

공시일	2020-03-13
기준일	2020-03-12

포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	5	0	5	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

159

공시일	2020-03-13
기준일	2020-03-12

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

952

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

701

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-13
기준일	2020-03-12

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	7,308	0	7,308	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S200310

579

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

893

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-13
기준일	2020-03-12

유로인덱스모(주식-파생형)

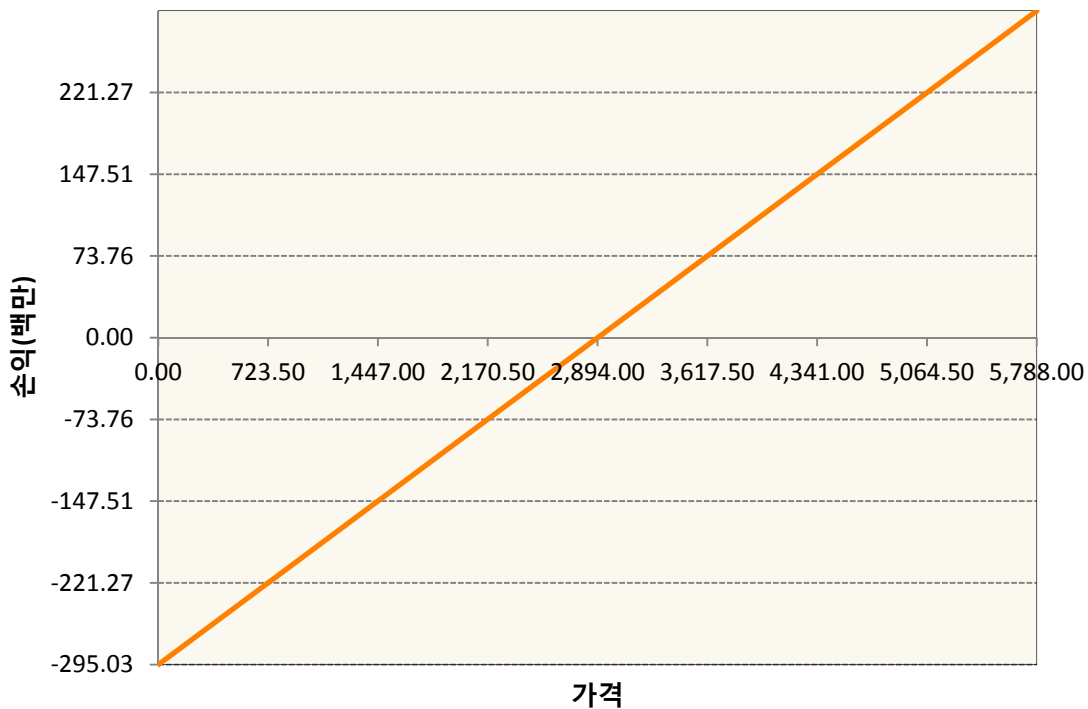
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	295	0	295	

2. 만기시점의 손익구조

VGH0-EURO STOXX 50 Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH0	EURO STOXX 50 Mar20	24
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

20

공시일	2020-03-13
기준일	2020-03-12

차이나인덱스모(주식-파생형)

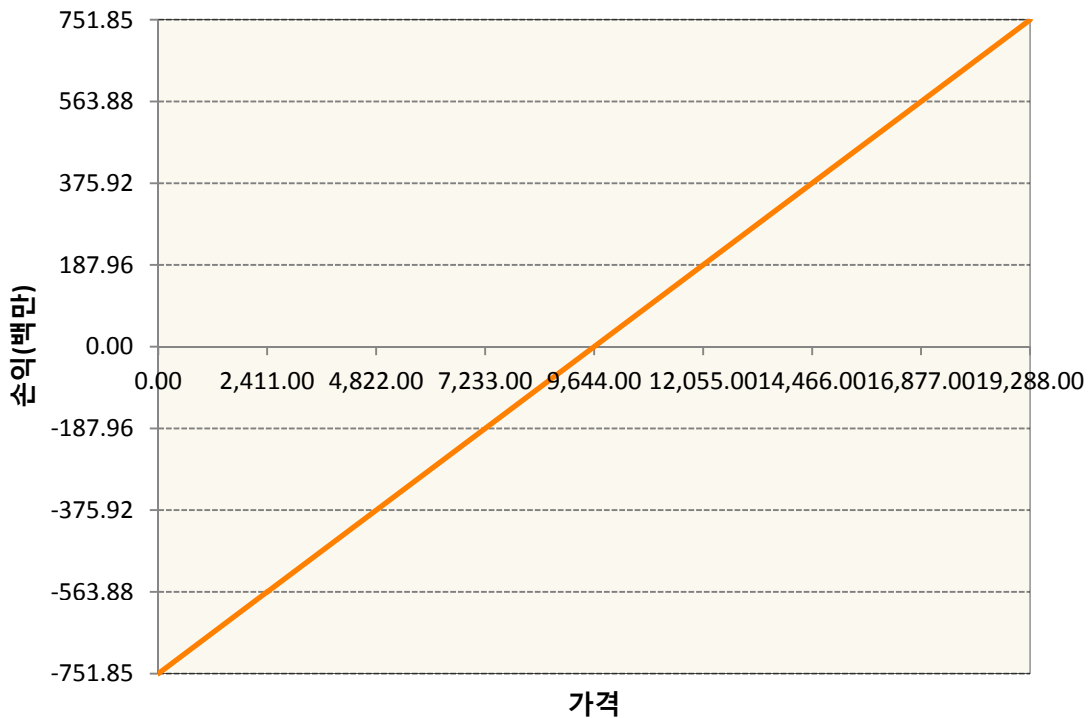
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	752	0	752	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH0	HSCEI Futures Mar20	60
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

56

공시일	2020-03-13
기준일	2020-03-12

커버드콜모(주식혼합-파생형)

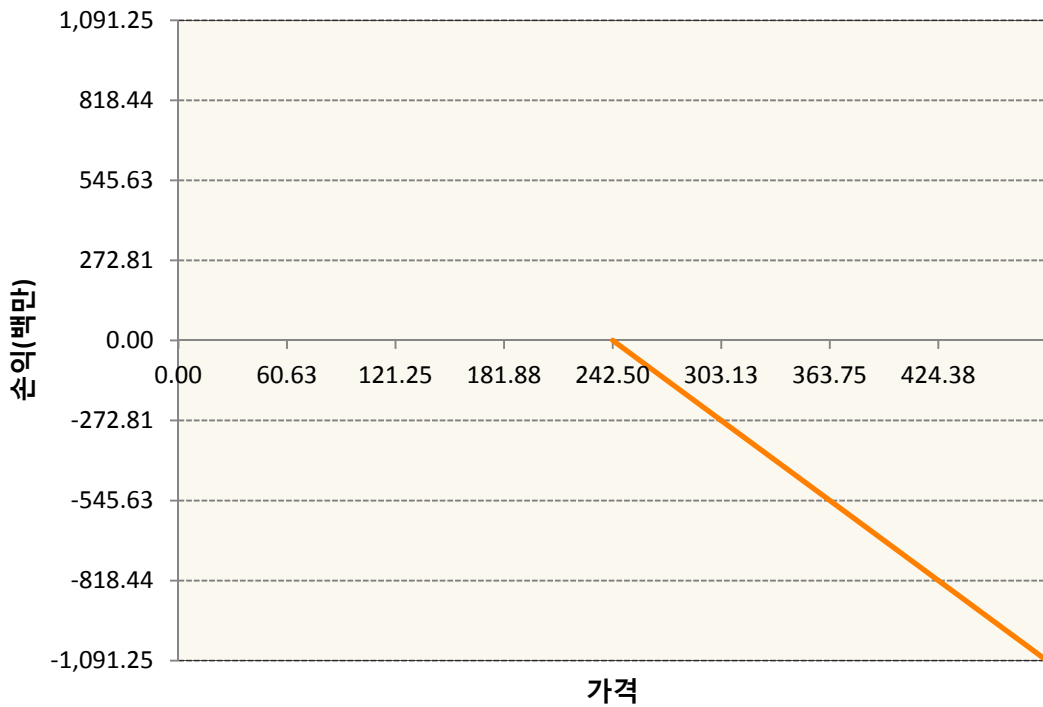
1. 계약금액

(단위:백만원)

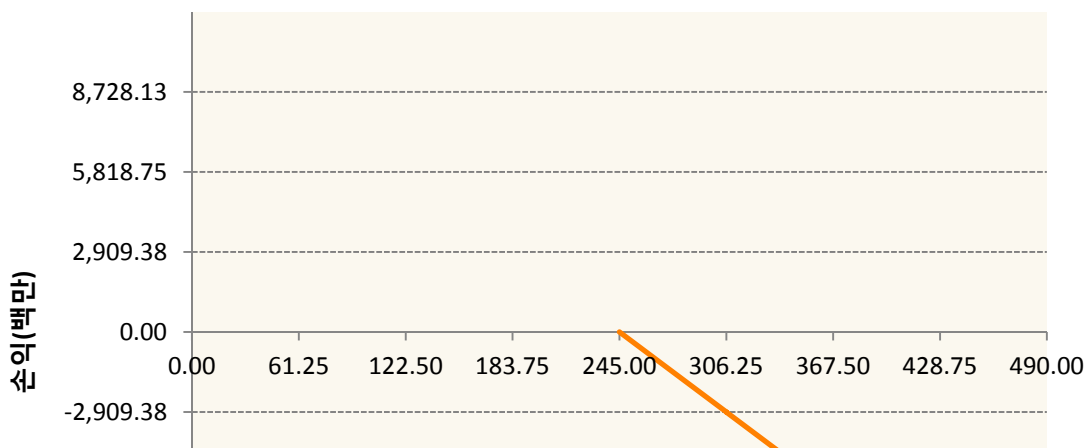
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	163,580	-163,580	장내
누계	유가증권	옵션	0	186,343	-186,343	장내

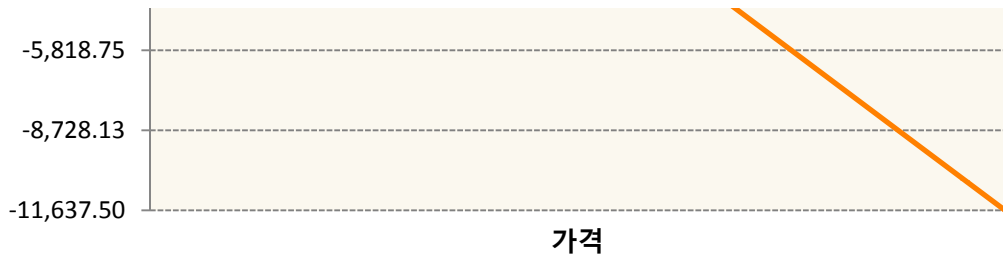
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q42420-2020-04 콜242.5

