

공시일	2020-02-11
기준일	2020-02-10

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	2020-02-11
기준일	2020-02-10

스마트인덱스모

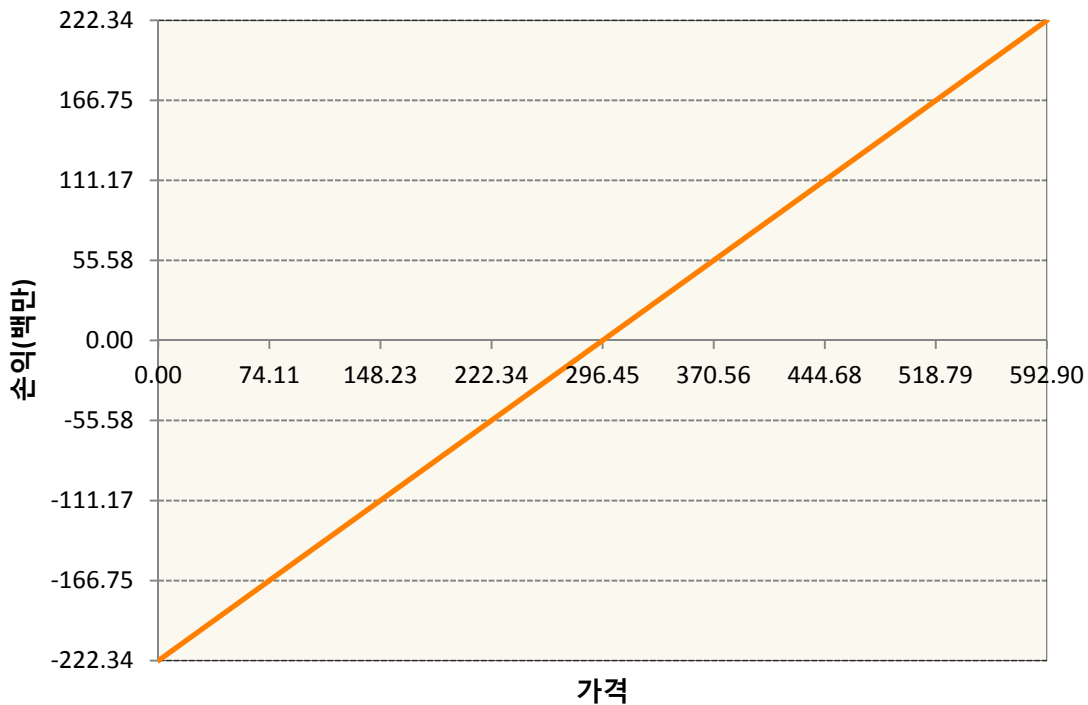
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	222	0	222	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						18
기초자산의 변동성								
가격	-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	2020-02-11
기준일	2020-02-10

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)

670

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-11
기준일	2020-02-10

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)	418
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	153

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

885

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-11
기준일	2020-02-10

유로인덱스모(주식-파생형)

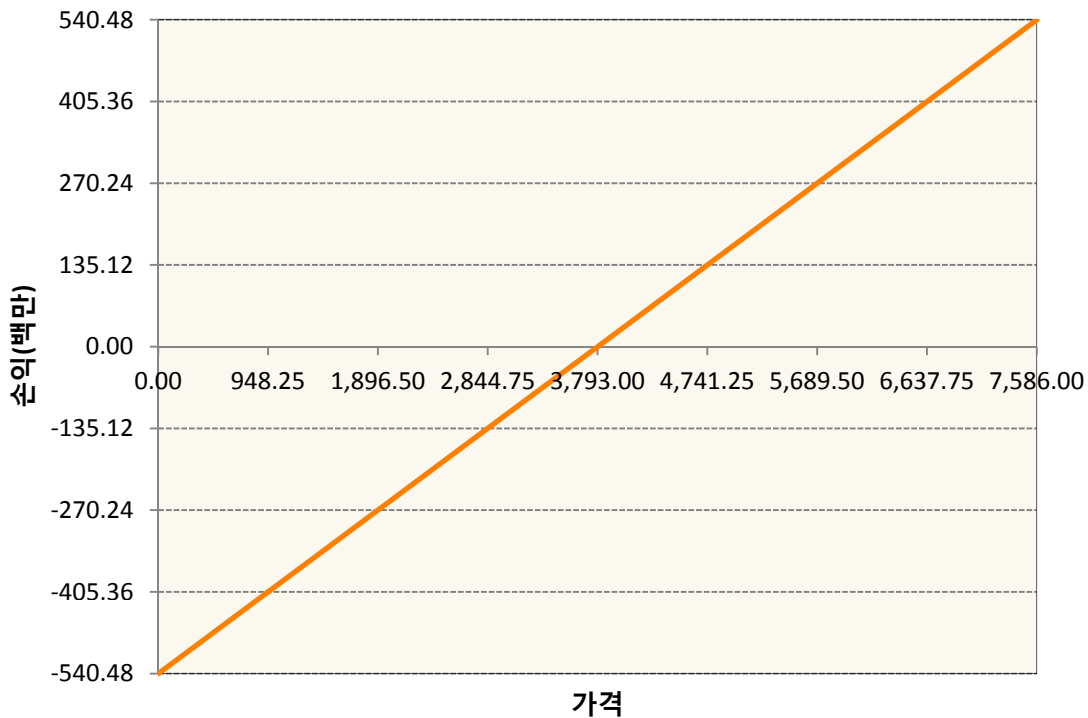
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	540	0	540	

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	2020-02-11
기준일	2020-02-10

차이나인덱스모(주식-파생형)

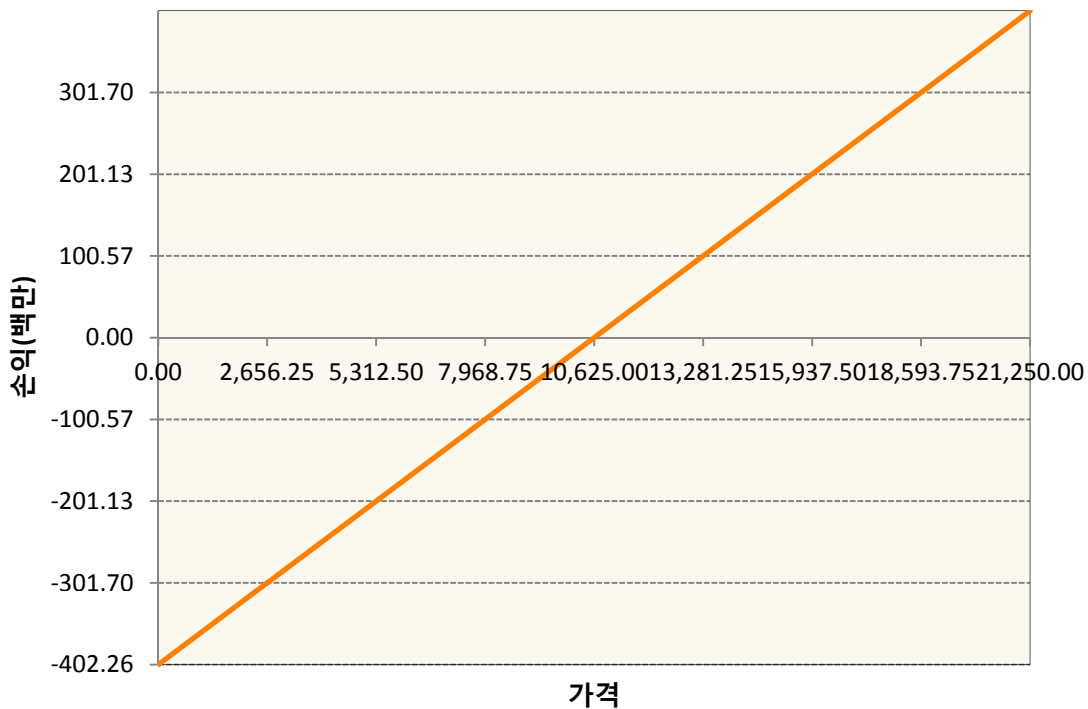
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	402	0	402	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	2020-02-11
기준일	2020-02-10

커버드콜모(주식혼합-파생형)

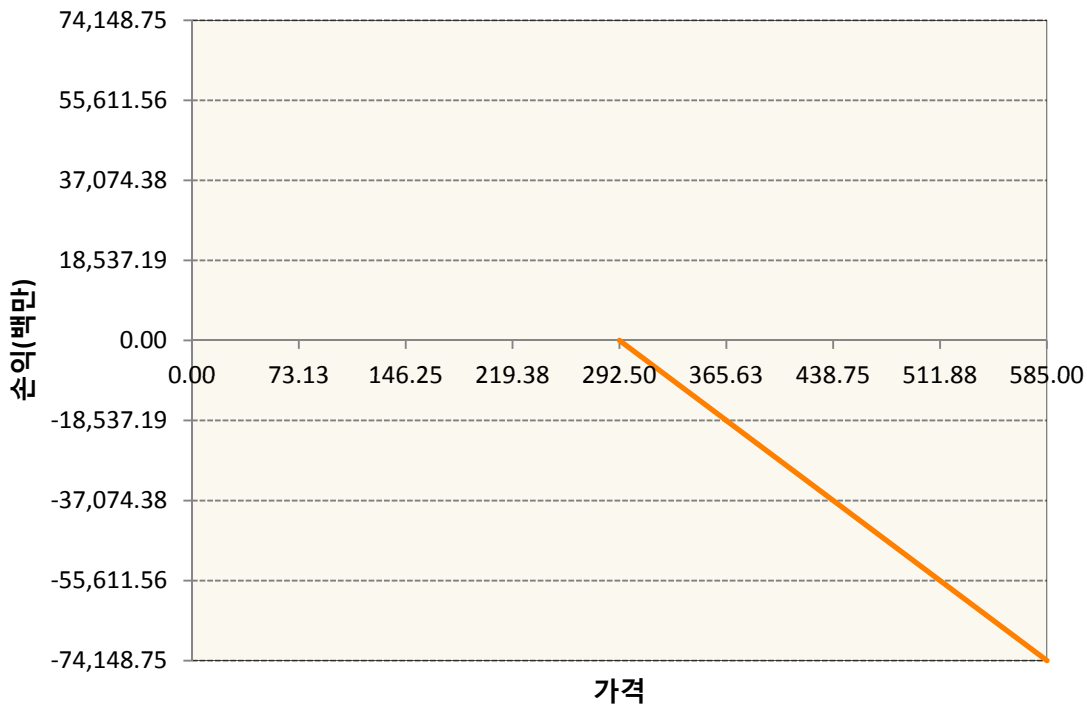
1. 계약금액

(단위:백만원)

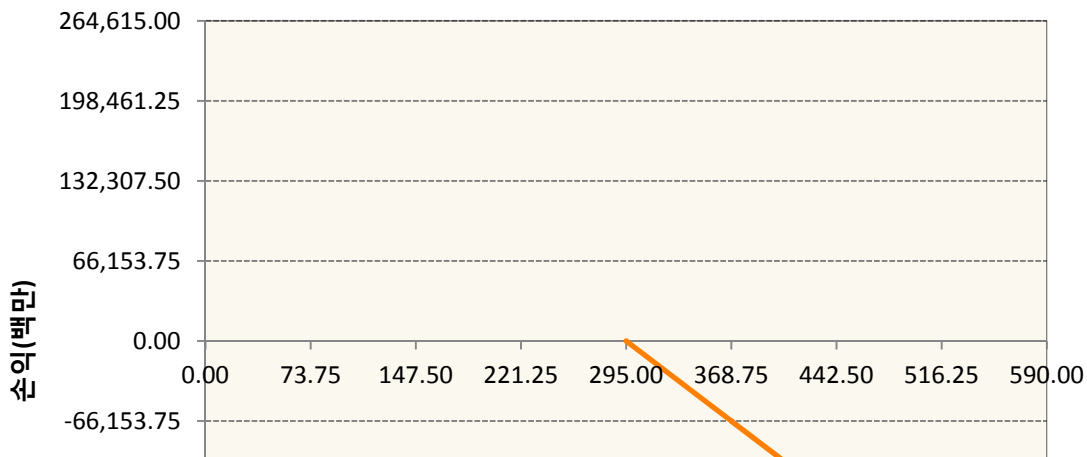
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	455,004	-455,004	장내

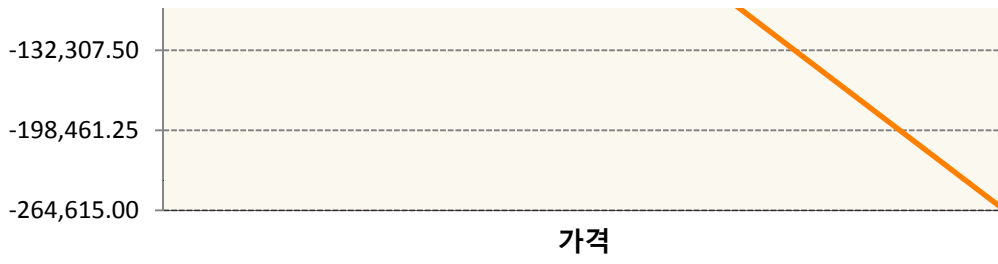
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q22927-2020-02 콜292.5

