

공시일	2020-02-28
기준일	2020-02-27

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	2020-02-28
기준일	2020-02-27

스마트인덱스모

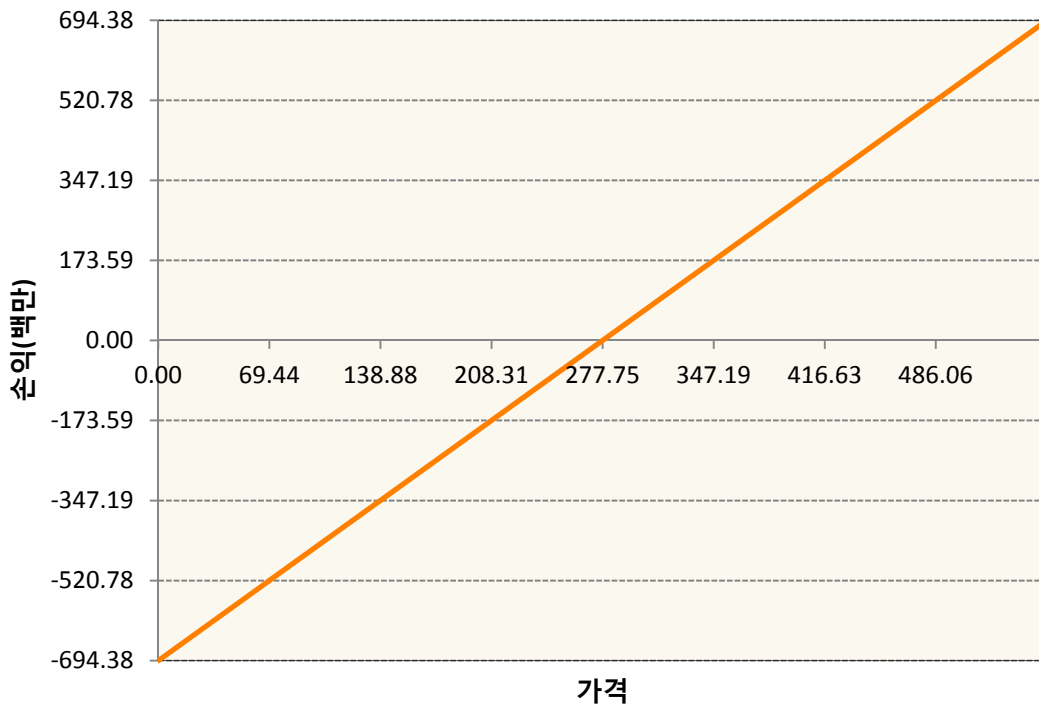
1. 계약금액

(단위:백만원)

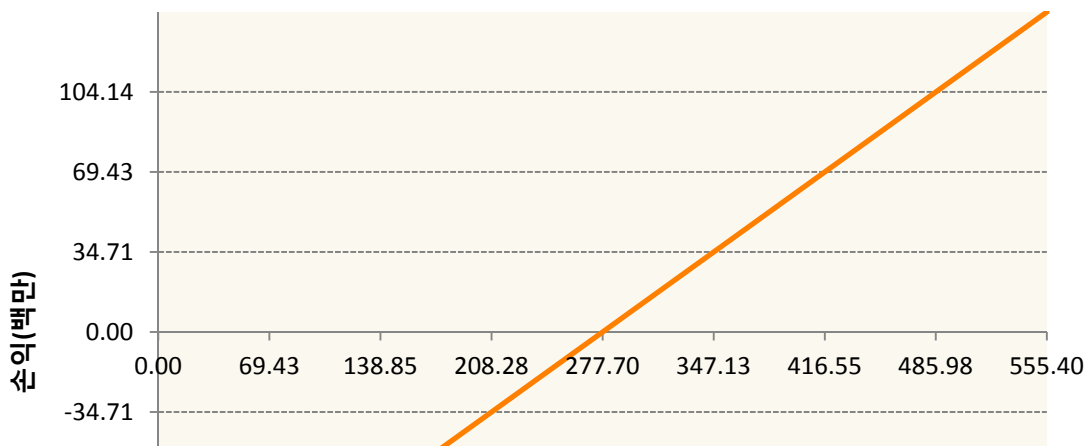
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	139	0	139	장내
누계	유가증권	선물	833	0	833	장내

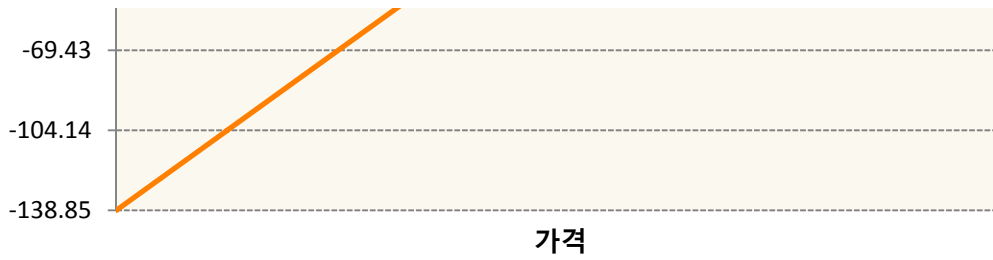
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						55
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55	
-5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37	
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	18	18	18	18	18	18	18	
5.33%	37	37	37	37	37	37	37	
8.00%	55	55	55	55	55	55	55	
KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						11
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11	
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7	
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	4	4	4	4	4	4	4	
5.33%	7	7	7	7	7	7	7	
8.00%	11	11	11	11	11	11	11	

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

57

공시일	2020-02-28
기준일	2020-02-27

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

1,086

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

642

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-28
기준일	2020-02-27

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)	445
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	162

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

921

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-02-28
기준일	2020-02-27

유로인덱스모(주식-파생형)

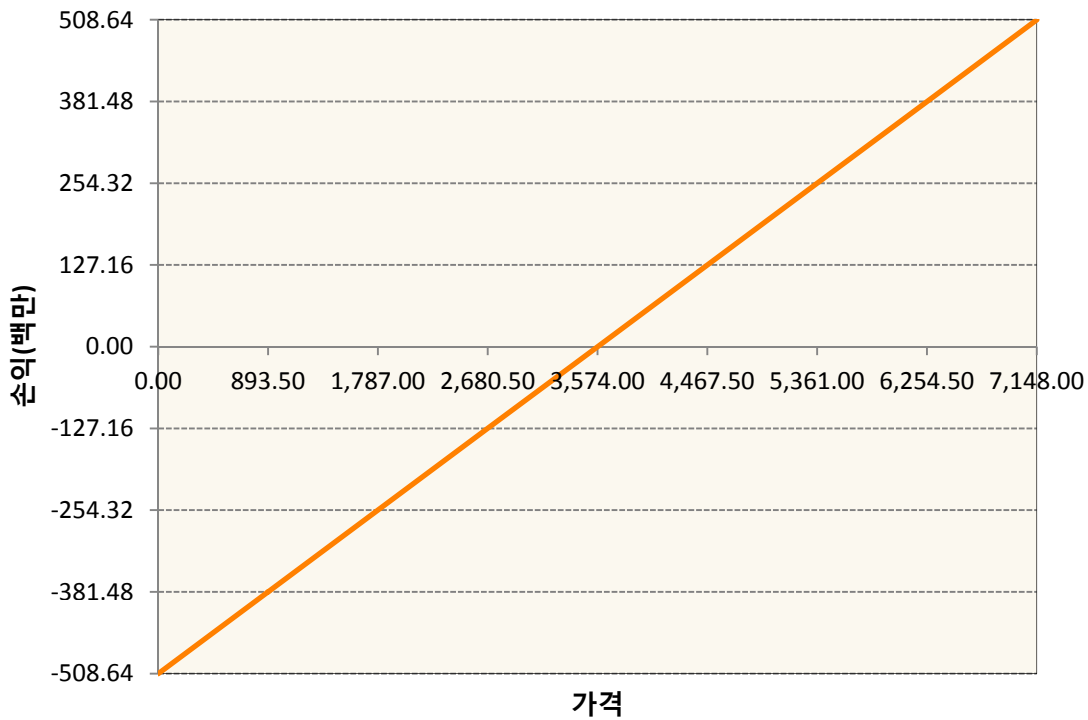
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	509	0	509	

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	2020-02-28
기준일	2020-02-27

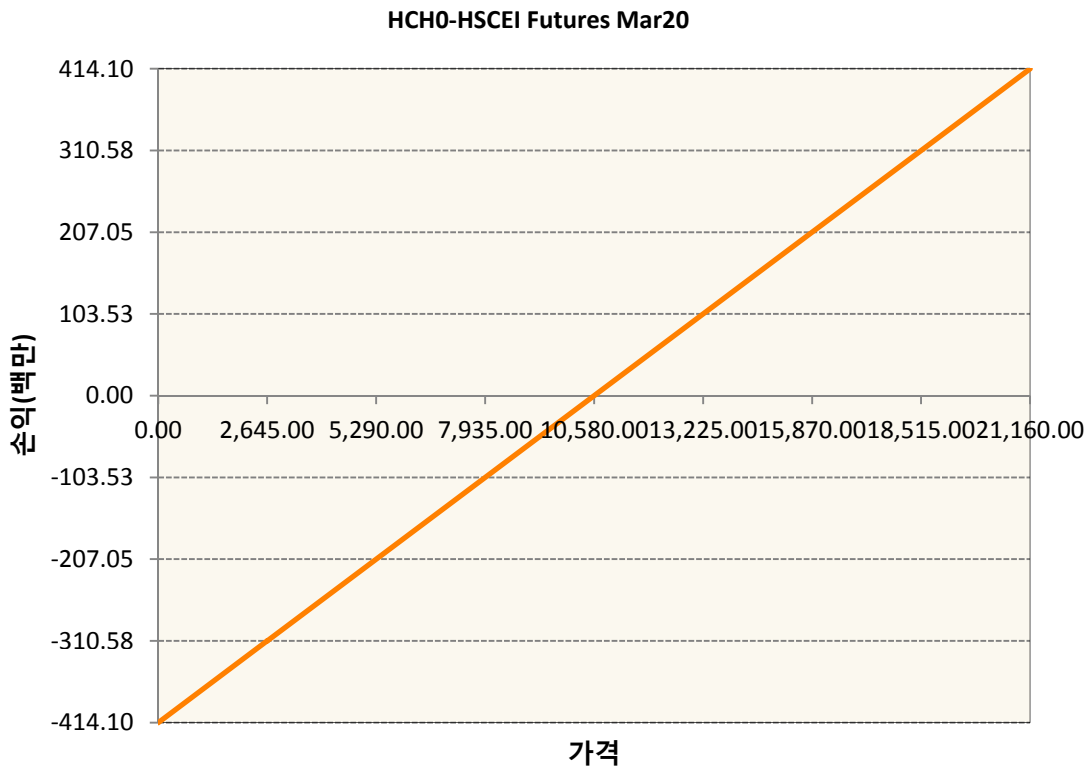
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	414	0	414	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

30

공시일	2020-02-28
기준일	2020-02-27

커버드콜모(주식혼합-파생형)

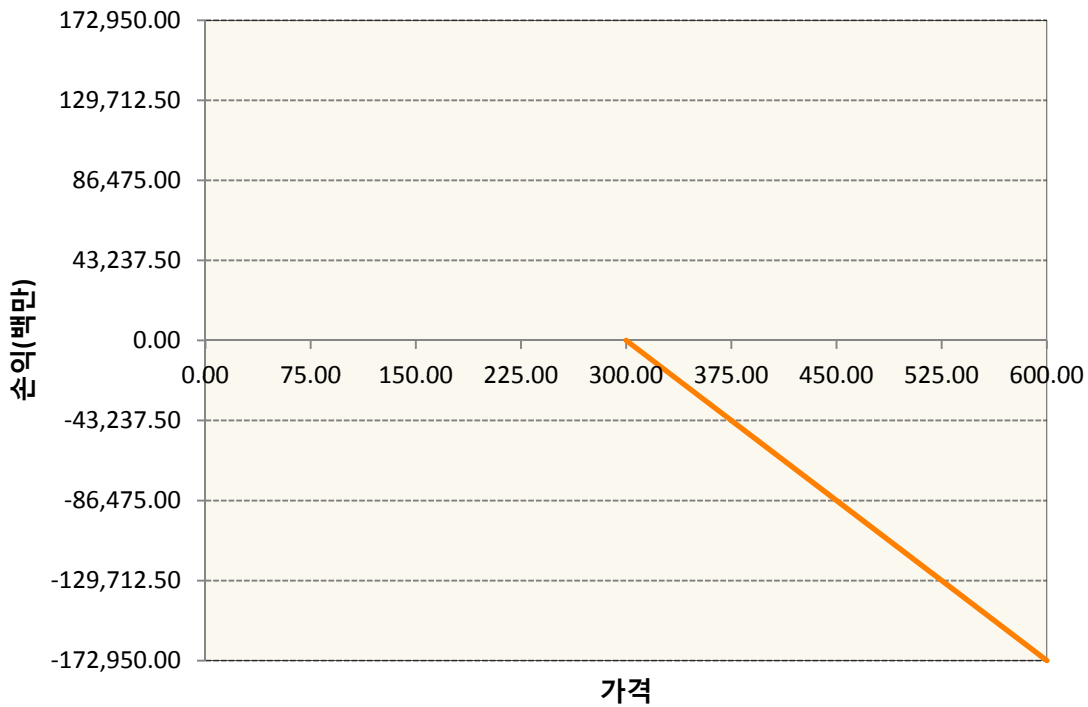
1. 계약금액

(단위:백만원)

