

공시일	2020-02-20
기준일	2020-02-19

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	2020-02-20
기준일	2020-02-19

스마트인덱스모

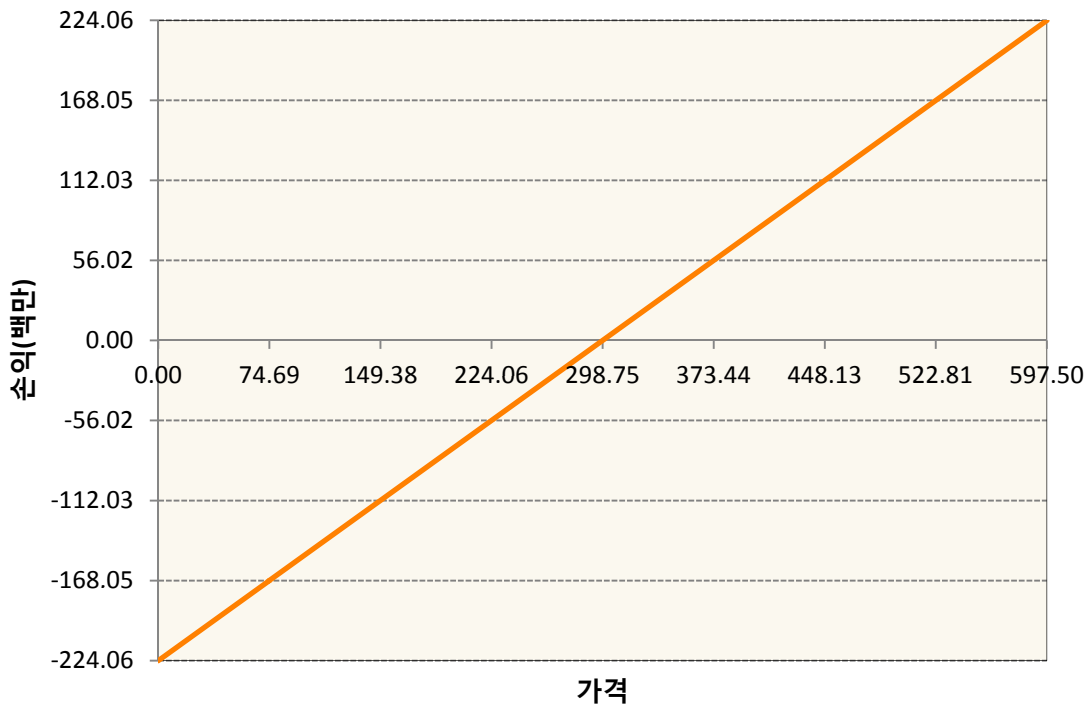
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	224	0	224	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	2020-02-20
기준일	2020-02-19

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

1,161

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

676

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-20
기준일	2020-02-19

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)

921

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-20
기준일	2020-02-19

유로인덱스모(주식-파생형)

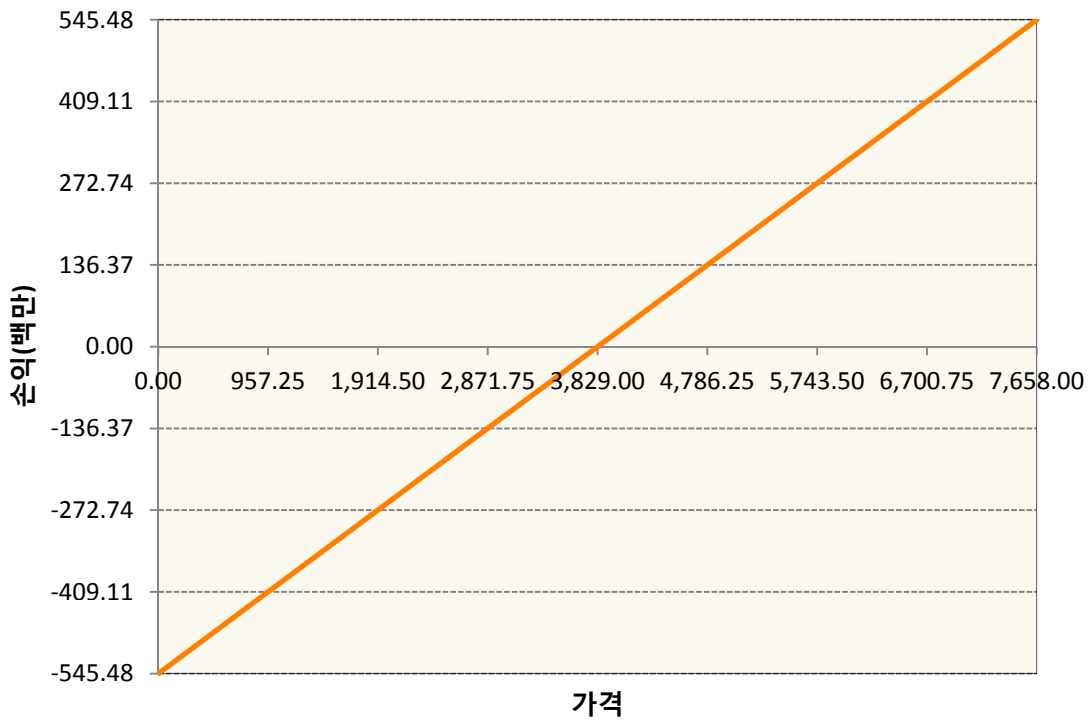
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	545	0	545	

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)

30

공시일	2020-02-20
기준일	2020-02-19

차이나인덱스모(주식-파생형)

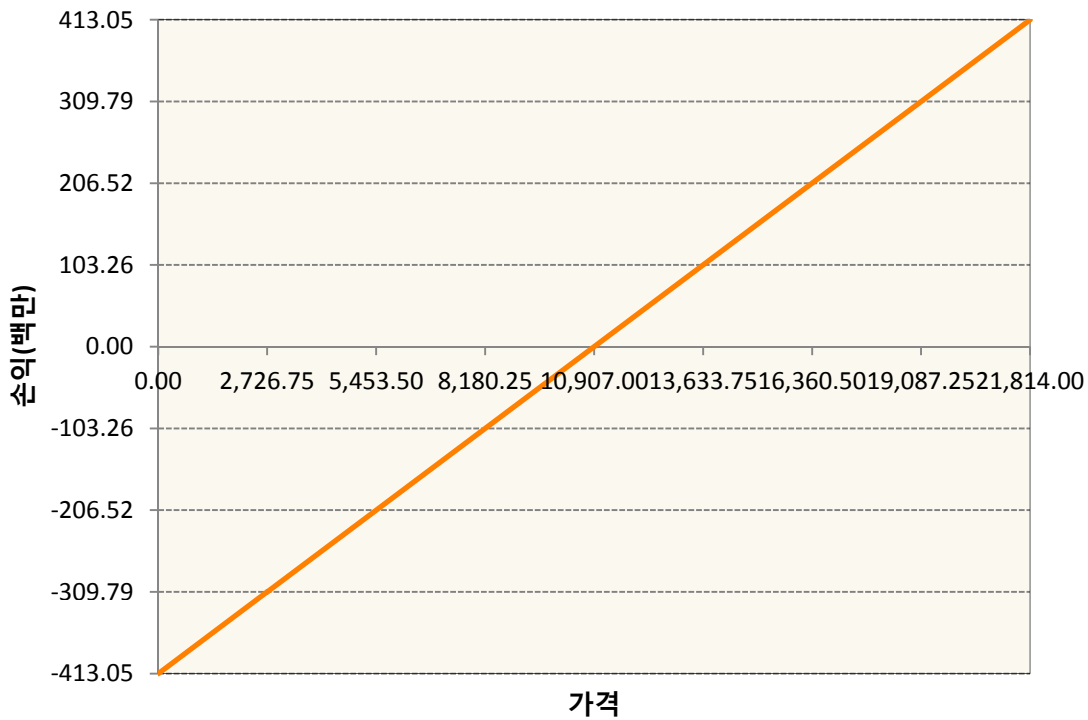
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	413	0	413	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	2020-02-20
기준일	2020-02-19

커버드콜모(주식혼합-파생형)

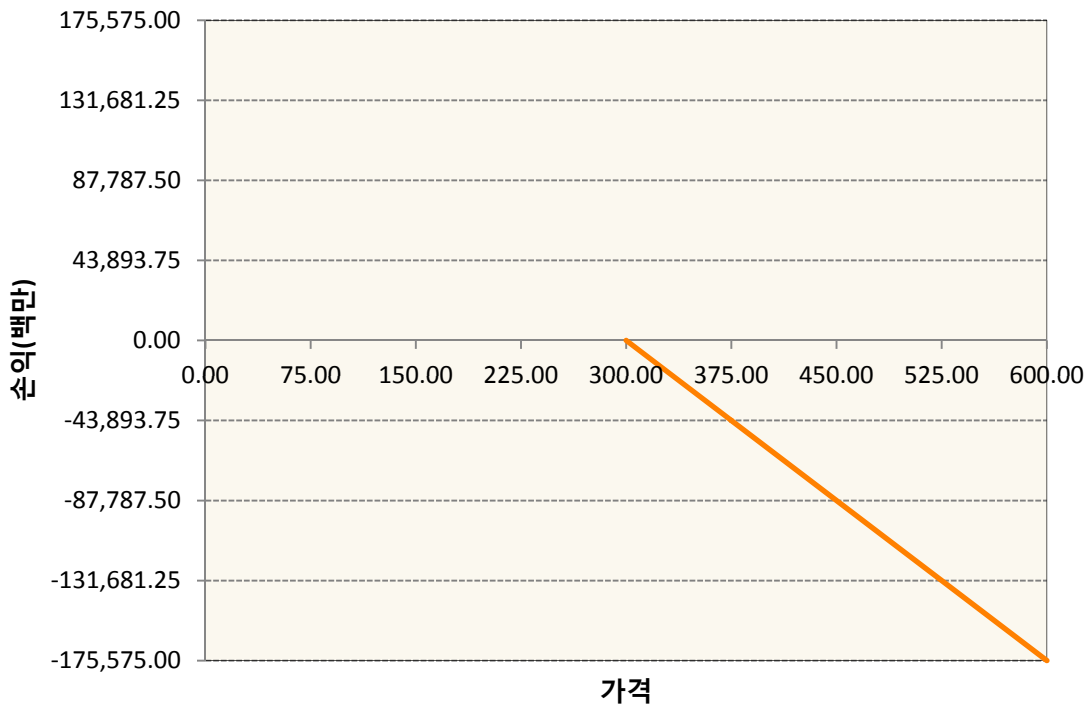
1. 계약금액

(단위:백만원)

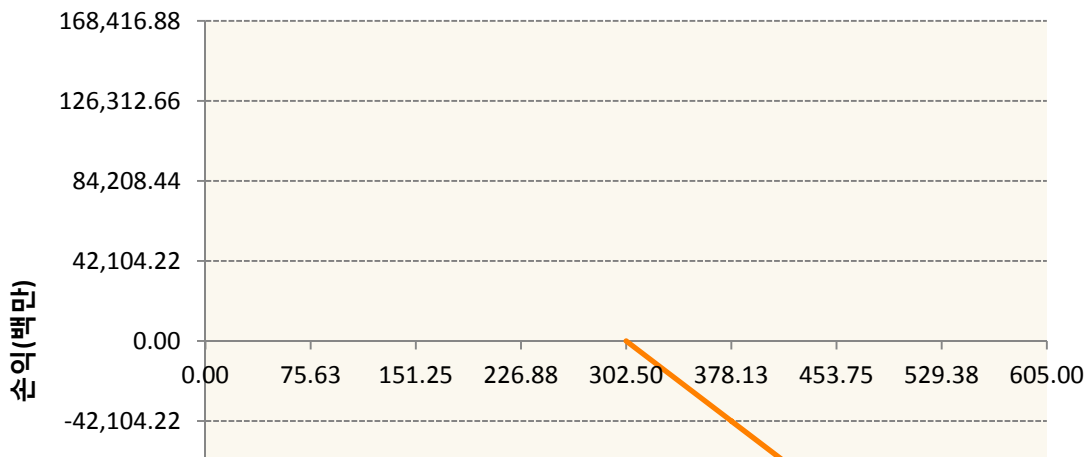
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	452,742	-452,742	장내

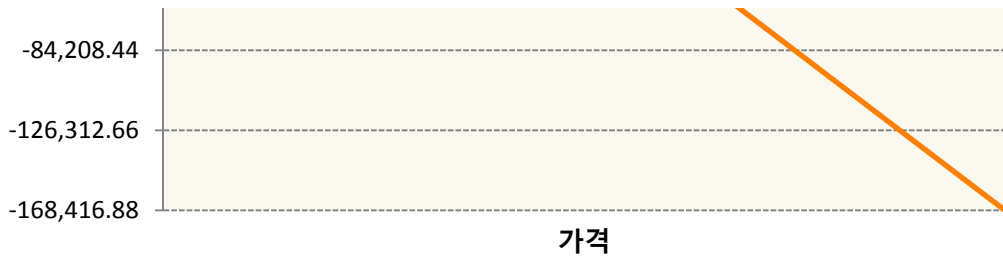
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q33007-2020-03 콜300

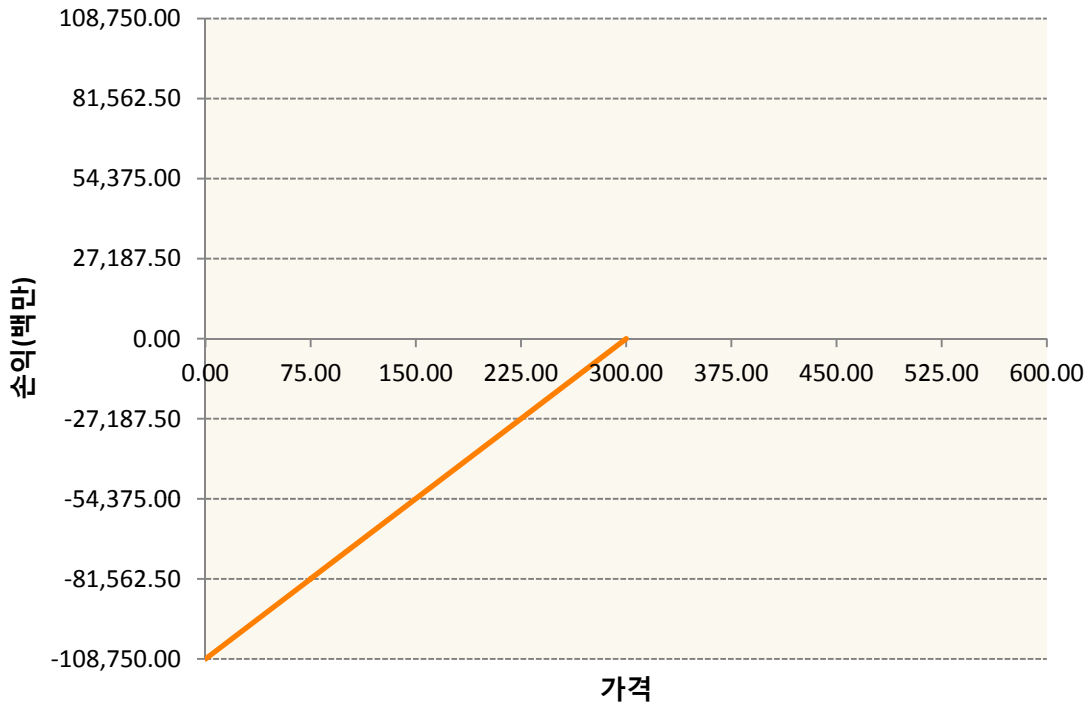


KR4201Q33023-2020-03 콜302.5





KR4301Q33005-2020-03 풋300



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q33007		2020-03 콜300					10,381
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,535	4,396	4,227	4,029	3,808	3,565	3,303
-5.33%	4,069	3,813	3,533	3,232	2,914	2,583	2,240
-2.67%	3,070	2,697	2,314	1,923	1,526	1,123	717
0%	1,314	876	438	0	-439	-877	-1,316
2.67%	-1,294	-1,715	-2,141	-2,569	-3,000	-3,434	-3,868
5.33%	-4,680	-5,017	-5,372	-5,741	-6,122	-6,512	-6,910
8.00%	-8,647	-8,874	-9,132	-9,415	-9,720	-10,043	-10,381
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5					9,440
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,779	3,672	3,537	3,374	3,187	2,979	2,751

