

공시일	2020-02-27
기준일	2020-02-26

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)

48

공시일	2020-02-27
기준일	2020-02-26

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

1,092

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

652

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-27
기준일	2020-02-26

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)	444
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	162

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

938

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-27
기준일	2020-02-26

유로인덱스모(주식-파생형)

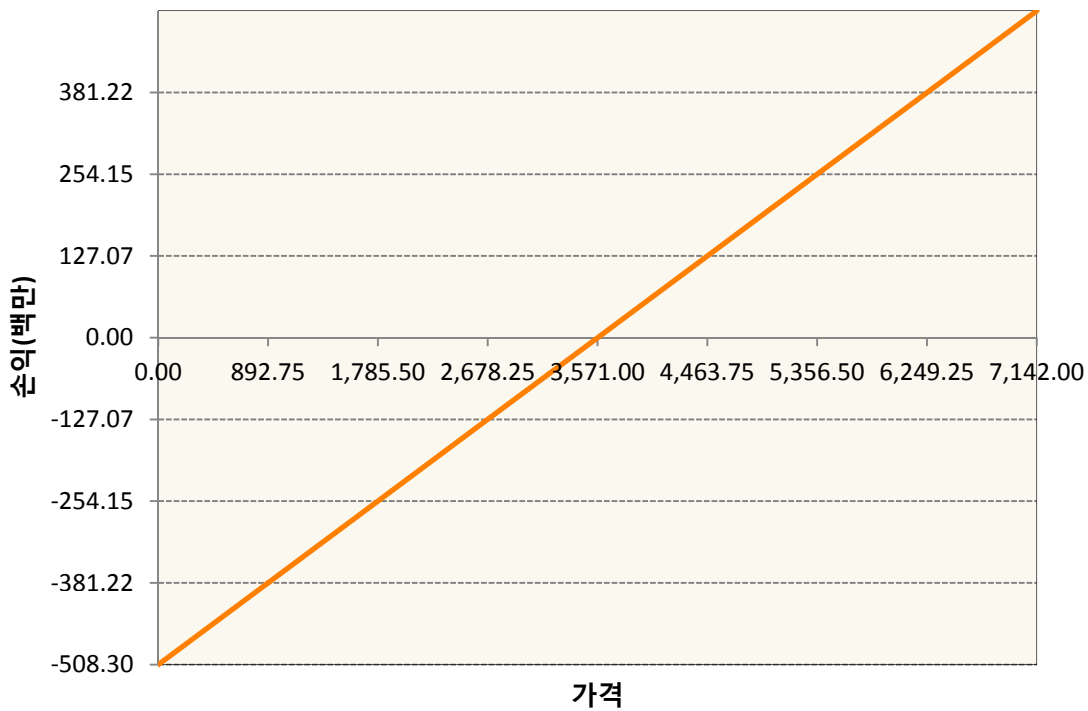
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	508	0	508	

2. 만기시점의 손익구조

VGH0-EURO STOXX 50 Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH0	EURO STOXX 50 Mar20	41
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

29

공시일	2020-02-27
기준일	2020-02-26

차이나인덱스모(주식-파생형)

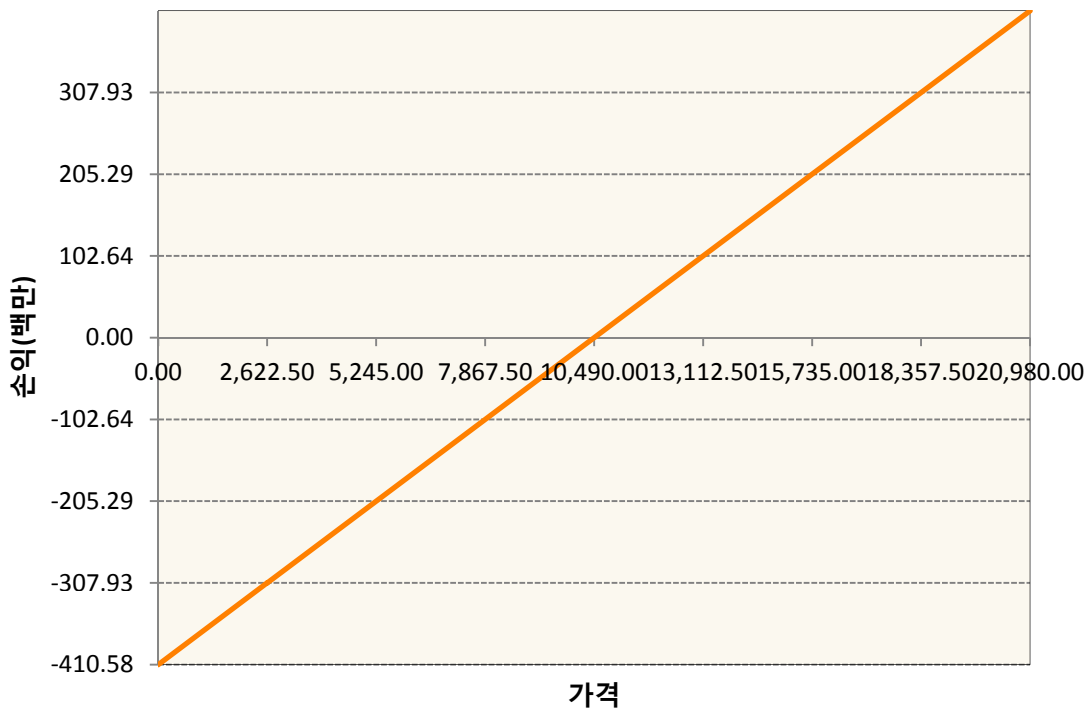
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	411	0	411	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	2020-02-27
기준일	2020-02-26

커버드콜모(주식혼합-파생형)

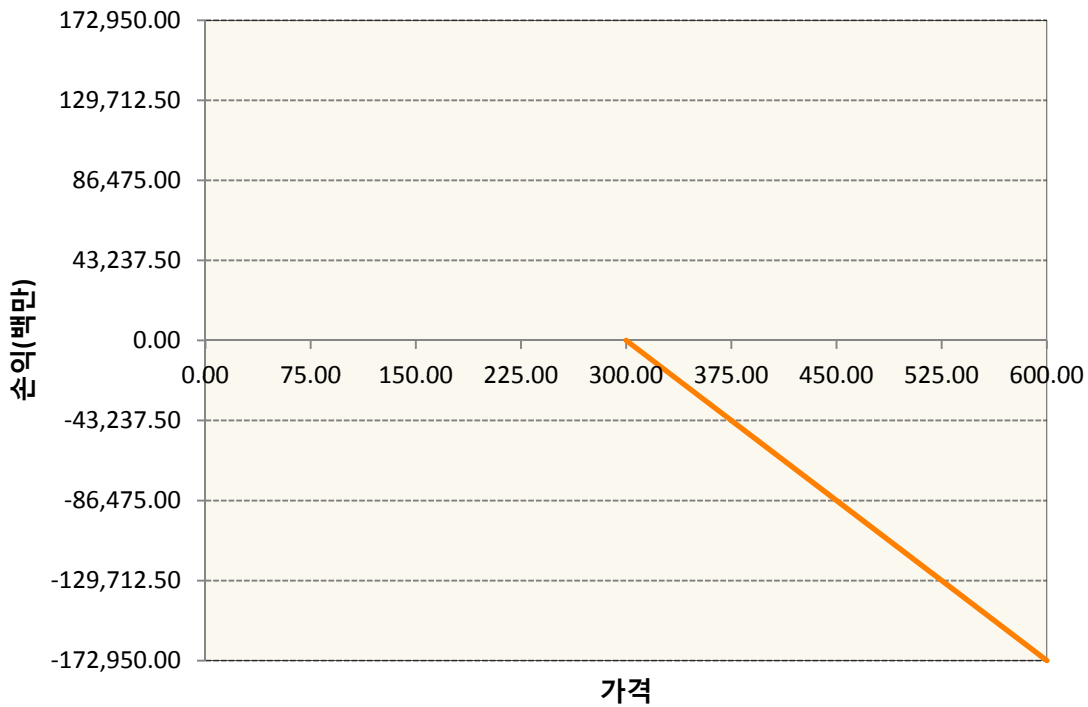
1. 계약금액

(단위:백만원)

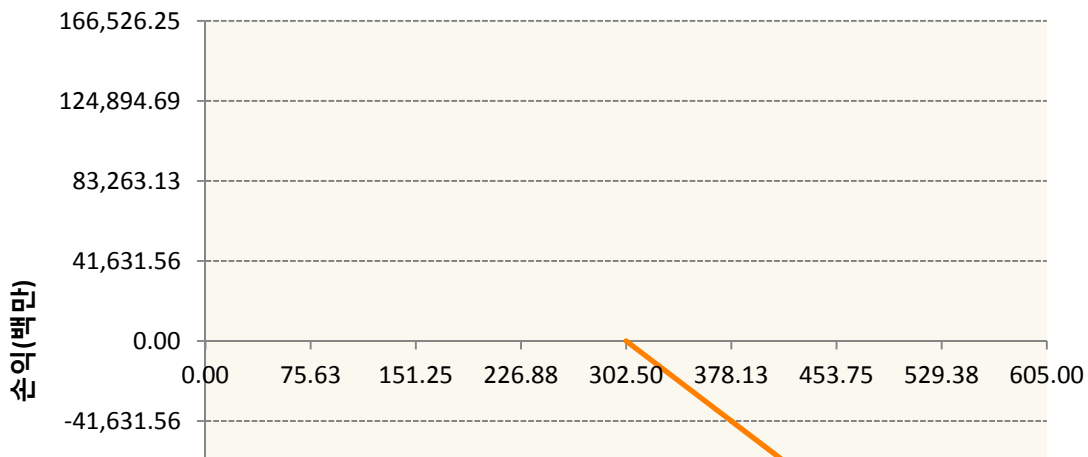
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	448,226	-448,226	장내

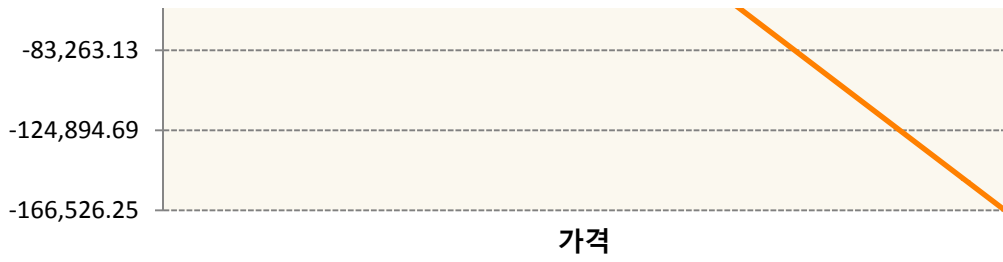
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q33007-2020-03 콜300

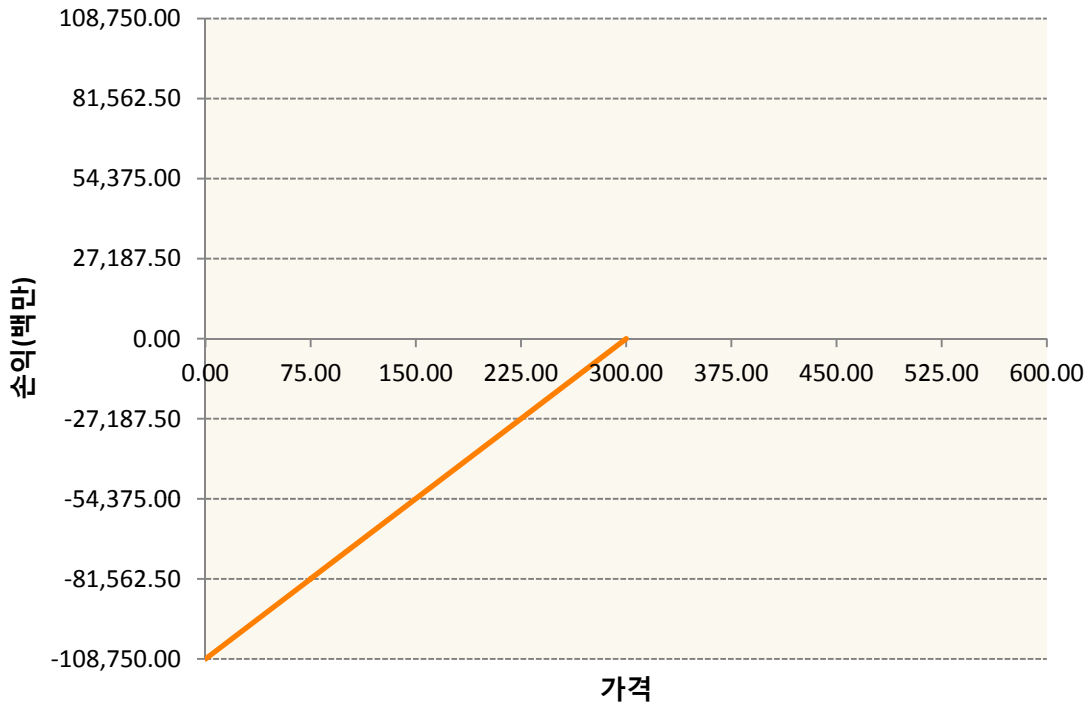


KR4201Q33023-2020-03 콜302.5





KR4301Q33005-2020-03 풋300



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q33007		2020-03 콜300					5,696	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	950	943	927	901	862	809	739	
-5.33%	931	902	857	792	708	603	479	
-2.67%	849	769	663	531	377	201	7	
0%	592	420	222	0	-241	-499	-771	
2.67%	-41	-326	-628	-943	-1,268	-1,601	-1,942	
5.33%	-1,287	-1,662	-2,040	-2,420	-2,803	-3,188	-3,573	
8.00%	-3,314	-3,710	-4,107	-4,504	-4,901	-5,298	-5,696	
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5					4,942	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	722	717	707	688	659	618	562	

-5.33%	711	691	659	610	544	460	358
-2.67%	658	600	519	414	288	141	-24
0%	480	346	185	0	-206	-429	-668
2.67%	13	-227	-486	-762	-1,051	-1,351	-1,660
5.33%	-965	-1,303	-1,648	-1,998	-2,353	-2,711	-3,071
8.00%	-2,645	-3,028	-3,410	-3,793	-4,176	-4,559	-4,942
KR4301Q33005 2020-03 풋300							7,935
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,921	-7,921	-7,921	-7,922	-7,925	-7,928	-7,935
-5.33%	-5,218	-5,219	-5,222	-5,227	-5,237	-5,251	-5,270
-2.67%	-2,519	-2,528	-2,542	-2,564	-2,594	-2,632	-2,679
0%	143	107	59	0	-70	-150	-238
2.67%	2,654	2,559	2,452	2,336	2,212	2,082	1,947
5.33%	4,772	4,611	4,447	4,282	4,114	3,945	3,774
8.00%	6,249	6,072	5,895	5,717	5,539	5,360	5,181

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

(단위:백만원)

