

공시일	2020-02-07
기준일	2020-02-06

## 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	2020-02-07
기준일	2020-02-06

## 스마트인덱스모

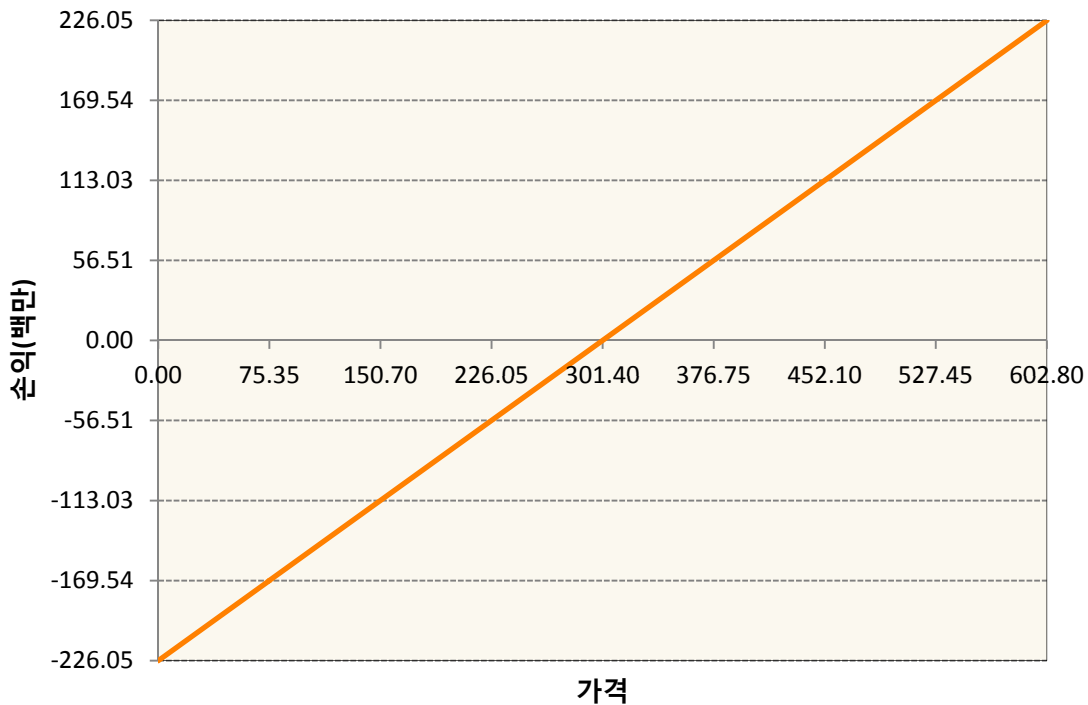
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	226	0	226	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						18
가격	기초자산의 변동성							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
-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%	18	18	18	18	18	18	18	

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

(단위:백만원)

15

공시일	2020-02-07
기준일	2020-02-06

## 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

1,152

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

669

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-07
기준일	2020-02-06

## 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)	408
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	149

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

859

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-07
기준일	2020-02-06

## 유로인덱스모(주식-파생형)

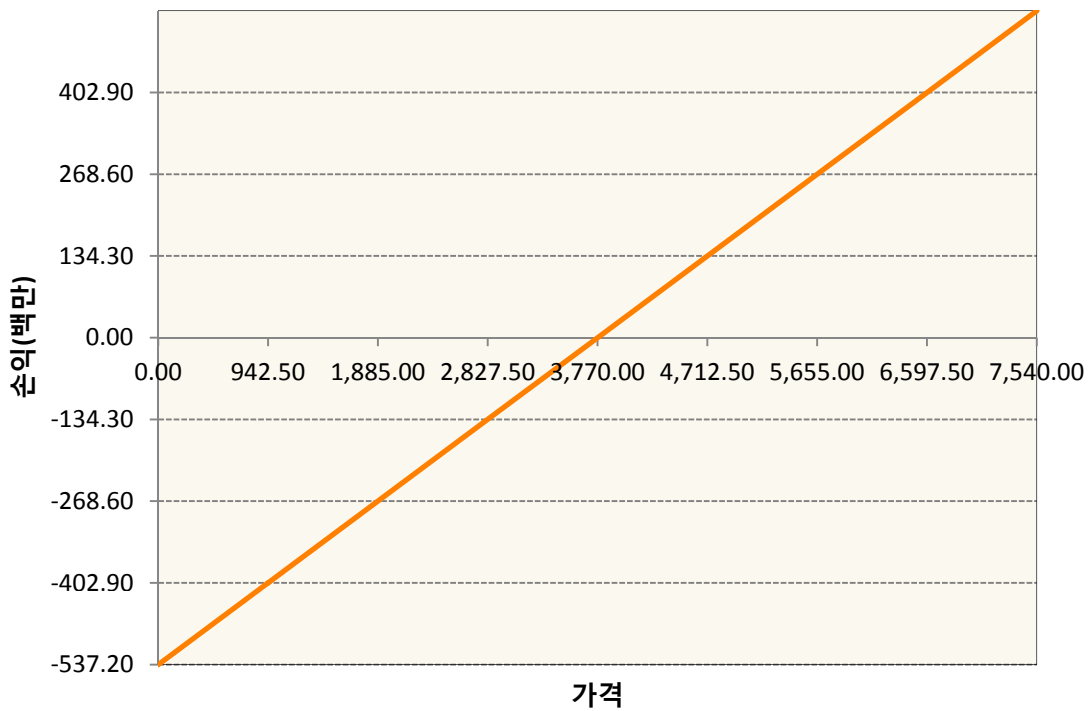
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	537	0	537	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGH0-EURO STOXX 50 Mar20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH0	EURO STOXX 50 Mar20	43
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

30
----

공시일	2020-02-07
기준일	2020-02-06

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

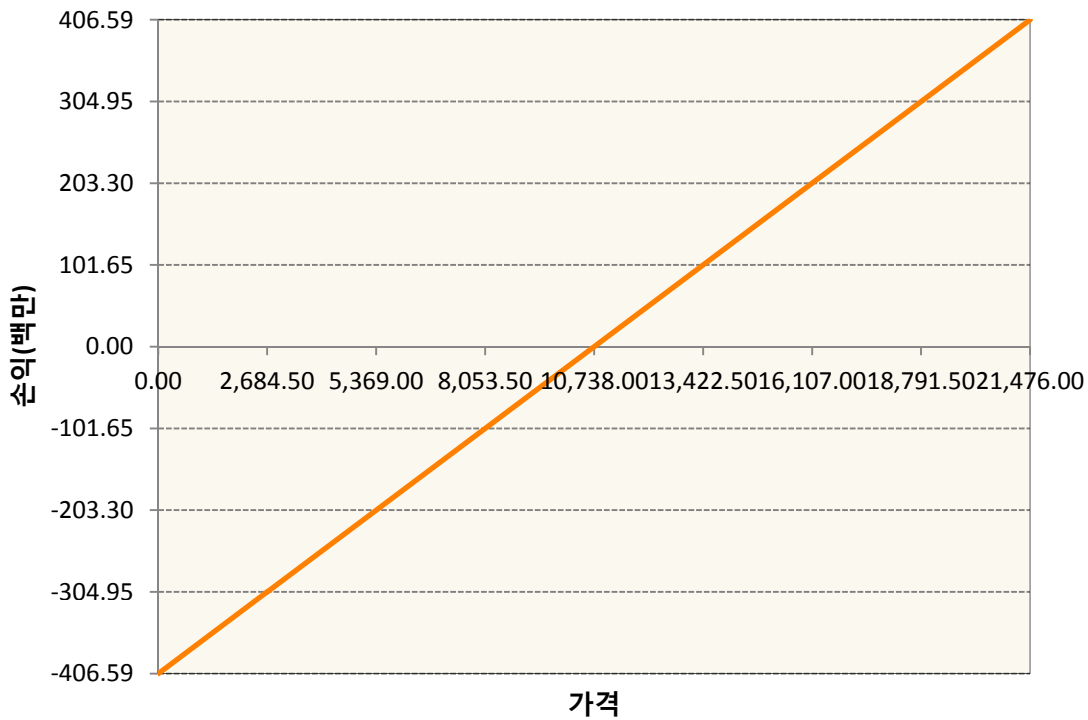
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	407	0	407	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCG0-HSCEI Futures Feb20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCG0	HSCEI Futures Feb20	33
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

30

공시일	2020-02-07
기준일	2020-02-06

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

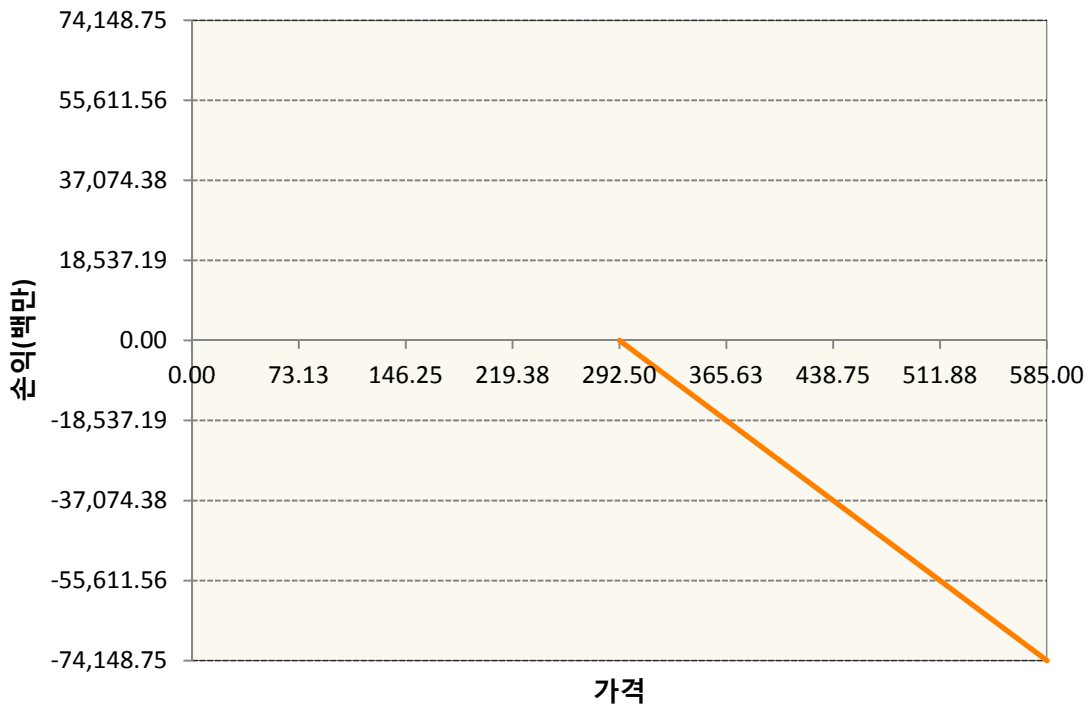
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

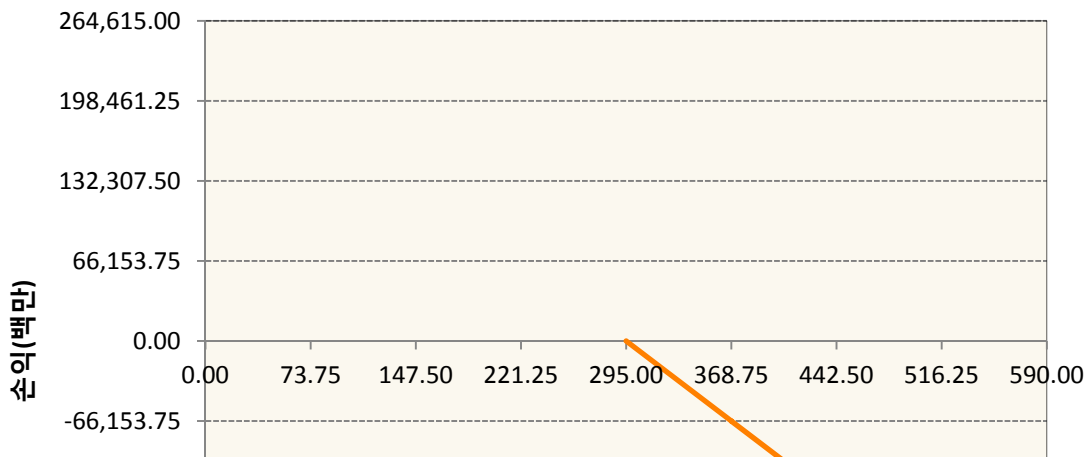
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	455,004	-455,004	장내

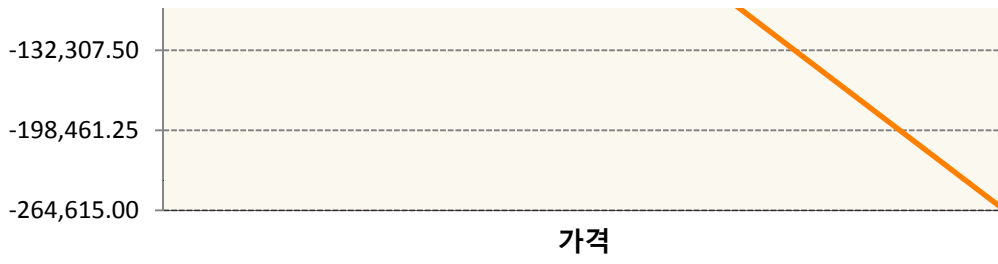
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q22927-2020-02 콜292.5

