

공시일	2020-03-02
기준일	2020-02-28

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	2020-03-02
기준일	2020-02-28

스마트인덱스모

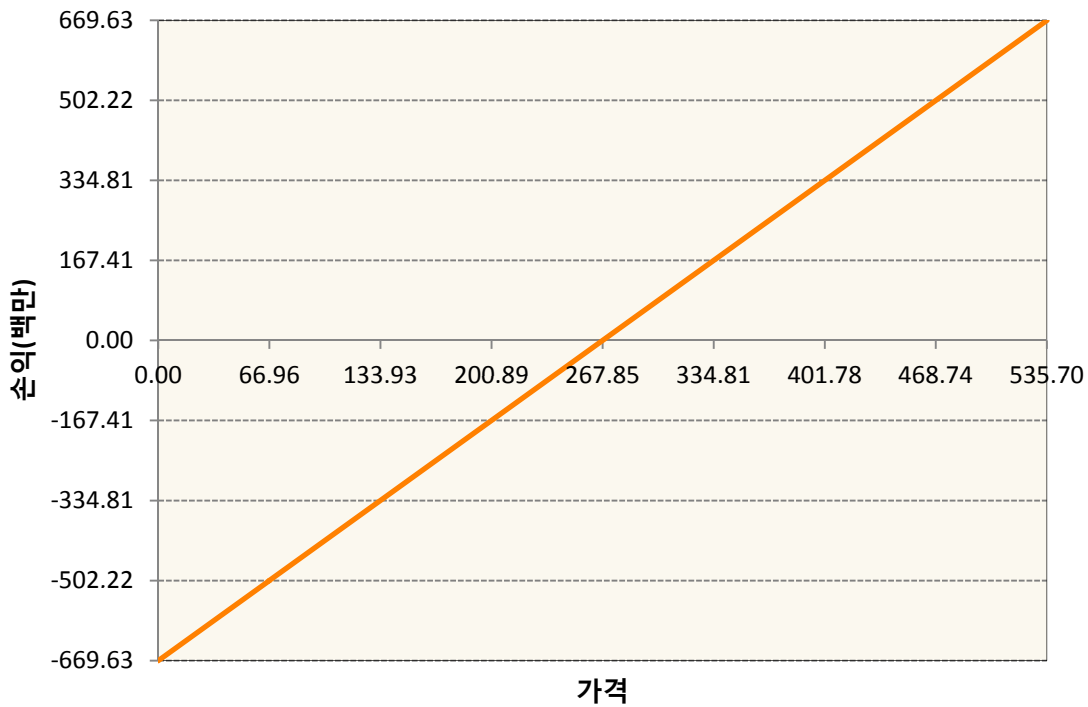
1. 계약금액

(단위:백만원)

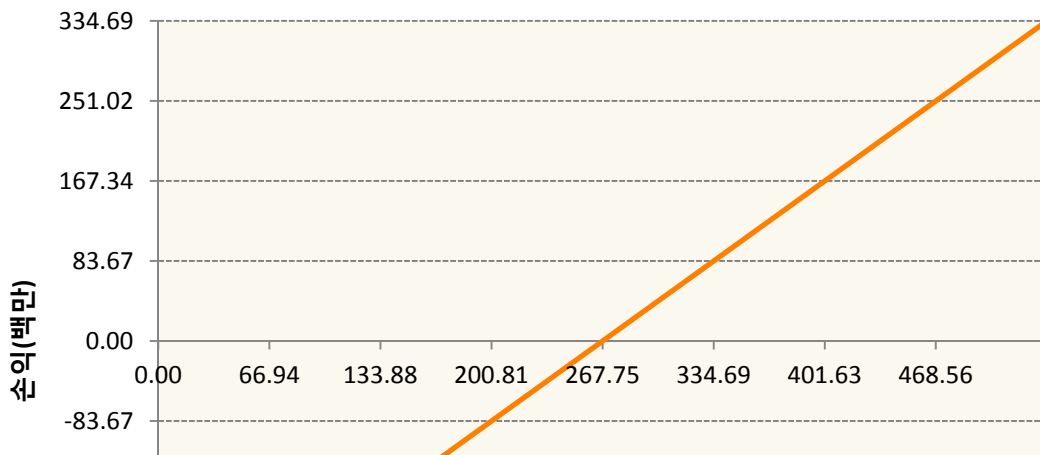
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	201	0	201	장내
누계	유가증권	선물	1,004	0	1,004	장내

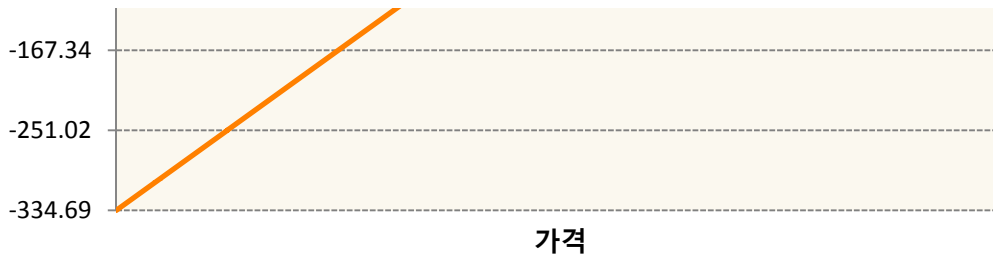
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						54
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54	
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	
-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%	36	36	36	36	36	36	36	
8.00%	54	54	54	54	54	54	54	
KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						27
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27	
-5.33%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	9	9	9	9	9	9	9	
5.33%	18	18	18	18	18	18	18	
8.00%	27	27	27	27	27	27	27	

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

71

공시일	2020-03-02
기준일	2020-02-28

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

1,048

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

638

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-02
기준일	2020-02-28

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)	422
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	154

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

874

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-02
기준일	2020-02-28

유로인덱스모(주식-파생형)

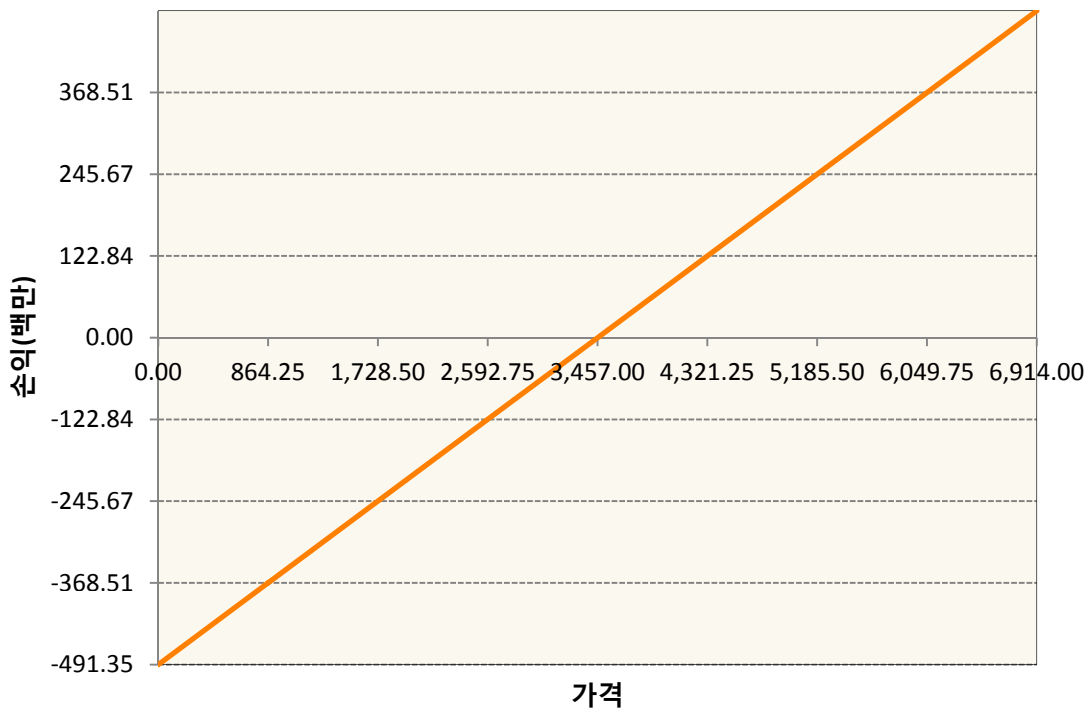
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	491	0	491	

2. 만기시점의 손익구조

VGH0-EURO STOXX 50 Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH0	EURO STOXX 50 Mar20	39
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

29

공시일	2020-03-02
기준일	2020-02-28

차이나인덱스모(주식-파생형)

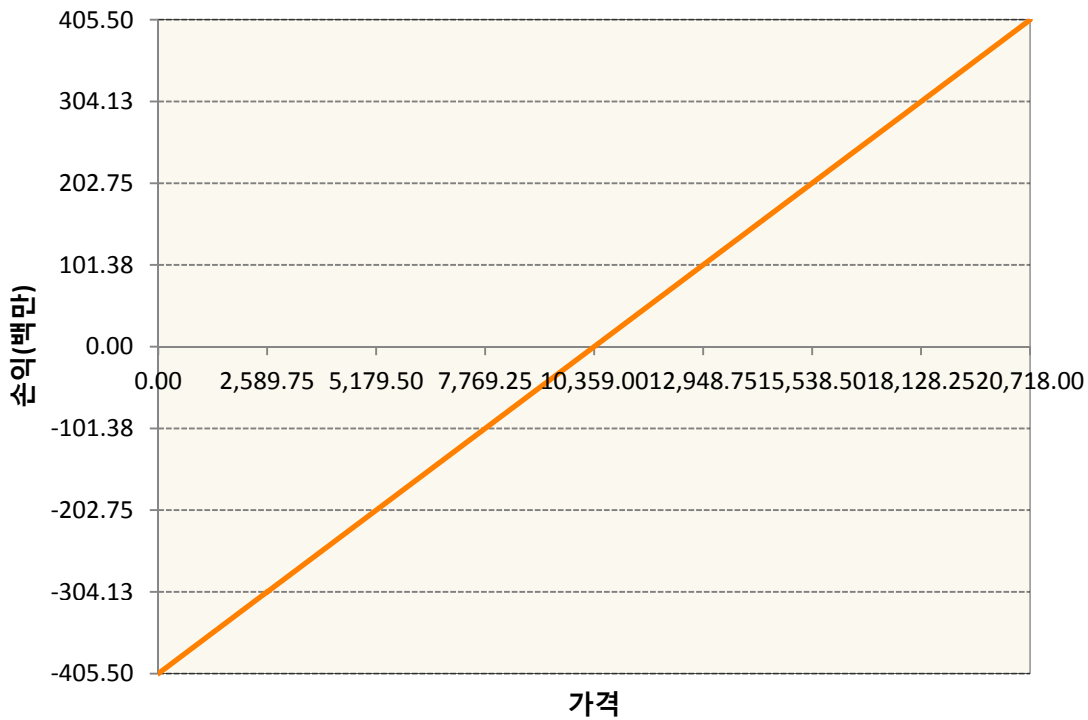
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	406	0	406	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH0	HSCEI Futures Mar20	32
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

29

공시일	2020-03-02
기준일	2020-02-28

커버드콜모(주식혼합-파생형)

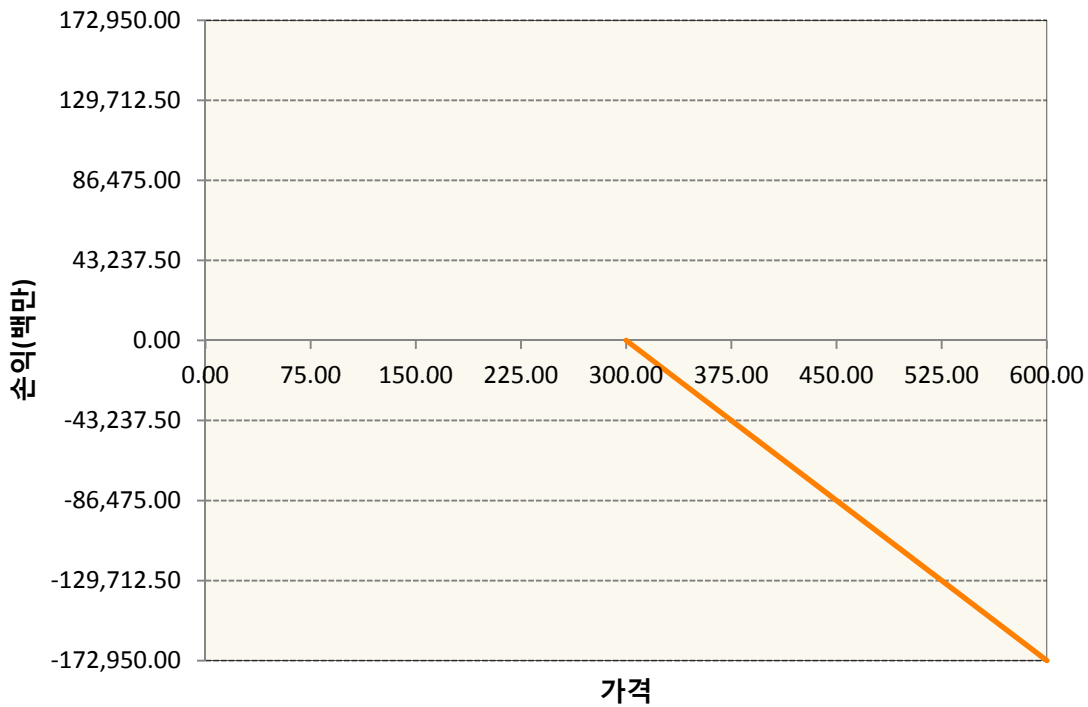
1. 계약금액

(단위:백만원)

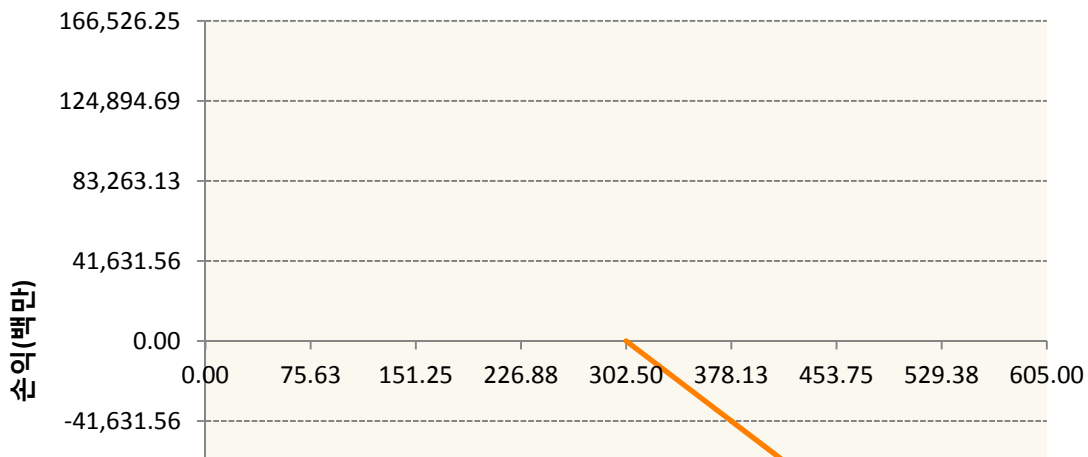
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	448,226	-448,226	장내

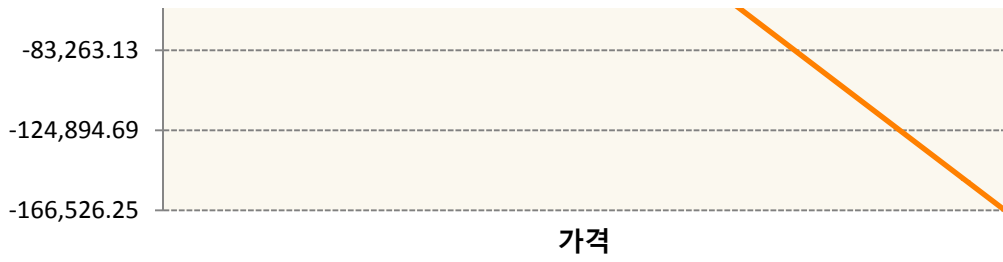
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q33007-2020-03 콜300