15,799

공시일	2020-02-27
기준일	2020-02-26

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

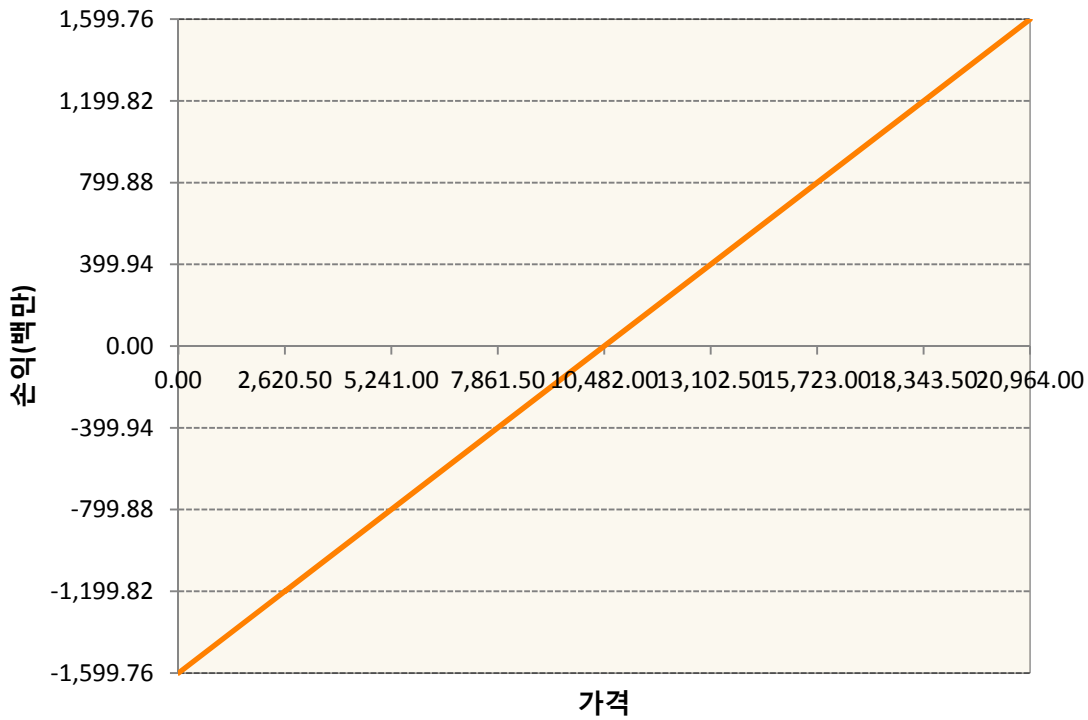
1. 계약금액

(단위:백만원)

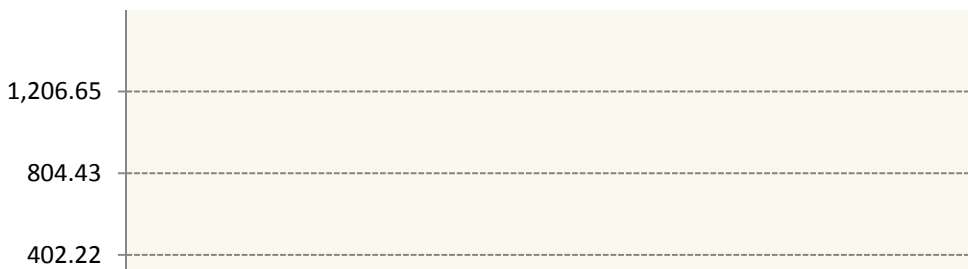
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,600	0	1,600	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,598	-4,598	장내
누계	통화	선도	0	2,199	-2,199	장외

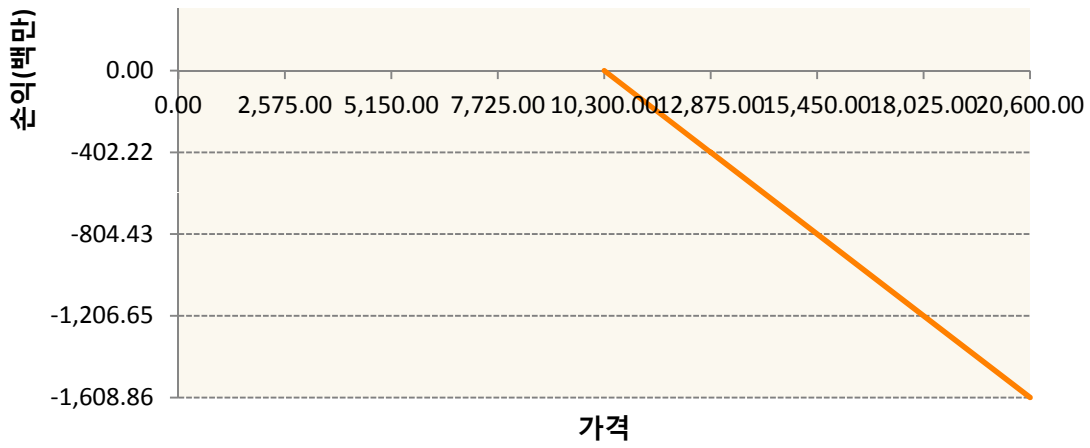
2. 만기시점의 손익구조

HCG0-HSCEI Futures Feb20

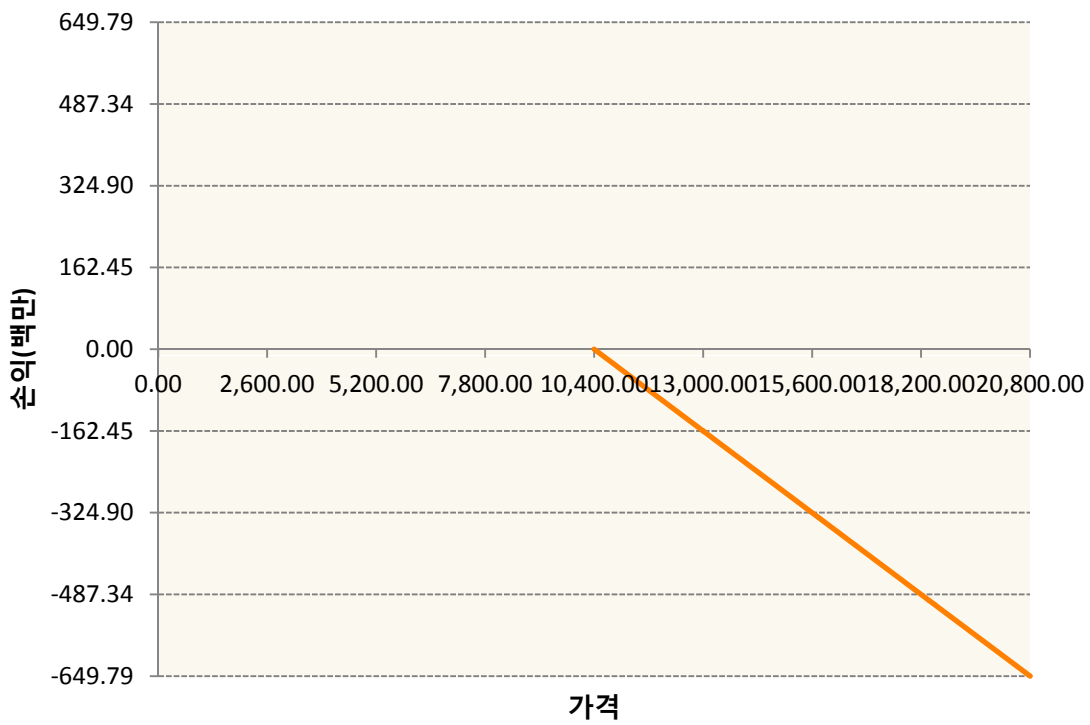


OHHIG0-C103-HSCEI

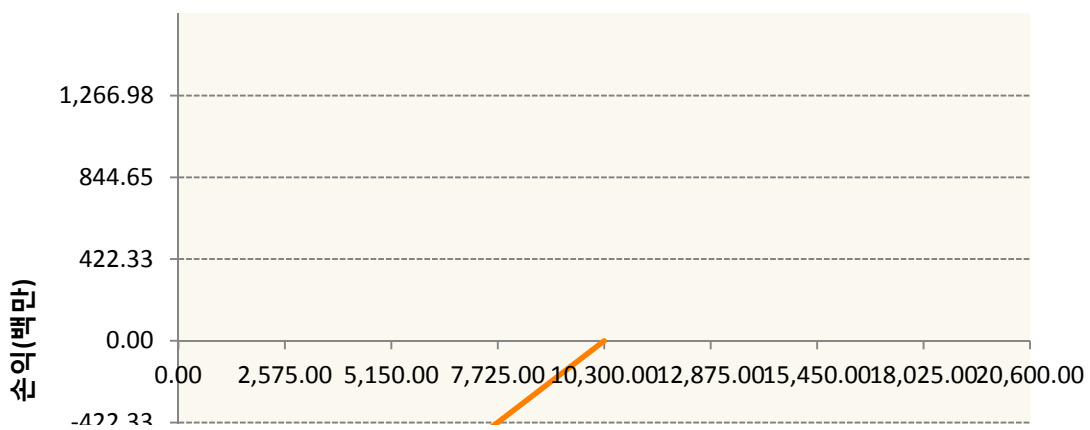


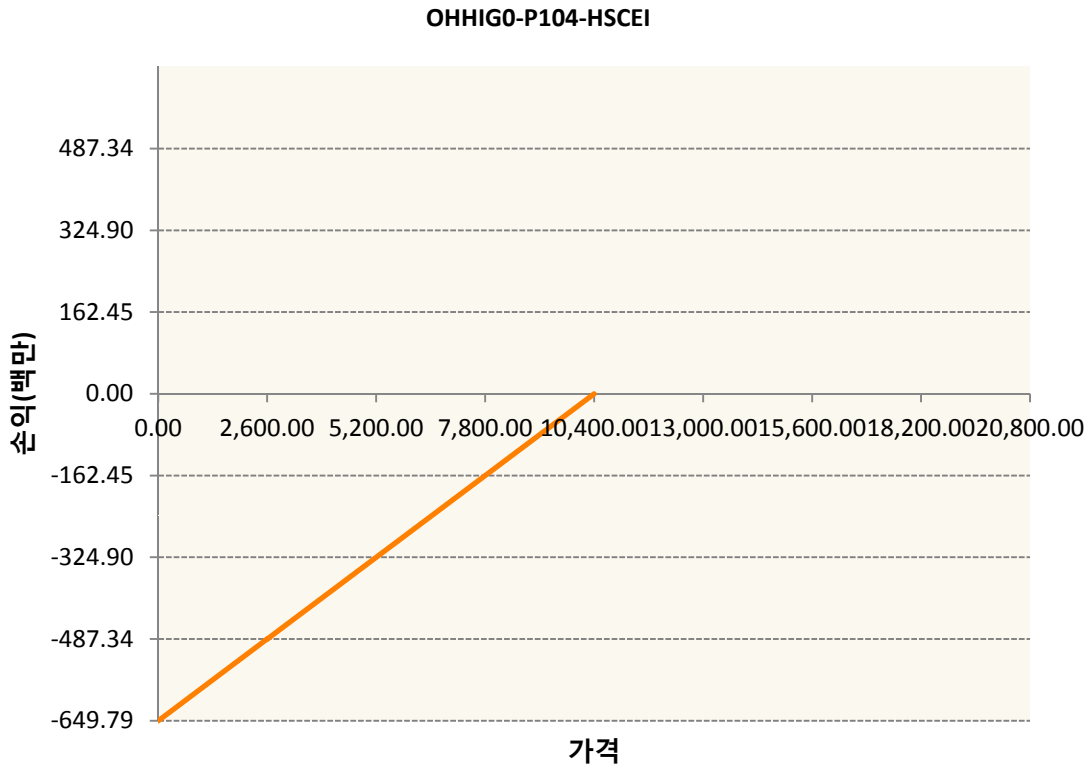


OHHIG0-C104-HSCEI



OHHIG0-P103-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E	176
HCG0 HSCEI Futures Feb20	128
OHHIG0-C1(HSCEI	129
OHHIG0-C1(HSCEI	52
OHHIG0-P1(HSCEI	135
OHHIG0-P1(HSCEI	52

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

510

공시일	2020-02-27
기준일	2020-02-26

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

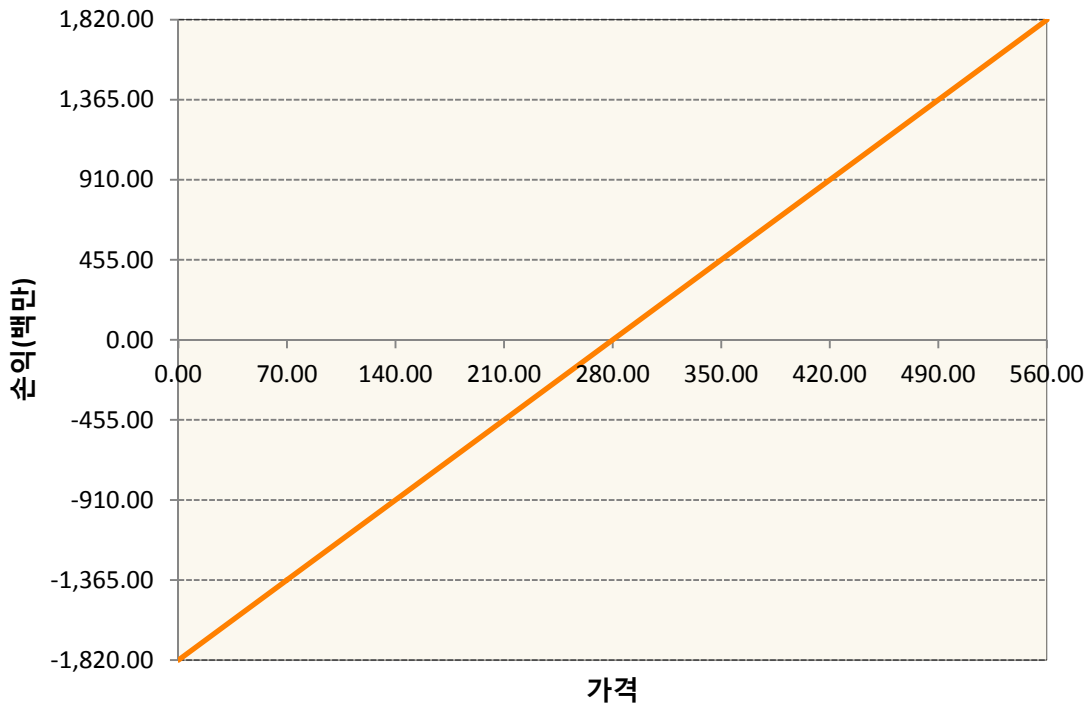
1. 계약금액

(단위:백만원)

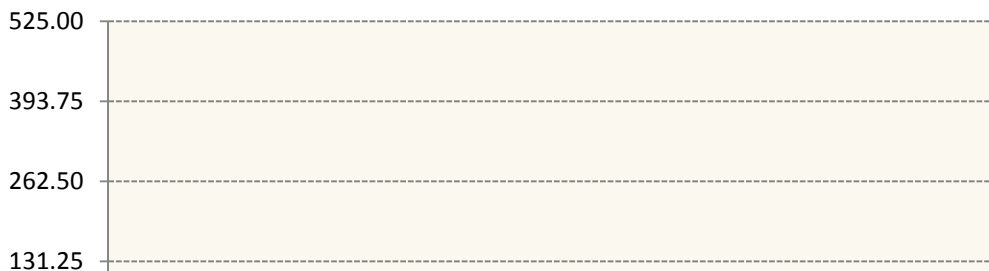
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,820	0	1,820	장내
누계	유가증권	스왑	3,125	0	3,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,612	-3,612	장내

