

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-03-09 |
| 기준일 | 2020-03-06 |

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 | 2020-03-09 |
| 기준일 | 2020-03-06 |

스마트인덱스모

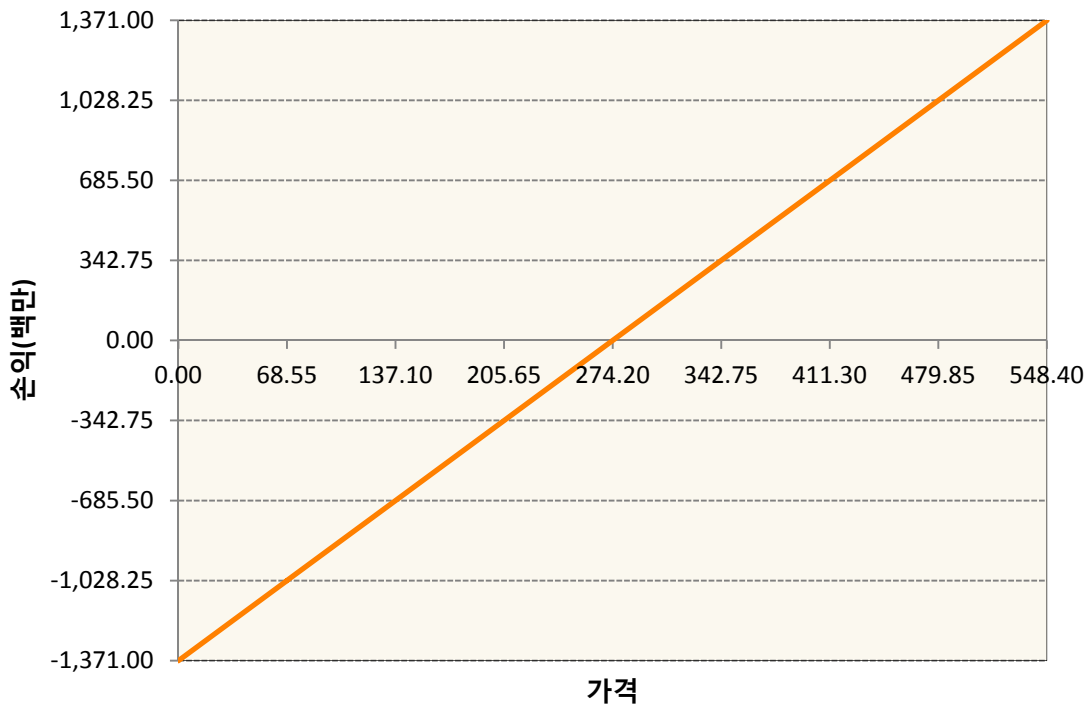
1. 계약금액

(단위:백만원)

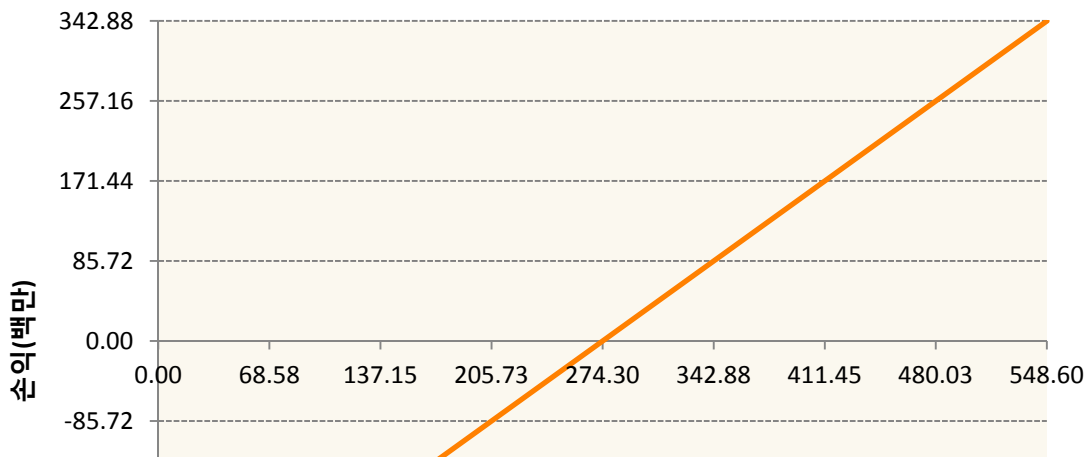
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,714 | 0 | 1,714 | 장내 |

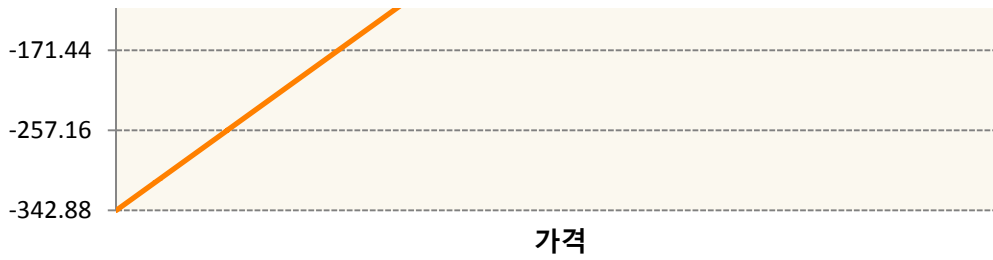
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101Q30005 | | 2020-03 코스피200지수선물 | | | | | | 110 |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -110 | -110 | -110 | -110 | -110 | -110 | -110 | |
| -5.33% | -73 | -73 | -73 | -73 | -73 | -73 | -73 | |
| -2.67% | -37 | -37 | -37 | -37 | -37 | -37 | -37 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 37 | 37 | 37 | 37 | 37 | 37 | 37 | |
| 5.33% | 73 | 73 | 73 | 73 | 73 | 73 | 73 | |
| 8.00% | 110 | 110 | 110 | 110 | 110 | 110 | 110 | |
| KR4101Q60002 | | 2020-06 코스피200지수선물 | | | | | | 28 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -28 | -28 | -28 | -28 | -28 | -28 | -28 | |
| -5.33% | -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% | 28 | 28 | 28 | 28 | 28 | 28 | 28 | |

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

124

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-03-09 |
| 기준일 | 2020-03-06 |

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

1,057

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

680

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-03-09 |
| 기준일 | 2020-03-06 |

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) | 449 |
| SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2) | 164 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|------------|
| 953 |
|------------|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-03-09 |
| 기준일 | 2020-03-06 |

유로인덱스모(주식-파생형)

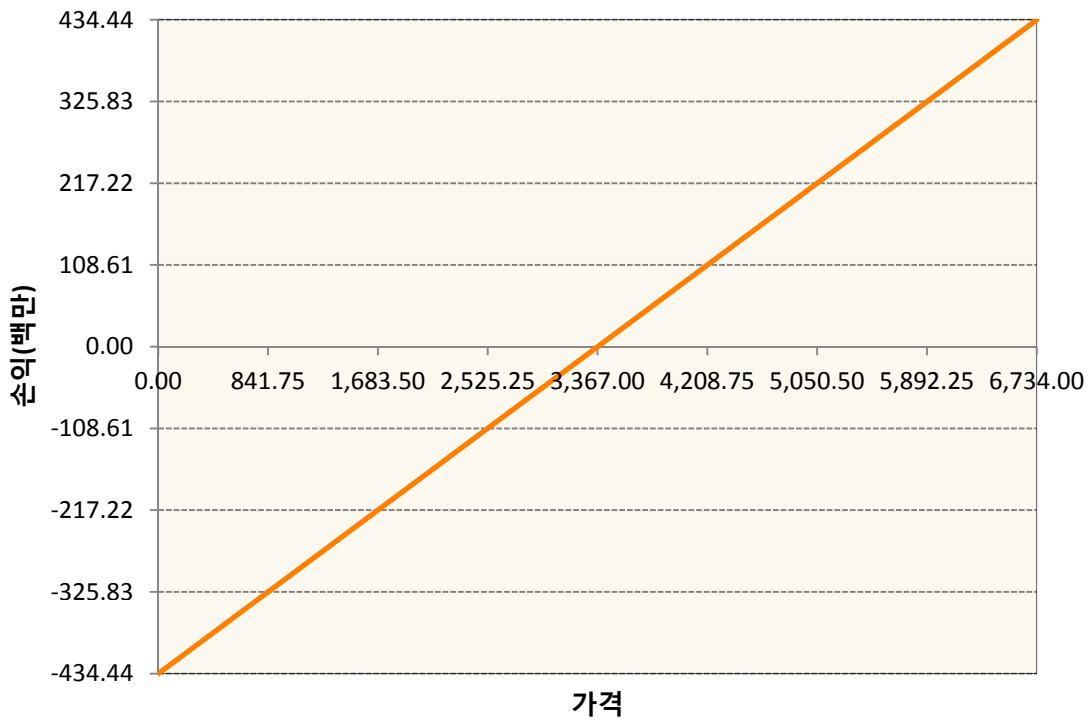
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 434 | 0 | 434 | |

2. 만기시점의 손익구조

VGH0-EURO STOXX 50 Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

| |
|----|
| 26 |
|----|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-03-09 |
| 기준일 | 2020-03-06 |

차이나인덱스모(주식-파생형)

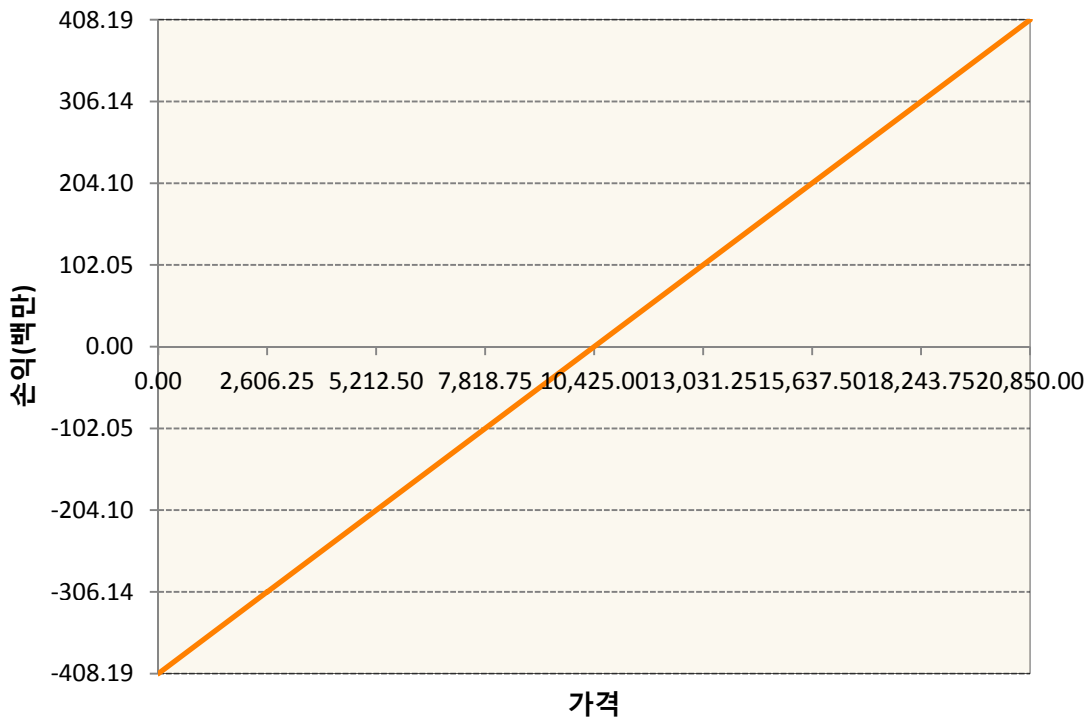
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 408 | 0 | 408 | 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 | 2020-03-09 |
| 기준일 | 2020-03-06 |

커버드콜모(주식혼합-파생형)

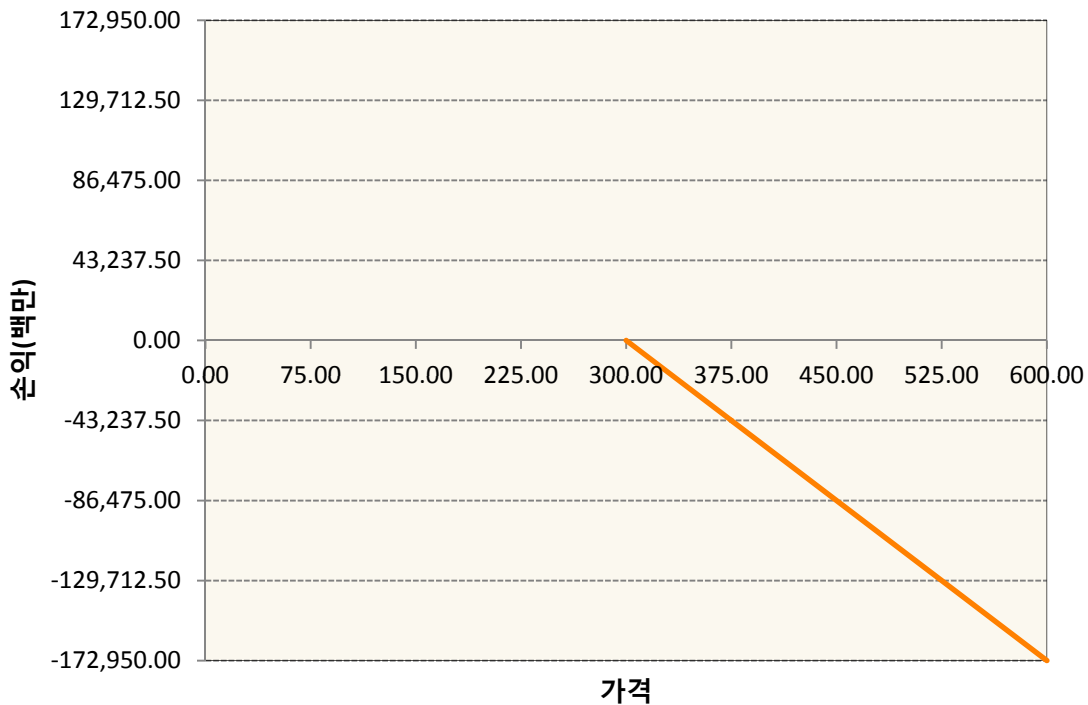
1. 계약금액

(단위:백만원)

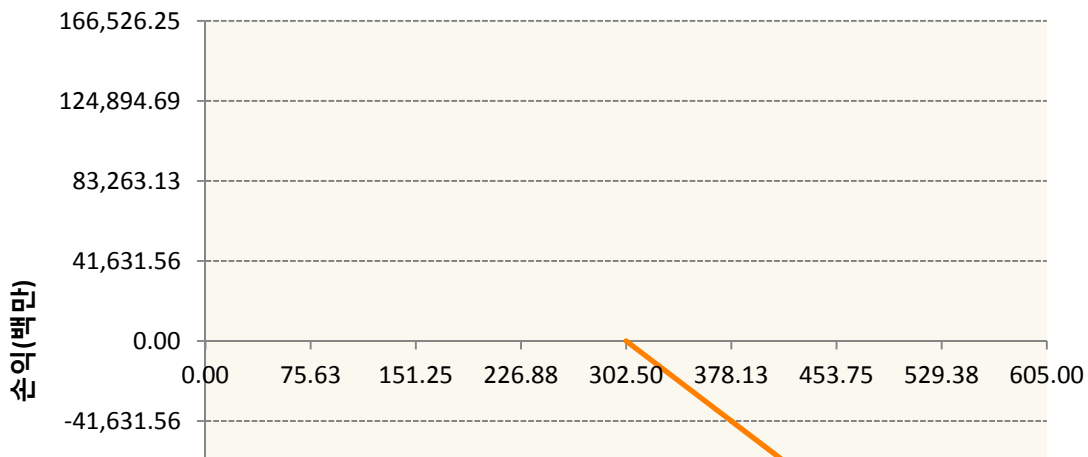
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 448,226 | -448,226 | 장내 |