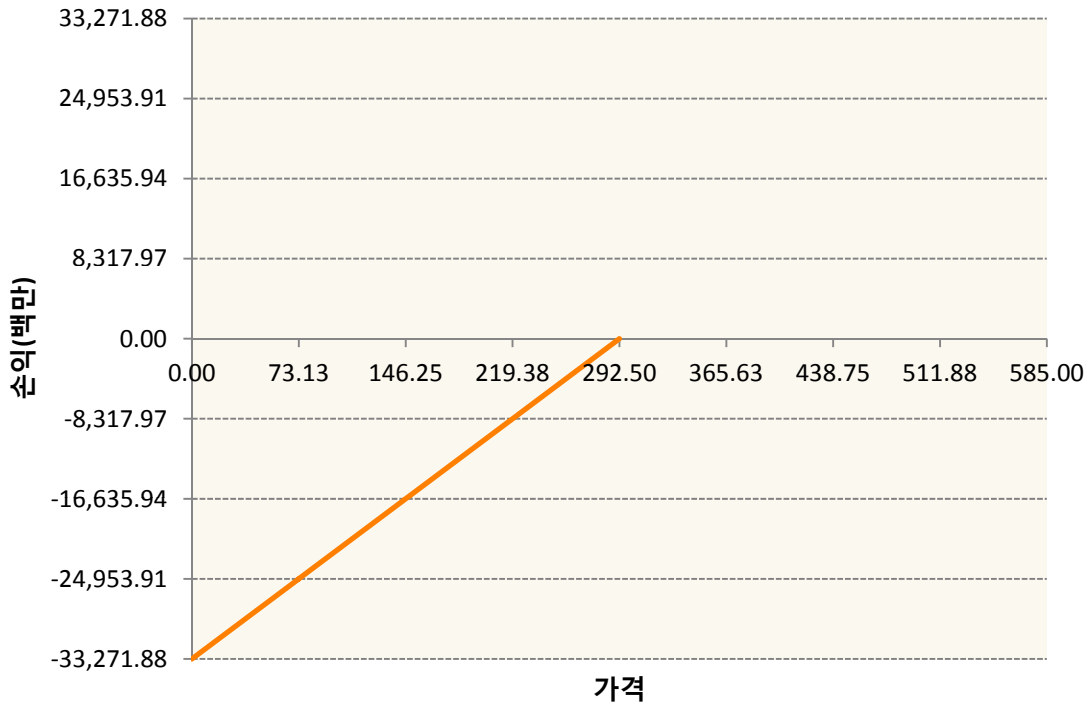


KR4201Q22950-2020-02 콜295

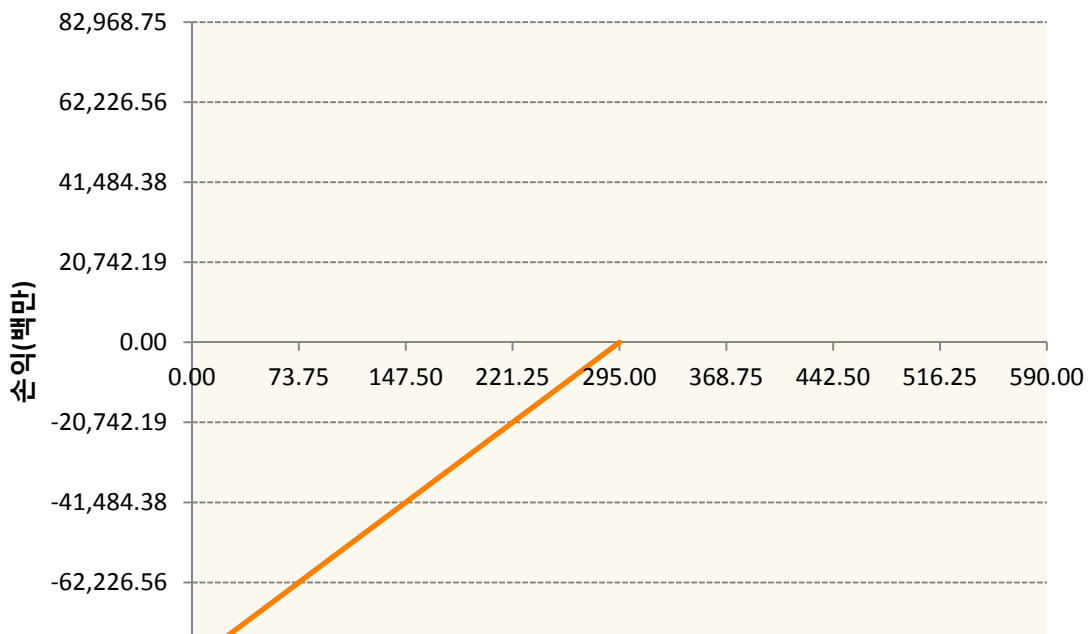




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



KR4301Q22958-2020-02 풋295



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q22927		2020-02 콜292.5						5,635
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,520	2,495	2,462	2,423	2,378	2,327	2,271	
-5.33%	2,306	2,233	2,154	2,072	1,987	1,900	1,811	
-2.67%	1,603	1,498	1,394	1,289	1,185	1,081	976	
0%	241	165	84	0	-87	-177	-269	
2.67%	-1,579	-1,609	-1,647	-1,691	-1,742	-1,799	-1,861	
5.33%	-3,571	-3,577	-3,588	-3,604	-3,626	-3,653	-3,686	
8.00%	-5,598	-5,599	-5,601	-5,605	-5,612	-5,622	-5,635	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						19,338
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	7,411	7,354	7,275	7,173	7,049	6,905	6,742	
-5.33%	6,942	6,736	6,507	6,260	5,997	5,722	5,436	
-2.67%	5,100	4,739	4,377	4,014	3,649	3,283	2,917	
0%	989	668	338	0	-343	-691	-1,042	
2.67%	-5,055	-5,208	-5,390	-5,595	-5,820	-6,063	-6,321	
5.33%	-11,983	-12,024	-12,087	-12,171	-12,277	-12,405	-12,554	
8.00%	-19,136	-19,143	-19,157	-19,181	-19,218	-19,270	-19,338	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						1,771
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,759	-1,760	-1,761	-1,762	-1,764	-1,767	-1,771	
-5.33%	-864	-874	-885	-898	-913	-929	-946	
-2.67%	-182	-209	-236	-262	-289	-316	-343	
0%	35	25	13	0	-15	-31	-49	
2.67%	52	51	50	48	46	42	37	
5.33%	52	52	52	52	52	52	51	
8.00%	52	52	52	52	52	52	52	
KR4301Q22958		2020-02 풋295						4,945
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-4,931	-4,931	-4,932	-4,933	-4,936	-4,940	-4,945	
-5.33%	-2,690	-2,701	-2,717	-2,736	-2,760	-2,787	-2,818	
-2.67%	-742	-803	-864	-927	-990	-1,053	-1,117	
0%	135	93	48	0	-51	-103	-158	
2.67%	248	244	237	227	213	196	176	

5.33%	251	251	251	250	249	246	243
8.00%	251	251	251	251	251	251	250

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

(단위:백만원)

**34,061**

공시일	2020-02-07
기준일	2020-02-06

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

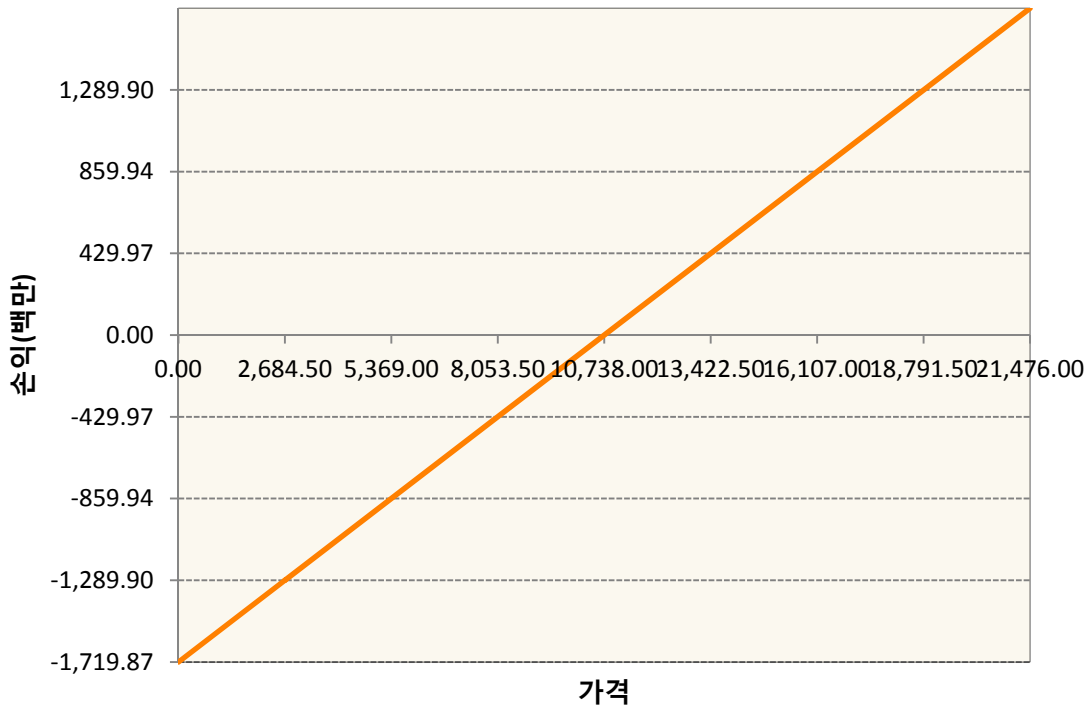
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

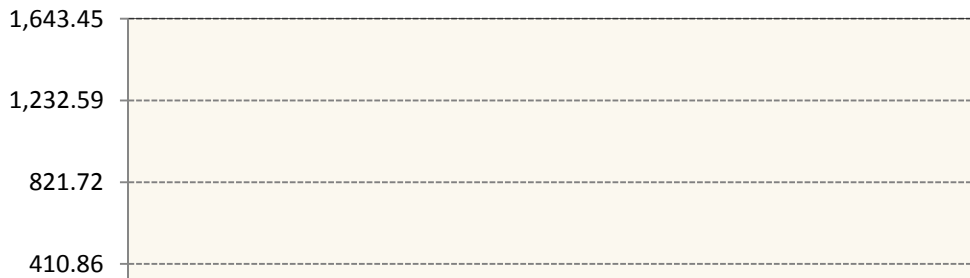
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,720	0	1,720	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,551	-4,551	장내
누계	통화	선도	0	2,140	-2,140	장외

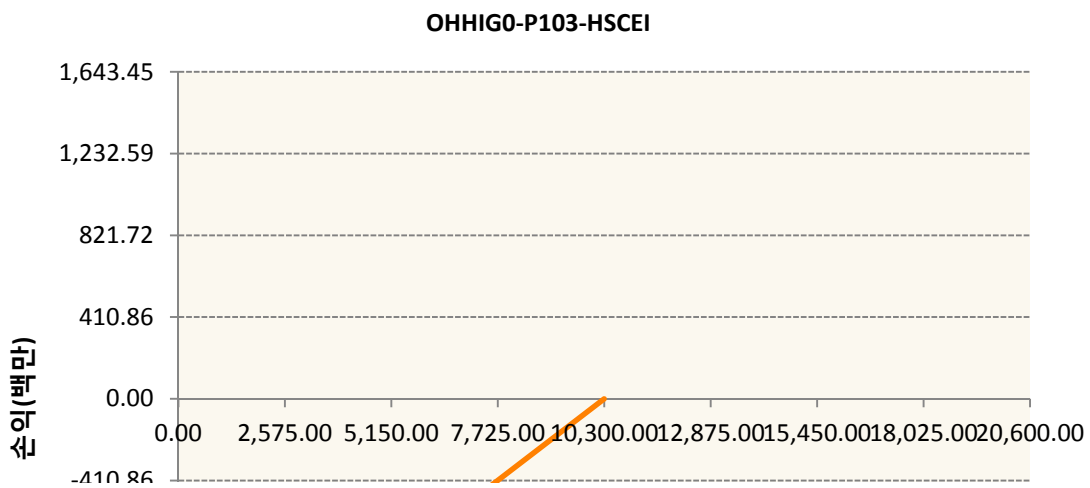
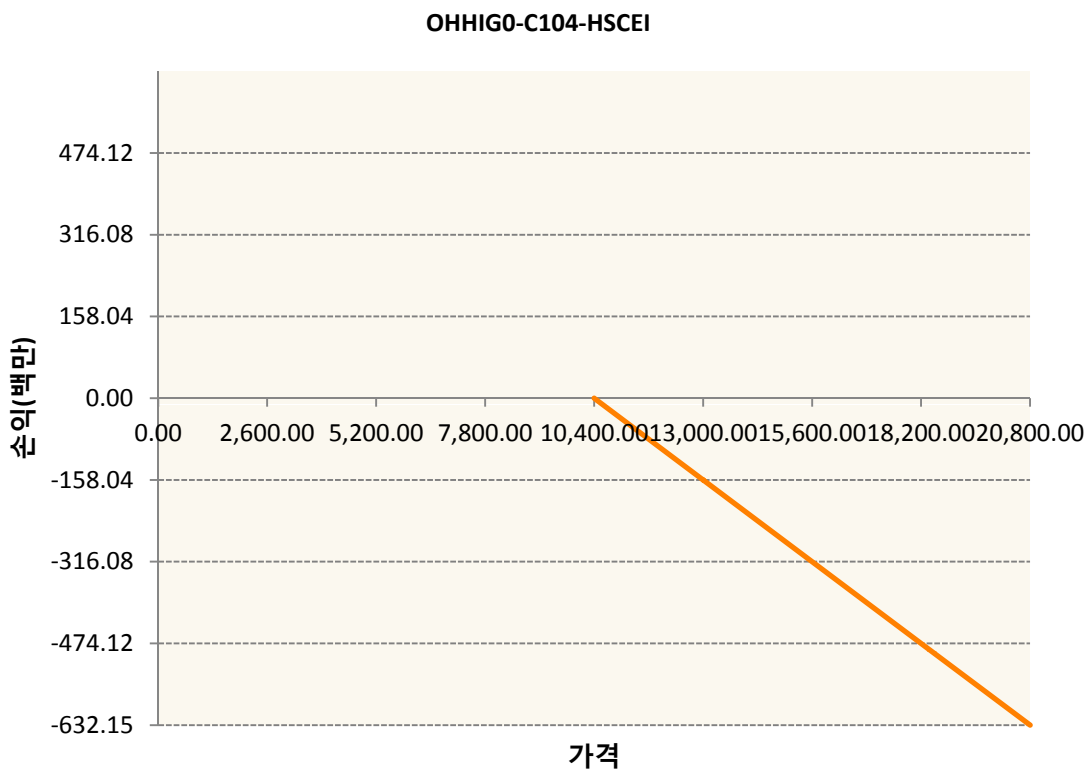
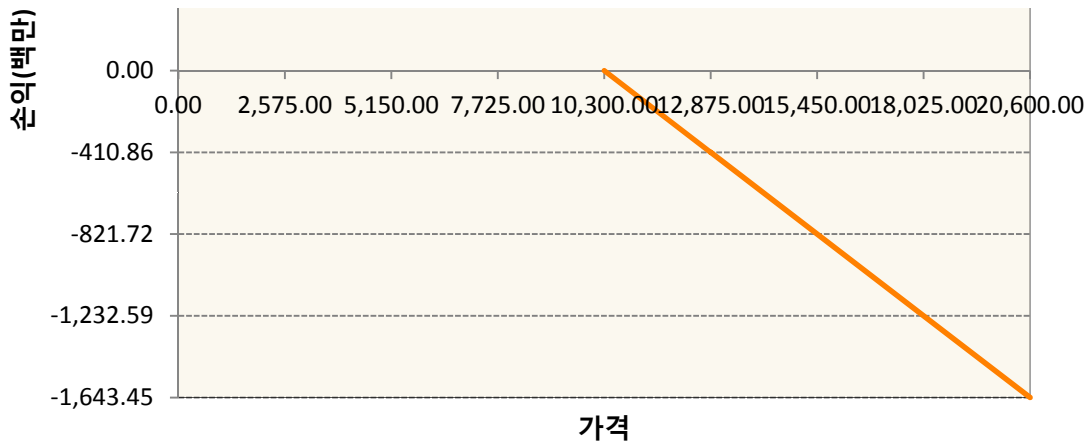
### 2. 만기시점의 손익구조

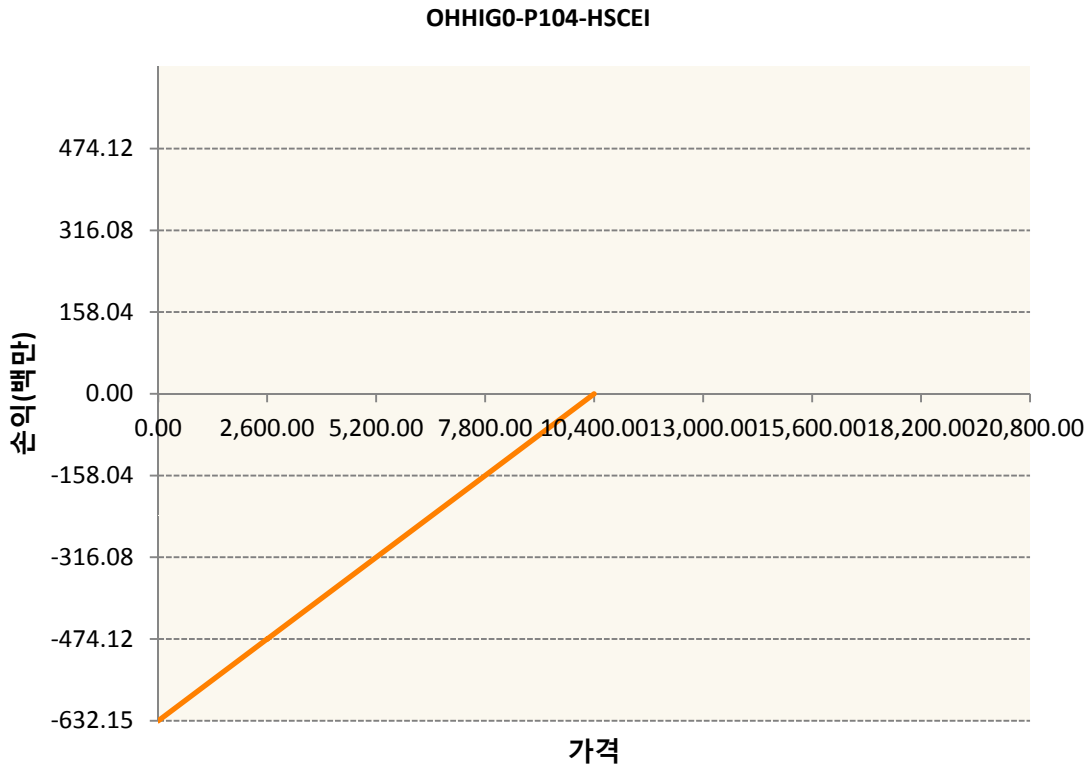
HCG0-HSCEI Futures Feb20



OHHIG0-C103-HSCEI







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

FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	171
HCG0 HSCEI Futures Feb20	138
OHHIG0-C1( HSCEI	131
OHHIG0-C1( HSCEI	51
OHHIG0-P1( HSCEI	131
OHHIG0-P1( HSCEI	51

