

공시일	2020-03-16
기준일	2020-03-13

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)

166

공시일	2020-03-16
기준일	2020-03-13

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

854

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

728

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-16
기준일	2020-03-13

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

577

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

891

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-16
기준일	2020-03-13

유로인덱스모(주식-파생형)

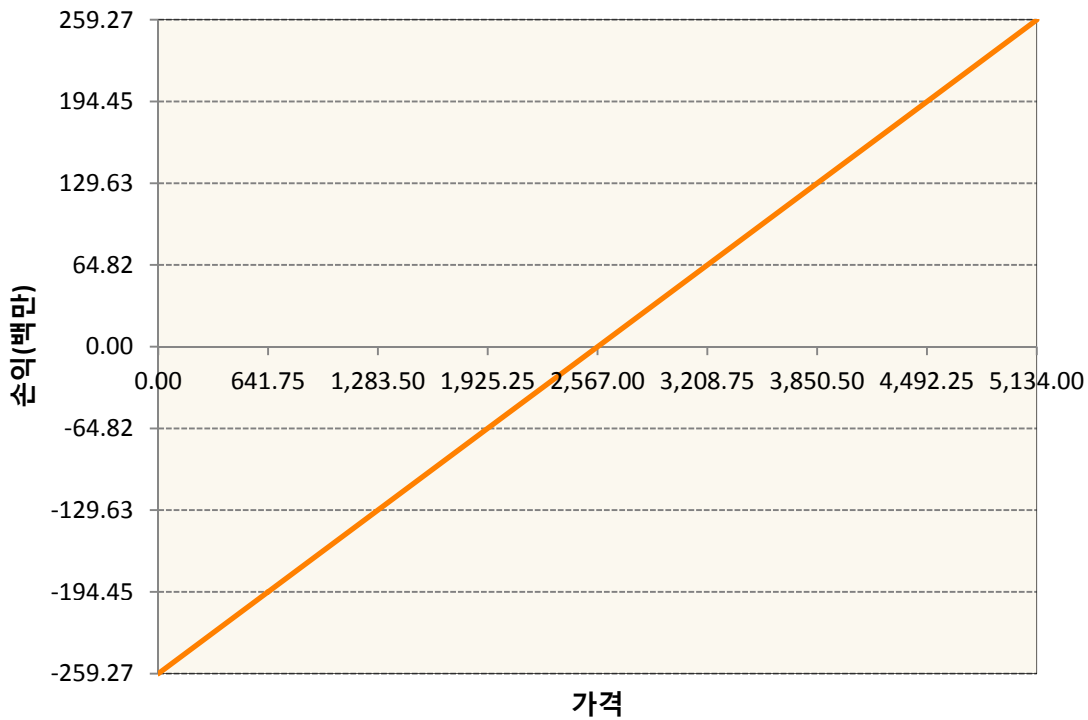
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	259	0	259	

2. 만기시점의 손익구조

VGH0-EURO STOXX 50 Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH0	EURO STOXX 50 Mar20	21
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

20

공시일	2020-03-16
기준일	2020-03-13

차이나인덱스모(주식-파생형)

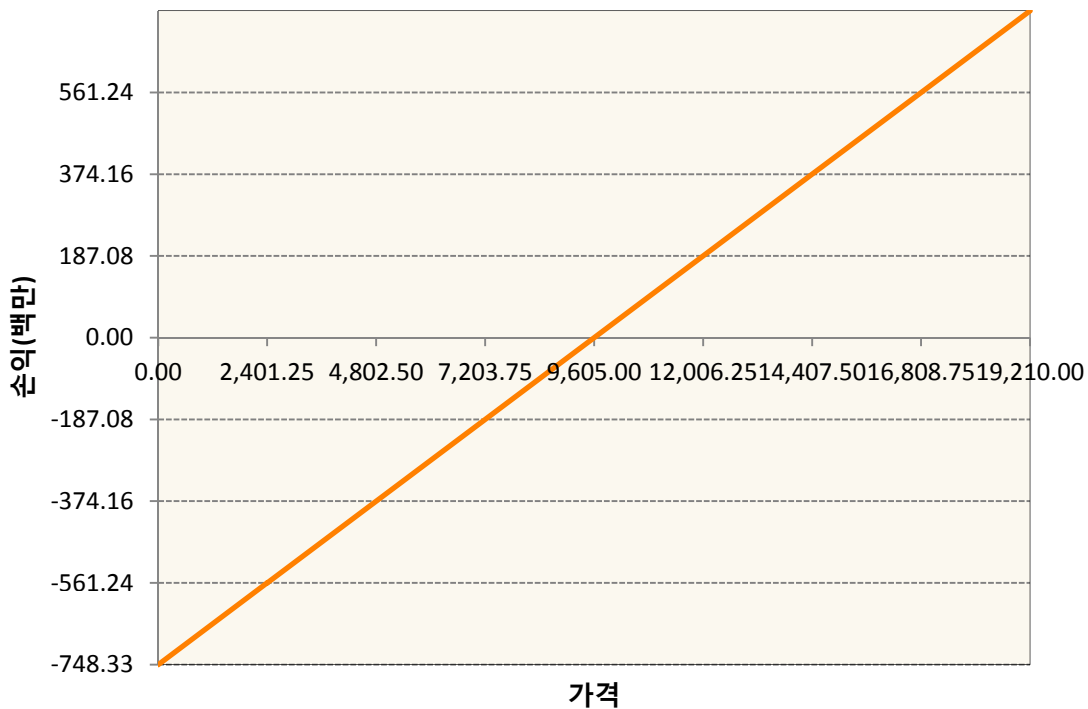
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	748	0	748	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)

57

공시일	2020-03-16
기준일	2020-03-13

커버드콜모(주식혼합-파생형)

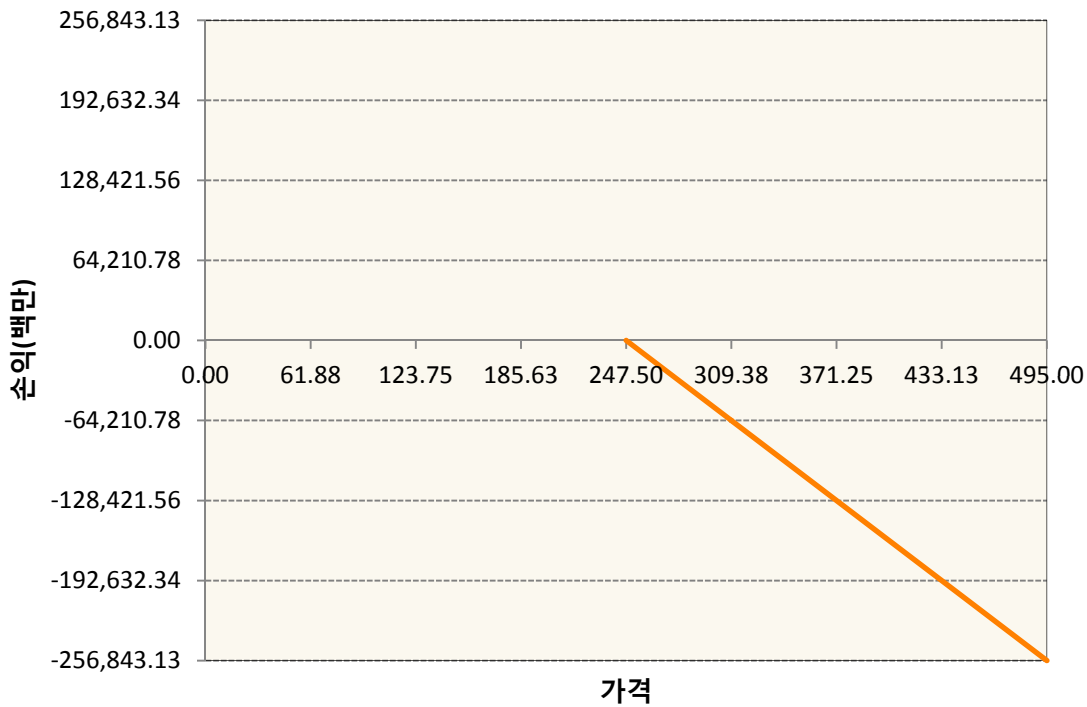
1. 계약금액

(단위:백만원)

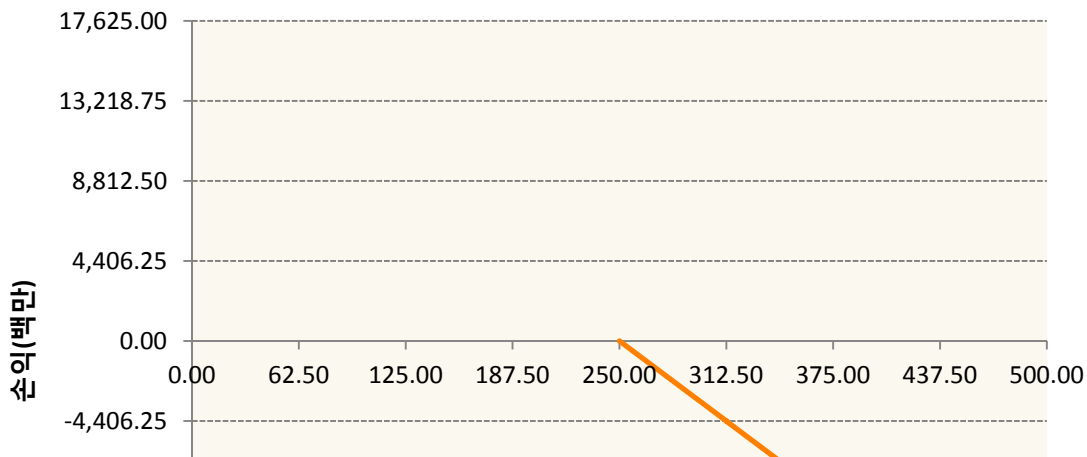
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	233,168	-233,168	장내
누계	유가증권	옵션	0	364,187	-364,187	장내

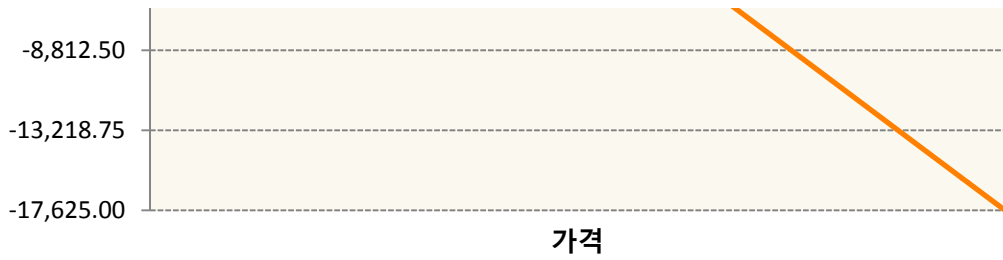
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

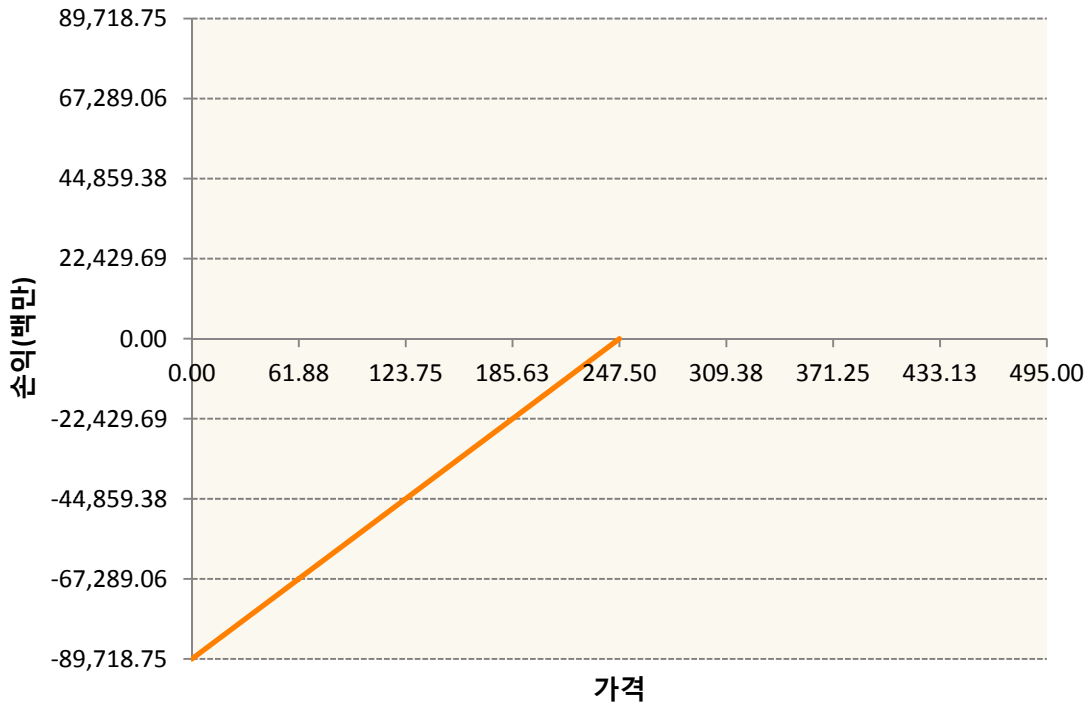


KR4201Q42503-2020-04 콜250





KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q42479		2020-04 콜247.5					14,666	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	9,114	8,402	7,624	6,793	5,919	5,009	4,070	
-5.33%	7,806	6,909	5,967	4,990	3,985	2,958	1,913	
-2.67%	5,968	4,911	3,831	2,734	1,623	501	-629	
0%	3,530	2,359	1,182	0	-1,186	-2,374	-3,564	
2.67%	456	-769	-1,994	-3,219	-4,443	-5,667	-6,890	
5.33%	-3,252	-4,469	-5,690	-6,914	-8,140	-9,368	-10,596	
8.00%	-7,557	-8,709	-9,879	-11,062	-12,256	-13,458	-14,666	
KR4201Q42503		2020-04 콜250					965	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	575	530	481	428	371	312	250	

-5.33%	497	440	379	316	250	182	113
-2.67%	386	317	246	174	100	25	-51
0%	236	158	79	0	-80	-160	-240
2.67%	43	-40	-123	-206	-289	-373	-456
5.33%	-192	-276	-360	-445	-529	-613	-698
8.00%	-468	-550	-632	-714	-798	-881	-965
KR4301Q42477 2020-04 풋247.5							5,556
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,478	-3,781	-4,106	-4,450	-4,808	-5,177	-5,556
-5.33%	-1,678	-2,044	-2,425	-2,818	-3,219	-3,628	-4,042
-2.67%	-54	-473	-900	-1,333	-1,769	-2,210	-2,652
0%	1,377	920	460	0	-462	-924	-1,387
2.67%	2,605	2,130	1,655	1,180	705	230	-244
5.33%	3,635	3,161	2,686	2,209	1,733	1,256	779
8.00%	4,476	4,021	3,561	3,097	2,629	2,159	1,687

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

(단위:백만원)