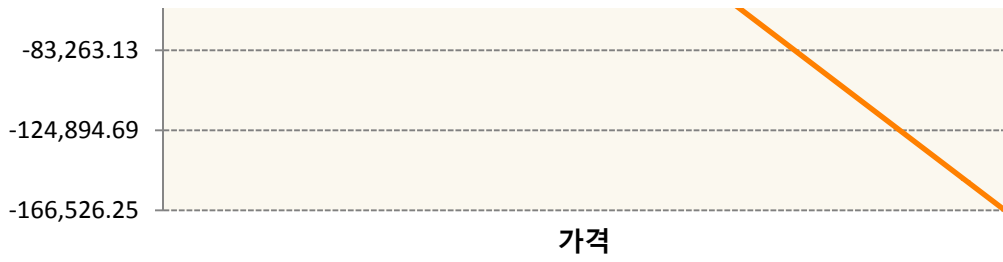
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q33007-2020-03 콜300

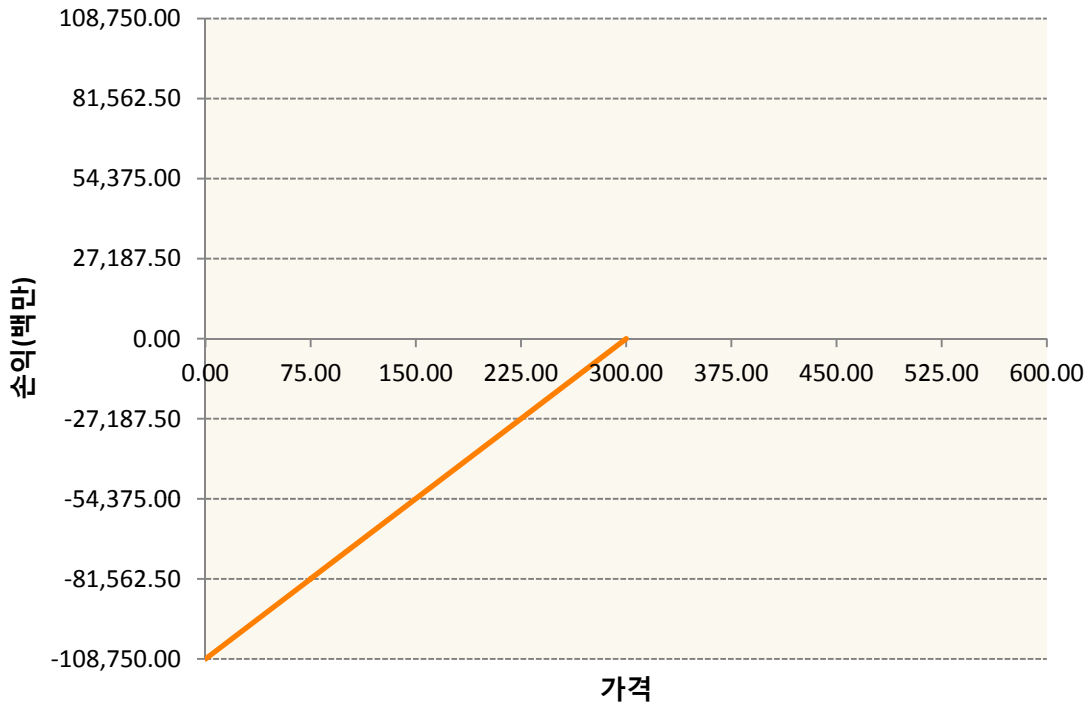


KR4201Q33023-2020-03 콜302.5





KR4301Q33005-2020-03 풋300



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4201Q33007 | | 2020-03 콜300 | | | | | 3,182 | |
|--------------|---------|----------------|--------|--------|--------|--------|--------|--|
| | | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 105 | 105 | 105 | 105 | 104 | 103 | 100 | |
| -5.33% | 105 | 105 | 104 | 102 | 98 | 90 | 78 | |
| -2.67% | 104 | 102 | 95 | 84 | 65 | 38 | 2 | |
| 0% | 91 | 73 | 43 | 0 | -56 | -127 | -210 | |
| 2.67% | -5 | -78 | -170 | -280 | -406 | -546 | -698 | |
| 5.33% | -421 | -596 | -785 | -986 | -1,195 | -1,413 | -1,636 | |
| 8.00% | -1,587 | -1,849 | -2,114 | -2,380 | -2,647 | -2,914 | -3,182 | |
| KR4201Q33023 | | 2020-03 콜302.5 | | | | | 2,531 | |
| | | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 64 | 64 | 64 | 64 | 64 | 63 | 61 | |

| | | | | | | | |
|---------------------------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| -5.33% | 64 | 64 | 64 | 63 | 60 | 55 | 47 |
| -2.67% | 64 | 62 | 59 | 52 | 40 | 22 | -4 |
| 0% | 57 | 47 | 29 | 0 | -40 | -92 | -155 |
| 2.67% | 5 | -43 | -107 | -189 | -286 | -397 | -521 |
| 5.33% | -255 | -389 | -539 | -703 | -880 | -1,066 | -1,260 |
| 8.00% | -1,083 | -1,315 | -1,552 | -1,793 | -2,037 | -2,283 | -2,531 |
| KR4301Q33005 2020-03 풋300 | | | | | | | 7,966 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -7,966 | -7,966 | -7,966 | -7,966 | -7,966 | -7,966 | -7,966 |
| -5.33% | -5,308 | -5,308 | -5,308 | -5,308 | -5,308 | -5,308 | -5,309 |
| -2.67% | -2,649 | -2,649 | -2,650 | -2,650 | -2,651 | -2,653 | -2,657 |
| 0% | 8 | 7 | 5 | 0 | -8 | -20 | -36 |
| 2.67% | 2,656 | 2,644 | 2,625 | 2,599 | 2,566 | 2,526 | 2,480 |
| 5.33% | 5,198 | 5,139 | 5,072 | 4,997 | 4,916 | 4,830 | 4,739 |
| 8.00% | 7,289 | 7,169 | 7,048 | 6,925 | 6,801 | 6,677 | 6,553 |

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

(단위:백만원)

10,574

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-03-09 |
| 기준일 | 2020-03-06 |

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

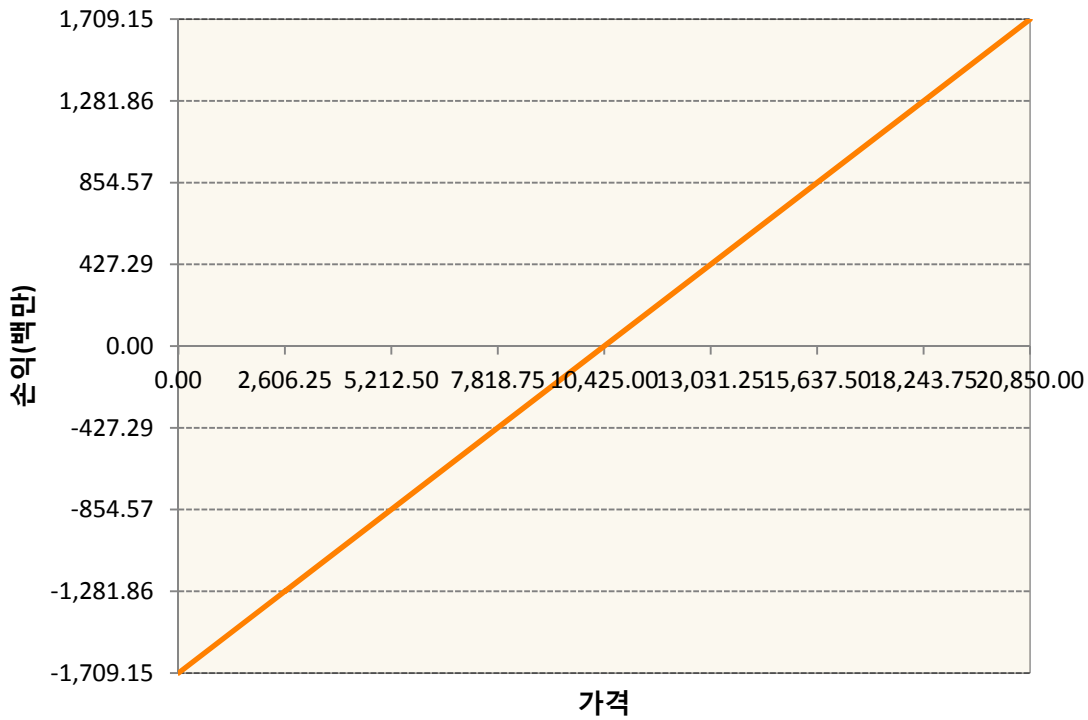
1. 계약금액

(단위:백만원)

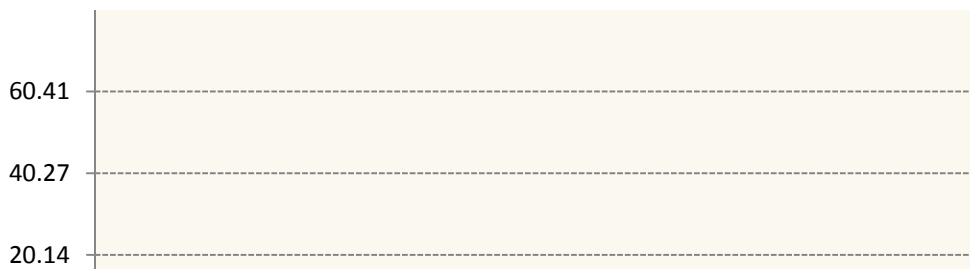
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,709 | 0 | 1,709 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 4,715 | -4,715 | 장내 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 2,160 | -2,160 | 장외 |

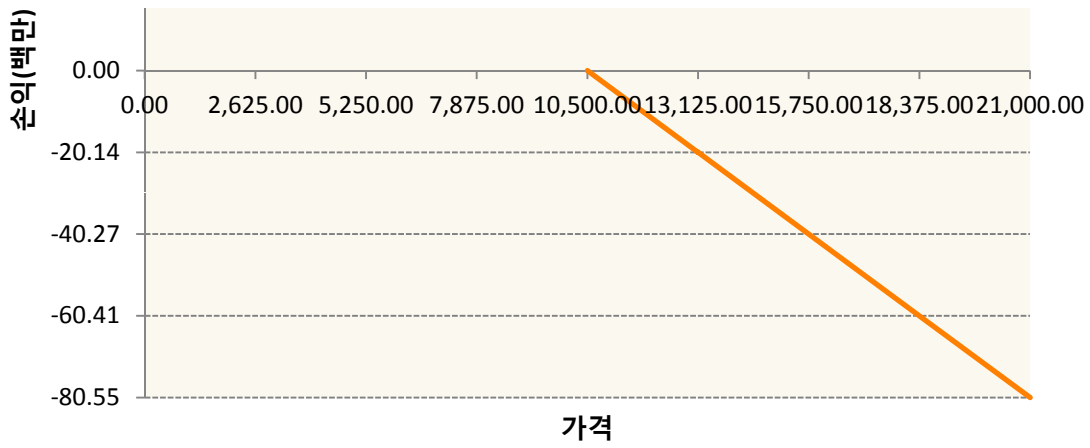
2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20

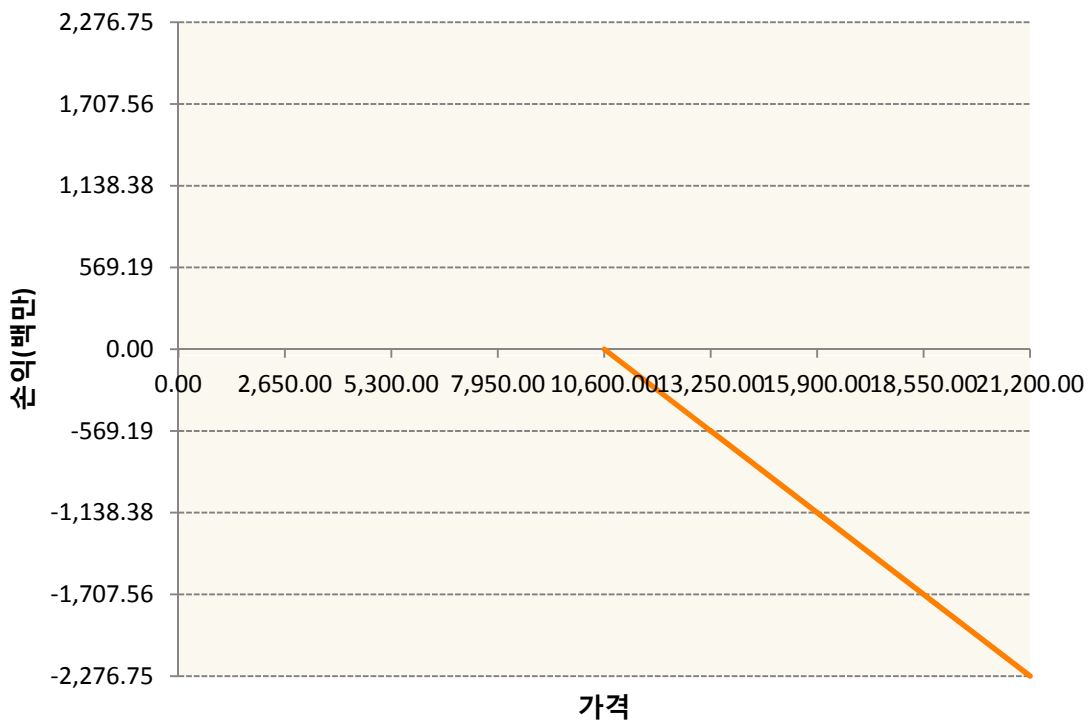


OHHIH0-C105-HSCEI

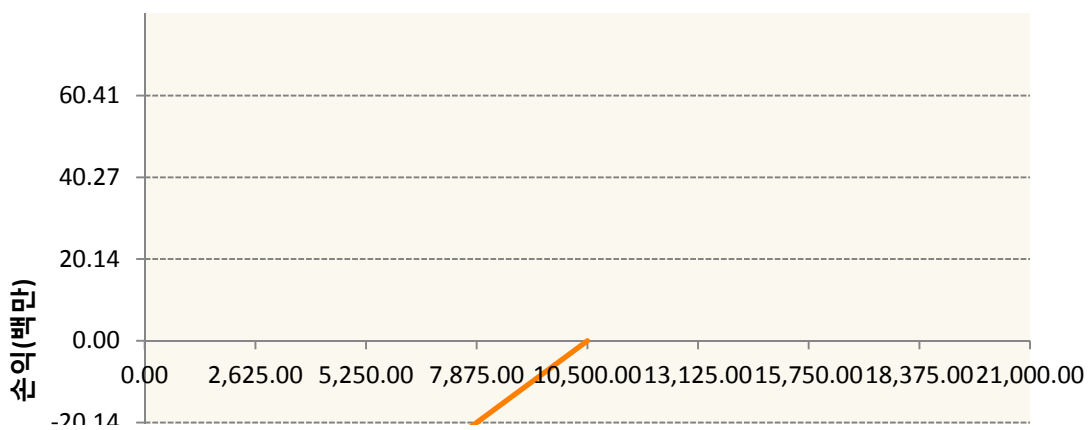


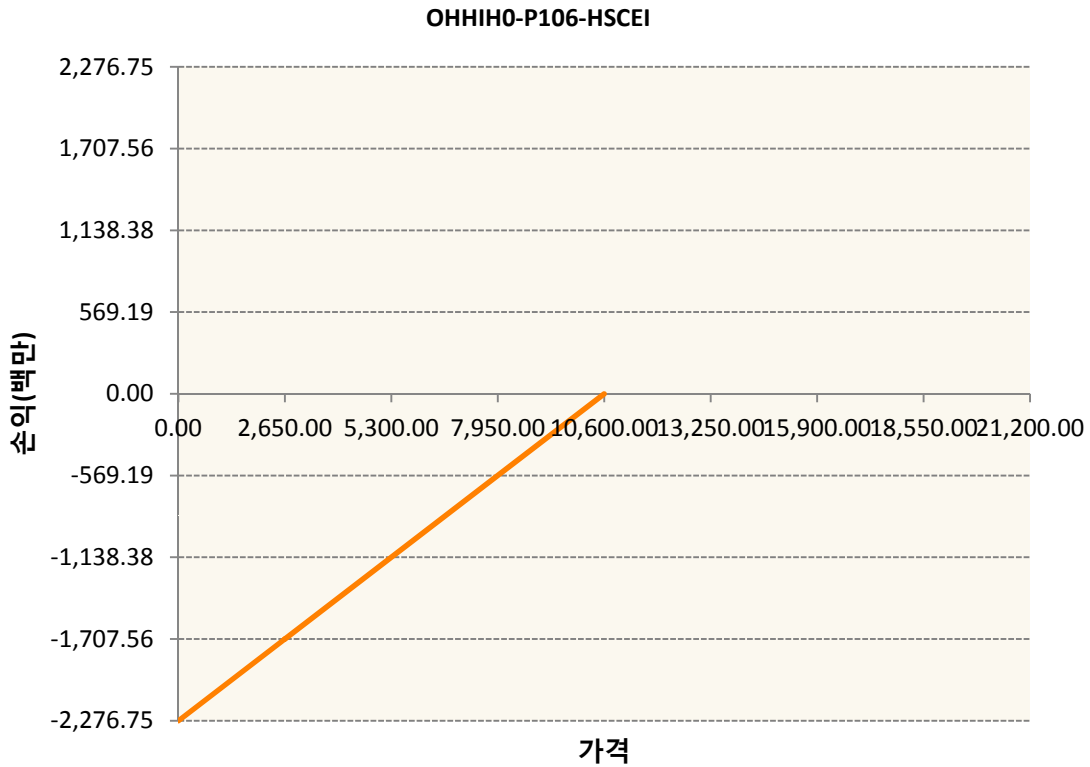
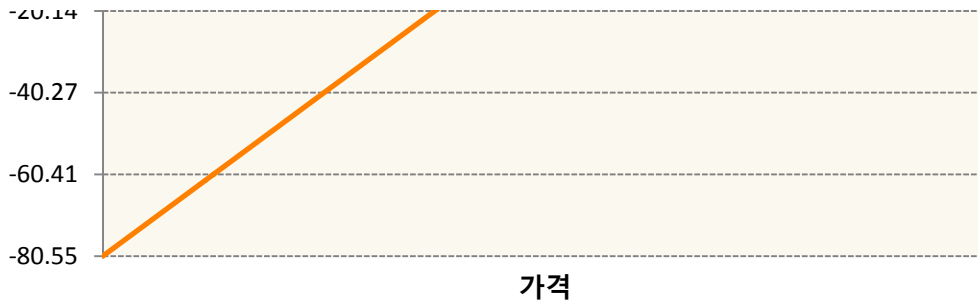