-5.33%	3,438	3,228	2,991	2,732	2,454	2,160	1,853
-2.67%	2,664	2,337	1,996	1,644	1,283	914	540
0%	1,231	823	412	0	-413	-827	-1,242
2.67%	-996	-1,413	-1,832	-2,252	-2,673	-3,095	-3,517
5.33%	-3,995	-4,349	-4,716	-5,093	-5,478	-5,869	-6,265
8.00%	-7,611	-7,863	-8,143	-8,443	-8,762	-9,095	-9,440
KR4301Q33005 2020-03 풋300							7,157
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,028	-7,034	-7,045	-7,063	-7,087	-7,118	-7,157
-5.33%	-4,191	-4,227	-4,273	-4,330	-4,396	-4,471	-4,553
-2.67%	-1,567	-1,669	-1,780	-1,897	-2,020	-2,147	-2,279
0%	476	318	159	0	-159	-319	-478
2.67%	1,659	1,521	1,379	1,234	1,086	936	785
5.33%	2,128	2,057	1,975	1,882	1,781	1,673	1,558
8.00%	2,249	2,227	2,195	2,153	2,101	2,040	1,969

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

(단위:백만원)

25,900

공시일	2020-02-20
기준일	2020-02-19

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

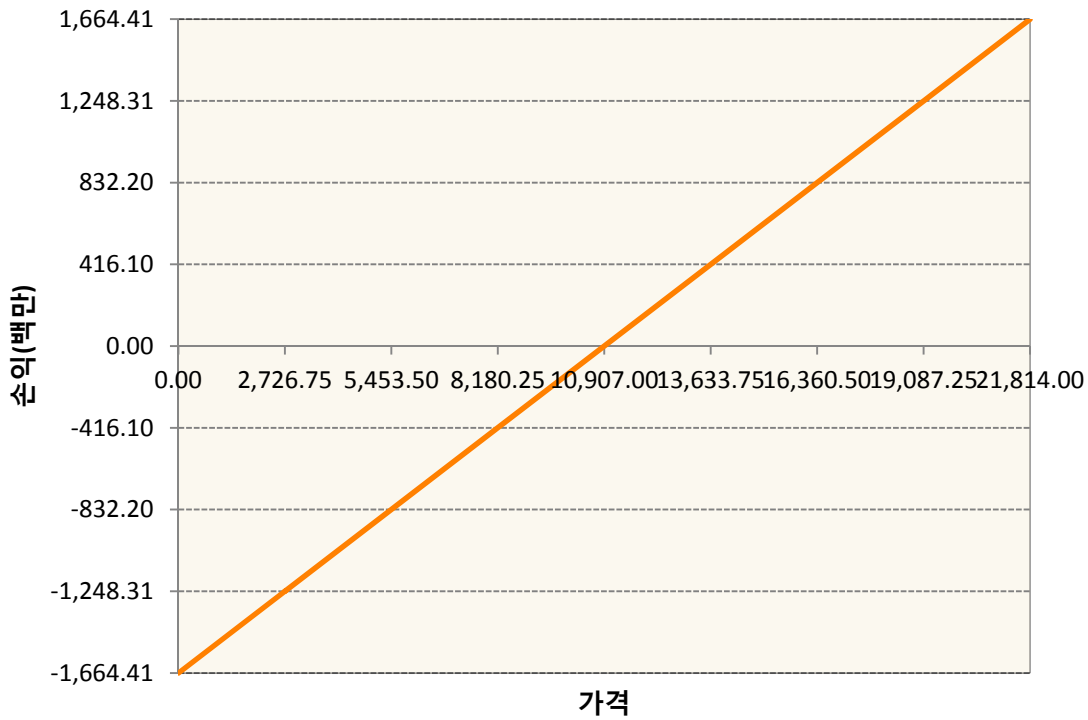
1. 계약금액

(단위:백만원)

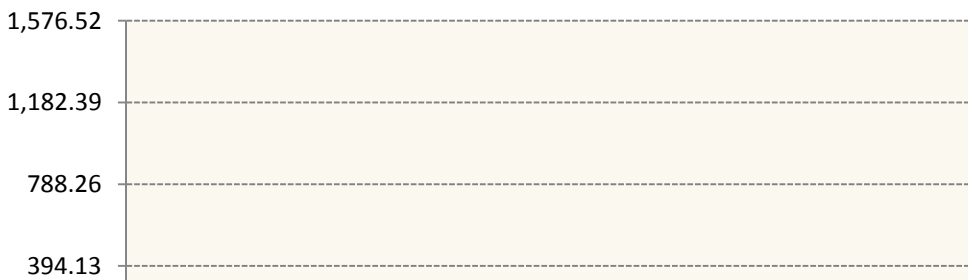
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,664	0	1,664	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,426	-4,426	장내
누계	통화	선도	0	4,310	-4,310	장외

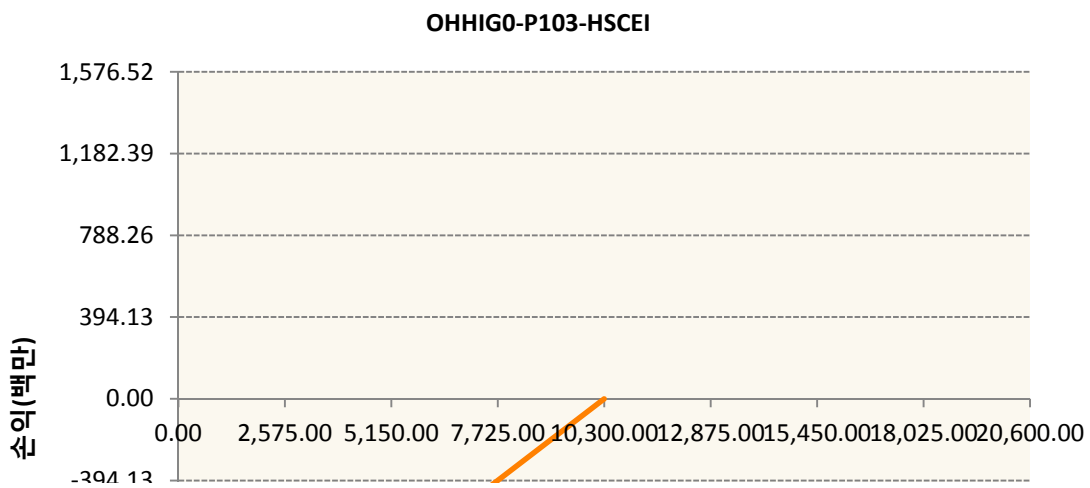
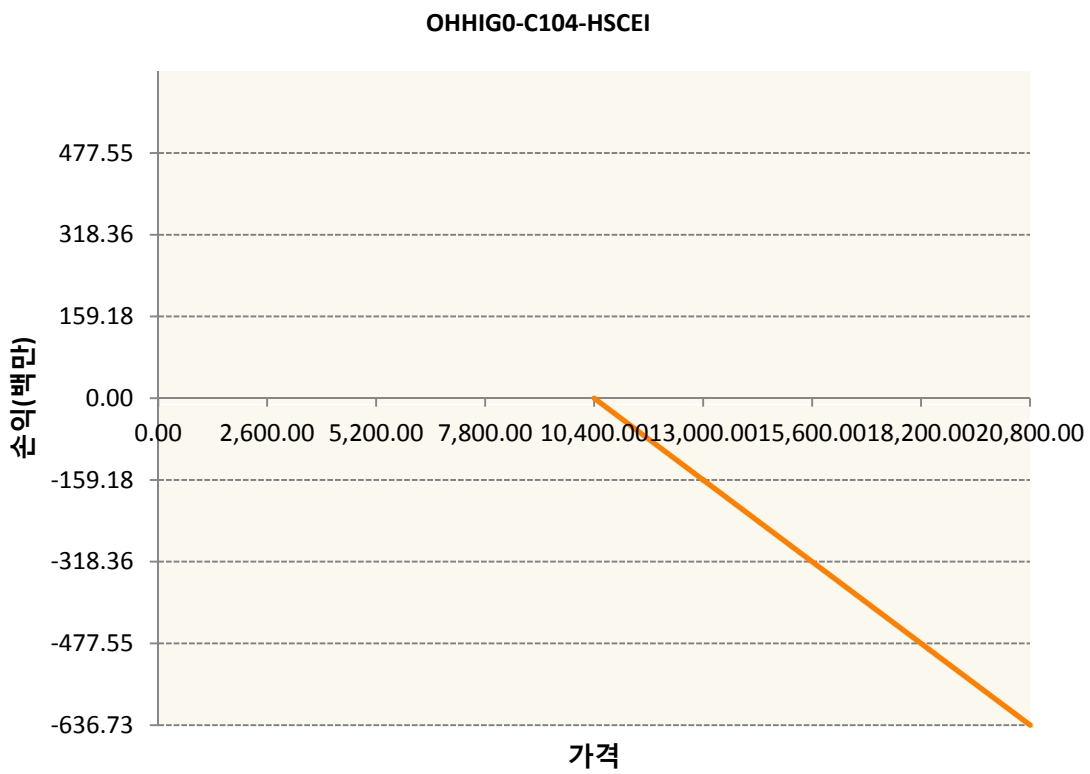
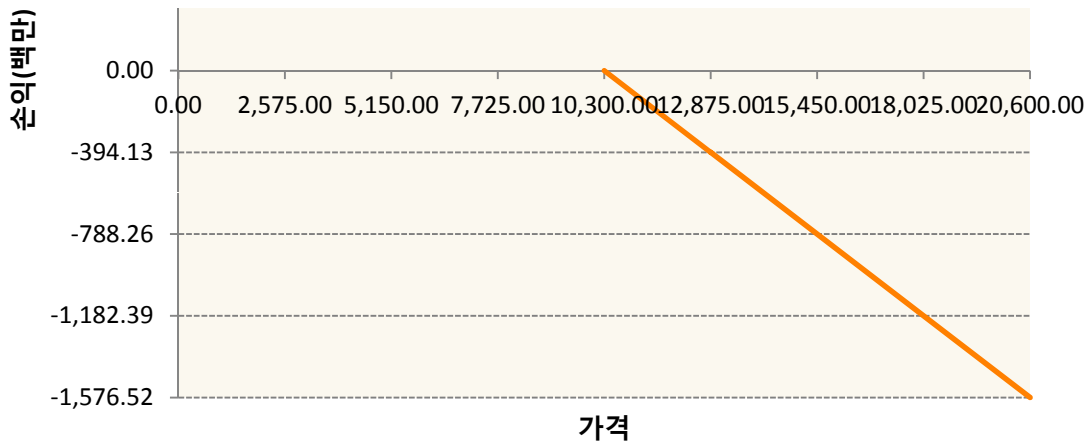
2. 만기시점의 손익구조

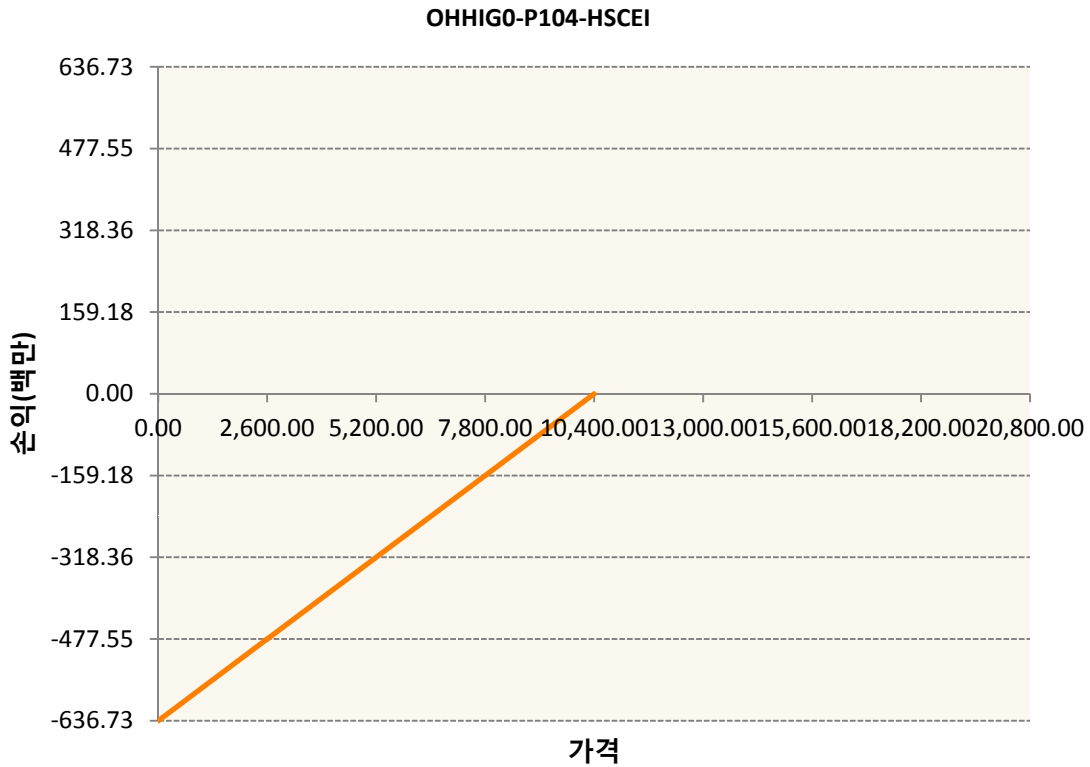
HCG0-HSCEI Futures Feb20



OHHIG0-C103-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	172
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E	172
HCG0 HSCEI Futures Feb20	133
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)
	557

공시일	2020-02-20
기준일	2020-02-19

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

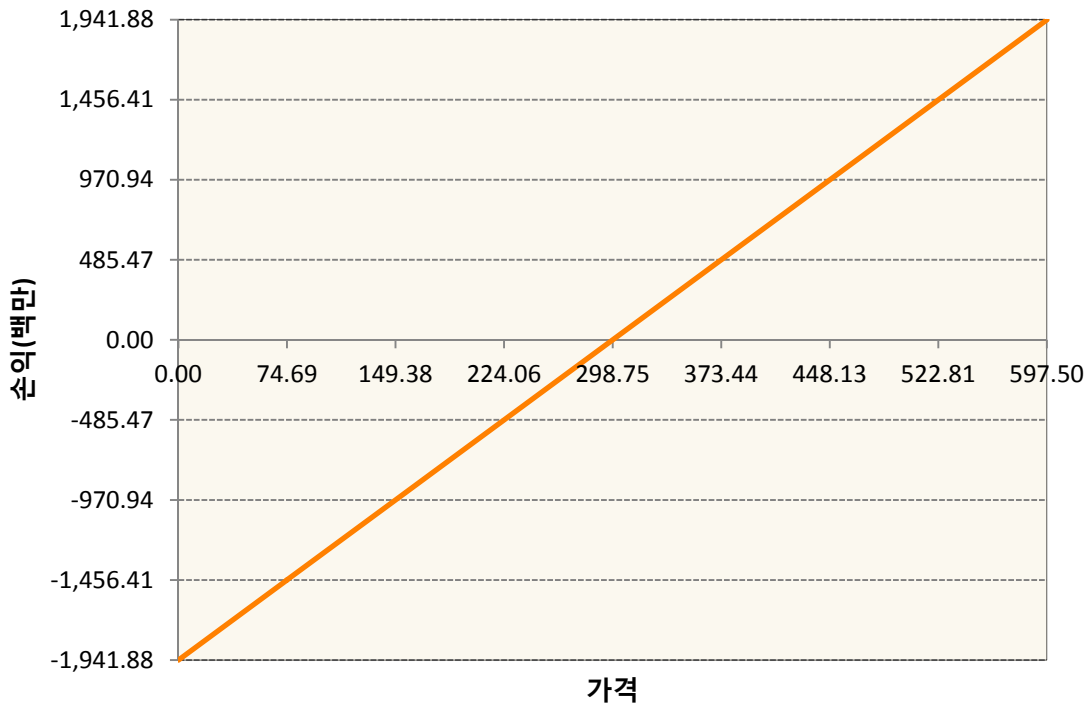
1. 계약금액

(단위:백만원)

