

공시일	2020-02-17
기준일	2020-02-14

## 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	2020-02-17
기준일	2020-02-14

## 스마트인덱스모

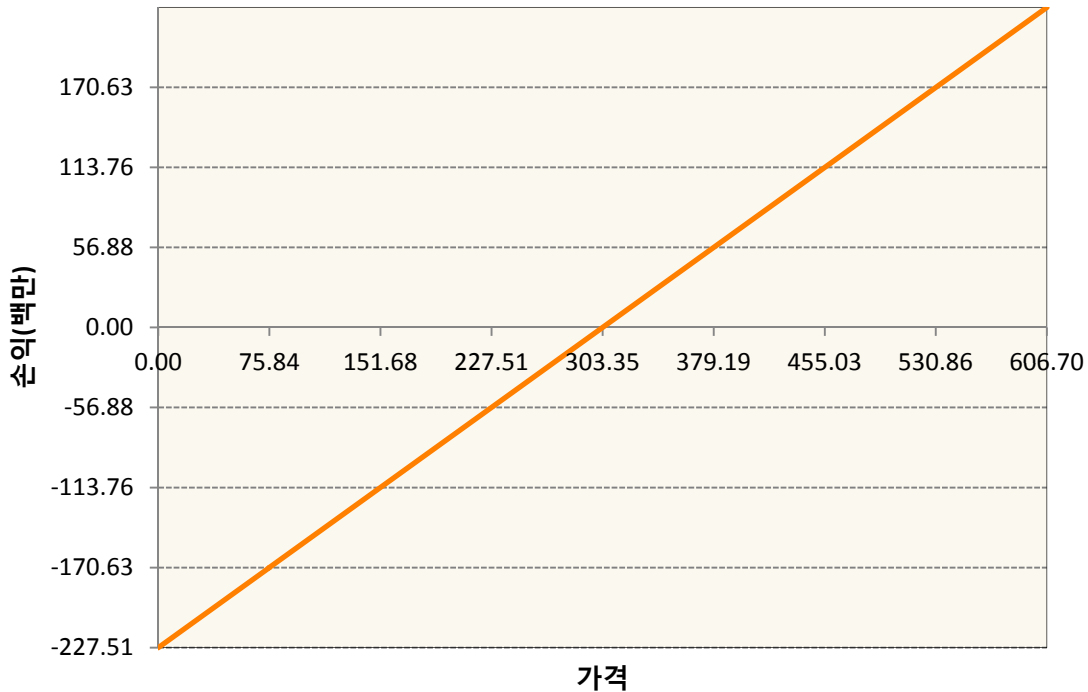
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	228	0	228	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	2020-02-17
기준일	2020-02-14

## 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

1,165

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

678

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-17
기준일	2020-02-14

## 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)

889

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-17
기준일	2020-02-14

## 유로인덱스모(주식-파생형)

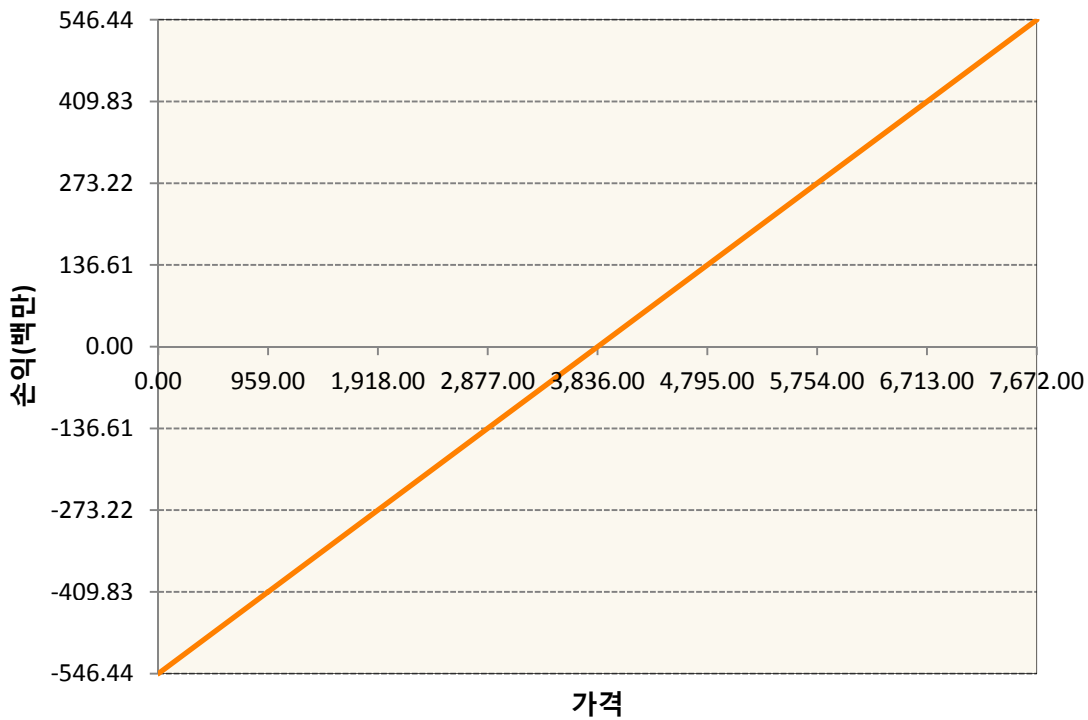
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	546	0	546	

### 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	2020-02-17
기준일	2020-02-14

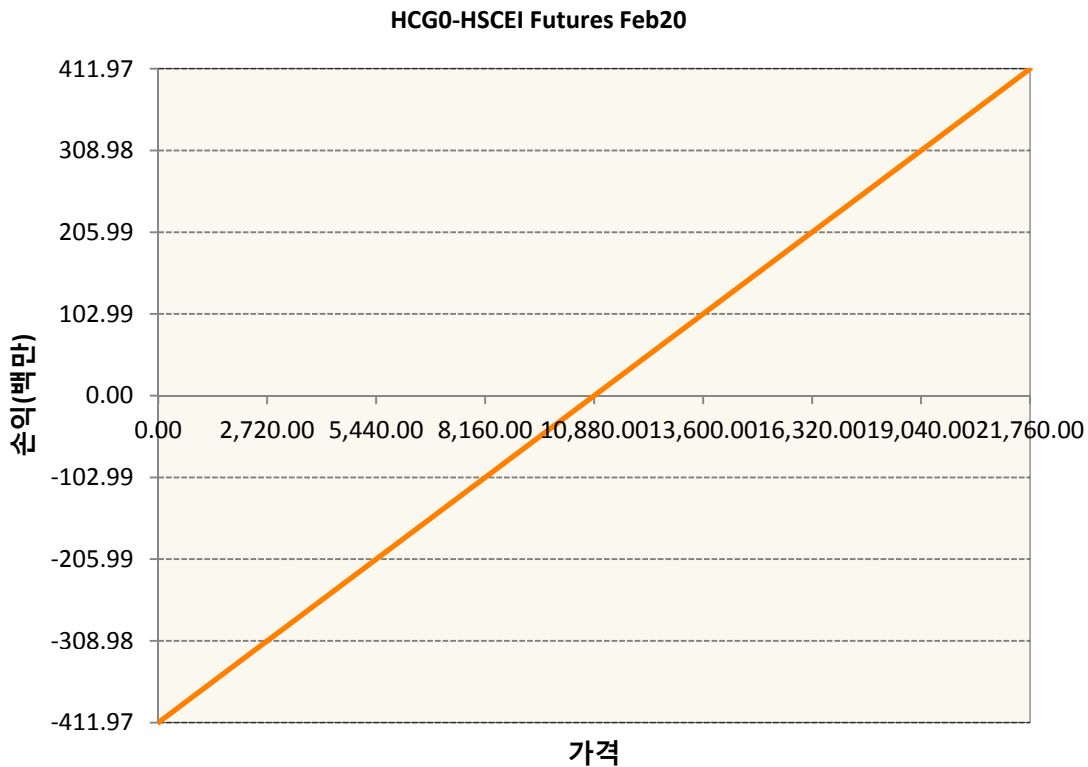
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	412	0	412	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	2020-02-17
기준일	2020-02-14

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

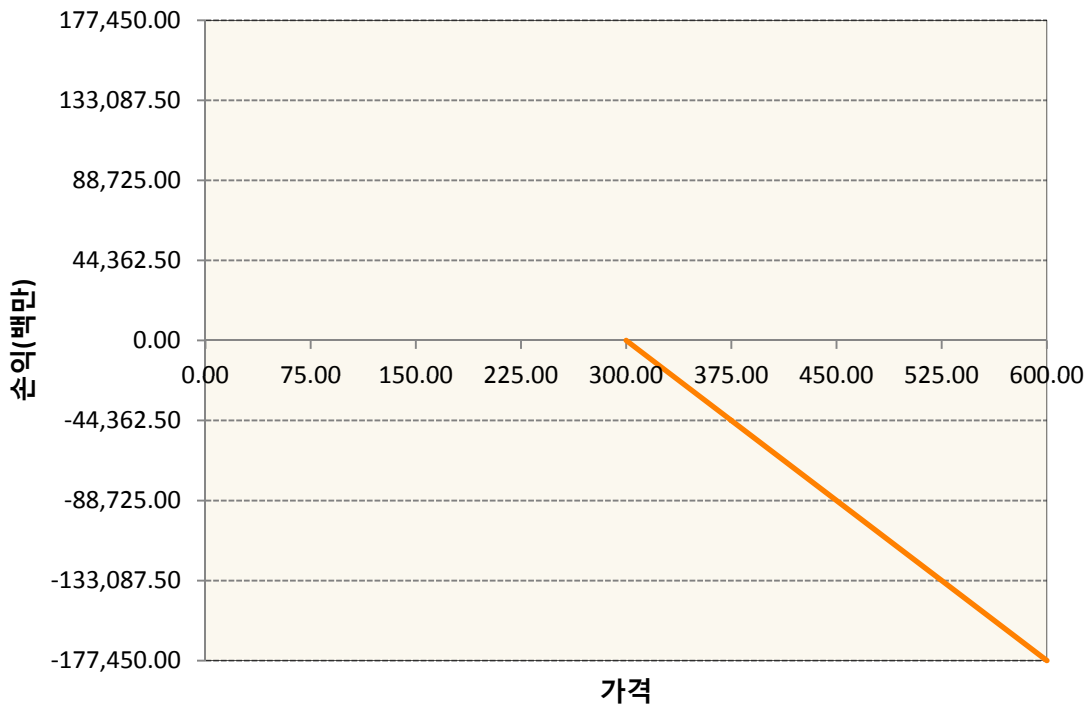
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

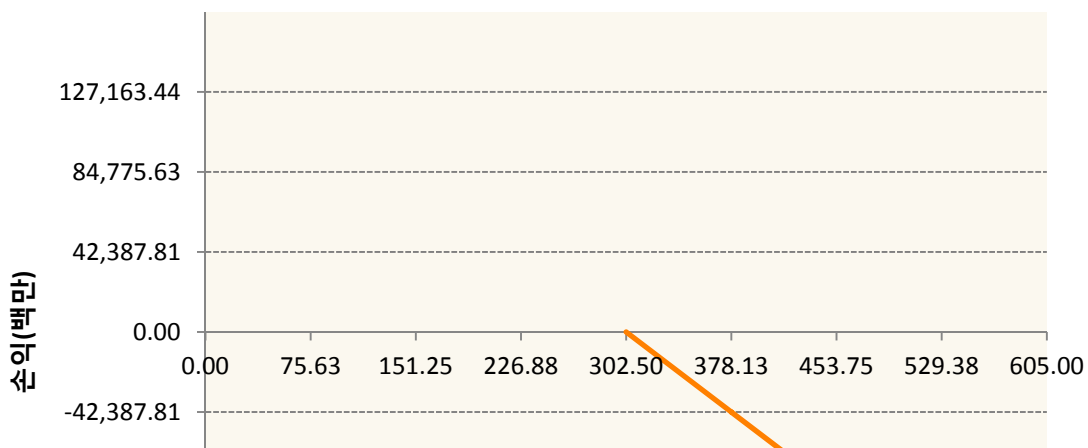
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	229,436	-229,436	장내
누계	유가증권	옵션	0	455,751	-455,751	장내

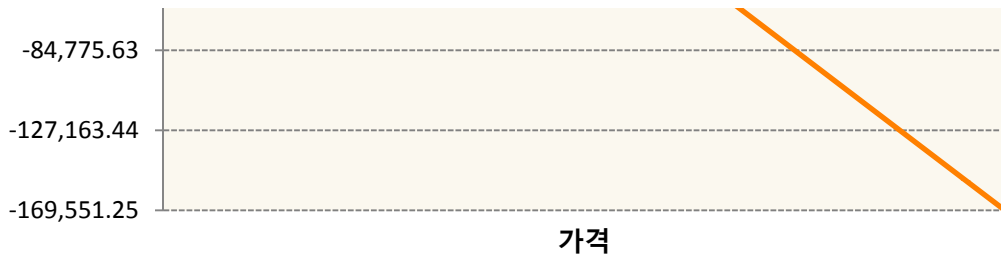
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q33007-2020-03 콜300

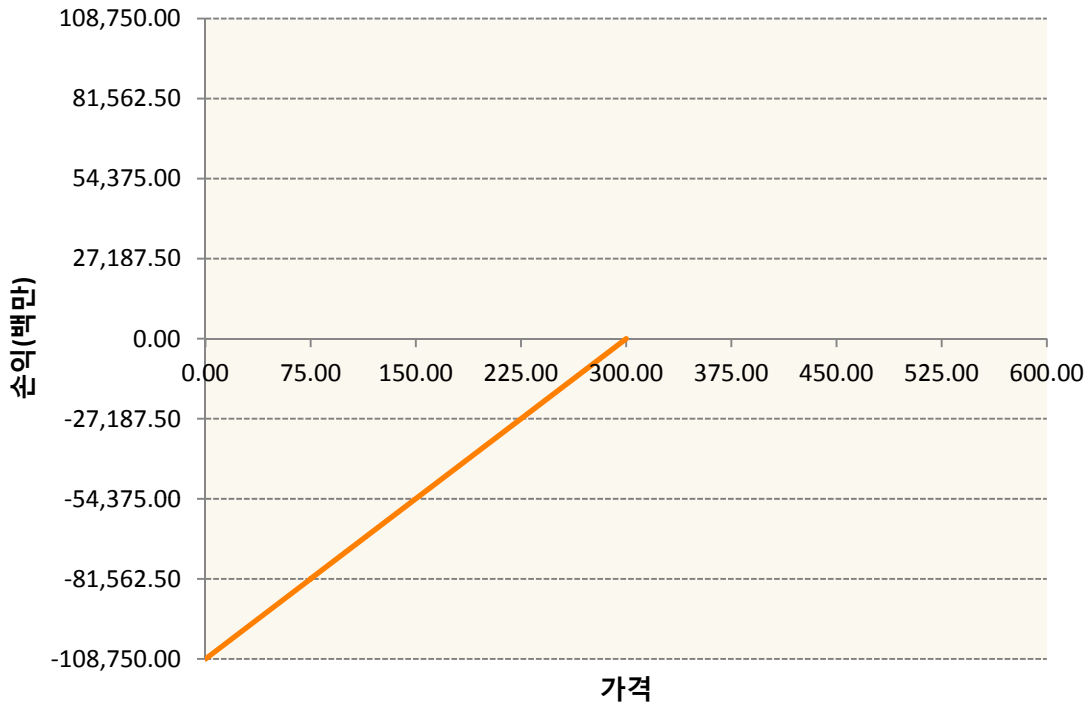


KR4201Q33023-2020-03 콜302.5





KR4301Q33005-2020-03 풋300



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q33007		2020-03 콜300					11,399
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,201	5,946	5,661	5,350	5,018	4,669	4,305
-5.33%	5,334	4,952	4,554	4,143	3,722	3,293	2,857
-2.67%	3,801	3,328	2,853	2,376	1,897	1,417	936
0%	1,474	983	492	0	-492	-985	-1,478
2.67%	-1,637	-2,071	-2,516	-2,971	-3,432	-3,899	-4,370
5.33%	-5,400	-5,731	-6,088	-6,467	-6,864	-7,275	-7,697
8.00%	-9,625	-9,845	-10,102	-10,390	-10,705	-11,042	-11,399
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5					10,438
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,306	5,097	4,856	4,588	4,298	3,990	3,665