OHHIH0-C106-HSCEI



OHHIH0-P105-HSCEI





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | (단위:백만원) |
|------------------------------|----------|
| FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E | 173 |
| HCH0 HSCEI Futures Mar20 | 137 |
| 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 | 2020-03-09 |
| 기준일 | 2020-03-06 |

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

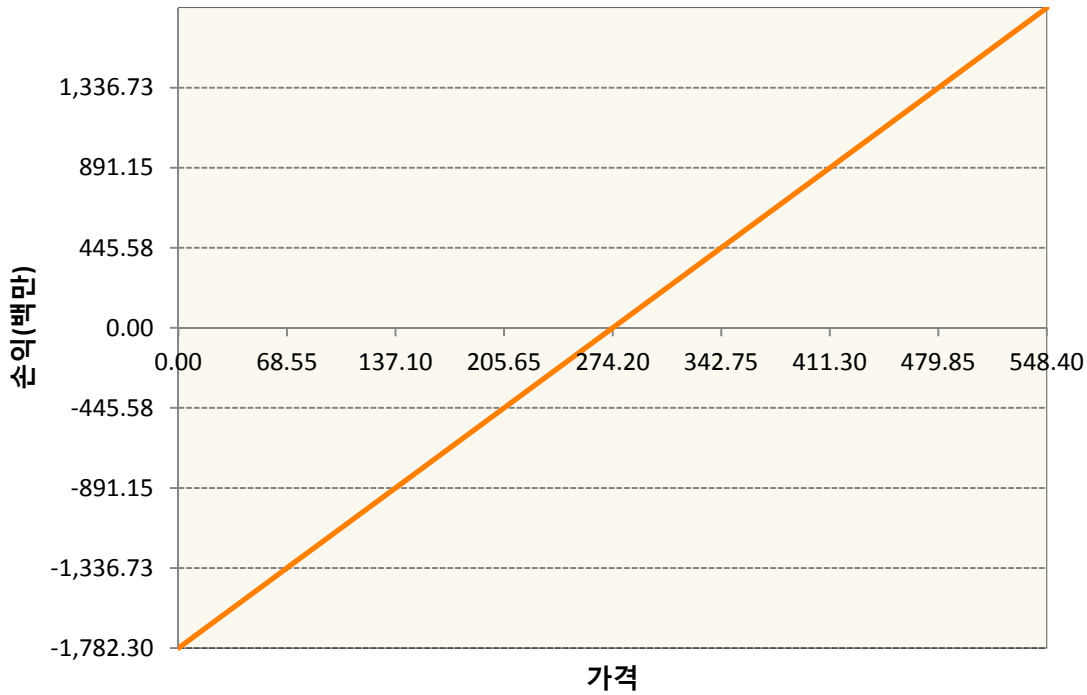
1. 계약금액

(단위:백만원)

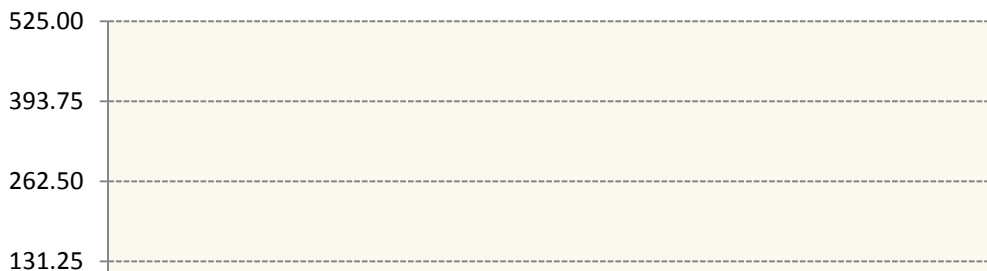
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,782 | 0 | 1,782 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 3,125 | 0 | 3,125 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 3,612 | -3,612 | 장내 |

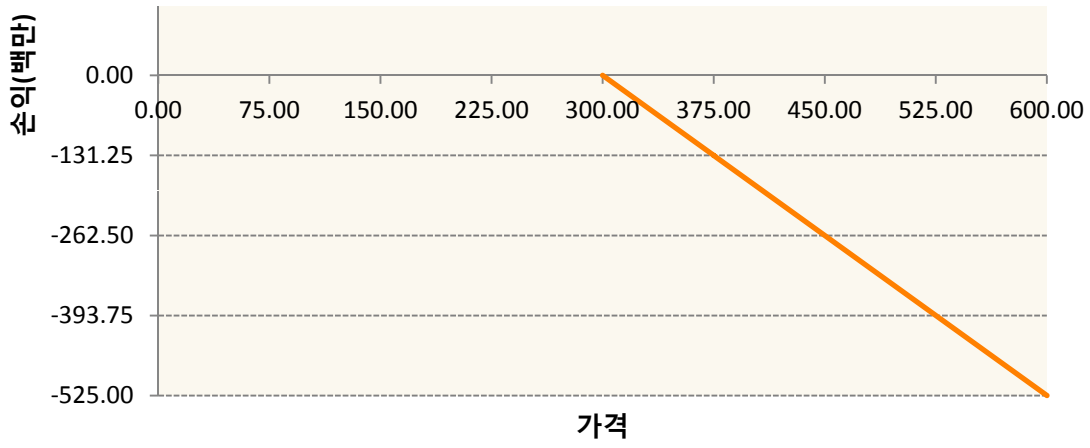
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

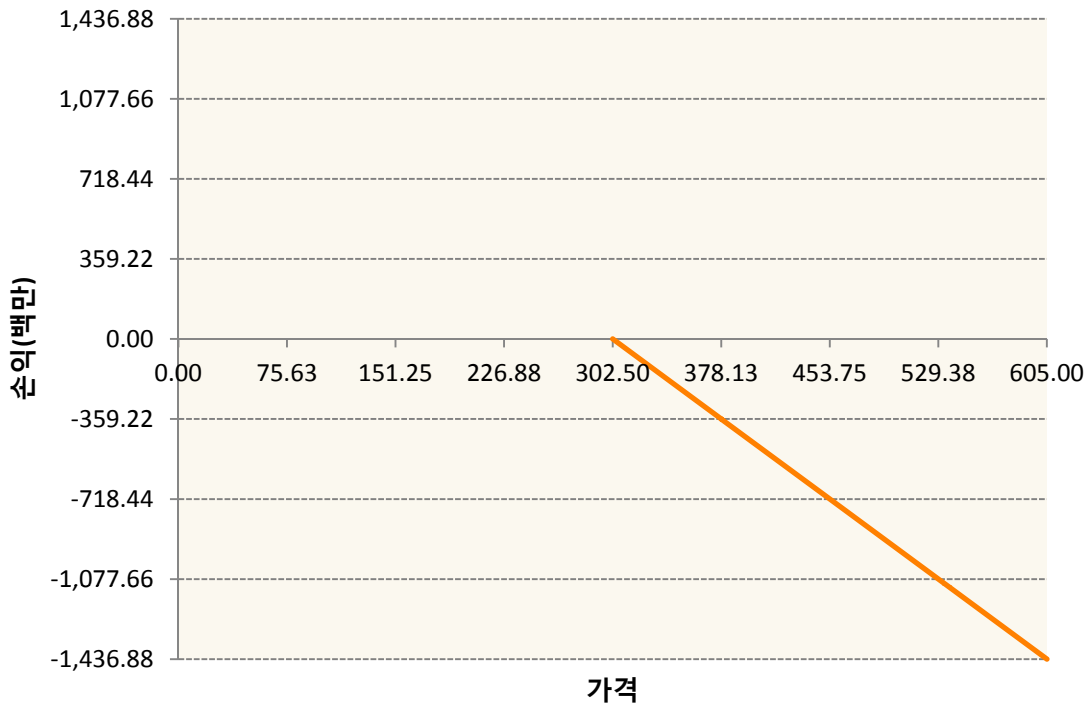


KR4201Q33007-2020-03 콜300

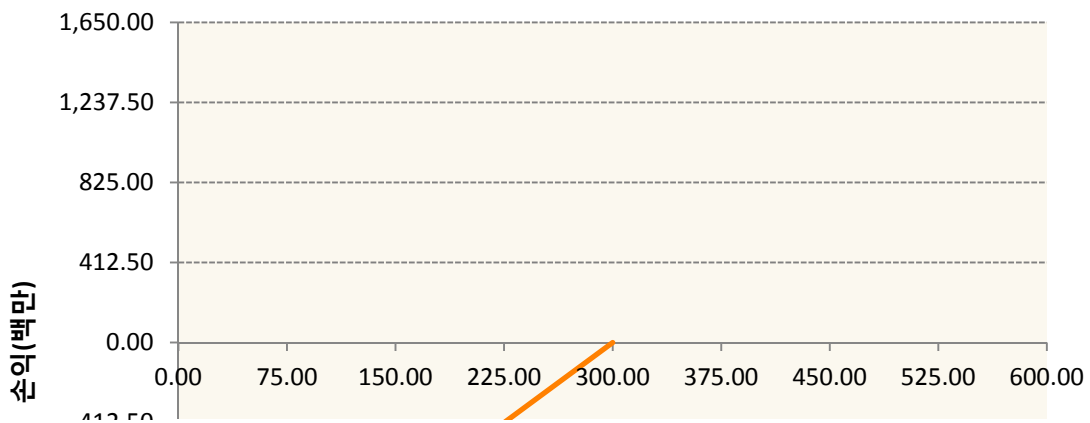




KR4201Q33023-2020-03 콜302.5



KR4301Q33005-2020-03 풋300





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| 2.529E+11 | | UBCSFXC1 INDEX_16 | | | | | | 269 |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -269 | -269 | -269 | -269 | -269 | -269 | -269 | |
| -5.33% | -179 | -179 | -179 | -179 | -179 | -179 | -179 | |
| -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% | 179 | 179 | 179 | 179 | 179 | 179 | 179 | |
| 8.00% | 269 | 269 | 269 | 269 | 269 | 269 | 269 | |
| KR4101Q30005 | | 2020-03 코스피200지수선물 | | | | | | 143 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -143 | -143 | -143 | -143 | -143 | -143 | -143 | |
| -5.33% | -95 | -95 | -95 | -95 | -95 | -95 | -95 | |
| -2.67% | -48 | -48 | -48 | -48 | -48 | -48 | -48 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 48 | 48 | 48 | 48 | 48 | 48 | 48 | |
| 5.33% | 95 | 95 | 95 | 95 | 95 | 95 | 95 | |
| 8.00% | 143 | 143 | 143 | 143 | 143 | 143 | 143 | |
| KR4201Q33007 | | 2020-03 콜300 | | | | | | 10 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| -5.33% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| -2.67% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | -1 | |
| 2.67% | 0 | 0 | -1 | -1 | -1 | -2 | -2 | |
| 5.33% | -1 | -2 | -2 | -3 | -4 | -4 | -5 | |
| 8.00% | -5 | -6 | -6 | -7 | -8 | -9 | -10 | |
| 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 | 0 |
| -2.67% | 1 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | -1 |
| 2.67% | 0 | 0 | -1 | -2 | -2 | -2 | -3 |
| 5.33% | -2 | -3 | -5 | -6 | -8 | -9 | -11 |
| 8.00% | -9 | -11 | -13 | -15 | -18 | -20 | -22 |
| KR4301Q33005 2020-03 풋300 | | | | | | | 121 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -121 | -121 | -121 | -121 | -121 | -121 | -121 |
| -5.33% | -81 | -81 | -81 | -81 | -81 | -81 | -81 |
| -2.67% | -40 | -40 | -40 | -40 | -40 | -40 | -40 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | -1 |
| 2.67% | 40 | 40 | 40 | 39 | 39 | 38 | 38 |
| 5.33% | 79 | 78 | 77 | 76 | 75 | 73 | 72 |
| 8.00% | 111 | 109 | 107 | 105 | 103 | 101 | 99 |

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

(단위:백만원)

534

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-03-09 |
| 기준일 | 2020-03-06 |

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

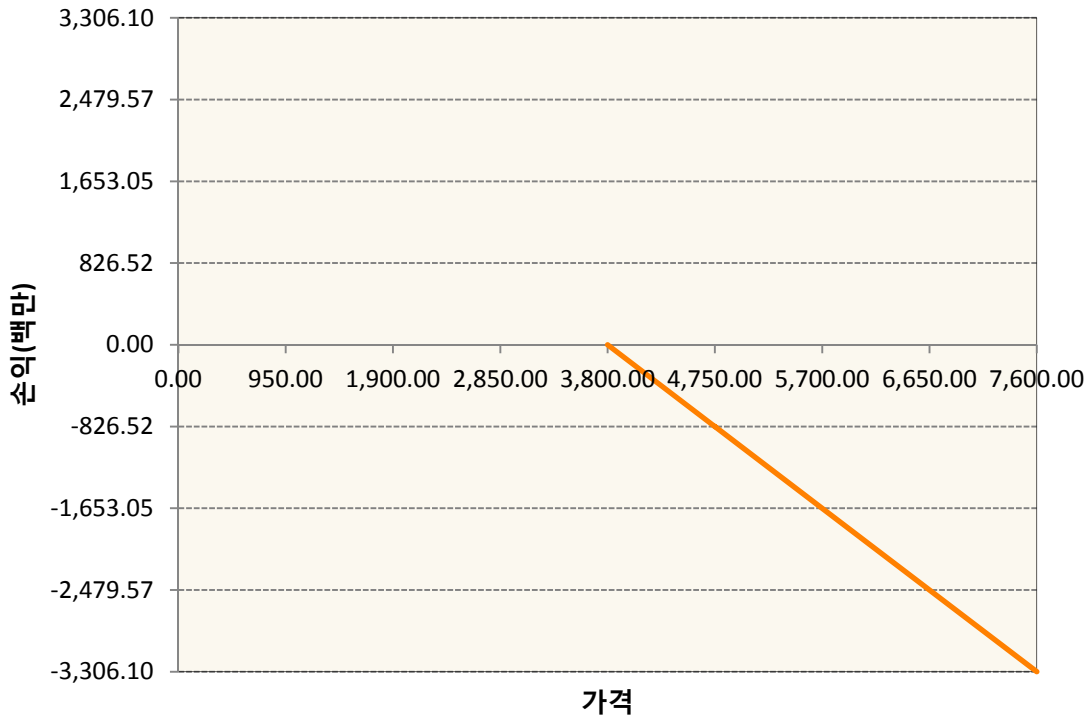
1. 계약금액

(단위:백만원)