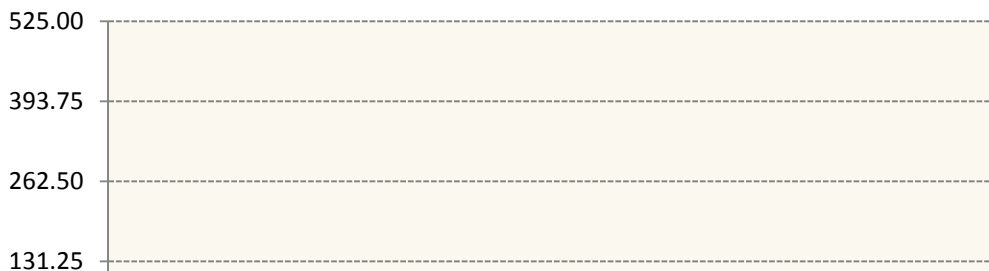
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	894	-894	장내
신규	유가증권	스왑	0	1,000	-1,000	장외
신규	유가증권	옵션	1,703	0	1,703	장내
누계	유가증권	선물	1,942	0	1,942	장내
누계	유가증권	스왑	5,125	0	5,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,612	-3,612	장내

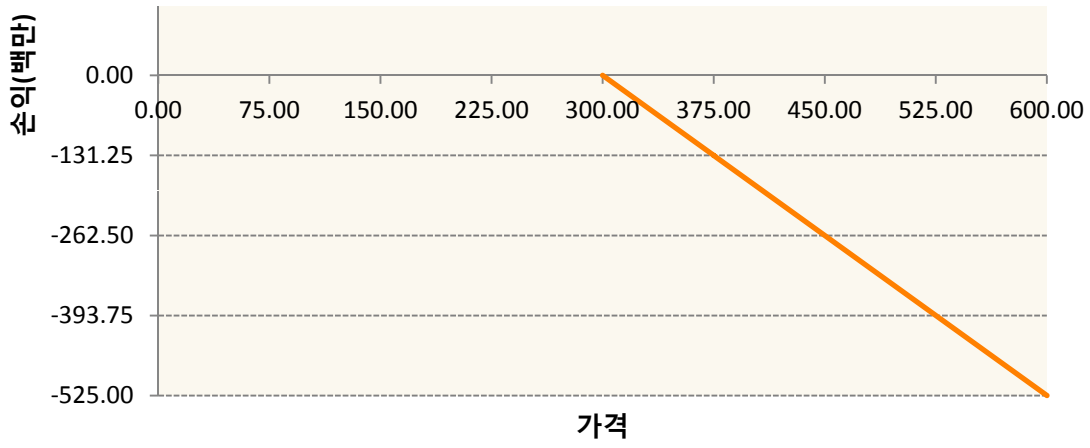
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

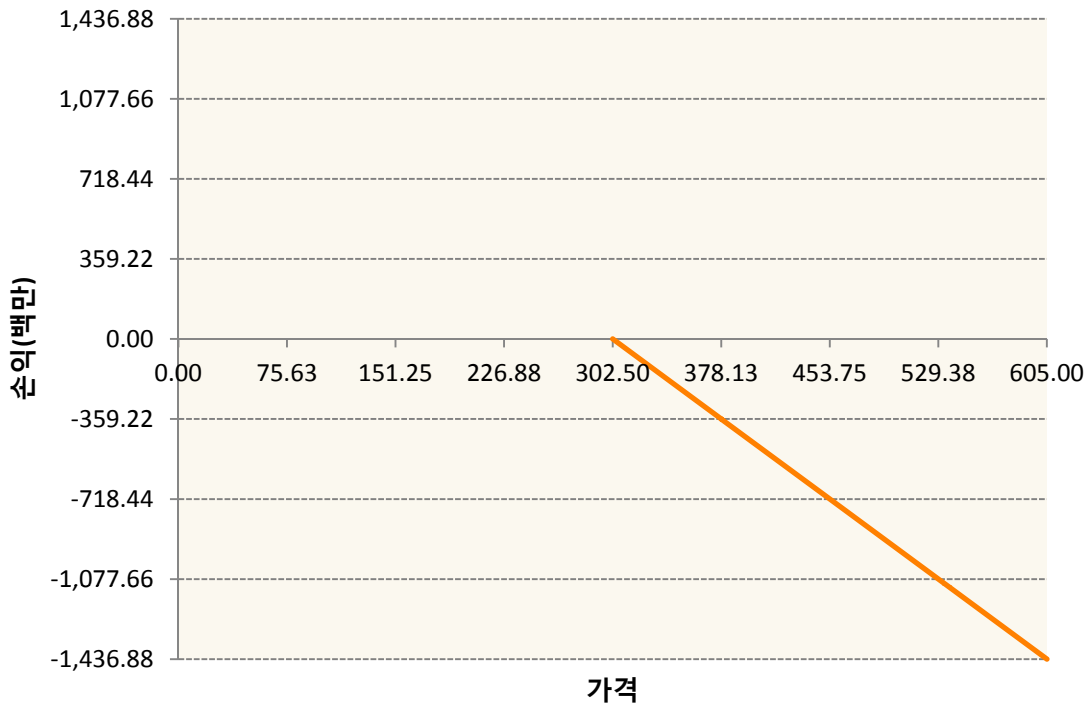


KR4201Q33007-2020-03 콜300

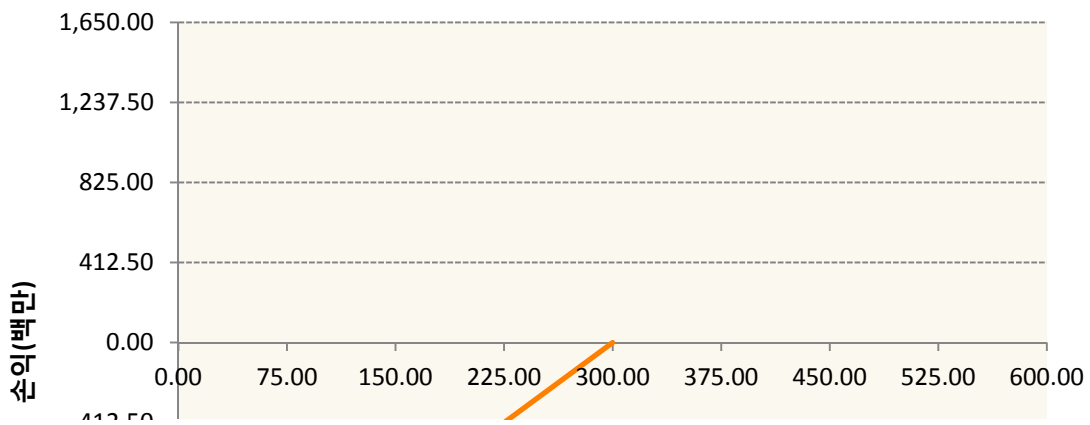




KR4201Q33023-2020-03 콜302.5



KR4301Q33005-2020-03 풋300





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						441
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-441	-441	-441	-441	-441	-441	-441	
-5.33%	-294	-294	-294	-294	-294	-294	-294	
-2.67%	-147	-147	-147	-147	-147	-147	-147	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	147	147	147	147	147	147	147	
5.33%	294	294	294	294	294	294	294	
8.00%	441	441	441	441	441	441	441	
KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						155
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-155	-155	-155	-155	-155	-155	-155	
-5.33%	-103	-103	-103	-103	-103	-103	-103	
-2.67%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	52	52	52	52	52	52	52	
5.33%	103	103	103	103	103	103	103	
8.00%	155	155	155	155	155	155	155	
KR4201Q33007		2020-03 콜300						31
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	14	13	13	12	11	11	10	
-5.33%	12	11	11	10	9	8	7	
-2.67%	9	8	7	6	5	3	2	
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4	
2.67%	-4	-5	-6	-8	-9	-10	-12	
5.33%	-14	-15	-16	-17	-18	-19	-21	
8.00%	-26	-27	-27	-28	-29	-30	-31	
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5						81
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	32	31	30	29	27	25	23
-5.33%	29	28	26	23	21	18	16
-2.67%	23	20	17	14	11	8	5
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	-8	-12	-16	-19	-23	-26	-30
5.33%	-34	-37	-40	-43	-47	-50	-53
8.00%	-65	-67	-69	-72	-75	-78	-81
KR4301Q33005 2020-03 풋300							109
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-107	-107	-107	-107	-108	-108	-109
-5.33%	-64	-64	-65	-66	-67	-68	-69
-2.67%	-24	-25	-27	-29	-31	-33	-35
0%	7	5	2	0	-2	-5	-7
2.67%	25	23	21	19	16	14	12
5.33%	32	31	30	29	27	25	24
8.00%	34	34	33	33	32	31	30

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

(단위:백만원)

787

공시일	2020-02-20
기준일	2020-02-19

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

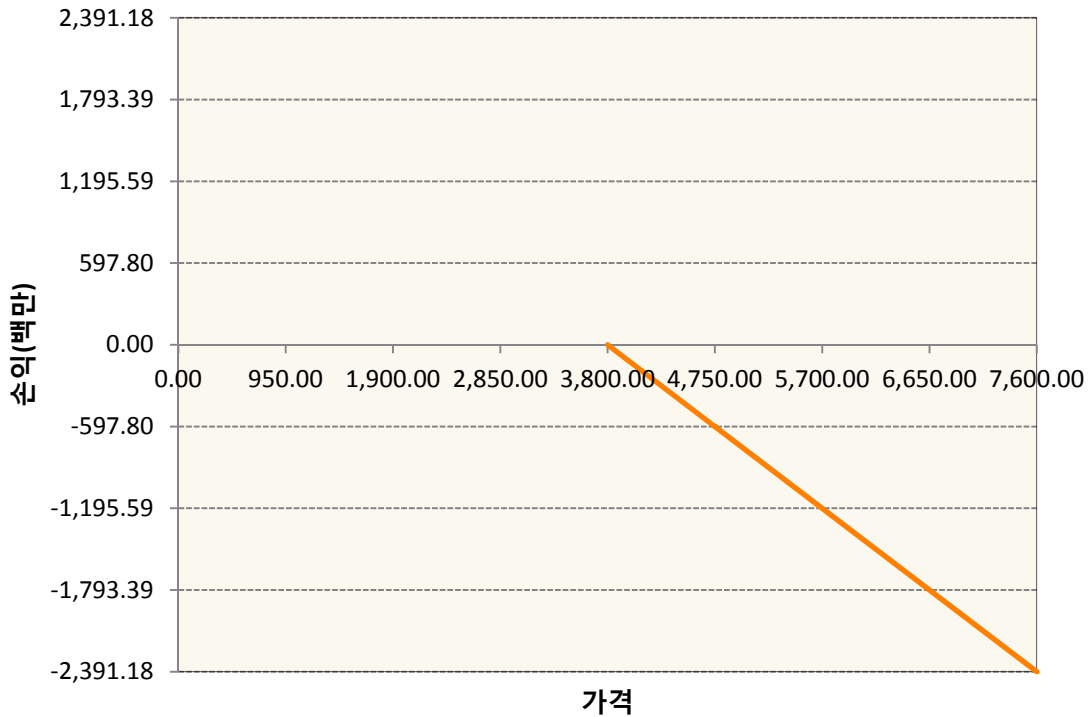
1. 계약금액

(단위:백만원)

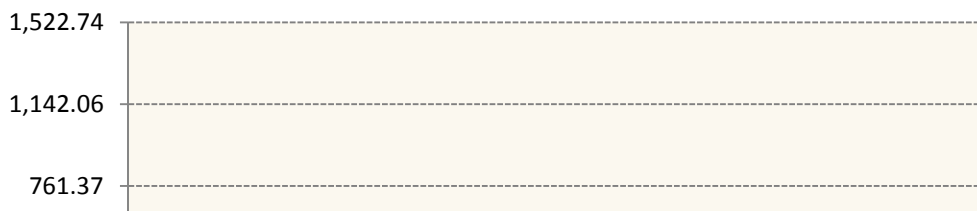
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	644	0	644	
누계	유가증권	스왑	11,559	0	11,559	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,828	-7,828	장내
누계	통화	선도	0	3,370	-3,370	장외

