

공시일	2020-03-04
기준일	2020-03-03

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	2020-03-04
기준일	2020-03-03

스마트인덱스모

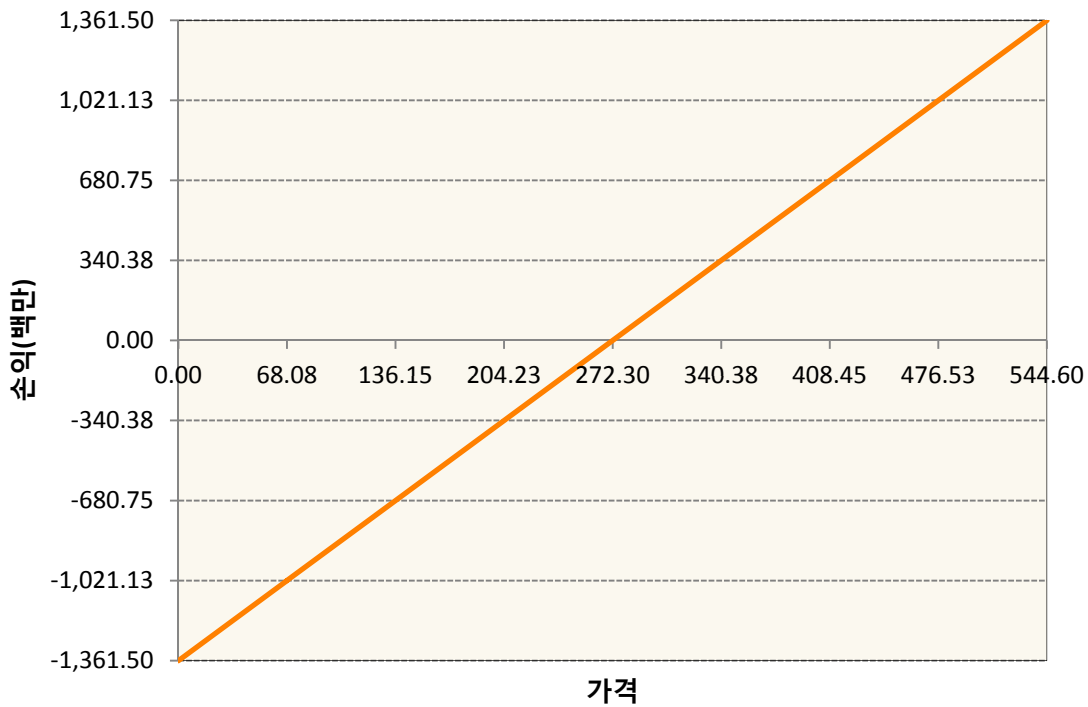
1. 계약금액

(단위:백만원)

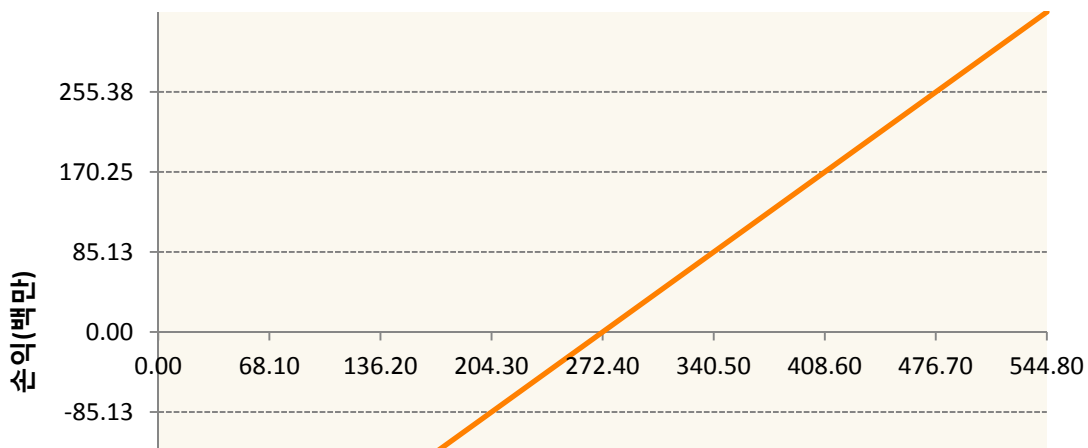
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	691	0	691	장내
누계	유가증권	선물	1,702	0	1,702	장내

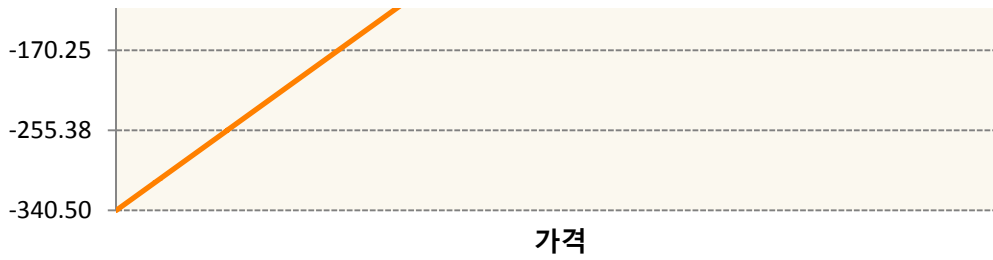
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						109
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-109	-109	-109	-109	-109	-109	-109	
-5.33%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72	
-2.67%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	36	36	36	36	36	36	36	
5.33%	72	72	72	72	72	72	72	
8.00%	109	109	109	109	109	109	109	
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)

119

공시일	2020-03-04
기준일	2020-03-03

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

1,066

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

665

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-04
기준일	2020-03-03

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)	442
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	161

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

945

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-04
기준일	2020-03-03

유로인덱스모(주식-파생형)

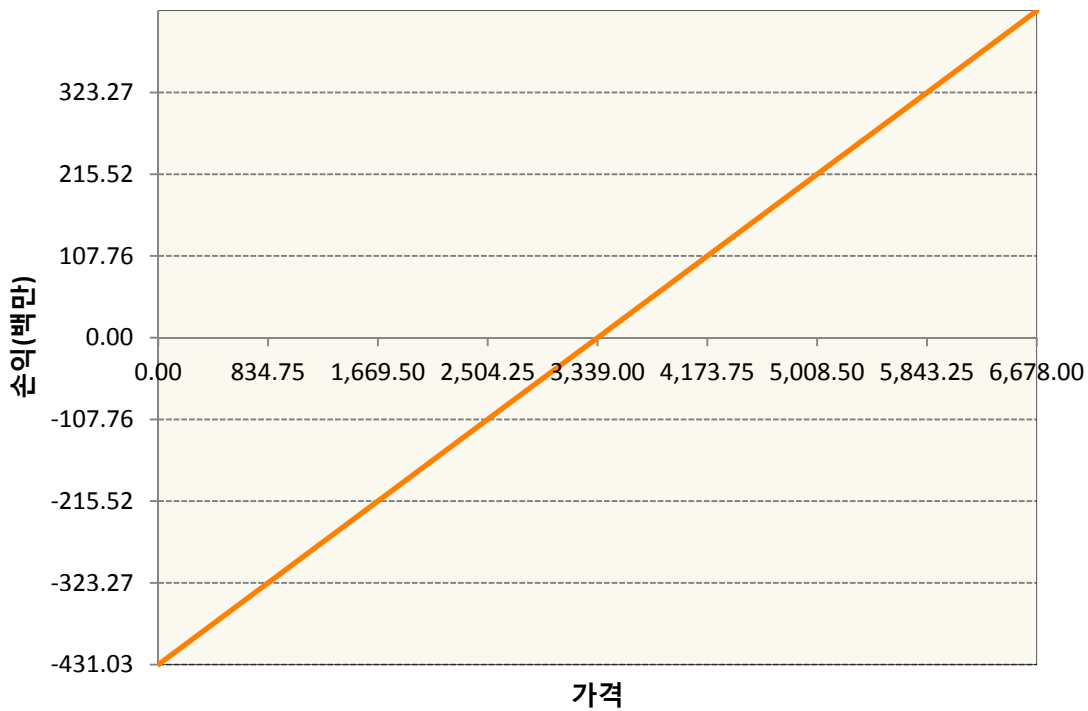
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	431	0	431	

2. 만기시점의 손익구조

VGHO-EURO STOXX 50 Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGHO	EURO STOXX 50 Mar20	34
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

26

공시일	2020-03-04
기준일	2020-03-03

차이나인덱스모(주식-파생형)

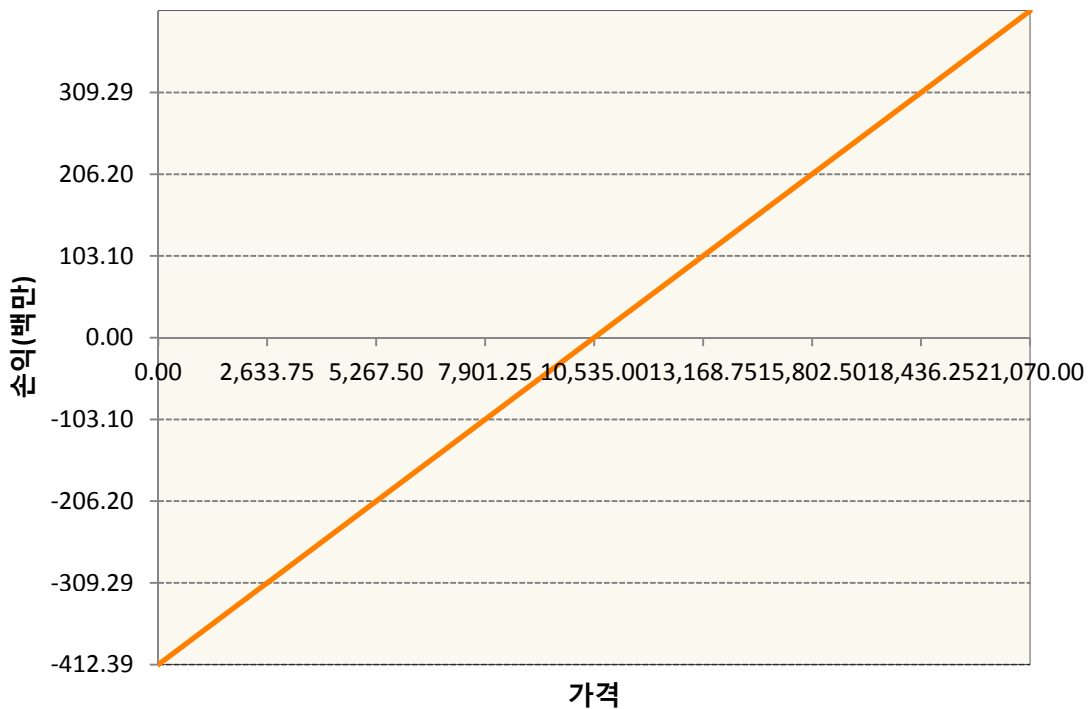
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	412	0	412	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	2020-03-04
기준일	2020-03-03

커버드콜모(주식혼합-파생형)

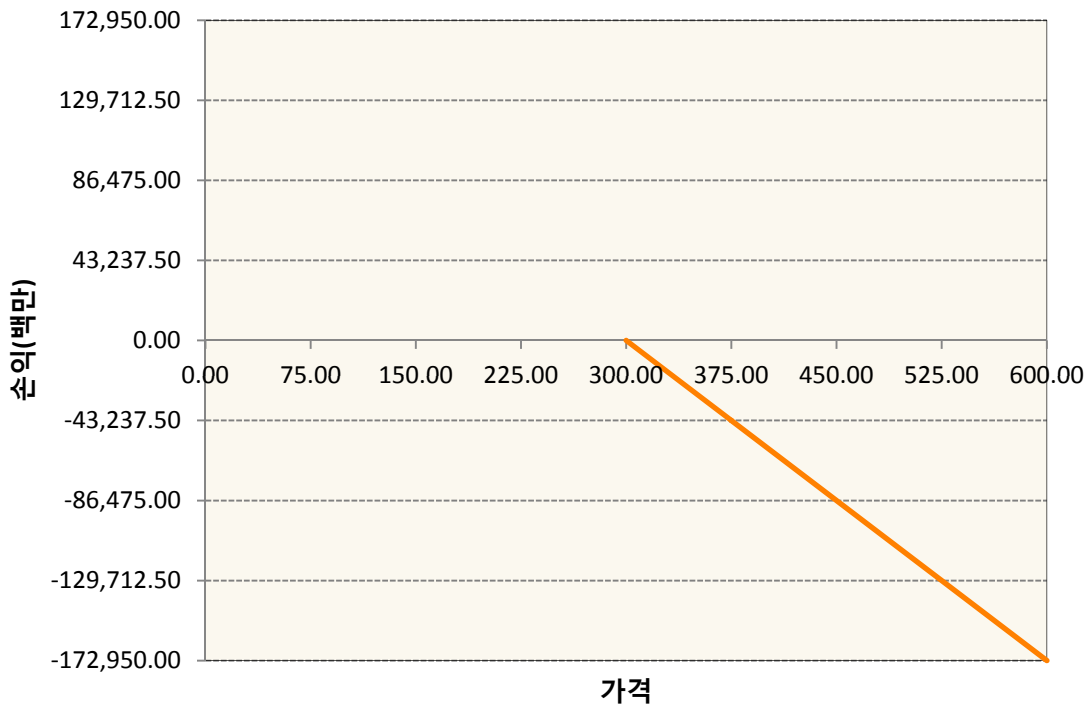
1. 계약금액

(단위:백만원)

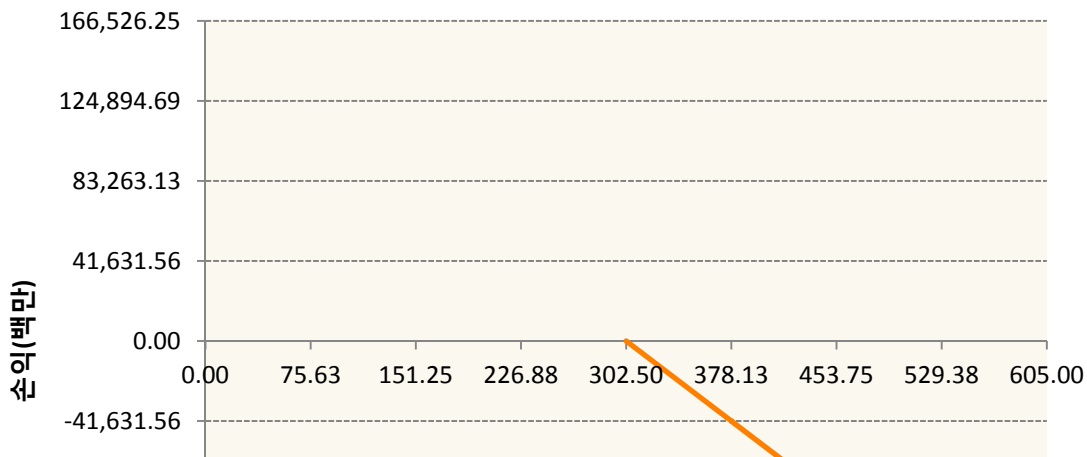
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	448,226	-448,226	장내