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

**512**

공시일	2020-02-07
기준일	2020-02-06

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

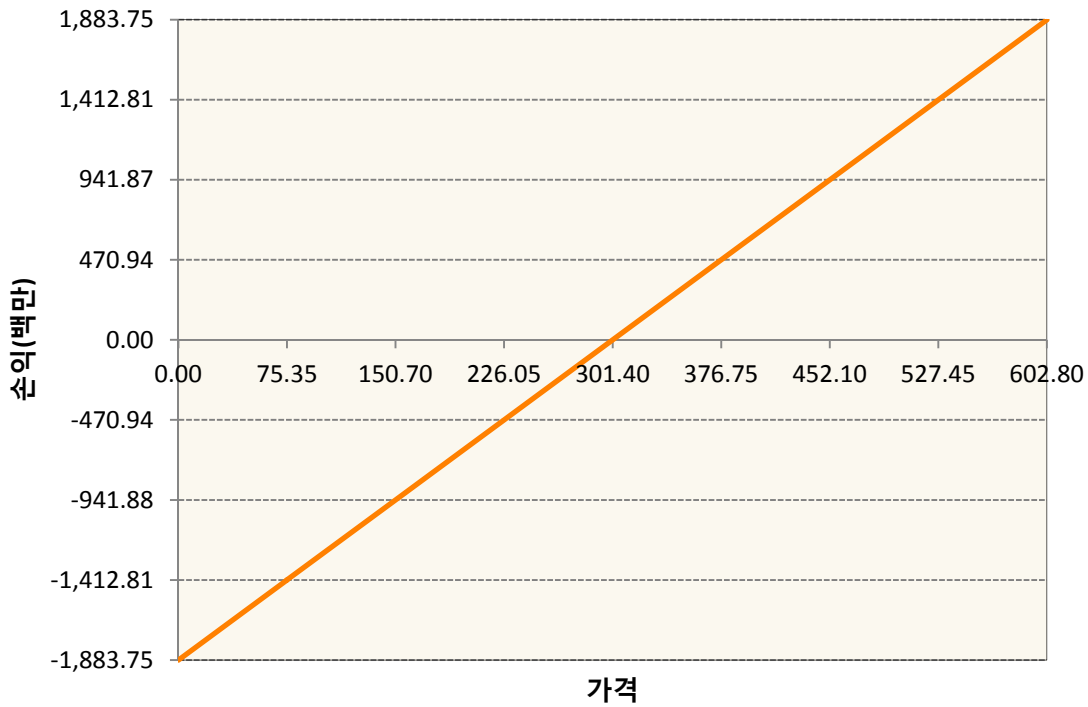
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

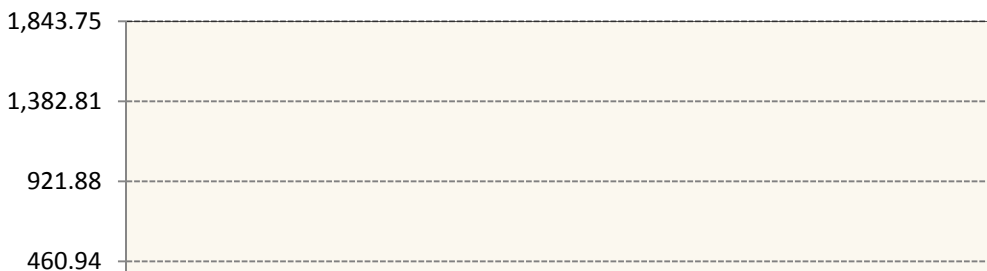
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,884	0	1,884	장내
누계	유가증권	스왑	3,625	0	3,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,608	-3,608	장내

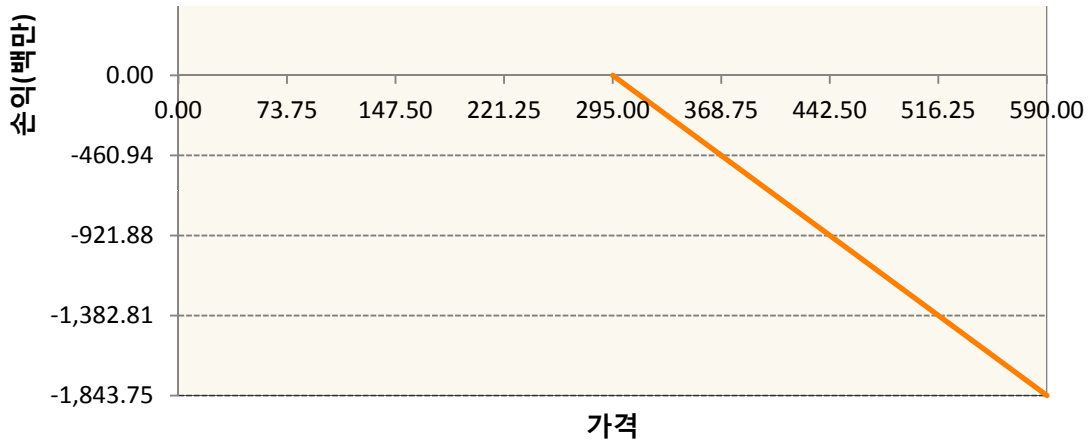
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

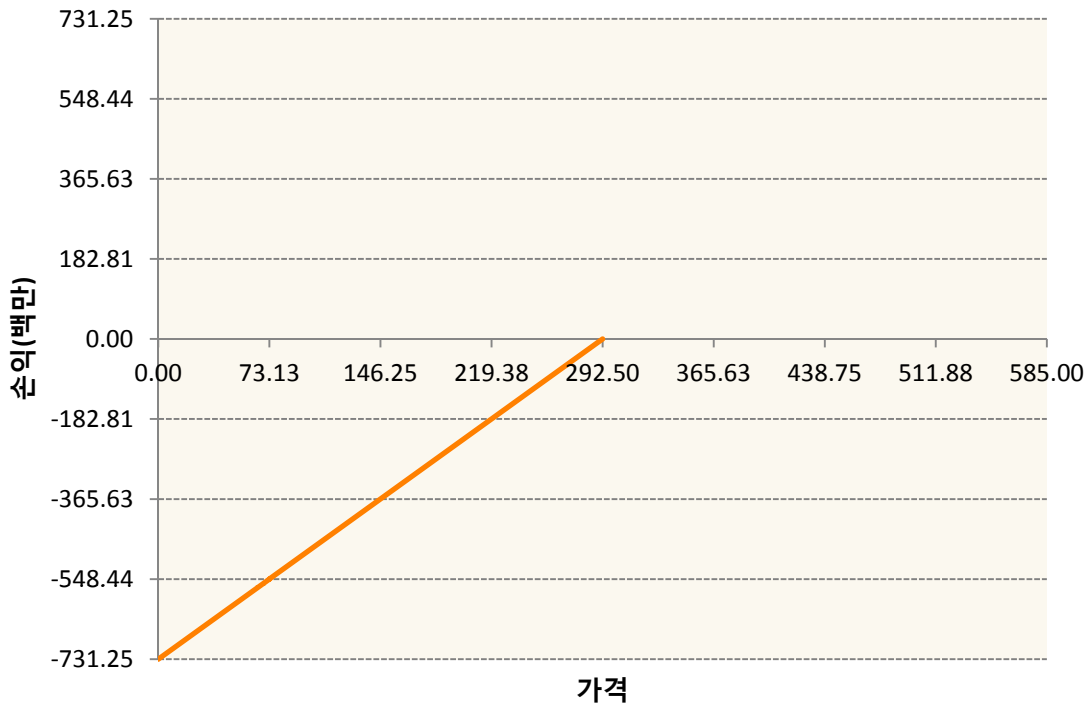


KR4201Q22950-2020-02 콜295

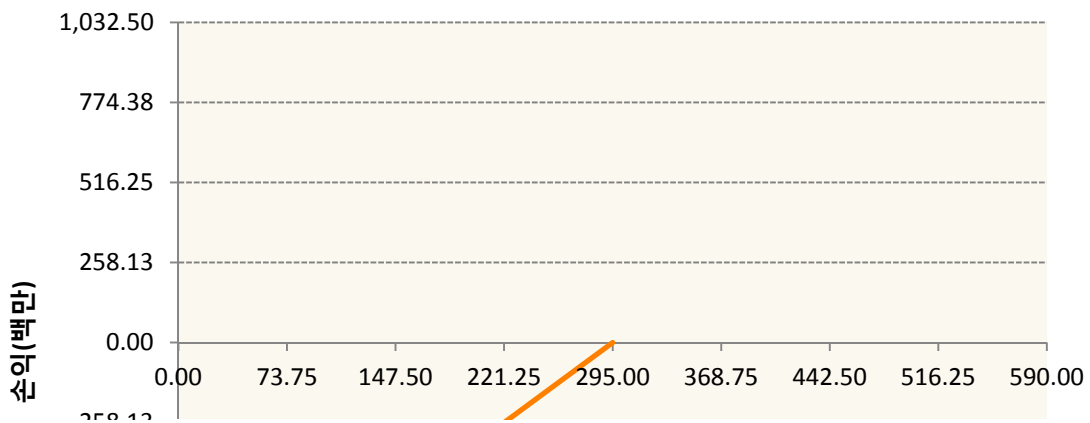




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



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						150
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-150	-150	-150	-150	-150	-150	-150	
-5.33%	-100	-100	-100	-100	-100	-100	-100	
-2.67%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	50	50	50	50	50	50	50	
5.33%	100	100	100	100	100	100	100	
8.00%	150	150	150	150	150	150	150	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						135
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	52	51	51	50	49	48	47	
-5.33%	48	47	45	44	42	40	38	
-2.67%	36	33	30	28	25	23	20	
0%	7	5	2	0	-2	-5	-7	
2.67%	-35	-36	-38	-39	-41	-42	-44	
5.33%	-83	-84	-84	-85	-86	-86	-87	
8.00%	-133	-133	-133	-134	-134	-134	-135	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						39
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-5.33%	-19	-19	-19	-20	-20	-20	-21
-2.67%	-4	-5	-5	-6	-6	-7	-8
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1
KR4301Q22958                      2020-02 풋295							62
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-62
-5.33%	-33	-34	-34	-34	-34	-35	-35
-2.67%	-9	-10	-11	-12	-12	-13	-14
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	3	3	3	3	3	2	2
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

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

(단위:백만원)

**678**

공시일	2020-02-07
기준일	2020-02-06

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

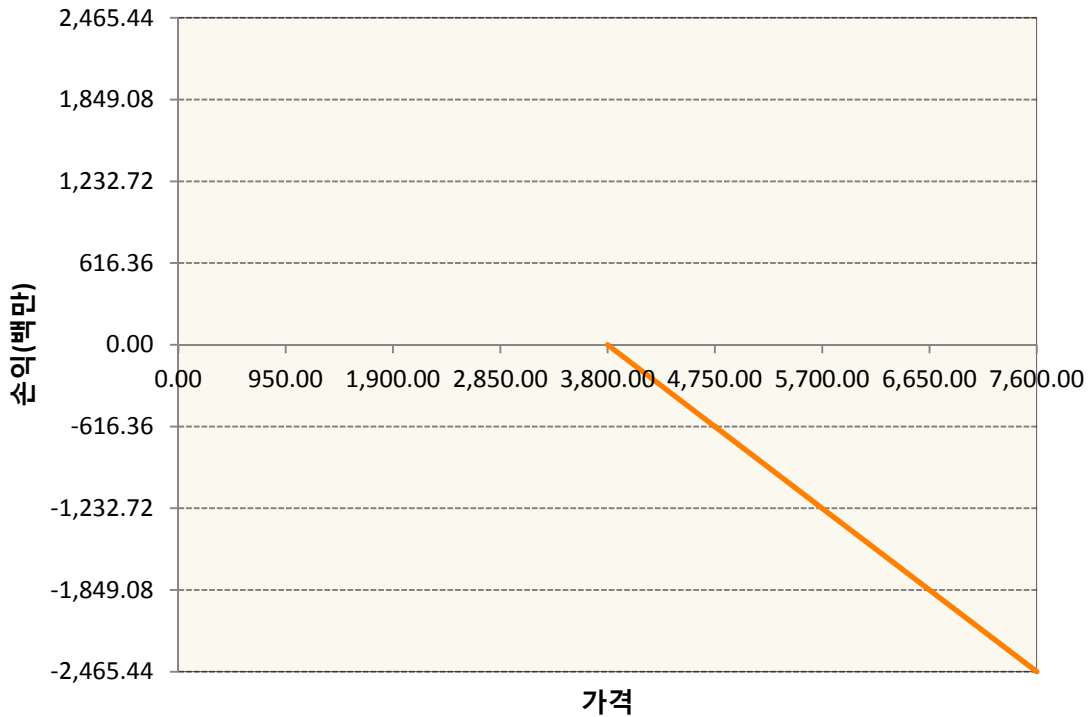
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

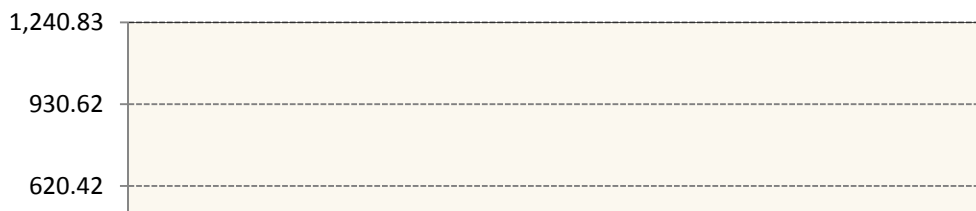
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	584	0	584	
누계	유가증권	스왑	13,559	0	13,559	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,413	-7,413	장내
누계	통화	선도	0	3,405	-3,405	장외

