

공시일	2020-02-06
기준일	2020-02-05

## 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



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

(단위:백만원)

14

공시일	2020-02-06
기준일	2020-02-05

## 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

1,142

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

663

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-06
기준일	2020-02-05

## 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)	396
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	145

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

**831**

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-06
기준일	2020-02-05

## 유로인덱스모(주식-파생형)

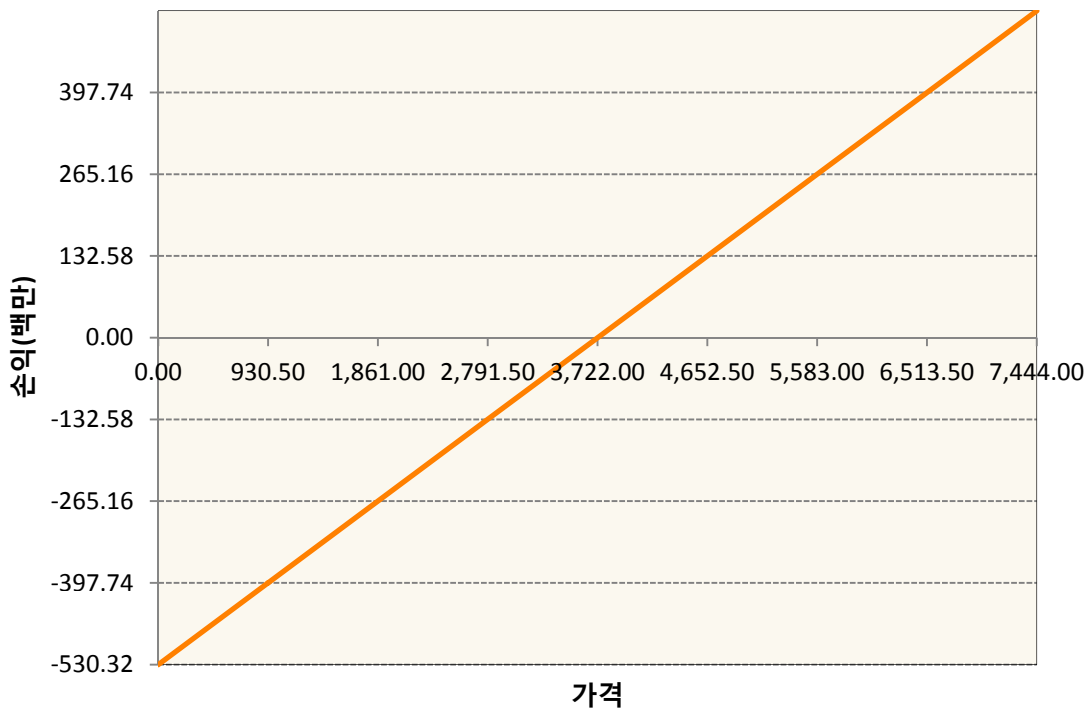
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	530	0	530	

### 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	2020-02-06
기준일	2020-02-05

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

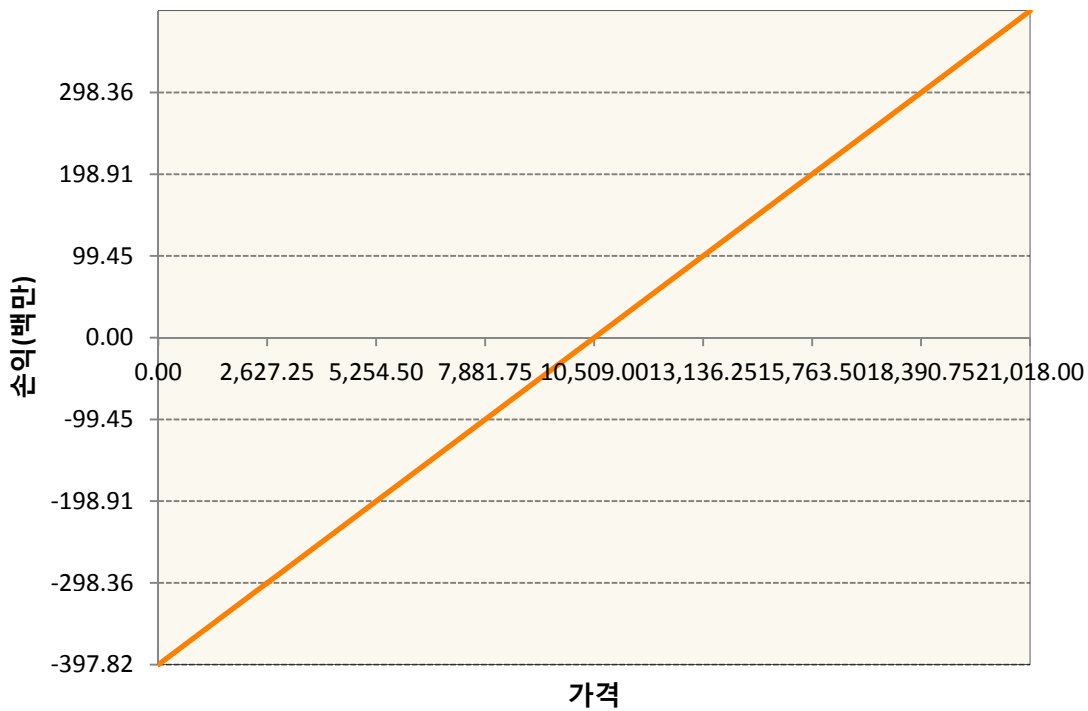
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	398	0	398	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	2020-02-06
기준일	2020-02-05

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

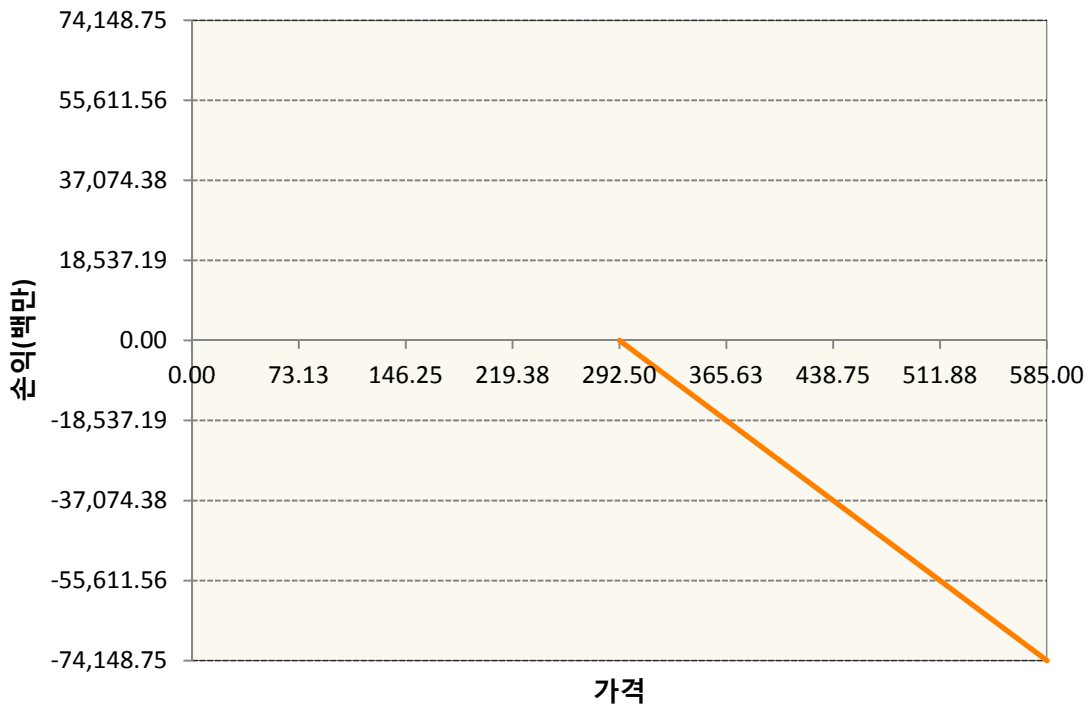
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

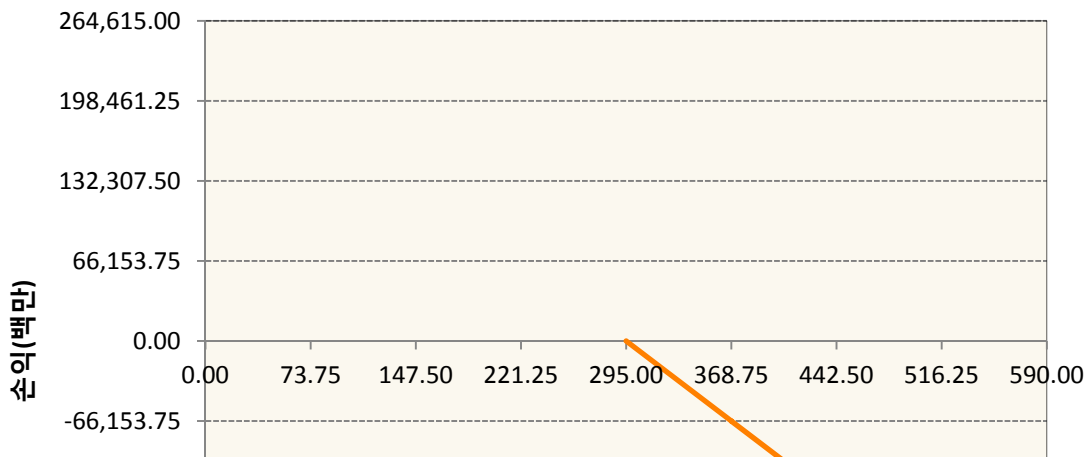
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	455,004	-455,004	장내

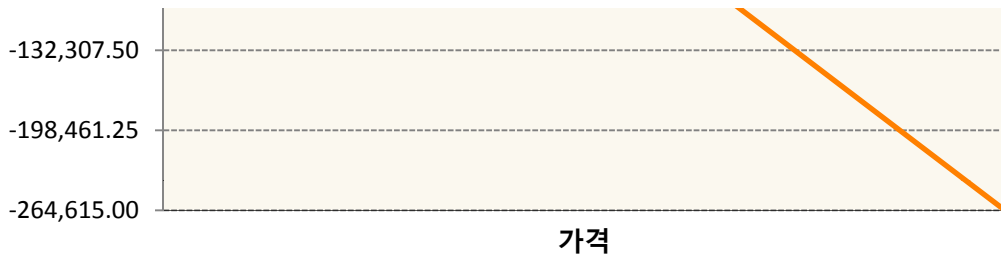
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q22927-2020-02 콜292.5

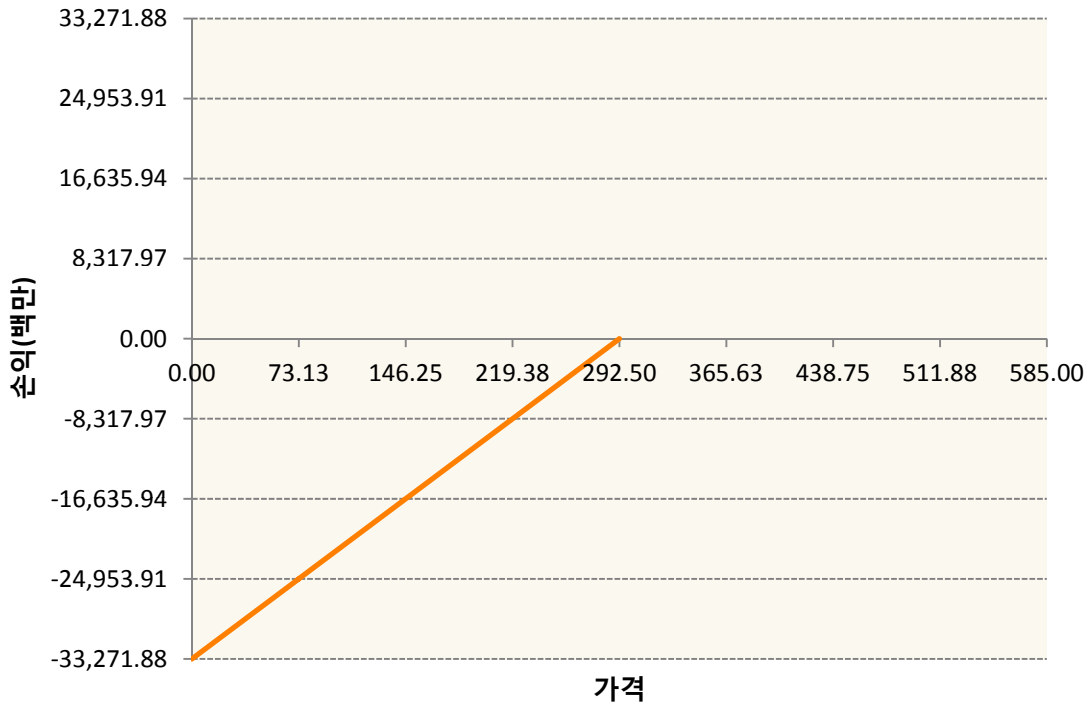


KR4201Q22950-2020-02 콜295

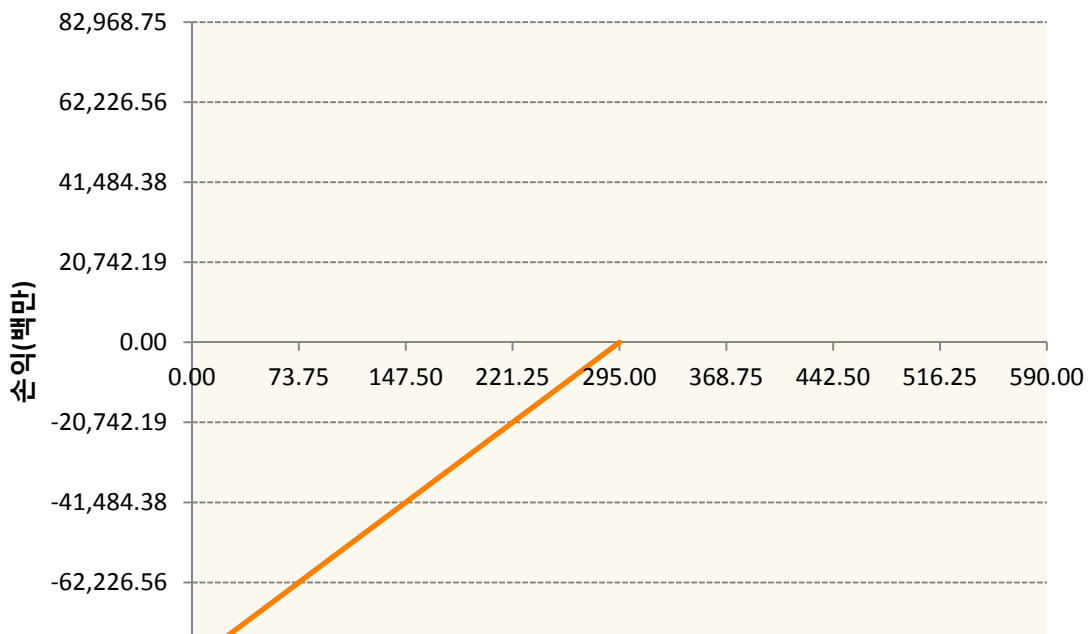




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



KR4301Q22958-2020-02 풋295



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q22927		2020-02 콜292.5						4,696
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,283	1,276	1,265	1,248	1,226	1,199	1,166	
-5.33%	1,237	1,204	1,164	1,116	1,062	1,002	937	
-2.67%	1,006	925	840	750	657	562	465	
0%	338	225	113	0	-113	-225	-338	
2.67%	-913	-1,004	-1,099	-1,196	-1,296	-1,398	-1,501	
5.33%	-2,611	-2,656	-2,708	-2,768	-2,835	-2,906	-2,983	
8.00%	-4,514	-4,528	-4,548	-4,575	-4,609	-4,649	-4,696	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						15,610
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,565	3,552	3,527	3,487	3,431	3,358	3,266	
-5.33%	3,476	3,398	3,294	3,164	3,011	2,836	2,641	
-2.67%	2,946	2,714	2,458	2,183	1,892	1,588	1,274	
0%	1,162	777	390	0	-391	-784	-1,177	
2.67%	-2,609	-2,977	-3,351	-3,730	-4,114	-4,500	-4,889	
5.33%	-8,192	-8,404	-8,642	-8,904	-9,184	-9,480	-9,789	
8.00%	-14,762	-14,838	-14,942	-15,073	-15,230	-15,409	-15,610	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						2,335
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,333	-2,333	-2,333	-2,333	-2,333	-2,334	-2,335	
-5.33%	-1,448	-1,449	-1,450	-1,453	-1,456	-1,461	-1,467	
-2.67%	-584	-595	-608	-624	-640	-659	-678	
0%	88	58	29	0	-29	-59	-88	
2.67%	347	332	315	296	276	255	233	
5.33%	381	379	376	372	366	359	350	
8.00%	382	382	382	381	381	379	377	
KR4301Q22958		2020-02 풋295						6,055
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-6,053	-6,053	-6,053	-6,054	-6,054	-6,054	-6,055	
-5.33%	-3,864	-3,865	-3,866	-3,869	-3,874	-3,880	-3,889	
-2.67%	-1,694	-1,709	-1,729	-1,753	-1,782	-1,815	-1,851	
0%	198	133	67	0	-68	-137	-206	
2.67%	1,164	1,109	1,051	991	928	865	800	

