

공시일	2020-02-21
기준일	2020-02-20

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	2020-02-21
기준일	2020-02-20

스마트인덱스모

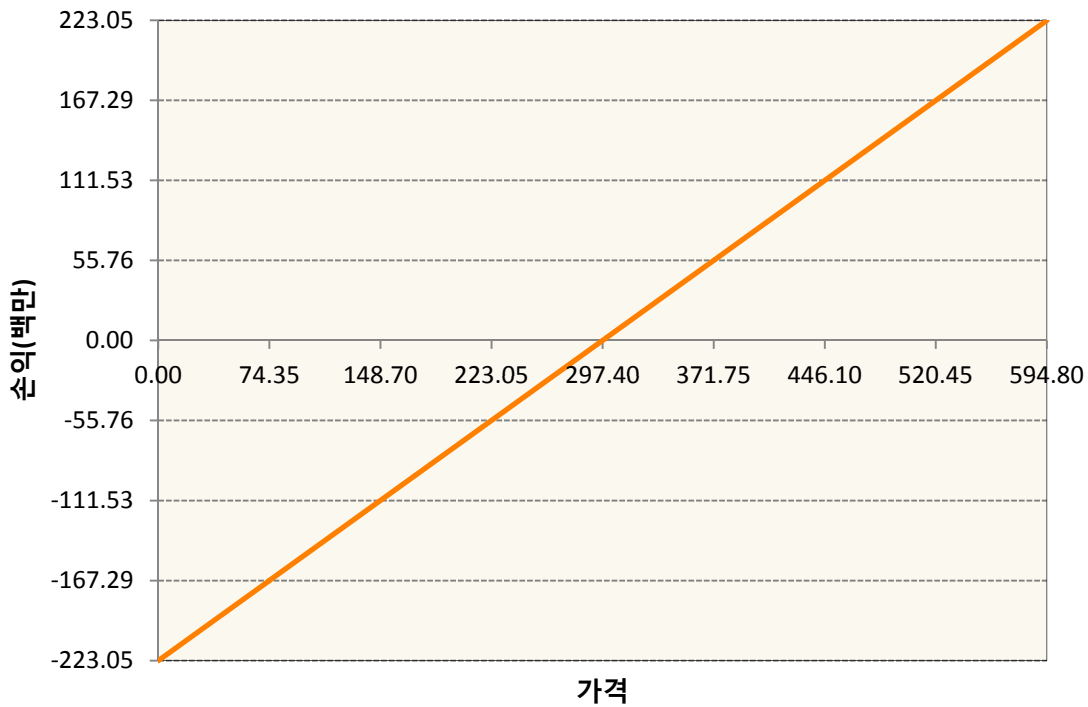
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	223	0	223	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	2020-02-21
기준일	2020-02-20

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

1,166

* 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	2020-02-21
기준일	2020-02-20

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)	440
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	161

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

928

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-21
기준일	2020-02-20

유로인덱스모(주식-파생형)

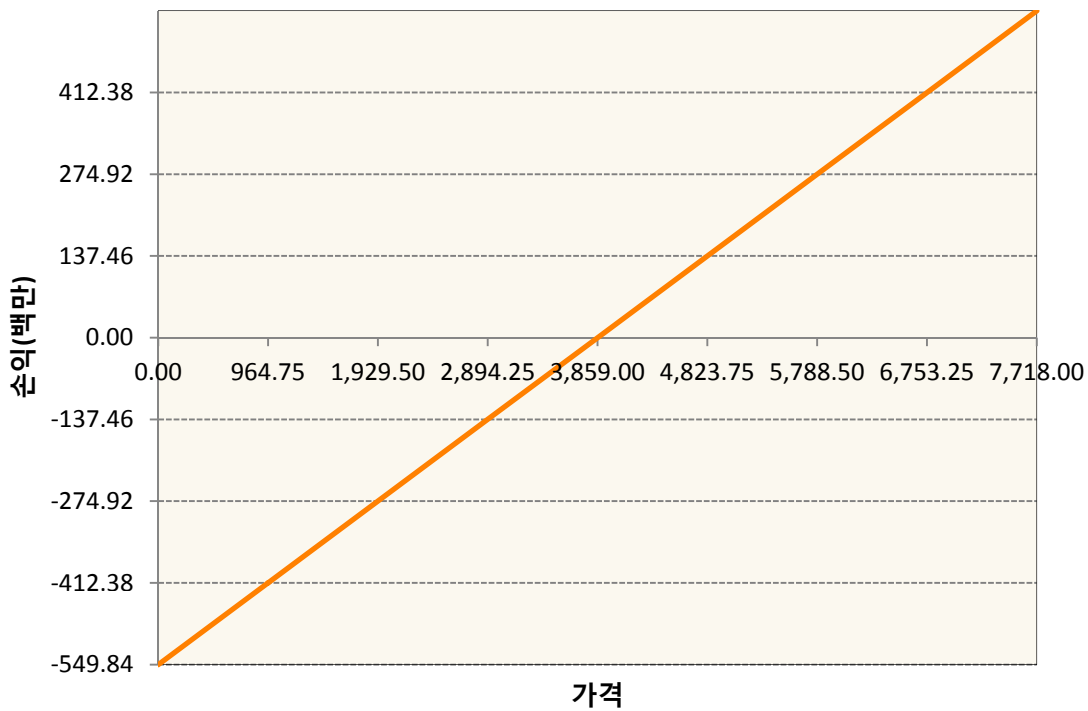
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	550	0	550	

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	2020-02-21
기준일	2020-02-20

차이나인덱스모(주식-파생형)

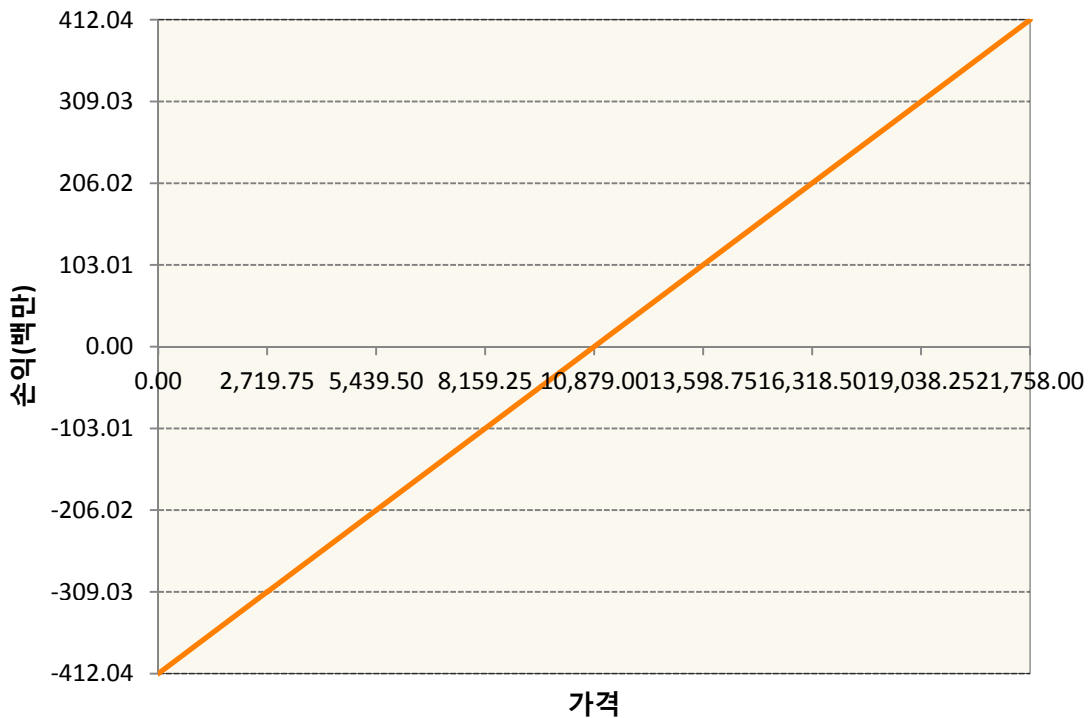
1. 계약금액

(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

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	2020-02-21
기준일	2020-02-20

커버드콜모(주식혼합-파생형)

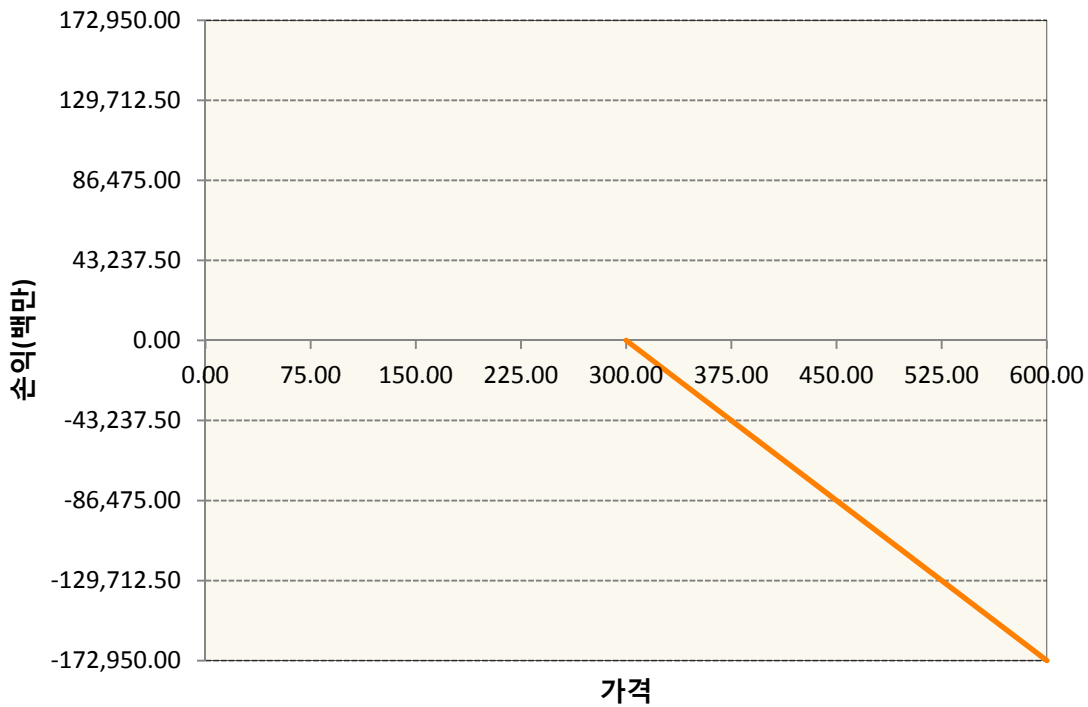
1. 계약금액

(단위:백만원)

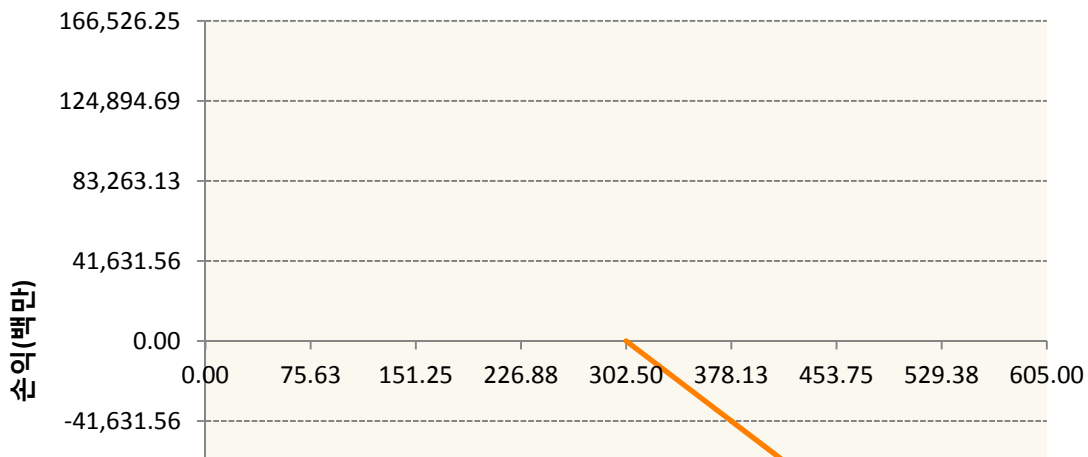
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	4,465	0	4,465	장내
누계	유가증권	옵션	0	448,226	-448,226	장내

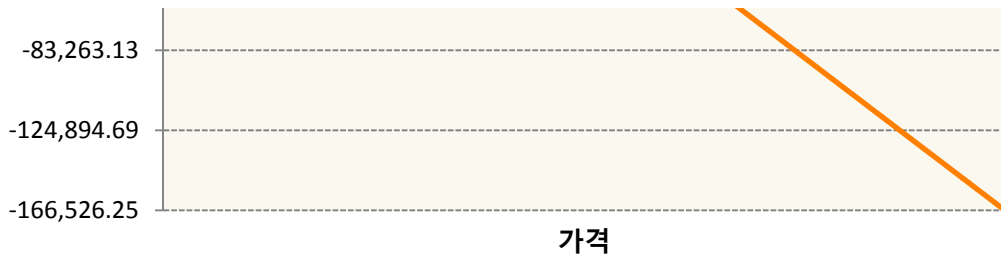
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q33007-2020-03 콜300

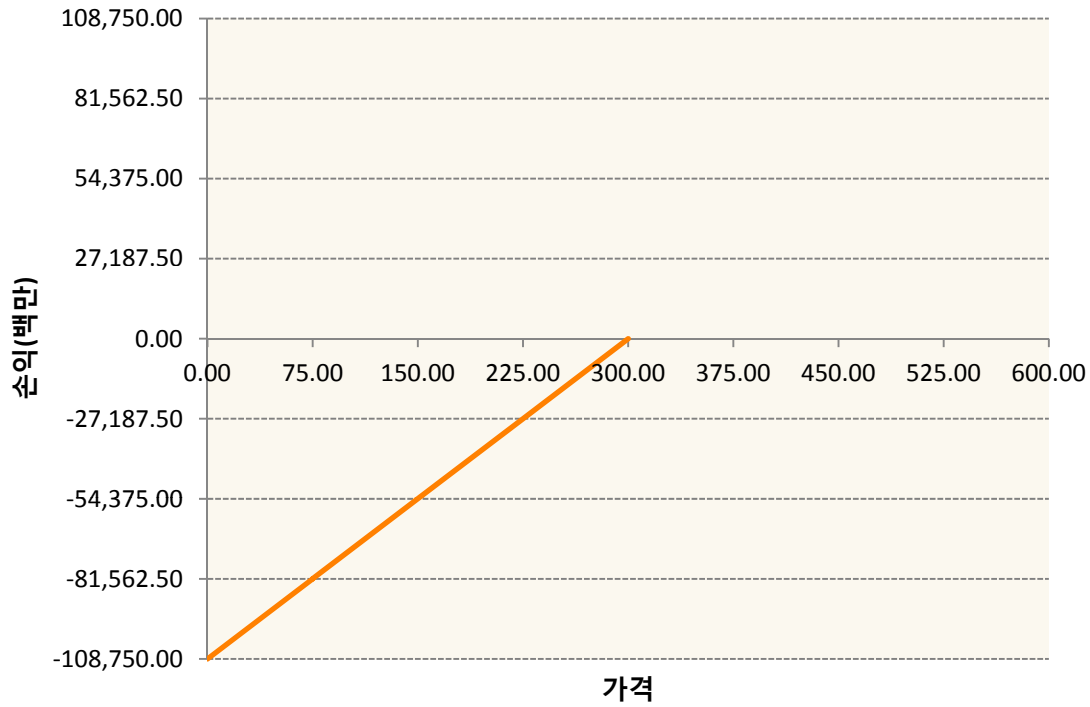


KR4201Q33023-2020-03 콜302.5





KR4301Q33005-2020-03 풋300



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q33007		2020-03 콜300					9,869	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4,125	4,001	3,846	3,664	3,456	3,227	2,978	
-5.33%	3,728	3,493	3,232	2,948	2,646	2,329	1,999	
-2.67%	2,858	2,505	2,139	1,762	1,378	986	590	
0%	1,295	865	433	0	-434	-868	-1,303	
2.67%	-1,082	-1,513	-1,947	-2,383	-2,820	-3,258	-3,696	
5.33%	-4,234	-4,596	-4,972	-5,359	-5,756	-6,159	-6,569	
8.00%	-7,997	-8,253	-8,537	-8,844	-9,171	-9,513	-9,869	
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5					8,986	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,439	3,344	3,220	3,070	2,895	2,698	2,481	

