

공시일	2020-03-11
기준일	2020-03-10

## 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	2020-03-11
기준일	2020-03-10

## 스마트인덱스모

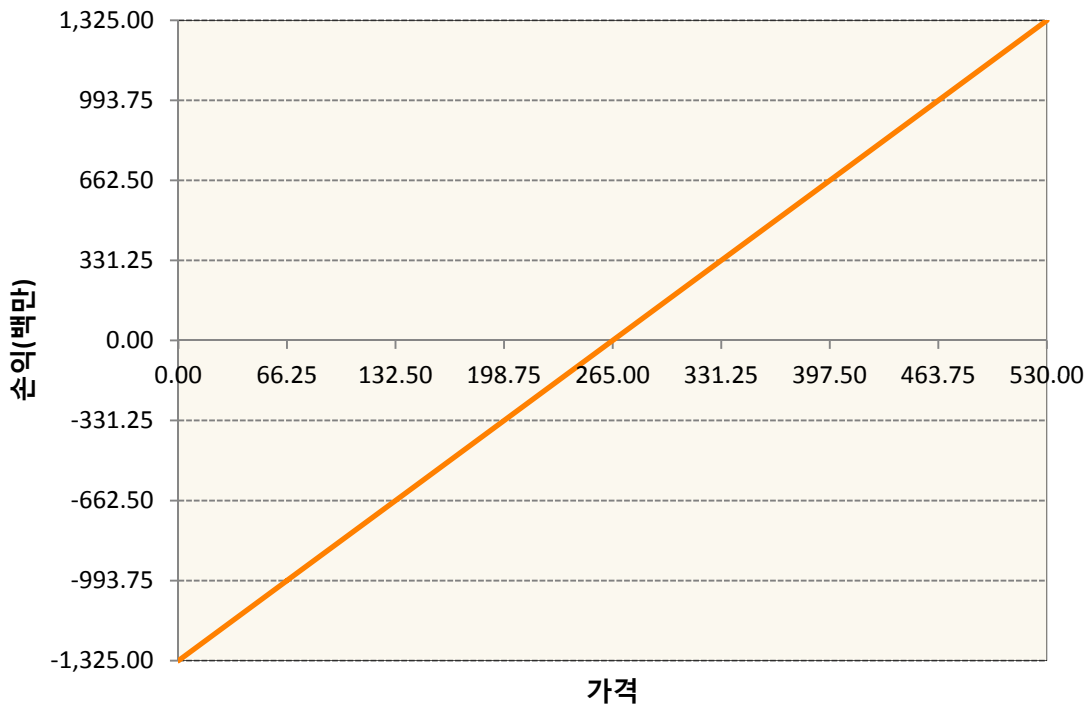
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

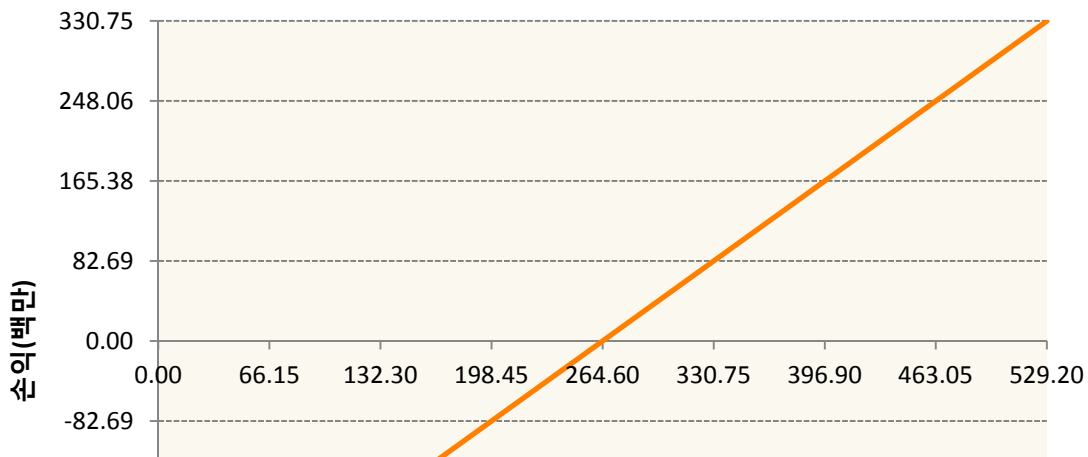
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,656	0	1,656	장내

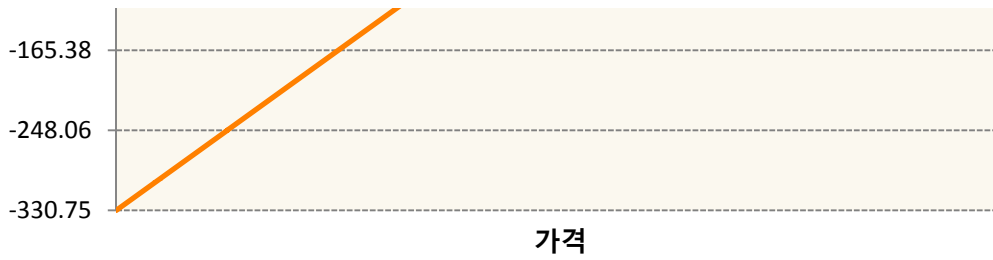
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물





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

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						106
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106	
-5.33%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71	
-2.67%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	35	35	35	35	35	35	35	
5.33%	71	71	71	71	71	71	71	
8.00%	106	106	106	106	106	106	106	
KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						26
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26	
-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%	26	26	26	26	26	26	26	

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

**124**

공시일	2020-03-11
기준일	2020-03-10

## 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

964

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

690

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-11
기준일	2020-03-10

## SMART중국본토중소형CSI500상장

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	7,308	0	7,308	장외
누계	지수	스왑	7,308	0	7,308	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S200310

600
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

932
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-11
기준일	2020-03-10

## 유로인덱스모(주식-파생형)

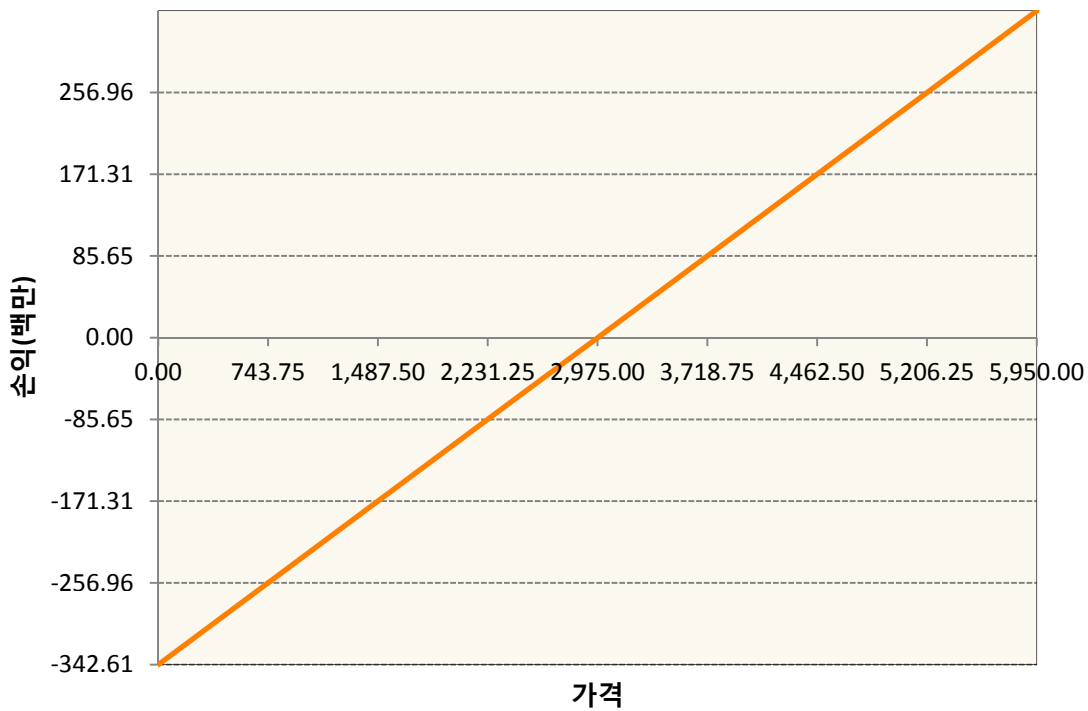
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	343	0	343	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGH0-EURO STOXX 50 Mar20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH0	EURO STOXX 50 Mar20	27
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

23
----

공시일	2020-03-11
기준일	2020-03-10

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

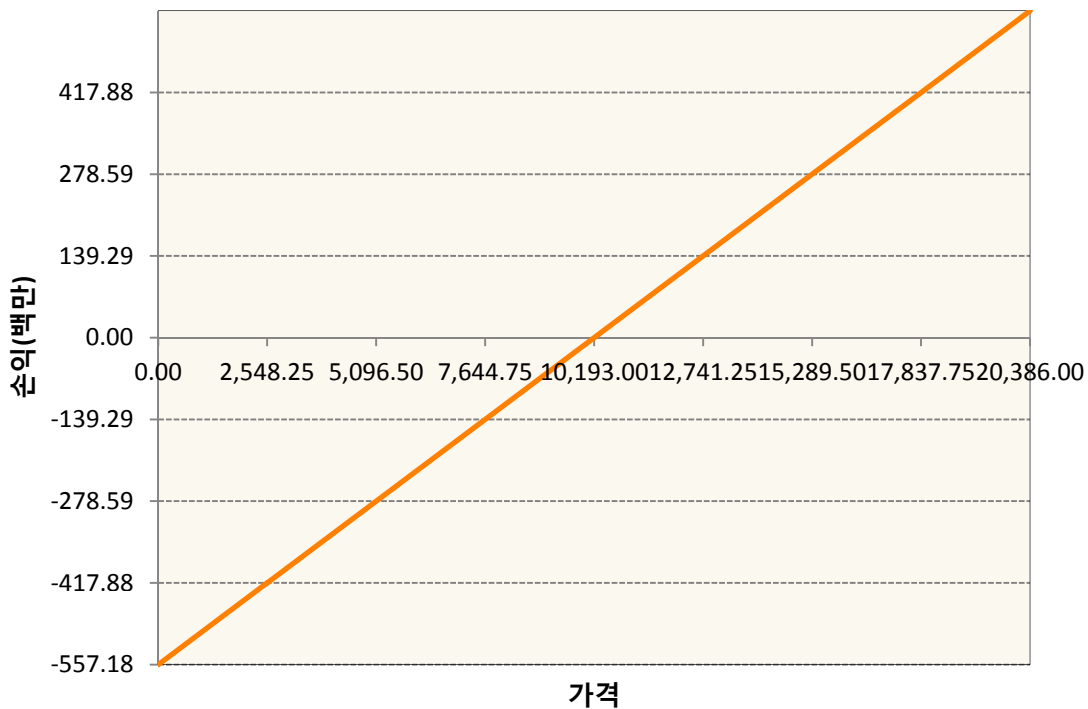
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	557	0	557	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH0	HSCEI Futures Mar20	45
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

42
----

공시일	2020-03-11
기준일	2020-03-10

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

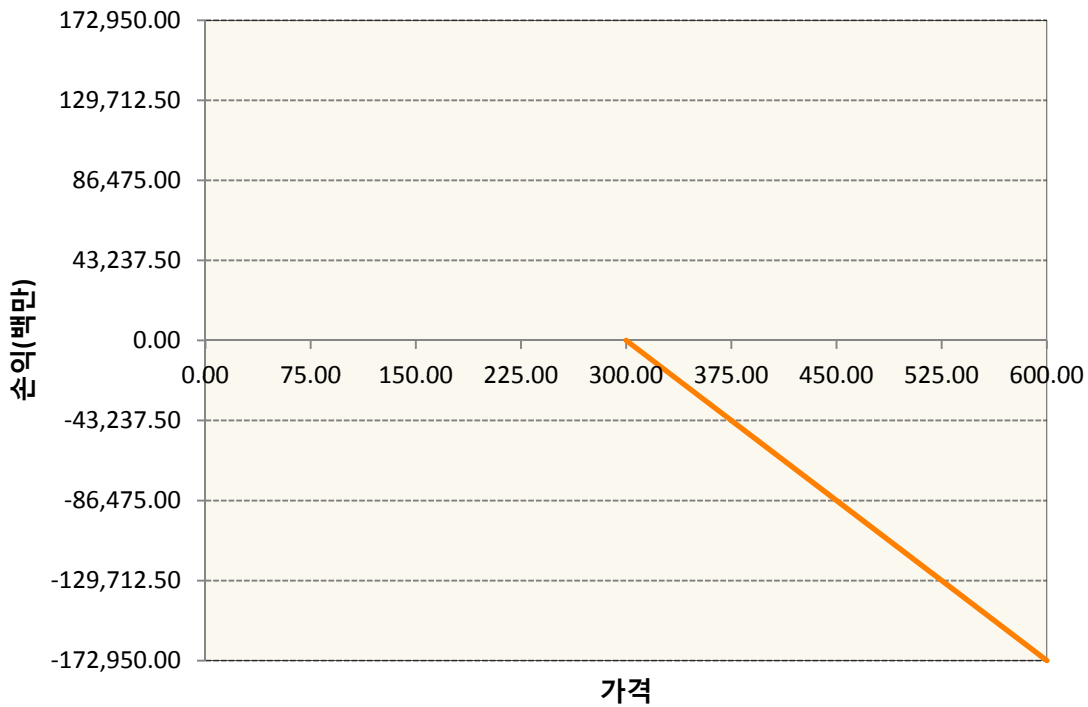
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

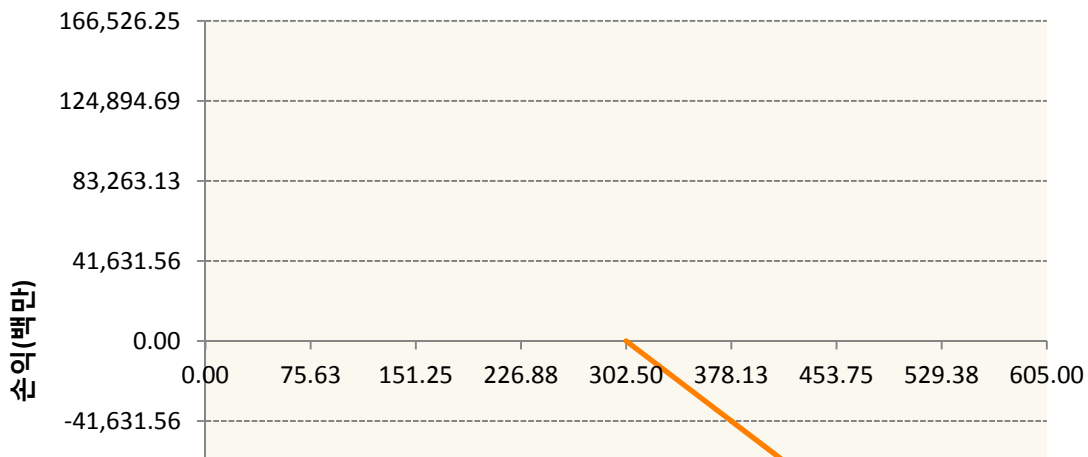
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	448,226	-448,226	장내

