

공시일	2020-03-05
기준일	2020-03-04

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	2020-03-05
기준일	2020-03-04

스마트인덱스모

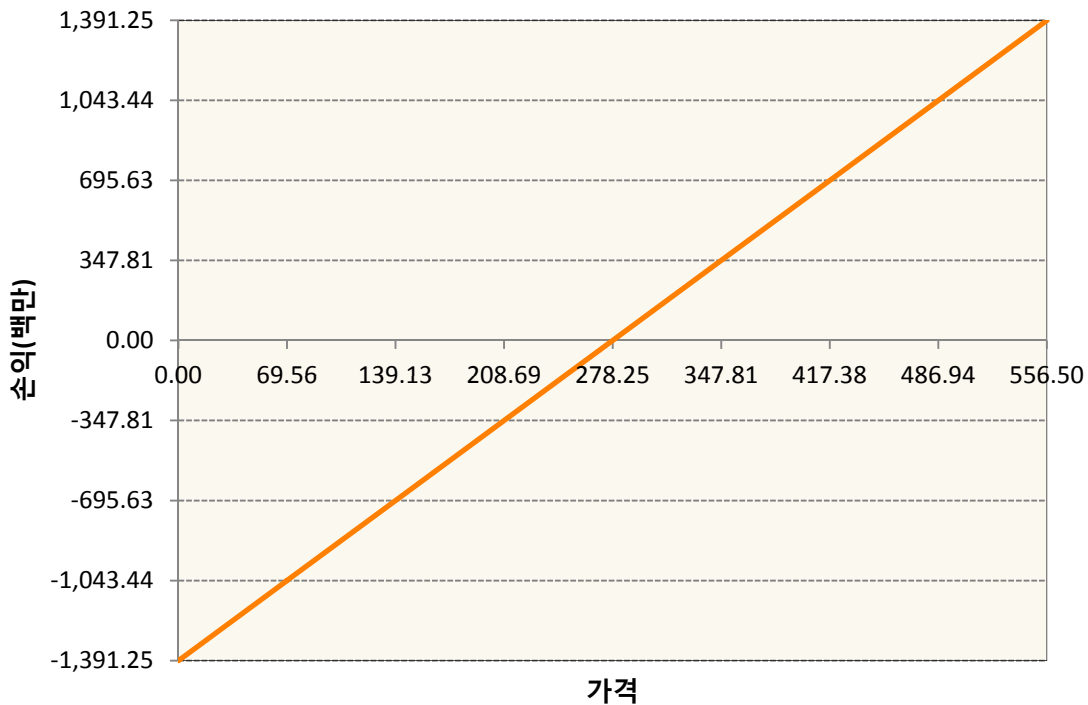
1. 계약금액

(단위:백만원)

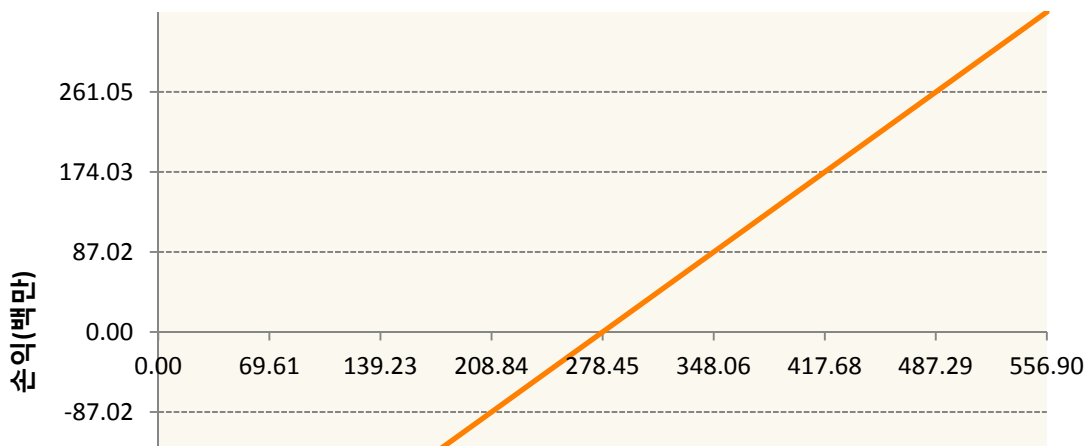
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,739	0	1,739	장내

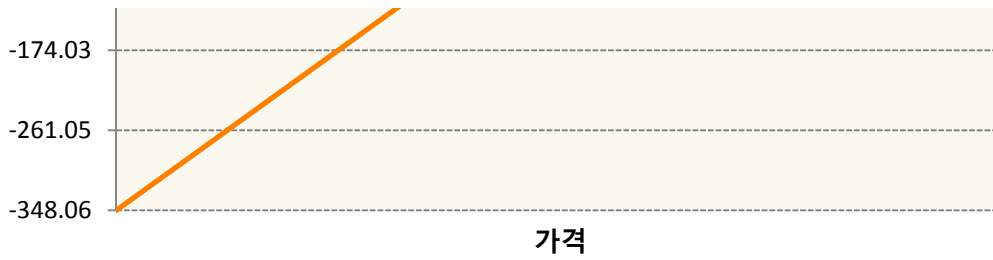
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						111
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111	
-5.33%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74	
-2.67%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	37	37	37	37	37	37	37	
5.33%	74	74	74	74	74	74	74	
8.00%	111	111	111	111	111	111	111	
KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						28
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28	
-5.33%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
-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%	19	19	19	19	19	19	19	
8.00%	28	28	28	28	28	28	28	

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

124

공시일	2020-03-05
기준일	2020-03-04

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

1,052

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

659

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-05
기준일	2020-03-04

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)

948

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-05
기준일	2020-03-04

유로인덱스모(주식-파생형)

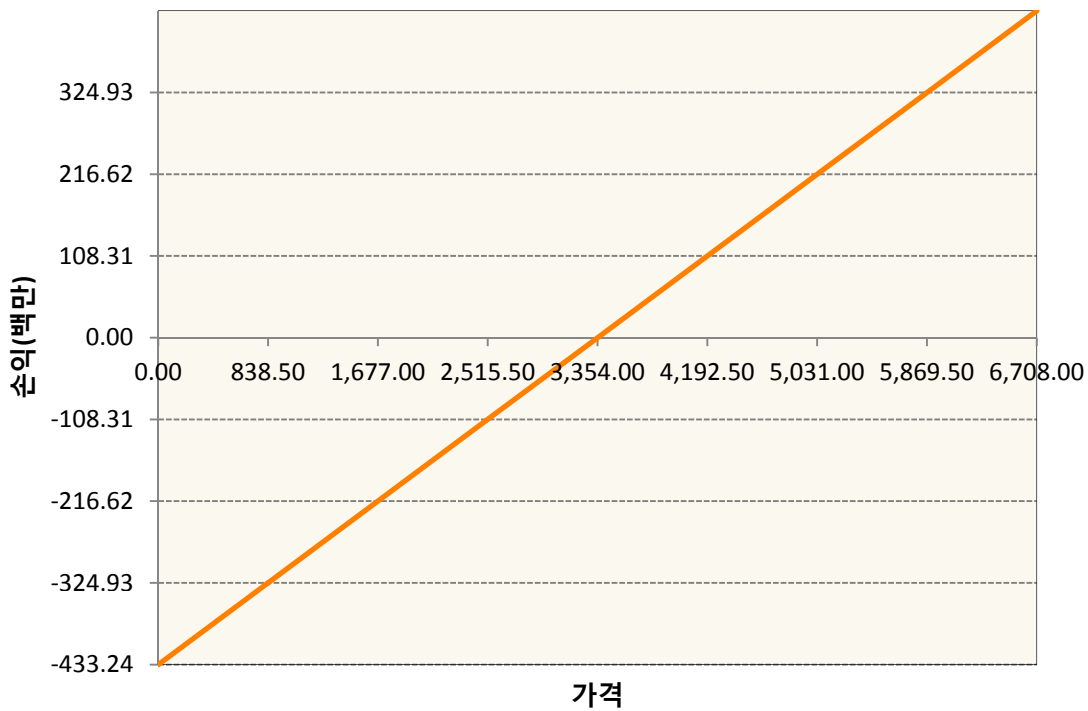
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	433	0	433	

2. 만기시점의 손익구조

VGH0-EURO STOXX 50 Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH0	EURO STOXX 50 Mar20	35
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

26

공시일	2020-03-05
기준일	2020-03-04

차이나인덱스모(주식-파생형)

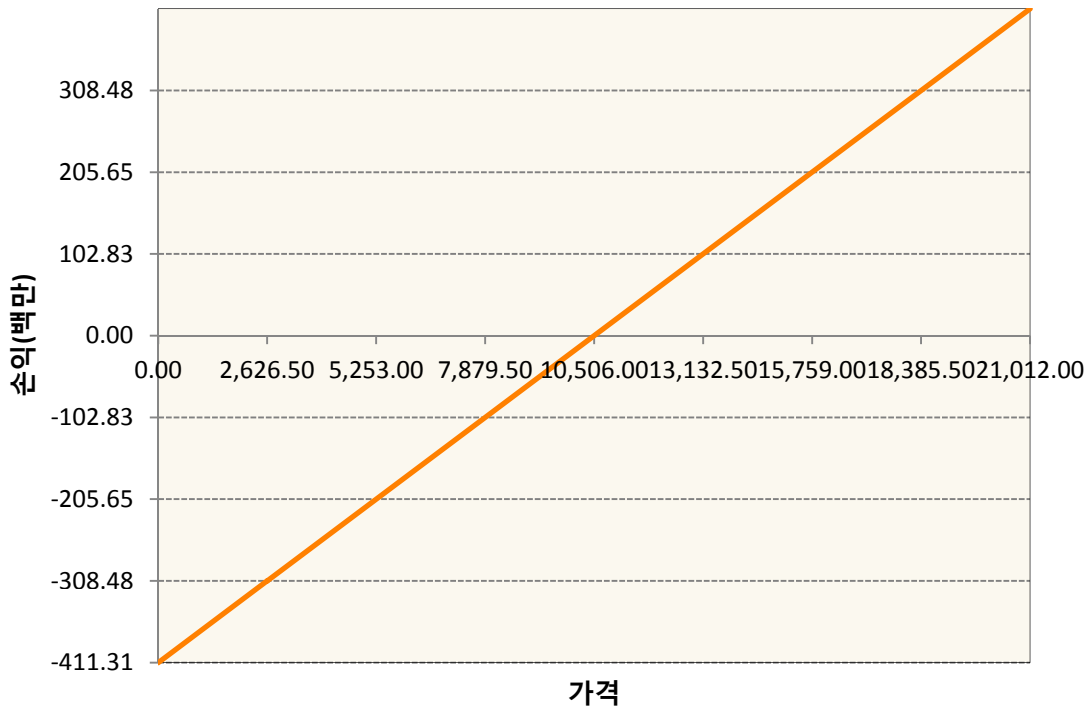
1. 계약금액

(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	2020-03-05
기준일	2020-03-04

커버드콜모(주식혼합-파생형)

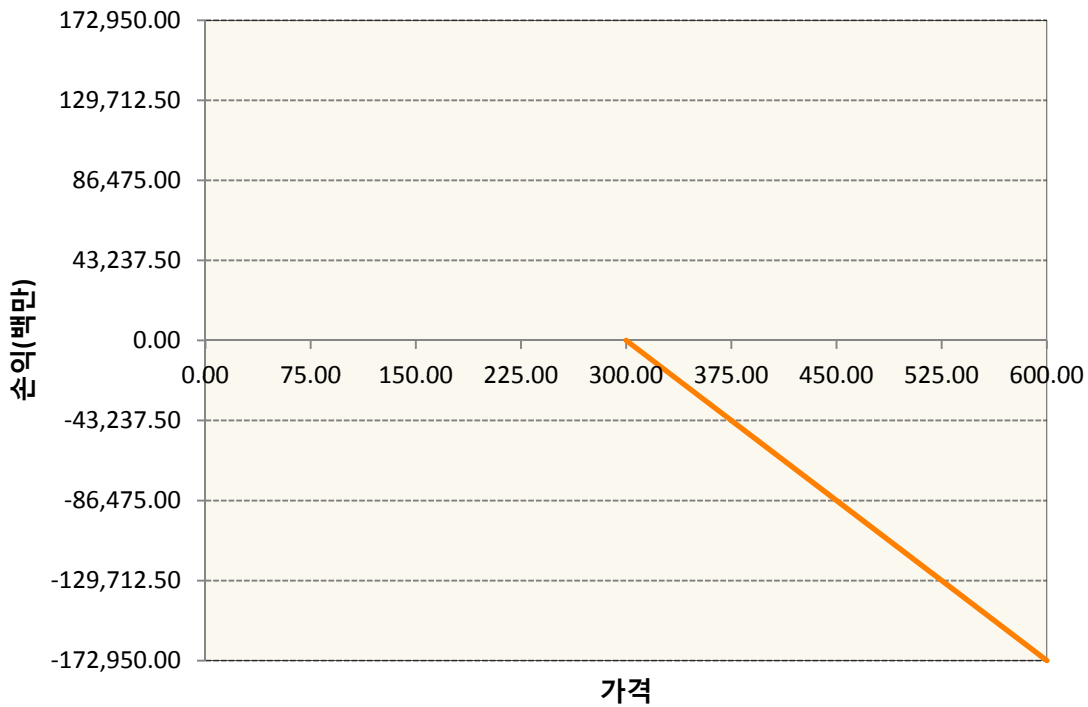
1. 계약금액

(단위:백만원)

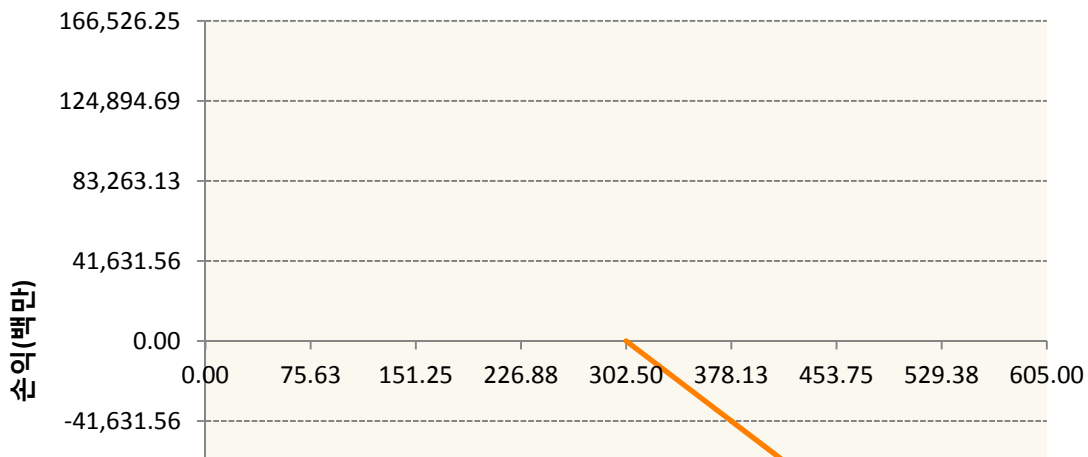
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	448,226	-448,226	장내

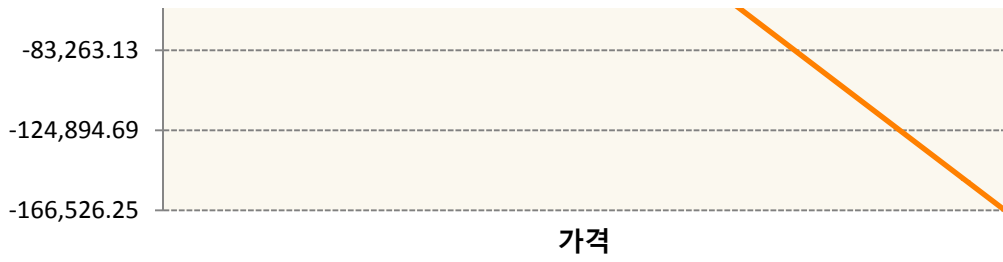
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q33007-2020-03 콜300

