

공시일	2020-02-14
기준일	2020-02-13

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	2020-02-14
기준일	2020-02-13

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

1,167

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

679

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-14
기준일	2020-02-13

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)	419
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	153

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

888

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-14
기준일	2020-02-13

유로인덱스모(주식-파생형)

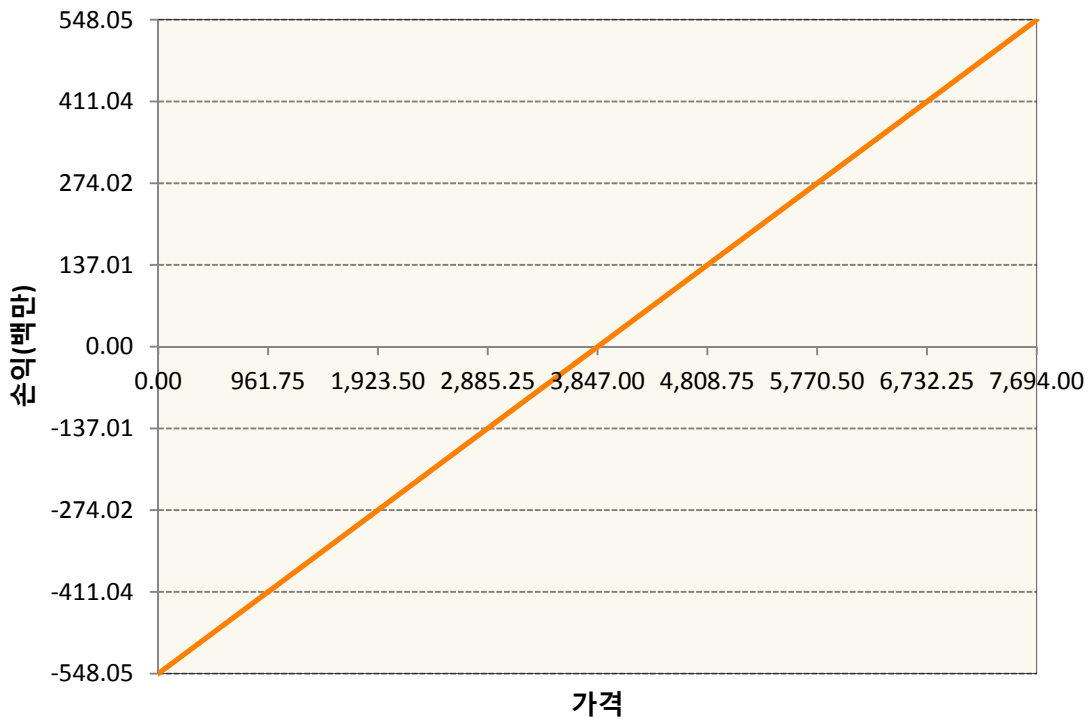
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	548	0	548	

2. 만기시점의 손익구조

VGH0-EURO STOXX 50 Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH0	EURO STOXX 50 Mar20	44
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

31

공시일	2020-02-14
기준일	2020-02-13

차이나인덱스모(주식-파생형)

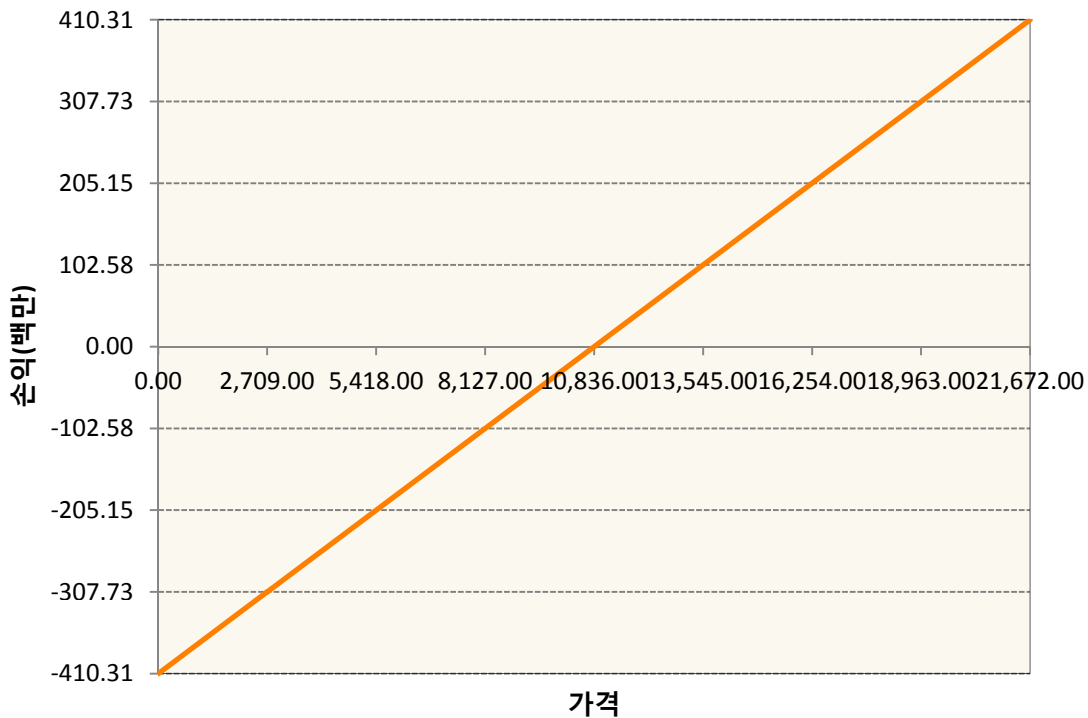
1. 계약금액

(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

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	2020-02-14
기준일	2020-02-13

커버드콜모(주식혼합-파생형)

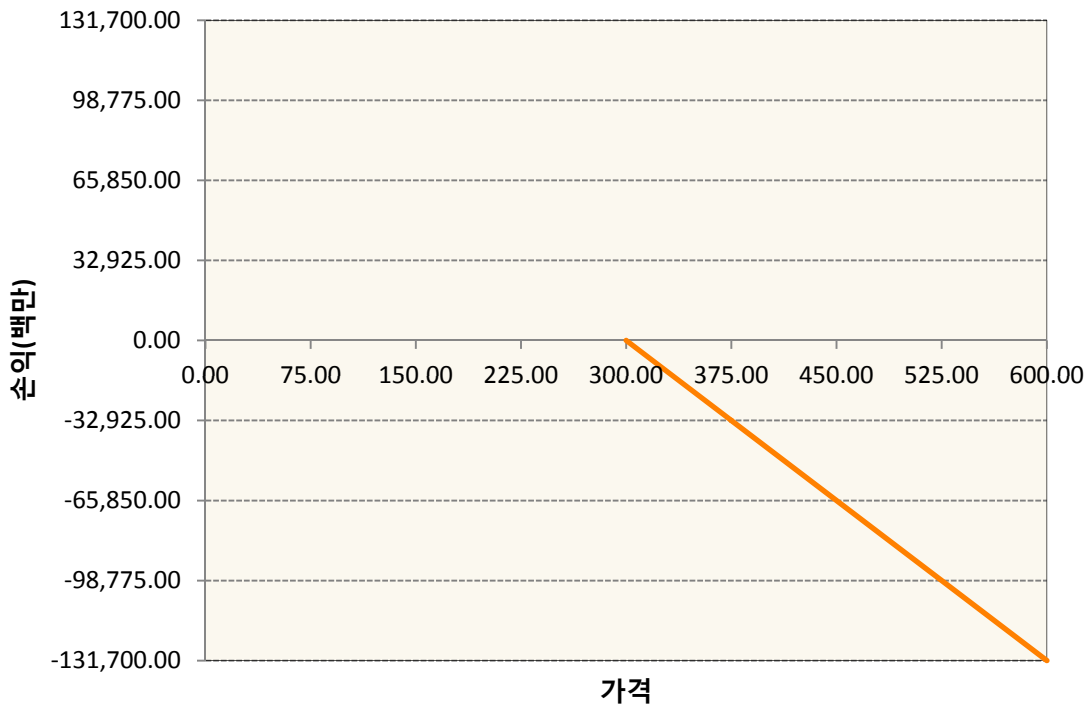
1. 계약금액

(단위:백만원)

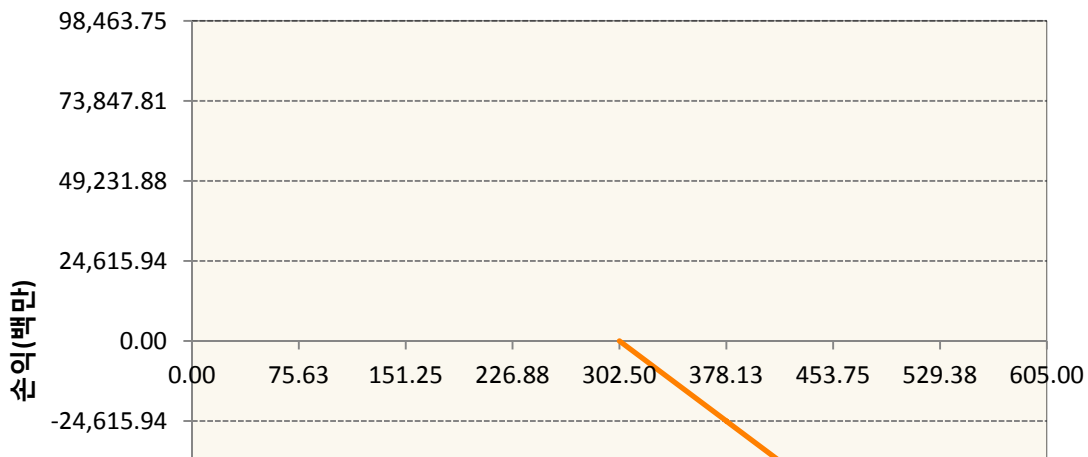
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	199,223	-199,223	장내
누계	유가증권	옵션	0	233,366	-233,366	장내

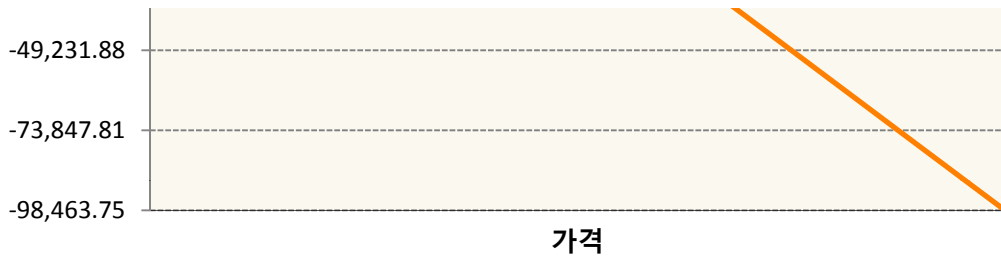
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q33007-2020-03 콜300

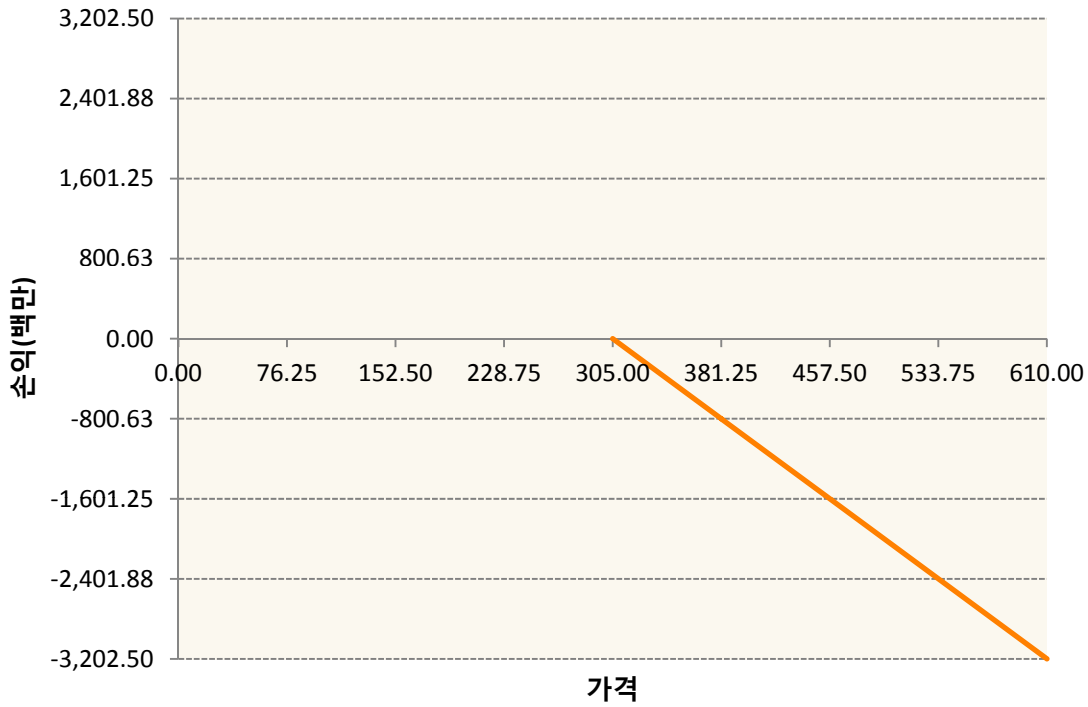


KR4201Q33023-2020-03 콜302.5





KR4201Q33056-2020-03 콜305



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q33007		2020-03 콜300					8,167
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,253	4,078	3,880	3,661	3,425	3,175	2,912
-5.33%	3,694	3,426	3,142	2,847	2,542	2,229	1,911
-2.67%	2,685	2,341	1,992	1,641	1,287	931	574
0%	1,117	745	372	0	-372	-745	-1,117
2.67%	-1,026	-1,371	-1,721	-2,076	-2,433	-2,794	-3,157
5.33%	-3,673	-3,949	-4,241	-4,547	-4,863	-5,188	-5,520
8.00%	-6,695	-6,888	-7,107	-7,347	-7,606	-7,880	-8,167
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5					5,838
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,837	2,726	2,596	2,449	2,288	2,116	1,933