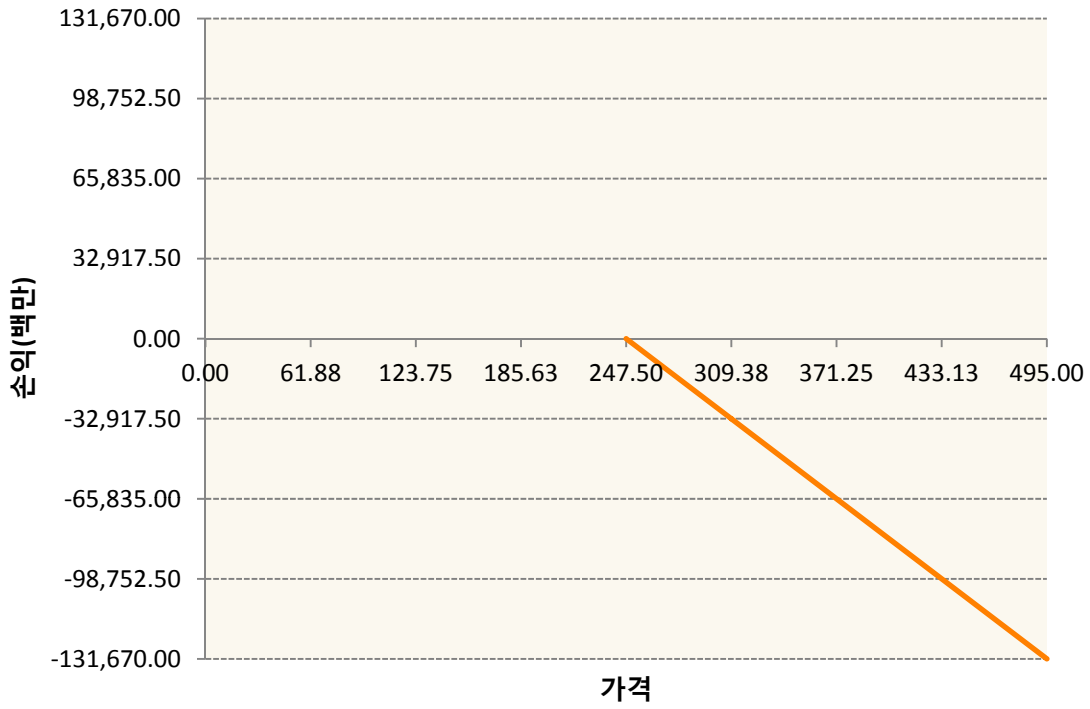


KR4201Q42453-2020-04 콜245

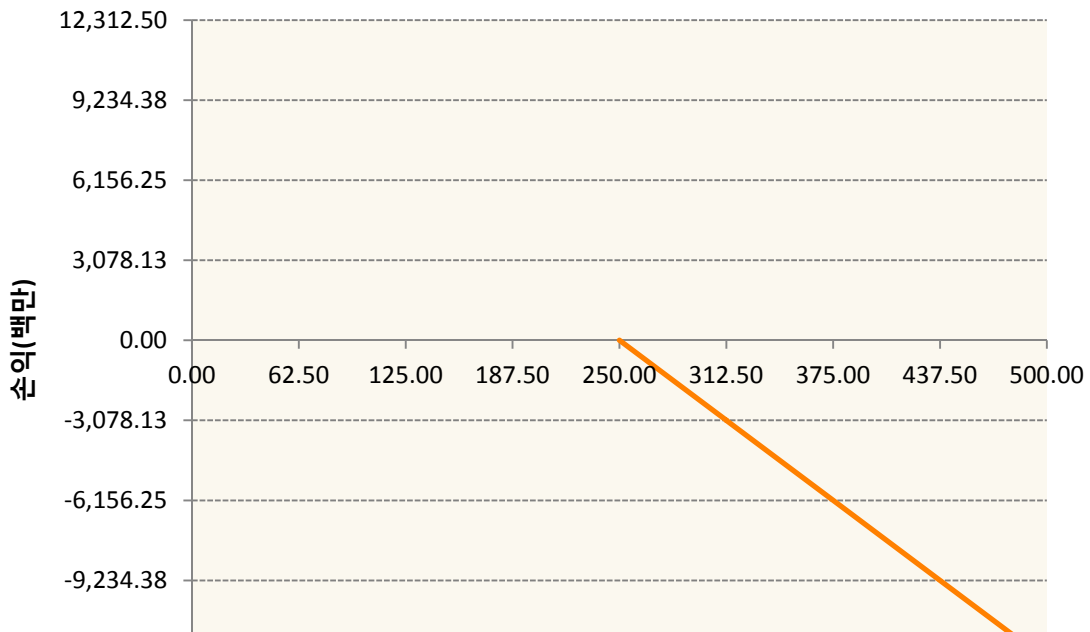


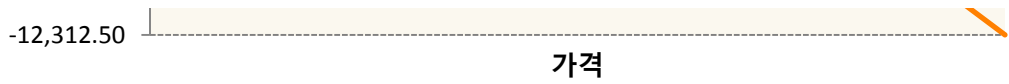


KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

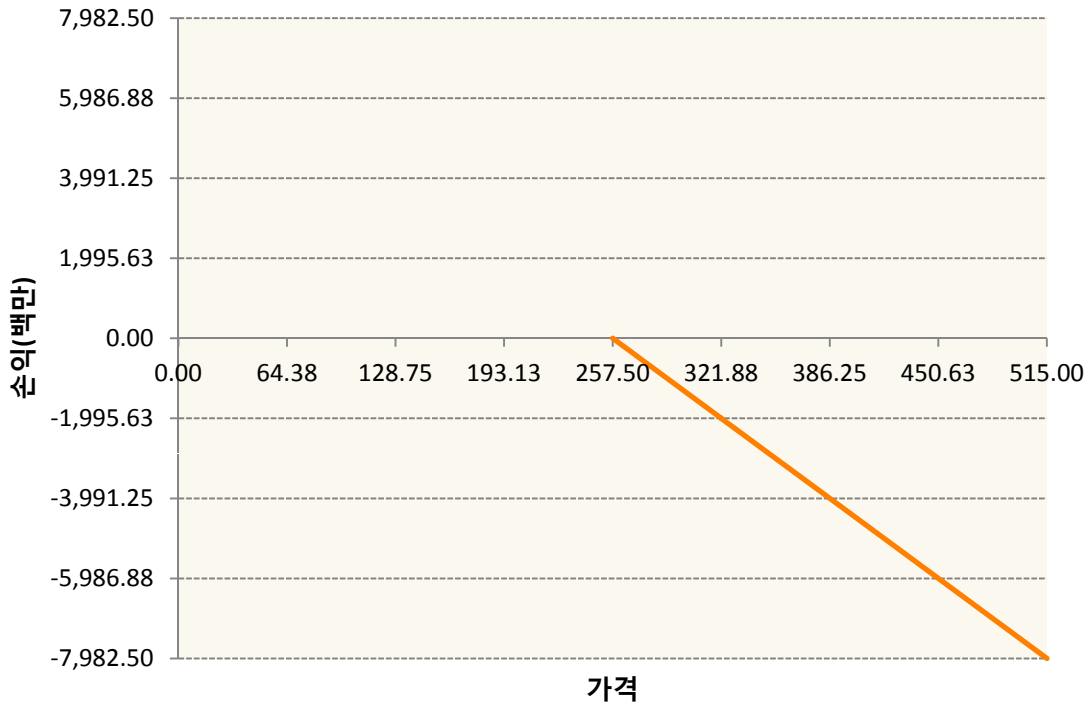


KR4201Q42503-2020-04 콜250

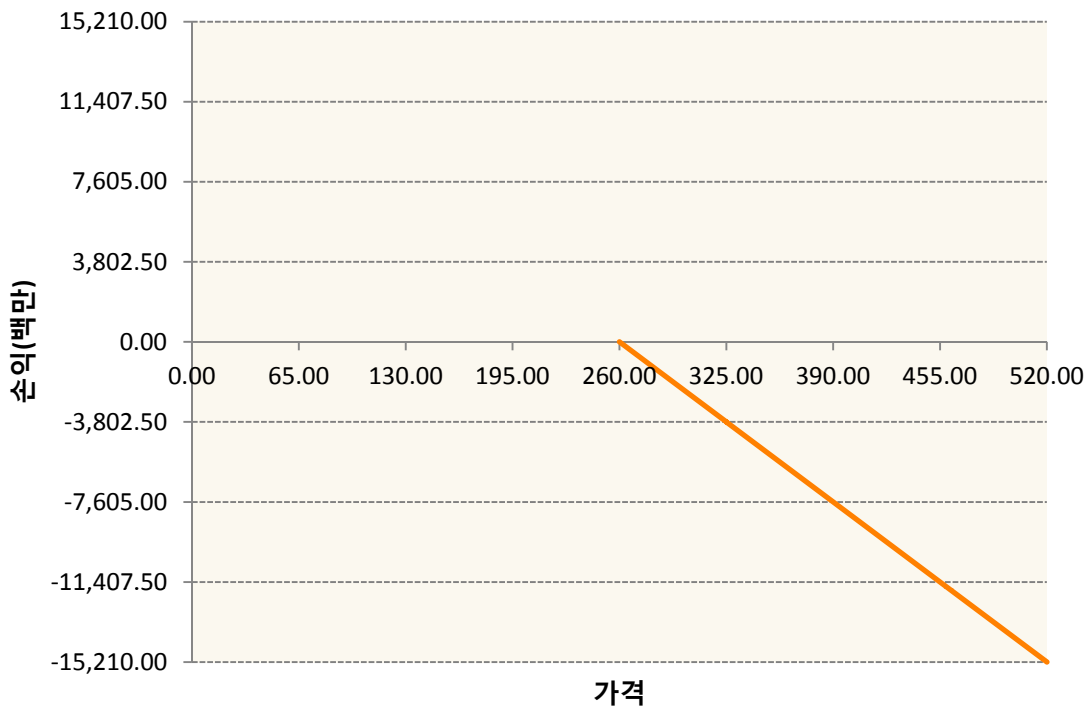




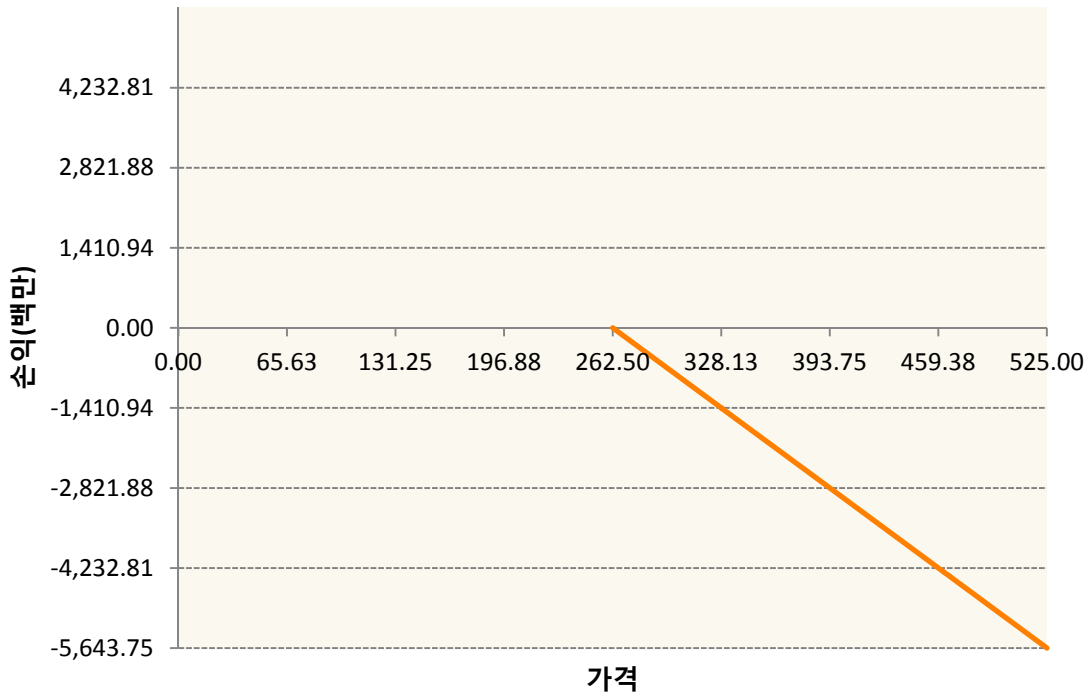
KR4201Q42578-2020-04 콜257.5



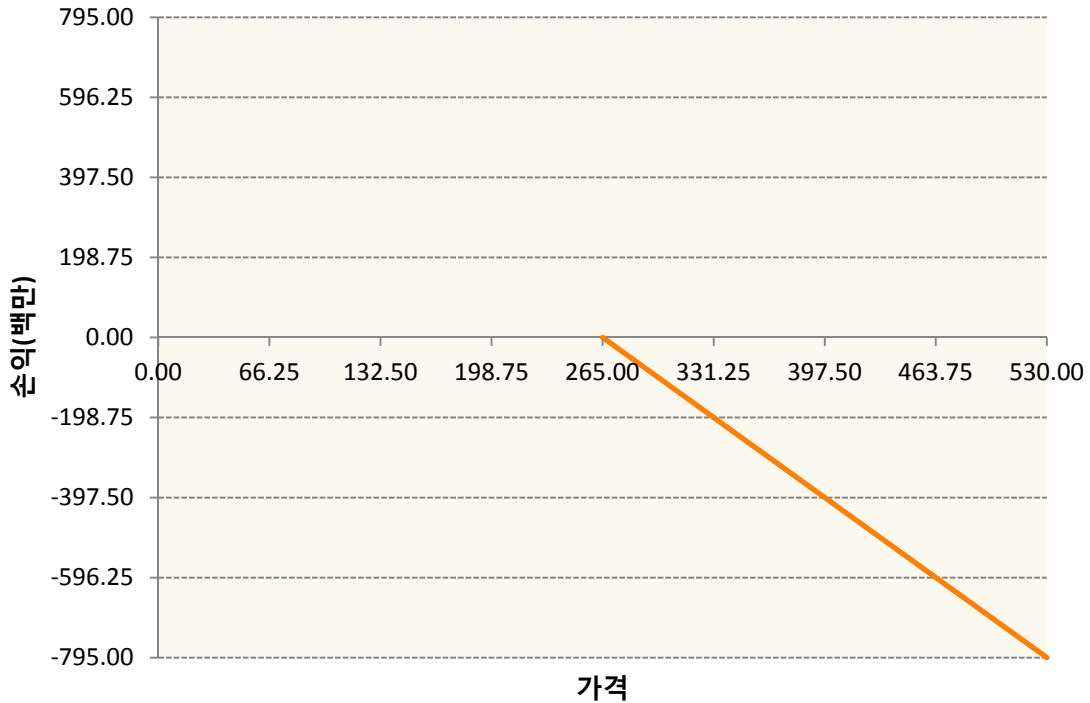
KR4201Q42602-2020-04 콜260



KR4201Q42628-2020-04 콜262.5



KR4201Q42651-2020-04 콜265



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q42420 2020-04 콜242.5

73

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	51	48	44	41	37	33	29
-5.33%	42	38	34	30	25	21	17
-2.67%	29	25	21	16	12	7	3
0%	13	9	4	0	-4	-9	-13
2.67%	-6	-10	-14	-19	-23	-27	-32
5.33%	-29	-32	-36	-40	-43	-48	-52
8.00%	-53	-56	-59	-62	-66	-70	-73

KR4201Q42453 2020-04 콜245 754

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	506	472	436	398	359	320	279
-5.33%	420	378	336	293	249	205	161
-2.67%	299	253	207	160	114	67	20
0%	143	95	48	0	-48	-95	-143
2.67%	-50	-95	-141	-187	-233	-280	-327
5.33%	-274	-314	-356	-398	-442	-486	-531
8.00%	-525	-558	-594	-632	-671	-712	-754

KR4201Q42479 2020-04 콜247.5 8,198

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,260	4,906	4,526	4,127	3,712	3,284	2,845
-5.33%	4,419	3,975	3,518	3,050	2,575	2,093	1,606
-2.67%	3,215	2,706	2,193	1,678	1,161	642	122
0%	1,612	1,074	537	0	-537	-1,074	-1,610
2.67%	-393	-919	-1,448	-1,980	-2,513	-3,047	-3,583
5.33%	-2,770	-3,250	-3,742	-4,243	-4,752	-5,266	-5,785
8.00%	-5,465	-5,876	-6,310	-6,763	-7,230	-7,709	-8,198

KR4201Q42503 2020-04 콜250 735

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	450	420	387	352	316	278	239
-5.33%	383	344	303	262	219	176	132
-2.67%	284	238	192	145	98	50	3
0%	149	99	50	0	-50	-100	-149
2.67%	-22	-72	-123	-173	-223	-273	-324
5.33%	-230	-276	-324	-372	-421	-470	-519
8.00%	-468	-509	-552	-596	-642	-688	-735

KR4201Q42578 2020-04 콜257.5 415

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	217	204	188	170	151	131	109
-5.33%	191	172	151	129	105	80	55

-2.67%	150	125	99	72	45	17	-11
0%	89	60	30	0	-30	-61	-92
2.67%	7	-25	-57	-89	-121	-154	-186
5.33%	-98	-131	-163	-196	-228	-261	-294
8.00%	-225	-256	-287	-319	-350	-382	-415
KR4201Q42602 2020-04 콜260							751
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	372	350	323	292	258	222	183
-5.33%	331	298	261	222	180	135	89
-2.67%	263	220	174	125	76	24	-28
0%	163	110	55	0	-56	-113	-170
2.67%	23	-37	-97	-157	-217	-277	-338
5.33%	-159	-221	-283	-345	-407	-470	-532
8.00%	-383	-443	-504	-566	-627	-689	-751
KR4201Q42628 2020-04 콜262.5							264
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	124	116	108	97	86	73	60
-5.33%	111	100	88	74	60	44	28
-2.67%	90	75	59	42	25	7	-12
0%	57	39	20	0	-20	-40	-61
2.67%	11	-10	-32	-53	-75	-97	-119
5.33%	-50	-73	-95	-118	-141	-164	-187
8.00%	-126	-149	-172	-195	-218	-241	-264
KR4201Q42651 2020-04 콜265							35
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	16	15	14	12	11	9	7
-5.33%	14	13	11	9	7	5	3
-2.67%	12	10	8	5	3	1	-2
0%	8	5	3	0	-3	-5	-8
2.67%	2	-1	-4	-7	-10	-13	-16
5.33%	-6	-9	-12	-15	-19	-22	-25
8.00%	-16	-19	-22	-25	-29	-32	-35

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

(단위:백만원)

9,270

공시일	2020-03-13
기준일	2020-03-12

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

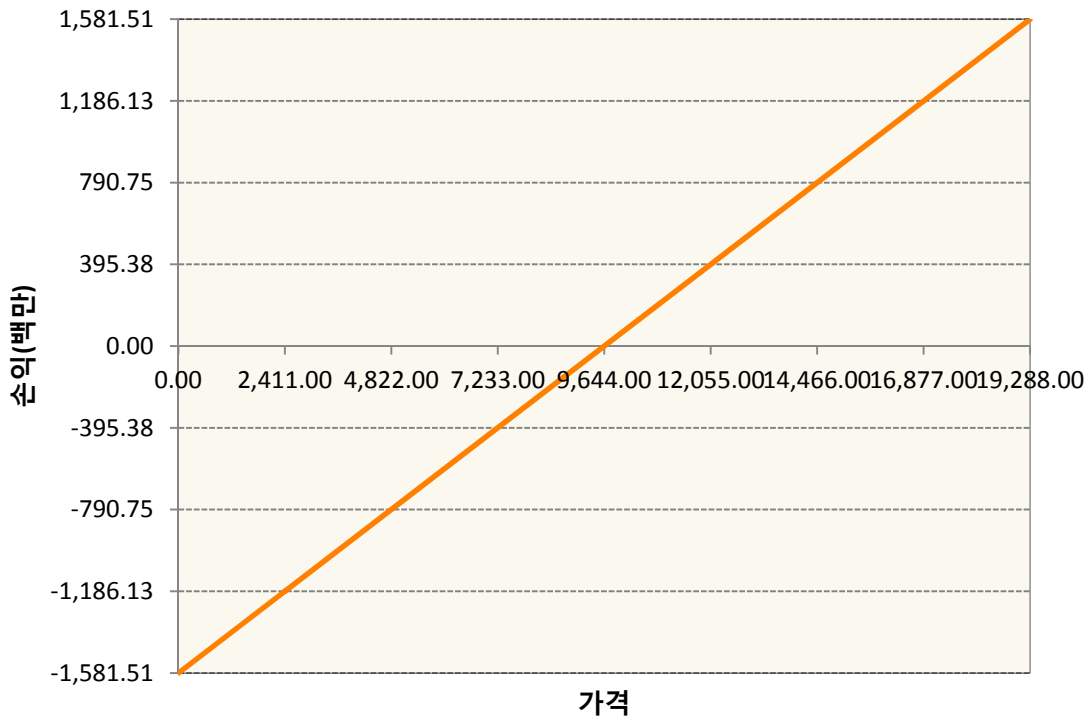
1. 계약금액

(단위:백만원)

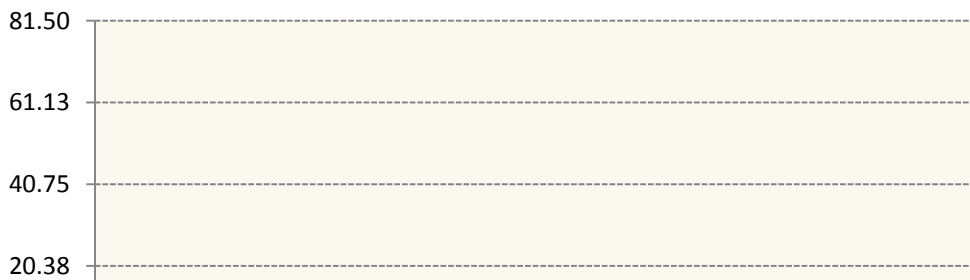
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,582	0	1,582	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,771	-4,771	장내
누계	통화	선도	0	2,186	-2,186	장외

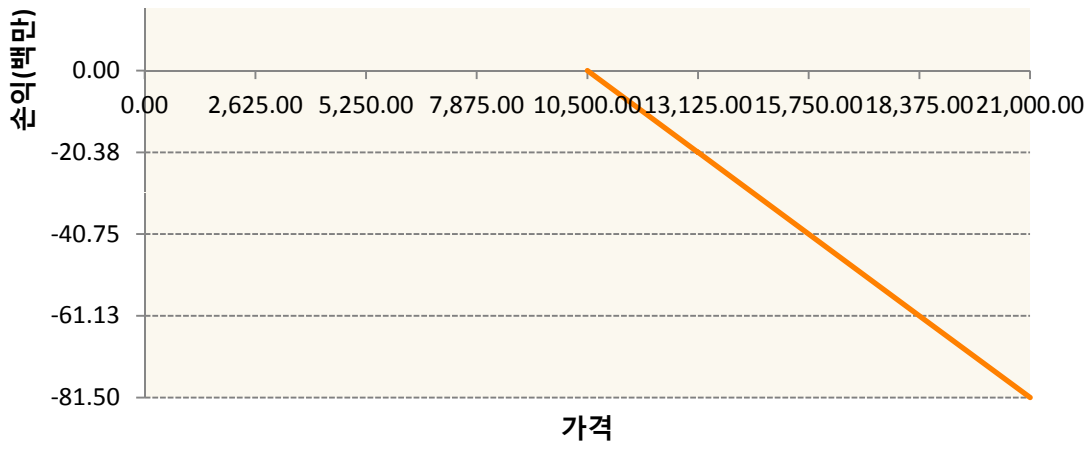
2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20

