

공시일	2020-02-05
기준일	2020-02-04

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	2020-02-05
기준일	2020-02-04

스마트인덱스모

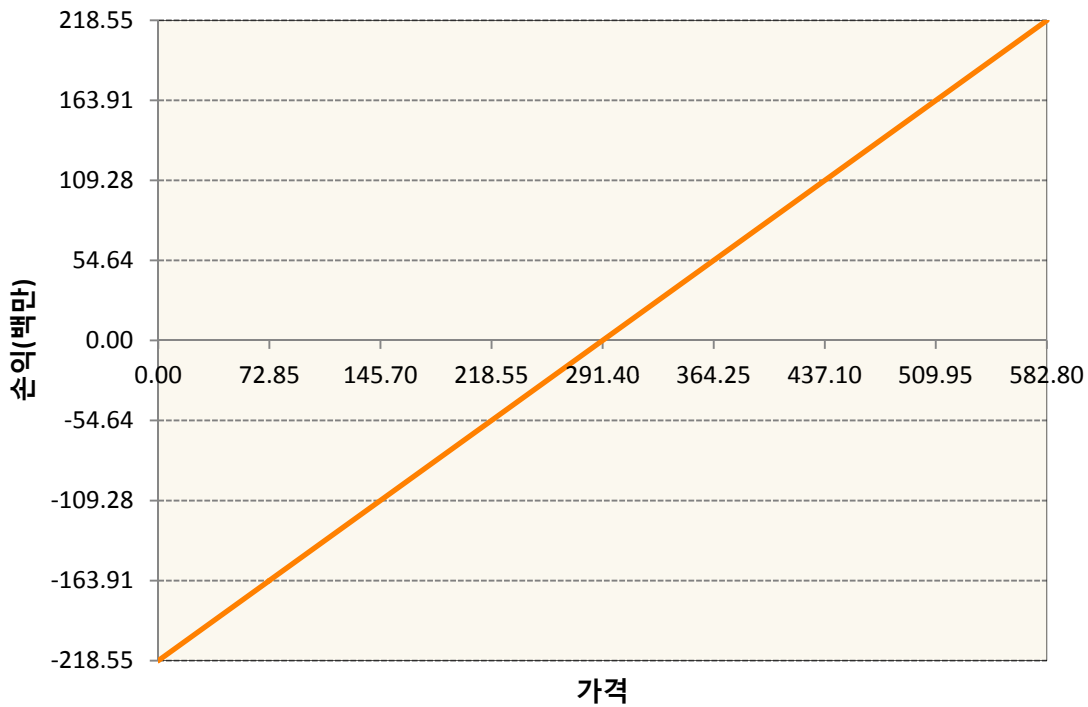
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	219	0	219	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	2020-02-05
기준일	2020-02-04

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

1,126

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

651

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-05
기준일	2020-02-04

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)	386
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	141

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

809

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-05
기준일	2020-02-04

유로인덱스모(주식-파생형)

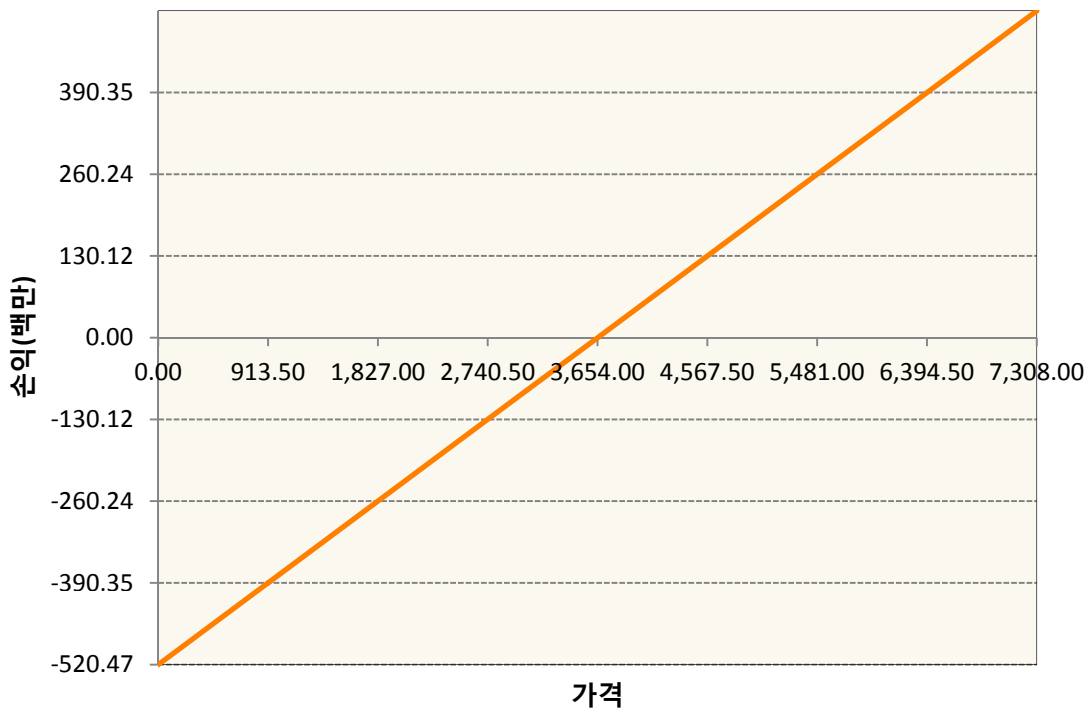
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	520	0	520	

2. 만기시점의 손익구조

VGHO-EURO STOXX 50 Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGHO	EURO STOXX 50 Mar20	42
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

29

공시일	2020-02-05
기준일	2020-02-04

차이나인덱스모(주식-파생형)

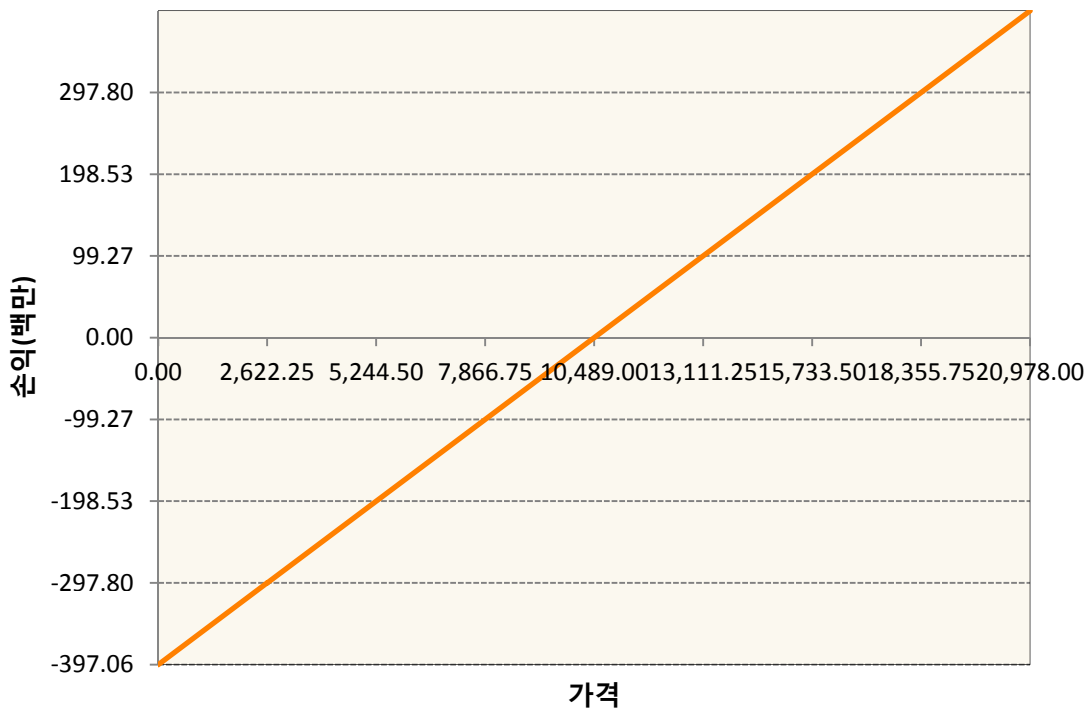
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	397	0	397	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCG0-HSCEI Futures Feb20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCG0	HSCEI Futures Feb20	32
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

29

공시일	2020-02-05
기준일	2020-02-04

커버드콜모(주식혼합-파생형)

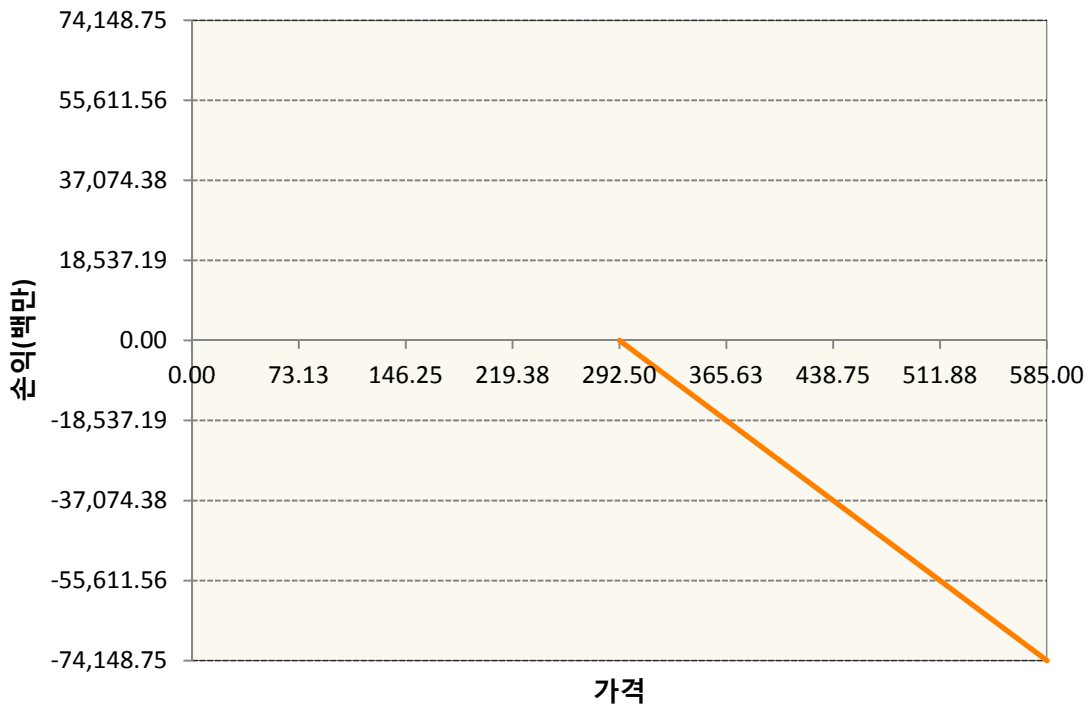
1. 계약금액

(단위:백만원)

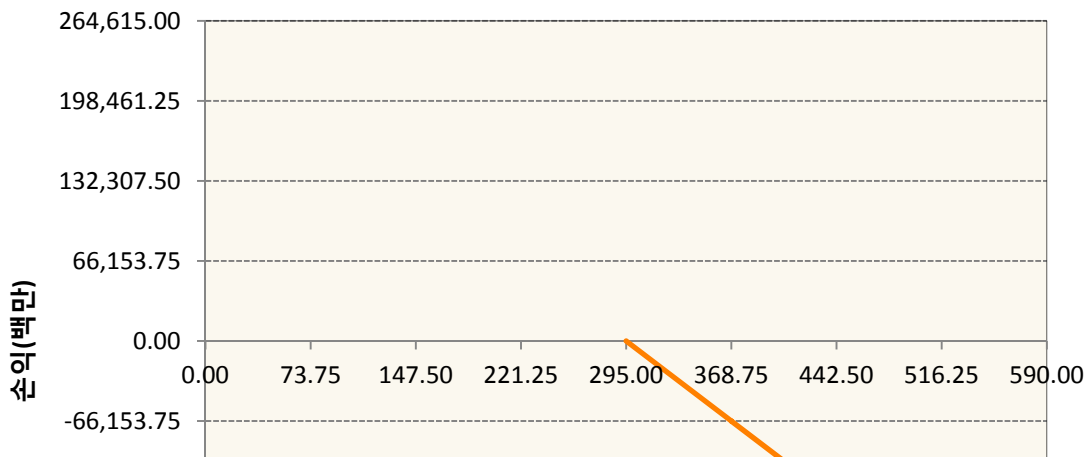
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	455,004	-455,004	장내

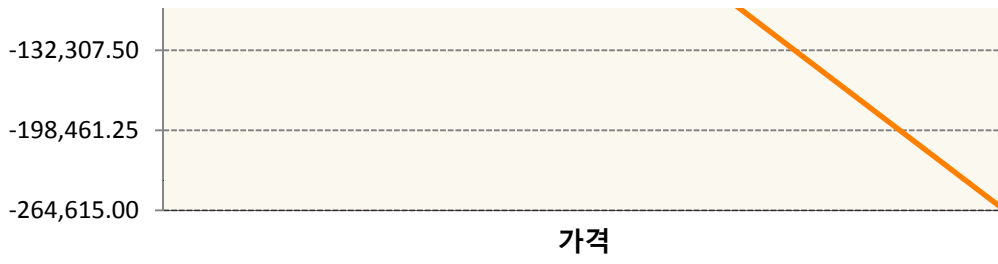
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q22927-2020-02 콜292.5

