

공시일	2020-02-25
기준일	2020-02-24

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	2020-02-25
기준일	2020-02-24

스마트인덱스모

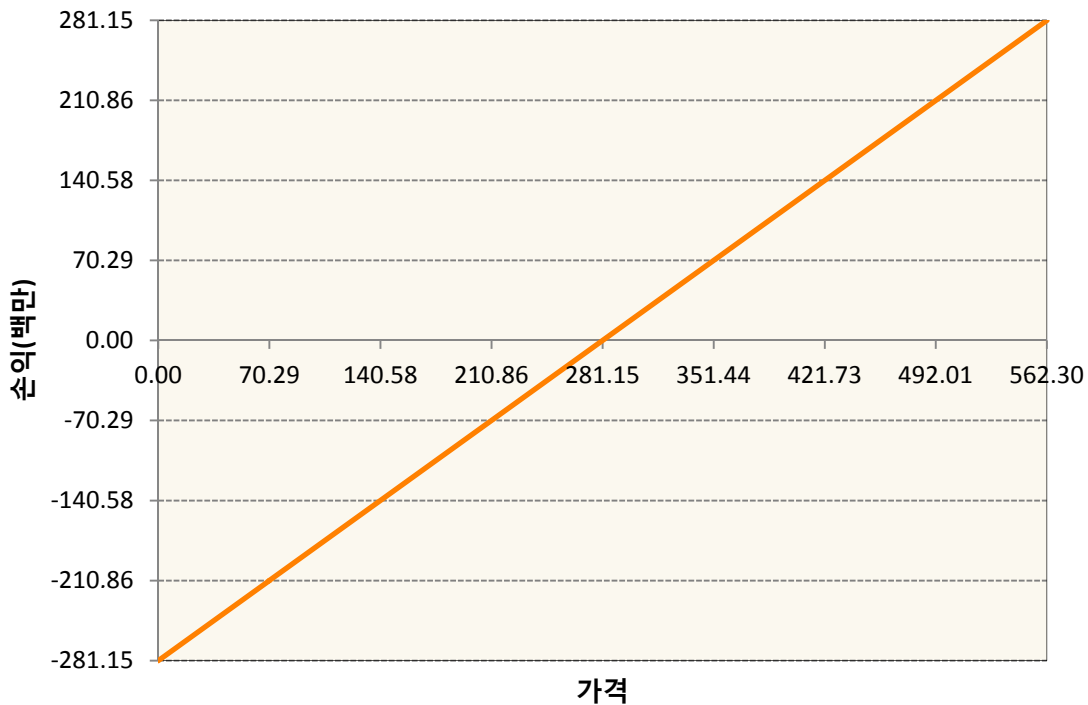
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	281	0	281	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						22
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22	
-5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	
-2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	7	7	7	7	7	7	7	
5.33%	15	15	15	15	15	15	15	
8.00%	22	22	22	22	22	22	22	

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

(단위:백만원)

19

공시일	2020-02-25
기준일	2020-02-24

SMART합성-MSCI선진국증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	14,446	0	14,446	장외
누계	지수	스왑	14,446	0	14,446	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S200224

1,156

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

672

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-25
기준일	2020-02-24

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)	452
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	165

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

956

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-25
기준일	2020-02-24

유로인덱스모(주식-파생형)

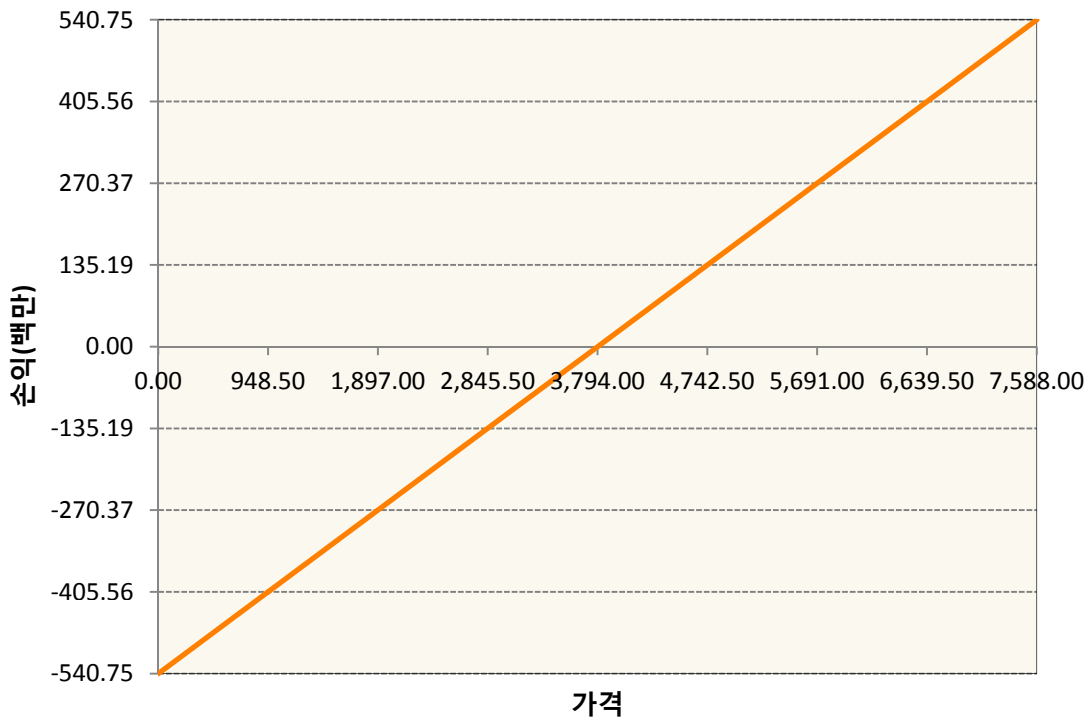
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	541	0	541	

2. 만기시점의 손익구조

VGH0-EURO STOXX 50 Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH0	EURO STOXX 50 Mar20	43
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

30

공시일	2020-02-25
기준일	2020-02-24

차이나인덱스모(주식-파생형)

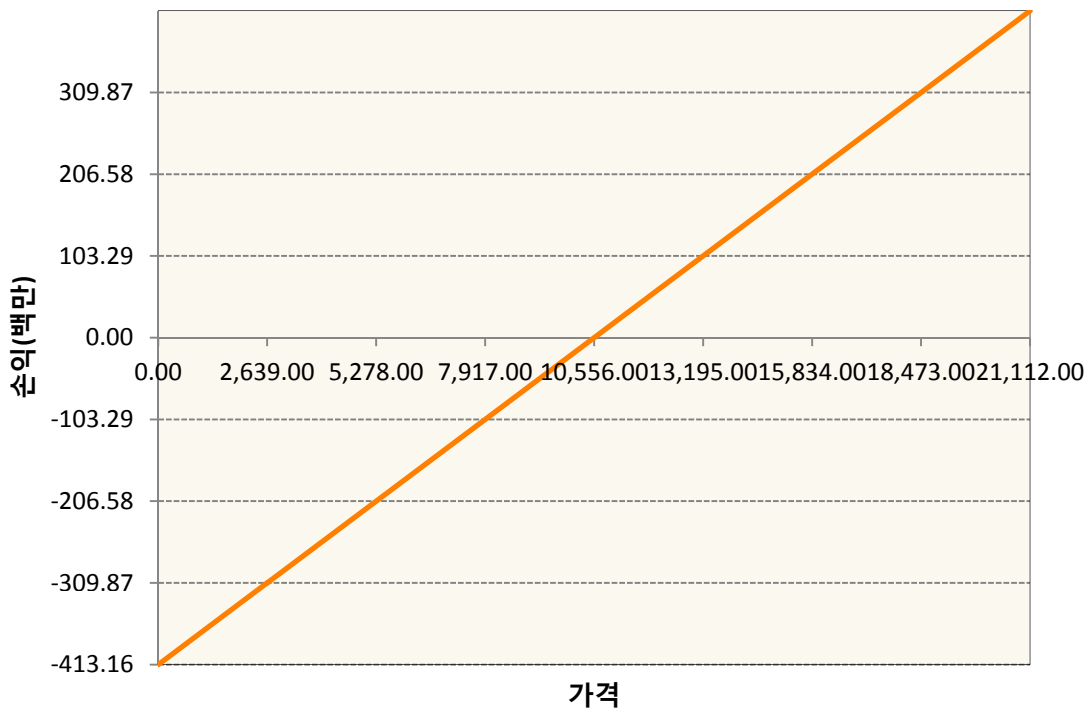
1. 계약금액

(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

HCH0-HSCEI Futures Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH0	HSCEI Futures Mar20	33
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

30

공시일	2020-02-25
기준일	2020-02-24

커버드콜모(주식혼합-파생형)

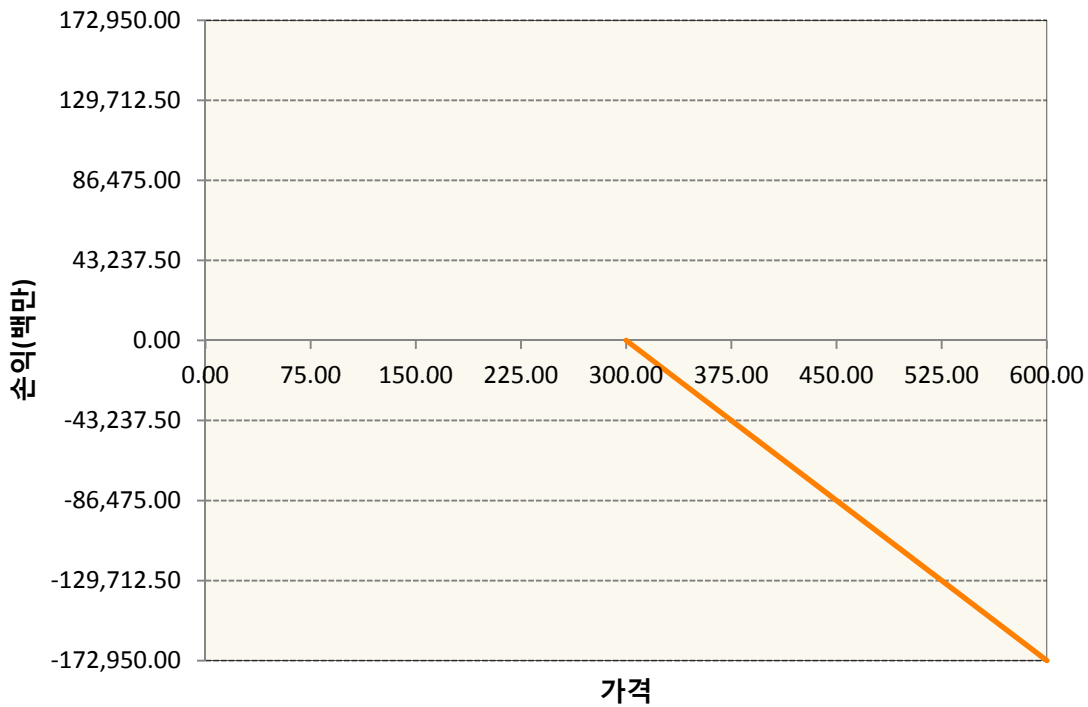
1. 계약금액

(단위:백만원)

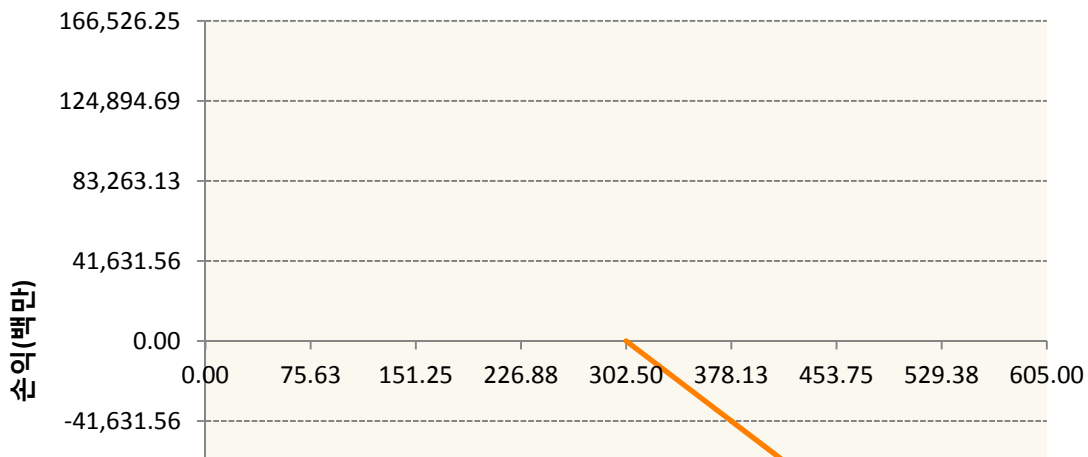
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	448,226	-448,226	장내

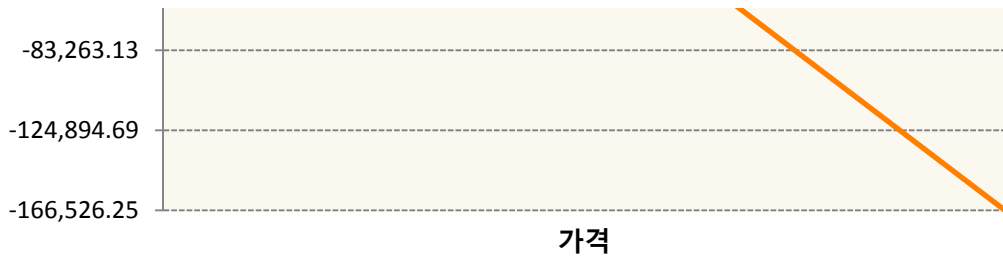
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q33007-2020-03 콜300