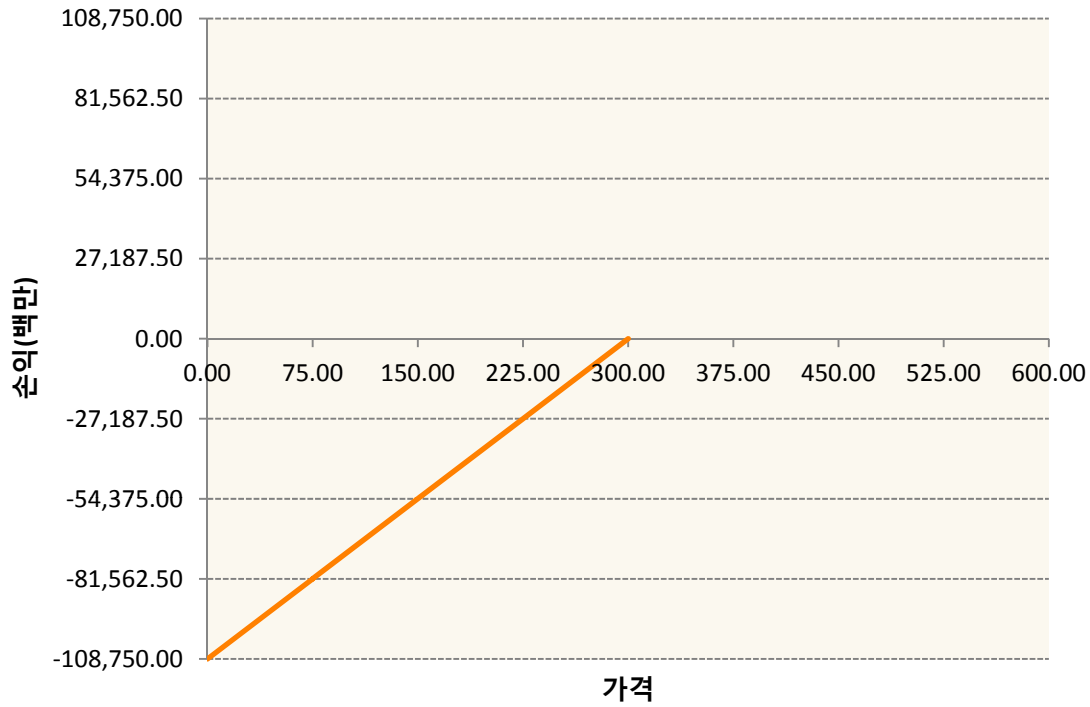


KR4201Q33023-2020-03 콜302.5





KR4301Q33005-2020-03 풋300



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q33007		2020-03 콜300					2,946	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	213	213	211	208	201	188	169	
-5.33%	212	210	203	191	171	140	97	
-2.67%	207	195	173	138	89	23	-59	
0%	177	138	79	0	-100	-221	-361	
2.67%	66	-33	-159	-310	-483	-676	-886	
5.33%	-254	-449	-669	-909	-1,167	-1,438	-1,722	
8.00%	-984	-1,287	-1,602	-1,928	-2,261	-2,601	-2,946	
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5					2,451	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	151	151	150	148	143	134	119	

-5.33%	151	149	145	137	122	99	65
-2.67%	147	140	125	100	63	12	-55
0%	129	103	60	0	-79	-177	-293
2.67%	57	-16	-113	-233	-376	-538	-718
5.33%	-166	-320	-501	-703	-924	-1,161	-1,412
8.00%	-709	-967	-1,242	-1,530	-1,829	-2,136	-2,451
KR4301Q33005 2020-03 풋300							7,716
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,709	-7,709	-7,709	-7,709	-7,710	-7,712	-7,716
-5.33%	-5,120	-5,120	-5,121	-5,123	-5,127	-5,134	-5,145
-2.67%	-2,532	-2,534	-2,538	-2,546	-2,560	-2,579	-2,606
0%	51	42	25	0	-34	-78	-132
2.67%	2,608	2,574	2,528	2,468	2,397	2,314	2,221
5.33%	5,069	4,986	4,888	4,777	4,655	4,524	4,386
8.00%	7,296	7,145	6,986	6,820	6,648	6,471	6,291

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

(단위:백만원)

10,450

공시일	2020-03-02
기준일	2020-02-28

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

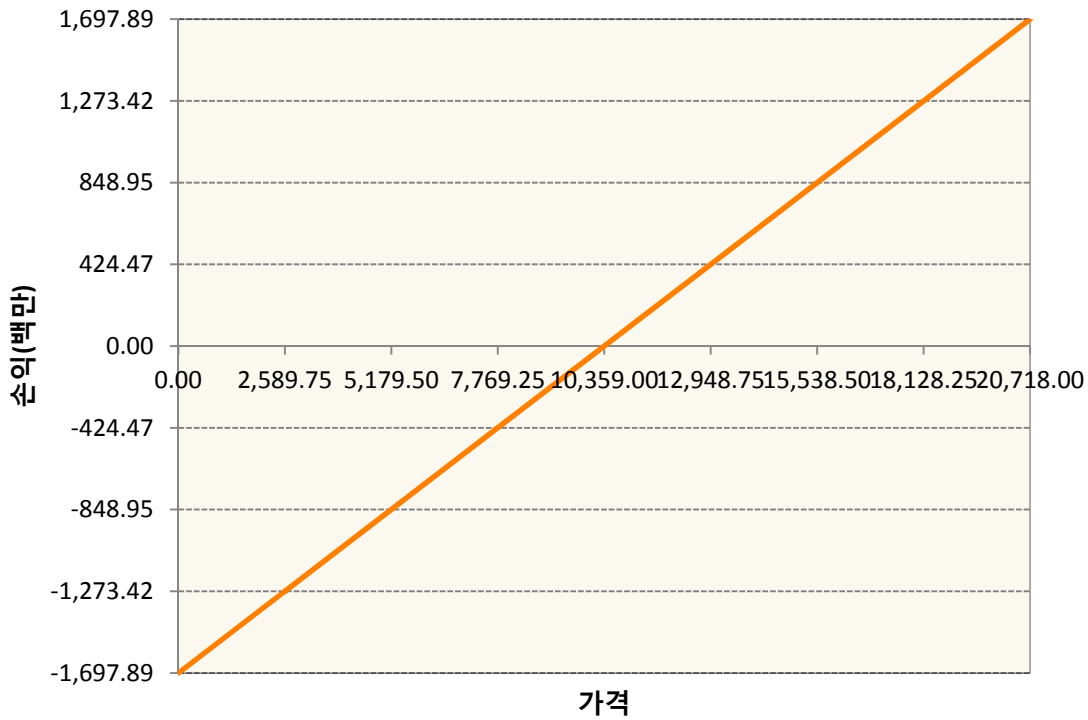
1. 계약금액

(단위:백만원)

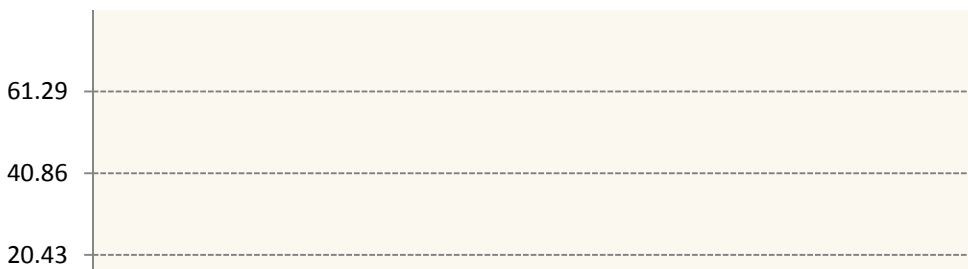
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,698	0	1,698	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,783	-4,783	장내
누계	통화	선도	0	2,192	-2,192	장외

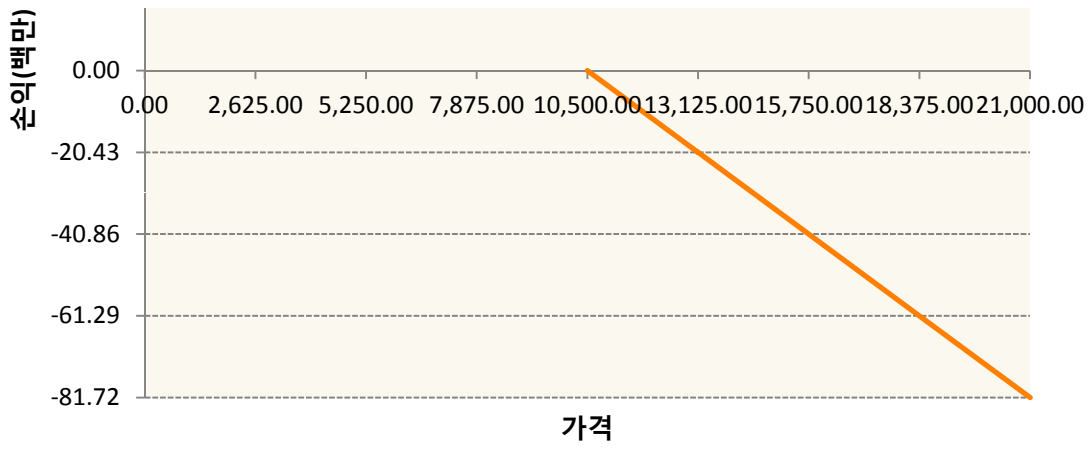
2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20

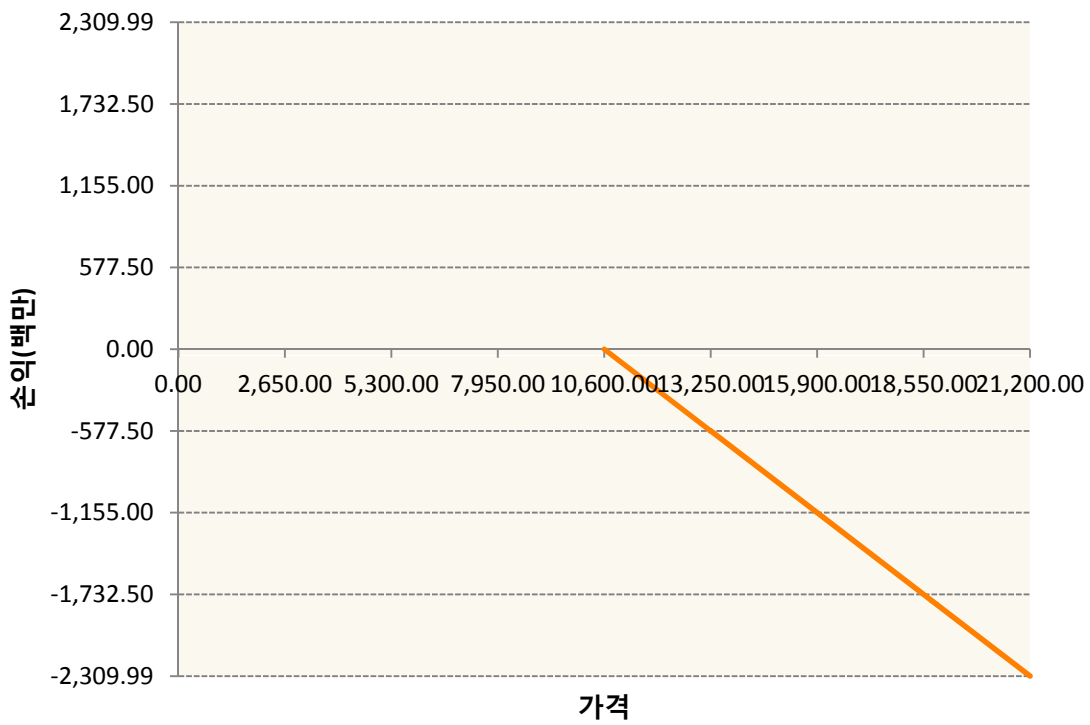


OHHIH0-C105-HSCEI

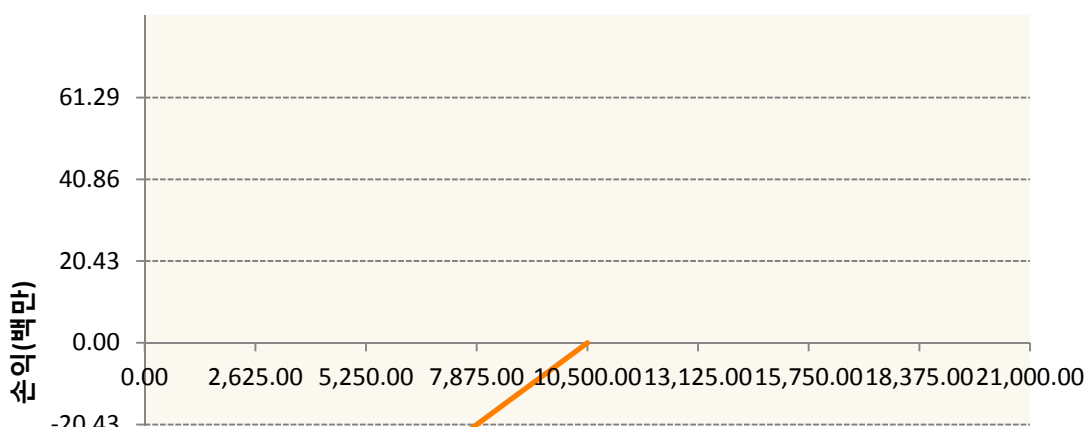


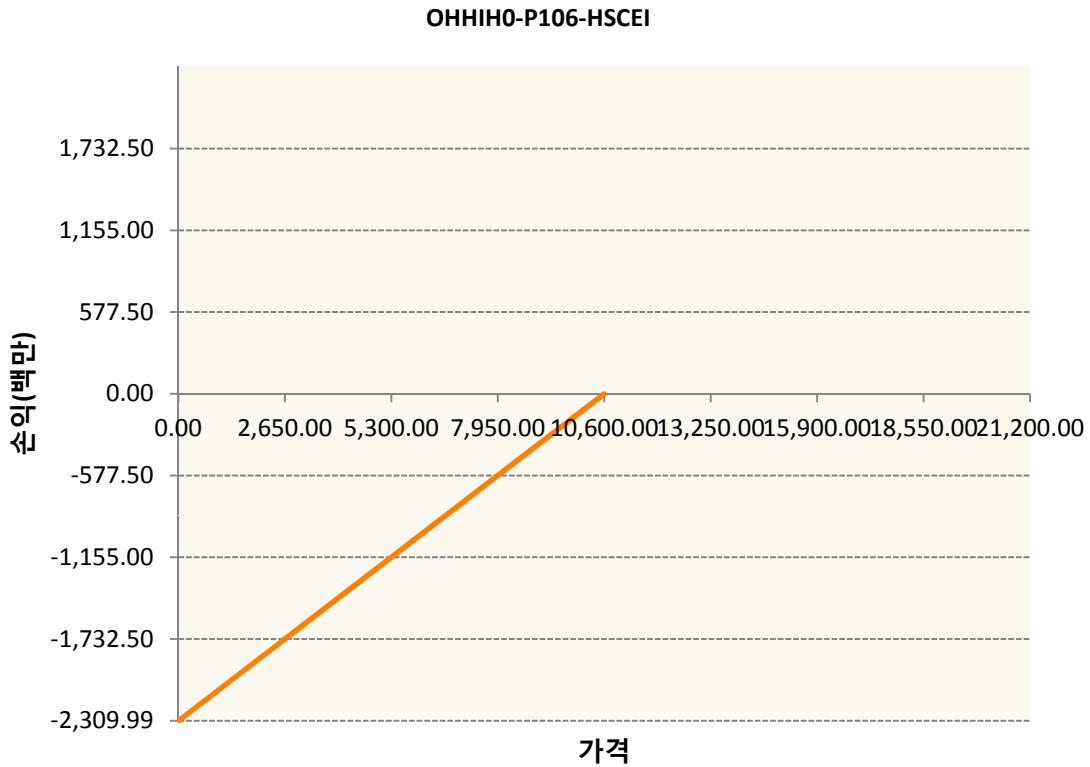
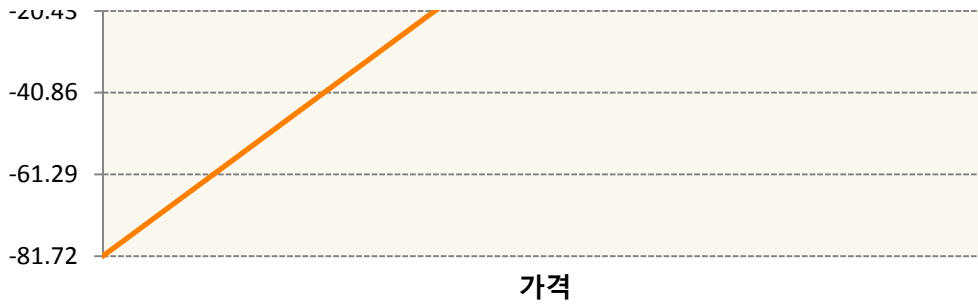


