

공시일	2020-02-26
기준일	2020-02-25

## 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	2020-02-26
기준일	2020-02-25

## 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	14,446	0	14,446	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0( 신한MXWO 미래S200224

1,121

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

667

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-26
기준일	2020-02-25

## 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)	456
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	166

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

965

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-26
기준일	2020-02-25

## 유로인덱스모(주식-파생형)

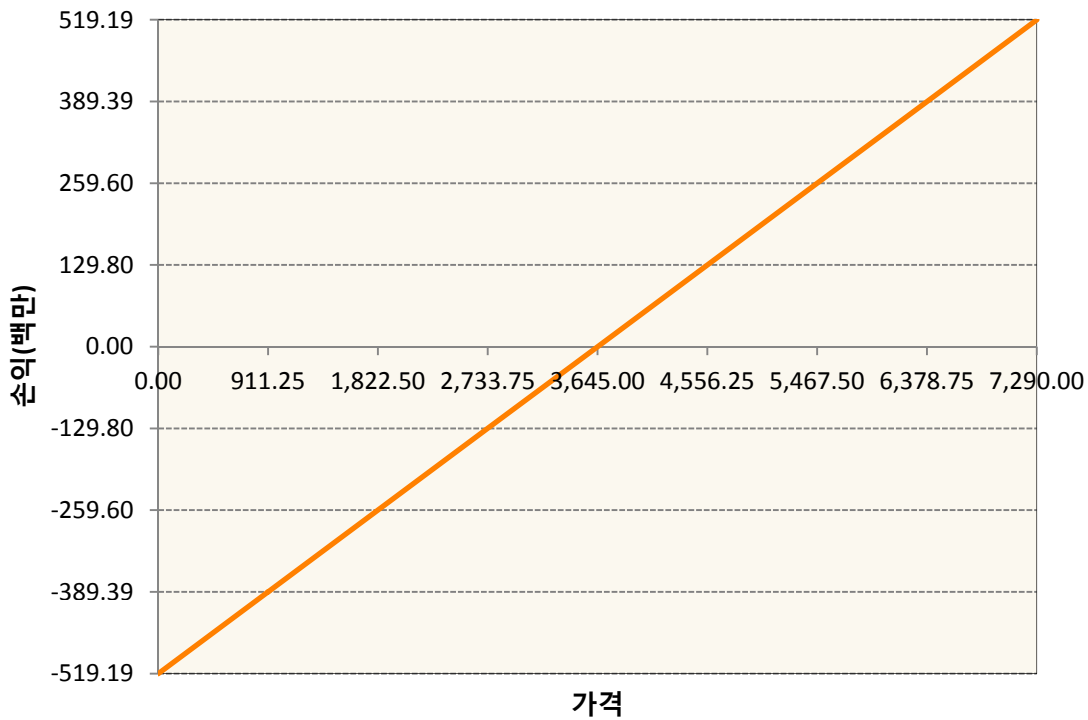
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	519	0	519	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGH0-EURO STOXX 50 Mar20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH0	EURO STOXX 50 Mar20	42
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

30
----

공시일	2020-02-26
기준일	2020-02-25

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

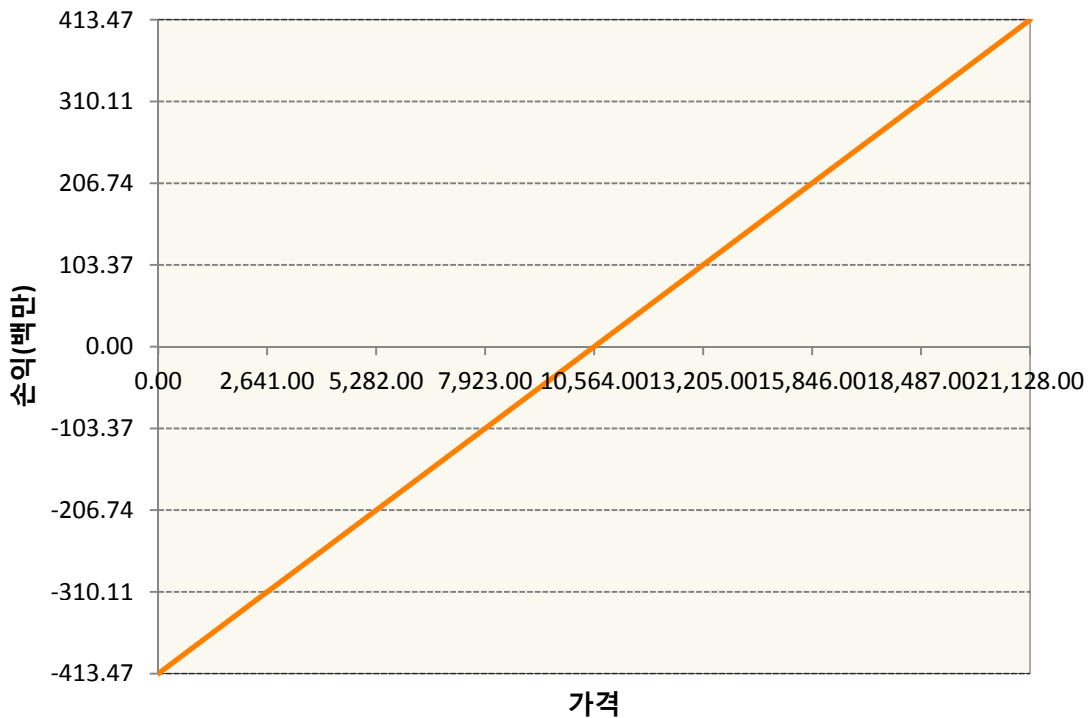
### 1. 계약금액

(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	2020-02-26
기준일	2020-02-25

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

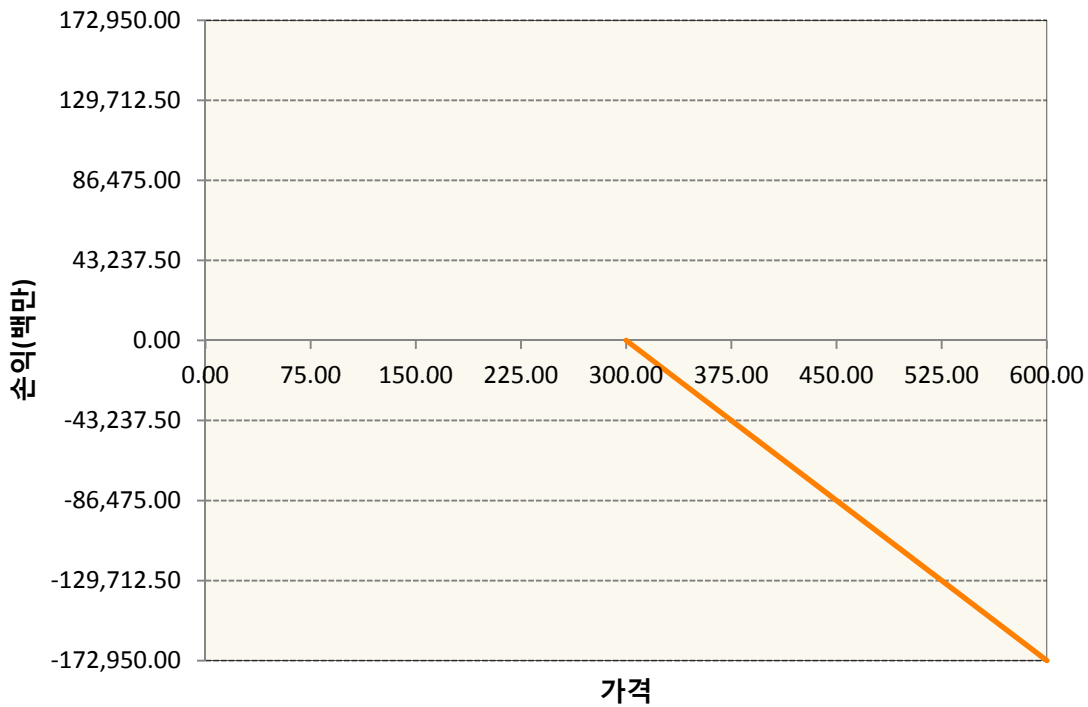
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

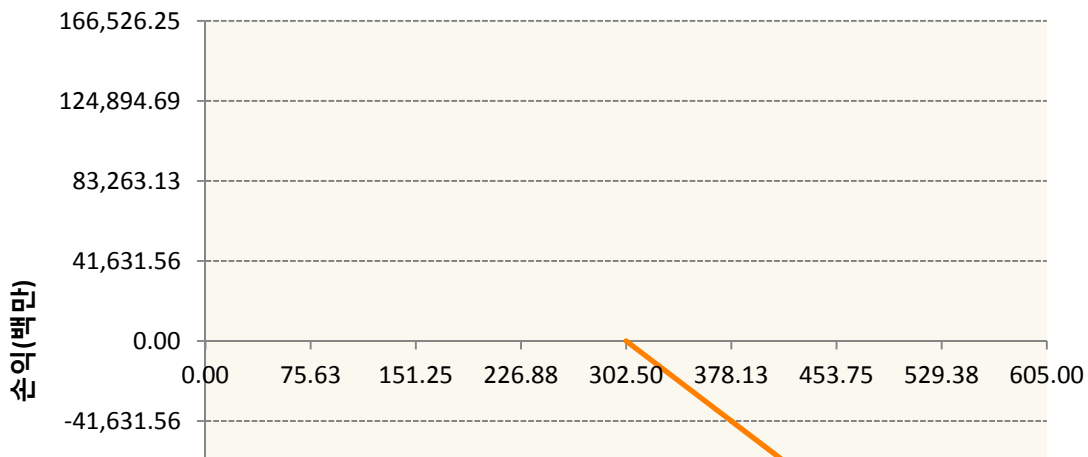
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	448,226	-448,226	장내

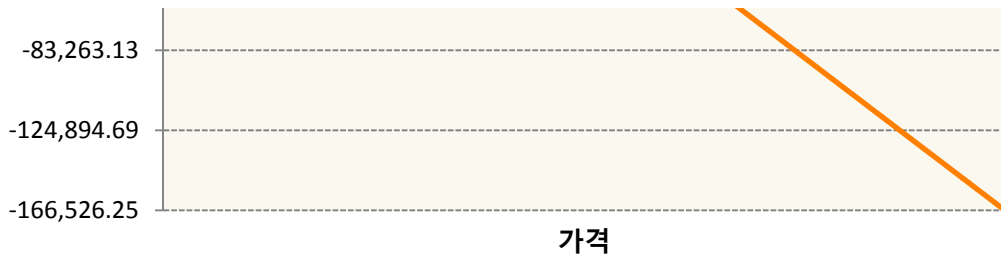
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q33007-2020-03 콜300

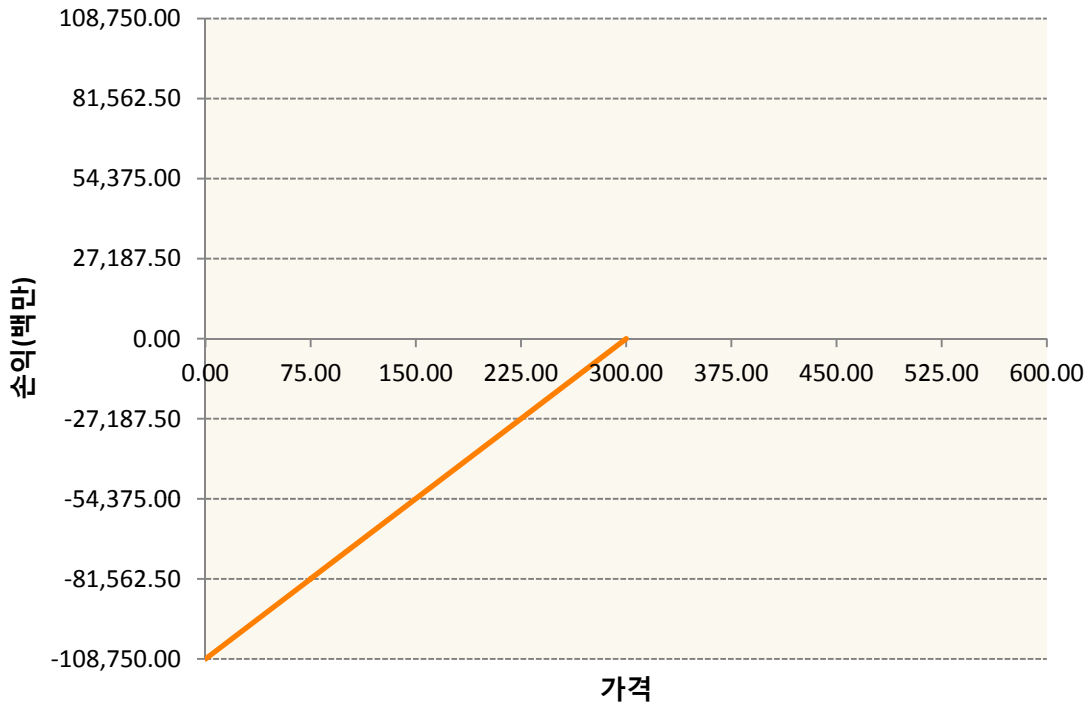


KR4201Q33023-2020-03 콜302.5





KR4301Q33005-2020-03 풋300



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q33007		2020-03 콜300					6,856
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,537	1,517	1,482	1,431	1,362	1,273	1,166
-5.33%	1,483	1,422	1,337	1,228	1,095	940	765
-2.67%	1,300	1,160	990	795	578	342	89
0%	818	566	292	0	-306	-624	-952
2.67%	-194	-552	-919	-1,291	-1,669	-2,050	-2,434
5.33%	-1,939	-2,349	-2,760	-3,170	-3,580	-3,990	-4,400
8.00%	-4,491	-4,875	-5,264	-5,658	-6,055	-6,455	-6,856
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5					6,042
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,202	1,189	1,164	1,126	1,072	1,001	913

-5.33%	1,168	1,124	1,060	974	867	738	590
-2.67%	1,043	935	800	639	456	253	32
0%	692	484	252	0	-269	-552	-847
2.67%	-91	-407	-735	-1,072	-1,417	-1,768	-2,123
5.33%	-1,516	-1,903	-2,291	-2,679	-3,069	-3,459	-3,849
8.00%	-3,701	-4,087	-4,475	-4,865	-5,256	-5,649	-6,042
KR4301Q33005 2020-03 풋300							7,929
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,906	-7,906	-7,907	-7,909	-7,912	-7,919	-7,929
-5.33%	-5,162	-5,164	-5,170	-5,180	-5,196	-5,217	-5,246
-2.67%	-2,431	-2,448	-2,474	-2,509	-2,554	-2,608	-2,671
0%	219	158	85	0	-94	-196	-306
2.67%	2,590	2,460	2,322	2,180	2,033	1,883	1,730
5.33%	4,384	4,210	4,037	3,863	3,690	3,516	3,343
8.00%	5,441	5,293	5,141	4,984	4,825	4,664	4,501

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

(단위:백만원)