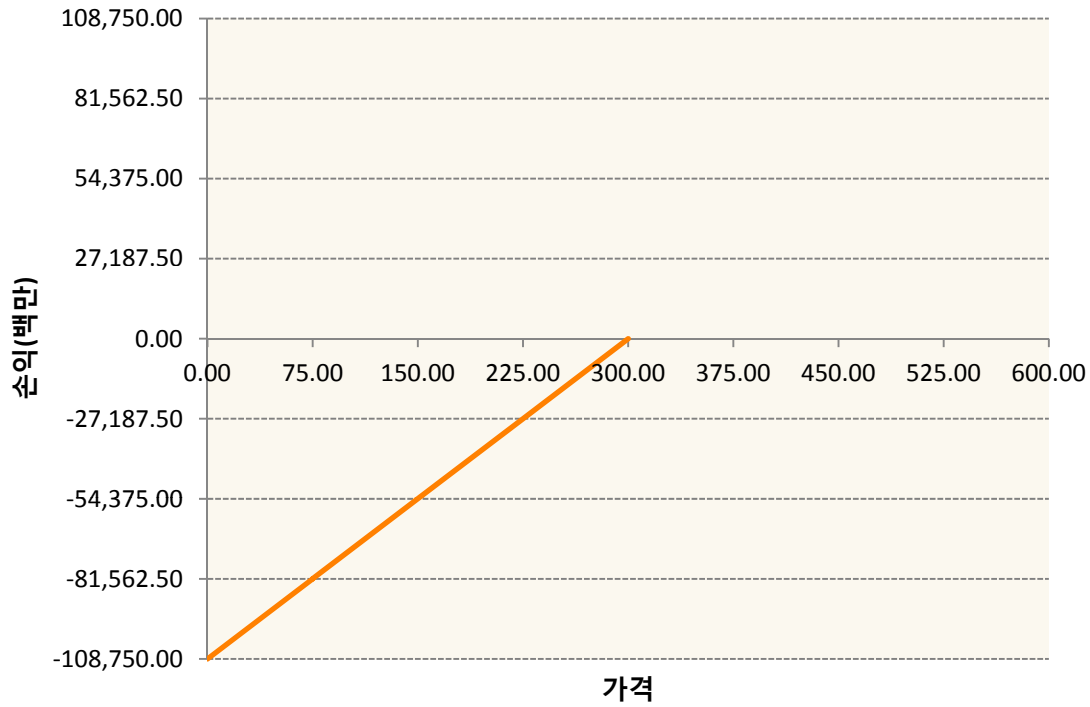


KR4201Q33023-2020-03 콜302.5





KR4301Q33005-2020-03 풋300



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q33007		2020-03 콜300					4,361	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	302	301	301	298	294	286	273	
-5.33%	301	298	293	282	265	239	203	
-2.67%	292	277	252	215	164	99	19	
0%	230	173	96	0	-114	-244	-390	
2.67%	-39	-187	-355	-539	-738	-948	-1,168	
5.33%	-839	-1,095	-1,358	-1,628	-1,902	-2,179	-2,460	
8.00%	-2,532	-2,837	-3,142	-3,447	-3,752	-4,057	-4,361	
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5					3,607	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	202	202	202	200	198	192	184	

-5.33%	202	201	198	191	179	161	135
-2.67%	197	189	173	148	111	63	1
0%	163	125	71	0	-88	-192	-310
2.67%	-6	-116	-247	-395	-560	-738	-927
5.33%	-565	-780	-1,006	-1,242	-1,486	-1,735	-1,990
8.00%	-1,870	-2,158	-2,447	-2,736	-3,026	-3,316	-3,607
KR4301Q33005 2020-03 풋300							8,003
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,002	-8,002	-8,002	-8,002	-8,002	-8,002	-8,003
-5.33%	-5,314	-5,314	-5,315	-5,315	-5,317	-5,320	-5,325
-2.67%	-2,628	-2,629	-2,632	-2,637	-2,646	-2,659	-2,677
0%	52	41	24	0	-32	-72	-119
2.67%	2,667	2,619	2,560	2,491	2,414	2,330	2,239
5.33%	5,004	4,889	4,768	4,643	4,515	4,384	4,250
8.00%	6,705	6,553	6,402	6,251	6,100	5,948	5,797

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

(단위:백만원)

12,927

공시일	2020-03-05
기준일	2020-03-04

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

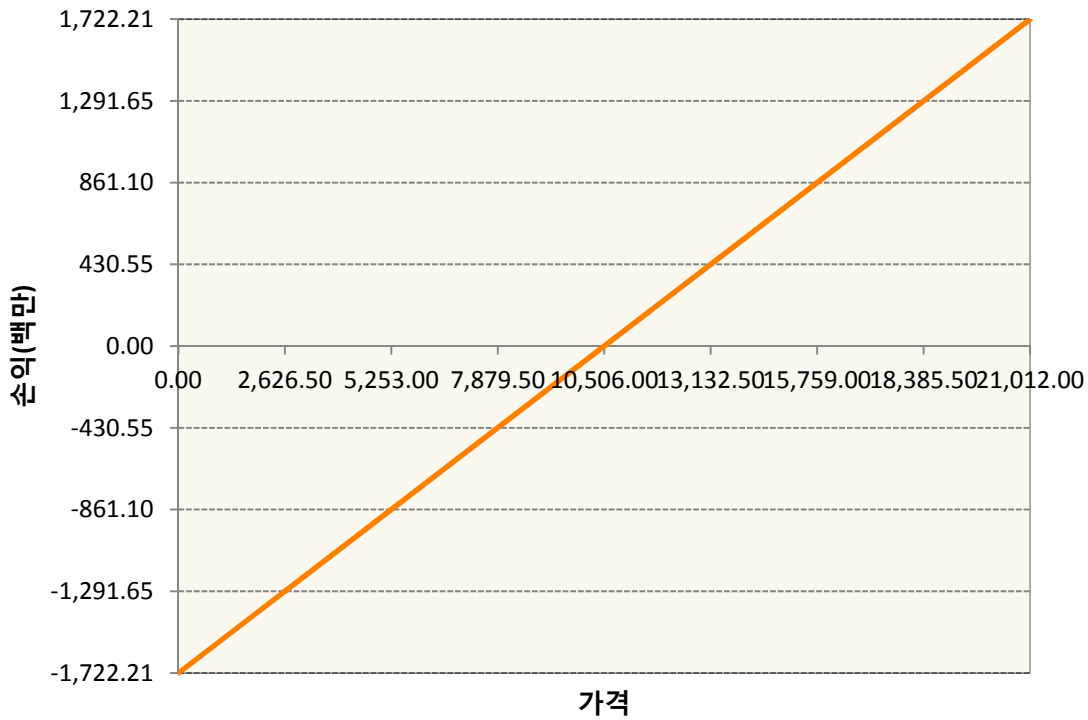
1. 계약금액

(단위:백만원)

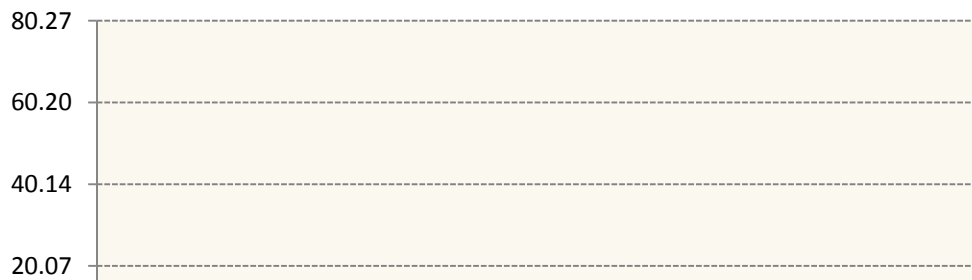
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,722	0	1,722	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,699	-4,699	장내
누계	통화	선도	0	2,153	-2,153	장외

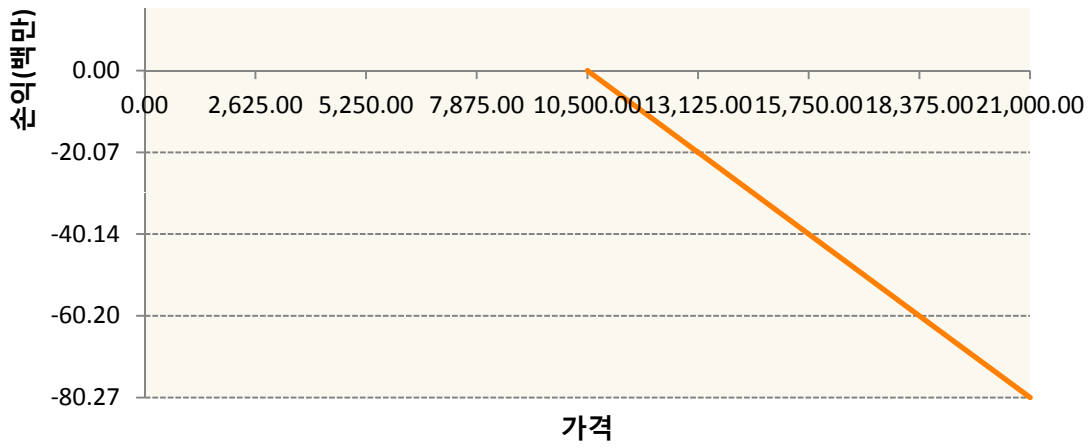
2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20

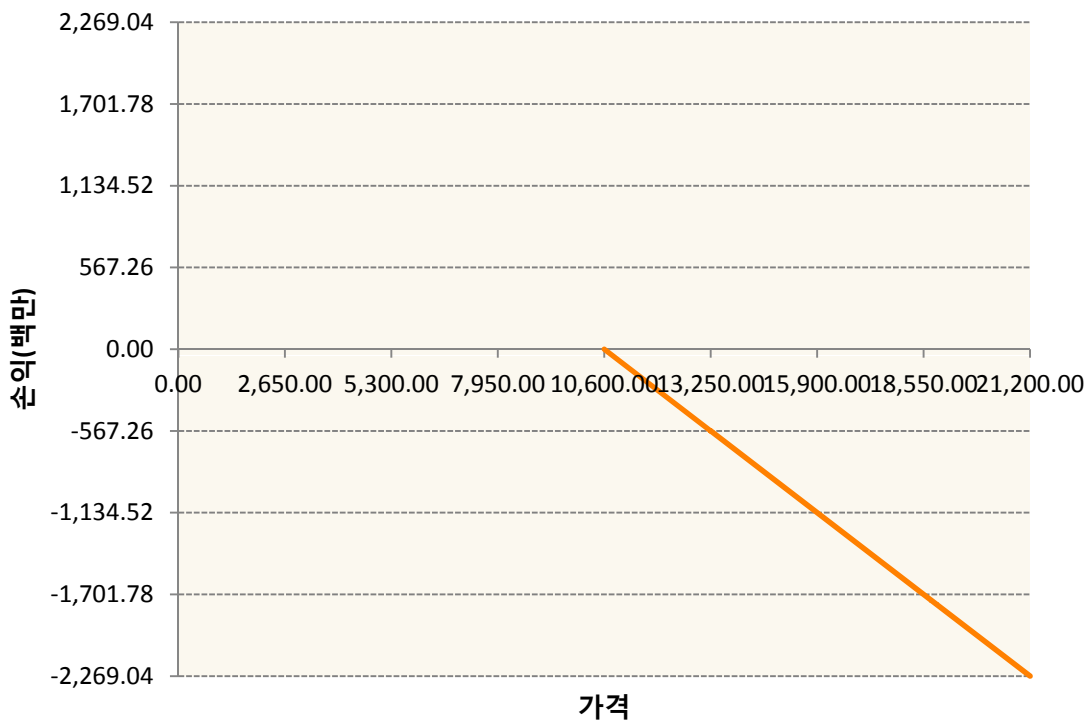


OHHIH0-C105-HSCEI

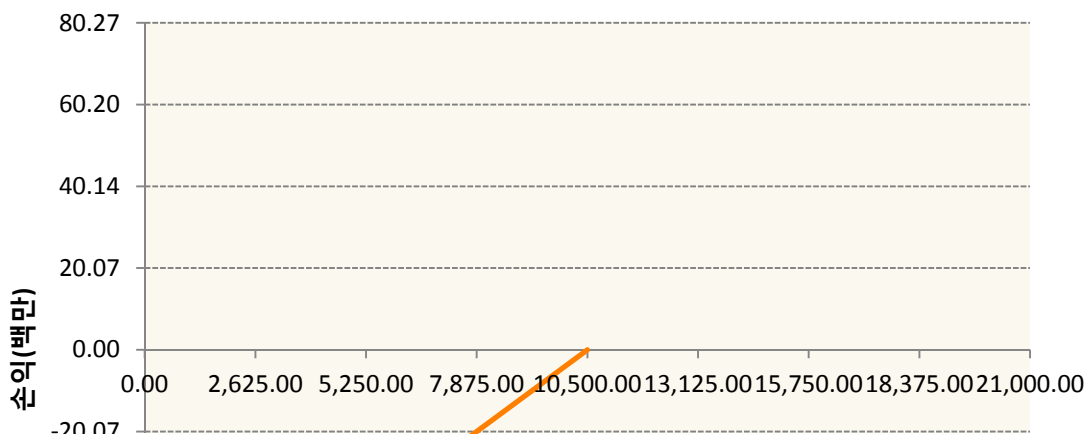


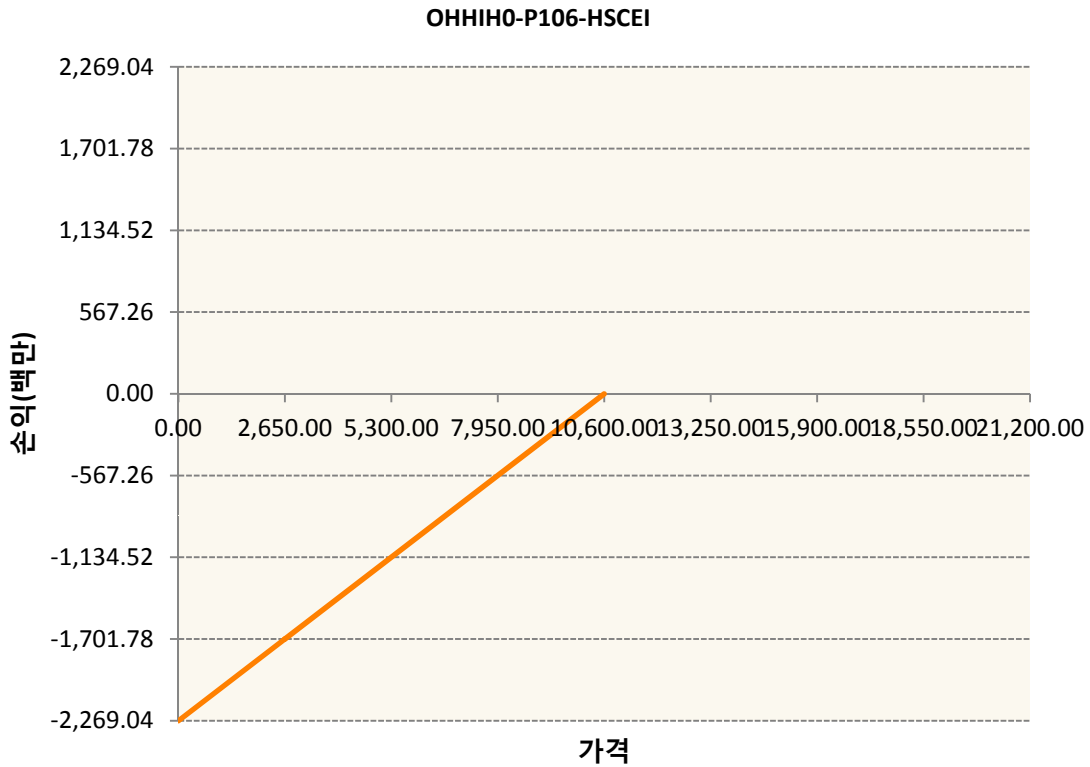
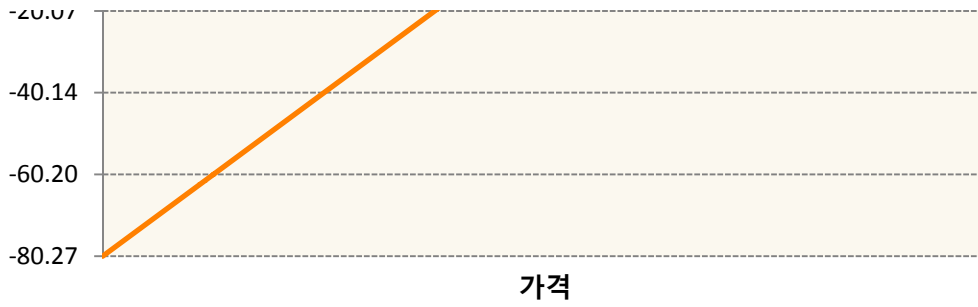