공시일	2020-02-17
기준일	2020-02-14

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

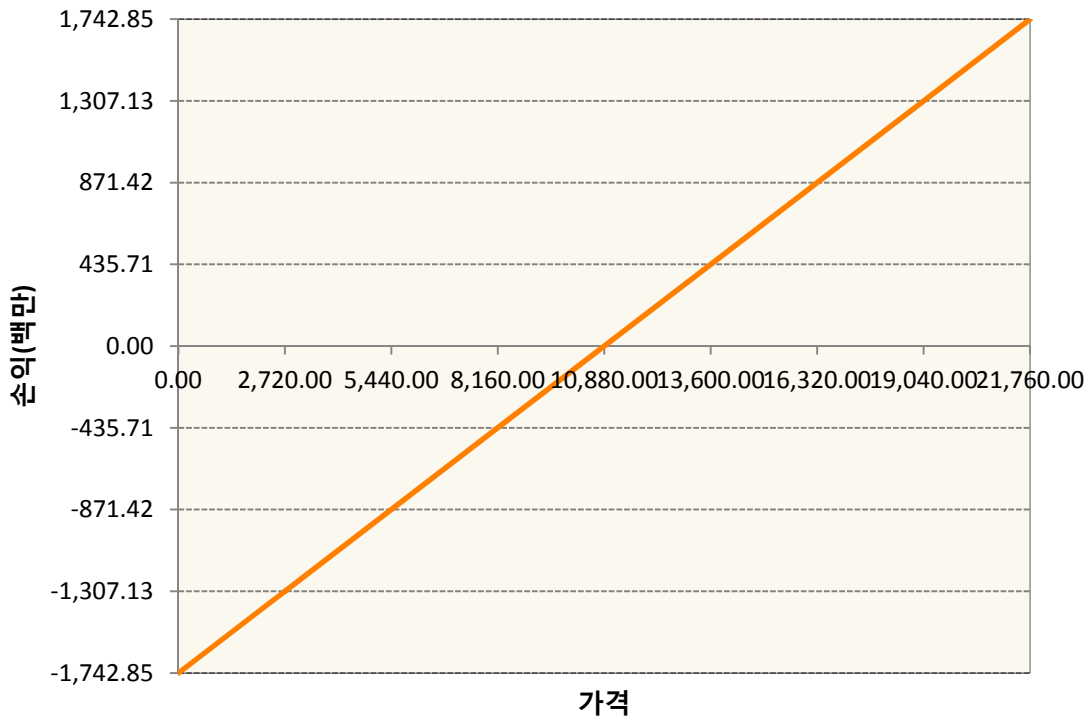
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

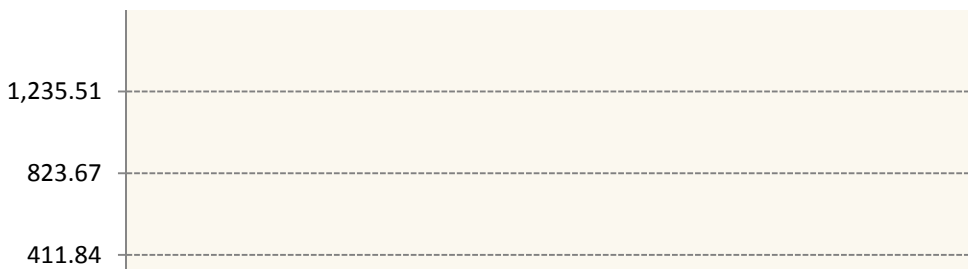
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,743	0	1,743	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,484	-4,484	장내
누계	통화	선도	0	2,145	-2,145	장외

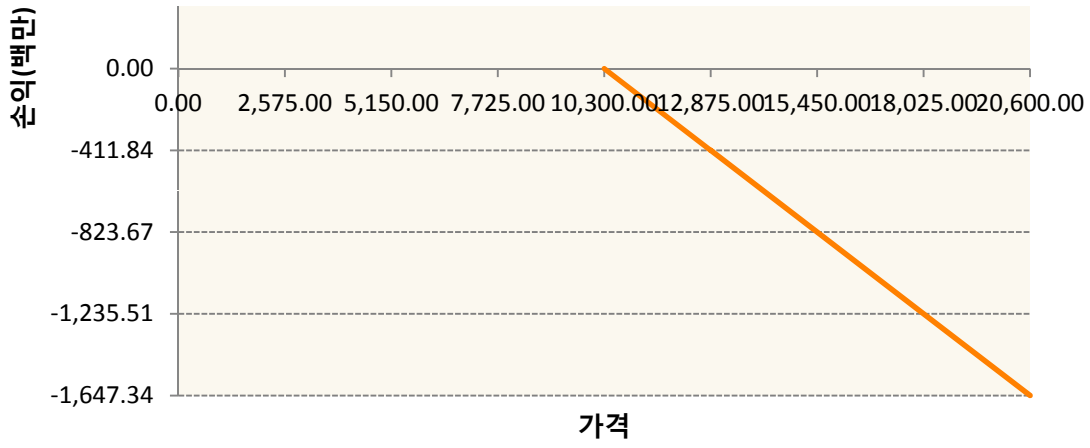
### 2. 만기시점의 손익구조

HCG0-HSCEI Futures Feb20

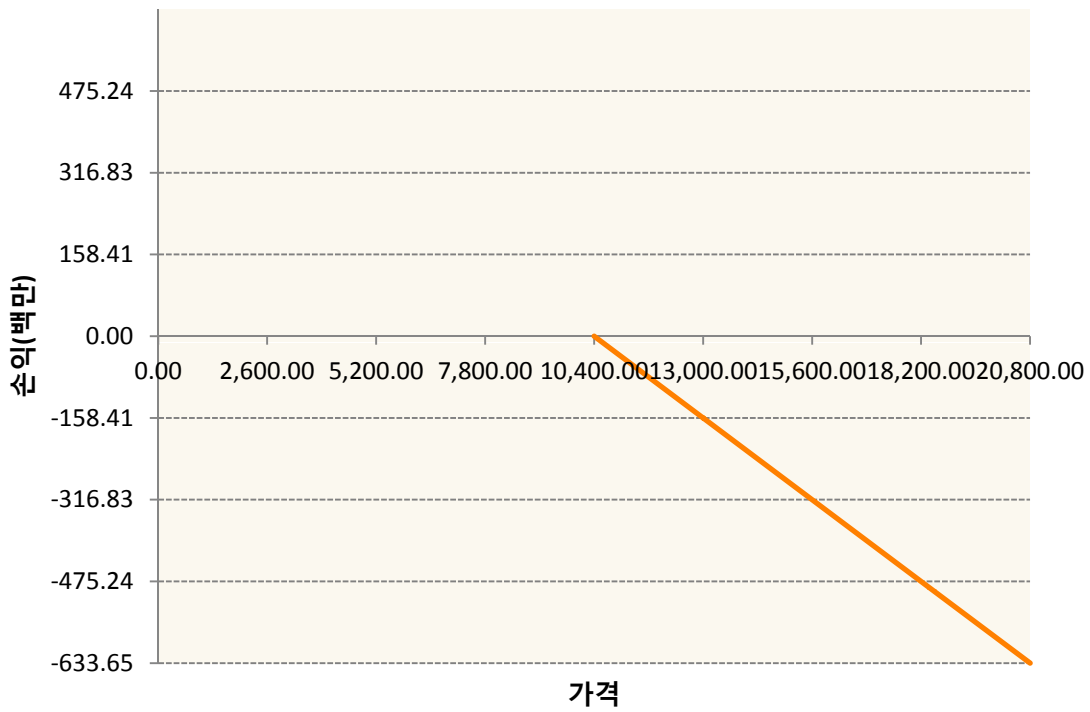


OHHIG0-C103-HSCEI

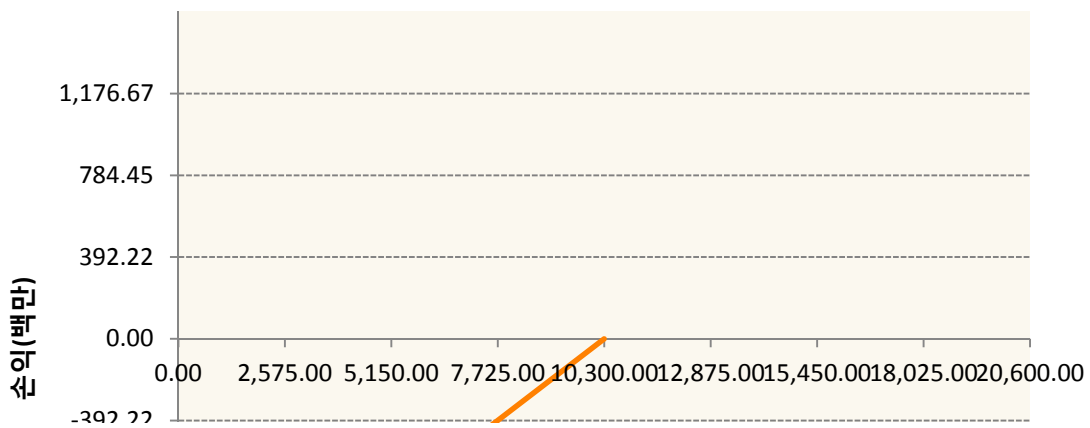


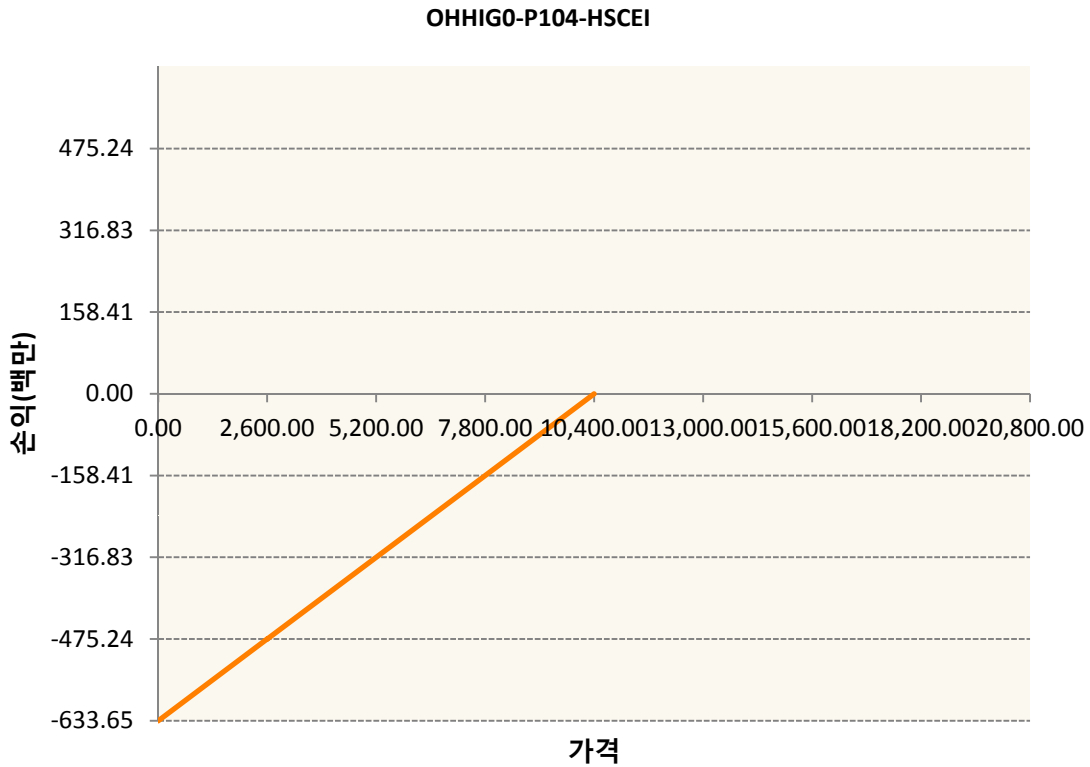


OHHIG0-C104-HSCEI



OHHIG0-P103-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	172
HCG0 HSCEI Futures Feb20	139
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)
	<b>509</b>

공시일	2020-02-17
기준일	2020-02-14

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

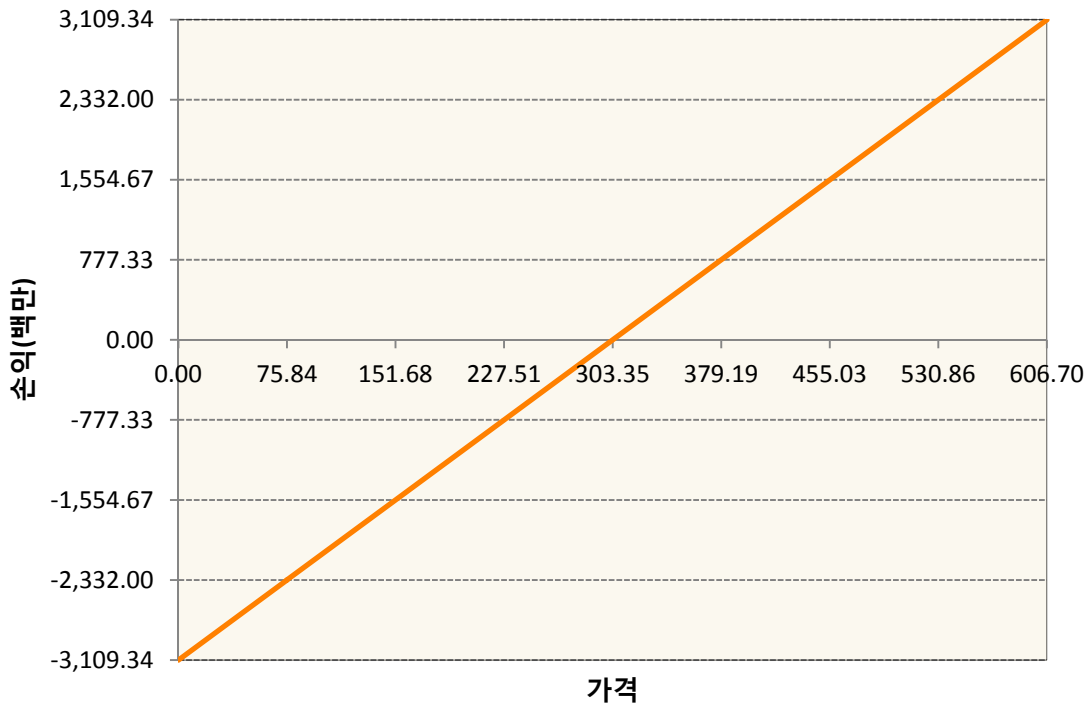
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

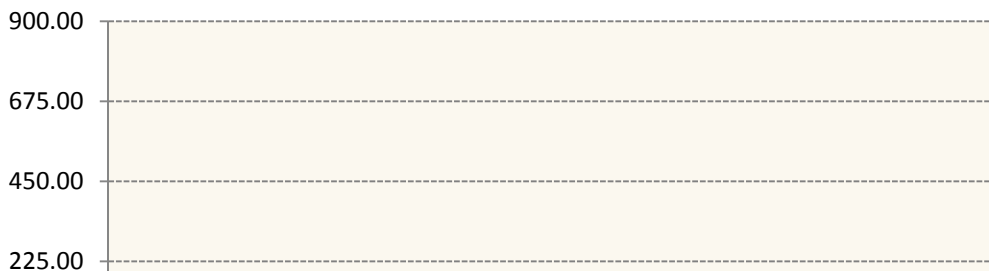
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	5,662	-5,662	장내
누계	유가증권	선물	3,109	0	3,109	장내
누계	유가증권	스왑	6,125	0	6,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	5,568	-5,568	장내