-5.33%	2,499	2,319	2,125	1,920	1,706	1,485	1,258
-2.67%	1,861	1,618	1,369	1,116	861	603	342
0%	830	553	277	0	-277	-554	-831
2.67%	-628	-897	-1,167	-1,440	-1,713	-1,988	-2,263
5.33%	-2,480	-2,705	-2,940	-3,182	-3,430	-3,684	-3,941
8.00%	-4,640	-4,805	-4,987	-5,184	-5,393	-5,611	-5,838
KR4201Q33056 2020-03 콜305							181
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	82	79	75	71	66	61	56
-5.33%	73	68	62	56	50	43	36
-2.67%	56	48	41	33	25	17	9
0%	26	18	9	0	-9	-18	-27
2.67%	-16	-25	-34	-43	-52	-61	-70
5.33%	-72	-80	-88	-96	-105	-113	-122
8.00%	-139	-145	-152	-158	-166	-173	-181

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

(단위:백만원)

12,989

공시일	2020-02-14
기준일	2020-02-13

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

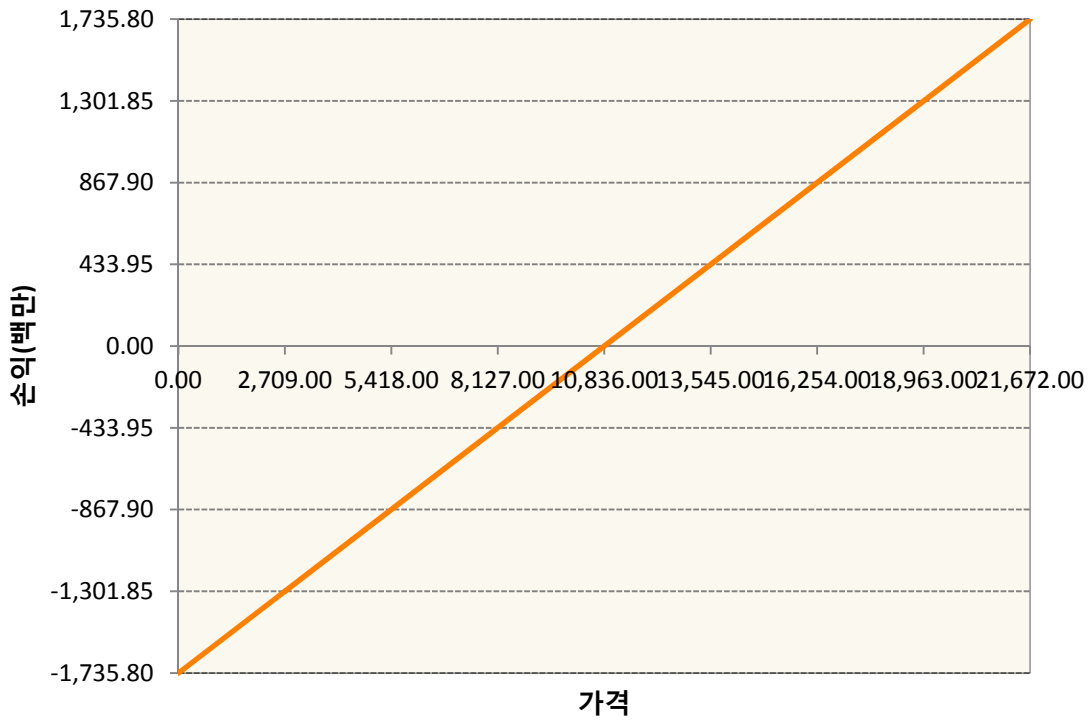
1. 계약금액

(단위:백만원)

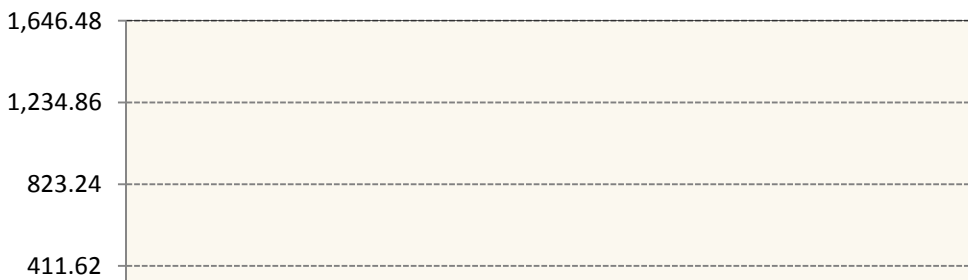
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,736	0	1,736	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,481	-4,481	장내
누계	통화	선도	0	2,144	-2,144	장외

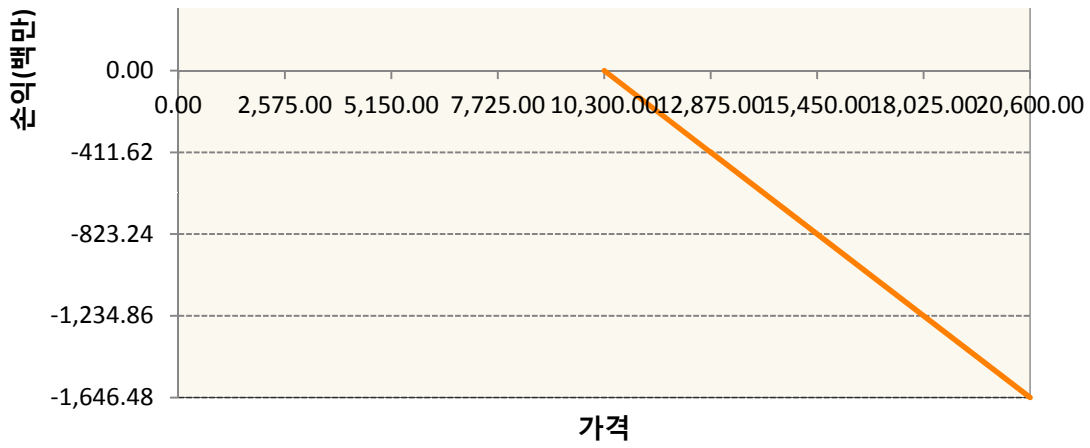
2. 만기시점의 손익구조

HCG0-HSCEI Futures Feb20

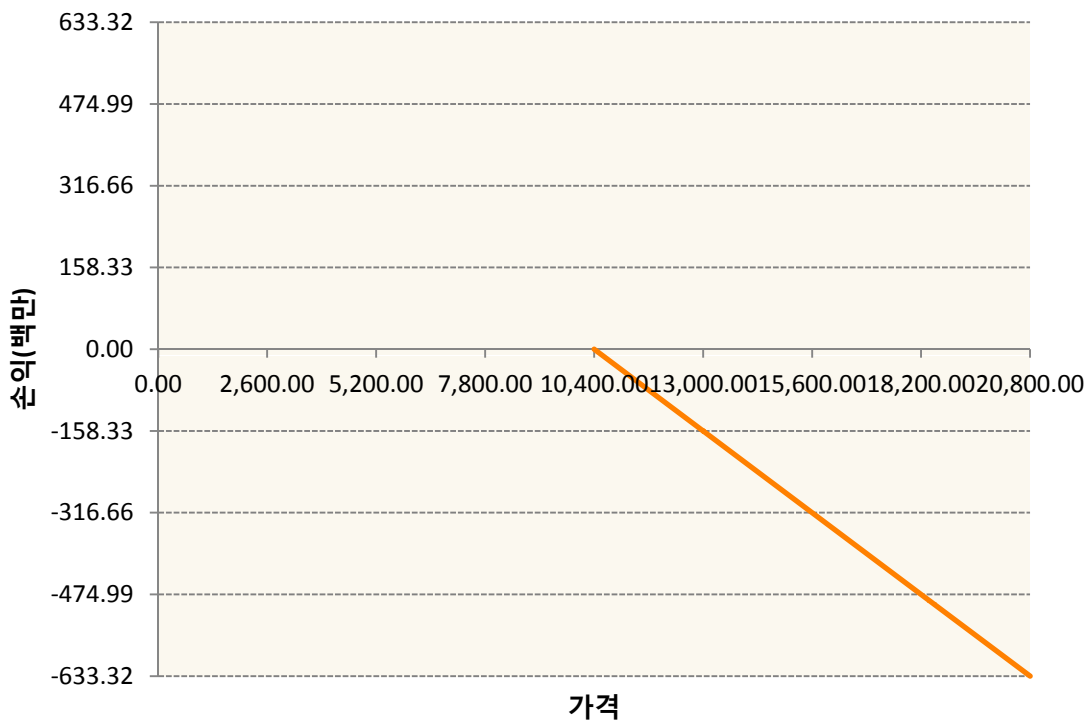


OHHIG0-C103-HSCEI

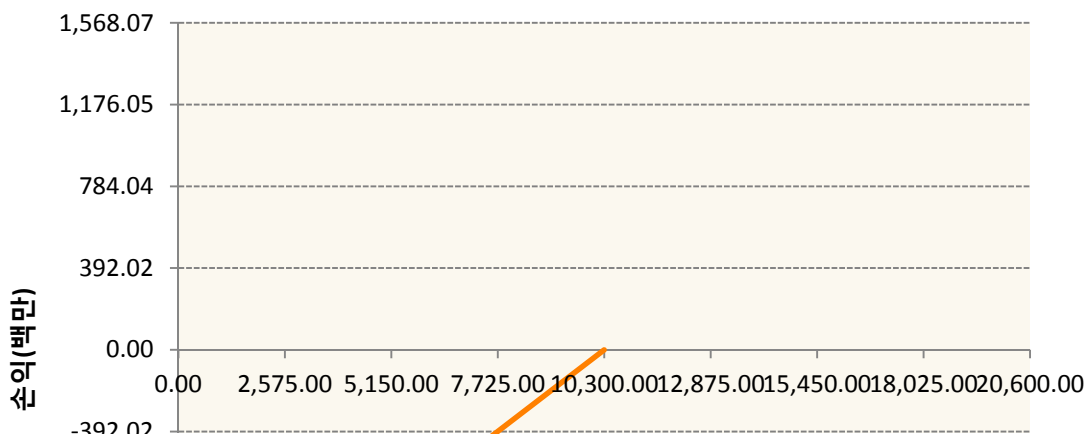


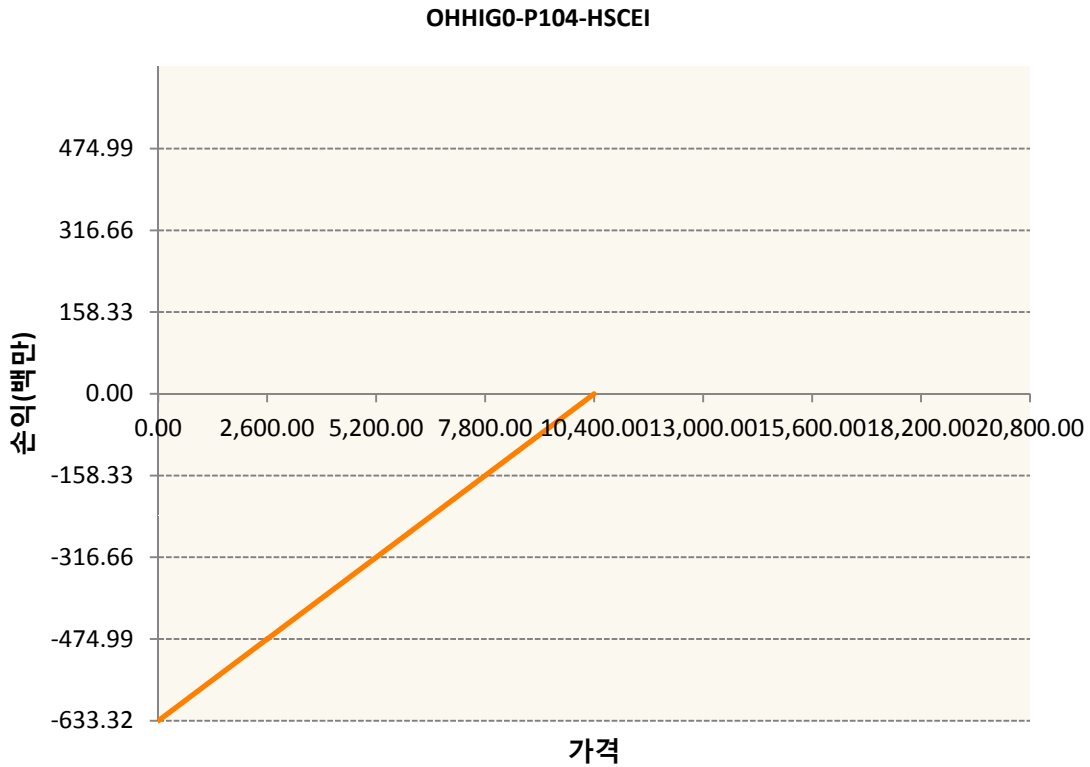


OHHIG0-C104-HSCEI



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)

509

5.33%	351	351	351	351	351	351	351
8.00%	526	526	526	526	526	526	526
KR4101Q30005 2020-03 코스피200지수선물							247
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-247	-247	-247	-247	-247	-247	-247
-5.33%	-165	-165	-165	-165	-165	-165	-165
-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%	165	165	165	165	165	165	165
8.00%	247	247	247	247	247	247	247

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

(단위:백만원)

