

공시일	2020-03-17
기준일	2020-03-16

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	2020-03-17
기준일	2020-03-16

스마트인덱스모

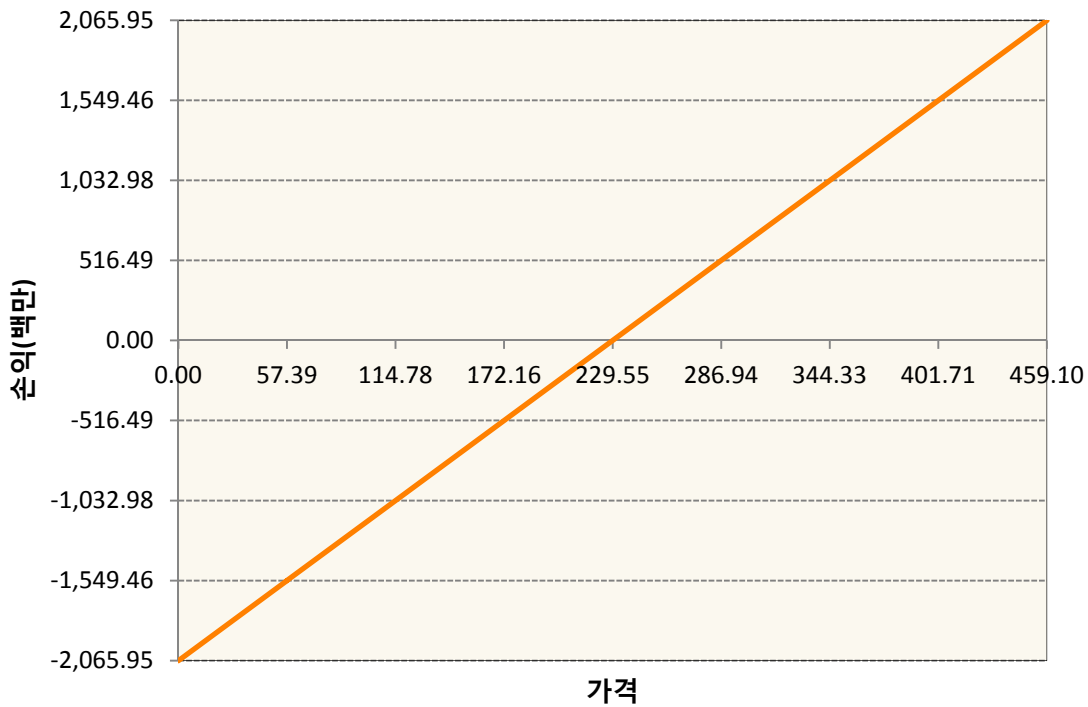
1. 계약금액

(단위:백만원)

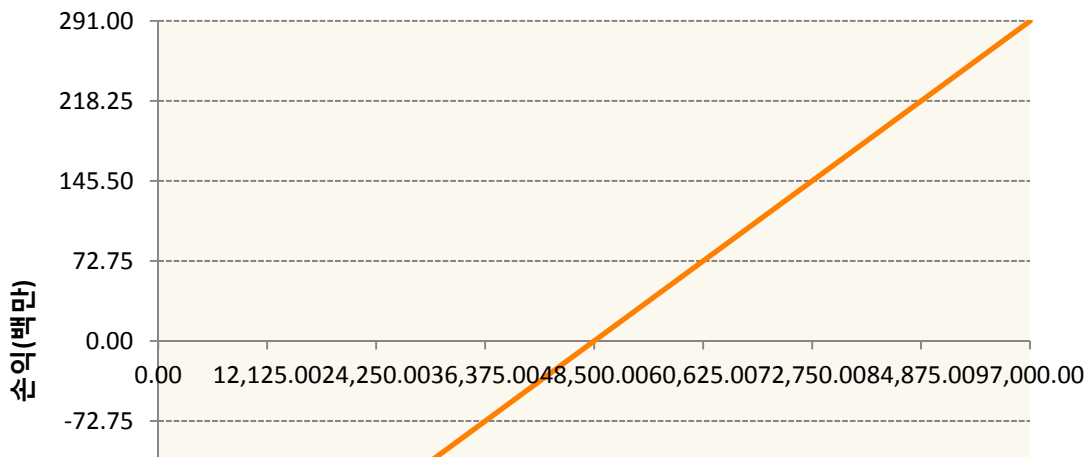
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	350	0	350	장내
누계	유가증권	선물	2,357	0	2,357	장내

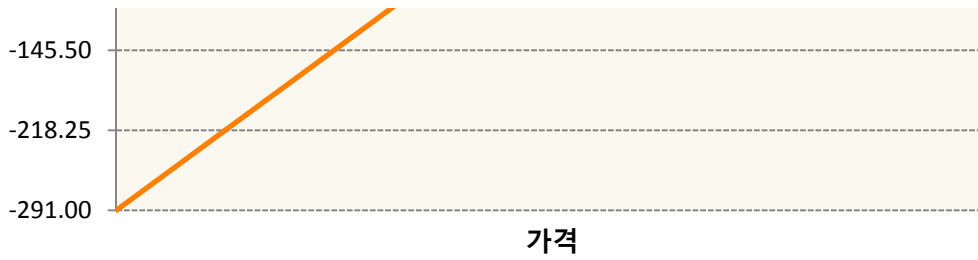
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



KR4111Q40003-2020-04 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						168
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168	
-5.33%	-112	-112	-112	-112	-112	-112	-112	
-2.67%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	56	56	56	56	56	56	56	
5.33%	112	112	112	112	112	112	112	
8.00%	168	168	168	168	168	168	168	
KR4111Q40003		2020-04 삼성전자개별선물						23
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23	
-5.33%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16	
-2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	8	8	8	8	8	8	8	
5.33%	16	16	16	16	16	16	16	
8.00%	23	23	23	23	23	23	23	

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

196

공시일	2020-03-17
기준일	2020-03-16

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

906

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

801

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-17
기준일	2020-03-16

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)

SWCSI500000 신한CSI500미래S200310

547

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

841

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-17
기준일	2020-03-16

유로인덱스모(주식-파생형)

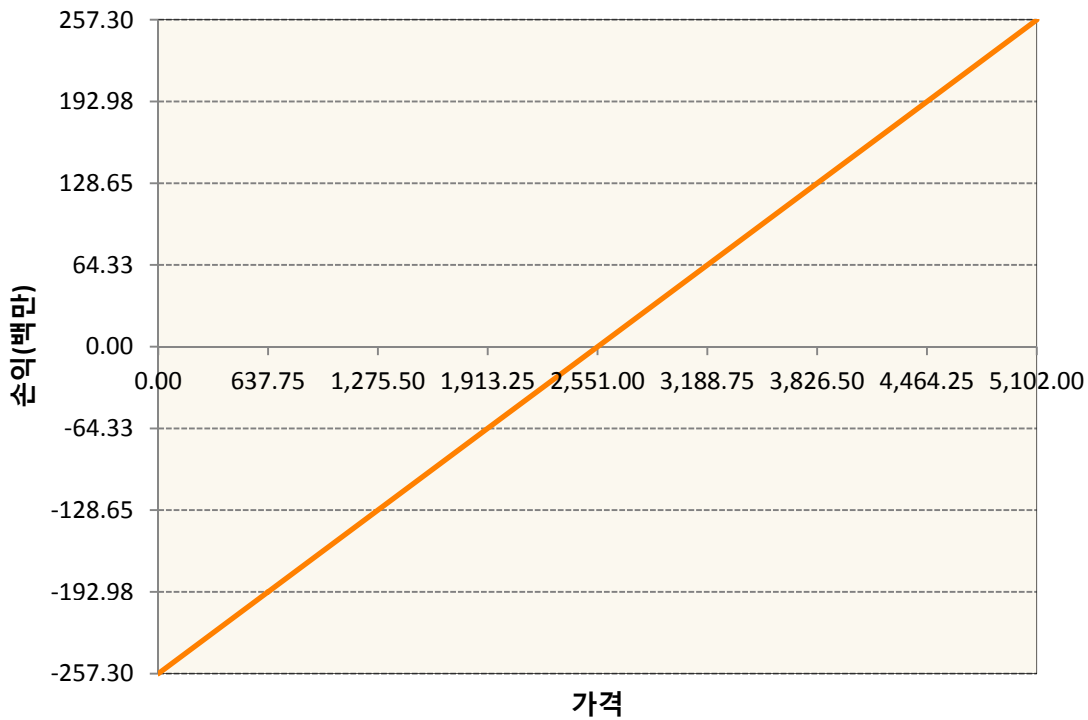
1. 계약금액

(단위:백만원)

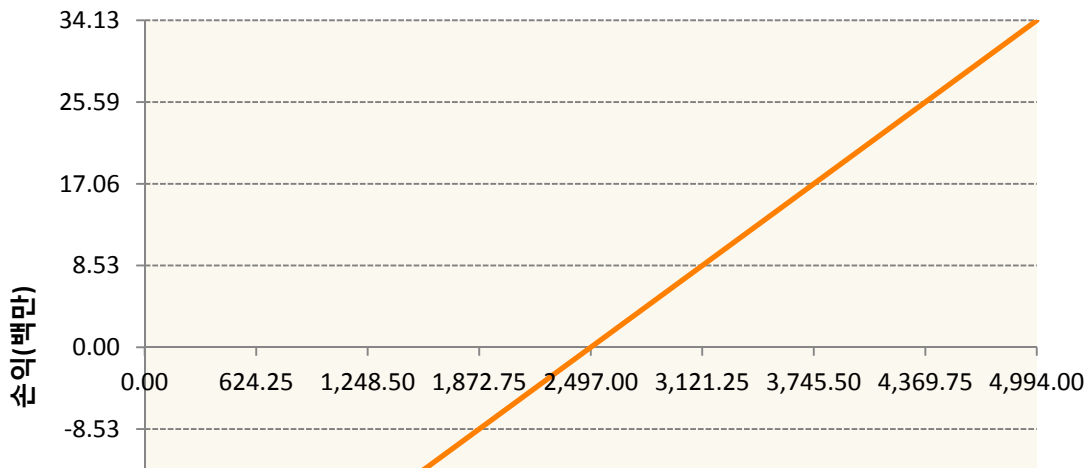
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	291	0	291	

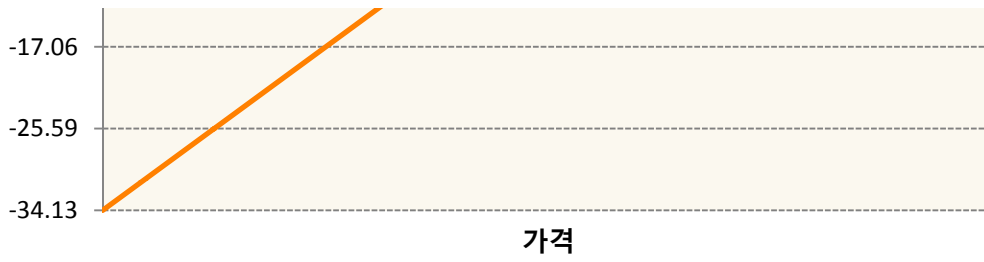
2. 만기시점의 손익구조

VGHO-EURO STOXX 50 Mar20



VGM0-EURO STOXX 50 Jun20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

VGH0	EURO STOXX 50 Mar20	21
VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	3

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

23

공시일	2020-03-17
기준일	2020-03-16

차이나인덱스모(주식-파생형)

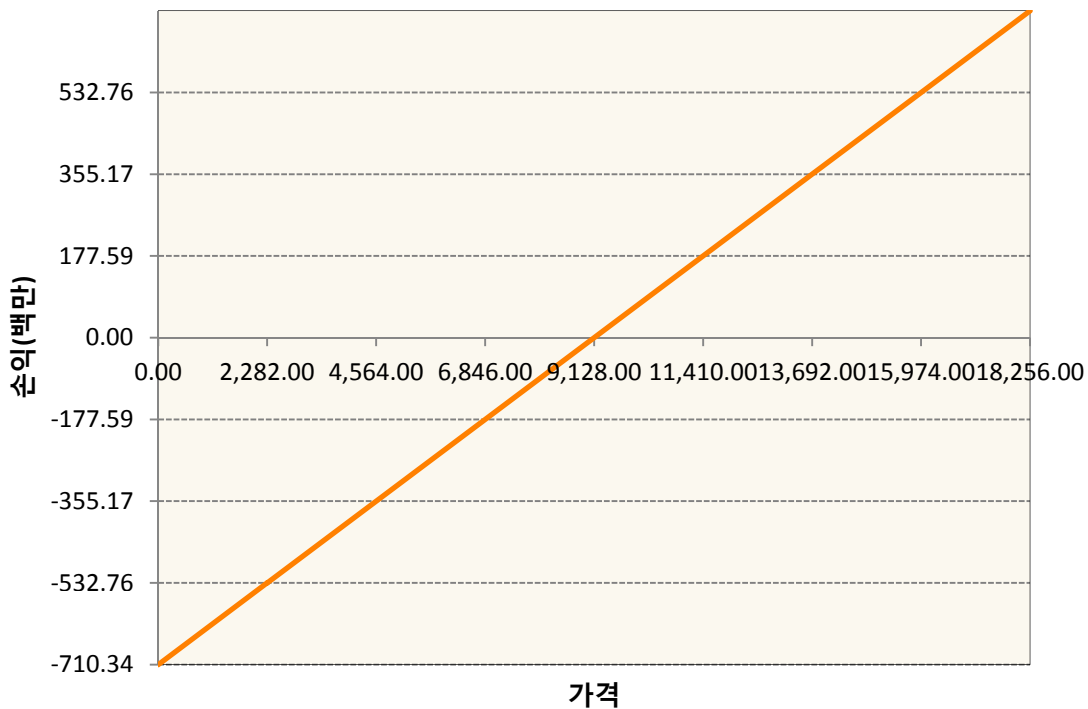
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	710	0	710	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH0	HSCEI Futures Mar20	57
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

54

공시일	2020-03-17
기준일	2020-03-16

커버드콜모(주식혼합-파생형)

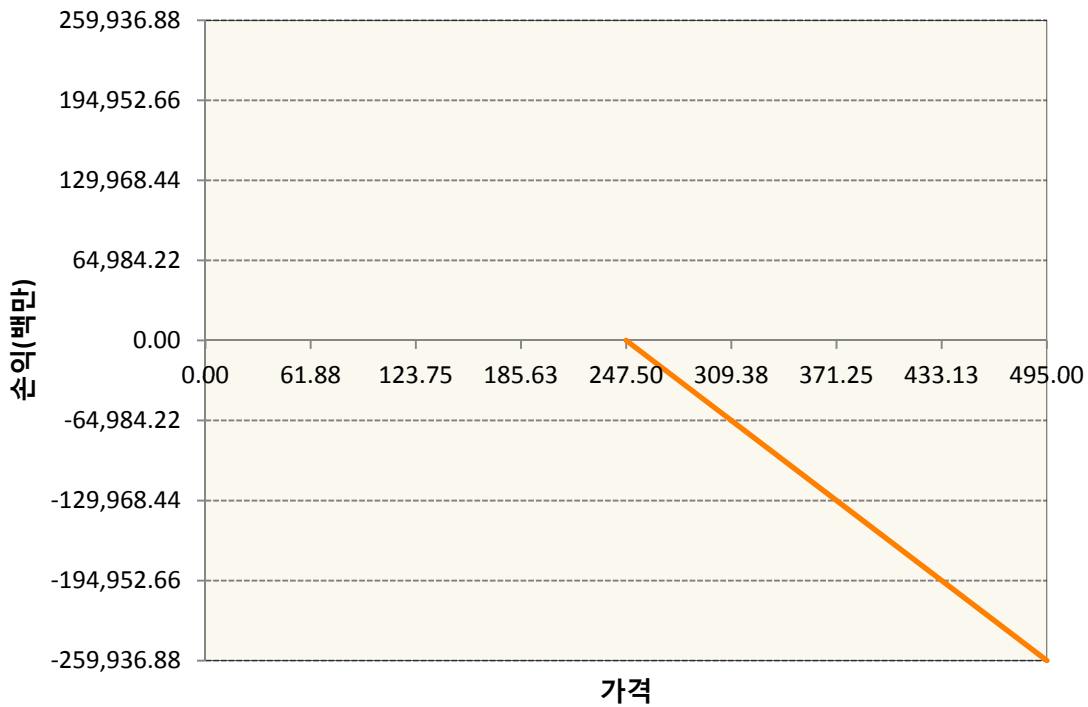
1. 계약금액

(단위:백만원)