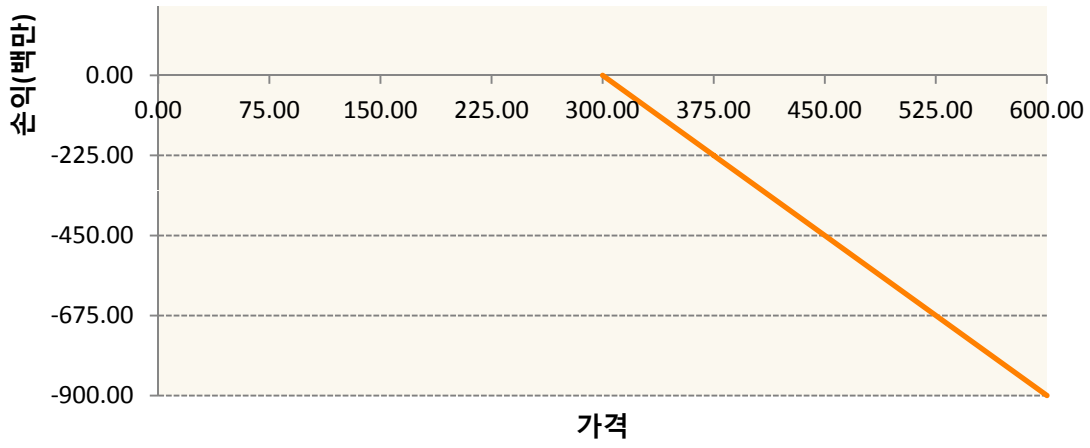
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

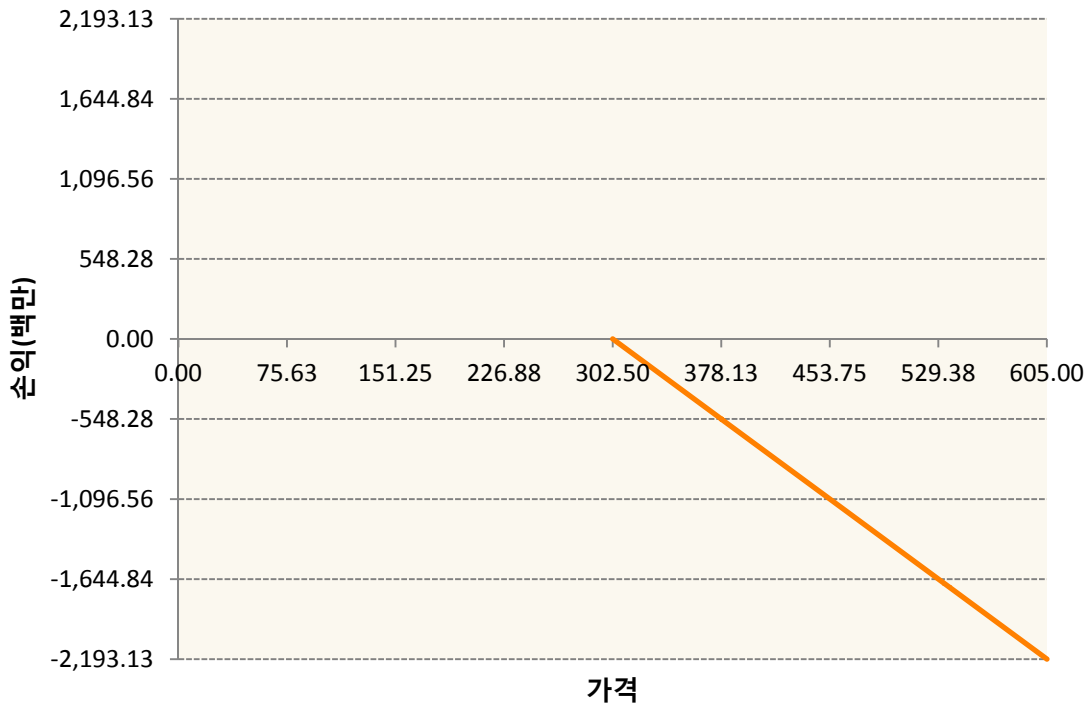


KR4201Q33007-2020-03 콜300

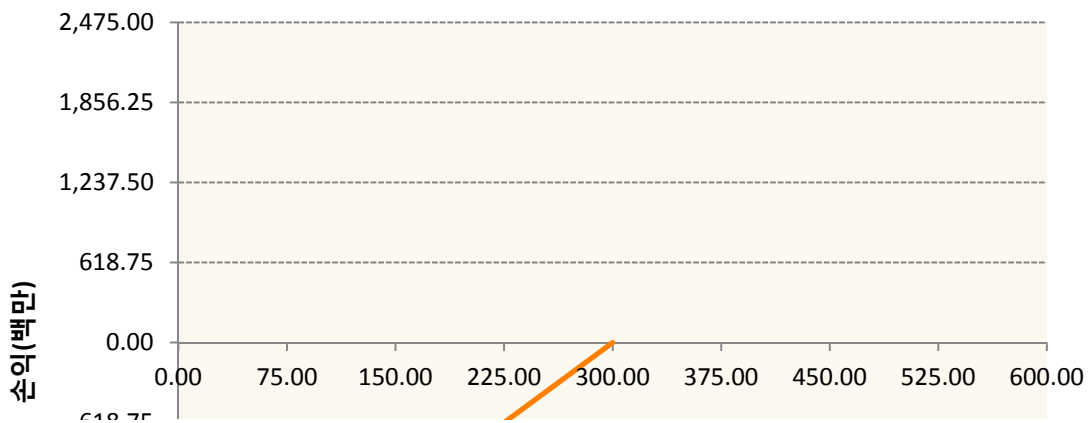


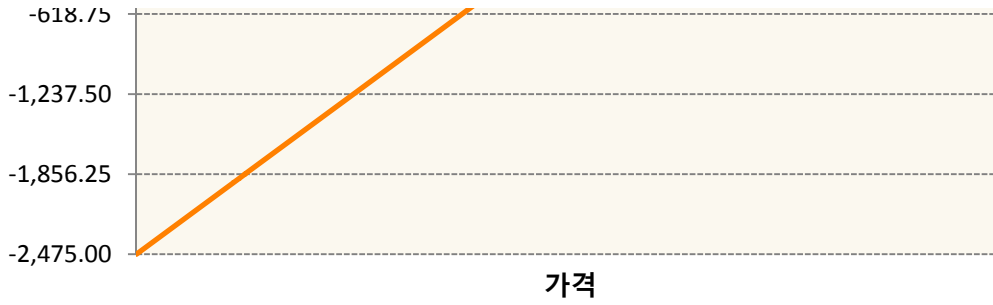


KR4201Q33023-2020-03 콜302.5



KR4301Q33005-2020-03 풋300





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						526
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-526	-526	-526	-526	-526	-526	-526	
-5.33%	-351	-351	-351	-351	-351	-351	-351	
-2.67%	-175	-175	-175	-175	-175	-175	-175	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	175	175	175	175	175	175	175	
5.33%	351	351	351	351	351	351	351	
8.00%	526	526	526	526	526	526	526	
KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						248
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-248	-248	-248	-248	-248	-248	-248	
-5.33%	-166	-166	-166	-166	-166	-166	-166	
-2.67%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	83	83	83	83	83	83	83	
5.33%	166	166	166	166	166	166	166	
8.00%	248	248	248	248	248	248	248	
KR4201Q33007		2020-03 콜300						58
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	31	30	29	27	25	24	22	
-5.33%	27	25	23	21	19	17	14	
-2.67%	19	17	14	12	10	7	5	
0%	7	5	2	0	-2	-5	-7	
2.67%	-8	-11	-13	-15	-17	-20	-22	
5.33%	-27	-29	-31	-33	-35	-37	-39	
8.00%	-49	-50	-51	-53	-54	-56	-58	
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5						135
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	69	66	63	59	56	52	47
-5.33%	60	56	51	46	41	36	31
-2.67%	44	38	33	27	21	15	9
0%	18	12	6	0	-6	-12	-18
2.67%	-17	-23	-28	-34	-40	-46	-52
5.33%	-61	-65	-70	-75	-80	-86	-91
8.00%	-111	-114	-118	-122	-126	-130	-135
KR4301Q33005                      2020-03 풋300							148
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-142	-142	-143	-144	-145	-146	-148
-5.33%	-78	-80	-82	-84	-87	-89	-92
-2.67%	-25	-28	-31	-35	-38	-42	-46
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	28	26	23	20	17	14	11
5.33%	33	33	31	30	28	26	24
8.00%	35	34	34	33	33	32	30

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

(단위:백만원)

**1,058**

공시일	2020-02-17
기준일	2020-02-14

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

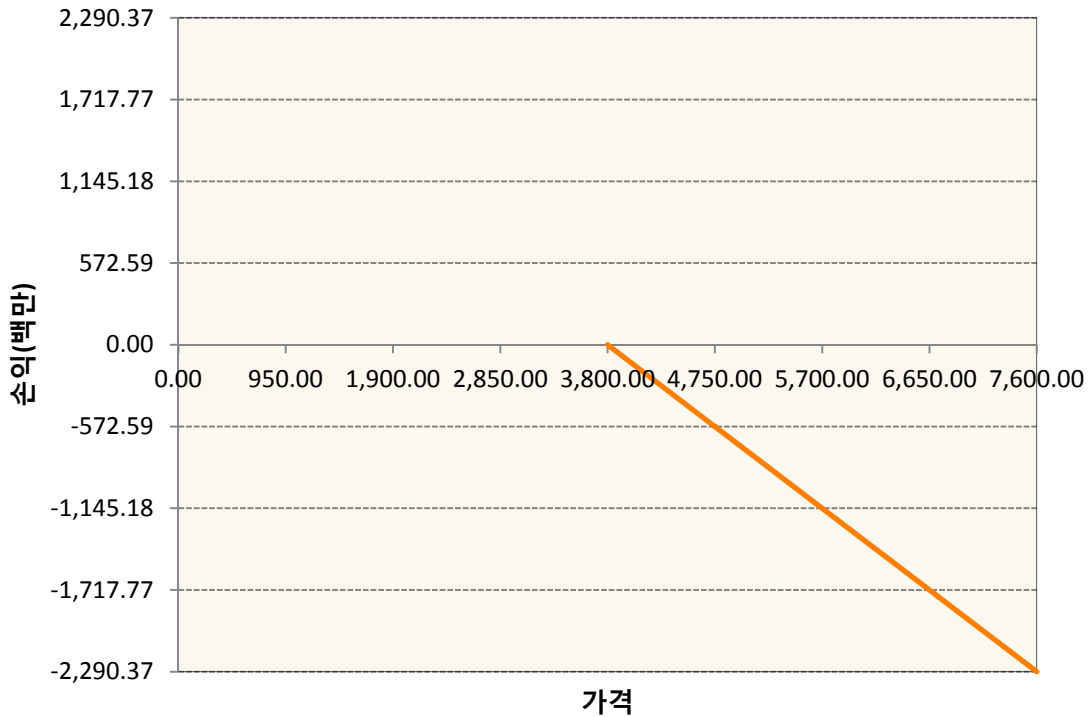
### 1. 계약금액

(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	398	0	398	
누계	유가증권	스왑	13,400	0	13,400	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,935	-6,935	장내
누계	통화	선도	0	3,365	-3,365	장외

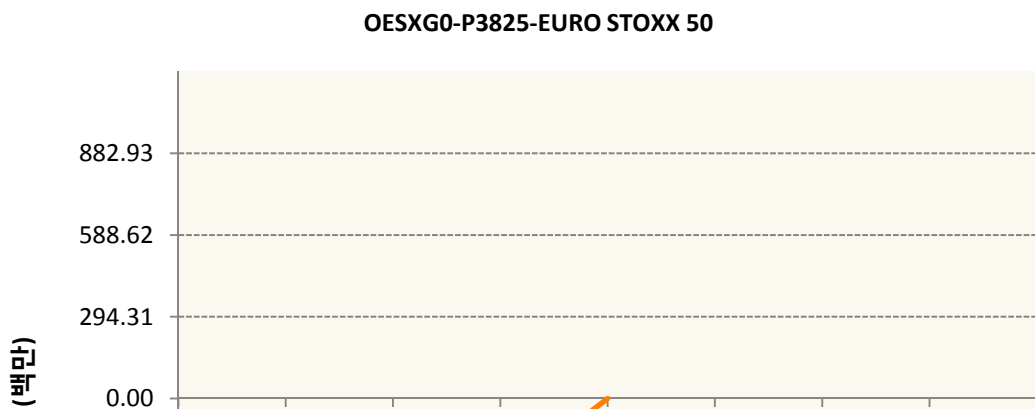
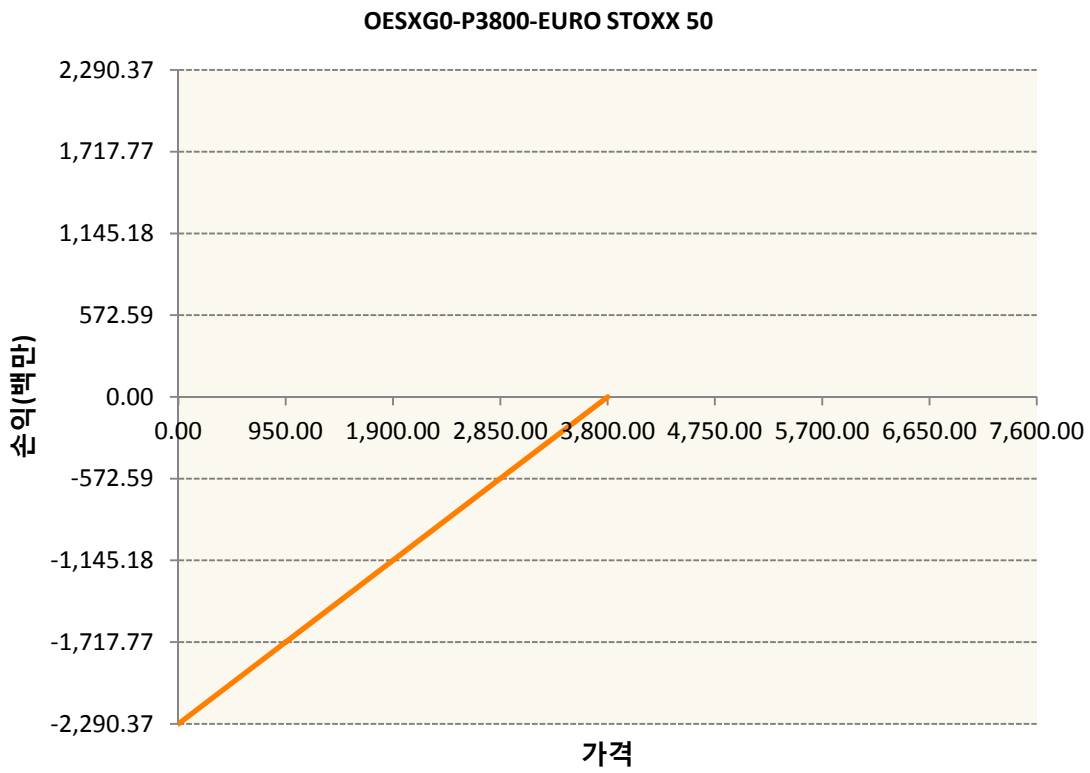
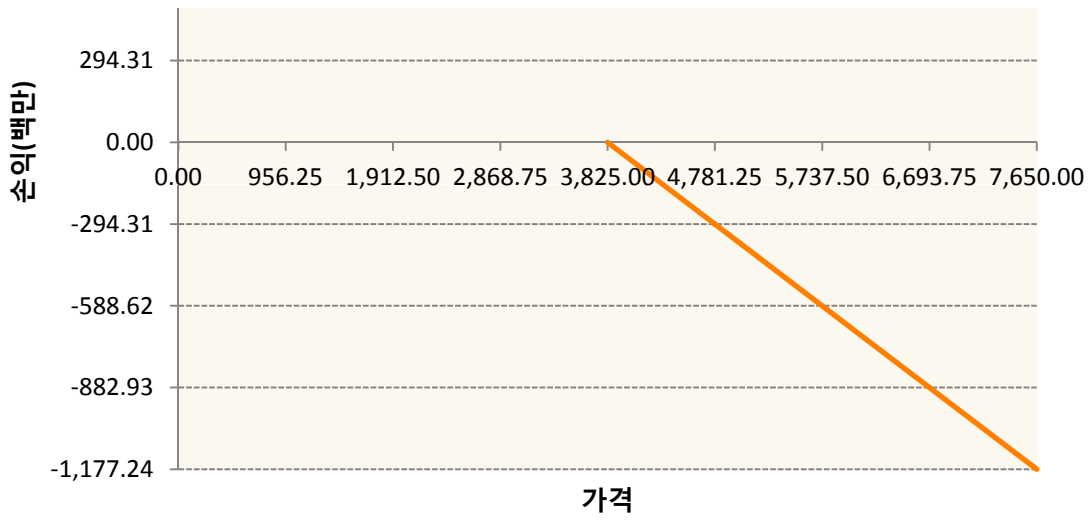
### 2. 만기시점의 손익구조

