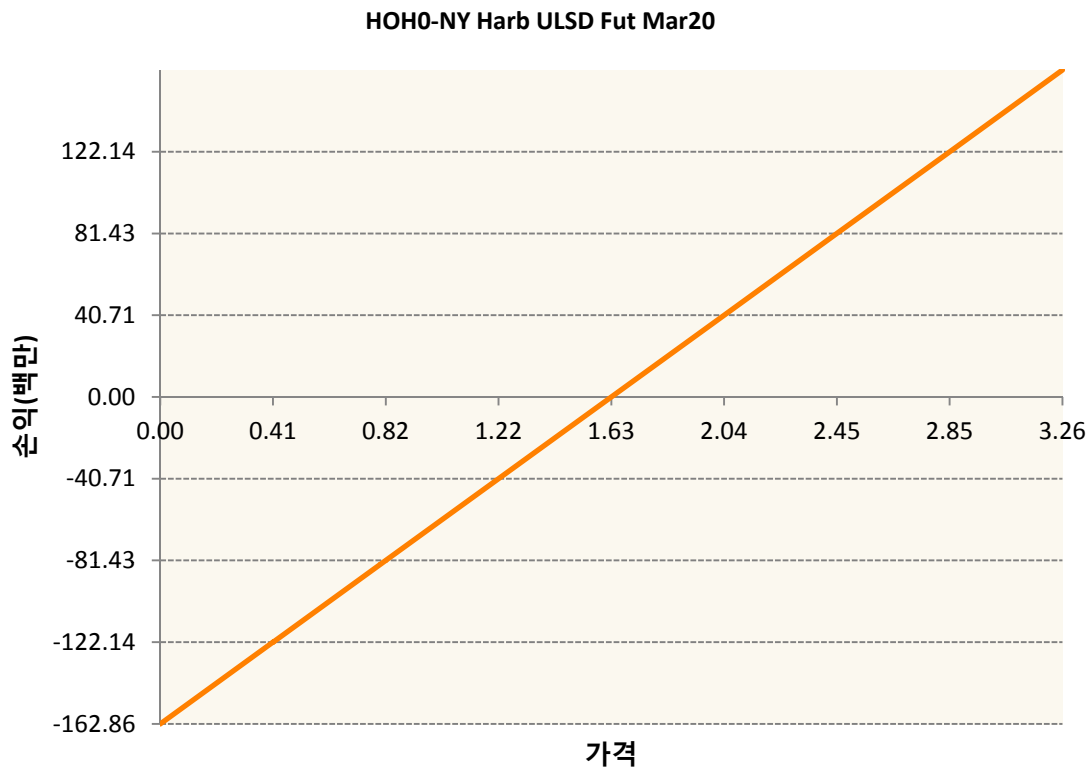
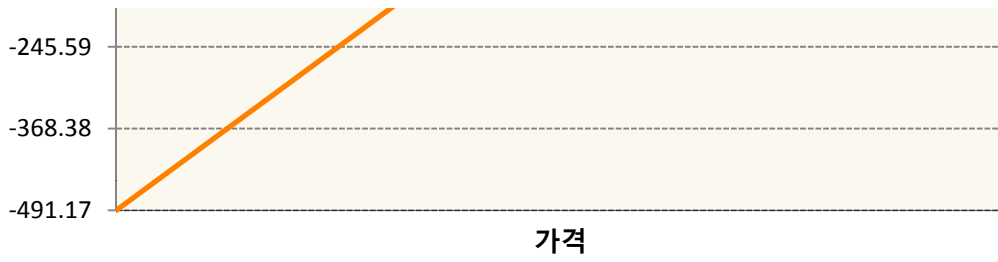
2. 만기시점의 손익구조