OHHIH0-C106-HSCEI



OHHIH0-P105-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E	175
HCH0 HSCEI Futures Mar20	136
OHHIH0-C1(HSCEI	7
OHHIH0-C1(HSCEI	185
OHHIH0-P1(HSCEI	7
OHHIH0-P1(HSCEI	185

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	529

공시일	2020-03-02
기준일	2020-02-28

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

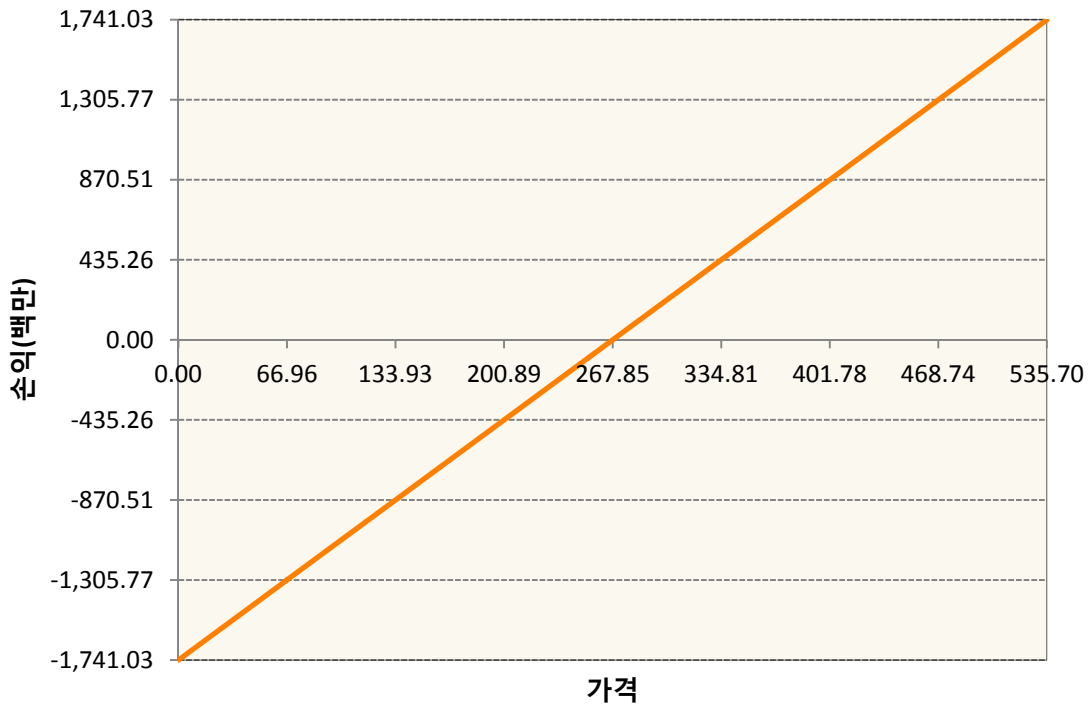
1. 계약금액

(단위:백만원)

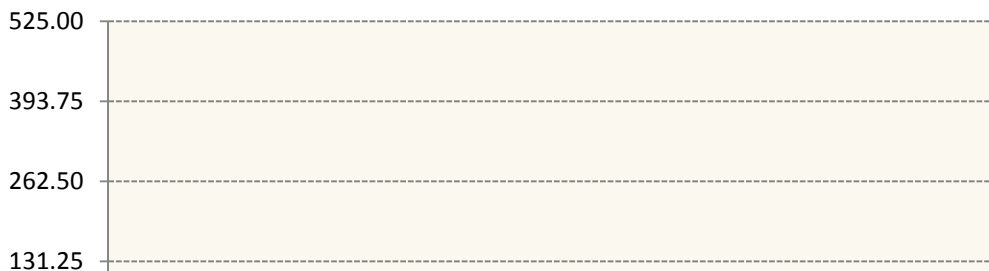
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,741	0	1,741	장내
누계	유가증권	스왑	3,125	0	3,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,612	-3,612	장내

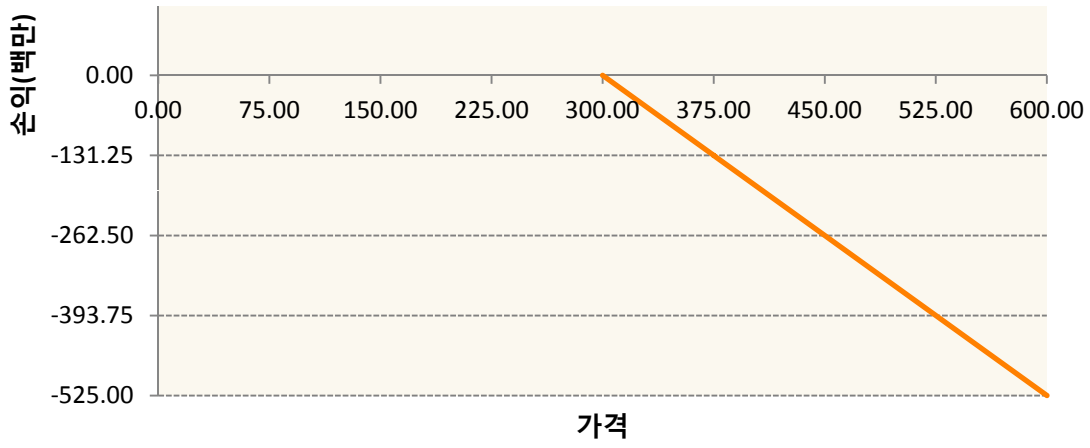
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

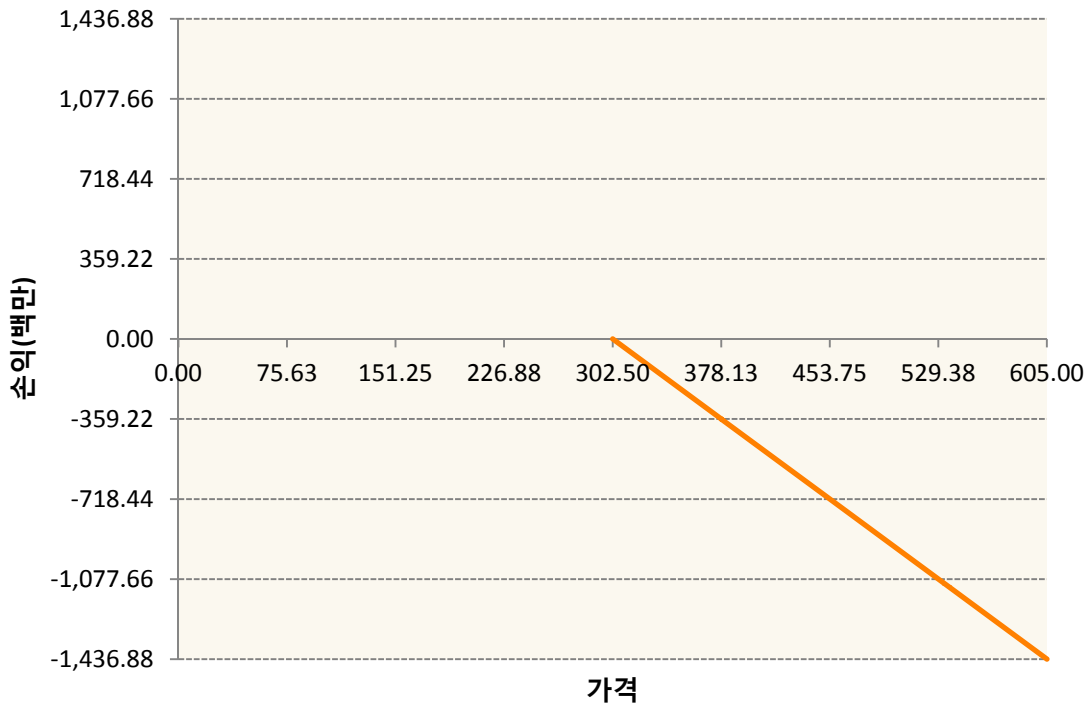


KR4201Q33007-2020-03 콜300

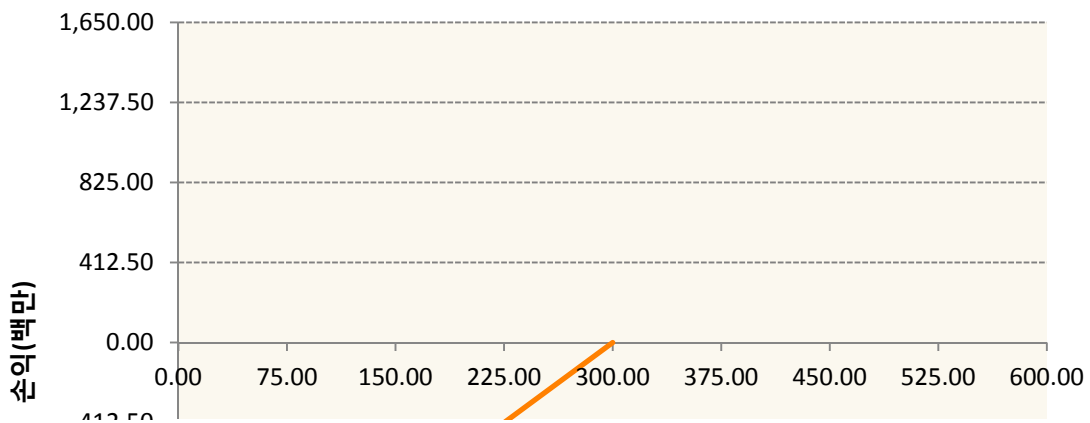




KR4201Q33023-2020-03 콜302.5



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						139
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-139	-139	-139	-139	-139	-139	-139	
-5.33%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93	
-2.67%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	46	46	46	46	46	46	46	
5.33%	93	93	93	93	93	93	93	
8.00%	139	139	139	139	139	139	139	
KR4201Q33007		2020-03 콜300						9
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1	
-5.33%	1	1	1	1	1	0	0	
-2.67%	1	1	1	0	0	0	0	
0%	1	0	0	0	0	-1	-1	
2.67%	0	0	0	-1	-1	-2	-3	
5.33%	-1	-1	-2	-3	-4	-4	-5	
8.00%	-3	-4	-5	-6	-7	-8	-9	
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5						21
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	1	1	1	1	1	1	1
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-2.67%	1	1	1	1	1	0	0
0%	1	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	0	0	-1	-2	-3	-5	-6
5.33%	-1	-3	-4	-6	-8	-10	-12
8.00%	-6	-8	-11	-13	-16	-18	-21
KR4301Q33005 2020-03 풋300							117
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117
-5.33%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
-2.67%	-38	-38	-39	-39	-39	-39	-40
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	40	39	38	37	36	35	34
5.33%	77	76	74	72	71	69	67
8.00%	111	108	106	103	101	98	95

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

(단위:백만원)

527

공시일	2020-03-02
기준일	2020-02-28

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

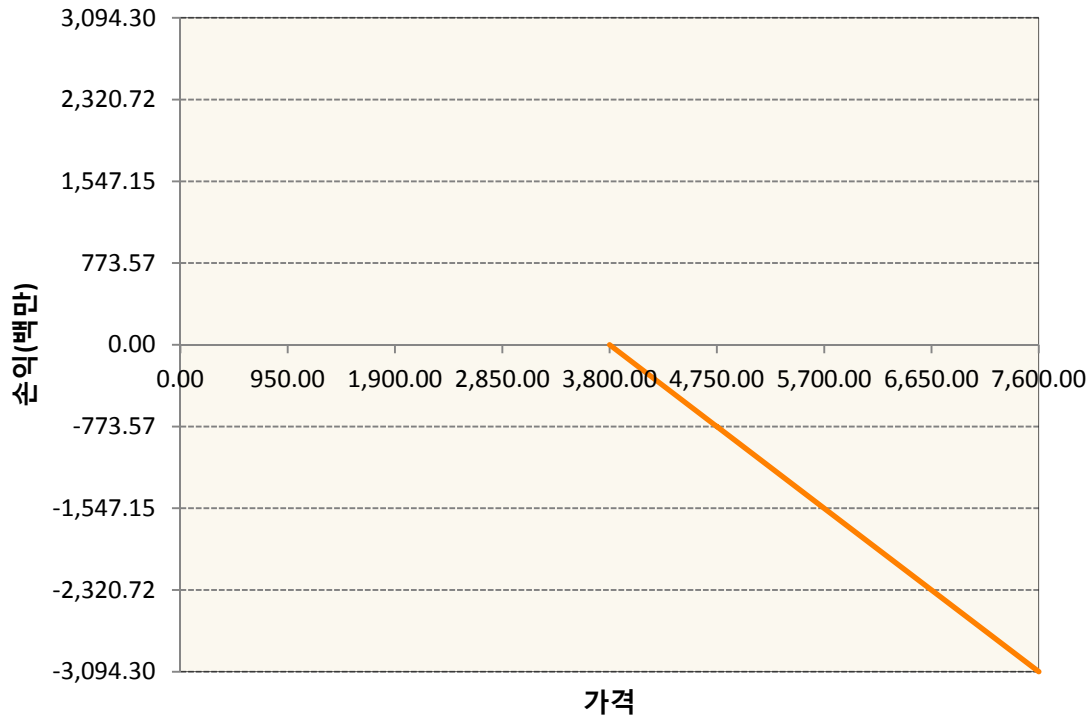
1. 계약금액

(단위:백만원)

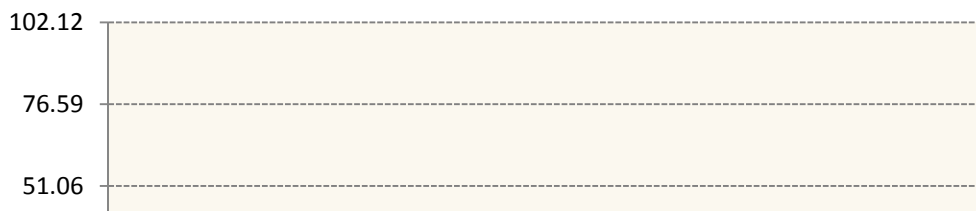
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	177	0	177	
누계	유가증권	스왑	12,016	0	12,016	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,393	-6,393	장내
누계	통화	선도	0	3,503	-3,503	장외

