

공시일	2020-02-10
기준일	2020-02-07

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)

15

공시일	2020-02-10
기준일	2020-02-07

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

1,158

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

673

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-10
기준일	2020-02-07

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)	412
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	151

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

875

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-10
기준일	2020-02-07

유로인덱스모(주식-파생형)

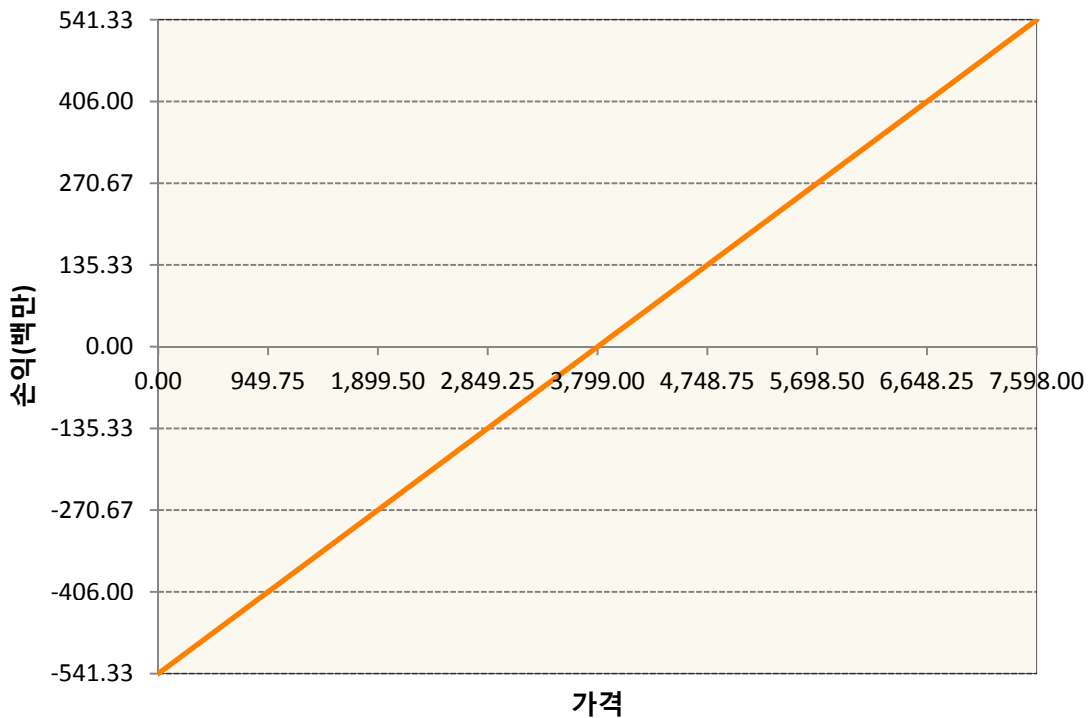
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	541	0	541	

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	2020-02-10
기준일	2020-02-07

차이나인덱스모(주식-파생형)

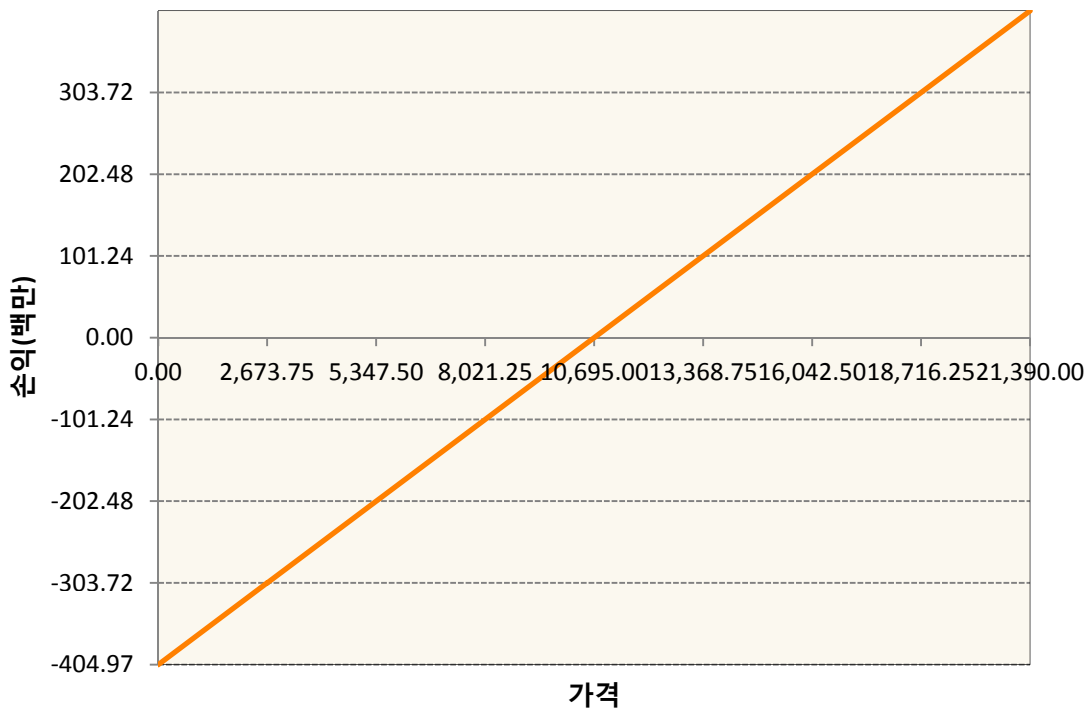
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	405	0	405	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)

30

공시일	2020-02-10
기준일	2020-02-07

커버드콜모(주식혼합-파생형)

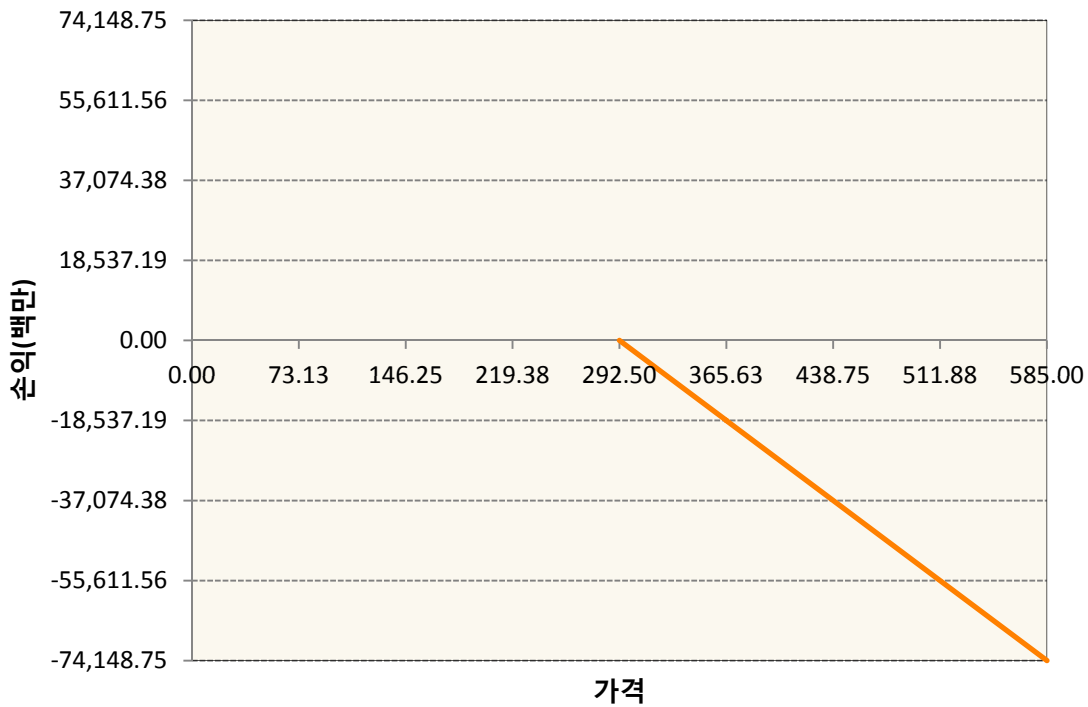
1. 계약금액

(단위:백만원)

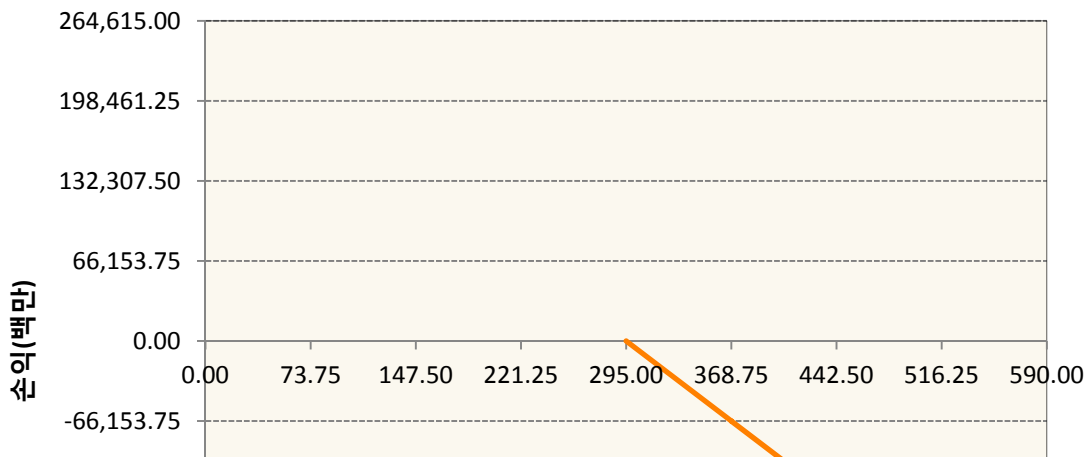
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	455,004	-455,004	장내

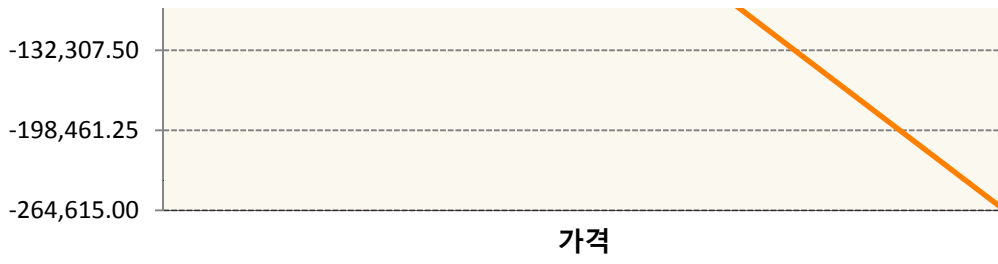
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q22927-2020-02 콜292.5

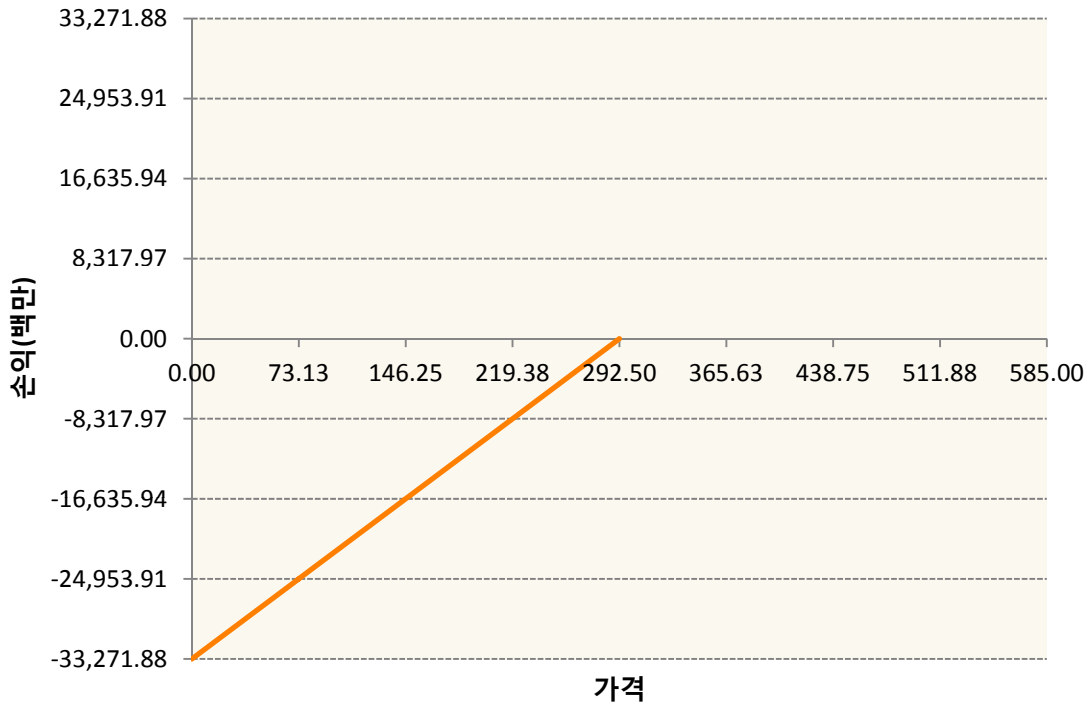


KR4201Q22950-2020-02 콜295

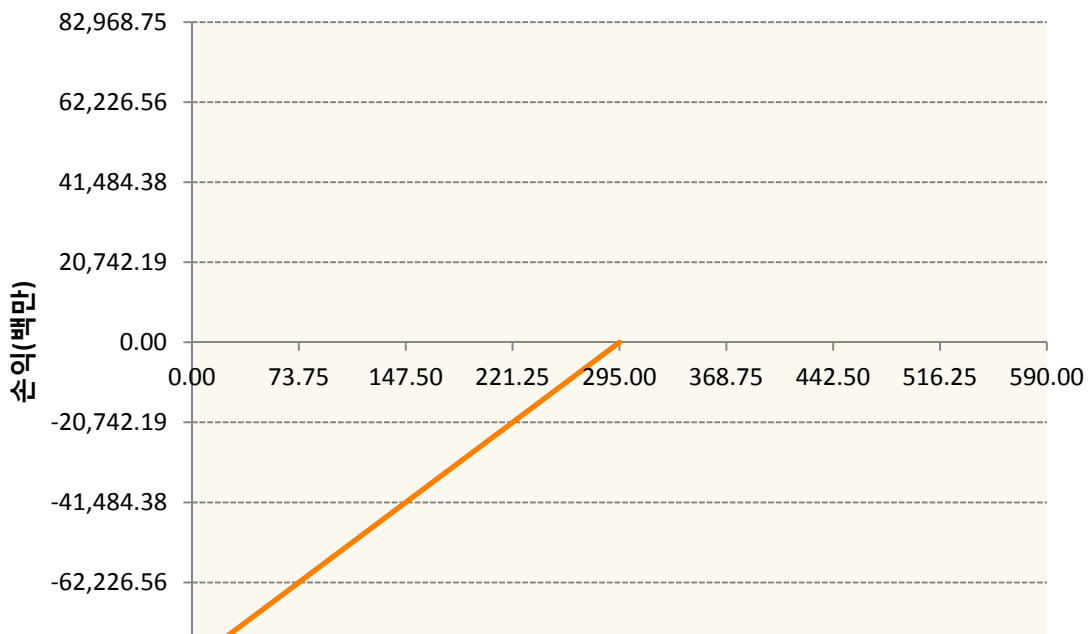




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



KR4301Q22958-2020-02 풋295



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q22927		2020-02 콜292.5						5,490
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,024	2,013	1,996	1,974	1,946	1,913	1,875	
-5.33%	1,916	1,866	1,810	1,749	1,683	1,614	1,542	
-2.67%	1,422	1,328	1,234	1,139	1,044	949	854	
0%	251	170	86	0	-88	-177	-267	
2.67%	-1,482	-1,516	-1,557	-1,605	-1,659	-1,717	-1,780	
5.33%	-3,444	-3,451	-3,463	-3,480	-3,502	-3,530	-3,563	
8.00%	-5,454	-5,454	-5,457	-5,461	-5,467	-5,477	-5,490	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						18,694
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5,749	5,727	5,690	5,638	5,568	5,481	5,377	
-5.33%	5,538	5,413	5,263	5,092	4,901	4,695	4,474	
-2.67%	4,350	4,051	3,743	3,430	3,113	2,791	2,467	
0%	994	666	334	0	-336	-675	-1,014	
2.67%	-4,627	-4,800	-4,998	-5,216	-5,450	-5,699	-5,959	
5.33%	-11,408	-11,456	-11,524	-11,614	-11,725	-11,856	-12,006	
8.00%	-18,494	-18,501	-18,516	-18,540	-18,577	-18,628	-18,694	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						1,988
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,985	-1,985	-1,985	-1,985	-1,986	-1,987	-1,988	
-5.33%	-1,084	-1,087	-1,092	-1,098	-1,105	-1,114	-1,125	
-2.67%	-293	-315	-338	-361	-384	-408	-431	
0%	46	32	17	0	-18	-36	-56	
2.67%	80	79	78	75	71	66	60	
5.33%	81	81	81	81	80	80	79	
8.00%	81	81	81	81	81	81	81	
KR4301Q22958		2020-02 풋295						5,434
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-5,431	-5,431	-5,431	-5,431	-5,432	-5,432	-5,434	
-5.33%	-3,197	-3,199	-3,204	-3,211	-3,222	-3,235	-3,251	
-2.67%	-1,080	-1,120	-1,164	-1,210	-1,257	-1,307	-1,358	
0%	159	108	55	0	-56	-112	-169	
2.67%	373	366	355	341	324	302	278	