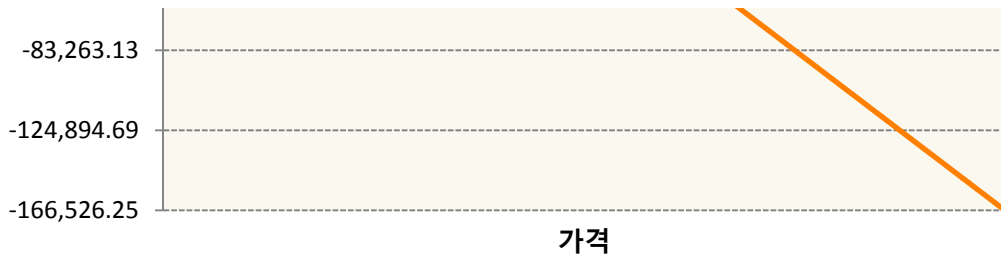
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q33007-2020-03 콜300

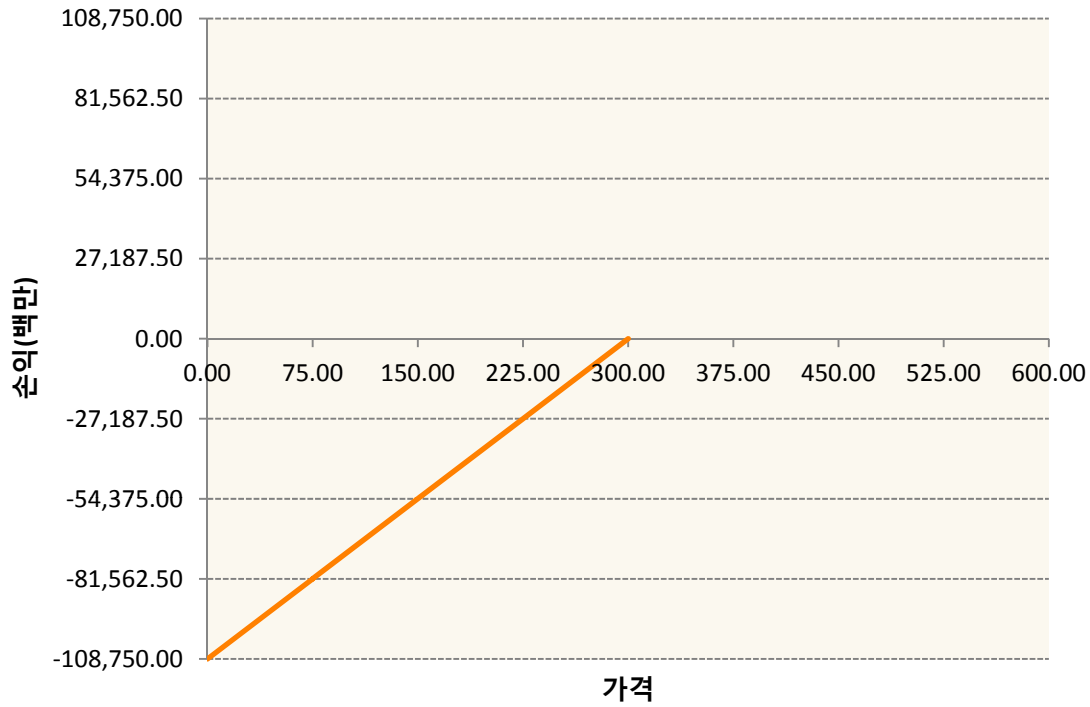


KR4201Q33023-2020-03 콜302.5





KR4301Q33005-2020-03 풋300



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q33007		2020-03 콜300					293	
		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	0	-1	-2	-4	-8	
5.33%	-1	-2	-5	-12	-22	-38	-59	
8.00%	-21	-42	-73	-114	-164	-224	-293	
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5					173	
		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	0
2.67%	0	0	0	0	-1	-2	-4
5.33%	0	-1	-2	-5	-10	-18	-31
8.00%	-7	-16	-32	-55	-86	-125	-173
KR4301Q33005 2020-03 풋300							7,674
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,674	-7,674	-7,674	-7,674	-7,674	-7,674	-7,674
-5.33%	-5,116	-5,116	-5,116	-5,116	-5,116	-5,116	-5,116
-2.67%	-2,558	-2,558	-2,558	-2,558	-2,558	-2,558	-2,558
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	2,558	2,558	2,558	2,558	2,558	2,558	2,557
5.33%	5,116	5,116	5,115	5,114	5,111	5,107	5,100
8.00%	7,669	7,663	7,652	7,637	7,617	7,592	7,562

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

(단위:백만원)

7,681

공시일	2020-03-11
기준일	2020-03-10

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

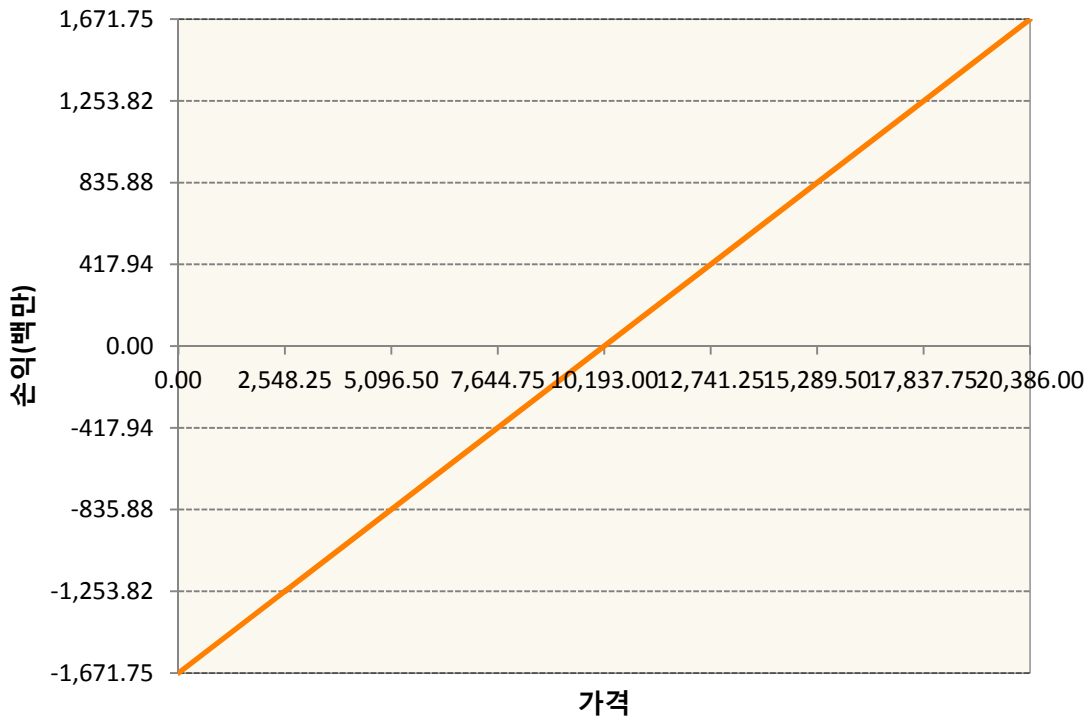
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

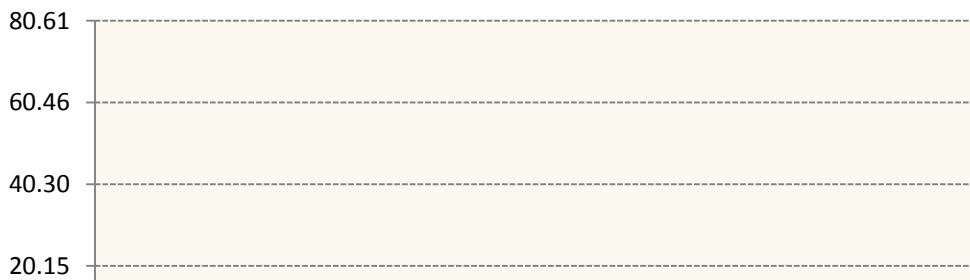
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,672	0	1,672	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,718	-4,718	장내
누계	통화	선도	0	2,162	-2,162	장외

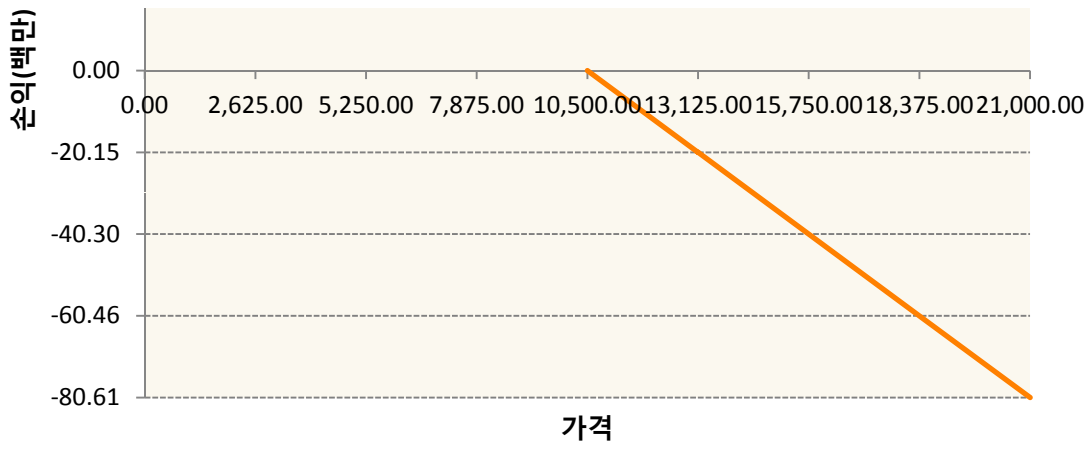
### 2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20

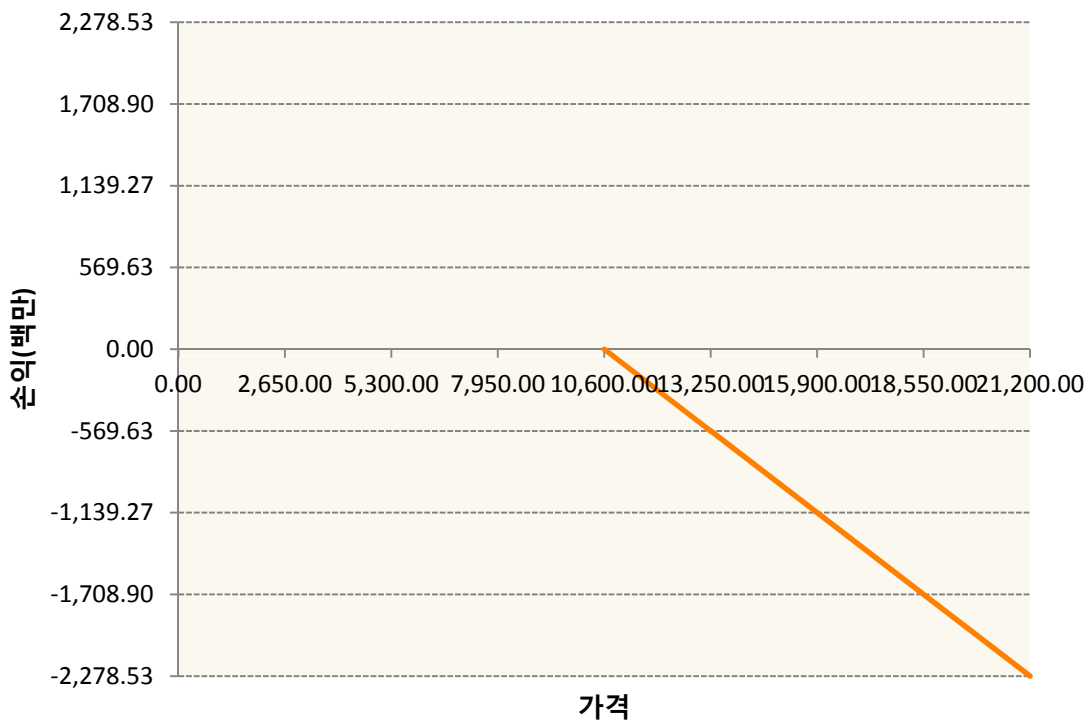


OHHIH0-C105-HSCEI

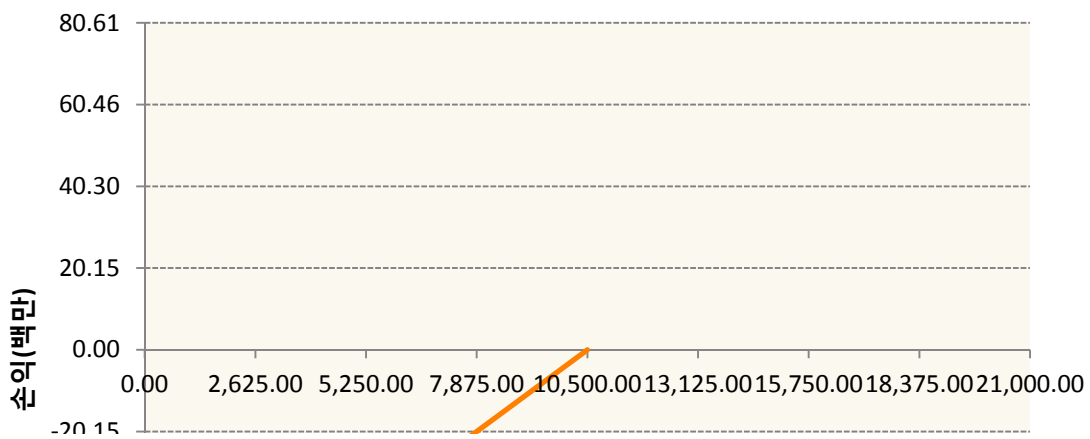


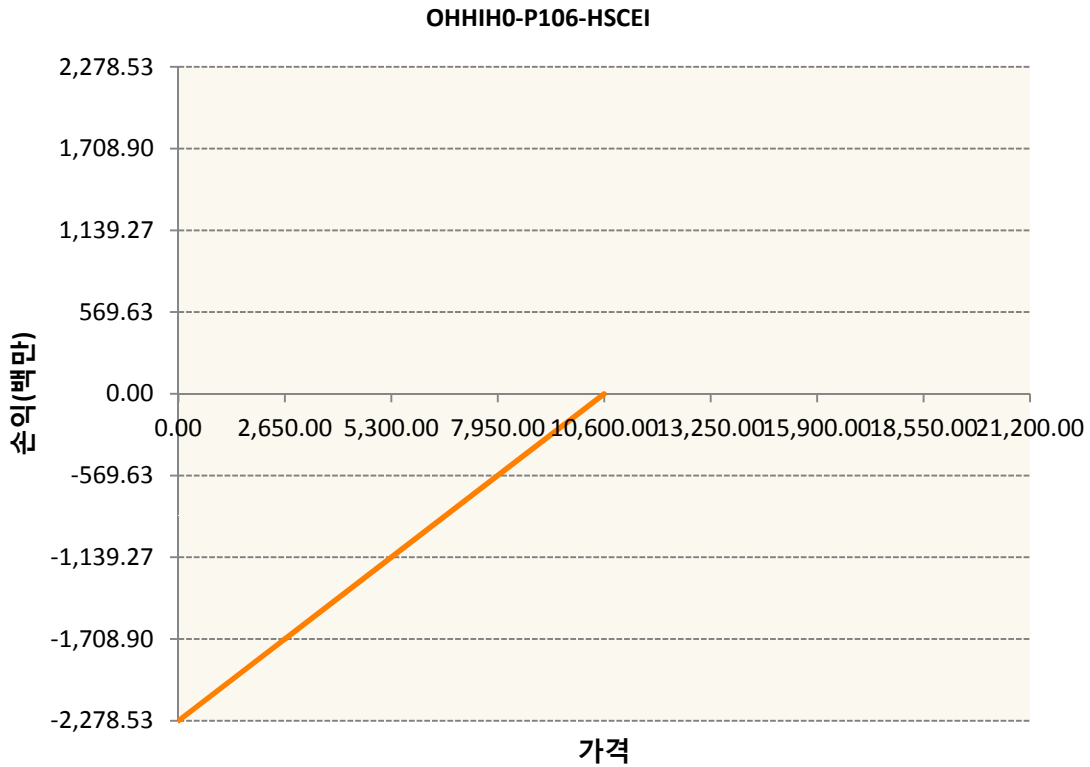


OHHIH0-C106-HSCEI



OHHIH0-P105-HSCEI





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

FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E	173
HCH0 HSCEI Futures Mar20	134
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)

