

공시일	2020-02-18
기준일	2020-02-17

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	2020-02-18
기준일	2020-02-17

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	2020-02-18
기준일	2020-02-17

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)	433
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	158

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

916

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-18
기준일	2020-02-17

유로인덱스모(주식-파생형)

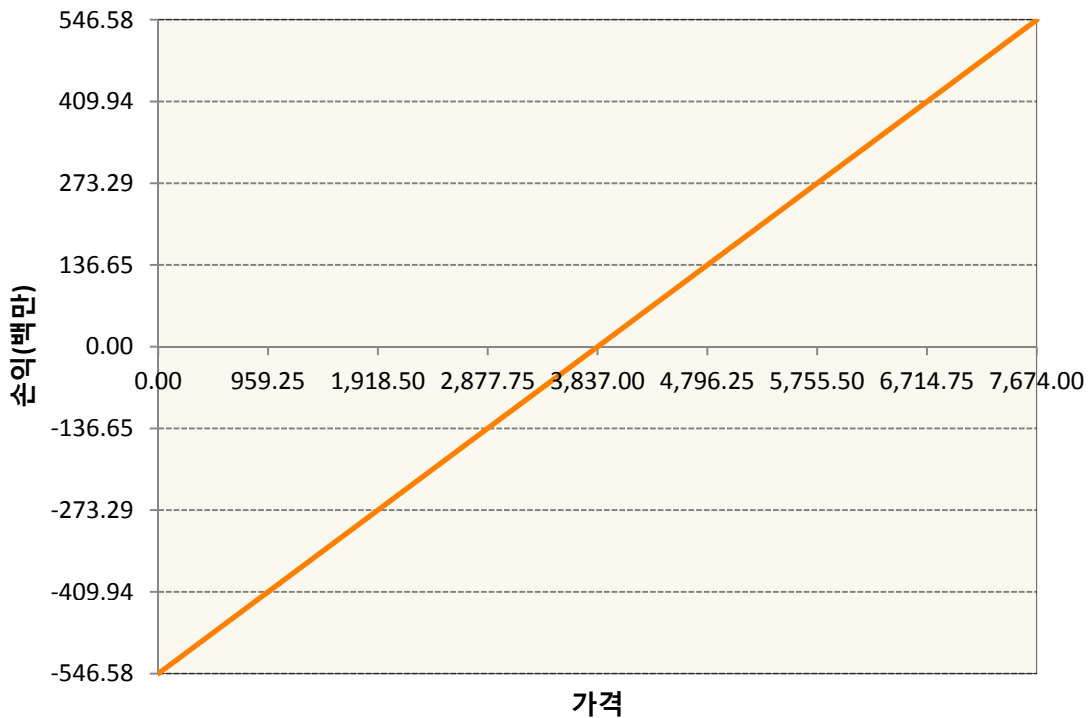
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	547	0	547	

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	2020-02-18
기준일	2020-02-17

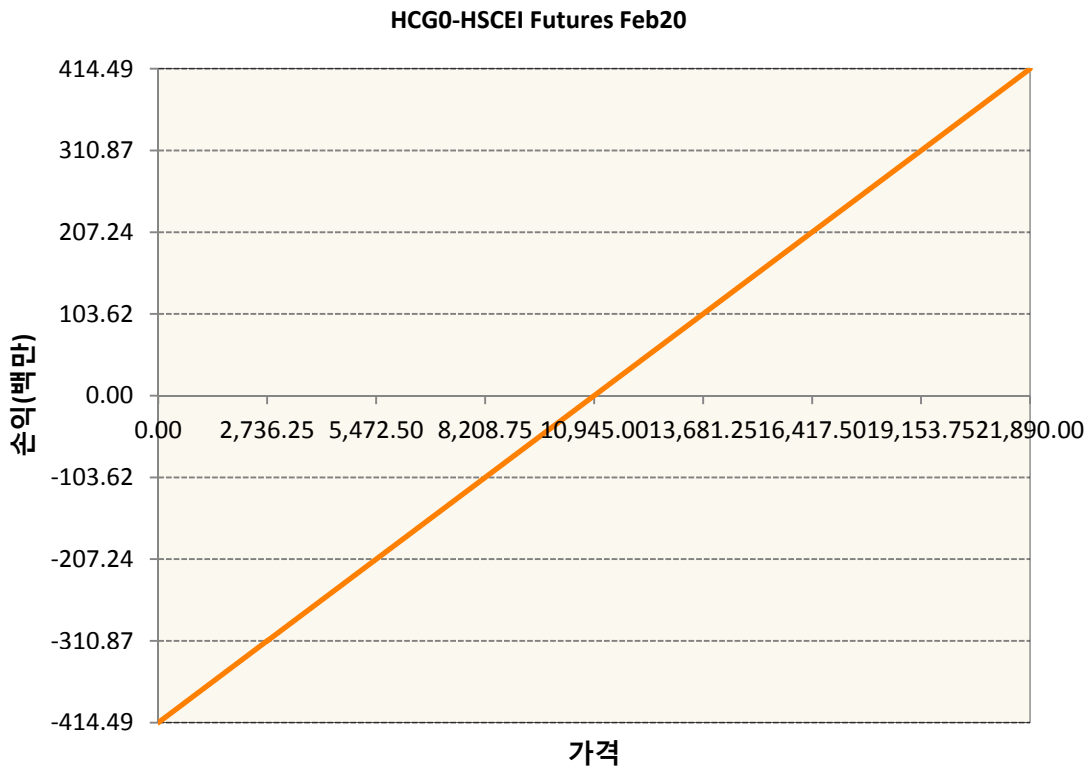
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	414	0	414	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	2020-02-18
기준일	2020-02-17

커버드콜모(주식혼합-파생형)

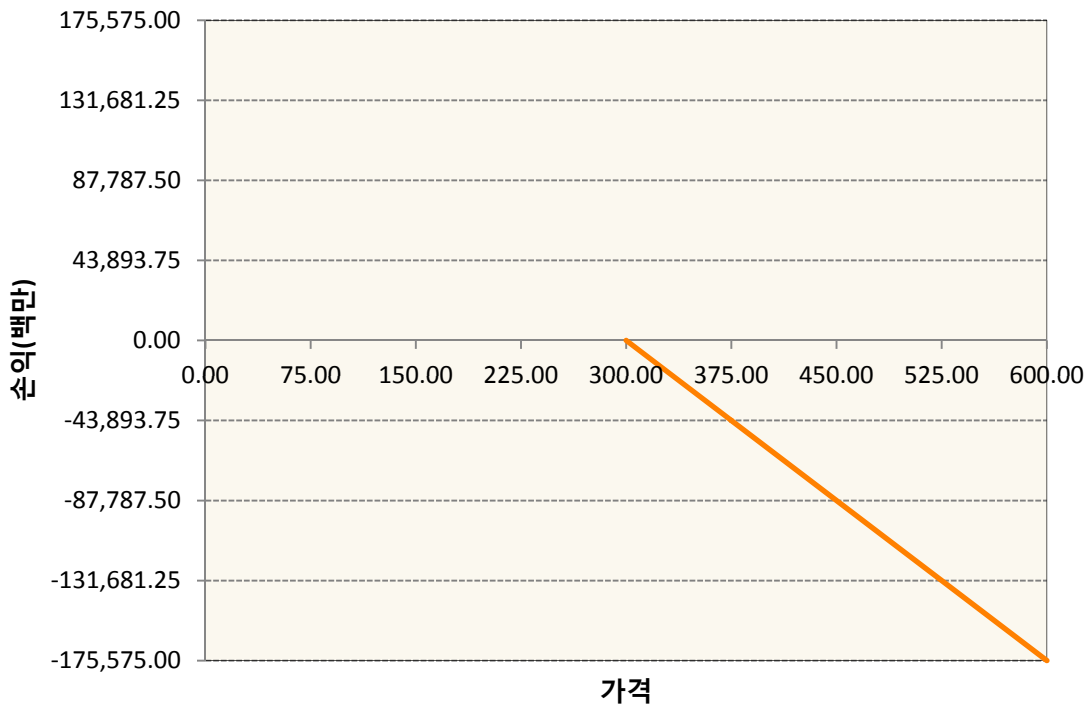
1. 계약금액

(단위:백만원)

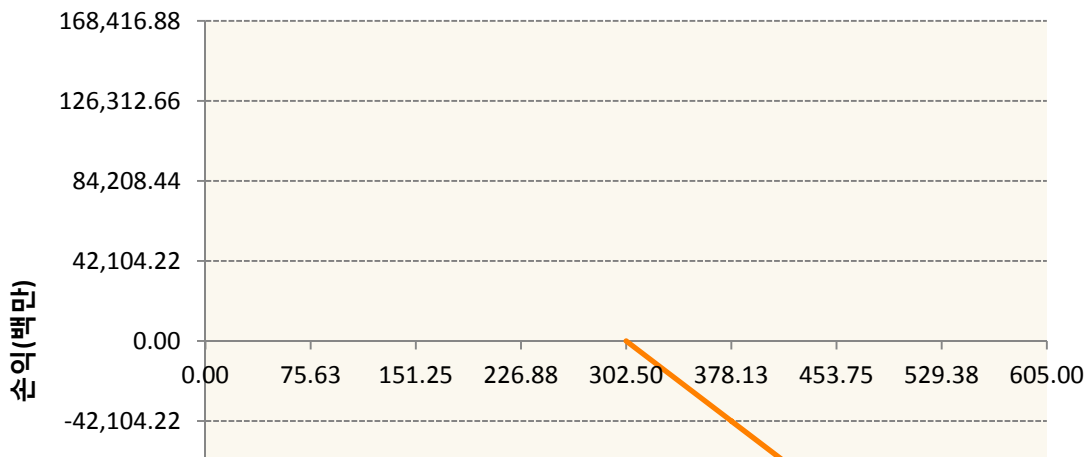
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	2,946	0	2,946	장내
누계	유가증권	옵션	0	452,742	-452,742	장내

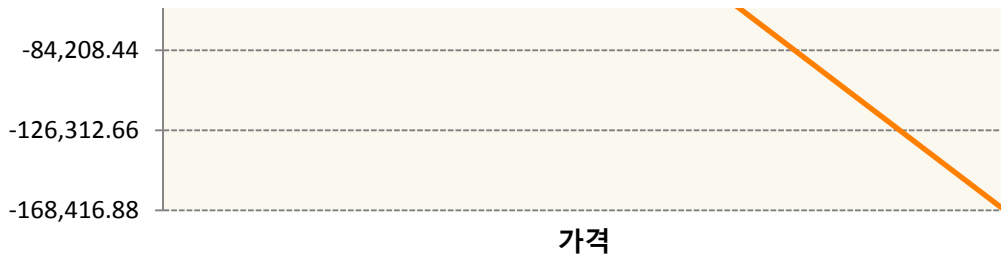
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q33007-2020-03 콜300

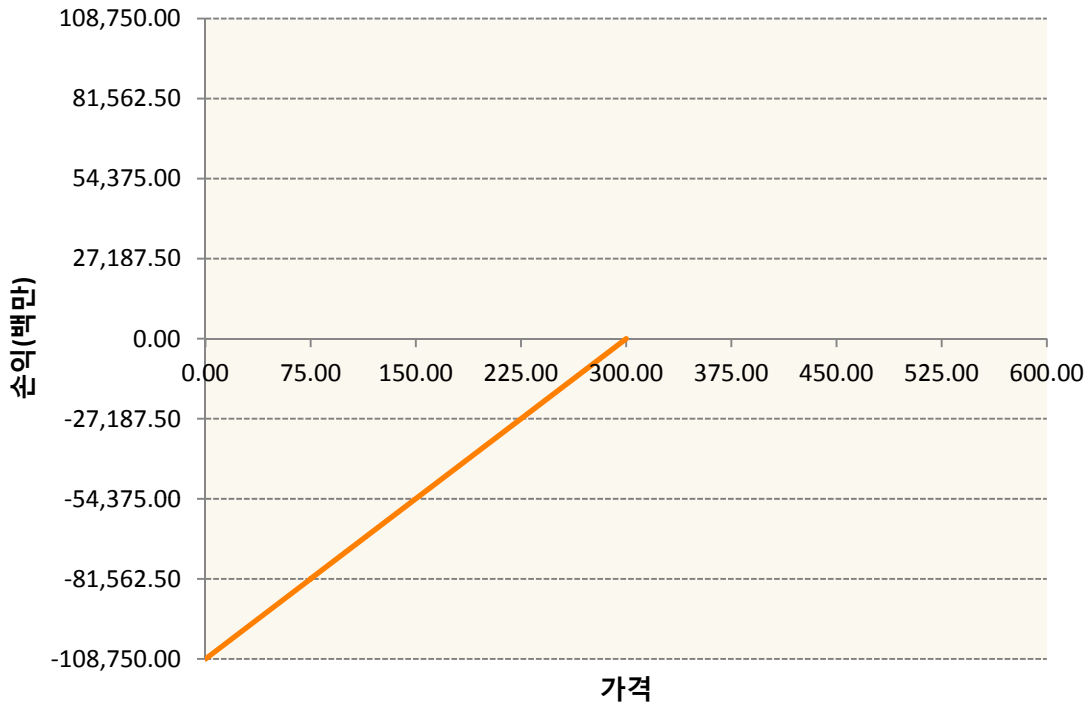


KR4201Q33023-2020-03 콜302.5





KR4301Q33005-2020-03 풋300



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q33007		2020-03 콜300					11,263
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,852	5,635	5,389	5,117	4,823	4,512	4,187
-5.33%	5,081	4,738	4,379	4,006	3,622	3,229	2,829
-2.67%	3,640	3,203	2,763	2,320	1,876	1,430	982
0%	1,375	918	459	0	-459	-919	-1,379
2.67%	-1,711	-2,111	-2,523	-2,944	-3,371	-3,804	-4,242
5.33%	-5,473	-5,769	-6,092	-6,435	-6,797	-7,172	-7,559
8.00%	-9,700	-9,887	-10,110	-10,362	-10,641	-10,943	-11,263
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5					10,334
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,983	4,808	4,602	4,370	4,116	3,843	3,553

-5.33%	4,392	4,098	3,784	3,452	3,107	2,752	2,387
-2.67%	3,232	2,834	2,430	2,021	1,607	1,191	773
0%	1,324	883	441	0	-441	-883	-1,324
2.67%	-1,376	-1,784	-2,199	-2,619	-3,044	-3,471	-3,901
5.33%	-4,769	-5,087	-5,427	-5,784	-6,153	-6,534	-6,924
8.00%	-8,666	-8,879	-9,124	-9,396	-9,690	-10,004	-10,334
KR4301Q33005 2020-03 풋300							6,571
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,353	-6,368	-6,392	-6,424	-6,465	-6,514	-6,571
-5.33%	-3,546	-3,610	-3,687	-3,772	-3,866	-3,967	-4,074
-2.67%	-1,138	-1,276	-1,417	-1,560	-1,706	-1,853	-2,002
0%	468	313	157	0	-157	-315	-472
2.67%	1,211	1,113	1,005	890	769	643	512
5.33%	1,434	1,398	1,350	1,292	1,223	1,145	1,060
8.00%	1,477	1,469	1,455	1,433	1,404	1,367	1,321

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

(단위:백만원)

