

공시일	2020-03-03
기준일	2020-03-02

## 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	2020-03-03
기준일	2020-03-02

## 스마트인덱스모

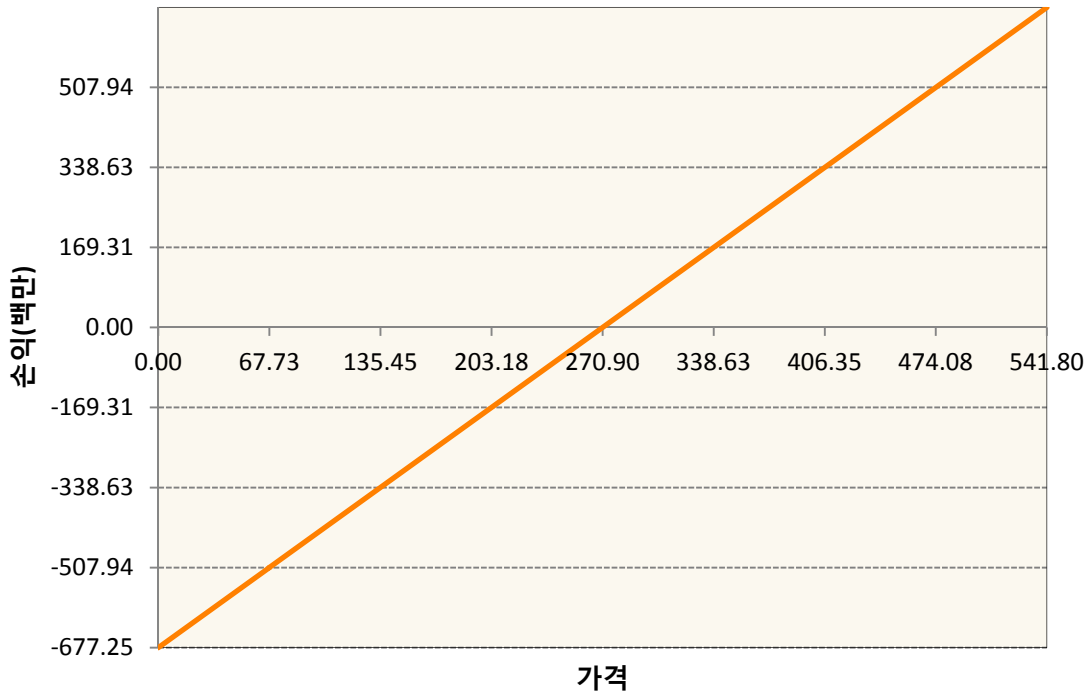
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

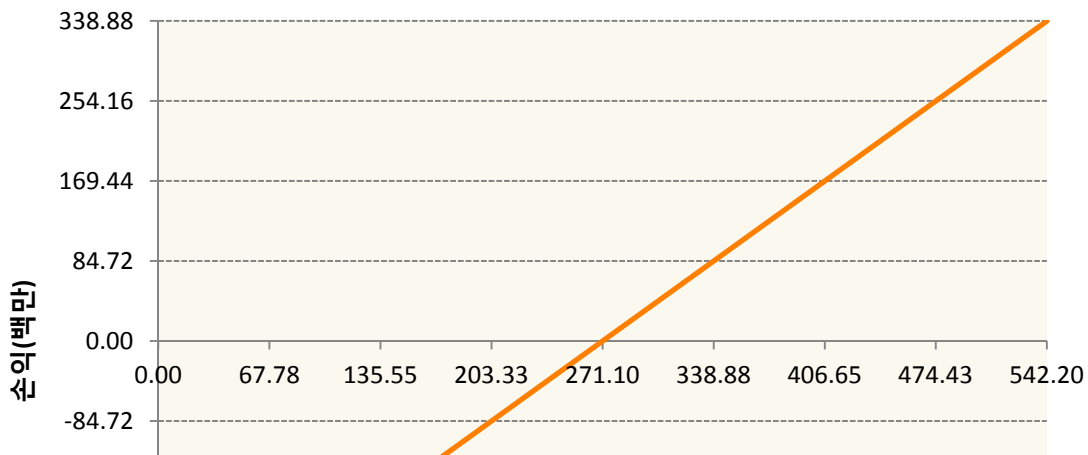
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,016	0	1,016	장내

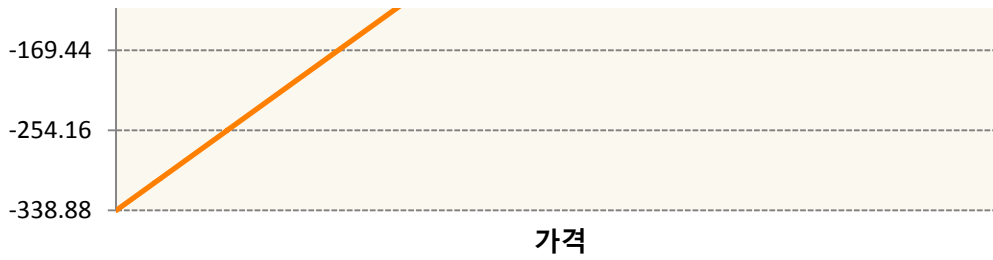
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						54
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54	
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	18	18	18	18	18	18	18	
5.33%	36	36	36	36	36	36	36	
8.00%	54	54	54	54	54	54	54	
KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						27
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27	
-5.33%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	9	9	9	9	9	9	9	
5.33%	18	18	18	18	18	18	18	
8.00%	27	27	27	27	27	27	27	

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

72

공시일	2020-03-03
기준일	2020-03-02

## 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

1,032

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

633

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-03
기준일	2020-03-02

## 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)	440
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	160

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

929

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-03
기준일	2020-03-02

## 유로인덱스모(주식-파생형)

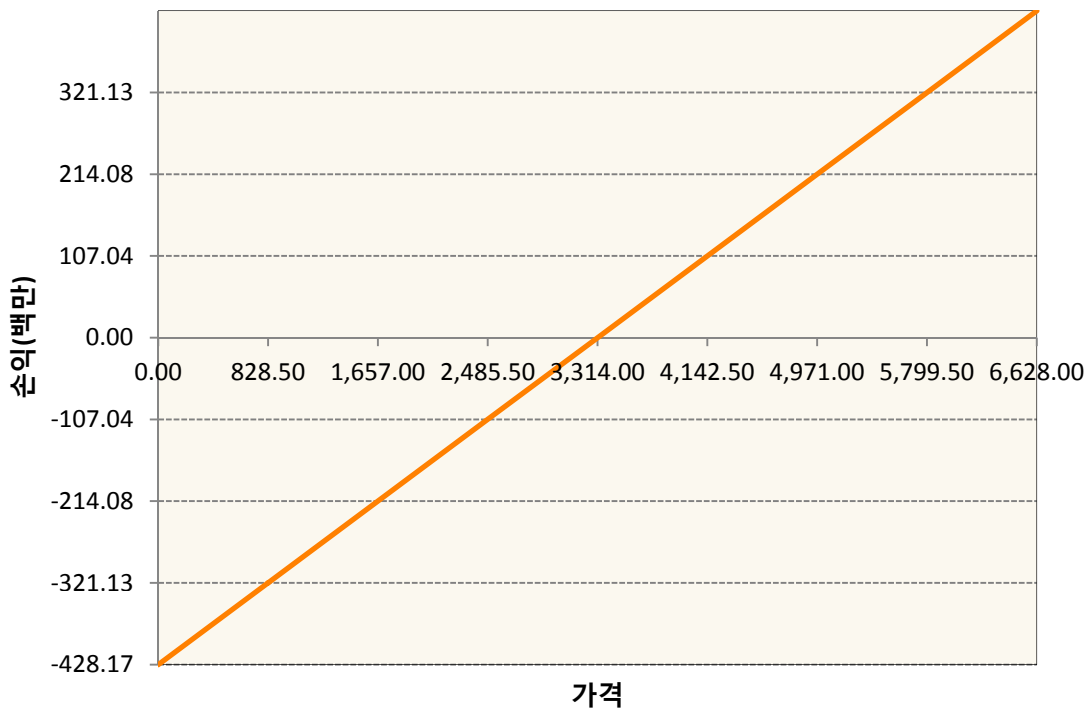
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	428	0	428	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGHO-EURO STOXX 50 Mar20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

26
----

공시일	2020-03-03
기준일	2020-03-02

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

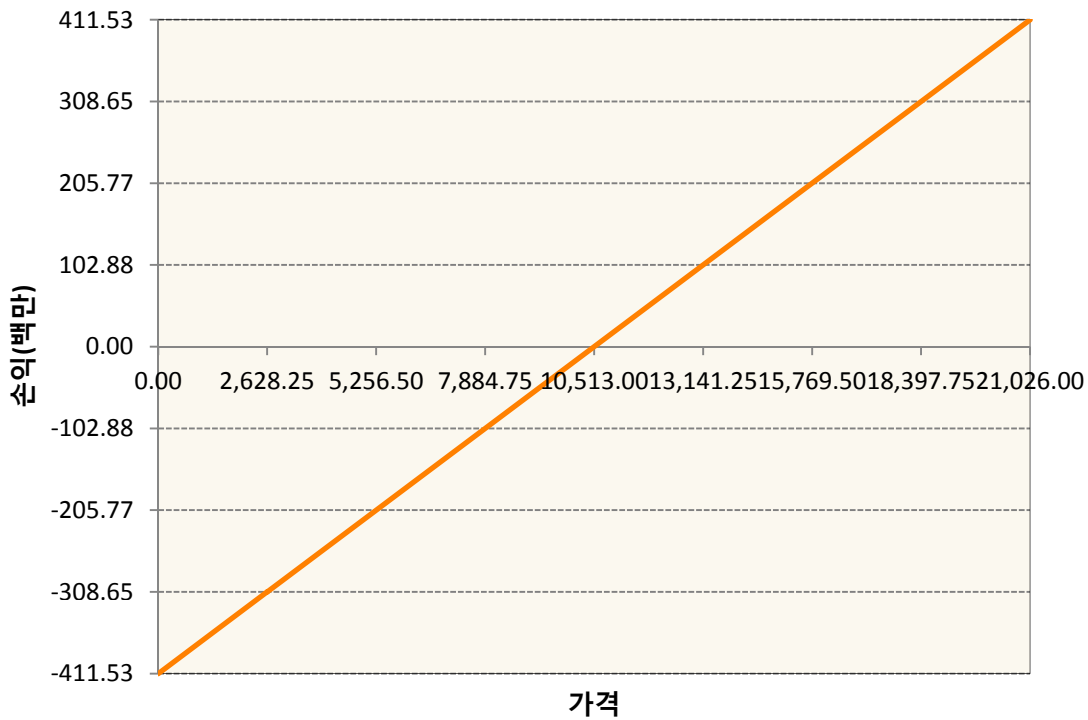
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

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

### 2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH0	HSCEI Futures Mar20	33
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

30

공시일	2020-03-03
기준일	2020-03-02

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

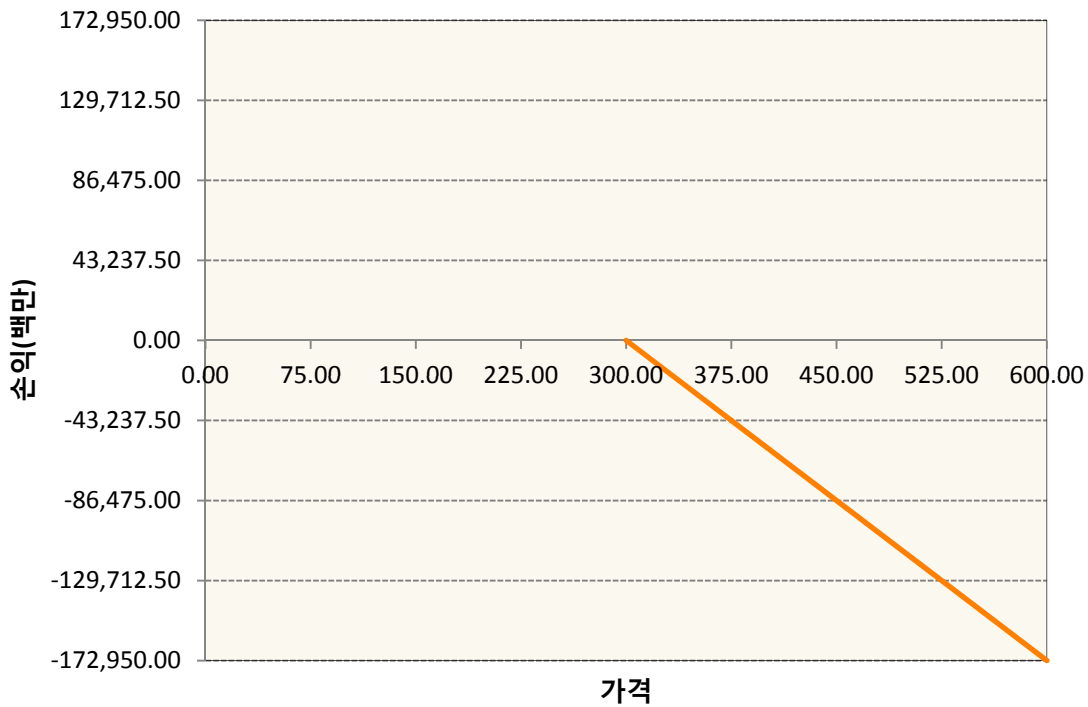
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

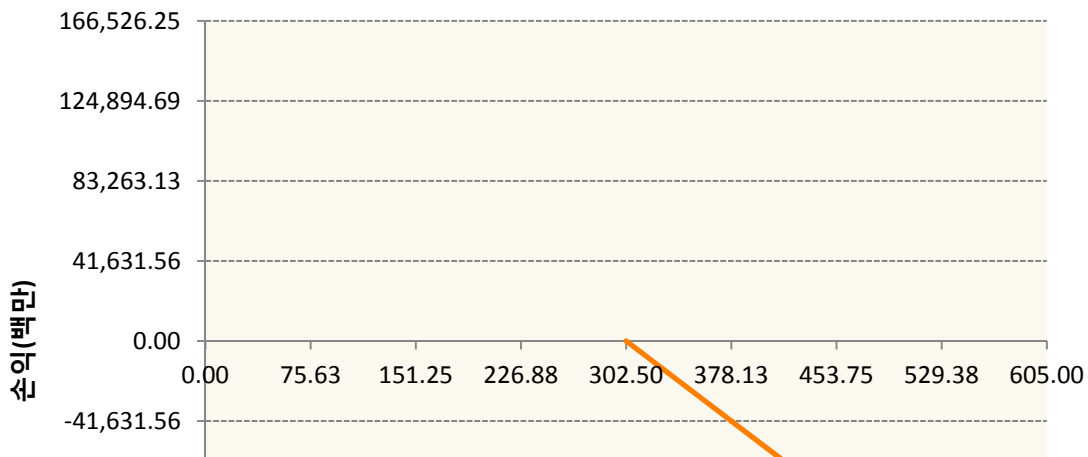
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	448,226	-448,226	장내

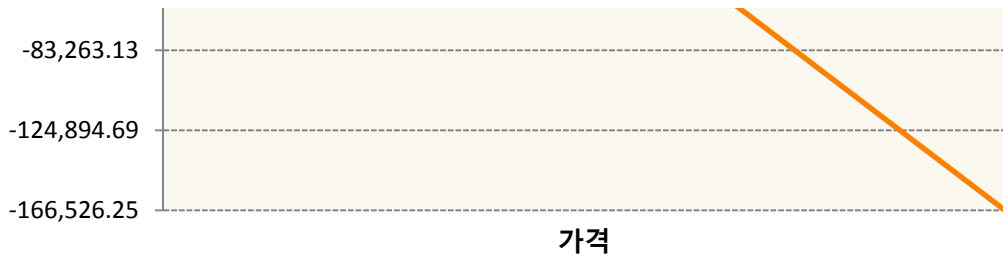
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q33007-2020-03 콜300