18,415

공시일	2020-02-26
기준일	2020-02-25

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

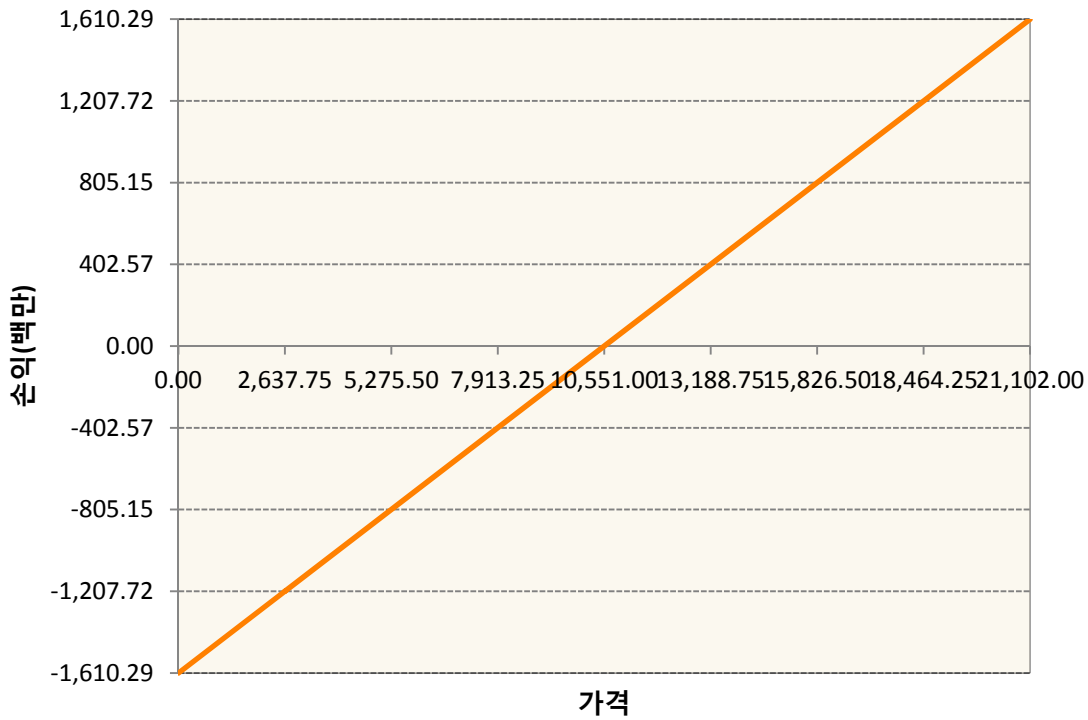
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

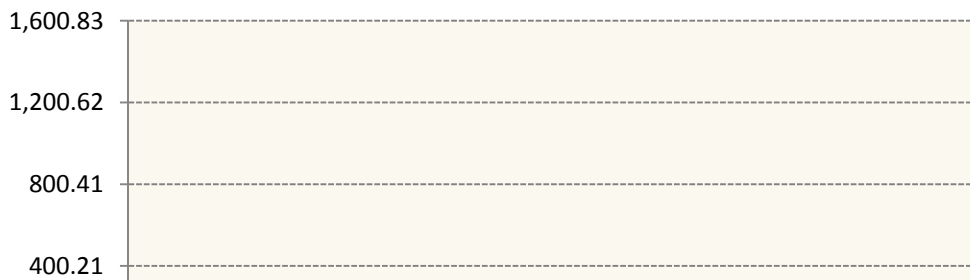
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,610	0	1,610	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,575	-4,575	장내
누계	통화	선도	0	2,188	-2,188	장외

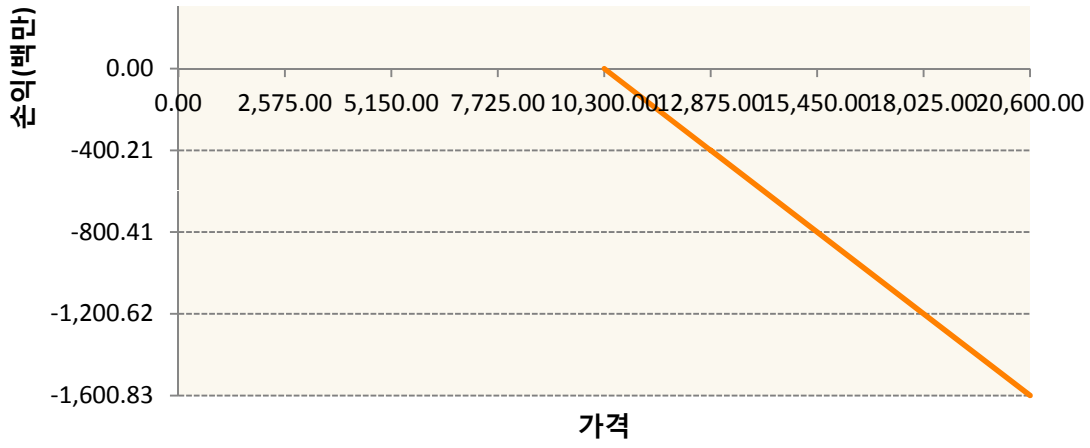
### 2. 만기시점의 손익구조

HCG0-HSCEI Futures Feb20

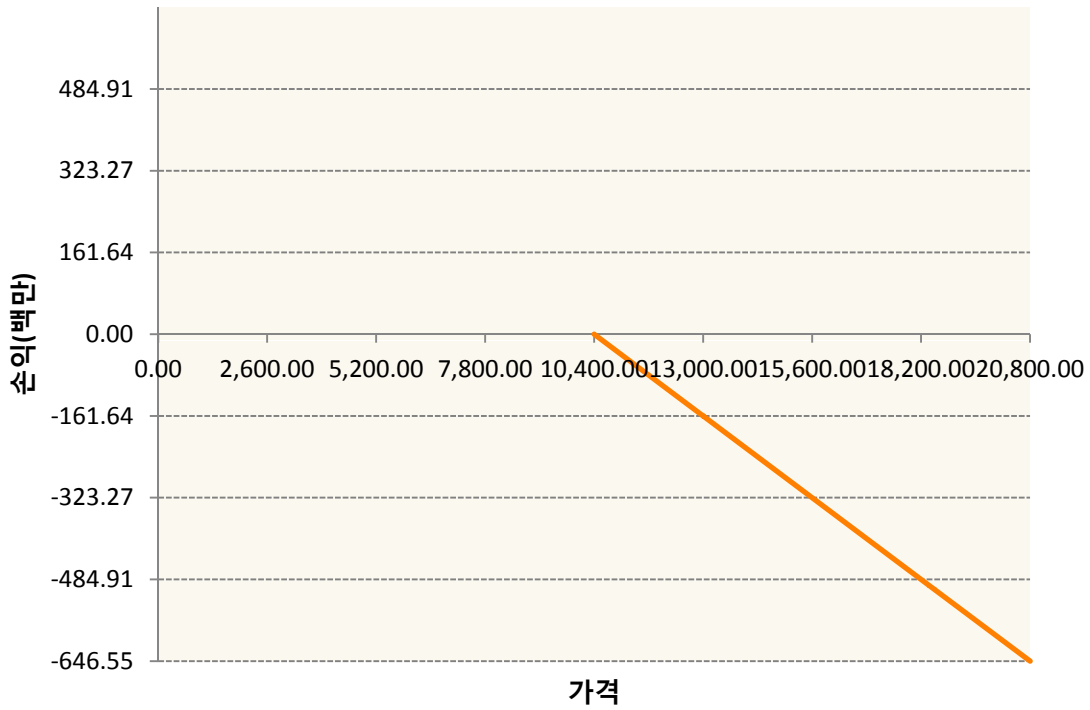


OHHIG0-C103-HSCEI

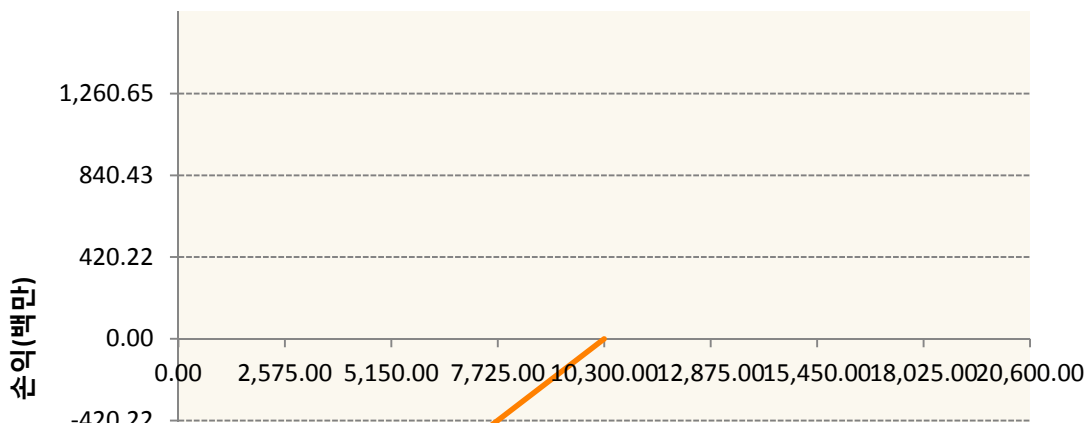


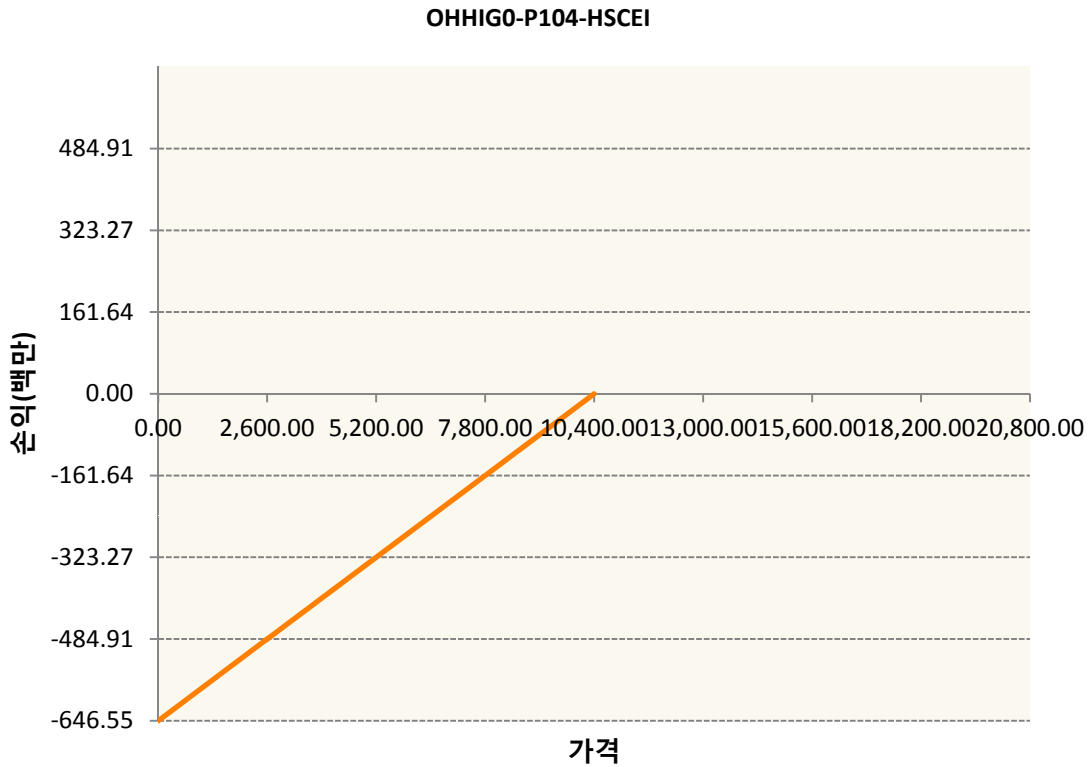


OHHIG0-C104-HSCEI



OHHIG0-P103-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E		175
HCG0 HSCEI Futures Feb20		129
OHHIG0-C1( HSCEI		128
OHHIG0-C1( HSCEI		52
OHHIG0-P1( HSCEI		134
OHHIG0-P1( HSCEI		52

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		509

공시일	2020-02-26
기준일	2020-02-25

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

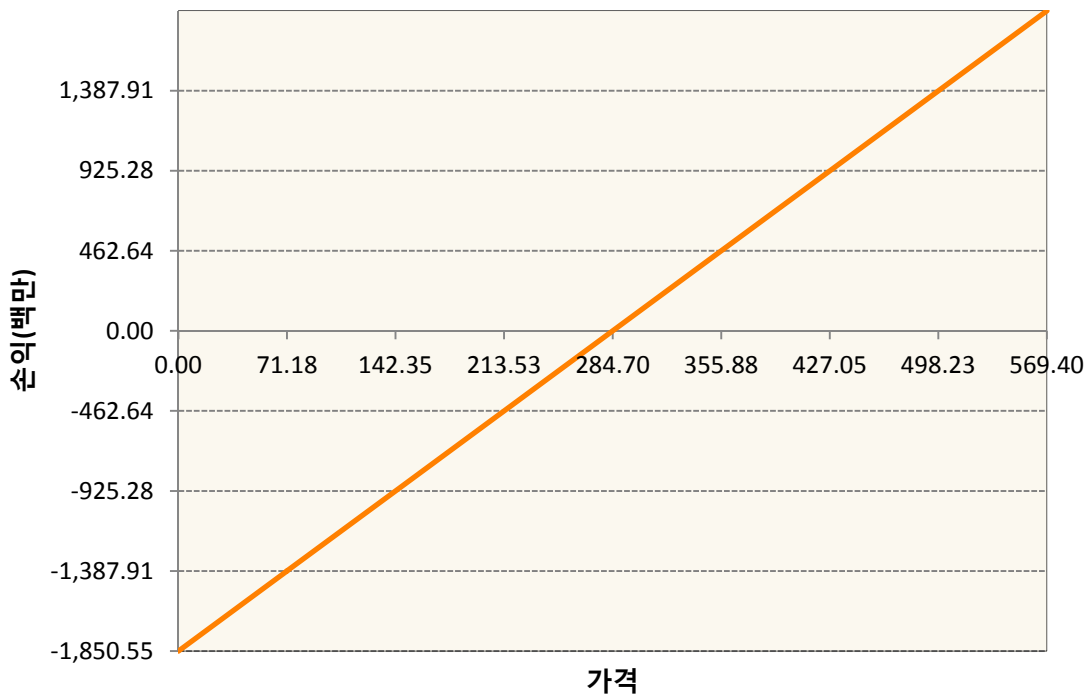
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

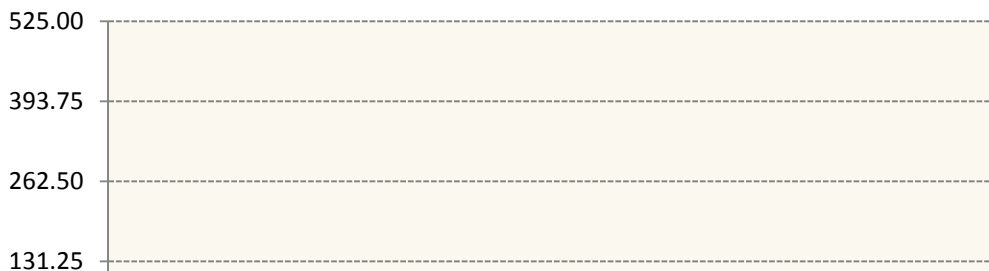
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,851	0	1,851	장내
누계	유가증권	스왑	3,125	0	3,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,612	-3,612	장내

