

공시일	2020-02-24
기준일	2020-02-21

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)

19

공시일	2020-02-24
기준일	2020-02-21

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

1,162

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

675

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-24
기준일	2020-02-21

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)	446
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	163

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

943

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-24
기준일	2020-02-21

유로인덱스모(주식-파생형)

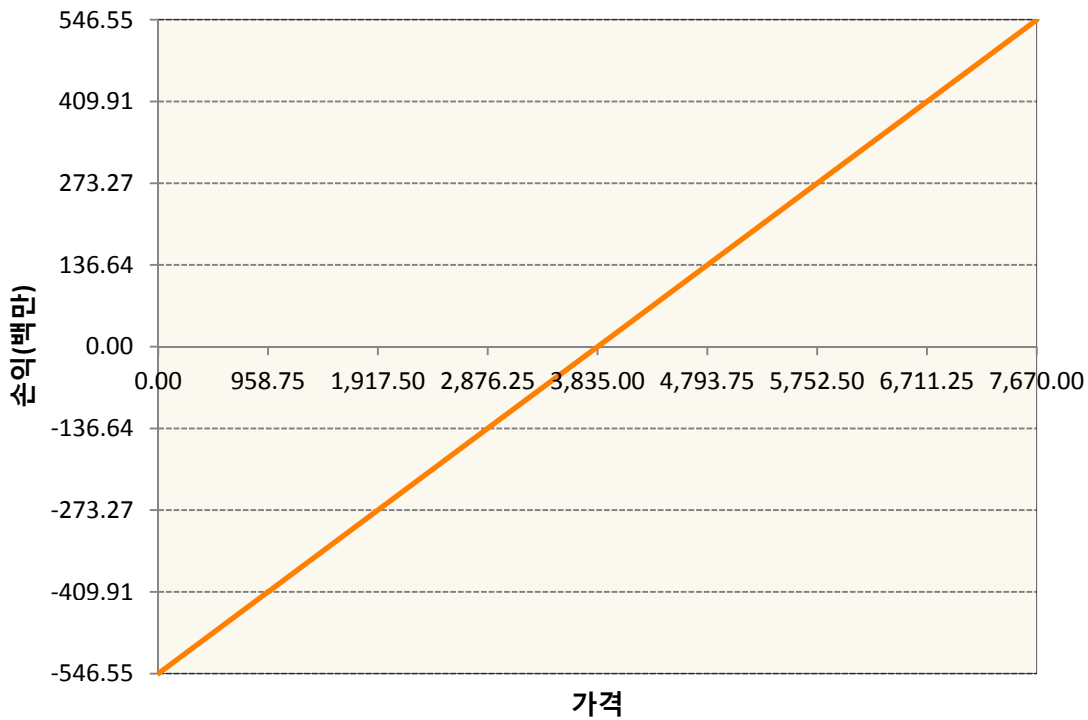
1. 계약금액

(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)

30

공시일	2020-02-24
기준일	2020-02-21

차이나인덱스모(주식-파생형)

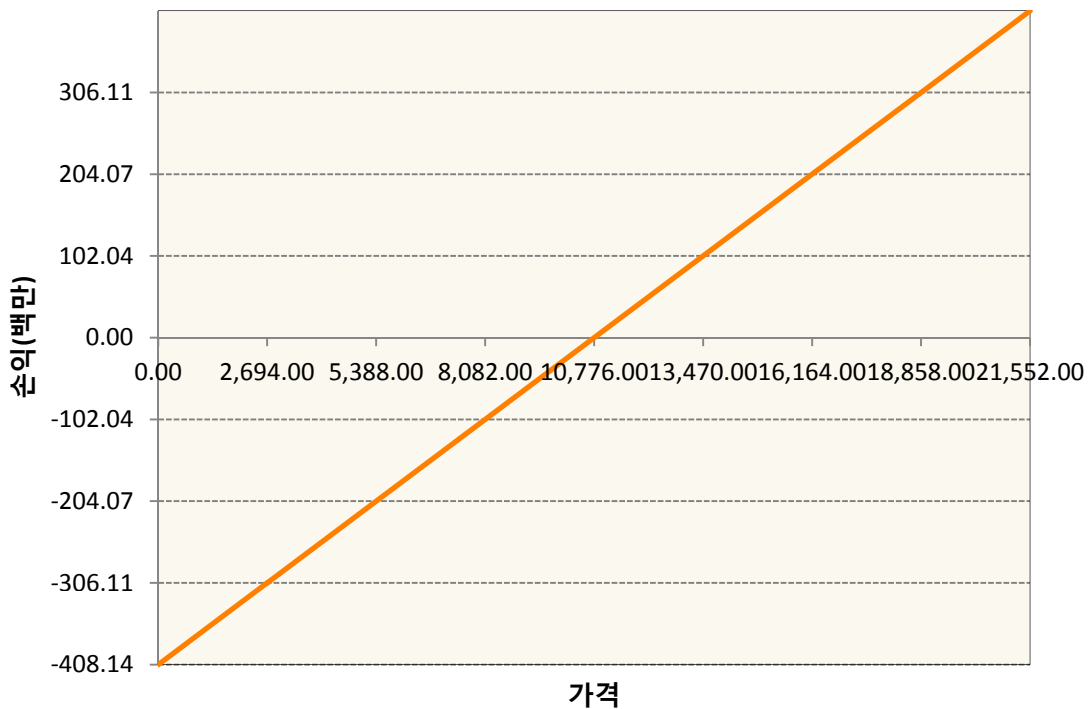
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	408	0	408	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	2020-02-24
기준일	2020-02-21

커버드콜모(주식혼합-파생형)

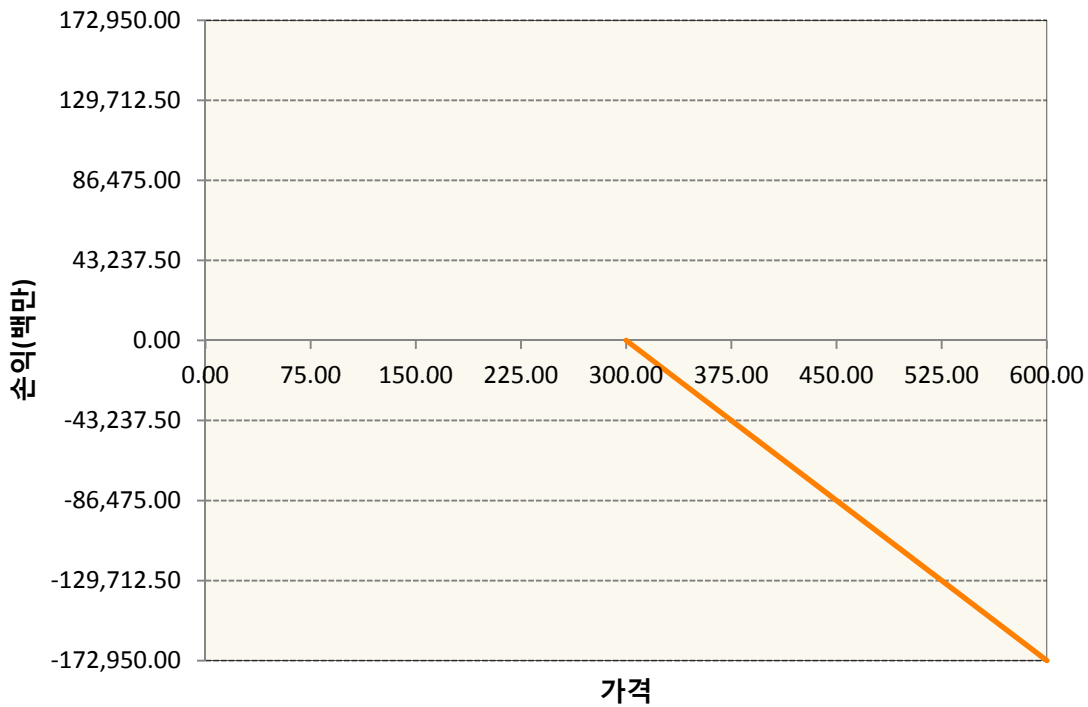
1. 계약금액

(단위:백만원)

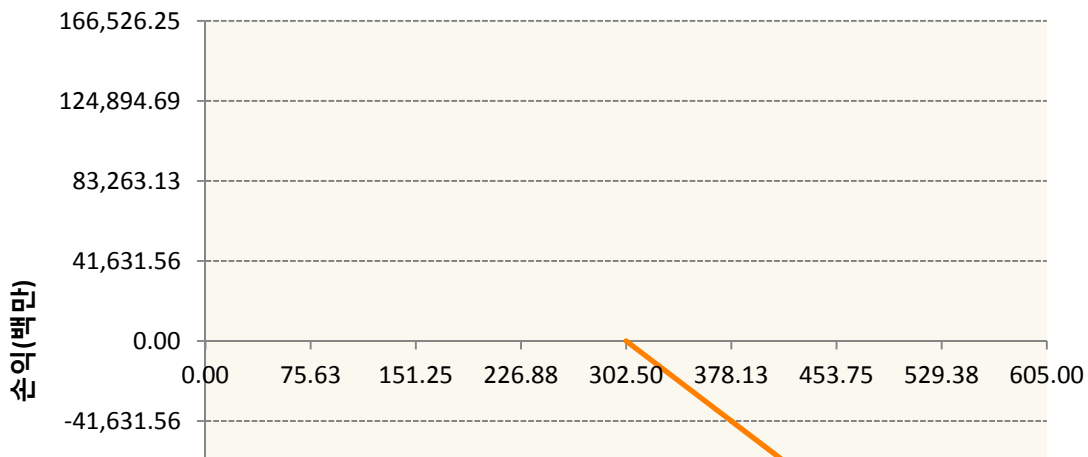
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	448,226	-448,226	장내

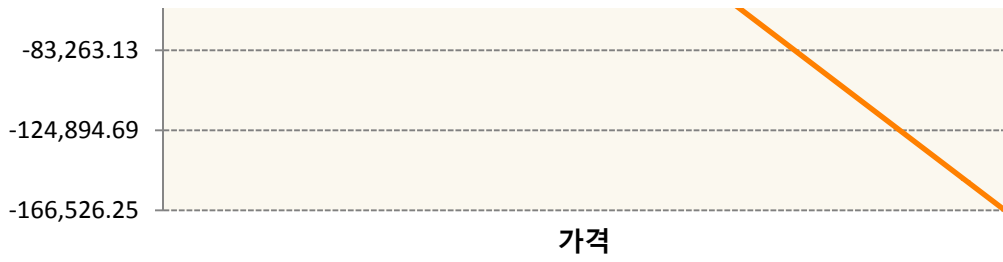
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q33007-2020-03 콜300

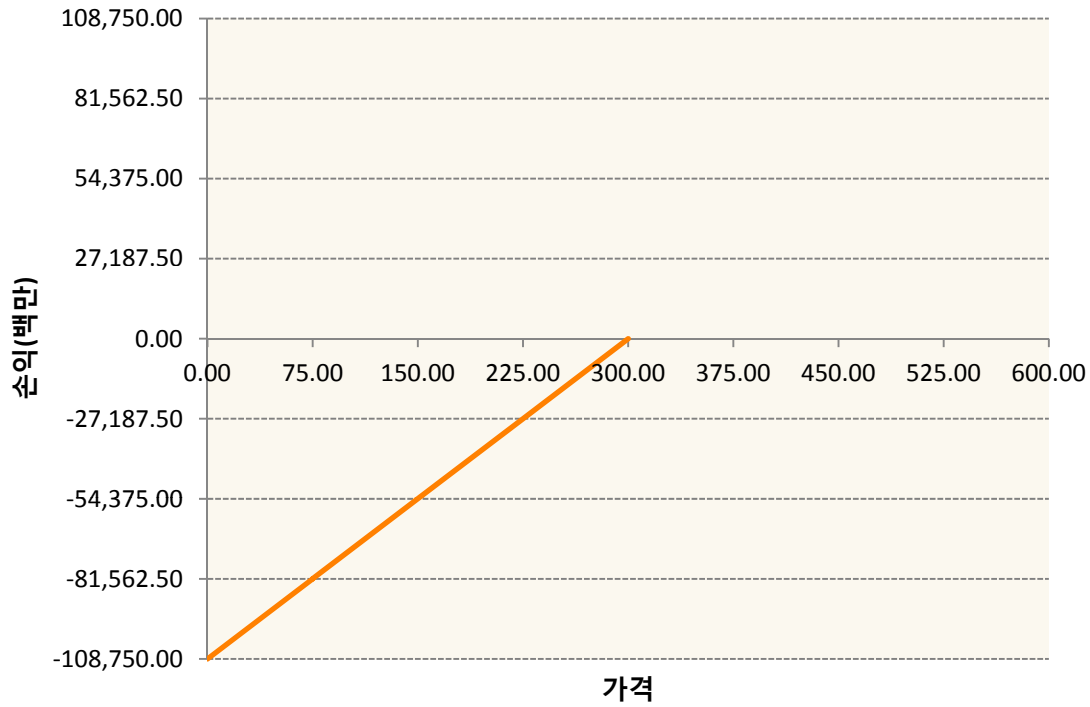


KR4201Q33023-2020-03 콜302.5





KR4301Q33005-2020-03 풋300



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q33007		2020-03 콜300					8,913
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,110	3,034	2,931	2,802	2,647	2,470	2,272
-5.33%	2,883	2,717	2,522	2,301	2,057	1,794	1,515
-2.67%	2,317	2,034	1,730	1,409	1,075	729	374
0%	1,182	794	400	0	-404	-810	-1,220
2.67%	-711	-1,144	-1,576	-2,008	-2,441	-2,873	-3,305
5.33%	-3,414	-3,813	-4,218	-4,629	-5,043	-5,461	-5,881
8.00%	-6,823	-7,131	-7,459	-7,805	-8,164	-8,534	-8,913
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5					8,039
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,544	2,488	2,409	2,305	2,178	2,029	1,859

-5.33%	2,384	2,255	2,096	1,910	1,702	1,474	1,228
-2.67%	1,963	1,726	1,465	1,184	887	577	256
0%	1,068	722	365	0	-372	-748	-1,129
2.67%	-499	-910	-1,322	-1,734	-2,146	-2,558	-2,971
5.33%	-2,835	-3,237	-3,643	-4,050	-4,460	-4,870	-5,282
8.00%	-5,886	-6,215	-6,560	-6,917	-7,284	-7,658	-8,039
KR4301Q33005 2020-03 풋300							7,658
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,594	-7,596	-7,600	-7,607	-7,618	-7,635	-7,658
-5.33%	-4,781	-4,795	-4,816	-4,846	-4,884	-4,931	-4,986
-2.67%	-2,044	-2,099	-2,167	-2,245	-2,333	-2,428	-2,531
0%	397	270	138	0	-141	-286	-433
2.67%	2,192	2,026	1,860	1,694	1,528	1,362	1,196
5.33%	3,177	3,047	2,910	2,768	2,623	2,474	2,323
8.00%	3,556	3,492	3,415	3,328	3,231	3,126	3,014

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

(단위:백만원)

