

공시일	2020-02-19
기준일	2020-02-18

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	2020-02-19
기준일	2020-02-18

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	2020-02-19
기준일	2020-02-18

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)	437
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	159

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

930

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-19
기준일	2020-02-18

유로인덱스모(주식-파생형)

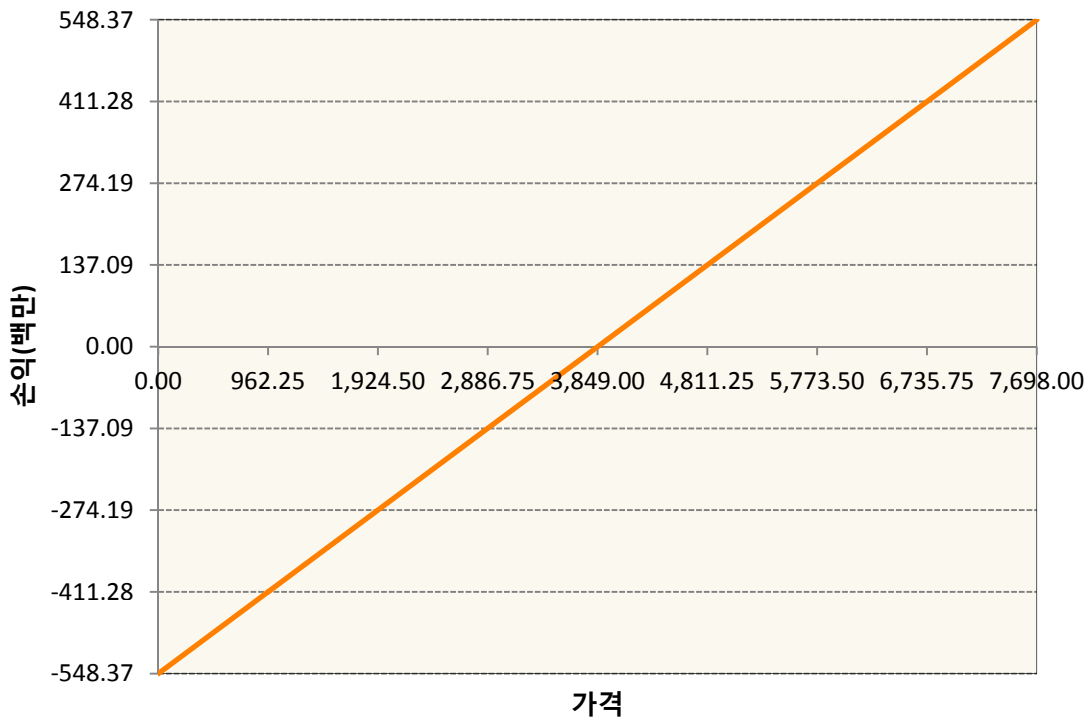
1. 계약금액

(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	2020-02-19
기준일	2020-02-18

차이나인덱스모(주식-파생형)

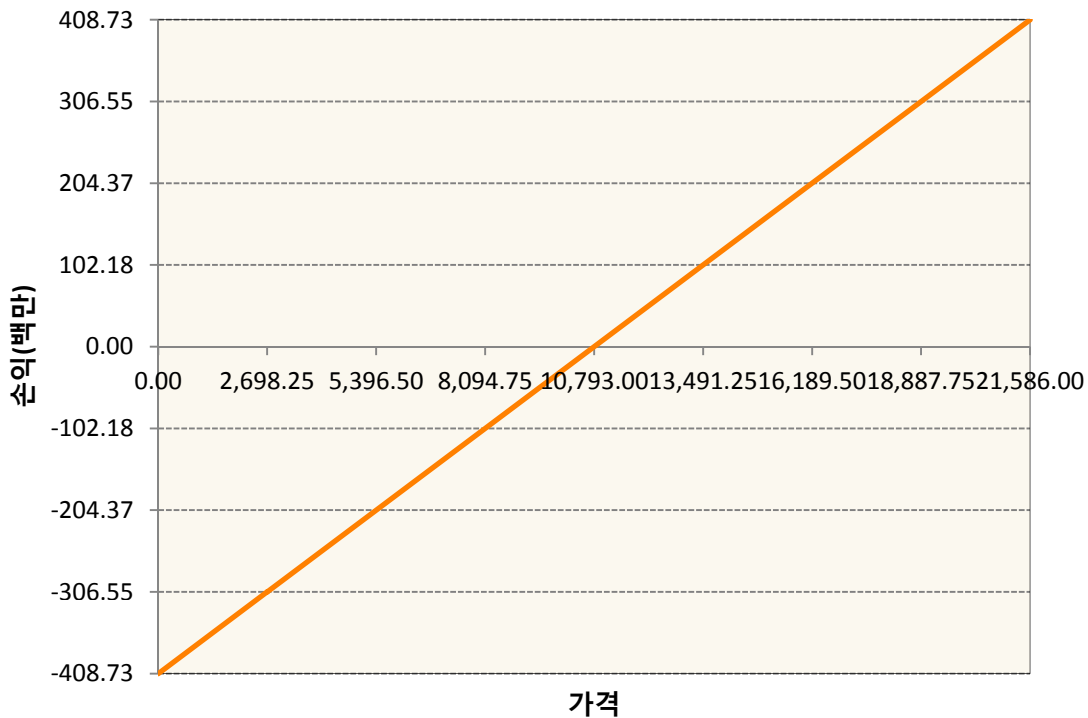
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	409	0	409	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	2020-02-19
기준일	2020-02-18

커버드콜모(주식혼합-파생형)

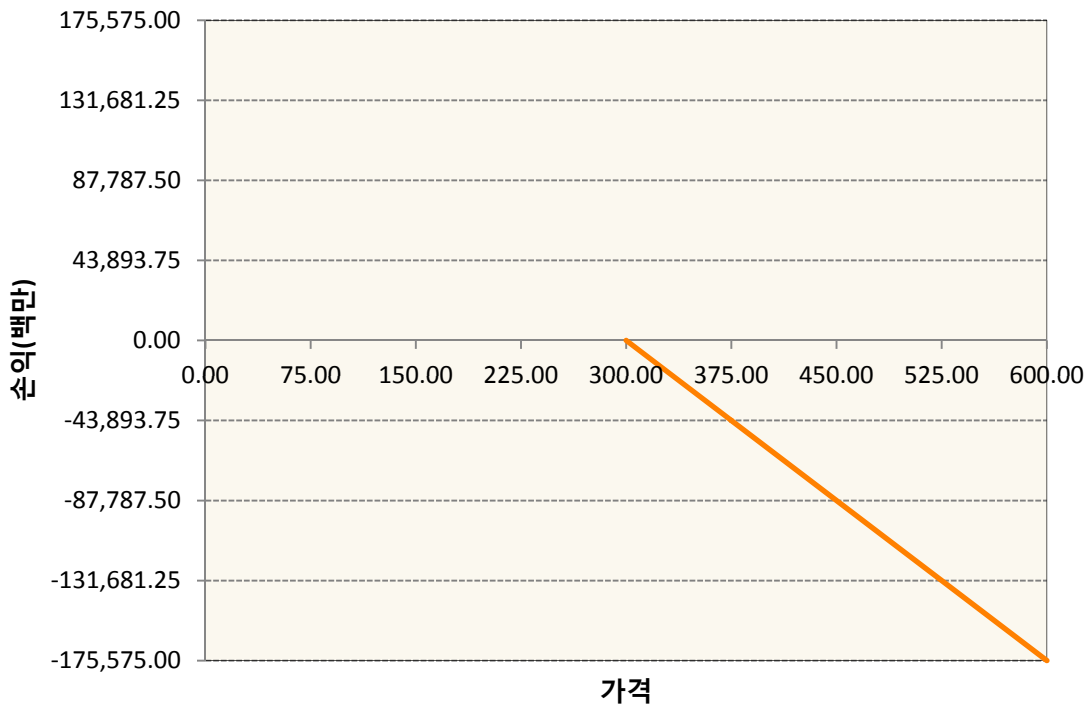
1. 계약금액

(단위:백만원)

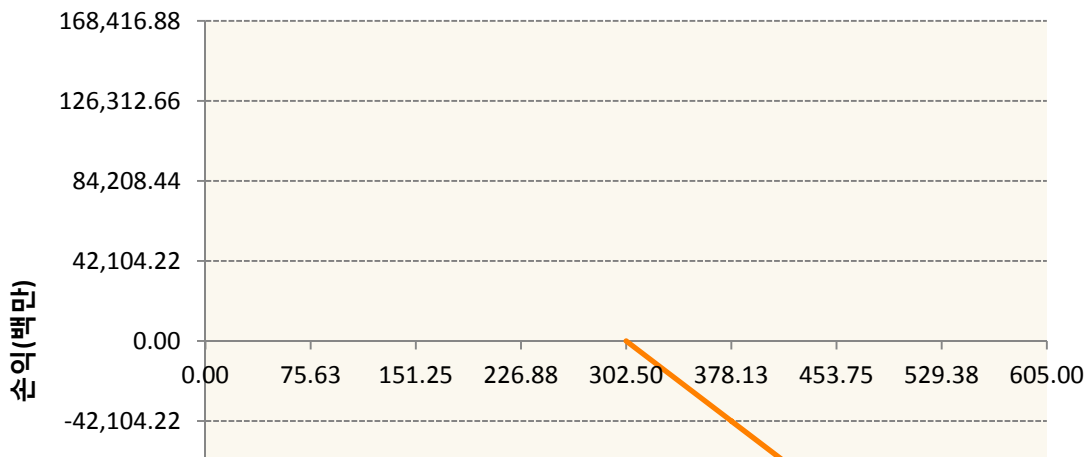
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	452,742	-452,742	장내

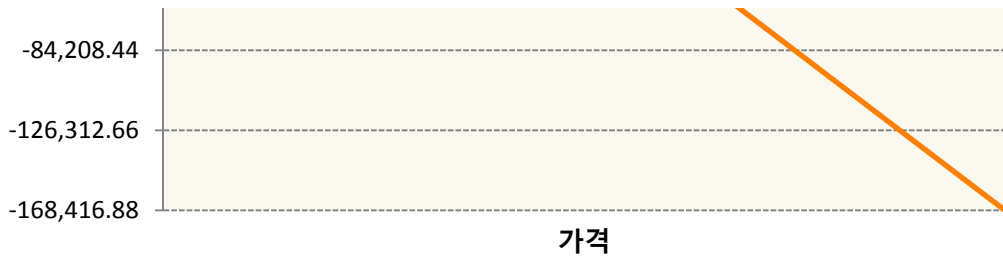
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q33007-2020-03 콜300

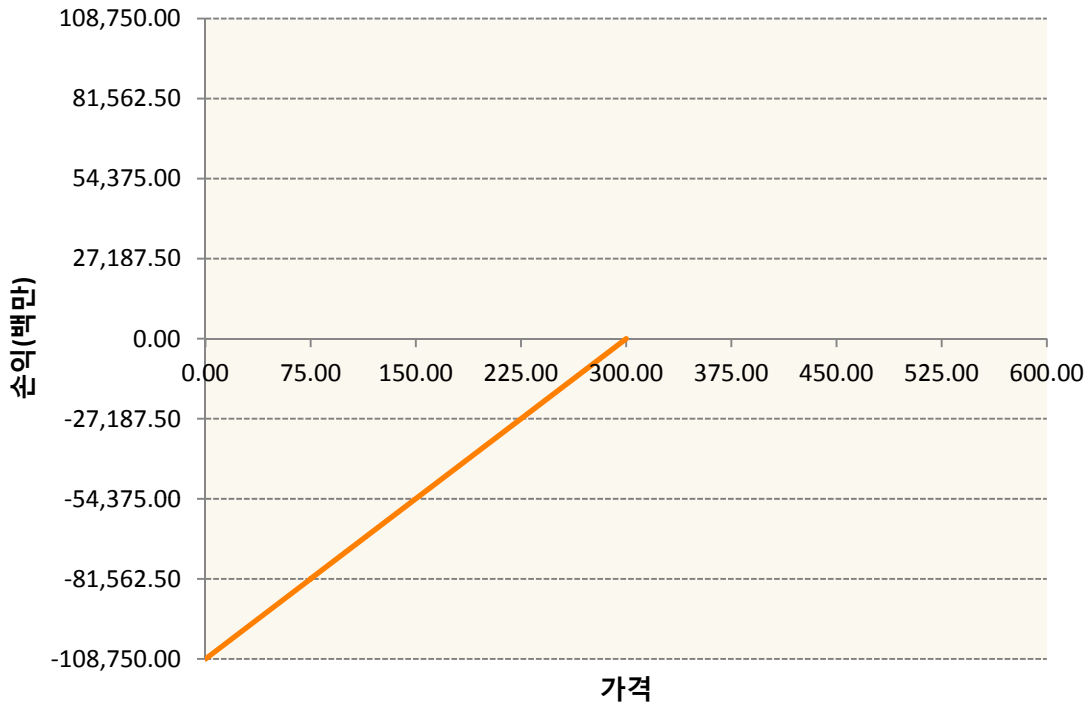


KR4201Q33023-2020-03 콜302.5





KR4301Q33005-2020-03 풋300



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q33007		2020-03 콜300					10,253
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,487	4,345	4,171	3,969	3,742	3,493	3,225
-5.33%	4,025	3,766	3,481	3,175	2,852	2,514	2,165
-2.67%	3,047	2,670	2,282	1,885	1,481	1,072	658
0%	1,341	894	447	0	-448	-896	-1,344
2.67%	-1,196	-1,632	-2,072	-2,514	-2,959	-3,405	-3,852
5.33%	-4,502	-4,859	-5,234	-5,621	-6,020	-6,426	-6,840
8.00%	-8,398	-8,647	-8,926	-9,230	-9,555	-9,897	-10,253
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5					9,323
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,747	3,637	3,497	3,330	3,138	2,923	2,690

-5.33%	3,407	3,193	2,952	2,688	2,405	2,105	1,792
-2.67%	2,647	2,317	1,971	1,613	1,246	872	491
0%	1,252	837	420	0	-421	-843	-1,267
2.67%	-912	-1,342	-1,773	-2,205	-2,637	-3,069	-3,502
5.33%	-3,836	-4,209	-4,593	-4,986	-5,386	-5,792	-6,202
8.00%	-7,379	-7,653	-7,953	-8,273	-8,610	-8,961	-9,323
KR4301Q33005 2020-03 풋300							7,189
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,054	-7,061	-7,072	-7,091	-7,116	-7,149	-7,189
-5.33%	-4,223	-4,259	-4,306	-4,364	-4,431	-4,507	-4,592
-2.67%	-1,595	-1,697	-1,808	-1,926	-2,050	-2,179	-2,312
0%	485	324	162	0	-163	-325	-489
2.67%	1,735	1,588	1,437	1,284	1,129	972	814
5.33%	2,263	2,181	2,088	1,986	1,875	1,757	1,634
8.00%	2,413	2,384	2,345	2,295	2,235	2,165	2,086

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

(단위:백만원)