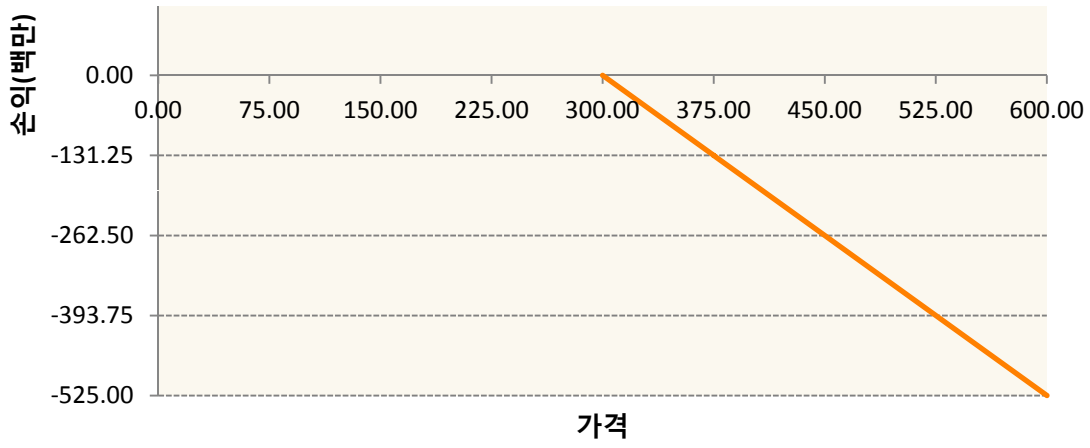
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

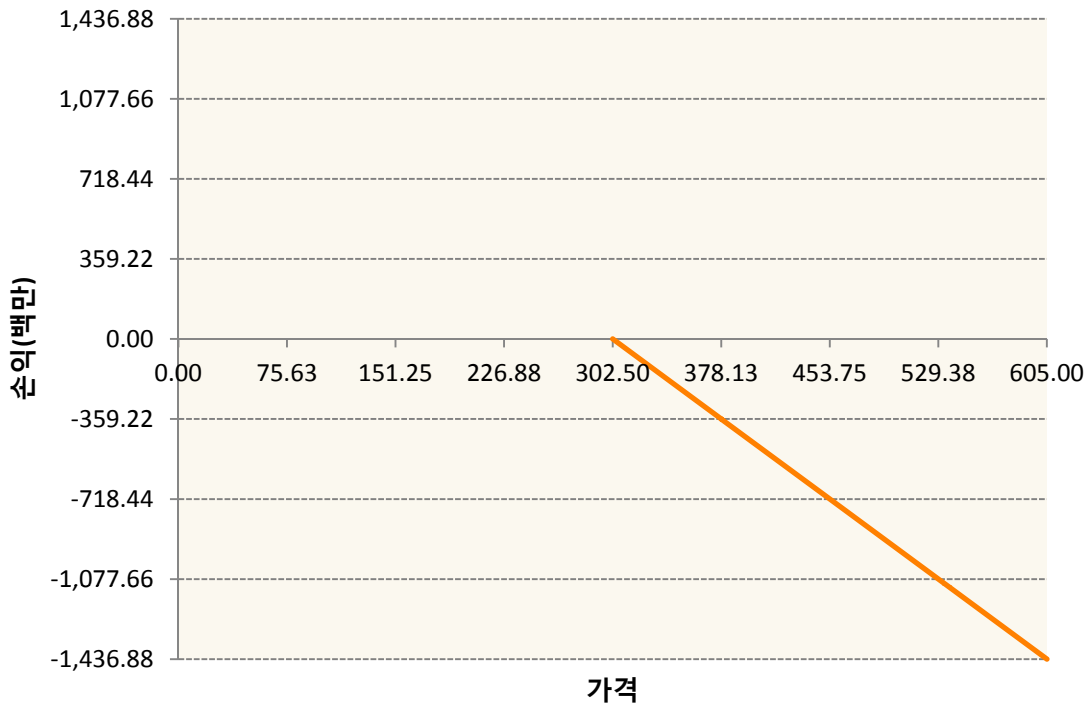


KR4201Q33007-2020-03 콜300

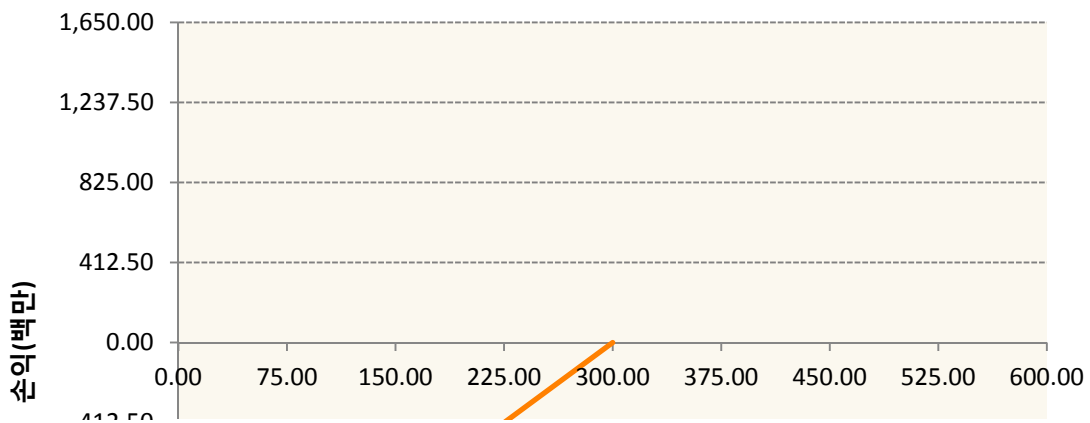




KR4201Q33023-2020-03 콜302.5



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						148
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-148	-148	-148	-148	-148	-148	-148	
-5.33%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99	
-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%	99	99	99	99	99	99	99	
8.00%	148	148	148	148	148	148	148	
KR4201Q33007		2020-03 콜300						21
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5	5	4	4	4	4	4	
-5.33%	5	4	4	4	3	3	2	
-2.67%	4	4	3	2	2	1	0	
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3	
2.67%	-1	-2	-3	-4	-5	-6	-7	
5.33%	-6	-7	-8	-10	-11	-12	-13	
8.00%	-14	-15	-16	-17	-18	-20	-21	
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5						52
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	10	10	10	10	9	9	8
-5.33%	10	10	9	8	7	6	5
-2.67%	9	8	7	6	4	2	0
0%	6	4	2	0	-2	-5	-7
2.67%	-1	-4	-6	-9	-12	-15	-18
5.33%	-13	-16	-20	-23	-26	-30	-33
8.00%	-32	-35	-39	-42	-45	-49	-52
KR4301Q33005 2020-03 풋300							120
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120
-5.33%	-78	-78	-78	-79	-79	-79	-80
-2.67%	-37	-37	-38	-38	-39	-40	-41
0%	3	2	1	0	-1	-3	-5
2.67%	39	37	35	33	31	29	26
5.33%	67	64	61	59	56	53	51
8.00%	83	80	78	76	73	71	68

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

(단위:백만원)

581

공시일	2020-02-26
기준일	2020-02-25

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

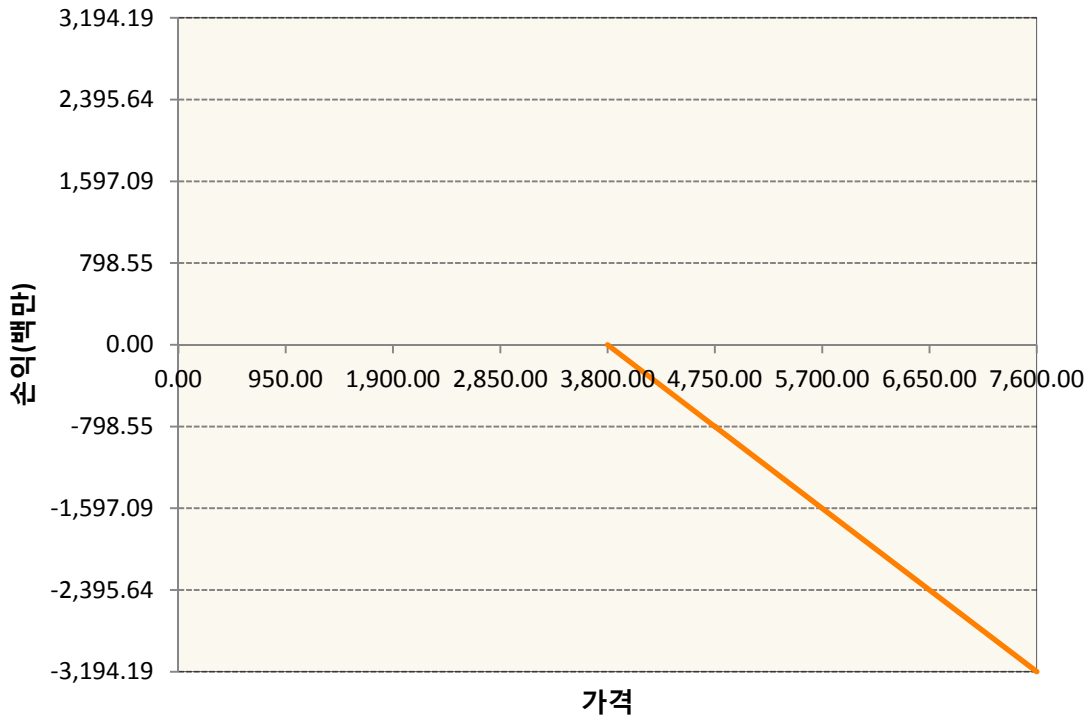
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

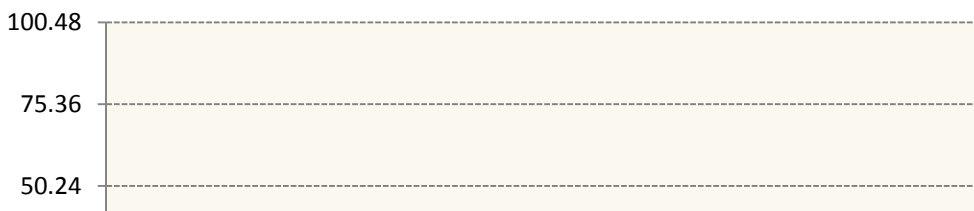
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	188	0	188	
누계	유가증권	스왑	11,822	0	11,822	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,589	-6,589	장내
누계	통화	선도	0	3,446	-3,446	장외

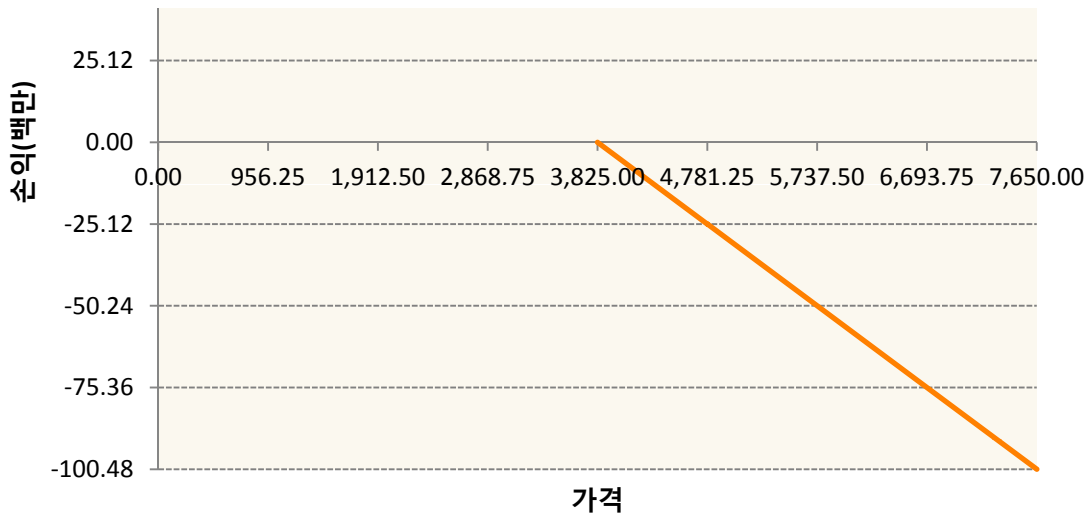
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXH0-C3800-EURO STOXX 50**