23,059

공시일	2020-02-24
기준일	2020-02-21

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

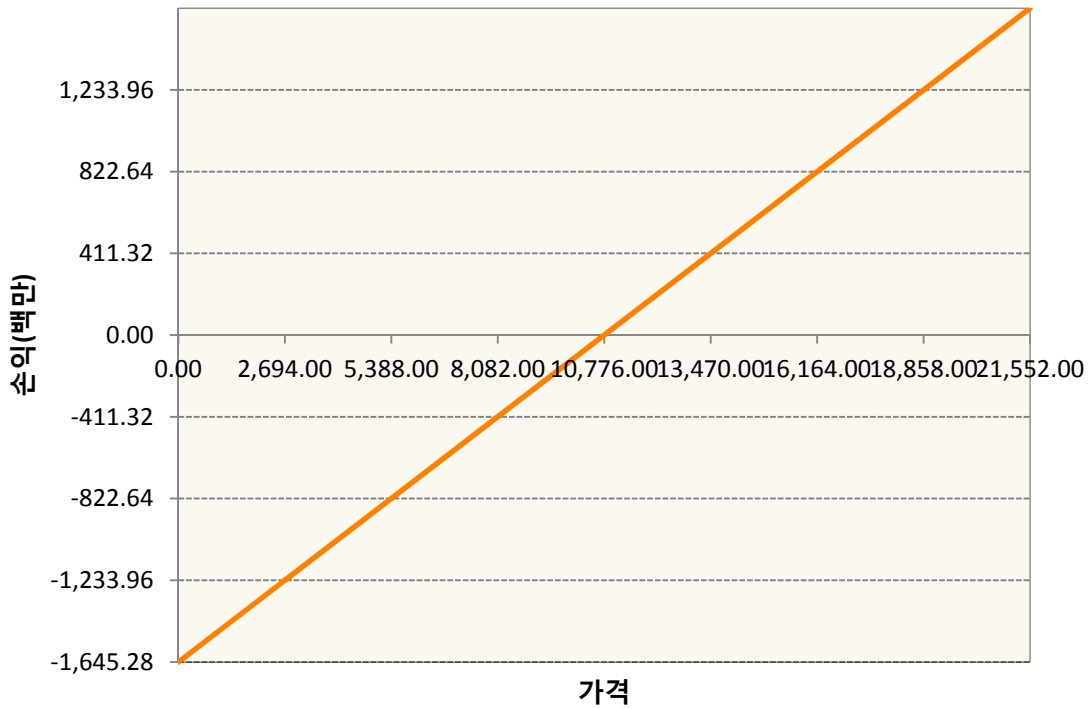
1. 계약금액

(단위:백만원)

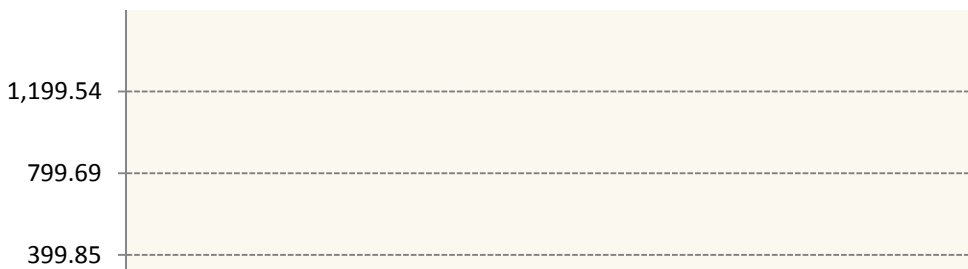
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,645	0	1,645	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,491	-4,491	장내
누계	통화	선도	0	2,186	-2,186	장외

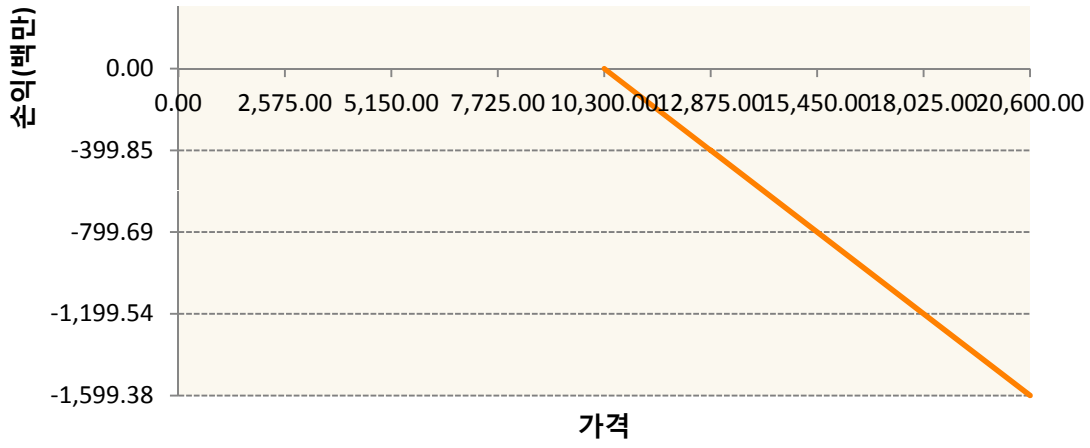
2. 만기시점의 손익구조

HCG0-HSCEI Futures Feb20

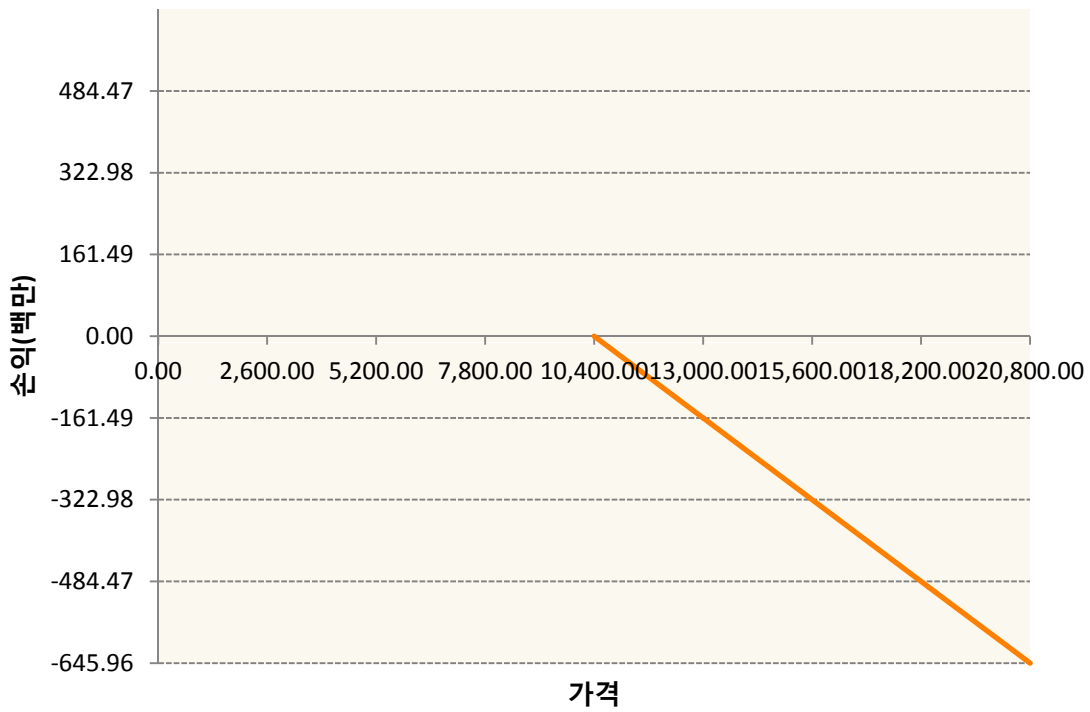


OHHIG0-C103-HSCEI

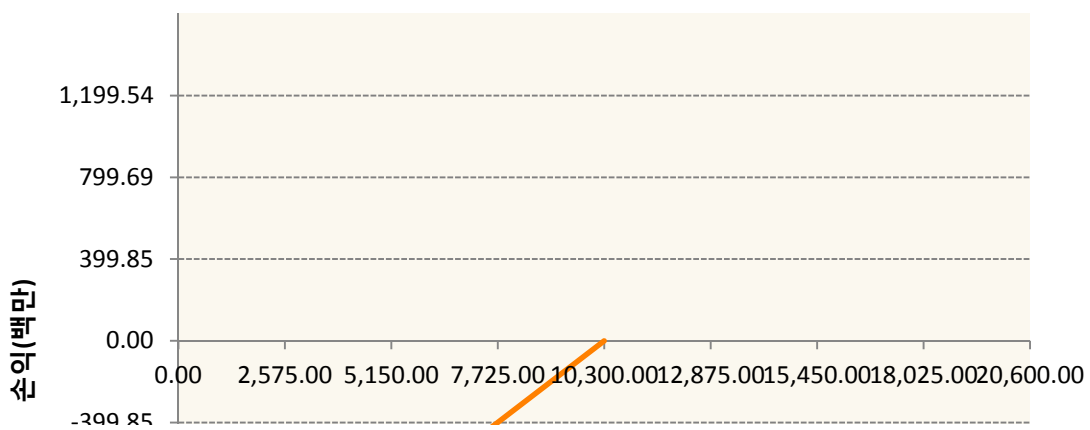


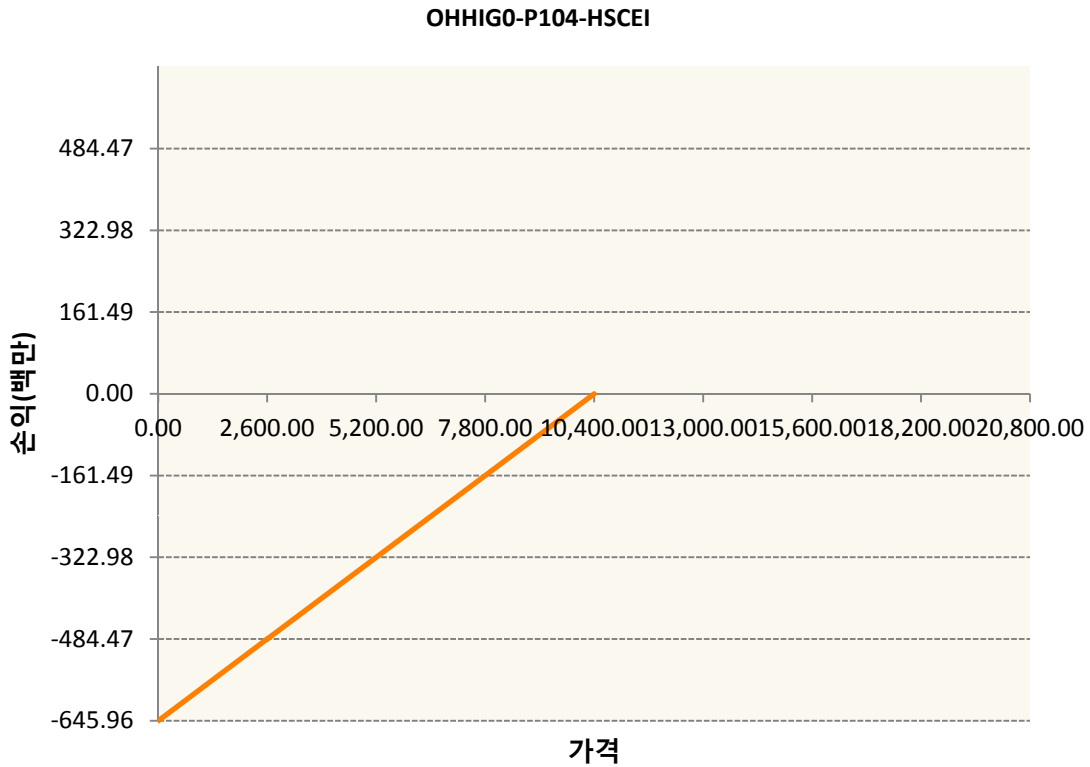


OHHIG0-C104-HSCEI



OHHIG0-P103-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E		175
HCG0 HSCEI Futures Feb20		132
OHHIG0-C1(HSCEI		128
OHHIG0-C1(HSCEI		52
OHHIG0-P1(HSCEI		128
OHHIG0-P1(HSCEI		52

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		505

공시일	2020-02-24
기준일	2020-02-21

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

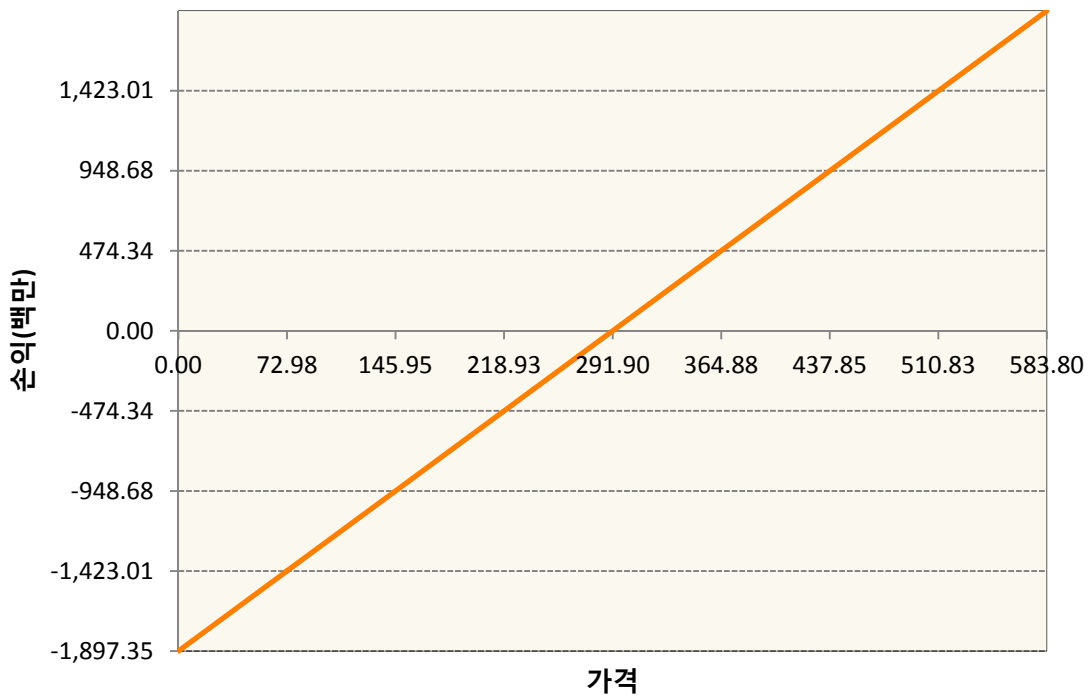
1. 계약금액

(단위:백만원)

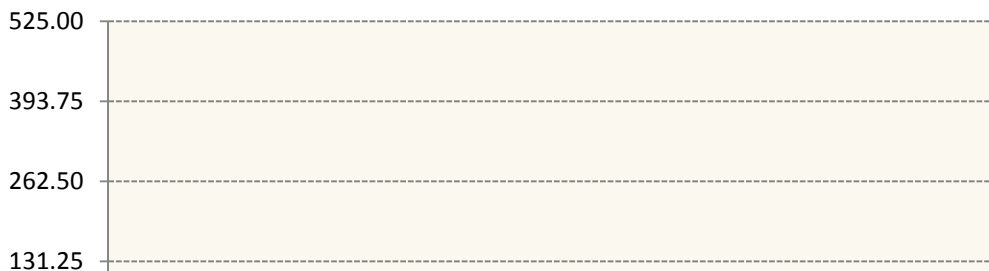
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	2,000	-2,000	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,897	0	1,897	장내
누계	유가증권	스왑	3,125	0	3,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,612	-3,612	장내