25,514

공시일	2020-02-19
기준일	2020-02-18

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

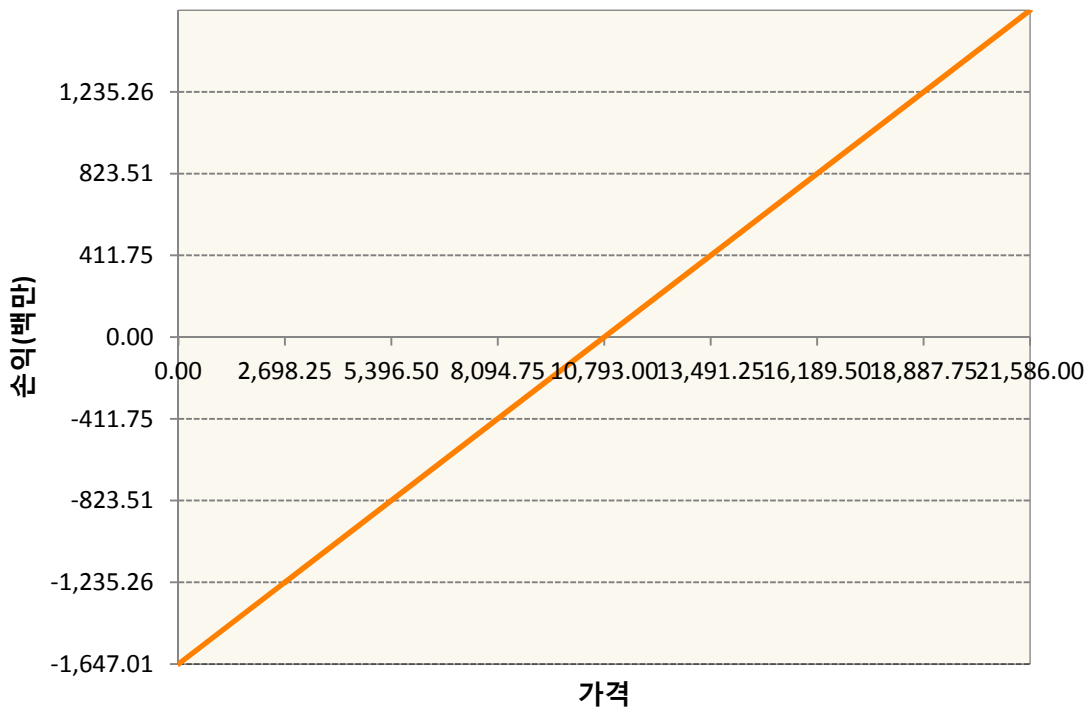
1. 계약금액

(단위:백만원)

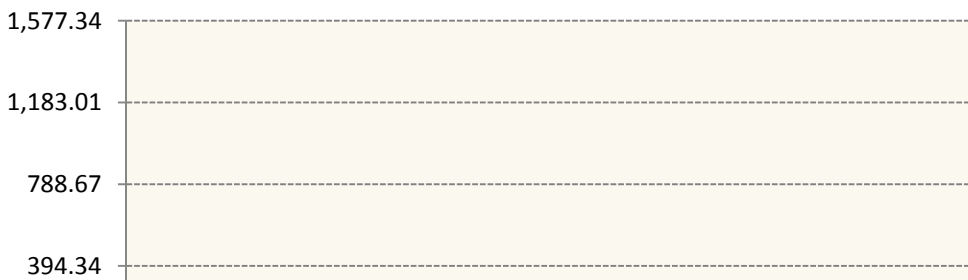
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,647	0	1,647	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,429	-4,429	장내
누계	통화	선도	0	2,156	-2,156	장외

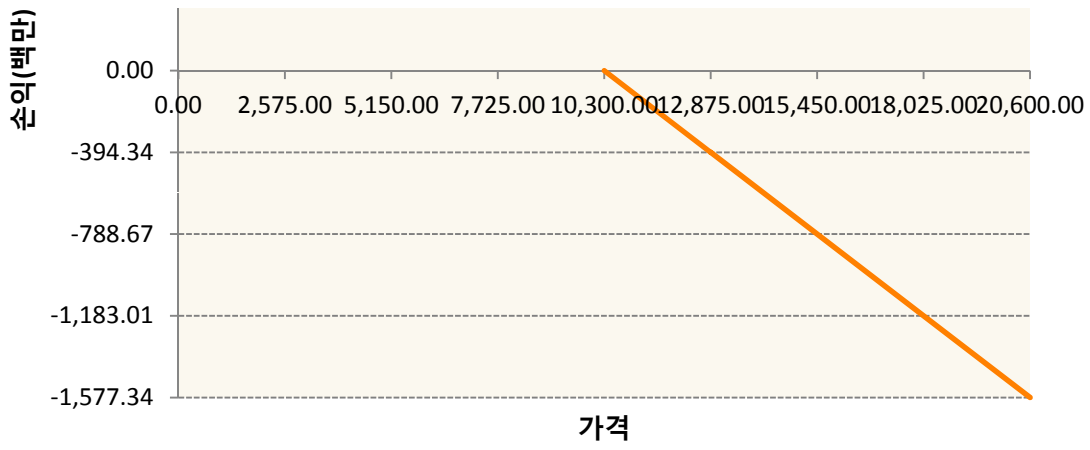
2. 만기시점의 손익구조

HCG0-HSCEI Futures Feb20

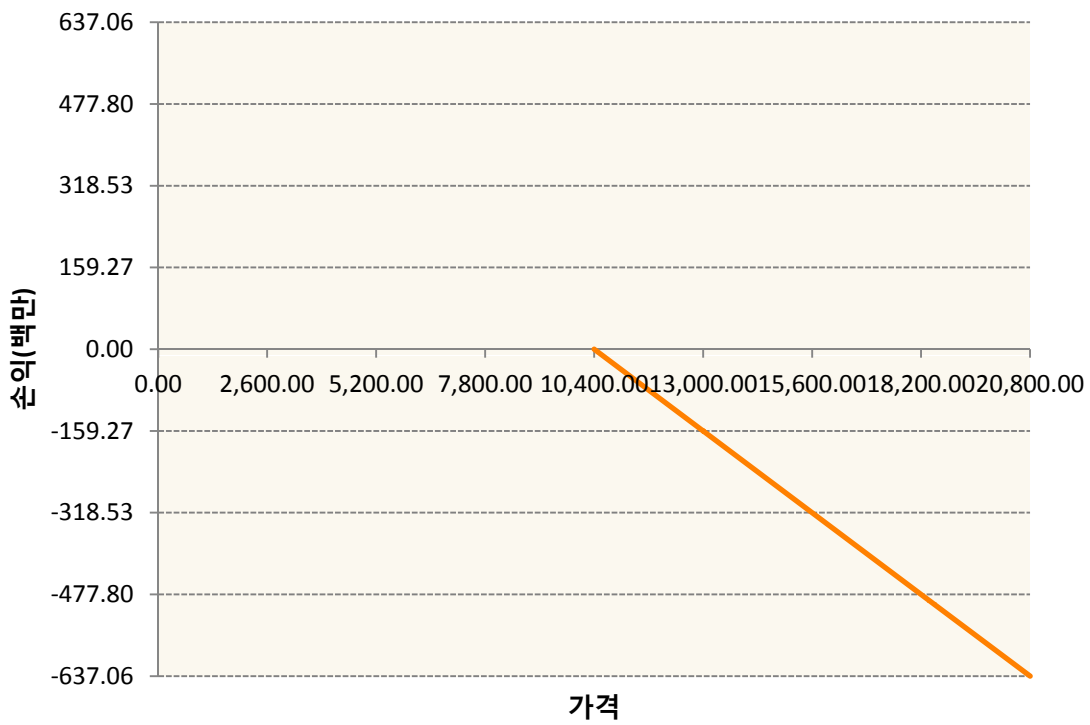


OHHIG0-C103-HSCEI

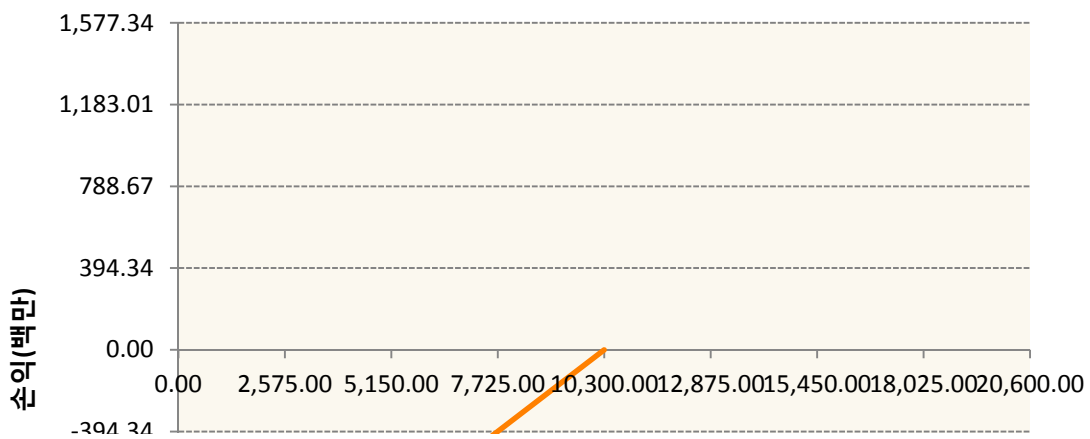


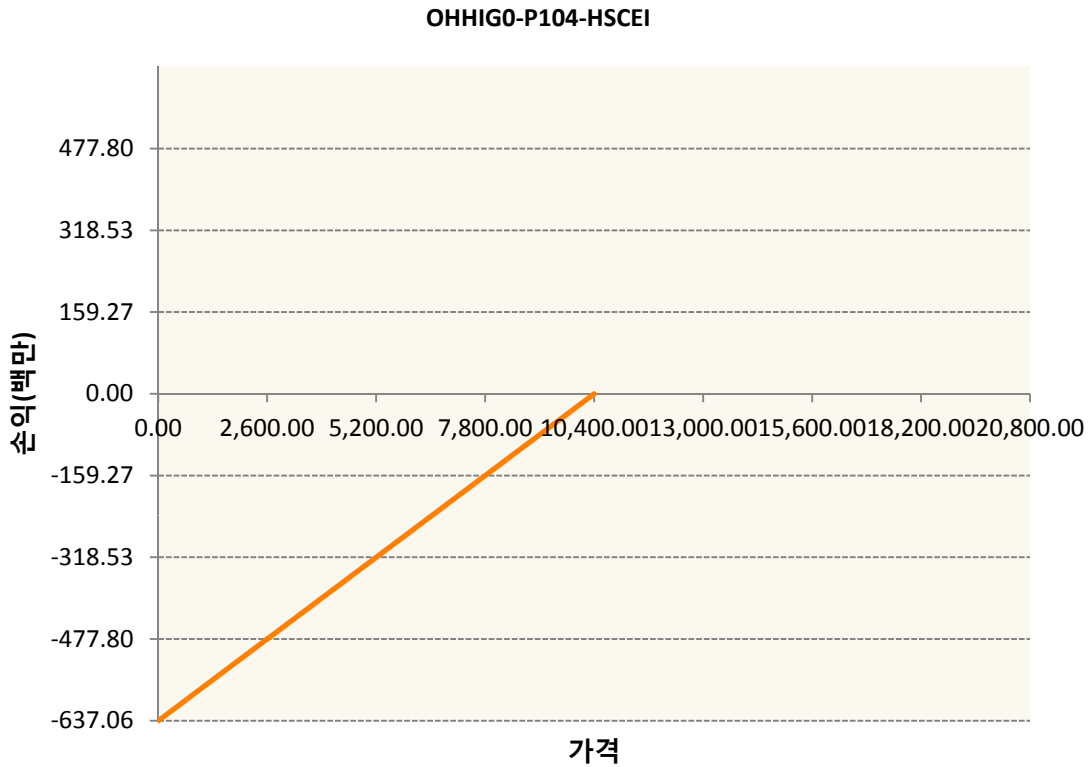


OHHIG0-C104-HSCEI



OHHIG0-P103-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E		172
HCG0 HSCEI Futures Feb20		132
OHHIG0-C1(HSCEI		126
OHHIG0-C1(HSCEI		51
OHHIG0-P1(HSCEI		126
OHHIG0-P1(HSCEI		51

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		499

공시일	2020-02-19
기준일	2020-02-18

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

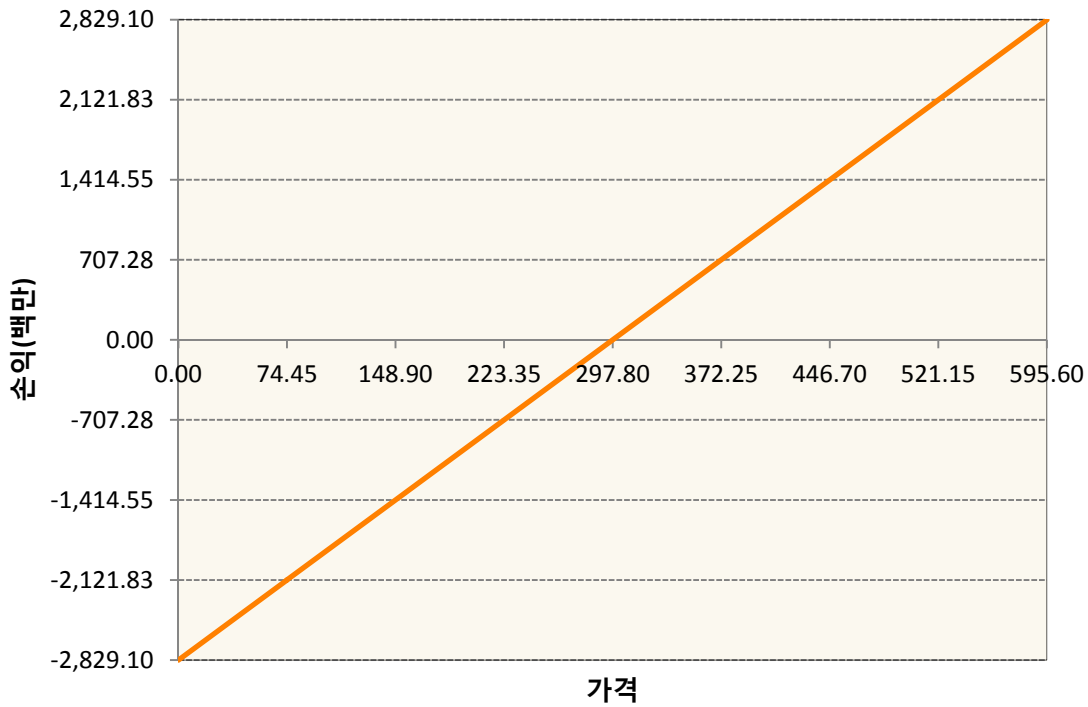
1. 계약금액

(단위:백만원)

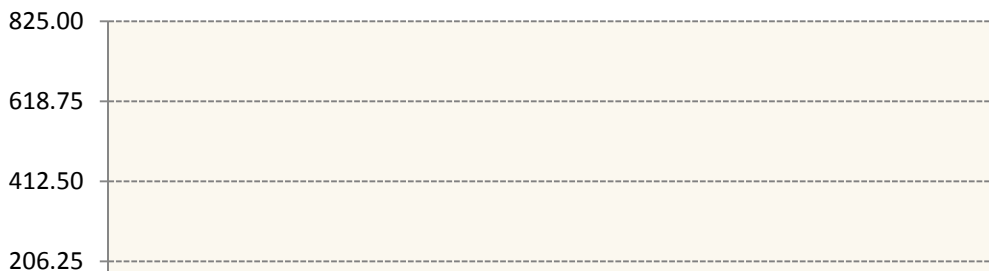
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	223	-223	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	224	0	224	장내
누계	유가증권	선물	2,829	0	2,829	장내
누계	유가증권	스왑	6,125	0	6,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	5,342	-5,342	장내