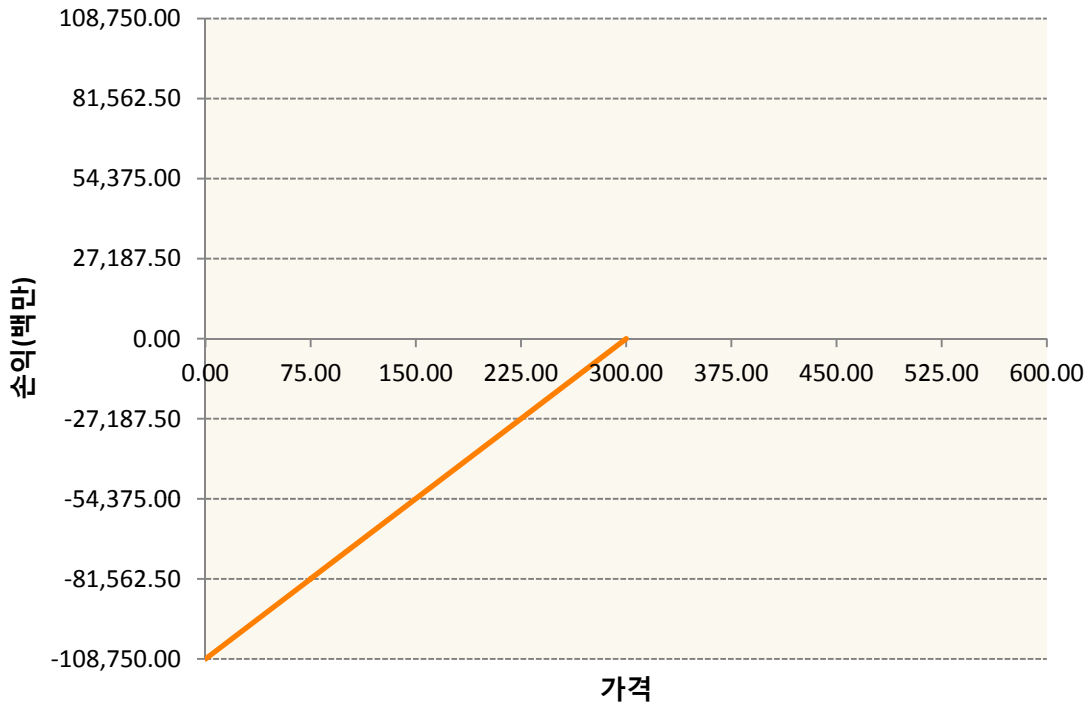


KR4201Q33023-2020-03 콜302.5





KR4301Q33005-2020-03 풋300



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q33007		2020-03 콜300					6,034	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,127	1,116	1,094	1,060	1,011	945	861	
-5.33%	1,098	1,060	1,002	922	821	698	555	
-2.67%	989	890	763	609	433	235	18	
0%	670	472	247	0	-265	-546	-840	
2.67%	-66	-378	-705	-1,042	-1,389	-1,742	-2,101	
5.33%	-1,445	-1,838	-2,233	-2,629	-3,027	-3,426	-3,825	
8.00%	-3,607	-4,009	-4,412	-4,816	-5,222	-5,628	-6,034	
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5					5,267	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	867	860	845	820	783	731	664	

-5.33%	850	823	780	719	639	539	420
-2.67%	778	704	605	481	335	168	-18
0%	553	394	209	0	-229	-474	-735
2.67%	-1	-268	-553	-852	-1,163	-1,483	-1,811
5.33%	-1,099	-1,458	-1,823	-2,191	-2,562	-2,935	-3,311
8.00%	-2,910	-3,303	-3,696	-4,088	-4,481	-4,874	-5,267
KR4301Q33005 2020-03 풋300							7,946
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,931	-7,931	-7,932	-7,933	-7,935	-7,939	-7,946
-5.33%	-5,218	-5,219	-5,222	-5,228	-5,238	-5,253	-5,274
-2.67%	-2,510	-2,520	-2,536	-2,559	-2,591	-2,631	-2,680
0%	155	115	63	0	-74	-157	-248
2.67%	2,646	2,543	2,431	2,310	2,182	2,049	1,911
5.33%	4,699	4,535	4,369	4,201	4,033	3,863	3,693
8.00%	6,074	5,904	5,733	5,561	5,388	5,214	5,040

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

(단위:백만원)

16,546

공시일	2020-02-25
기준일	2020-02-24

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

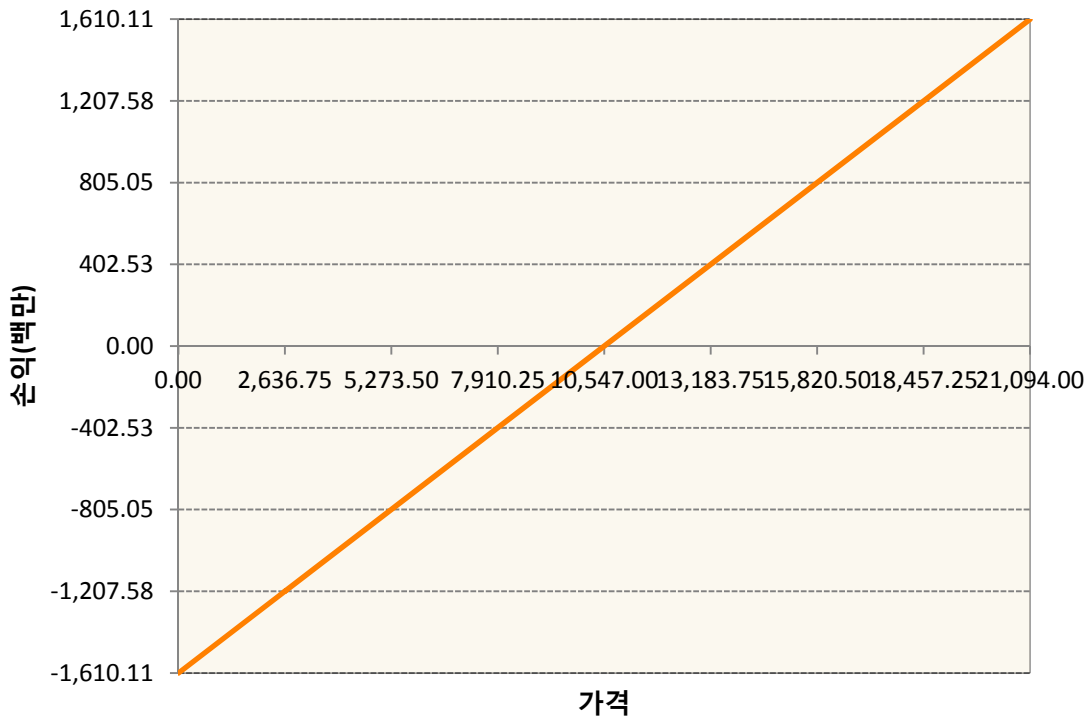
1. 계약금액

(단위:백만원)

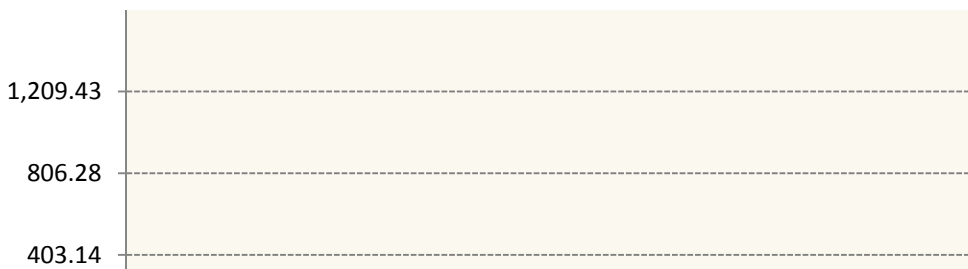
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,610	0	1,610	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,528	-4,528	장내
누계	통화	선도	0	2,204	-2,204	장외

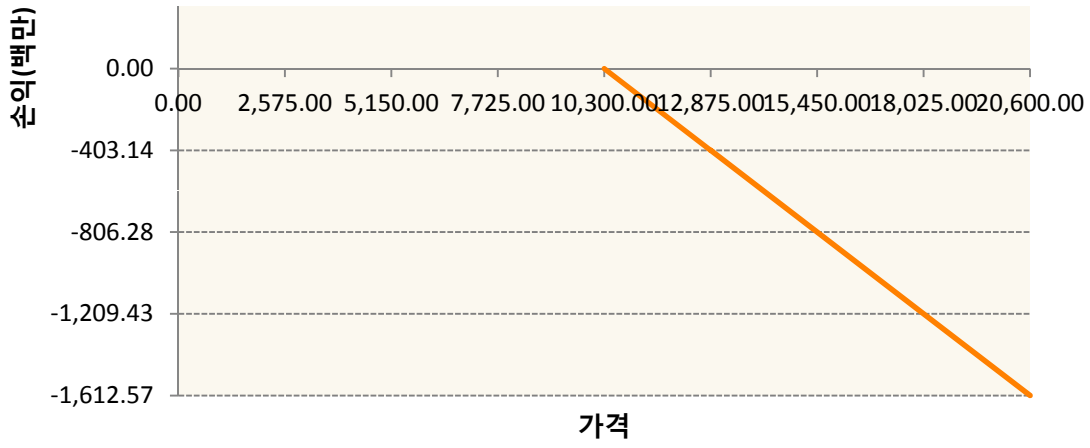
2. 만기시점의 손익구조

HCG0-HSCEI Futures Feb20

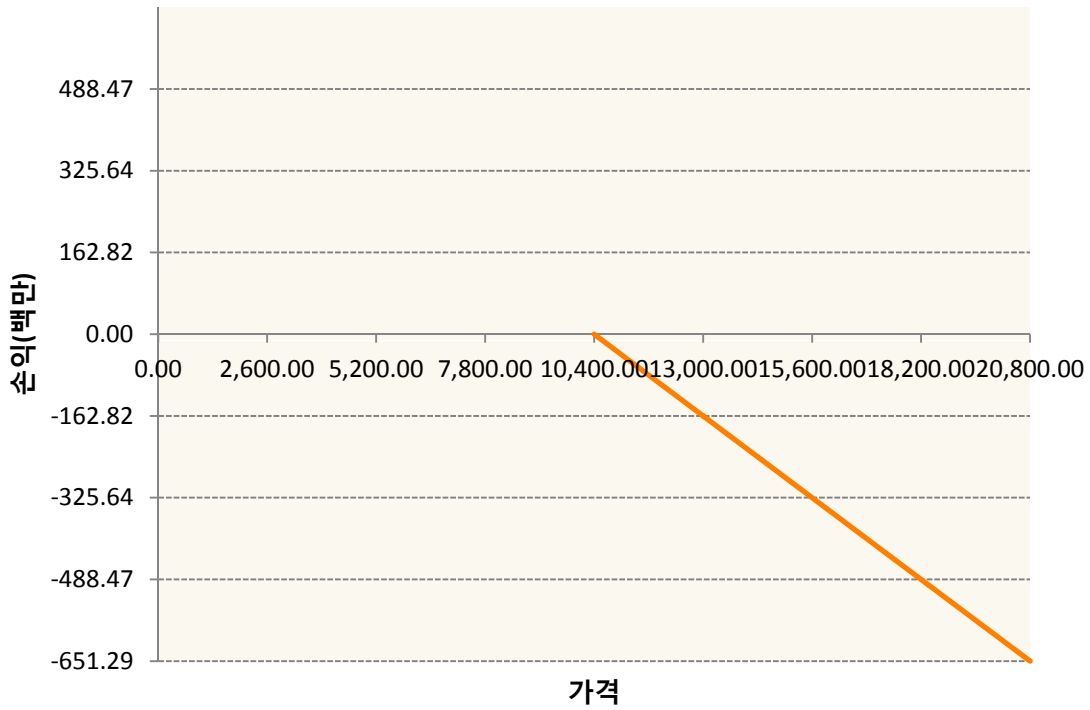


OHHIG0-C103-HSCEI

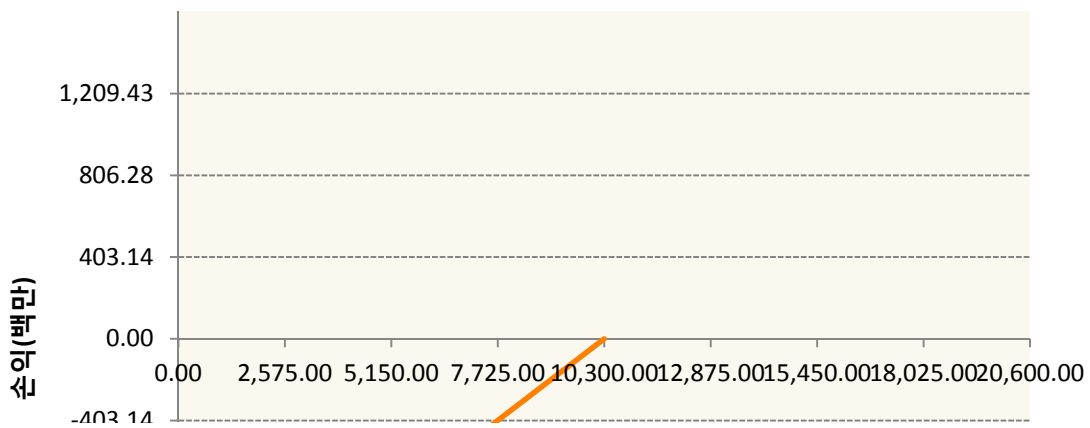


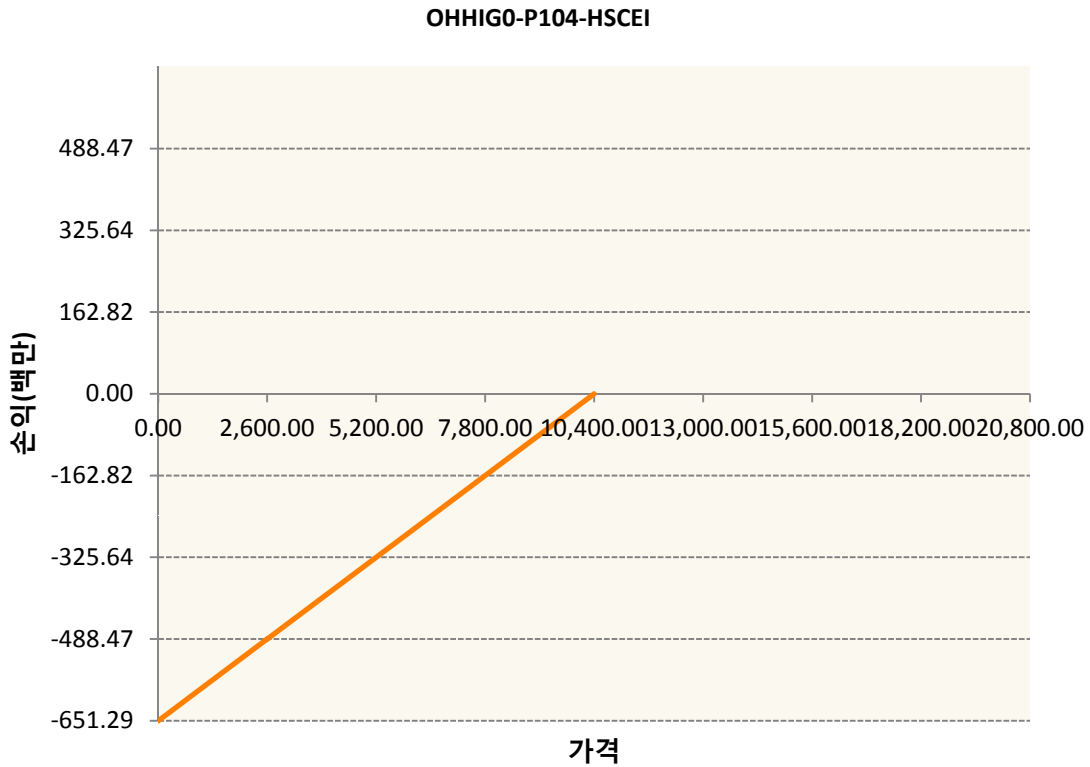


OHHIG0-C104-HSCEI



OHHIG0-P103-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E		176
HCG0 HSCEI Futures Feb20		129
OHHIG0-C1(HSCEI		129
OHHIG0-C1(HSCEI		52
OHHIG0-P1(HSCEI		129
OHHIG0-P1(HSCEI		52