5.33%	379	379	379	378	376	373	369
8.00%	379	379	379	379	379	379	379

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

(단위:백만원)

35,244

공시일	2020-02-10
기준일	2020-02-07

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

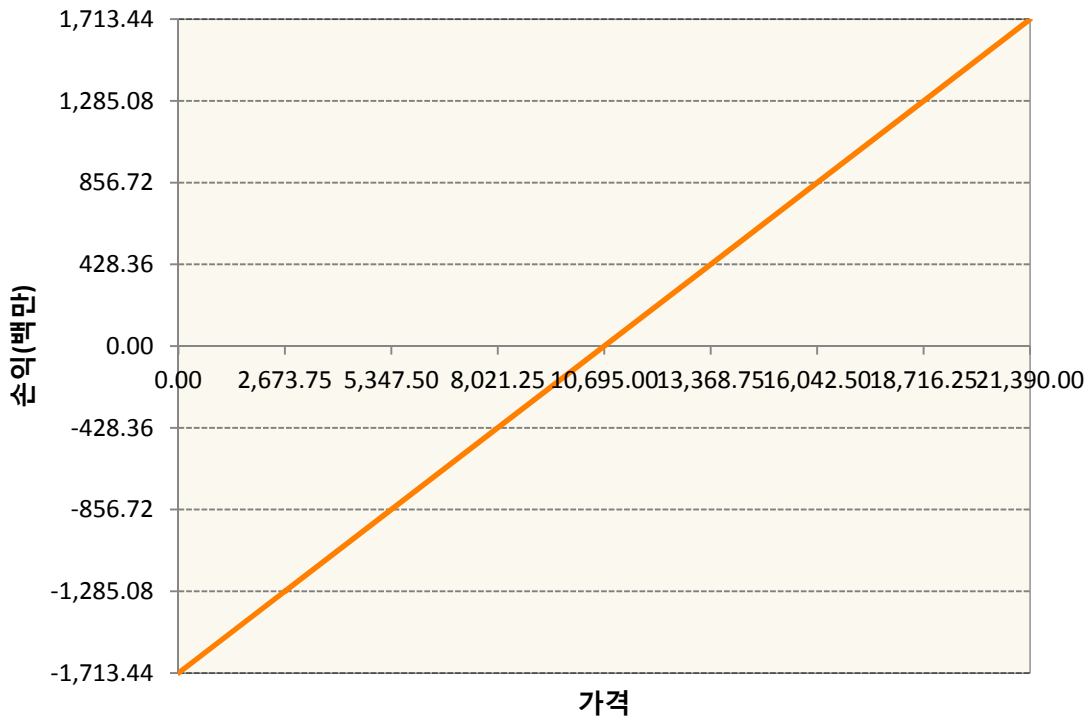
1. 계약금액

(단위:백만원)

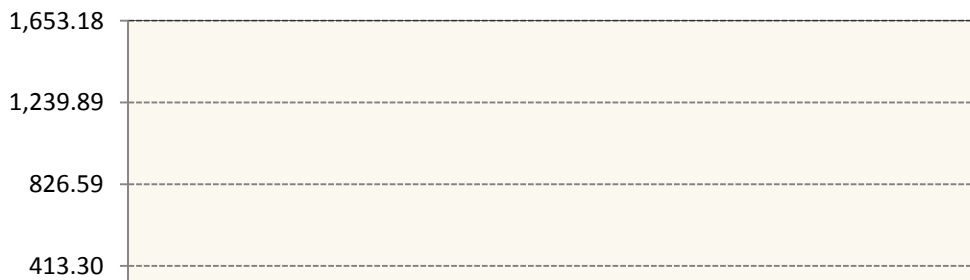
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,713	0	1,713	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,578	-4,578	장내
누계	통화	선도	0	2,152	-2,152	장외

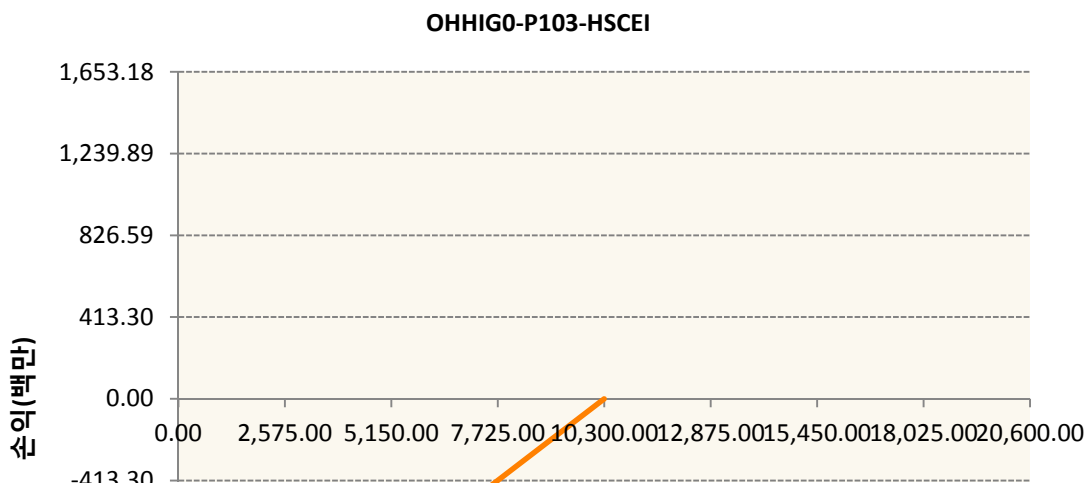
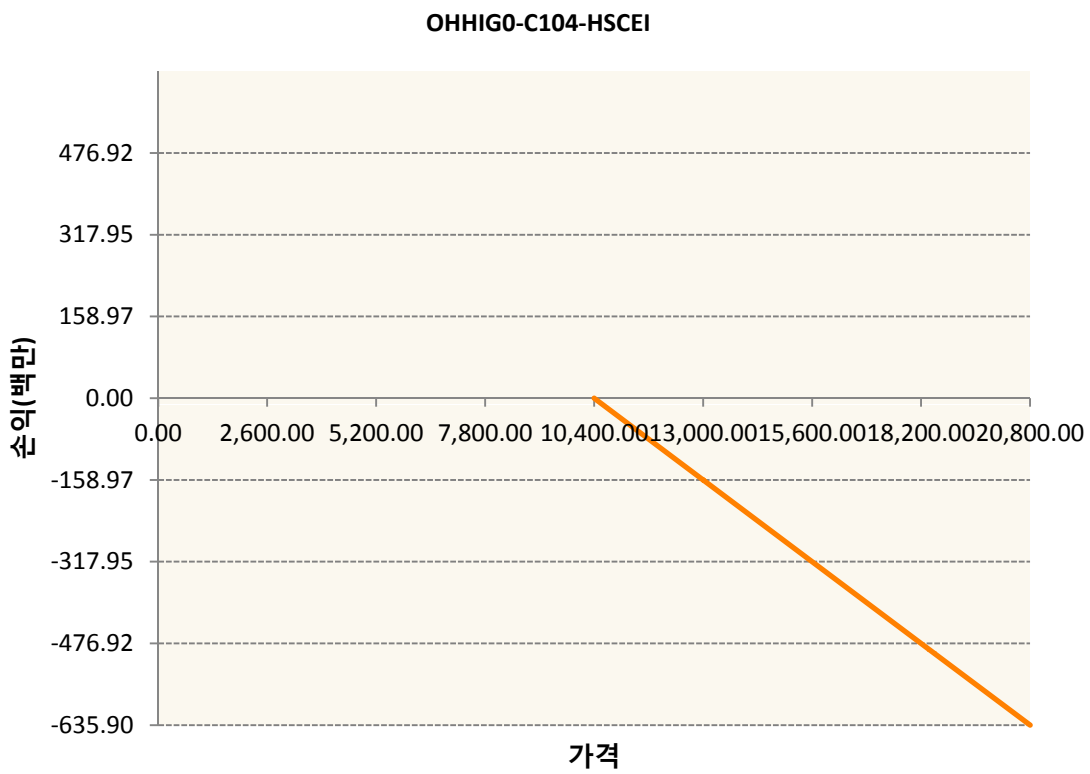
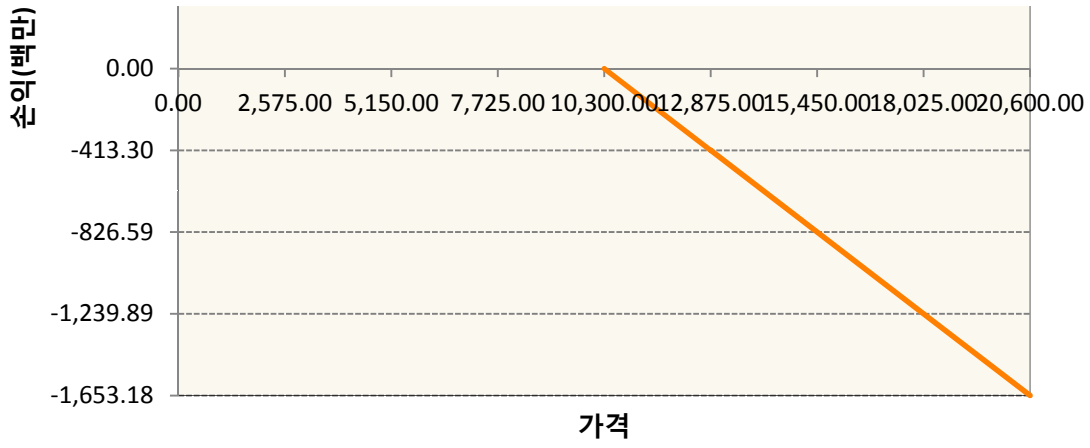
2. 만기시점의 손익구조

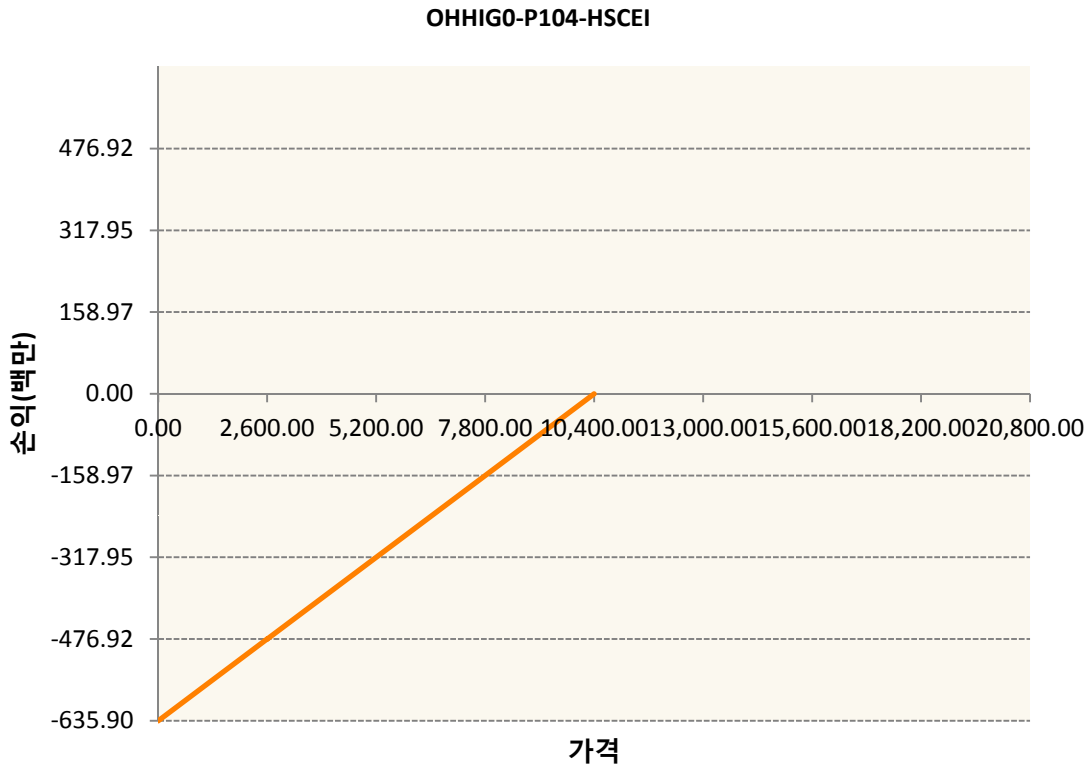
HCG0-HSCEI Futures Feb20



OHHIG0-C103-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	172
HCG0 HSCEI Futures Feb20	137
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)
	516