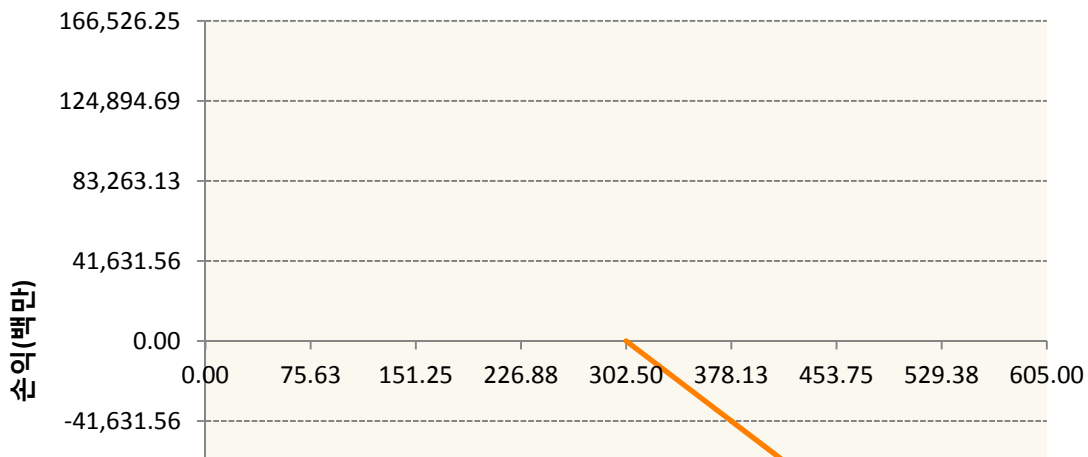
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	448,226	-448,226	장내

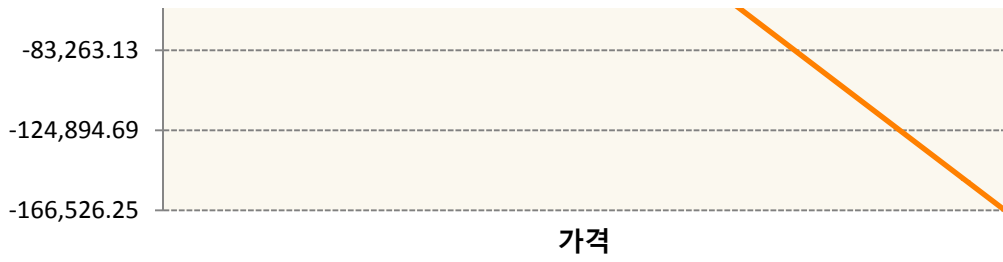
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q33007-2020-03 콜300

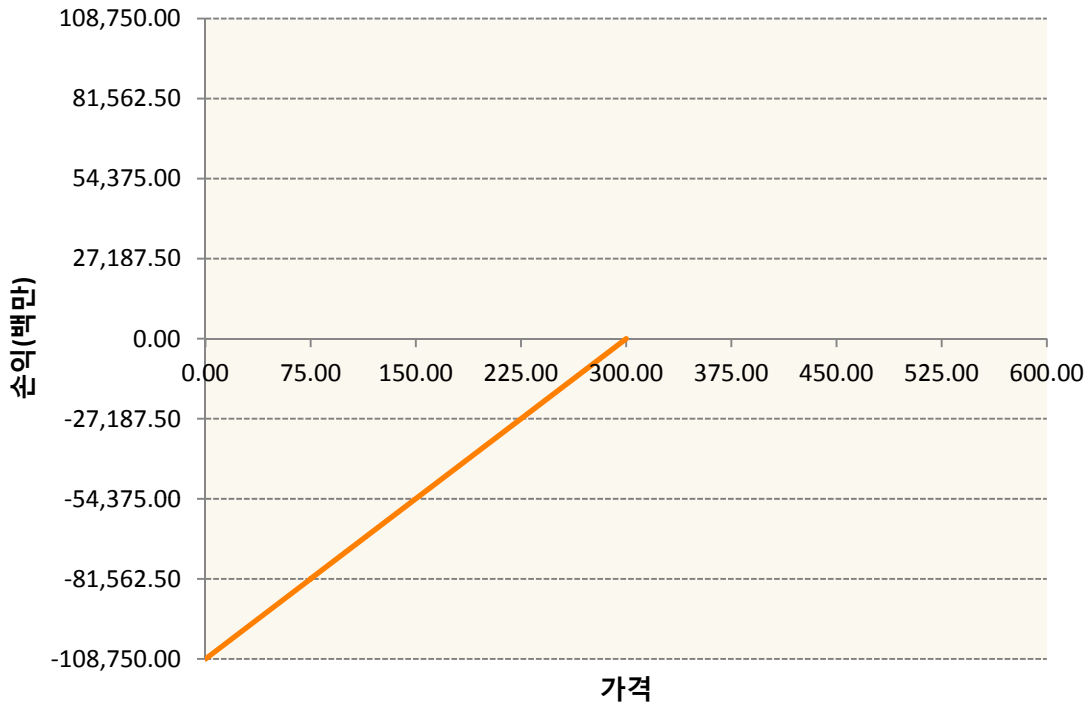


KR4201Q33023-2020-03 콜302.5





KR4301Q33005-2020-03 풋300



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q33007		2020-03 콜300					4,960	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	679	675	667	650	624	586	534	
-5.33%	670	653	624	579	517	438	341	
-2.67%	624	571	495	397	276	134	-27	
0%	462	335	180	0	-201	-421	-658	
2.67%	19	-215	-472	-745	-1,034	-1,334	-1,644	
5.33%	-934	-1,274	-1,621	-1,975	-2,334	-2,696	-3,062	
8.00%	-2,609	-3,001	-3,393	-3,785	-4,177	-4,568	-4,960	
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5					4,260	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	507	505	499	487	468	439	399	

-5.33%	501	491	470	437	390	328	249
-2.67%	473	436	380	304	207	90	-45
0%	365	269	146	0	-168	-356	-561
2.67%	48	-143	-358	-593	-844	-1,109	-1,387
5.33%	-680	-977	-1,286	-1,605	-1,931	-2,264	-2,601
8.00%	-2,035	-2,403	-2,773	-3,143	-3,515	-3,887	-4,260
KR4301Q33005 2020-03 풋300							7,887
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,872	-7,872	-7,873	-7,874	-7,876	-7,880	-7,887
-5.33%	-5,196	-5,197	-5,200	-5,205	-5,214	-5,228	-5,247
-2.67%	-2,524	-2,531	-2,543	-2,563	-2,590	-2,626	-2,670
0%	123	94	53	0	-64	-138	-221
2.67%	2,663	2,581	2,486	2,381	2,265	2,142	2,011
5.33%	4,908	4,757	4,601	4,439	4,274	4,106	3,935
8.00%	6,623	6,434	6,244	6,054	5,864	5,674	5,484

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

(단위:백만원)

14,199

공시일	2020-02-28
기준일	2020-02-27

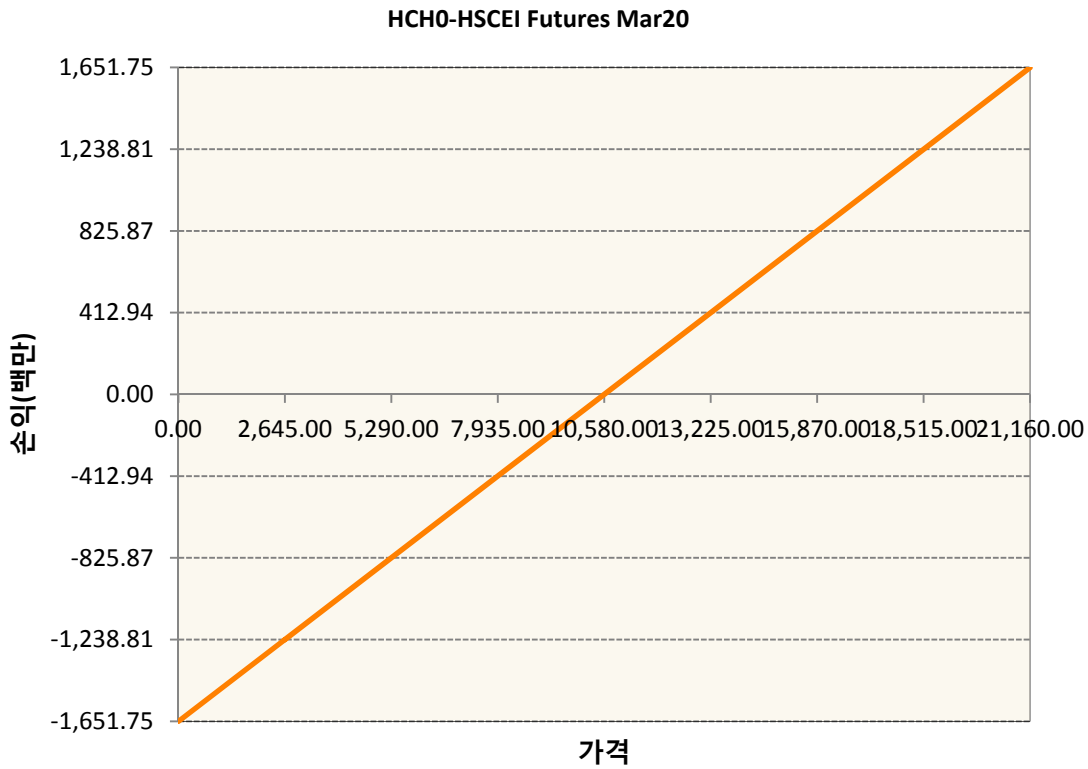
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,652	0	1,652	장내
누계	통화	선도	0	2,198	-2,198	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E	176
HCH0 HSCEI Futures Mar20	132

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

(단위:백만원)

180

공시일	2020-02-28
기준일	2020-02-27

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

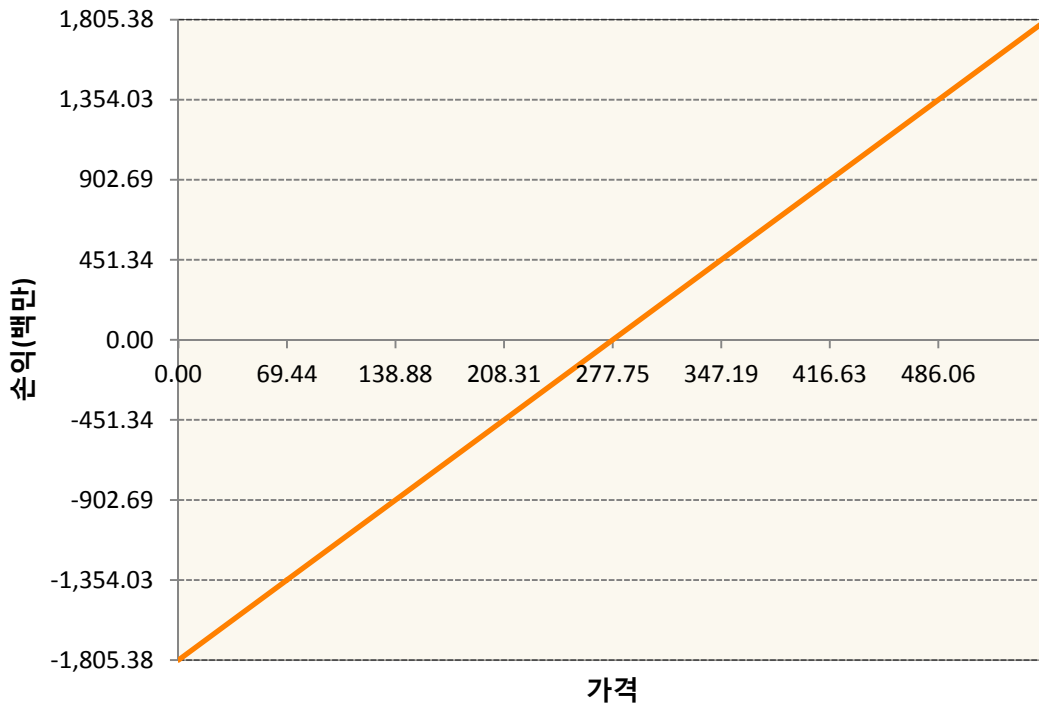
1. 계약금액

(단위:백만원)

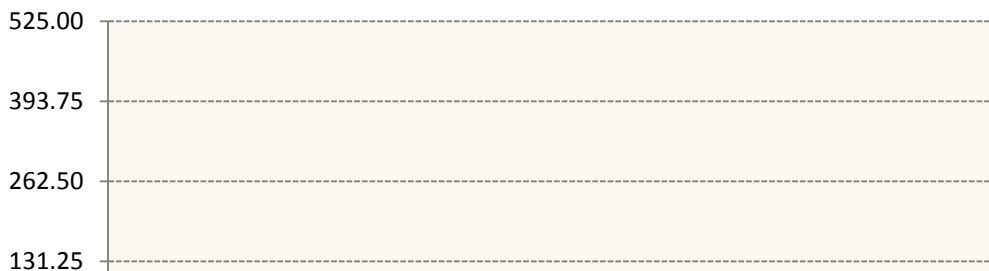
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,805	0	1,805	장내
누계	유가증권	스왑	3,125	0	3,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,612	-3,612	장내

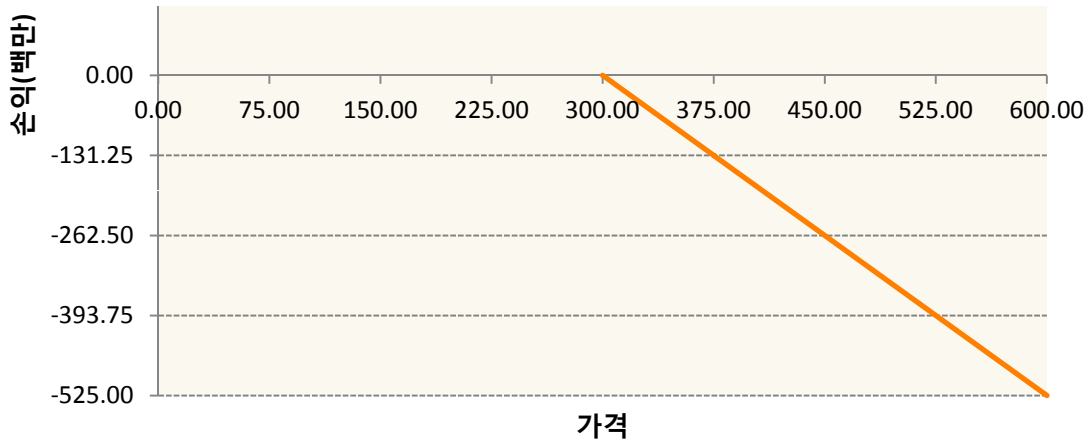
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