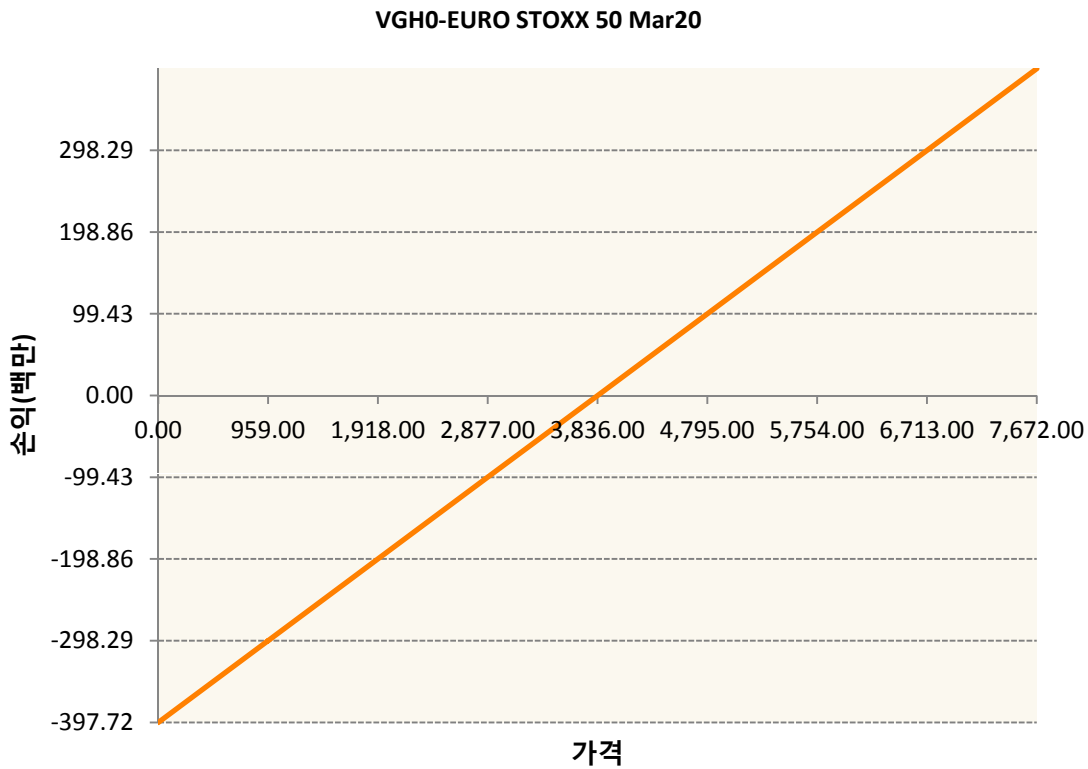
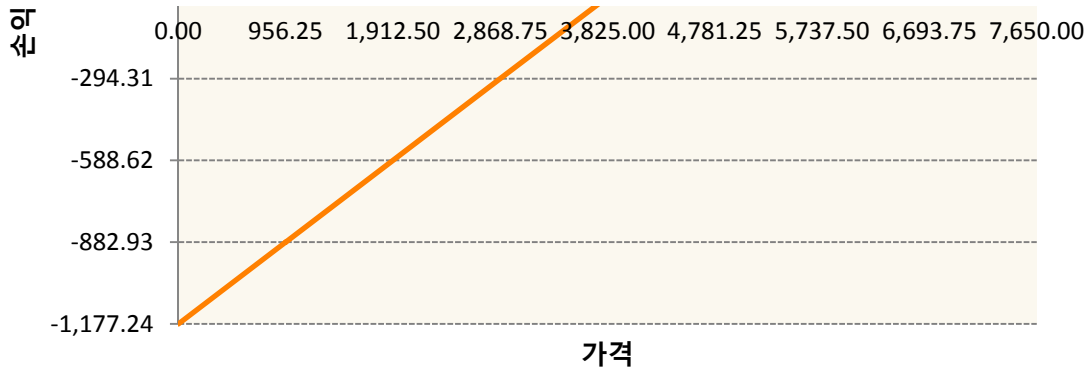
**OESXG0-C3800-EURO STOXX 50**



**OESXG0-C3825-EURO STOXX 50**







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		10
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E		269
OESXG0-C3& EURO STOXX 50		183
OESXG0-C3& EURO STOXX 50		94
OESXG0-P3& EURO STOXX 50		183
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)

964



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

(단위:백만원)

85



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

(단위:백만원)

125

공시일	2020-02-17
기준일	2020-02-14

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

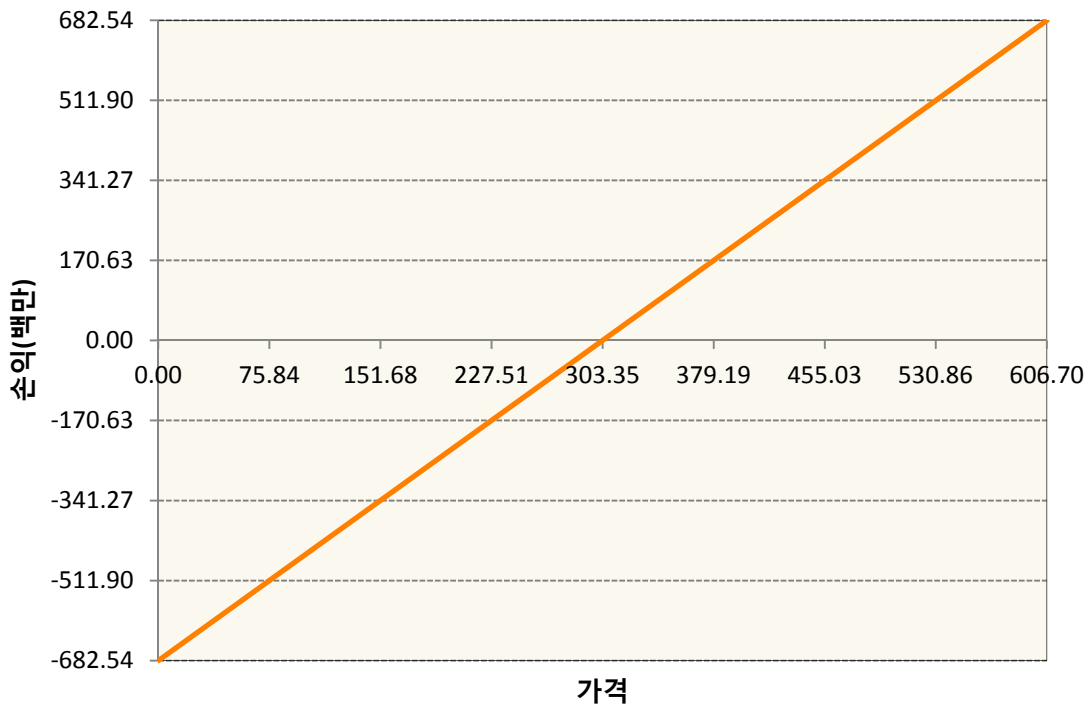
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	683	0	683	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005      2020-03 코스피200지수선물      55

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-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%	55	55	55	55	55	55	55

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

(단위:백만원)

45

공시일	2020-02-17
기준일	2020-02-14

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

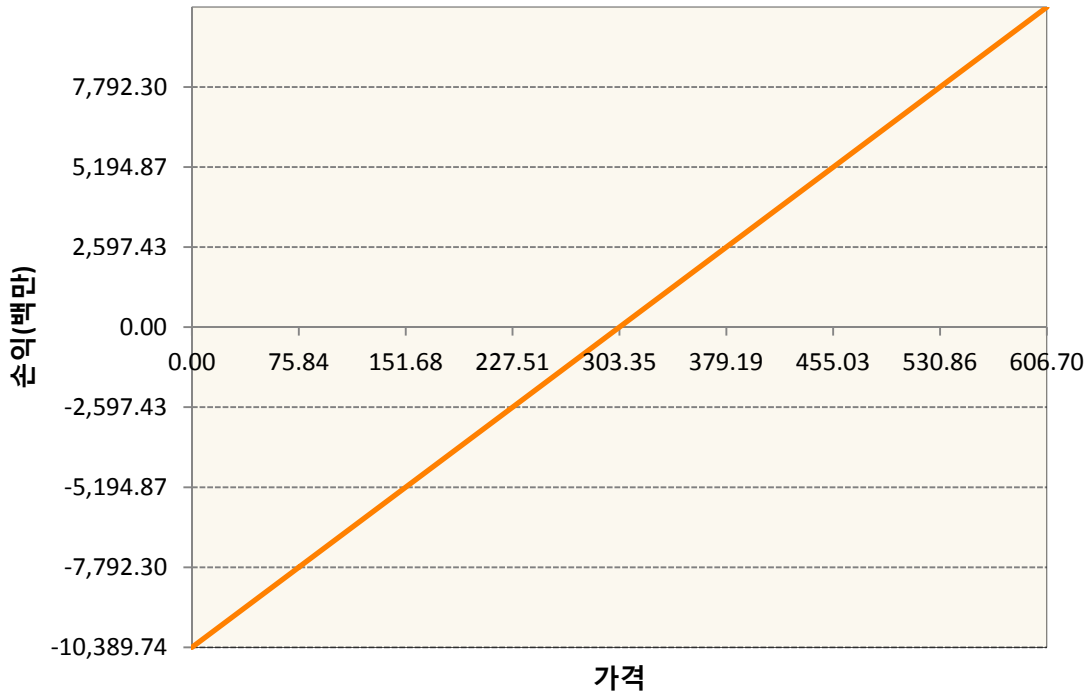
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

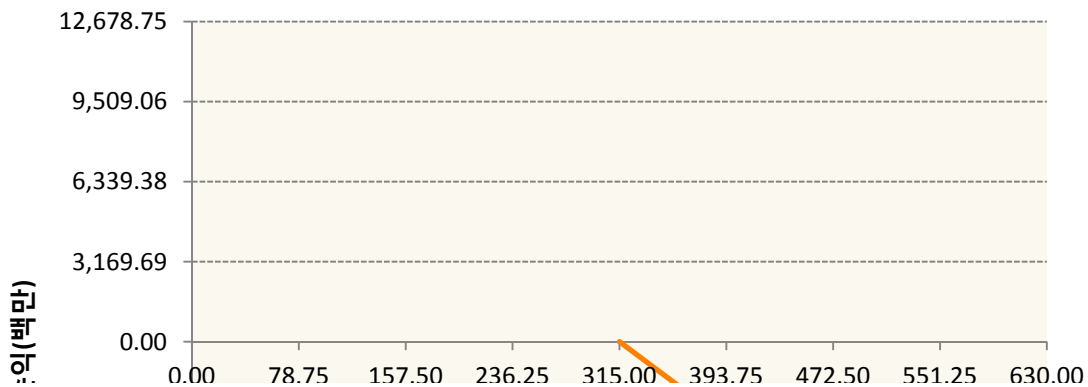
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	2,852	3,457	-604	장내
누계	유가증권	선물	10,390	0	10,390	장내
누계	유가증권	옵션	2,257	20,854	-18,598	장내

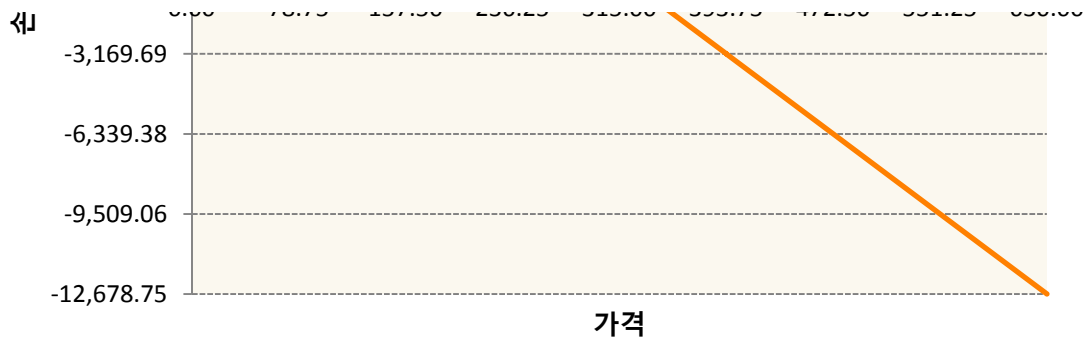
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