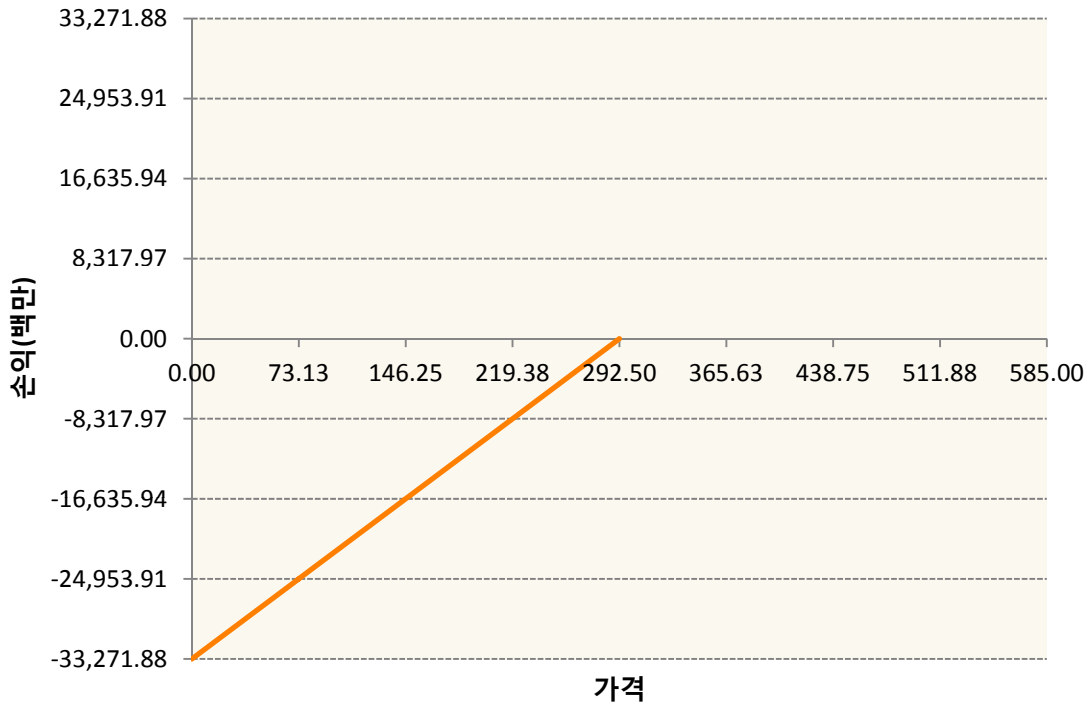


KR4201Q22950-2020-02 콜295

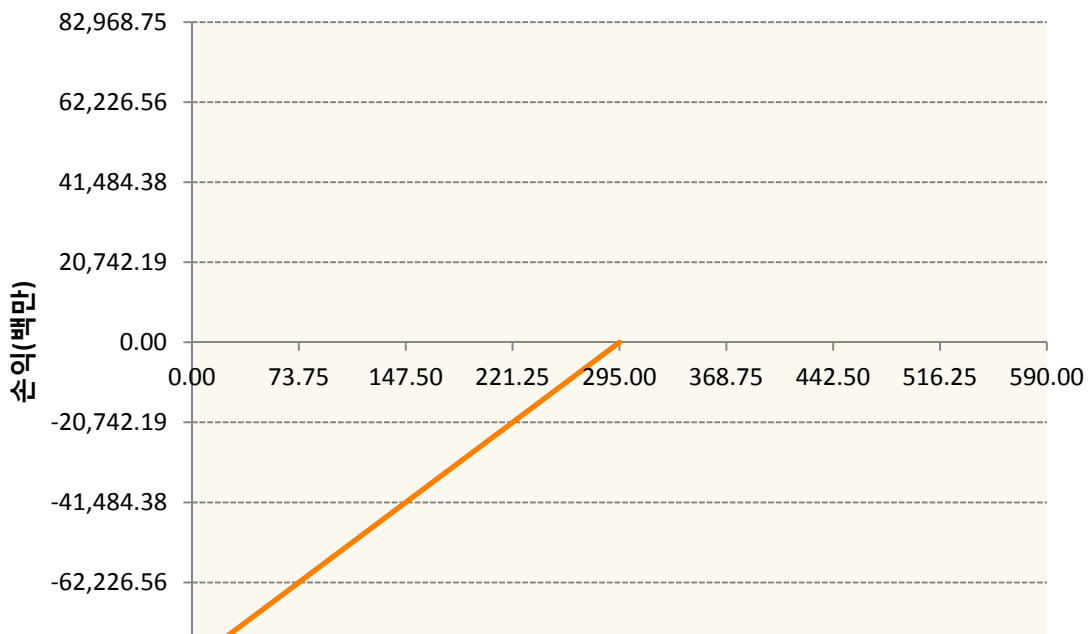




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



KR4301Q22958-2020-02 풋295



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q22927		2020-02 콜292.5						5,569
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,386	1,386	1,385	1,383	1,379	1,374	1,367	
-5.33%	1,374	1,363	1,348	1,329	1,305	1,278	1,247	
-2.67%	1,162	1,106	1,049	990	929	868	806	
0%	181	122	62	0	-63	-127	-191	
2.67%	-1,579	-1,594	-1,614	-1,638	-1,666	-1,699	-1,735	
5.33%	-3,563	-3,564	-3,566	-3,570	-3,576	-3,584	-3,596	
8.00%	-5,565	-5,565	-5,565	-5,565	-5,566	-5,567	-5,569	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						18,854
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,532	3,532	3,531	3,528	3,522	3,512	3,497	
-5.33%	3,519	3,501	3,474	3,434	3,382	3,317	3,239	
-2.67%	3,152	3,011	2,854	2,686	2,509	2,323	2,130	
0%	727	485	243	0	-243	-487	-731	
2.67%	-4,833	-4,929	-5,044	-5,174	-5,317	-5,473	-5,638	
5.33%	-11,743	-11,753	-11,771	-11,799	-11,838	-11,889	-11,952	
8.00%	-18,821	-18,822	-18,823	-18,825	-18,831	-18,840	-18,854	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						2,205
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,205	-2,205	-2,205	-2,205	-2,205	-2,205	-2,205	
-5.33%	-1,307	-1,307	-1,307	-1,308	-1,308	-1,310	-1,311	
-2.67%	-431	-441	-451	-463	-475	-488	-501	
0%	36	25	13	0	-13	-27	-42	
2.67%	66	66	66	65	64	62	59	
5.33%	66	66	66	66	66	66	66	
8.00%	66	66	66	66	66	66	66	
KR4301Q22958		2020-02 풋295						5,941
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-5,941	-5,941	-5,941	-5,941	-5,941	-5,941	-5,941	
-5.33%	-3,720	-3,720	-3,720	-3,720	-3,720	-3,721	-3,723	
-2.67%	-1,509	-1,518	-1,530	-1,544	-1,561	-1,581	-1,603	
0%	128	85	43	0	-43	-86	-130	
2.67%	377	374	370	364	355	344	331	

5.33%	379	379	379	379	379	378	377
8.00%	379	379	379	379	379	379	379

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

(단위:백만원)

40,113

공시일	2020-02-11
기준일	2020-02-10

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

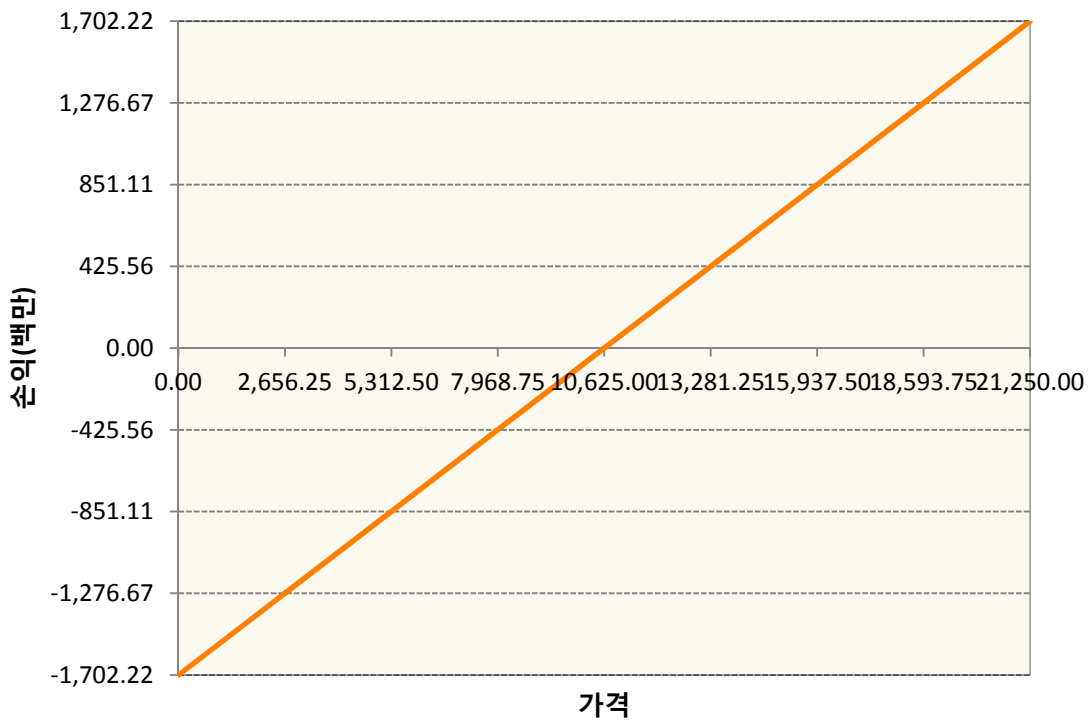
1. 계약금액

(단위:백만원)

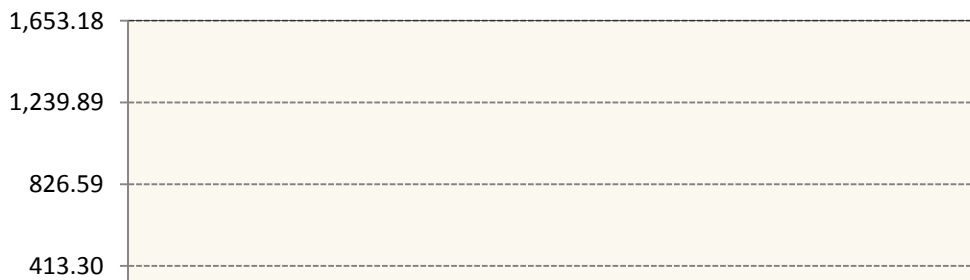
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,702	0	1,702	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,499	-4,499	장내
누계	통화	선도	0	2,152	-2,152	장외

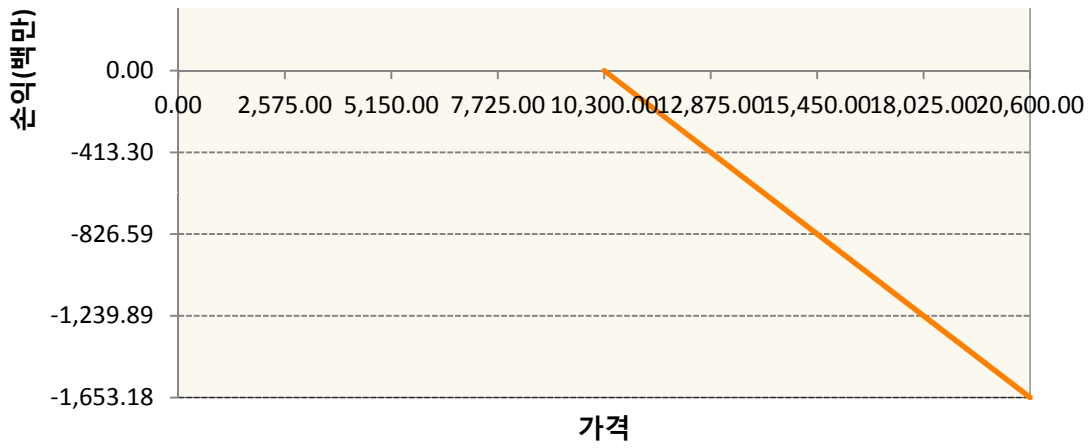
2. 만기시점의 손익구조

HCG0-HSCEI Futures Feb20

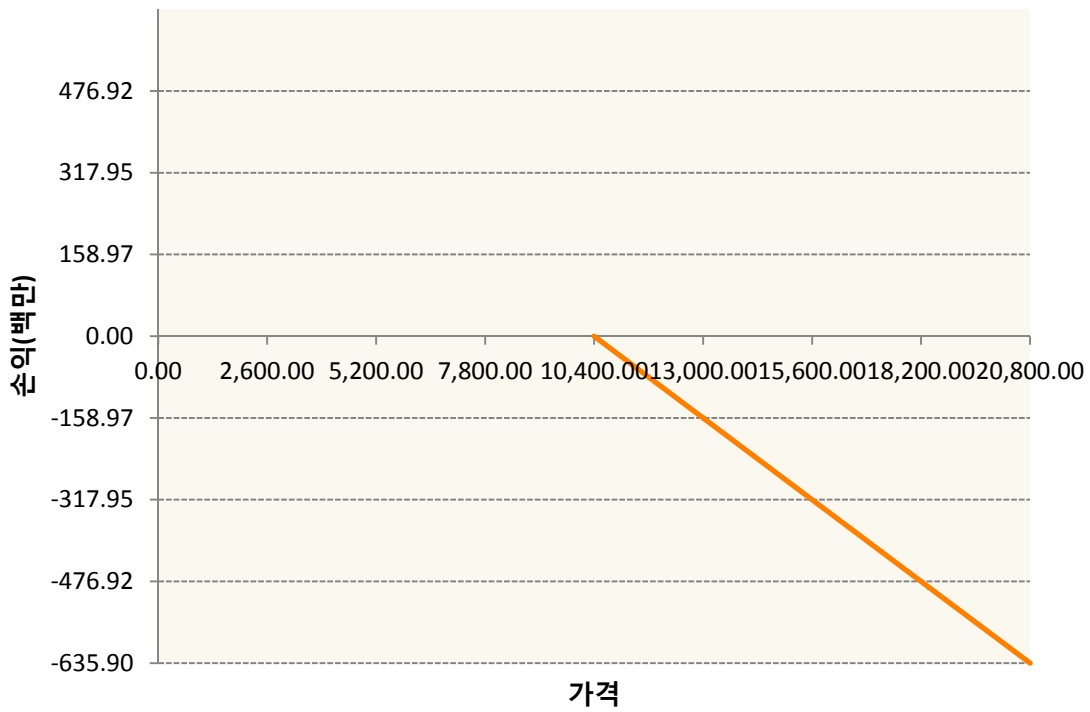


OHHIG0-C103-HSCEI

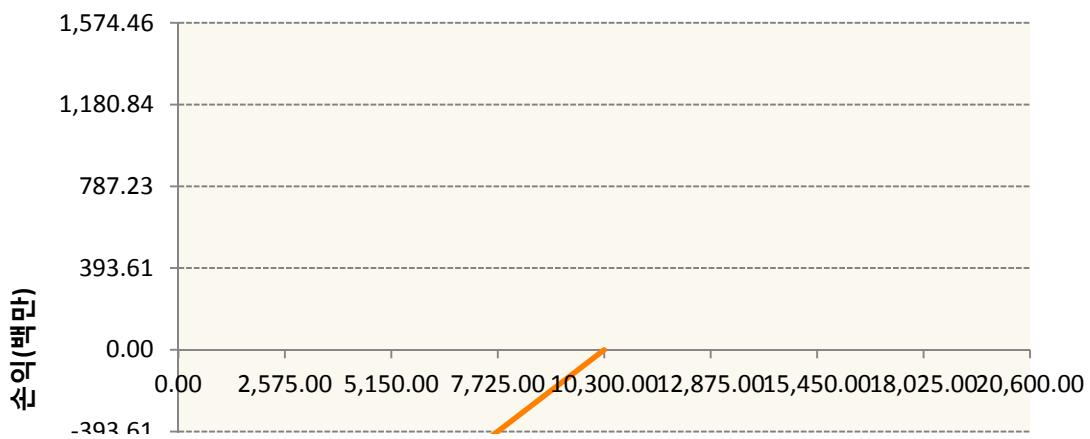


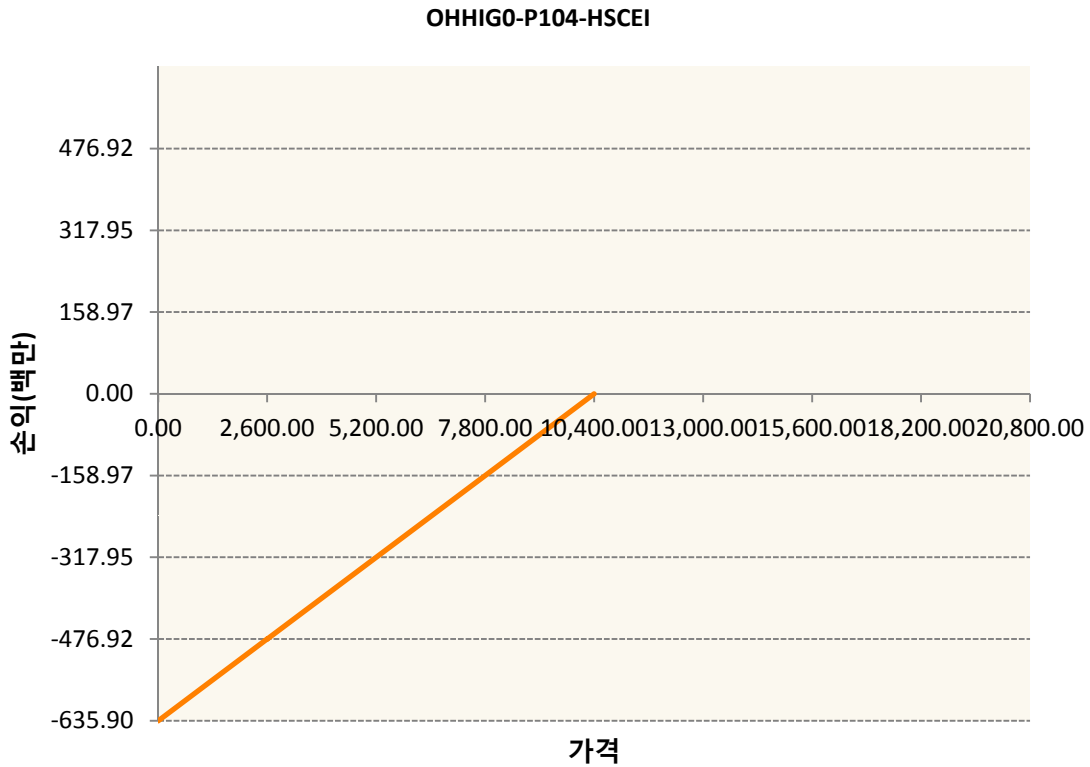


OHHIG0-C104-HSCEI



OHHIG0-P103-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	172
HCG0 HSCEI Futures Feb20	136
OHHIG0-C1(HSCEI	132
OHHIG0-C1(HSCEI	51
OHHIG0-P1(HSCEI	126
OHHIG0-P1(HSCEI	51