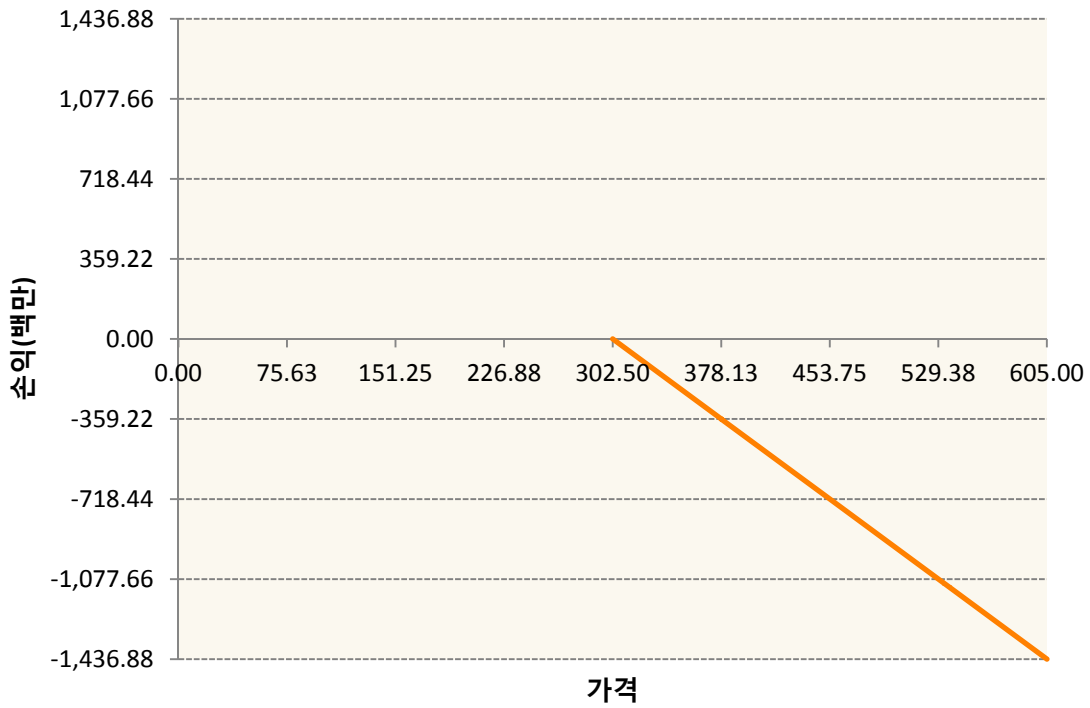


KR4201Q33007-2020-03 콜300

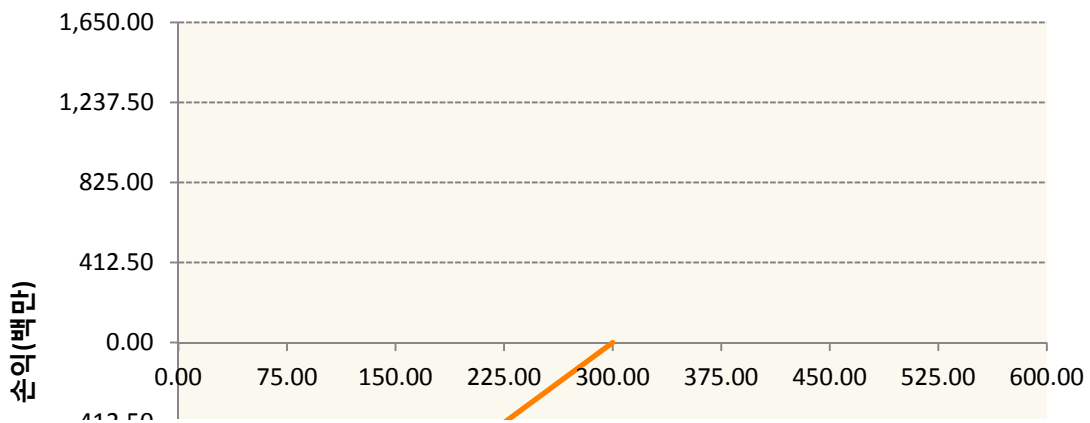




KR4201Q33023-2020-03 콜302.5



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						144
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-144	-144	-144	-144	-144	-144	-144	
-5.33%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96	
-2.67%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	48	48	48	48	48	48	48	
5.33%	96	96	96	96	96	96	96	
8.00%	144	144	144	144	144	144	144	
KR4201Q33007		2020-03 콜300						15
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2	2	2	2	2	2	2	
-5.33%	2	2	2	2	2	1	1	
-2.67%	2	2	2	1	1	0	0	
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2	
2.67%	0	-1	-1	-2	-3	-4	-5	
5.33%	-3	-4	-5	-6	-7	-8	-9	
8.00%	-8	-9	-10	-11	-13	-14	-15	
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5						37
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	4	4	4	4	4	4	3
-5.33%	4	4	4	4	3	3	2
-2.67%	4	4	3	3	2	1	0
0%	3	2	1	0	-1	-3	-5
2.67%	0	-1	-3	-5	-7	-10	-12
5.33%	-6	-8	-11	-14	-17	-20	-22
8.00%	-18	-21	-24	-27	-30	-34	-37
KR4301Q33005 2020-03 풋300							120
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-119	-119	-119	-119	-119	-120	-120
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-80
-2.67%	-38	-38	-39	-39	-39	-40	-41
0%	2	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	40	39	38	36	34	32	31
5.33%	74	72	70	67	65	62	60
8.00%	100	98	95	92	89	86	83

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

(단위:백만원)

552

공시일	2020-02-28
기준일	2020-02-27

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

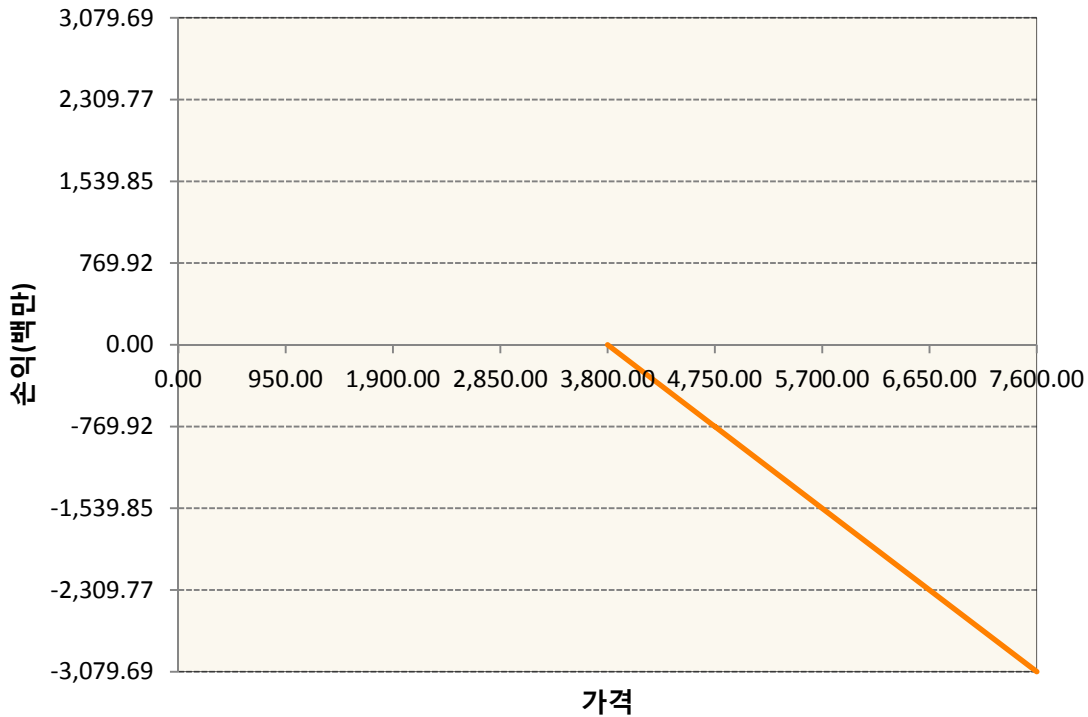
1. 계약금액

(단위:백만원)

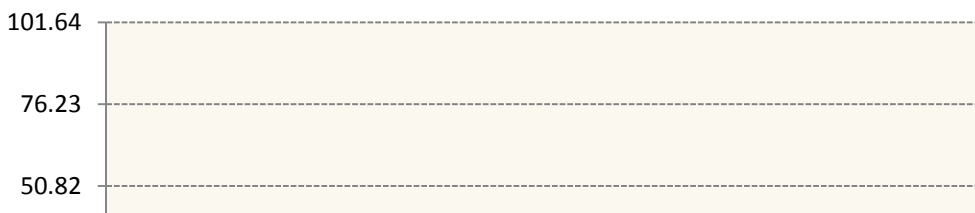
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	184	0	184	
누계	유가증권	스왑	11,958	0	11,958	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,363	-6,363	장내
누계	통화	선도	0	3,486	-3,486	장외

