

공시일	2020-02-12
기준일	2020-02-11

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	2020-02-12
기준일	2020-02-11

스마트인덱스모

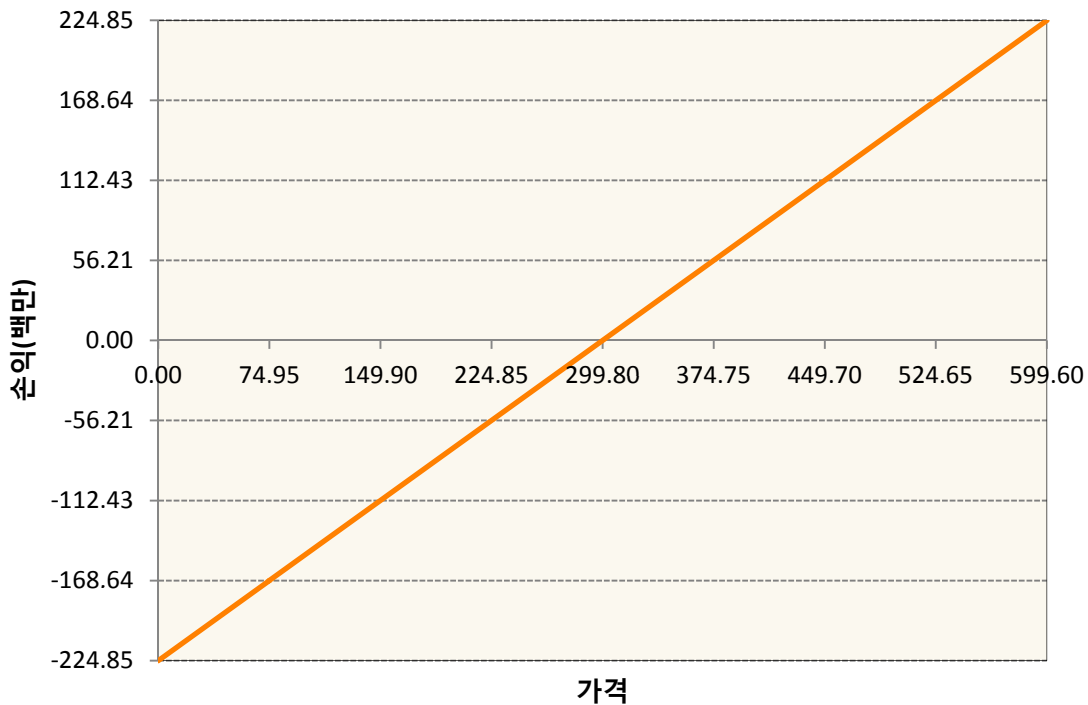
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	225	0	225	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	2020-02-12
기준일	2020-02-11

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

1,156

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

672

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-12
기준일	2020-02-11

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)	415
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	152

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

880

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-12
기준일	2020-02-11

유로인덱스모(주식-파생형)

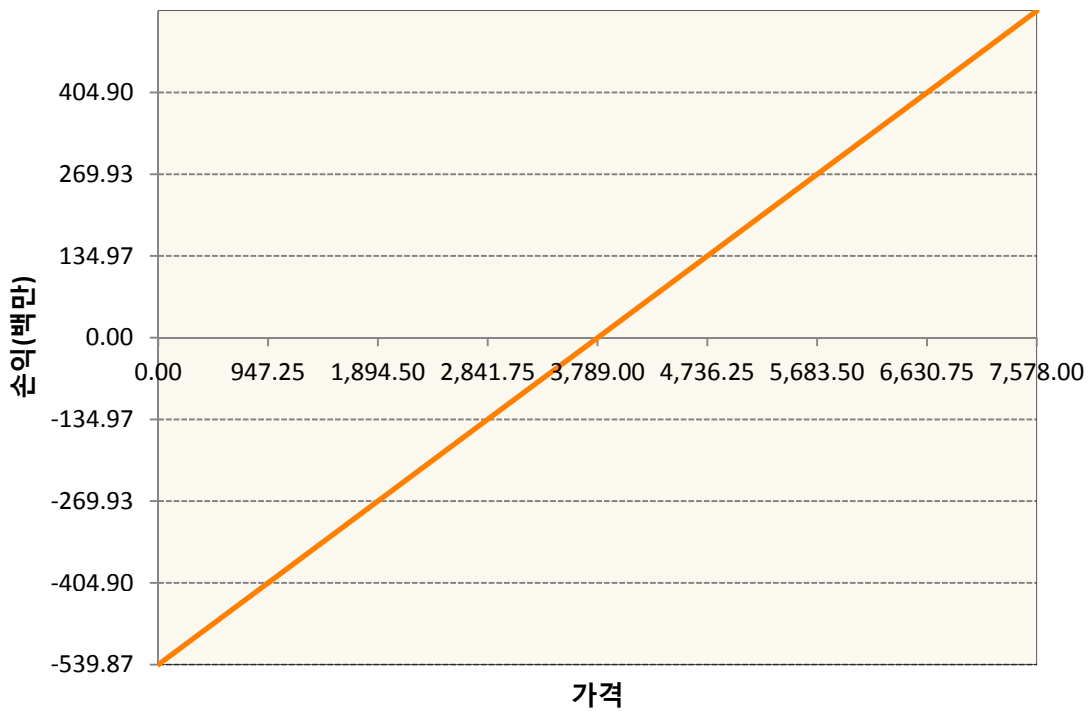
1. 계약금액

(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	2020-02-12
기준일	2020-02-11

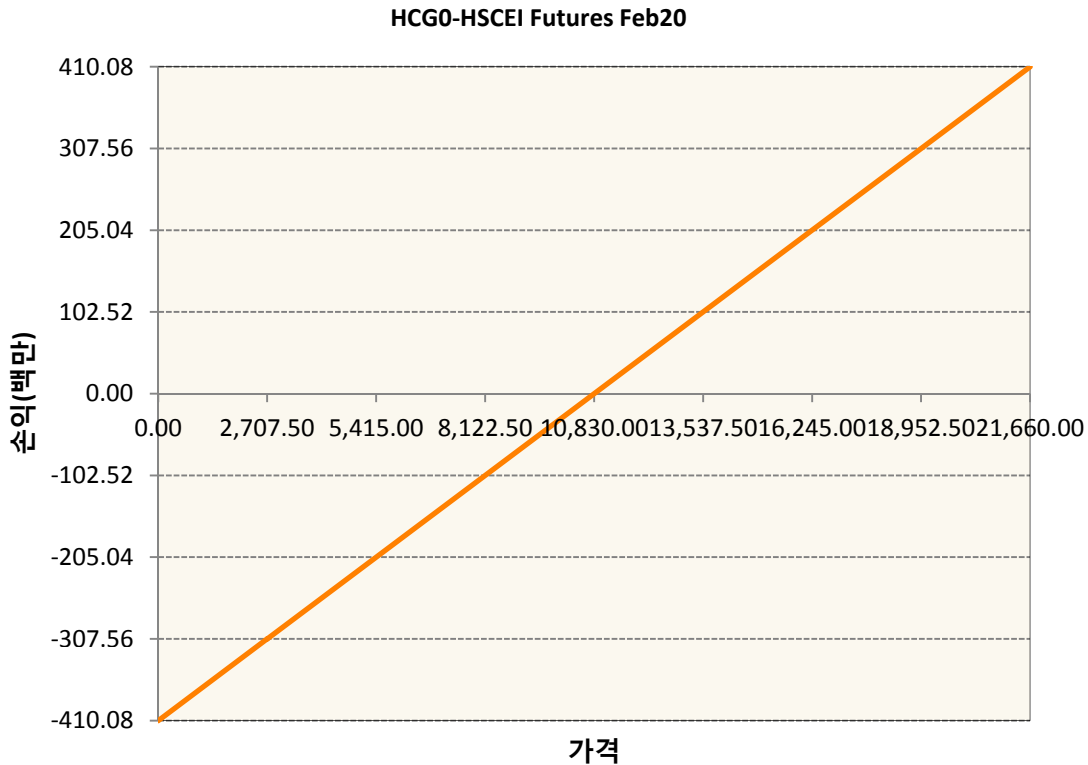
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	410	0	410	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

30

공시일	2020-02-12
기준일	2020-02-11

커버드콜모(주식혼합-파생형)

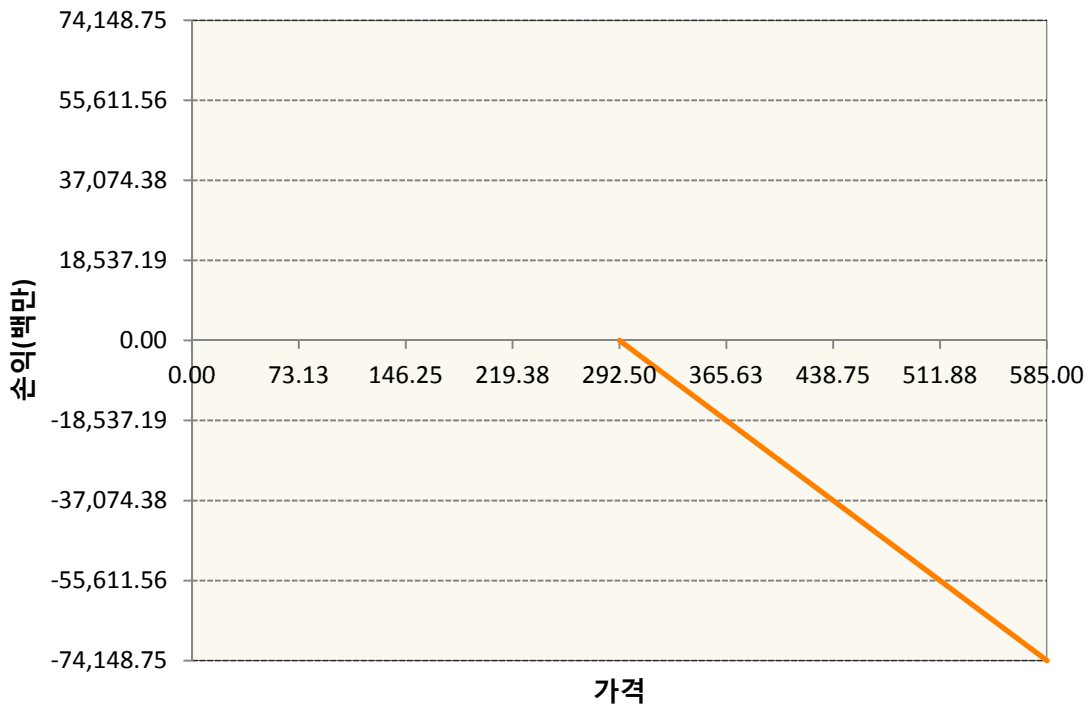
1. 계약금액

(단위:백만원)

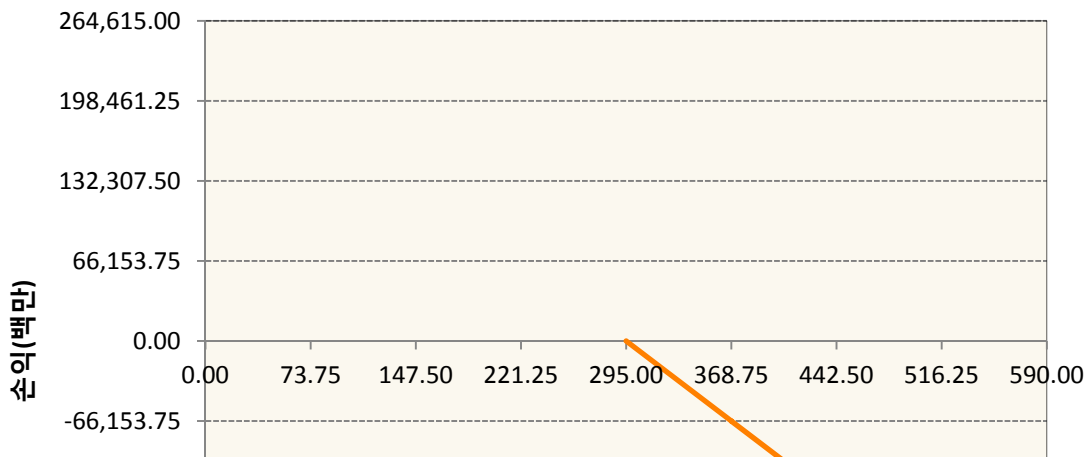
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	455,004	-455,004	장내

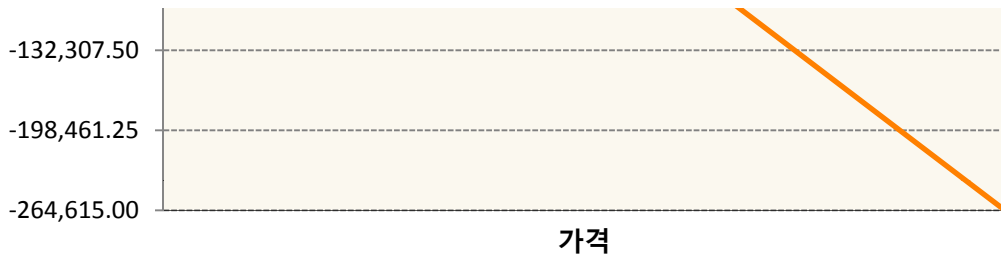
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q22927-2020-02 콜292.5