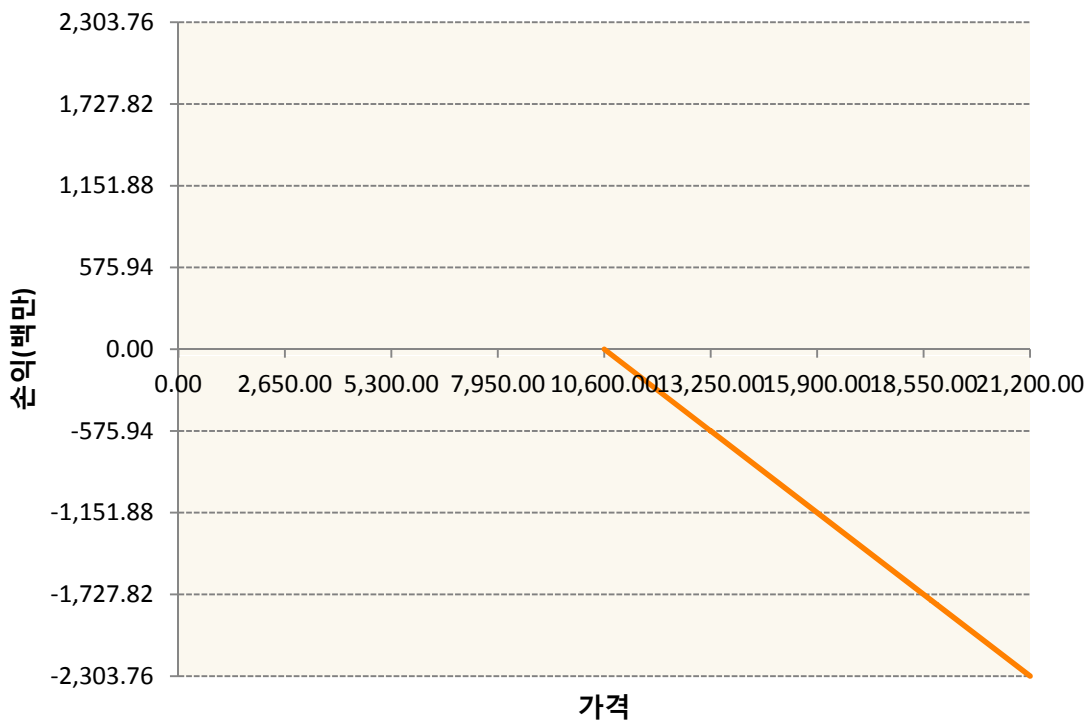


OHHIH0-C105-HSCEI

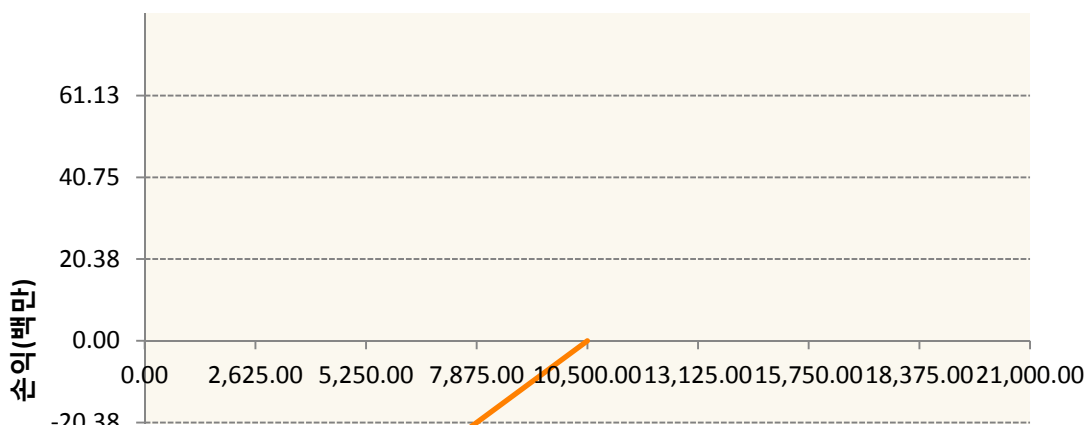


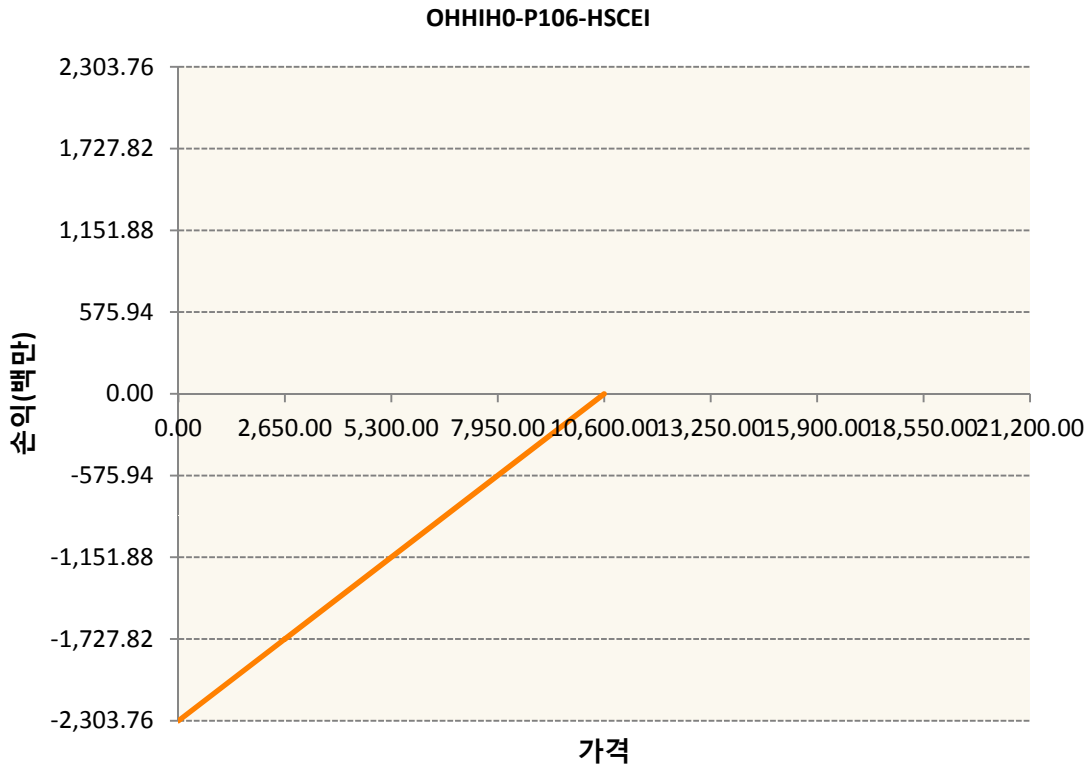
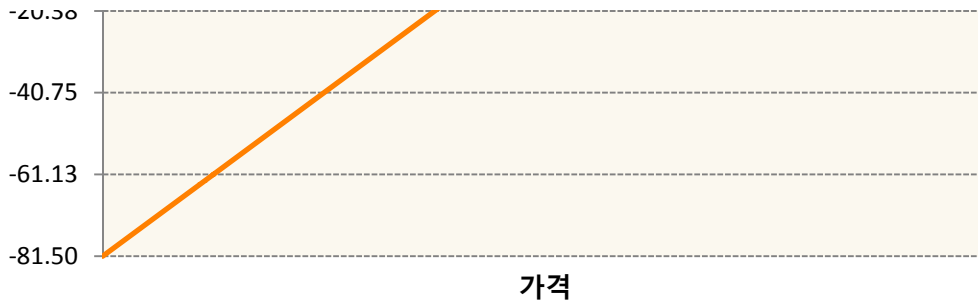


OHHIH0-C106-HSCEI



OHHIH0-P105-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E	175
HCH0 HSCEI Futures Mar20	127
OHHIH0-C1(HSCEI	7
OHHIH0-C1(HSCEI	184
OHHIH0-P1(HSCEI	7
OHHIH0-P1(HSCEI	184

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	536

공시일	2020-03-13
기준일	2020-03-12

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

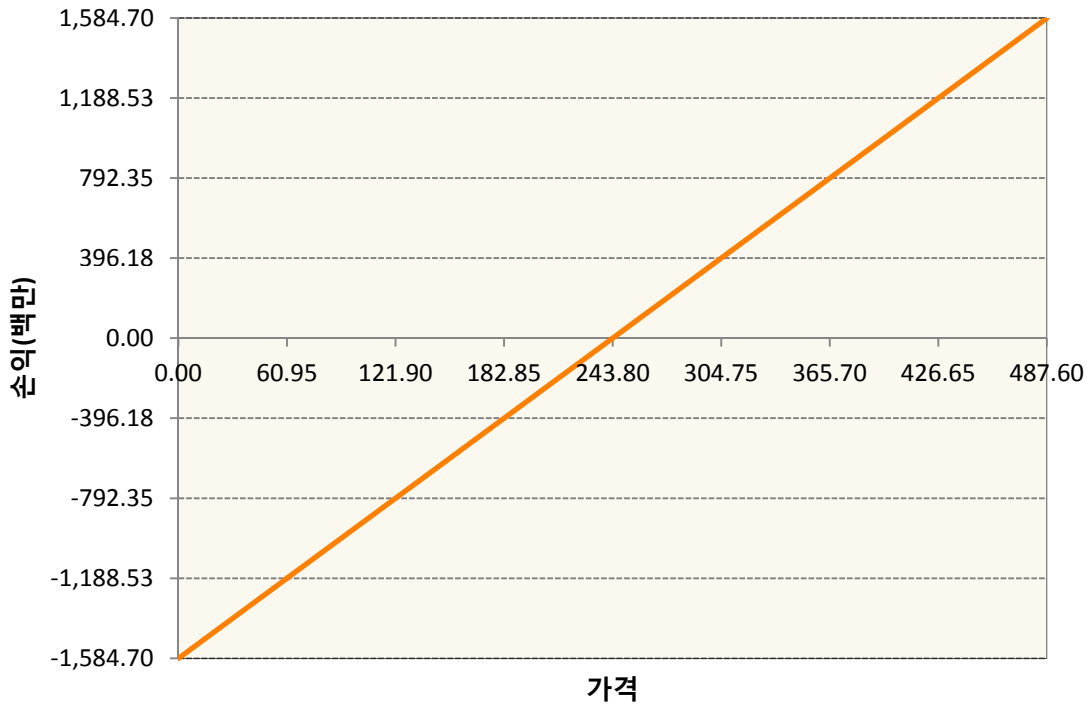
1. 계약금액

(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
누계	유가증권	선물	1,585	0	1,585	장내
누계	유가증권	스왑	3,125	0	3,125	장외

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



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
KR4101Q60002 2020-06 코스피200지수선물							129
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-129	-129	-129	-129	-129	-129	-129
-5.33%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	43	43	43	43	43	43	43
5.33%	86	86	86	86	86	86	86
8.00%	129	129	129	129	129	129	129

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

(단위:백만원)

396

공시일	2020-03-13
기준일	2020-03-12

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

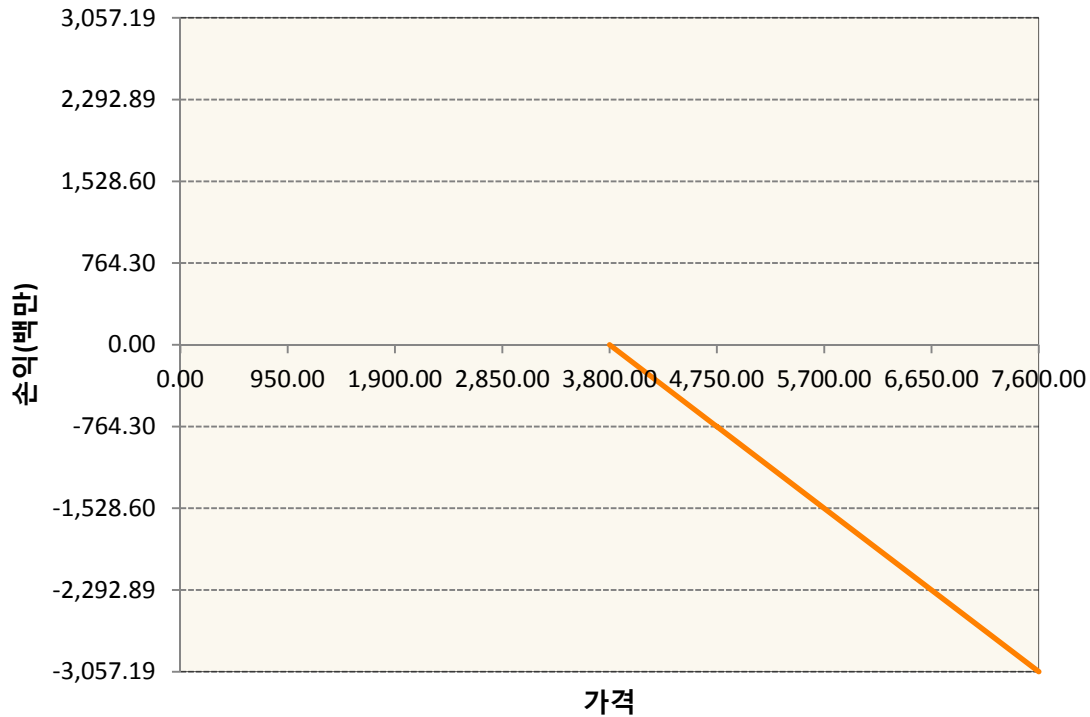
1. 계약금액

(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	464	0	464	
누계	유가증권	스왑	8,686	0	8,686	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,323	-6,323	장내
누계	통화	선도	545	3,578	-3,033	장외