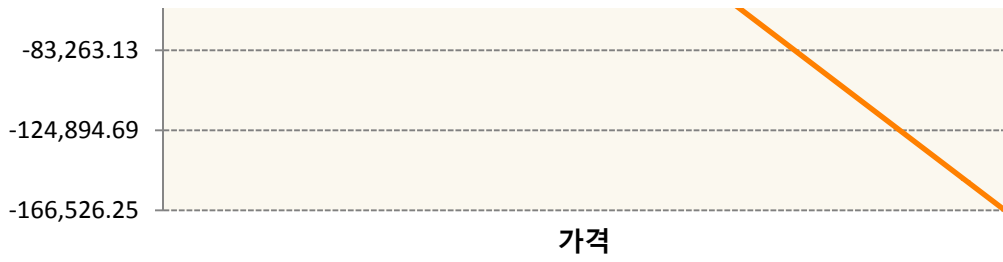
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q33007-2020-03 콜300

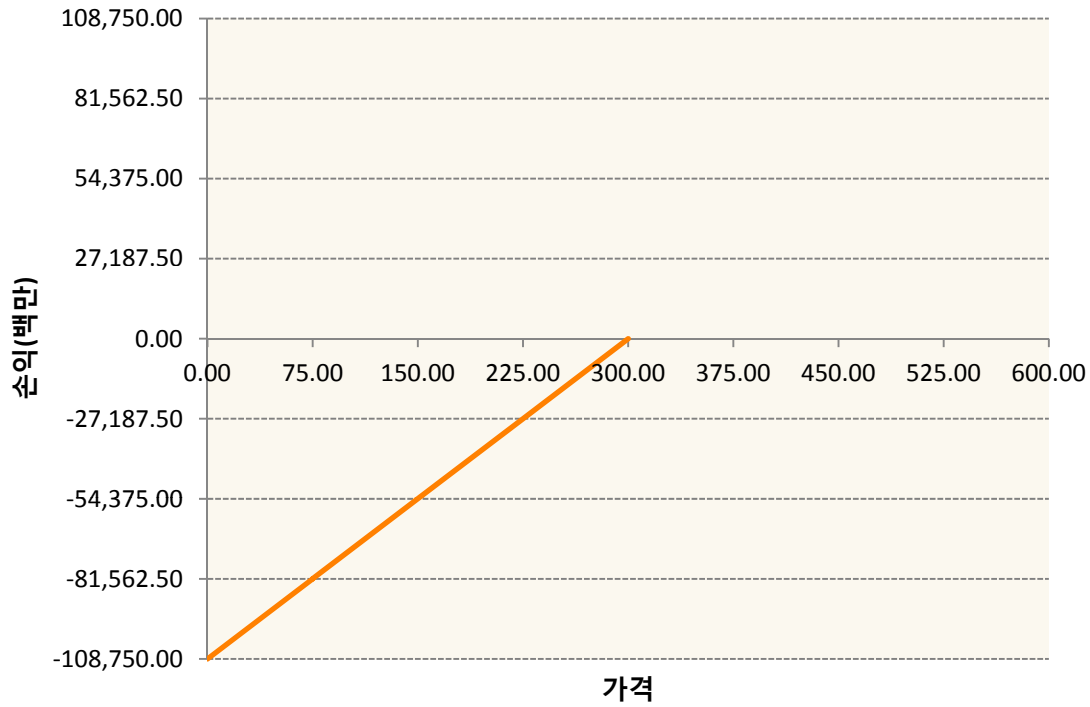


KR4201Q33023-2020-03 콜302.5





KR4301Q33005-2020-03 풋300



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q33007		2020-03 콜300					3,023	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	156	156	156	154	152	146	137	
-5.33%	156	155	152	146	136	118	93	
-2.67%	153	147	134	112	80	35	-23	
0%	132	104	60	0	-78	-172	-283	
2.67%	28	-58	-166	-296	-445	-611	-792	
5.33%	-329	-513	-717	-938	-1,171	-1,415	-1,669	
8.00%	-1,226	-1,513	-1,807	-2,106	-2,408	-2,714	-3,023	
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5					2,464	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	104	104	104	103	101	98	91	

-5.33%	104	103	102	98	91	79	60
-2.67%	102	99	91	76	53	20	-24
0%	91	73	43	0	-58	-132	-221
2.67%	28	-32	-112	-213	-332	-469	-620
5.33%	-209	-352	-517	-700	-898	-1,109	-1,332
8.00%	-861	-1,108	-1,365	-1,631	-1,904	-2,182	-2,464
KR4301Q33005 2020-03 풋300							7,836
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,834	-7,834	-7,834	-7,834	-7,835	-7,835	-7,836
-5.33%	-5,211	-5,211	-5,211	-5,212	-5,213	-5,216	-5,221
-2.67%	-2,587	-2,588	-2,590	-2,594	-2,601	-2,612	-2,628
0%	33	27	17	0	-24	-55	-94
2.67%	2,629	2,602	2,565	2,516	2,457	2,389	2,312
5.33%	5,114	5,035	4,944	4,844	4,734	4,618	4,495
8.00%	7,278	7,133	6,983	6,829	6,673	6,514	6,353

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

(단위:백만원)

10,549

공시일	2020-03-04
기준일	2020-03-03

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

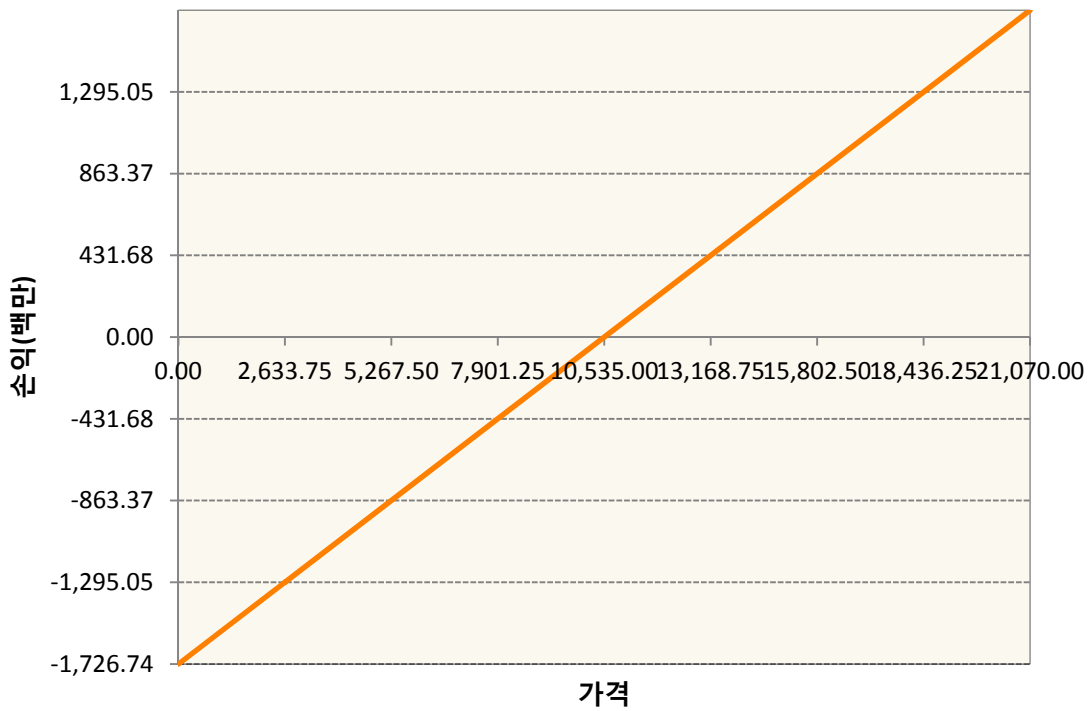
1. 계약금액

(단위:백만원)

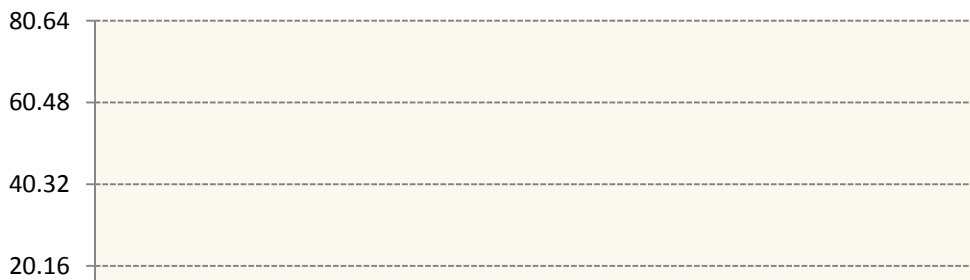
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,727	0	1,727	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,720	-4,720	장내
누계	통화	선도	0	2,163	-2,163	장외

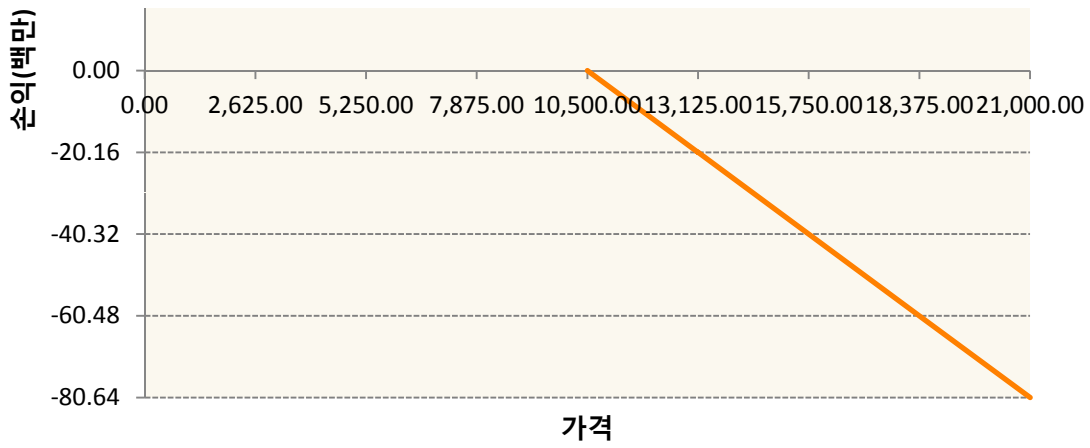
2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20