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		503

공시일	2020-02-25
기준일	2020-02-24

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

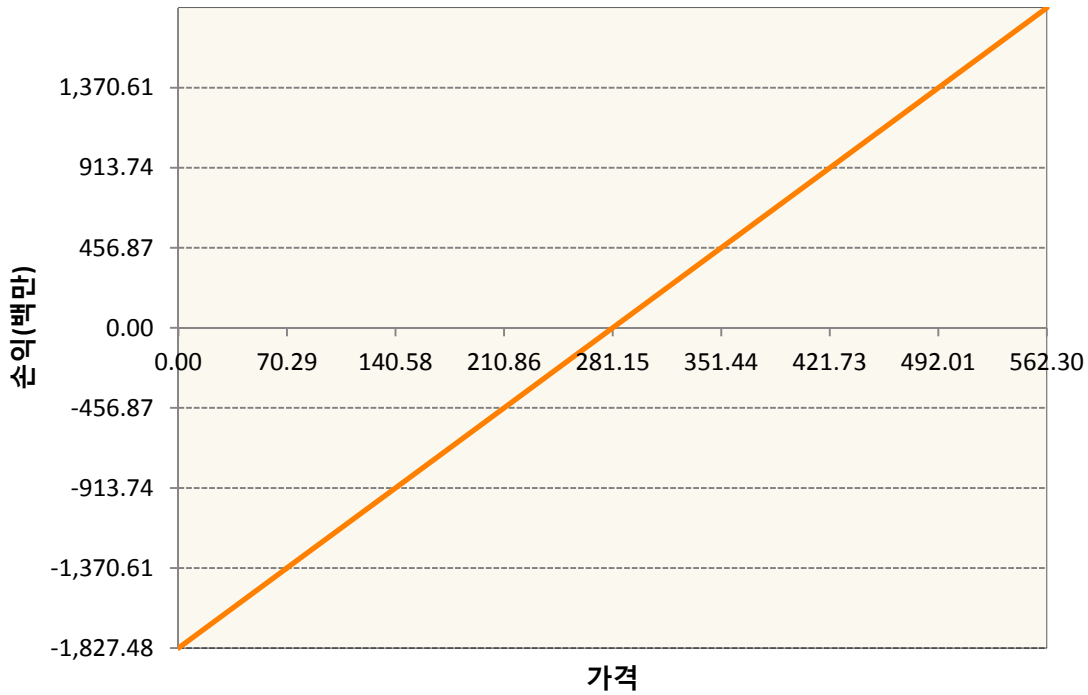
1. 계약금액

(단위:백만원)

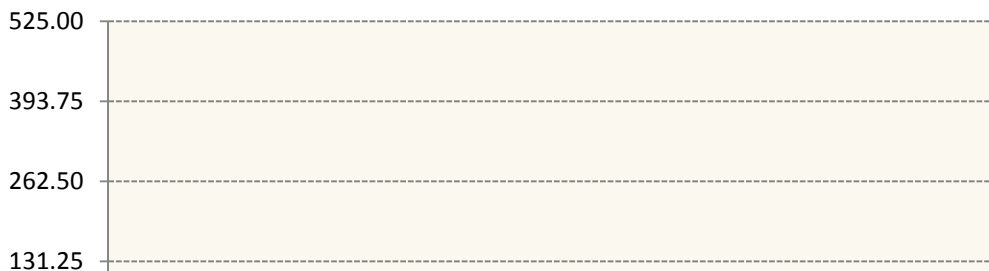
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,827	0	1,827	장내
누계	유가증권	스왑	3,125	0	3,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,612	-3,612	장내

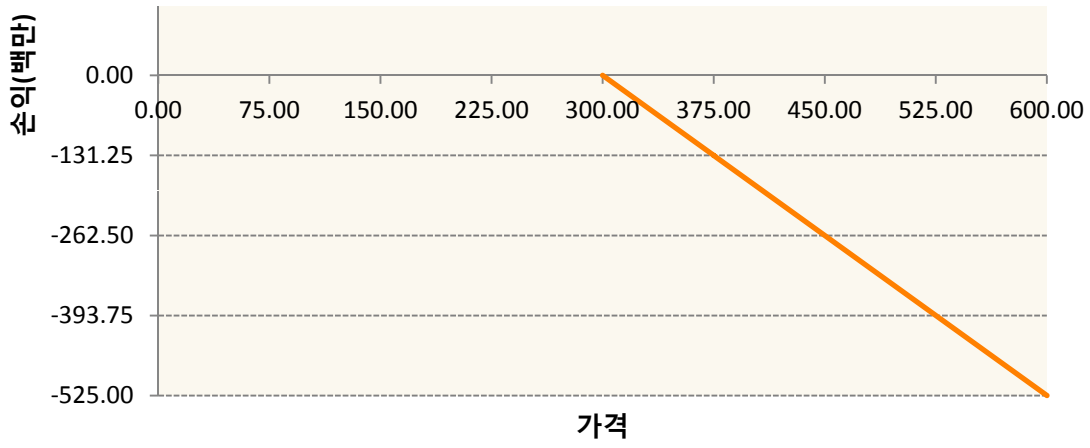
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

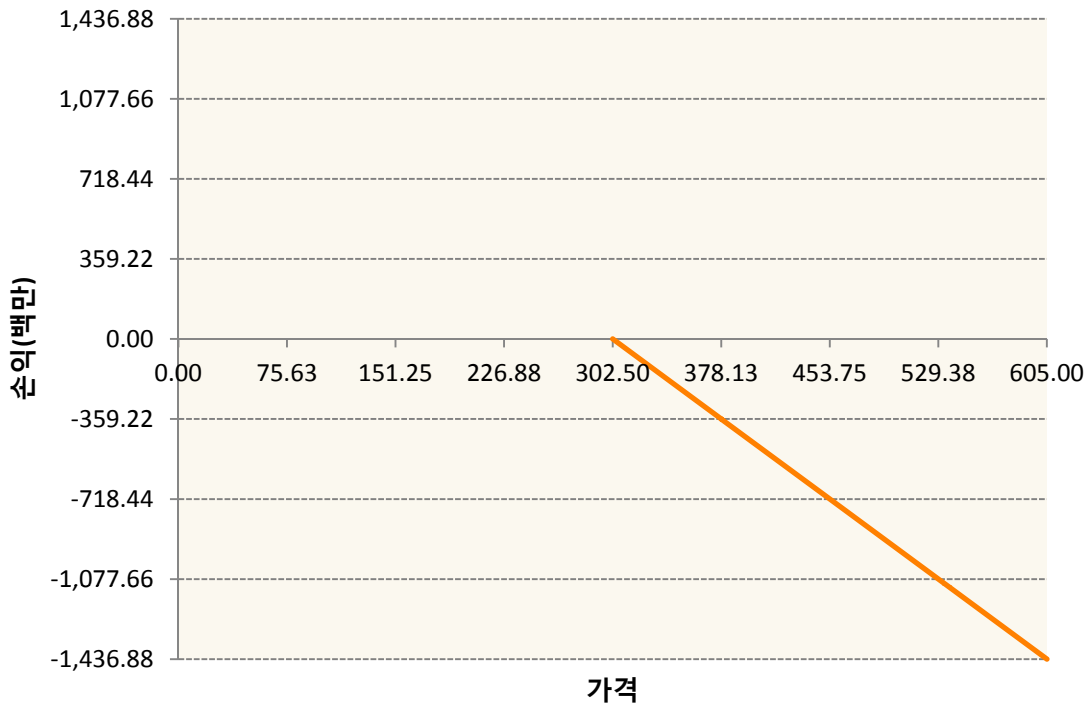


KR4201Q33007-2020-03 콜300

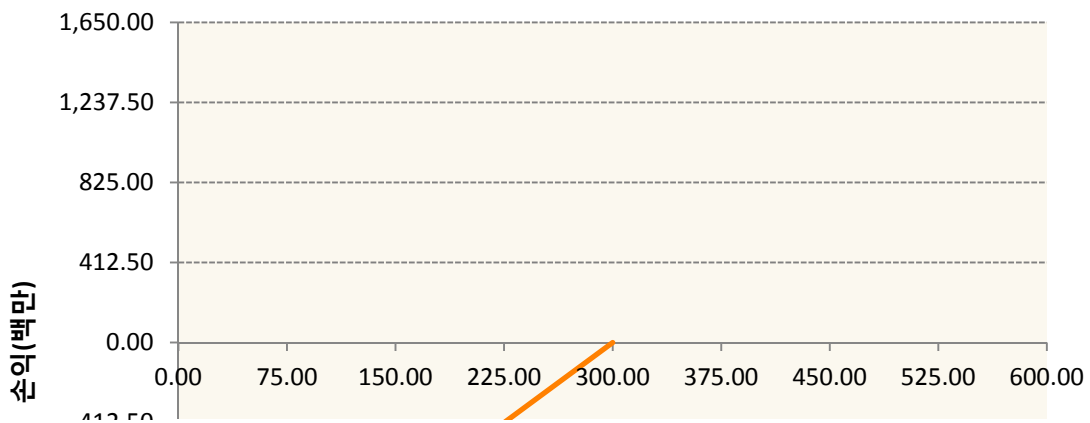




KR4201Q33023-2020-03 콜302.5



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						146
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-146	-146	-146	-146	-146	-146	-146	
-5.33%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97	
-2.67%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	49	49	49	49	49	49	49	
5.33%	97	97	97	97	97	97	97	
8.00%	146	146	146	146	146	146	146	
KR4201Q33007		2020-03 콜300						18
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3	3	3	3	3	3	3	
-5.33%	3	3	3	3	2	2	2	
-2.67%	3	3	2	2	1	1	0	
0%	2	1	1	0	-1	-2	-3	
2.67%	0	-1	-2	-3	-4	-5	-6	
5.33%	-4	-6	-7	-8	-9	-10	-12	
8.00%	-11	-12	-13	-15	-16	-17	-18	
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5						45
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	7	7	7	7	7	6	6
-5.33%	7	7	7	6	6	5	4
-2.67%	7	6	5	4	3	1	0
0%	5	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	0	-2	-5	-7	-10	-13	-16
5.33%	-9	-13	-16	-19	-22	-25	-29
8.00%	-25	-28	-32	-35	-39	-42	-45
KR4301Q33005 2020-03 풋300							121
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-121
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-80	-80
-2.67%	-38	-38	-38	-39	-39	-40	-41
0%	2	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	40	39	37	35	33	31	29
5.33%	71	69	66	64	61	59	56
8.00%	92	90	87	84	82	79	76

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

(단위:백만원)

568

공시일	2020-02-25
기준일	2020-02-24

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

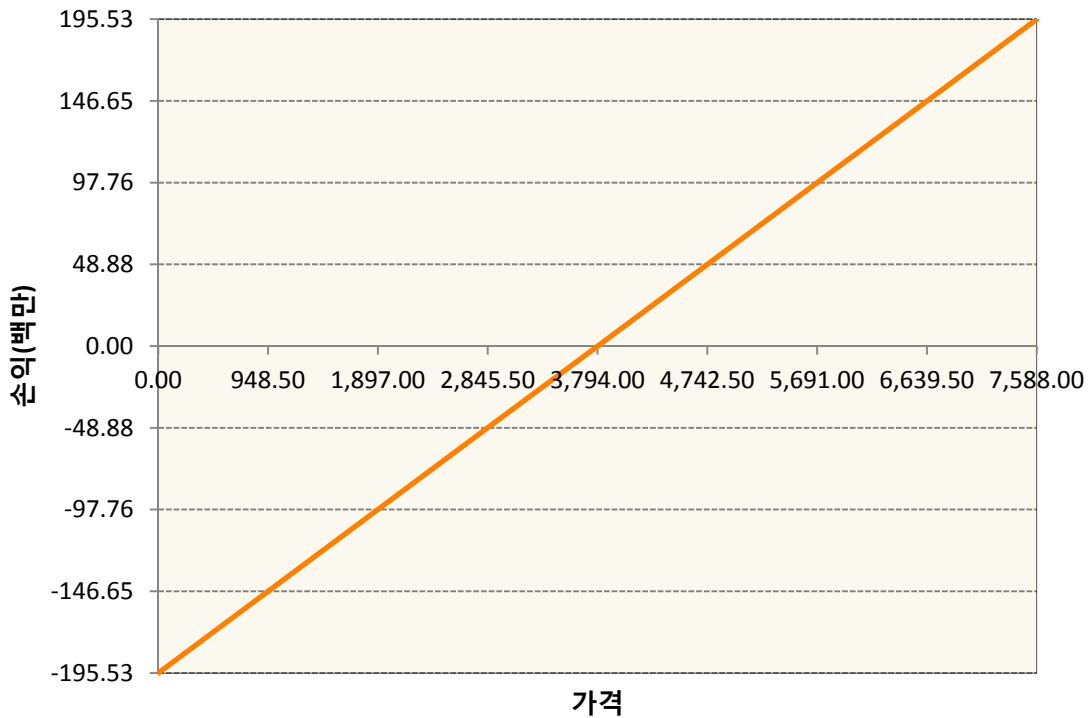
1. 계약금액

(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	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	196	0	196	
누계	유가증권	스왑	11,875	0	11,875	장외
누계	통화	선도	0	3,462	-3,462	장외

2. 만기시점의 손익구조

VGHO-EURO STOXX 50 Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	10
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	277
VGHO EURO STOXX 50 Mar20	16

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

(단위:백만원)