OHHIH0-C106-HSCEI



OHHIH0-P105-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E	172
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)
	524

공시일	2020-03-05
기준일	2020-03-04

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

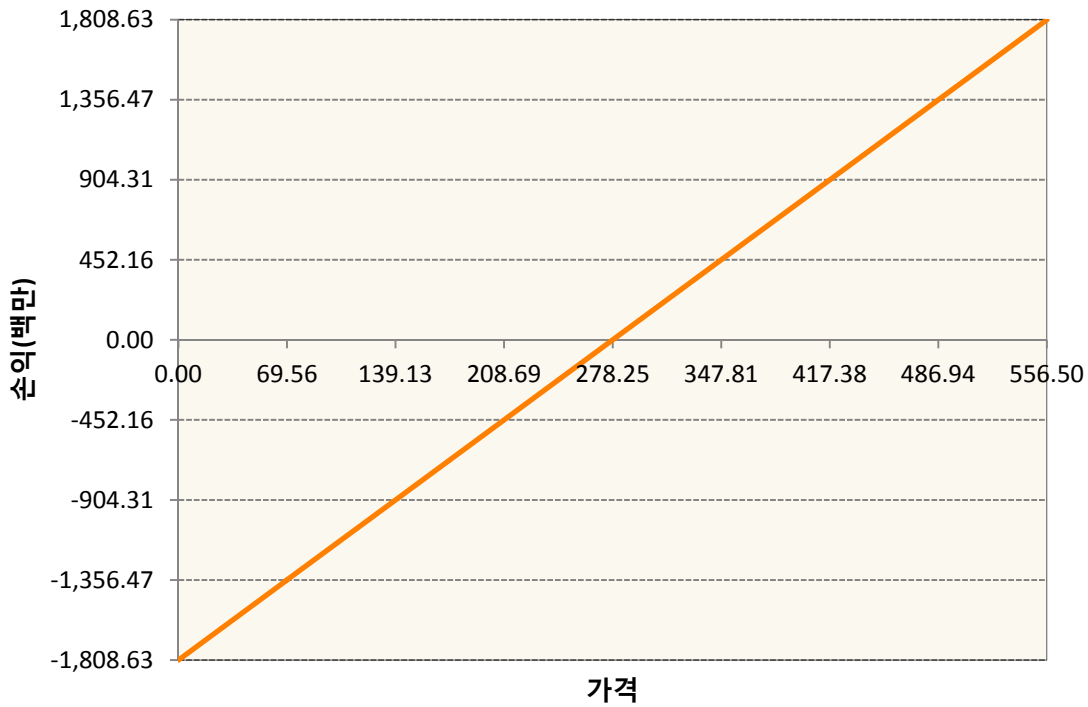
1. 계약금액

(단위:백만원)

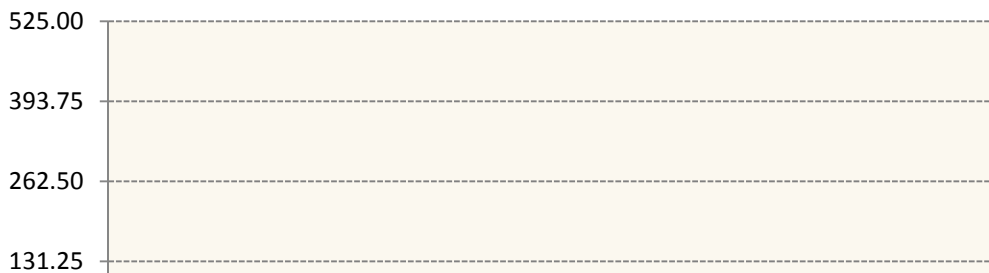
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,809	0	1,809	장내
누계	유가증권	스왑	3,125	0	3,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,612	-3,612	장내

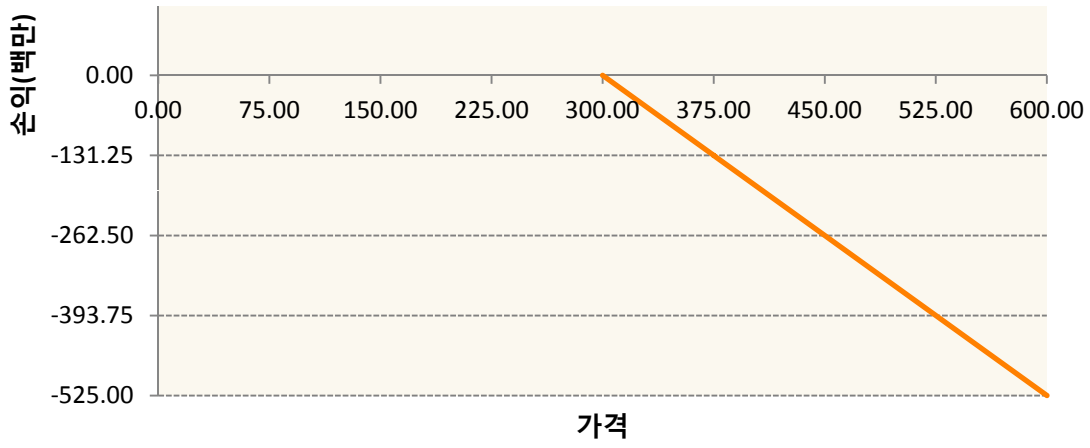
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

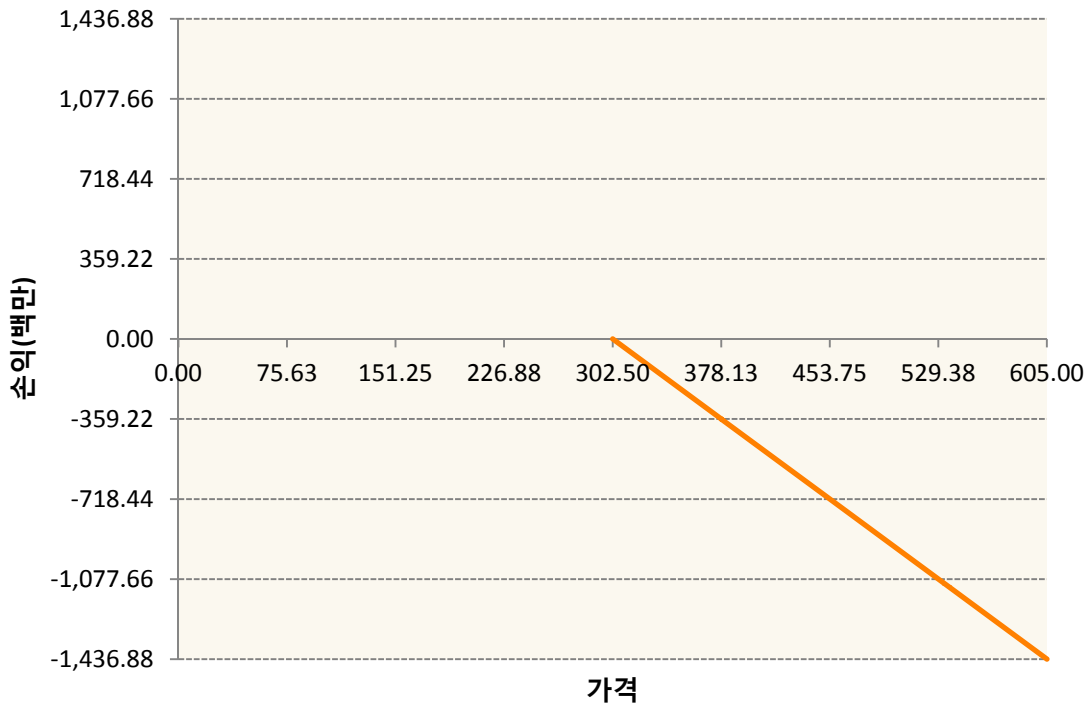


KR4201Q33007-2020-03 콜300

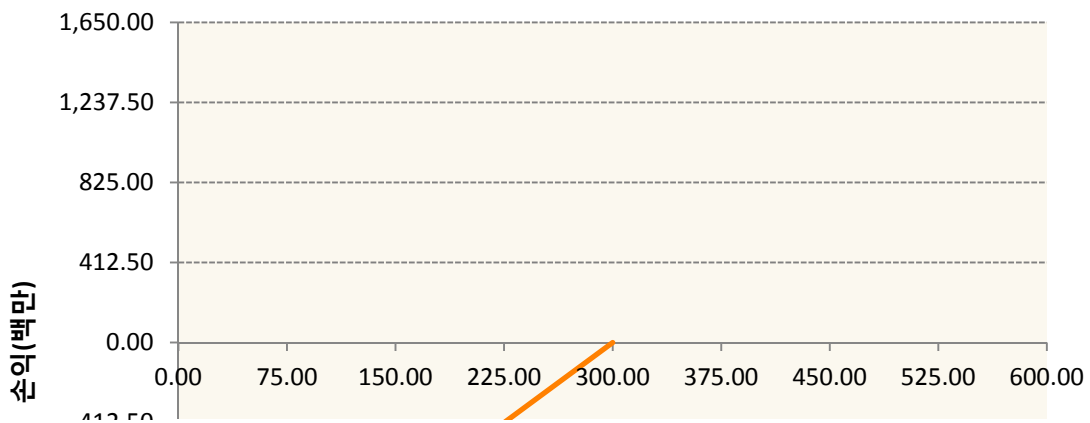




KR4201Q33023-2020-03 콜302.5



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						145
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-145	-145	-145	-145	-145	-145	-145	
-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%	145	145	145	145	145	145	145	
KR4201Q33007		2020-03 콜300						13
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	0	-1	-1	
2.67%	0	-1	-1	-2	-2	-3	-4	
5.33%	-3	-3	-4	-5	-6	-7	-7	
8.00%	-8	-9	-10	-10	-11	-12	-13	
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5						31
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	1	1	1	1	0
0%	1	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	0	-1	-2	-3	-5	-6	-8
5.33%	-5	-7	-9	-11	-13	-15	-17
8.00%	-16	-19	-21	-24	-26	-29	-31
KR4301Q33005 2020-03 풋300							121
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-121	-121	-121	-121	-121	-121	-121
-5.33%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
-2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-41
0%	1	1	0	0	0	-1	-2
2.67%	40	40	39	38	37	35	34
5.33%	76	74	72	70	69	67	64
8.00%	102	99	97	95	93	90	88

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

(단위:백만원)

550

공시일	2020-03-05
기준일	2020-03-04

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

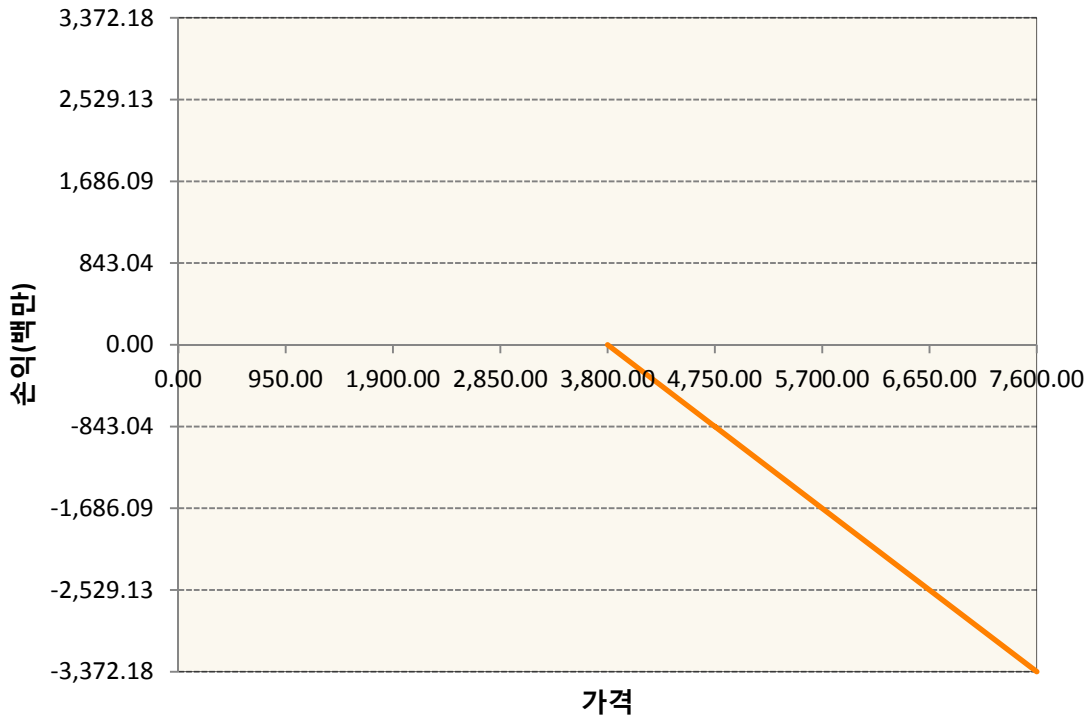
1. 계약금액

(단위:백만원)

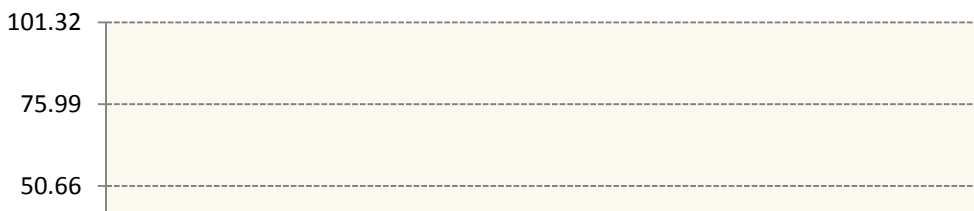
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	1	-1	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	440	0	440	
누계	유가증권	스왑	10,686	0	10,686	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,947	-6,947	장내
누계	통화	선도	530	3,476	-2,946	장외