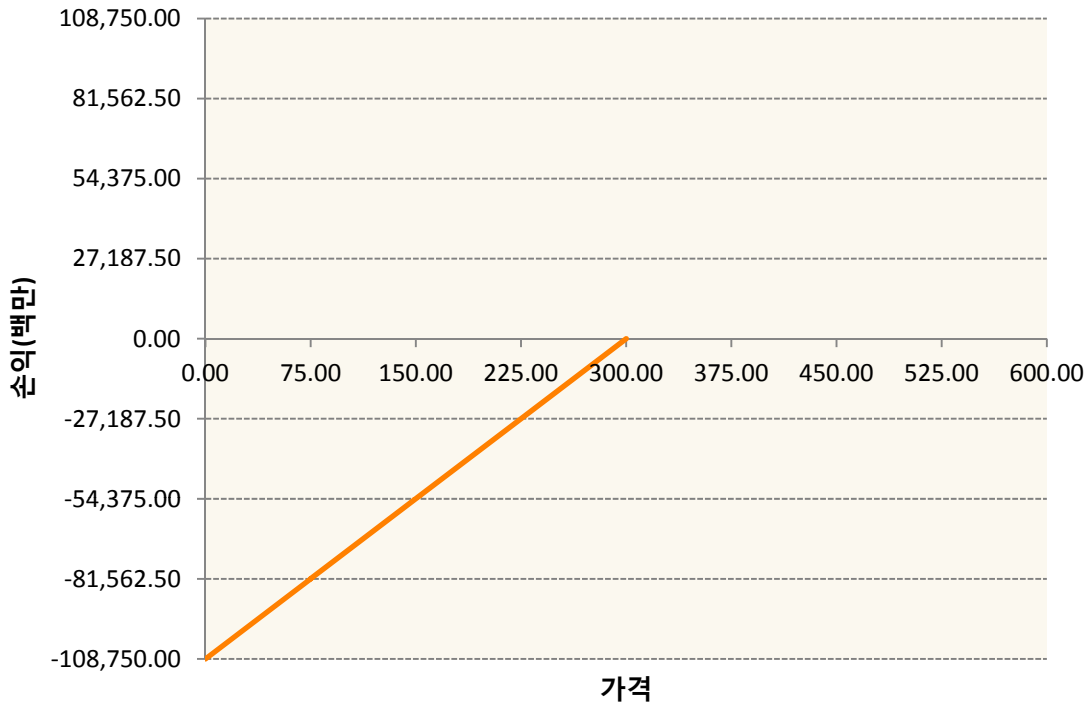


KR4201Q33023-2020-03 콜302.5





KR4301Q33005-2020-03 풋300



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q33007		2020-03 콜300					3,044	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	187	187	186	184	180	172	158	
-5.33%	187	185	181	172	157	134	101	
-2.67%	183	174	157	129	88	33	-37	
0%	156	122	70	0	-89	-197	-323	
2.67%	43	-51	-171	-313	-475	-655	-852	
5.33%	-312	-505	-720	-953	-1,199	-1,458	-1,727	
8.00%	-1,158	-1,456	-1,763	-2,076	-2,395	-2,718	-3,044	
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5					2,507	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	129	128	128	127	124	118	108	

-5.33%	128	127	125	119	109	92	67
-2.67%	126	121	110	90	60	19	-36
0%	111	89	52	0	-69	-155	-257
2.67%	40	-28	-118	-230	-362	-512	-679
5.33%	-202	-354	-529	-724	-935	-1,160	-1,397
8.00%	-825	-1,081	-1,350	-1,629	-1,915	-2,208	-2,507
KR4301Q33005 2020-03 풋300							7,780
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,774	-7,774	-7,774	-7,774	-7,775	-7,777	-7,780
-5.33%	-5,162	-5,162	-5,163	-5,165	-5,169	-5,175	-5,185
-2.67%	-2,551	-2,552	-2,557	-2,565	-2,578	-2,598	-2,624
0%	55	44	26	0	-36	-81	-135
2.67%	2,626	2,588	2,537	2,474	2,399	2,313	2,218
5.33%	5,076	4,983	4,876	4,759	4,632	4,498	4,356
8.00%	7,230	7,069	6,903	6,732	6,558	6,381	6,202

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

(단위:백만원)

**10,609**

공시일	2020-03-03
기준일	2020-03-02

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

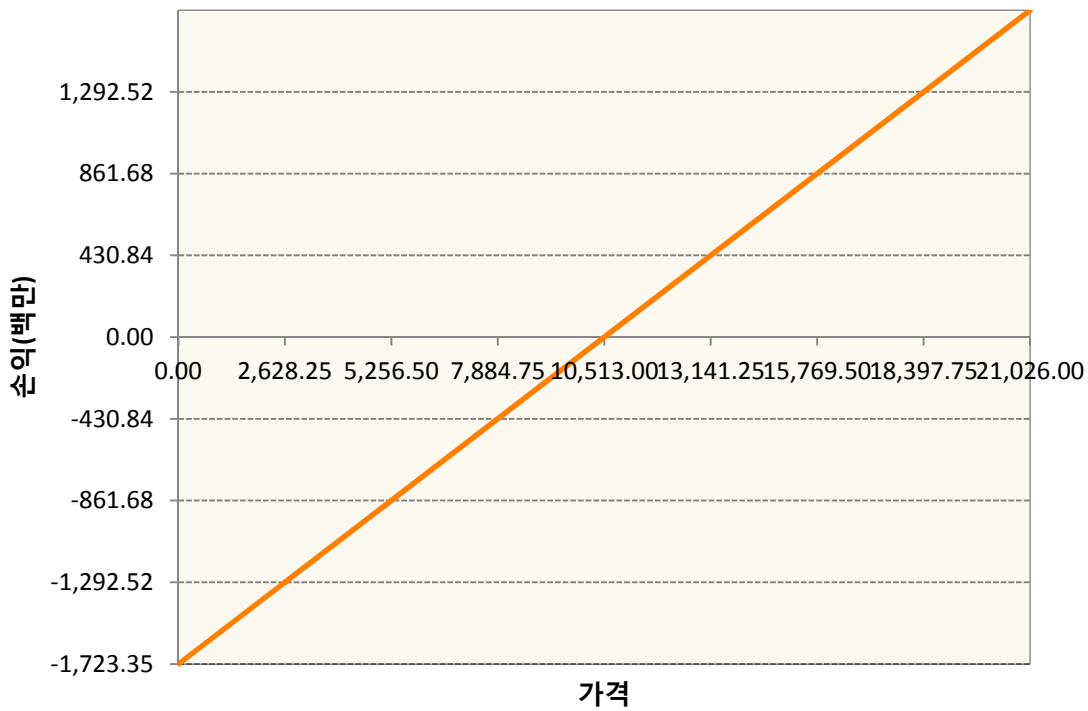
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

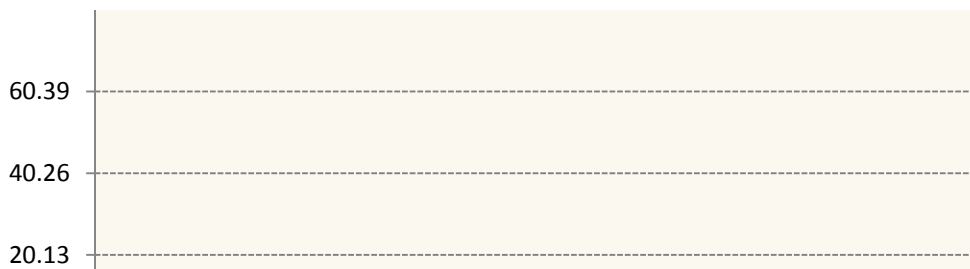
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,723	0	1,723	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,713	-4,713	장내
누계	통화	선도	0	2,159	-2,159	장외

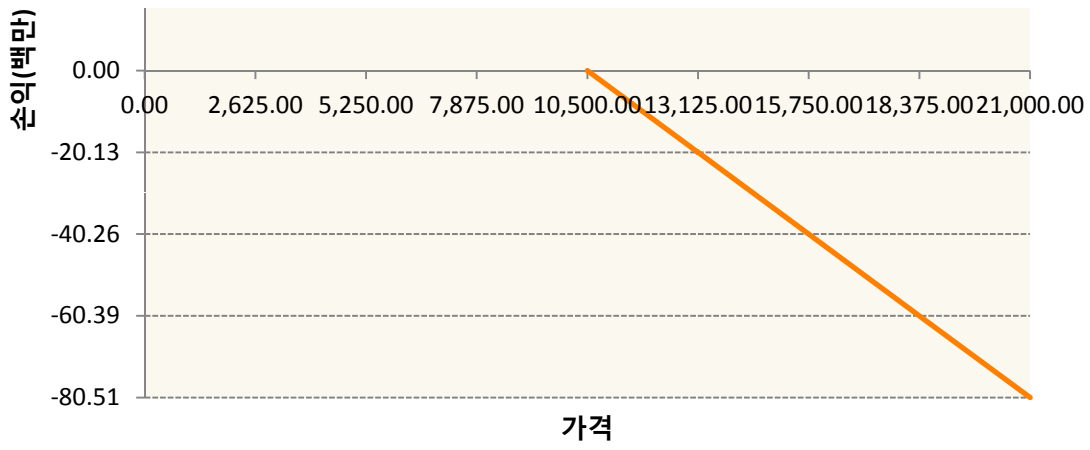
### 2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20

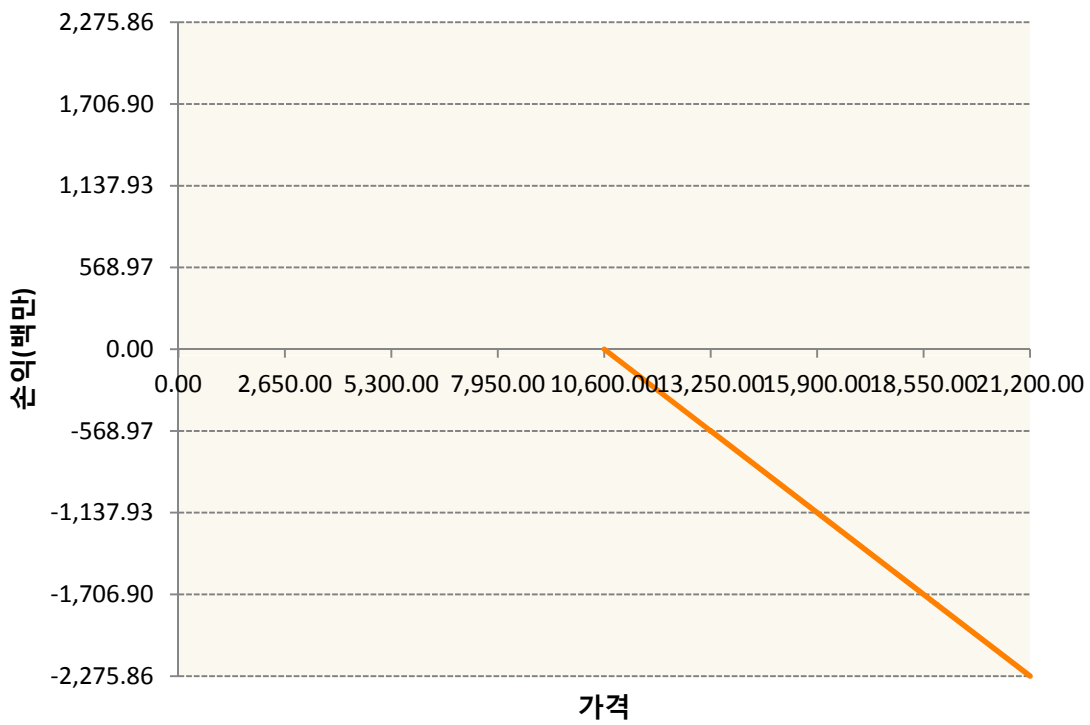


OHHIH0-C105-HSCEI

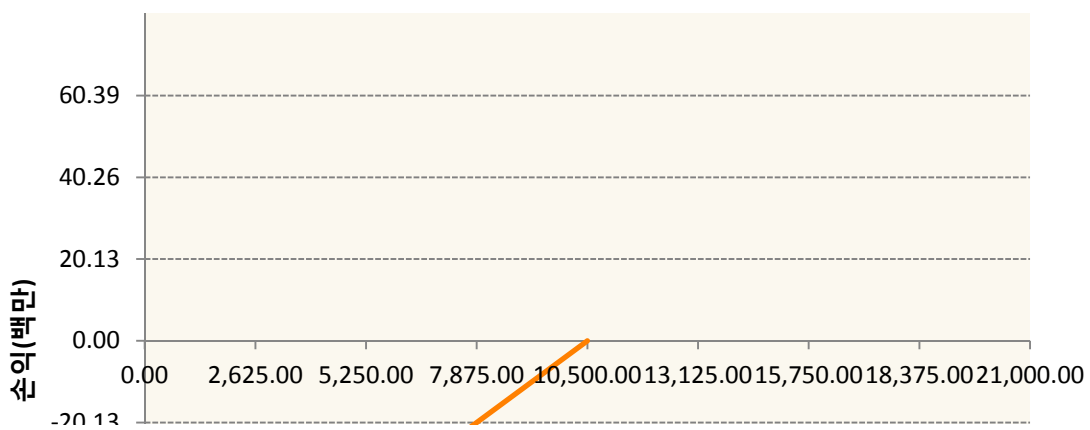


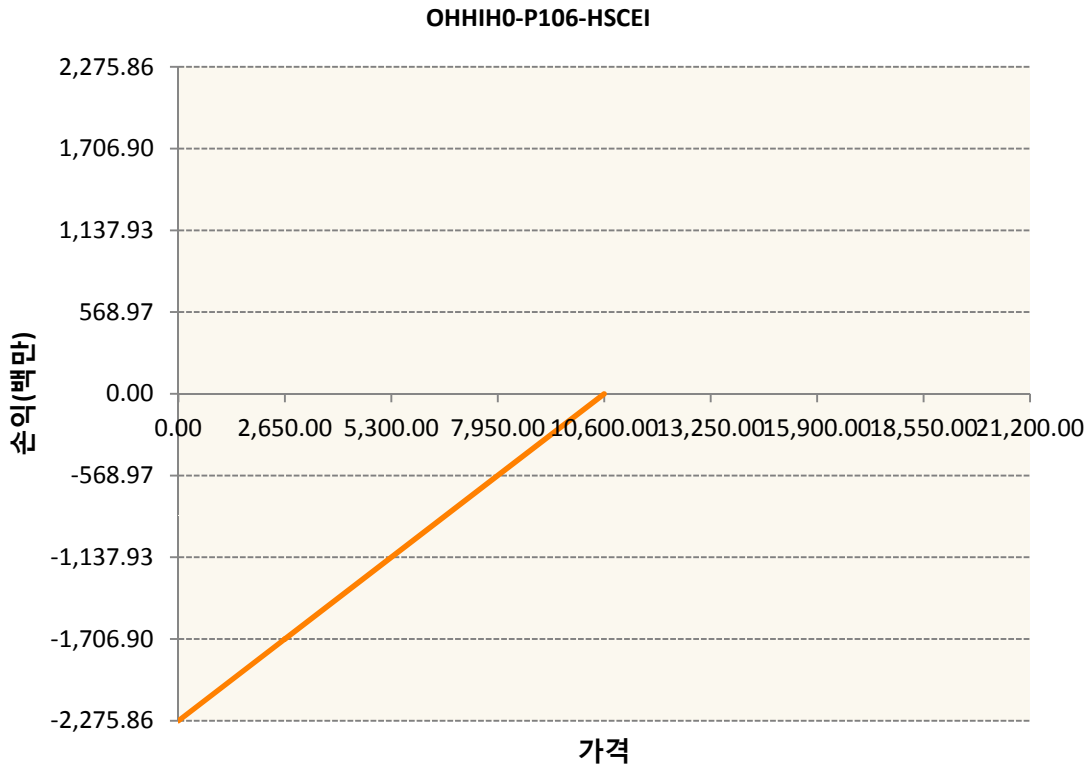
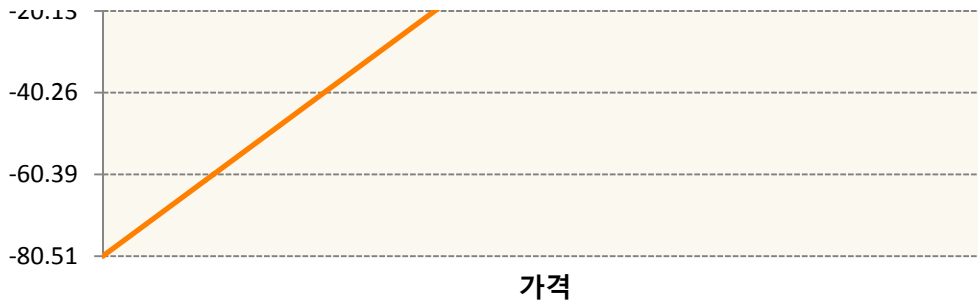