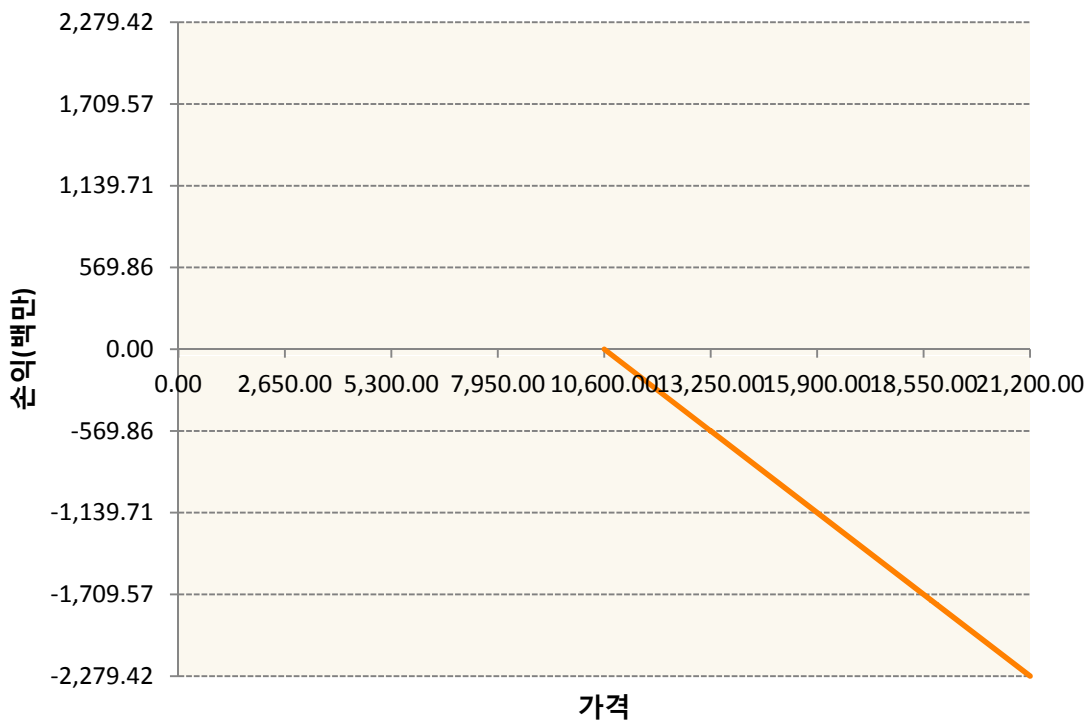


OHHIH0-C105-HSCEI

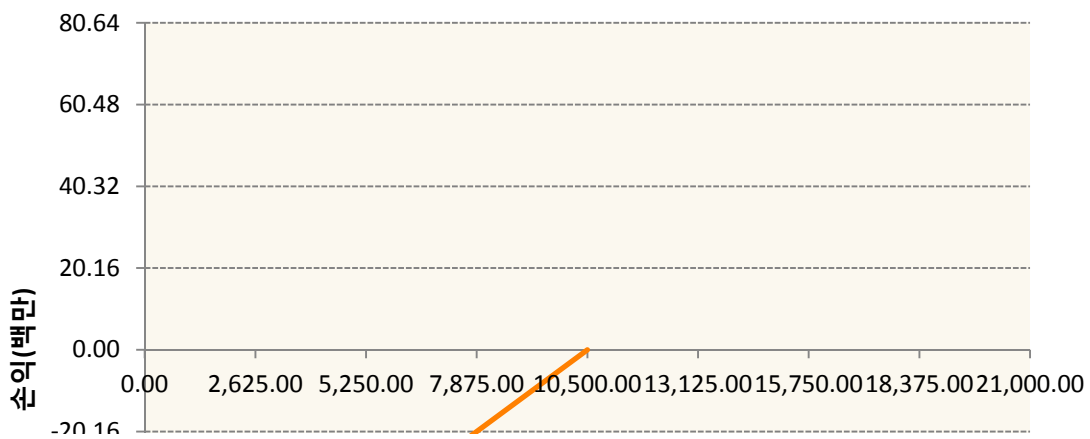


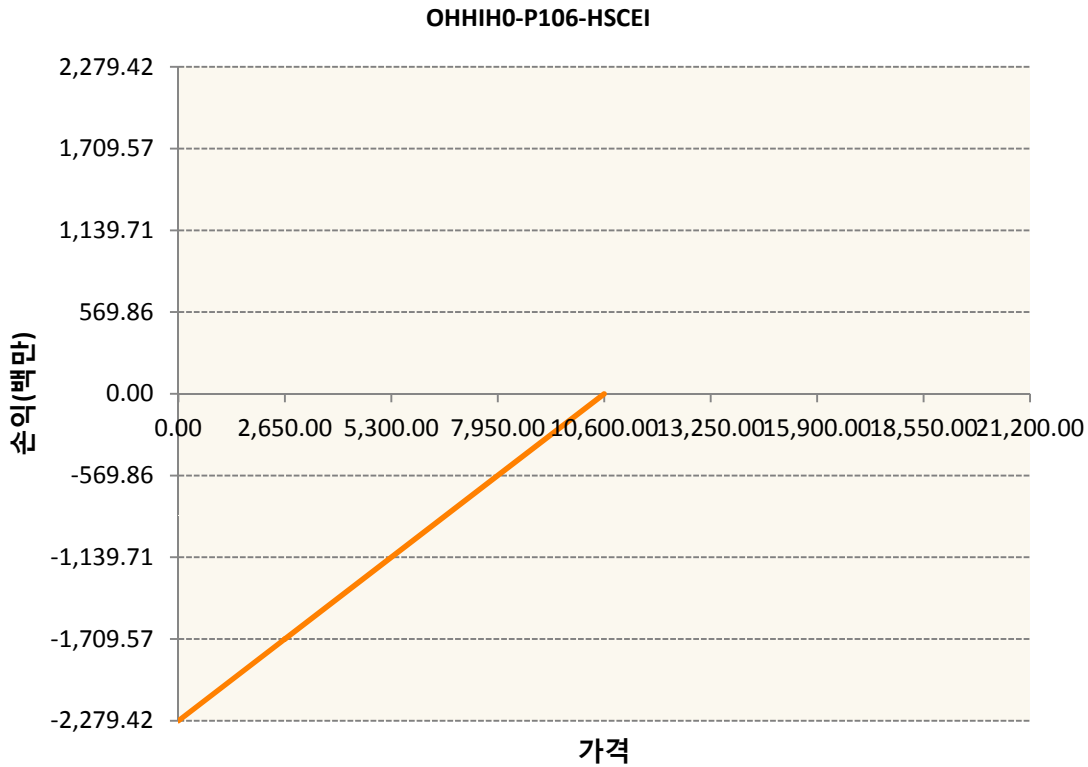
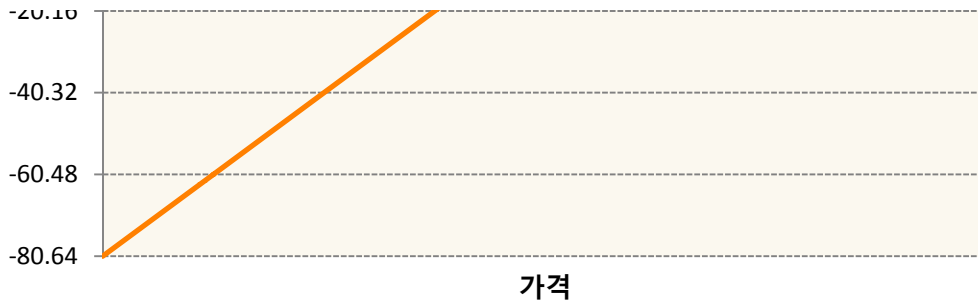


OHHIH0-C106-HSCEI



OHHIH0-P105-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E	173
HCH0 HSCEI Futures Mar20	138
OHHIH0-C1(HSCEI	6
OHHIH0-C1(HSCEI	182
OHHIH0-P1(HSCEI	6
OHHIH0-P1(HSCEI	182

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	526

공시일	2020-03-04
기준일	2020-03-03

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

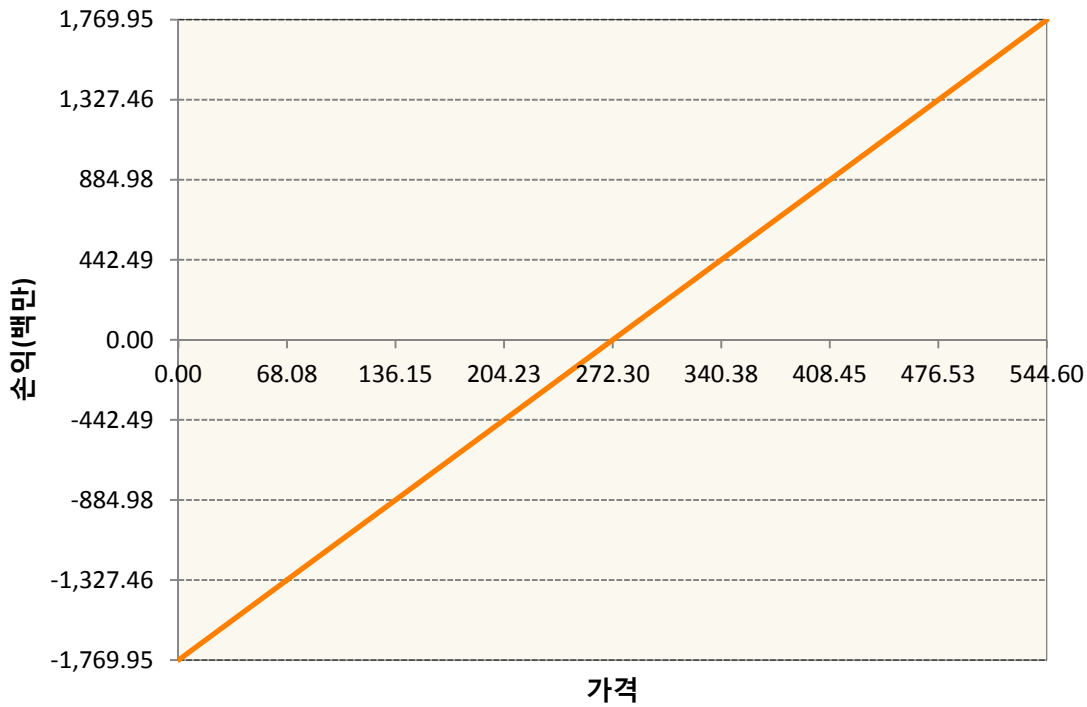
1. 계약금액

(단위:백만원)

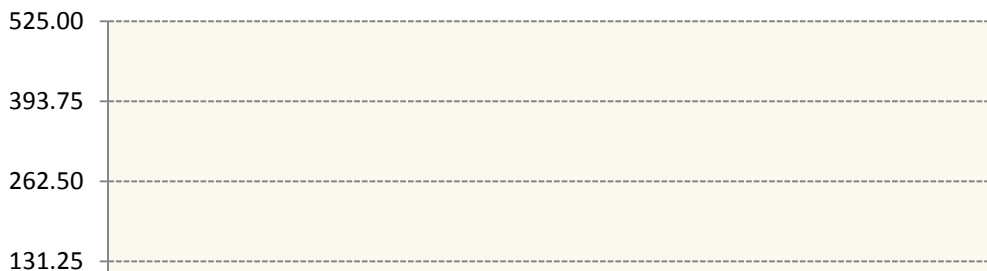
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,770	0	1,770	장내
누계	유가증권	스왑	3,125	0	3,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,612	-3,612	장내

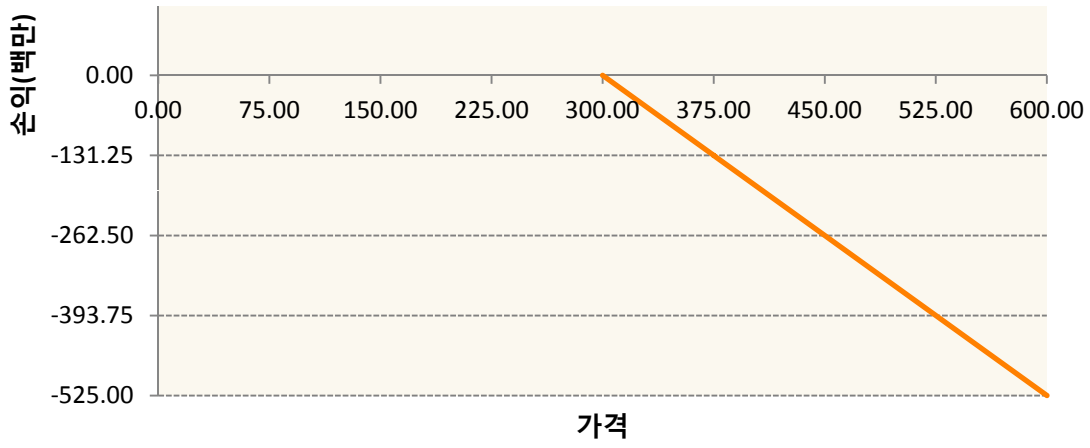
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

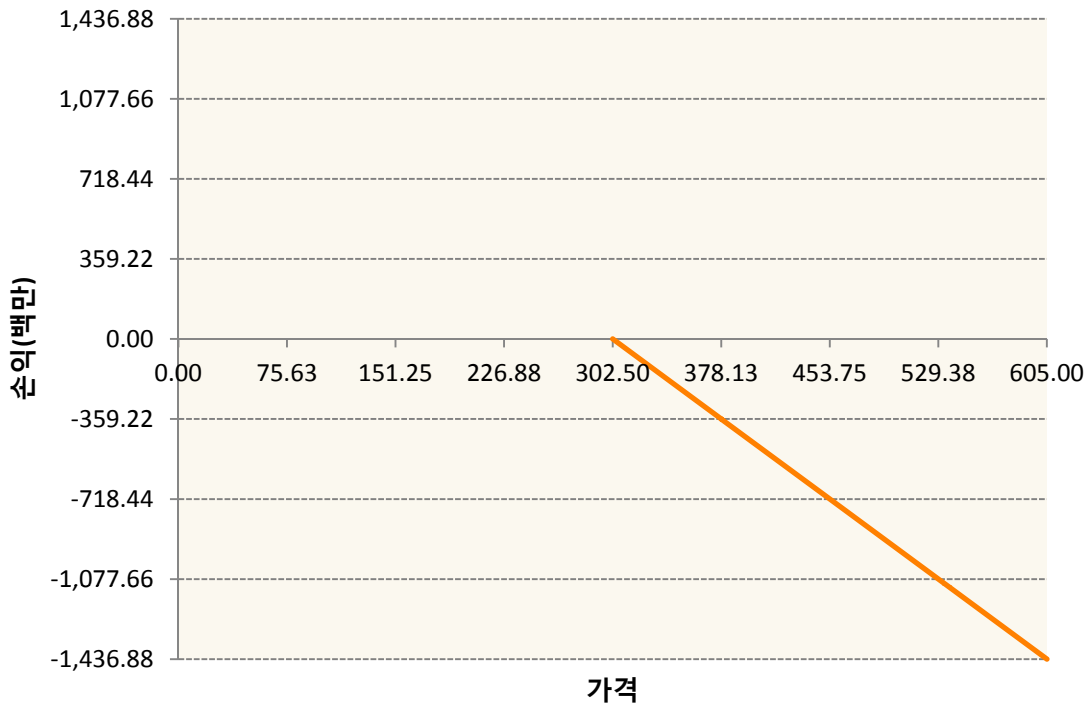


KR4201Q33007-2020-03 콜300

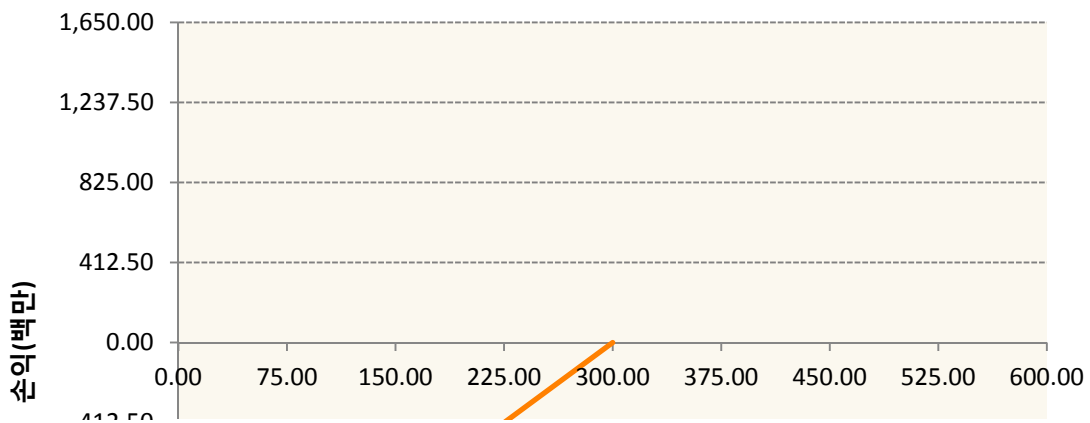




KR4201Q33023-2020-03 콜302.5



KR4301Q33005-2020-03 풋300





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						269
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-269	-269	-269	-269	-269	-269	-269	
-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%	269	269	269	269	269	269	269	
KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						141
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-141	-141	-141	-141	-141	-141	-141	
-5.33%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94	
-2.67%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	47	47	47	47	47	47	47	
5.33%	94	94	94	94	94	94	94	
8.00%	141	141	141	141	141	141	141	
KR4201Q33007		2020-03 콜300						9
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0	
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0	
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	
0%	0	0	0	0	0	-1	-1	
2.67%	0	0	-1	-1	-1	-2	-2	
5.33%	-1	-2	-2	-3	-4	-4	-5	
8.00%	-4	-5	-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	0	0	0
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	0	0	-1	-2	-3	-4	-5
5.33%	-2	-3	-4	-6	-8	-10	-11
8.00%	-7	-10	-12	-14	-16	-19	-21
KR4301Q33005 2020-03 풋300							119
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-40	-40
0%	1	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	40	39	39	38	37	36	35
5.33%	78	76	75	73	72	70	68
8.00%	110	108	106	104	101	99	96

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

(단위:백만원)

529

공시일	2020-03-04
기준일	2020-03-03

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

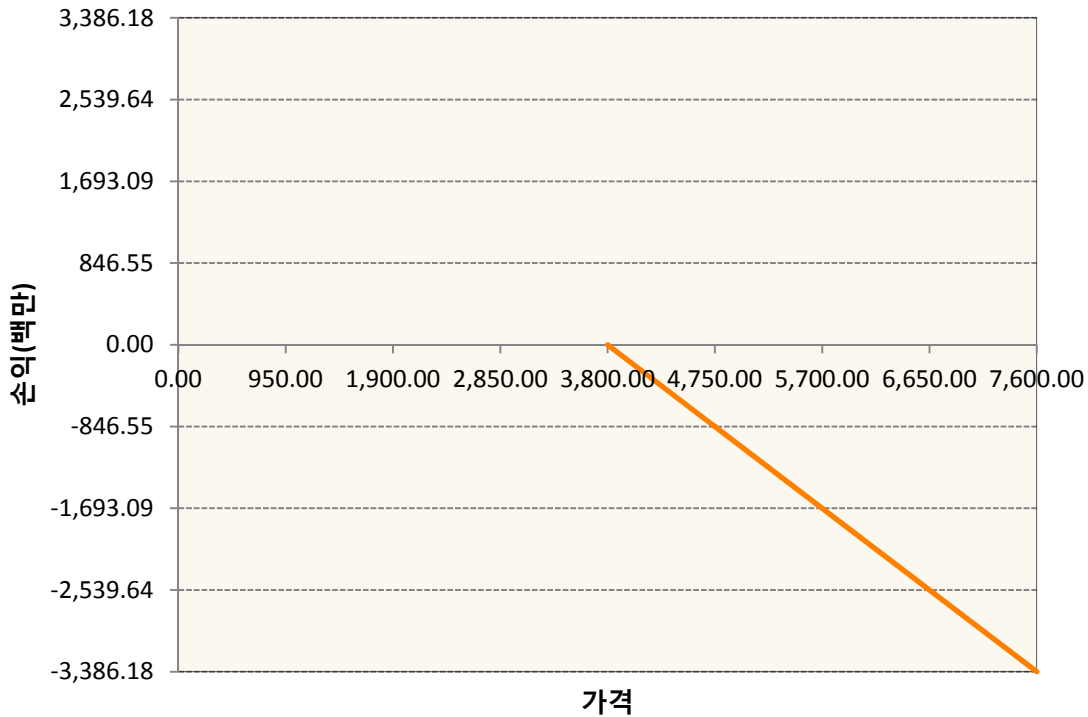
1. 계약금액

(단위:백만원)