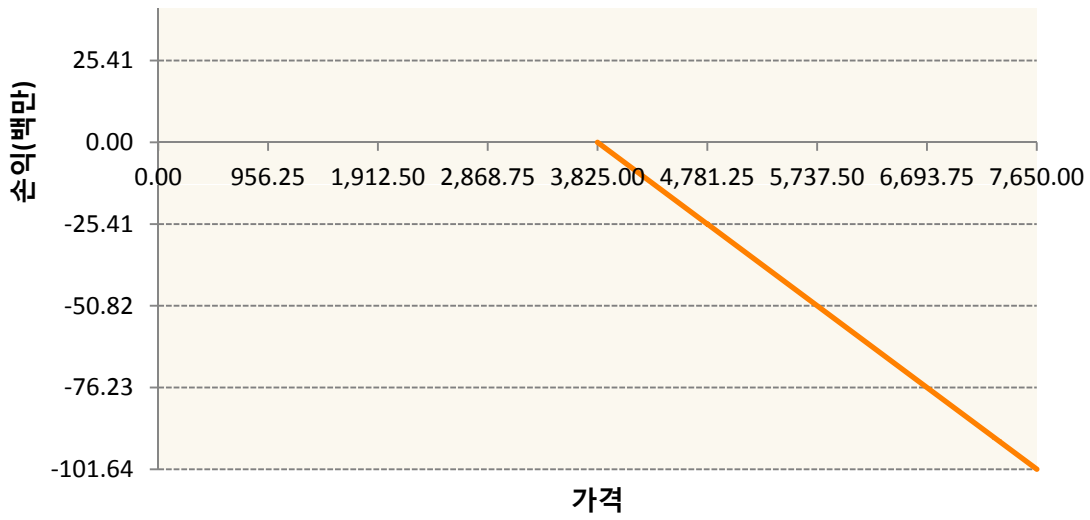
2. 만기시점의 손익구조

OESXH0-C3800-EURO STOXX 50

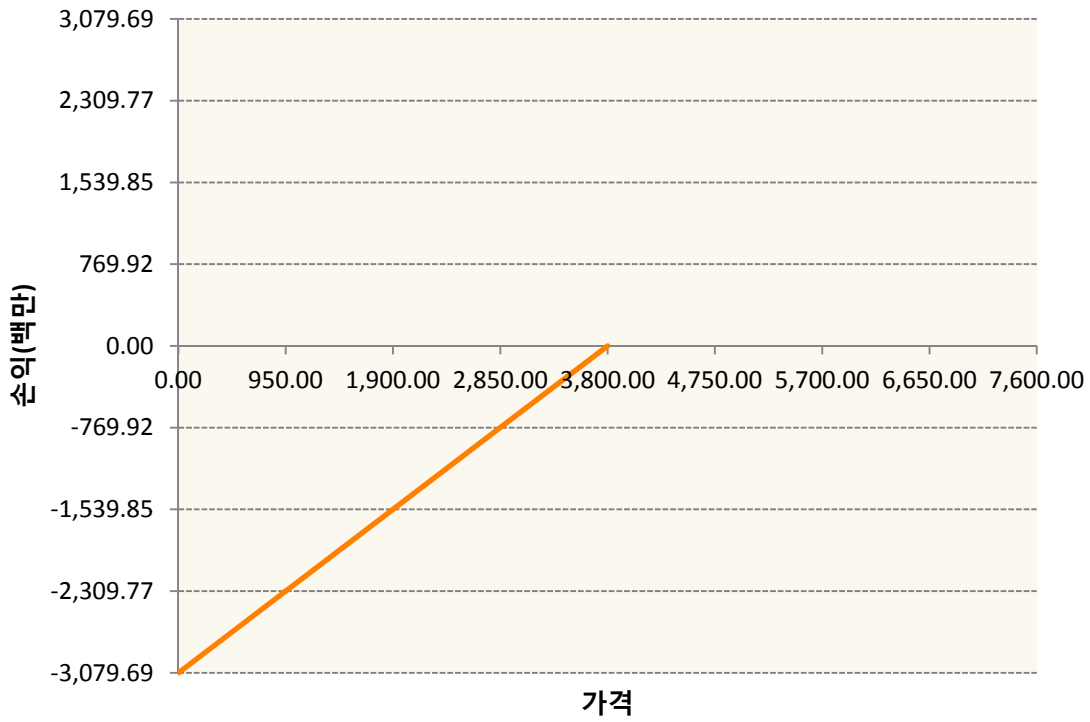


OESXH0-C3825-EURO STOXX 50

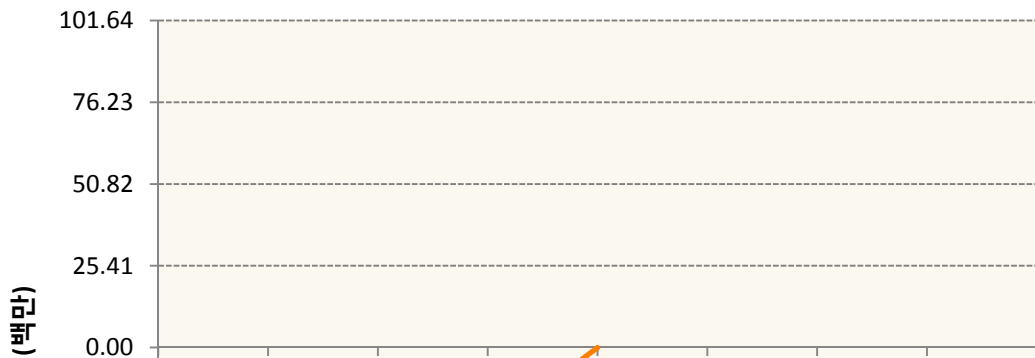


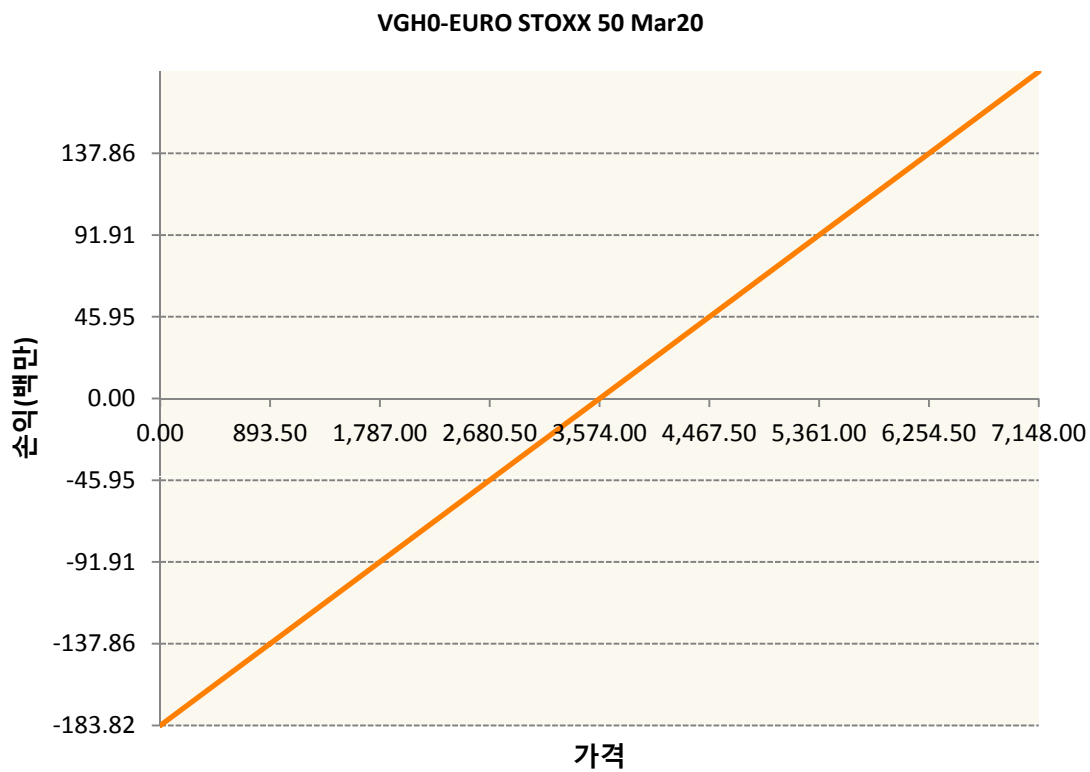
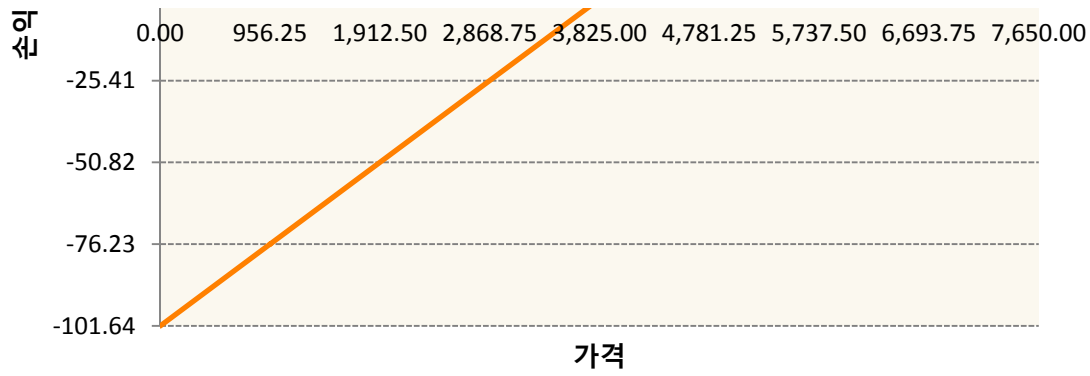


OESXH0-P3800-EURO STOXX 50



OESXH0-P3825-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		34
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E		279
OESXH0-C3& EURO STOXX 50		246
OESXH0-C3& EURO STOXX 50		8
OESXH0-P3& EURO STOXX 50		246
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)

923

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

(단위:백만원)

81

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

(단위:백만원)

119

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

(단위:백만원)

43

공시일	2020-02-28
기준일	2020-02-27

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

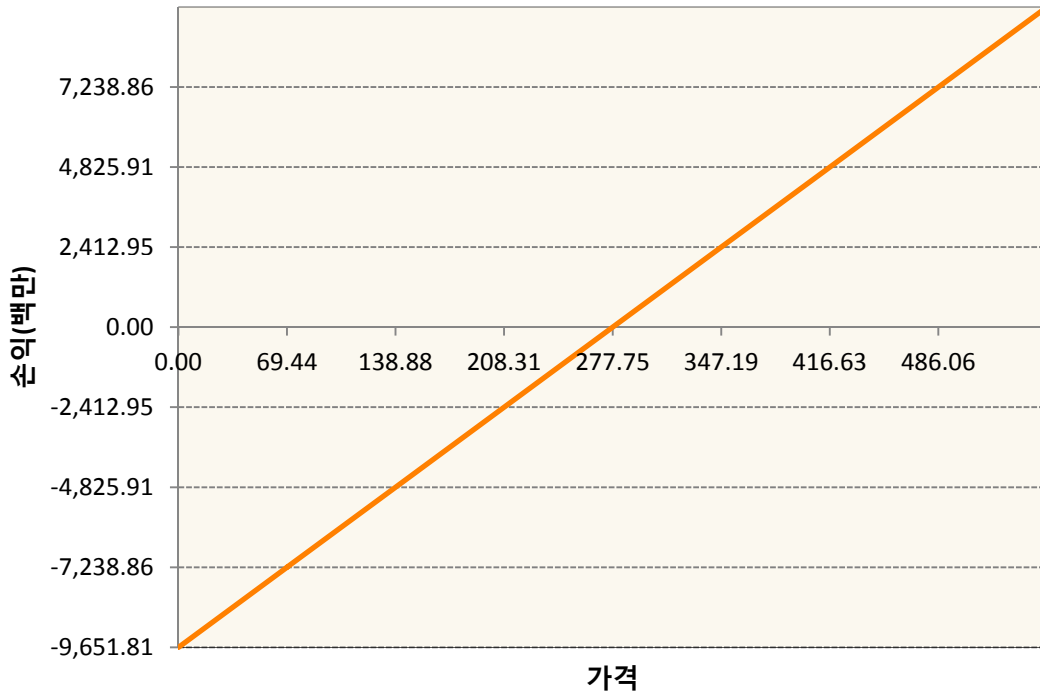
1. 계약금액

(단위:백만원)

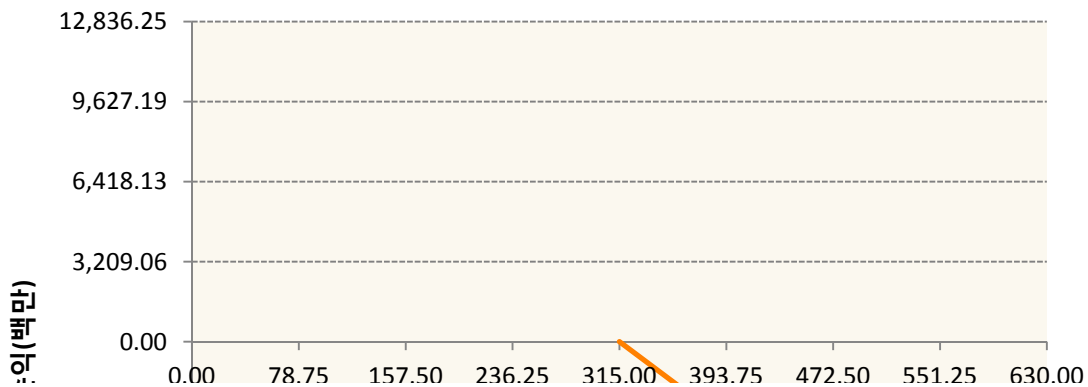
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,652	0	9,652	장내
누계	유가증권	옵션	2,257	12,836	-10,579	장내

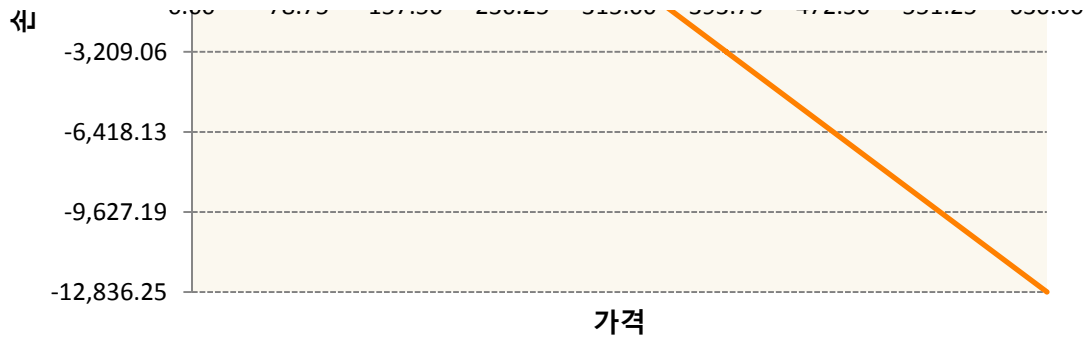
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

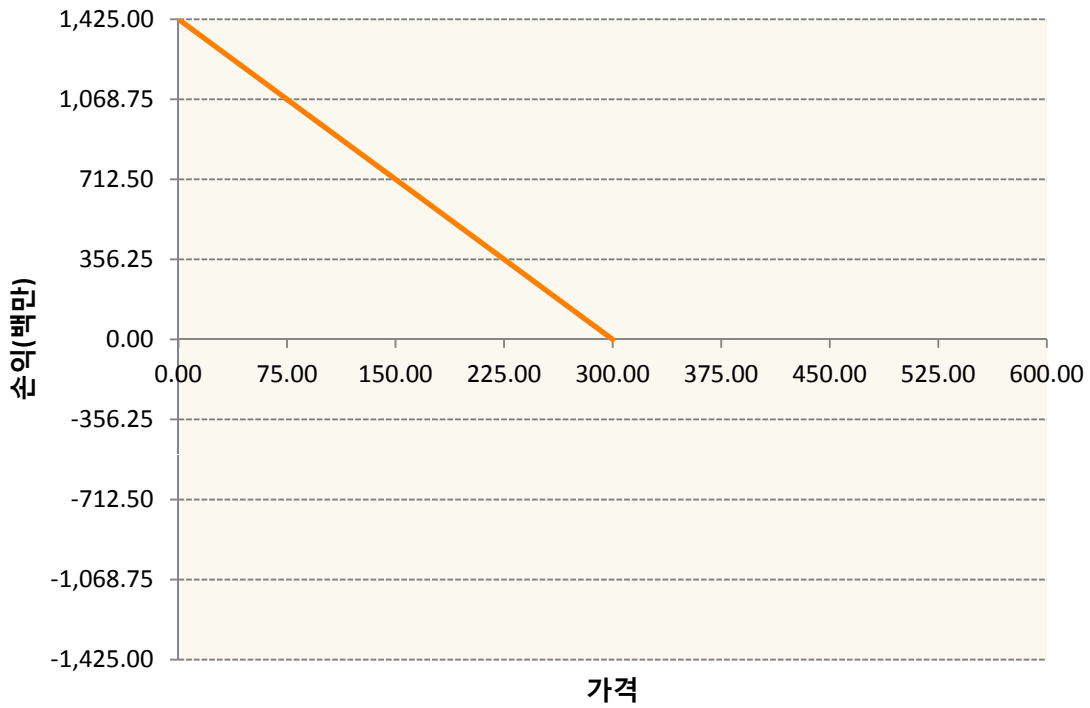


KR4201Q33155-2020-03 콜315

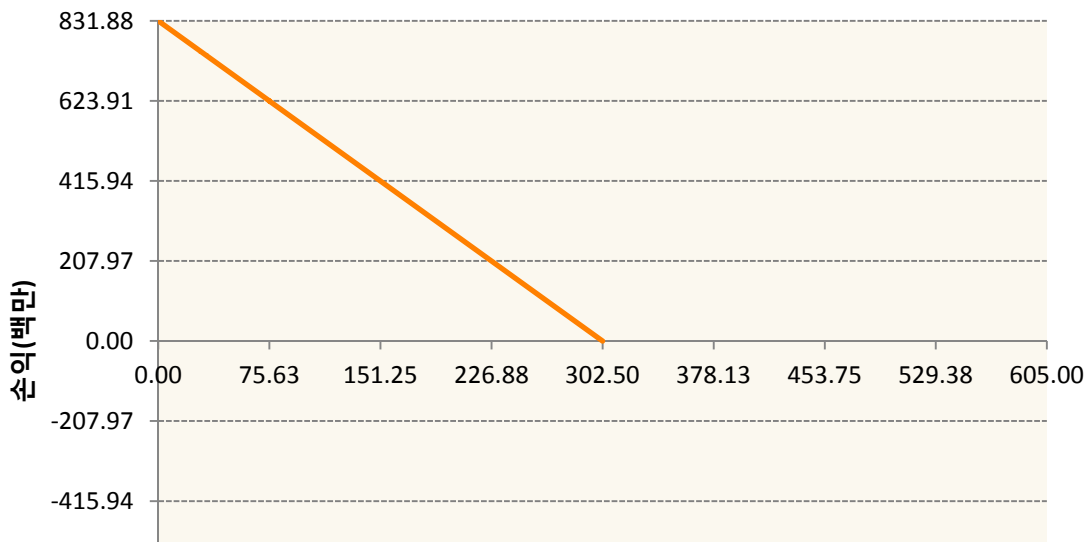


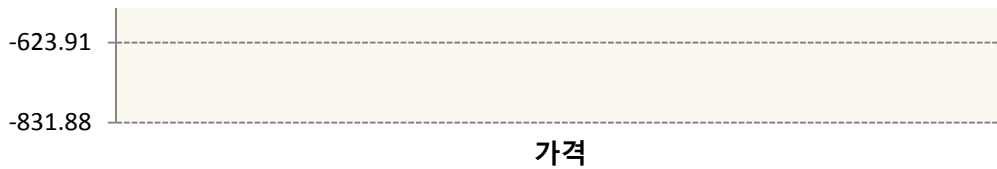


KR4301Q33005-2020-03 풋300



KR4301Q33021-2020-03 풋302.5





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%	-514	-514	-514	-514	-514	-514	-514	
-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%	514	514	514	514	514	514	514	
8.00%	770	770	770	770	770	770	770	
KR4201Q33155		2020-03 콜315						169
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	10	10	9	9	9	8	7	
-5.33%	10	9	9	9	8	6	4	
-2.67%	9	9	8	6	4	0	-4	
0%	8	7	4	0	-5	-12	-20	
2.67%	4	0	-7	-15	-25	-36	-49	
5.33%	-9	-20	-32	-46	-62	-79	-97	
8.00%	-43	-61	-81	-102	-123	-146	-169	
KR4301Q33005		2020-03 풋300						103
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	103	103	103	103	103	103	103	
-5.33%	68	68	68	68	68	69	69	
-2.67%	33	33	33	34	34	34	35	
0%	-2	-1	-1	0	1	2	3	
2.67%	-35	-34	-33	-31	-30	-28	-26	
5.33%	-64	-62	-60	-58	-56	-54	-52	
8.00%	-87	-84	-82	-79	-77	-74	-72	
KR4301Q33021		2020-03 풋302.5						60
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	60	60	60	60	60	60	60	
-5.33%	40	40	40	40	40	40	40	
-2.67%	19	20	20	20	20	20	20	