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

510

공시일	2020-02-11
기준일	2020-02-10

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

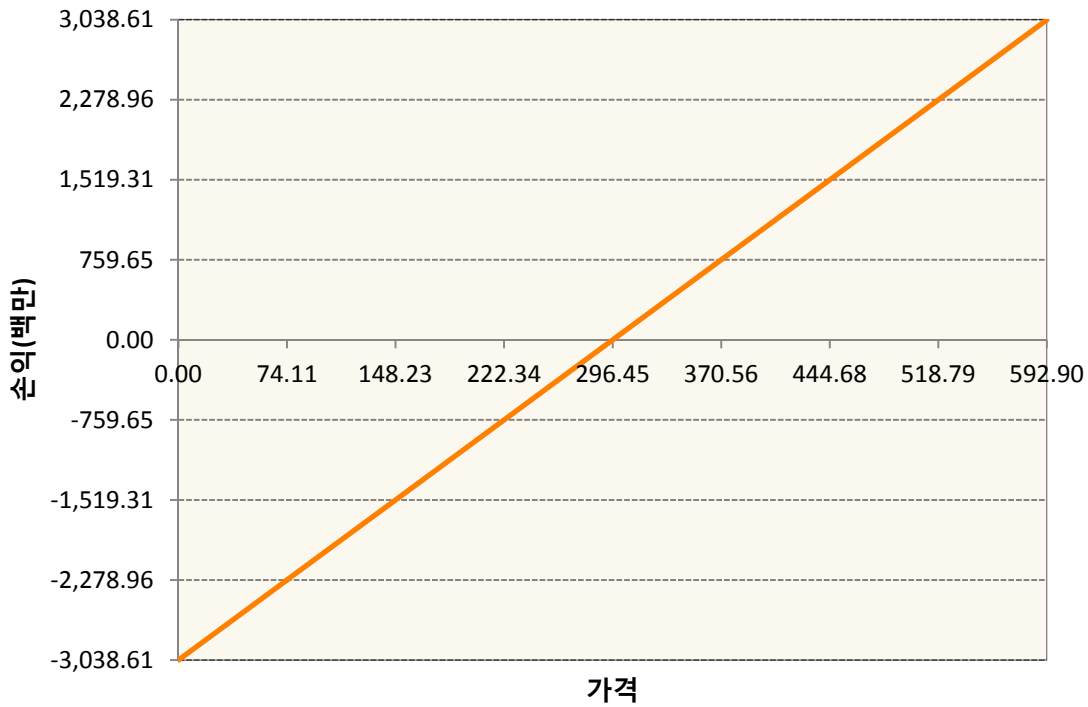
1. 계약금액

(단위:백만원)

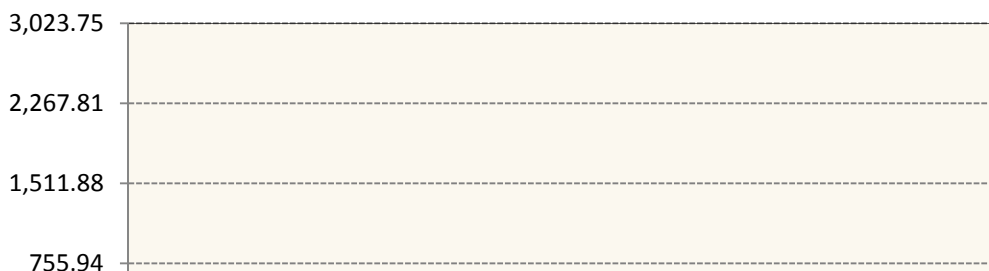
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,183	0	1,183	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	2,375	-2,375	장내
누계	유가증권	선물	3,039	0	3,039	장내
누계	유가증권	스왑	3,625	0	3,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	5,962	-5,962	장내

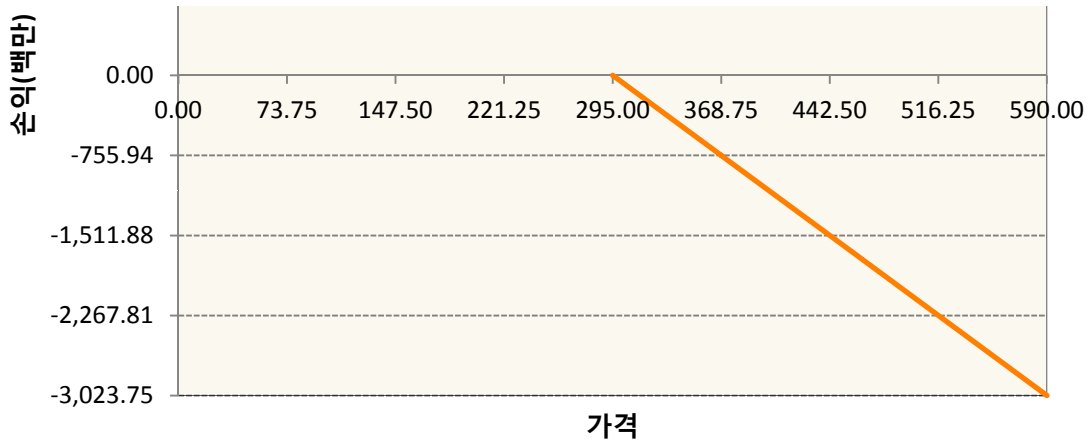
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

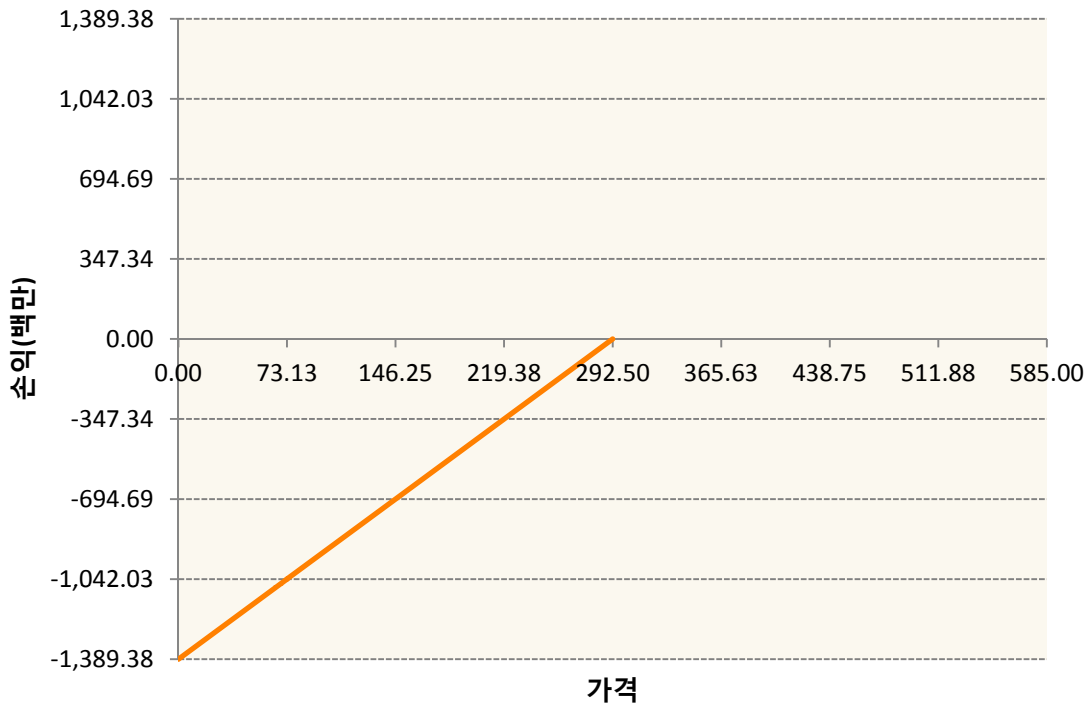


KR4201Q22950-2020-02 콜295

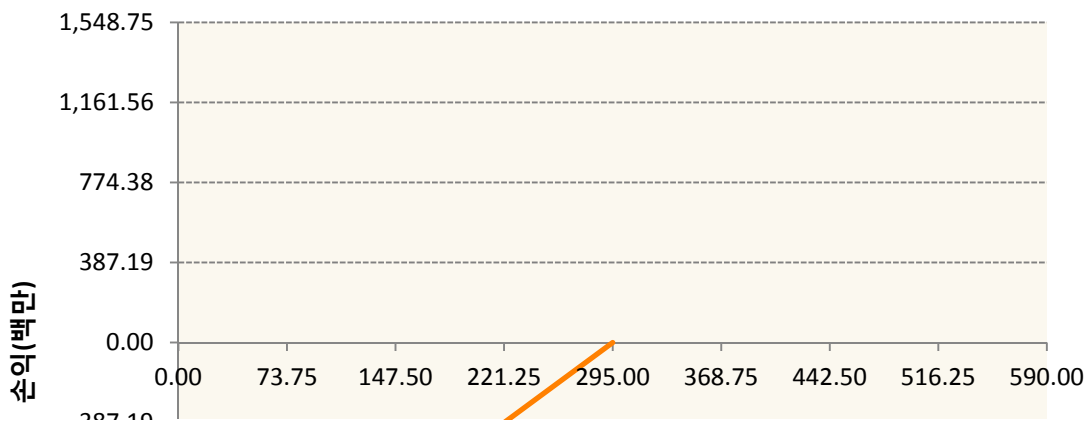




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



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						243
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-243	-243	-243	-243	-243	-243	-243	
-5.33%	-162	-162	-162	-162	-162	-162	-162	
-2.67%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	81	81	81	81	81	81	81	
5.33%	162	162	162	162	162	162	162	
8.00%	243	243	243	243	243	243	243	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						215
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	40	40	40	40	40	40	40	
-5.33%	40	40	40	39	39	38	37	
-2.67%	36	34	33	31	29	27	24	
0%	8	6	3	0	-3	-6	-8	
2.67%	-55	-56	-58	-59	-61	-63	-64	
5.33%	-134	-134	-135	-135	-135	-136	-137	
8.00%	-215	-215	-215	-215	-215	-215	-215	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						92
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
-5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-2.67%	-18	-18	-19	-19	-20	-20	-21
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	3	3	3	3	3	3	2
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3
KR4301Q22958 2020-02 풋295							111
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111
-5.33%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69
-2.67%	-28	-28	-29	-29	-29	-30	-30
0%	2	2	1	0	-1	-2	-2
2.67%	7	7	7	7	7	6	6
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	7	7	7	7	7	7	7

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

(단위:백만원)

1,029

공시일	2020-02-11
기준일	2020-02-10

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

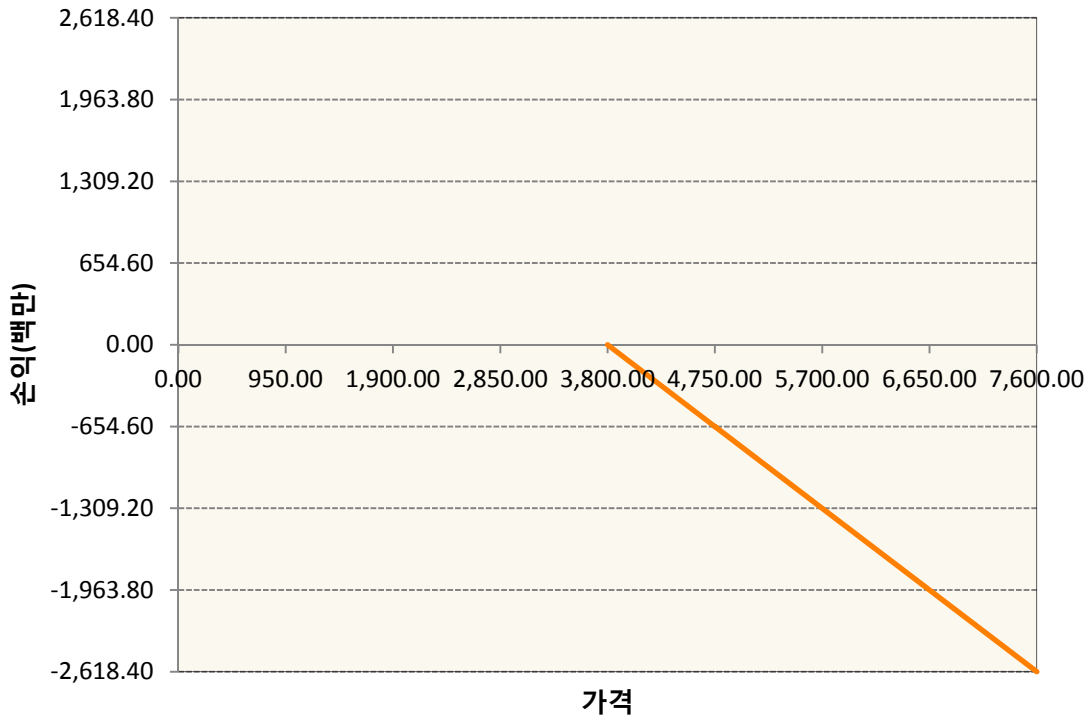
1. 계약금액

(단위:백만원)

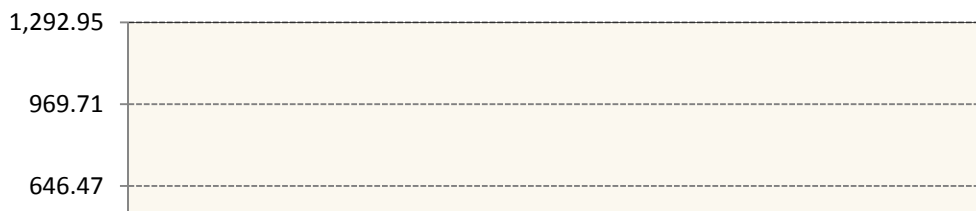
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	785	0	785	
누계	유가증권	스왑	13,585	0	13,585	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,823	-7,823	장내
누계	통화	선도	0	3,411	-3,411	장외