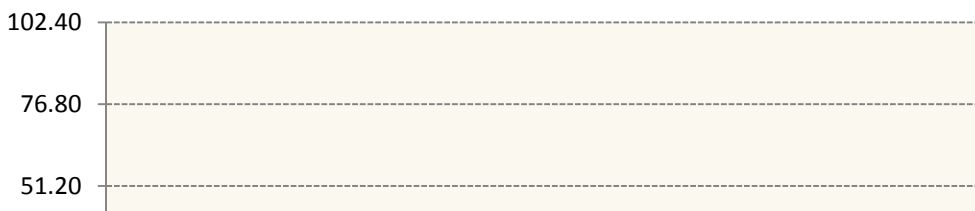
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 355 | 0 | 355 | |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 10,799 | 0 | 10,799 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 6,817 | -6,817 | 장내 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 535 | 3,512 | -2,977 | 장외 |

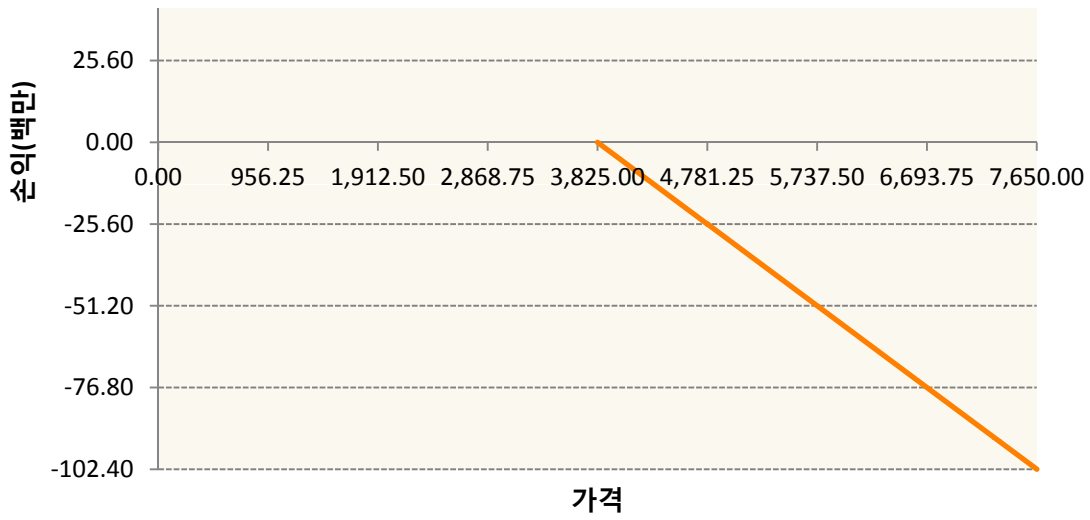
2. 만기시점의 손익구조

OESXH0-C3800-EURO STOXX 50

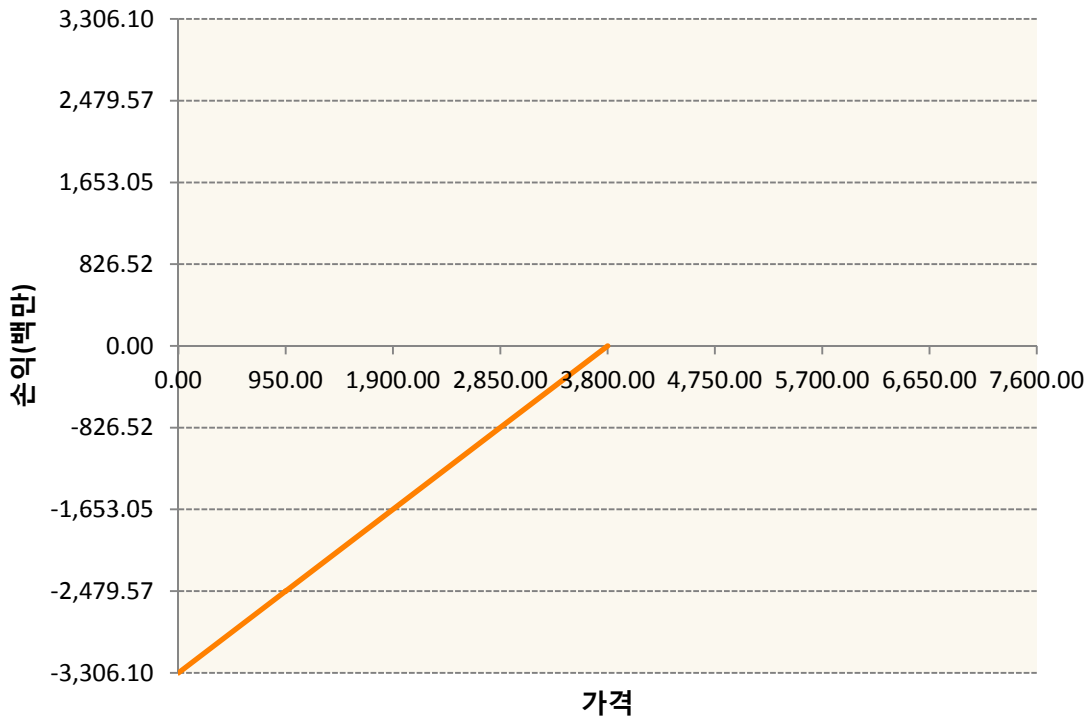


OESXH0-C3825-EURO STOXX 50

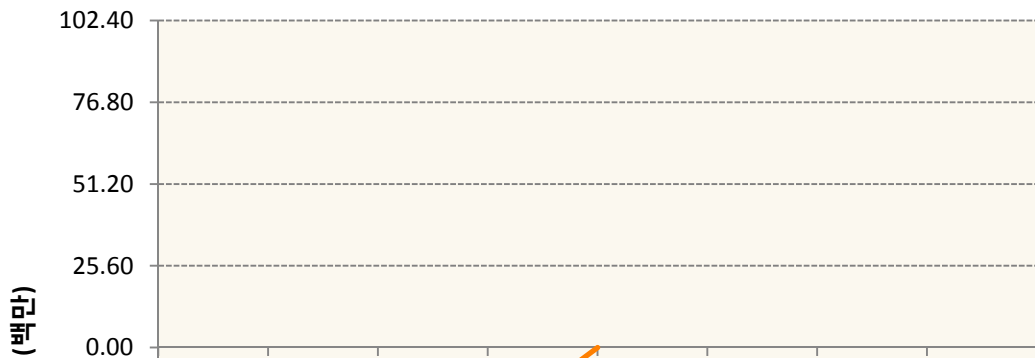


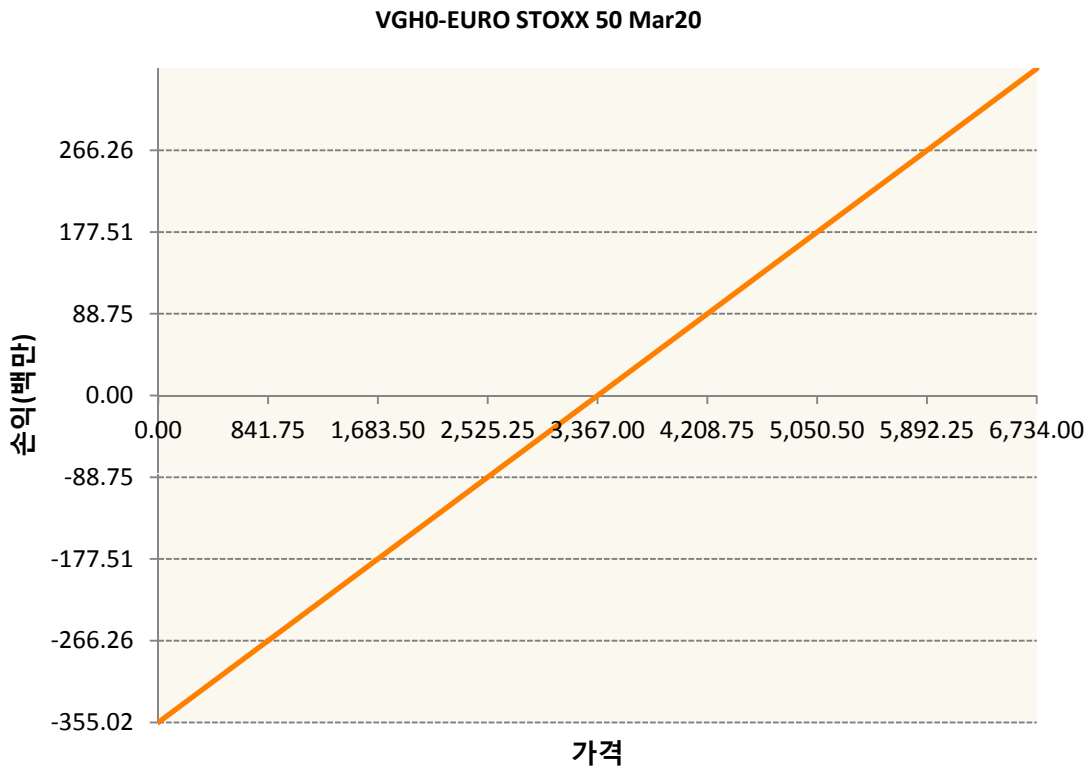
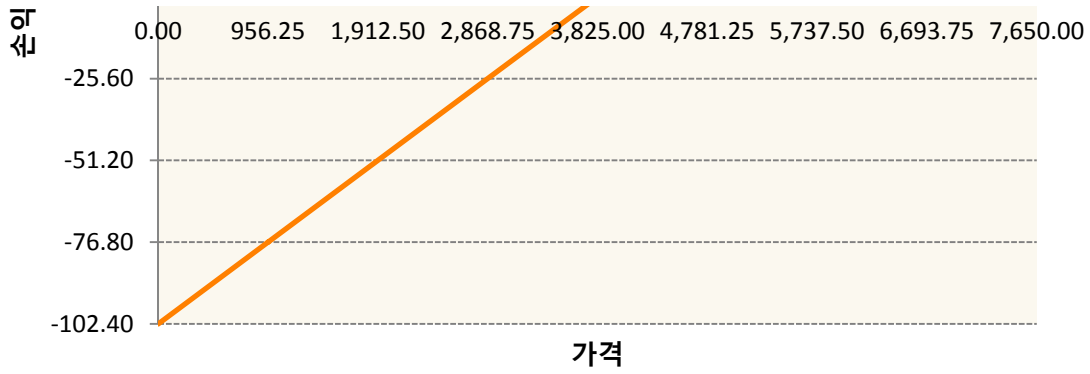


OESXH0-P3800-EURO STOXX 50



OESXH0-P3825-EURO STOXX 50





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|--|----------|
| 260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY | | 78 |
| FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E | | 281 |
| FX21020H00 EUR/KRW 27-03-20E | | 43 |
| OESXH0-C3& EURO STOXX 50 | | 264 |
| OESXH0-C3& EURO STOXX 50 | | 8 |
| OESXH0-P3& EURO STOXX 50 | | 264 |
| OESXH0-P3& EURO STOXX 50 | | 8 |
| VGHO EURO STOXX 50 Mar20 | | 28 |

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

(단위:백만원)

688

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

(단위:백만원)

957

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-03-09 |
| 기준일 | 2020-03-06 |

ETF스마트레버리지목표전환형9호

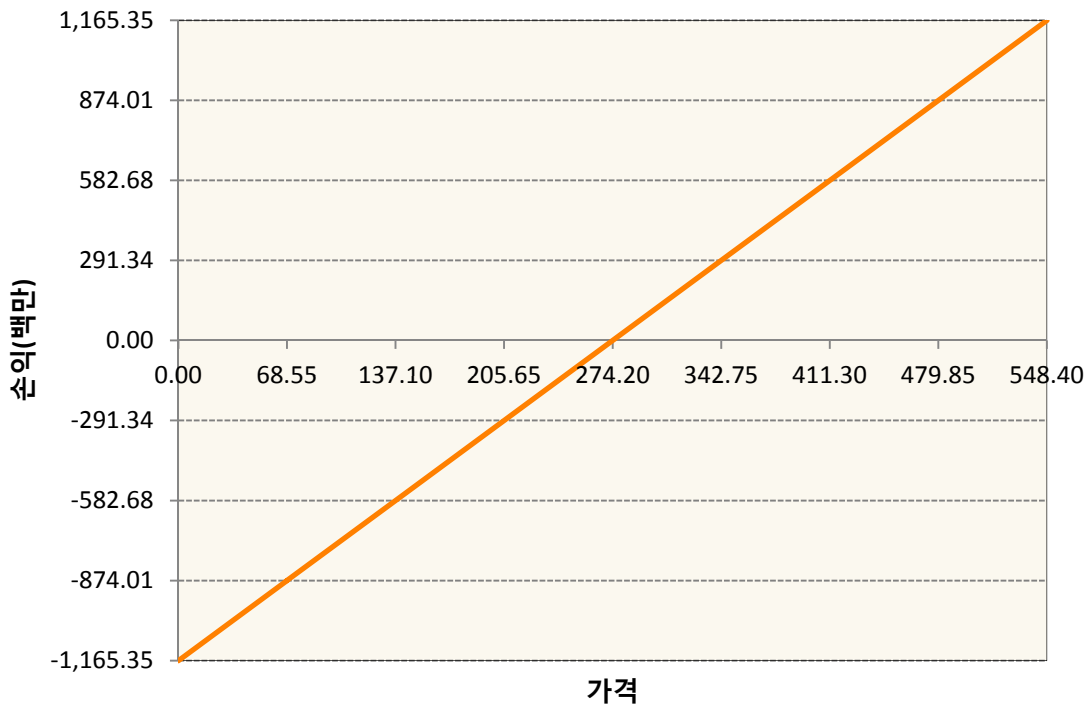
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,165 | 0 | 1,165 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101Q30005 | | 2020-03 코스피200지수선물 | | | | | | 94 |
|--------------|---------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|----|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -94 | -94 | -94 | -94 | -94 | -94 | -94 | |
| -5.33% | -62 | -62 | -62 | -62 | -62 | -62 | -62 | |
| -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% | 62 | 62 | 62 | 62 | 62 | 62 | 62 | |
| 8.00% | 94 | 94 | 94 | 94 | 94 | 94 | 94 | |

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

(단위:백만원)

84

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

(단위:백만원)

124

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

(단위:백만원)

45

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-03-09 |
| 기준일 | 2020-03-06 |

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

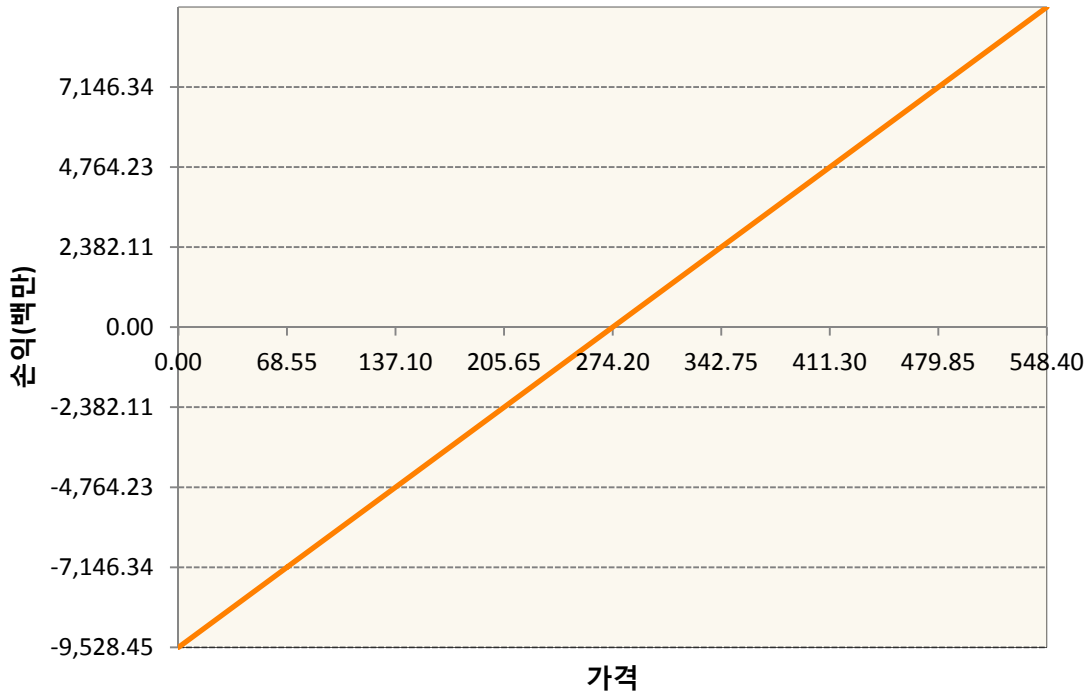
1. 계약금액

(단위:백만원)