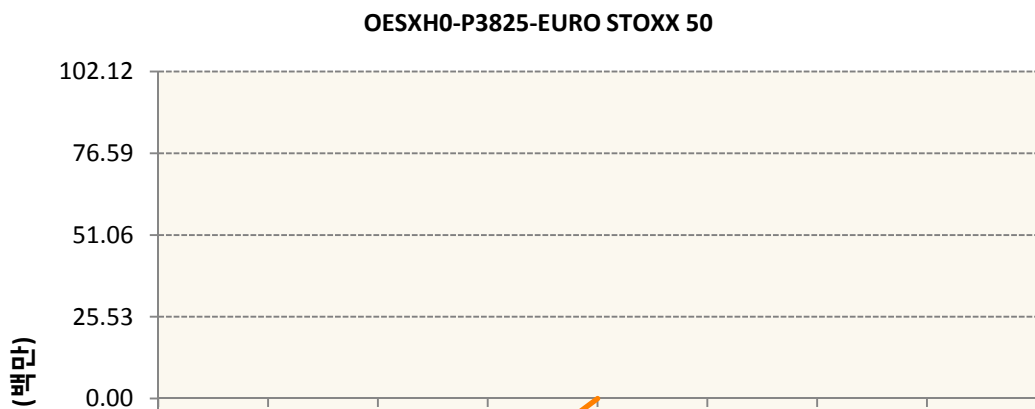
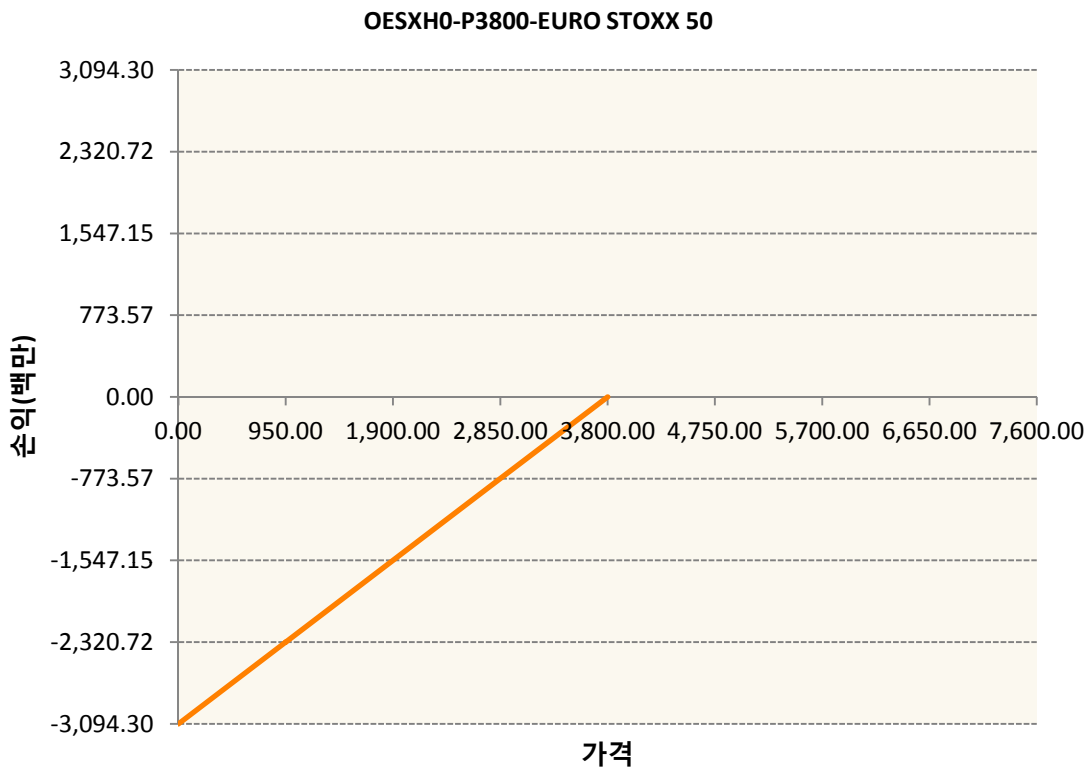
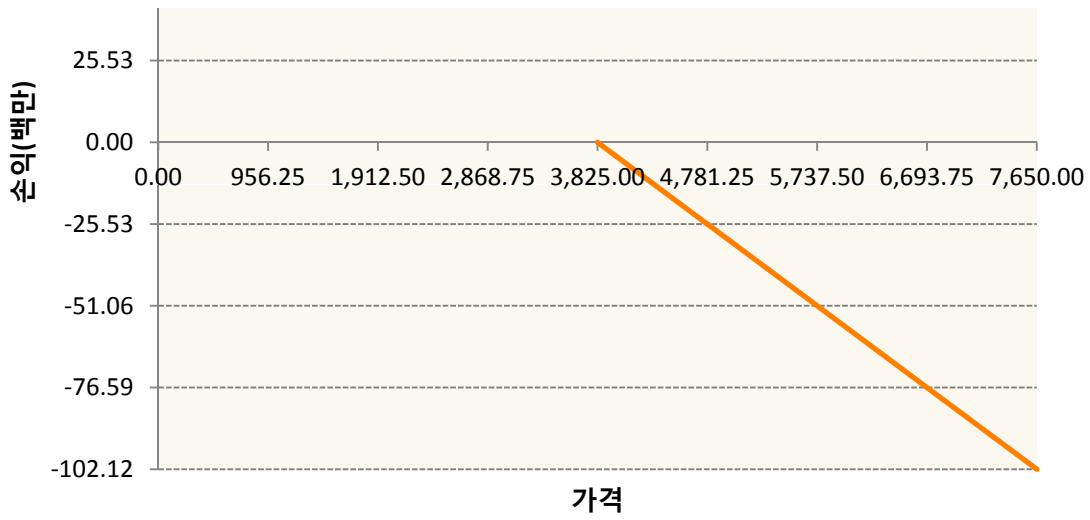
2. 만기시점의 손익구조

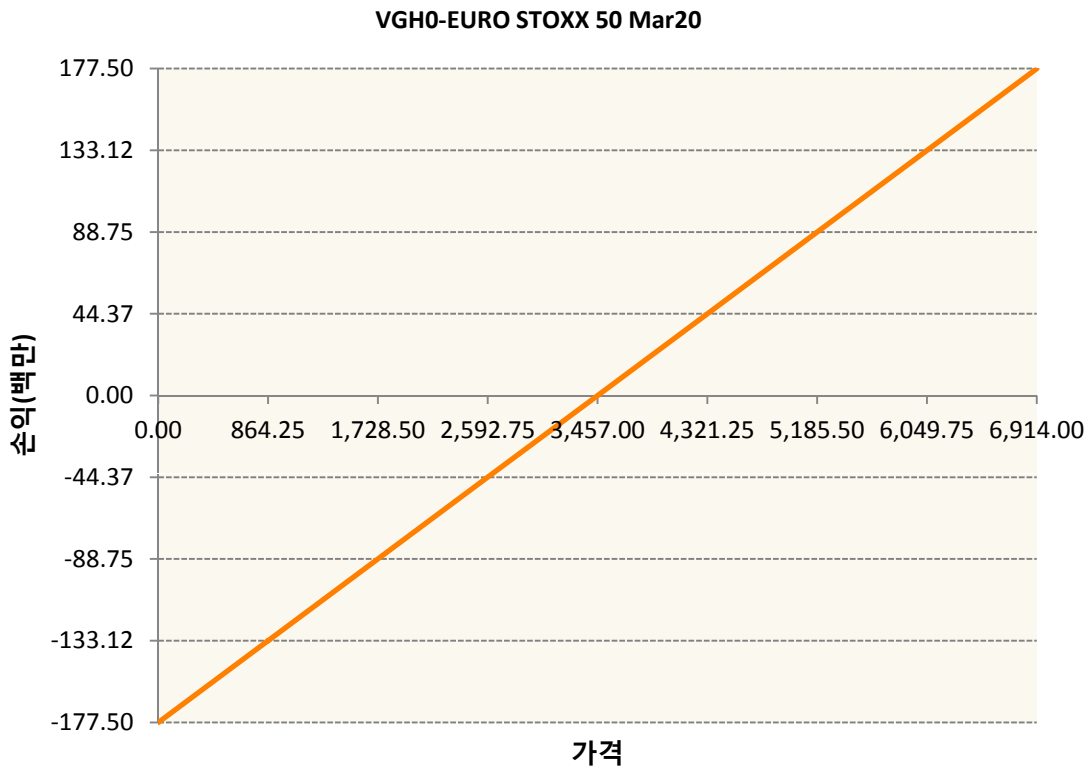
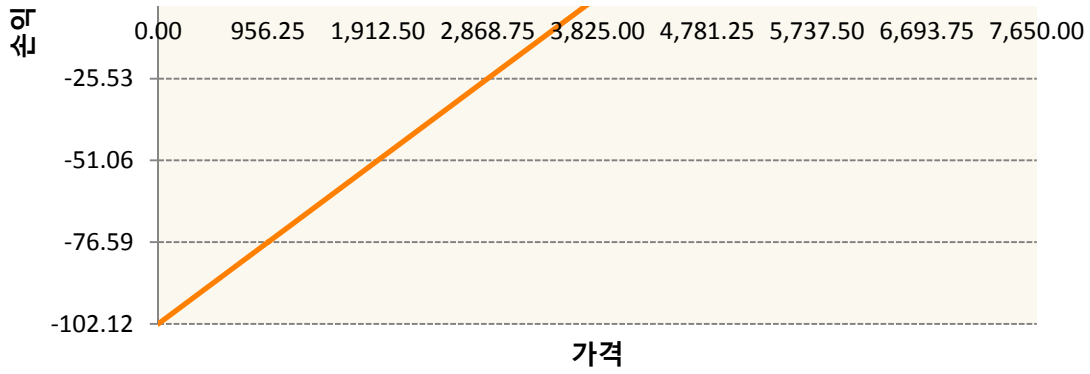
OESXH0-C3800-EURO STOXX 50



OESXH0-C3825-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP\SG EURO Covered CALL STRATEGY	64
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	280
OESXH0-C3\xEURO STOXX 50	248
OESXH0-C3\xEURO STOXX 50	8
OESXH0-P3\xEURO STOXX 50	248
OESXH0-P3\xEURO STOXX 50	8
VGHO EURO STOXX 50 Mar20	14

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

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

(단위:백만원)

914

공시일	2020-03-02
기준일	2020-02-28

ETF스마트레버리지목표전환형9호

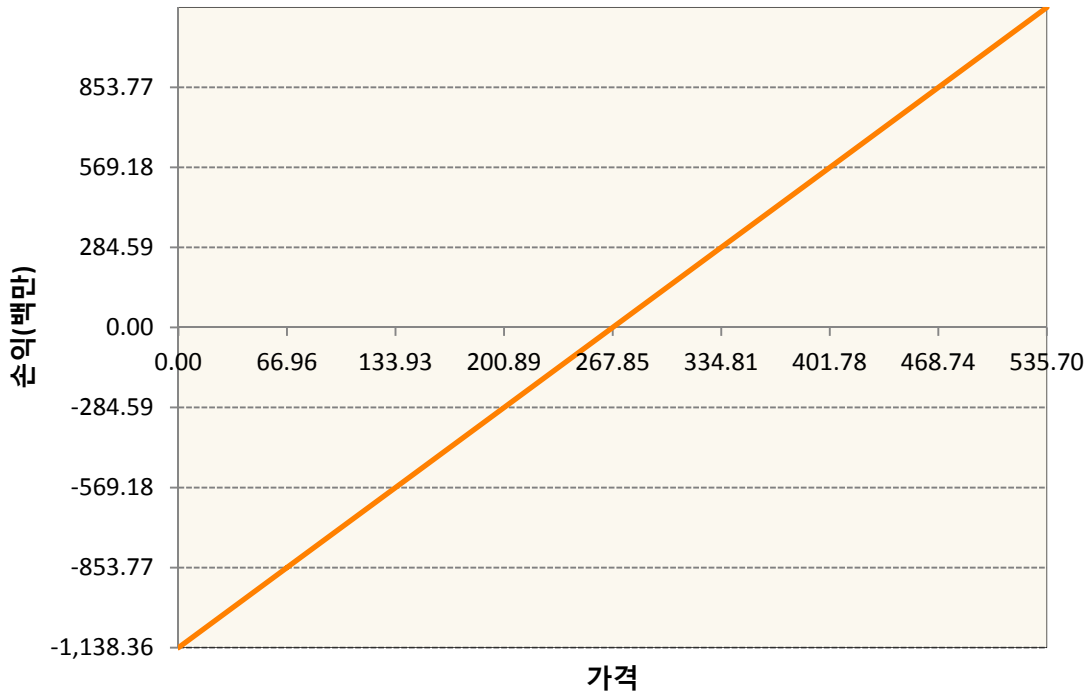
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,138	0	1,138	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						91
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91	
-5.33%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61	
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	30	30	30	30	30	30	30	
5.33%	61	61	61	61	61	61	61	
8.00%	91	91	91	91	91	91	91	

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

(단위:백만원)

81

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

(단위:백만원)

118

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

(단위:백만원)

43

공시일	2020-03-02
기준일	2020-02-28

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

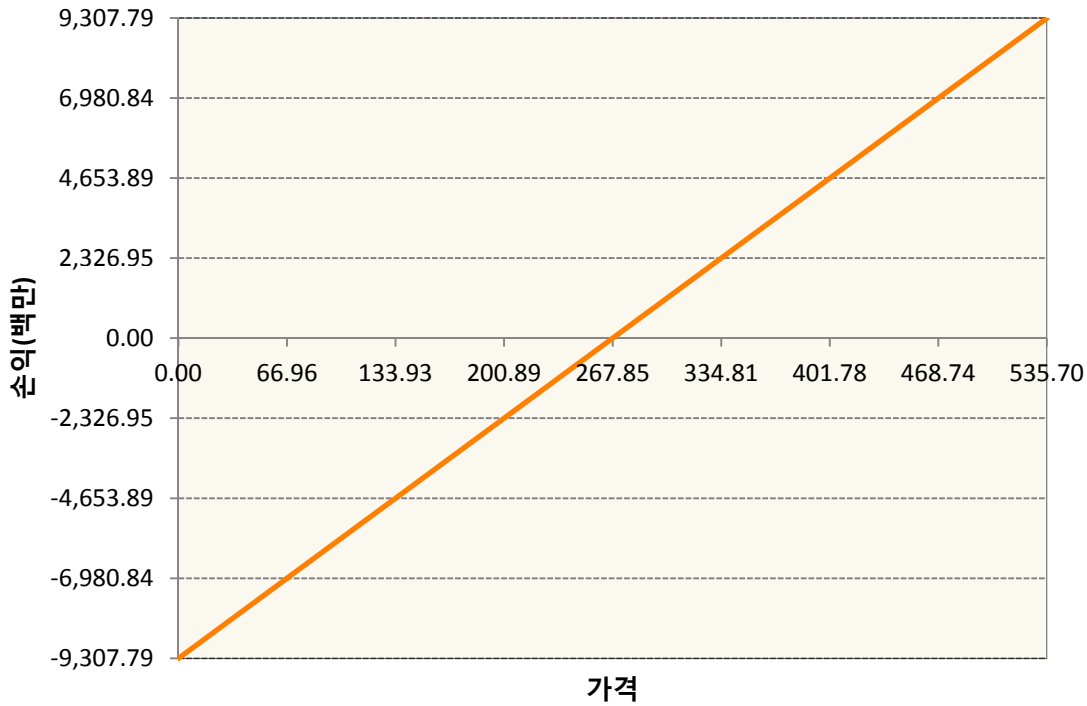
1. 계약금액

(단위:백만원)

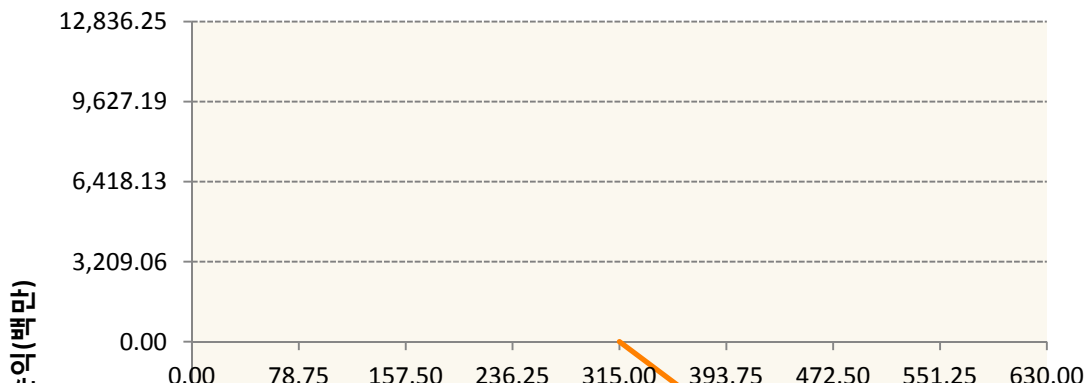
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,308	0	9,308	장내
누계	유가증권	옵션	2,257	12,836	-10,579	장내