27,047

공시일	2020-02-18
기준일	2020-02-17

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

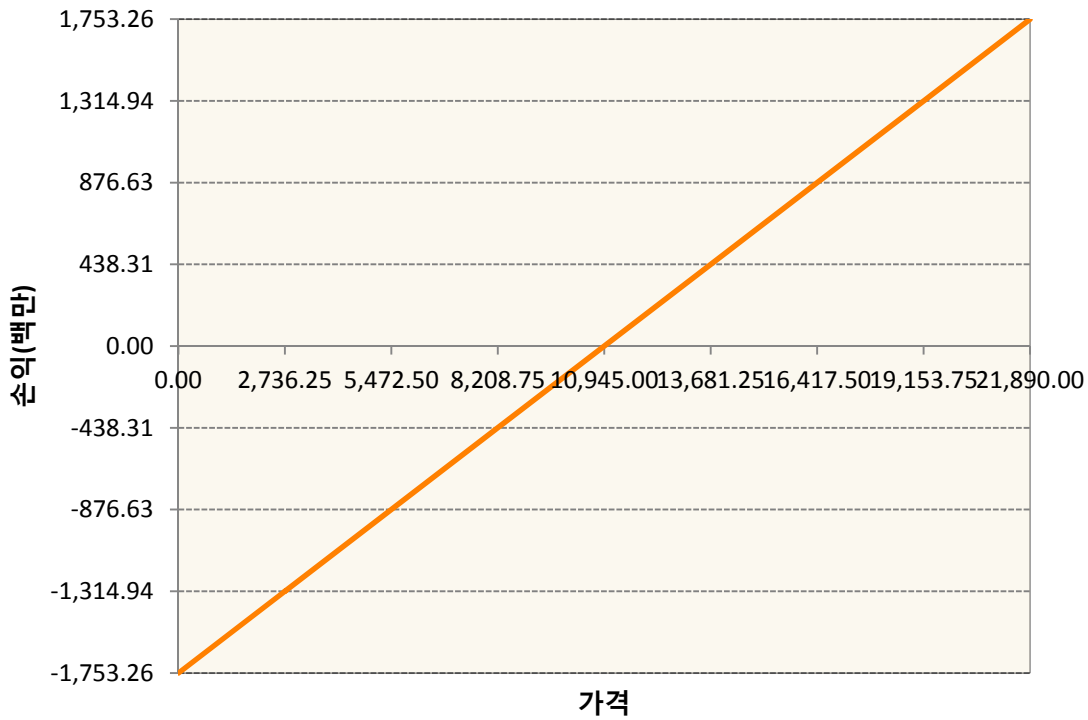
1. 계약금액

(단위:백만원)

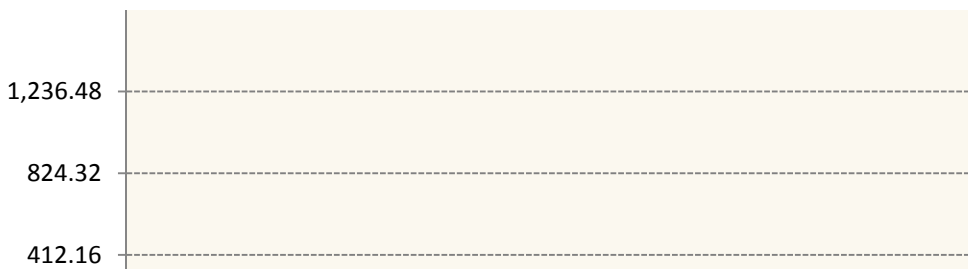
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,753	0	1,753	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,487	-4,487	장내
누계	통화	선도	0	2,146	-2,146	장외

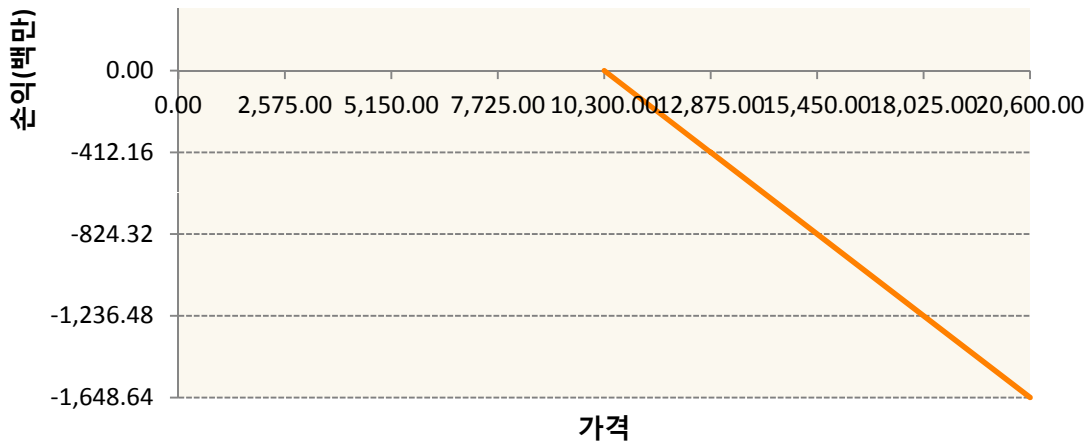
2. 만기시점의 손익구조

HCG0-HSCEI Futures Feb20

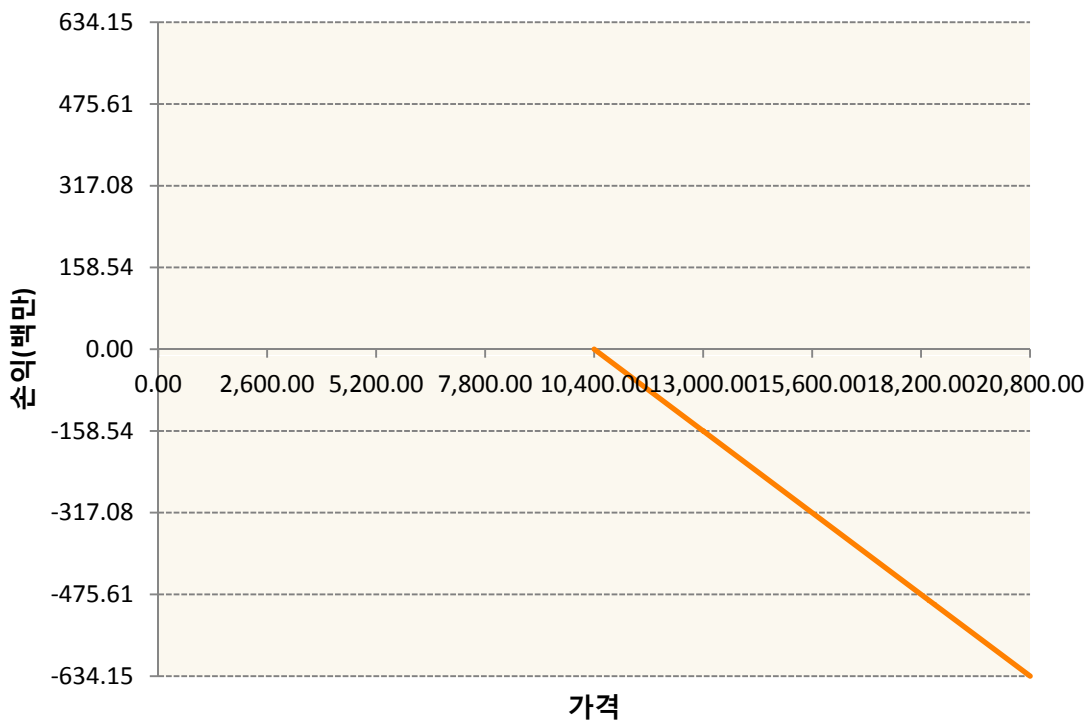


OHHIG0-C103-HSCEI

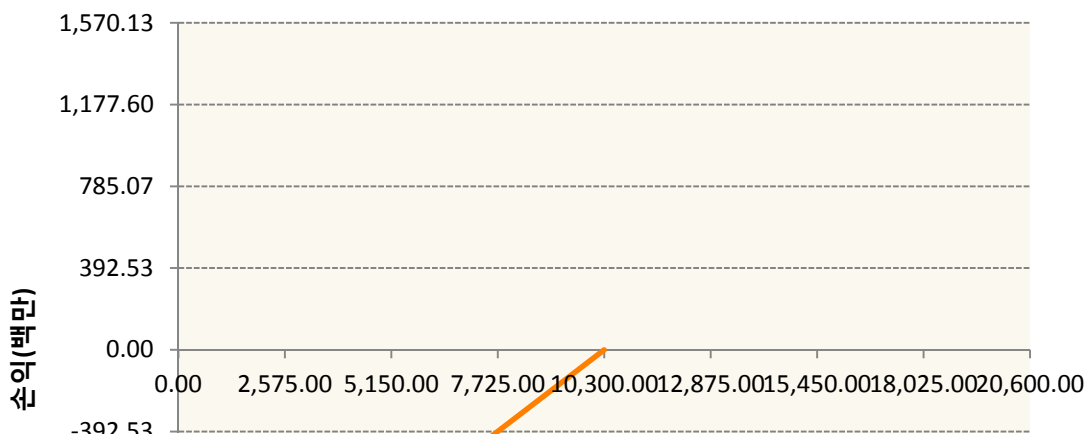


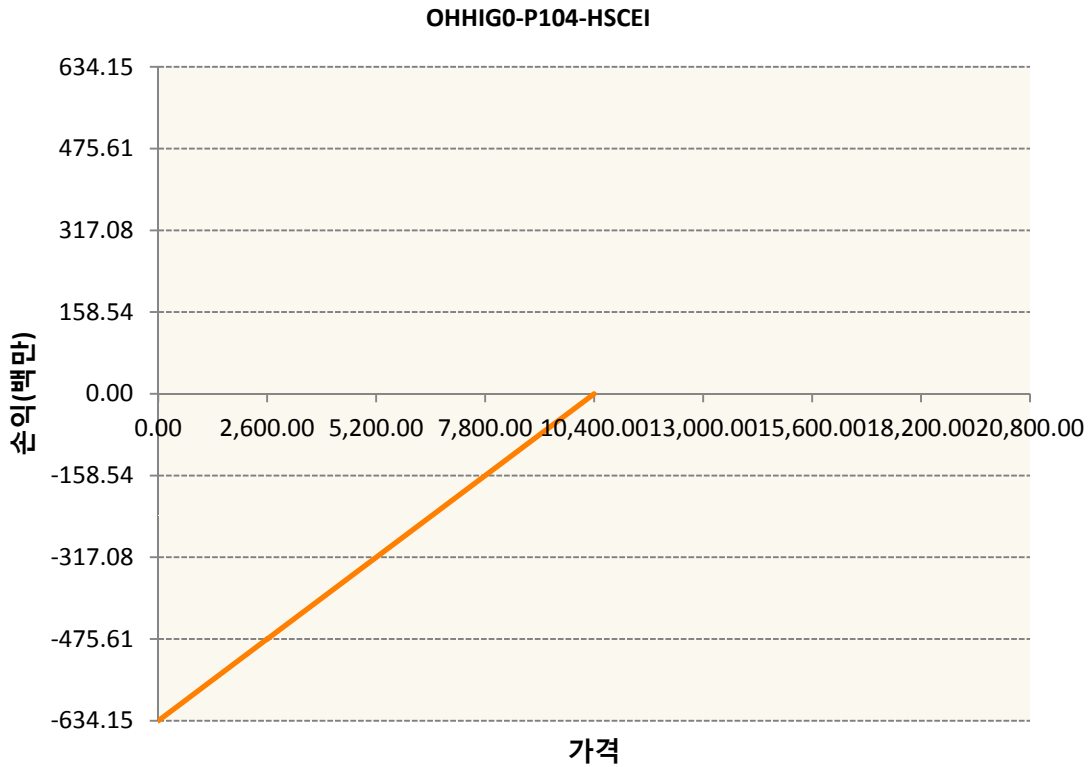


OHHIG0-C104-HSCEI



OHHIG0-P103-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	172
HCG0 HSCEI Futures Feb20	140
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)

511

공시일	2020-02-18
기준일	2020-02-17

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

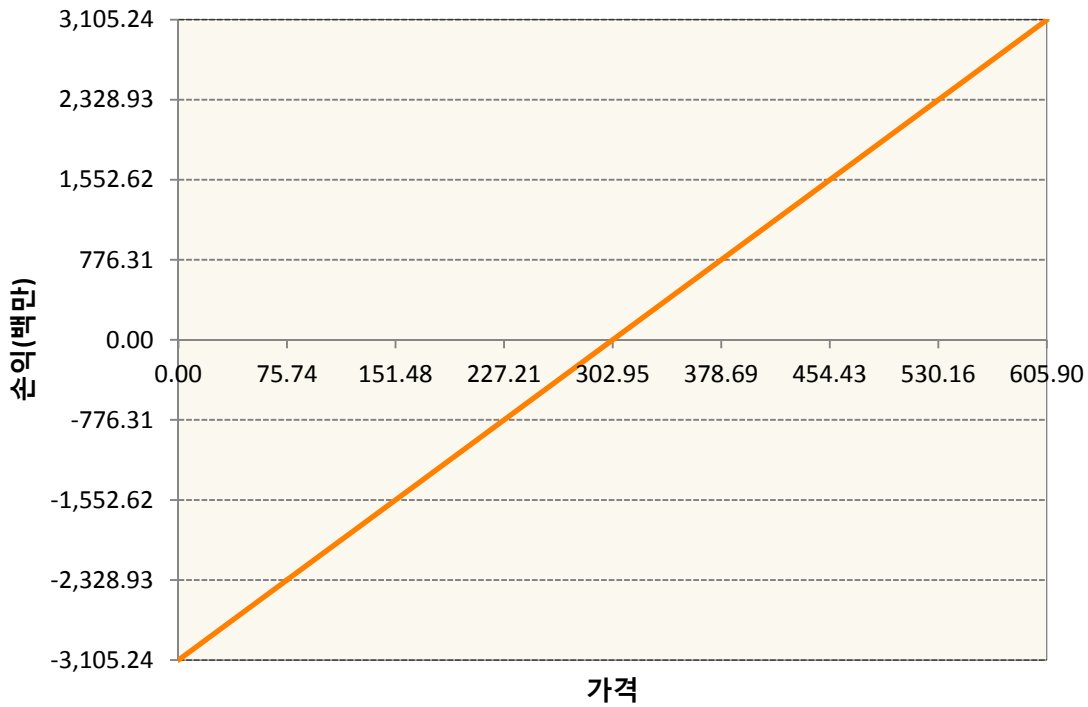
1. 계약금액

(단위:백만원)

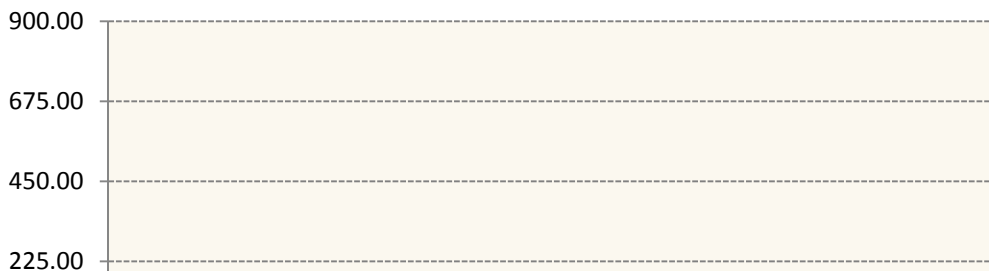
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,105	0	3,105	장내
누계	유가증권	스왑	6,125	0	6,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	5,568	-5,568	장내