-5.33%	3,149	2,957	2,737	2,493	2,229	1,948	1,652
-2.67%	2,477	2,170	1,845	1,507	1,158	800	436
0%	1,206	807	405	0	-407	-817	-1,227
2.67%	-816	-1,240	-1,664	-2,089	-2,514	-2,938	-3,363
5.33%	-3,601	-3,977	-4,362	-4,755	-5,153	-5,556	-5,963
8.00%	-7,024	-7,305	-7,610	-7,934	-8,273	-8,624	-8,986
KR4301Q33005 2020-03 풋300							7,347
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,248	-7,252	-7,259	-7,272	-7,291	-7,316	-7,347
-5.33%	-4,411	-4,437	-4,473	-4,519	-4,574	-4,638	-4,709
-2.67%	-1,732	-1,817	-1,913	-2,017	-2,127	-2,244	-2,365
0%	457	306	153	0	-154	-309	-465
2.67%	1,819	1,671	1,521	1,369	1,215	1,060	905
5.33%	2,408	2,323	2,228	2,123	2,011	1,893	1,770
8.00%	2,576	2,546	2,506	2,455	2,394	2,323	2,244

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

(단위:백만원)

25,006

공시일	2020-02-21
기준일	2020-02-20

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

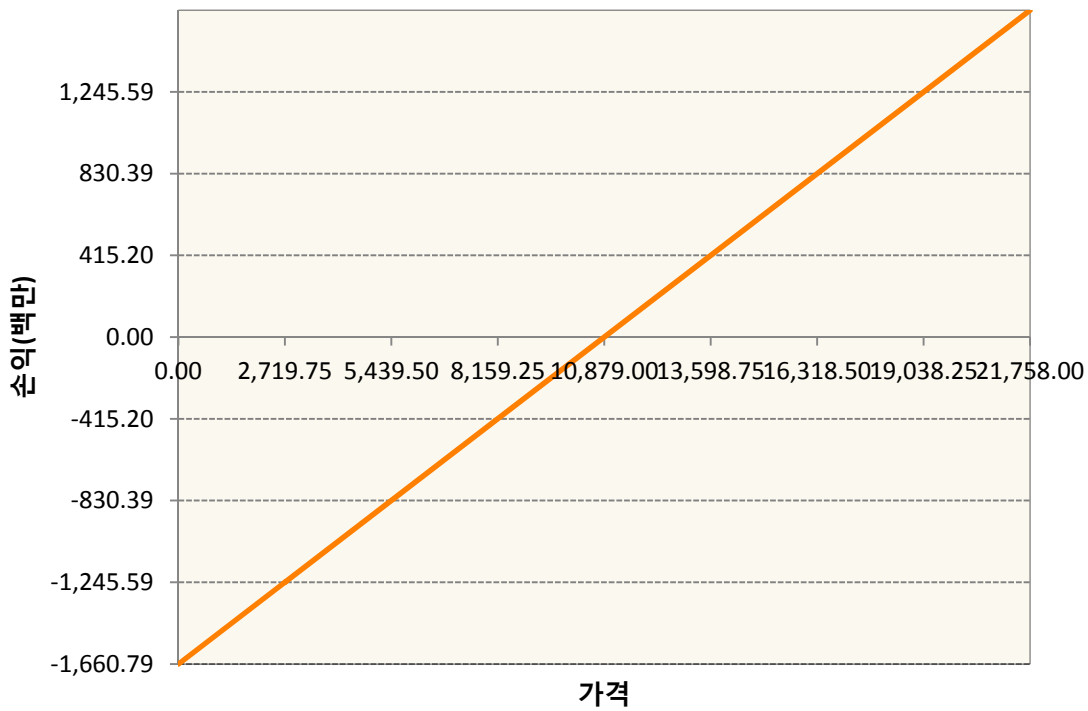
1. 계약금액

(단위:백만원)

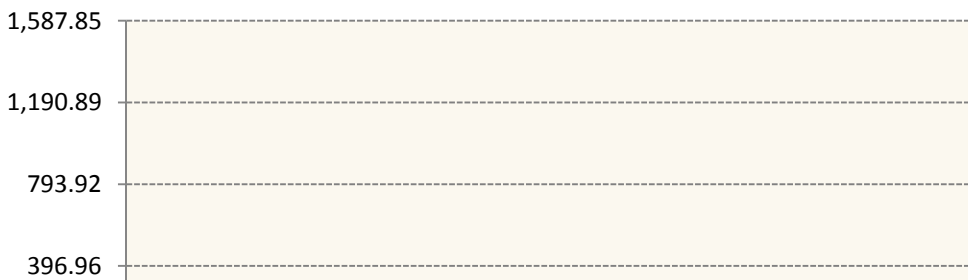
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,661	0	1,661	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,458	-4,458	장내
누계	통화	선도	0	4,341	-4,341	장외

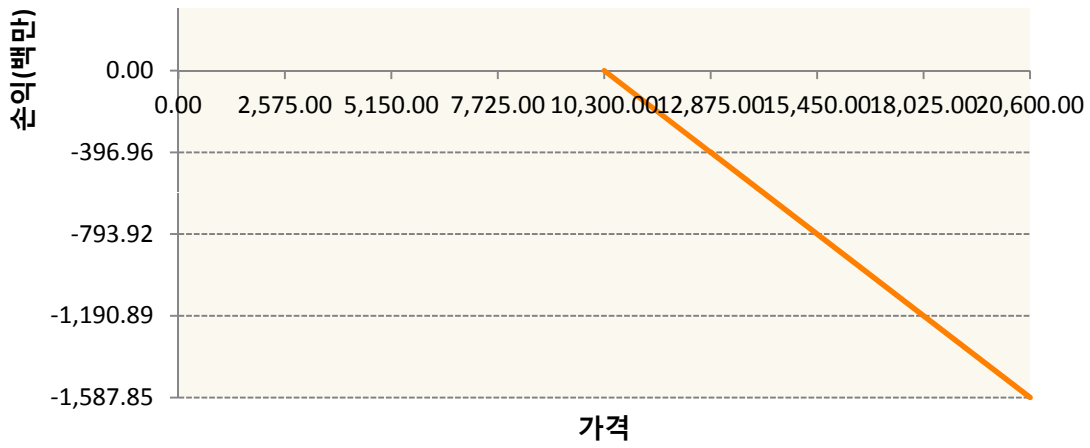
2. 만기시점의 손익구조

HCG0-HSCEI Futures Feb20

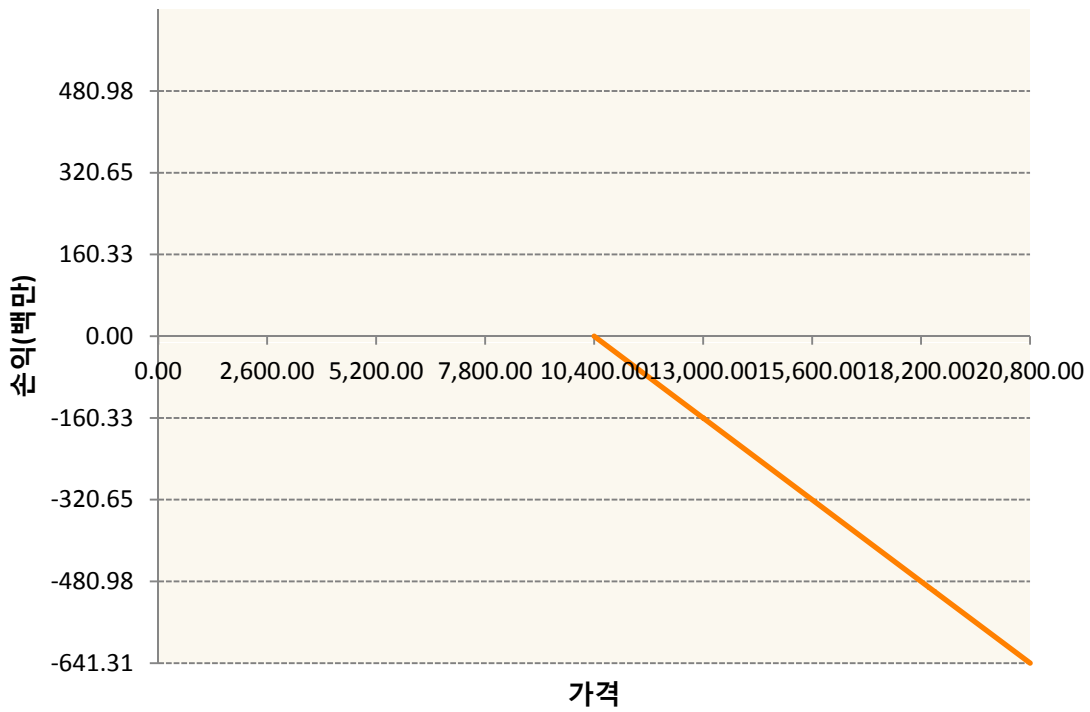


OHHIG0-C103-HSCEI

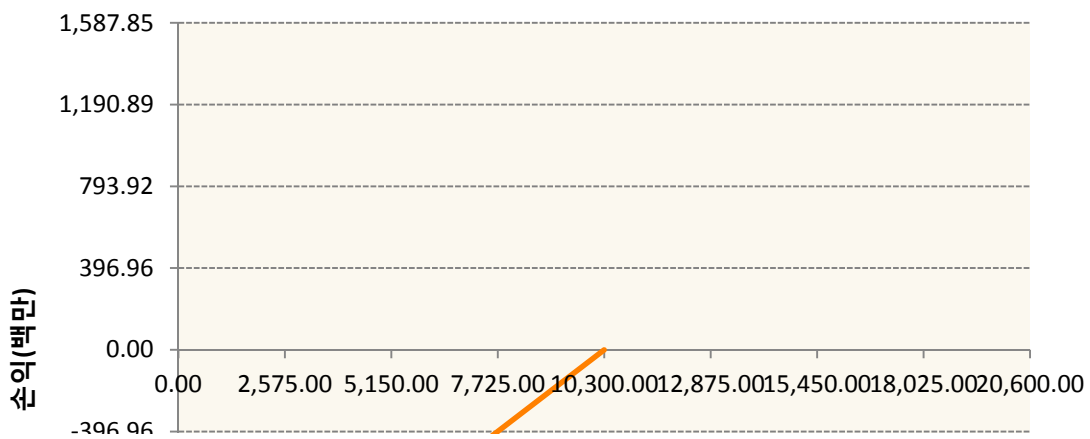


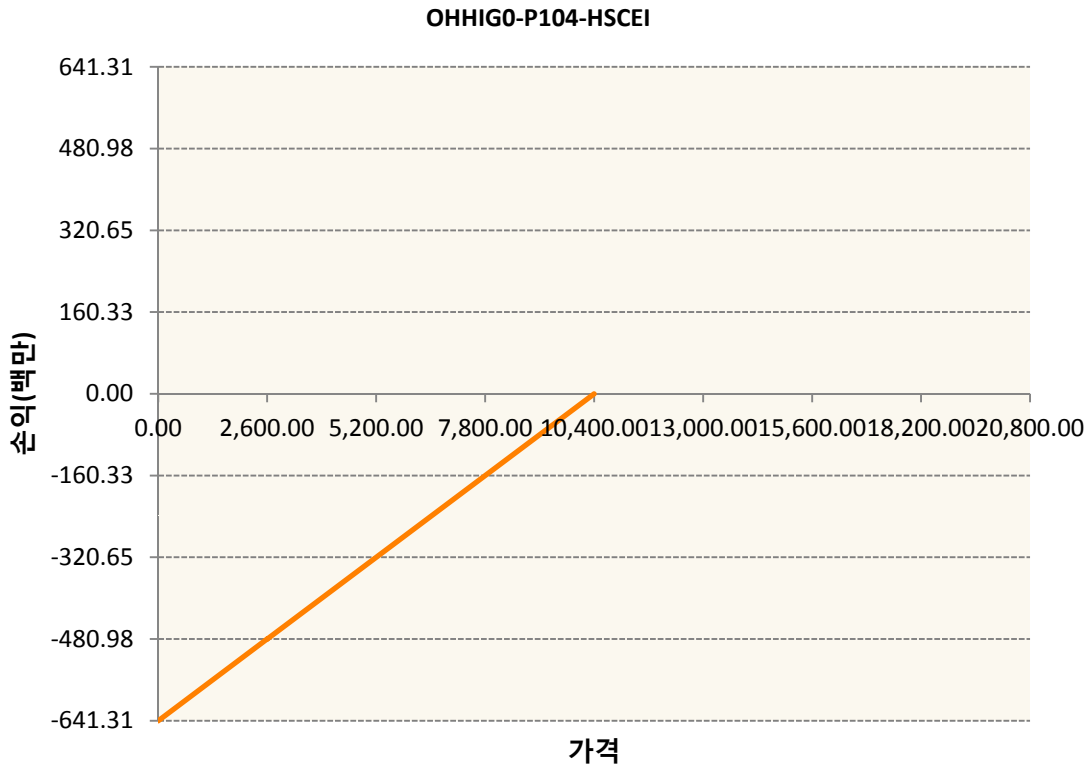


OHHIG0-C104-HSCEI



OHHIG0-P103-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21019X02 KRW/HKD 21-02-20E	174
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E	174
HCG0 HSCEI Futures Feb20	133
OHHIG0-C1(HSCEI	127
OHHIG0-C1(HSCEI	51
OHHIG0-P1(HSCEI	127
OHHIG0-P1(HSCEI	51

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	561

공시일	2020-02-21
기준일	2020-02-20

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

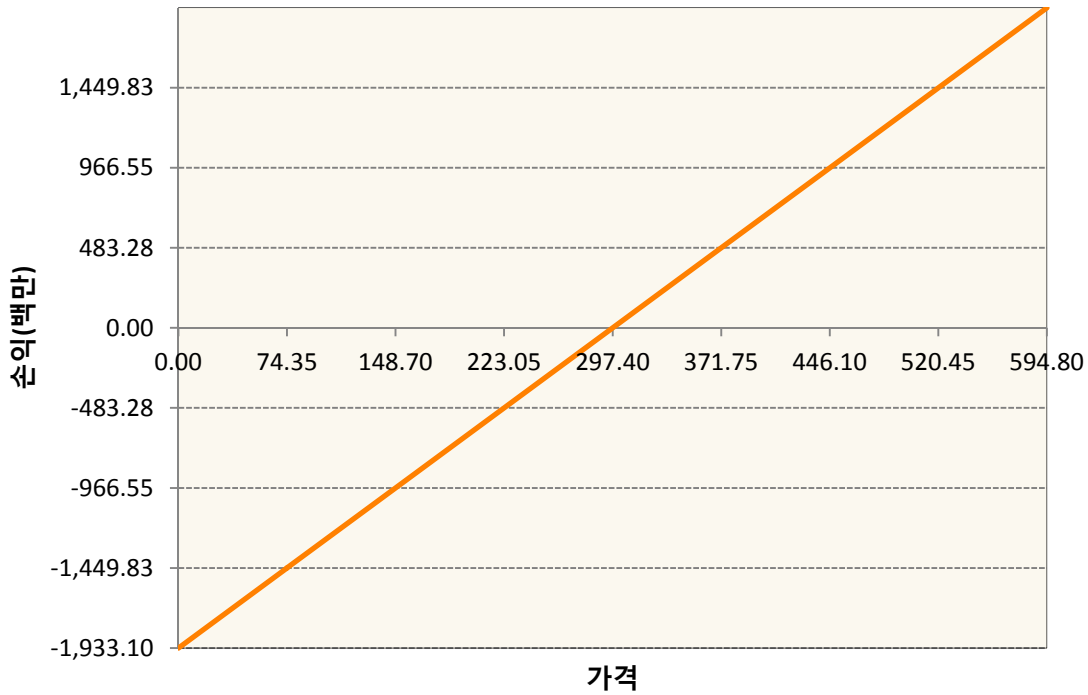
1. 계약금액

(단위:백만원)