729

공시일	2020-02-14
기준일	2020-02-13

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

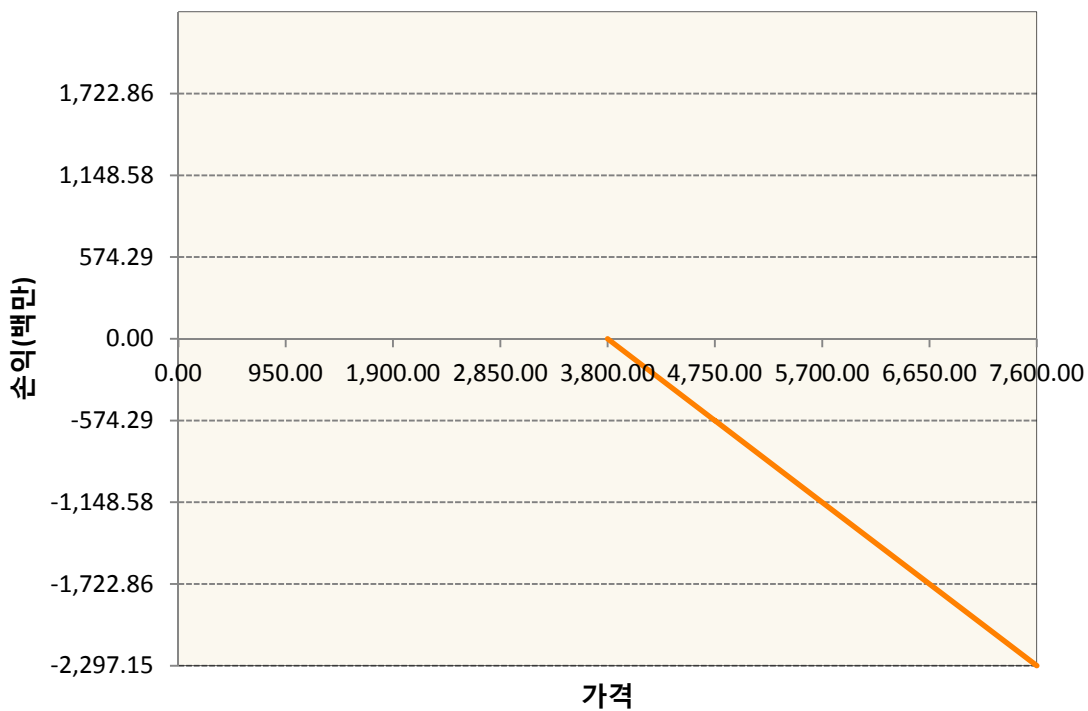
1. 계약금액

(단위:백만원)

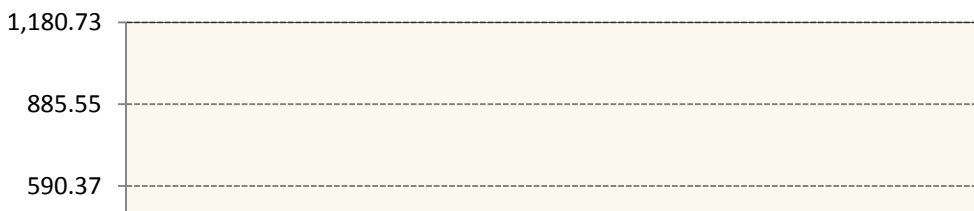
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	399	0	399	
누계	유가증권	스왑	13,440	0	13,440	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,956	-6,956	장내
누계	통화	선도	0	3,375	-3,375	장외

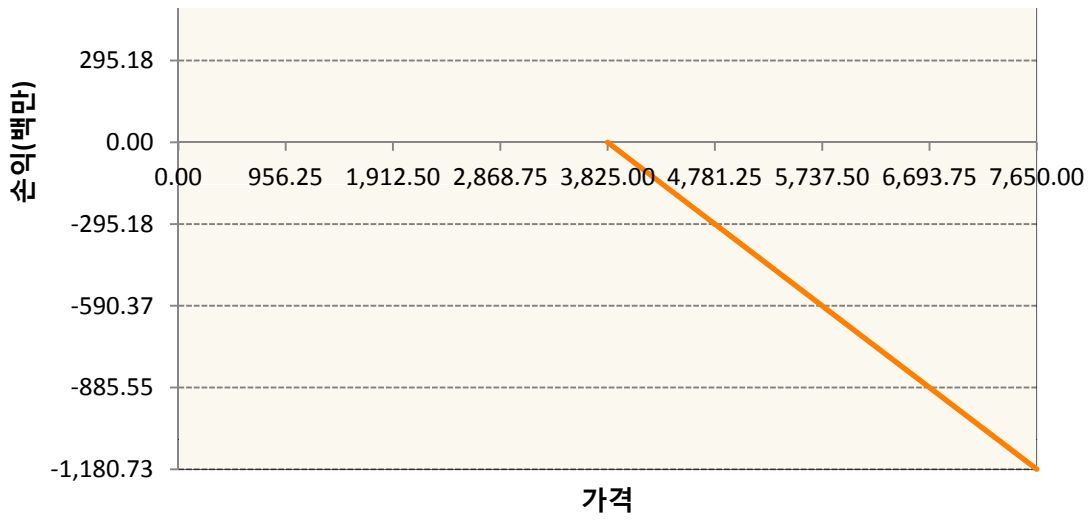
2. 만기시점의 손익구조

OESXG0-C3800-EURO STOXX 50

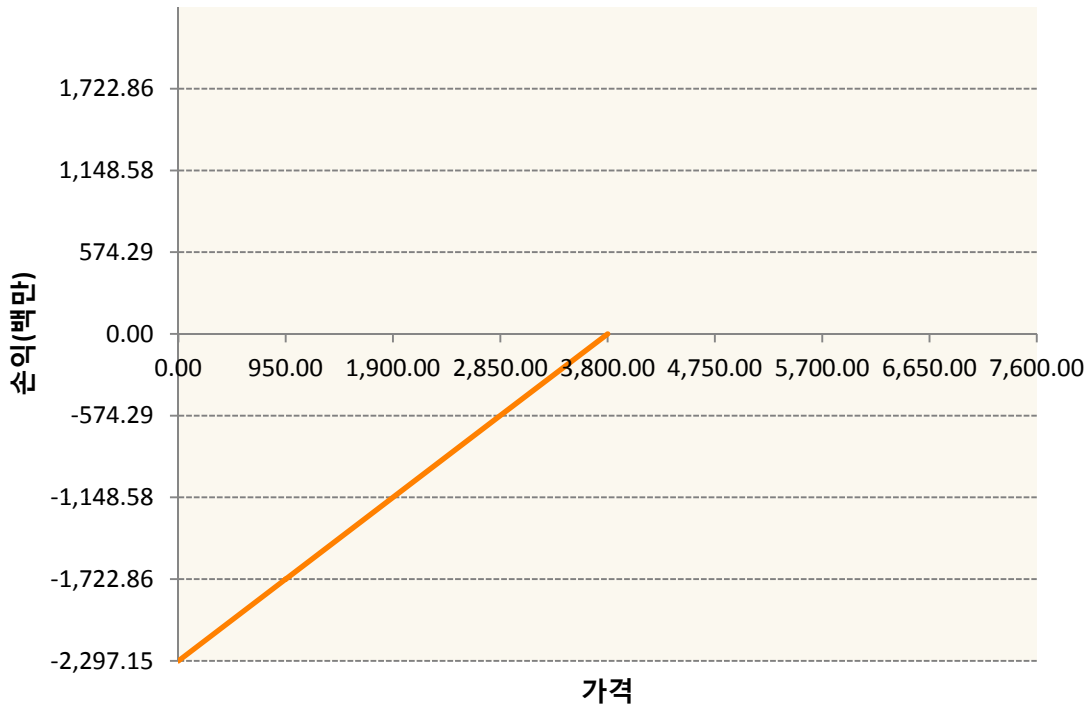


OESXG0-C3825-EURO STOXX 50

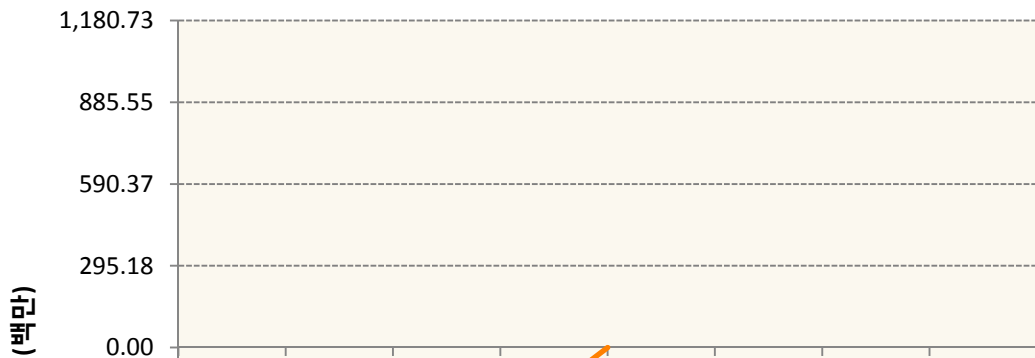


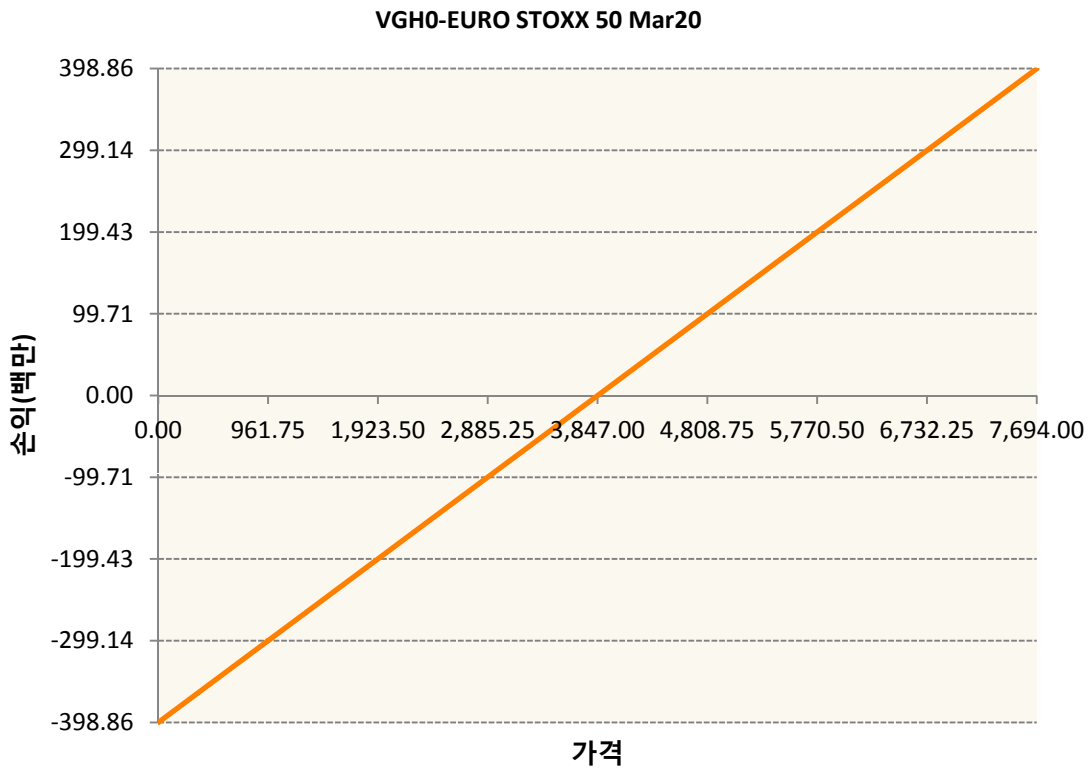
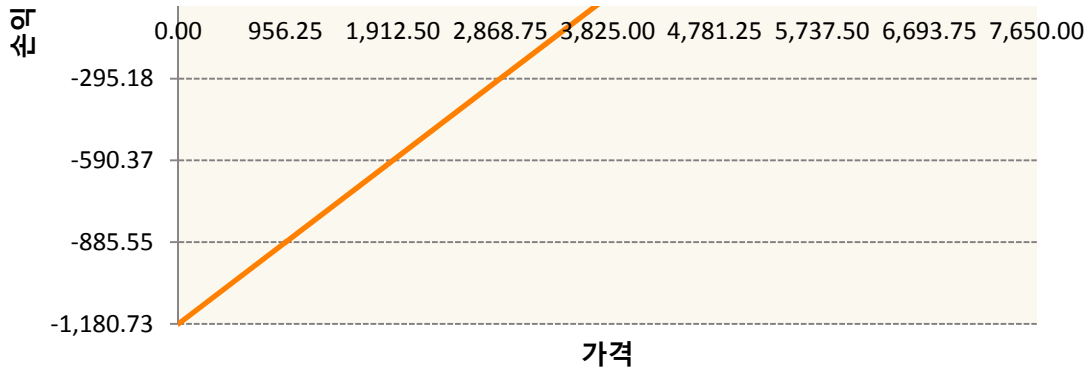


OESXG0-P3800-EURO STOXX 50



OESXG0-P3825-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP\SG EURO Covered CALL STRATEGY		11
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E		270
OESXG0-C3& EURO STOXX 50		184
OESXG0-C3& EURO STOXX 50		94
OESXG0-P3& EURO STOXX 50		184
OESXG0-P3& EURO STOXX 50		94
VGHO EURO STOXX 50 Mar20		32

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

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

(단위:백만원)

957

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

(단위:백만원)

84

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

(단위:백만원)

124

공시일	2020-02-14
기준일	2020-02-13

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

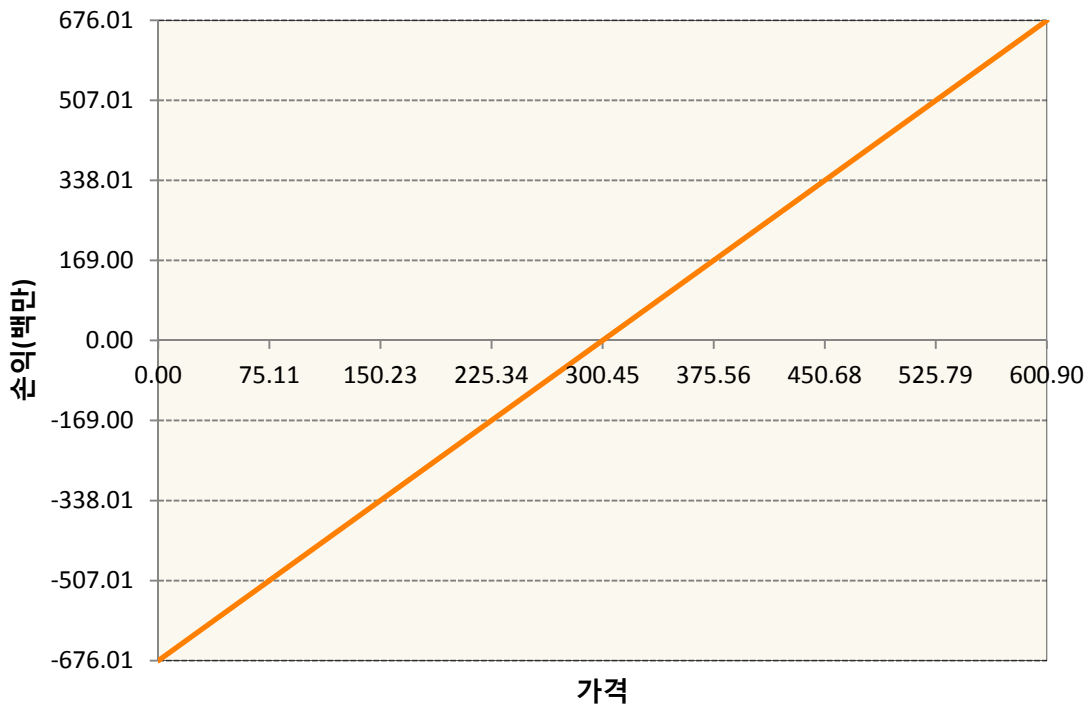
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	676	0	676	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	2020-02-14
기준일	2020-02-13