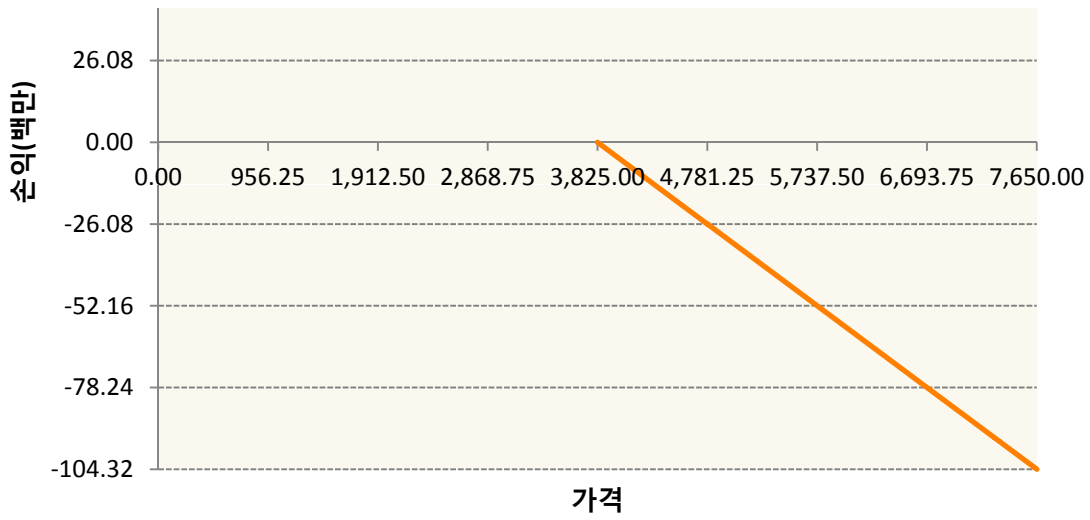
2. 만기시점의 손익구조

OESXH0-C3800-EURO STOXX 50

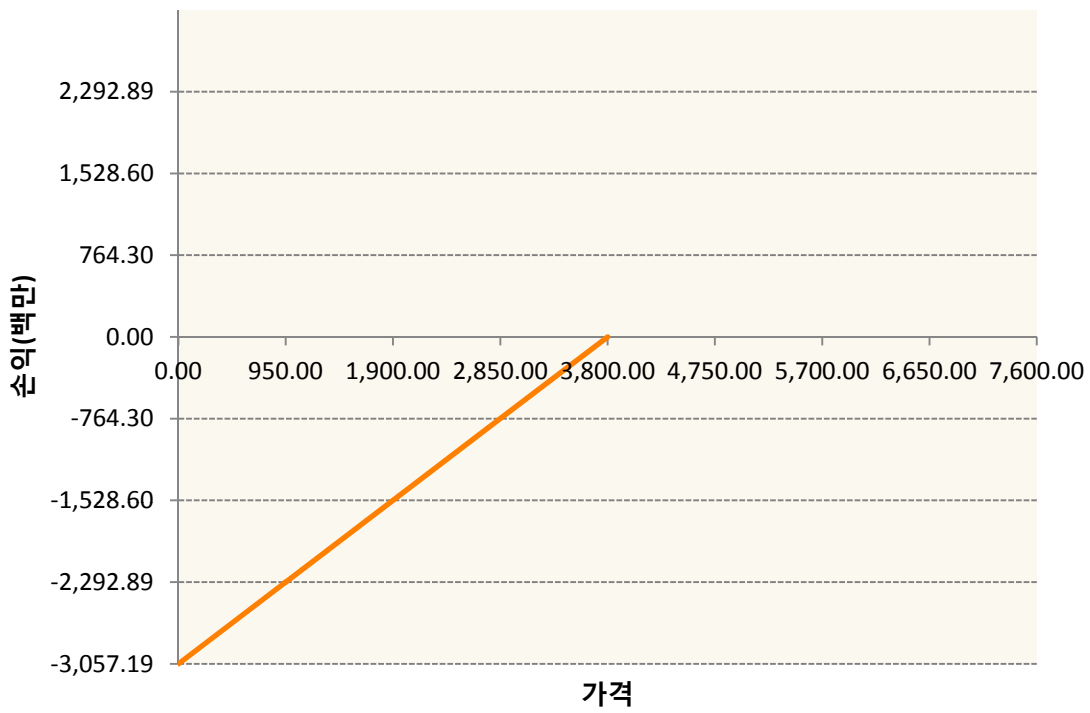


OESXH0-C3825-EURO STOXX 50

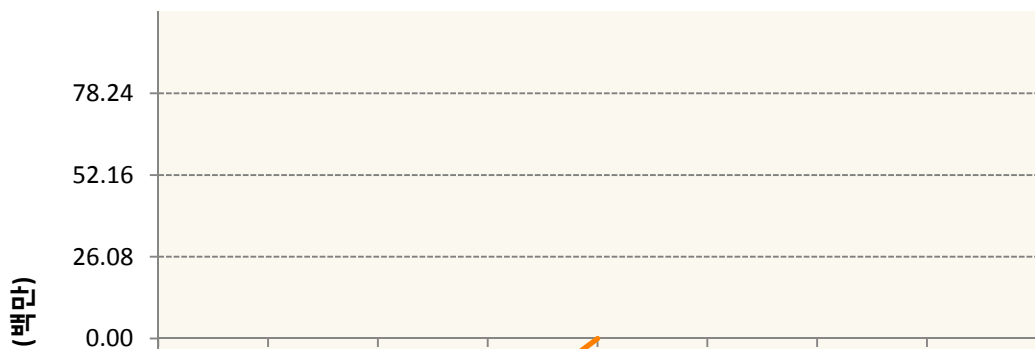


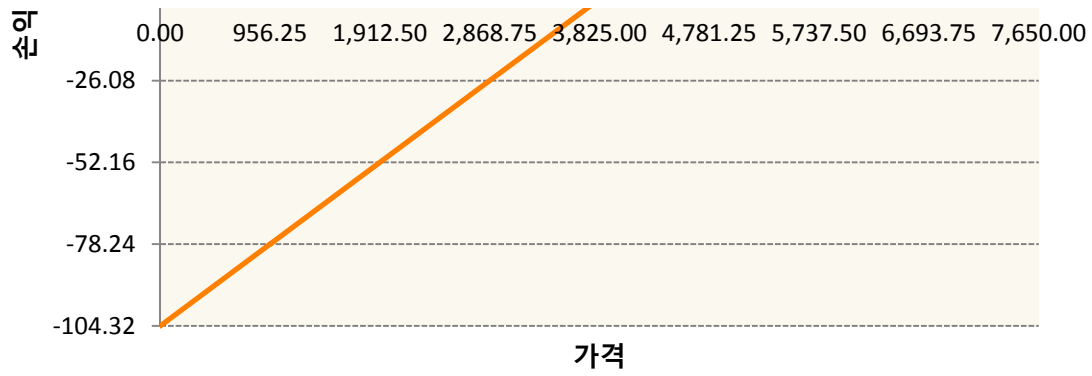


OESXH0-P3800-EURO STOXX 50

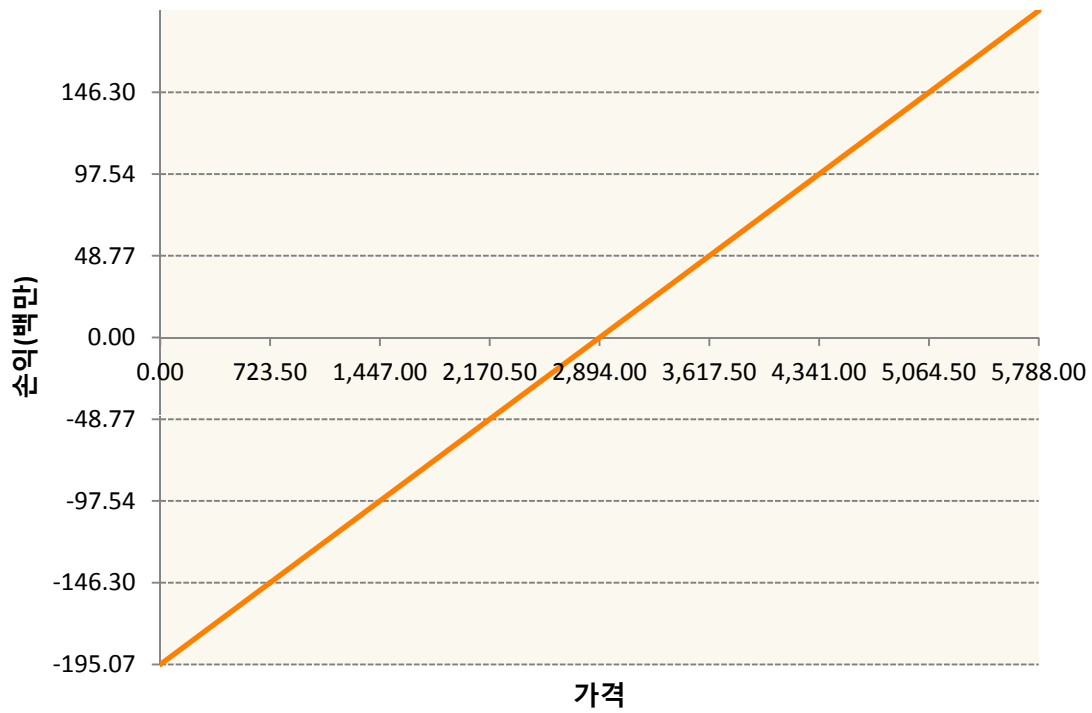


OESXH0-P3825-EURO STOXX 50

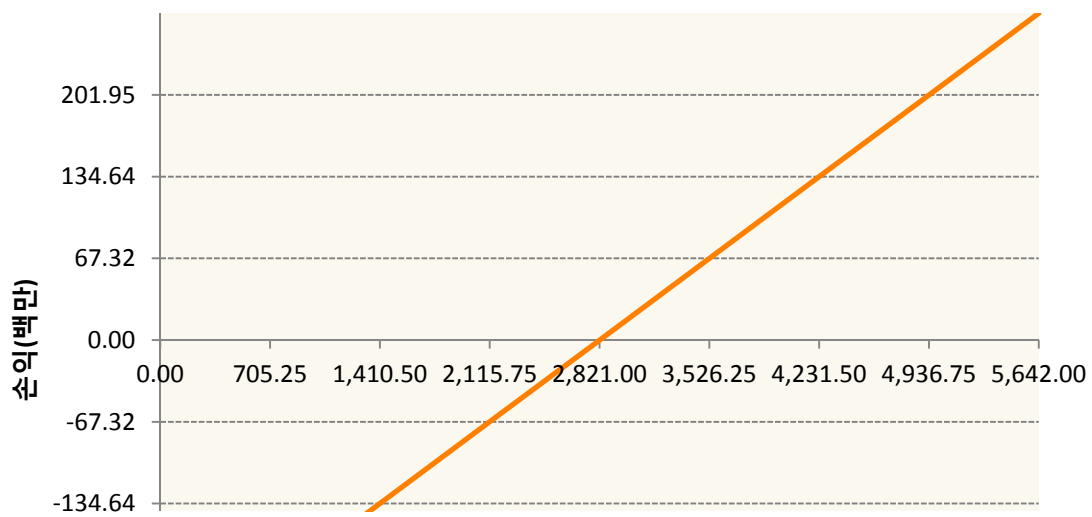


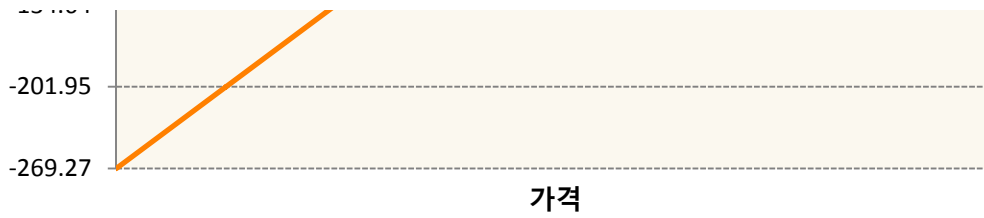


VGHO-EURO STOXX 50 Mar20



VGM0-EURO STOXX 50 Jun20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	1
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	286
FX21020H00 EUR/KRW 27-03-20E	44
OESXH0-C3€ EURO STOXX 50	245
OESXH0-C3€ EURO STOXX 50	8
OESXH0-P3€ EURO STOXX 50	245
OESXH0-P3€ EURO STOXX 50	8
VGH0 EURO STOXX 50 Mar20	16
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20	22

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

621

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

(단위:백만원)

929

공시일	2020-03-13
기준일	2020-03-12

ETF스마트레버리지목표전환형9호

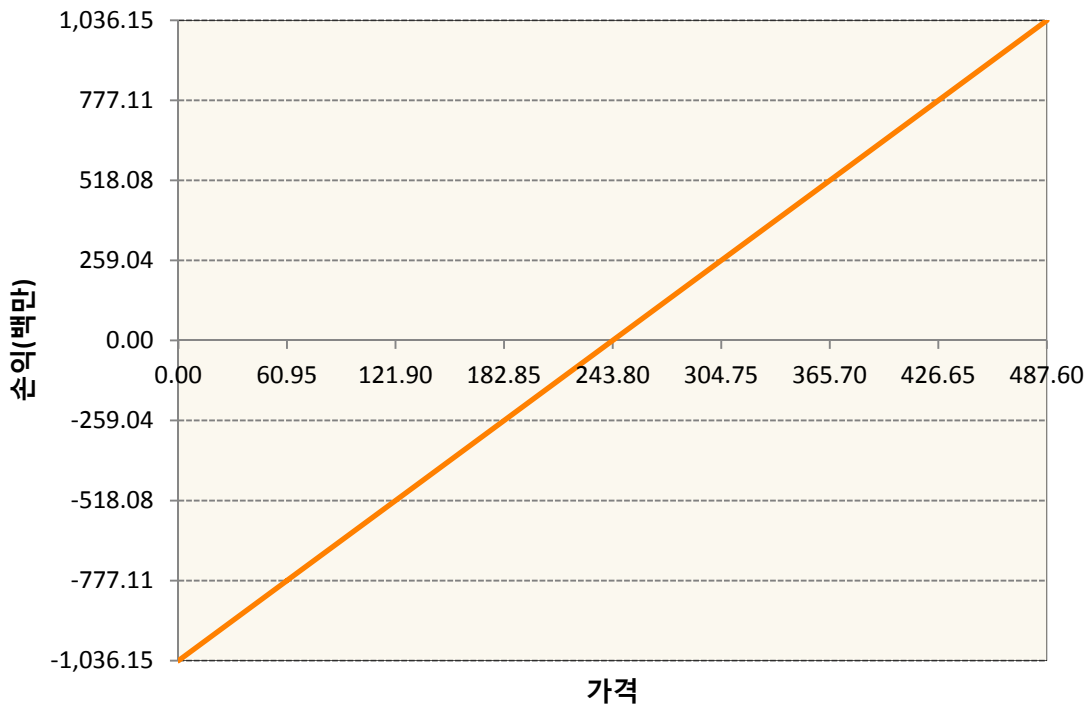
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,053	0	1,053	장내
누계	유가증권	선물	1,036	0	1,036	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						84
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84	
-5.33%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56	
-2.67%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	28	28	28	28	28	28	28	
5.33%	56	56	56	56	56	56	56	
8.00%	84	84	84	84	84	84	84	

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

(단위:백만원)

82

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

(단위:백만원)

120

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

(단위:백만원)

43

공시일	2020-03-13
기준일	2020-03-12

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

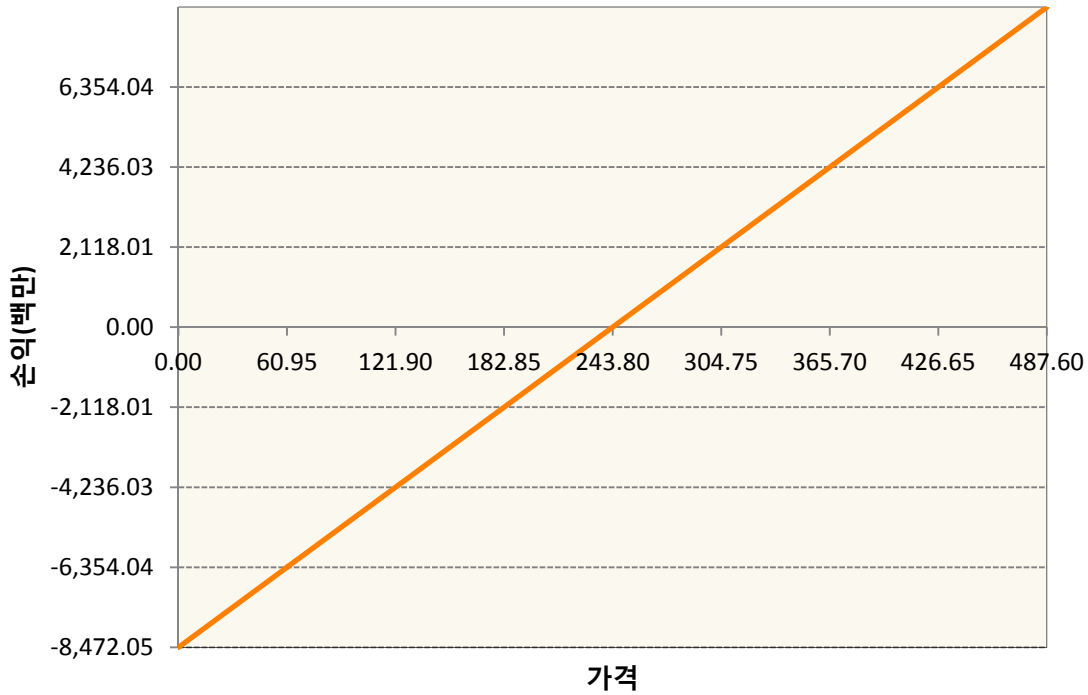
1. 계약금액

(단위:백만원)

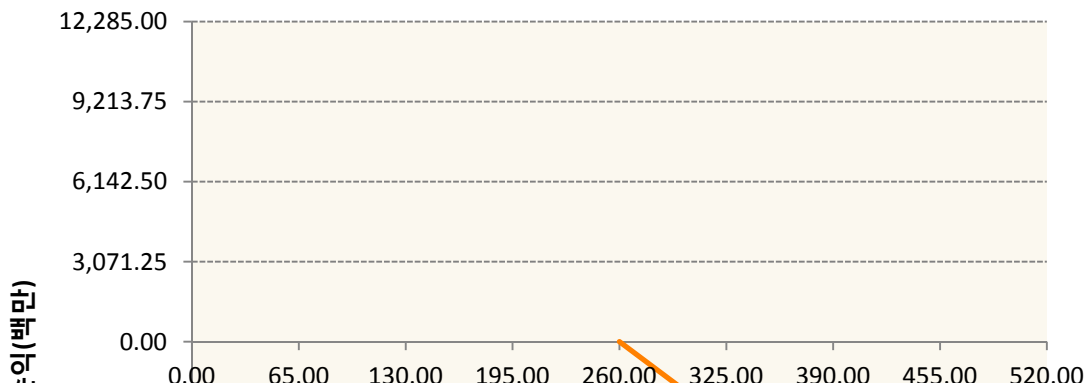
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	4,333	0	4,333	장내
신규	유가증권	옵션	7,268	17,725	-10,456	장내
누계	유가증권	선물	8,472	0	8,472	장내
누계	유가증권	옵션	7,698	17,338	-9,641	장내

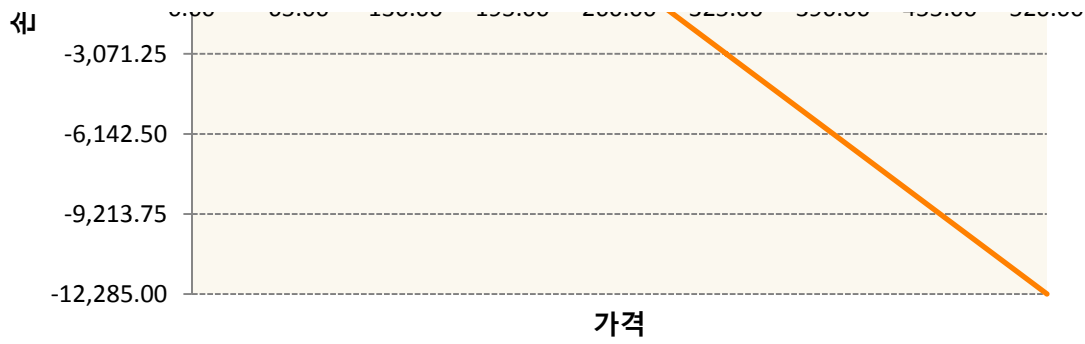
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