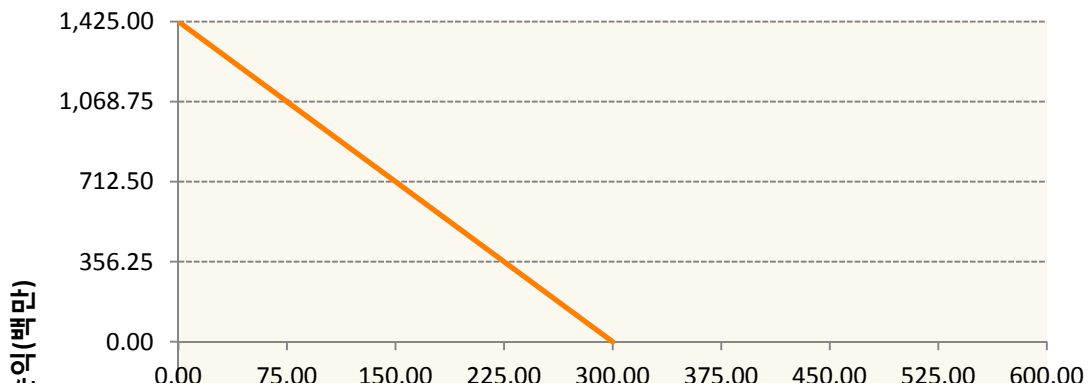
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 9,528 | 0 | 9,528 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 2,257 | 0 | 2,257 | 장내 |

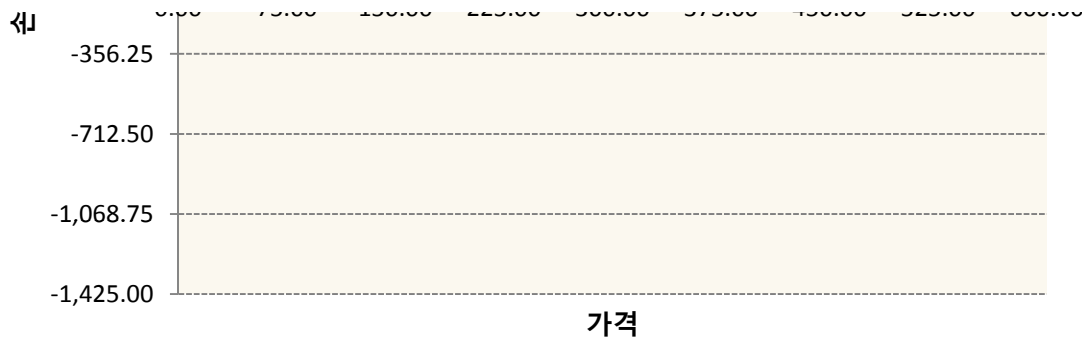
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

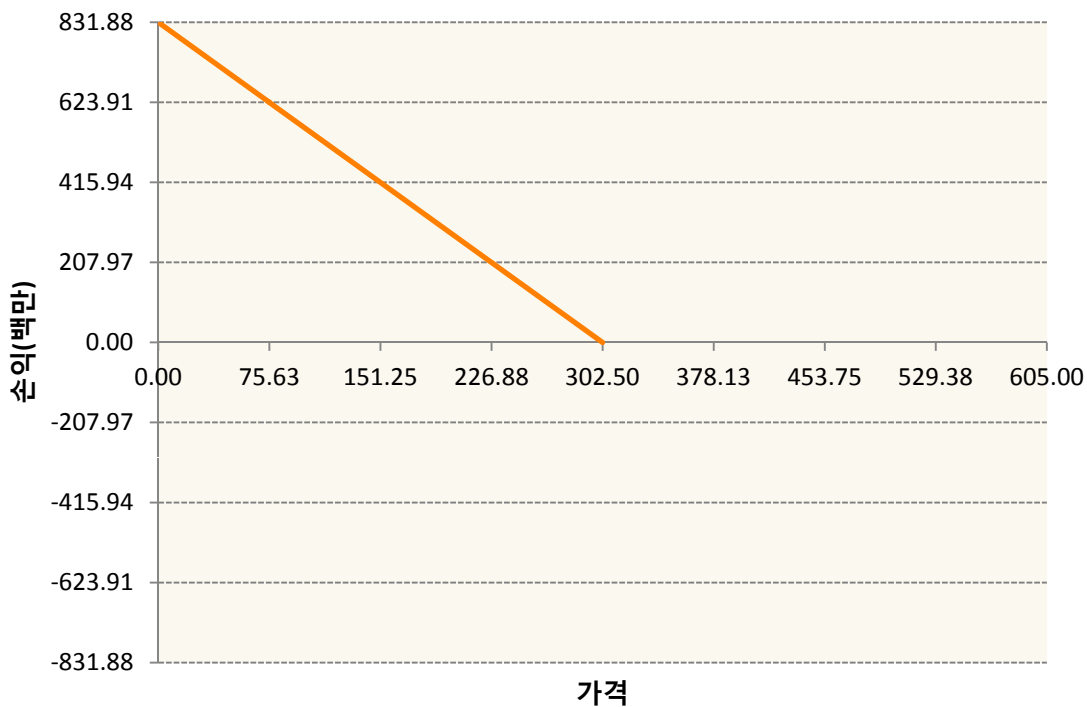


KR4301Q33005-2020-03 풋300





KR4301Q33021-2020-03 풋302.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101Q30005 | | 2020-03 코스피200지수선물 | | | | | | 765 |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|------|
| | | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -765 | -765 | -765 | -765 | -765 | -765 | -765 | -765 |
| -5.33% | -510 | -510 | -510 | -510 | -510 | -510 | -510 | -510 |
| -2.67% | -255 | -255 | -255 | -255 | -255 | -255 | -255 | -255 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 255 | 255 | 255 | 255 | 255 | 255 | 255 | 255 |
| 5.33% | 510 | 510 | 510 | 510 | 510 | 510 | 510 | 510 |
| 8.00% | 765 | 765 | 765 | 765 | 765 | 765 | 765 | 765 |
| KR4301Q33005 | | 2020-03 풋300 | | | | | | 104 |
| | | 기초자산의 변동성 | | | | | | |

| | | | | | | | |
|--------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 104 | 104 | 104 | 104 | 104 | 104 | 104 |
| -5.33% | 70 | 70 | 70 | 70 | 70 | 70 | 70 |
| -2.67% | 35 | 35 | 35 | 35 | 35 | 35 | 35 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | -35 | -35 | -34 | -34 | -34 | -33 | -32 |
| 5.33% | -68 | -67 | -66 | -65 | -64 | -63 | -62 |
| 8.00% | -96 | -94 | -92 | -91 | -89 | -87 | -86 |

KR4301Q33021 2020-03 풋302.5 60

| | | | | | | | |
|--------|-----------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 60 | 60 | 60 | 60 | 60 | 60 | 60 |
| -5.33% | 40 | 40 | 40 | 40 | 40 | 40 | 40 |
| -2.67% | 20 | 20 | 20 | 20 | 20 | 20 | 20 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | -20 | -20 | -20 | -20 | -20 | -20 | -19 |
| 5.33% | -40 | -40 | -39 | -39 | -38 | -38 | -37 |
| 8.00% | -57 | -57 | -56 | -55 | -54 | -53 | -52 |

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

(단위:백만원)

852

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-03-09 |
| 기준일 | 2020-03-06 |

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 205,915 | 0 | 205,915 | |

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 | 2020-03-09 |
| 기준일 | 2020-03-06 |

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0 | 5,287 | -5,287 | |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 109,184 | 0 | 109,184 | |

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 | 2020-03-09 |
| 기준일 | 2020-03-06 |

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 | 517,404 | 0 | 517,404 | |
| 누계 | 통화 | 선도 | 17,885 | 519,127 | -501,243 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|------------------------------|---------------------------------|
| FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E | 1,536 |
| FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E | 1,431 |
| FX21020F03 KRW/USD 31-03-20E | 3,052 |
| FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E | 2,862 |
| FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E | 2,575 |
| FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E | 954 |
| FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E | 1,183 |
| FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E | 1,211 |
| FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E | 954 |
| FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E | 1,908 |
| FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E | 3,281 |
| FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E | 3,281 |
| FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E | 1,908 |
| FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E | 3,815 |
| FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E | 2,232 |
| FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E | 1,908 |
| FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E | 191 |
| FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E | 4,865 |
| FX21020G06 USD/KRW 31-03-20E | 477 |
| FX21020H00 USD/KRW 31-03-20E | 954 |
| FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E | 2,385 |
| IE00BD8RGM75 | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 |
| IE00BHNZKL13 | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 |

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

(단위:백만원)

15,194

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

(단위:백만원)

127

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-03-09 |
| 기준일 | 2020-03-06 |

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

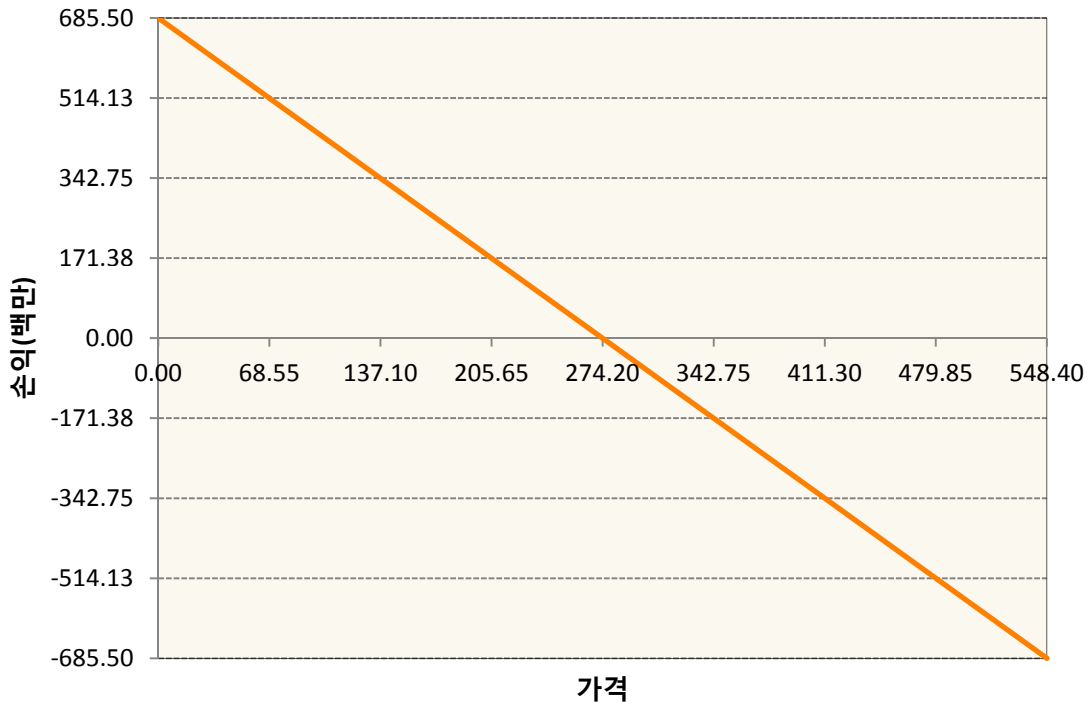
1. 계약금액

(단위:백만원)

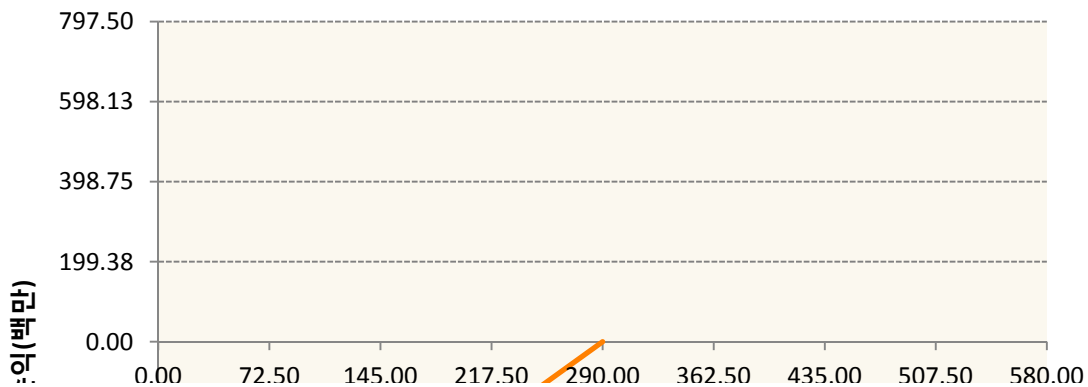
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 686 | -686 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 3,503 | -3,503 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

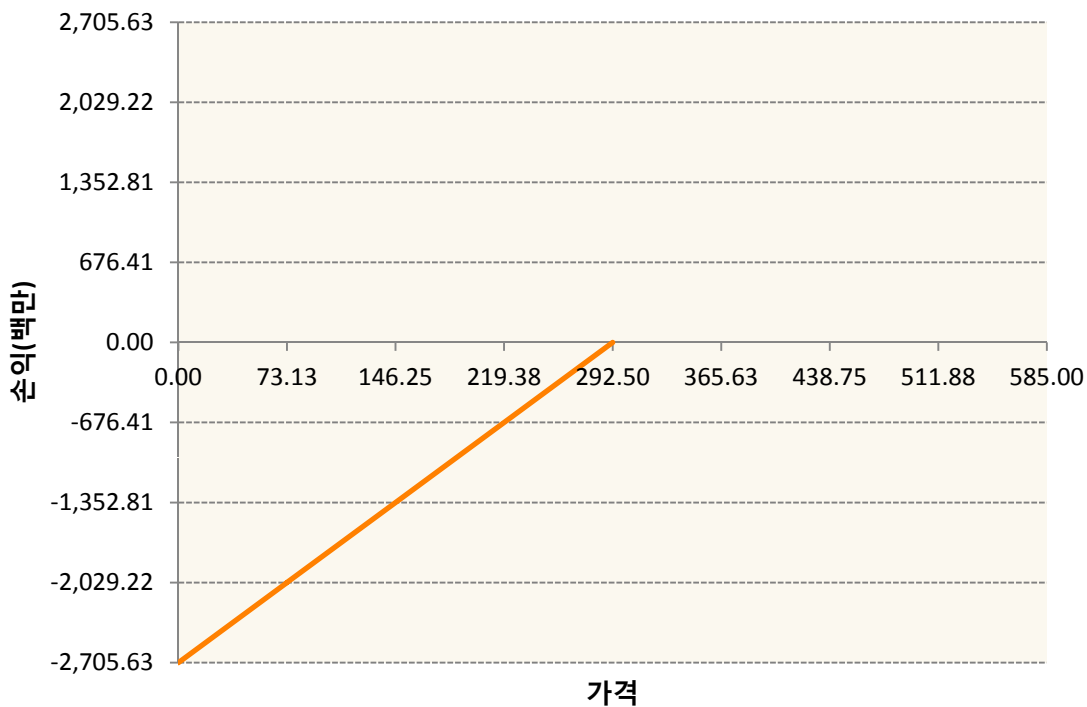


KR4301Q32908-2020-03 풋290





KR4301Q32924-2020-03 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101Q30005 | | 2020-03 코스피200지수선물 | | | | | | 55 |
|--------------|---------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|----|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 55 | 55 | 55 | 55 | 55 | 55 | 55 | |
| -5.33% | 37 | 37 | 37 | 37 | 37 | 37 | 37 | |
| -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% | -37 | -37 | -37 | -37 | -37 | -37 | -37 | |
| 8.00% | -55 | -55 | -55 | -55 | -55 | -55 | -55 | |
| KR4301Q32908 | | 2020-03 풋290 | | | | | | 60 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|--------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -60 | -60 | -60 | -60 | -60 | -60 | -60 |
| -5.33% | -40 | -40 | -40 | -40 | -40 | -40 | -40 |
| -2.67% | -19 | -19 | -19 | -19 | -20 | -20 | -20 |
| 0% | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | -1 | -1 |
| 2.67% | 19 | 19 | 18 | 17 | 17 | 16 | 15 |
| 5.33% | 33 | 32 | 31 | 30 | 29 | 28 | 27 |
| 8.00% | 40 | 39 | 38 | 38 | 37 | 36 | 35 |