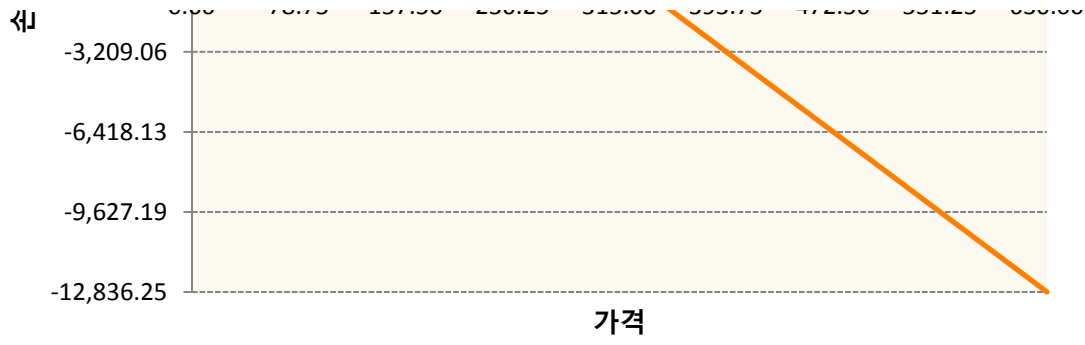
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

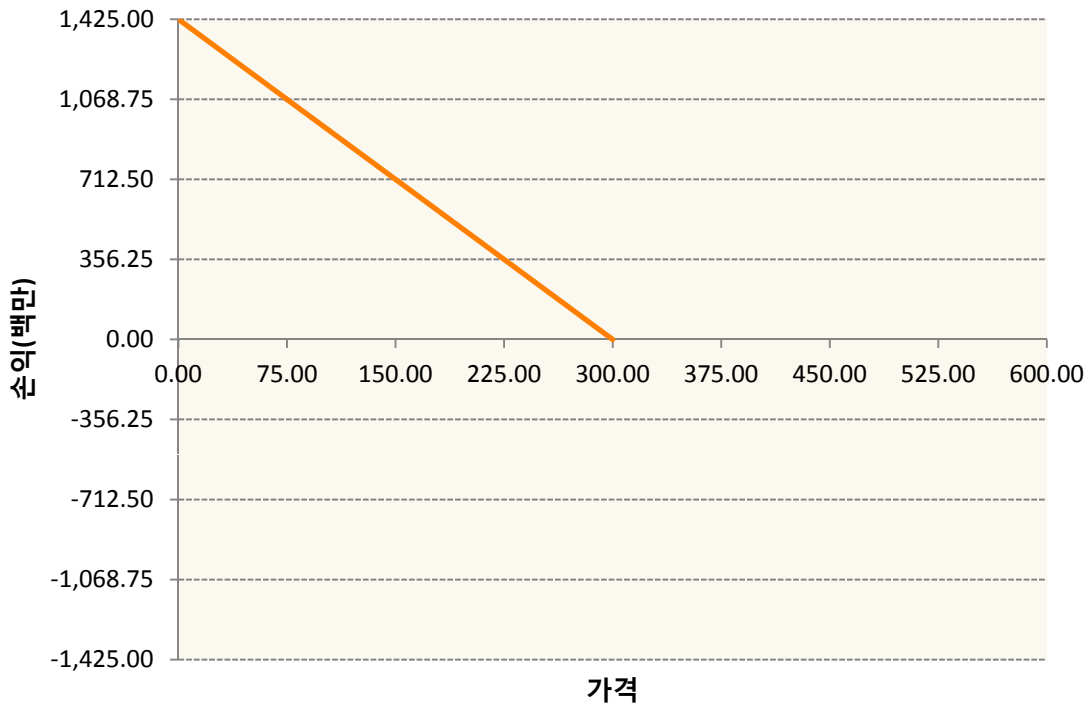


KR4201Q33155-2020-03 콜315

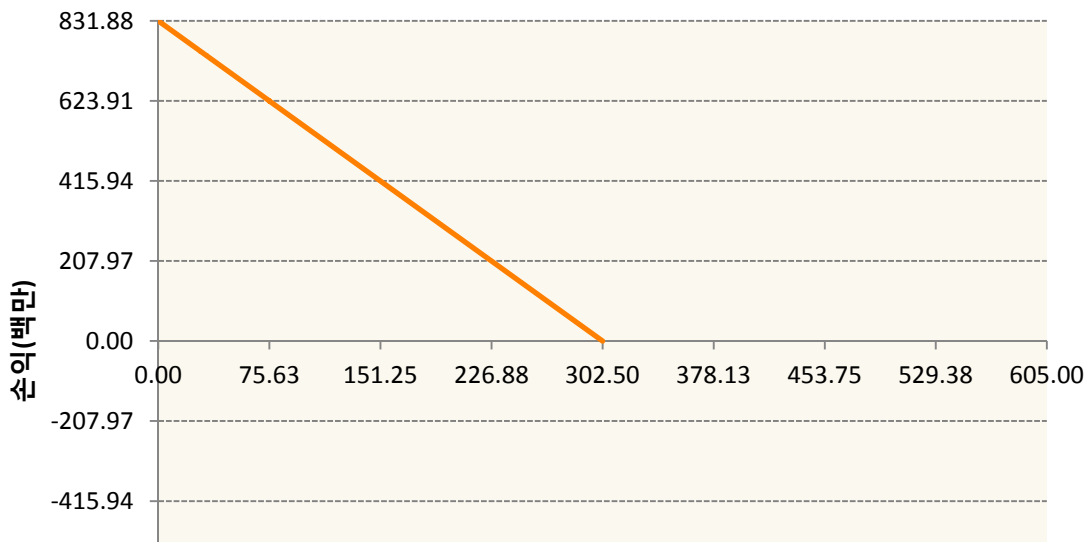


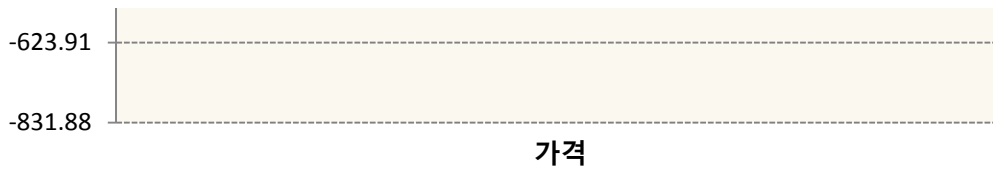


KR4301Q33005-2020-03 풋300



KR4301Q33021-2020-03 풋302.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						745
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-745	-745	-745	-745	-745	-745	-745	
-5.33%	-497	-497	-497	-497	-497	-497	-497	
-2.67%	-248	-248	-248	-248	-248	-248	-248	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	248	248	248	248	248	248	248	
5.33%	497	497	497	497	497	497	497	
8.00%	745	745	745	745	745	745	745	
KR4201Q33155		2020-03 콜315						83
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	2	1	0	-2	
0%	2	2	1	0	-2	-5	-8	
2.67%	1	0	-2	-5	-9	-14	-21	
5.33%	-1	-4	-9	-16	-24	-33	-44	
8.00%	-10	-18	-27	-39	-52	-67	-83	
KR4301Q33005		2020-03 풋300						101
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	101	101	101	101	101	101	101	
-5.33%	67	67	67	67	67	67	67	
-2.67%	33	33	33	33	34	34	34	
0%	-1	-1	0	0	0	1	2	
2.67%	-34	-34	-33	-32	-31	-30	-29	
5.33%	-66	-65	-64	-63	-61	-59	-57	
8.00%	-96	-94	-92	-89	-87	-85	-82	
KR4301Q33021		2020-03 풋302.5						59
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	59	59	59	59	59	59	59	
-5.33%	39	39	39	39	39	39	39	
-2.67%	19	19	19	19	19	20	20	

0%	0	0	0	0	0	0	1
2.67%	-20	-20	-19	-19	-19	-18	-17
5.33%	-39	-38	-38	-37	-36	-35	-34
8.00%	-56	-55	-54	-53	-52	-51	-49

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

(단위:백만원)

837

공시일	2020-03-02
기준일	2020-02-28

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	216,339	0	216,339	

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	2020-03-02
기준일	2020-02-28

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	11,653	-11,653	
누계	유가증권	수익증권	156,579	0	156,579	

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	2020-03-02
기준일	2020-02-28

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	536,689	0	536,689	
누계	통화	선도	6,069	528,445	-522,376	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,563
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,456
FX21020F03 KRW/USD 31-03-20E	3,107
FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E	2,913
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,622
FX21020G00 KRW/USD 06-03-20E	2,427
FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	971
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,204
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,233
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	971
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	1,942
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	3,340
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,340
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,942
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,884
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,272
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,942
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	194
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	4,952
FX21020G06 USD/KRW 31-03-20E	485

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

14,676

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

(단위:백만원)

121

공시일	2020-03-02
기준일	2020-02-28

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

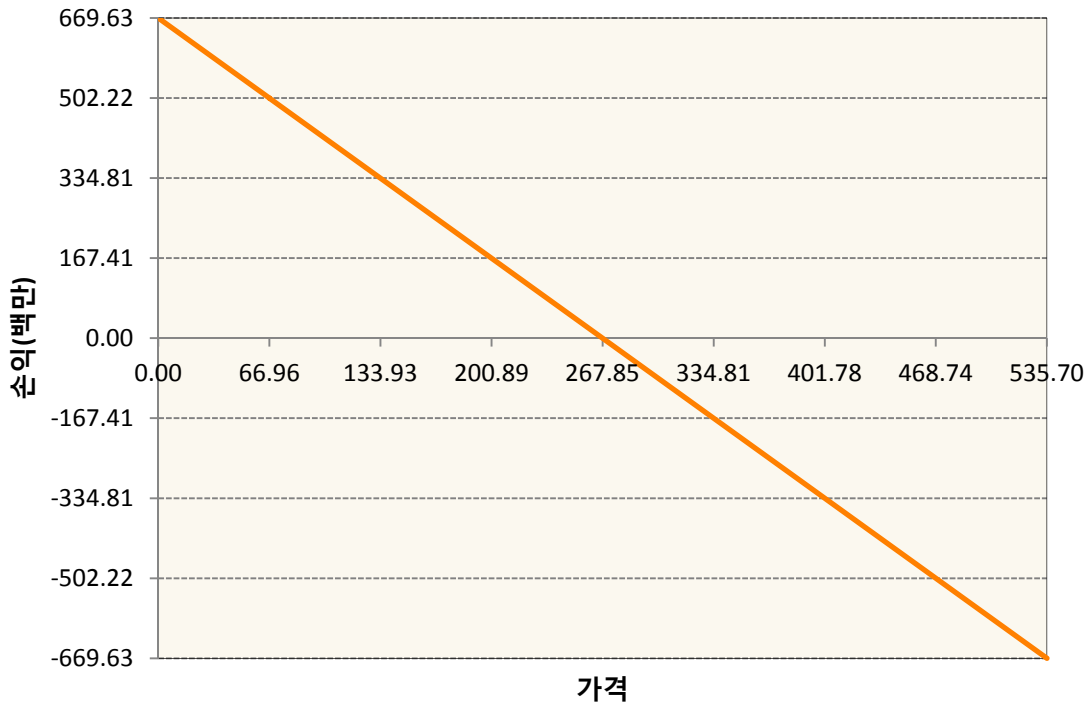
1. 계약금액

(단위:백만원)

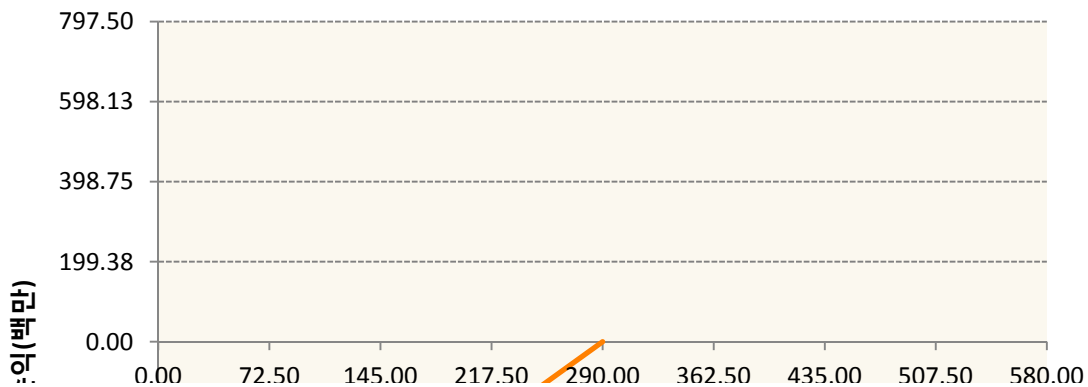
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	670	-670	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,503	-3,503	장내

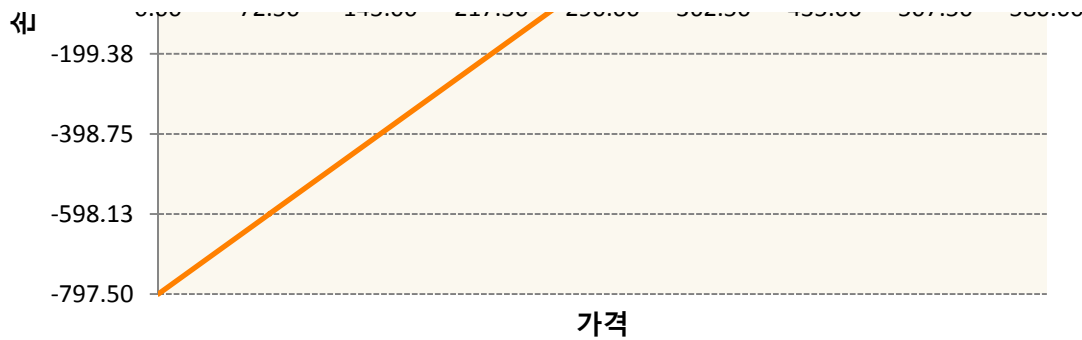
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

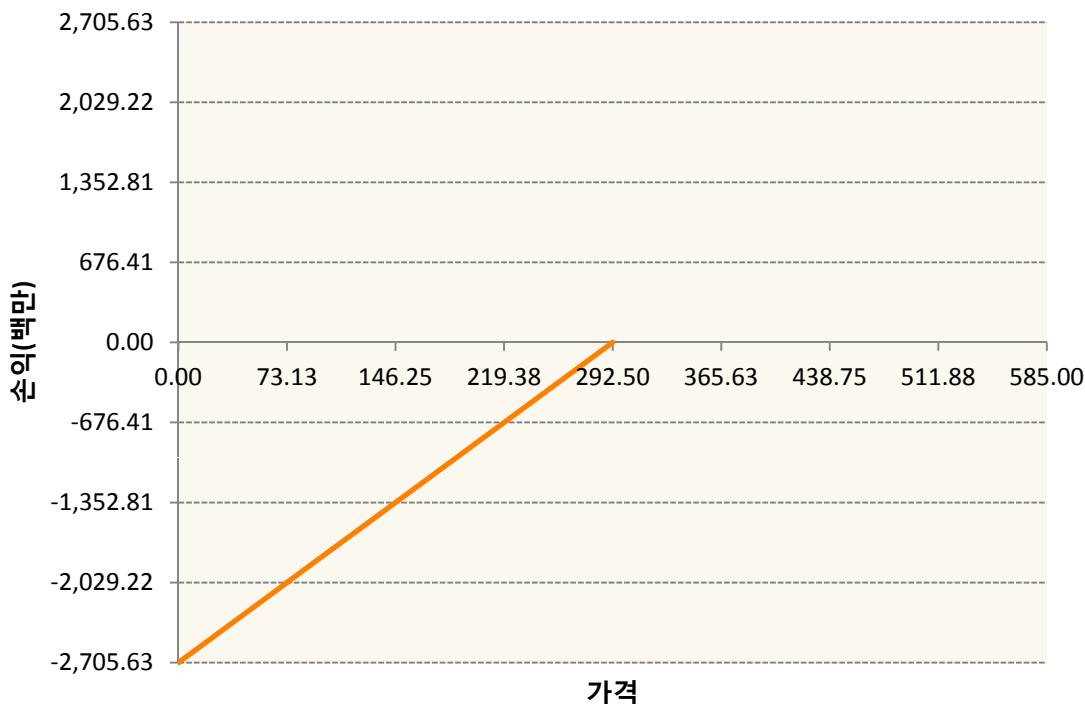


KR4301Q32908-2020-03 풋290





KR4301Q32924-2020-03 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						54
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	54	54	54	54	54	54	54	
-5.33%	36	36	36	36	36	36	36	
-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%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	
8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54	
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%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-19	-19	-20
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	20	19	18	17	16	15	14
5.33%	36	34	33	32	30	29	27
8.00%	48	46	45	43	42	40	39
KR4301Q32924 2020-03 풋292.5							194
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-194	-194	-194	-194	-194	-194	-194
-5.33%	-128	-128	-128	-128	-128	-129	-130
-2.67%	-62	-62	-63	-63	-64	-65	-66
0%	3	3	1	0	-2	-4	-6
2.67%	66	64	62	59	56	53	49
5.33%	123	119	115	111	107	102	98
8.00%	169	164	159	154	149	144	138