5.33%	1,351	1,341	1,326	1,306	1,282	1,254	1,222
8.00%	1,362	1,362	1,360	1,358	1,354	1,348	1,339

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

(단위:백만원)

**31,014**

공시일	2020-02-06
기준일	2020-02-05

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

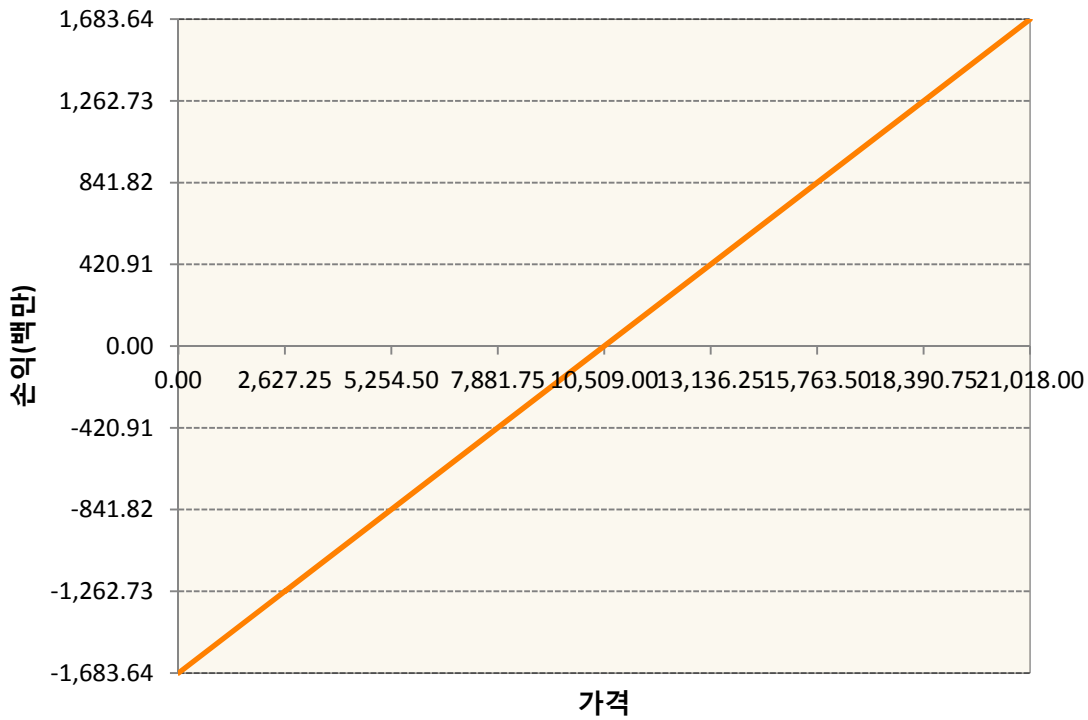
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

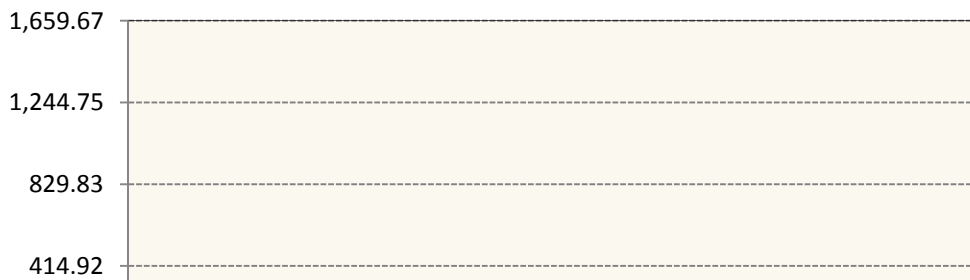
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,684	0	1,684	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,596	-4,596	장내
누계	통화	선도	0	2,161	-2,161	장외

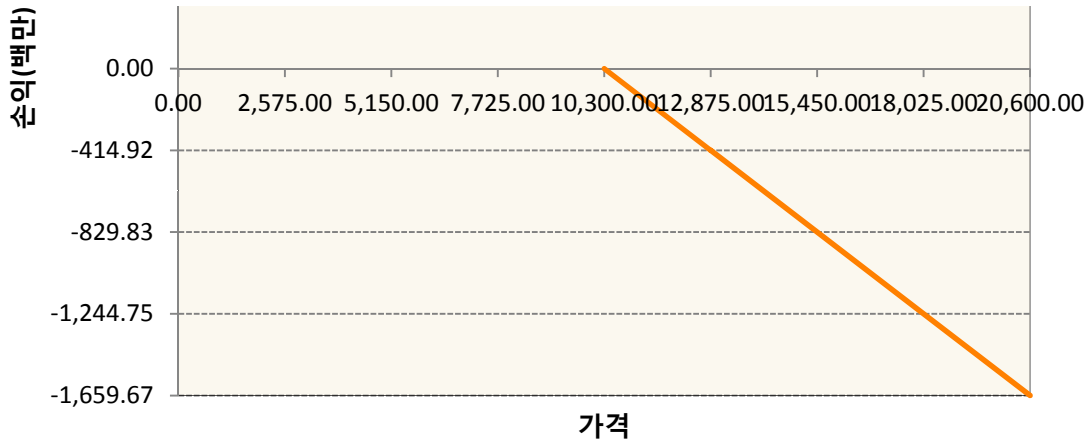
### 2. 만기시점의 손익구조

HCG0-HSCEI Futures Feb20

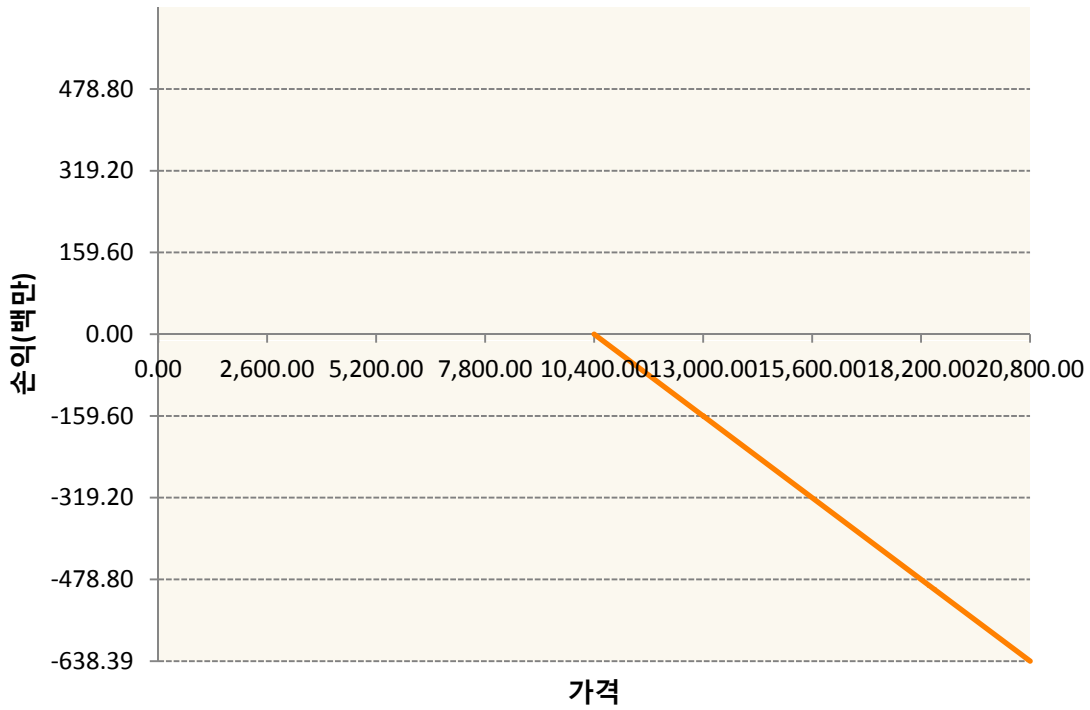


OHHIG0-C103-HSCEI

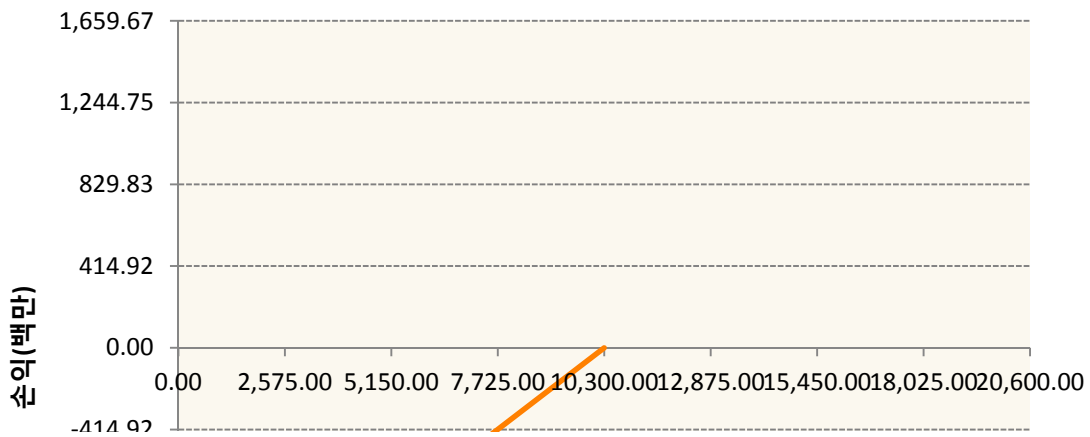


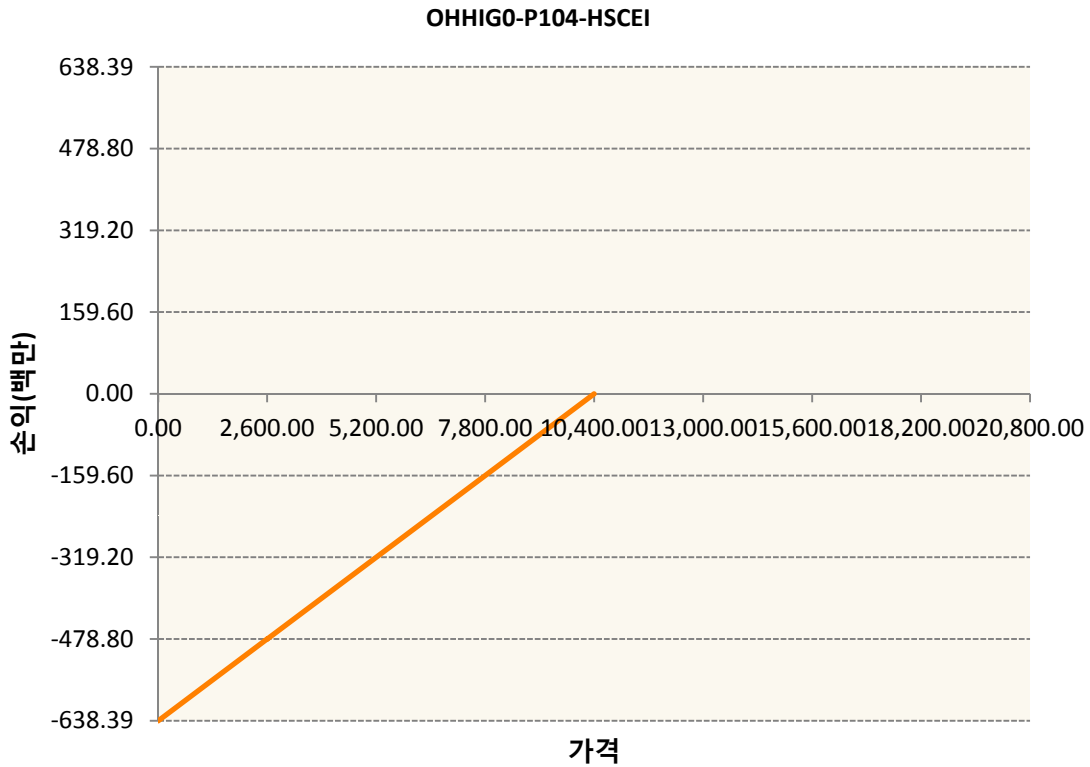


OHHIG0-C104-HSCEI



OHHIG0-P103-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	173
HCG0 HSCEI Futures Feb20	135
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)
	514

공시일	2020-02-06
기준일	2020-02-05

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

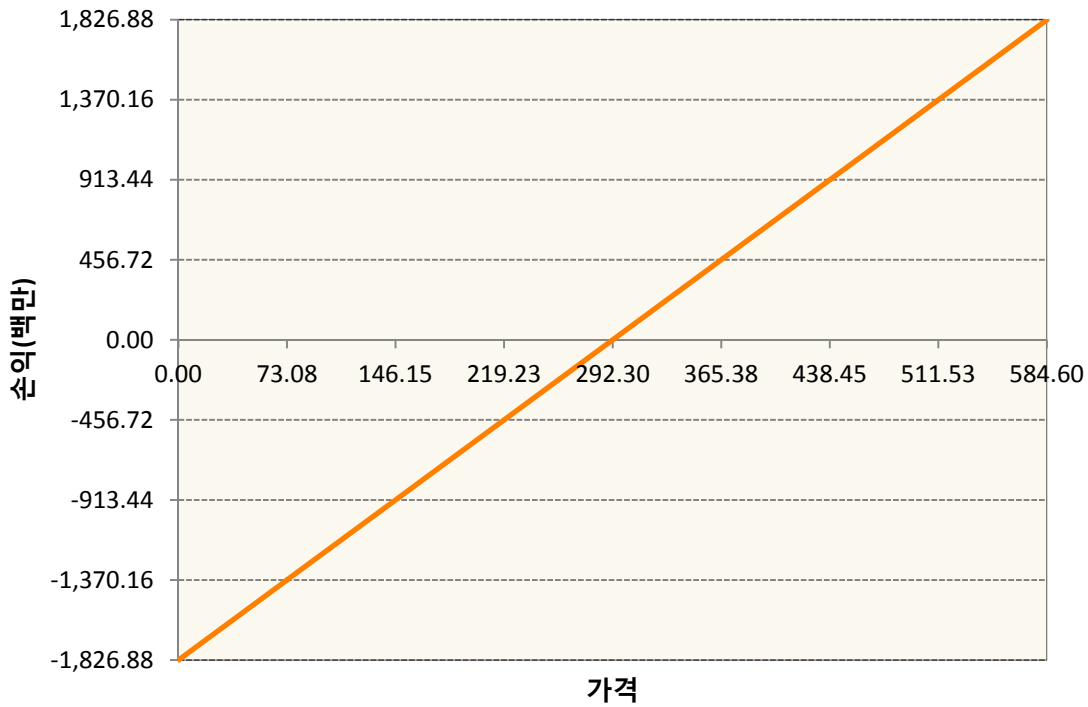
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