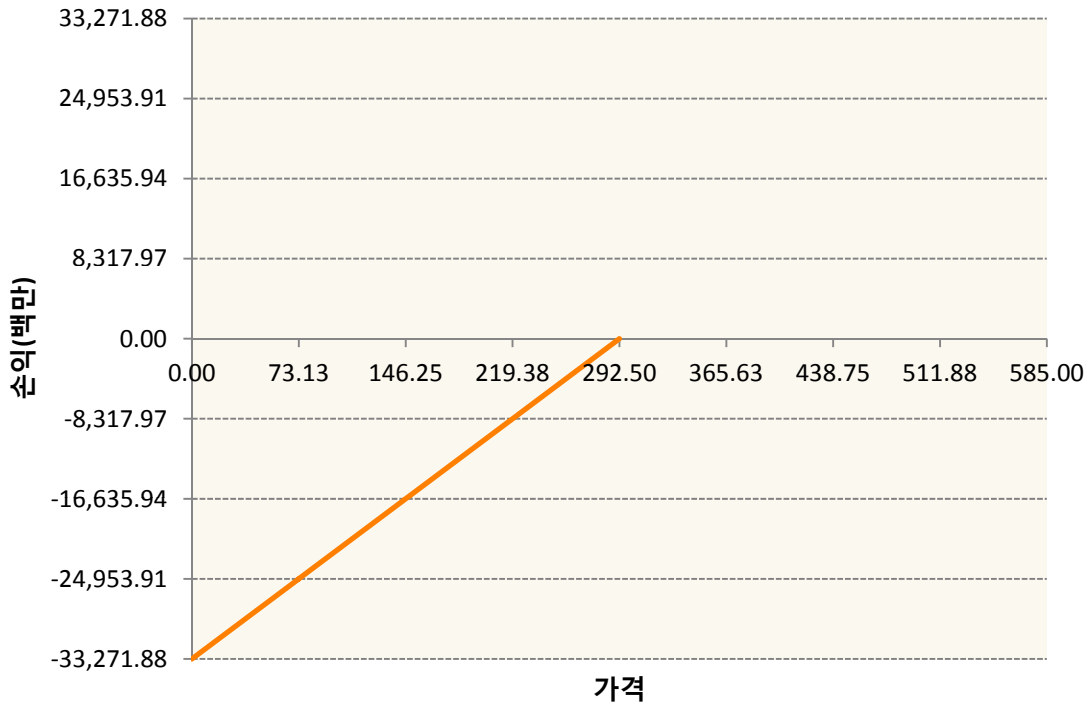


KR4201Q22950-2020-02 콜295

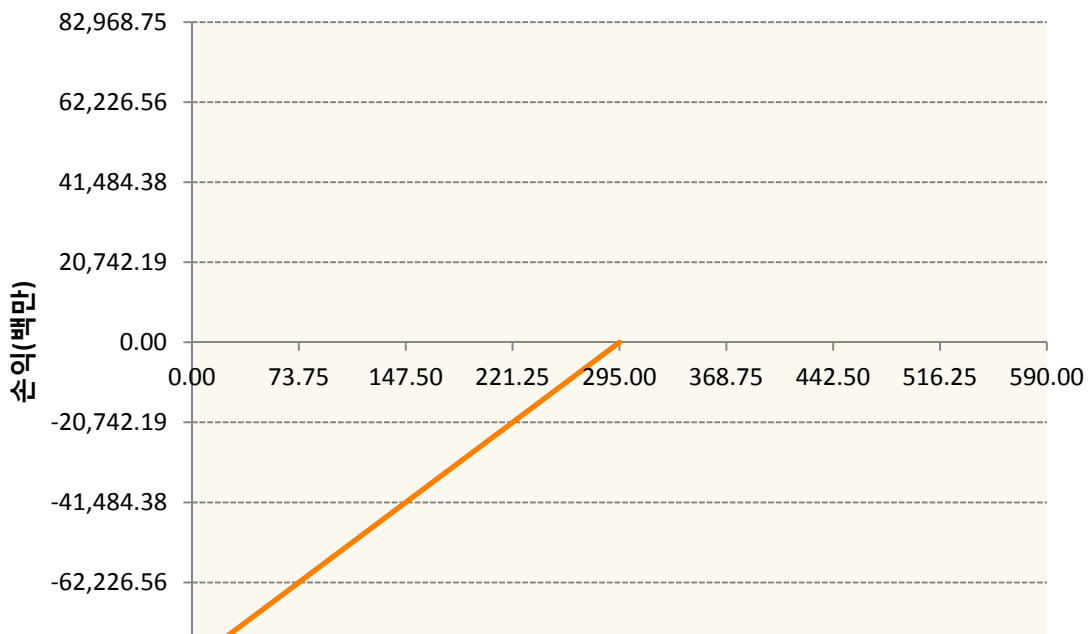




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



KR4301Q22958-2020-02 풋295



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q22927		2020-02 콜292.5						4,492
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,214	1,206	1,193	1,175	1,150	1,120	1,083	
-5.33%	1,168	1,134	1,092	1,042	985	922	853	
-2.67%	956	874	787	695	599	500	399	
0%	357	238	119	0	-119	-239	-358	
2.67%	-782	-888	-998	-1,109	-1,222	-1,336	-1,451	
5.33%	-2,381	-2,443	-2,513	-2,590	-2,672	-2,760	-2,852	
8.00%	-4,231	-4,255	-4,287	-4,328	-4,375	-4,430	-4,492	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						14,887
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,400	3,383	3,354	3,308	3,244	3,160	3,057	
-5.33%	3,306	3,224	3,113	2,975	2,812	2,625	2,417	
-2.67%	2,809	2,574	2,313	2,030	1,730	1,414	1,086	
0%	1,206	809	406	0	-409	-821	-1,235	
2.67%	-2,197	-2,611	-3,029	-3,449	-3,872	-4,295	-4,720	
5.33%	-7,393	-7,670	-7,971	-8,292	-8,629	-8,978	-9,338	
8.00%	-13,721	-13,844	-14,000	-14,185	-14,396	-14,631	-14,887	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						2,376
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,374	-2,374	-2,374	-2,375	-2,375	-2,375	-2,376	
-5.33%	-1,493	-1,494	-1,495	-1,497	-1,500	-1,505	-1,510	
-2.67%	-627	-636	-648	-662	-677	-694	-712	
0%	88	59	30	0	-30	-60	-89	
2.67%	418	398	376	353	329	304	278	
5.33%	477	474	468	461	452	442	429	
8.00%	481	480	480	479	477	475	472	
KR4301Q22958		2020-02 풋295						6,116
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-6,114	-6,114	-6,114	-6,114	-6,114	-6,115	-6,116	
-5.33%	-3,935	-3,935	-3,937	-3,939	-3,943	-3,949	-3,957	
-2.67%	-1,769	-1,781	-1,798	-1,819	-1,845	-1,875	-1,909	
0%	187	127	65	0	-66	-134	-202	
2.67%	1,333	1,267	1,198	1,128	1,057	986	914	

5.33%	1,623	1,604	1,580	1,551	1,517	1,479	1,437
8.00%	1,648	1,646	1,643	1,638	1,630	1,620	1,606

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

(단위:백만원)

29,495

공시일	2020-02-05
기준일	2020-02-04

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

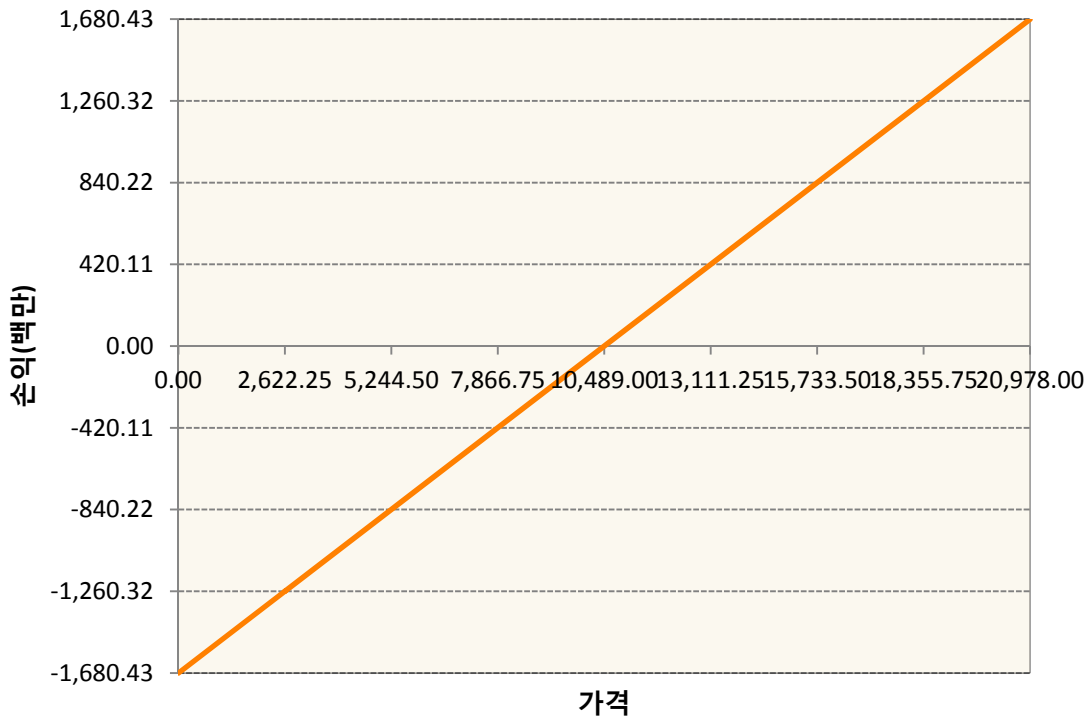
1. 계약금액

(단위:백만원)

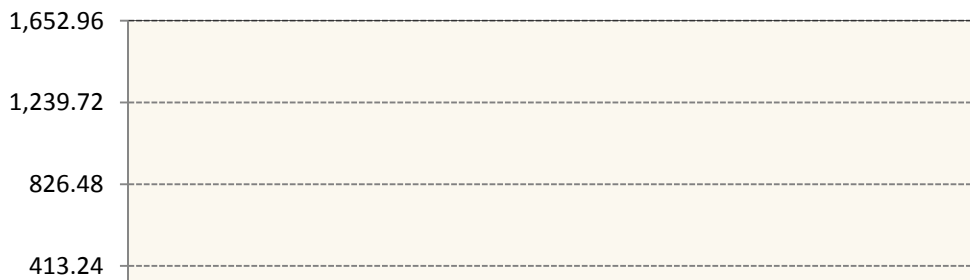
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,680	0	1,680	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,578	-4,578	장내
누계	통화	선도	0	2,152	-2,152	장외

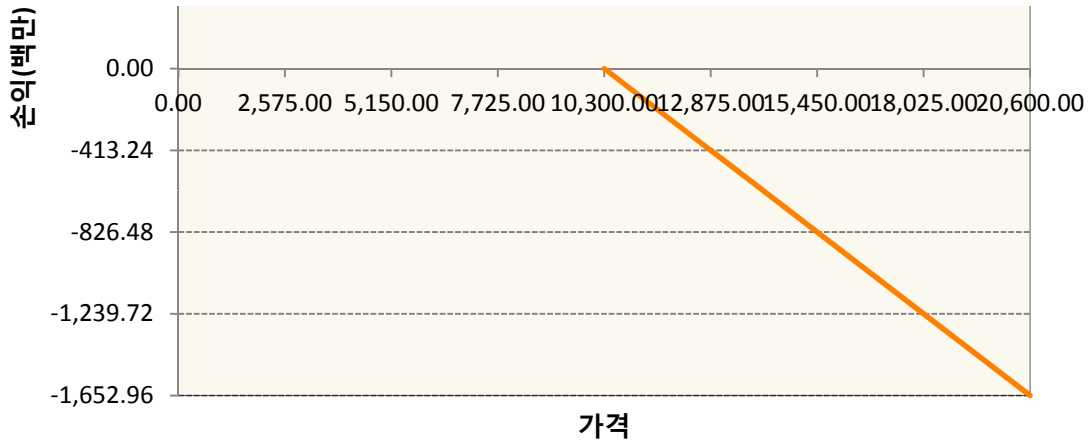
2. 만기시점의 손익구조

HCG0-HSCEI Futures Feb20

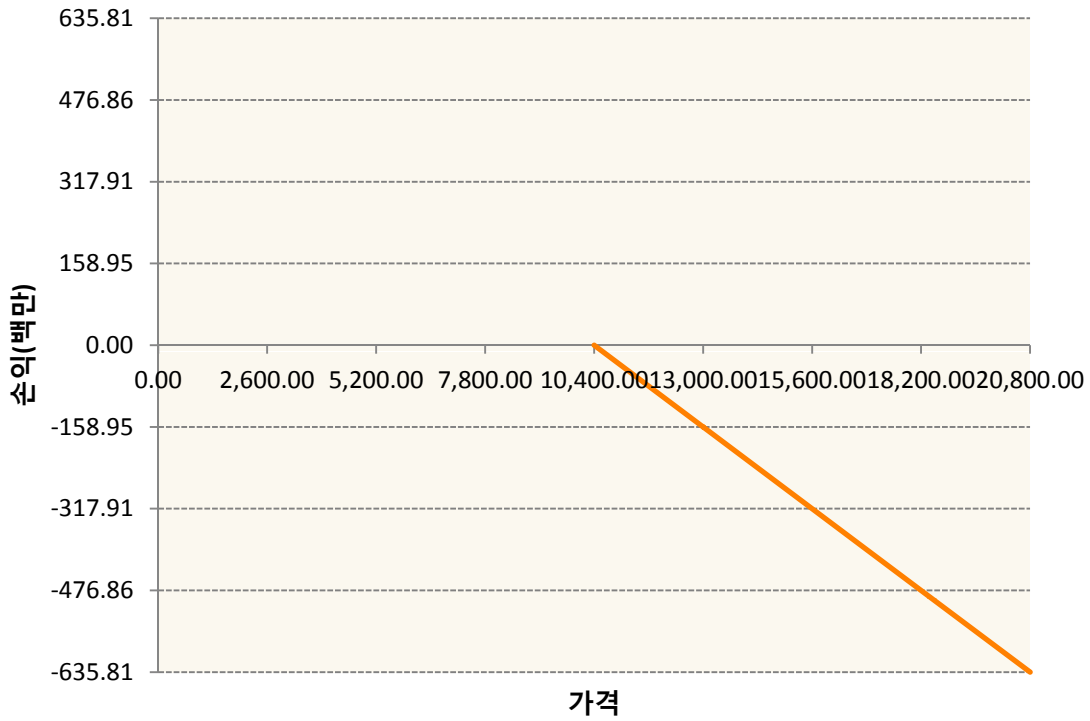


OHHIG0-C103-HSCEI

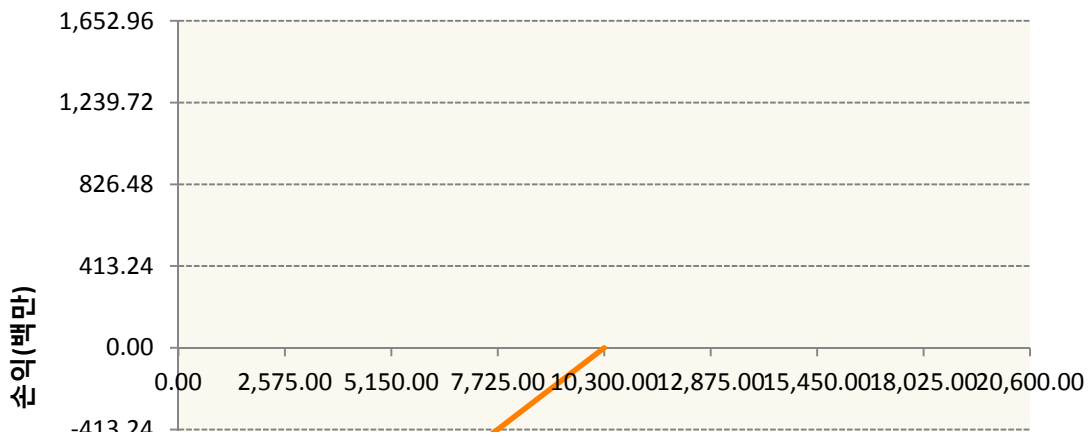


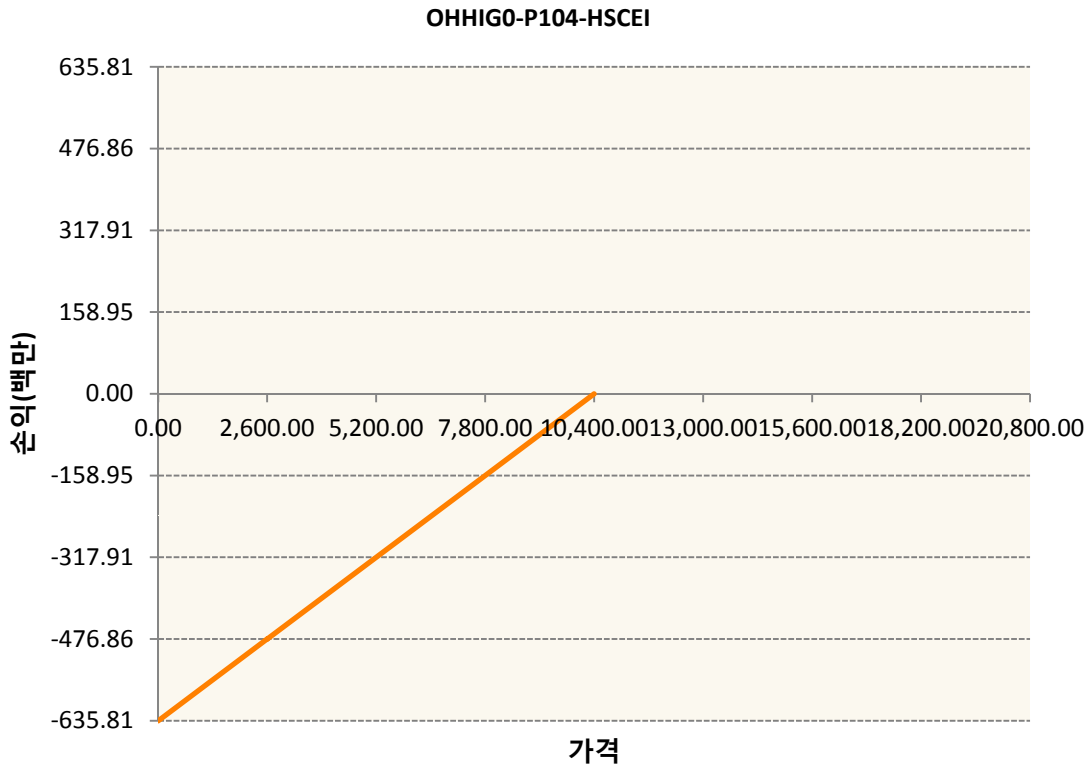


OHHIG0-C104-HSCEI



OHHIG0-P103-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	172
HCG0 HSCEI Futures Feb20	134
OHHIG0-C1(HSCEI	132
OHHIG0-C1(HSCEI	51
OHHIG0-P1(HSCEI	132
OHHIG0-P1(HSCEI	51