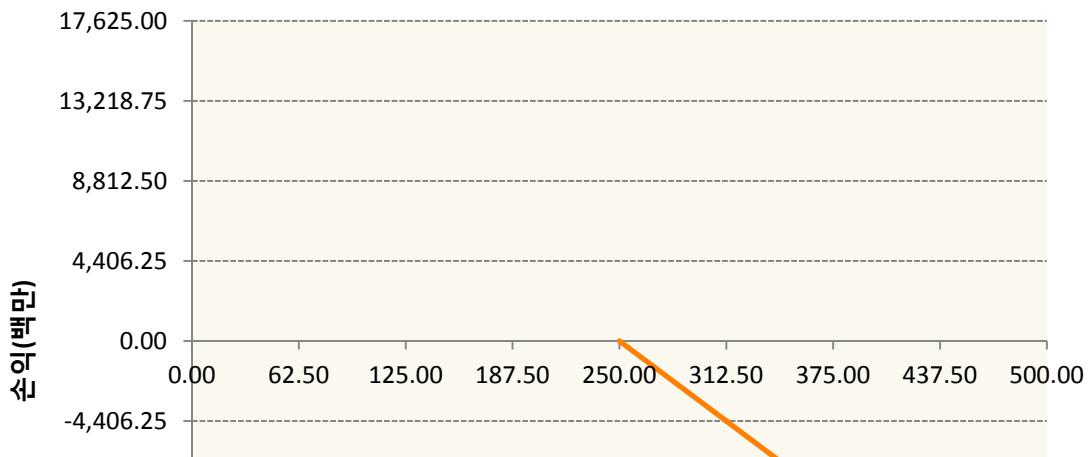
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	3,219	-3,219	장내
누계	유가증권	옵션	0	367,281	-367,281	장내

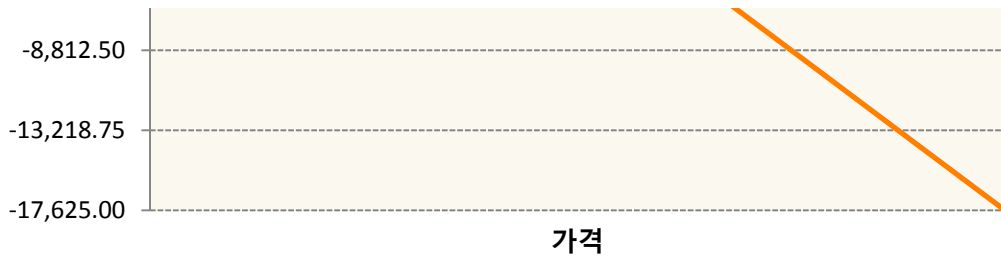
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

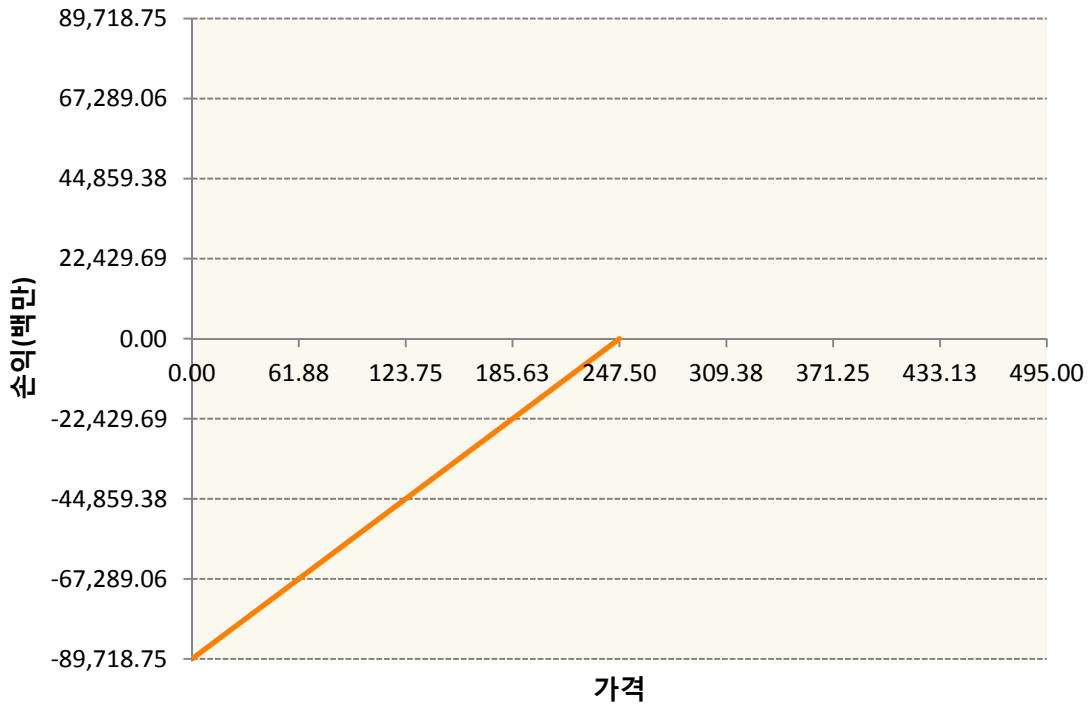


KR4201Q42503-2020-04 콜250





KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q42479		2020-04 콜247.5					13,055
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,265	6,699	6,050	5,332	4,555	3,729	2,861
-5.33%	6,389	5,639	4,821	3,947	3,028	2,072	1,085
-2.67%	5,111	4,179	3,199	2,181	1,133	61	-1,031
0%	3,350	2,258	1,139	0	-1,155	-2,323	-3,500
2.67%	1,045	-167	-1,389	-2,617	-3,851	-5,088	-6,329
5.33%	-1,839	-3,119	-4,399	-5,678	-6,958	-8,237	-9,516
8.00%	-5,307	-6,596	-7,887	-9,178	-10,470	-11,762	-13,055
KR4201Q42503		2020-04 콜250					844
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	449	415	375	330	280	227	172

-5.33%	398	352	300	245	186	124	60
-2.67%	323	264	201	136	68	-2	-74
0%	217	147	74	0	-76	-153	-231
2.67%	77	-3	-83	-164	-246	-329	-411
5.33%	-102	-187	-273	-358	-444	-530	-616
8.00%	-319	-406	-494	-582	-669	-757	-844
KR4301Q42477 2020-04 풋247.5							5,749
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,889	-4,141	-4,422	-4,728	-5,052	-5,394	-5,749
-5.33%	-2,009	-2,326	-2,666	-3,024	-3,397	-3,782	-4,177
-2.67%	-266	-645	-1,039	-1,446	-1,861	-2,285	-2,714
0%	1,317	886	446	0	-451	-906	-1,363
2.67%	2,727	2,256	1,783	1,308	832	354	-125
5.33%	3,955	3,463	2,970	2,478	1,986	1,494	1,002
8.00%	5,003	4,506	4,009	3,512	3,015	2,518	2,021

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

(단위:백만원)

14,538

공시일	2020-03-17
기준일	2020-03-16

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

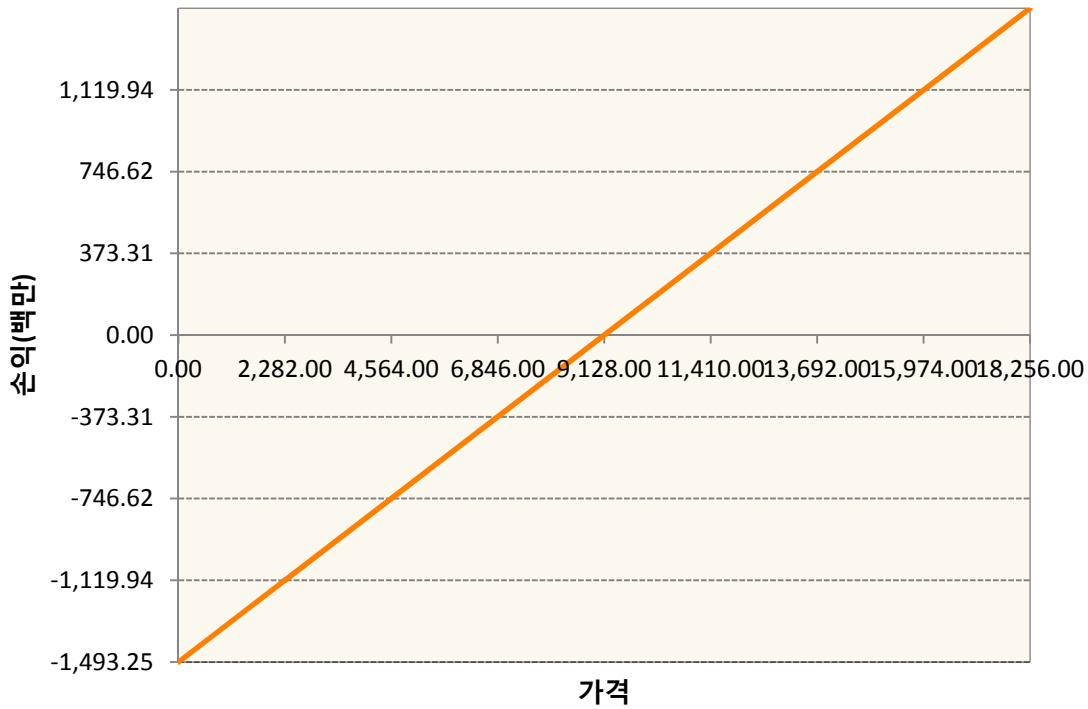
1. 계약금액

(단위:백만원)

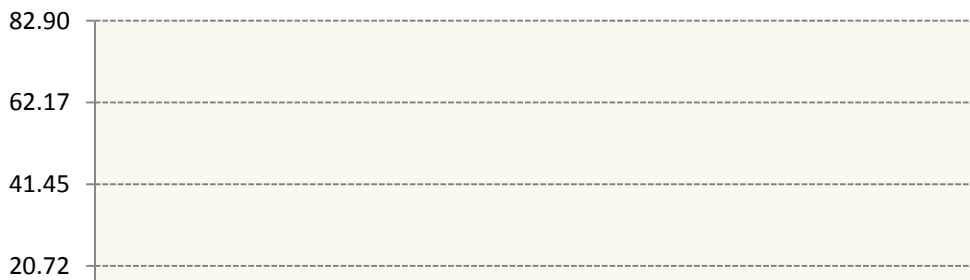
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,493	0	1,493	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,852	-4,852	장내
누계	통화	선도	695	2,223	-1,528	장외

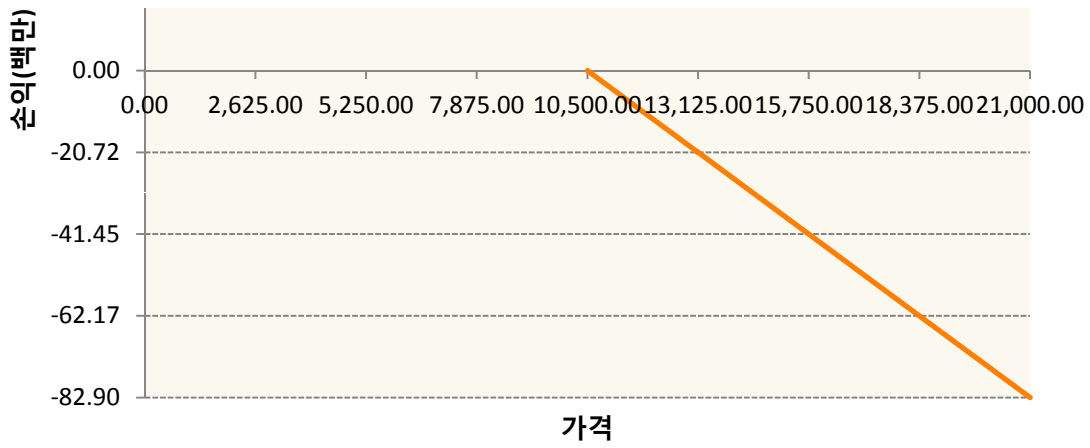
2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20