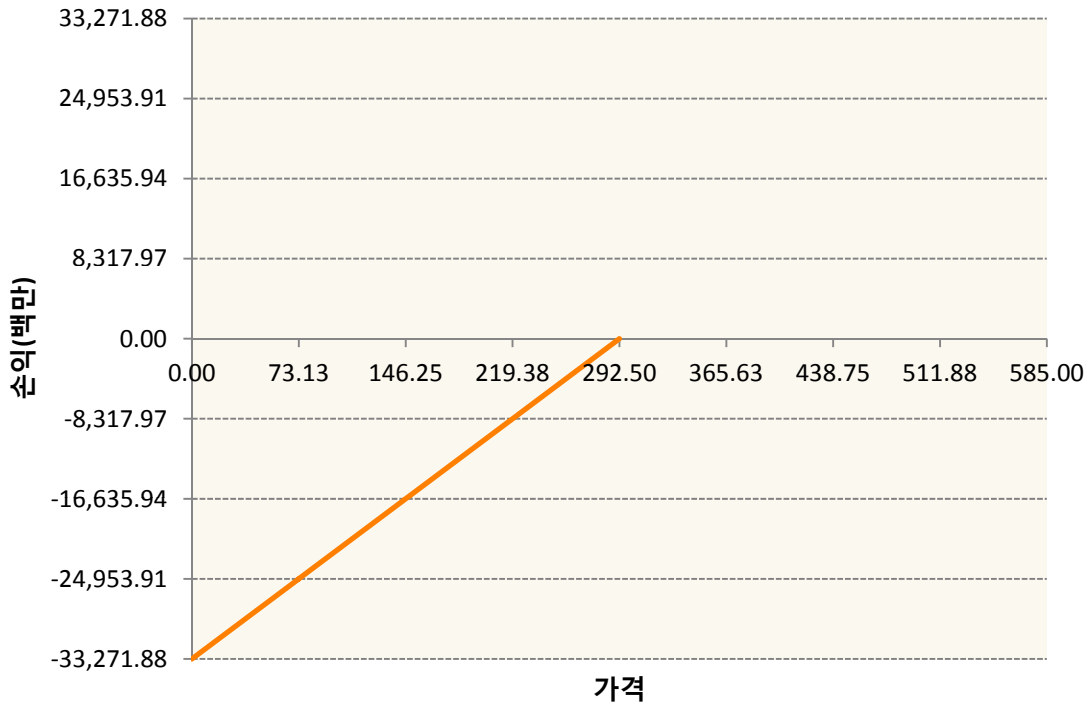


KR4201Q22950-2020-02 콜295

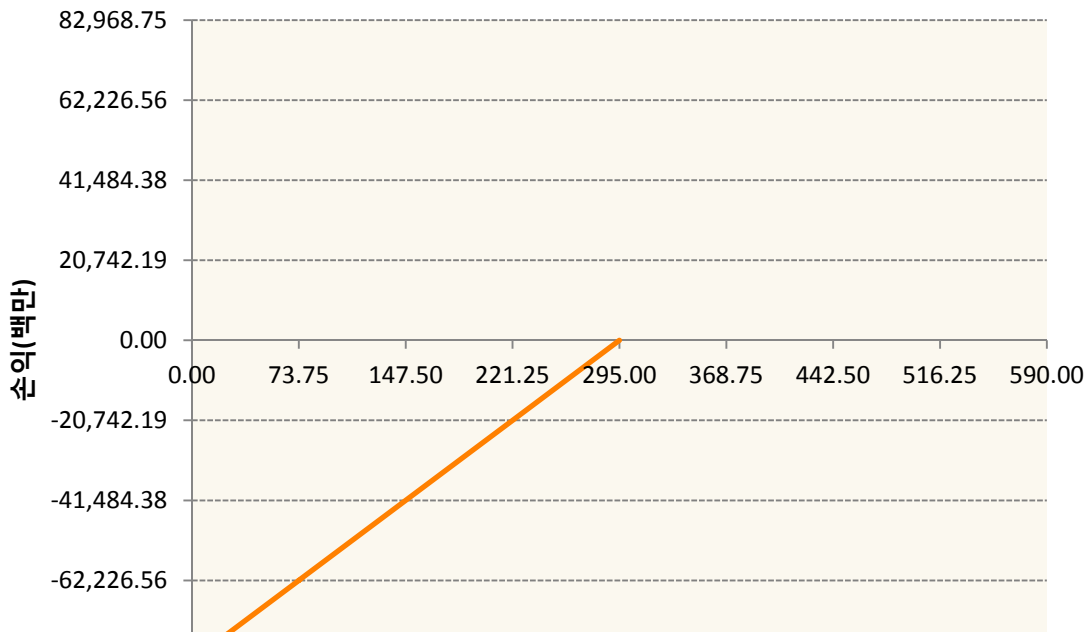




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



KR4301Q22958-2020-02 풋295



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q22927		2020-02 콜292.5						5,928
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,857	1,857	1,857	1,856	1,853	1,850	1,845	
-5.33%	1,843	1,831	1,816	1,797	1,774	1,749	1,721	
-2.67%	1,492	1,437	1,382	1,327	1,272	1,216	1,161	
0%	88	62	33	0	-36	-74	-114	
2.67%	-1,882	-1,884	-1,886	-1,891	-1,898	-1,907	-1,919	
5.33%	-3,904	-3,904	-3,905	-3,905	-3,905	-3,906	-3,907	
8.00%	-5,927	-5,927	-5,927	-5,927	-5,927	-5,927	-5,928	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						20,501
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4,805	4,805	4,804	4,803	4,800	4,795	4,786	
-5.33%	4,792	4,776	4,750	4,715	4,669	4,612	4,545	
-2.67%	4,205	4,050	3,887	3,718	3,546	3,369	3,190	
0%	465	318	163	0	-168	-341	-517	
2.67%	-6,197	-6,213	-6,238	-6,274	-6,322	-6,380	-6,448	
5.33%	-13,341	-13,342	-13,342	-13,344	-13,349	-13,356	-13,368	
8.00%	-20,499	-20,499	-20,499	-20,499	-20,499	-20,500	-20,501	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						1,945
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,945	-1,945	-1,945	-1,945	-1,945	-1,945	-1,945	
-5.33%	-1,038	-1,038	-1,038	-1,039	-1,040	-1,041	-1,043	
-2.67%	-204	-218	-232	-246	-260	-274	-288	
0%	7	5	3	0	-4	-8	-14	
2.67%	8	8	8	8	8	8	7	
5.33%	8	8	8	8	8	8	8	
8.00%	8	8	8	8	8	8	8	
KR4301Q22958		2020-02 풋295						5,453
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-5,453	-5,453	-5,453	-5,453	-5,453	-5,453	-5,453	
-5.33%	-3,209	-3,209	-3,209	-3,209	-3,210	-3,211	-3,212	
-2.67%	-1,004	-1,022	-1,042	-1,064	-1,088	-1,114	-1,140	
0%	51	37	20	0	-22	-45	-69	
2.67%	79	79	79	79	78	77	76	

5.33%	79	79	79	79	79	79	79
8.00%	79	79	79	79	79	79	79

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

(단위:백만원)

41,173

공시일	2020-02-12
기준일	2020-02-11

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

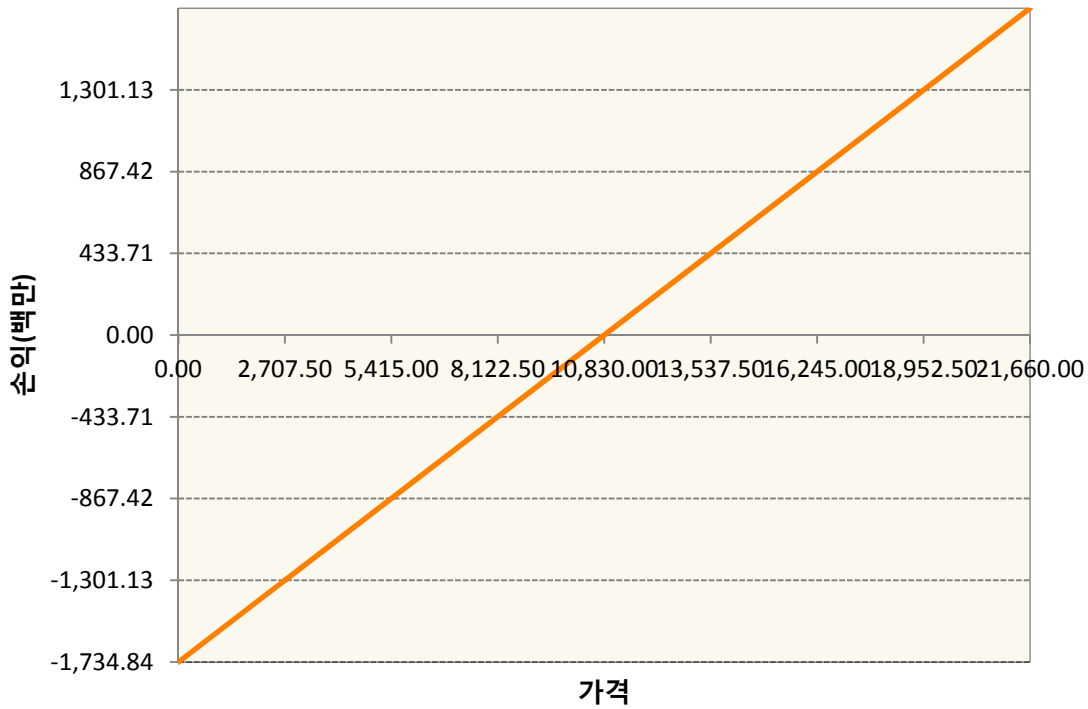
1. 계약금액

(단위:백만원)

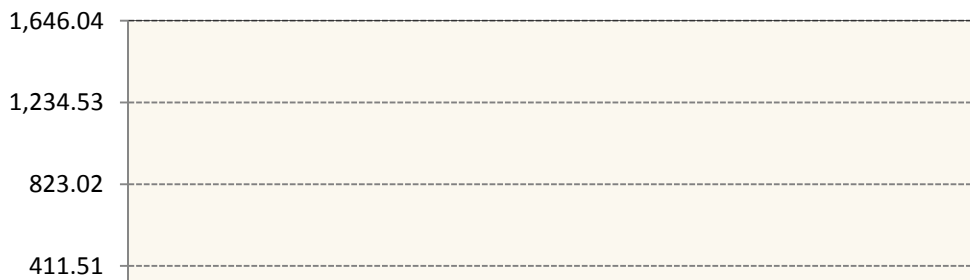
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,735	0	1,735	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,480	-4,480	장내
누계	통화	선도	0	2,143	-2,143	장외

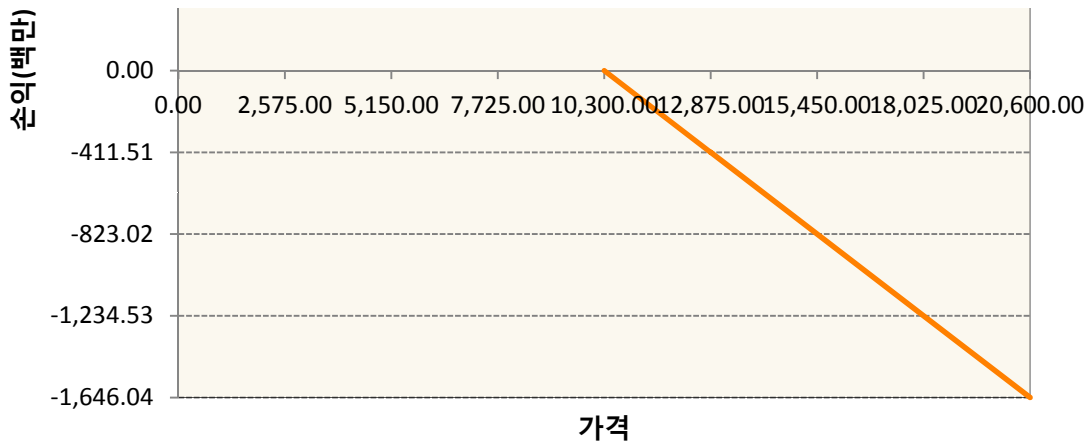
2. 만기시점의 손익구조

HCG0-HSCEI Futures Feb20

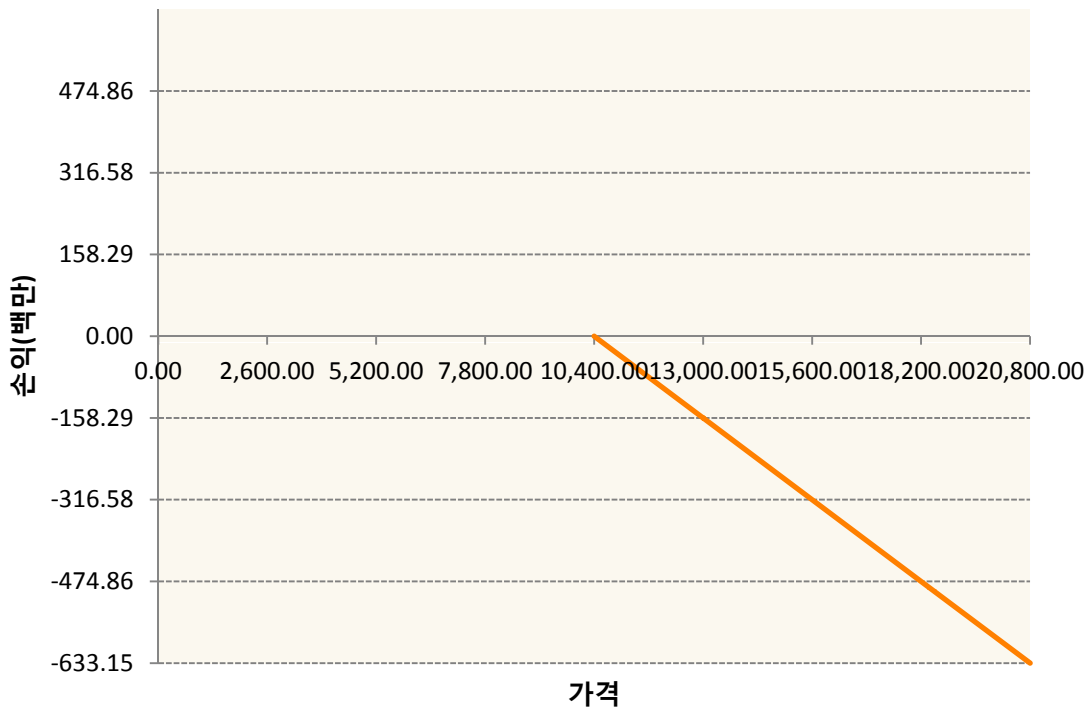


OHHIG0-C103-HSCEI

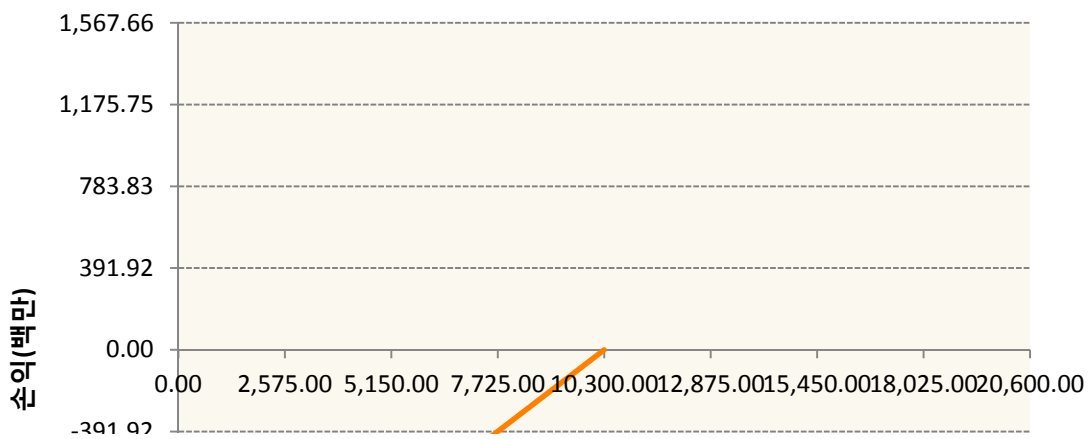


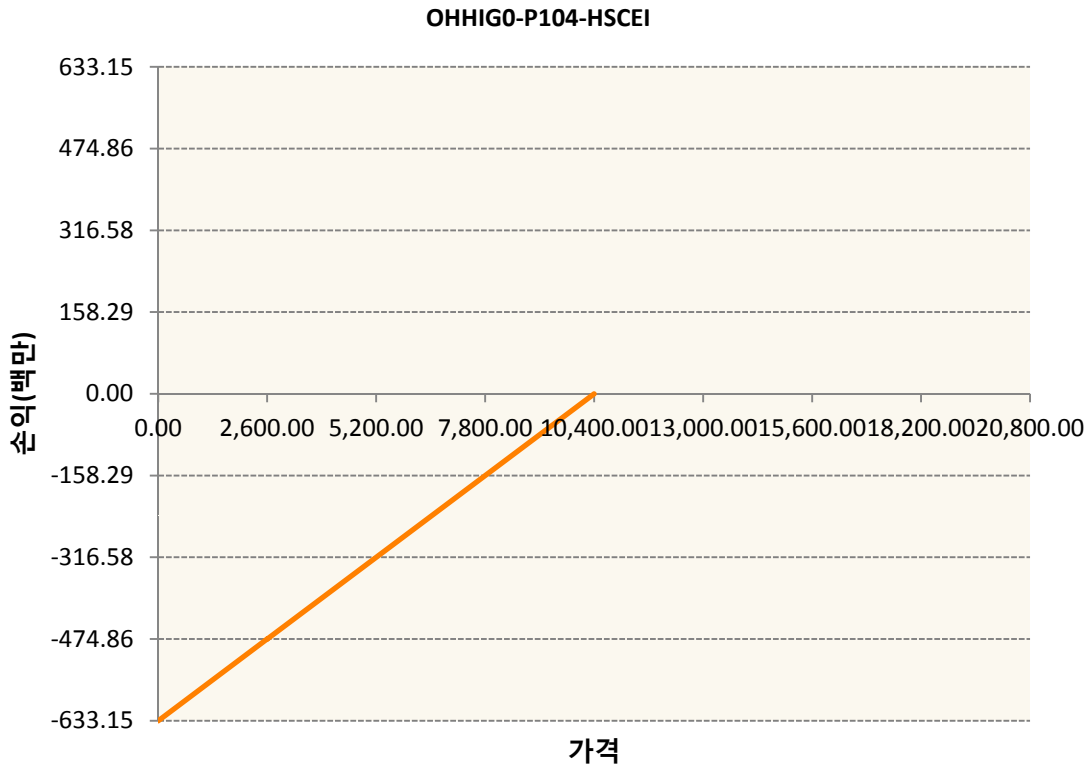


OHHIG0-C104-HSCEI



OHHIG0-P103-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	171
HCG0 HSCEI Futures Feb20	139
OHHIG0-C1(HSCEI	132
OHHIG0-C1(HSCEI	51
OHHIG0-P1(HSCEI	125
OHHIG0-P1(HSCEI	51