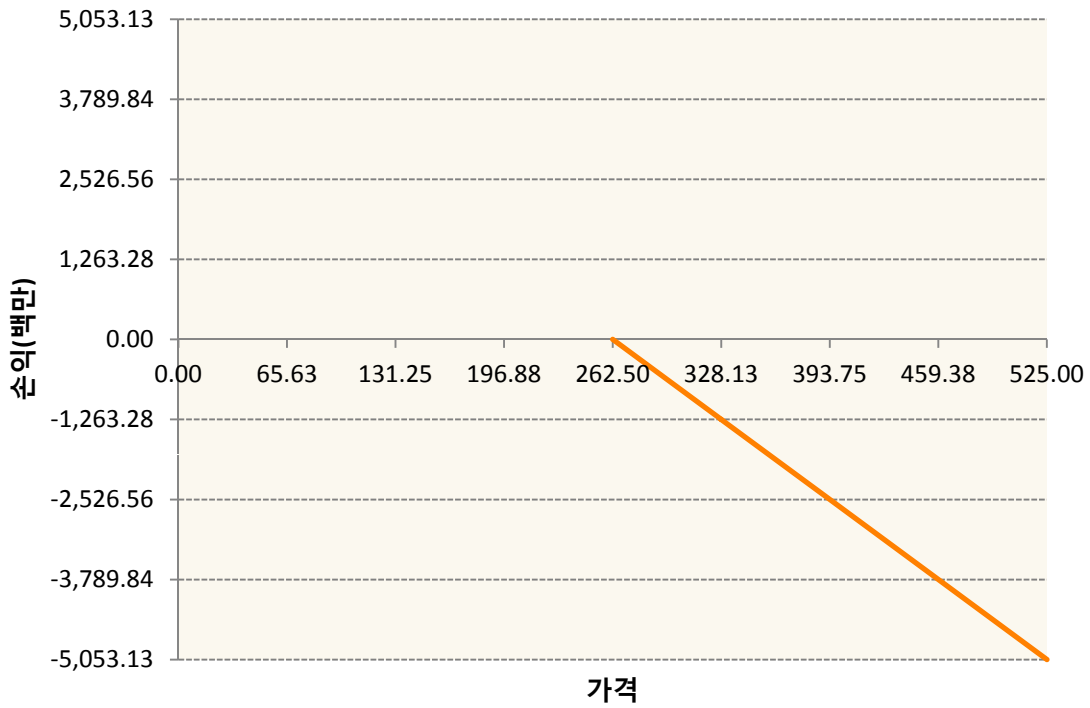


KR4201Q42602-2020-04 콜260

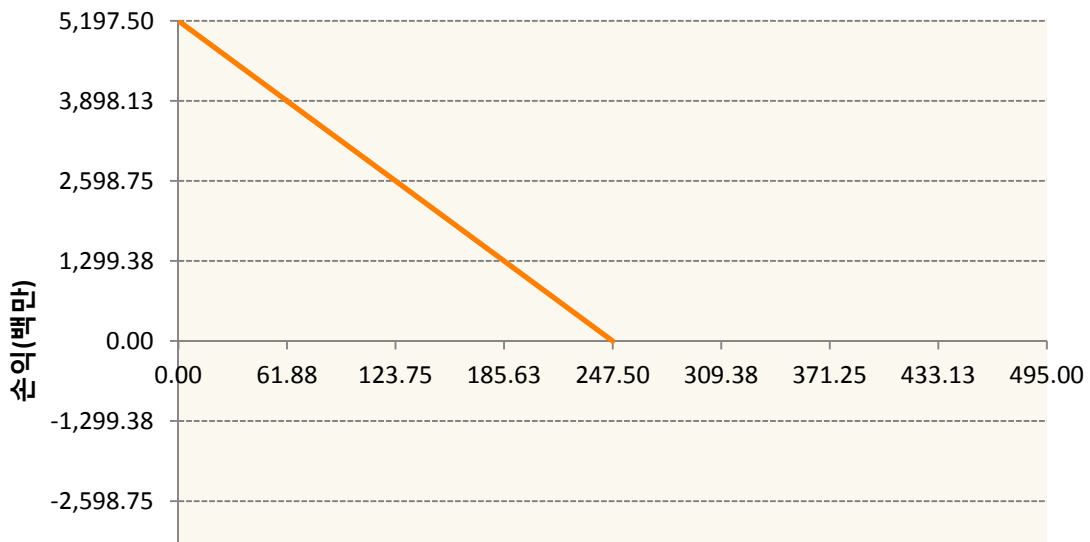


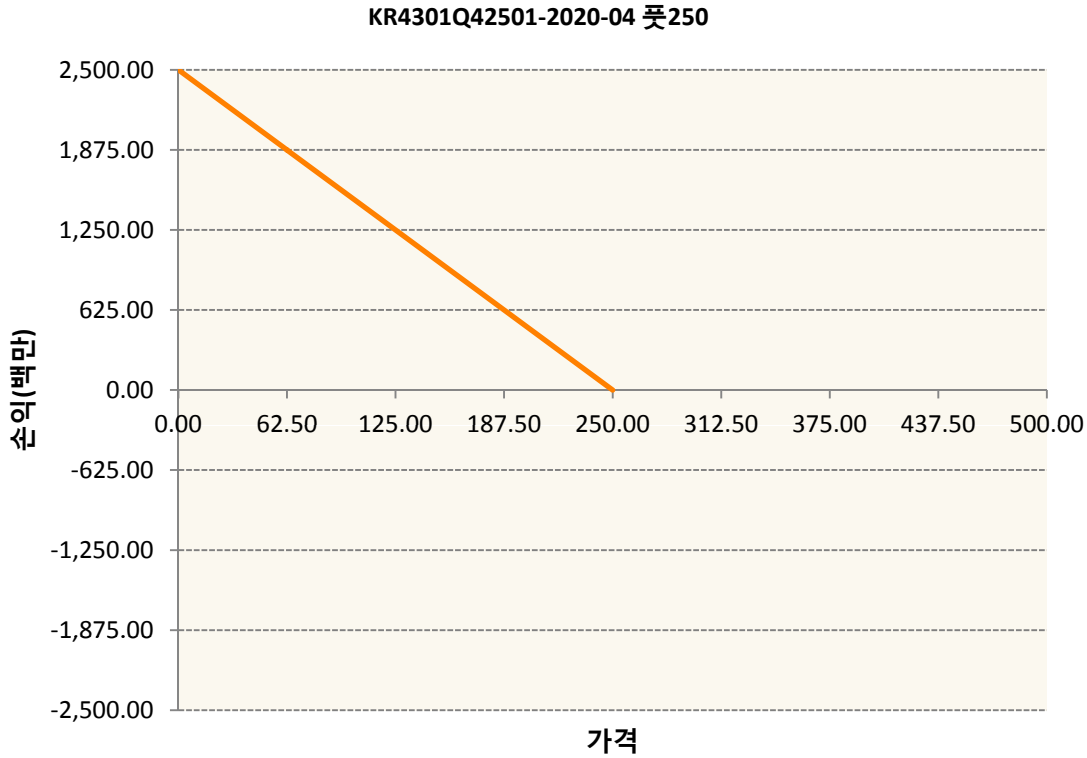
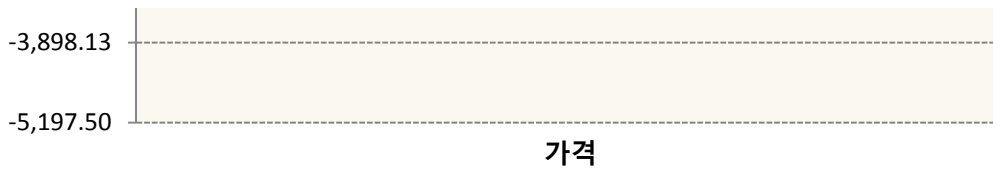


KR4201Q42628-2020-04 콜262.5



KR4301Q42477-2020-04 풋247.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						688
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-688	-688	-688	-688	-688	-688	-688	
-5.33%	-459	-459	-459	-459	-459	-459	-459	
-2.67%	-229	-229	-229	-229	-229	-229	-229	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	229	229	229	229	229	229	229	
5.33%	459	459	459	459	459	459	459	
8.00%	688	688	688	688	688	688	688	
KR4201Q42602		2020-04 콜260						606
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	301	282	261	236	209	179	148	
-5.33%	267	241	211	179	145	109	72	
-2.67%	213	178	140	101	61	20	-22	

0%	131	89	45	0	-45	-91	-137
2.67%	18	-30	-78	-127	-175	-224	-273
5.33%	-128	-179	-229	-279	-329	-379	-429
8.00%	-309	-358	-407	-457	-506	-556	-606
KR4201Q42628 2020-04 콜262.5							236
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	111	104	96	87	77	66	53
-5.33%	99	90	79	66	53	40	25
-2.67%	80	67	53	38	22	6	-11
0%	51	35	18	0	-18	-36	-55
2.67%	10	-9	-28	-48	-67	-87	-107
5.33%	-44	-65	-85	-106	-126	-147	-167
8.00%	-113	-133	-154	-175	-195	-216	-236
KR4301Q42477 2020-04 풋247.5							303
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	208	222	237	253	269	286	303
-5.33%	103	120	138	157	175	194	213
-2.67%	12	32	52	72	93	113	133
0%	-63	-42	-21	0	21	42	63
2.67%	-123	-102	-81	-60	-39	-18	3
5.33%	-167	-148	-129	-109	-89	-69	-49
8.00%	-199	-183	-166	-148	-130	-111	-92
KR4301Q42501 2020-04 풋250							149
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	107	113	119	126	134	141	149
-5.33%	54	62	70	79	87	96	105
-2.67%	8	18	27	37	46	56	65
0%	-30	-20	-10	0	10	20	30
2.67%	-61	-51	-41	-31	-21	-11	0
5.33%	-85	-76	-66	-56	-46	-36	-26
8.00%	-102	-94	-85	-77	-67	-58	-49

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

(단위:백만원)

1,600

공시일	2020-03-13
기준일	2020-03-12

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	197,687	0	197,687	

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	2020-03-13
기준일	2020-03-12

H2O글로벌본드(UH)(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	104,819	0	104,819	

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	2020-03-13
기준일	2020-03-12

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	496,711	0	496,711	
누계	통화	선도	36,195	521,087	-484,892	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,554
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,448
FX21020F03 KRW/USD 31-03-20E	3,089
FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E	2,896
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,606
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	1,930
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	3,320
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,320
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,930
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,861
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,259
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,930
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	193
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	4,923
FX21020G06 USD/KRW 31-03-20E	483
FX21020H00 USD/KRW 31-03-20E	965
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,413
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,008
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,008
FX21020H04 USD/KRW 21-04-20E	1,448

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

15,973

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

(단위:백만원)

124

공시일	2020-03-13
기준일	2020-03-12

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

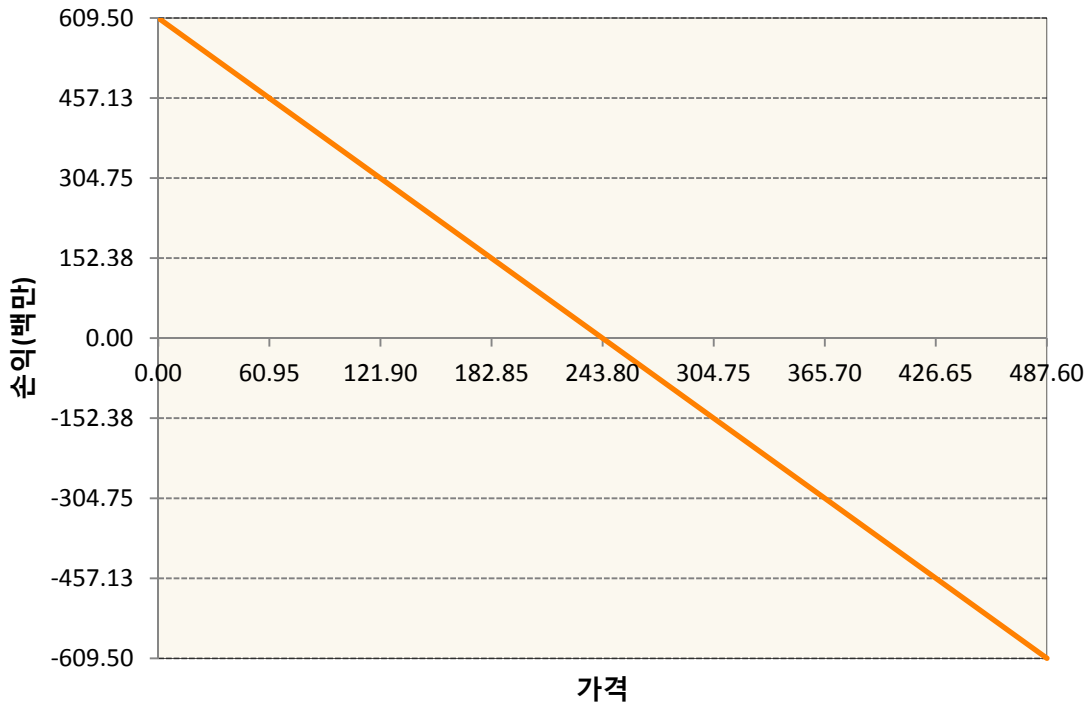
1. 계약금액

(단위:백만원)

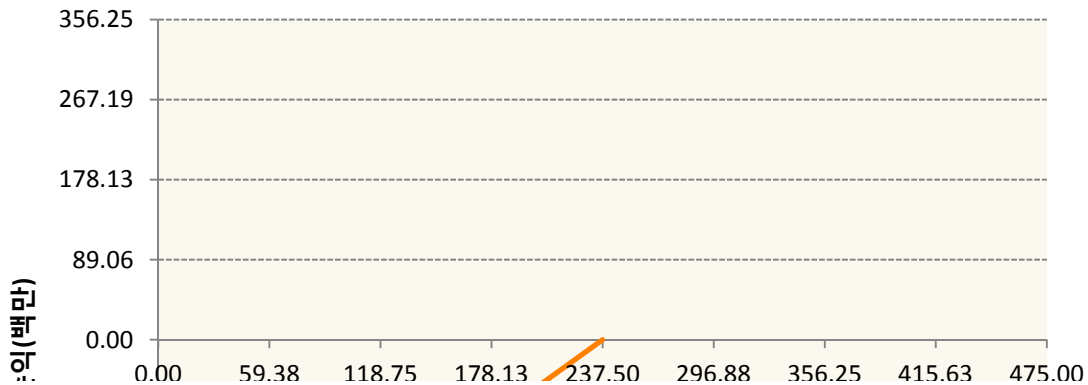
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	616	-616	장내
신규	유가증권	옵션	0	3,007	-3,007	장내
누계	유가증권	선물	0	610	-610	장내
누계	유가증권	옵션	0	2,885	-2,885	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