KR4301Q32924 2020-03 풋292.5 202

| | | | | | | | |
|--------|-----------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -202 | -202 | -202 | -202 | -202 | -202 | -202 |
| -5.33% | -134 | -134 | -134 | -134 | -134 | -134 | -134 |
| -2.67% | -66 | -66 | -66 | -66 | -67 | -67 | -67 |
| 0% | 1 | 1 | 1 | 0 | -1 | -2 | -3 |
| 2.67% | 66 | 65 | 63 | 61 | 59 | 57 | 55 |
| 5.33% | 120 | 117 | 114 | 111 | 107 | 104 | 101 |
| 8.00% | 150 | 148 | 145 | 142 | 139 | 136 | 133 |

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

(단위:백만원)

328

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-03-09 |
| 기준일 | 2020-03-06 |

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 | 8,961 | 0 | 8,961 | |
| 누계 | 통화 | 선도 | 1,240 | 10,087 | -8,847 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|------------------------------|-----|
| FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E | 324 |
| FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E | 90 |
| FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E | 180 |
| FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E | 213 |
| FX21020H00 USD/KRW 12-03-20E | 12 |
| FX21020H00 USD/KRW 12-03-20E | 38 |
| FX21020H01 USD/KRW 31-03-20E | 49 |
| IE00BD8RGM75 | |

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

| |
|------------|
| 320 |
|------------|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-03-09 |
| 기준일 | 2020-03-06 |

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

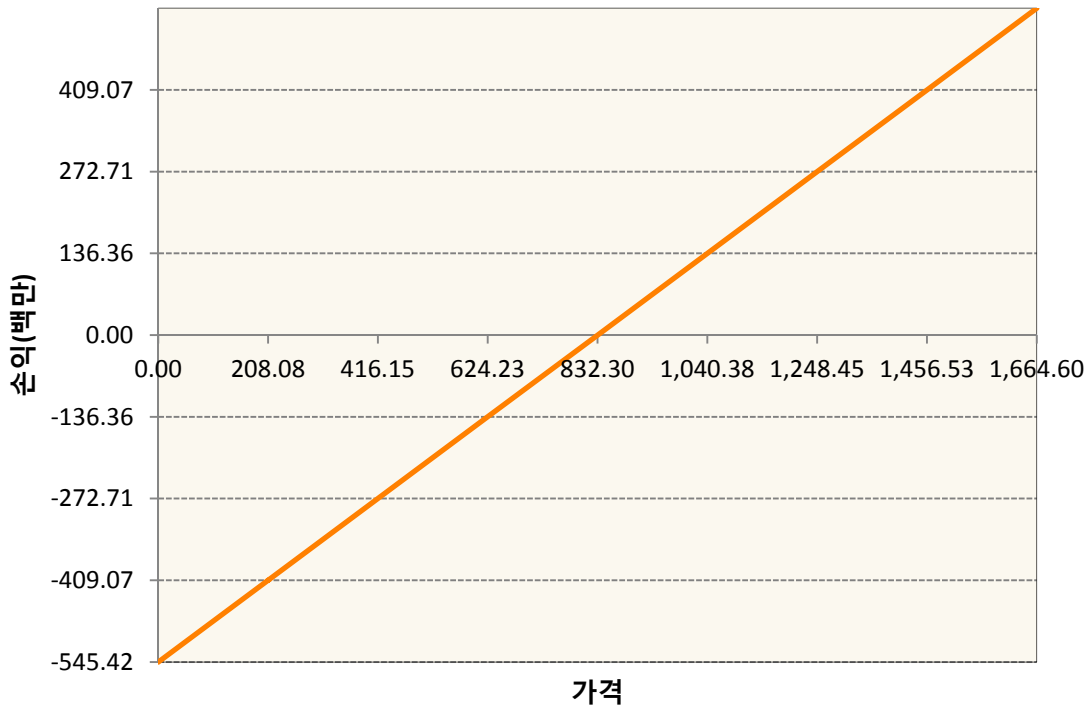
1. 계약금액

(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 | 545 | 0 | 545 | |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 1,104 | 0 | 1,104 | 장외 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 147 | 736 | -589 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

VNCH0-VN30 Index Future Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|------------------------------|----|
| 2.55E+11 VN30TR Index(EUR) | 88 |
| 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 | 44 |

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

(단위:백만원)

125

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-03-09 |
| 기준일 | 2020-03-06 |

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

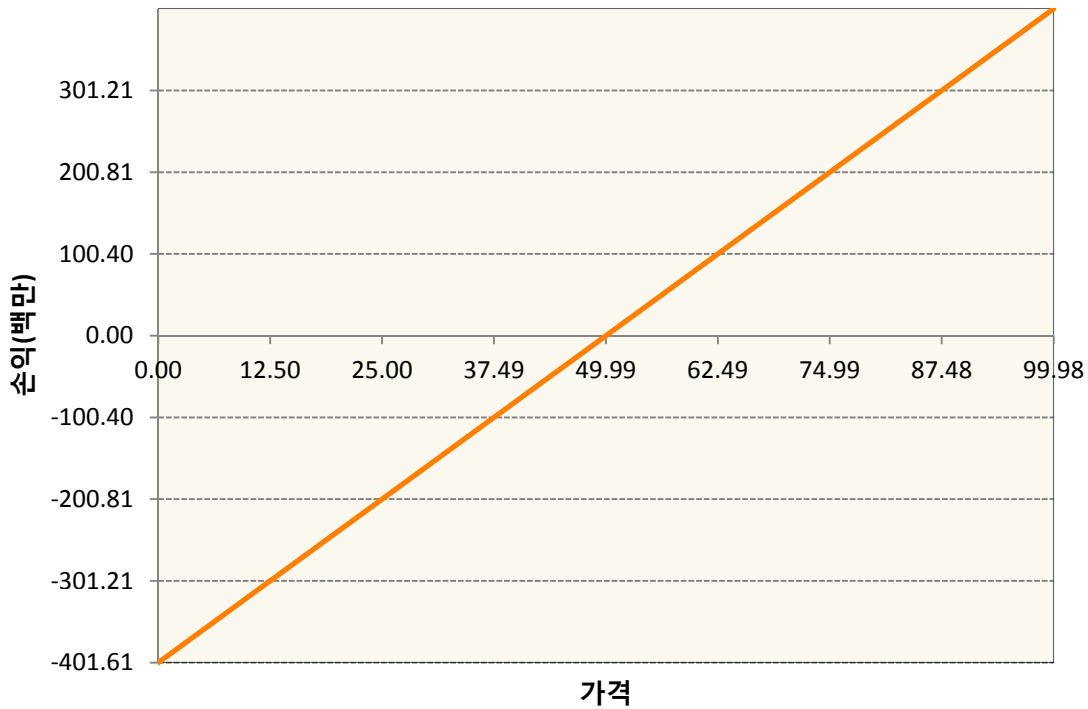
1. 계약금액

(단위:백만원)

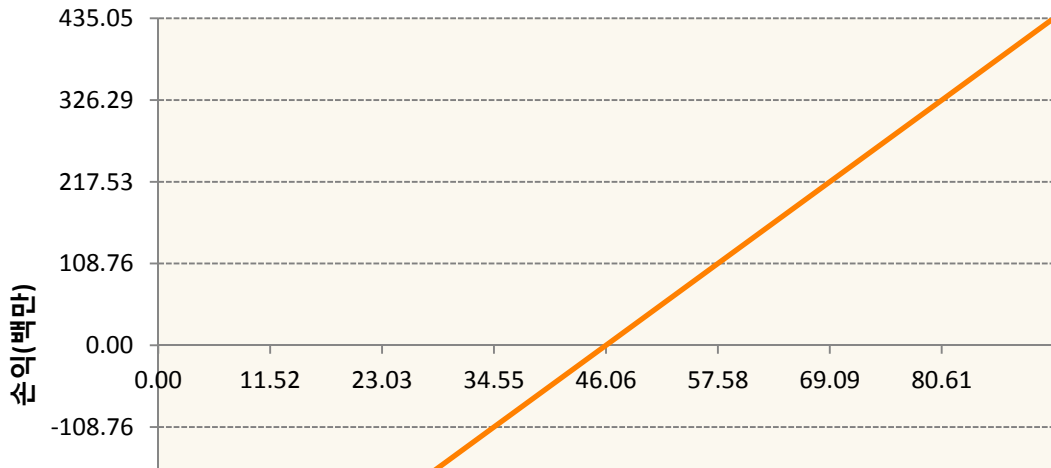
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,895 | 119 | 1,776 | |

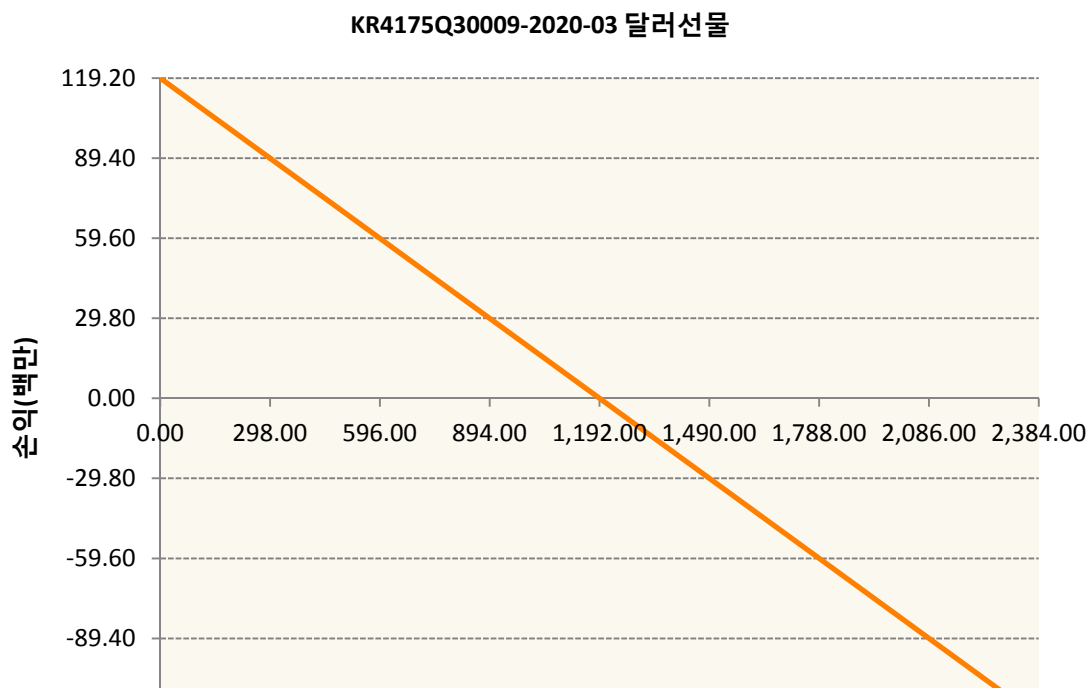
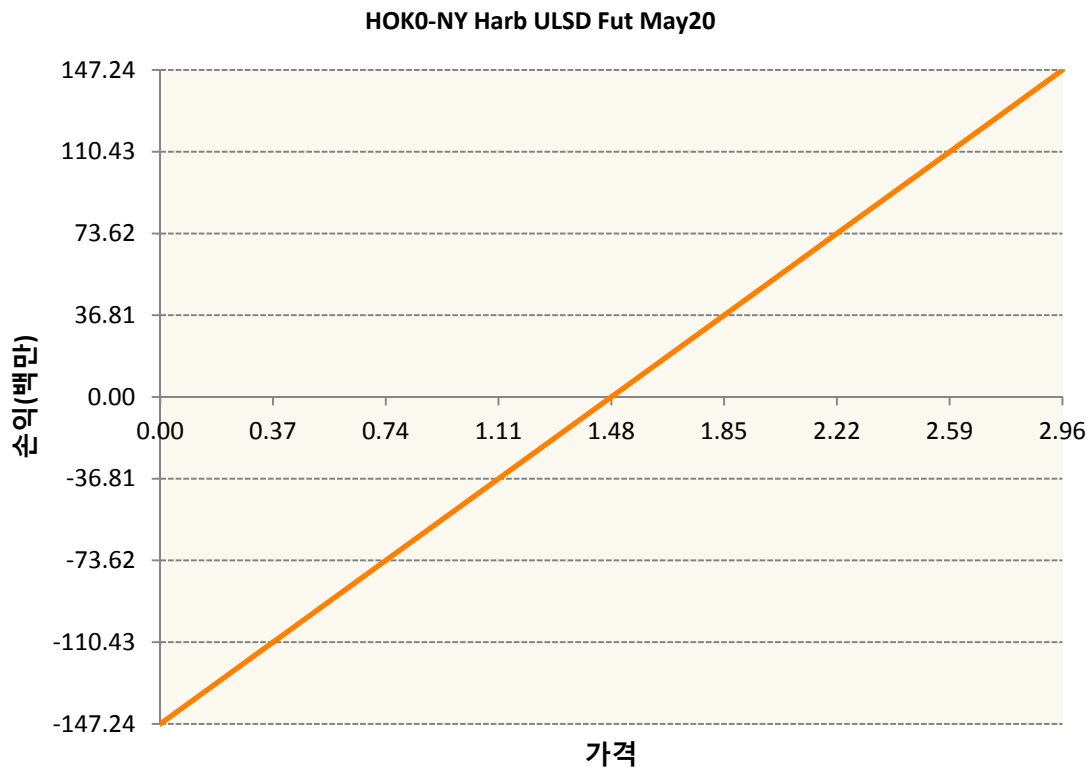
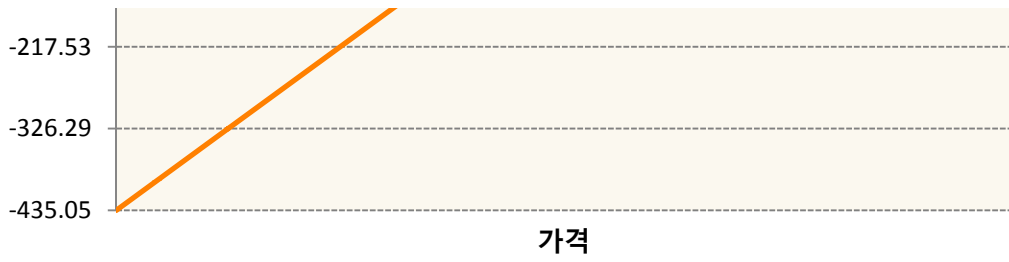
2. 만기시점의 손익구조

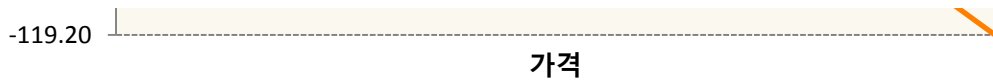
COK0-BRENT CRUDE FUTR May20



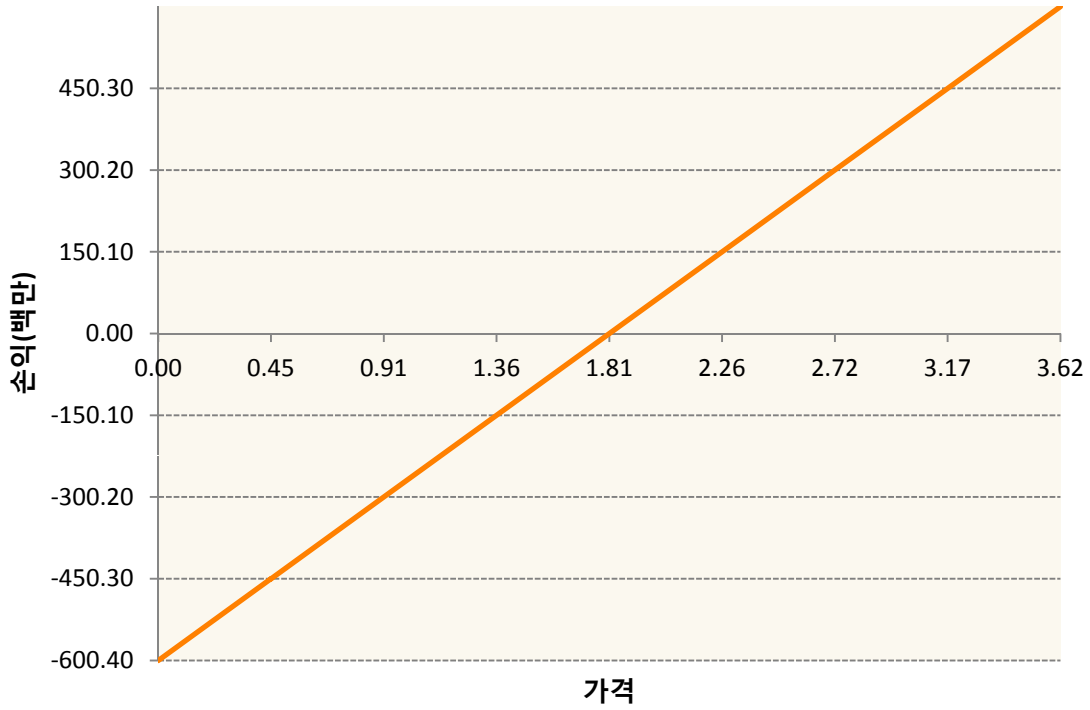
CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20