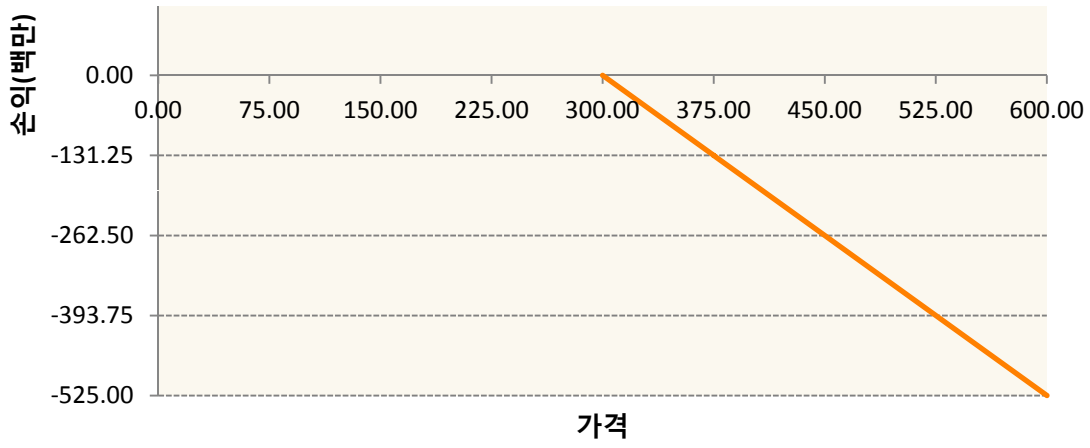
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

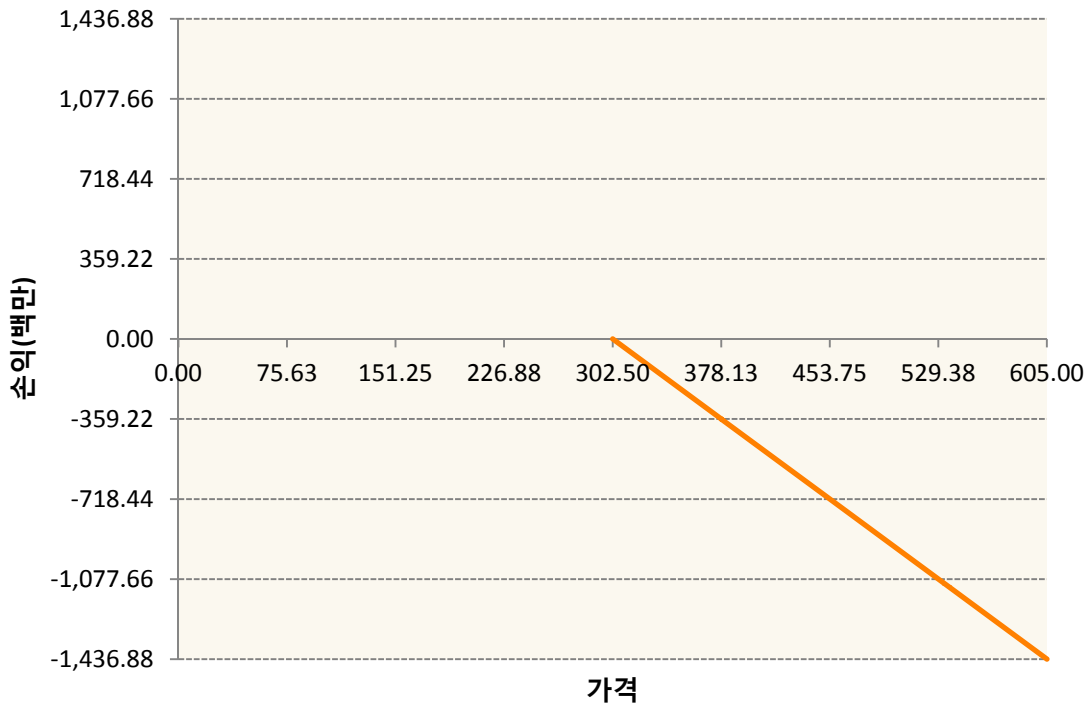


KR4201Q33007-2020-03 콜300

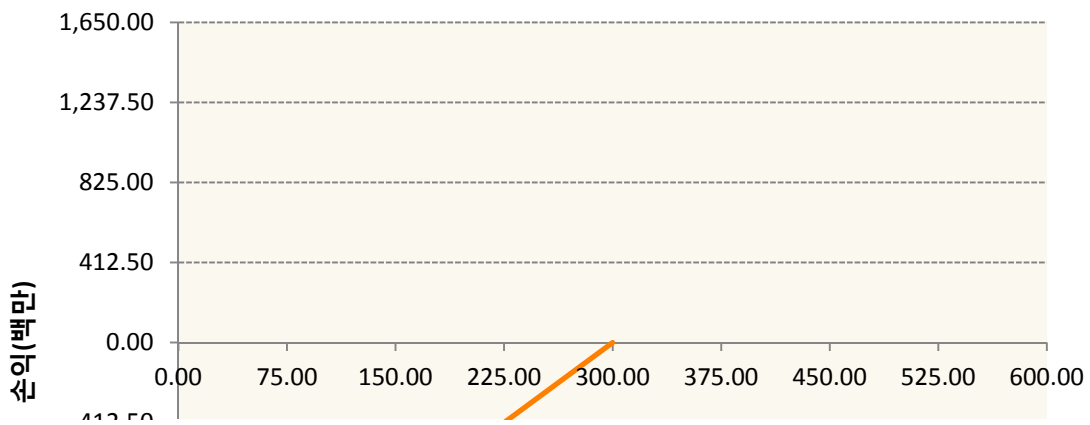




KR4201Q33023-2020-03 콜302.5



KR4301Q33005-2020-03 풋300





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						270
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-270	-270	-270	-270	-270	-270	-270	
-5.33%	-180	-180	-180	-180	-180	-180	-180	
-2.67%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	90	90	90	90	90	90	90	
5.33%	180	180	180	180	180	180	180	
8.00%	270	270	270	270	270	270	270	
KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						152
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-152	-152	-152	-152	-152	-152	-152	
-5.33%	-101	-101	-101	-101	-101	-101	-101	
-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%	101	101	101	101	101	101	101	
8.00%	152	152	152	152	152	152	152	
KR4201Q33007		2020-03 콜300						27
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	9	9	9	9	8	7	7	
-5.33%	9	8	8	7	6	5	5	
-2.67%	7	6	5	4	3	2	1	
0%	4	2	1	0	-1	-2	-4	
2.67%	-2	-3	-5	-6	-7	-9	-10	
5.33%	-10	-12	-13	-14	-15	-17	-18	
8.00%	-21	-22	-23	-24	-25	-26	-27	
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5						69
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	22	21	21	20	19	18	16
-5.33%	21	19	18	16	15	13	11
-2.67%	17	15	13	10	8	5	2
0%	9	6	3	0	-3	-6	-10
2.67%	-4	-8	-11	-15	-19	-22	-26
5.33%	-24	-28	-31	-35	-38	-42	-46
8.00%	-51	-54	-57	-60	-63	-66	-69
KR4301Q33005 2020-03 풋300							116
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-115	-115	-115	-115	-116	-116	-116
-5.33%	-73	-73	-73	-74	-74	-75	-76
-2.67%	-31	-32	-33	-34	-35	-37	-38
0%	6	4	2	0	-2	-4	-7
2.67%	33	31	28	26	23	21	18
5.33%	48	46	44	42	40	38	35
8.00%	54	53	52	50	49	47	46

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

(단위:백만원)

605

공시일	2020-02-24
기준일	2020-02-21

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

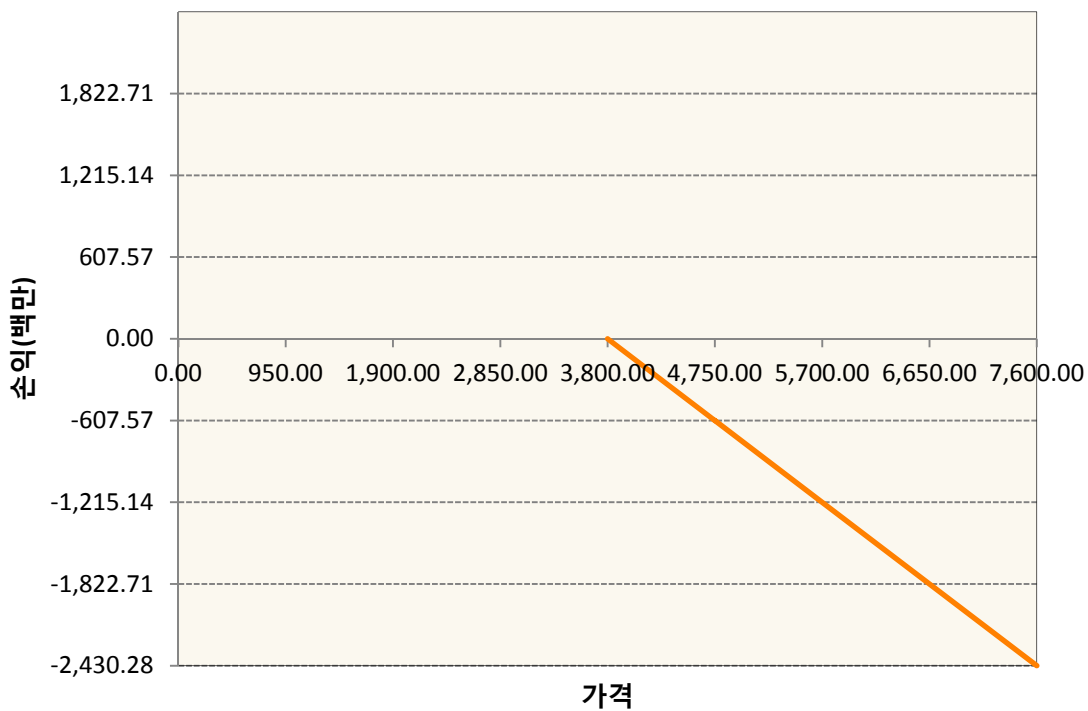
1. 계약금액

(단위:백만원)

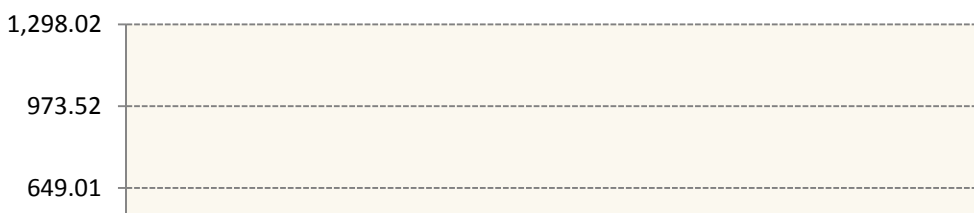
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	396	0	396	
누계	유가증권	스왑	11,748	0	11,748	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,457	-7,457	장내
누계	통화	선도	0	3,425	-3,425	장외