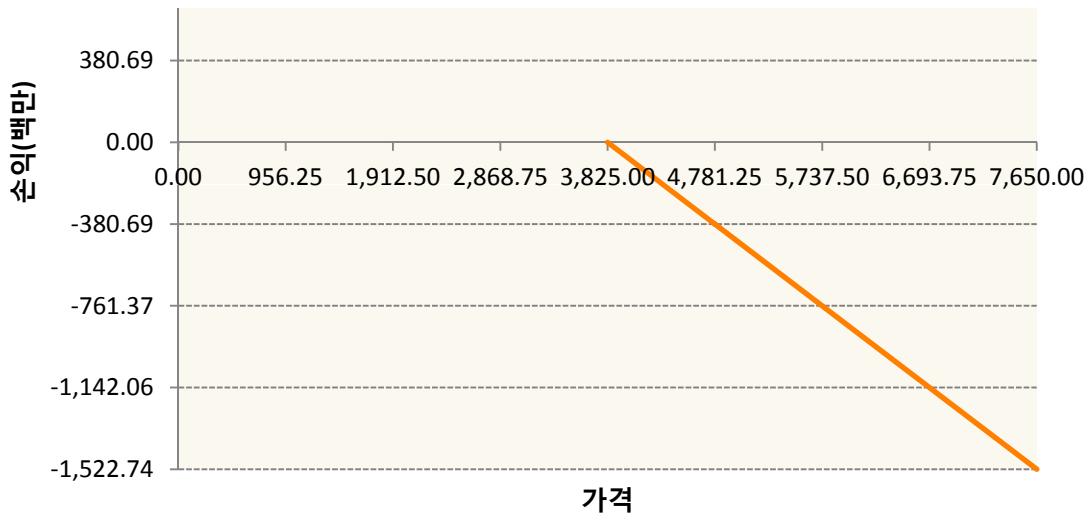
2. 만기시점의 손익구조

OESXG0-C3800-EURO STOXX 50

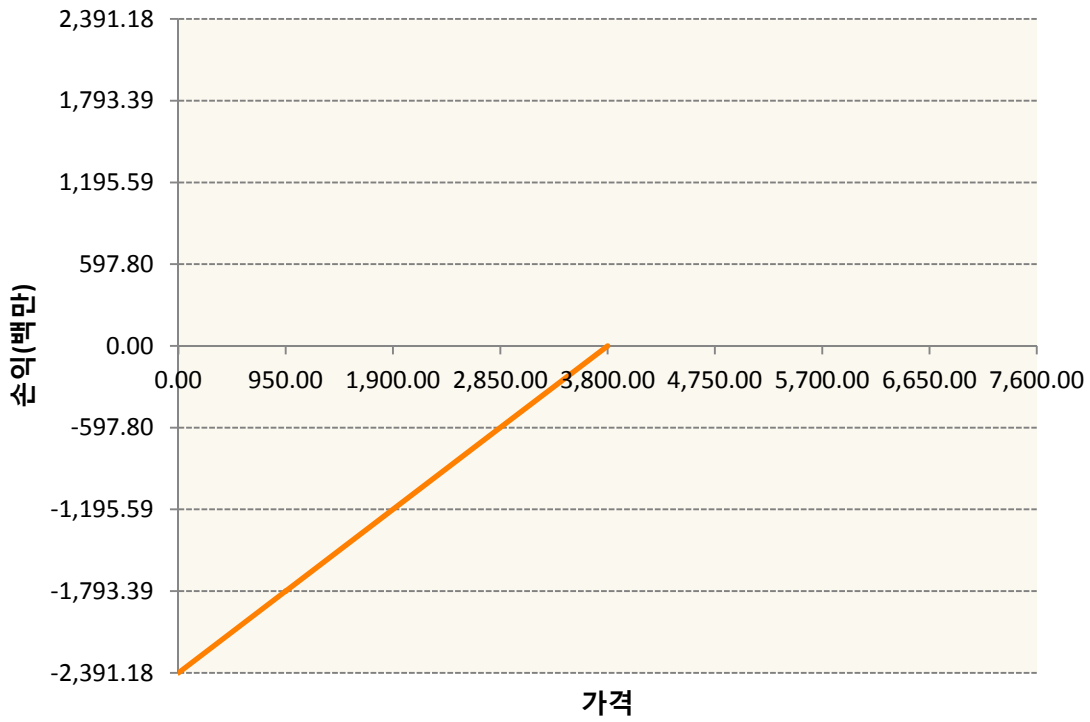


OESXG0-C3825-EURO STOXX 50

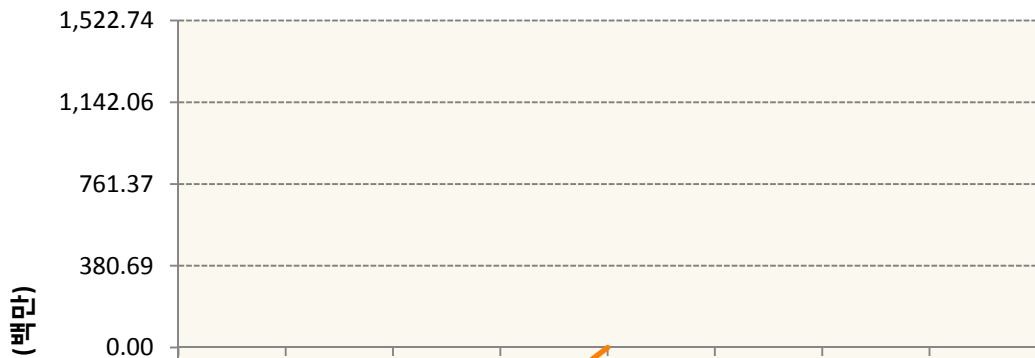


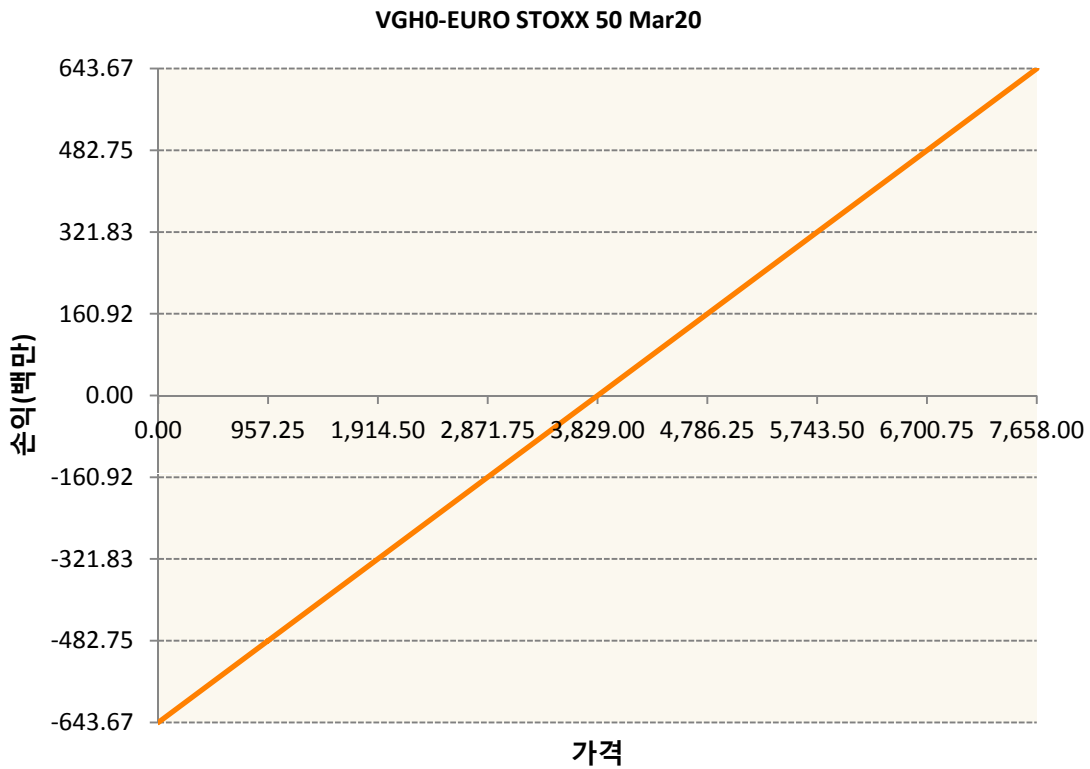
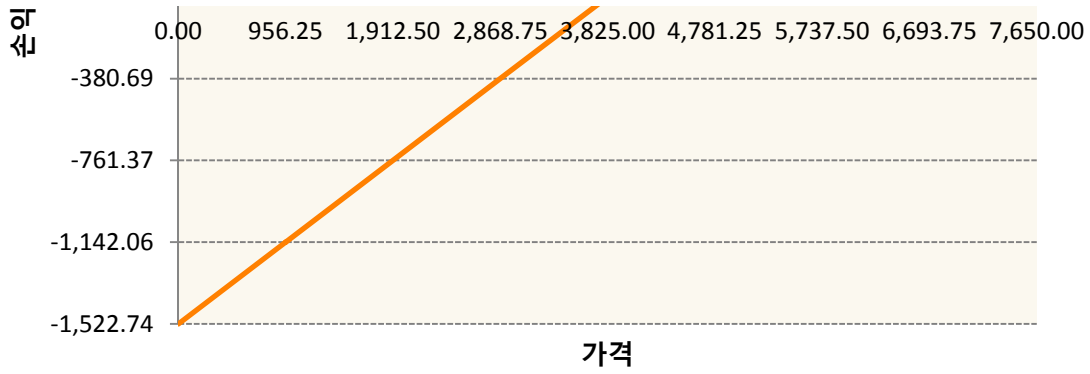


OESXG0-P3800-EURO STOXX 50



OESXG0-P3825-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP\SG EURO Covered CALL STRATEGY	9
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	270
OESXG0-C3\ EURO STOXX 50	191
OESXG0-C3\ EURO STOXX 50	122
OESXG0-P3\ EURO STOXX 50	191
OESXG0-P3\ EURO STOXX 50	122
VGH0 EURO STOXX 50 Mar20	51

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

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

(단위:백만원)

945

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

(단위:백만원)

83

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

(단위:백만원)

122

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

(단위:백만원)

44

공시일	2020-02-20
기준일	2020-02-19

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

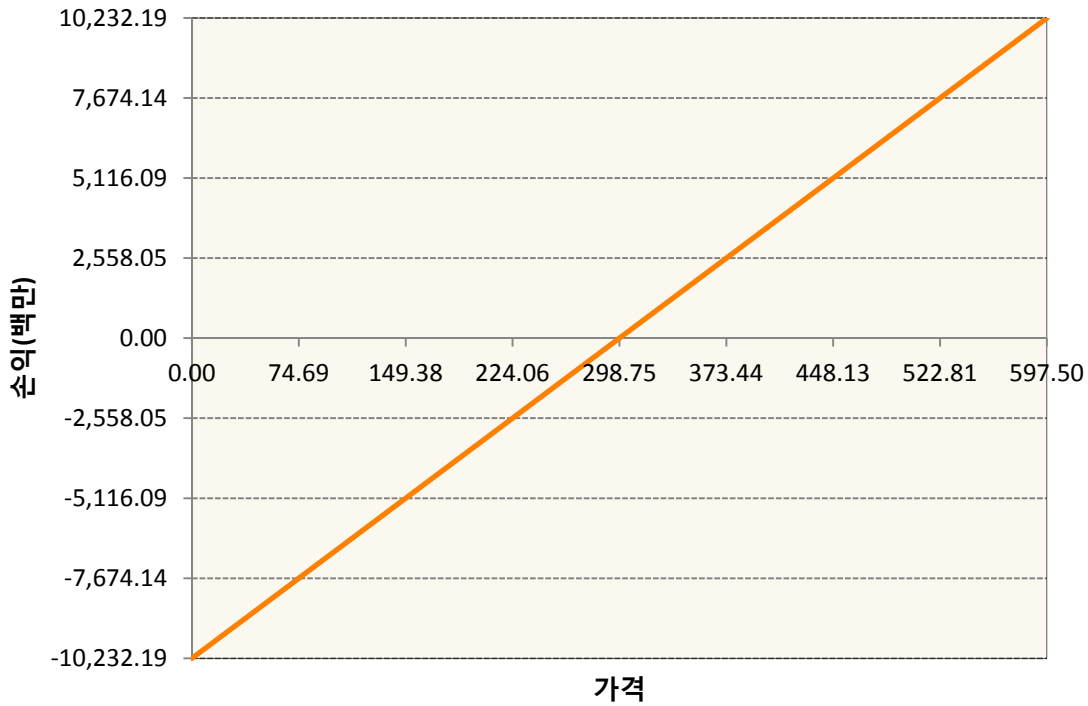
1. 계약금액

(단위:백만원)

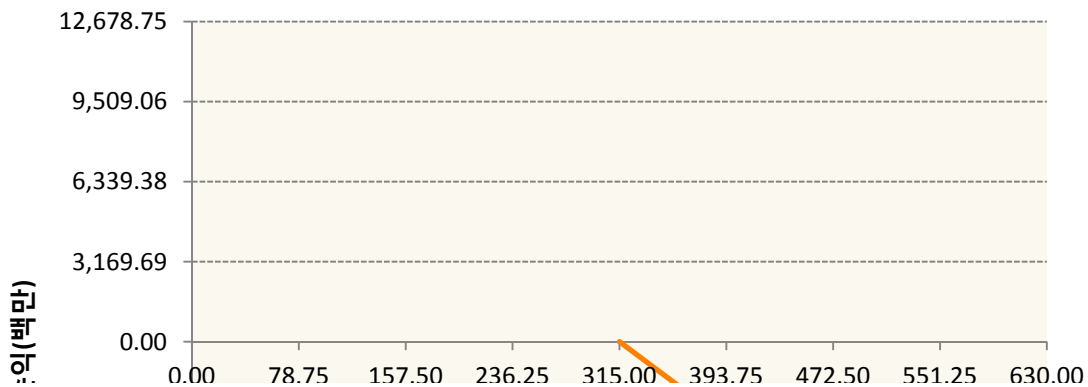
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,232	0	10,232	장내
누계	유가증권	옵션	2,257	20,854	-18,598	장내

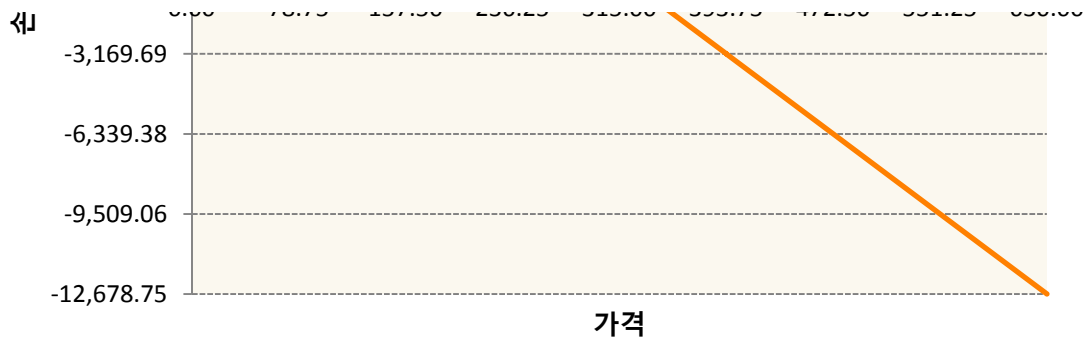
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