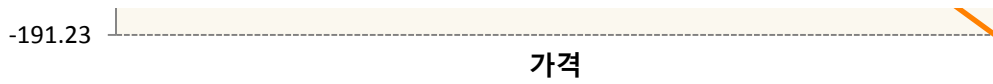
COKO-BRENT CRUDE FUTR May20



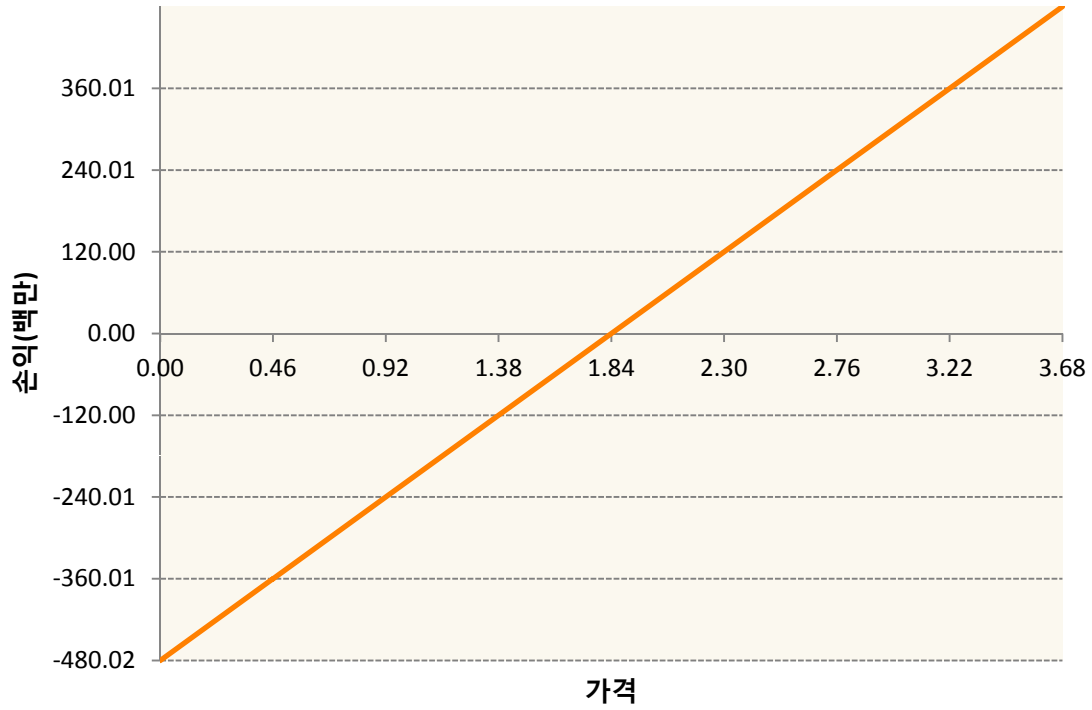
CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20