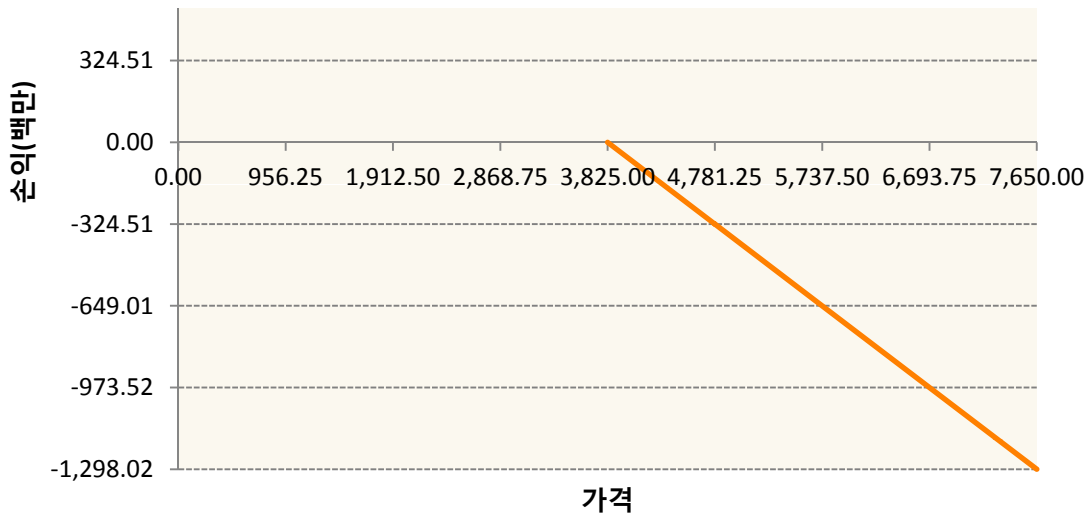
2. 만기시점의 손익구조

OESXG0-C3800-EURO STOXX 50

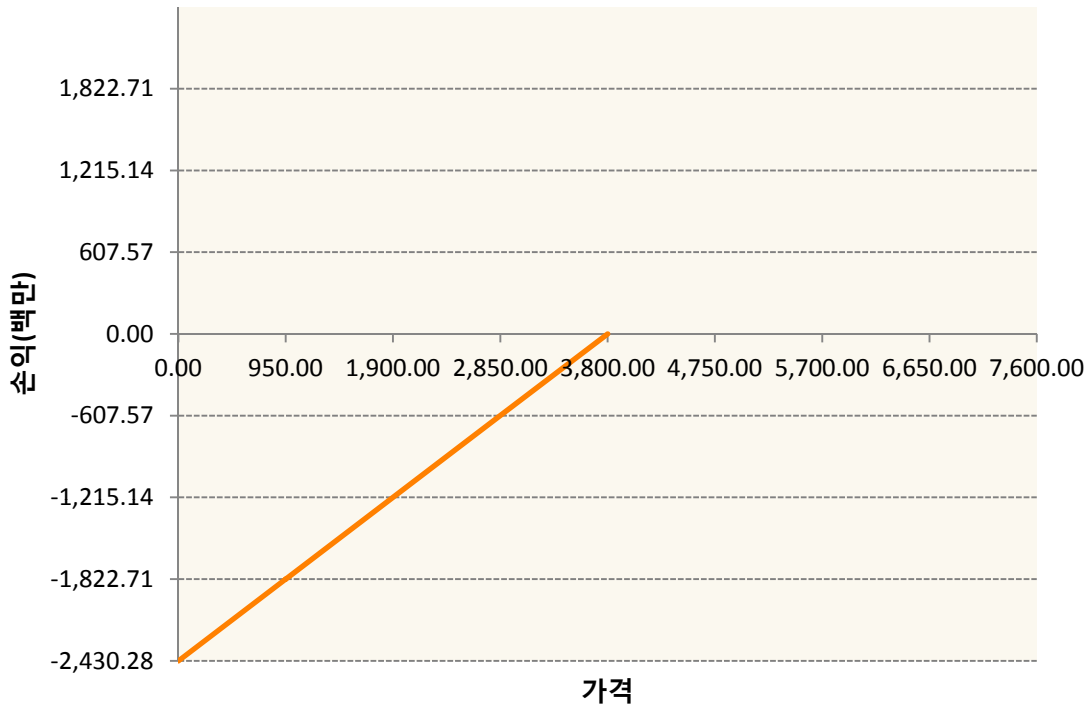


OESXG0-C3825-EURO STOXX 50

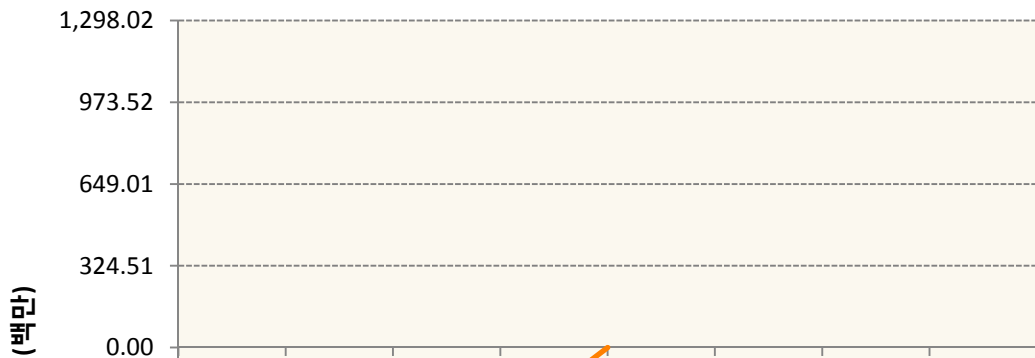


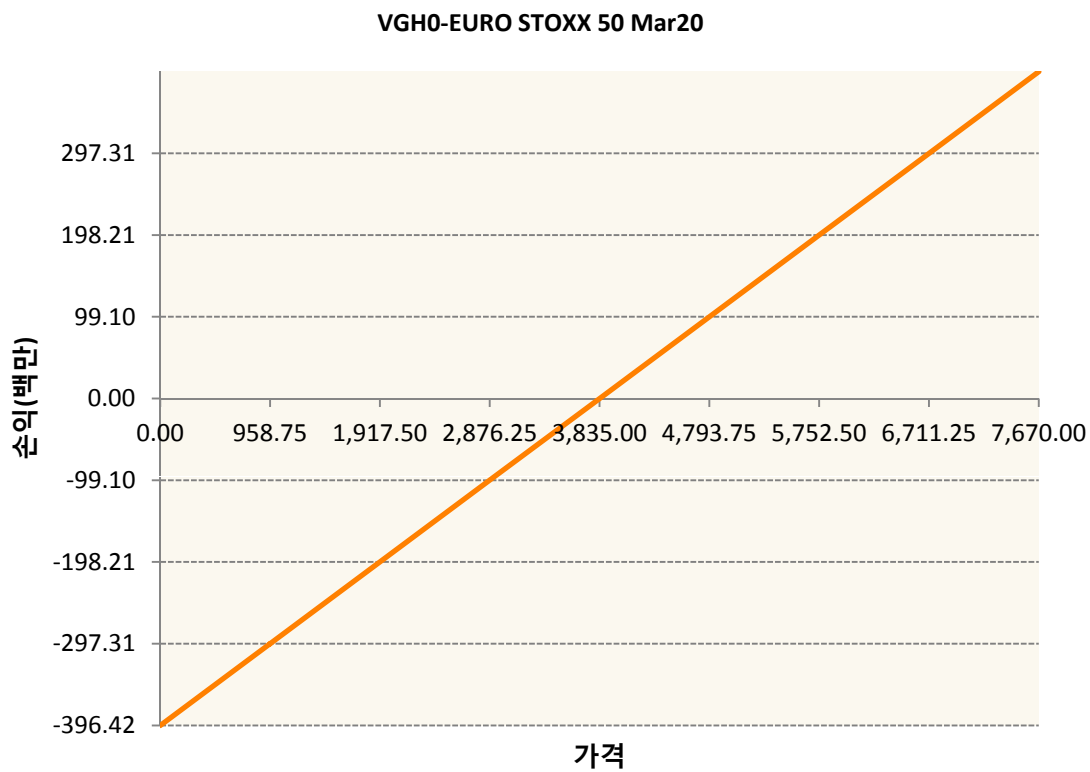
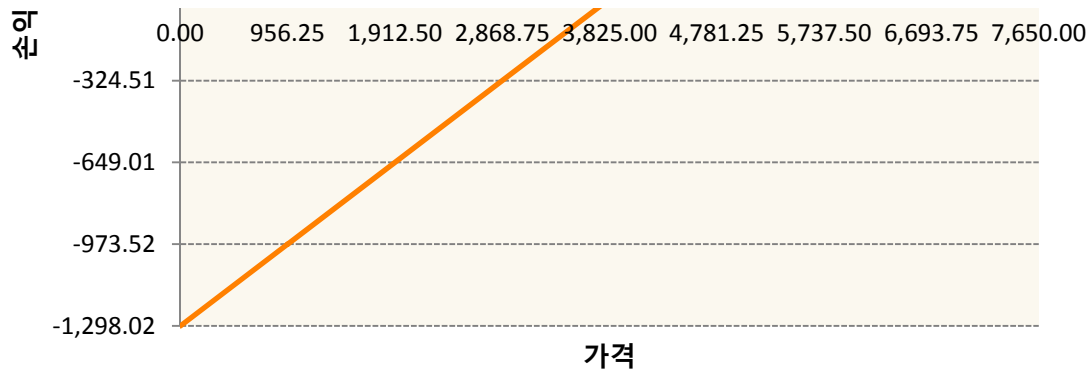


OESXG0-P3800-EURO STOXX 50



OESXG0-P3825-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		10
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E		274
OESXG0-C3& EURO STOXX 50		194
OESXG0-C3& EURO STOXX 50		104
OESXG0-P3& EURO STOXX 50		194
OESXG0-P3& EURO STOXX 50		104
VGHO EURO STOXX 50 Mar20		32

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

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

(단위:백만원)

931

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

(단위:백만원)

82

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

(단위:백만원)

121

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

(단위:백만원)

43

공시일	2020-02-24
기준일	2020-02-21

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

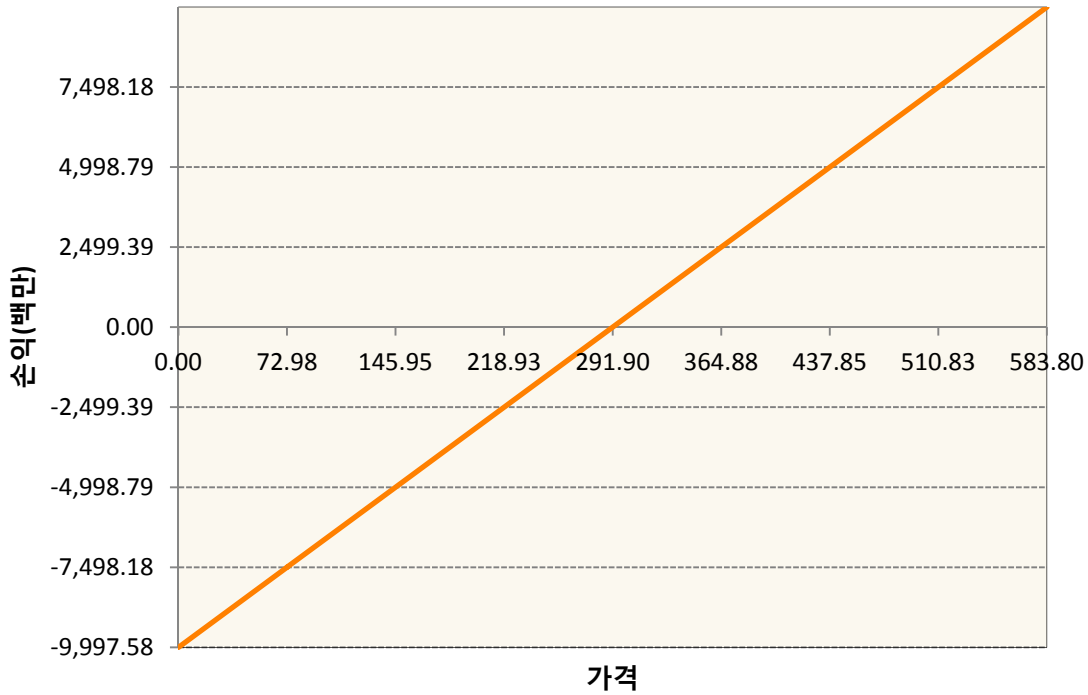
1. 계약금액

(단위:백만원)

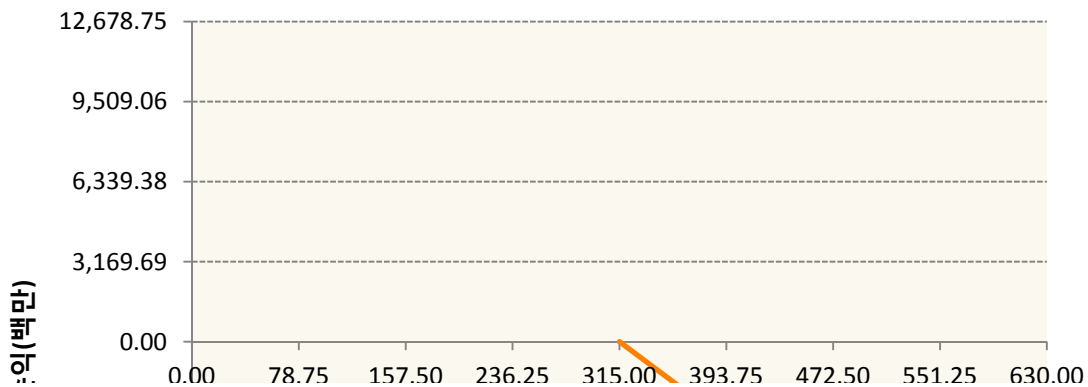
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,998	0	9,998	장내
누계	유가증권	옵션	2,257	20,854	-18,598	장내

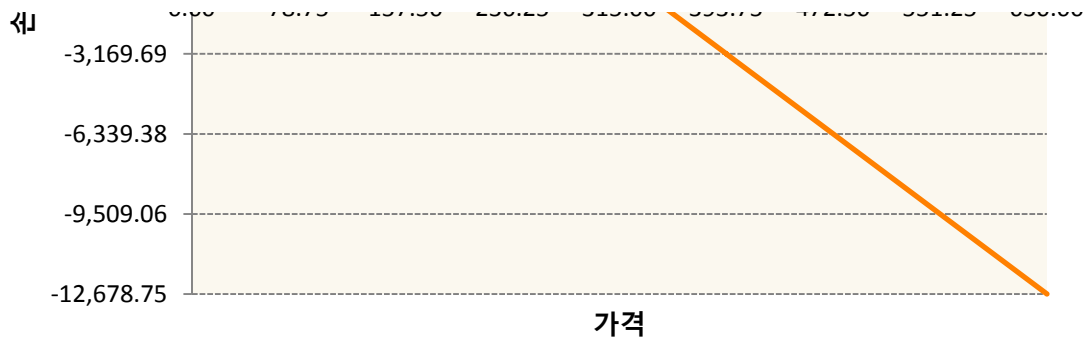
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