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

공시일	2020-02-12
기준일	2020-02-11

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

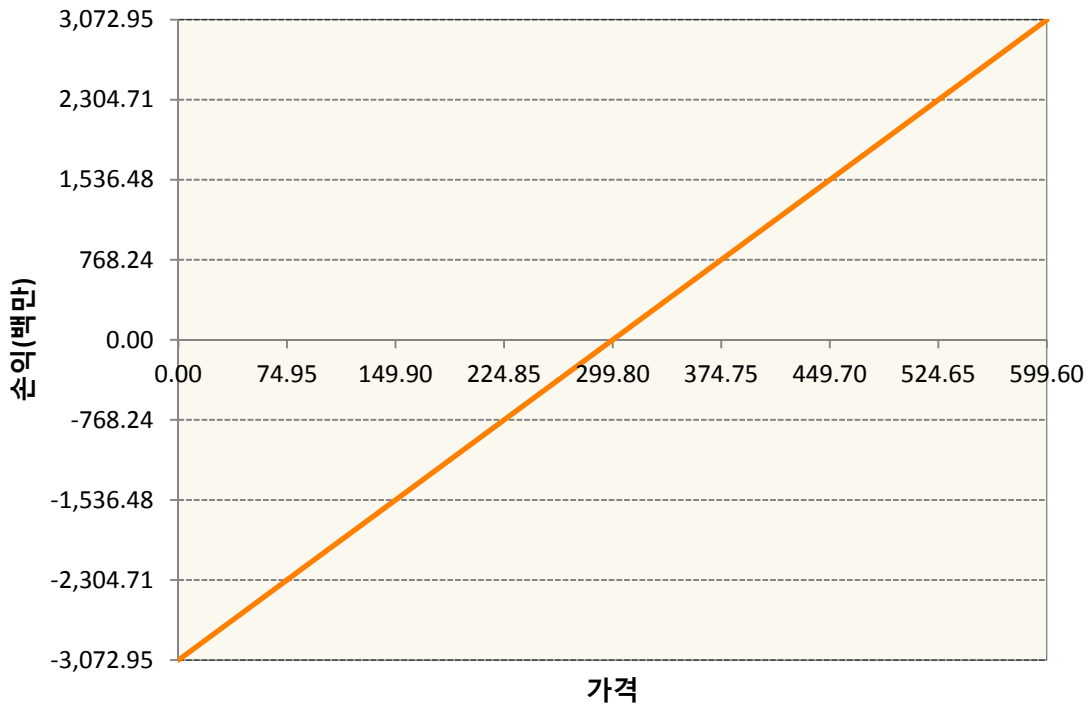
1. 계약금액

(단위:백만원)

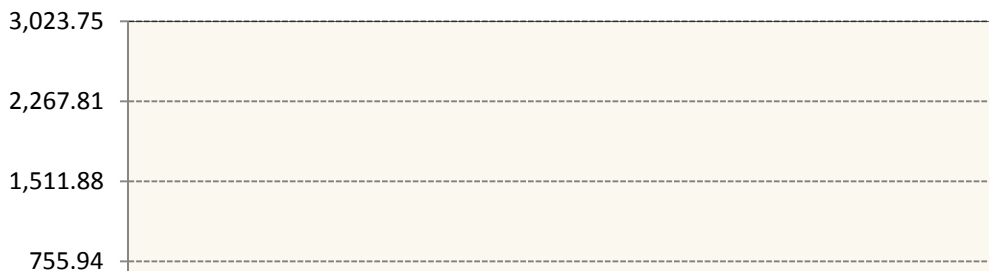
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,073	0	3,073	장내
누계	유가증권	스왑	3,625	0	3,625	장외
누계	유가증권	옵션	0	5,962	-5,962	장내

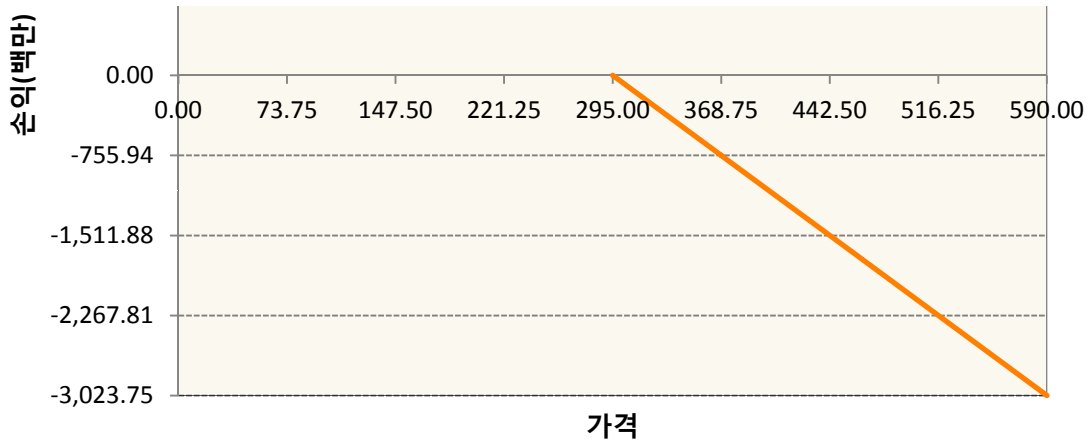
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

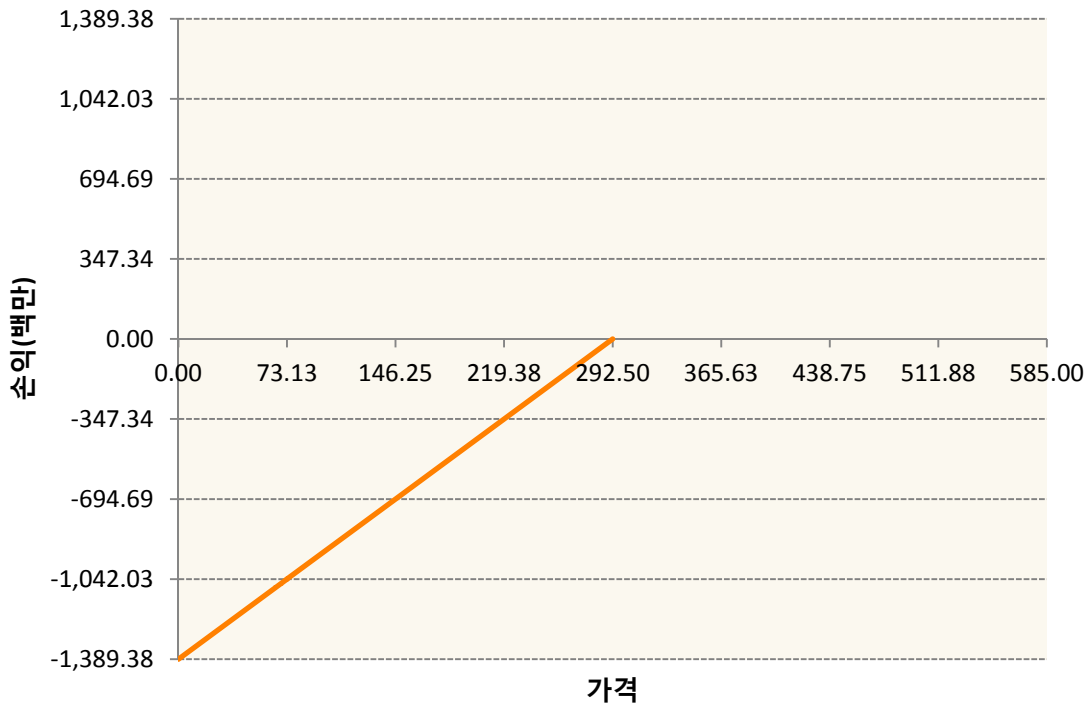


KR4201Q22950-2020-02 콜295

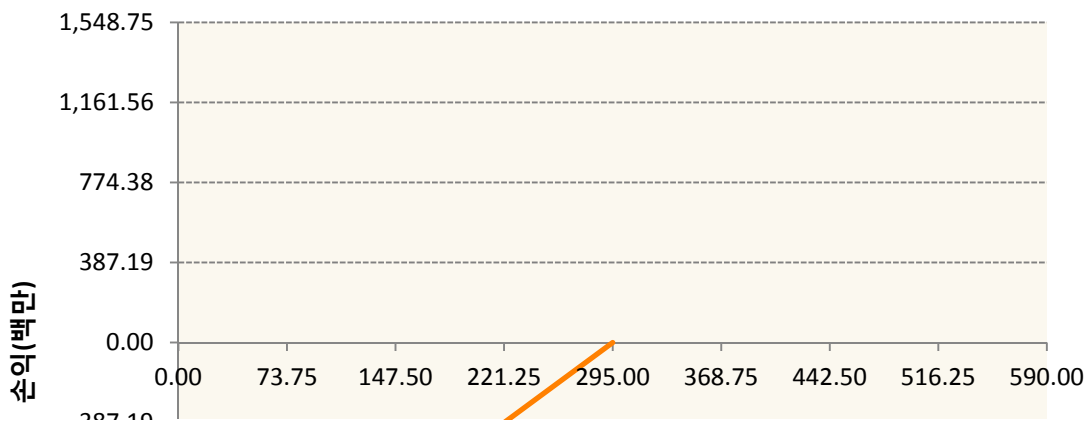




KR4301Q22925-2020-02 풋292.5



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						245
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-245	-245	-245	-245	-245	-245	-245	
-5.33%	-164	-164	-164	-164	-164	-164	-164	
-2.67%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	82	82	82	82	82	82	82	
5.33%	164	164	164	164	164	164	164	
8.00%	245	245	245	245	245	245	245	
KR4201Q22950		2020-02 콜295						234
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	55	55	55	55	55	55	55	
-5.33%	55	55	54	54	53	53	52	
-2.67%	48	46	44	42	41	39	36	
0%	5	4	2	0	-2	-4	-6	
2.67%	-71	-71	-71	-72	-72	-73	-74	
5.33%	-152	-152	-152	-152	-153	-153	-153	
8.00%	-234	-234	-234	-234	-234	-234	-234	
KR4301Q22925		2020-02 풋292.5						81
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
-5.33%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-44
-2.67%	-9	-9	-10	-10	-11	-11	-12
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
KR4301Q22958 2020-02 풋295							102
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-102	-102	-102	-102	-102	-102	-102
-5.33%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
-2.67%	-19	-19	-19	-20	-20	-21	-21
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

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

(단위:백만원)

994

공시일	2020-02-12
기준일	2020-02-11

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

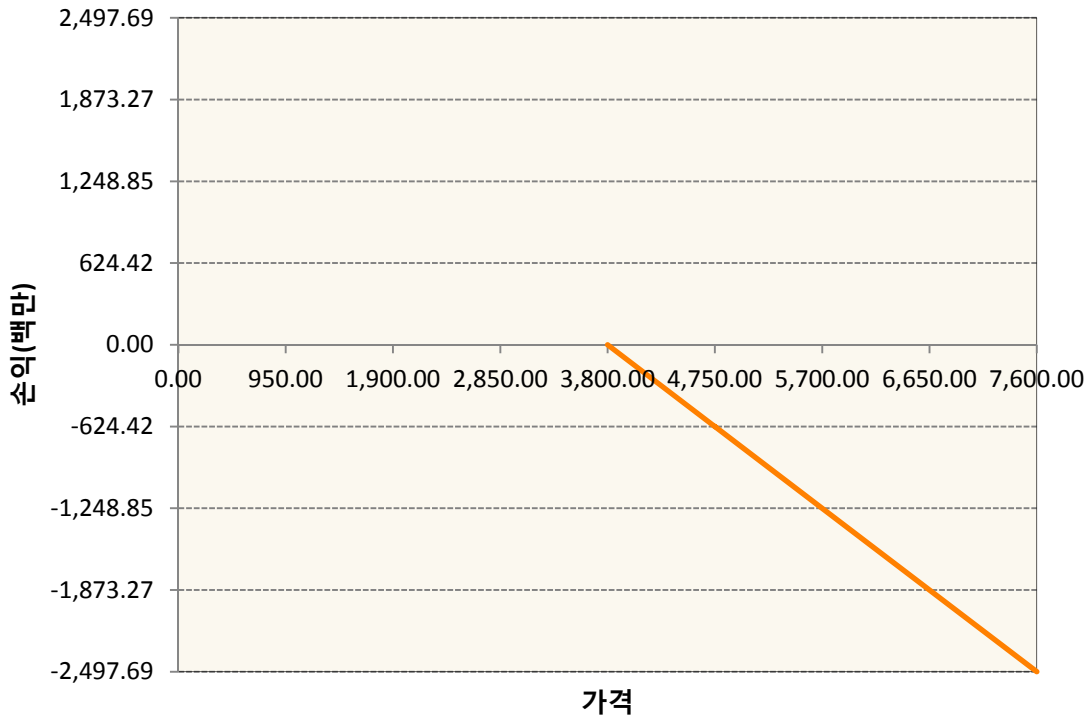
1. 계약금액

(단위:백만원)

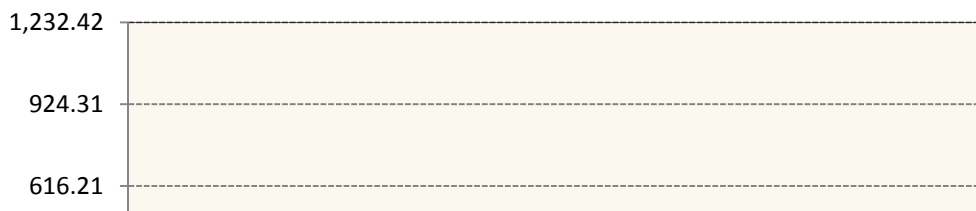
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	637	0	637	
누계	유가증권	스왑	13,468	0	13,468	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,510	-7,510	장내
누계	통화	선도	0	3,382	-3,382	장외