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

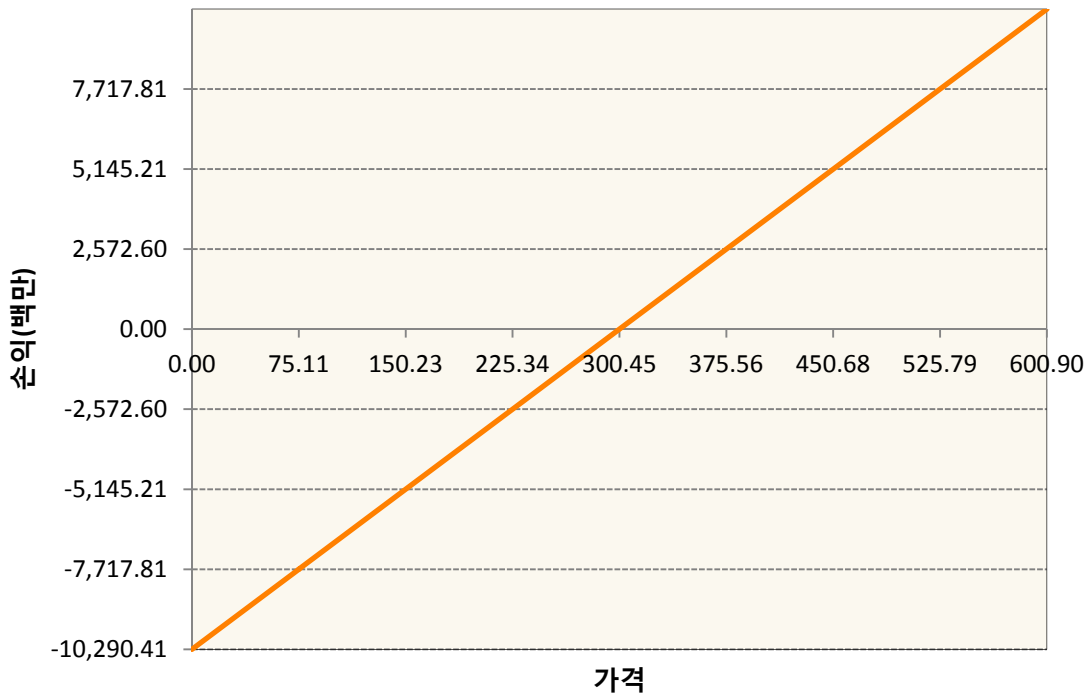
1. 계약금액

(단위:백만원)

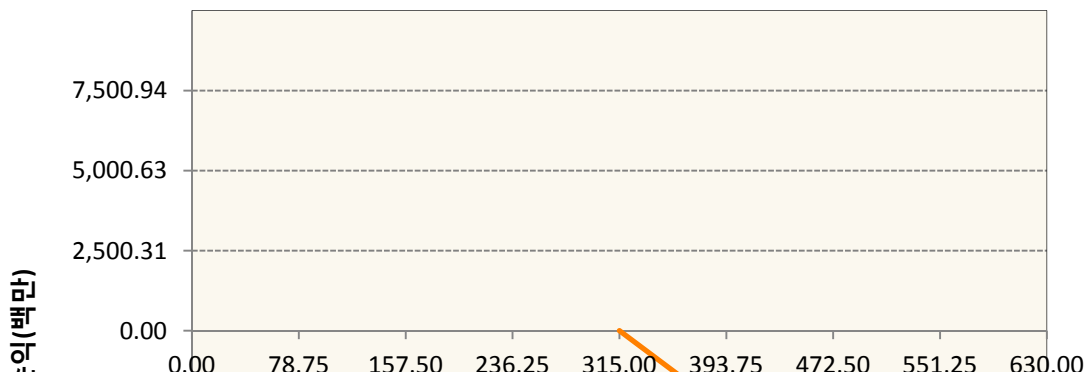
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	2,890	21,006	-18,116	장내
누계	유가증권	선물	10,290	0	10,290	장내
누계	유가증권	옵션	2,937	20,955	-18,018	장내

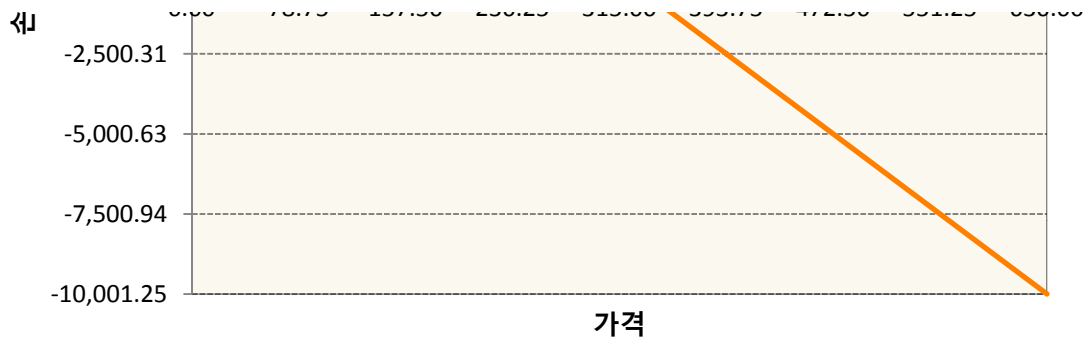
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

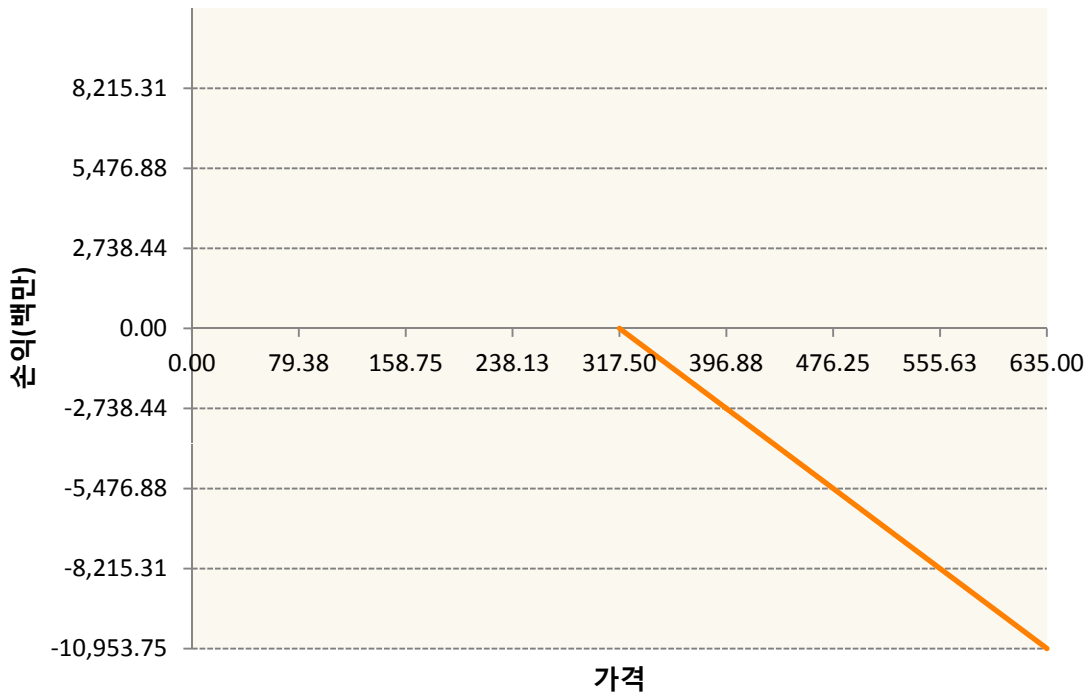


KR4201Q33155-2020-03 콜315

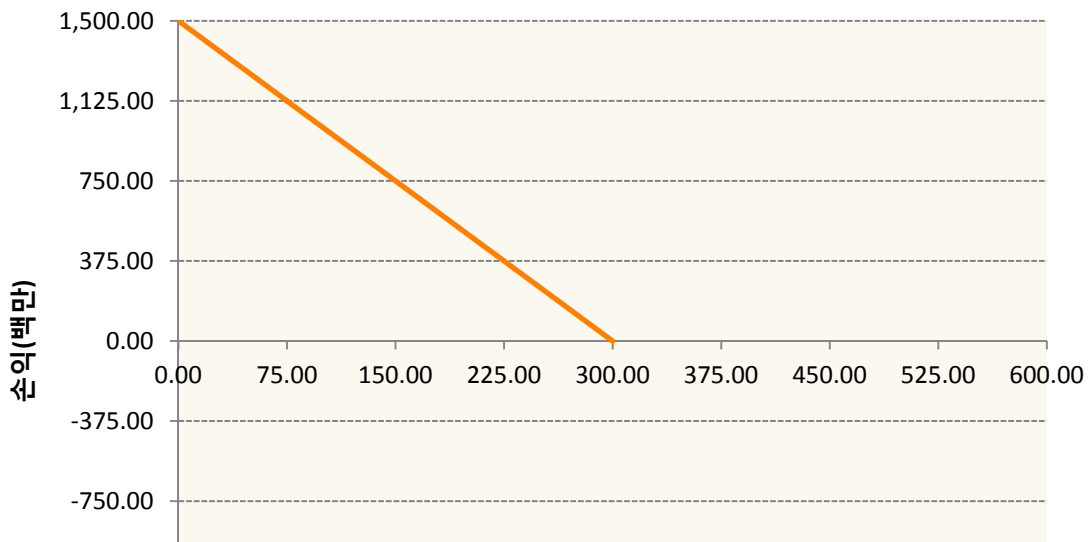


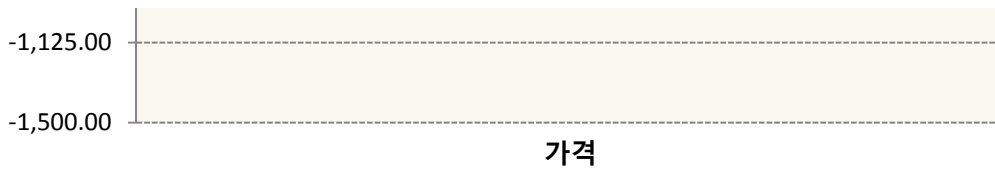


KR4201Q33171-2020-03 콜317.5

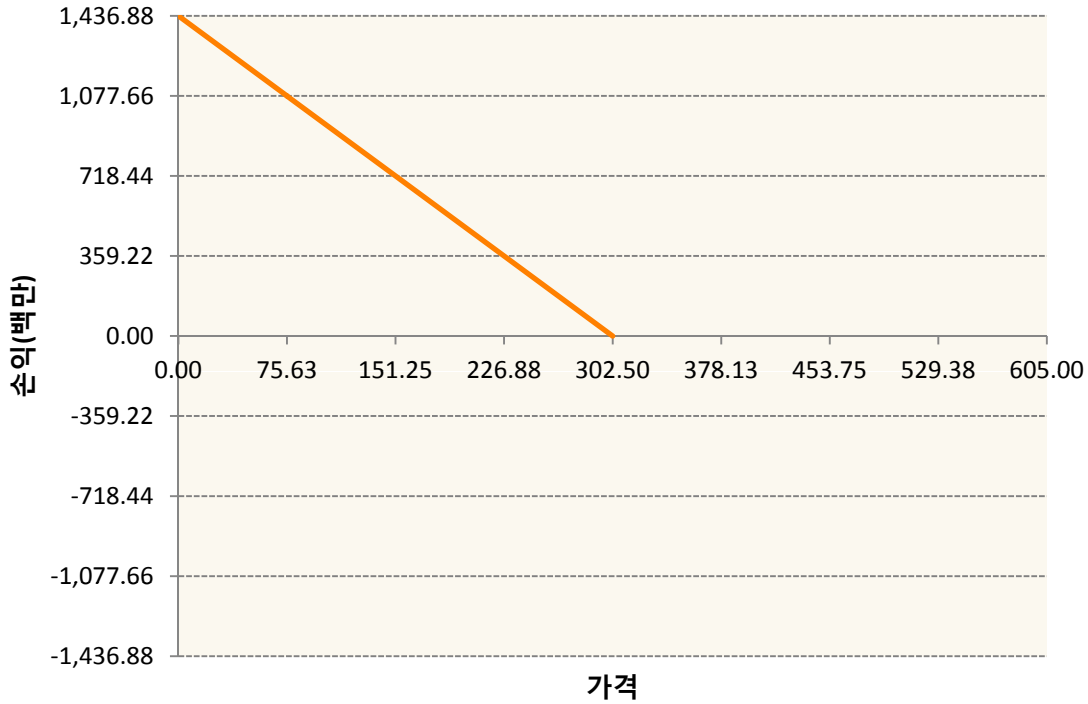


KR4301Q33005-2020-03 풋300





KR4301Q33021-2020-03 풋302.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						825
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-825	-825	-825	-825	-825	-825	-825	
-5.33%	-550	-550	-550	-550	-550	-550	-550	
-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%	550	550	550	550	550	550	550	
8.00%	825	825	825	825	825	825	825	
KR4201Q33155		2020-03 콜315						451
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	149	145	139	132	122	112	100	
-5.33%	139	130	120	107	93	78	61	
-2.67%	115	100	83	65	46	25	4	