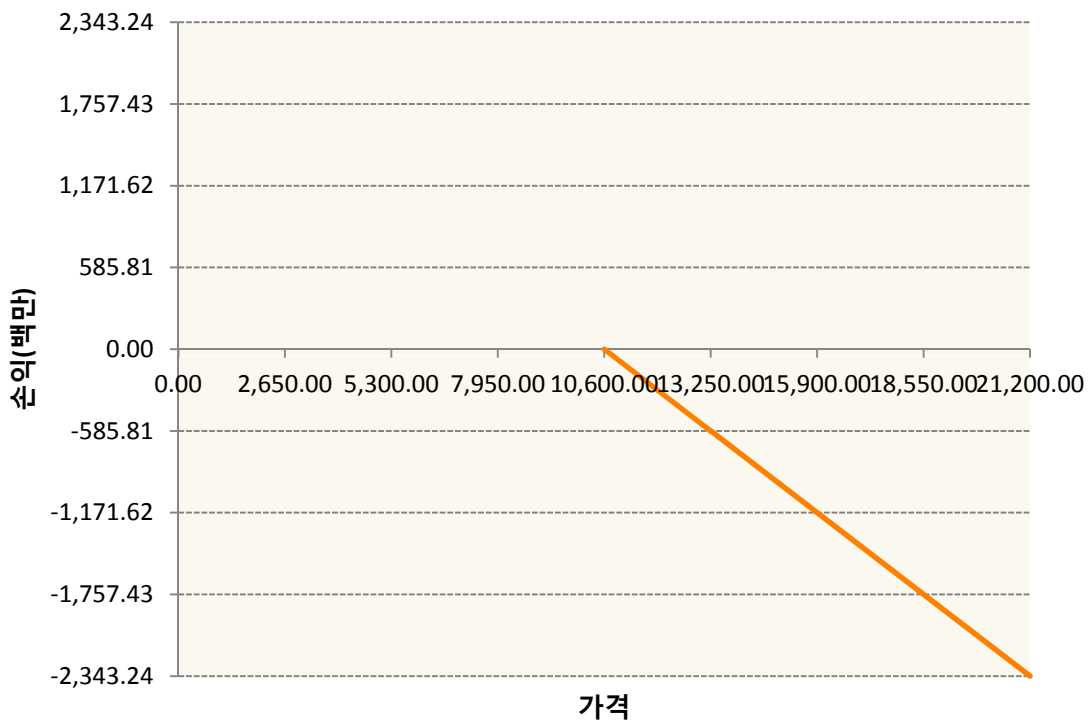


OHHIH0-C105-HSCEI

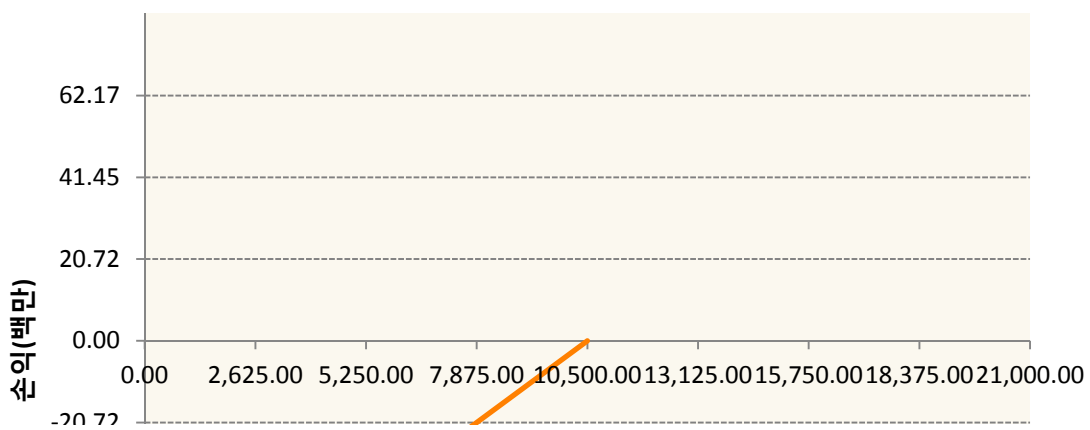


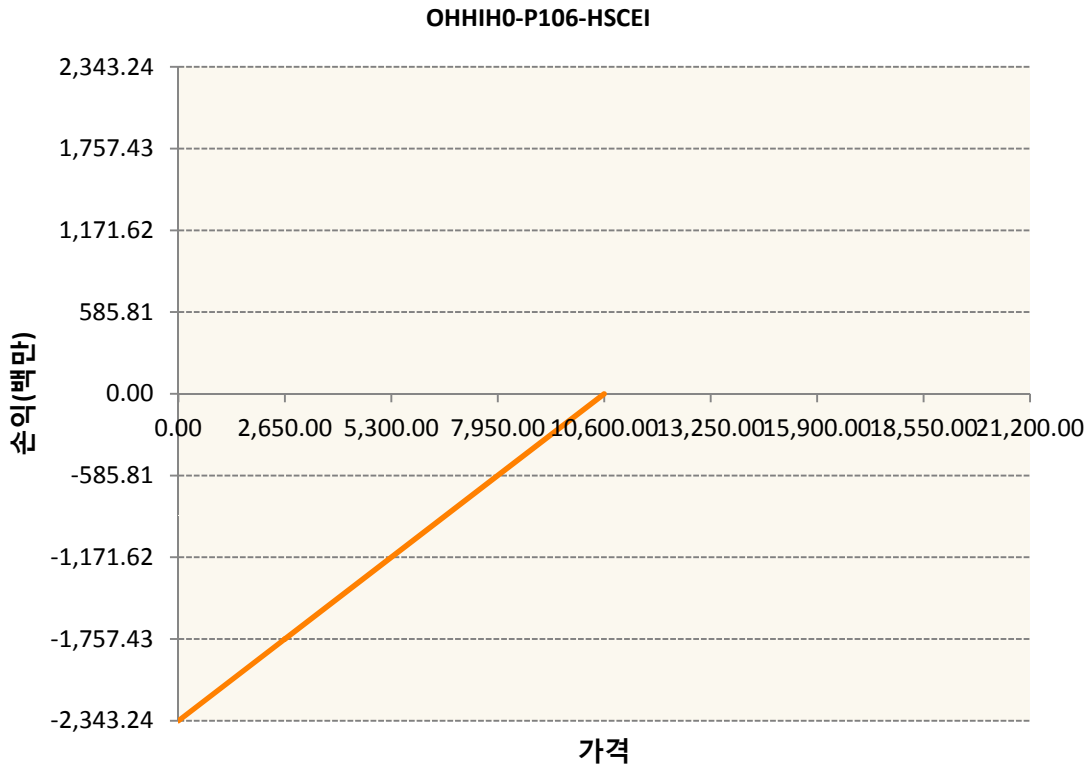


OHHIH0-C106-HSCEI



OHHIH0-P105-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E		178
FX21020H05 HKD/KRW 22-05-20E		56
HCH0 HSCEI Futures Mar20		119
OHHIH0-C1(HSCEI		7
OHHIH0-C1(HSCEI		187
OHHIH0-P1(HSCEI		7
OHHIH0-P1(HSCEI		187

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	566

공시일	2020-03-17
기준일	2020-03-16

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

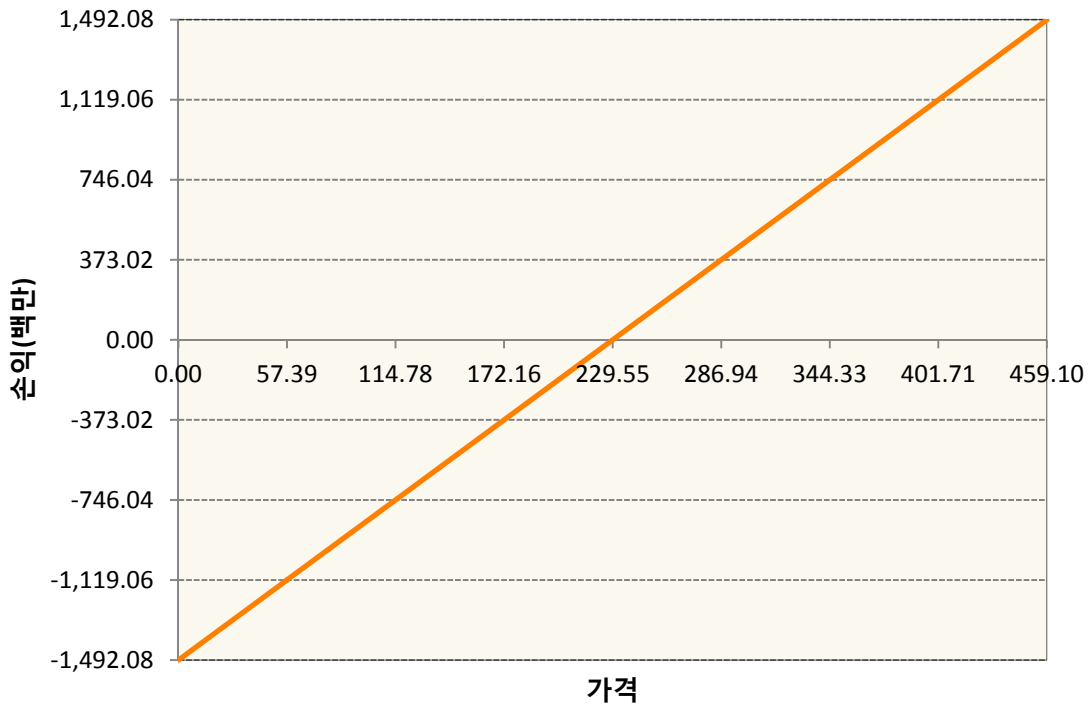
1. 계약금액

(단위:백만원)

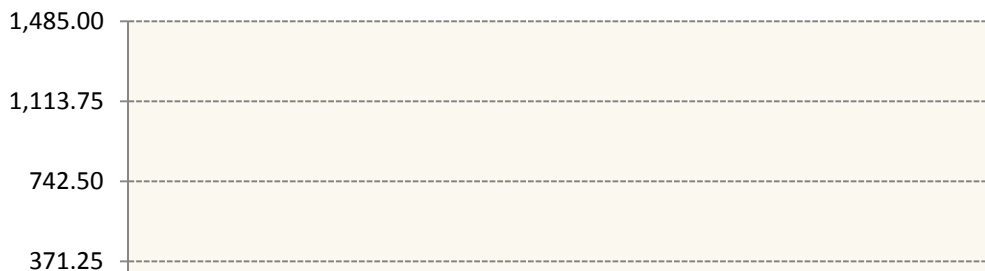
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	134	-134	장내
누계	유가증권	선물	1,492	0	1,492	장내
누계	유가증권	스왑	3,125	0	3,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,095	-3,095	장내

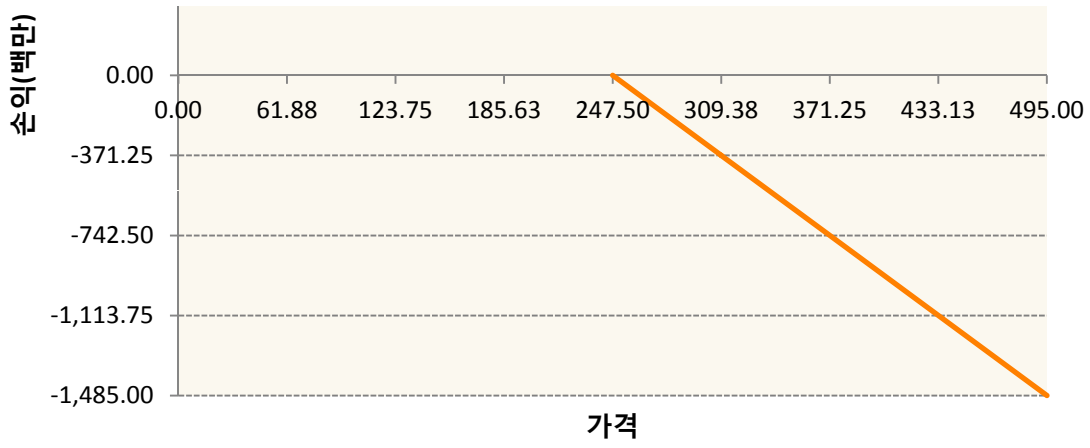
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

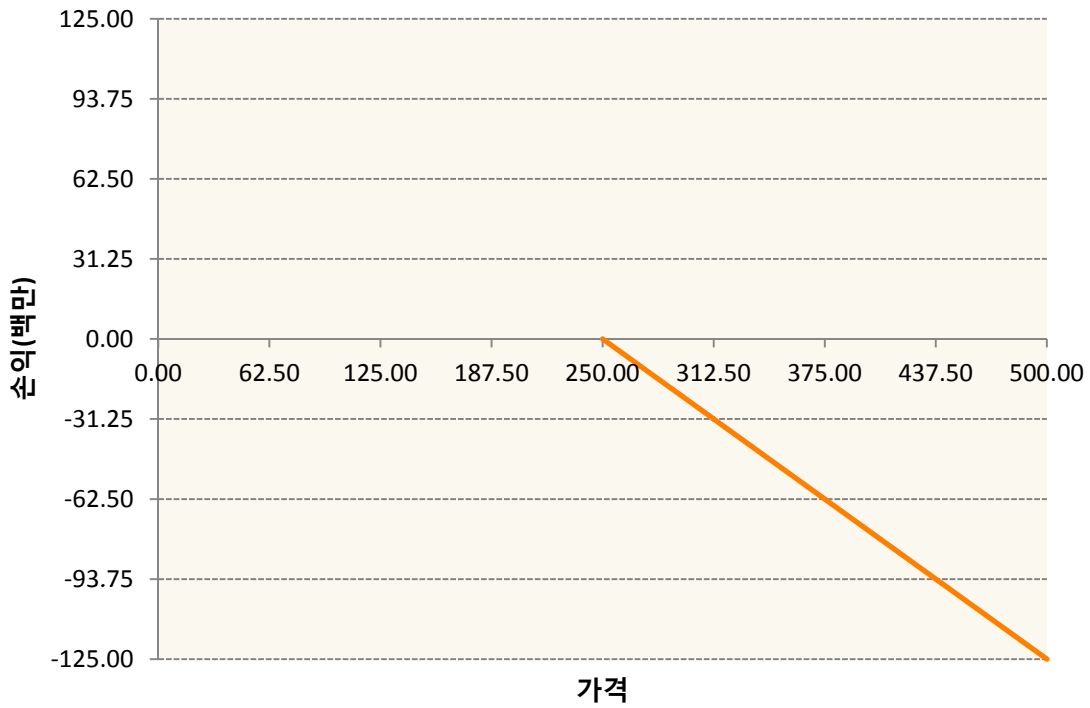


KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

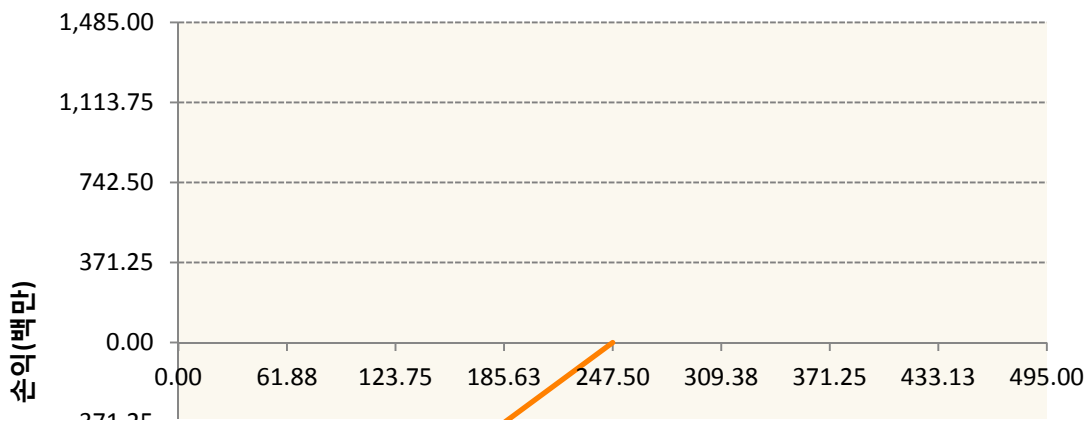




KR4201Q42503-2020-04 콜250



KR4301Q42477-2020-04 풋247.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						271
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-271	-271	-271	-271	-271	-271	-271	
-5.33%	-181	-181	-181	-181	-181	-181	-181	
-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%	181	181	181	181	181	181	181	
8.00%	271	271	271	271	271	271	271	
KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						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	-40	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	40	40	40	40	40	40	40	
5.33%	81	81	81	81	81	81	81	
8.00%	121	121	121	121	121	121	121	
KR4201Q42479		2020-04 콜247.5						75
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	42	38	35	30	26	21	16	
-5.33%	37	32	28	23	17	12	6	
-2.67%	29	24	18	12	6	0	-6	
0%	19	13	7	0	-7	-13	-20	
2.67%	6	-1	-8	-15	-22	-29	-36	
5.33%	-11	-18	-25	-32	-40	-47	-54	
8.00%	-30	-38	-45	-52	-60	-67	-75	
KR4201Q42503		2020-04 콜250						6
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	3	3	3	2	2	2	1
-5.33%	3	2	2	2	1	1	0
-2.67%	2	2	1	1	0	0	-1
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	1	0	-1	-1	-2	-2	-3
5.33%	-1	-1	-2	-3	-3	-4	-4
8.00%	-2	-3	-4	-4	-5	-5	-6
KR4301Q42477 2020-04 풋247.5							95
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-64	-69	-73	-78	-84	-89	-95
-5.33%	-33	-38	-44	-50	-56	-63	-69
-2.67%	-4	-11	-17	-24	-31	-38	-45
0%	22	15	7	0	-7	-15	-23
2.67%	45	37	30	22	14	6	-2
5.33%	65	57	49	41	33	25	17
8.00%	83	75	66	58	50	42	33

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

(단위:백만원)

528

공시일	2020-03-17
기준일	2020-03-16

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

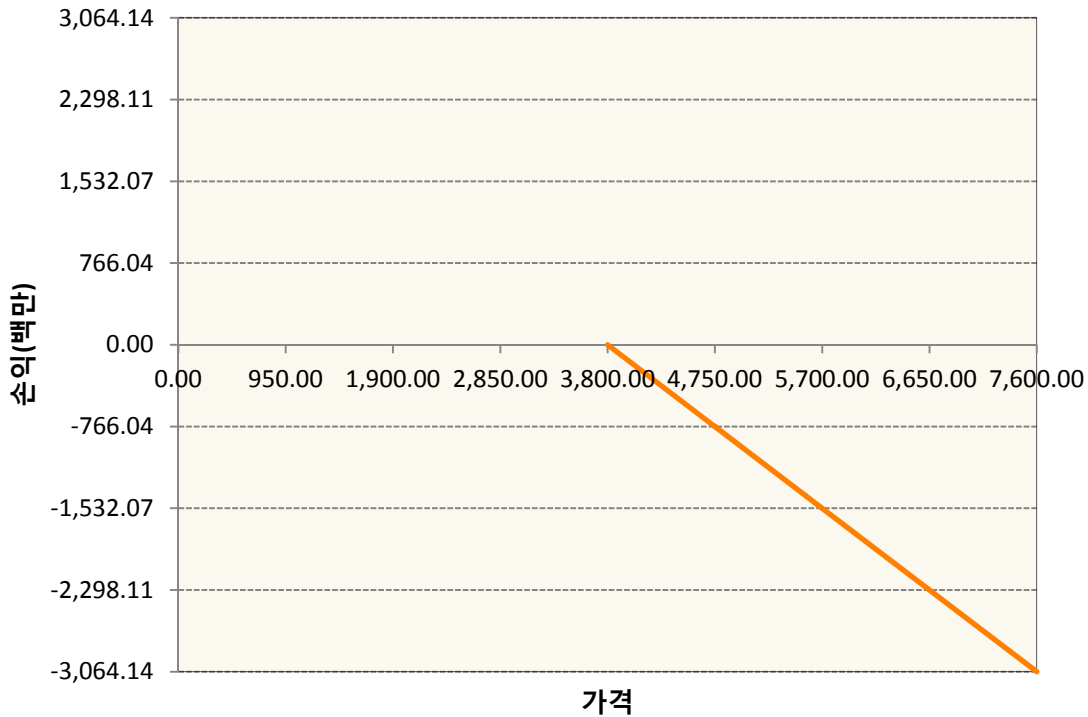
1. 계약금액

(단위:백만원)