538

공시일	2020-03-11
기준일	2020-03-10

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

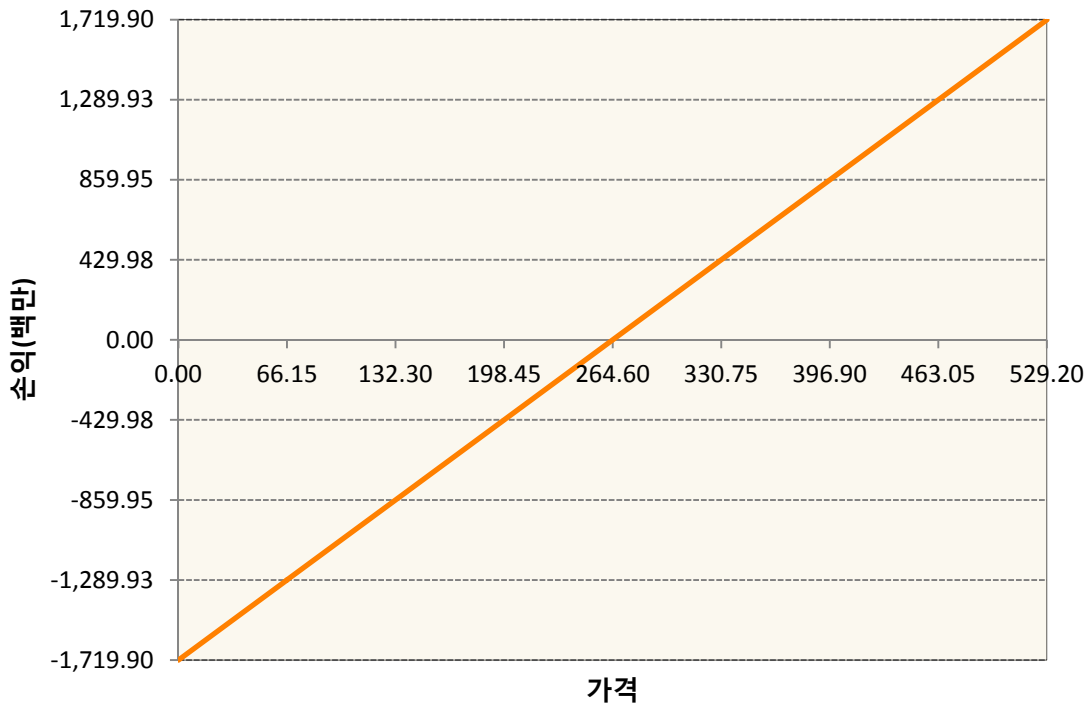
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

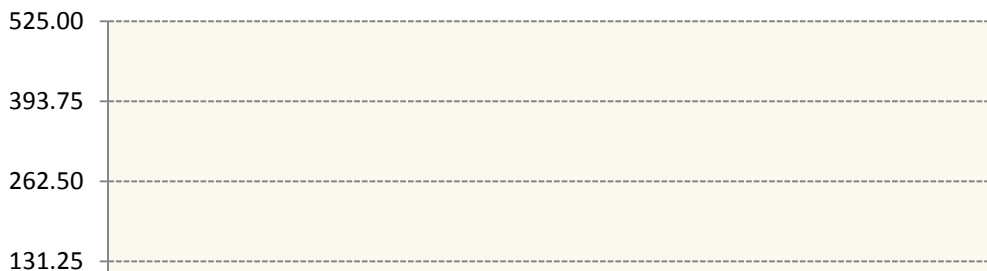
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,714	0	1,714	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,720	0	1,720	장내
누계	유가증권	스왑	3,125	0	3,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,612	-3,612	장내

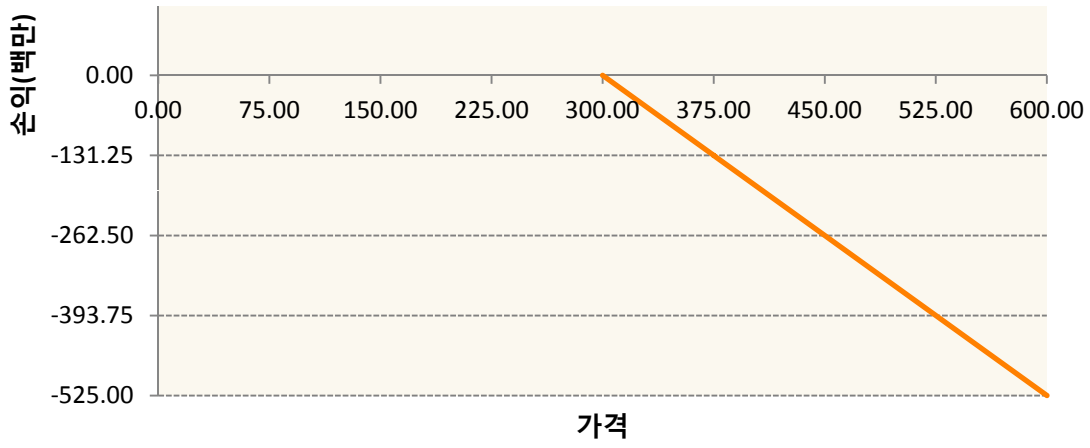
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

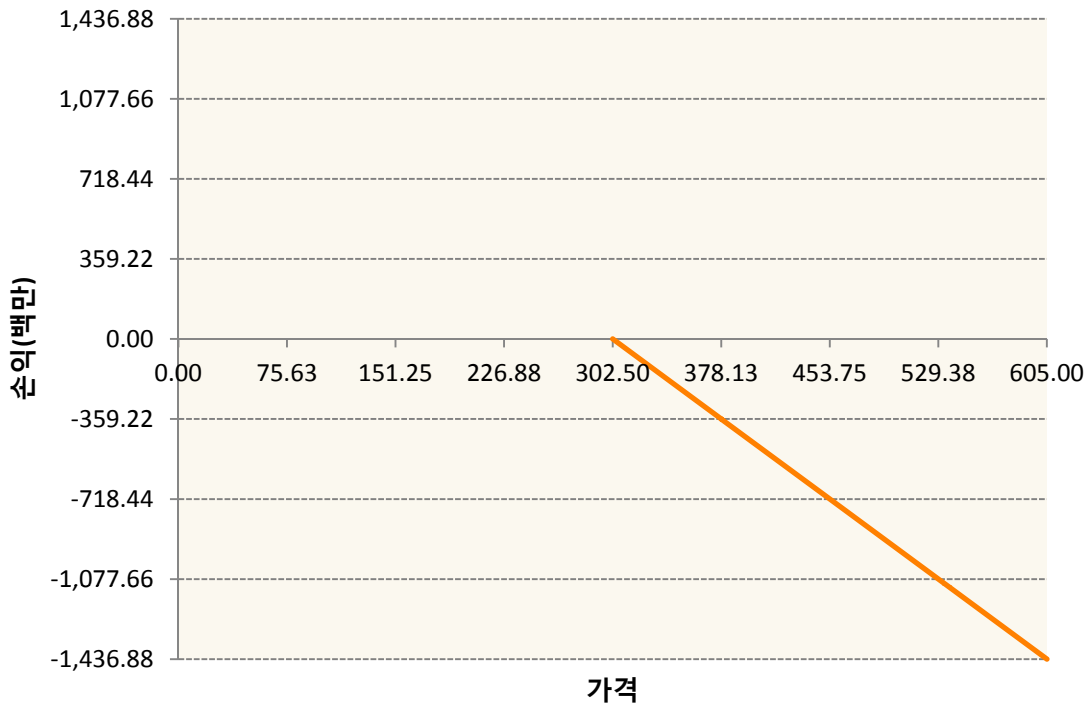


KR4201Q33007-2020-03 콜300

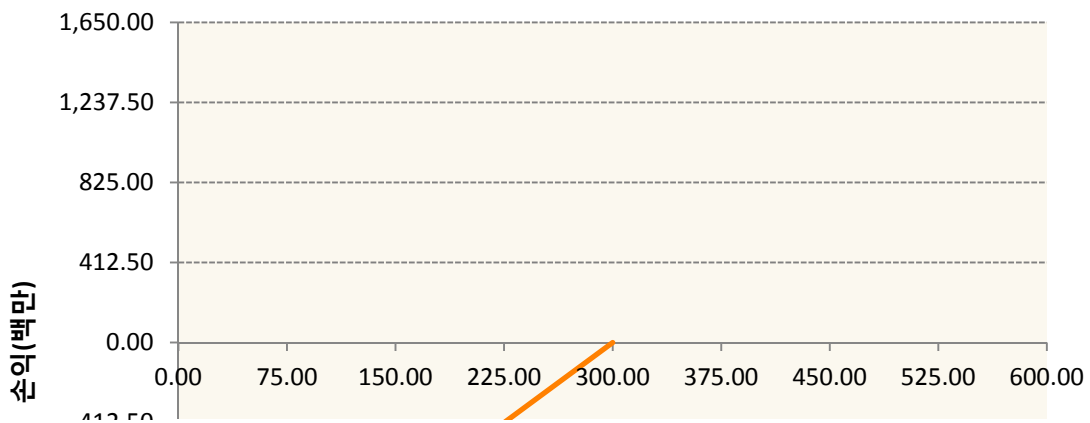




KR4201Q33023-2020-03 콜302.5



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	
KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						138
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-138	-138	-138	-138	-138	-138	-138	
-5.33%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92	
-2.67%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	46	46	46	46	46	46	46	
5.33%	92	92	92	92	92	92	92	
8.00%	138	138	138	138	138	138	138	
KR4201Q33007		2020-03 콜300						1
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	0	
2.67%	0	0	0	0	0	0	0	
5.33%	0	0	0	0	0	0	0	
8.00%	0	0	0	0	0	-1	-1	
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5						1
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	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	-1	-1	-1
KR4301Q33005      2020-03 풋300							116
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116
-5.33%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	39	39	39	39	39	39	39
5.33%	78	78	78	78	78	77	77
8.00%	116	116	116	116	116	115	115

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

(단위:백만원)

**514**

공시일	2020-03-11
기준일	2020-03-10

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

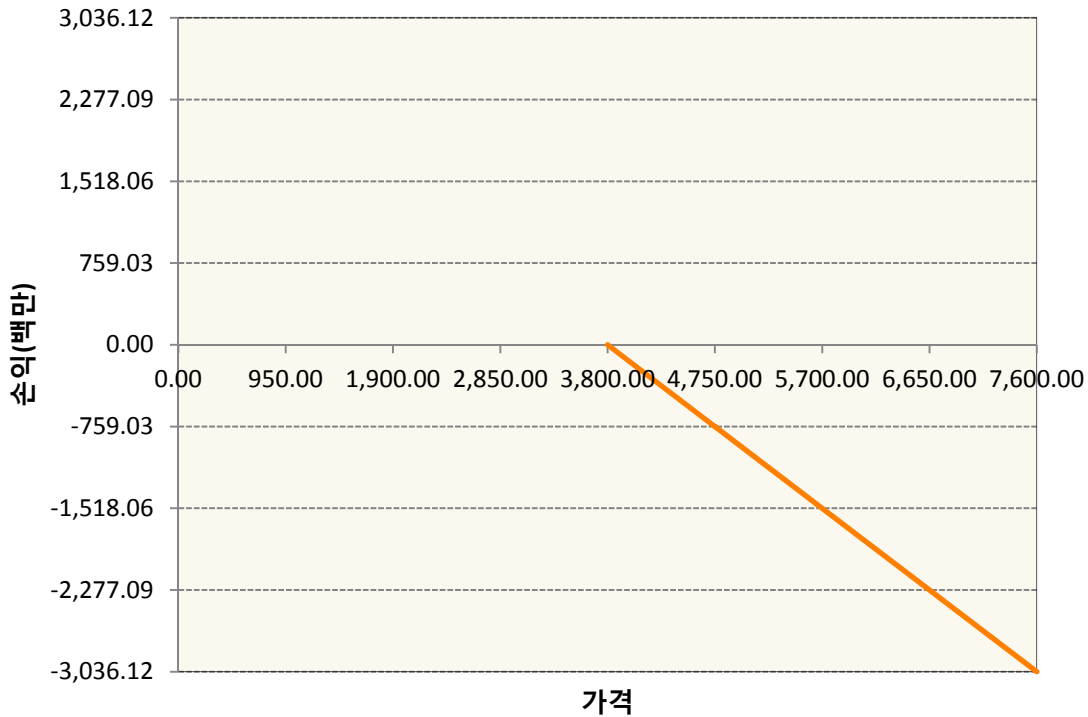
### 1. 계약금액

(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	79	0	79	
누계	유가증권	스왑	10,925	0	10,925	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,279	-6,279	장내
누계	통화	선도	542	3,553	-3,012	장외

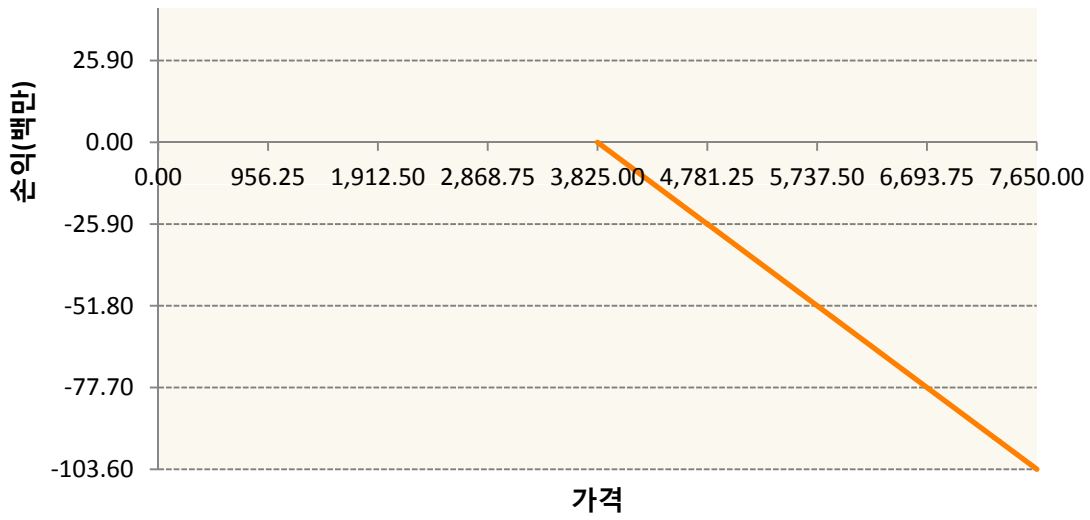
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXH0-C3800-EURO STOXX 50**