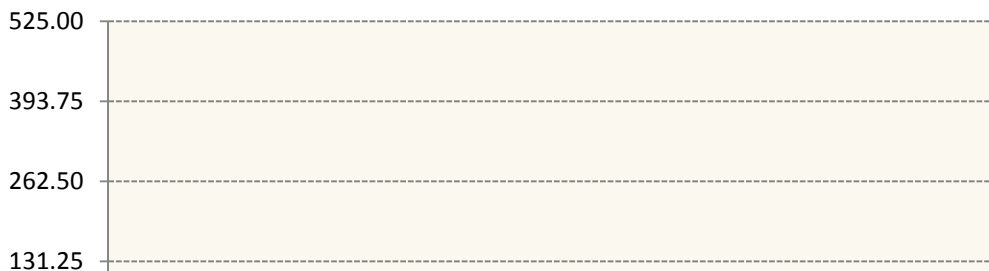
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,933	0	1,933	장내
누계	유가증권	스왑	5,125	0	5,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,612	-3,612	장내

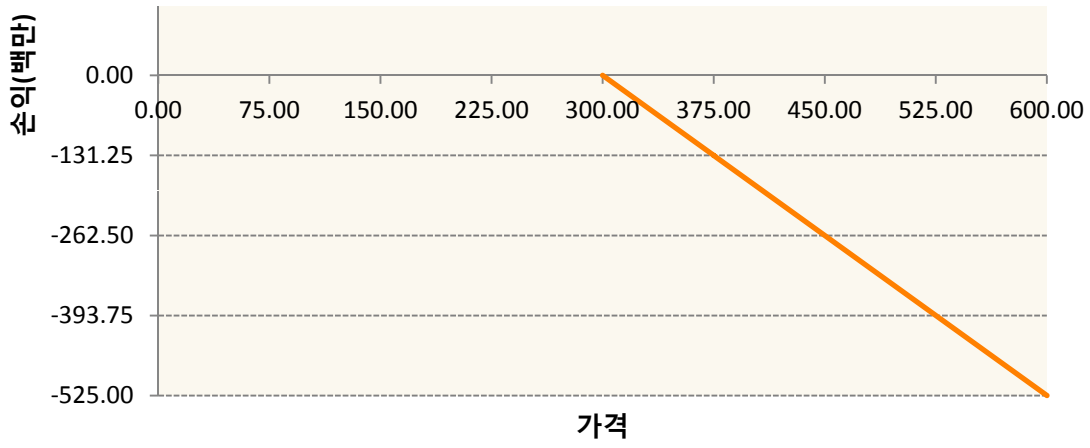
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

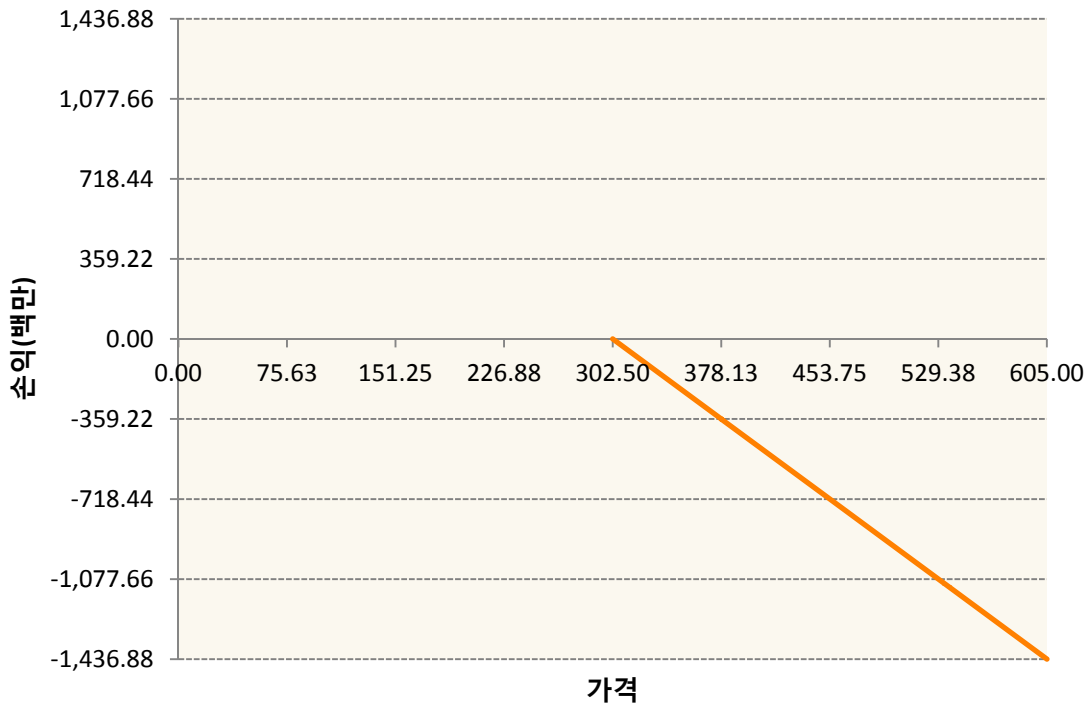


KR4201Q33007-2020-03 콜300

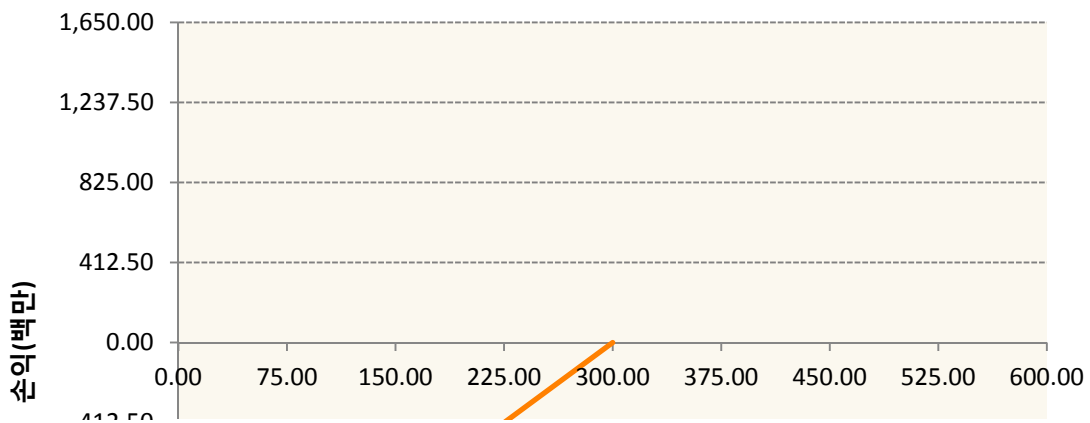




KR4201Q33023-2020-03 콜302.5



KR4301Q33005-2020-03 풋300





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						442
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-442	-442	-442	-442	-442	-442	-442	
-5.33%	-295	-295	-295	-295	-295	-295	-295	
-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%	295	295	295	295	295	295	295	
8.00%	442	442	442	442	442	442	442	
KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						154
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-154	-154	-154	-154	-154	-154	-154	
-5.33%	-103	-103	-103	-103	-103	-103	-103	
-2.67%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	51	51	51	51	51	51	51	
5.33%	103	103	103	103	103	103	103	
8.00%	154	154	154	154	154	154	154	
KR4201Q33007		2020-03 콜300						30
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	13	12	12	11	10	10	9	
-5.33%	11	11	10	9	8	7	6	
-2.67%	9	8	6	5	4	3	2	
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4	
2.67%	-3	-5	-6	-7	-9	-10	-11	
5.33%	-13	-14	-15	-16	-17	-19	-20	
8.00%	-24	-25	-26	-27	-28	-29	-30	
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5						78
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%	27	26	24	22	19	17	14
-2.67%	21	19	16	13	10	7	4
0%	10	7	3	0	-4	-7	-11
2.67%	-7	-11	-14	-18	-22	-25	-29
5.33%	-31	-34	-38	-41	-44	-48	-51
8.00%	-61	-63	-66	-68	-71	-74	-78
KR4301Q33005 2020-03 풋300							111
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-110	-110	-110	-110	-111	-111	-111
-5.33%	-67	-67	-68	-69	-69	-70	-71
-2.67%	-26	-28	-29	-31	-32	-34	-36
0%	7	5	2	0	-2	-5	-7
2.67%	28	25	23	21	18	16	14
5.33%	37	35	34	32	31	29	27
8.00%	39	39	38	37	36	35	34

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

(단위:백만원)

786

공시일	2020-02-21
기준일	2020-02-20

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

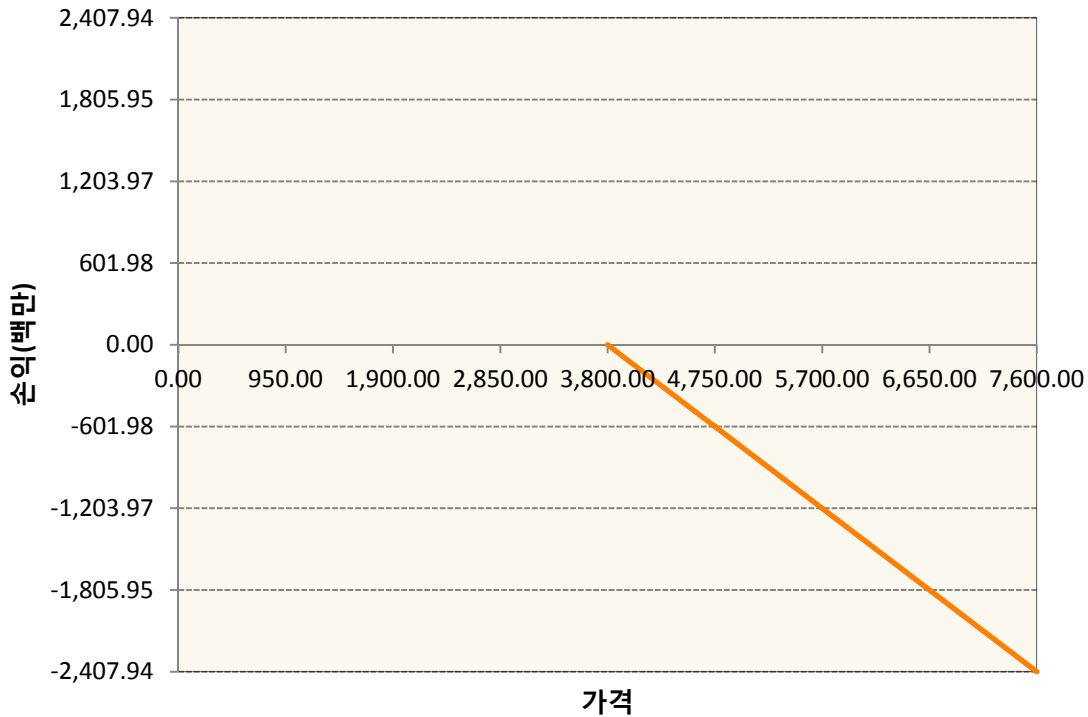
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	399	0	399	
누계	유가증권	스왑	11,640	0	11,640	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,388	-7,388	장내
누계	통화	선도	0	3,393	-3,393	장외