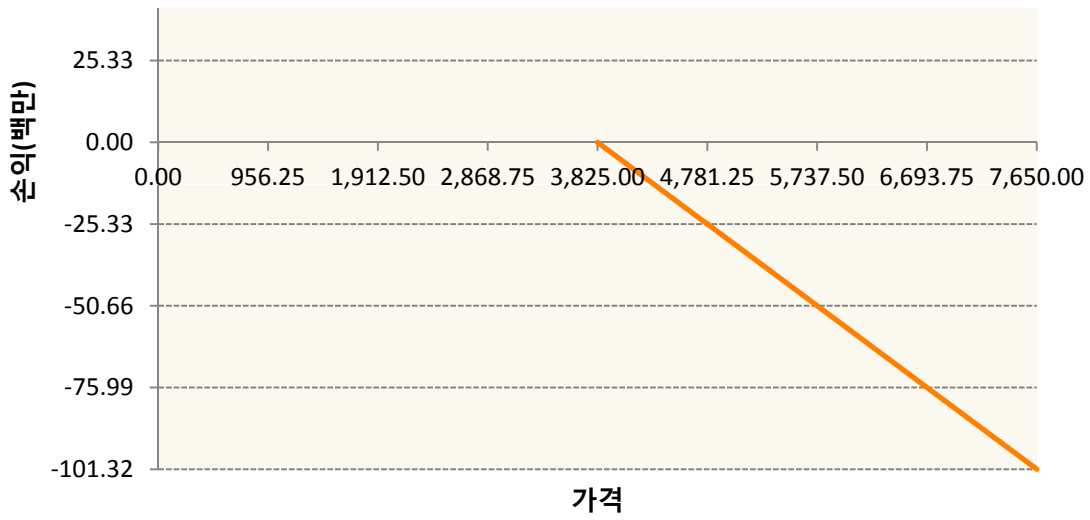
2. 만기시점의 손익구조

OESXH0-C3800-EURO STOXX 50

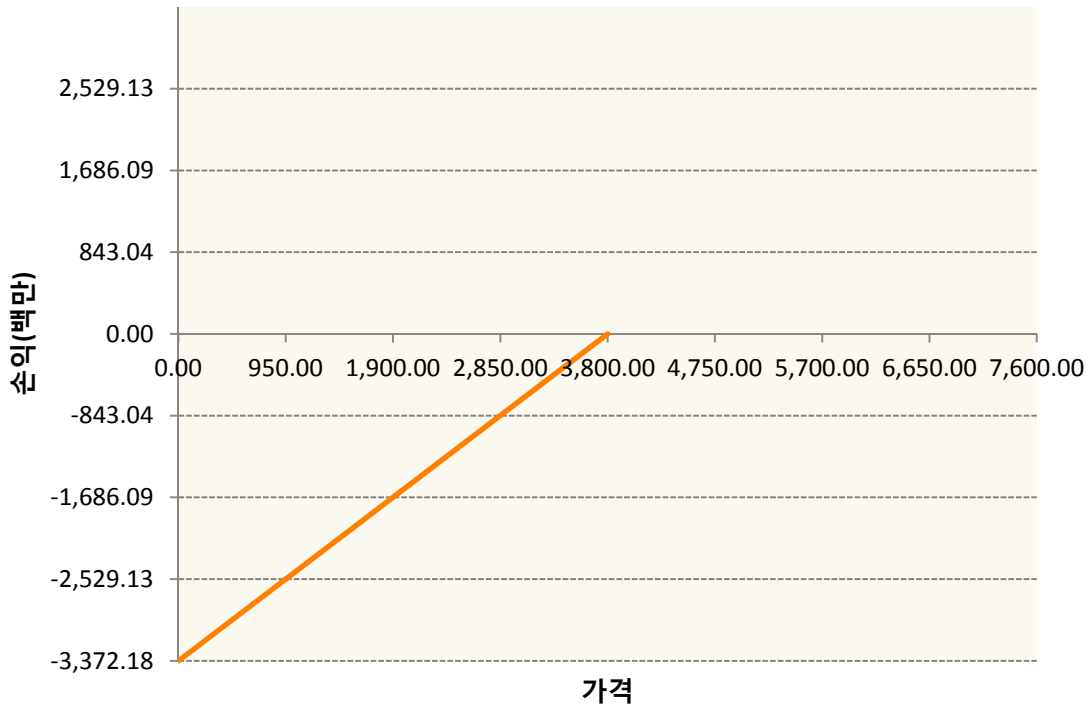


OESXH0-C3825-EURO STOXX 50

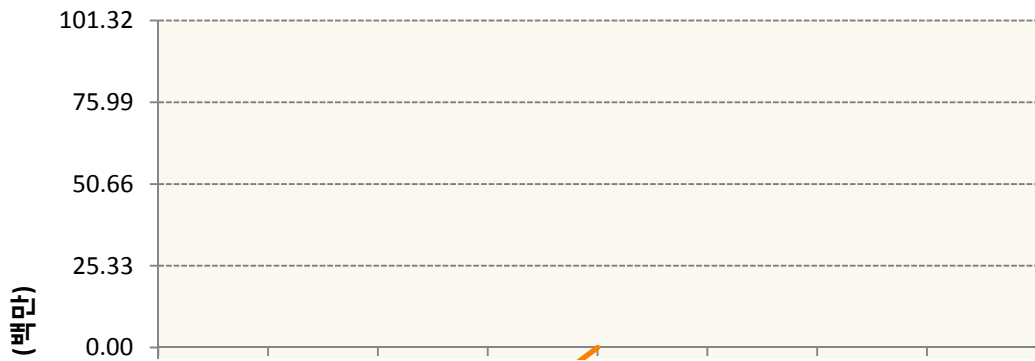


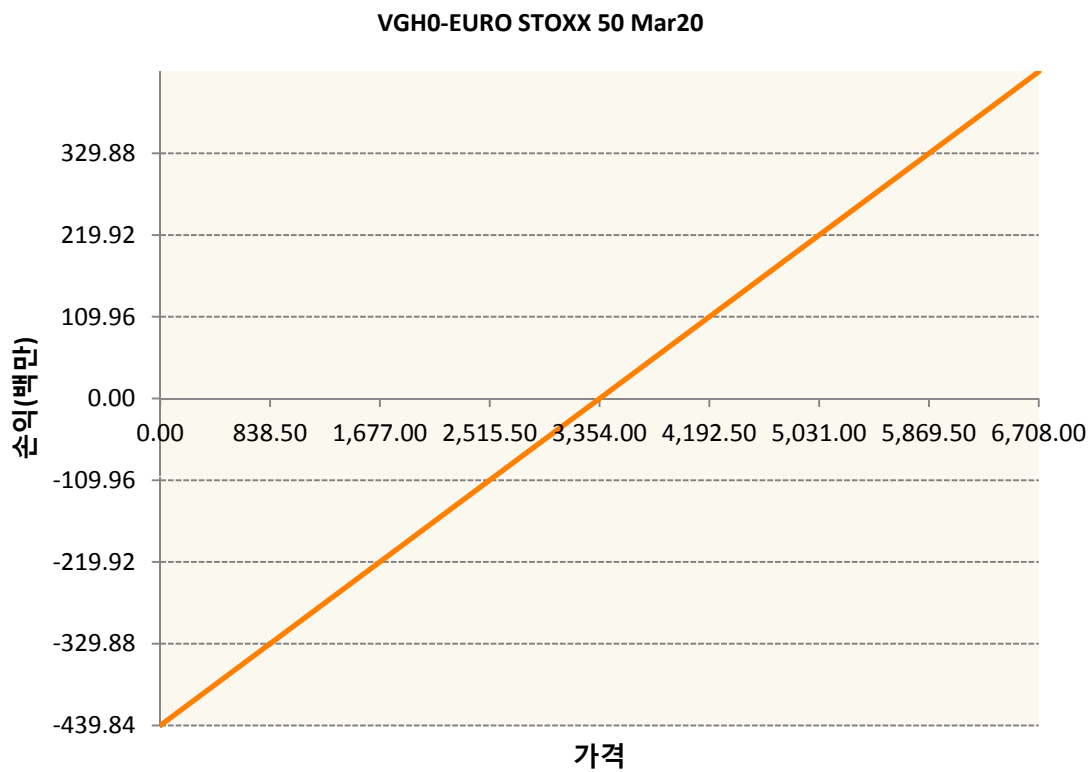
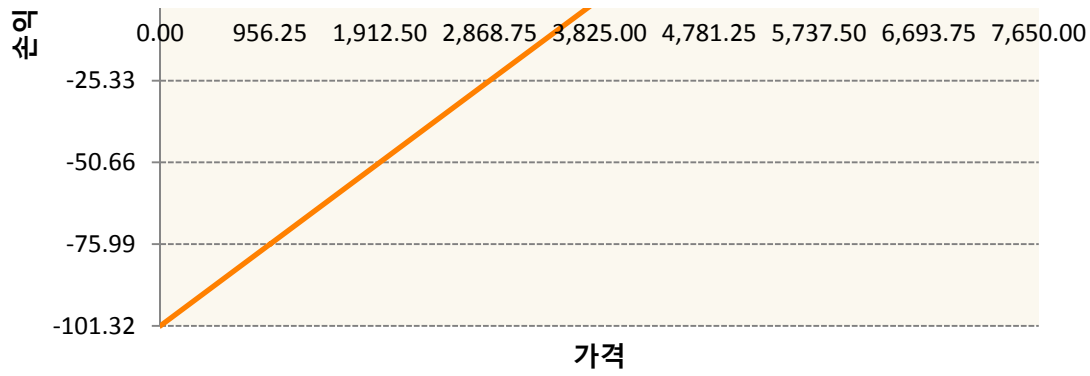


OESXH0-P3800-EURO STOXX 50



OESXH0-P3825-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	76
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	278
FX21020H00 EUR/KRW 27-03-20E	42
OESXH0-C3& EURO STOXX 50	270
OESXH0-C3& EURO STOXX 50	8
OESXH0-P3& EURO STOXX 50	270
OESXH0-P3& EURO STOXX 50	8
VGHO EURO STOXX 50 Mar20	35

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

(단위:백만원)

691

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

(단위:백만원)

956

공시일	2020-03-05
기준일	2020-03-04

ETF스마트레버리지목표전환형9호

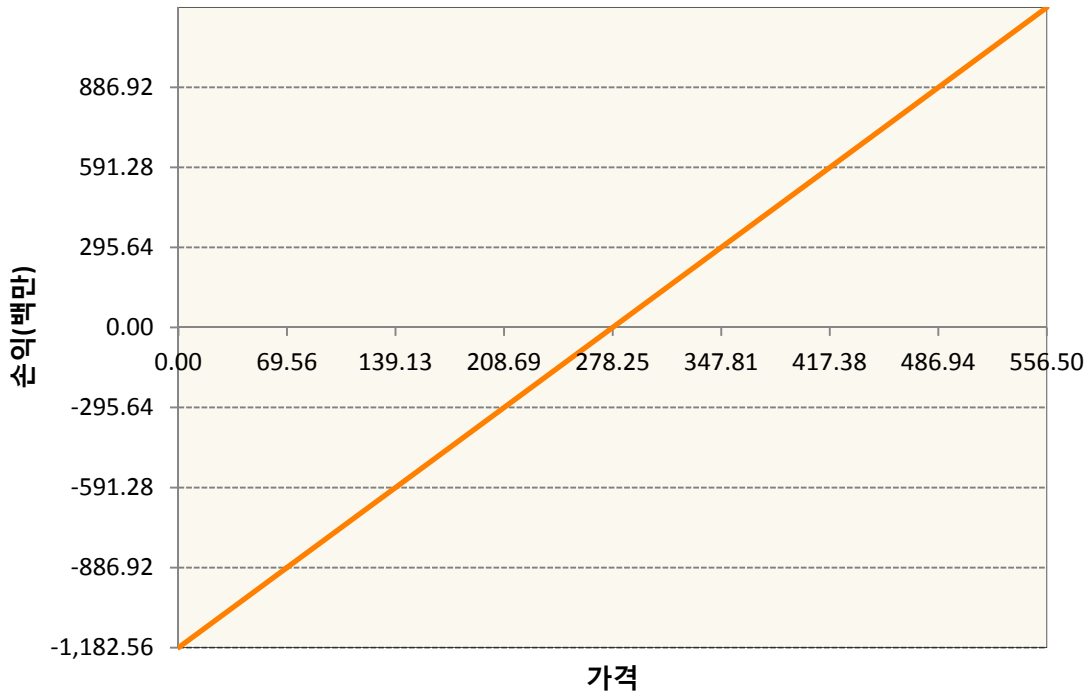
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,183	0	1,183	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						95
가격	기초자산의 변동성							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-95	
-5.33%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63	
-2.67%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	32	32	32	32	32	32	32	
5.33%	63	63	63	63	63	63	63	
8.00%	95	95	95	95	95	95	95	

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

(단위:백만원)

84

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

(단위:백만원)

124

공시일	2020-03-05
기준일	2020-03-04

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

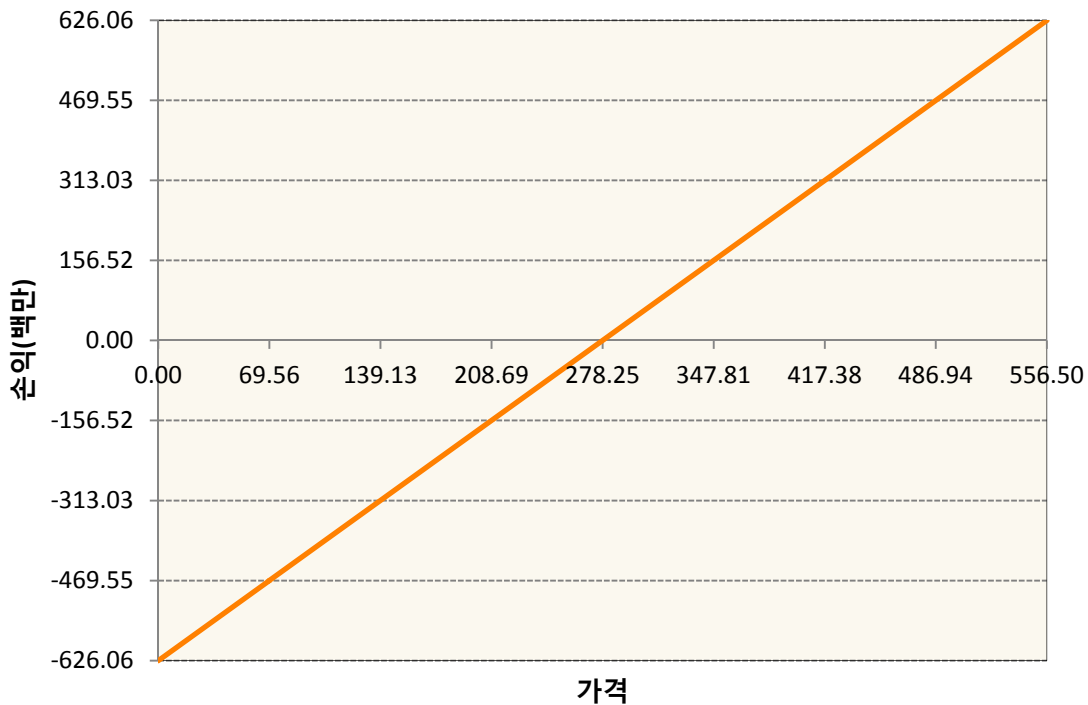
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	626	0	626	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%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
-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%	33	33	33	33	33	33	33	
8.00%	50	50	50	50	50	50	50	

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

(단위:백만원)

45

공시일	2020-03-05
기준일	2020-03-04

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

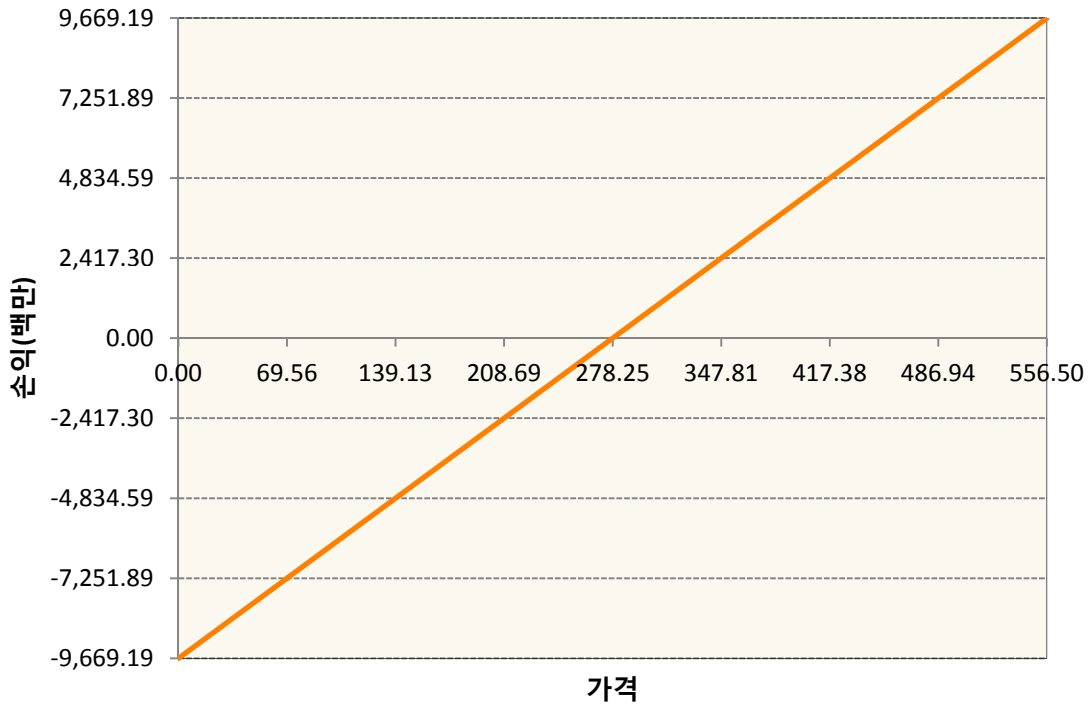
1. 계약금액

(단위:백만원)