공시일	2020-02-10
기준일	2020-02-07

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

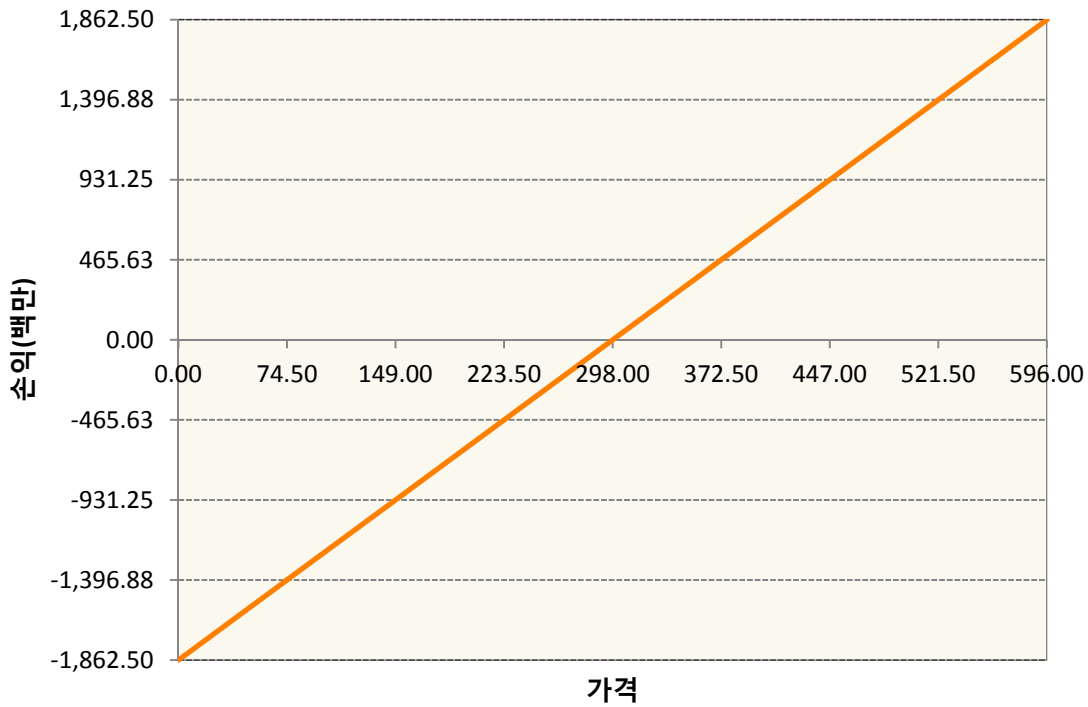
1. 계약금액

(단위:백만원)

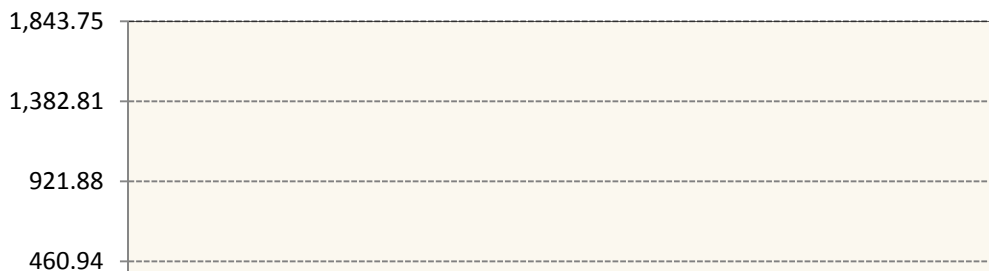
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,863	0	1,863	장내
누계	유가증권	스왑	3,625	0	3,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,608	-3,608	장내

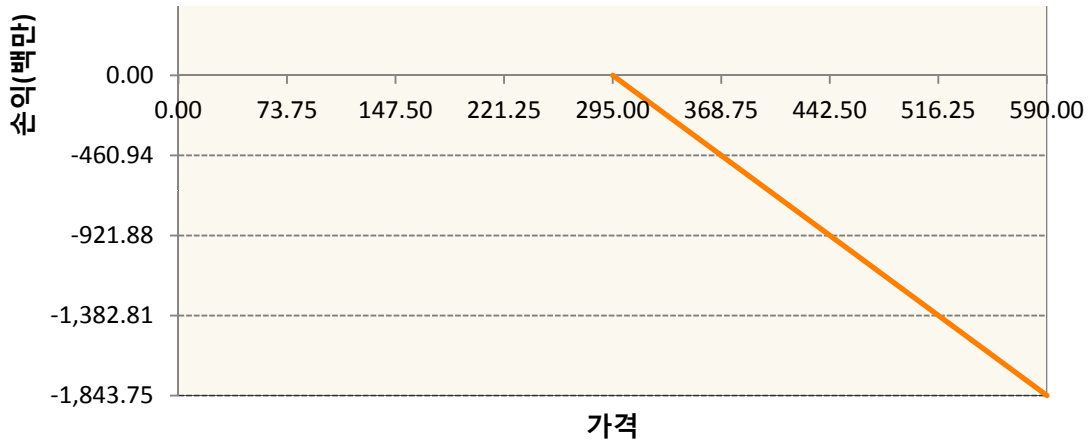
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

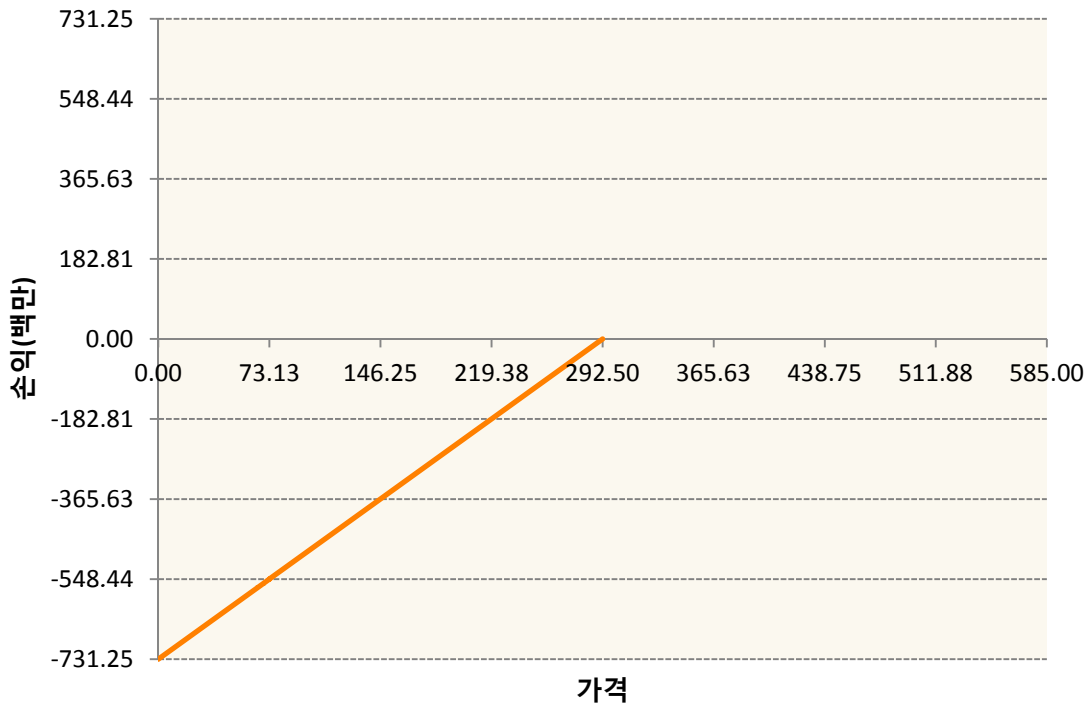


KR4201Q22950-2020-02 콜295

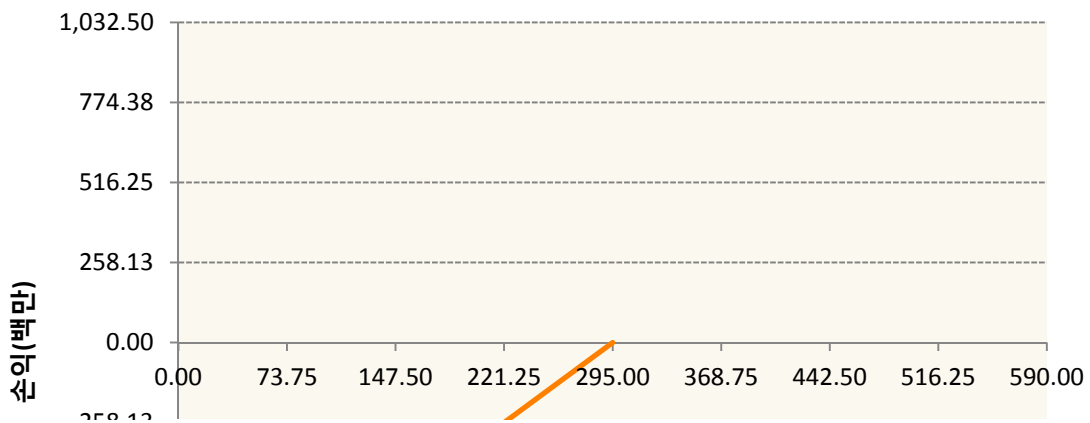




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



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						149
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-149	-149	-149	-149	-149	-149	-149	
-5.33%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99	
-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%	99	99	99	99	99	99	99	
8.00%	149	149	149	149	149	149	149	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						130
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	40	40	40	39	39	38	37	
-5.33%	39	38	37	35	34	33	31	
-2.67%	30	28	26	24	22	19	17	
0%	7	5	2	0	-2	-5	-7	
2.67%	-32	-33	-35	-36	-38	-40	-42	
5.33%	-79	-80	-80	-81	-82	-83	-84	
8.00%	-129	-129	-129	-129	-129	-130	-130	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						44
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
-5.33%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-25
-2.67%	-6	-7	-7	-8	-8	-9	-9
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	2	2	2	2	2	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2
KR4301Q22958 2020-02 풋295							68
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68
-5.33%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
-2.67%	-13	-14	-14	-15	-16	-16	-17
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)

700

공시일	2020-02-10
기준일	2020-02-07

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

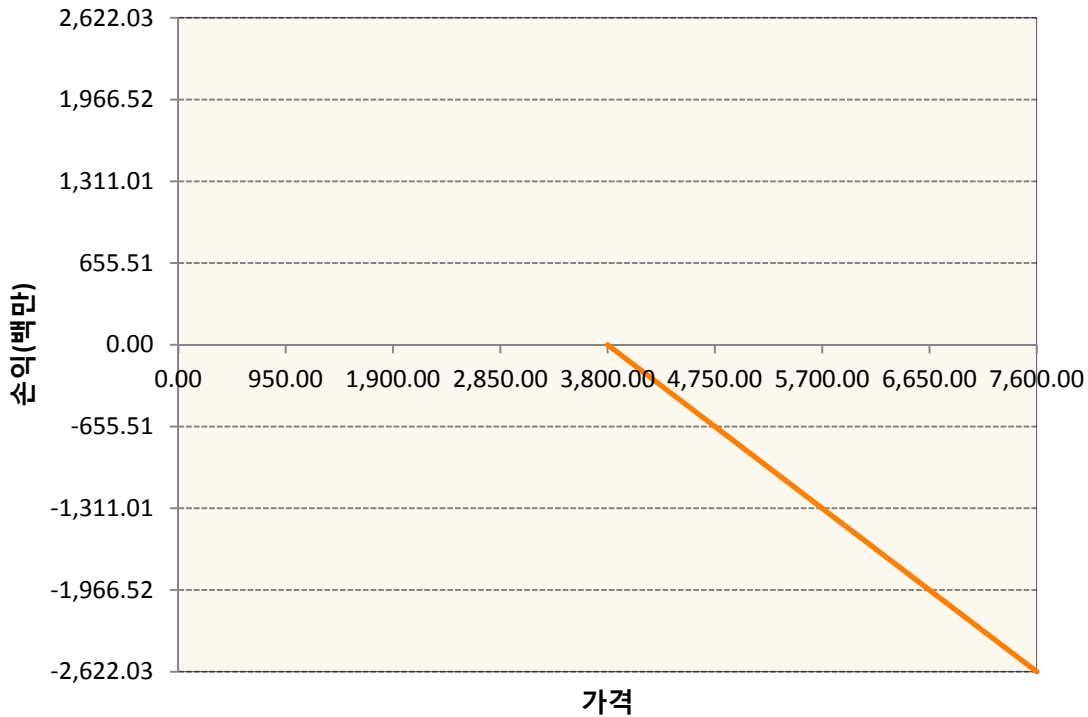
1. 계약금액

(단위:백만원)

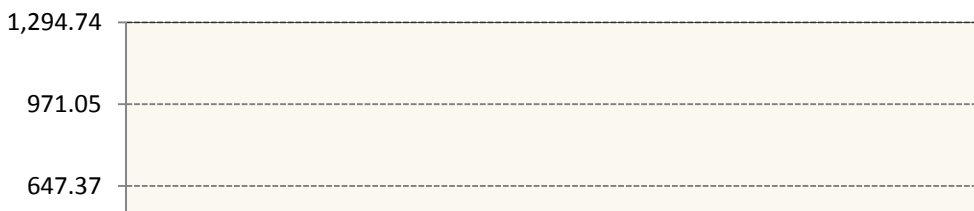
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	786	0	786	
누계	유가증권	스왑	13,605	0	13,605	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,834	-7,834	장내
누계	통화	선도	0	3,416	-3,416	장외