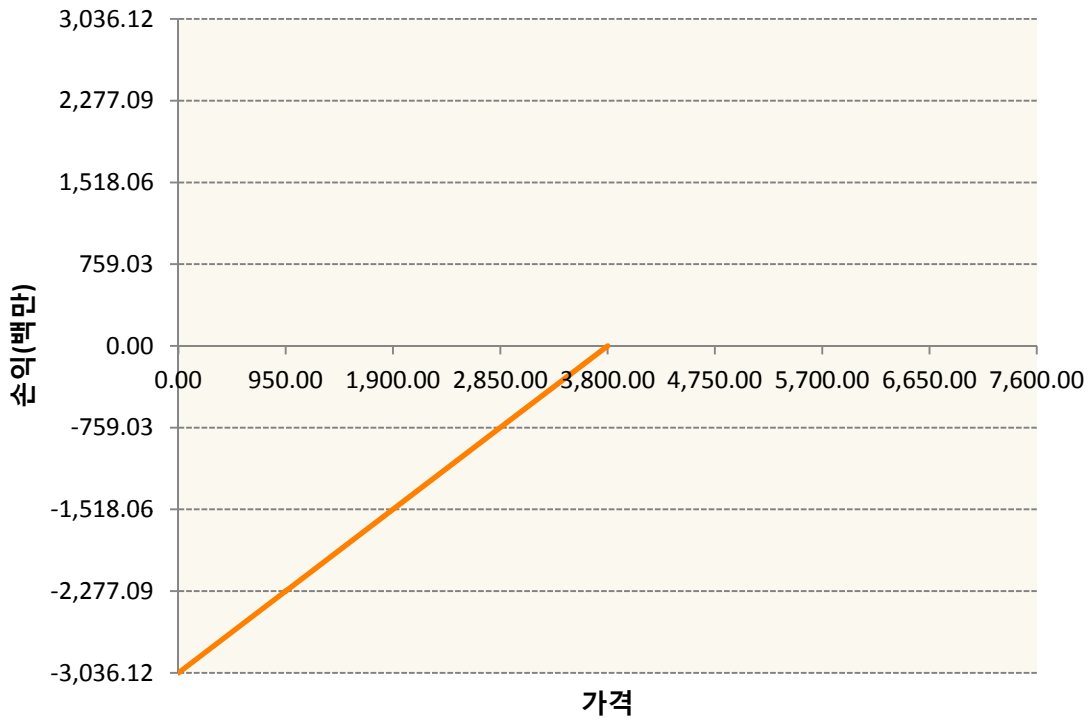


**OESXH0-C3825-EURO STOXX 50**

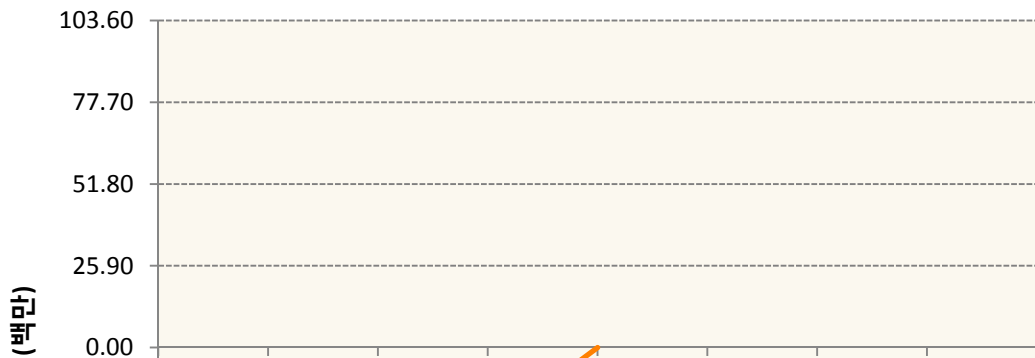


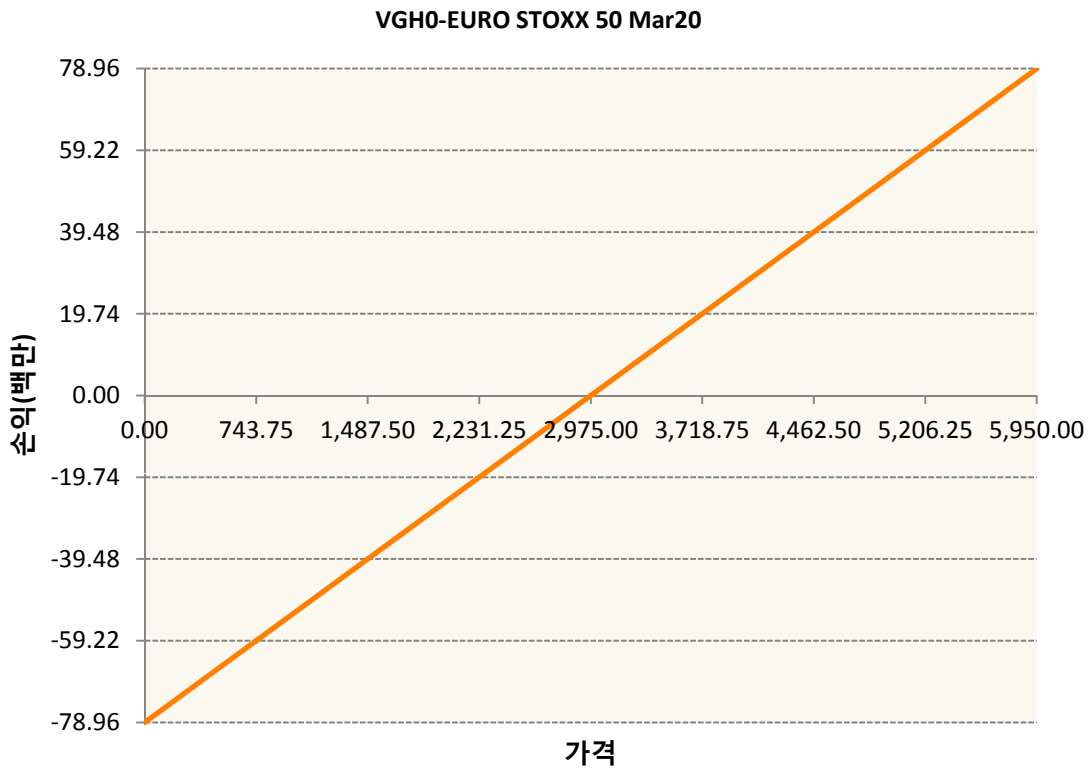
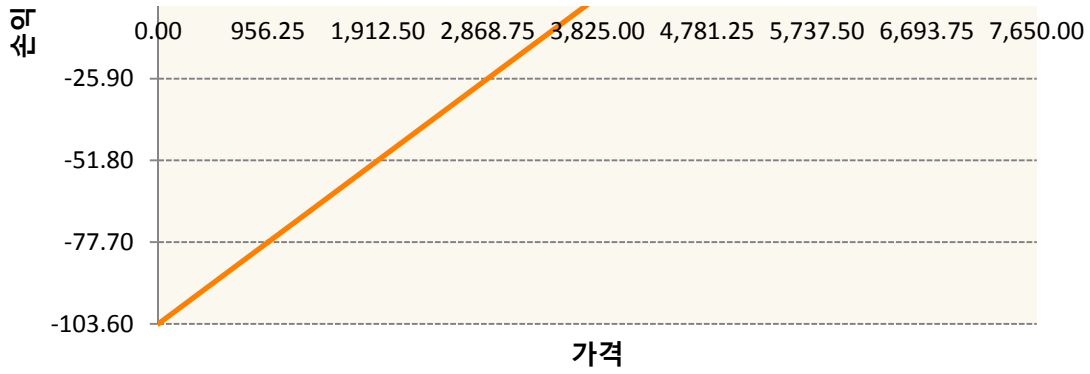


OESXH0-P3800-EURO STOXX 50



OESXH0-P3825-EURO STOXX 50





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

260105SQP\SG EURO Covered CALL STRATEGY	173
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	284
FX21020H00 EUR/KRW 27-03-20E	43
OESXH0-C3\xEURO STOXX 50	243
OESXH0-C3\xEURO STOXX 50	8
OESXH0-P3\xEURO STOXX 50	243
OESXH0-P3\xEURO STOXX 50	8
VGHO EURO STOXX 50 Mar20	6

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

(단위:백만원)

884



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

(단위:백만원)

955

공시일	2020-03-11
기준일	2020-03-10

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

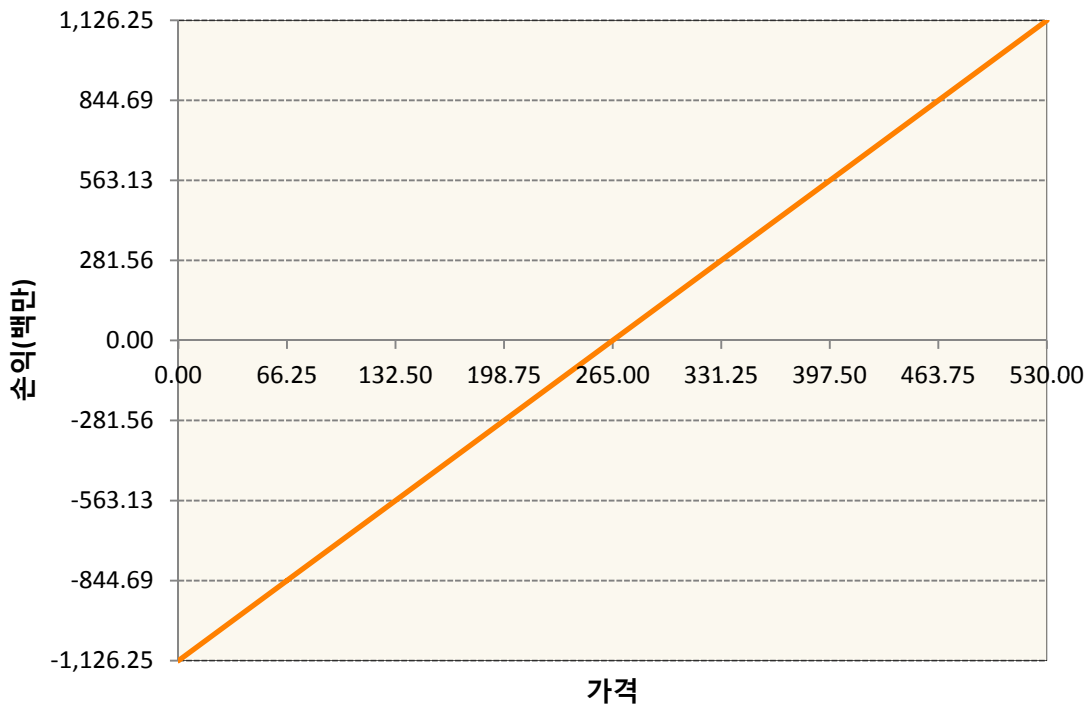
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,126	0	1,126	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						90
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90	
-5.33%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60	
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	30	30	30	30	30	30	30	
5.33%	60	60	60	60	60	60	60	
8.00%	90	90	90	90	90	90	90	

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

(단위:백만원)

84



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

(단위:백만원)

124

공시일	2020-03-11
기준일	2020-03-10

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

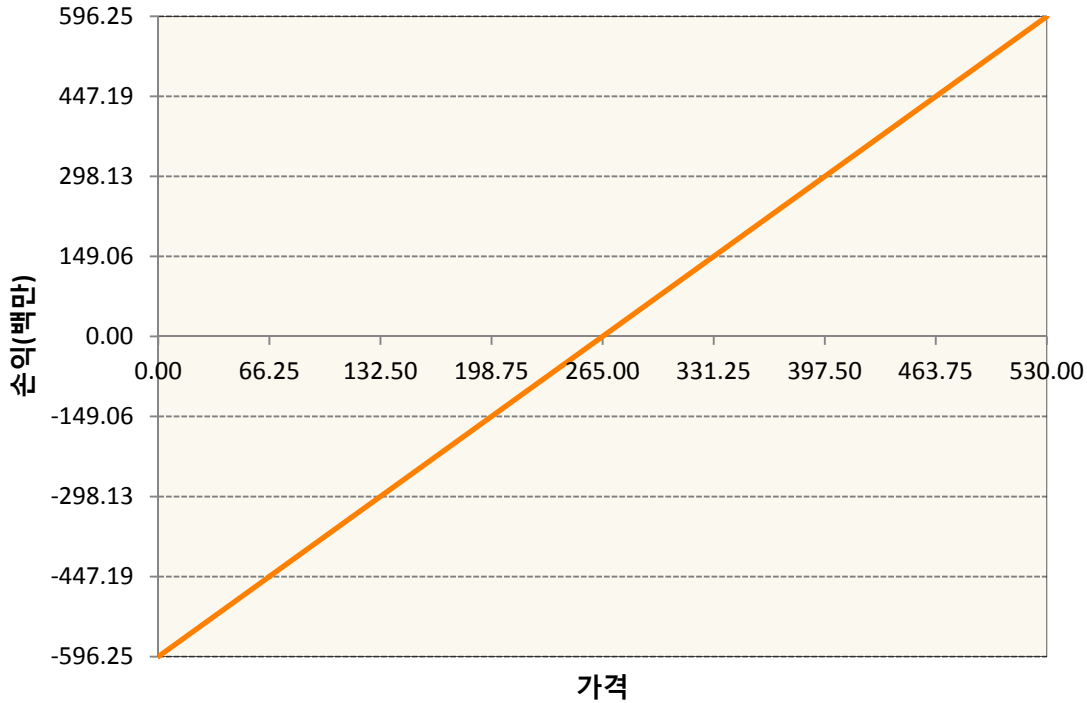
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	596	0	596	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						48
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48	
-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%	48	48	48	48	48	48	48	

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

(단위:백만원)

45

공시일	2020-03-11
기준일	2020-03-10

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

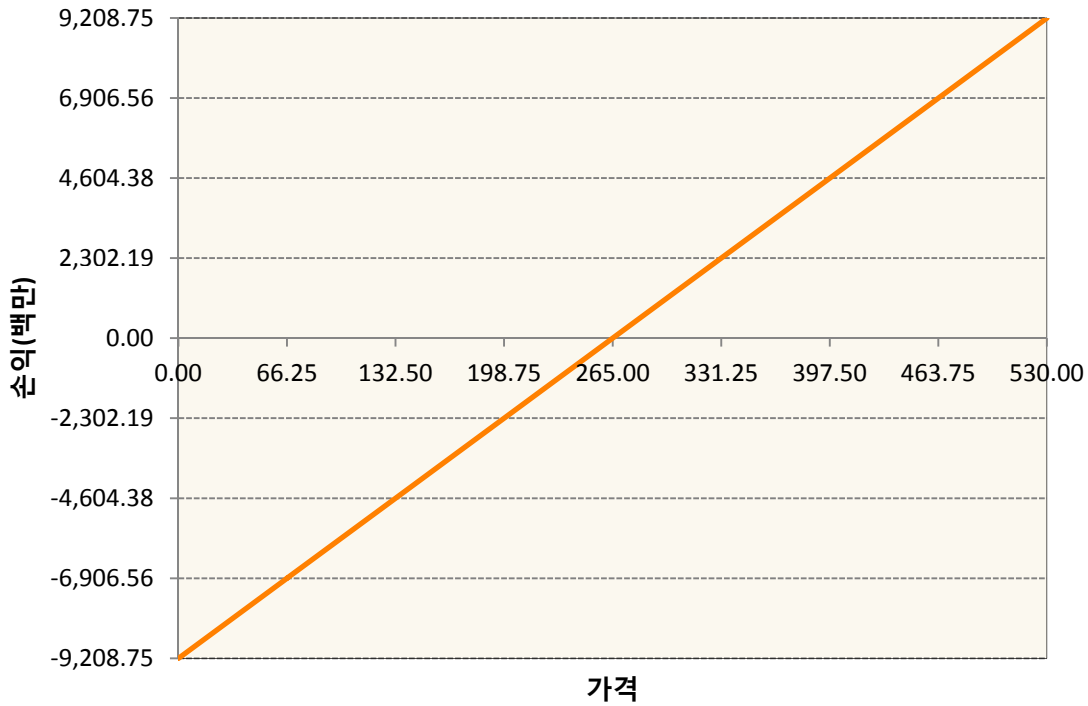
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