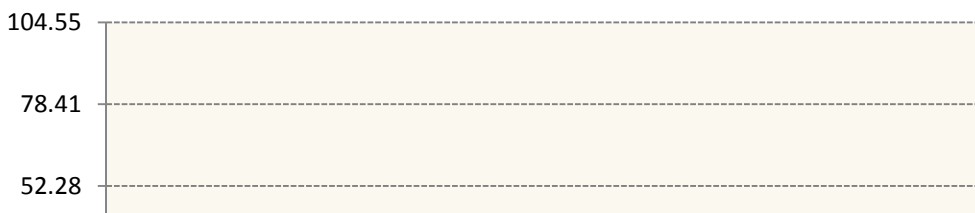
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	1	-1	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	410	0	410	
누계	유가증권	스왑	7,763	0	7,763	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,337	-6,337	장내
누계	통화	선도	547	3,586	-3,040	장외

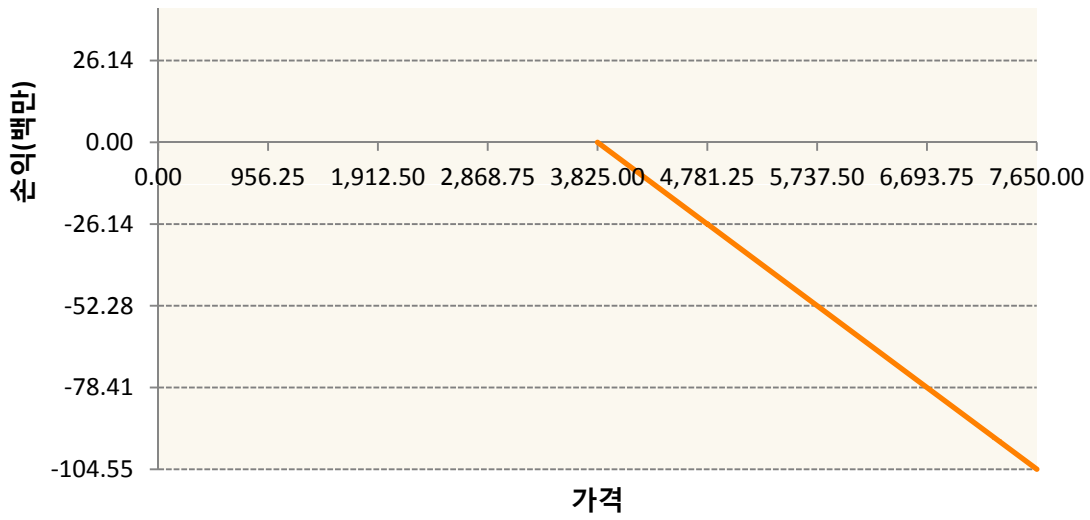
2. 만기시점의 손익구조

OESXH0-C3800-EURO STOXX 50

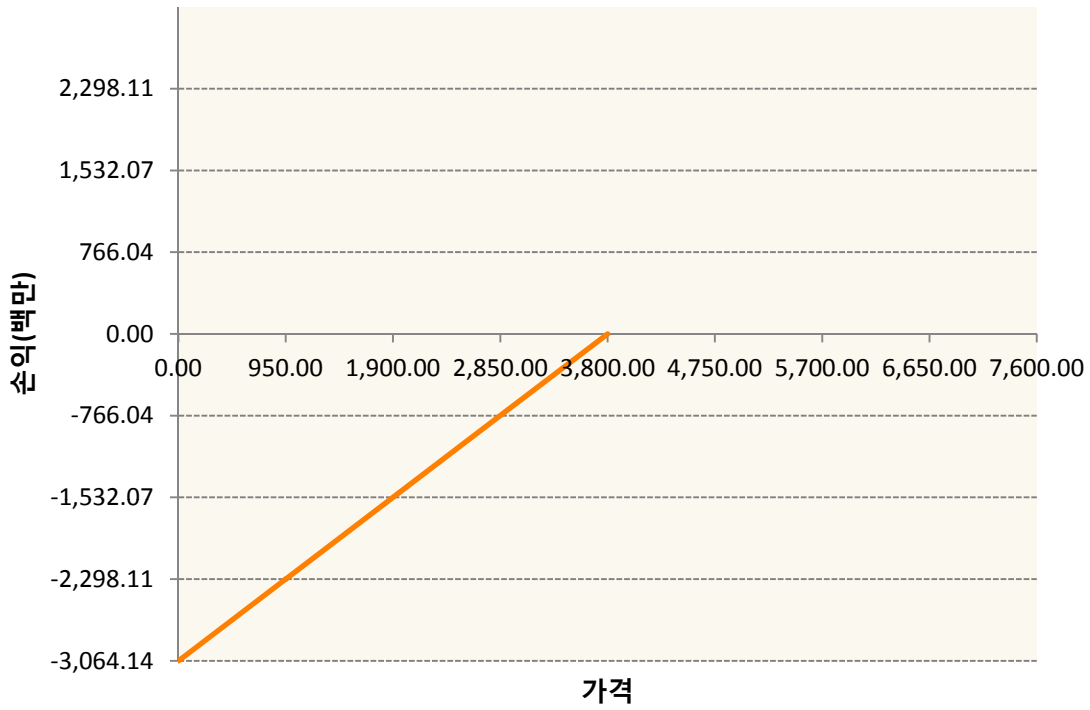


OESXH0-C3825-EURO STOXX 50

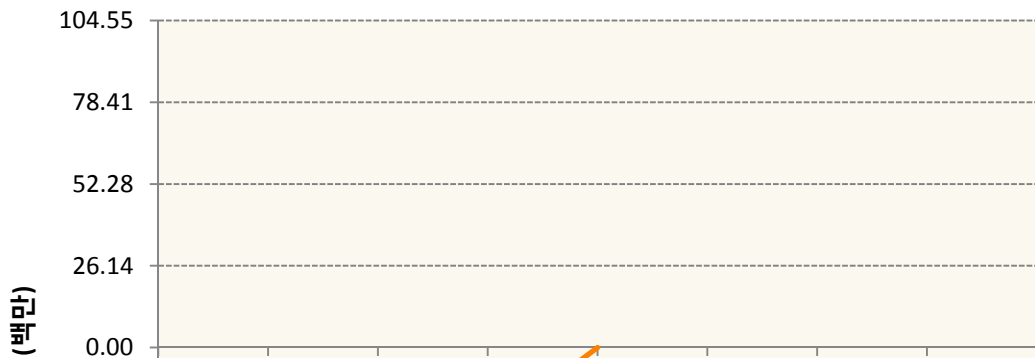


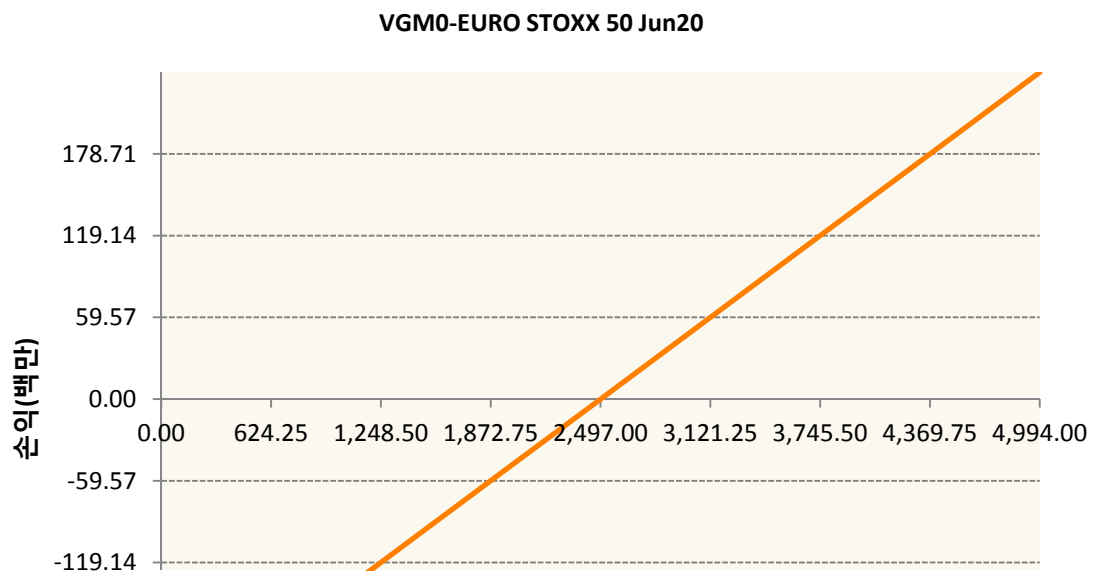
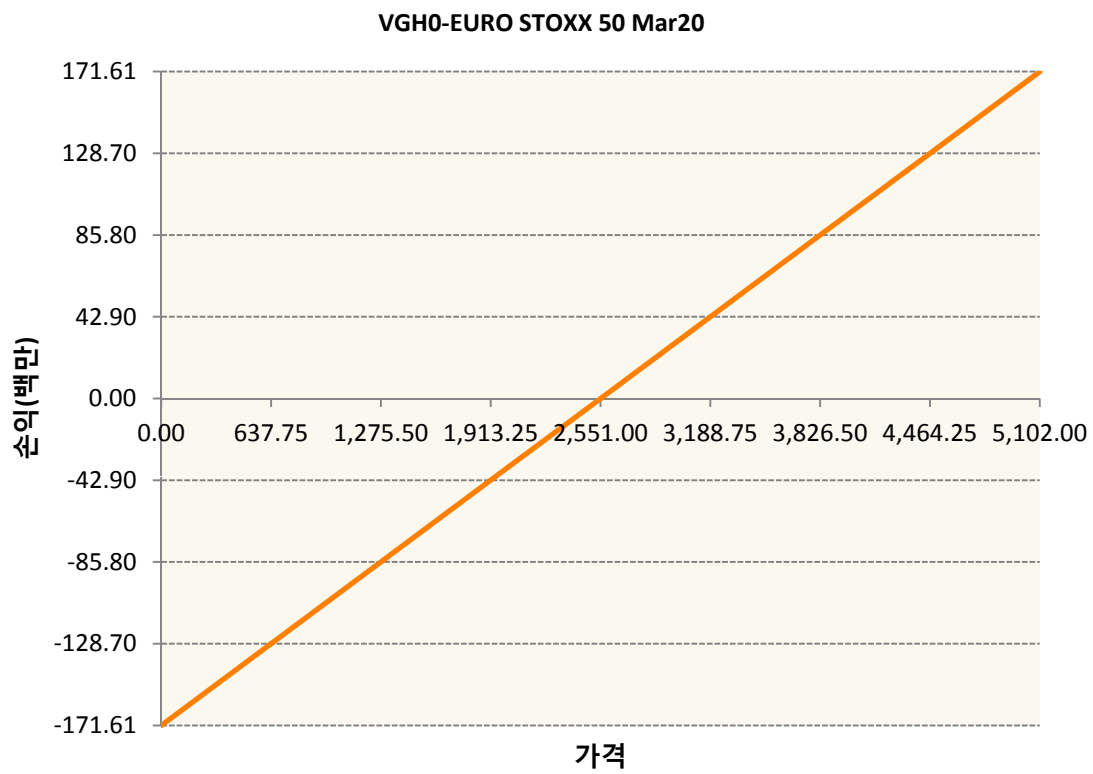
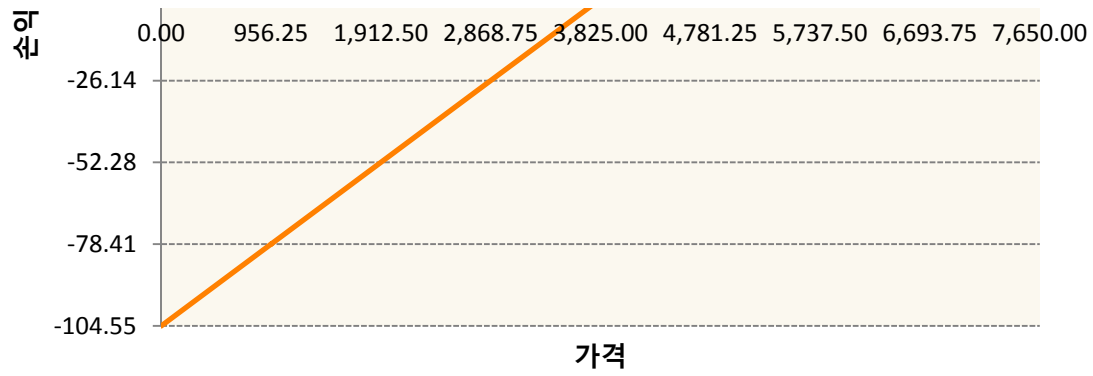


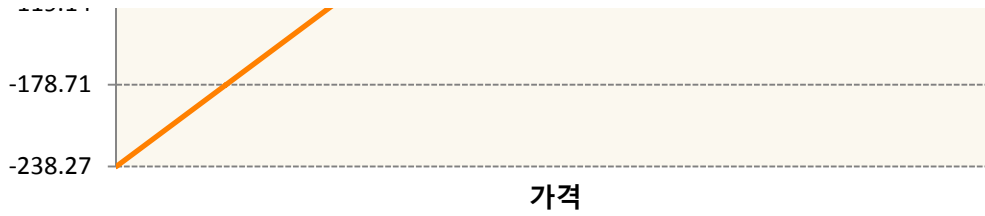
OESXH0-P3800-EURO STOXX 50



OESXH0-P3825-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	0
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	287
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)

690

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

(단위:백만원)

869

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

(단위:백만원)

79

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

(단위:백만원)

117

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

(단위:백만원)

