

공시일	2020-03-12
기준일	2020-03-11

## 포커스농산물모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	5	0	5	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음



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

(단위:백만원)

122

공시일	2020-03-12
기준일	2020-03-11

## 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

991

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

713

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-12
기준일	2020-03-11

## SMART중국본토중소형CSI500상장

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

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

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S200310

593

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

915

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-12
기준일	2020-03-11

## 유로인덱스모(주식-파생형)

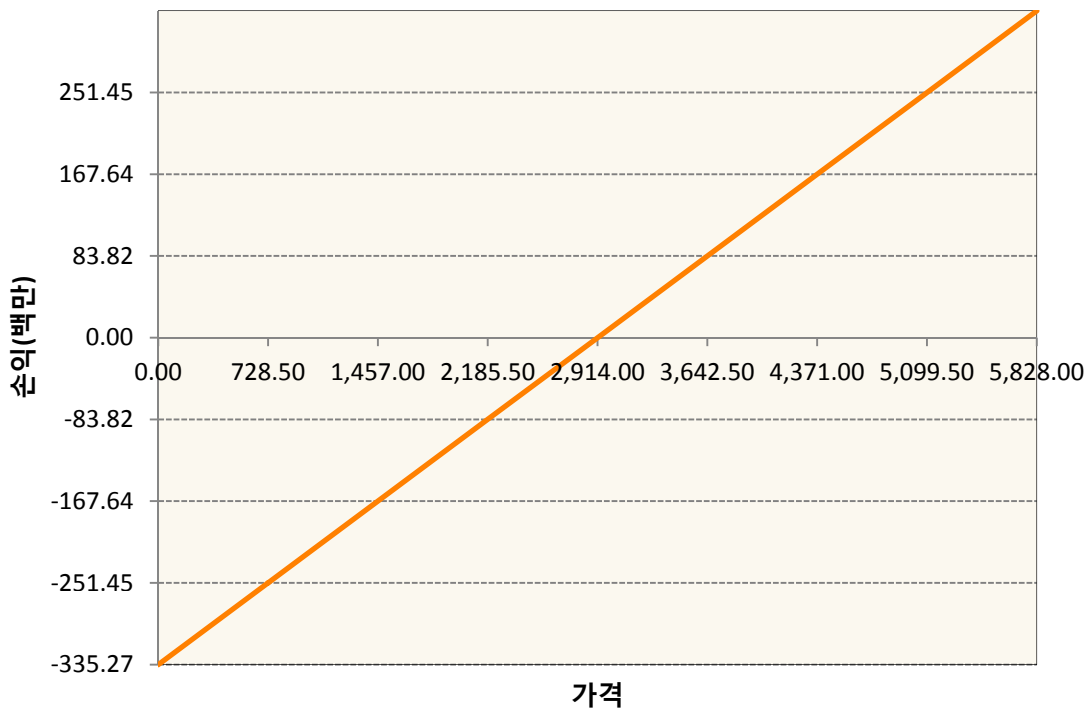
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	335	0	335	

### 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	2020-03-12
기준일	2020-03-11

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

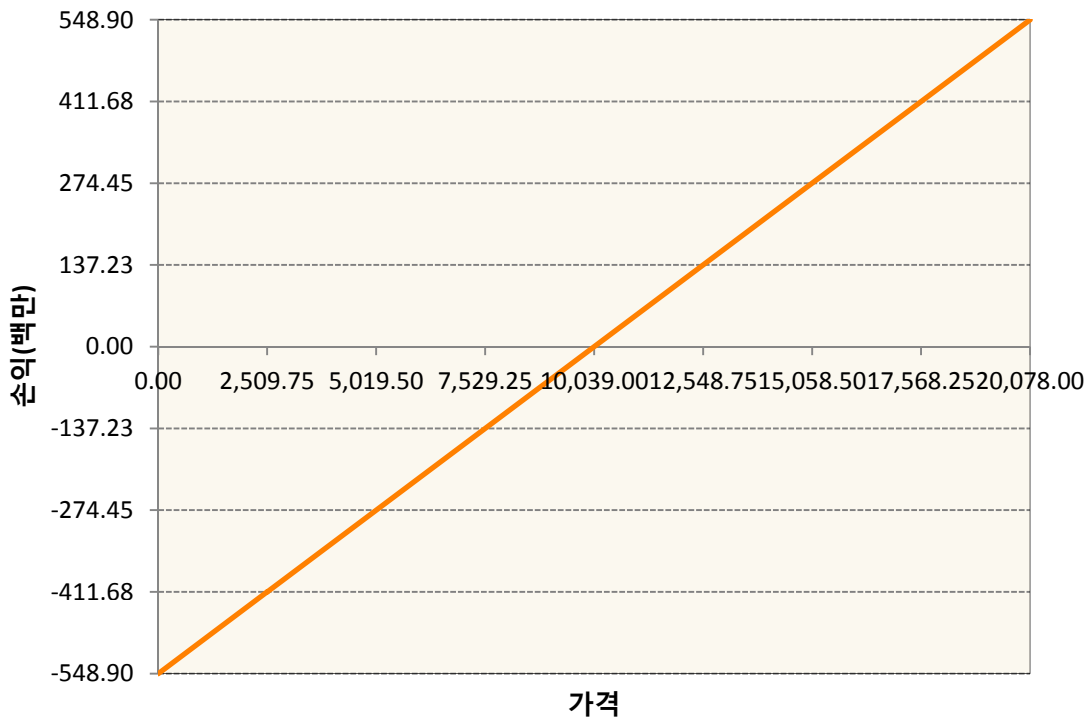
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	549	0	549	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH0	HSCEI Futures Mar20	44
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

41
----

공시일	2020-03-12
기준일	2020-03-11

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

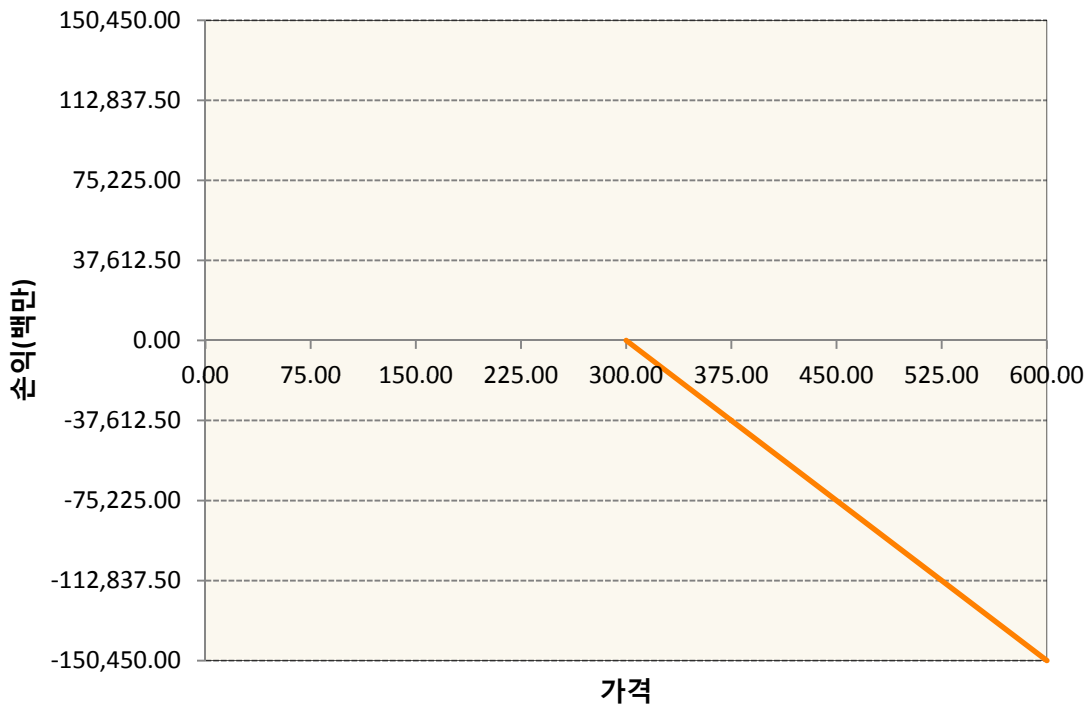
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

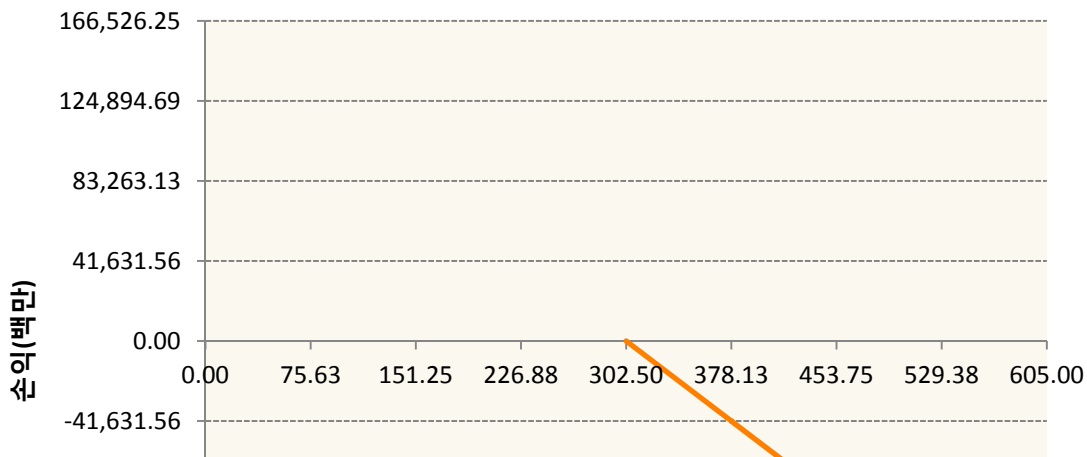
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	22,499	30,749	-8,250	장내
누계	유가증권	옵션	0	455,358	-455,358	장내

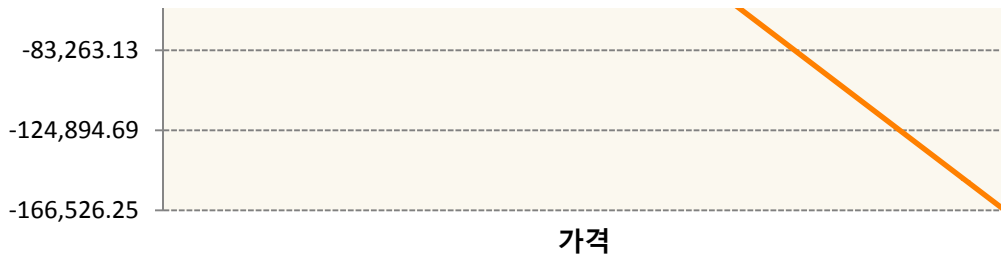
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q33007-2020-03 콜300