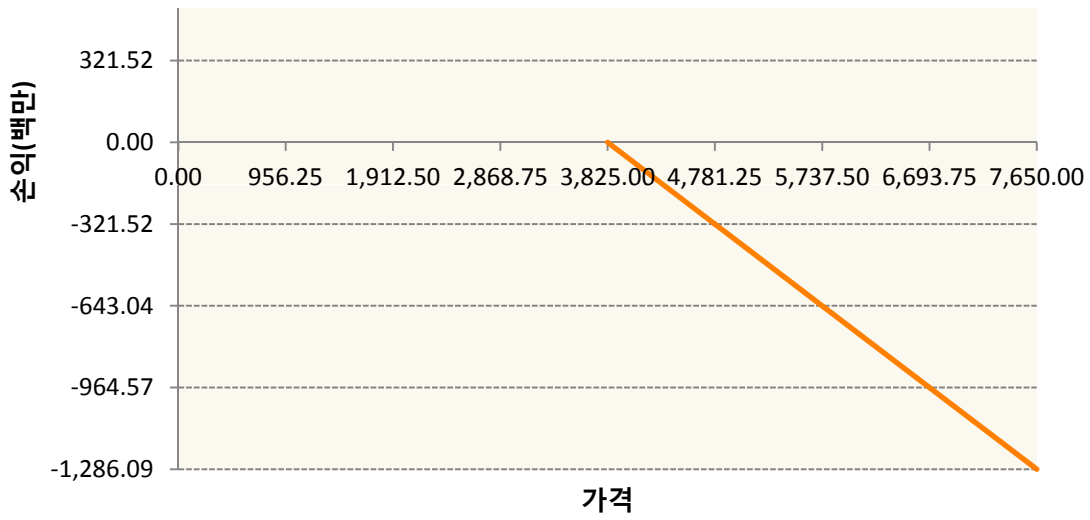
2. 만기시점의 손익구조

OESXG0-C3800-EURO STOXX 50

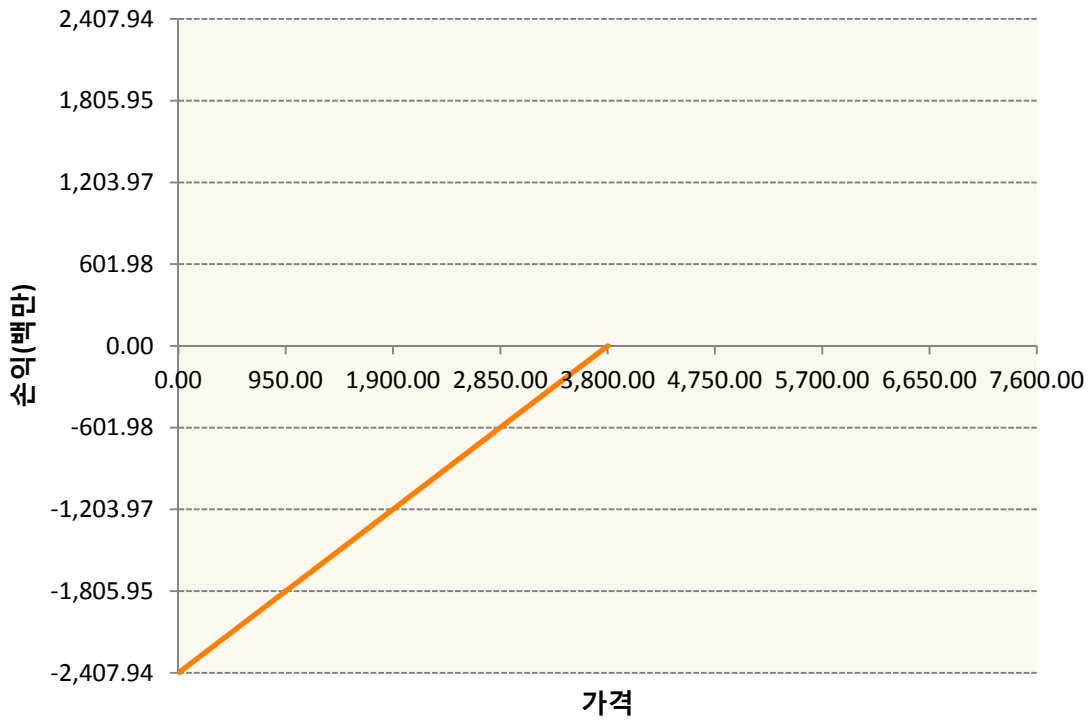


OESXG0-C3825-EURO STOXX 50

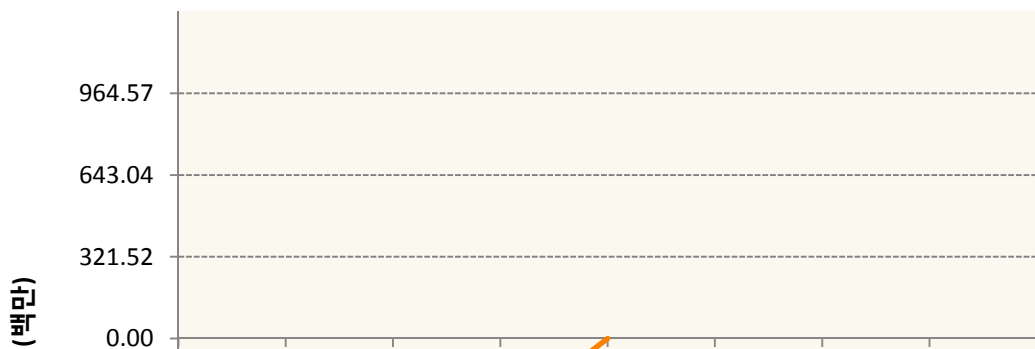


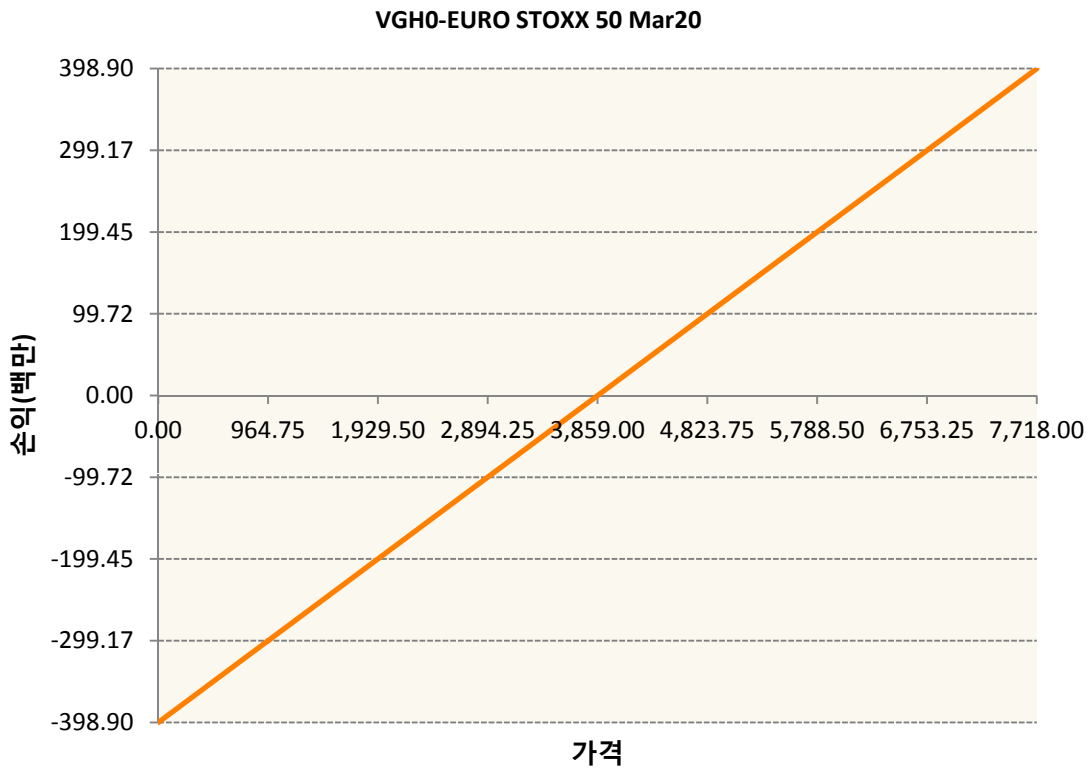
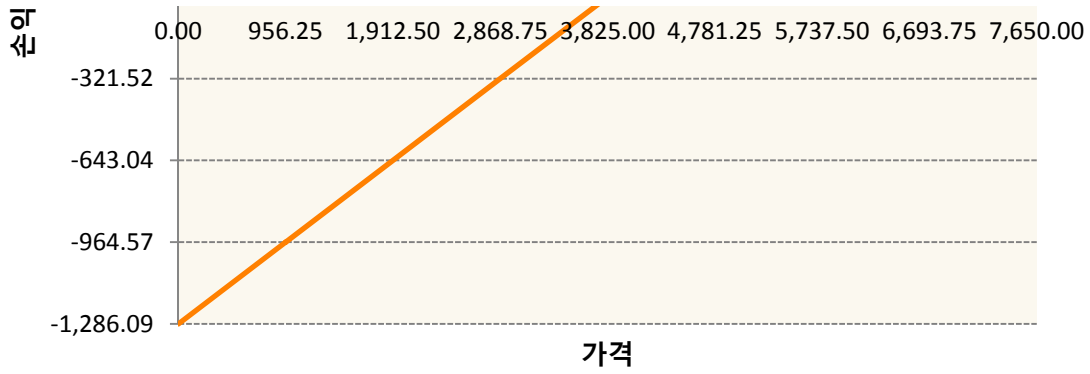


OESXG0-P3800-EURO STOXX 50



OESXG0-P3825-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		11
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E		271
OESXG0-C3& EURO STOXX 50		193
OESXG0-C3& EURO STOXX 50		103
OESXG0-P3& EURO STOXX 50		193
OESXG0-P3& EURO STOXX 50		103
VGH0	EURO STOXX 50 Mar20	32

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

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

(단위:백만원)

939

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	2020-02-21
기준일	2020-02-20

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

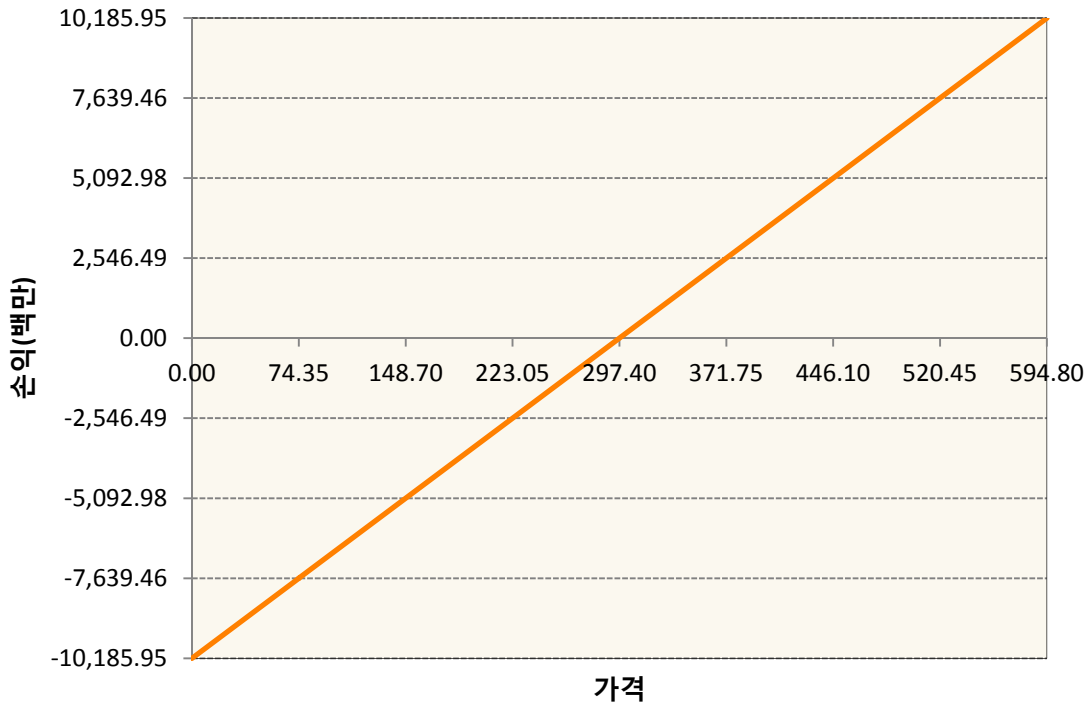
1. 계약금액

(단위:백만원)

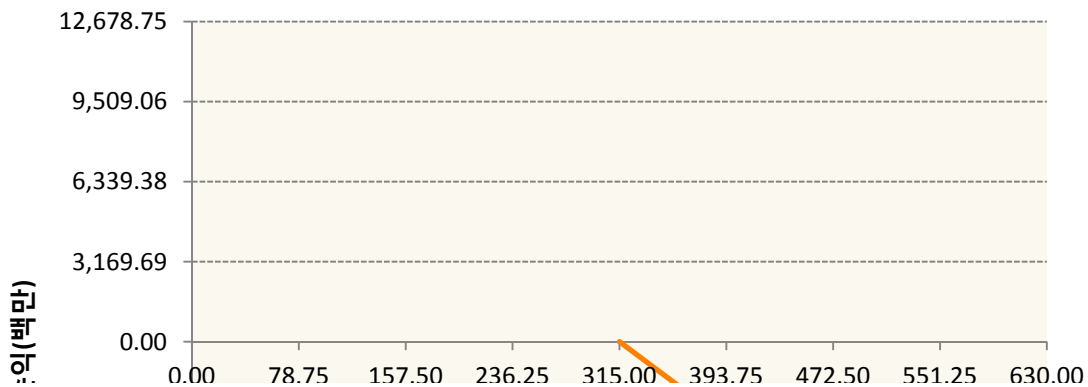
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,186	0	10,186	장내
누계	유가증권	옵션	2,257	20,854	-18,598	장내

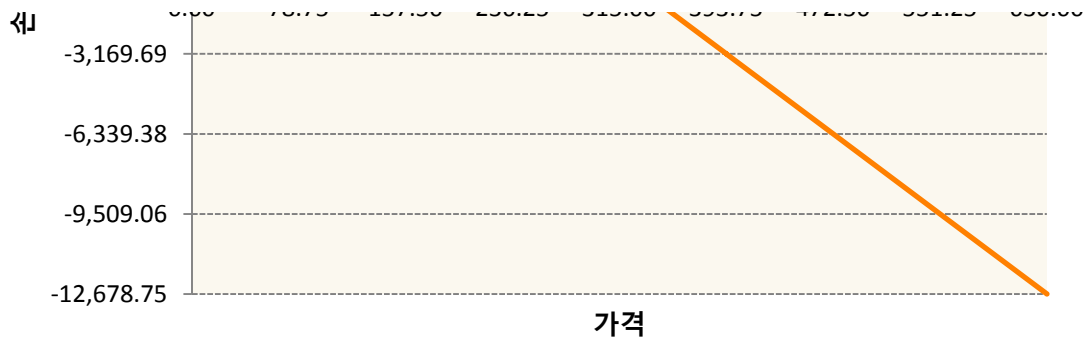
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