0%	68	46	24	0	-24	-49	-74
2.67%	-12	-39	-66	-93	-120	-148	-175
5.33%	-131	-160	-188	-216	-245	-273	-301
8.00%	-290	-316	-343	-369	-396	-424	-451
KR4201Q33171 2020-03 콜317.5							463
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	141	137	132	125	116	106	94
-5.33%	132	124	114	102	89	73	56
-2.67%	112	97	81	63	43	23	1
0%	69	47	24	0	-25	-51	-77
2.67%	-6	-34	-63	-92	-121	-150	-179
5.33%	-123	-154	-184	-215	-246	-277	-308
8.00%	-282	-312	-342	-372	-402	-432	-463
KR4301Q33005 2020-03 풋300							94
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	91	91	91	92	92	93	94
-5.33%	52	53	54	55	56	57	59
-2.67%	18	19	21	23	25	27	29
0%	-7	-5	-2	0	2	5	7
2.67%	-20	-18	-16	-14	-12	-10	-8
5.33%	-25	-24	-23	-22	-20	-19	-18
8.00%	-26	-25	-25	-25	-24	-23	-22
KR4301Q33021 2020-03 풋302.5							94
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	92	92	92	92	93	93	94
-5.33%	54	55	56	56	57	59	60
-2.67%	20	21	23	25	26	28	30
0%	-7	-4	-2	0	2	4	7
2.67%	-22	-20	-18	-16	-14	-12	-10
5.33%	-29	-28	-26	-25	-24	-22	-20
8.00%	-30	-30	-30	-29	-28	-27	-26

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

(단위:백만원)

1,524

공시일	2020-02-14
기준일	2020-02-13

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	213,087	0	213,087	

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	2020-02-14
기준일	2020-02-13

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	9,443	-9,443	
누계	유가증권	수익증권	185,296	0	185,296	

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	2020-02-14
기준일	2020-02-13

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	528,794	0	528,794	
누계	통화	선도	0	514,991	-514,991	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019Z02: KRW/USD 18-02-20E	189
FX21019Z02: KRW/USD 18-02-20E	2,025
FX21019Z02: KRW/USD 18-02-20E	946
FX21019Z03: KRW/USD 24-02-20E	3,785
FX21019Z04: KRW/USD 26-02-20E	1,892
FX21019Z04: KRW/USD 26-02-20E	2,025
FX21019Z04: KRW/USD 26-02-20E	189
FX21020F01!: KRW/USD 18-02-20E	1,703
FX21020F01!: KRW/USD 18-02-20E	284
FX21020F02: KRW/USD 21-02-20E	1,892
FX21020F02: KRW/USD 21-02-20E	3,255
FX21020F02: KRW/USD 23-03-20E	1,523
FX21020F02: KRW/USD 23-03-20E	1,419
FX21020F02!: KRW/USD 28-02-20E	1,892
FX21020F03: KRW/USD 28-02-20E	2,933
FX21020F03!: KRW/USD 31-03-20E	3,028
FX21020F04: KRW/USD 31-03-20E	2,839
FX21020F04: KRW/USD 28-02-20E	189
FX21020G00: KRW/USD 06-04-20E	2,555
FX21020G00: KRW/USD 06-03-20E	2,366
FX21020G00: KRW/USD 12-03-20E	946
FX21020G01: KRW/USD 12-03-20E	1,173
FX21020G01: KRW/USD 12-03-20E	1,202
FX21020G01: KRW/USD 12-03-20E	946

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

13,832

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

(단위:백만원)

127

공시일	2020-02-14
기준일	2020-02-13

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

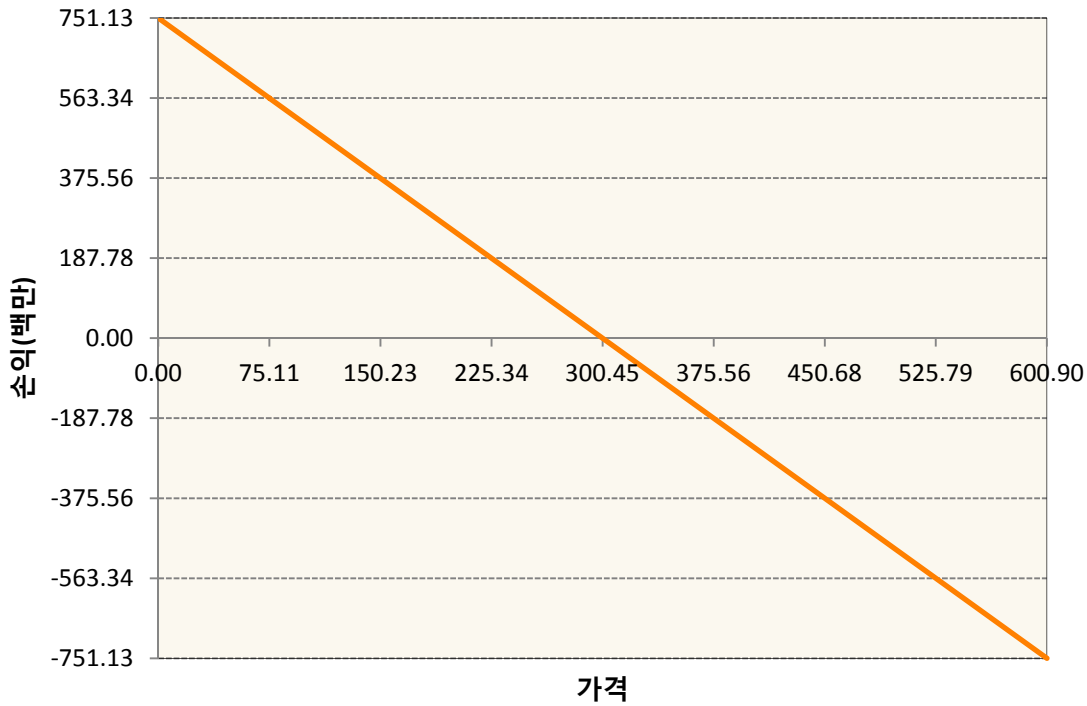
1. 계약금액

(단위:백만원)

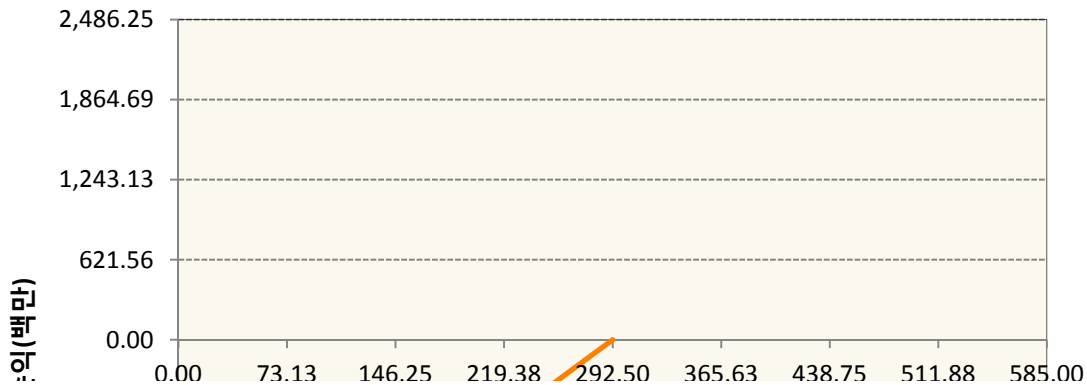
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	3,620	-3,620	장내
누계	유가증권	선물	0	751	-751	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,593	-3,593	장내

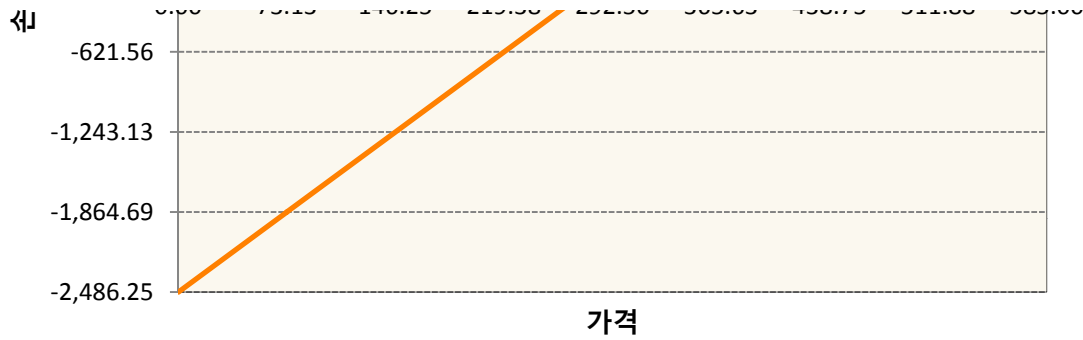
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

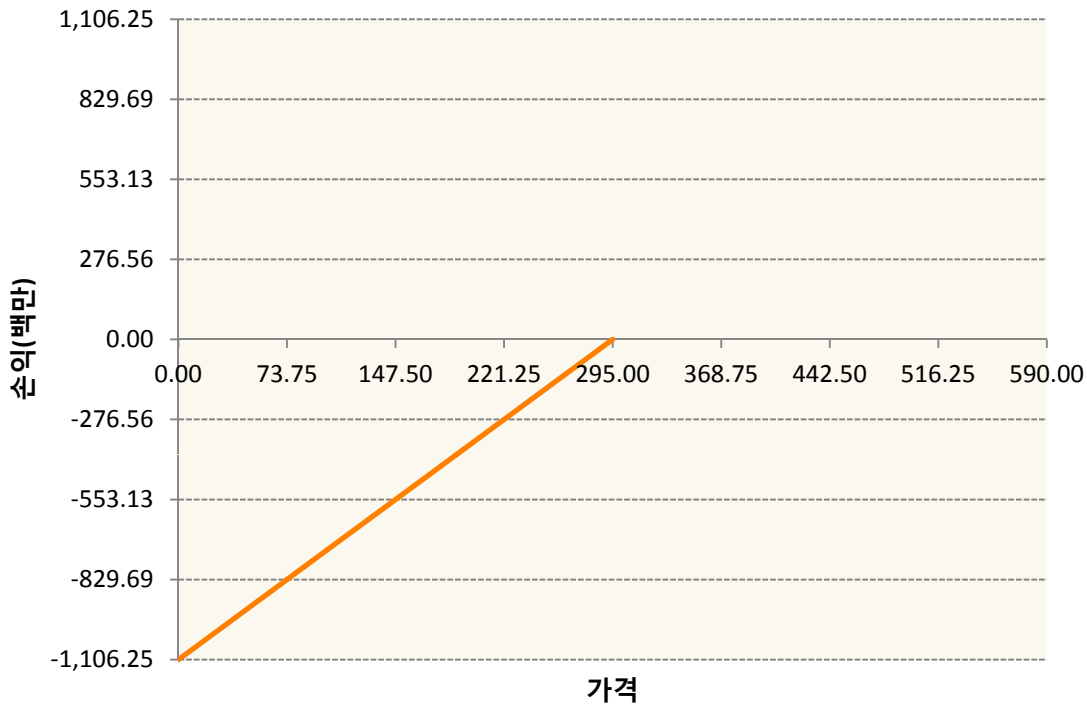


KR4301Q32924-2020-03 풋292.5





KR4301Q32957-2020-03 풋295



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	
KR4301Q32924		2020-03 풋292.5						127
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-116	-118	-119	-121	-123	-125	-127
-5.33%	-57	-60	-63	-66	-69	-73	-76
-2.67%	-14	-18	-21	-25	-29	-33	-37
0%	9	6	3	0	-3	-7	-10
2.67%	17	16	14	13	10	8	6
5.33%	19	19	18	18	17	15	14
8.00%	20	20	19	19	19	18	18
KR4301Q32957 2020-03 풋295							61
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-57	-58	-58	-59	-59	-60	-61
-5.33%	-30	-31	-32	-33	-35	-36	-37
-2.67%	-8	-10	-12	-13	-15	-17	-18
0%	5	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	10	9	8	7	6	5	4
5.33%	11	11	11	10	10	9	8
8.00%	12	12	11	11	11	11	10

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

(단위:백만원)

222

공시일	2020-02-14
기준일	2020-02-13

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	365	-365	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	11,349	0	11,349	
누계	통화	선도	355	11,804	-11,450	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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	322
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	89
FX21020G02 USD/KRW 28-02-20E	28
FX21020G02 KRW/USD 18-02-20E	28
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

327

공시일	2020-02-14
기준일	2020-02-13

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

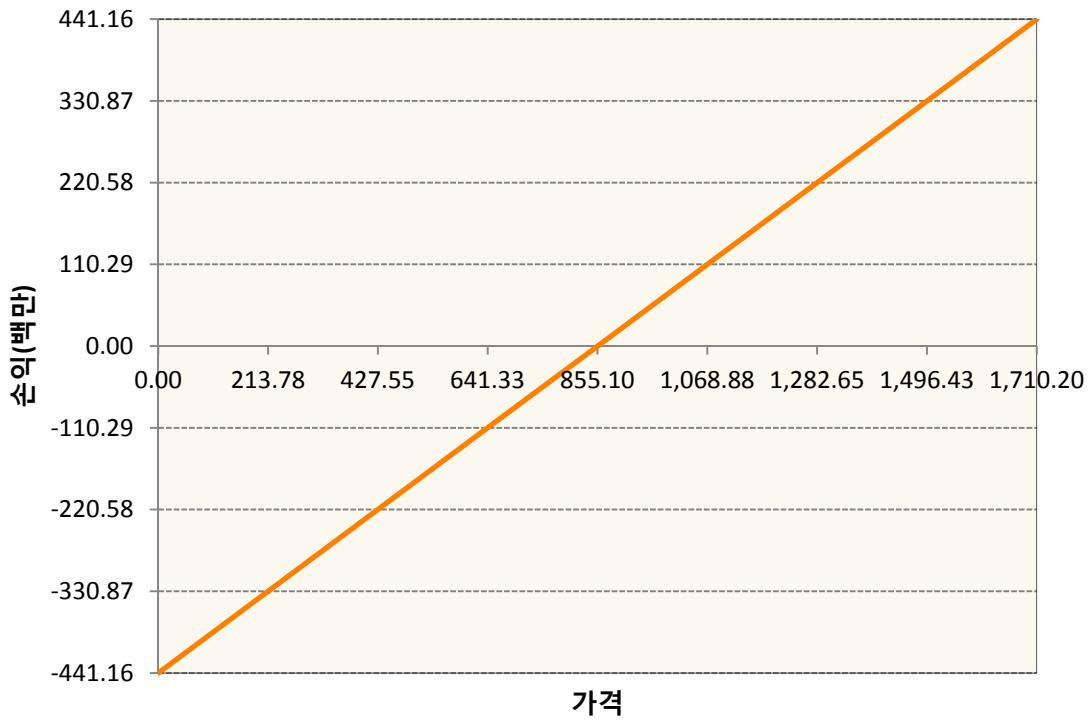
1. 계약금액

(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	441	0	441	
누계	유가증권	스왑	1,061	0	1,061	장외
누계	통화	선도	180	682	-502	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	35