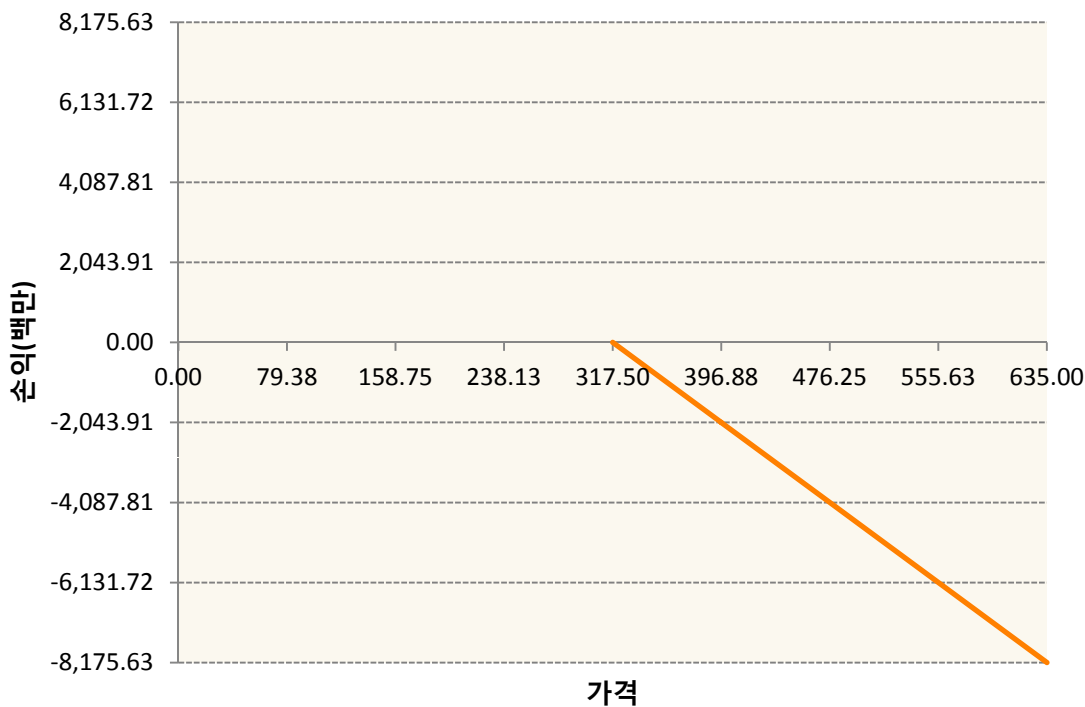


KR4201Q33155-2020-03 콜315

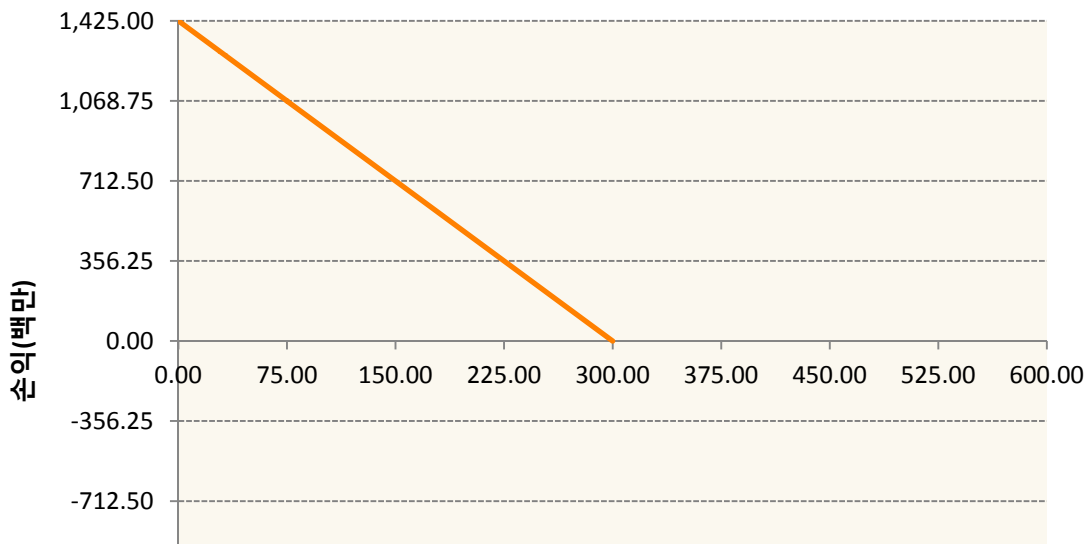


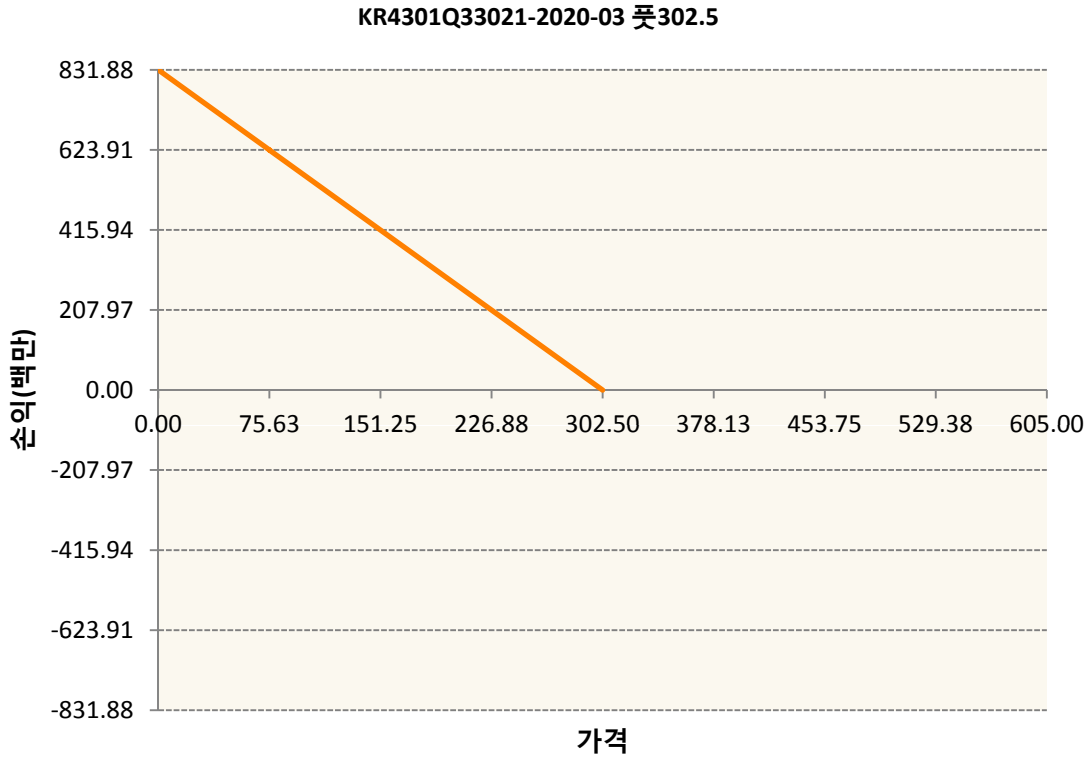
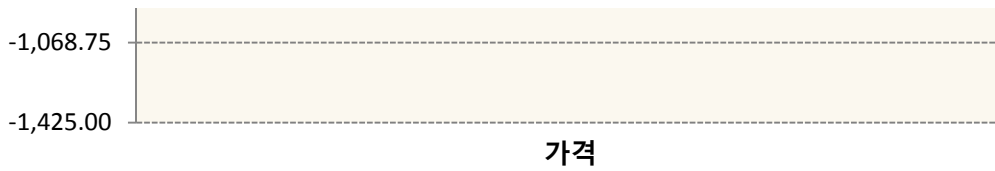


KR4201Q33171-2020-03 콜317.5



KR4301Q33005-2020-03 풋300





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						817
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-817	-817	-817	-817	-817	-817	-817	
-5.33%	-545	-545	-545	-545	-545	-545	-545	
-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%	545	545	545	545	545	545	545	
8.00%	817	817	817	817	817	817	817	
KR4201Q33155		2020-03 콜315						510
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	126	124	121	116	109	102	92	
-5.33%	121	115	108	98	87	73	59	
-2.67%	105	93	79	62	45	25	5	

0%	66	45	23	0	-24	-50	-75
2.67%	-12	-40	-69	-98	-127	-157	-187
5.33%	-141	-173	-204	-236	-268	-300	-332
8.00%	-326	-356	-386	-417	-448	-479	-510
KR4201Q33171 2020-03 콜317.5							304
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	68	67	65	63	59	55	49
-5.33%	65	63	59	53	47	39	31
-2.67%	58	51	43	34	24	13	1
0%	38	26	14	0	-15	-30	-45
2.67%	-3	-20	-37	-55	-73	-92	-110
5.33%	-75	-95	-115	-136	-156	-176	-196
8.00%	-182	-202	-223	-243	-263	-284	-304
KR4301Q33005 2020-03 풋300							94
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	92	92	92	93	93	93	94
-5.33%	55	55	56	57	58	59	60
-2.67%	21	22	23	25	26	28	30
0%	-6	-4	-2	0	2	4	6
2.67%	-22	-20	-18	-16	-14	-12	-10
5.33%	-28	-27	-26	-25	-23	-22	-20
8.00%	-29	-29	-29	-28	-28	-27	-26
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%	34	35	35	35	36	36	36
-2.67%	14	14	15	16	17	17	18
0%	-3	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-14	-13	-12	-11	-10	-9	-7
5.33%	-20	-19	-18	-17	-16	-15	-14
8.00%	-21	-21	-20	-20	-19	-19	-18

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

(단위:백만원)

1,402

공시일	2020-02-20
기준일	2020-02-19

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	215,075	0	215,075	

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	2020-02-20
기준일	2020-02-19

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	187,041	0	187,041	

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	2020-02-20
기준일	2020-02-19

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	533,962	0	533,962	
누계	통화	선도	0	582,519	-582,519	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	3,273
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	2,949
FX21020F03: KRW/USD 31-03-20E	3,045
FX21020F04: KRW/USD 31-03-20E	2,854
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	951
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,180
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,208
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	951
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	1,903
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	3,273
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,273
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,903

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

15,676

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

(단위:백만원)

125

공시일	2020-02-20
기준일	2020-02-19

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

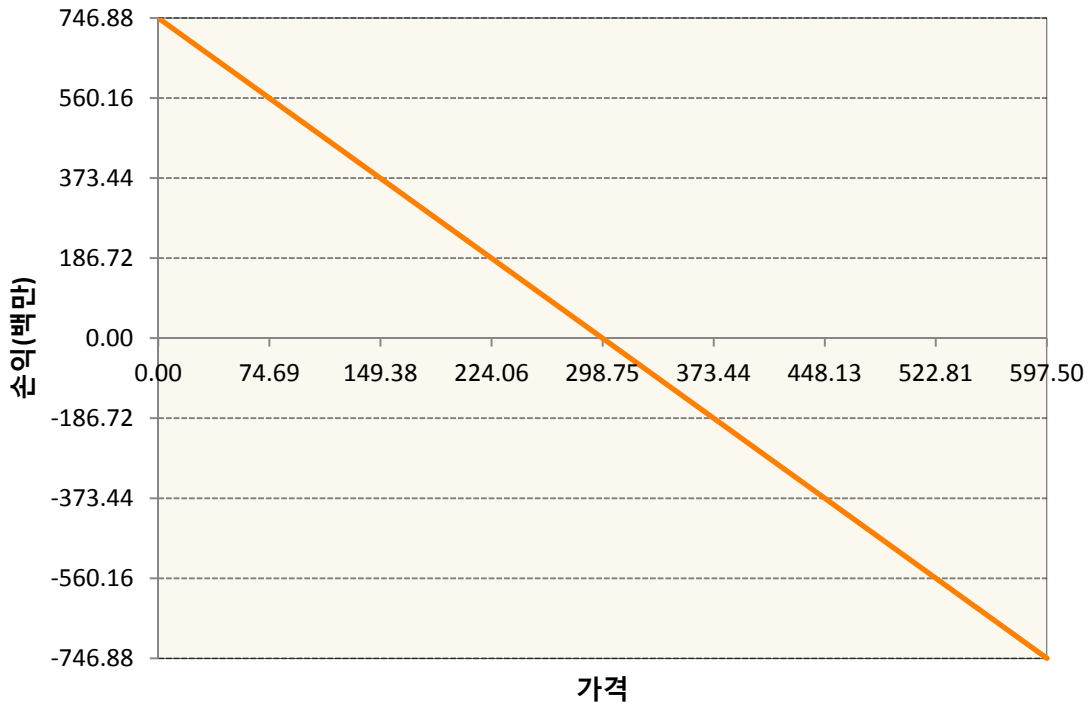
1. 계약금액

(단위:백만원)

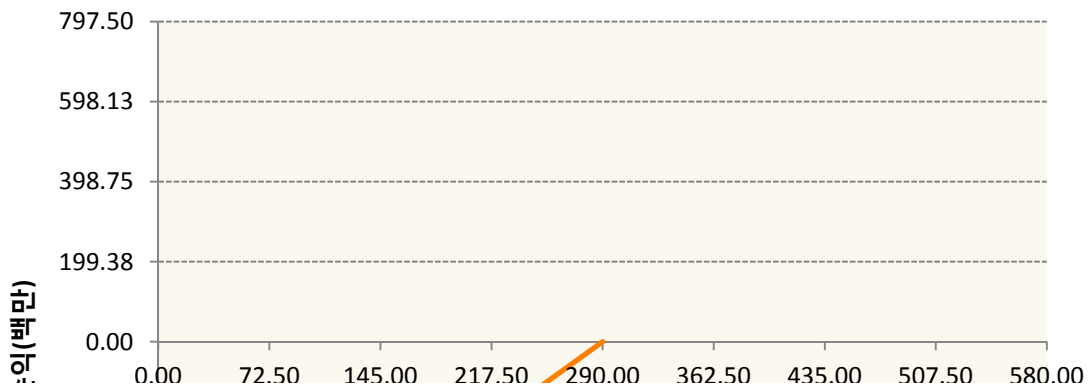
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	747	-747	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,503	-3,503	장내

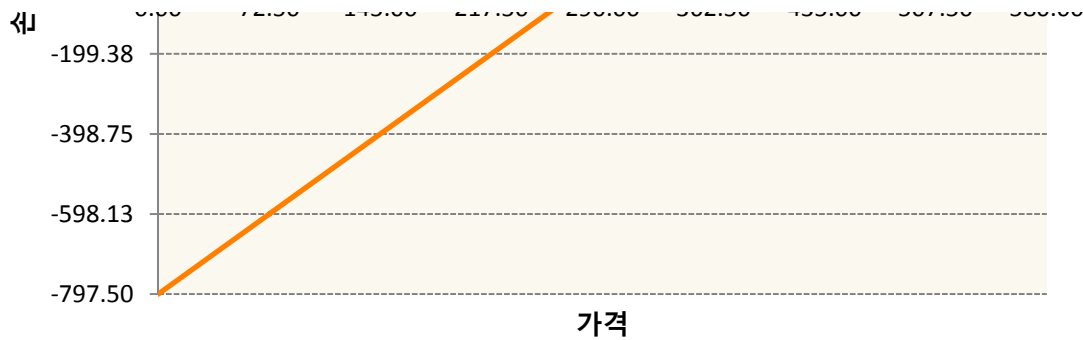
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

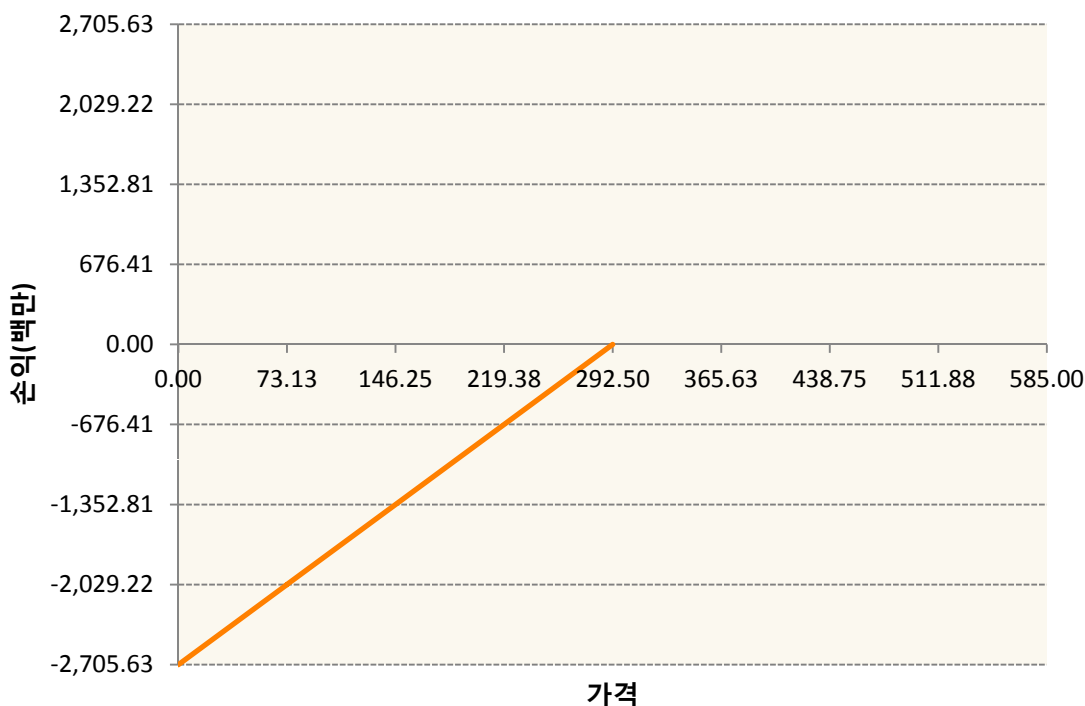


KR4301Q32908-2020-03 풋290





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						41
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-38	-38	-38	-39	-40	-40	-41
-5.33%	-18	-19	-20	-21	-22	-23	-24
-2.67%	-4	-6	-7	-8	-9	-10	-12
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	5	5	4	4	3	3	2
5.33%	6	6	6	5	5	5	4
8.00%	6	6	6	6	6	5	5

KR4301Q32924 2020-03 풋292.5 150

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-142	-143	-144	-145	-147	-148	-150
-5.33%	-74	-77	-79	-82	-85	-88	-91
-2.67%	-21	-25	-28	-32	-36	-40	-44
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	23	21	19	17	14	12	9
5.33%	26	26	25	24	23	21	19
8.00%	27	27	26	26	26	25	24

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

(단위:백만원)

229

공시일	2020-02-20
기준일	2020-02-19

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	11,185	0	11,185	
누계	통화	선도	642	11,512	-10,870	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	323
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)

327

공시일	2020-02-20
기준일	2020-02-19

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

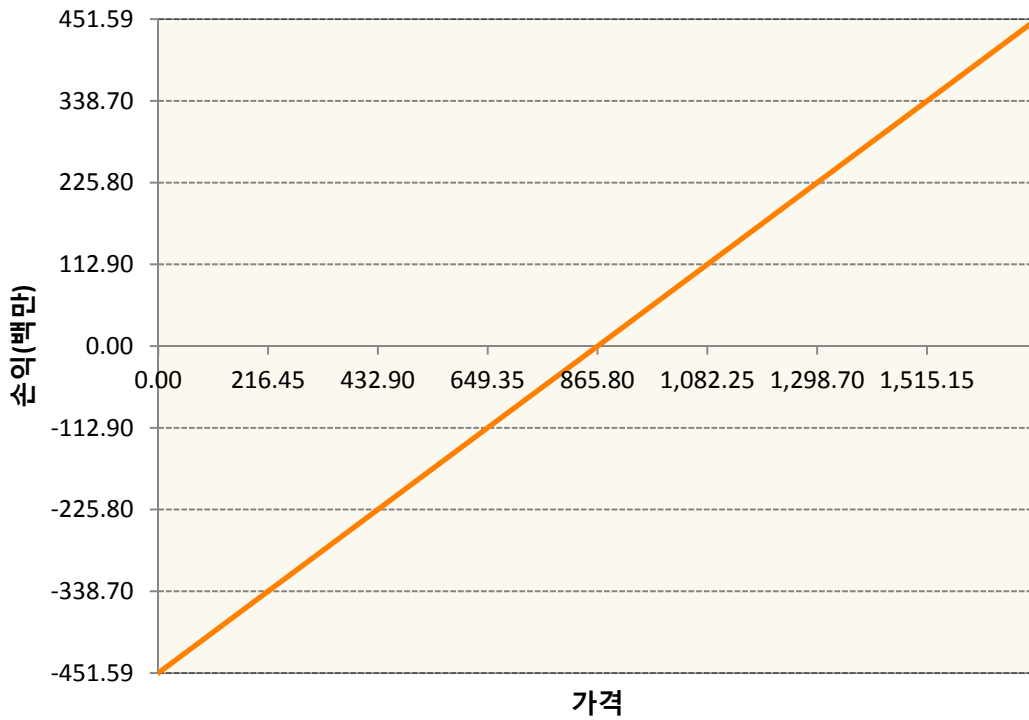
1. 계약금액

(단위:백만원)

