

공시일	2020-03-18
기준일	2020-03-17

## 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	2020-03-18
기준일	2020-03-17

## 스마트인덱스모

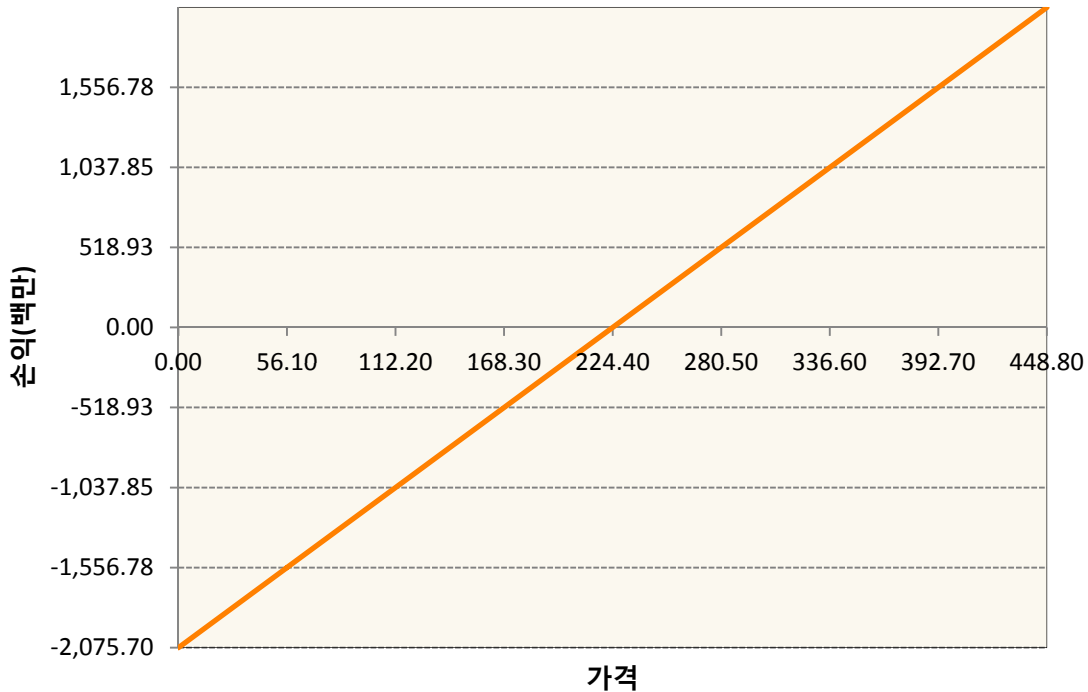
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

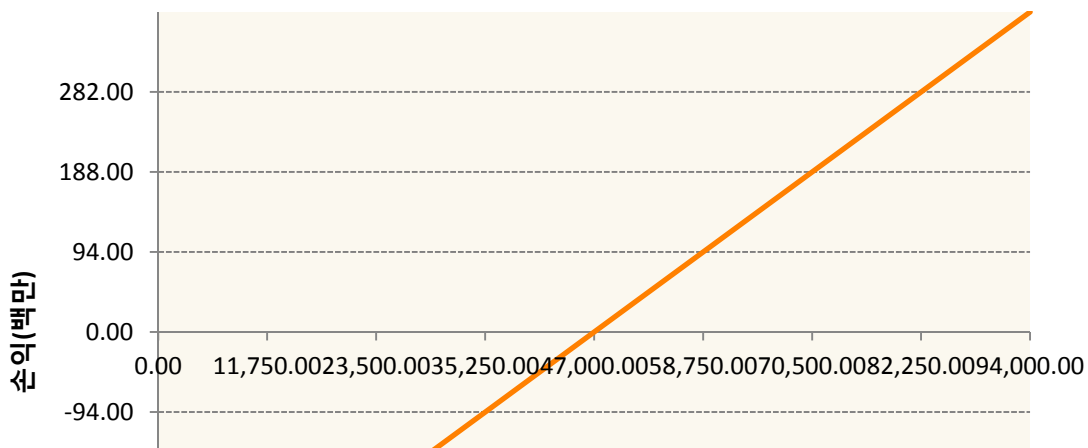
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	151	0	151	장내
누계	유가증권	선물	2,452	0	2,452	장내

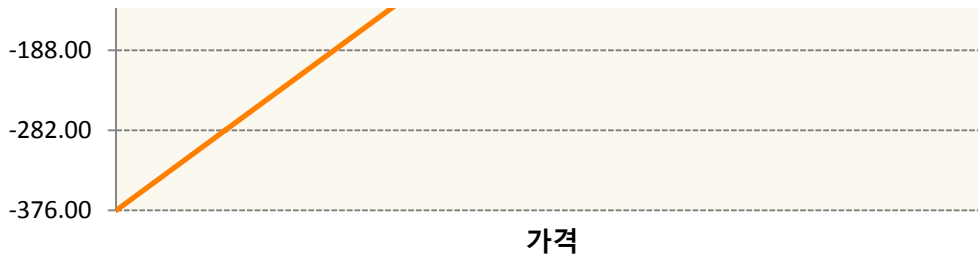
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



KR4111Q40003-2020-04 삼성전자개별선물





**3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						168
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168	
-5.33%	-112	-112	-112	-112	-112	-112	-112	
-2.67%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	56	56	56	56	56	56	56	
5.33%	112	112	112	112	112	112	112	
8.00%	168	168	168	168	168	168	168	
KR4111Q40003		2020-04 삼성전자개별선물						30
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30	
-5.33%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20	
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	10	10	10	10	10	10	10	
5.33%	20	20	20	20	20	20	20	
8.00%	30	30	30	30	30	30	30	

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

**206**

공시일	2020-03-18
기준일	2020-03-17

## 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

813

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

793

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-18
기준일	2020-03-17

## 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

544
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

851
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-18
기준일	2020-03-17

## 유로인덱스모(주식-파생형)

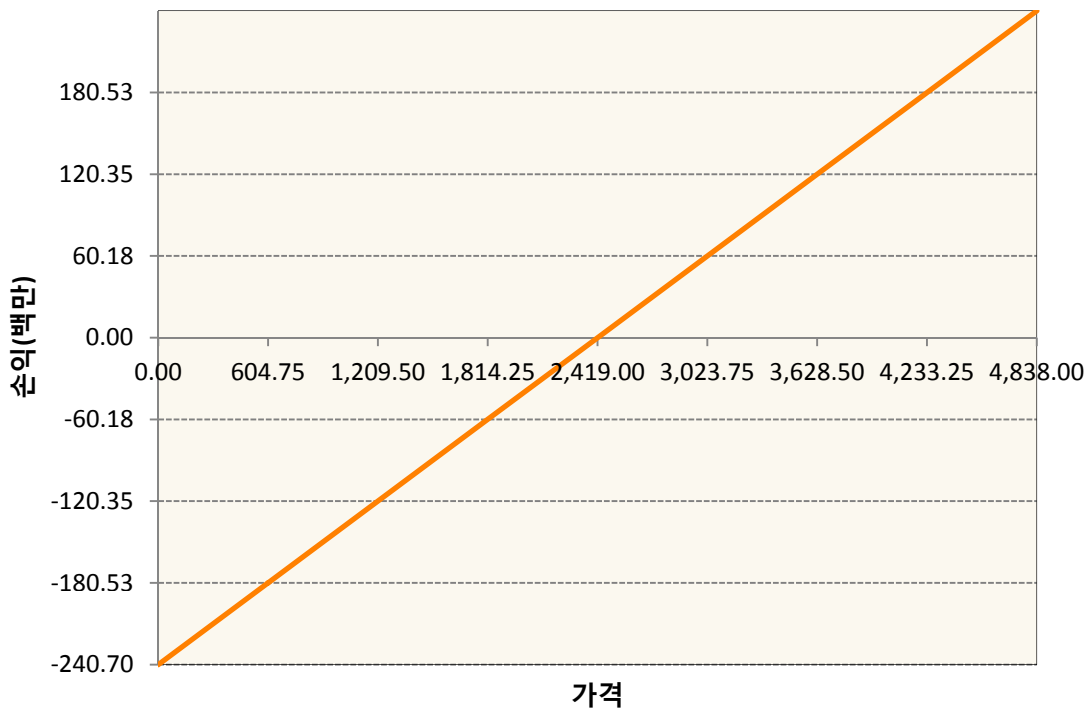
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

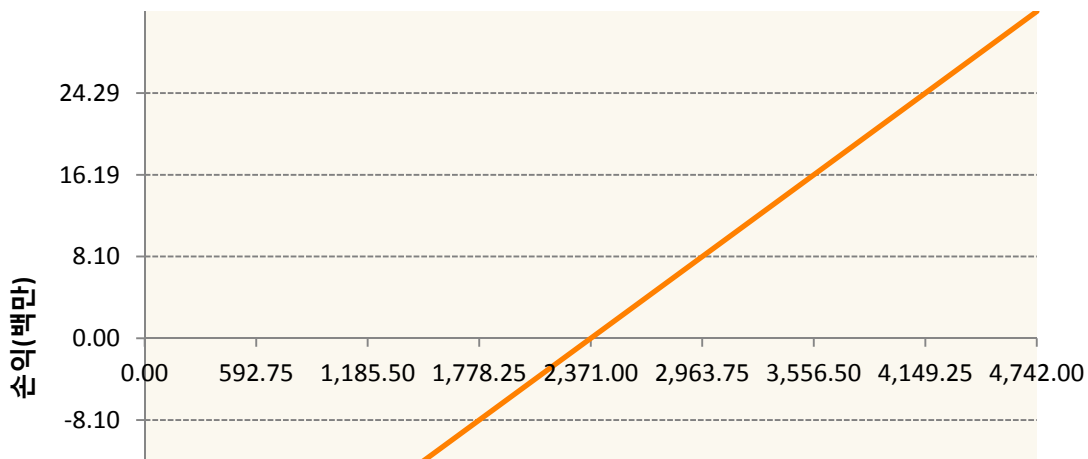
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	273	0	273	

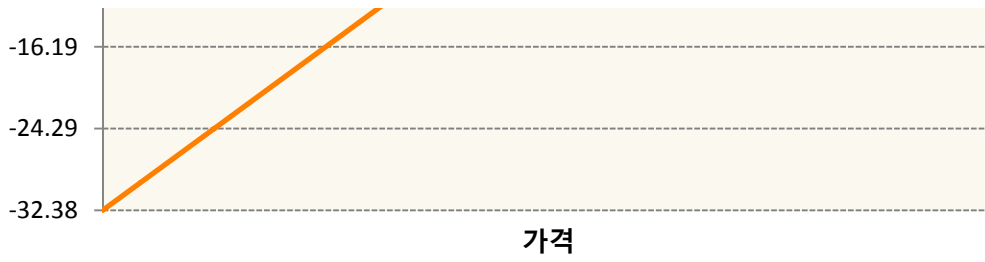
### 2. 만기시점의 손익구조

VGH0-EURO STOXX 50 Mar20



VGM0-EURO STOXX 50 Jun20





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

VGHO	EURO STOXX 50 Mar20	19
VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	3

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

22
----

공시일	2020-03-18
기준일	2020-03-17

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

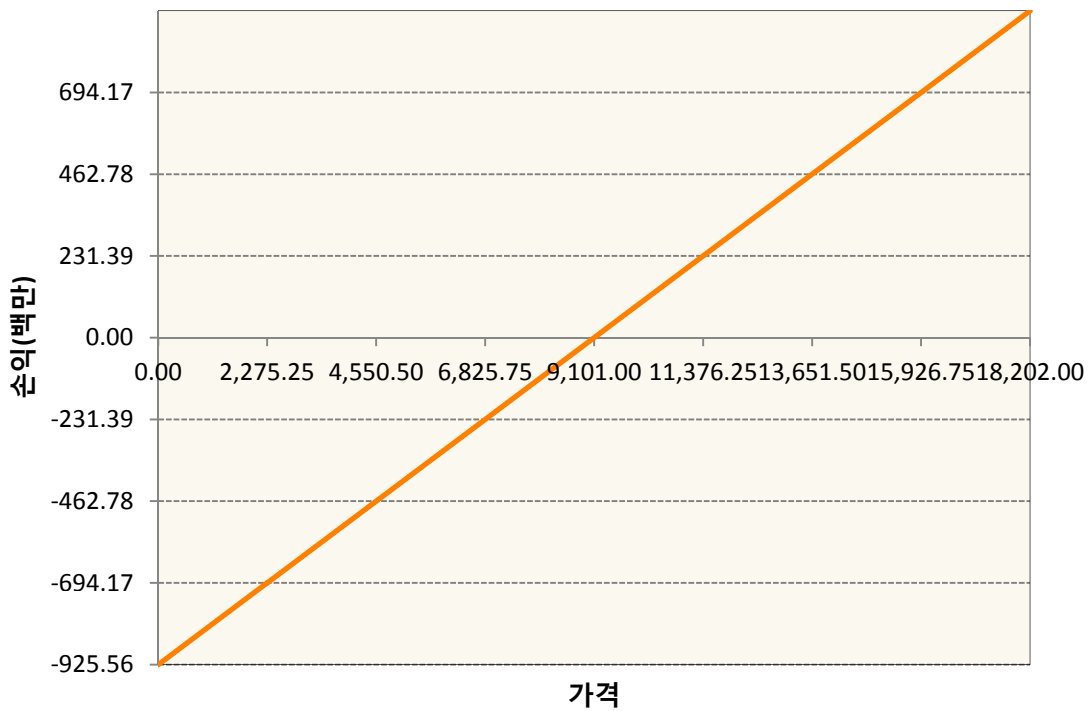
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	926	0	926	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH0	HSCEI Futures Mar20	74
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