42

공시일	2020-03-17
기준일	2020-03-16

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

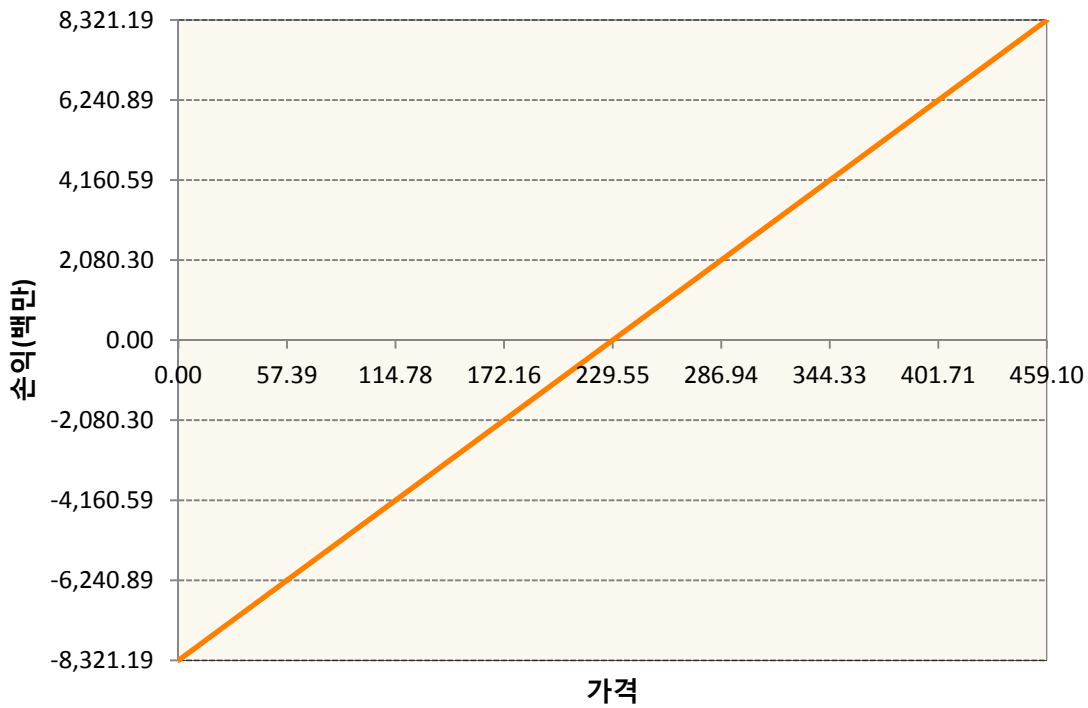
1. 계약금액

(단위:백만원)

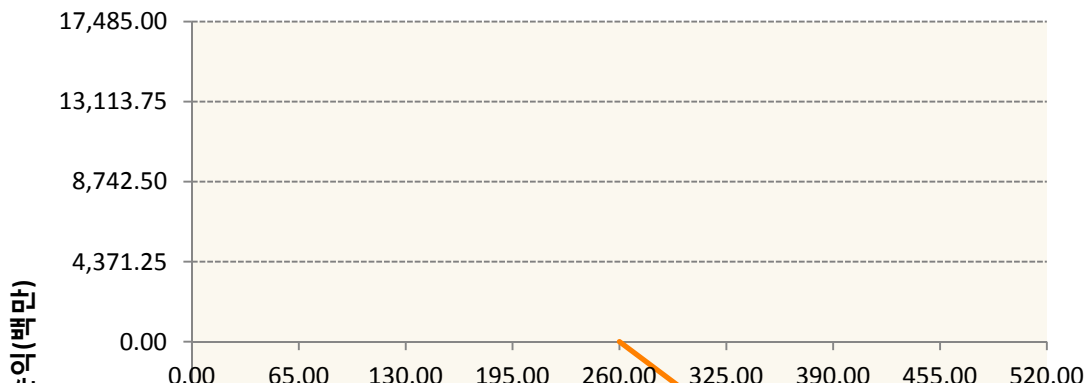
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,321	0	8,321	장내
누계	유가증권	옵션	6,004	17,485	-11,481	장내

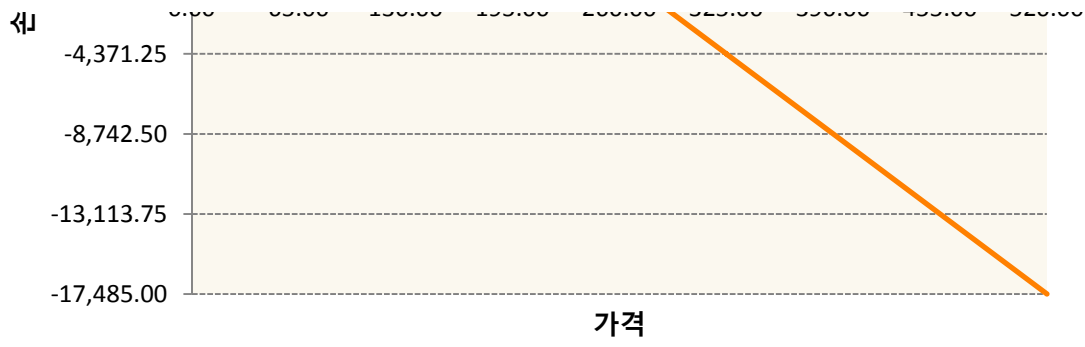
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

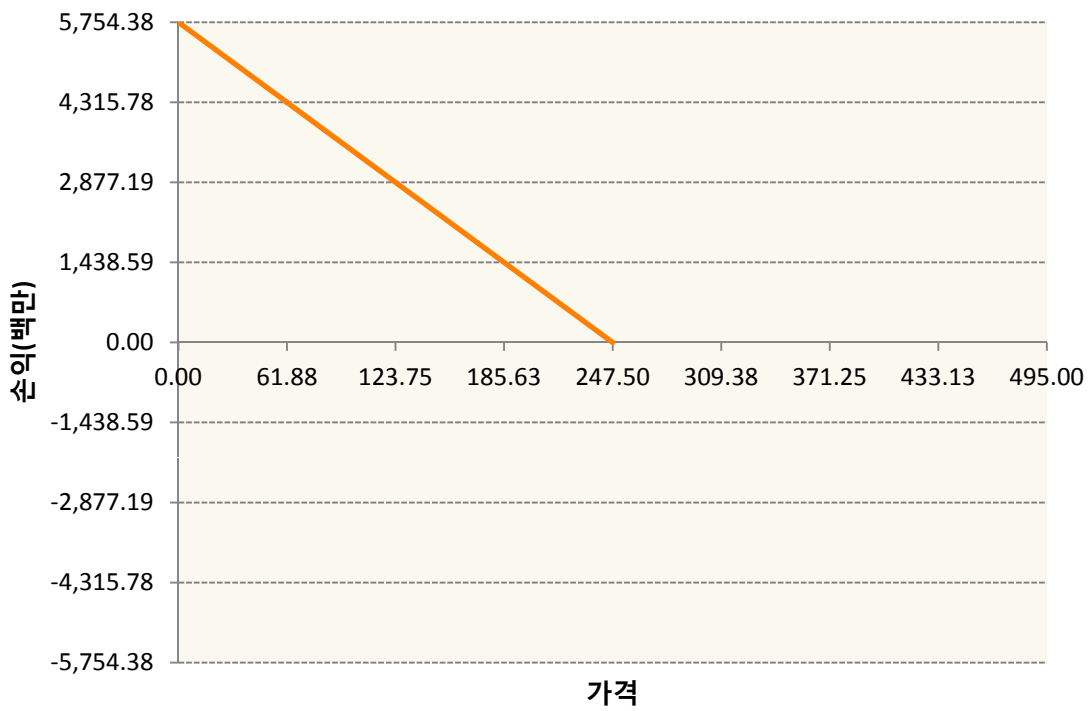


KR4201Q42602-2020-04 콜260

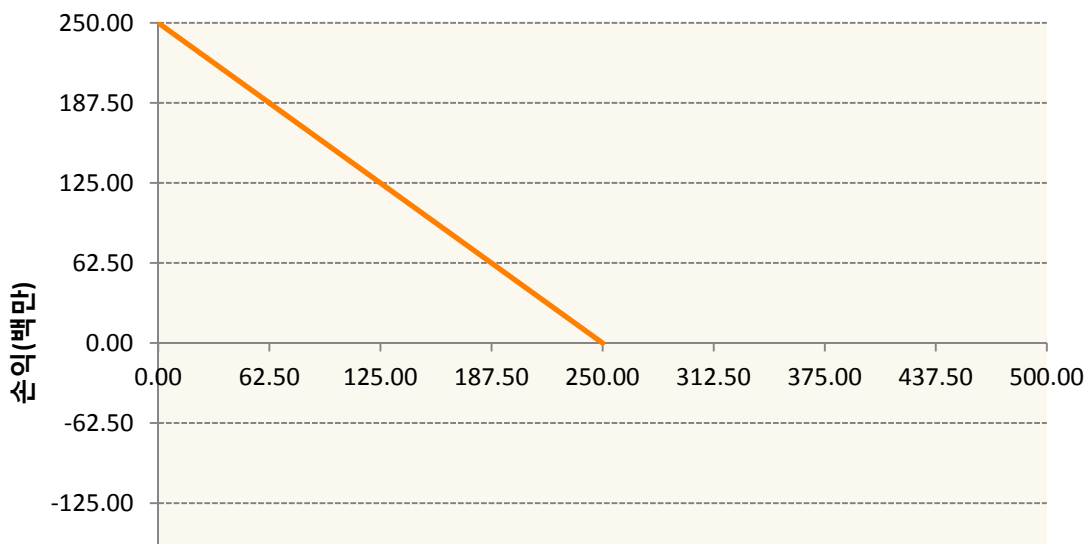


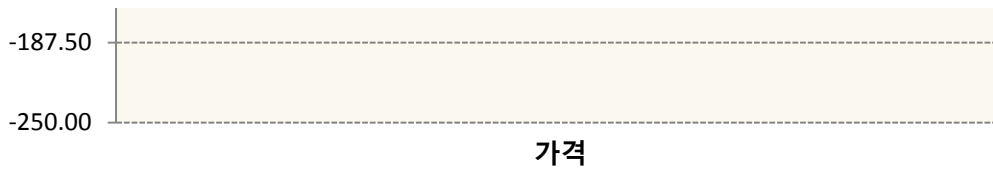


KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



KR4301Q42501-2020-04 풋250





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						676
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-676	-676	-676	-676	-676	-676	-676	
-5.33%	-450	-450	-450	-450	-450	-450	-450	
-2.67%	-225	-225	-225	-225	-225	-225	-225	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	225	225	225	225	225	225	225	
5.33%	450	450	450	450	450	450	450	
8.00%	676	676	676	676	676	676	676	
KR4201Q42602		2020-04 콜260						681
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	299	278	252	221	185	144	100	
-5.33%	273	243	207	166	121	72	20	
-2.67%	232	191	145	94	39	-19	-79	
0%	171	118	61	0	-64	-130	-197	
2.67%	84	20	-48	-118	-189	-262	-337	
5.33%	-33	-107	-183	-261	-339	-418	-498	
8.00%	-183	-265	-347	-430	-514	-597	-681	
KR4301Q42477		2020-04 풋247.5						369
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	249	266	284	303	324	346	369	
-5.33%	129	149	171	194	218	243	268	
-2.67%	17	41	67	93	119	147	174	
0%	-84	-57	-29	0	29	58	87	
2.67%	-175	-145	-114	-84	-53	-23	8	
5.33%	-254	-222	-191	-159	-127	-96	-64	
8.00%	-321	-289	-257	-225	-193	-161	-130	
KR4301Q42501		2020-04 풋250						16
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	11	12	13	13	14	15	16	
-5.33%	6	7	8	9	10	11	12	
-2.67%	1	2	3	4	5	6	8	

0%	-4	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-8	-6	-5	-4	-2	-1	0
5.33%	-11	-10	-8	-7	-6	-4	-3
8.00%	-14	-13	-12	-10	-9	-7	-6

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

(단위:백만원)

1,381

공시일	2020-03-17
기준일	2020-03-16

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	193,335	0	193,335	

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	2020-03-17
기준일	2020-03-16

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	102,510	0	102,510	

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	2020-03-17
기준일	2020-03-16

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	485,763	0	485,763	
누계	통화	선도	36,780	571,684	-534,904	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,579
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,471
FX21020F03 KRW/USD 31-03-20E	3,139
FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E	2,942
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,648
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	1,962
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	3,374
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,374
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,962
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,923
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,295
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,962
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	196
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	5,002
FX21020G06 USD/KRW 31-03-20E	490
FX21020H00 USD/KRW 31-03-20E	981
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,452
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,040
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,040
FX21020H04 USD/KRW 21-04-20E	1,471
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,393
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	981
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)

120

공시일	2020-03-17
기준일	2020-03-16

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

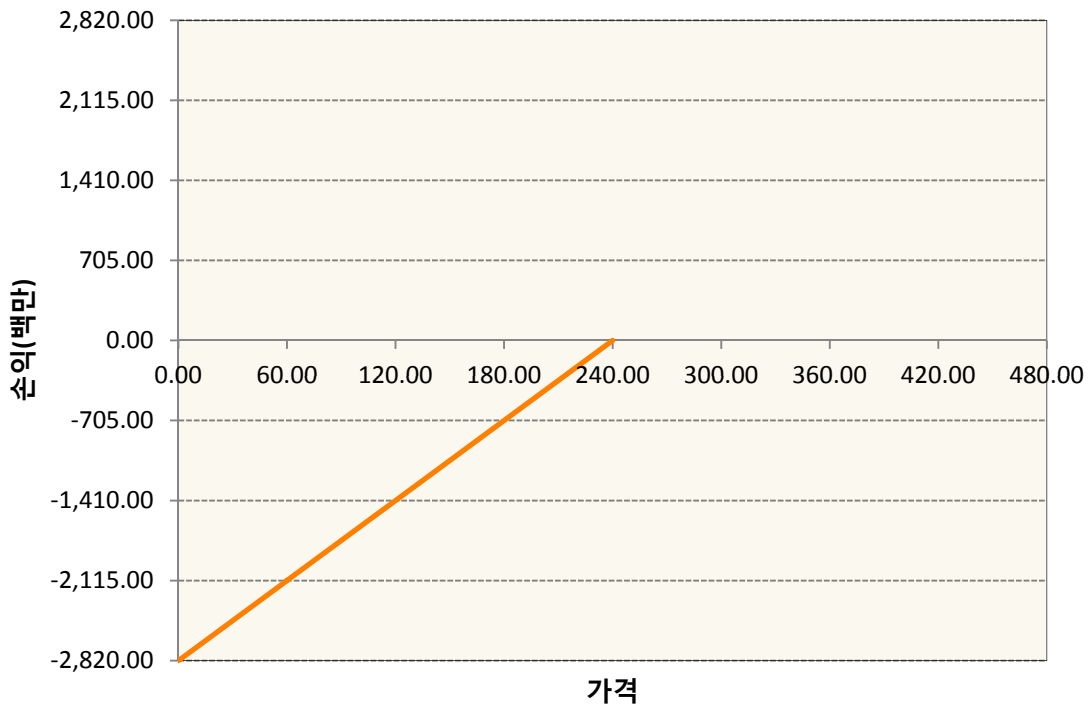
1. 계약금액

(단위:백만원)

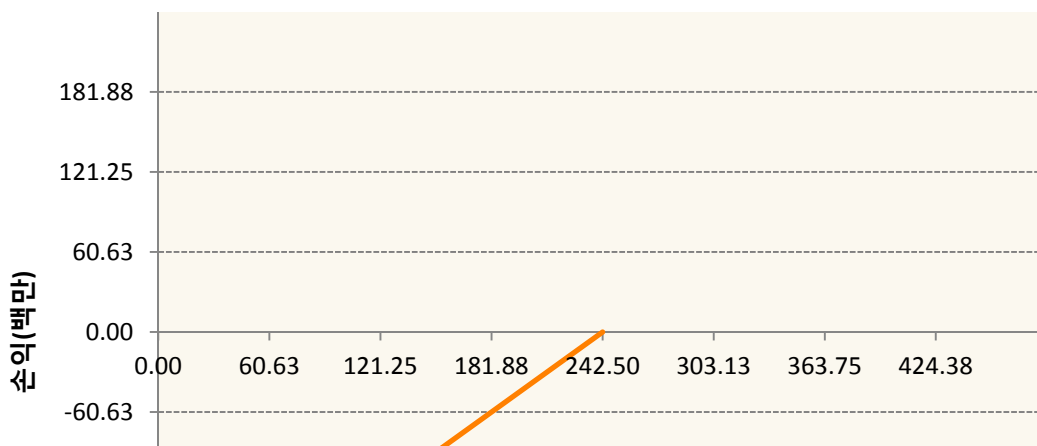
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	193	-193	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,063	-3,063	장내