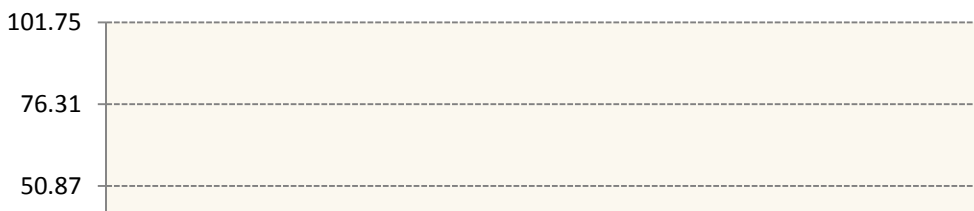
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	438	0	438	
누계	유가증권	스왑	11,971	0	11,971	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,178	-7,178	장내
누계	통화	선도	532	3,490	-2,958	장외

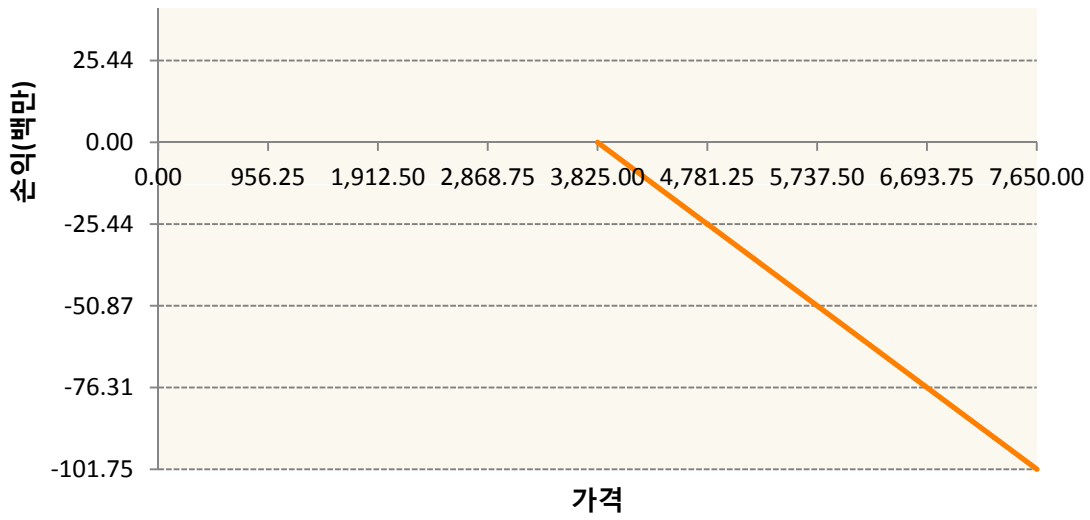
2. 만기시점의 손익구조

OESXH0-C3800-EURO STOXX 50

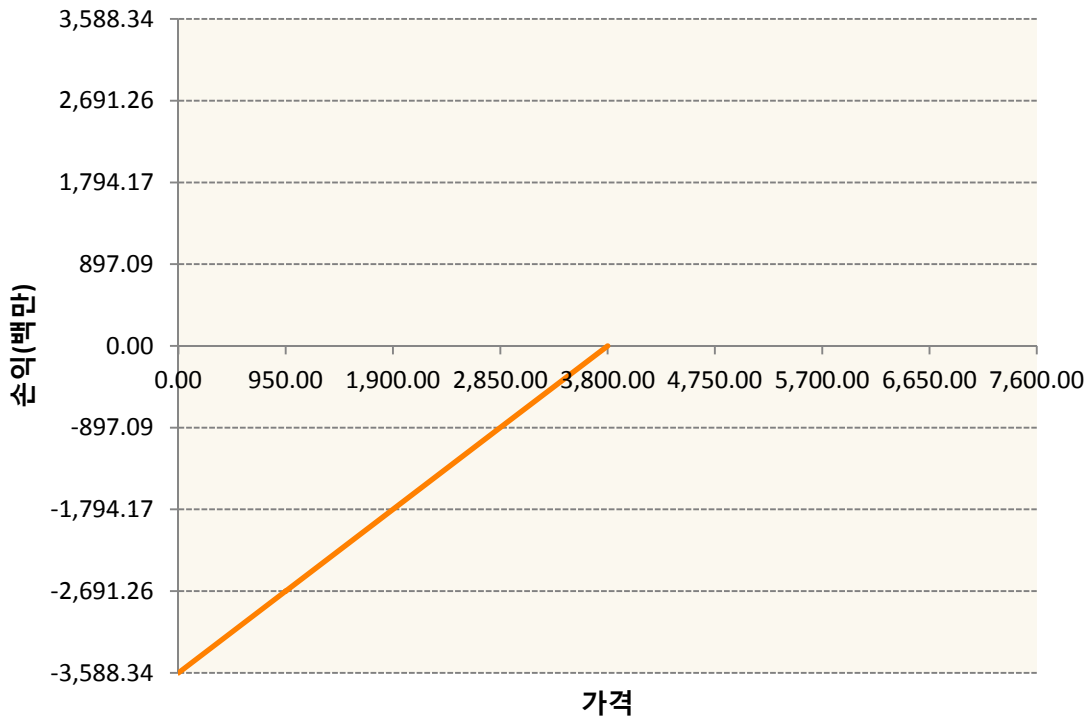


OESXH0-C3825-EURO STOXX 50



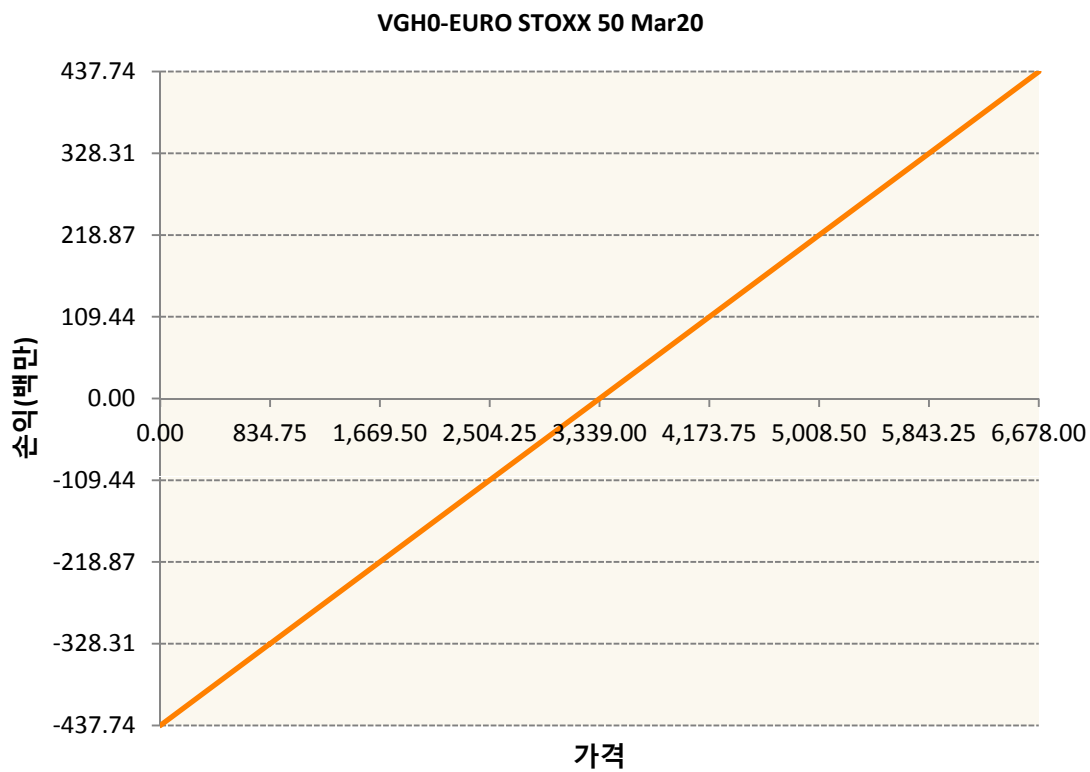
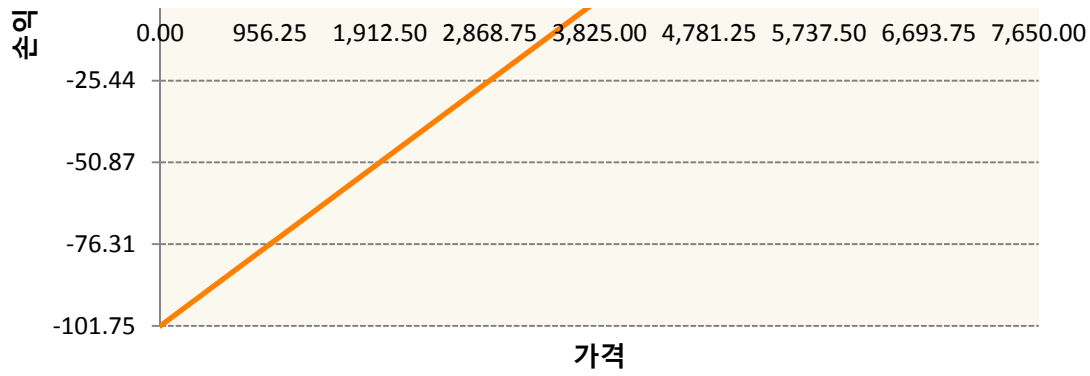


OESXH0-P3800-EURO STOXX 50



OESXH0-P3825-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	93
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	279
FX21020H00 EUR/KRW 27-03-20E	43
OESXH0-C3& EURO STOXX 50	271
OESXH0-C3& EURO STOXX 50	8
OESXH0-P3& EURO STOXX 50	287
OESXH0-P3& EURO STOXX 50	8
VGHO EURO STOXX 50 Mar20	35

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

(단위:백만원)

729

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

(단위:백만원)

922

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	2020-03-04
기준일	2020-03-03

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

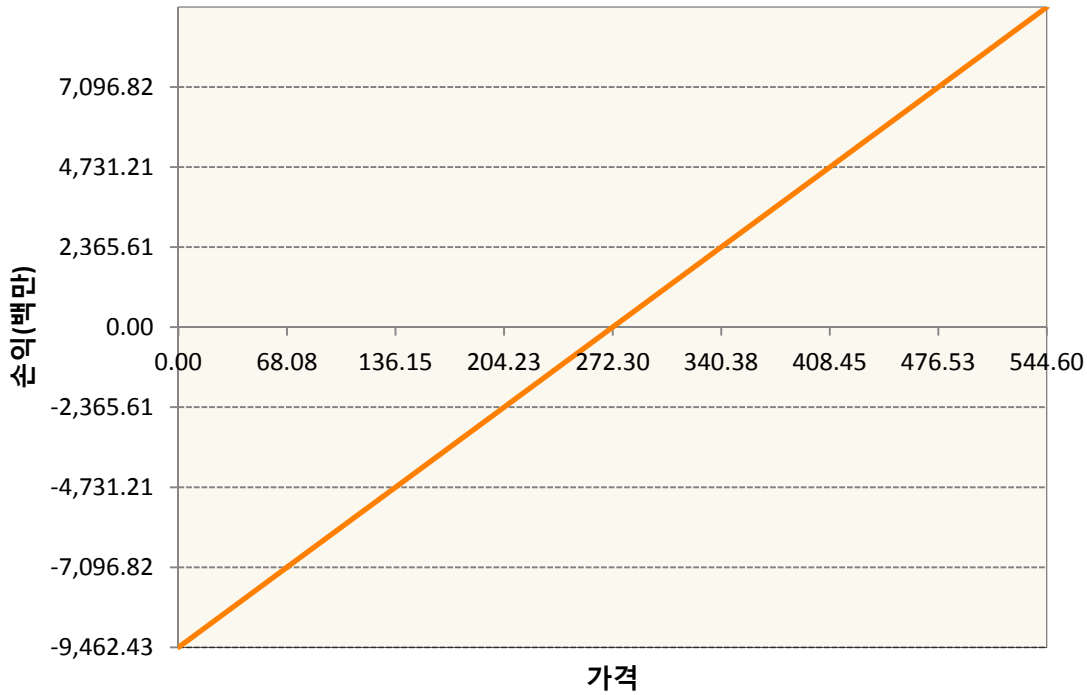
1. 계약금액

(단위:백만원)

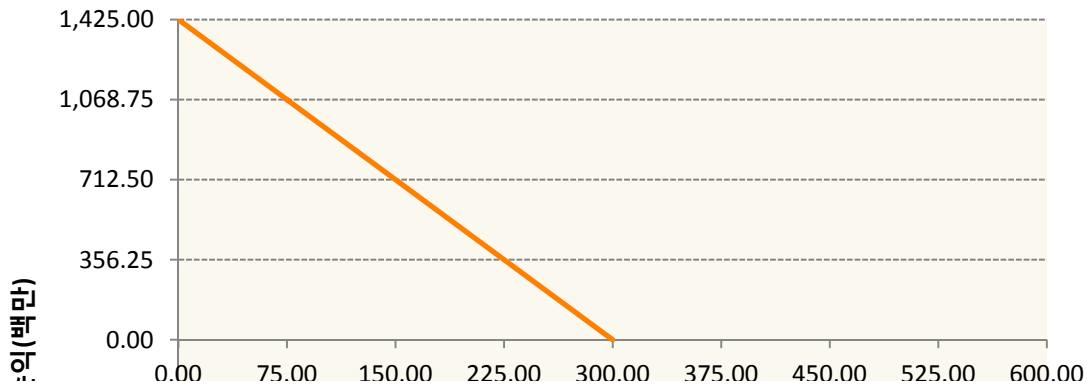
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,462	0	9,462	장내
누계	유가증권	옵션	2,257	0	2,257	장내