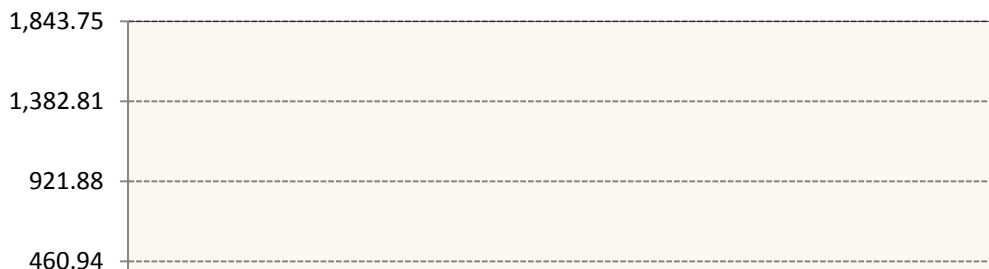
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,827	0	1,827	장내
누계	유가증권	스왑	3,625	0	3,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,608	-3,608	장내

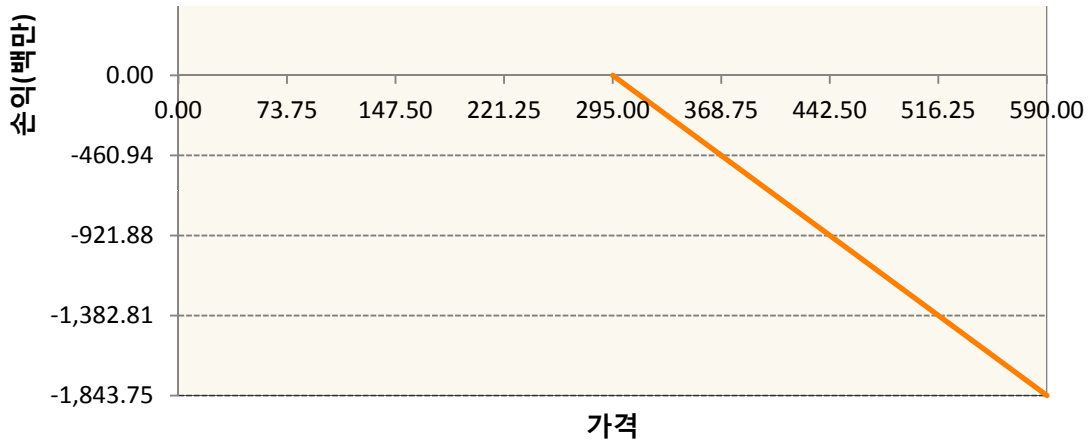
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

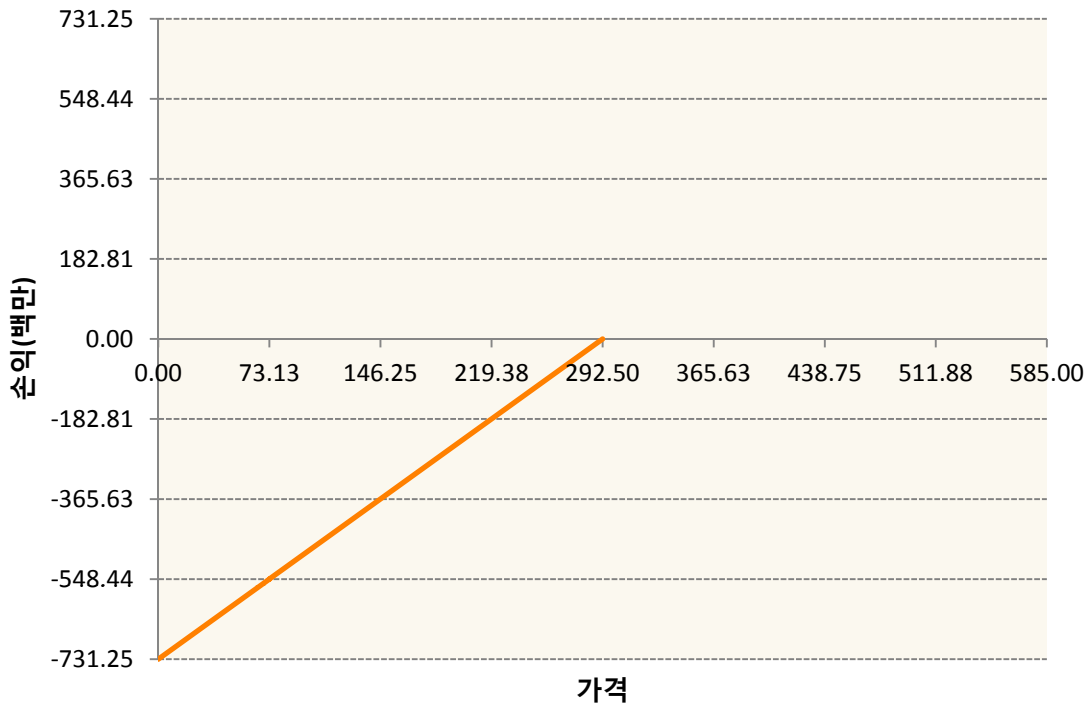


KR4201Q22950-2020-02 콜295

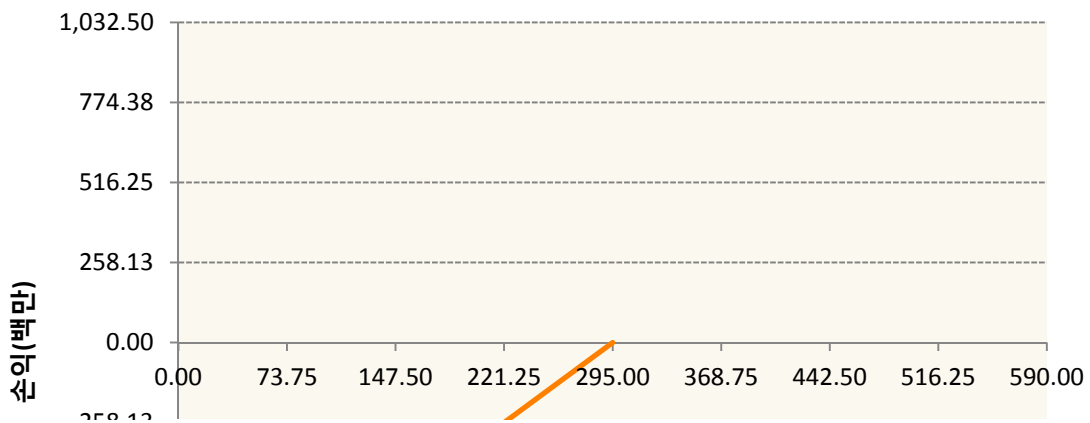




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



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						146
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-146	-146	-146	-146	-146	-146	-146	
-5.33%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97	
-2.67%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	49	49	49	49	49	49	49	
5.33%	97	97	97	97	97	97	97	
8.00%	146	146	146	146	146	146	146	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						109
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	25	25	25	24	24	23	23	
-5.33%	24	24	23	22	21	20	18	
-2.67%	21	19	17	15	13	11	9	
0%	8	5	3	0	-3	-5	-8	
2.67%	-18	-21	-23	-26	-29	-31	-34	
5.33%	-57	-59	-60	-62	-64	-66	-68	
8.00%	-103	-103	-104	-105	-106	-107	-109	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						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%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
-2.67%	-13	-13	-13	-14	-14	-14	-15
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	8	7	7	7	6	6	5
5.33%	8	8	8	8	8	8	8
8.00%	8	8	8	8	8	8	8
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	-48	-48	-48	-48	-48
-2.67%	-21	-21	-22	-22	-22	-23	-23
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	14	14	13	12	12	11	10
5.33%	17	17	16	16	16	16	15
8.00%	17	17	17	17	17	17	17

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

(단위:백만원)

**694**

공시일	2020-02-06
기준일	2020-02-05

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

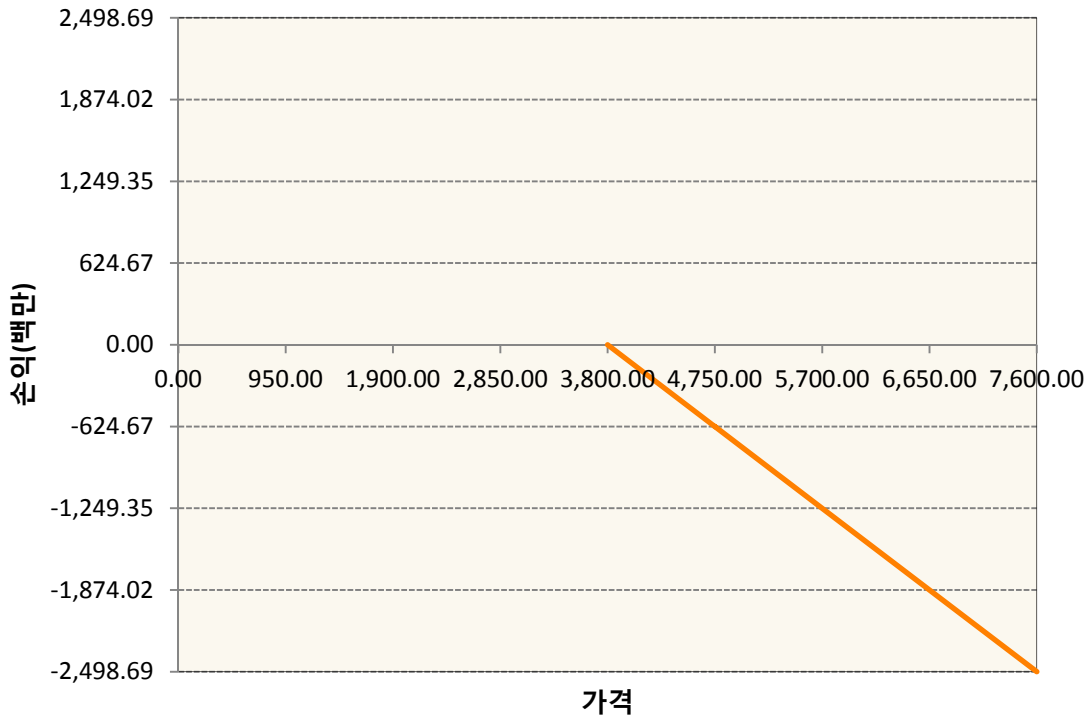
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

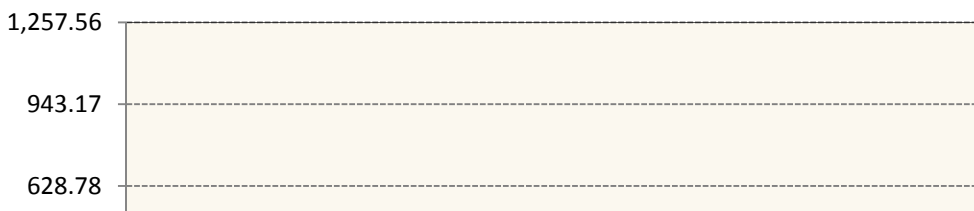
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	576	0	576	
누계	유가증권	스왑	13,742	0	13,742	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,513	-7,513	장내
누계	통화	선도	0	3,451	-3,451	장외

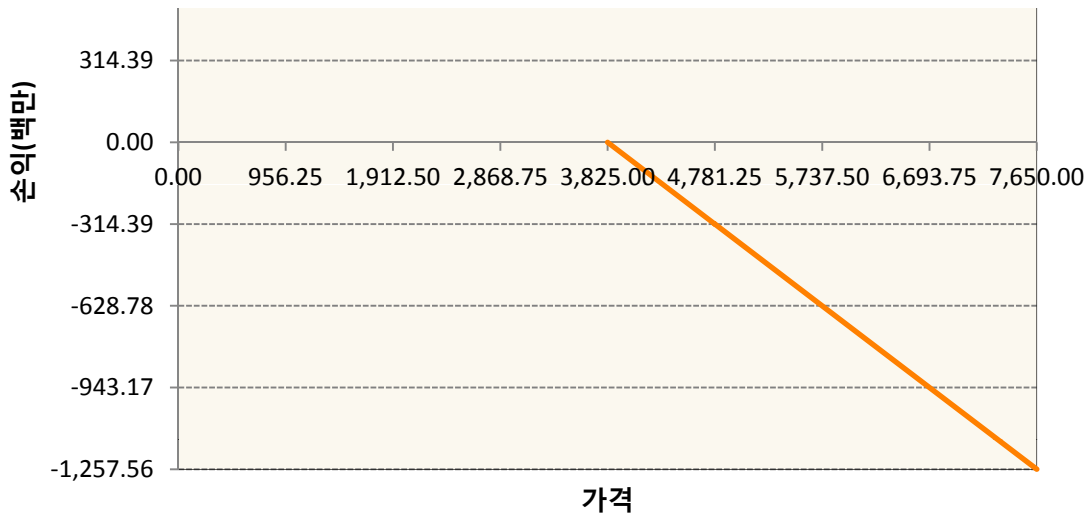
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXG0-C3800-EURO STOXX 50**