16,336

공시일	2020-03-16
기준일	2020-03-13

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

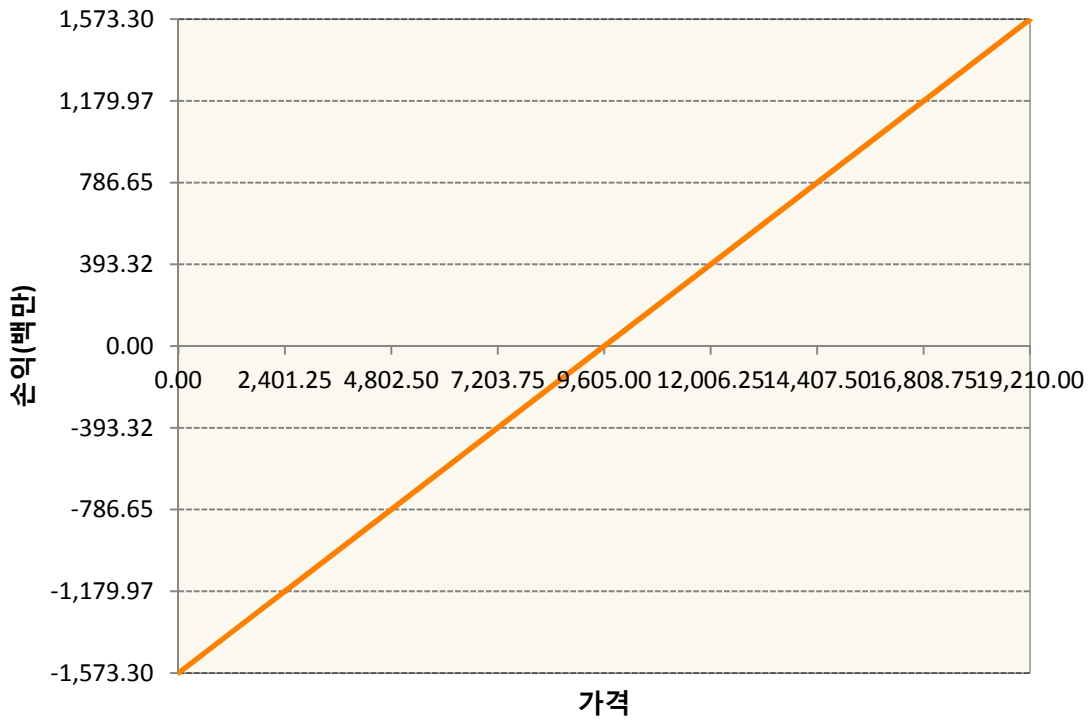
1. 계약금액

(단위:백만원)

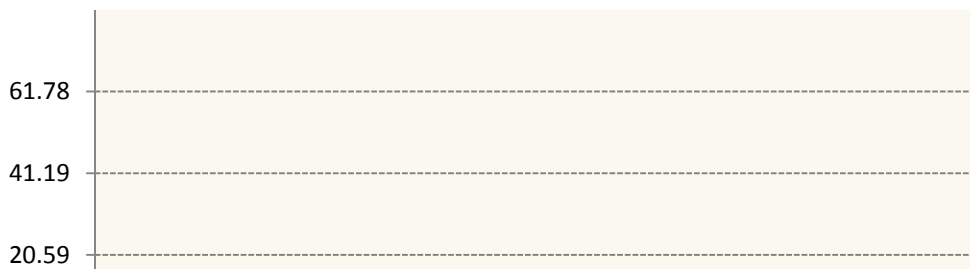
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,573	0	1,573	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,822	-4,822	장내
누계	통화	선도	0	2,209	-2,209	장외

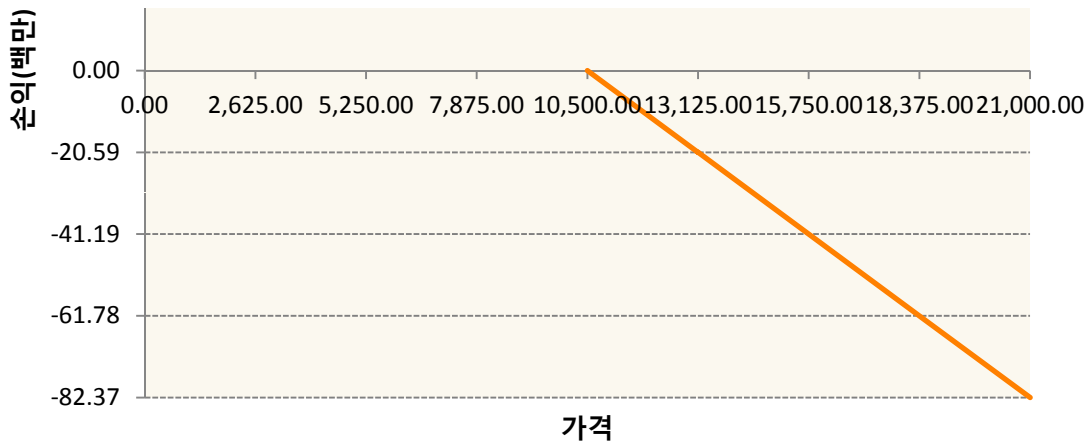
2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20

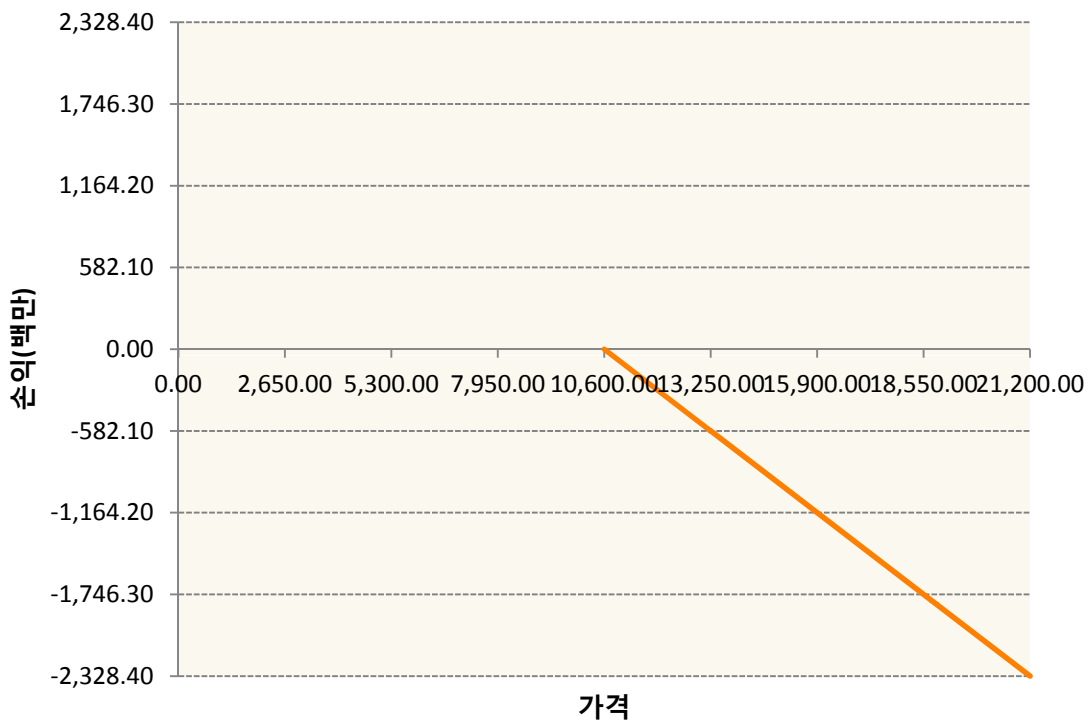


OHHIH0-C105-HSCEI

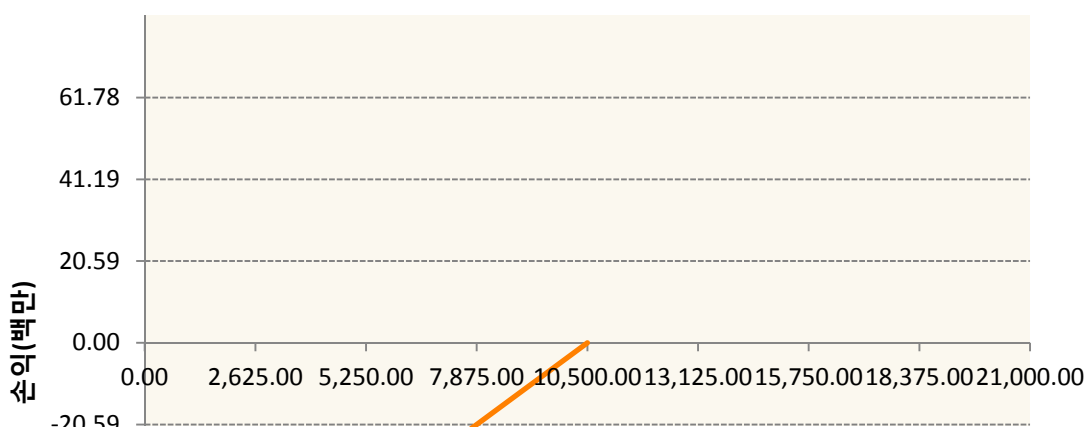


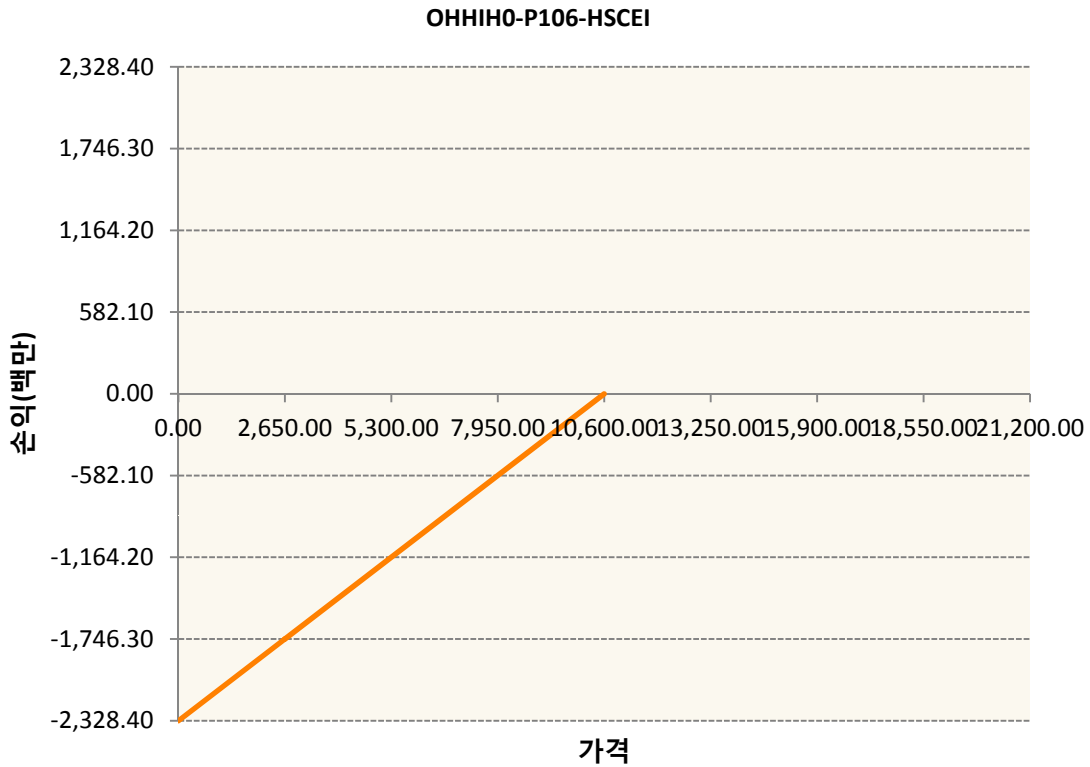
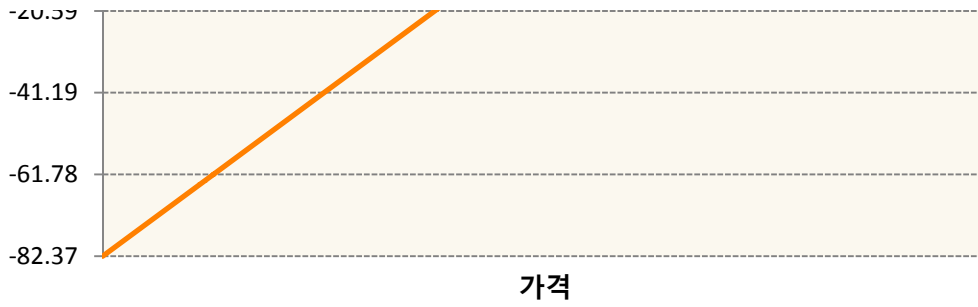


OHHIH0-C106-HSCEI



OHHIH0-P105-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E	177
HCH0 HSCEI Futures Mar20	126
OHHIH0-C1(HSCEI	7
OHHIH0-C1(HSCEI	186
OHHIH0-P1(HSCEI	7
OHHIH0-P1(HSCEI	186

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

546

공시일	2020-03-16
기준일	2020-03-13

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

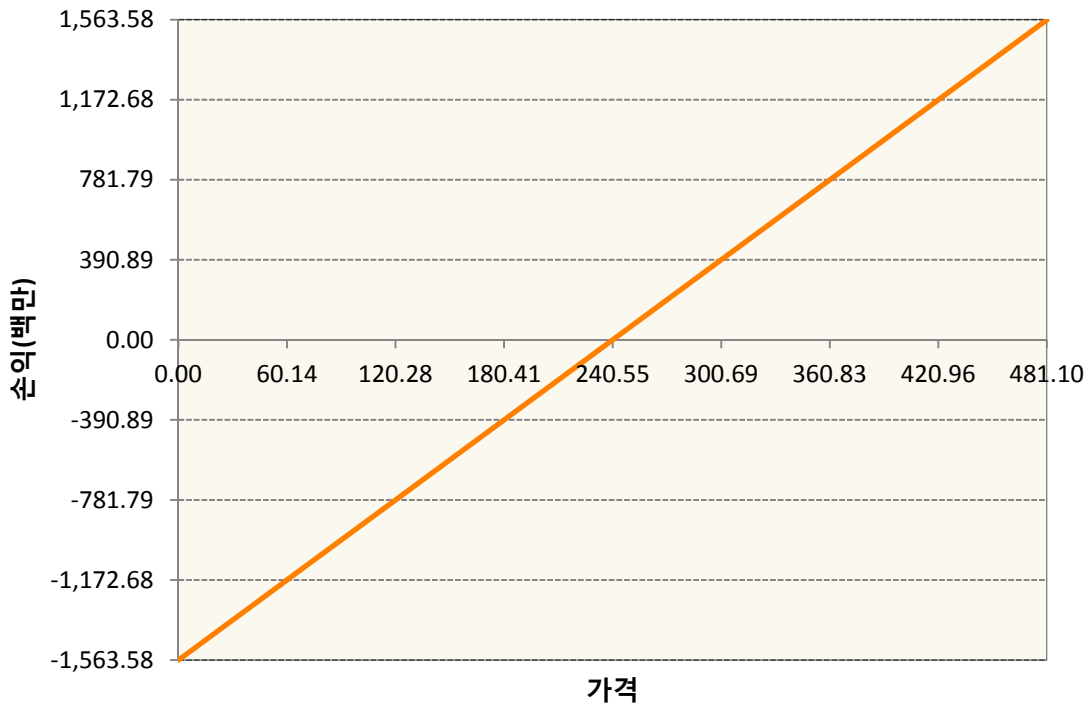
1. 계약금액

(단위:백만원)

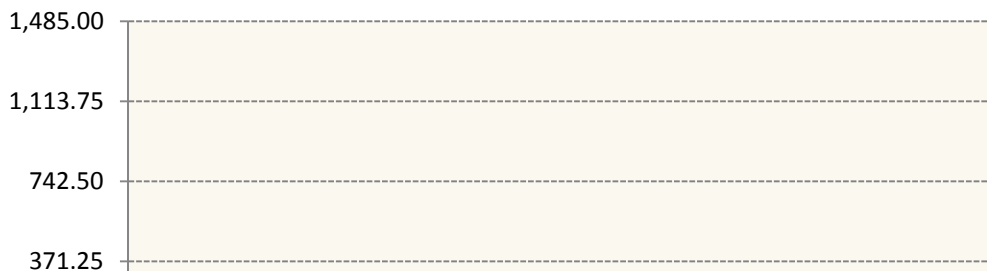
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	3,157	-3,157	장내
누계	유가증권	선물	1,564	0	1,564	장내
누계	유가증권	스왑	3,125	0	3,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	2,971	-2,971	장내