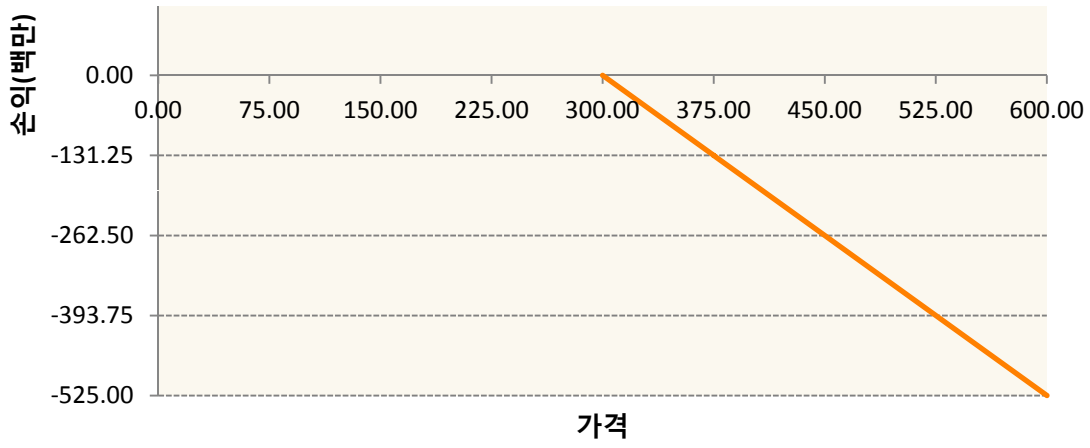
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

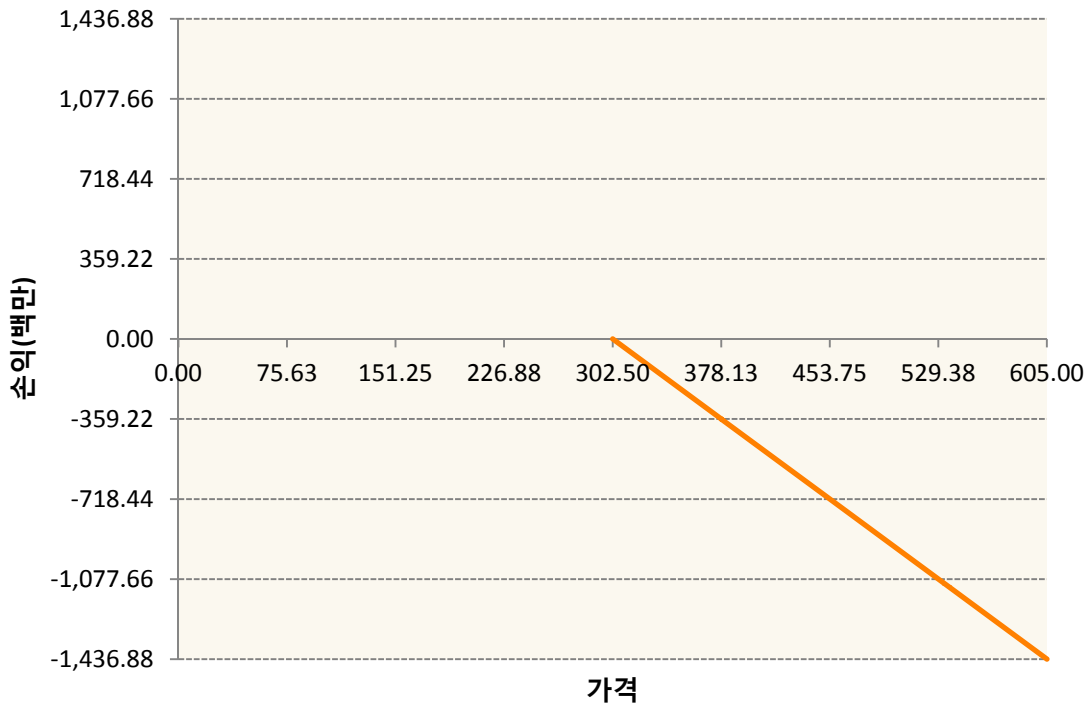


KR4201Q33007-2020-03 콜300

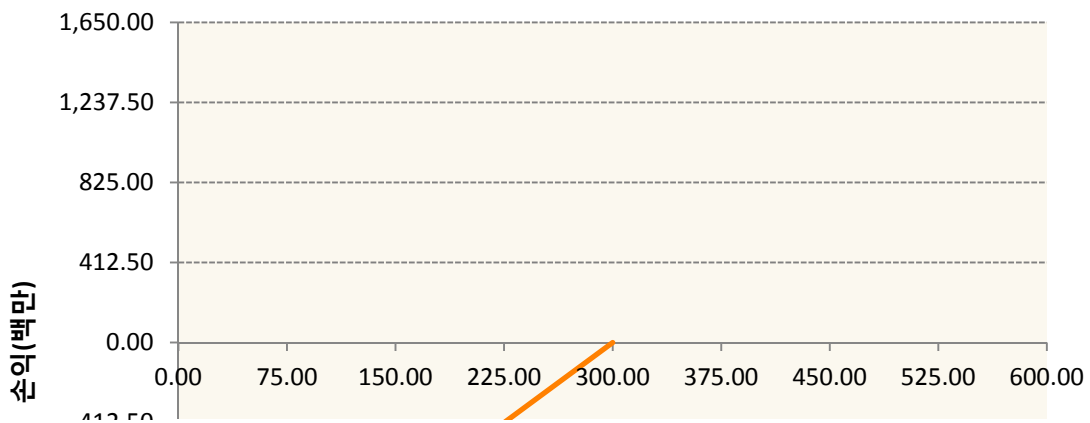




KR4201Q33023-2020-03 콜302.5



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						17
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3	3	3	3	3	2	2	
-5.33%	3	3	3	2	2	2	1	
-2.67%	3	2	2	2	1	1	0	
0%	2	1	1	0	-1	-2	-2	
2.67%	0	-1	-2	-3	-4	-5	-6	
5.33%	-4	-5	-6	-7	-9	-10	-11	
8.00%	-10	-11	-12	-14	-15	-16	-17	
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5						43
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	6	6	6	6	6	5	5
-5.33%	6	6	6	5	5	4	3
-2.67%	6	5	4	4	2	1	0
0%	4	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	0	-2	-4	-7	-9	-12	-14
5.33%	-8	-11	-14	-17	-20	-23	-26
8.00%	-23	-26	-29	-33	-36	-39	-43
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%	-79	-79	-79	-79	-79	-80	-80
-2.67%	-38	-38	-39	-39	-39	-40	-41
0%	2	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	40	39	37	35	34	32	30
5.33%	72	70	67	65	62	60	57
8.00%	95	92	89	87	84	81	79

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

(단위:백만원)

564

공시일	2020-02-27
기준일	2020-02-26

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

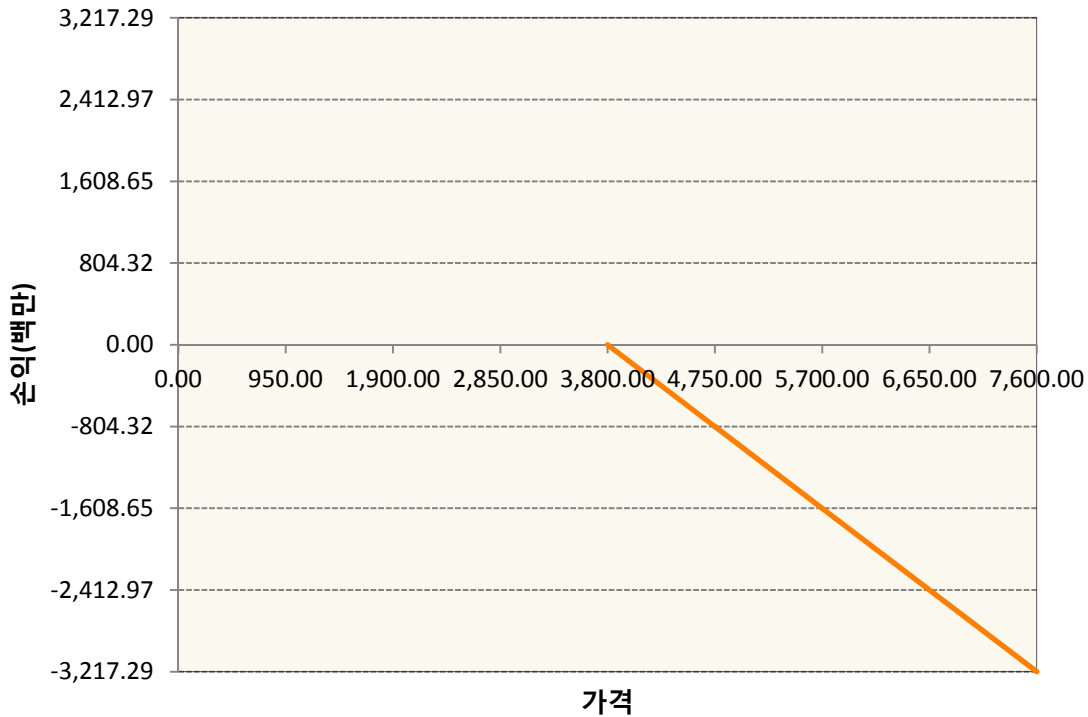
1. 계약금액

(단위:백만원)

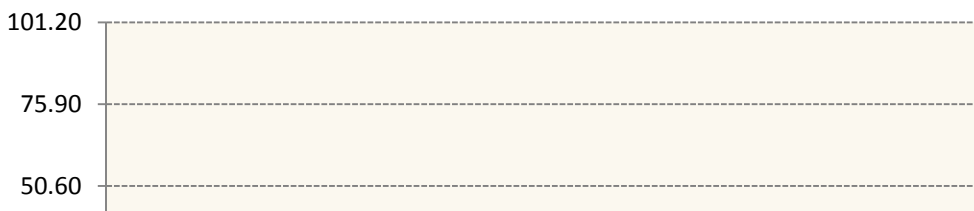
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	184	0	184	
누계	유가증권	스왑	11,907	0	11,907	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,637	-6,637	장내
누계	통화	선도	0	3,471	-3,471	장외