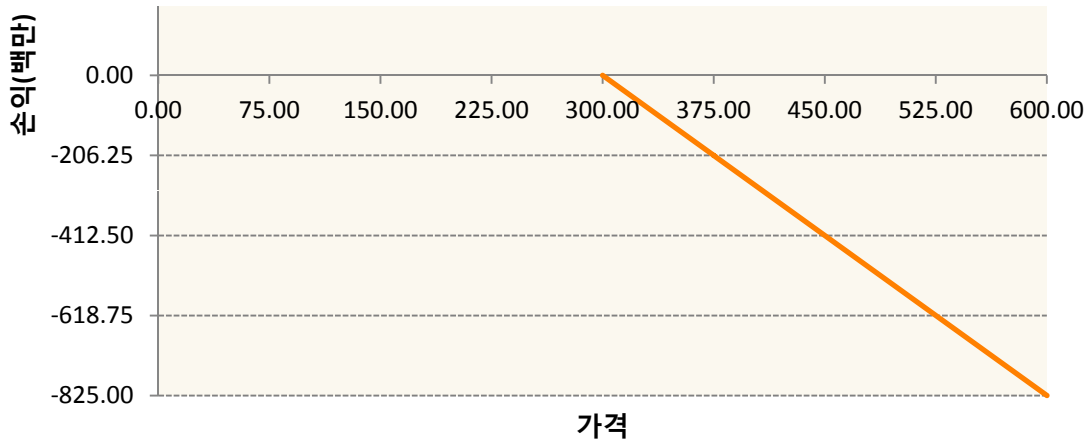
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

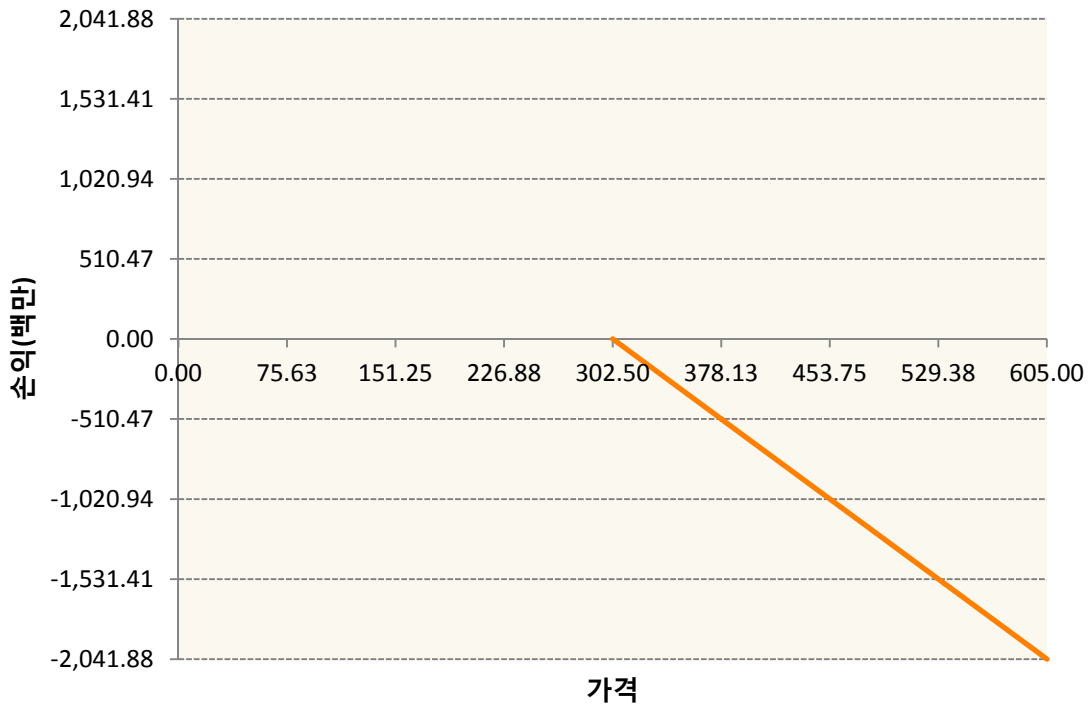


KR4201Q33007-2020-03 콜300

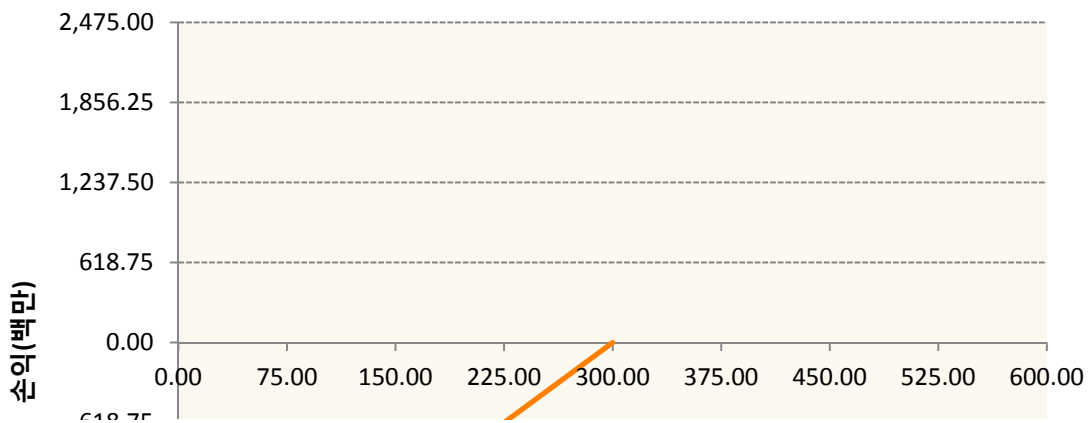




KR4201Q33023-2020-03 콜302.5



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						226
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-226	-226	-226	-226	-226	-226	-226	
-5.33%	-151	-151	-151	-151	-151	-151	-151	
-2.67%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	75	75	75	75	75	75	75	
5.33%	151	151	151	151	151	151	151	
8.00%	226	226	226	226	226	226	226	
KR4201Q33007		2020-03 콜300						48
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	21	20	20	19	18	16	15	
-5.33%	19	18	16	15	13	12	10	
-2.67%	14	13	11	9	7	5	3	
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6	
2.67%	-6	-8	-10	-12	-14	-16	-18	
5.33%	-21	-23	-25	-26	-28	-30	-32	
8.00%	-39	-41	-42	-43	-45	-47	-48	
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5						113
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	45	44	42	40	38	35	33
-5.33%	41	39	36	33	29	26	22
-2.67%	32	28	24	20	15	11	6
0%	15	10	5	0	-5	-10	-15
2.67%	-11	-16	-21	-27	-32	-37	-42
5.33%	-47	-51	-56	-60	-65	-70	-75
8.00%	-89	-93	-96	-100	-104	-109	-113
KR4301Q33005 2020-03 풋300							164
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-161	-161	-161	-161	-162	-163	-164
-5.33%	-96	-97	-98	-99	-101	-103	-104
-2.67%	-36	-39	-41	-44	-47	-50	-53
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	39	36	33	29	26	22	19
5.33%	51	50	48	45	43	40	37
8.00%	55	54	53	52	51	49	47

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

(단위:백만원)

1,034

공시일	2020-02-19
기준일	2020-02-18

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

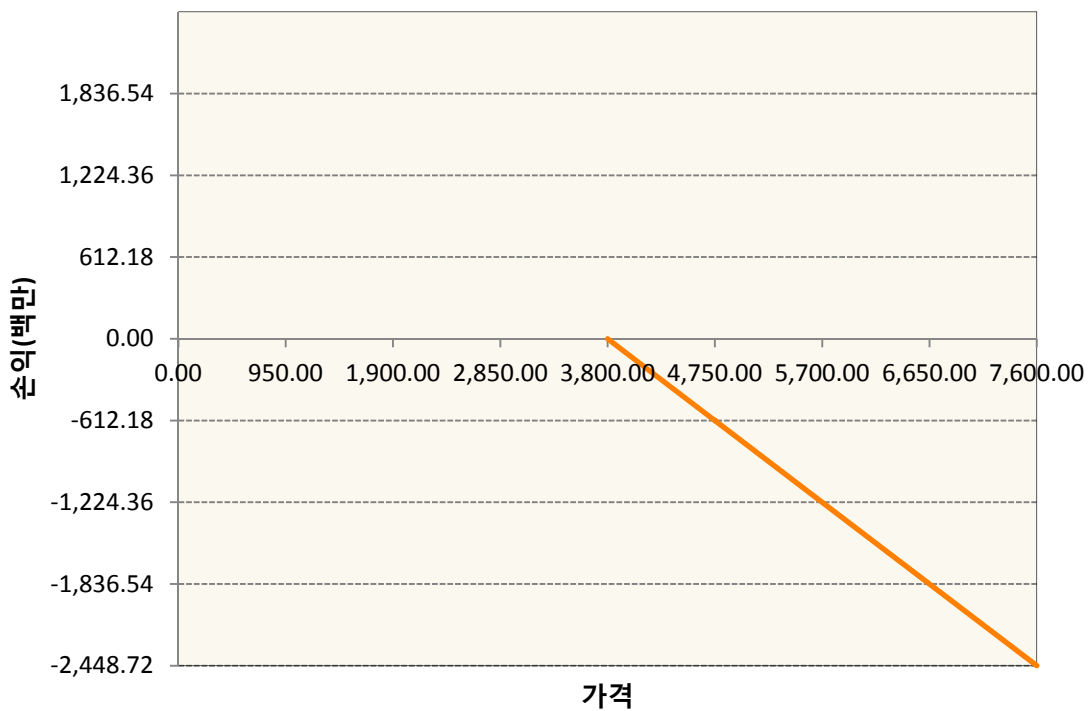
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	1	-1	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	697	0	697	
누계	유가증권	스왑	11,600	0	11,600	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,954	-7,954	장내
누계	통화	선도	0	3,382	-3,382	장외