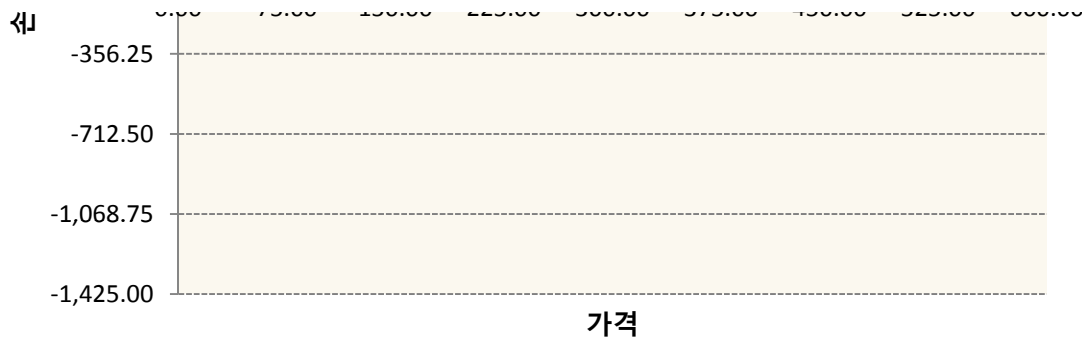
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

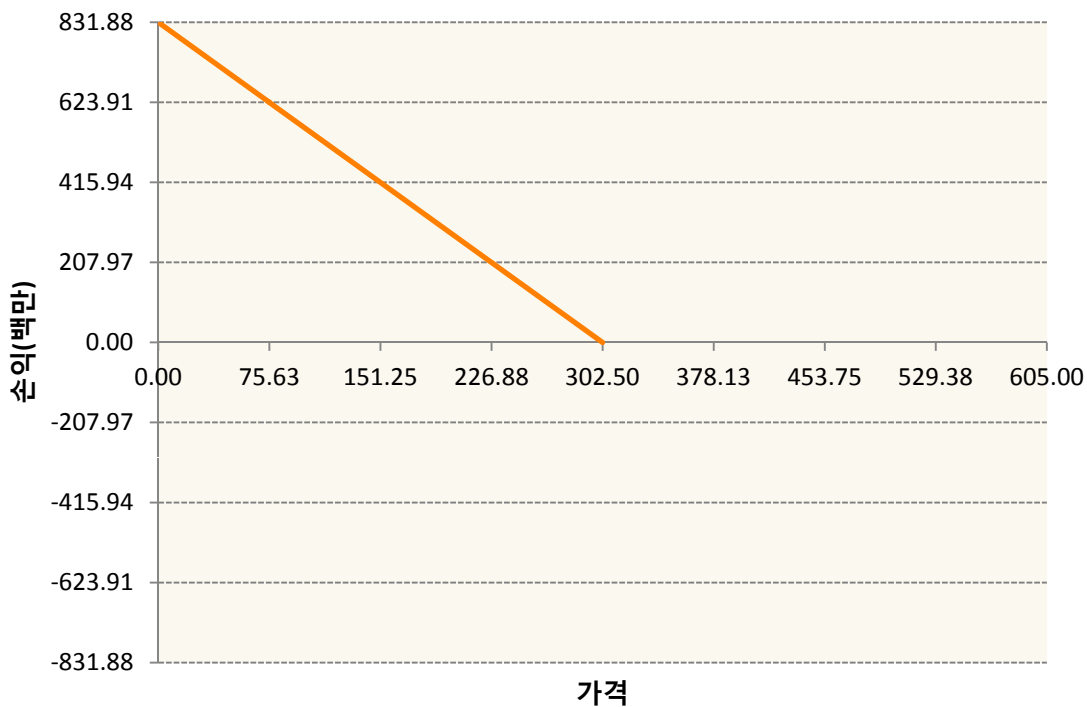


KR4301Q33005-2020-03 풋300





KR4301Q33021-2020-03 풋302.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						755
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-755	-755	-755	-755	-755	-755	-755	-755
-5.33%	-503	-503	-503	-503	-503	-503	-503	-503
-2.67%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	252	252	252	252	252	252	252	252
5.33%	503	503	503	503	503	503	503	503
8.00%	755	755	755	755	755	755	755	755
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	68	68
-2.67%	34	34	34	34	34	34	34
0%	0	0	0	0	0	1	1
2.67%	-34	-34	-34	-33	-32	-31	-30
5.33%	-67	-66	-65	-63	-62	-61	-59
8.00%	-95	-93	-92	-89	-87	-85	-83

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%	20	20	20	20	20	20	20
0%	0	0	0	0	0	0	1
2.67%	-20	-20	-20	-19	-19	-19	-18
5.33%	-39	-39	-38	-38	-37	-36	-35
8.00%	-57	-56	-55	-54	-53	-51	-50

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

(단위:백만원)

823

공시일	2020-03-04
기준일	2020-03-03

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	207,388	0	207,388	

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	2020-03-04
기준일	2020-03-03

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	10,514	-10,514	
누계	유가증권	수익증권	132,360	0	132,360	

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	2020-03-04
기준일	2020-03-03

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	514,503	0	514,503	
누계	통화	선도	17,928	520,390	-502,462	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,539
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,434
FX21020F03 KRW/USD 31-03-20E	3,060
FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E	2,868
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,582
FX21020G00 KRW/USD 06-03-20E	2,390
FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	956
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,186
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,214
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	956
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	1,912
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	3,289
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,289
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,912
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,825
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,237
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,912
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	191
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	4,876
FX21020G06 USD/KRW 31-03-20E	478
FX21020H00 USD/KRW 31-03-20E	956

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

15,107

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

(단위:백만원)

123

공시일	2020-03-04
기준일	2020-03-03

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

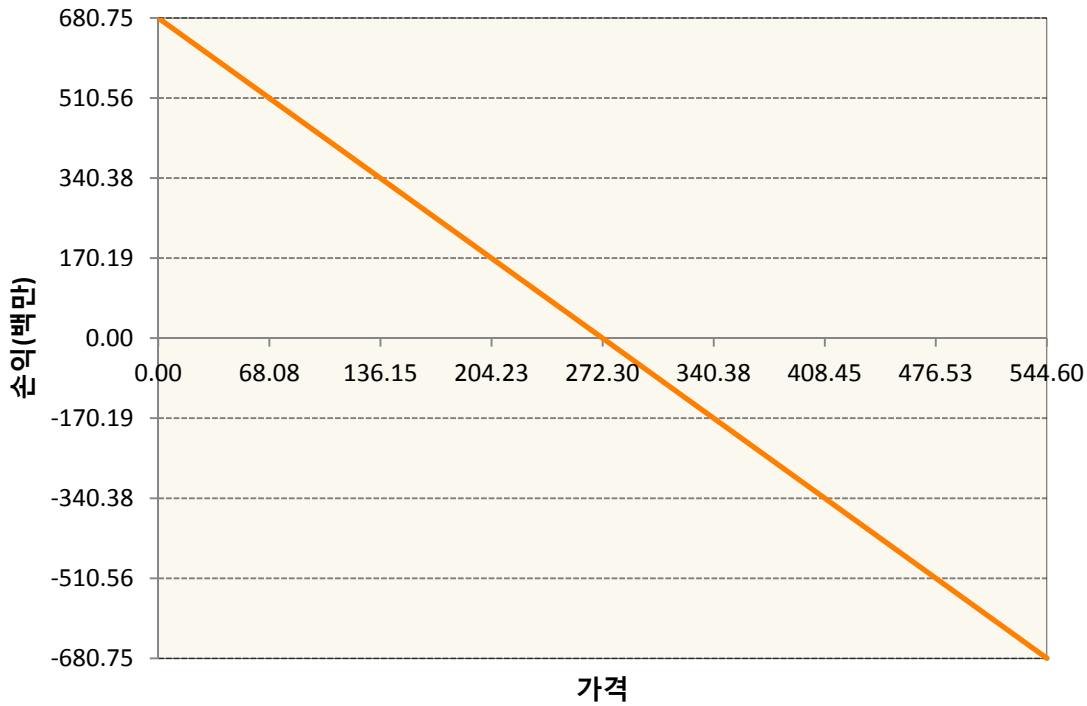
1. 계약금액

(단위:백만원)

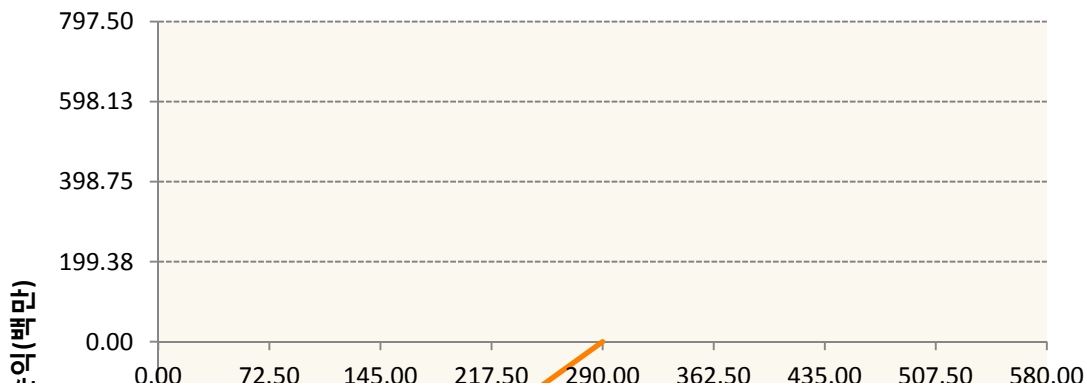
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	681	-681	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,503	-3,503	장내

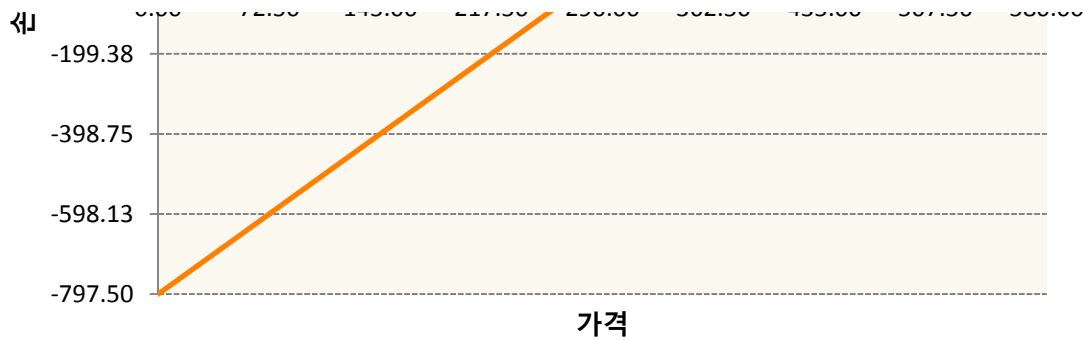
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

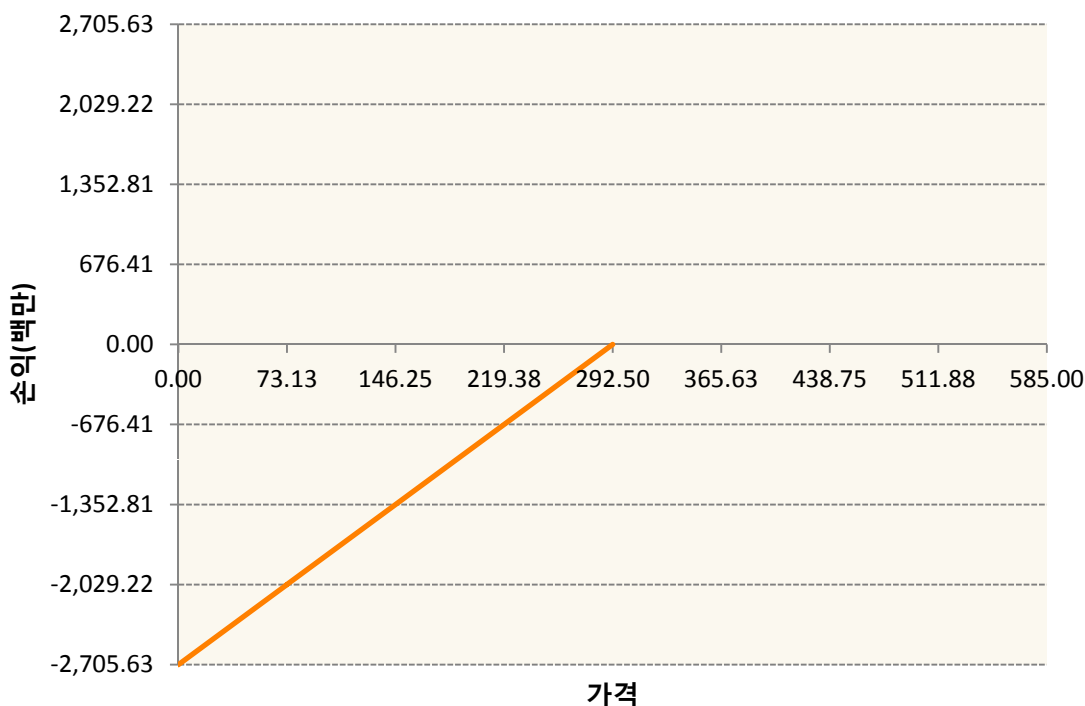


KR4301Q32908-2020-03 풋290





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						58
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-5.33%	-38	-38	-38	-38	-38	-39	-39
-2.67%	-18	-19	-19	-19	-19	-19	-20
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	19	19	18	17	16	15	14
5.33%	35	33	32	31	30	28	27
8.00%	45	43	42	41	40	38	37

KR4301Q32924 2020-03 풋292.5 198

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-197	-197	-197	-197	-197	-198	-198
-5.33%	-130	-130	-131	-131	-131	-131	-131
-2.67%	-64	-64	-64	-64	-65	-66	-67
0%	3	2	1	0	-1	-3	-5
2.67%	66	64	62	60	57	54	51
5.33%	121	118	114	110	106	102	98
8.00%	162	157	153	148	144	140	135

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

(단위:백만원)

317

공시일	2020-03-04
기준일	2020-03-03

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	532	-532	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	9,444	0	9,444	
누계	통화	선도	633	10,111	-9,478	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	325
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	90
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	181
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	213
FX21020H00 USD/KRW 12-03-20E	12
FX21020H00 USD/KRW 12-03-20E	38
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