72
----

공시일	2020-03-18
기준일	2020-03-17

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

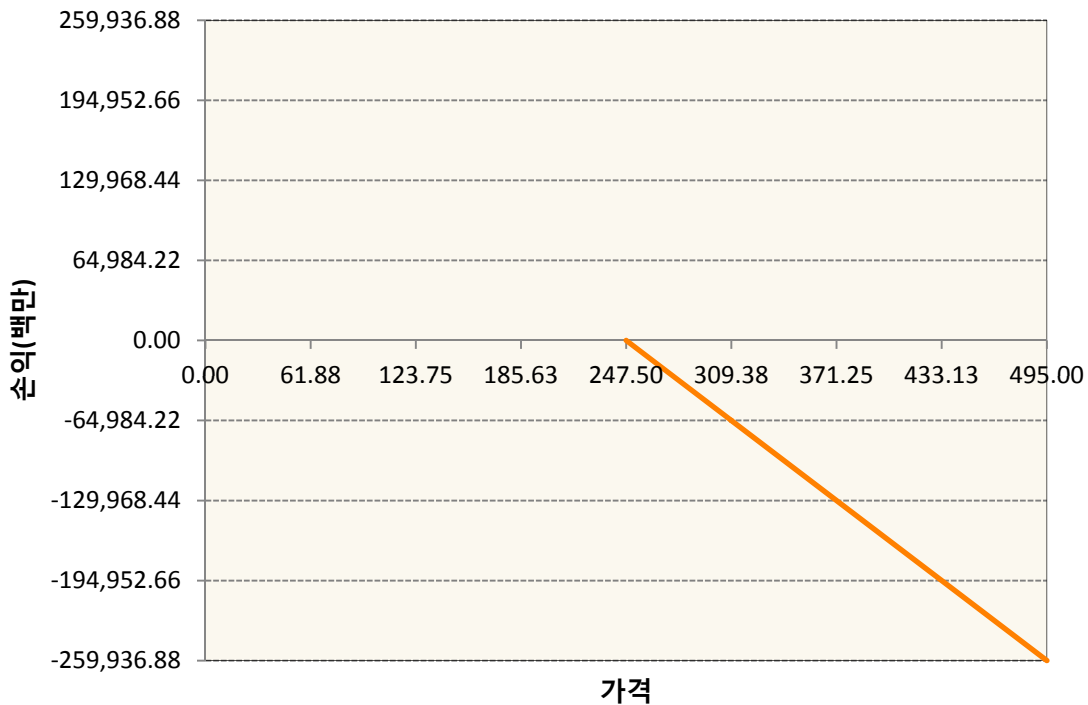
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

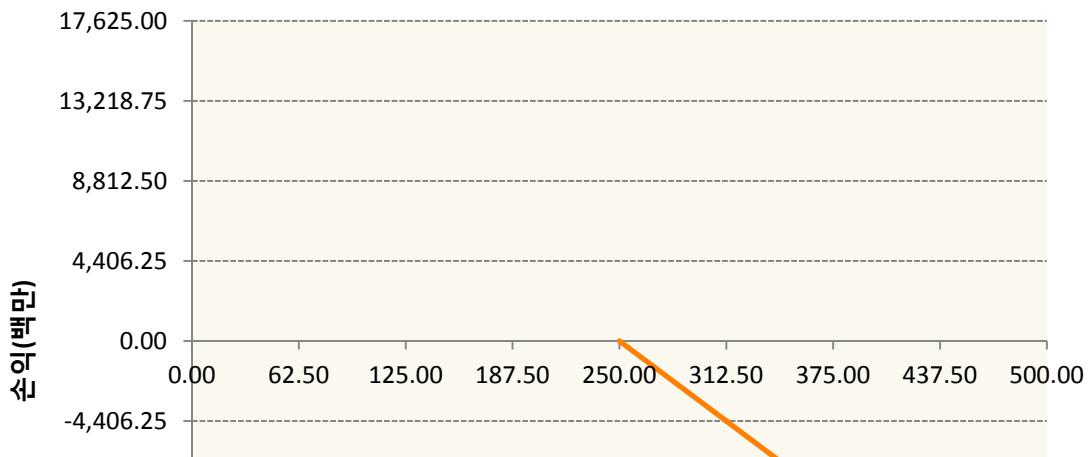
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	367,281	-367,281	장내

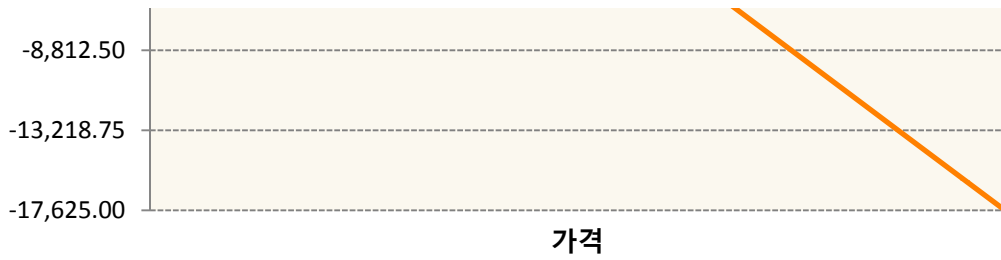
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

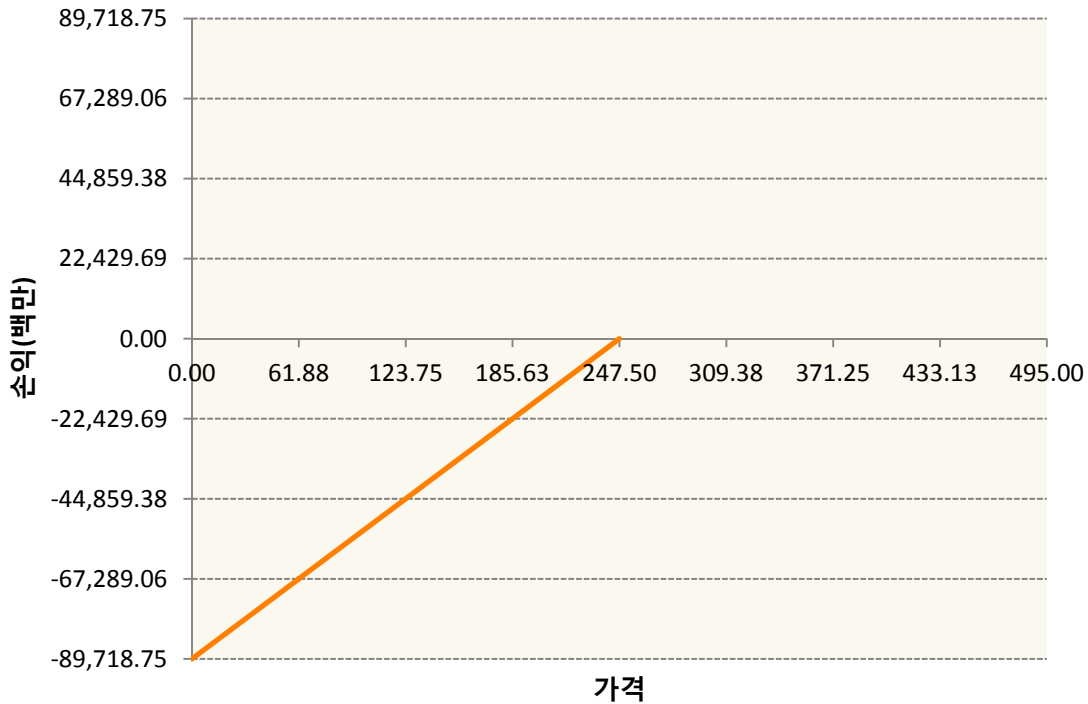


KR4201Q42503-2020-04 콜250





KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q42479		2020-04 콜247.5					11,486	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5,676	5,257	4,750	4,167	3,517	2,808	2,050	
-5.33%	5,100	4,515	3,849	3,114	2,321	1,480	599	
-2.67%	4,220	3,456	2,625	1,738	808	-159	-1,156	
0%	2,955	2,015	1,026	0	-1,056	-2,135	-3,233	
2.67%	1,232	135	-988	-2,131	-3,291	-4,463	-5,645	
5.33%	-1,007	-2,221	-3,444	-4,675	-5,912	-7,152	-8,396	
8.00%	-3,792	-5,074	-6,356	-7,639	-8,922	-10,204	-11,486	
KR4201Q42503		2020-04 콜250					738	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	347	322	292	255	215	170	121	

-5.33%	315	279	238	192	141	87	31
-2.67%	263	216	164	107	48	-15	-80
0%	189	129	66	0	-69	-139	-211
2.67%	85	15	-58	-133	-209	-286	-364
5.33%	-51	-131	-211	-293	-375	-457	-540
8.00%	-223	-309	-395	-480	-566	-652	-738
KR4301Q42477                      2020-04 풋247.5							5,839
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,114	-4,334	-4,588	-4,869	-5,173	-5,498	-5,839
-5.33%	-2,206	-2,489	-2,800	-3,135	-3,489	-3,859	-4,242
-2.67%	-409	-755	-1,124	-1,510	-1,910	-2,321	-2,742
0%	1,257	852	432	0	-441	-889	-1,342
2.67%	2,775	2,320	1,857	1,388	913	436	-45
5.33%	4,135	3,643	3,147	2,650	2,151	1,651	1,150
8.00%	5,330	4,816	4,301	3,787	3,272	2,758	2,244

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

(단위:백만원)

**12,991**

공시일	2020-03-18
기준일	2020-03-17

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

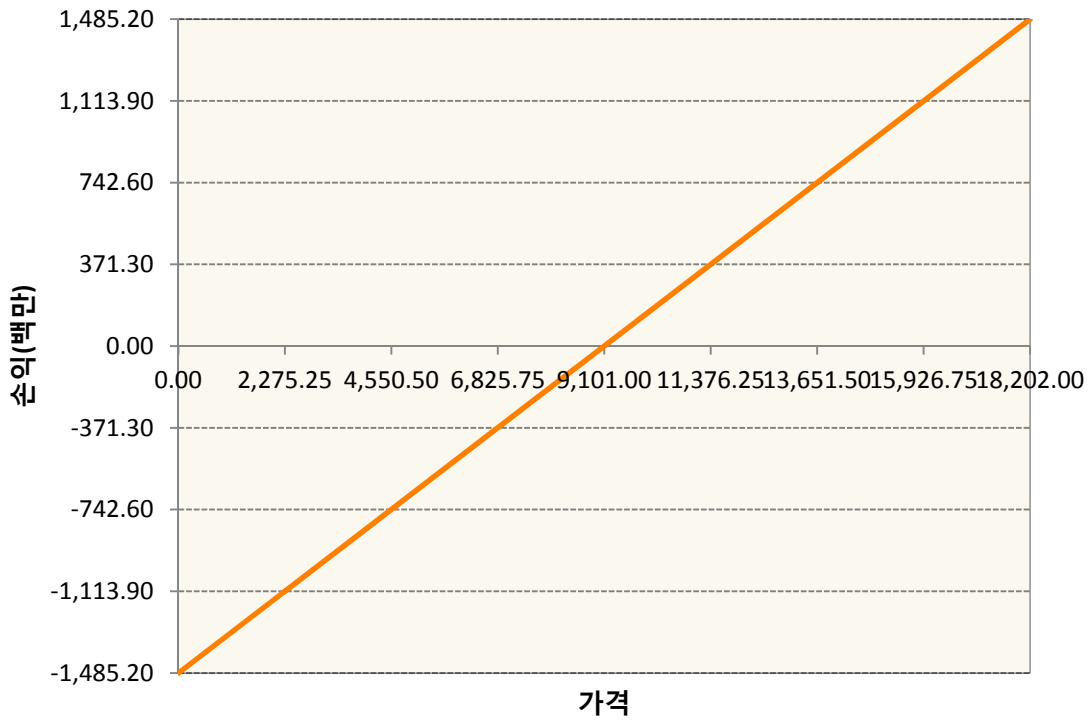
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

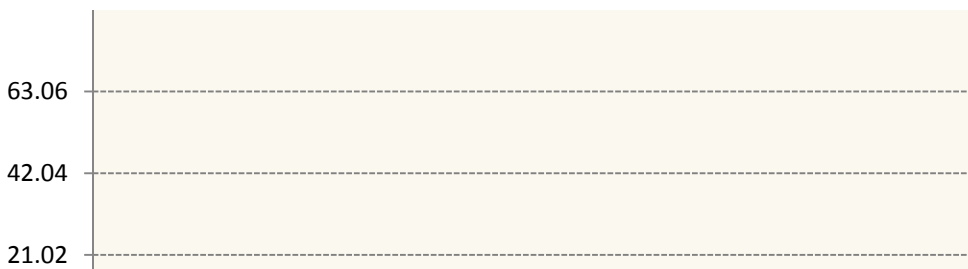
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,485	0	1,485	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,921	-4,921	장내
누계	통화	선도	705	2,255	-1,550	장외

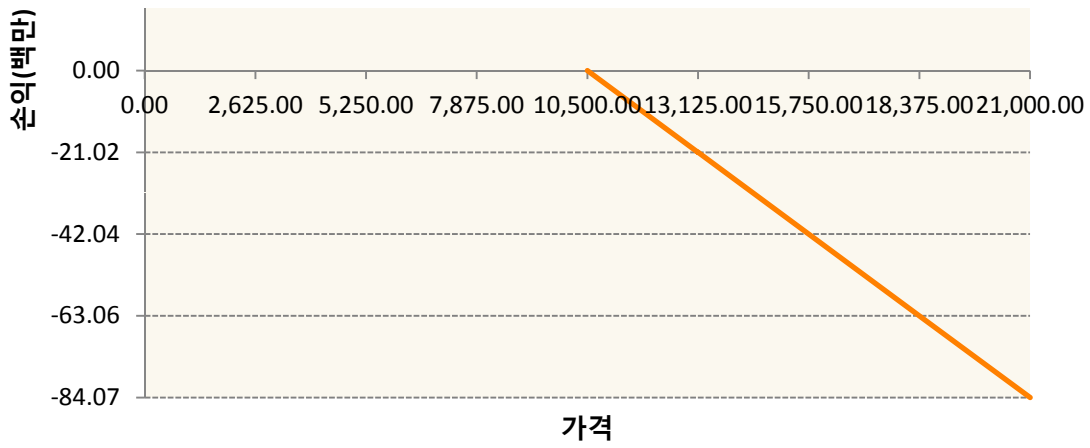
### 2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20