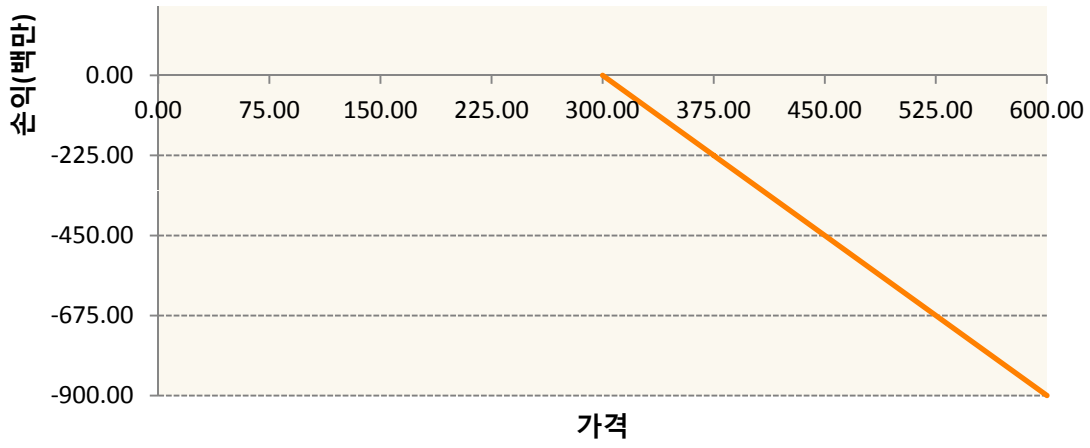
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

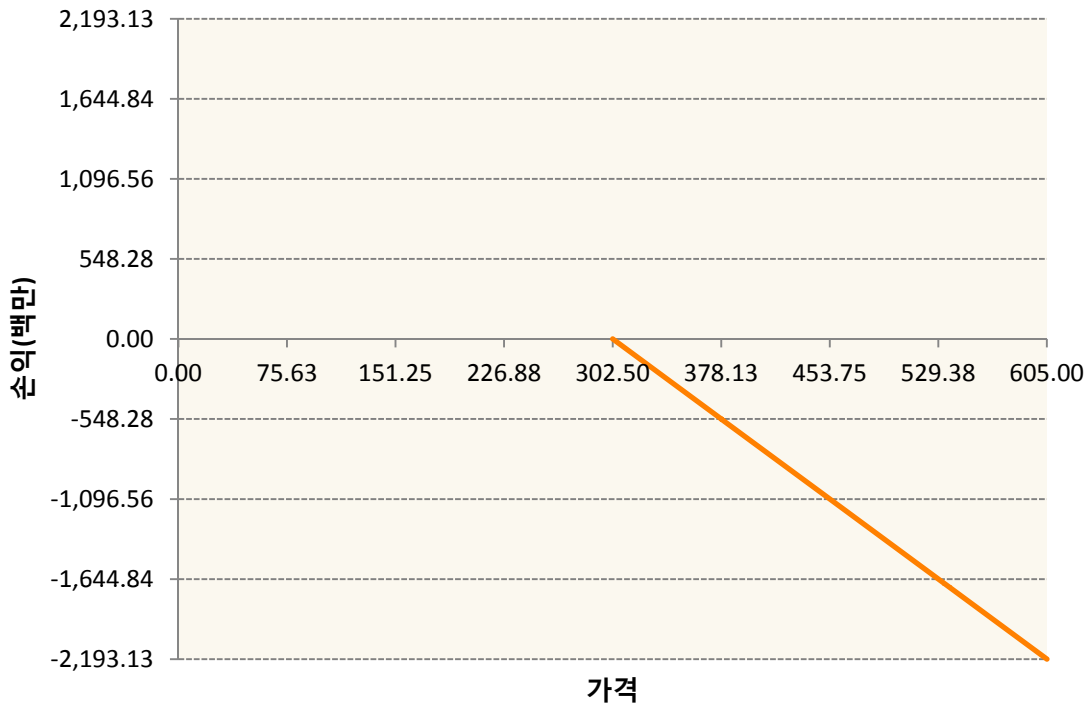


KR4201Q33007-2020-03 콜300

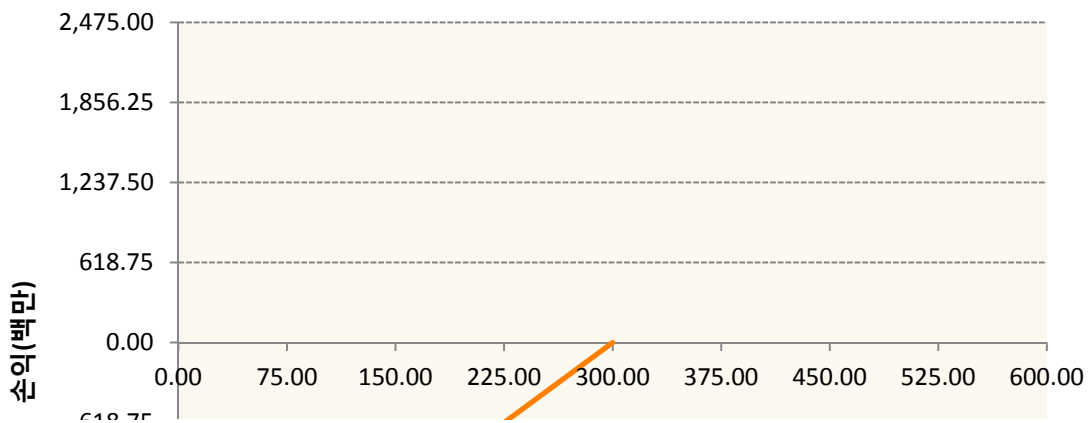


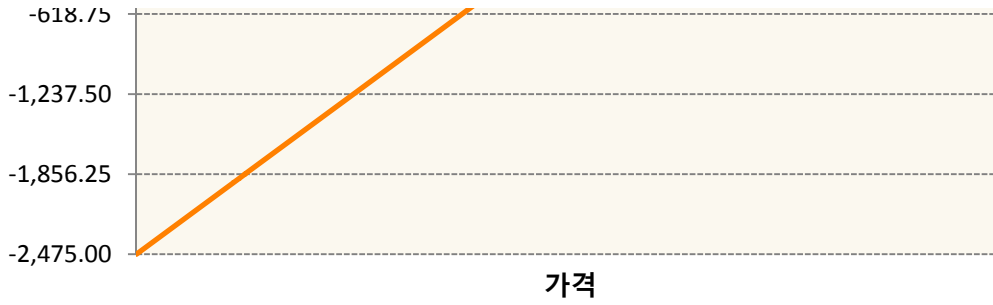


KR4201Q33023-2020-03 콜302.5



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%	30	29	28	26	25	23	21	
-5.33%	26	24	22	21	19	17	15	
-2.67%	19	16	14	12	10	7	5	
0%	7	5	2	0	-2	-5	-7	
2.67%	-9	-11	-13	-15	-17	-20	-22	
5.33%	-28	-30	-31	-33	-35	-37	-39	
8.00%	-50	-51	-52	-53	-55	-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%	65	63	60	57	54	50	46
-5.33%	57	53	49	45	40	36	31
-2.67%	42	37	32	26	21	16	10
0%	17	11	6	0	-6	-11	-17
2.67%	-18	-23	-29	-34	-40	-45	-51
5.33%	-62	-66	-71	-75	-80	-85	-90
8.00%	-113	-116	-119	-122	-126	-130	-135
KR4301Q33005 2020-03 풋300							150
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-145	-145	-145	-146	-147	-148	-150
-5.33%	-81	-82	-84	-86	-88	-90	-93
-2.67%	-26	-29	-32	-36	-39	-42	-46
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	28	25	23	20	18	15	12
5.33%	33	32	31	29	28	26	24
8.00%	34	33	33	33	32	31	30

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

(단위:백만원)

1,063

공시일	2020-02-18
기준일	2020-02-17

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

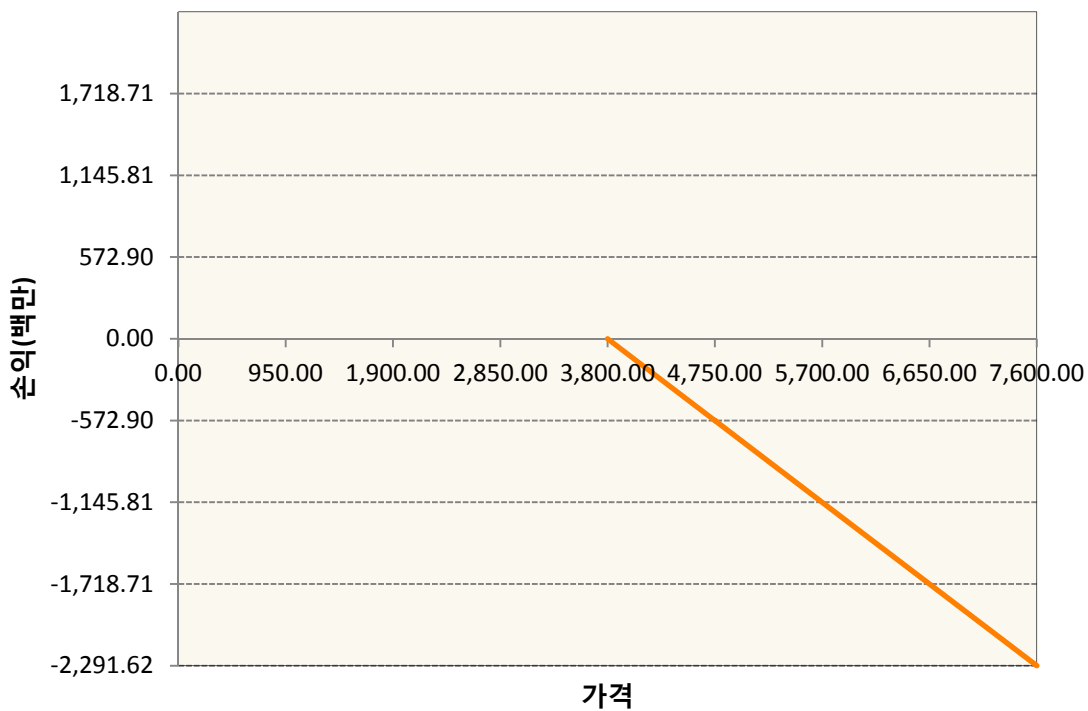
1. 계약금액

(단위:백만원)

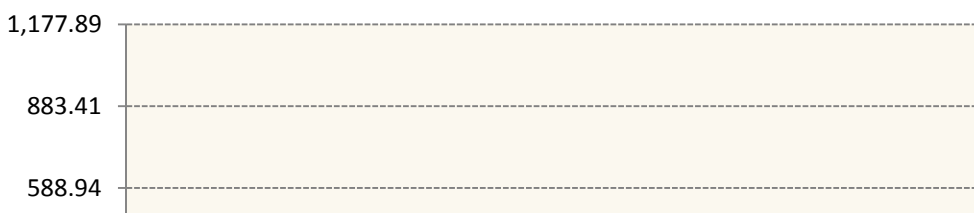
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	398	0	398	
누계	유가증권	스왑	13,408	0	13,408	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,939	-6,939	장내
누계	통화	선도	0	3,367	-3,367	장외