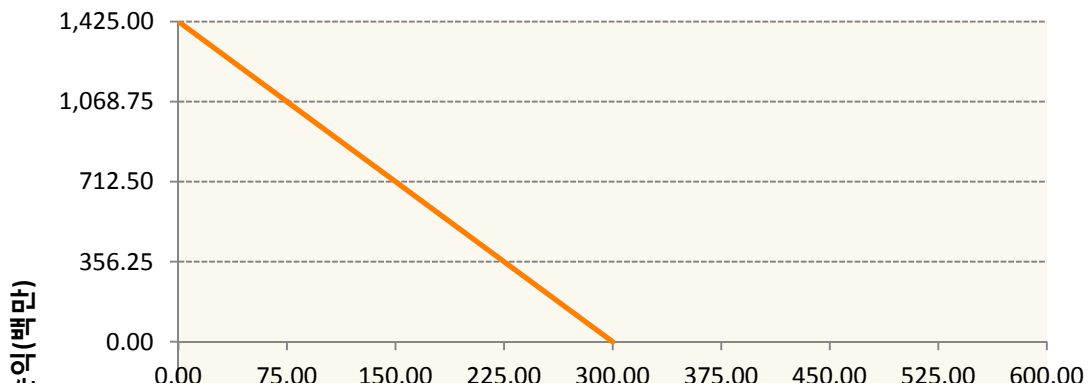
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,669	0	9,669	장내
누계	유가증권	옵션	2,257	0	2,257	장내

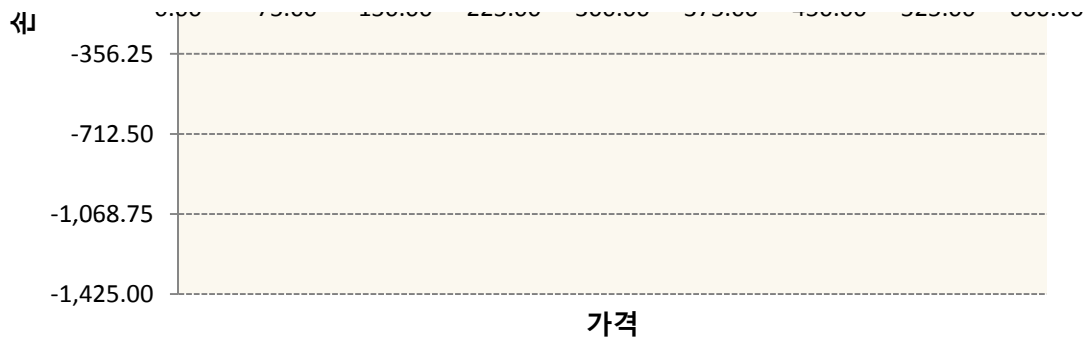
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

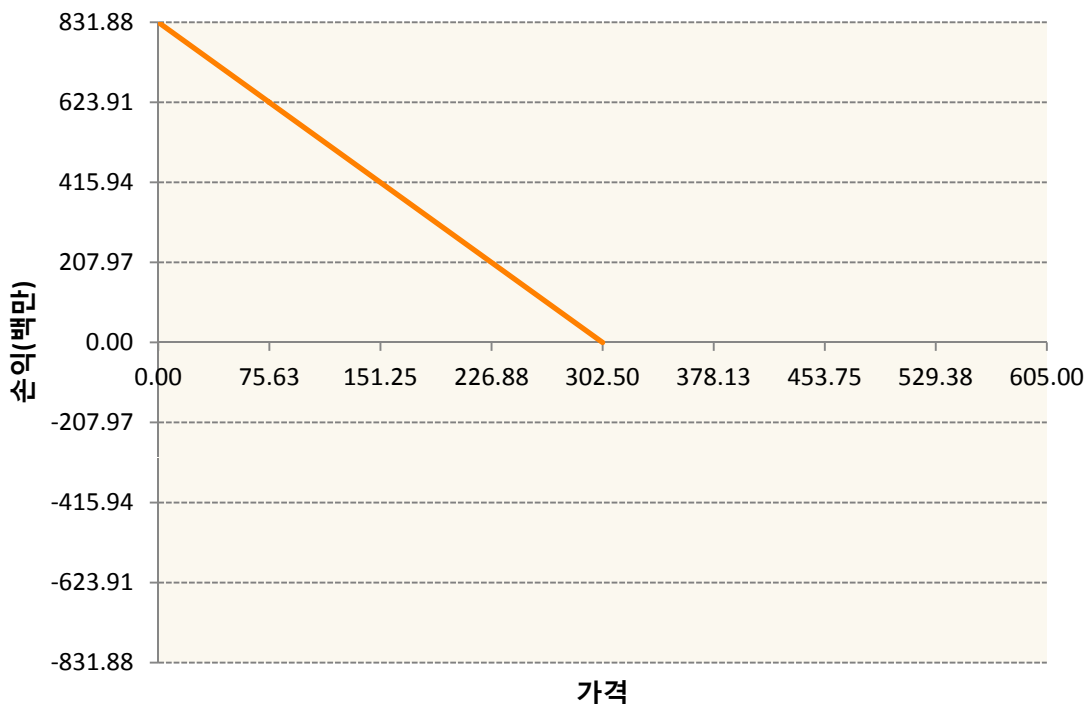


KR4301Q33005-2020-03 풋300





KR4301Q33021-2020-03 풋302.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						773
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-773	-773	-773	-773	-773	-773	-773	
-5.33%	-515	-515	-515	-515	-515	-515	-515	
-2.67%	-258	-258	-258	-258	-258	-258	-258	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	258	258	258	258	258	258	258	
5.33%	515	515	515	515	515	515	515	
8.00%	773	773	773	773	773	773	773	
KR4301Q33005		2020-03 풋300						105
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	105	105	105	105	105	105	105
-5.33%	70	70	70	70	70	70	70
-2.67%	34	34	34	35	35	35	35
0%	-1	-1	0	0	0	1	2
2.67%	-35	-34	-34	-33	-32	-31	-29
5.33%	-66	-64	-62	-61	-59	-57	-56
8.00%	-88	-86	-84	-82	-80	-78	-76

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	41	41	41	41	41
-2.67%	20	20	20	20	20	20	20
0%	0	0	0	0	0	0	1
2.67%	-20	-20	-20	-19	-19	-18	-18
5.33%	-39	-38	-38	-37	-36	-35	-34
8.00%	-54	-53	-52	-50	-49	-48	-47

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

(단위:백만원)

848

공시일	2020-03-05
기준일	2020-03-04

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	205,876	0	205,876	

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	2020-03-05
기준일	2020-03-04

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	7,306	-7,306	
누계	유가증권	수익증권	124,087	0	124,087	

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	2020-03-05
기준일	2020-03-04

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	510,738	0	510,738	
누계	통화	선도	17,817	546,863	-529,046	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,530
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,425
FX21020F03 KRW/USD 31-03-20E	3,041
FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E	2,851
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,566
FX21020G00 KRW/USD 06-03-20E	2,376
FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	950
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,178
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,207
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	950
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	1,900
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	3,269
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,269
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,900
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,801
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,224
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,900
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	190
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	4,846
FX21020G06 USD/KRW 31-03-20E	475
FX21020H00 USD/KRW 31-03-20E	950
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,376
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)

127

공시일	2020-03-05
기준일	2020-03-04

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

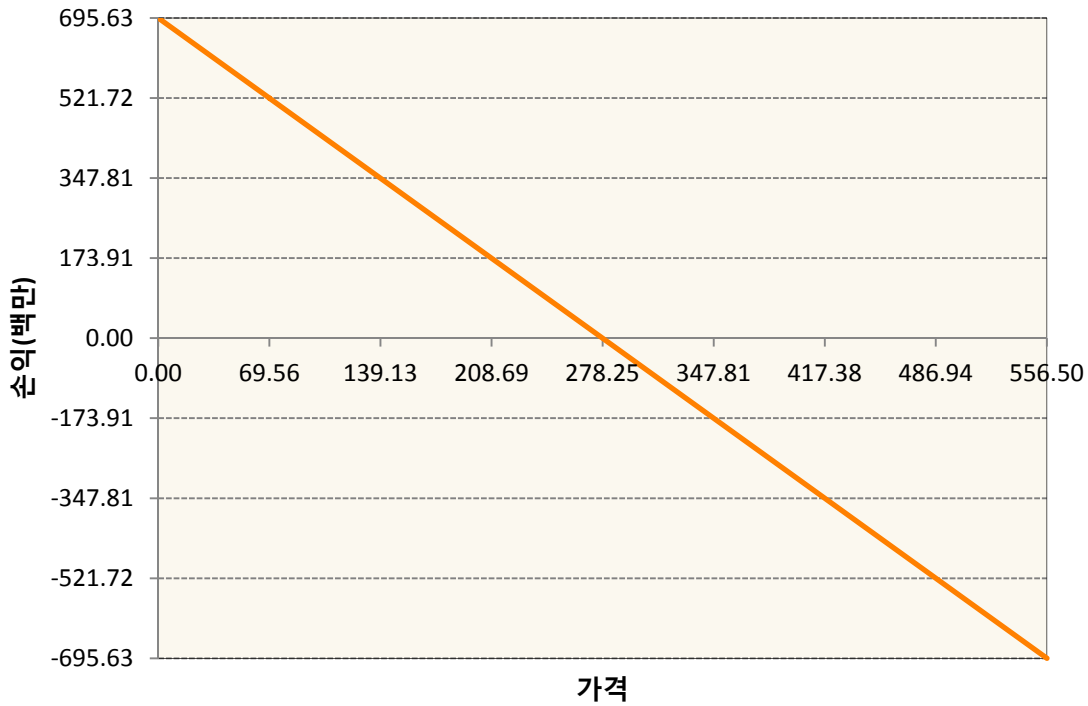
1. 계약금액

(단위:백만원)

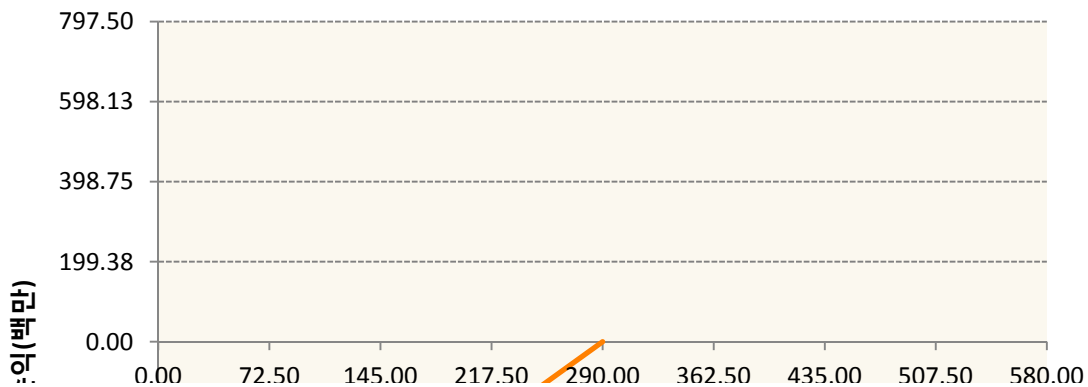
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	696	-696	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,503	-3,503	장내

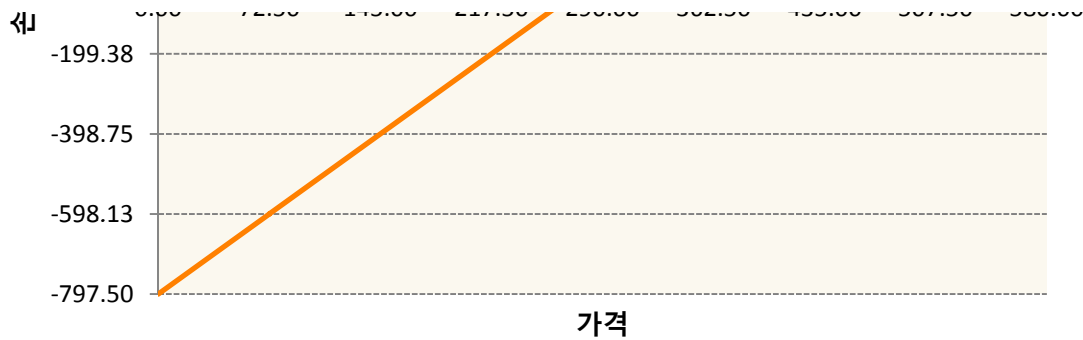
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

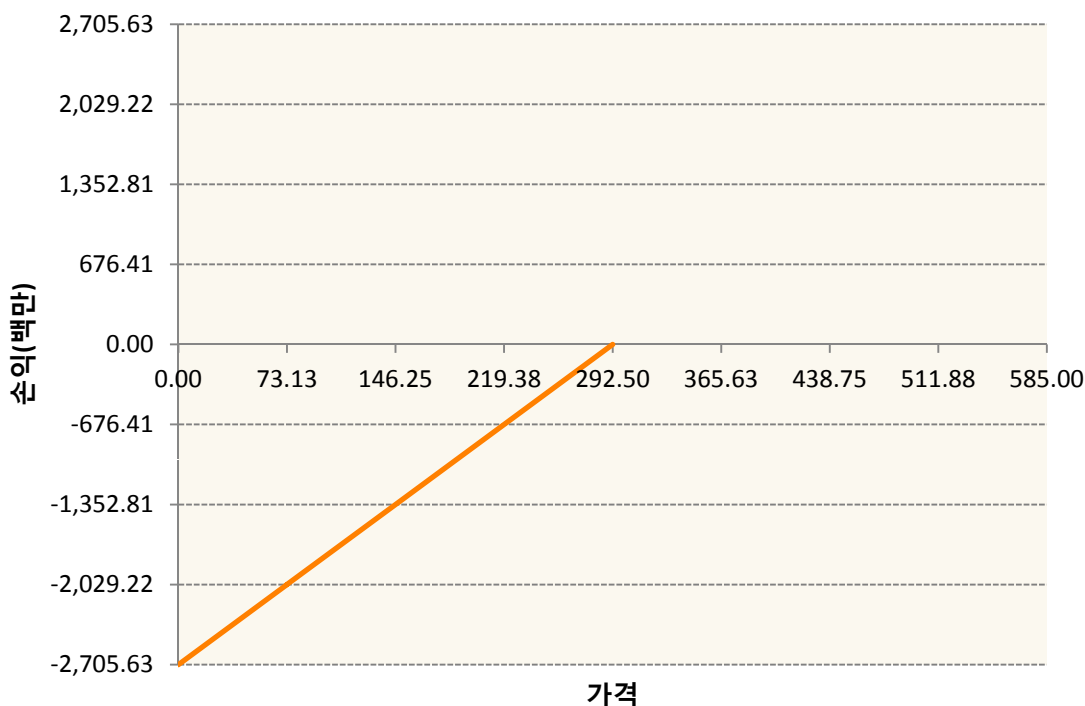


KR4301Q32908-2020-03 풋290





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						59
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-58	-58	-58	-58	-58	-59	-59
-5.33%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-39
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-19	-19	-19
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	18	17	16	15	14	13	12
5.33%	29	28	27	26	25	24	22
8.00%	34	33	32	32	31	30	29
KR4301Q32924 2020-03 풋292.5							200
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-200	-200	-200	-200	-200	-200	-200
-5.33%	-131	-131	-131	-131	-131	-132	-132
-2.67%	-63	-63	-63	-64	-65	-66	-67
0%	4	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	64	61	58	55	52	49	45
5.33%	107	104	100	96	92	89	85
8.00%	130	127	124	121	118	115	111