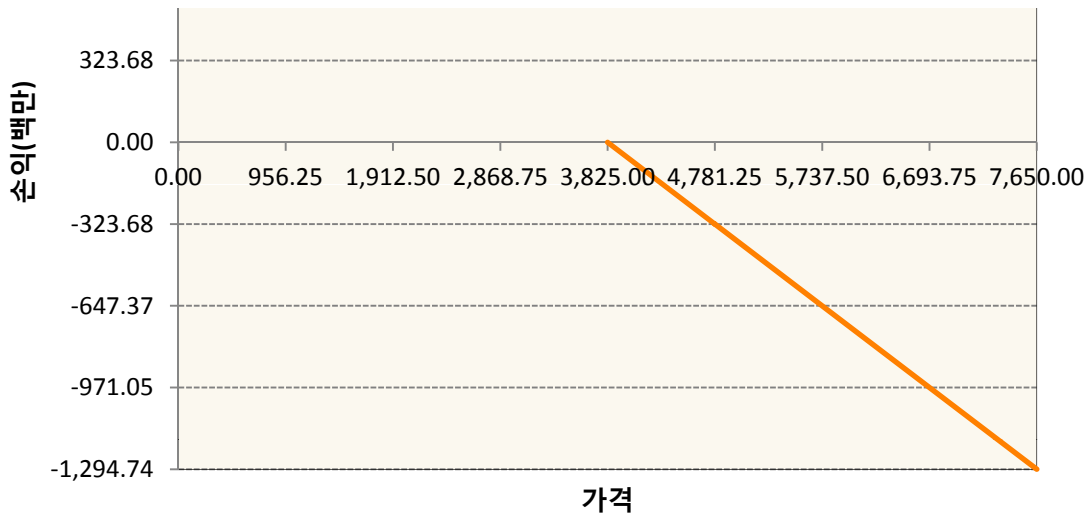
2. 만기시점의 손익구조

OESXG0-C3800-EURO STOXX 50

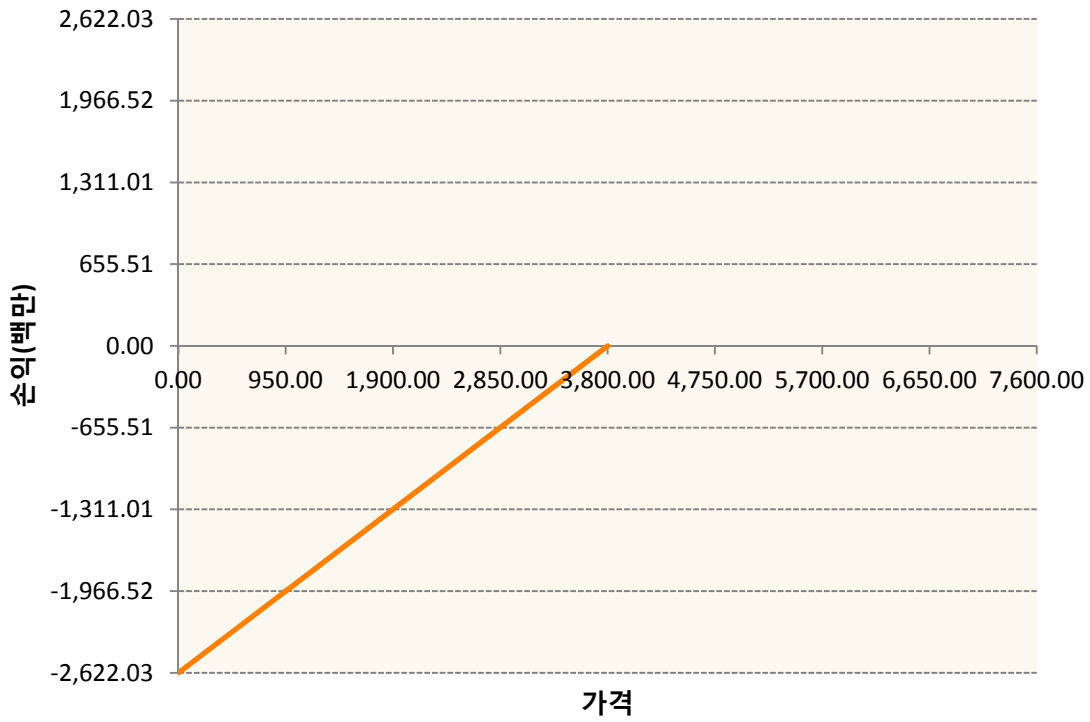


OESXG0-C3825-EURO STOXX 50

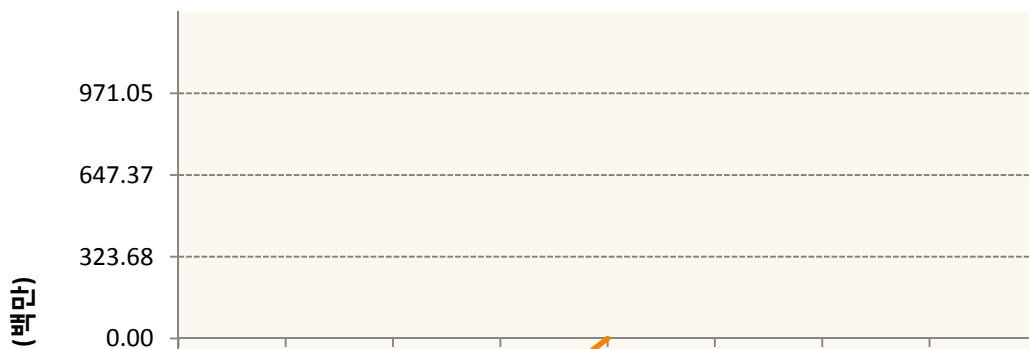


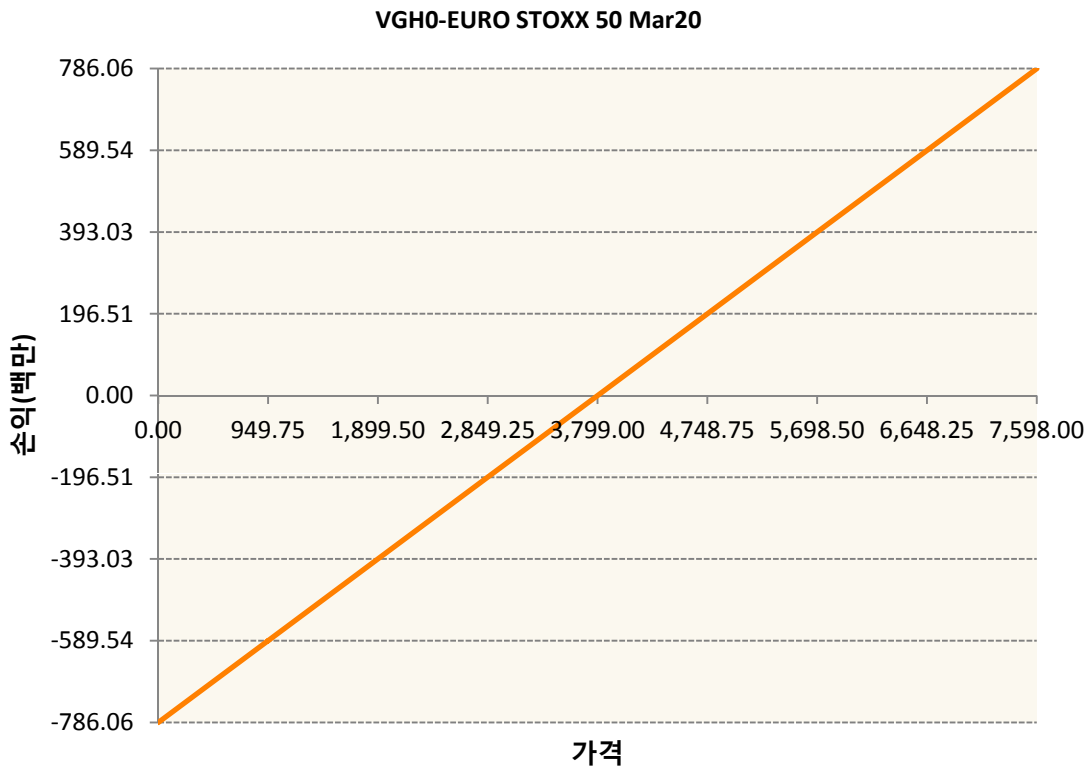
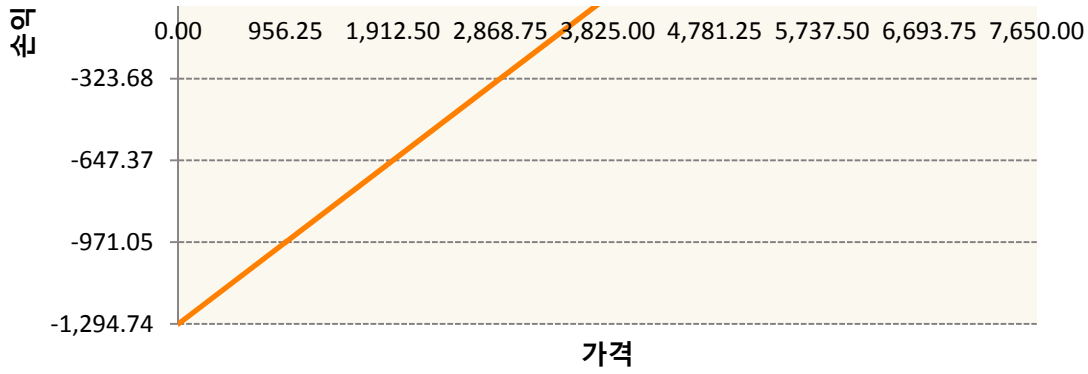


OESXG0-P3800-EURO STOXX 50



OESXG0-P3825-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	4
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	273
OESXG0-C3& EURO STOXX 50	210
OESXG0-C3& EURO STOXX 50	104
OESXG0-P3& EURO STOXX 50	210
OESXG0-P3& EURO STOXX 50	104
VGHO EURO STOXX 50 Mar20	63

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

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

(단위:백만원)

949

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

(단위:백만원)

84

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

(단위:백만원)

123

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

(단위:백만원)

44

공시일	2020-02-10
기준일	2020-02-07

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

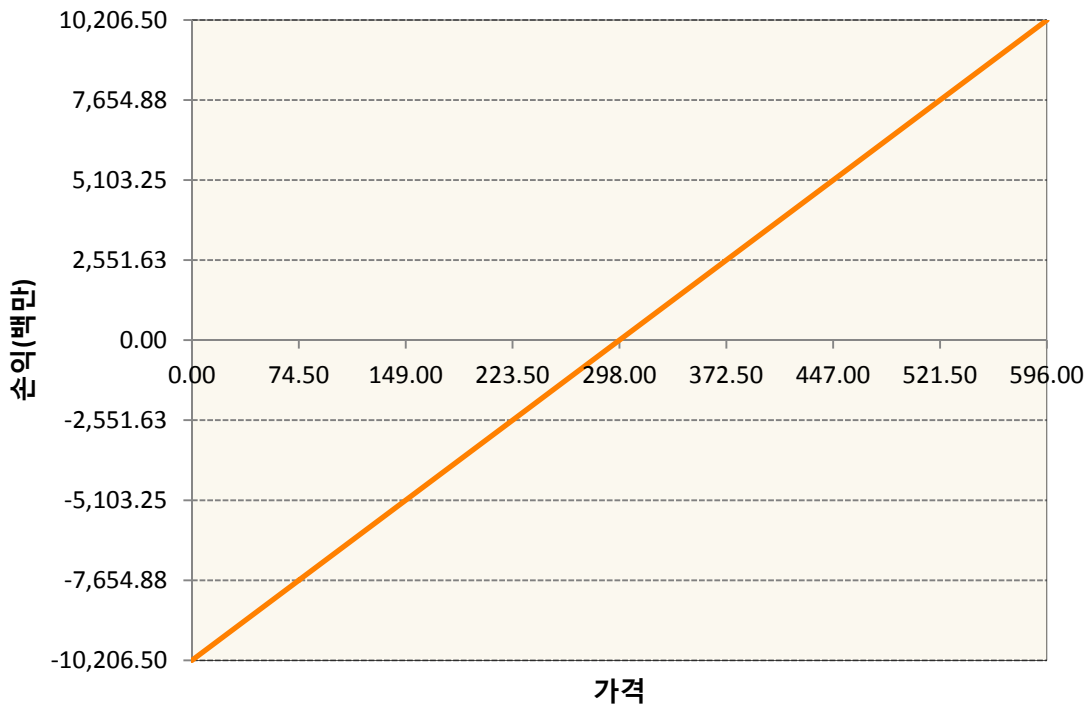
1. 계약금액

(단위:백만원)

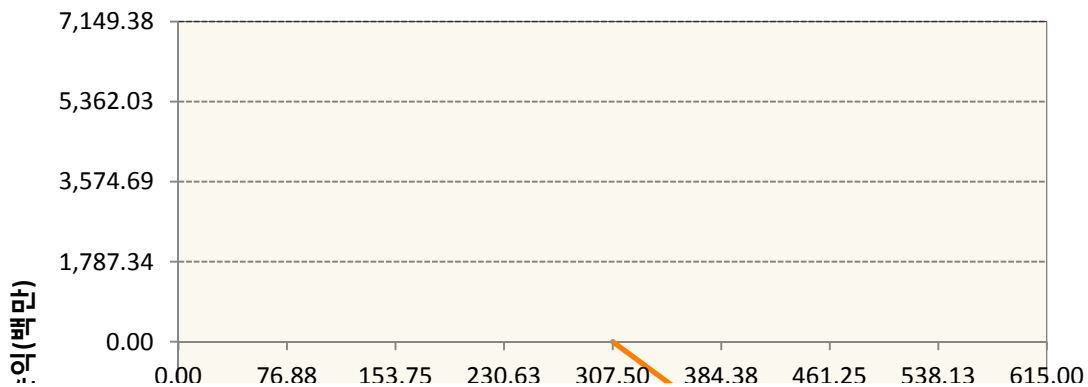
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	77	0	77	장내
누계	유가증권	선물	10,207	0	10,207	장내
누계	유가증권	옵션	2,944	20,557	-17,613	장내

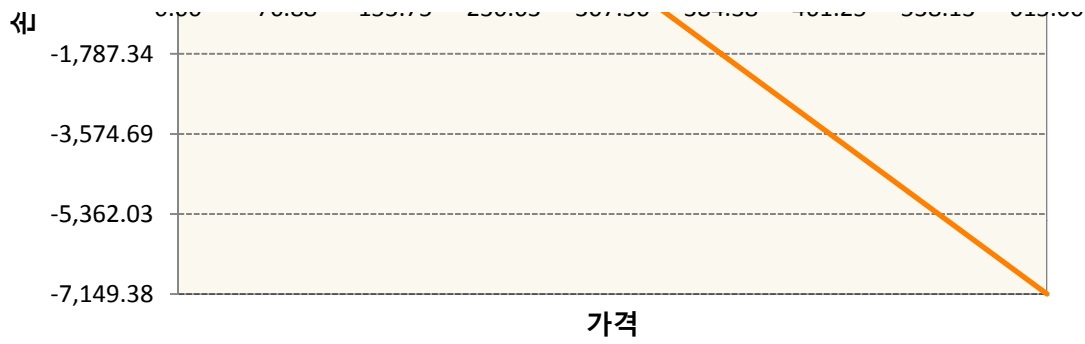
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