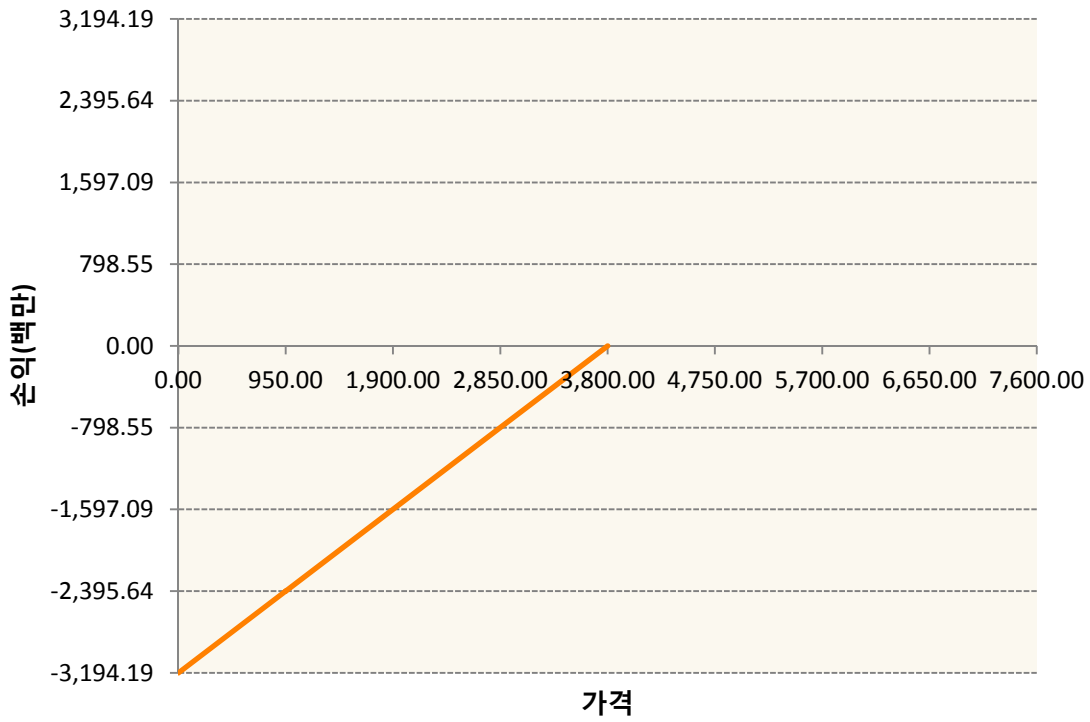


**OESXH0-C3825-EURO STOXX 50**

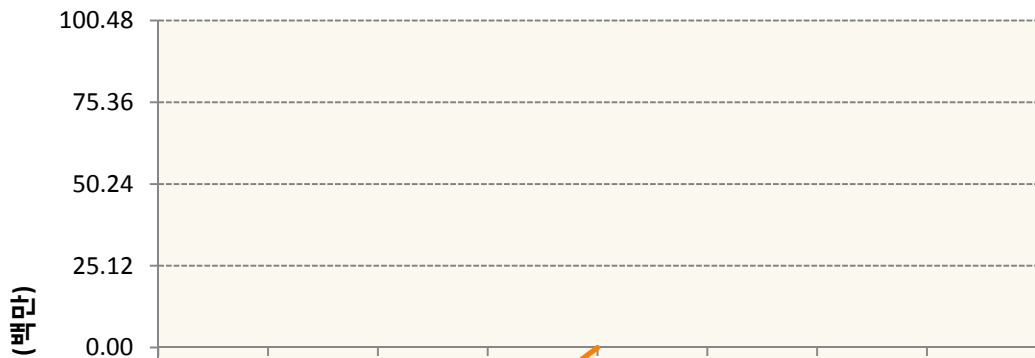


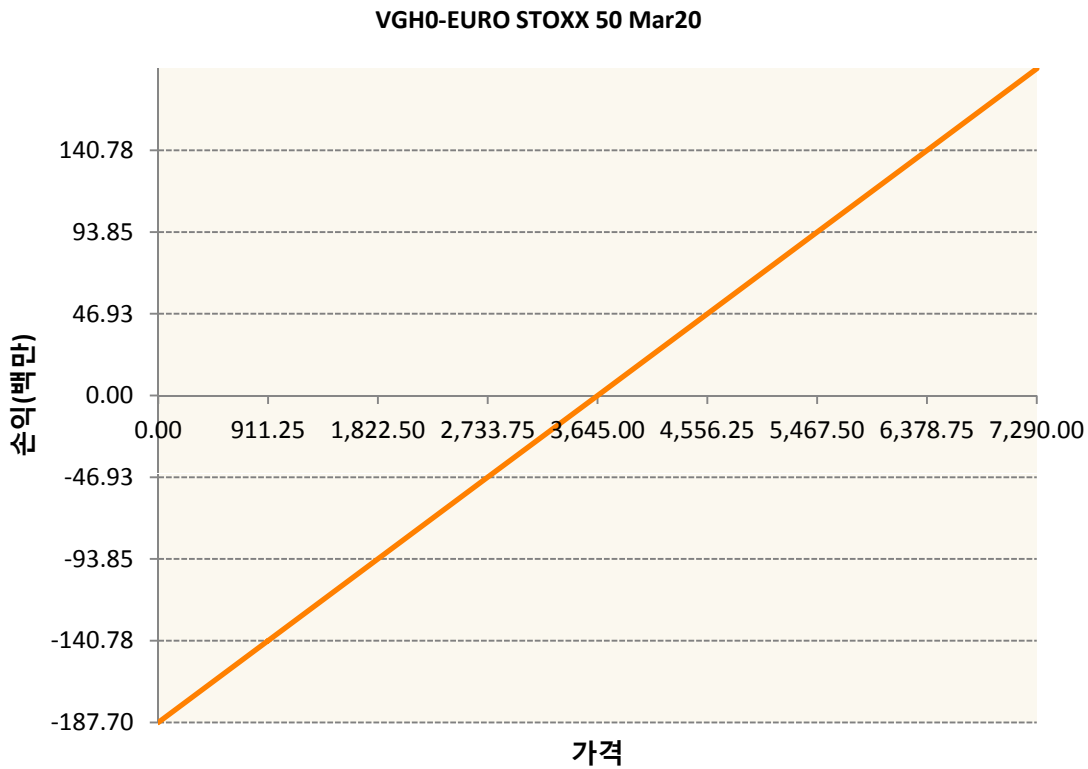
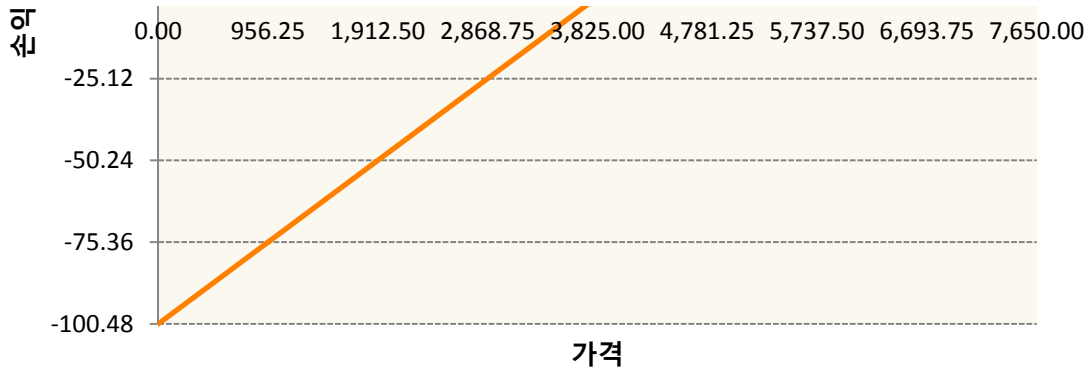


OESXH0-P3800-EURO STOXX 50



OESXH0-P3825-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		18
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E		276
OESXH0-C3& EURO STOXX 50		256
OESXH0-C3& EURO STOXX 50		8
OESXH0-P3& EURO STOXX 50		256
OESXH0-P3& EURO STOXX 50		8
VGHO EURO STOXX 50 Mar20		15

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

공시일	2020-02-26
기준일	2020-02-25

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

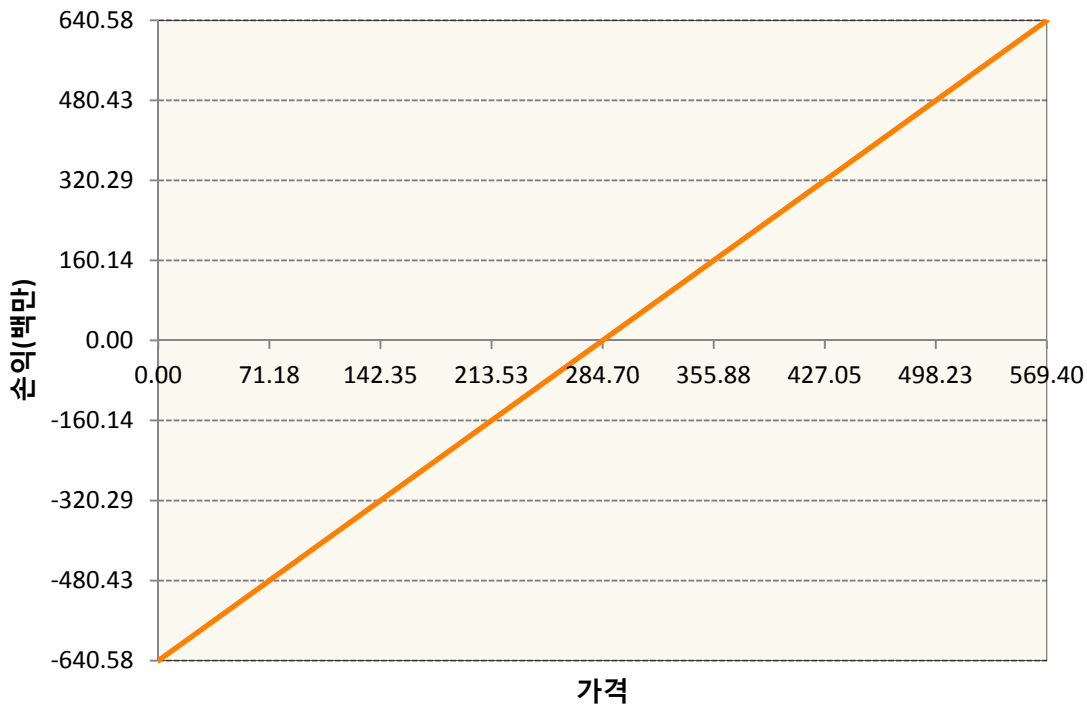
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	641	0	641	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						51
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51	
-5.33%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	17	17	17	17	17	17	17	
5.33%	34	34	34	34	34	34	34	
8.00%	51	51	51	51	51	51	51	

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

(단위:백만원)

44

공시일	2020-02-26
기준일	2020-02-25

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

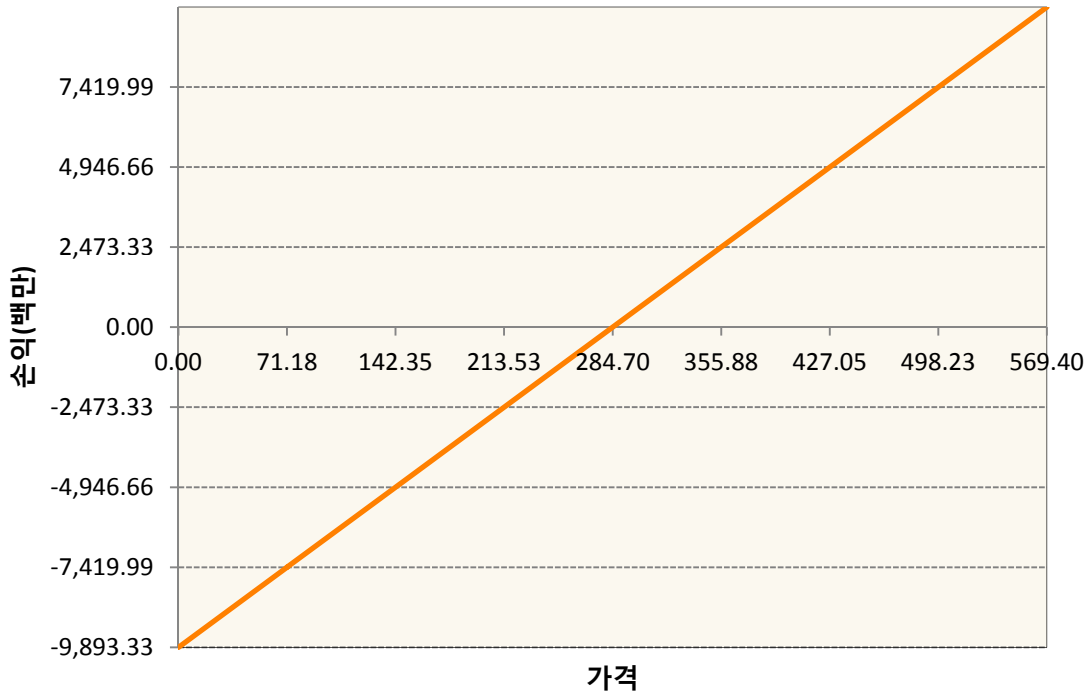
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

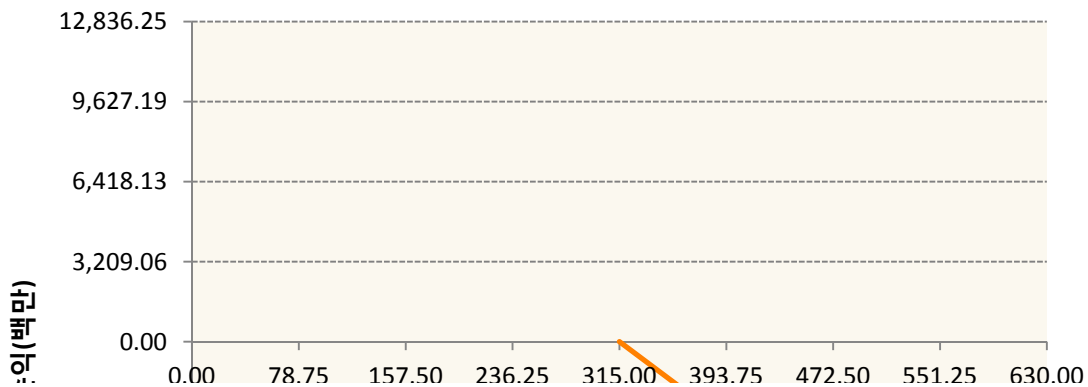
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	142	0	142	장내
신규	유가증권	옵션	0	158	-158	장내
누계	유가증권	선물	9,893	0	9,893	장내
누계	유가증권	옵션	2,257	21,012	-18,755	장내

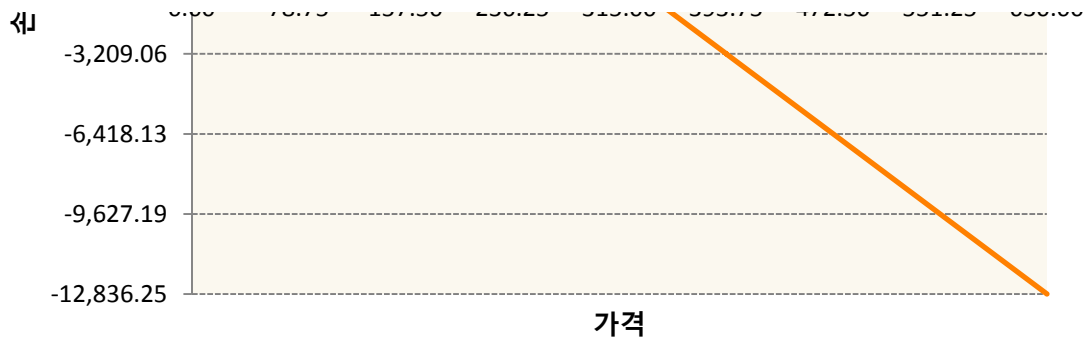
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