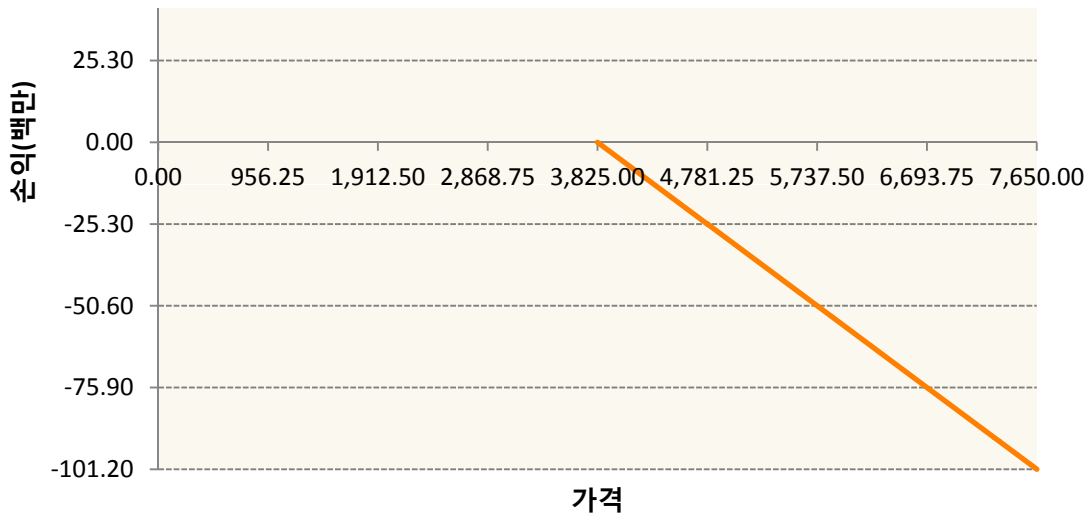
2. 만기시점의 손익구조

OESXH0-C3800-EURO STOXX 50

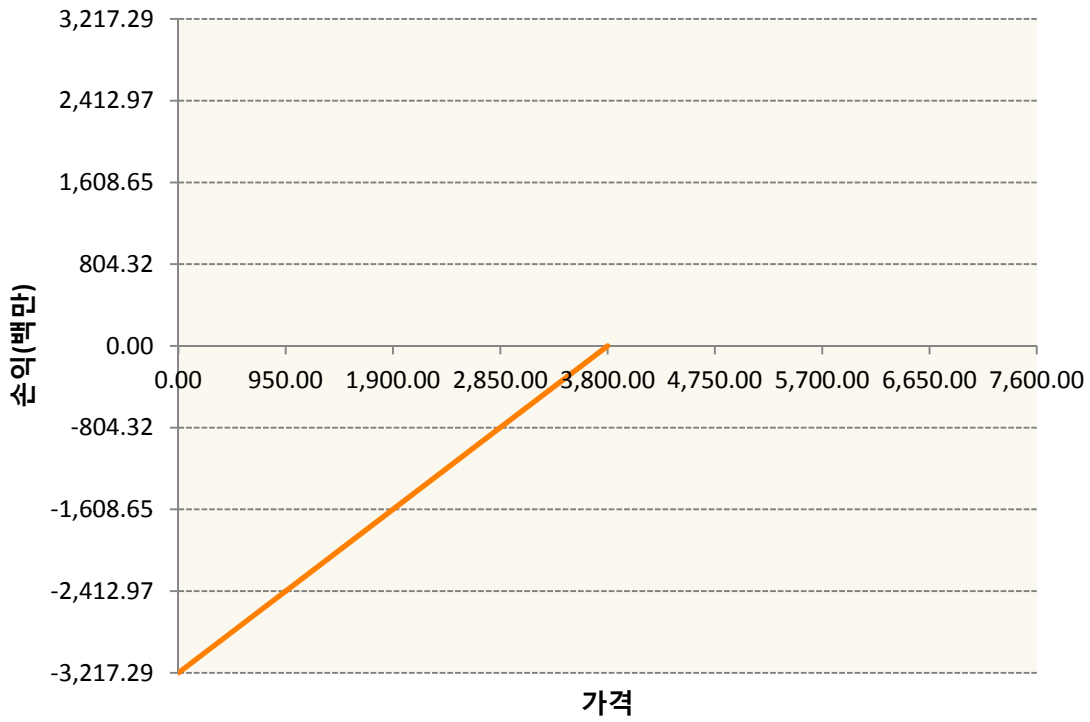


OESXH0-C3825-EURO STOXX 50

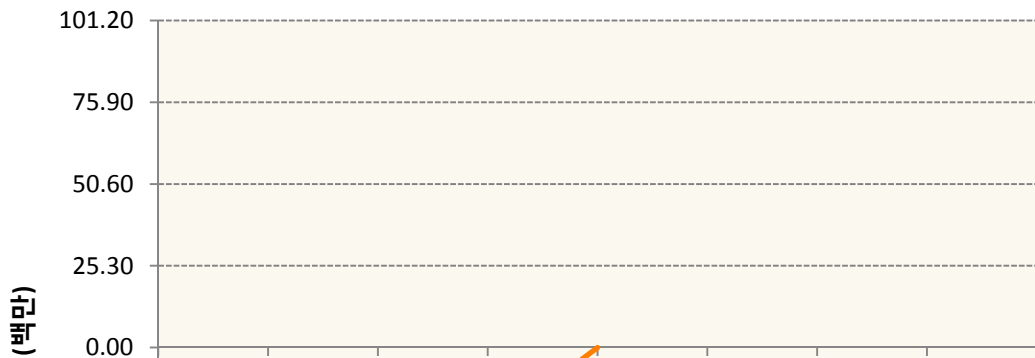


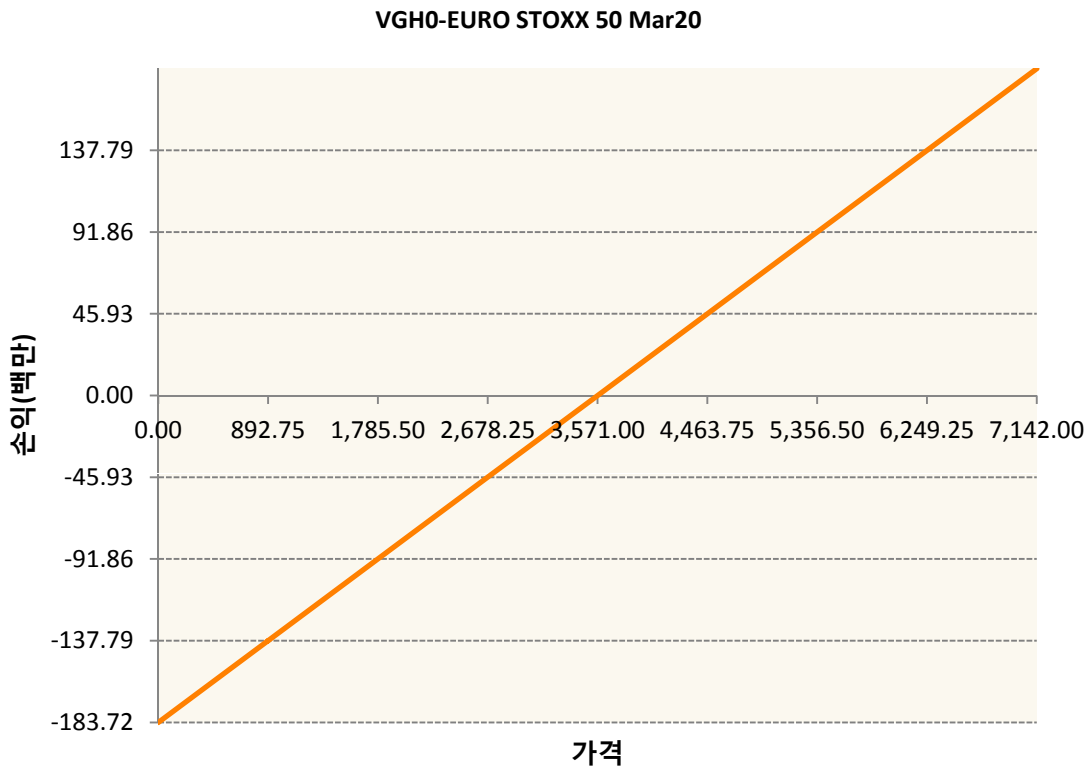
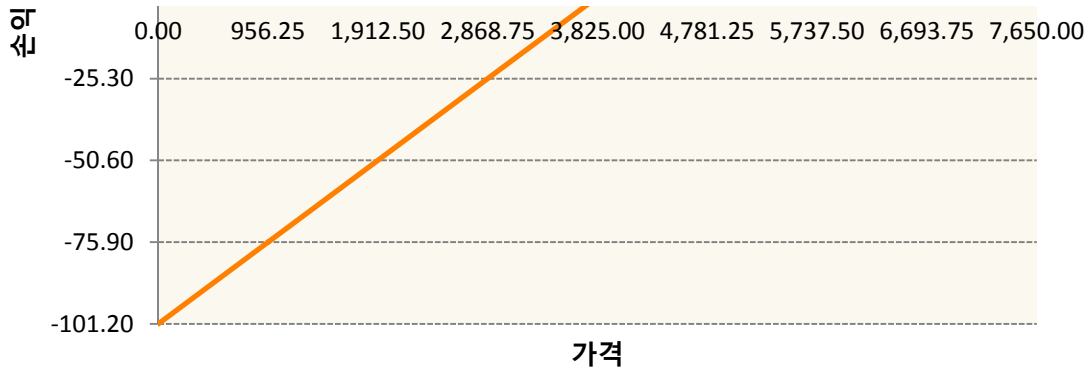


OESXH0-P3800-EURO STOXX 50



OESXH0-P3825-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		36
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E		278
OESXH0-C3& EURO STOXX 50		257
OESXH0-C3& EURO STOXX 50		8
OESXH0-P3& EURO STOXX 50		257
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)

930

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

(단위:백만원)

82

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

(단위:백만원)

120

공시일	2020-02-27
기준일	2020-02-26

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

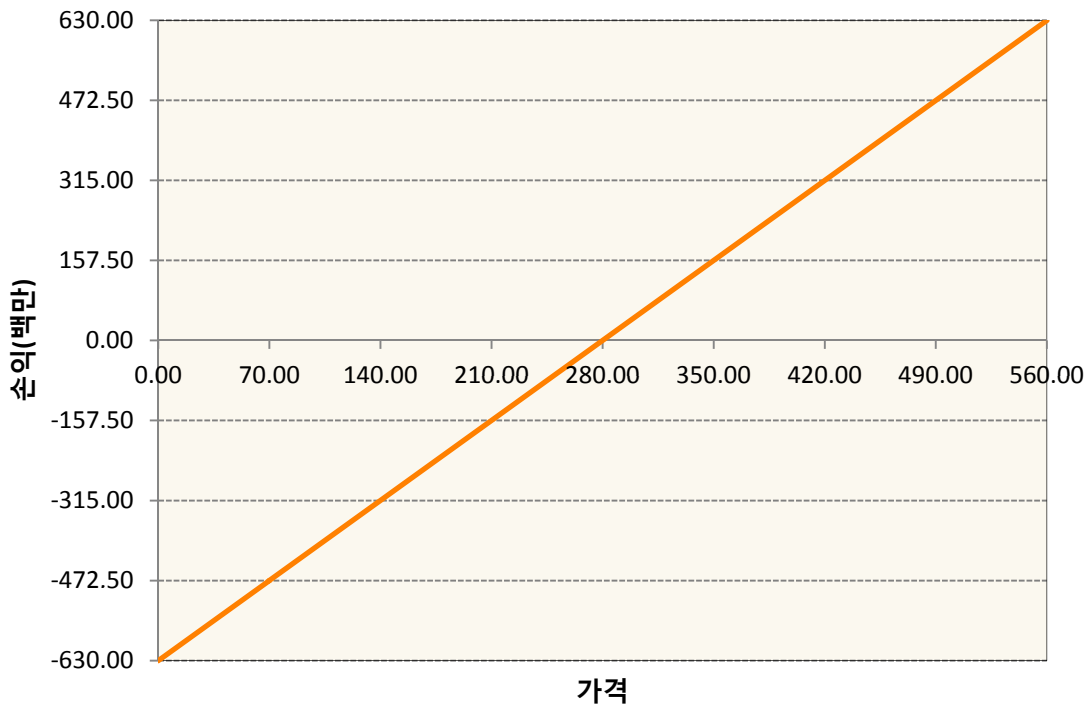
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	630	0	630	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						50
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	
-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%	50	50	50	50	50	50	50	

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

(단위:백만원)

43

공시일	2020-02-27
기준일	2020-02-26

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

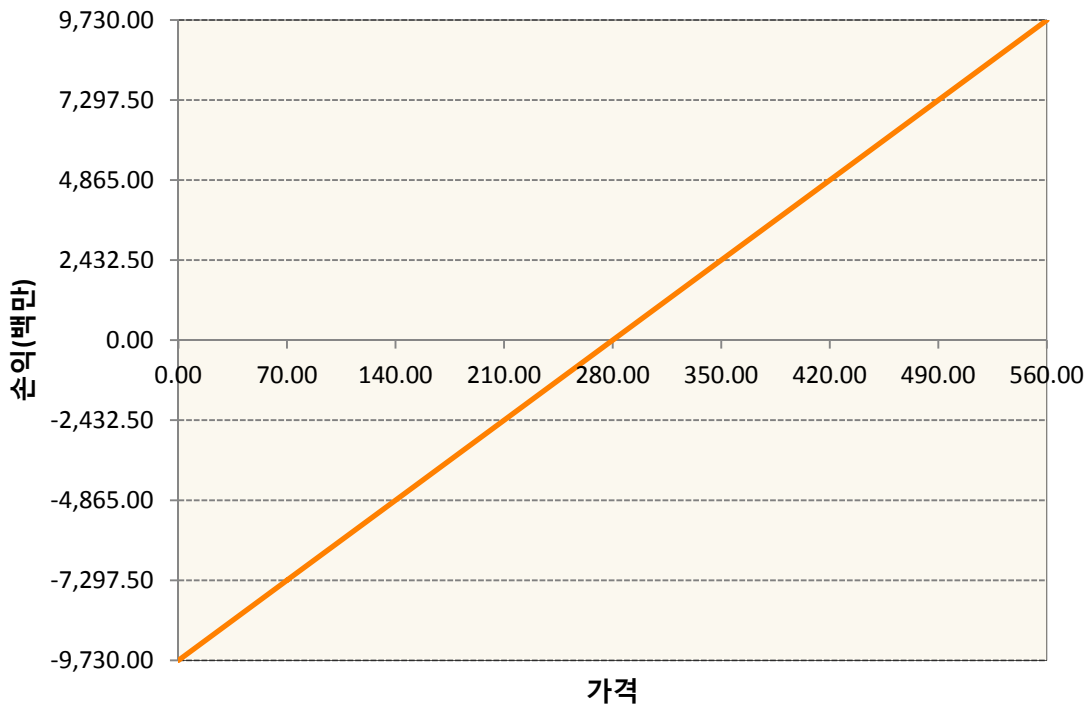
1. 계약금액

(단위:백만원)

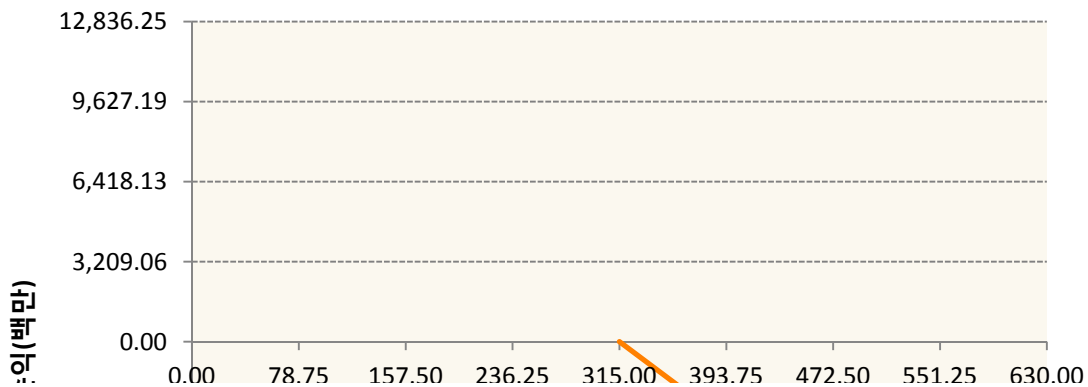
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,730	0	9,730	장내
누계	유가증권	옵션	2,257	21,012	-18,755	장내

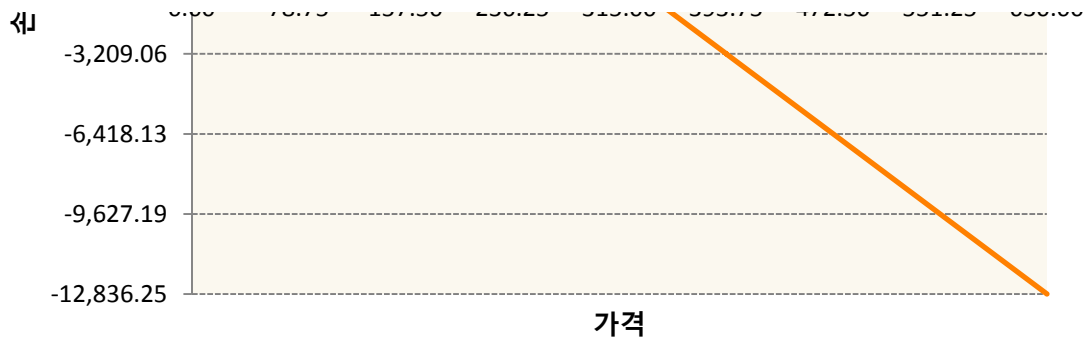
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