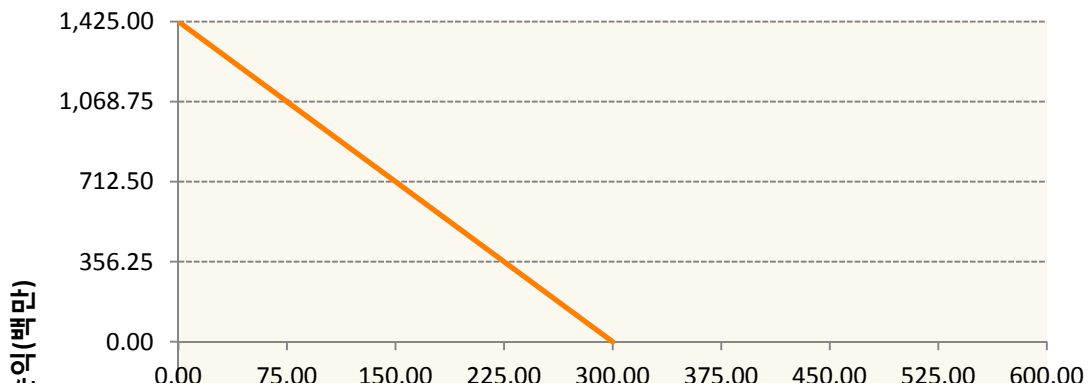
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,209	0	9,209	장내
누계	유가증권	옵션	2,257	0	2,257	장내

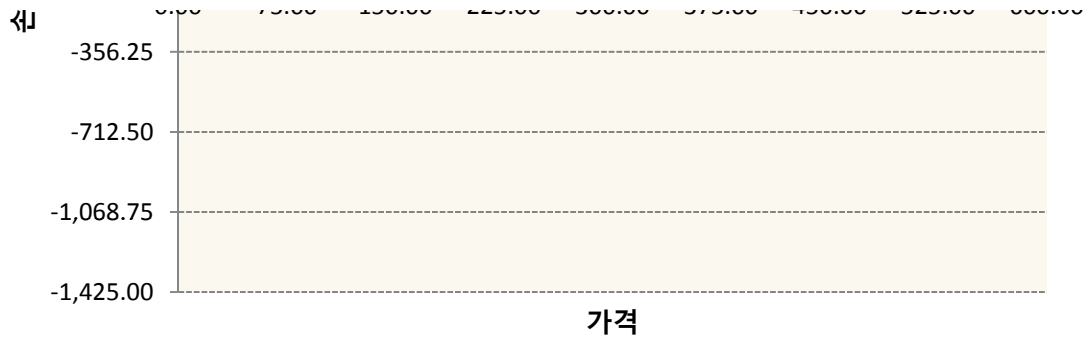
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

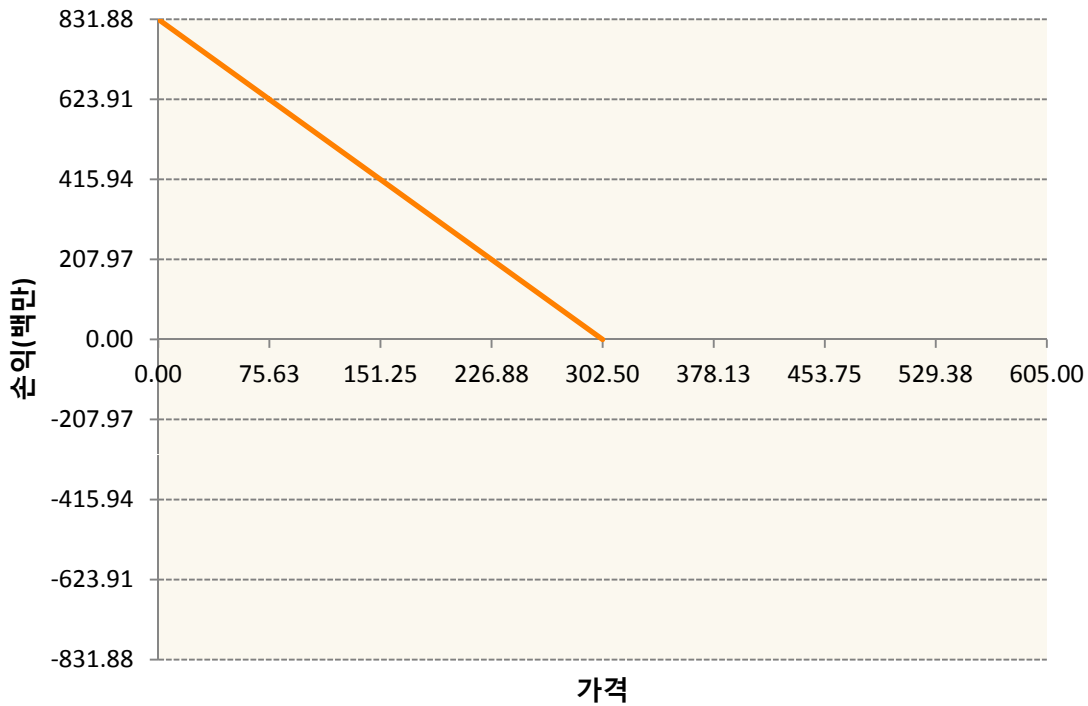


KR4301Q33005-2020-03 풋300





KR4301Q33021-2020-03 풋302.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						736
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-736	-736	-736	-736	-736	-736	-736	
-5.33%	-491	-491	-491	-491	-491	-491	-491	
-2.67%	-245	-245	-245	-245	-245	-245	-245	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	245	245	245	245	245	245	245	
5.33%	491	491	491	491	491	491	491	
8.00%	736	736	736	736	736	736	736	
KR4301Q33005		2020-03 풋300						101
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	101	101	101	101	101	101	101
-5.33%	67	67	67	67	67	67	67
-2.67%	34	34	34	34	34	34	34
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
5.33%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67
8.00%	-100	-100	-100	-100	-100	-99	-99

KR4301Q33021                      2020-03 풋302.5                      58

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	58	58	58	58	58	58	58
-5.33%	39	39	39	39	39	39	39
-2.67%	19	19	19	19	19	19	19
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
8.00%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58

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

(단위:백만원)

**846**

공시일	2020-03-11
기준일	2020-03-10

## 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	203,148	0	203,148	

### 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	2020-03-11
기준일	2020-03-10

## 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	107,715	0	107,715	

### 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	2020-03-11
기준일	2020-03-10

## 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	510,433	0	510,433	
누계	통화	선도	17,898	569,156	-551,258	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	3,055
FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E	2,864
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,577
FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	955
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,184
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,212
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	955
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	1,909
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	3,284
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,284
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,909
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,818
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,234
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,909
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	191
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	4,868
FX21020G06 USD/KRW 31-03-20E	477
FX21020H00 USD/KRW 31-03-20E	955
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,386
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	1,985
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	1,985
IE00BD8RGM75	*
IE00BHNZKL13	*

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

16,812



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

(단위:백만원)

127

공시일	2020-03-11
기준일	2020-03-10

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

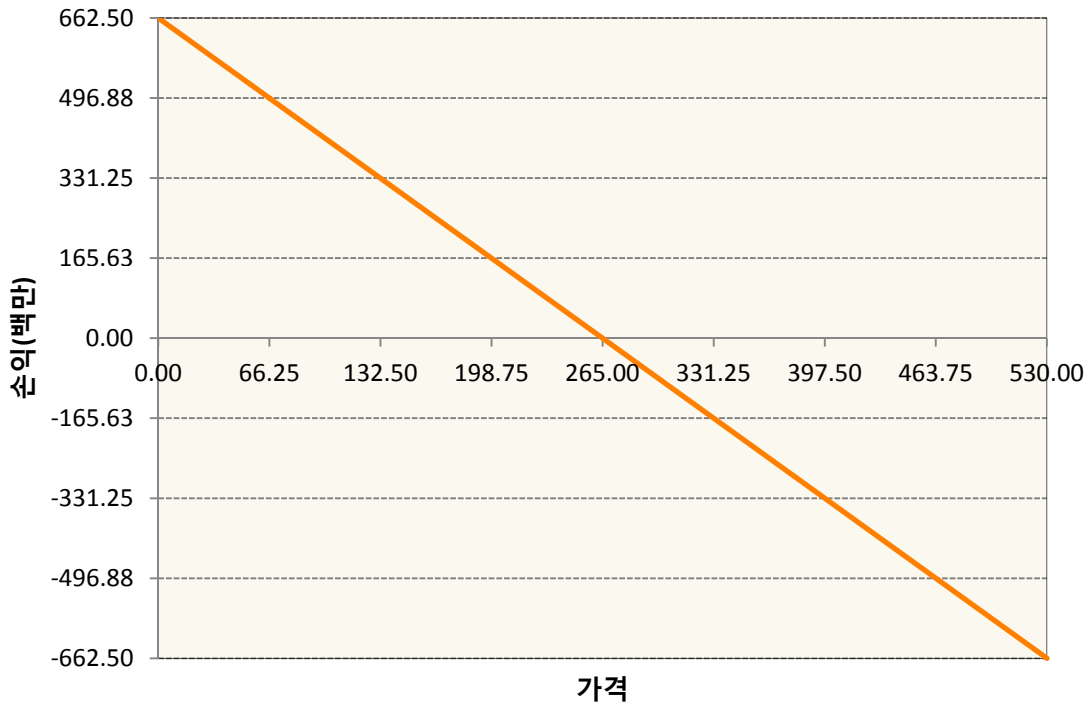
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

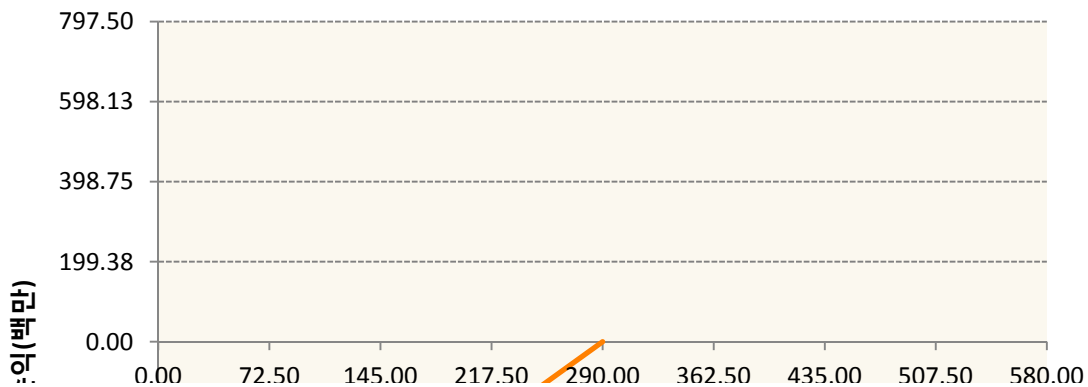
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	663	-663	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,503	-3,503	장내

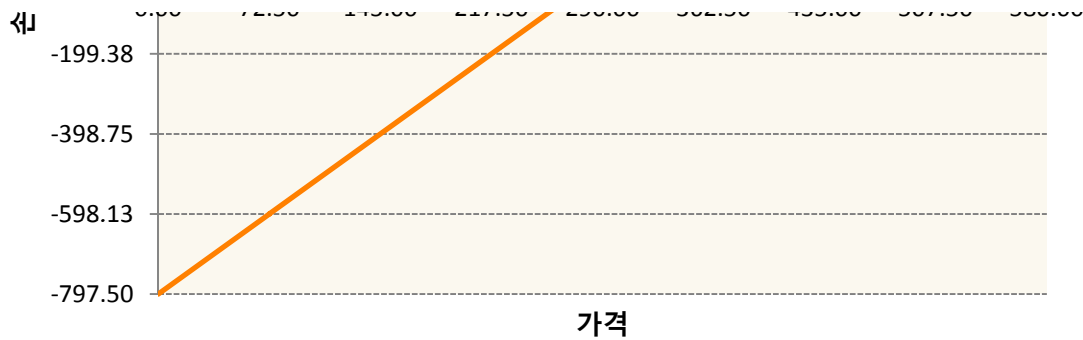
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

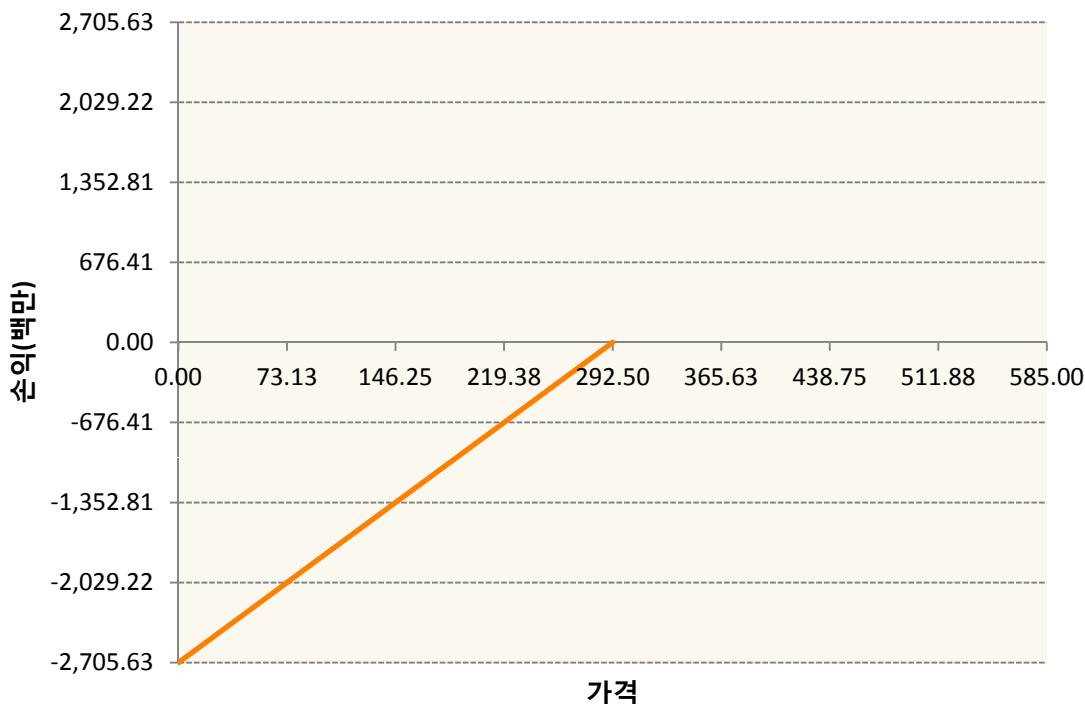


KR4301Q32908-2020-03 풋290





KR4301Q32924-2020-03 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						53
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	53	53	53	53	53	53	53	
-5.33%	35	35	35	35	35	35	35	
-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%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53	
KR4301Q32908		2020-03 풋290						58
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	19	19	19	19	19	19	19
5.33%	39	39	38	38	38	38	37
8.00%	56	56	55	54	54	53	53
KR4301Q32924                      2020-03 풋292.5							196

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-196	-196	-196	-196	-196	-196	-196
-5.33%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-2.67%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	65	65	65	65	65	65	65
5.33%	130	130	130	130	129	128	128
8.00%	193	191	190	188	187	185	183

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

(단위:백만원)

**304**

공시일	2020-03-11
기준일	2020-03-10

## 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	8,664	0	8,664	
누계	통화	선도	5,620	14,426	-8,806	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
FX21020H00 USD/KRW 12-03-20E	12
FX21020H00 USD/KRW 12-03-20E	38
FX21020H01 USD/KRW 31-03-20E	49
FX21020H02 USD/KRW 12-03-20E	350
FX21020H02 KRW/USD 13-04-20E	347
IE00BD8RGM75	