926

공시일	2020-02-25
기준일	2020-02-24

ETF스마트레버리지목표전환형9호

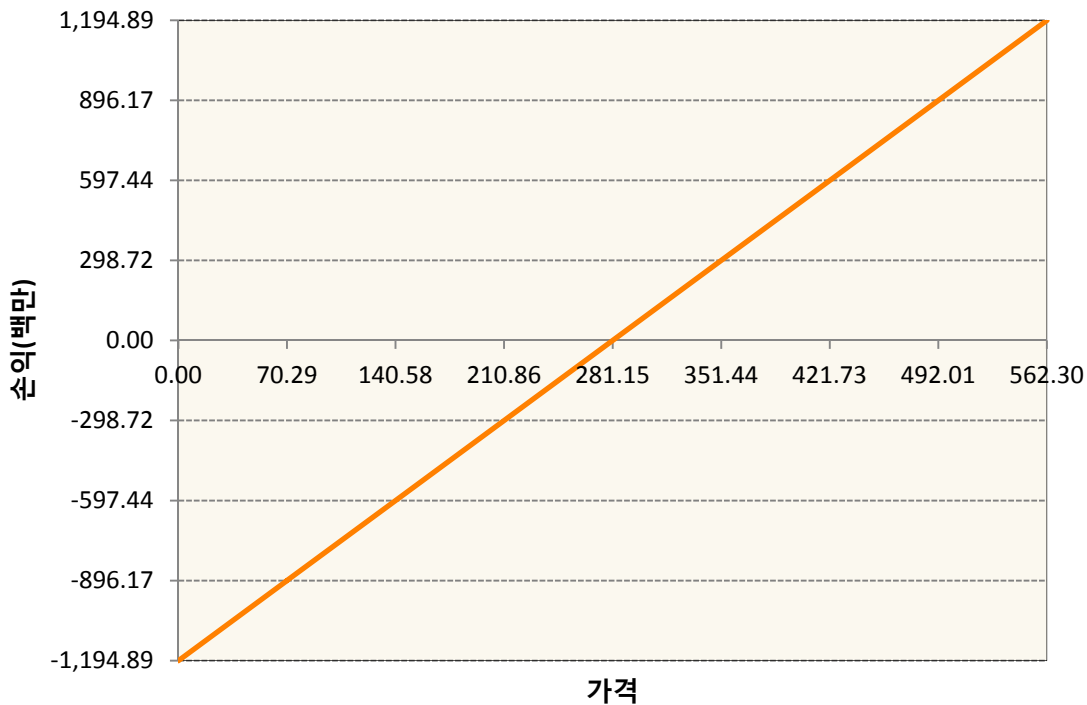
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,195	0	1,195	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						96
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96	
-5.33%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64	
-2.67%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	32	32	32	32	32	32	32	
5.33%	64	64	64	64	64	64	64	
8.00%	96	96	96	96	96	96	96	

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

(단위:백만원)

82

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

(단위:백만원)

120

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

(단위:백만원)

43

공시일	2020-02-25
기준일	2020-02-24

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

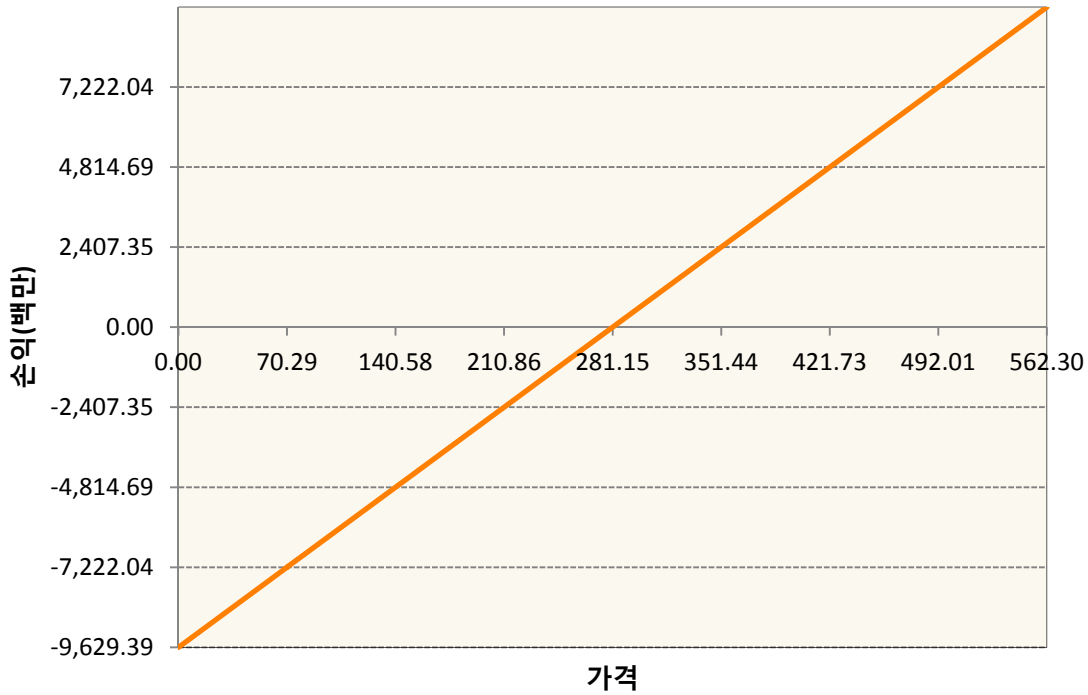
1. 계약금액

(단위:백만원)

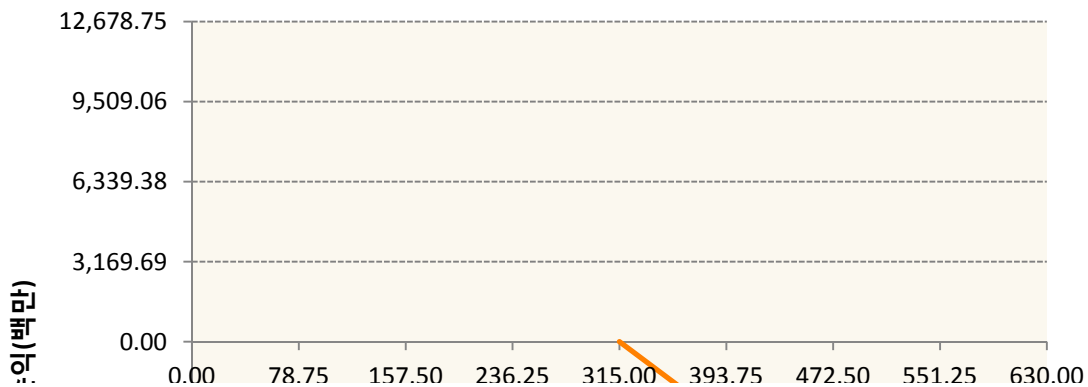
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,629	0	9,629	장내
누계	유가증권	옵션	2,257	20,854	-18,598	장내

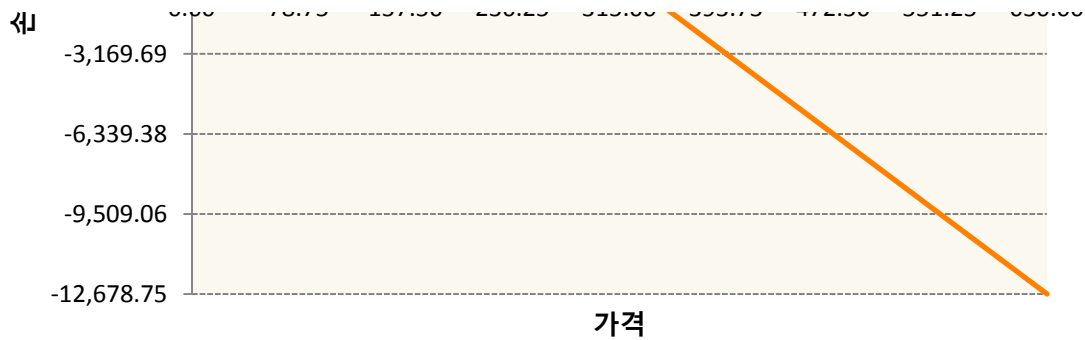
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

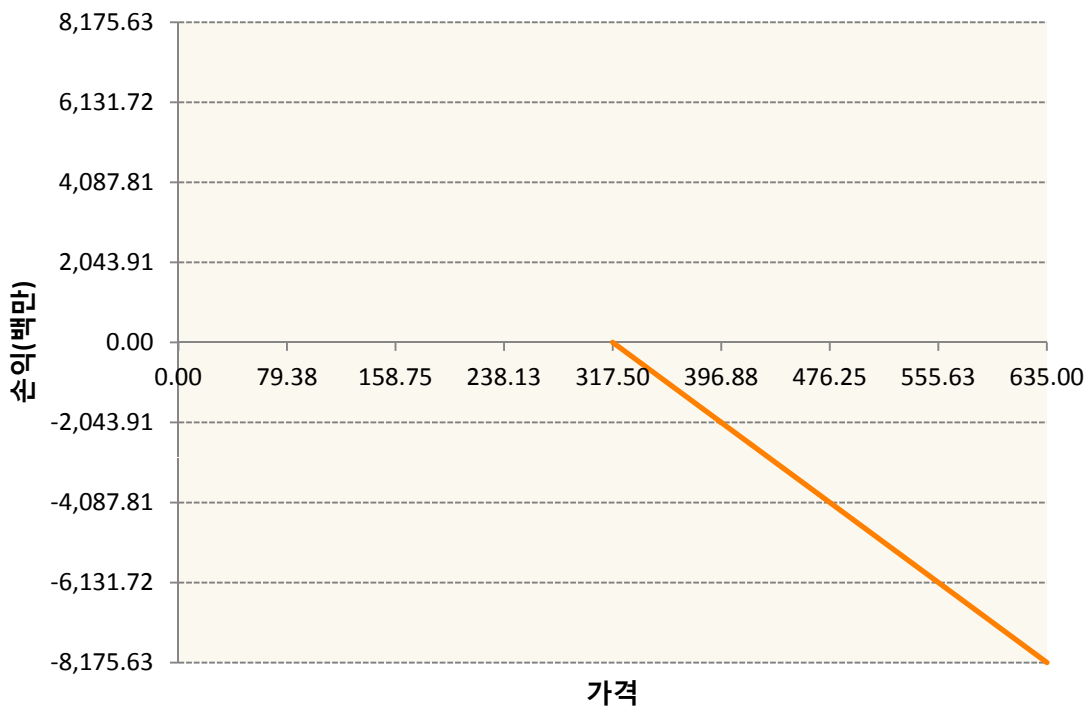


KR4201Q33155-2020-03 콜315

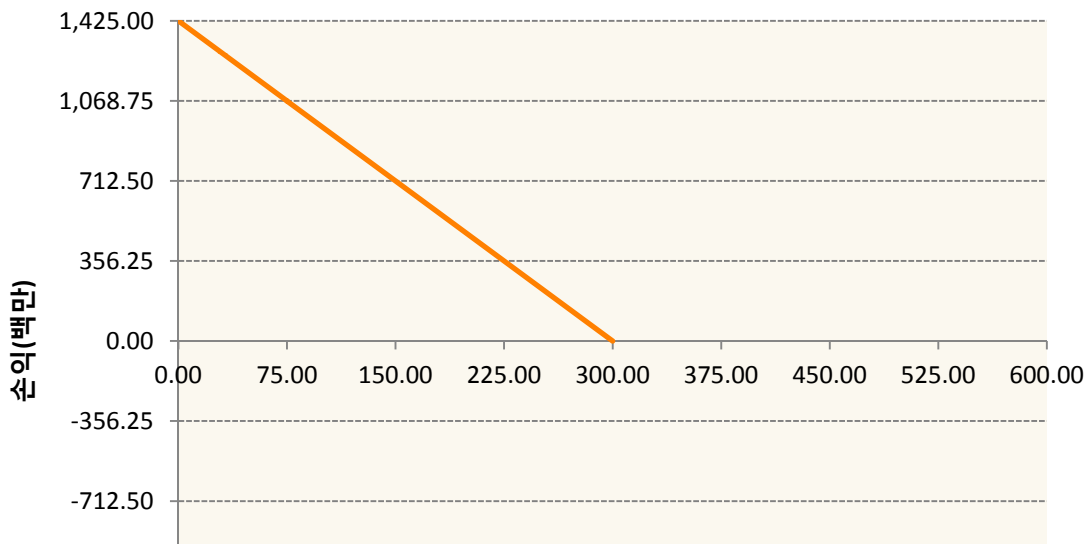


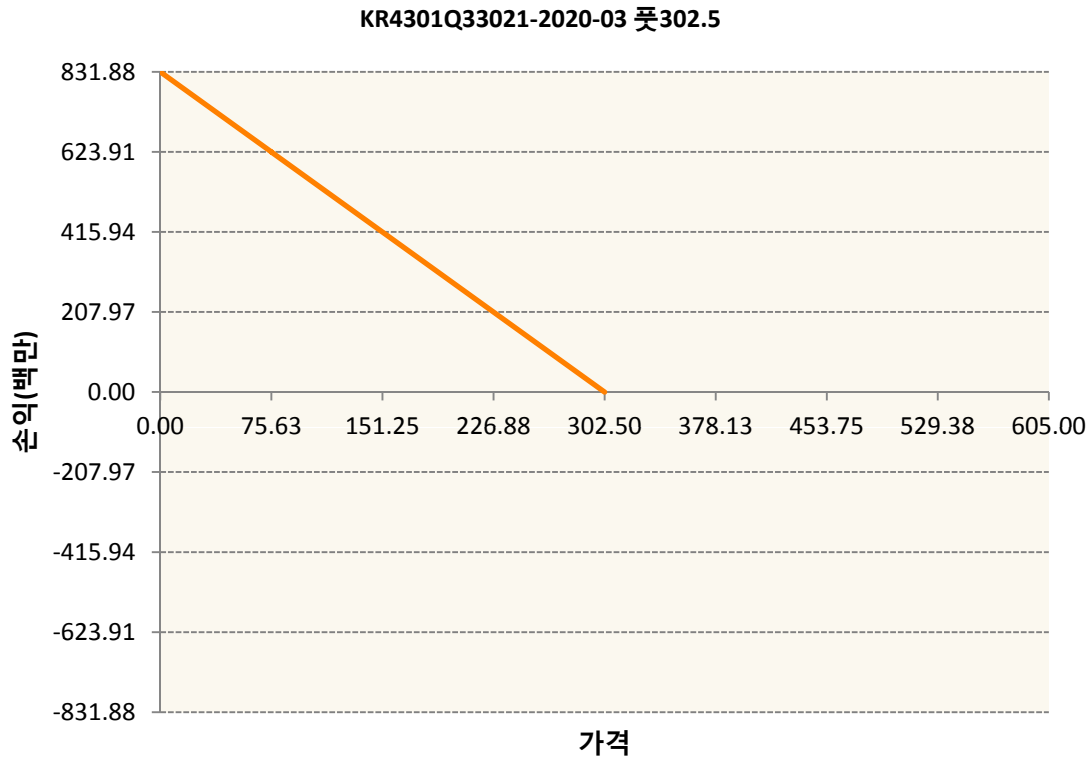
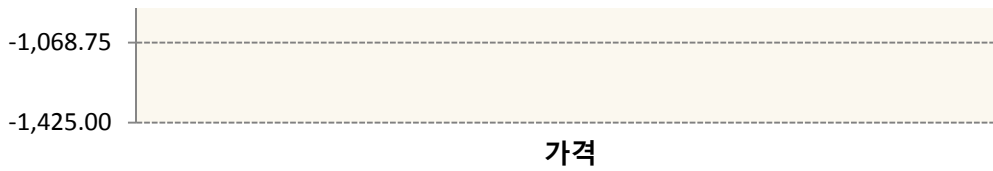