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

(단위:백만원)

114

공시일	2020-02-14
기준일	2020-02-13

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

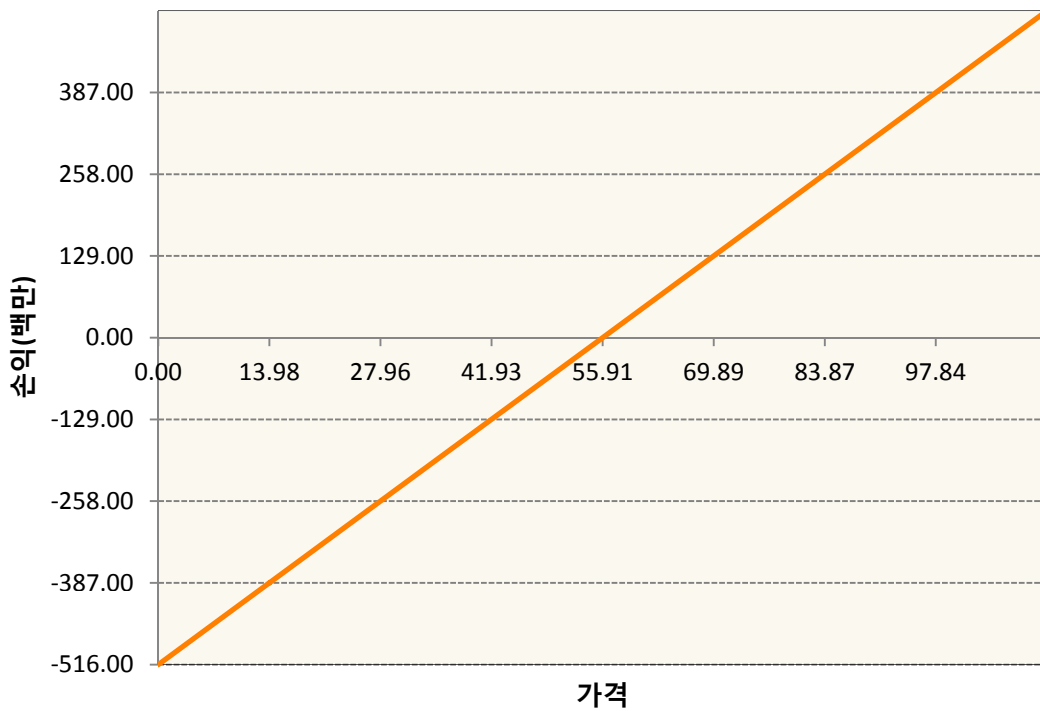
1. 계약금액

(단위:백만원)

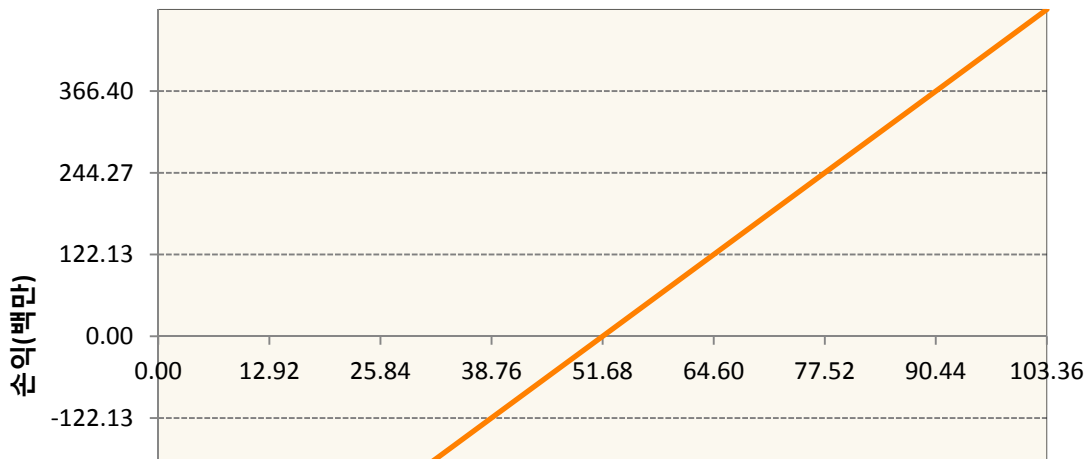
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,136	189	1,946	

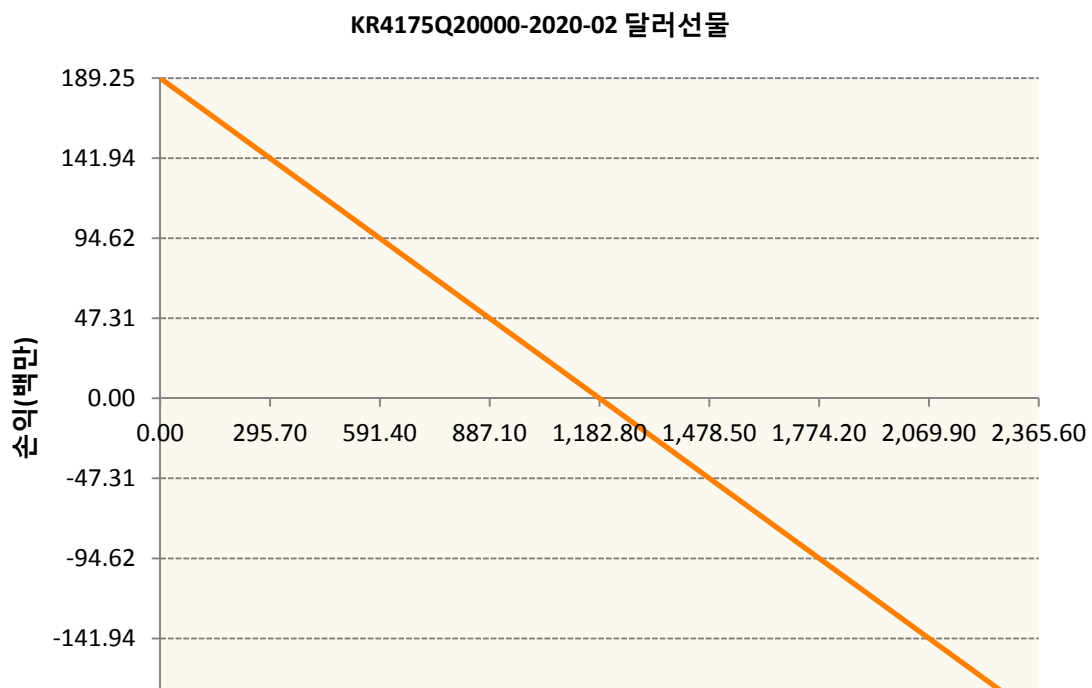
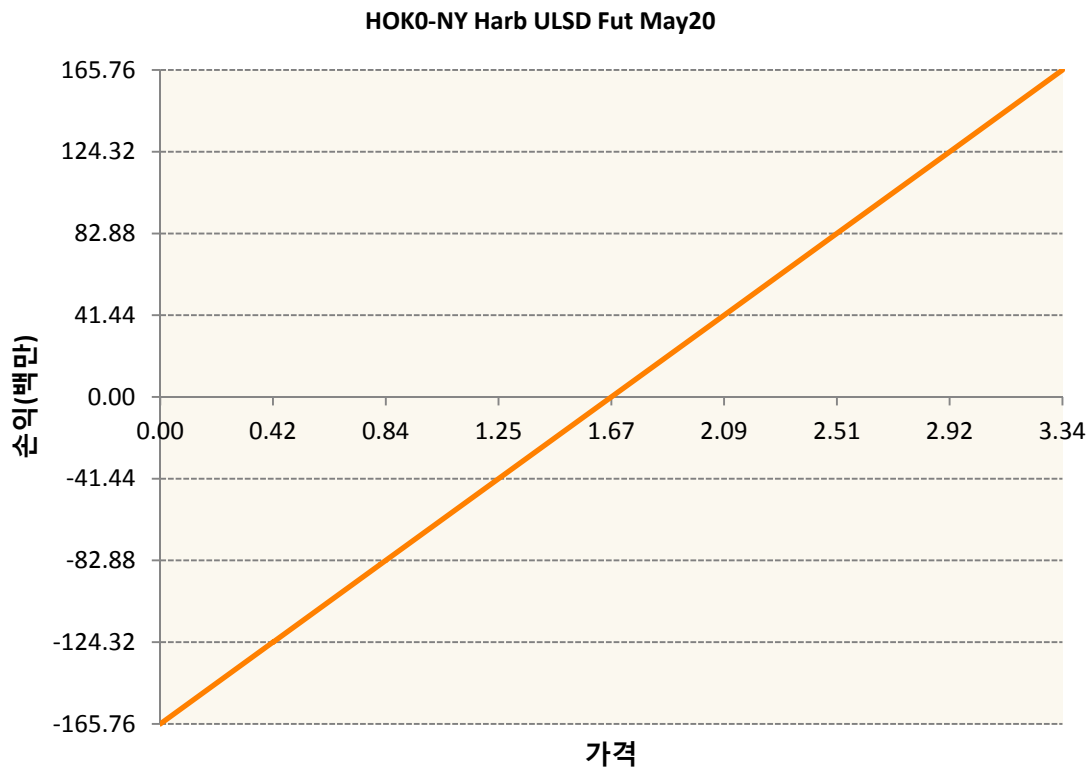
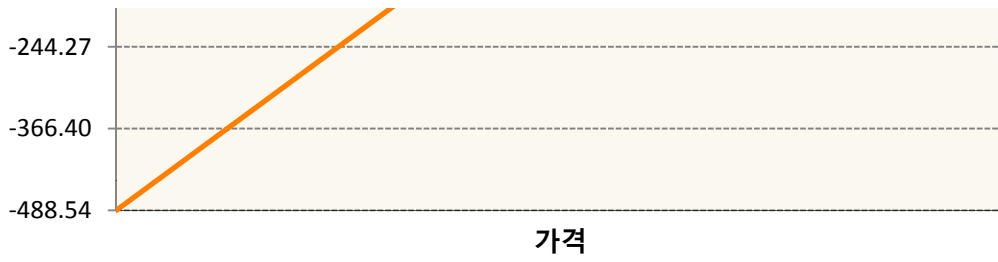
2. 만기시점의 손익구조