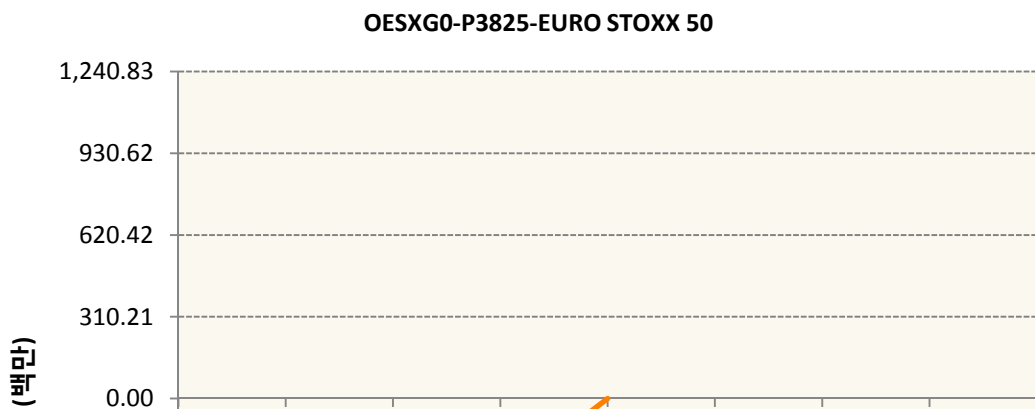
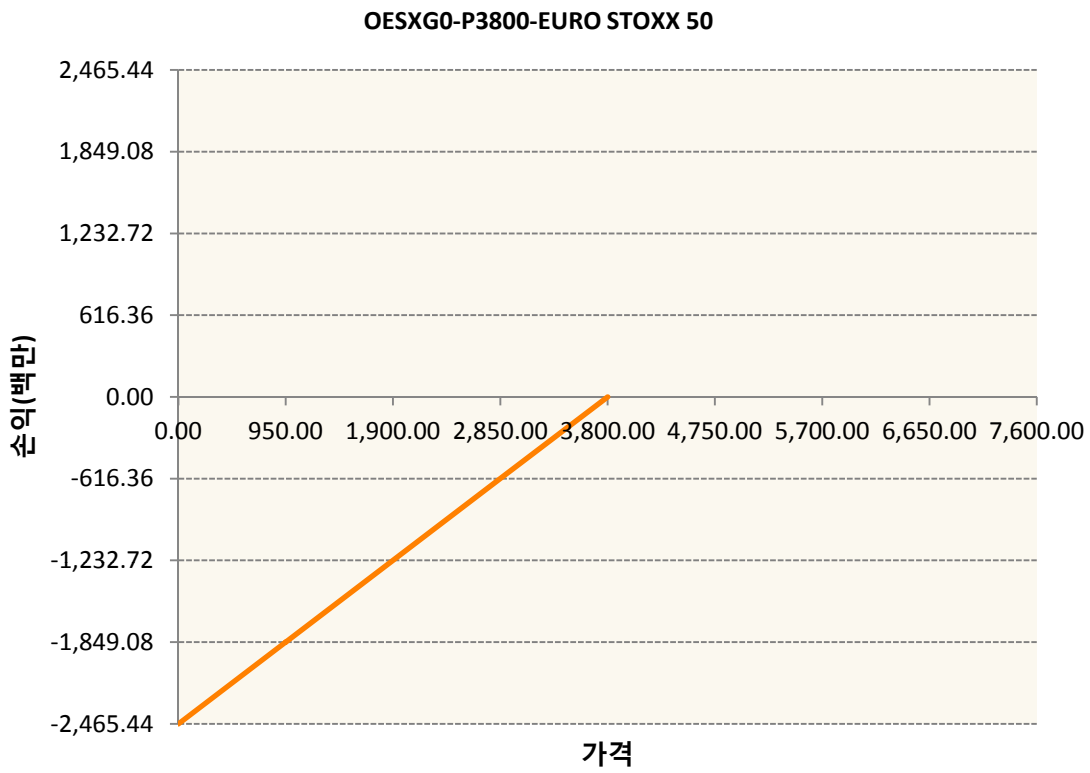
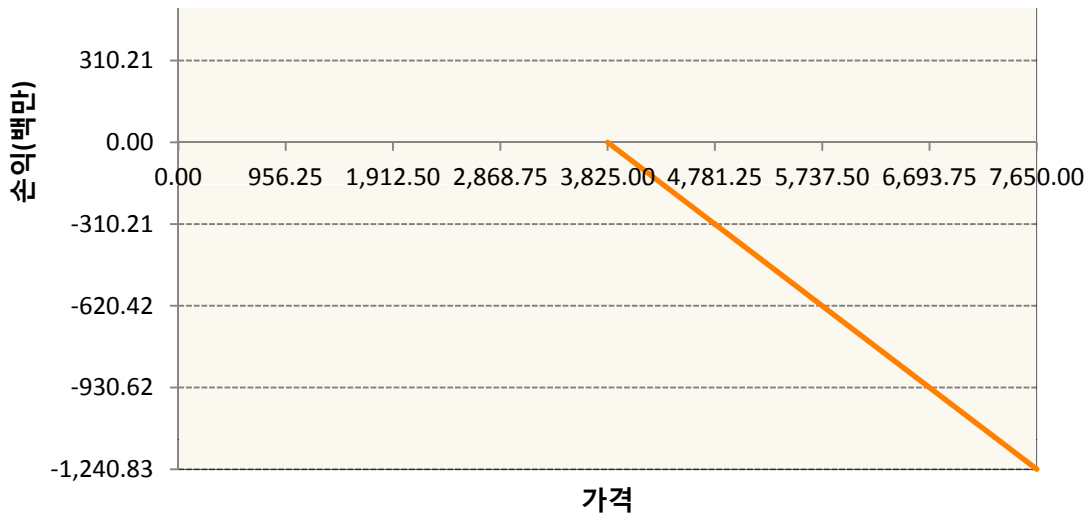
### 2. 만기시점의 손익구조

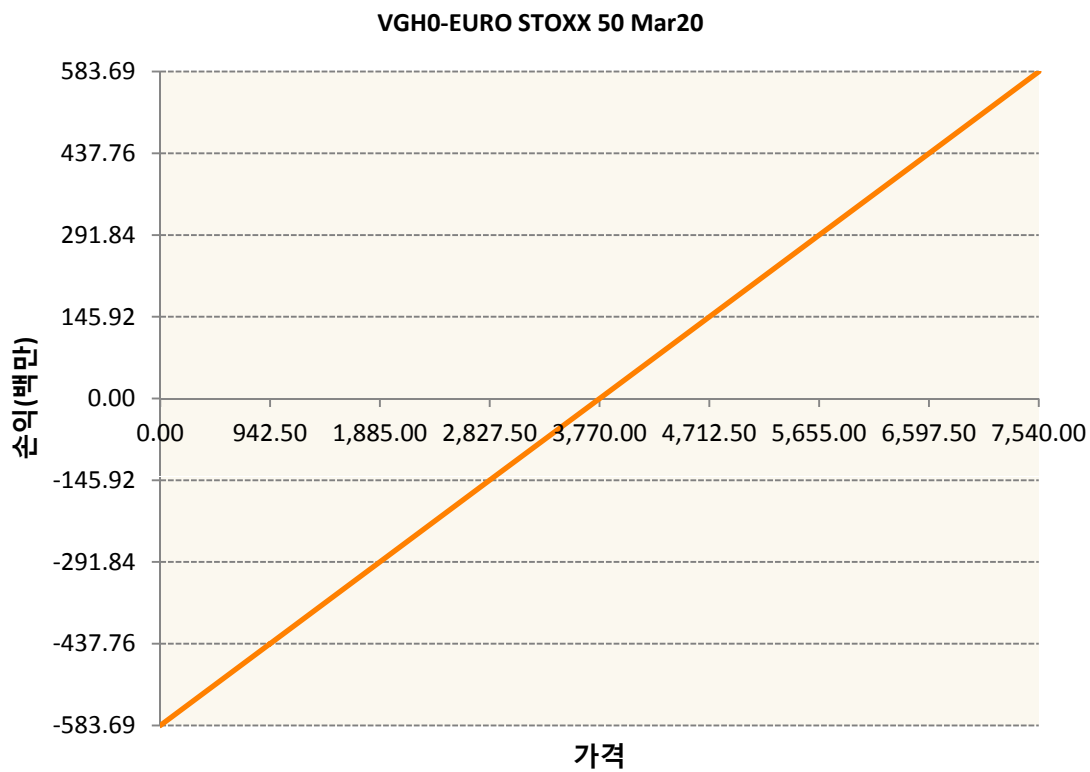
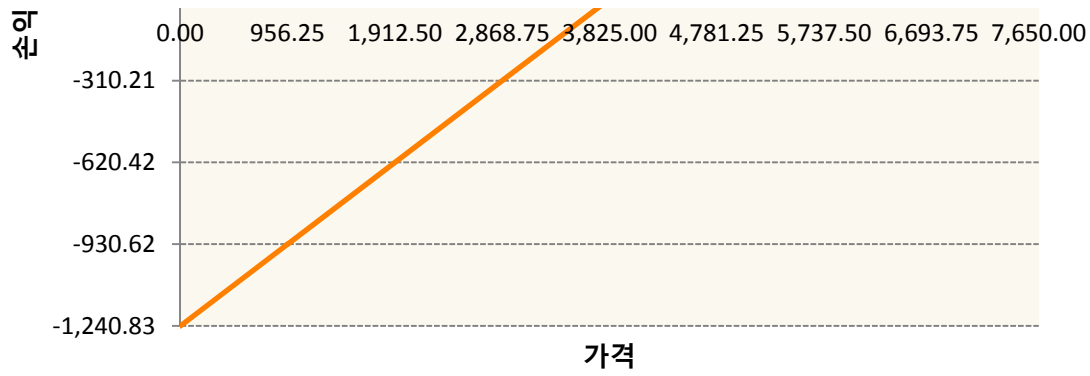
**OESXG0-C3800-EURO STOXX 50**



**OESXG0-C3825-EURO STOXX 50**







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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	2
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	272
OESXG0-C3& EURO STOXX 50	197
OESXG0-C3& EURO STOXX 50	99
OESXG0-P3& EURO STOXX 50	197
OESXG0-P3& EURO STOXX 50	99
VGHO EURO STOXX 50 Mar20	47

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





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

(단위:백만원)

955



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

(단위:백만원)

84



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

(단위:백만원)

124

공시일	2020-02-07
기준일	2020-02-06

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

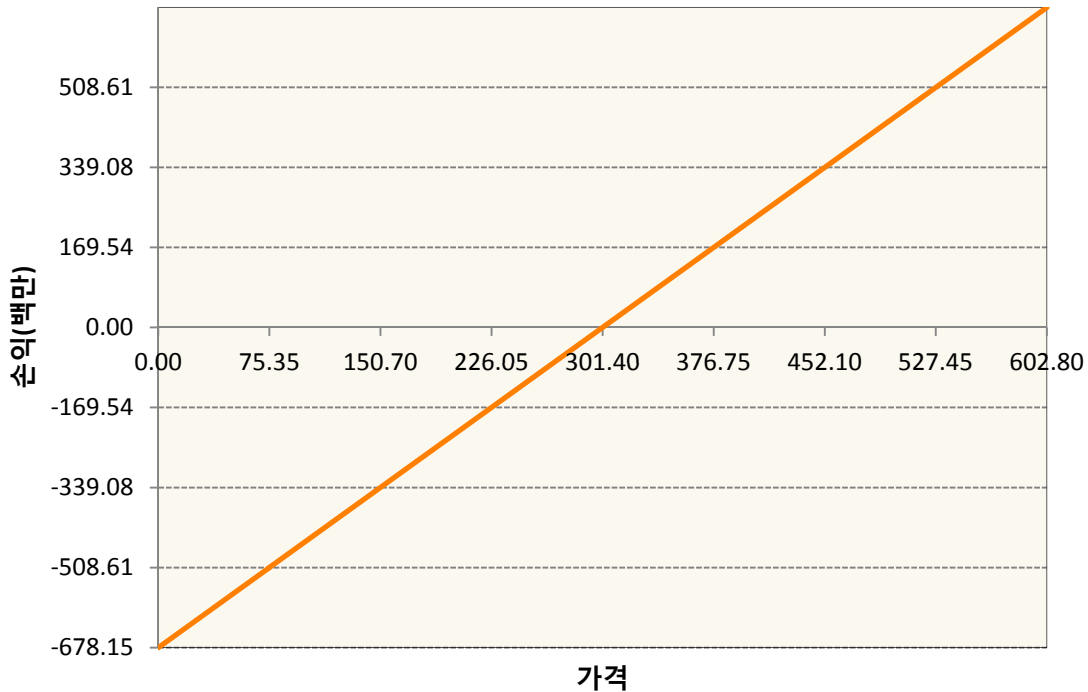
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	678	0	678	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005      2020-03 코스피200지수선물      54

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	18	18	18	18	18	18	18
5.33%	36	36	36	36	36	36	36
8.00%	54	54	54	54	54	54	54

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

(단위:백만원)

45

공시일	2020-02-07
기준일	2020-02-06

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

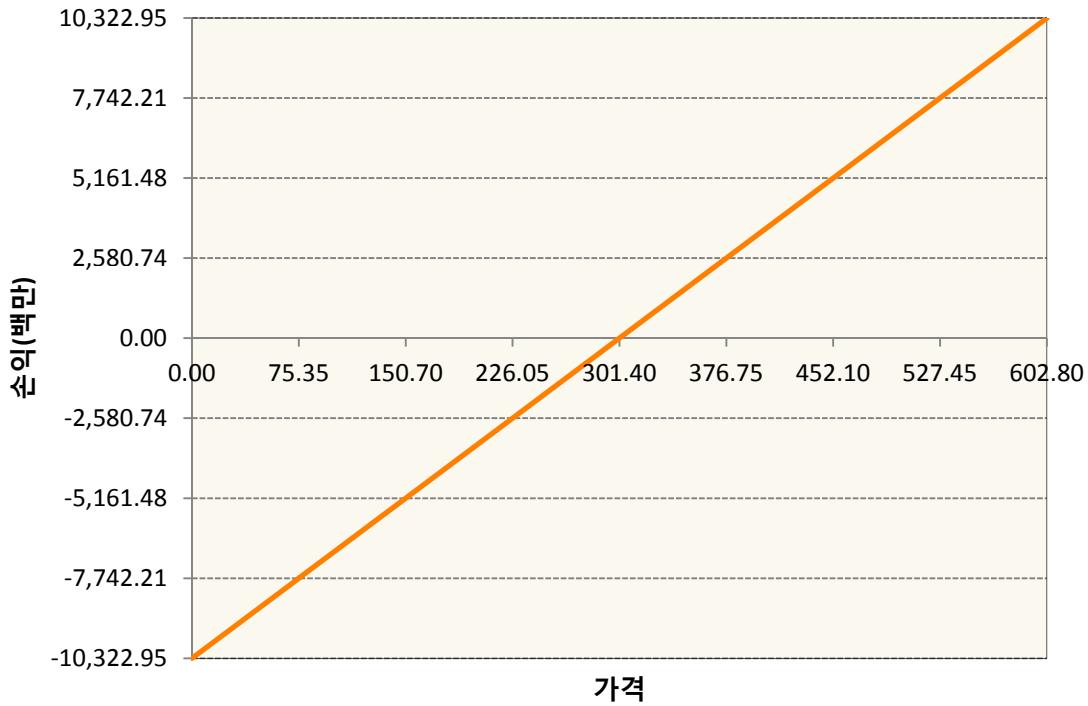
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

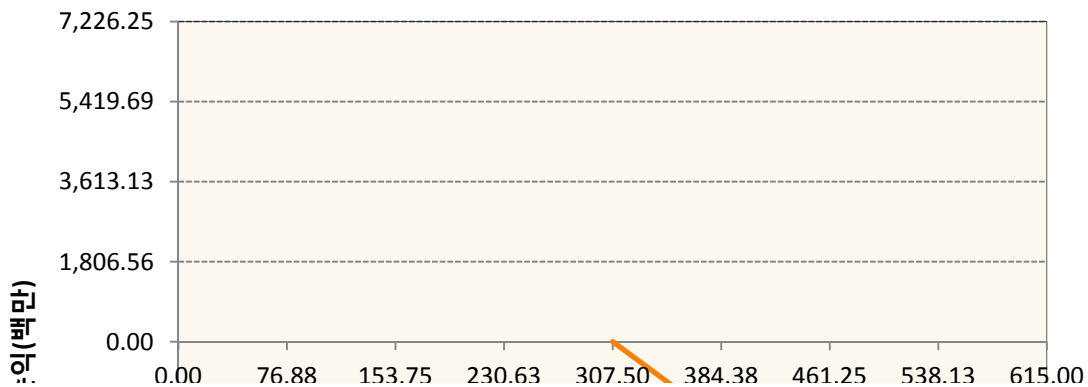
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	77	0	77	장내
누계	유가증권	선물	10,323	0	10,323	장내
누계	유가증권	옵션	2,944	20,634	-17,690	장내

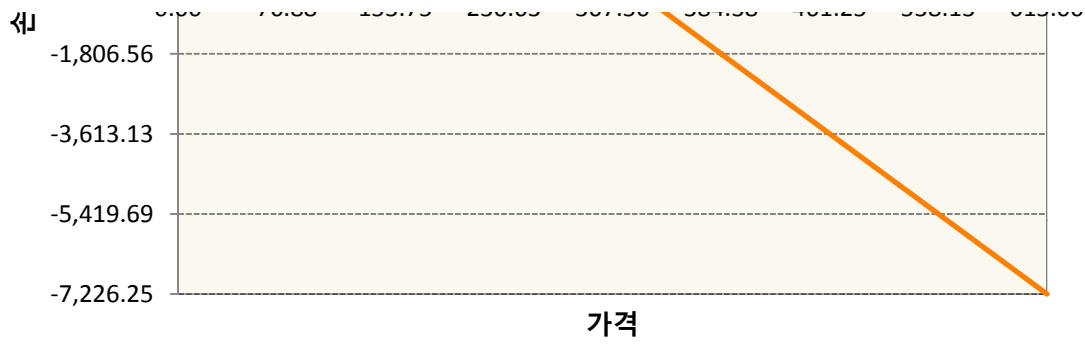
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