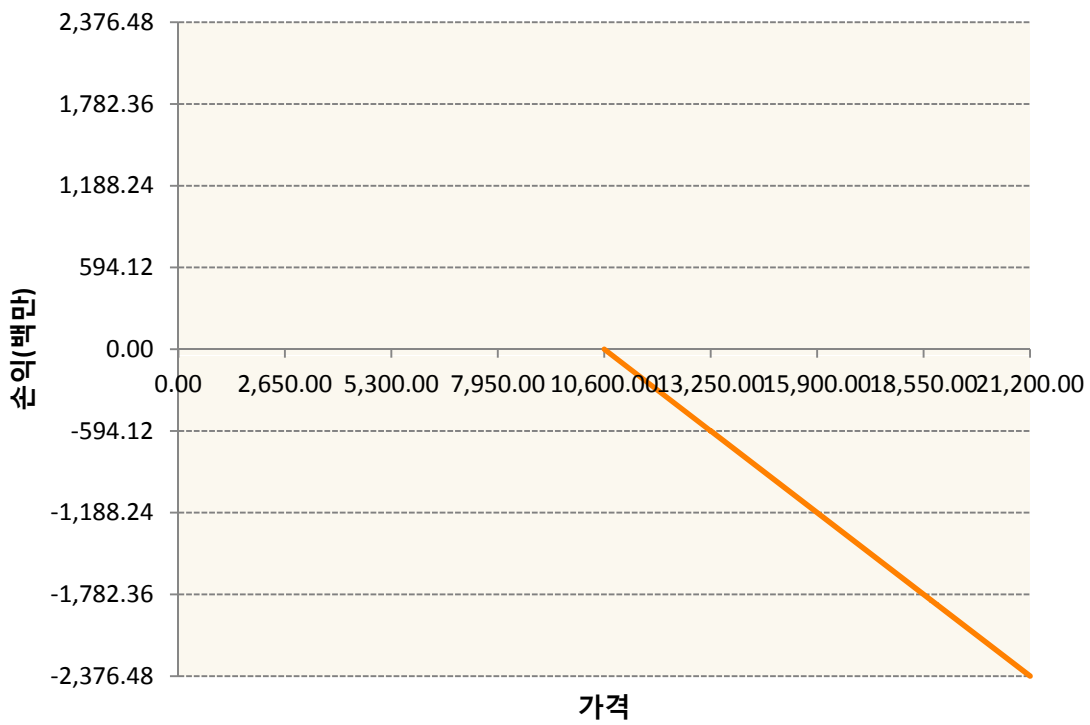


OHHIH0-C105-HSCEI

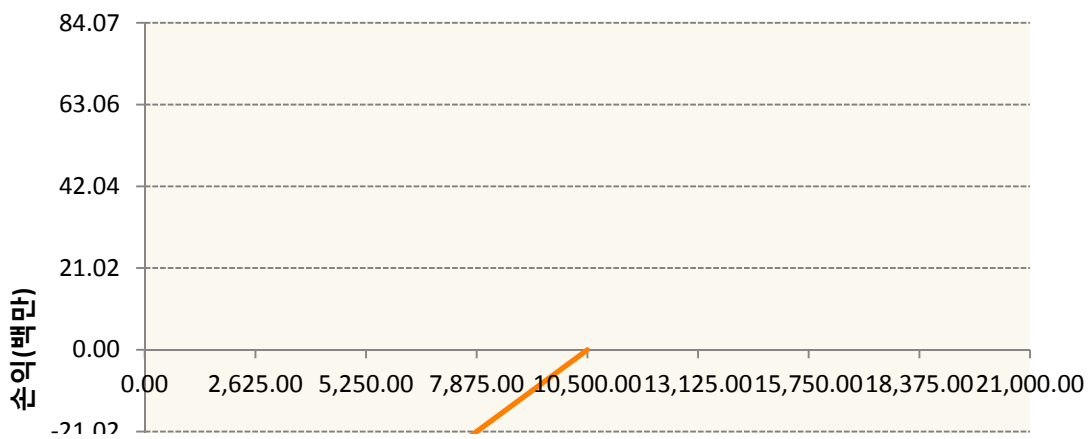


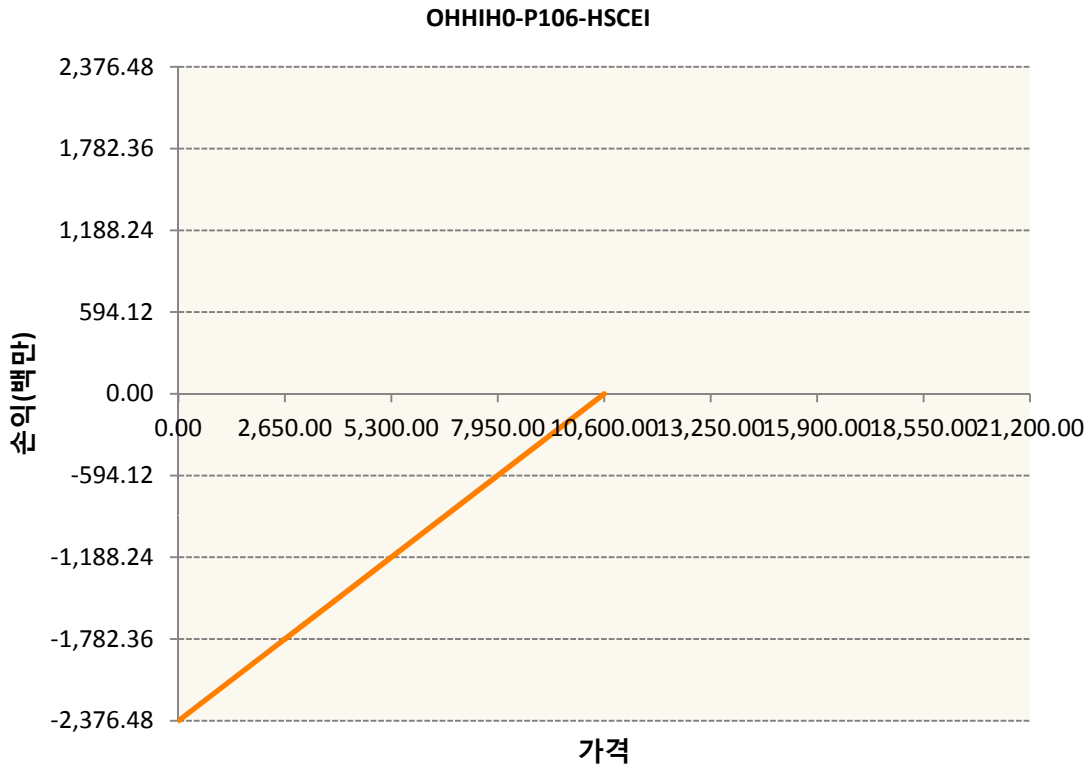


OHHIH0-C106-HSCEI



OHHIH0-P105-HSCEI





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

FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E	180
FX21020H05 HKD/KRW 22-05-20E	56
HCH0 HSCEI Futures Mar20	119
OHHIH0-C1(HSCEI	7
OHHIH0-C1(HSCEI	190
OHHIH0-P1(HSCEI	7
OHHIH0-P1(HSCEI	190

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

<b>583</b>
------------

공시일	2020-03-18
기준일	2020-03-17

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

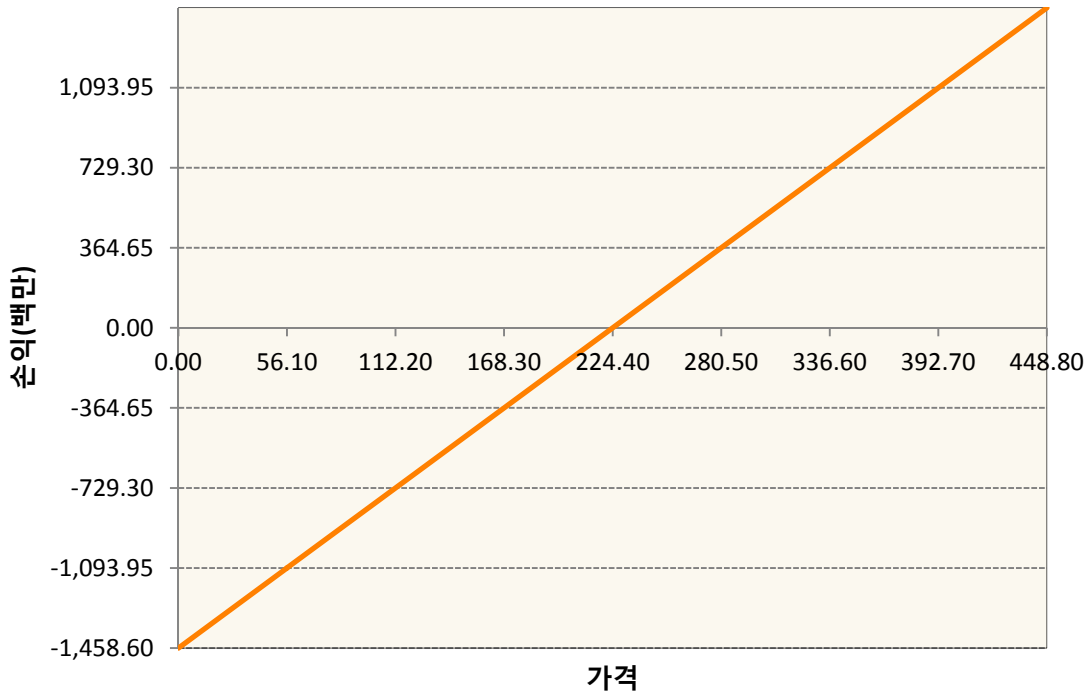
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

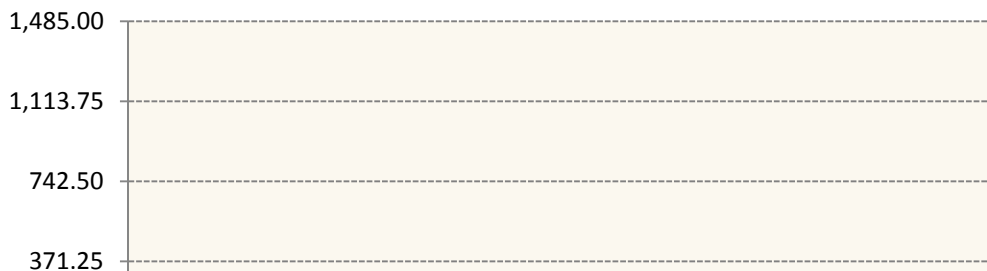
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,459	0	1,459	장내
누계	유가증권	스왑	3,125	0	3,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,095	-3,095	장내

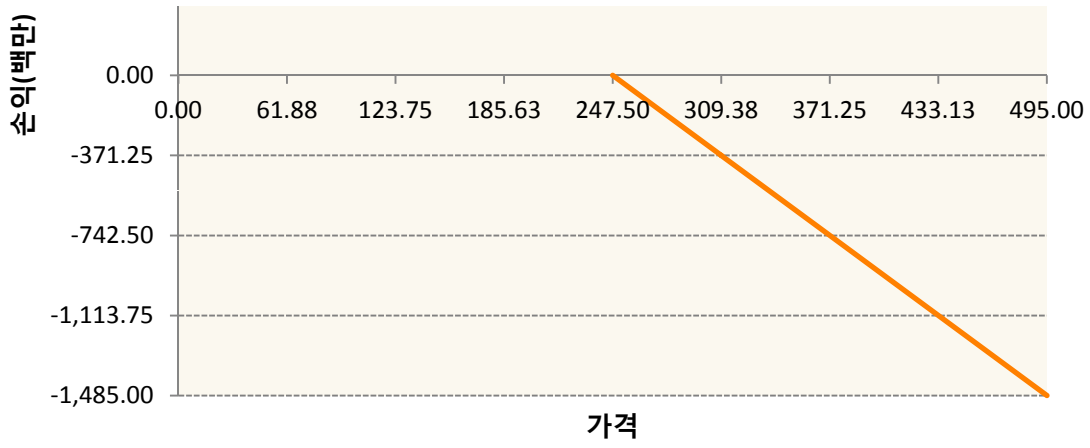
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