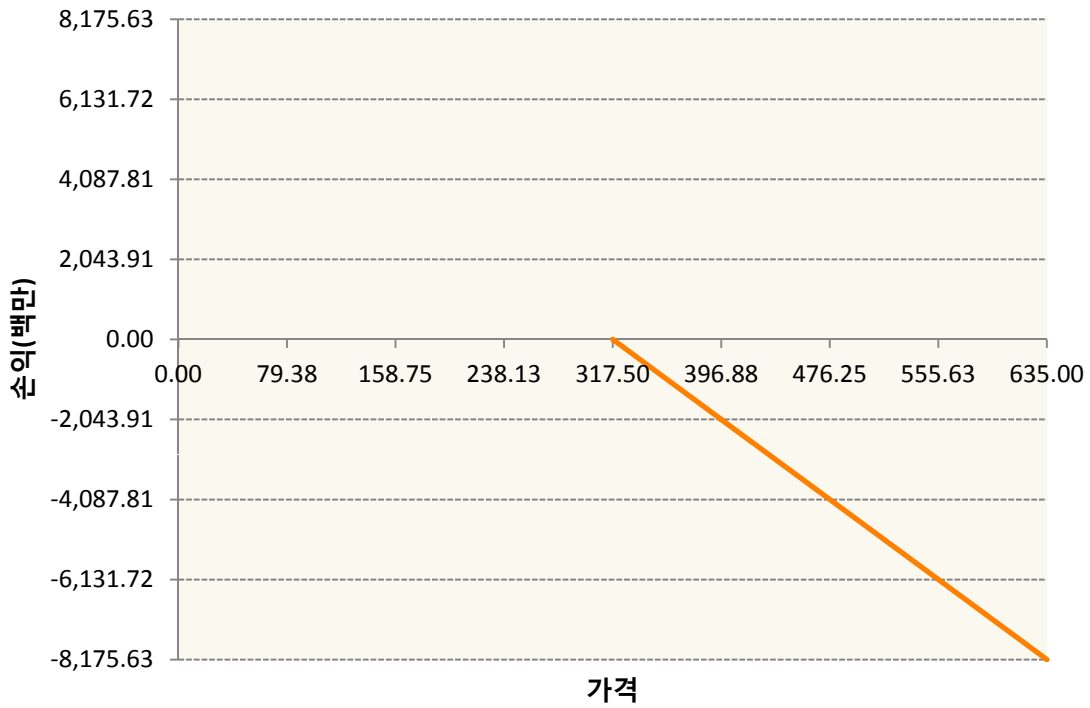


KR4201Q33155-2020-03 콜315

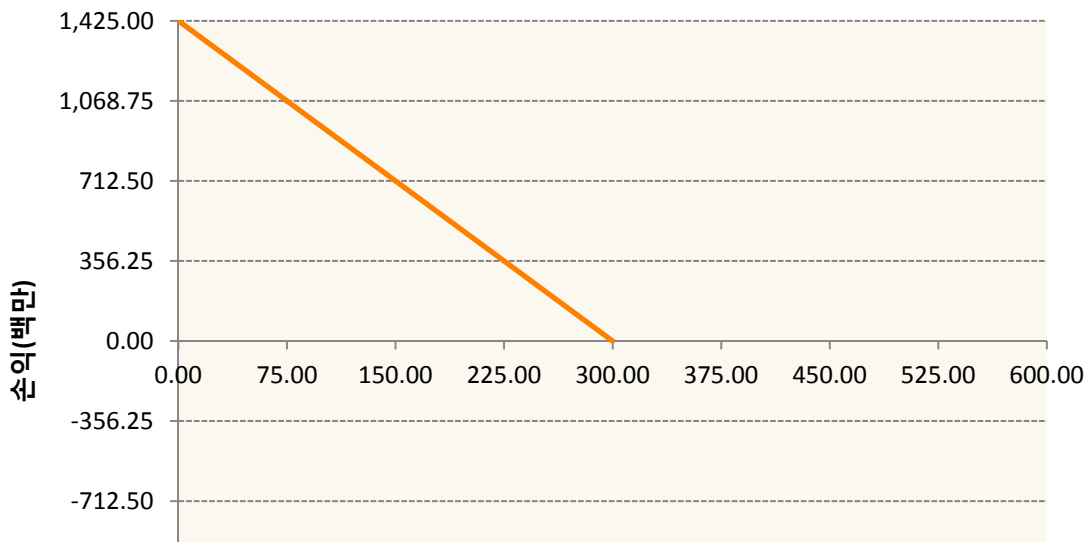


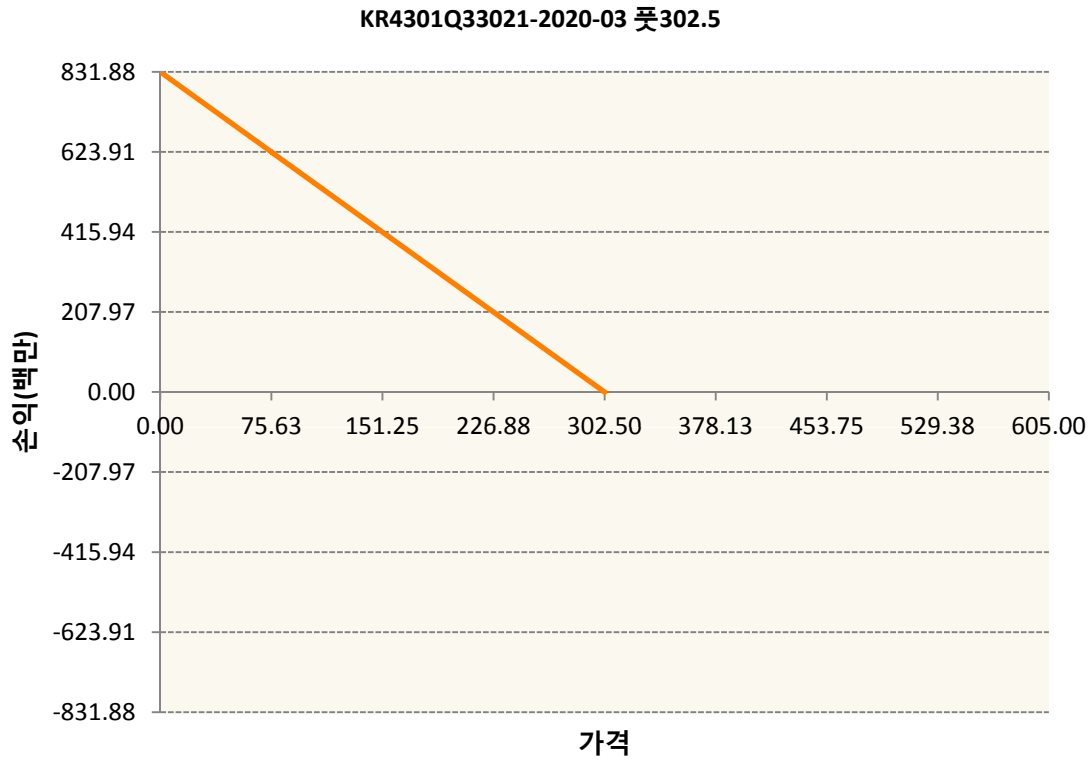
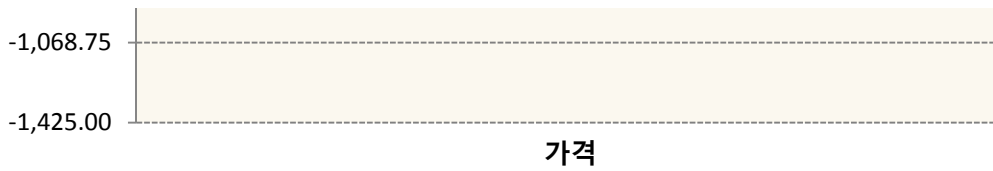


KR4201Q33171-2020-03 콜317.5



KR4301Q33005-2020-03 풋300





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						801
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-801	-801	-801	-801	-801	-801	-801	
-5.33%	-534	-534	-534	-534	-534	-534	-534	
-2.67%	-267	-267	-267	-267	-267	-267	-267	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	267	267	267	267	267	267	267	
5.33%	534	534	534	534	534	534	534	
8.00%	801	801	801	801	801	801	801	
KR4201Q33155		2020-03 콜315						412
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	77	76	74	72	68	63	56	
-5.33%	75	72	68	62	54	45	34	
-2.67%	68	61	52	41	28	13	-3	

0%	48	34	18	0	-19	-40	-62
2.67%	2	-20	-44	-68	-94	-120	-147
5.33%	-84	-113	-143	-173	-203	-233	-263
8.00%	-222	-254	-285	-317	-349	-380	-412
KR4201Q33171 2020-03 콜317.5							242
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	40	40	39	38	36	33	30
-5.33%	39	38	36	33	29	24	18
-2.67%	36	33	28	22	15	6	-3
0%	27	19	10	0	-11	-23	-36
2.67%	3	-10	-23	-38	-53	-69	-85
5.33%	-43	-61	-79	-97	-116	-135	-154
8.00%	-120	-141	-161	-181	-201	-222	-242
KR4301Q33005 2020-03 풋300							100
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	100	100	100	100	100	100	100
-5.33%	63	63	63	63	64	65	65
-2.67%	27	28	28	29	31	32	33
0%	-5	-4	-2	0	2	4	6
2.67%	-29	-27	-24	-22	-20	-18	-16
5.33%	-42	-40	-38	-36	-34	-32	-30
8.00%	-47	-46	-45	-44	-42	-41	-39
KR4301Q33021 2020-03 풋302.5							60
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	59	59	59	59	59	60	60
-5.33%	38	38	38	38	38	39	39
-2.67%	17	17	18	18	19	19	20
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-18	-17	-16	-14	-13	-12	-11
5.33%	-27	-26	-25	-24	-23	-22	-20
8.00%	-32	-31	-30	-29	-28	-28	-27

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

(단위:백만원)

1,240

공시일	2020-02-24
기준일	2020-02-21

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	218,859	0	218,859	

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	2020-02-24
기준일	2020-02-21

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	4,853	-4,853	
누계	유가증권	수익증권	185,477	0	185,477	

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	2020-02-24
기준일	2020-02-21

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	543,327	0	543,327	
누계	통화	선도	0	574,854	-574,854	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019Z03 KRW/USD 24-02-20E	3,869
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,935
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	2,070
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	193
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,557
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,451
FX21020F03 KRW/USD 28-02-20E	1,935
FX21020F03 KRW/USD 28-02-20E	2,999
FX21020F03 KRW/USD 31-03-20E	3,096
FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E	2,902
FX21020F04 KRW/USD 28-02-20E	193
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,612
FX21020G00 KRW/USD 06-03-20E	2,418
FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	967
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,200
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,229
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	967
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	1,935
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	3,328
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,328
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,935
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,869
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

123

공시일	2020-02-24
기준일	2020-02-21

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

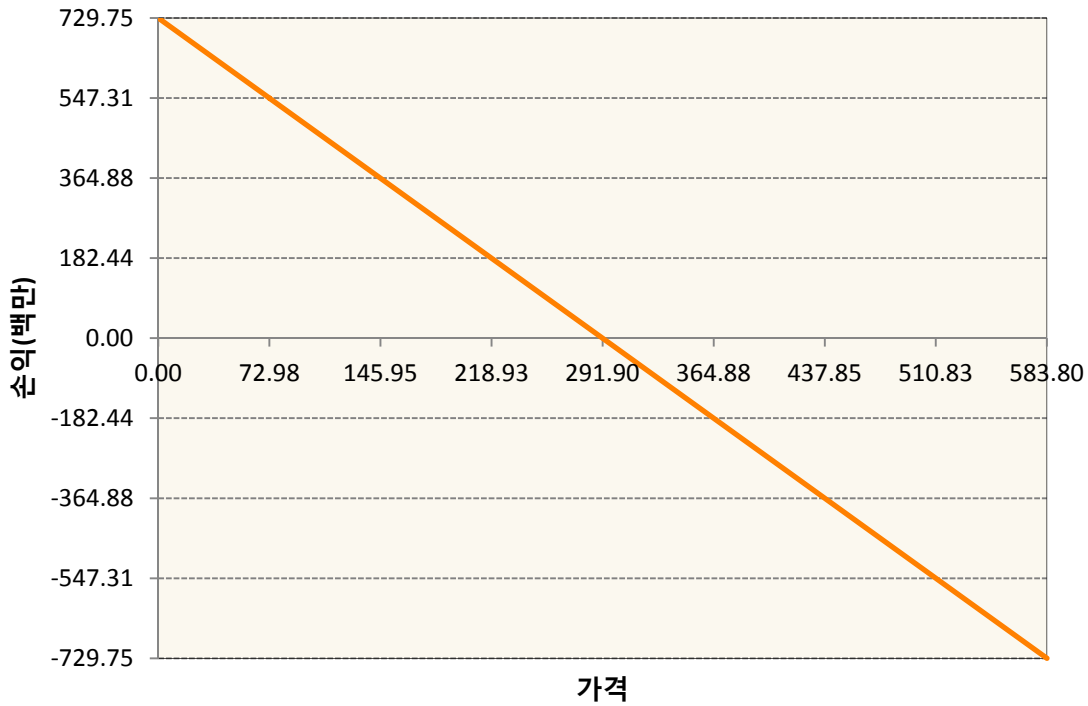
1. 계약금액

(단위:백만원)

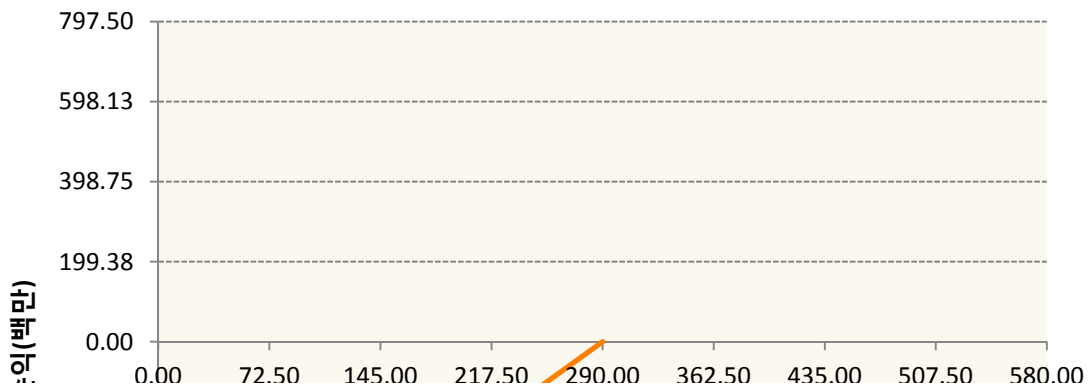
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	730	-730	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,503	-3,503	장내

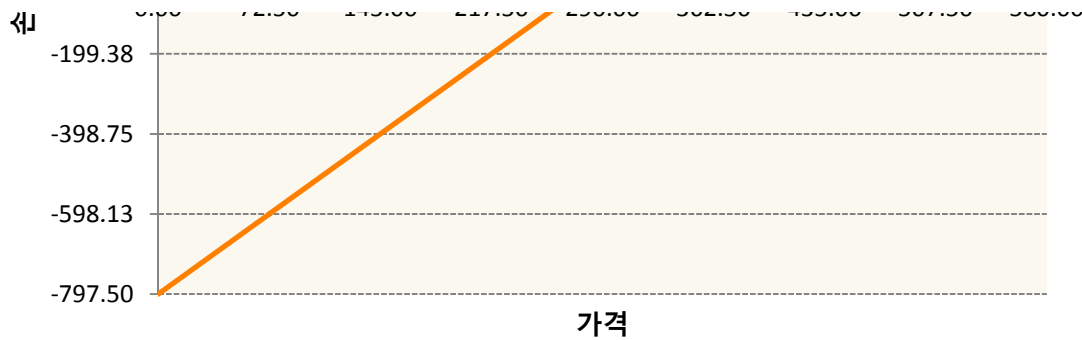
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

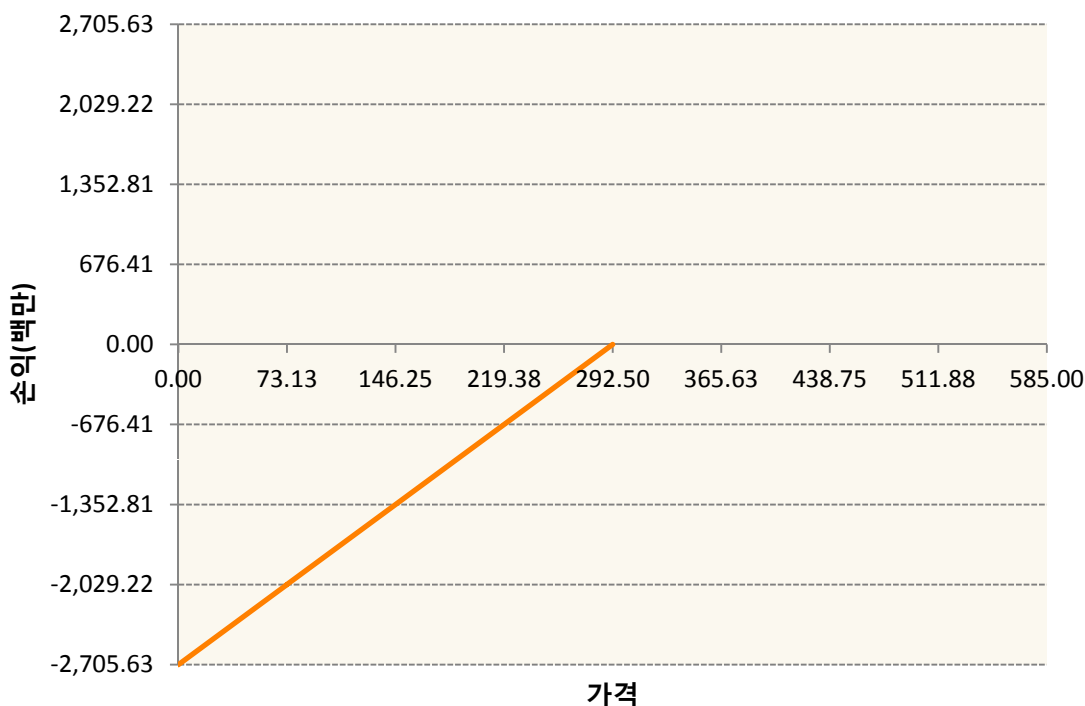


KR4301Q32908-2020-03 풋290





KR4301Q32924-2020-03 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						58
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	58	58	58	58	58	58	58	
-5.33%	39	39	39	39	39	39	39	
-2.67%	19	19	19	19	19	19	19	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39	
8.00%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58	
KR4301Q32908		2020-03 풋290						48
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-46	-47	-47	-47	-47	-48	-48
-5.33%	-26	-26	-27	-28	-28	-29	-30
-2.67%	-8	-9	-10	-12	-13	-14	-15
0%	4	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	9	9	8	7	6	5	4
5.33%	11	11	11	10	9	9	8
8.00%	12	12	11	11	11	11	10

KR4301Q32924 2020-03 풋292.5 172

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-168	-168	-169	-169	-170	-171	-172
-5.33%	-98	-99	-100	-102	-104	-107	-109
-2.67%	-34	-37	-41	-44	-47	-51	-55
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12
2.67%	38	35	31	28	24	20	17
5.33%	48	46	44	42	40	37	34
8.00%	50	50	49	48	47	45	44

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

(단위:백만원)

277

공시일	2020-02-24
기준일	2020-02-21

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	469	-469	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	10,912	0	10,912	
누계	통화	선도	1,112	11,705	-10,593	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020F03(KRW/USD 28-02-20E	211
FX21020F04(KRW/USD 28-02-20E	301
FX21020F04(KRW/USD 28-02-20E	5
FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	329
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	91
FX21020G02 USD/KRW 28-02-20E	29
FX21020G03 USD/KRW 28-02-20E	23
FX21020G04 USD/KRW 28-02-20E	37
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