KR4201Q33171-2020-03 콜317.5



KR4301Q33005-2020-03 풋300





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						770
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-770	-770	-770	-770	-770	-770	-770	
-5.33%	-513	-513	-513	-513	-513	-513	-513	
-2.67%	-257	-257	-257	-257	-257	-257	-257	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	257	257	257	257	257	257	257	
5.33%	513	513	513	513	513	513	513	
8.00%	770	770	770	770	770	770	770	
KR4201Q33155		2020-03 콜315						226
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	19	19	19	18	18	16	15	
-5.33%	19	19	18	17	15	12	8	
-2.67%	18	17	15	12	7	2	-5	

0%	16	12	7	0	-8	-19	-30
2.67%	6	-2	-13	-25	-39	-55	-71
5.33%	-19	-35	-52	-71	-91	-113	-135
8.00%	-74	-98	-122	-147	-173	-199	-226
KR4201Q33171 2020-03 콜317.5							128
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9	9	9	9	9	8	7
-5.33%	9	9	9	8	7	6	4
-2.67%	9	9	8	6	4	1	-3
0%	8	6	4	0	-5	-10	-17
2.67%	4	-1	-6	-13	-21	-30	-40
5.33%	-9	-17	-27	-38	-50	-62	-75
8.00%	-37	-50	-65	-80	-95	-111	-128
KR4301Q33005 2020-03 풋300							104
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	104	104	104	104	104	104	104
-5.33%	68	68	68	69	69	69	69
-2.67%	33	33	33	34	34	34	35
0%	-2	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-35	-33	-32	-30	-29	-27	-25
5.33%	-62	-59	-57	-55	-53	-51	-48
8.00%	-80	-77	-75	-73	-71	-68	-66
KR4301Q33021 2020-03 풋302.5							61
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	61	61	61	61	61	61	61
-5.33%	40	40	40	40	40	40	40
-2.67%	20	20	20	20	20	20	20
0%	-1	-1	0	0	0	1	2
2.67%	-20	-20	-19	-18	-17	-17	-16
5.33%	-37	-36	-35	-34	-33	-31	-30
8.00%	-49	-48	-47	-45	-44	-43	-41

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

(단위:백만원)

986

공시일	2020-02-25
기준일	2020-02-24

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	221,155	0	221,155	

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	2020-02-25
기준일	2020-02-24

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	187,423	0	187,423	

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	2020-02-25
기준일	2020-02-24

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	549,016	0	549,016	
누계	통화	선도	0	584,232	-584,232	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,952
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	2,089
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	195
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,572
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,464
FX21020F02 KRW/USD 28-02-20E	1,952
FX21020F03 KRW/USD 28-02-20E	3,026
FX21020F03 KRW/USD 31-03-20E	3,124
FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E	2,928
FX21020F04 KRW/USD 28-02-20E	195
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,636
FX21020G00 KRW/USD 06-03-20E	2,440
FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	976
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,210
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,240
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	976
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	1,952
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	3,358
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,358
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,952
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,905
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,284
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,952

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

15,859

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

(단위:백만원)

123

공시일	2020-02-25
기준일	2020-02-24

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

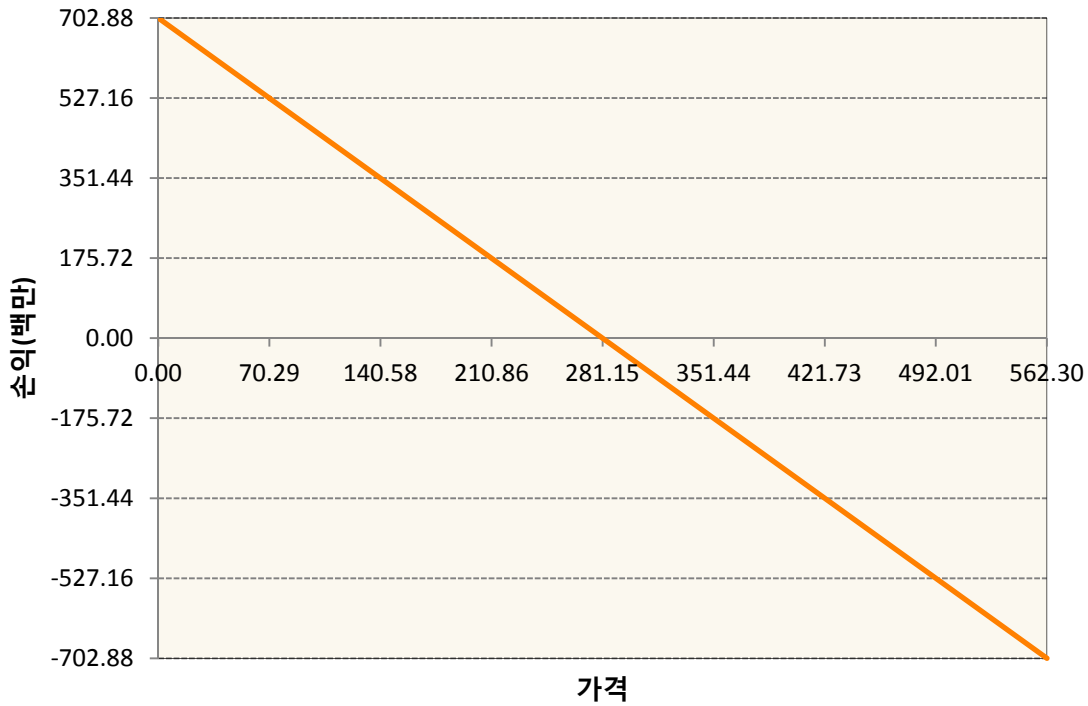
1. 계약금액

(단위:백만원)

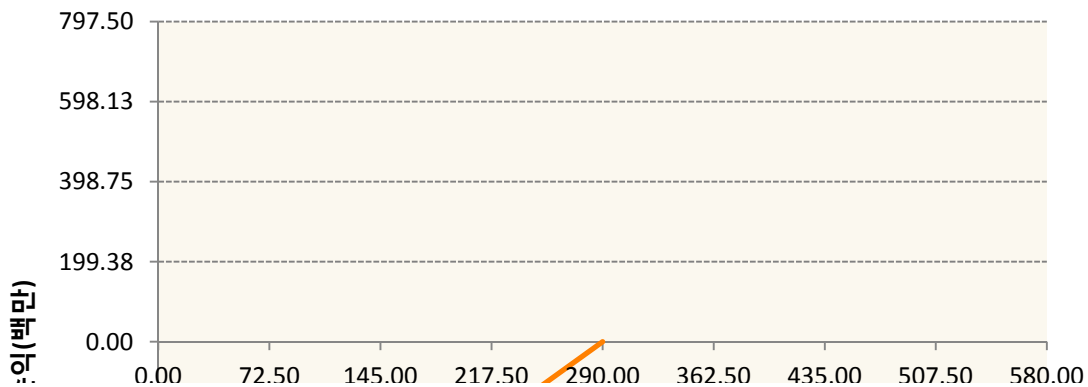
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	703	-703	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,503	-3,503	장내

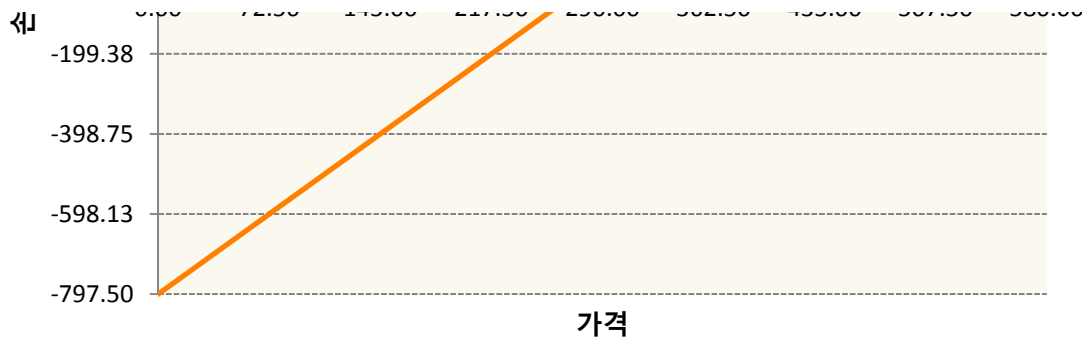
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

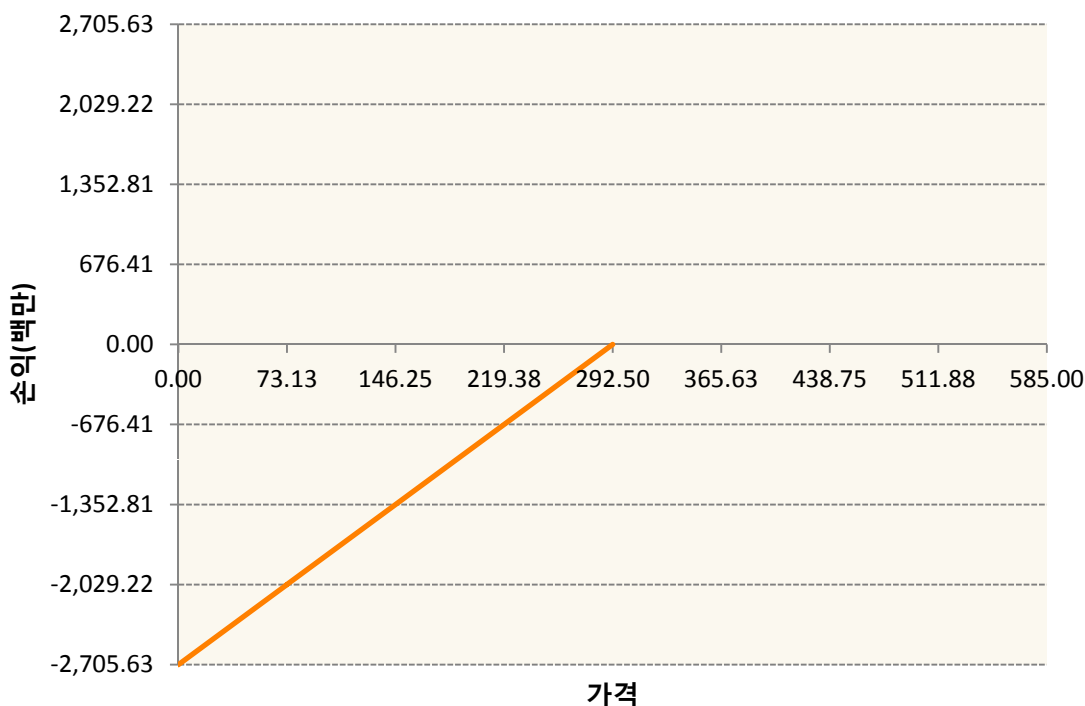


KR4301Q32908-2020-03 풋290





KR4301Q32924-2020-03 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						56
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	56	56	56	56	56	56	56	
-5.33%	37	37	37	37	37	37	37	
-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%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37	
8.00%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56	
KR4301Q32908		2020-03 풋290						56
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
-5.33%	-35	-35	-36	-36	-36	-36	-37
-2.67%	-15	-16	-16	-17	-17	-18	-19
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	17	16	14	13	12	11	9
5.33%	26	24	23	22	21	20	18
8.00%	29	29	28	27	26	25	24

KR4301Q32924 2020-03 풋292.5 194

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-193	-193	-193	-193	-193	-194	-194
-5.33%	-124	-124	-124	-125	-126	-127	-128
-2.67%	-56	-57	-58	-59	-61	-63	-65
0%	8	6	3	0	-3	-6	-10
2.67%	61	57	53	49	44	40	36
5.33%	96	92	88	83	79	75	70
8.00%	114	111	108	104	101	97	94

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

(단위:백만원)

319

공시일	2020-02-25
기준일	2020-02-24

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	11,026	0	11,026	
누계	통화	선도	1,123	11,812	-10,689	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020F03(KRW/USD 28-02-20E	213
FX21020F04(KRW/USD 28-02-20E	304
FX21020F04(KRW/USD 28-02-20E	5
FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	332
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	92
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)

351

공시일	2020-02-25
기준일	2020-02-24

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

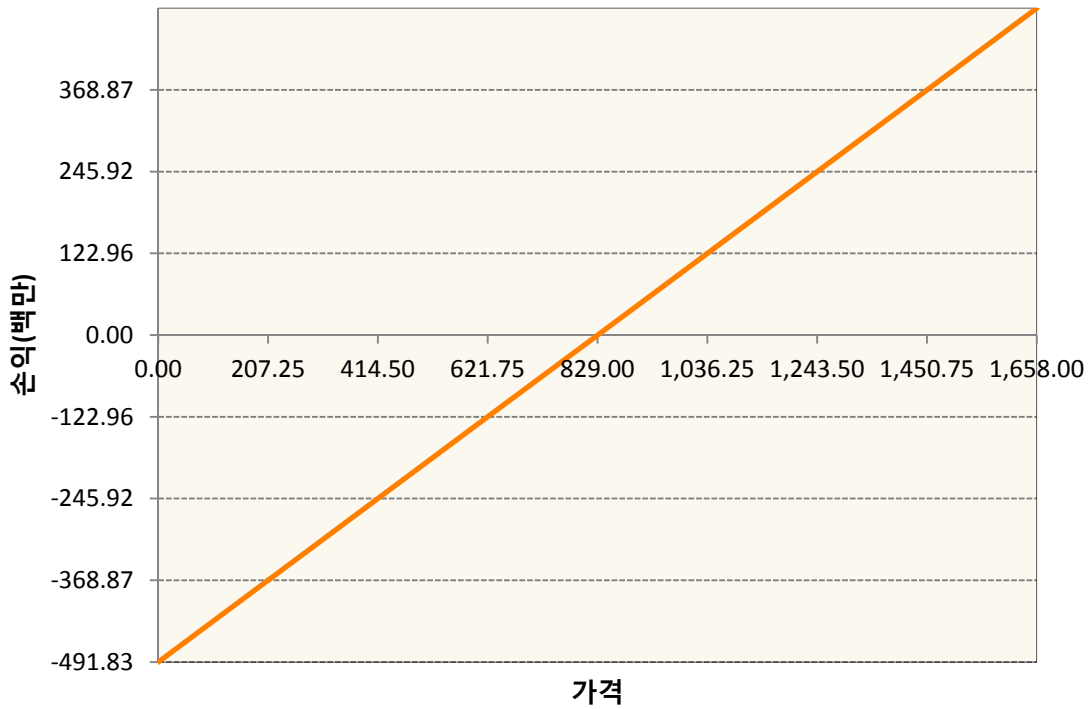
1. 계약금액

(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	492	0	492	
누계	유가증권	스왑	1,088	0	1,088	장외
누계	통화	선도	185	699	-515	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCH0-VN30 Index Future Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	87
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	39