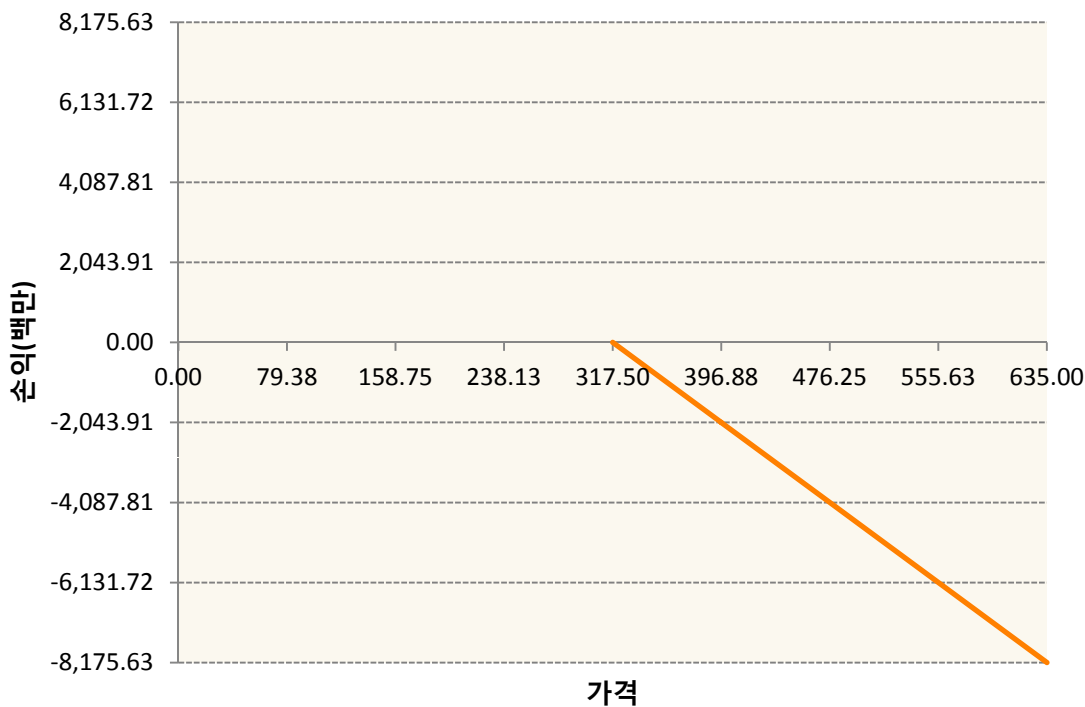


KR4201Q33155-2020-03 콜315

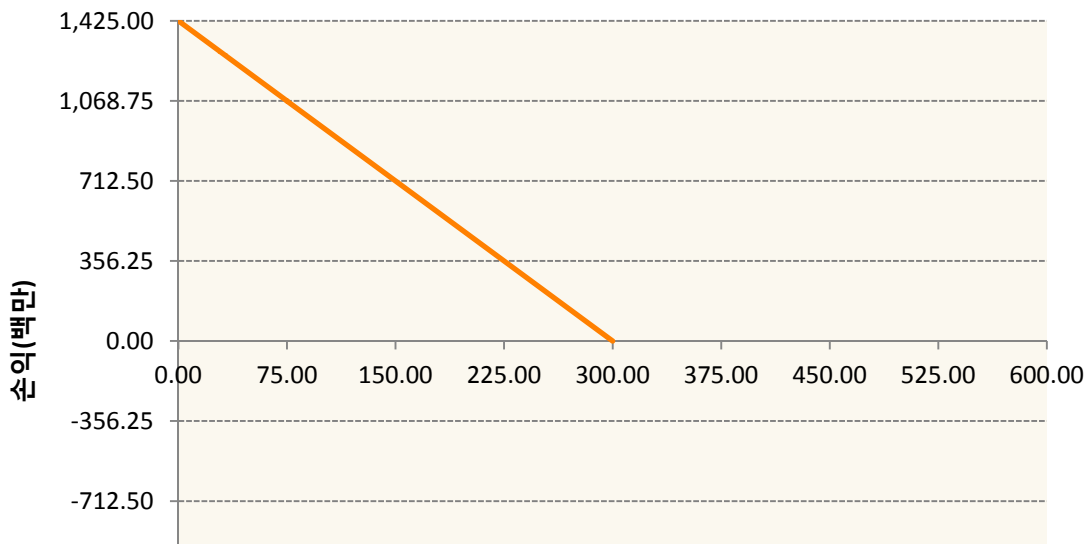


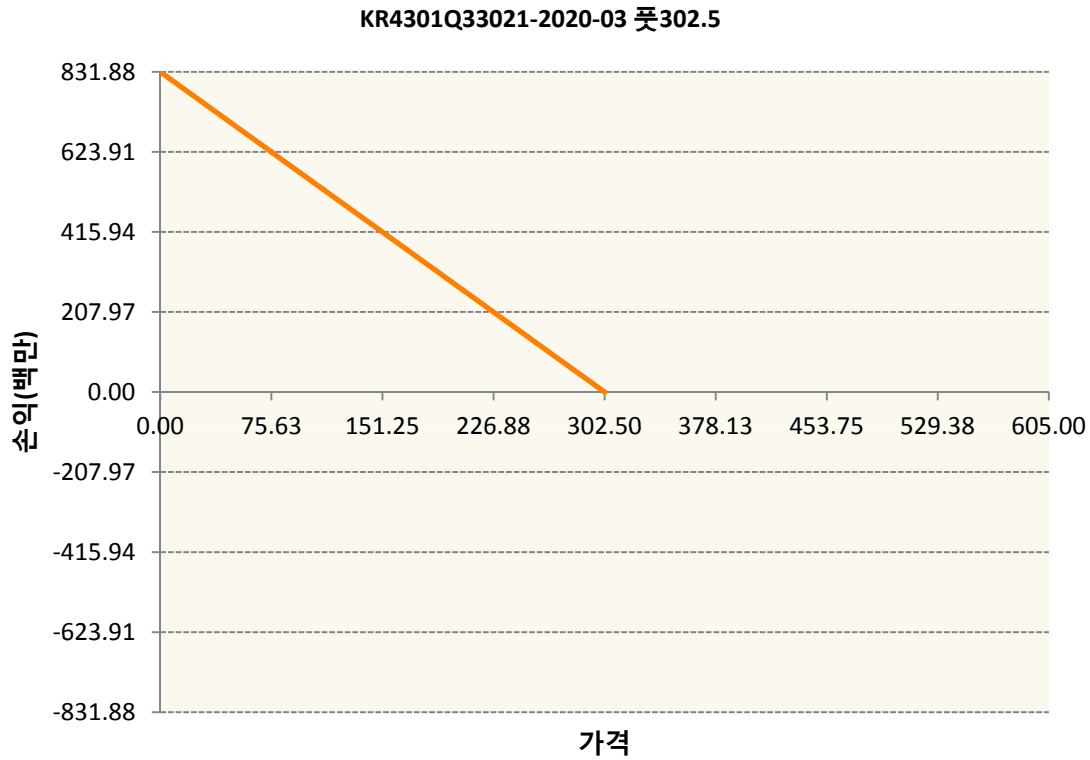
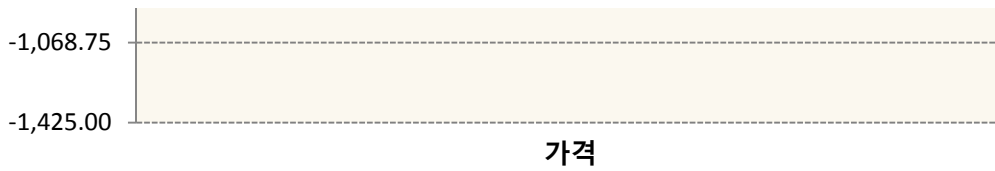


KR4201Q33171-2020-03 콜317.5



KR4301Q33005-2020-03 풋300





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						813
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-813	-813	-813	-813	-813	-813	-813	
-5.33%	-542	-542	-542	-542	-542	-542	-542	
-2.67%	-271	-271	-271	-271	-271	-271	-271	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	271	271	271	271	271	271	271	
5.33%	542	542	542	542	542	542	542	
8.00%	813	813	813	813	813	813	813	
KR4201Q33155		2020-03 콜315						486
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	115	113	110	105	99	92	83	
-5.33%	110	105	98	89	78	66	52	
-2.67%	96	85	72	57	40	21	2	

0%	62	43	22	0	-24	-48	-73
2.67%	-6	-34	-61	-90	-119	-148	-178
5.33%	-123	-155	-187	-219	-251	-283	-315
8.00%	-295	-326	-358	-390	-422	-454	-486
KR4201Q33171 2020-03 콜317.5							289
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	61	61	59	57	54	49	44
-5.33%	59	57	53	48	42	35	27
-2.67%	53	47	40	31	21	11	-1
0%	36	25	13	0	-14	-29	-44
2.67%	-1	-17	-33	-51	-69	-87	-105
5.33%	-65	-85	-105	-125	-146	-166	-186
8.00%	-164	-185	-205	-226	-247	-268	-289
KR4301Q33005 2020-03 풋300							96
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	95	95	95	95	96	96	96
-5.33%	58	58	59	59	60	61	62
-2.67%	23	24	25	26	28	29	31
0%	-6	-4	-2	0	2	4	6
2.67%	-24	-22	-20	-18	-16	-14	-12
5.33%	-32	-30	-29	-28	-26	-25	-23
8.00%	-34	-33	-33	-32	-31	-30	-29
KR4301Q33021 2020-03 풋302.5							58
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	57	57	57	58	58	58	58
-5.33%	36	36	36	36	37	37	37
-2.67%	15	15	16	17	17	18	19
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-16	-14	-13	-12	-11	-10	-8
5.33%	-22	-21	-20	-19	-18	-17	-16
8.00%	-24	-23	-23	-22	-22	-21	-21

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

(단위:백만원)

1,358

공시일	2020-02-21
기준일	2020-02-20

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	216,550	0	216,550	

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	2020-02-21
기준일	2020-02-20

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	188,311	0	188,311	

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	2020-02-21
기준일	2020-02-20

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	537,445	0	537,445	
누계	통화	선도	0	635,071	-635,071	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E	3,836
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,918
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	2,052
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	192
FX21020F02: KRW/USD 21-02-20E	1,918
FX21020F02: KRW/USD 21-02-20E	3,299
FX21020F02: KRW/USD 23-03-20E	1,544
FX21020F02: KRW/USD 23-03-20E	1,438
FX21020F02: KRW/USD 28-02-20E	1,918
FX21020F03: KRW/USD 28-02-20E	2,973
FX21020F03: KRW/USD 31-03-20E	3,069
FX21020F04: KRW/USD 31-03-20E	2,877
FX21020F04: KRW/USD 28-02-20E	192
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,589
FX21020G00 KRW/USD 06-03-20E	2,397
FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	959
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,189
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,218
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	959
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	1,918
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	3,299
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,299
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,918
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,836

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

17,089

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

(단위:백만원)

125

공시일	2020-02-21
기준일	2020-02-20

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

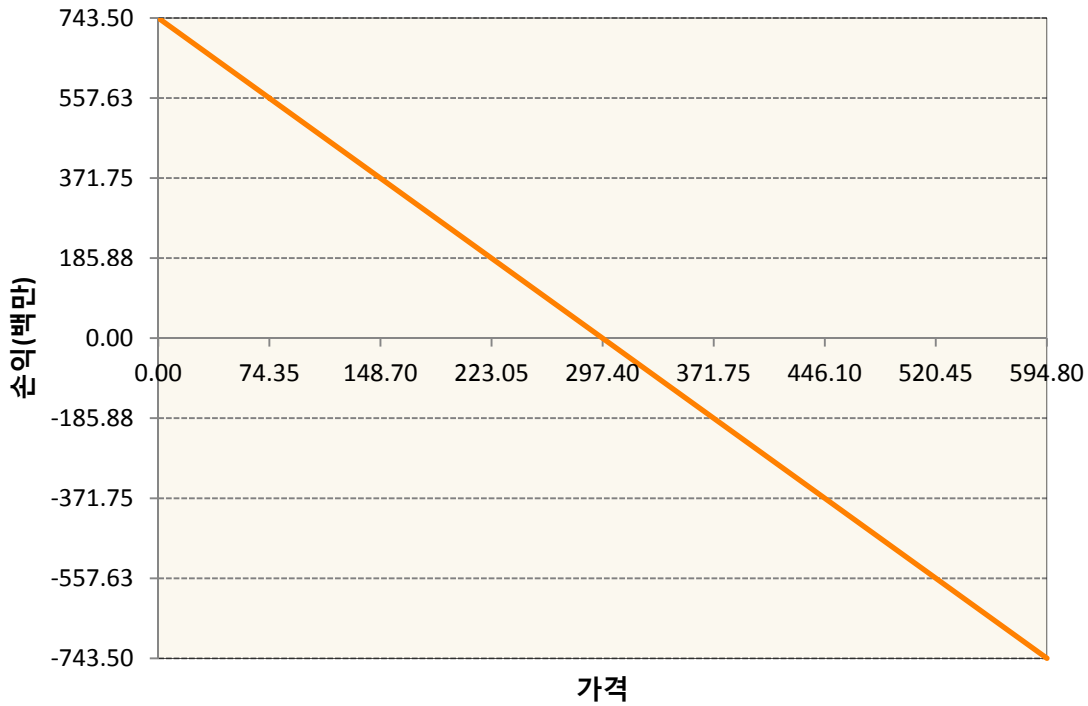
1. 계약금액

(단위:백만원)

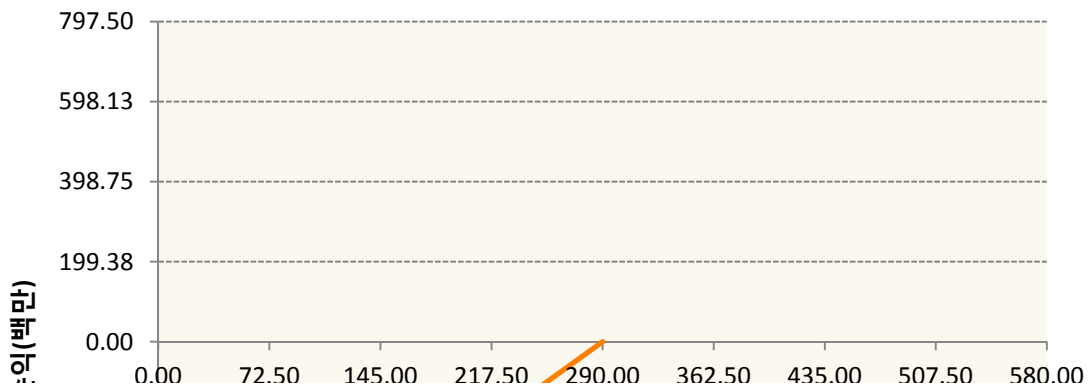
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	744	-744	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,503	-3,503	장내

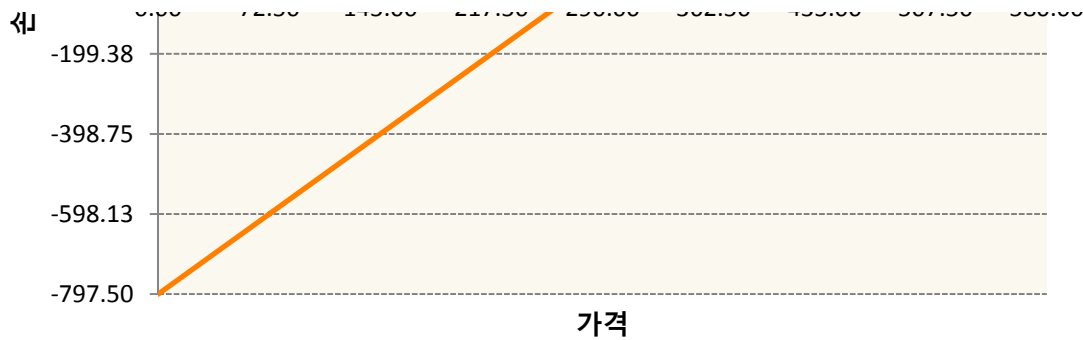
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

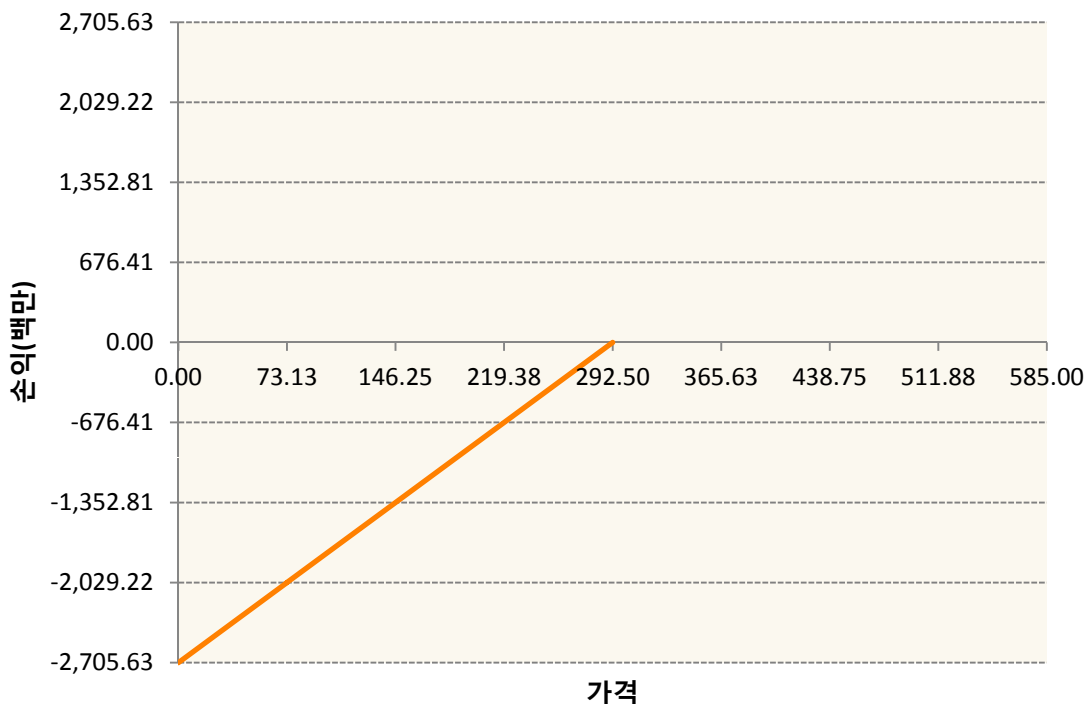


KR4301Q32908-2020-03 풋290





KR4301Q32924-2020-03 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						59
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	59	59	59	59	59	59	59	
-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%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59	
KR4301Q32908		2020-03 풋290						43
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-41	-41	-41	-42	-42	-43	-43
-5.33%	-21	-22	-22	-23	-24	-25	-26
-2.67%	-6	-7	-8	-9	-10	-11	-13
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	6	6	5	5	4	3	2
5.33%	7	7	7	6	6	6	5
8.00%	7	7	7	7	7	7	6