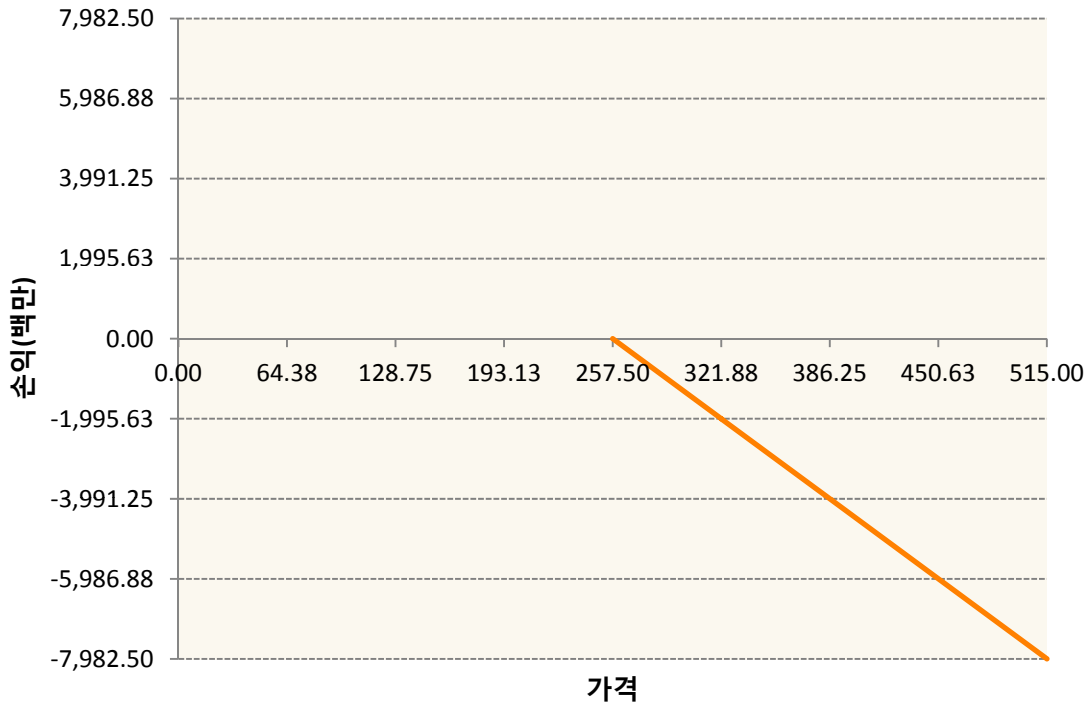


KR4201Q33023-2020-03 콜302.5

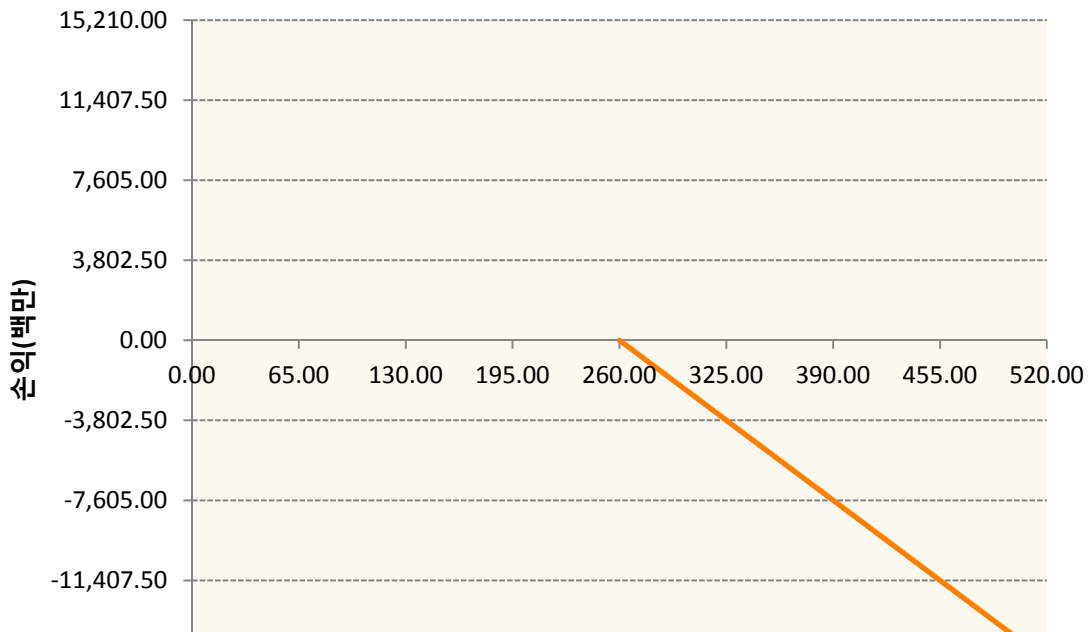


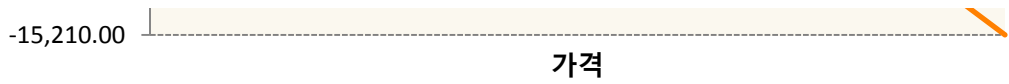


**KR4201Q42578-2020-04 콜257.5**

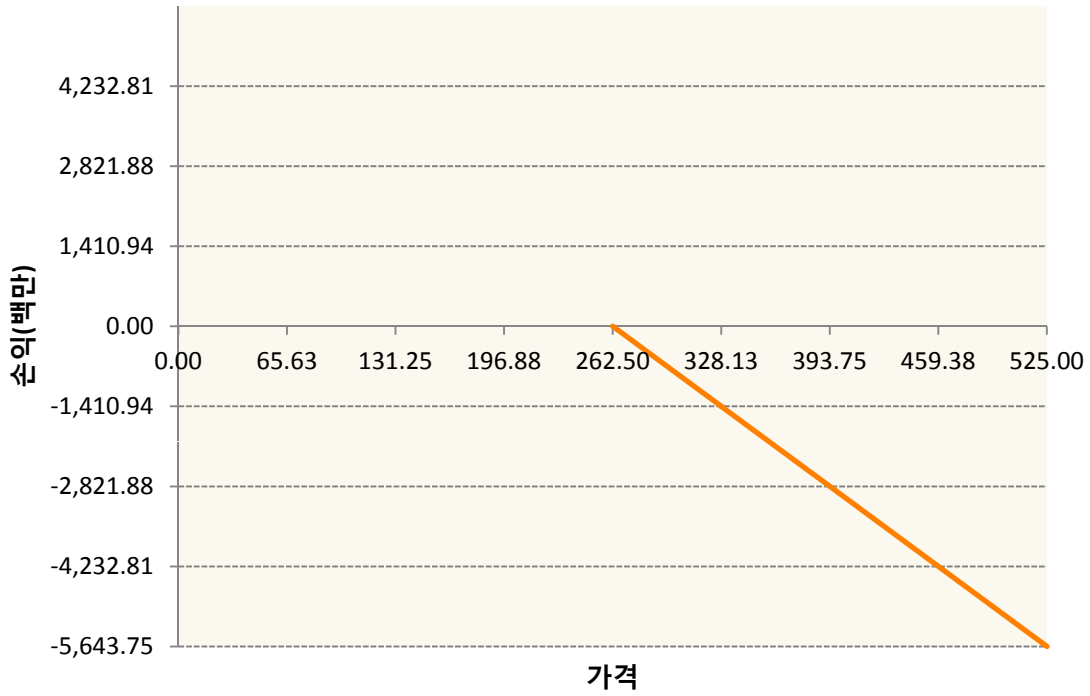


**KR4201Q42602-2020-04 콜260**

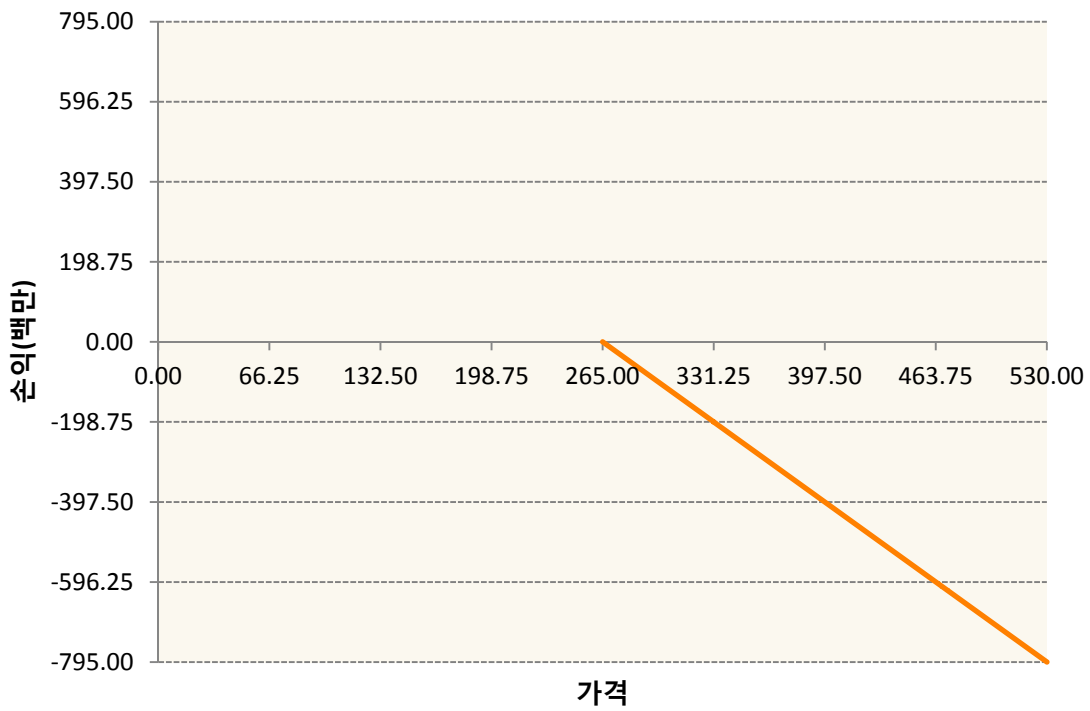




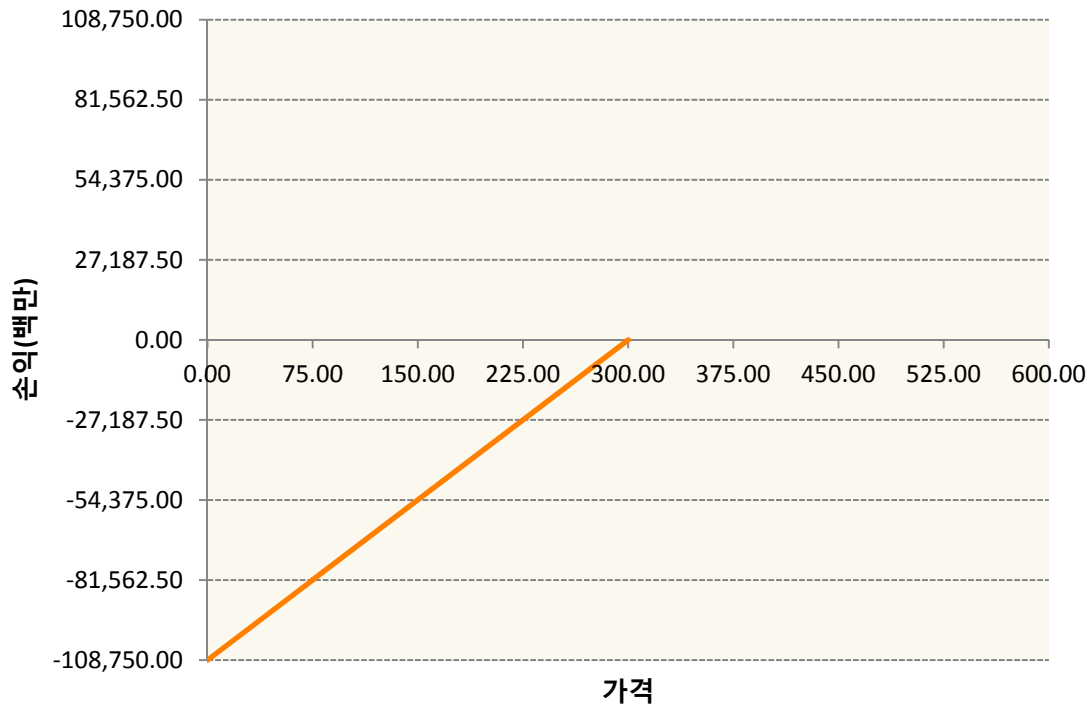
KR4201Q42628-2020-04 콜262.5



KR4201Q42651-2020-04 콜265



KR4301Q33005-2020-03 풋300



3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q33007		2020-03 콜300						2
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	-2	
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	0	0	-1	
KR4201Q42578		2020-04 콜257.5						489
기초자산의 변동성								



0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	2,484	2,484	2,484	2,484	2,484	2,484	2,484
5.33%	4,969	4,969	4,969	4,969	4,969	4,969	4,969
8.00%	7,453	7,453	7,453	7,453	7,453	7,453	7,452

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

(단위:백만원)

**8,898**

공시일	2020-03-12
기준일	2020-03-11

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

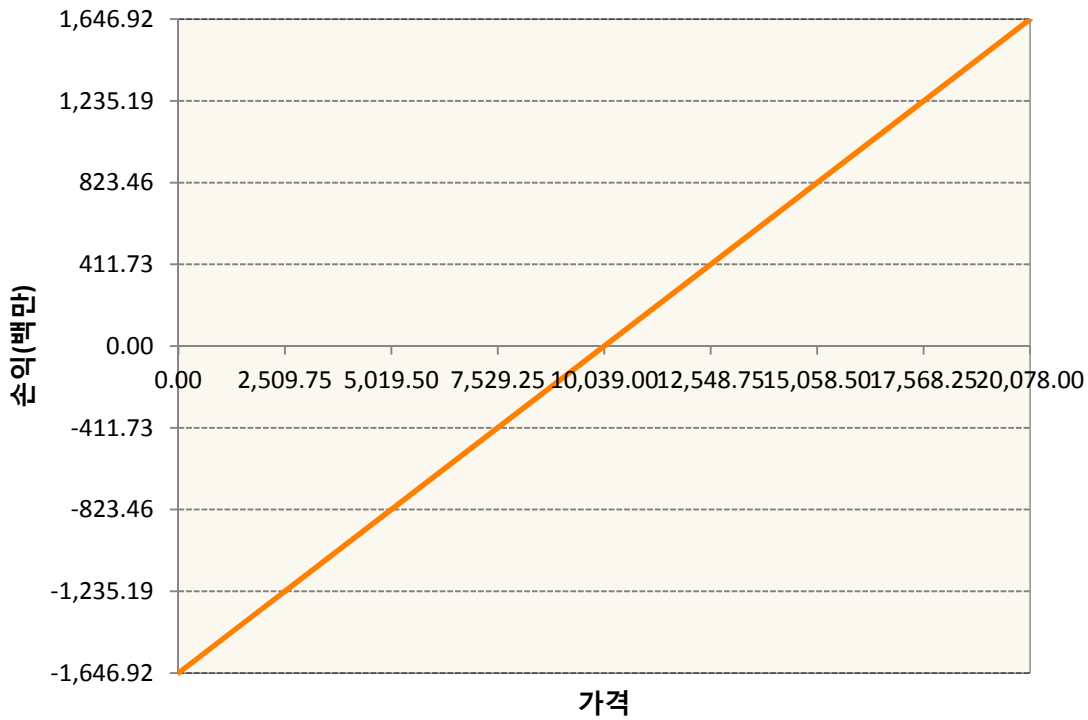
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

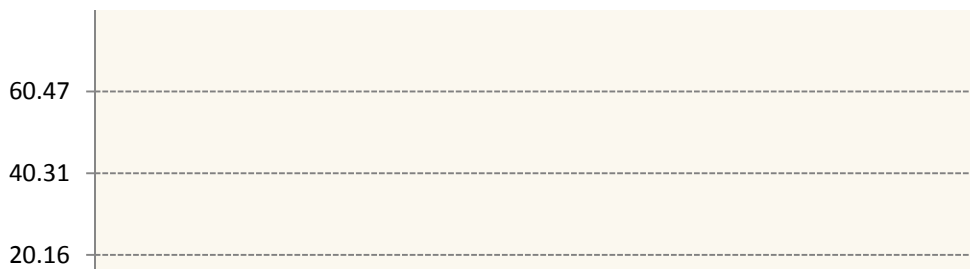
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,647	0	1,647	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,720	-4,720	장내
누계	통화	선도	0	2,162	-2,162	장외

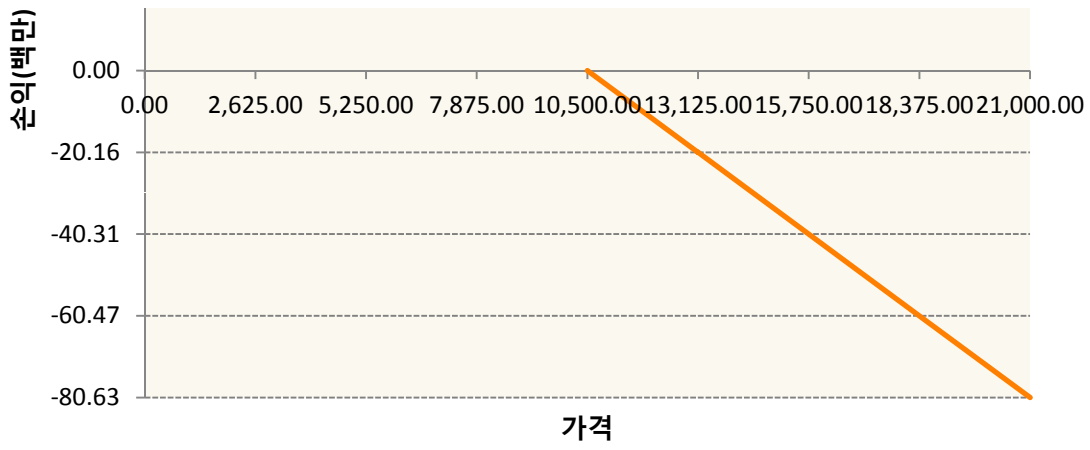
### 2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20