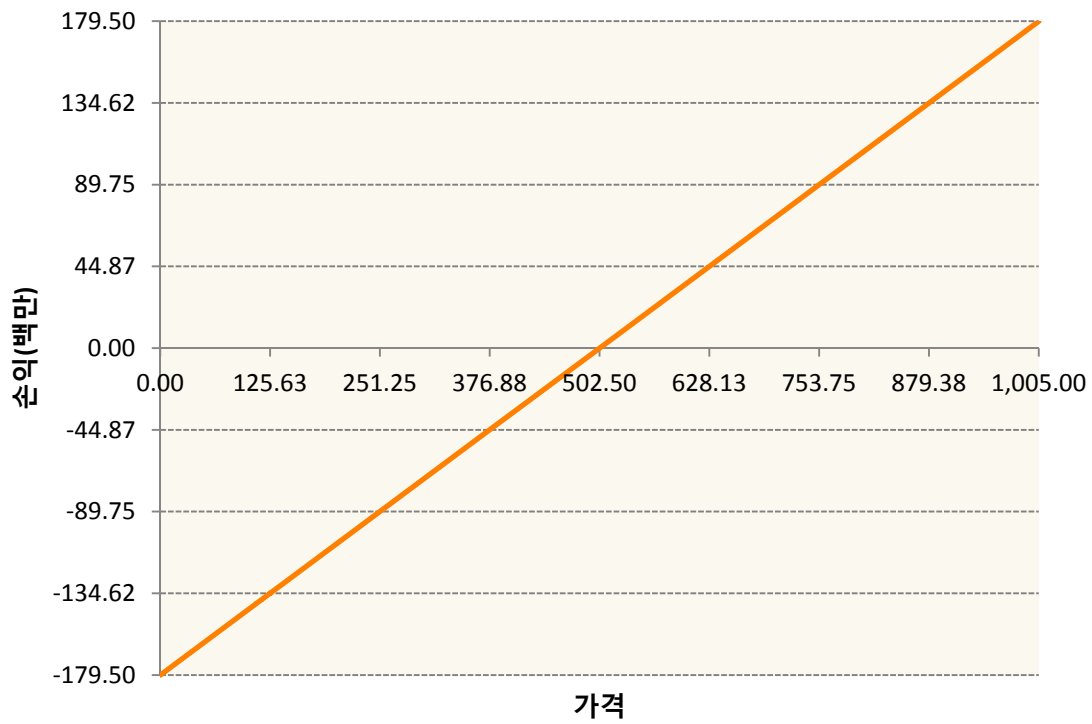




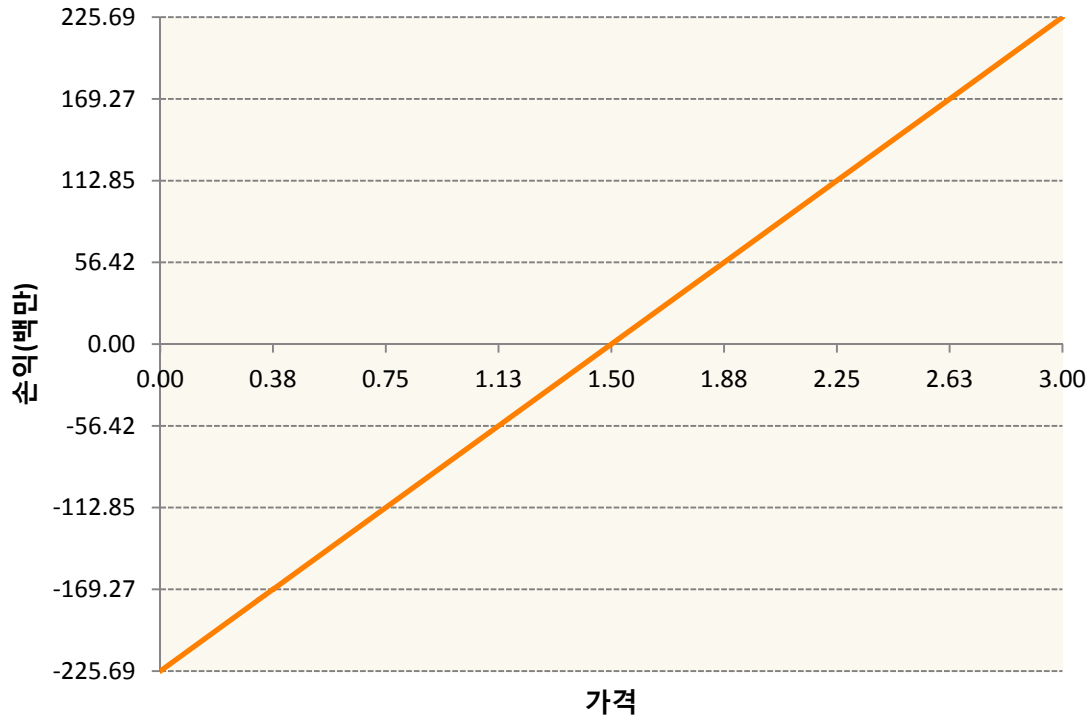
NGH20-NATURAL GAS FUTR Mar20



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	39
HOH0	NY Harb ULSD Fut Mar20	13
KR4175Q20C	2020-02 달러선물	15
NGH20	NATURAL GAS FUTR Mar20	38
QSH0	Low Su Gasoil G Mar20	14
XBH0	GASOLINE RBOB FUT Mar20	18

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

(단위:백만원)

321

공시일	2020-02-04
기준일	2020-02-03

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

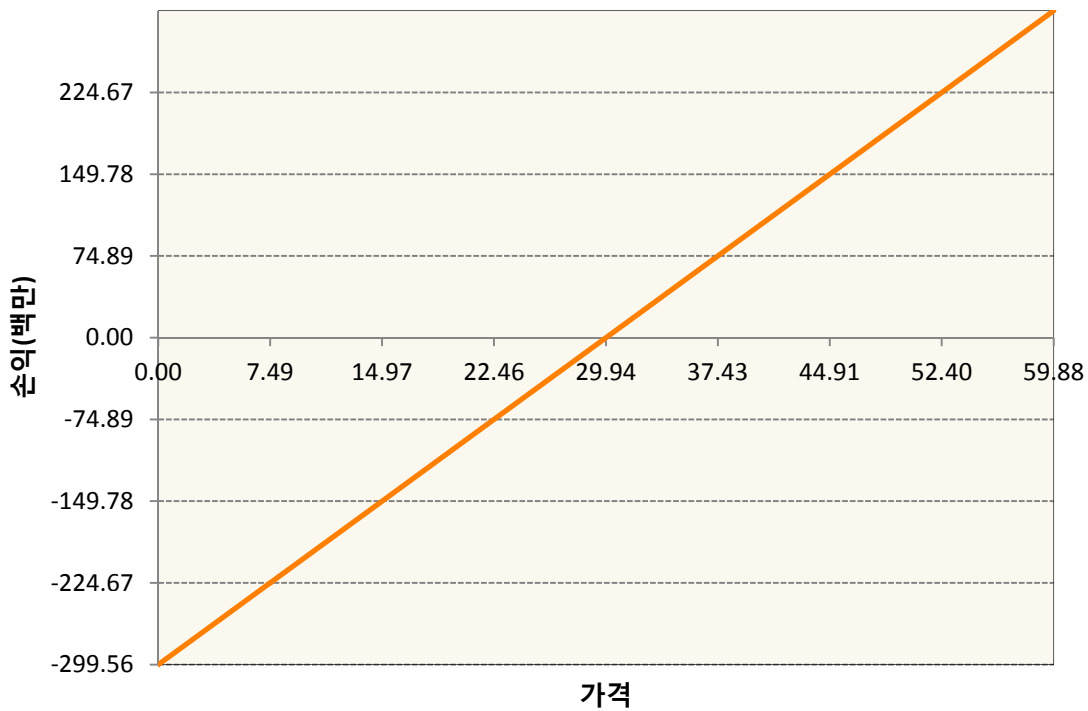
1. 계약금액

(단위:백만원)