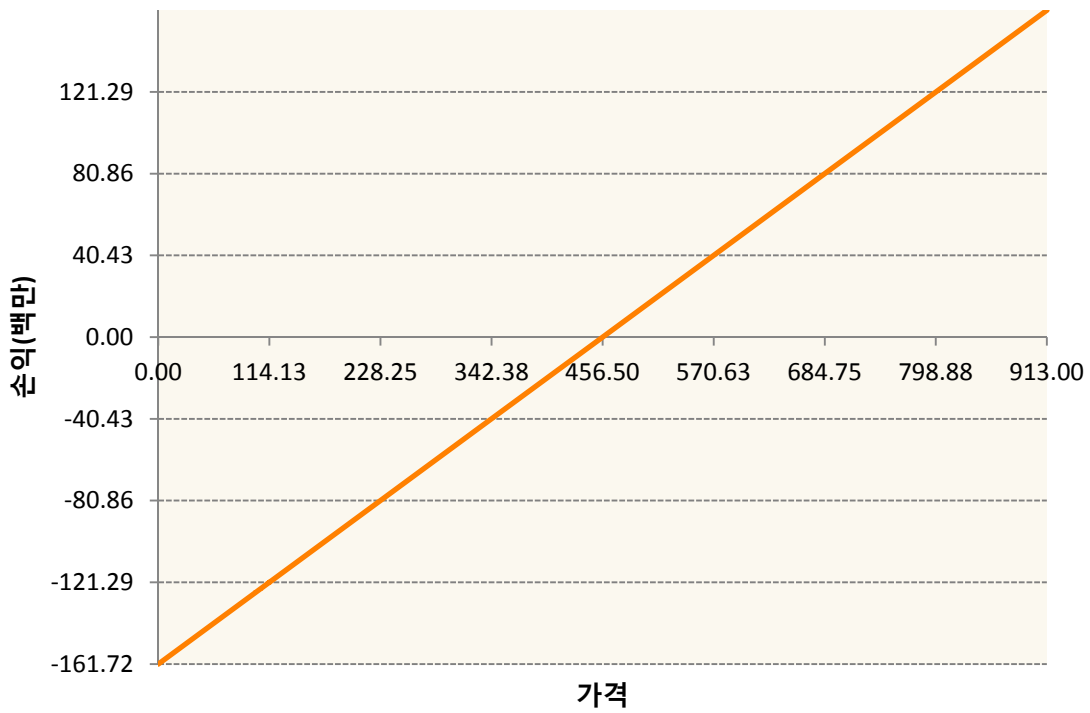




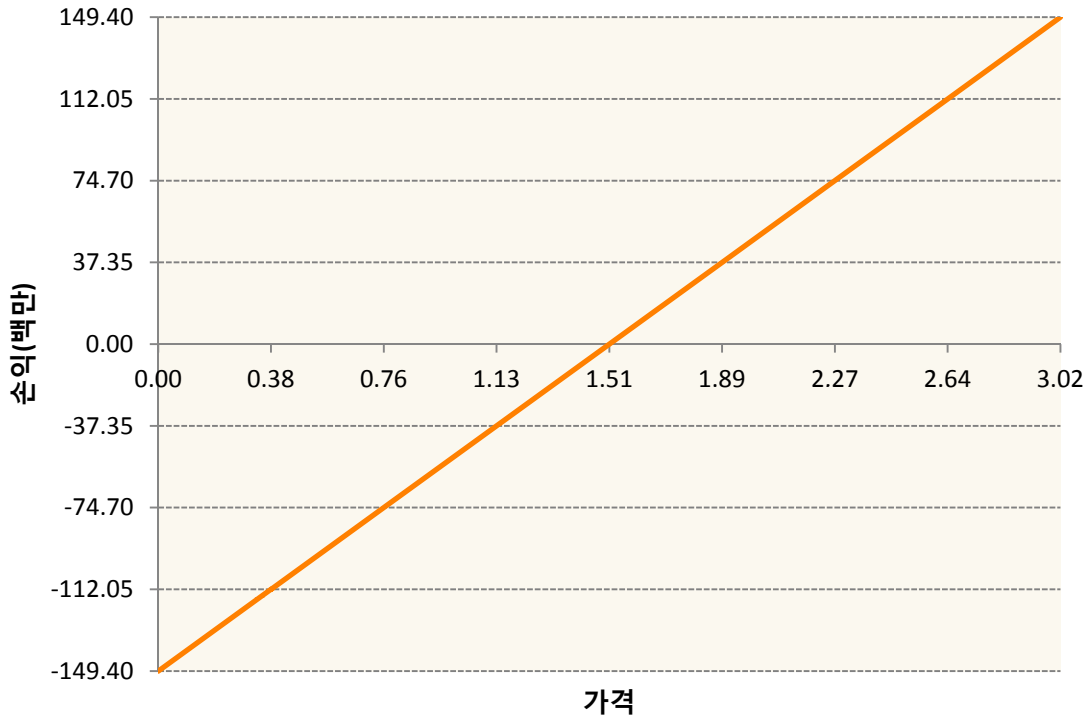
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



QSK0-Low Su Gasoil G Mar20



XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| C0K0 | BRENT CRUDE FUTR May20 | 32 |
| CLK0 | WTI CRUDE FUTURE May20 | 35 |
| HOK0 | NY Harb ULSD Fut May20 | 12 |
| KR4175Q30C | 2020-03 달러선물 | 10 |
| NGK20 | NATURAL GAS FUTR May20 | 48 |
| QSK0 | Low Su Gasoil G Mar20 | 13 |
| XBK0 | GASOLINE RBOB FUT May20 | 12 |

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

(단위:백만원)

312

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-03-09 |
| 기준일 | 2020-03-06 |

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

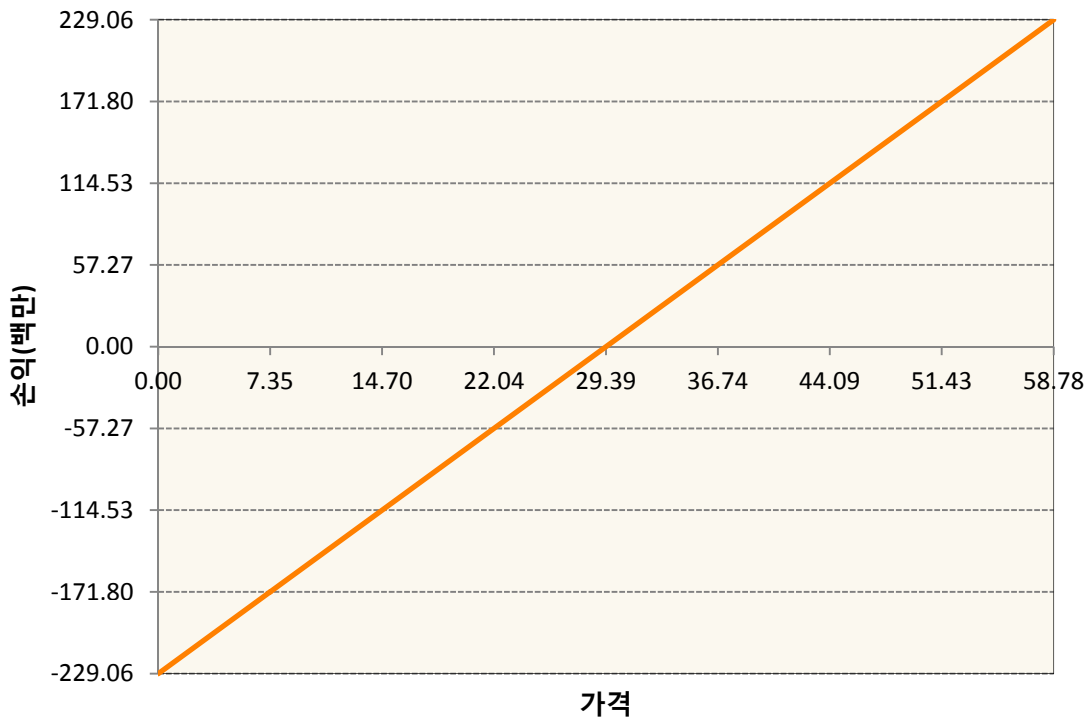
1. 계약금액

(단위:백만원)

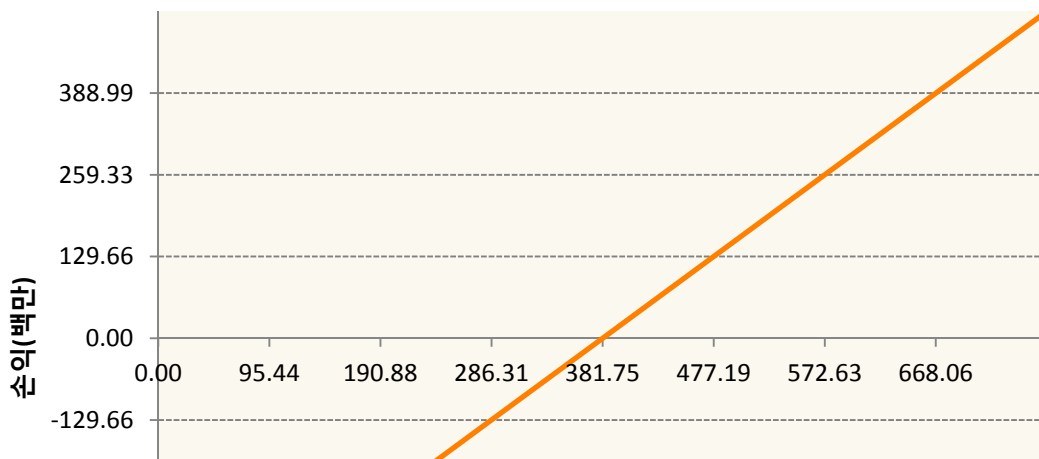
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,581 | 155 | 2,426 | |

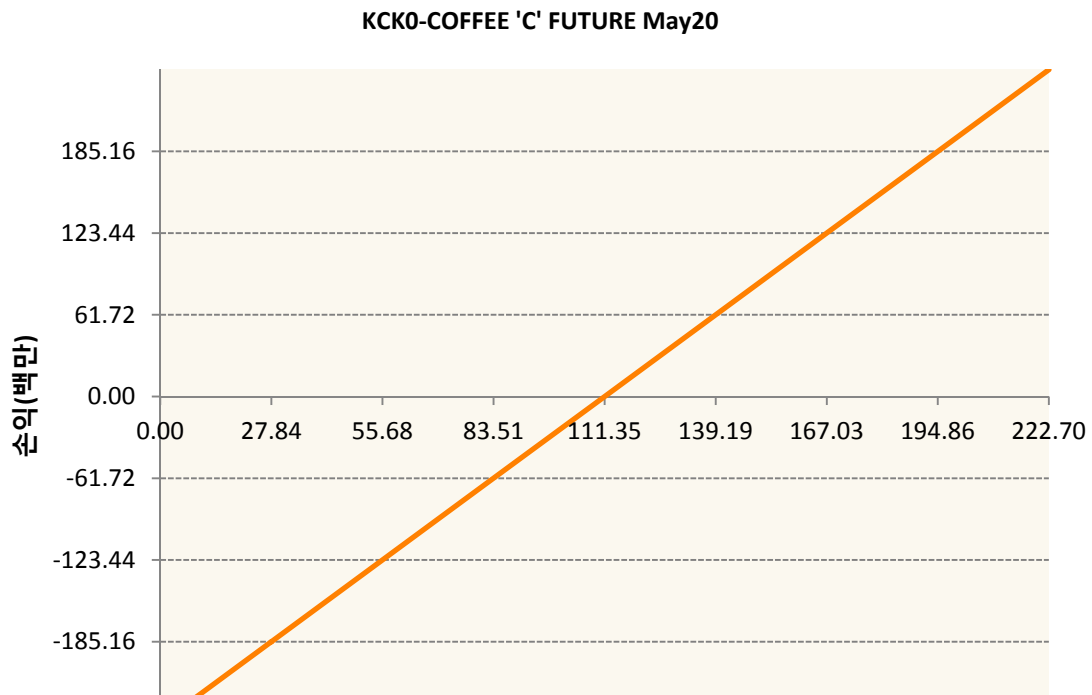
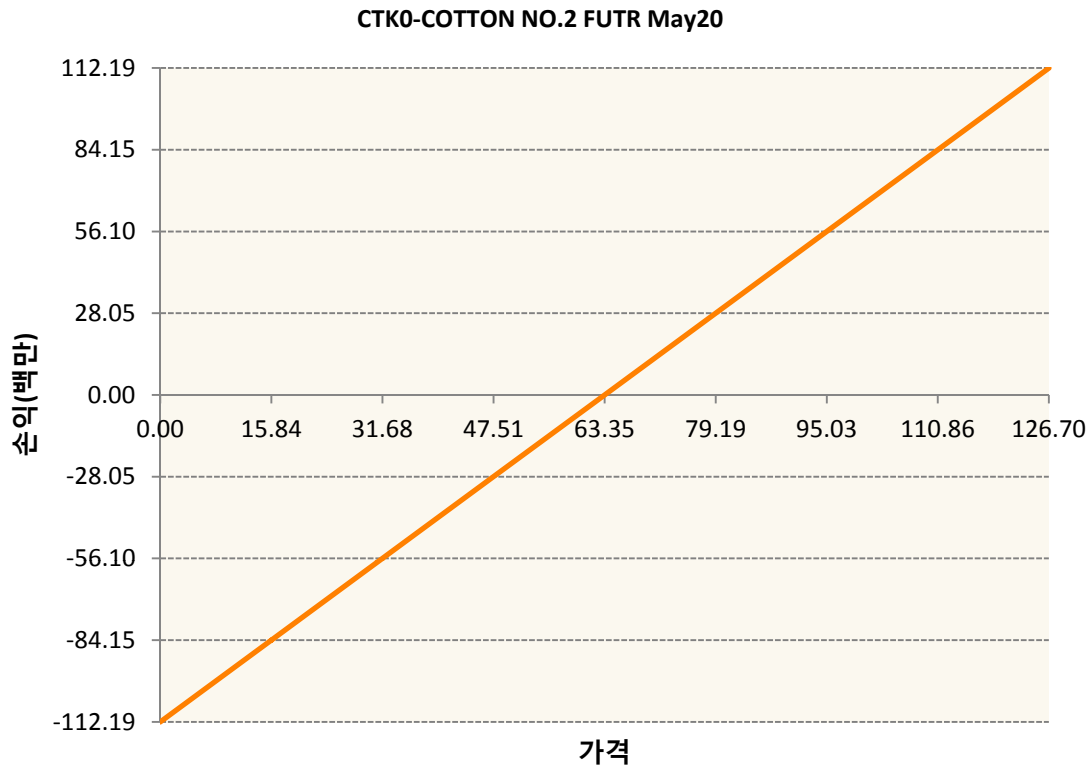
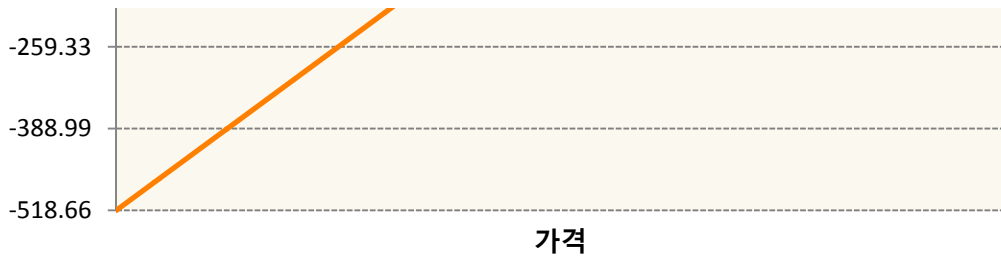
2. 만기시점의 손익구조