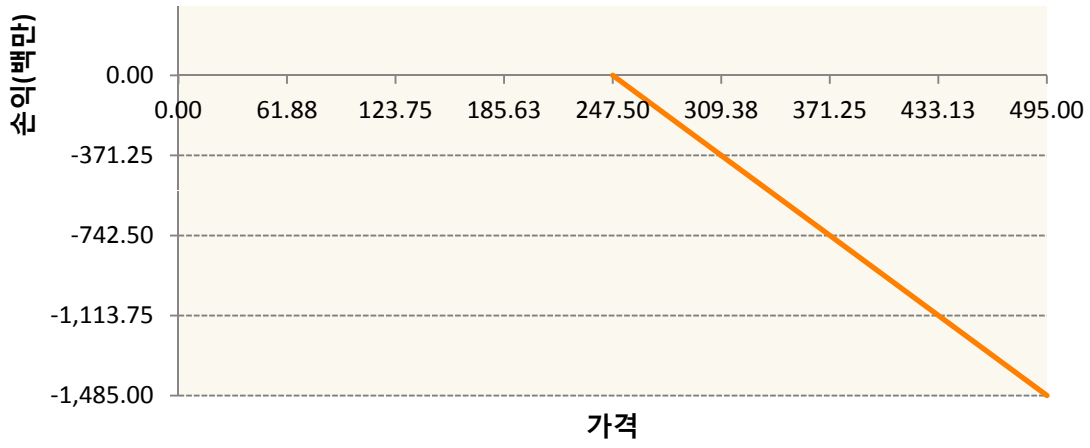
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

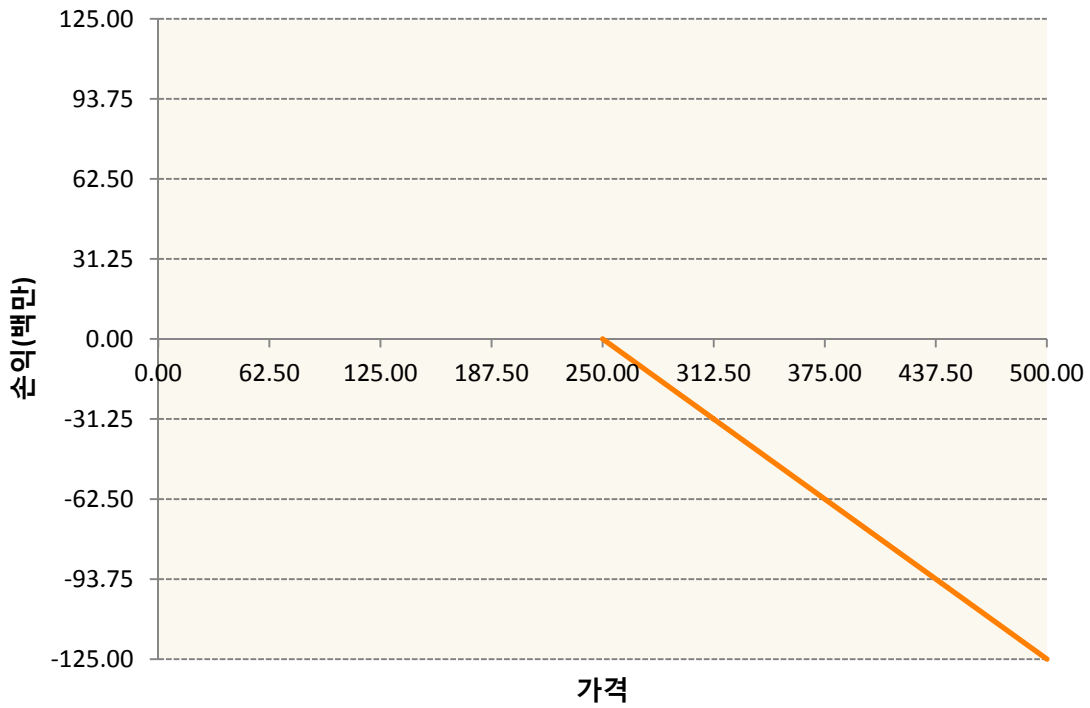


KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

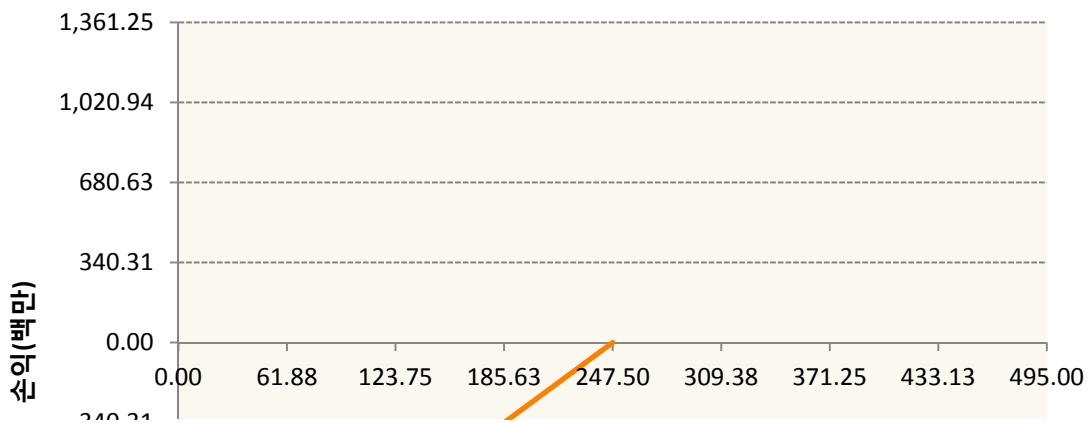




KR4201Q42503-2020-04 콜250



KR4301Q42477-2020-04 풋247.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						272
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-272	-272	-272	-272	-272	-272	-272	
-5.33%	-181	-181	-181	-181	-181	-181	-181	
-2.67%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	91	91	91	91	91	91	91	
5.33%	181	181	181	181	181	181	181	
8.00%	272	272	272	272	272	272	272	
KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						125
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125	
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83	
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	42	42	42	42	42	42	42	
5.33%	83	83	83	83	83	83	83	
8.00%	125	125	125	125	125	125	125	
KR4201Q42479		2020-04 콜247.5						85
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	53	49	44	39	34	29	24	
-5.33%	45	40	35	29	23	17	11	
-2.67%	35	28	22	16	9	3	-4	
0%	20	14	7	0	-7	-14	-21	
2.67%	3	-4	-12	-19	-26	-33	-40	
5.33%	-19	-26	-33	-40	-47	-54	-61	
8.00%	-44	-50	-57	-64	-71	-78	-85	
KR4201Q42503		2020-04 콜250						7
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	4	4	3	3	3	2	2
-5.33%	4	3	3	2	2	1	1
-2.67%	3	2	2	1	1	0	0
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	0	0	-1	-1	-2	-3	-3
5.33%	-1	-2	-3	-3	-4	-4	-5
8.00%	-3	-4	-4	-5	-6	-6	-7
KR4301Q42477 2020-04 풋247.5							84
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-53	-57	-62	-68	-73	-79	-84
-5.33%	-25	-31	-37	-43	-49	-55	-61
-2.67%	-1	-7	-14	-20	-27	-34	-40
0%	21	14	7	0	-7	-14	-21
2.67%	40	32	25	18	11	3	-4
5.33%	55	48	41	34	26	19	12
8.00%	68	61	54	47	40	33	26

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

(단위:백만원)

533

공시일	2020-03-16
기준일	2020-03-13

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

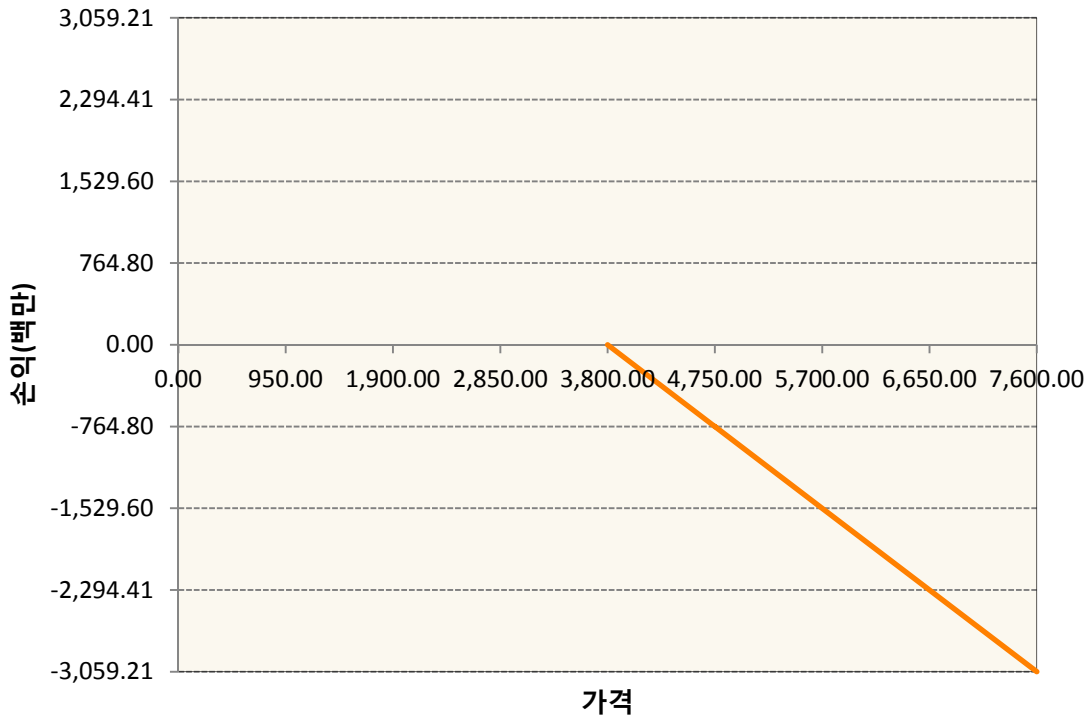
1. 계약금액

(단위:백만원)

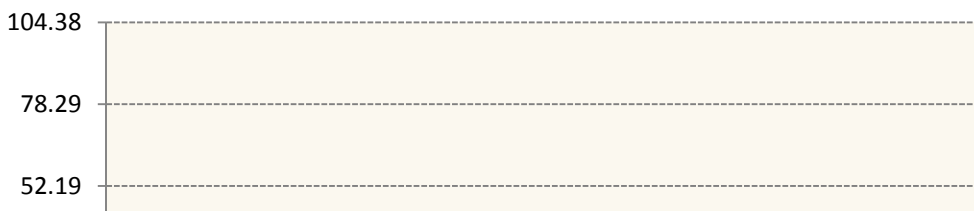
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	412	0	412	
누계	유가증권	스왑	8,692	0	8,692	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,327	-6,327	장내
누계	통화	선도	546	3,581	-3,035	장외