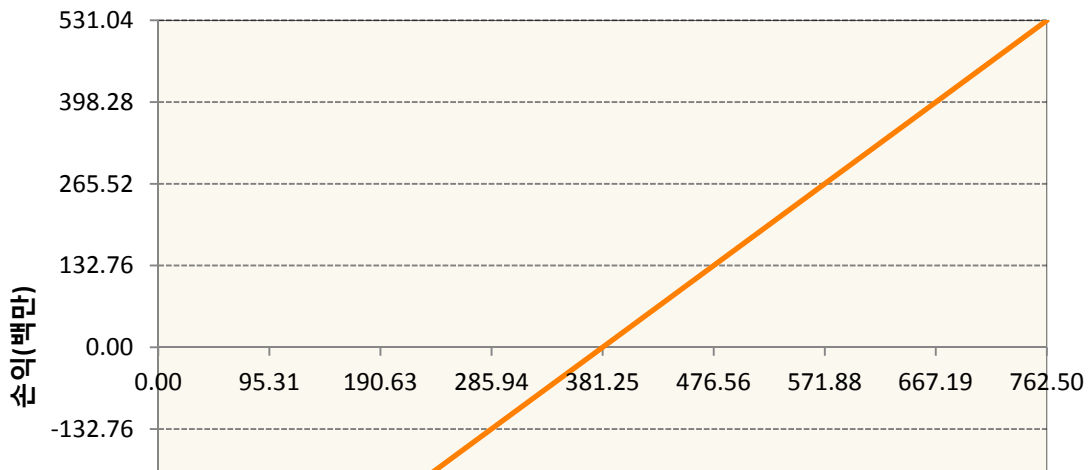
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,717	155	2,562	