346

공시일	2020-02-24
기준일	2020-02-21

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

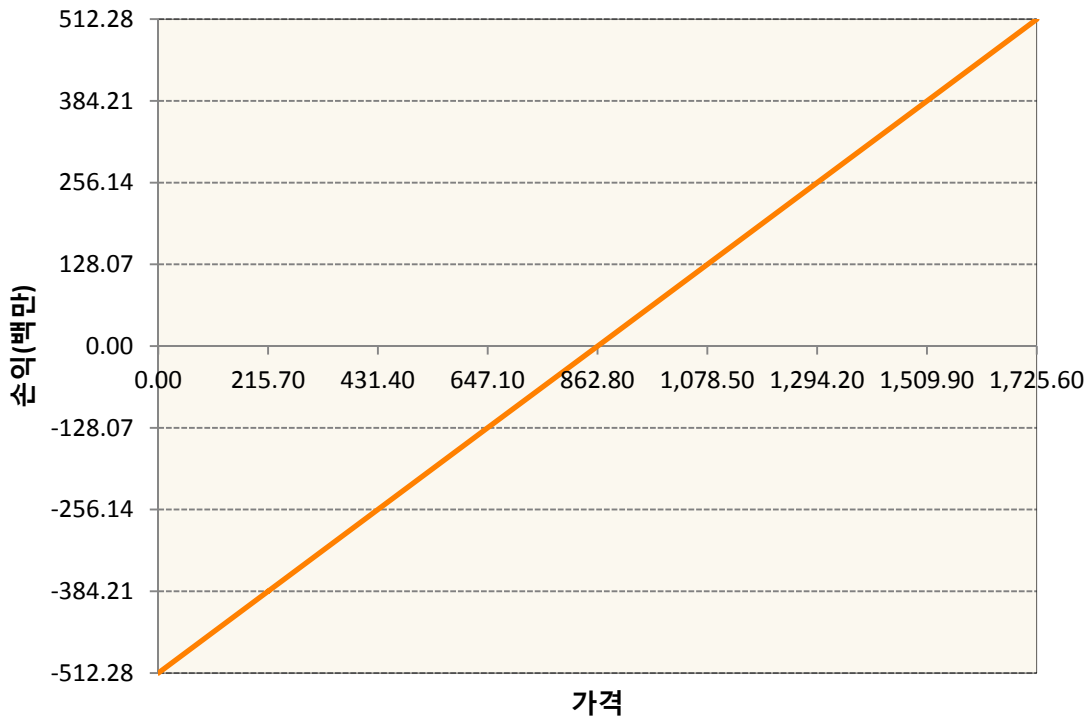
1. 계약금액

(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	512	0	512	
누계	유가증권	스왑	1,077	0	1,077	장외
누계	통화	선도	183	692	-509	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCH0-VN30 Index Future Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	86
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	41

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

(단위:백만원)

117

공시일	2020-02-24
기준일	2020-02-21

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

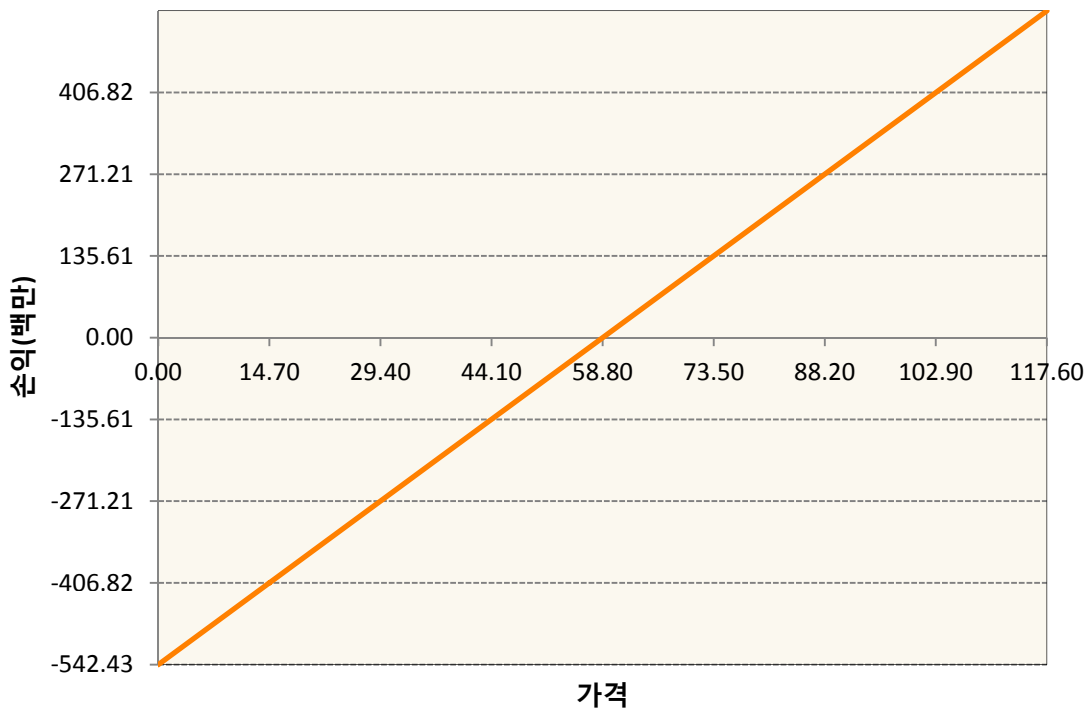
1. 계약금액

(단위:백만원)

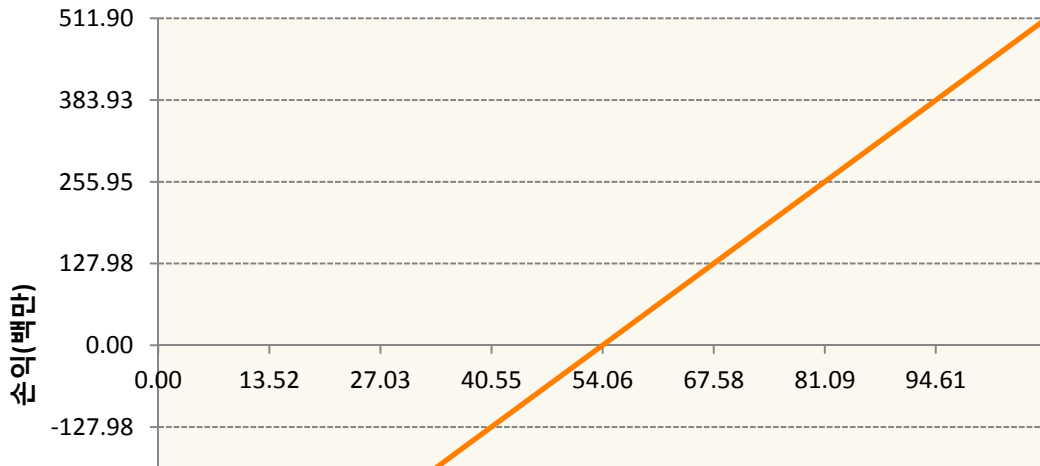
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,212	194	2,019	

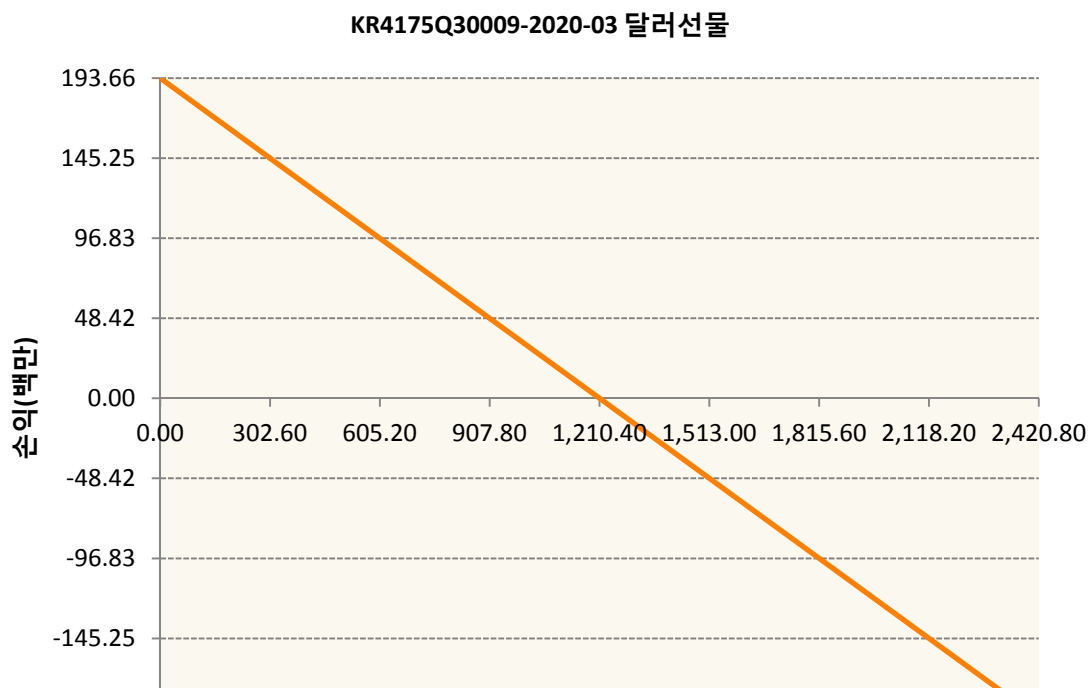
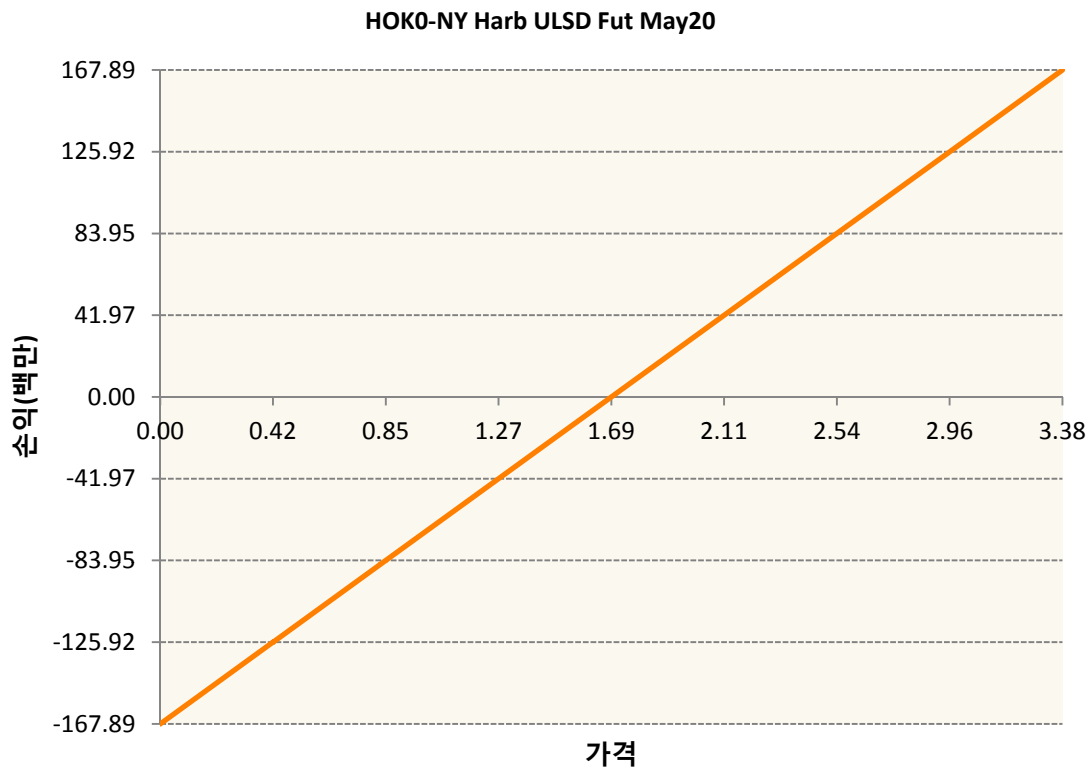
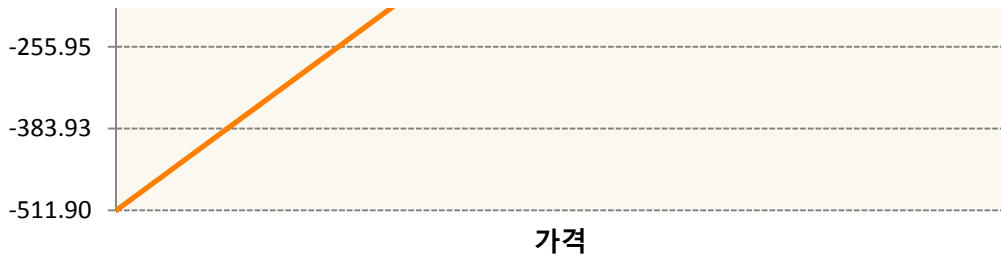
2. 만기시점의 손익구조

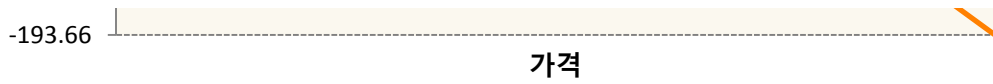
COK0-BRENT CRUDE FUTR May20



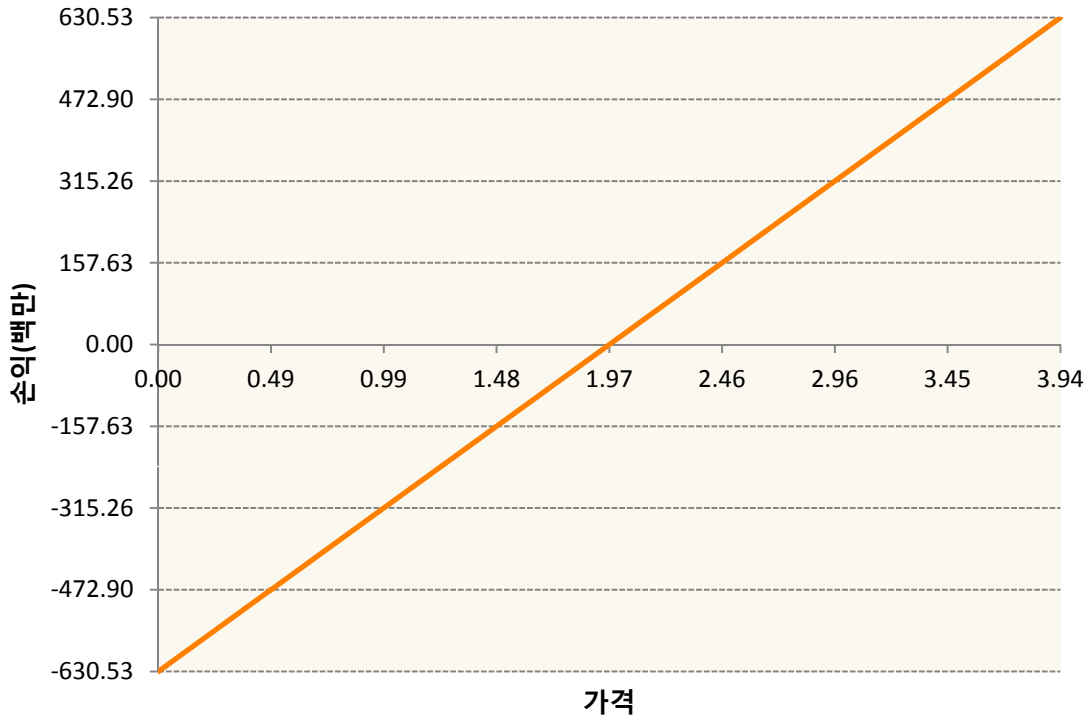
CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20