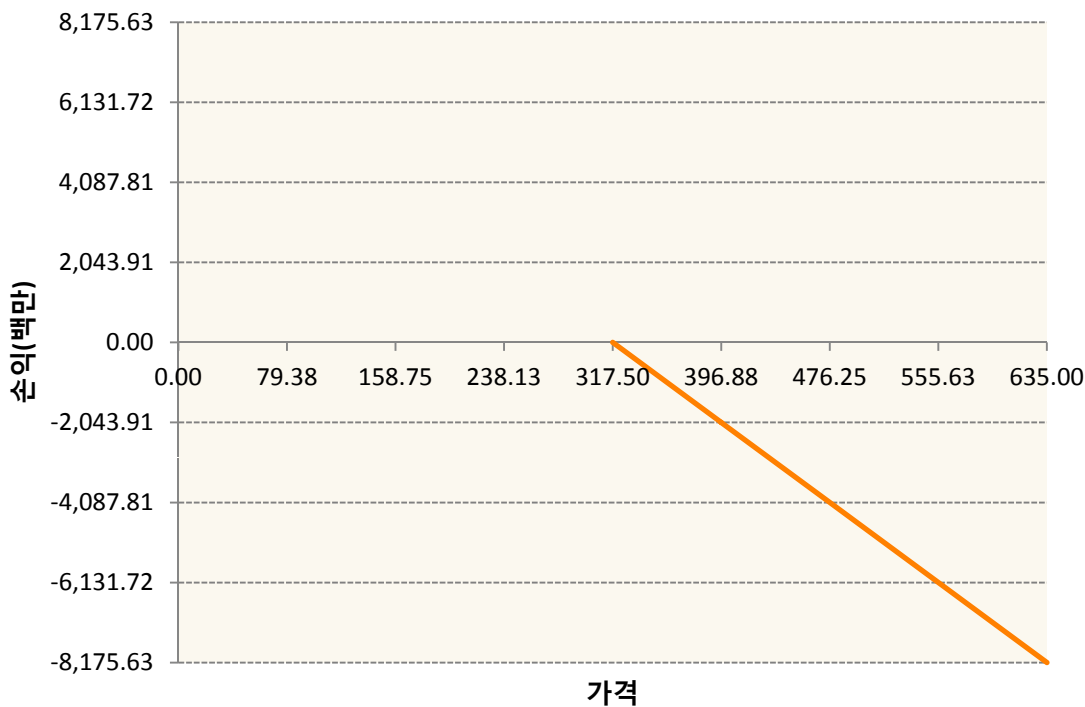


KR4201Q33155-2020-03 콜315

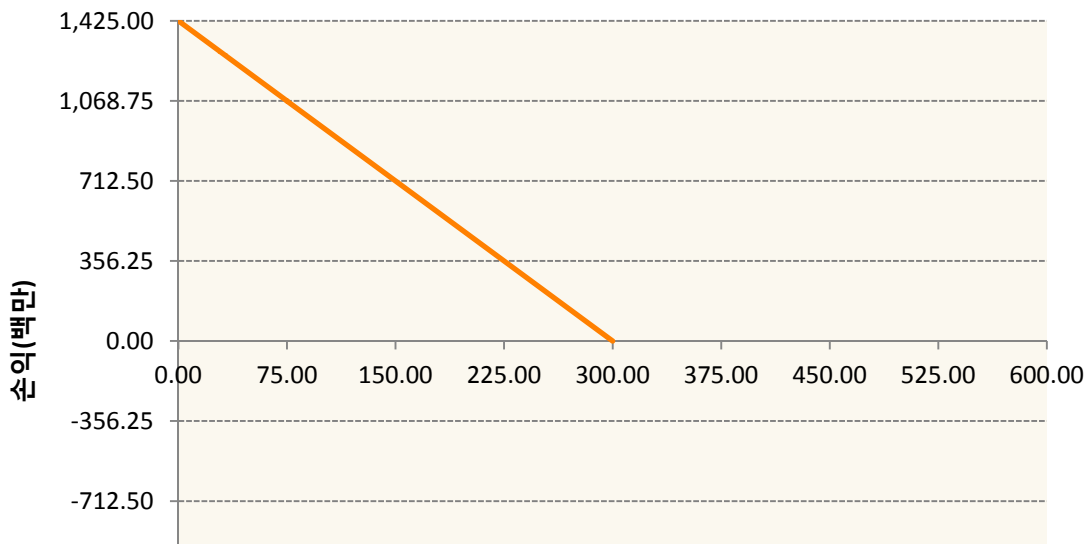


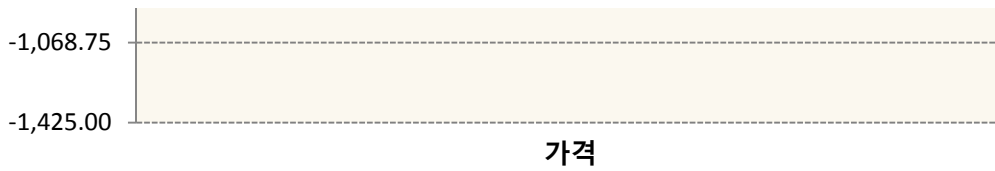


KR4201Q33171-2020-03 콜317.5

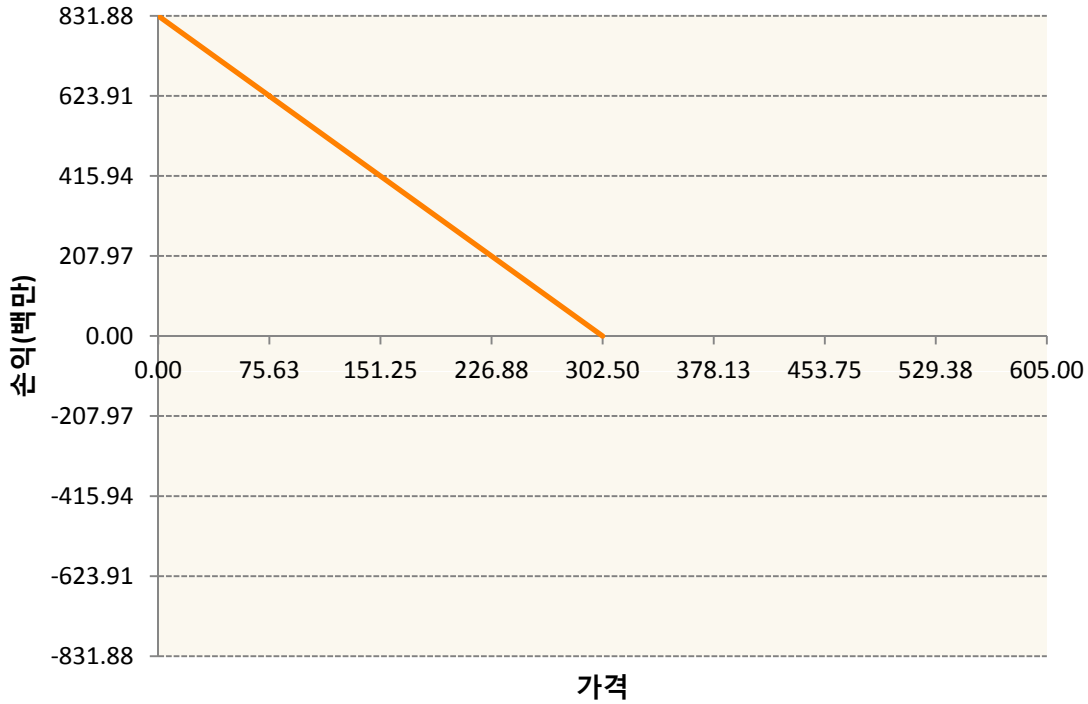


KR4301Q33005-2020-03 풋300





KR4301Q33021-2020-03 풋302.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						778
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-778	-778	-778	-778	-778	-778	-778	
-5.33%	-519	-519	-519	-519	-519	-519	-519	
-2.67%	-259	-259	-259	-259	-259	-259	-259	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	259	259	259	259	259	259	259	
5.33%	519	519	519	519	519	519	519	
8.00%	778	778	778	778	778	778	778	
KR4201Q33155		2020-03 콜315						207
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	15	15	15	15	14	13	12	
-5.33%	15	15	14	13	12	10	6	
-2.67%	15	14	12	10	6	1	-5	

0%	13	10	6	0	-7	-16	-26
2.67%	5	-2	-11	-21	-34	-48	-63
5.33%	-16	-29	-45	-62	-81	-101	-122
8.00%	-64	-86	-108	-132	-157	-182	-207
KR4201Q33171 2020-03 콜317.5							115
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	3
-2.67%	7	7	6	5	3	0	-3
0%	6	5	3	0	-4	-9	-14
2.67%	3	0	-5	-11	-18	-25	-34
5.33%	-7	-14	-23	-32	-43	-54	-67
8.00%	-31	-43	-56	-70	-85	-100	-115
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	69	69	69
-2.67%	33	33	33	34	34	34	35
0%	-2	-1	-1	0	1	2	3
2.67%	-35	-34	-32	-31	-29	-27	-26
5.33%	-63	-60	-58	-56	-54	-52	-49
8.00%	-82	-80	-77	-75	-73	-70	-68
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	1
2.67%	-20	-20	-19	-18	-18	-17	-16
5.33%	-38	-37	-35	-34	-33	-32	-31
8.00%	-51	-49	-48	-46	-45	-44	-42

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

(단위:백만원)

975

공시일	2020-02-27
기준일	2020-02-26

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	217,890	0	217,890	

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	2020-02-27
기준일	2020-02-26

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	4,142	-4,142	
누계	유가증권	수익증권	176,342	0	176,342	

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	2020-02-27
기준일	2020-02-26

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	540,538	0	540,538	
누계	통화	선도	0	594,334	-594,334	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,567
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,460
FX21020F02 KRW/USD 28-02-20E	1,947
FX21020F03 KRW/USD 28-02-20E	3,018
FX21020F03 KRW/USD 31-03-20E	3,115
FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E	2,921
FX21020F04 KRW/USD 28-02-20E	195
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,629
FX21020G00 KRW/USD 06-03-20E	2,434
FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	974
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,207
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,236
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	974
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	1,947
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	3,349
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,349
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,947
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,894
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,278
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,947
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	195
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	4,965
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)

124

공시일	2020-02-27
기준일	2020-02-26

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

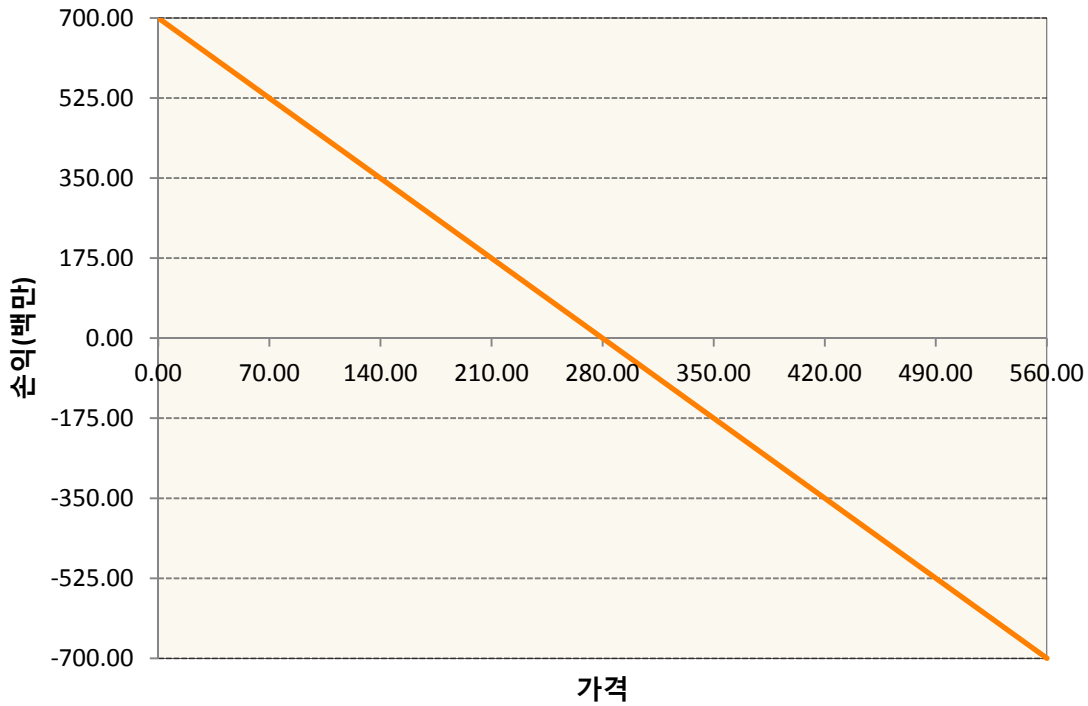
1. 계약금액

(단위:백만원)

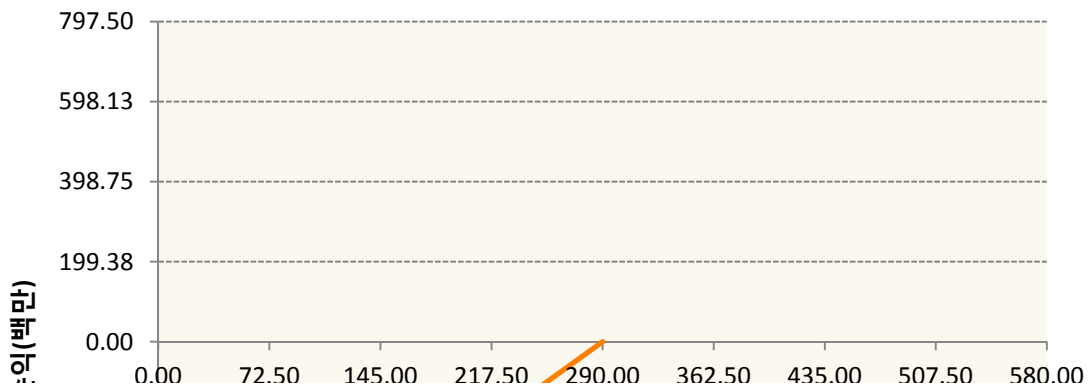
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	700	-700	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,503	-3,503	장내

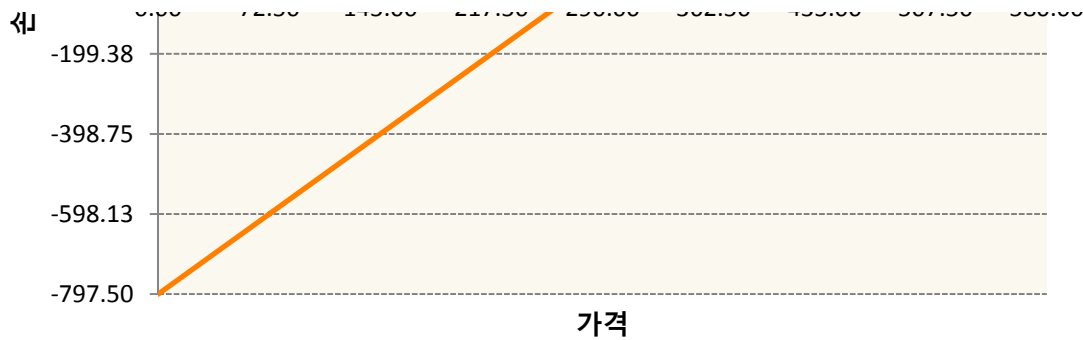
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

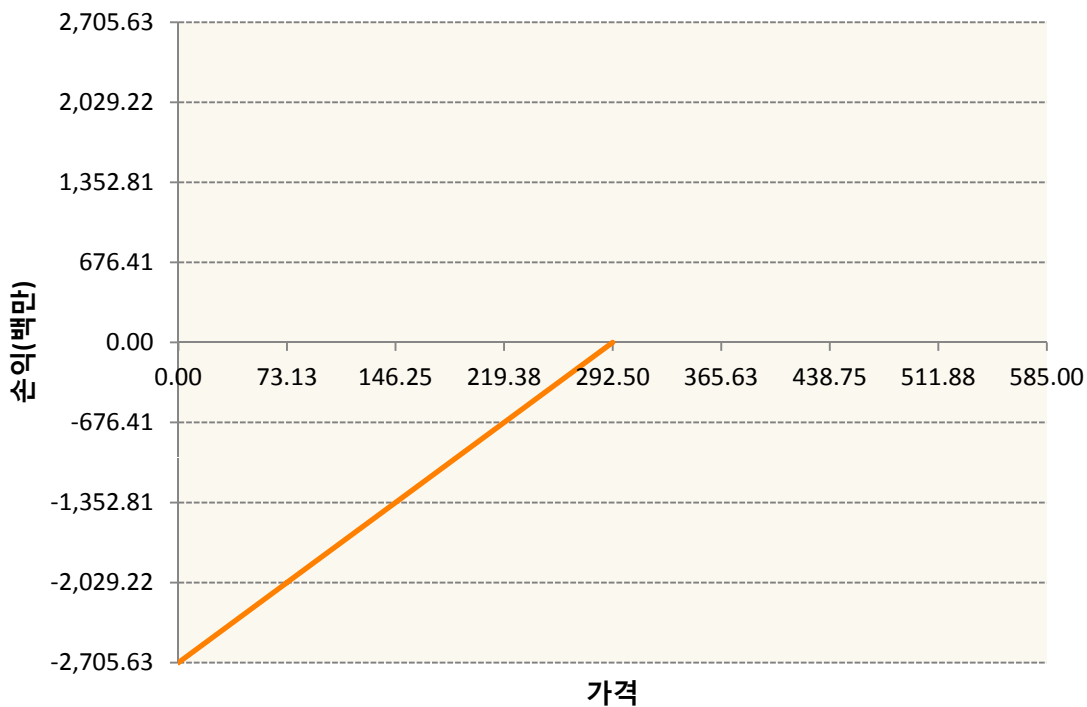


KR4301Q32908-2020-03 풋290





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						57
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-57
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-37	-37
-2.67%	-16	-16	-16	-17	-18	-18	-19
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	17	16	15	14	12	11	10
5.33%	27	26	24	23	22	21	19
8.00%	31	31	30	29	28	27	26
KR4301Q32924 2020-03 풋292.5							195
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-194	-194	-194	-194	-194	-194	-195
-5.33%	-125	-125	-125	-126	-126	-127	-128
-2.67%	-57	-57	-59	-60	-62	-64	-66
0%	8	5	3	0	-3	-6	-10
2.67%	62	58	54	50	46	42	37
5.33%	100	95	91	87	82	78	73
8.00%	120	117	113	110	106	102	98

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

(단위:백만원)

319

공시일	2020-02-27
기준일	2020-02-26

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	373	-373	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	10,481	0	10,481	
누계	통화	선도	1,120	16,793	-15,674	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020F03(KRW/USD 28-02-20E	212
FX21020F04(KRW/USD 28-02-20E	303
FX21020F04(KRW/USD 28-02-20E	5
FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	331
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
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	184
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	217
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