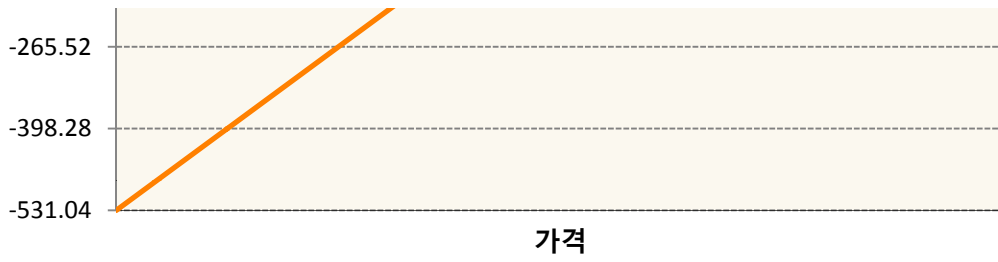
2. 만기시점의 손익구조

BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20

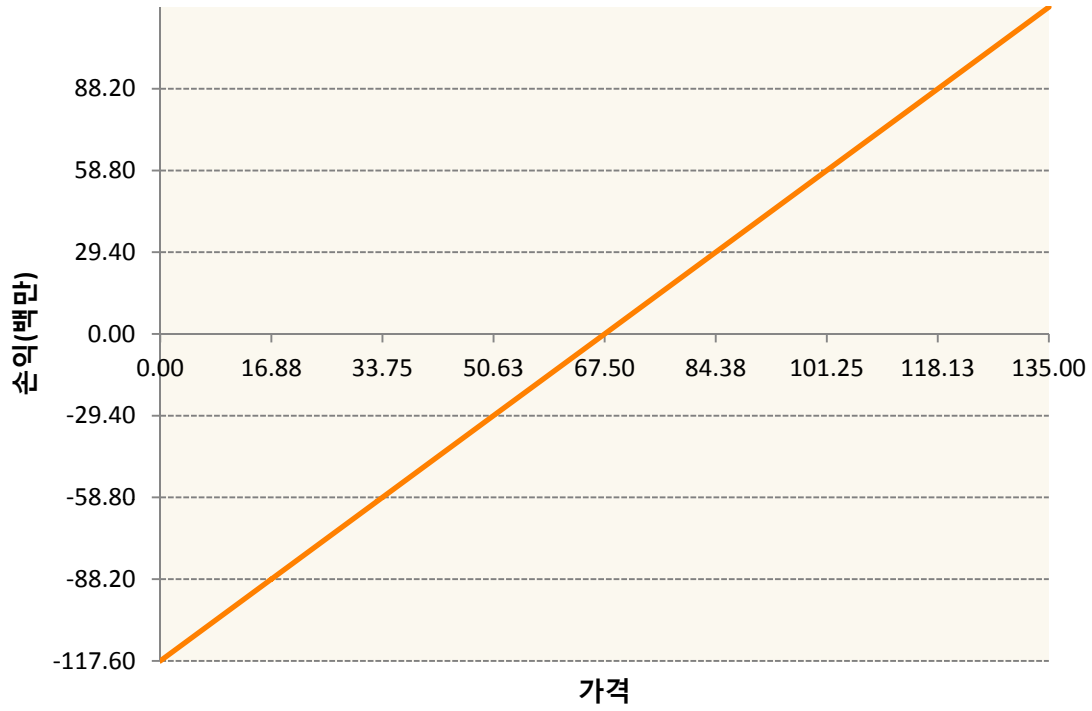


CH0-CORN FUTURE Mar20