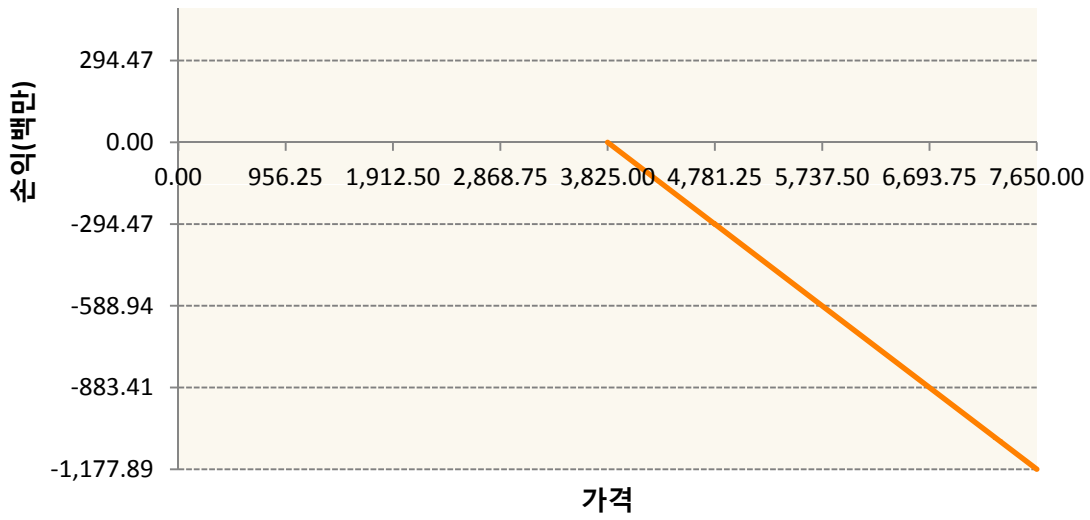
2. 만기시점의 손익구조

OESXG0-C3800-EURO STOXX 50

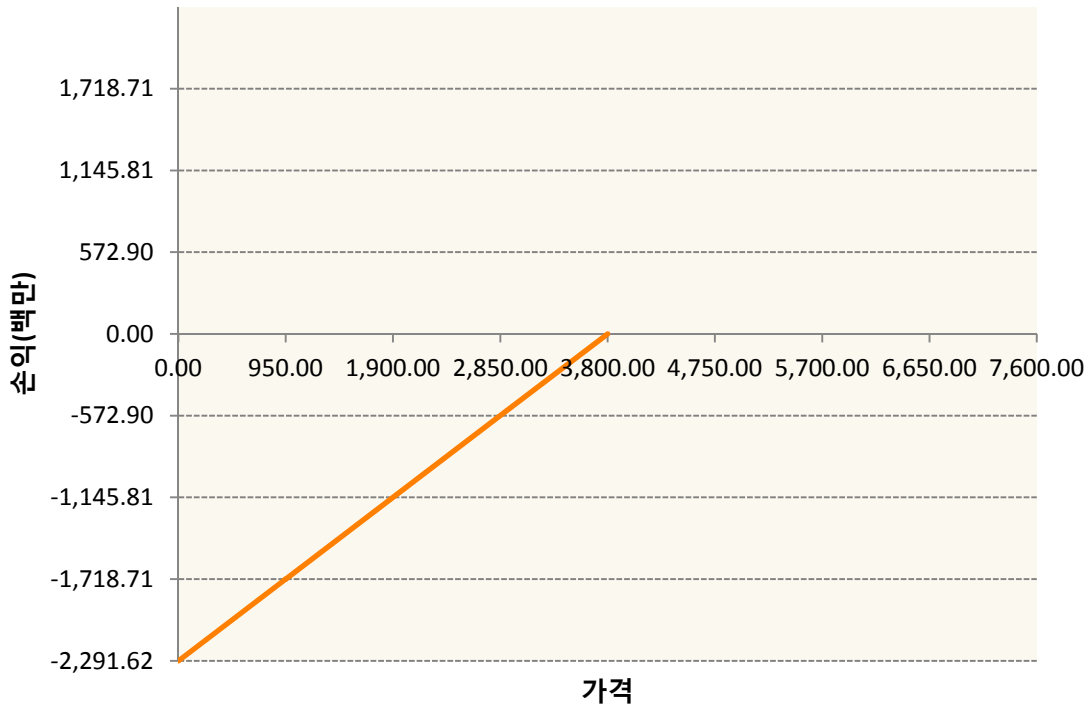


OESXG0-C3825-EURO STOXX 50

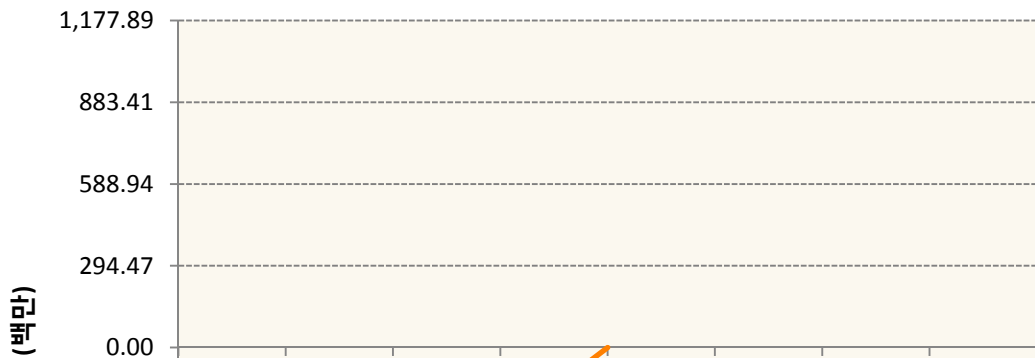


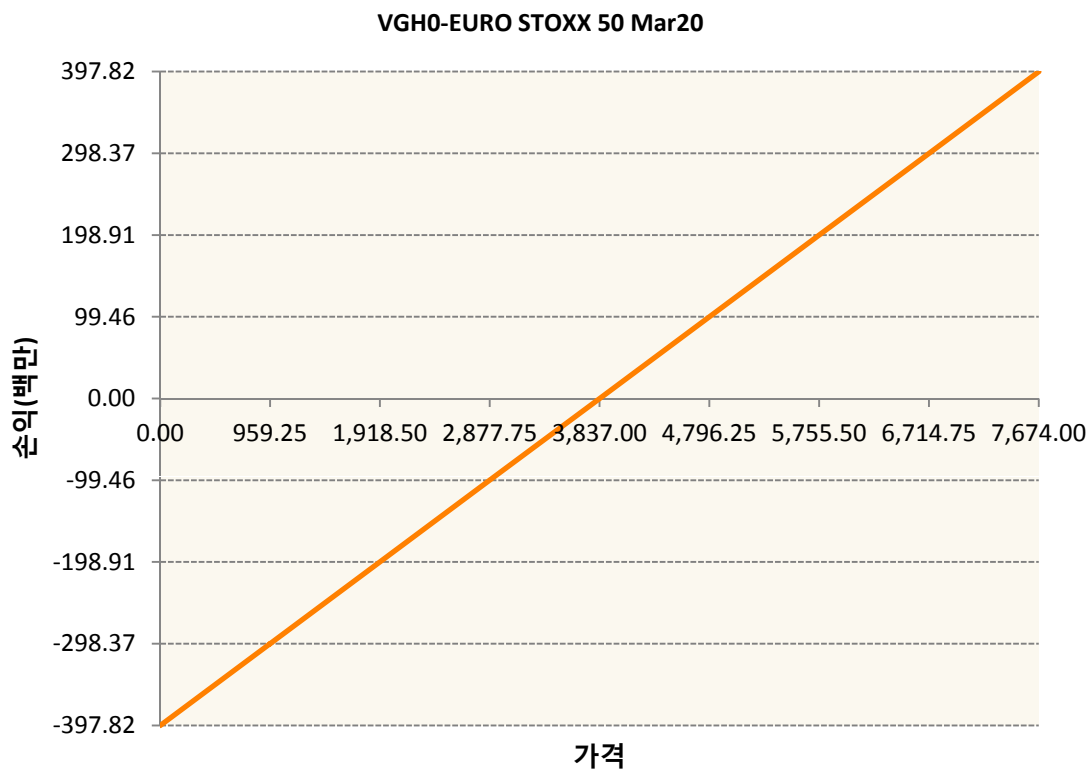
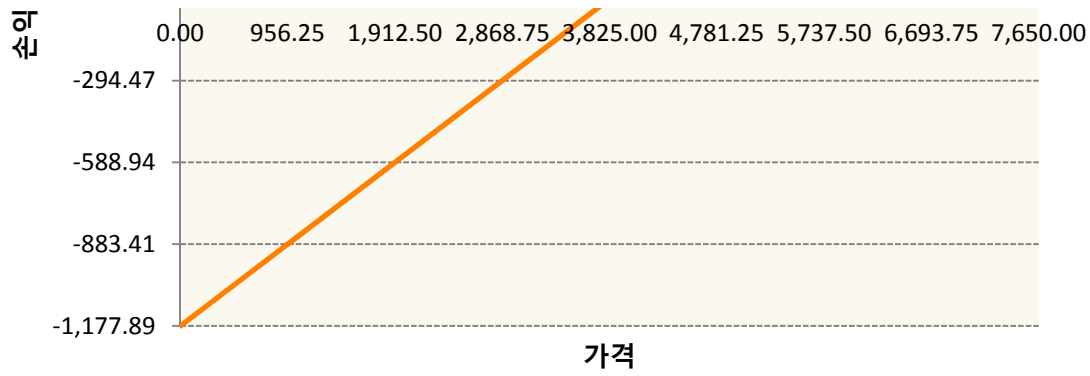


OESXG0-P3800-EURO STOXX 50



OESXG0-P3825-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		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
VGH0 EURO STOXX 50 Mar20		32

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

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

(단위:백만원)

963

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

(단위:백만원)

85

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

(단위:백만원)

125

공시일	2020-02-18
기준일	2020-02-17

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

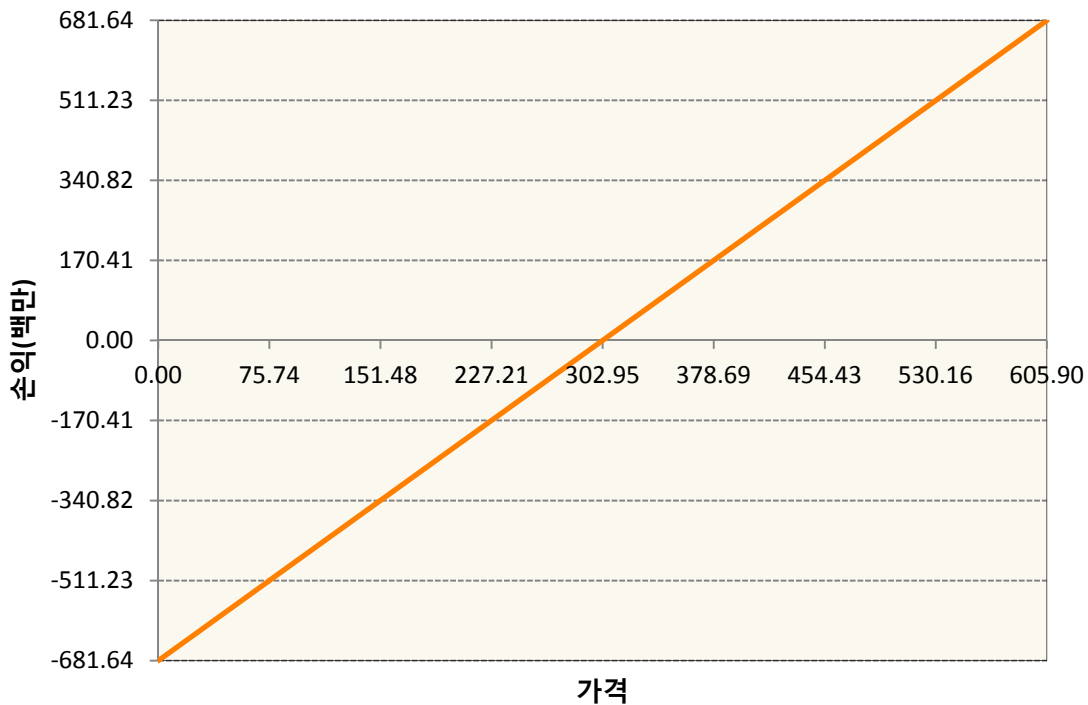
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	682	0	682	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	2020-02-18
기준일	2020-02-17

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

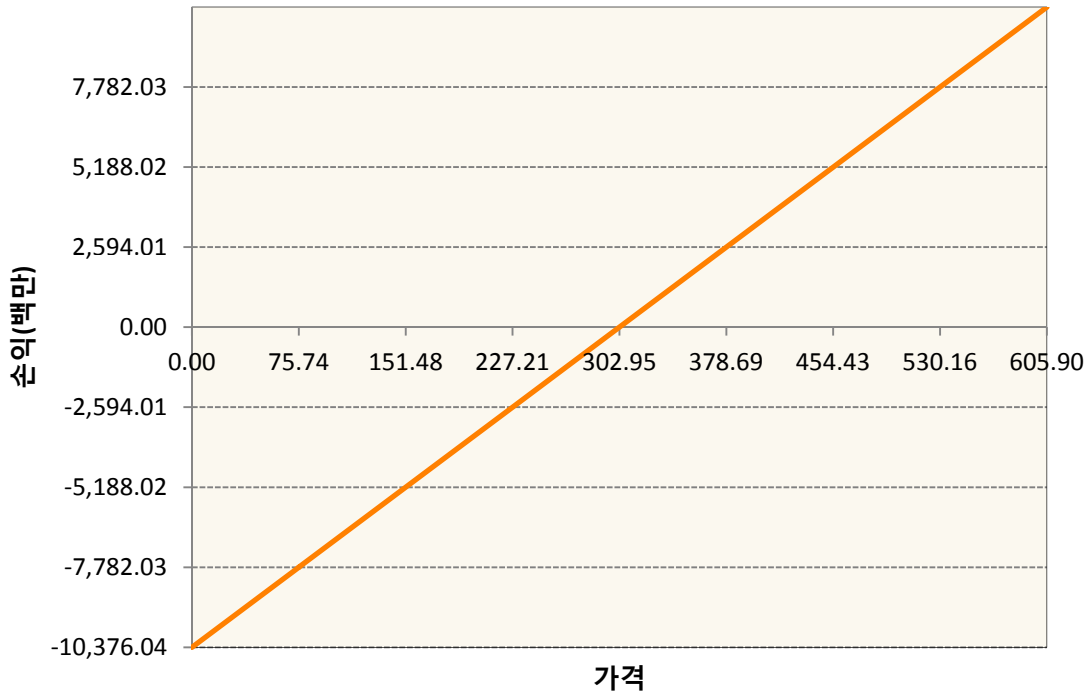
1. 계약금액

(단위:백만원)

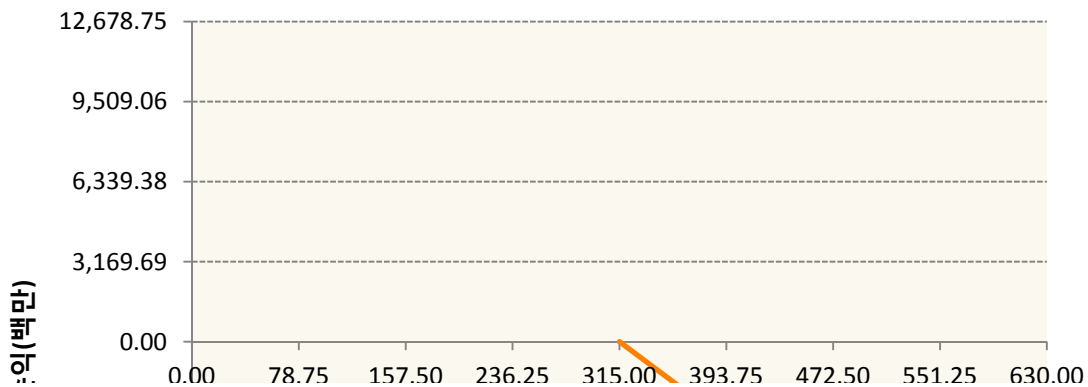
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,376	0	10,376	장내
누계	유가증권	옵션	2,257	20,854	-18,598	장내

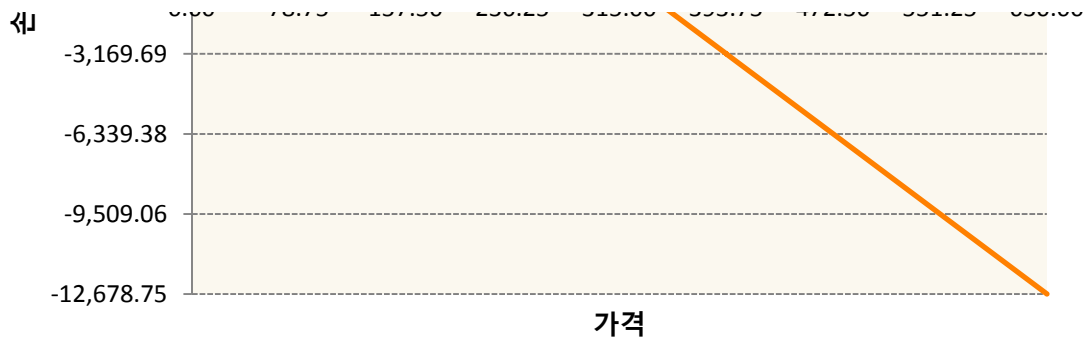
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