302

공시일	2020-03-04
기준일	2020-03-03

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

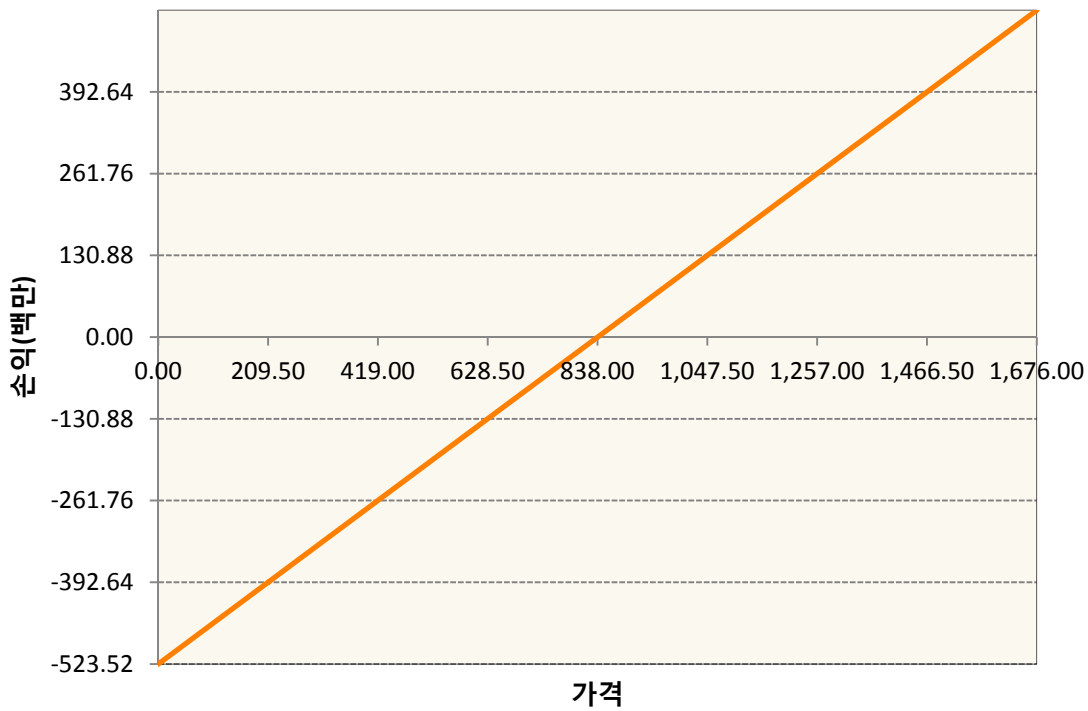
1. 계약금액

(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	524	0	524	
누계	유가증권	스왑	1,097	0	1,097	장외
누계	통화	선도	146	731	-585	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	42

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

(단위:백만원)

123

공시일	2020-03-04
기준일	2020-03-03

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

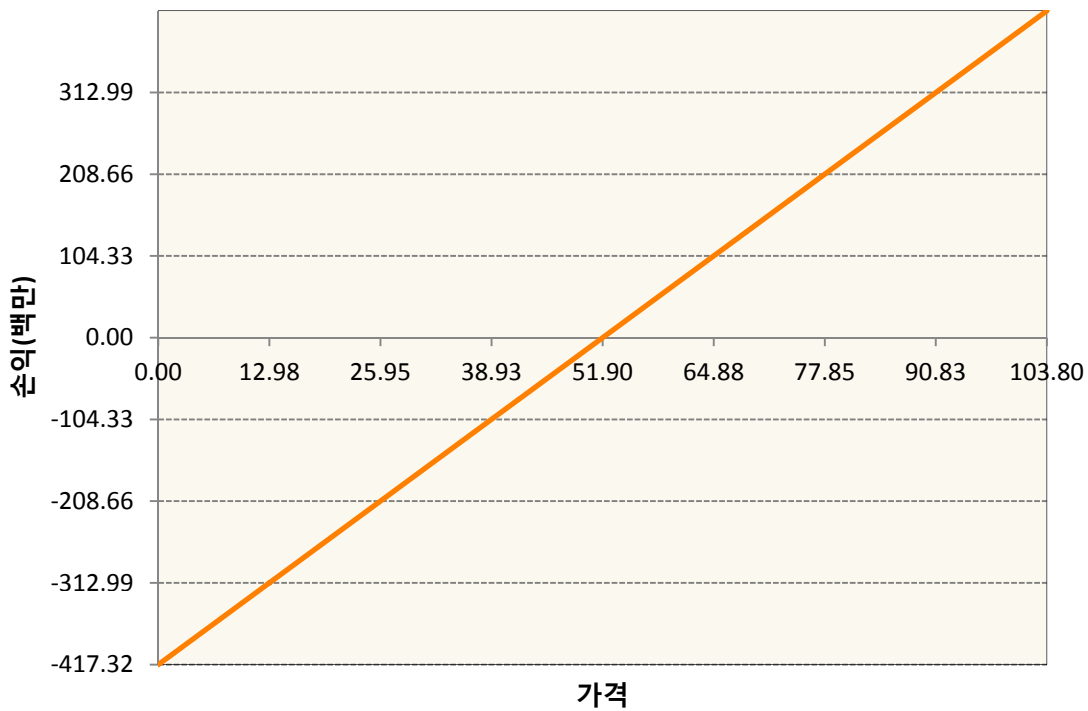
1. 계약금액

(단위:백만원)

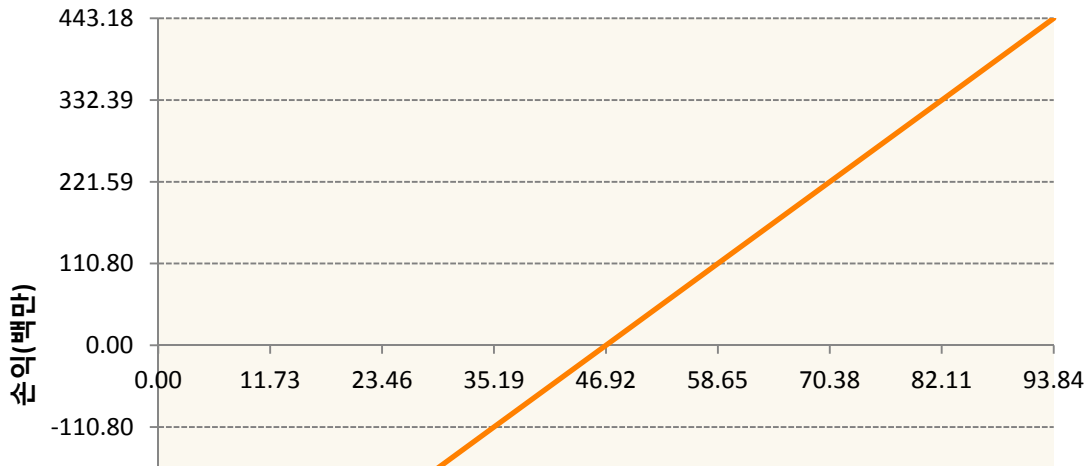
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,919	119	1,799	

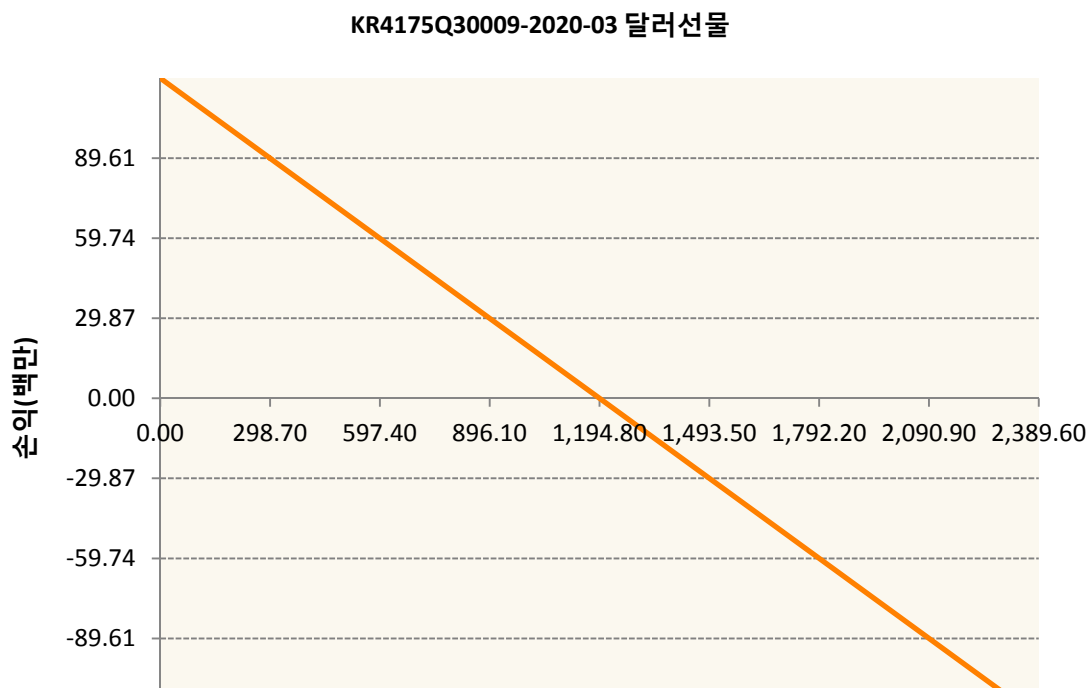
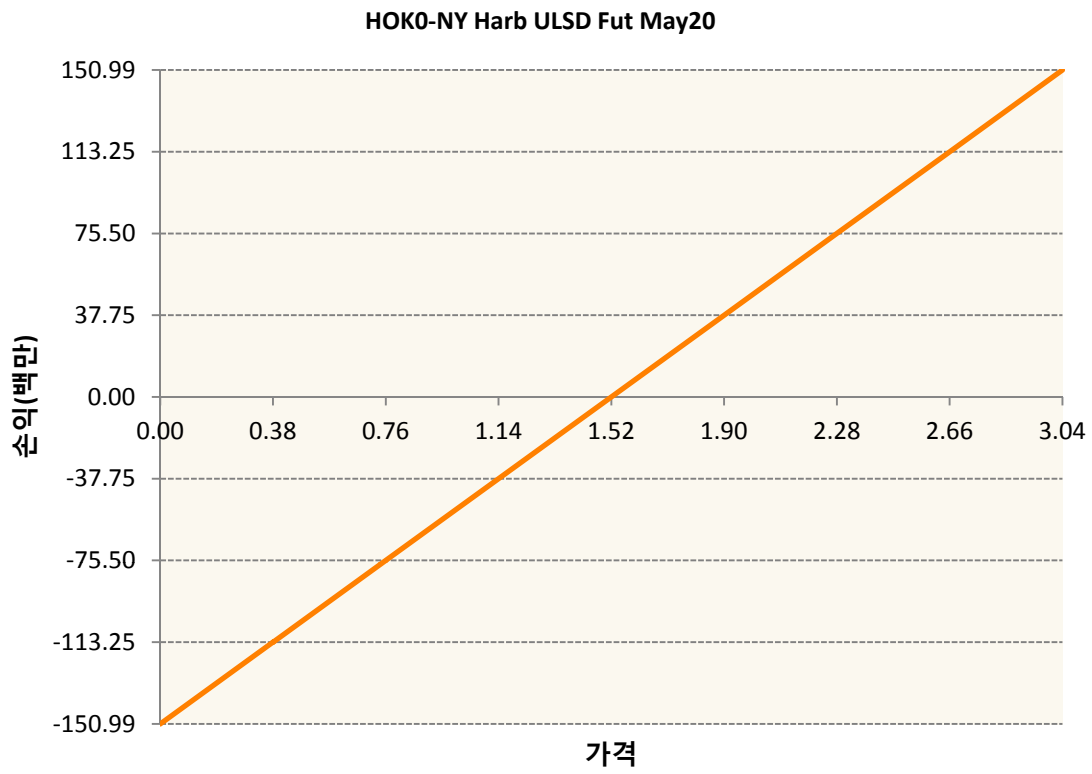
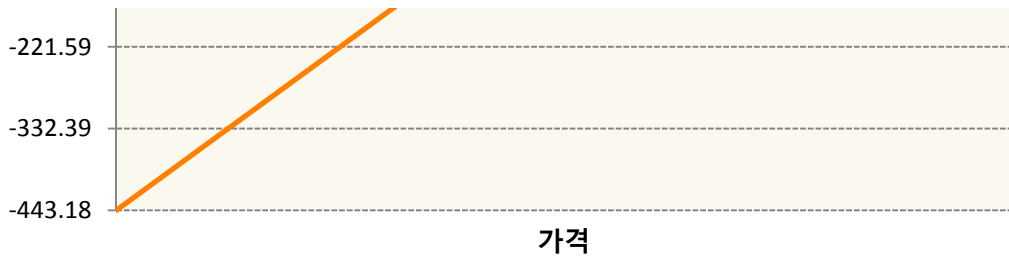
2. 만기시점의 손익구조

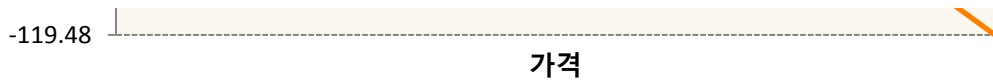
COK0-BRENT CRUDE FUTR May20



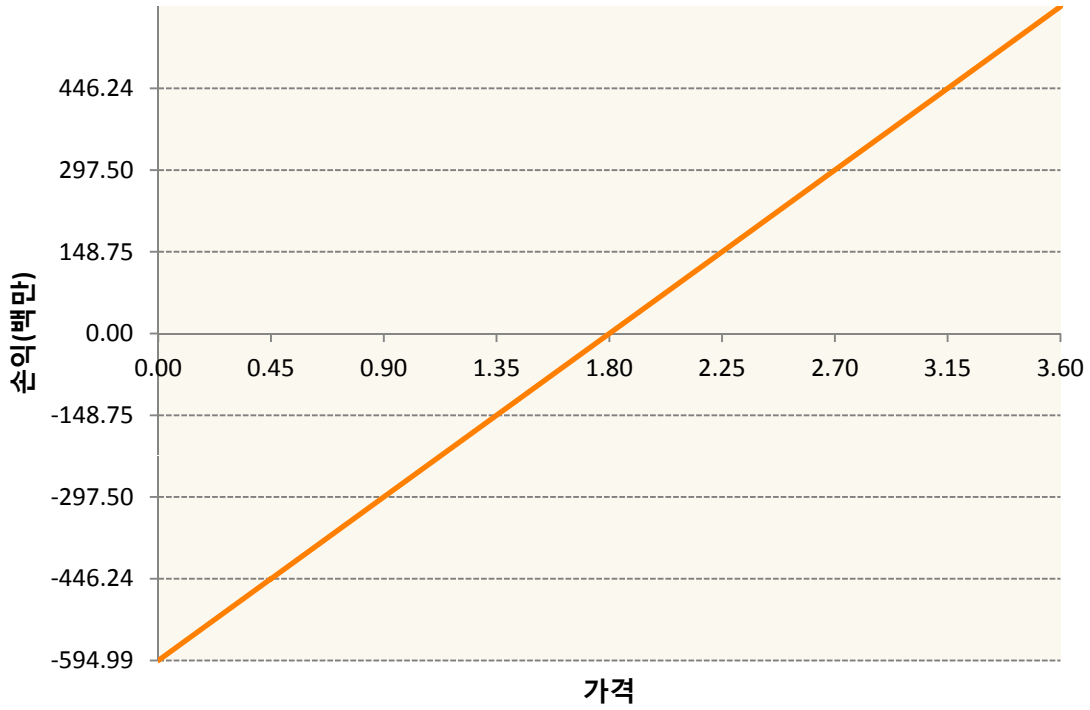
CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20