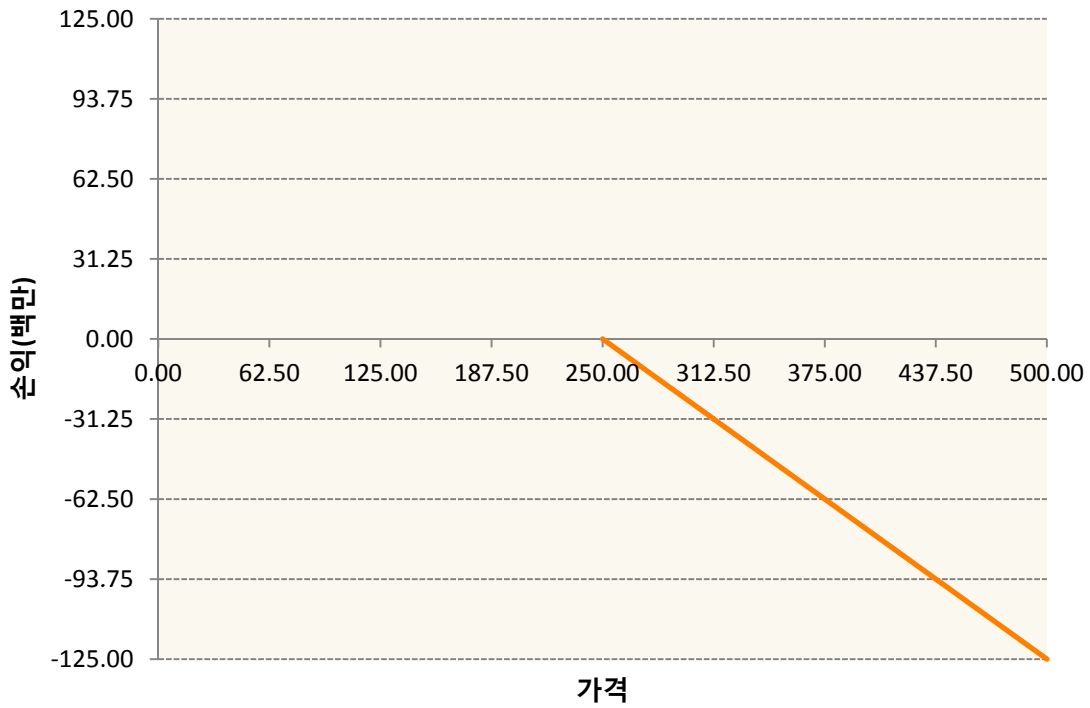


KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

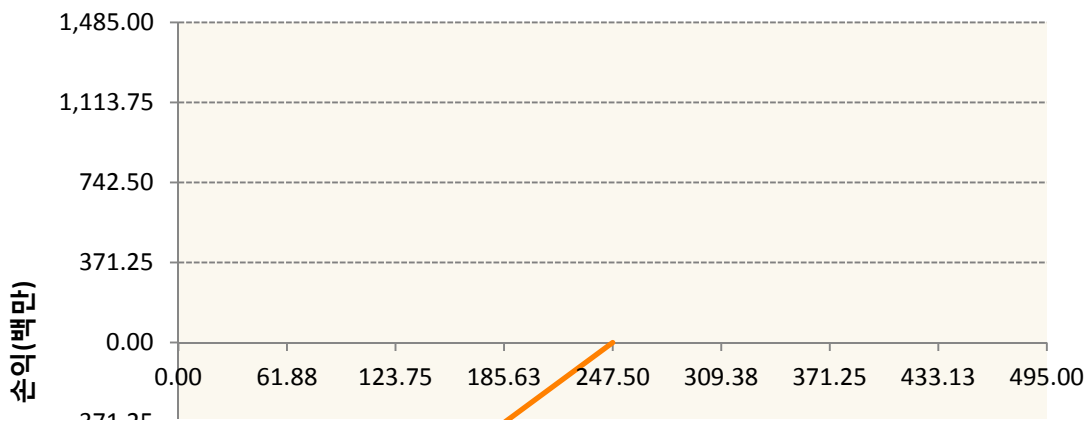




**KR4201Q42503-2020-04 콜250**



**KR4301Q42477-2020-04 풋247.5**





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						272
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-272	-272	-272	-272	-272	-272	-272	
-5.33%	-181	-181	-181	-181	-181	-181	-181	
-2.67%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	91	91	91	91	91	91	91	
5.33%	181	181	181	181	181	181	181	
8.00%	272	272	272	272	272	272	272	
KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						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%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79	
-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%	79	79	79	79	79	79	79	
8.00%	118	118	118	118	118	118	118	
KR4201Q42479		2020-04 콜247.5						66
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	32	30	27	24	20	16	12	
-5.33%	29	26	22	18	13	8	3	
-2.67%	24	20	15	10	5	-1	-7	
0%	17	12	6	0	-6	-12	-18	
2.67%	7	1	-6	-12	-19	-25	-32	
5.33%	-6	-13	-20	-27	-34	-41	-48	
8.00%	-22	-29	-36	-44	-51	-58	-66	
KR4201Q42503		2020-04 콜250						5
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	2	2	2	2	2	1	1
-5.33%	2	2	2	1	1	1	0
-2.67%	2	2	1	1	0	0	-1
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	1	0	0	-1	-1	-2	-3
5.33%	0	-1	-1	-2	-3	-3	-4
8.00%	-2	-2	-3	-3	-4	-5	-5
KR4301Q42477      2020-04 풋247.5							97
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-68	-72	-76	-81	-86	-91	-97
-5.33%	-37	-41	-46	-52	-58	-64	-70
-2.67%	-7	-13	-19	-25	-32	-38	-45
0%	21	14	7	0	-7	-15	-22
2.67%	46	38	31	23	15	7	-1
5.33%	68	60	52	44	36	27	19
8.00%	88	80	71	63	54	46	37

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

(단위:백만원)

519

공시일	2020-03-18
기준일	2020-03-17

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

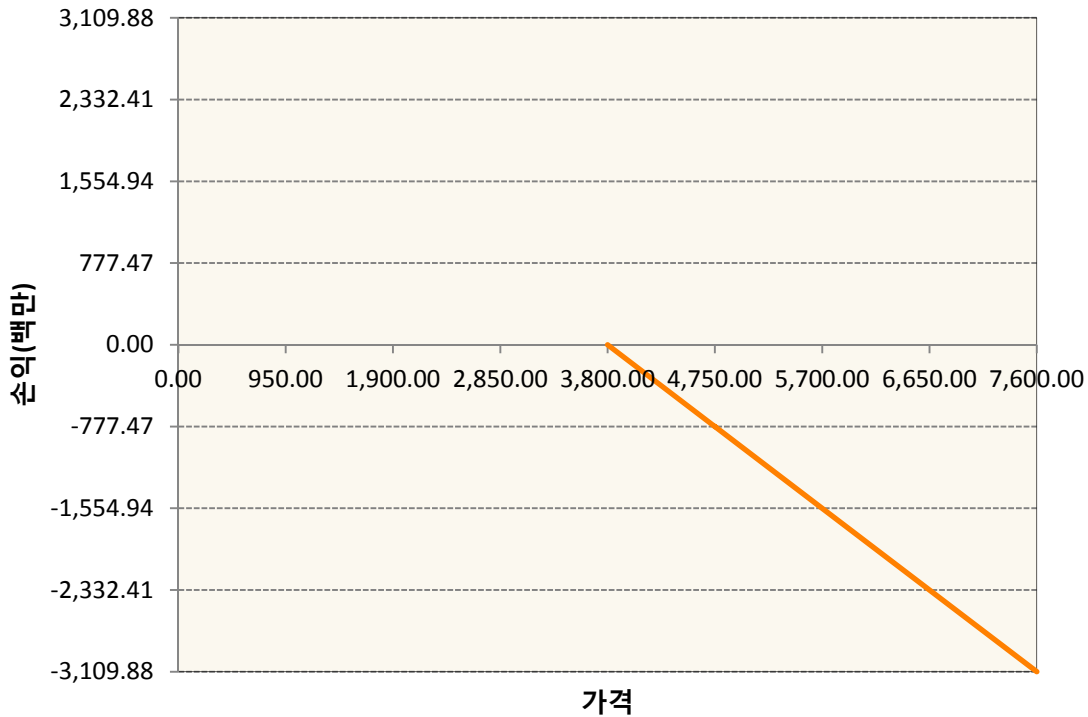
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

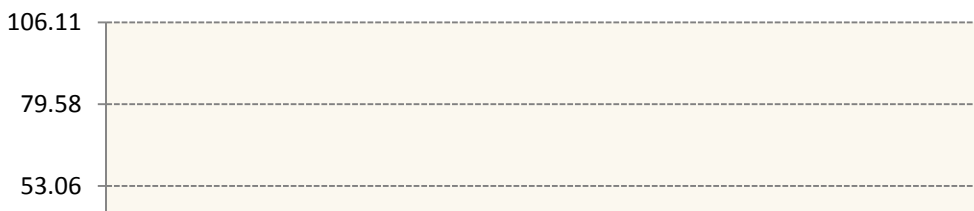
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	387	0	387	
누계	유가증권	스왑	7,879	0	7,879	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,432	-6,432	장내
누계	통화	선도	555	3,640	-3,085	장외

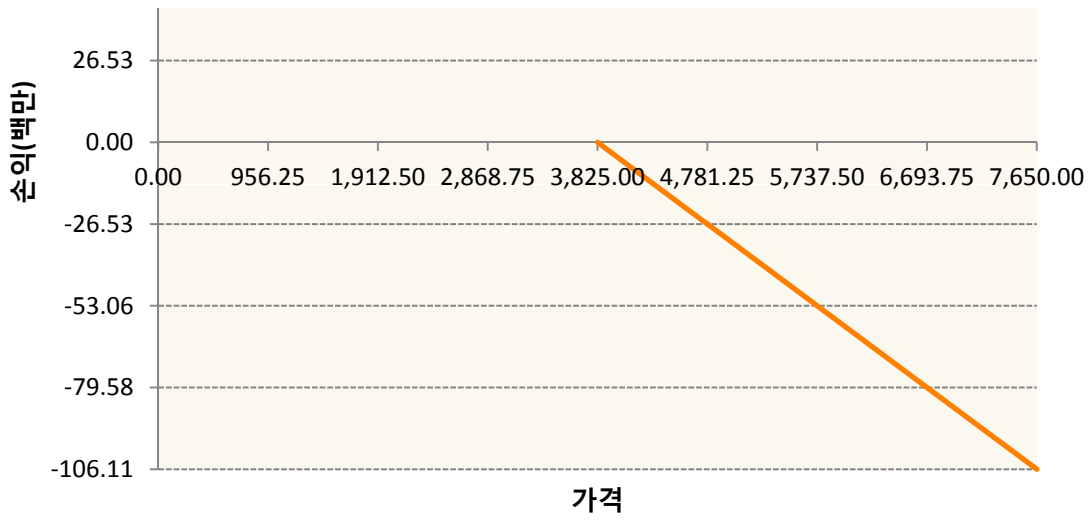
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXH0-C3800-EURO STOXX 50**