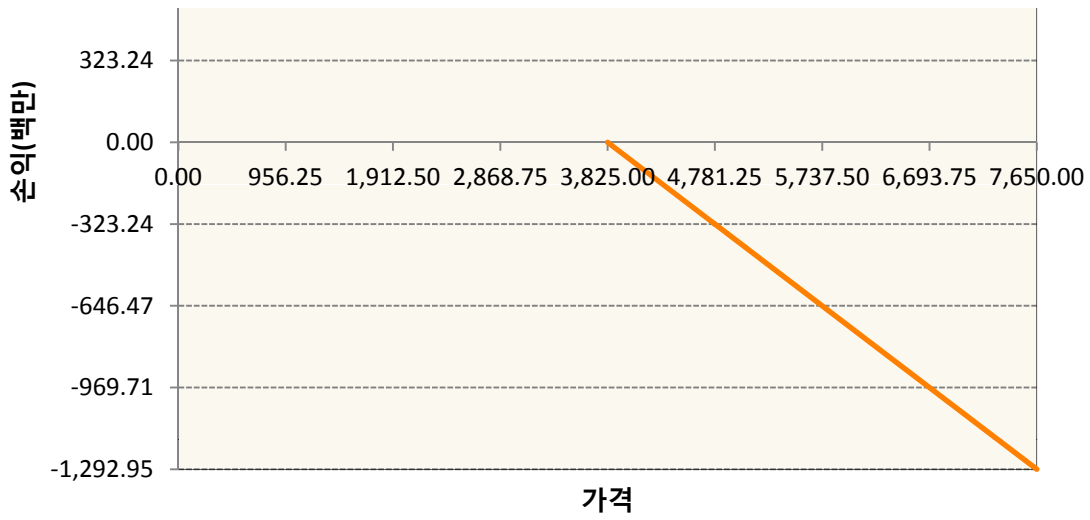
2. 만기시점의 손익구조

OESXG0-C3800-EURO STOXX 50

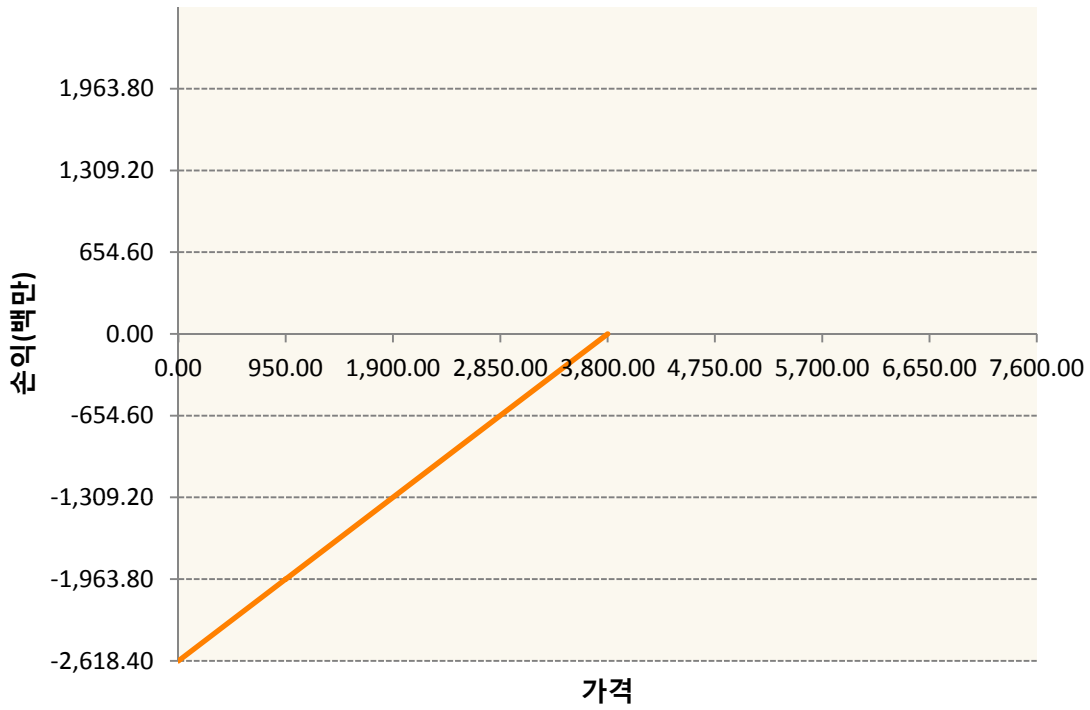


OESXG0-C3825-EURO STOXX 50

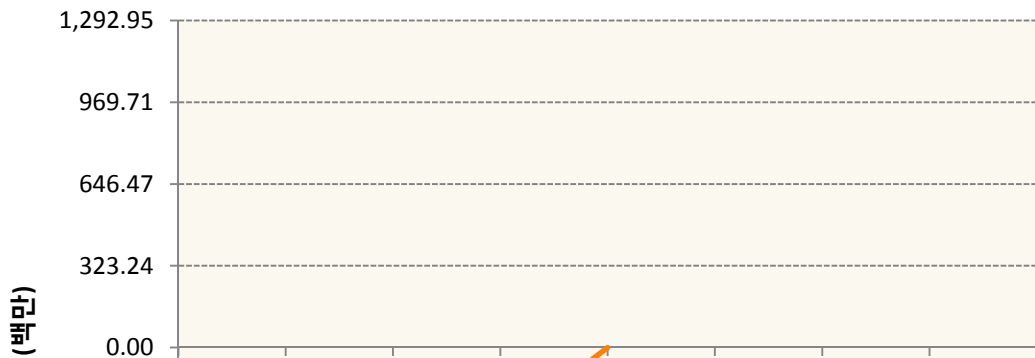


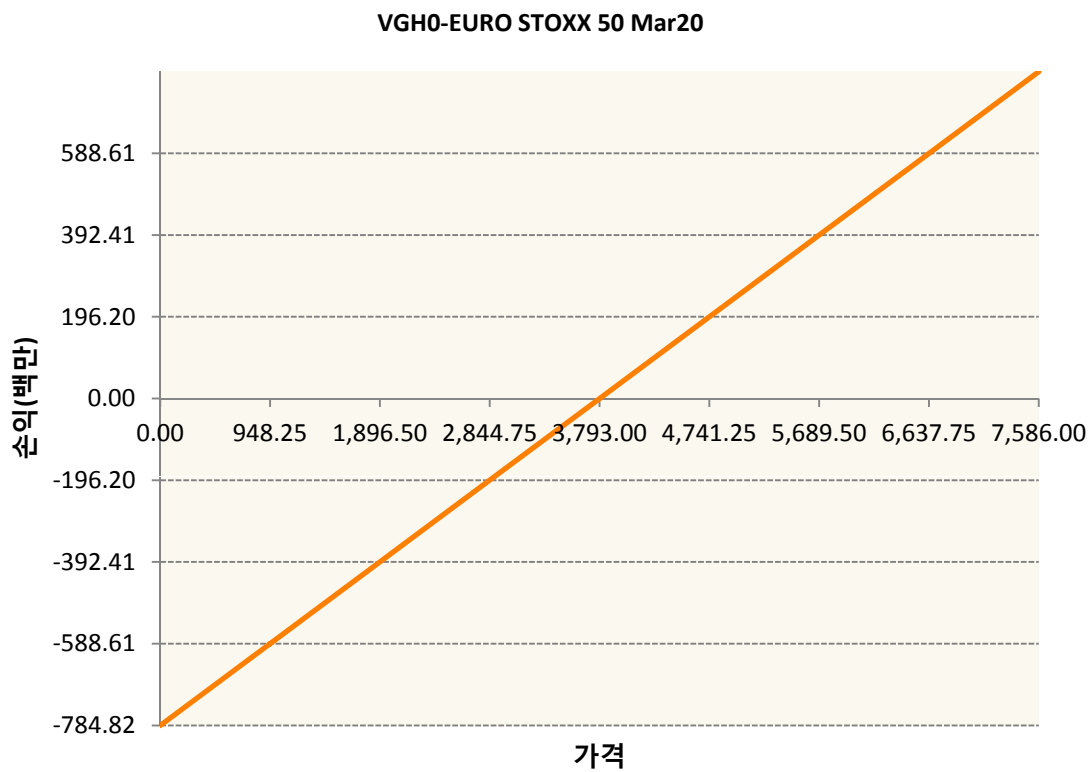
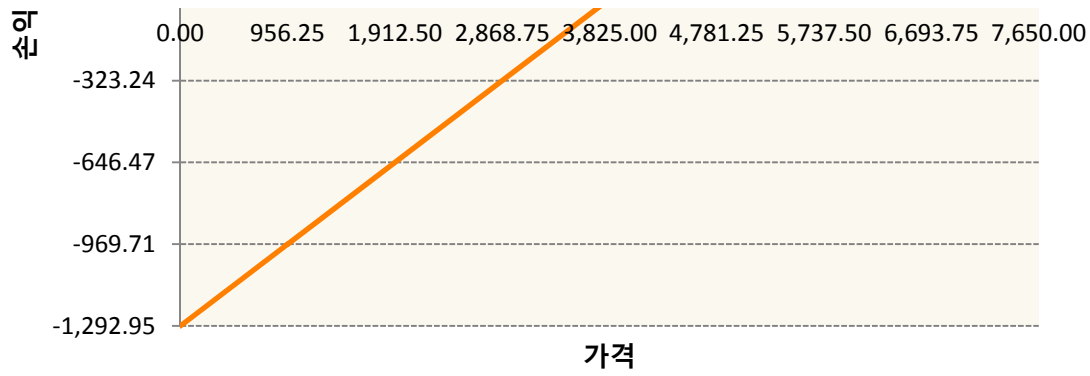


OESXG0-P3800-EURO STOXX 50



OESXG0-P3825-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		3
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E		273
OESXG0-C3& EURO STOXX 50		209
OESXG0-C3& EURO STOXX 50		103
OESXG0-P3& EURO STOXX 50		209
OESXG0-P3& EURO STOXX 50		103
VGHO	EURO STOXX 50 Mar20	63

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

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

(단위:백만원)

943

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

(단위:백만원)

83

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

(단위:백만원)

122

공시일	2020-02-11
기준일	2020-02-10

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

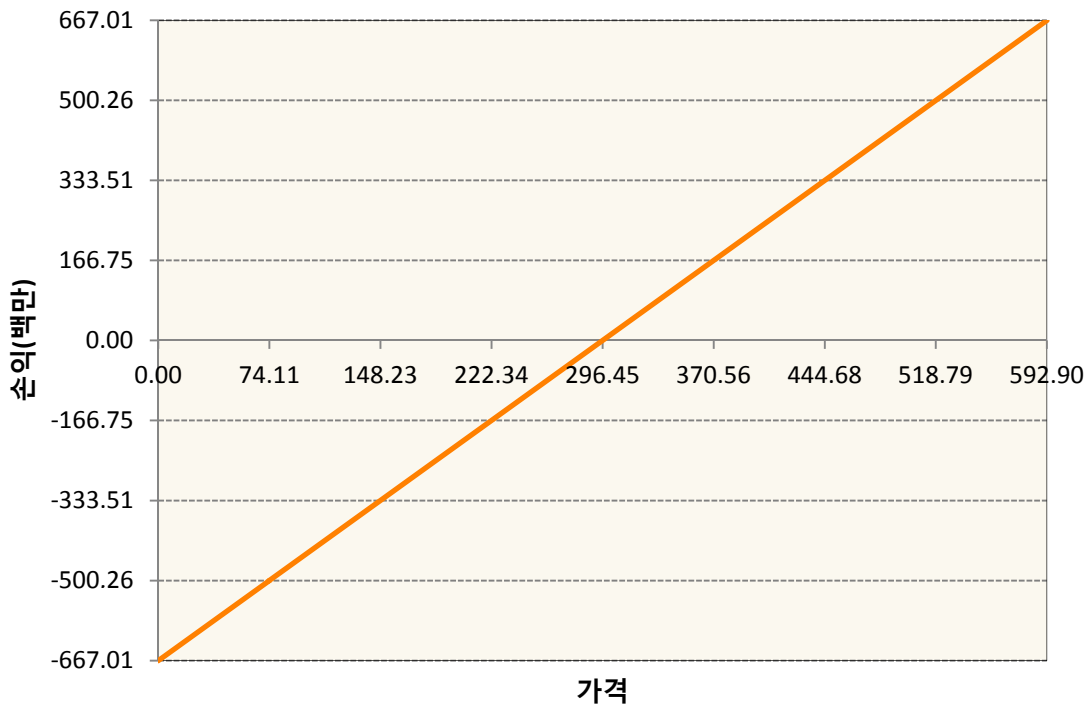
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	667	0	667	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005 2020-03 코스피200지수선물 53

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-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%	53	53	53	53	53	53	53

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

(단위:백만원)

44

공시일	2020-02-11
기준일	2020-02-10

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

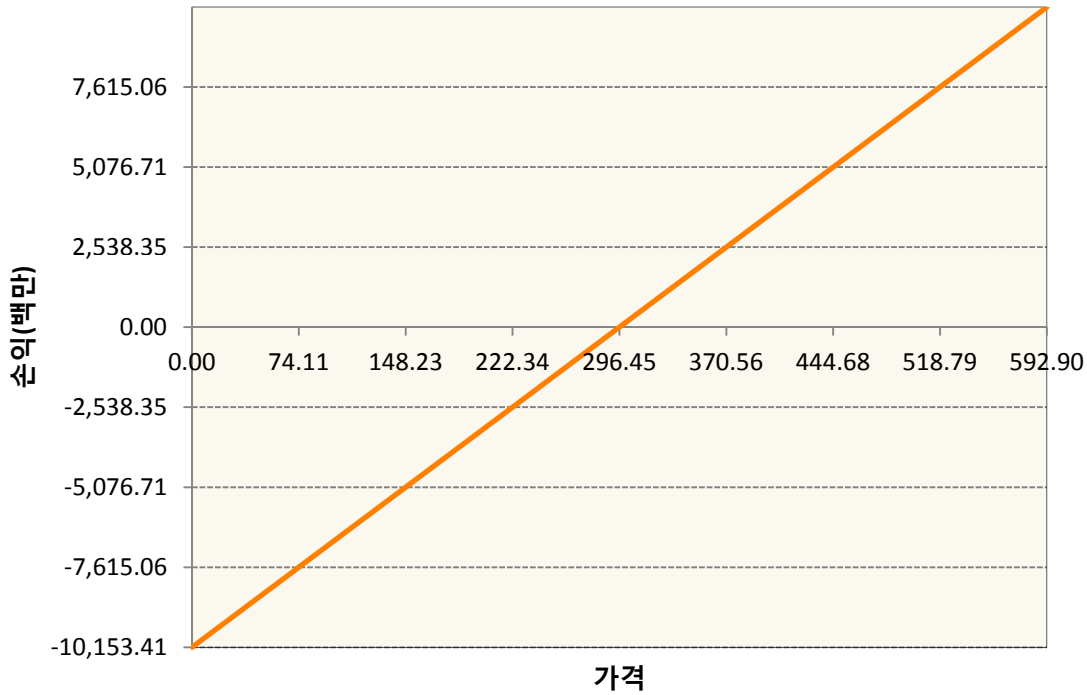
1. 계약금액

(단위:백만원)

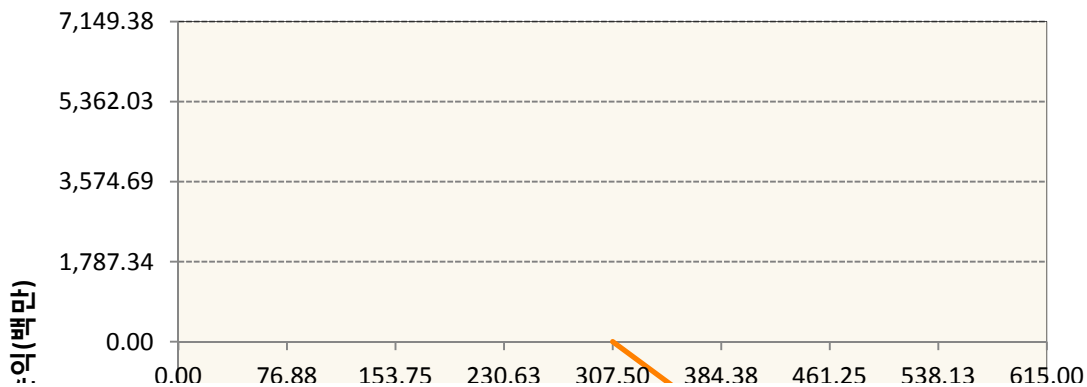
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,153	0	10,153	장내
누계	유가증권	옵션	2,944	20,557	-17,613	장내

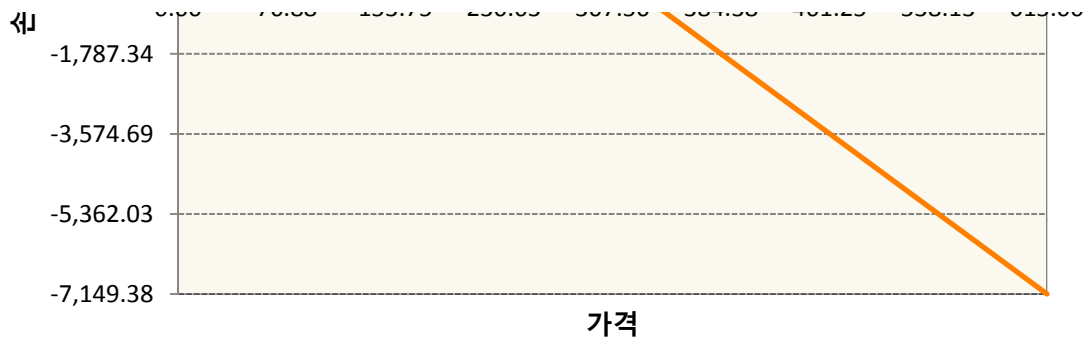
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