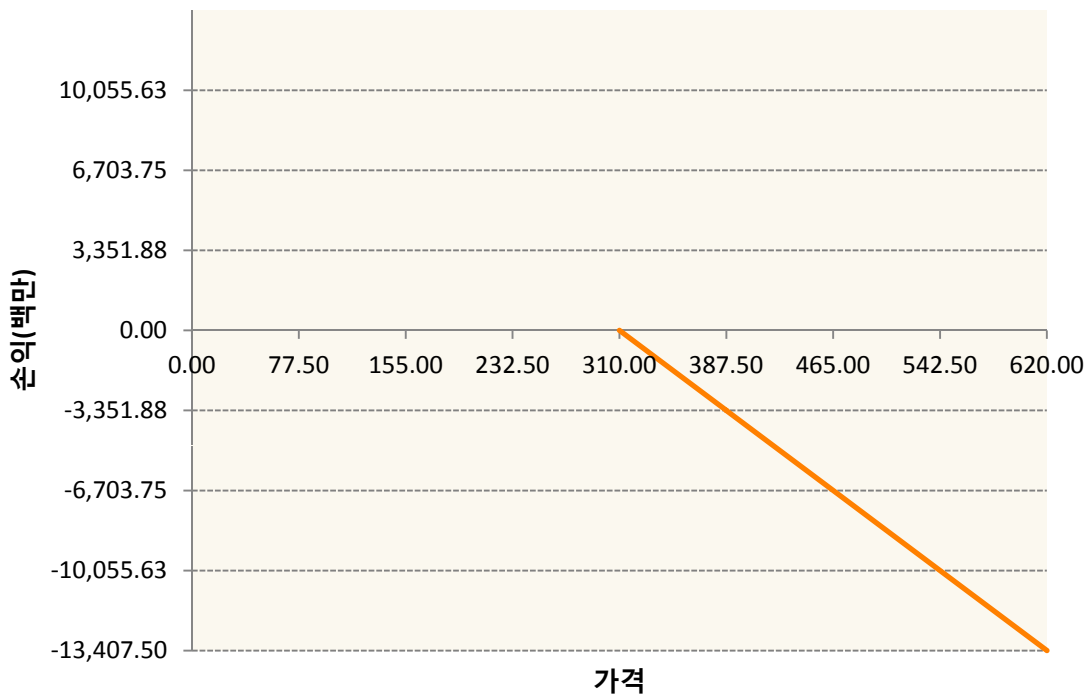


KR4201Q23073-2020-02 콜307.5

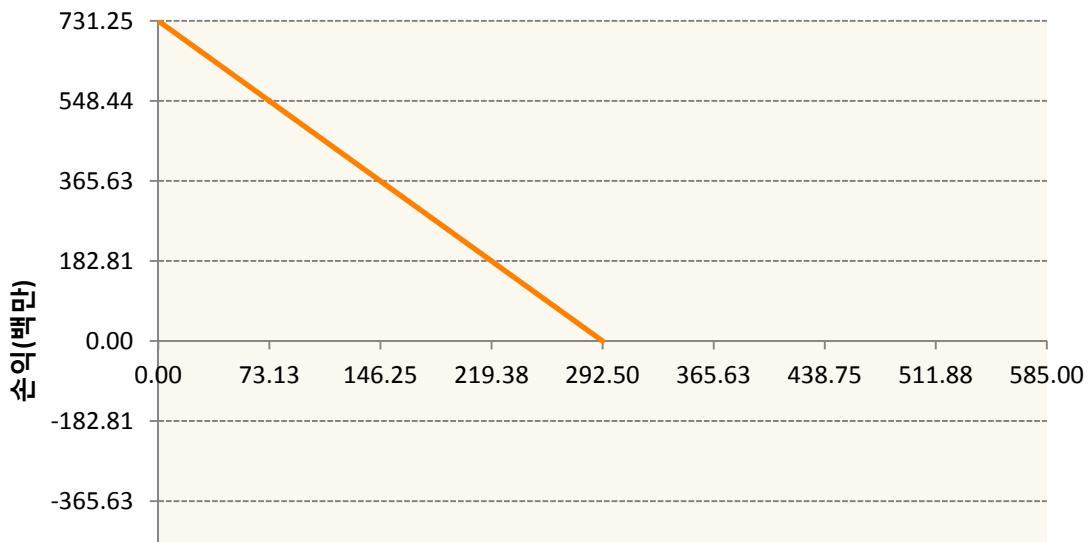


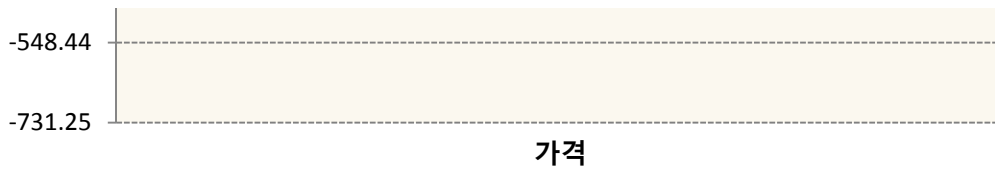


KR4201Q23107-2020-02 콜310

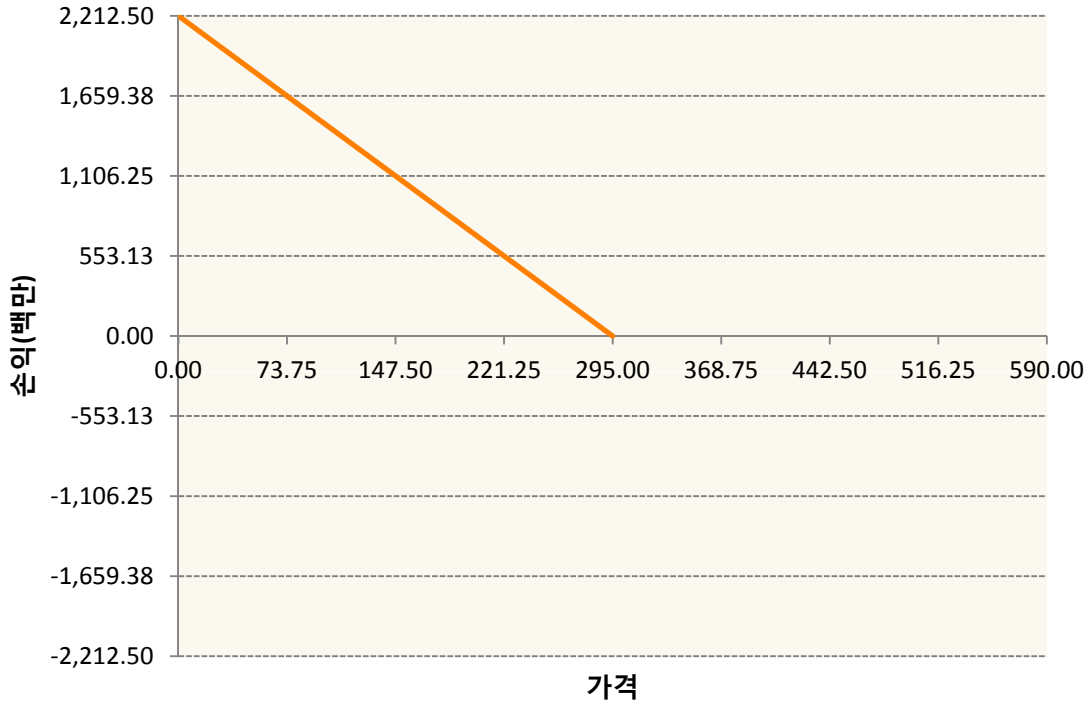


KR4301Q22925-2020-02 풋292.5





KR4301Q22958-2020-02 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물					817
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-817	-817	-817	-817	-817	-817	-817
-5.33%	-545	-545	-545	-545	-545	-545	-545
-2.67%	-272	-272	-272	-272	-272	-272	-272
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	272	272	272	272	272	272	272
5.33%	545	545	545	545	545	545	545
8.00%	817	817	817	817	817	817	817
KR4201Q23073		2020-02 콜307.5					337
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	34	34	34	34	34	34	33
-5.33%	34	34	34	33	32	31	29
-2.67%	33	31	29	26	22	19	14

0%	18	13	7	0	-7	-14	-22
2.67%	-35	-44	-53	-63	-72	-81	-90
5.33%	-148	-156	-164	-172	-180	-188	-197
8.00%	-309	-312	-316	-321	-326	-331	-337
KR4201Q23107 2020-02 콜310							561
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	44	44	44	44	44	44	43
-5.33%	44	44	44	43	42	40	37
-2.67%	43	41	38	34	30	24	17
0%	27	19	10	0	-11	-23	-35
2.67%	-43	-59	-76	-92	-109	-126	-142
5.33%	-219	-235	-251	-268	-285	-302	-319
8.00%	-495	-504	-514	-524	-536	-548	-561
KR4301Q22925 2020-02 풋292.5							44
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	44	44	44	44	44	44	44
-5.33%	24	24	24	24	24	24	25
-2.67%	6	7	7	8	8	9	9
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-1	-1
5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
KR4301Q22958 2020-02 풋295							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%	85	85	85	86	86	86	87
-2.67%	29	30	31	32	34	35	36
0%	-4	-3	-1	0	1	3	5
2.67%	-10	-10	-9	-9	-9	-8	-7
5.33%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10

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

(단위:백만원)

1,505

공시일	2020-02-10
기준일	2020-02-07

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	212,688	0	212,688	

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	2020-02-10
기준일	2020-02-07

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	10,780	-10,780	
누계	유가증권	수익증권	194,388	0	194,388	

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	2020-02-10
기준일	2020-02-07

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	527,902	0	527,902	
누계	통화	선도	0	558,248	-558,248	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019Z00 KRW/USD 10-02-20E	1,652
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	1,557
FX21019Z01 KRW/USD 12-02-20E	949
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	190
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	2,031
FX21019Z02 KRW/USD 18-02-20E	949
FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E	3,797
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,898
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	2,031
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	190
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	190
FX21020F00 KRW/USD 10-02-20E	1,139
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	1,709
FX21020F01 KRW/USD 18-02-20E	285
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E	1,898
FX21020F02 KRW/USD 21-02-20E	3,265
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,528
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,424
FX21020F02 KRW/USD 28-02-20E	1,898
FX21020F03 KRW/USD 28-02-20E	2,943
FX21020F03 KRW/USD 31-03-20E	3,037
FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E	2,848
FX21020F04 KRW/USD 28-02-20E	190
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,563
FX21020G00 KRW/USD 06-03-20E	2,373
FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	949
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,177
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

15,026

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

(단위:백만원)

125

공시일	2020-02-10
기준일	2020-02-07

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

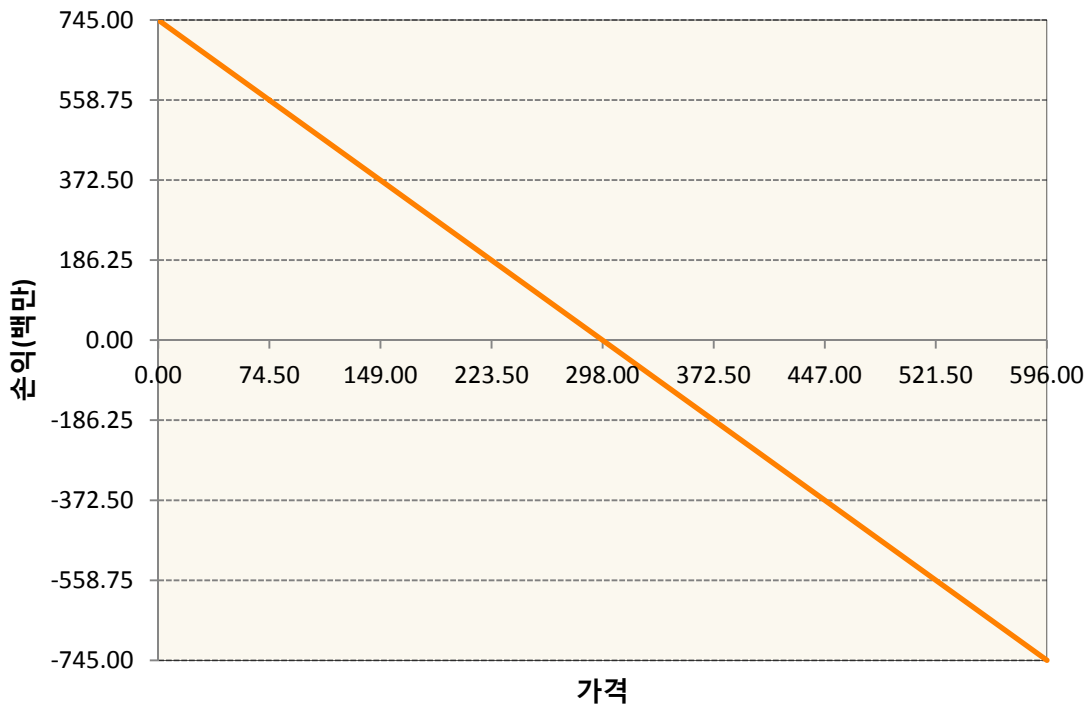
1. 계약금액

(단위:백만원)

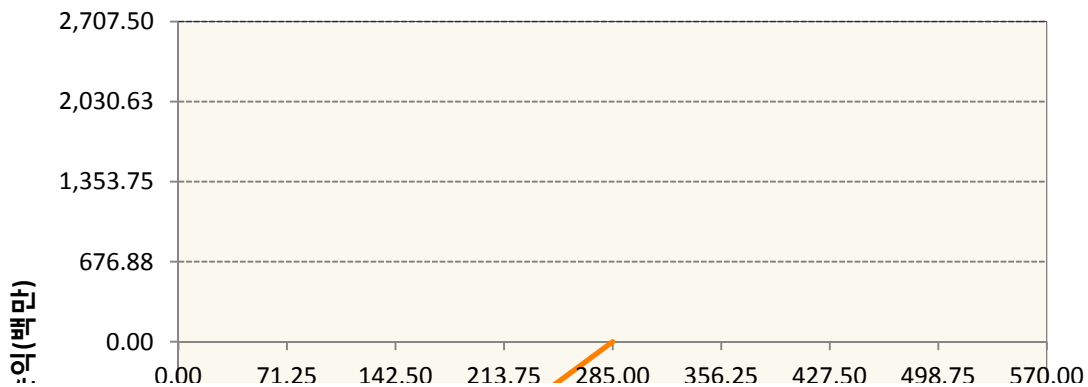
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	71	0	71	장내
누계	유가증권	선물	0	745	-745	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,498	-3,498	장내

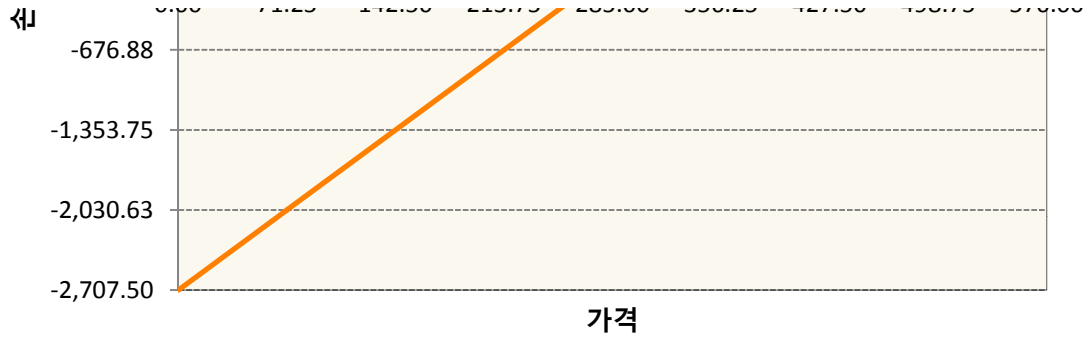
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

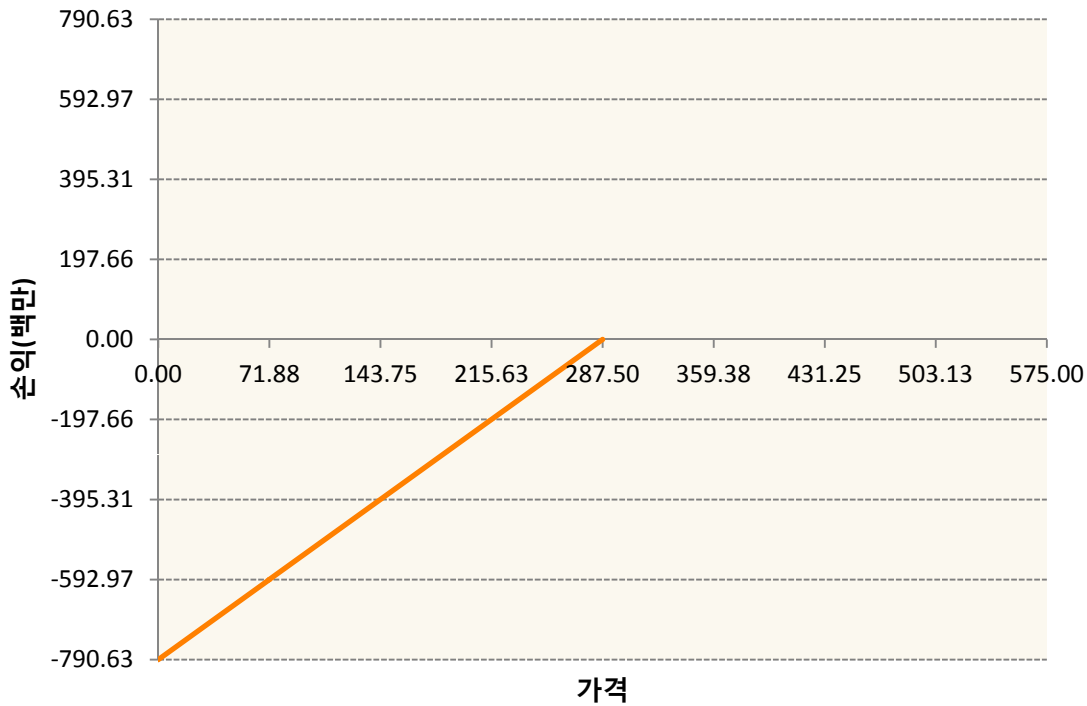


KR4301Q22859-2020-02 풋285





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						104
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-101	-101	-101	-102	-102	-103	-104
-5.33%	-33	-35	-37	-39	-40	-42	-44
-2.67%	-3	-4	-5	-7	-8	-10	-11
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 36