0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-20	-20	-19	-19	-18	-17	-16
5.33%	-38	-37	-36	-35	-34	-33	-32
8.00%	-53	-51	-50	-49	-47	-46	-44

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

(단위:백만원)

891

공시일	2020-02-28
기준일	2020-02-27

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	217,236	0	217,236	

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	2020-02-28
기준일	2020-02-27

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	6,883	-6,883	
누계	유가증권	수익증권	168,932	0	168,932	

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	2020-02-28
기준일	2020-02-27

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	538,935	0	538,935	
누계	통화	선도	0	594,480	-594,480	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,568
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,461
FX21020F02 KRW/USD 28-02-20E	1,948
FX21020F03 KRW/USD 28-02-20E	3,019
FX21020F03 KRW/USD 31-03-20E	3,116
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	1,237
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	974
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	1,948
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	3,350
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,350
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,948
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,895
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,279
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,948
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	195
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	4,966
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	2020-02-28
기준일	2020-02-27

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

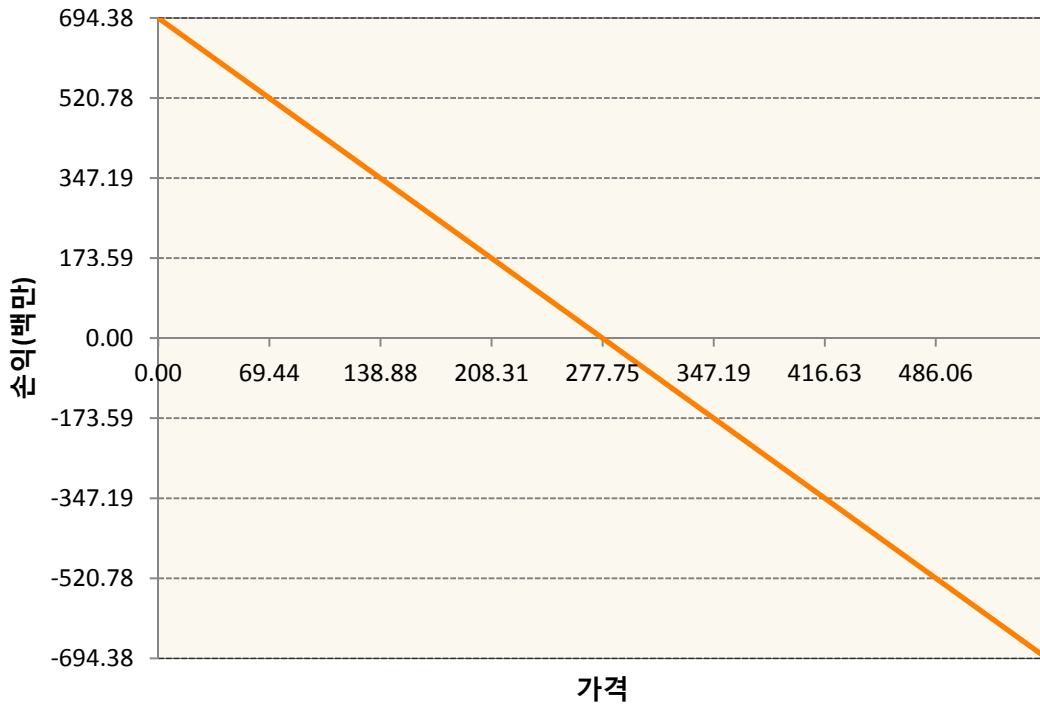
1. 계약금액

(단위:백만원)

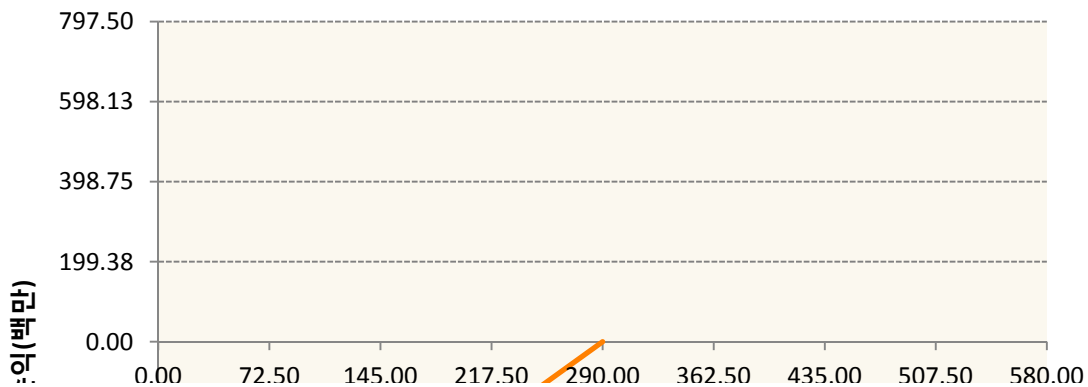
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	694	-694	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,503	-3,503	장내

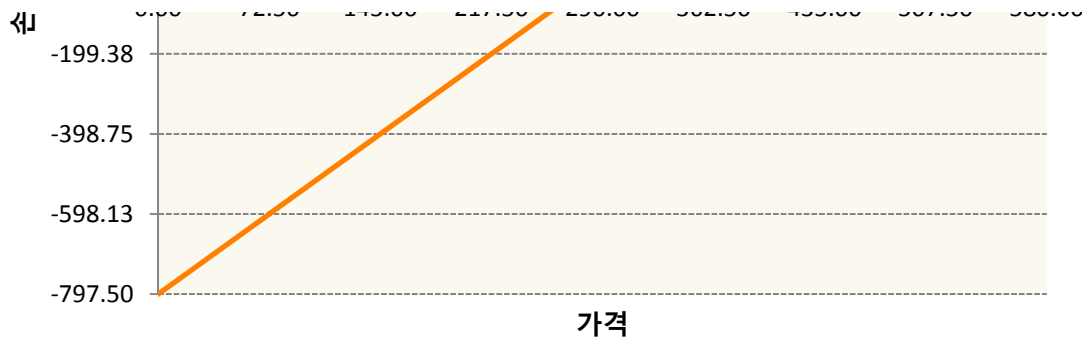
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

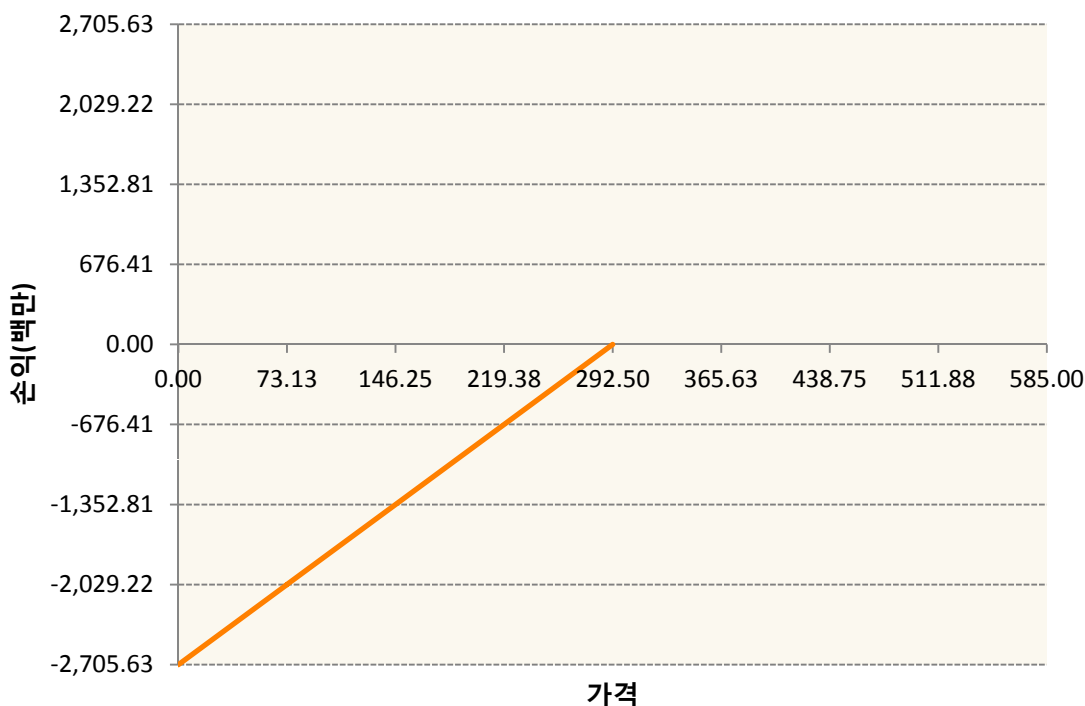


KR4301Q32908-2020-03 풋290





KR4301Q32924-2020-03 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						55
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	55	55	55	55	55	55	55	
-5.33%	37	37	37	37	37	37	37	
-2.67%	18	18	18	18	18	18	18	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37	
8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55	
KR4301Q32908		2020-03 풋290						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%	-36	-36	-37	-37	-37	-37	-38
-2.67%	-16	-17	-17	-17	-18	-19	-19
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	18	17	16	15	13	12	11
5.33%	30	28	27	26	24	23	21
8.00%	36	35	34	33	32	30	29

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	-195	-195
-5.33%	-126	-126	-126	-127	-127	-128	-129
-2.67%	-58	-59	-60	-61	-63	-64	-66
0%	7	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	64	61	57	53	49	45	40
5.33%	108	103	99	94	89	85	80
8.00%	135	131	127	122	118	113	109

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

(단위:백만원)

316

공시일	2020-02-28
기준일	2020-02-27

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	10,450	0	10,450	
누계	통화	선도	1,120	16,797	-15,678	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	2020-02-28
기준일	2020-02-27

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

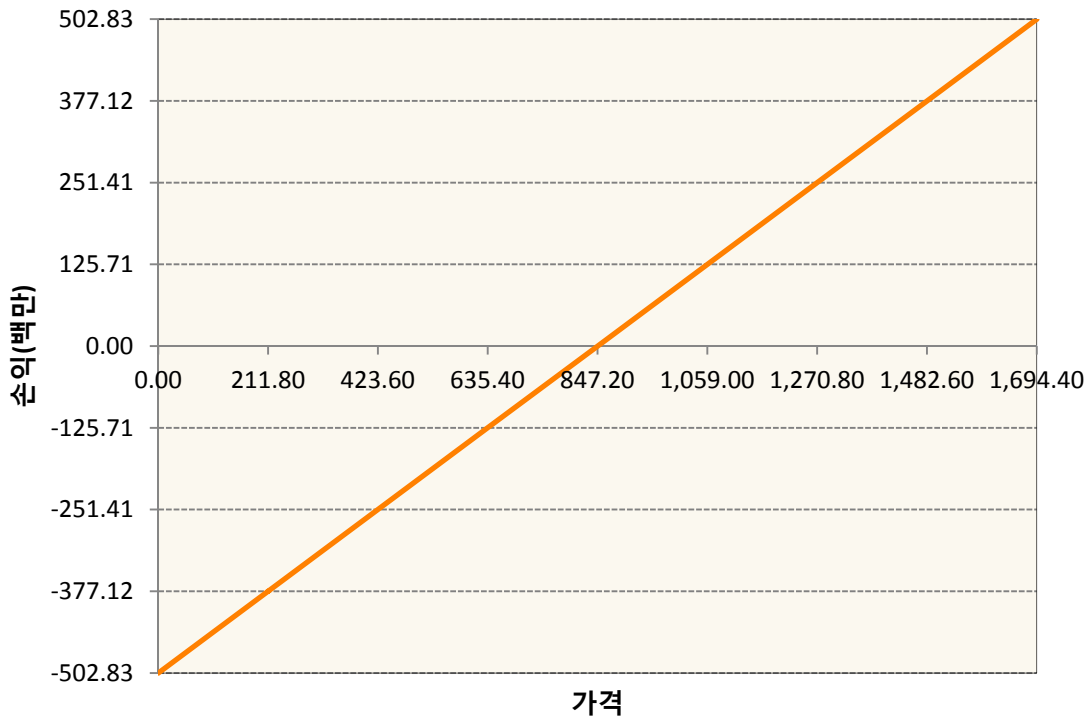
1. 계약금액

(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	503	0	503	
누계	유가증권	스왑	1,096	0	1,096	장외
누계	통화	선도	186	850	-664	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCH0-VN30 Index Future Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	88
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)