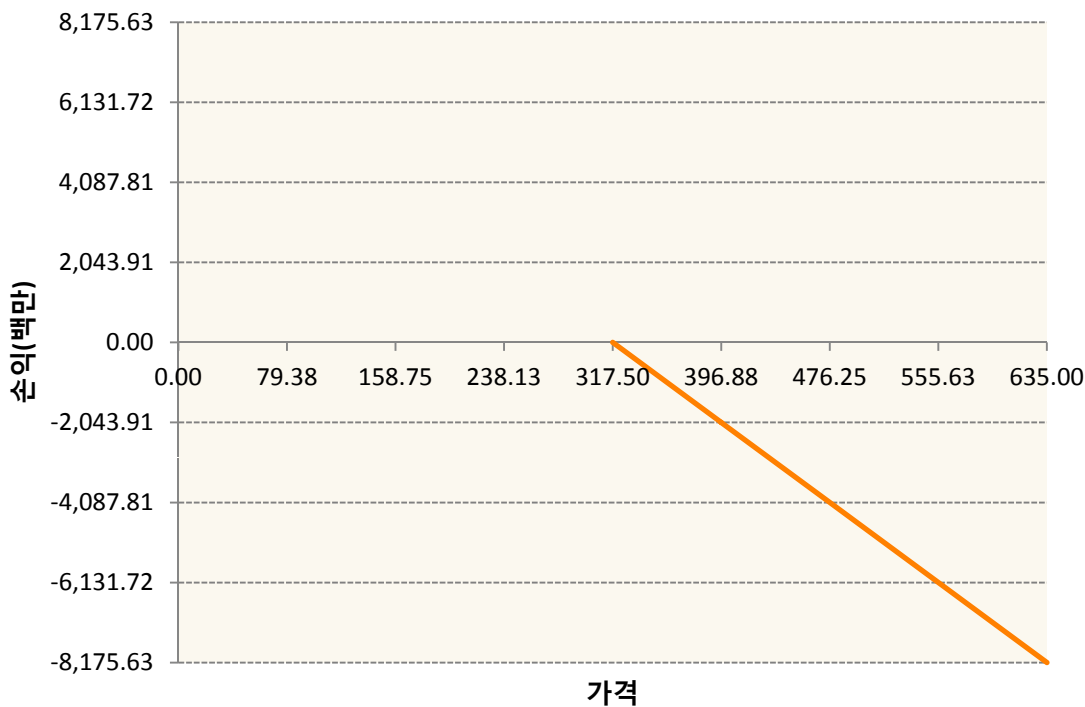


KR4201Q33155-2020-03 콜315

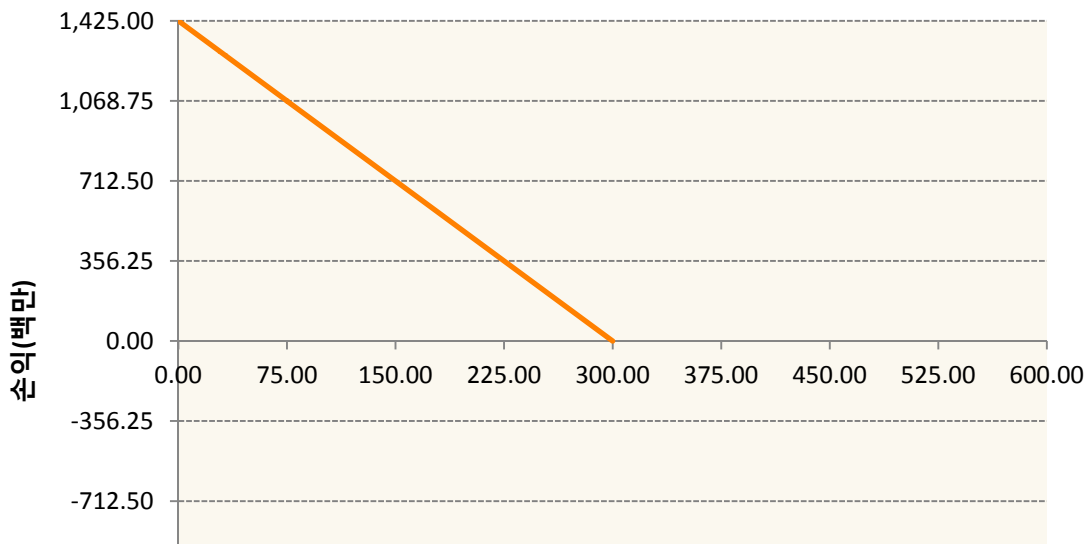


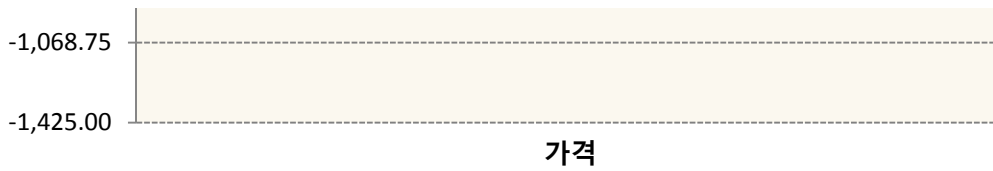


KR4201Q33171-2020-03 콜317.5

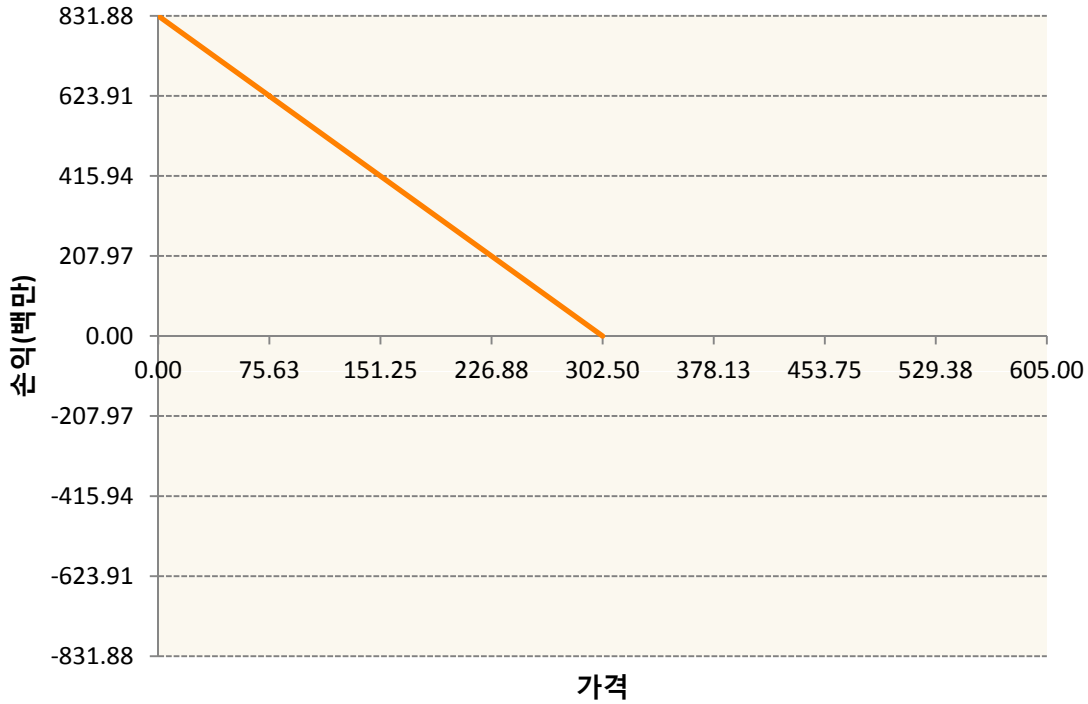


KR4301Q33005-2020-03 풋300





KR4301Q33021-2020-03 풋302.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						830
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-830	-830	-830	-830	-830	-830	-830	
-5.33%	-553	-553	-553	-553	-553	-553	-553	
-2.67%	-277	-277	-277	-277	-277	-277	-277	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	277	277	277	277	277	277	277	
5.33%	553	553	553	553	553	553	553	
8.00%	830	830	830	830	830	830	830	
KR4201Q33155		2020-03 콜315						601
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	208	202	194	184	172	158	142	
-5.33%	193	181	166	149	131	110	89	
-2.67%	158	137	115	91	65	39	11	

0%	90	61	31	0	-31	-63	-95
2.67%	-25	-59	-93	-128	-163	-197	-232
5.33%	-191	-226	-261	-296	-331	-366	-401
8.00%	-407	-438	-469	-501	-534	-567	-601
KR4201Q33171 2020-03 콜317.5							364
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	116	113	109	103	96	88	79
-5.33%	109	102	94	84	73	61	48
-2.67%	91	79	66	52	36	20	4
0%	54	37	19	0	-19	-39	-59
2.67%	-10	-31	-53	-74	-96	-118	-140
5.33%	-106	-128	-151	-174	-197	-219	-242
8.00%	-235	-255	-277	-298	-320	-342	-364
KR4301Q33005 2020-03 풋300							85
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	82	82	82	83	83	84	85
-5.33%	45	46	47	49	50	51	53
-2.67%	14	16	18	20	22	24	26
0%	-6	-4	-2	0	2	4	6
2.67%	-16	-15	-13	-12	-10	-8	-6
5.33%	-19	-19	-18	-17	-16	-15	-14
8.00%	-20	-20	-20	-19	-19	-18	-18
KR4301Q33021 2020-03 풋302.5							52
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	51	51	51	51	52	52	52
-5.33%	29	30	30	31	32	32	33
-2.67%	10	11	12	13	14	15	17
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-11	-10	-9	-8	-7	-6	-5
5.33%	-14	-14	-13	-12	-12	-11	-10
8.00%	-15	-15	-14	-14	-14	-13	-13

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

(단위:백만원)

1,554

공시일	2020-02-17
기준일	2020-02-14

## 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	213,618	0	213,618	

### 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	2020-02-17
기준일	2020-02-14

## 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	185,774	0	185,774	

### 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	2020-02-17
기준일	2020-02-14

## 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	530,345	0	530,345	
누계	통화	선도	0	579,433	-579,433	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	3,786
FX21019Z04: KRW/USD 26-02-20E	1,893
FX21019Z04: KRW/USD 26-02-20E	2,025
FX21019Z04: KRW/USD 26-02-20E	189
FX21020F01: KRW/USD 18-02-20E	1,704
FX21020F01: KRW/USD 18-02-20E	284
FX21020F02: KRW/USD 21-02-20E	1,893
FX21020F02: KRW/USD 21-02-20E	3,256
FX21020F02: KRW/USD 23-03-20E	1,524
FX21020F02: KRW/USD 23-03-20E	1,420
FX21020F02: KRW/USD 28-02-20E	1,893
FX21020F03: KRW/USD 28-02-20E	2,934
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	1,174
FX21020G01: KRW/USD 12-03-20E	1,202
FX21020G01: KRW/USD 12-03-20E	946
FX21020G02: KRW/USD 18-03-20E	1,893
FX21020G02: KRW/USD 18-03-20E	3,256

IE00BD8RGM75

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

15,566



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

(단위:백만원)

128

공시일	2020-02-17
기준일	2020-02-14

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

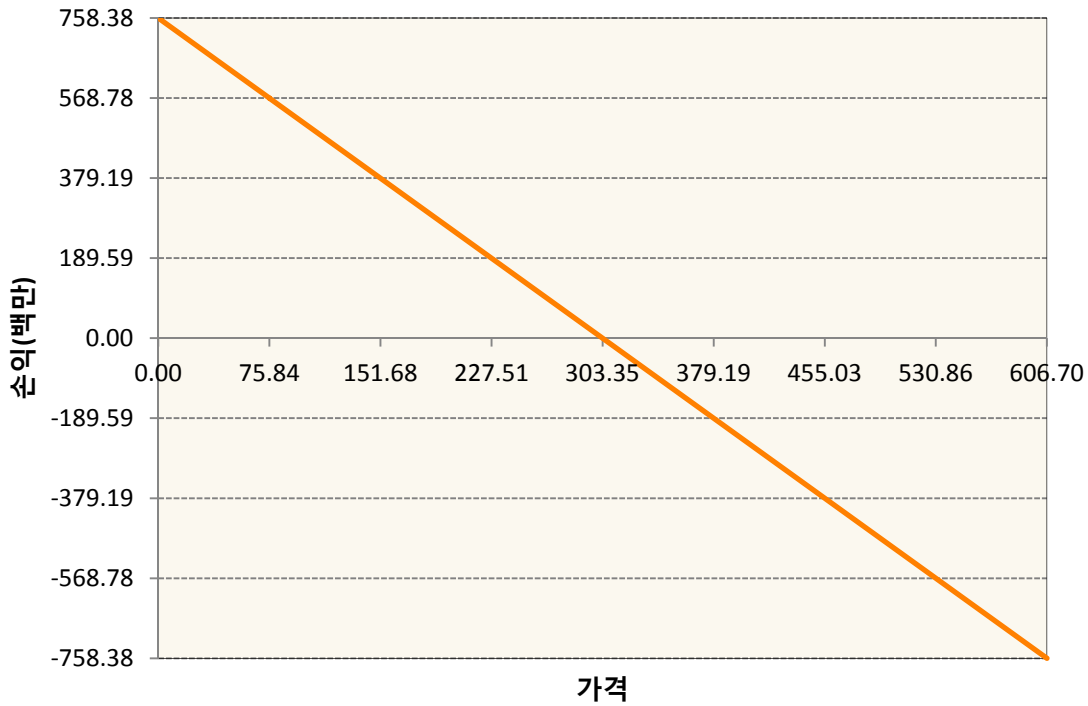
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

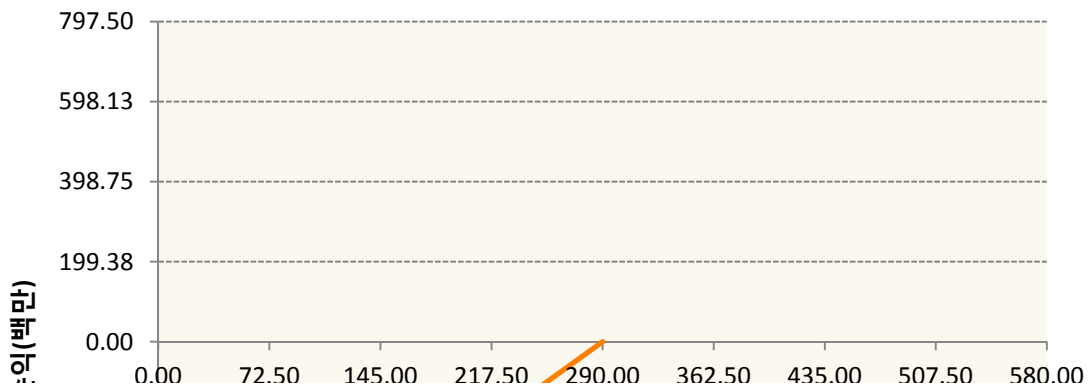
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	72	1,097	-1,025	장내
누계	유가증권	선물	0	758	-758	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,503	-3,503	장내

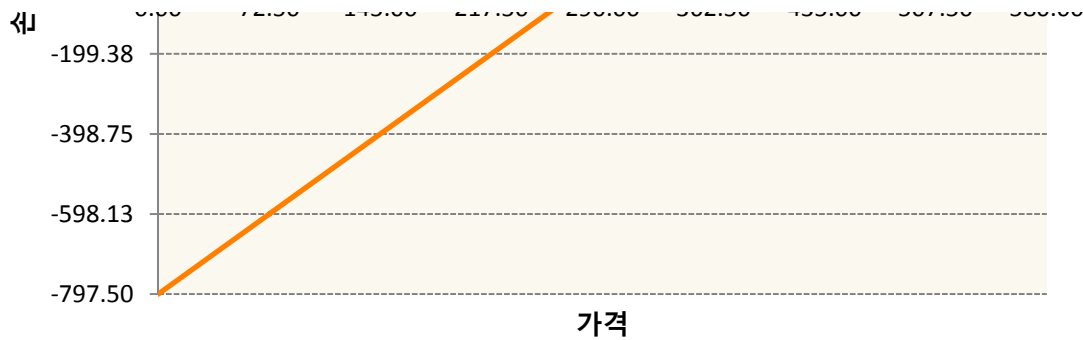
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

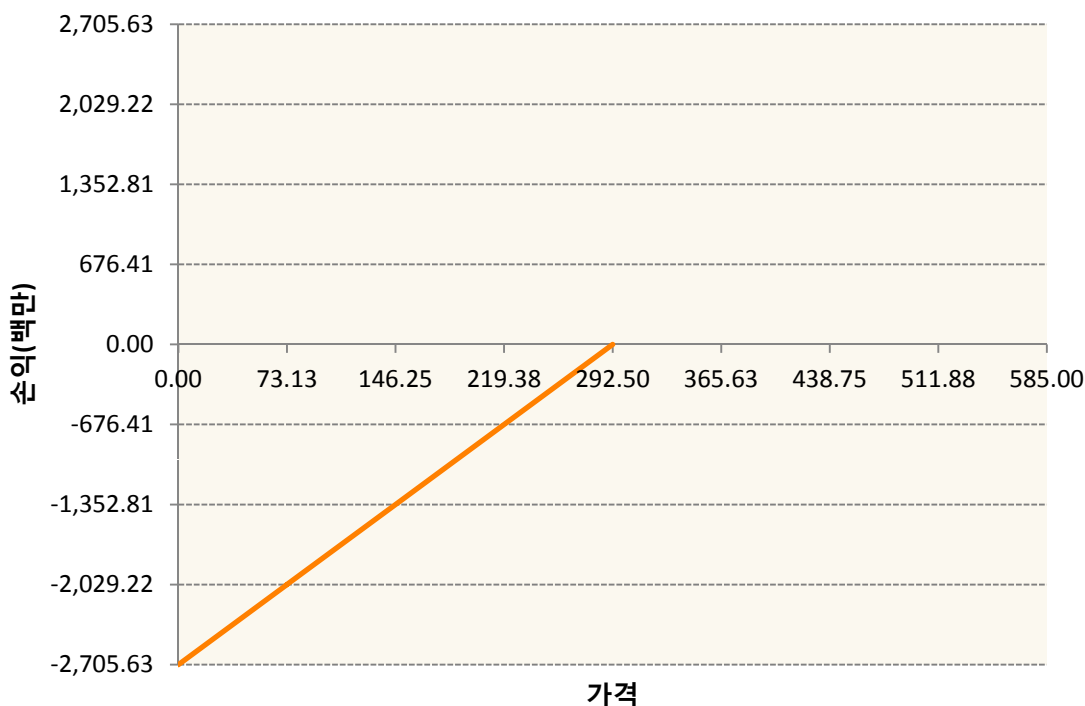


KR4301Q32908-2020-03 풋290





KR4301Q32924-2020-03 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						61
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	61	61	61	61	61	61	61	
-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%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61	
KR4301Q32908		2020-03 풋290						34
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-29	-30	-31	-32	-32	-33	-34
-5.33%	-13	-14	-15	-16	-17	-18	-20
-2.67%	-2	-3	-4	-6	-7	-8	-9
0%	2	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	3	3	3	2	2	1	1
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