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-5.33%	-15	-15	-16	-16	-16	-17	-17
-2.67%	-2	-2	-3	-4	-4	-5	-5
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)

112

공시일	2020-02-10
기준일	2020-02-07

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	11,694	0	11,694	
누계	통화	선도	475	16,350	-15,875	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
FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	323
FX21020G01 USD/KRW 13-02-20E	38
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

453

공시일	2020-02-10
기준일	2020-02-07

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

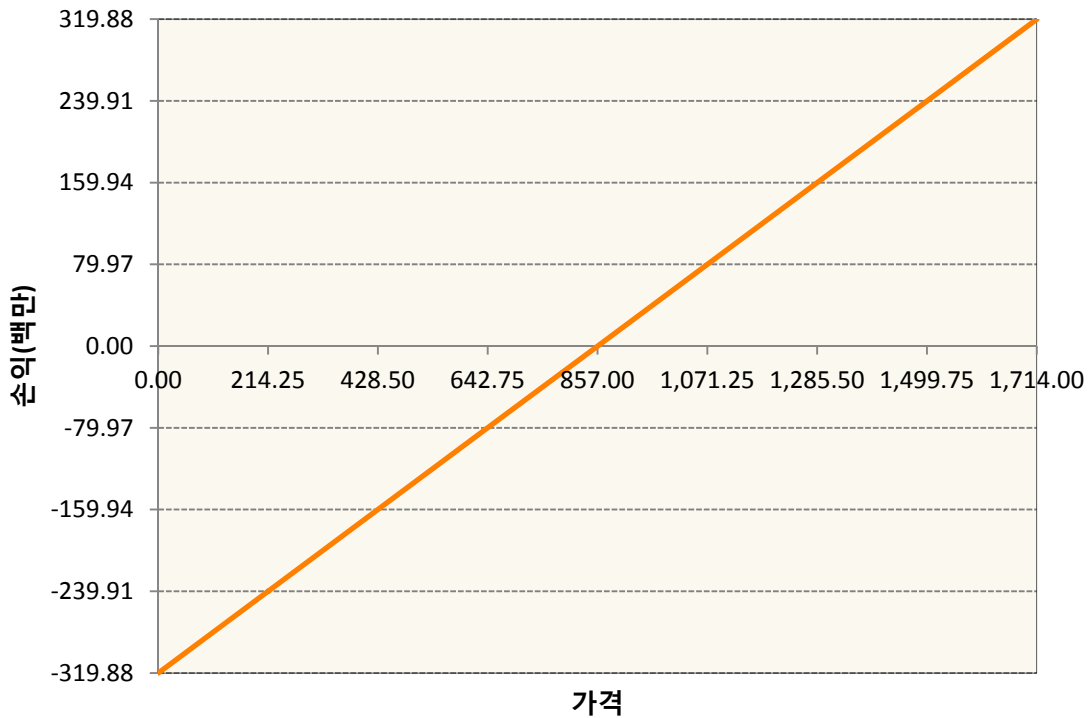
1. 계약금액

(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	320	0	320	
누계	유가증권	스왑	1,074	0	1,074	장외
누계	통화	선도	182	625	-443	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	26

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

(단위:백만원)

106

공시일	2020-02-10
기준일	2020-02-07

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

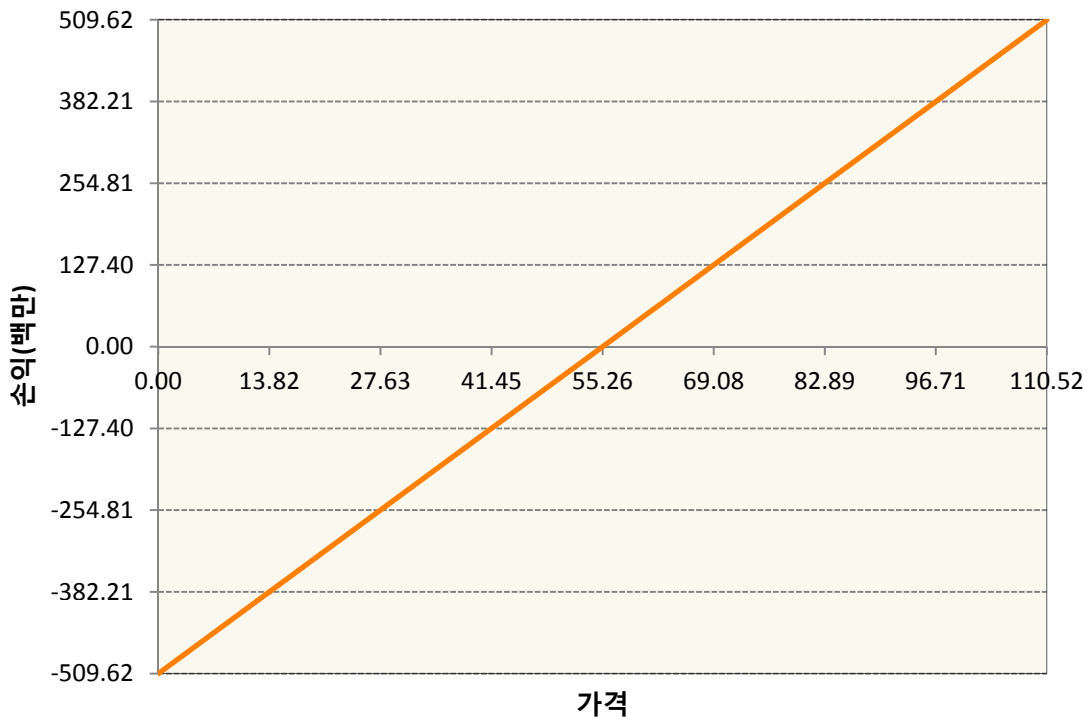
1. 계약금액

(단위:백만원)

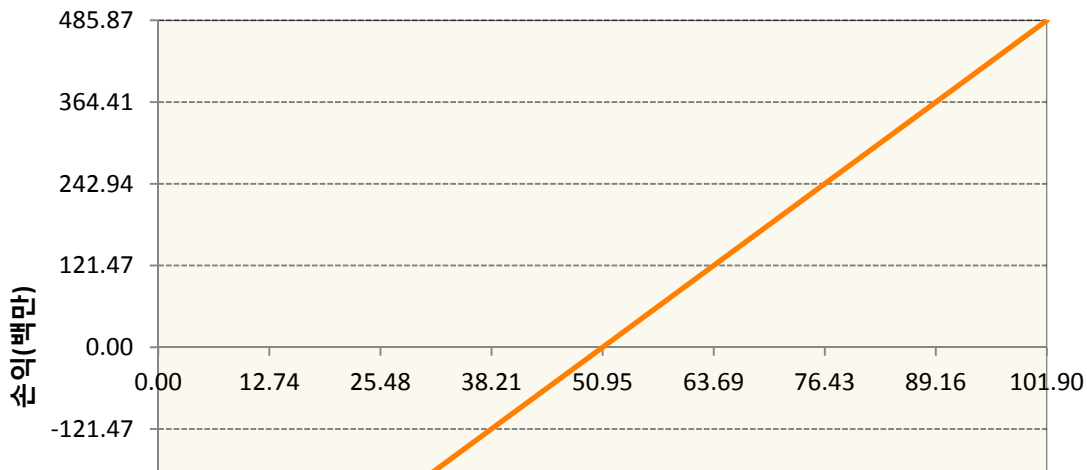
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,055	190	1,865	