OHHIH0-C106-HSCEI



OHHIH0-P105-HSCEI





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

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

공시일	2020-03-03
기준일	2020-03-02

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

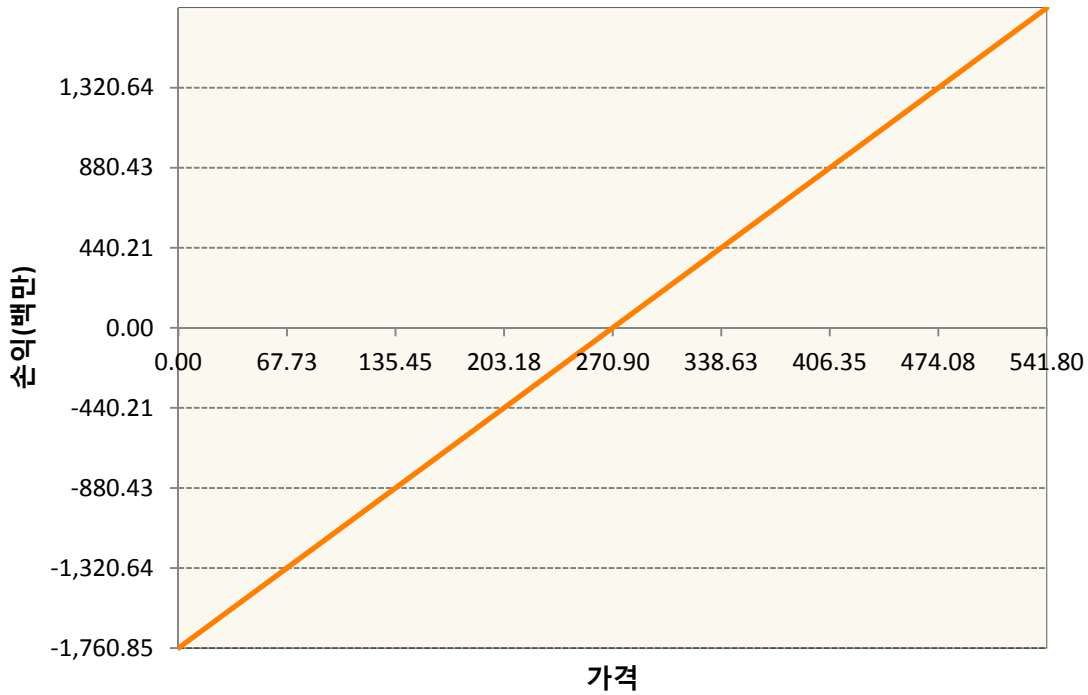
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

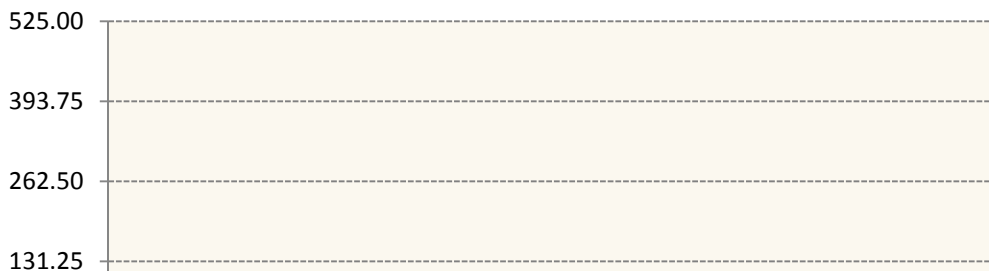
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,761	0	1,761	장내
누계	유가증권	스왑	3,125	0	3,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,612	-3,612	장내

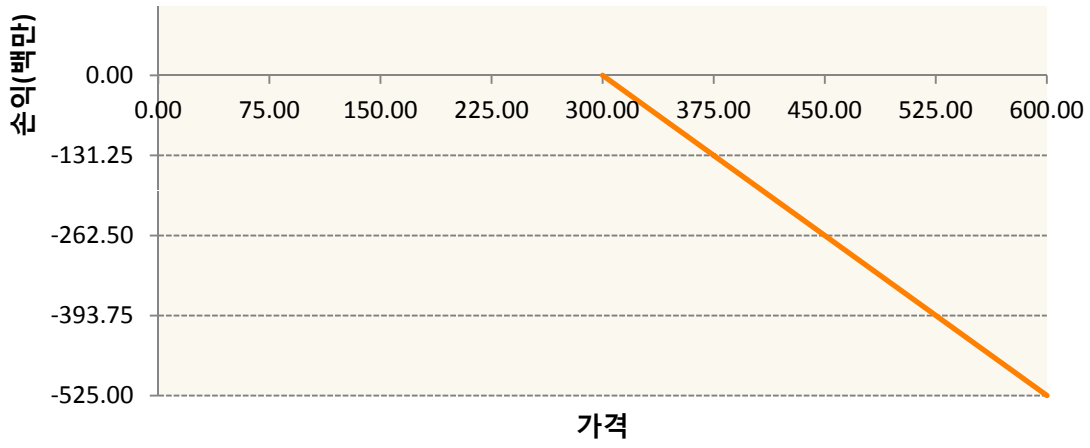
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

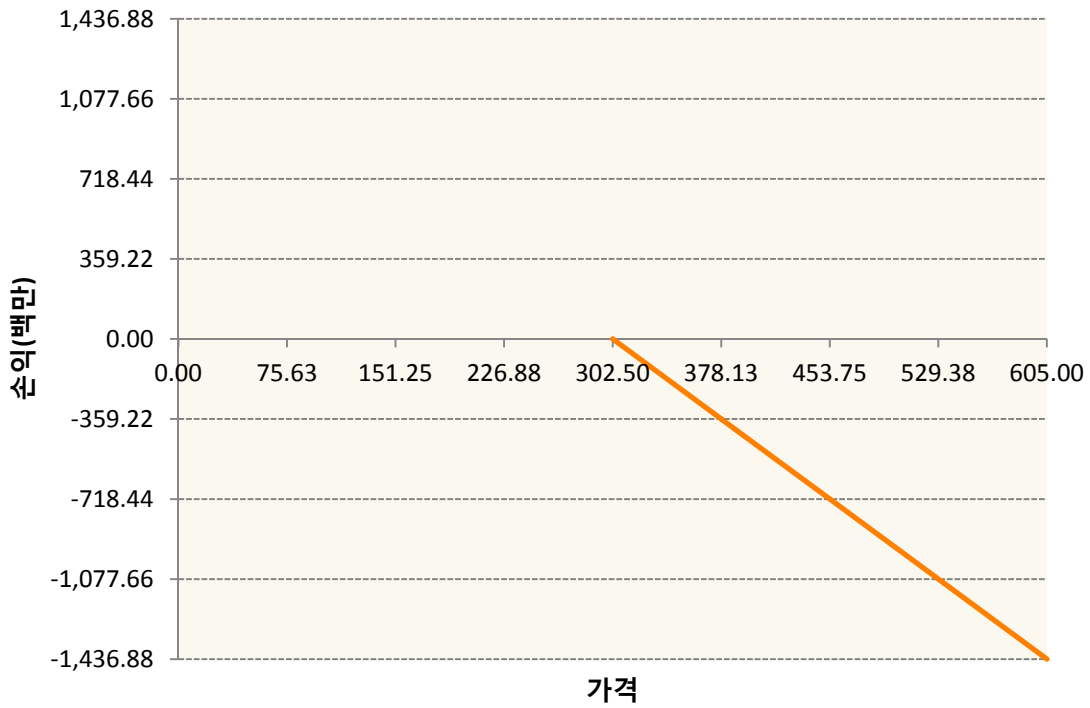


KR4201Q33007-2020-03 콜300

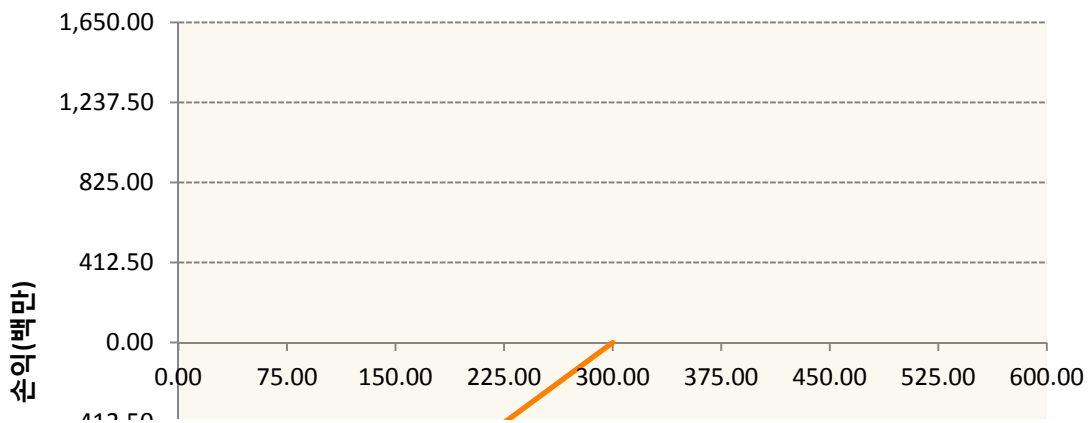




KR4201Q33023-2020-03 콜302.5



KR4301Q33005-2020-03 풋300





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						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	
KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						141
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-141	-141	-141	-141	-141	-141	-141	
-5.33%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94	
-2.67%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	47	47	47	47	47	47	47	
5.33%	94	94	94	94	94	94	94	
8.00%	141	141	141	141	141	141	141	
KR4201Q33007		2020-03 콜300						9
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1	1	1	1	1	1	0	
-5.33%	1	1	1	1	0	0	0	
-2.67%	1	1	0	0	0	0	0	
0%	0	0	0	0	0	-1	-1	
2.67%	0	0	-1	-1	-1	-2	-3	
5.33%	-1	-2	-2	-3	-4	-4	-5	
8.00%	-4	-4	-5	-6	-7	-8	-9	
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5						22
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	1	0	0
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	0	0	-1	-2	-3	-4	-6
5.33%	-2	-3	-5	-6	-8	-10	-12
8.00%	-7	-9	-12	-14	-17	-19	-22
KR4301Q33005      2020-03 풋300							118
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118
-5.33%	-78	-78	-78	-78	-78	-79	-79
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-40
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	40	39	38	38	36	35	34
5.33%	77	76	74	72	70	68	66
8.00%	110	107	105	102	100	97	94

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

(단위:백만원)

530

공시일	2020-03-03
기준일	2020-03-02

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

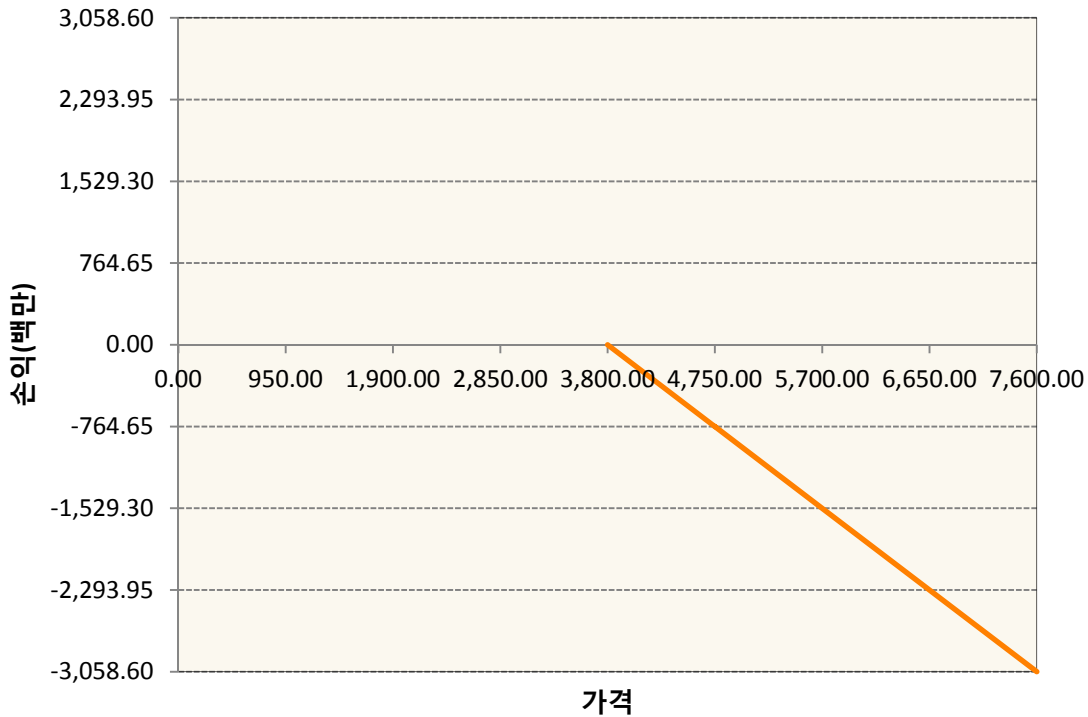
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

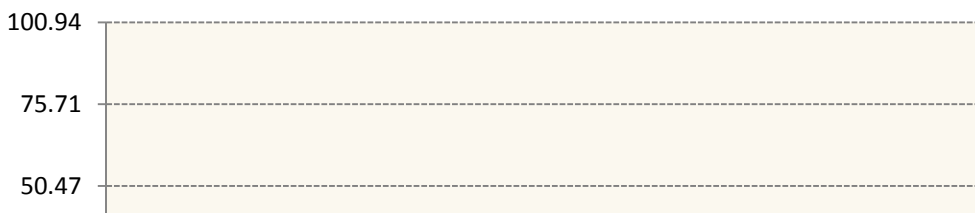
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	170	0	170	
누계	유가증권	스왑	11,877	0	11,877	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,319	-6,319	장내
누계	통화	선도	0	3,462	-3,462	장외

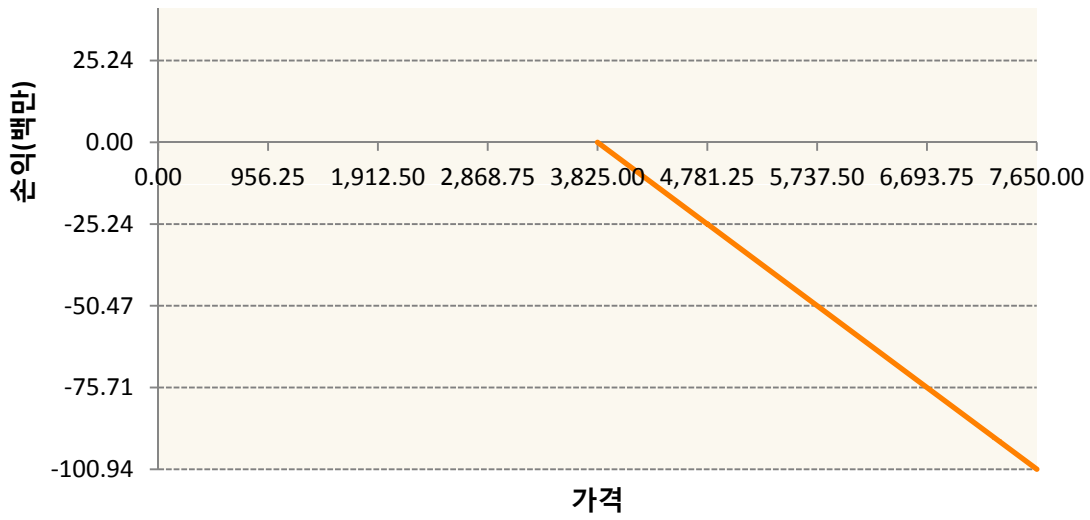
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXH0-C3800-EURO STOXX 50**