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

574
-----

공시일	2020-03-11
기준일	2020-03-10

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

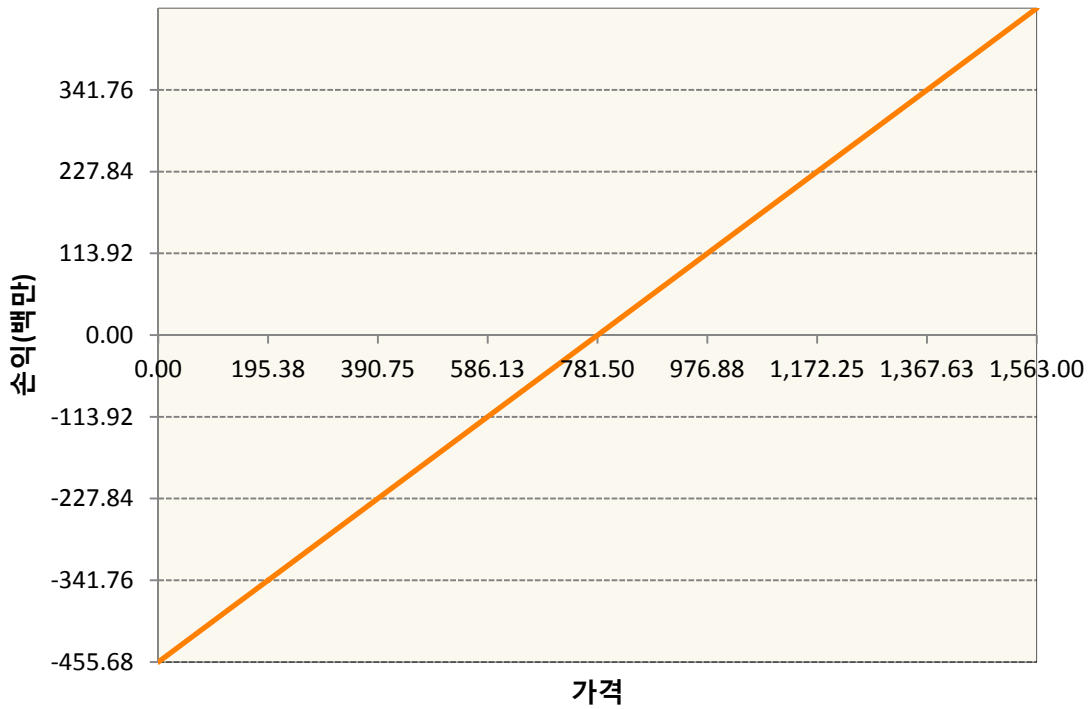
### 1. 계약금액

(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	456	0	456	
누계	유가증권	스왑	1,117	0	1,117	장외
누계	통화	선도	311	745	-433	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

VNCH0-VN30 Index Future Mar20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	89
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
FX21020H02 EUR/KRW 27-03-20E	13
VNCH0 VN30 Index Future Mar20	36

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

(단위:백만원)

**135**

공시일	2020-03-11
기준일	2020-03-10

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

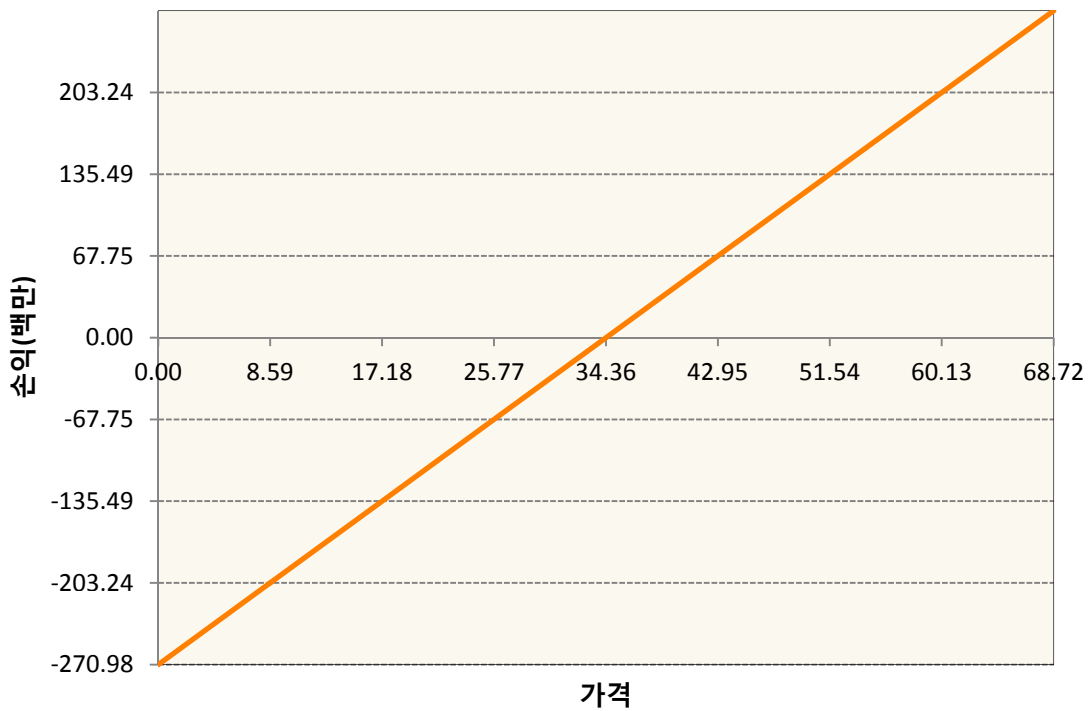
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

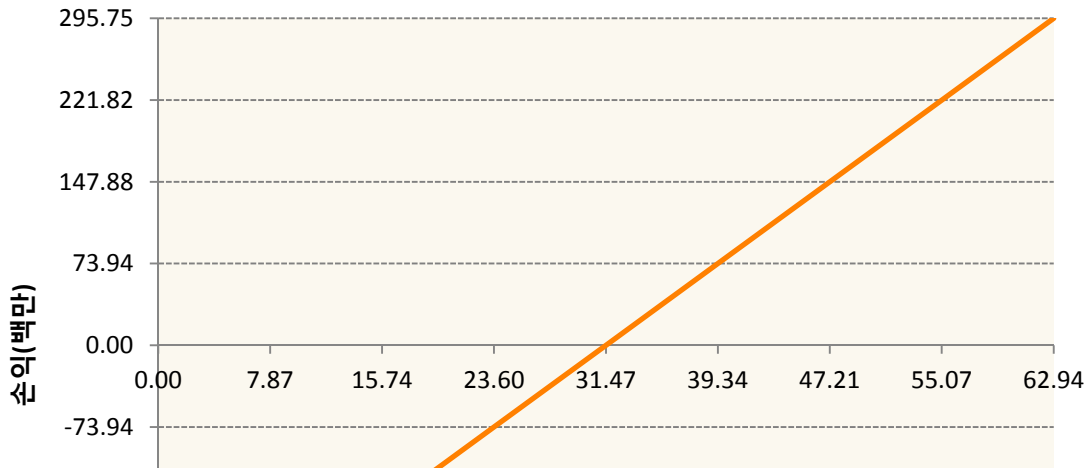
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,524	119	1,405	

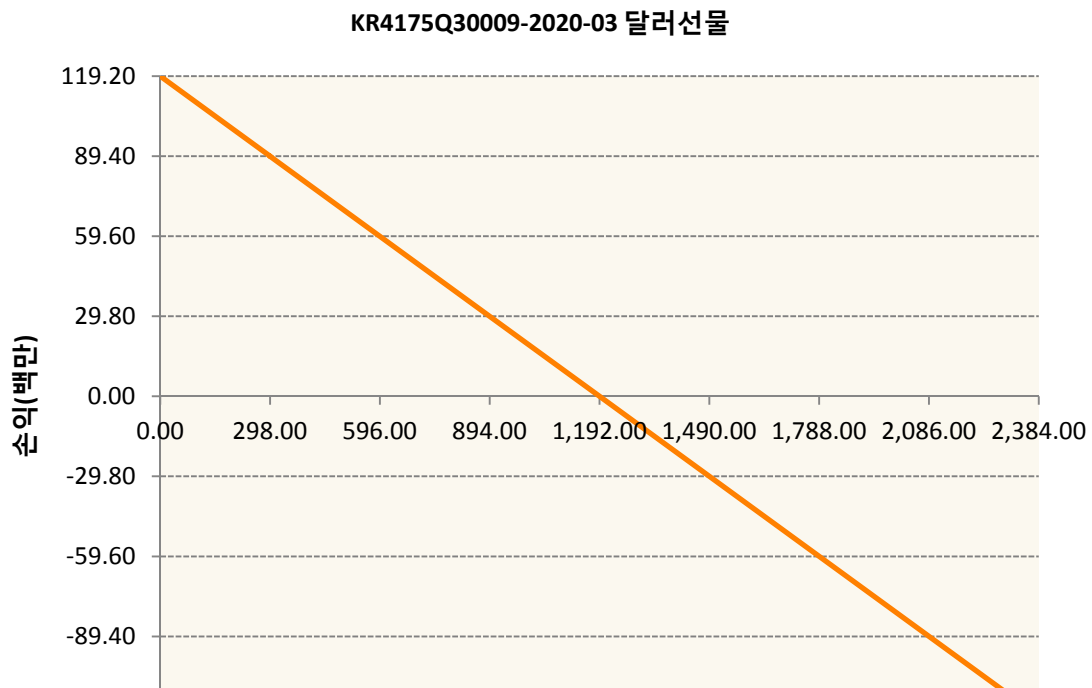
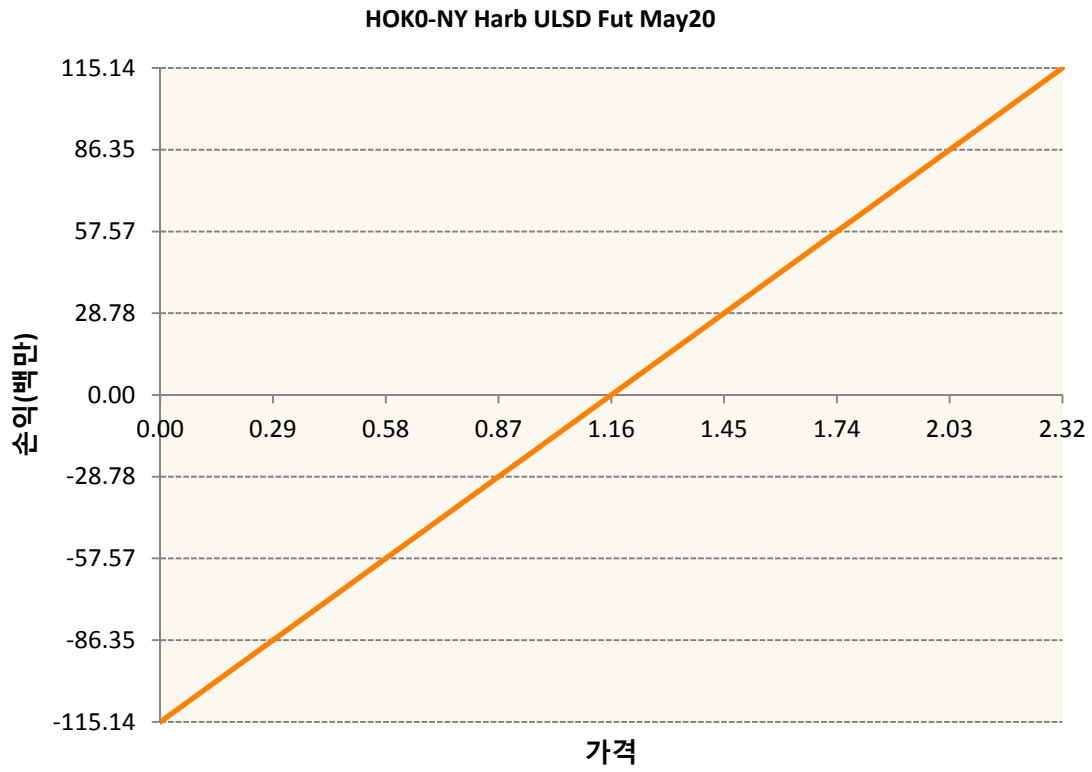
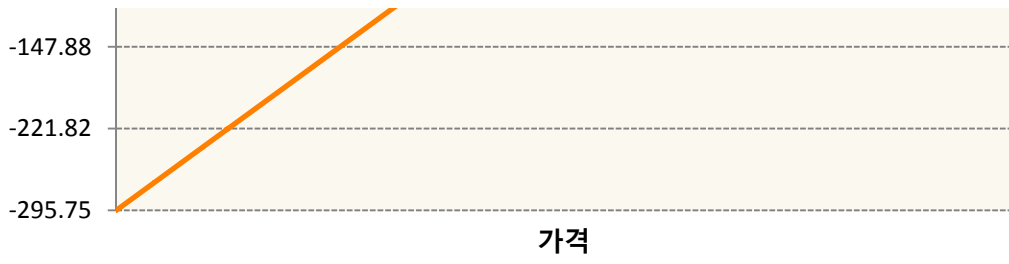
### 2. 만기시점의 손익구조

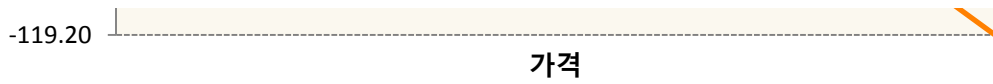
**COK0-BRENT CRUDE FUTR May20**



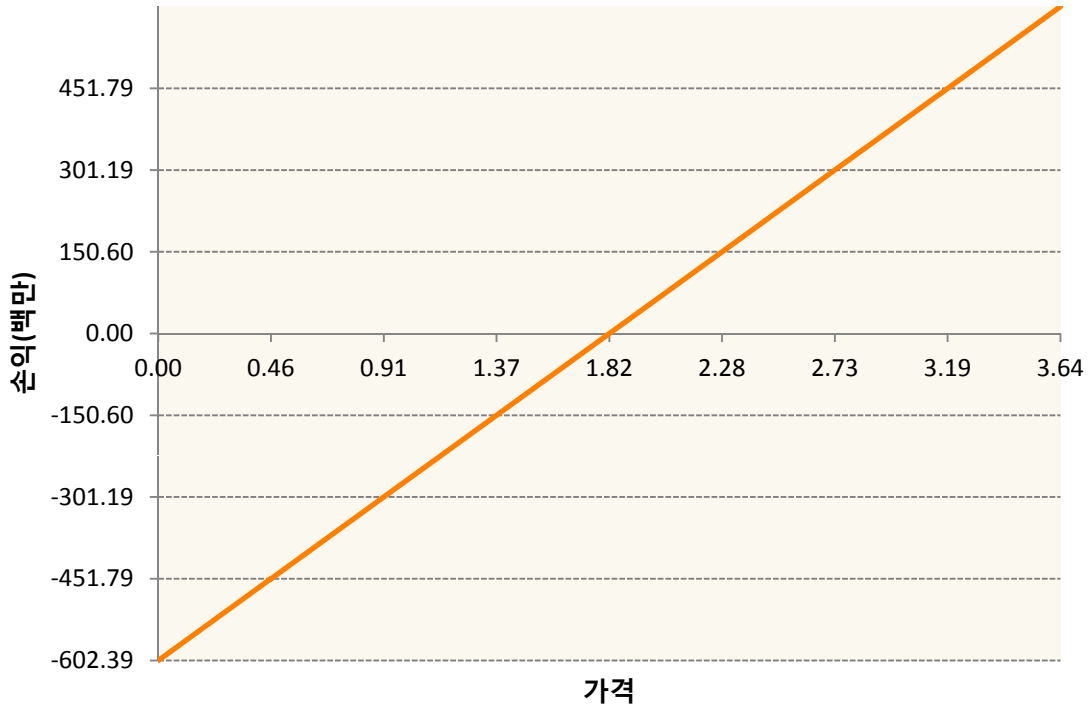
**CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20**