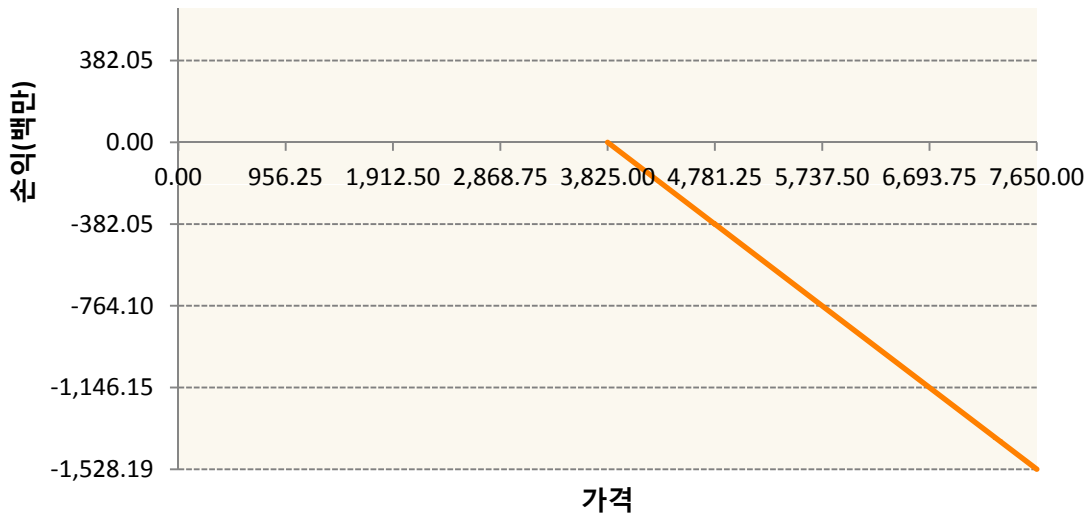
2. 만기시점의 손익구조

OESXG0-C3800-EURO STOXX 50

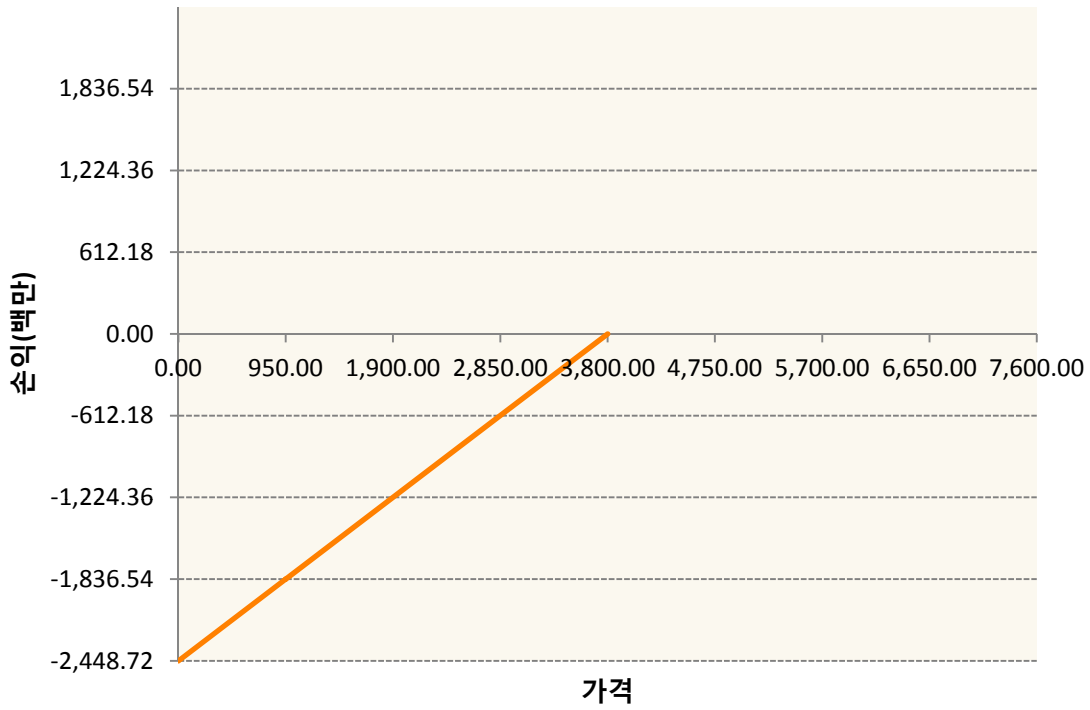


OESXG0-C3825-EURO STOXX 50

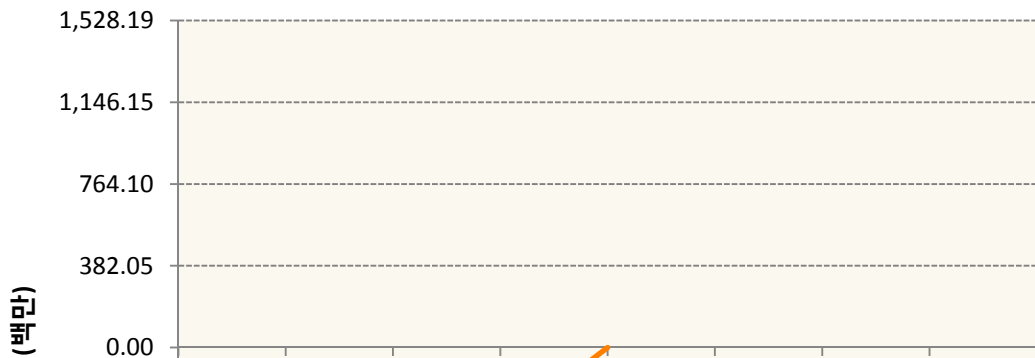


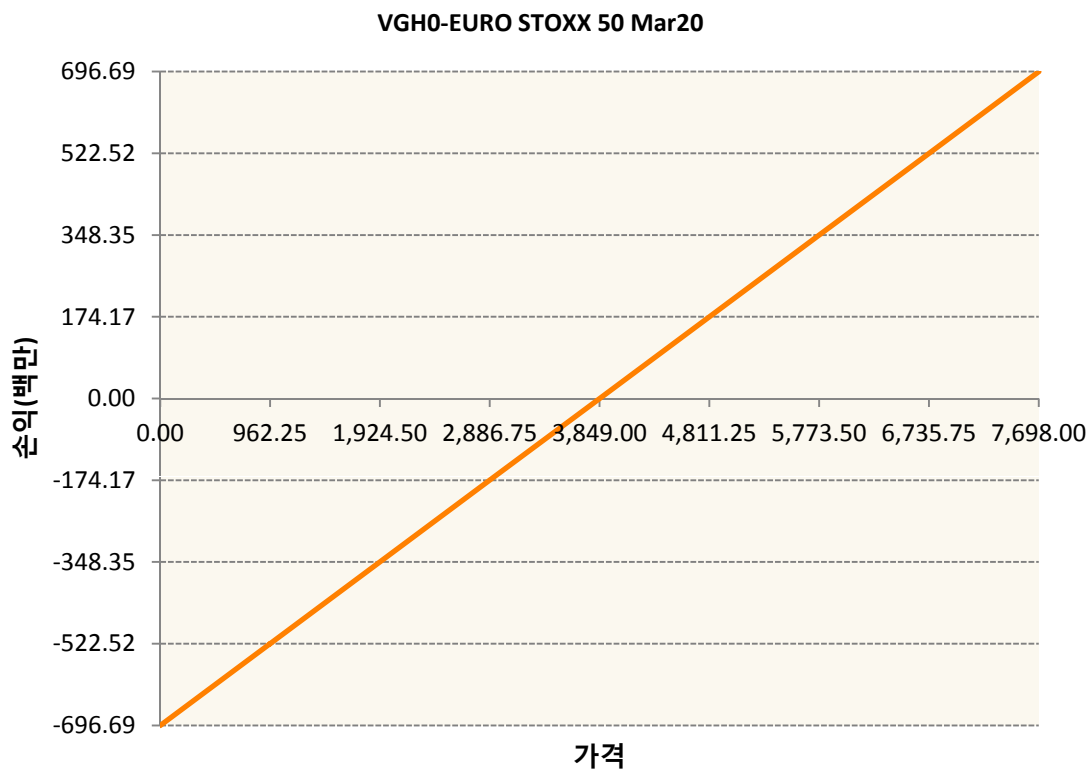
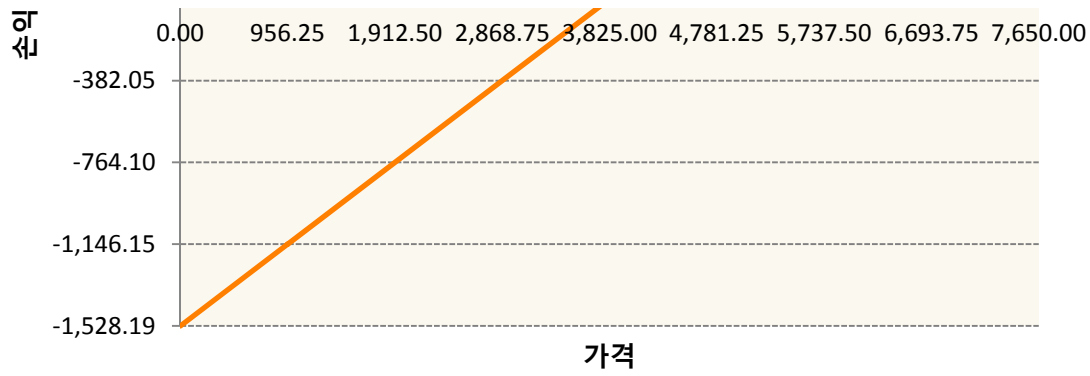


OESXG0-P3800-EURO STOXX 50



OESXG0-P3825-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP\SG EURO Covered CALL STRATEGY		10
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E		271
OESXG0-C3\ EURO STOXX 50		196
OESXG0-C3\ EURO STOXX 50		122
OESXG0-P3\ EURO STOXX 50		196
OESXG0-P3\ EURO STOXX 50		122
VGH0	EURO STOXX 50 Mar20	56

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

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

(단위:백만원)

949

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

(단위:백만원)

84

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

(단위:백만원)

123

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

(단위:백만원)

44

공시일	2020-02-19
기준일	2020-02-18

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

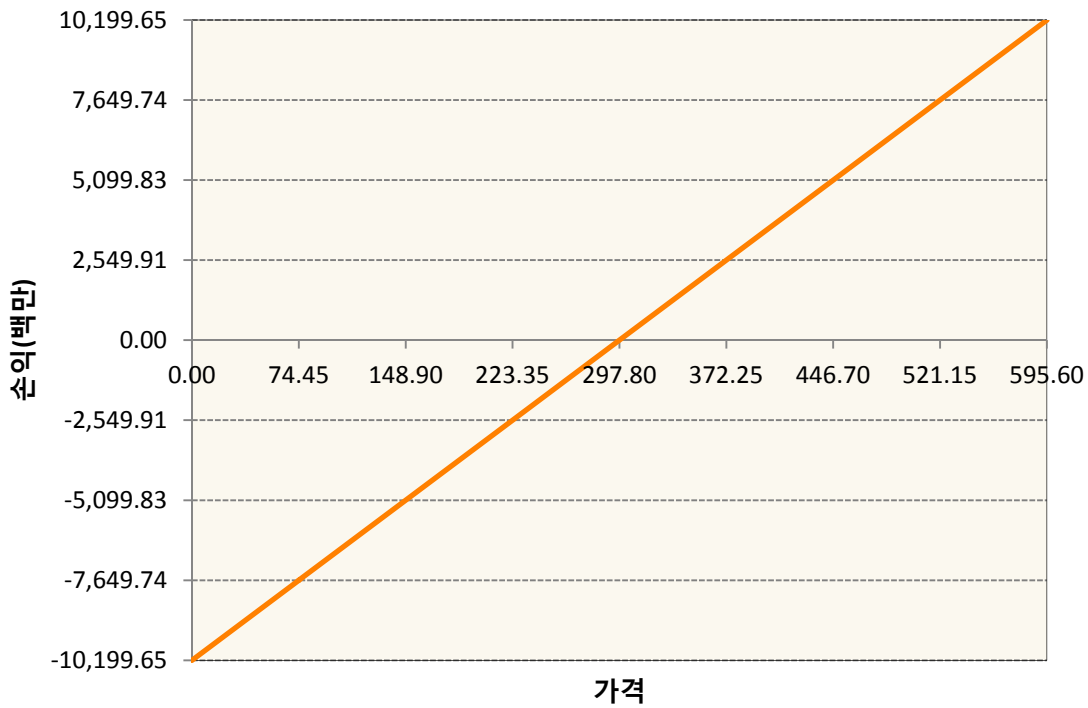
1. 계약금액

(단위:백만원)

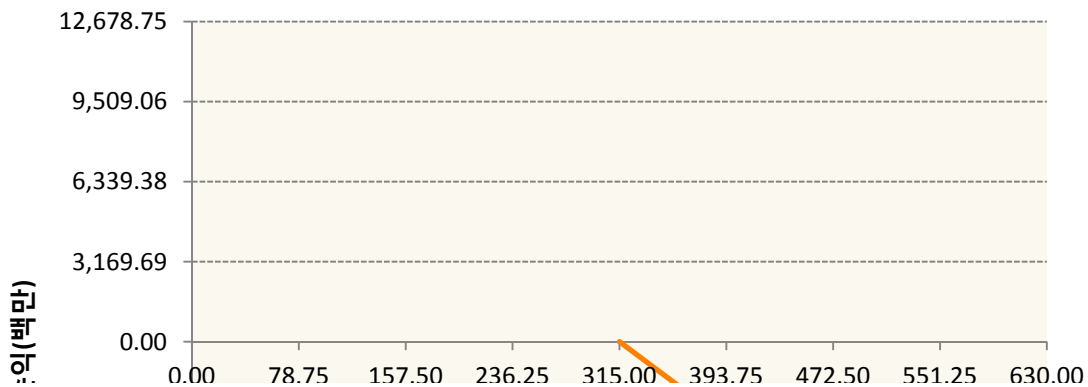
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,200	0	10,200	장내
누계	유가증권	옵션	2,257	20,854	-18,598	장내

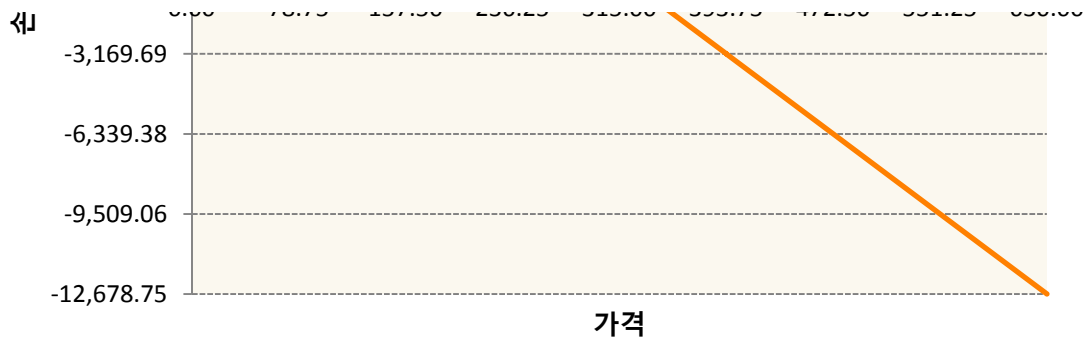
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