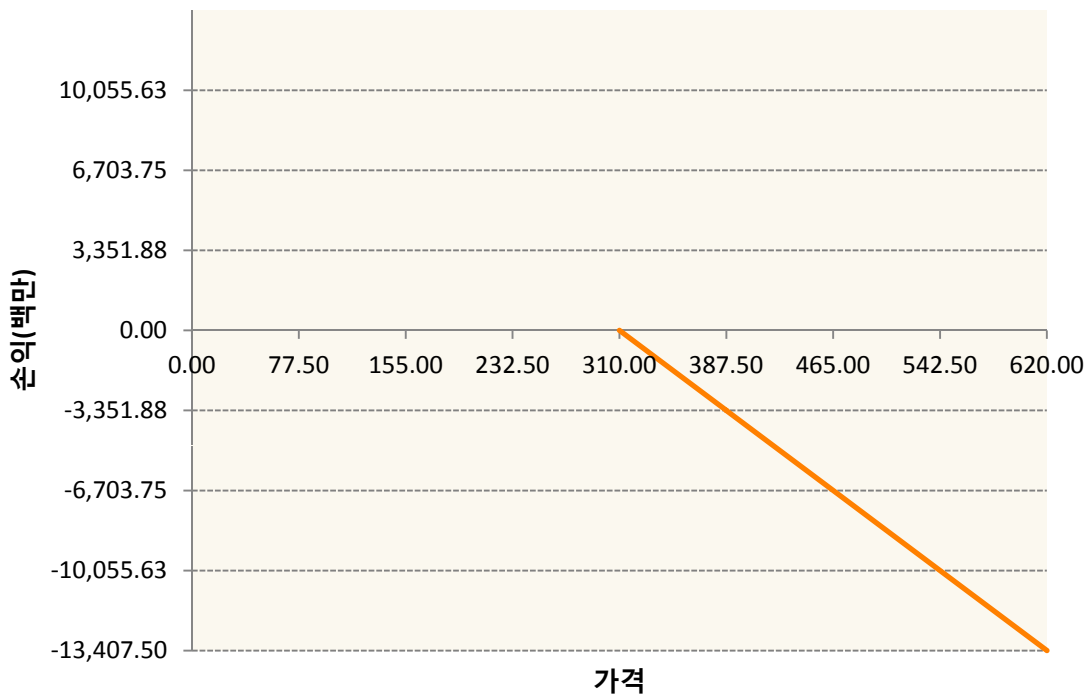


KR4201Q23073-2020-02 콜307.5

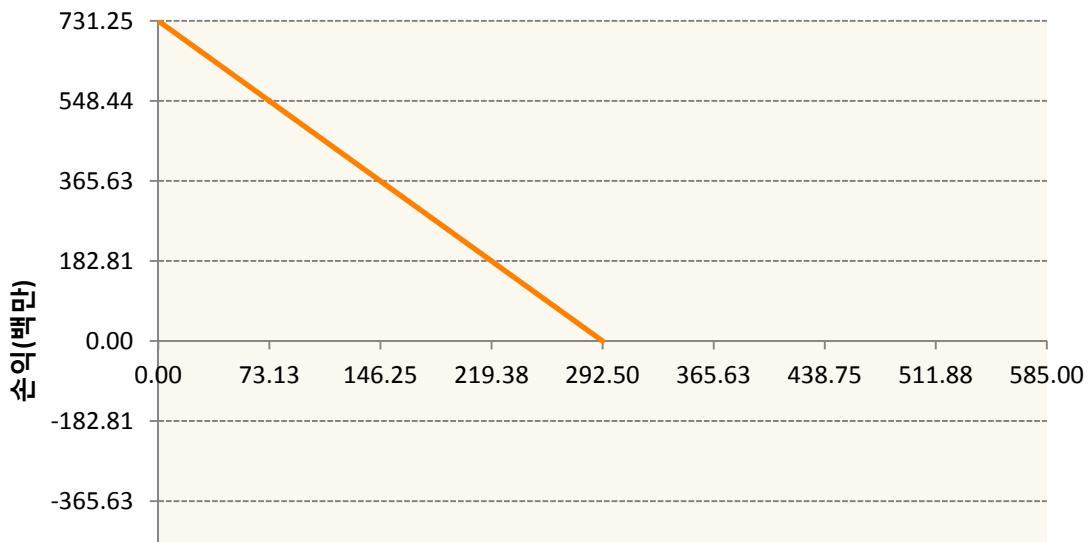


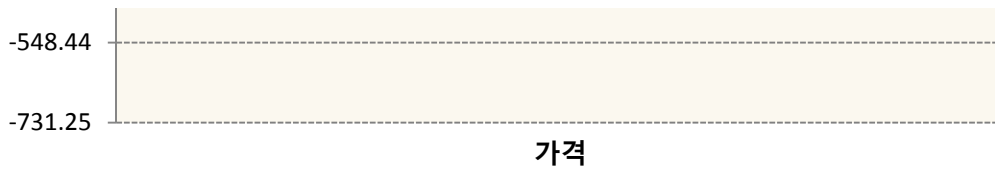


KR4201Q23107-2020-02 콜310

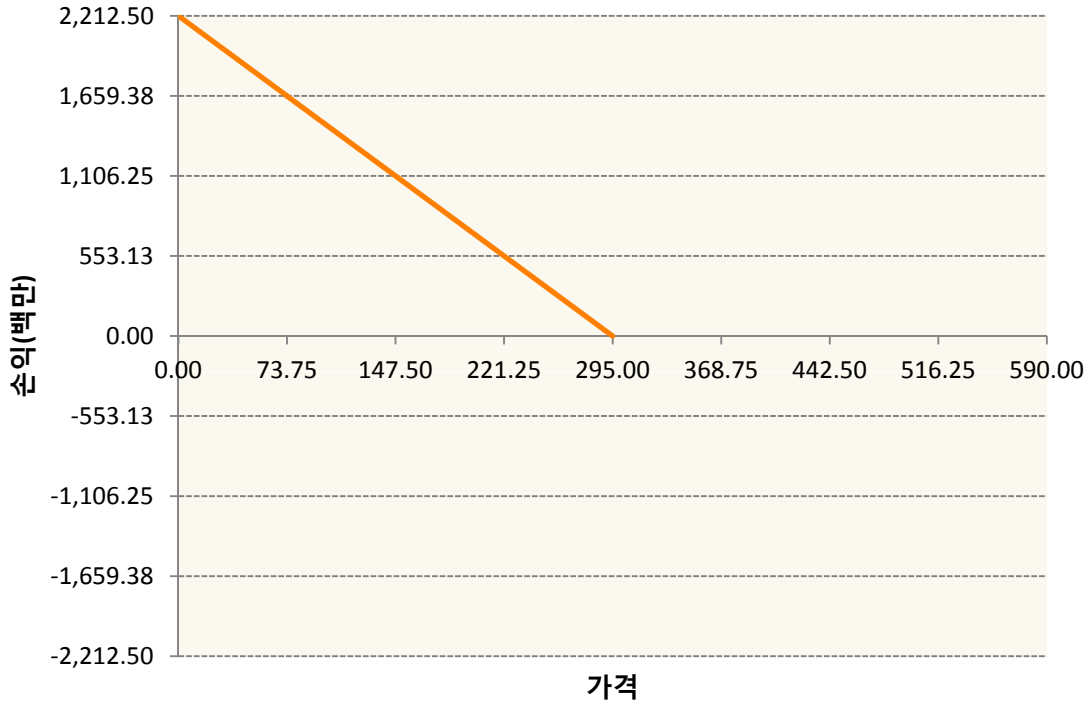


KR4301Q22925-2020-02 풋292.5





KR4301Q22958-2020-02 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						812
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-812	-812	-812	-812	-812	-812	-812	
-5.33%	-541	-541	-541	-541	-541	-541	-541	
-2.67%	-271	-271	-271	-271	-271	-271	-271	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	271	271	271	271	271	271	271	
5.33%	541	541	541	541	541	541	541	
8.00%	812	812	812	812	812	812	812	
KR4201Q23073		2020-02 콜307.5						297
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	8	8	8	8	8	8	8	
-5.33%	8	8	8	8	8	8	8	
-2.67%	8	8	8	8	7	6	5	

0%	6	4	2	0	-3	-6	-10
2.67%	-20	-26	-32	-38	-44	-50	-56
5.33%	-119	-124	-130	-135	-141	-147	-153
8.00%	-282	-284	-285	-288	-290	-293	-297
KR4201Q23107 2020-02 콜310							469
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8	8	8	8	8	8	8
-5.33%	8	8	8	8	8	8	8
-2.67%	8	8	8	7	7	6	5
0%	6	5	3	0	-4	-8	-13
2.67%	-19	-28	-37	-46	-56	-66	-77
5.33%	-153	-165	-177	-190	-202	-214	-226
8.00%	-429	-434	-439	-446	-453	-460	-469
KR4301Q22925 2020-02 풋292.5							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%	29	29	29	29	29	29	29
-2.67%	9	10	10	10	10	11	11
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							158
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	158	158	158	158	158	158	158
-5.33%	99	99	99	99	99	99	99
-2.67%	40	40	41	41	42	42	43
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-10	-10	-10	-10	-9	-9	-9
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)

1,241

공시일	2020-02-11
기준일	2020-02-10

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	213,671	0	213,671	

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	2020-02-11
기준일	2020-02-10

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	195,292	0	195,292	

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	2020-02-11
기준일	2020-02-10

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	530,415	0	530,415	
누계	통화	선도	0	548,203	-548,203	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019Z01: KRW/USD 12-02-20E	1,557
FX21019Z01: KRW/USD 12-02-20E	950
FX21019Z02: KRW/USD 18-02-20E	190
FX21019Z02: KRW/USD 18-02-20E	2,032
FX21019Z02: KRW/USD 18-02-20E	950
FX21019Z03: KRW/USD 24-02-20E	3,799
FX21019Z04: KRW/USD 26-02-20E	1,899
FX21019Z04: KRW/USD 26-02-20E	2,032
FX21019Z04: KRW/USD 26-02-20E	190
FX21020F01: KRW/USD 18-02-20E	1,709
FX21020F01: KRW/USD 18-02-20E	285
FX21020F02: KRW/USD 21-02-20E	1,899
FX21020F02: KRW/USD 21-02-20E	3,267
FX21020F02: KRW/USD 23-03-20E	1,529
FX21020F02: KRW/USD 23-03-20E	1,425
FX21020F02: KRW/USD 28-02-20E	1,899
FX21020F03: KRW/USD 28-02-20E	2,944
FX21020F03: KRW/USD 31-03-20E	3,039
FX21020F04: KRW/USD 31-03-20E	2,849
FX21020F04: KRW/USD 28-02-20E	190
FX21020G00: KRW/USD 06-04-20E	2,564
FX21020G00: KRW/USD 06-03-20E	2,374
FX21020G00: KRW/USD 12-03-20E	950
FX21020G01: KRW/USD 12-03-20E	1,178
FX21020G01: KRW/USD 12-03-20E	1,206
FX21020G01: KRW/USD 12-03-20E	950

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

14,742

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

(단위:백만원)

125

공시일	2020-02-11
기준일	2020-02-10

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

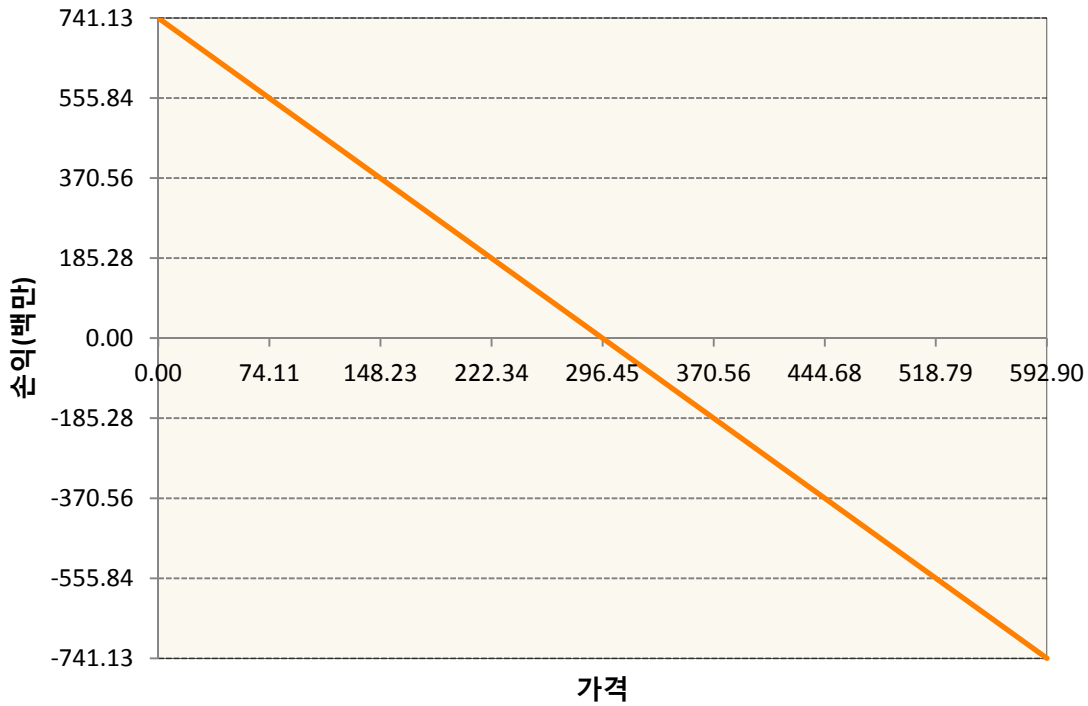
1. 계약금액

(단위:백만원)

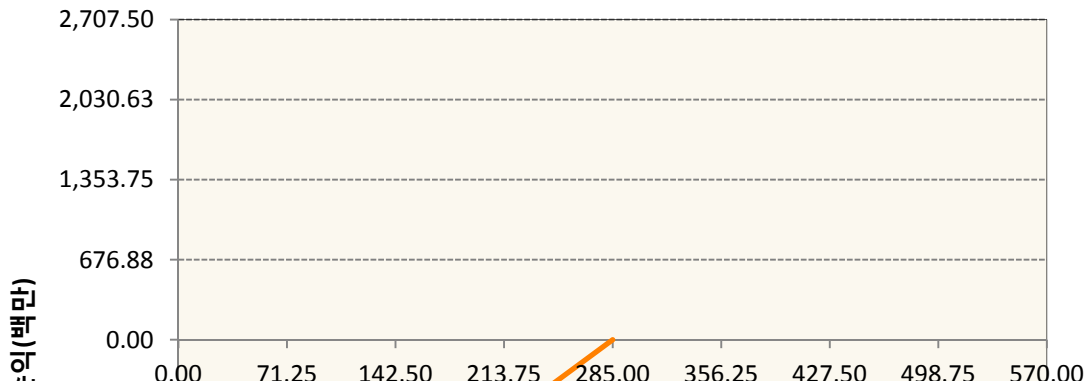
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	741	-741	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,498	-3,498	장내

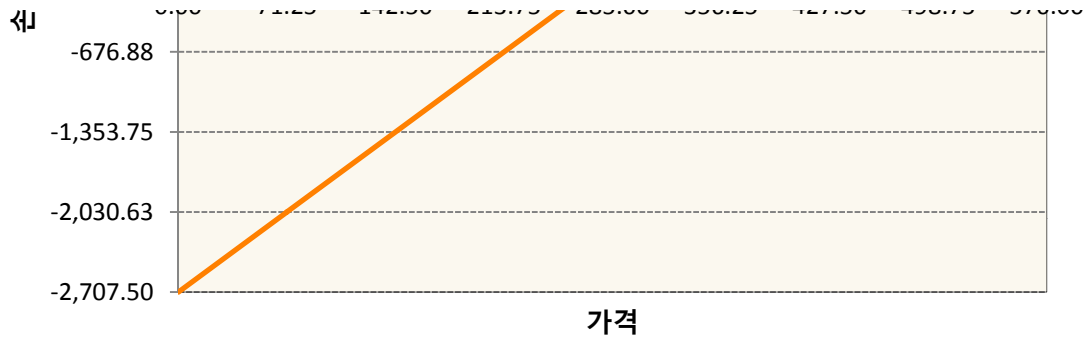
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