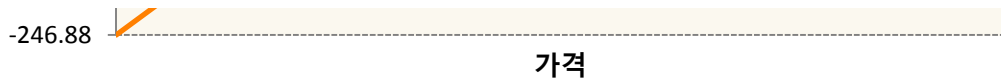
BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20



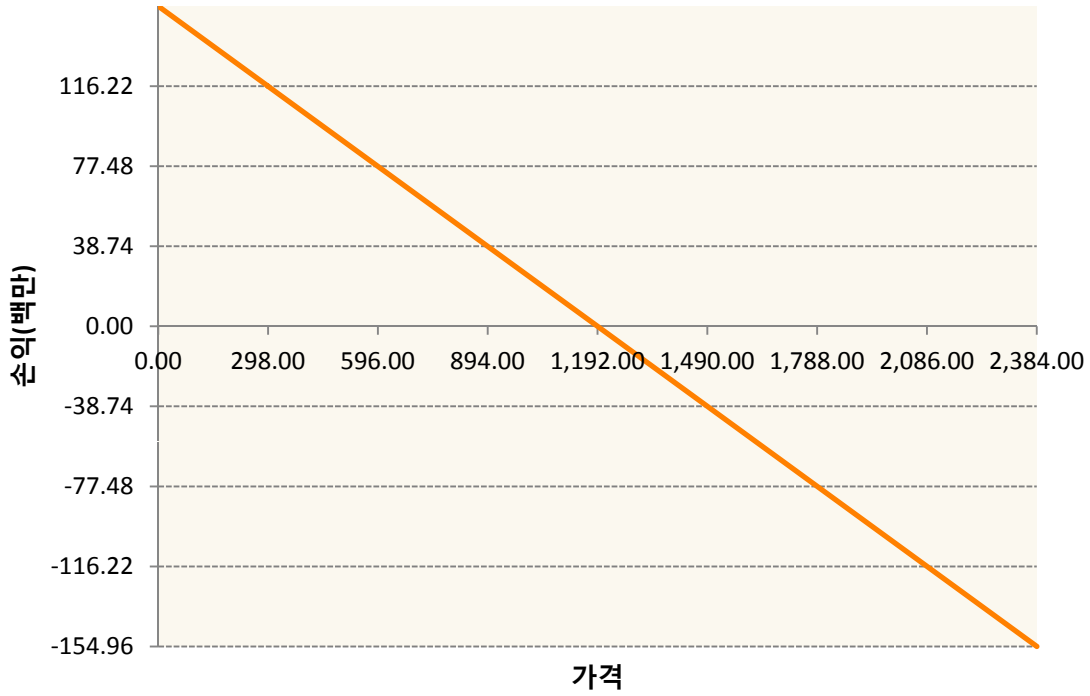
CK0-CORN FUTURE May20



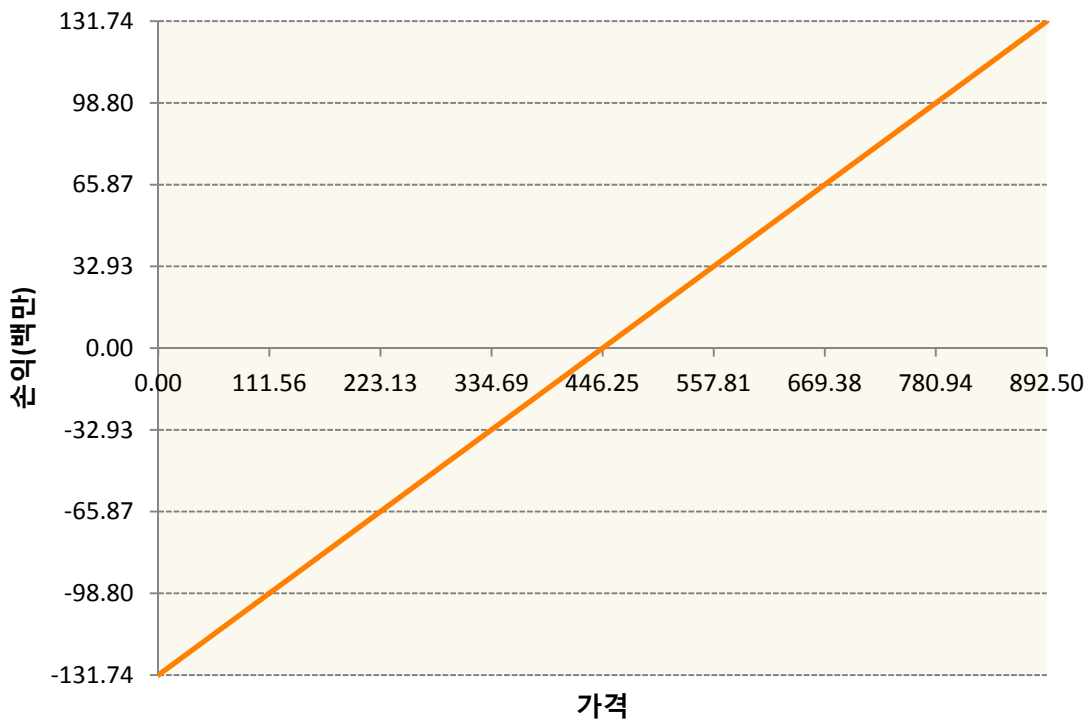




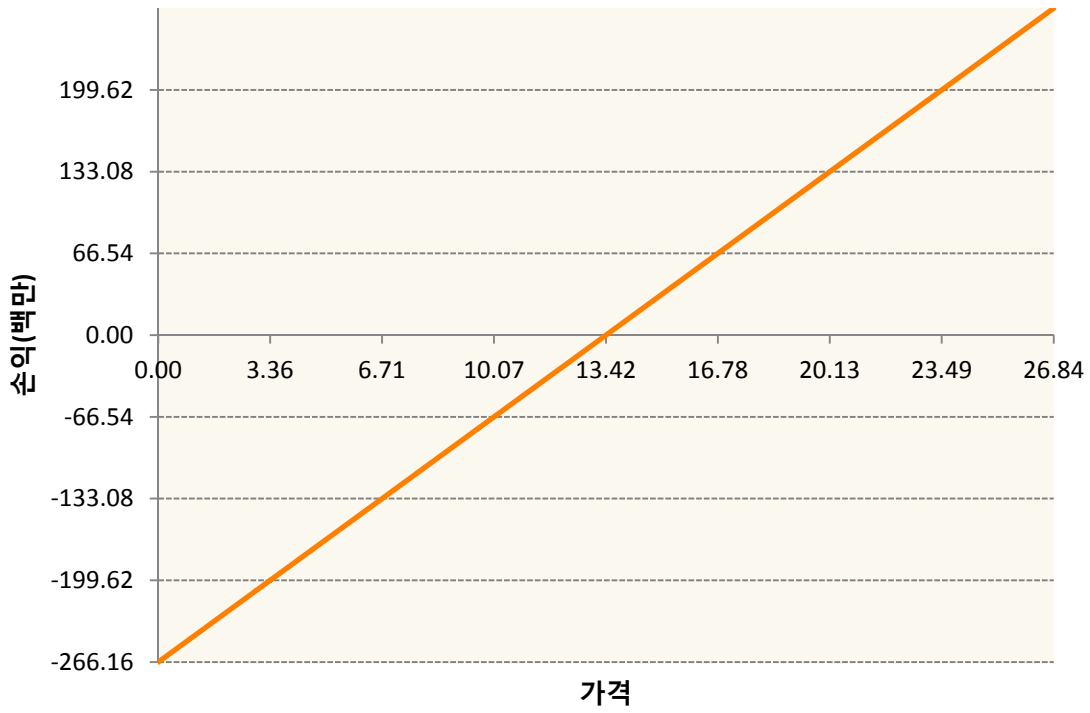
KR4175Q30009-2020-03 달러선물



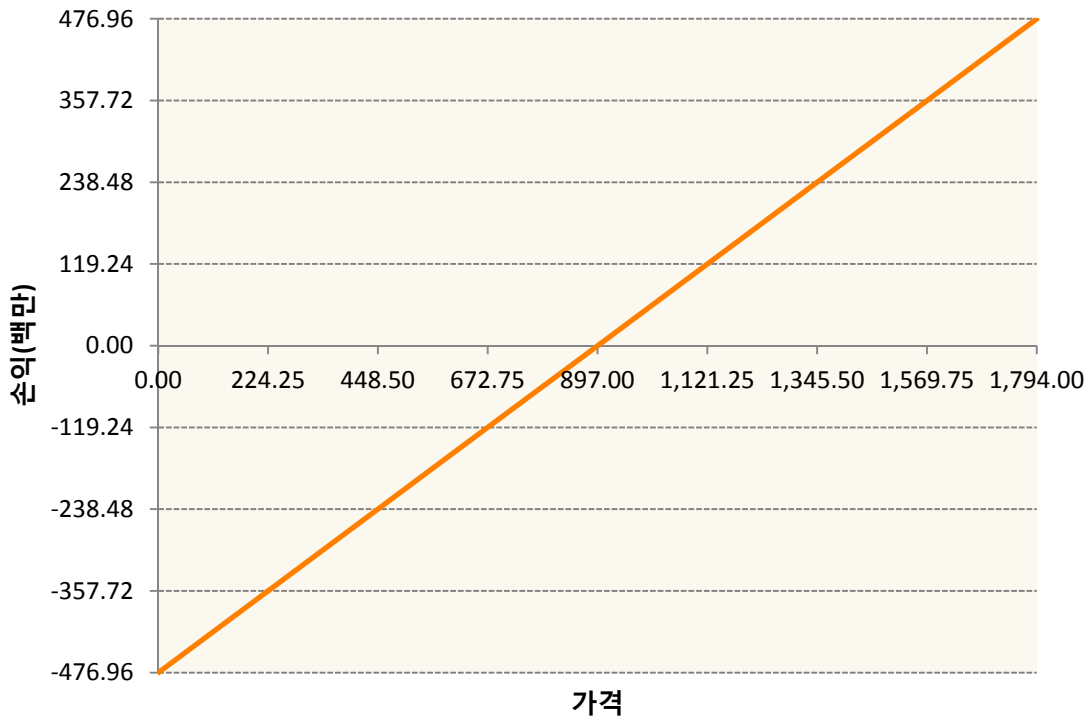
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



SBK0-Sugar May20

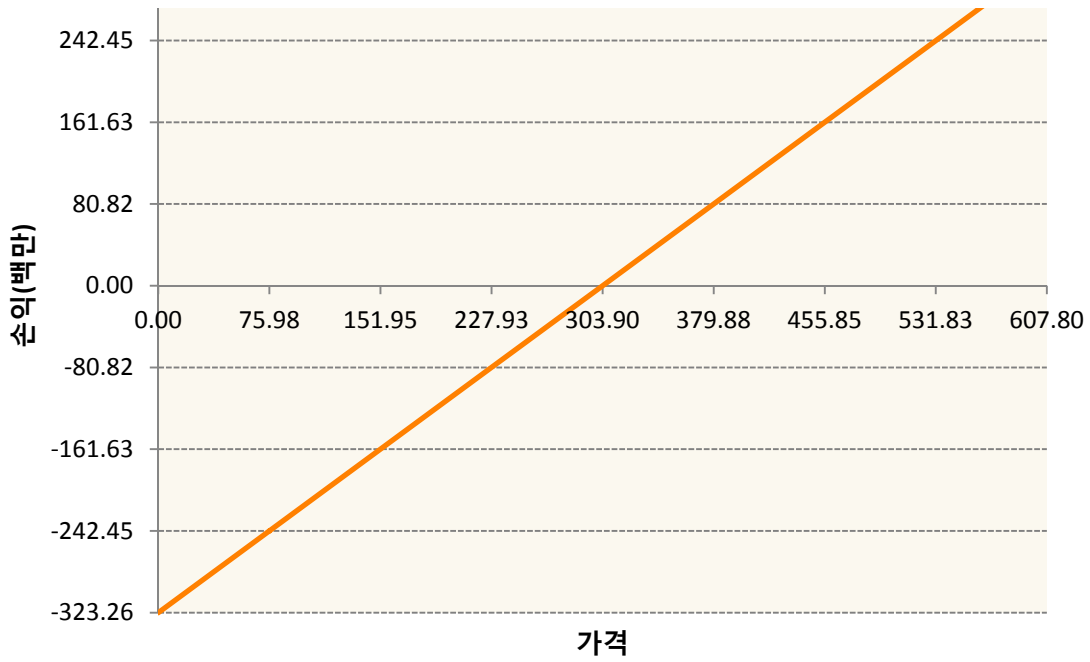


SK0-SOYBEAN FUTURE May20

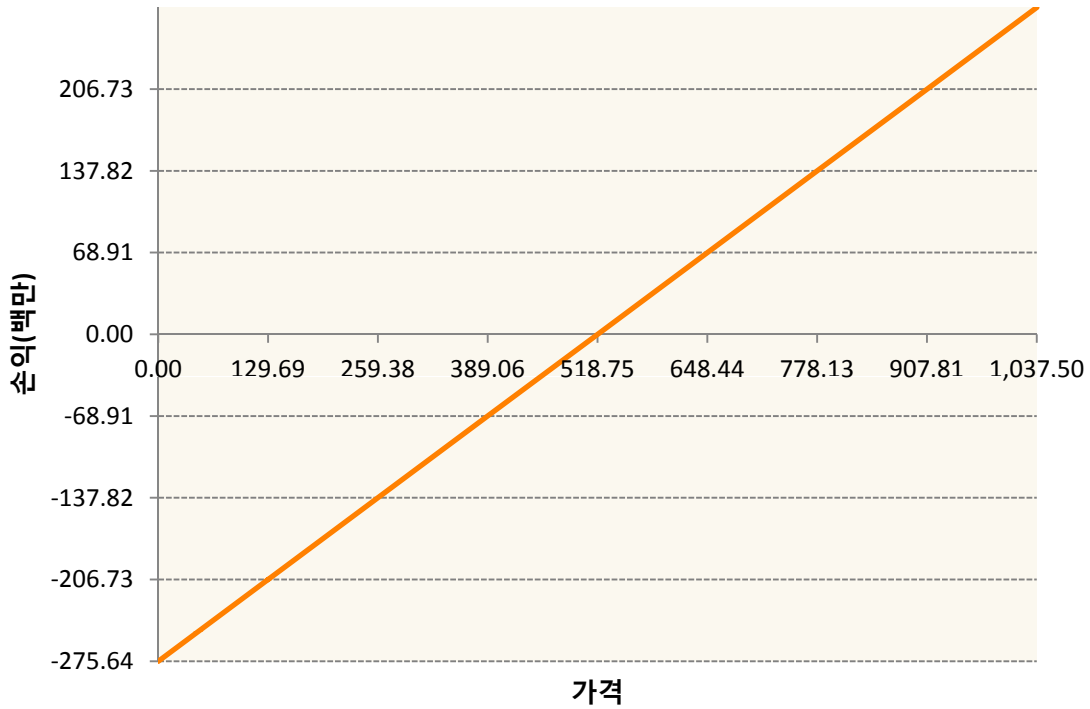


SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





WK0-WHEAT FUTURE(CBT) May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| BOK0 | SOYBEAN OIL FUTR May20 | 18 |
| CK0 | CORN FUTURE May20 | 41 |
| CTK0 | COTTON NO.2 FUTR May20 | 9 |
| KCK0 | COFFEE 'C' FUTURE May20 | 20 |
| KR4175Q30C | 2020-03 달러선물 | 12 |

| | | |
|------|-------------------------|----|
| KWK0 | KC HRW WHEAT FUT May20 | 11 |
| SBK0 | Sugar May20 | 21 |
| 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)

223