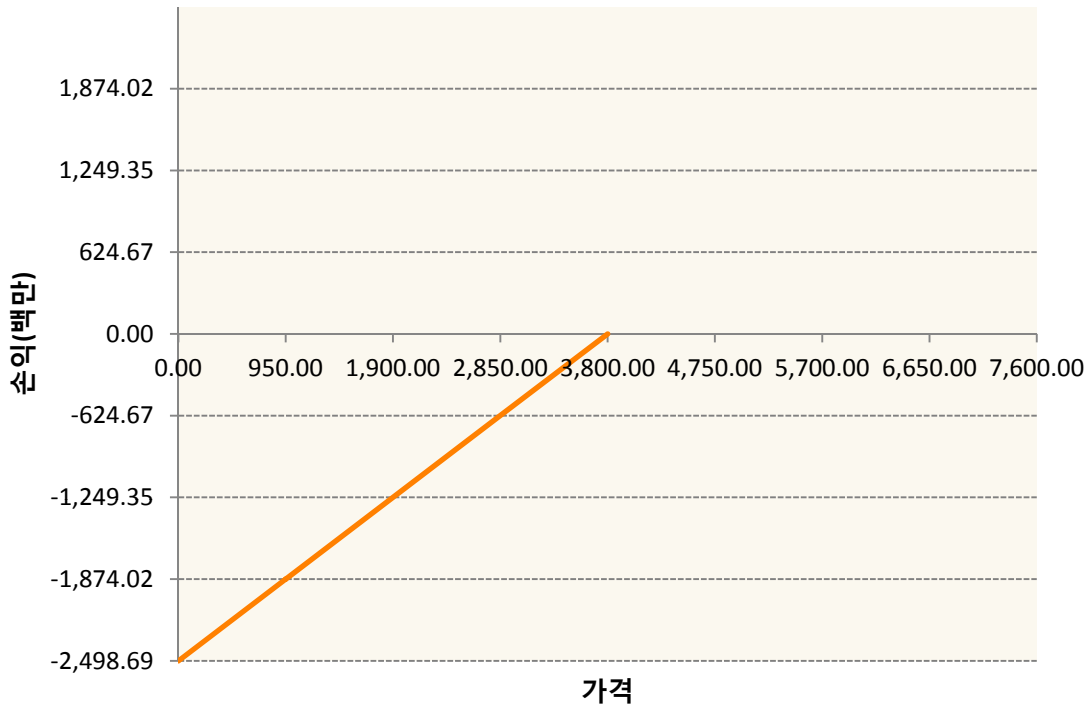


**OESXG0-C3825-EURO STOXX 50**

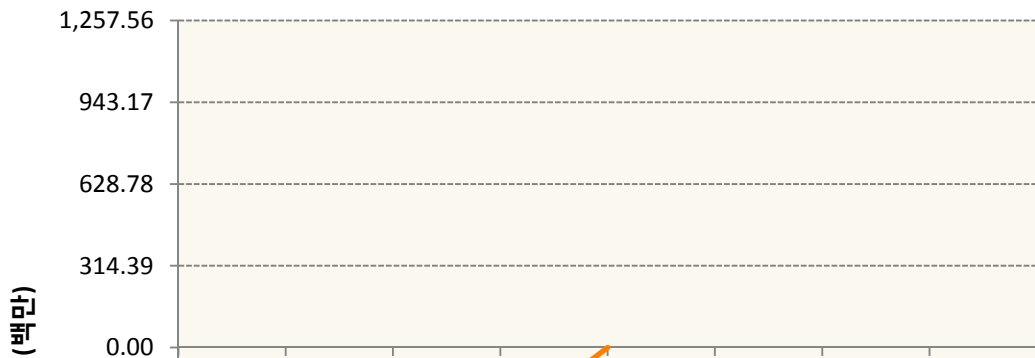


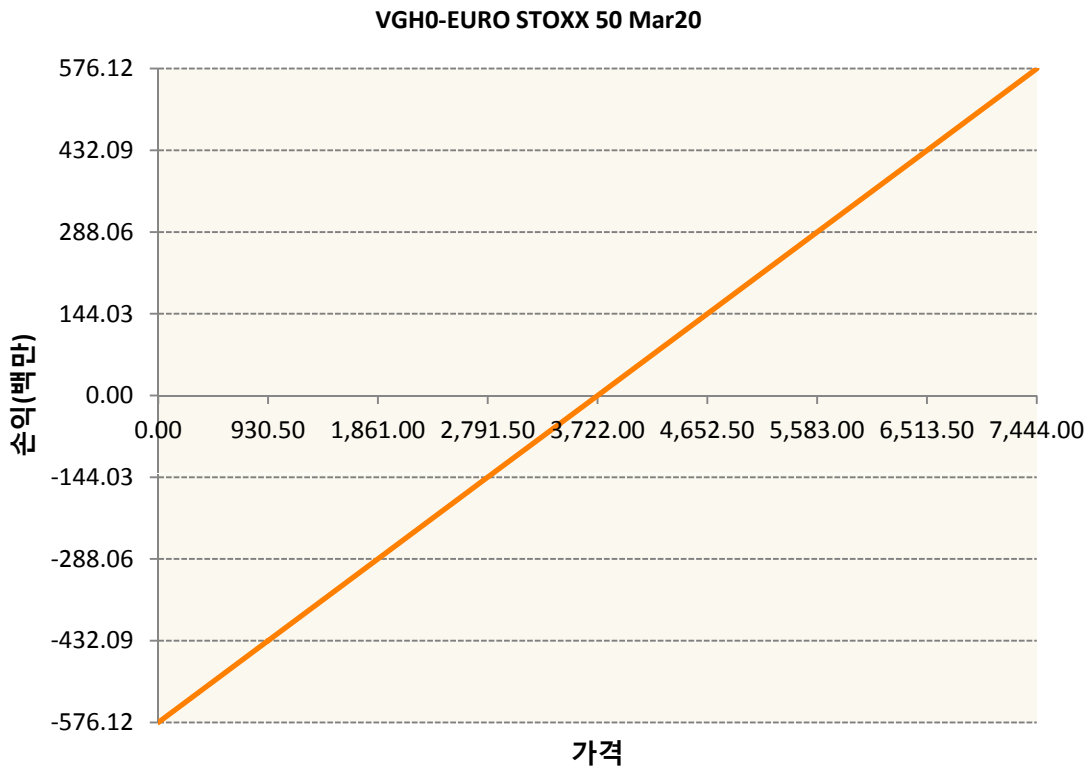
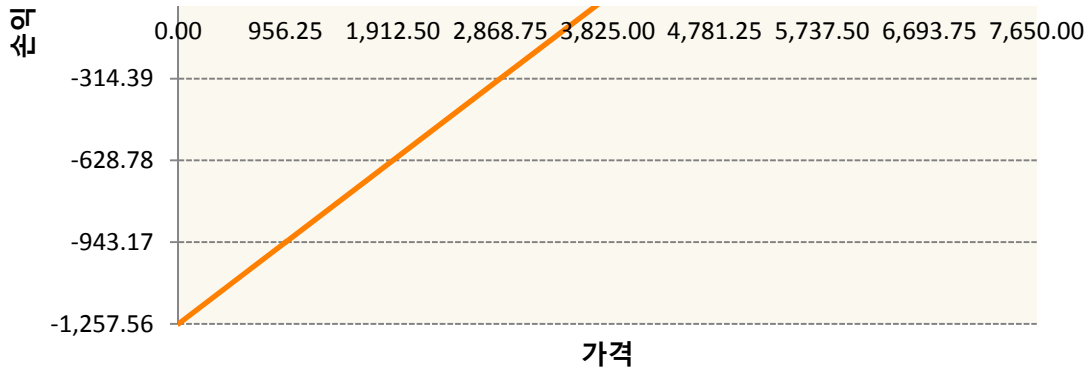


OESXG0-P3800-EURO STOXX 50



OESXG0-P3825-EURO STOXX 50





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)**

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	12
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	276
OESXG0-C3& EURO STOXX 50	200
OESXG0-C3& EURO STOXX 50	101
OESXG0-P3& EURO STOXX 50	200
OESXG0-P3& EURO STOXX 50	101
VGHO EURO STOXX 50 Mar20	46

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





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

(단위:백만원)

912



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

(단위:백만원)

80



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

(단위:백만원)

118



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

(단위:백만원)

43

공시일	2020-02-06
기준일	2020-02-05

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

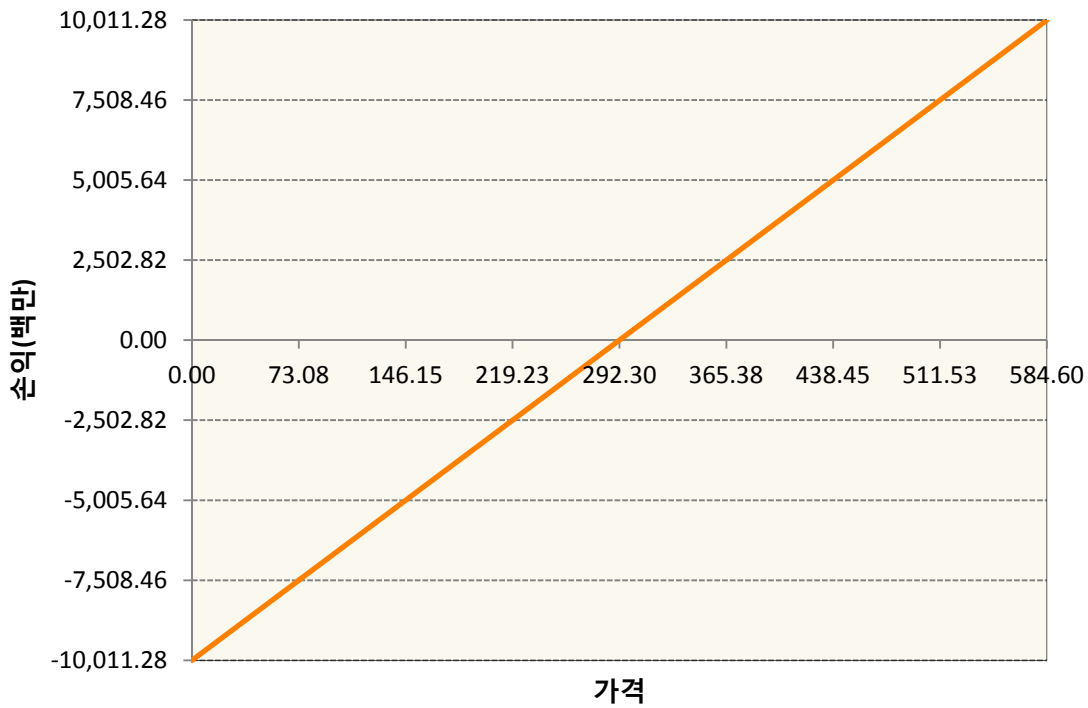
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

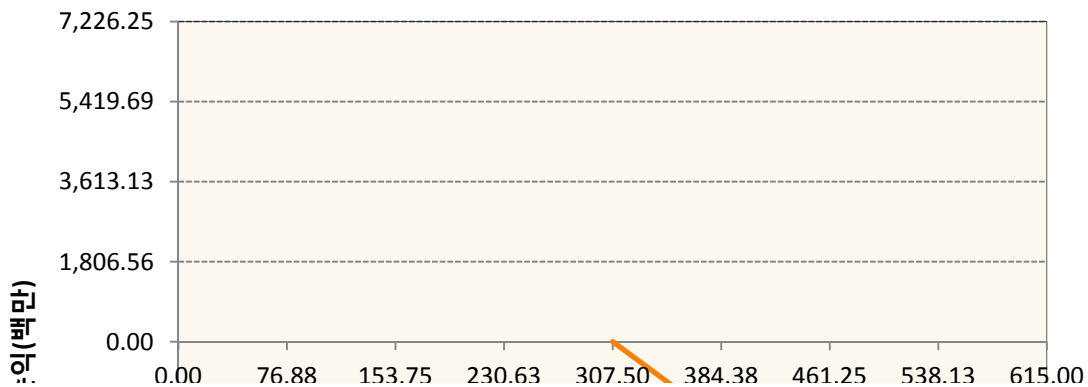
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,011	0	10,011	장내
누계	유가증권	옵션	2,944	20,711	-17,768	장내

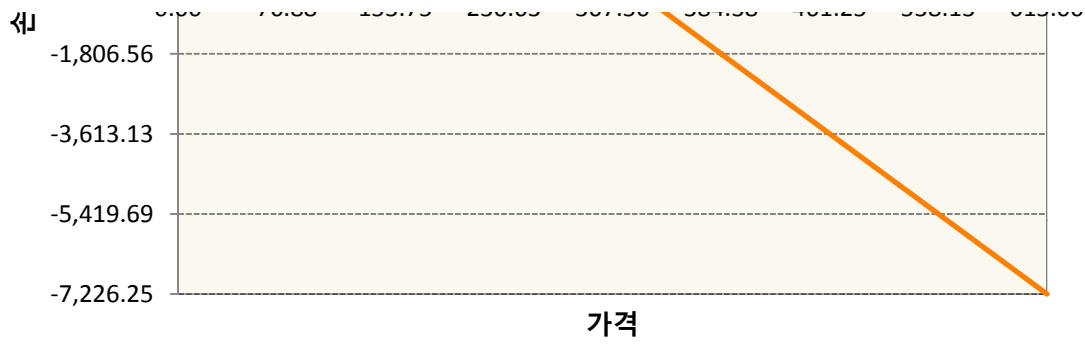
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