KR4301Q32924                      2020-03 풋292.5    129

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-115	-117	-119	-121	-123	-126	-129
-5.33%	-53	-57	-60	-64	-68	-72	-75
-2.67%	-11	-15	-19	-24	-28	-32	-36
0%	9	6	3	0	-3	-7	-10
2.67%	15	14	13	11	9	7	5
5.33%	16	16	16	15	14	13	12
8.00%	16	16	16	16	16	15	15

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

(단위:백만원)

**186**

공시일	2020-02-17
기준일	2020-02-14

## 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	11,384	0	11,384	
누계	통화	선도	355	11,806	-11,451	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	2020-02-17
기준일	2020-02-14

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

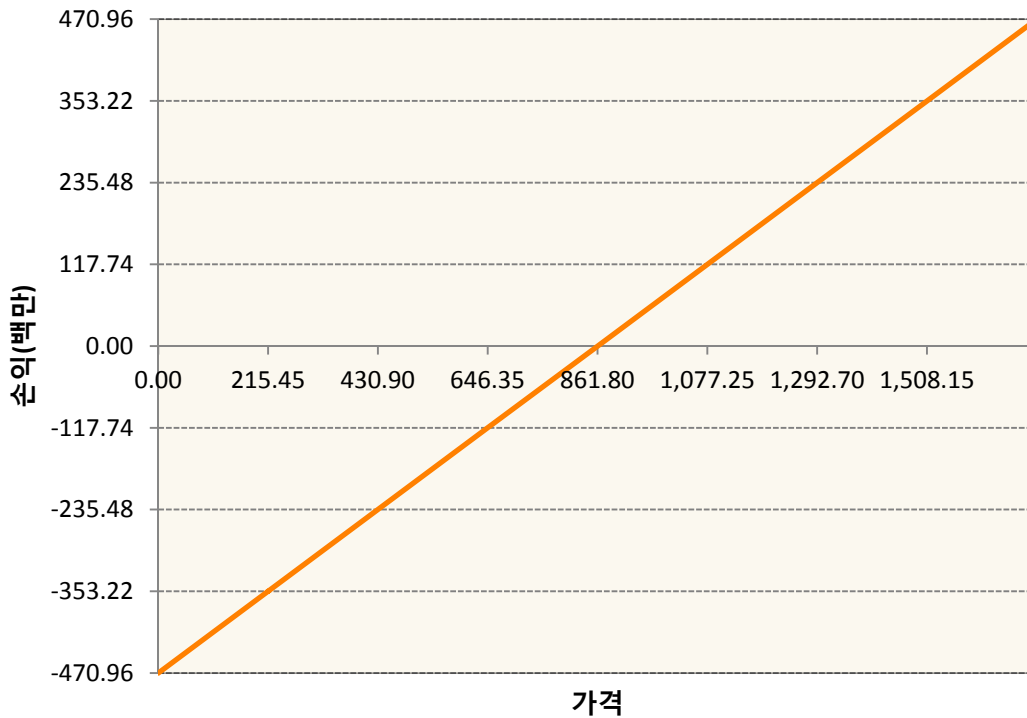
### 1. 계약금액

(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	471	0	471	
누계	유가증권	스왑	1,058	0	1,058	장외
누계	통화	선도	180	680	-500	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	38

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

(단위:백만원)

**115**

공시일	2020-02-17
기준일	2020-02-14

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

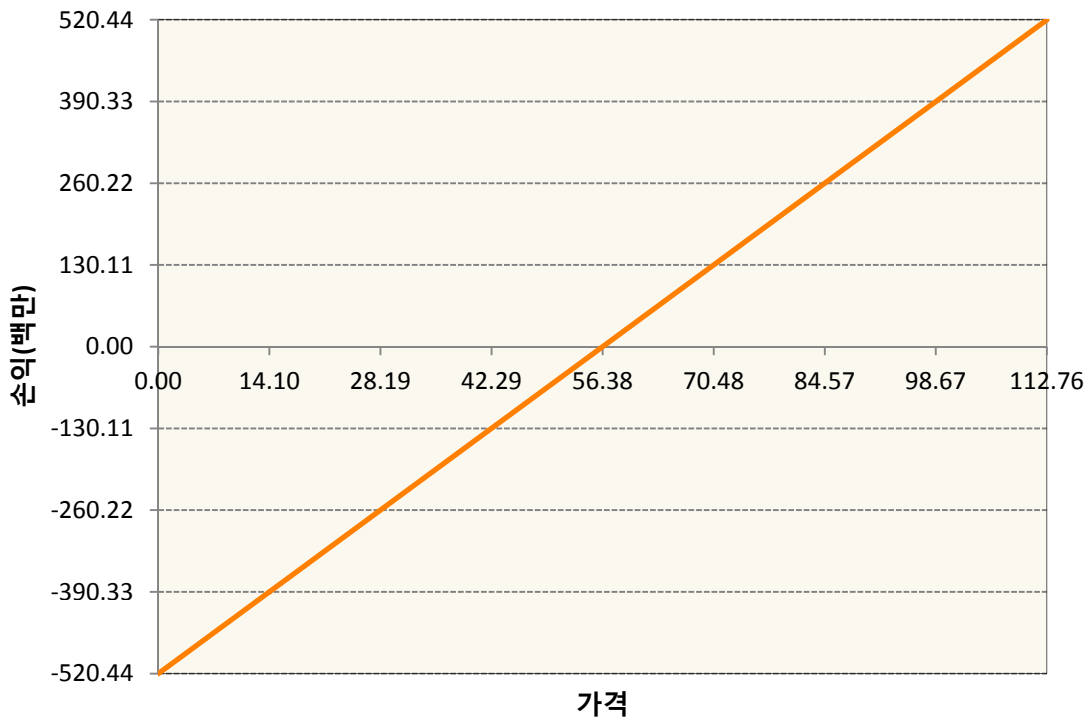
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

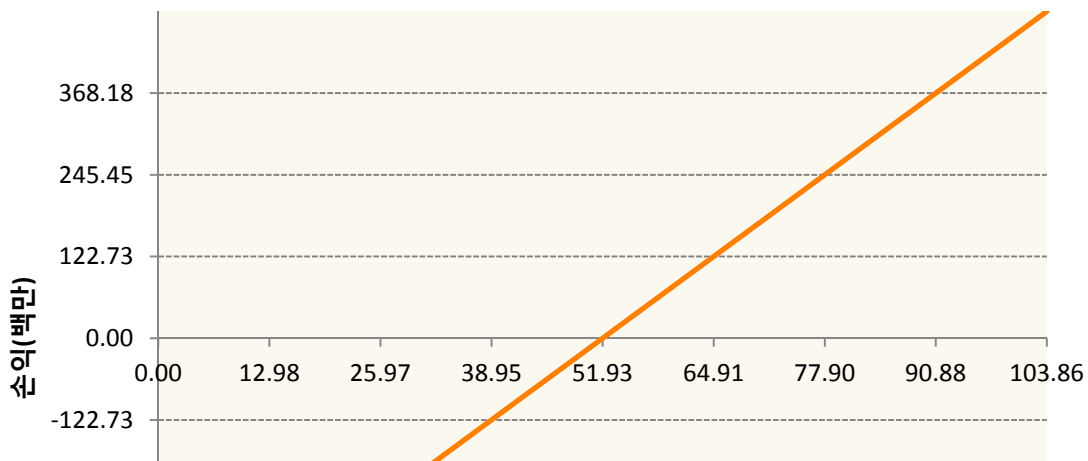
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,139	189	1,950	

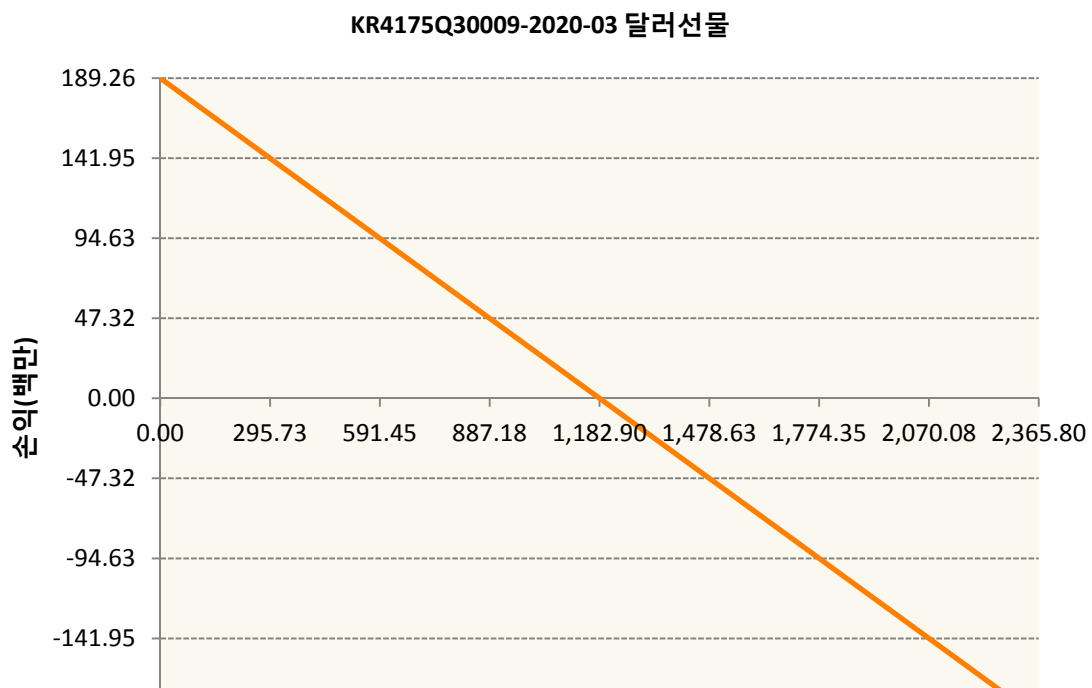
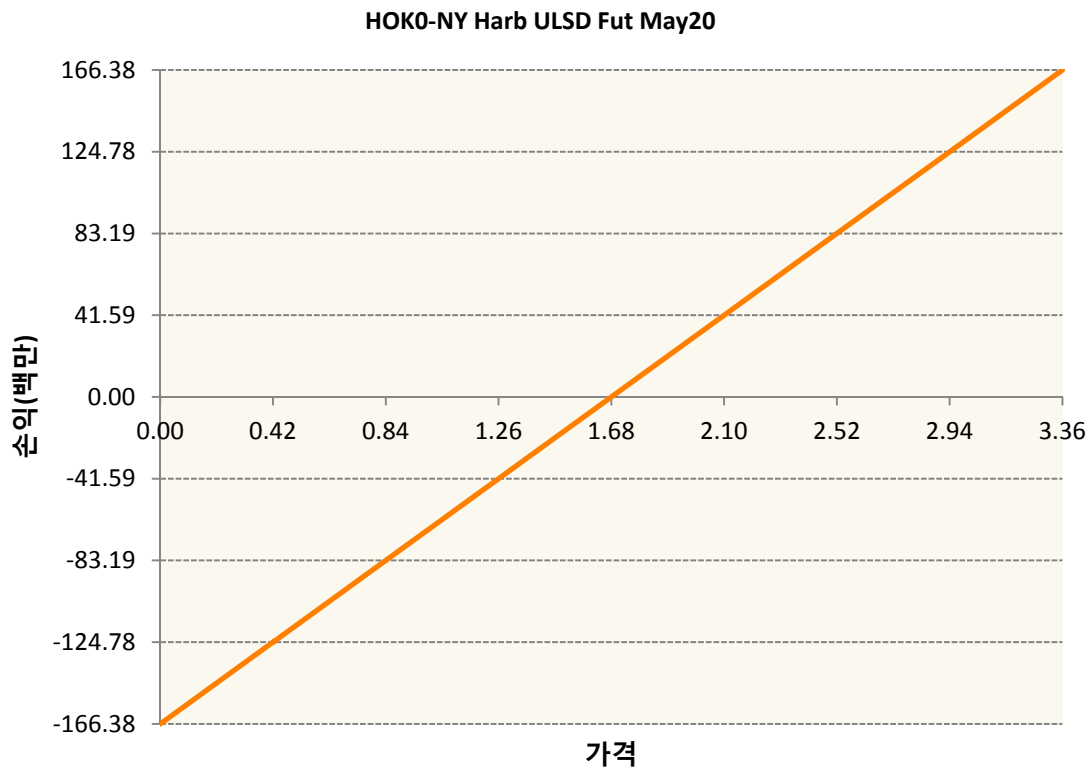
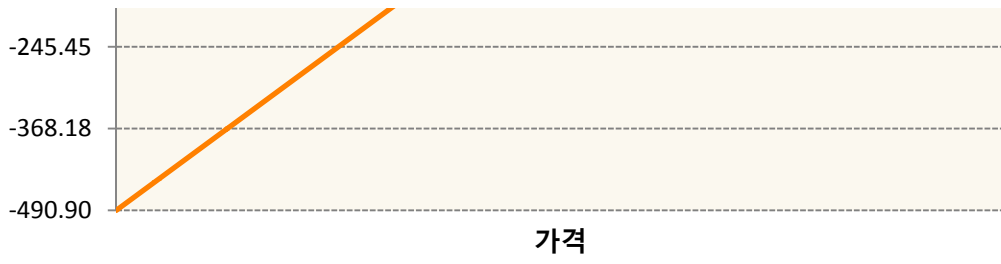
### 2. 만기시점의 손익구조

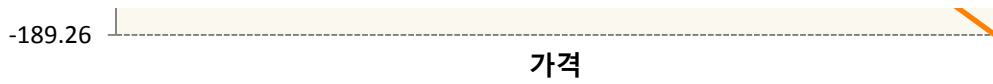
COK0-BRENT CRUDE FUTR May20



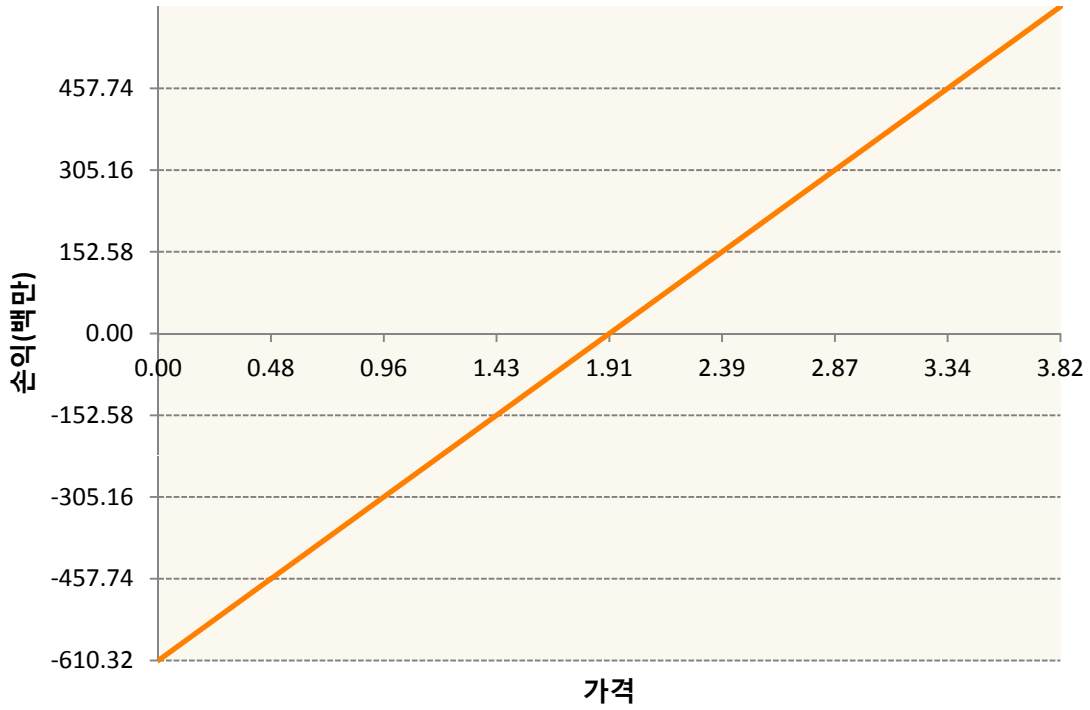
CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20