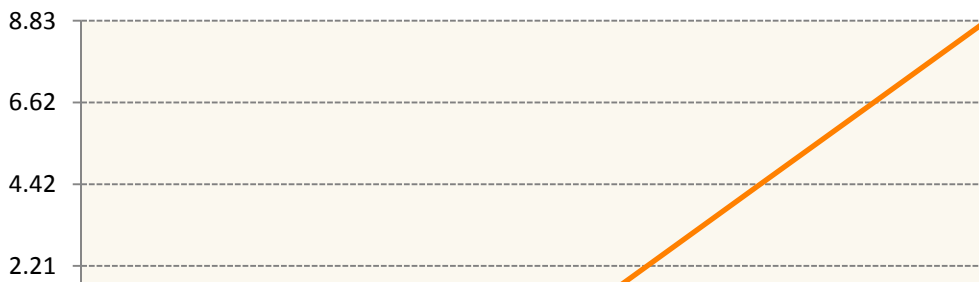
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	460	0	460	
누계	유가증권	스왑	1,059	0	1,059	장외
누계	통화	선도	180	681	-501	장외

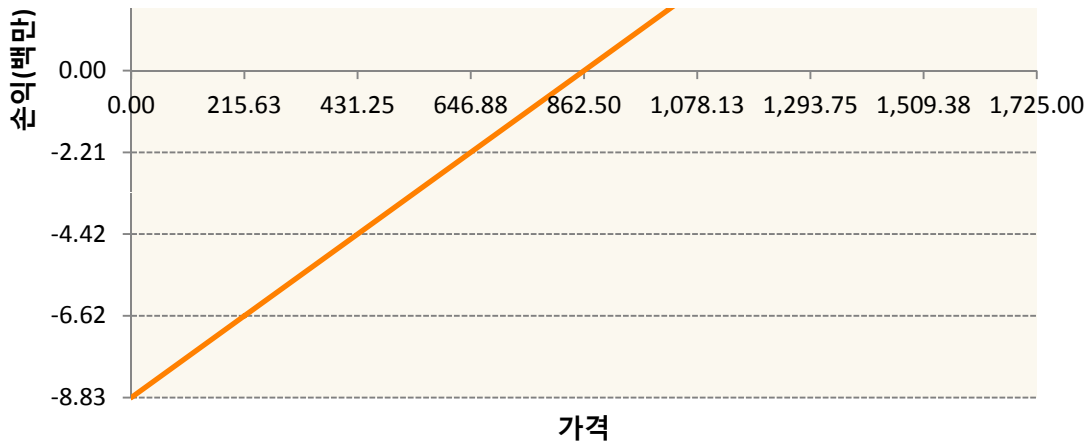
2. 만기시점의 손익구조

VNCG0-VN30 Index Future Feb20



VNCH0-VN30 Index Future Mar20





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	36
VNCH0 VN30 Index Future Mar20	1

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

113

공시일	2020-02-20
기준일	2020-02-19

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

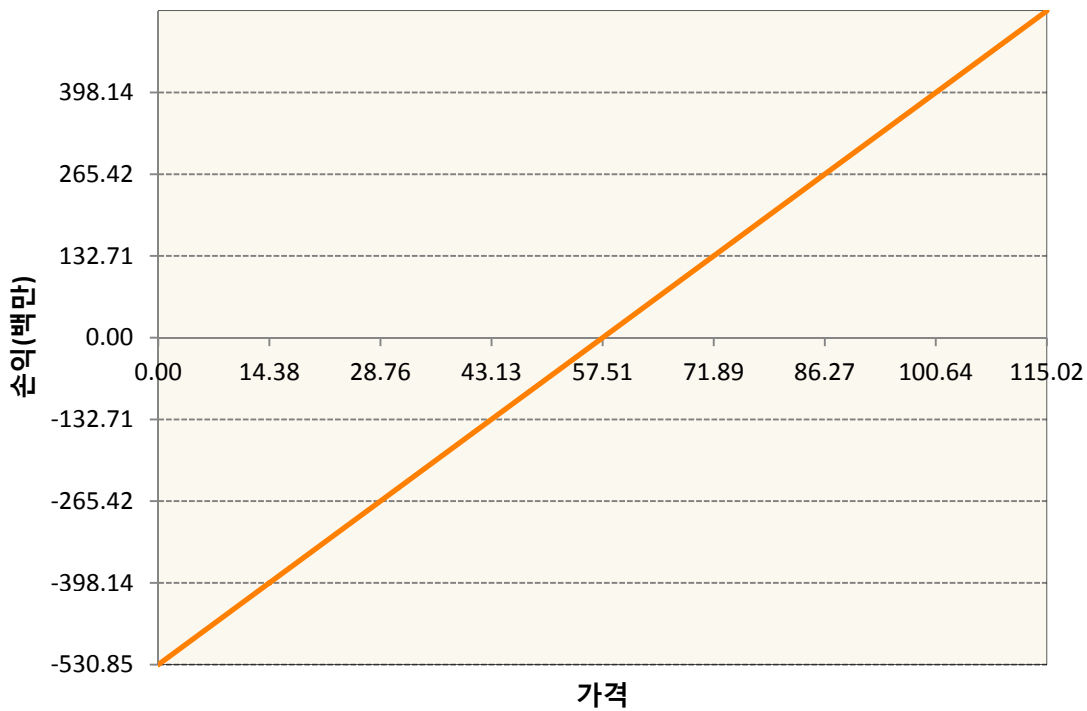
1. 계약금액

(단위:백만원)

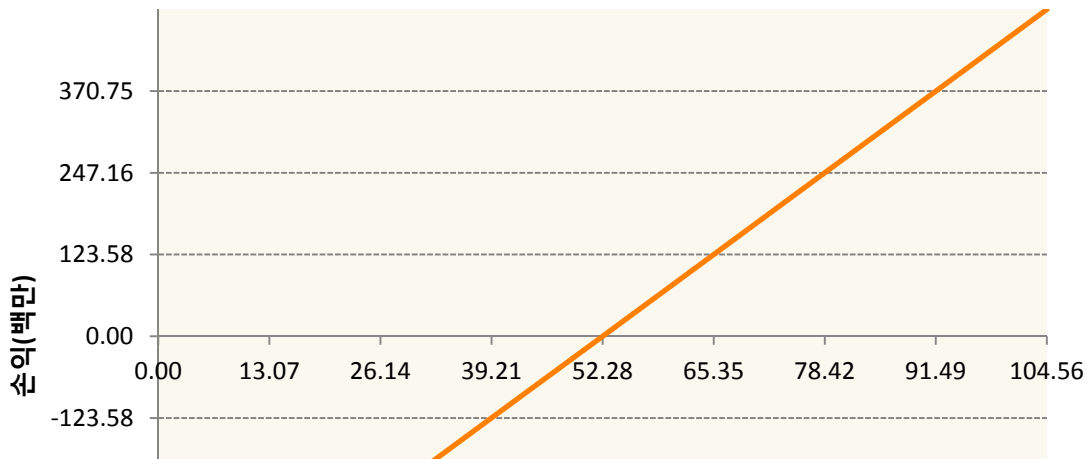
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,182	190	1,991	

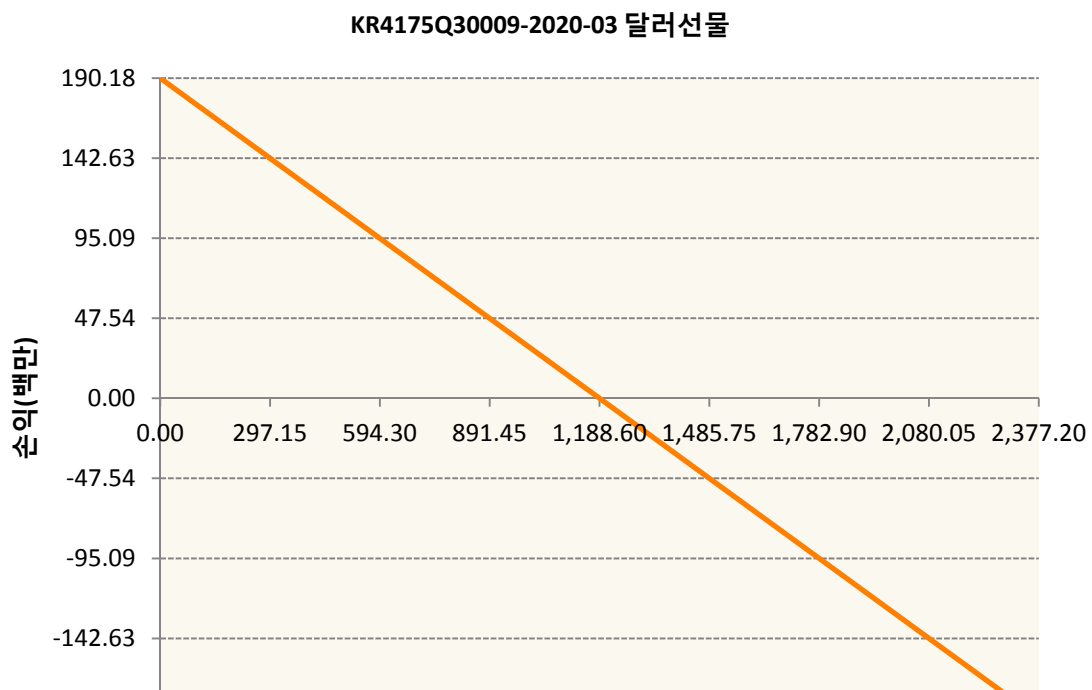
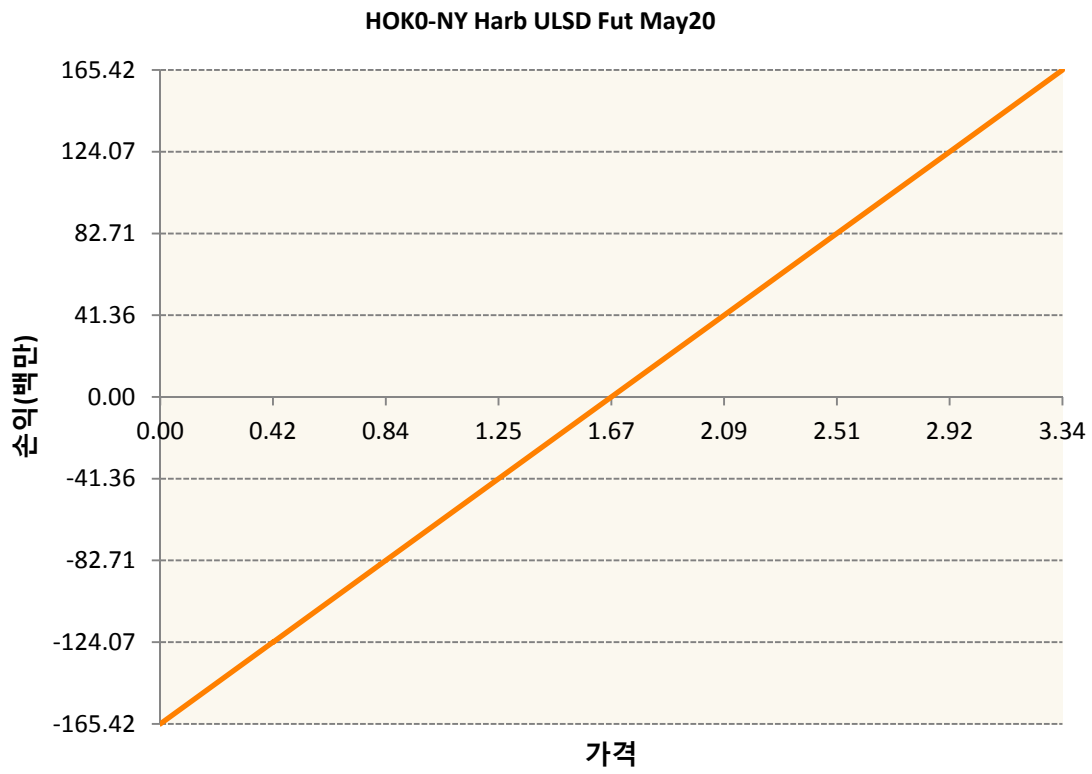
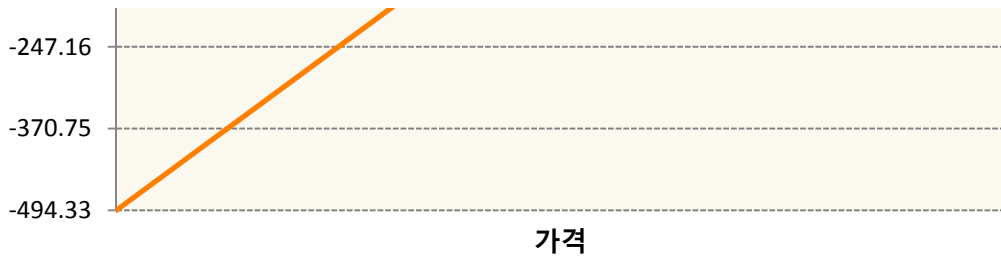
2. 만기시점의 손익구조