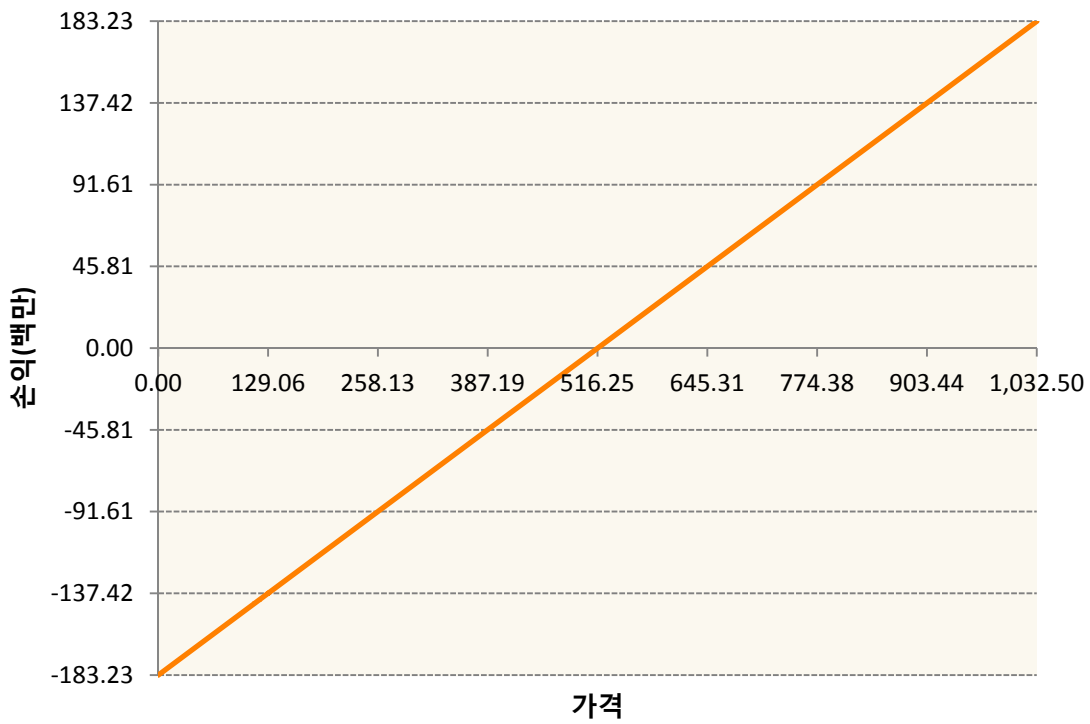




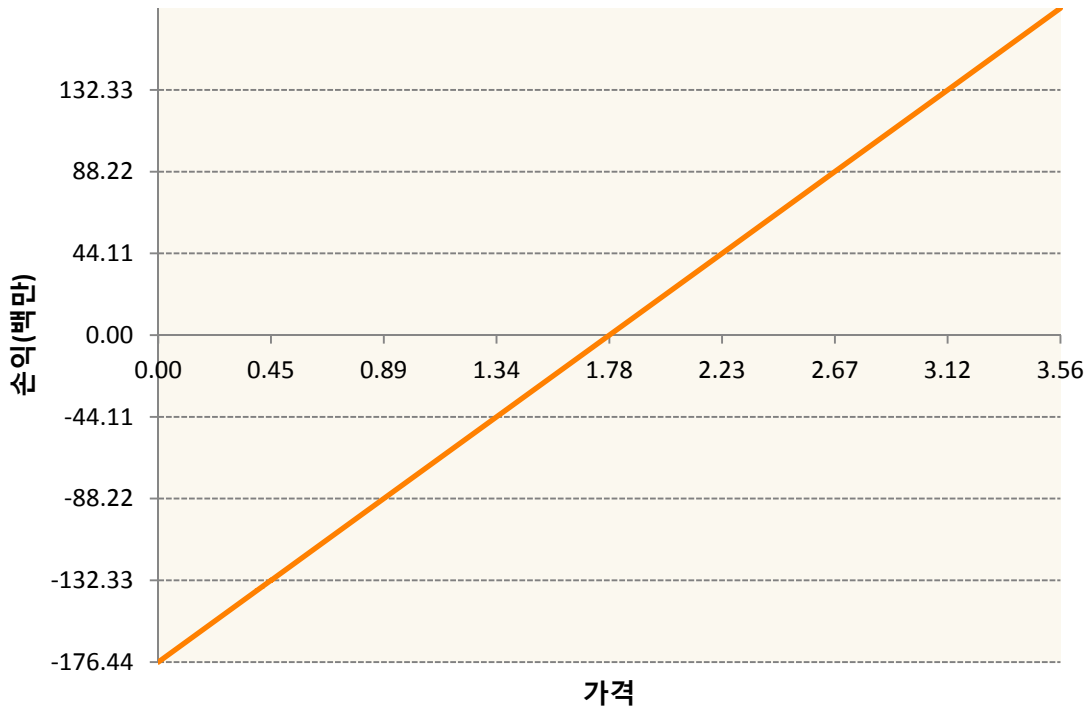
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



QSK0-Low Su Gasoil G Mar20



XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	43
CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	41
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	13
KR4175Q30C	2020-03 달러선물	15
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	50
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	15
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	14

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

(단위:백만원)

355

공시일	2020-02-24
기준일	2020-02-21

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

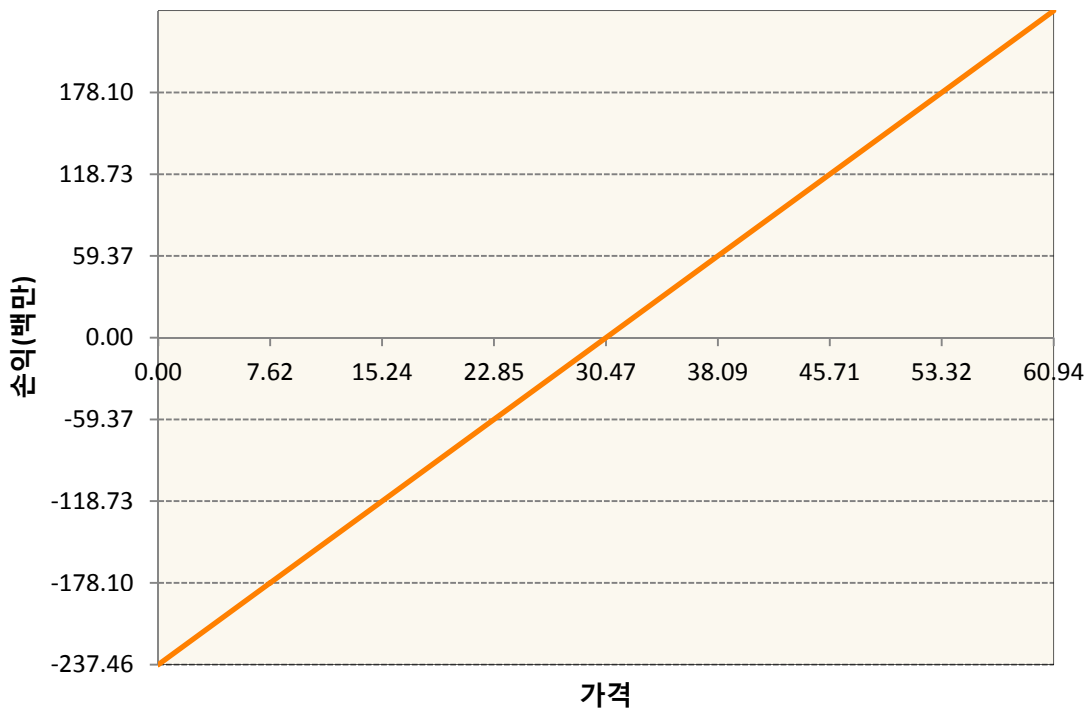
1. 계약금액

(단위:백만원)

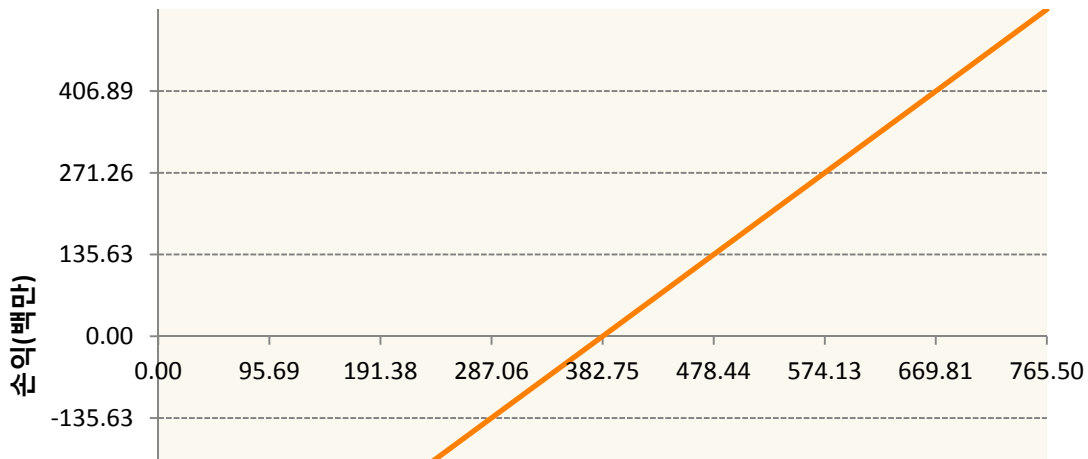
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,741	157	2,584	

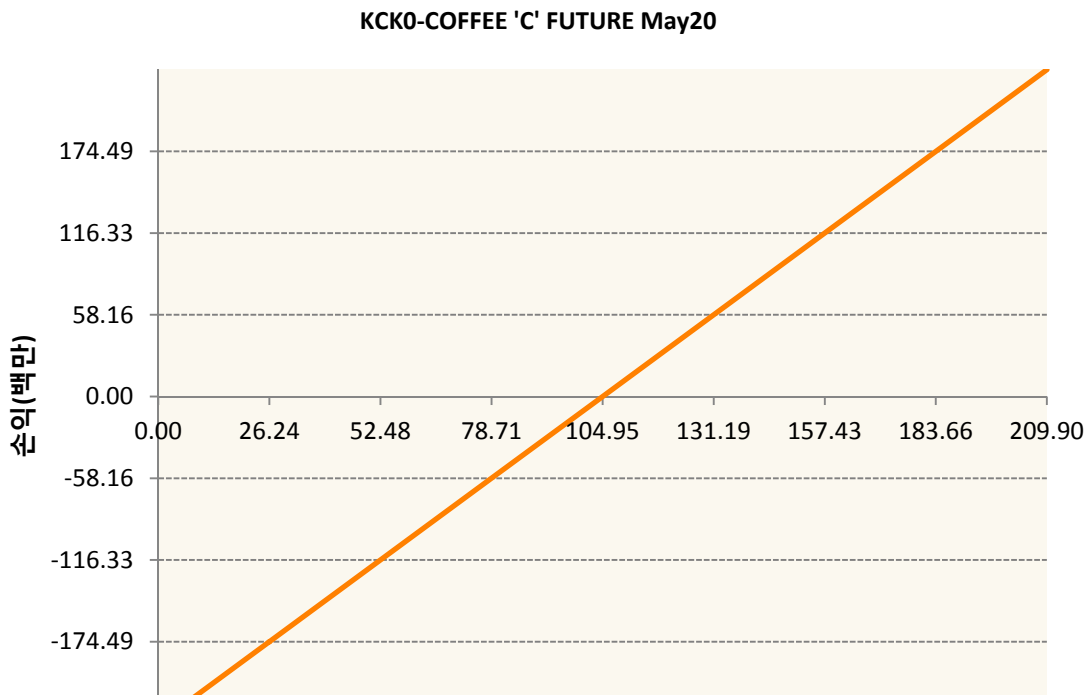
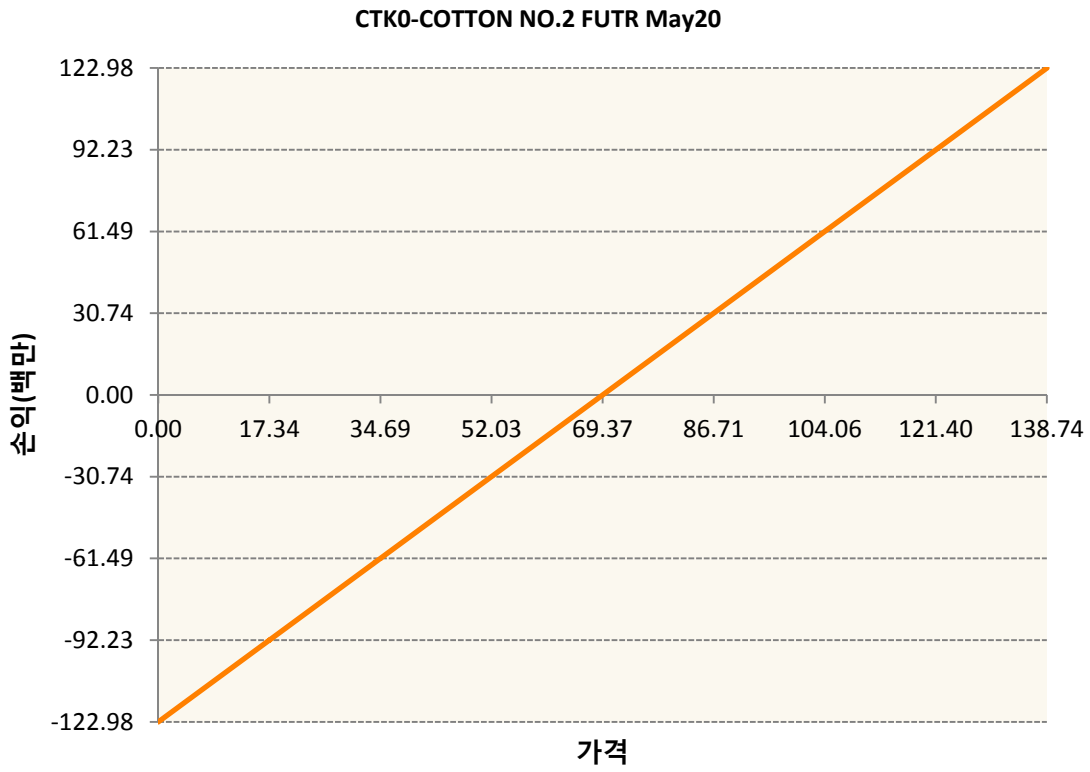
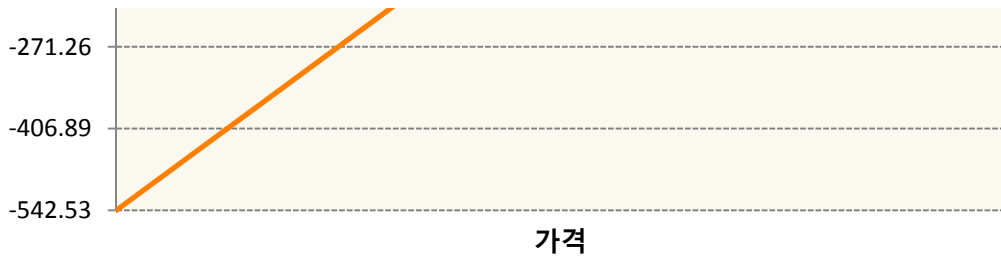
2. 만기시점의 손익구조