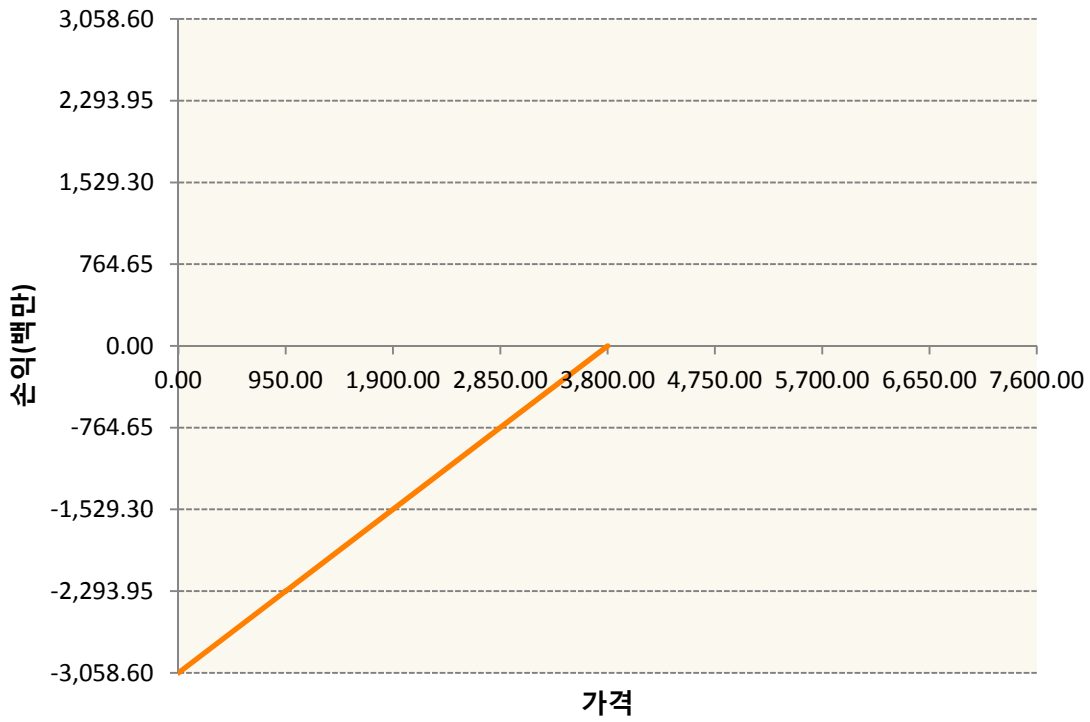


**OESXH0-C3825-EURO STOXX 50**

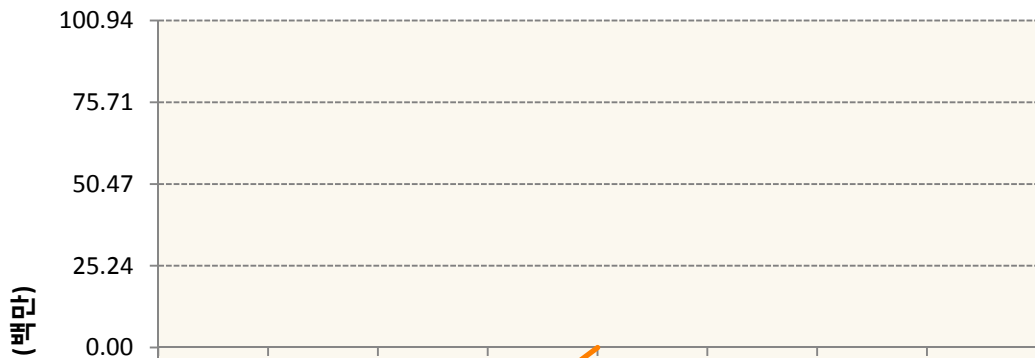


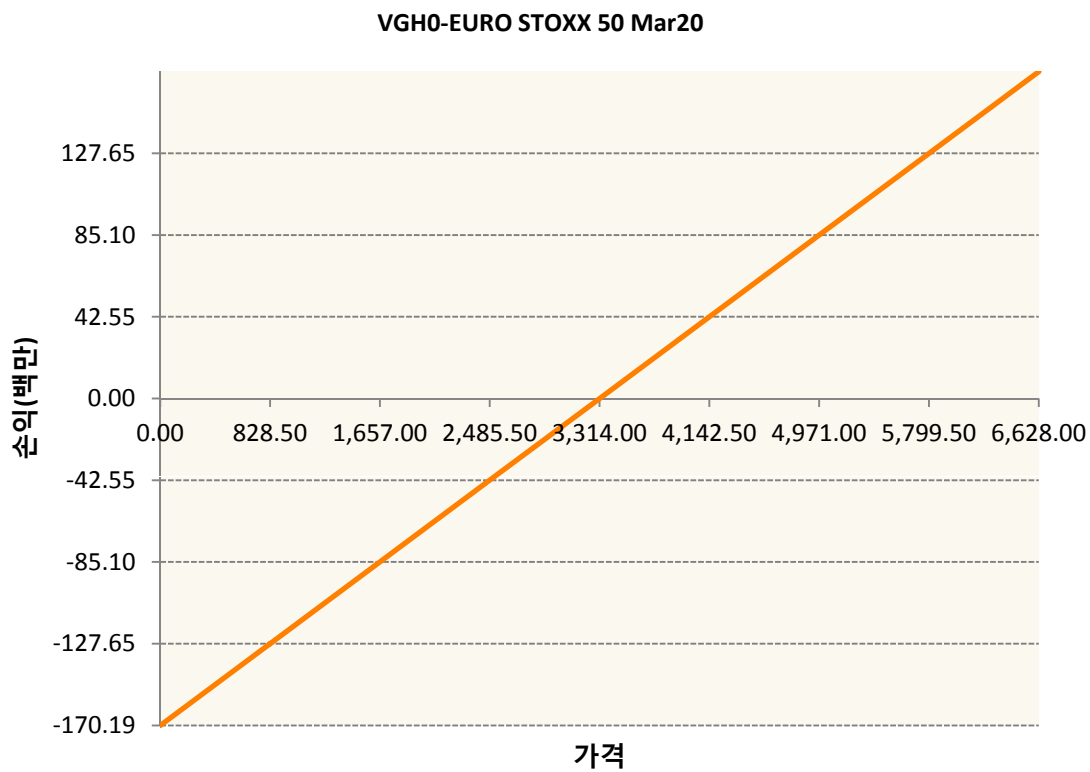
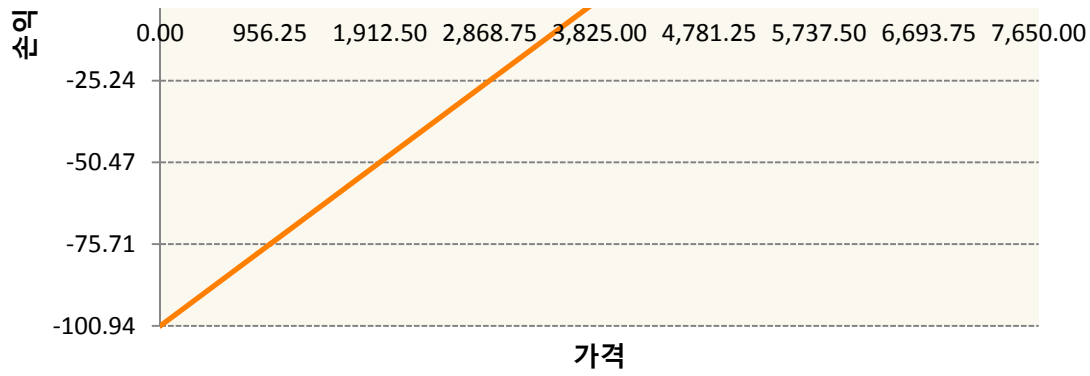


**OESXH0-P3800-EURO STOXX 50**



**OESXH0-P3825-EURO STOXX 50**





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)**

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	95
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	277
OESXH0-C3& EURO STOXX 50	245
OESXH0-C3& EURO STOXX 50	8
OESXH0-P3& EURO STOXX 50	245
OESXH0-P3& EURO STOXX 50	8
VGHO EURO STOXX 50 Mar20	14

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





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

(단위:백만원)

923

공시일	2020-03-03
기준일	2020-03-02

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

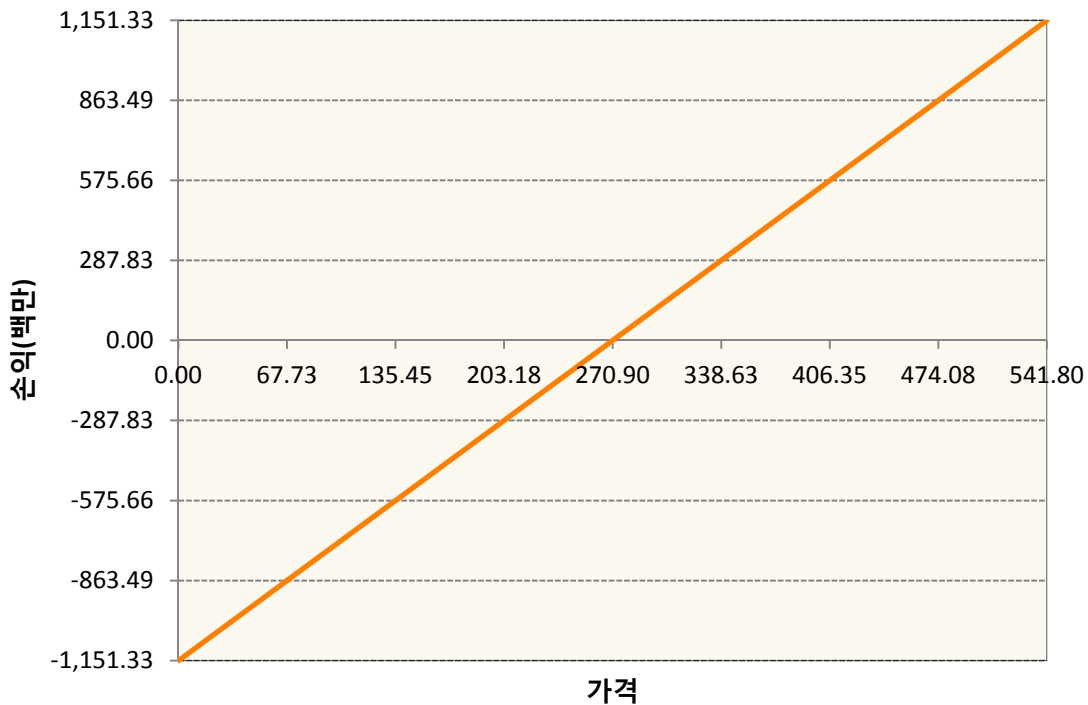
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,151	0	1,151	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						92
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92	
-5.33%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61	
-2.67%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	31	31	31	31	31	31	31	
5.33%	61	61	61	61	61	61	61	
8.00%	92	92	92	92	92	92	92	

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

(단위:백만원)

81



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

(단위:백만원)

120

공시일	2020-03-03
기준일	2020-03-02

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

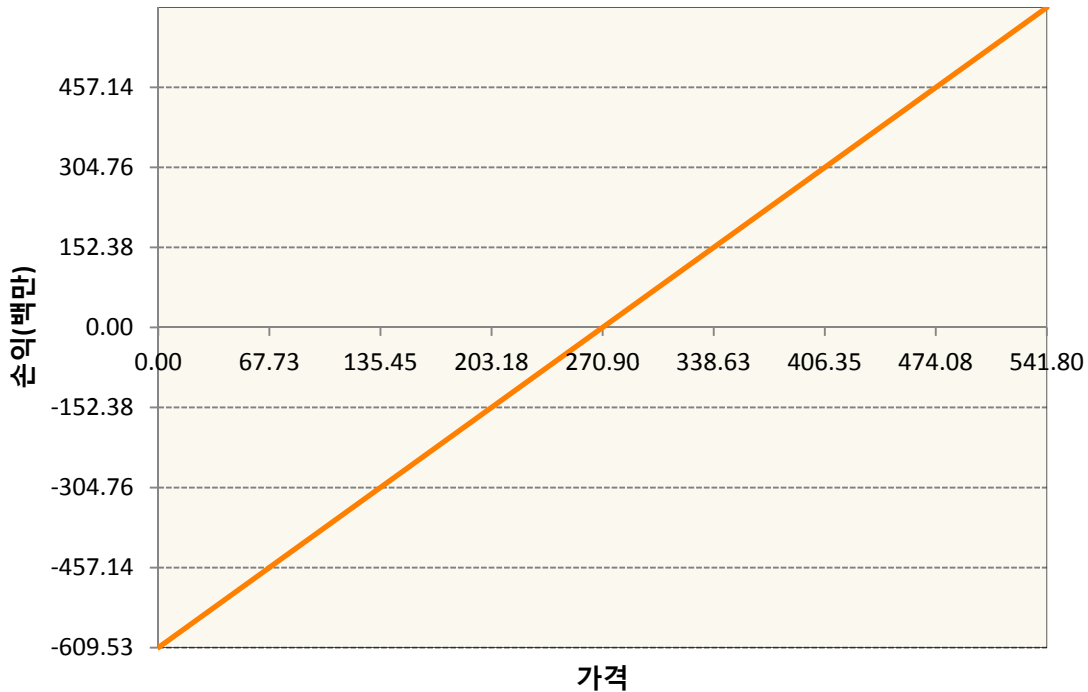
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	610	0	610	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005      2020-03 코스피200지수선물      49

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	16	16	16	16	16	16	16
5.33%	32	32	32	32	32	32	32
8.00%	49	49	49	49	49	49	49

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

(단위:백만원)

43

공시일	2020-03-03
기준일	2020-03-02

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

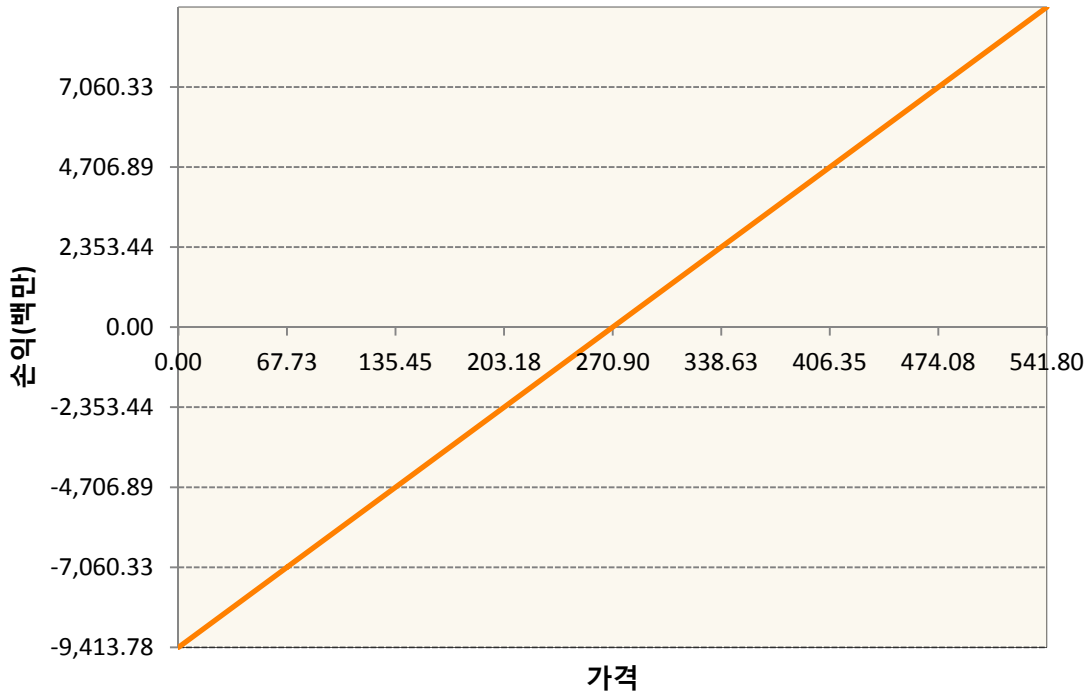
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