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	510

공시일	2020-02-05
기준일	2020-02-04

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

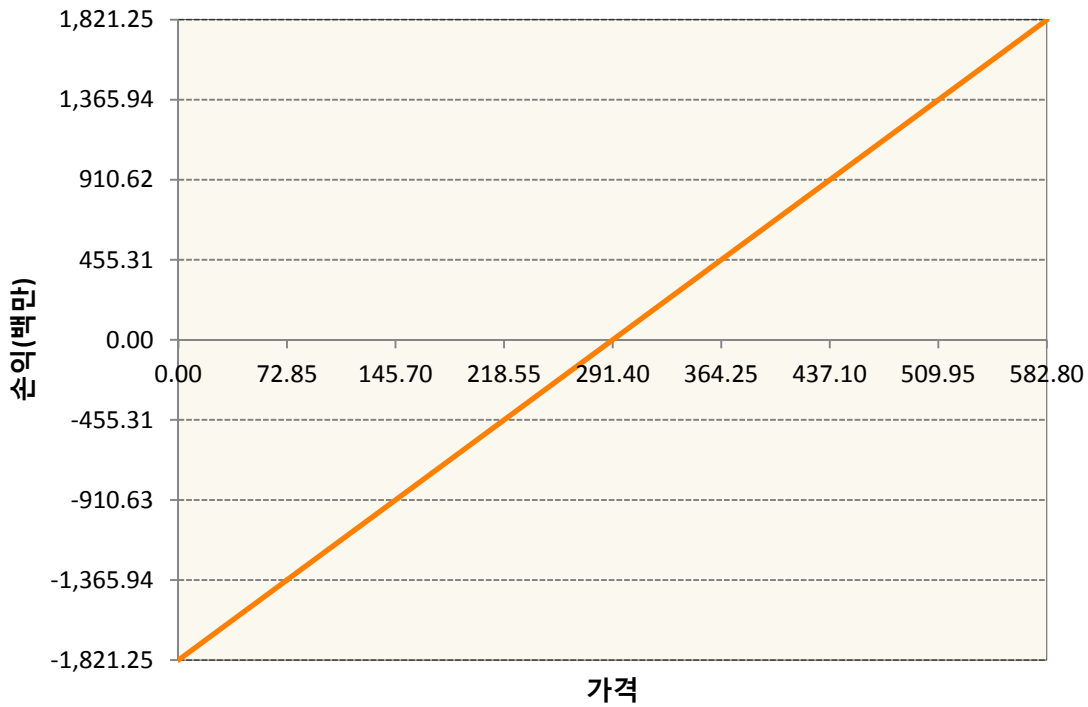
1. 계약금액

(단위:백만원)

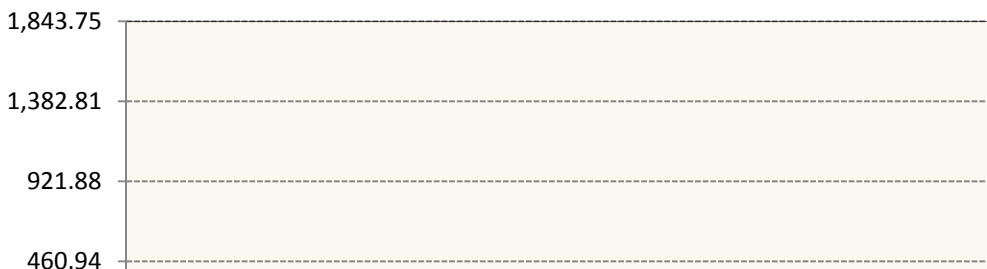
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,821	0	1,821	장내
누계	유가증권	스왑	3,625	0	3,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,608	-3,608	장내

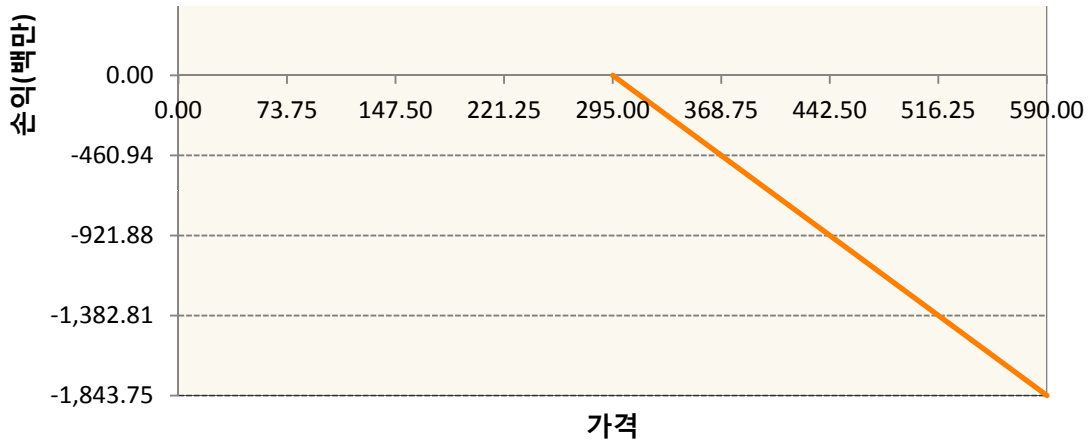
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

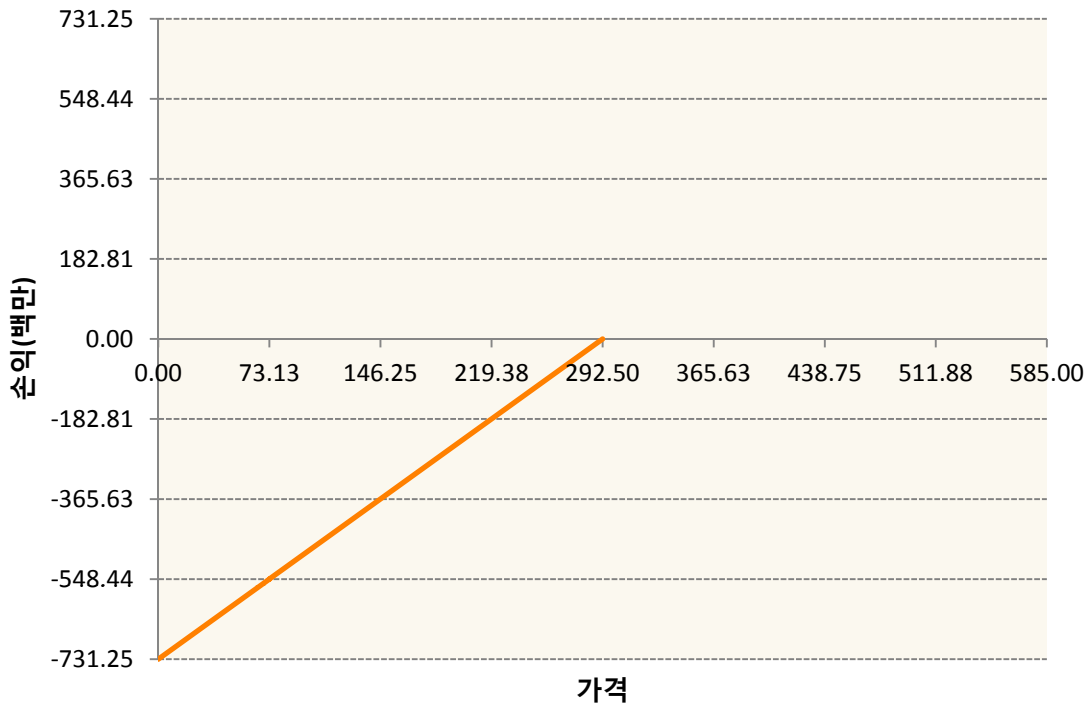


KR4201Q22950-2020-02 콜295

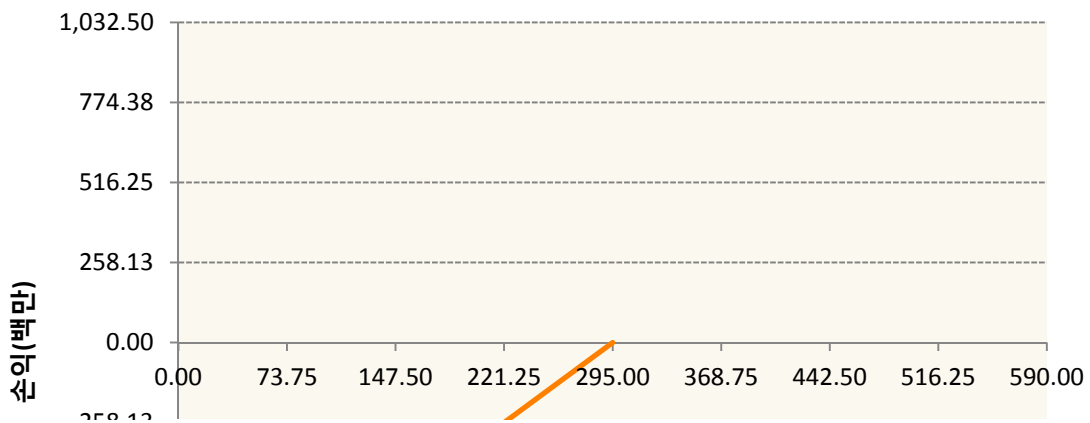




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



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						145
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-145	-145	-145	-145	-145	-145	-145	
-5.33%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97	
-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%	97	97	97	97	97	97	97	
8.00%	145	145	145	145	145	145	145	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						104
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	24	24	23	23	23	22	21	
-5.33%	23	22	22	21	20	18	17	
-2.67%	20	18	16	14	12	10	8	
0%	8	6	3	0	-3	-6	-9	
2.67%	-15	-18	-21	-24	-27	-30	-33	
5.33%	-52	-53	-56	-58	-60	-63	-65	
8.00%	-96	-96	-98	-99	-100	-102	-104	
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	-33
-2.67%	-14	-14	-14	-15	-15	-15	-16
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	9	9	8	8	7	7	6
5.33%	10	10	10	10	10	10	9
8.00%	11	11	11	11	10	10	10
KR4301Q22958 2020-02 풋295							76
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
-5.33%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-2.67%	-22	-22	-22	-23	-23	-23	-24
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	17	16	15	14	13	12	11
5.33%	20	20	20	19	19	18	18
8.00%	21	20	20	20	20	20	20

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

(단위:백만원)

687

공시일	2020-02-05
기준일	2020-02-04

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

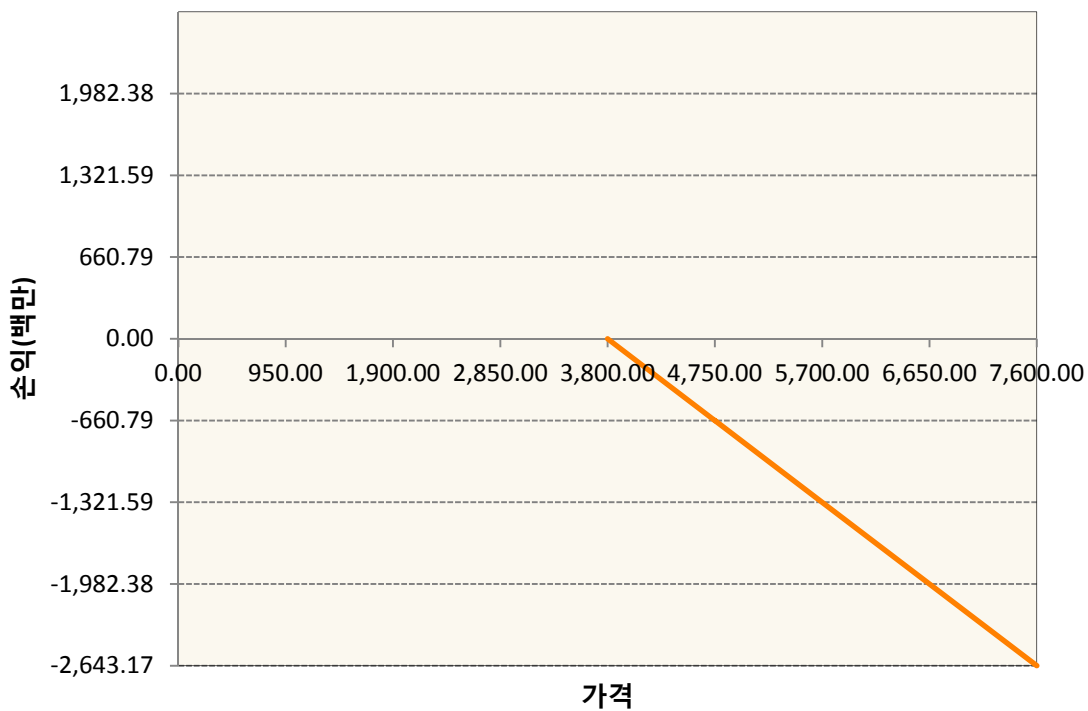
1. 계약금액

(단위:백만원)

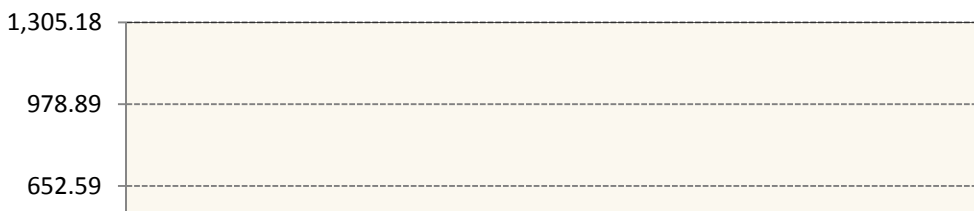
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	754	0	754	
누계	유가증권	스왑	13,714	0	13,714	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,897	-7,897	장내
누계	통화	선도	0	3,444	-3,444	장외