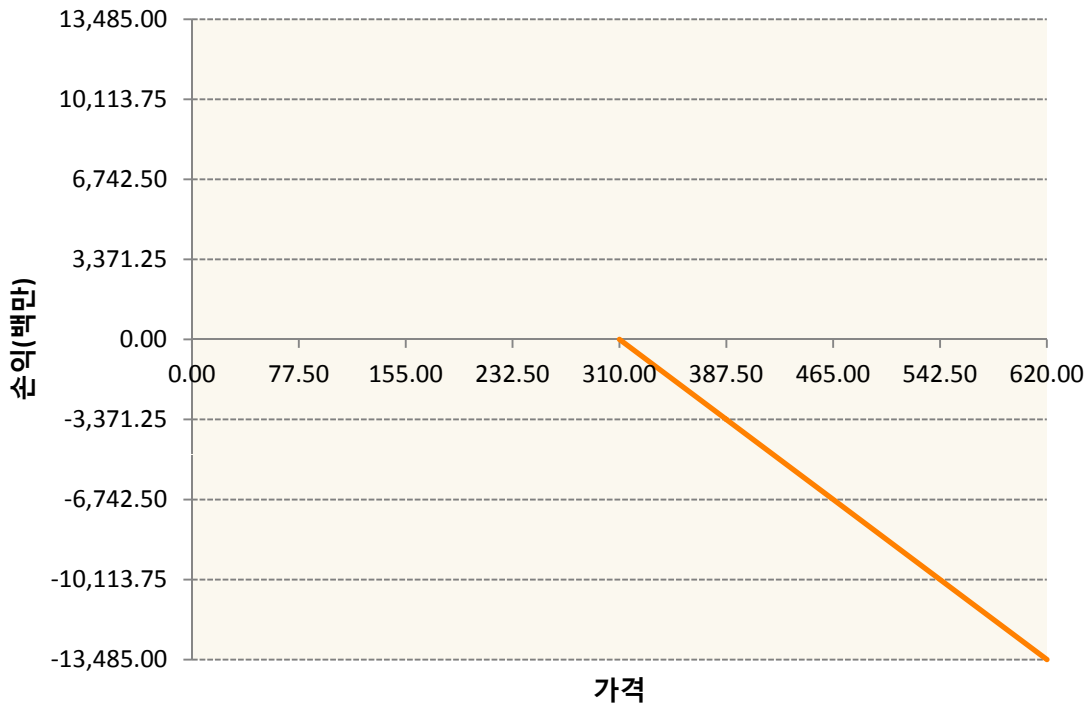


KR4201Q23073-2020-02 콜307.5

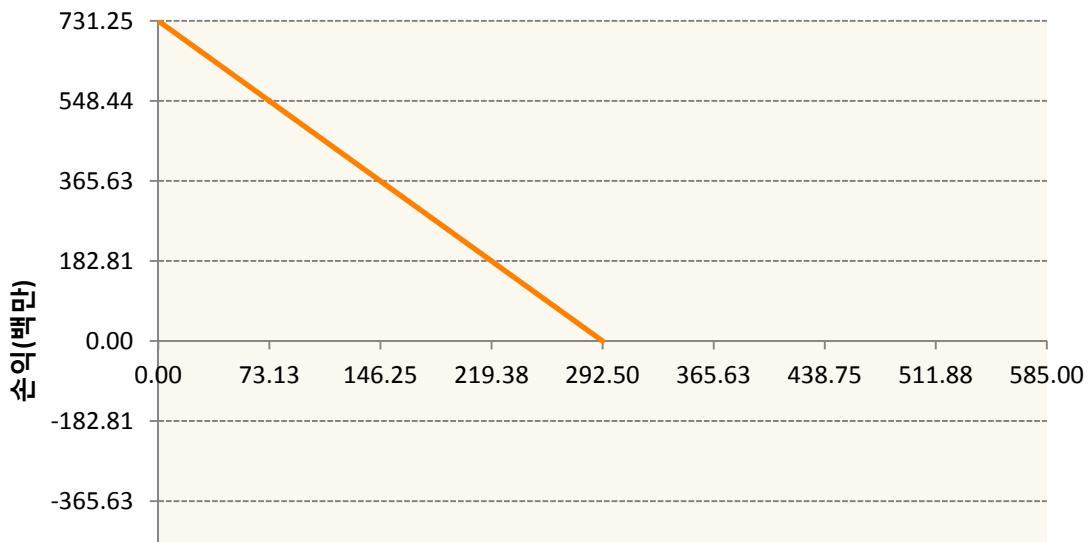


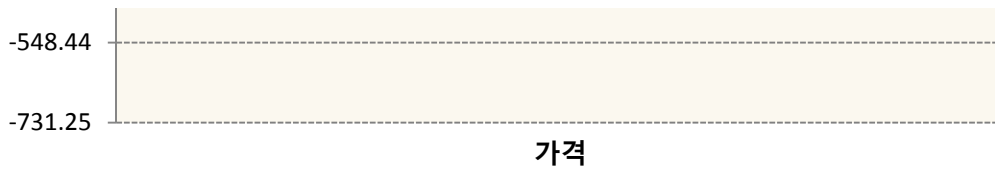


KR4201Q23107-2020-02 콜310

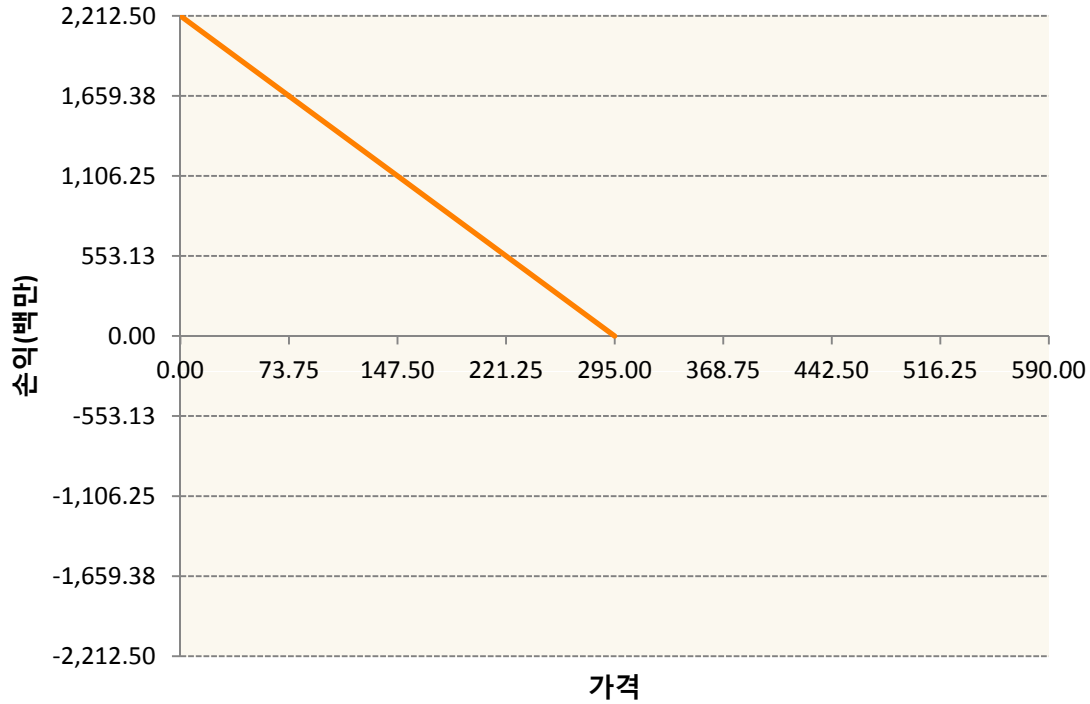


KR4301Q22925-2020-02 풋292.5





KR4301Q22958-2020-02 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						800
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-800	-800	-800	-800	-800	-800	-800	
-5.33%	-533	-533	-533	-533	-533	-533	-533	
-2.67%	-267	-267	-267	-267	-267	-267	-267	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	267	267	267	267	267	267	267	
5.33%	533	533	533	533	533	533	533	
8.00%	800	800	800	800	800	800	800	
KR4201Q23073		2020-02 콜307.5						254
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	21	21	21	21	20	20	20	
-5.33%	21	21	20	20	19	18	16	
-2.67%	20	19	17	15	13	9	5	

0%	14	10	5	0	-6	-12	-19
2.67%	-12	-20	-29	-38	-48	-57	-67
5.33%	-79	-90	-101	-112	-123	-134	-145
8.00%	-197	-206	-215	-225	-234	-244	-254
KR4201Q23107                      2020-02 콜310							413
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	27	27	27	27	26	26	25
-5.33%	27	27	26	26	25	23	21
-2.67%	26	25	23	20	17	12	6
0%	19	14	8	0	-9	-19	-30
2.67%	-13	-26	-40	-55	-71	-87	-104
5.33%	-109	-129	-149	-169	-189	-209	-229
8.00%	-298	-317	-336	-355	-374	-394	-413
KR4301Q22925                      2020-02 풋292.5							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%	32	32	32	32	32	32	32
-2.67%	13	13	13	14	14	14	15
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-8	-7	-7	-7	-6	-6	-5
5.33%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
KR4301Q22958                      2020-02 풋295							161
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	161	161	161	161	161	161	161
-5.33%	103	103	103	103	103	103	104
-2.67%	45	46	46	47	48	48	49
0%	-5	-4	-2	0	2	4	5
2.67%	-31	-30	-28	-26	-25	-23	-21
5.33%	-36	-36	-35	-35	-34	-33	-33
8.00%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36

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

(단위:백만원)

1,246

공시일	2020-02-06
기준일	2020-02-05

## 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	212,347	0	212,347	

### 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	2020-02-06
기준일	2020-02-05

## 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	221,648	0	221,648	

### 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	2020-02-06
기준일	2020-02-05

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	10,765	-10,765	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	533,527	0	533,527	
누계	통화	선도	0	595,869	-595,869	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,383
FX21019Z00 KRW/USD 06-02-20E	2,574
FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	1,659
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	1,563
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	3,813
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,906
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	1,906
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E	3,279
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,535
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,430
FX21020F02 KRW/USD 28-02-20E	1,906
FX21020F03 KRW/USD 28-02-20E	2,955
FX21020F03 KRW/USD 31-03-20E	3,050
FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E	2,860
FX21020F04 KRW/USD 28-02-20E	191
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,574
FX21020G00 KRW/USD 06-03-20E	2,383
IE00BD8RGM75	

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

**15,947**

공시일	2020-02-06
기준일	2020-02-05

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

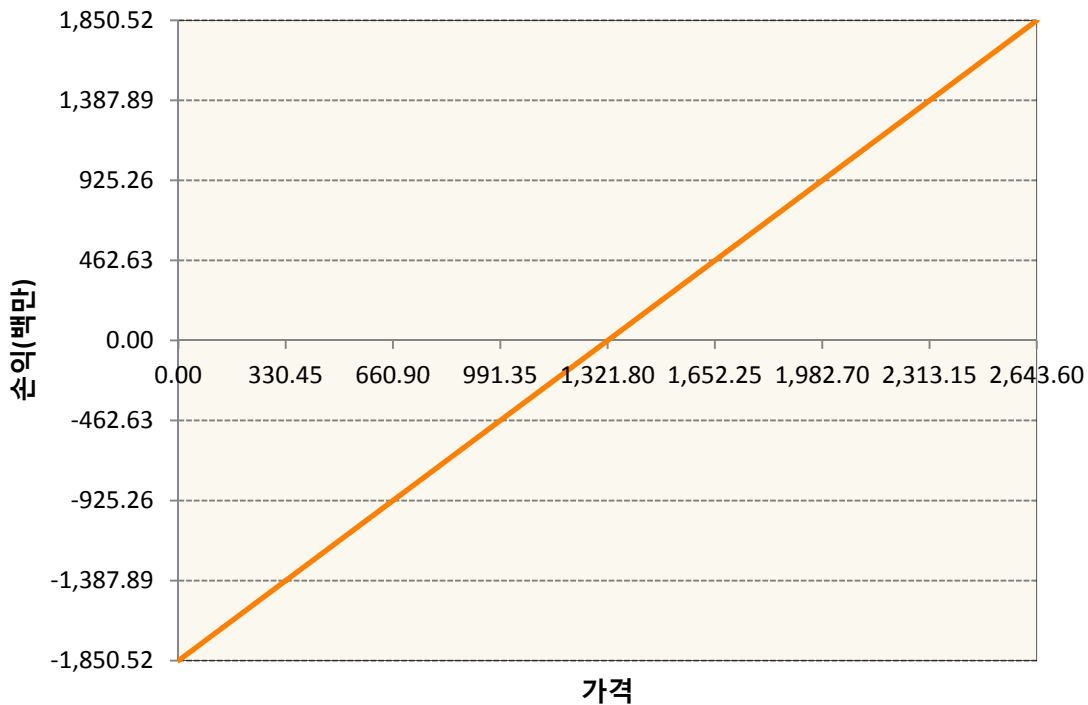
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,851	0	1,851	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4108Q30000-2020-03 KRX300 선물



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

(단위:백만원)

121

공시일	2020-02-06
기준일	2020-02-05

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

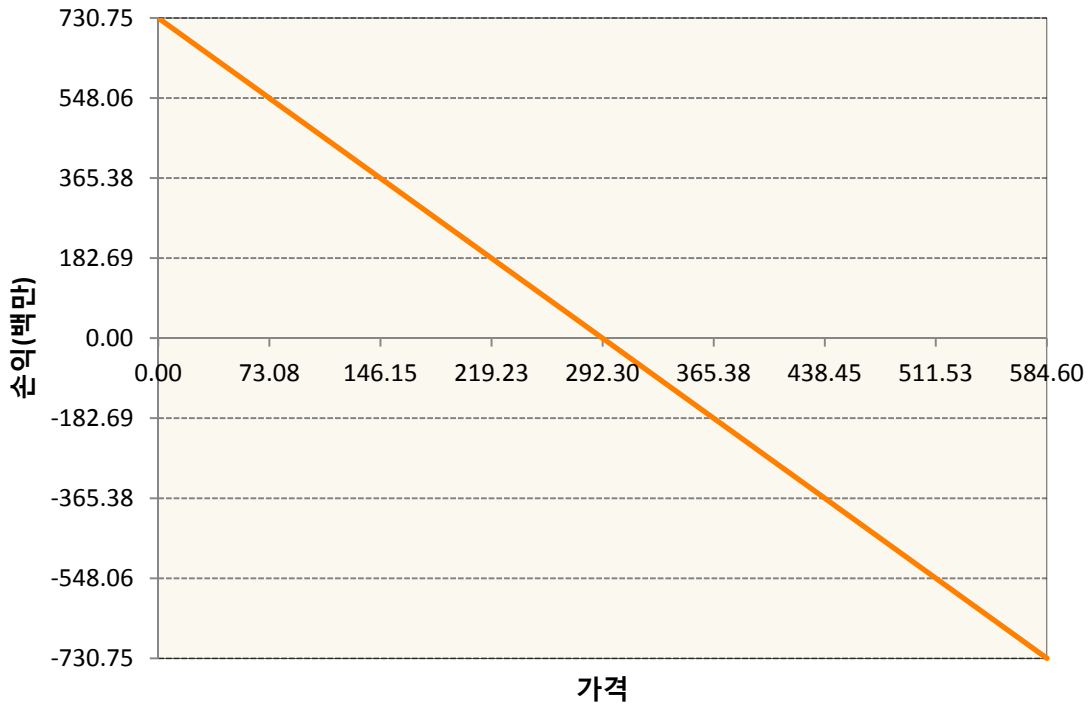
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

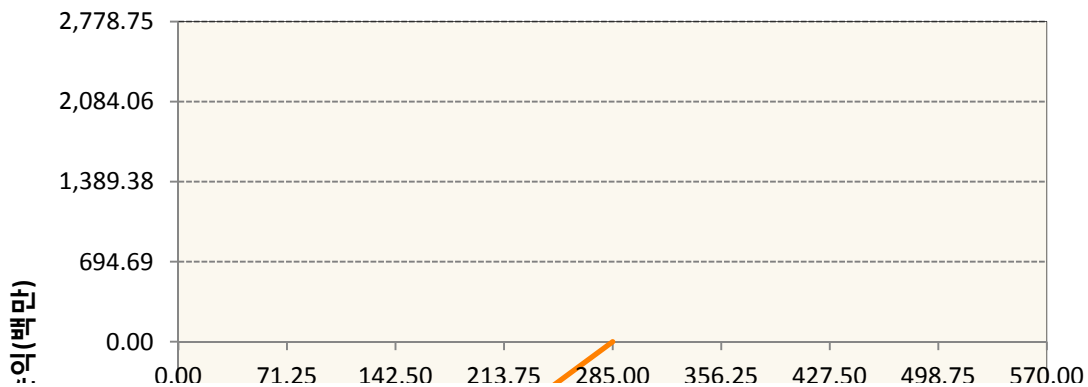
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	731	-731	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,569	-3,569	장내

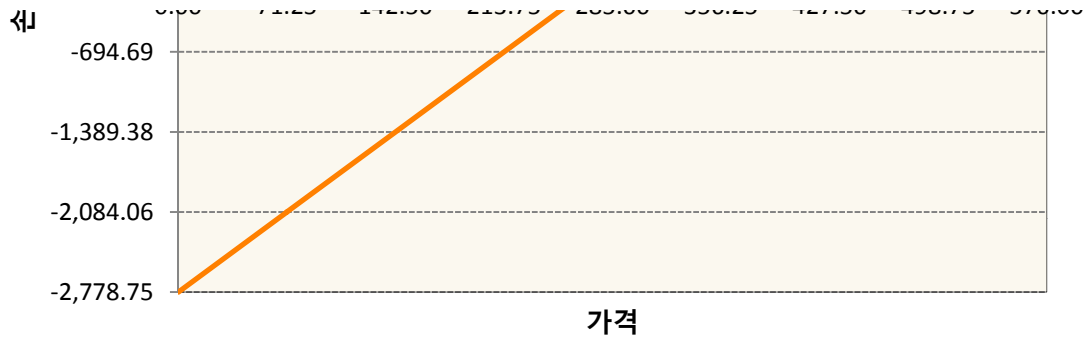
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

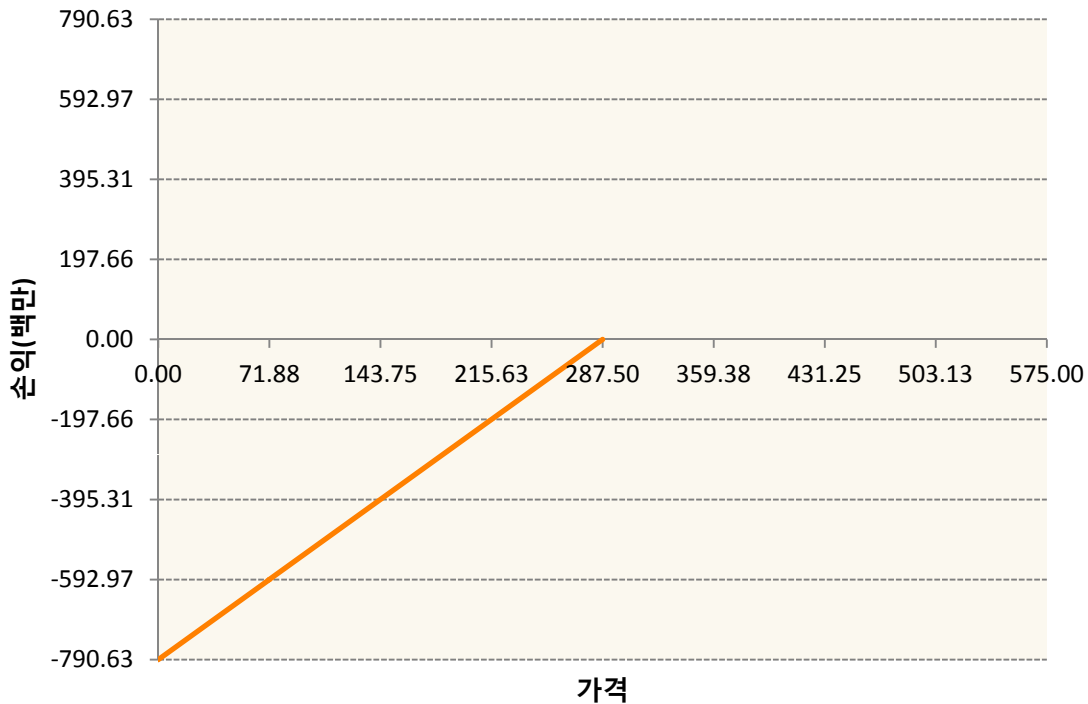


KR4301Q22859-2020-02 풋285





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						154
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-152	-152	-152	-153	-153	-153	-154
-5.33%	-78	-79	-80	-81	-82	-84	-85
-2.67%	-19	-21	-24	-26	-29	-31	-33
0%	4	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	7	7	7	7	6	5	5
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	7	7	7	7	7	7	7