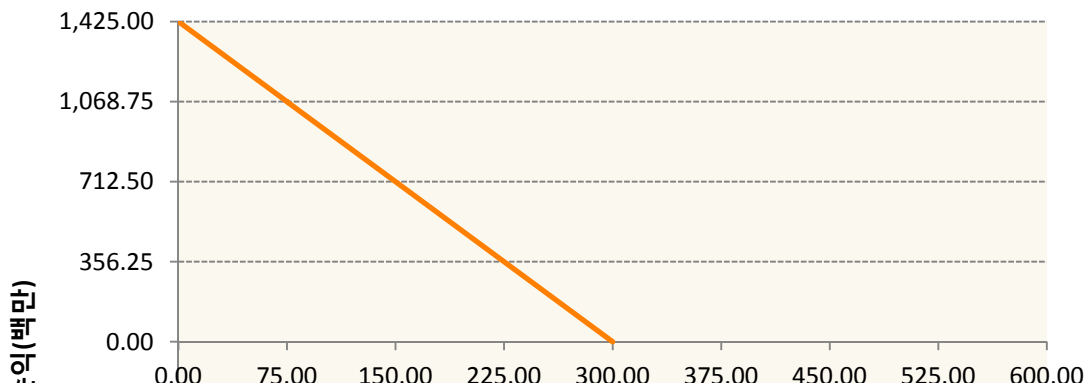
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,414	0	9,414	장내
누계	유가증권	옵션	2,257	0	2,257	장내

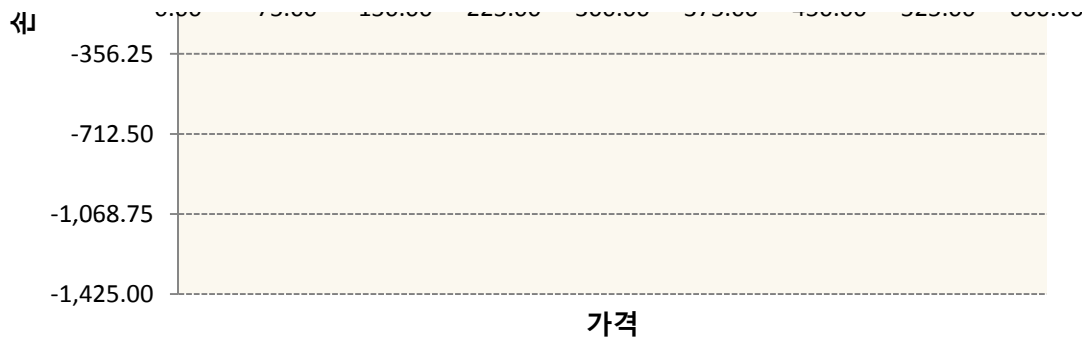
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

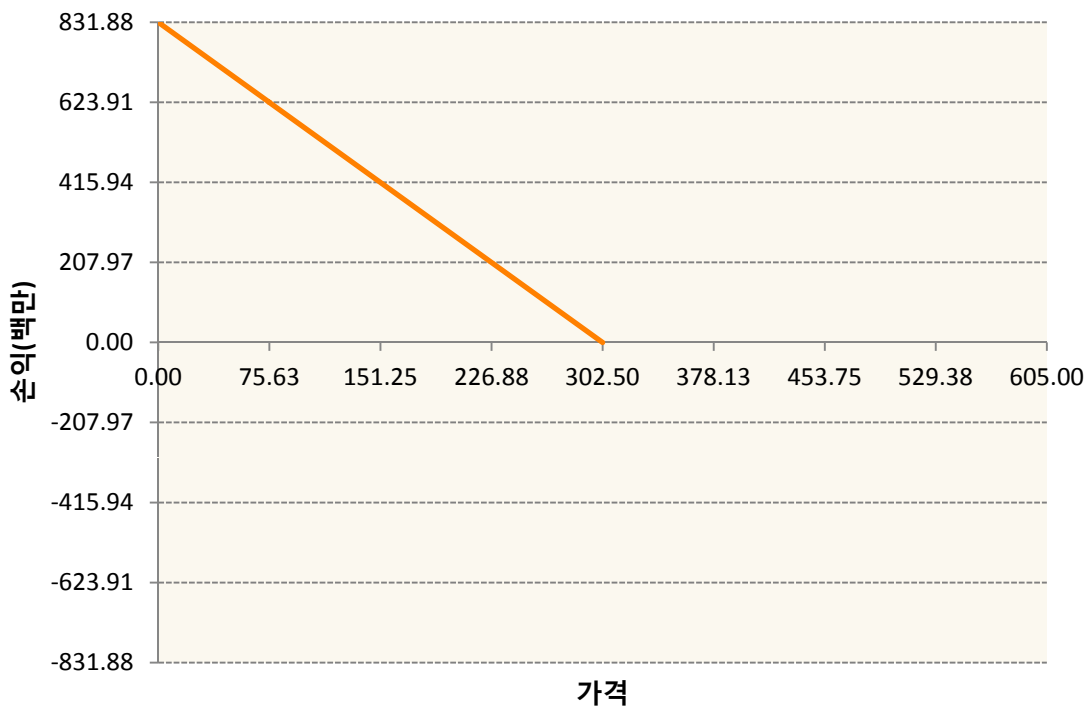


KR4301Q33005-2020-03 풋300





KR4301Q33021-2020-03 풋302.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						752
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-752	-752	-752	-752	-752	-752	-752	
-5.33%	-501	-501	-501	-501	-501	-501	-501	
-2.67%	-251	-251	-251	-251	-251	-251	-251	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	251	251	251	251	251	251	251	
5.33%	501	501	501	501	501	501	501	
8.00%	752	752	752	752	752	752	752	
KR4301Q33005		2020-03 풋300						102
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	102	102	102	102	102	102	102
-5.33%	68	68	68	68	68	68	68
-2.67%	33	33	34	34	34	34	34
0%	-1	-1	0	0	0	1	2
2.67%	-34	-34	-33	-32	-31	-30	-29
5.33%	-67	-65	-64	-62	-61	-59	-57
8.00%	-95	-93	-90	-88	-86	-84	-81

KR4301Q33021                      2020-03 풋302.5                      59

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	59	59	59	59	59	59	59
-5.33%	39	39	39	39	39	39	39
-2.67%	20	20	20	20	20	20	20
0%	0	0	0	0	0	0	1
2.67%	-20	-20	-19	-19	-19	-18	-17
5.33%	-39	-38	-38	-37	-36	-35	-34
8.00%	-56	-55	-54	-53	-52	-50	-49

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

(단위:백만원)

**822**

공시일	2020-03-03
기준일	2020-03-02

## 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	210,627	0	210,627	

### 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	2020-03-03
기준일	2020-03-02

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	7,341	-7,341	
누계	유가증권	수익증권	145,103	0	145,103	

### 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	2020-03-03
기준일	2020-03-02

## 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	522,517	0	522,517	
누계	통화	선도	5,969	519,737	-513,768	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,537
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,432
FX21020F03 KRW/USD 31-03-20E	3,056
FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E	2,865
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,578
FX21020G00 KRW/USD 06-03-20E	2,387
FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	955
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,184
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,213
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	955
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	1,910
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	3,285
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,285
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,910
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,820
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,235
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,910
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	191
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	4,870
FX21020G06 USD/KRW 31-03-20E	477

IE00BD8RGM75

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

**14,421**



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

(단위:백만원)

123

공시일	2020-03-03
기준일	2020-03-02

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

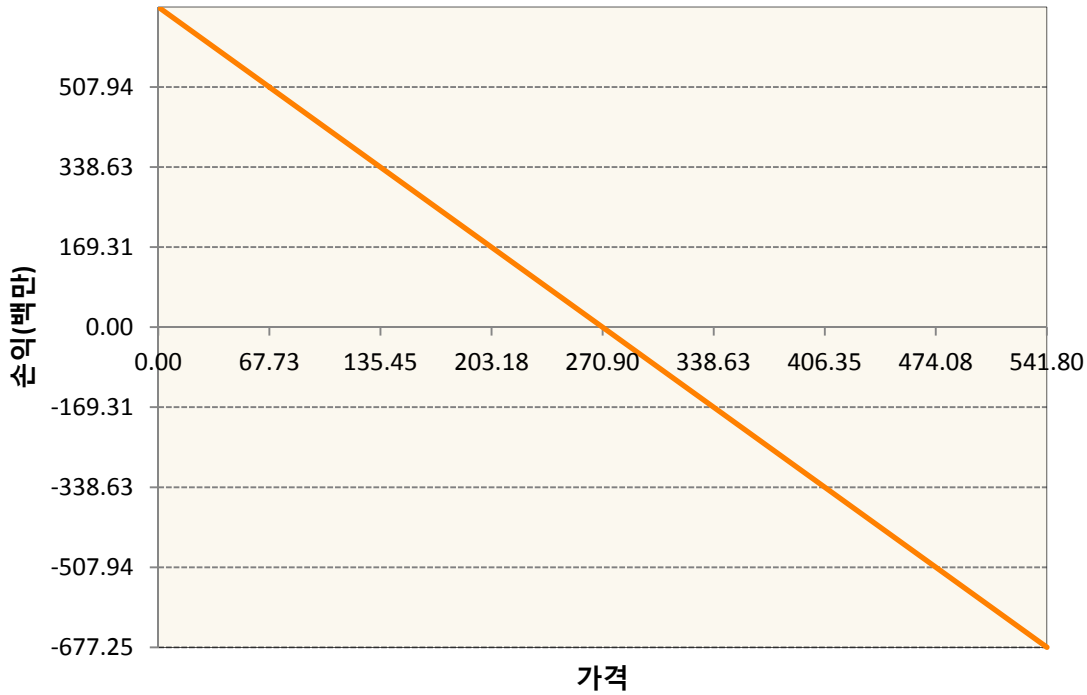
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

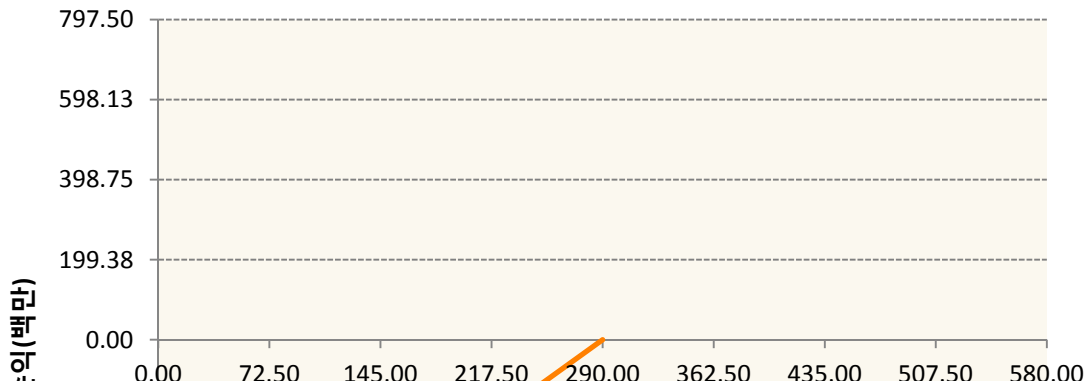
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	677	-677	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,503	-3,503	장내

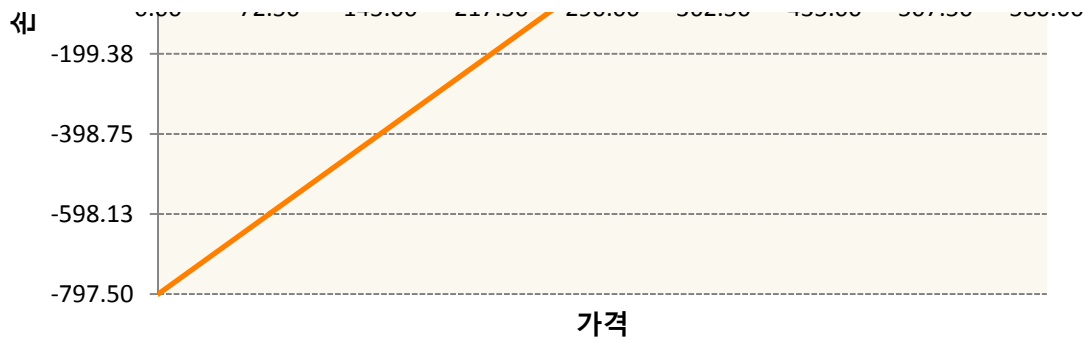
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

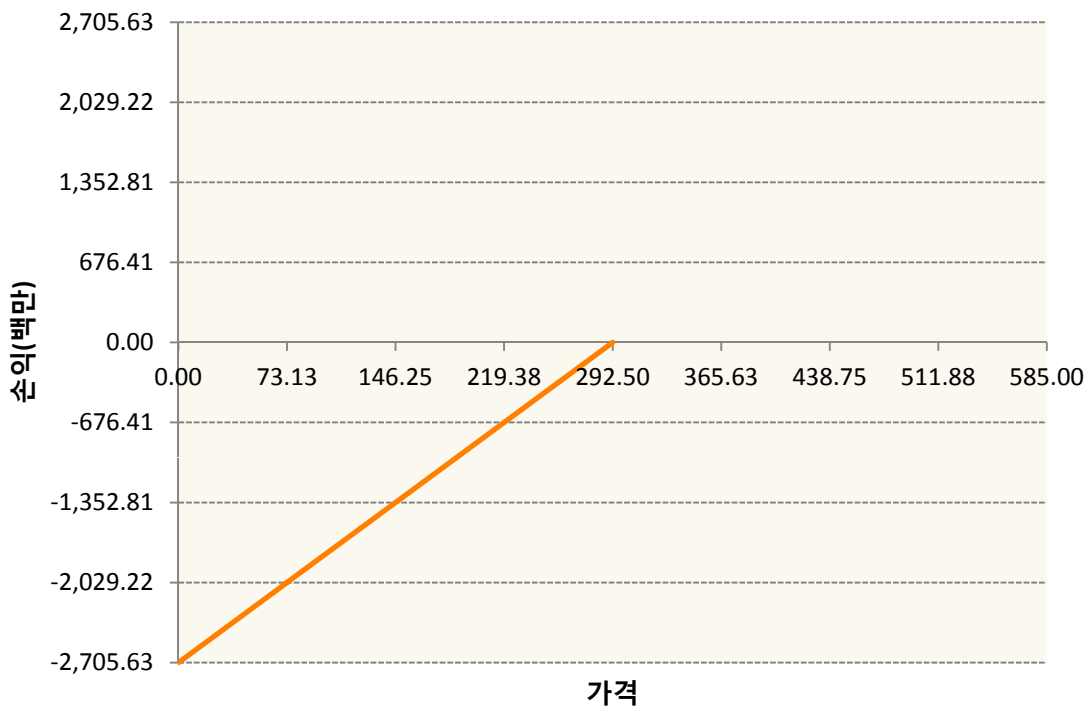


KR4301Q32908-2020-03 풋290





KR4301Q32924-2020-03 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						54
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	54	54	54	54	54	54	54	
-5.33%	36	36	36	36	36	36	36	
-2.67%	18	18	18	18	18	18	18	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	
8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54	
KR4301Q32908		2020-03 풋290						58
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-57	-57	-57	-57	-58	-58	-58
-5.33%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-19	-19	-20
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	19	19	18	17	16	15	13
5.33%	35	33	32	31	29	28	27
8.00%	46	44	43	41	40	38	37
KR4301Q32924                      2020-03 풋292.5							196
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-195	-195	-195	-195	-195	-195	-196
-5.33%	-129	-129	-129	-129	-129	-130	-130
-2.67%	-62	-62	-63	-63	-64	-65	-66
0%	4	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	66	64	61	58	55	52	48
5.33%	121	117	113	109	104	100	96
8.00%	163	158	153	148	143	138	134