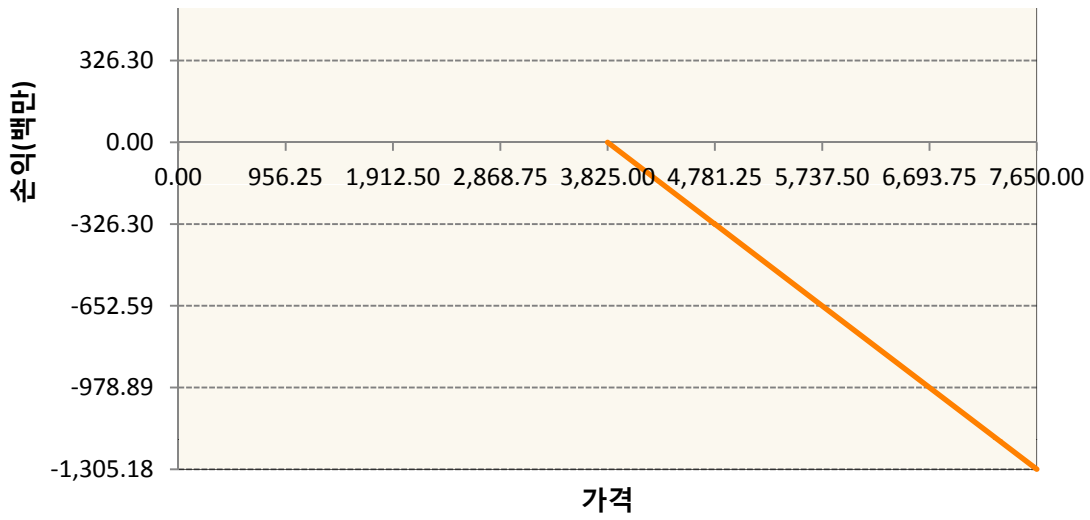
2. 만기시점의 손익구조

OESXG0-C3800-EURO STOXX 50

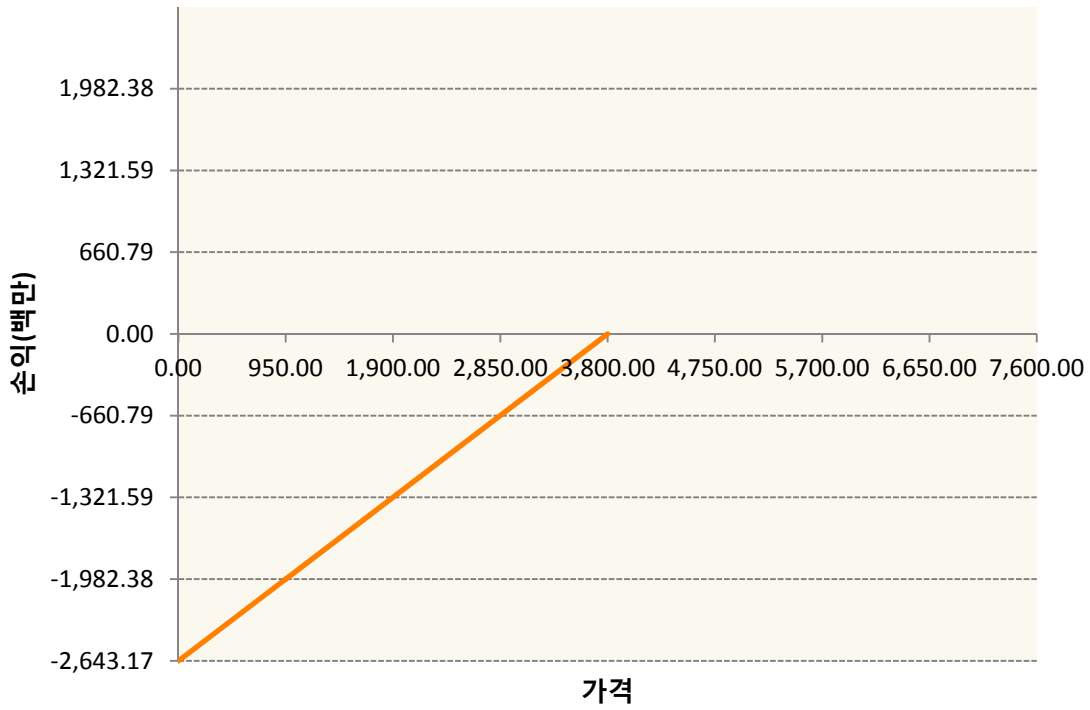


OESXG0-C3825-EURO STOXX 50

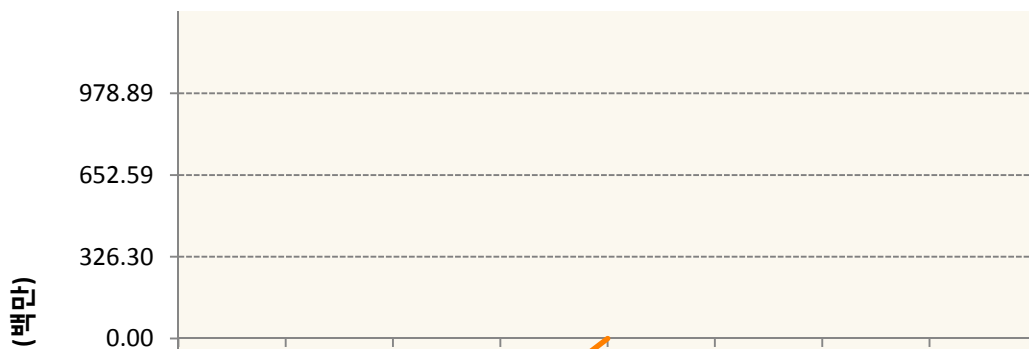


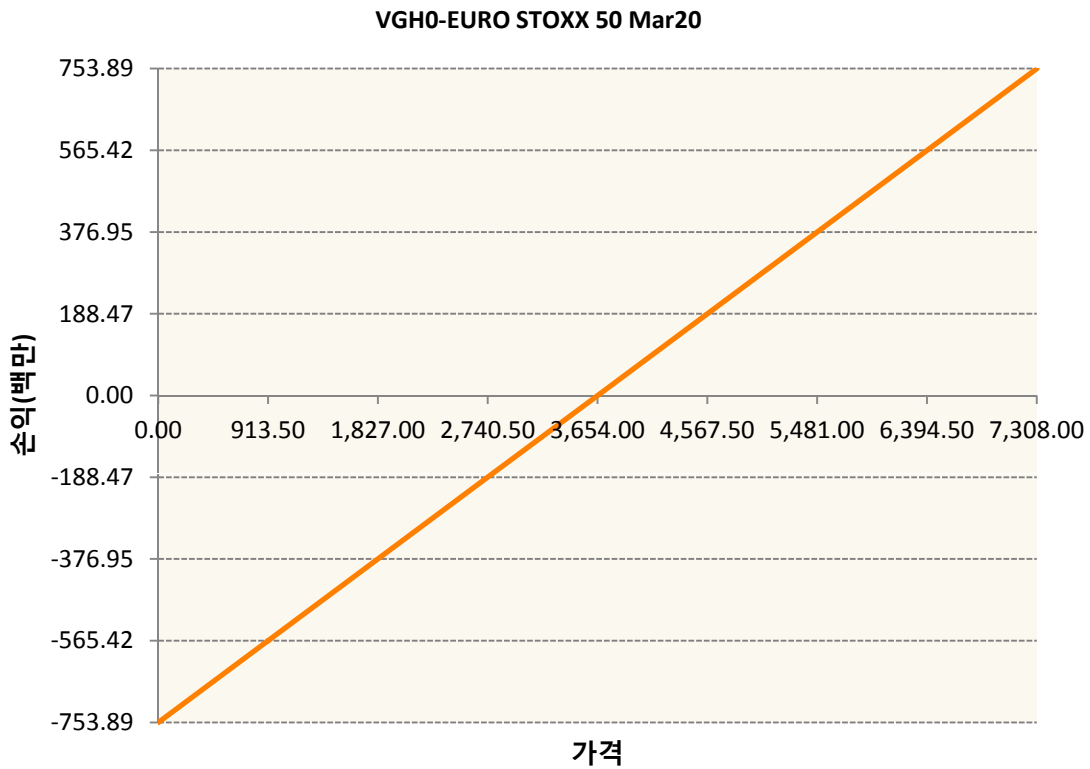
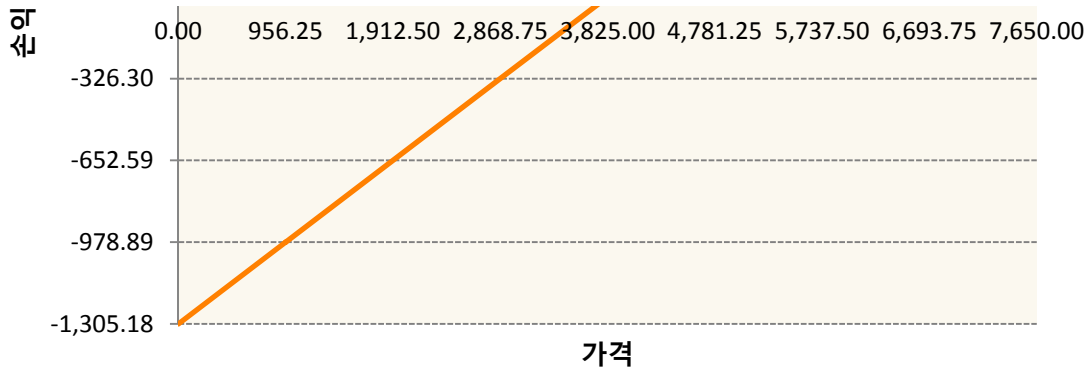


OESXG0-P3800-EURO STOXX 50



OESXG0-P3825-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	31
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	276
OESXG0-C3& EURO STOXX 50	211
OESXG0-C3& EURO STOXX 50	104
OESXG0-P3& EURO STOXX 50	211
OESXG0-P3& EURO STOXX 50	104
VGHO EURO STOXX 50 Mar20	60

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

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

(단위:백만원)

907

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

(단위:백만원)

80

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

(단위:백만원)

118

공시일	2020-02-05
기준일	2020-02-04

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

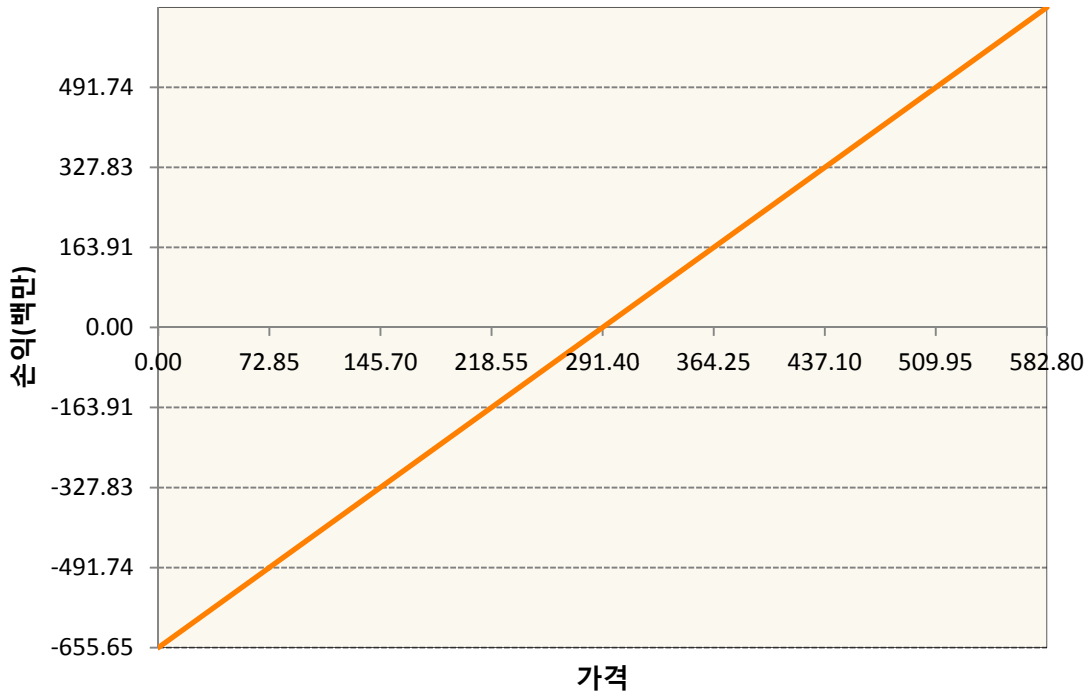
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	656	0	656	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						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%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
-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%	35	35	35	35	35	35	35	
8.00%	52	52	52	52	52	52	52	

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

(단위:백만원)

42

공시일	2020-02-05
기준일	2020-02-04

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

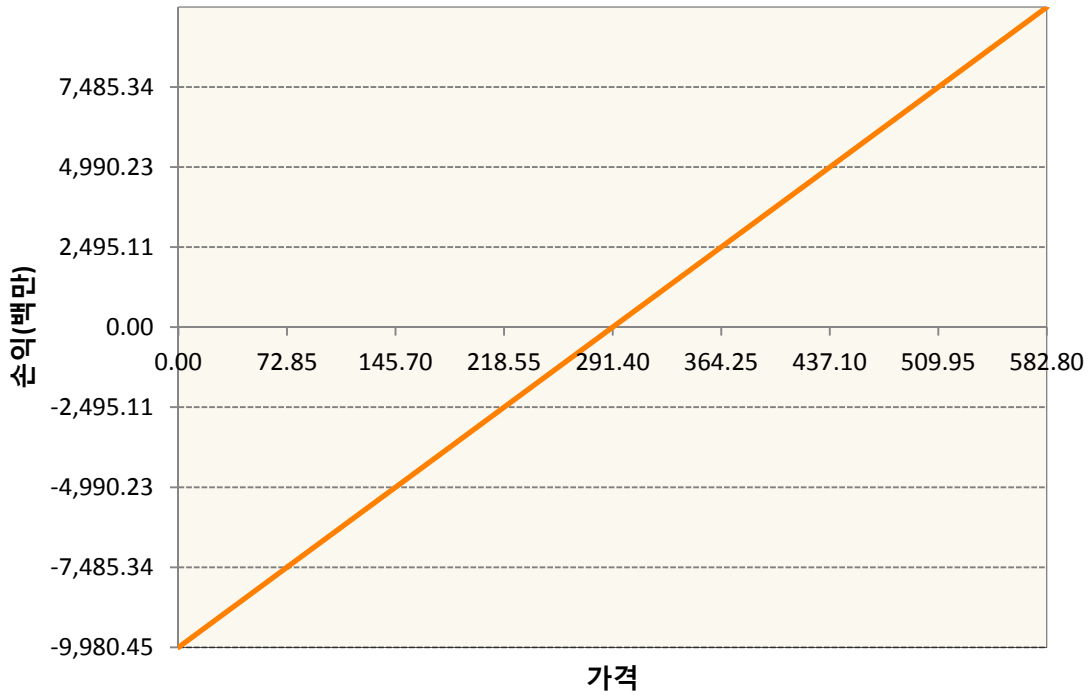
1. 계약금액

(단위:백만원)

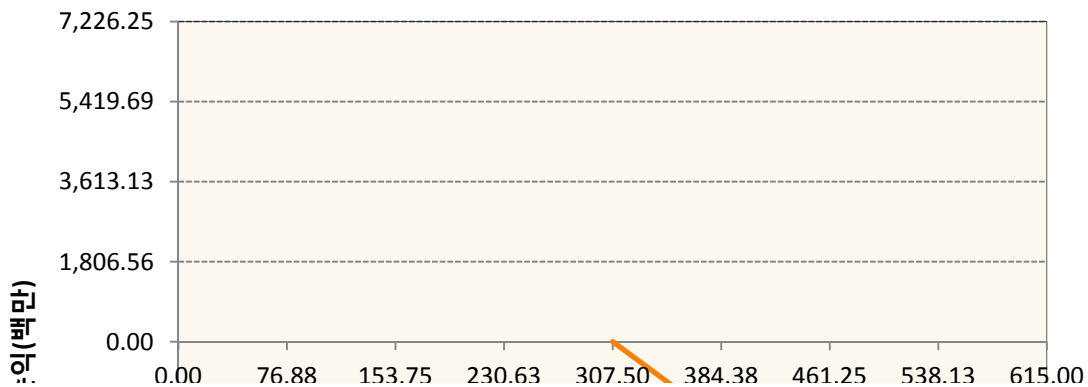
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	77	0	77	장내
누계	유가증권	선물	9,980	0	9,980	장내
누계	유가증권	옵션	2,944	20,711	-17,768	장내

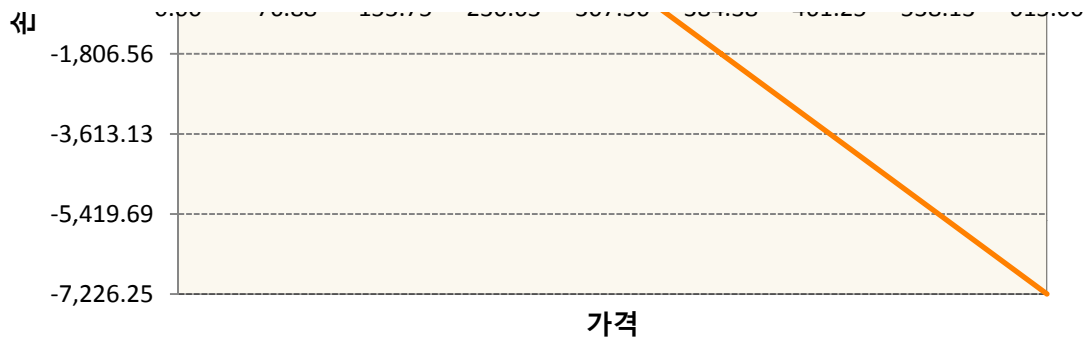
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