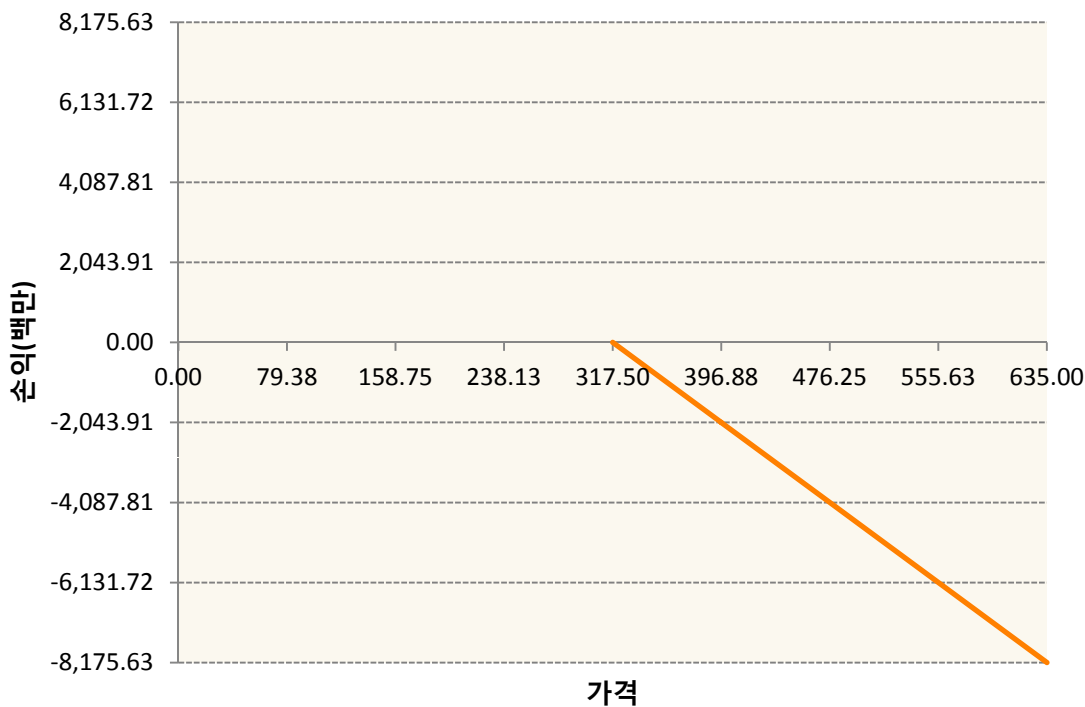


KR4201Q33155-2020-03 콜315

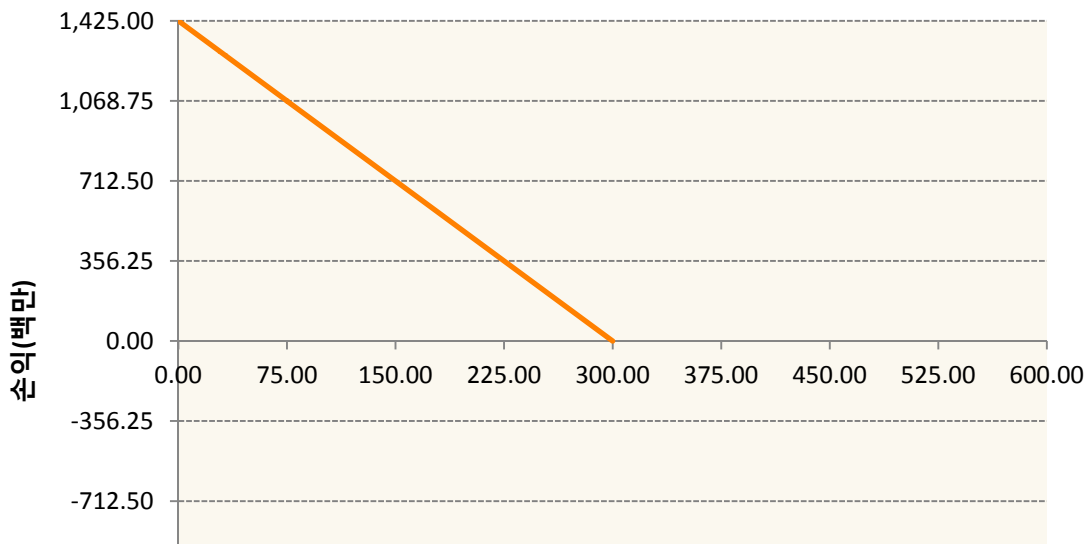


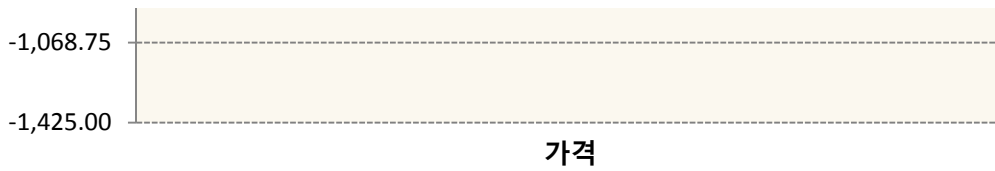


KR4201Q33171-2020-03 콜317.5

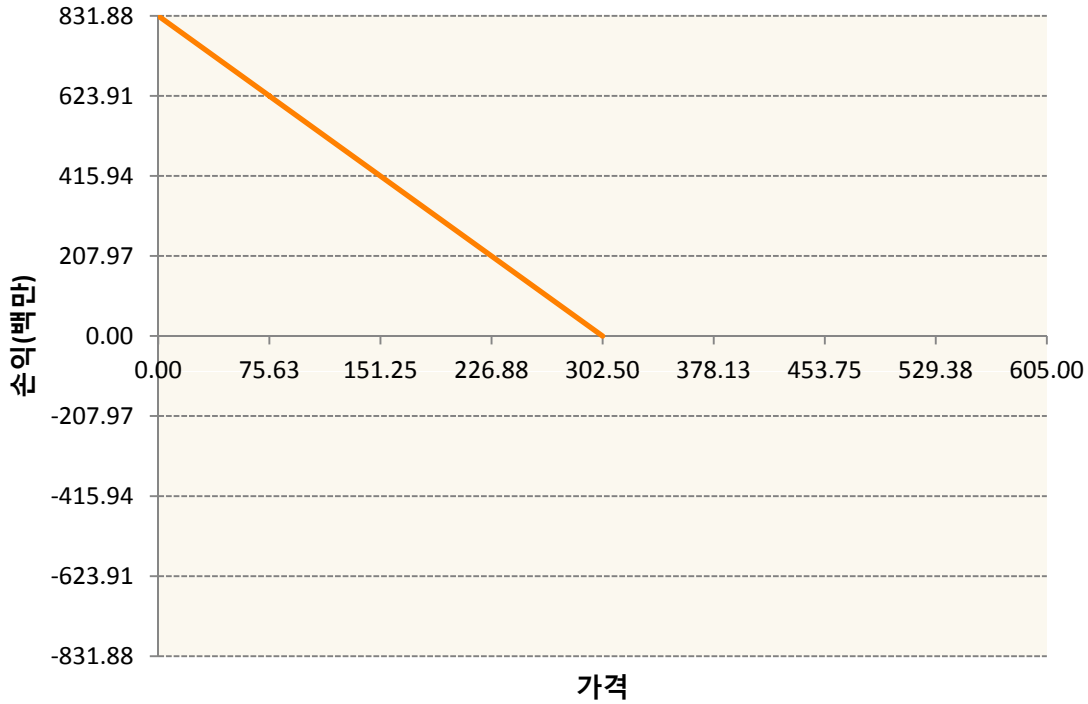


KR4301Q33005-2020-03 풋300





KR4301Q33021-2020-03 풋302.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						790
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-790	-790	-790	-790	-790	-790	-790	
-5.33%	-527	-527	-527	-527	-527	-527	-527	
-2.67%	-263	-263	-263	-263	-263	-263	-263	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	263	263	263	263	263	263	263	
5.33%	527	527	527	527	527	527	527	
8.00%	790	790	790	790	790	790	790	
KR4201Q33155		2020-03 콜315						276
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	29	29	29	28	27	25	22	
-5.33%	29	28	27	25	22	18	13	
-2.67%	27	25	22	17	11	4	-6	

0%	22	17	9	0	-11	-24	-38
2.67%	6	-5	-19	-35	-52	-70	-90
5.33%	-32	-52	-73	-95	-119	-143	-168
8.00%	-108	-135	-162	-190	-219	-247	-276
KR4201Q33171                      2020-03 콜317.5							156
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	14	14	14	14	13	12	11
-5.33%	14	14	13	12	11	9	6
-2.67%	14	13	11	9	6	1	-4
0%	11	9	5	0	-6	-13	-21
2.67%	4	-2	-9	-18	-28	-38	-50
5.33%	-15	-26	-38	-51	-65	-79	-94
8.00%	-54	-70	-87	-103	-121	-138	-156
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	68	68	68	69
-2.67%	32	32	32	33	33	34	35
0%	-3	-2	-1	0	1	3	4
2.67%	-34	-32	-30	-29	-27	-25	-23
5.33%	-57	-55	-53	-51	-48	-46	-44
8.00%	-71	-69	-67	-65	-63	-61	-59
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%	19	19	19	20	20	20	20
0%	-1	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-20	-19	-18	-17	-16	-15	-14
5.33%	-35	-34	-33	-32	-30	-29	-28
8.00%	-45	-44	-43	-41	-40	-39	-38

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

(단위:백만원)

1,064

공시일	2020-02-26
기준일	2020-02-25

## 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	219,083	0	219,083	

### 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	2020-02-26
기준일	2020-02-25

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	4,165	-4,165	
누계	유가증권	수익증권	181,484	0	181,484	

### 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	2020-02-26
기준일	2020-02-25

## 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	543,630	0	543,630	
누계	통화	선도	0	579,492	-579,492	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	1,936
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	2,072
FX21019Z04 KRW/USD 26-02-20E	194
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,559
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,452
FX21020F02 KRW/USD 28-02-20E	1,936
FX21020F03 KRW/USD 28-02-20E	3,002
FX21020F03 KRW/USD 31-03-20E	3,098
FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E	2,905
FX21020F04 KRW/USD 28-02-20E	194
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,614
FX21020G00 KRW/USD 06-03-20E	2,421
FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	968
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,201
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,230
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	968
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	1,936
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	3,331
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,331
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,936
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,873
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,266
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,936

IE00BD8RGM75

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

15,897



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

(단위:백만원)

125

공시일	2020-02-26
기준일	2020-02-25

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

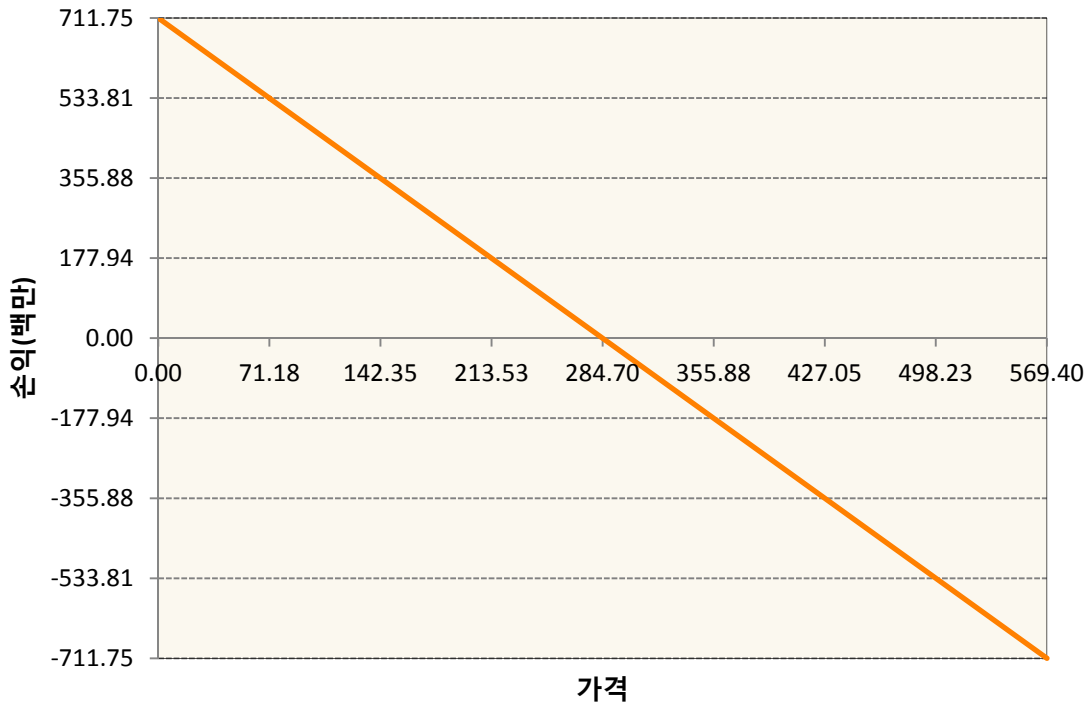
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

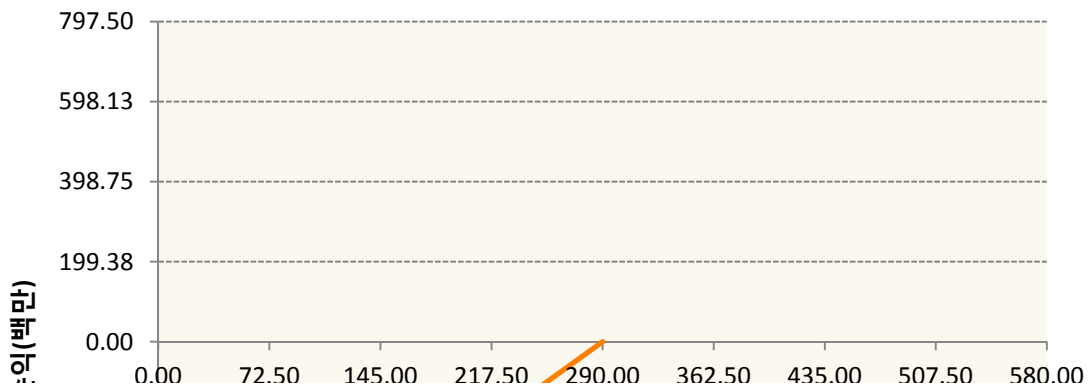
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	712	-712	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,503	-3,503	장내

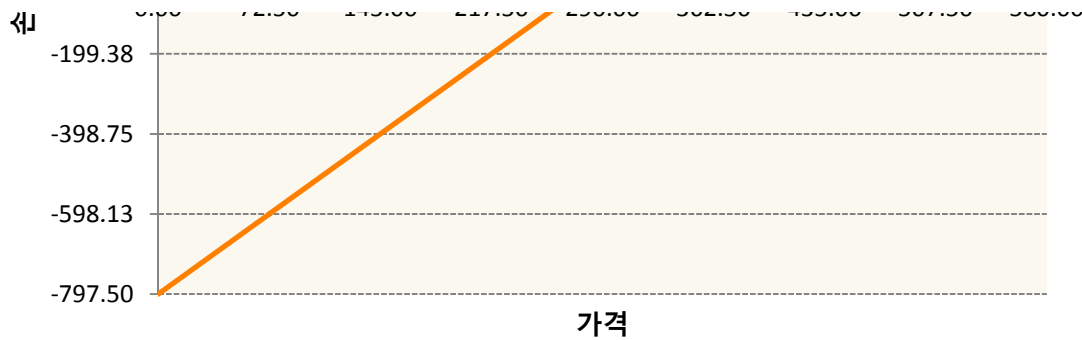
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

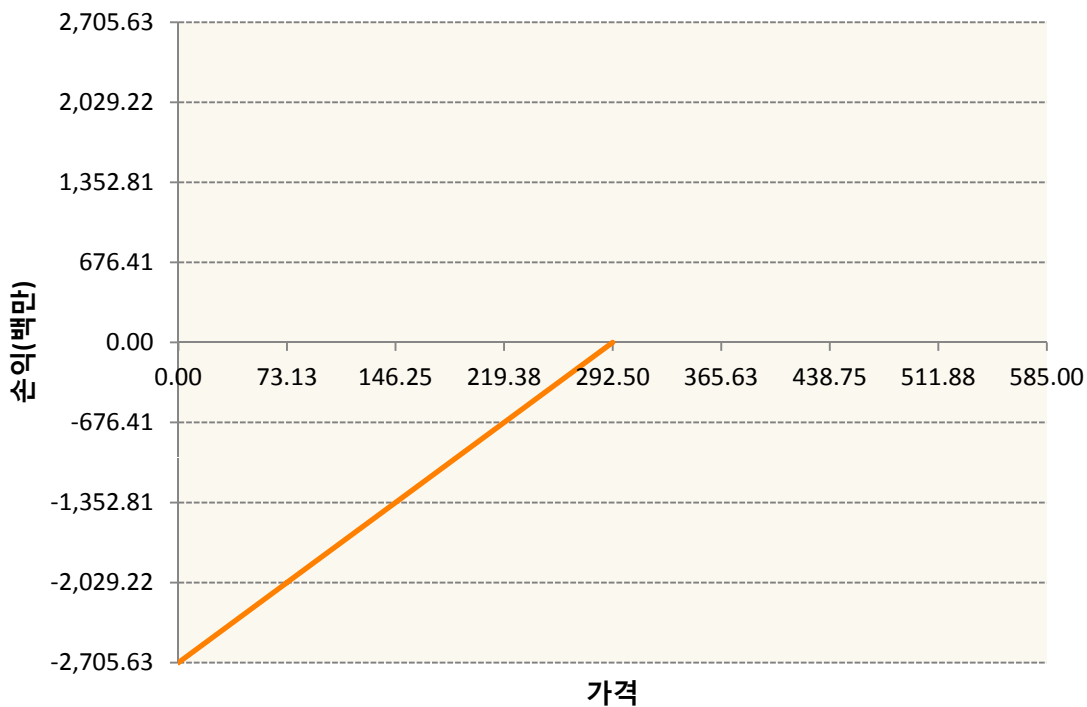


KR4301Q32908-2020-03 풋290





KR4301Q32924-2020-03 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						57
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	57	57	57	57	57	57	57	
-5.33%	38	38	38	38	38	38	38	
-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%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38	
8.00%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57	
KR4301Q32908		2020-03 풋290						55
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-55	-55
-5.33%	-33	-34	-34	-34	-35	-35	-36
-2.67%	-14	-14	-15	-16	-16	-17	-18
0%	3	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	15	14	13	11	10	9	8
5.33%	21	21	20	19	18	16	15
8.00%	24	23	23	22	22	21	20

KR4301Q32924                      2020-03 풋292.5                      190

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-189	-189	-189	-189	-189	-190	-190
-5.33%	-119	-119	-120	-121	-122	-123	-124
-2.67%	-51	-52	-54	-56	-58	-61	-64
0%	10	7	3	0	-4	-7	-11
2.67%	56	52	48	43	39	35	30
5.33%	83	80	76	72	68	64	60
8.00%	95	93	90	88	85	82	79