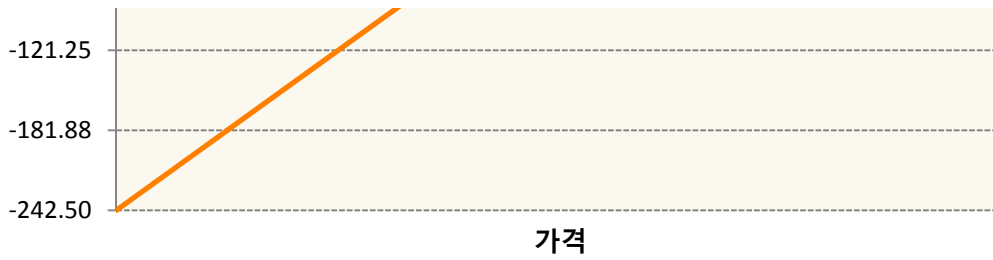
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q42402-2020-04 풋240



KR4301Q42428-2020-04 풋242.5





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q42402		2020-04 풋240						175
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-106	-117	-127	-139	-151	-163	-175	
-5.33%	-50	-63	-75	-88	-101	-115	-128	
-2.67%	0	-14	-28	-42	-56	-70	-85	
0%	45	30	15	0	-15	-30	-45	
2.67%	84	68	53	37	22	6	-9	
5.33%	116	101	85	70	54	38	23	
8.00%	143	128	113	98	83	67	52	
KR4301Q42428		2020-04 풋242.5						15
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-10	-10	-11	-12	-13	-14	-15	
-5.33%	-5	-6	-7	-8	-9	-10	-11	
-2.67%	0	-1	-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	11	10	9	7	6	5	

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

152

공시일	2020-03-17
기준일	2020-03-16

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	8,246	0	8,246	
누계	통화	선도	944	9,502	-8,557	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	185
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	219
FX21020H01 USD/KRW 31-03-20E	50
FX21020H02 KRW/USD 13-04-20E	356
FX21020H04 USD/KRW 31-03-20E	26
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

311

공시일	2020-03-17
기준일	2020-03-16

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

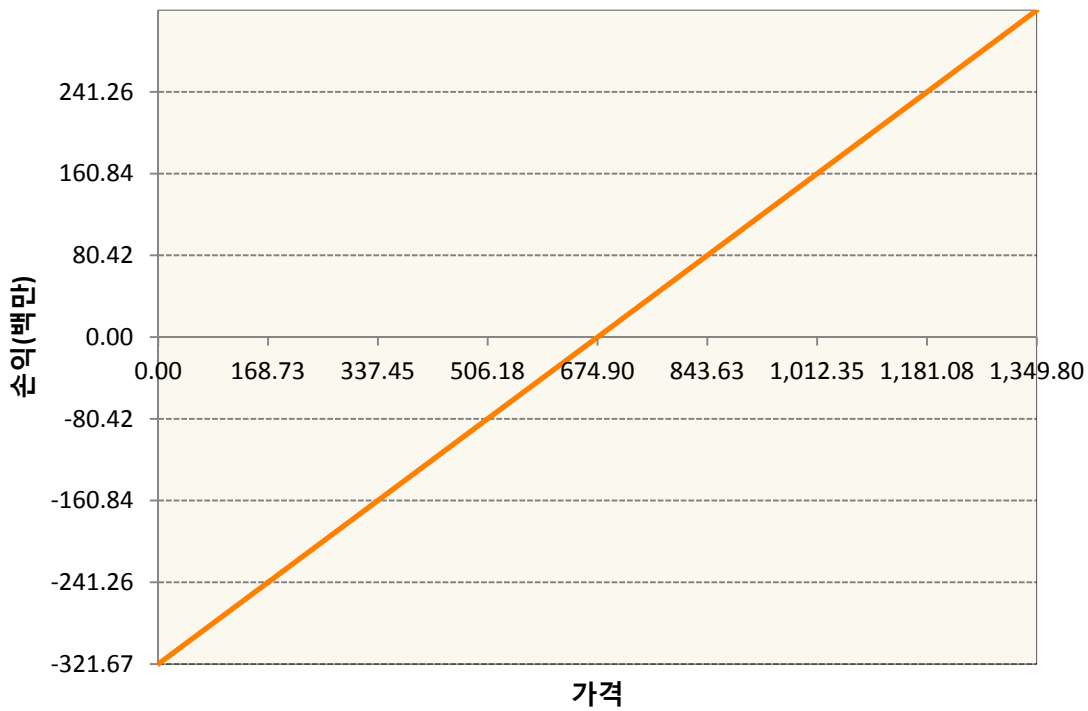
1. 계약금액

(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	322	0	322	
누계	유가증권	스왑	1,127	0	1,127	장외
누계	통화	선도	478	752	-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	26

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

(단위:백만원)

141

공시일	2020-03-17
기준일	2020-03-16

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

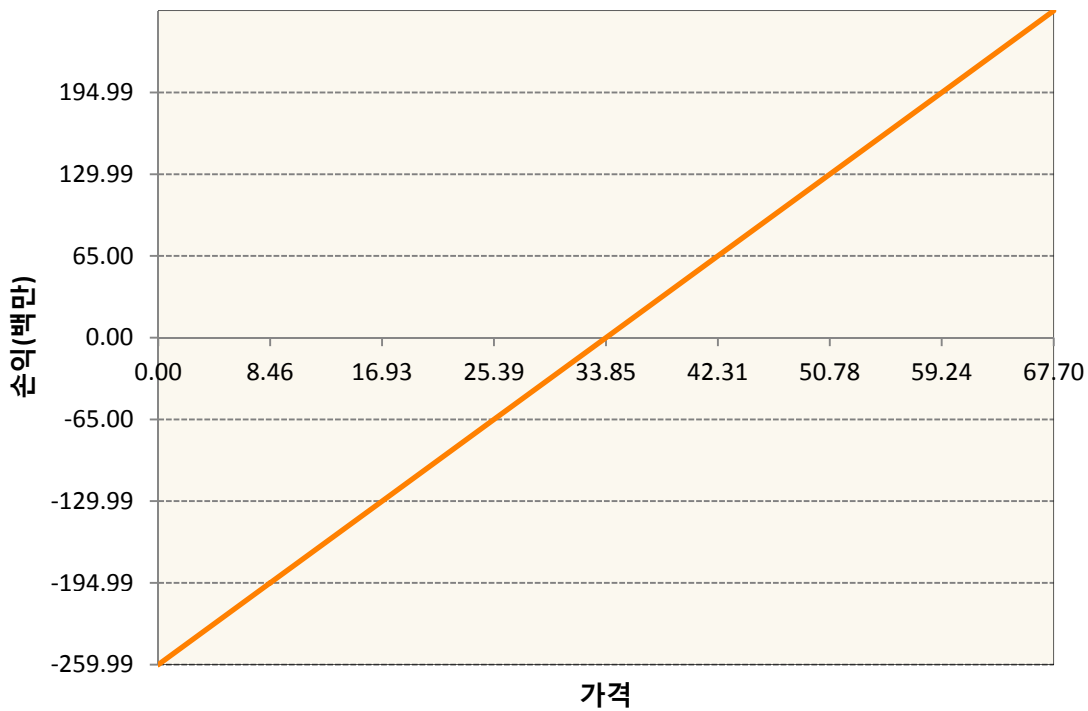
1. 계약금액

(단위:백만원)

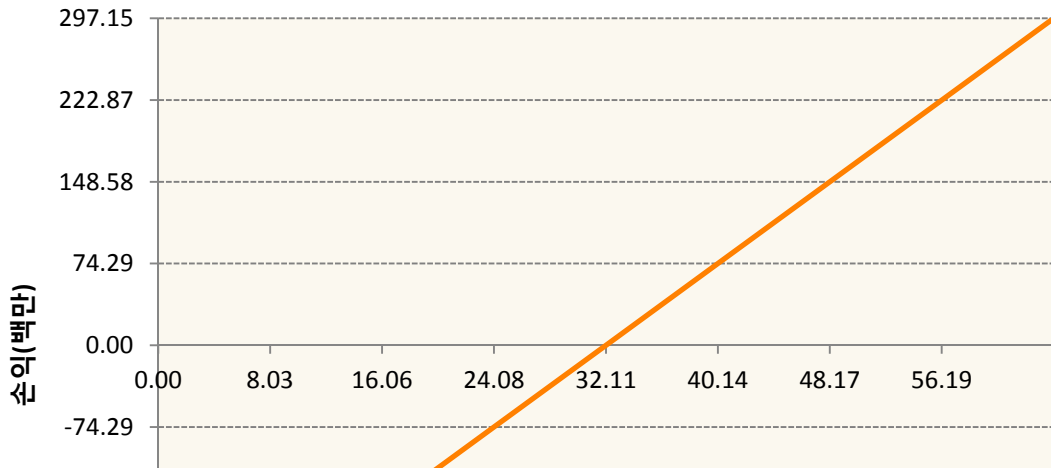
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,505	122	1,383	

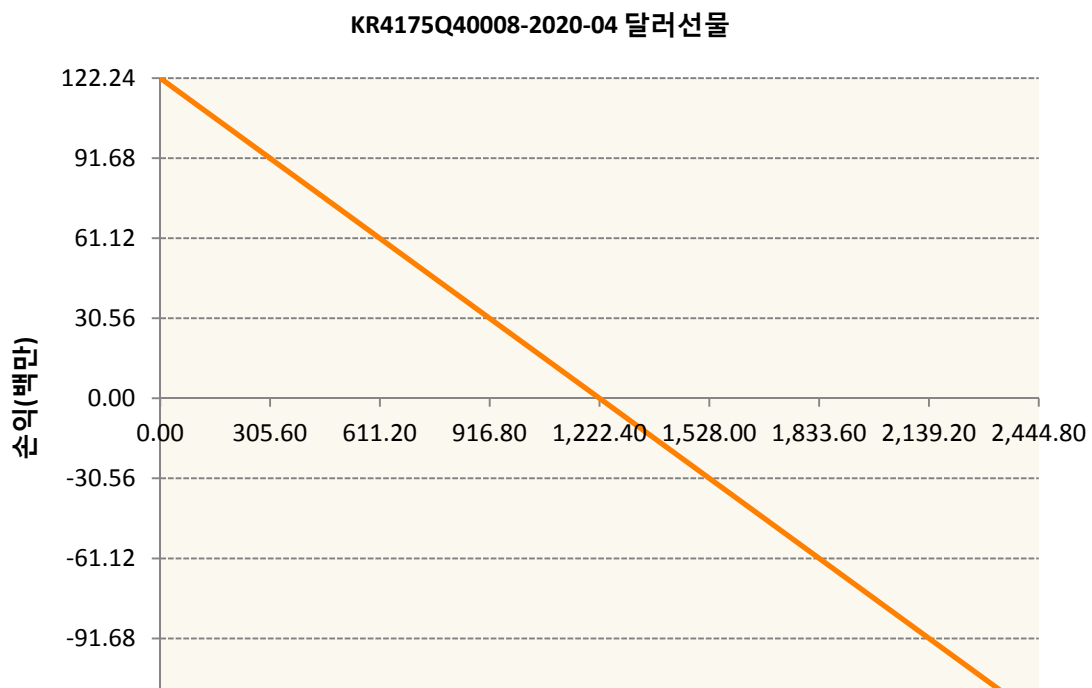
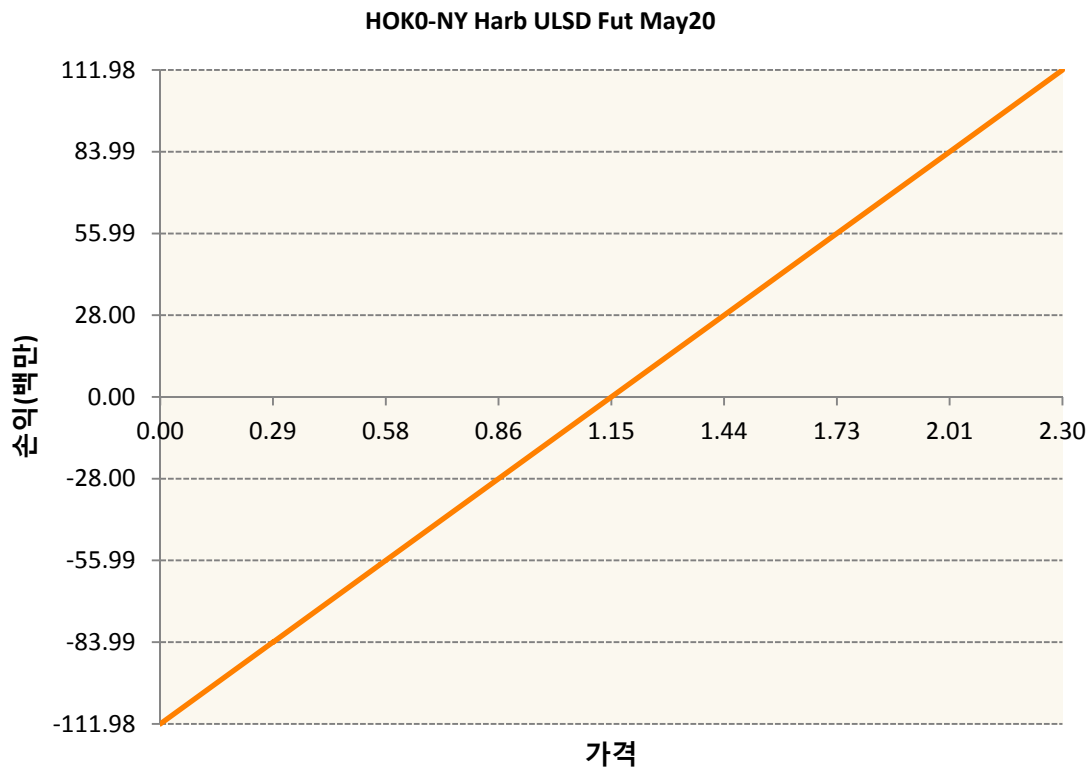
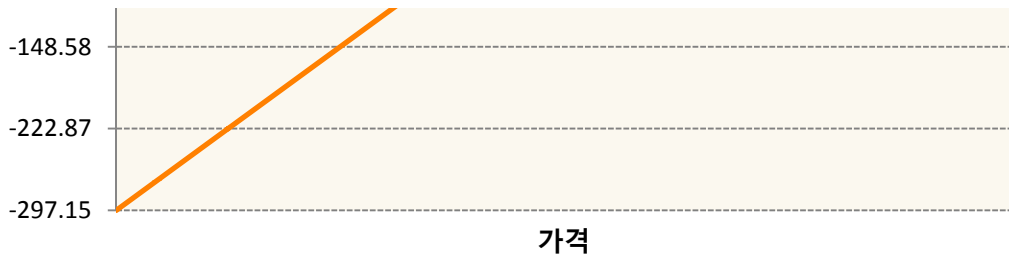
2. 만기시점의 손익구조

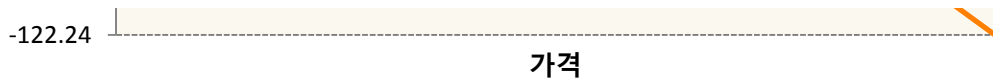
COK0-BRENT CRUDE FUTR May20



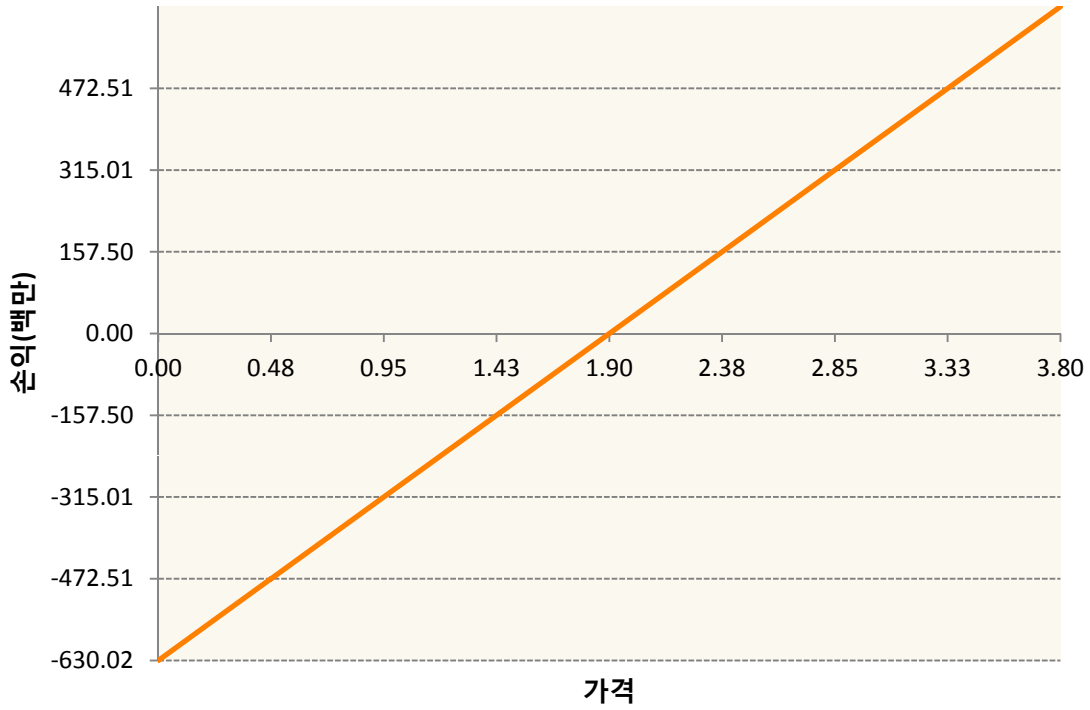
CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20