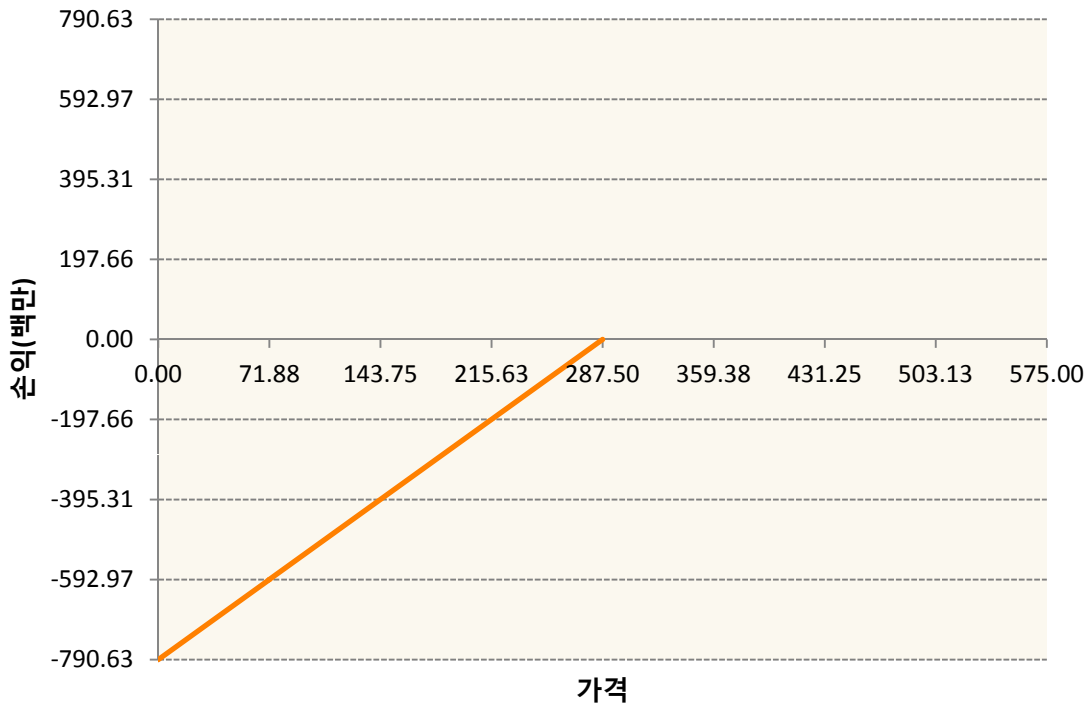


KR4301Q22859-2020-02 풋285





KR4301Q22875-2020-02 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						59
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	59	59	59	59	59	59	59	
-5.33%	39	39	39	39	39	39	39	
-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%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39	
8.00%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59	
KR4301Q22859		2020-02 풋285						119
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-118	-118	-118	-118	-118	-119	-119
-5.33%	-45	-45	-46	-47	-48	-49	-50
-2.67%	-3	-4	-5	-6	-7	-8	-9
0%	0	0	0	0	0	0	0
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 41

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
-5.33%	-19	-19	-20	-20	-20	-20	-20
-2.67%	-3	-3	-3	-4	-4	-5	-5
0%	0	0	0	0	0	0	0
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)

115

공시일	2020-02-11
기준일	2020-02-10

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	11,751	0	11,751	
누계	통화	선도	475	11,966	-11,491	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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)

335

공시일	2020-02-11
기준일	2020-02-10

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

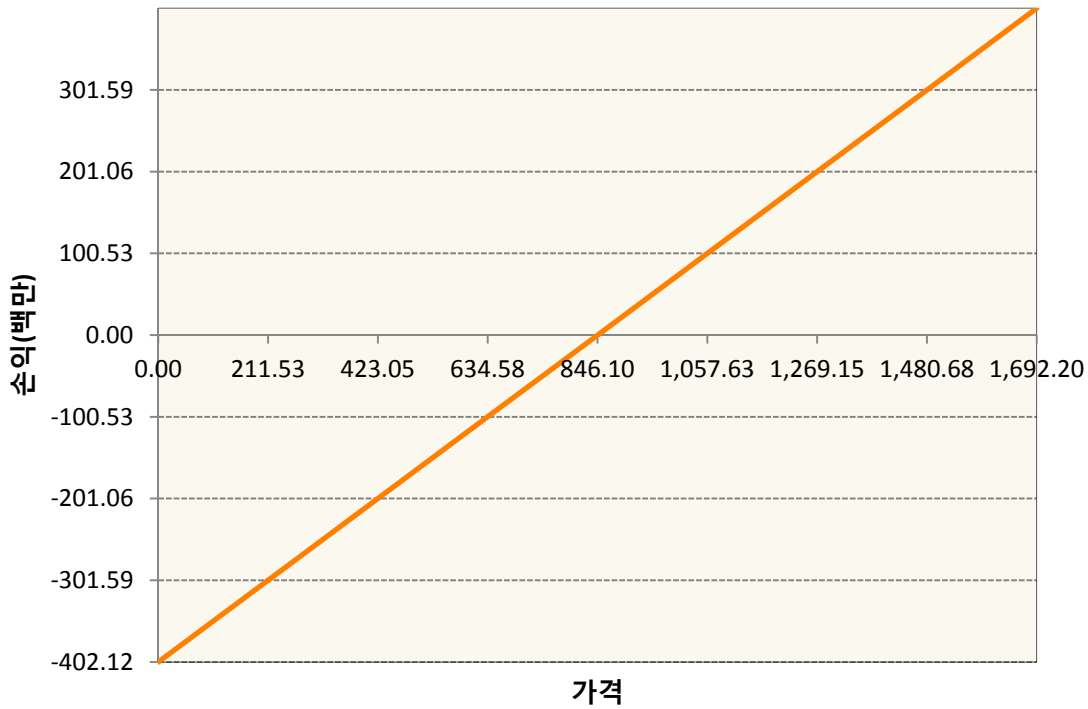
1. 계약금액

(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	402	0	402	
누계	유가증권	스왑	1,072	0	1,072	장외
누계	통화	선도	182	689	-507	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
FX21020G01 KRW/EUR 22-05-20E	5
VNCG0 VN30 Index Future Feb20	32

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

(단위:백만원)

113

공시일	2020-02-11
기준일	2020-02-10

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

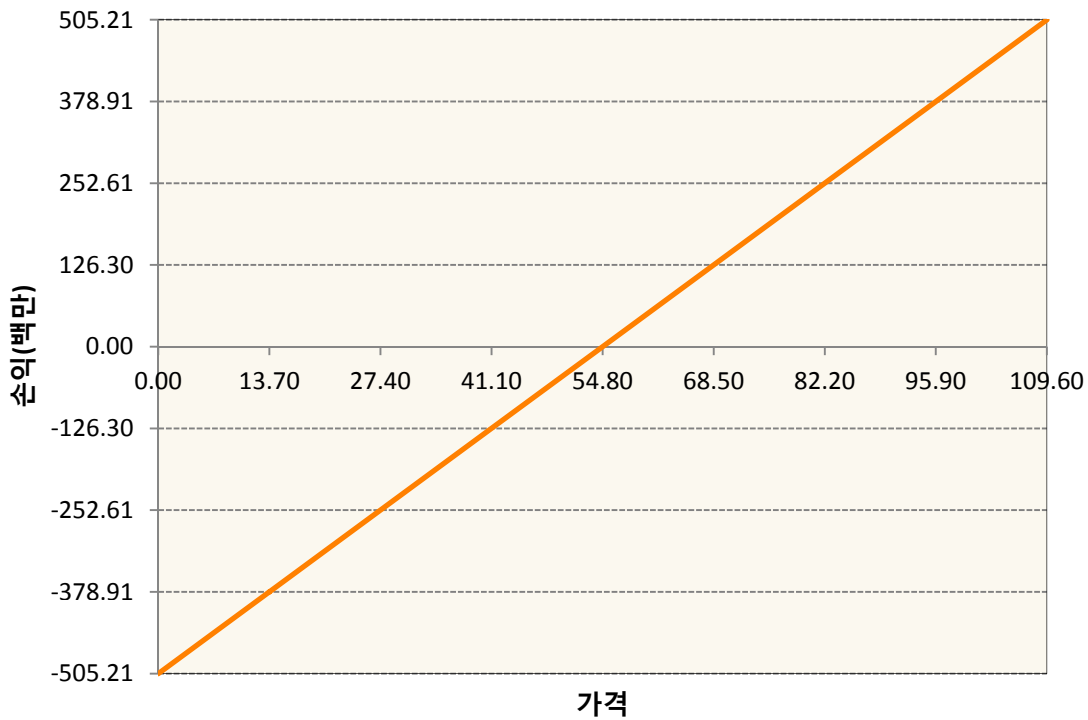
1. 계약금액

(단위:백만원)

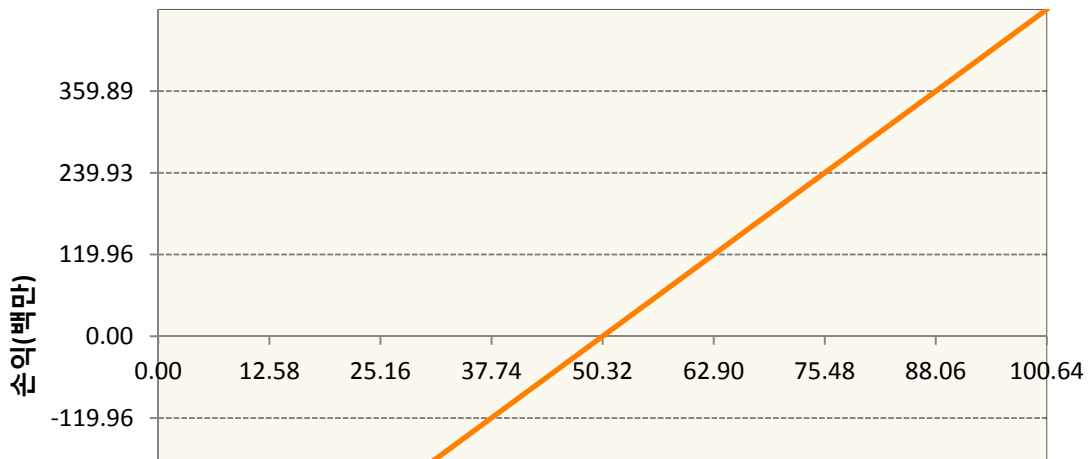
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,044	190	1,854	