493

공시일	2020-02-27
기준일	2020-02-26

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

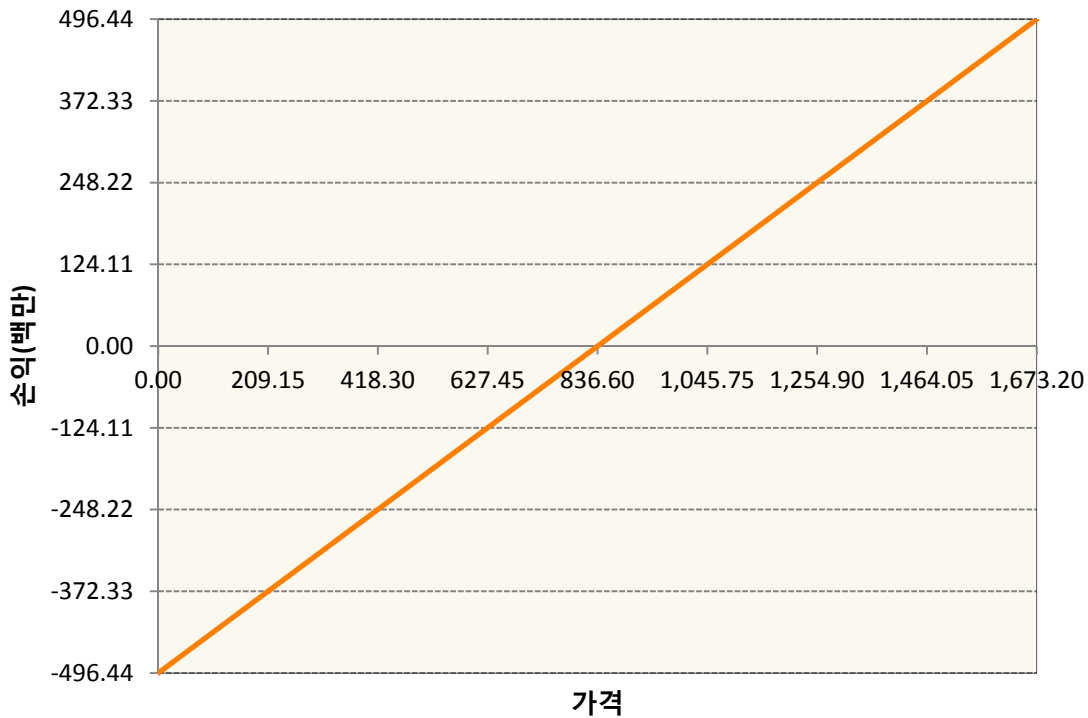
1. 계약금액

(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	496	0	496	
누계	유가증권	스왑	1,091	0	1,091	장외
누계	통화	선도	185	847	-661	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	10
FX21020G01 KRW/EUR 22-05-20E	5
FX21020G05 KRW/EUR 26-06-20E	12
VNCH0 VN30 Index Future Mar20	40

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

(단위:백만원)

126

공시일	2020-02-27
기준일	2020-02-26

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

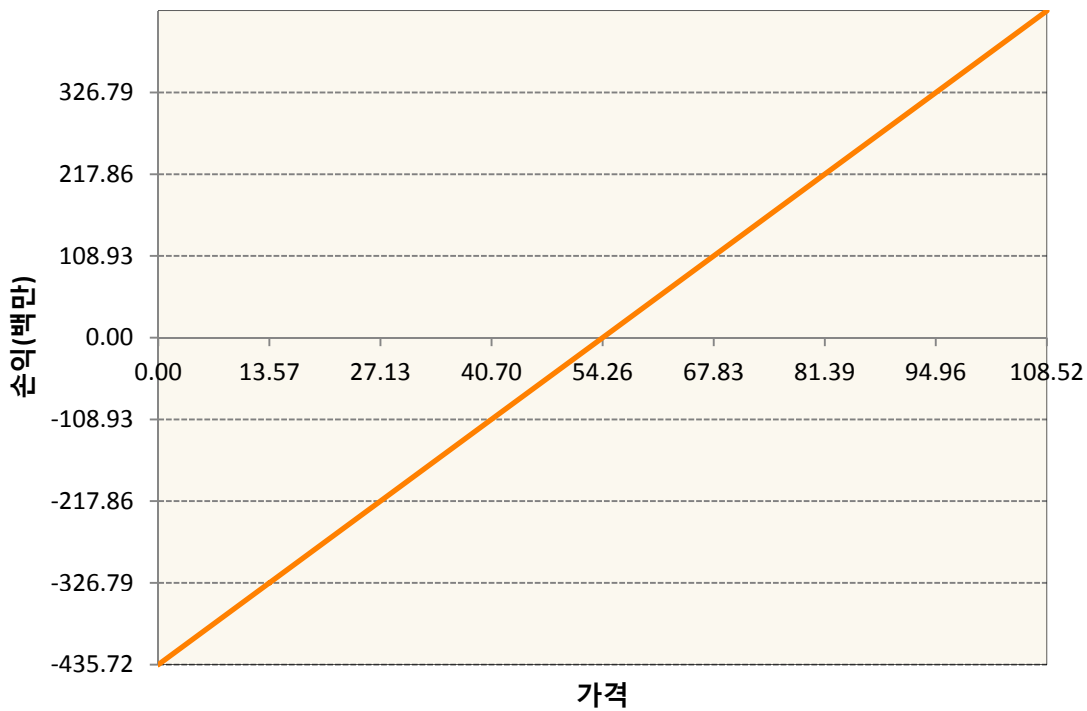
1. 계약금액

(단위:백만원)

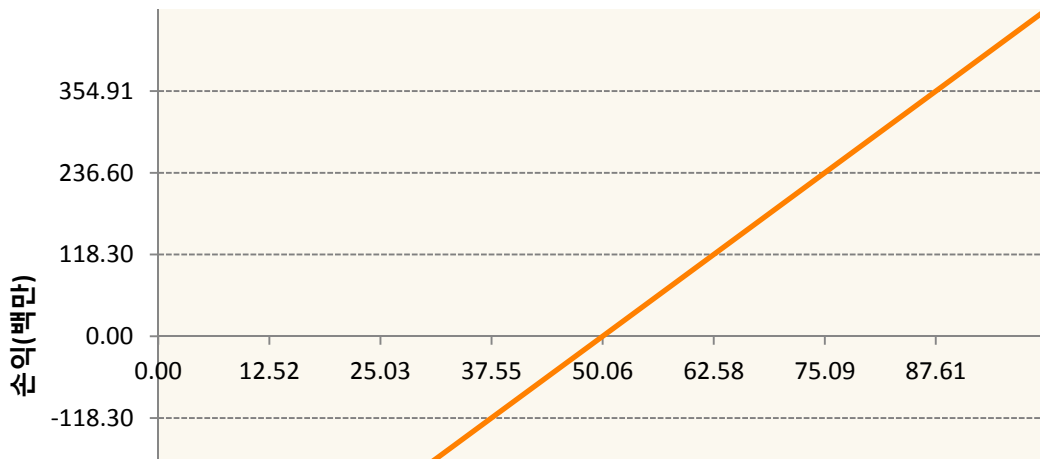
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,025	195	1,830	