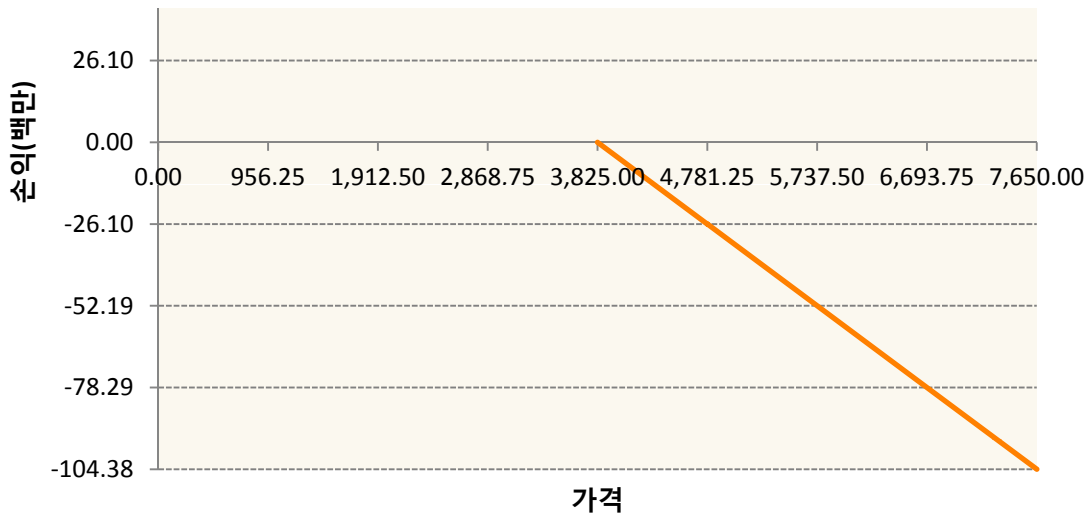
2. 만기시점의 손익구조

OESXH0-C3800-EURO STOXX 50

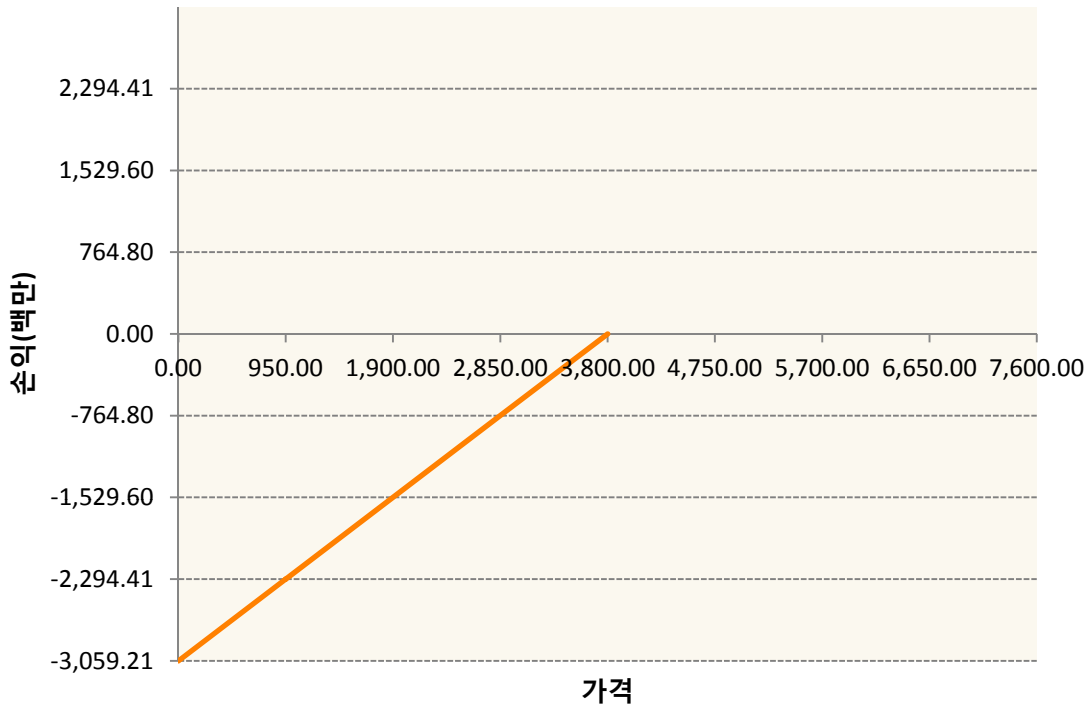


OESXH0-C3825-EURO STOXX 50

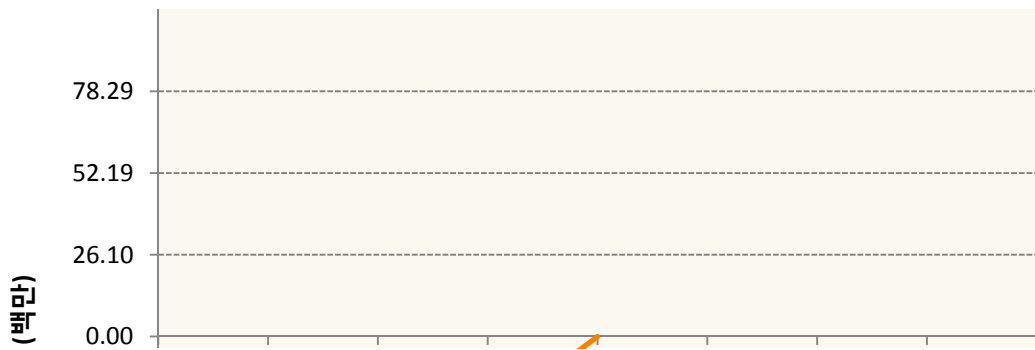


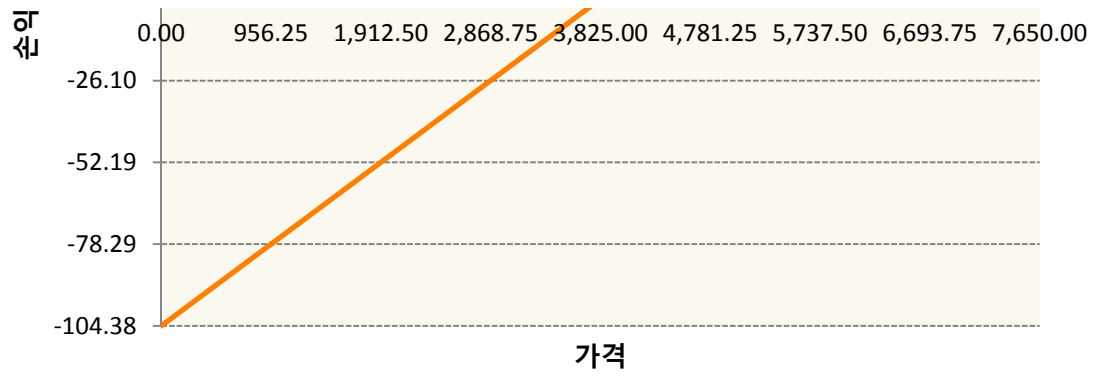


OESXH0-P3800-EURO STOXX 50

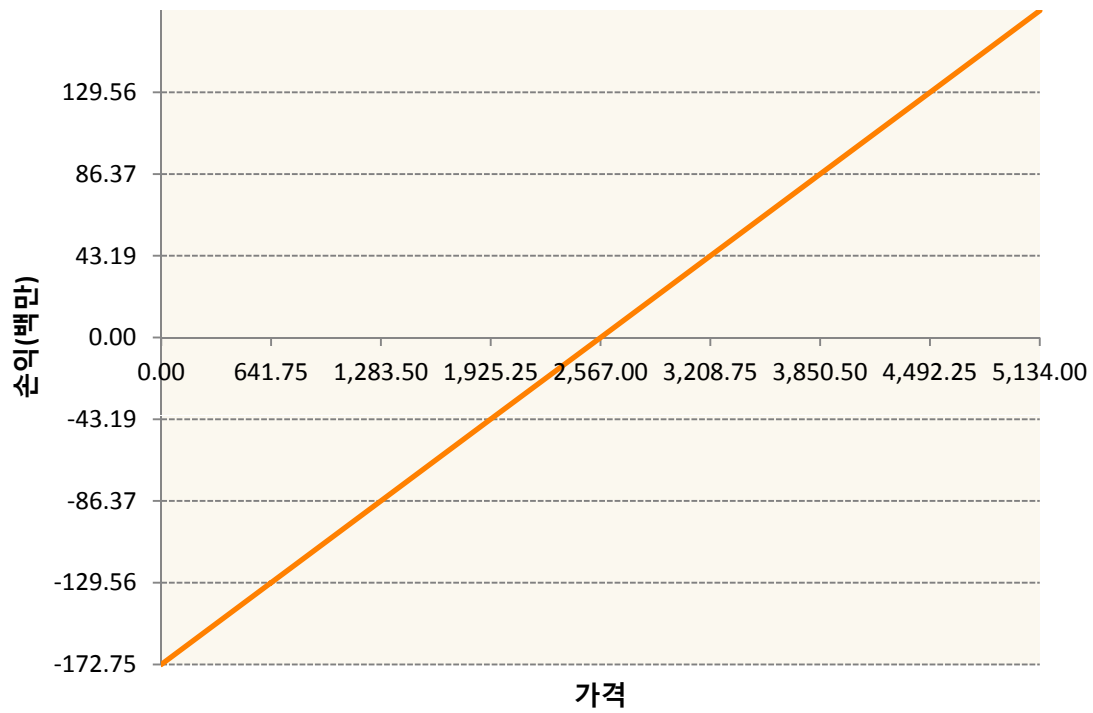


OESXH0-P3825-EURO STOXX 50

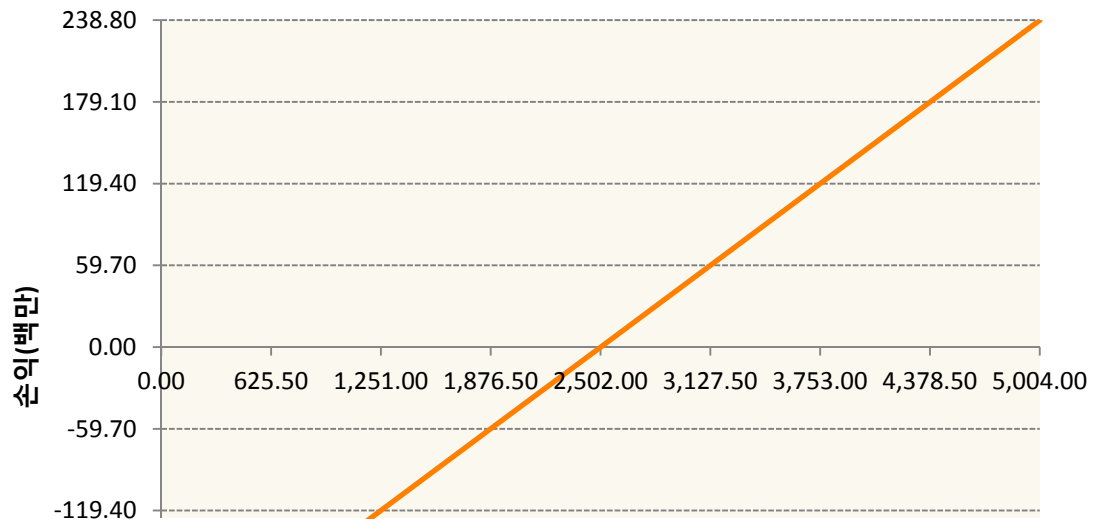


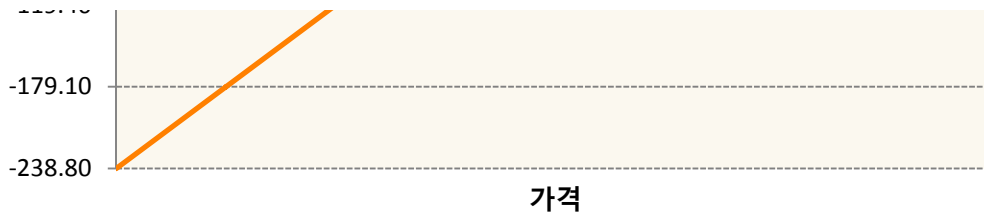


VGHO-EURO STOXX 50 Mar20



VGM0-EURO STOXX 50 Jun20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	85
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	14
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20	19

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

882

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

(단위:백만원)

882

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

(단위:백만원)

81

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

(단위:백만원)

119

공시일	2020-03-16
기준일	2020-03-13

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

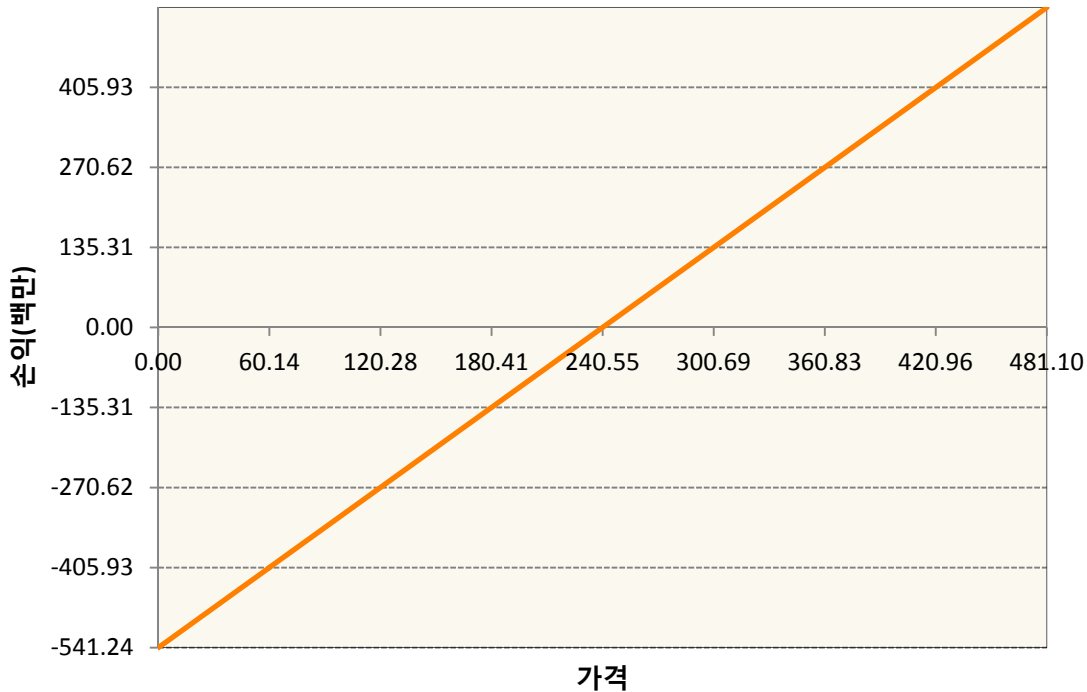
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	541	0	541	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002 2020-06 코스피200지수선물 43

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
-5.33%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
-2.67%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	14	14	14	14	14	14	14
5.33%	29	29	29	29	29	29	29
8.00%	43	43	43	43	43	43	43

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

(단위:백만원)

43

공시일	2020-03-16
기준일	2020-03-13

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

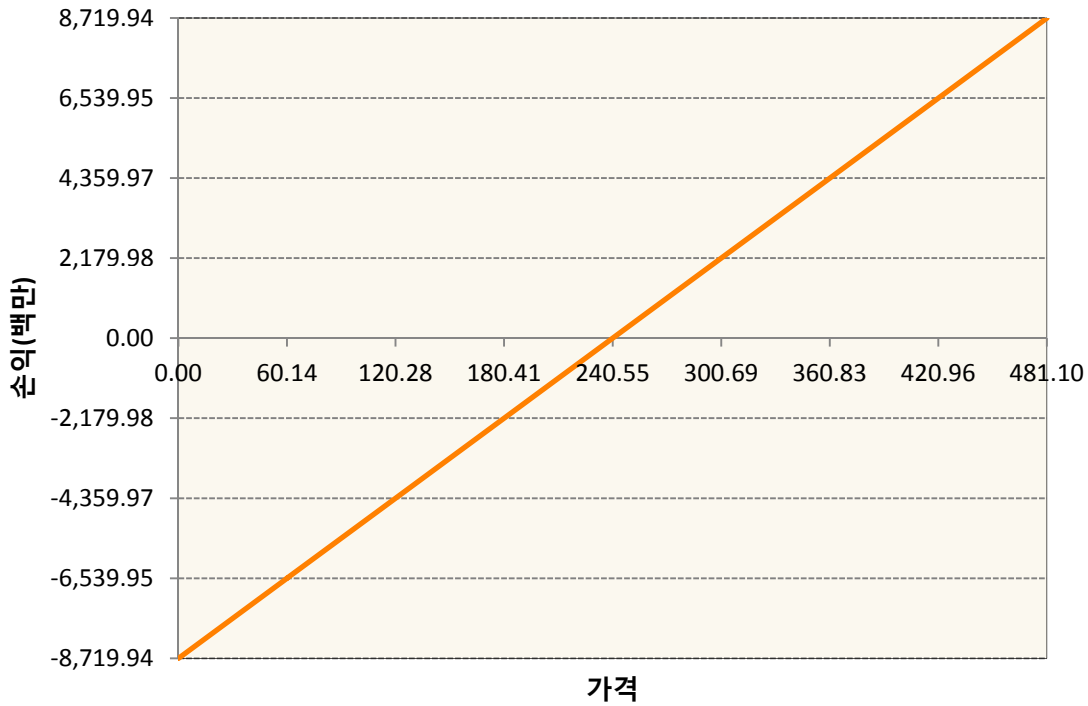
1. 계약금액

(단위:백만원)

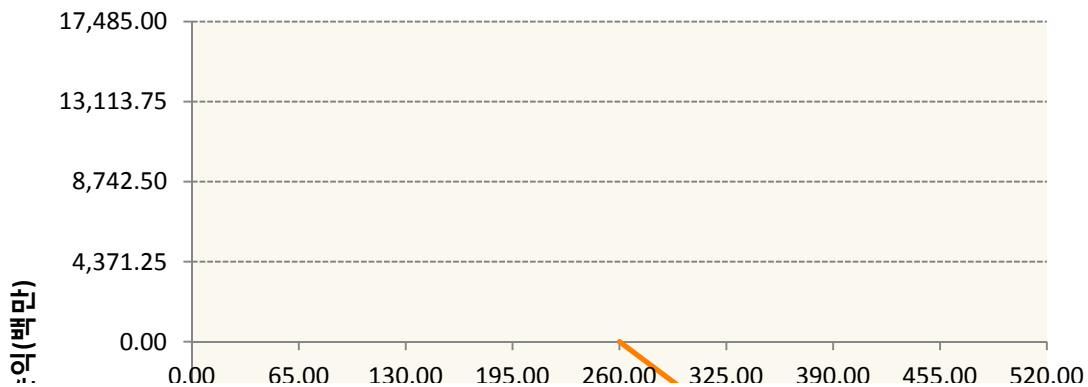
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	351	0	351	장내
신규	유가증권	옵션	499	7,757	-7,258	장내
누계	유가증권	선물	8,720	0	8,720	장내
누계	유가증권	옵션	6,004	17,485	-11,481	장내

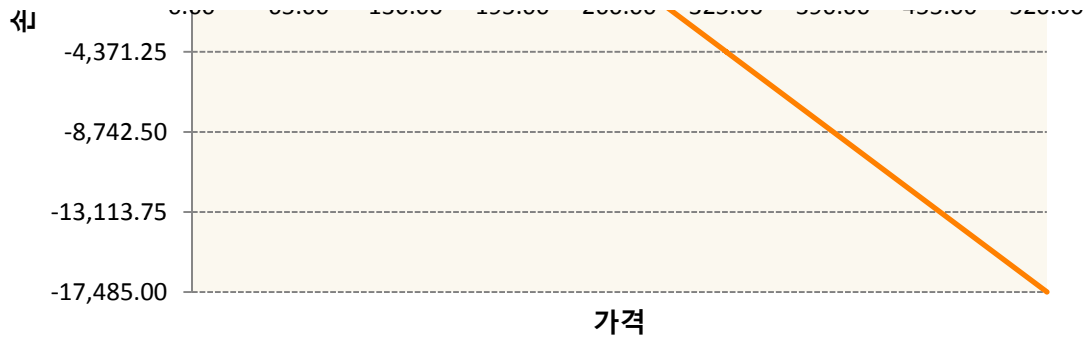
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