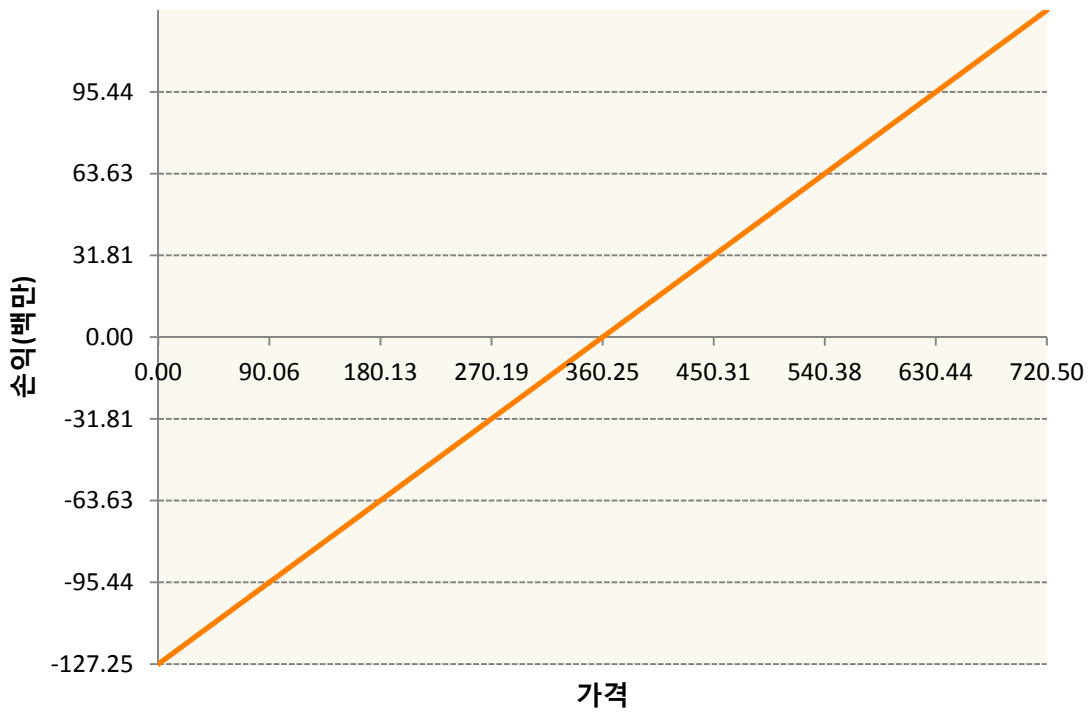




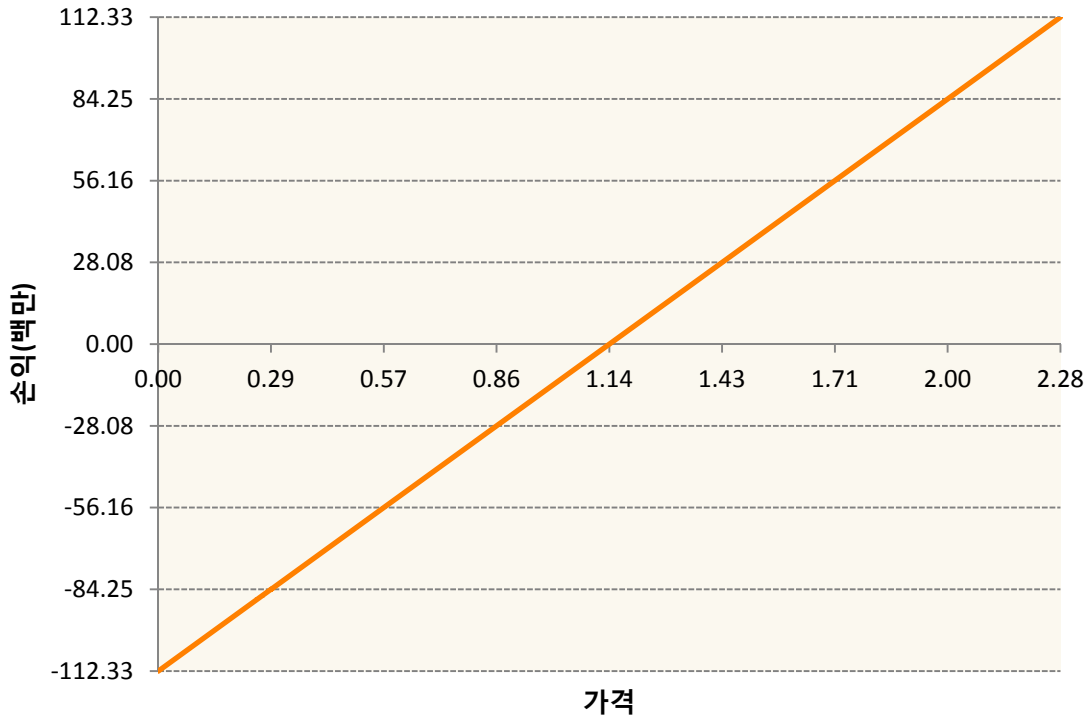
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



QSK0-Low Su Gasoil G Mar20



**XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20**



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	22
CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	24
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	9
KR4175Q30C	2020-03 달러선물	10
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	48
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	10
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	9

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

(단위:백만원)

<b>294</b>
------------

공시일	2020-03-11
기준일	2020-03-10

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

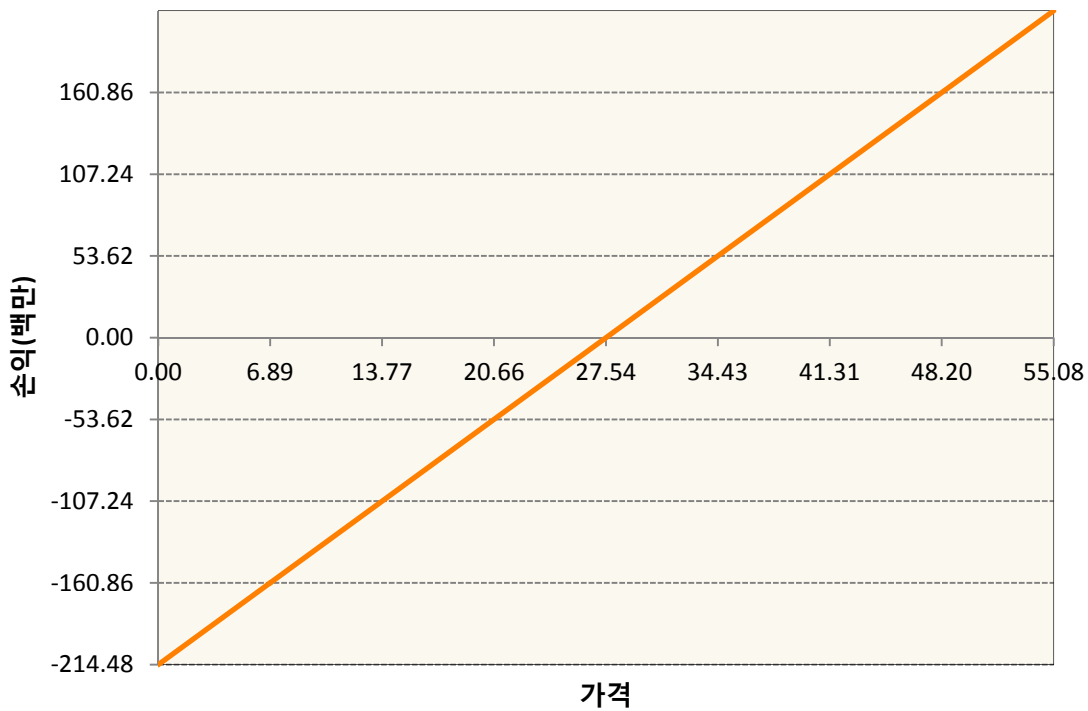
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

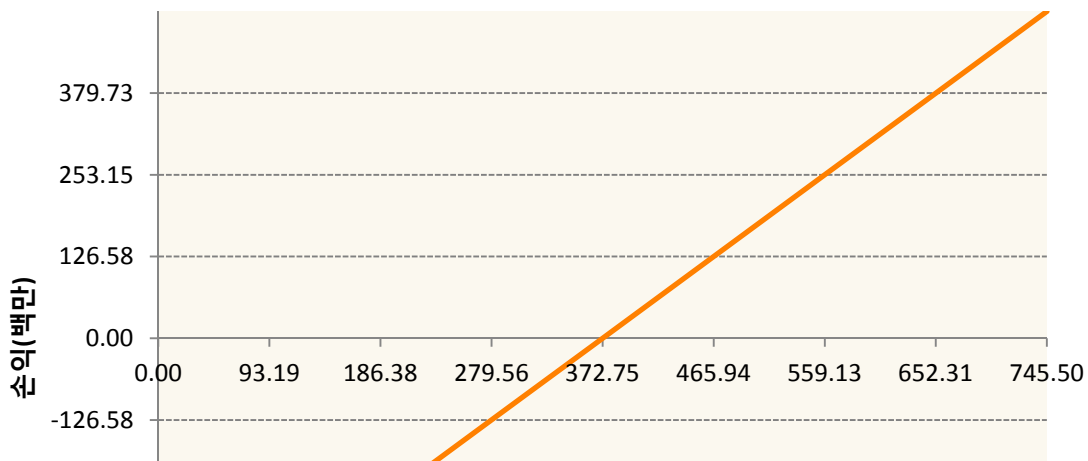
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,509	155	2,354	

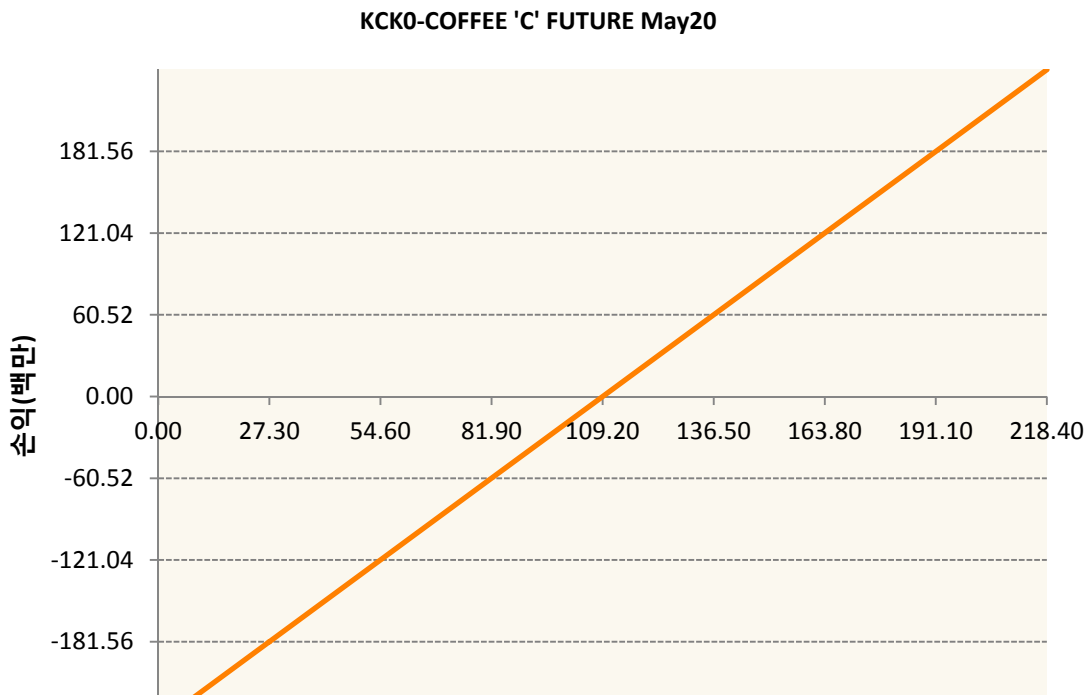
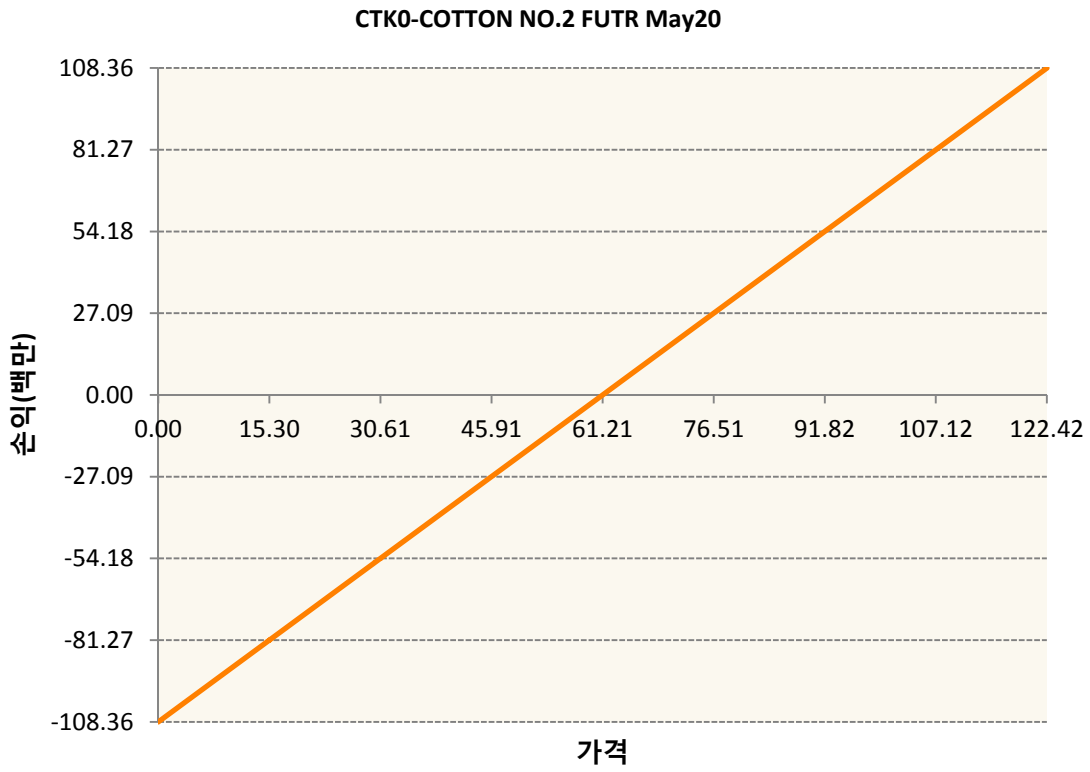
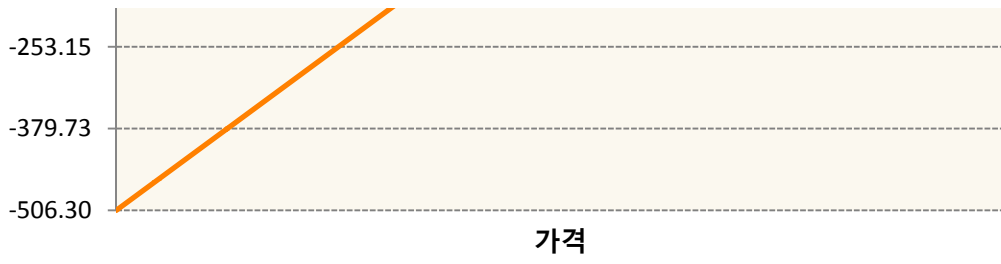
### 2. 만기시점의 손익구조