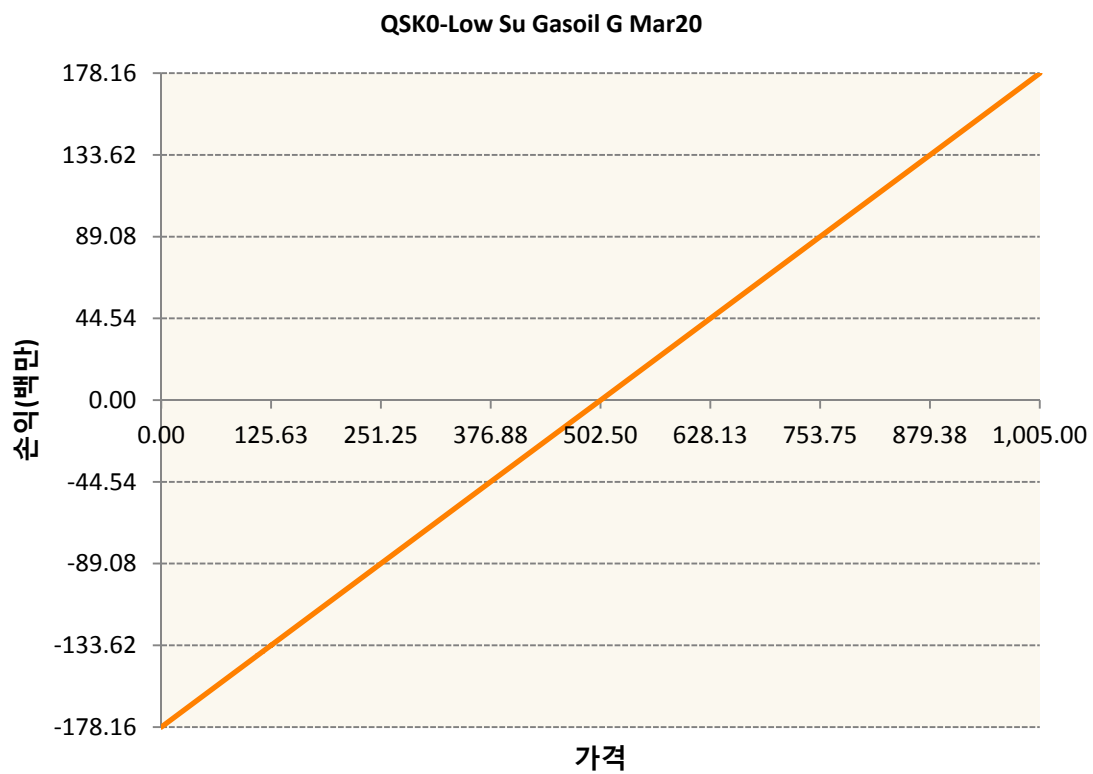
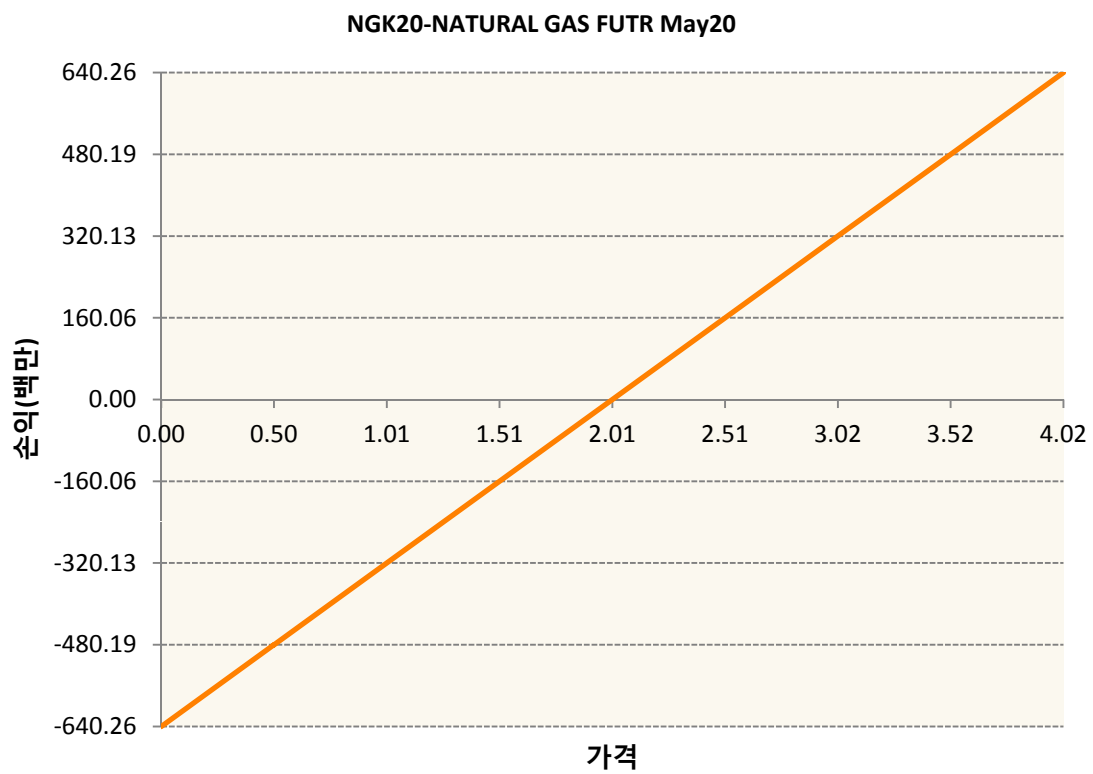
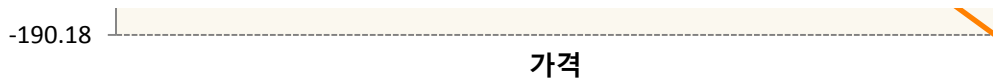
COK0-BRENT CRUDE FUTR May20



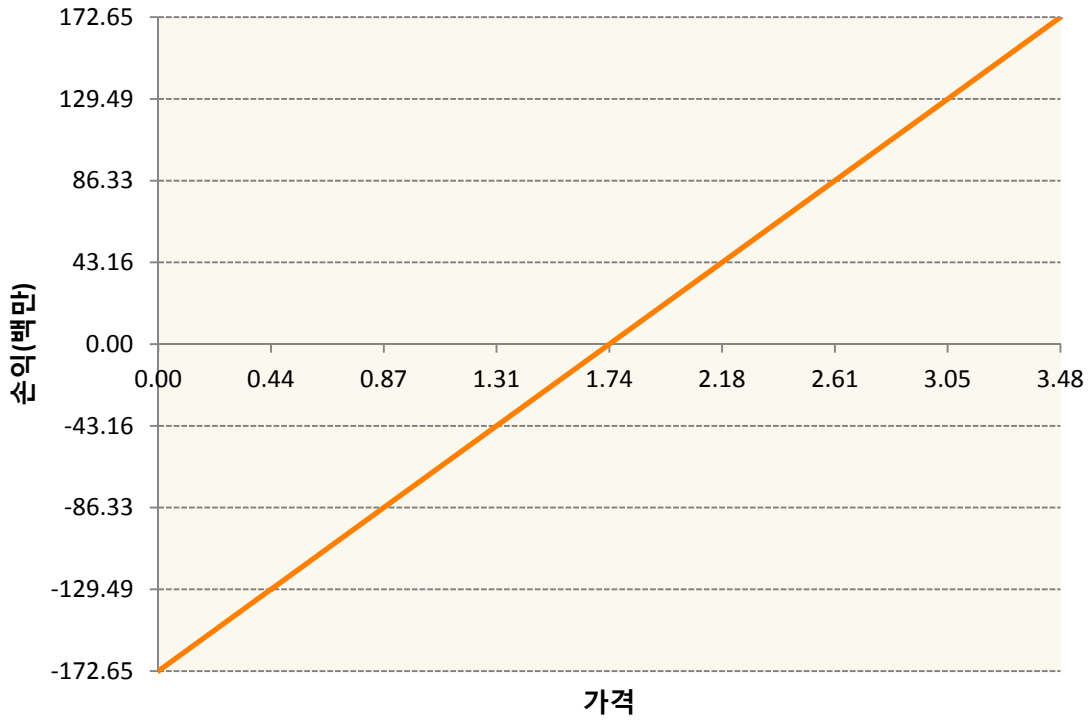
CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20







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	51
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	14
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	14

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

(단위:백만원)

351

공시일	2020-02-20
기준일	2020-02-19

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

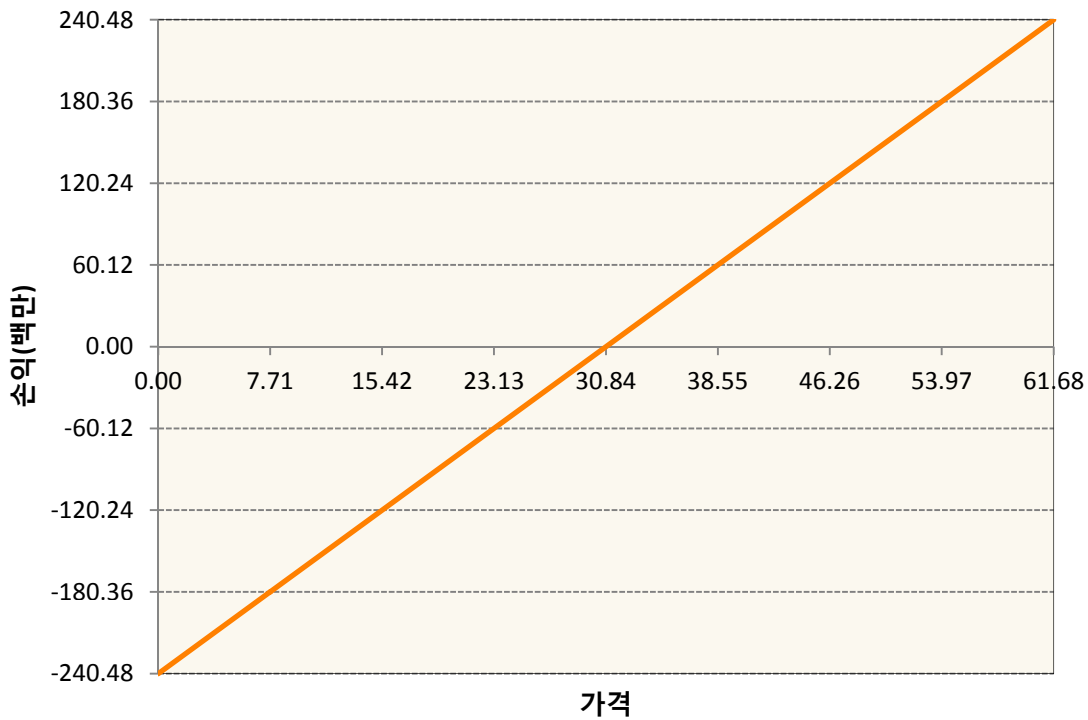
1. 계약금액

(단위:백만원)

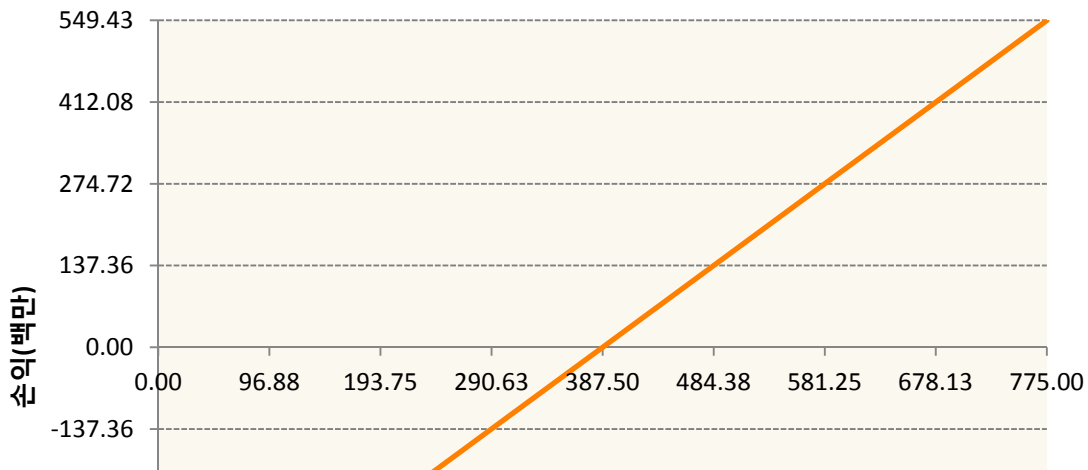
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,764	155	2,609	

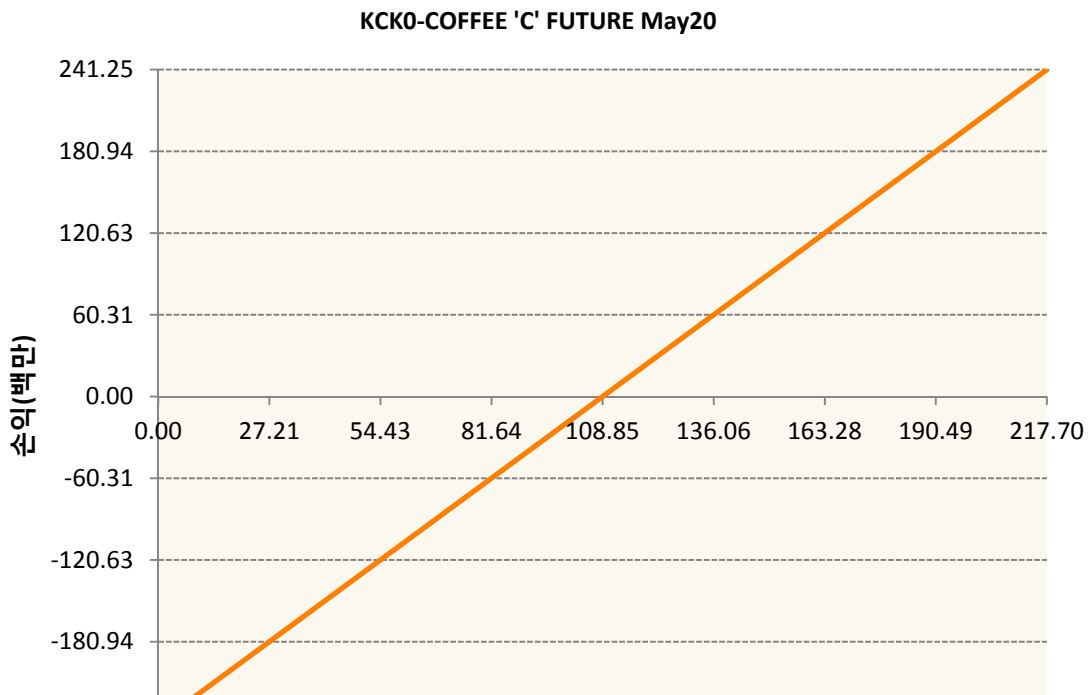
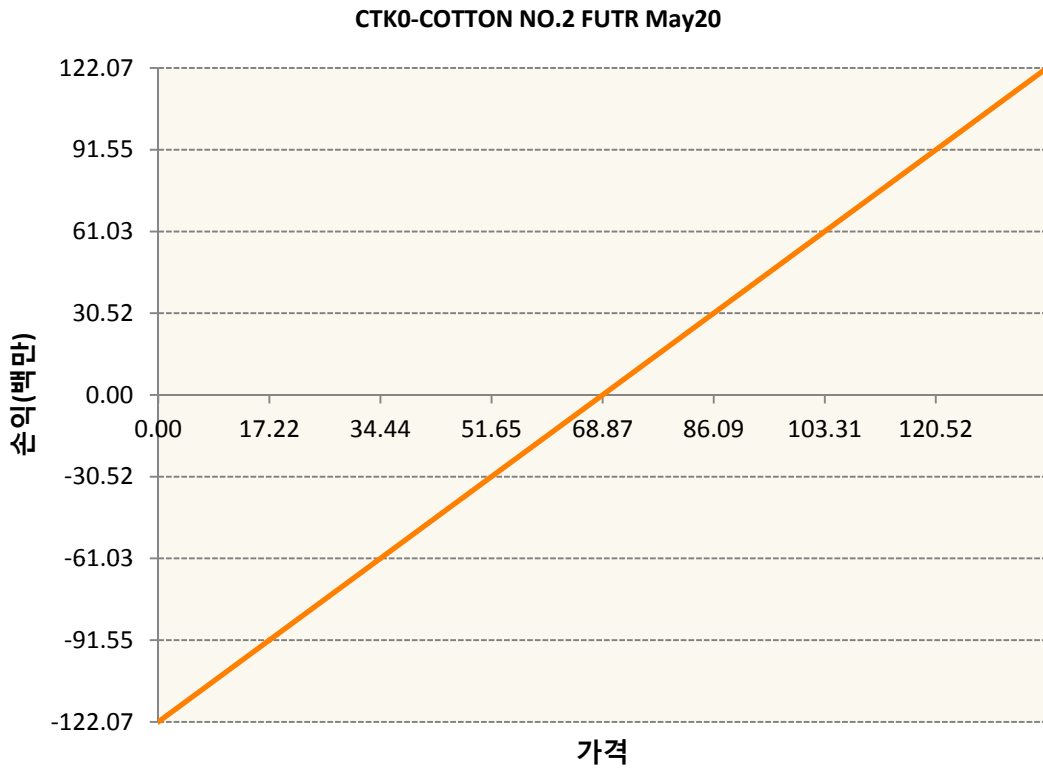
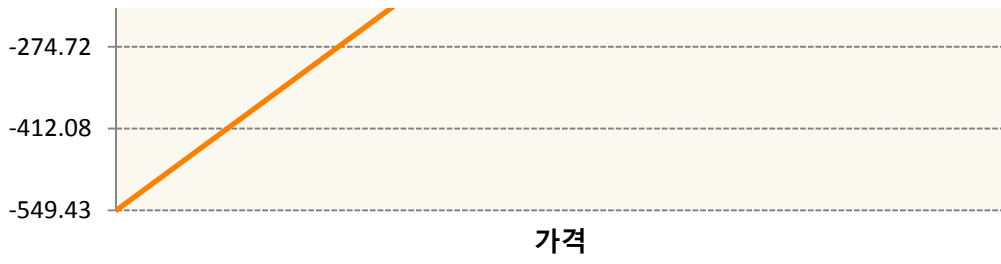
2. 만기시점의 손익구조