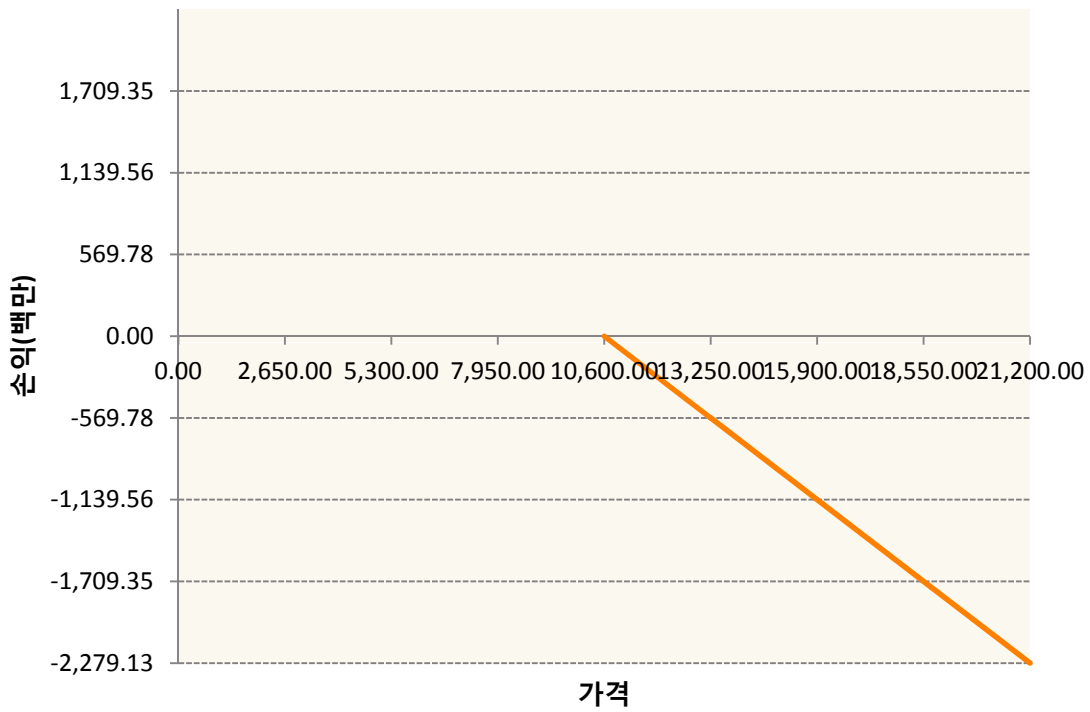


OHHIH0-C105-HSCEI

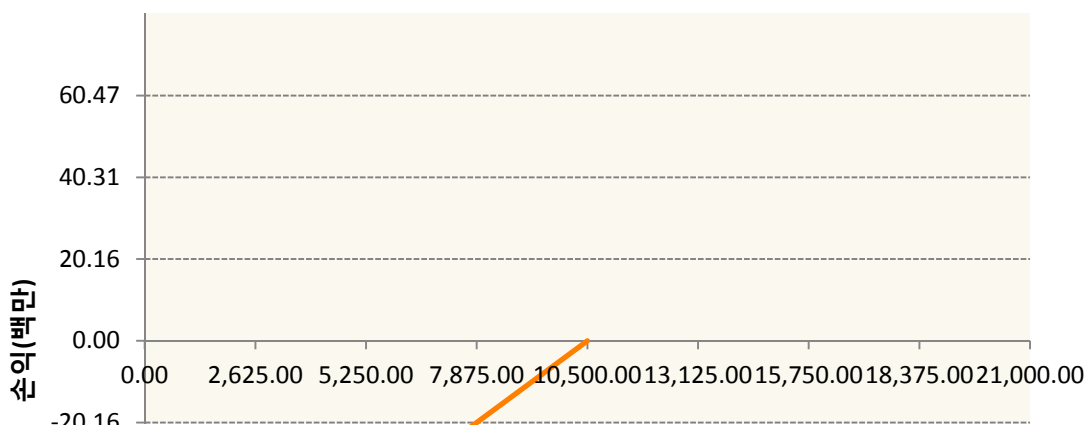


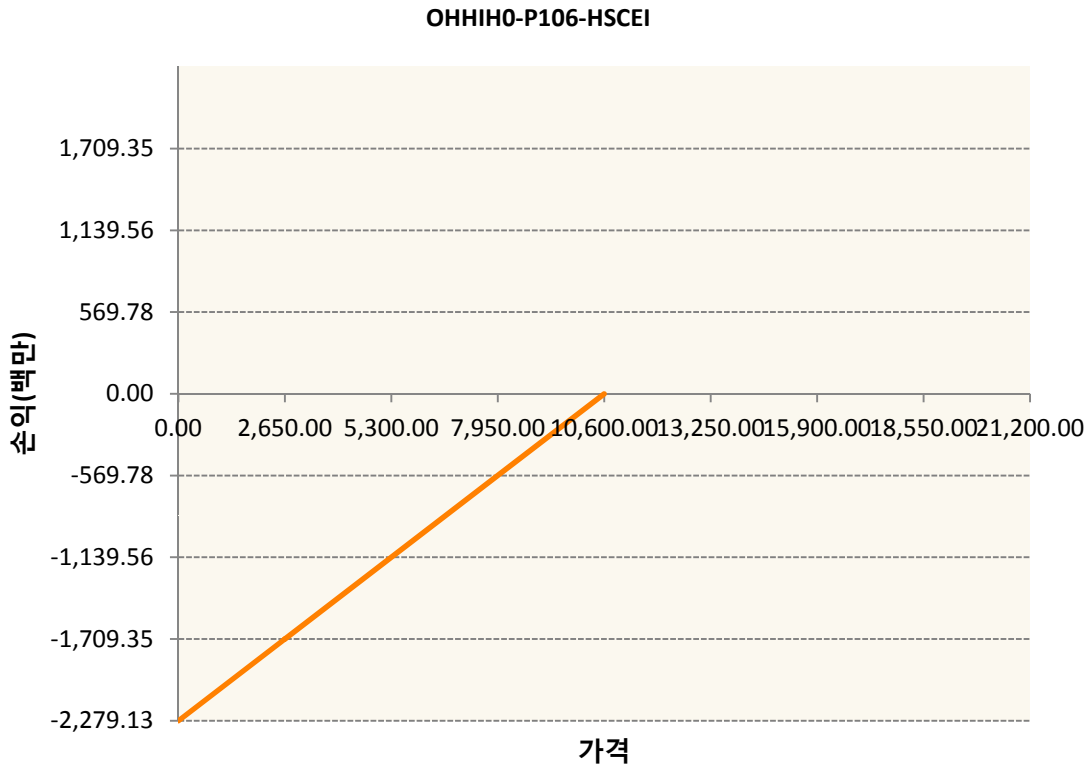
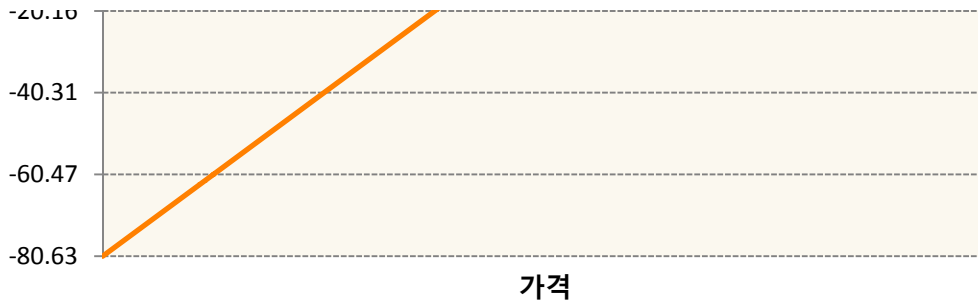


OHHIH0-C106-HSCEI



OHHIH0-P105-HSCEI





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

FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E	173
HCH0 HSCEI Futures Mar20	132
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)**

**537**

공시일	2020-03-12
기준일	2020-03-11

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

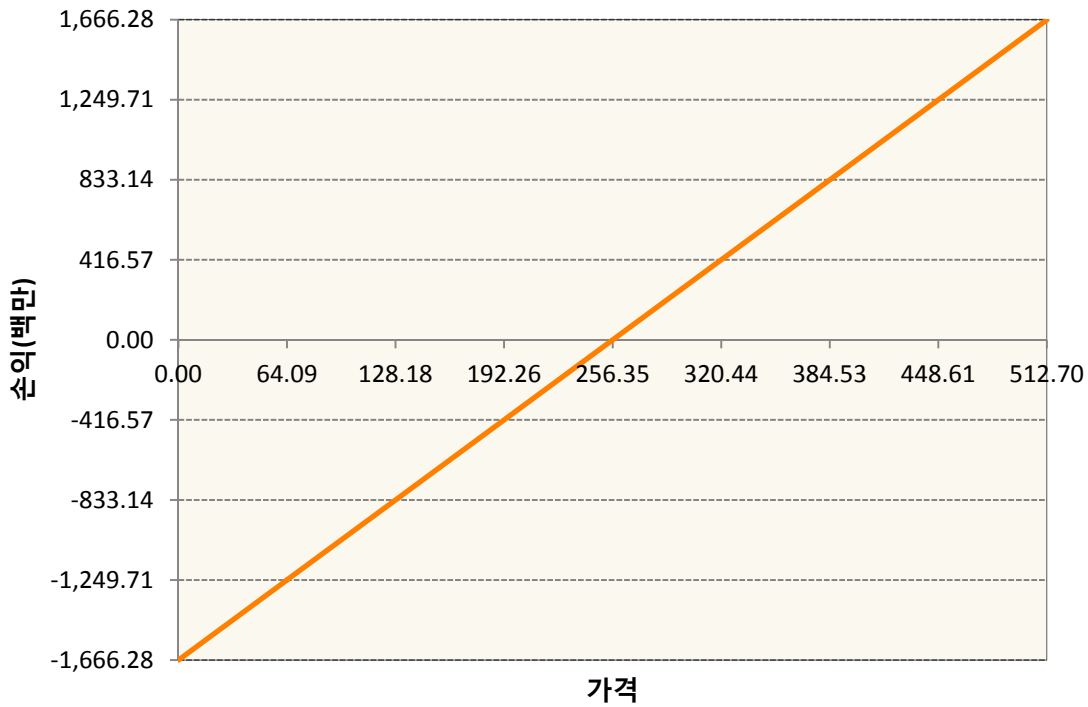
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

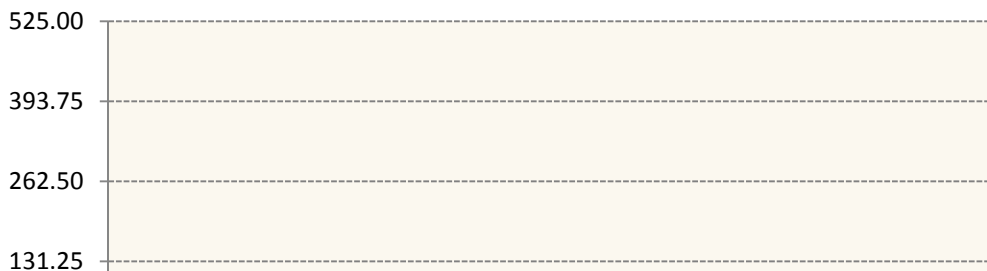
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,666	0	1,666	장내
누계	유가증권	스왑	3,125	0	3,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,612	-3,612	장내

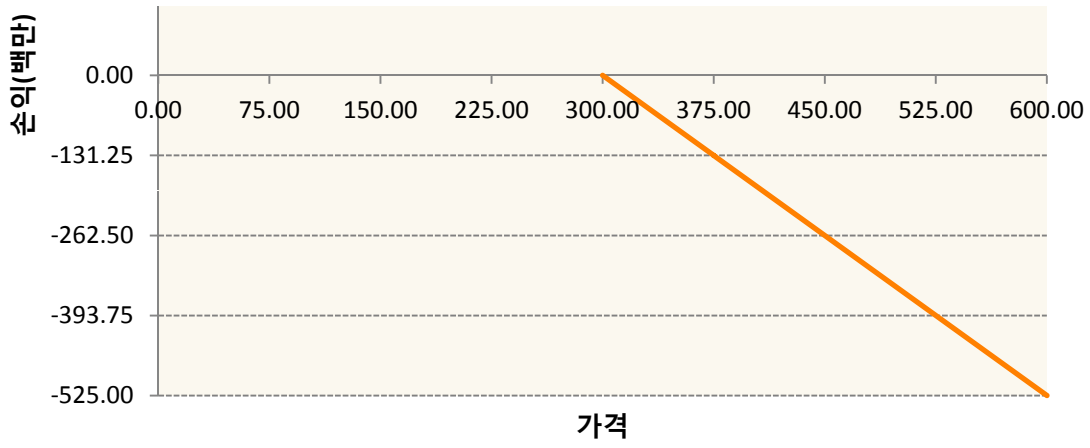
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

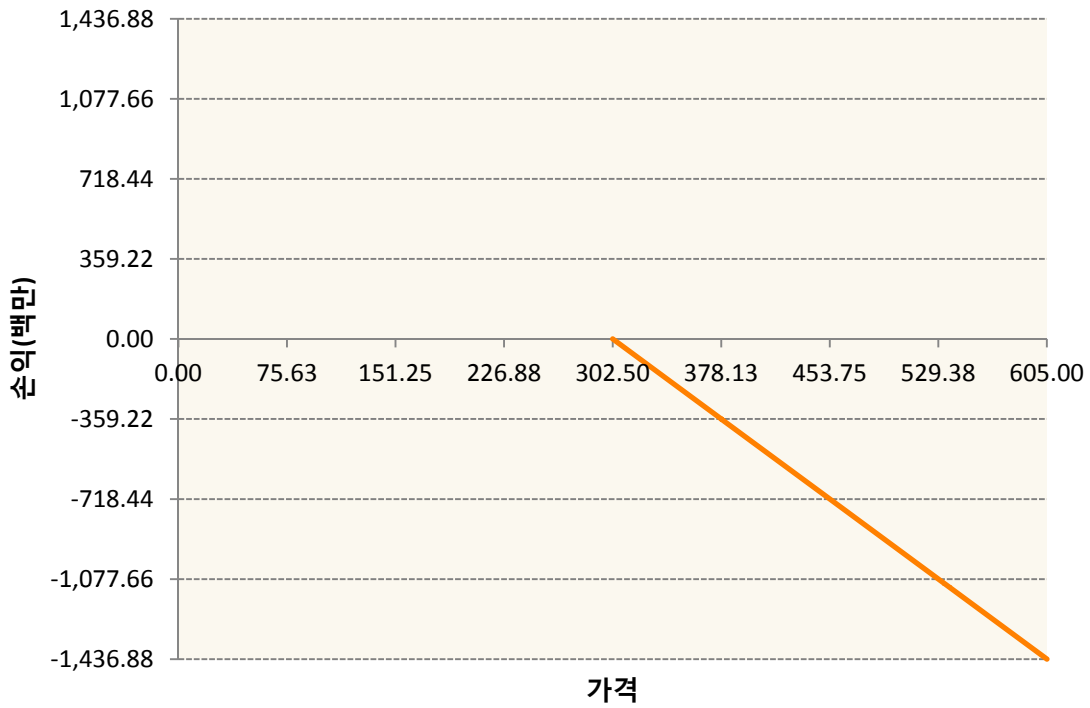


KR4201Q33007-2020-03 콜300

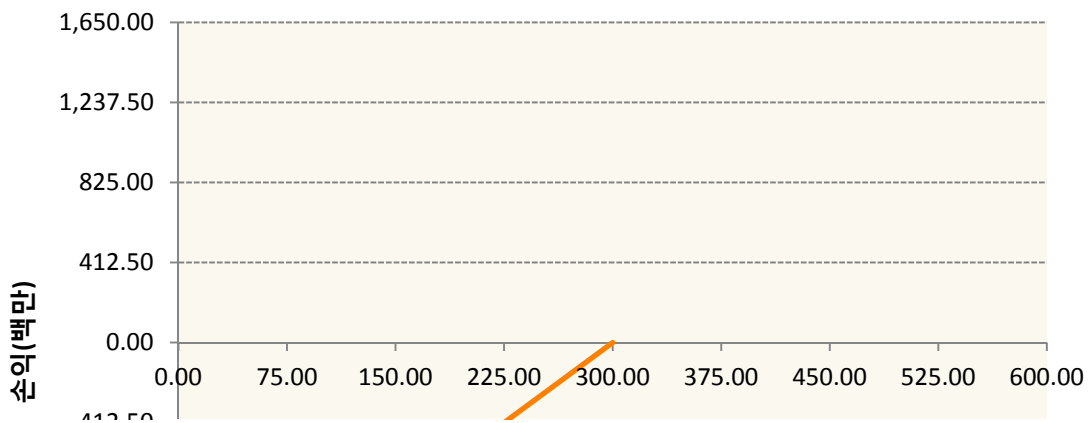




KR4201Q33023-2020-03 콜302.5



KR4301Q33005-2020-03 풋300





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						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	
KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						134
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-134	-134	-134	-134	-134	-134	-134	
-5.33%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89	
-2.67%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	45	45	45	45	45	45	45	
5.33%	89	89	89	89	89	89	89	
8.00%	134	134	134	134	134	134	134	
KR4201Q33007		2020-03 콜300						0
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	0	0	
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5						0
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	0	0
KR4301Q33005      2020-03 풋300							113
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-113	-113	-113	-113	-113	-113	-113
-5.33%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-2.67%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	38	38	38	38	38	38	38
5.33%	75	75	75	75	75	75	75
8.00%	113	113	113	113	113	113	113

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

(단위:백만원)

**510**

공시일	2020-03-12
기준일	2020-03-11

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

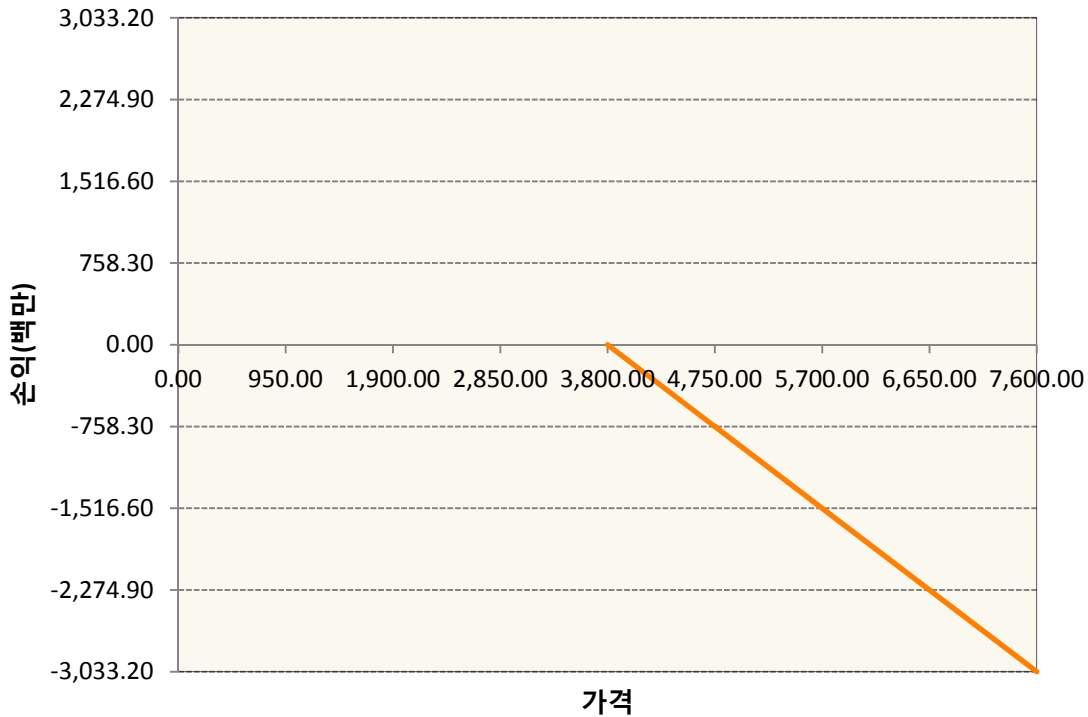
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

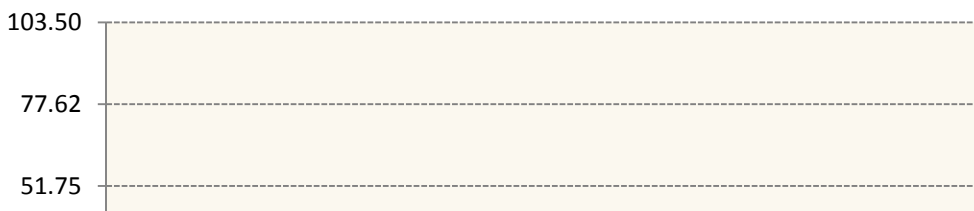
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	2	-2	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	77	0	77	
누계	유가증권	스왑	8,618	0	8,618	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,273	-6,273	장내
누계	통화	선도	541	3,550	-3,009	장외