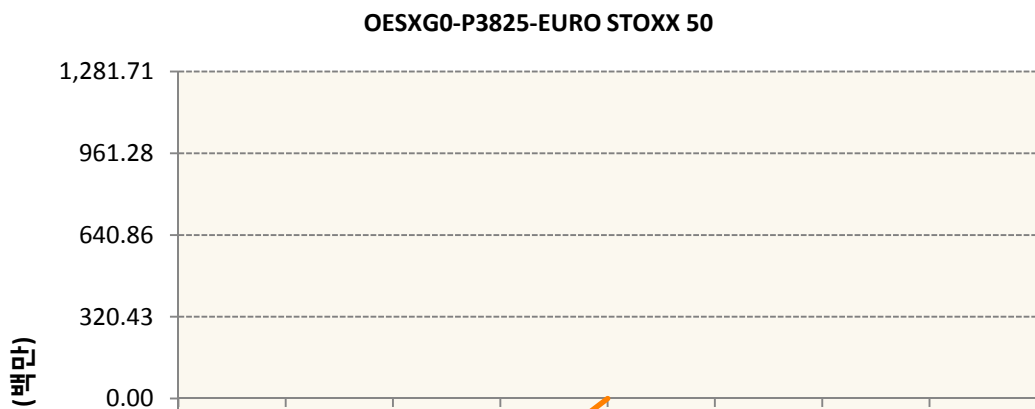
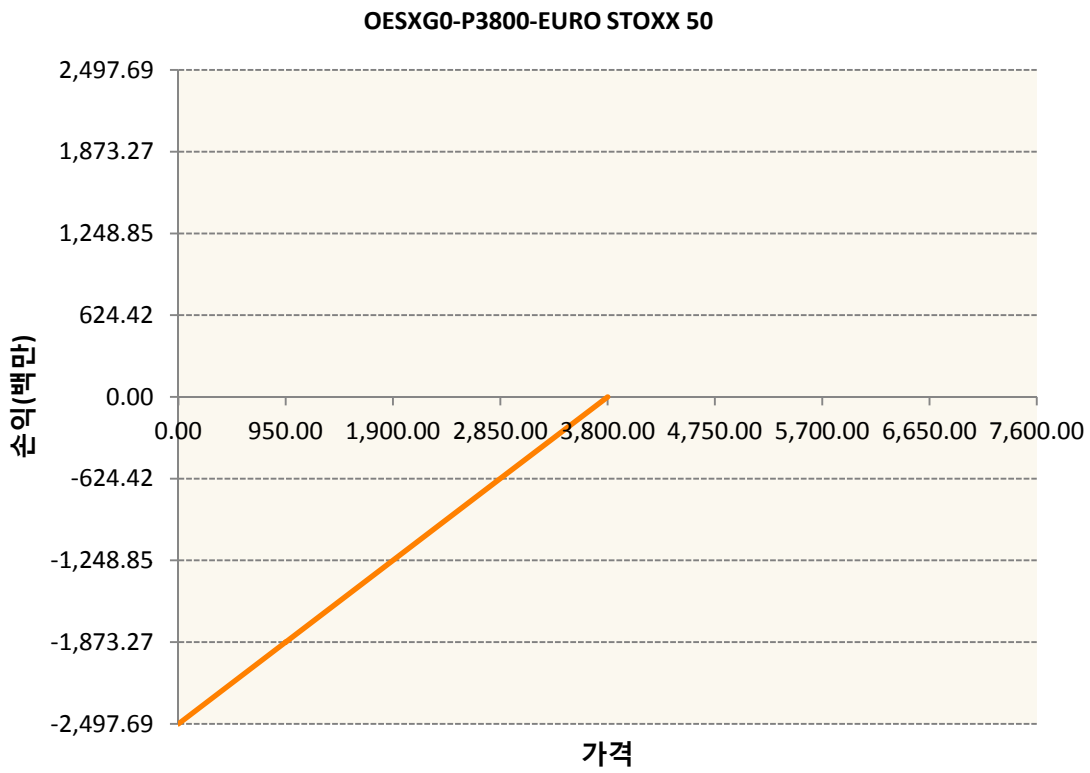
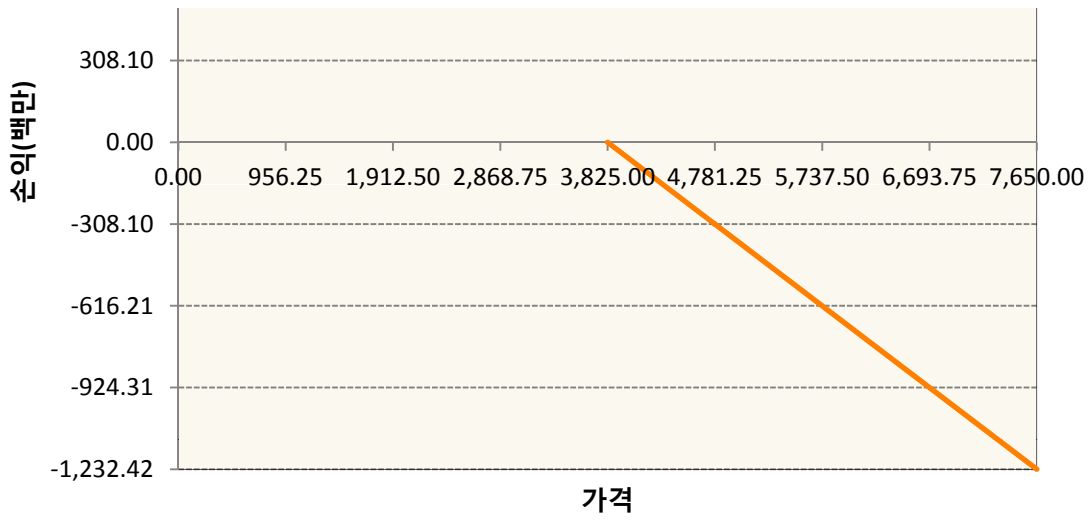
2. 만기시점의 손익구조

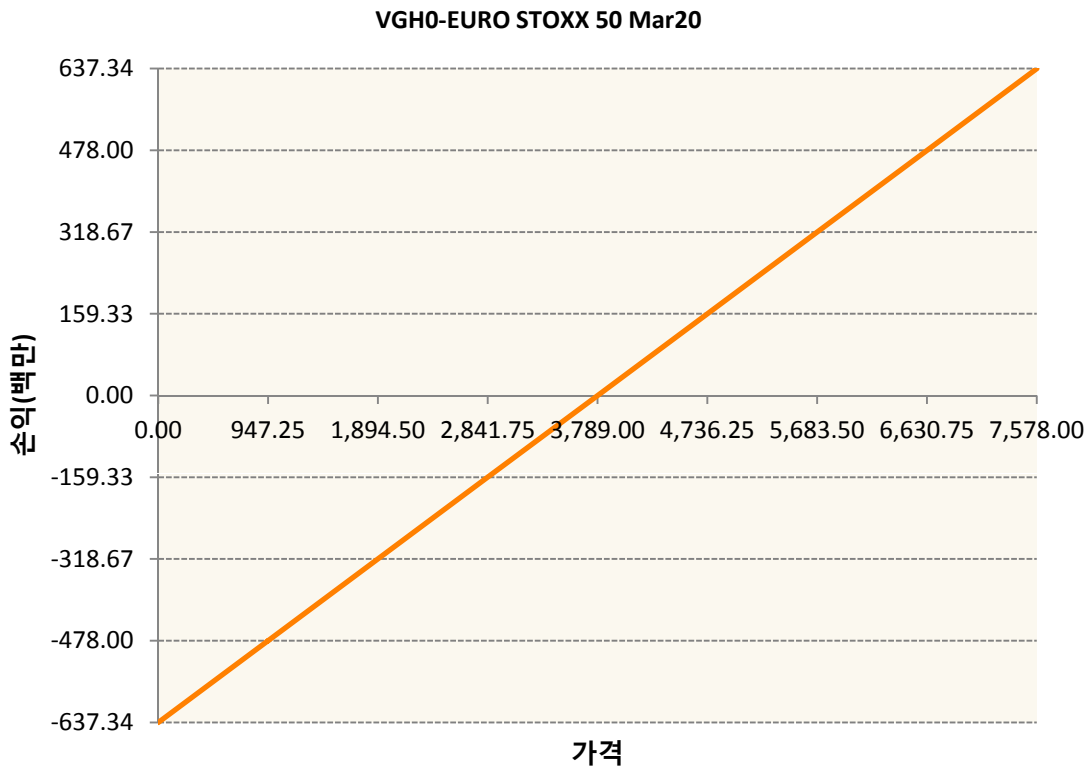
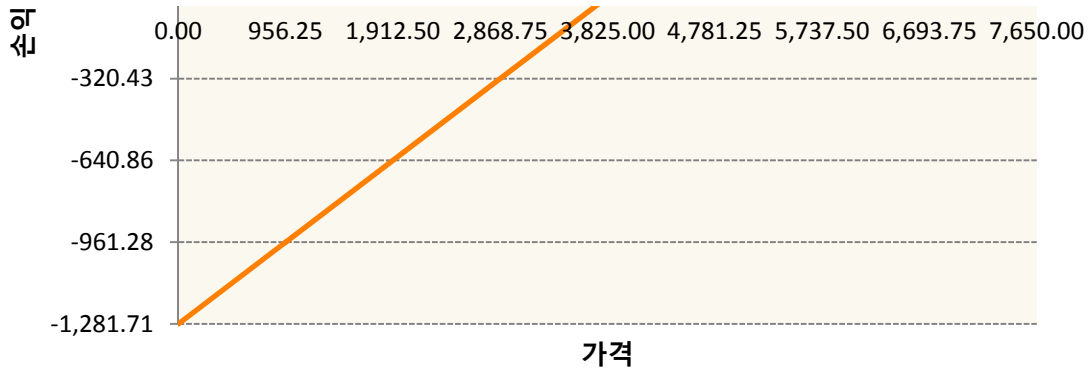
OESXG0-C3800-EURO STOXX 50



OESXG0-C3825-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	3
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	271
OESXG0-C3& EURO STOXX 50	200
OESXG0-C3& EURO STOXX 50	99
OESXG0-P3& EURO STOXX 50	200
OESXG0-P3& EURO STOXX 50	103
VGH0 EURO STOXX 50 Mar20	51

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

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

(단위:백만원)

45

공시일	2020-02-12
기준일	2020-02-11

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

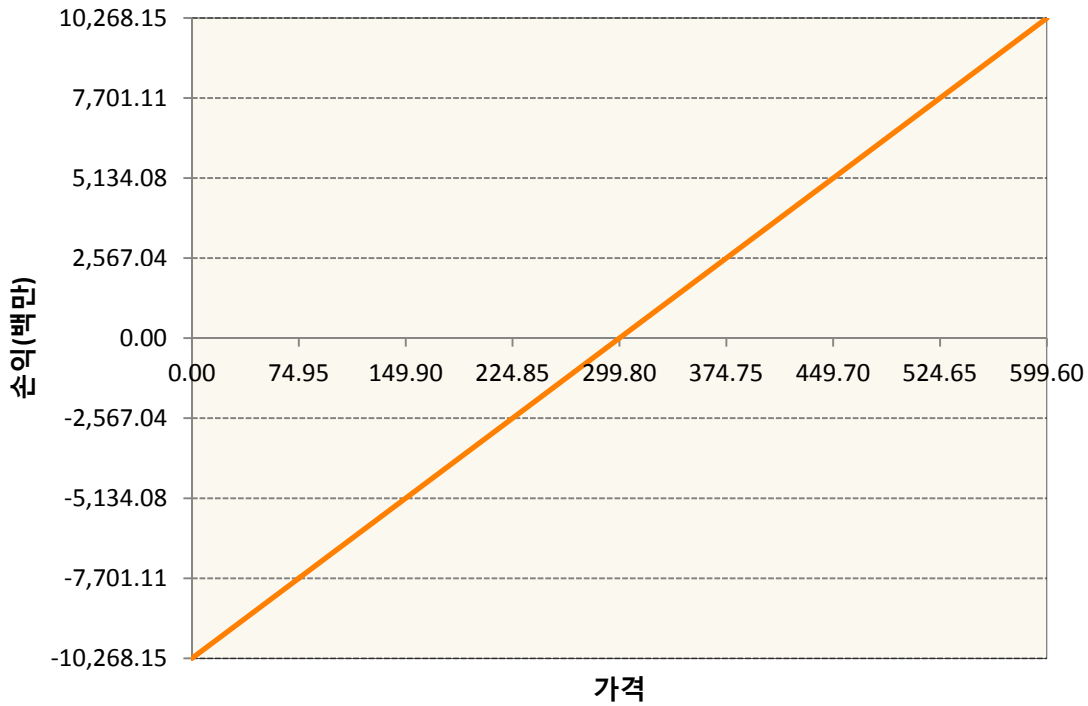
1. 계약금액

(단위:백만원)

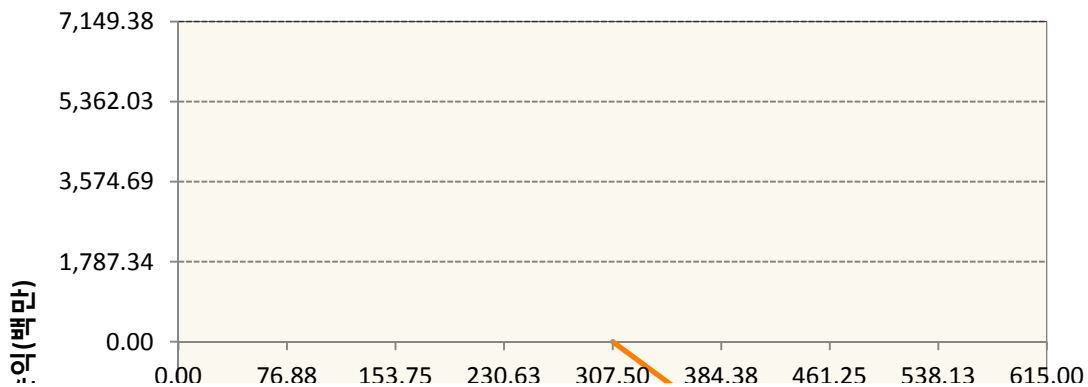
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,268	0	10,268	장내
누계	유가증권	옵션	2,944	20,557	-17,613	장내

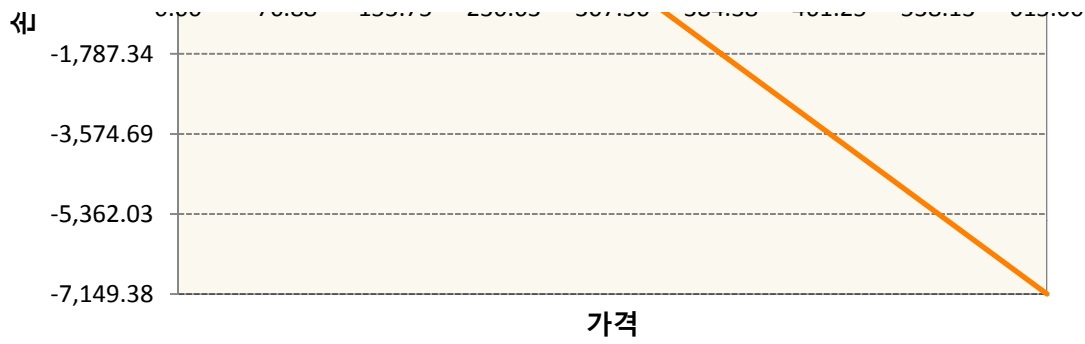
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