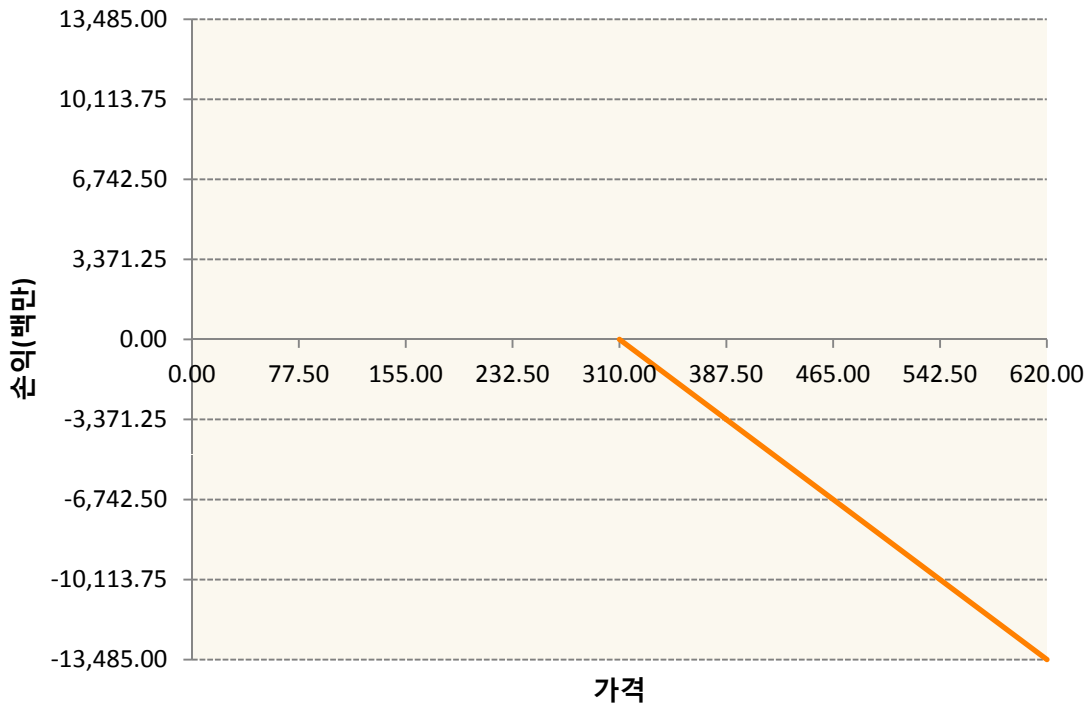


KR4201Q23073-2020-02 콜307.5

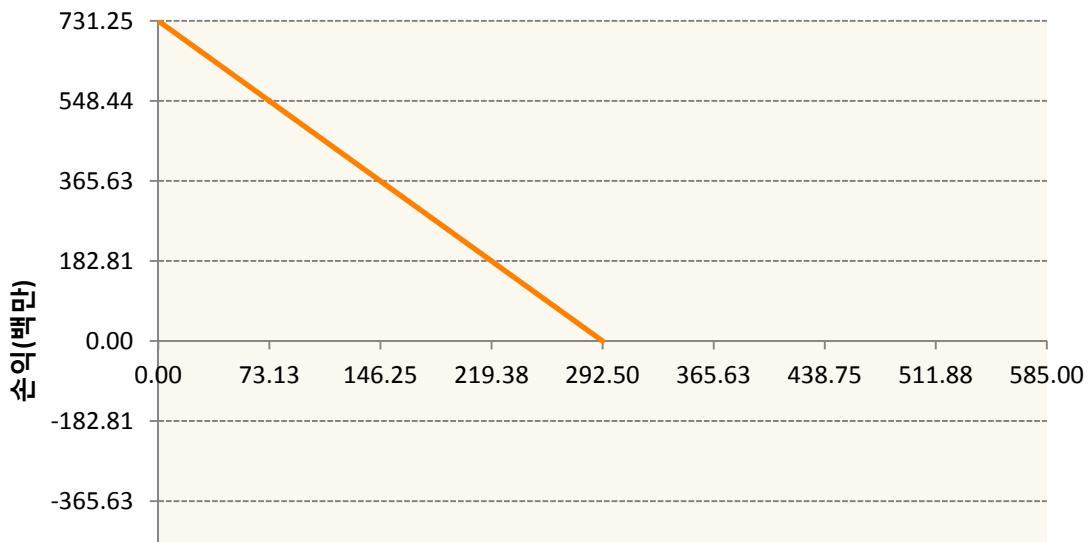


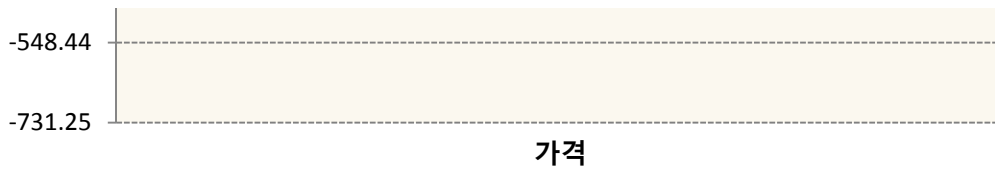


KR4201Q23107-2020-02 콜310

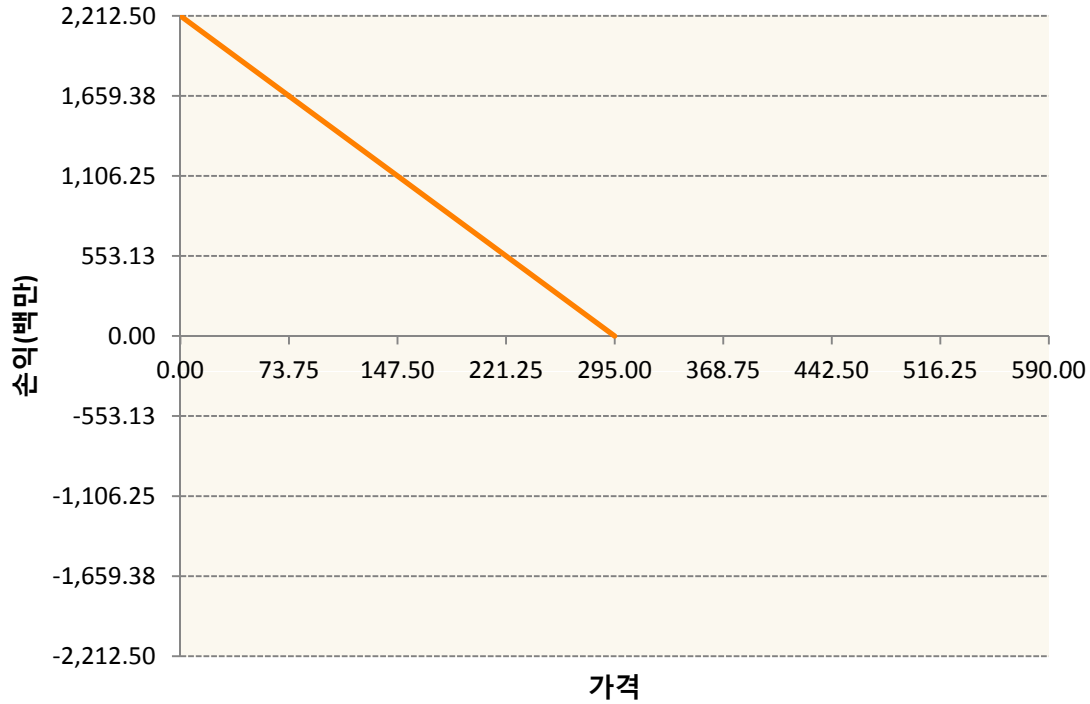


KR4301Q22925-2020-02 풋292.5





KR4301Q22958-2020-02 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						796
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-796	-796	-796	-796	-796	-796	-796	
-5.33%	-531	-531	-531	-531	-531	-531	-531	
-2.67%	-265	-265	-265	-265	-265	-265	-265	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	265	265	265	265	265	265	265	
5.33%	531	531	531	531	531	531	531	
8.00%	796	796	796	796	796	796	796	
KR4201Q23073		2020-02 콜307.5						242
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	21	21	21	21	21	20	20	
-5.33%	21	21	21	20	19	17	16	
-2.67%	20	19	17	15	12	9	4	

0%	14	10	6	0	-6	-13	-20
2.67%	-9	-18	-27	-36	-46	-56	-66
5.33%	-69	-81	-92	-104	-116	-128	-139
8.00%	-177	-187	-198	-209	-220	-231	-242
KR4201Q23107 2020-02 콜310							395
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	28	28	28	28	28	27	26
-5.33%	28	28	27	27	25	23	21
-2.67%	27	26	24	21	16	11	5
0%	20	15	8	0	-10	-20	-32
2.67%	-9	-23	-37	-53	-69	-86	-103
5.33%	-96	-116	-137	-158	-179	-201	-222
8.00%	-267	-288	-309	-330	-352	-373	-395
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	33
-2.67%	14	14	14	15	15	15	16
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-9	-9	-8	-8	-7	-7	-6
5.33%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-9
8.00%	-11	-11	-11	-11	-10	-10	-10
KR4301Q22958 2020-02 풋295							163
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	163	163	163	163	163	163	163
-5.33%	105	105	105	105	105	105	106
-2.67%	47	47	48	49	49	50	51
0%	-5	-3	-2	0	2	4	5
2.67%	-36	-34	-32	-30	-28	-26	-24
5.33%	-43	-43	-42	-41	-40	-39	-38
8.00%	-44	-44	-44	-44	-43	-43	-43

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

(단위:백만원)

1,225

공시일	2020-02-05
기준일	2020-02-04

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	212,125	0	212,125	

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	2020-02-05
기준일	2020-02-04

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	221,415	0	221,415	

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	2020-02-05
기준일	2020-02-04

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	543,732	0	543,732	
누계	통화	선도	0	593,819	-593,819	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,375
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,565
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	1,653
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	1,558
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	950
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	190
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	2,033
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	950
FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E	3,800
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,900
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	2,033
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	190
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	190
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	1,140
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	1,710
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	285
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E	1,900
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E	3,268
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,529
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,425
FX21020F02 KRW/USD 28-02-20E	1,900
FX21020F03 KRW/USD 28-02-20E	2,945
FX21020F03 KRW/USD 31-03-20E	3,040
FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E	2,850
FX21020F04 KRW/USD 28-02-20E	190
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,565
FX21020G00 KRW/USD 06-03-20E	2,375
IE00BD8RGM75	

* 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	2020-02-05
기준일	2020-02-04

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

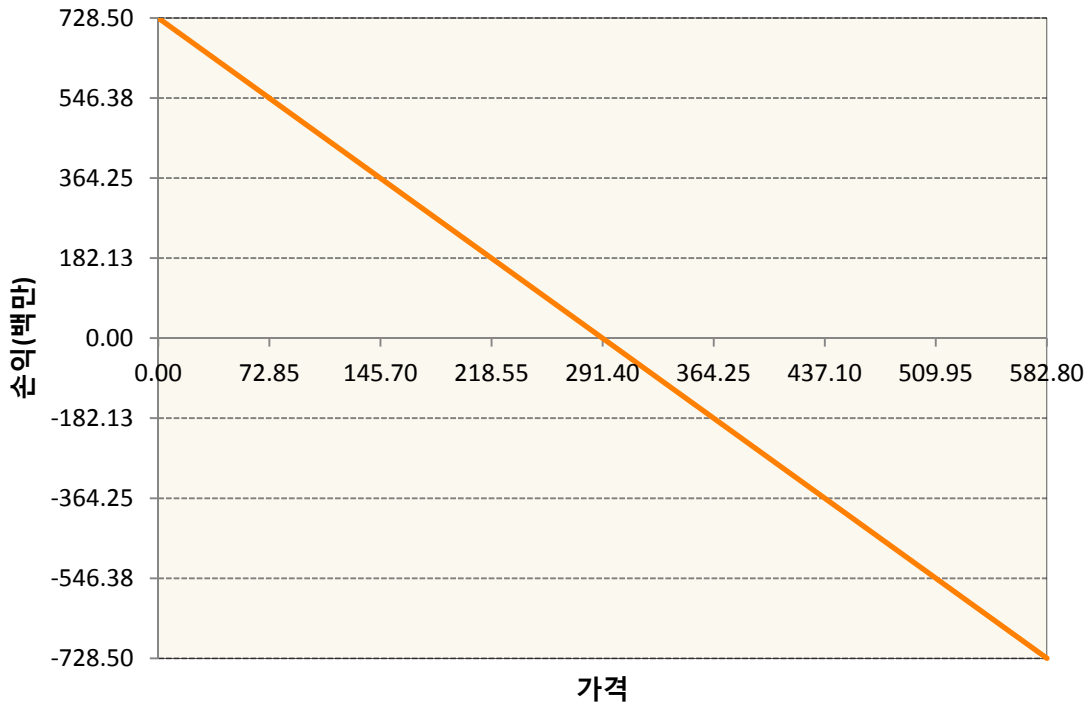
1. 계약금액

(단위:백만원)

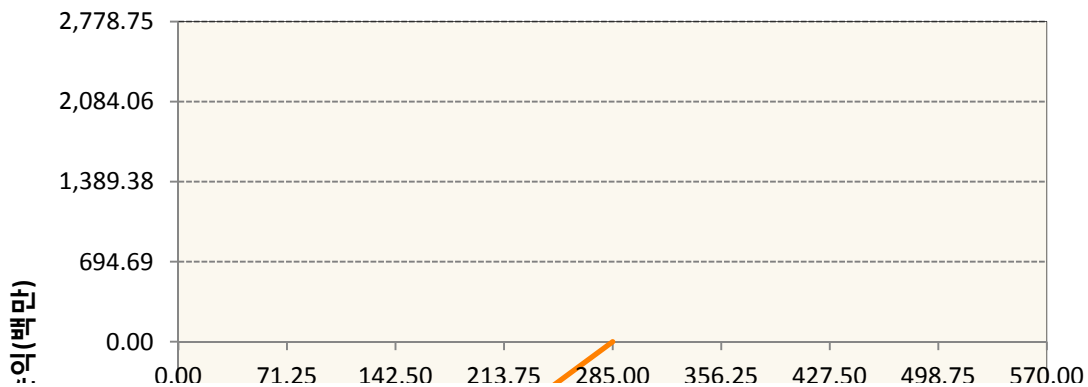
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	729	-729	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,569	-3,569	장내

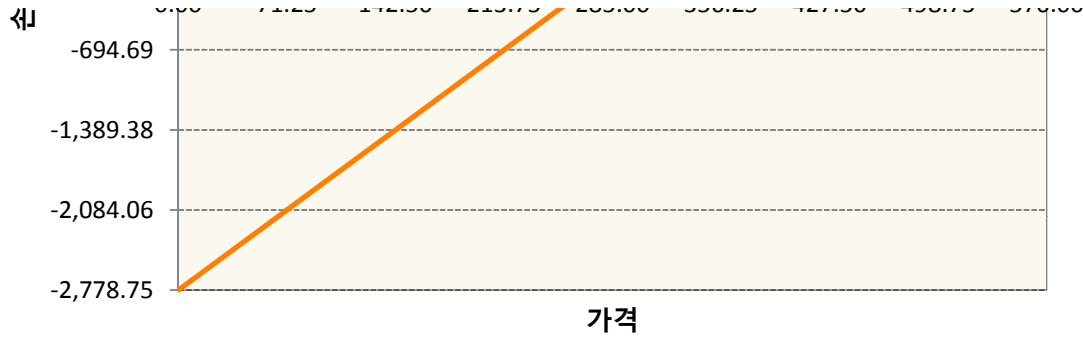
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