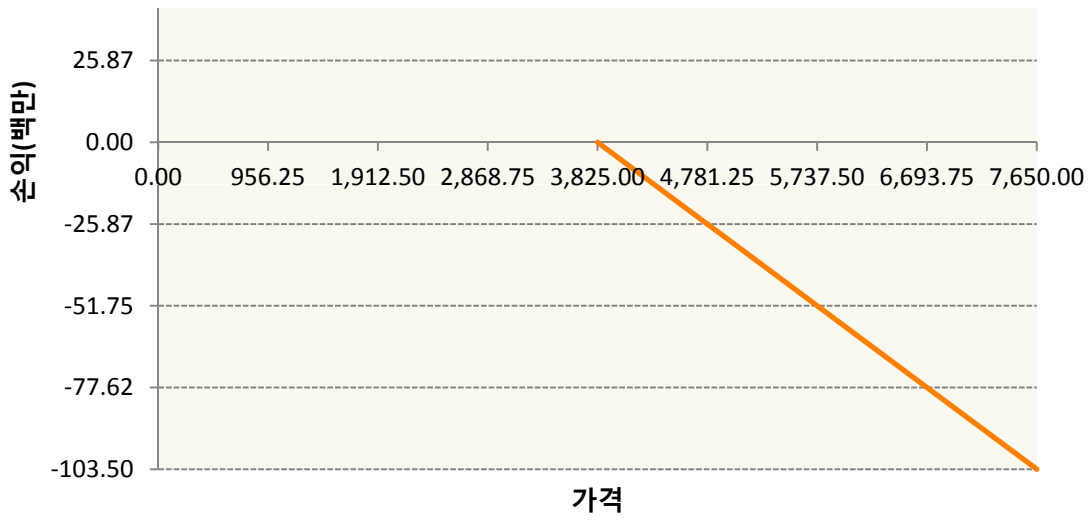
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXH0-C3800-EURO STOXX 50**

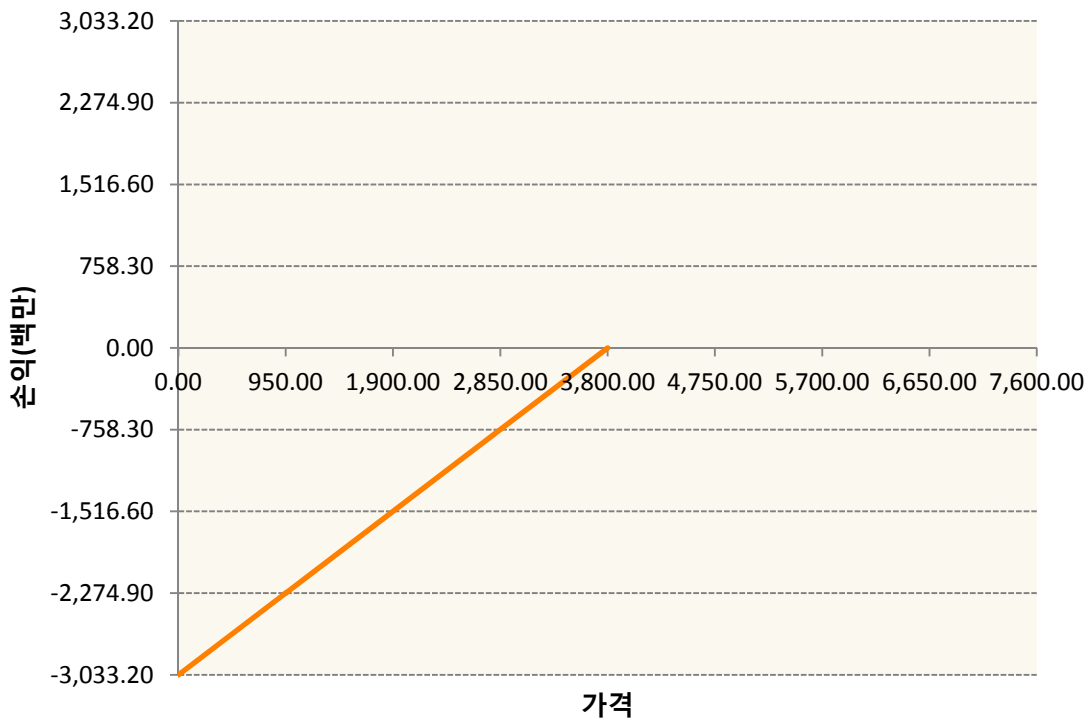


**OESXH0-C3825-EURO STOXX 50**

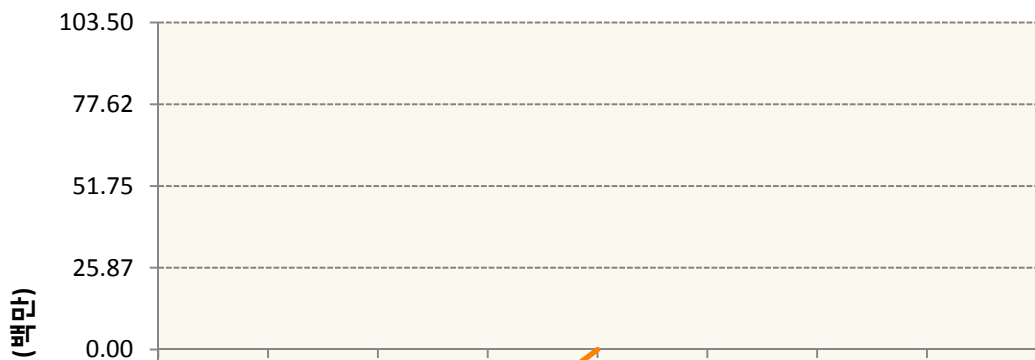


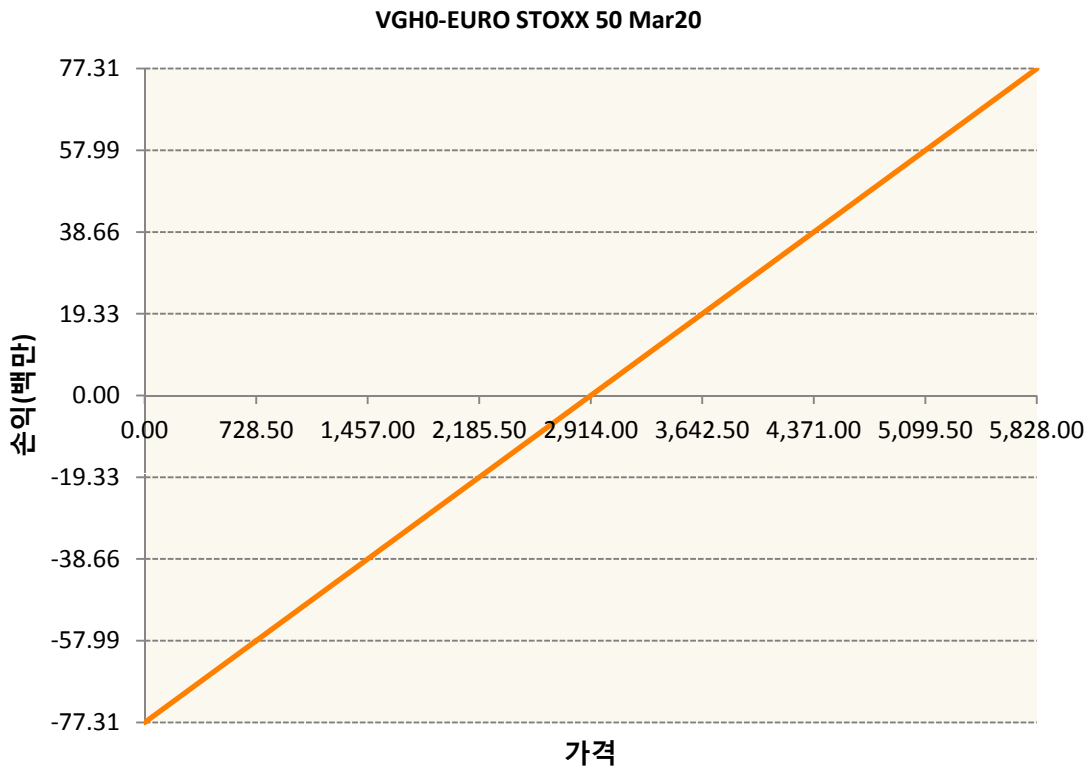
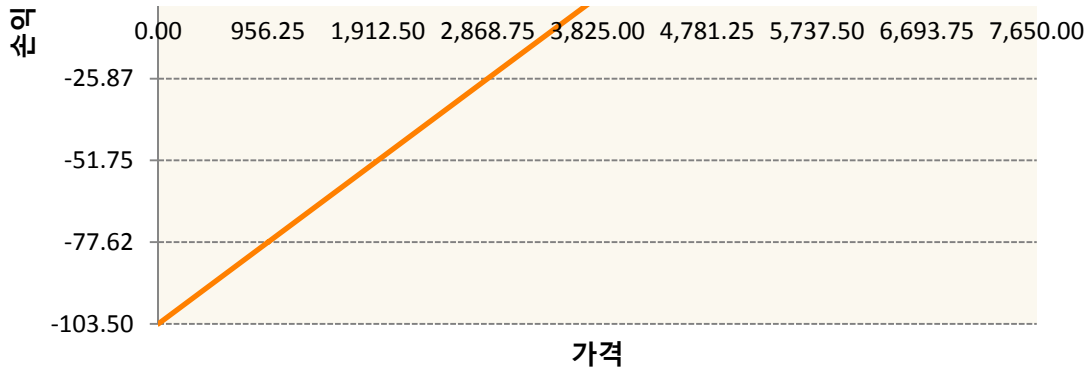


OESXH0-P3800-EURO STOXX 50



OESXH0-P3825-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		0
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E		284
FX21020H00 EUR/KRW 27-03-20E		43
OESXH0-C3& EURO STOXX 50		243
OESXH0-C3& EURO STOXX 50		8
OESXH0-P3& EURO STOXX 50		243
OESXH0-P3& EURO STOXX 50		8
VGHO EURO STOXX 50 Mar20		6

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

(단위:백만원)

588

공시일	2020-03-12
기준일	2020-03-11

## ETF스마트레버리지목표전환형8호

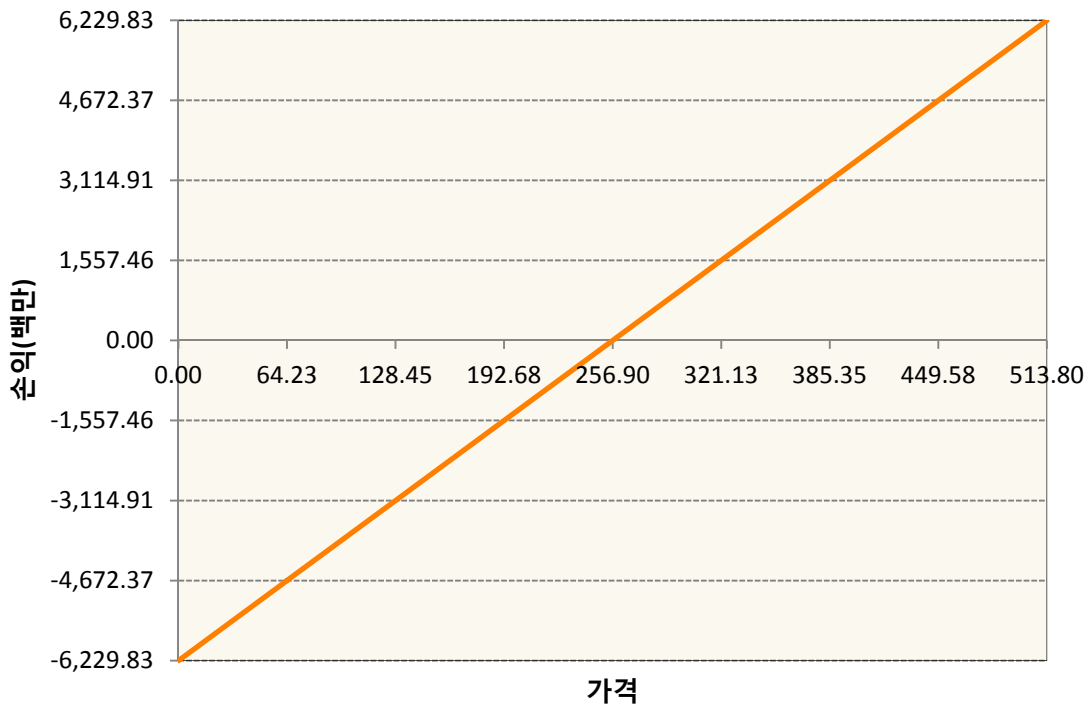
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

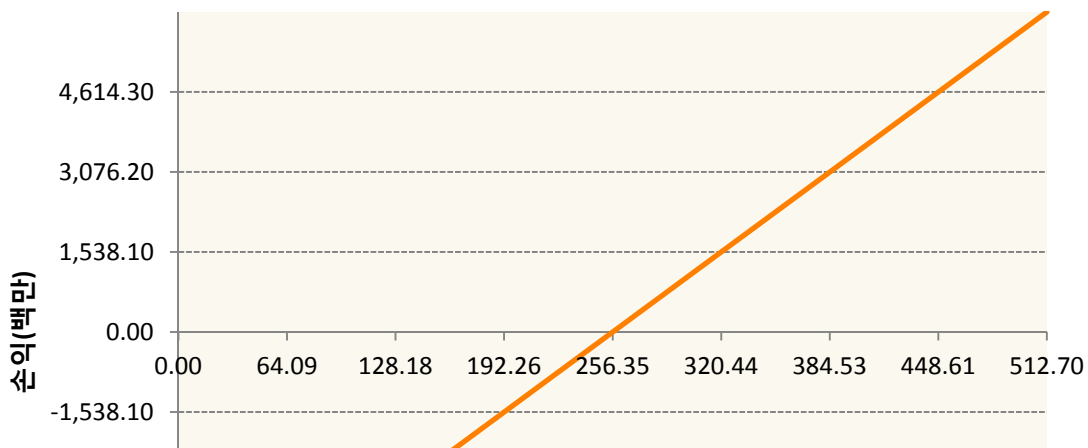
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	6,256	6,265	-10	장내
누계	유가증권	선물	12,382	0	12,382	장내

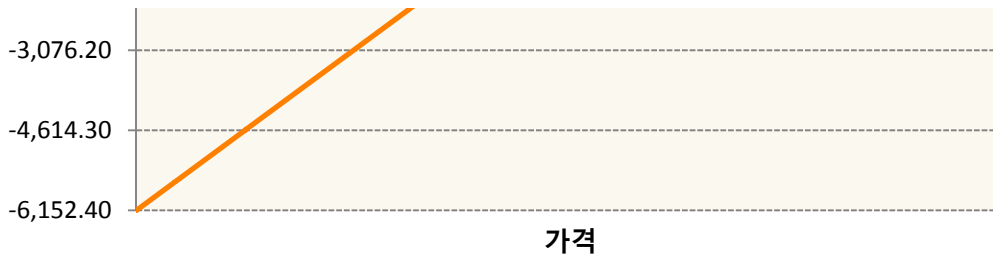
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물





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

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						499
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-499	-499	-499	-499	-499	-499	-499	
-5.33%	-332	-332	-332	-332	-332	-332	-332	
-2.67%	-166	-166	-166	-166	-166	-166	-166	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	166	166	166	166	166	166	166	
5.33%	332	332	332	332	332	332	332	
8.00%	499	499	499	499	499	499	499	
KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						493
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-493	-493	-493	-493	-493	-493	-493	
-5.33%	-329	-329	-329	-329	-329	-329	-329	
-2.67%	-164	-164	-164	-164	-164	-164	-164	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	164	164	164	164	164	164	164	
5.33%	329	329	329	329	329	329	329	
8.00%	493	493	493	493	493	493	493	

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

942



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

(단위:백만원)

83



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

(단위:백만원)

122



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

(단위:백만원)