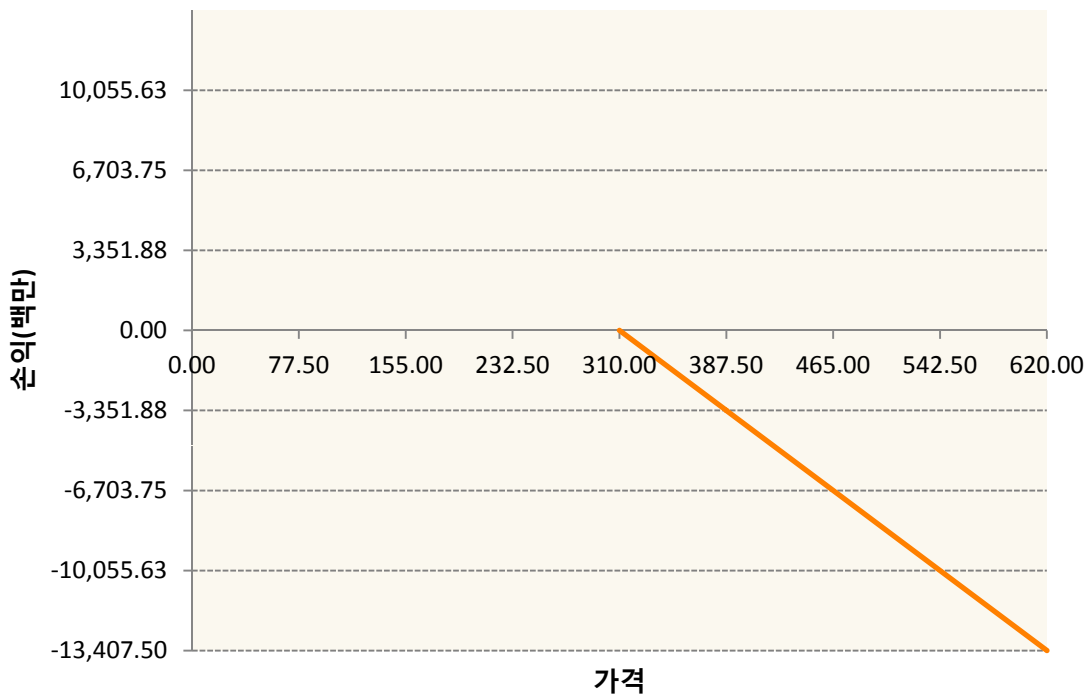


KR4201Q23073-2020-02 콜307.5

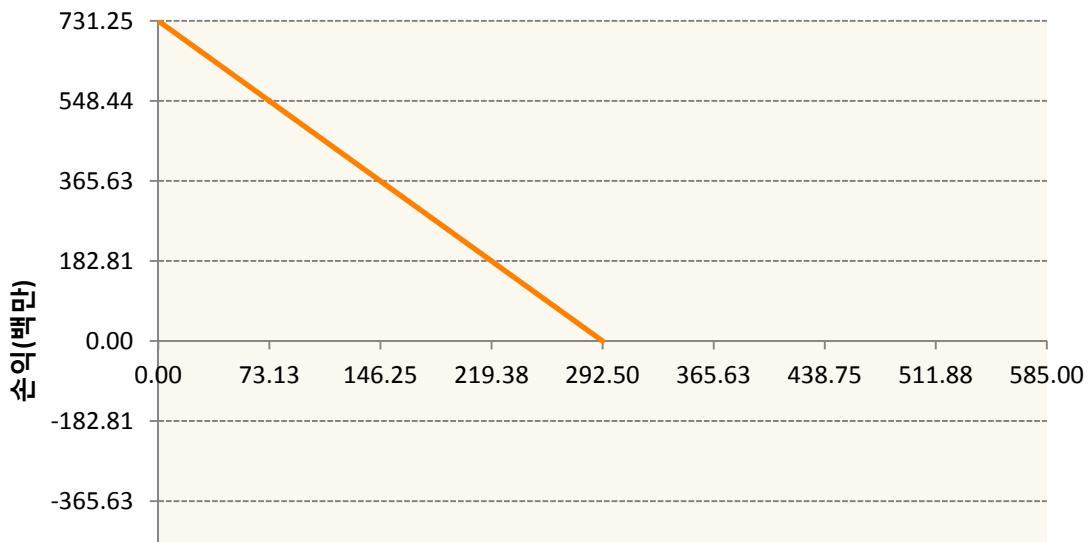


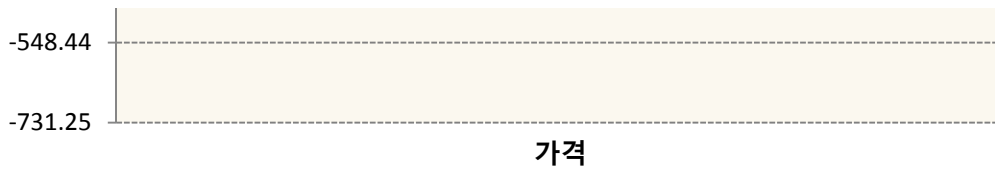


KR4201Q23107-2020-02 콜310

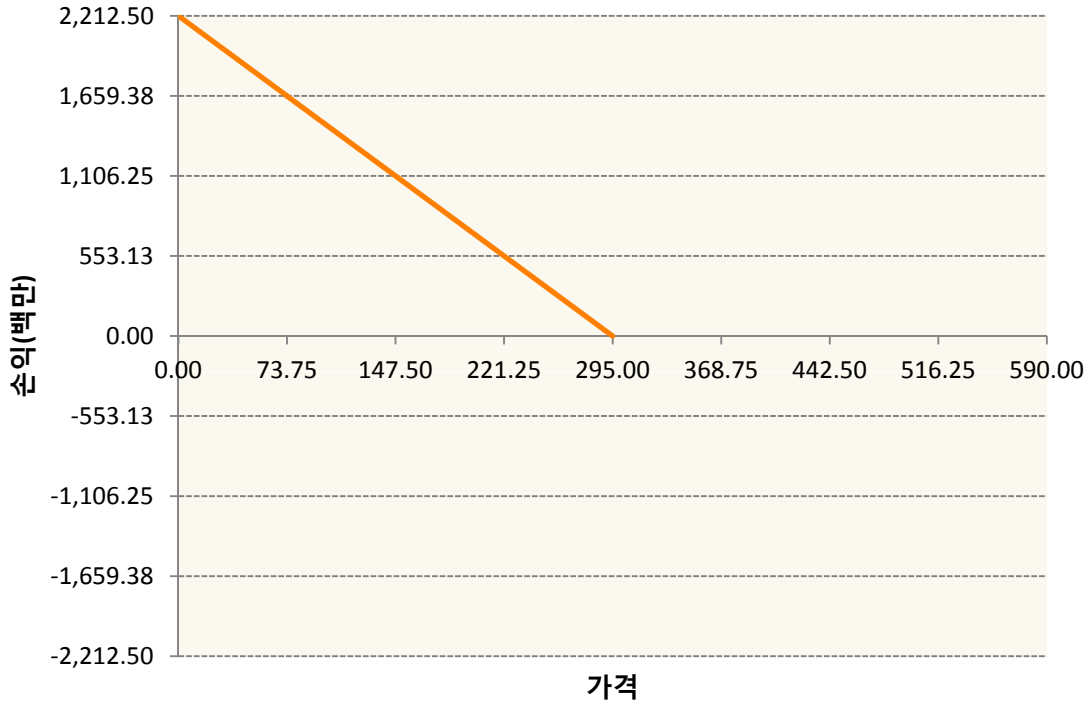


KR4301Q22925-2020-02 풋292.5





KR4301Q22958-2020-02 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						820
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-820	-820	-820	-820	-820	-820	-820	
-5.33%	-547	-547	-547	-547	-547	-547	-547	
-2.67%	-273	-273	-273	-273	-273	-273	-273	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	273	273	273	273	273	273	273	
5.33%	547	547	547	547	547	547	547	
8.00%	820	820	820	820	820	820	820	
KR4201Q23073		2020-02 콜307.5						359
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	9	9	9	9	9	9	9	
-5.33%	9	9	9	9	9	9	9	
-2.67%	9	9	9	9	8	8	7	

0%	6	5	2	0	-3	-6	-9
2.67%	-37	-42	-48	-53	-58	-64	-69
5.33%	-175	-177	-179	-182	-185	-189	-192
8.00%	-356	-356	-357	-357	-358	-358	-359
KR4201Q23107 2020-02 콜310							576
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	7	6
0%	6	5	3	0	-3	-7	-12
2.67%	-36	-45	-54	-63	-73	-82	-92
5.33%	-238	-245	-252	-260	-268	-276	-285
8.00%	-564	-565	-566	-568	-570	-573	-576
KR4301Q22925 2020-02 풋292.5							43
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	43	43	43	43	43	43	43
-5.33%	23	23	23	23	23	23	23
-2.67%	4	5	5	5	6	6	6
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
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%	86	86	86	86	86	86	86
-2.67%	27	27	28	28	29	30	30
0%	-1	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2

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

(단위:백만원)

1,406

공시일	2020-02-12
기준일	2020-02-11

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	212,602	0	212,602	

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	2020-02-12
기준일	2020-02-11

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	194,302	0	194,302	

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	2020-02-12
기준일	2020-02-11

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	527,552	0	527,552	
누계	통화	선도	0	545,663	-545,663	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019Z01: KRW/USD 12-02-20E	1,550
FX21019Z01: KRW/USD 12-02-20E	945
FX21019Z02: KRW/USD 18-02-20E	189
FX21019Z02: KRW/USD 18-02-20E	2,023
FX21019Z02: KRW/USD 18-02-20E	945
FX21019Z03: KRW/USD 24-02-20E	3,781
FX21019Z04: KRW/USD 26-02-20E	1,891
FX21019Z04: KRW/USD 26-02-20E	2,023
FX21019Z04: KRW/USD 26-02-20E	189
FX21020F01: KRW/USD 18-02-20E	1,702
FX21020F01: KRW/USD 18-02-20E	284
FX21020F02: KRW/USD 21-02-20E	1,891
FX21020F02: KRW/USD 21-02-20E	3,252
FX21020F02: KRW/USD 23-03-20E	1,522
FX21020F02: KRW/USD 23-03-20E	1,418
FX21020F02: KRW/USD 28-02-20E	1,891
FX21020F03: KRW/USD 28-02-20E	2,930
FX21020F03: KRW/USD 31-03-20E	3,025
FX21020F04: KRW/USD 31-03-20E	2,836
FX21020F04: KRW/USD 28-02-20E	189
FX21020G00: KRW/USD 06-04-20E	2,552
FX21020G00: KRW/USD 06-03-20E	2,363
FX21020G00: KRW/USD 12-03-20E	945
FX21020G01: KRW/USD 12-03-20E	1,172
FX21020G01: KRW/USD 12-03-20E	1,201
FX21020G01: KRW/USD 12-03-20E	945

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

14,639

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

(단위:백만원)

126

공시일	2020-02-12
기준일	2020-02-11

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

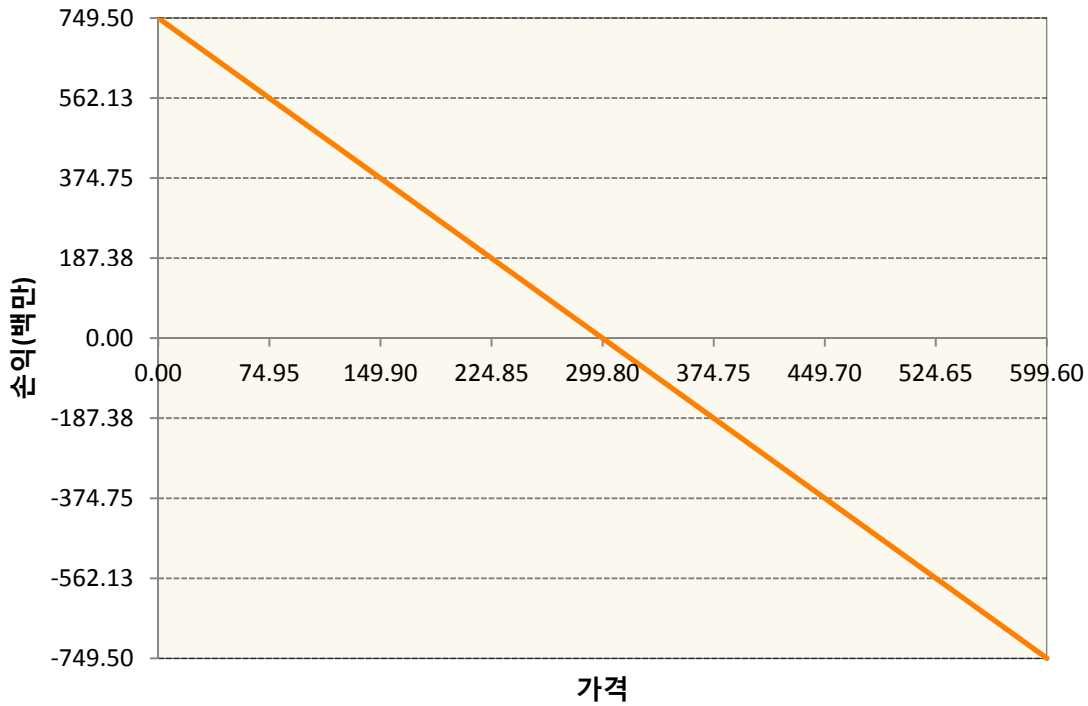
1. 계약금액

(단위:백만원)

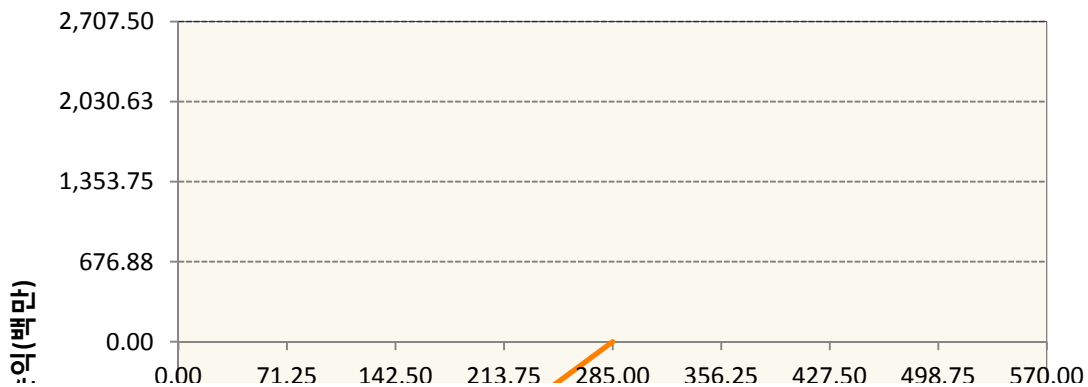
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	750	-750	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,498	-3,498	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

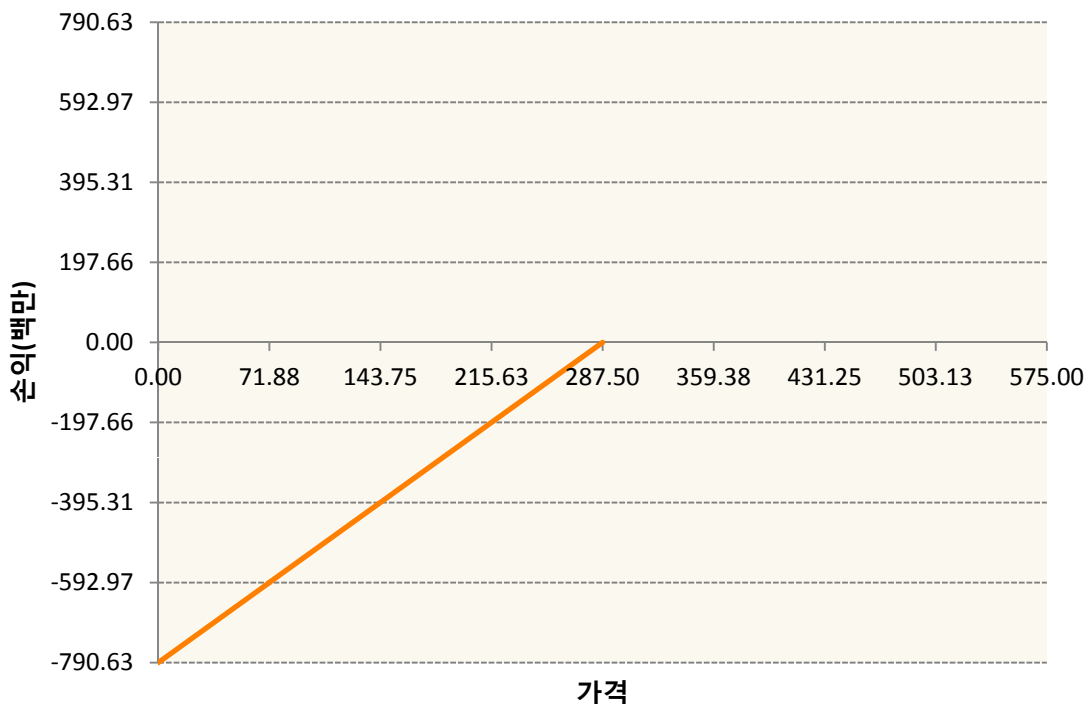


KR4301Q22859-2020-02 풋285





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						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%	-21	-22	-23	-24	-25	-26	-27
-2.67%	0	0	0	-1	-1	-2	-2
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 33