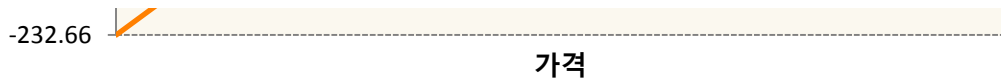
BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20



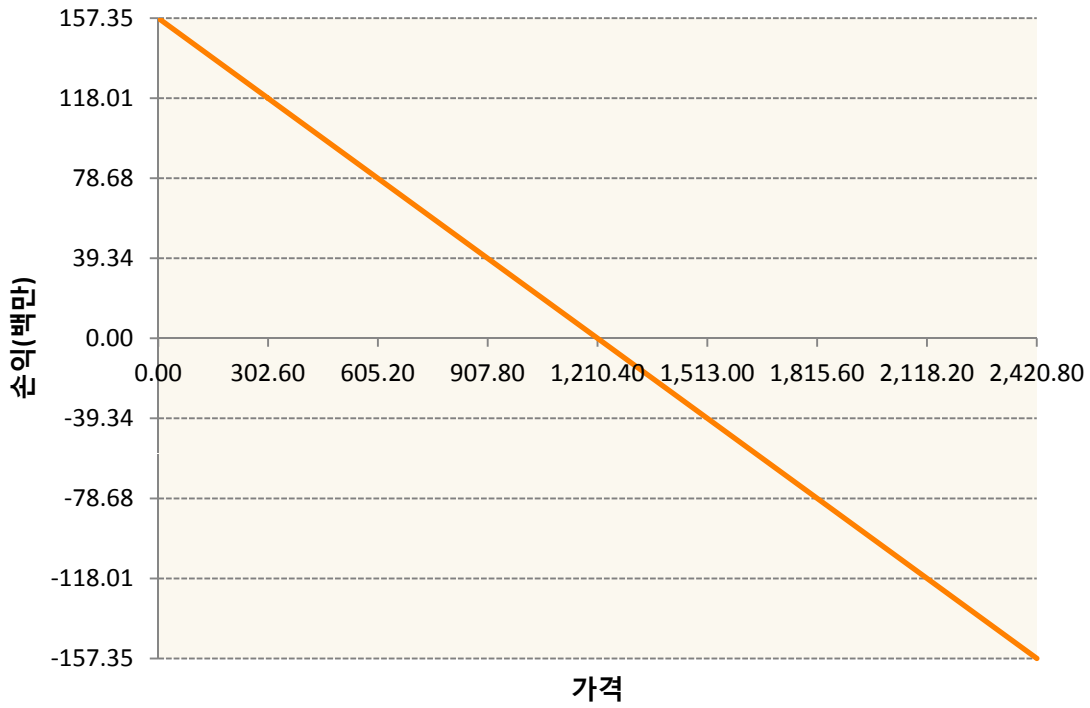
CK0-CORN FUTURE May20



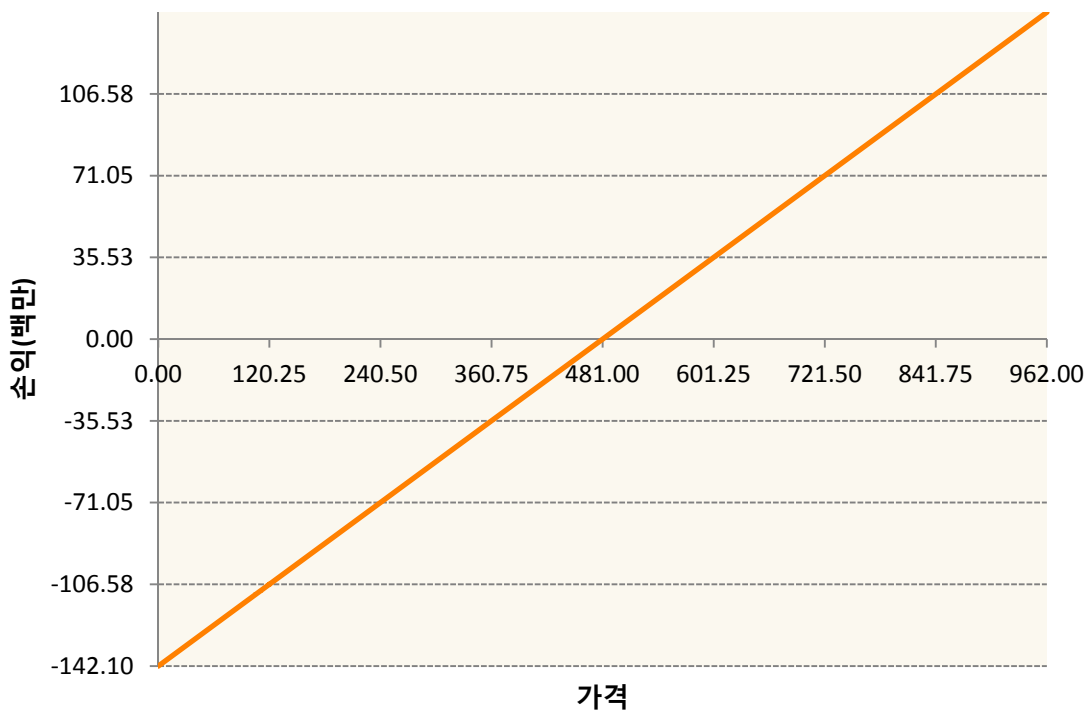




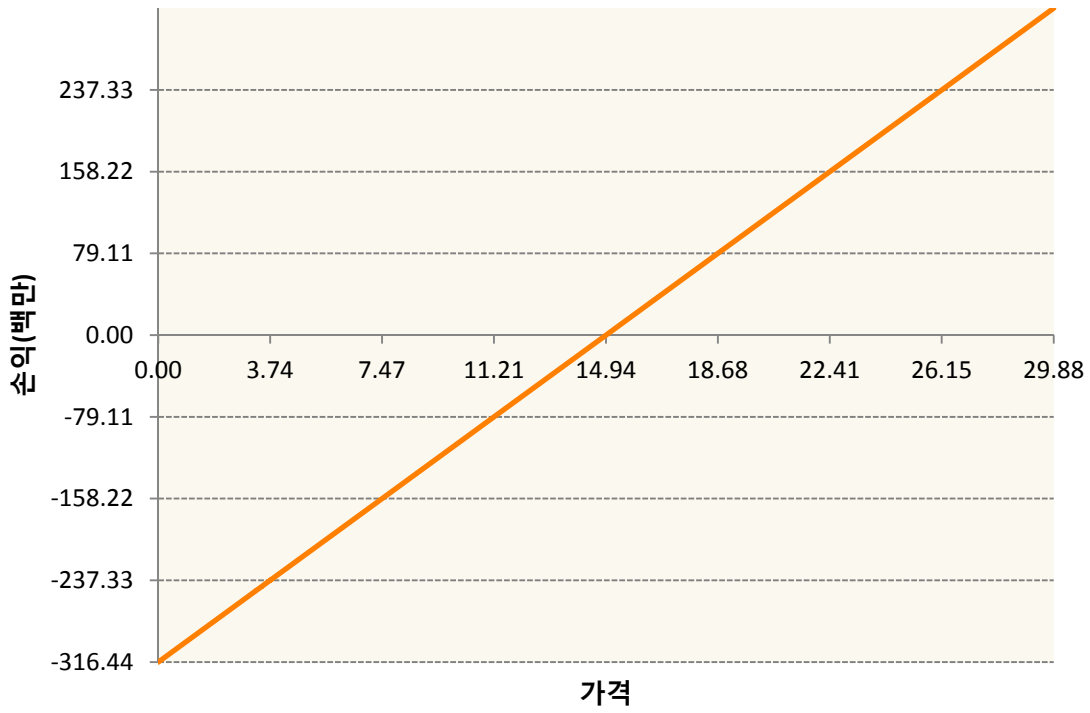
KR4175Q30009-2020-03 달러선물



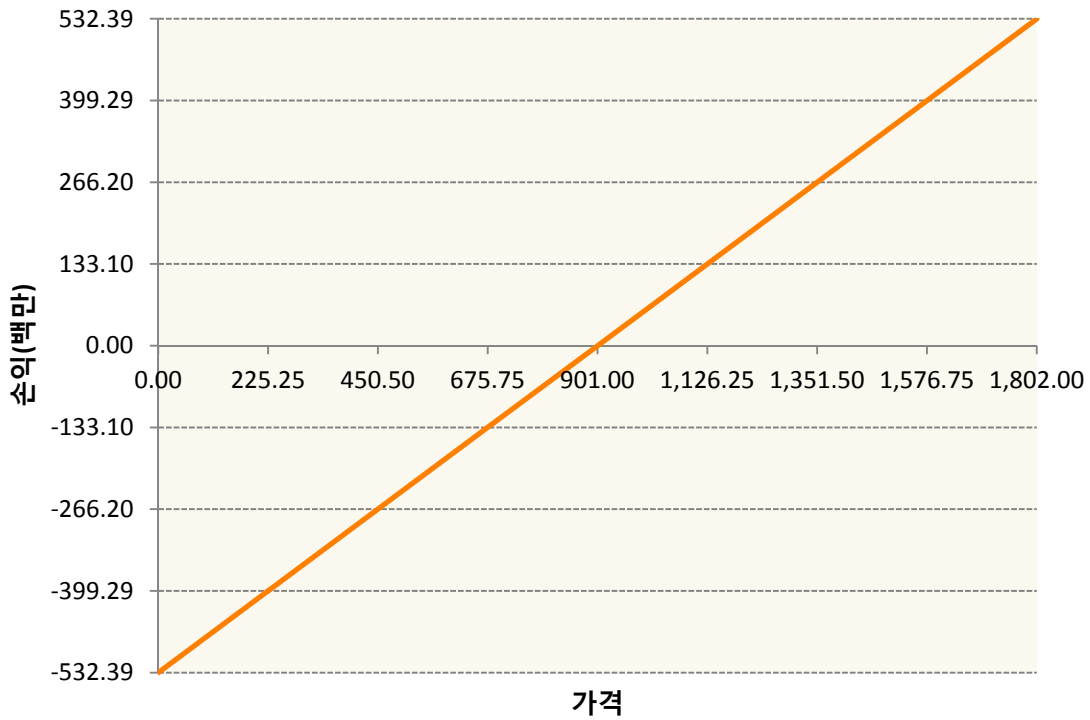
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



SBK0-Sugar May20

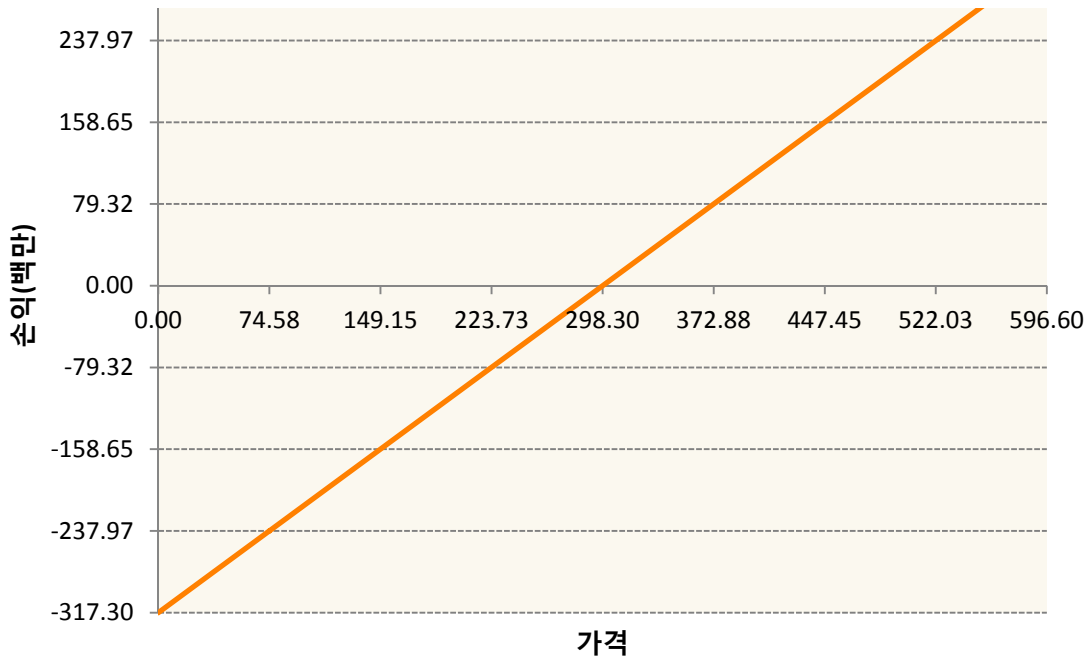


SK0-SOYBEAN FUTURE May20

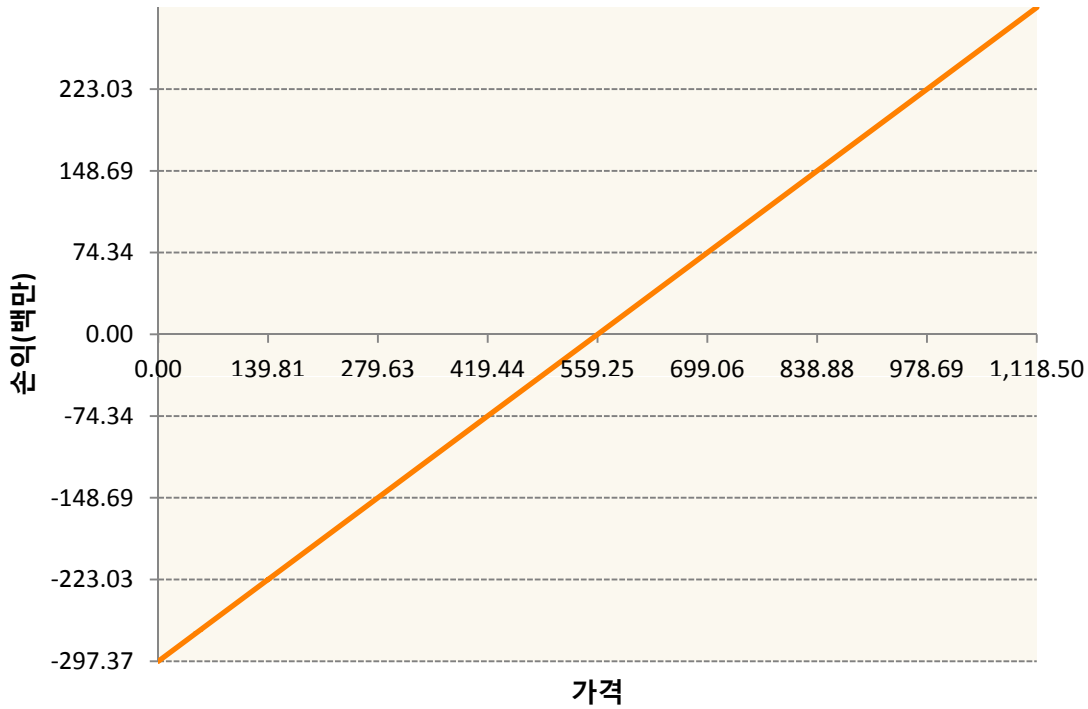


SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





WK0-WHEAT FUTURE(CBT) May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	19
CK0	CORN FUTURE May20	43
CTK0	COTTON NO.2 FUTR May20	10
KCK0	COFFEE 'C' FUTURE May20	19
KR4175Q30C	2020-03 달러선물	13

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	24

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

(단위:백만원)

236