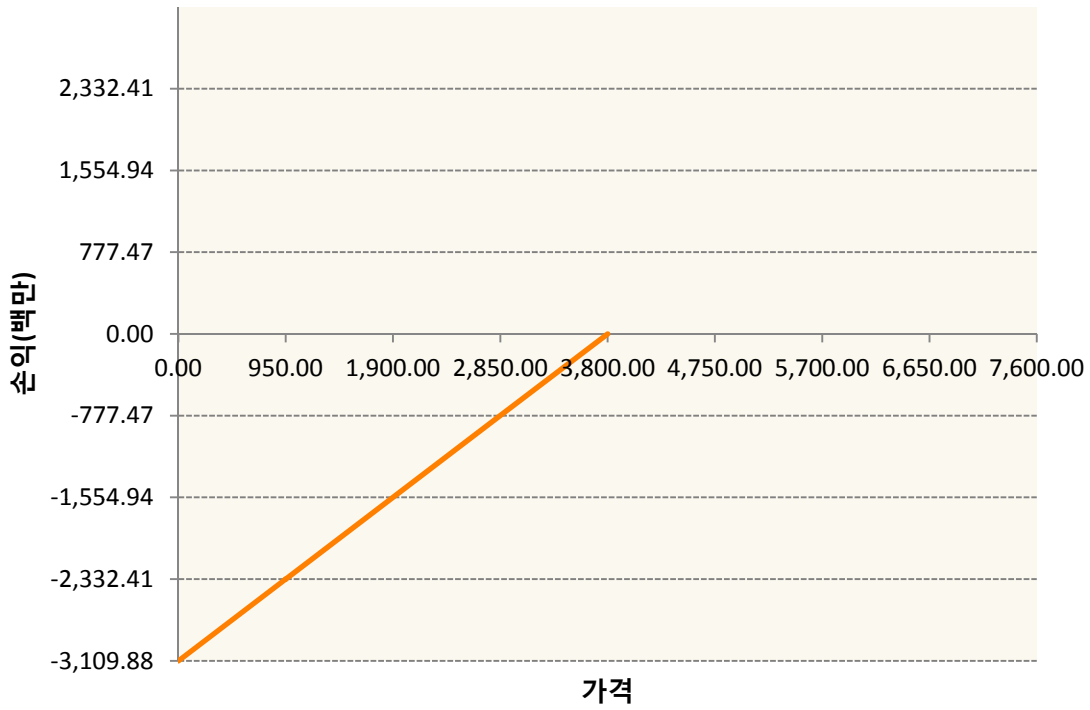


**OESXH0-C3825-EURO STOXX 50**

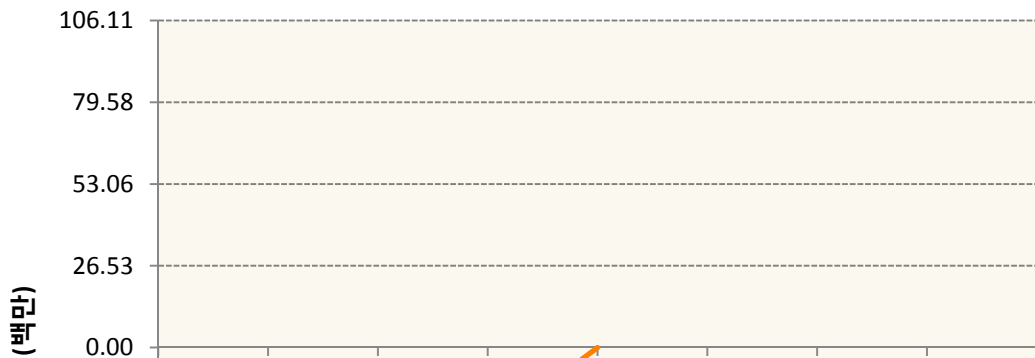


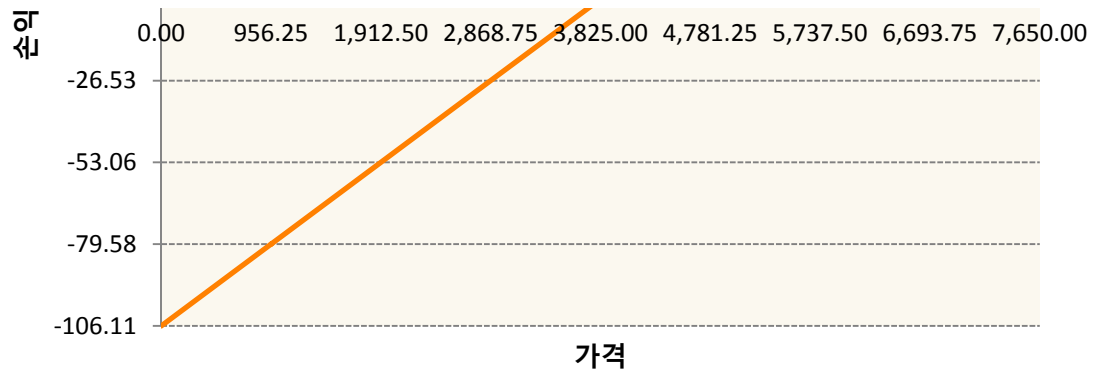


OESXH0-P3800-EURO STOXX 50

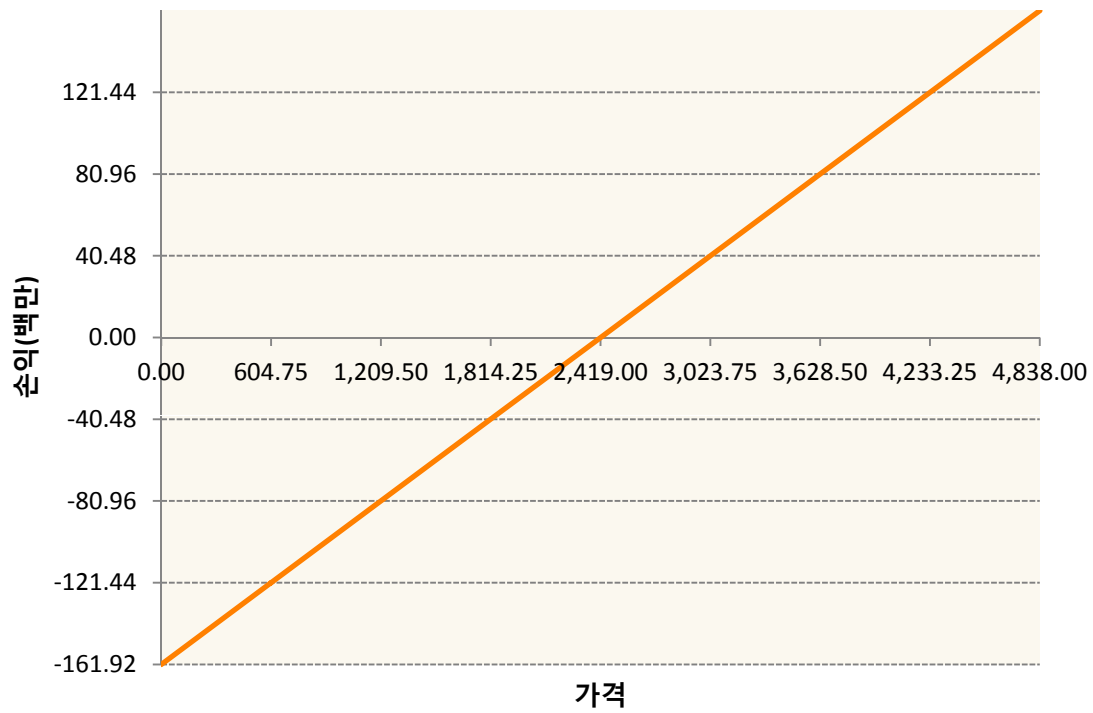


OESXH0-P3825-EURO STOXX 50

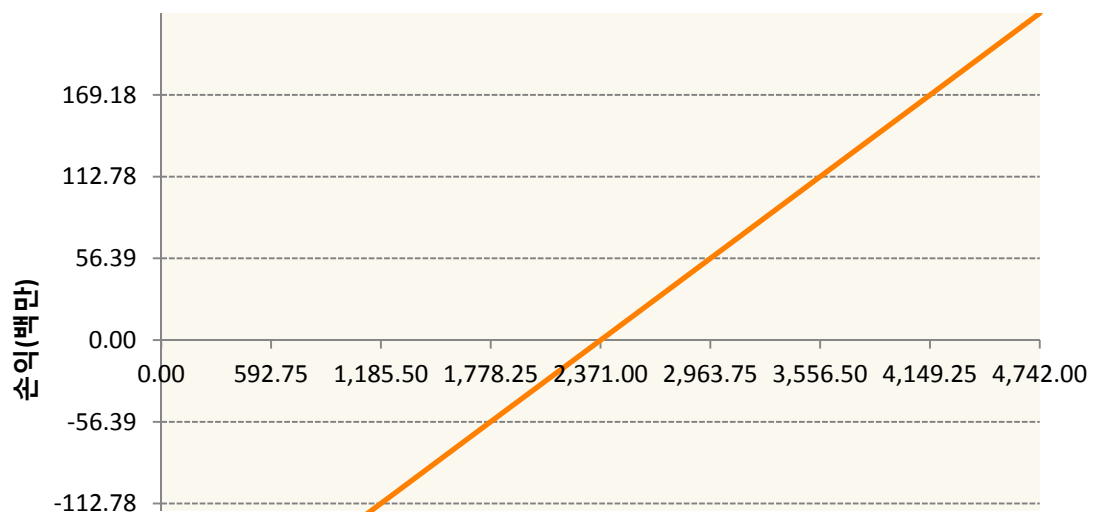


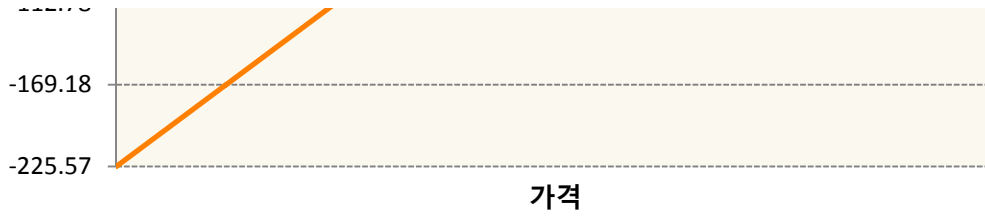


**VGHO-EURO STOXX 50 Mar20**



**VGM0-EURO STOXX 50 Jun20**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP×SG	EURO Covered CALL STRATEGY	0
FX21019Z04	KRW/EUR 27-03-20E	291
FX21020H00	EUR/KRW 27-03-20E	44
OESXH0-C3ξ	EURO STOXX 50	249
OESXH0-C3ξ	EURO STOXX 50	8
OESXH0-P3ξ	EURO STOXX 50	249
OESXH0-P3ξ	EURO STOXX 50	8
VGH0	EURO STOXX 50 Mar20	13
VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	18

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	<b>711</b>



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

(단위:백만원)

853

공시일	2020-03-18
기준일	2020-03-17

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

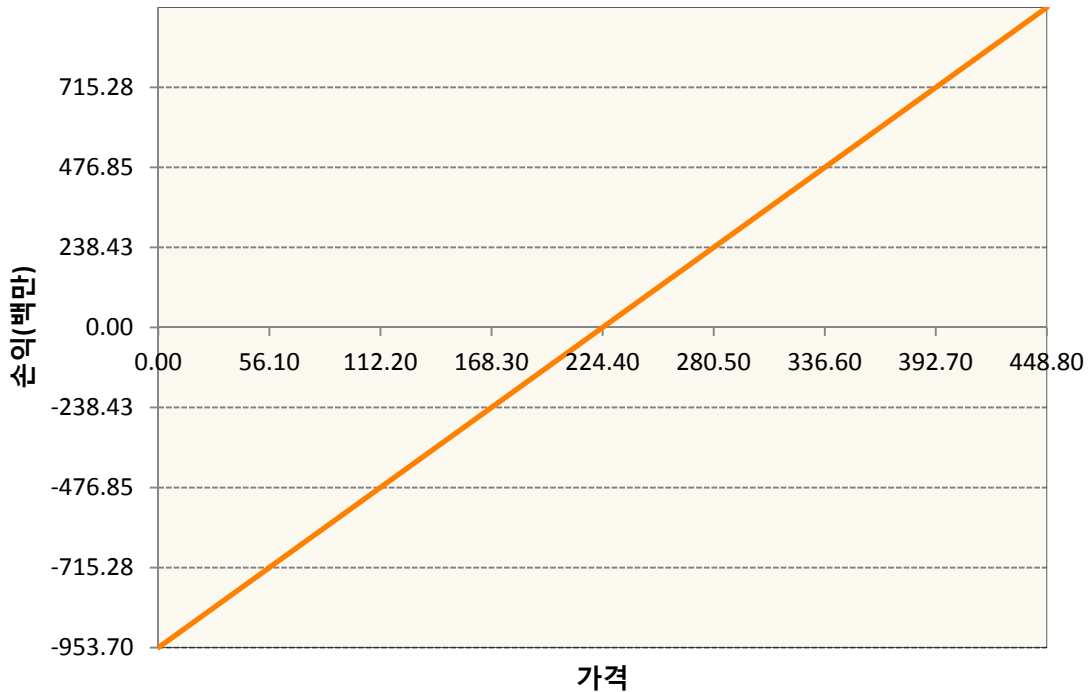
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	954	0	954	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						77
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77	
-5.33%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51	
-2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	26	26	26	26	26	26	26	
5.33%	51	51	51	51	51	51	51	
8.00%	77	77	77	77	77	77	77	

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

(단위:백만원)

78



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

(단위:백만원)

115



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

(단위:백만원)

41

공시일	2020-03-18
기준일	2020-03-17

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

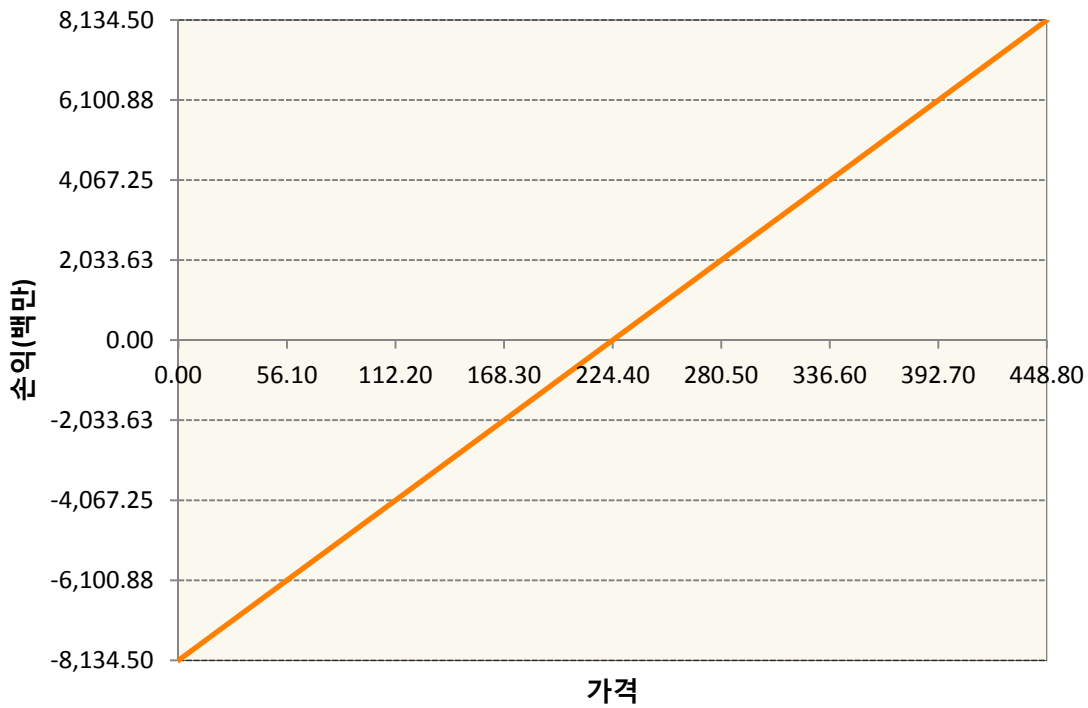
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

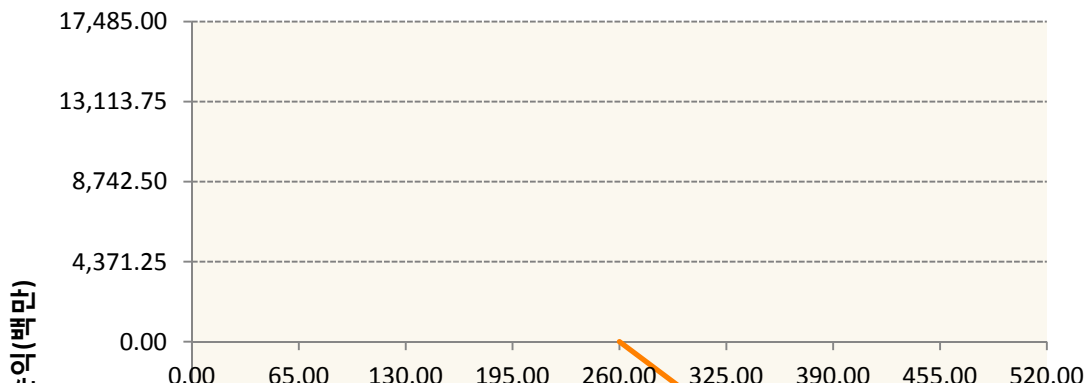
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,135	0	8,135	장내
누계	유가증권	옵션	6,004	17,485	-11,481	장내

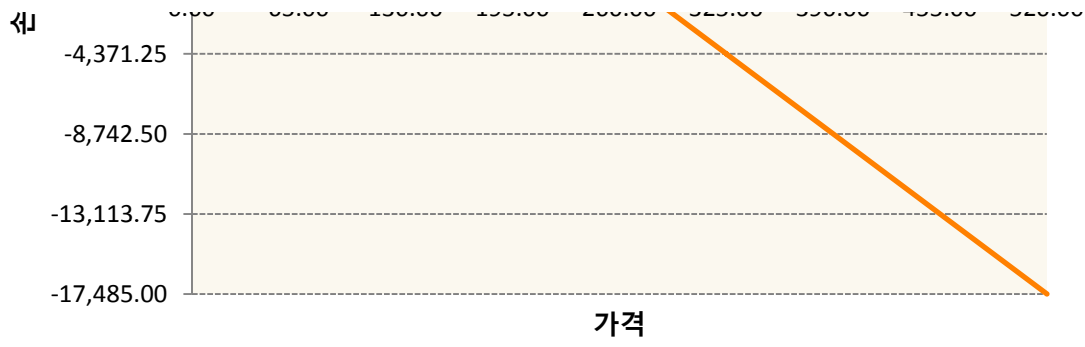
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