KR4301Q22875                      2020-02 풋287.5                      48

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
-5.33%	-27	-27	-27	-27	-28	-28	-28
-2.67%	-8	-9	-9	-10	-11	-11	-12
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	4	3	3	3	3	3	2
5.33%	4	4	4	4	4	4	3
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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

(단위:백만원)

**237**

공시일	2020-02-06
기준일	2020-02-05

## H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	363	-363	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	12,213	0	12,213	
누계	통화	선도	0	12,368	-12,368	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	296
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	2020-02-06
기준일	2020-02-05

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

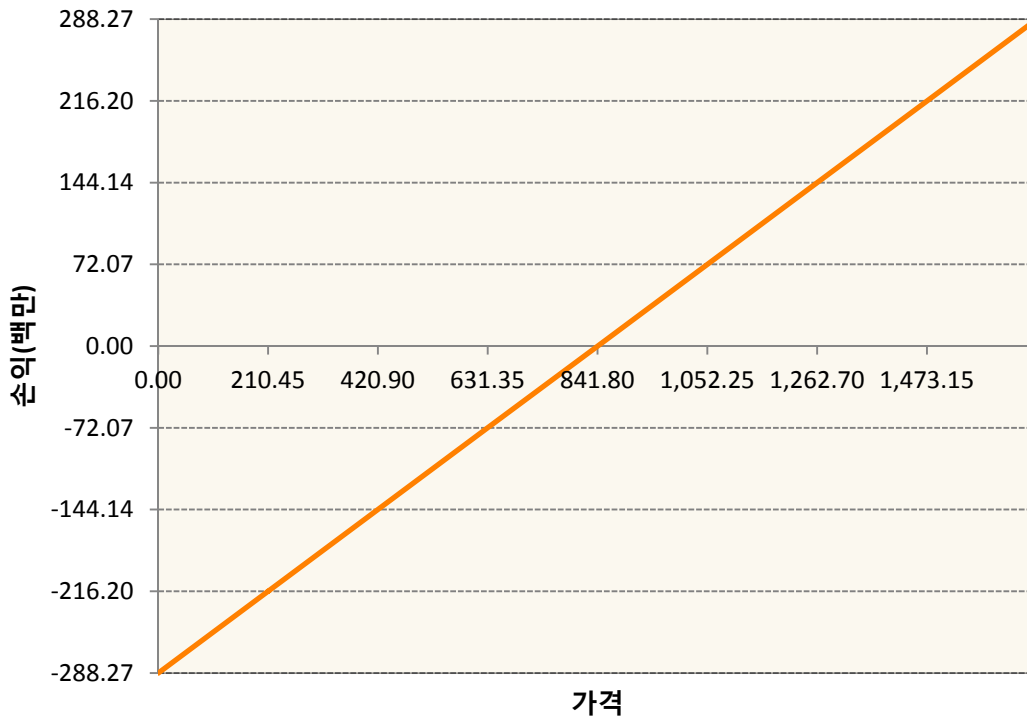
### 1. 계약금액

(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	288	0	288	
누계	유가증권	스왑	1,085	0	1,085	장외
누계	통화	선도	184	631	-447	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	23

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

(단위:백만원)

**104**

공시일	2020-02-06
기준일	2020-02-05

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

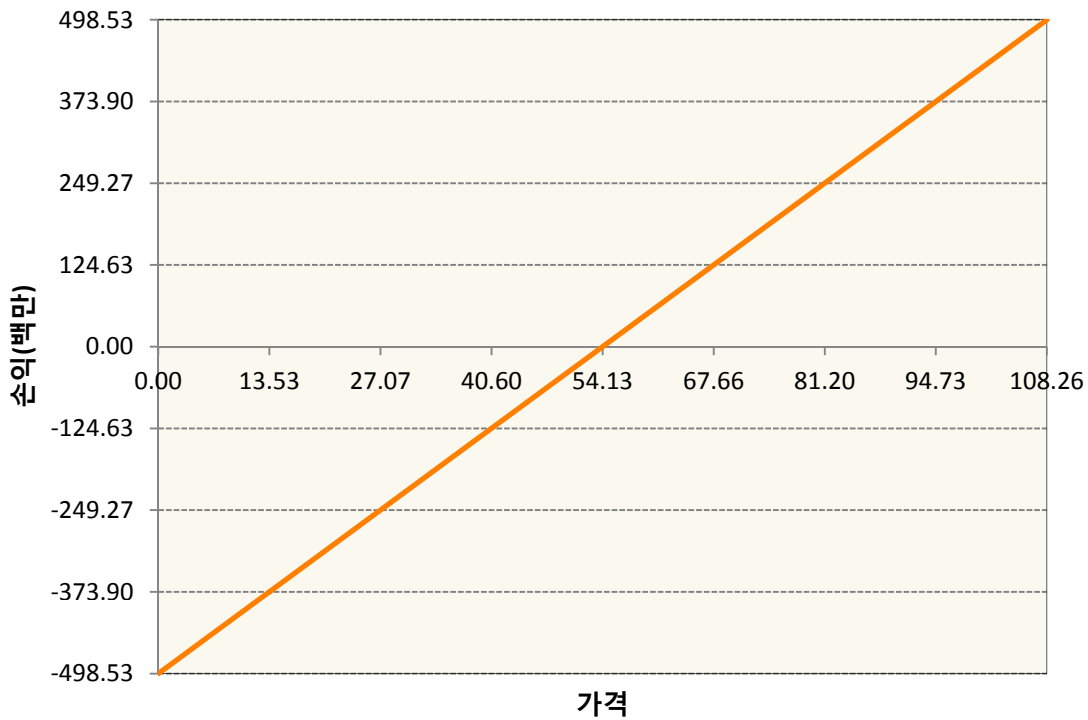
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

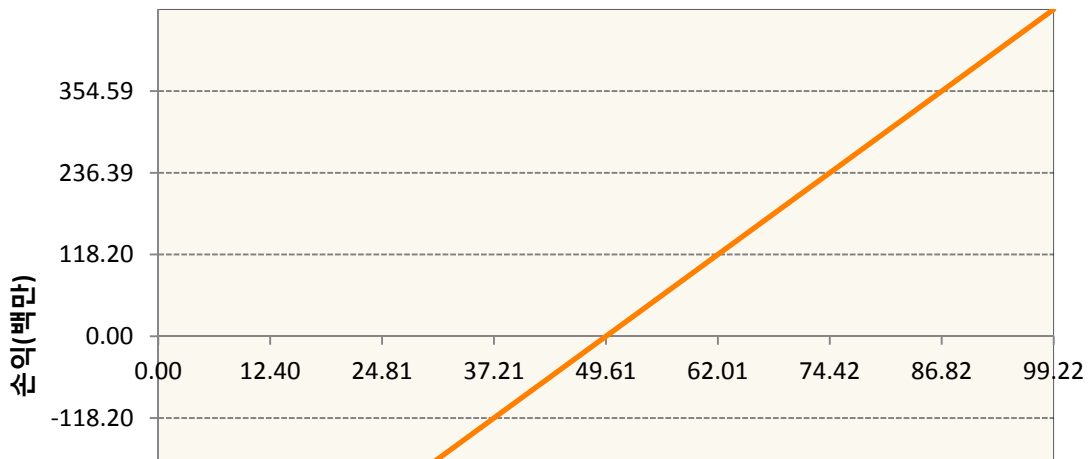
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,011	191	1,820	