KR4301Q32924 2020-03 풋292.5 157

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-151	-151	-152	-153	-154	-156	-157
-5.33%	-82	-84	-86	-88	-91	-94	-97
-2.67%	-25	-28	-32	-36	-40	-43	-47
0%	11	8	4	0	-4	-8	-12
2.67%	27	25	22	20	17	14	11
5.33%	31	30	29	28	27	25	23
8.00%	32	32	31	31	30	30	29

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

(단위:백만원)

245

공시일	2020-02-21
기준일	2020-02-20

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	11,257	0	11,257	
누계	통화	선도	647	11,603	-10,956	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020F03(KRW/USD 28-02-20E	209
FX21020F04(KRW/USD 28-02-20E	298
FX21020F04(KRW/USD 28-02-20E	5
FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	326
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	90
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)

330

공시일	2020-02-21
기준일	2020-02-20

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

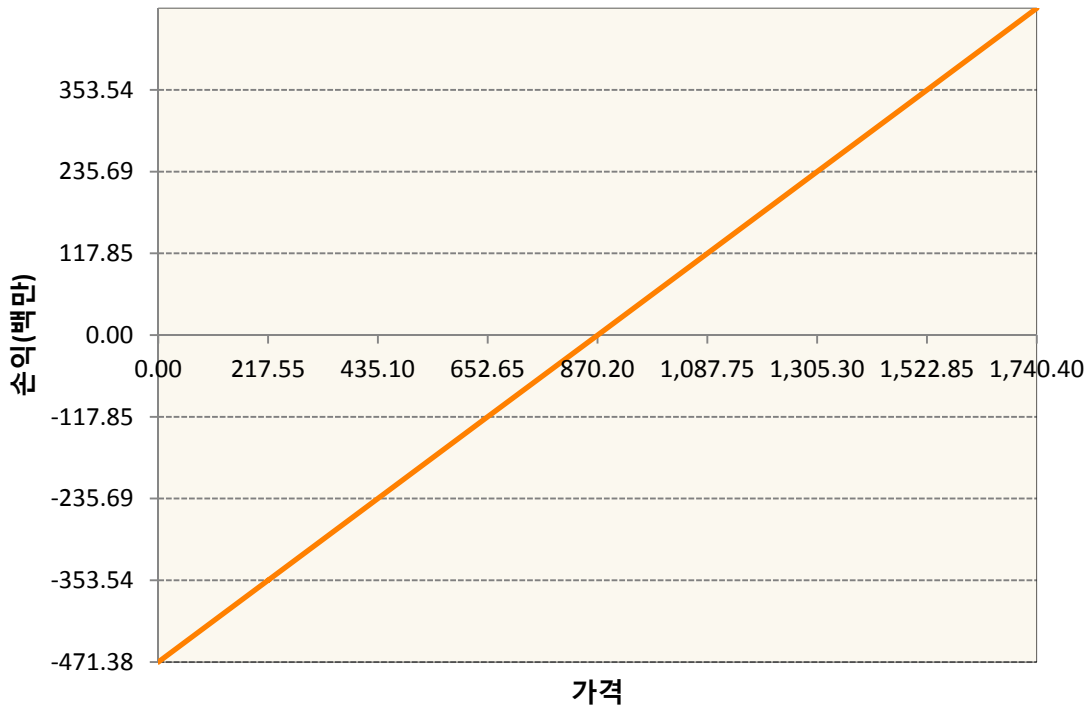
1. 계약금액

(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	1,067	0	1,067	장외
누계	통화	선도	181	685	-504	장외

2. 만기시점의 손익구조

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
VNCH0 VN30 Index Future Mar20	38

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

(단위:백만원)

115

공시일	2020-02-21
기준일	2020-02-20

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

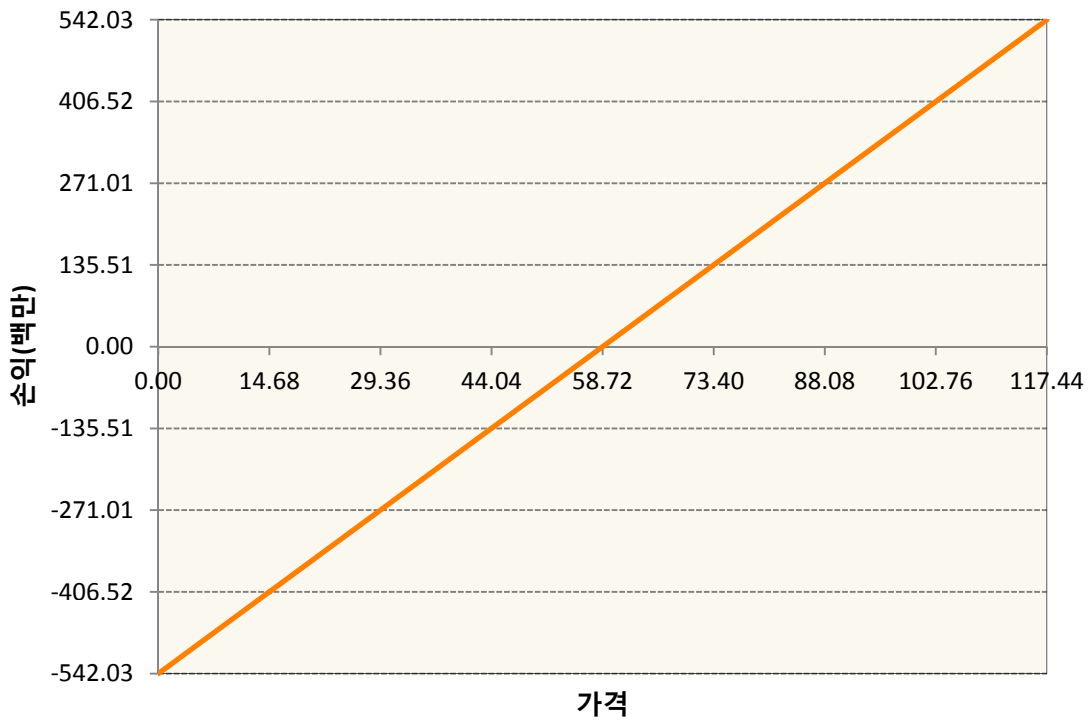
1. 계약금액

(단위:백만원)

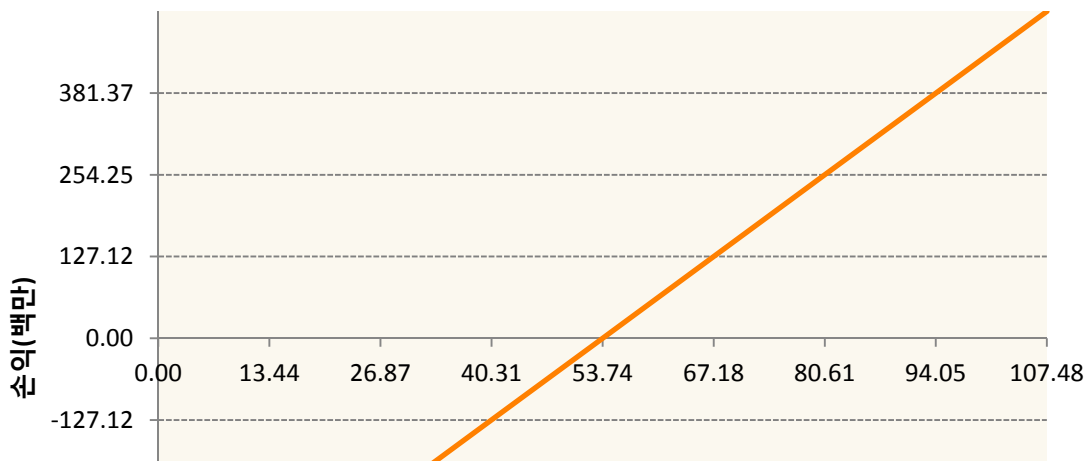
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,219	192	2,028	