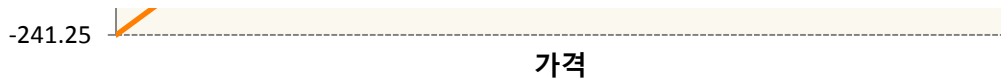
BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20



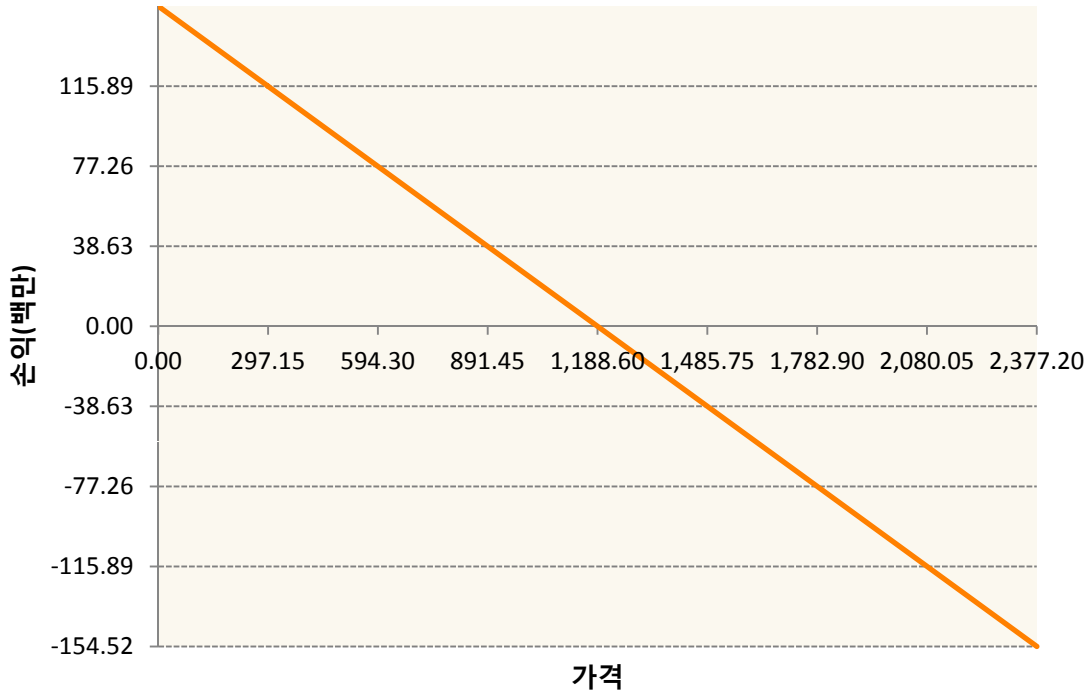
CK0-CORN FUTURE May20



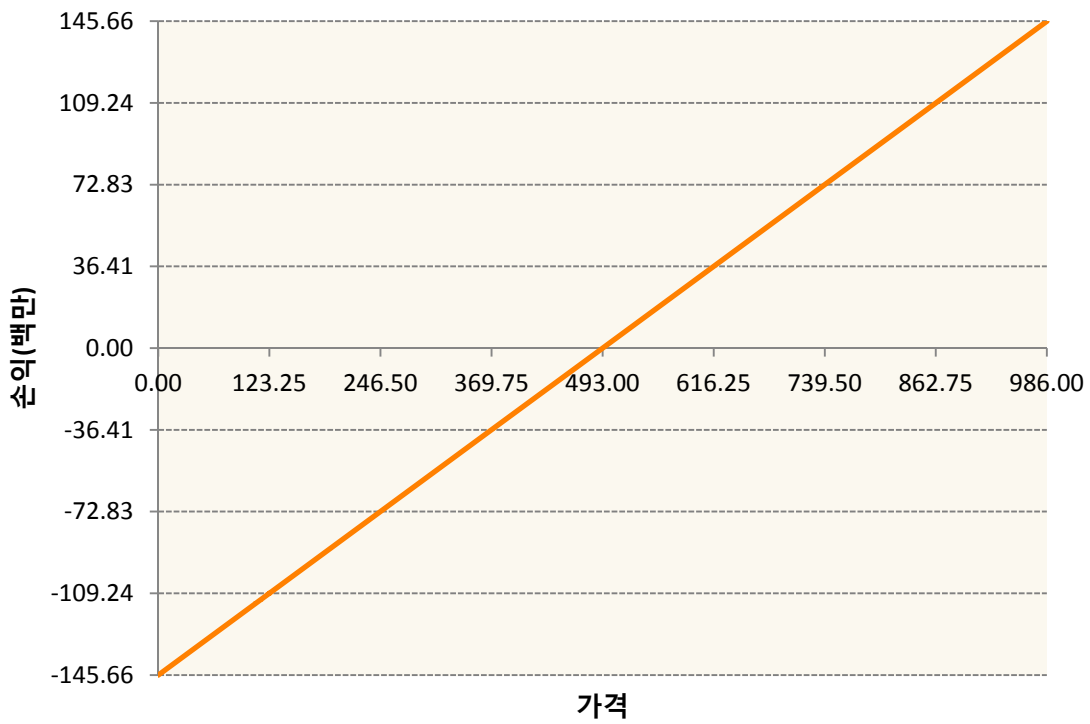




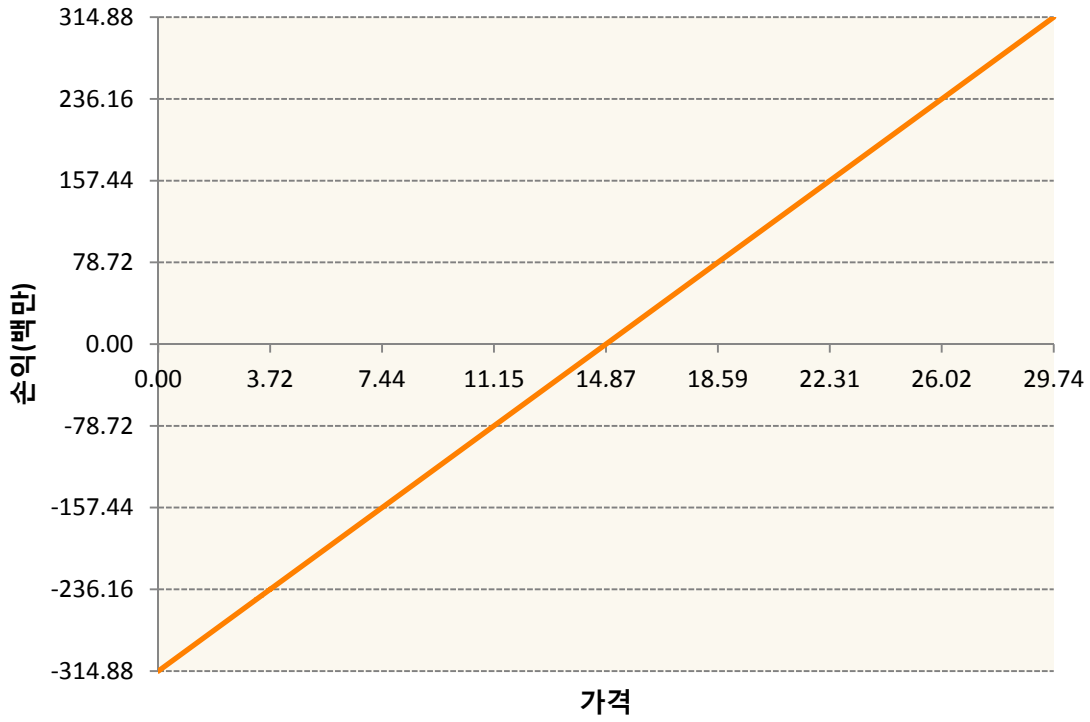
KR4175Q30009-2020-03 달러선물



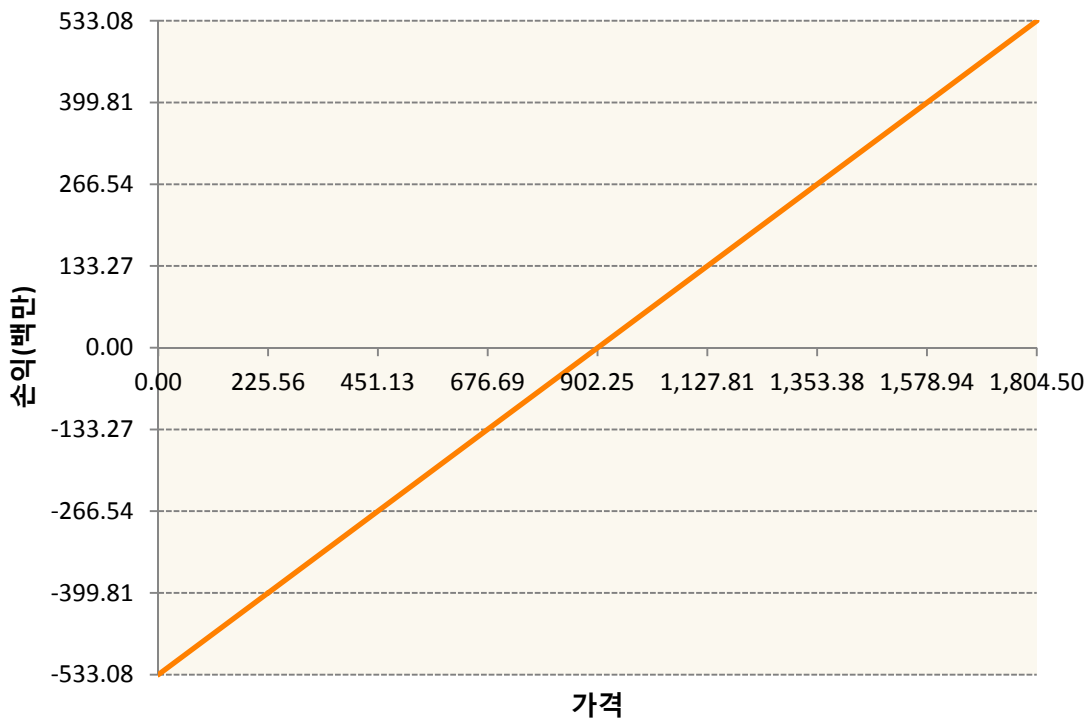
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



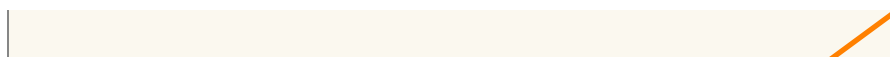
SBK0-Sugar May20

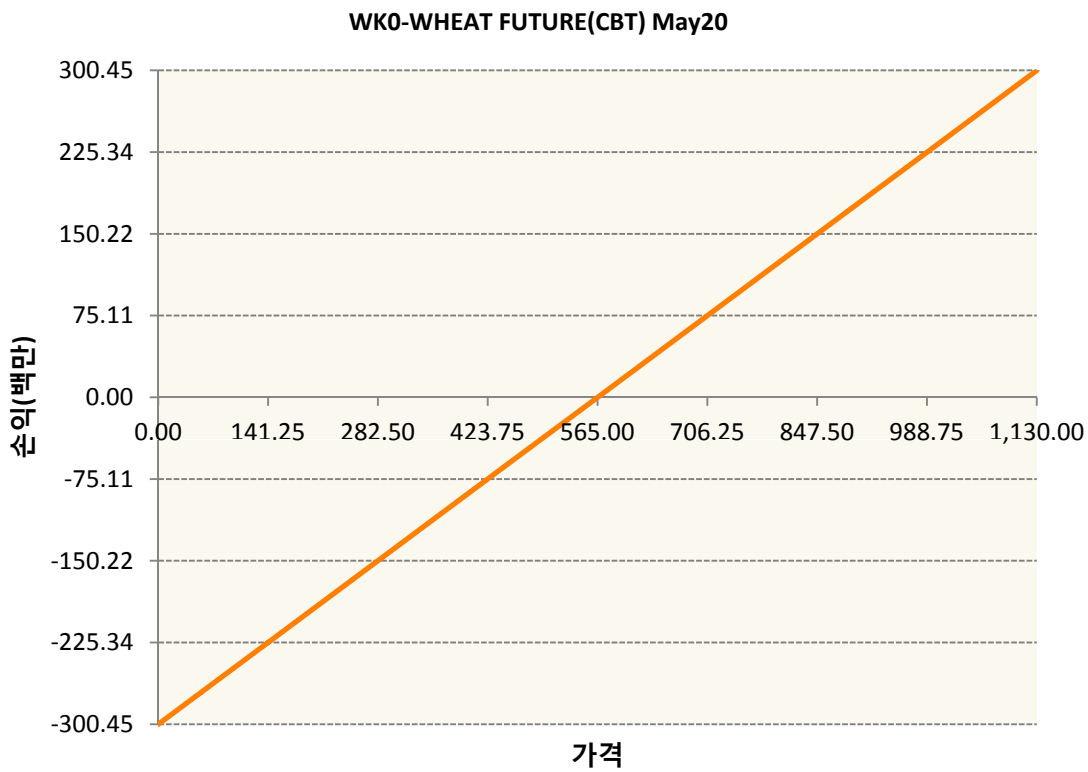
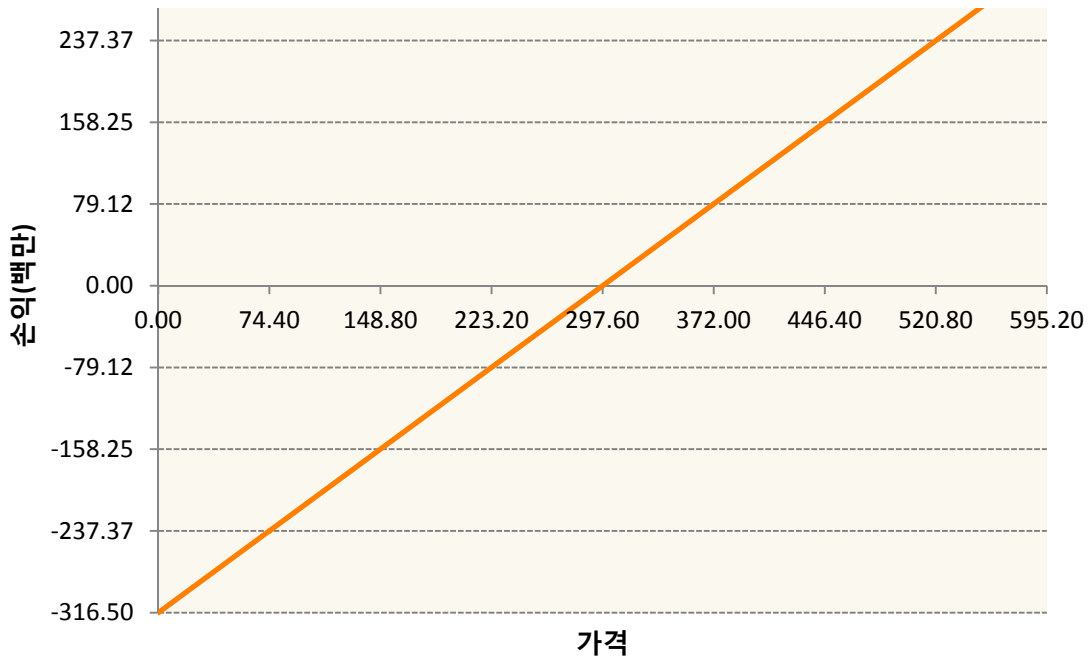


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



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	12
SBK0	Sugar May20	25
SK0	SOYBEAN FUTURE May20	43
SMK0	SOYBEAN MEAL FUTR May20	25
WK0	WHEAT FUTURE(CBT) May20	24

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

(단위:백만원)

240