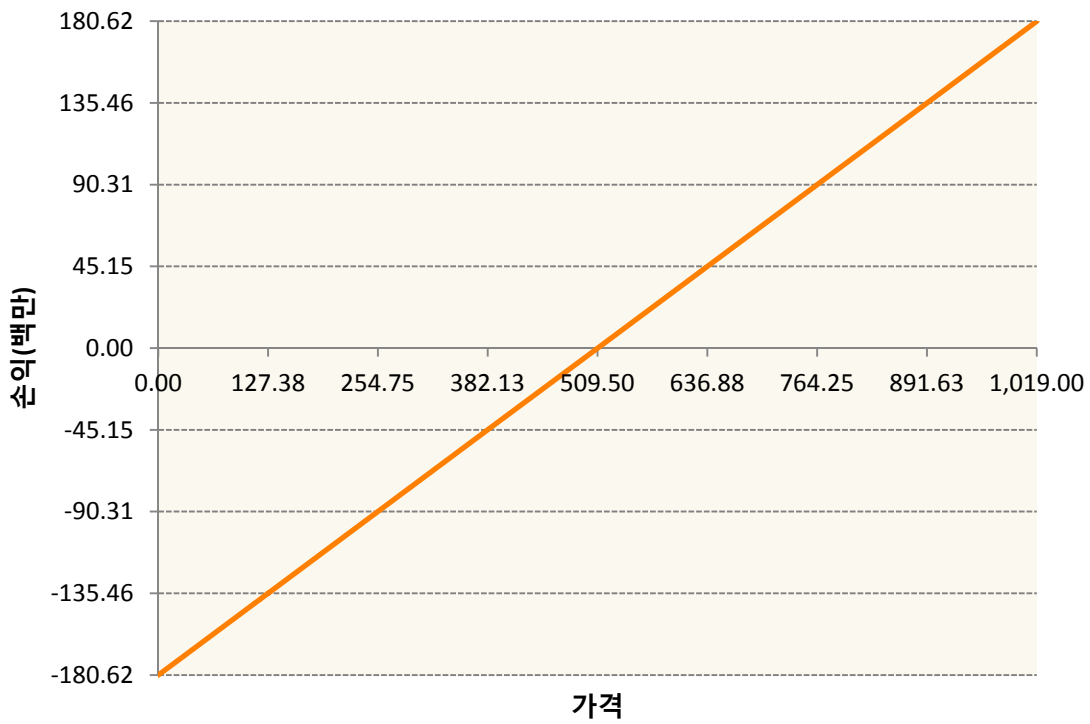




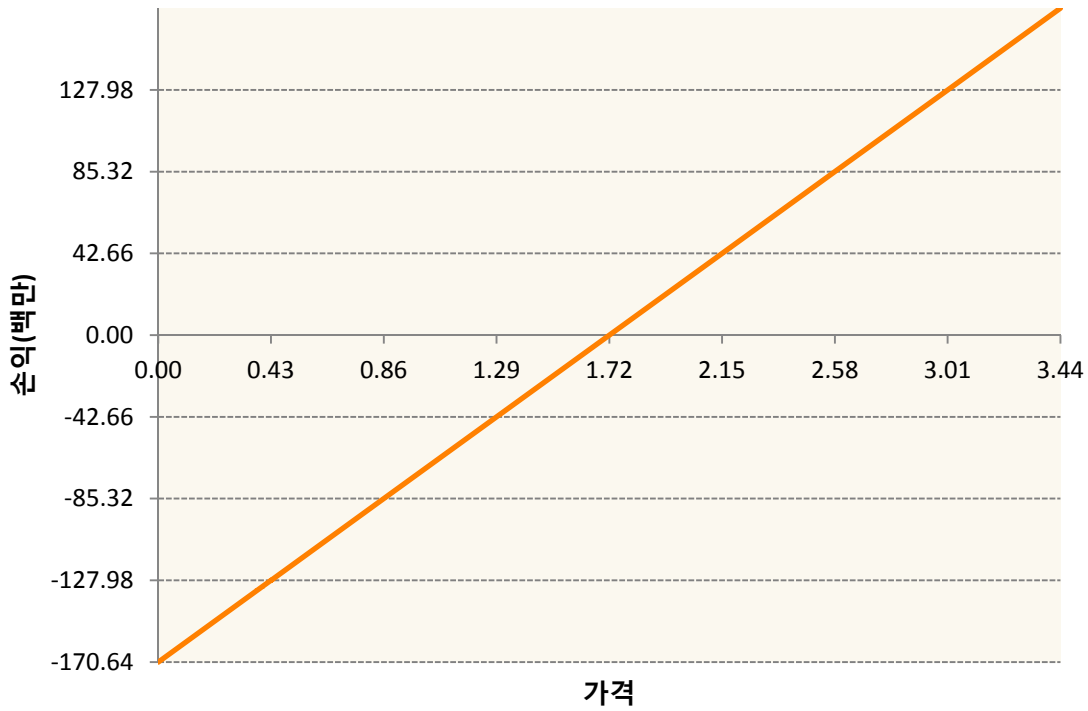
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



QSK0-Low Su Gasoil G Mar20



**XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20**



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	42
CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	39
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	13
KR4175Q30C	2020-03 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	2020-02-17
기준일	2020-02-14

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

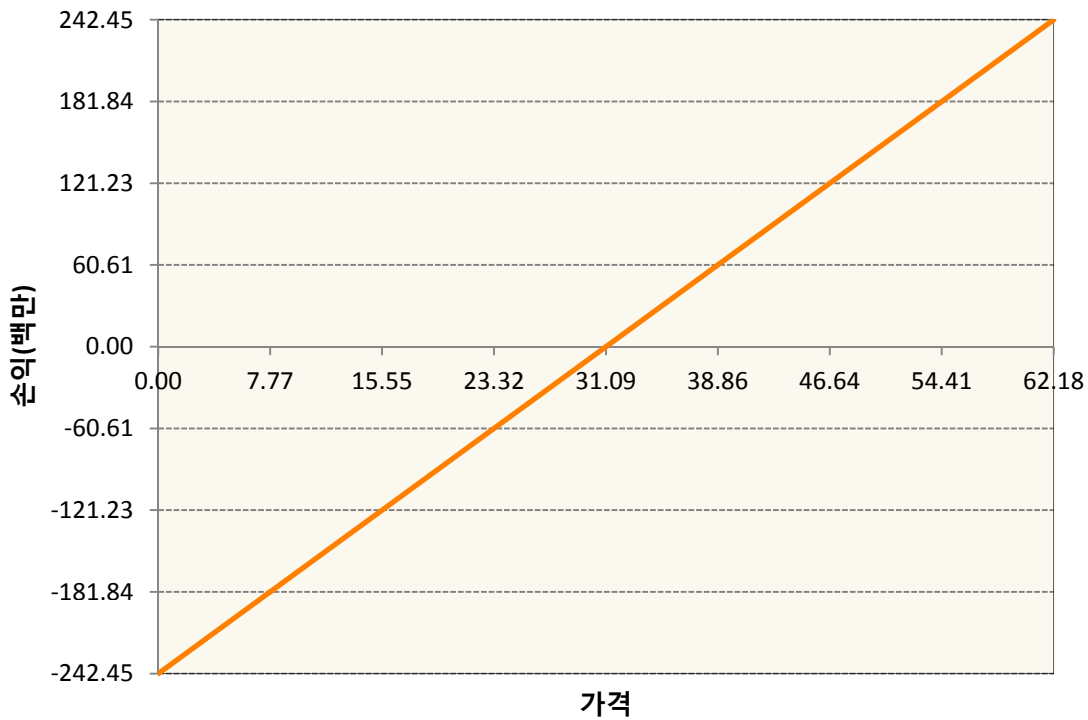
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

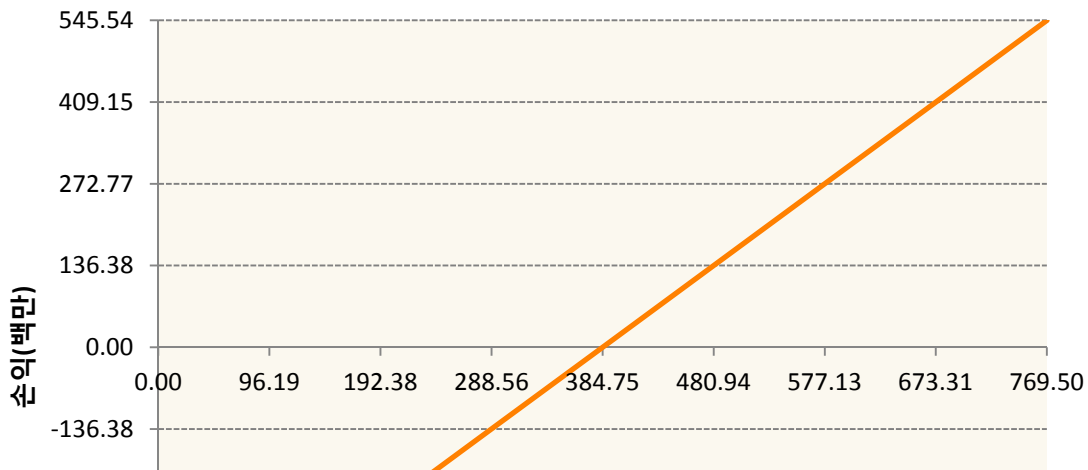
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,740	154	2,586	

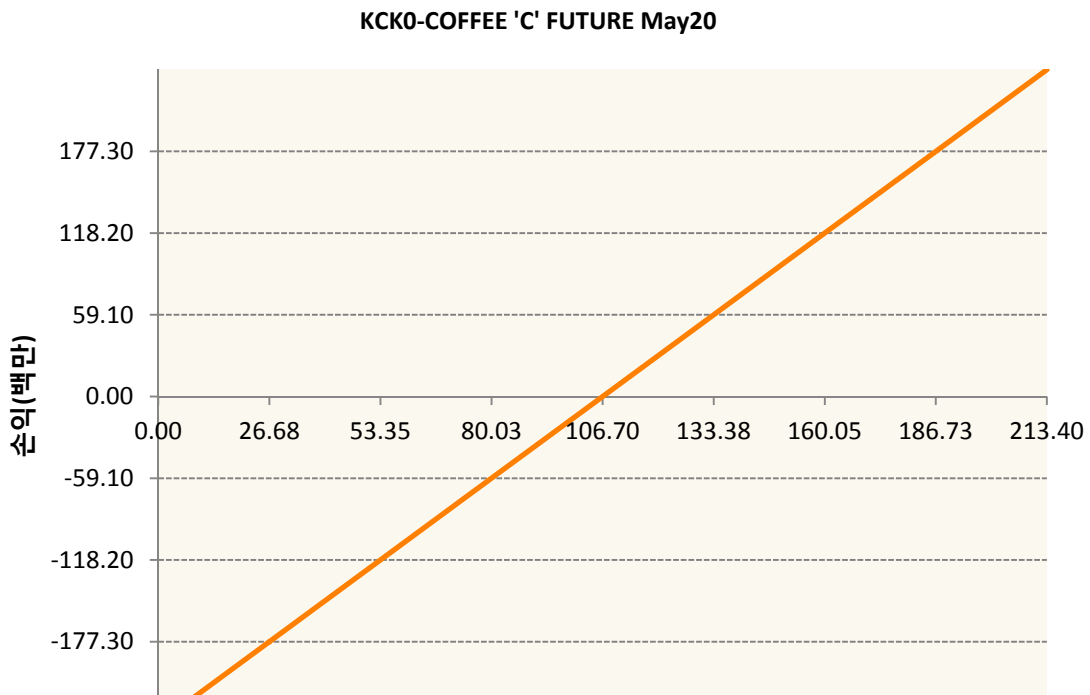
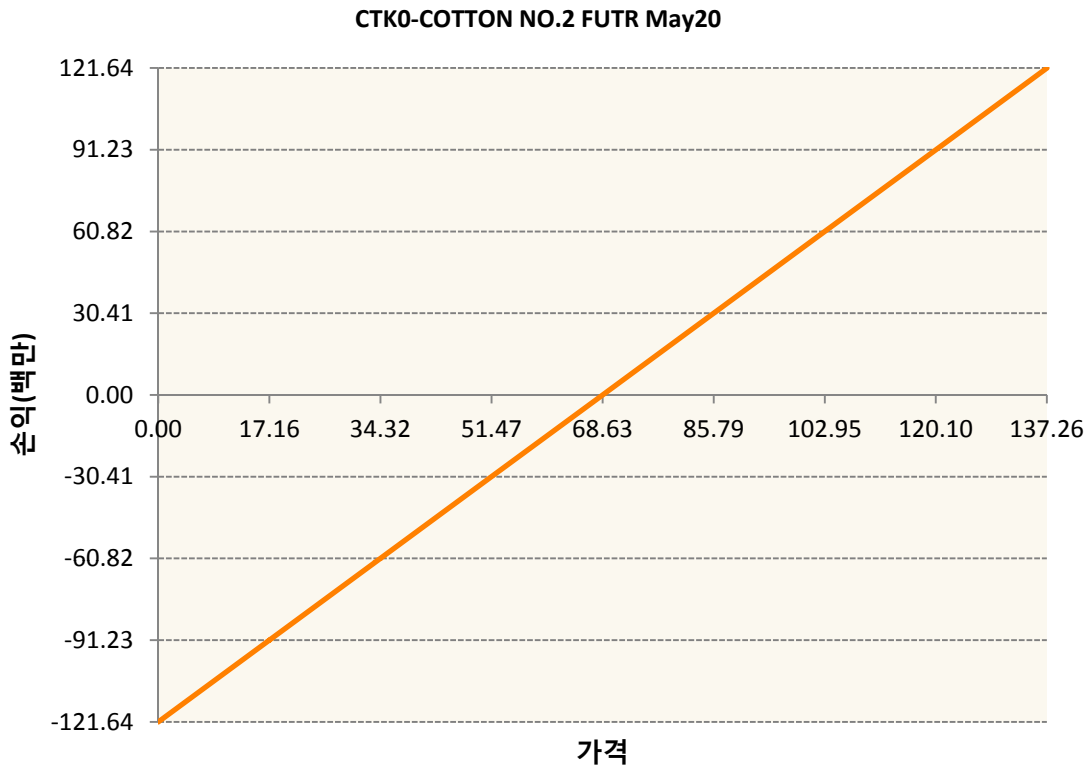
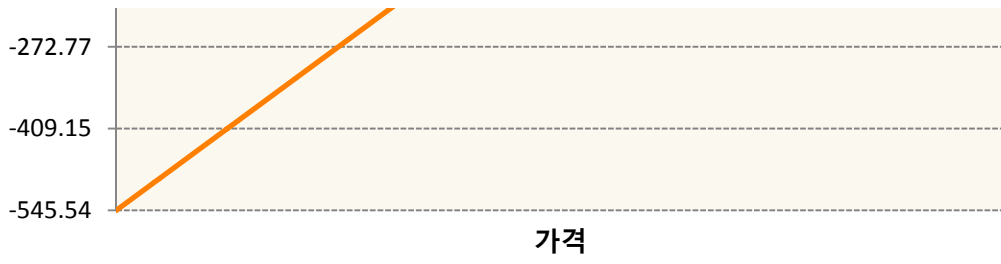
### 2. 만기시점의 손익구조