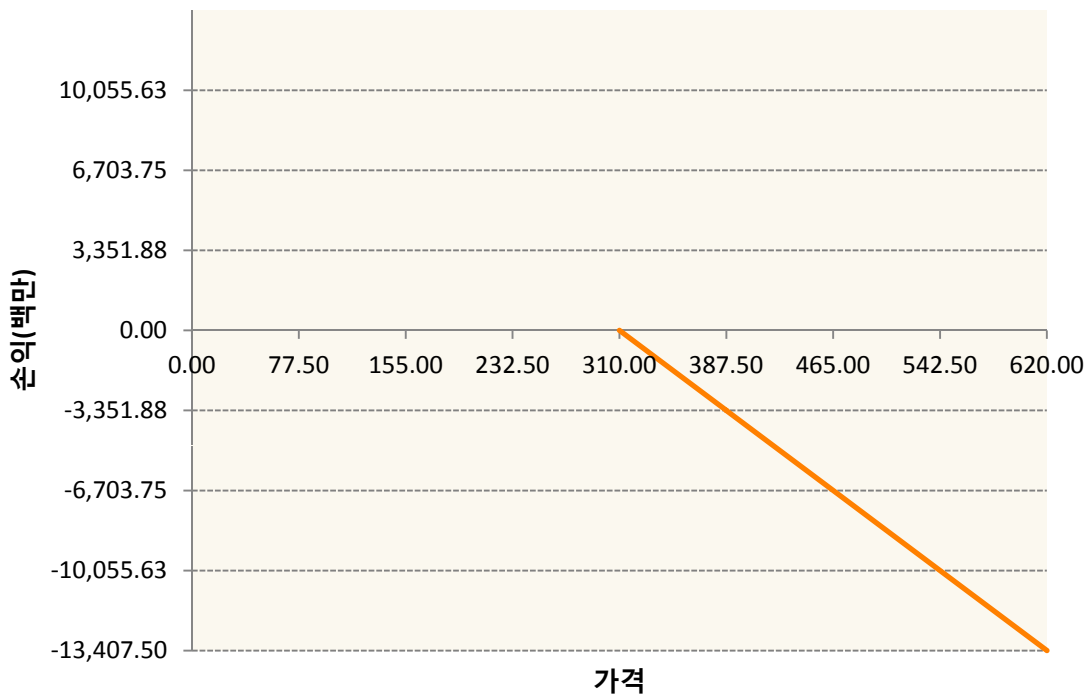


KR4201Q23073-2020-02 콜307.5

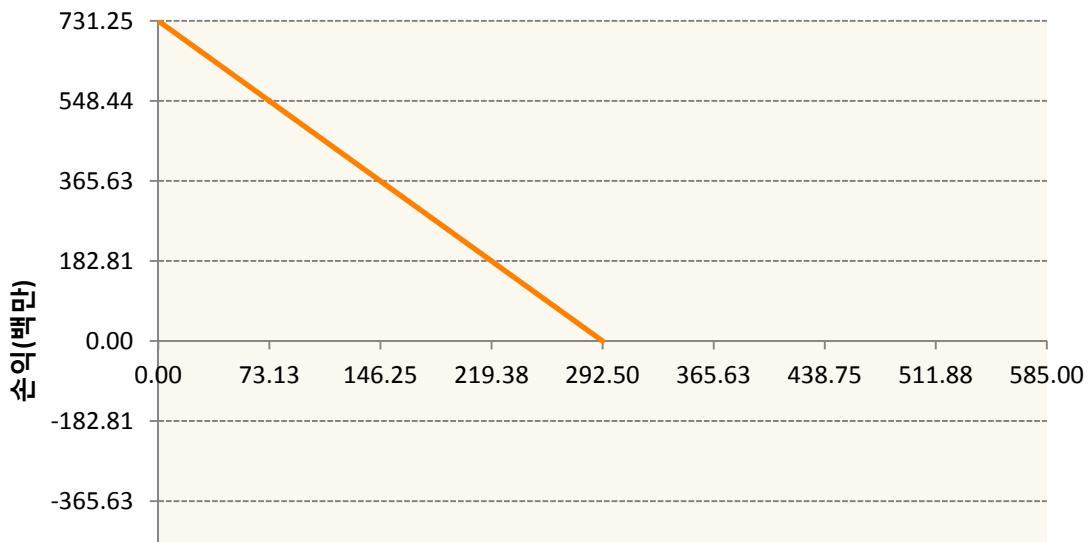


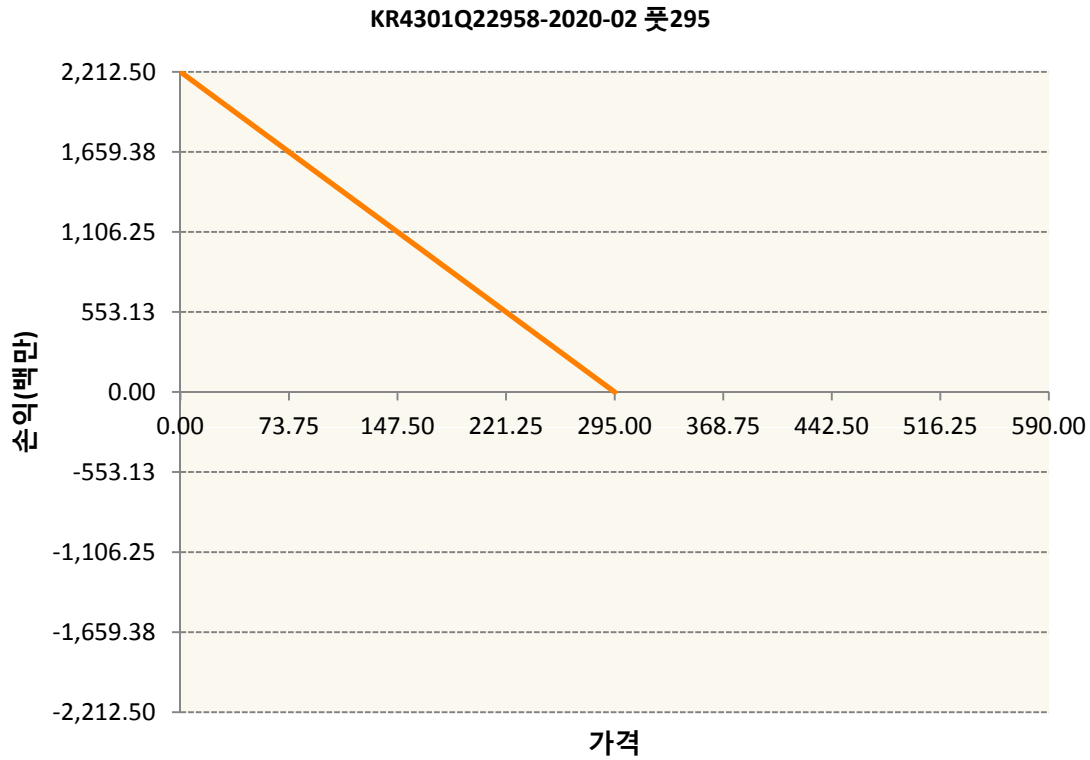
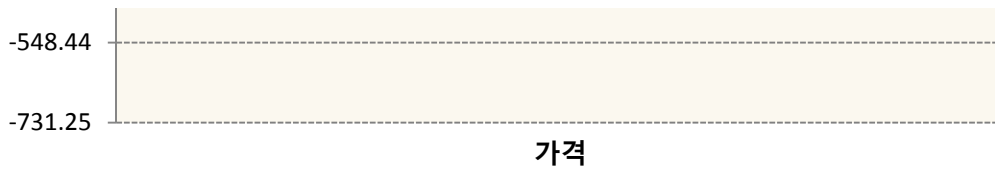


KR4201Q23107-2020-02 콜310



KR4301Q22925-2020-02 풋292.5





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

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						824
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-824	-824	-824	-824	-824	-824	-824	
-5.33%	-549	-549	-549	-549	-549	-549	-549	
-2.67%	-275	-275	-275	-275	-275	-275	-275	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	275	275	275	275	275	275	275	
5.33%	549	549	549	549	549	549	549	
8.00%	824	824	824	824	824	824	824	
KR4201Q23073		2020-02 콜307.5						378
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	57	57	56	56	56	55	54	
-5.33%	56	56	54	53	51	48	45	
-2.67%	51	48	44	39	34	28	22	

0%	25	17	9	0	-9	-18	-27
2.67%	-49	-59	-69	-79	-90	-100	-110
5.33%	-181	-188	-195	-203	-212	-220	-229
8.00%	-351	-354	-357	-362	-366	-372	-378
KR4201Q23107                      2020-02 콜310							634
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	77	76	76	76	75	74	73
-5.33%	76	75	74	72	69	66	61
-2.67%	71	67	61	55	47	38	28
0%	39	27	14	0	-15	-30	-45
2.67%	-65	-84	-103	-121	-140	-159	-178
5.33%	-276	-292	-308	-324	-341	-359	-376
8.00%	-572	-579	-588	-598	-609	-622	-634
KR4301Q22925                      2020-02 풋292.5							39
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	39	39	39	39	39	39	39
-5.33%	19	19	19	20	20	20	21
-2.67%	4	5	5	6	6	7	8
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
KR4301Q22958                      2020-02 풋295							132
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	131	132	132	132	132	132	132
-5.33%	72	72	72	73	74	74	75
-2.67%	20	21	23	25	26	28	30
0%	-4	-2	-1	0	1	3	4
2.67%	-7	-6	-6	-6	-6	-5	-5
5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-6
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7

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

(단위:백만원)

**1,663**

공시일	2020-02-07
기준일	2020-02-06

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	211,126	0	211,126	

### 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	2020-02-07
기준일	2020-02-06

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	16,724	-16,724	
누계	유가증권	수익증권	203,650	0	203,650	

### 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	2020-02-07
기준일	2020-02-06

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	6,689	-6,689	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	523,803	0	523,803	
누계	통화	선도	0	555,096	-555,096	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	1,642
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	1,548
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	944
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	189
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	2,020
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	944
FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E	3,775
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,888
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	2,020
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	189
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	189
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	1,133
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	1,699
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	283
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E	1,888
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E	3,247
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,520
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,416
FX21020F02 KRW/USD 28-02-20E	1,888
FX21020F03 KRW/USD 28-02-20E	2,926
FX21020F03 KRW/USD 31-03-20E	3,020
FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E	2,832
FX21020F04 KRW/USD 28-02-20E	189
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,548
FX21020G00 KRW/USD 06-03-20E	2,360
FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	944
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,170
IE00BD8RGM75	

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

14,857



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

(단위:백만원)

126

공시일	2020-02-07
기준일	2020-02-06

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

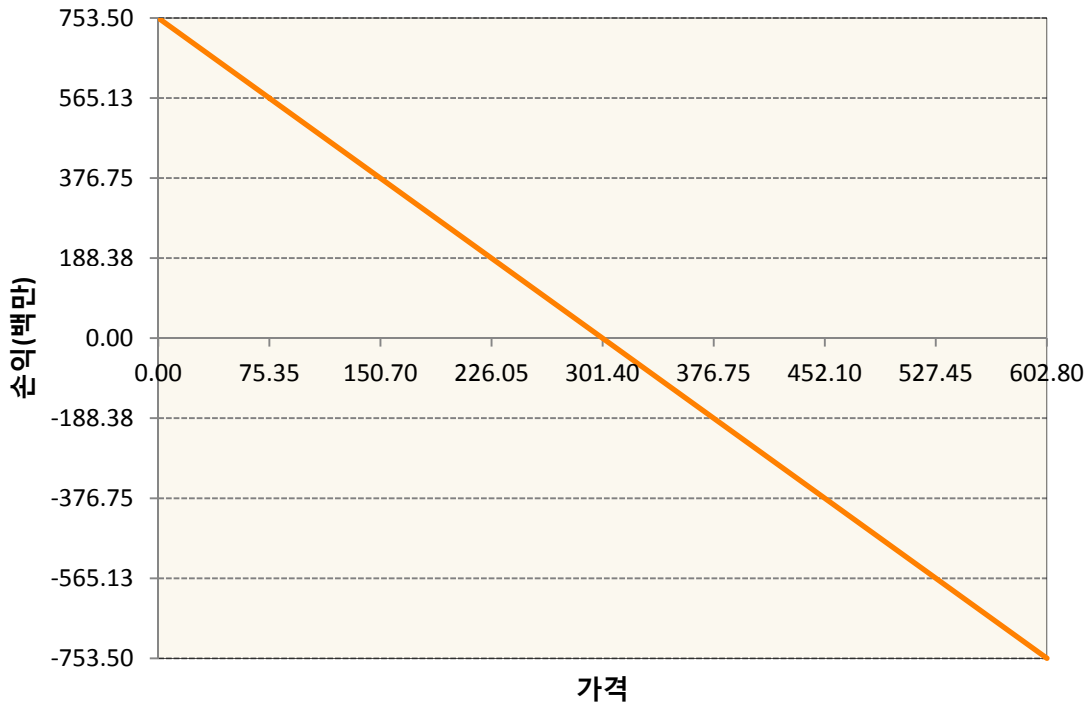
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

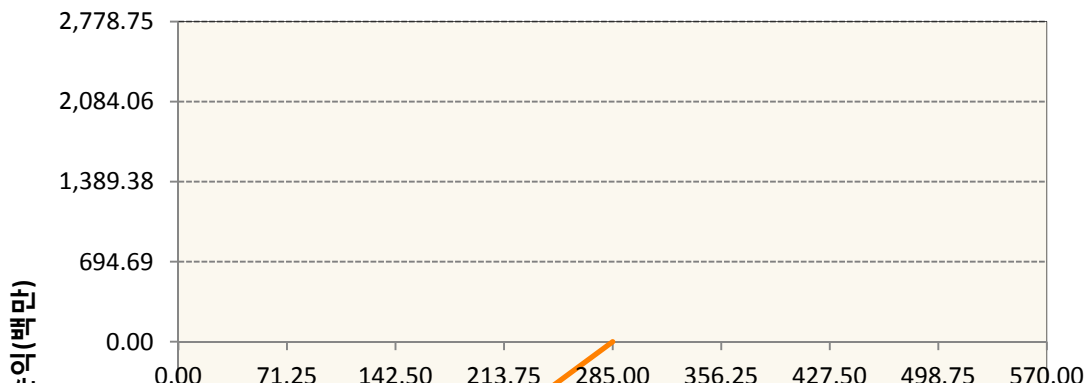
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	754	-754	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,569	-3,569	장내

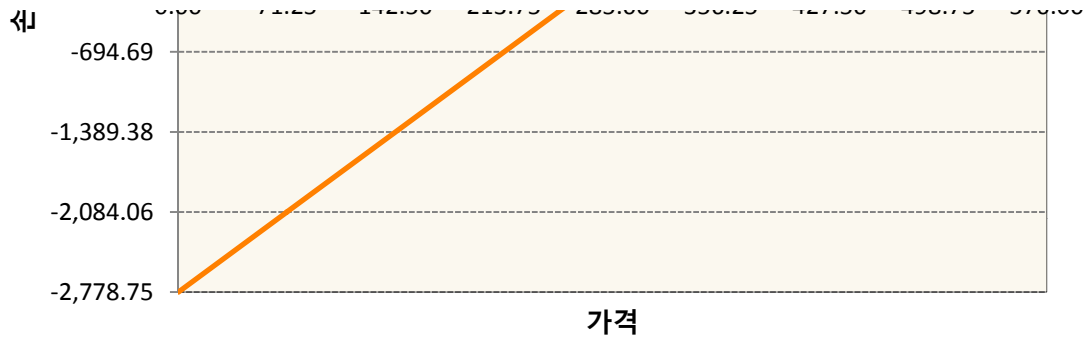
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