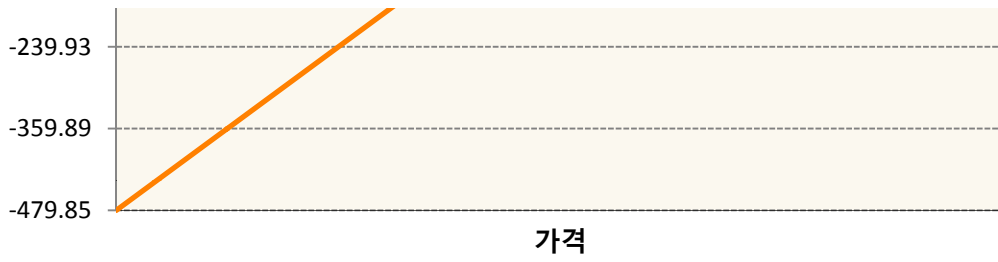
2. 만기시점의 손익구조

COKO-BRENT CRUDE FUTR May20

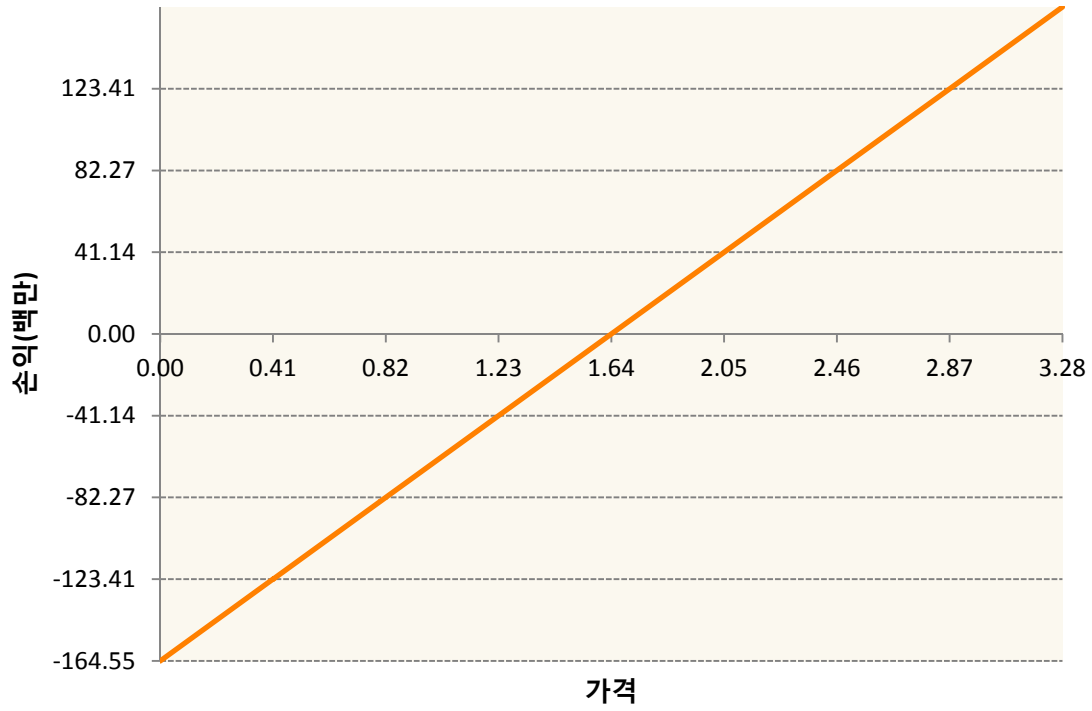


CLH0-WTI CRUDE FUTURE Mar20

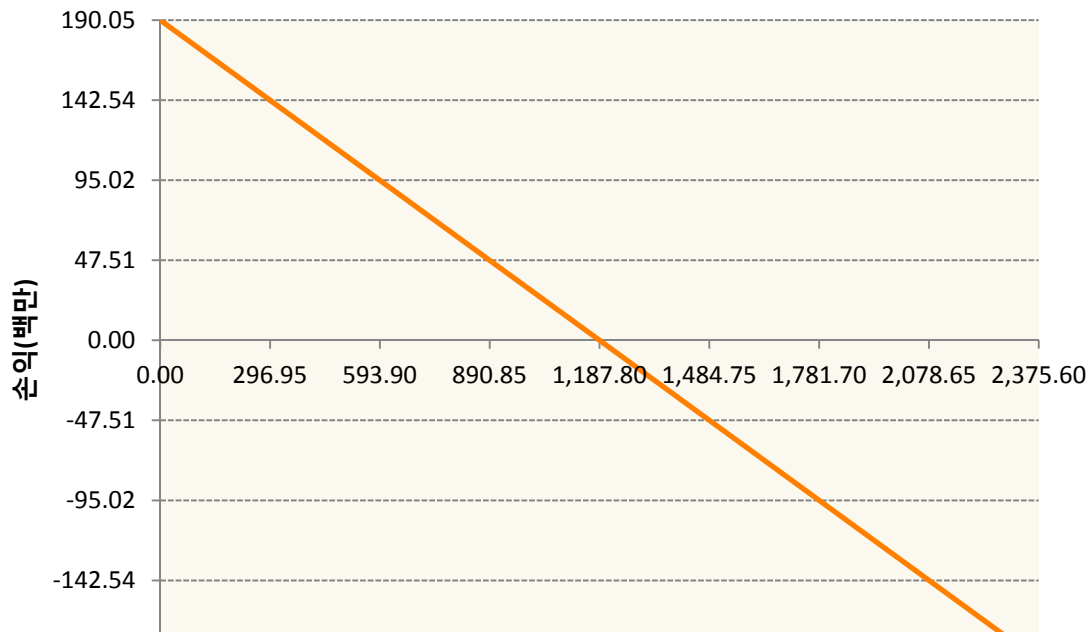


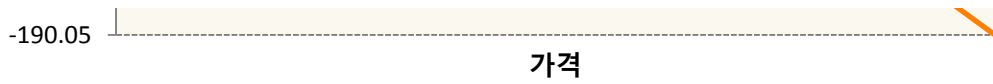


HOH0-NY Harb ULSD Fut Mar20

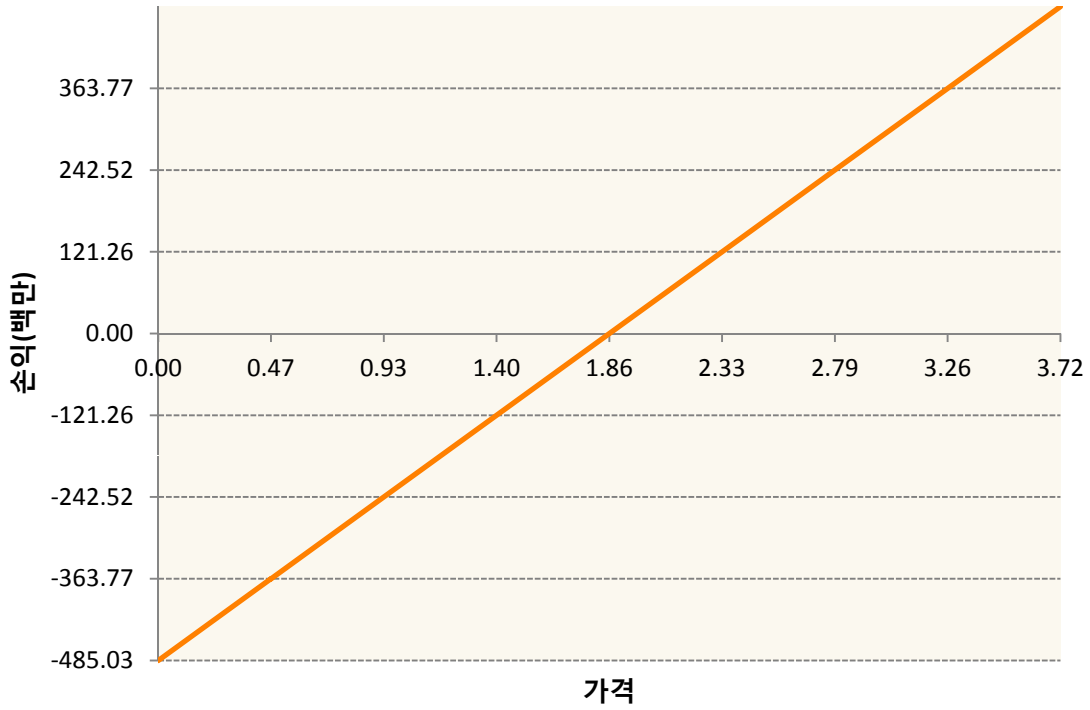


KR4175Q20000-2020-02 달러선물

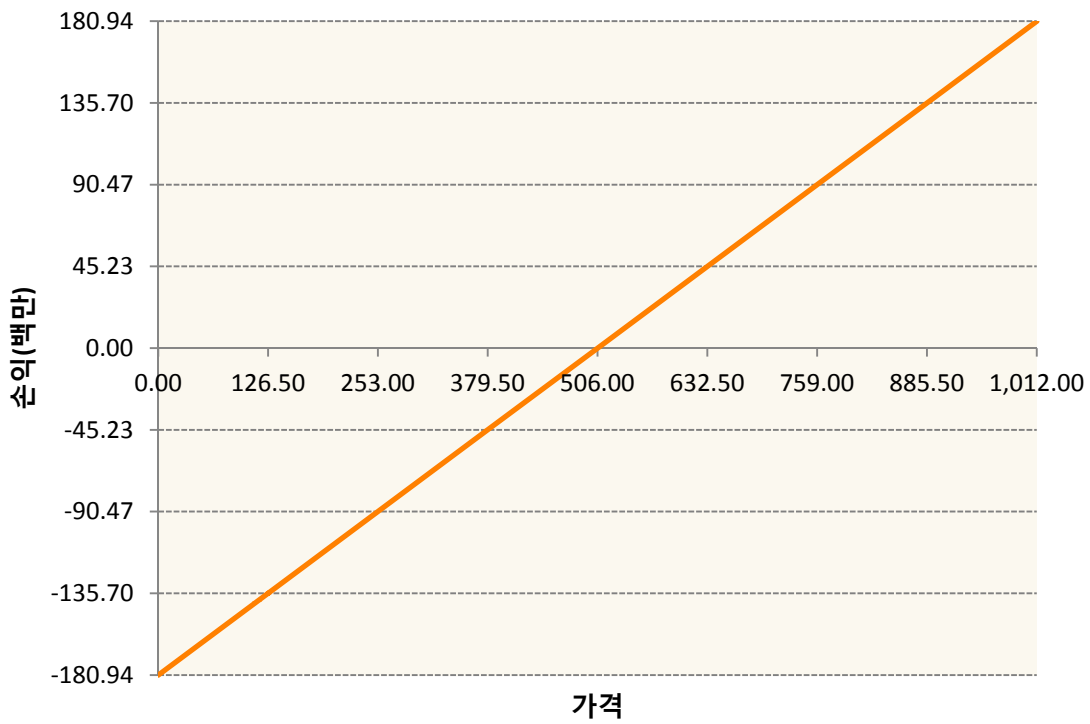




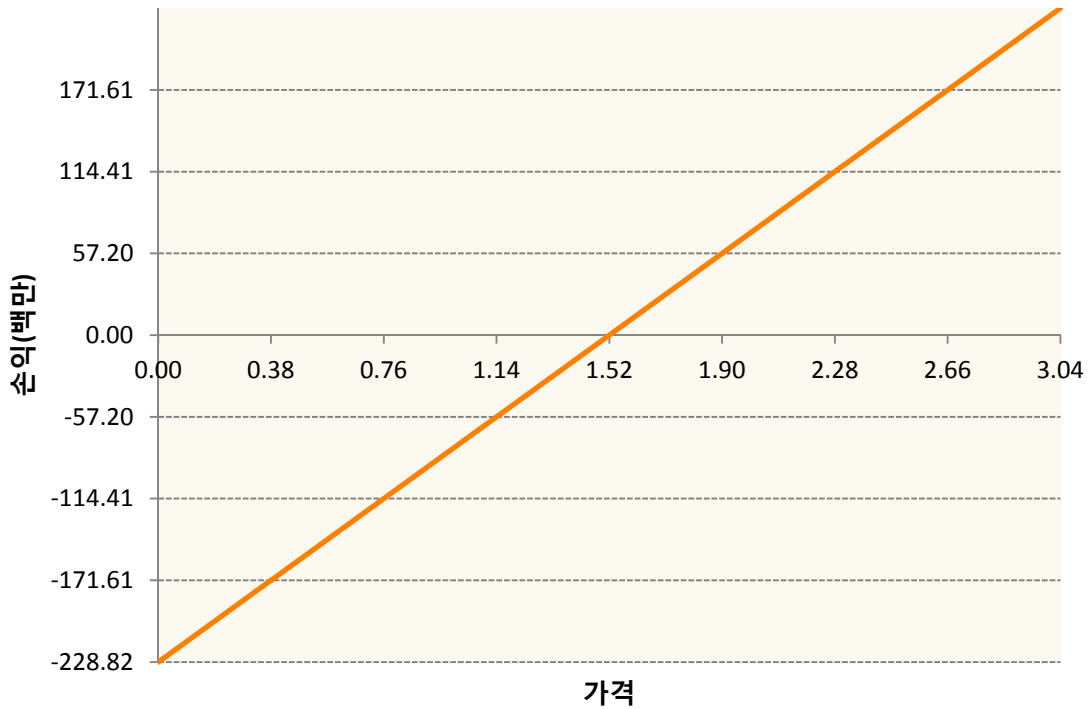
NGH20-NATURAL GAS FUTR Mar20



QSH0-Low Su Gasoil G Mar20



XBH0-GASOLINE RBOB FUT Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	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	18

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

320

공시일	2020-02-11
기준일	2020-02-10

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

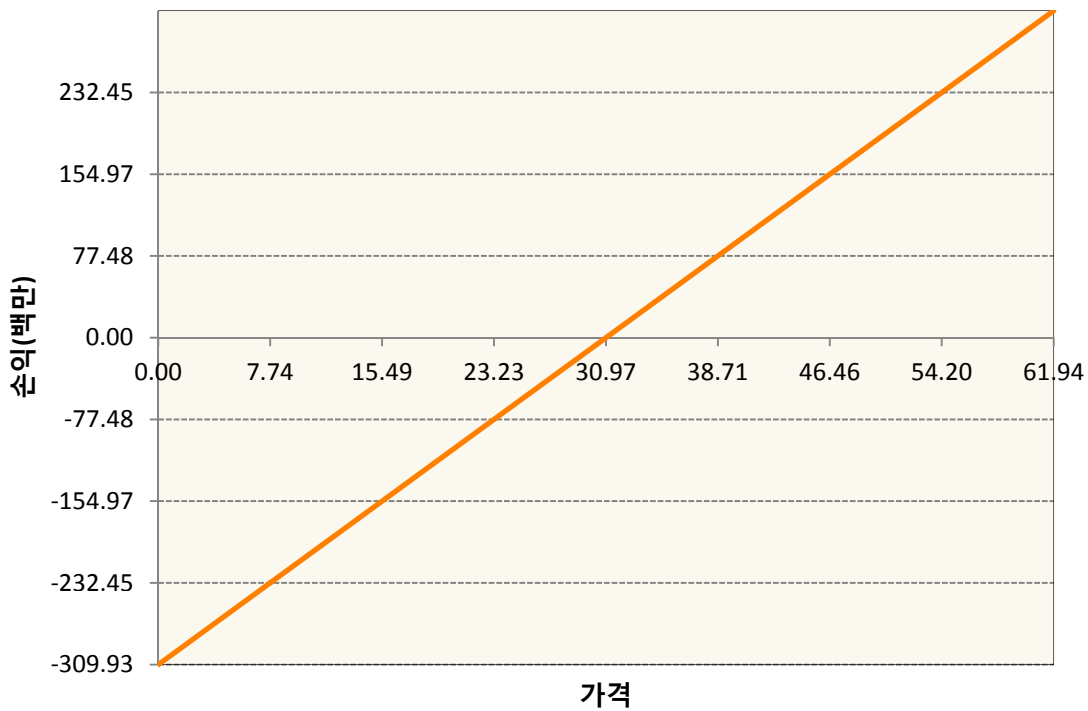
1. 계약금액

(단위:백만원)

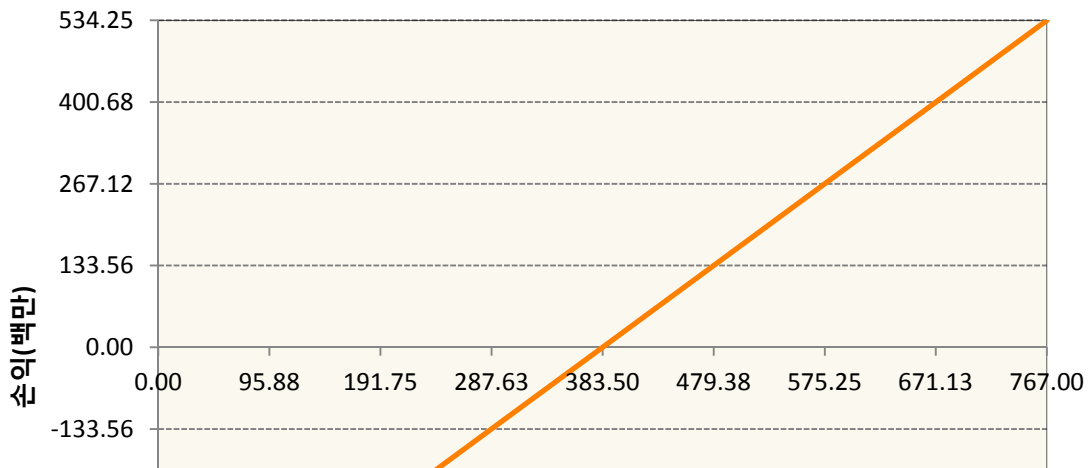
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,737	154	2,583	

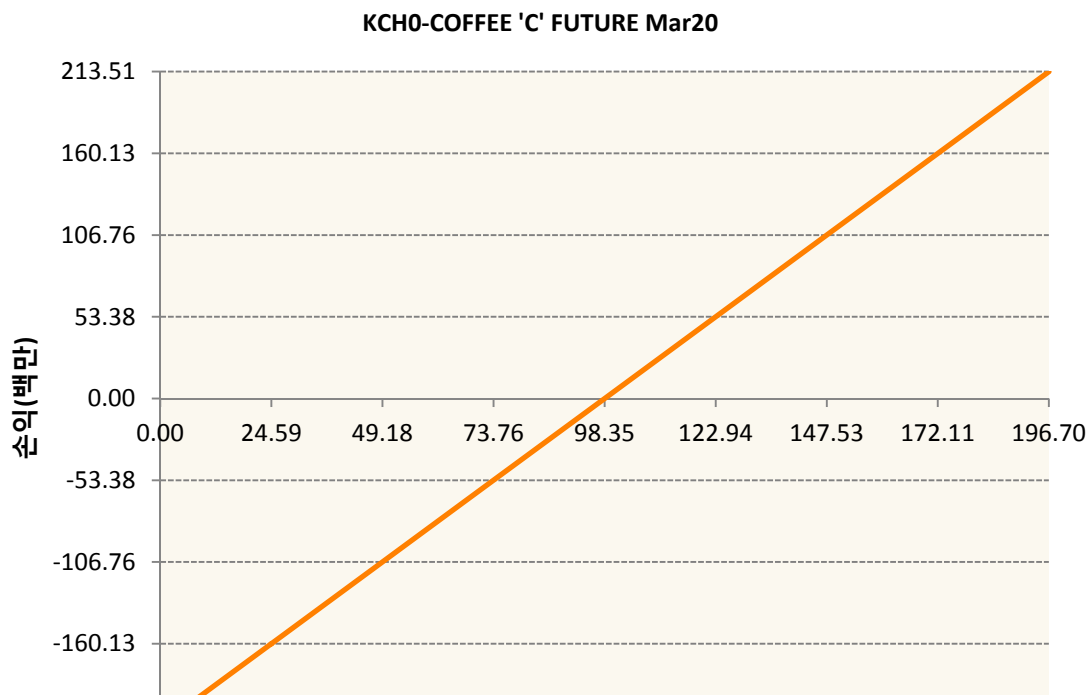
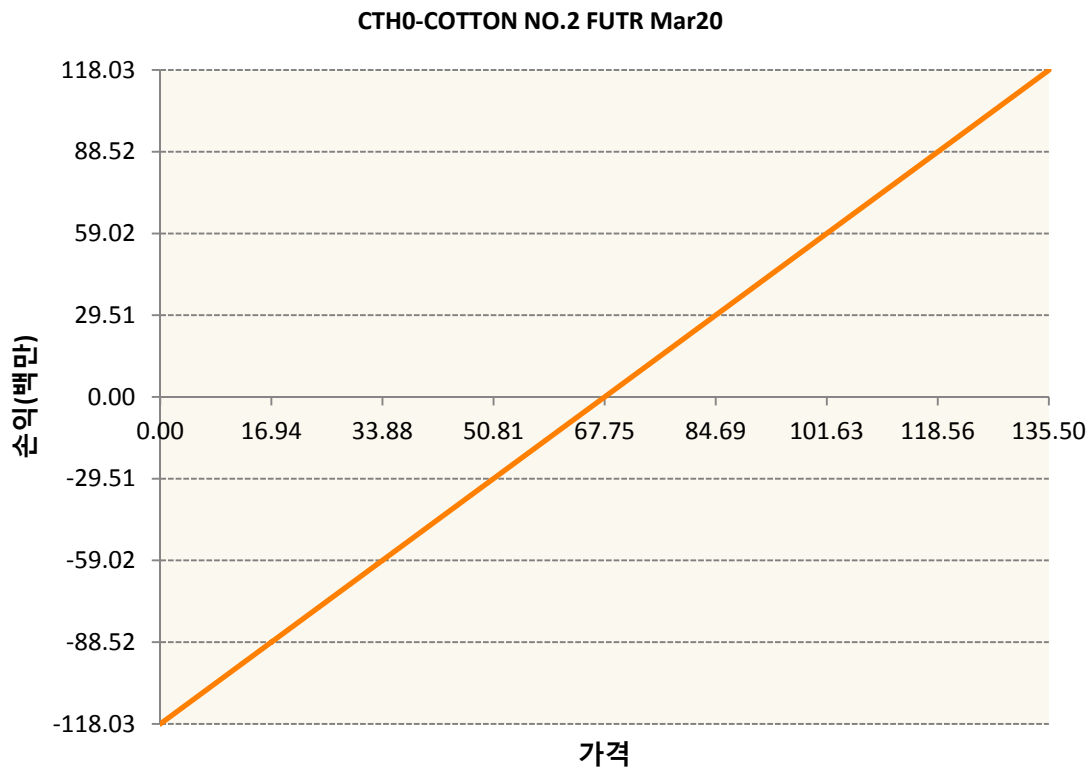
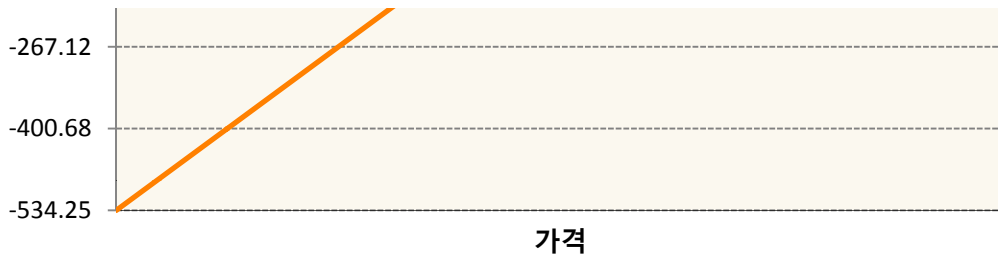
2. 만기시점의 손익구조