44
----

공시일	2020-03-12
기준일	2020-03-11

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

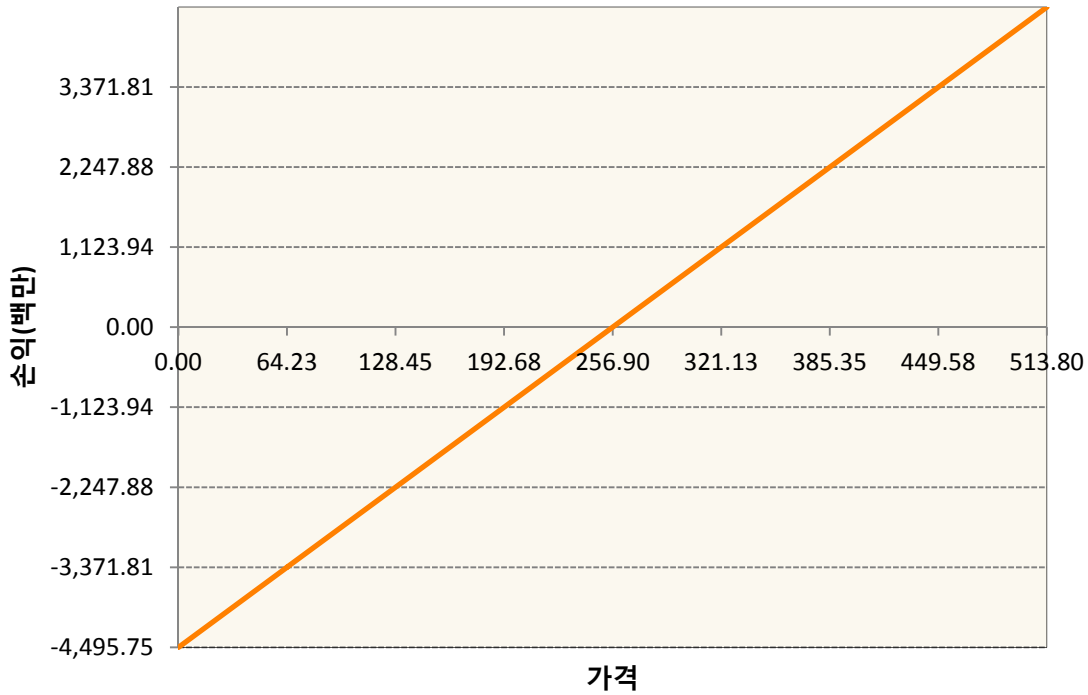
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

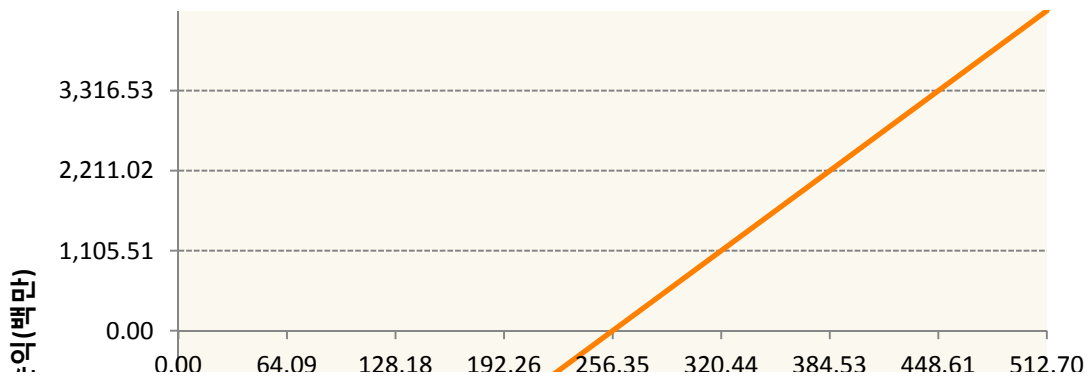
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	4,496	4,503	-7	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,918	0	8,918	장내
누계	유가증권	옵션	2,257	0	2,257	장내

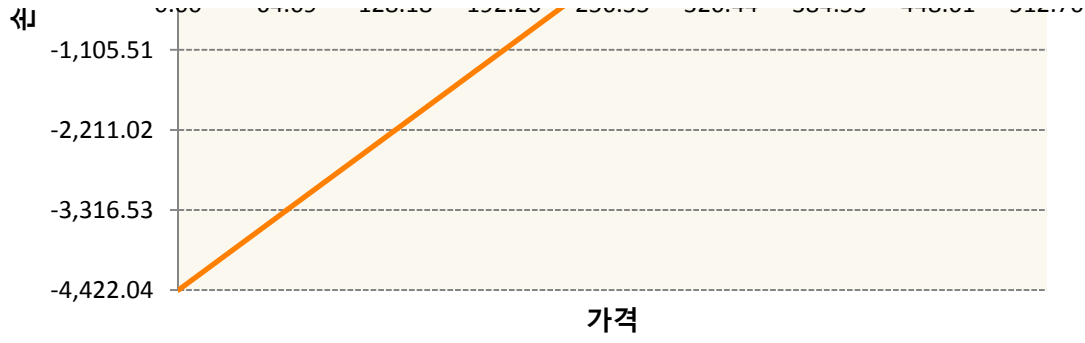
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

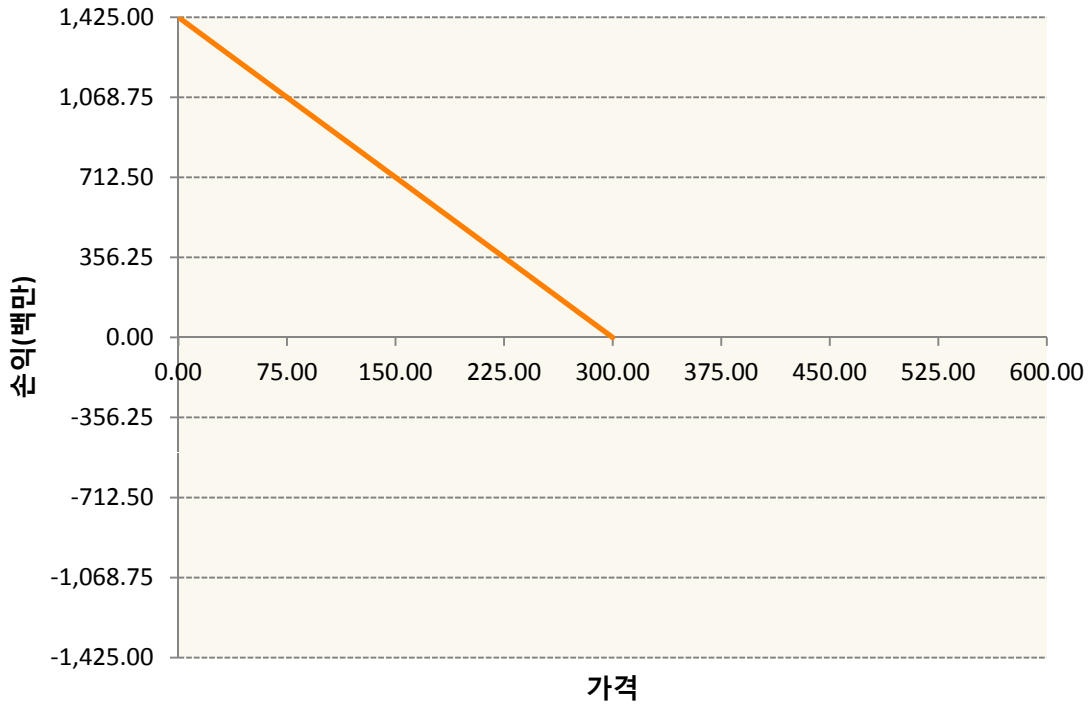


KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

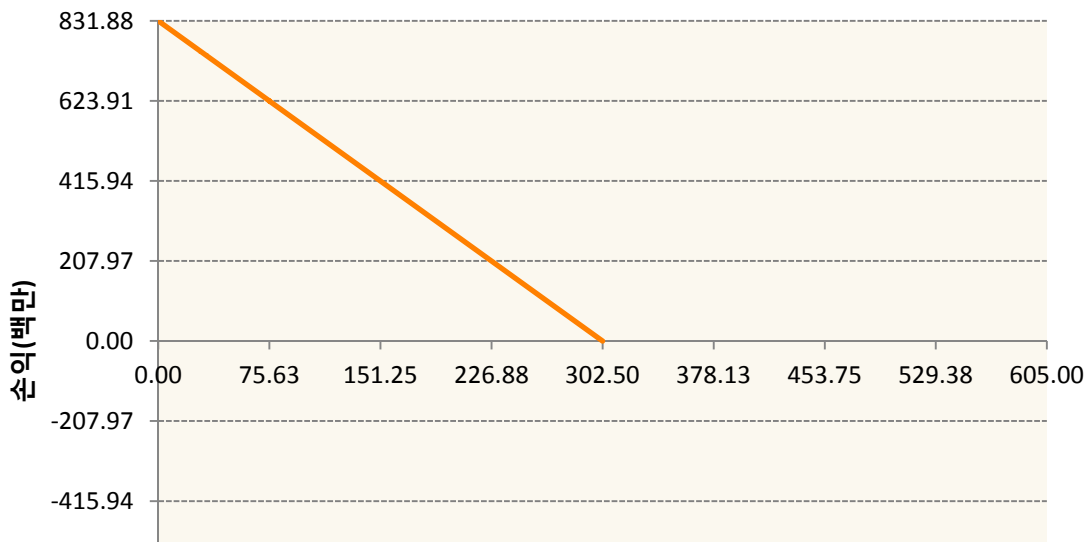


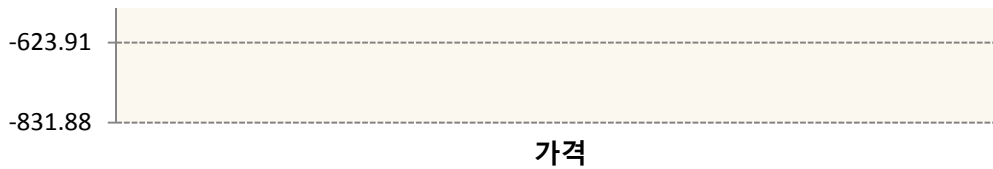


KR4301Q33005-2020-03 풋300



KR4301Q33021-2020-03 풋302.5





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

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						360
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-360	-360	-360	-360	-360	-360	-360	
-5.33%	-240	-240	-240	-240	-240	-240	-240	
-2.67%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	120	120	120	120	120	120	120	
5.33%	240	240	240	240	240	240	240	
8.00%	360	360	360	360	360	360	360	
KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						355
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-355	-355	-355	-355	-355	-355	-355	
-5.33%	-236	-236	-236	-236	-236	-236	-236	
-2.67%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	118	118	118	118	118	118	118	
5.33%	236	236	236	236	236	236	236	
8.00%	355	355	355	355	355	355	355	
KR4301Q33005		2020-03 풋300						98
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	98	98	98	98	98	98	98	
-5.33%	65	65	65	65	65	65	65	
-2.67%	33	33	33	33	33	33	33	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
5.33%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65	
8.00%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98	
KR4301Q33021		2020-03 풋302.5						57
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	57	57	57	57	57	57	57	
-5.33%	38	38	38	38	38	38	38	
-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%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
8.00%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57

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

(단위:백만원)

**833**

공시일	2020-03-12
기준일	2020-03-11

## 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	195,398	0	195,398	

### 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	2020-03-12
기준일	2020-03-11

## 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	103,604	0	103,604	

### 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	2020-03-12
기준일	2020-03-11

## 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	490,949	0	490,949	
누계	통화	선도	17,895	569,061	-551,166	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	3,054
FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E	2,863
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,577
FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	954
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,183
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,212
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	954
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	1,909
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	3,283
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,283
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,909
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,818
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,233
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,909
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	191
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	4,867
FX21020G06 USD/KRW 31-03-20E	477
FX21020H00 USD/KRW 31-03-20E	954
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)

16,796



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

(단위:백만원)

125

공시일	2020-03-12
기준일	2020-03-11

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

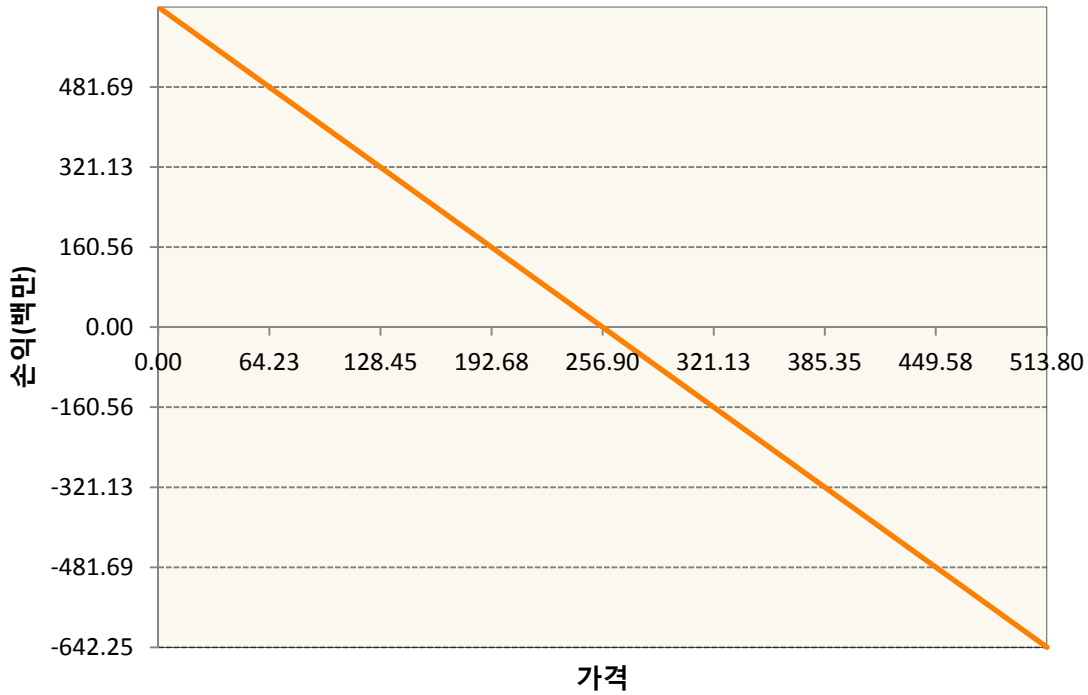
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

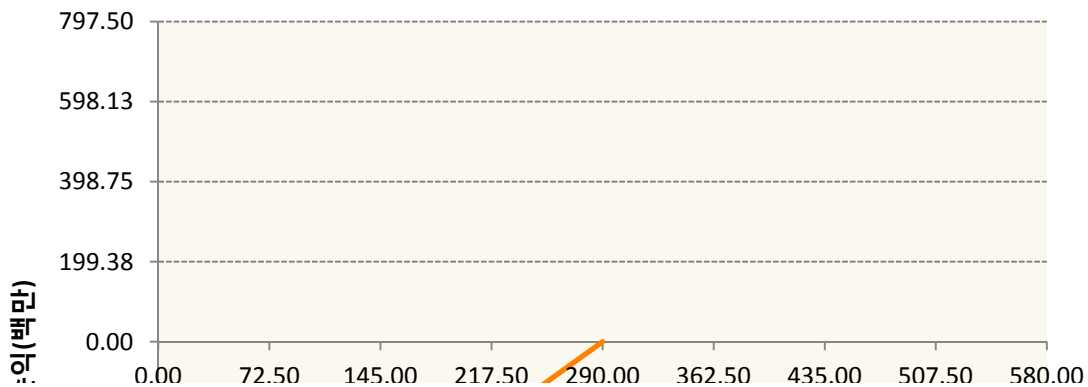
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	642	-642	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,503	-3,503	장내

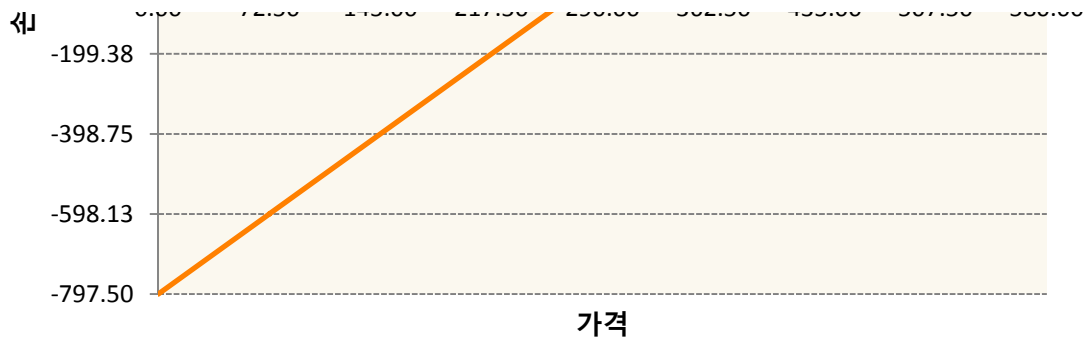
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