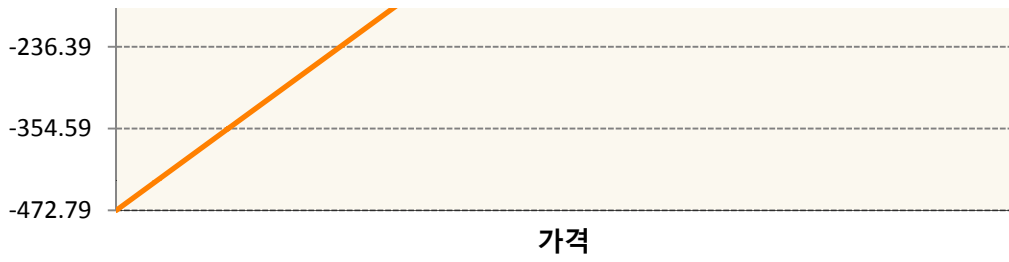
### 2. 만기시점의 손익구조

**COKO-BRENT CRUDE FUTR May20**

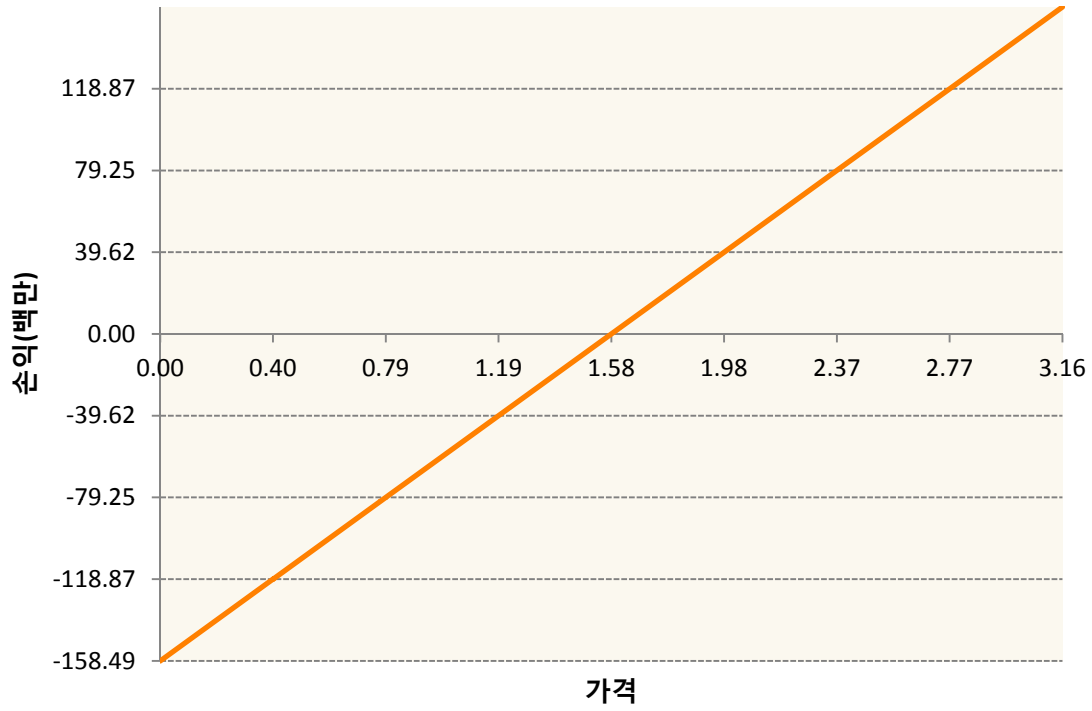


**CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20**

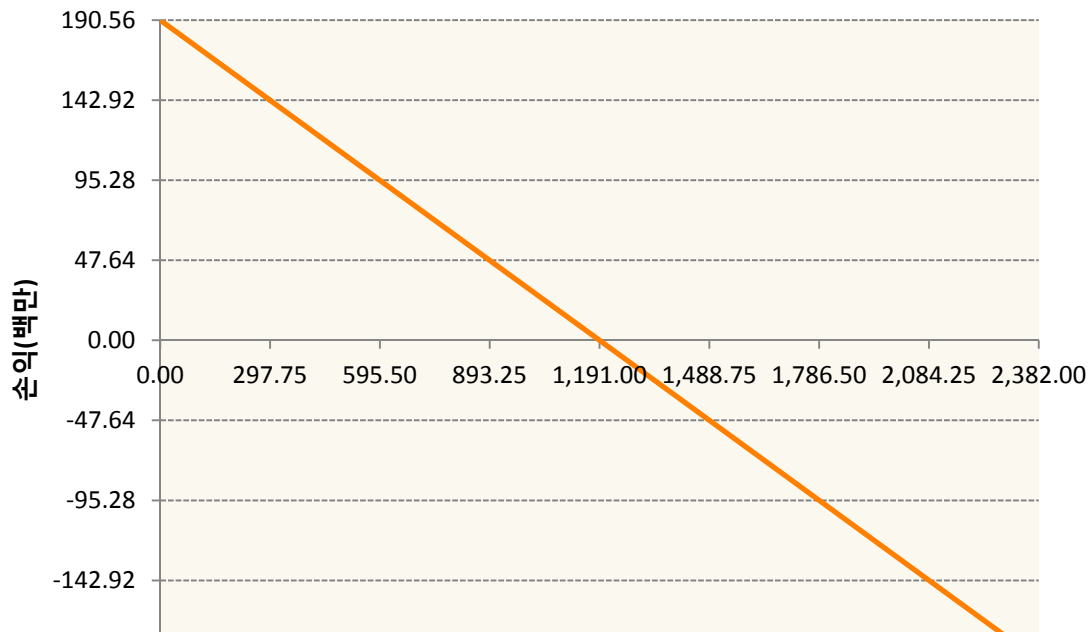


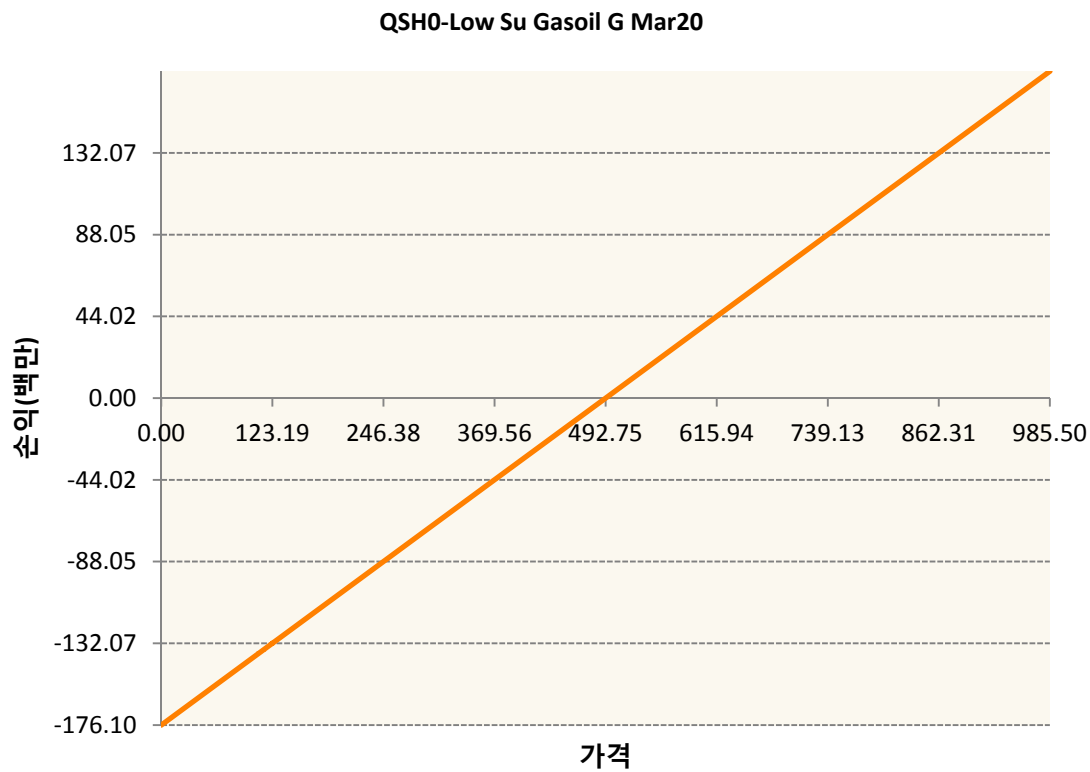
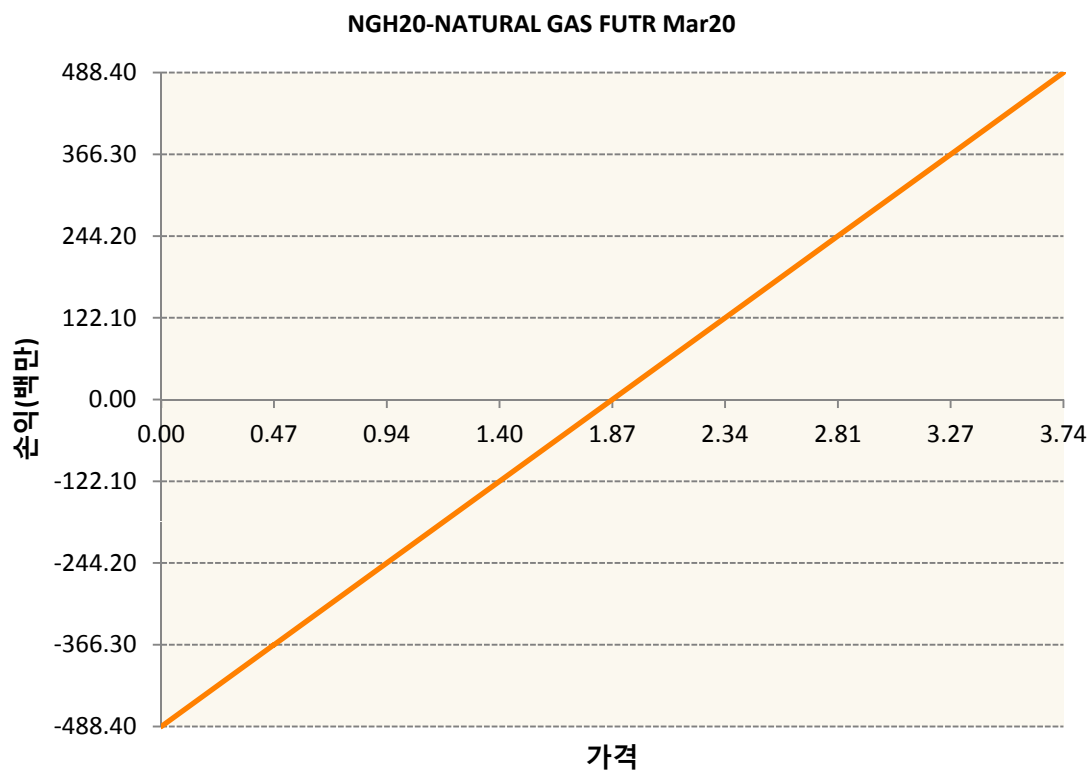
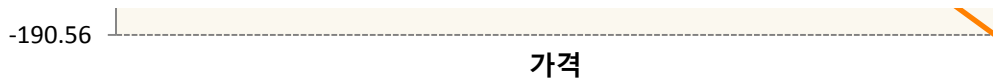


**HOH0-NY Harb ULSD Fut Mar20**

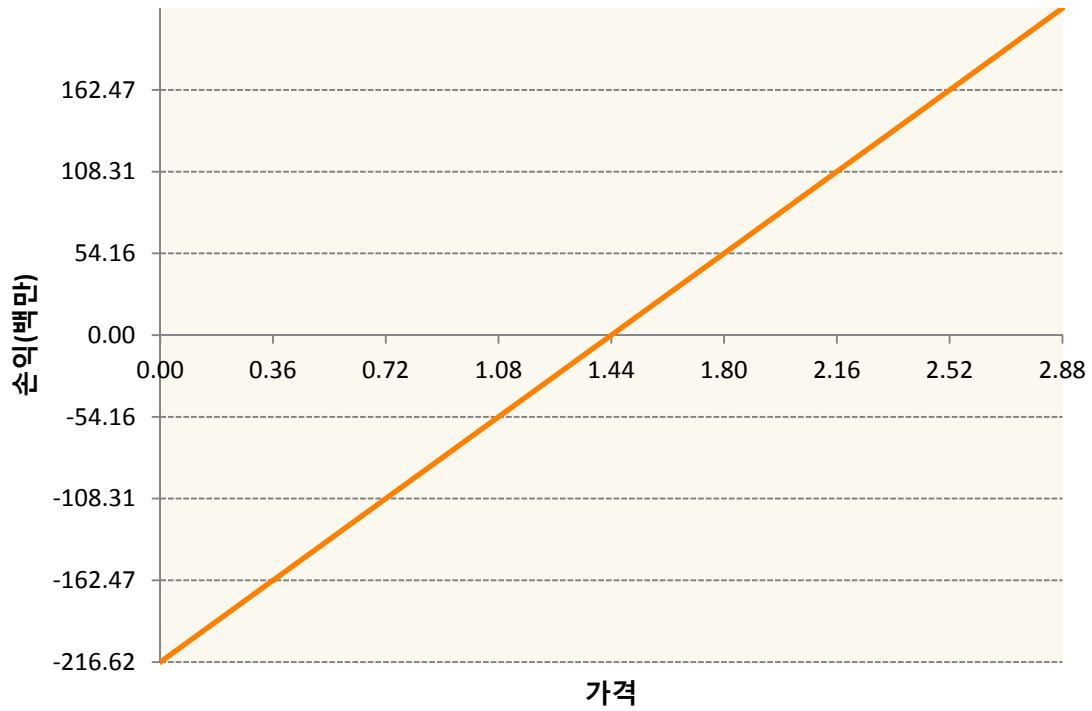


**KR4175Q20000-2020-02 달러선물**





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	39
QSH0	Low Su Gasoil G Mar20	14
XBH0	GASOLINE RBOB FUT Mar20	17

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

(단위:백만원)

316

공시일	2020-02-06
기준일	2020-02-05

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

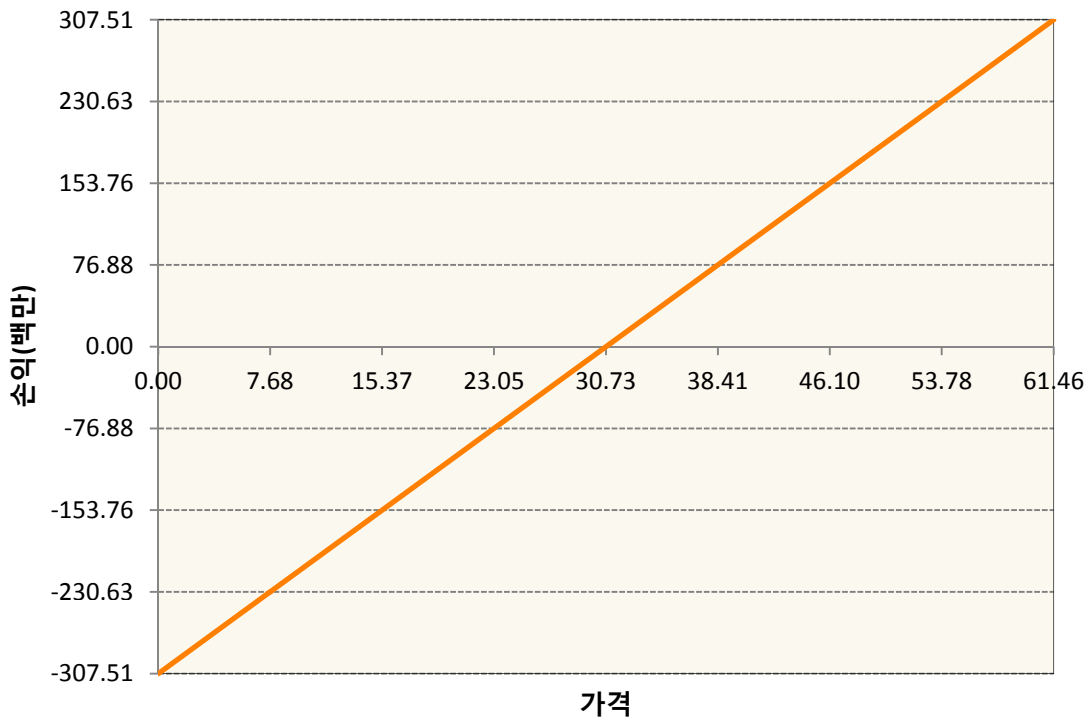
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

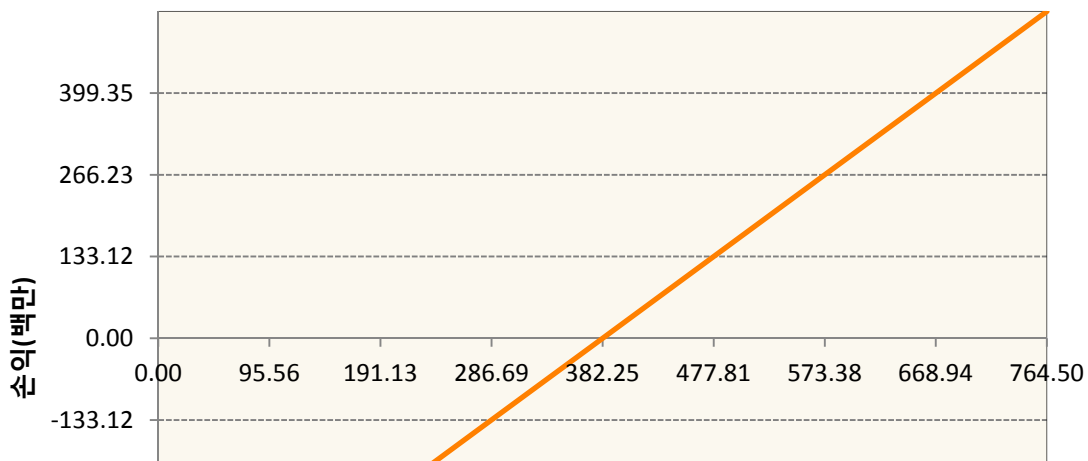
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,723	155	2,568	

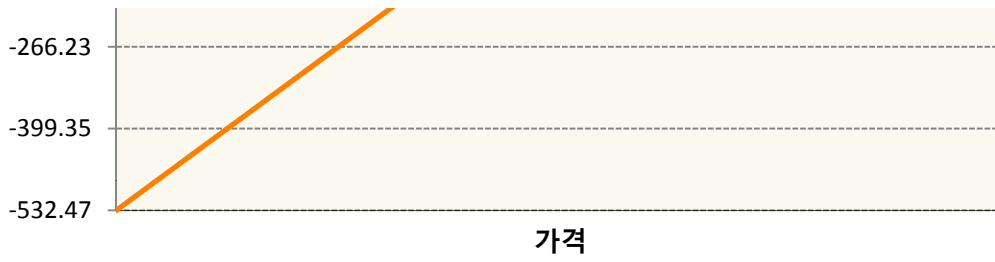
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20**