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

(단위:백만원)

118

공시일	2020-02-25
기준일	2020-02-24

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

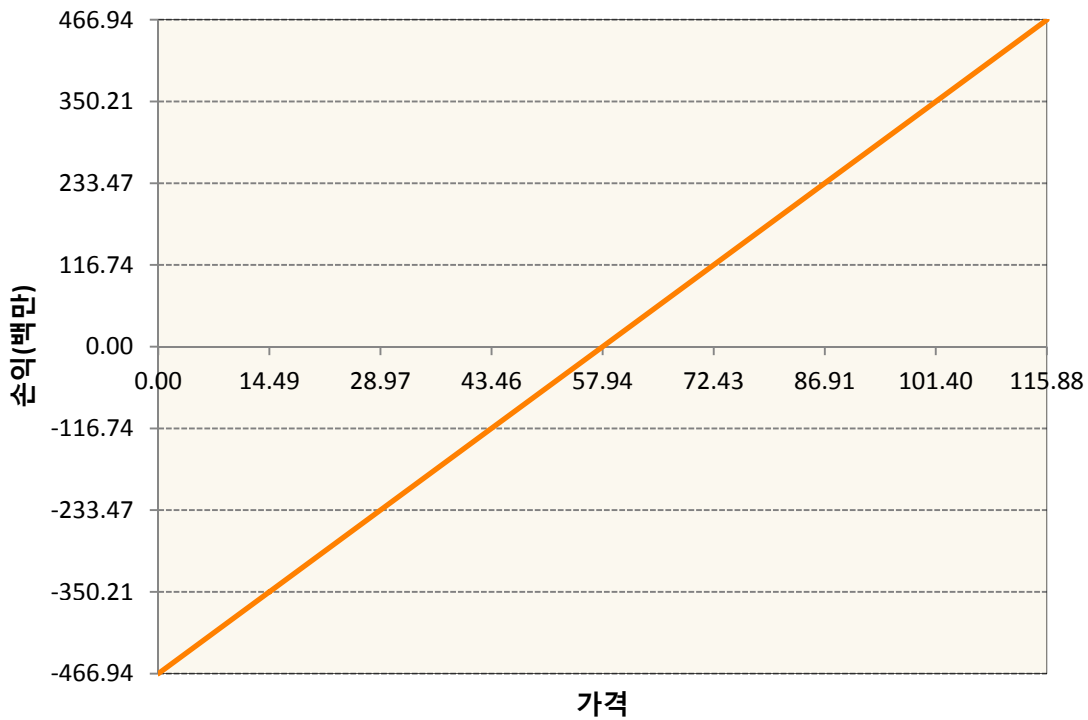
1. 계약금액

(단위:백만원)

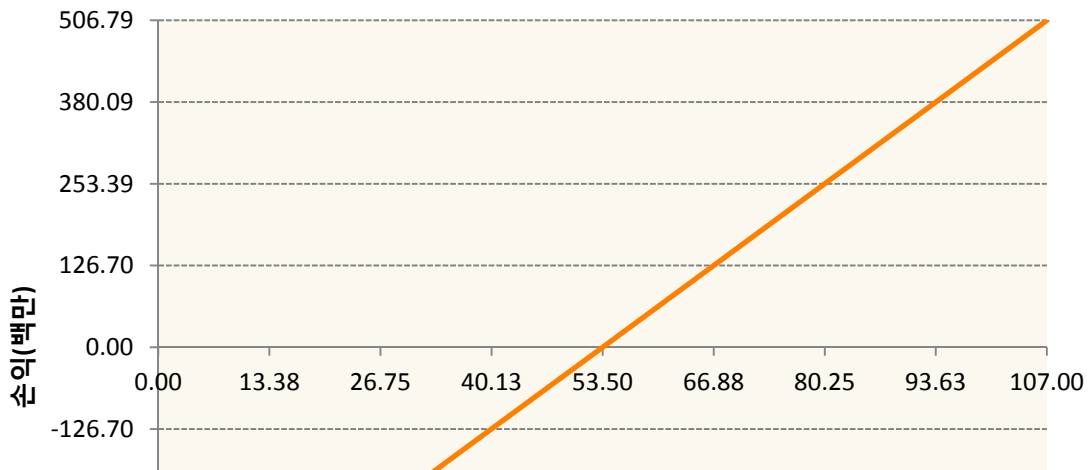
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,143	195	1,948	

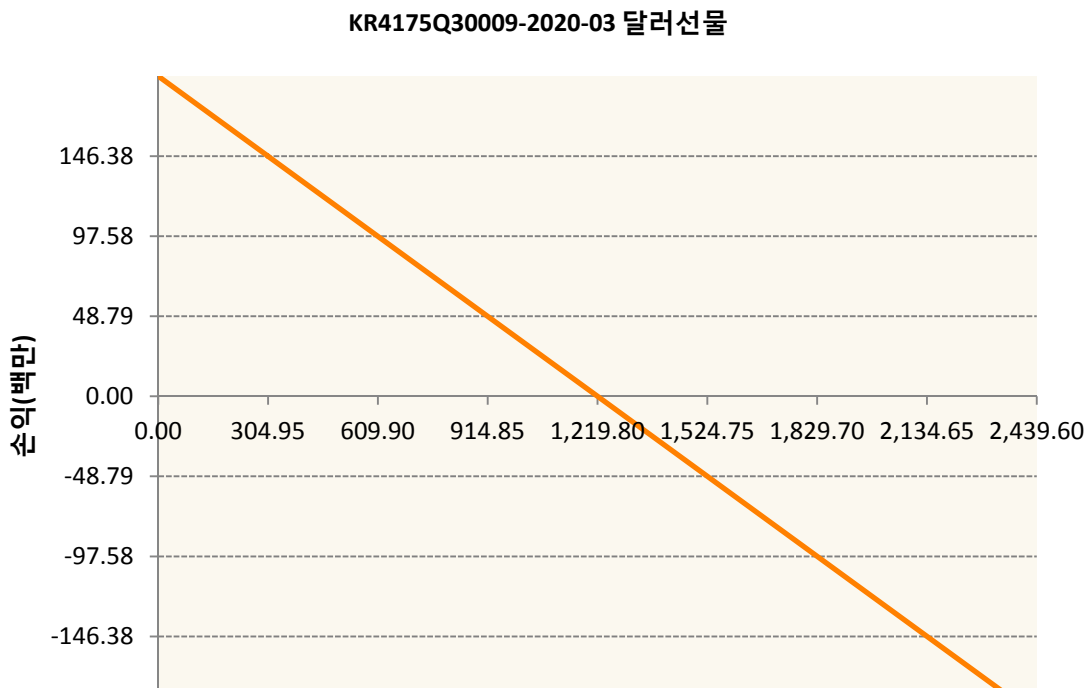
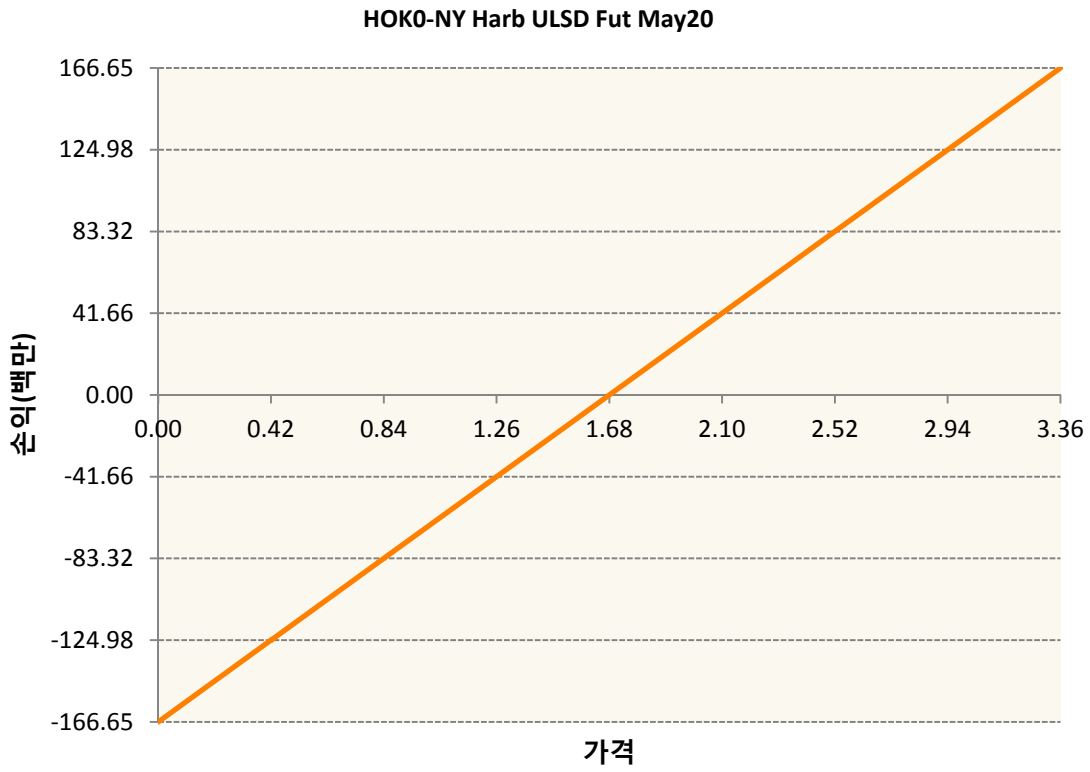
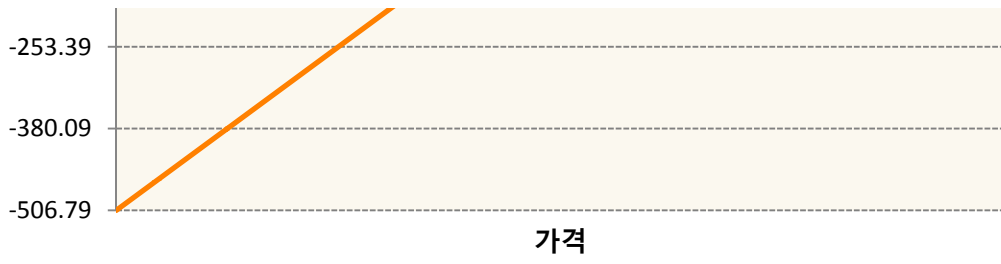
2. 만기시점의 손익구조

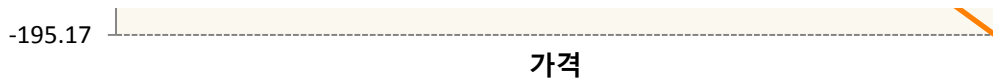
COK0-BRENT CRUDE FUTR May20



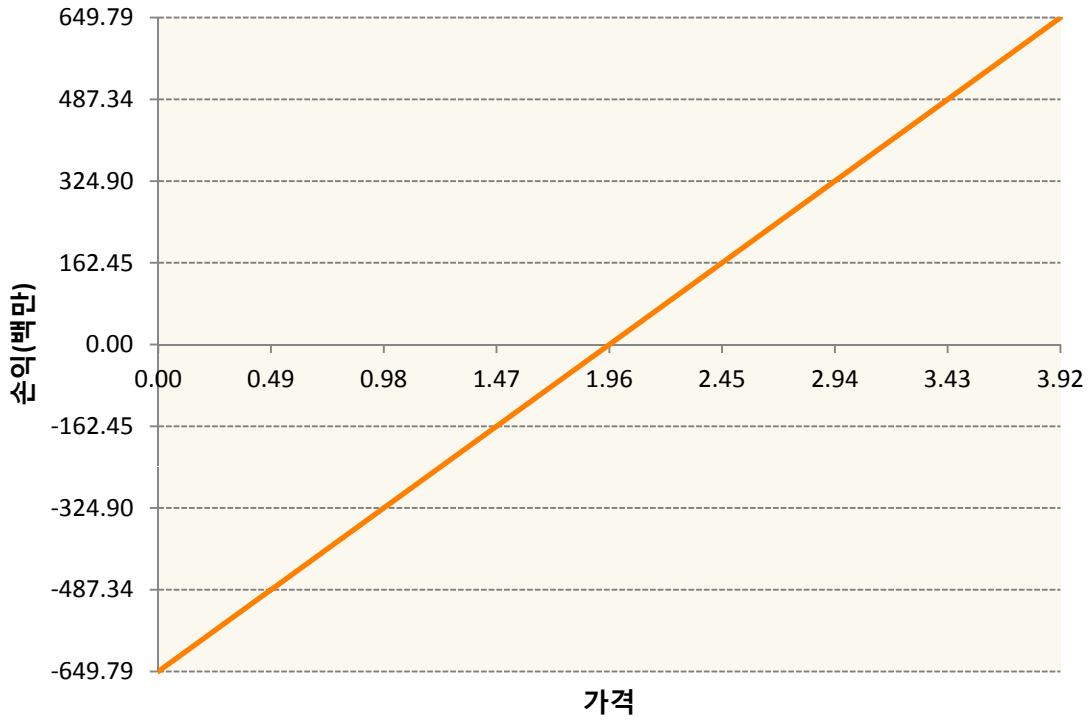
CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20