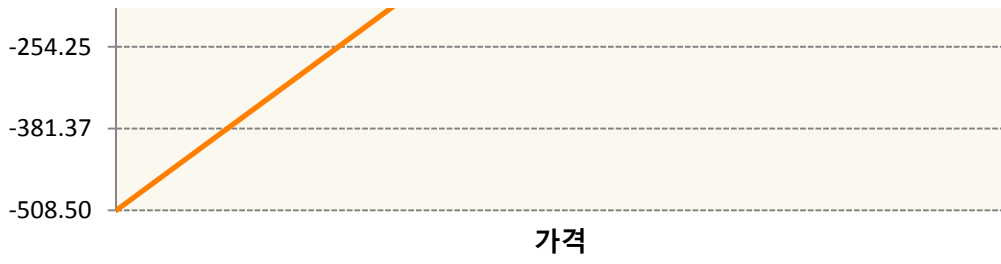
2. 만기시점의 손익구조

COK0-BRENT CRUDE FUTR May20

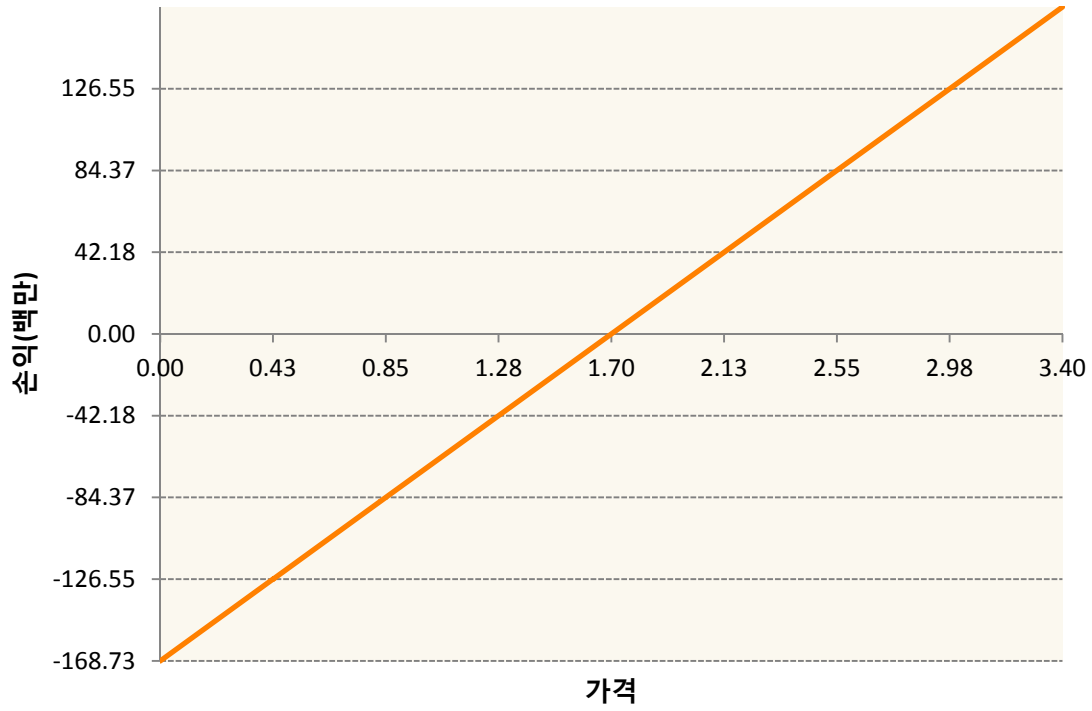


CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20

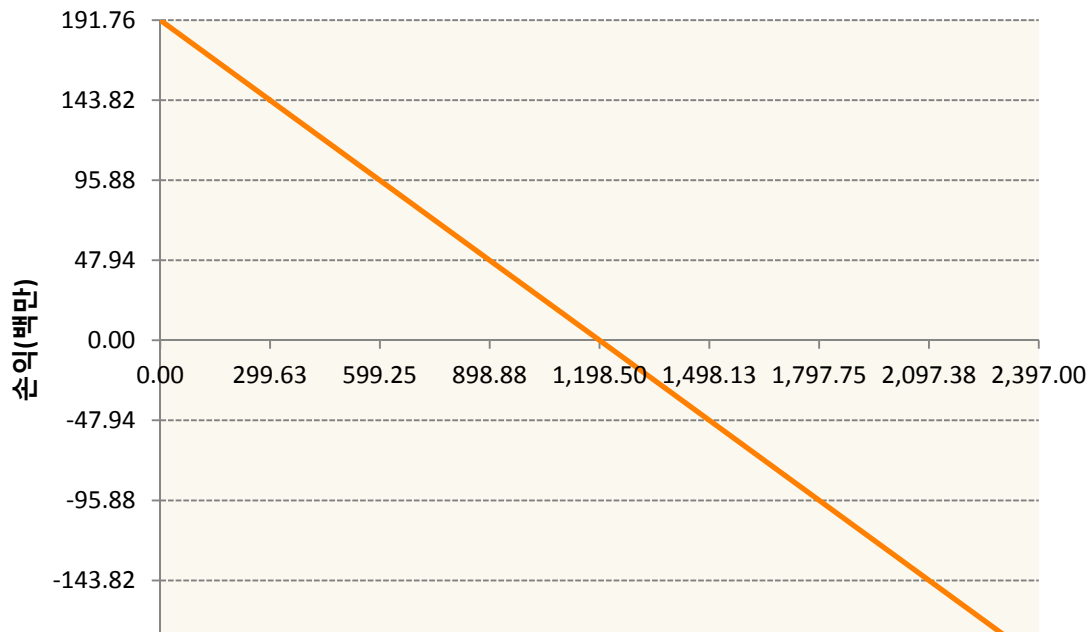


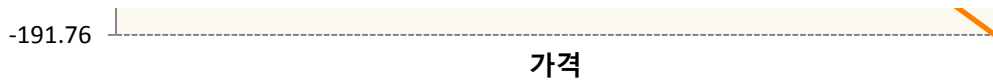


HOK0-NY Harb ULSD Fut May20

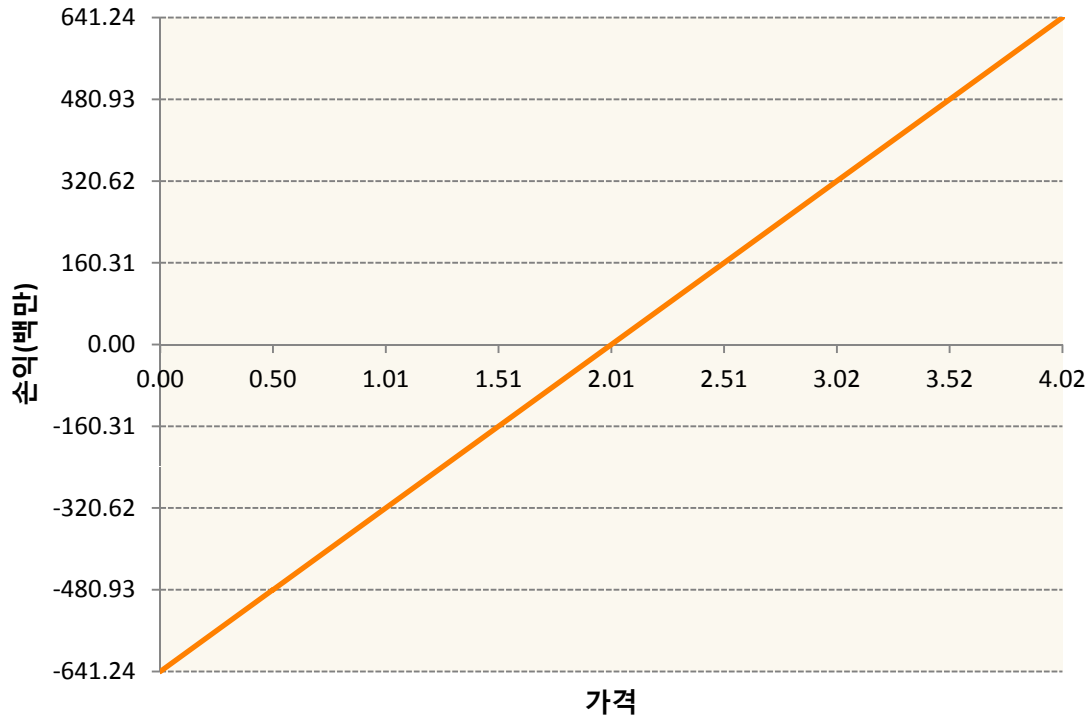


KR4175Q30009-2020-03 달러선물

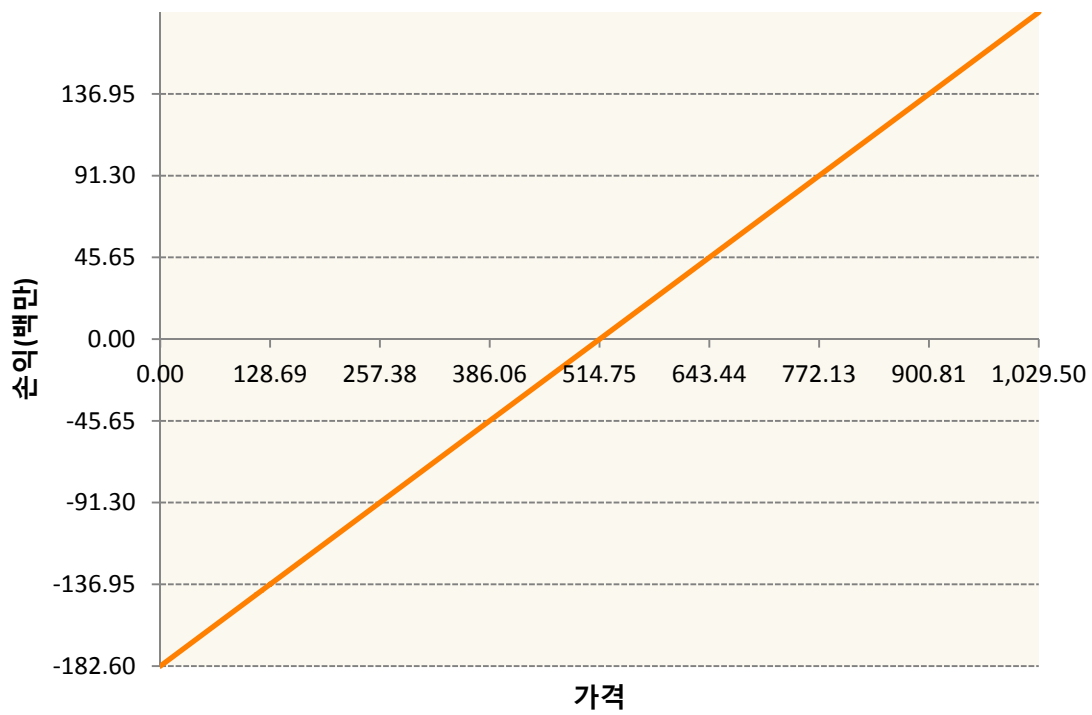




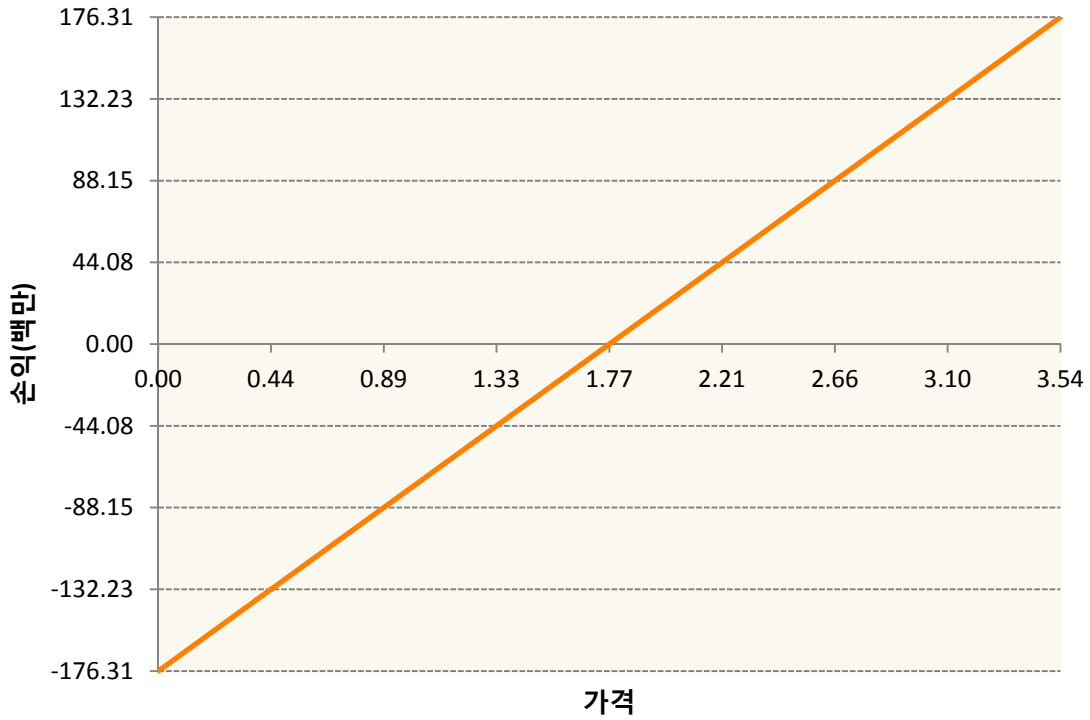
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



QSK0-Low Su Gasoil G Mar20



XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	43
CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	41
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	13
KR4175Q30C	2020-03 달러선물	15
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	51
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	15
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	14

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

(단위:백만원)

357

공시일	2020-02-21
기준일	2020-02-20

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

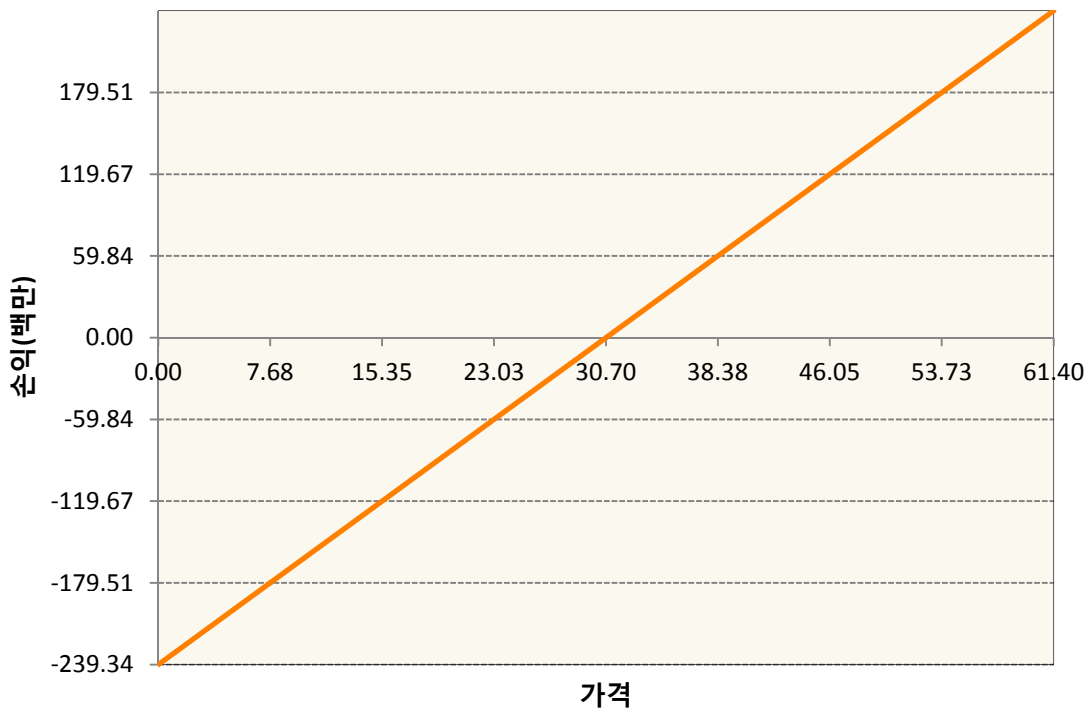
1. 계약금액

(단위:백만원)

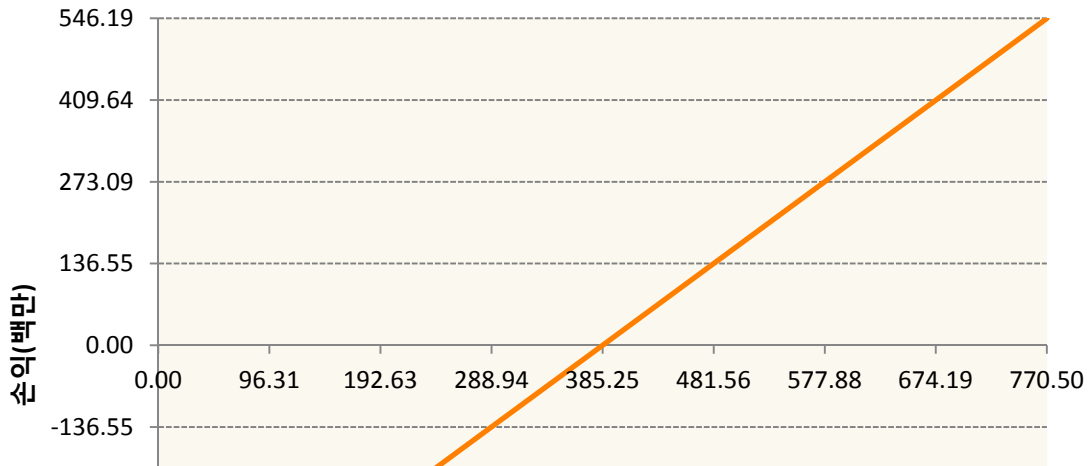
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,766	156	2,610	

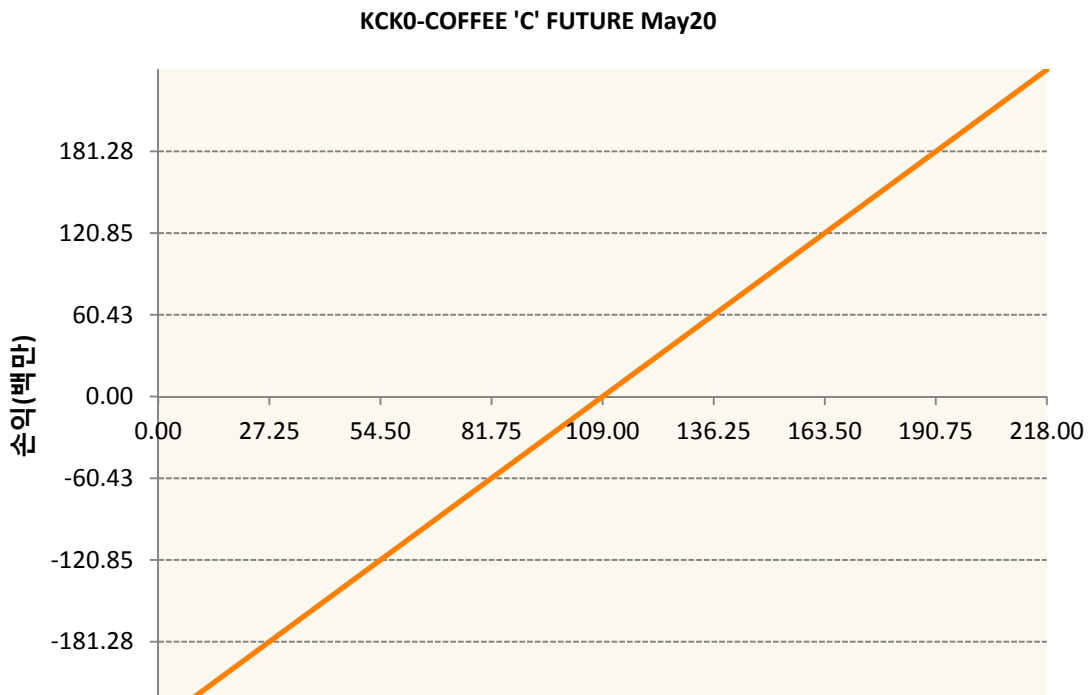
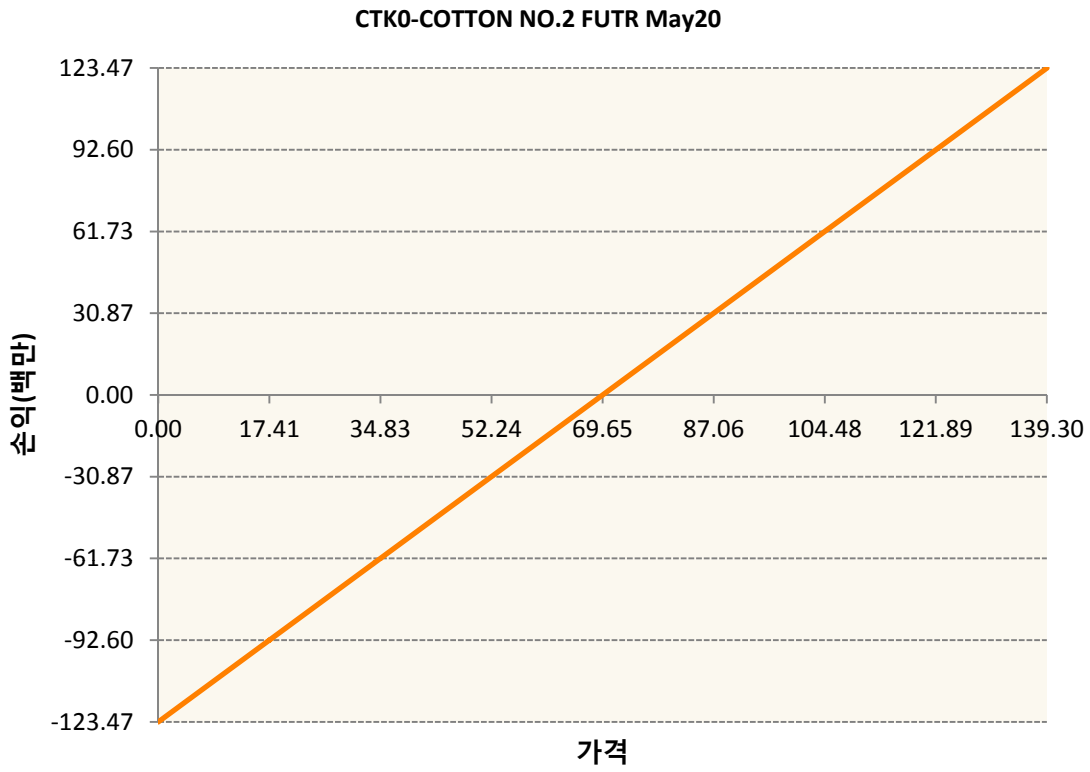
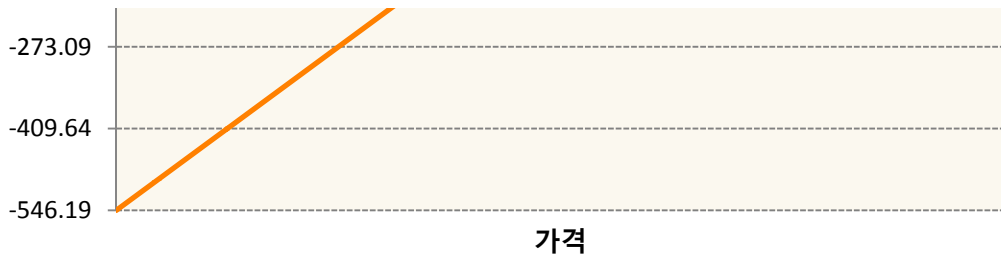
2. 만기시점의 손익구조