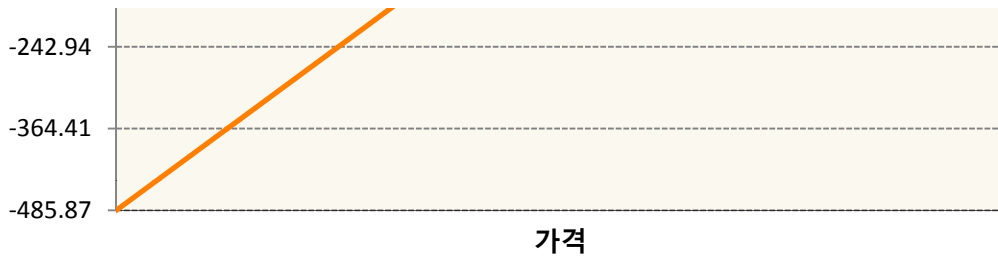
2. 만기시점의 손익구조

COKO-BRENT CRUDE FUTR May20

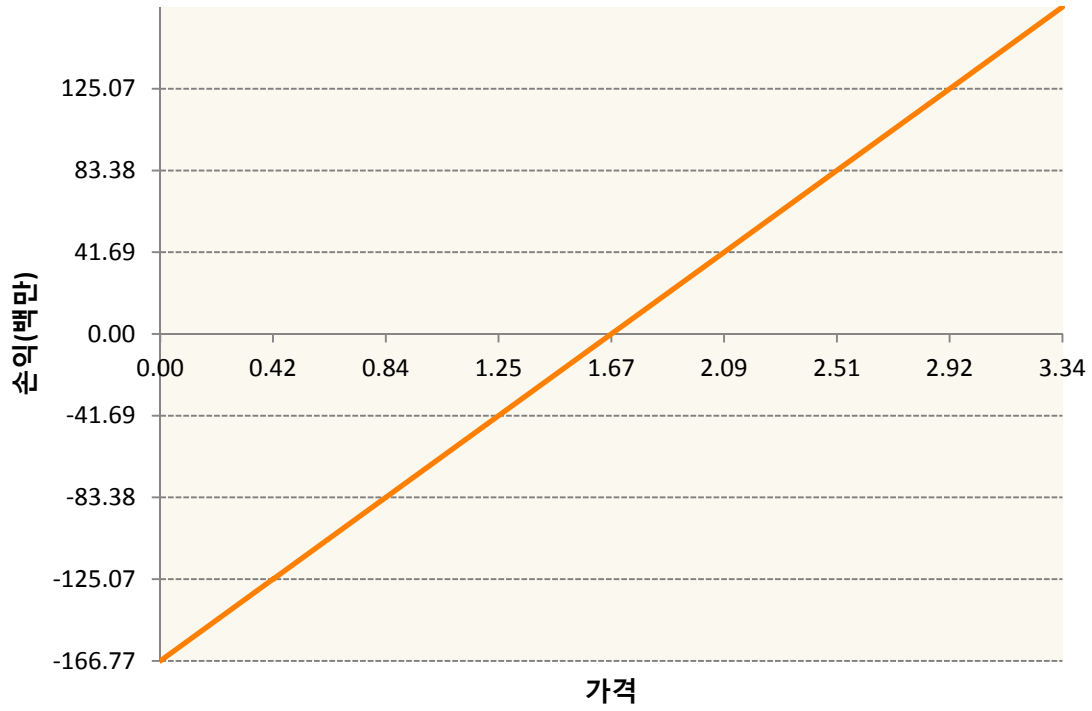


CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20

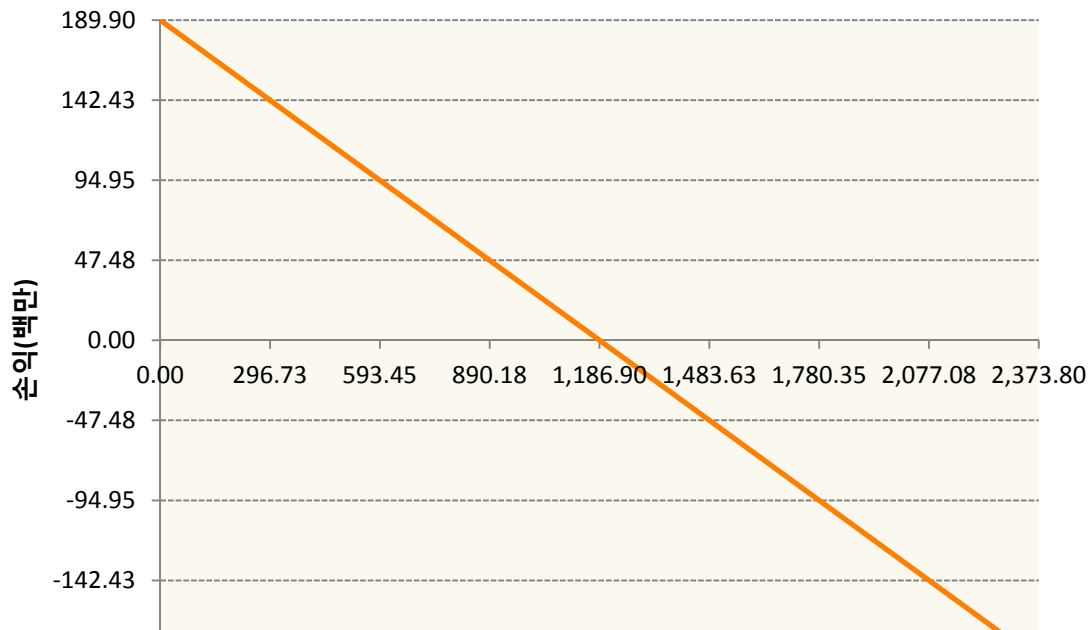


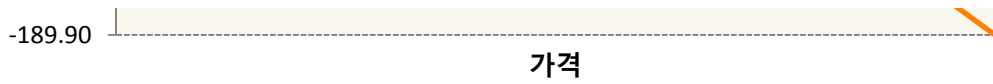


HOH0-NY Harb ULSD Fut Mar20

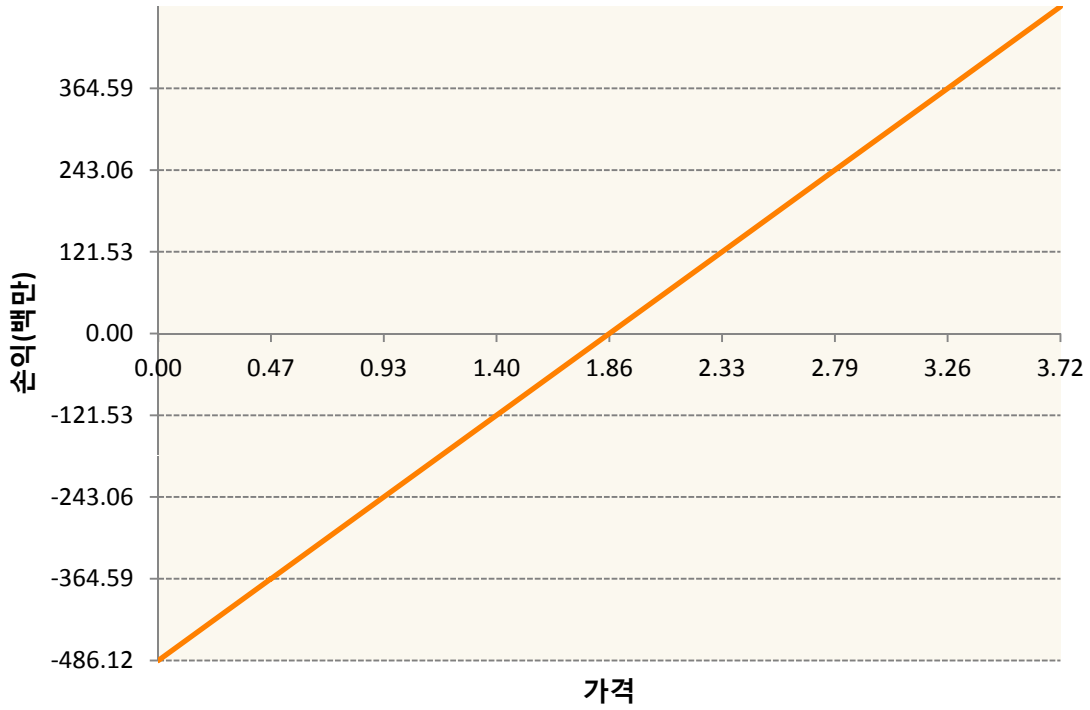


KR4175Q20000-2020-02 달러선물

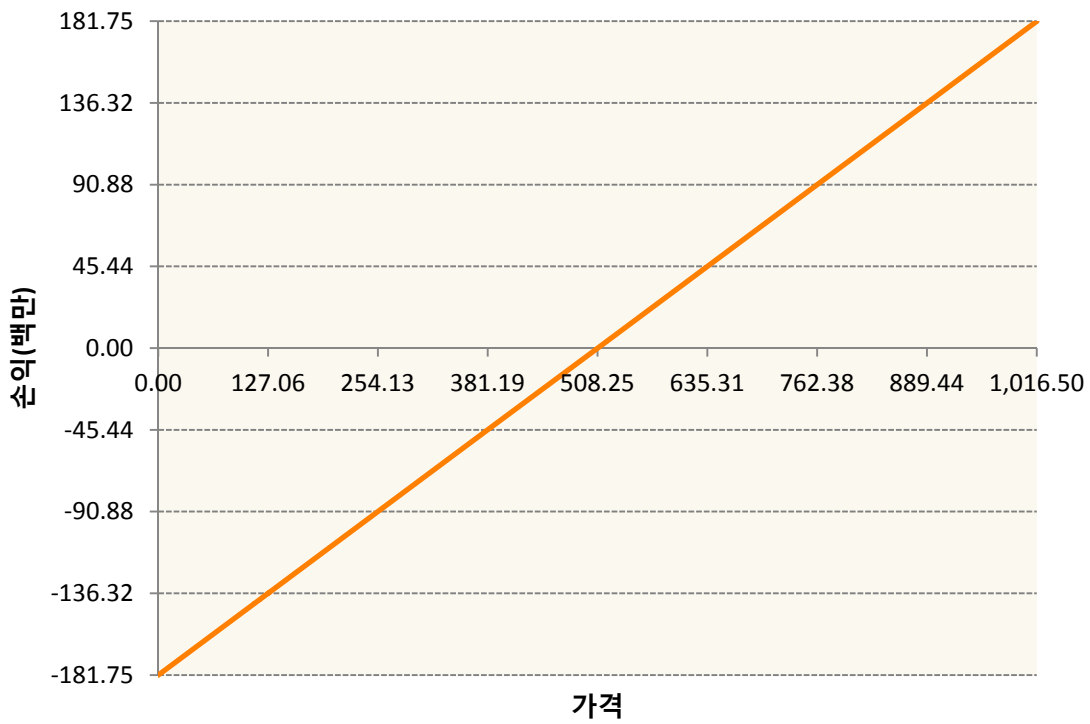




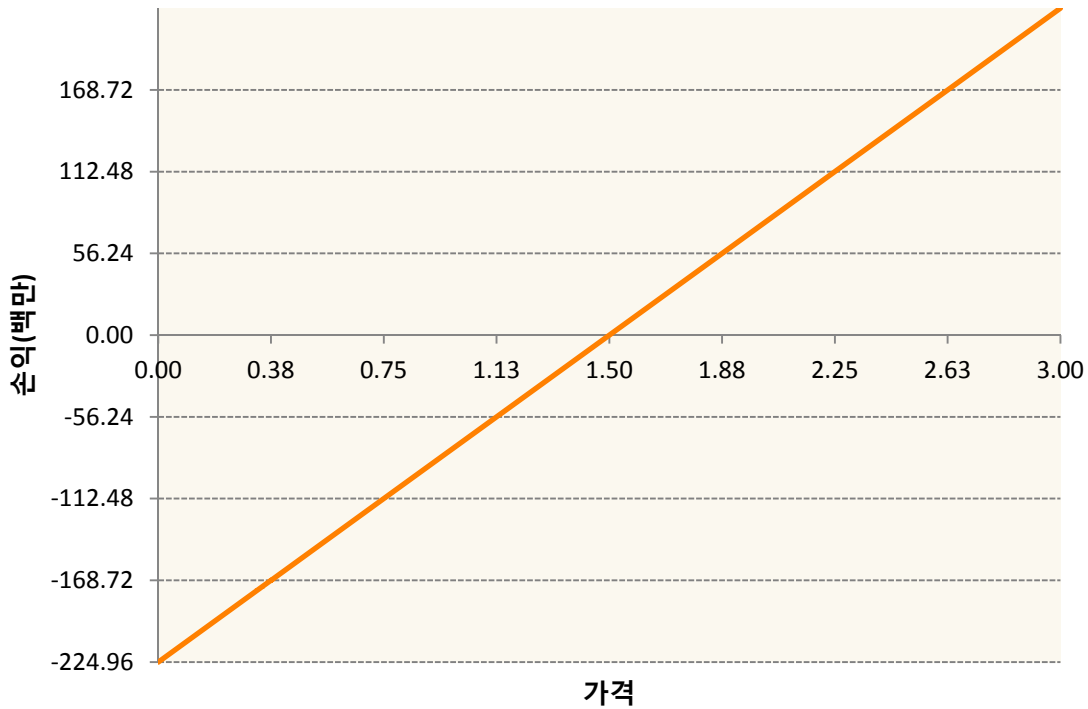
NGH20-NATURAL GAS FUTR Mar20



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	2020-02-10
기준일	2020-02-07

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

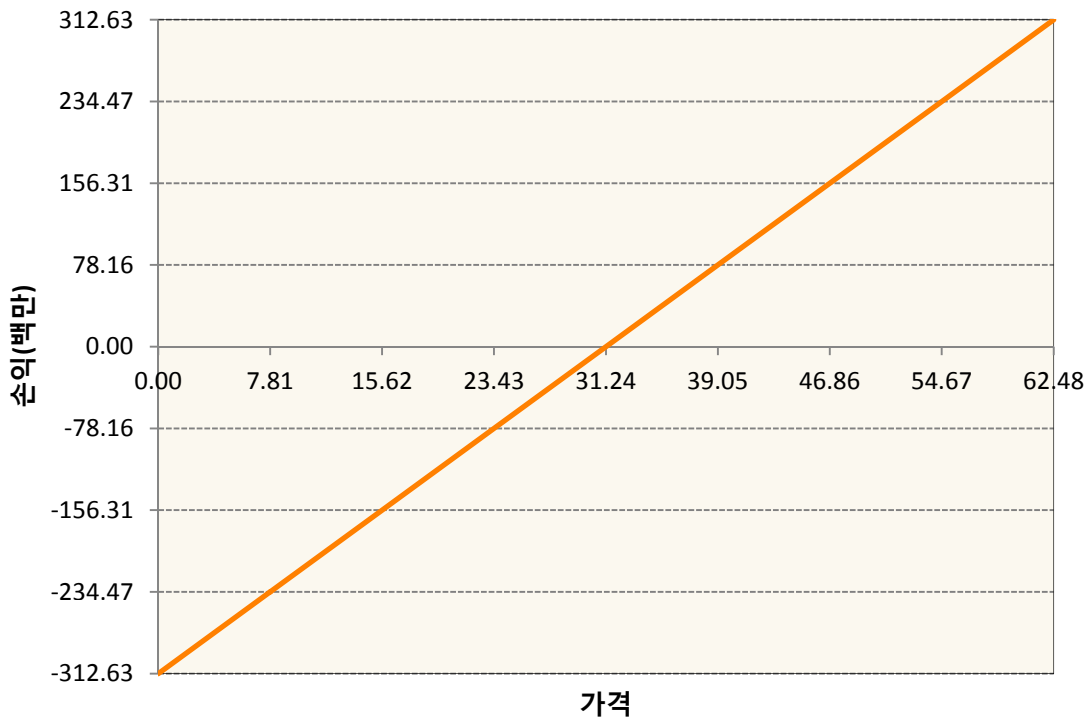
1. 계약금액

(단위:백만원)

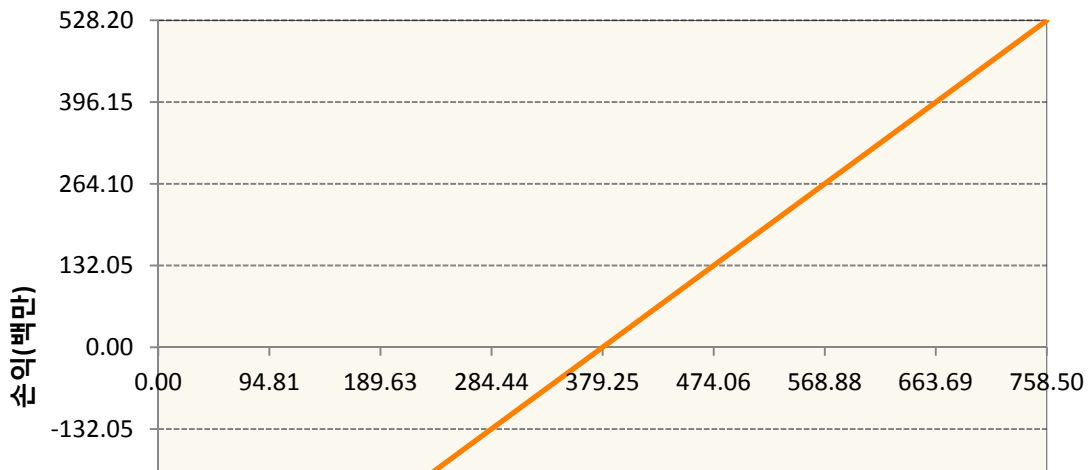
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,725	154	2,571	