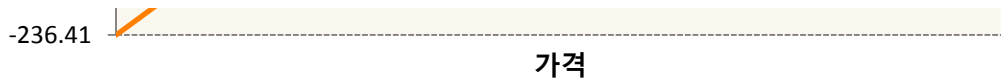
**BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20**



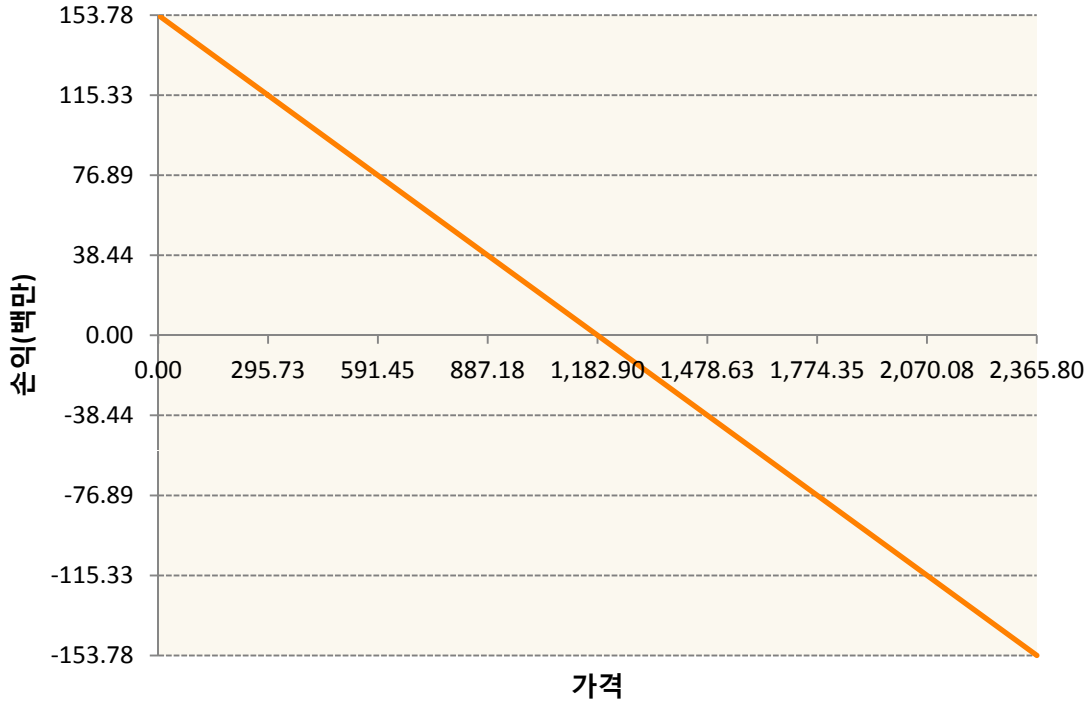
**CK0-CORN FUTURE May20**



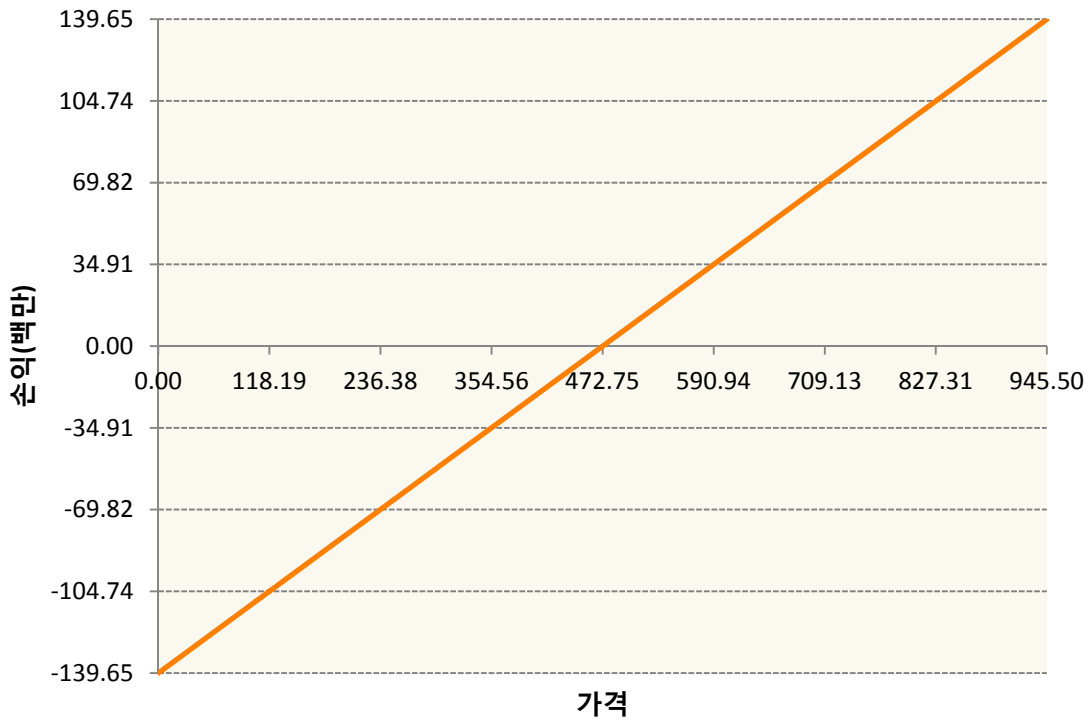




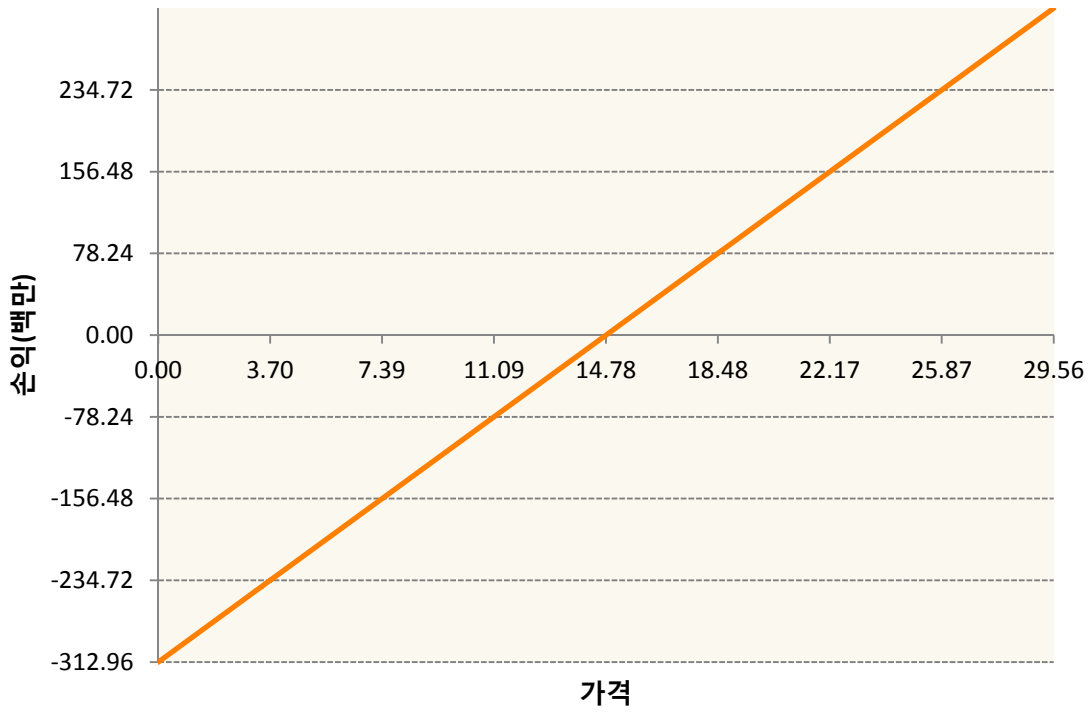
KR4175Q30009-2020-03 달러선물



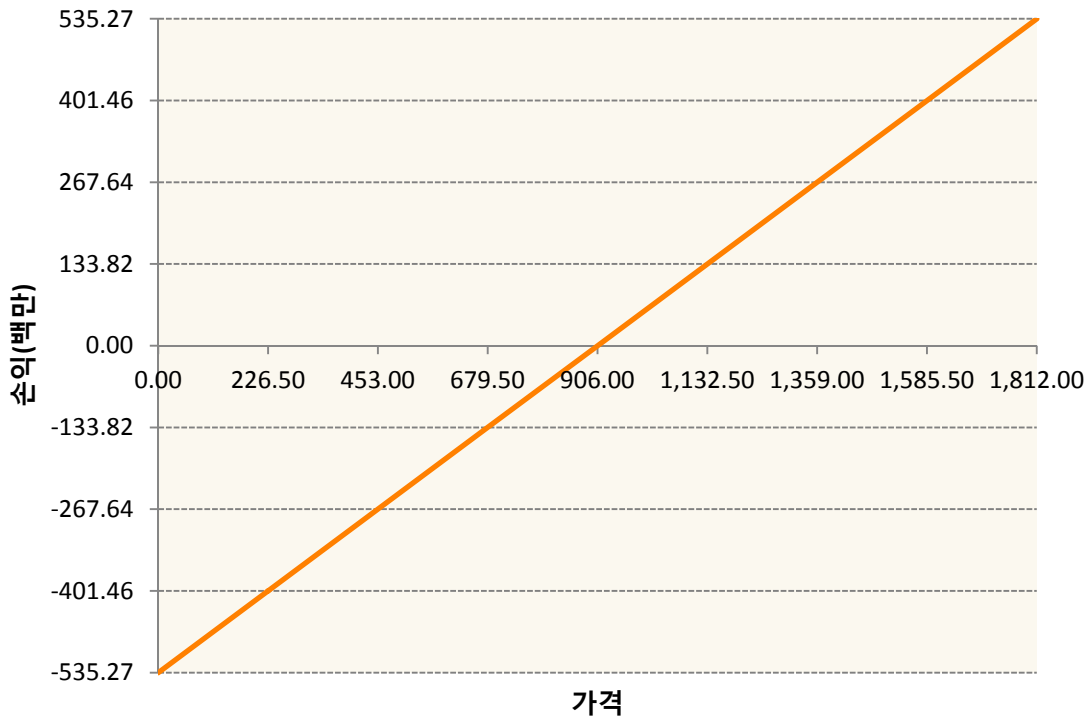
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



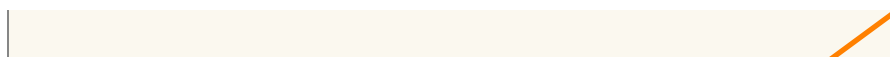
SBK0-Sugar May20

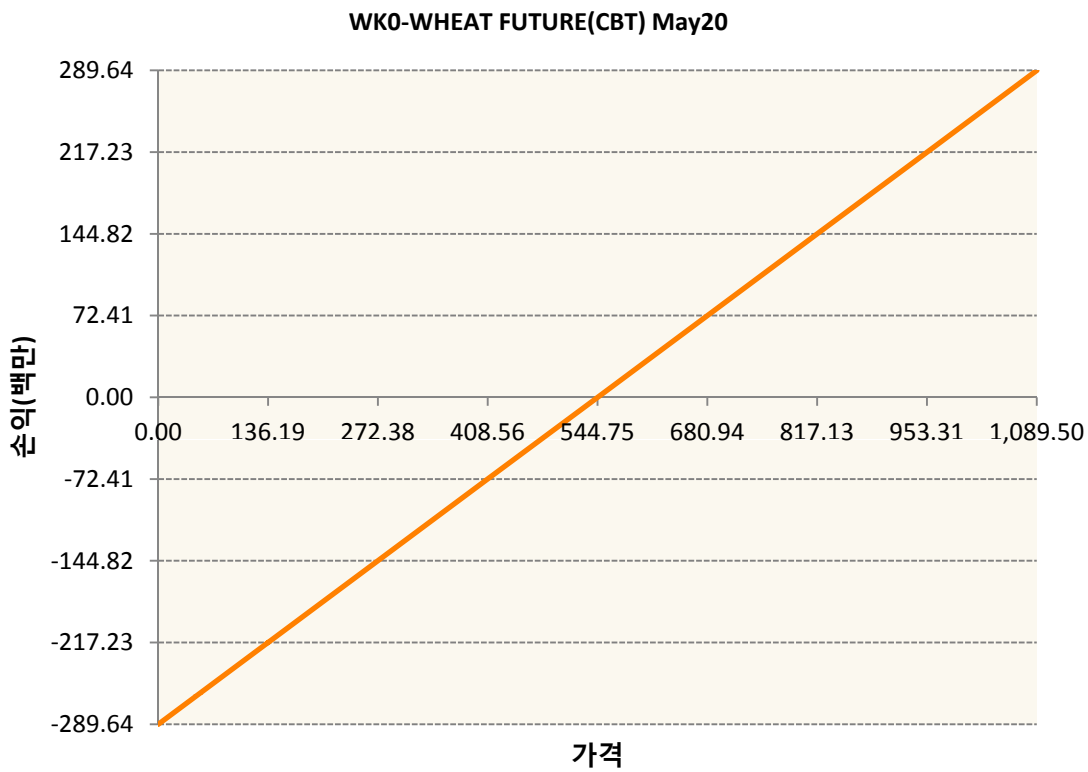
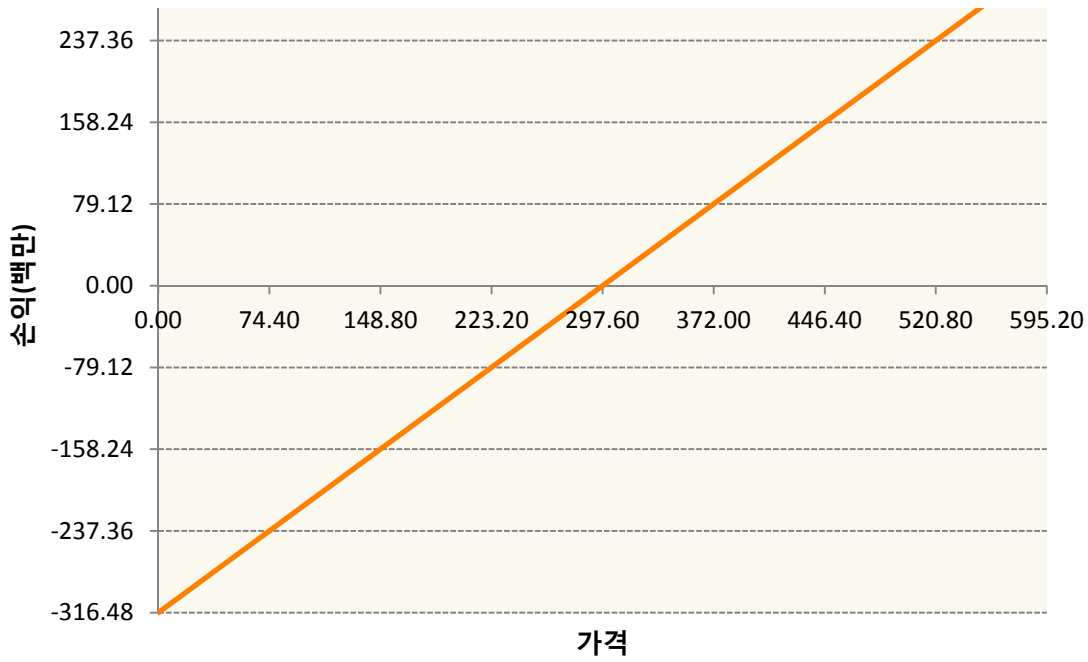


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	19
CK0	CORN FUTURE May20	44
CTK0	COTTON NO.2 FUTR May20	10
KCK0	COFFEE 'C' FUTURE May20	19
KR4175Q30C	2020-03 달러선물	12

KWK0	KC HRW WHEAT FUT May20	11
SBK0	Sugar May20	25
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)

**237**