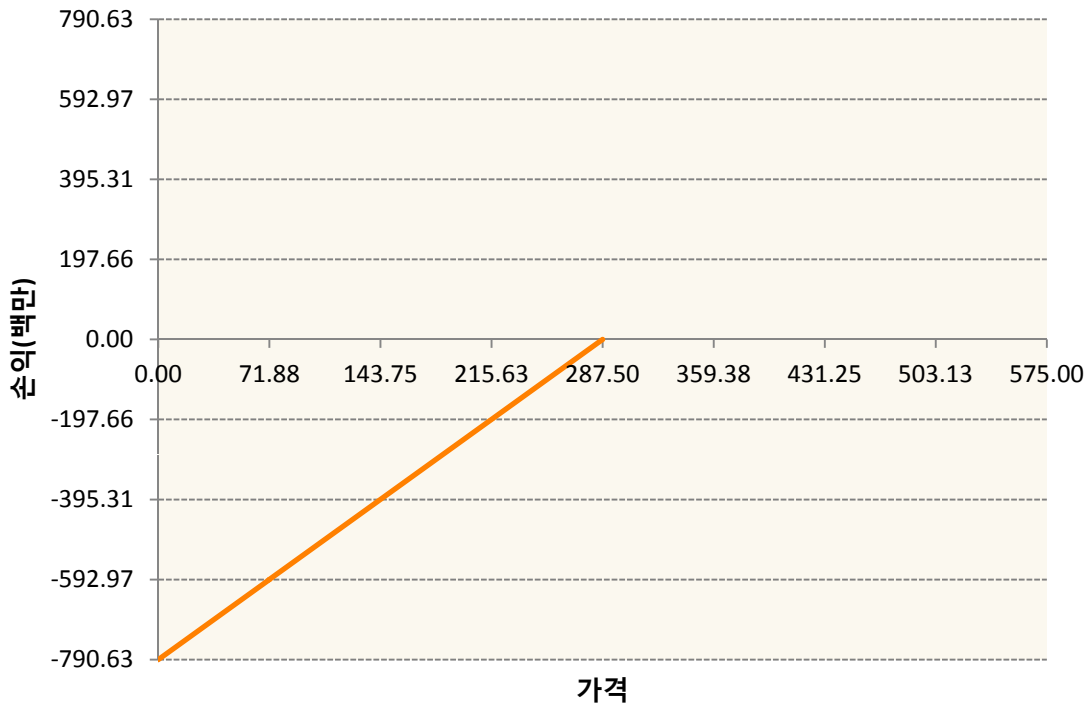


KR4301Q22859-2020-02 풋285





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%	39	39	39	39	39	39	39	
-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%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39	
8.00%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58	
KR4301Q22859		2020-02 풋285						162
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-161	-161	-161	-161	-161	-162	-162
-5.33%	-86	-87	-88	-89	-90	-91	-93
-2.67%	-24	-26	-29	-31	-33	-36	-38
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	11	10	10	9	9	8	7
5.33%	11	11	11	11	11	10	10
8.00%	11	11	11	11	11	11	11
KR4301Q22875 2020-02 풋287.5							50

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
-5.33%	-29	-29	-29	-29	-30	-30	-30
-2.67%	-10	-10	-11	-11	-12	-13	-13
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	5	5	4	4	4	4	3
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

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

(단위:백만원)

261

공시일	2020-02-05
기준일	2020-02-04

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	12,564	0	12,564	
누계	통화	선도	0	12,325	-12,325	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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
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	2020-02-05
기준일	2020-02-04

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

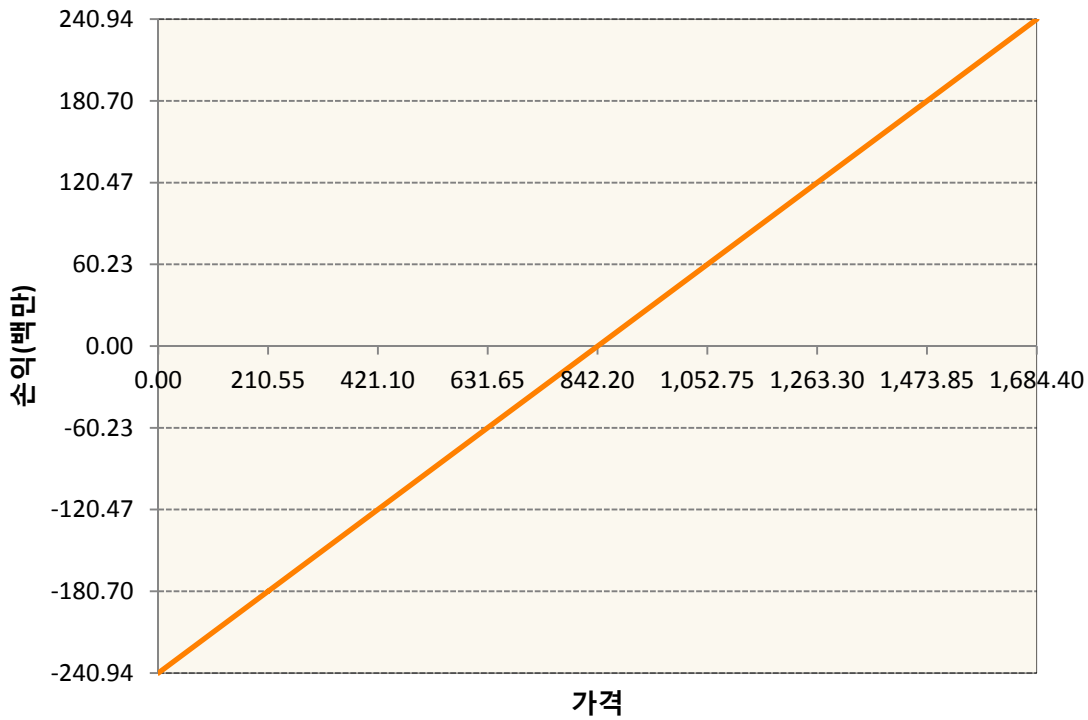
1. 계약금액

(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	241	0	241	
누계	유가증권	스왑	1,083	0	1,083	장외
누계	통화	선도	184	630	-446	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
FX21020G00 EUR/KRW 27-03-20E	9
VNCG0 VN30 Index Future Feb20	19

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

(단위:백만원)

102

공시일	2020-02-05
기준일	2020-02-04

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

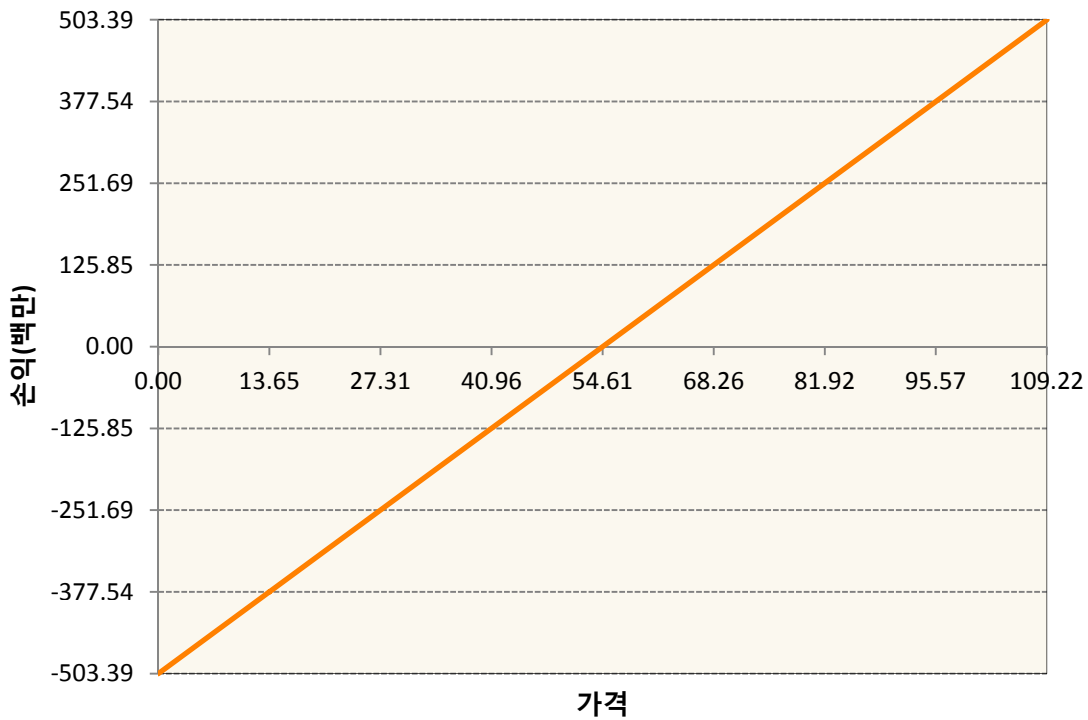
1. 계약금액

(단위:백만원)

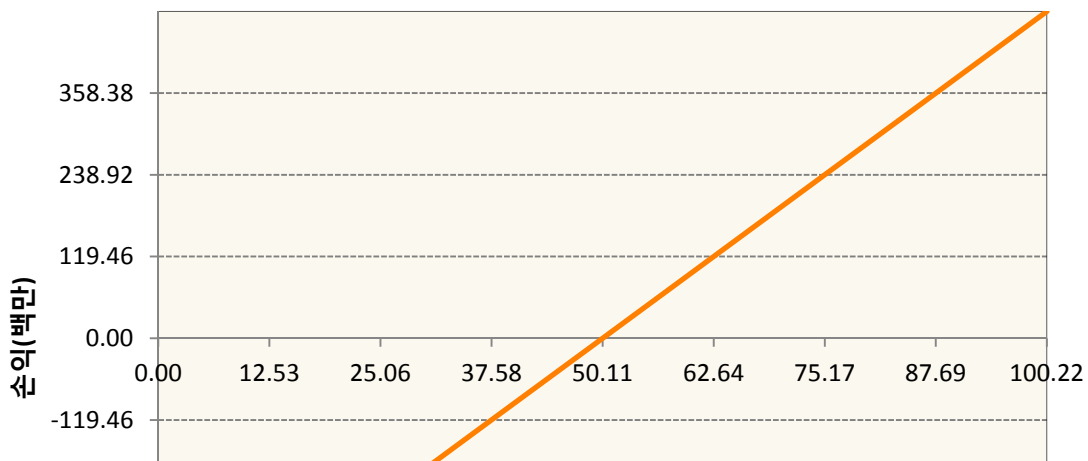
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,009	190	1,819	

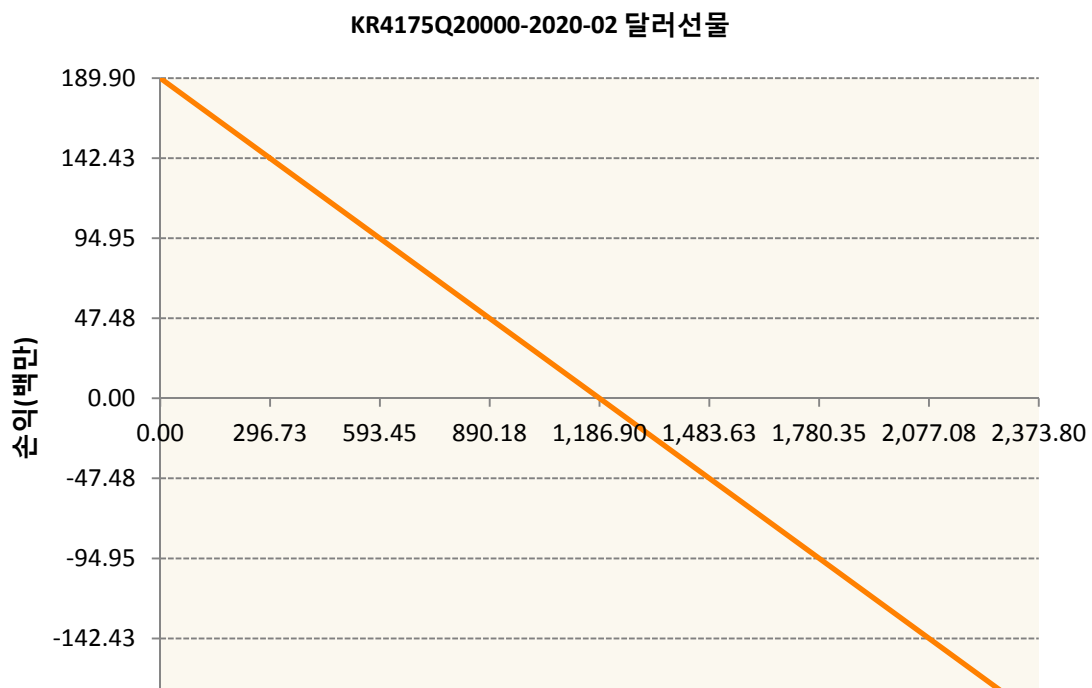
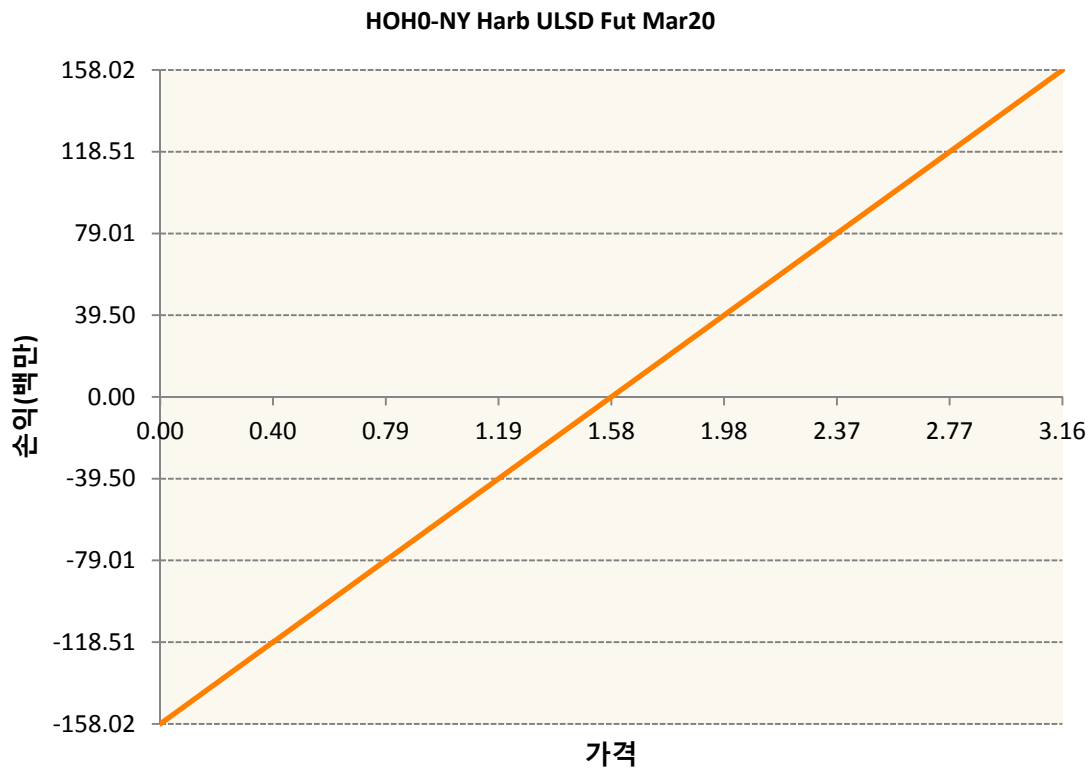
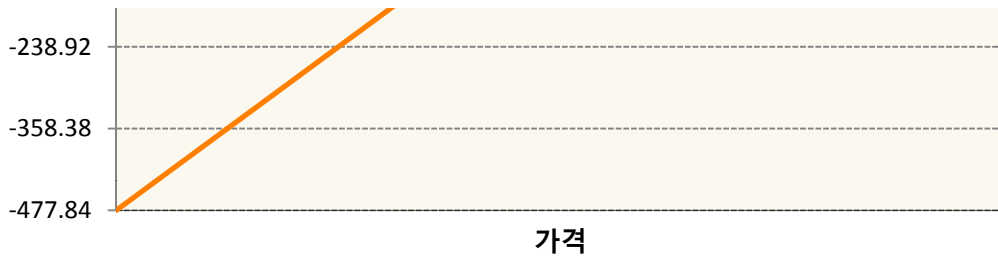
2. 만기시점의 손익구조