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

(단위:백만원)

**314**

공시일	2020-02-26
기준일	2020-02-25

## 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	10,917	0	10,917	
누계	통화	선도	1,113	11,716	-10,602	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)

352
-----

공시일	2020-02-26
기준일	2020-02-25

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

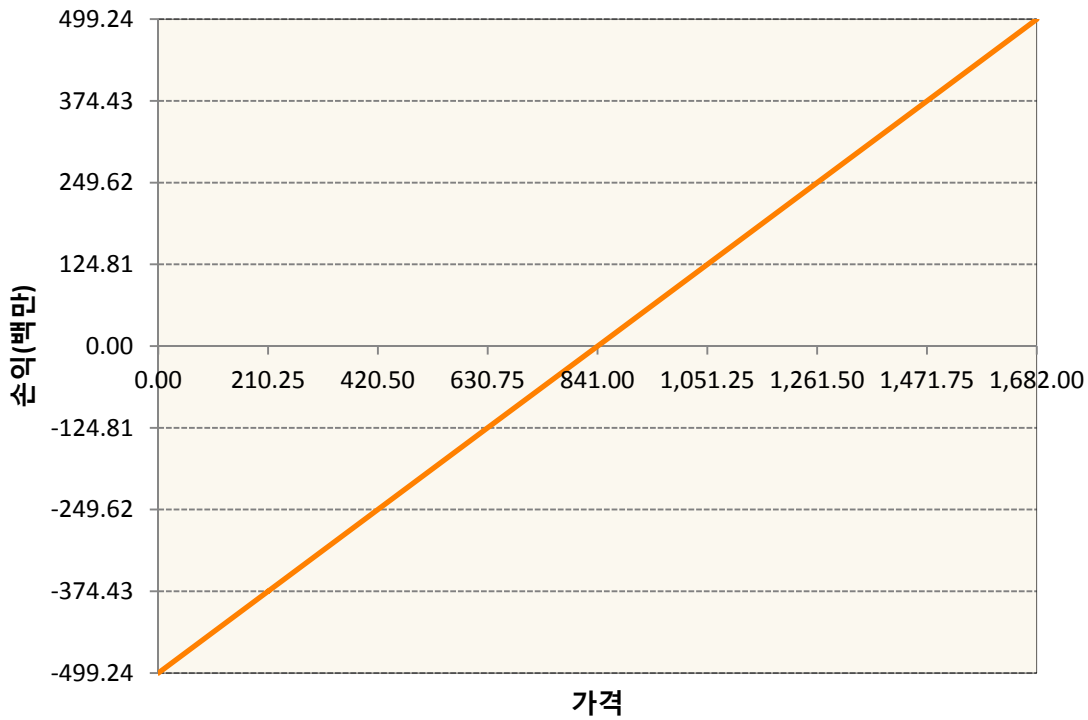
### 1. 계약금액

(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	499	0	499	
누계	유가증권	스왑	1,083	0	1,083	장외
누계	통화	선도	184	696	-512	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	40

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

(단위:백만원)

**120**

공시일	2020-02-26
기준일	2020-02-25

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

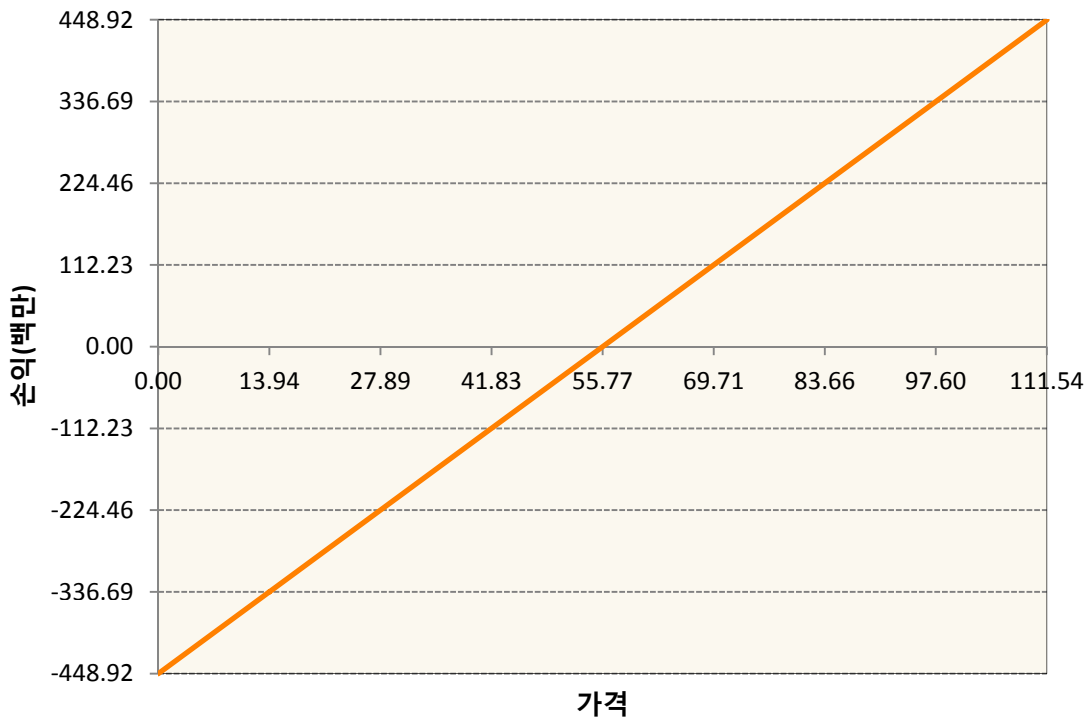
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

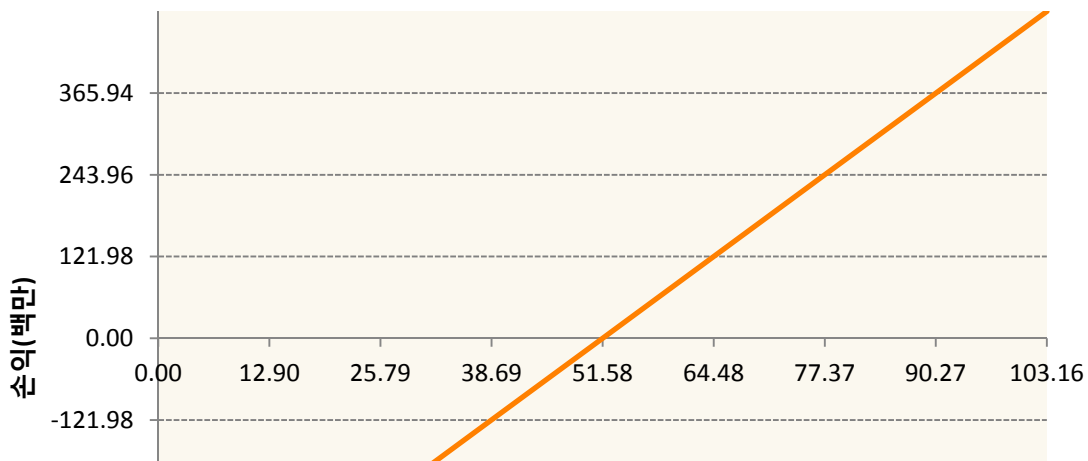
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,062	194	1,868	

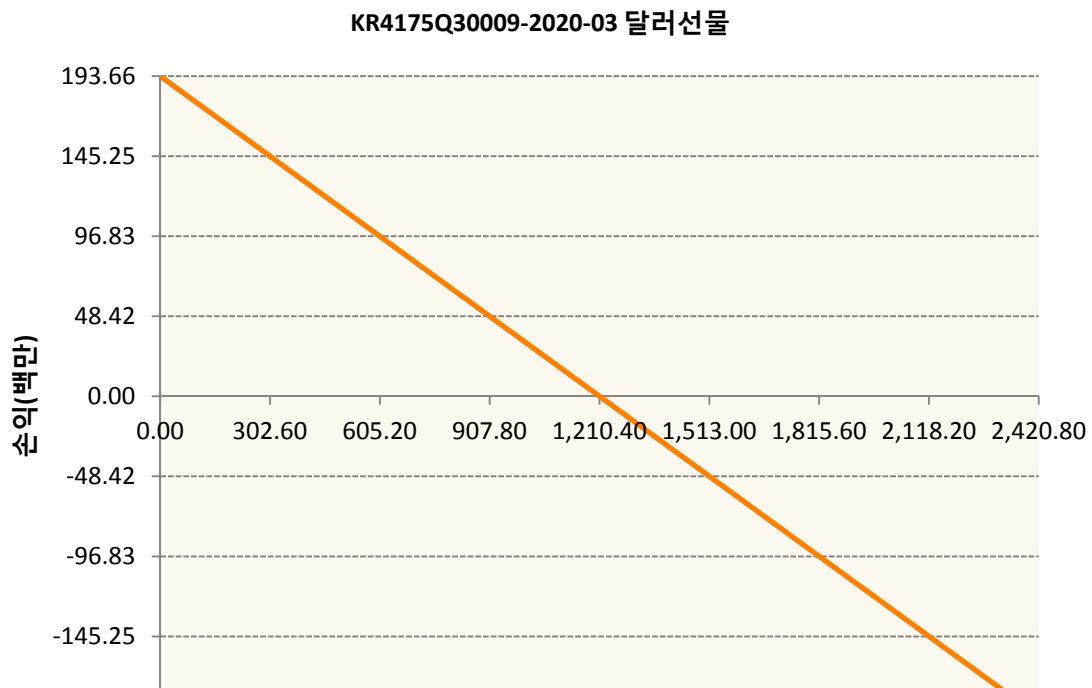
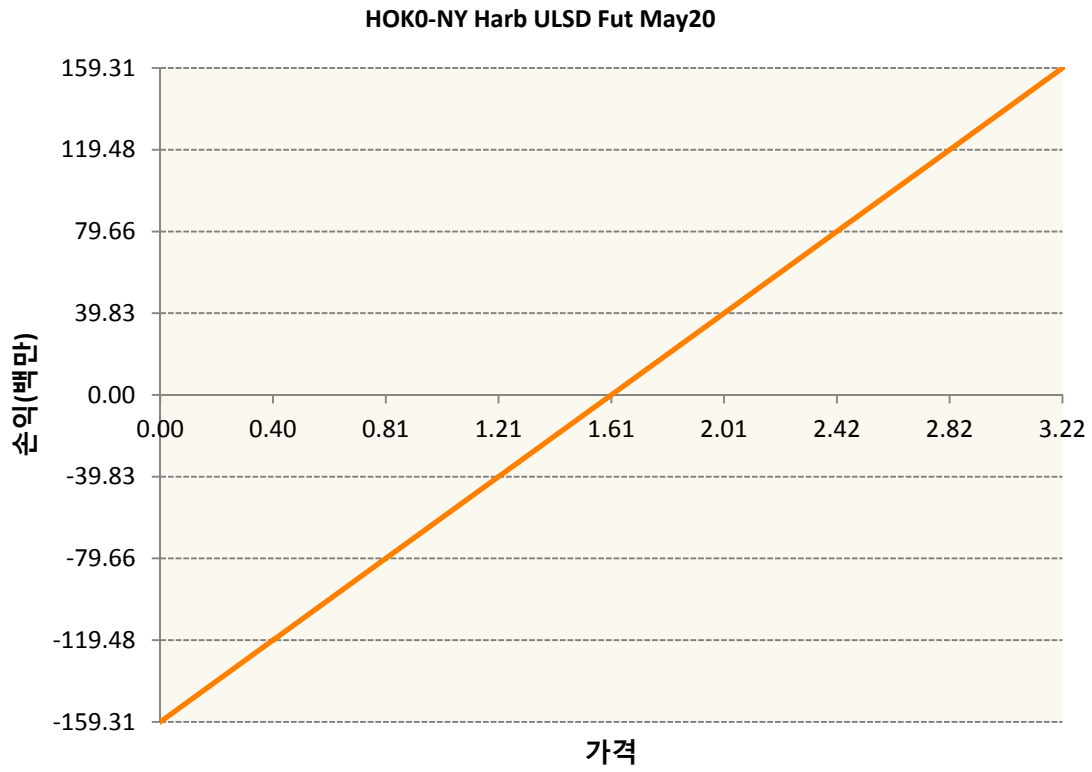
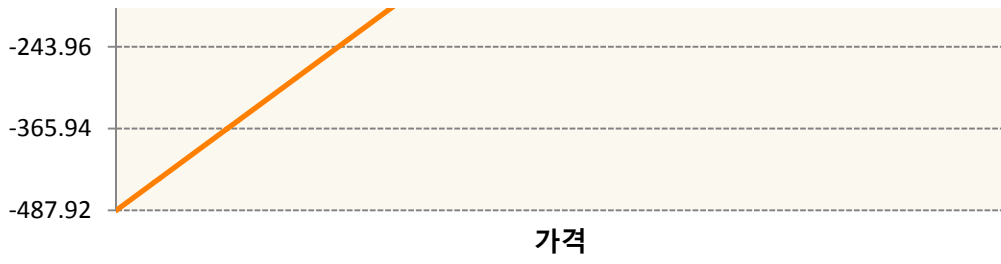
### 2. 만기시점의 손익구조