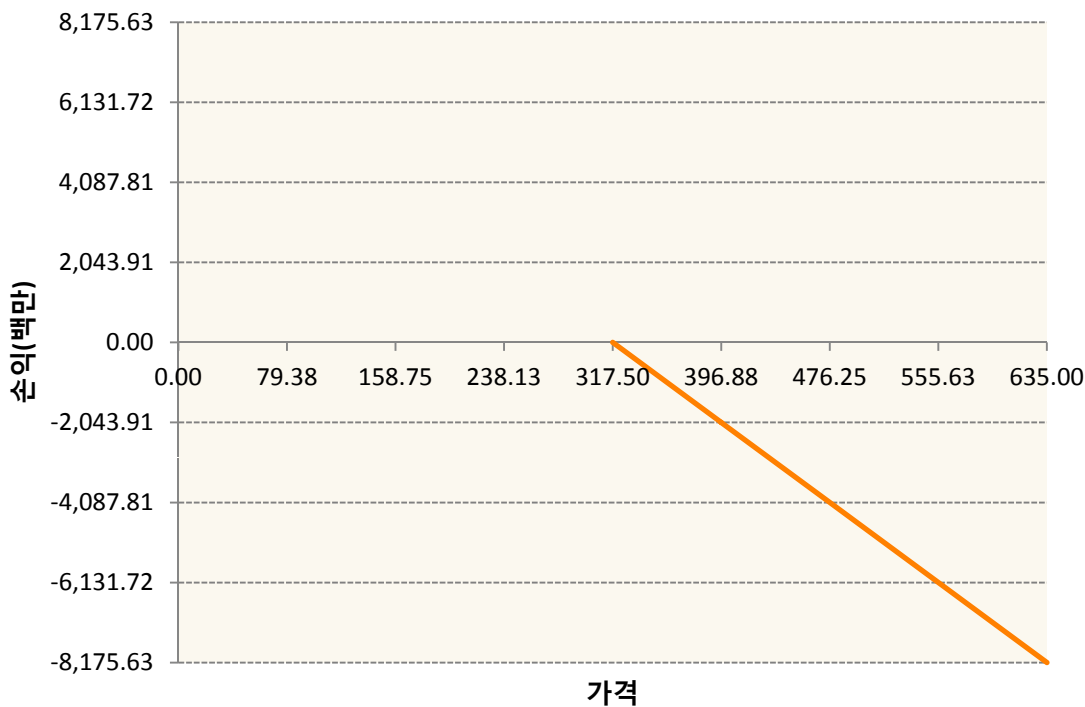


KR4201Q33155-2020-03 콜315

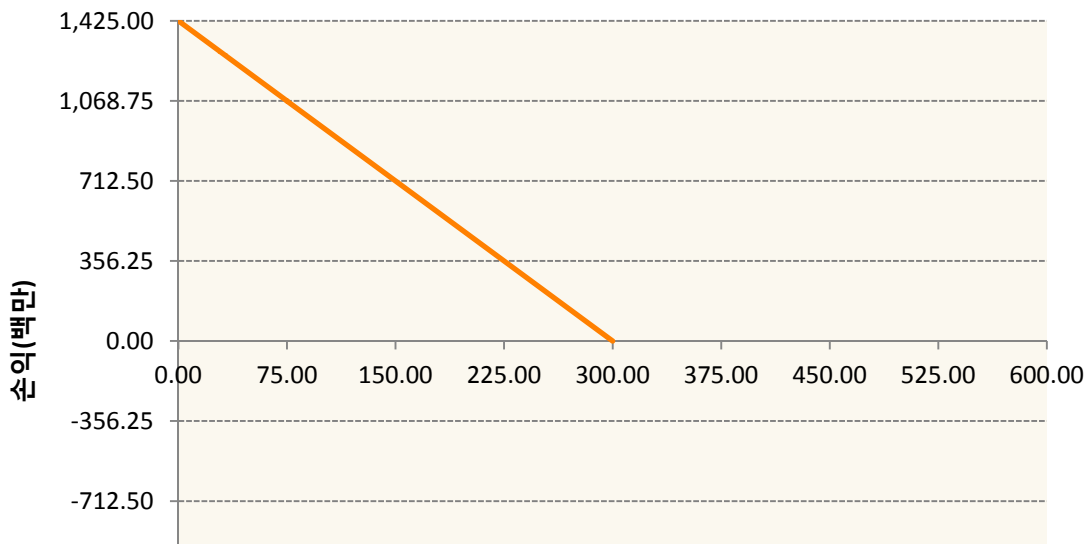


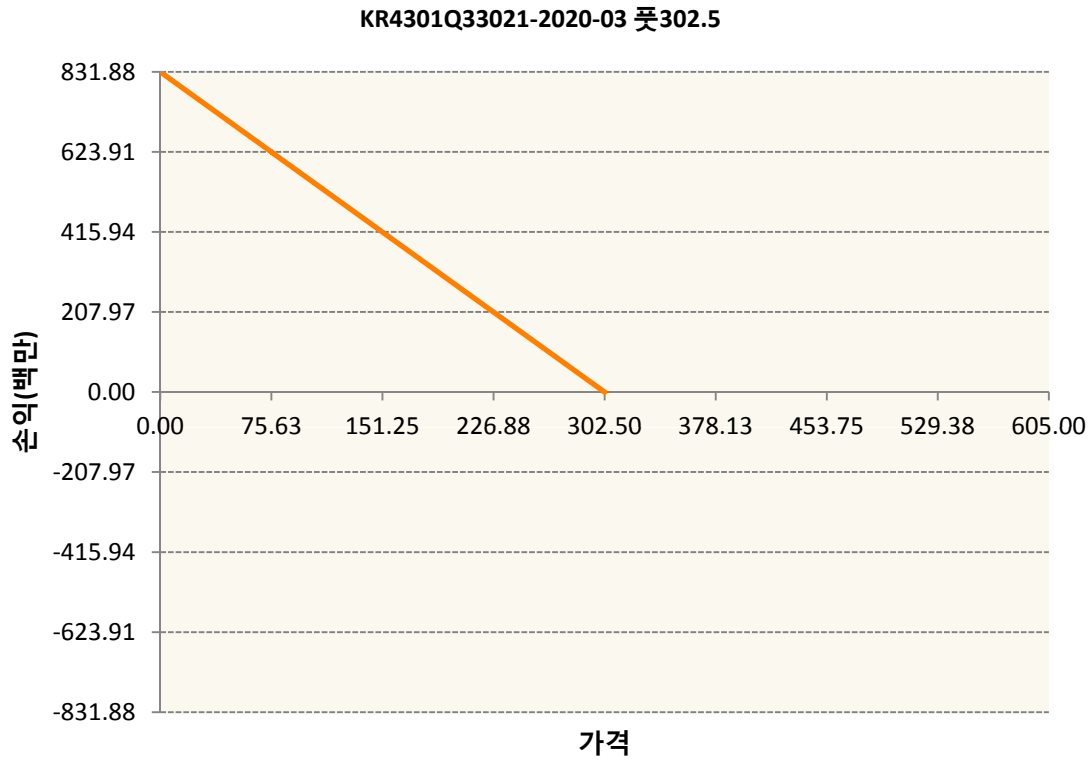
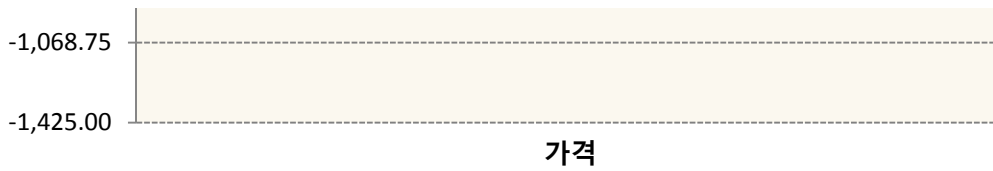


KR4201Q33171-2020-03 콜317.5



KR4301Q33005-2020-03 풋300





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						816
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-816	-816	-816	-816	-816	-816	-816	
-5.33%	-544	-544	-544	-544	-544	-544	-544	
-2.67%	-272	-272	-272	-272	-272	-272	-272	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	272	272	272	272	272	272	272	
5.33%	544	544	544	544	544	544	544	
8.00%	816	816	816	816	816	816	816	
KR4201Q33155		2020-03 콜315						505
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	127	125	121	116	109	101	91	
-5.33%	122	116	108	98	86	72	57	
-2.67%	105	93	78	62	44	24	3	

0%	67	46	24	0	-25	-50	-77
2.67%	-9	-38	-67	-96	-126	-156	-187
5.33%	-134	-167	-199	-232	-264	-297	-329
8.00%	-314	-346	-377	-409	-441	-473	-505
KR4201Q33171 2020-03 콜317.5							301
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	68	67	66	63	59	55	49
-5.33%	66	63	59	53	47	39	30
-2.67%	58	52	44	34	24	12	0
0%	39	27	14	0	-15	-30	-46
2.67%	-2	-19	-36	-54	-73	-92	-111
5.33%	-72	-92	-113	-133	-154	-175	-195
8.00%	-176	-197	-217	-238	-259	-280	-301
KR4301Q33005 2020-03 풋300							94
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	92	93	93	93	93	94	94
-5.33%	55	56	56	57	58	59	60
-2.67%	21	22	24	25	27	29	30
0%	-6	-4	-2	0	2	4	6
2.67%	-23	-21	-19	-17	-15	-13	-11
5.33%	-30	-29	-27	-26	-25	-23	-21
8.00%	-32	-31	-31	-30	-29	-28	-27
KR4301Q33021 2020-03 풋302.5							57
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	56	56	56	56	56	57	57
-5.33%	35	35	35	35	36	36	37
-2.67%	14	15	15	16	17	18	19
0%	-3	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-15	-14	-13	-11	-10	-9	-8
5.33%	-21	-20	-19	-18	-17	-16	-15
8.00%	-22	-22	-22	-21	-20	-20	-19

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

(단위:백만원)

1,395

공시일	2020-02-19
기준일	2020-02-18

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	215,013	0	215,013	

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	2020-02-19
기준일	2020-02-18

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	186,985	0	186,985	

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	2020-02-19
기준일	2020-02-18

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	533,784	0	533,784	
누계	통화	선도	0	517,908	-517,908	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E	3,806
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,903
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	2,036
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	190
FX21020F02: KRW/USD 21-02-20E	1,903
FX21020F02: KRW/USD 21-02-20E	3,274
FX21020F02: KRW/USD 23-03-20E	1,532
FX21020F02: KRW/USD 23-03-20E	1,427
FX21020F03: KRW/USD 28-02-20E	1,903
FX21020F03: KRW/USD 28-02-20E	2,950
FX21020F03: KRW/USD 31-03-20E	3,045
FX21020F04: KRW/USD 31-03-20E	2,855
FX21020F04: KRW/USD 28-02-20E	190
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,569
FX21020G00 KRW/USD 06-03-20E	2,379
FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	952
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,180
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,209
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	952
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	1,903
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	3,274
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

13,905

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

(단위:백만원)

126

공시일	2020-02-19
기준일	2020-02-18

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

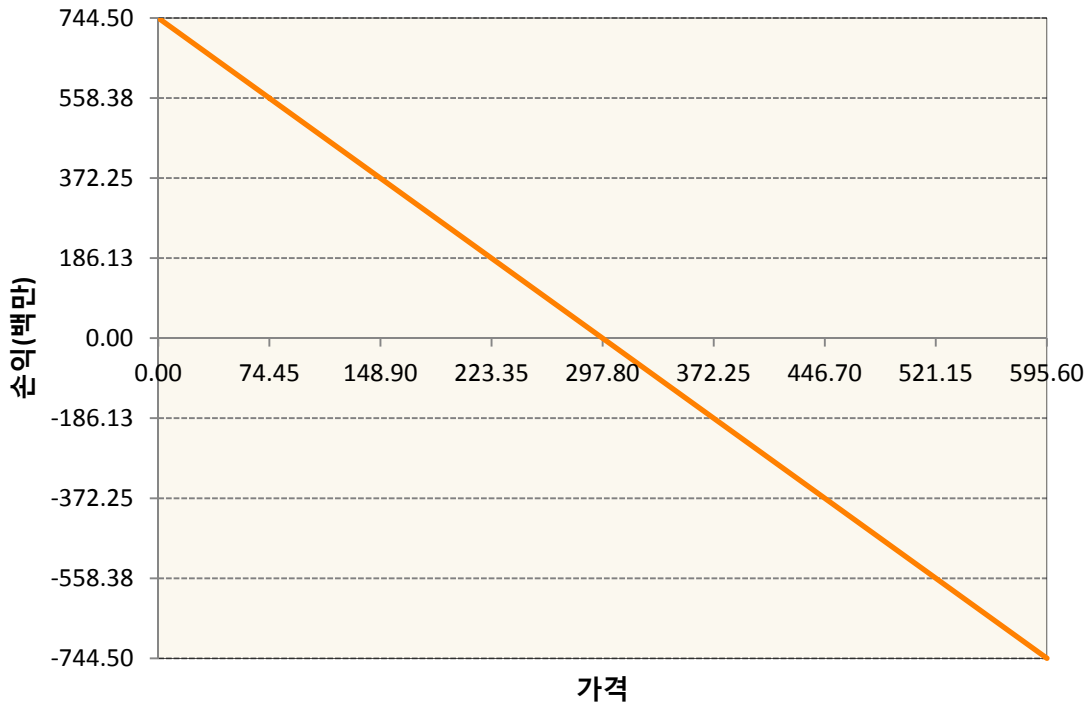
1. 계약금액

(단위:백만원)

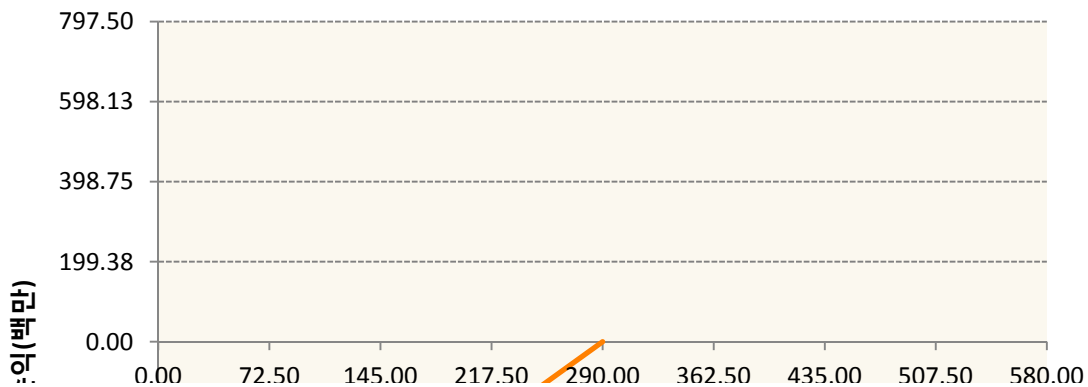
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	745	-745	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,503	-3,503	장내

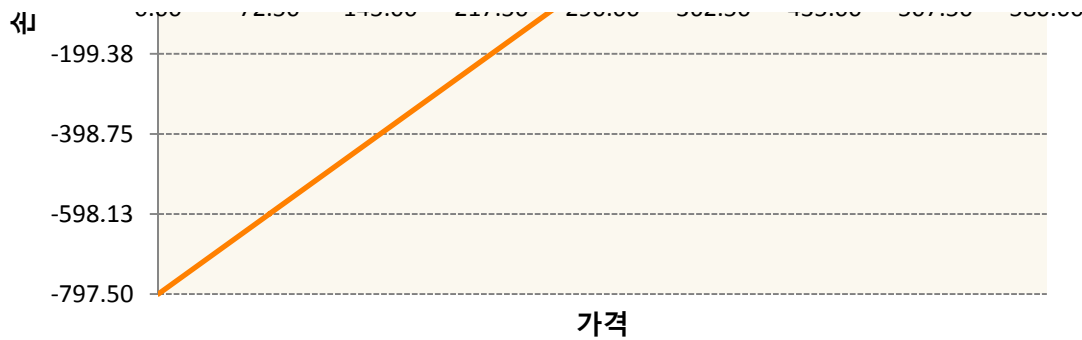
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

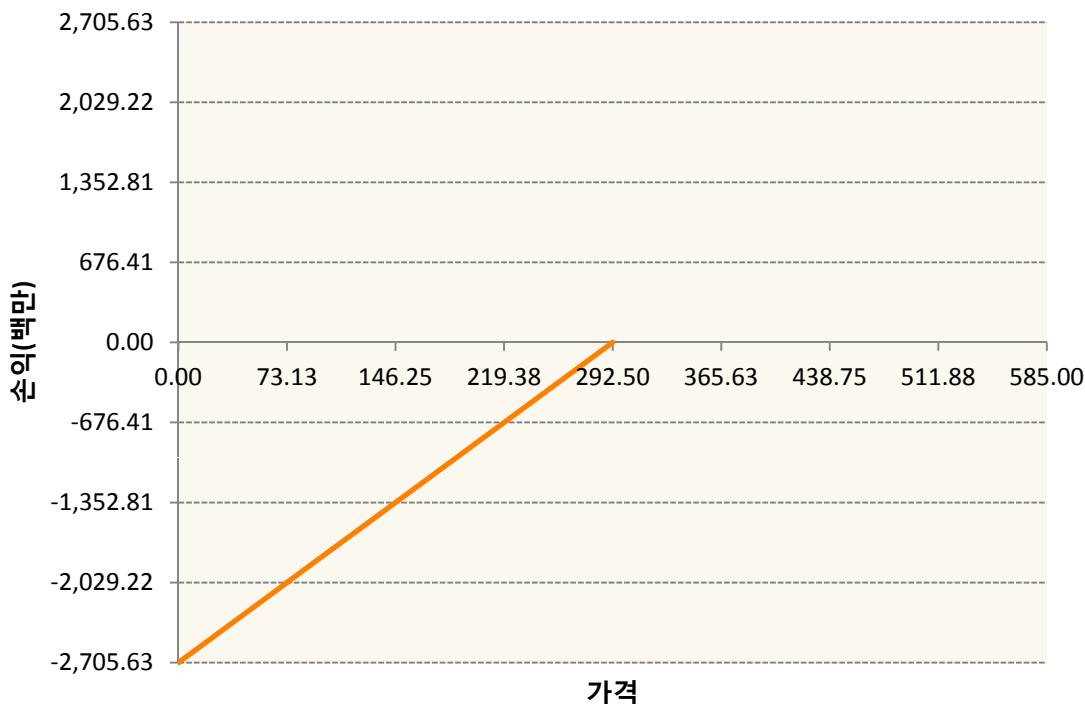


KR4301Q32908-2020-03 풋290





KR4301Q32924-2020-03 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						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	
KR4301Q32908		2020-03 풋290						42
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-38	-39	-39	-40	-40	-41	-42
-5.33%	-19	-20	-21	-22	-23	-24	-25
-2.67%	-5	-6	-7	-8	-10	-11	-12
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	6	5	5	4	4	3	2
5.33%	6	6	6	6	6	5	5
8.00%	7	7	7	6	6	6	6

KR4301Q32924 2020-03 풋292.5 152

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-144	-145	-146	-147	-149	-150	-152
-5.33%	-76	-79	-81	-84	-87	-90	-93
-2.67%	-22	-26	-30	-34	-38	-42	-46
0%	11	8	4	0	-4	-8	-12
2.67%	25	23	21	18	15	13	9
5.33%	29	28	27	26	25	23	21
8.00%	30	30	29	29	28	27	26

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

(단위:백만원)

234

공시일	2020-02-19
기준일	2020-02-18

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	11,181	0	11,181	
누계	통화	선도	642	11,514	-10,872	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020F03(KRW/USD 28-02-20E	207
FX21020F04(KRW/USD 28-02-20E	296
FX21020F04(KRW/USD 28-02-20E	5
FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	324
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	89
FX21020G02 USD/KRW 28-02-20E	29
FX21020G03 USD/KRW 28-02-20E	23
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