127

공시일	2020-02-28
기준일	2020-02-27

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

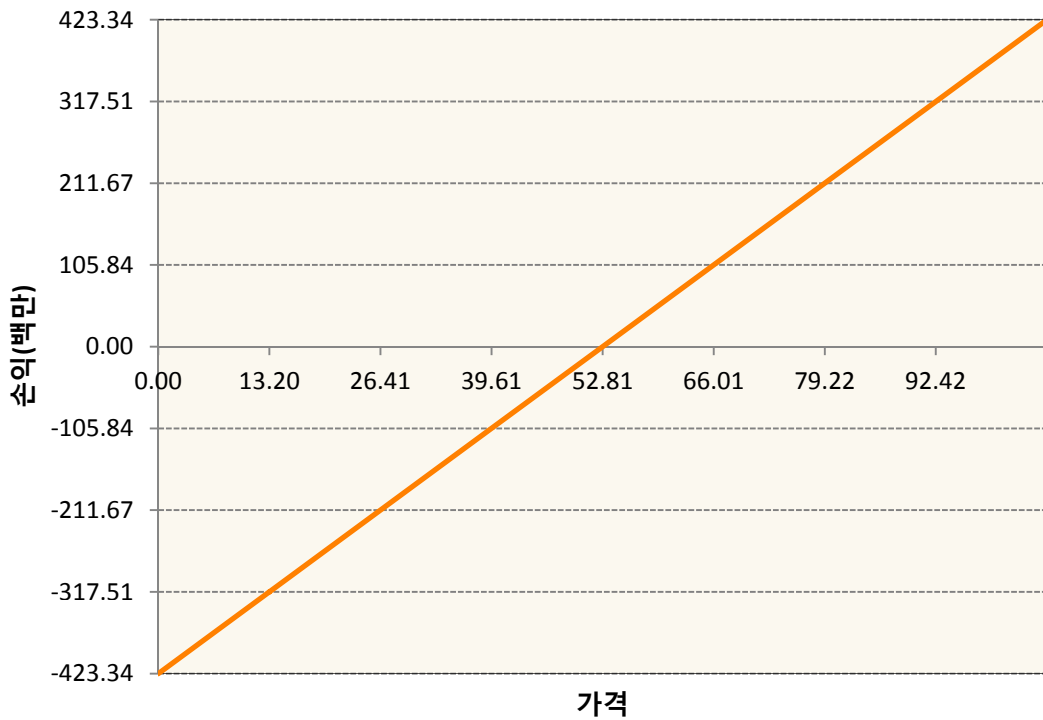
1. 계약금액

(단위:백만원)

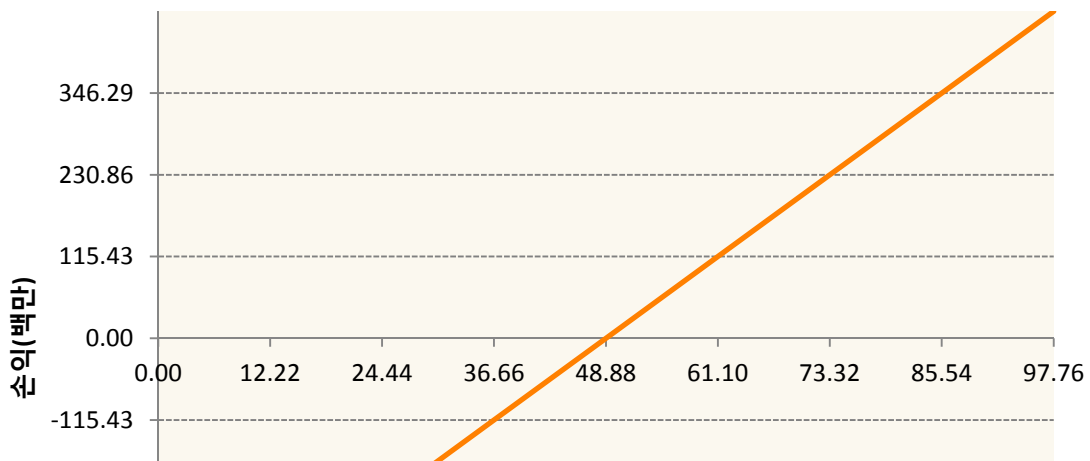
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,975	195	1,781	

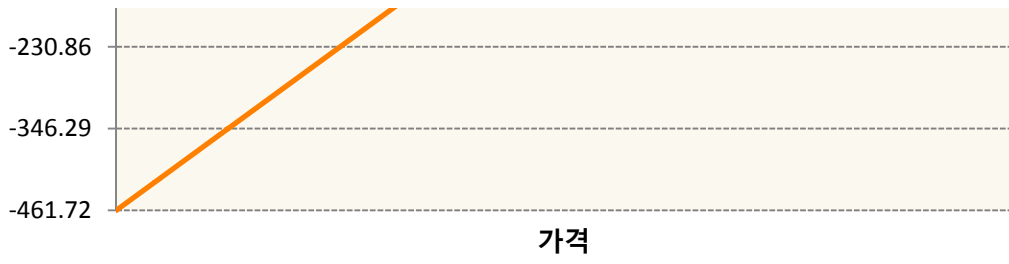
2. 만기시점의 손익구조

COK0-BRENT CRUDE FUTR May20

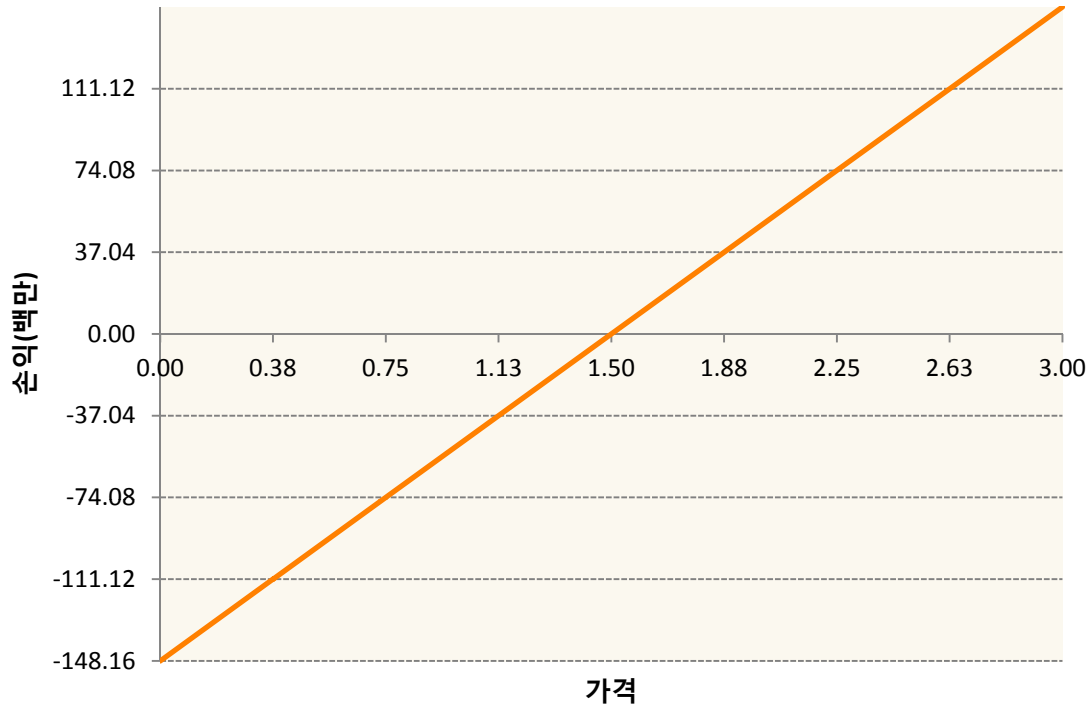


CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20

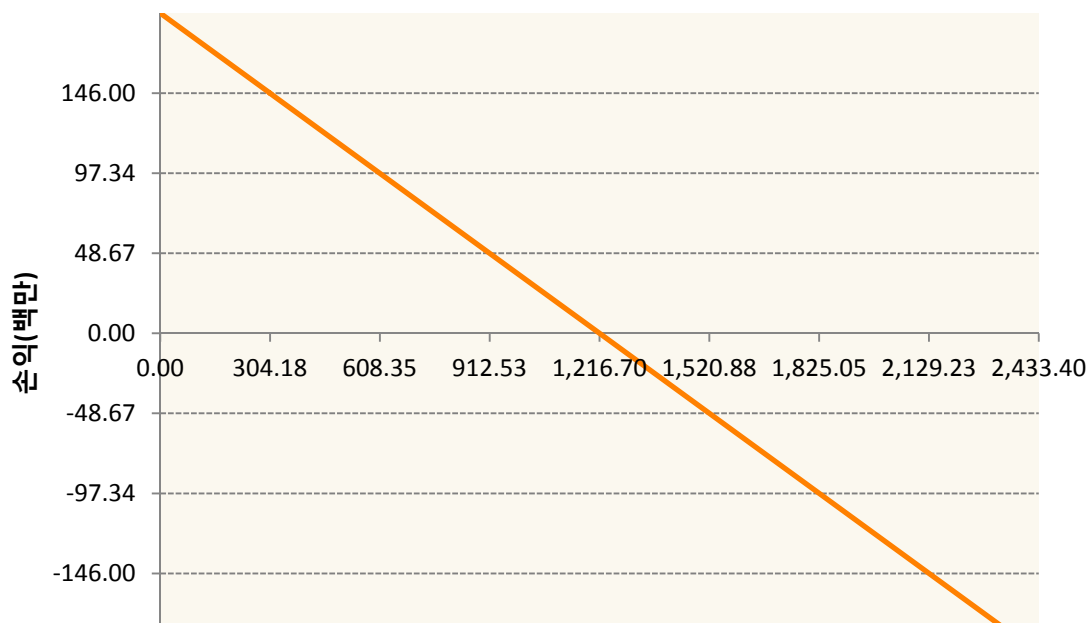


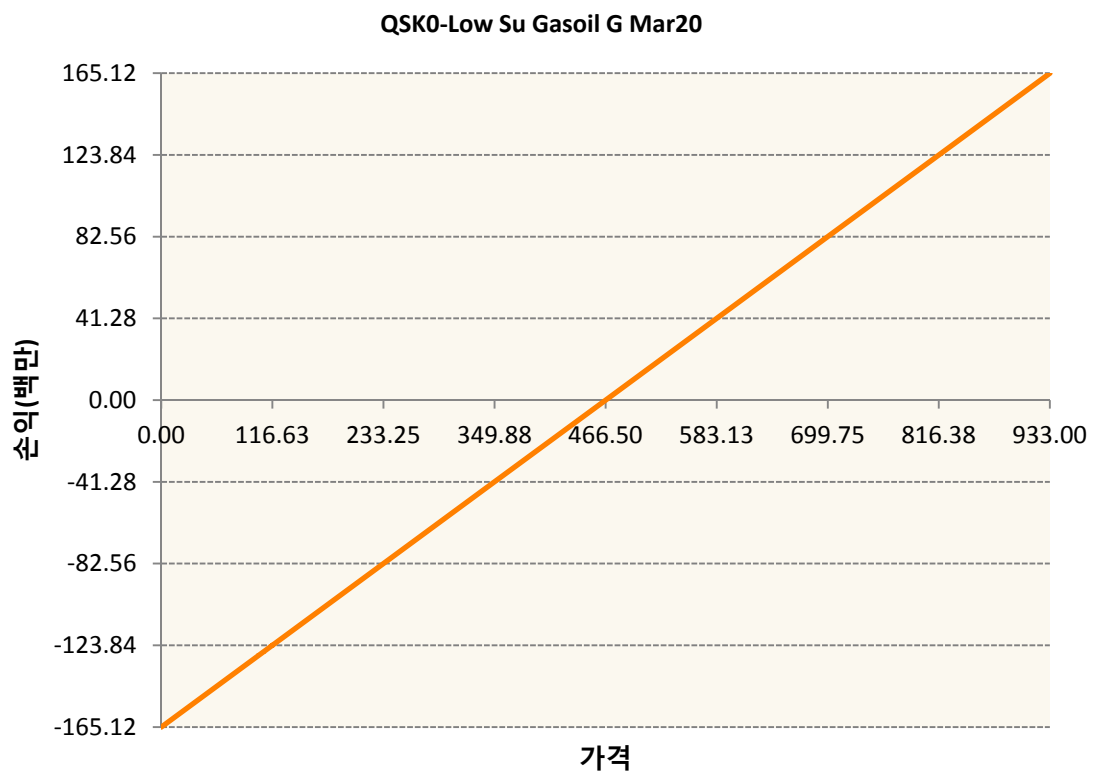
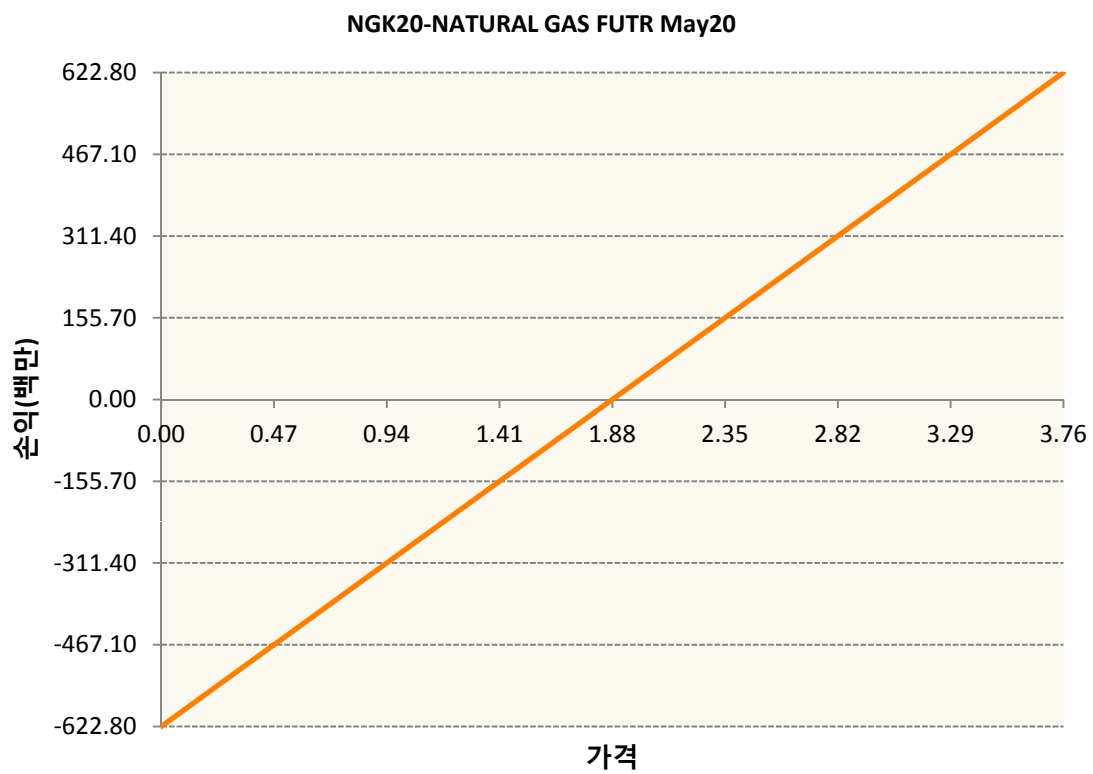
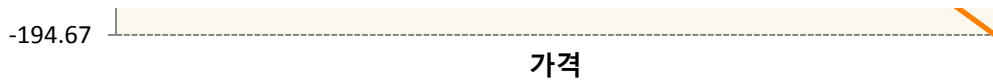