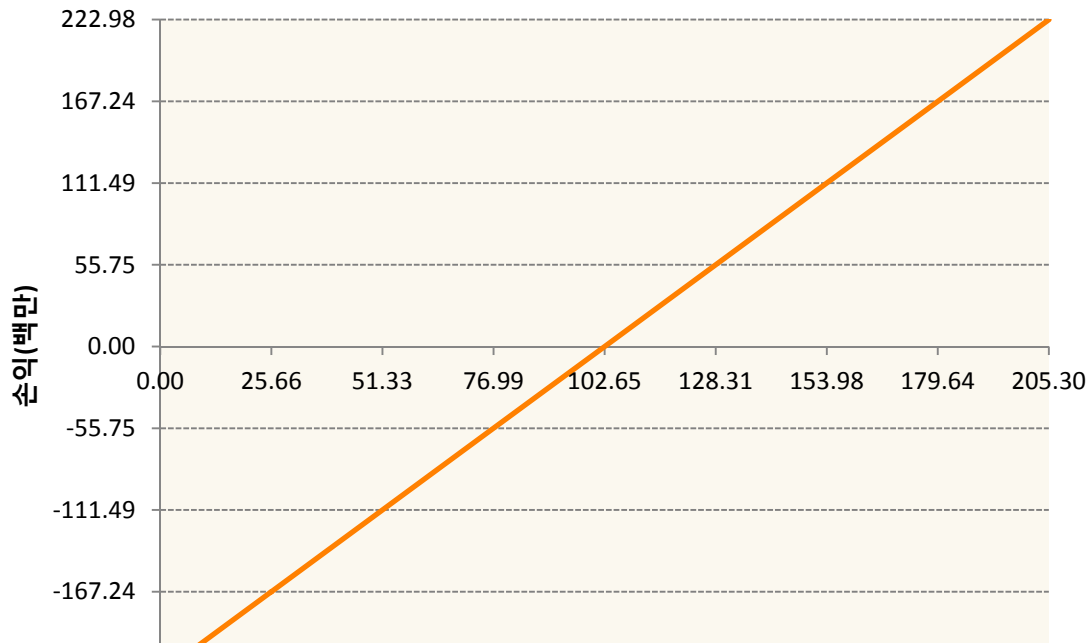


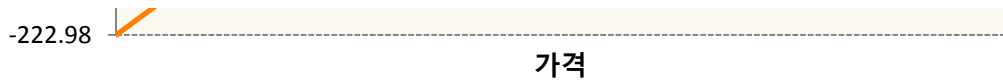


CTH0-COTTON NO.2 FUTR Mar20

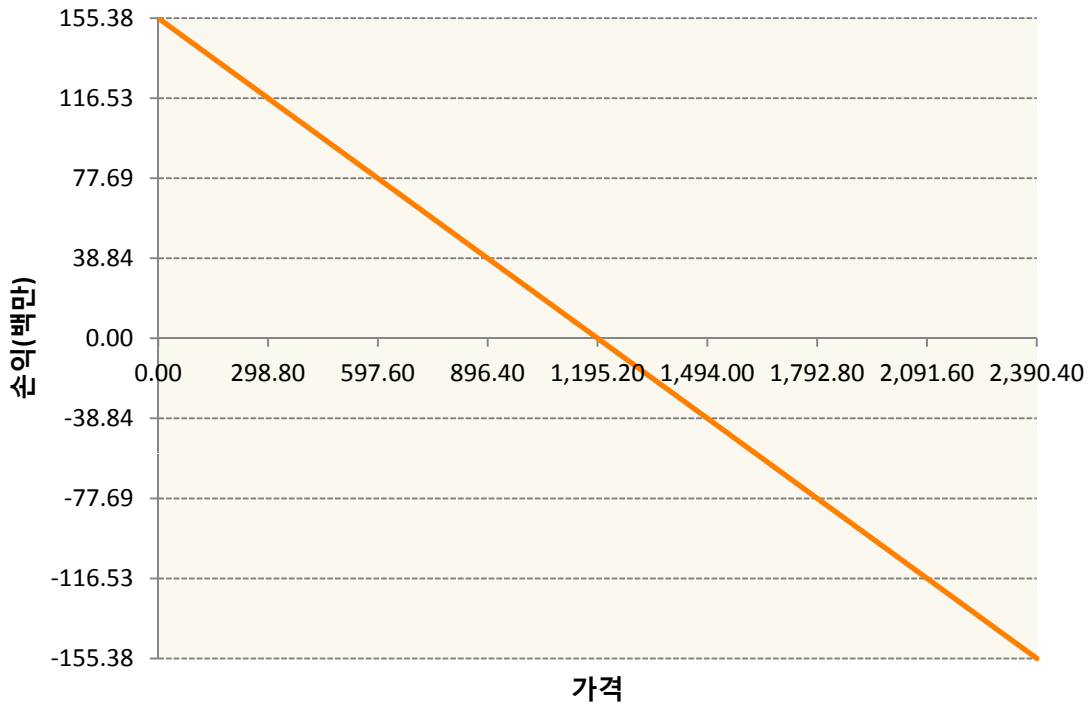


KCH0-COFFEE 'C' FUTURE Mar20