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

(단위:백만원)

**313**

공시일	2020-03-03
기준일	2020-03-02

## 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	10,131	0	10,131	
누계	통화	선도	0	10,099	-10,099	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	325
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	90
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	180
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	213
IE00BD8RGM75	

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

277
-----

공시일	2020-03-03
기준일	2020-03-02

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

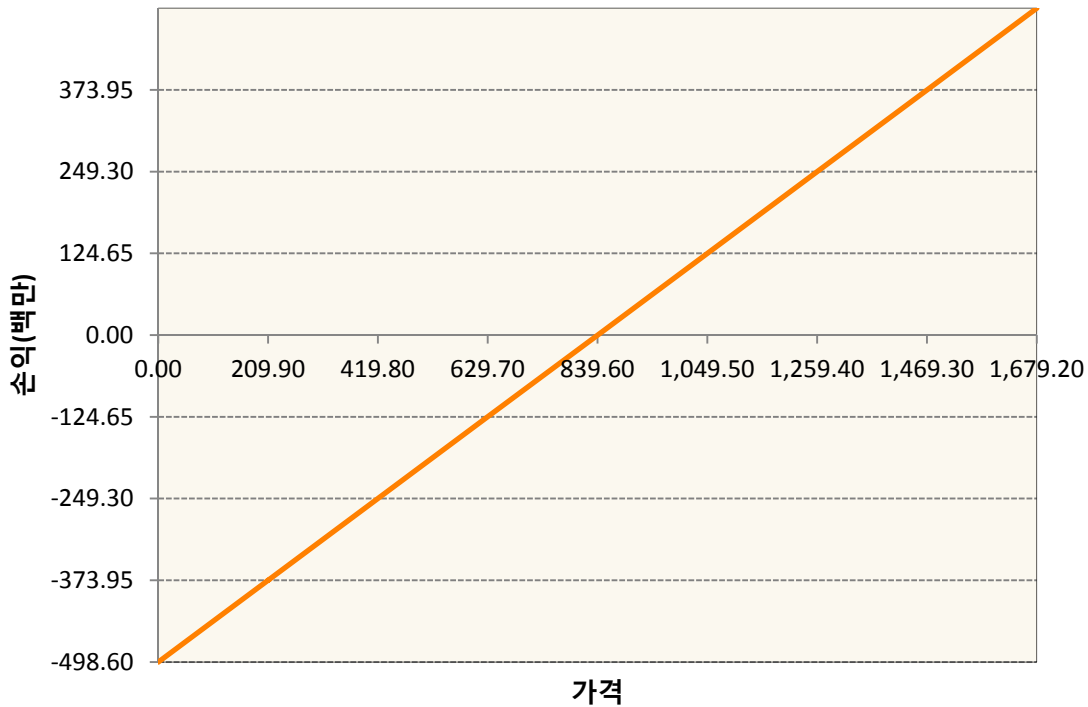
### 1. 계약금액

(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	499	0	499	
누계	유가증권	스왑	1,088	0	1,088	장외
누계	통화	선도	145	726	-581	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	40

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

(단위:백만원)

**121**

공시일	2020-03-03
기준일	2020-03-02

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

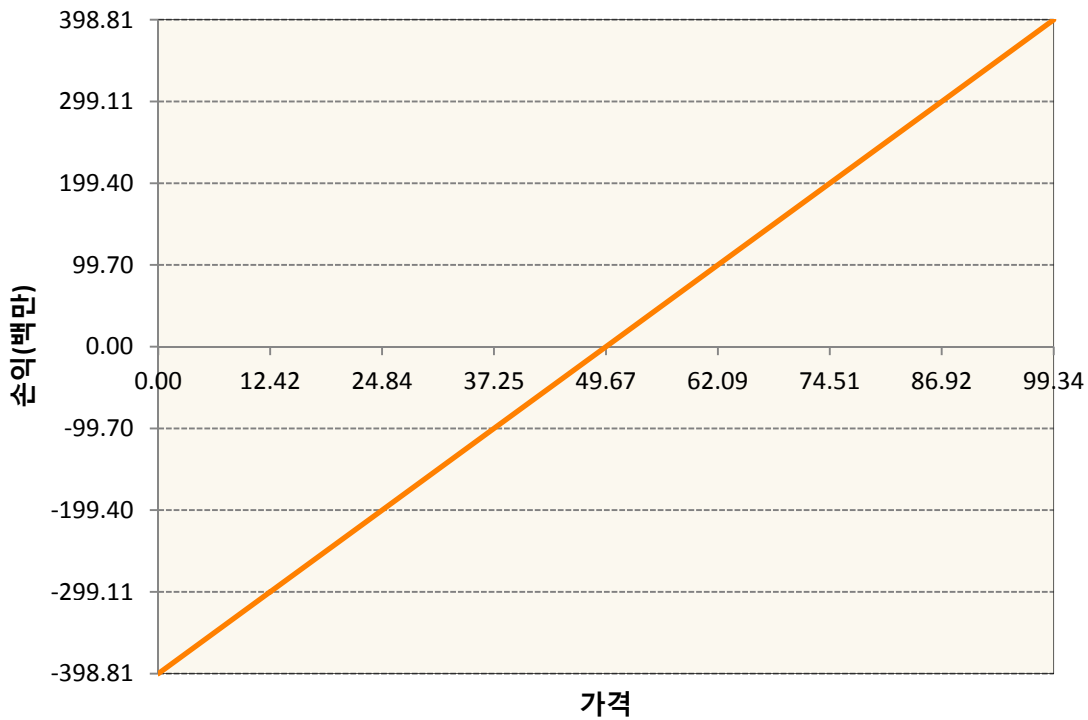
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

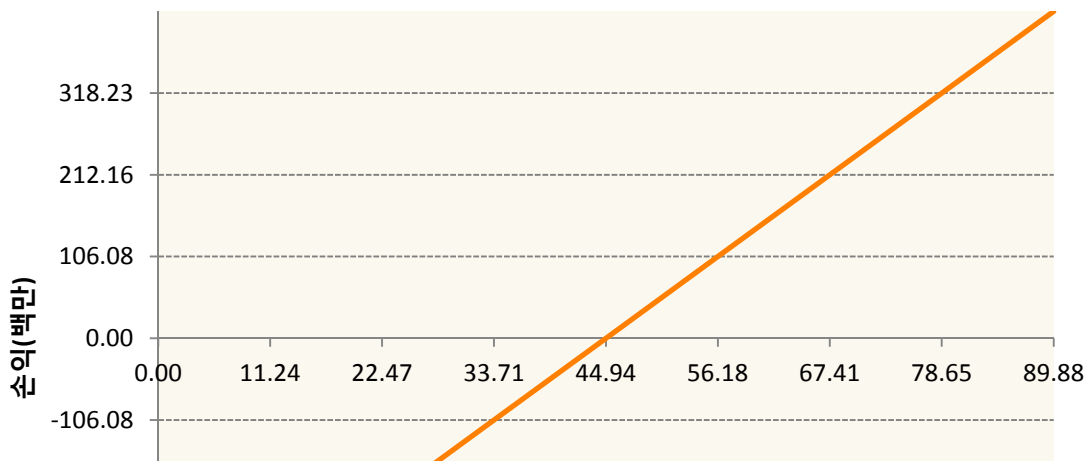
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,845	119	1,725	

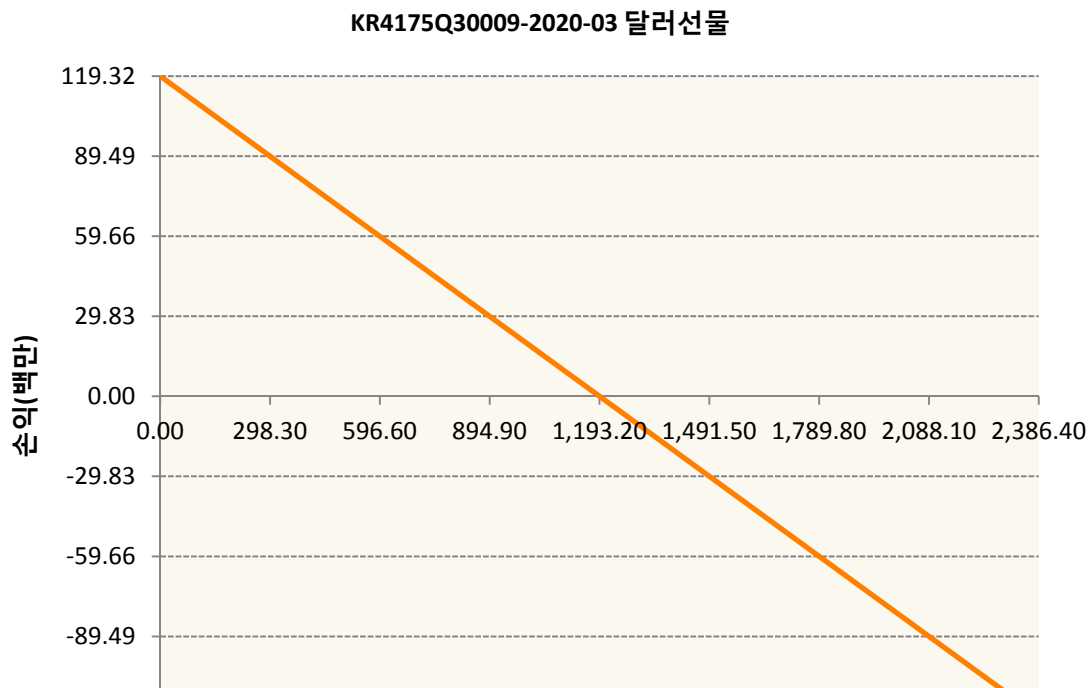
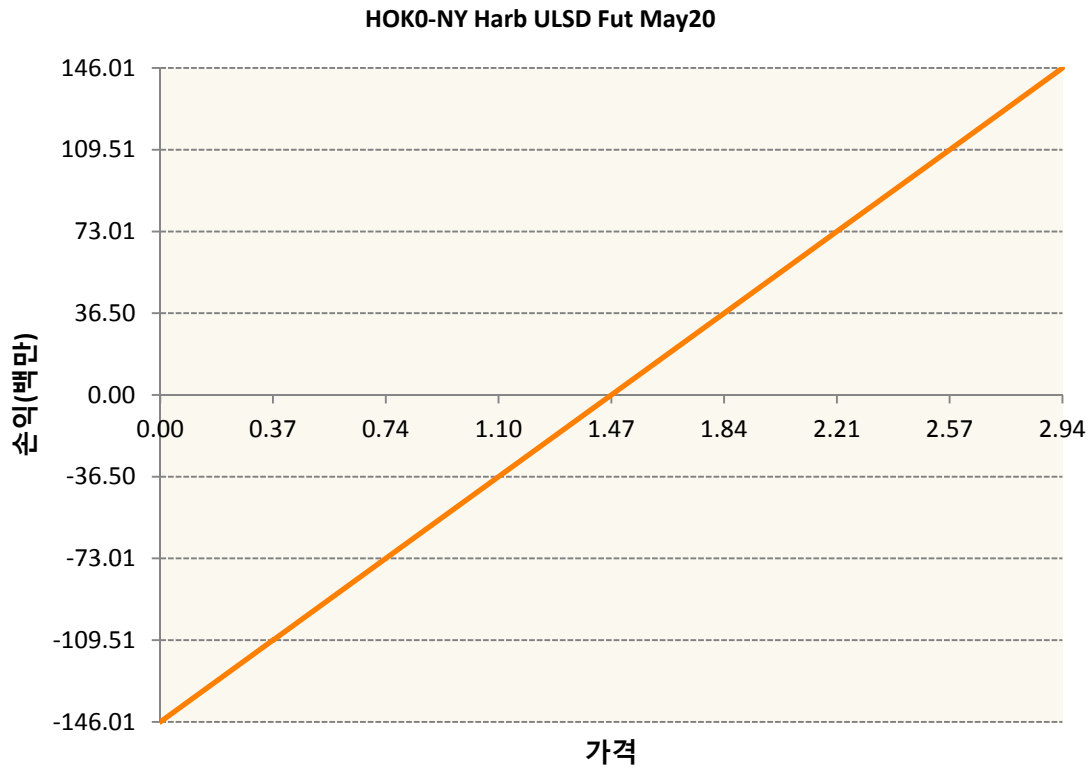
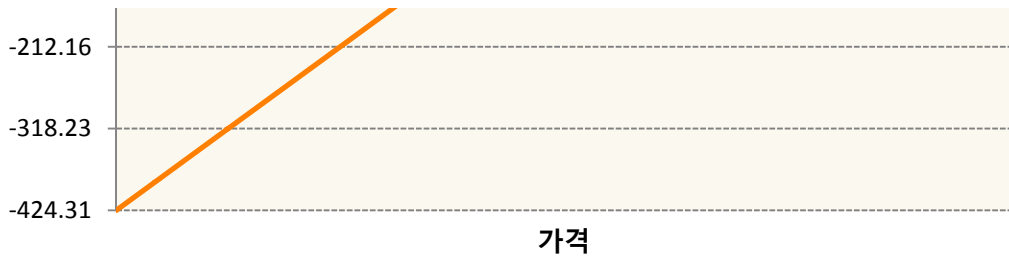
### 2. 만기시점의 손익구조