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

(단위:백만원)

331

공시일	2020-03-05
기준일	2020-03-04

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	529	-529	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	8,846	0	8,846	
누계	통화	선도	1,235	10,049	-8,813	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	323
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	89
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	180
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	212
FX21020H00 USD/KRW 12-03-20E	12
FX21020H00 USD/KRW 12-03-20E	38
FX21020H01 USD/KRW 31-03-20E	48
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

319

공시일	2020-03-05
기준일	2020-03-04

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

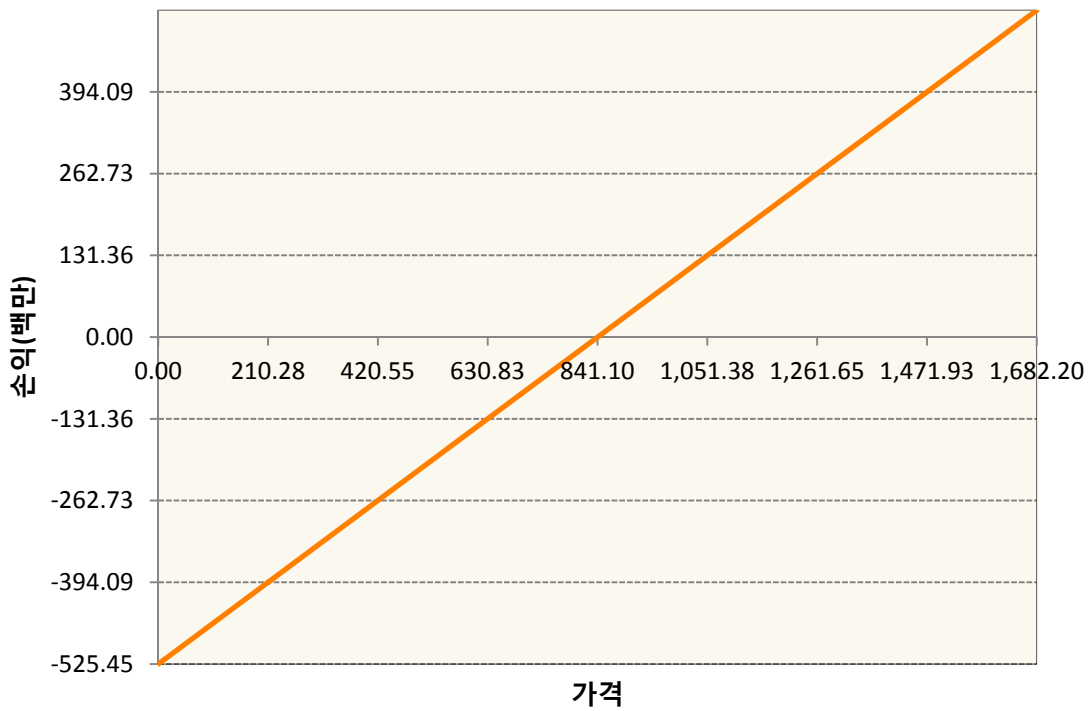
1. 계약금액

(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	525	0	525	
누계	유가증권	스왑	1,093	0	1,093	장외
누계	통화	선도	146	728	-583	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCH0-VN30 Index Future Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	87
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	2020-03-05
기준일	2020-03-04

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

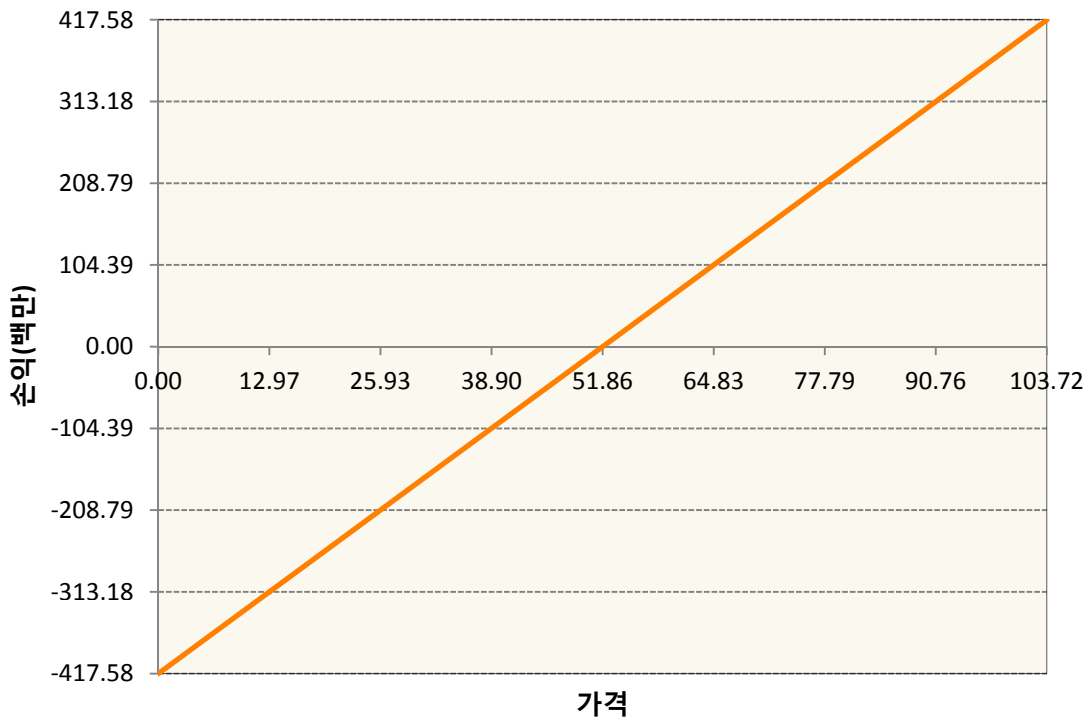
1. 계약금액

(단위:백만원)

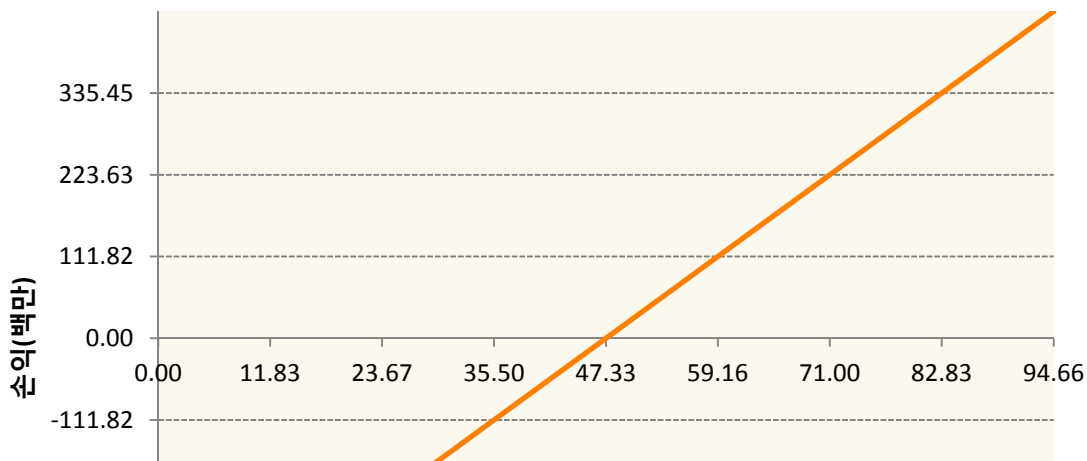
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,939	119	1,820	

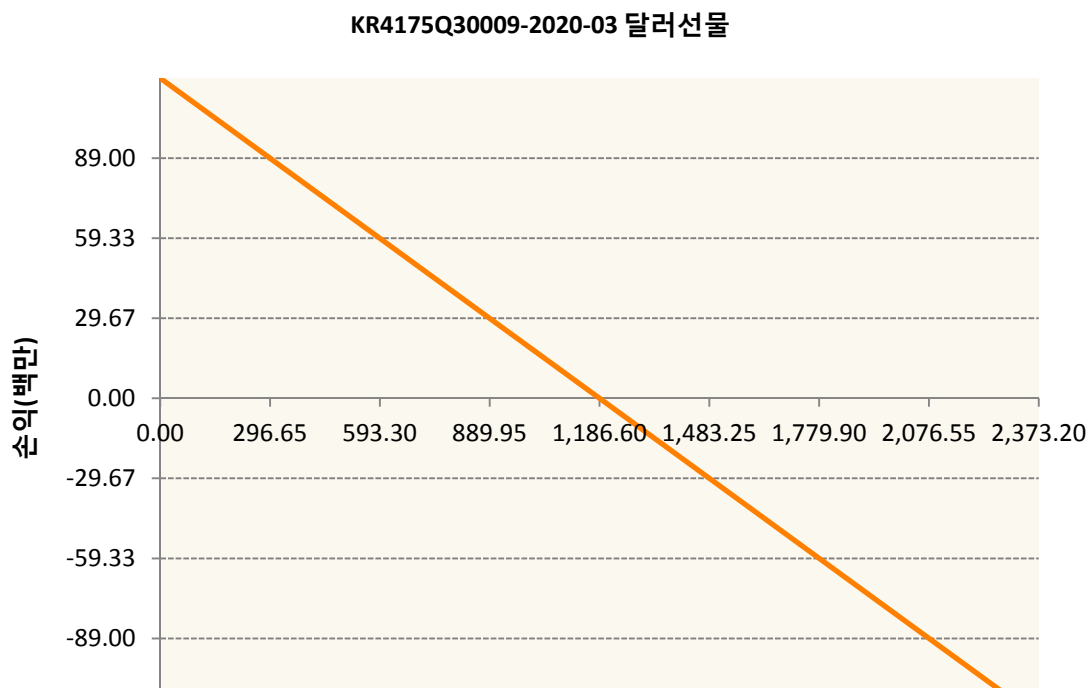
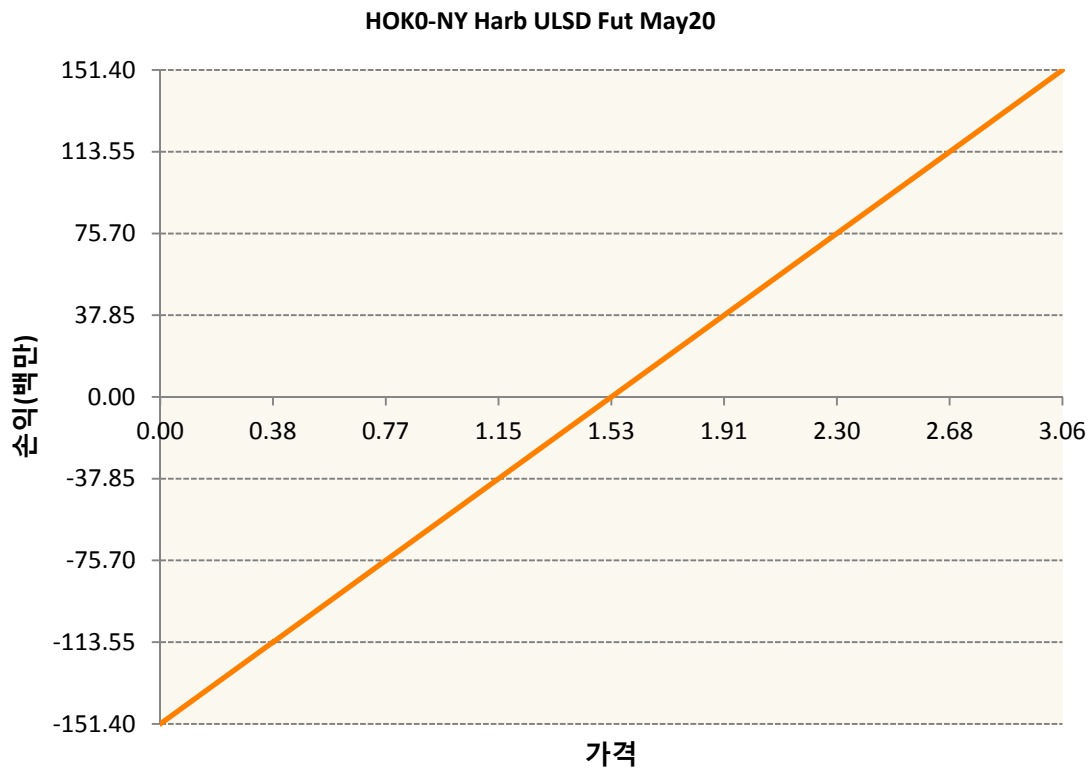
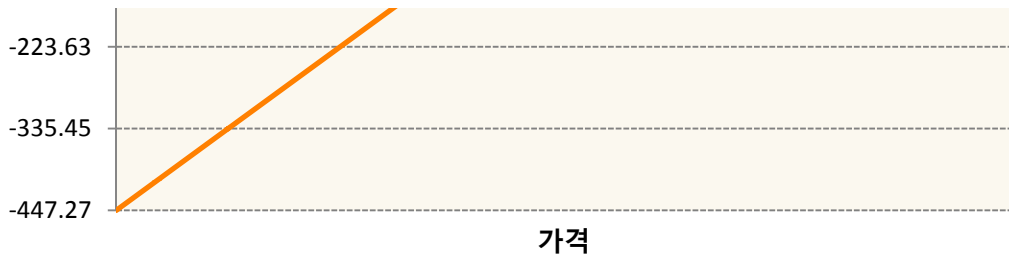
2. 만기시점의 손익구조