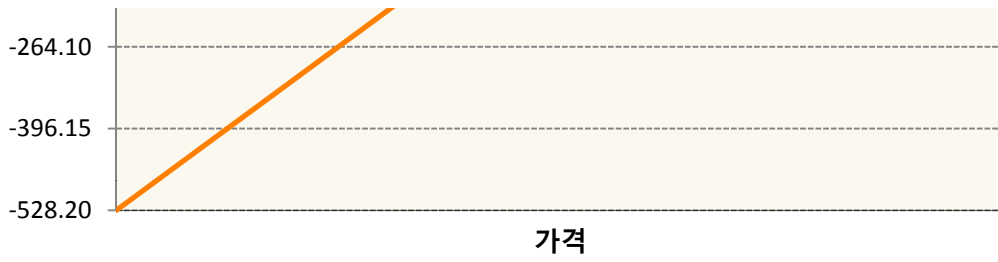
2. 만기시점의 손익구조

BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20

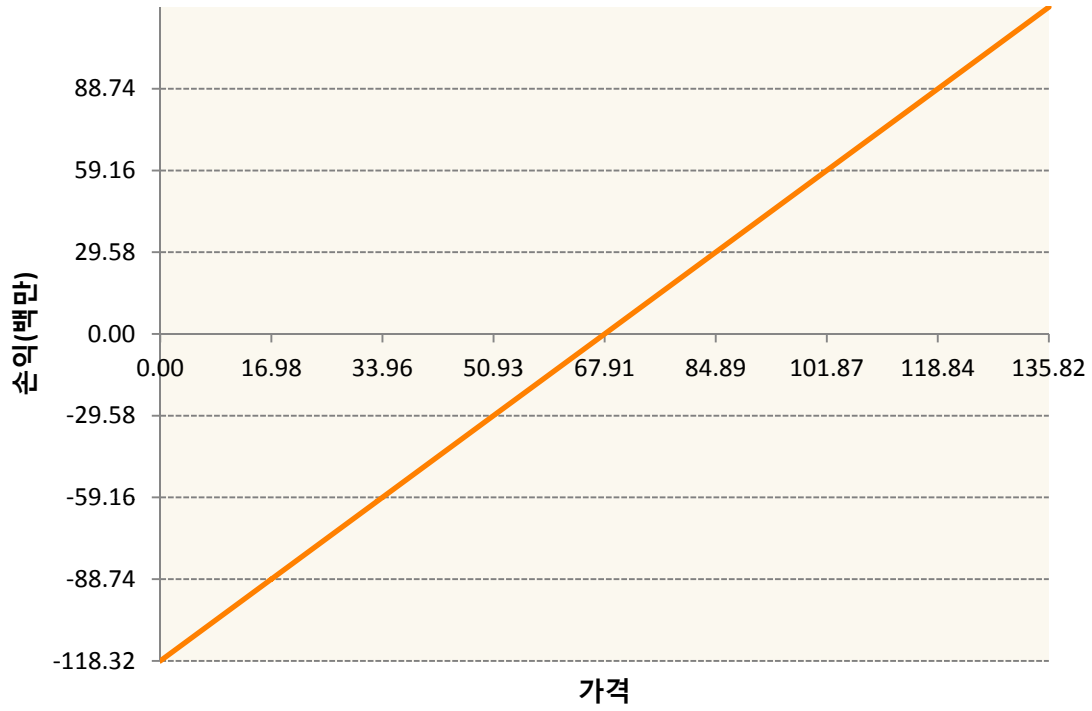


CH0-CORN FUTURE Mar20

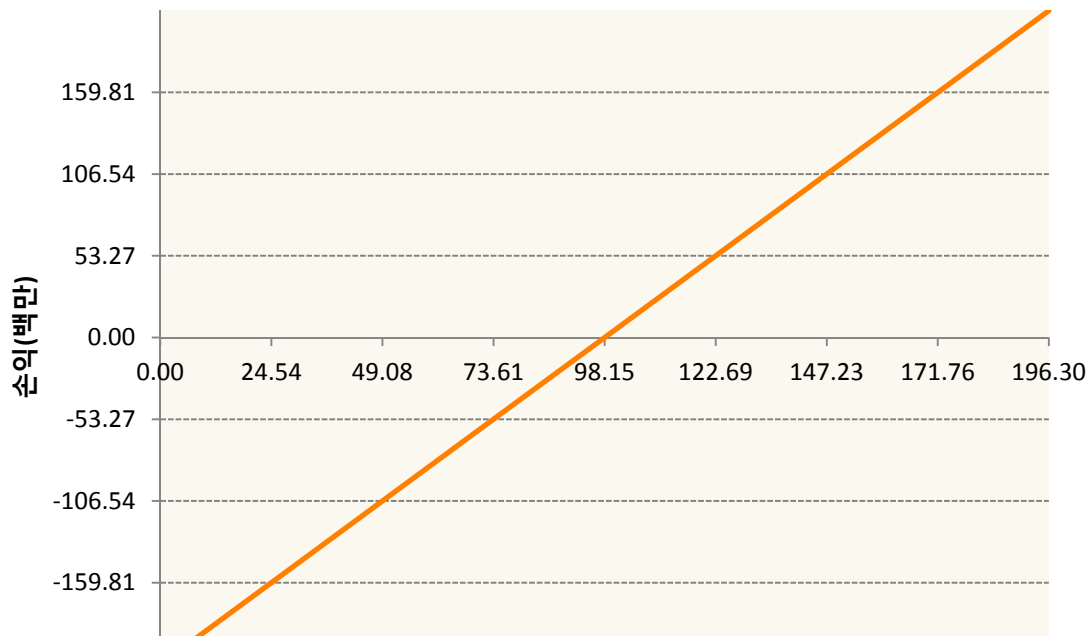


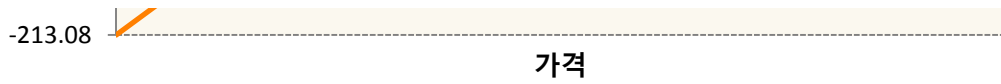


CTH0-COTTON NO.2 FUTR Mar20

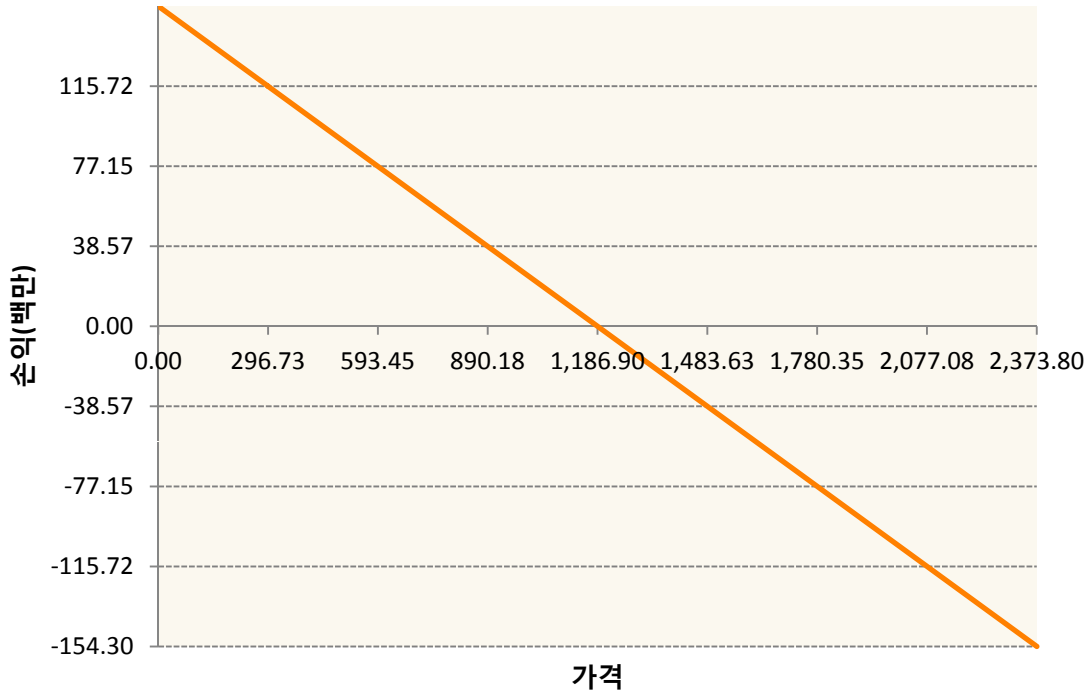


KCH0-COFFEE 'C' FUTURE Mar20

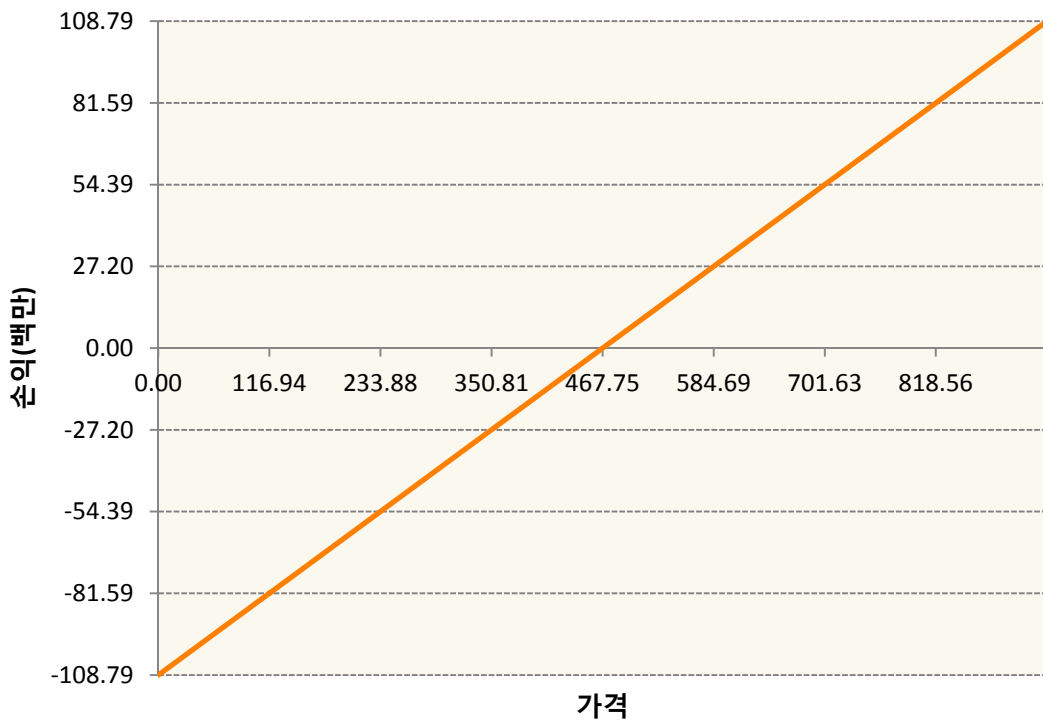




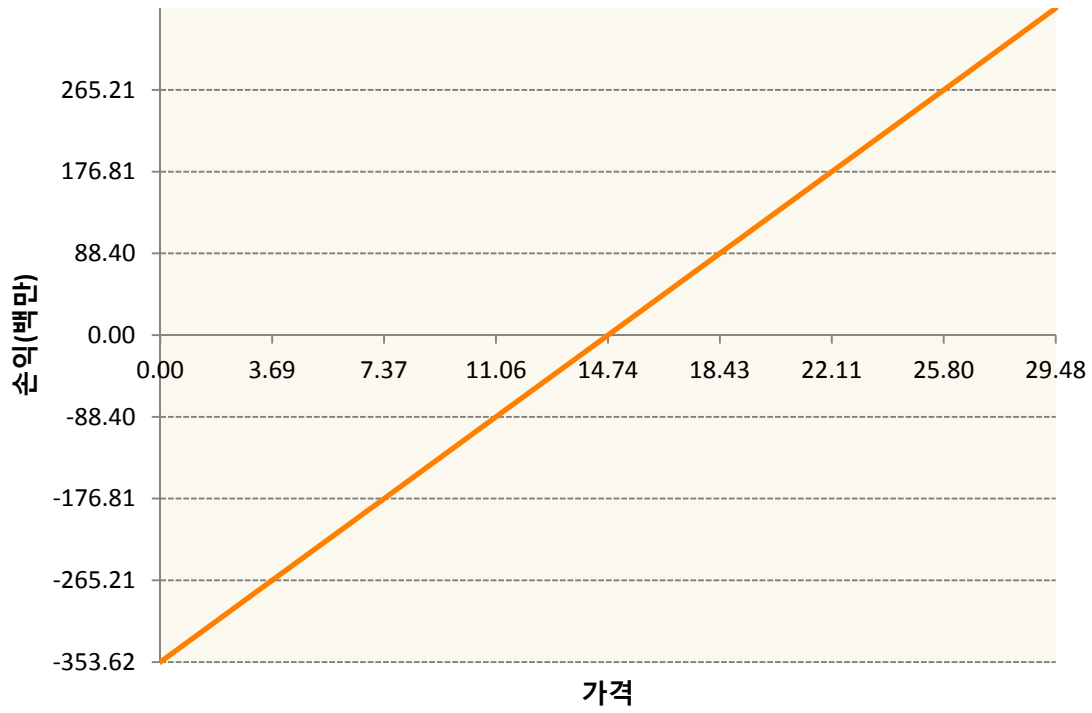
KR4175Q20000-2020-02 달러선물



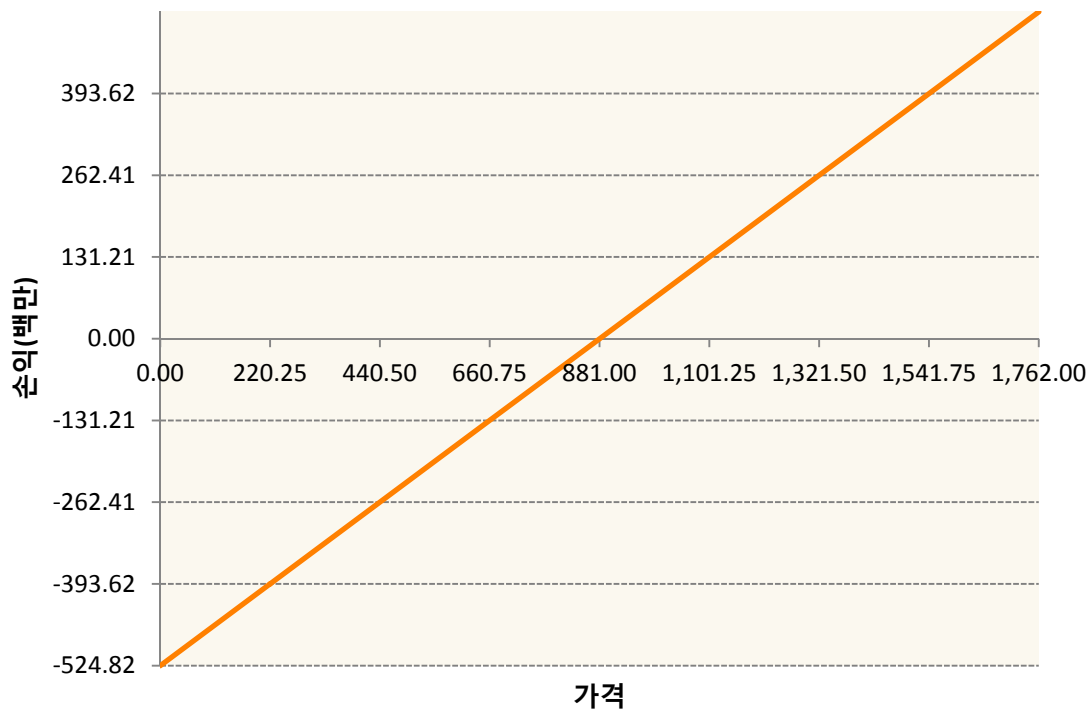
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



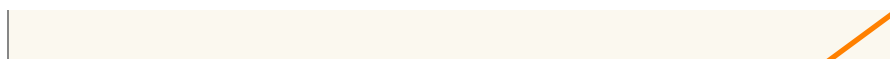
SBH0-Sugar Mar20

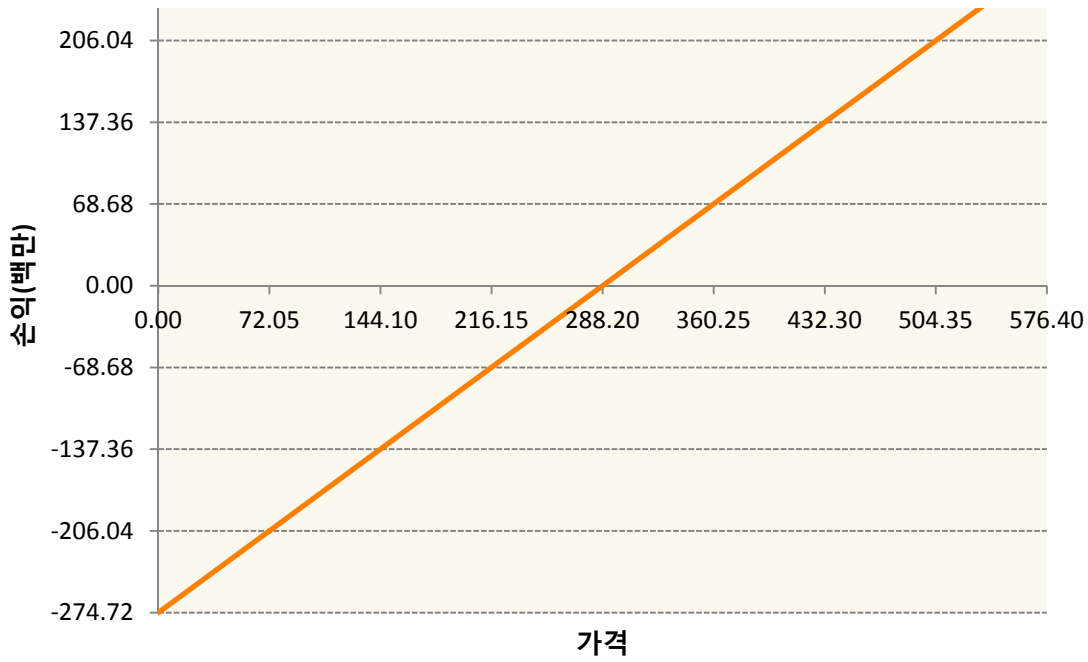


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20

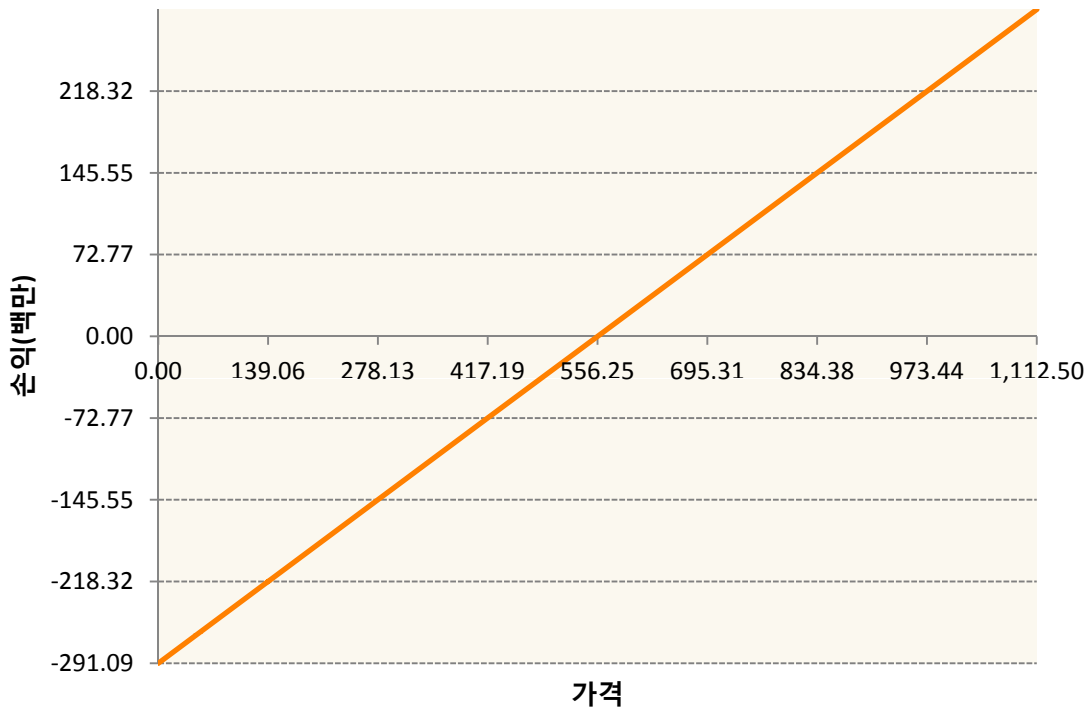


SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





WHO-WHEAT FUTURE(CBT) Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH0	SOYBEAN OIL FUTR Mar20	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	23

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

(단위:백만원)

236