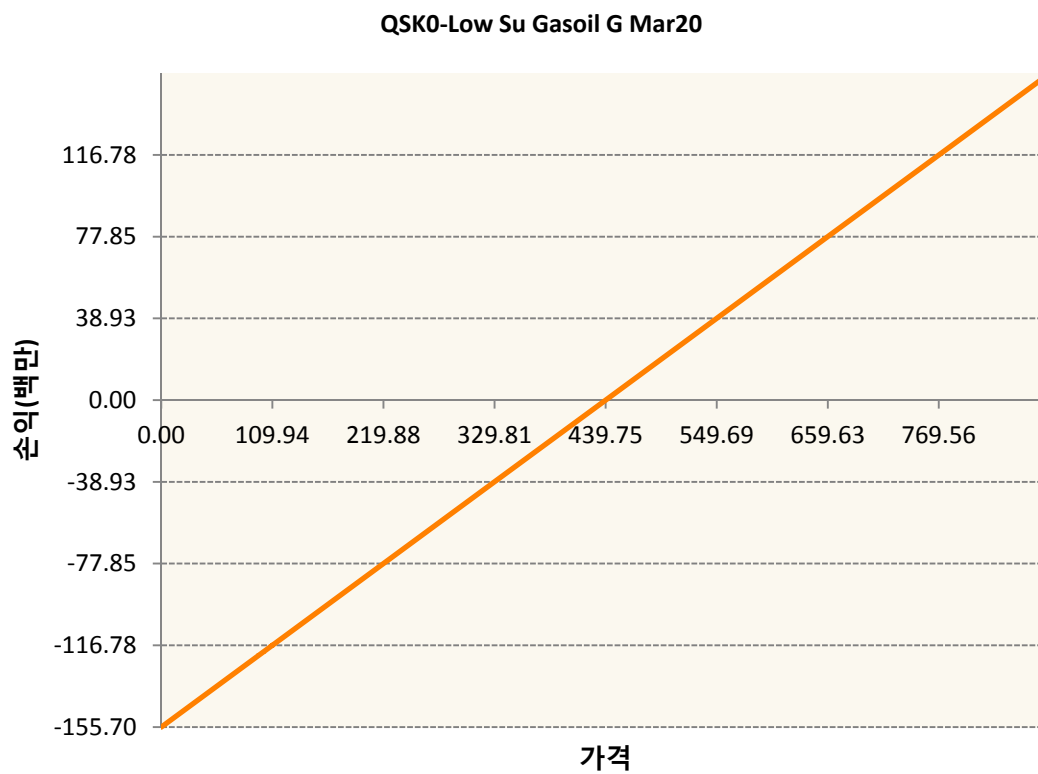
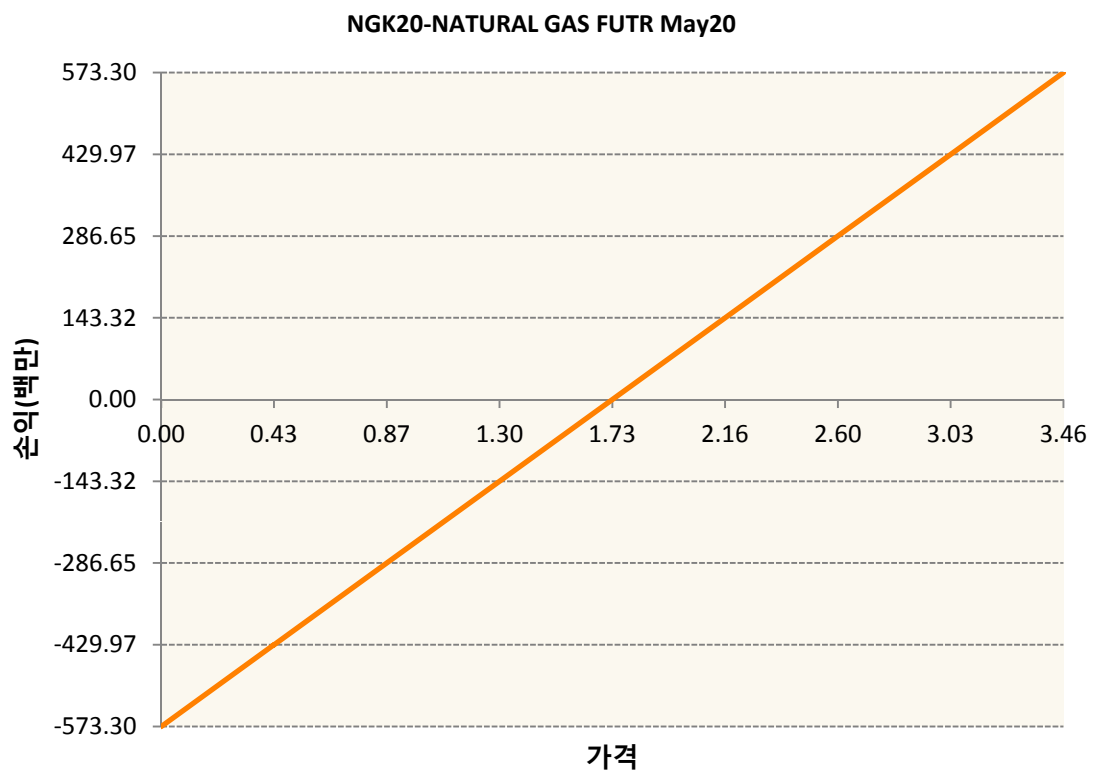
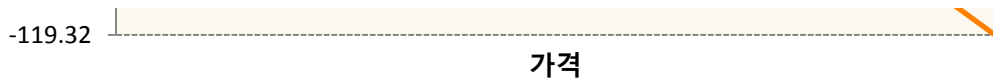
**COK0-BRENT CRUDE FUTR May20**



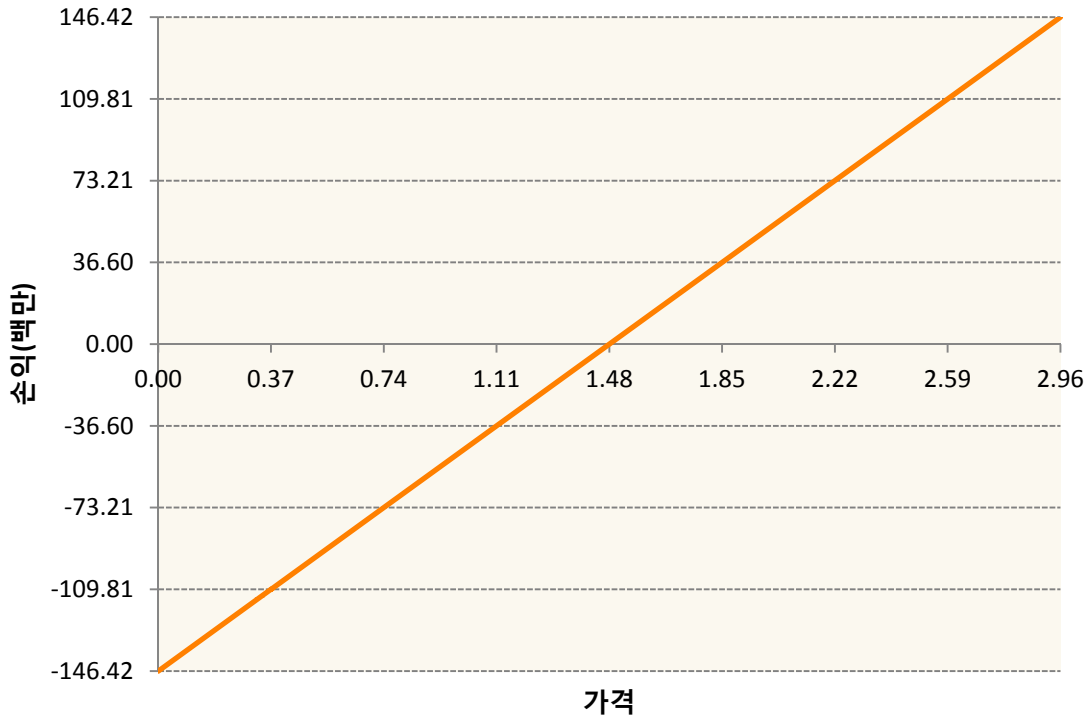
**CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20**







**XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20**



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)**

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	32
CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	34
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	12
KR4175Q30C	2020-03 달러선물	10
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	46
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	12
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	12

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

**301**

공시일	2020-03-03
기준일	2020-03-02

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

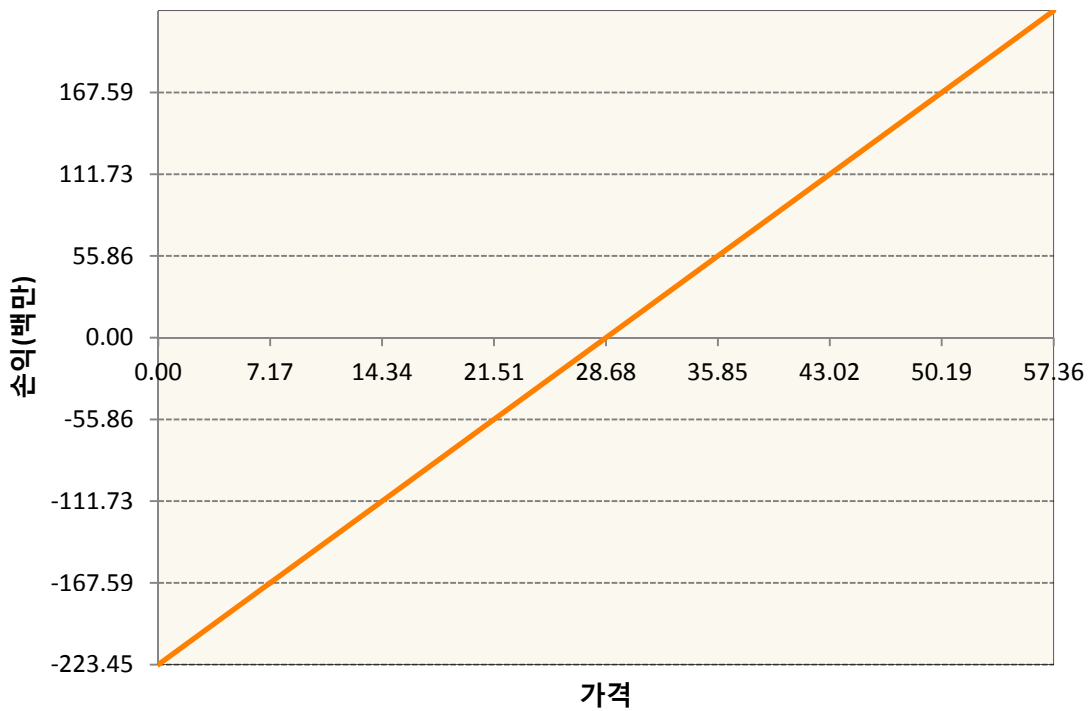
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

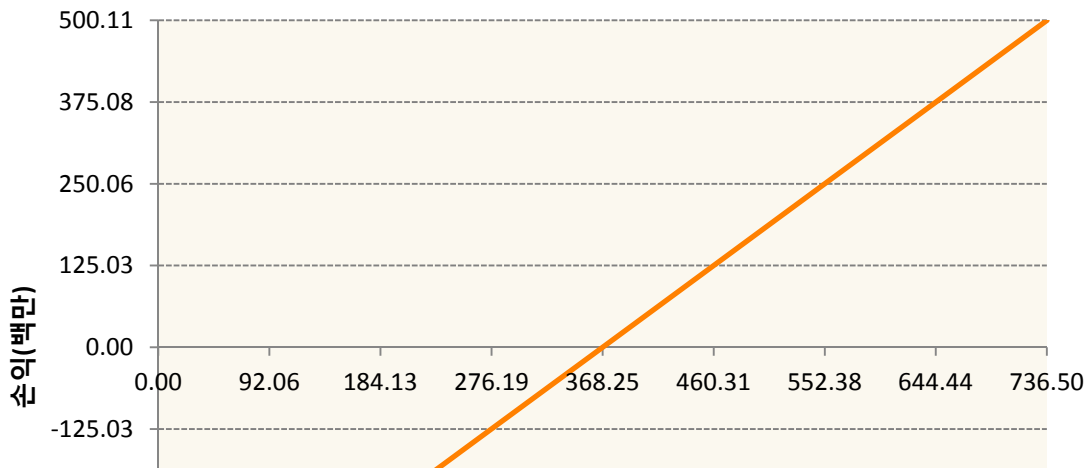
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,572	155	2,417	

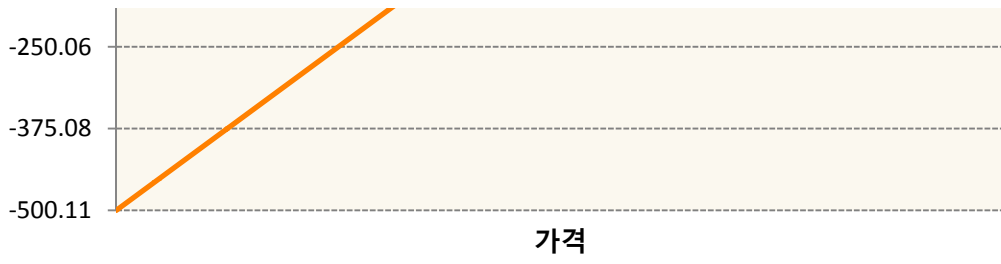
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20**