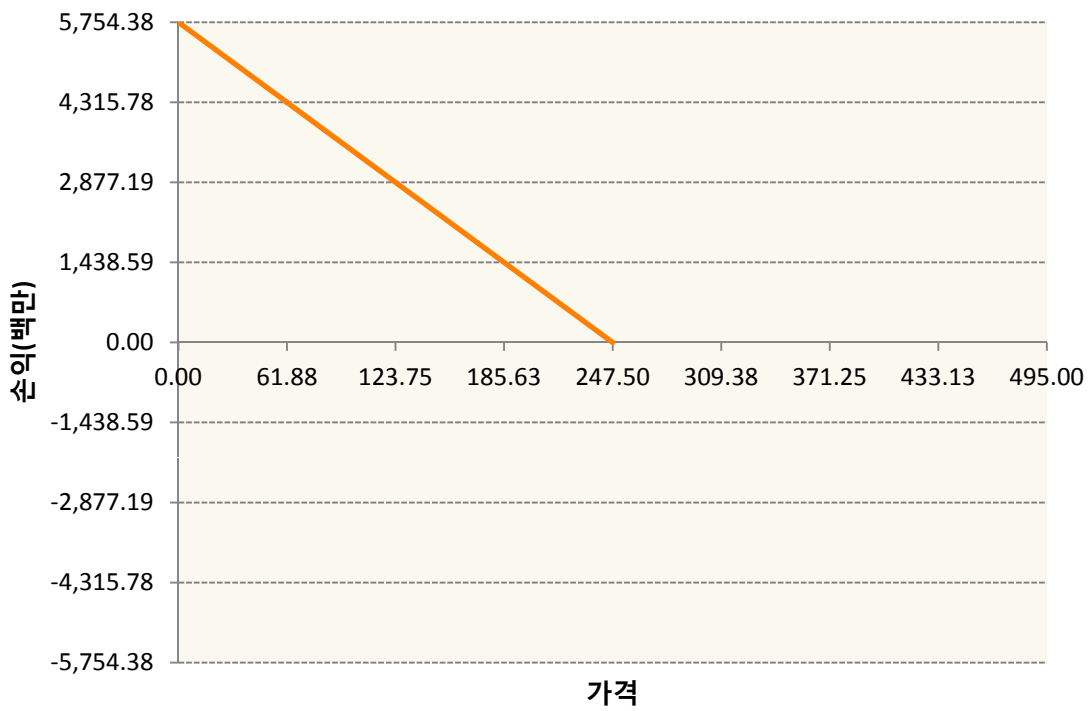


KR4201Q42602-2020-04 콜260

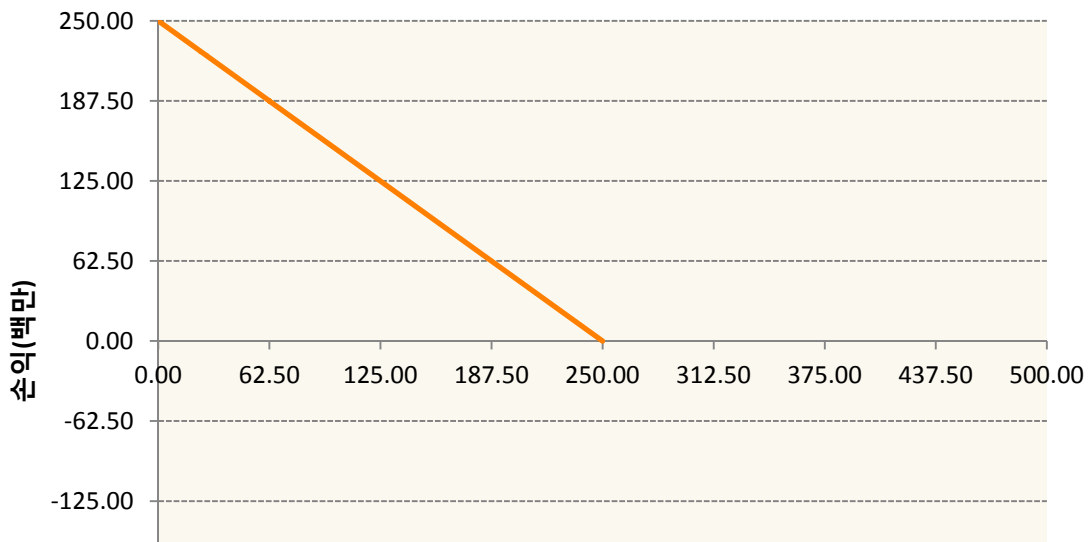


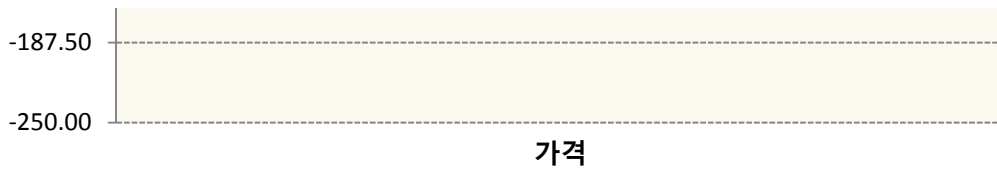


KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



KR4301Q42501-2020-04 풋250





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

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						658
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-658	-658	-658	-658	-658	-658	-658	
-5.33%	-439	-439	-439	-439	-439	-439	-439	
-2.67%	-219	-219	-219	-219	-219	-219	-219	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	219	219	219	219	219	219	219	
5.33%	439	439	439	439	439	439	439	
8.00%	658	658	658	658	658	658	658	
KR4201Q42602		2020-04 콜260						582
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	222	208	189	165	137	104	66	
-5.33%	207	185	158	126	89	47	2	
-2.67%	181	150	113	72	26	-24	-77	
0%	140	98	51	0	-55	-113	-174	
2.67%	80	27	-31	-92	-156	-222	-290	
5.33%	-4	-69	-136	-206	-278	-351	-426	
8.00%	-117	-191	-267	-345	-423	-502	-582	
KR4301Q42477		2020-04 풋247.5						374
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	264	278	294	312	332	353	374	
-5.33%	142	160	180	201	224	248	272	
-2.67%	26	48	72	97	122	149	176	
0%	-81	-55	-28	0	28	57	86	
2.67%	-178	-149	-119	-89	-59	-28	3	
5.33%	-265	-234	-202	-170	-138	-106	-74	
8.00%	-342	-309	-276	-243	-210	-177	-144	
KR4301Q42501		2020-04 풋250						16
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	12	12	13	14	15	15	16	
-5.33%	6	7	8	9	10	11	12	
-2.67%	1	2	3	4	5	6	8	

0%	-3	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-8	-6	-5	-4	-3	-1	0
5.33%	-12	-10	-9	-8	-6	-5	-3
8.00%	-15	-14	-12	-11	-9	-8	-7

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

(단위:백만원)

**1,295**

공시일	2020-03-18
기준일	2020-03-17

## 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	196,851	0	196,851	

### 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	2020-03-18
기준일	2020-03-17

## 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	104,375	0	104,375	

### 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	2020-03-18
기준일	2020-03-17

## 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	494,605	0	494,605	
누계	통화	선도	37,305	579,844	-542,539	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,602
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,492
FX21020F03 KRW/USD 31-03-20E	3,183
FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E	2,984
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,686
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	1,990
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	3,422
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,422
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,990
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,979
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,328
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,990
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	199
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	5,073
FX21020G06 USD/KRW 31-03-20E	497
FX21020H00 USD/KRW 31-03-20E	995
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,487
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,069
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,069
FX21020H04 USD/KRW 21-04-20E	1,492
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,427
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	995

IE00BD8RGM75

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)





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

(단위:백만원)

118

공시일	2020-03-18
기준일	2020-03-17

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

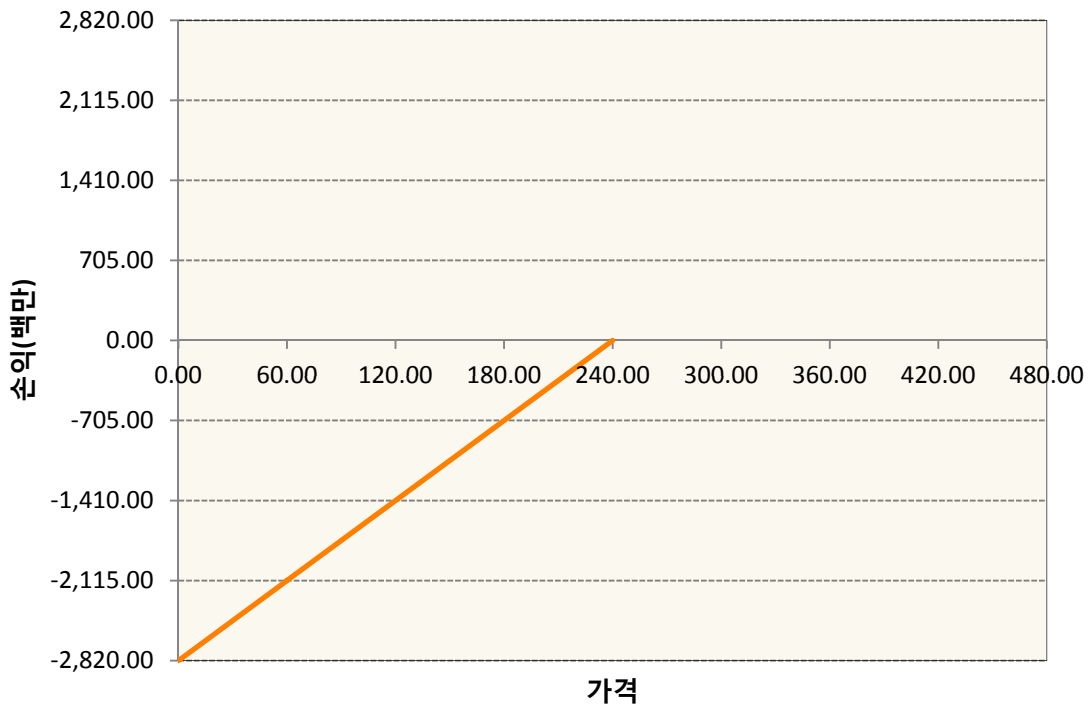
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

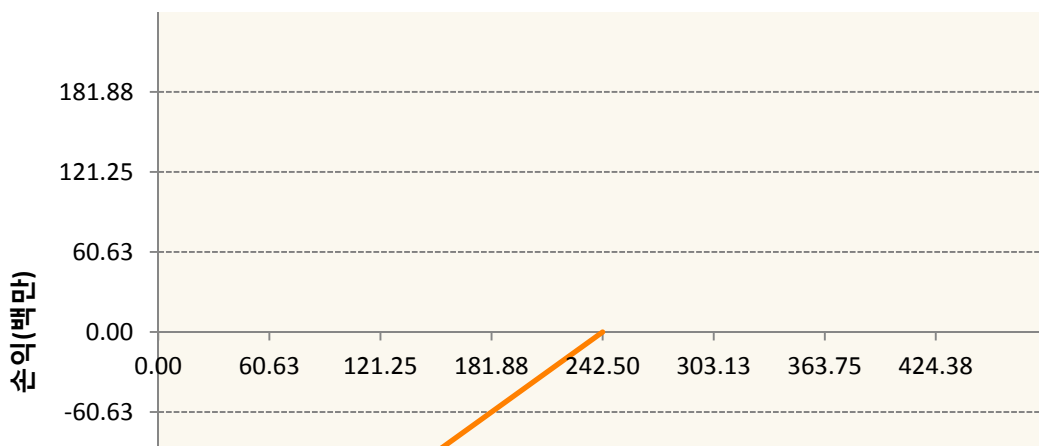
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,063	-3,063	장내

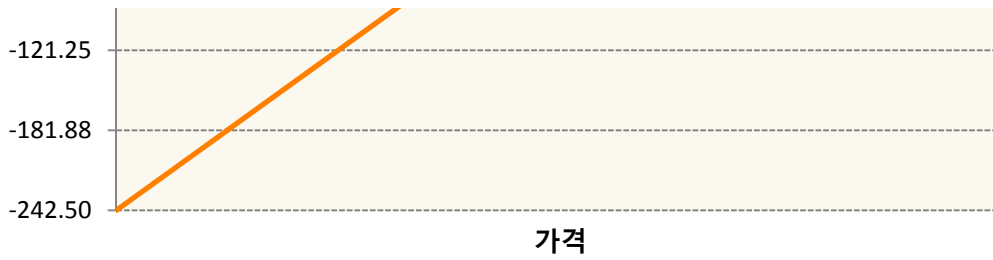
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q42402-2020-04 풋240



KR4301Q42428-2020-04 풋242.5





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

KR4301Q42402		2020-04 풋240						180
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-116	-125	-134	-145	-156	-168	-180	
-5.33%	-58	-69	-80	-93	-106	-119	-132	
-2.67%	-4	-17	-31	-44	-58	-73	-87	
0%	44	30	15	0	-15	-30	-45	
2.67%	87	72	56	40	24	9	-7	
5.33%	125	109	92	76	60	44	27	
8.00%	157	141	124	108	92	75	59	
KR4301Q42428		2020-04 풋242.5						16
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-10	-11	-12	-13	-14	-15	-16	
-5.33%	-5	-6	-7	-8	-9	-10	-11	
-2.67%	-1	-2	-3	-4	-5	-6	-7	
0%	4	2	1	0	-1	-3	-4	
2.67%	8	6	5	4	2	1	0	
5.33%	11	10	8	7	5	4	3	
8.00%	14	12	11	10	8	7	5	

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

**159**

공시일	2020-03-18
기준일	2020-03-17

## 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	8,396	0	8,396	
누계	통화	선도	1,654	9,637	-7,983	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	188
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	222
FX21020H01 USD/KRW 31-03-20E	51
FX21020H02 KRW/USD 13-04-20E	361
FX21020H04 USD/KRW 31-03-20E	26
FX21020H05 USD/KRW 31-03-20E	28
FX21020H05 USD/KRW 31-03-20E	28
IE00BD8RGM75	