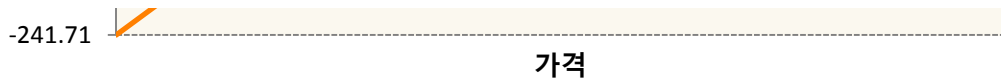
BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20



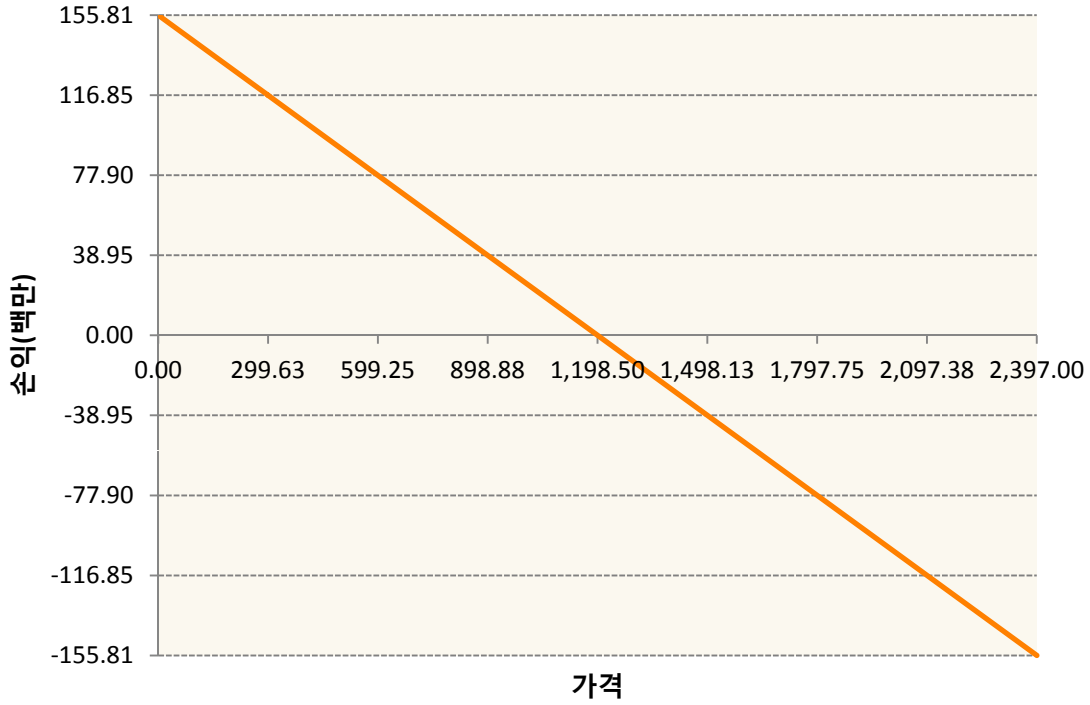
CK0-CORN FUTURE May20



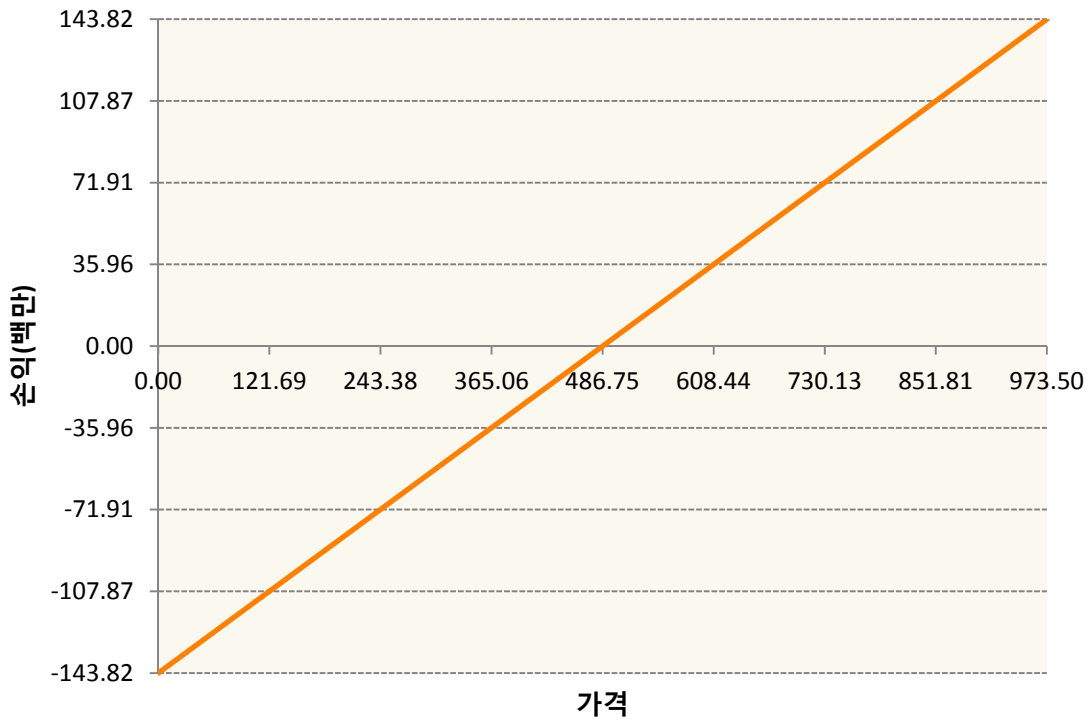




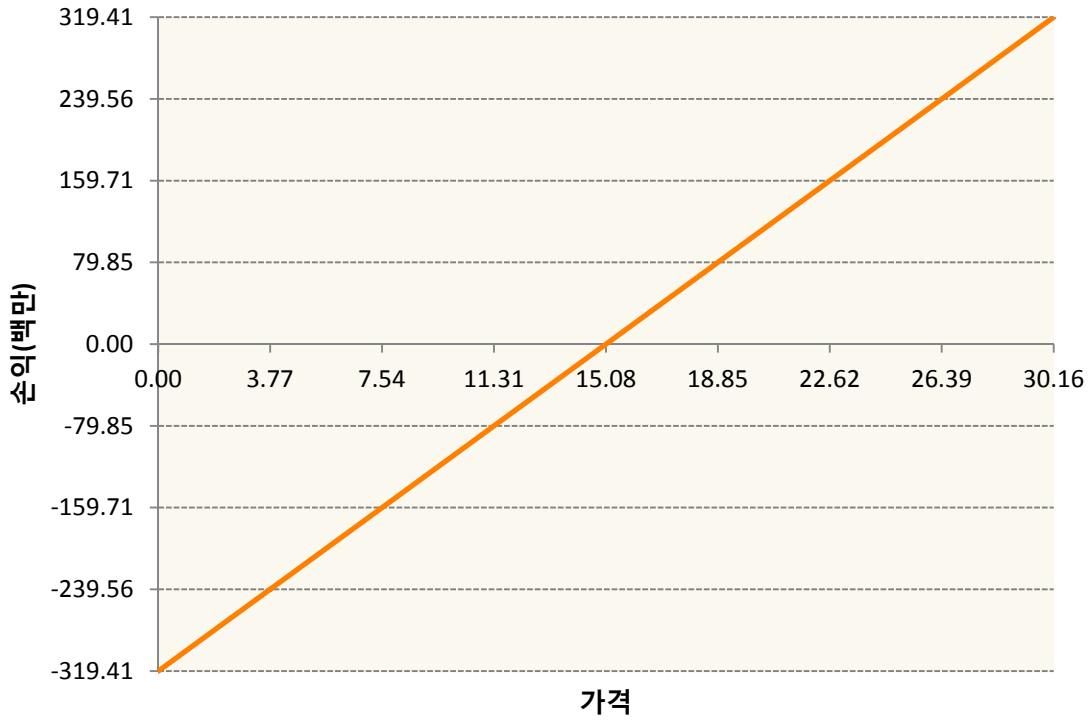
KR4175Q30009-2020-03 달러선물



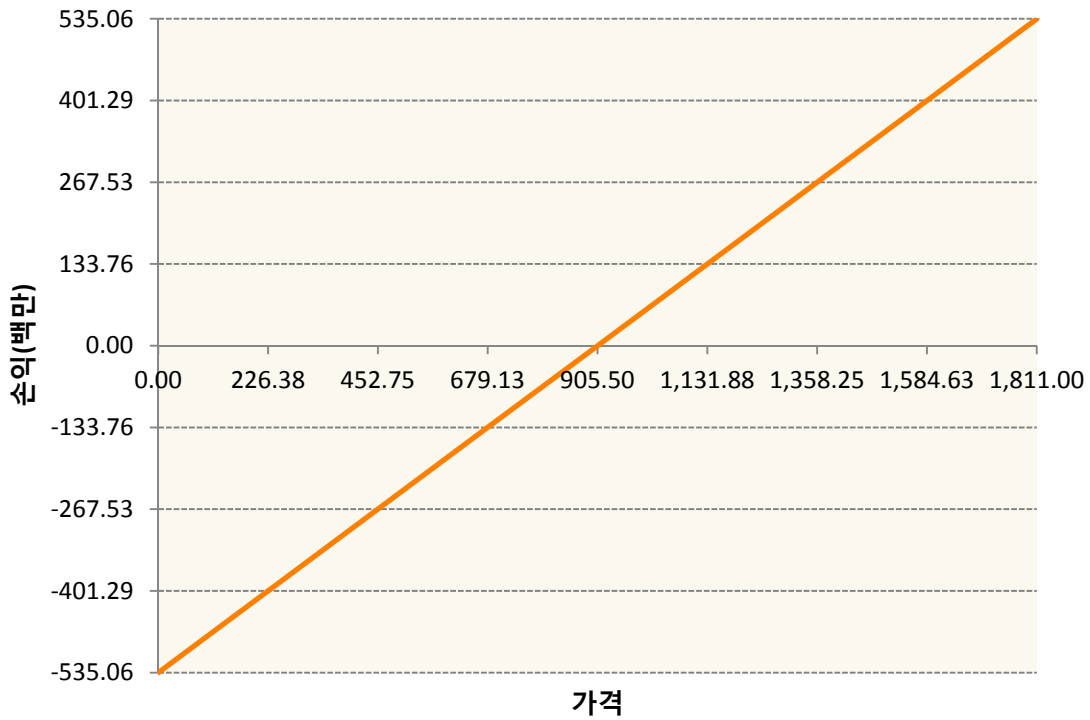
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



SBK0-Sugar May20

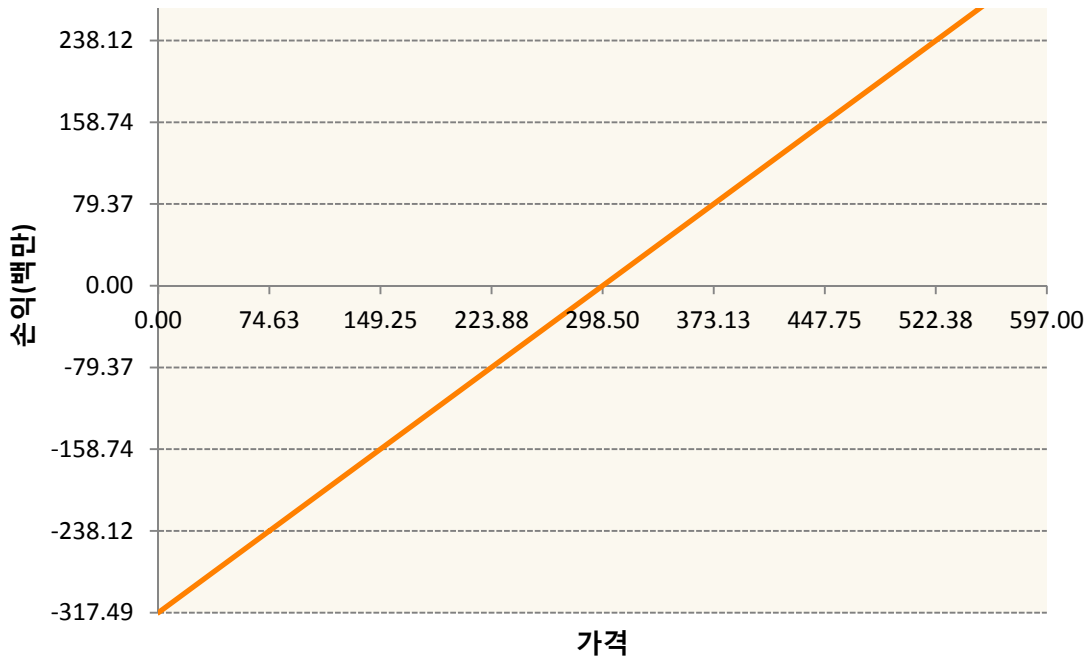


SK0-SOYBEAN FUTURE May20

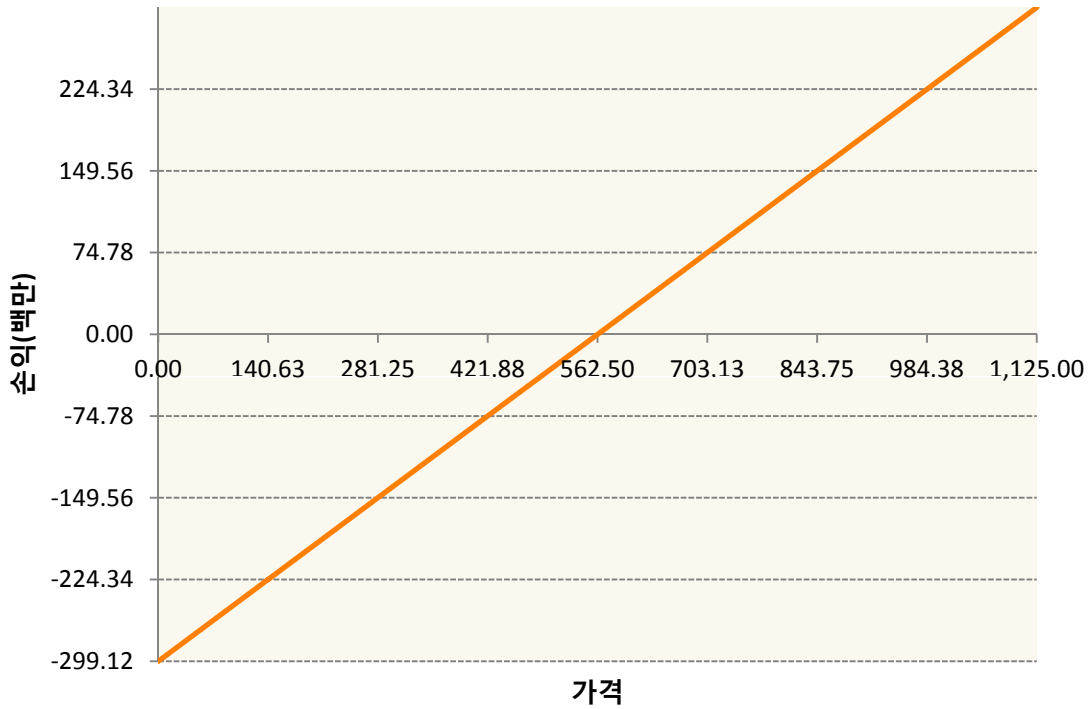


SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





WK0-WHEAT FUTURE(CBT) 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	26
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