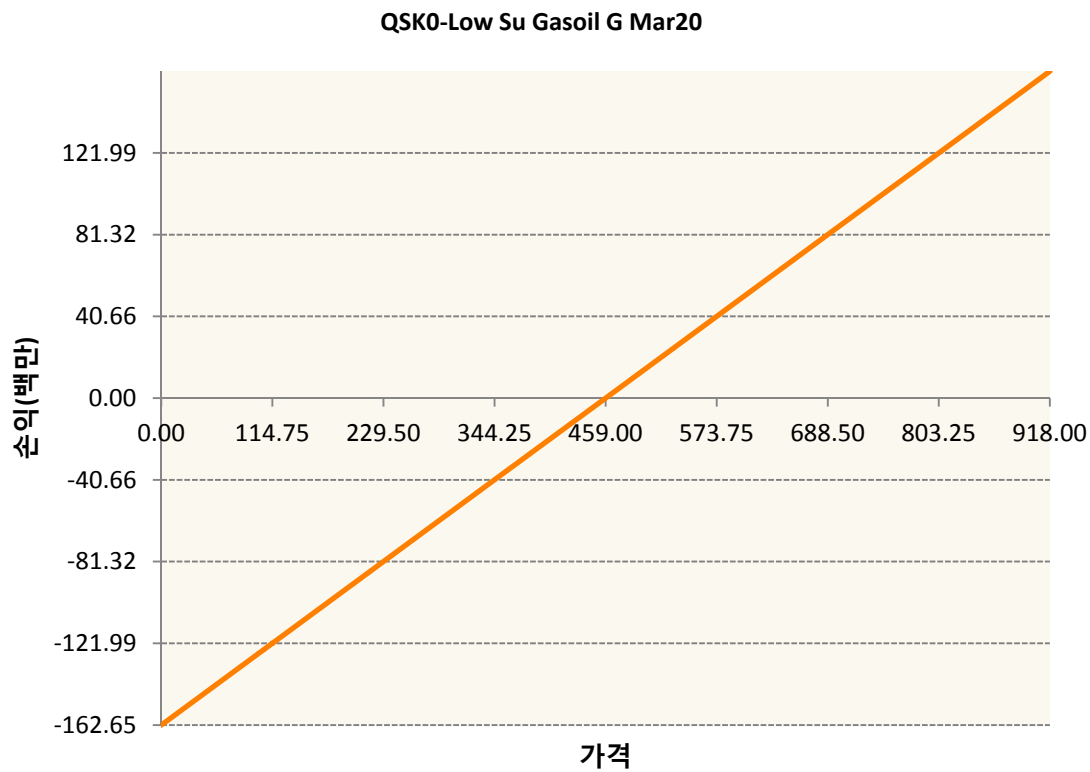
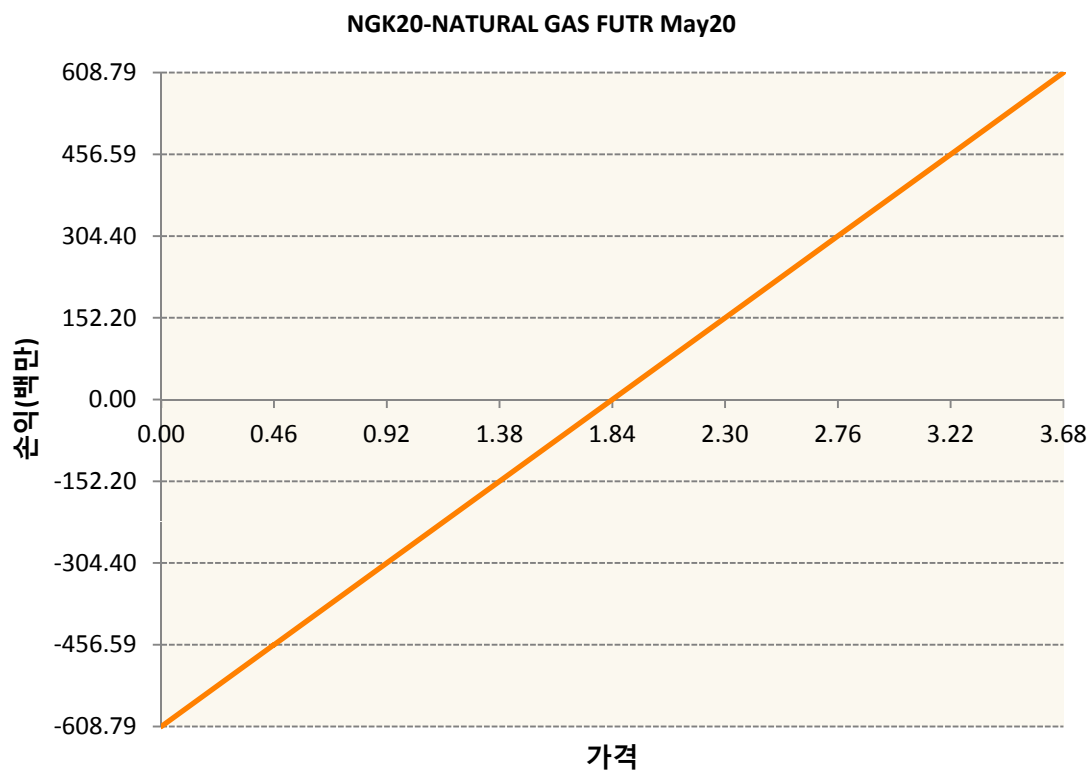
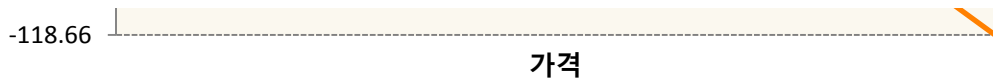
COK0-BRENT CRUDE FUTR May20



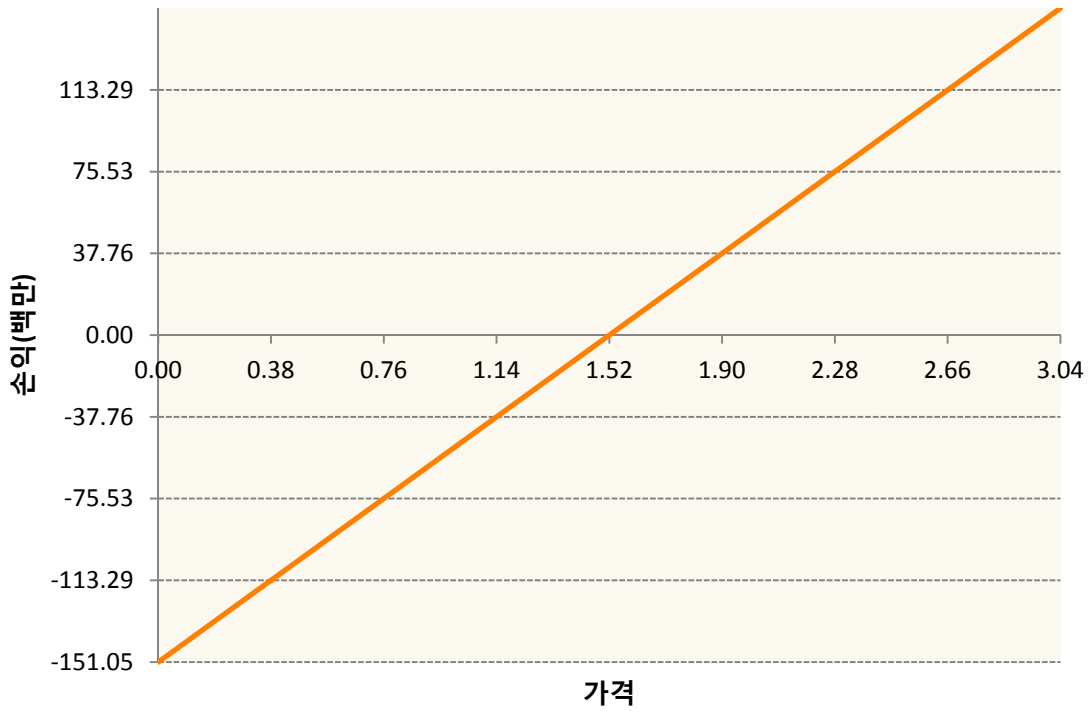
CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20







XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	33
CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	36
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	12
KR4175Q30C	2020-03 달러선물	9
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	49
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	13
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	12

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

(단위:백만원)

318

공시일	2020-03-05
기준일	2020-03-04

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

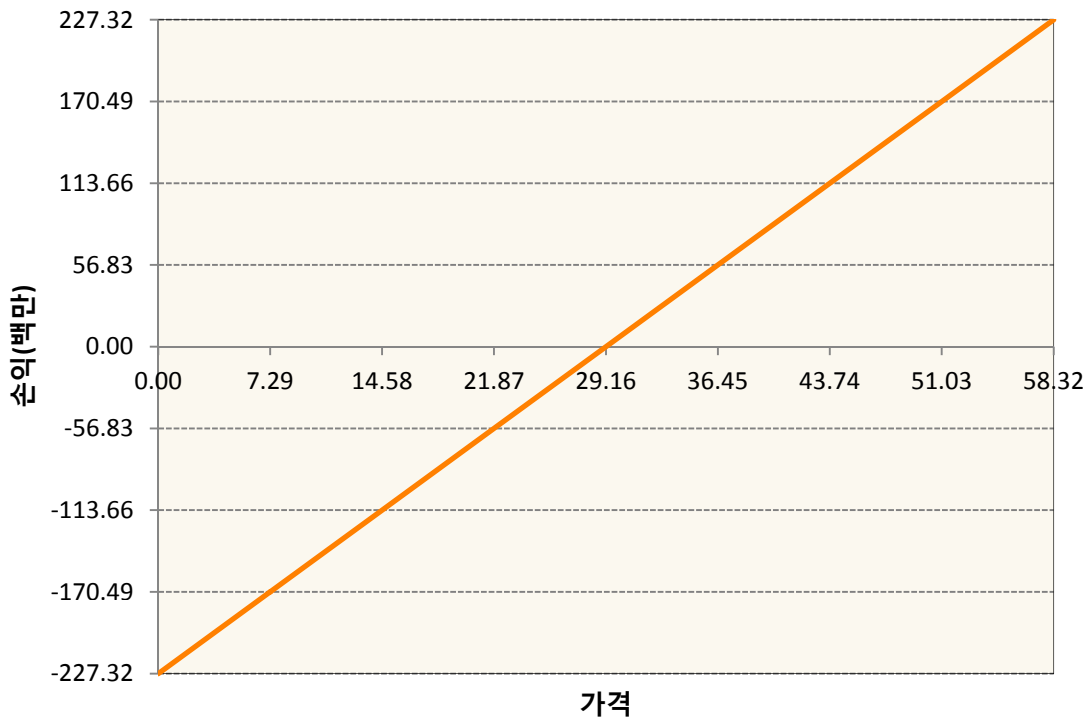
1. 계약금액

(단위:백만원)

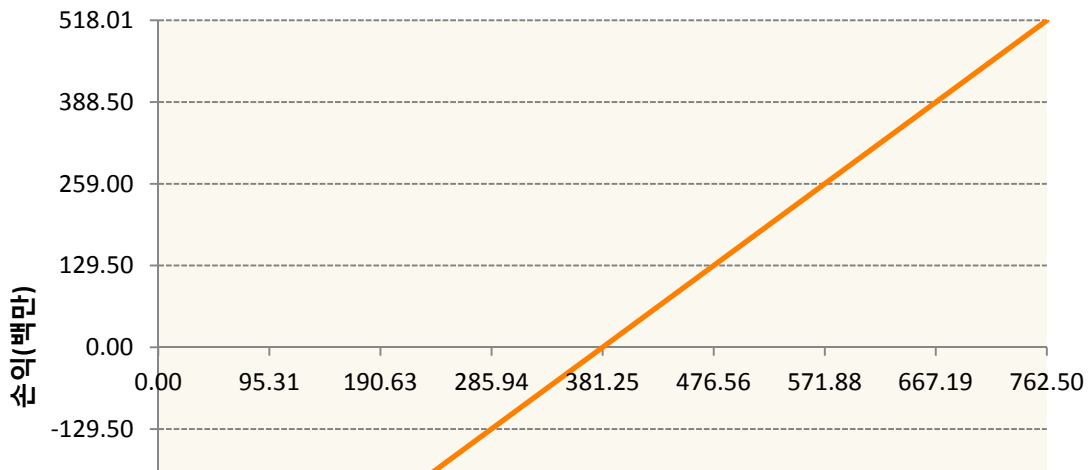
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,626	154	2,472	

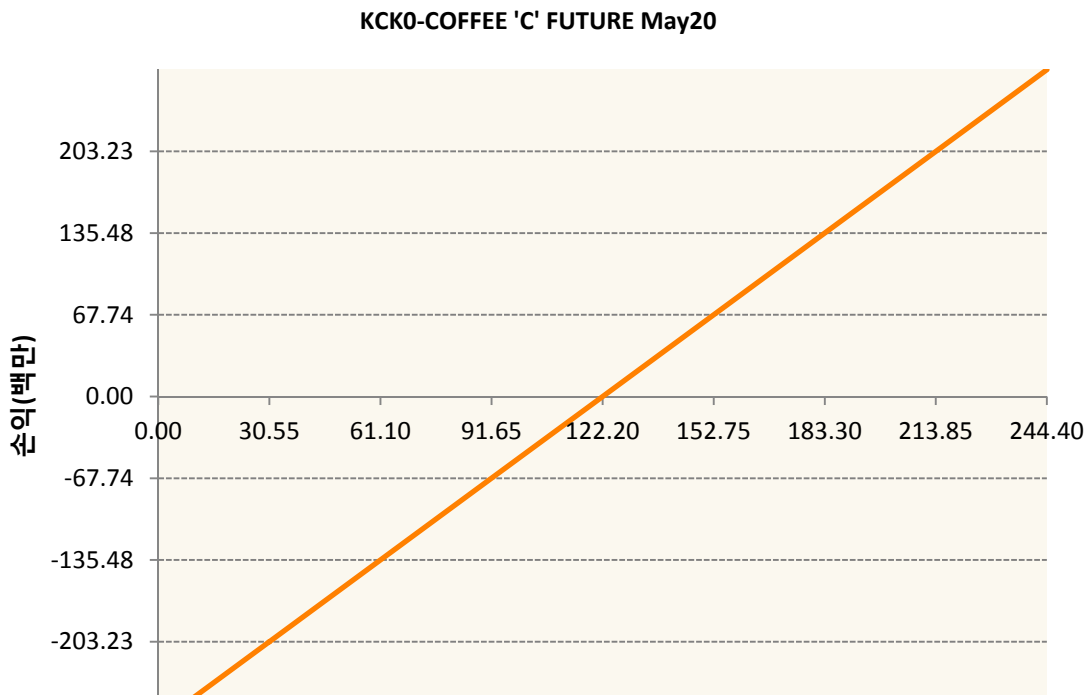
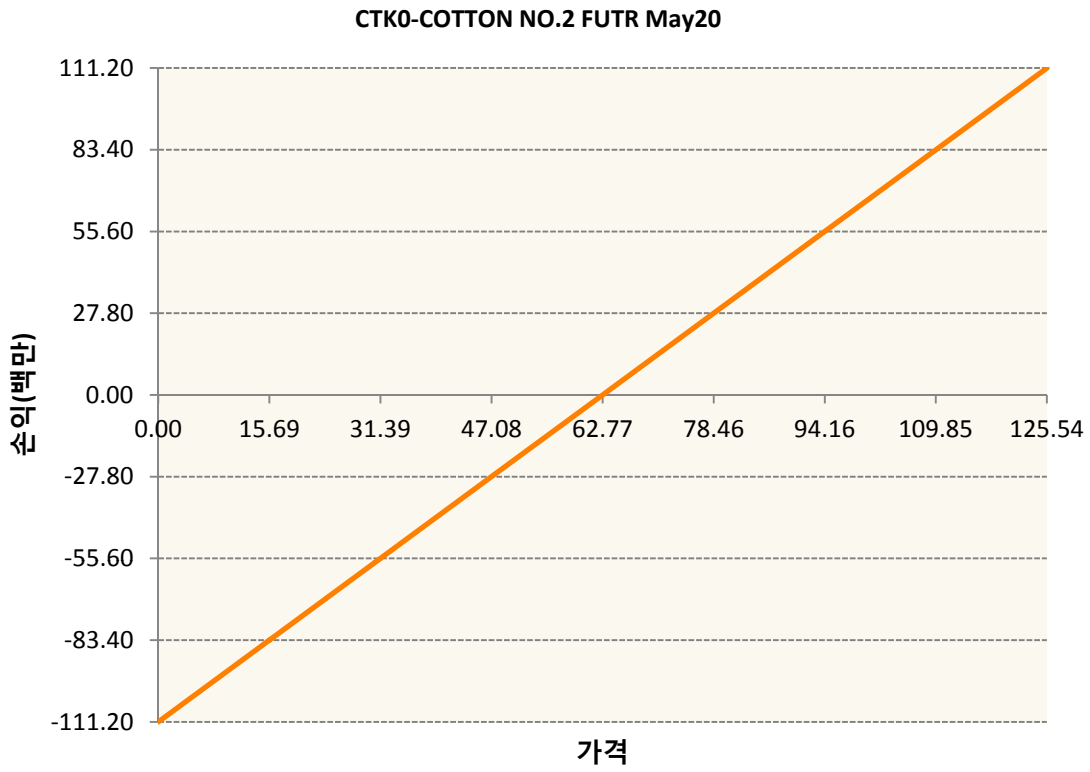
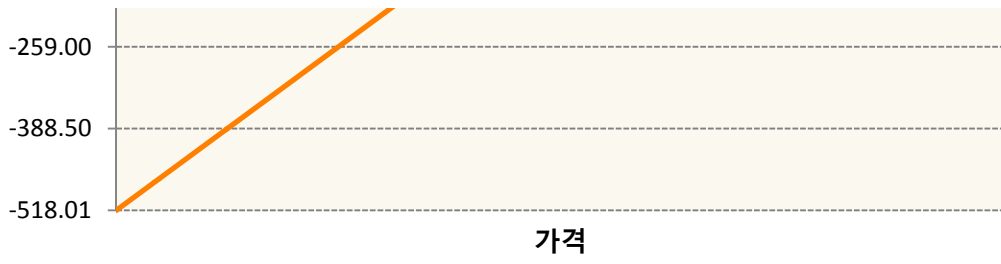
2. 만기시점의 손익구조