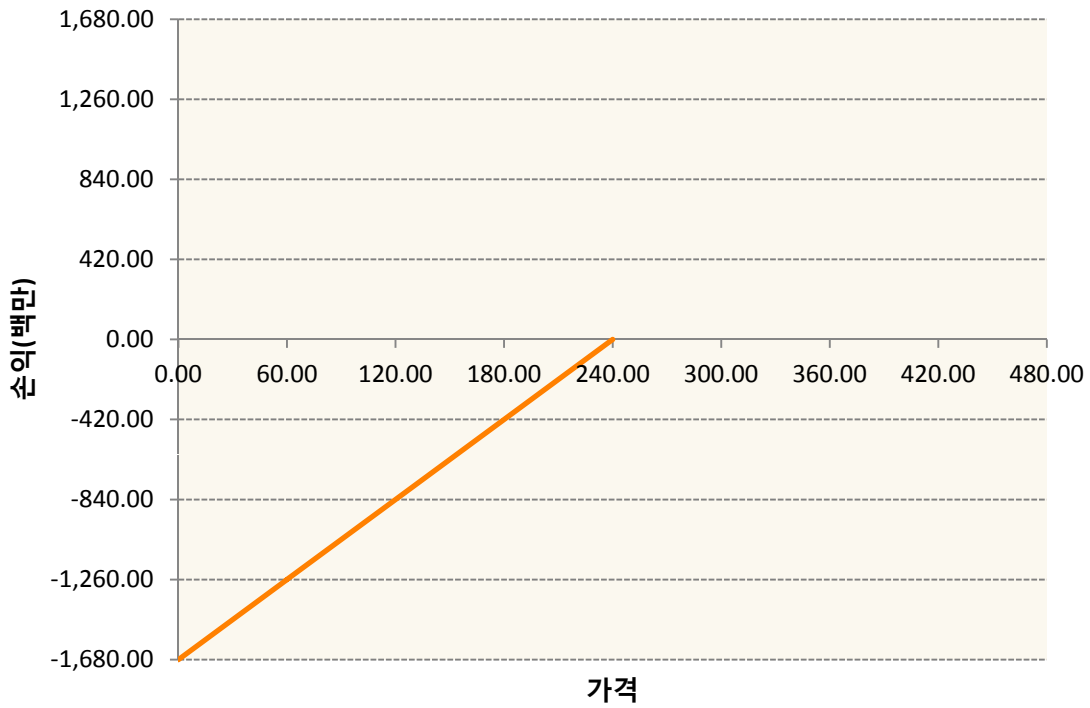


KR4301Q42378-2020-04 풋237.5

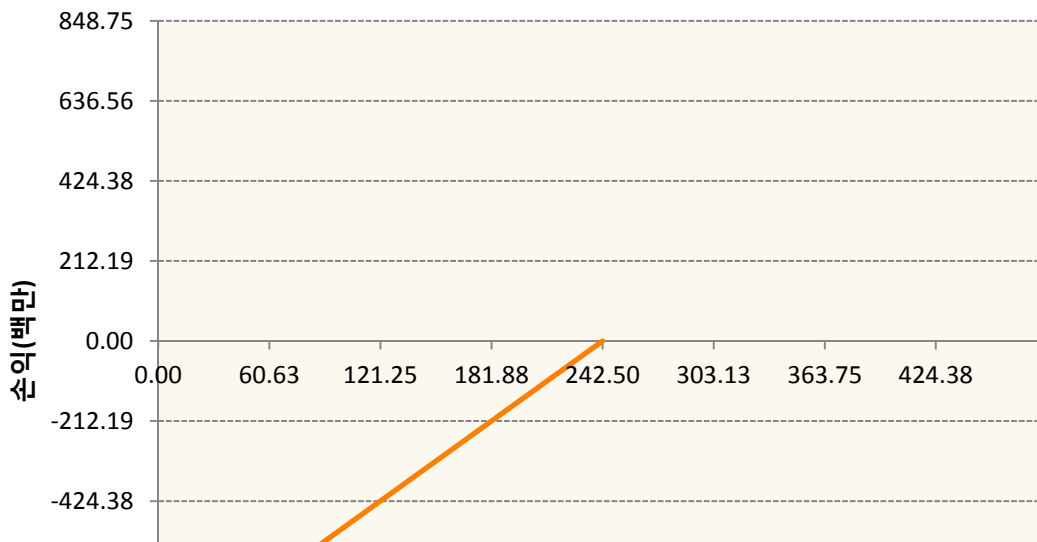


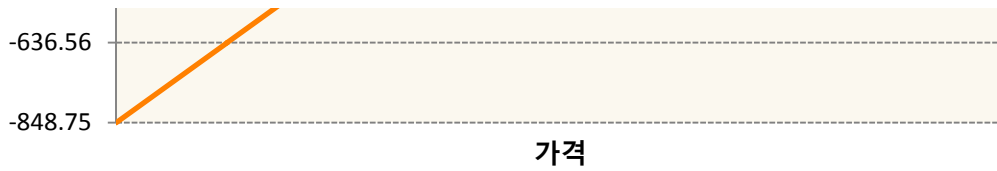


KR4301Q42402-2020-04 풋240



KR4301Q42428-2020-04 풋242.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 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	
KR4301Q42378		2020-04 풋237.5						18
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-10	-12	-13	-14	-16	-17	-18	
-5.33%	-4	-6	-7	-9	-10	-11	-13	
-2.67%	0	-1	-2	-4	-5	-7	-8	
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4	
2.67%	7	6	4	3	2	0	-1	
5.33%	9	8	7	5	4	3	2	
8.00%	10	9	8	7	6	5	4	
KR4301Q42402		2020-04 풋240						89
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-53	-59	-65	-71	-77	-83	-89	
-5.33%	-23	-30	-36	-43	-50	-56	-63	
-2.67%	1	-6	-13	-19	-26	-33	-40	
0%	20	13	7	0	-7	-13	-20	
2.67%	34	28	22	16	9	3	-4	
5.33%	44	39	33	28	22	16	10	
8.00%	50	46	42	37	32	27	21	
KR4301Q42428		2020-04 풋242.5						47
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-29	-32	-35	-38	-41	-44	-47	
-5.33%	-13	-17	-20	-23	-26	-30	-33	
-2.67%	0	-4	-7	-11	-14	-17	-21	

0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	18	15	12	9	5	2	-1
5.33%	24	21	18	15	12	9	6
8.00%	28	26	23	21	18	15	12

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

(단위:백만원)

170

공시일	2020-03-13
기준일	2020-03-12

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	8,431	0	8,431	
누계	통화	선도	929	9,350	-8,421	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	182
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	215
FX21020H01 USD/KRW 31-03-20E	49
FX21020H02 KRW/USD 13-04-20E	350
FX21020H04 USD/KRW 31-03-20E	25
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

295

공시일	2020-03-13
기준일	2020-03-12

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

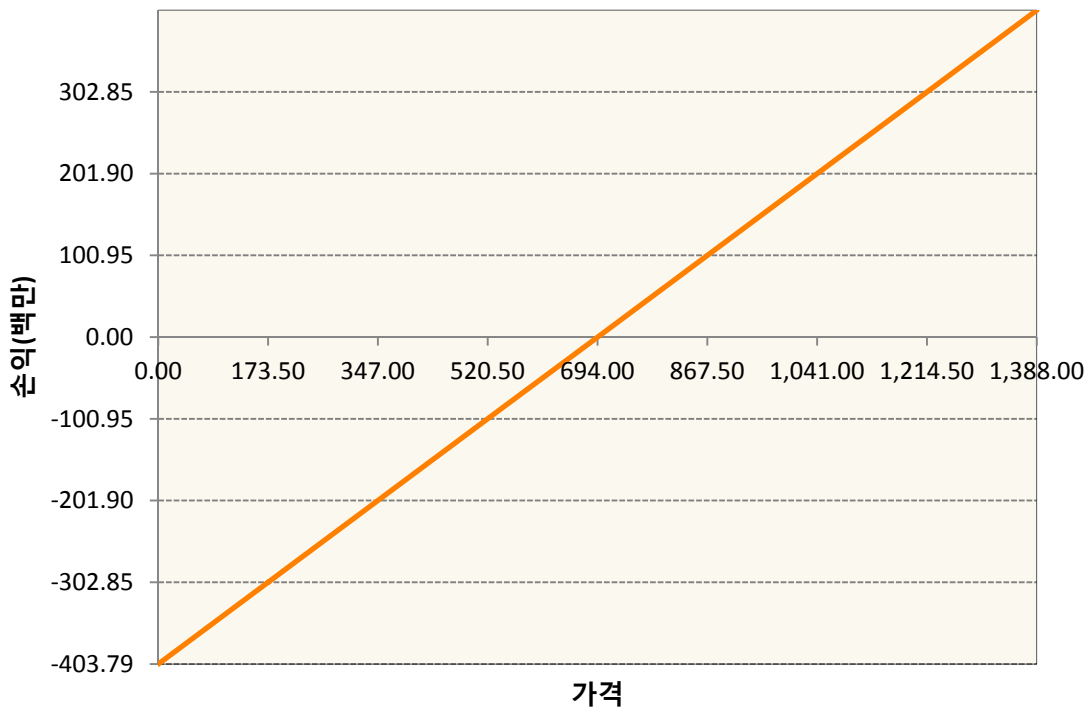
1. 계약금액

(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	404	0	404	
누계	유가증권	스왑	1,125	0	1,125	장외
누계	통화	선도	314	750	-436	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCH0-VN30 Index Future Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	90
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	7
FX21020F00 KRW/EUR 27-03-20E	7

FX21020F01: KRW/EUR 27-03-20E	7
FX21020F01: KRW/EUR 27-03-20E	7
FX21020F03: KRW/EUR 24-04-20E	7
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
FX21020H02 EUR/KRW 27-03-20E	13
VNCH0 VN30 Index Future Mar20	32

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

(단위:백만원)

135

공시일	2020-03-13
기준일	2020-03-12

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

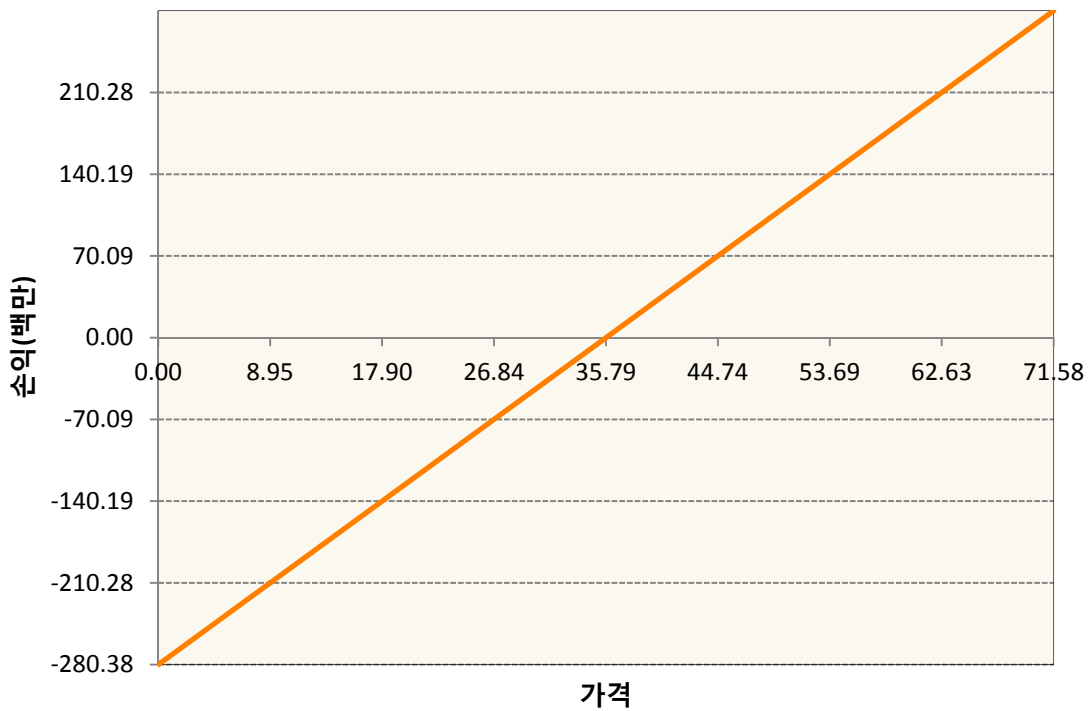
1. 계약금액

(단위:백만원)

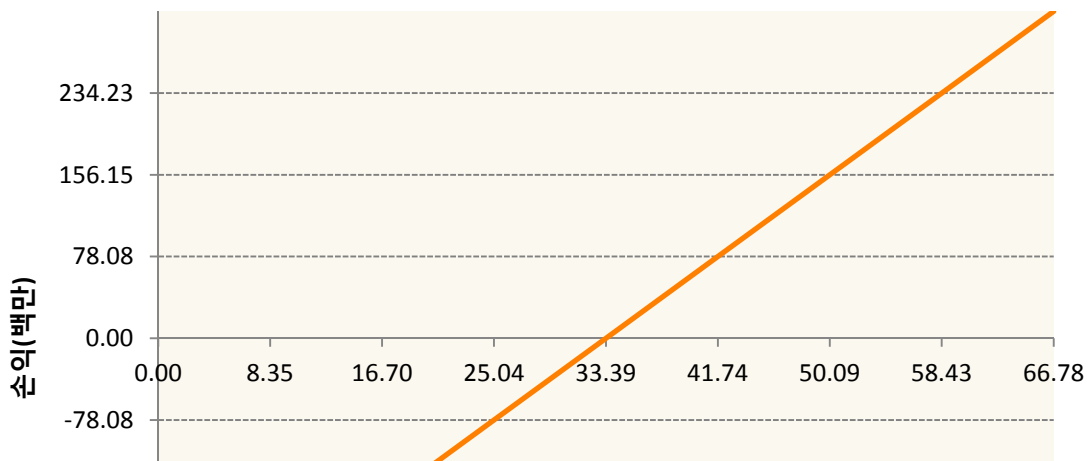
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,594	121	1,473	