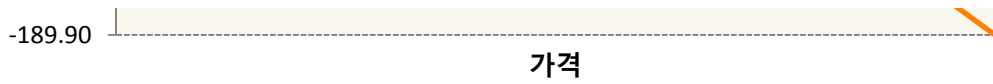
COKO-BRENT CRUDE FUTR May20



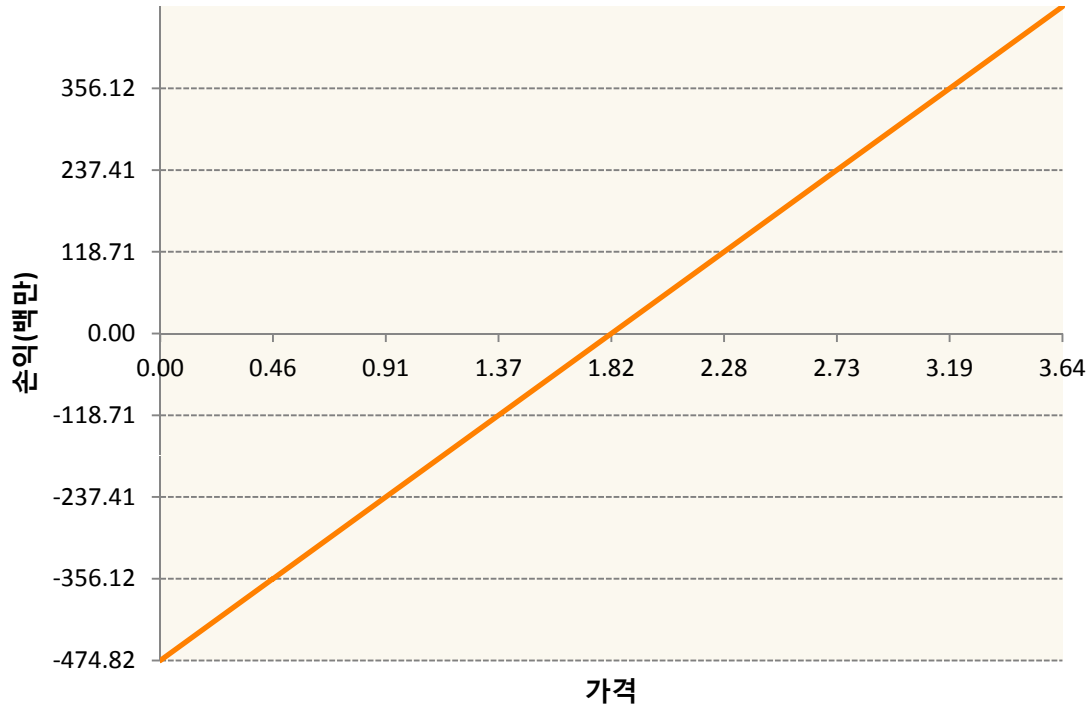
CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20



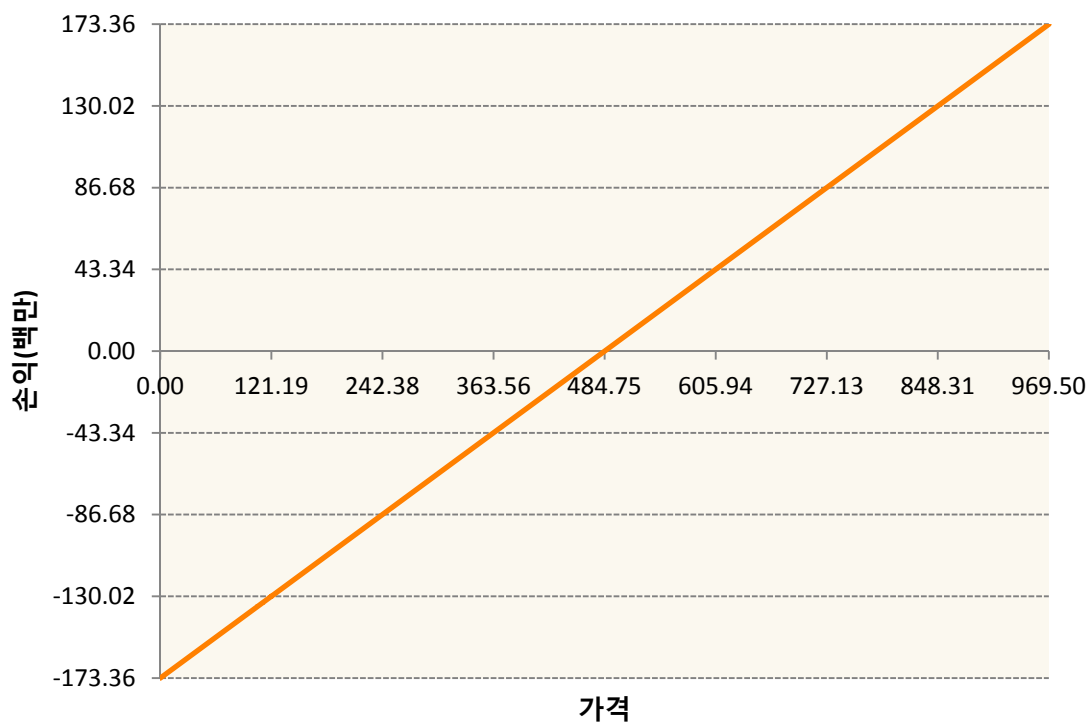




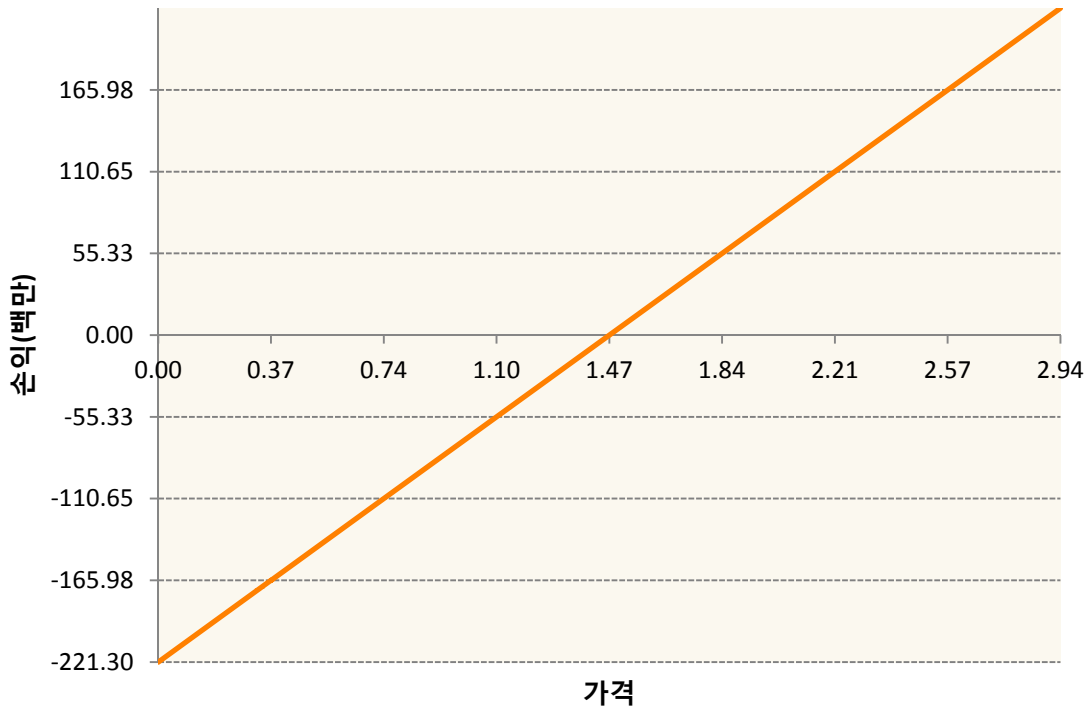
NGH20-NATURAL GAS FUTR Mar20



QSH0-Low Su Gasoil G Mar20



XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	40
CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	38
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)

315

공시일	2020-02-05
기준일	2020-02-04

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

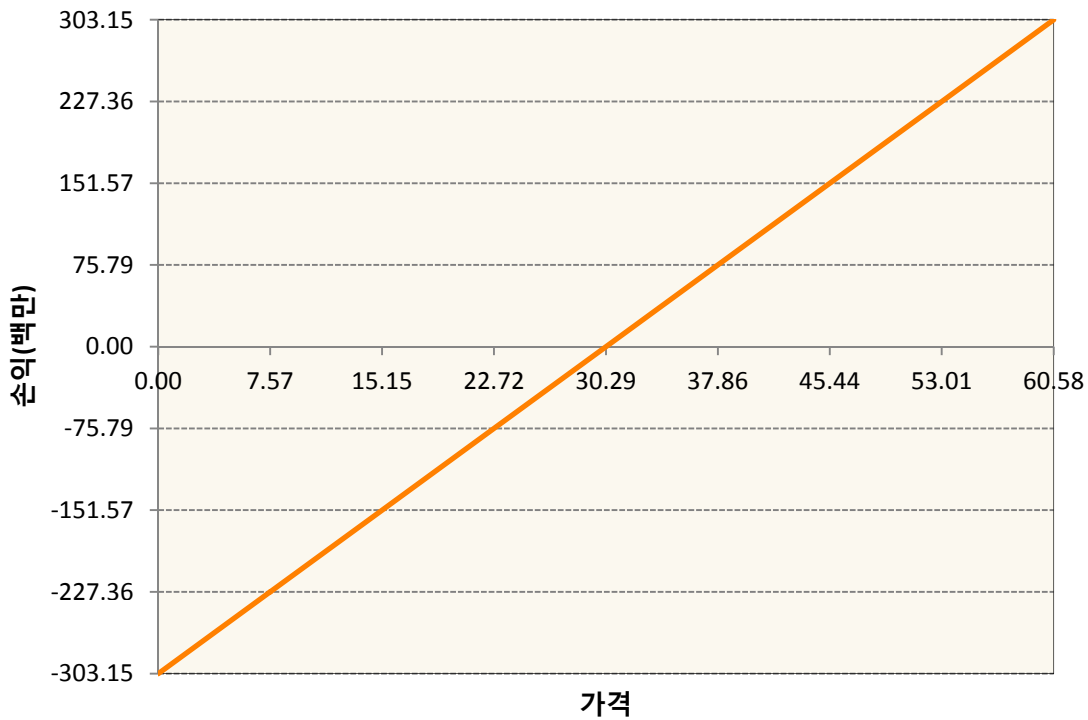
1. 계약금액

(단위:백만원)

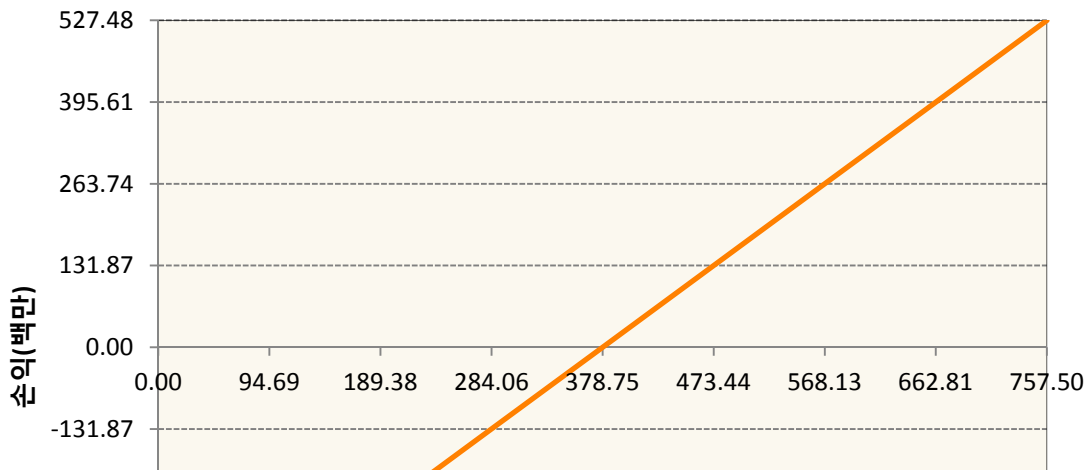
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,715	154	2,560	

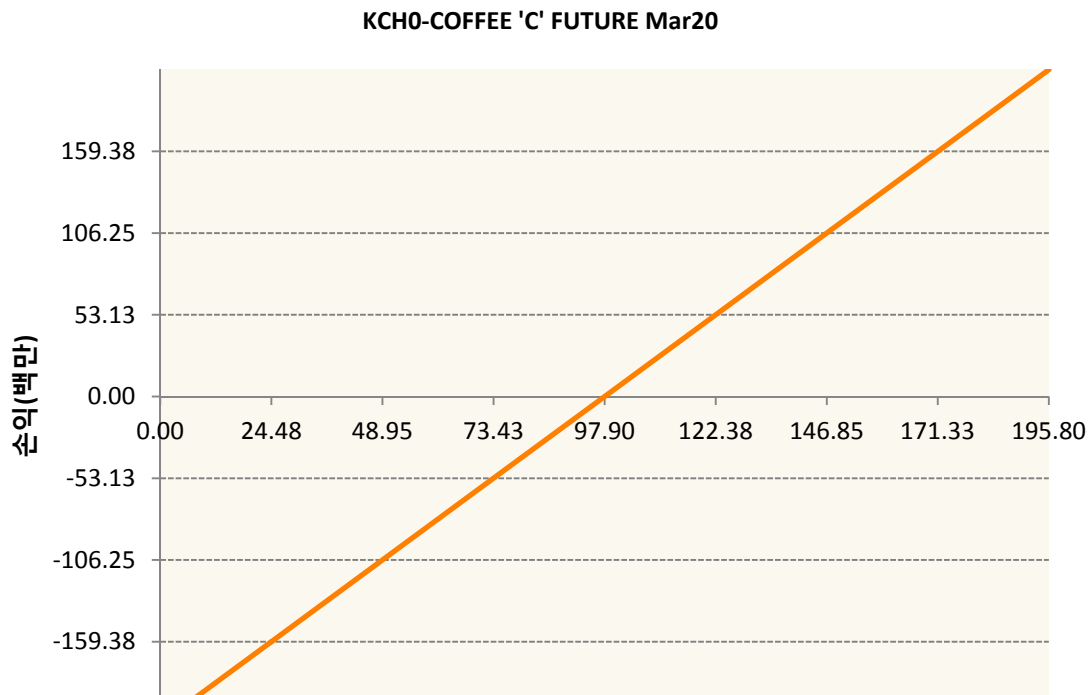
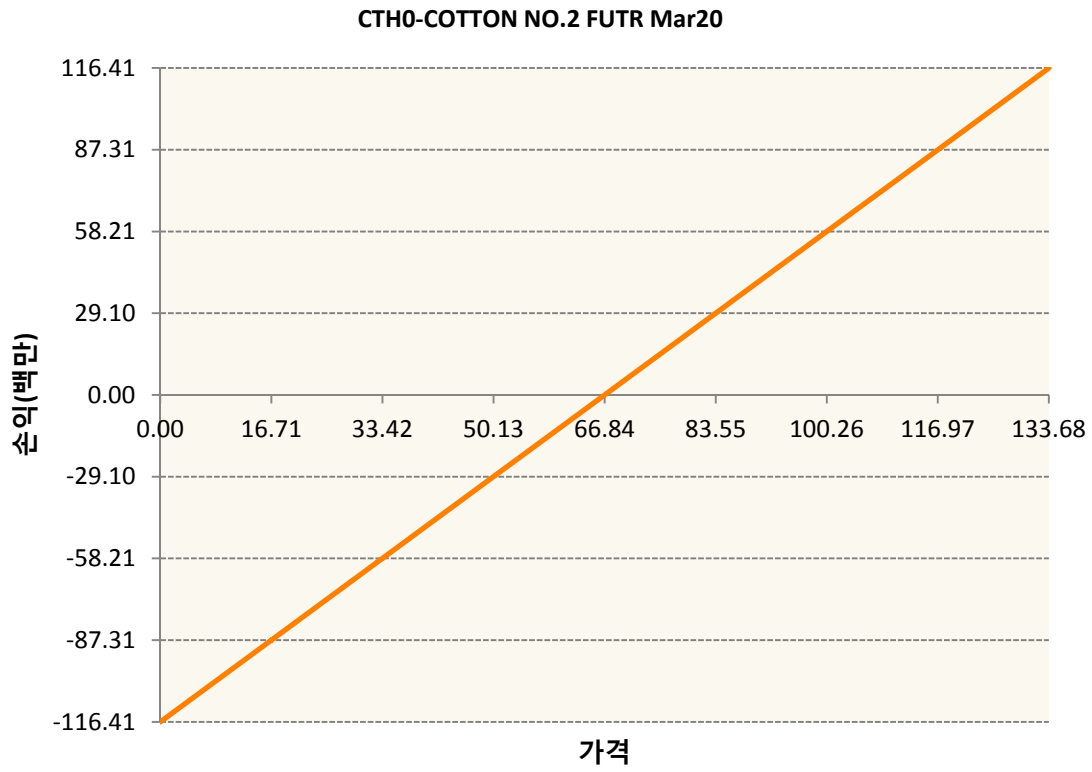
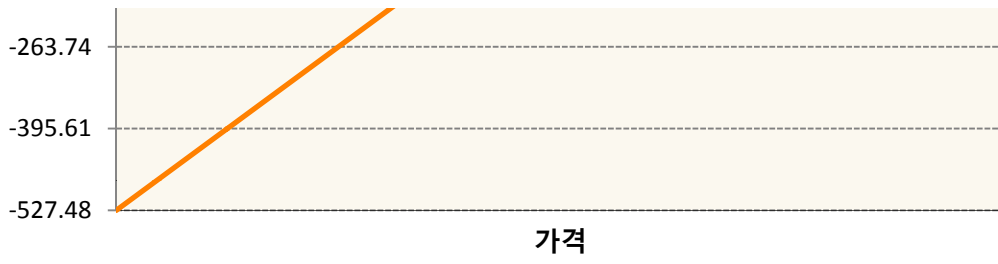
2. 만기시점의 손익구조