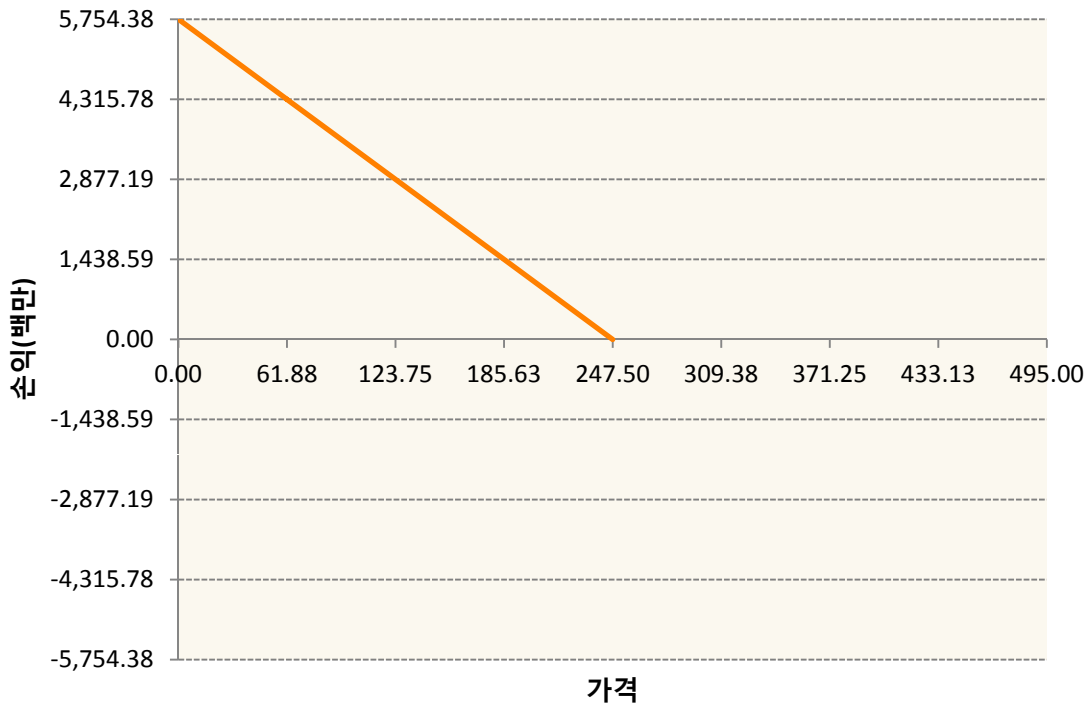


KR4201Q42602-2020-04 콜260

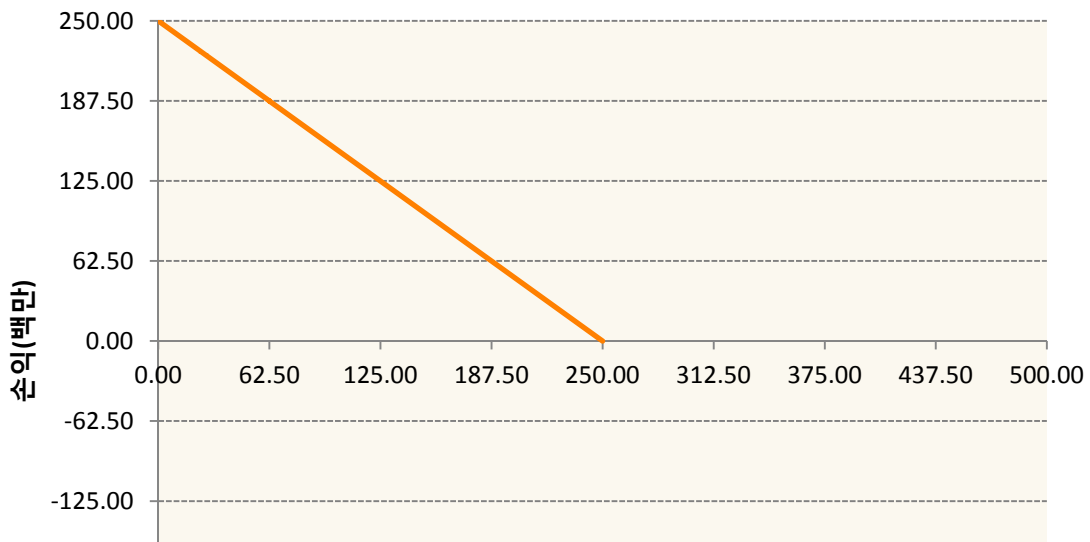


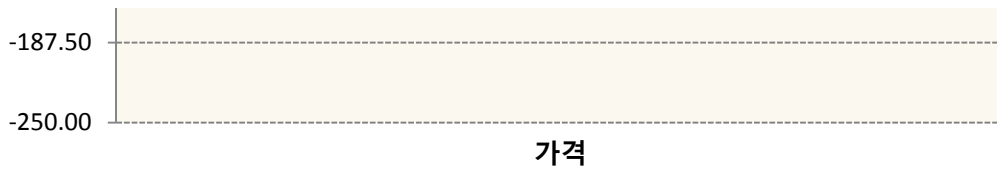


KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



KR4301Q42501-2020-04 풋250





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						698
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-698	-698	-698	-698	-698	-698	-698	
-5.33%	-465	-465	-465	-465	-465	-465	-465	
-2.67%	-233	-233	-233	-233	-233	-233	-233	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	233	233	233	233	233	233	233	
5.33%	465	465	465	465	465	465	465	
8.00%	698	698	698	698	698	698	698	
KR4201Q42602		2020-04 콜260						794
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	394	366	332	294	251	204	154	
-5.33%	353	314	269	220	167	112	54	
-2.67%	290	238	182	123	61	-3	-69	
0%	198	134	68	0	-70	-141	-214	
2.67%	72	-1	-76	-151	-228	-305	-383	
5.33%	-91	-171	-252	-333	-414	-495	-576	
8.00%	-293	-377	-460	-544	-627	-710	-794	
KR4301Q42477		2020-04 풋247.5						356
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	223	242	263	285	308	332	356	
-5.33%	108	131	156	181	206	233	259	
-2.67%	3	30	58	85	113	142	170	
0%	-88	-59	-30	0	30	59	89	
2.67%	-167	-137	-106	-76	-45	-15	16	
5.33%	-233	-203	-172	-142	-111	-81	-50	
8.00%	-287	-258	-228	-199	-169	-138	-108	
KR4301Q42501		2020-04 풋250						16
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	10	11	12	13	14	15	16	
-5.33%	5	6	7	8	9	10	11	
-2.67%	0	2	3	4	5	6	7	

0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-7	-6	-5	-3	-2	-1	1
5.33%	-10	-9	-8	-6	-5	-4	-2
8.00%	-13	-12	-10	-9	-8	-6	-5

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

(단위:백만원)

1,483

공시일	2020-03-16
기준일	2020-03-13

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	200,544	0	200,544	

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	2020-03-16
기준일	2020-03-13

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	106,334	0	106,334	

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	2020-03-16
기준일	2020-03-13

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	503,889	0	503,889	
누계	통화	선도	36,579	526,616	-490,037	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,570
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,463
FX21020F03 KRW/USD 31-03-20E	3,121
FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E	2,926
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,634
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	1,951
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	3,356
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,356
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,951
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,902
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,283
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,951
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	195
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	4,975
FX21020G06 USD/KRW 31-03-20E	488
FX21020H00 USD/KRW 31-03-20E	975
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,439
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,029
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,029
FX21020H04 USD/KRW 21-04-20E	1,463

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

16,199

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

(단위:백만원)

122

공시일	2020-03-16
기준일	2020-03-13

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

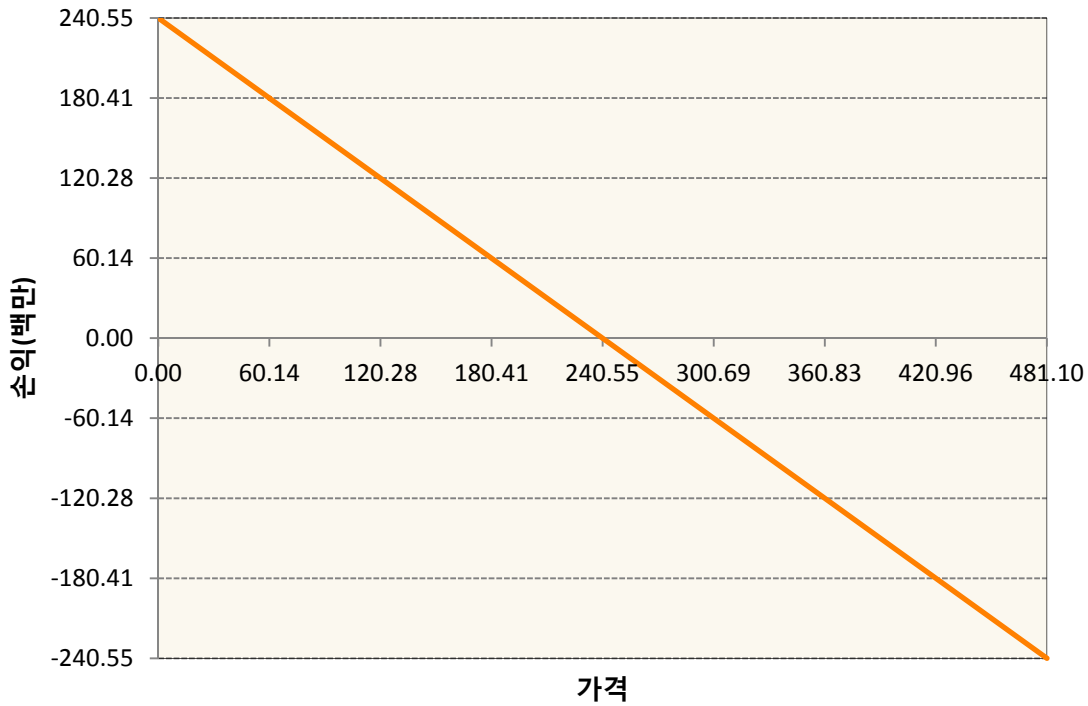
1. 계약금액

(단위:백만원)

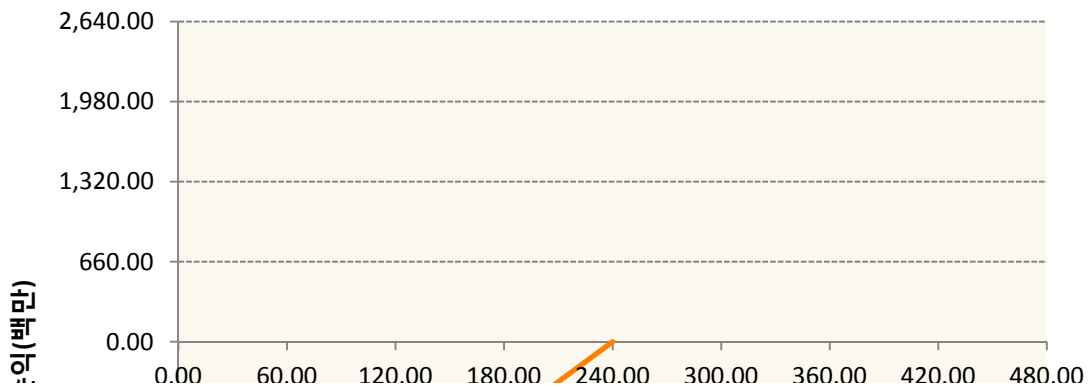
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	347	0	347	장내
신규	유가증권	옵션	548	1,041	-493	장내
누계	유가증권	선물	0	241	-241	장내
누계	유가증권	옵션	0	2,883	-2,883	장내

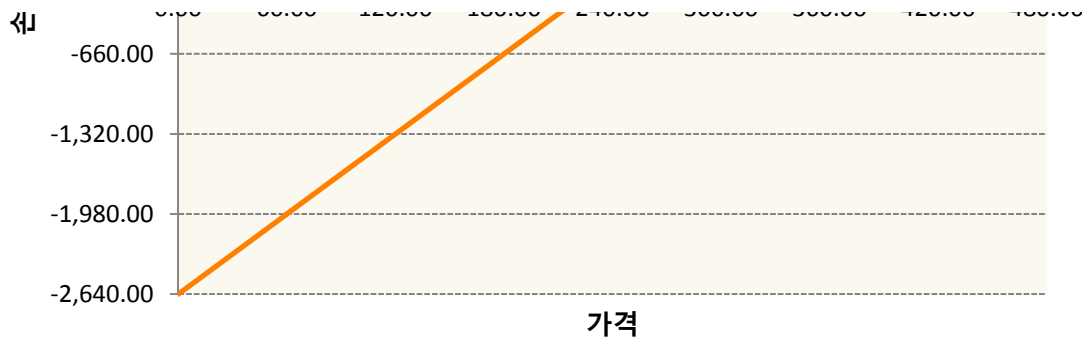
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

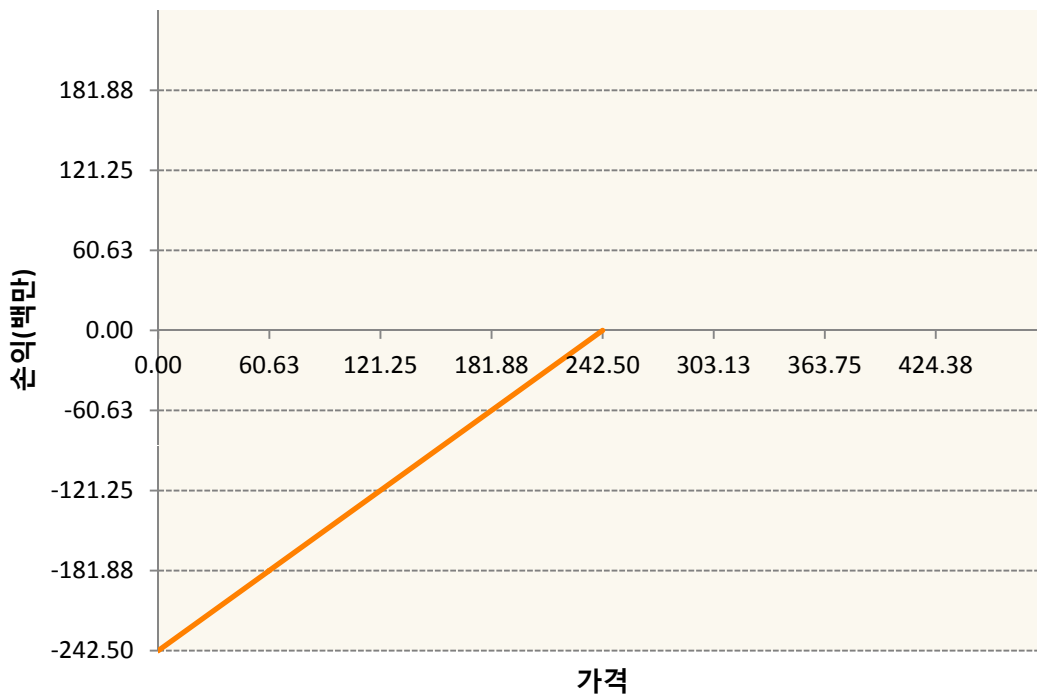


KR4301Q42402-2020-04 풋240





KR4301Q42428-2020-04 풋242.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						19
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	19	19	19	19	19	19	19	
-5.33%	13	13	13	13	13	13	13	
-2.67%	6	6	6	6	6	6	6	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6	
5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13	
8.00%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
KR4301Q42402		2020-04 풋240						156
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-86	-97	-108	-120	-131	-144	-156
-5.33%	-37	-49	-62	-75	-88	-101	-114
-2.67%	6	-8	-21	-35	-49	-62	-76
0%	42	28	14	0	-14	-28	-42
2.67%	72	58	44	30	16	2	-12
5.33%	97	83	70	56	43	29	15
8.00%	116	104	91	78	65	52	39
KR4301Q42428 2020-04 풋242.5							15

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8	-9	-10	-11	-12	-13	-15
-5.33%	-4	-5	-6	-7	-8	-9	-11
-2.67%	0	-1	-2	-3	-5	-6	-7
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%	11	10	9	8	6	5	4

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

(단위:백만원)