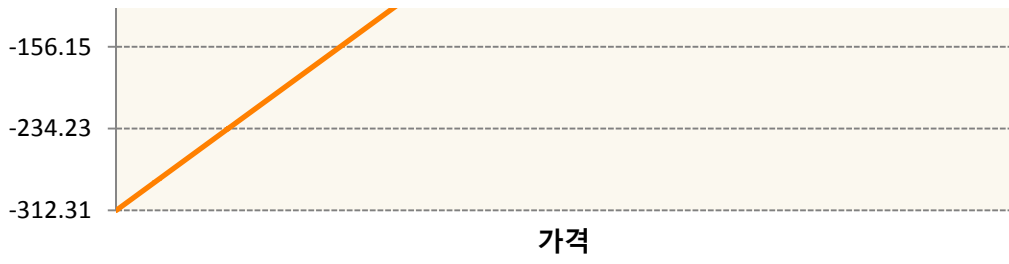
2. 만기시점의 손익구조

COK0-BRENT CRUDE FUTR May20

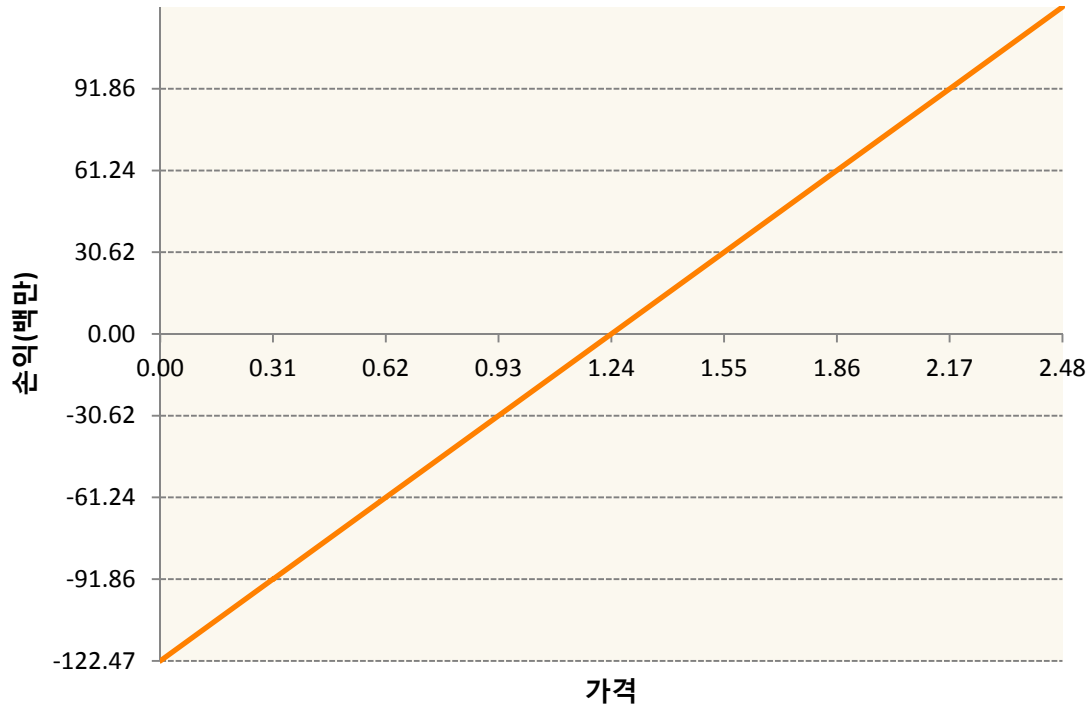


CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20

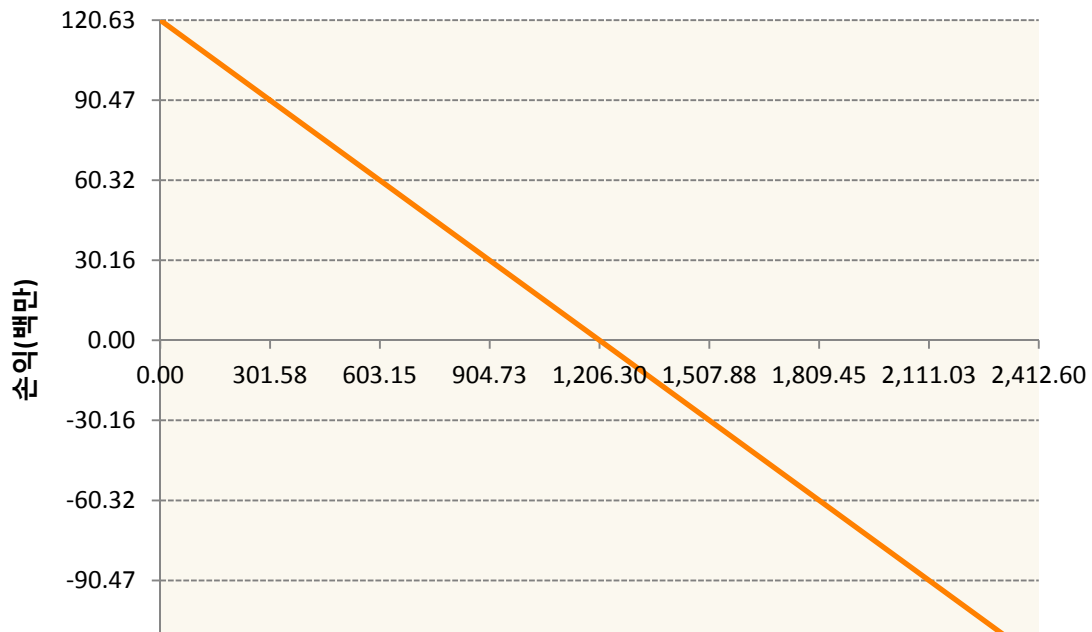


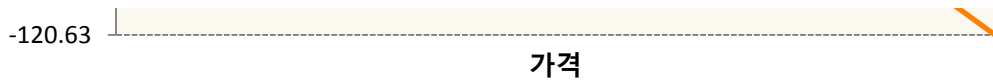


HOK0-NY Harb ULSD Fut May20

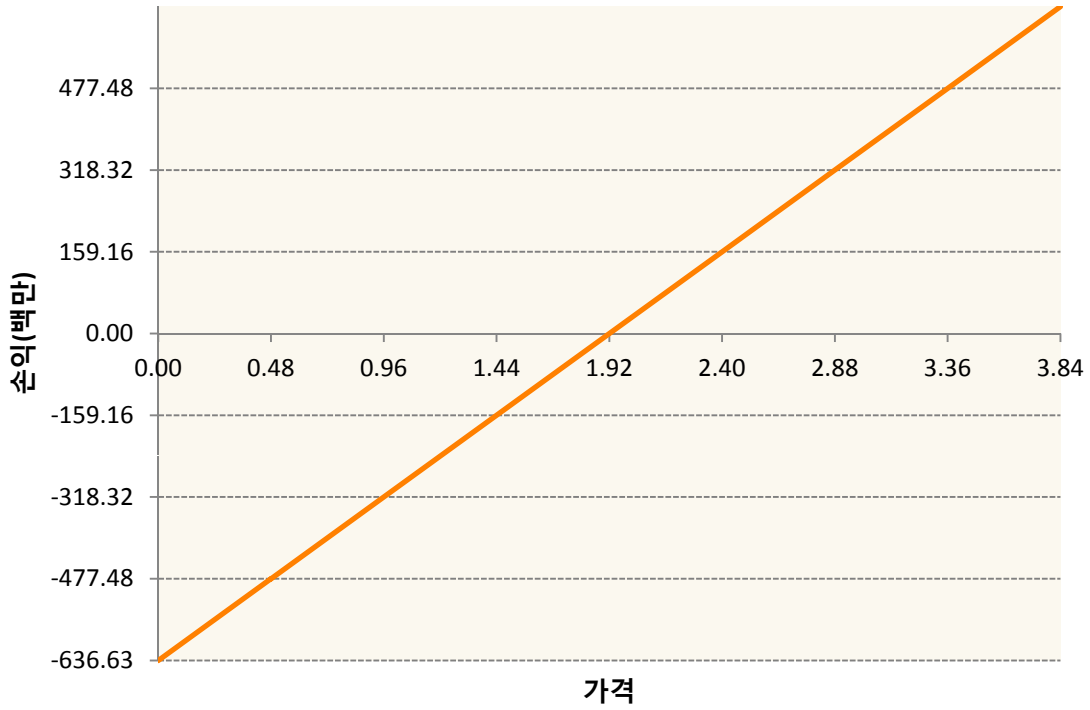


KR4175Q30009-2020-03 달러선물

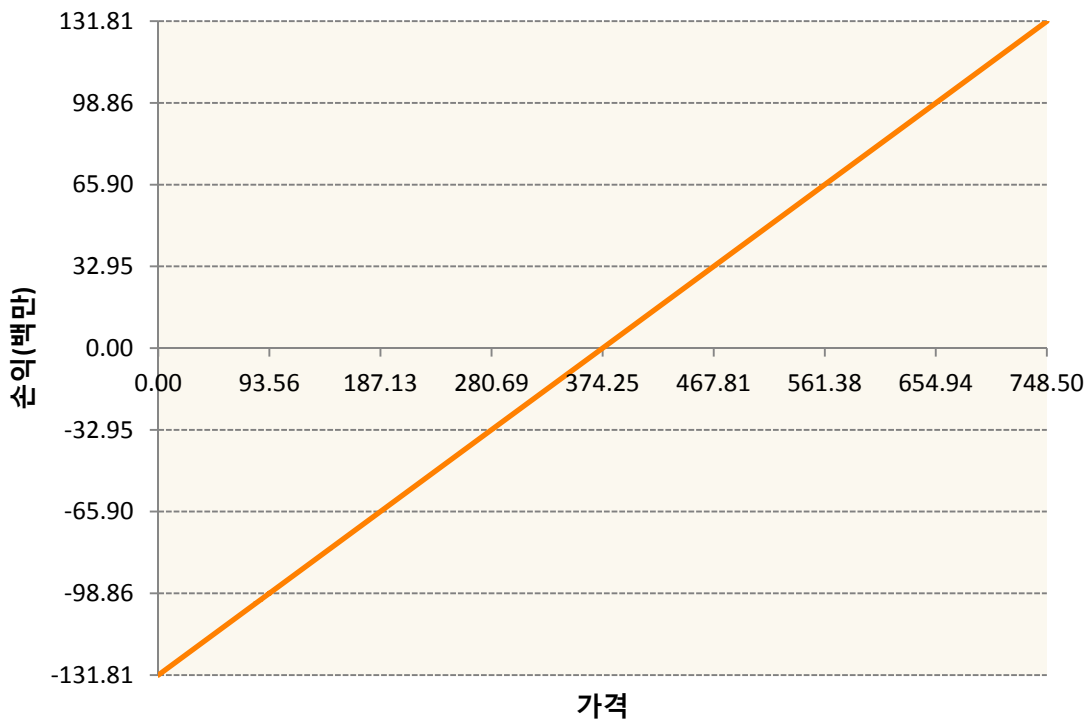




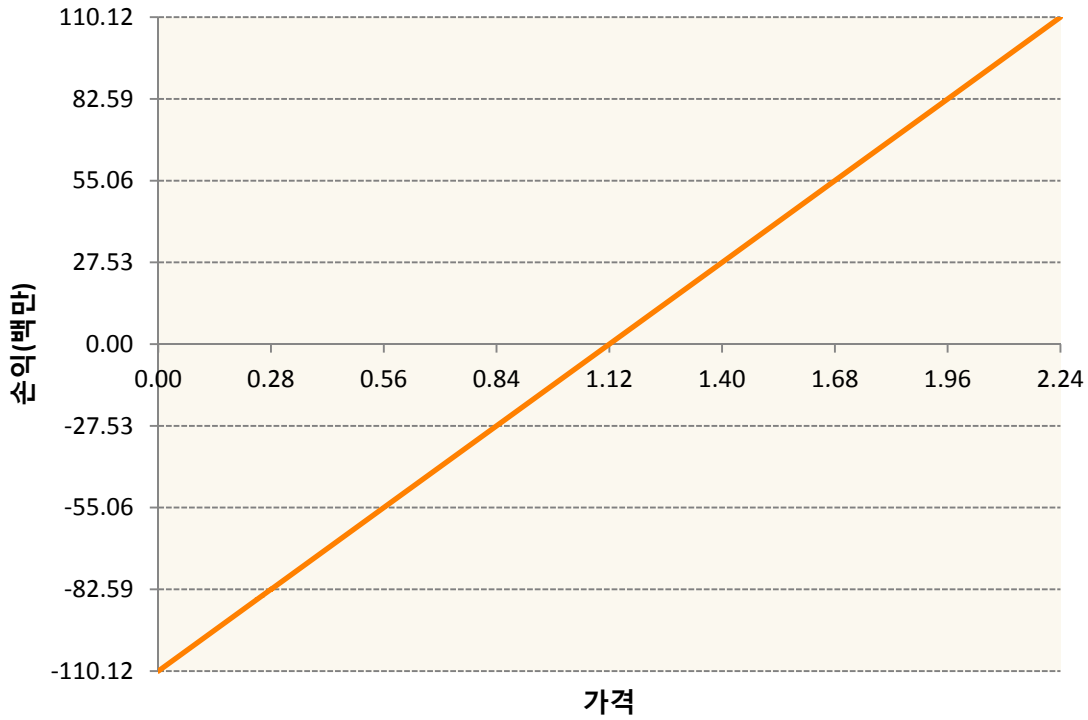
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



QSK0-Low Su Gasoil G Mar20



XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	22
CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	25
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	10
KR4175Q30C	2020-03 달러선물	10
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	51
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	11
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	9

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

(단위:백만원)

312

공시일	2020-03-13
기준일	2020-03-12

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

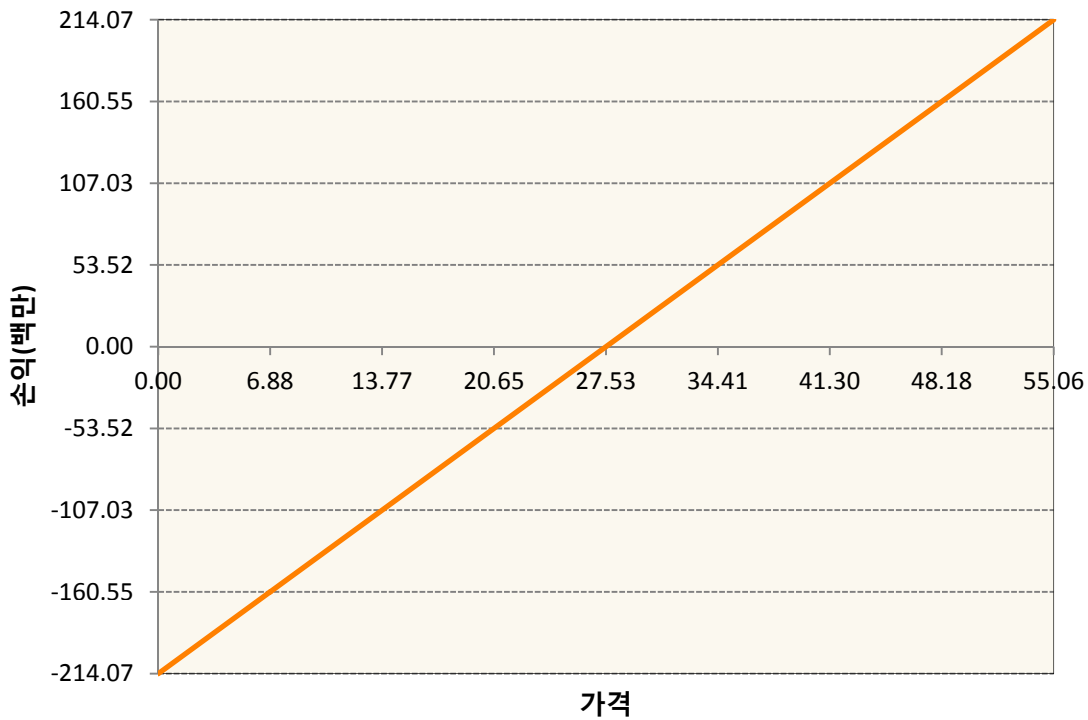
1. 계약금액

(단위:백만원)

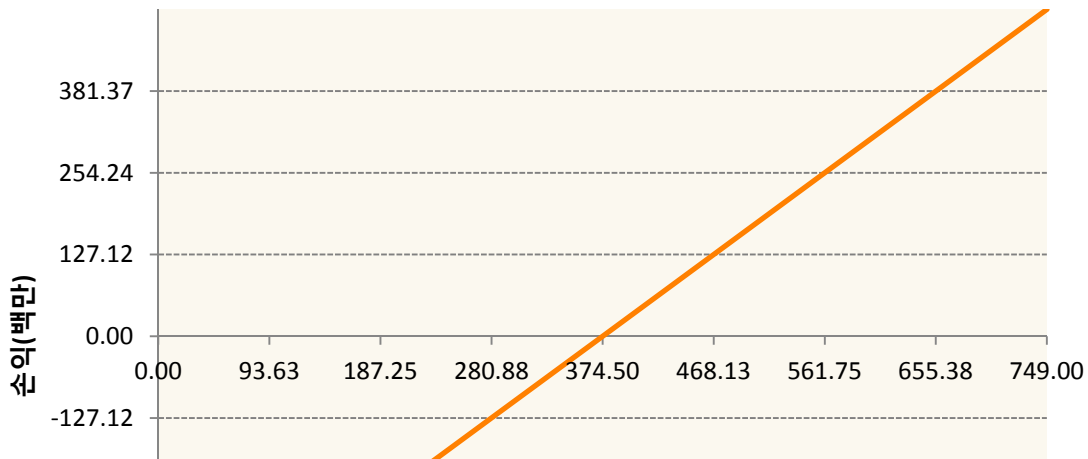
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,508	157	2,351	

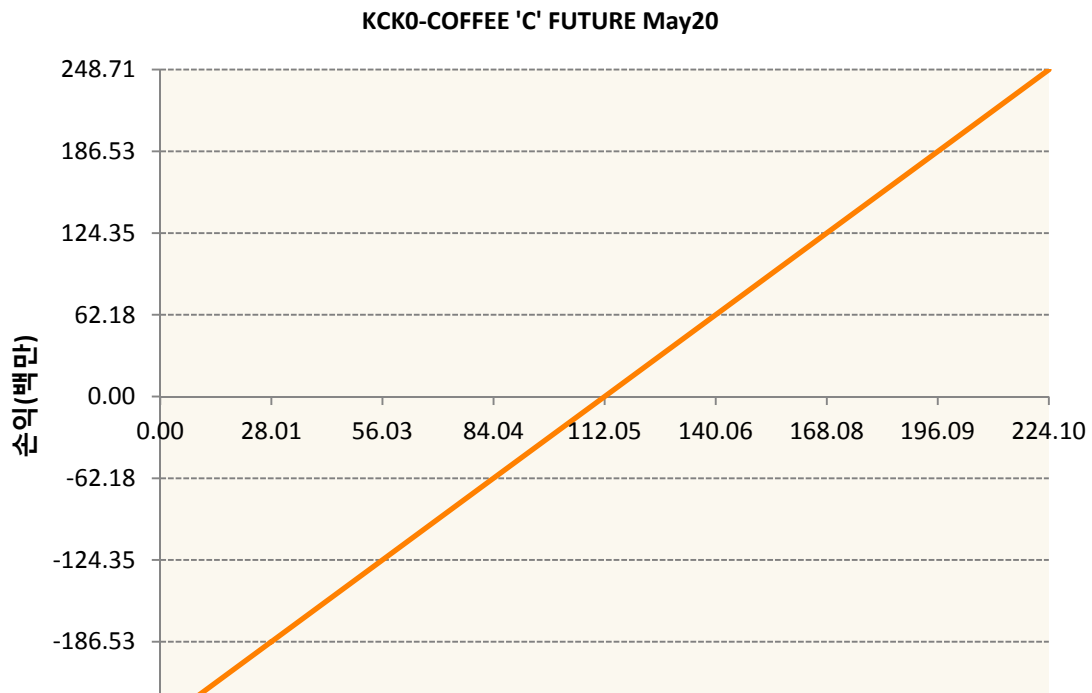
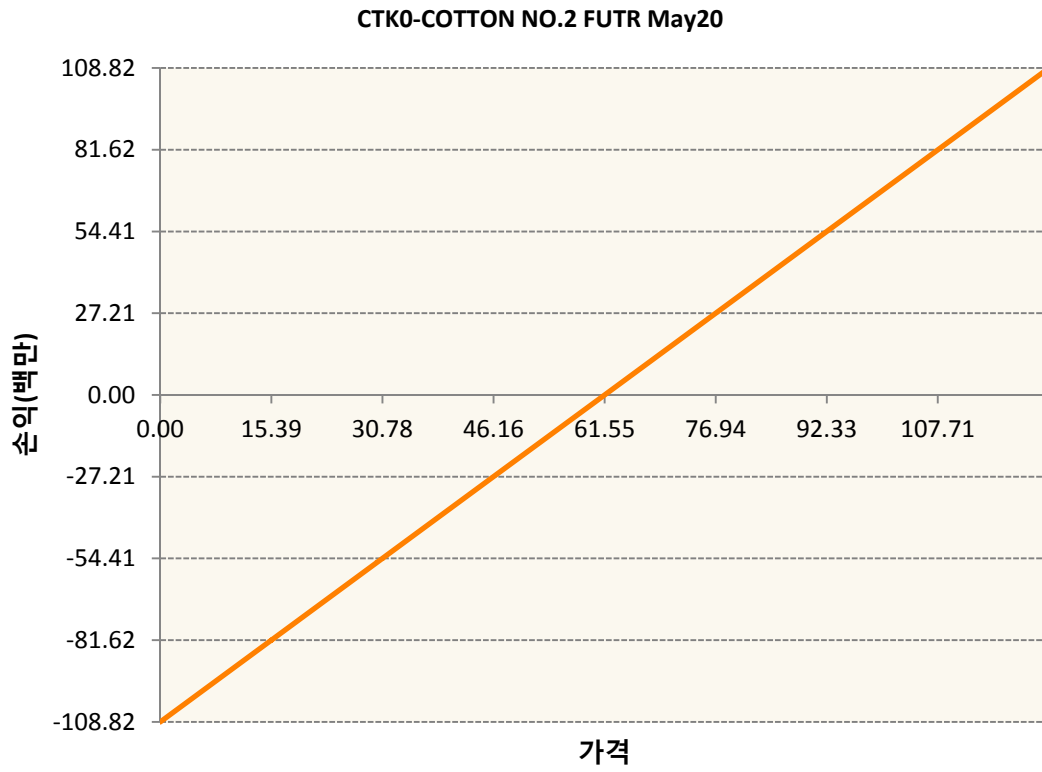
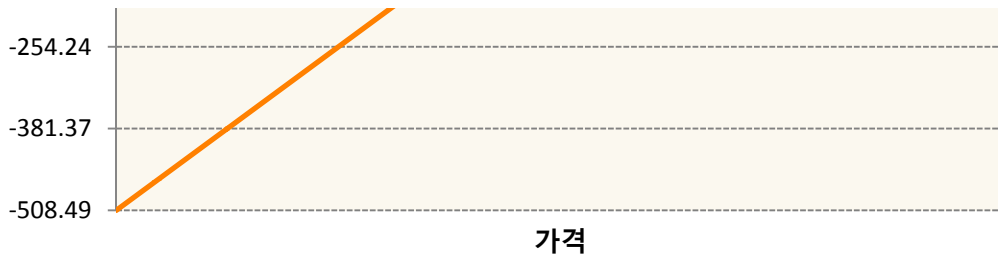
2. 만기시점의 손익구조