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

(단위:백만원)

309

공시일	2020-03-02
기준일	2020-02-28

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	10,406	0	10,406	
누계	통화	선도	0	10,268	-10,268	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	330
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	91
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)

282

공시일	2020-03-02
기준일	2020-02-28

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

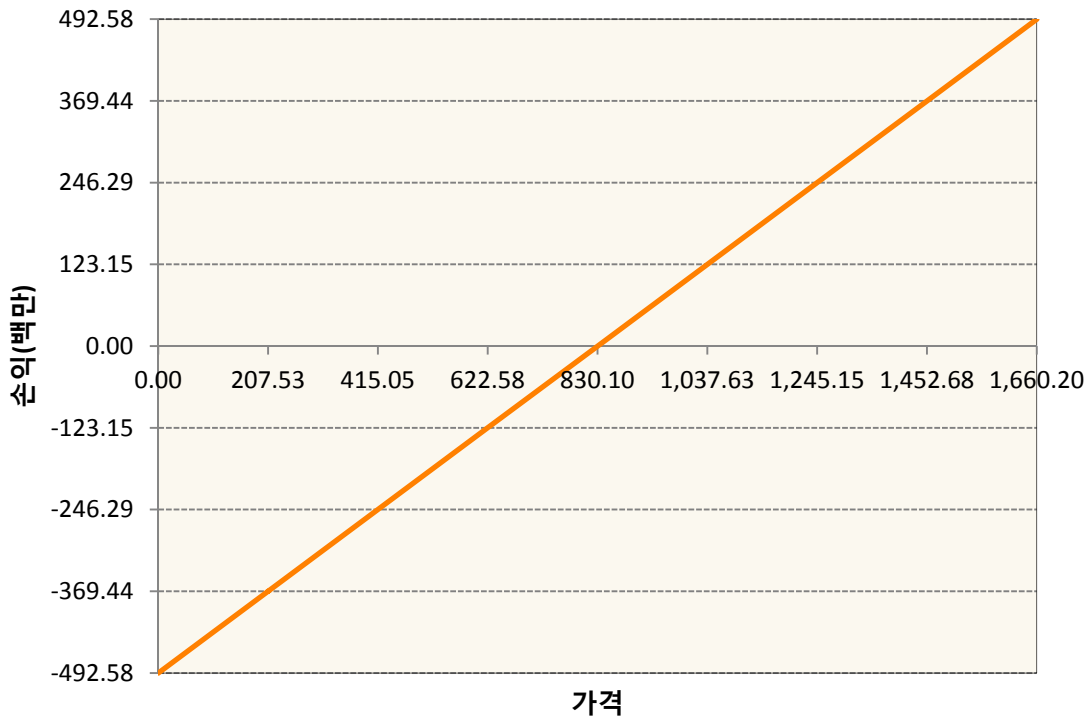
1. 계약금액

(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	493	0	493	
누계	유가증권	스왑	1,101	0	1,101	장외
누계	통화	선도	147	734	-587	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCH0-VN30 Index Future Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	88
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	39

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

(단위:백만원)

121

공시일	2020-03-02
기준일	2020-02-28

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

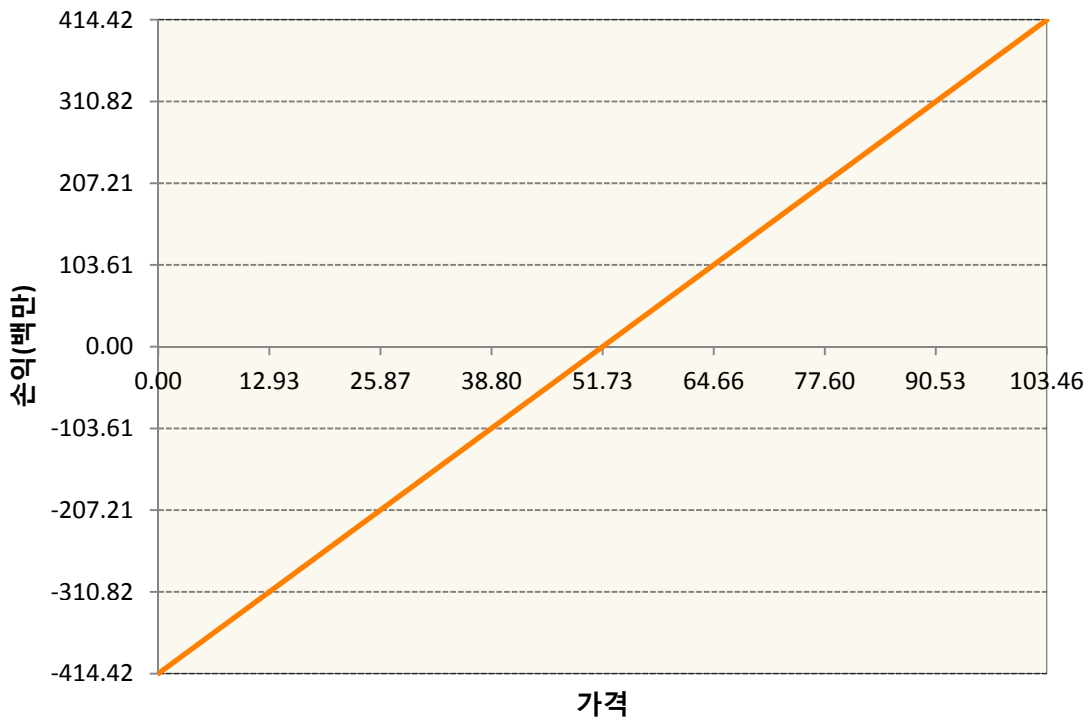
1. 계약금액

(단위:백만원)

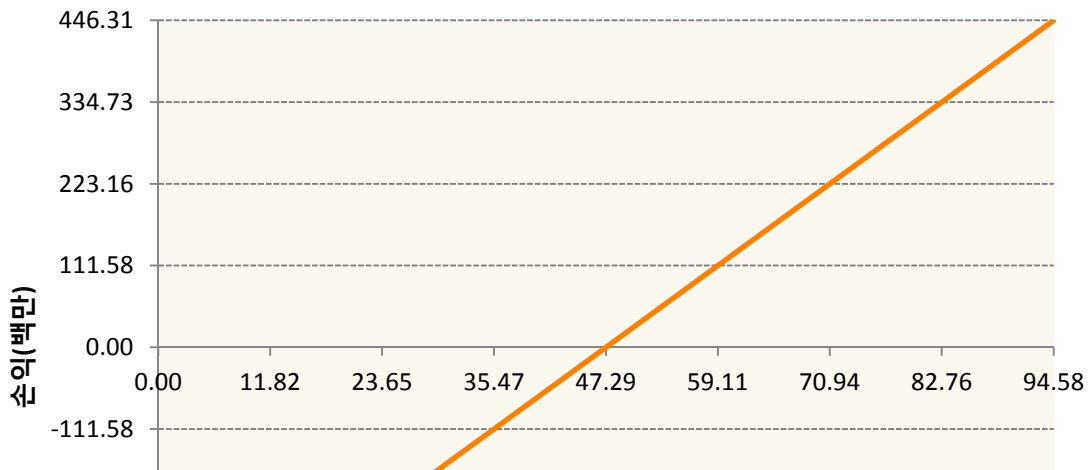
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,911	121	1,789	

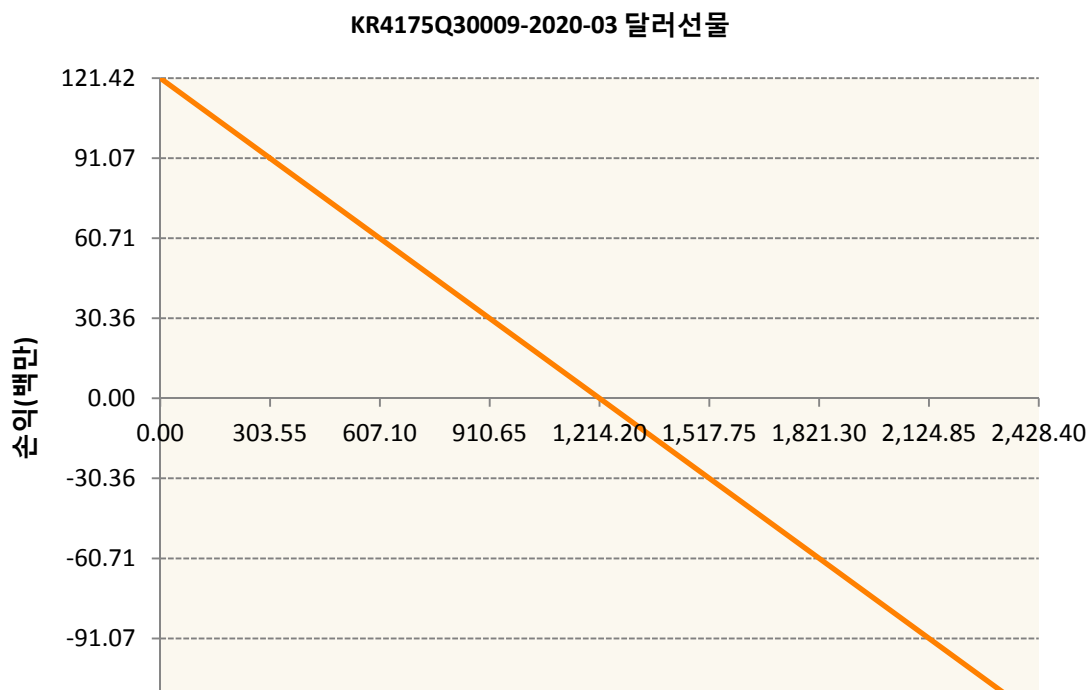
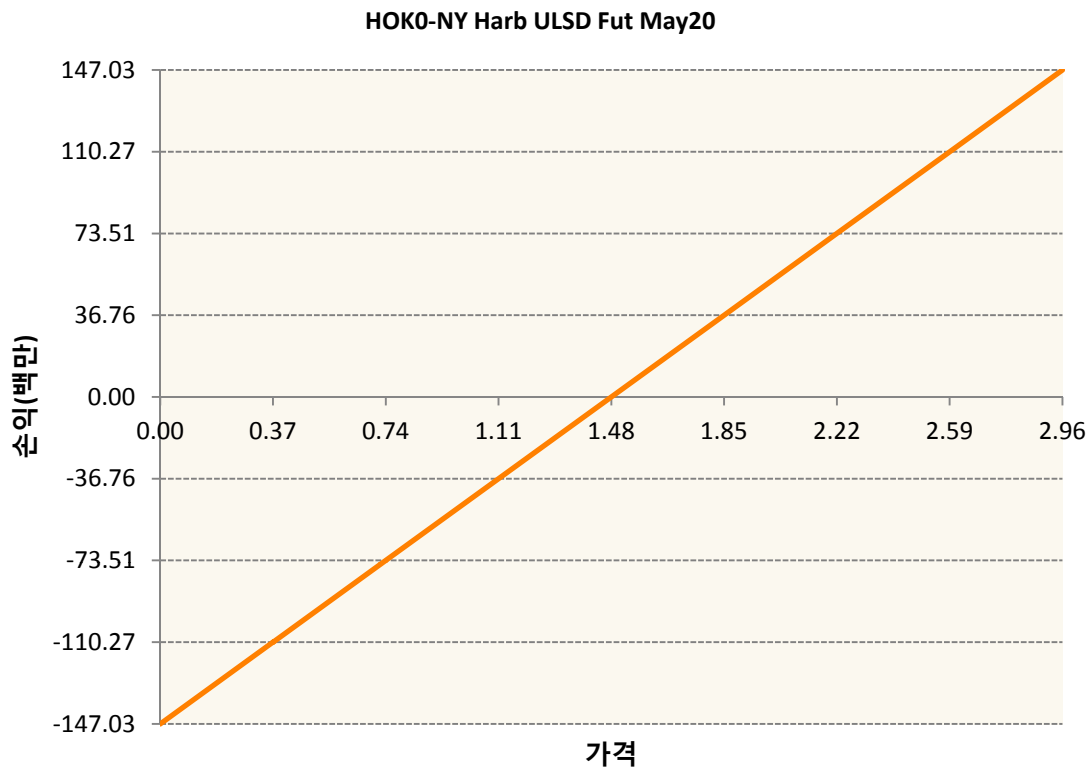
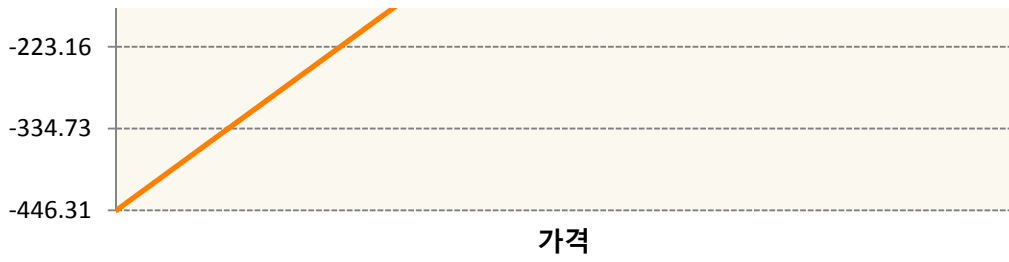
2. 만기시점의 손익구조

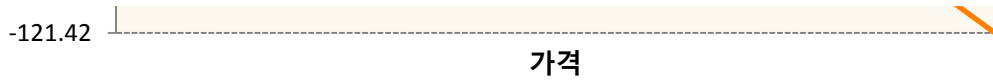
COK0-BRENT CRUDE FUTR May20



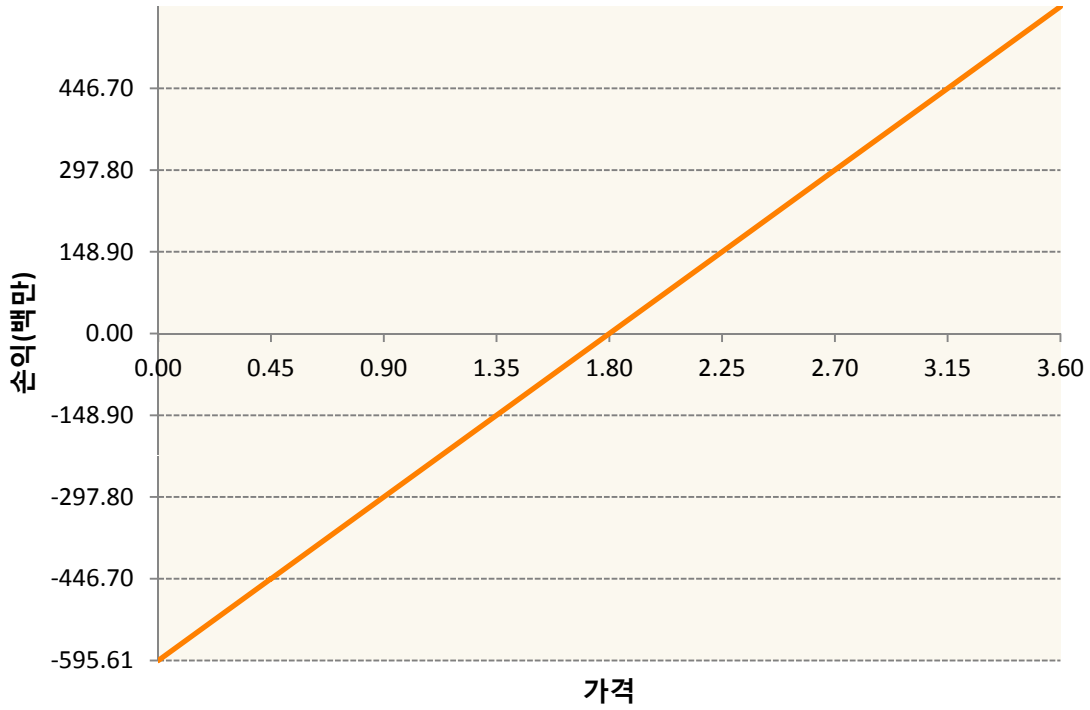
CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20