150

공시일	2020-03-16
기준일	2020-03-13

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	8,553	0	8,553	
누계	통화	선도	939	9,450	-8,511	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	184
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	218
FX21020H01 USD/KRW 31-03-20E	50
FX21020H02 KRW/USD 13-04-20E	354
FX21020H04 USD/KRW 31-03-20E	25
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

299

공시일	2020-03-16
기준일	2020-03-13

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

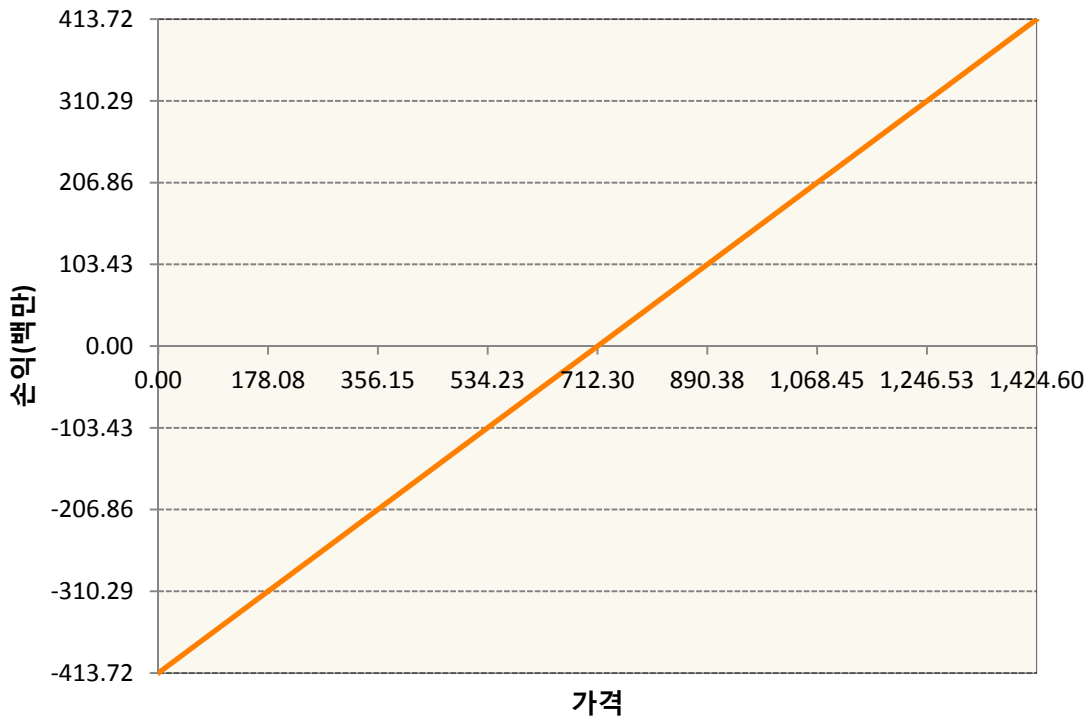
1. 계약금액

(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	414	0	414	
누계	유가증권	스왑	1,126	0	1,126	장외
누계	통화	선도	478	750	-273	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
FX21020H04 EUR/KRW 27-03-20E	13
VNCH0 VN30 Index Future Mar20	33

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

(단위:백만원)

146

공시일	2020-03-16
기준일	2020-03-13

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

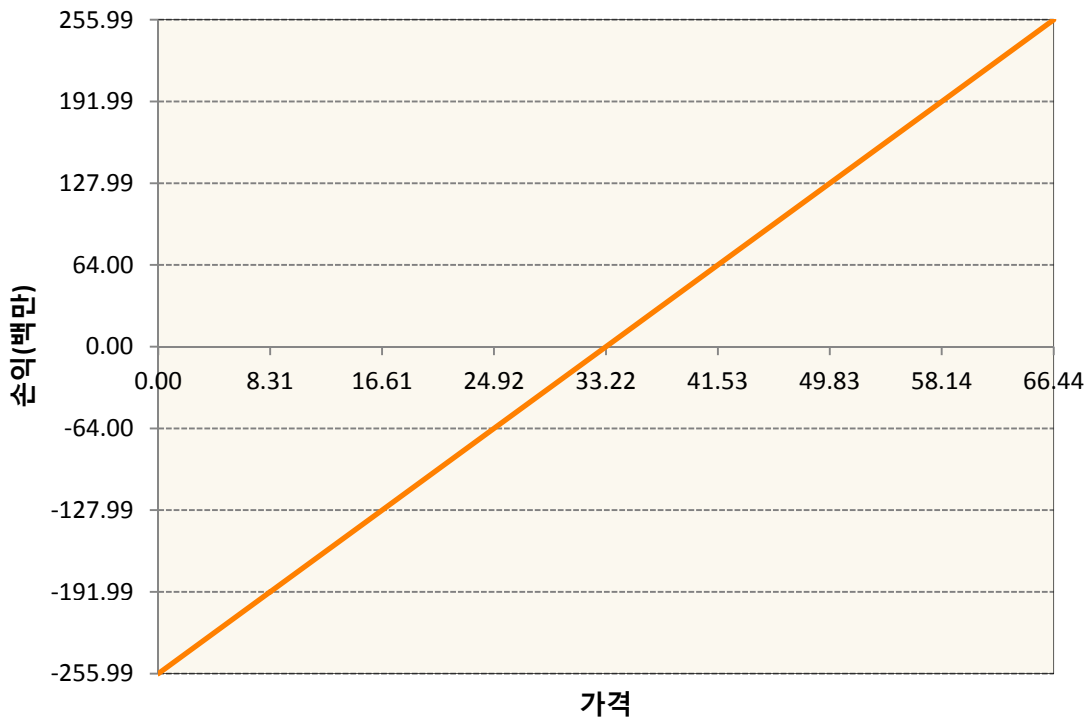
1. 계약금액

(단위:백만원)

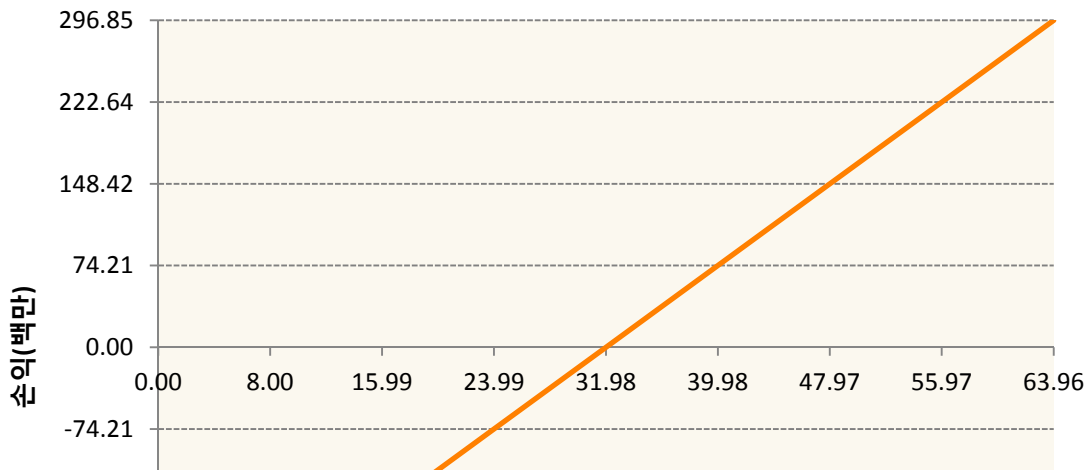
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,500	122	1,379	

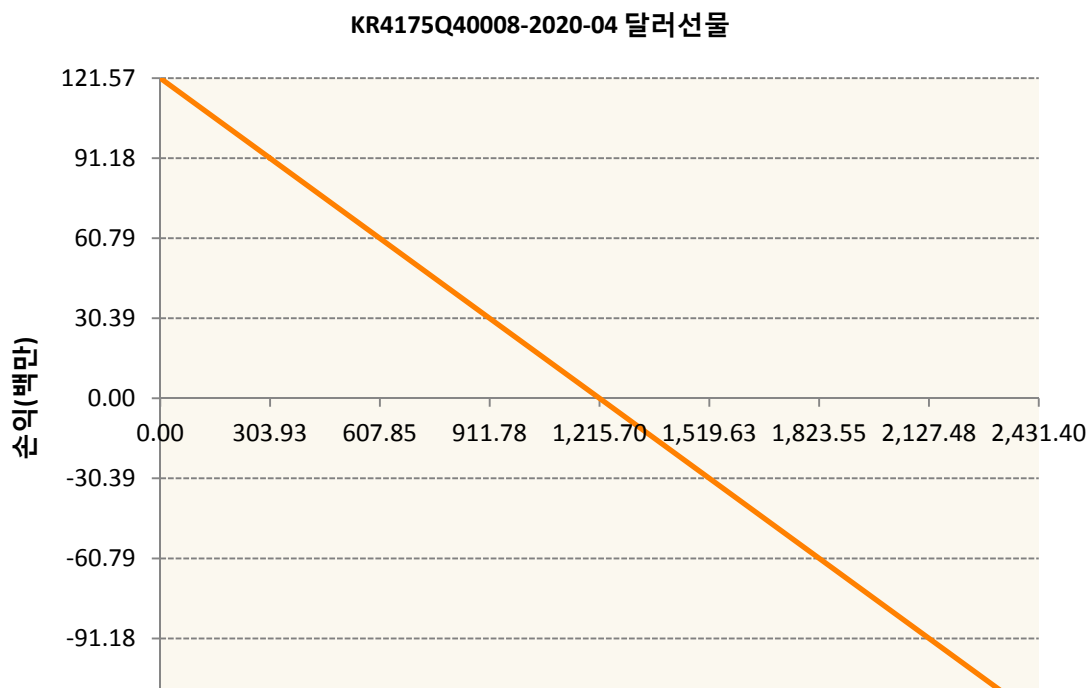
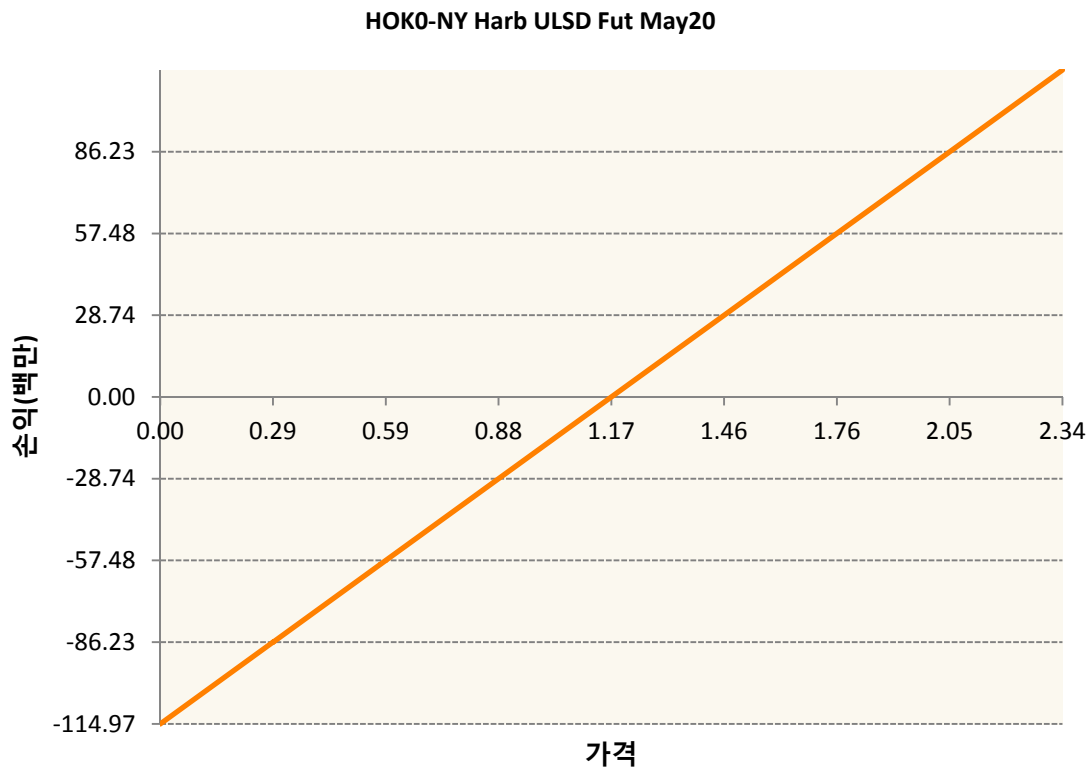
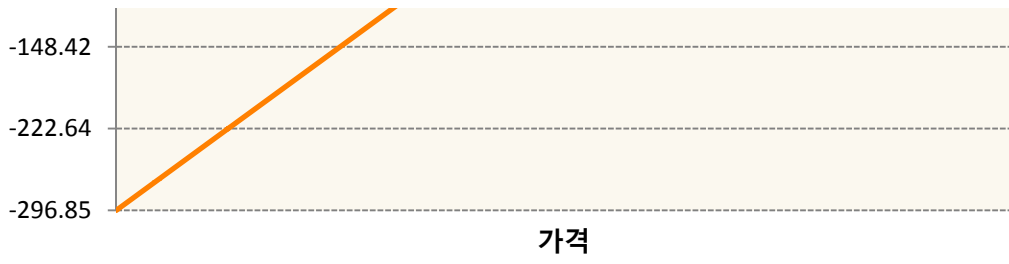
2. 만기시점의 손익구조

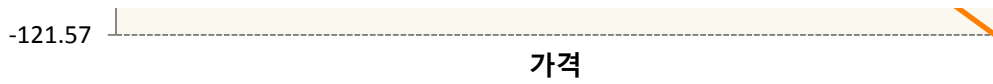
COK0-BRENT CRUDE FUTR May20



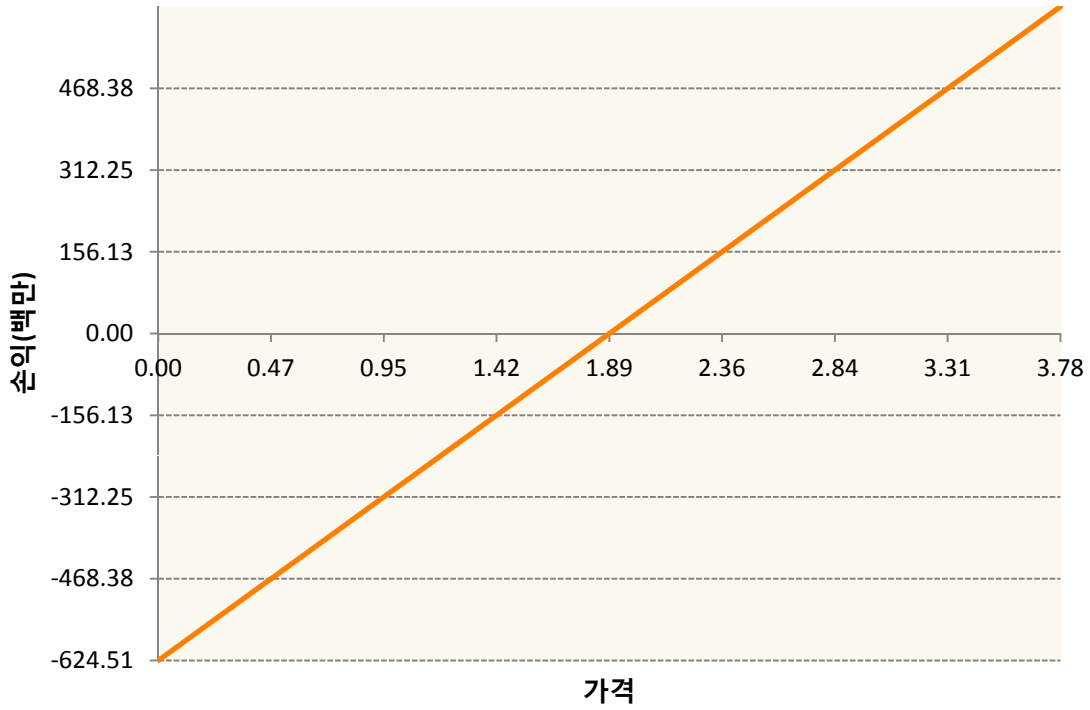
CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20