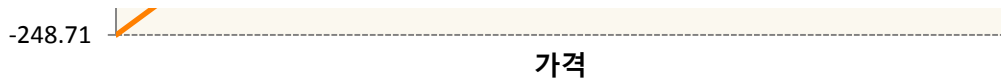
BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20



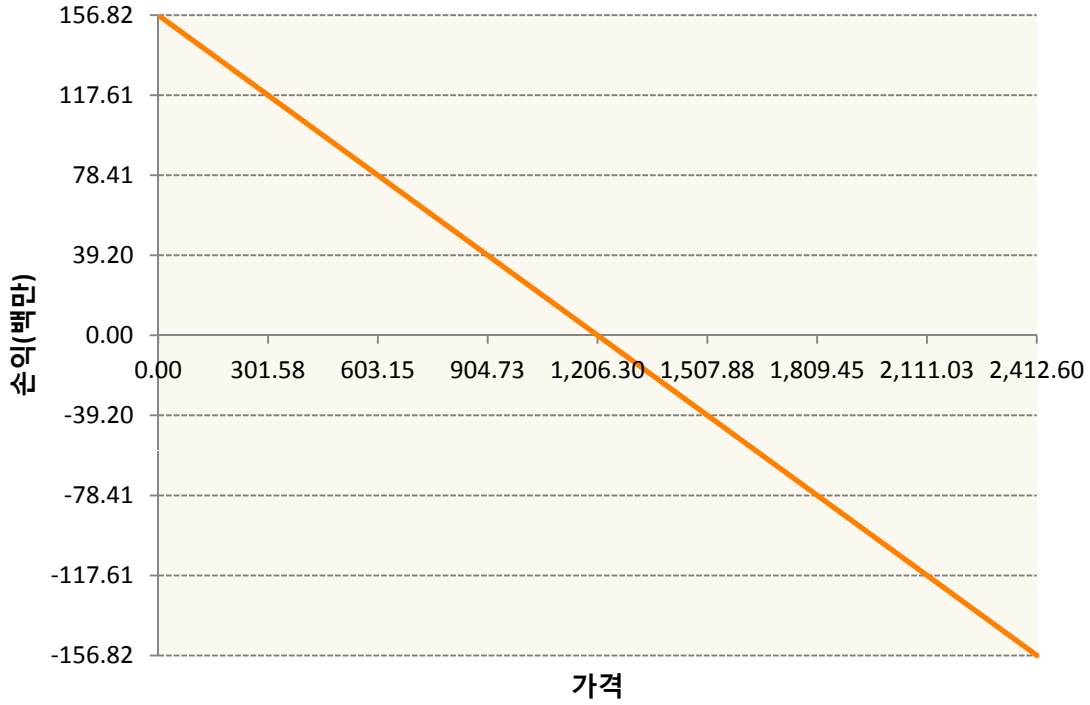
CK0-CORN FUTURE May20



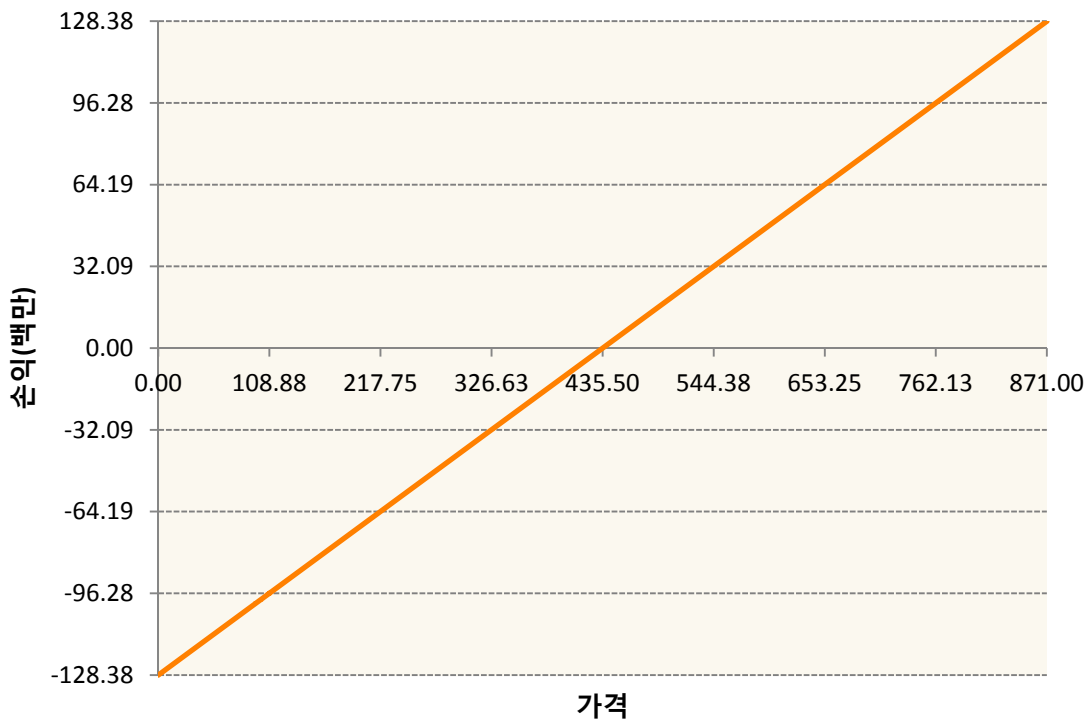




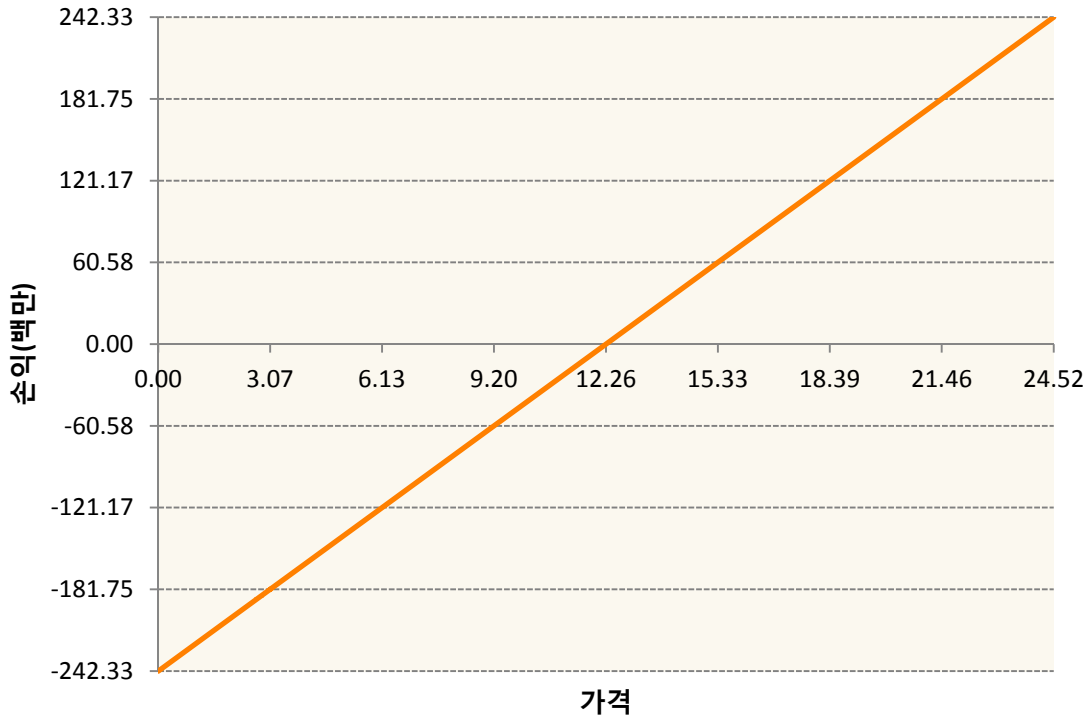
KR4175Q30009-2020-03 달러선물



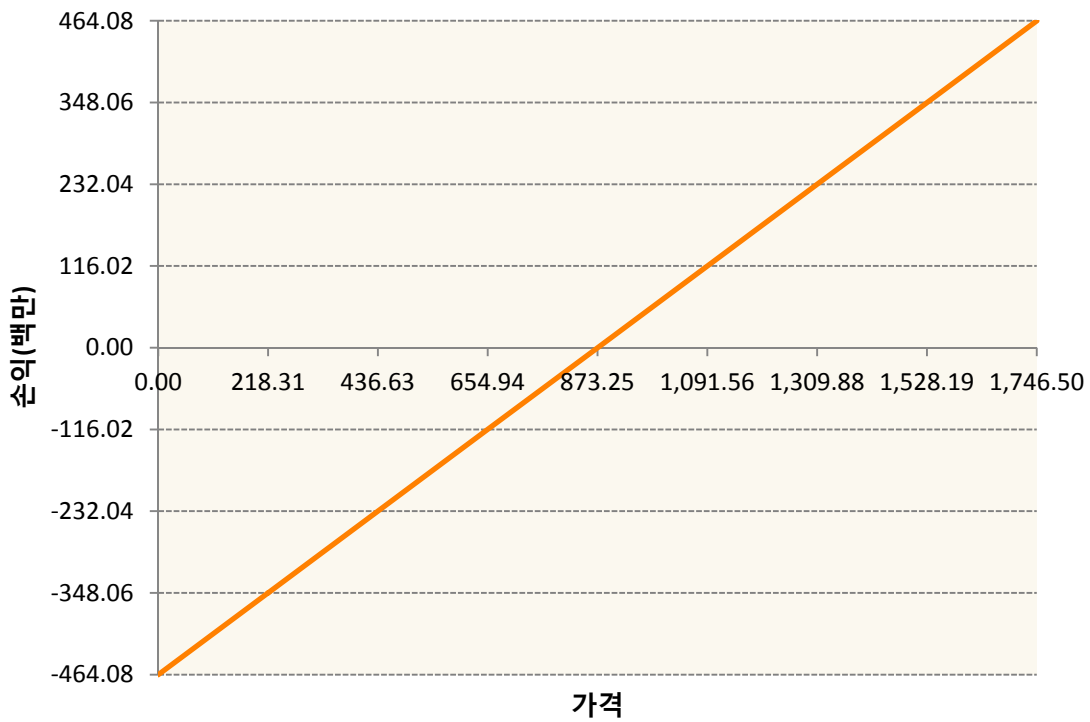
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



SBK0-Sugar May20

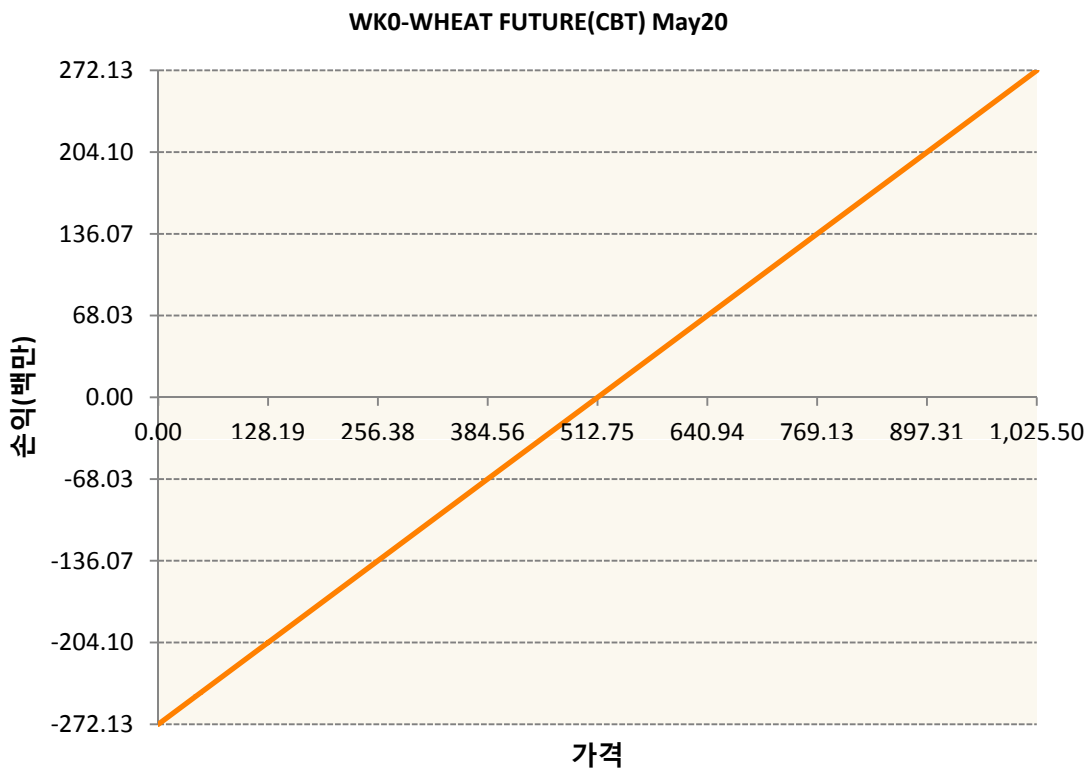
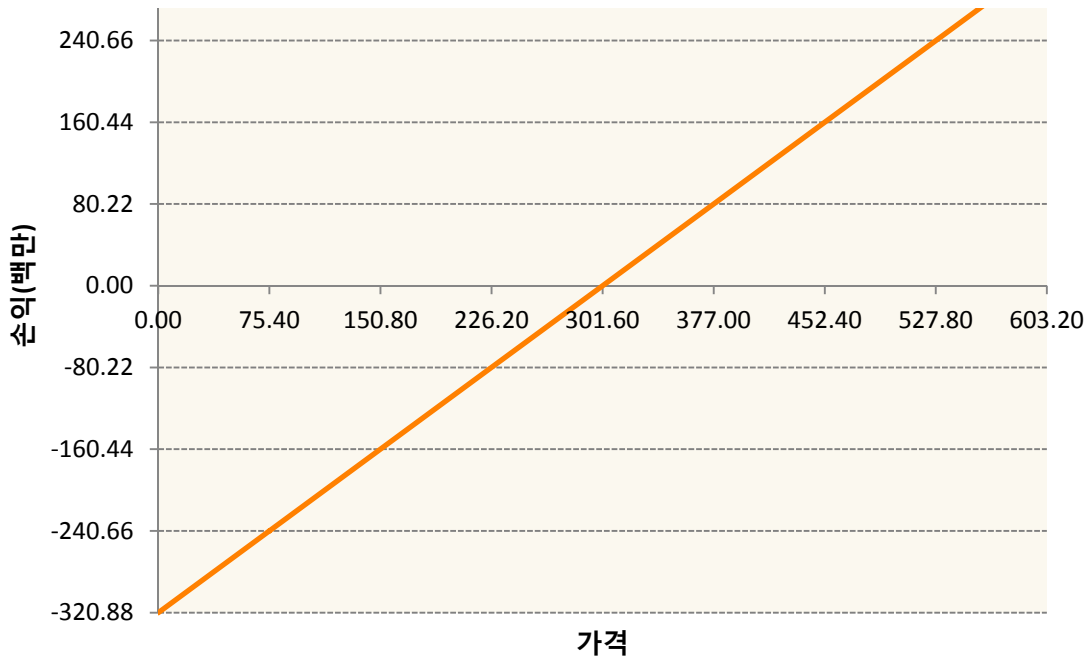


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	17
CK0	CORN FUTURE May20	41
CTK0	COTTON NO.2 FUTR May20	9
KCK0	COFFEE 'C' FUTURE May20	20
KR4175Q30C	2020-03 달러선물	13

KWK0	KC HRW WHEAT FUT May20	10
SBK0	Sugar May20	19
SK0	SOYBEAN FUTURE May20	37
SMK0	SOYBEAN MEAL FUTR May20	26
WK0	WHEAT FUTURE(CBT) May20	22

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

(단위:백만원)

220