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-5.33%	-12	-12	-12	-12	-12	-13	-13
-2.67%	0	-1	-1	-1	-1	-1	-2
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)

63

공시일	2020-02-12
기준일	2020-02-11

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	11,686	0	11,686	
누계	통화	선도	473	13,021	-12,549	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020F00(KRW/USD 13-02-20E	127
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
FX21020G01(USD/KRW 13-02-20E	38
FX21020G01(KRW/USD 12-03-20E	89
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

362

공시일	2020-02-12
기준일	2020-02-11

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

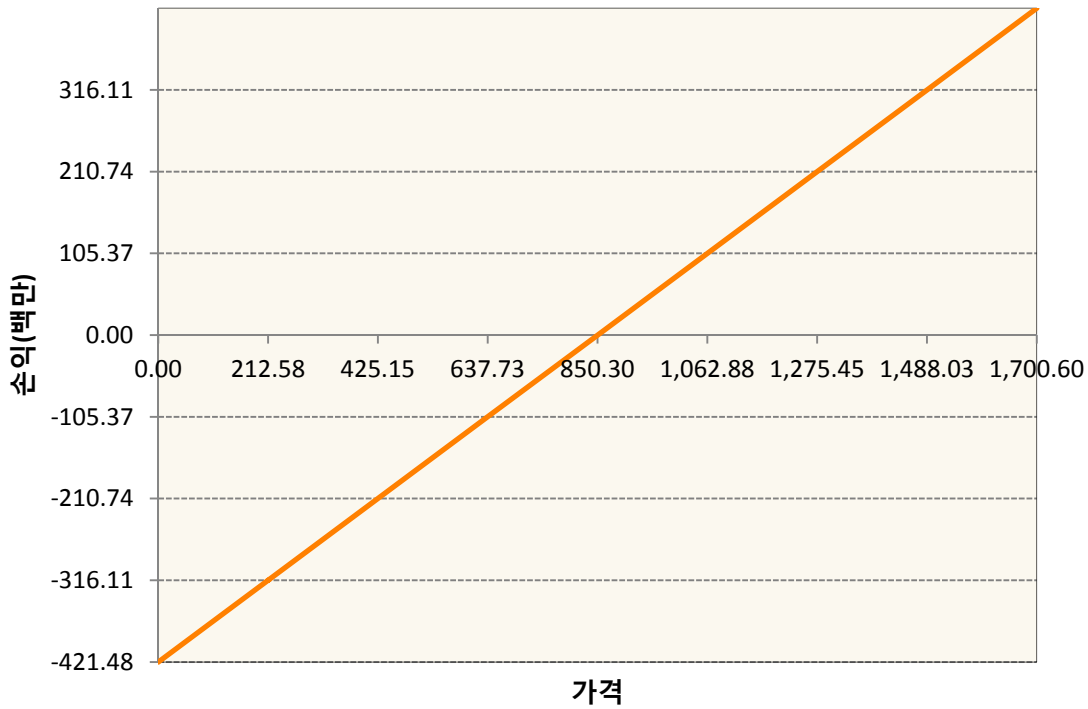
1. 계약금액

(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	421	0	421	
누계	유가증권	스왑	1,063	0	1,063	장외
누계	통화	선도	180	683	-503	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCG0-VN30 Index Future Feb20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	85
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	34

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

(단위:백만원)

113

공시일	2020-02-12
기준일	2020-02-11

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

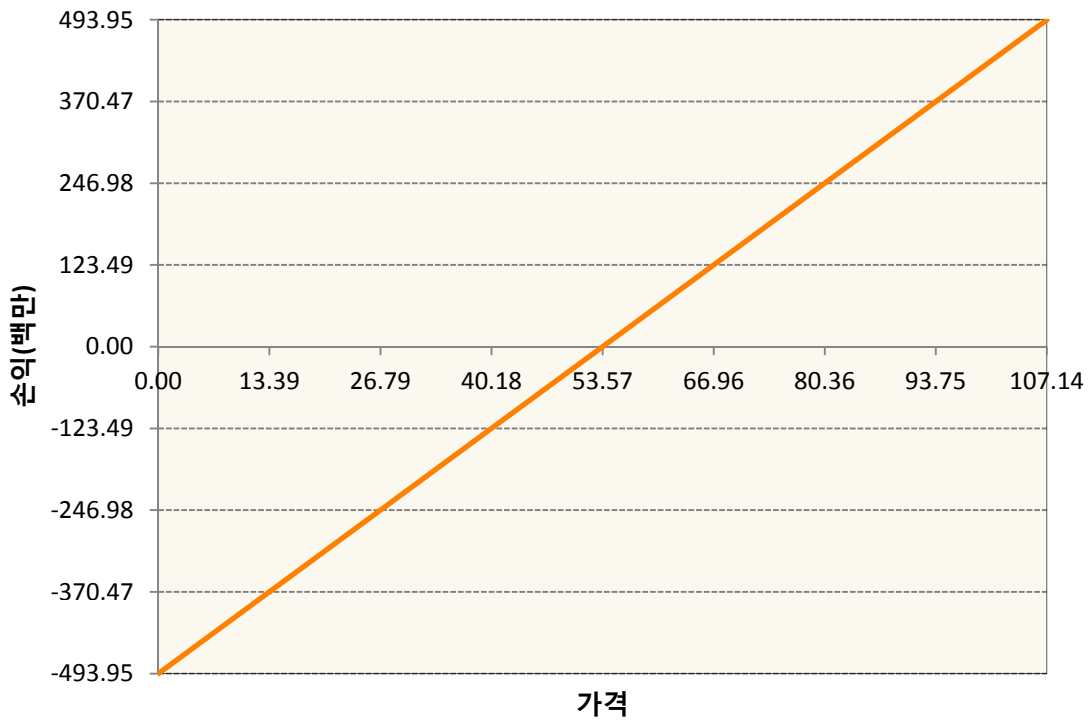
1. 계약금액

(단위:백만원)

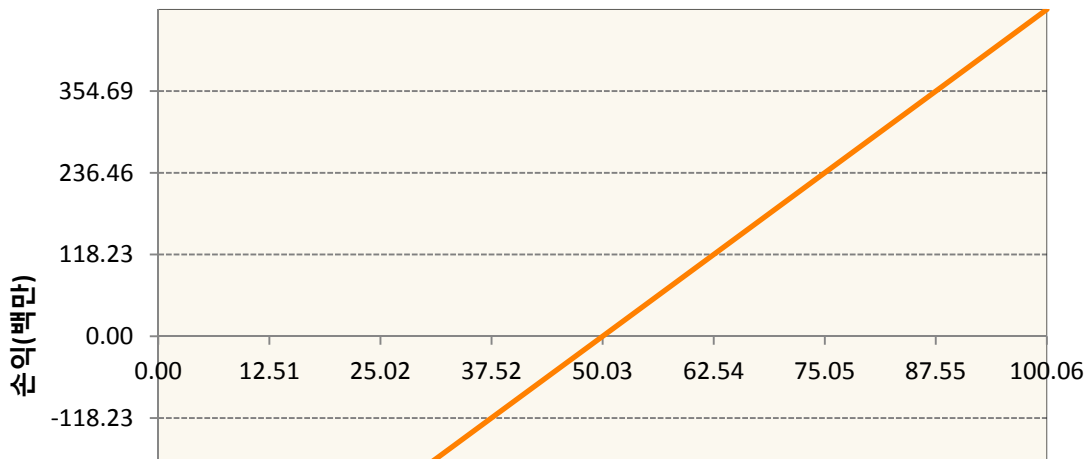
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,062	189	1,873	