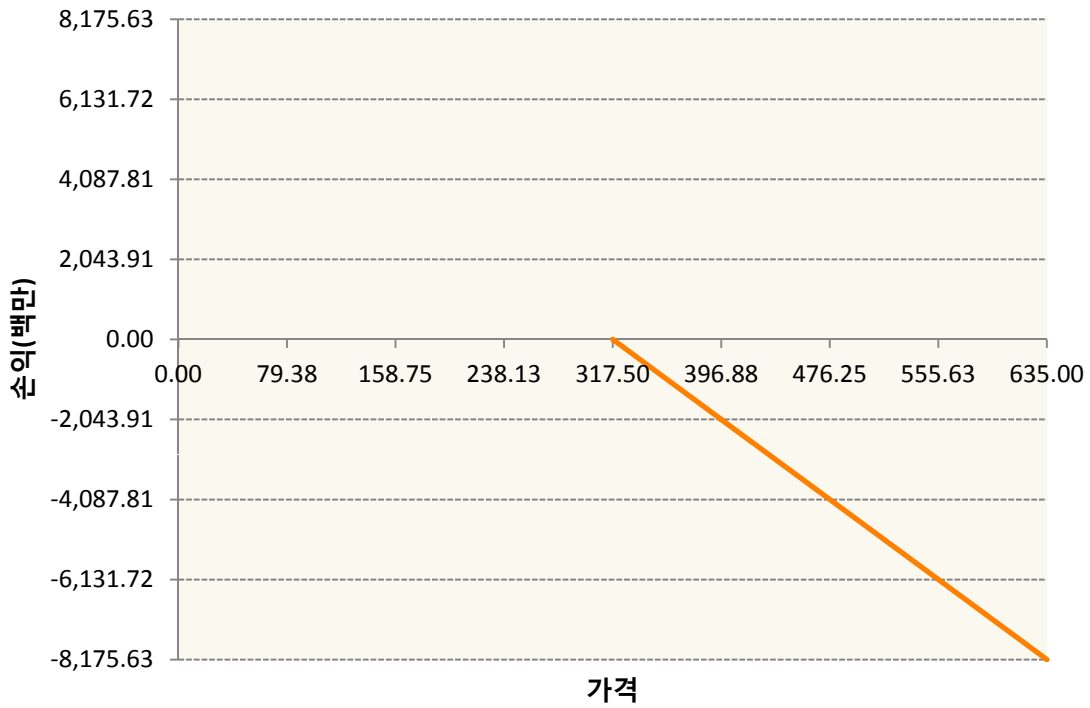


KR4201Q33155-2020-03 콜315

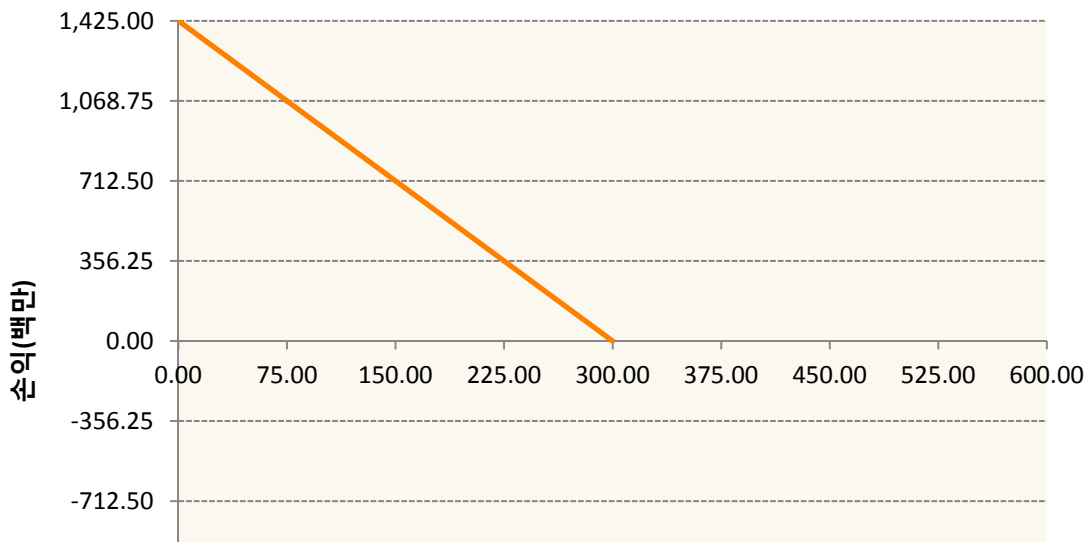


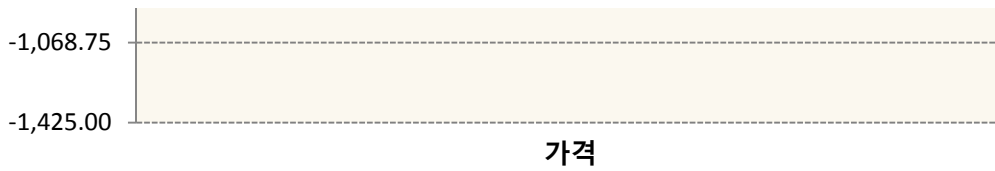


KR4201Q33171-2020-03 콜317.5

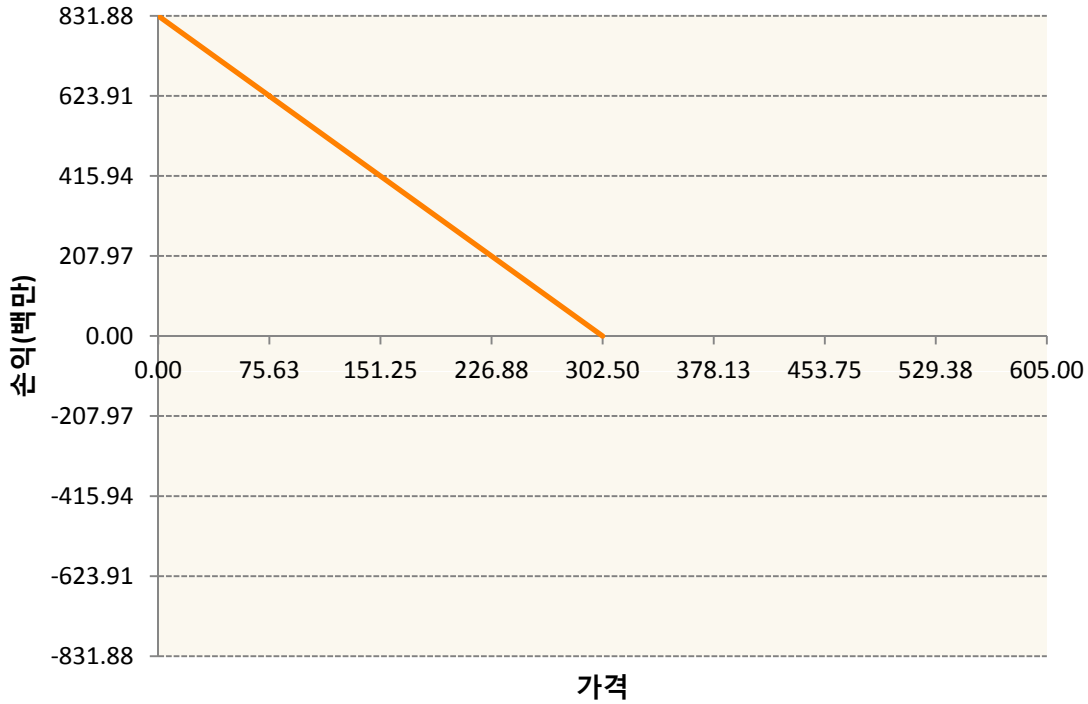


KR4301Q33005-2020-03 풋300





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						589
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	187	182	176	168	158	146	132	
-5.33%	175	165	153	138	122	104	85	
-2.67%	145	127	107	85	62	38	13	

0%	82	56	28	0	-29	-58	-88
2.67%	-27	-59	-92	-124	-157	-189	-222
5.33%	-191	-224	-257	-290	-323	-356	-389
8.00%	-408	-437	-466	-496	-527	-558	-589
KR4201Q33171 2020-03 콜317.5							355
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	103	100	97	93	87	80	73
-5.33%	97	92	85	77	68	57	46
-2.67%	82	72	61	48	34	20	5
0%	49	34	17	0	-18	-36	-54
2.67%	-11	-31	-51	-72	-92	-113	-133
5.33%	-105	-127	-148	-169	-191	-212	-234
8.00%	-234	-253	-273	-294	-314	-335	-355
KR4301Q33005 2020-03 풋300							86
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	83	83	84	84	85	85	86
-5.33%	46	47	48	49	51	52	53
-2.67%	15	17	19	20	22	24	26
0%	-6	-4	-2	0	2	4	6
2.67%	-16	-15	-13	-12	-10	-8	-7
5.33%	-19	-18	-18	-17	-16	-15	-14
8.00%	-19	-19	-19	-19	-18	-18	-17
KR4301Q33021 2020-03 풋302.5							53
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	52	52	52	52	52	53	53
-5.33%	30	30	31	31	32	33	33
-2.67%	11	12	12	13	14	16	17
0%	-4	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-11	-10	-9	-8	-7	-6	-5
5.33%	-14	-13	-13	-12	-12	-11	-10
8.00%	-14	-14	-14	-14	-14	-13	-13

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

(단위:백만원)

1,541

공시일	2020-02-18
기준일	2020-02-17

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	213,833	0	213,833	

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	2020-02-18
기준일	2020-02-17

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	185,959	0	185,959	

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	2020-02-18
기준일	2020-02-17

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	530,858	0	530,858	
누계	통화	선도	0	579,874	-579,874	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019Z02: KRW/USD 18-02-20E	189
FX21019Z02: KRW/USD 18-02-20E	2,027
FX21019Z02: KRW/USD 18-02-20E	947
FX21019Z03: KRW/USD 24-02-20E	3,788
FX21019Z04: KRW/USD 26-02-20E	1,894
FX21019Z04: KRW/USD 26-02-20E	2,027
FX21019Z04: KRW/USD 26-02-20E	189
FX21020F01: KRW/USD 18-02-20E	1,705
FX21020F01: KRW/USD 18-02-20E	284
FX21020F02: KRW/USD 21-02-20E	1,894
FX21020F02: KRW/USD 21-02-20E	3,258
FX21020F02: KRW/USD 23-03-20E	1,525
FX21020F02: KRW/USD 23-03-20E	1,421
FX21020F02: KRW/USD 28-02-20E	1,894
FX21020F03: KRW/USD 28-02-20E	2,936
FX21020F03: KRW/USD 31-03-20E	3,031
FX21020F04: KRW/USD 31-03-20E	2,841
FX21020F04: KRW/USD 28-02-20E	189
FX21020G00: KRW/USD 06-04-20E	2,557
FX21020G00: KRW/USD 06-03-20E	2,368
FX21020G00: KRW/USD 12-03-20E	947
FX21020G01: KRW/USD 12-03-20E	1,174
FX21020G01: KRW/USD 12-03-20E	1,203
FX21020G01: KRW/USD 12-03-20E	947
FX21020G02: KRW/USD 18-03-20E	1,894
FX21020G02: KRW/USD 18-03-20E	3,258

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

15,583

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

(단위:백만원)

127

공시일	2020-02-18
기준일	2020-02-17

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

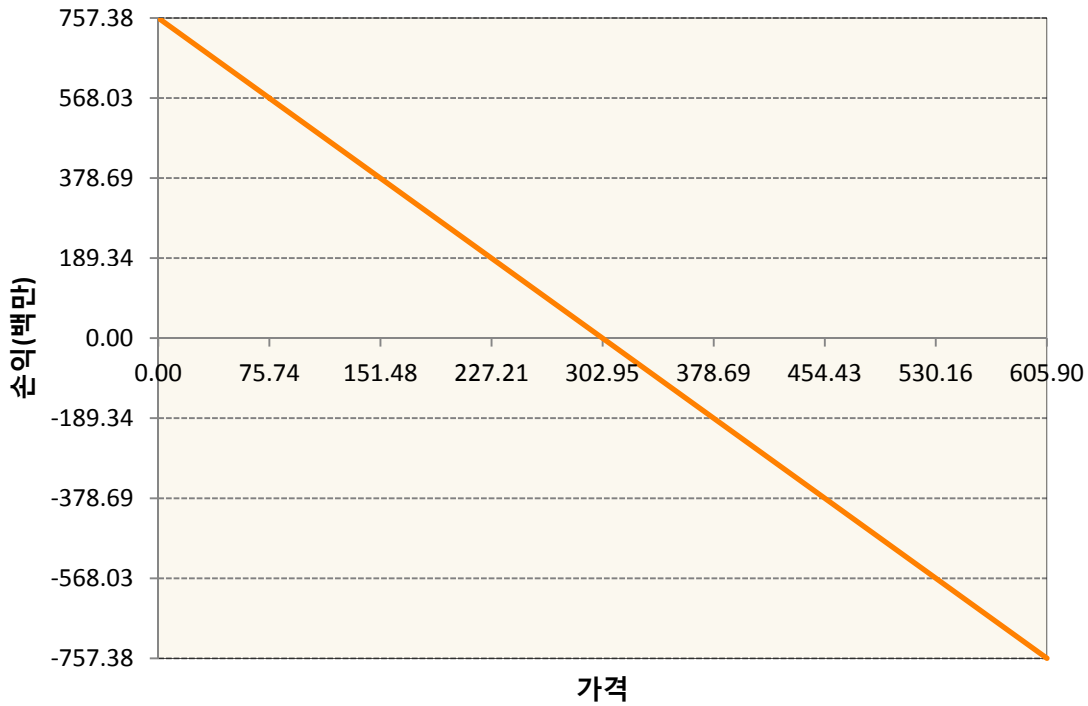
1. 계약금액

(단위:백만원)

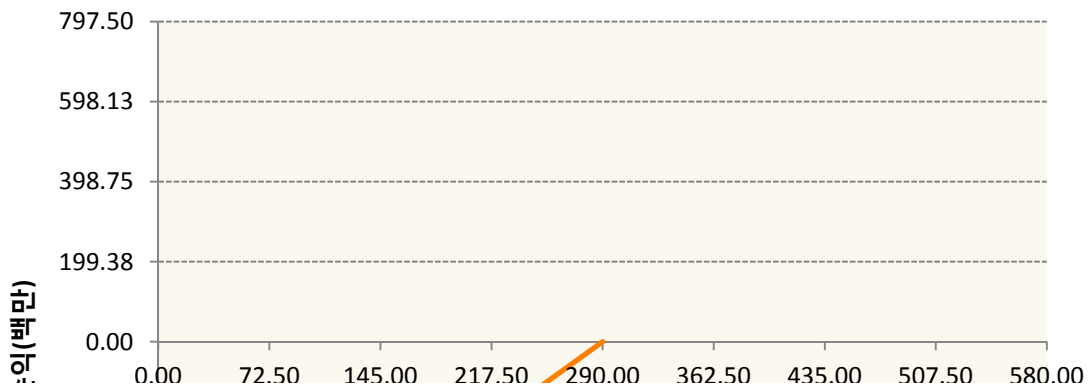
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	757	-757	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,503	-3,503	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

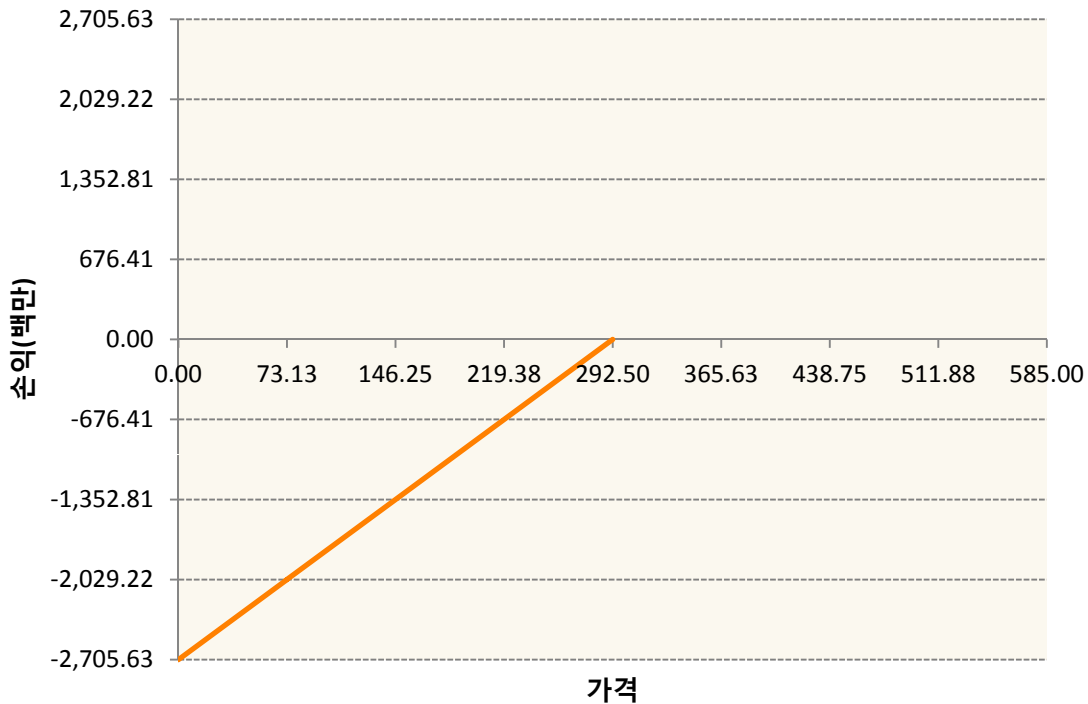


KR4301Q32908-2020-03 풋290





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%	-30	-31	-31	-32	-33	-34	-34
-5.33%	-13	-14	-15	-16	-17	-18	-19
-2.67%	-2	-3	-4	-6	-7	-8	-9
0%	2	1	1	0	-1	-2	-2
2.67%	3	3	3	2	2	1	1
5.33%	3	3	3	3	3	3	2
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

KR4301Q32924

2020-03 풋292.5

130

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-118	-119	-121	-123	-125	-127	-130
-5.33%	-55	-58	-61	-65	-68	-72	-75
-2.67%	-12	-16	-20	-24	-27	-31	-35
0%	8	6	3	0	-3	-6	-10
2.67%	14	13	12	10	9	7	5
5.33%	15	15	15	14	13	12	11
8.00%	15	15	15	15	15	15	14