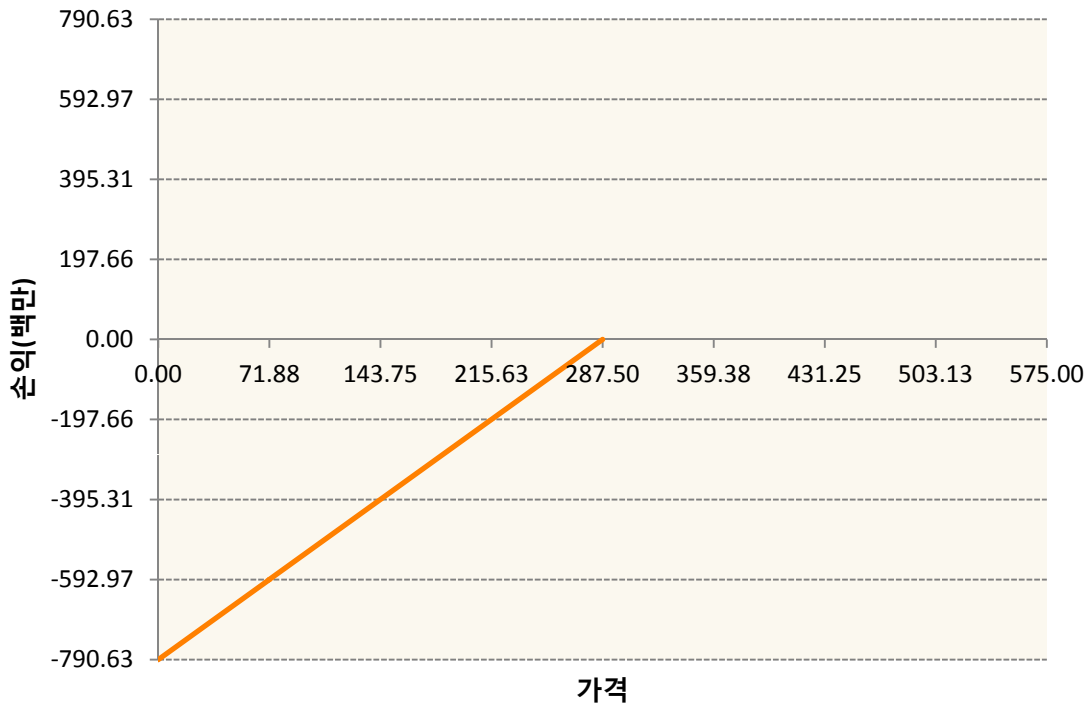


KR4301Q22859-2020-02 풋285





KR4301Q22875-2020-02 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						60
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	60	60	60	60	60	60	60	
-5.33%	40	40	40	40	40	40	40	
-2.67%	20	20	20	20	20	20	20	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20	
5.33%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40	
8.00%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60	
KR4301Q22859		2020-02 풋285						89
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-83	-83	-84	-85	-86	-87	-89
-5.33%	-22	-24	-26	-28	-31	-33	-35
-2.67%	-1	-2	-3	-4	-6	-7	-9
0%	0	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

KR4301Q22875                      2020-02 풋287.5                      31

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-30	-30	-30	-30	-30	-31	-31
-5.33%	-10	-11	-11	-12	-13	-13	-14
-2.67%	-1	-1	-2	-2	-3	-3	-4
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

**92**

공시일	2020-02-07
기준일	2020-02-06

## H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	542	-542	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	11,602	0	11,602	
누계	통화	선도	0	16,258	-16,258	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	349
FX21020F00 KRW/USD 13-02-20E	126
FX21020F03 KRW/USD 28-02-20E	206
FX21020F04 KRW/USD 28-02-20E	294
FX21020F04 KRW/USD 28-02-20E	5
FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	321
IE00BD8RGM75	

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

435
-----

공시일	2020-02-07
기준일	2020-02-06

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

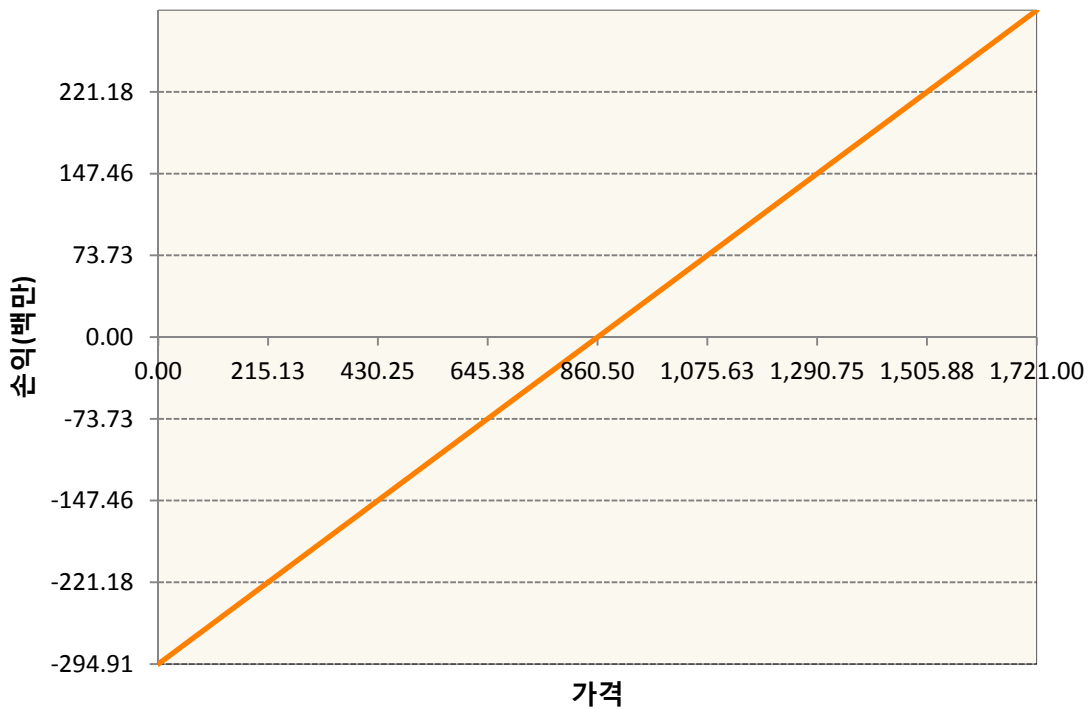
### 1. 계약금액

(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	295	0	295	
누계	유가증권	스왑	1,070	0	1,070	장외
누계	통화	선도	182	623	-441	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

VNCG0-VN30 Index Future Feb20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	86
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	24

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

(단위:백만원)

**104**

공시일	2020-02-07
기준일	2020-02-06

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

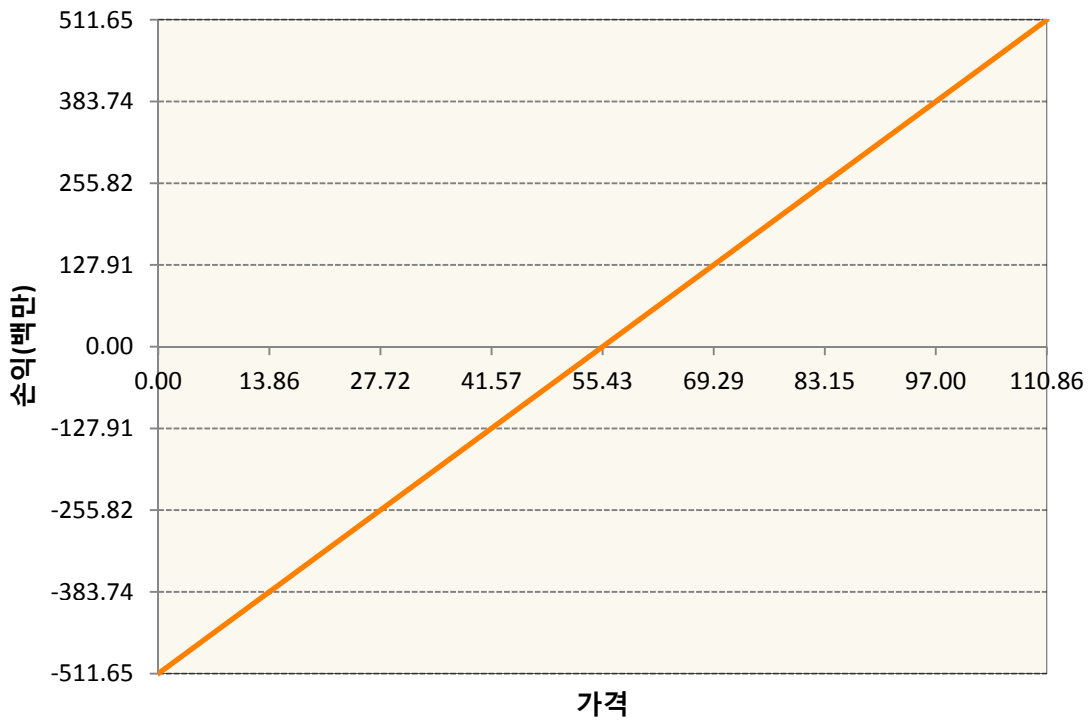
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

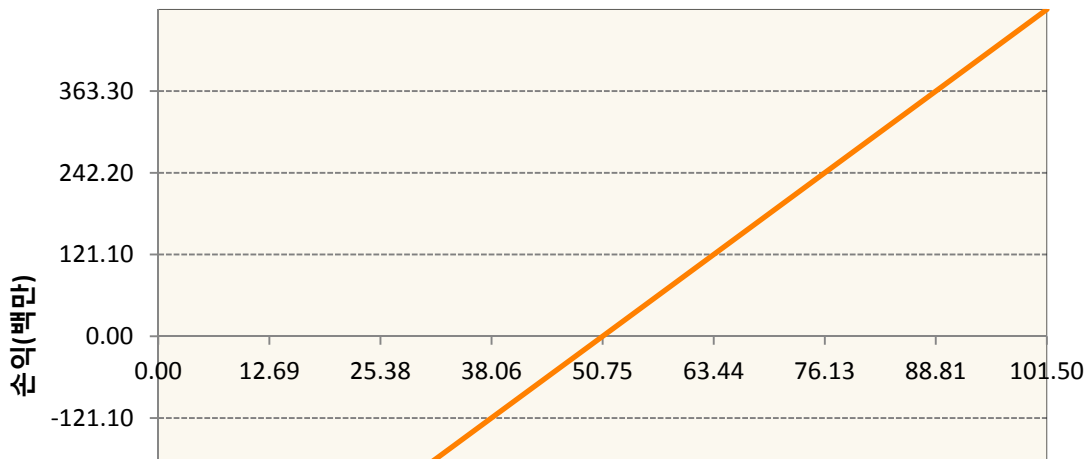
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,052	189	1,864	

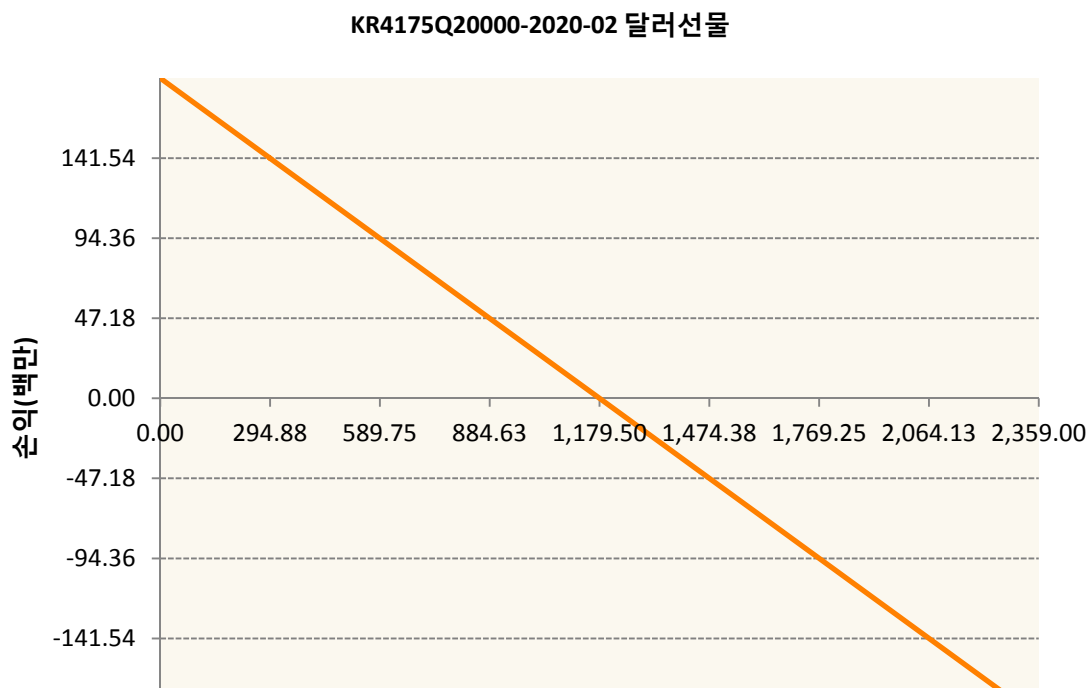
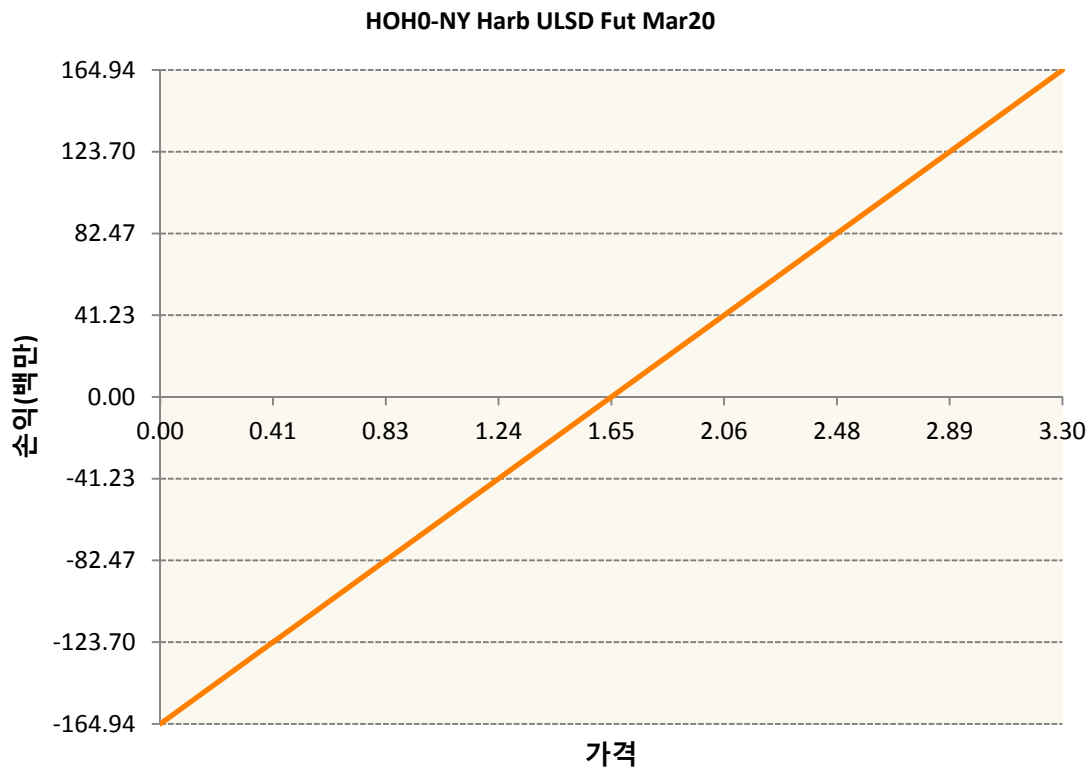
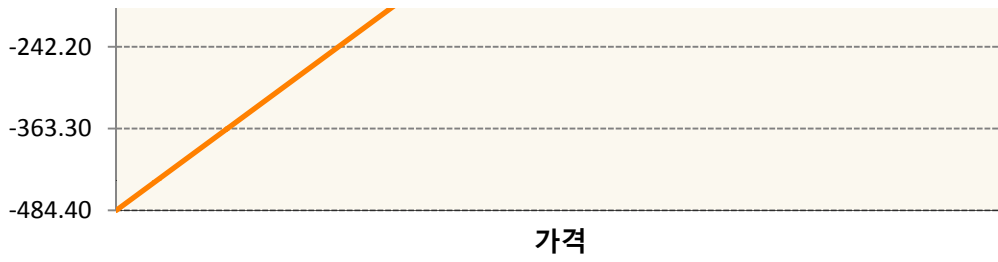
### 2. 만기시점의 손익구조