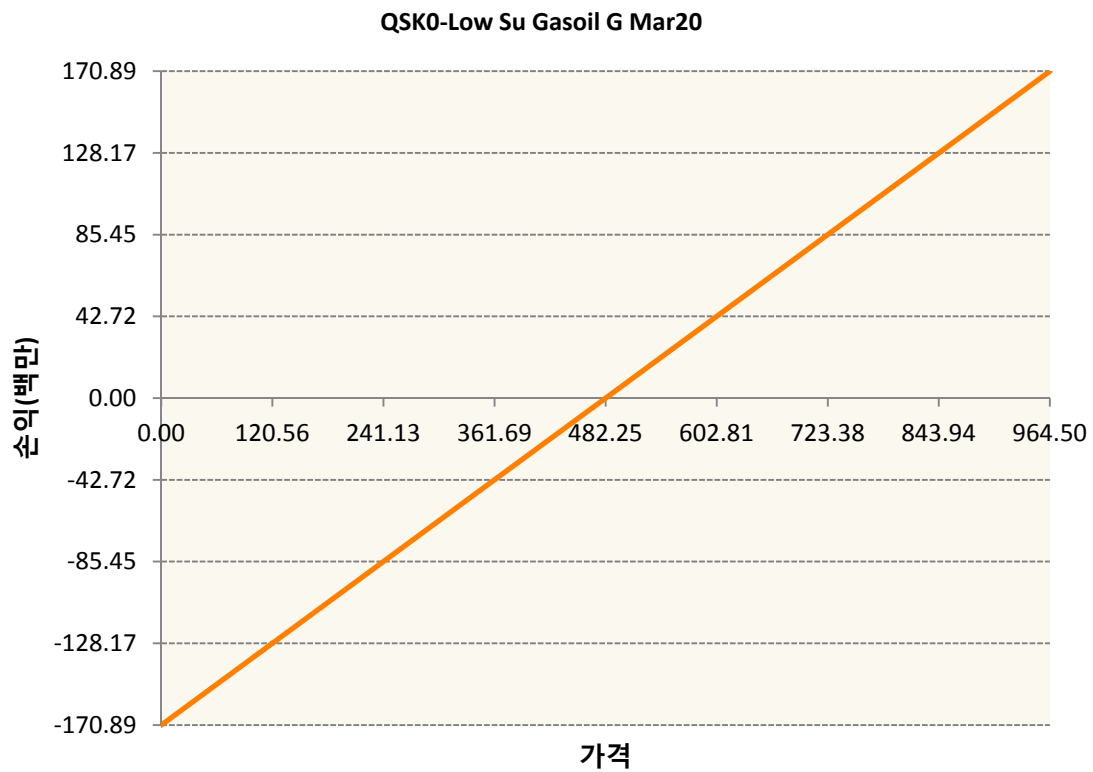
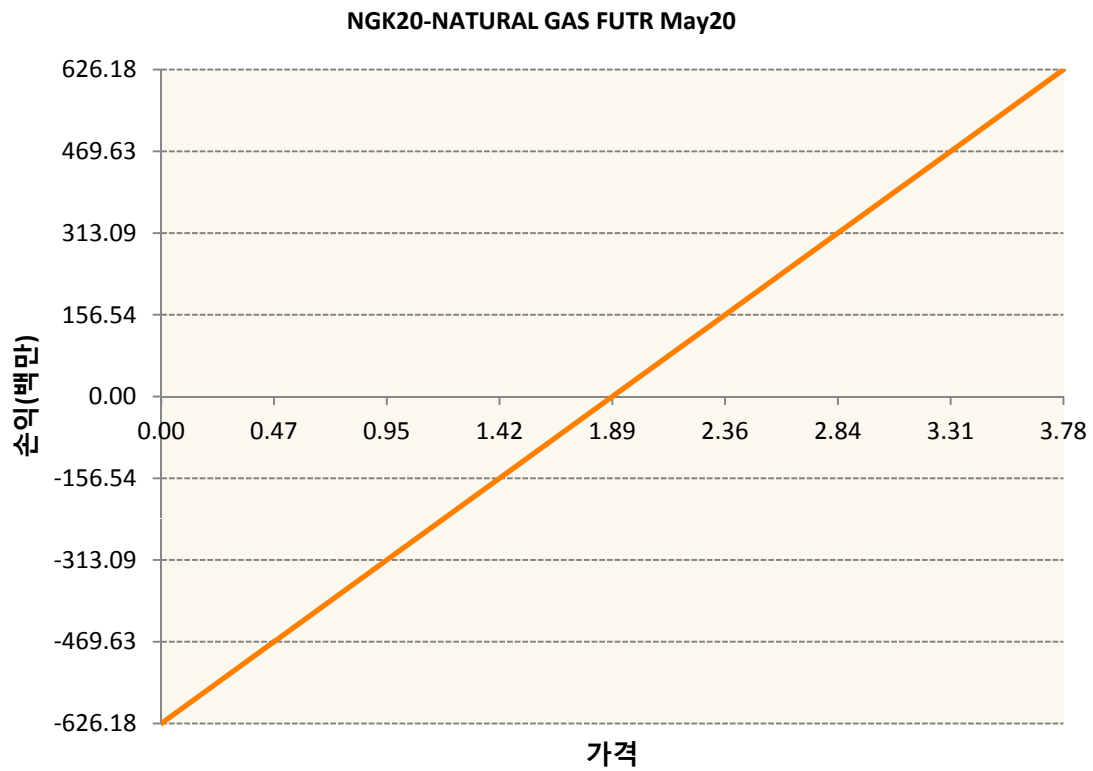
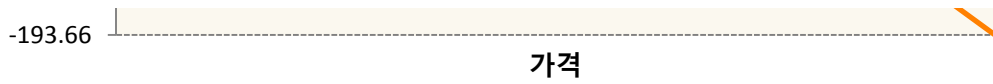
**COK0-BRENT CRUDE FUTR May20**



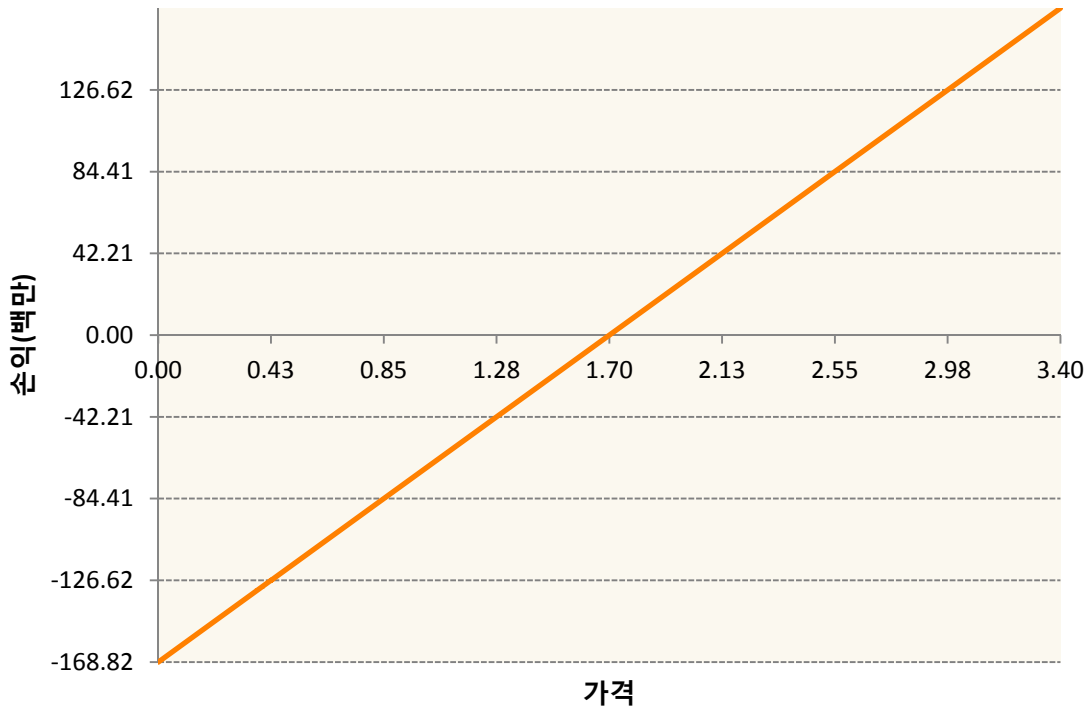
**CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20**







**XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20**



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	36
CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	39
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	13
KR4175Q30C	2020-03 달러선물	15
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	50
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	14
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	14

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

(단위:백만원)

**335**

공시일	2020-02-26
기준일	2020-02-25

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

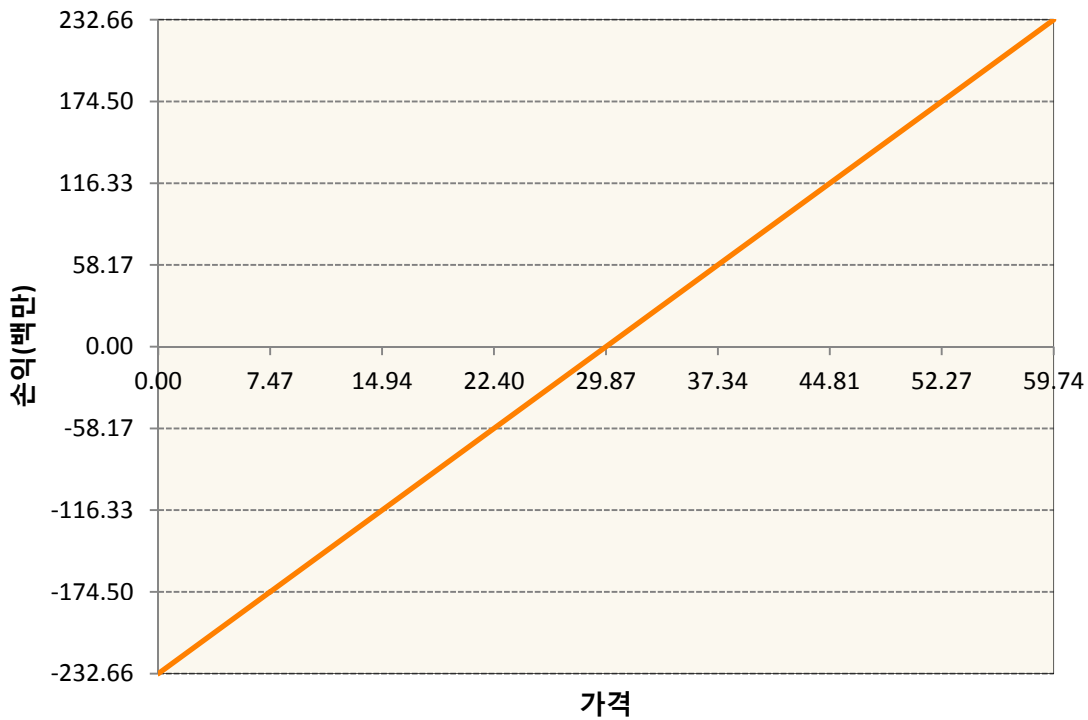
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

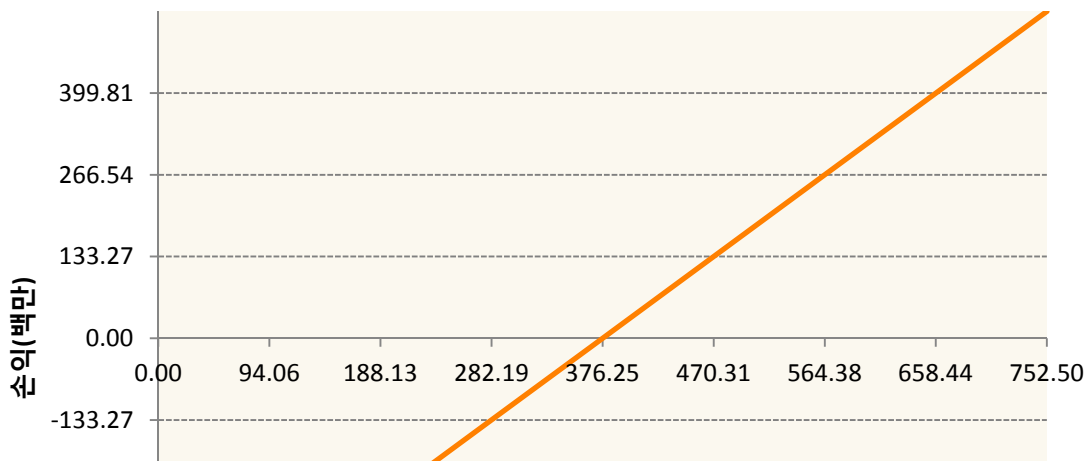
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,686	157	2,528	

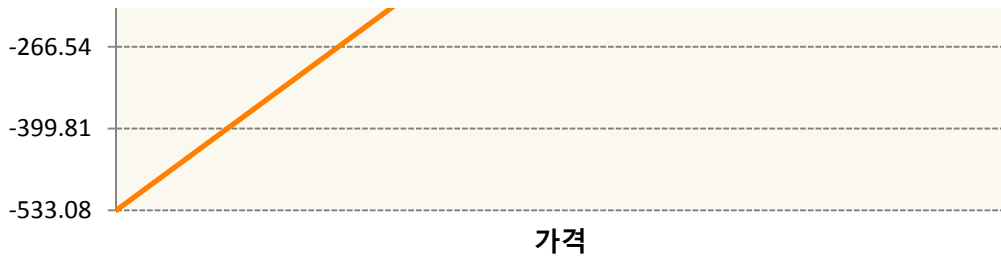
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20**