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

(단위:백만원)

187

공시일	2020-02-18
기준일	2020-02-17

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	275	-275	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	11,120	0	11,120	
누계	통화	선도	355	11,815	-11,460	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020F03(KRW/USD 28-02-20E	206
FX21020F04(KRW/USD 28-02-20E	295
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	2020-02-18
기준일	2020-02-17

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

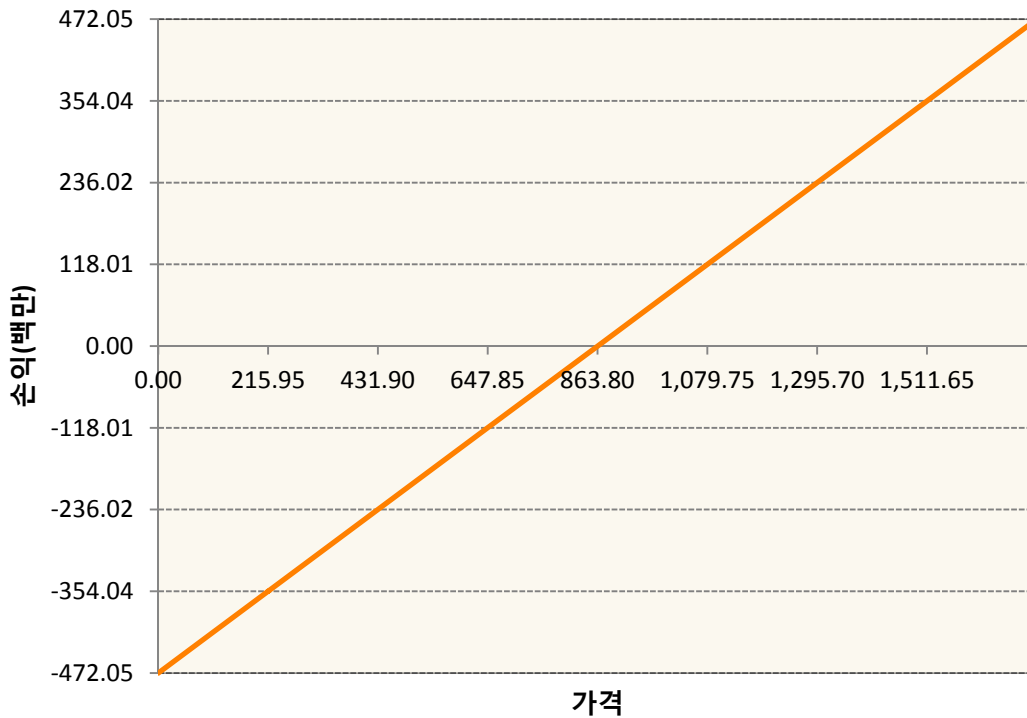
1. 계약금액

(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	472	0	472	
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	2020-02-18
기준일	2020-02-17

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

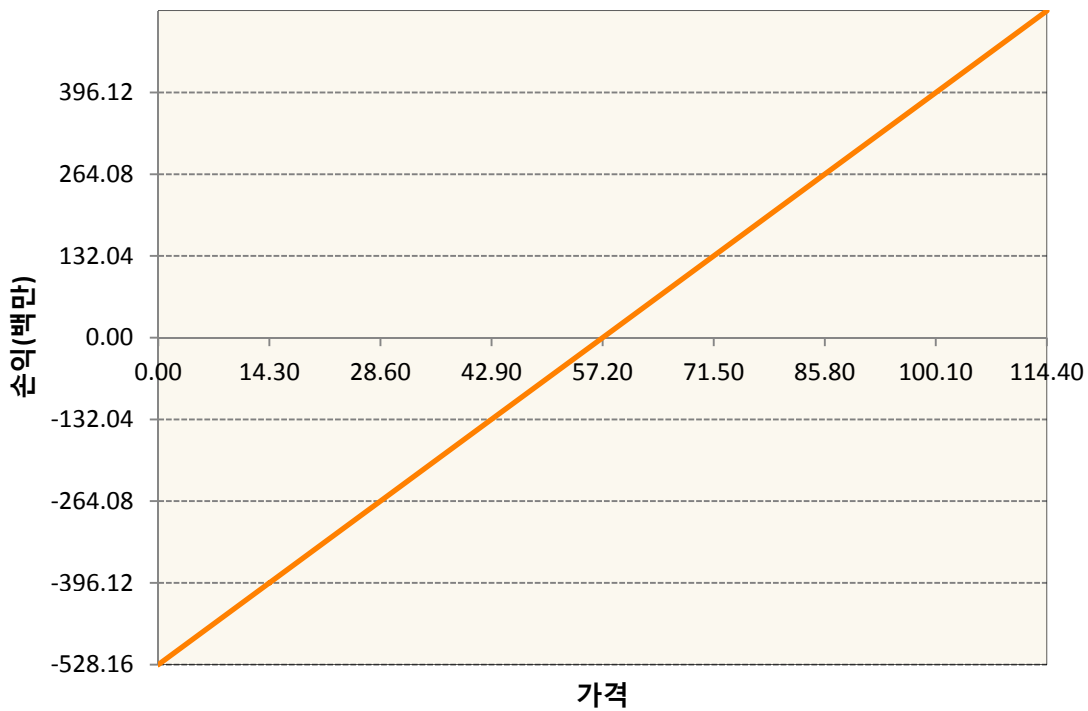
1. 계약금액

(단위:백만원)

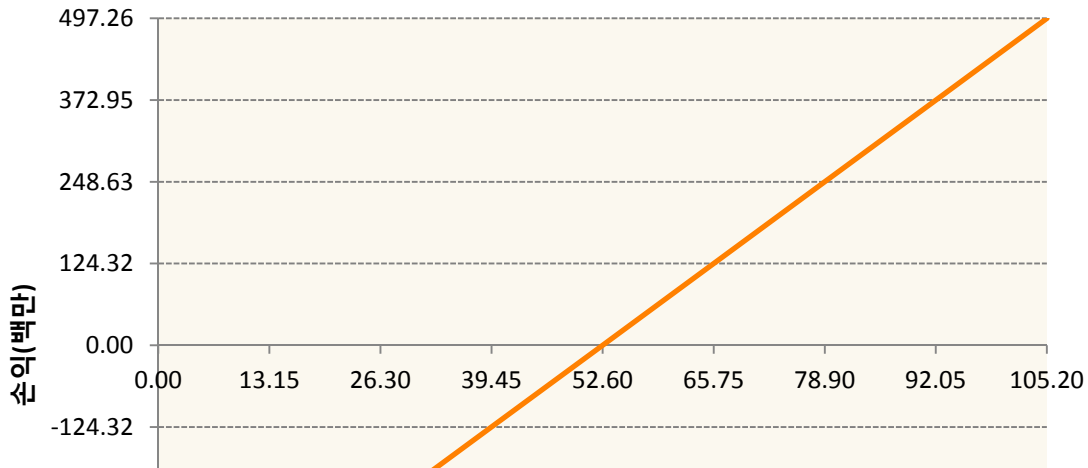
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,153	189	1,964	

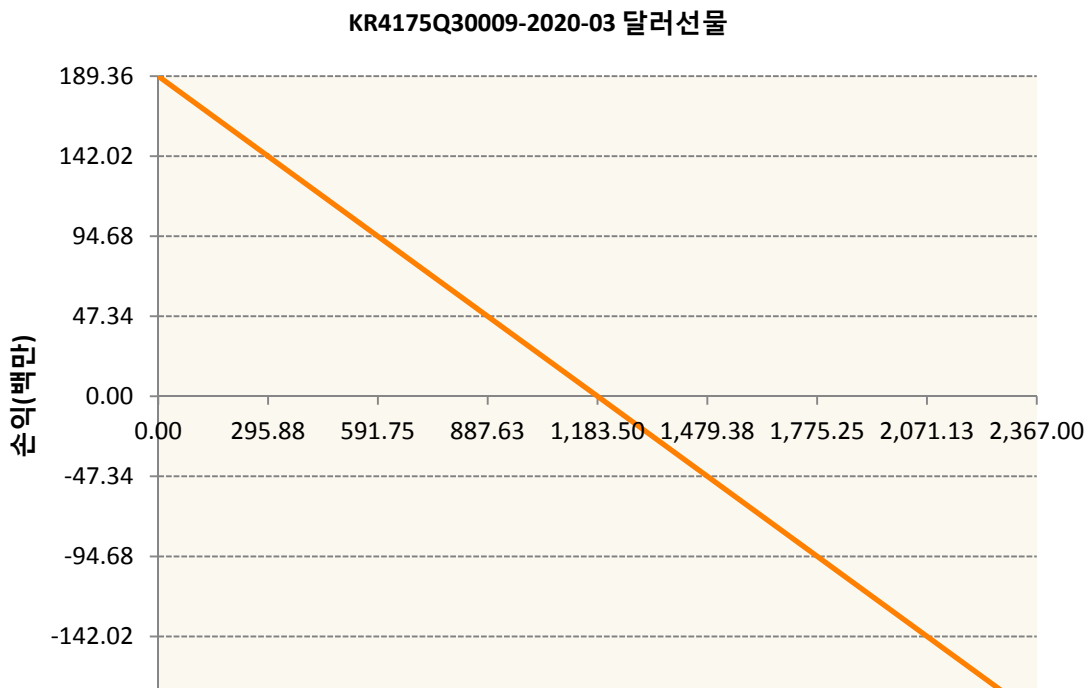
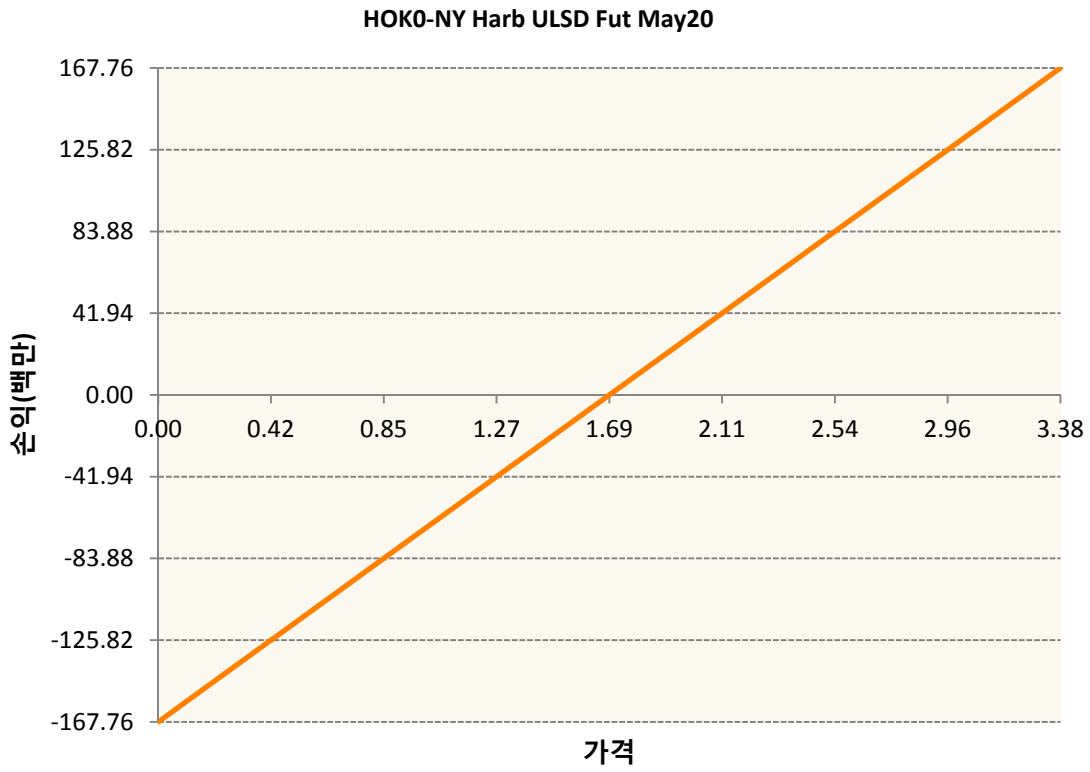
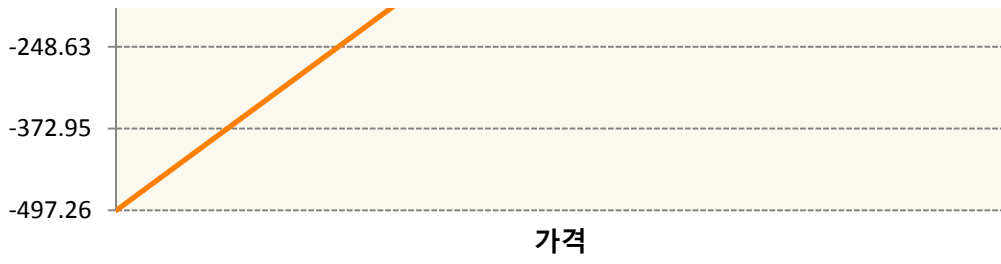
2. 만기시점의 손익구조

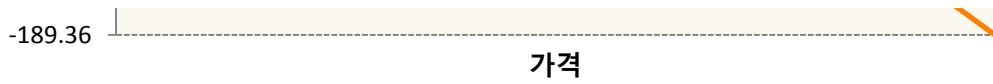
COK0-BRENT CRUDE FUTR May20



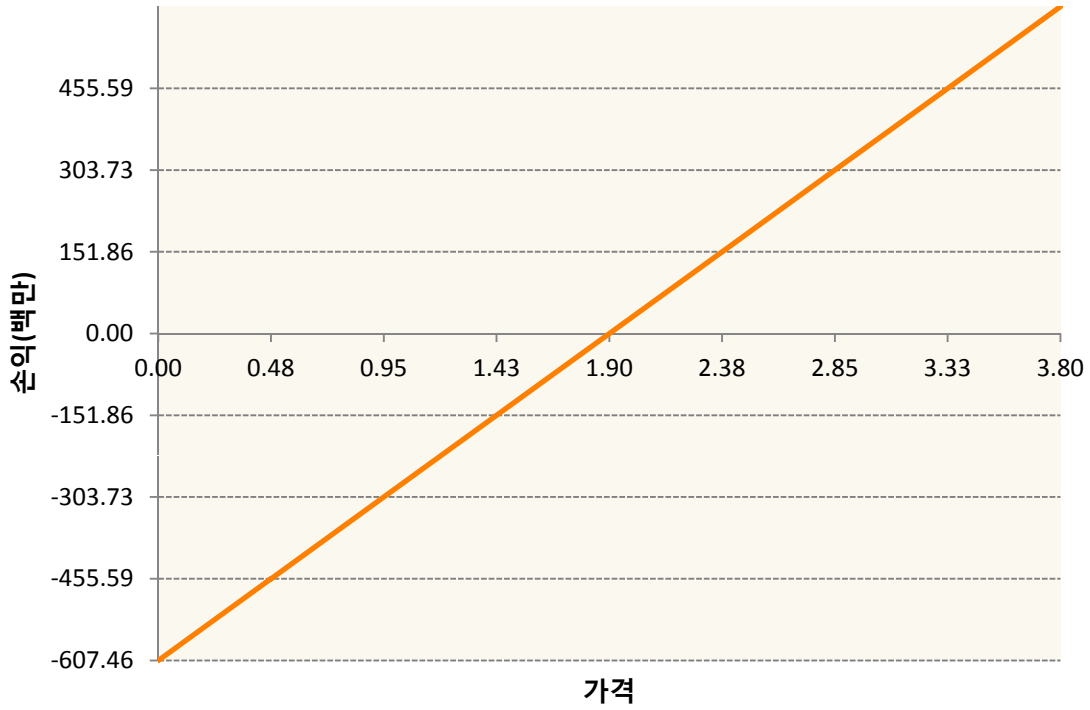
CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20