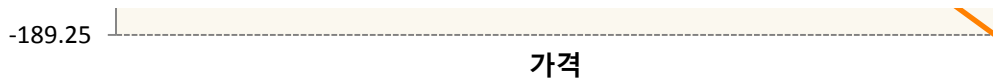
COK0-BRENT CRUDE FUTR May20



CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20



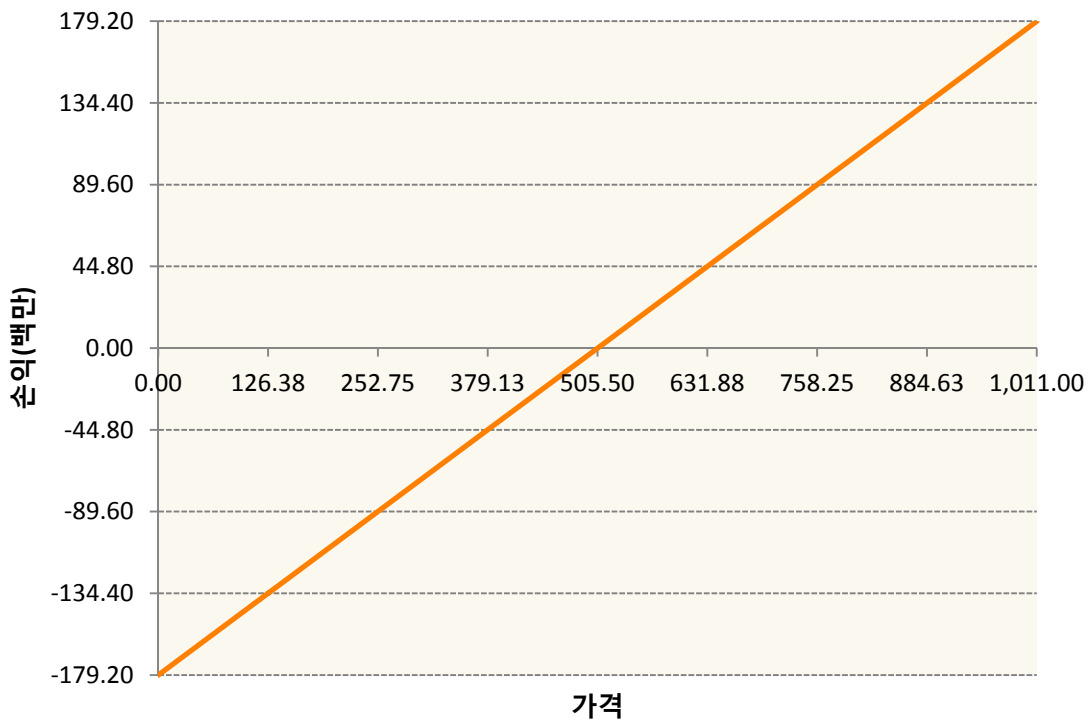




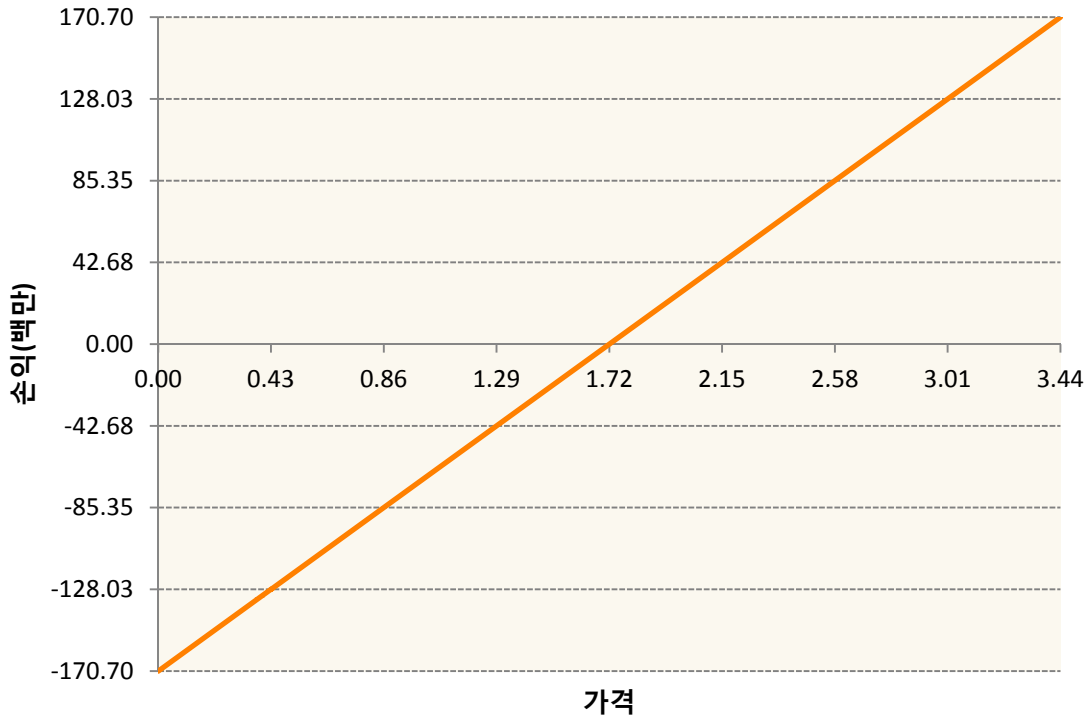
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



QSK0-Low Su Gasoil G Mar20



XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	41
CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	39
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	13
KR4175Q20C	2020-02 달러선물	15
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	49
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	14
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	14

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

(단위:백만원)

342

공시일	2020-02-14
기준일	2020-02-13

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

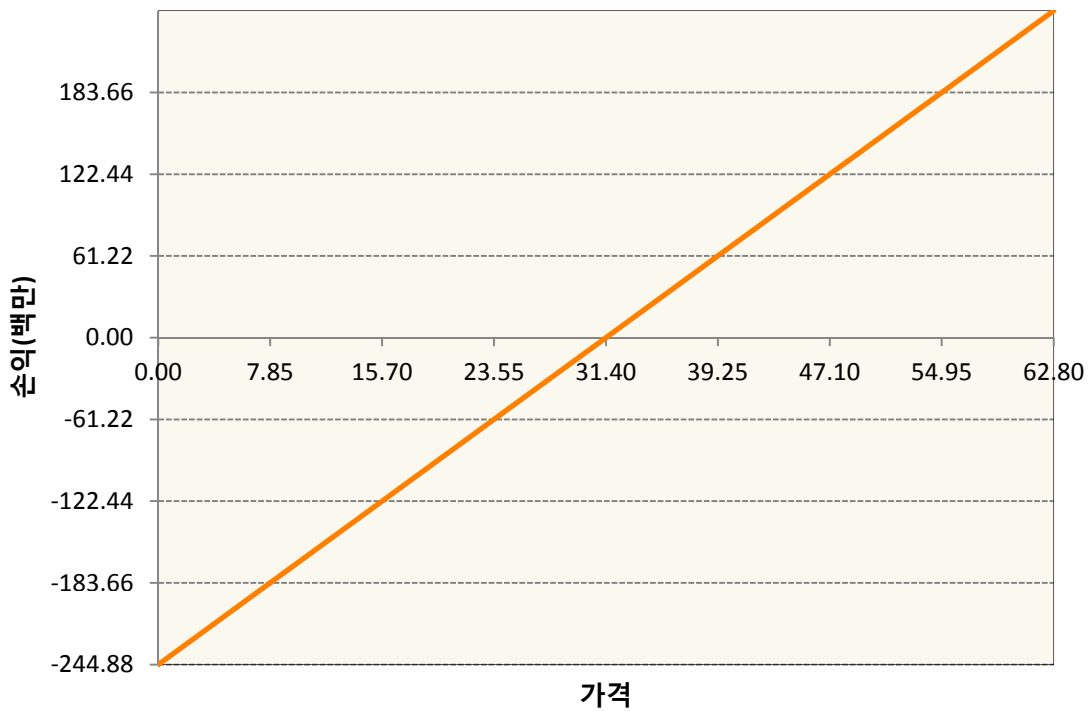
1. 계약금액

(단위:백만원)

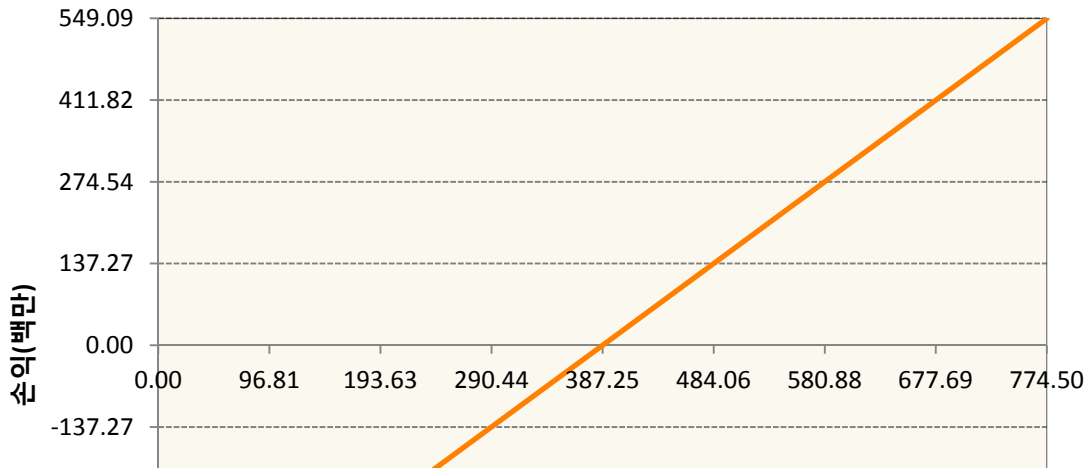
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,746	154	2,592	

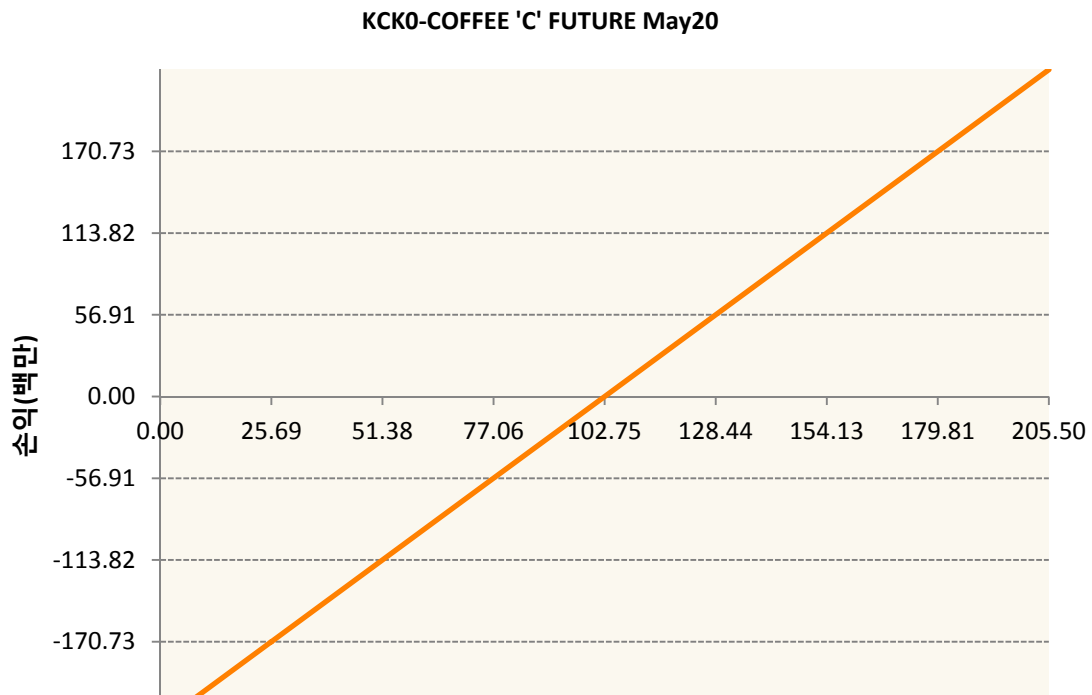
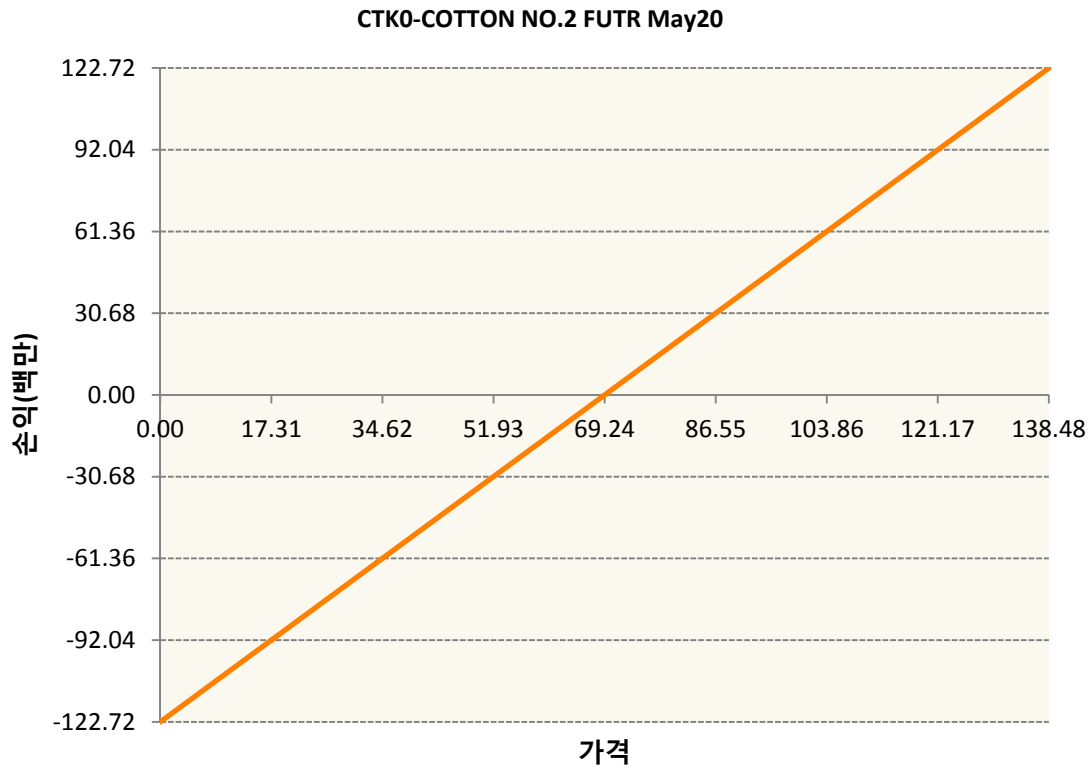
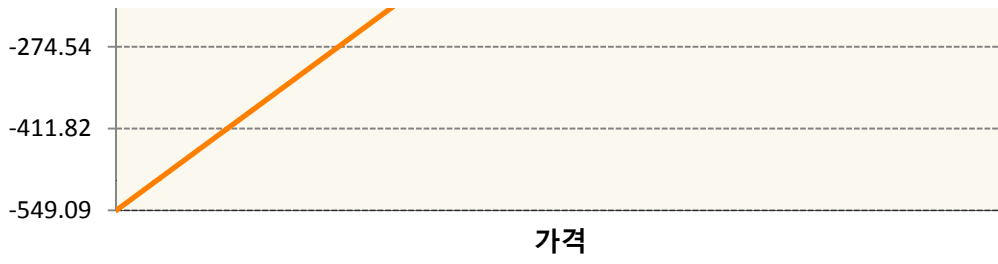
2. 만기시점의 손익구조

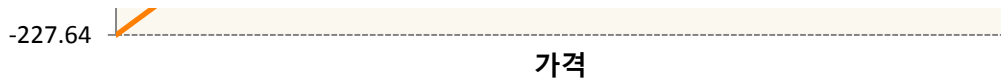
BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20