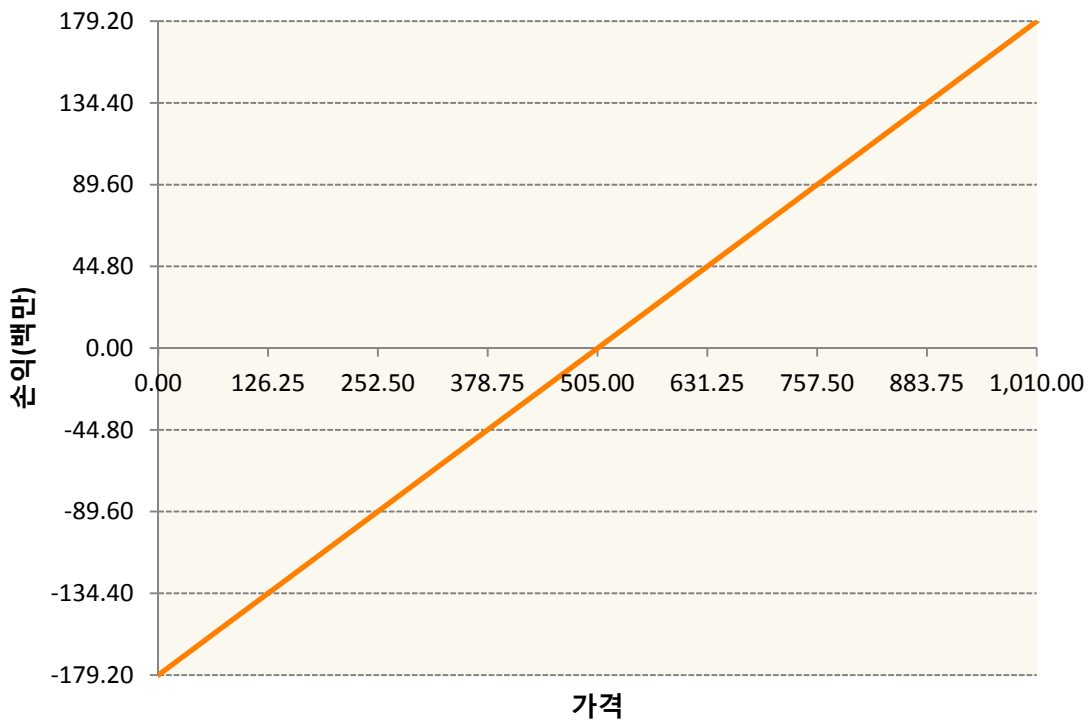




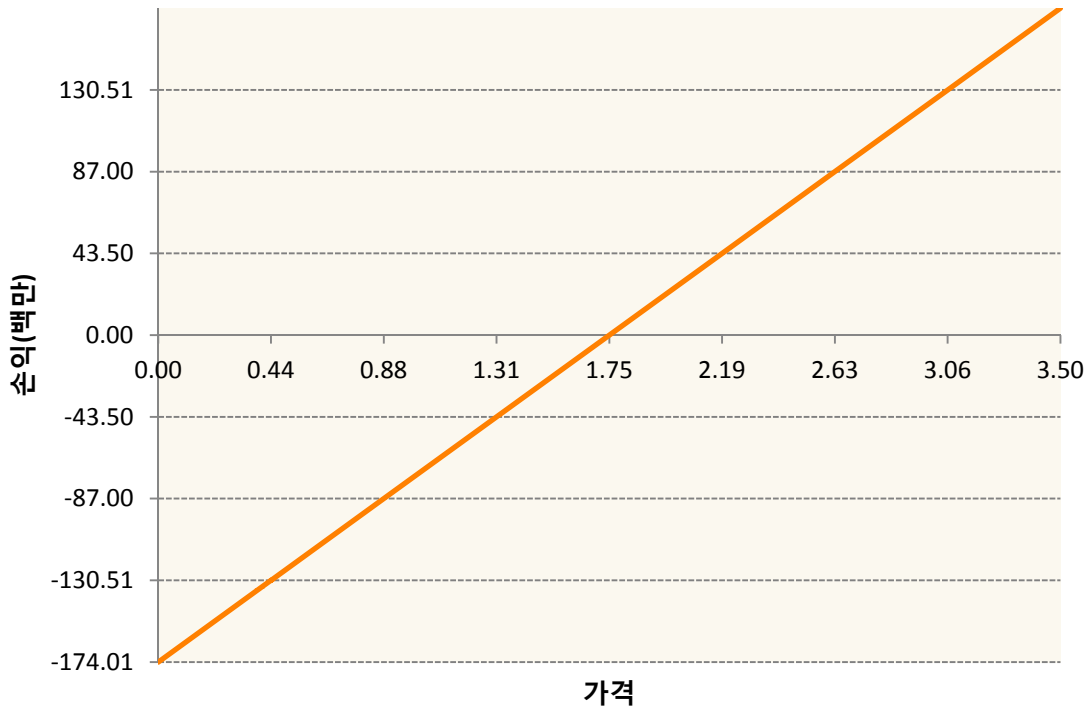
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



QSK0-Low Su Gasoil G Mar20



XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	37
CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	41
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	13
KR4175Q30C	2020-03 달러선물	16
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	52
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	14
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	14

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

346

공시일	2020-02-25
기준일	2020-02-24

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

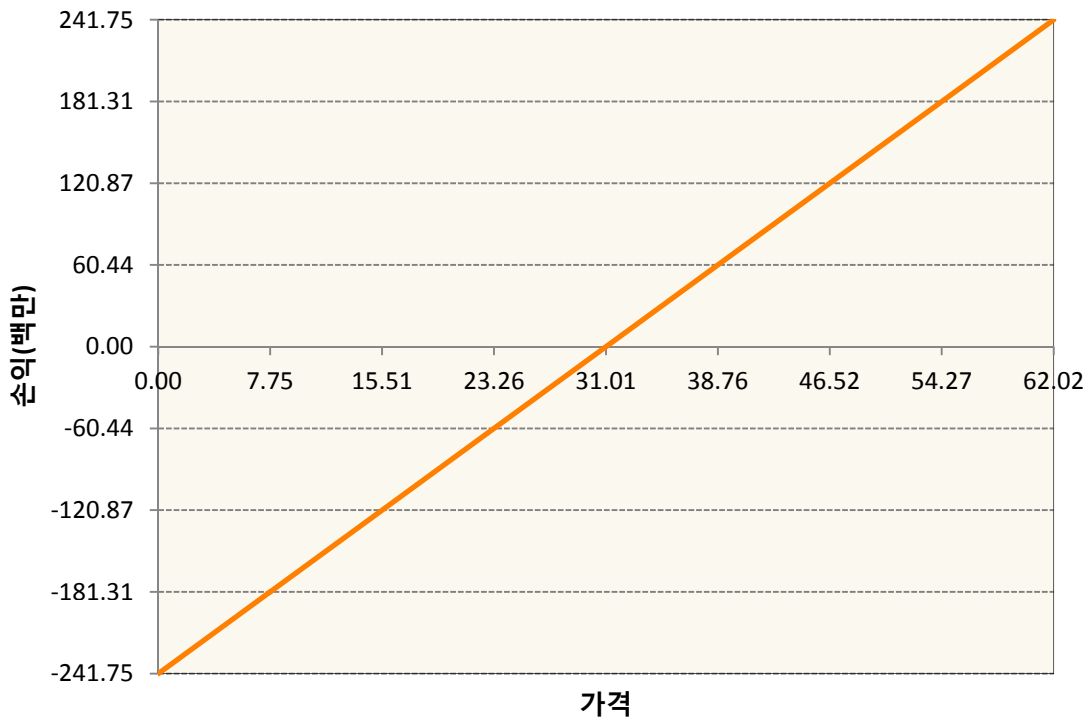
1. 계약금액

(단위:백만원)

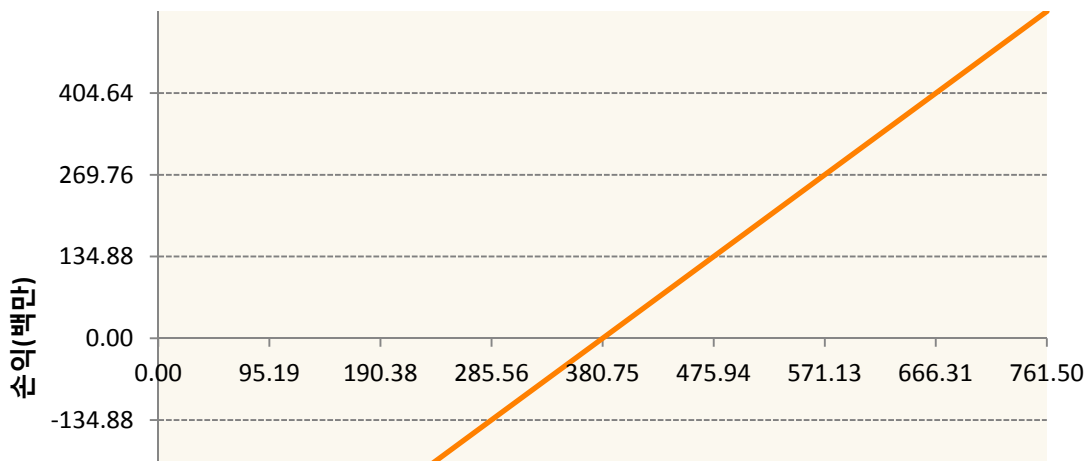
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,747	159	2,589	