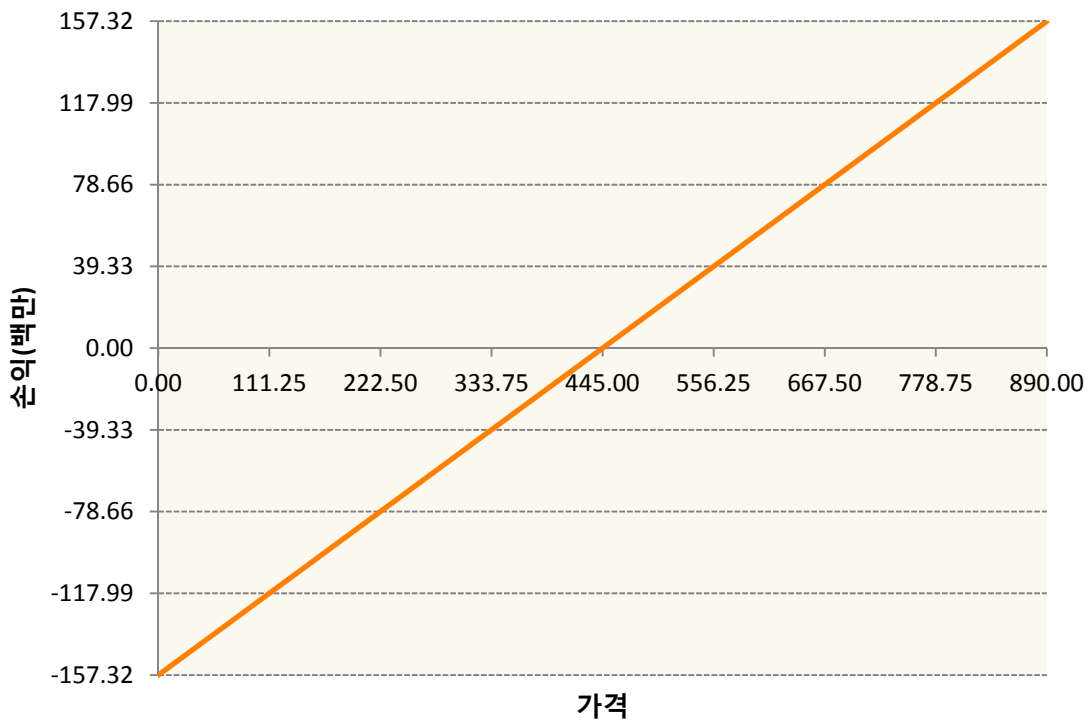




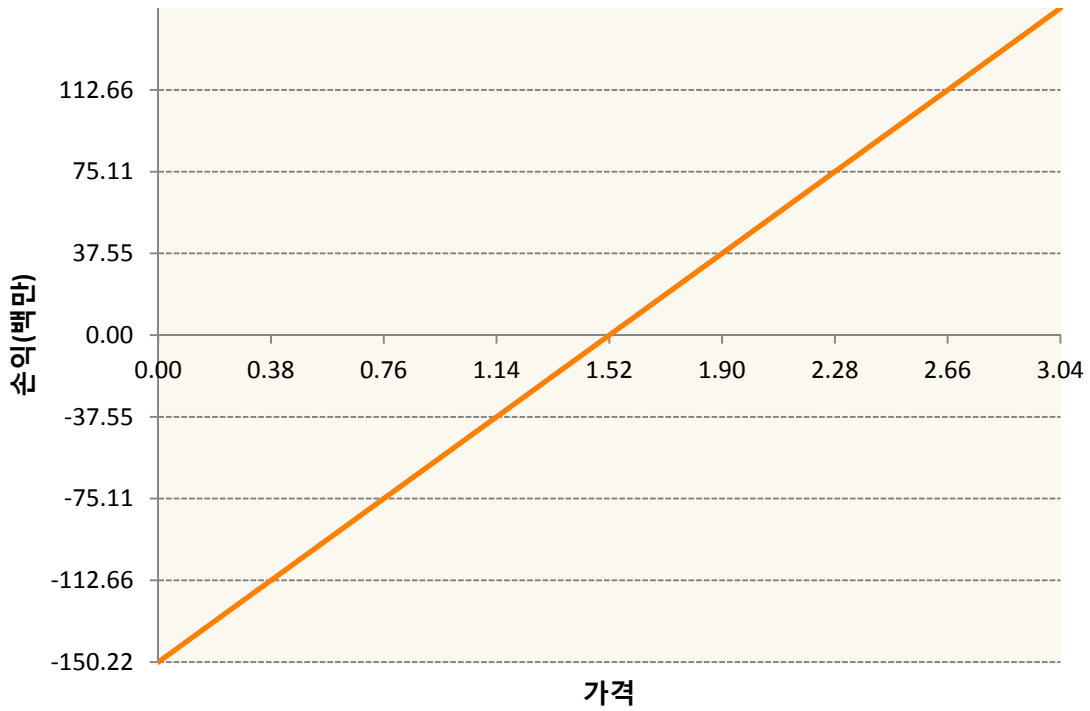
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



QSK0-Low Su Gasoil G Mar20



XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	33
CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	36
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	12
KR4175Q30C	2020-03 달러선물	10
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	48
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	13
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	12

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

(단위:백만원)

311

공시일	2020-03-02
기준일	2020-02-28

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

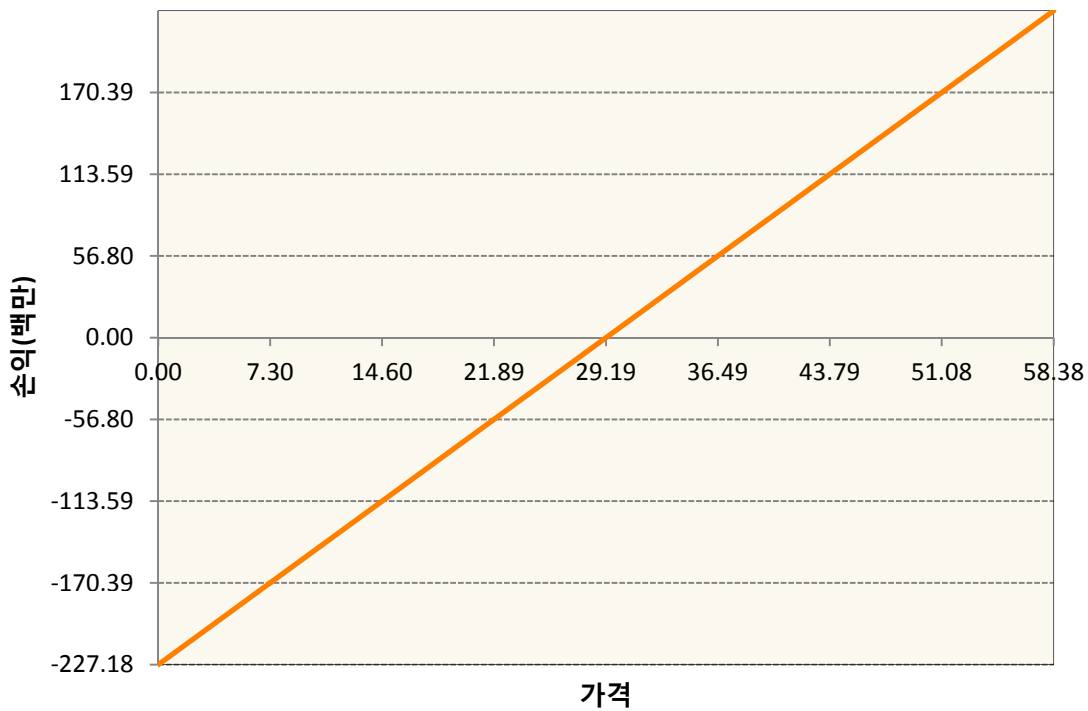
1. 계약금액

(단위:백만원)

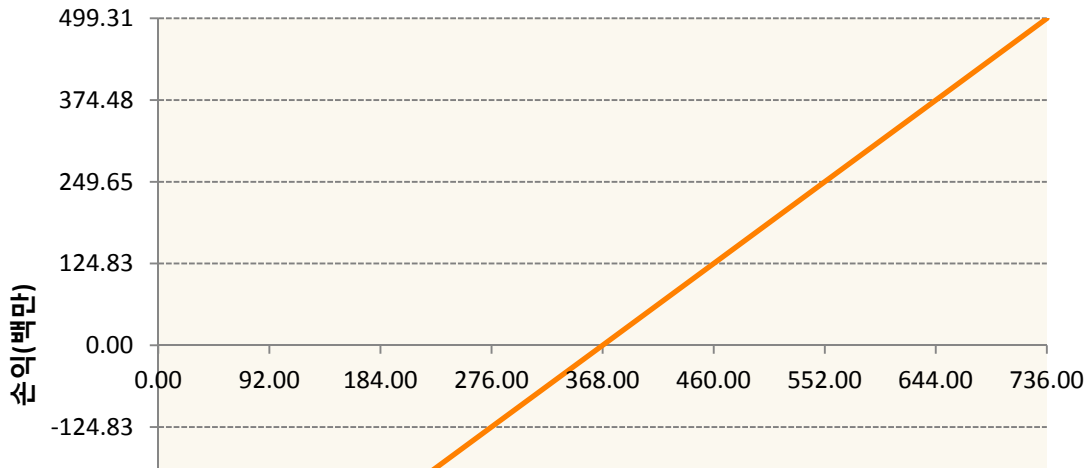
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,574	158	2,417	

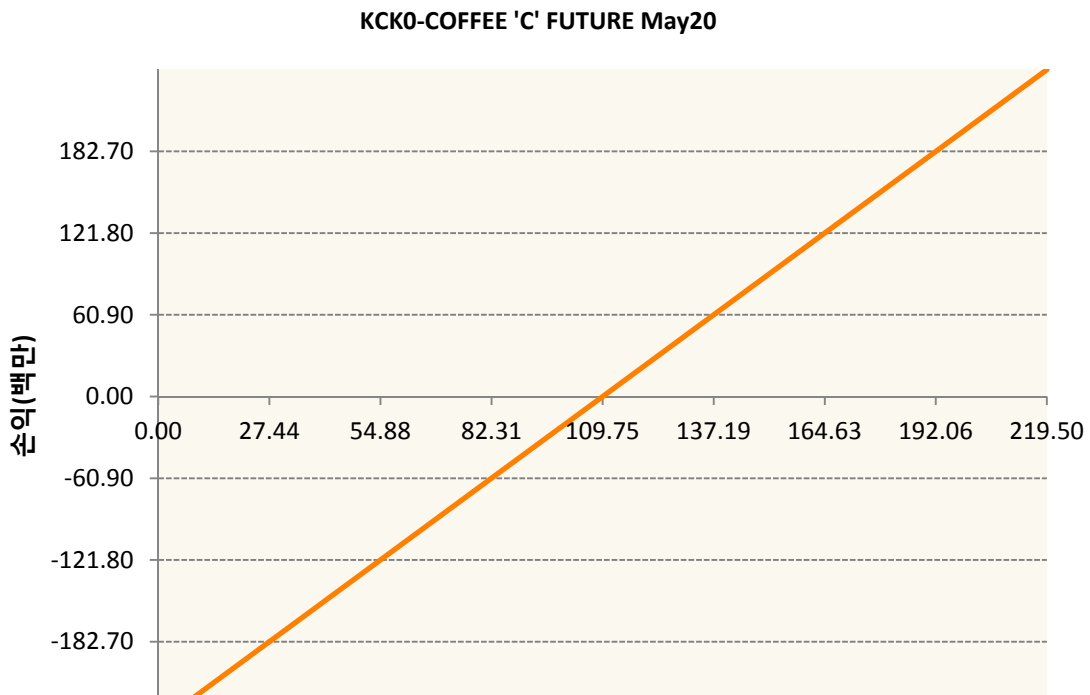
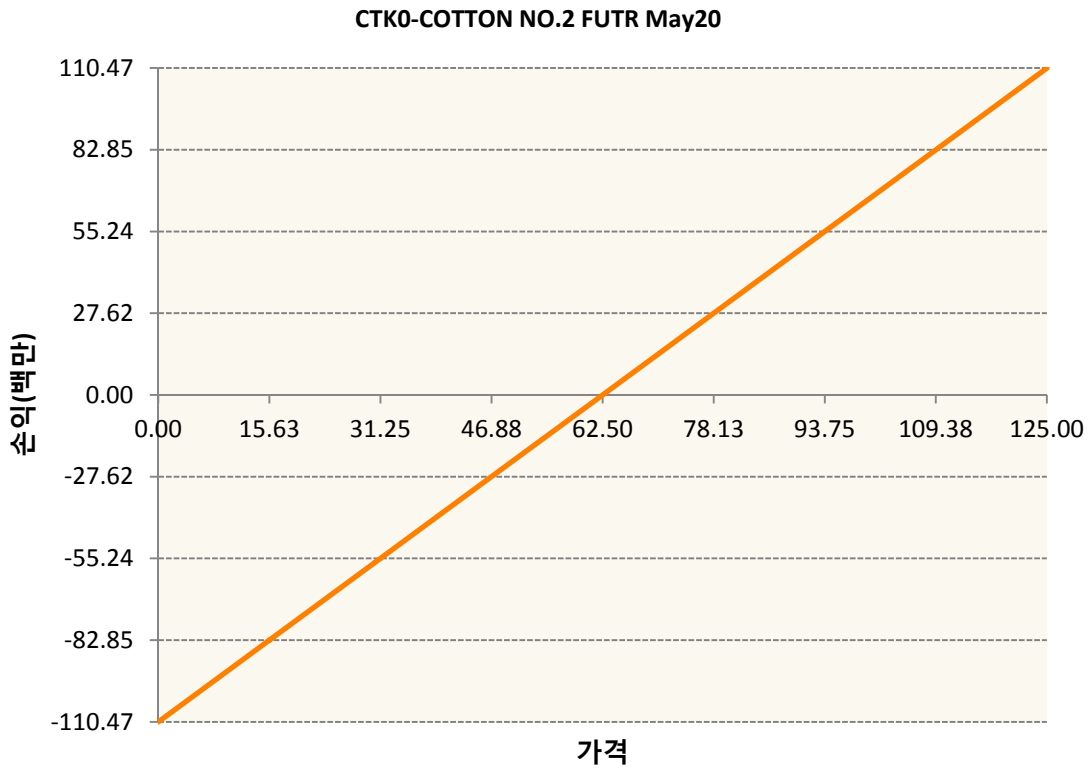
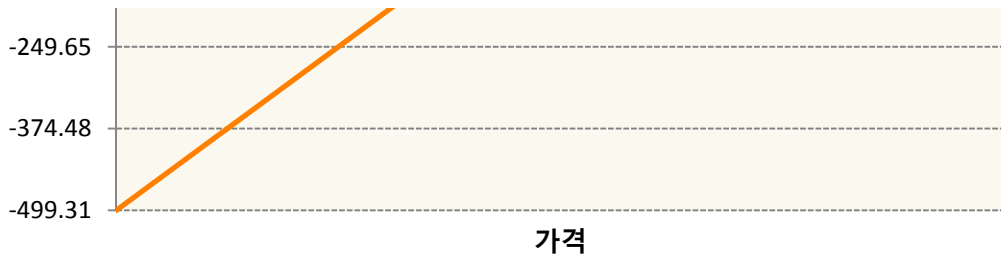
2. 만기시점의 손익구조