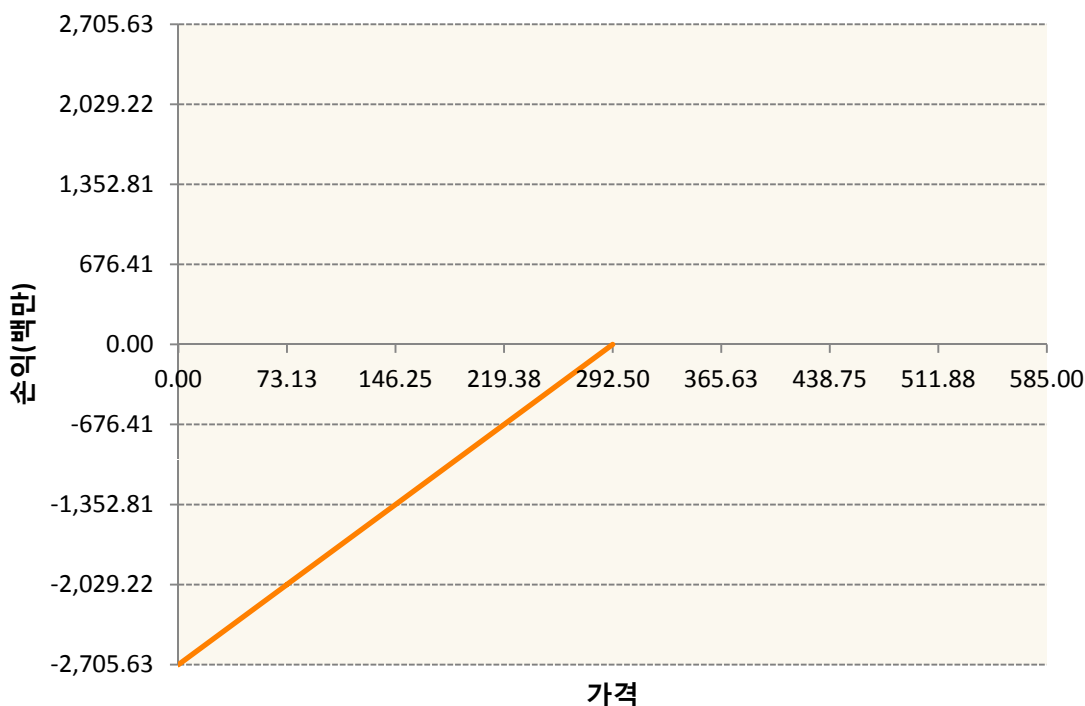


KR4301Q32908-2020-03 풋290





KR4301Q32924-2020-03 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						51
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	51	51	51	51	51	51	51	
-5.33%	34	34	34	34	34	34	34	
-2.67%	17	17	17	17	17	17	17	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
5.33%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	
8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51	
KR4301Q32908		2020-03 풋290						57
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
-5.33%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
-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%	38	38	38	38	38	38	38
8.00%	57	57	56	56	56	56	56

KR4301Q32924                      2020-03 풋292.5                      190

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-190	-190	-190	-190	-190	-190	-190
-5.33%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127
-2.67%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	63	63	63	63	63	63	63
5.33%	127	127	127	127	127	127	127
8.00%	190	190	190	190	190	190	190

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

(단위:백만원)

**296**

공시일	2020-03-12
기준일	2020-03-11

## 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	8,334	0	8,334	
누계	통화	선도	5,619	14,423	-8,804	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
FX21020H02 USD/KRW 12-03-20E	350
FX21020H02 KRW/USD 13-04-20E	346
IE00BD8RGM75	

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

574
-----

공시일	2020-03-12
기준일	2020-03-11

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

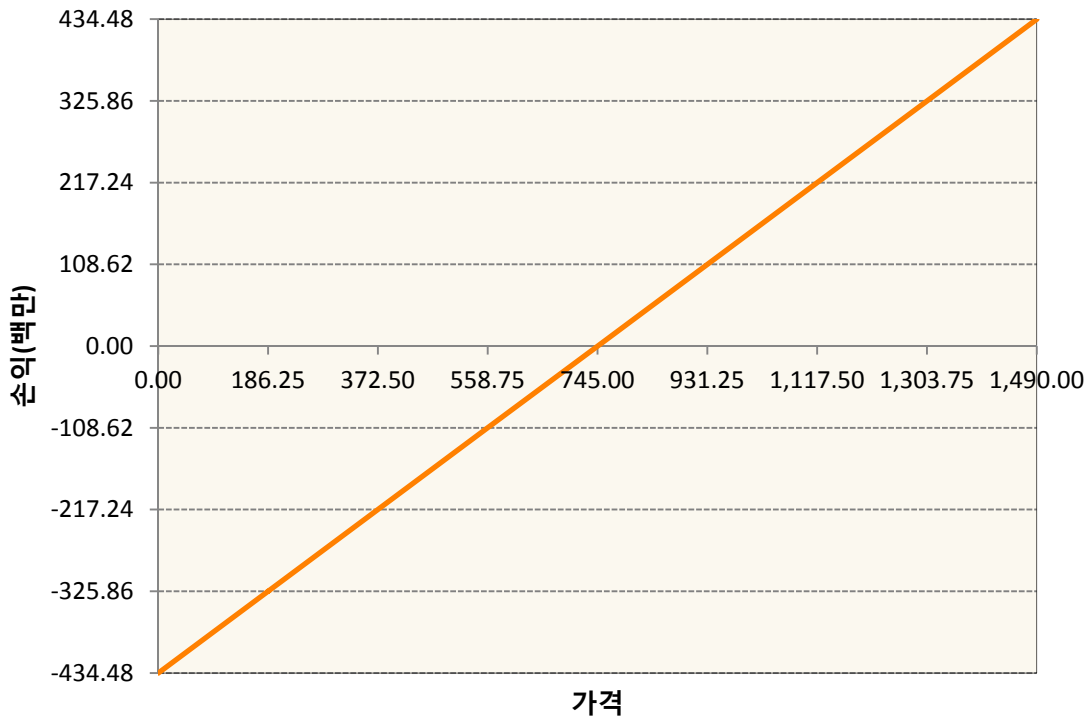
### 1. 계약금액

(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	434	0	434	
누계	유가증권	스왑	1,116	0	1,116	장외
누계	통화	선도	311	744	-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	35

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

(단위:백만원)

**134**

공시일	2020-03-12
기준일	2020-03-11

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

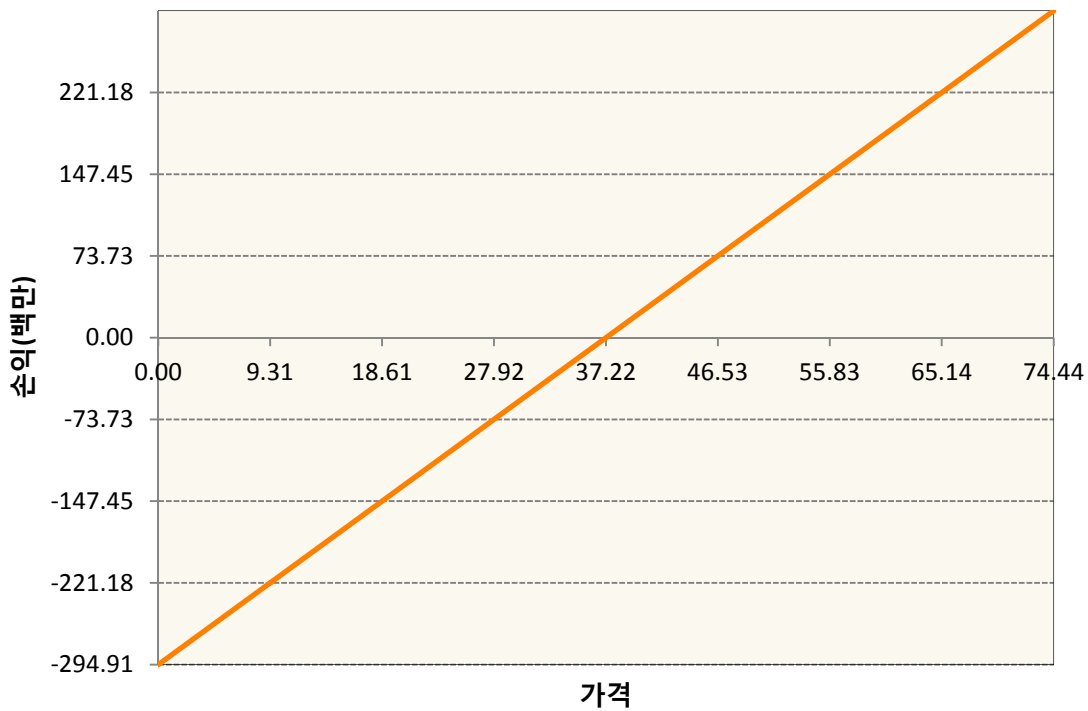
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

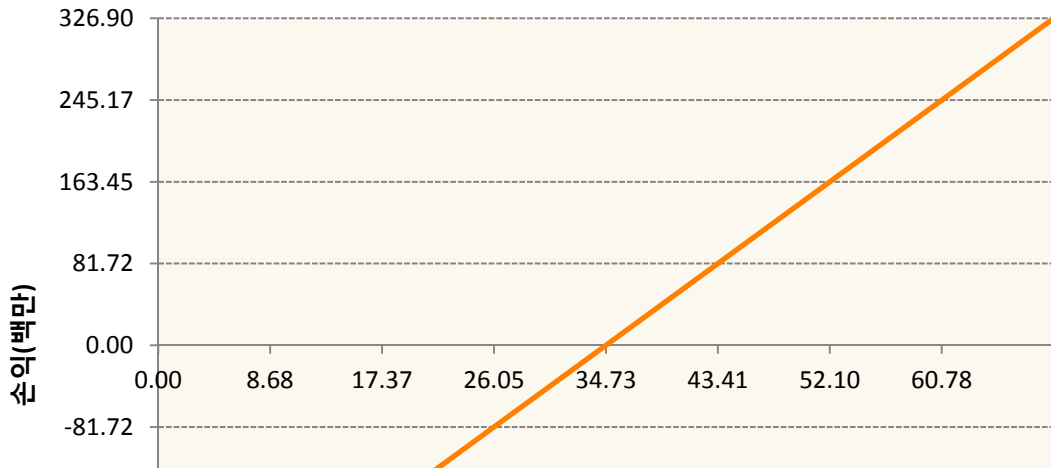
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,648	120	1,529	

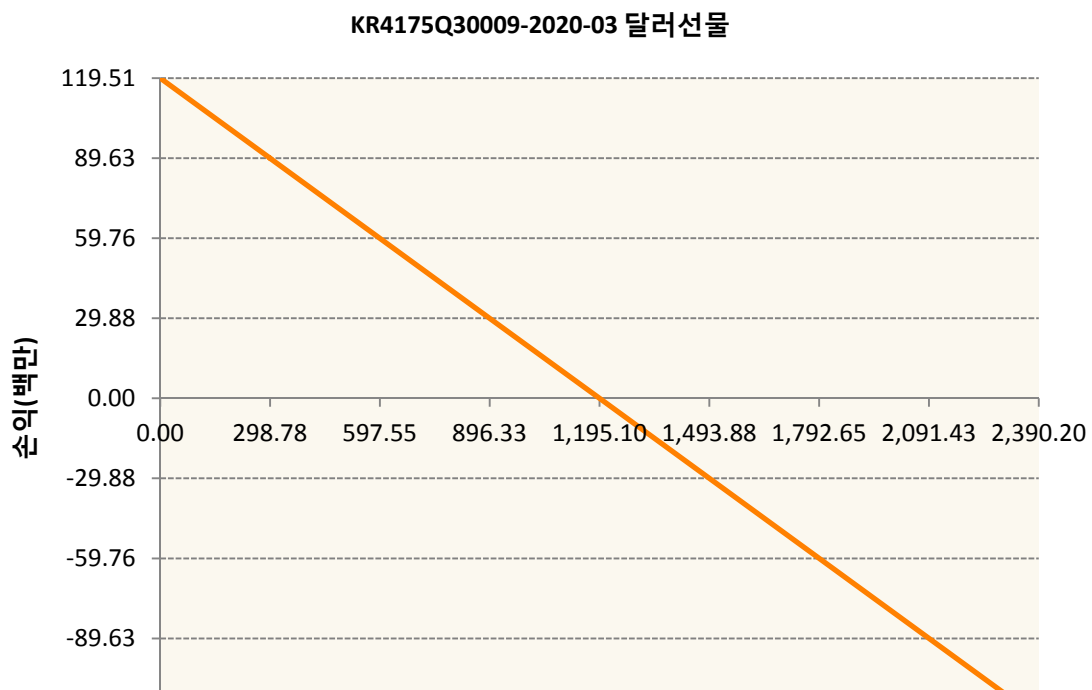
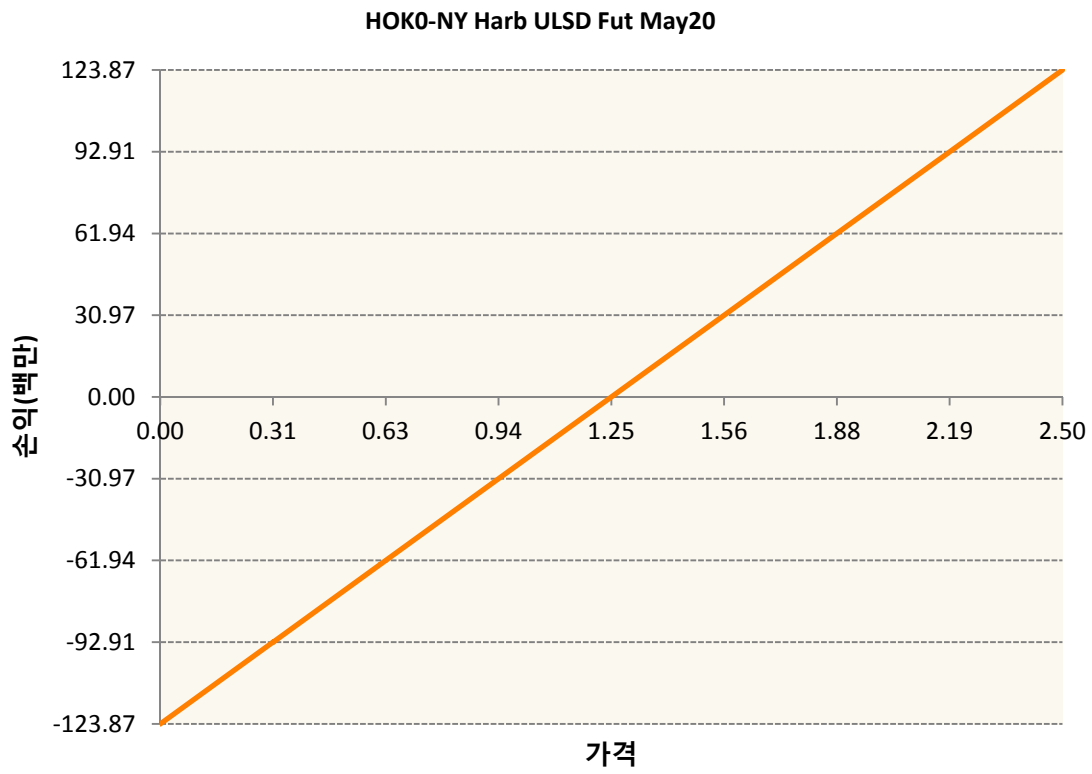
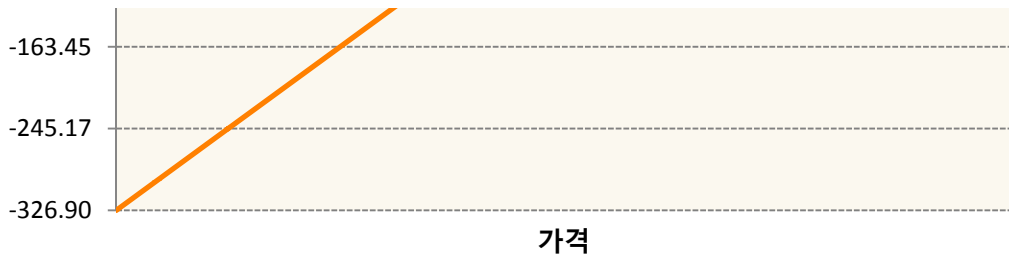
### 2. 만기시점의 손익구조