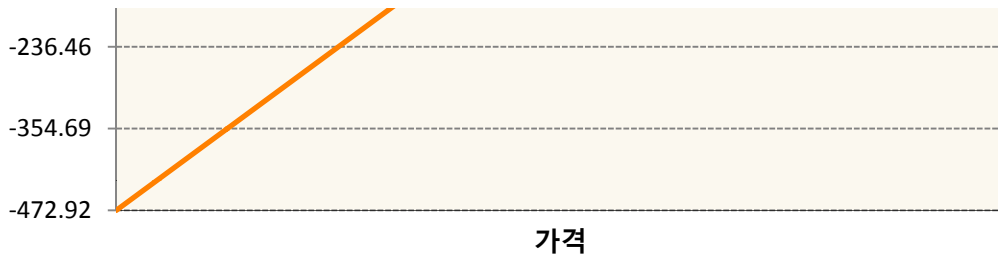
2. 만기시점의 손익구조

COK0-BRENT CRUDE FUTR May20

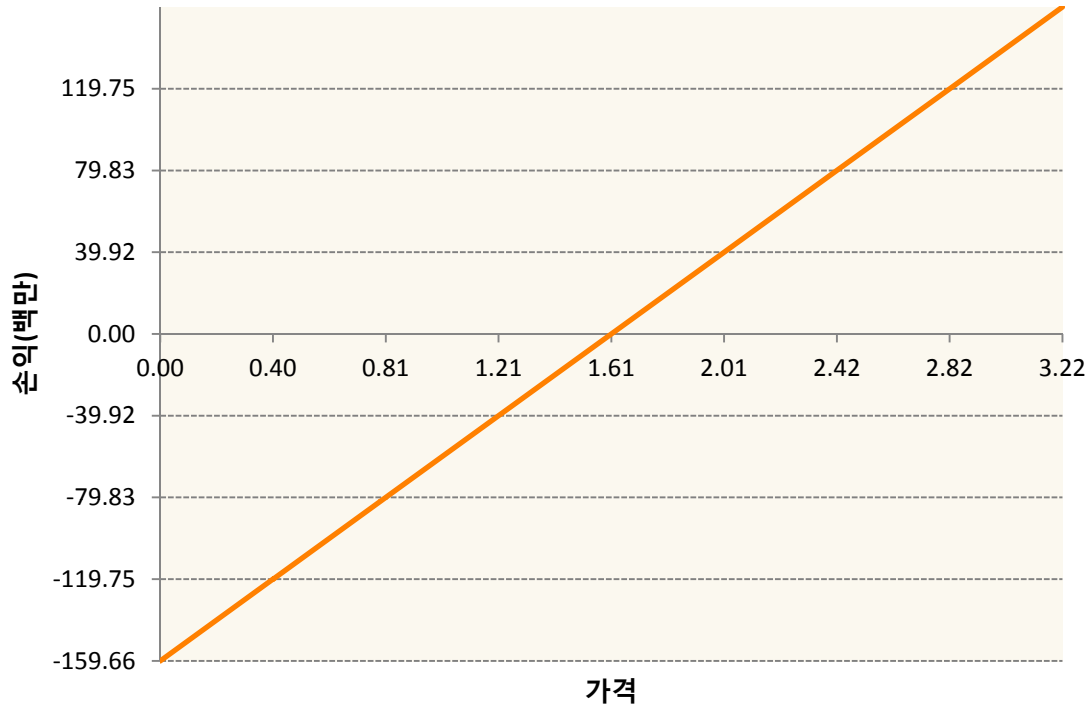


CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20

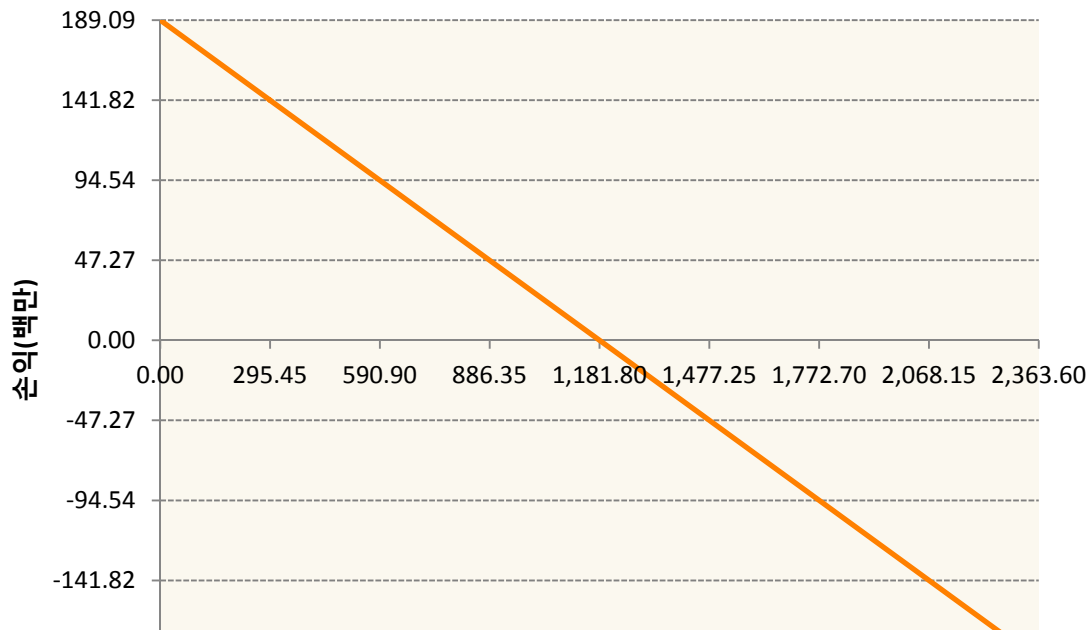


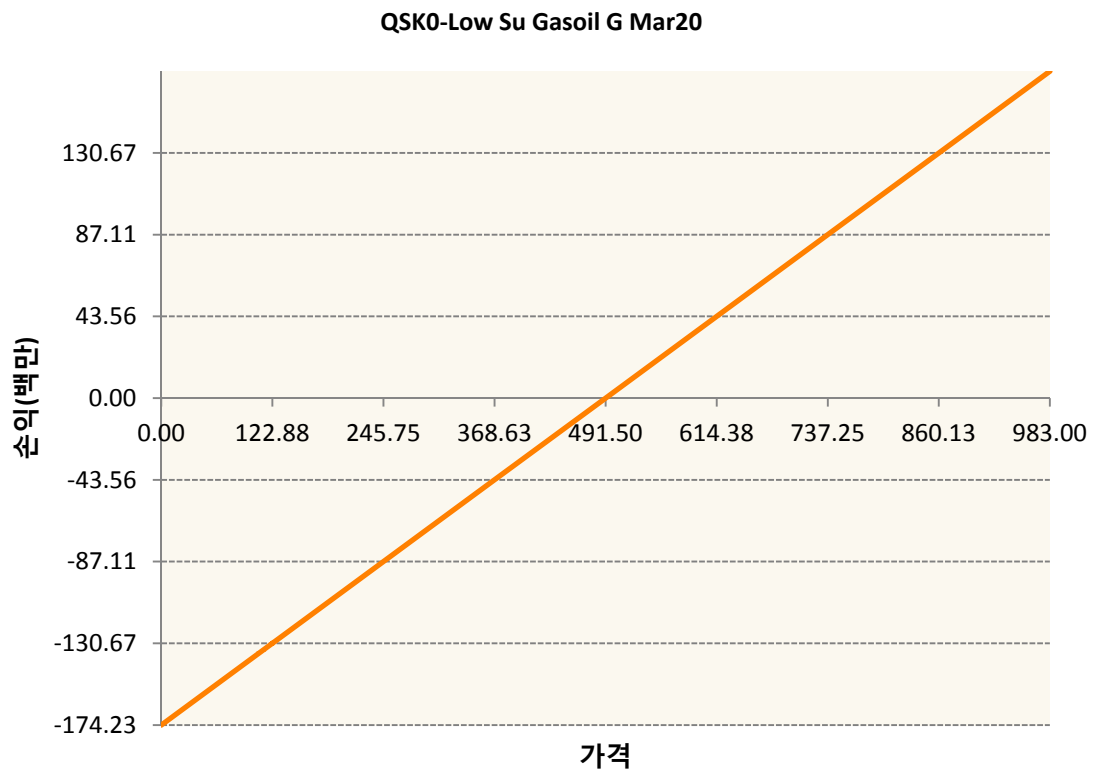
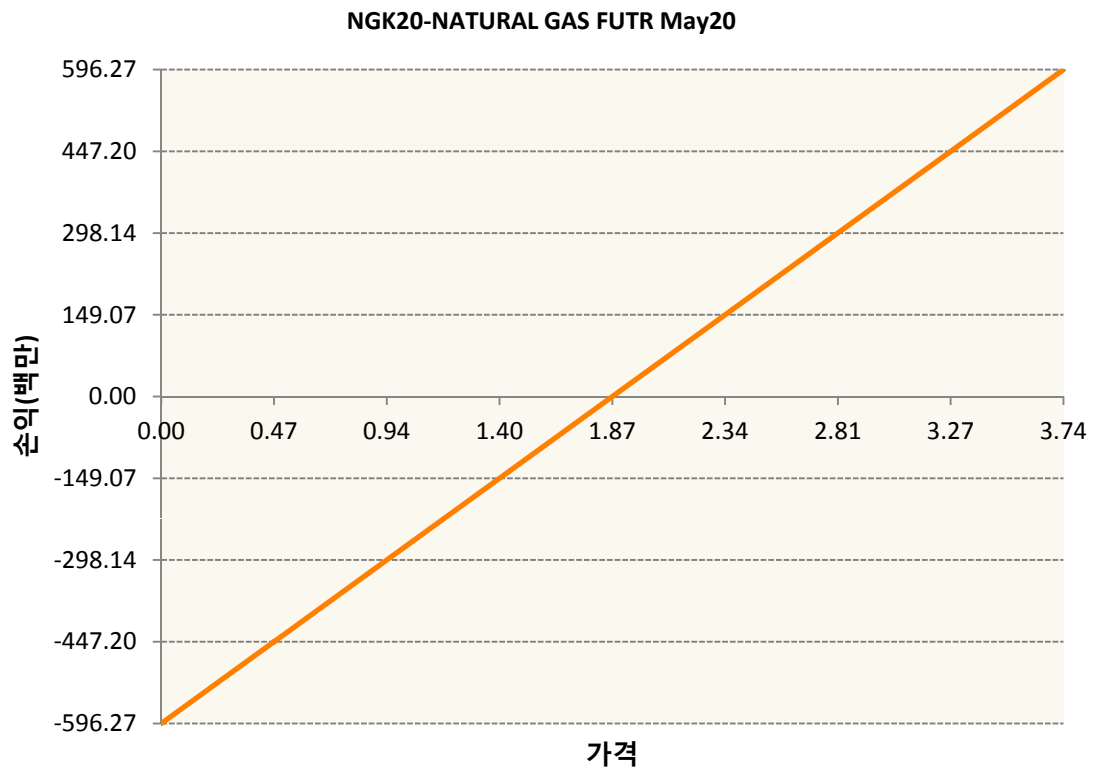
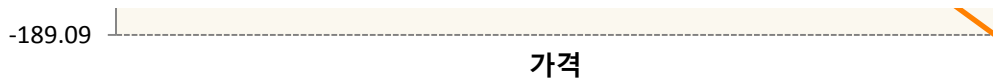


HOK0-NY Harb ULSD Fut May20

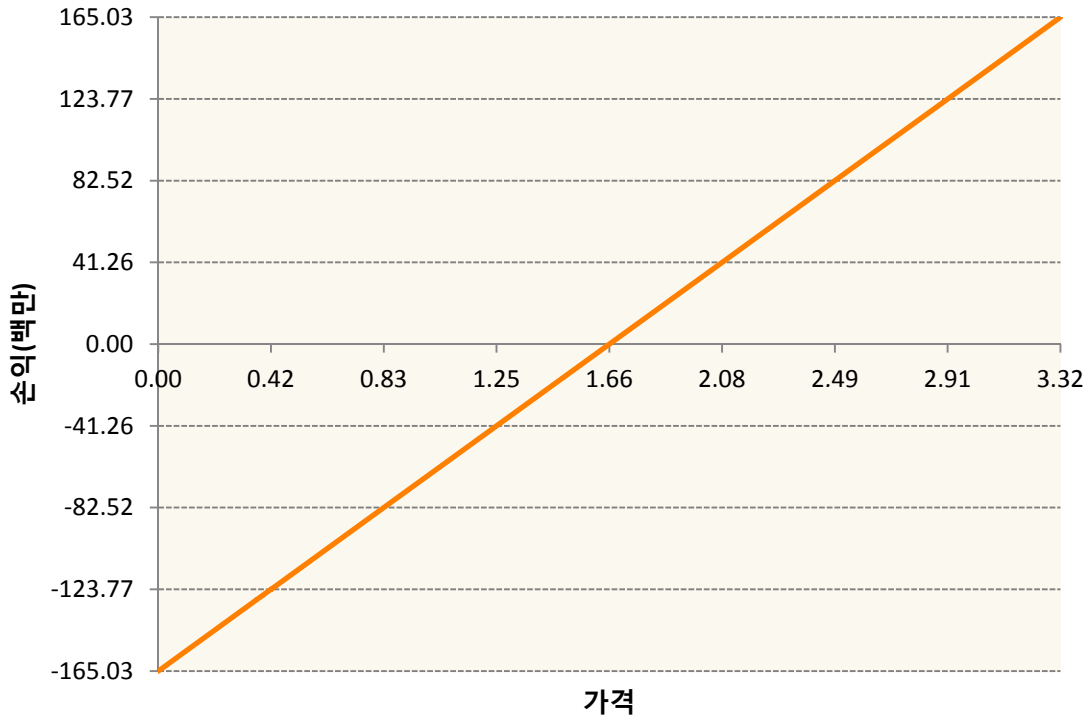


KR4175Q20000-2020-02 달러선물





XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	40
CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	38
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	13
KR4175Q20C	2020-02 달러선물	15
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	48
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	14
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	13

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

(단위:백만원)

330

공시일	2020-02-12
기준일	2020-02-11

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

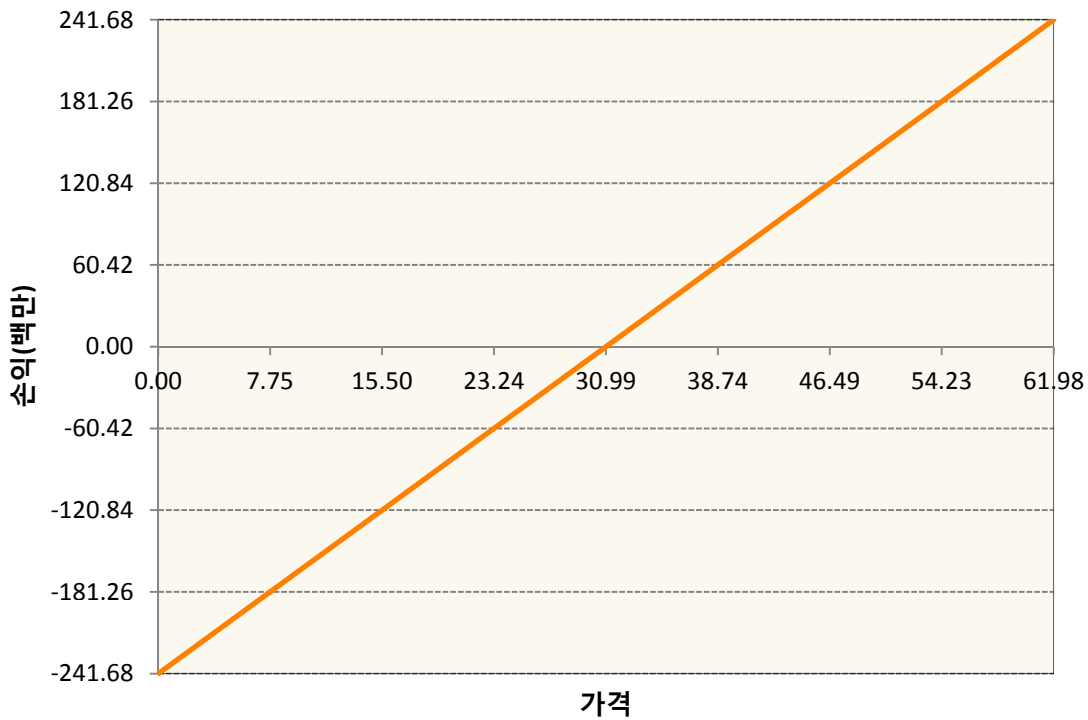
1. 계약금액

(단위:백만원)

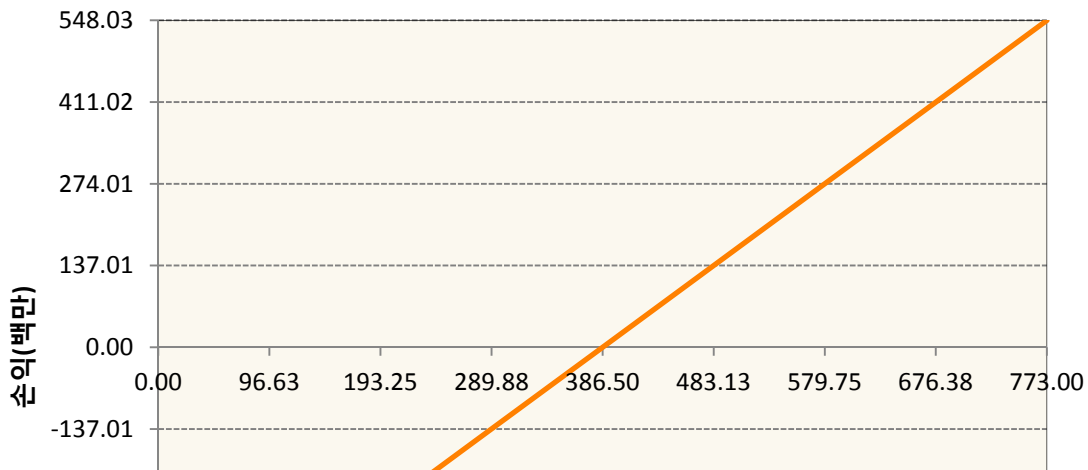
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,730	154	2,577	

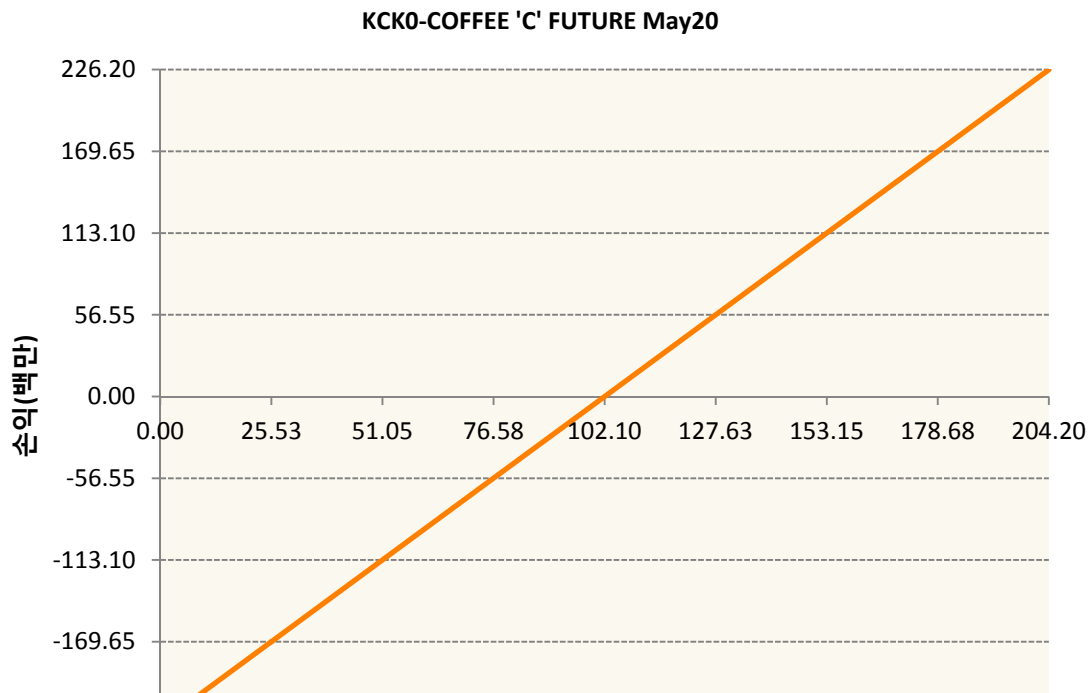
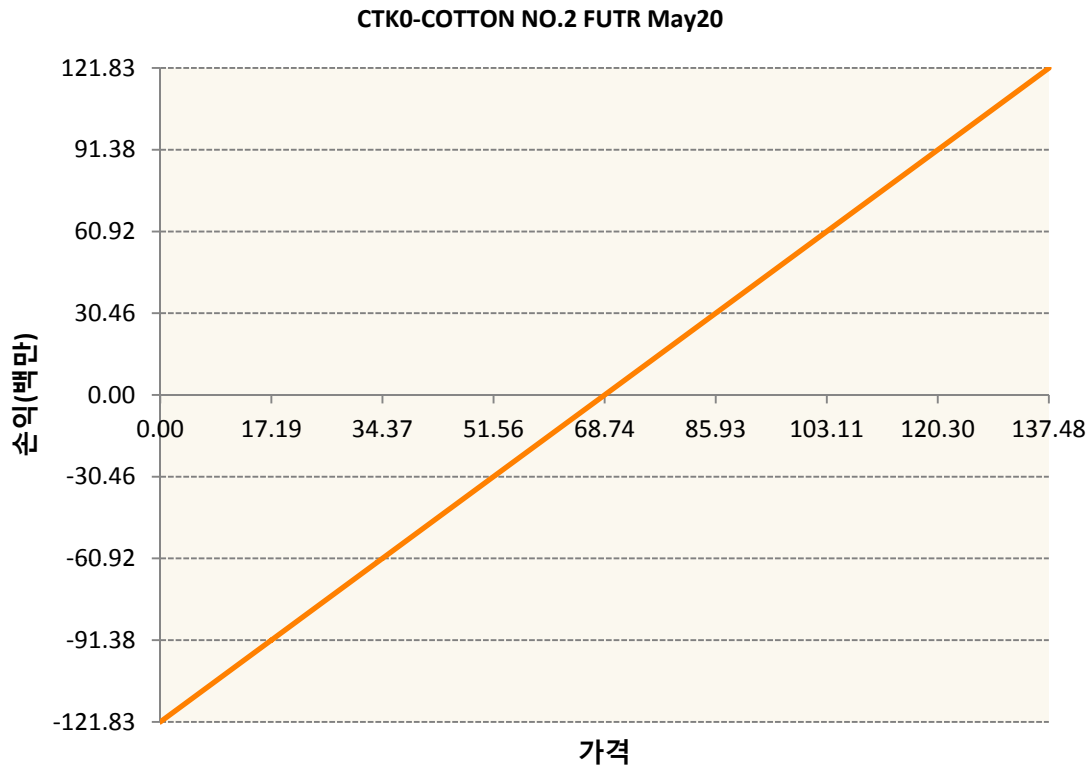
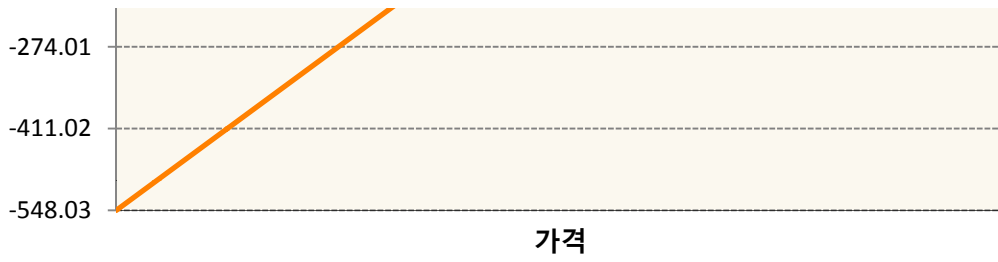
2. 만기시점의 손익구조