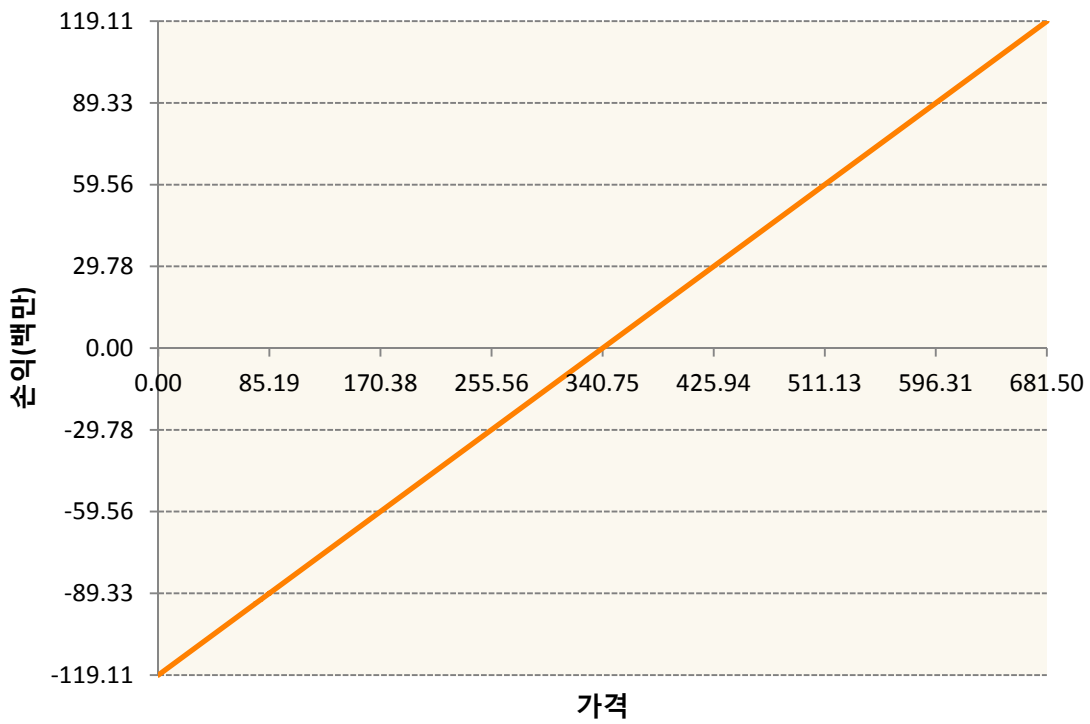




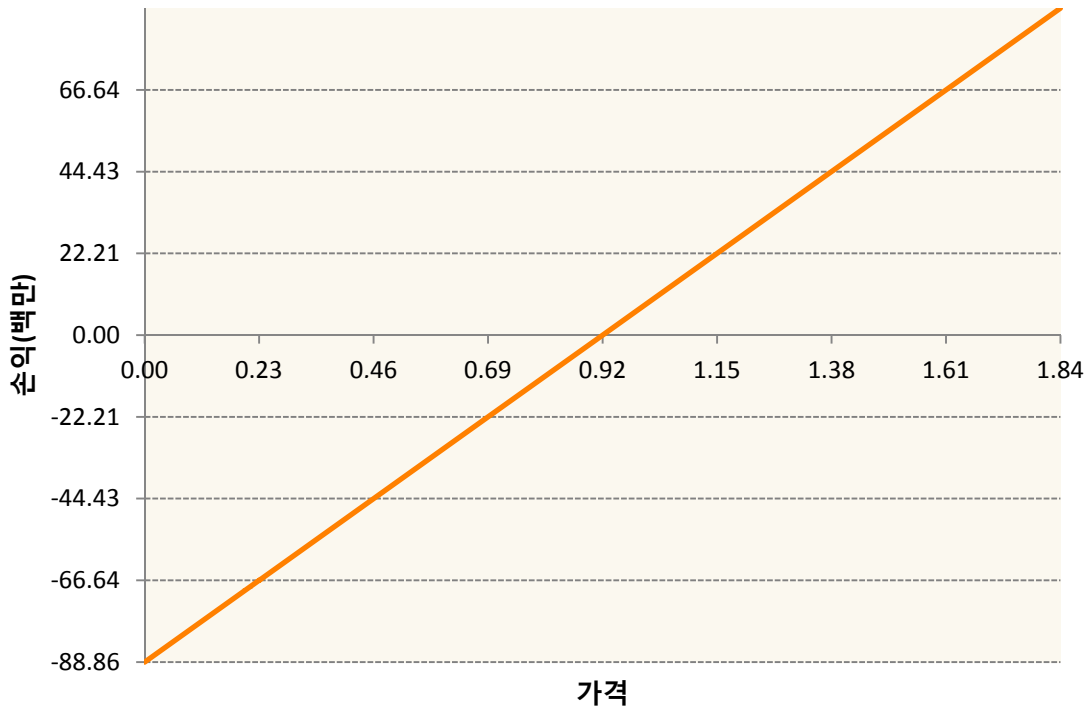
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



QSK0-Low Su Gasoil G Mar20



XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	20
CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	24
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	9
KR4175Q40C	2020-04 달러선물	10
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	50
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	10
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	7

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

(단위:백만원)

298

공시일	2020-03-16
기준일	2020-03-13

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

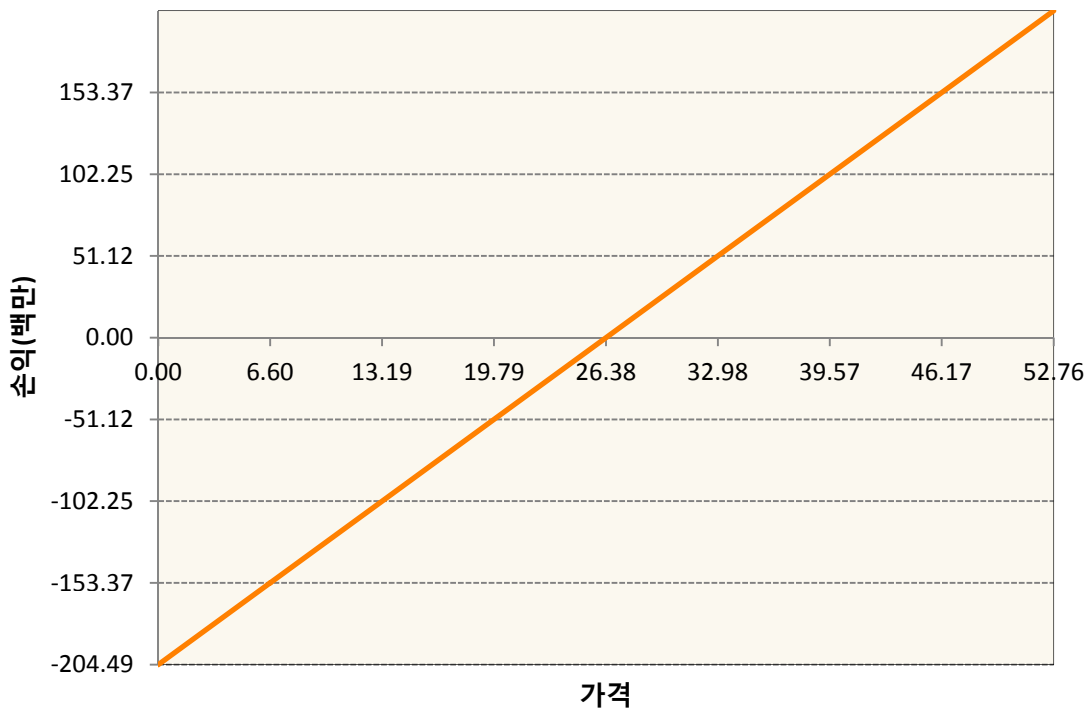
1. 계약금액

(단위:백만원)

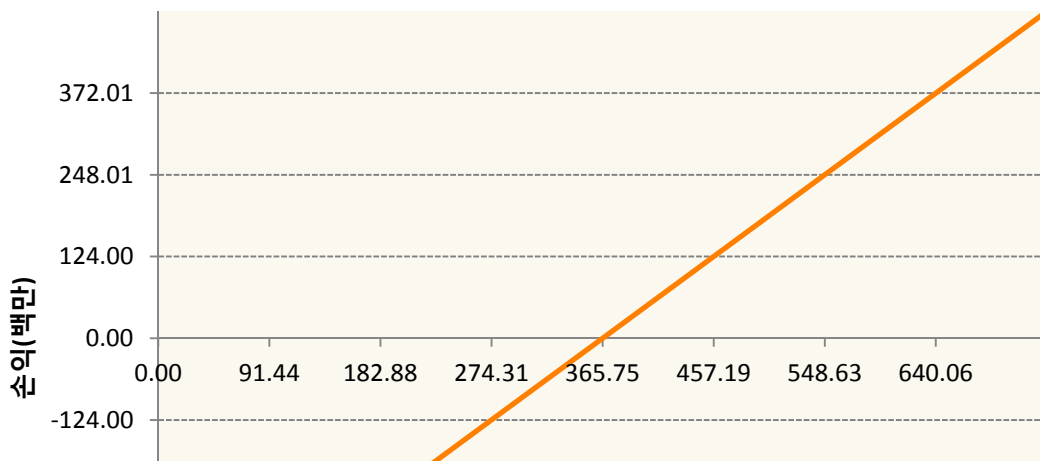
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,450	97	2,353	

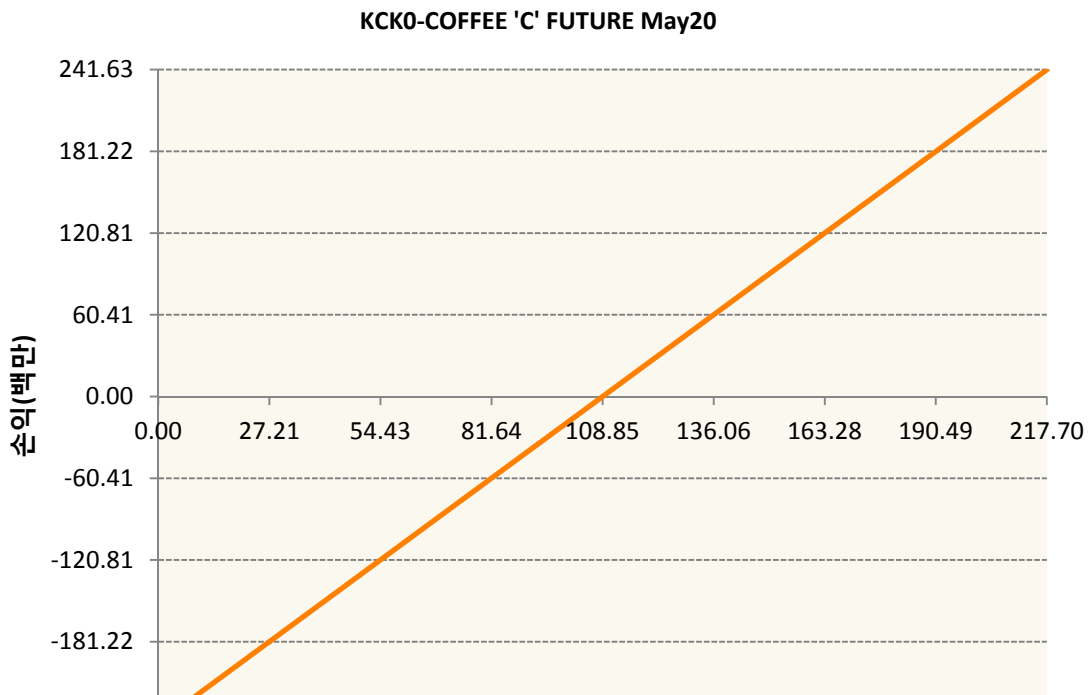
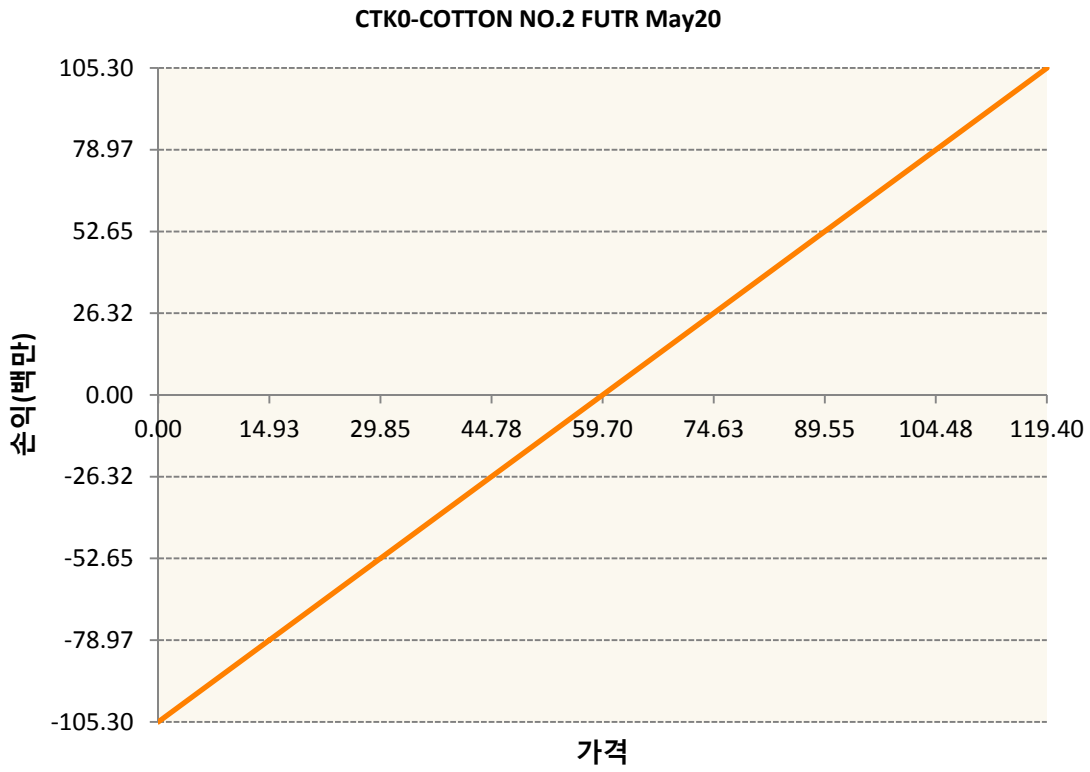
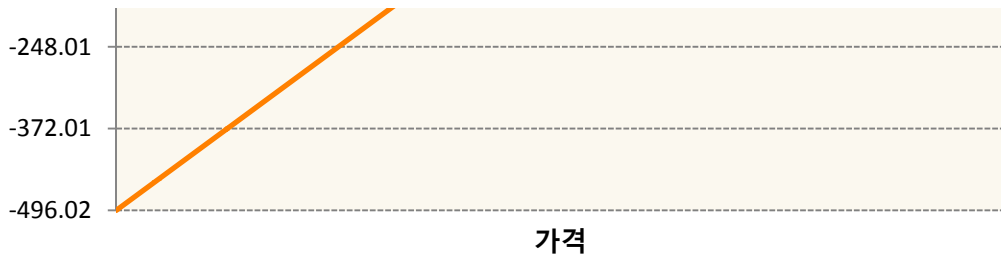
2. 만기시점의 손익구조

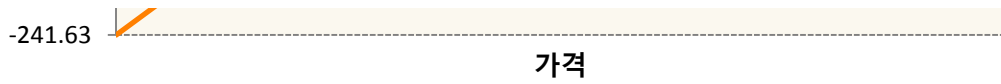
BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20