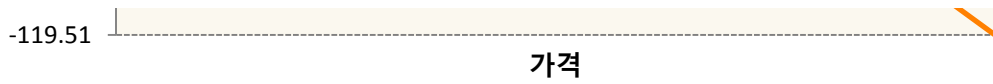
**COK0-BRENT CRUDE FUTR May20**



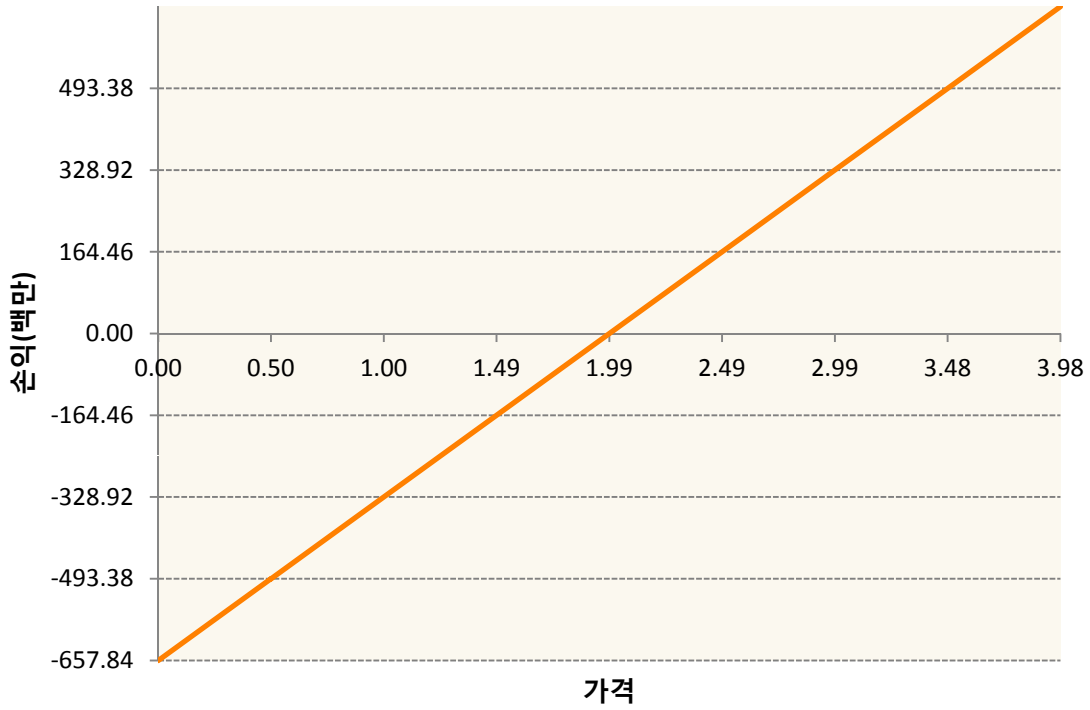
**CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20**



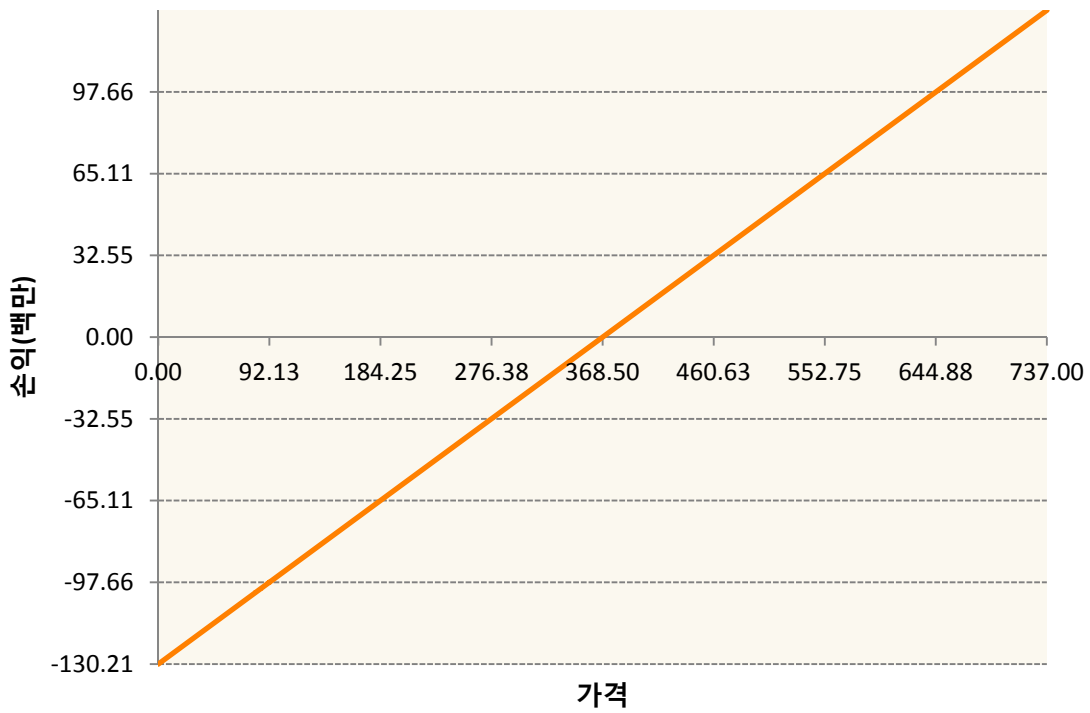




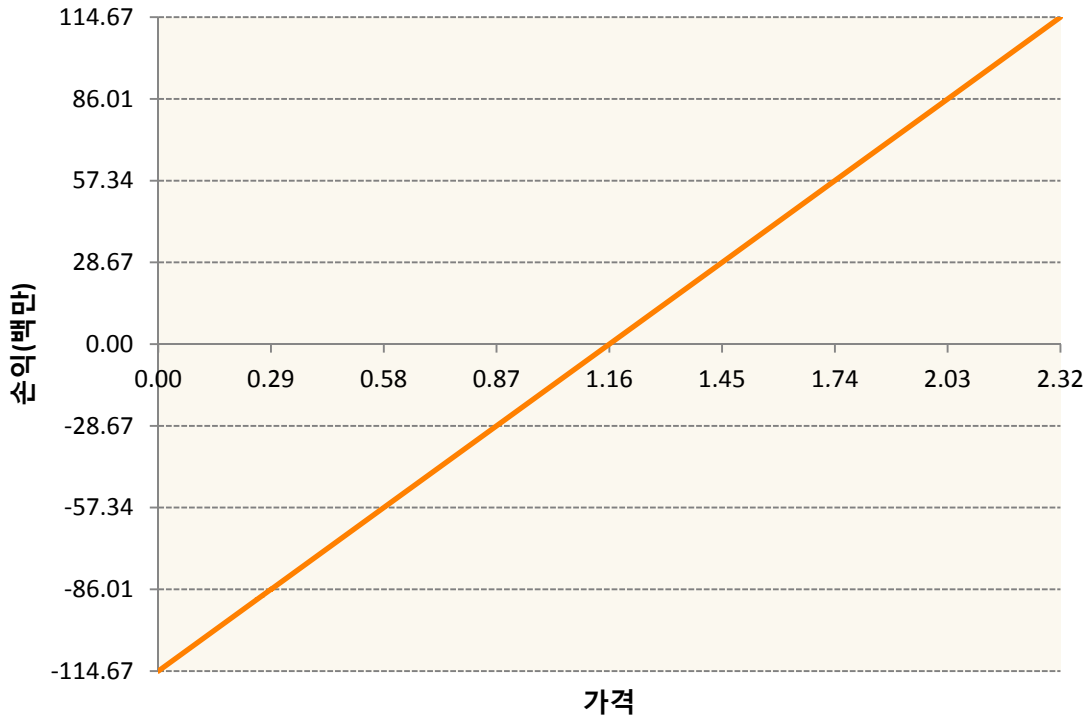
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



QSK0-Low Su Gasoil G Mar20



**XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20**



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	24
CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	26
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	10
KR4175Q30C	2020-03 달러선물	10
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	53
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	10
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	9

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

(단위:백만원)

**323**

공시일	2020-03-12
기준일	2020-03-11

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

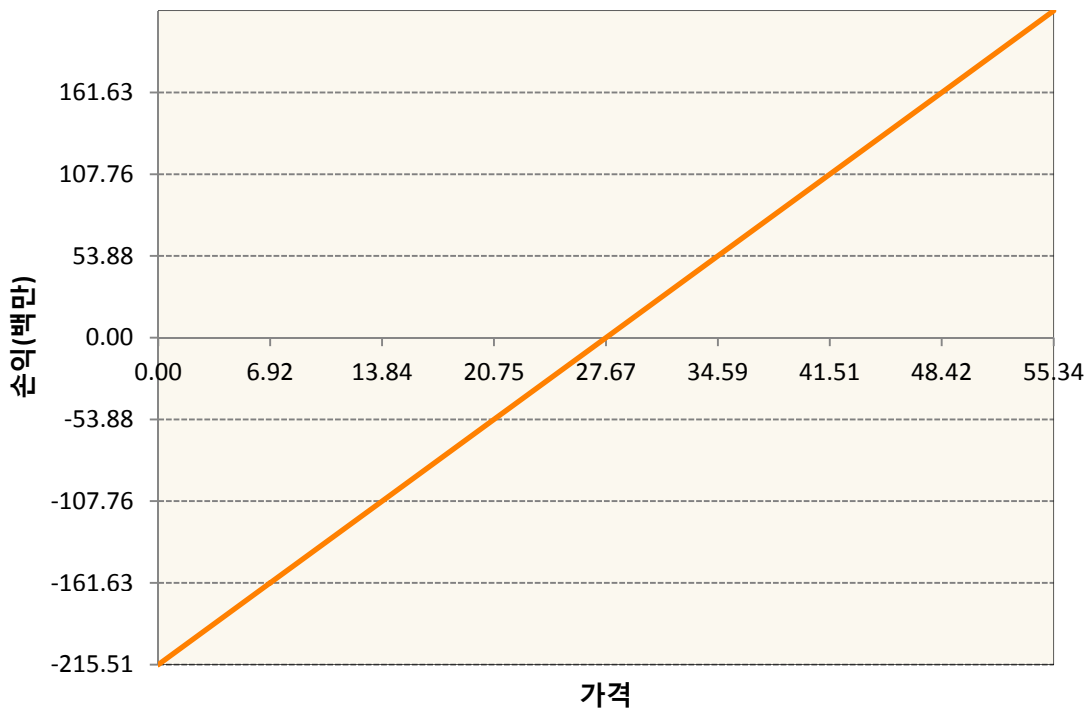
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

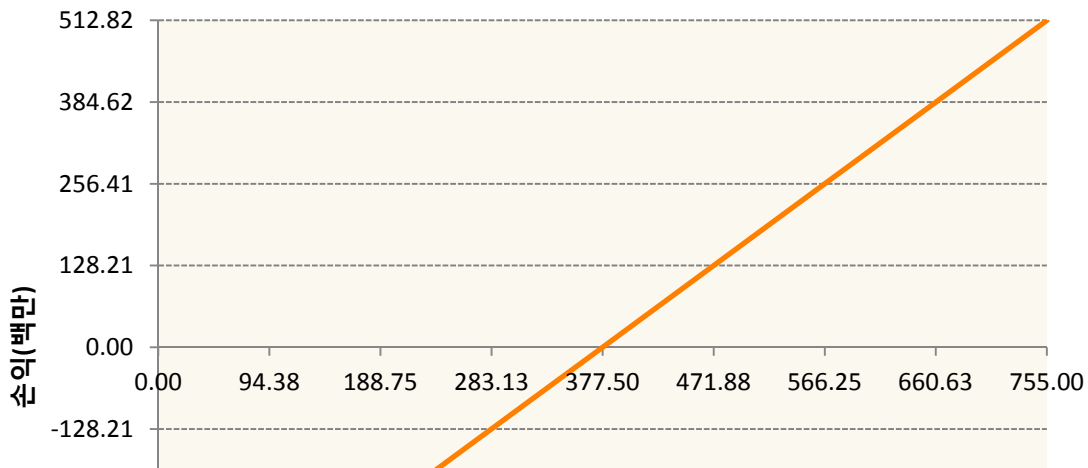
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,536	155	2,381	

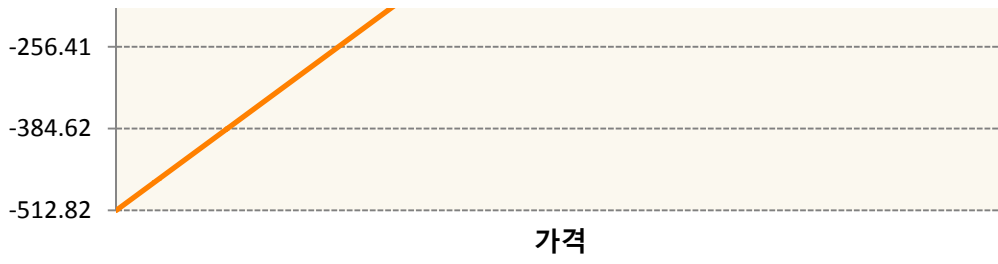
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20**