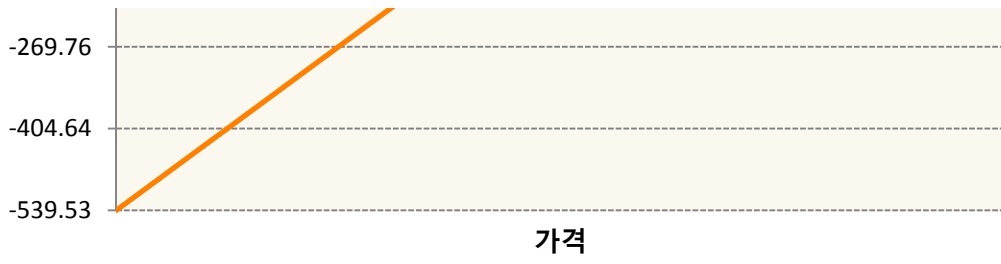
2. 만기시점의 손익구조

BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20

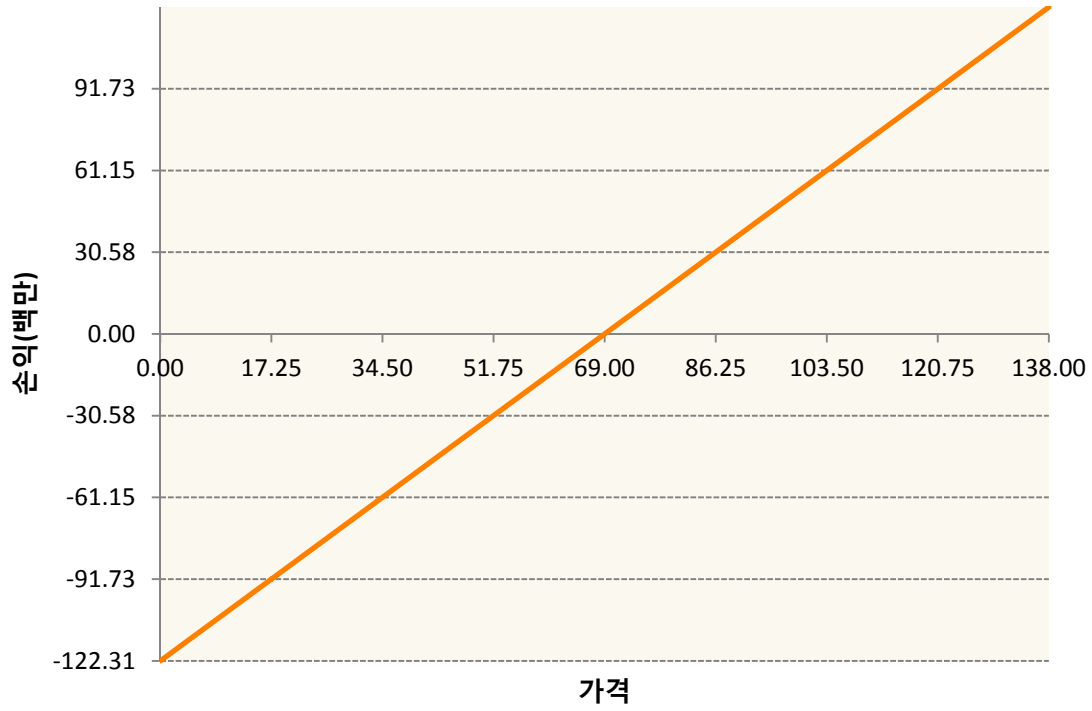


CK0-CORN FUTURE May20

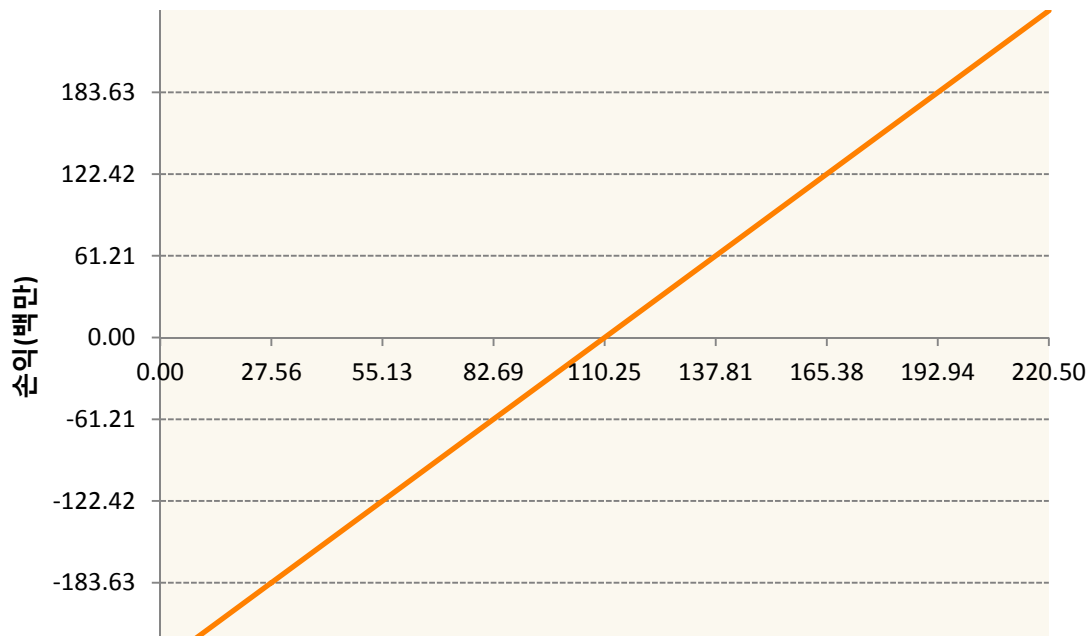


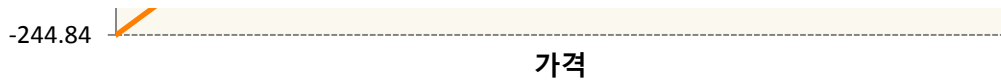


CTK0-COTTON NO.2 FUTR May20

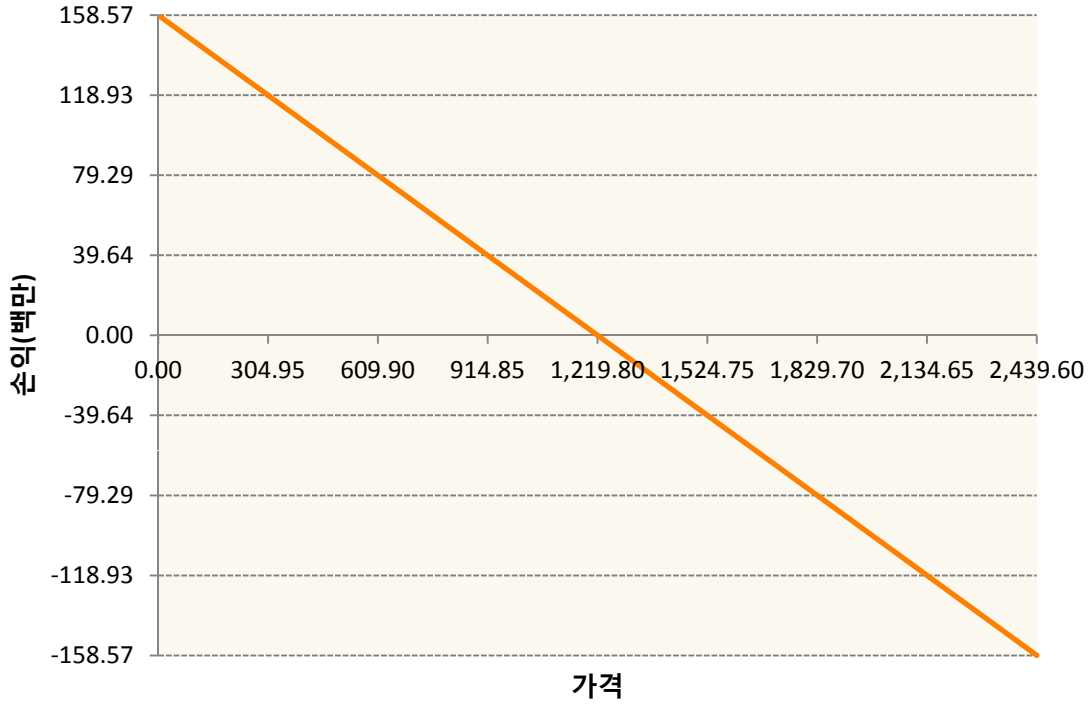


KCK0-COFFEE 'C' FUTURE May20

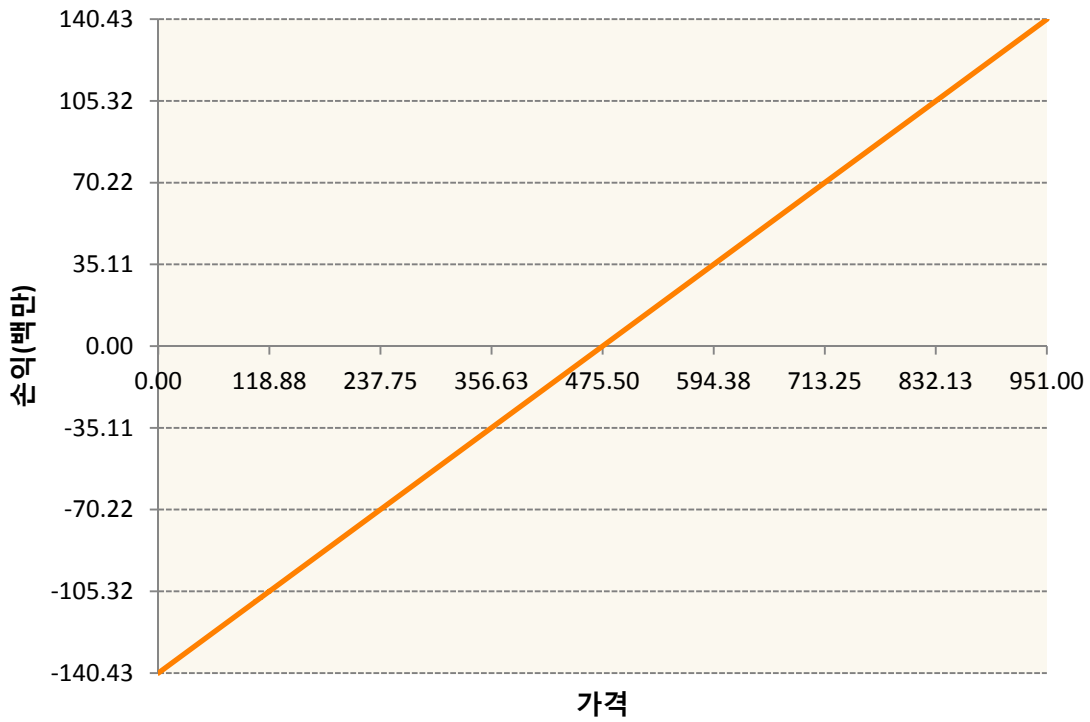




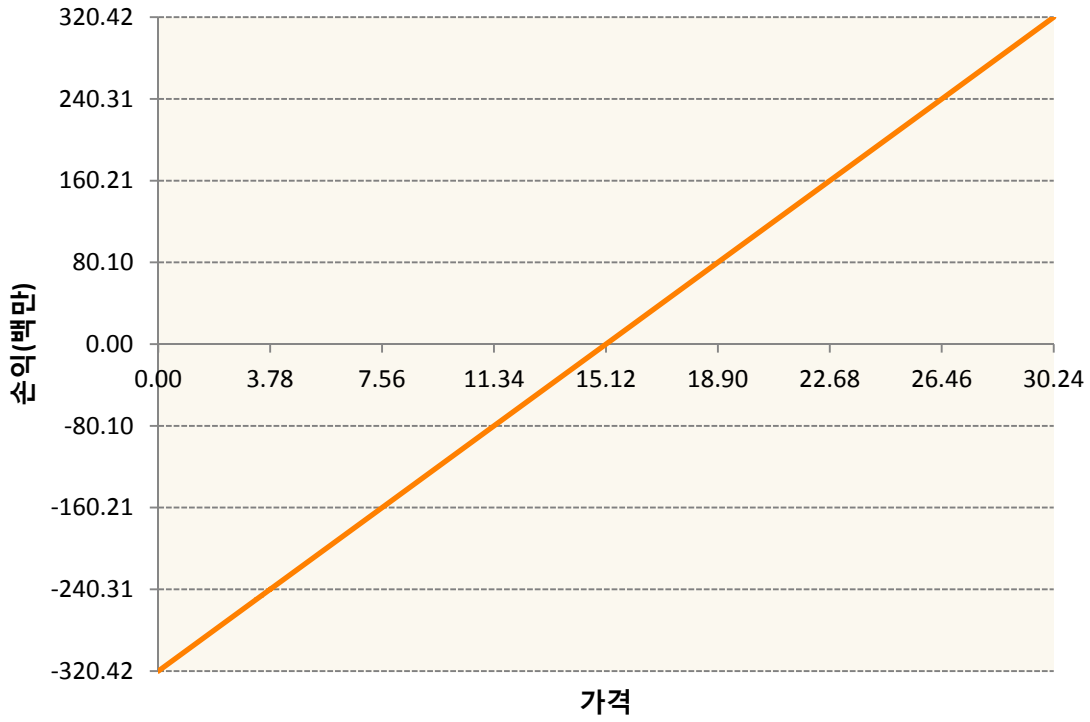
KR4175Q30009-2020-03 달러선물



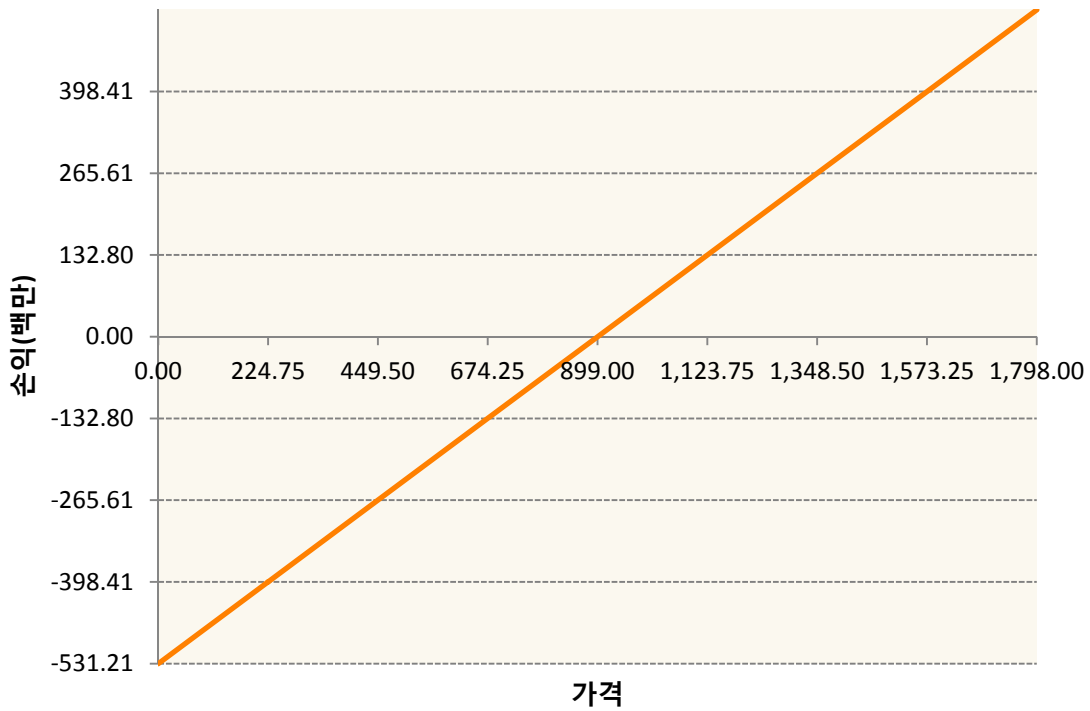
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



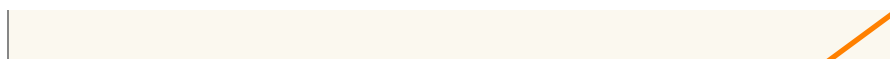
SBK0-Sugar May20

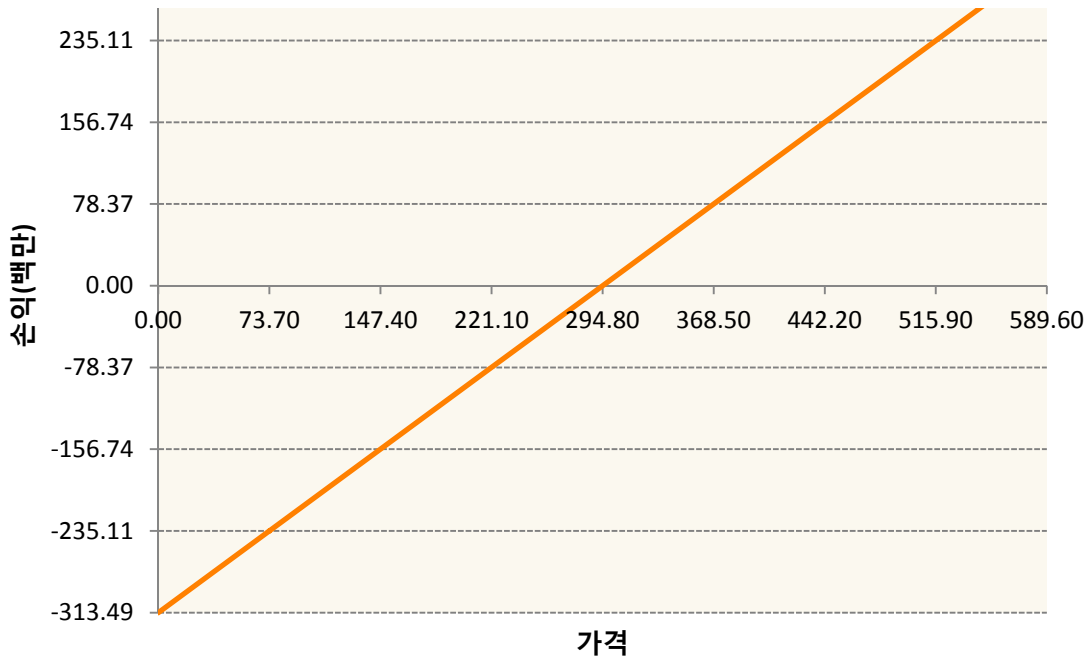


SK0-SOYBEAN FUTURE May20

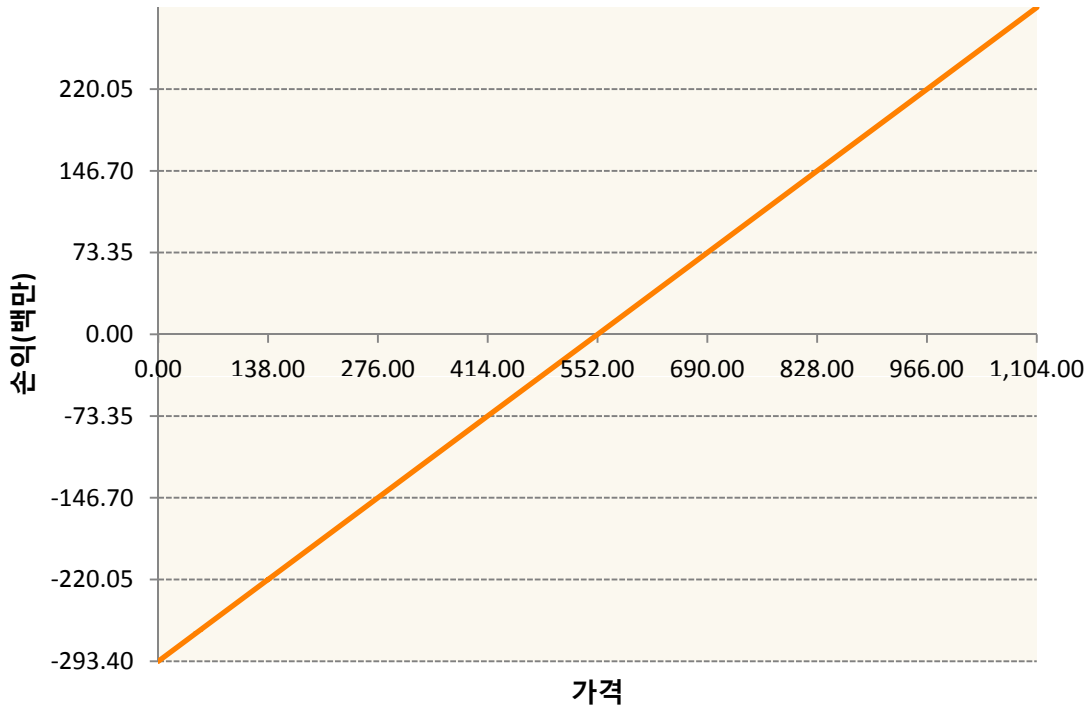


SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





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	20
KR4175Q30C	2020-03 달러선물	13

KWK0	KC HRW WHEAT FUT May20	11
SBK0	Sugar May20	26
SK0	SOYBEAN FUTURE May20	42
SMK0	SOYBEAN MEAL FUTR May20	25
WK0	WHEAT FUTURE(CBT) May20	23

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

(단위:백만원)

237