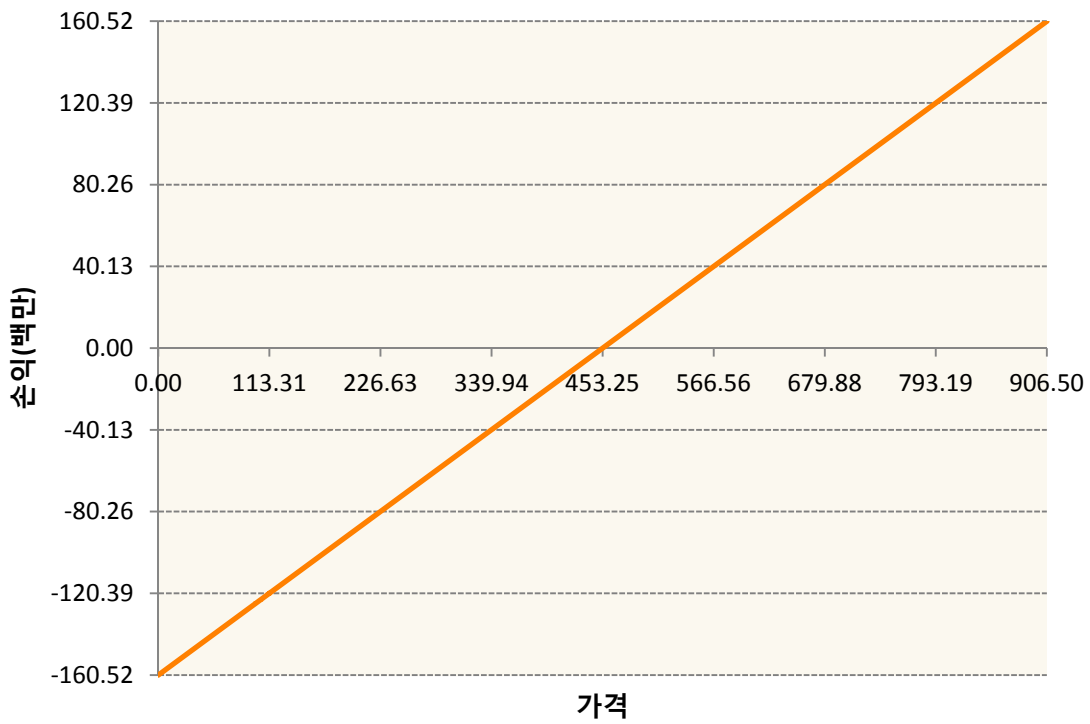




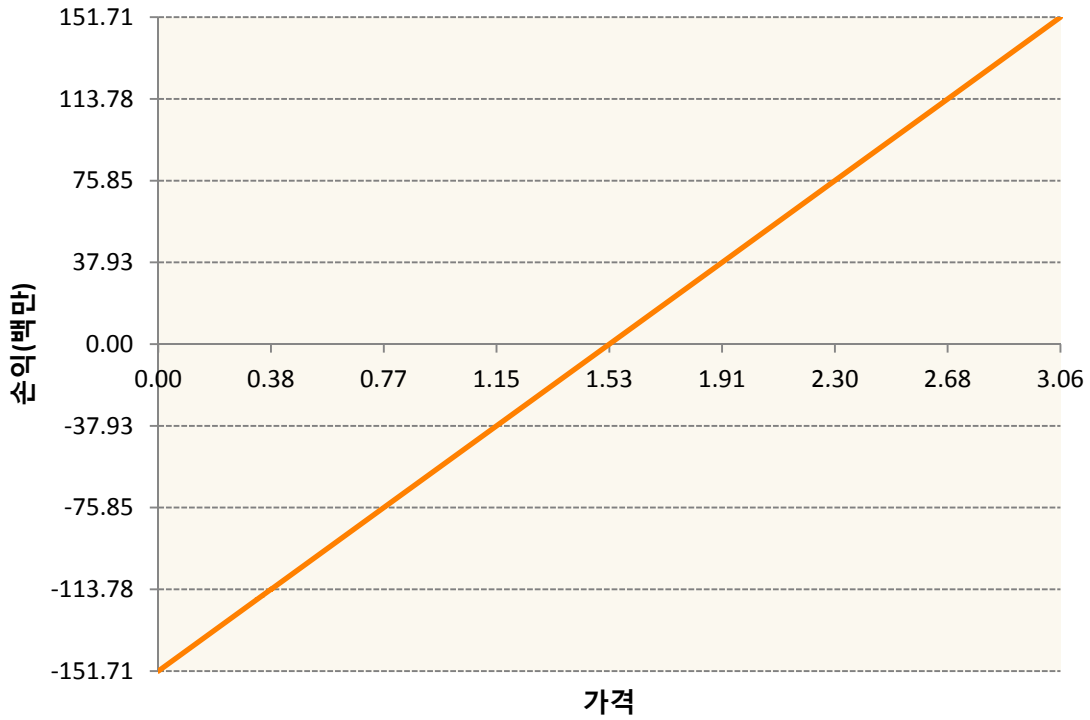
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



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	35
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)

315

공시일	2020-03-04
기준일	2020-03-03

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

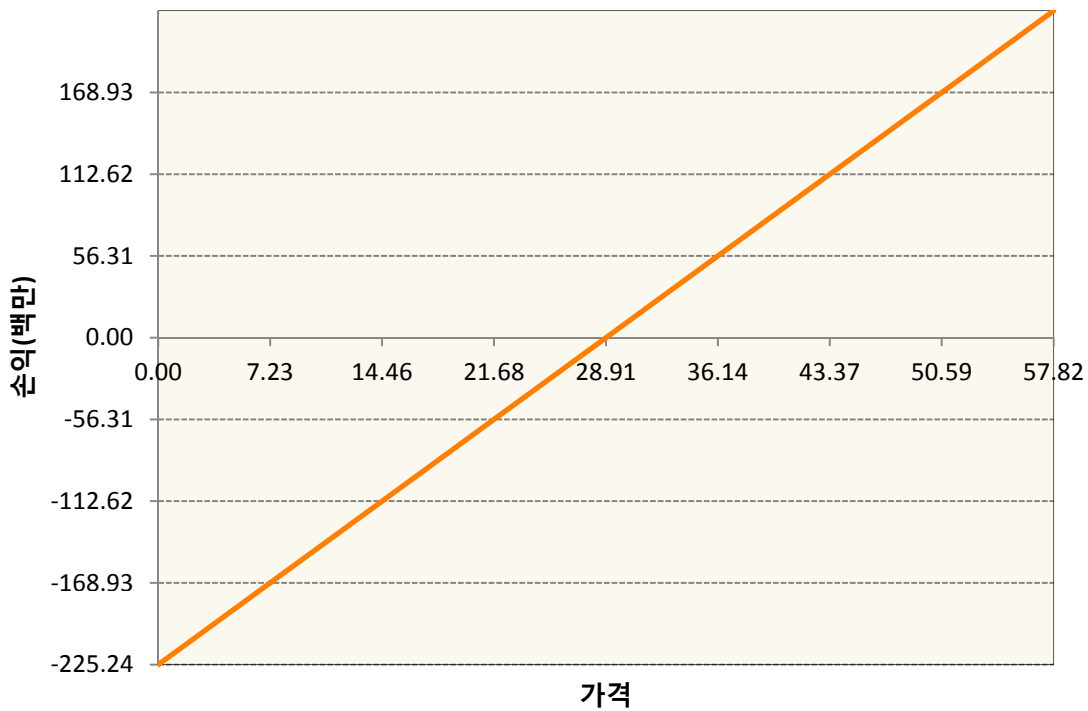
1. 계약금액

(단위:백만원)

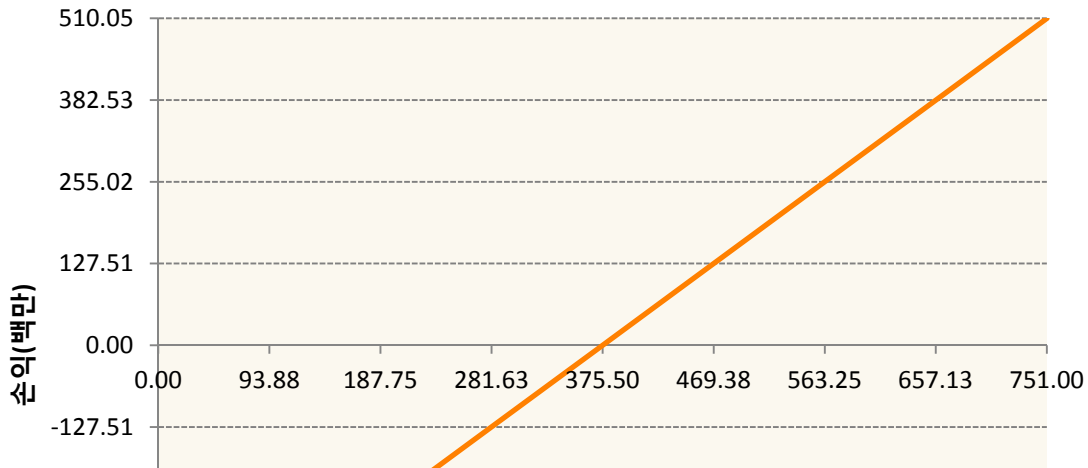
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,599	155	2,444	

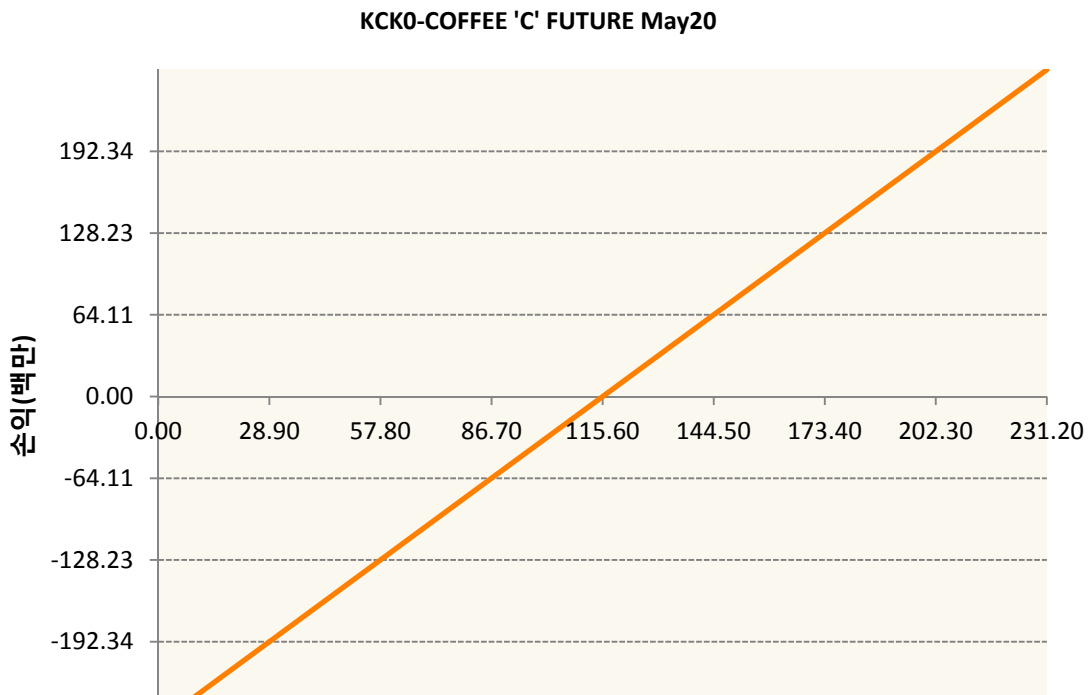
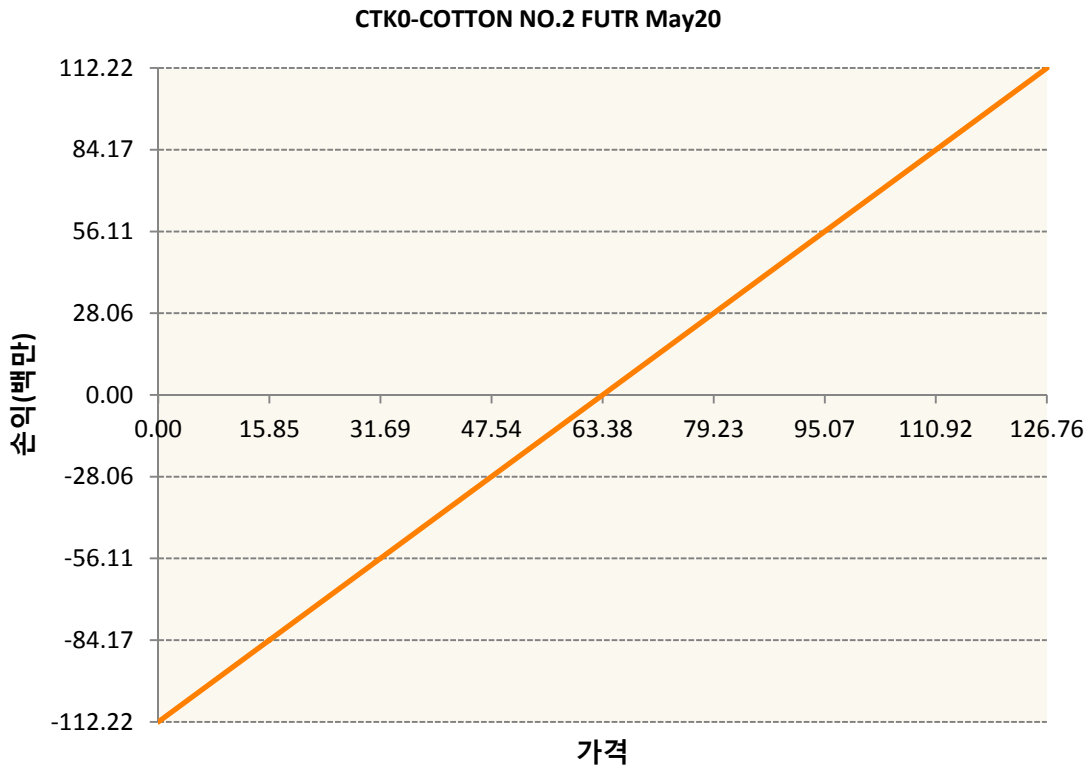
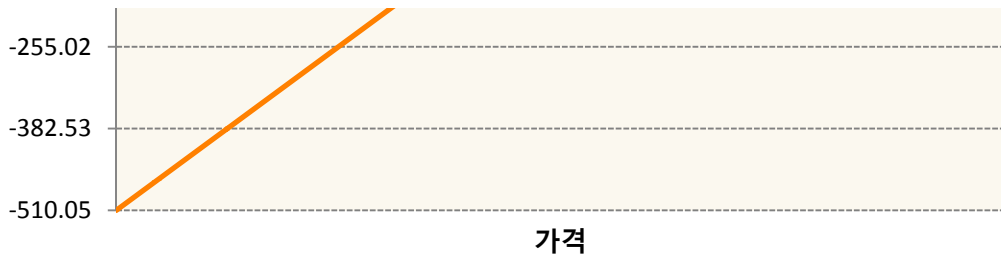
2. 만기시점의 손익구조

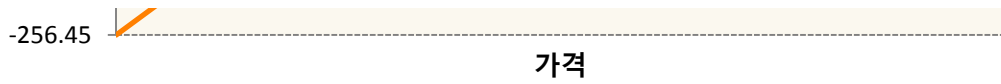
BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20