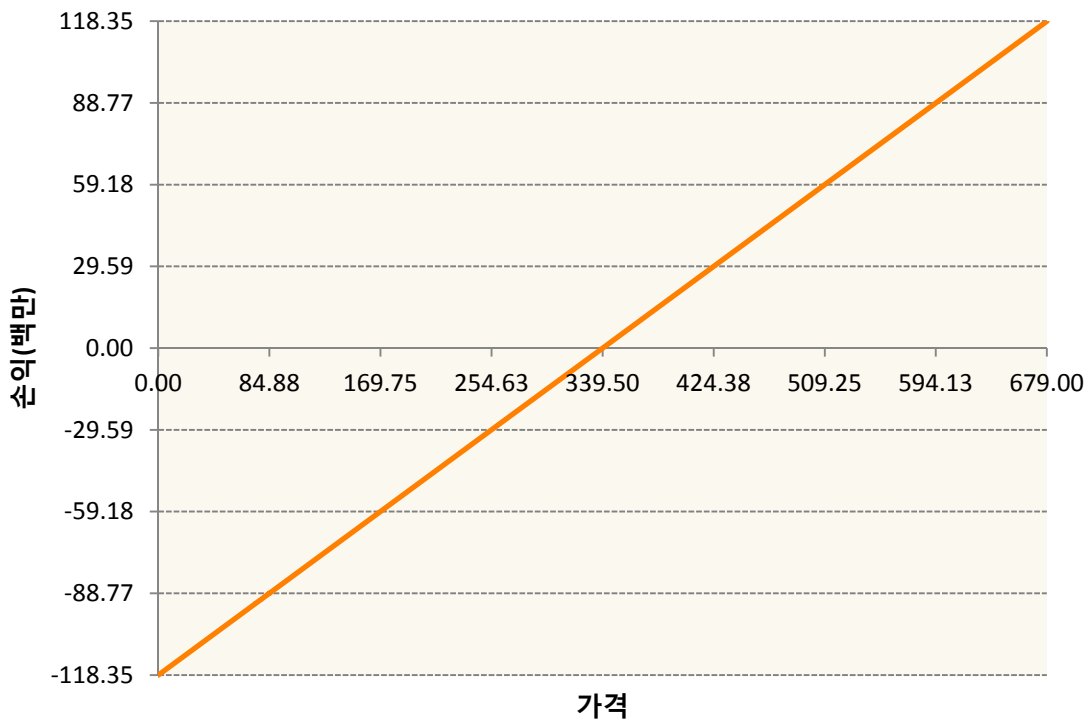




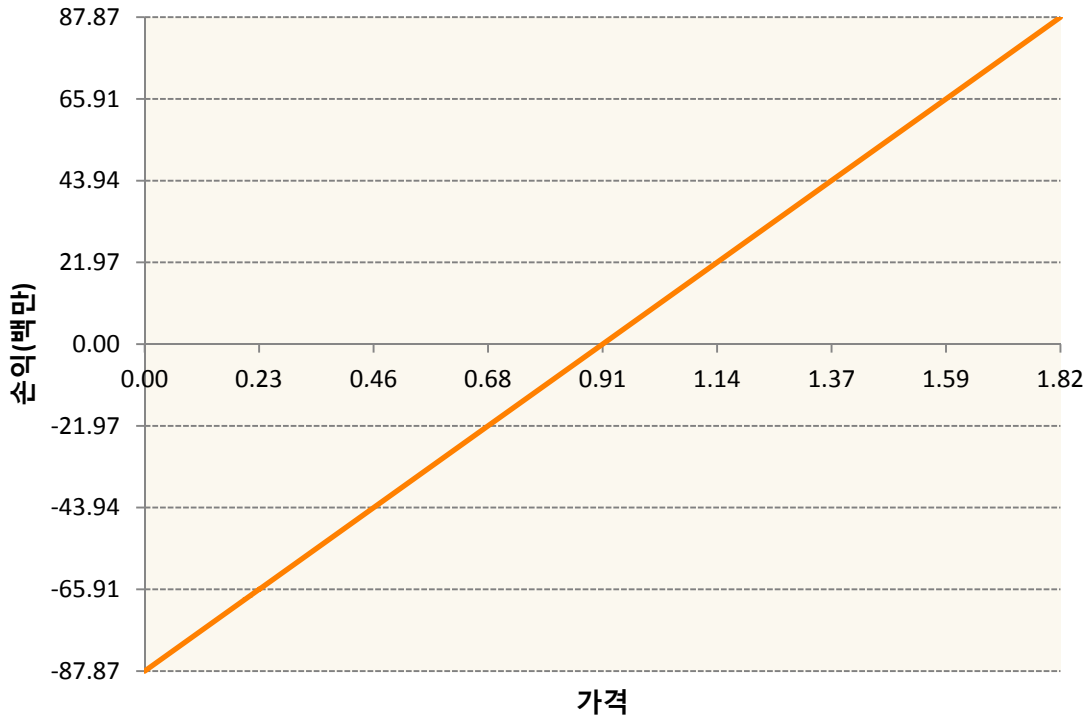
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



QSK0-Low Su Gasoil G Mar20



XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	21
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	9
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	7

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

(단위:백만원)

299

공시일	2020-03-17
기준일	2020-03-16

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

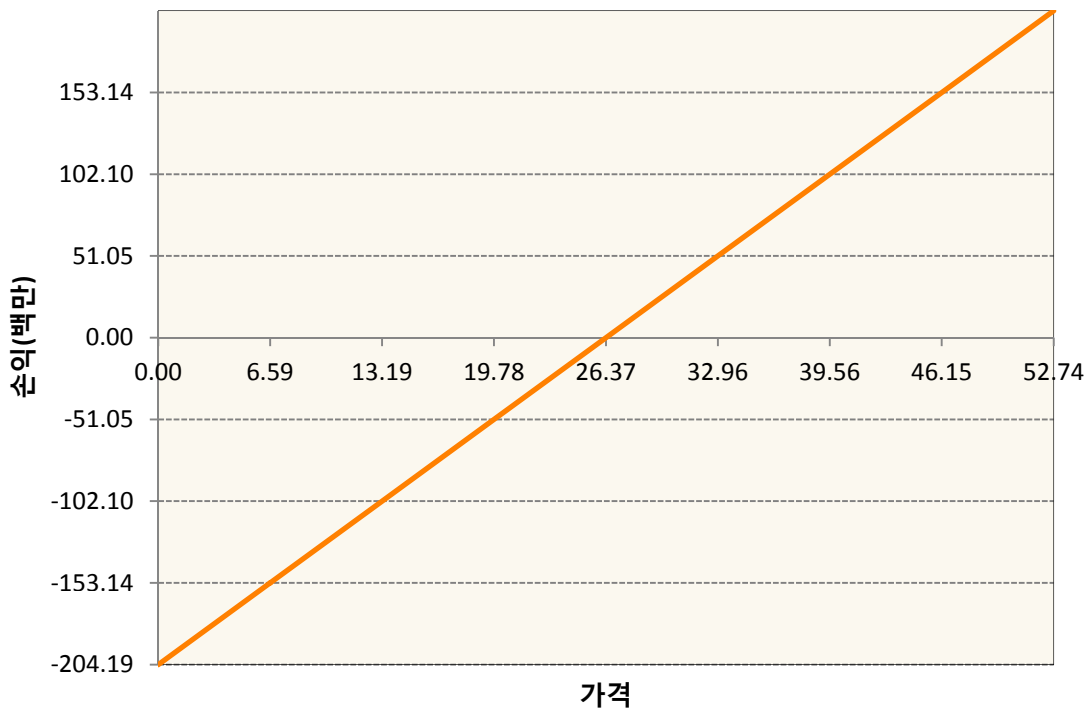
1. 계약금액

(단위:백만원)

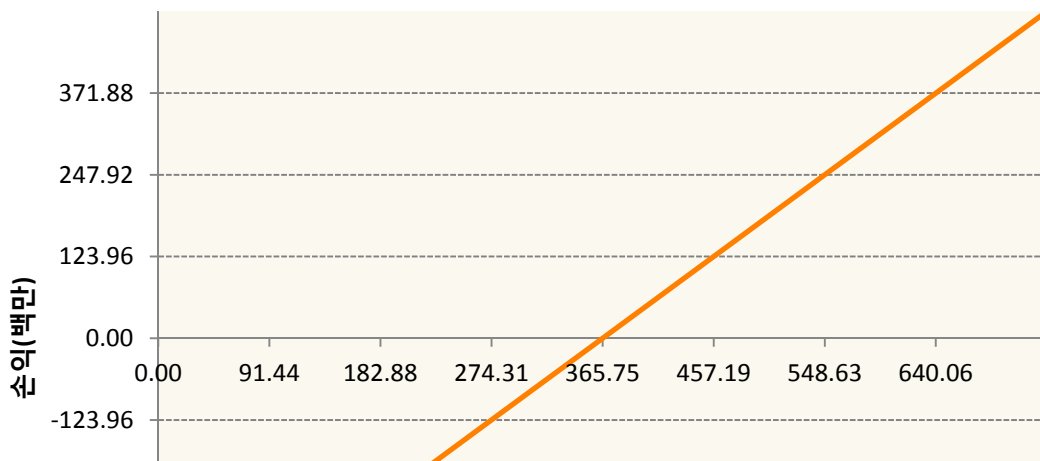
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,438	98	2,340	