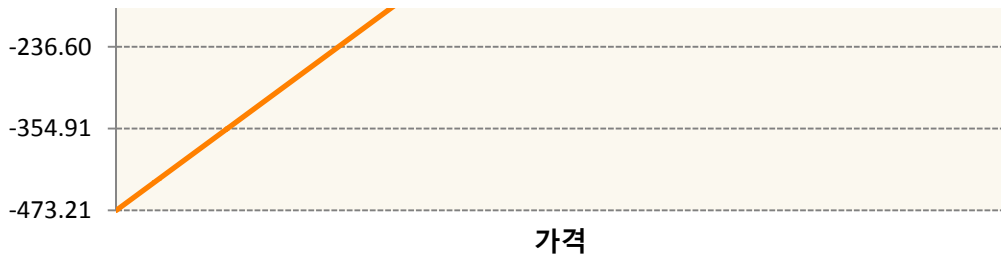
2. 만기시점의 손익구조

COK0-BRENT CRUDE FUTR May20

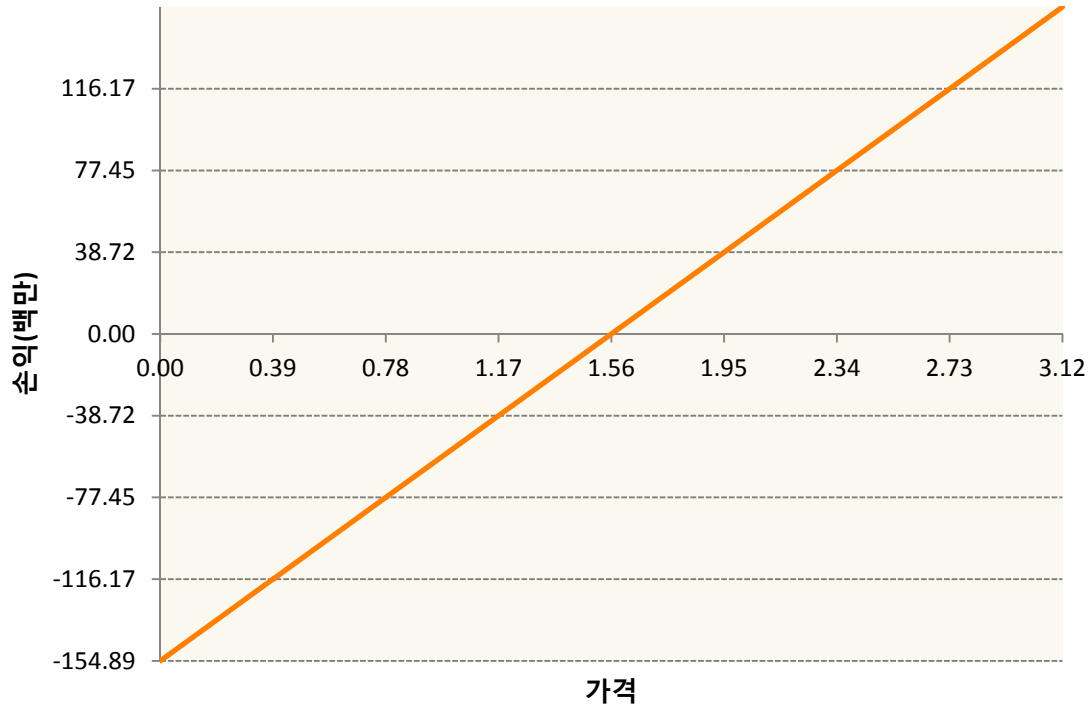


CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20

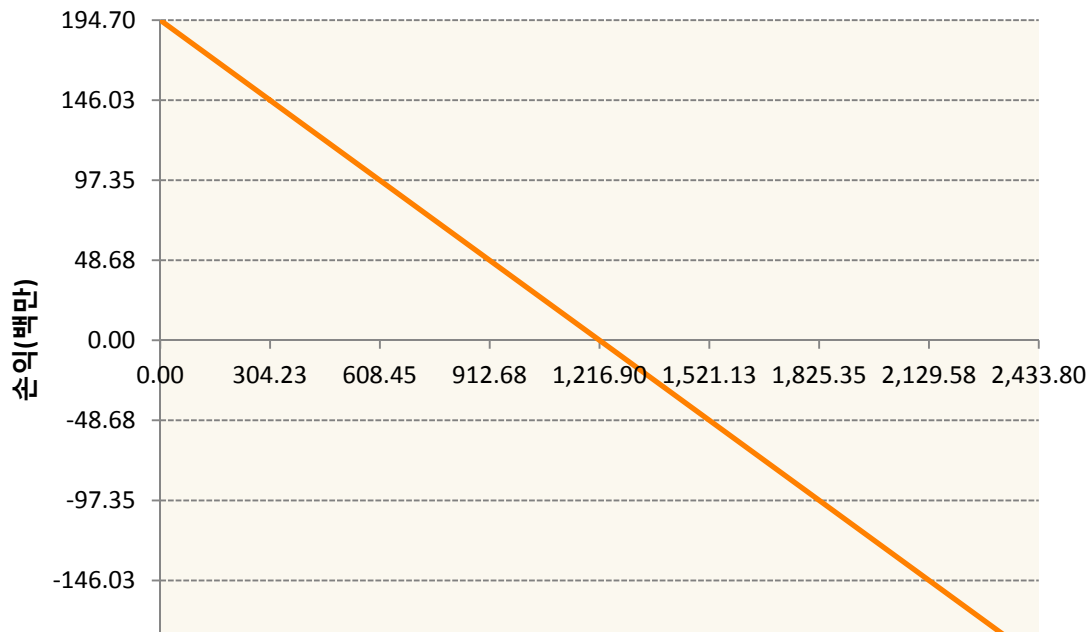


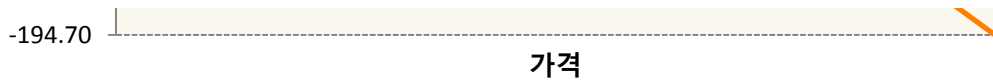


HOK0-NY Harb ULSD Fut May20

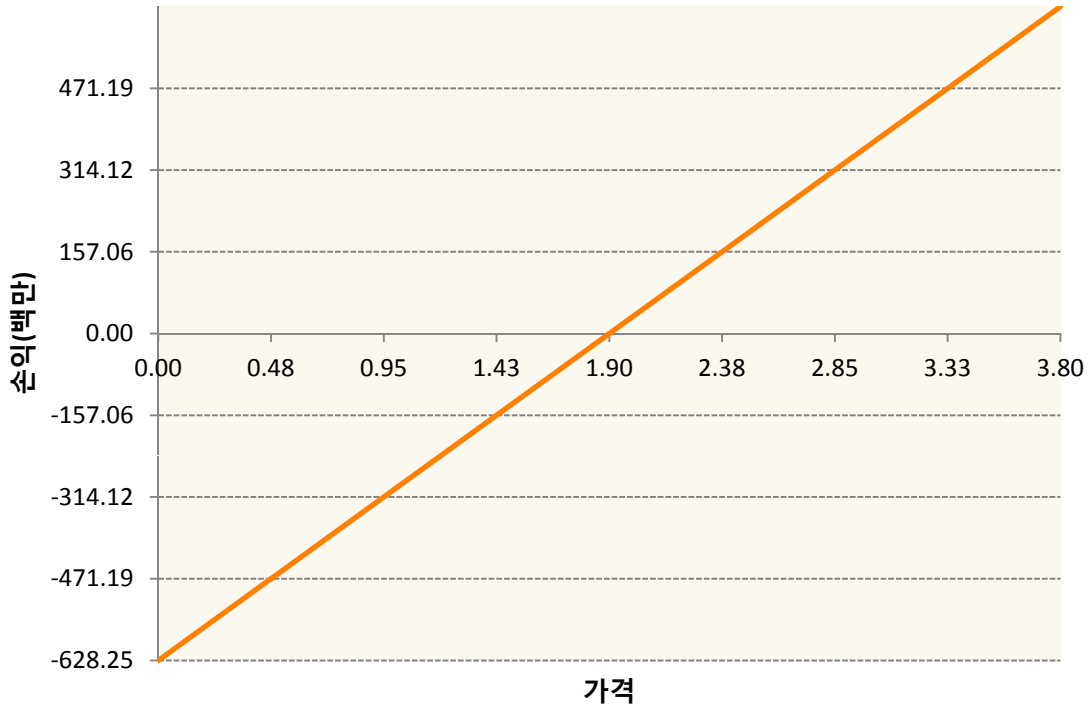


KR4175Q30009-2020-03 달러선물

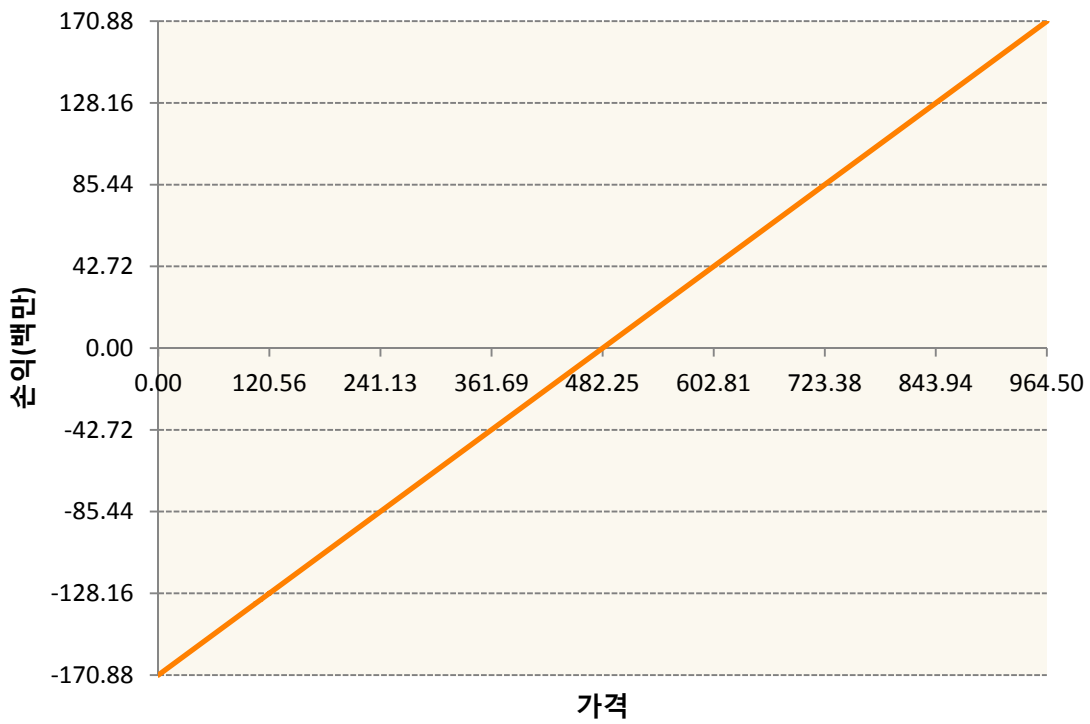




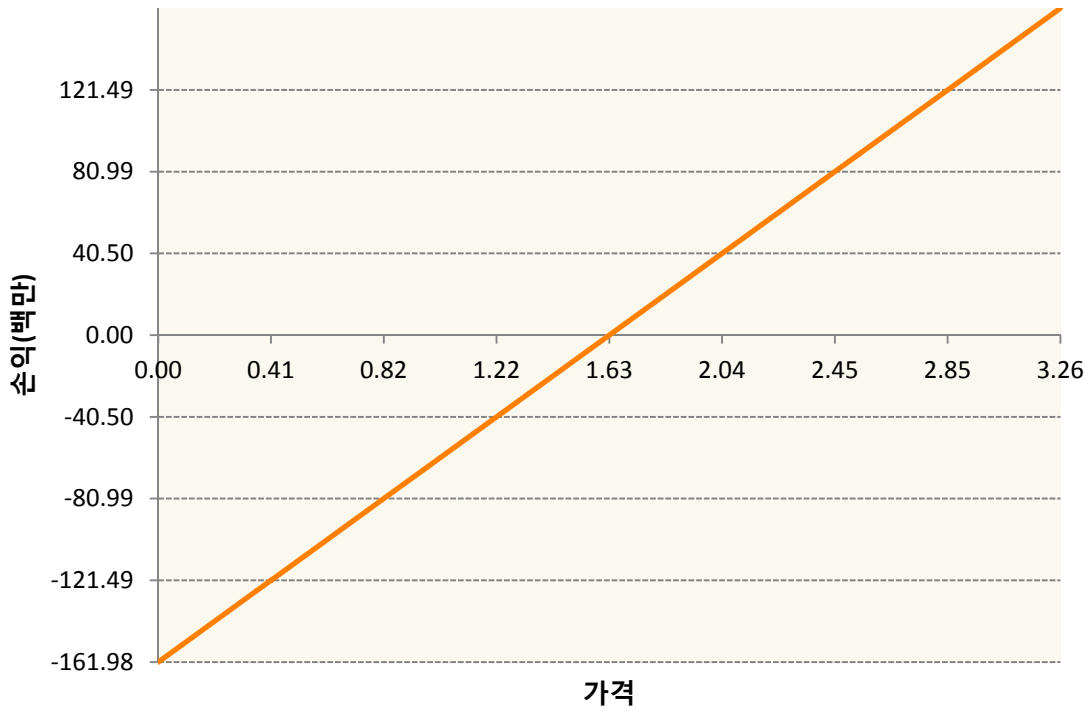
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



QSK0-Low Su Gasoil G Mar20



XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	35
CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	38
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	12
KR4175Q30C	2020-03 달러선물	16
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	50
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	14
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	13

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

(단위:백만원)

330

공시일	2020-02-27
기준일	2020-02-26

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

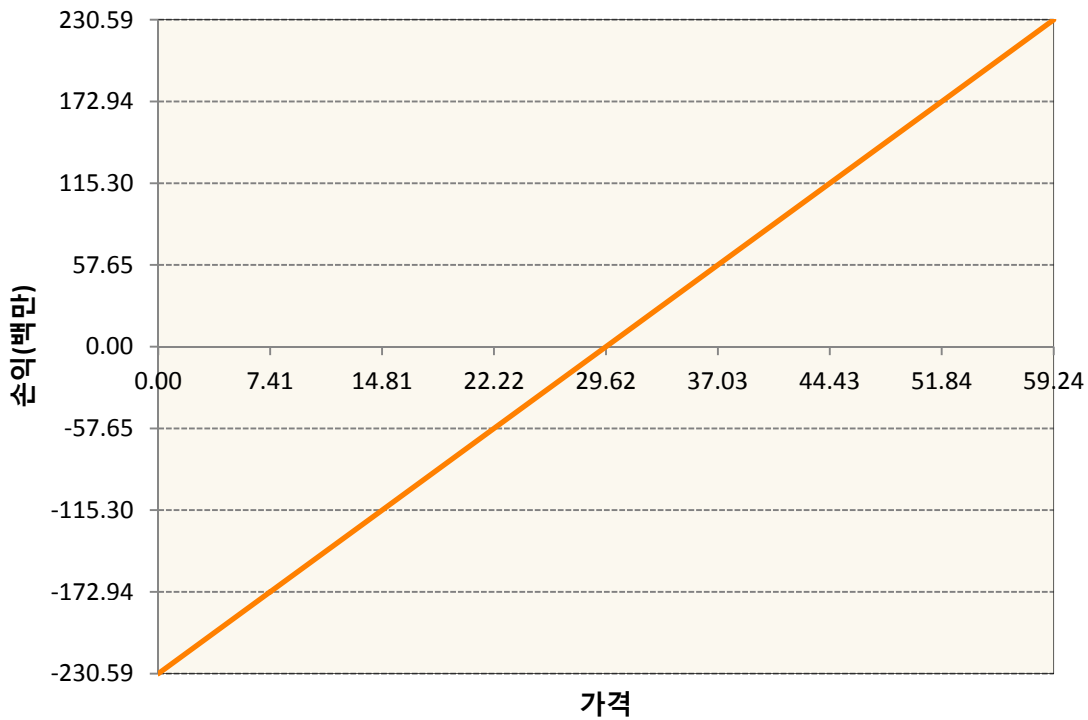
1. 계약금액

(단위:백만원)

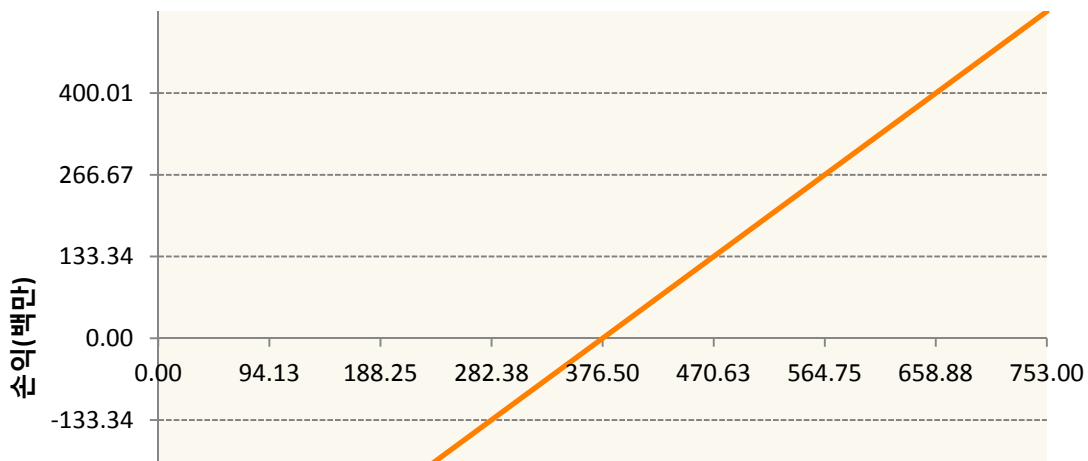
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,639	158	2,481	

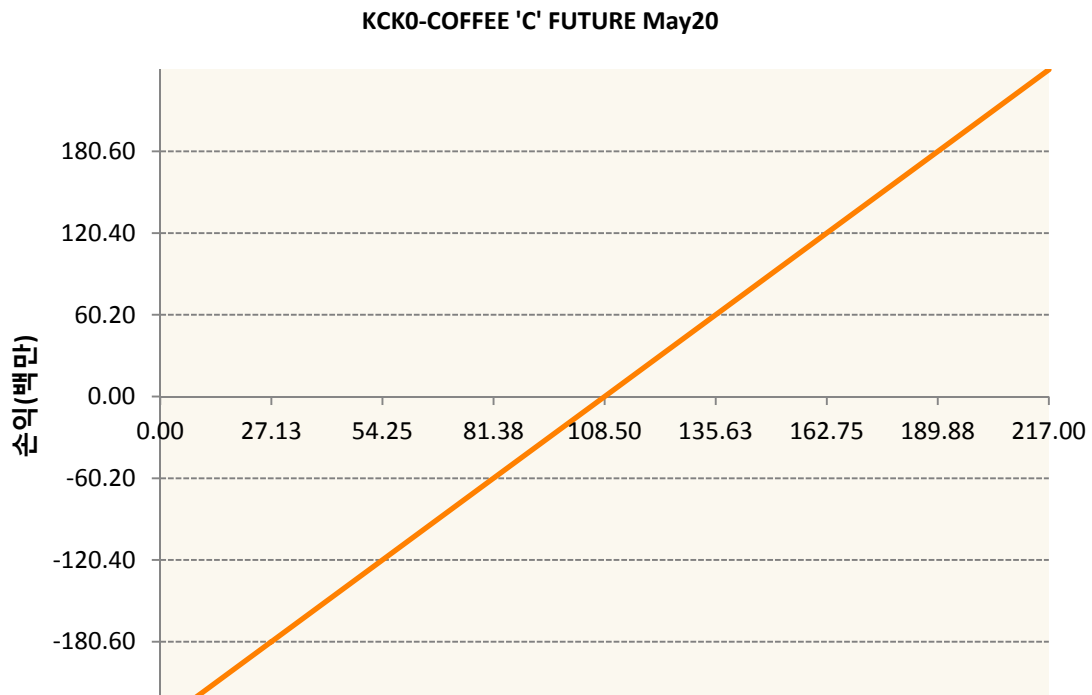
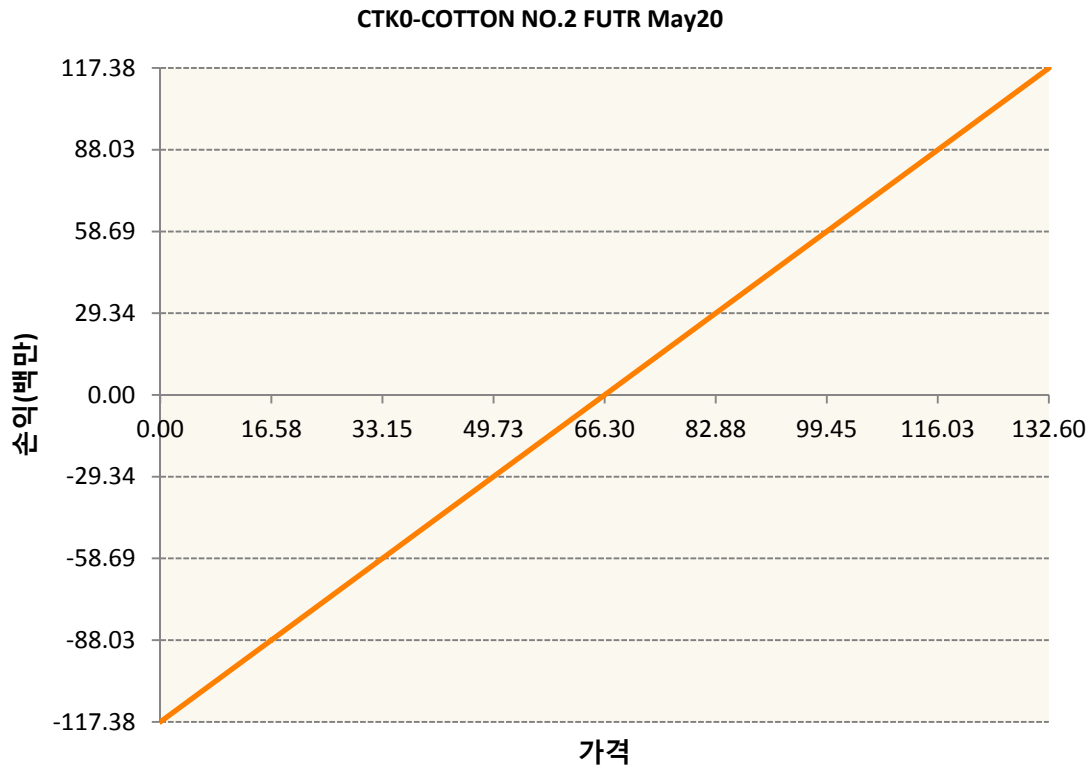
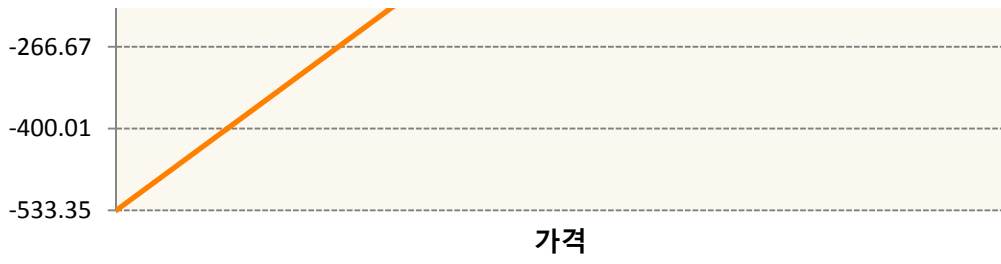
2. 만기시점의 손익구조