326

공시일	2020-02-19
기준일	2020-02-18

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

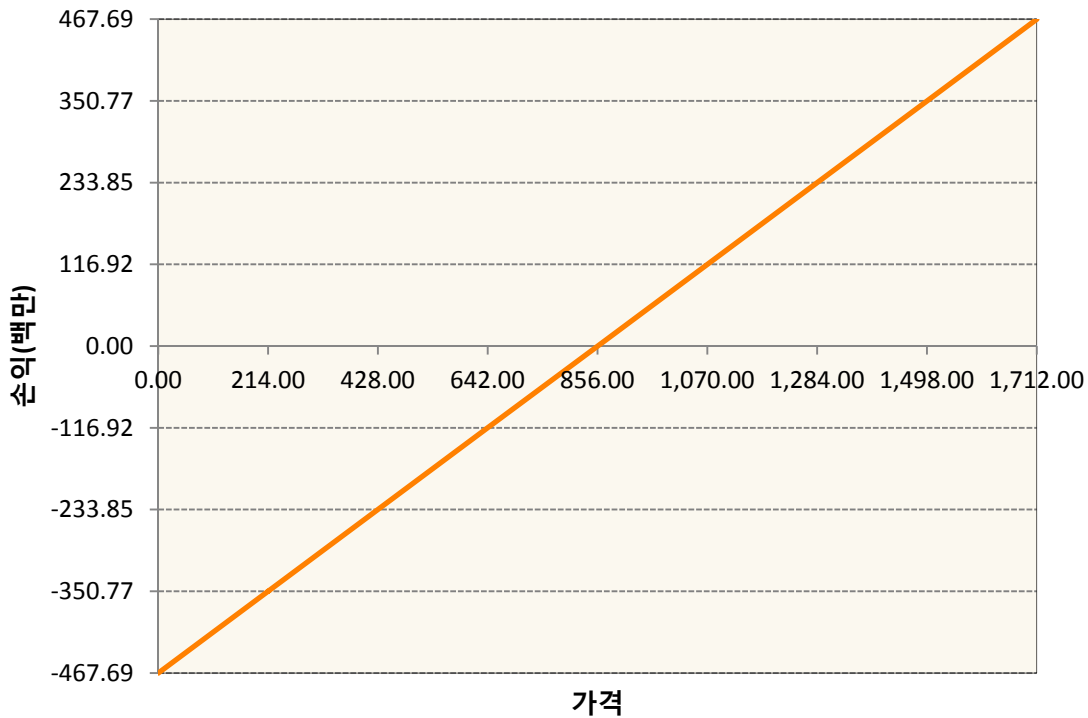
1. 계약금액

(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	468	0	468	
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	37

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

(단위:백만원)

114

공시일	2020-02-19
기준일	2020-02-18

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

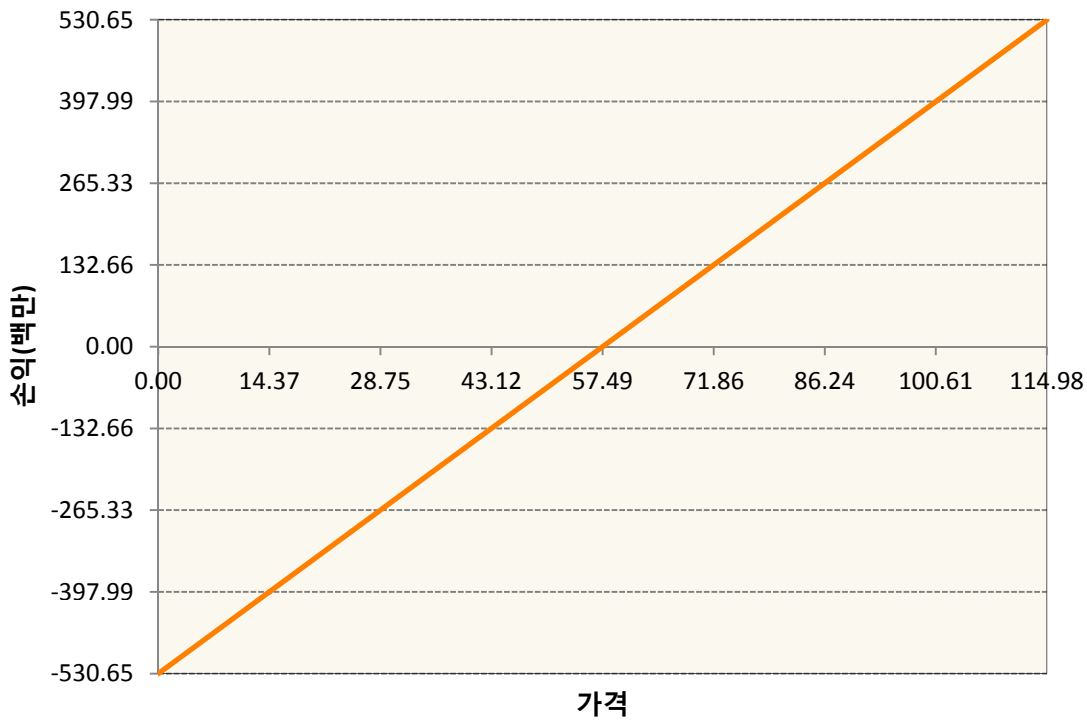
1. 계약금액

(단위:백만원)

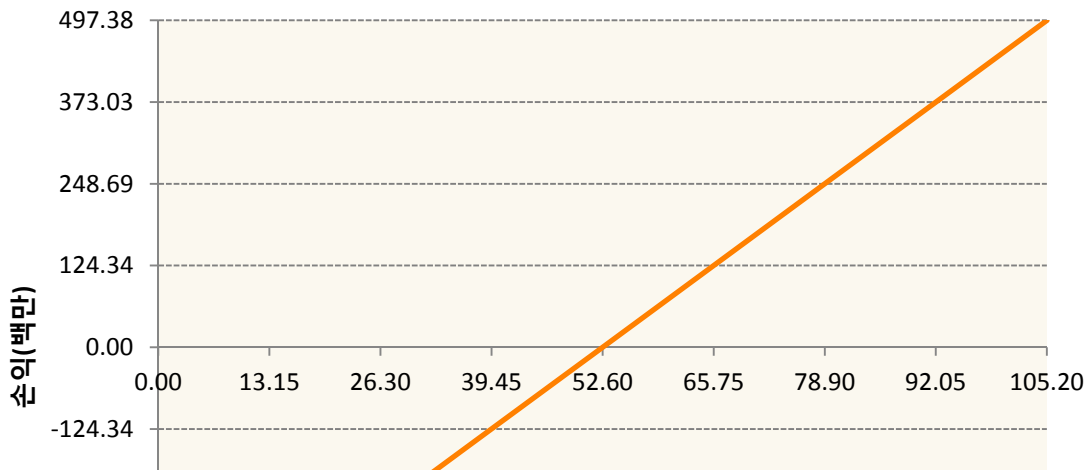
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,155	190	1,964	

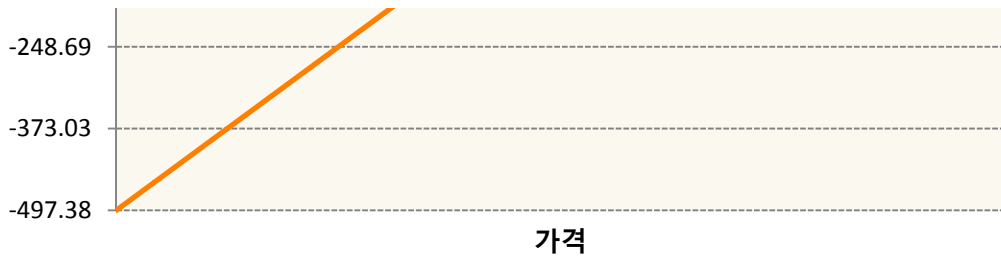
2. 만기시점의 손익구조

COK0-BRENT CRUDE FUTR May20

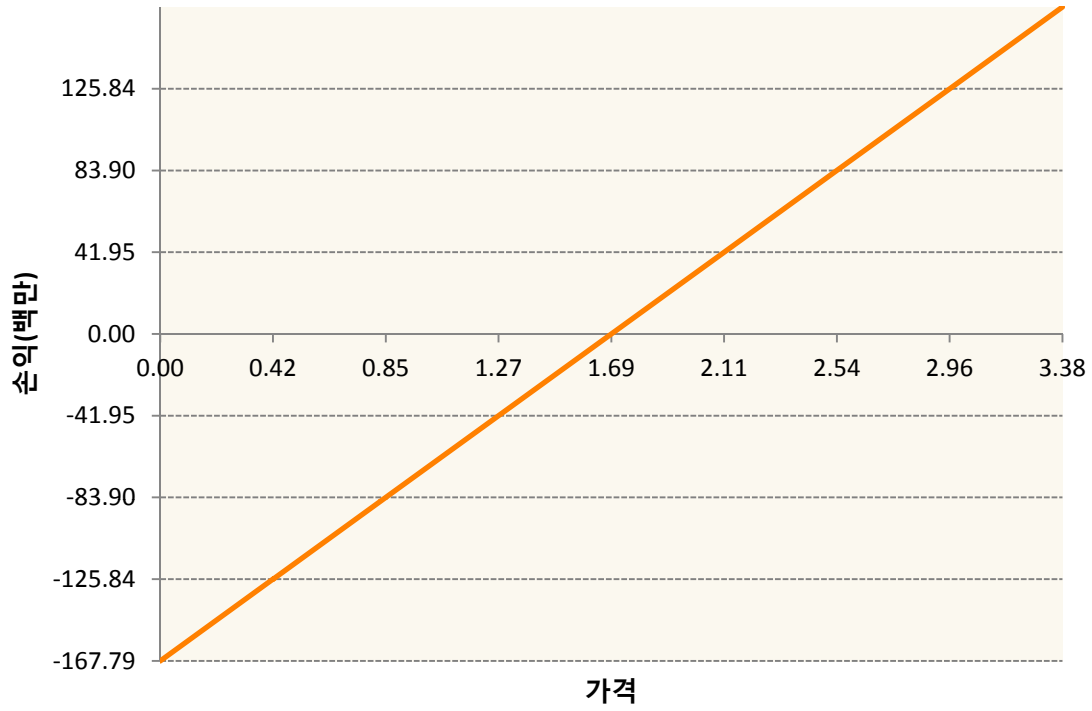


CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20

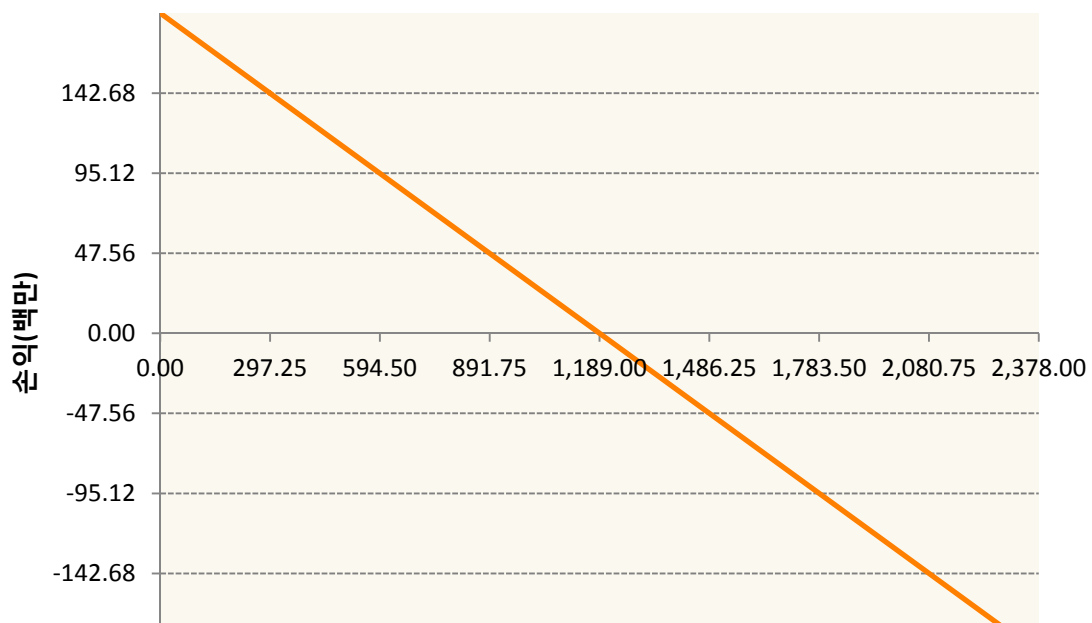


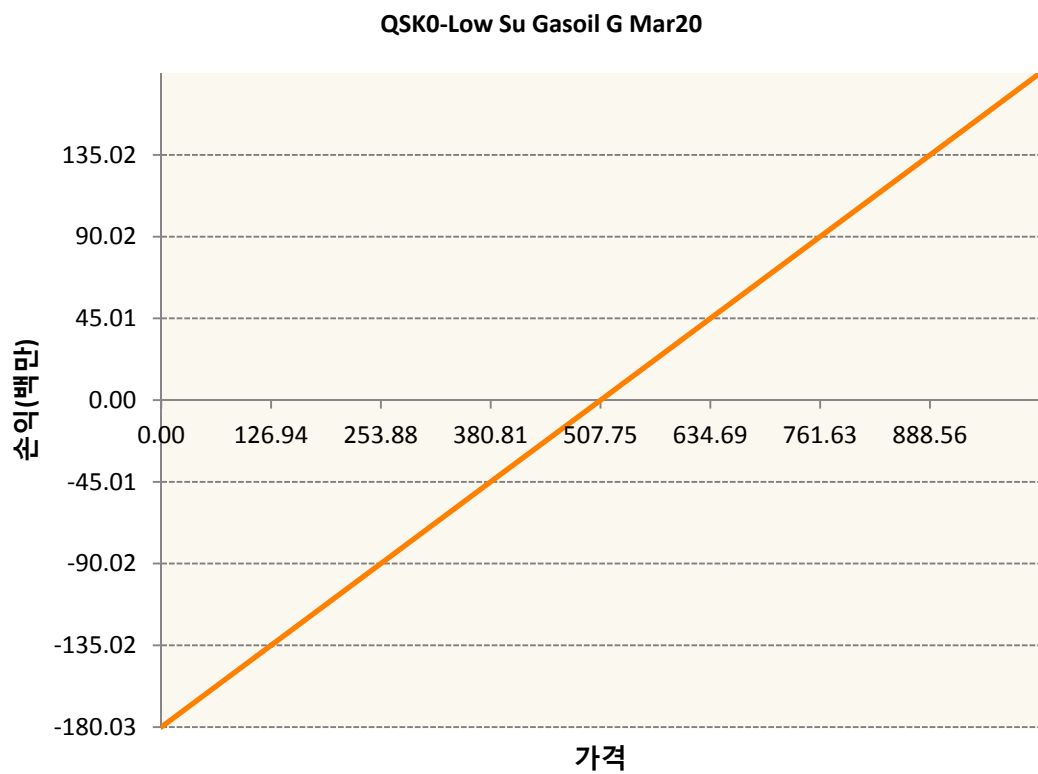
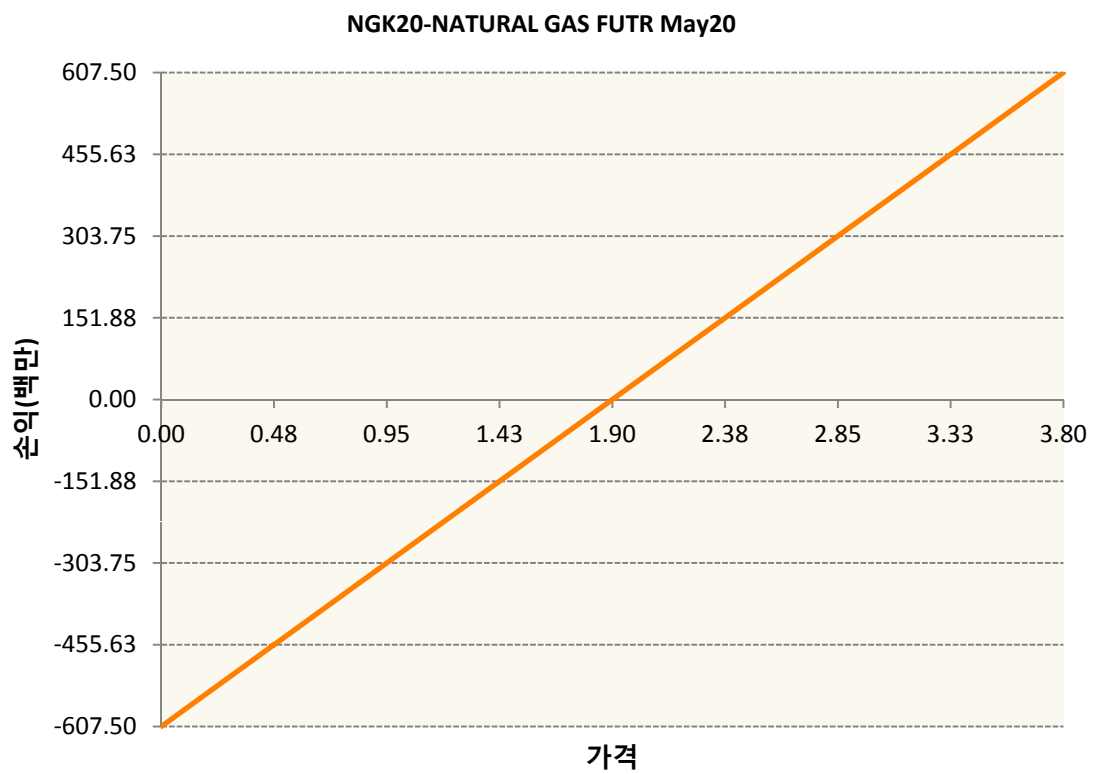
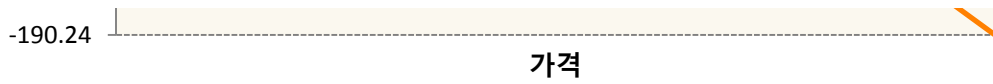