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

<b>336</b>
------------

공시일	2020-03-18
기준일	2020-03-17

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

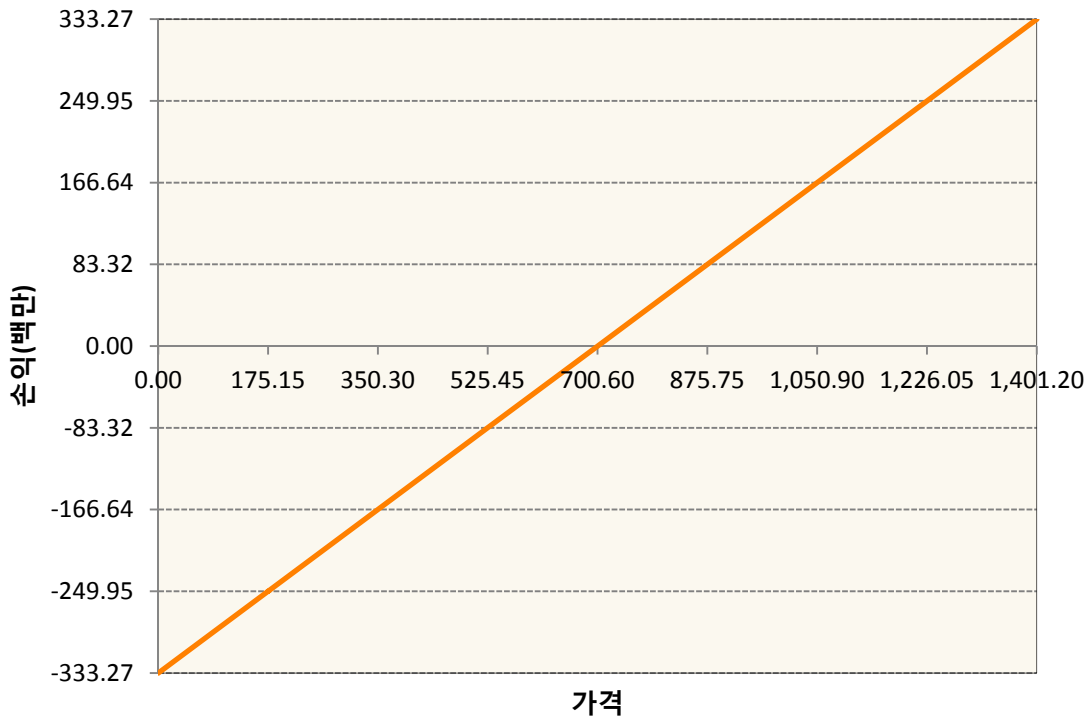
### 1. 계약금액

(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	333	0	333	
누계	유가증권	스왑	1,144	0	1,144	장외
누계	통화	선도	485	763	-277	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

VNCH0-VN30 Index Future Mar20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	92
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	3
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	3
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	3
FX21020F00 KRW/EUR 27-03-20E	7
FX21020F00 KRW/EUR 27-03-20E	7

FX21020F01: KRW/EUR 27-03-20E	7
FX21020F01: KRW/EUR 27-03-20E	7
FX21020F03: KRW/EUR 24-04-20E	7
FX21020F04: EUR/KRW 24-04-20E	2
FX21020G00 EUR/KRW 27-03-20E	10
FX21020G01 KRW/EUR 22-05-20E	6
FX21020G05 KRW/EUR 26-06-20E	12
FX21020H02 EUR/KRW 27-03-20E	13
FX21020H04 EUR/KRW 27-03-20E	13
VNCH0 VN30 Index Future Mar20	27

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

(단위:백만원)

**144**

공시일	2020-03-18
기준일	2020-03-17

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

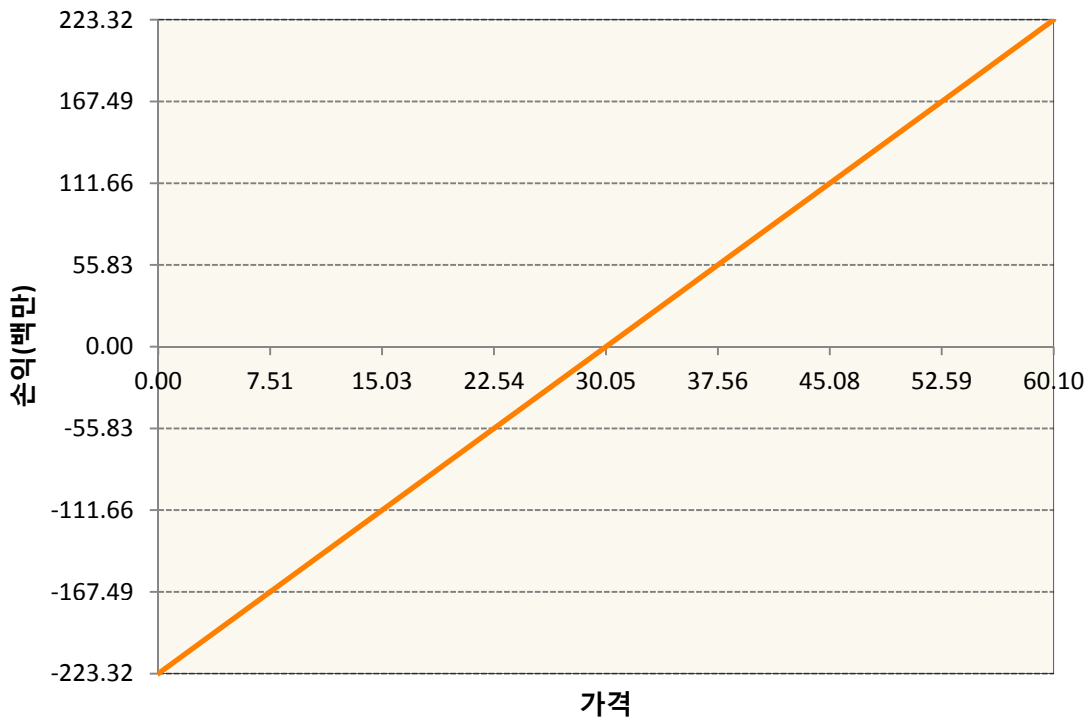
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

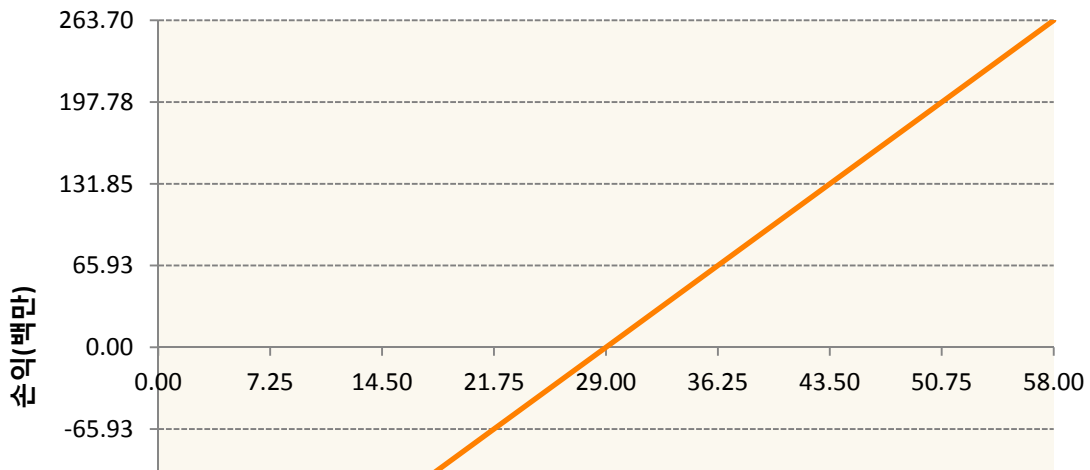
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,352	124	1,227	

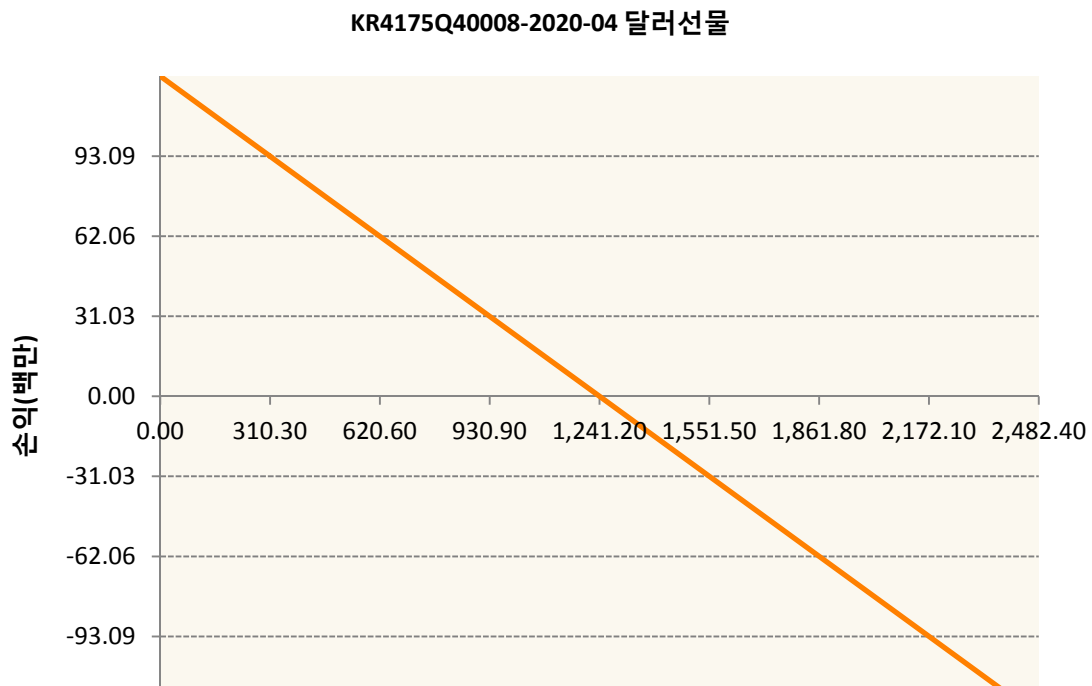
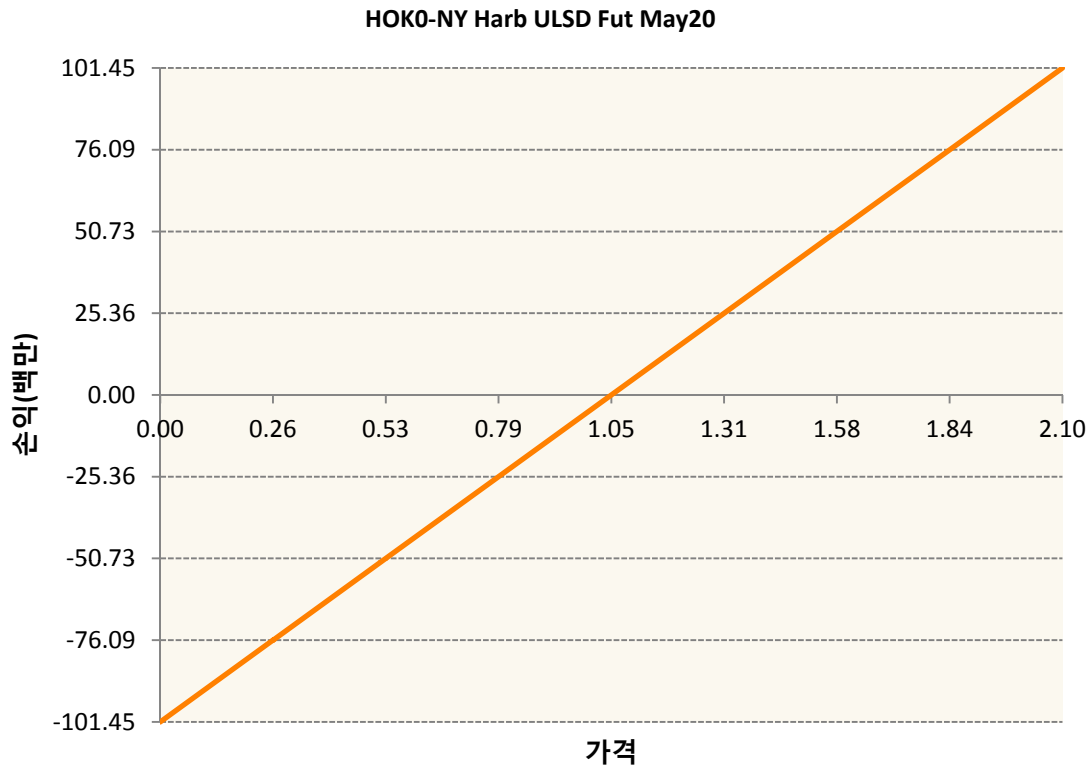
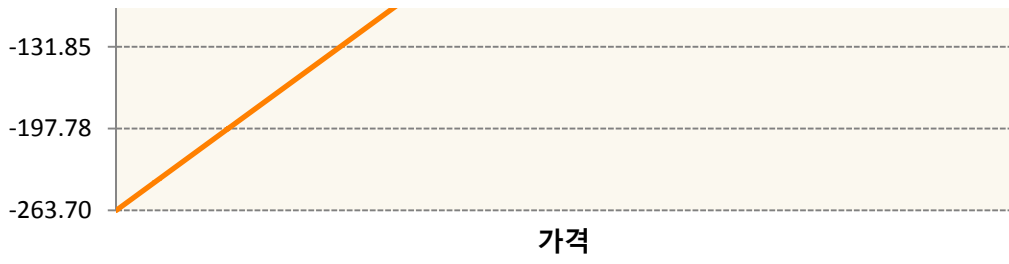
### 2. 만기시점의 손익구조