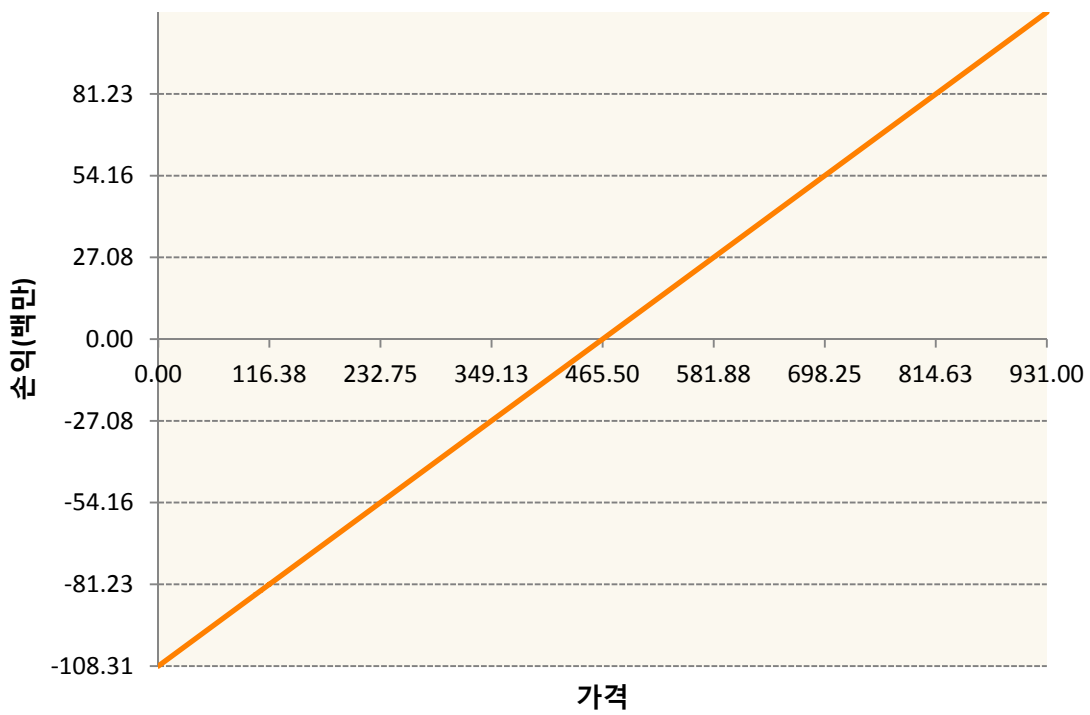




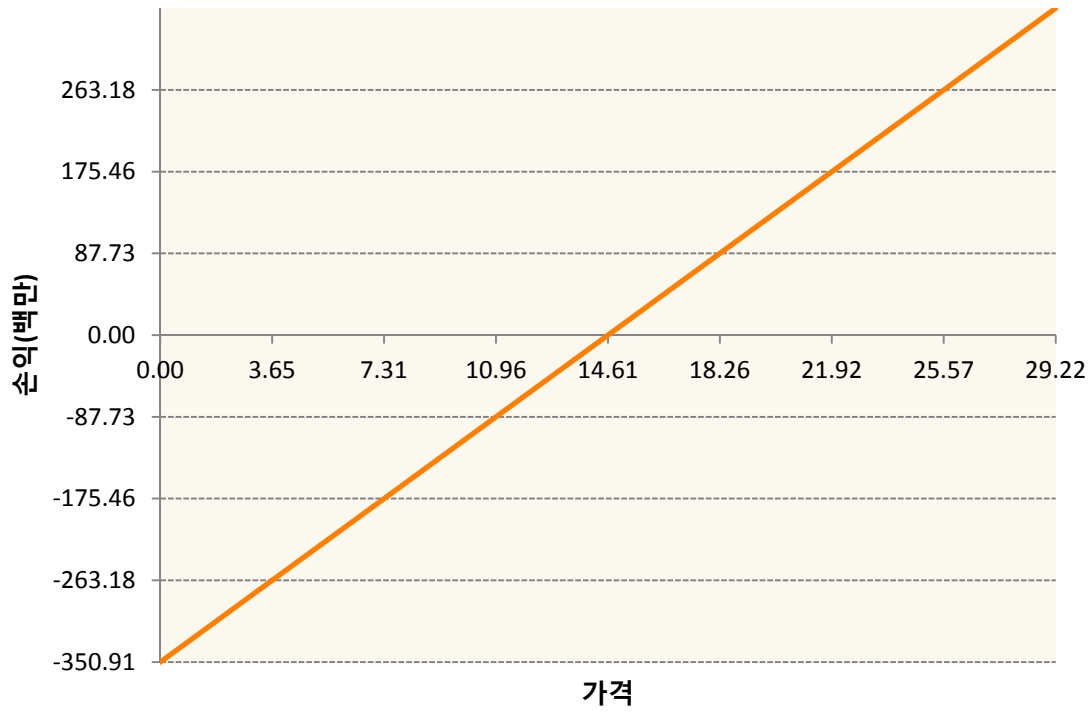
KR4175Q20000-2020-02 달러선물



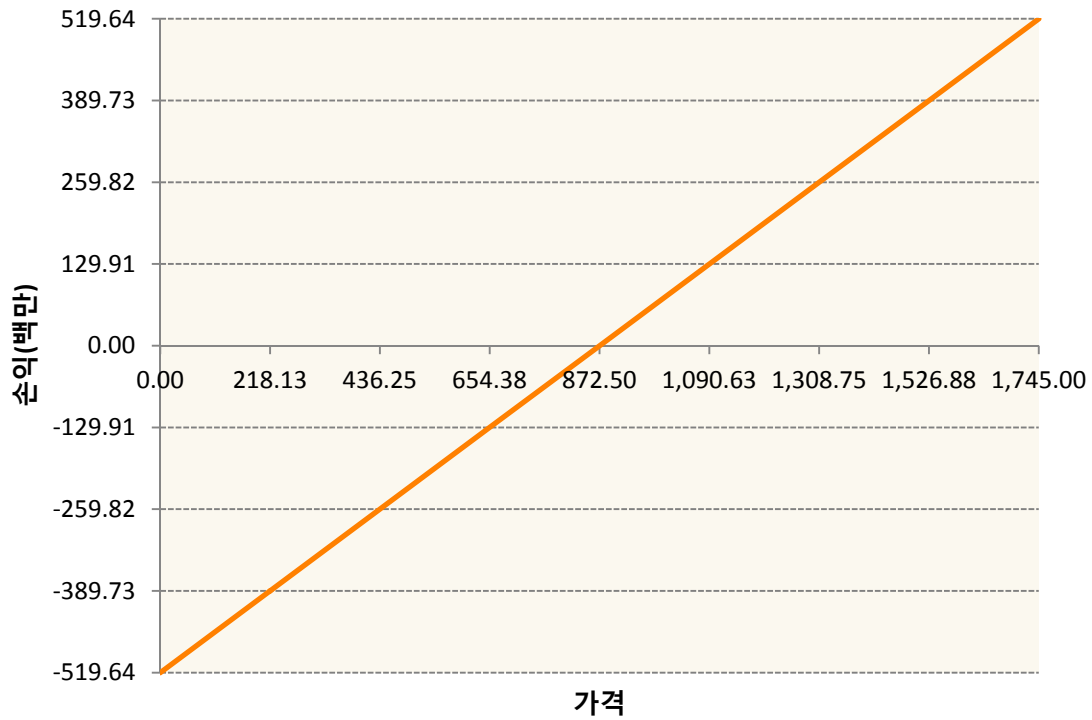
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