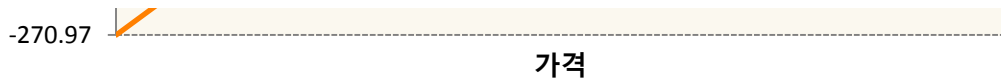
BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20



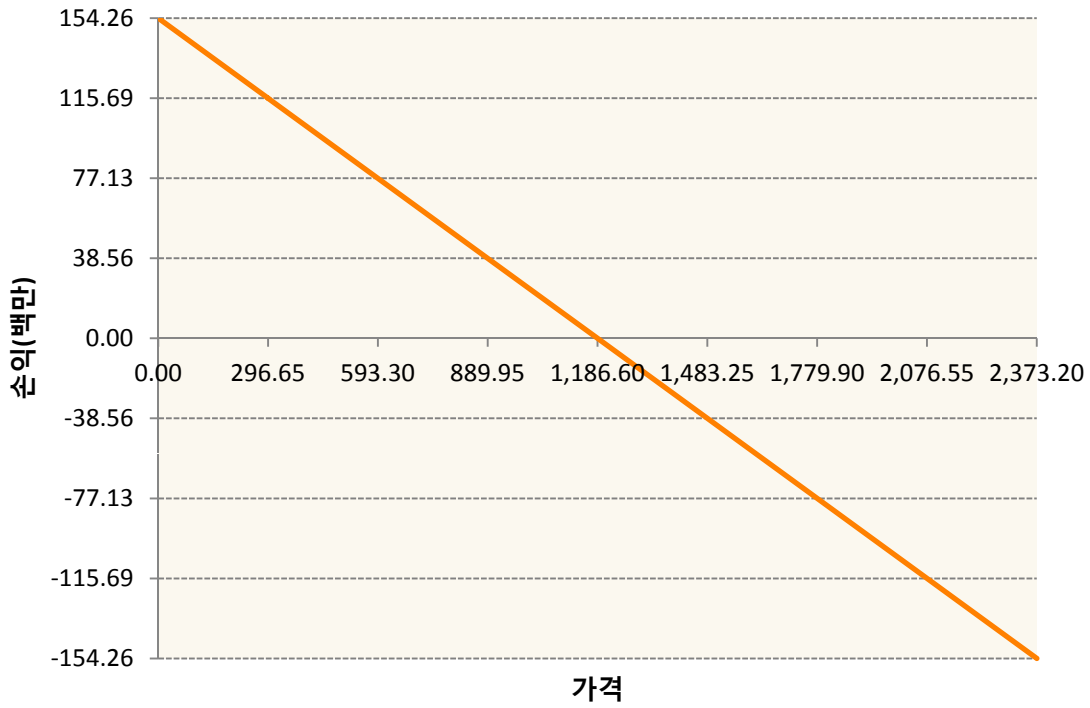
CK0-CORN FUTURE May20



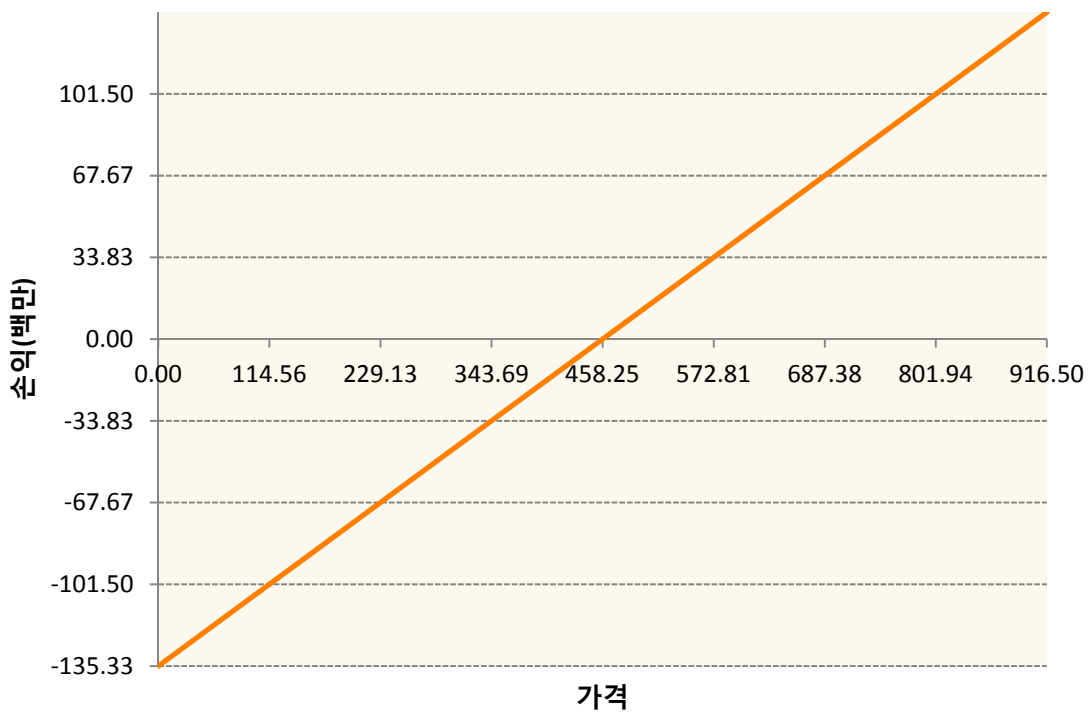




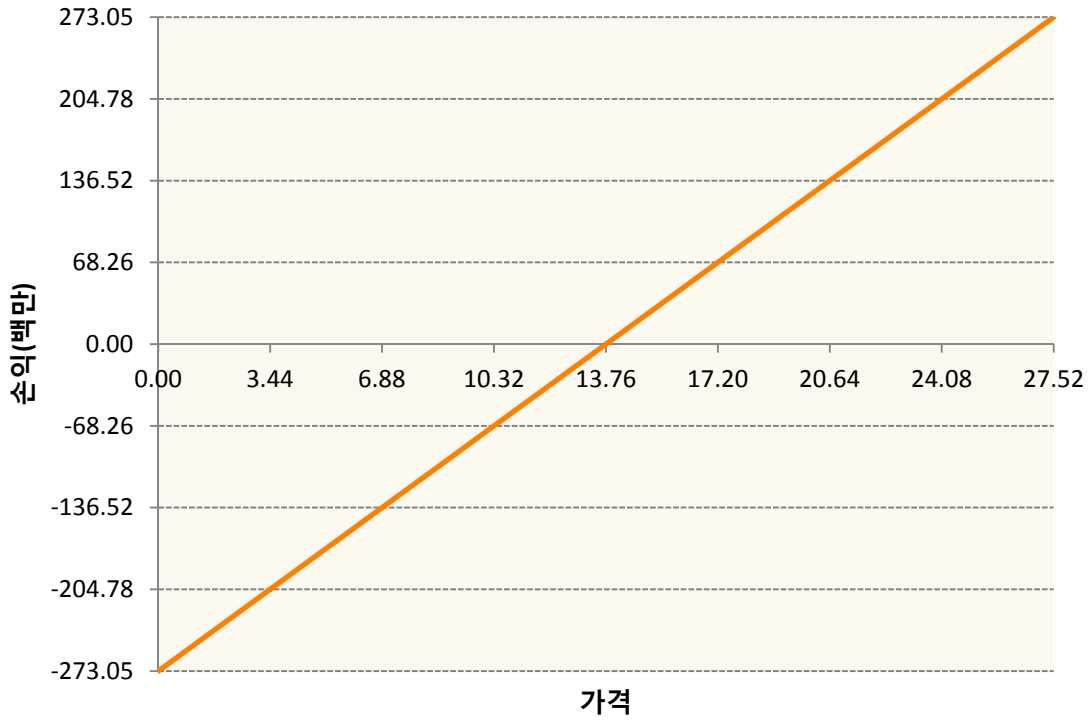
KR4175Q30009-2020-03 달러선물



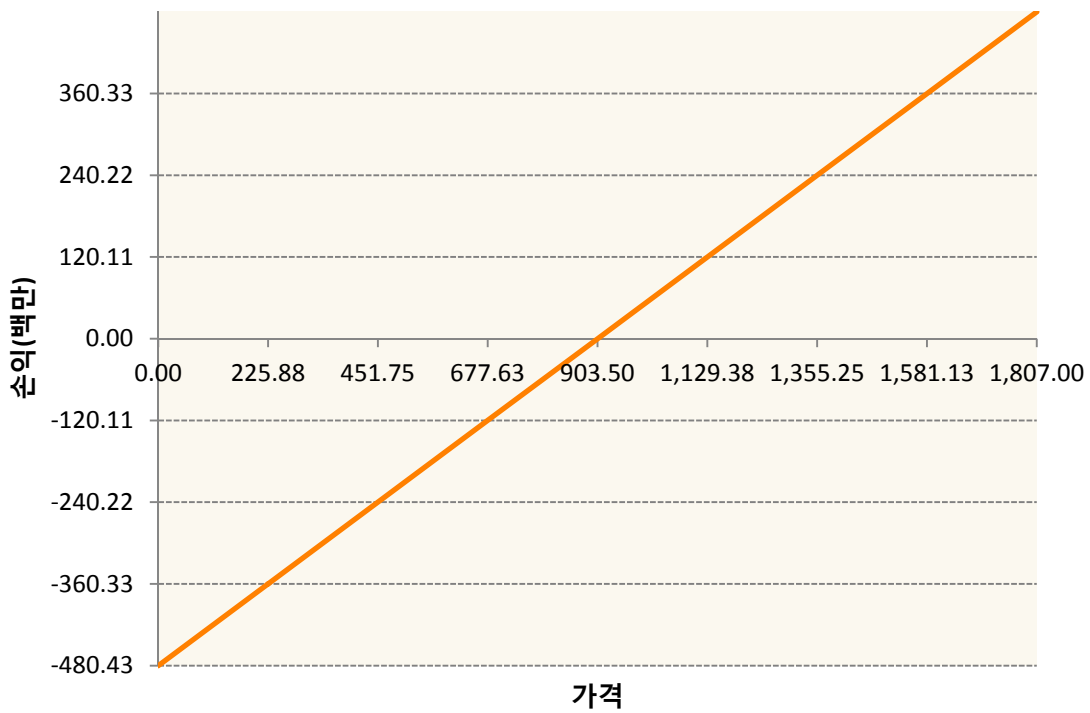
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



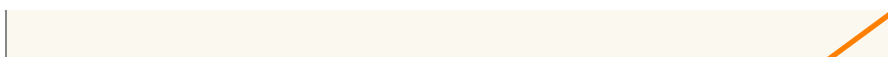
SBK0-Sugar May20

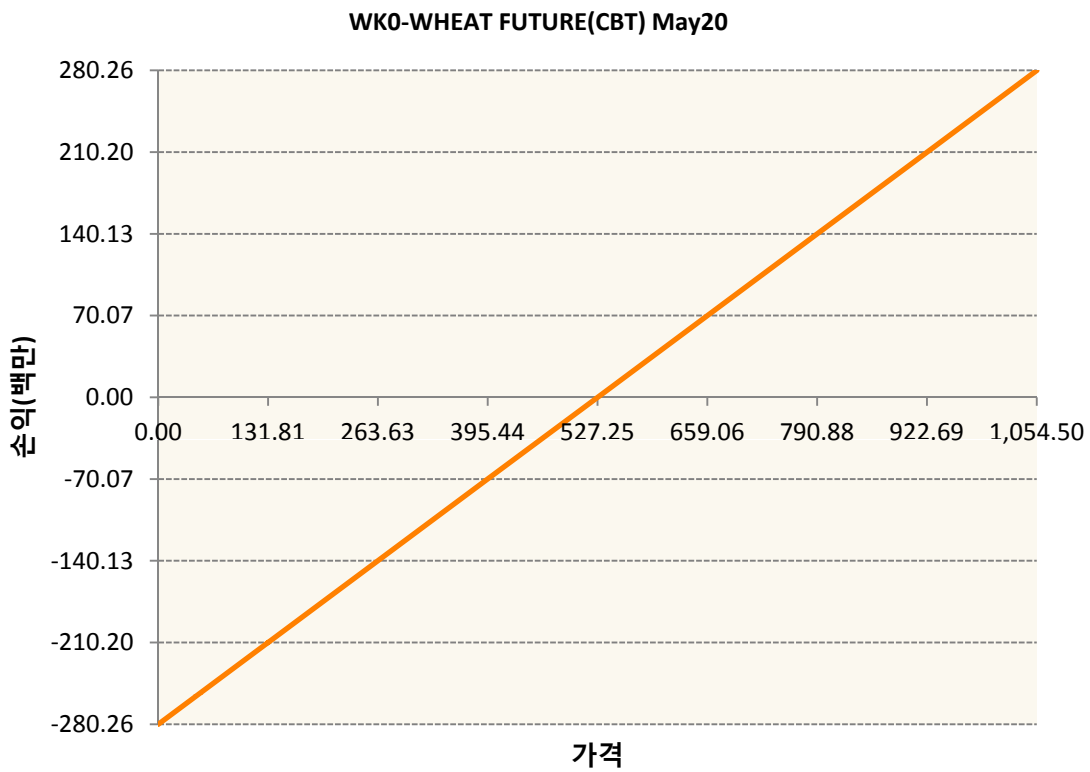
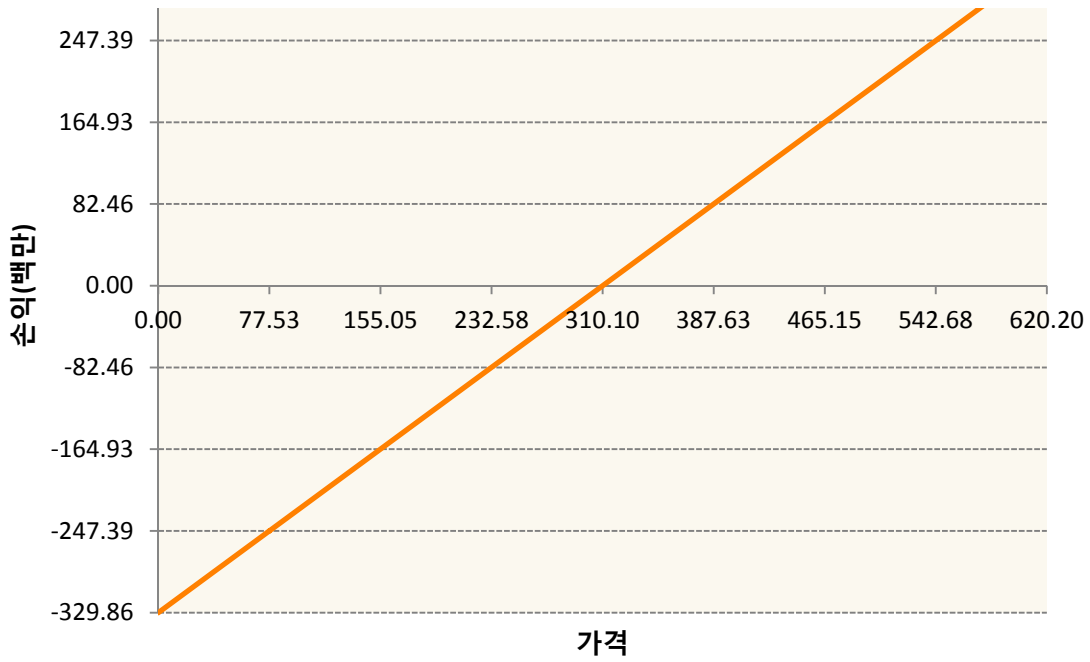


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	18
CK0	CORN FUTURE May20	41
CTK0	COTTON NO.2 FUTR May20	9
KCK0	COFFEE 'C' FUTURE May20	22
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)

230