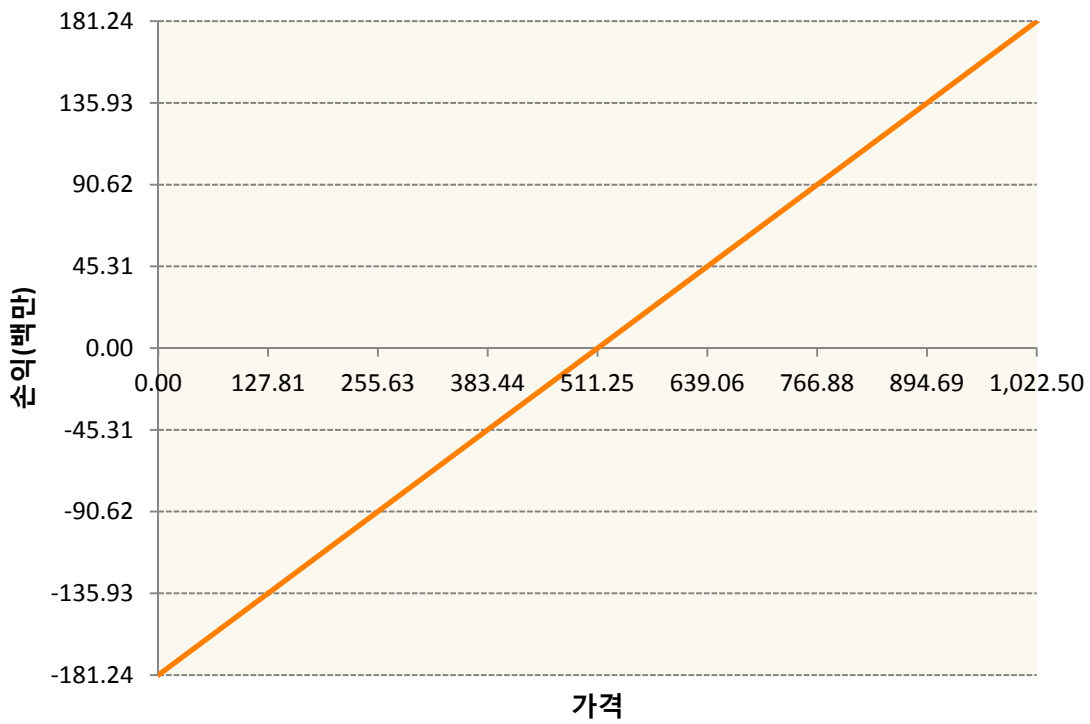




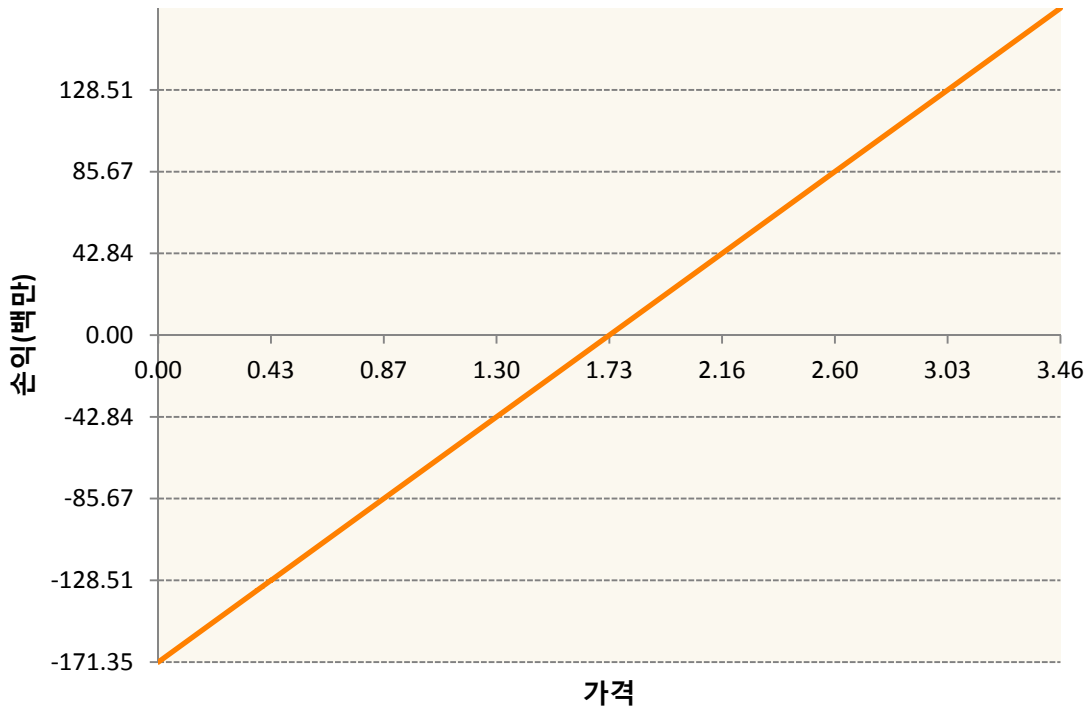
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



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	40
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)

344

공시일	2020-02-18
기준일	2020-02-17

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

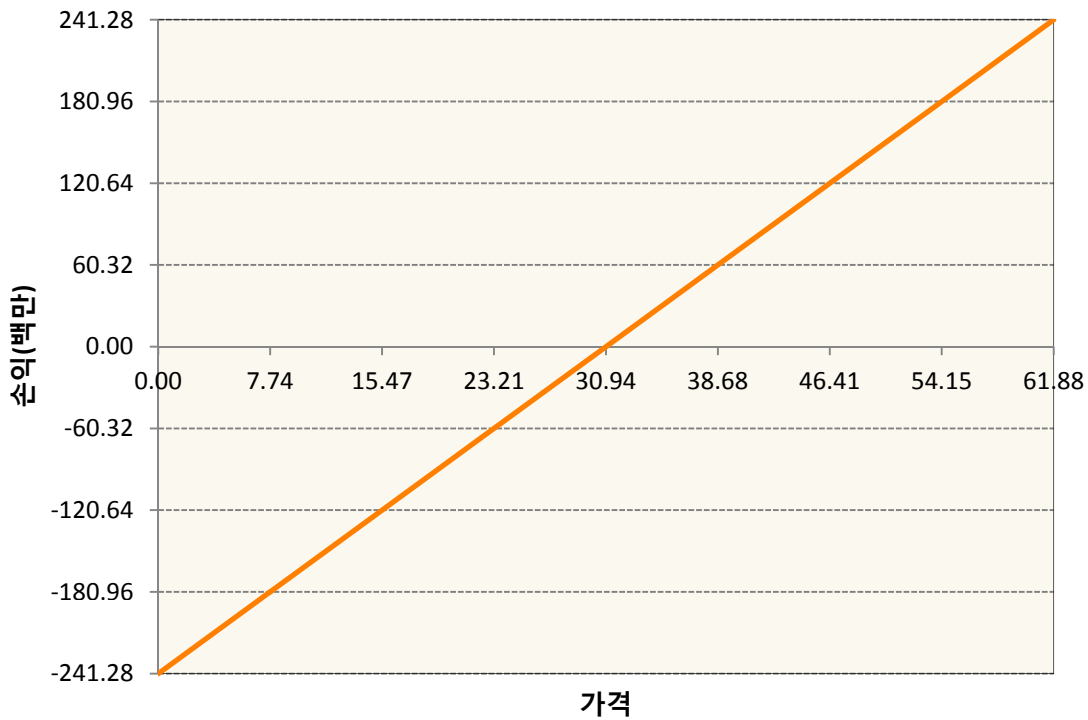
1. 계약금액

(단위:백만원)

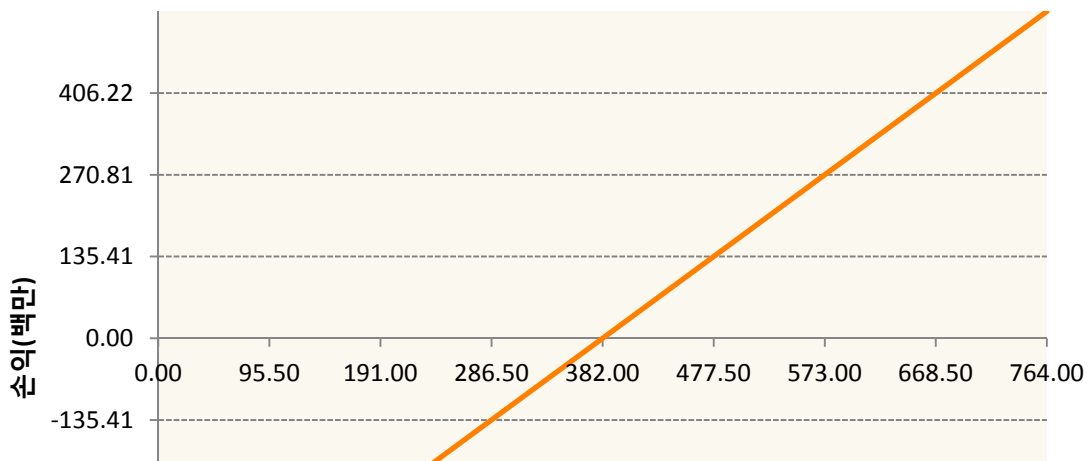
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,735	154	2,582	

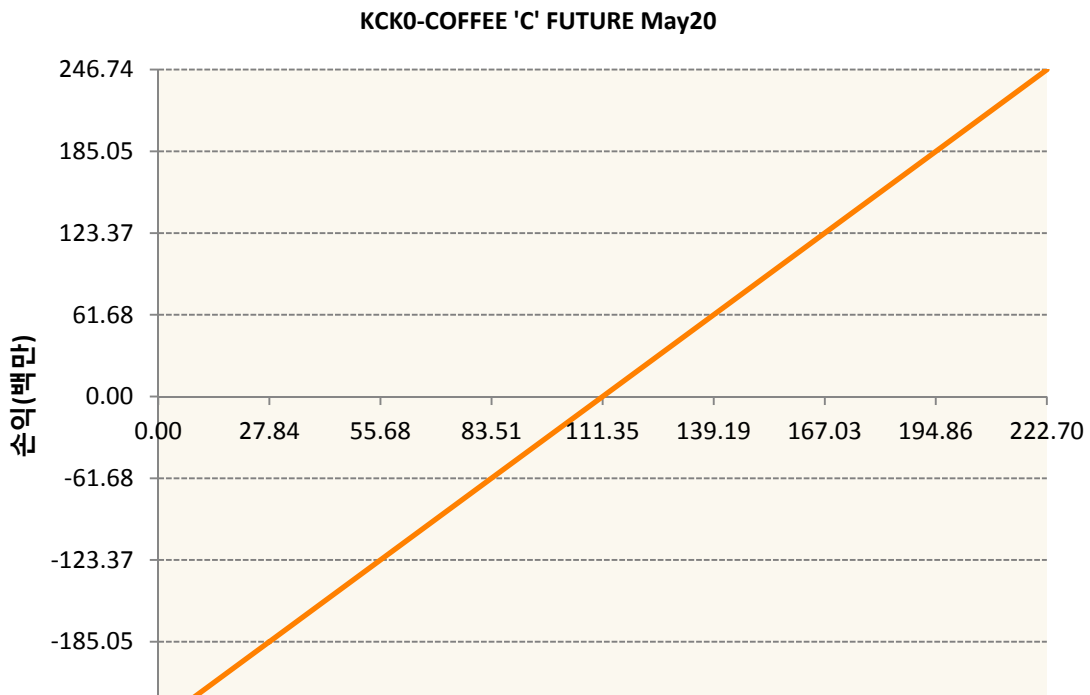
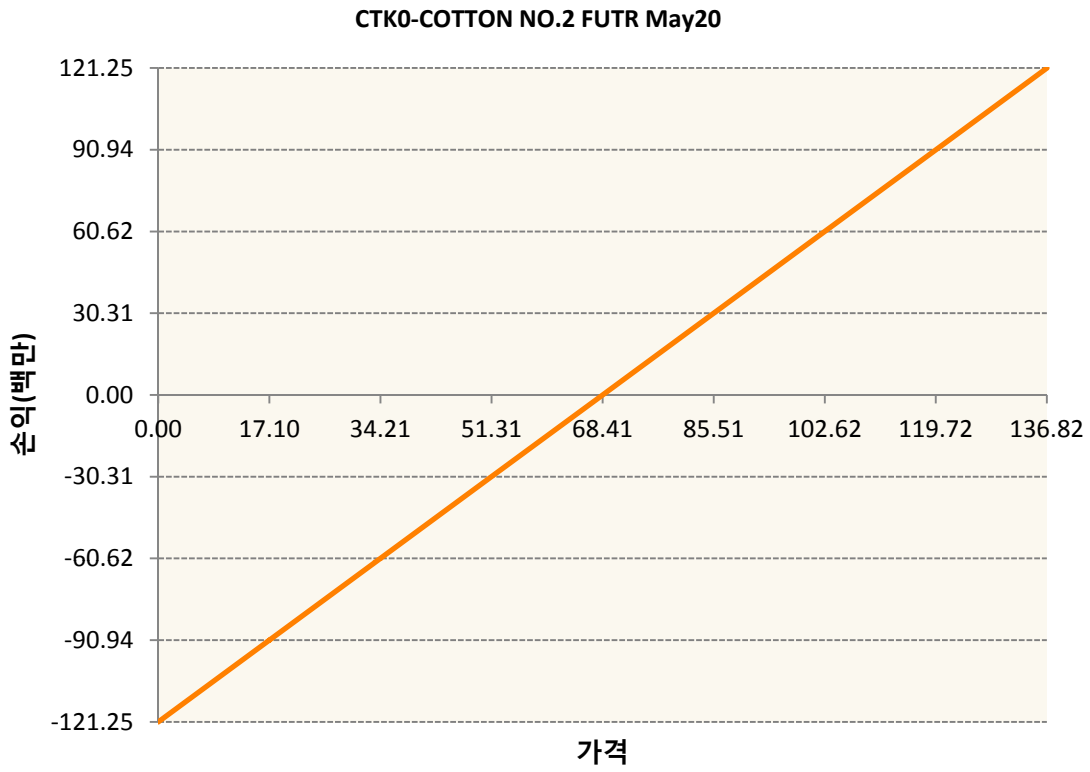
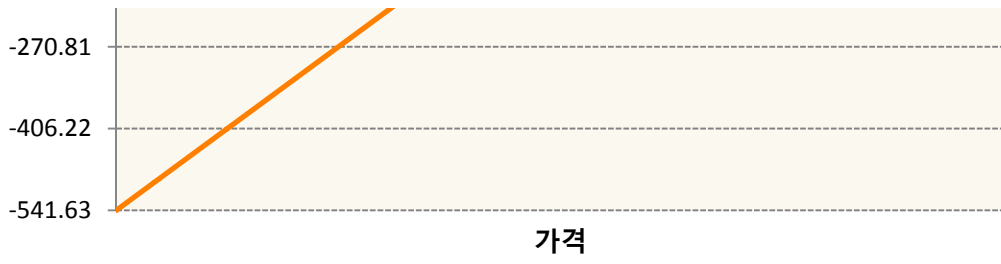
2. 만기시점의 손익구조