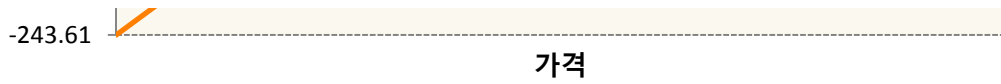
BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20



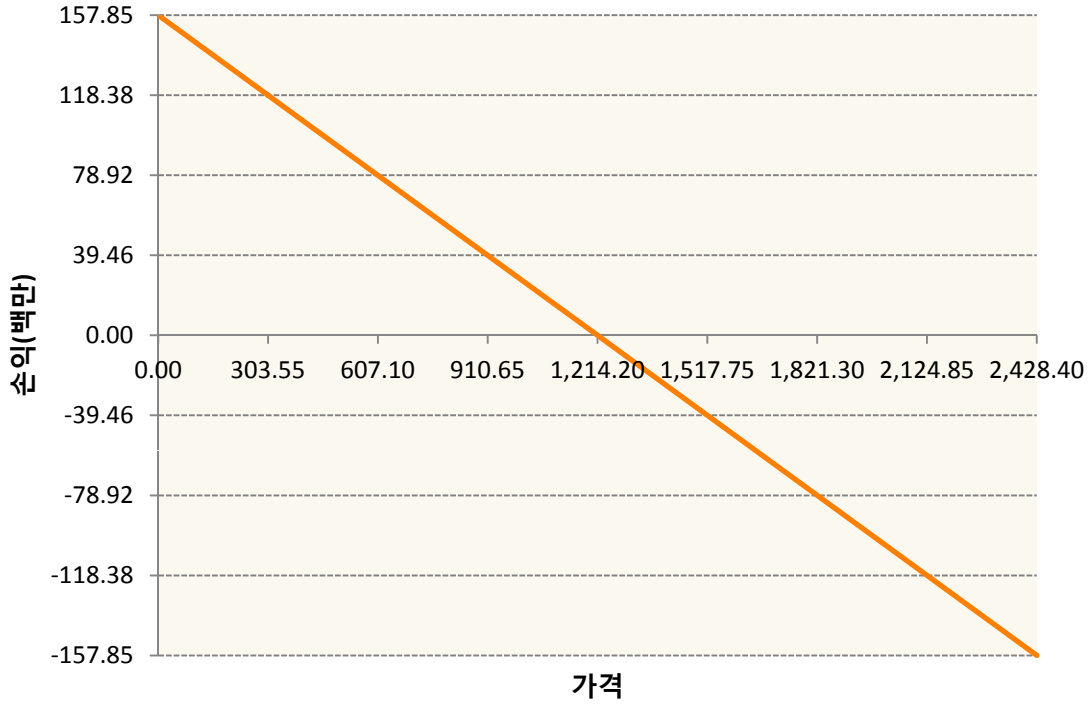
CK0-CORN FUTURE May20



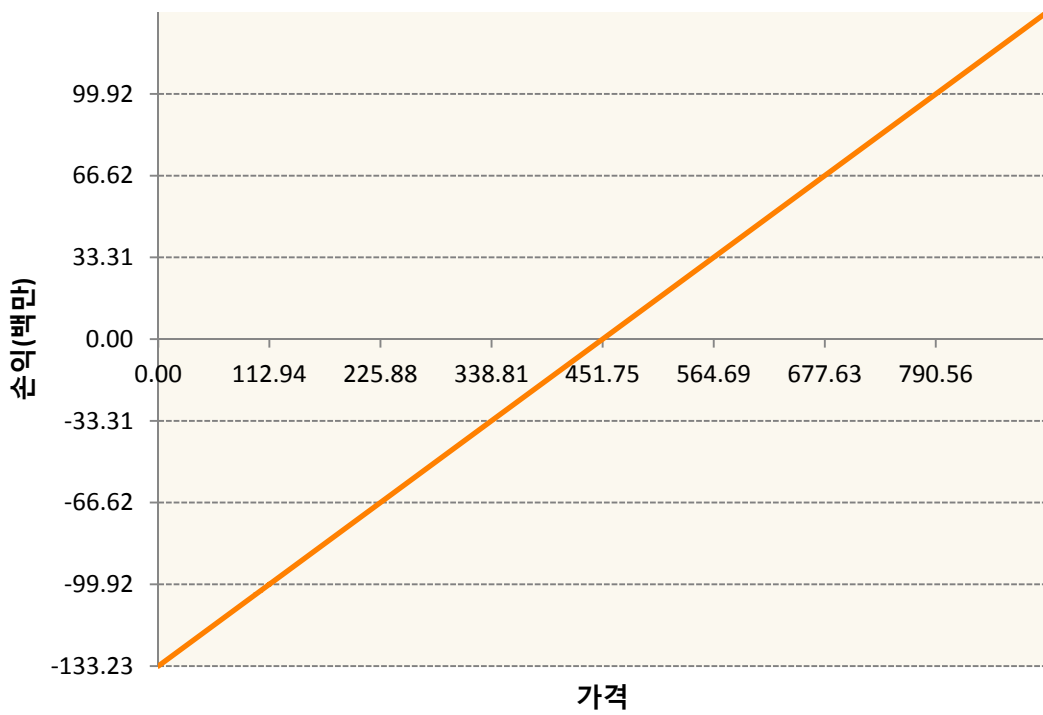




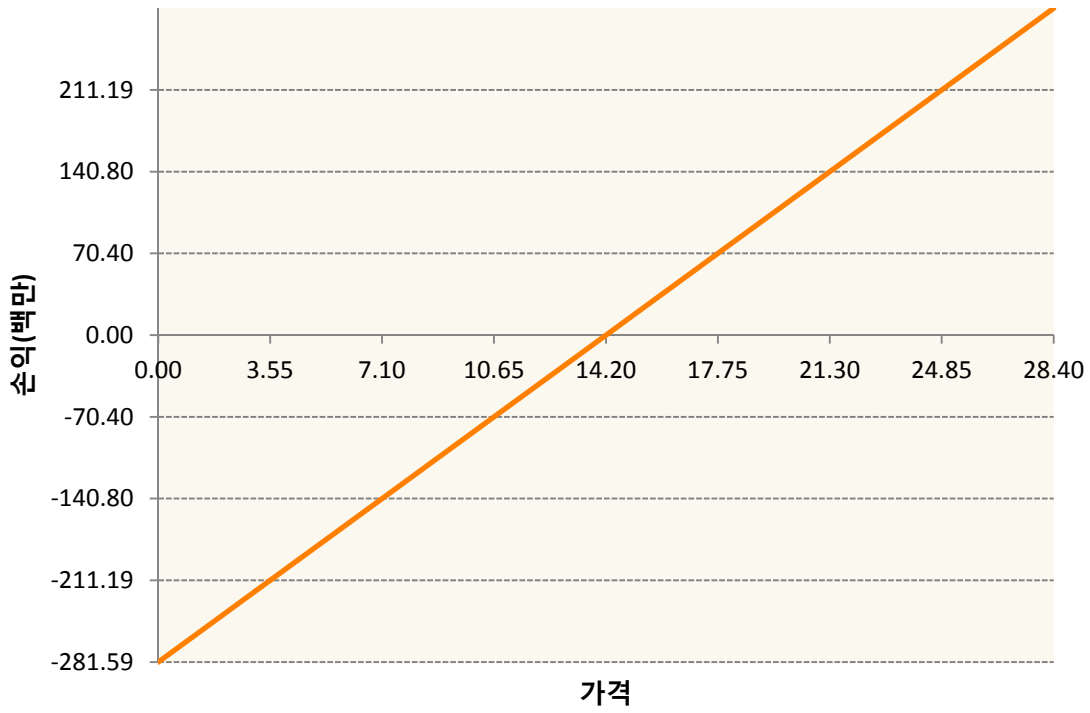
KR4175Q30009-2020-03 달러선물



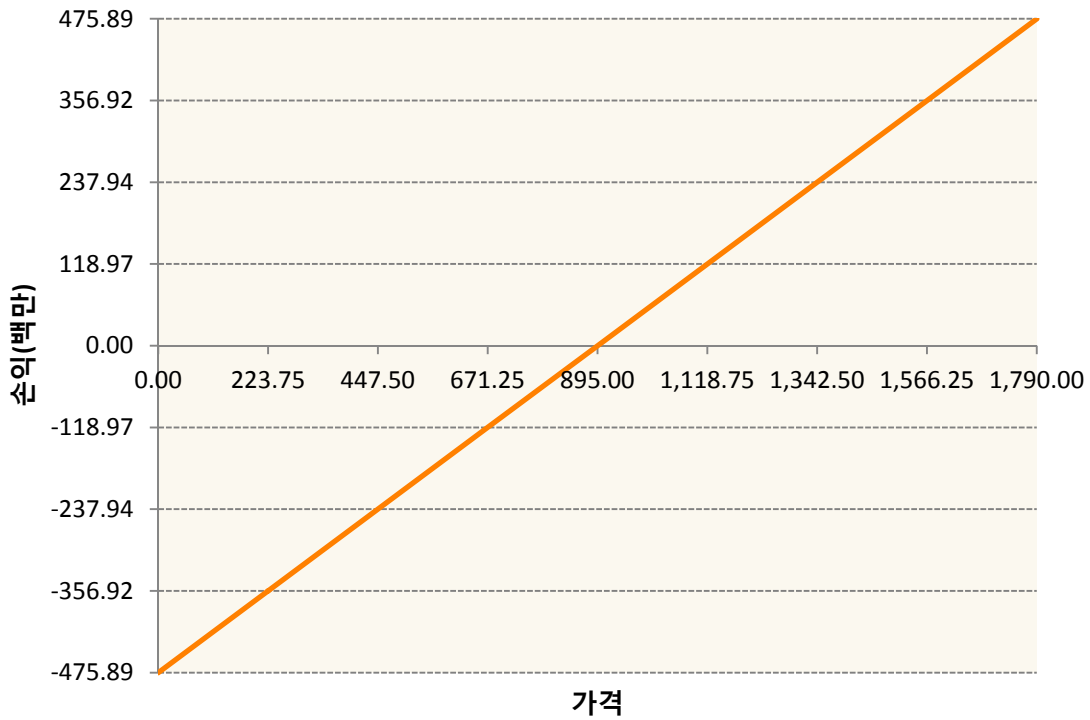
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



SBK0-Sugar May20

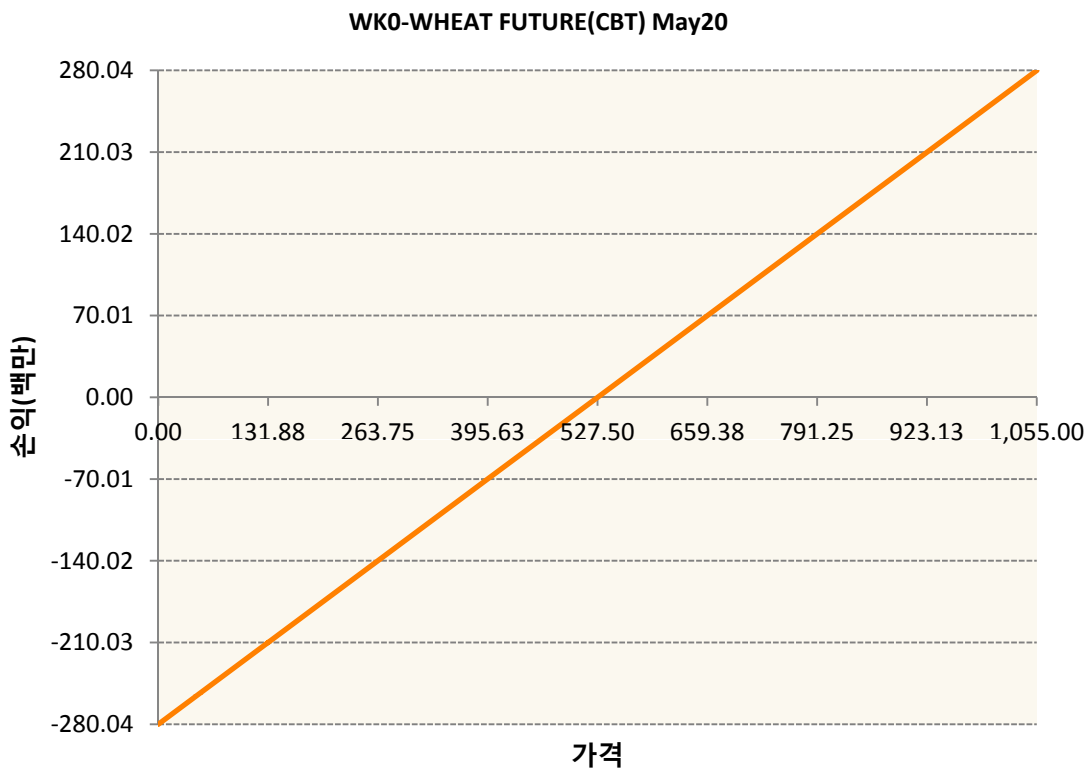
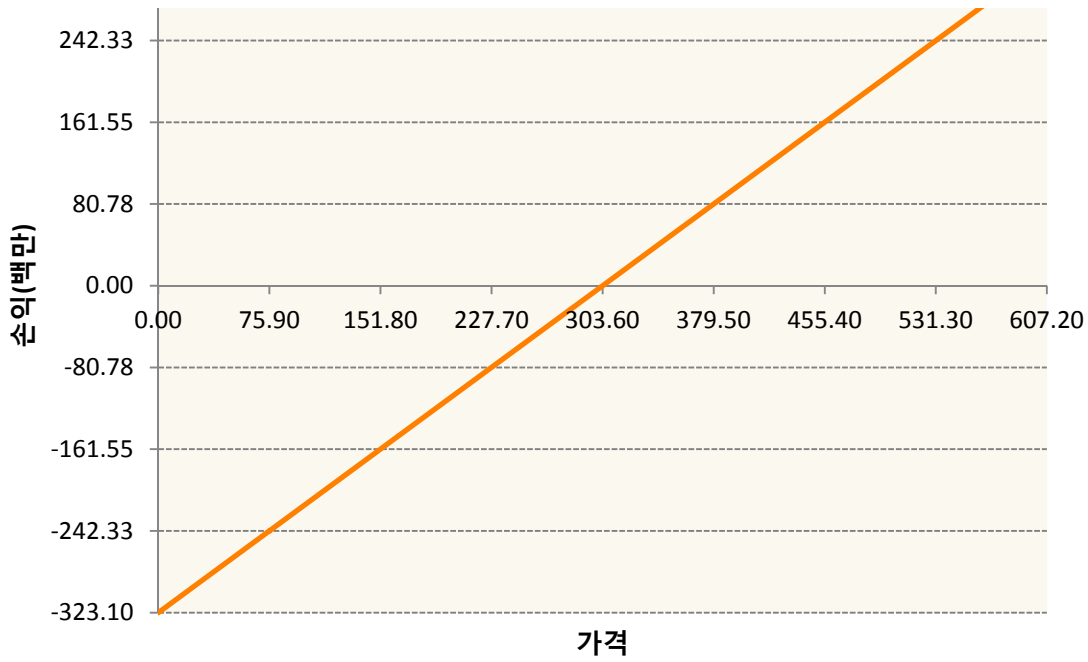


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	18
CK0	CORN FUTURE May20	40
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	23
SK0	SOYBEAN FUTURE May20	38
SMK0	SOYBEAN MEAL FUTR May20	26
WK0	WHEAT FUTURE(CBT) May20	22

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

(단위:백만원)

223