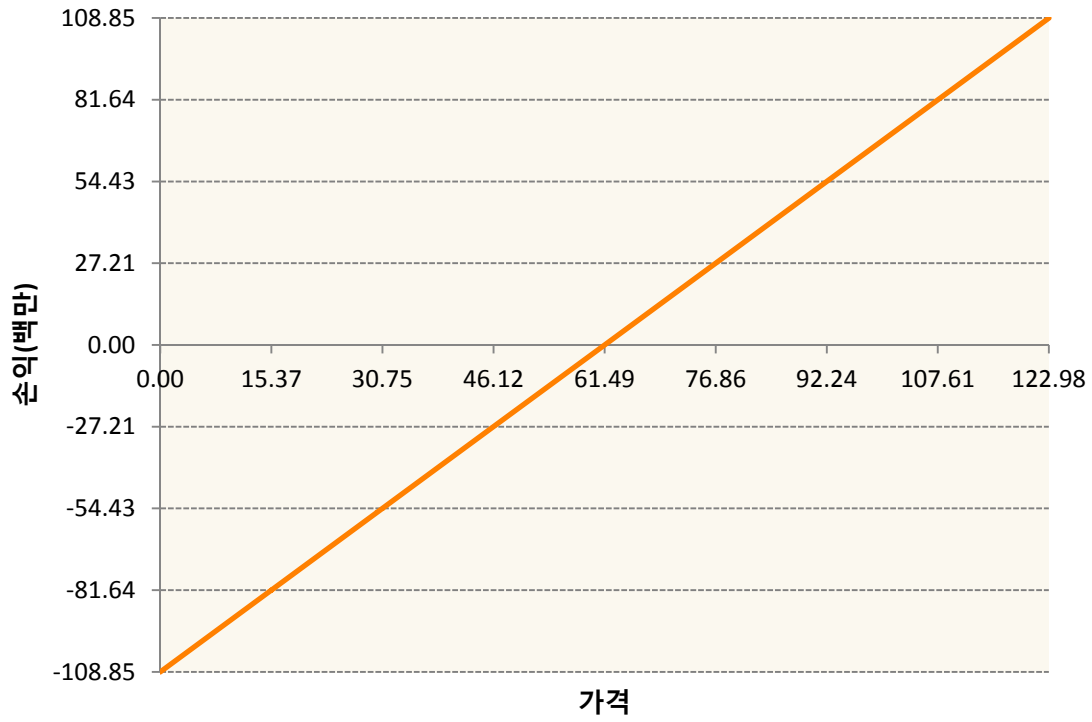


**CK0-CORN FUTURE May20**

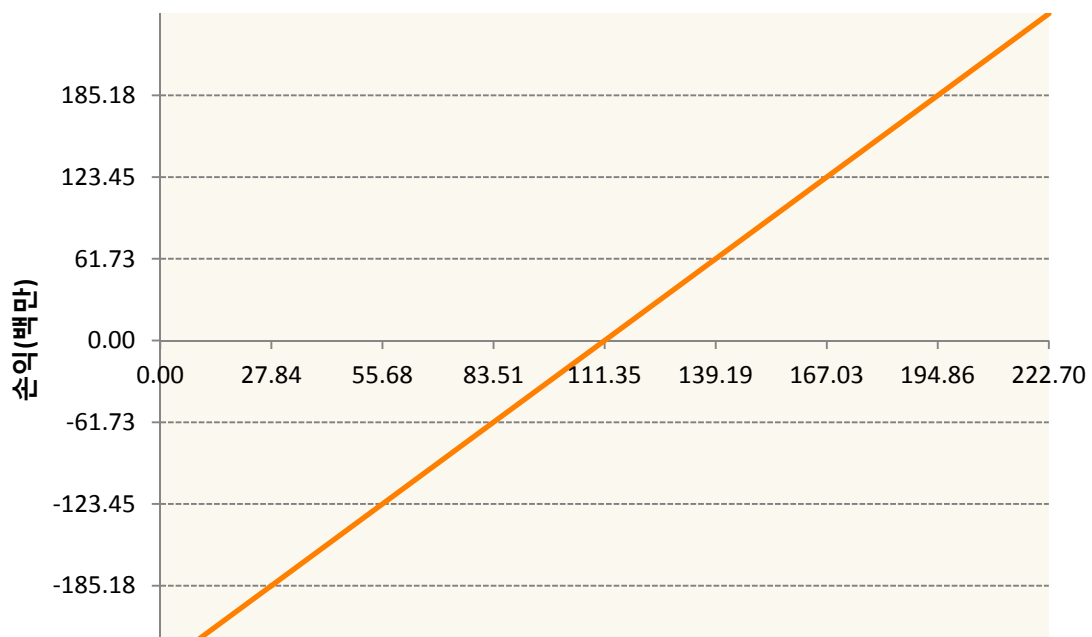


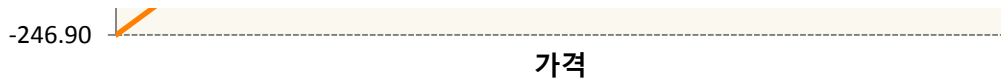


CTK0-COTTON NO.2 FUTR May20

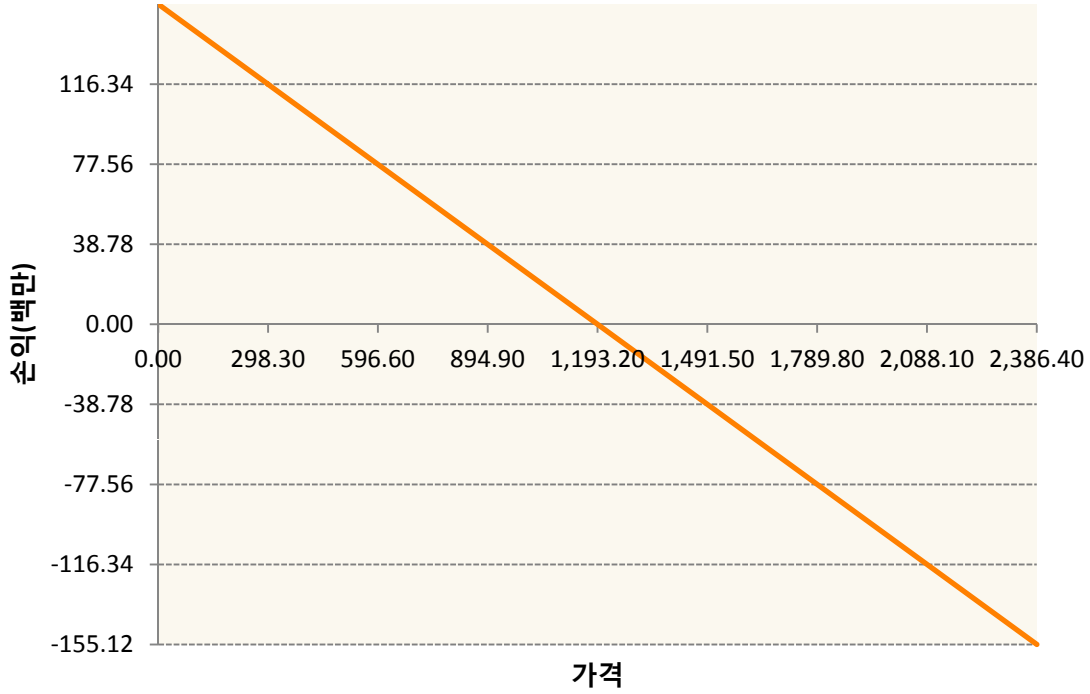


KCK0-COFFEE 'C' FUTURE May20

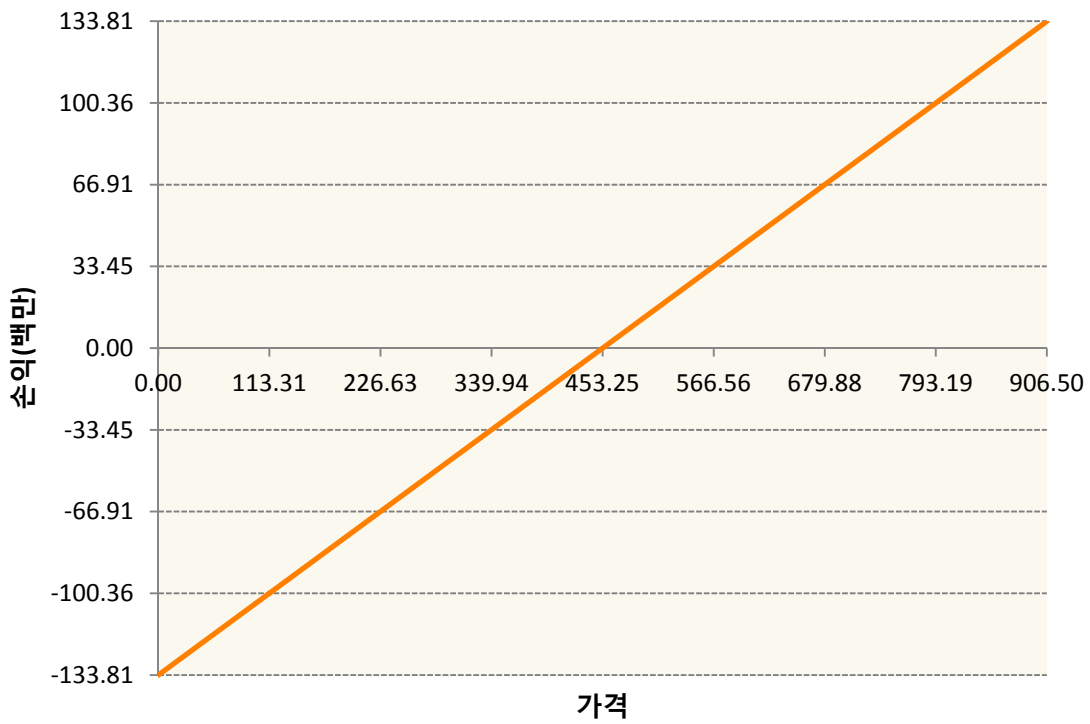




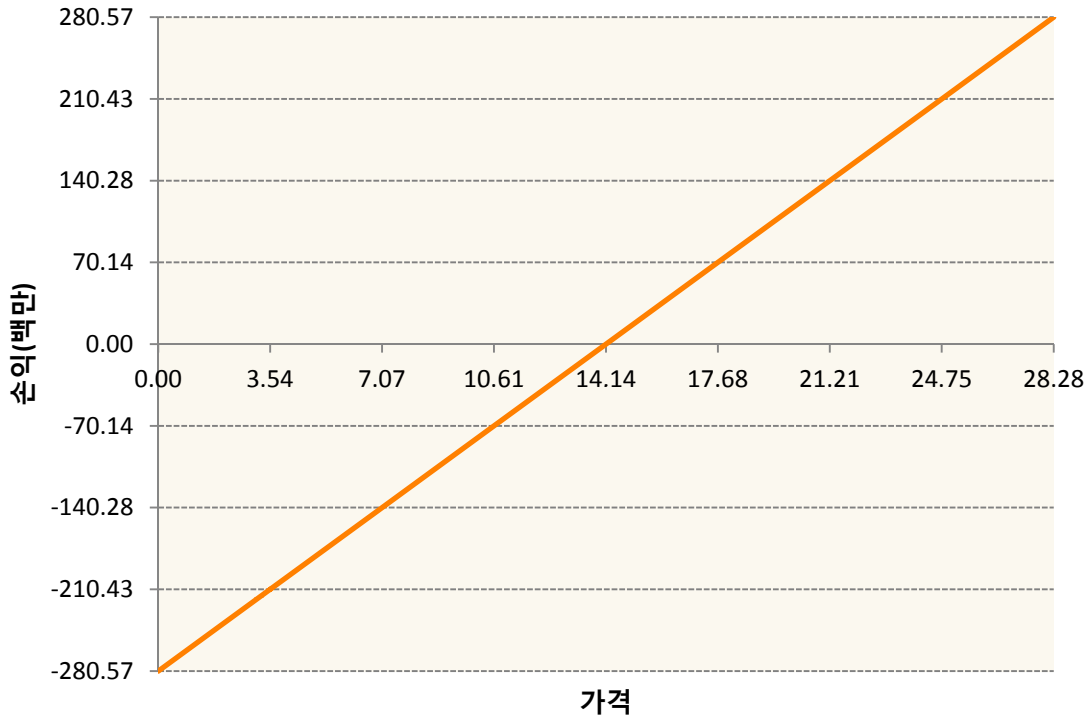
KR4175Q30009-2020-03 달러선물



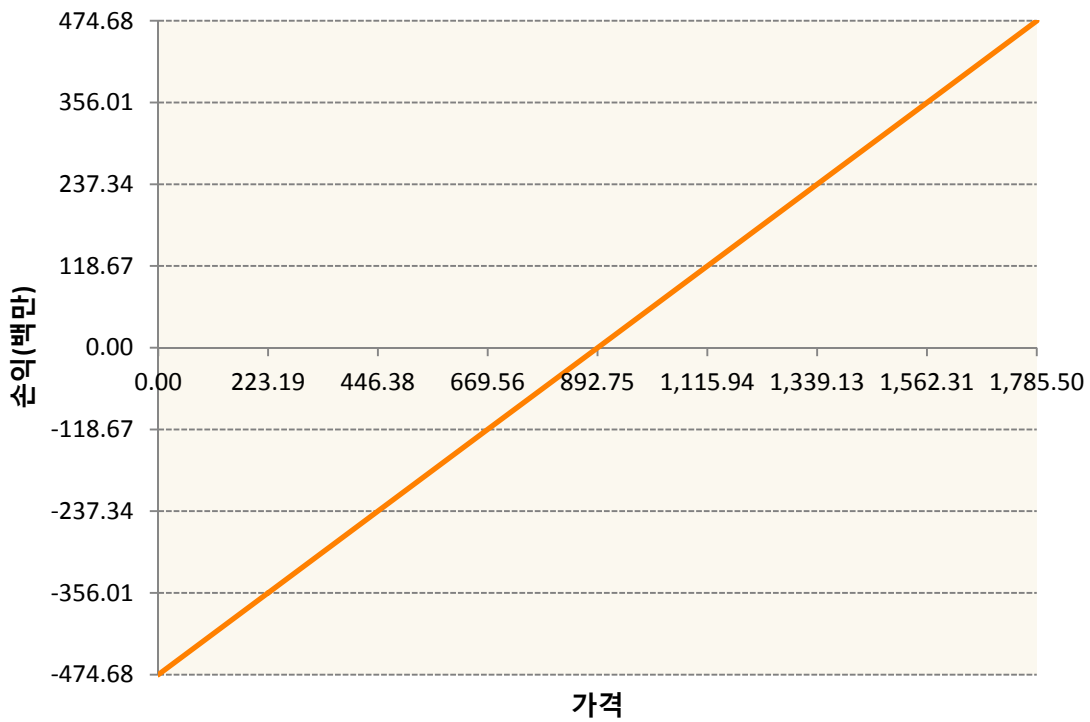
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



SBK0-Sugar May20

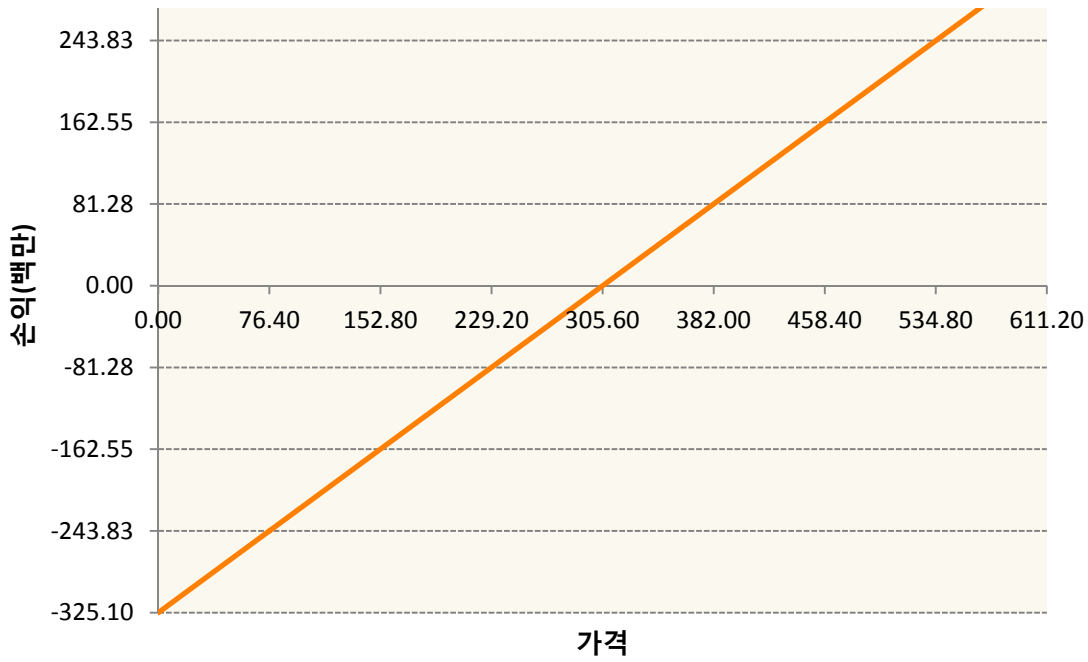


SK0-SOYBEAN FUTURE May20

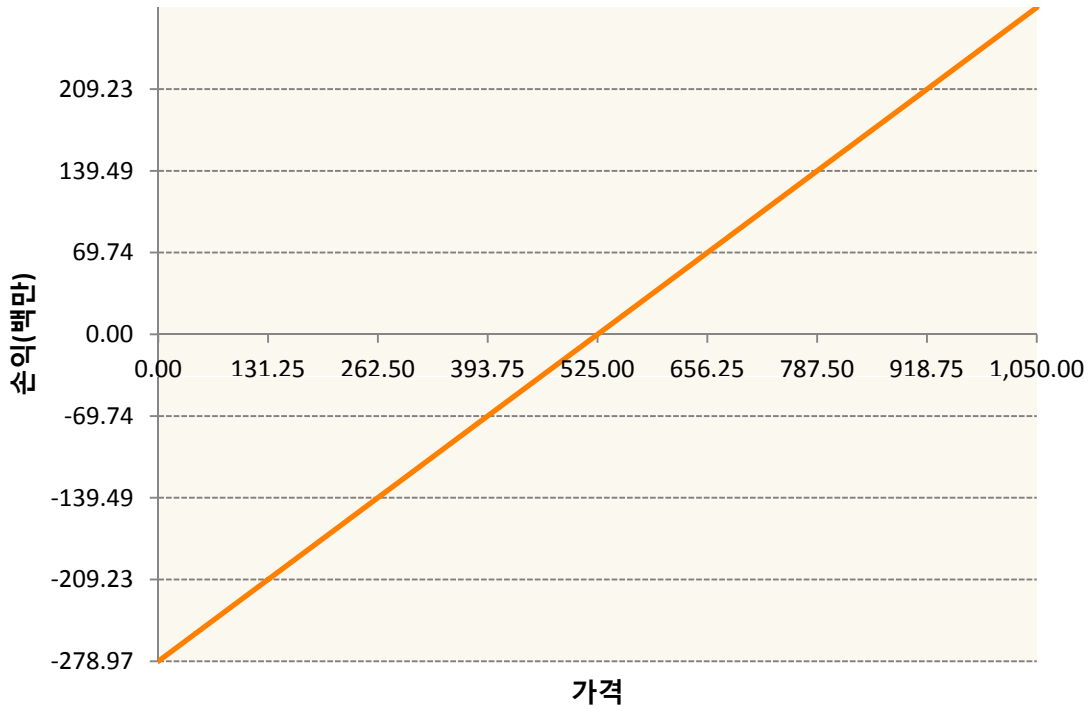


SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





WK0-WHEAT FUTURE(CBT) May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	18
CK0	CORN FUTURE May20	40
CTK0	COTTON NO.2 FUTR May20	9
KCK0	COFFEE 'C' FUTURE May20	20
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)

**224**