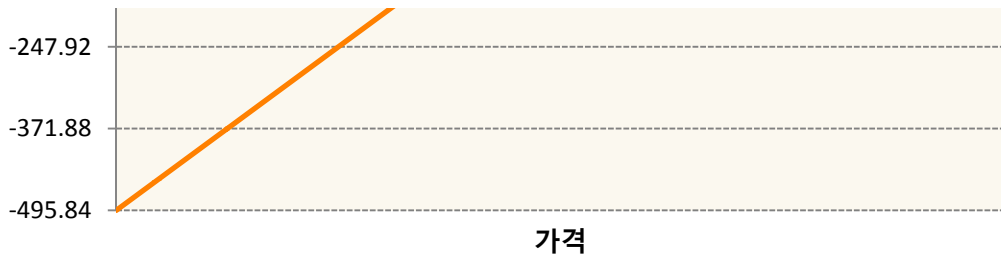
2. 만기시점의 손익구조

BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20

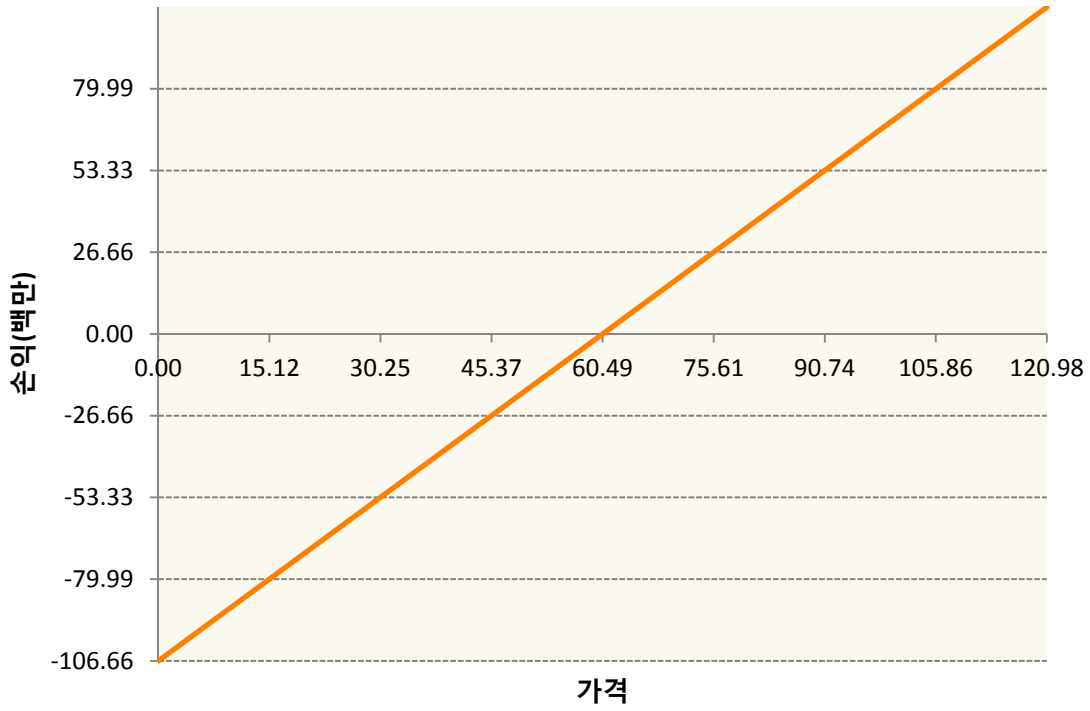


CK0-CORN FUTURE May20

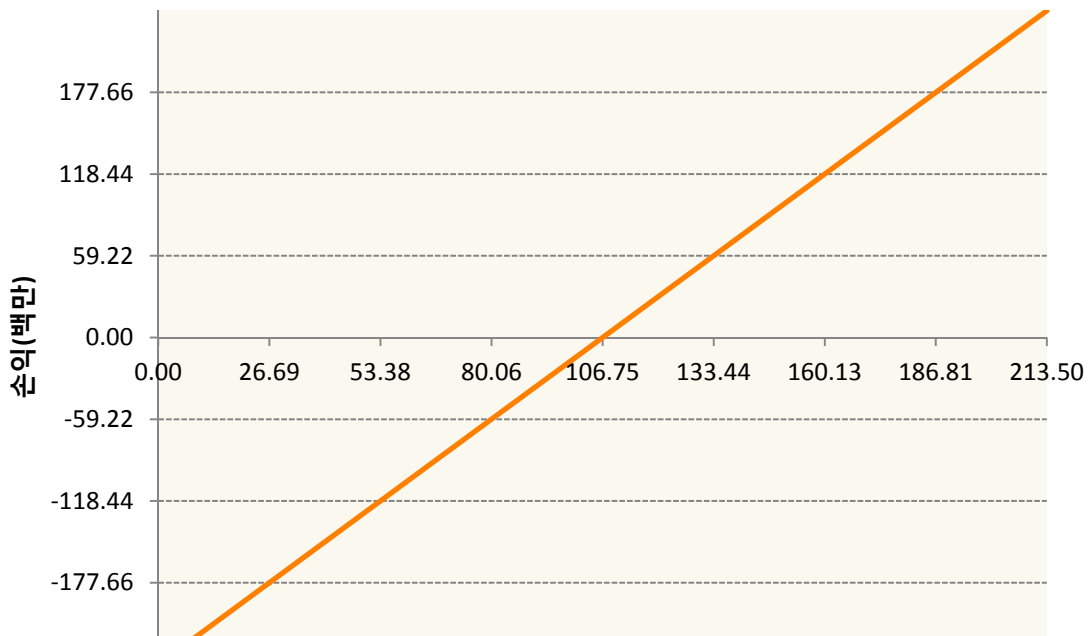


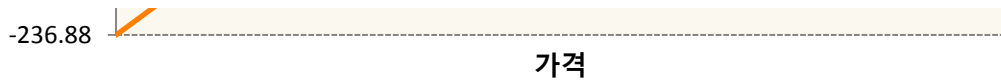


CTK0-COTTON NO.2 FUTR May20

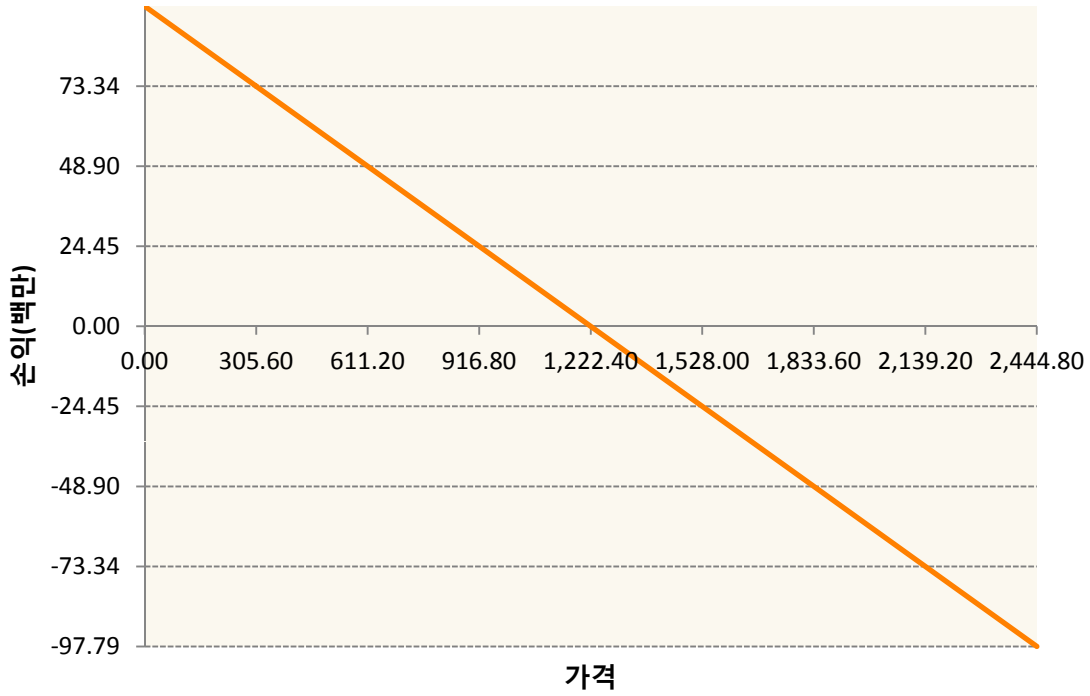


KCK0-COFFEE 'C' FUTURE May20

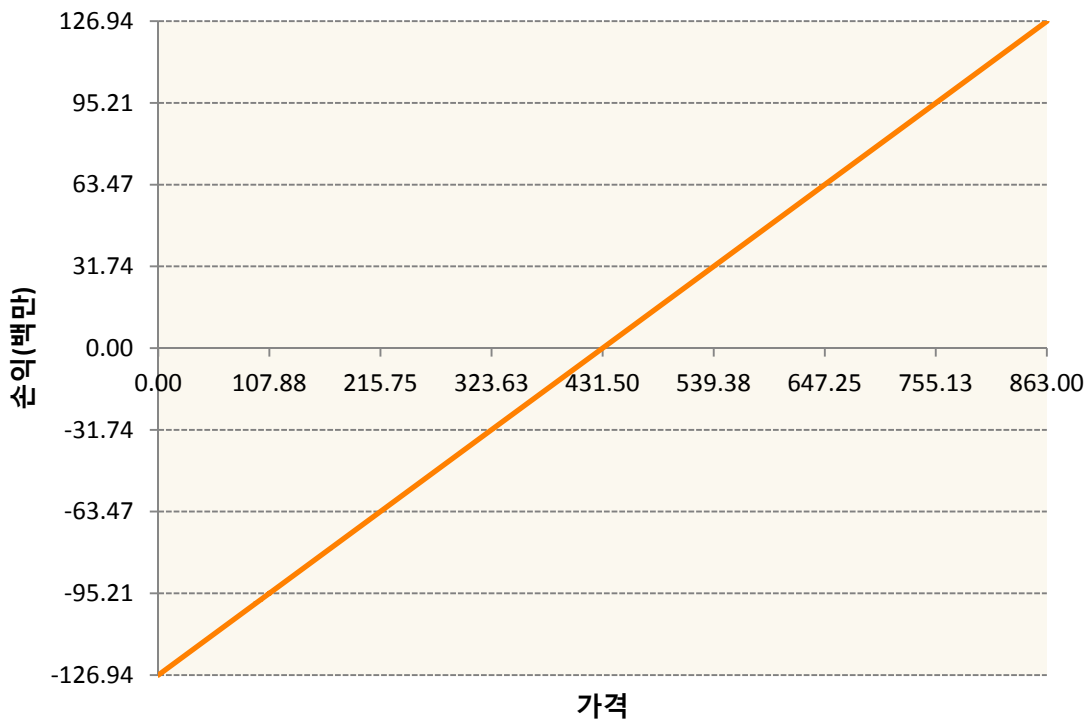




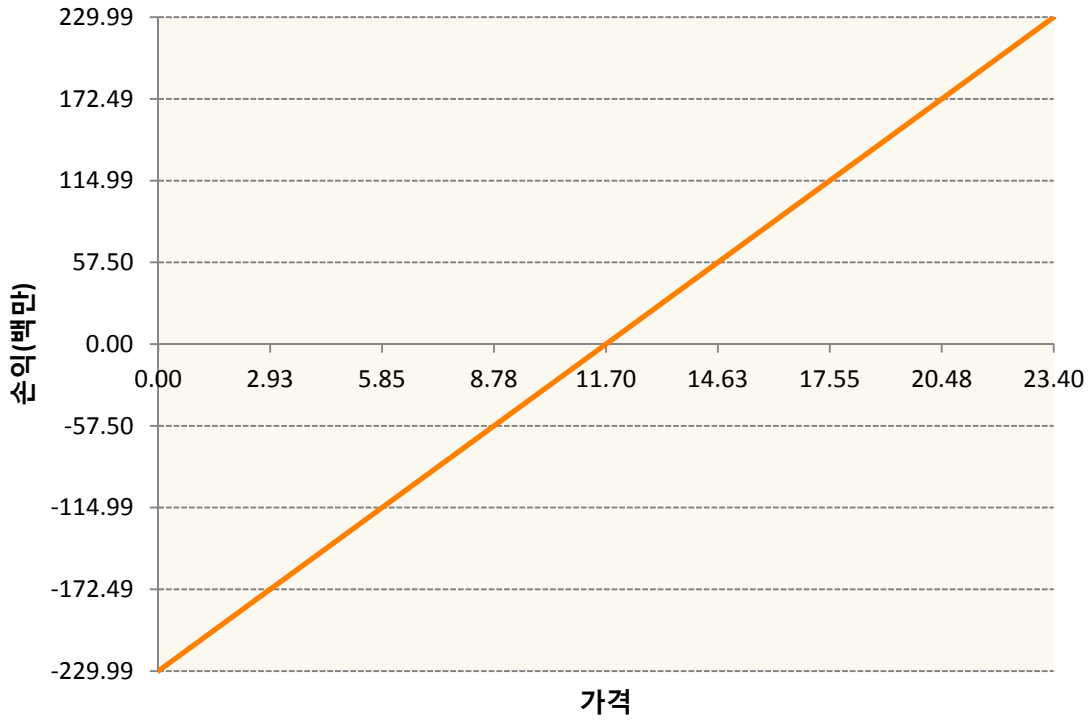
KR4175Q40008-2020-04 달러선물



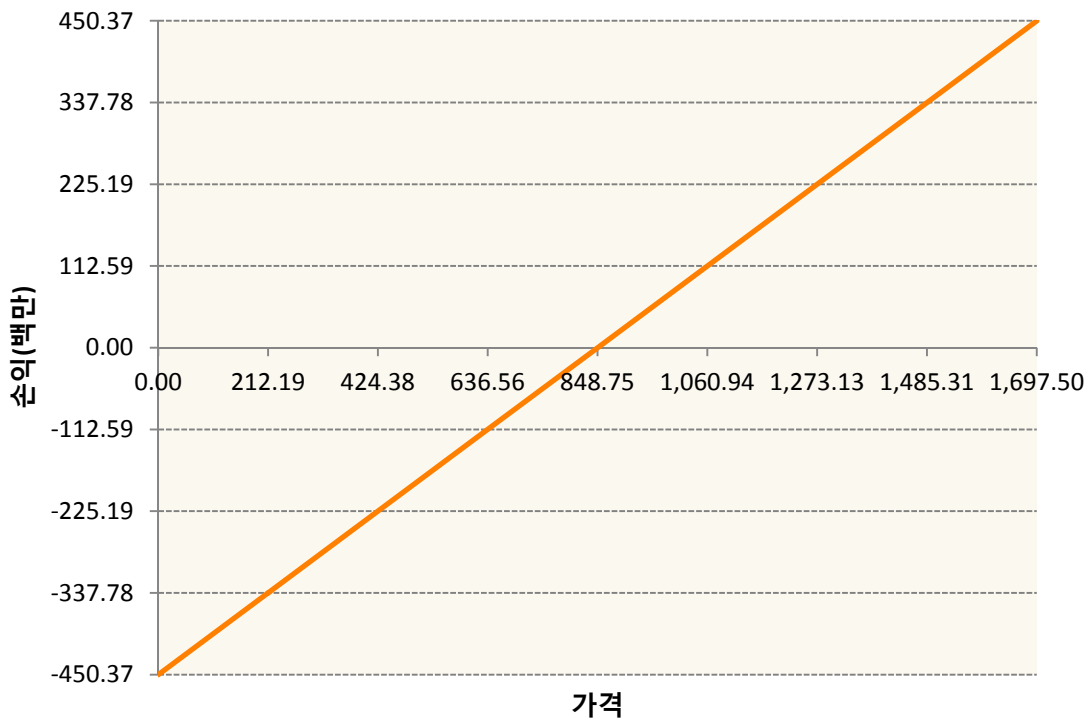
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



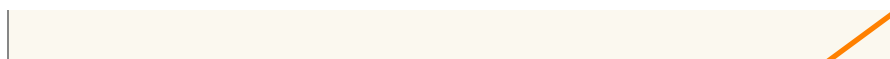
SBK0-Sugar May20

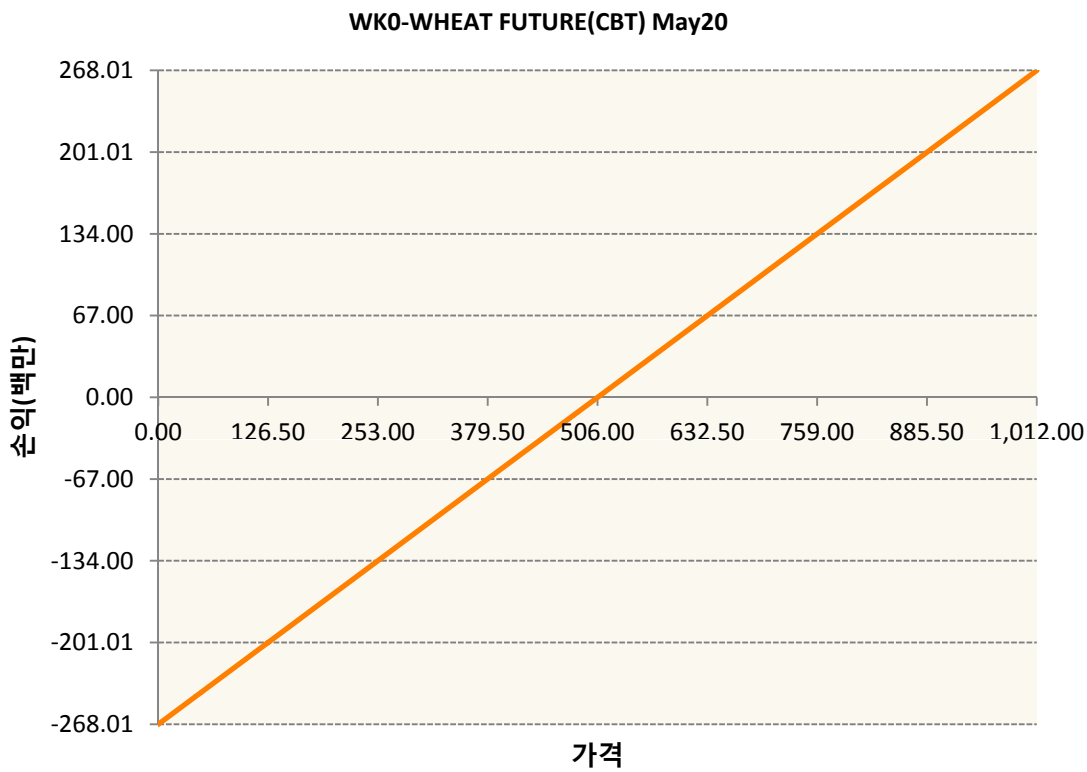
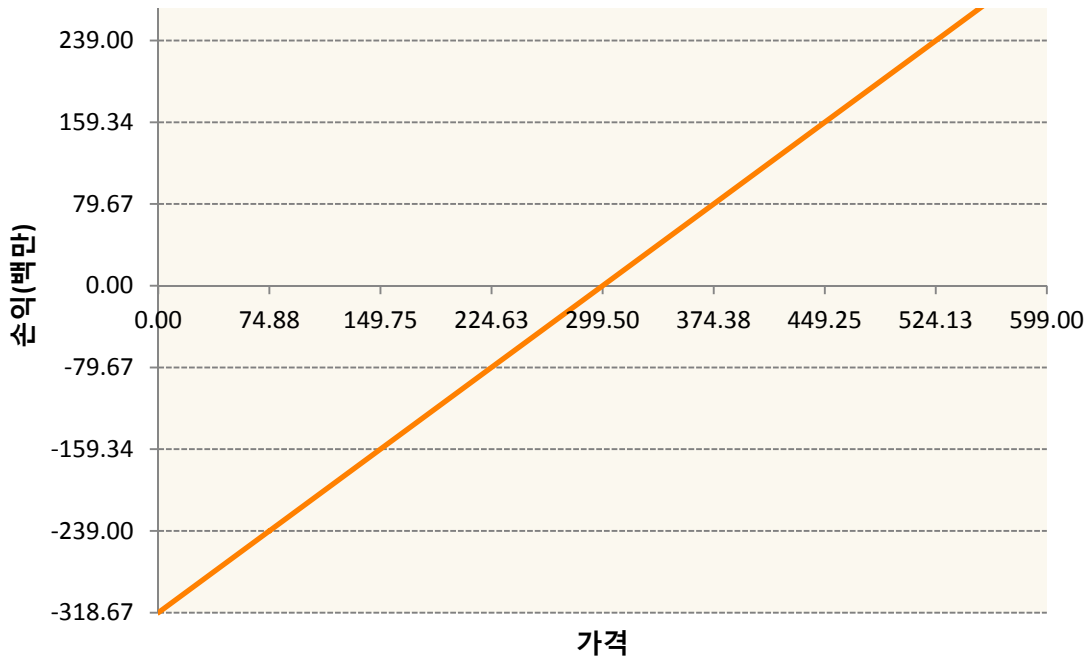


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



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	9
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	36
SMK0	SOYBEAN MEAL FUTR May20	25
WK0	WHEAT FUTURE(CBT) May20	21

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

(단위:백만원)

216