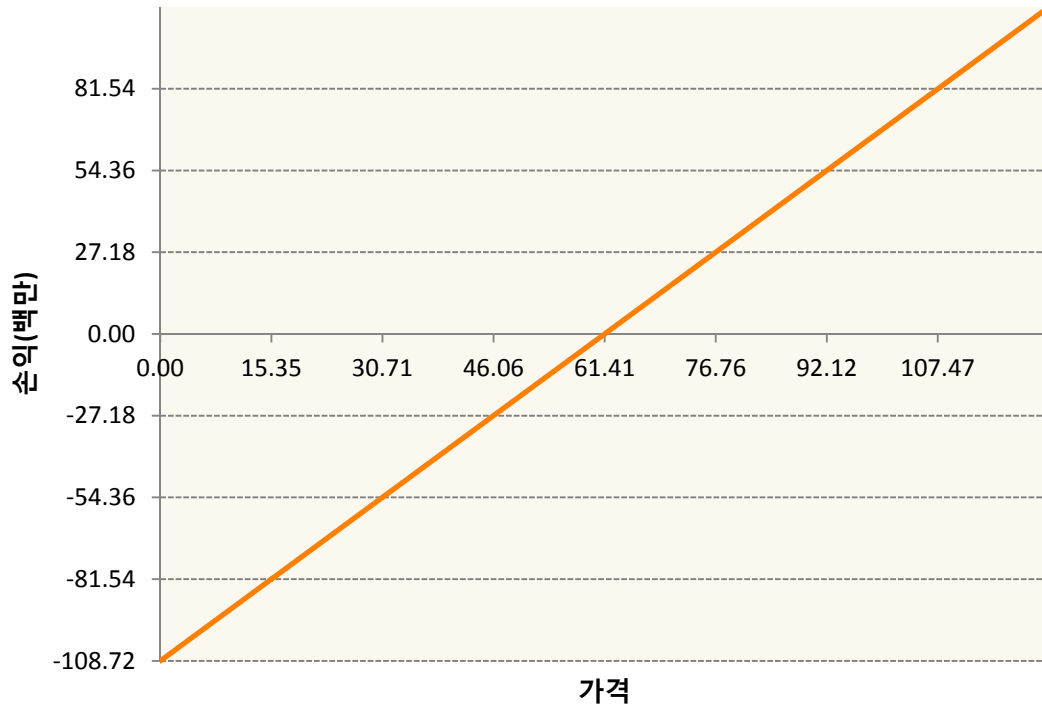


**CK0-CORN FUTURE May20**

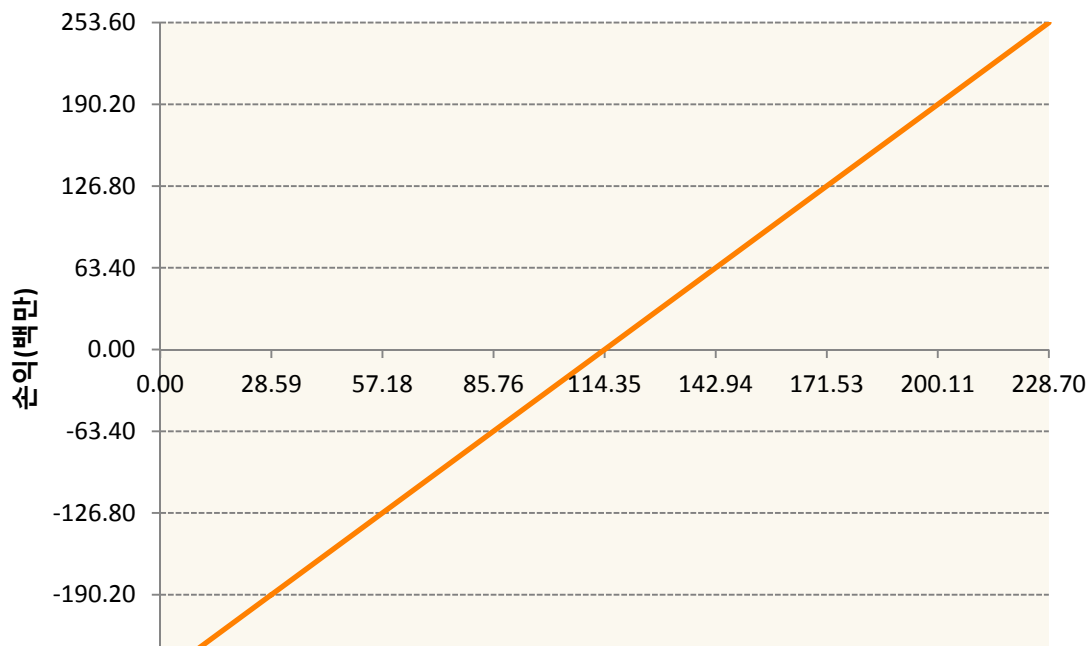


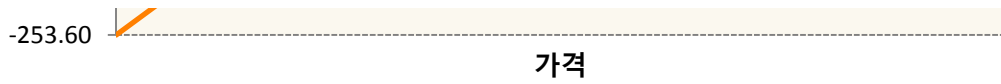


CTK0-COTTON NO.2 FUTR May20

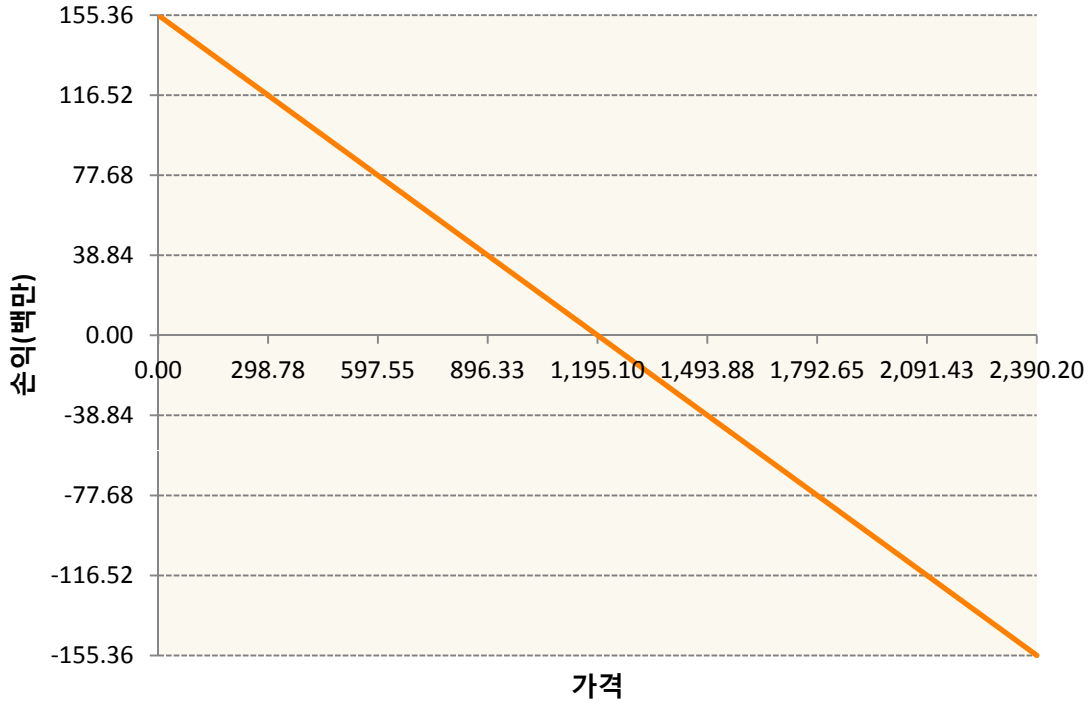


KCK0-COFFEE 'C' FUTURE May20

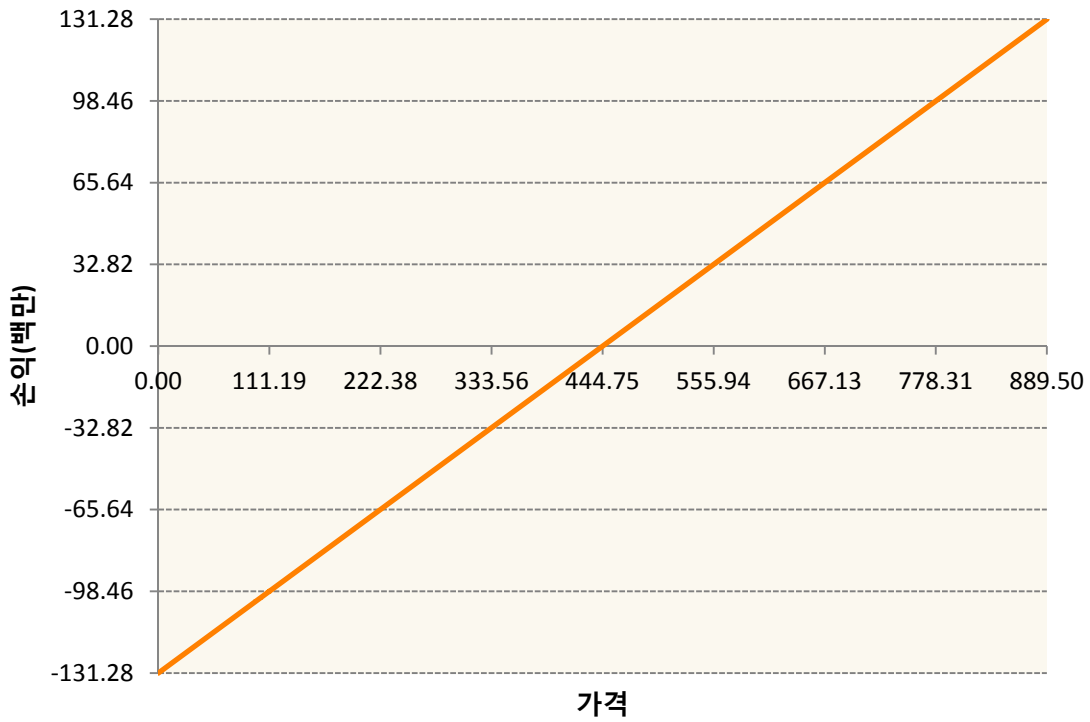




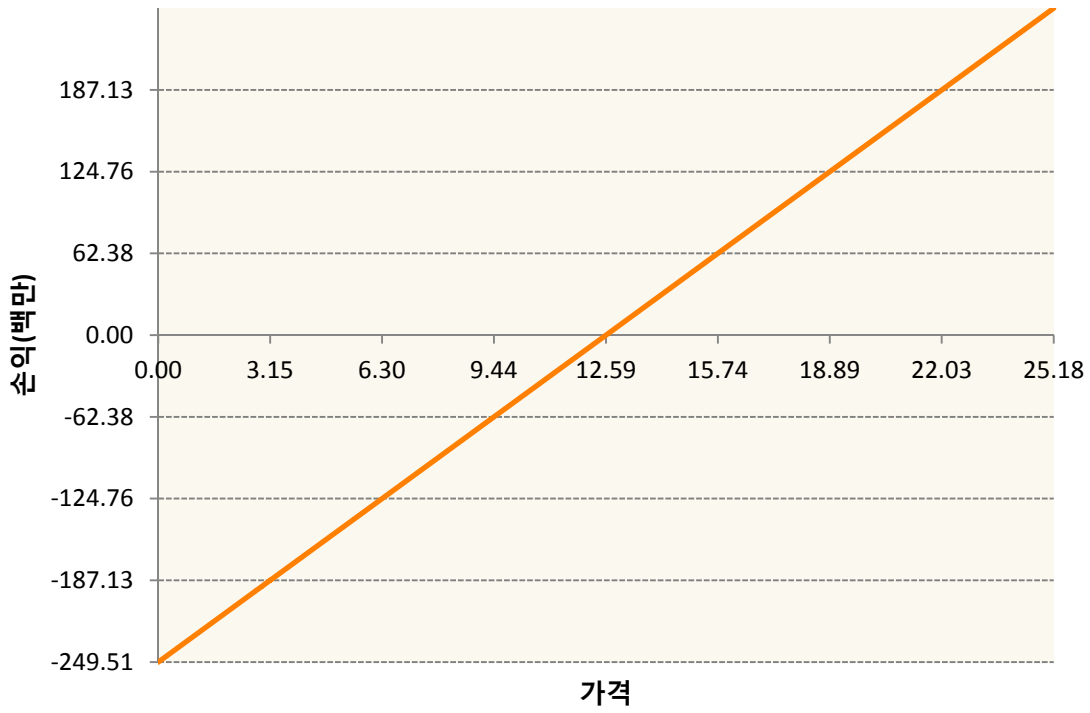
KR4175Q30009-2020-03 달러선물



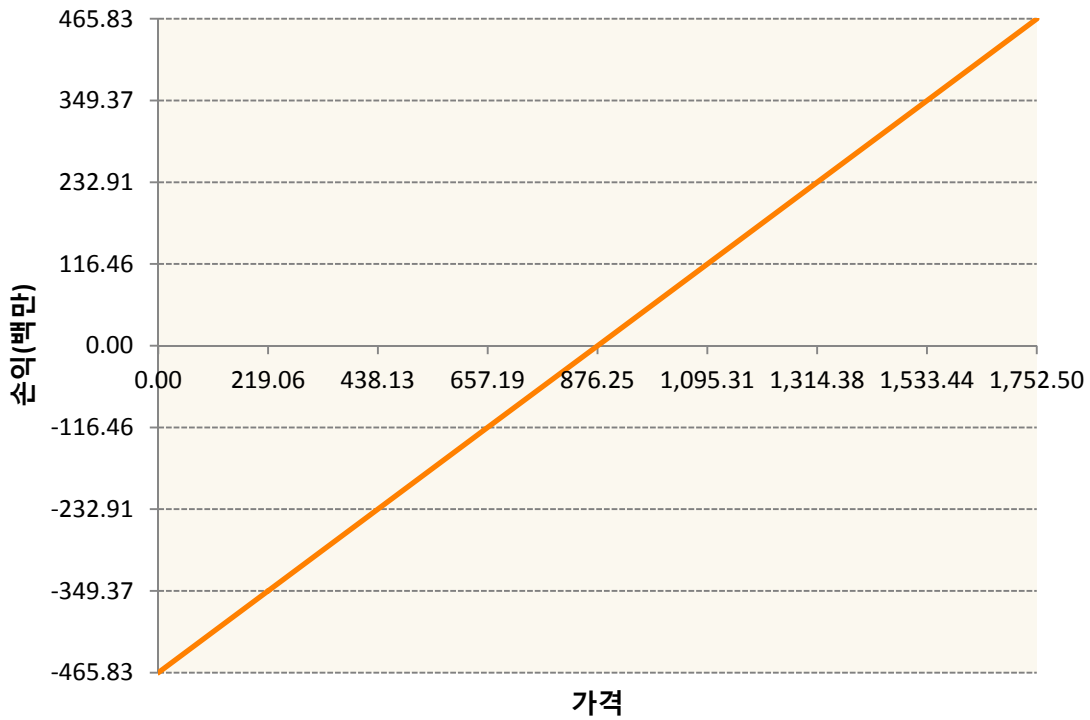
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



SBK0-Sugar May20

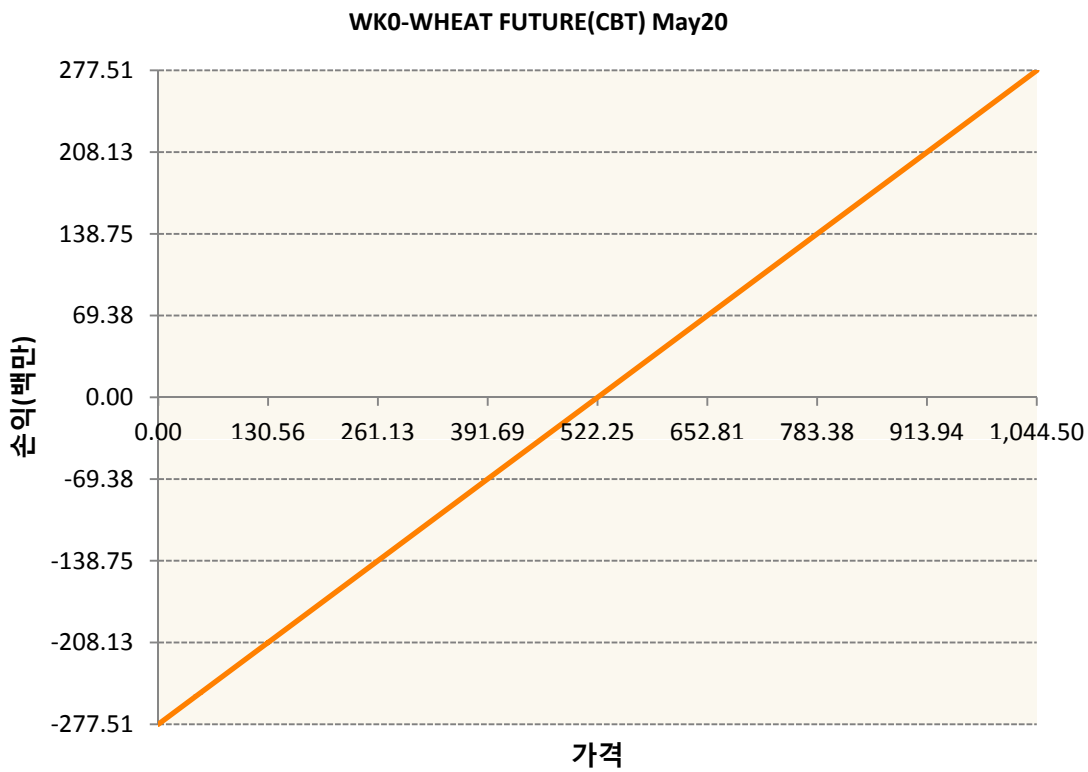
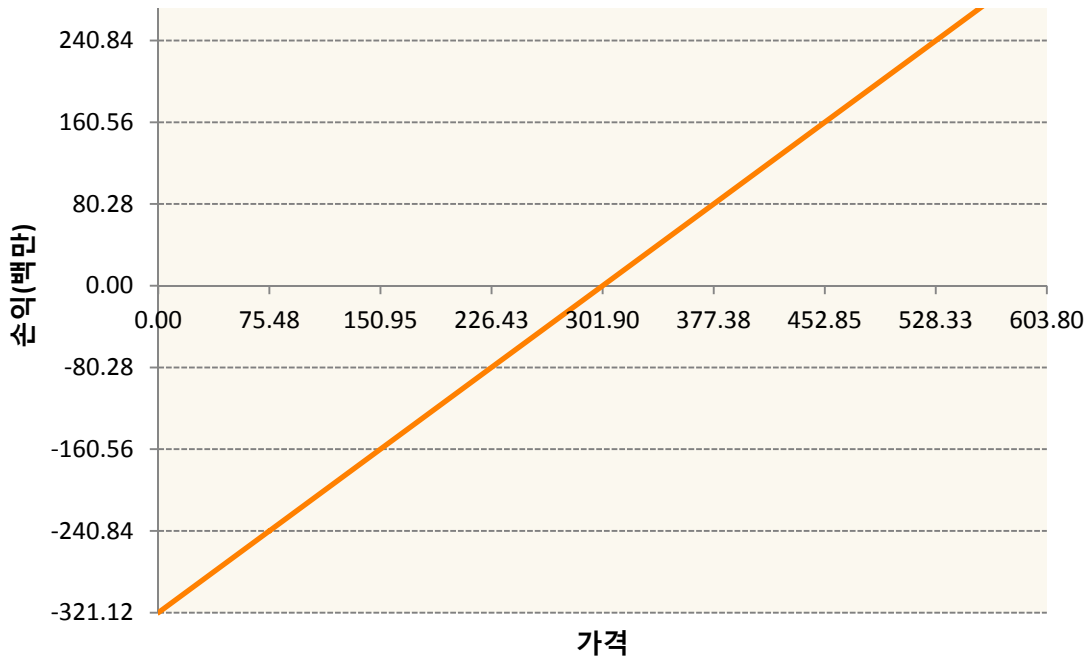


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





**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	20
KR4175Q30C	2020-03 달러선물	12

KWK0	KC HRW WHEAT FUT May20	11
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)

**222**