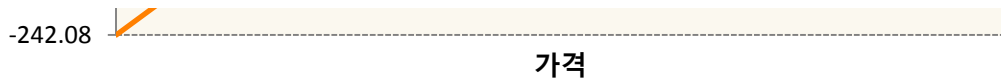
**BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20**



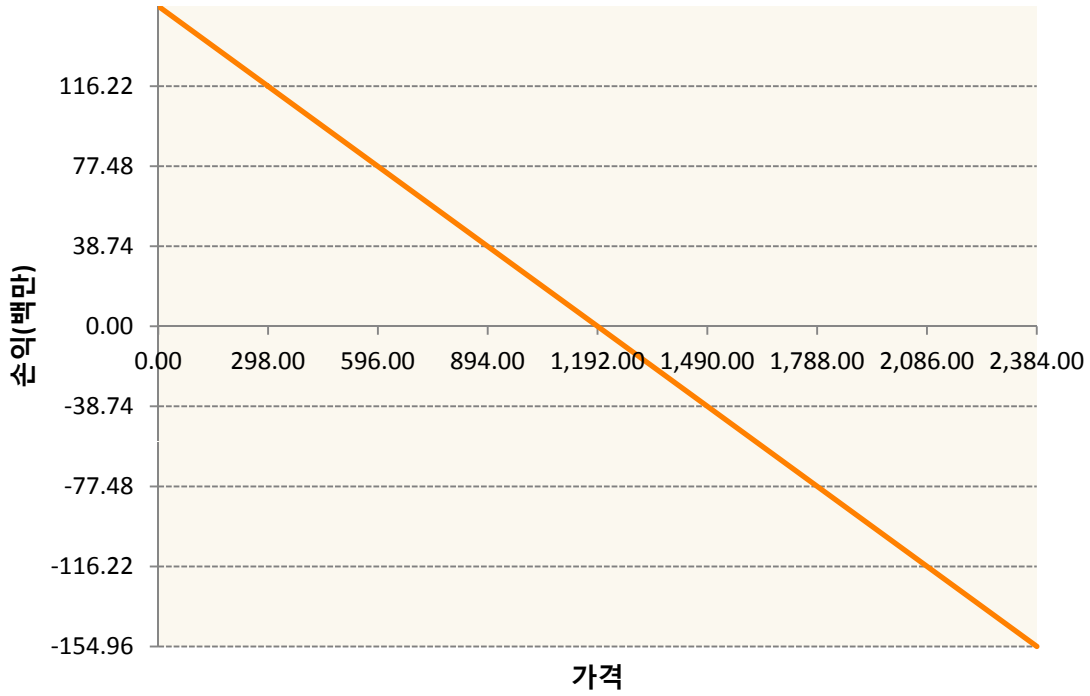
**CK0-CORN FUTURE May20**



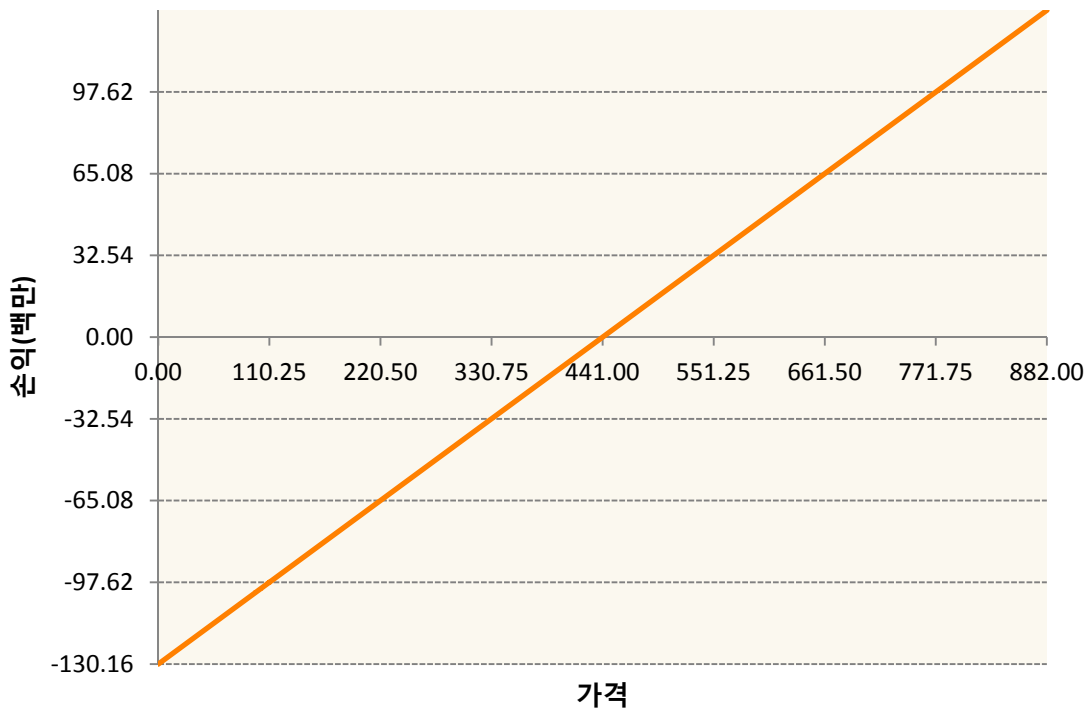




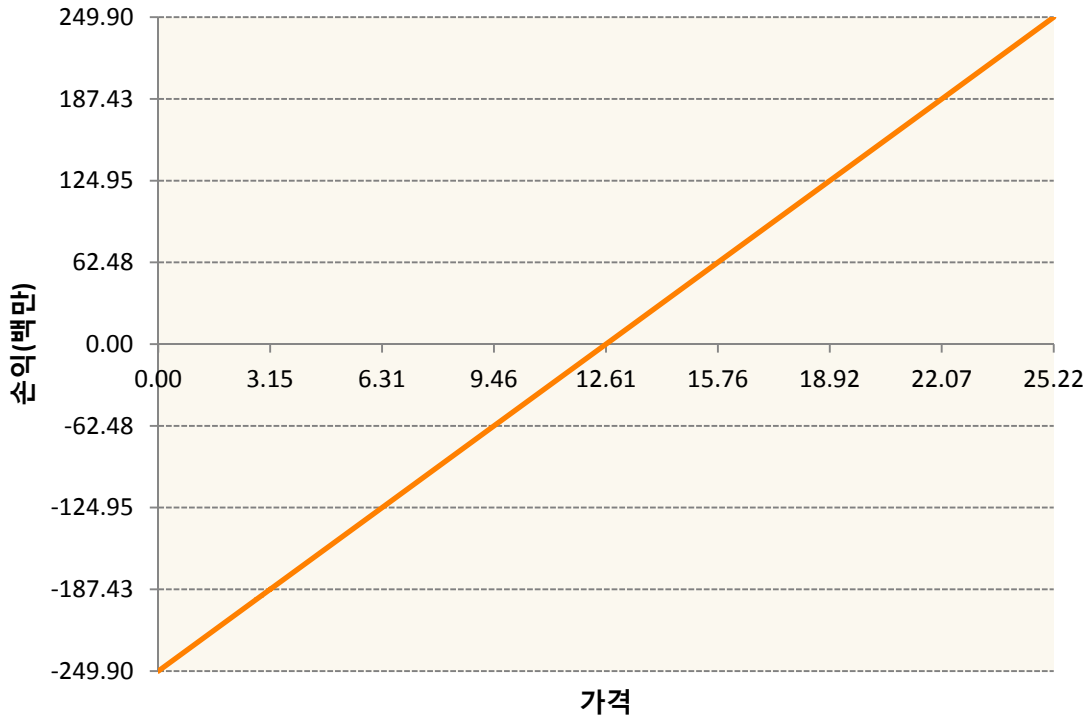
KR4175Q30009-2020-03 달러선물



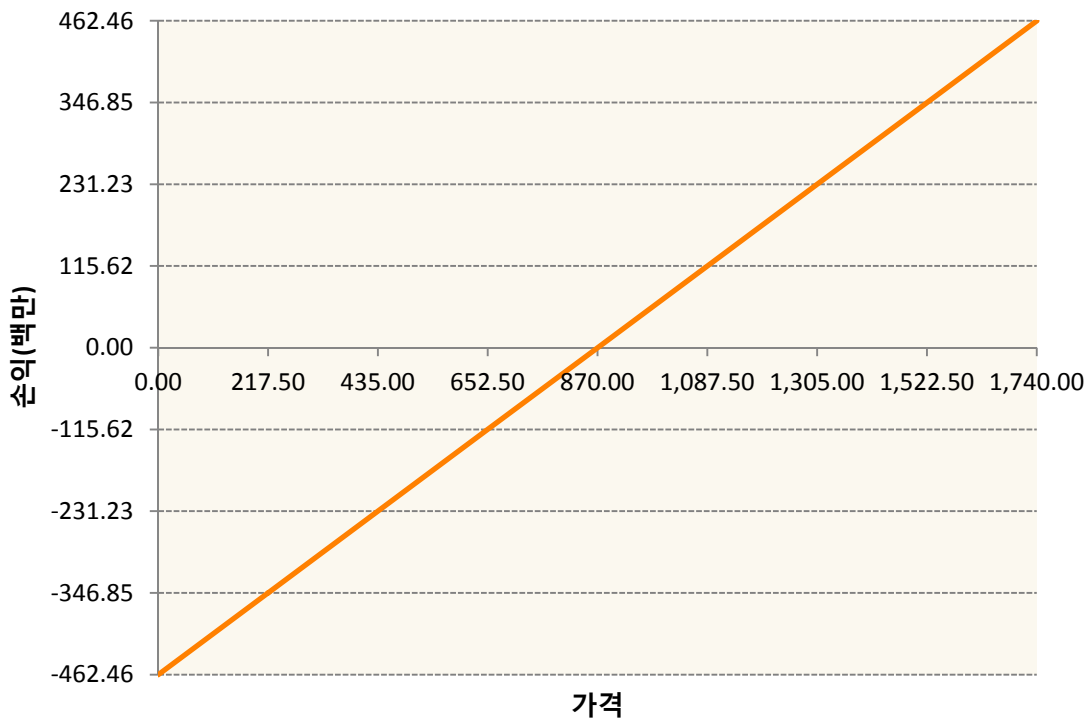
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



SBK0-Sugar May20

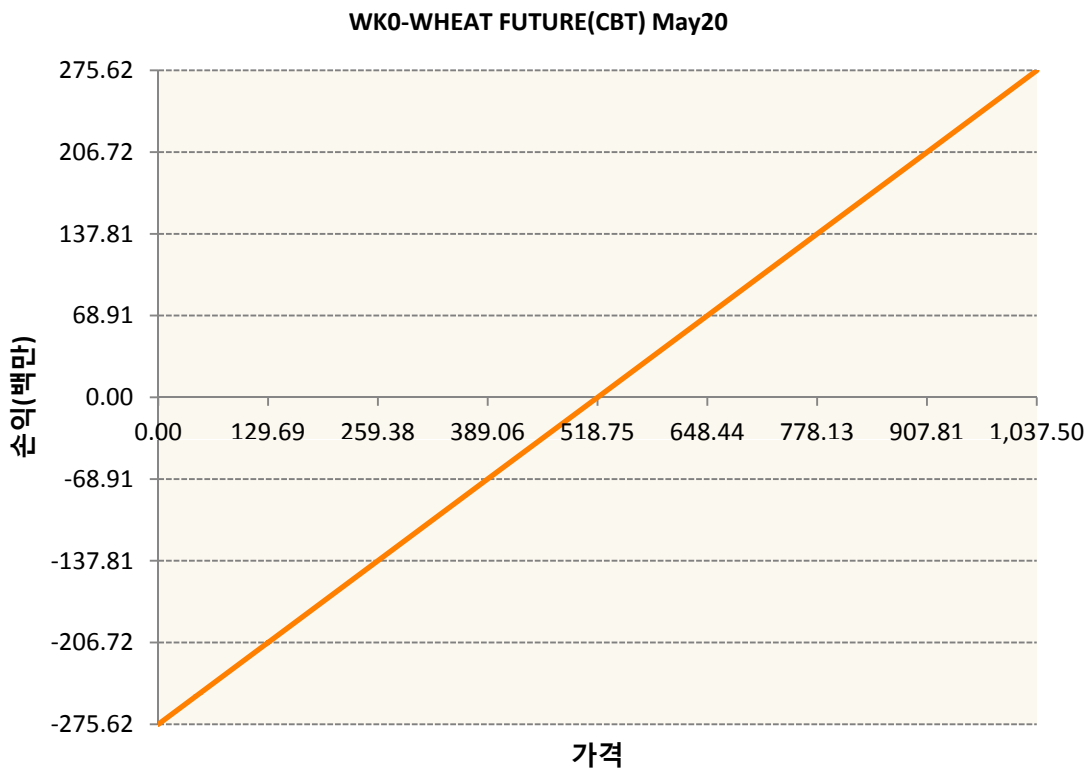
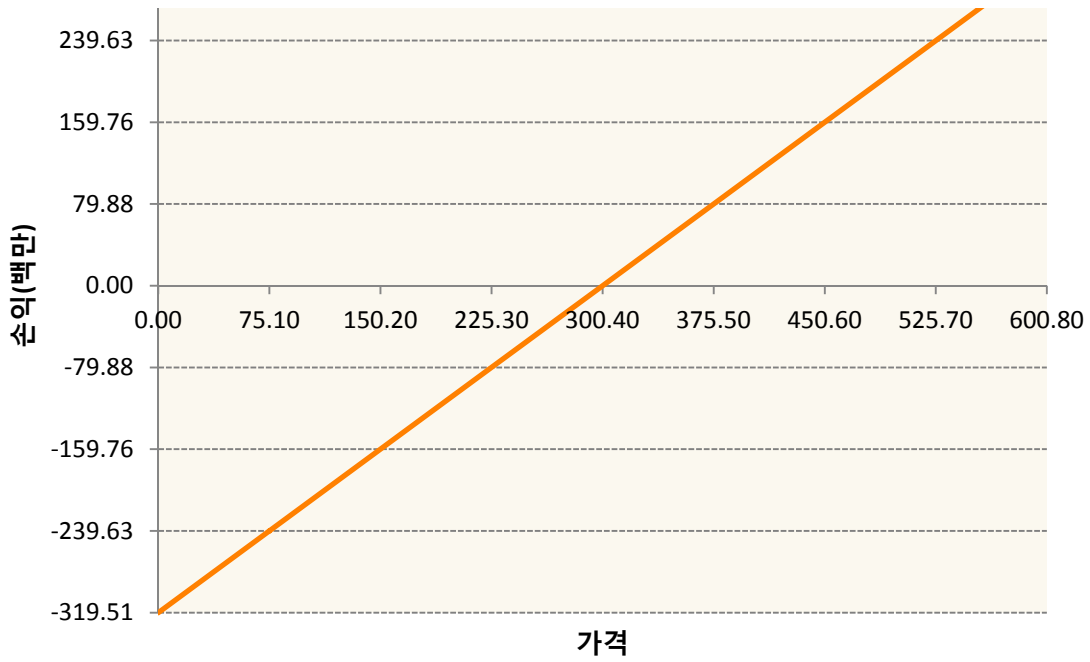


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	17
CK0	CORN FUTURE May20	41
CTK0	COTTON NO.2 FUTR May20	9
KCK0	COFFEE 'C' FUTURE May20	19
KR4175Q30C	2020-03 달러선물	12

KWK0	KC HRW WHEAT FUT May20	10
SBK0	Sugar May20	20
SK0	SOYBEAN FUTURE May20	37
SMK0	SOYBEAN MEAL FUTR May20	26
WK0	WHEAT FUTURE(CBT) May20	22

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

(단위:백만원)

**219**