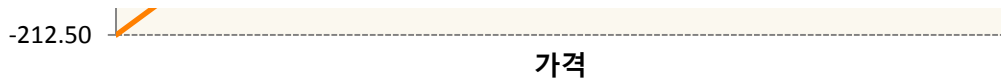
BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20



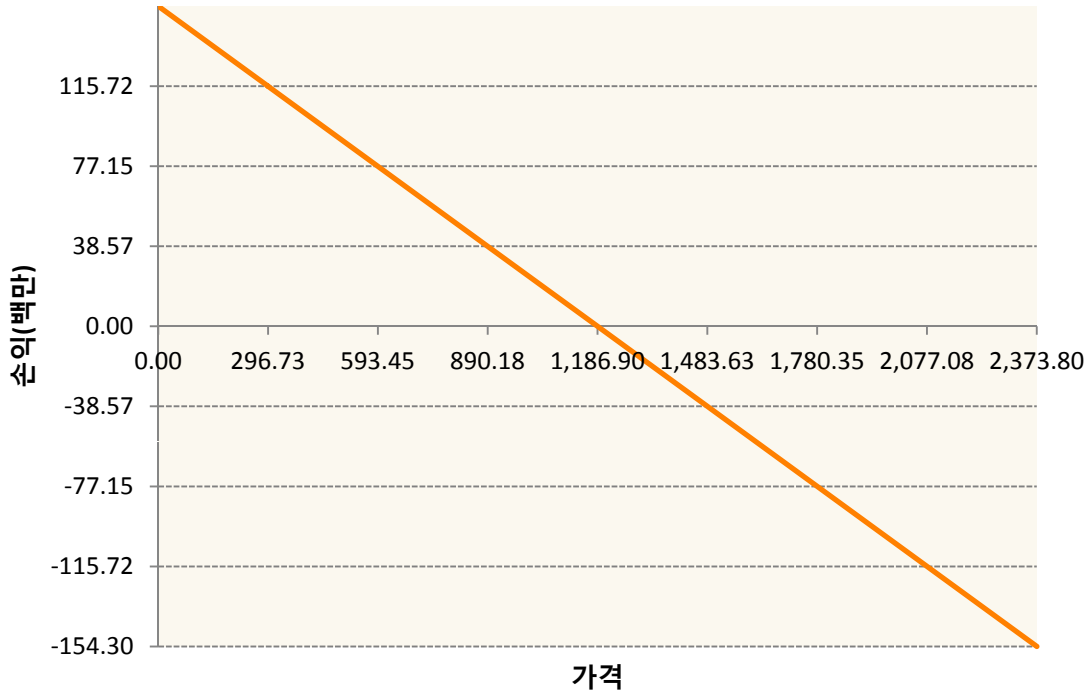
CH0-CORN FUTURE Mar20



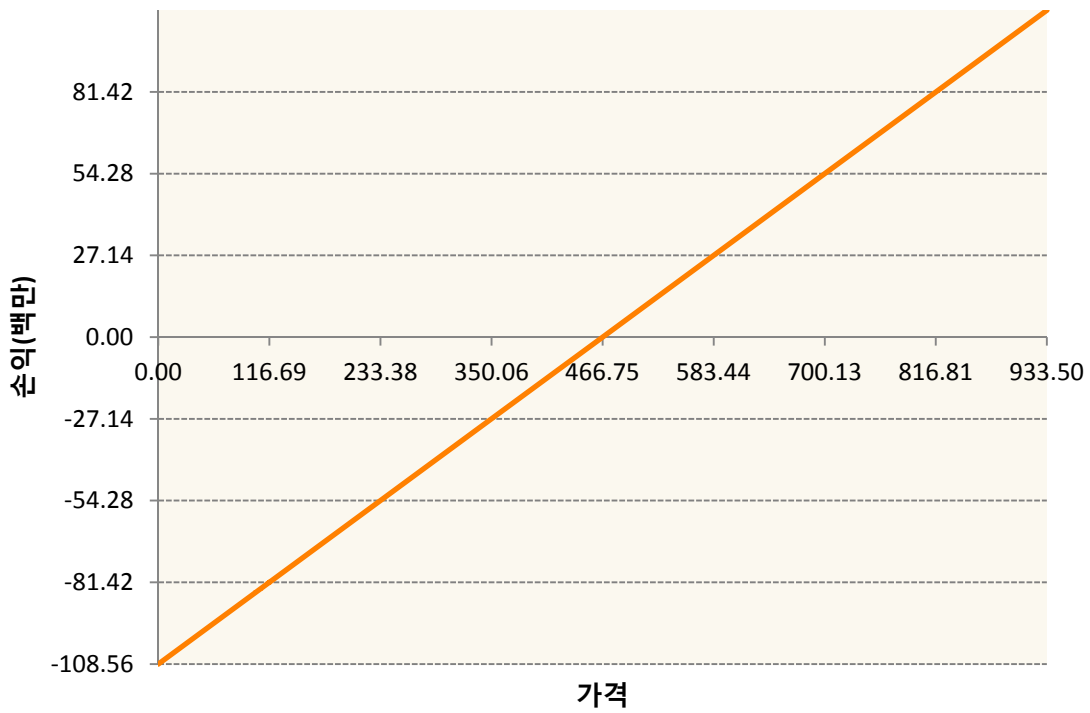




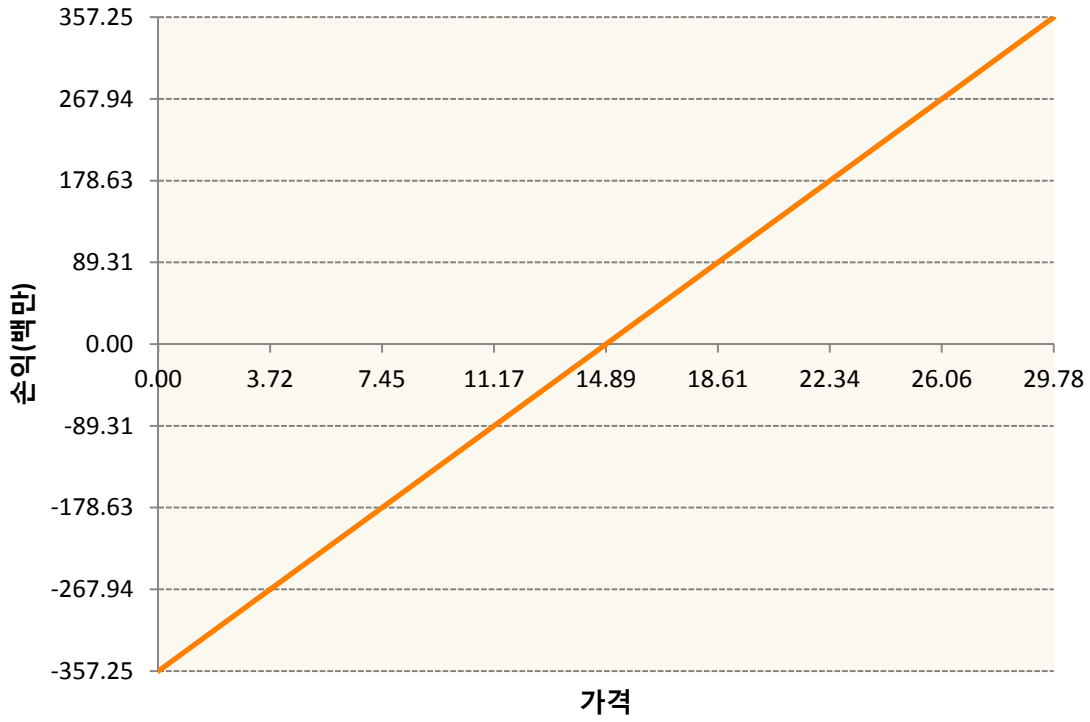
KR4175Q20000-2020-02 달러선물



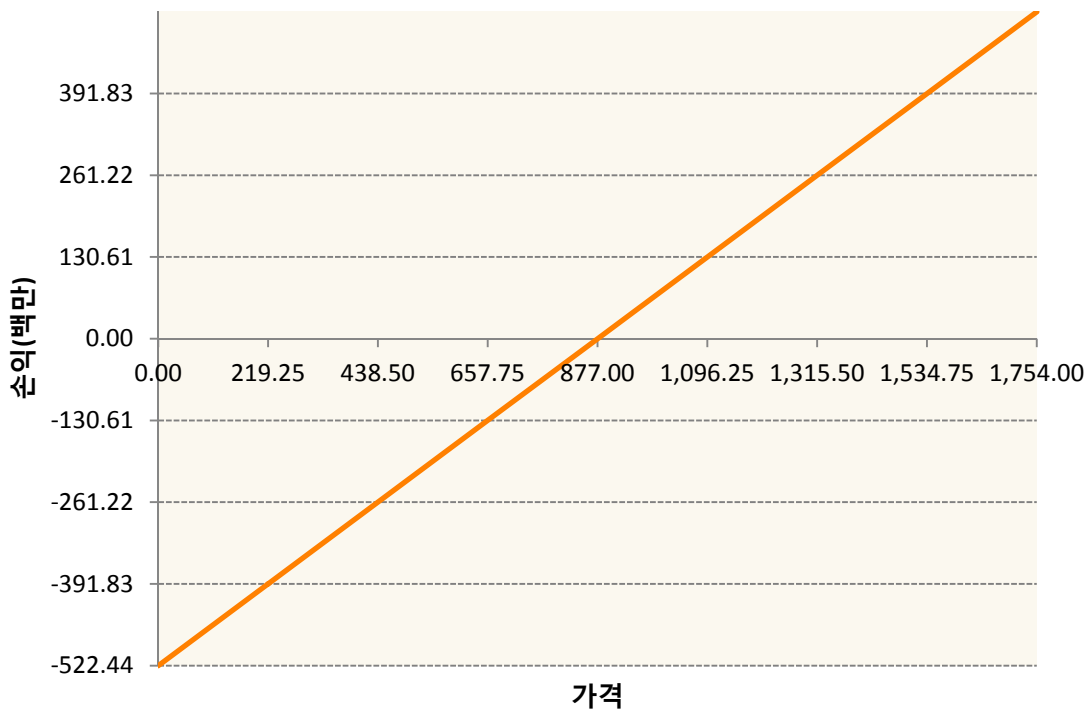
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

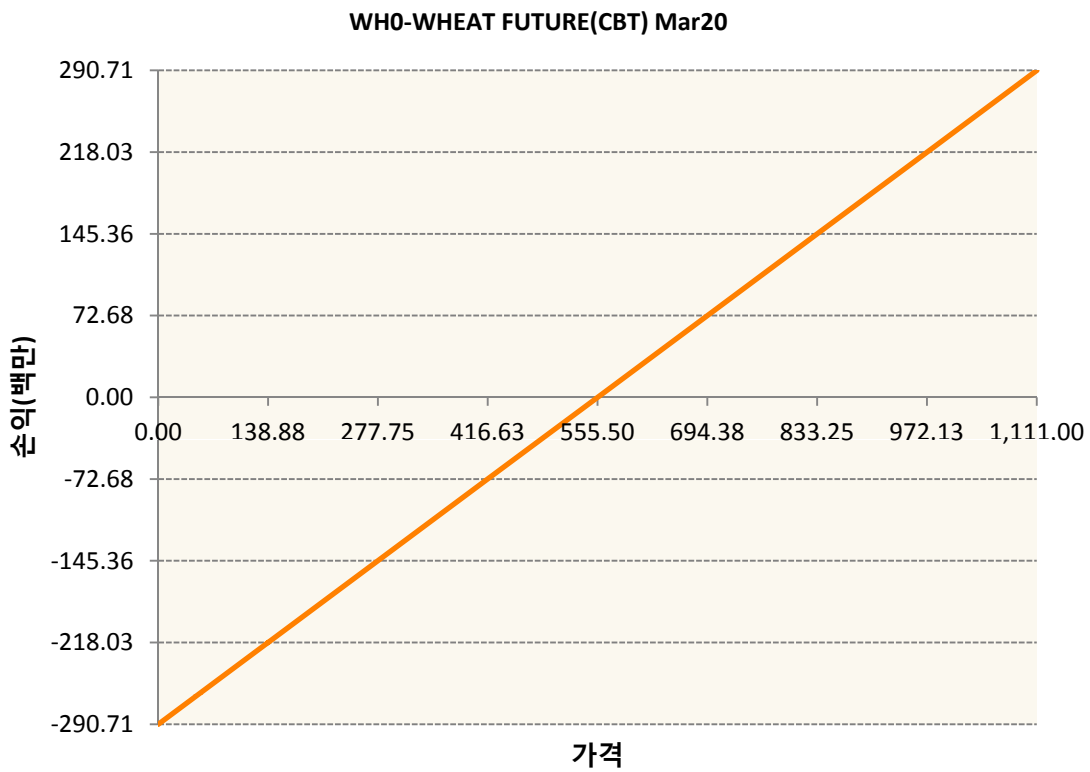
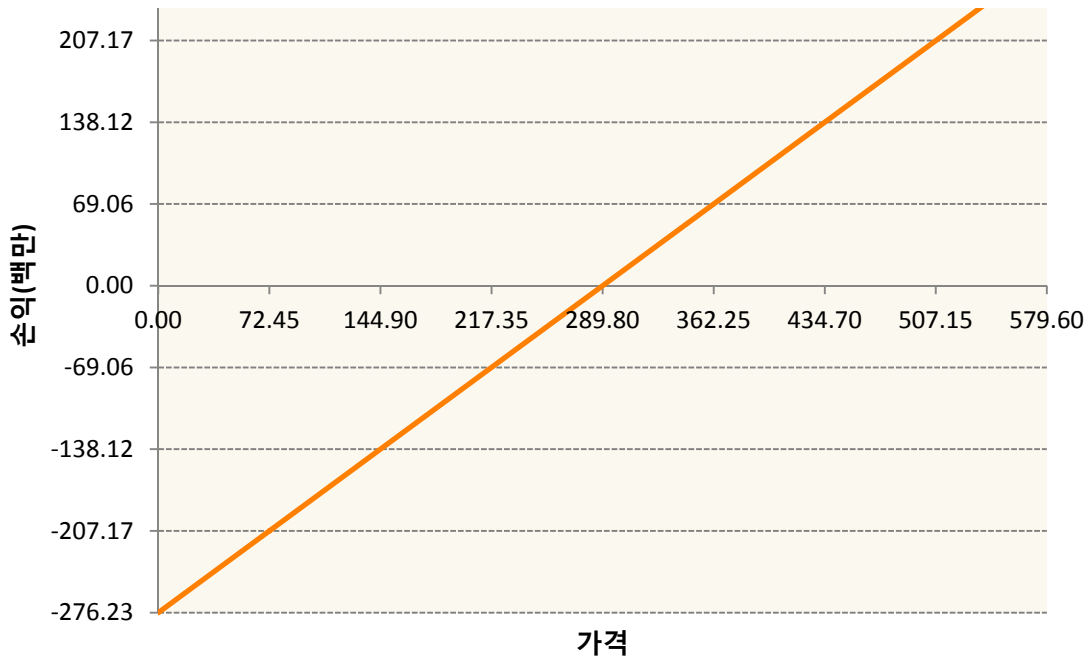


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20



SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





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	17
KR4175Q20C	2020-02 달러선물	12

KWH0	KC HRW WHEAT FUT Mar20	9
SBH0	Sugar Mar20	29
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)

235