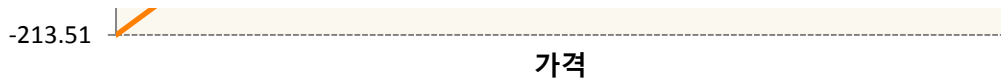
BOH0-SOYBEAN OIL FUTR Mar20



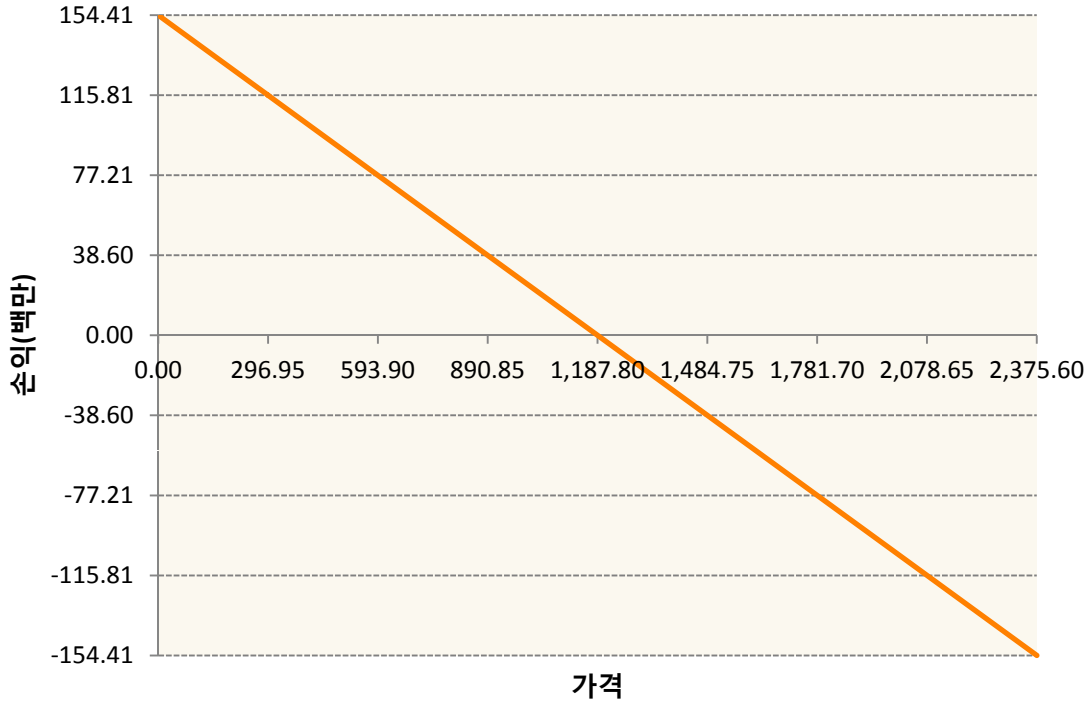
CH0-CORN FUTURE Mar20



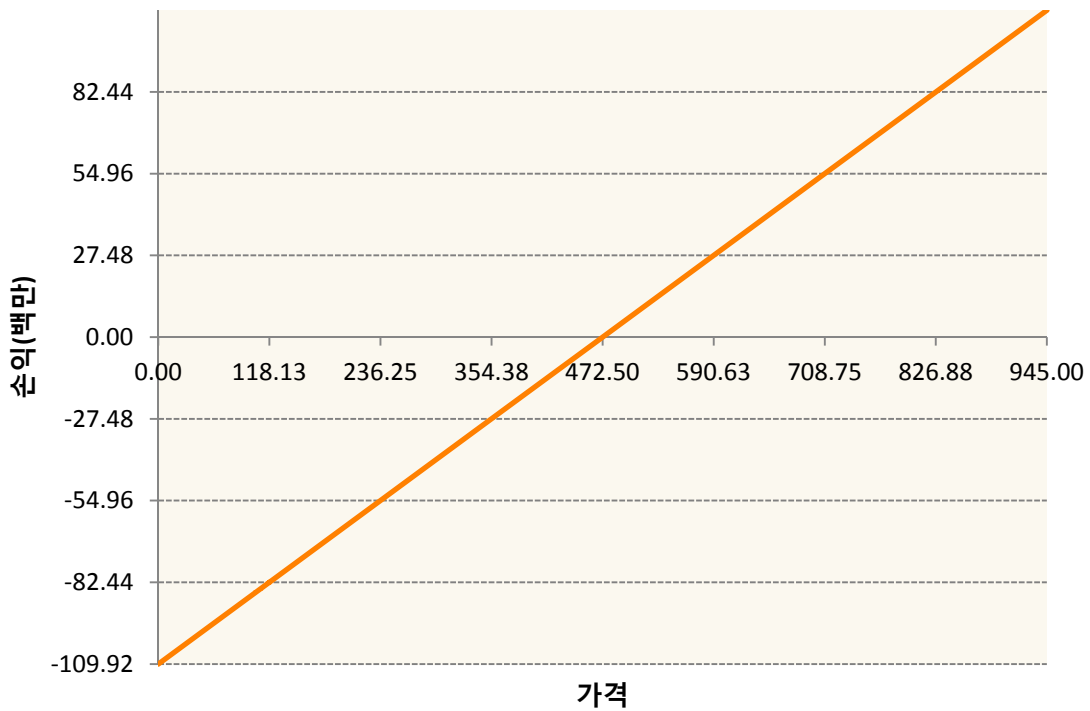




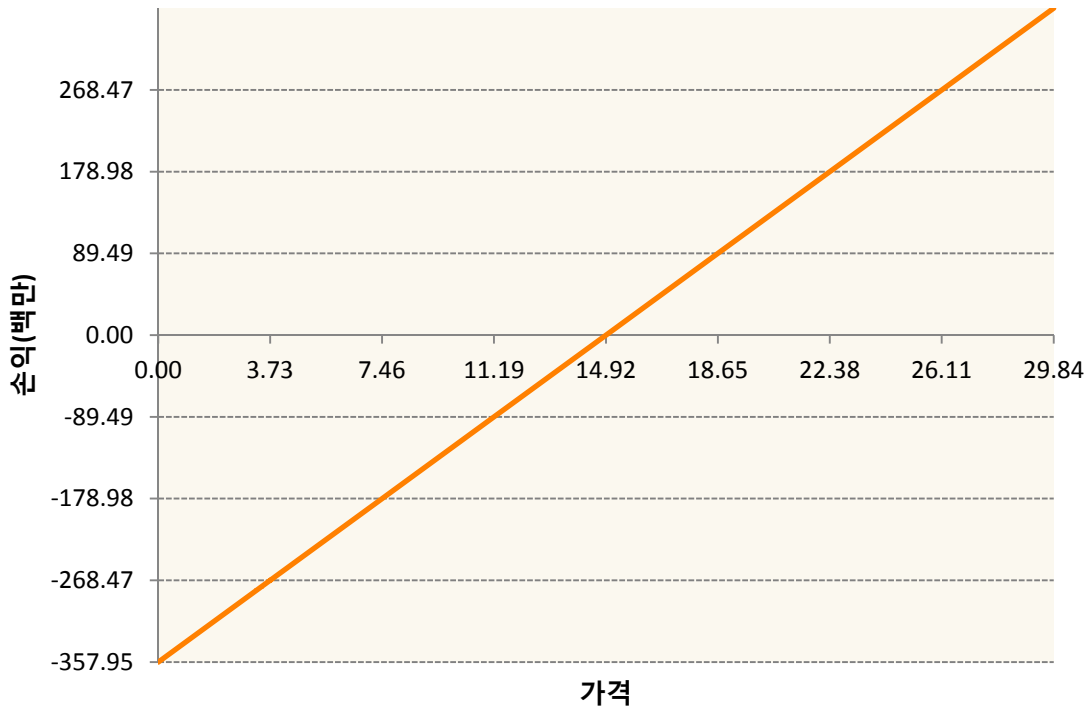
KR4175Q20000-2020-02 달러선물



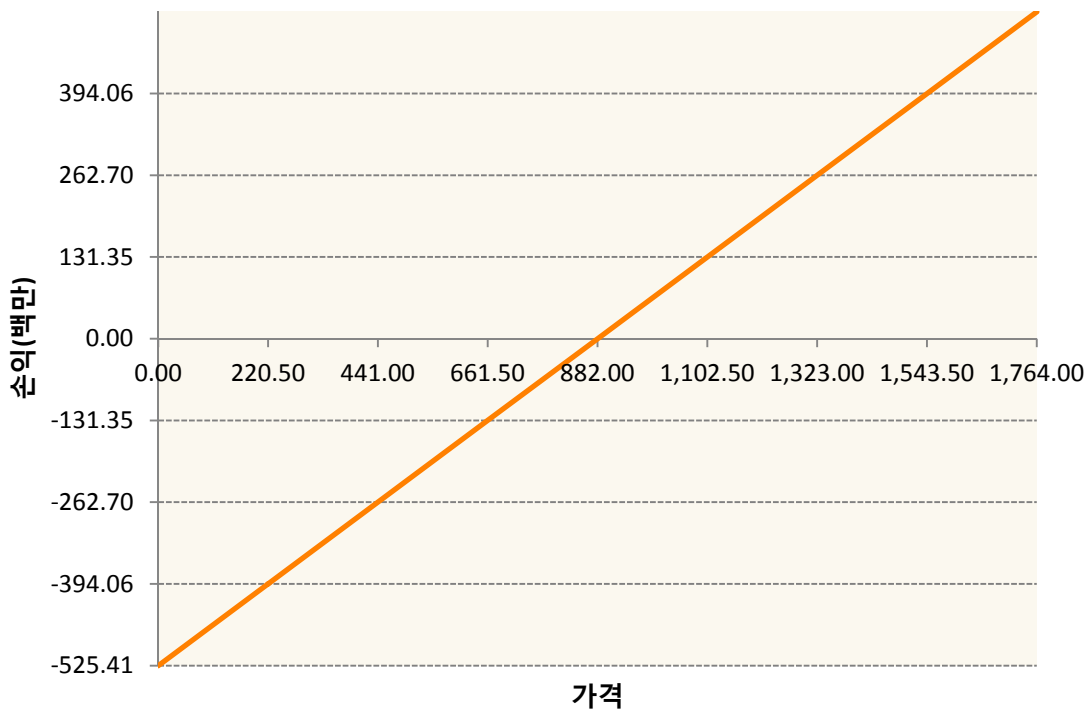
KWH0-KC HRW WHEAT FUT Mar20



SBH0-Sugar Mar20

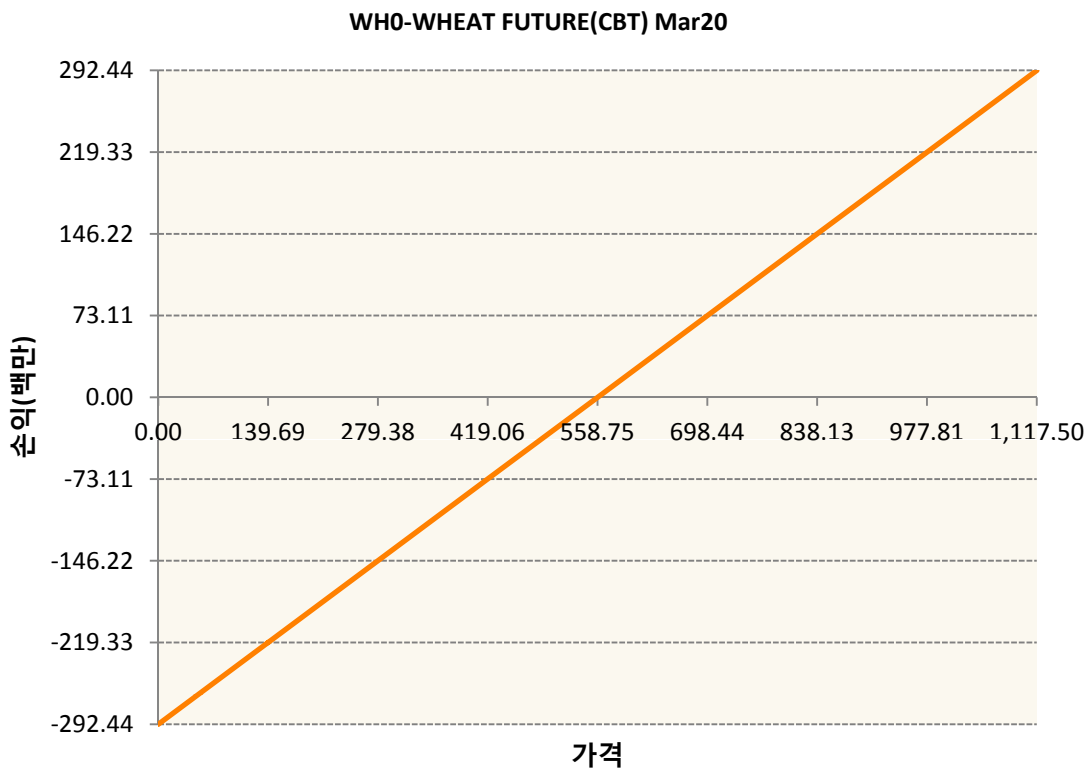
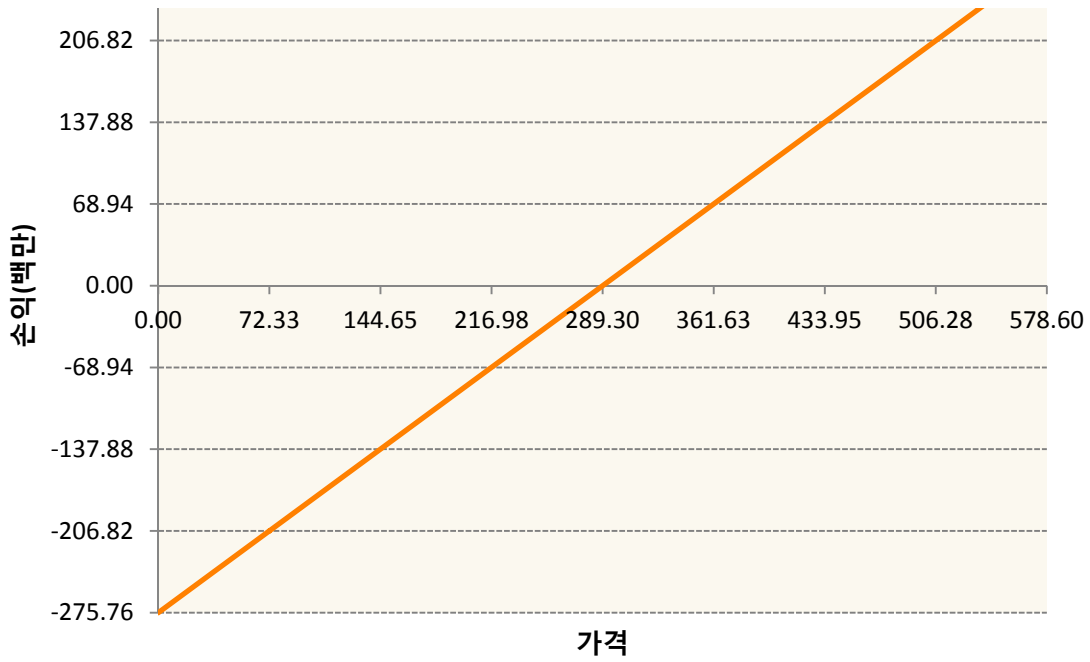


SH0-SOYBEAN FUTURE Mar20



SMH0-SOYBEAN MEAL FUTR Mar20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOH0	SOYBEAN OIL FUTR Mar20	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	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)

237