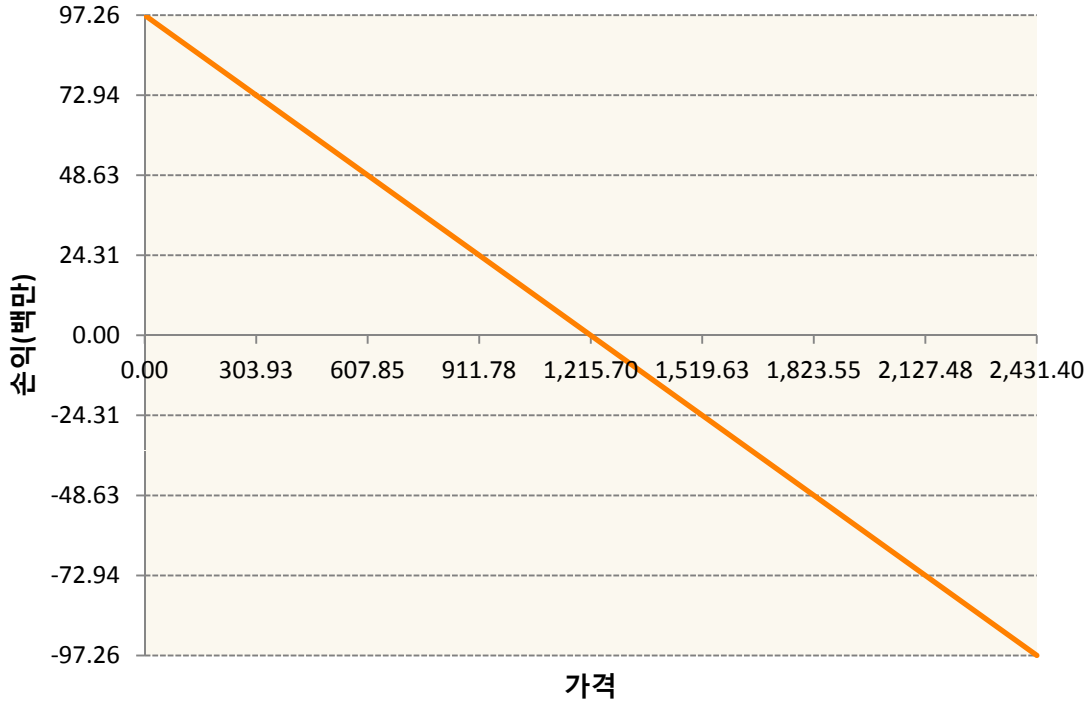
CK0-CORN FUTURE May20



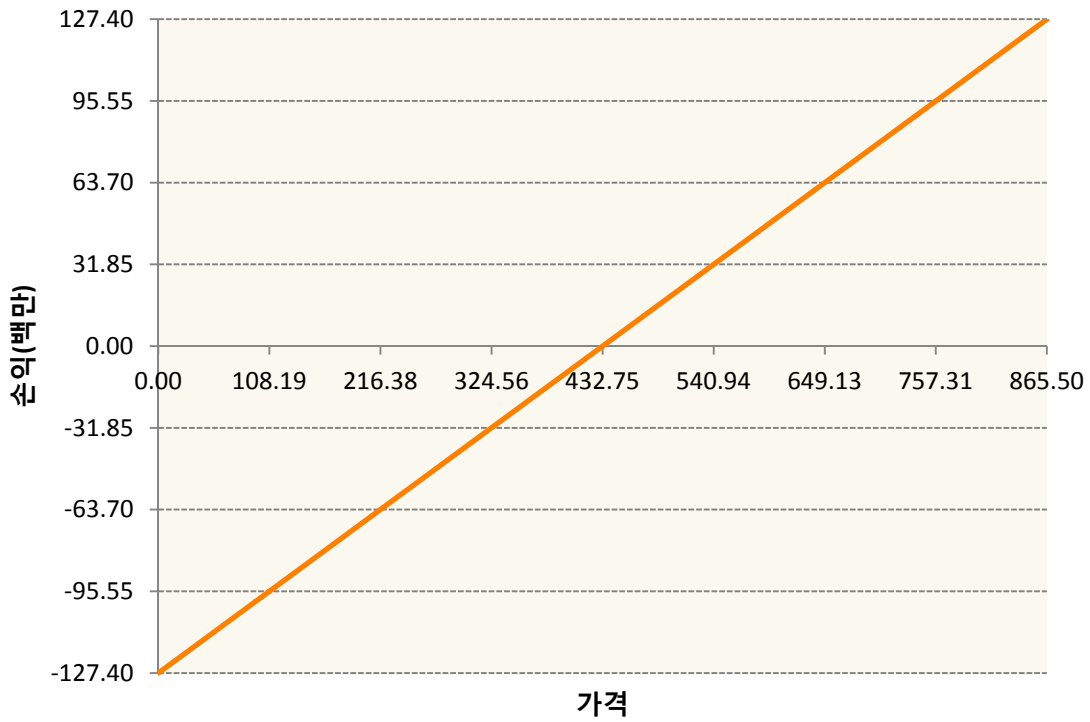




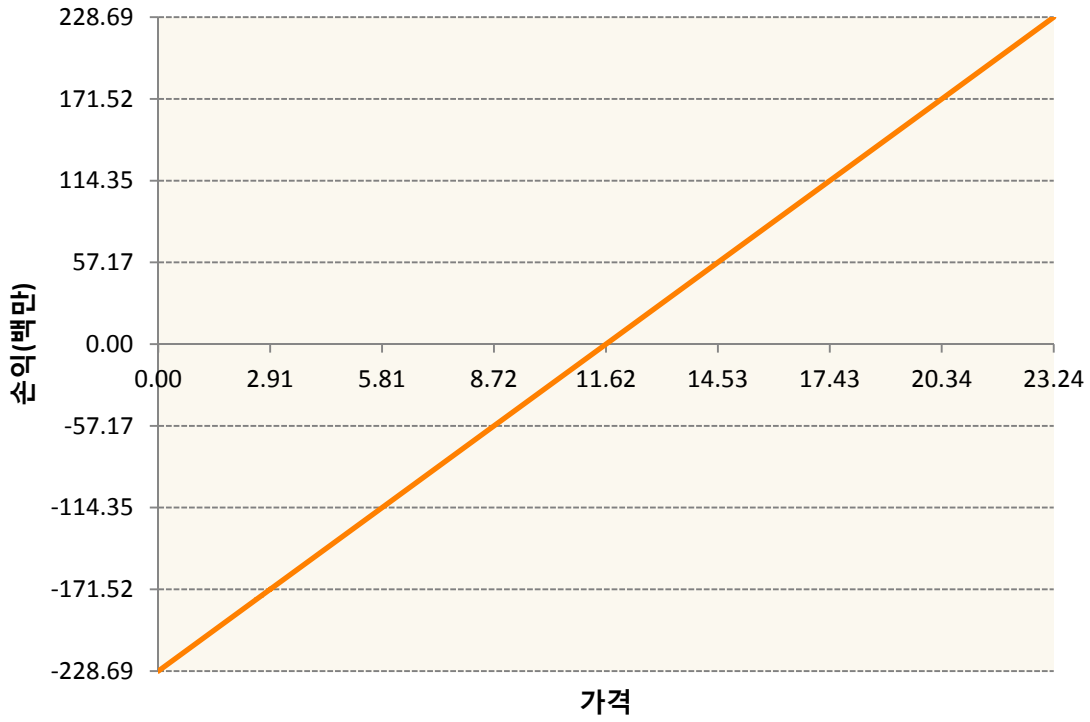
KR4175Q40008-2020-04 달러선물



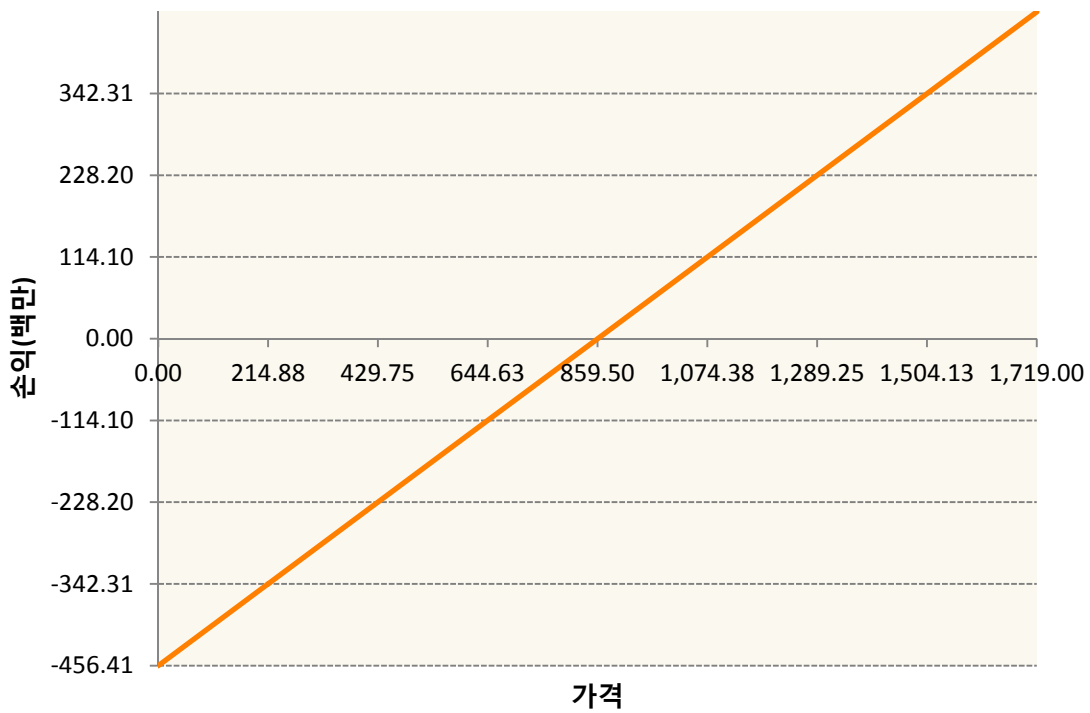
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



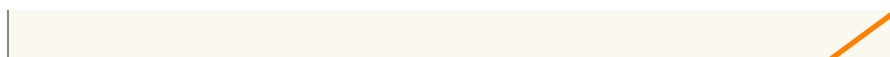
SBK0-Sugar May20

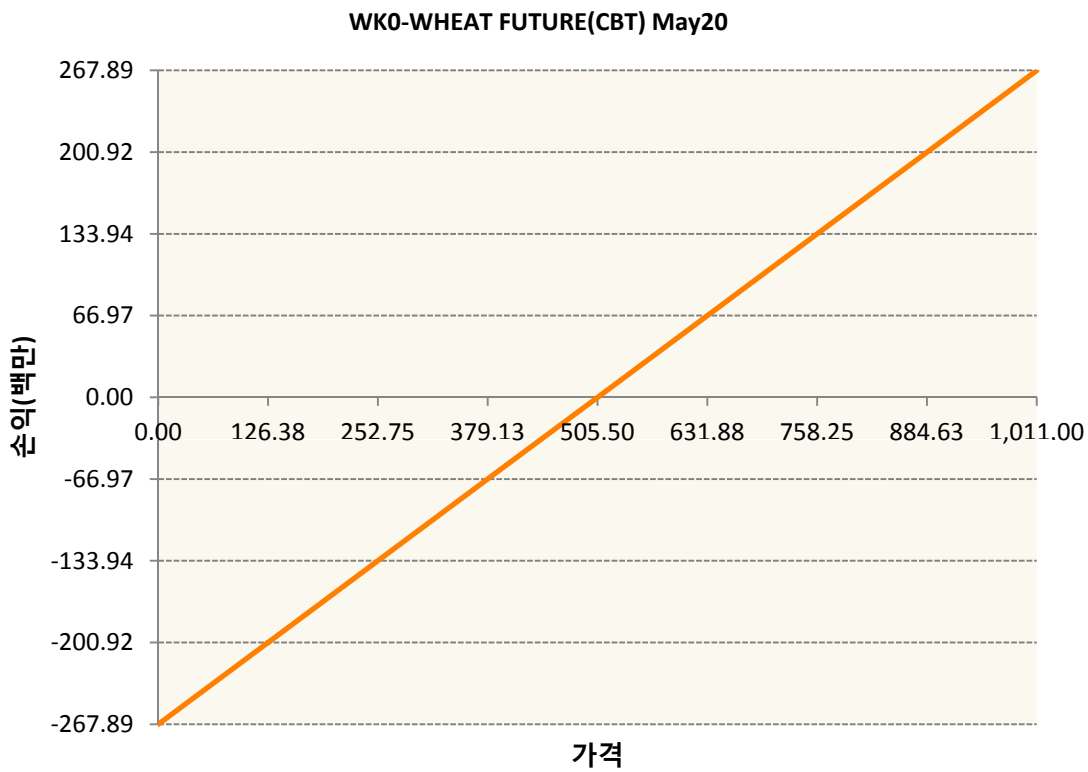
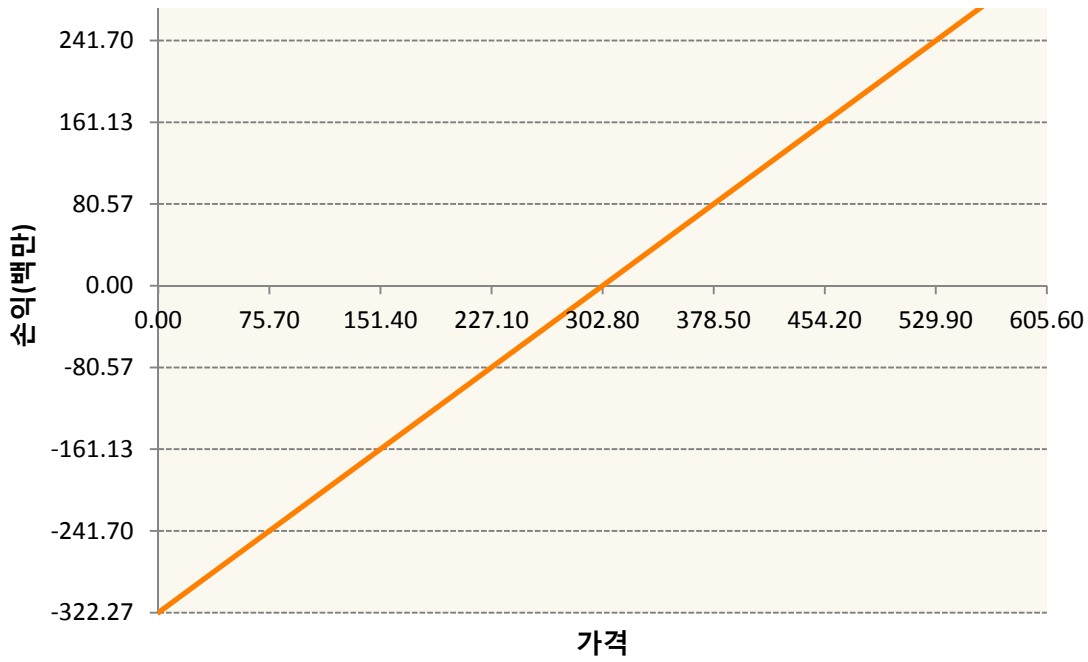


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	16
CK0	CORN FUTURE May20	40
CTK0	COTTON NO.2 FUTR May20	8
KCK0	COFFEE 'C' FUTURE May20	19
KR4175Q40C	2020-04 달러선물	8

KWK0	KC HRW WHEAT FUT May20	10
SBK0	Sugar May20	18
SK0	SOYBEAN FUTURE May20	37
SMK0	SOYBEAN MEAL FUTR May20	26
WK0	WHEAT FUTURE(CBT) May20	21

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

(단위:백만원)

217