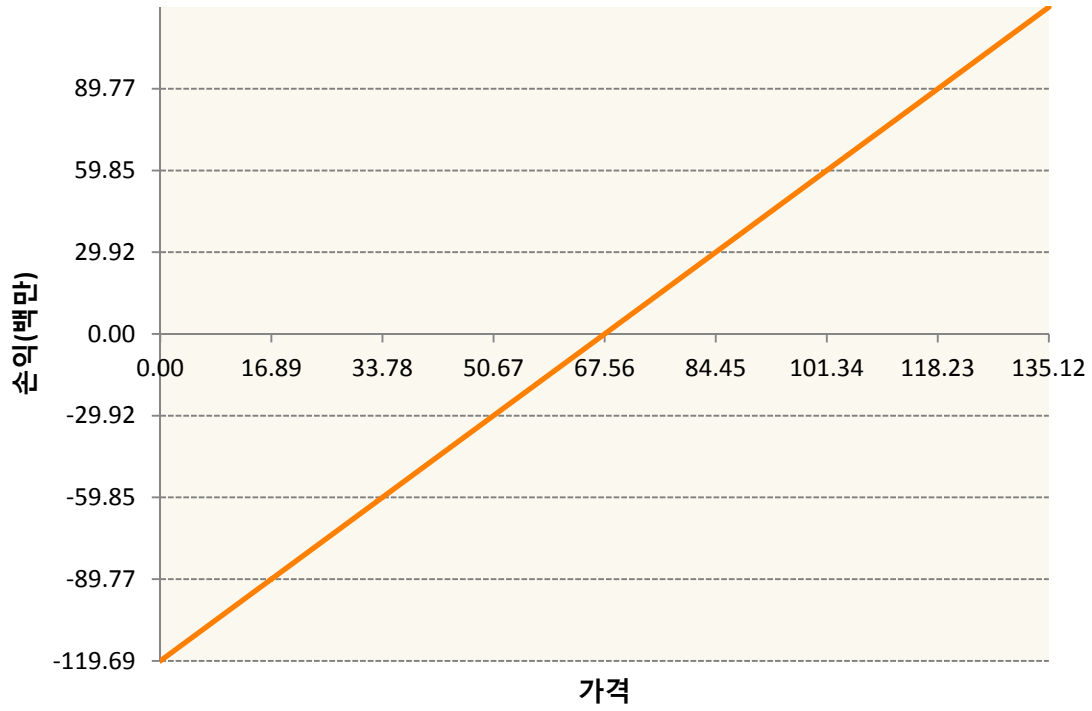


**CK0-CORN FUTURE May20**

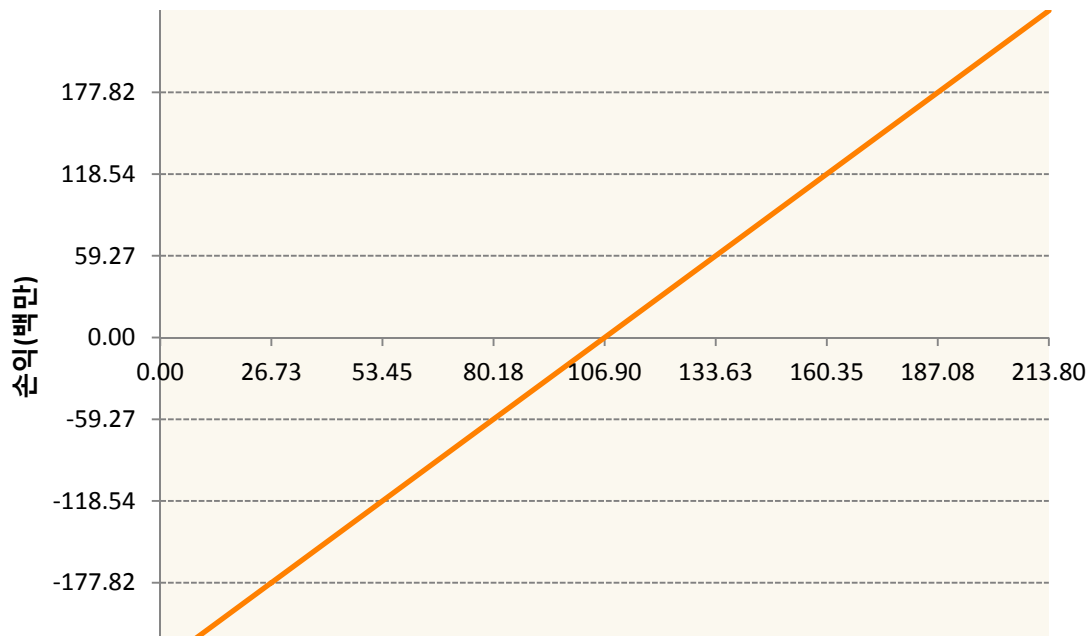


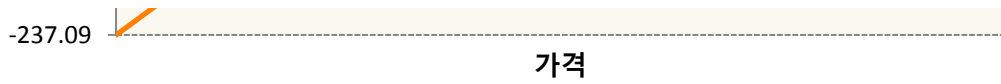


**CTK0-COTTON NO.2 FUTR May20**

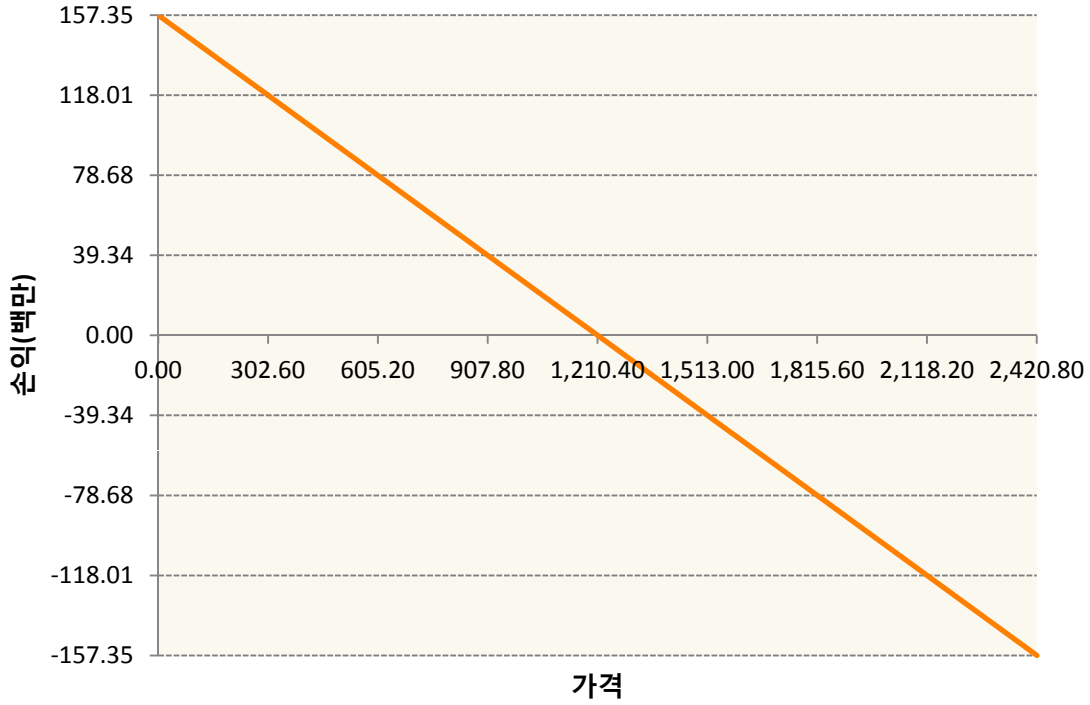


**KCK0-COFFEE 'C' FUTURE May20**

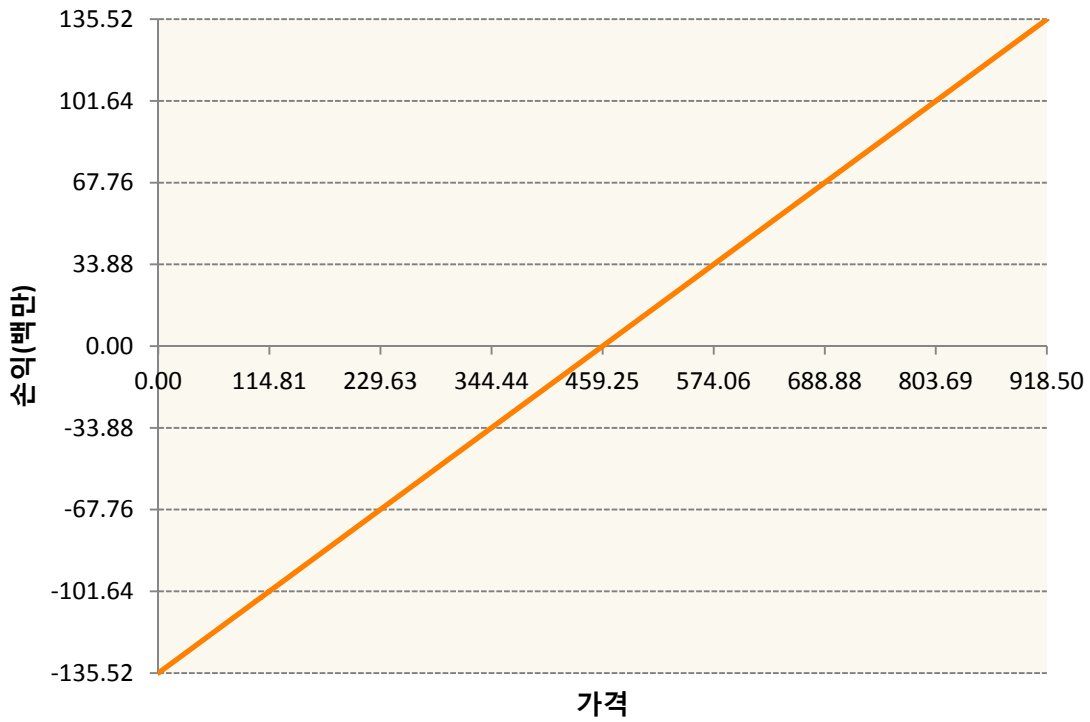




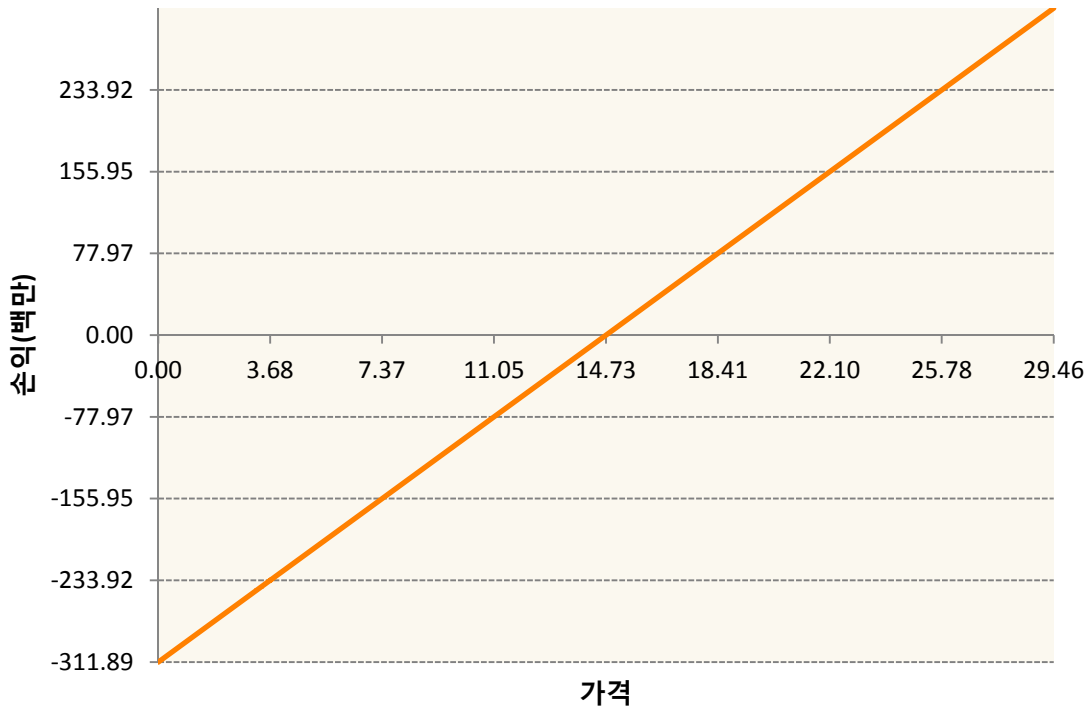
KR4175Q30009-2020-03 달러선물



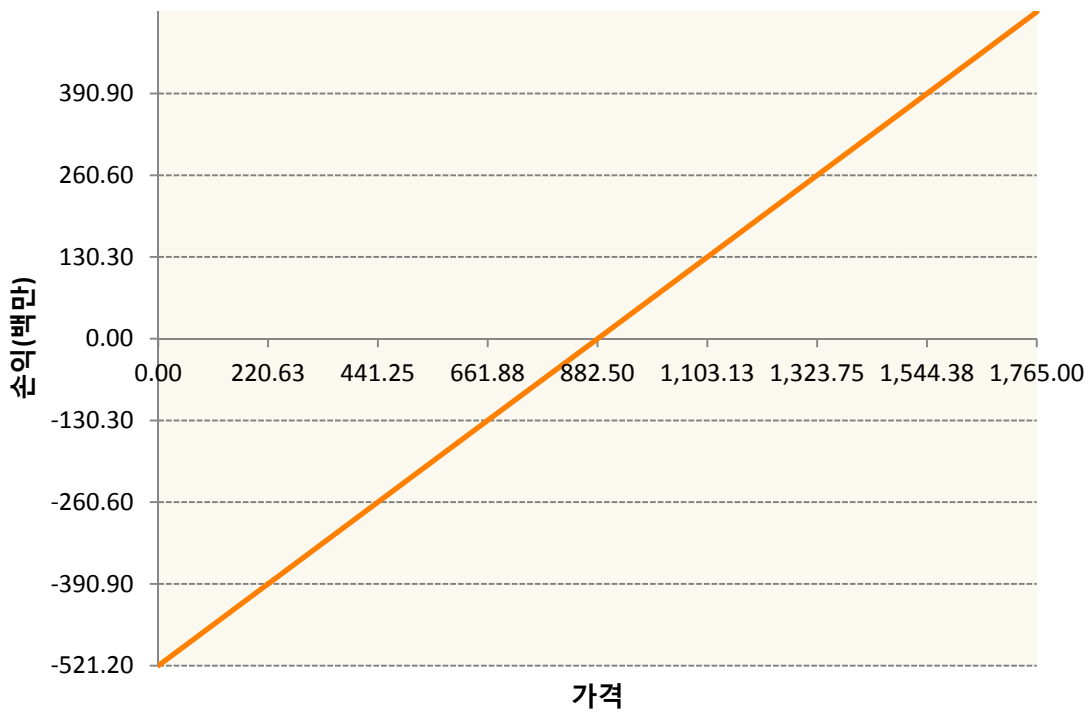
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



SBK0-Sugar May20

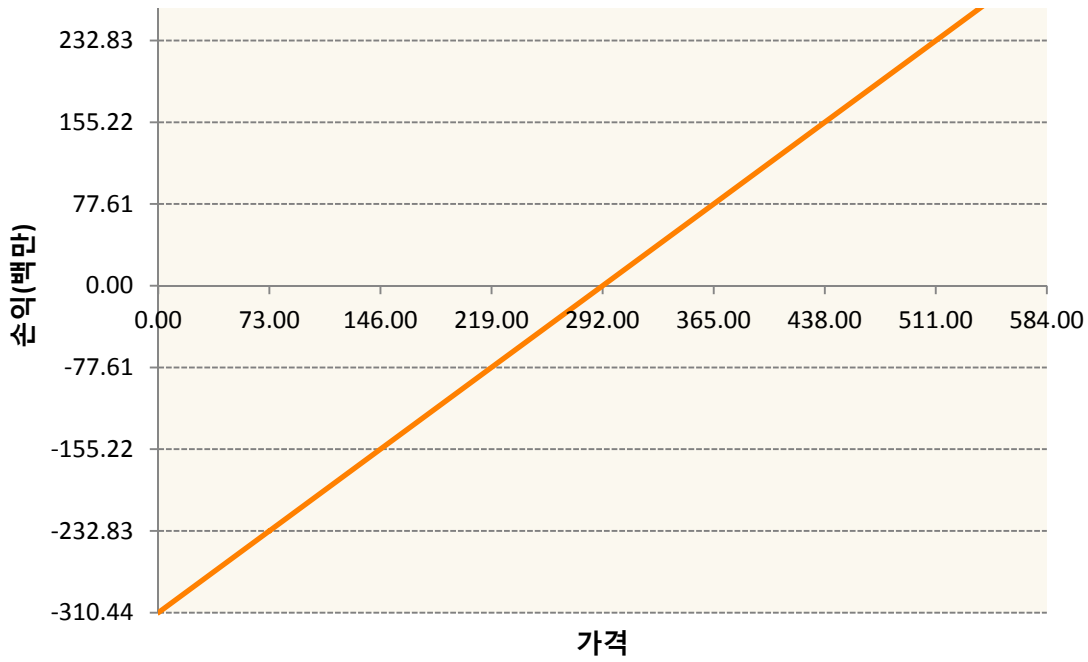


SK0-SOYBEAN FUTURE May20

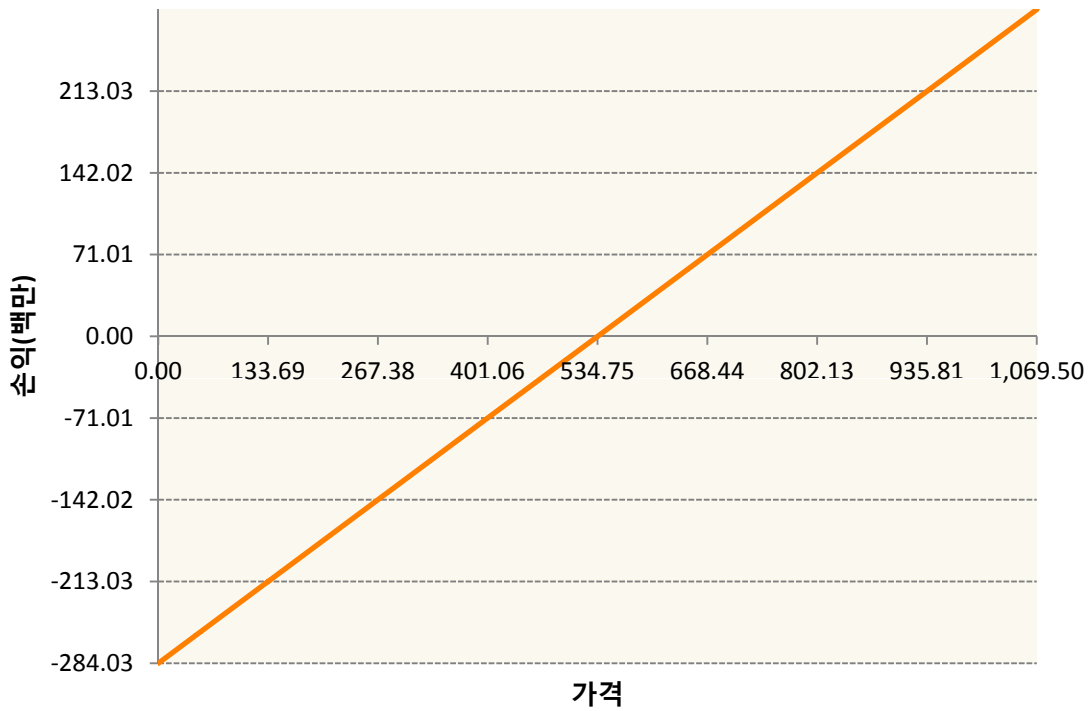


SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





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	19
KR4175Q30C	2020-03 달러선물	13

KWK0	KC HRW WHEAT FUT May20	11
SBK0	Sugar May20	25
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)

**232**