HOK0-NY Harb ULSD Fut May20

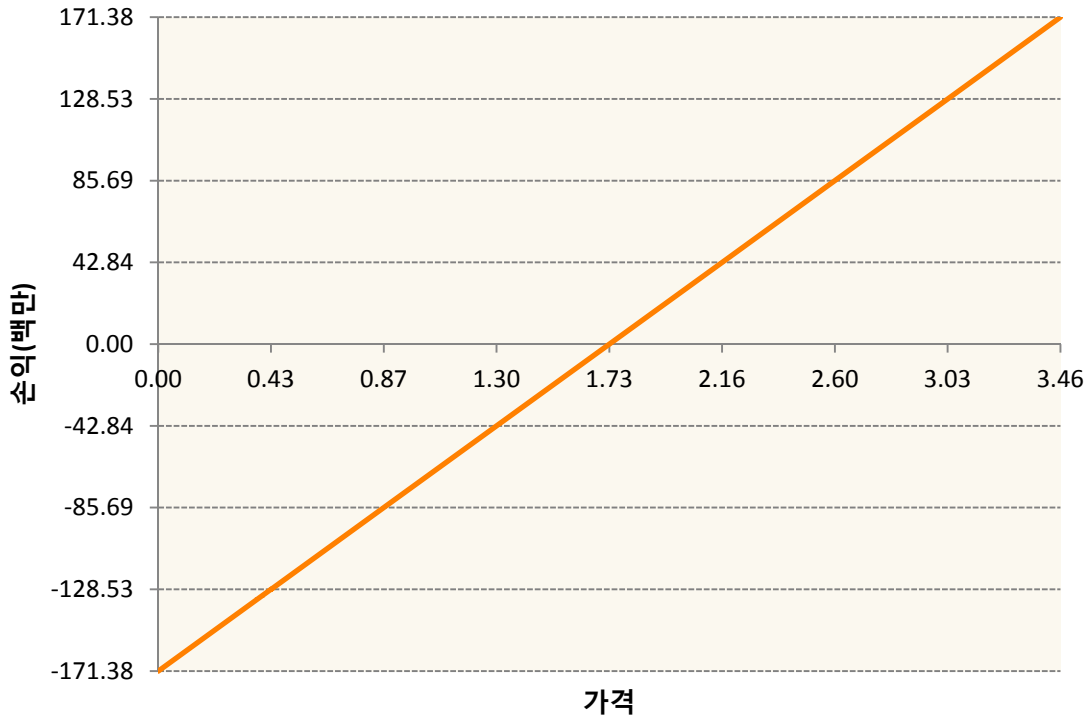


KR4175Q30009-2020-03 달러선물





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	2020-02-19
기준일	2020-02-18

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

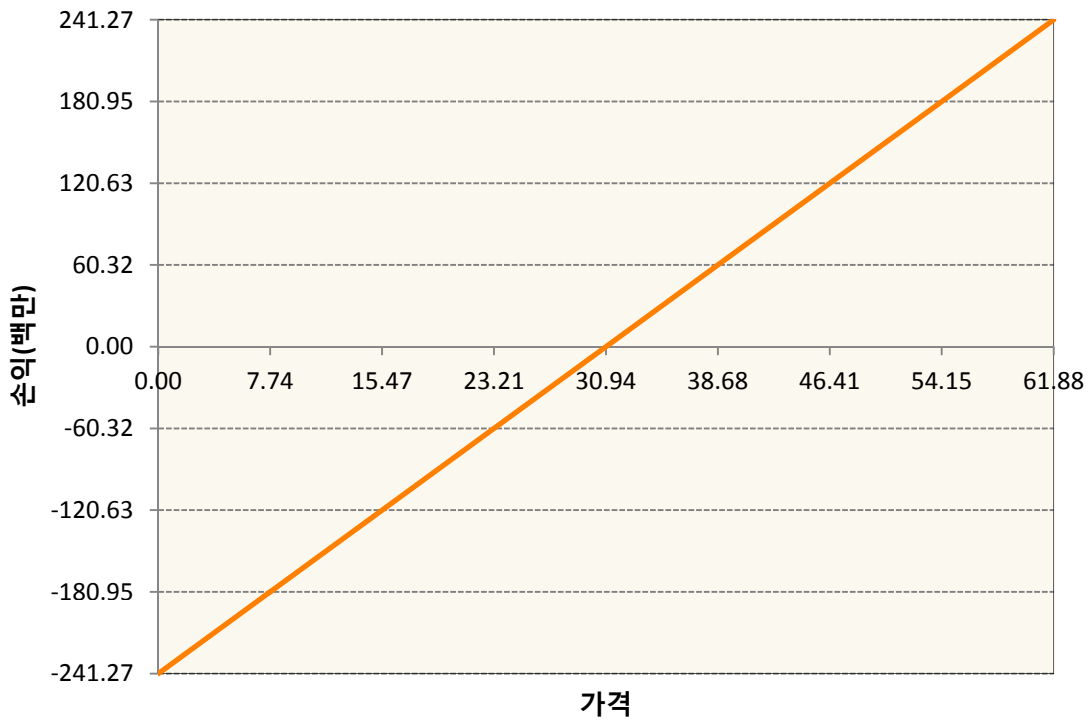
1. 계약금액

(단위:백만원)

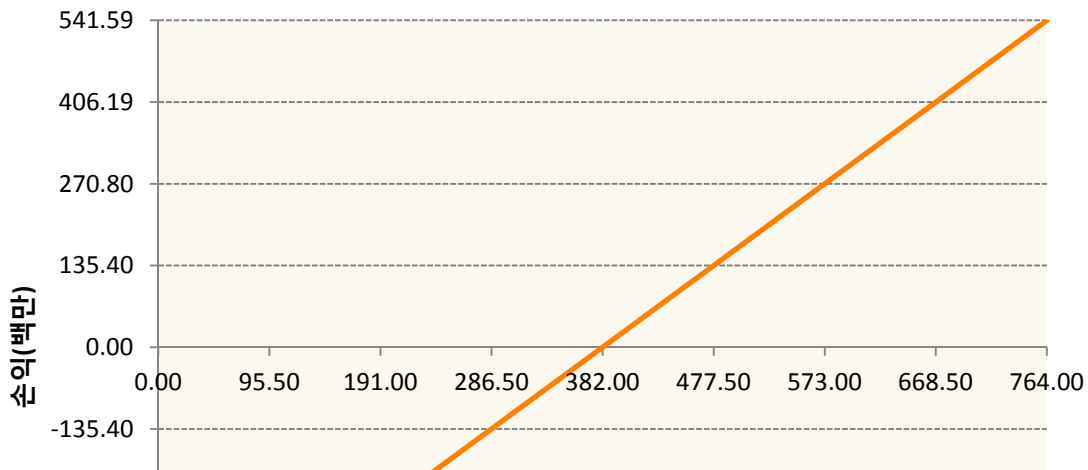
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,735	155	2,581	