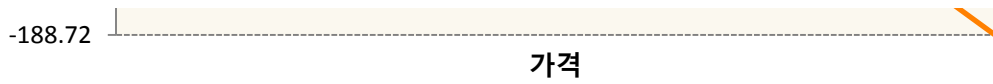
**COKO-BRENT CRUDE FUTR May20**



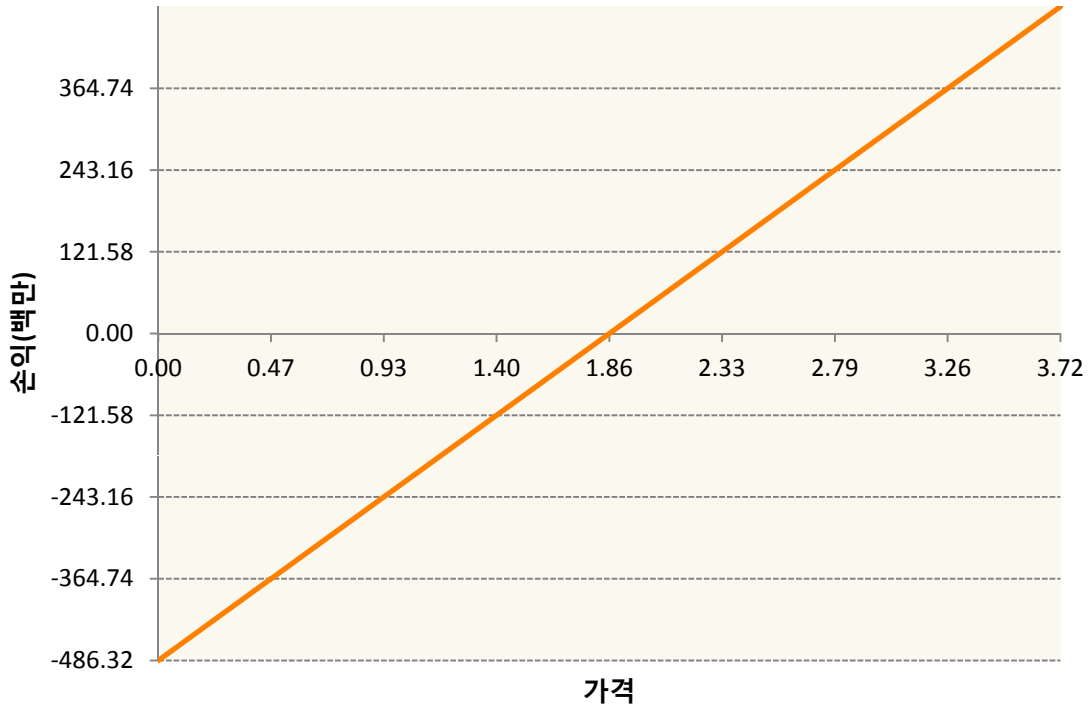
**CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20**



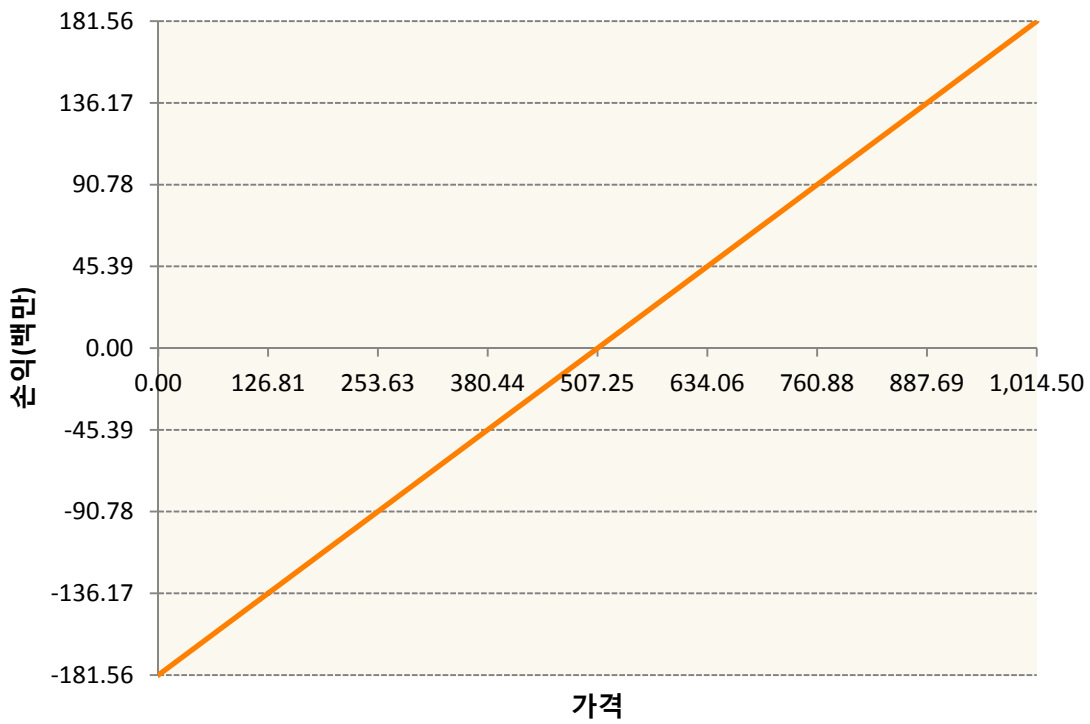




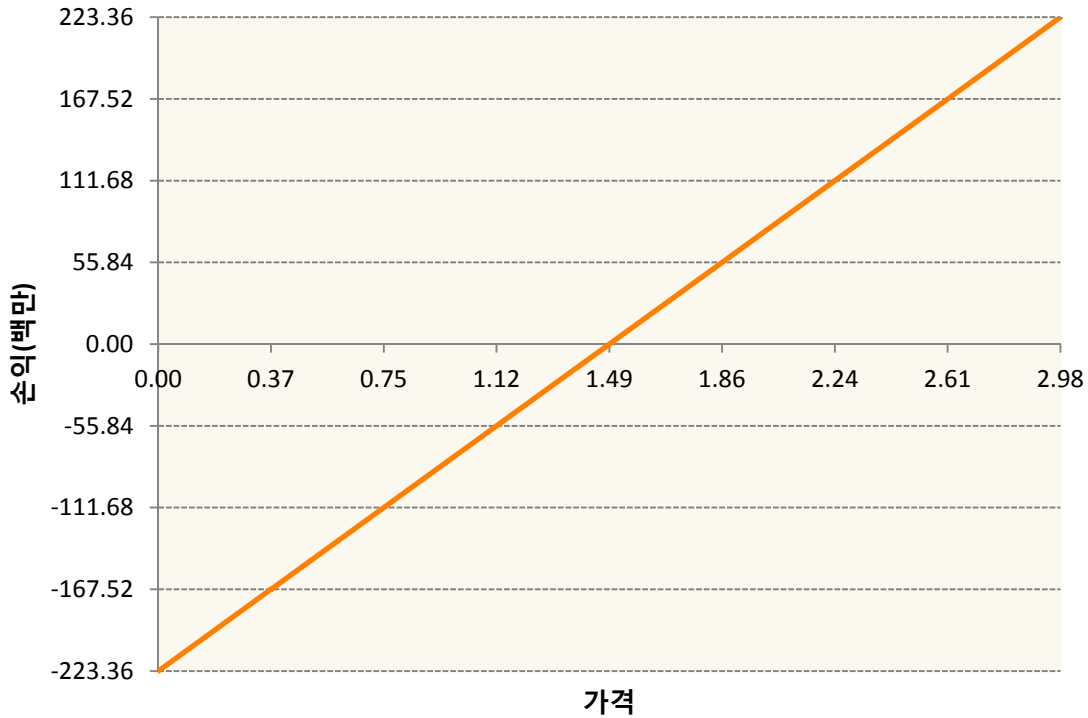
NGH20-NATURAL GAS FUTR Mar20



QSH0-Low Su Gasoil G Mar20



XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	41
CLH0	WTI CRUDE FUTURE Mar20	39
HOH0	NY Harb ULSD Fut Mar20	13
KR4175Q20C	2020-02 달러선물	15
NGH20	NATURAL GAS FUTR Mar20	39
QSH0	Low Su Gasoil G Mar20	15
XBH0	GASOLINE RBOB FUT Mar20	18

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

322

공시일	2020-02-07
기준일	2020-02-06

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

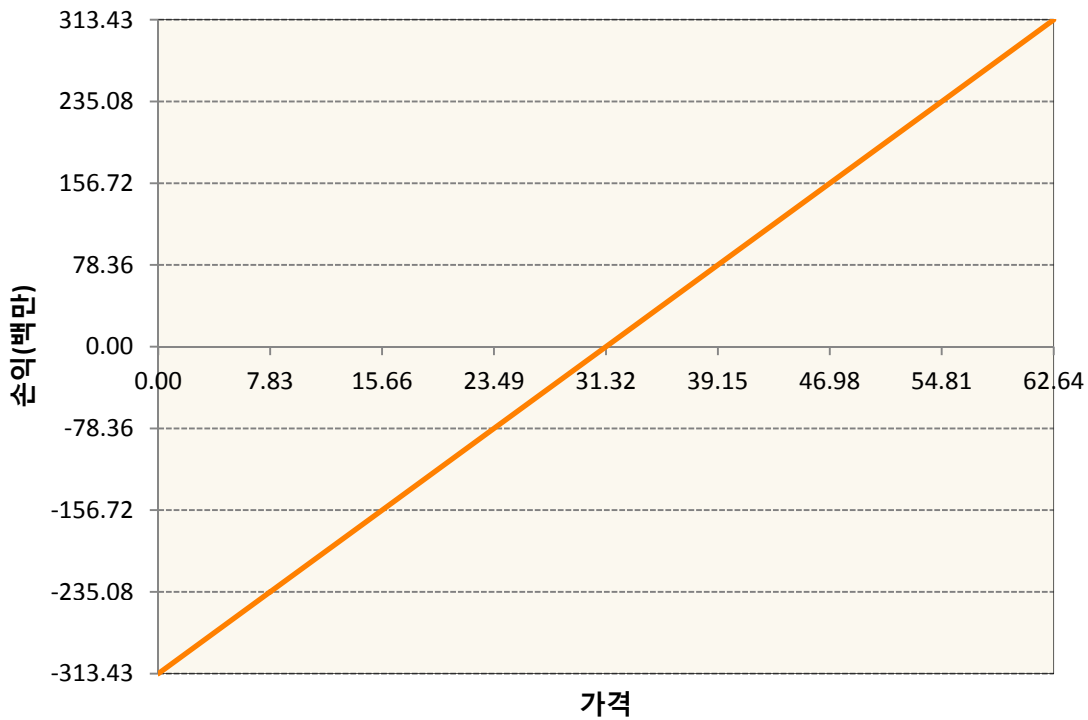
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

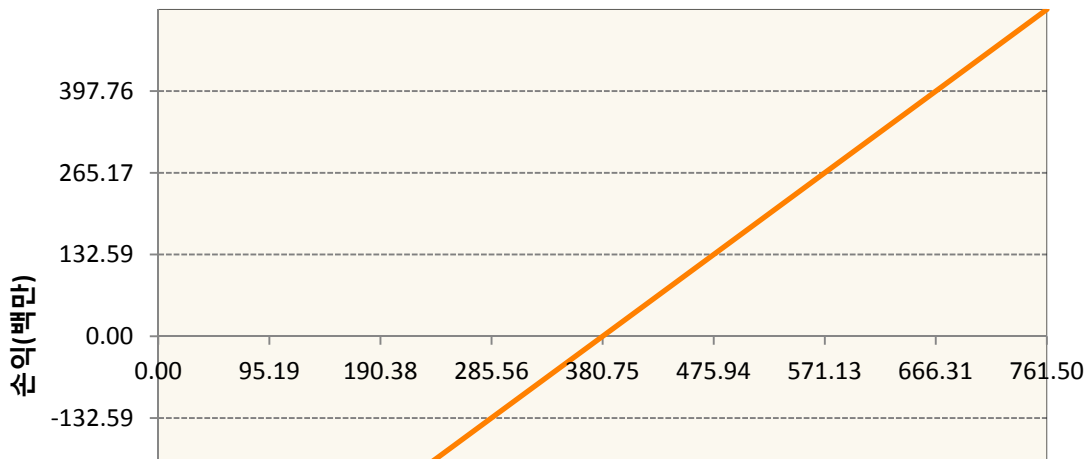
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,729	153	2,576	

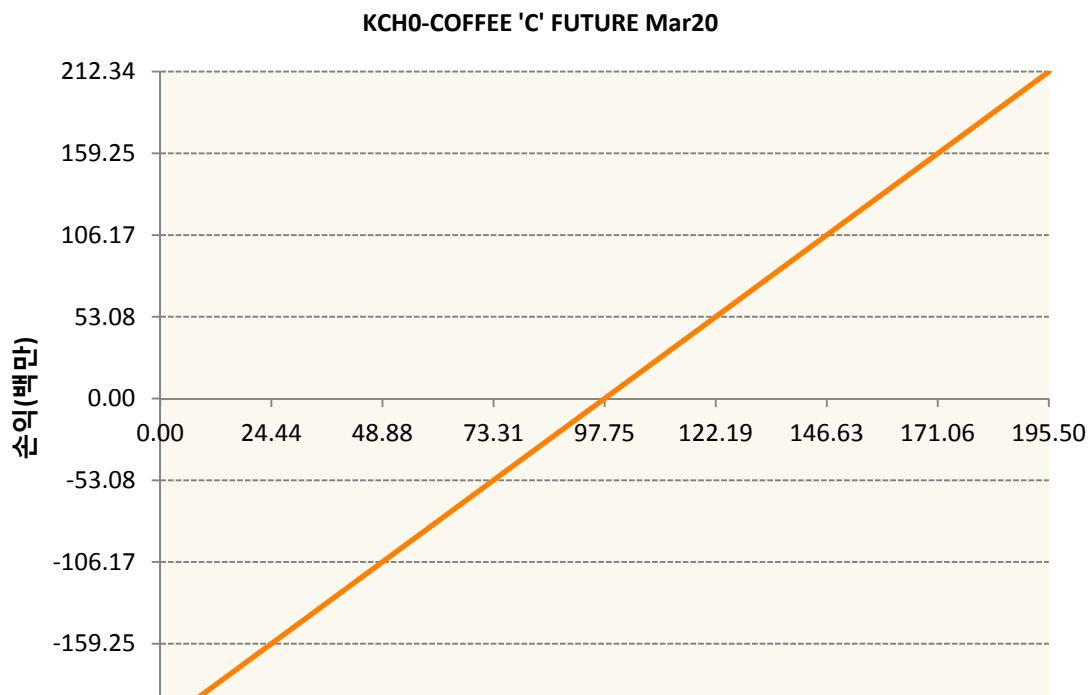
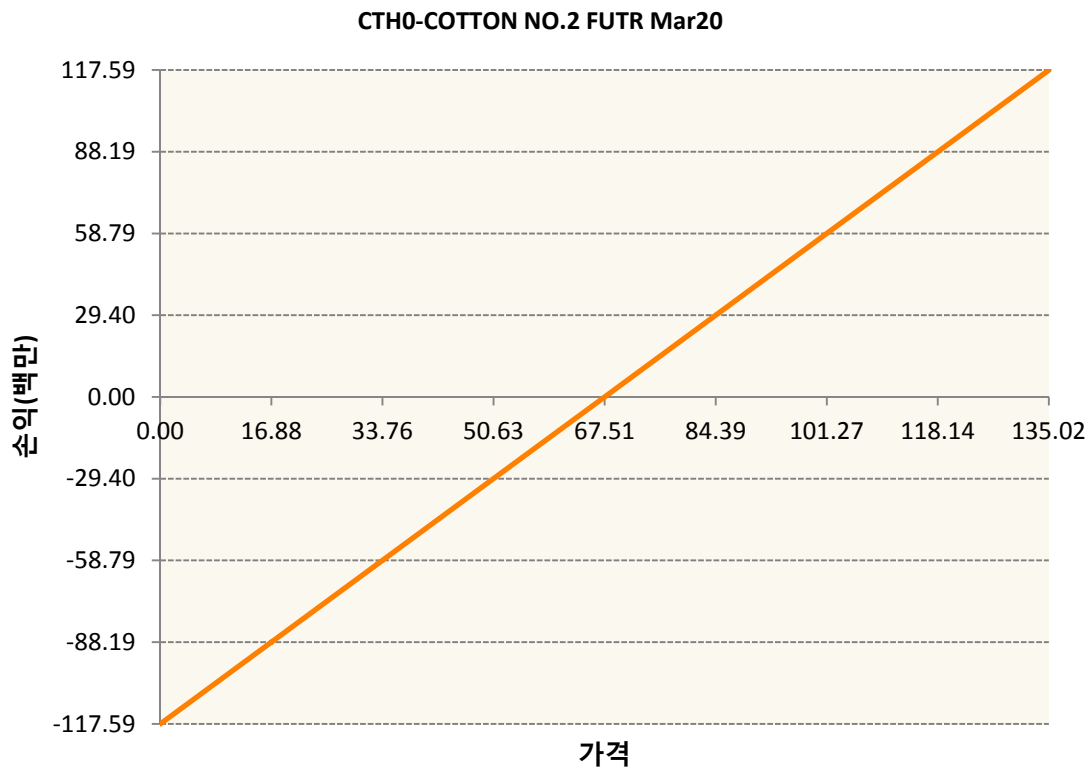
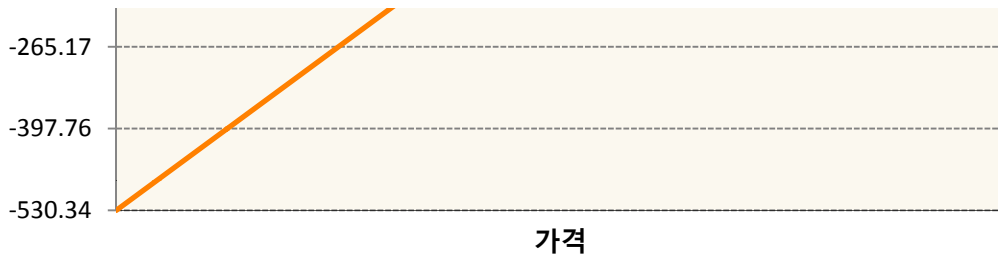
### 2. 만기시점의 손익구조