HOK0-NY Harb ULSD Fut May20

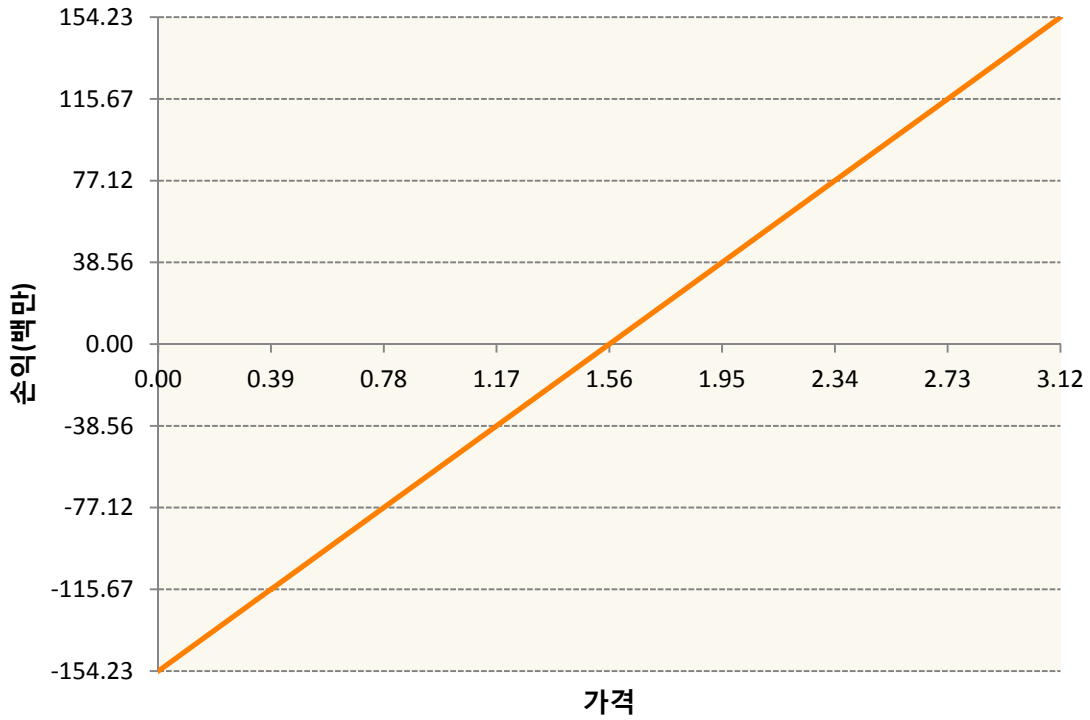


KR4175Q30009-2020-03 달러선물





XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	34
CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	37
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	12
KR4175Q30C	2020-03 달러선물	16
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	50
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	13
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	12

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

(단위:백만원)

323

공시일	2020-02-28
기준일	2020-02-27

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

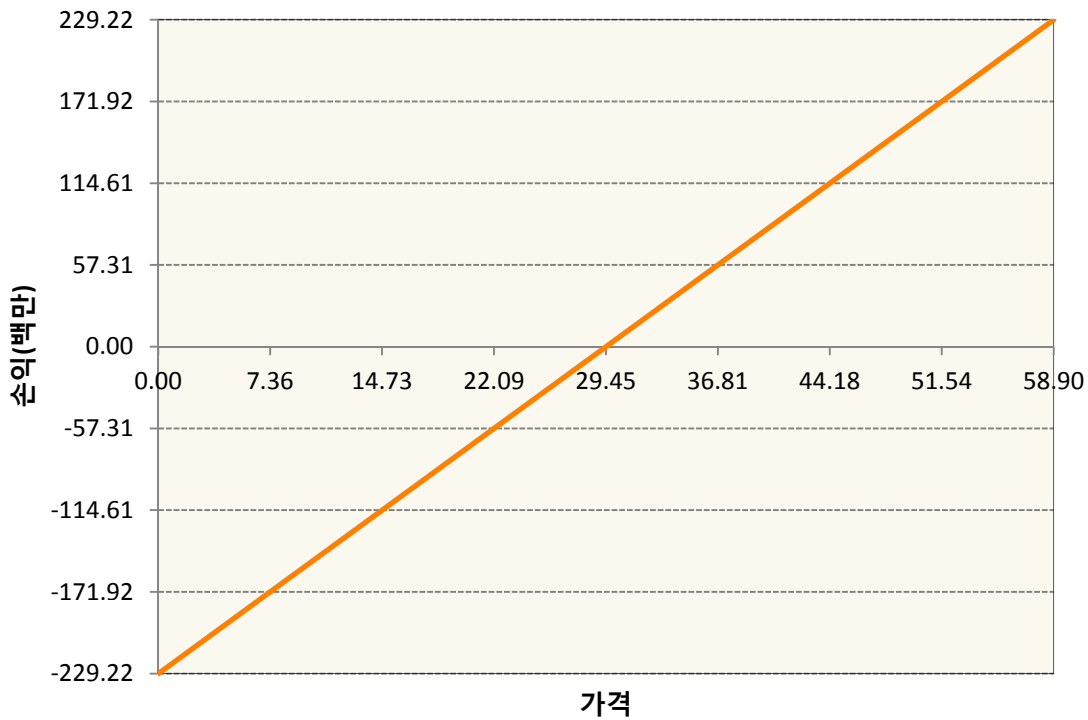
1. 계약금액

(단위:백만원)

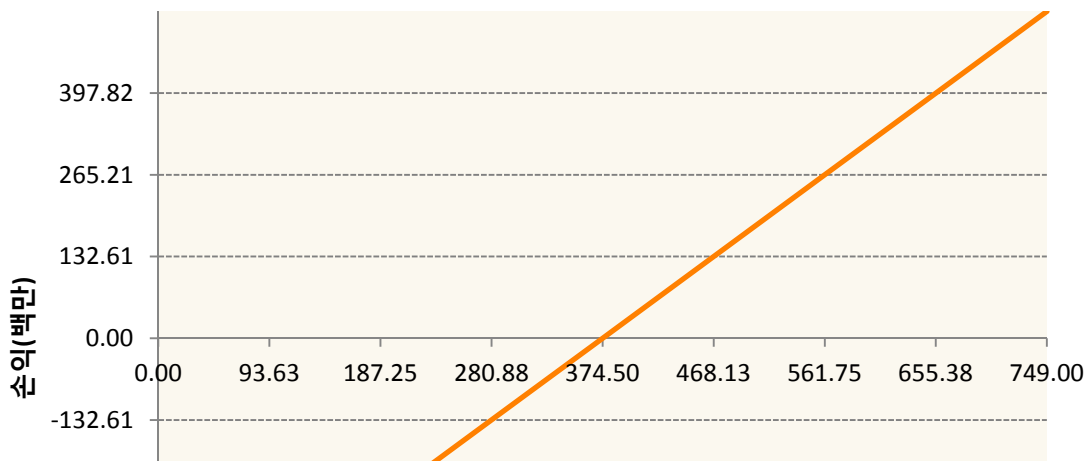
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,641	158	2,482	