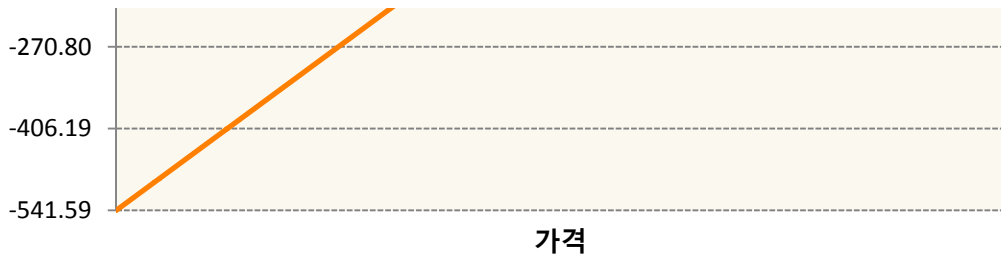
2. 만기시점의 손익구조

BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20

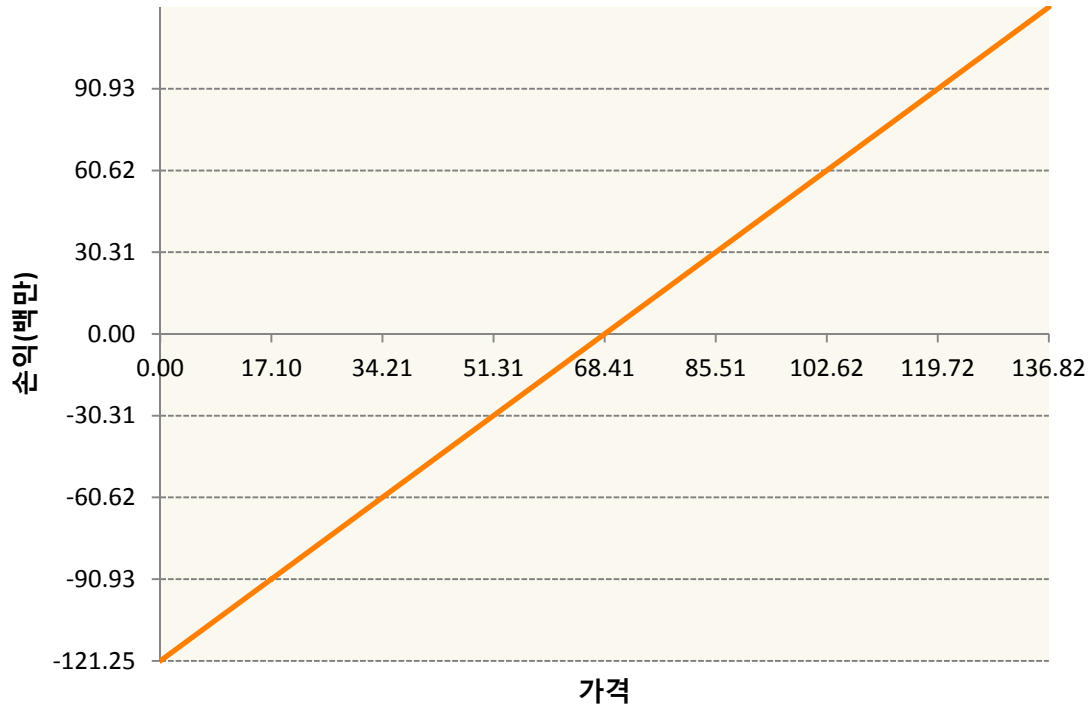


CK0-CORN FUTURE May20

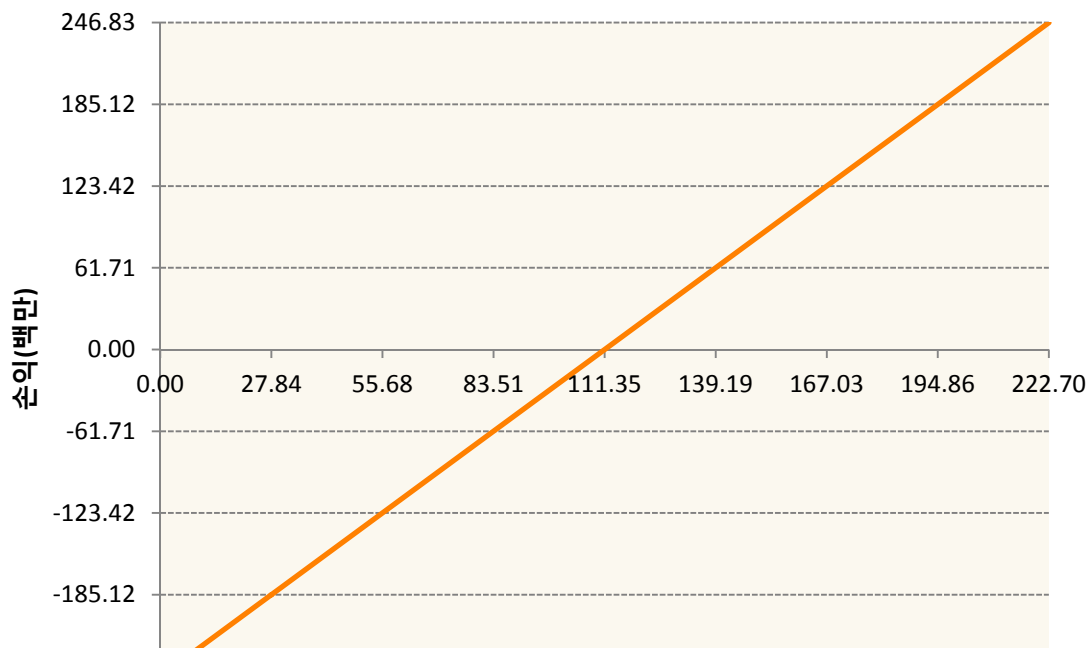


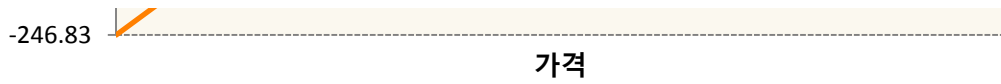


CTK0-COTTON NO.2 FUTR May20

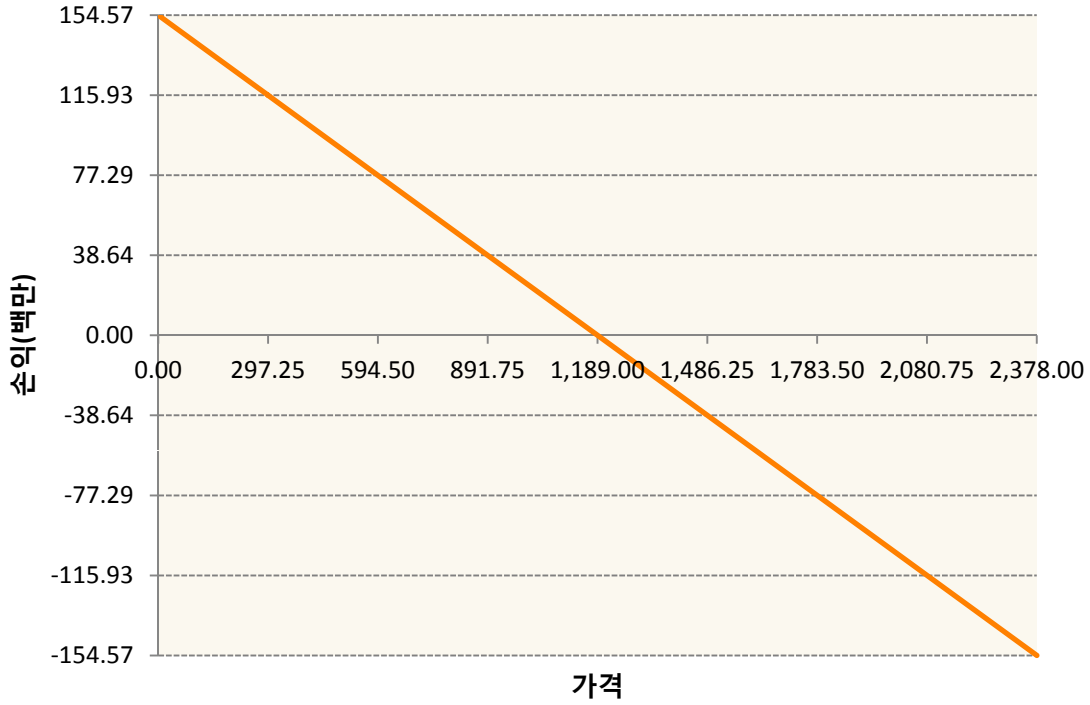


KCK0-COFFEE 'C' FUTURE May20

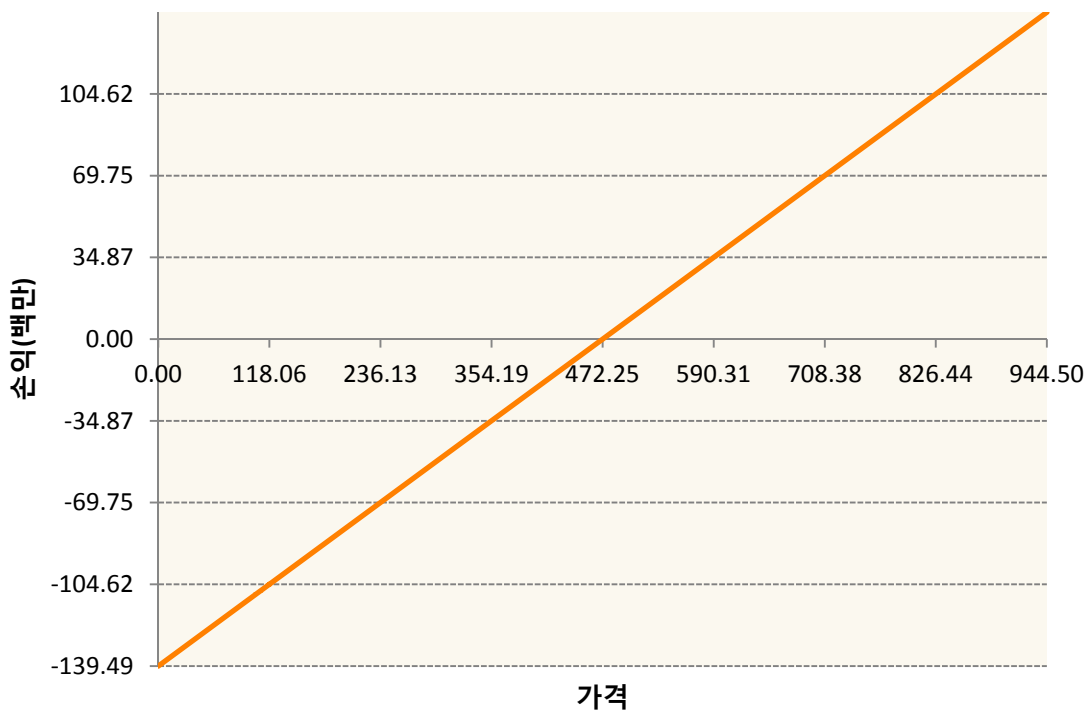




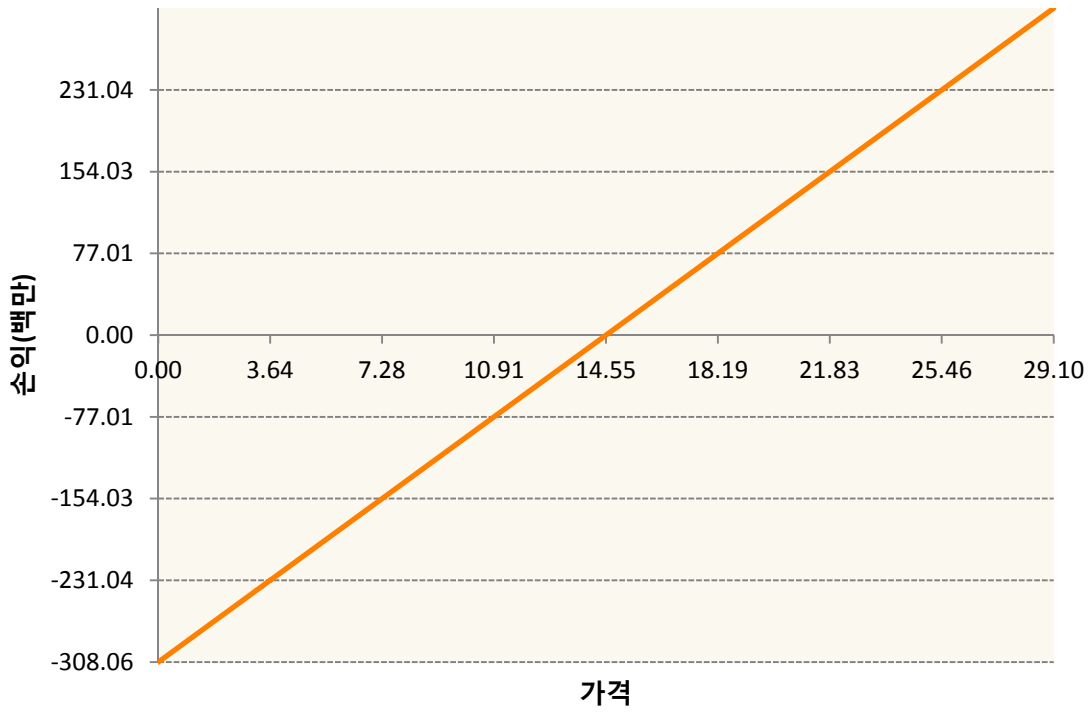
KR4175Q30009-2020-03 달러선물



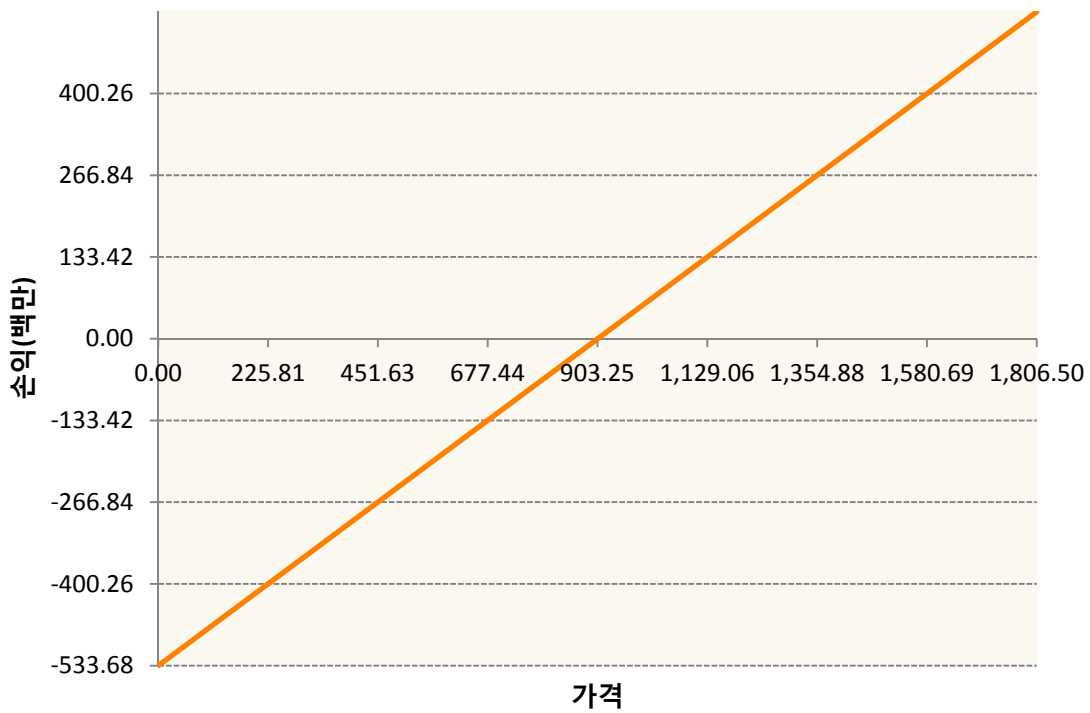
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



SBK0-Sugar May20

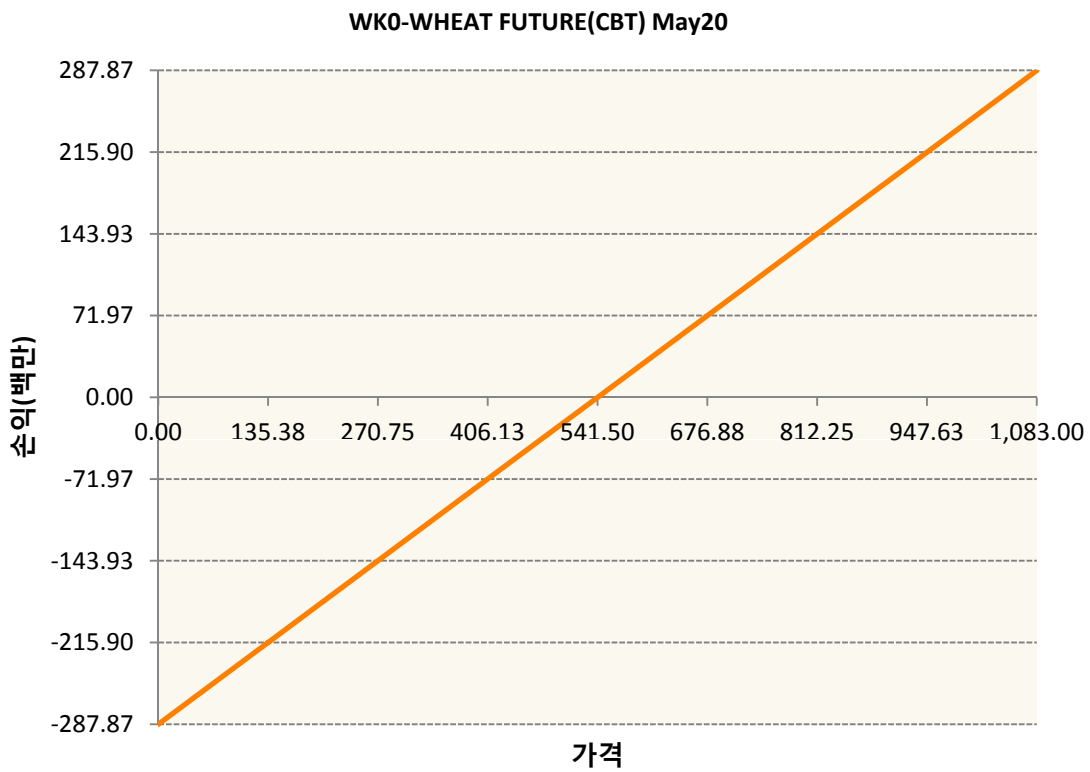
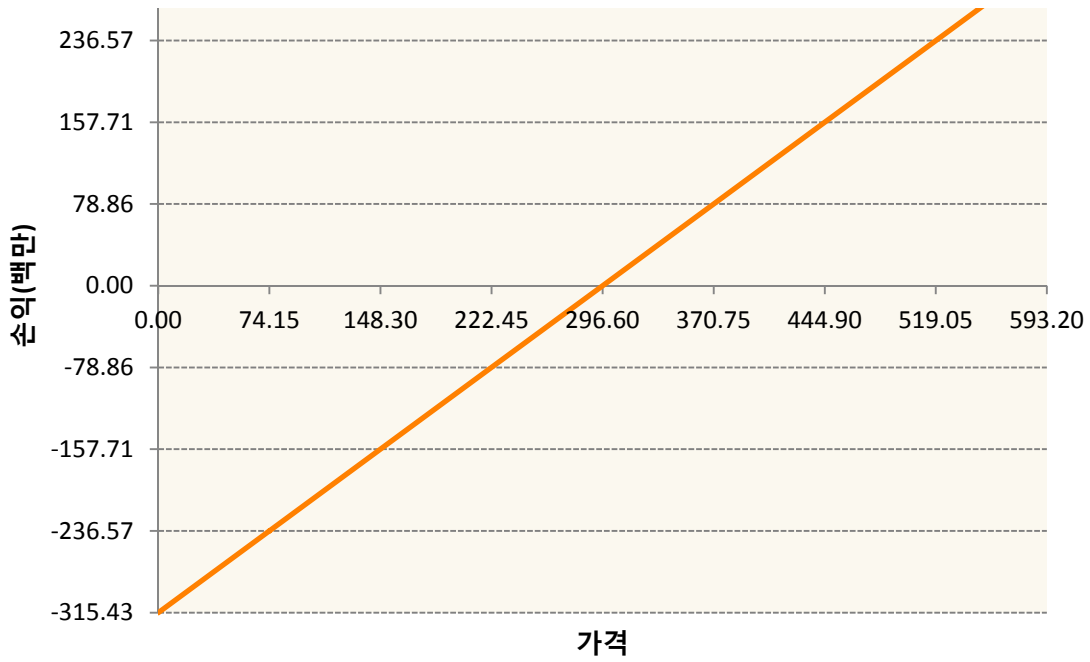


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	19
CK0	CORN FUTURE May20	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