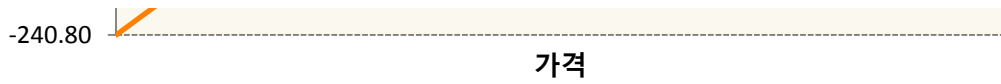
BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20



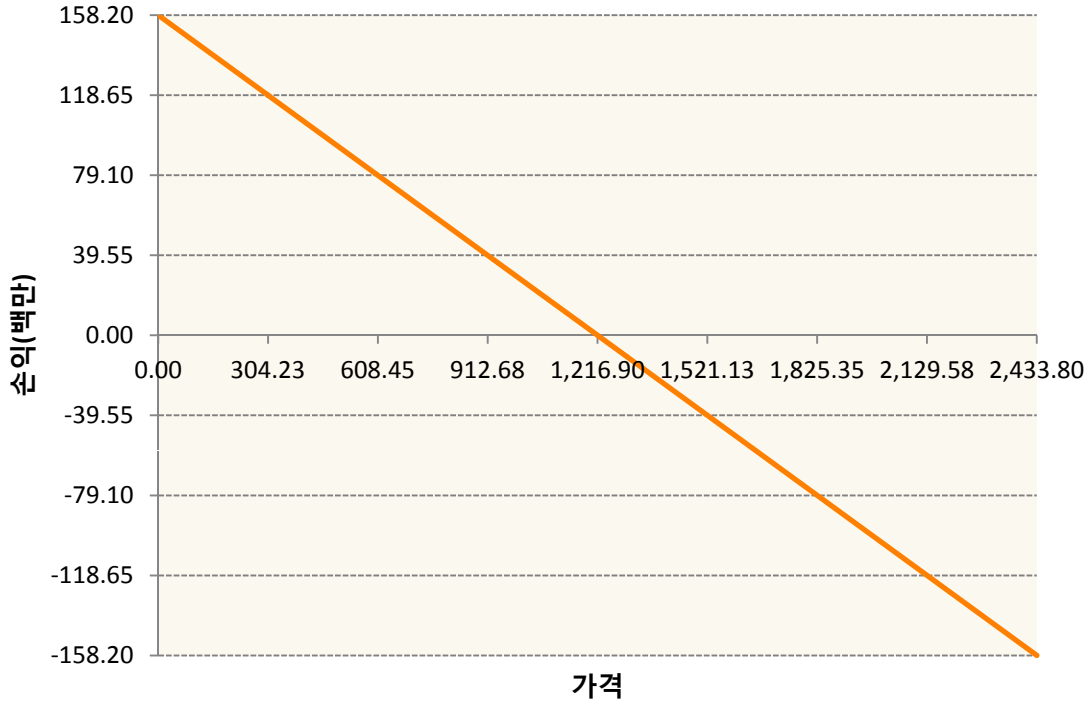
CK0-CORN FUTURE May20



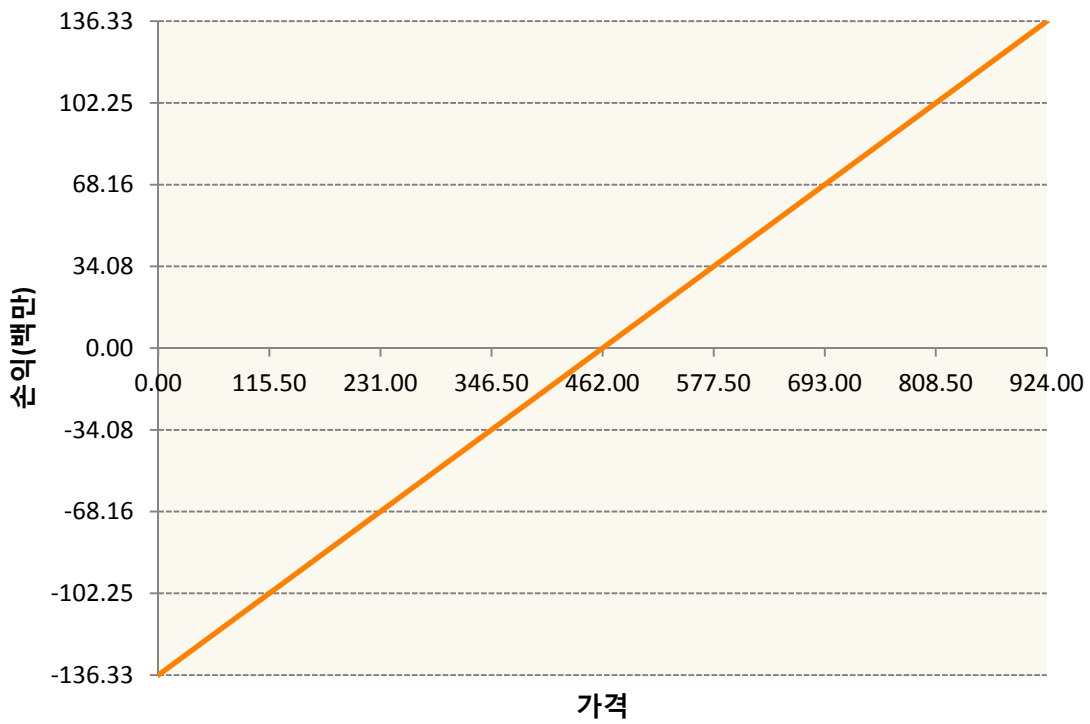




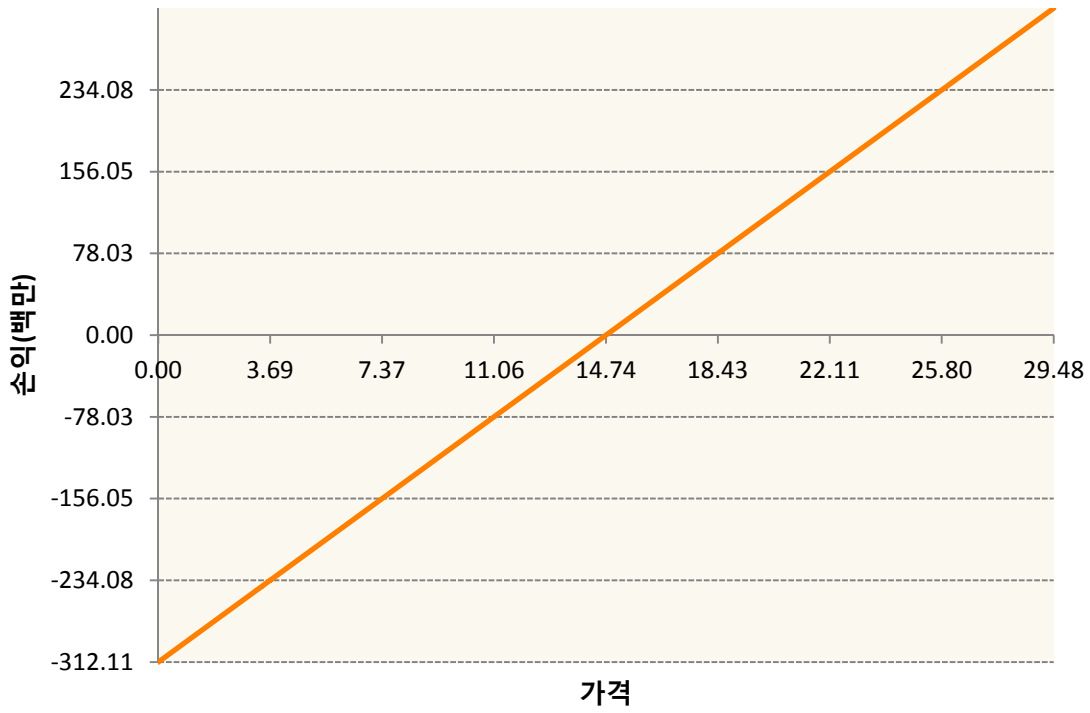
KR4175Q30009-2020-03 달러선물



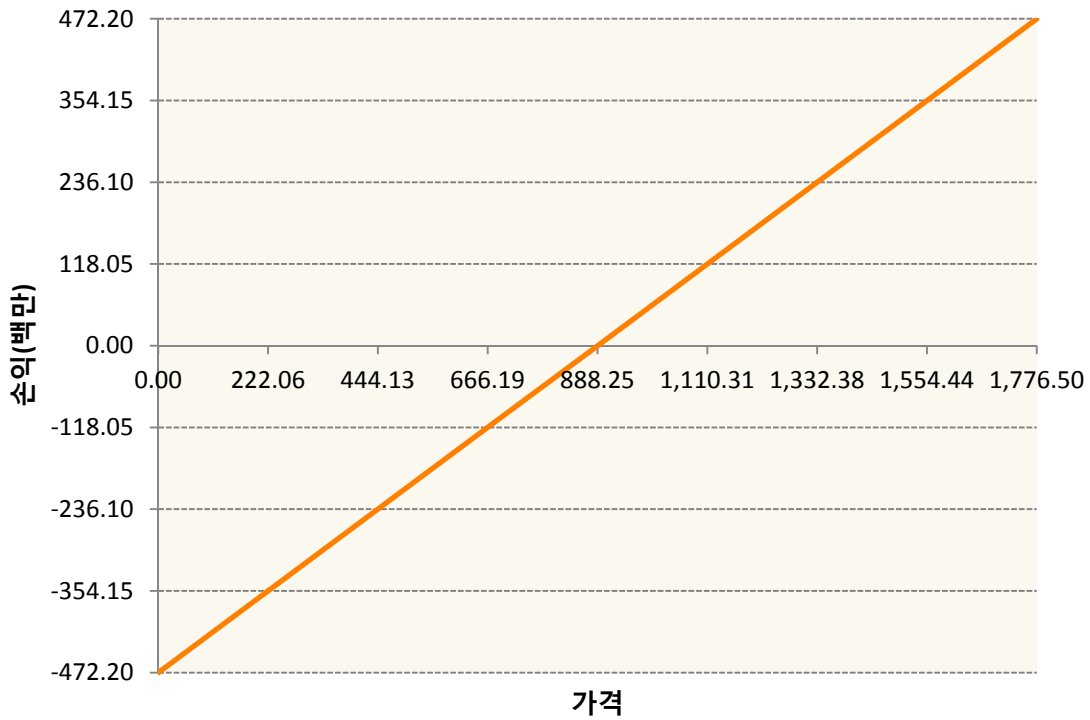
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



SBK0-Sugar May20

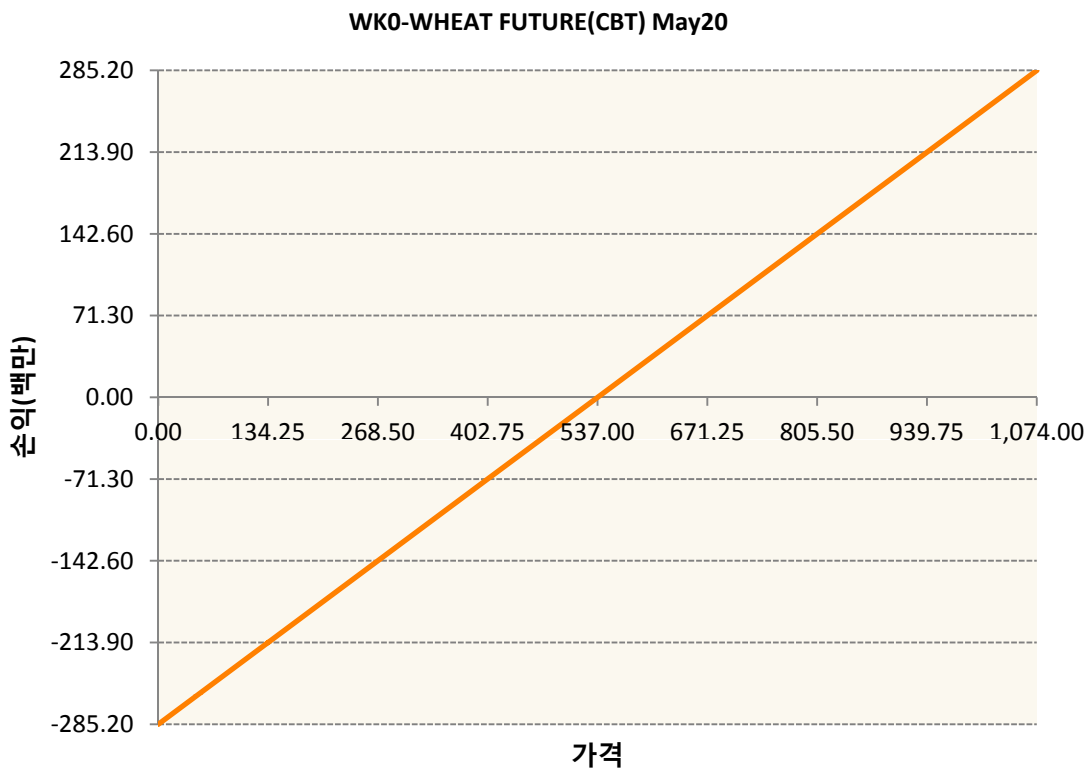
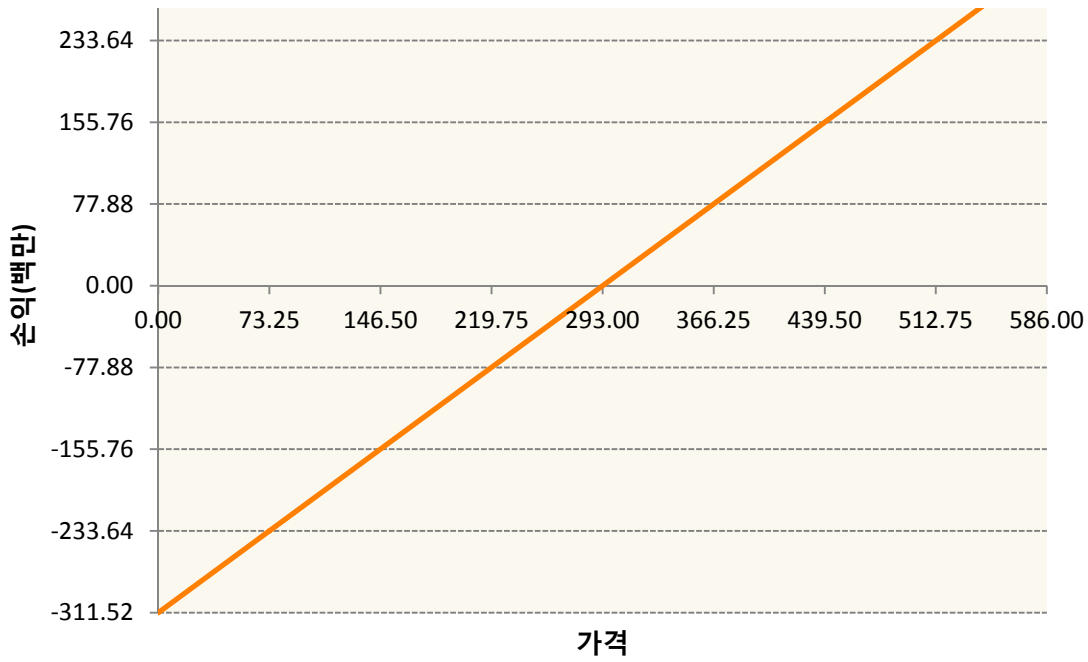


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	18
CK0	CORN FUTURE May20	43
CTK0	COTTON NO.2 FUTR May20	9
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	38
SMK0	SOYBEAN MEAL FUTR May20	25
WK0	WHEAT FUTURE(CBT) May20	23

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

(단위:백만원)

229