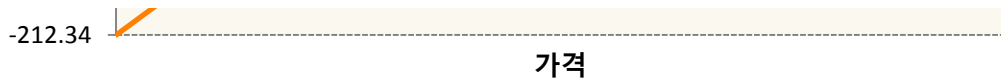
**BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20**



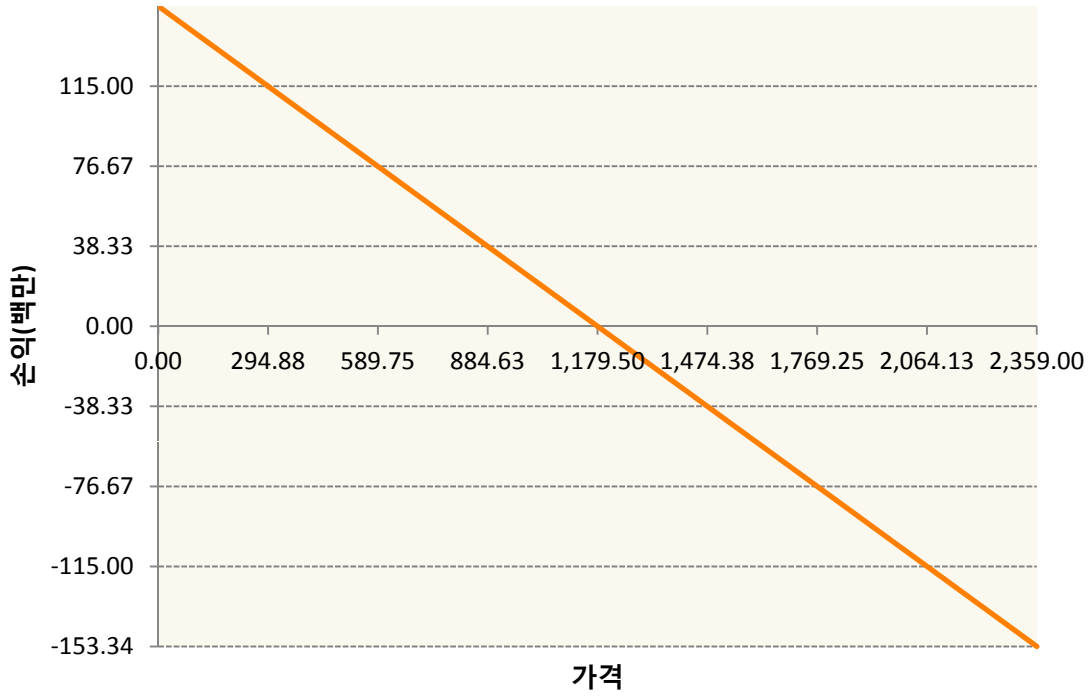
**CH0-CORN FUTURE Mar20**



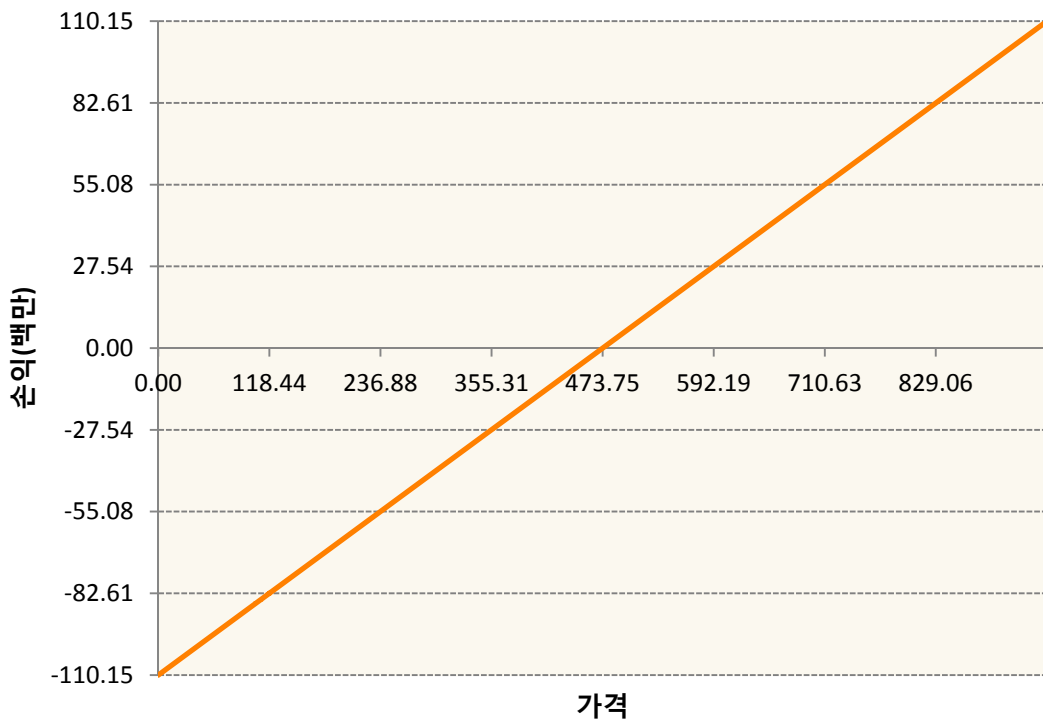




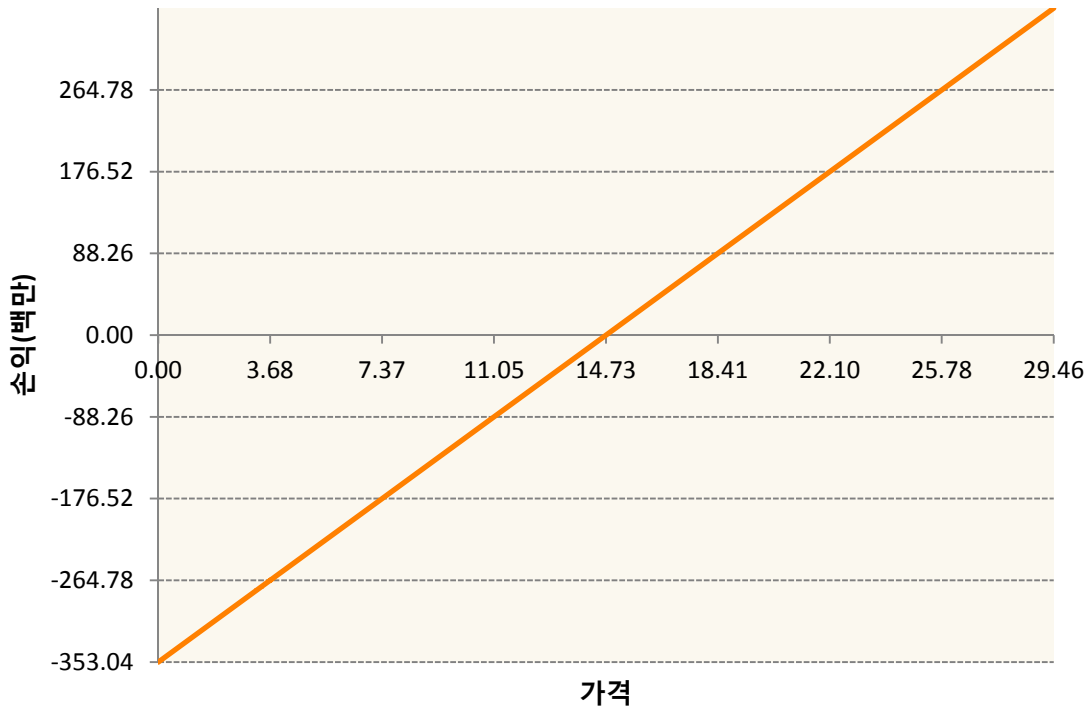
KR4175Q20000-2020-02 달러선물



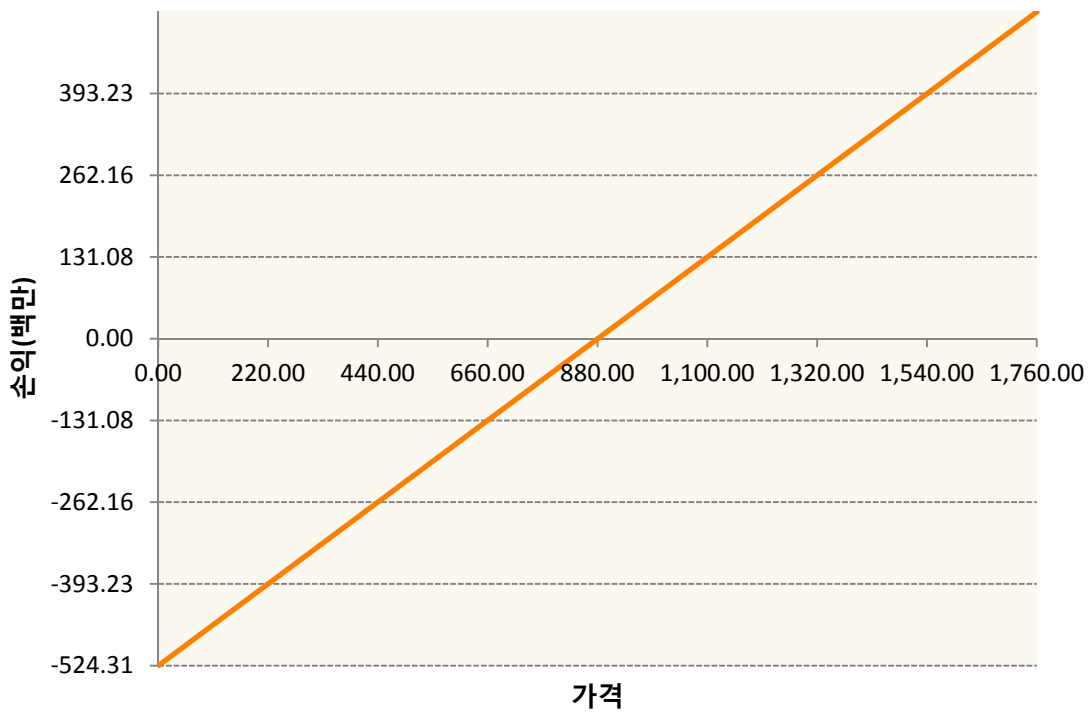
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

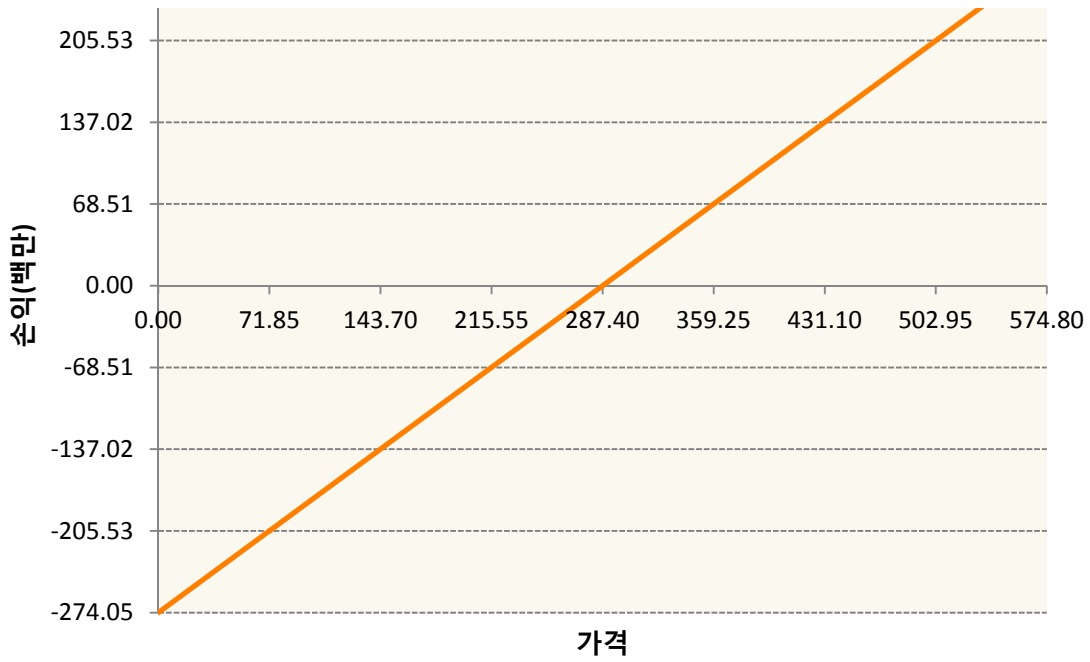


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20

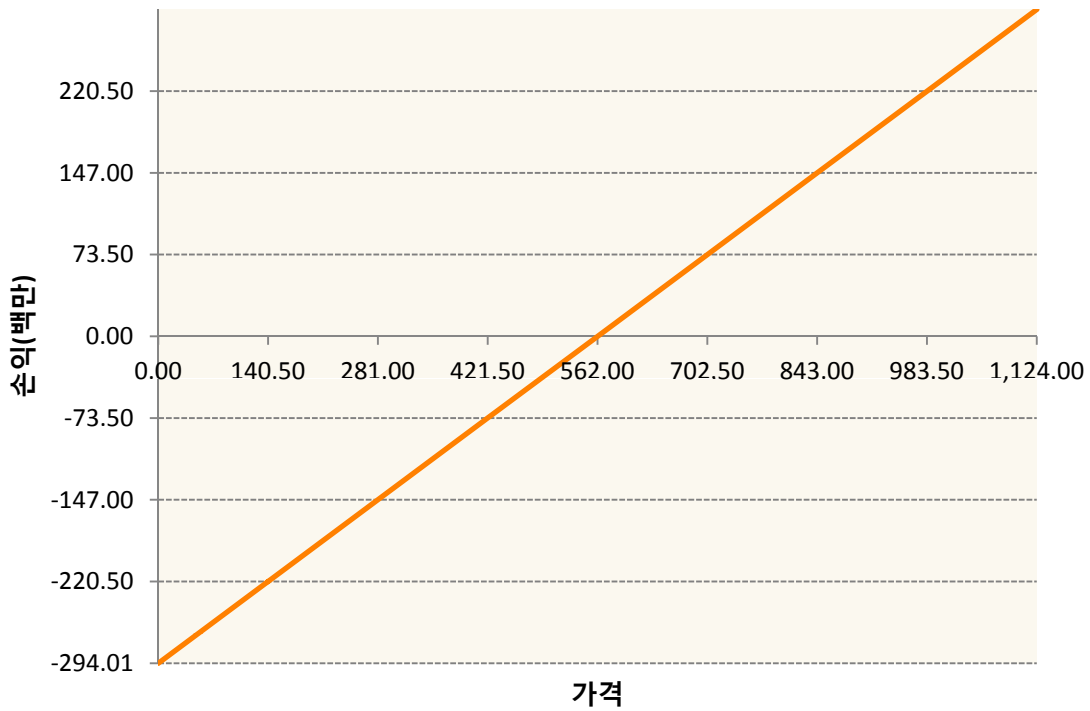


SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





WHO-WHEAT FUTURE(CBT) Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH0	SOYBEAN OIL FUTR Mar20	25
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	28
SH0	SOYBEAN FUTURE Mar20	42
SMH0	SOYBEAN MEAL FUTR Mar20	22
WH0	WHEAT FUTURE(CBT) Mar20	24

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

(단위:백만원)

**236**