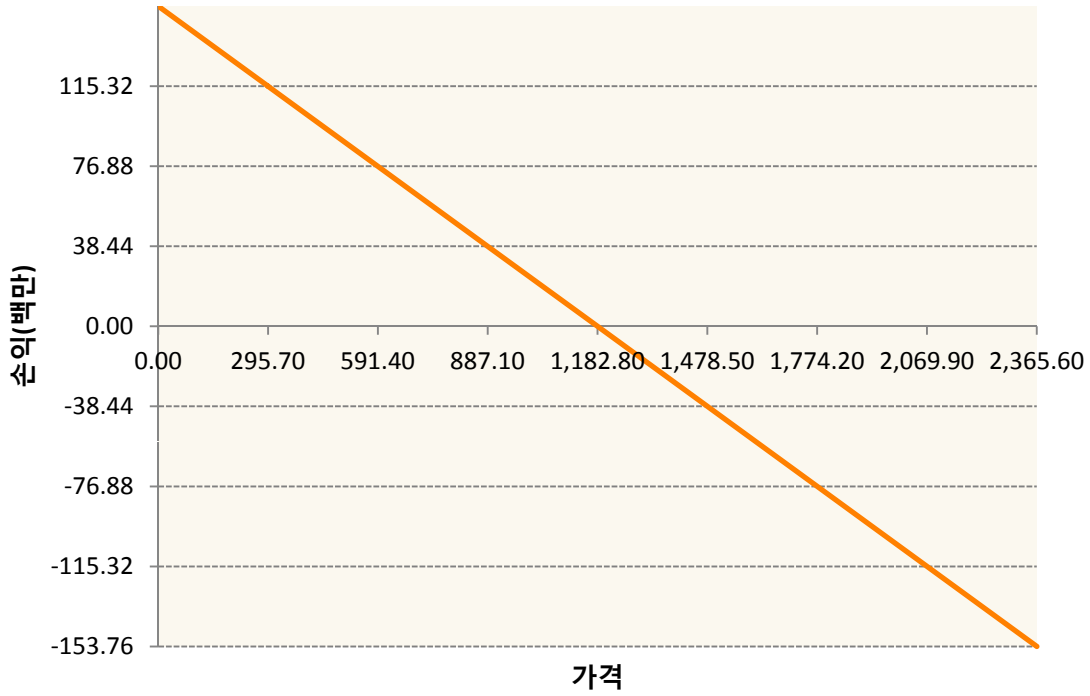
CK0-CORN FUTURE May20



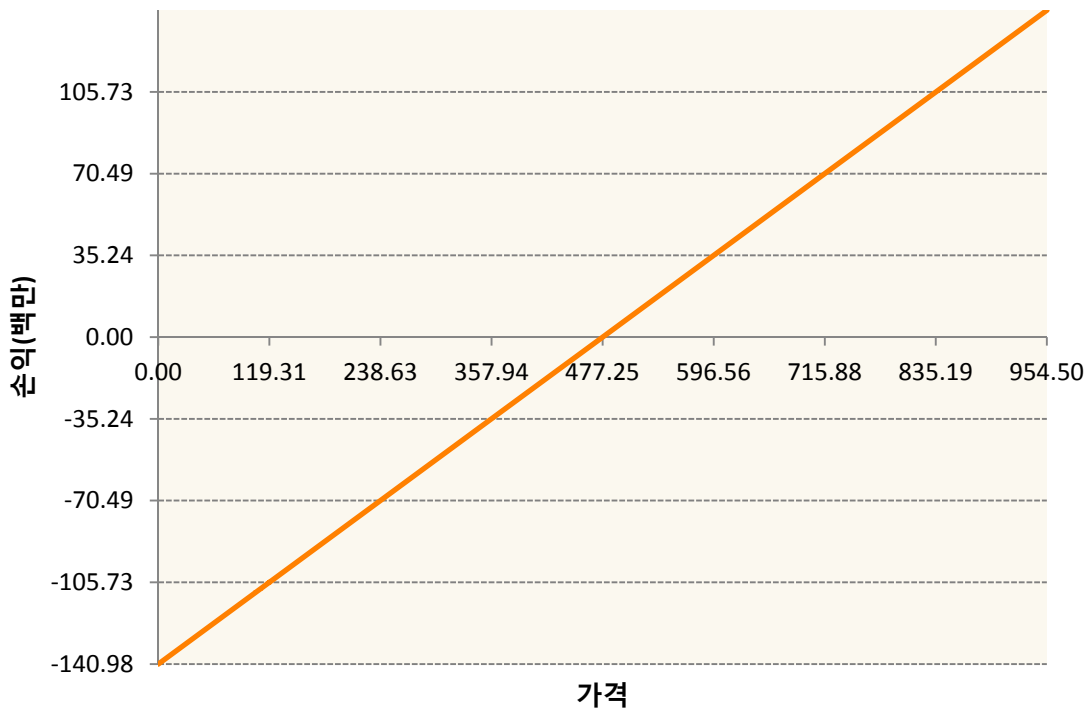




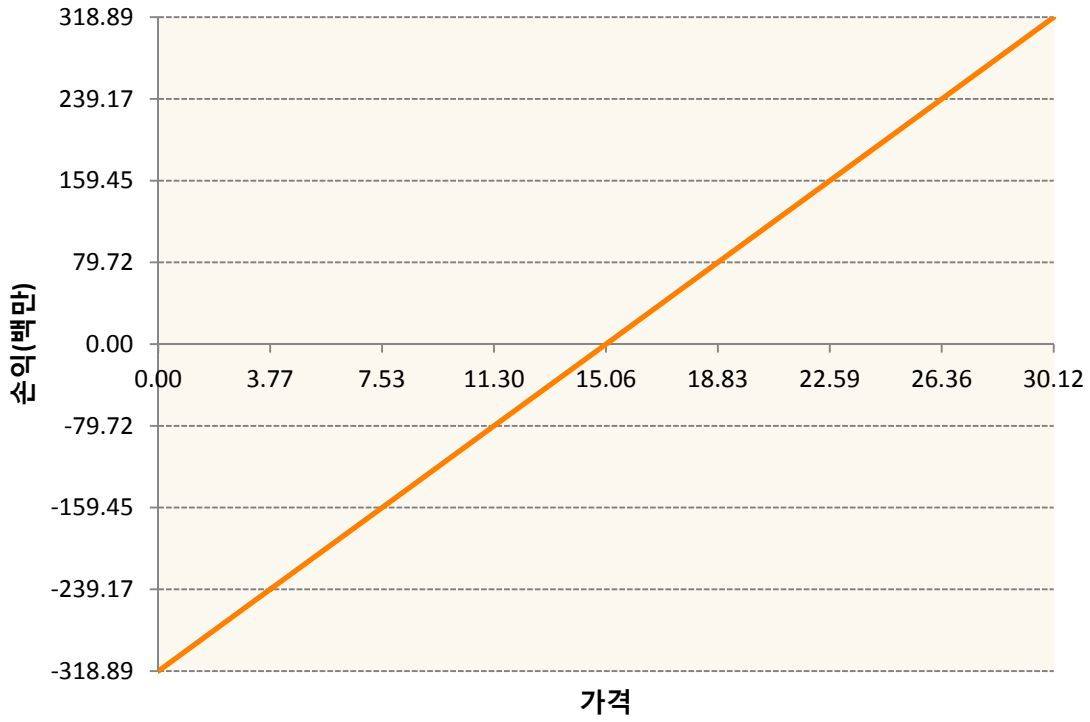
KR4175Q20000-2020-02 달러선물



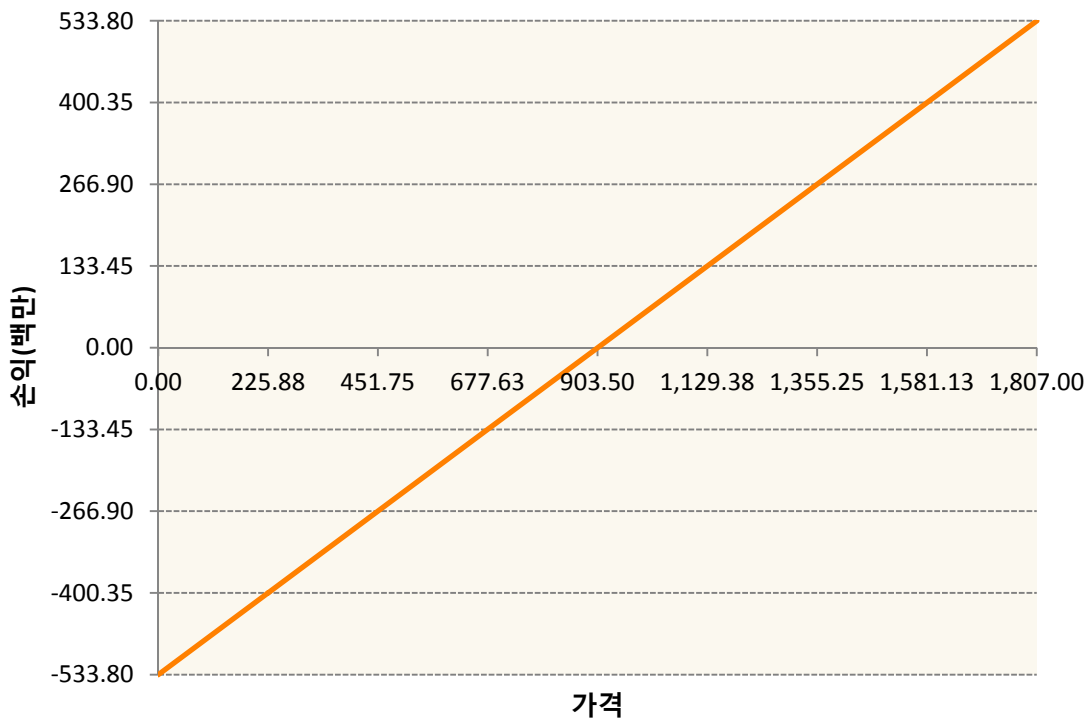
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



SBK0-Sugar May20

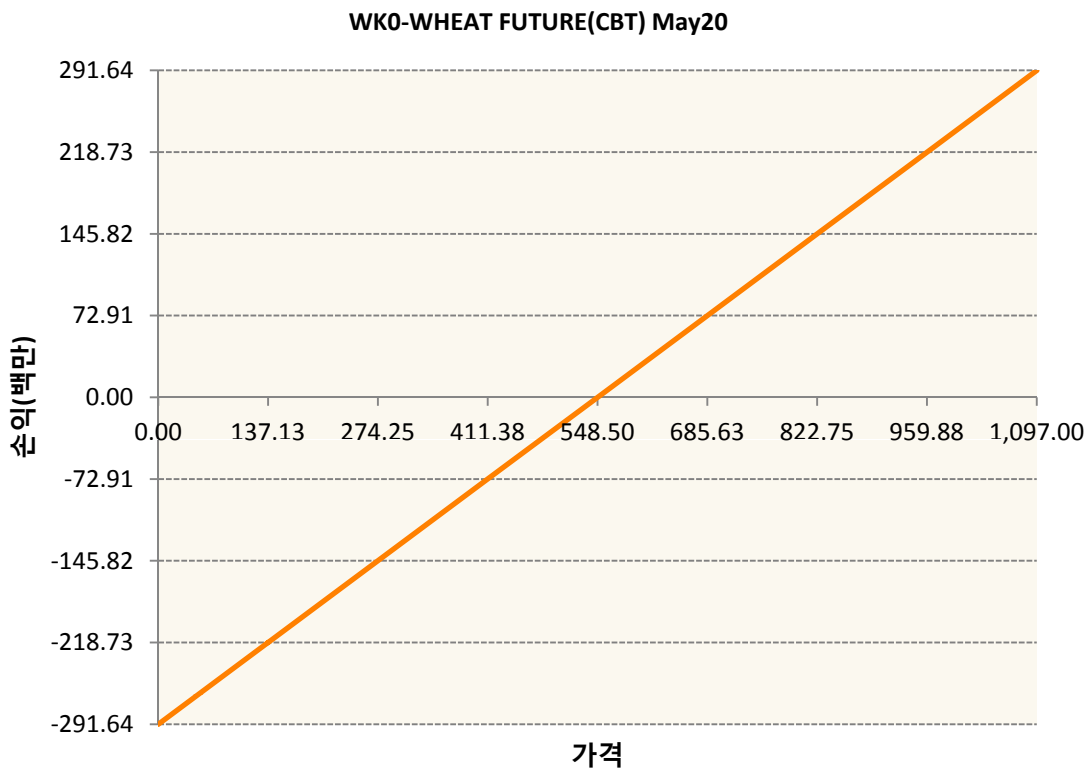
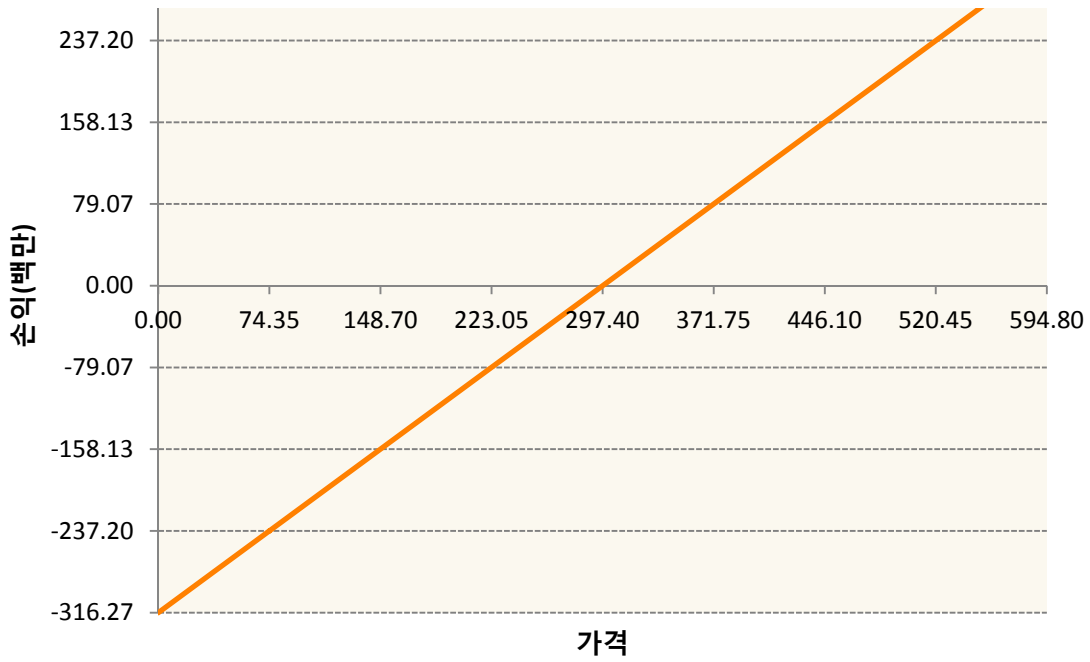


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	20
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	26
SK0	SOYBEAN FUTURE May20	43
SMK0	SOYBEAN MEAL FUTR May20	25
WK0	WHEAT FUTURE(CBT) May20	23

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

(단위:백만원)

238