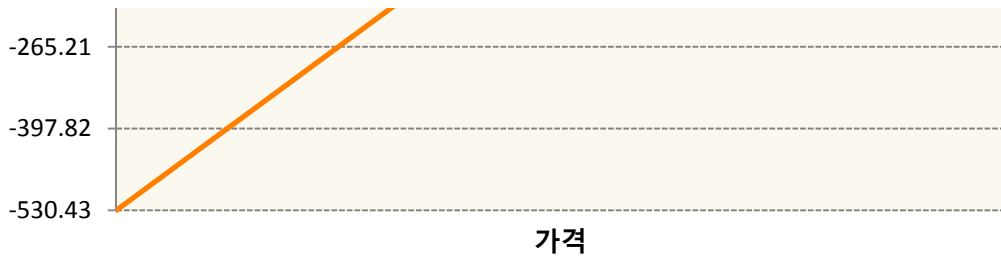
2. 만기시점의 손익구조

BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20

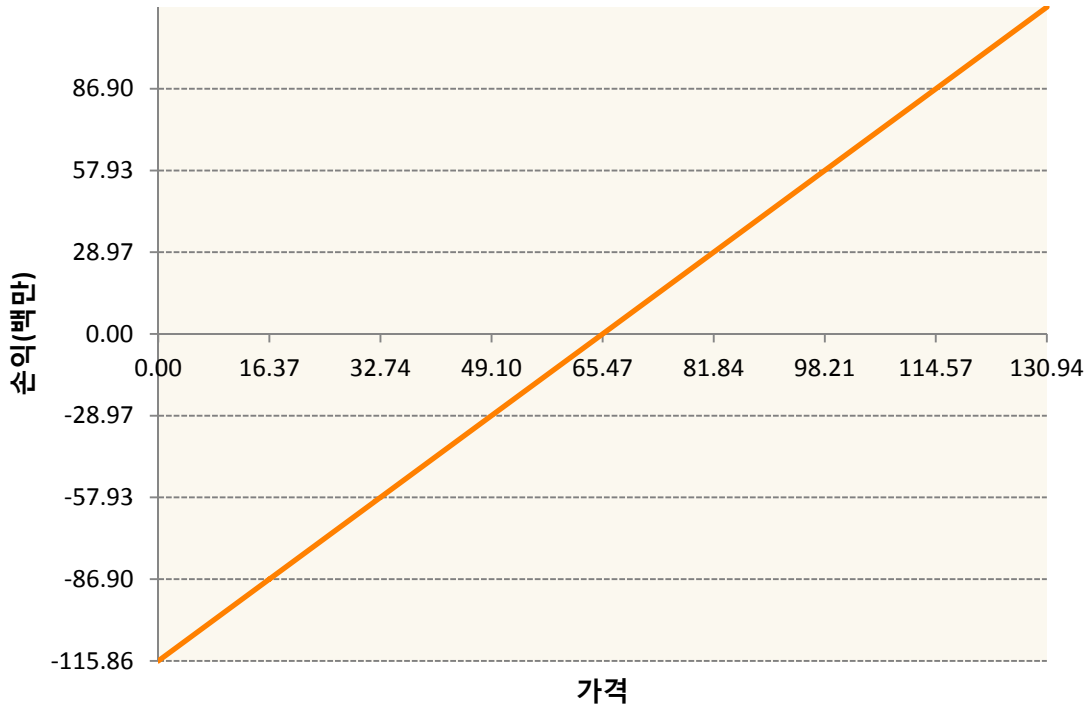


CK0-CORN FUTURE May20

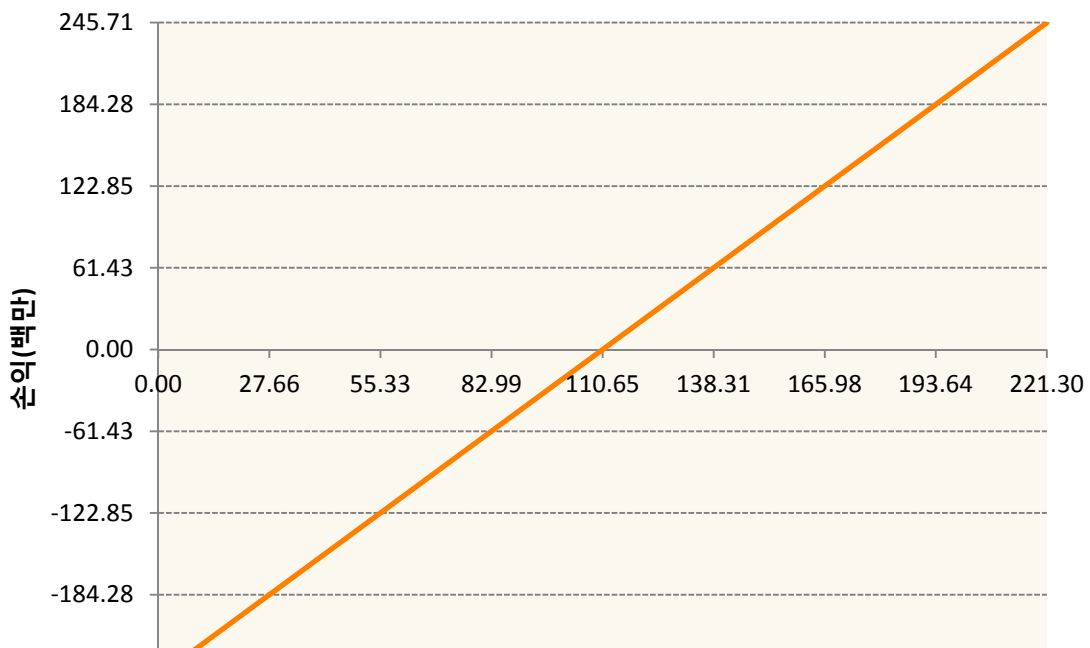


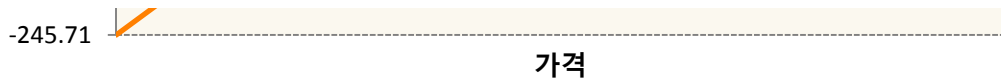


CTK0-COTTON NO.2 FUTR May20

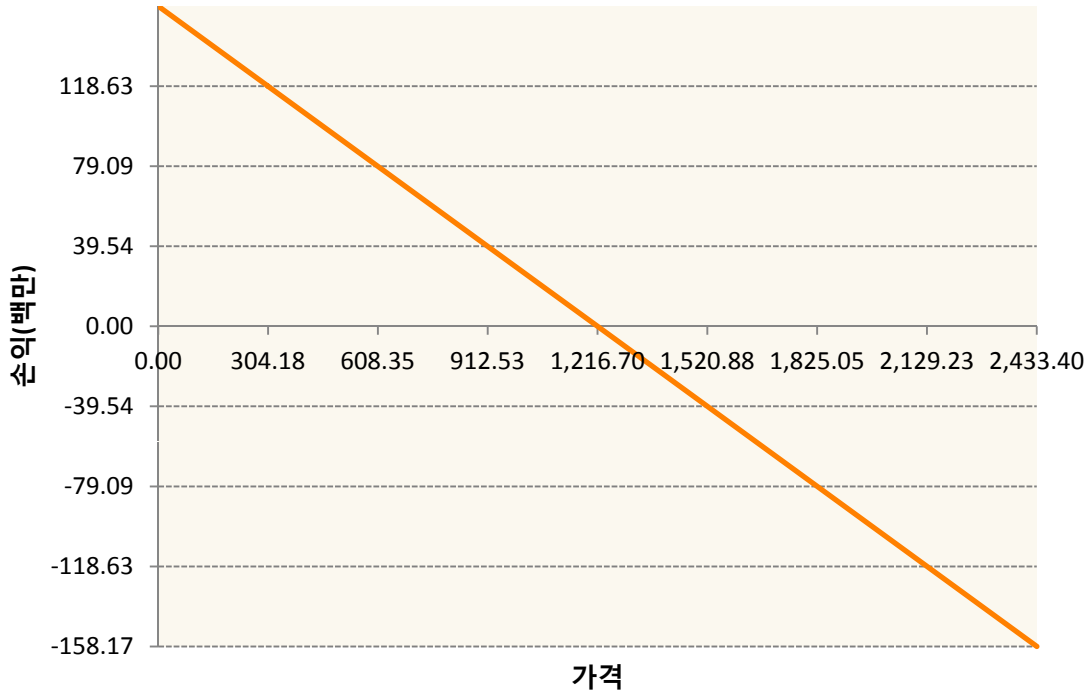


KCK0-COFFEE 'C' FUTURE May20

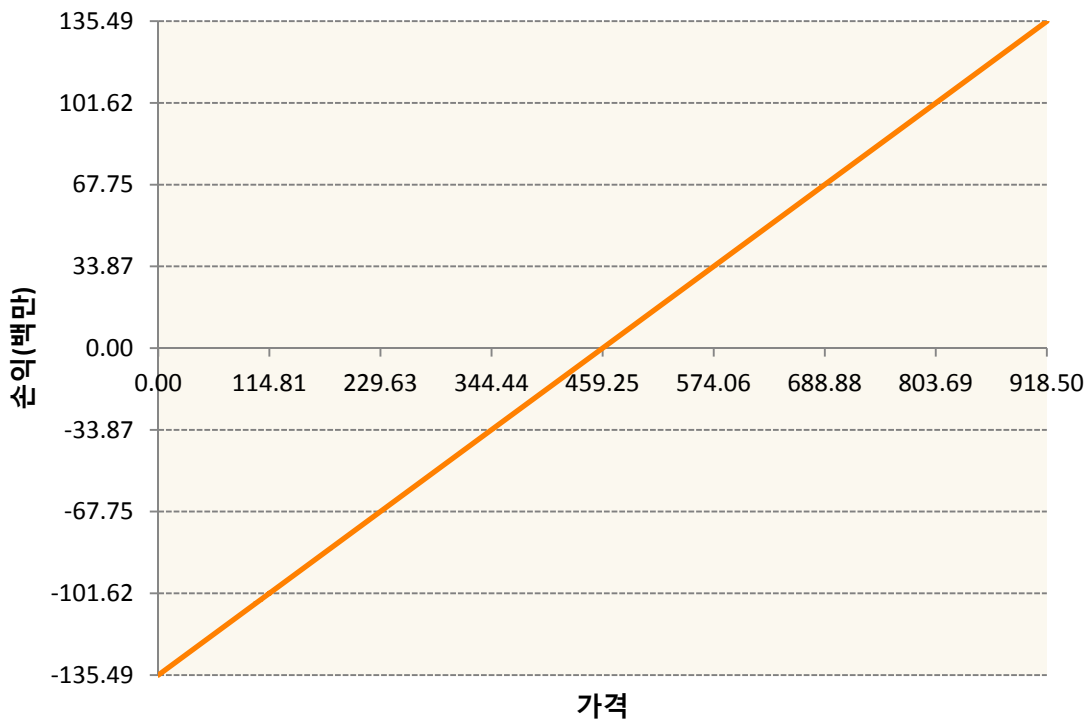




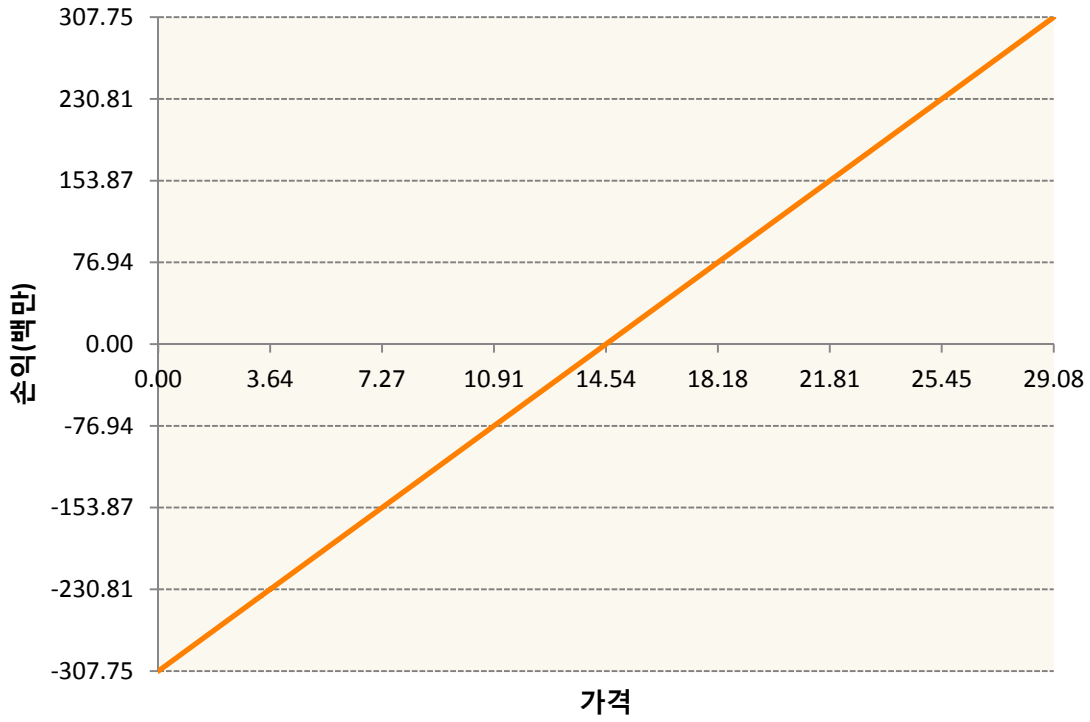
KR4175Q30009-2020-03 달러선물



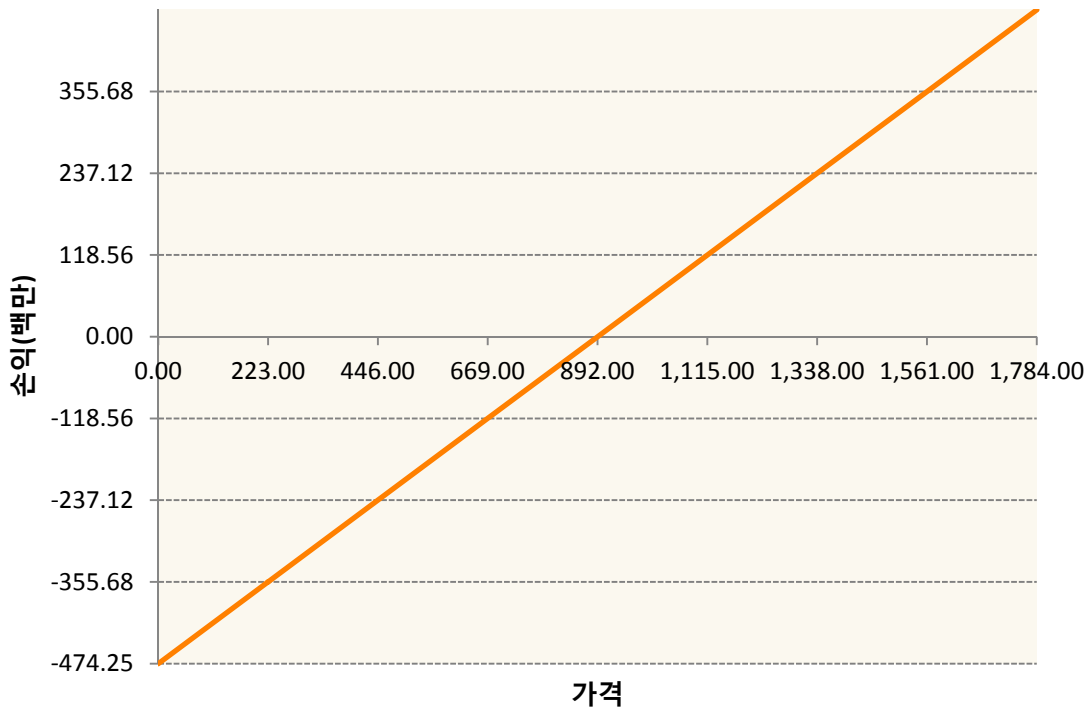
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



SBK0-Sugar May20

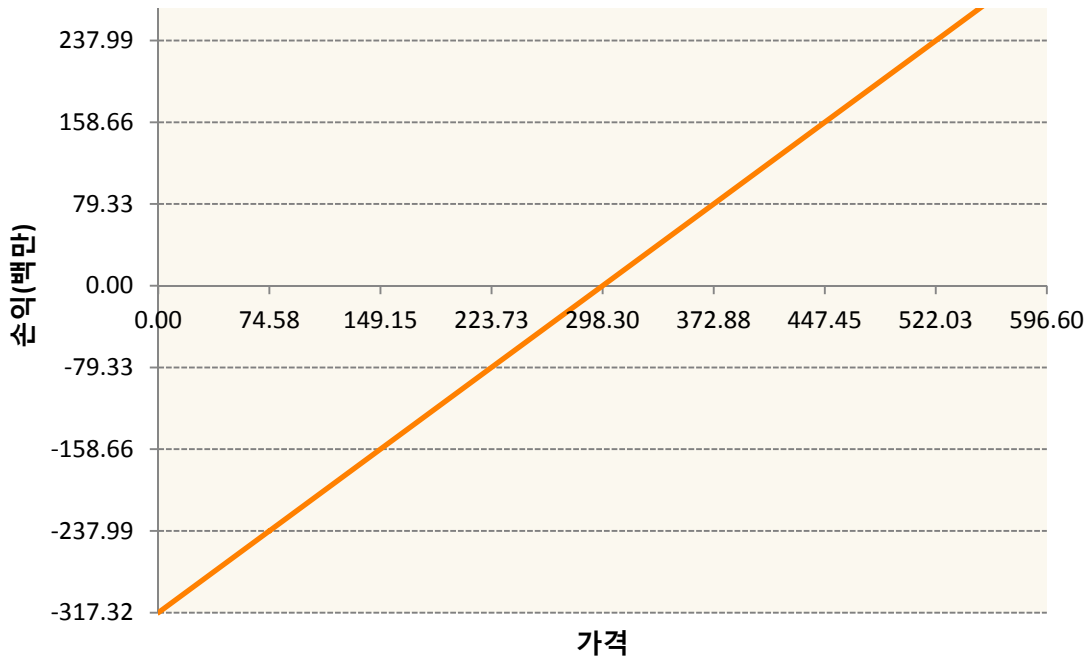


SK0-SOYBEAN FUTURE May20

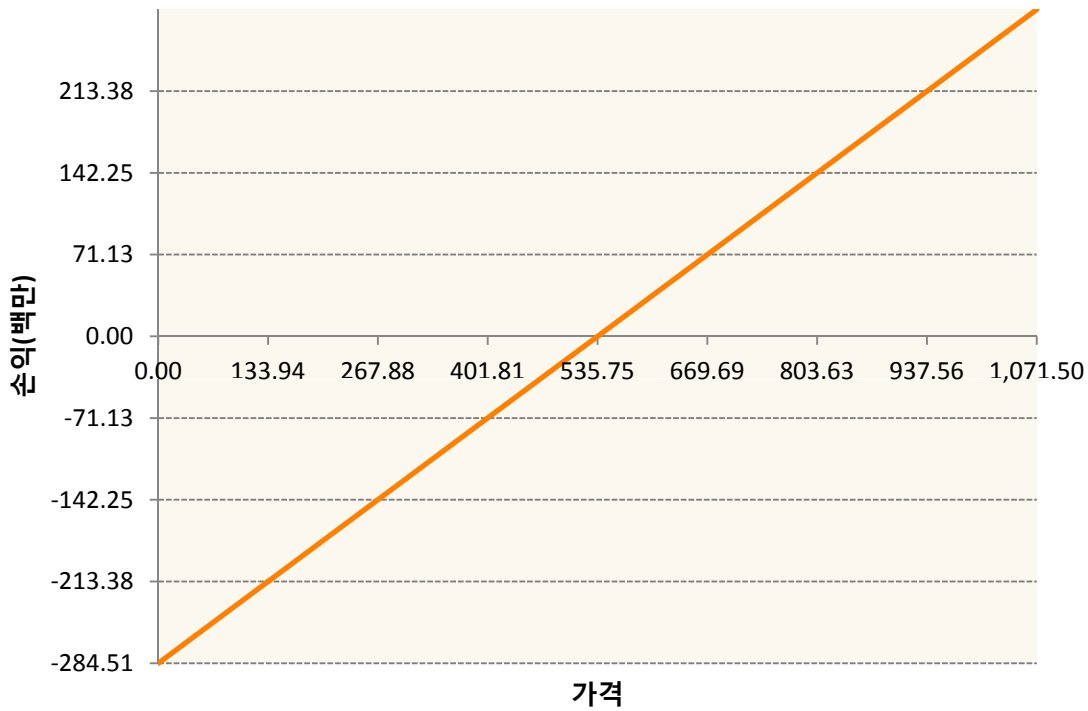


SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





WK0-WHEAT FUTURE(CBT) May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	18
CK0	CORN FUTURE May20	42
CTK0	COTTON NO.2 FUTR May20	9
KCK0	COFFEE 'C' FUTURE May20	20
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