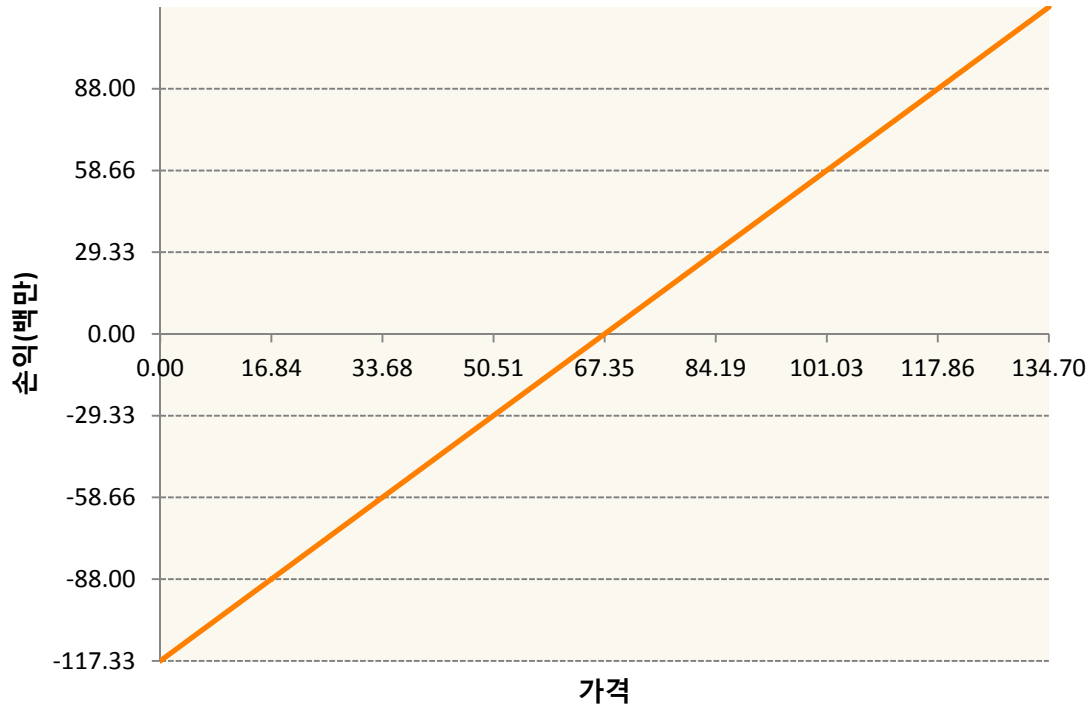


**CH0-CORN FUTURE Mar20**

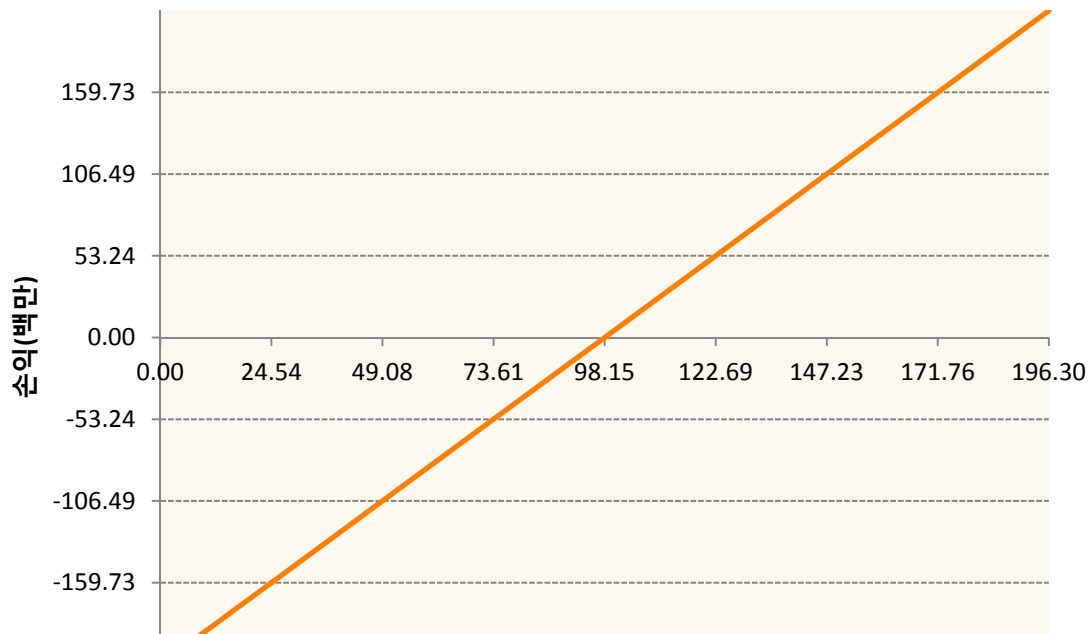


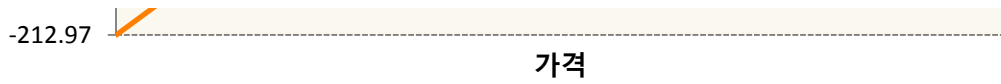


CTH0-COTTON NO.2 FUTR Mar20

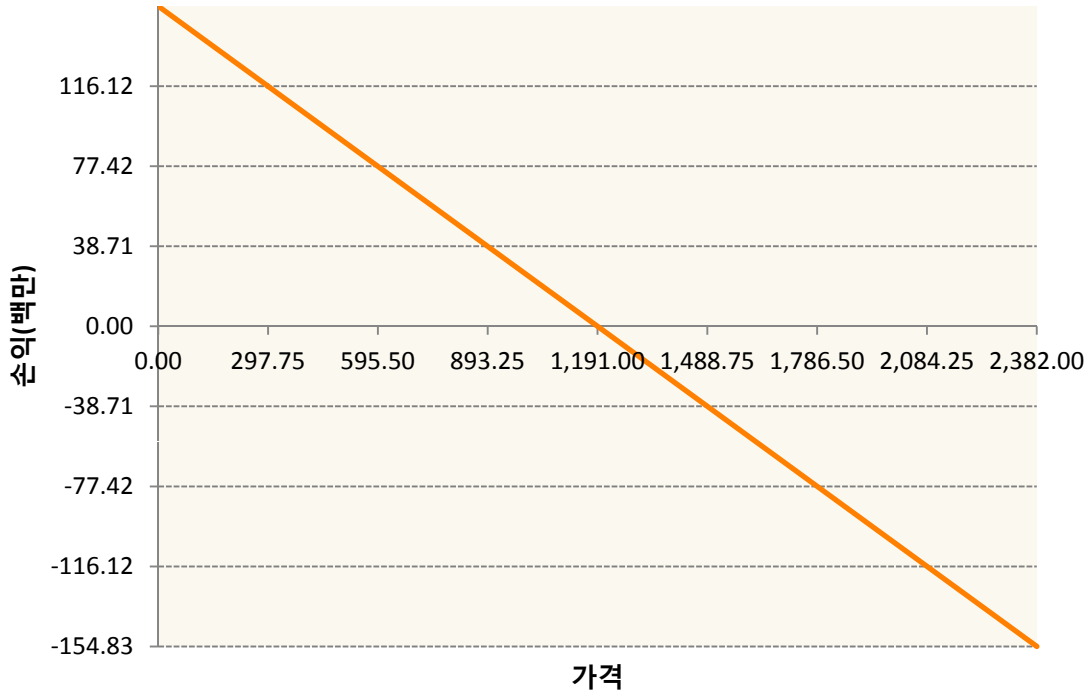


KCH0-COFFEE 'C' FUTURE Mar20

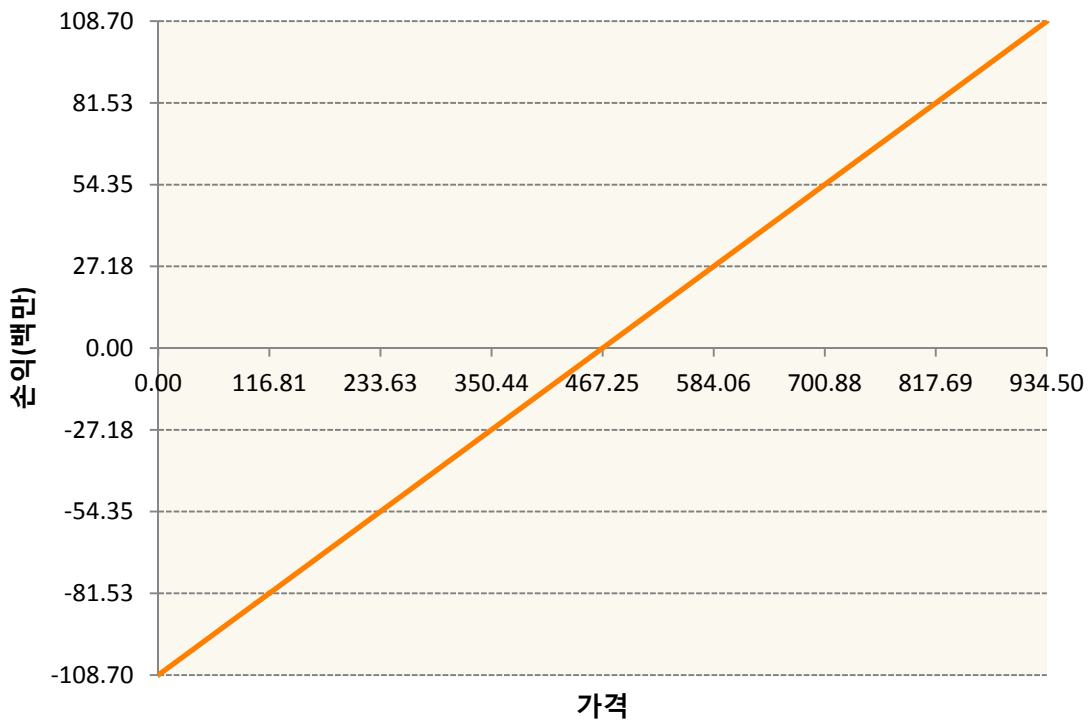




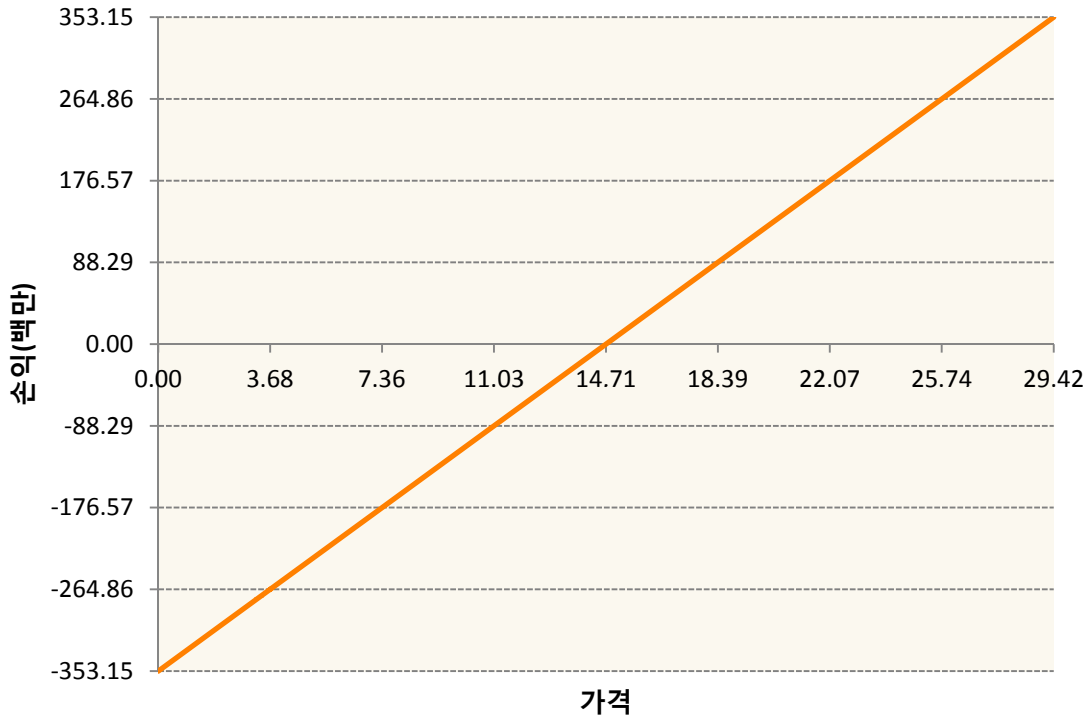
KR4175Q20000-2020-02 달러선물



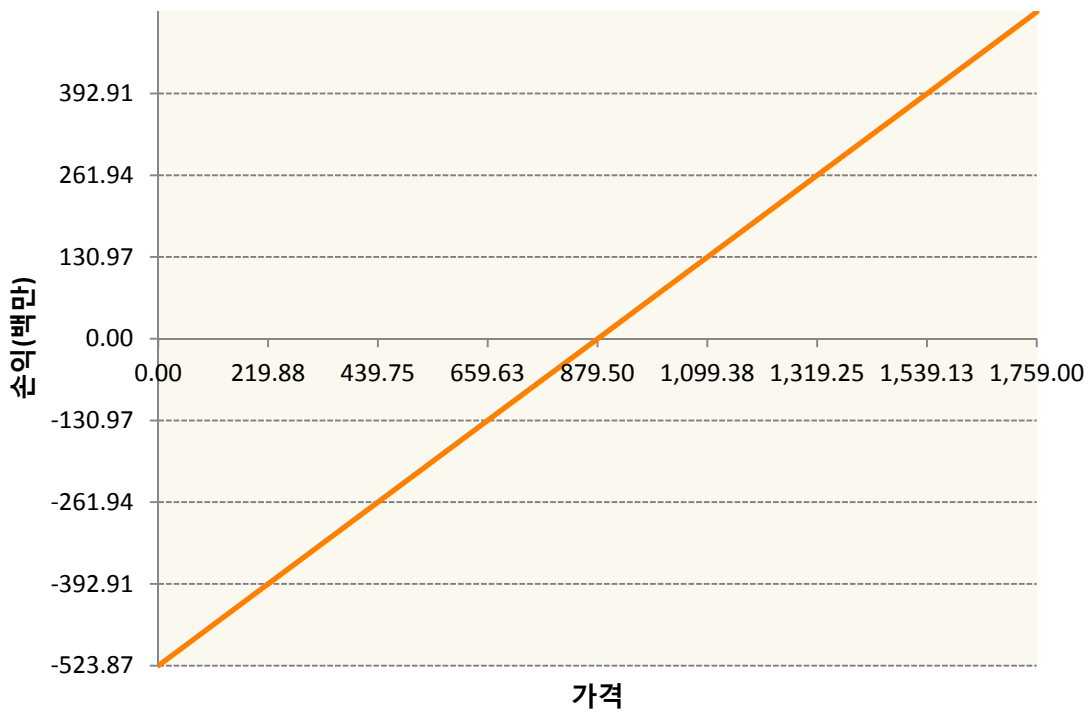
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

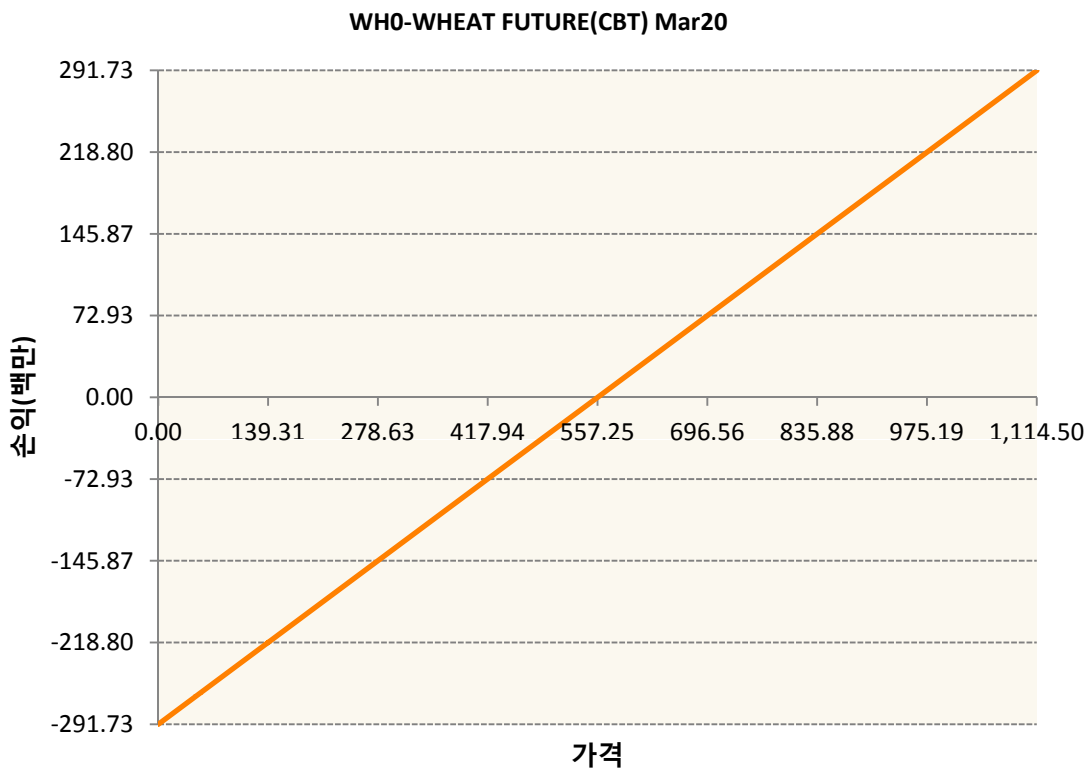
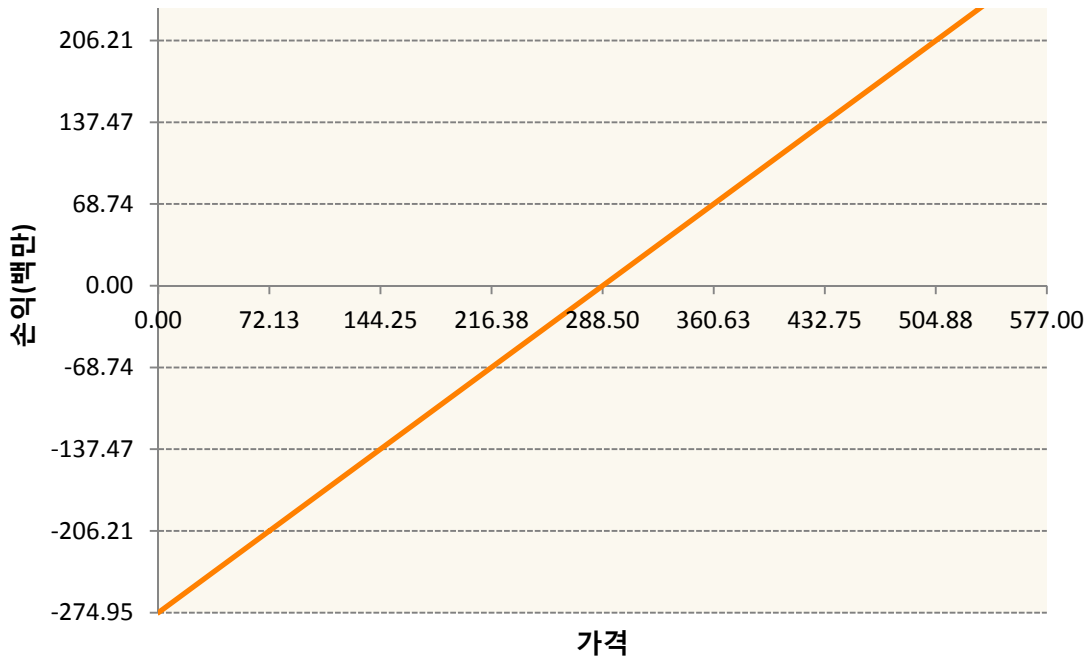


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20



SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BOH0	SOYBEAN OIL FUTR Mar20	25
CH0	CORN FUTURE Mar20	43
CTH0	COTTON NO.2 FUTR Mar20	9
KCH0	COFFEE 'C' FUTURE Mar20	17
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**