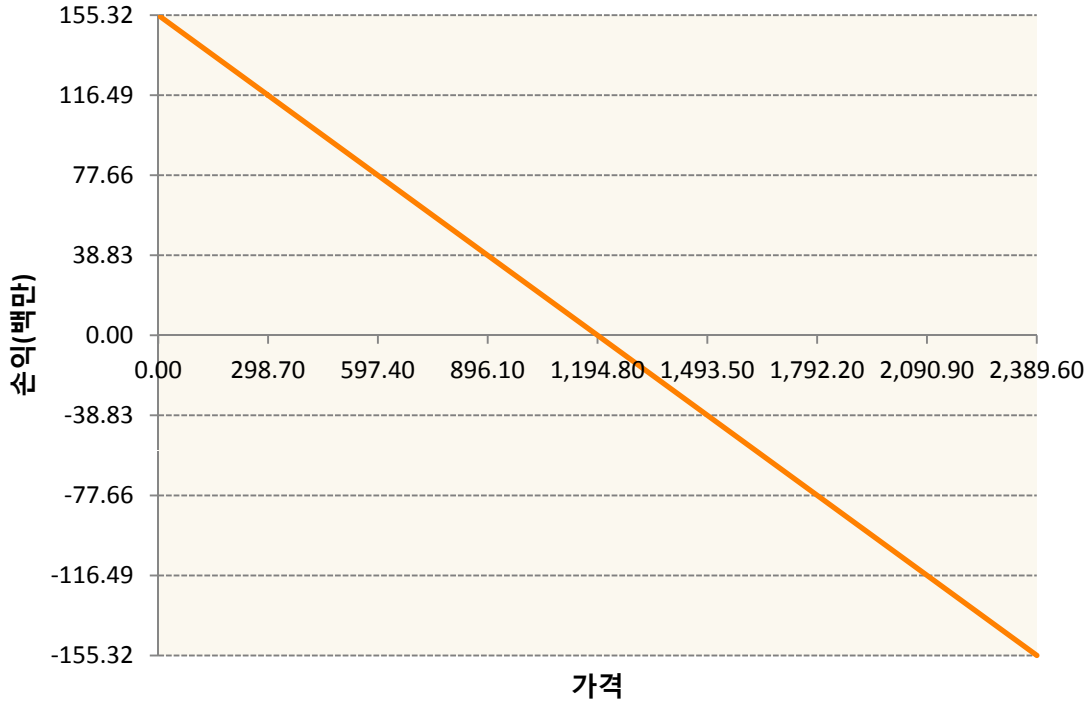
CK0-CORN FUTURE May20



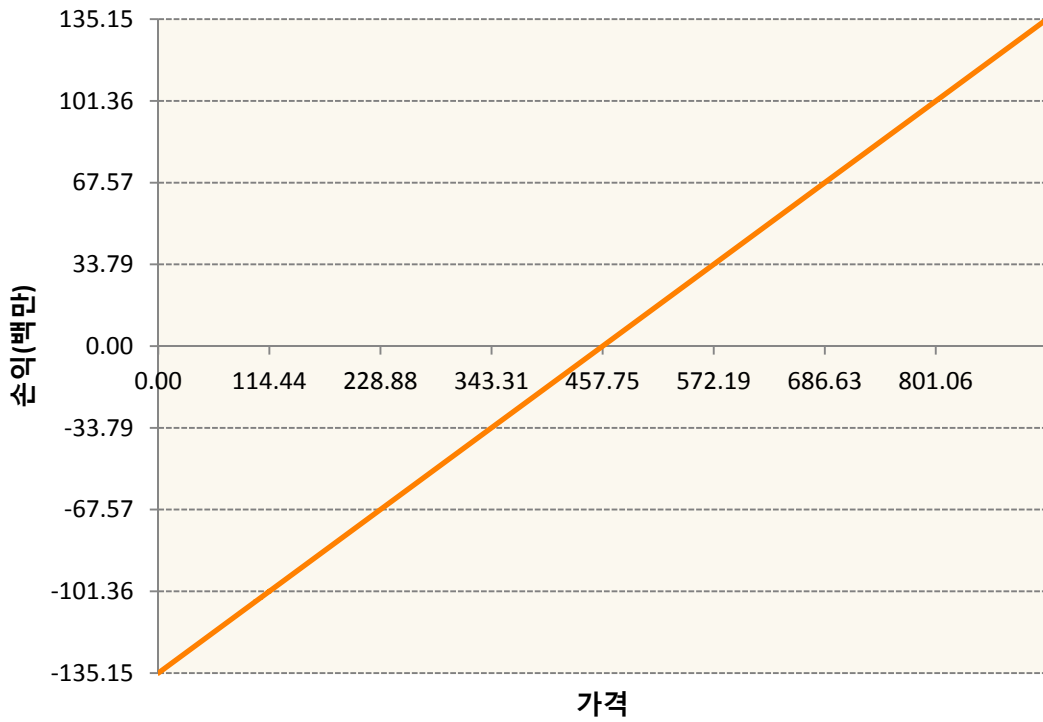




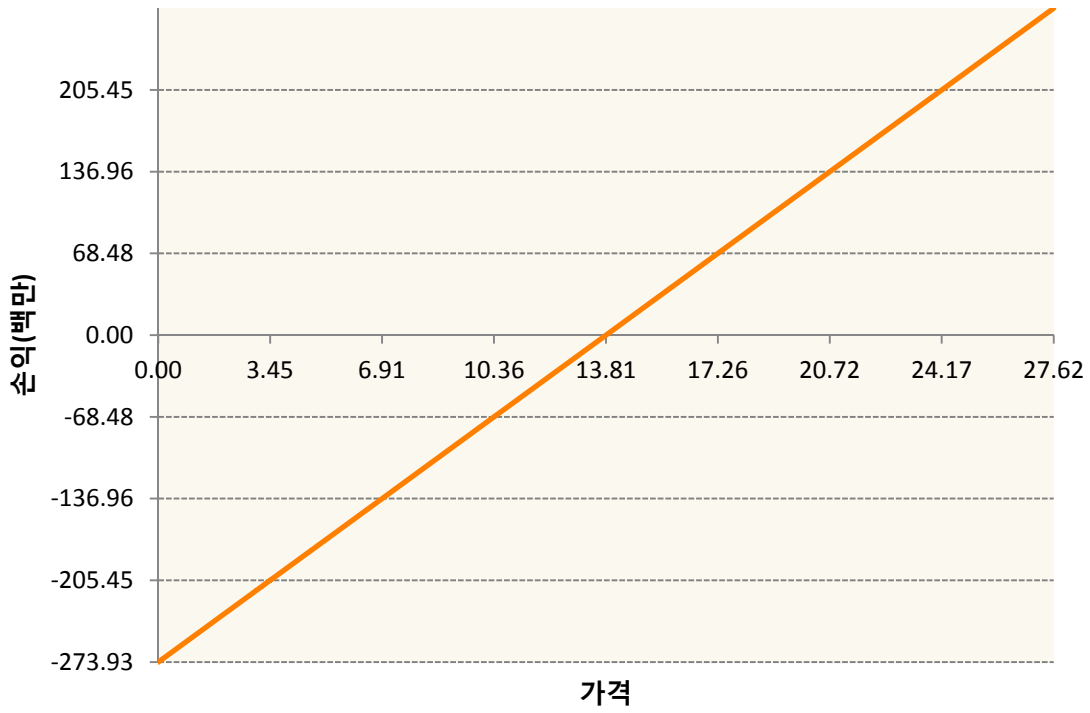
KR4175Q30009-2020-03 달러선물



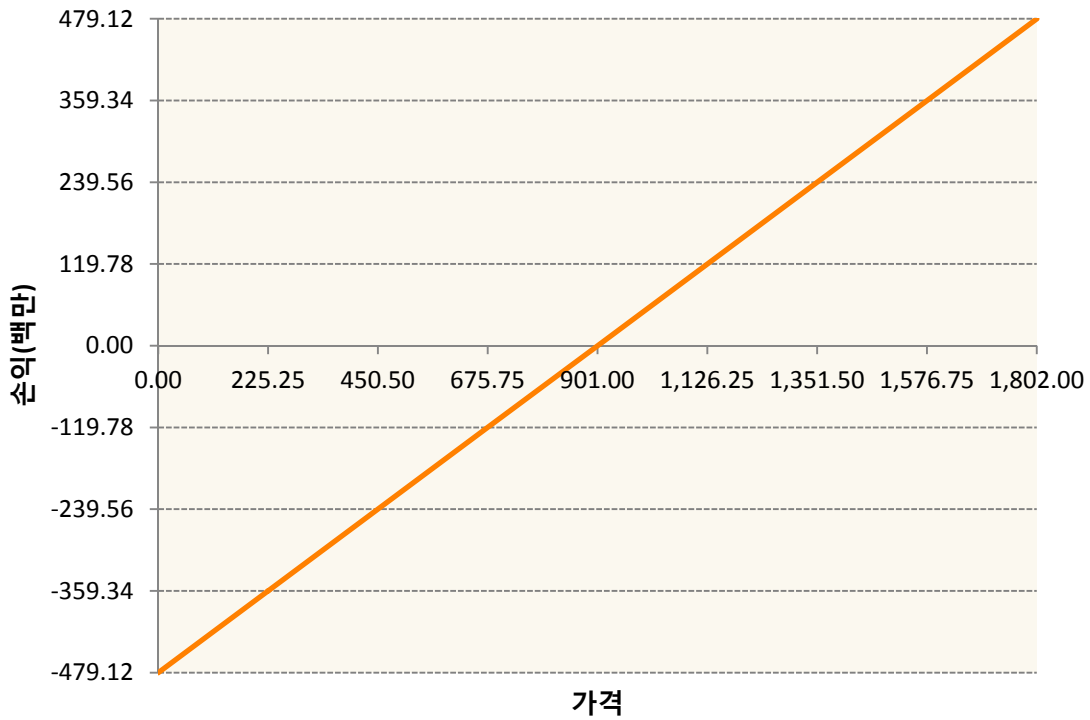
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



SBK0-Sugar May20

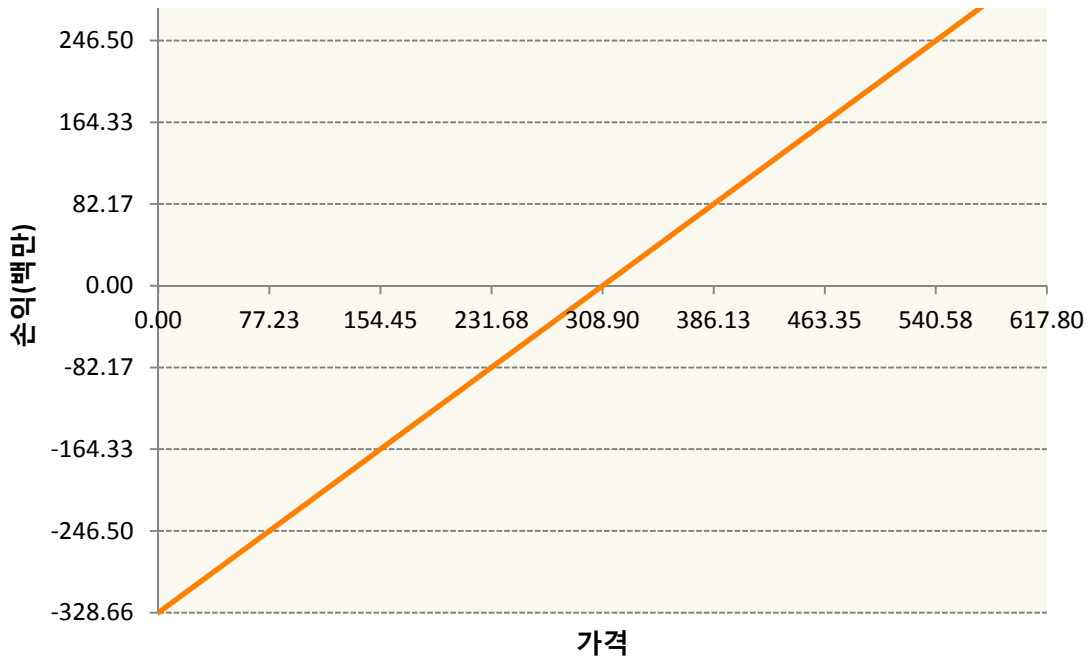


SK0-SOYBEAN FUTURE May20

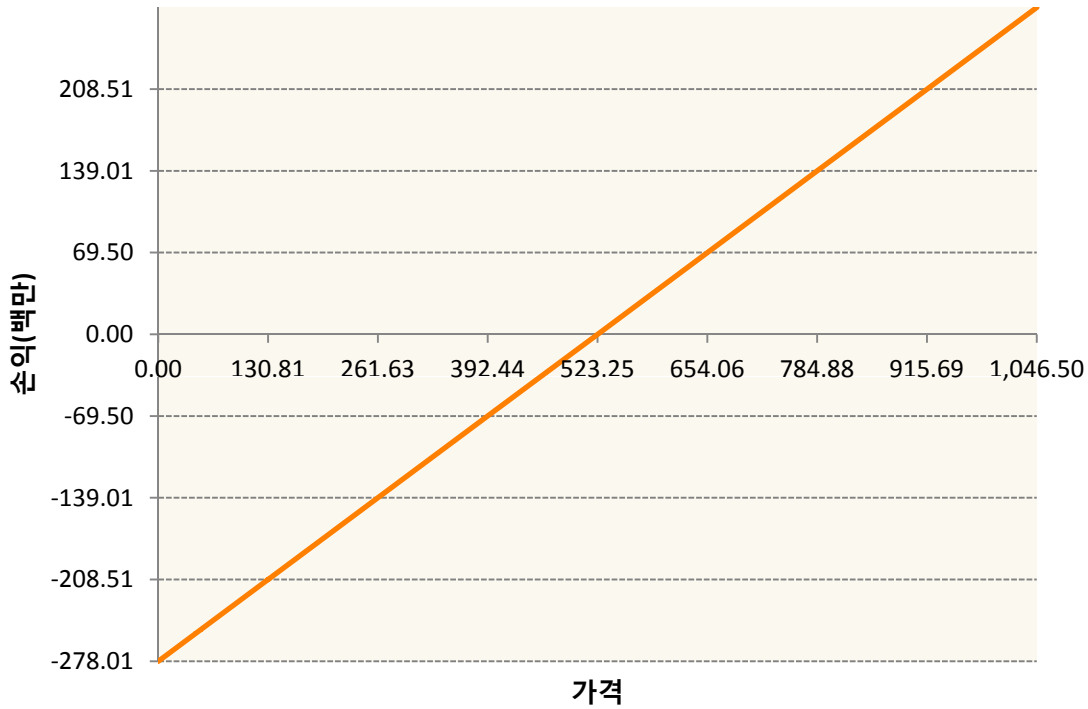


SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





WK0-WHEAT FUTURE(CBT) May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	18
CK0	CORN FUTURE May20	41
CTK0	COTTON NO.2 FUTR May20	9
KCK0	COFFEE 'C' FUTURE May20	21
KR4175Q30C	2020-03 달러선물	12

KWK0	KC HRW WHEAT FUT May20	11
SBK0	Sugar May20	22
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)

226