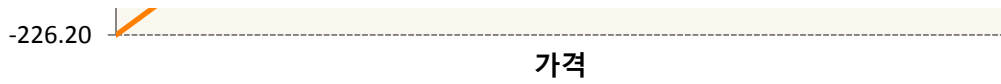
BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20



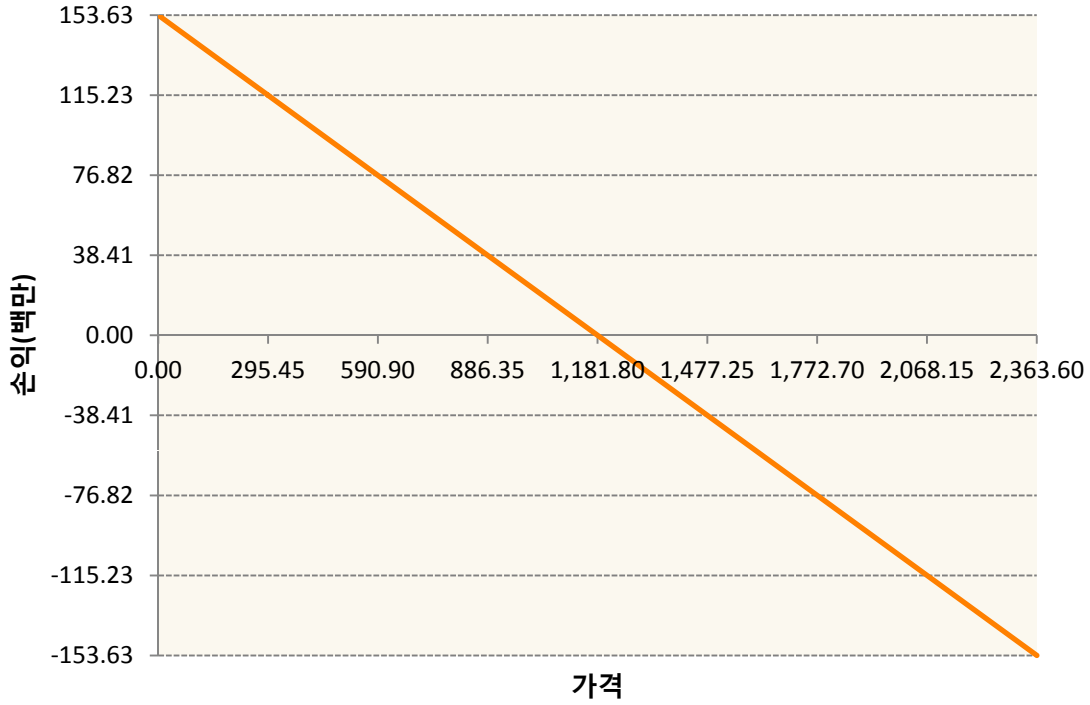
CK0-CORN FUTURE May20



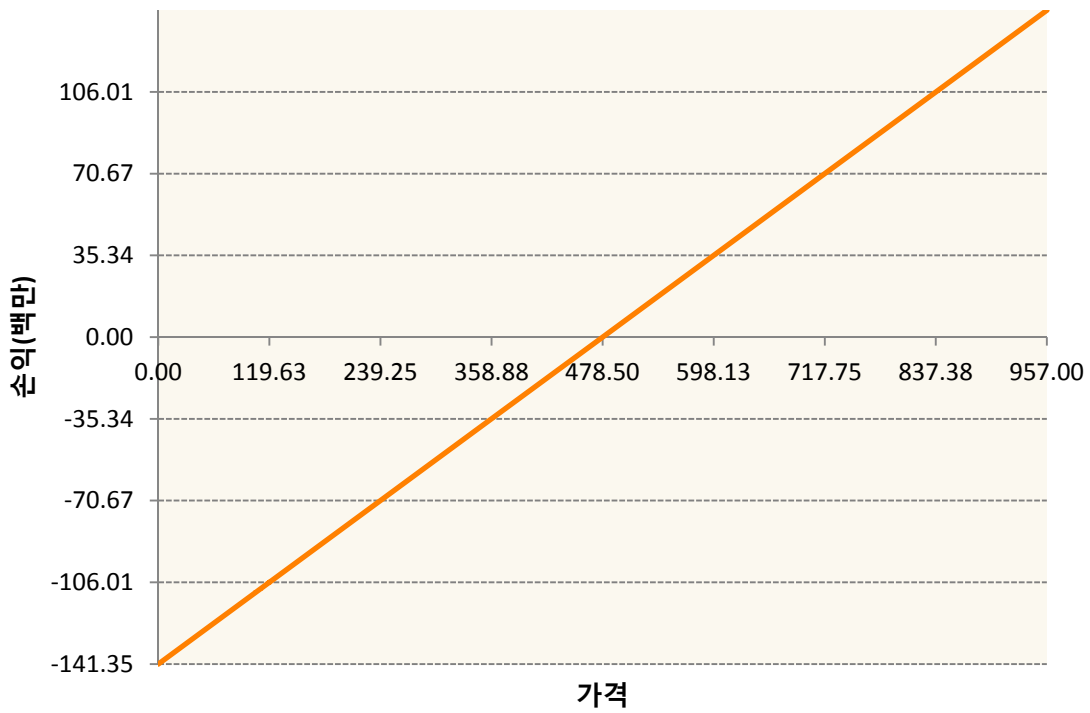




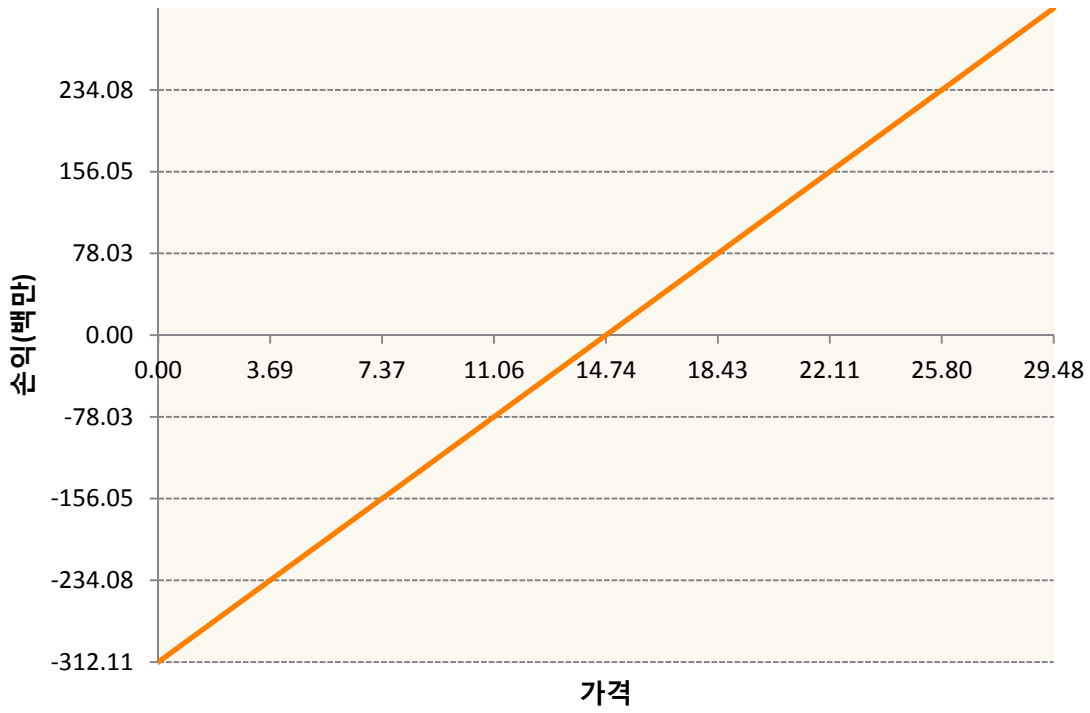
KR4175Q20000-2020-02 달러선물



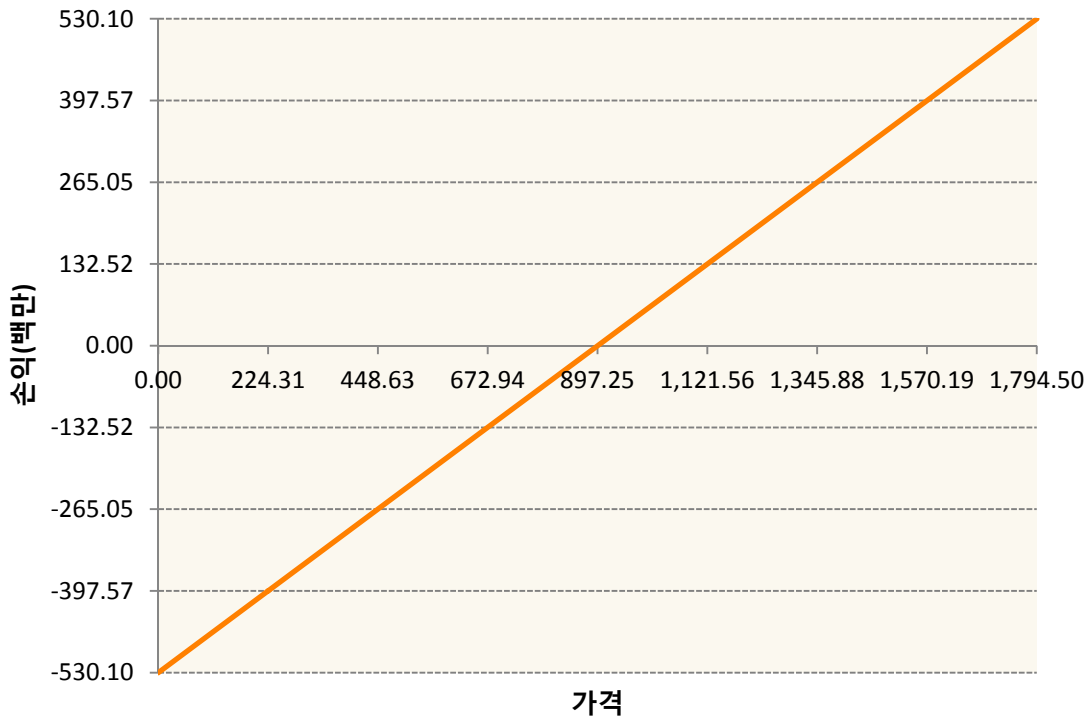
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



SBK0-Sugar May20

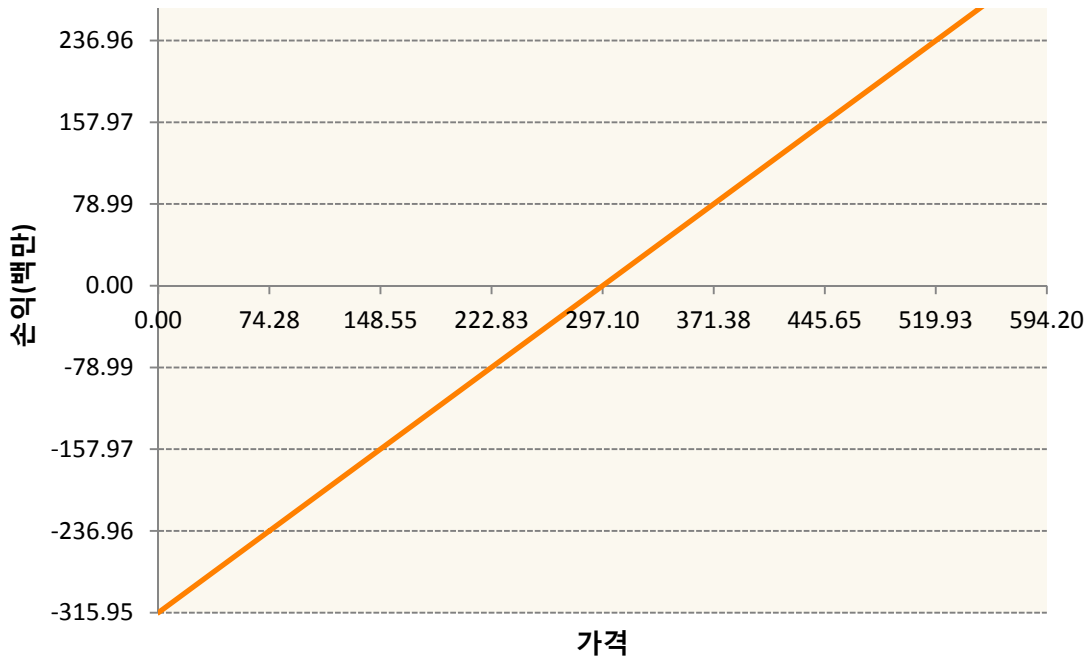


SK0-SOYBEAN FUTURE May20

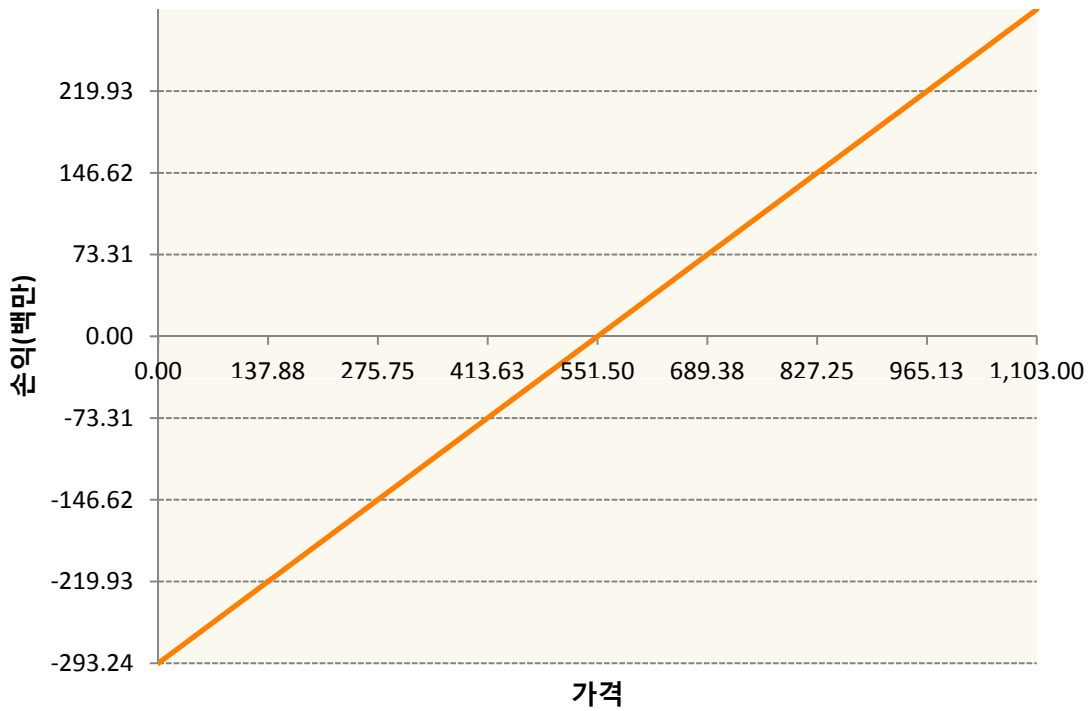


SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





WK0-WHEAT FUTURE(CBT) May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	19
CK0	CORN FUTURE May20	44
CTK0	COTTON NO.2 FUTR May20	10
KCK0	COFFEE 'C' FUTURE May20	18
KR4175Q20C	2020-02 달러선물	12

KWK0	KC HRW WHEAT FUT May20	11
SBK0	Sugar May20	25
SK0	SOYBEAN FUTURE May20	42
SMK0	SOYBEAN MEAL FUTR May20	25
WK0	WHEAT FUTURE(CBT) May20	23

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

(단위:백만원)

236