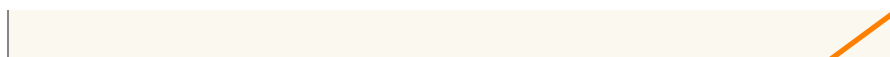
SBH0-Sugar Mar20

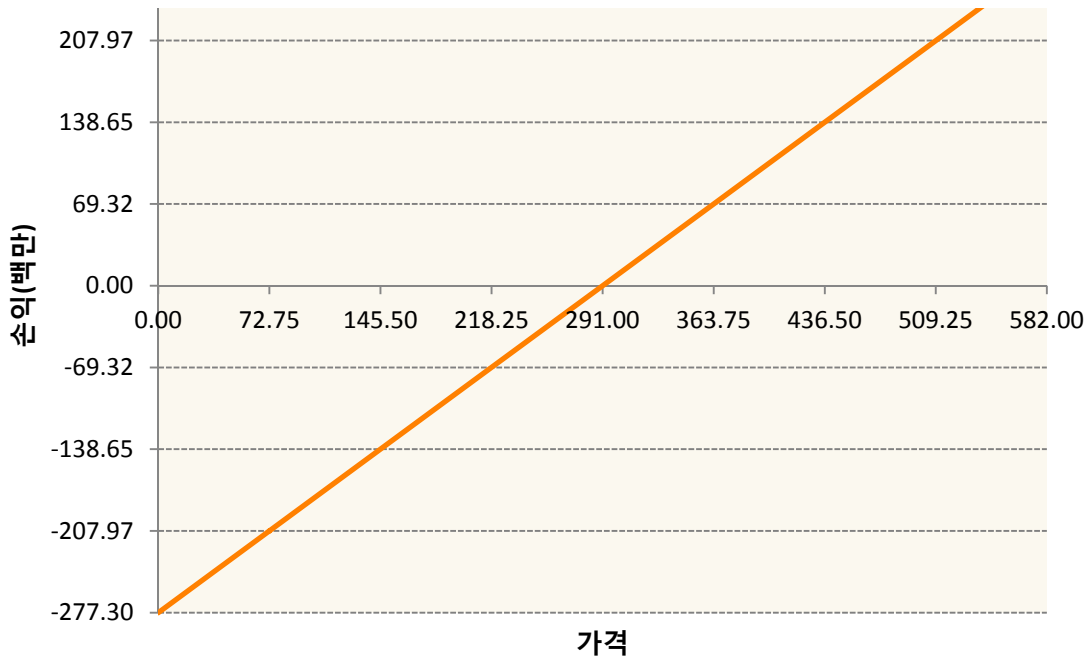


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20

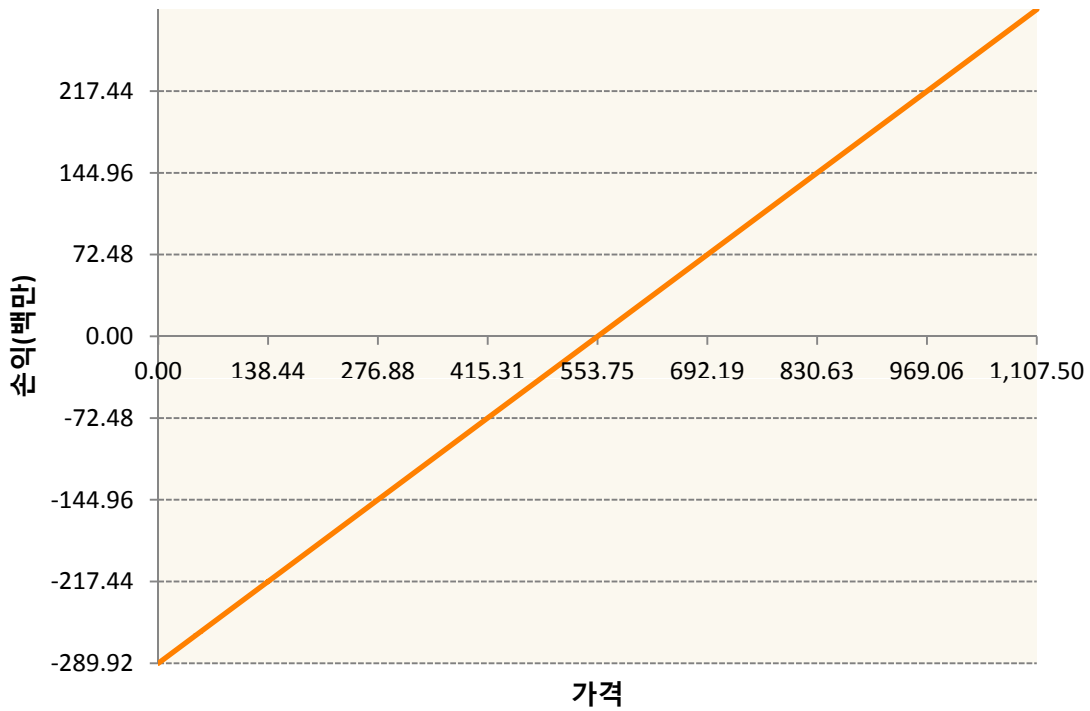


SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





WHO-WHEAT FUTURE(CBT) Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH0	SOYBEAN OIL FUTR Mar20	24
CH0	CORN FUTURE Mar20	42
CTH0	COTTON NO.2 FUTR Mar20	9
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)

236