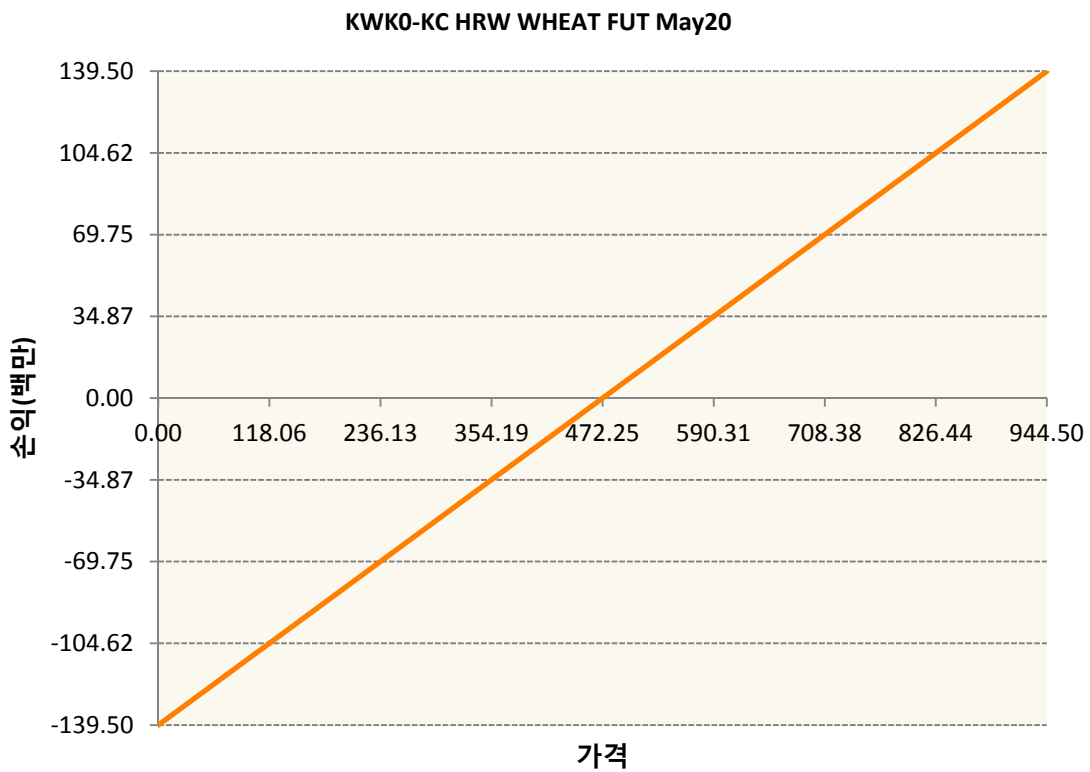
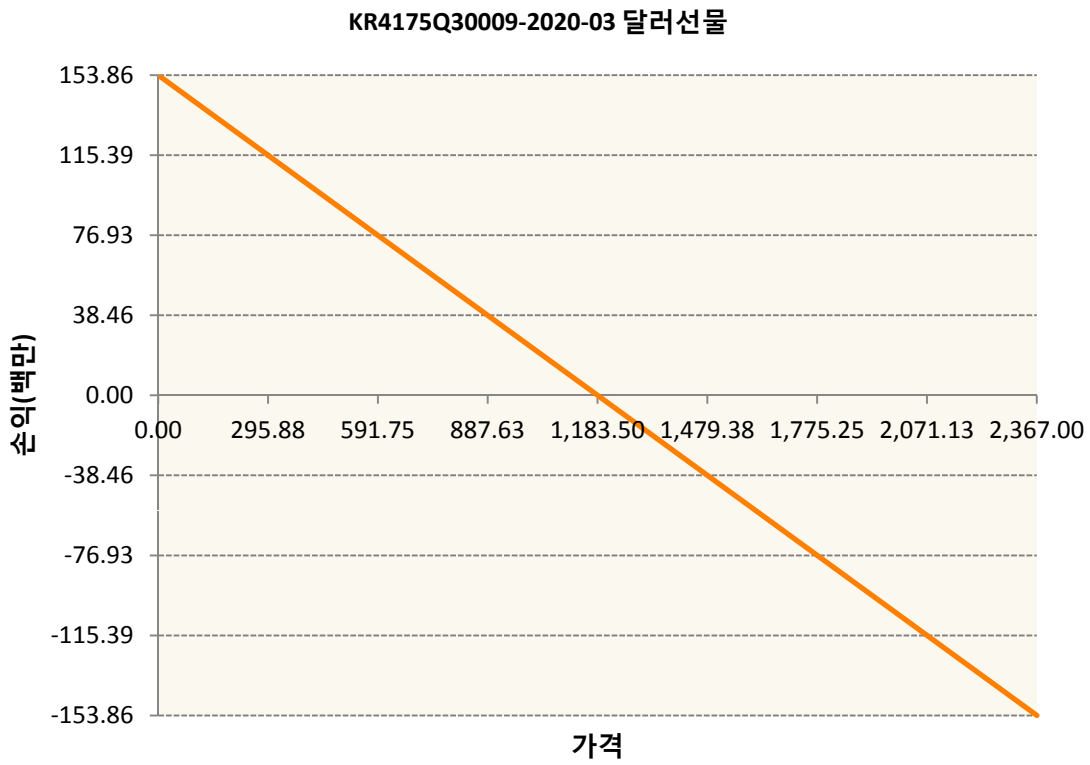
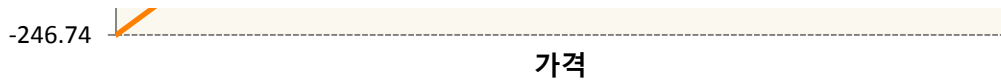
BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20



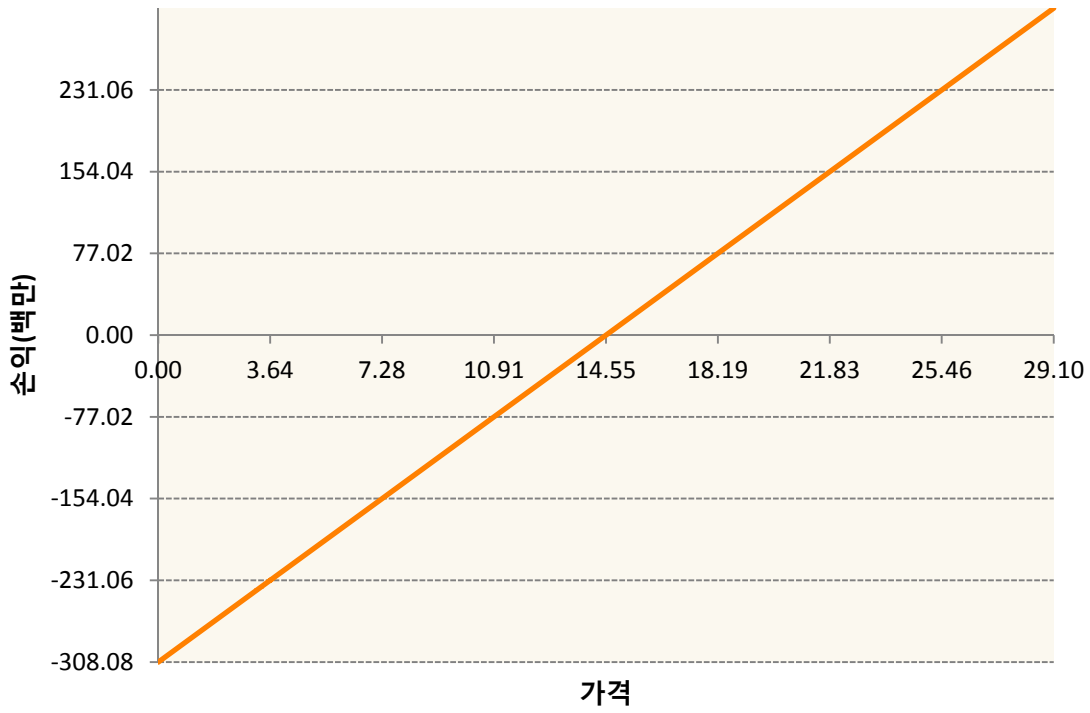
CK0-CORN FUTURE May20



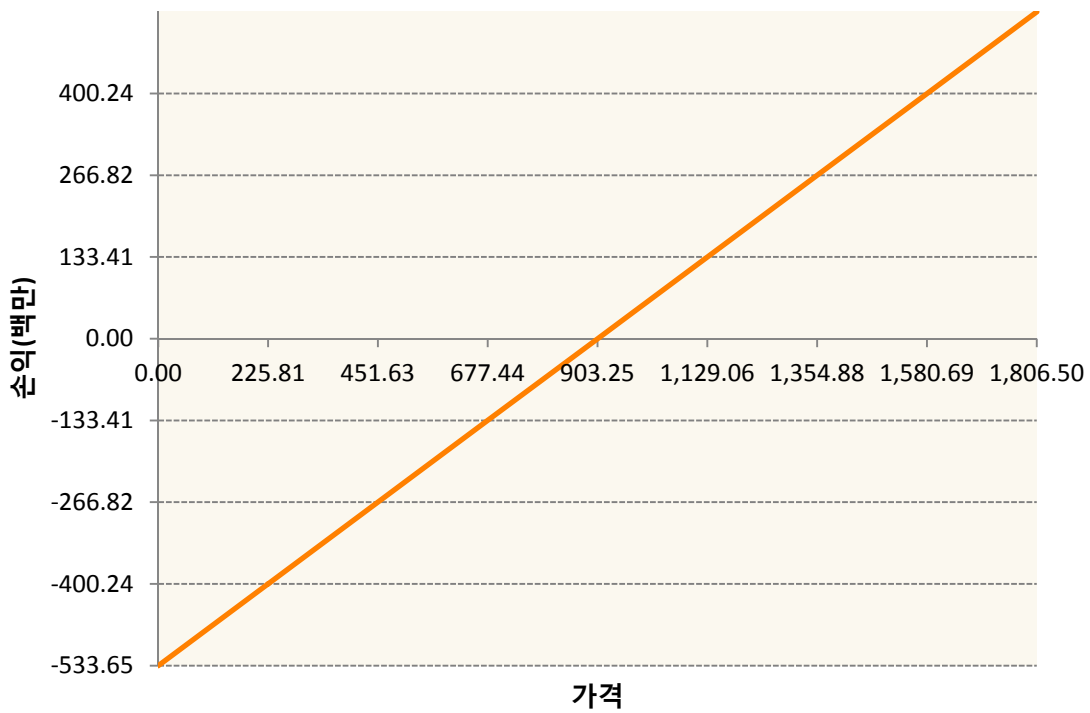




SBK0-Sugar May20

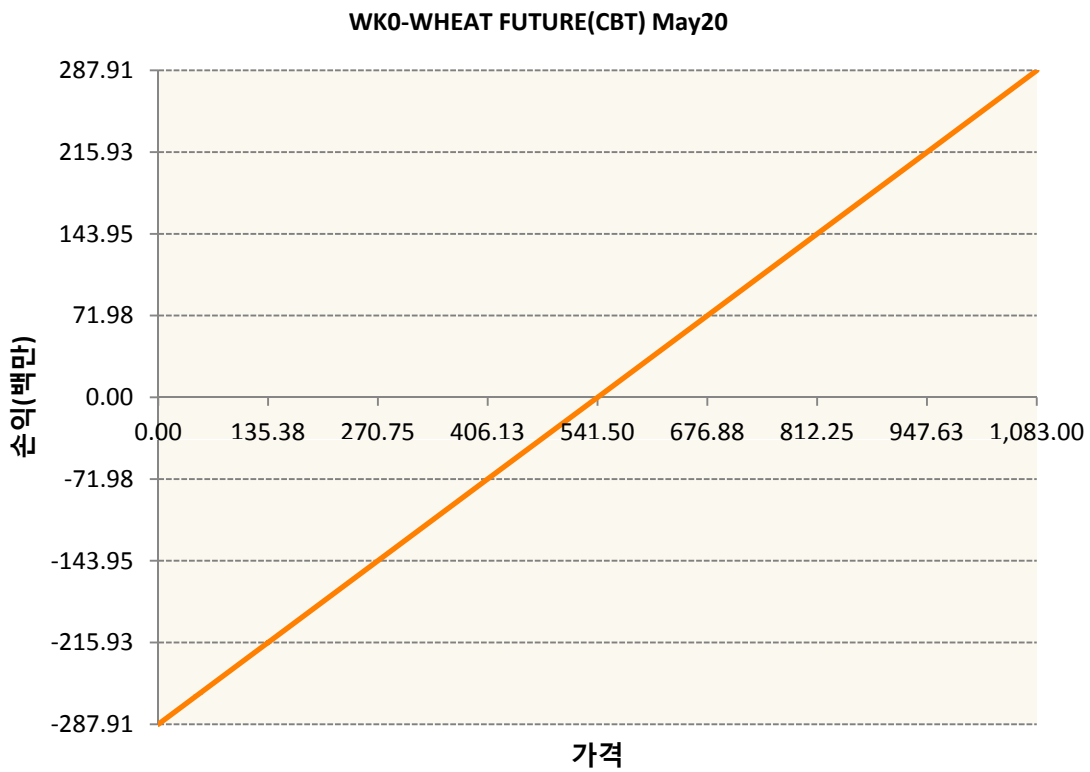
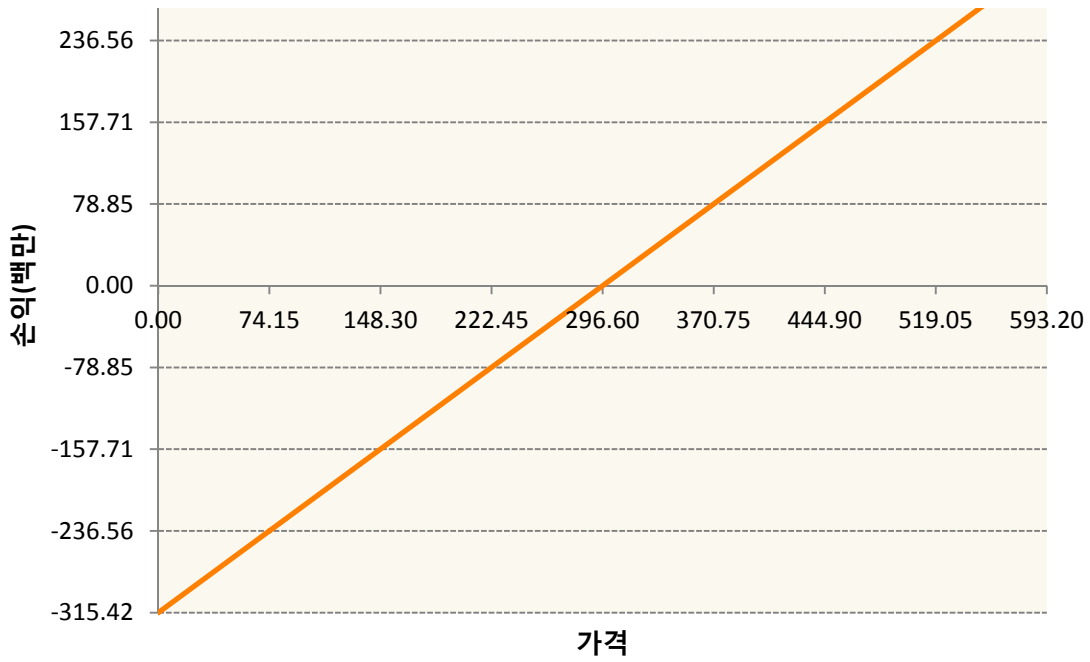


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	19
CK0	CORN FUTURE May20	43
CTK0	COTTON NO.2 FUTR May20	10
KCK0	COFFEE 'C' FUTURE May20	20
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