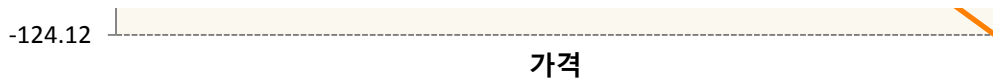
**COK0-BRENT CRUDE FUTR May20**



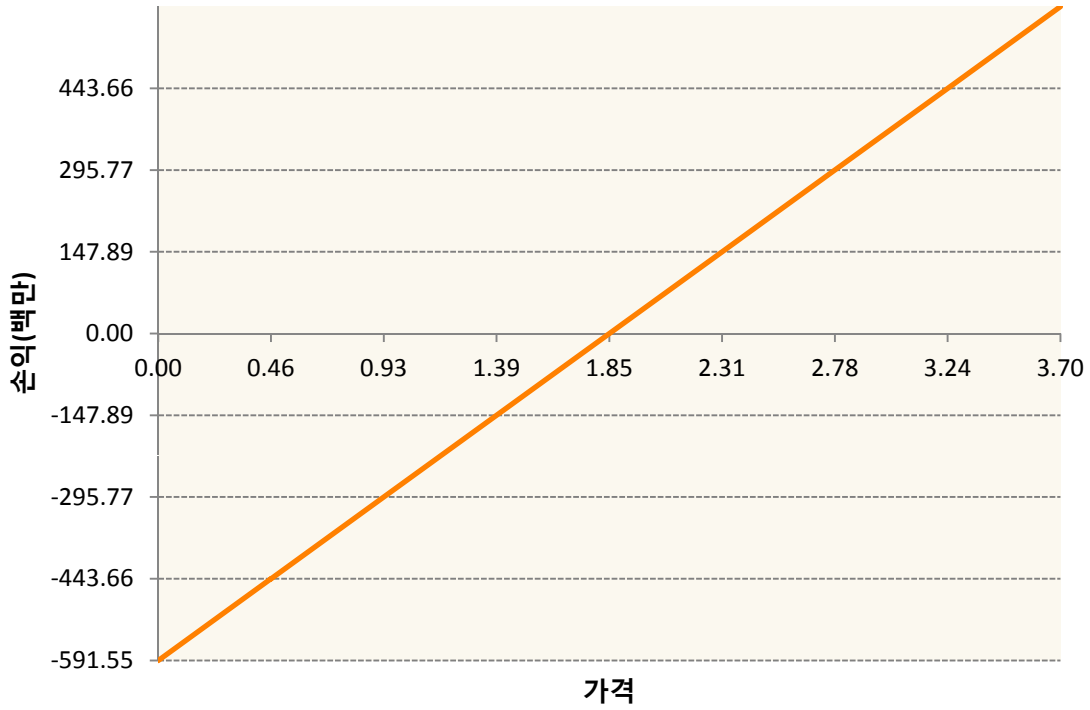
**CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20**



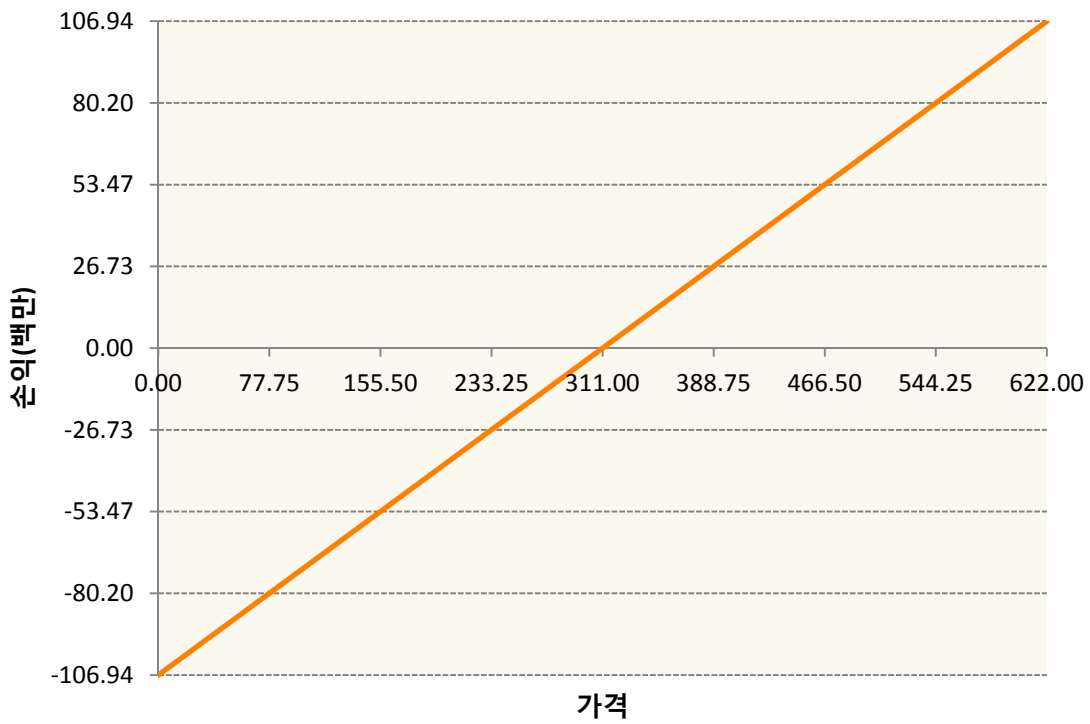




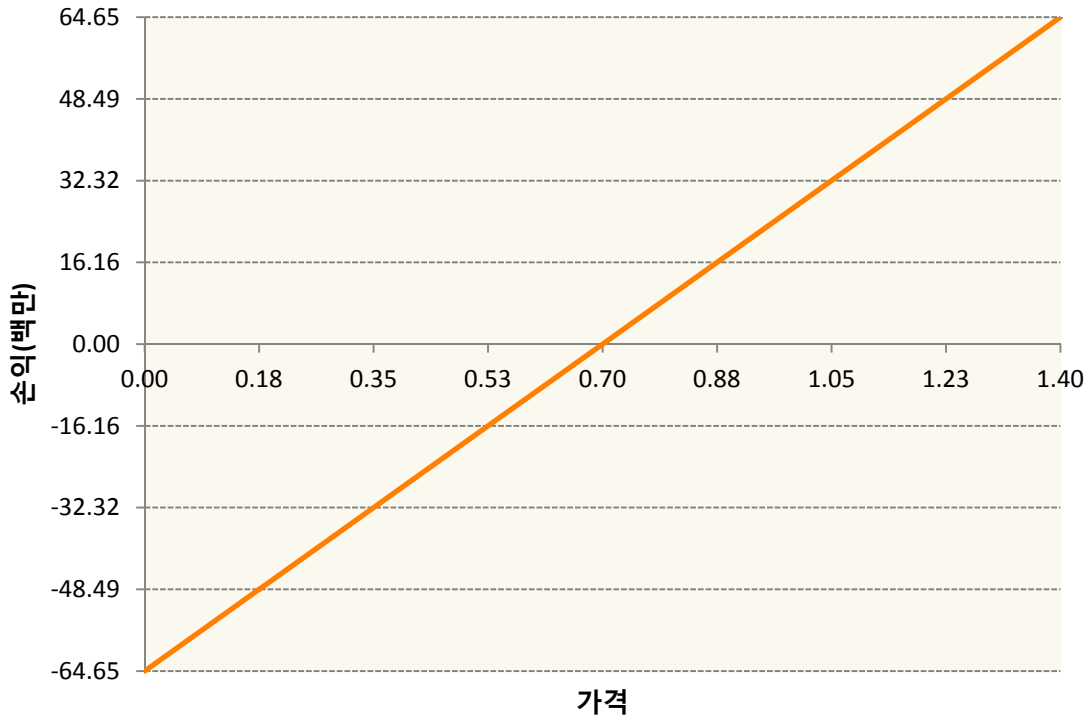
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



QSK0-Low Su Gasoil G Mar20



**XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20**



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	18
CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	21
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	8
KR4175Q40C	2020-04 달러선물	10
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	47
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	9
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	5

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

(단위:백만원)

<b>274</b>
------------

공시일	2020-03-18
기준일	2020-03-17

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

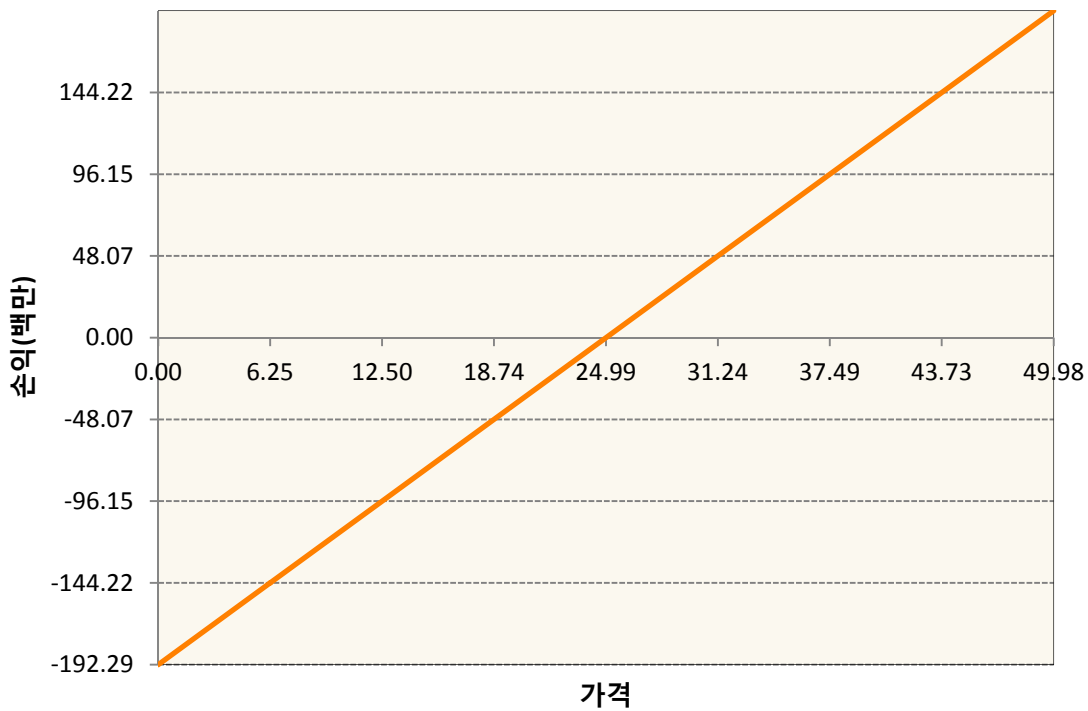
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

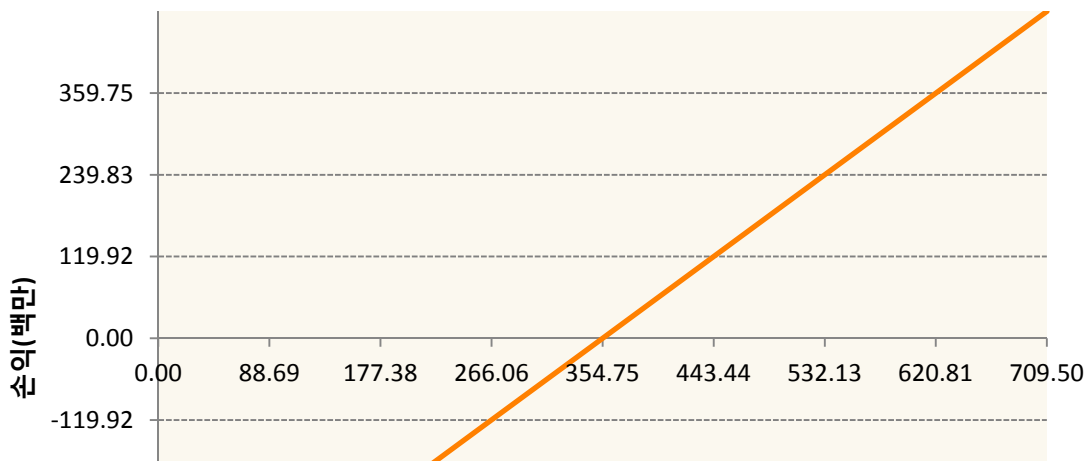
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,324	99	2,225	

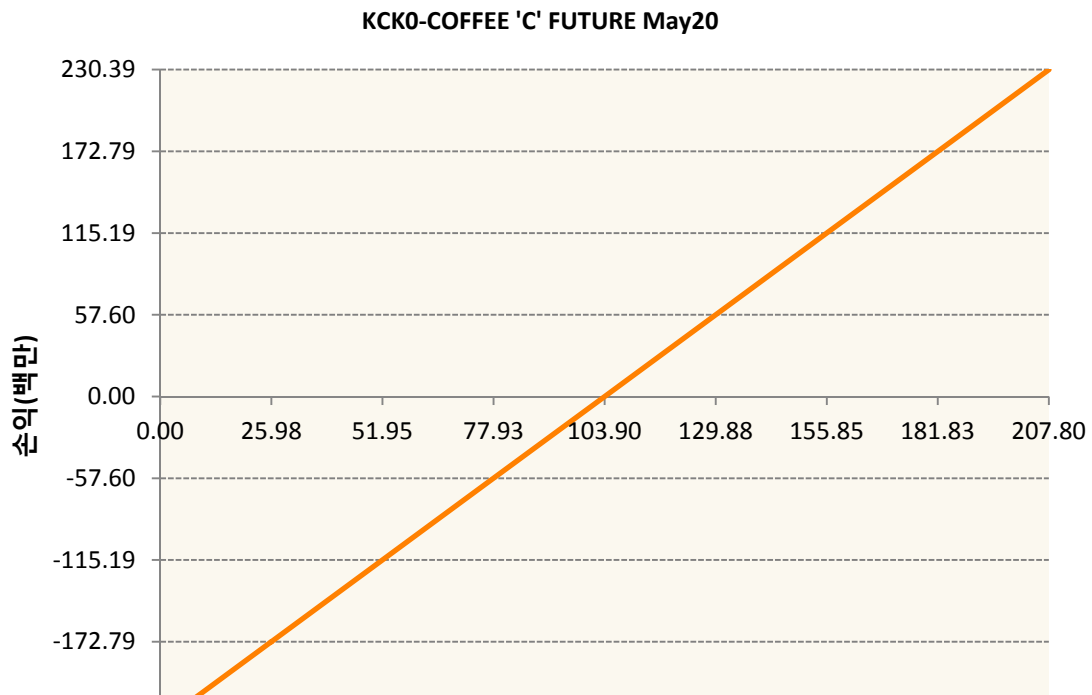
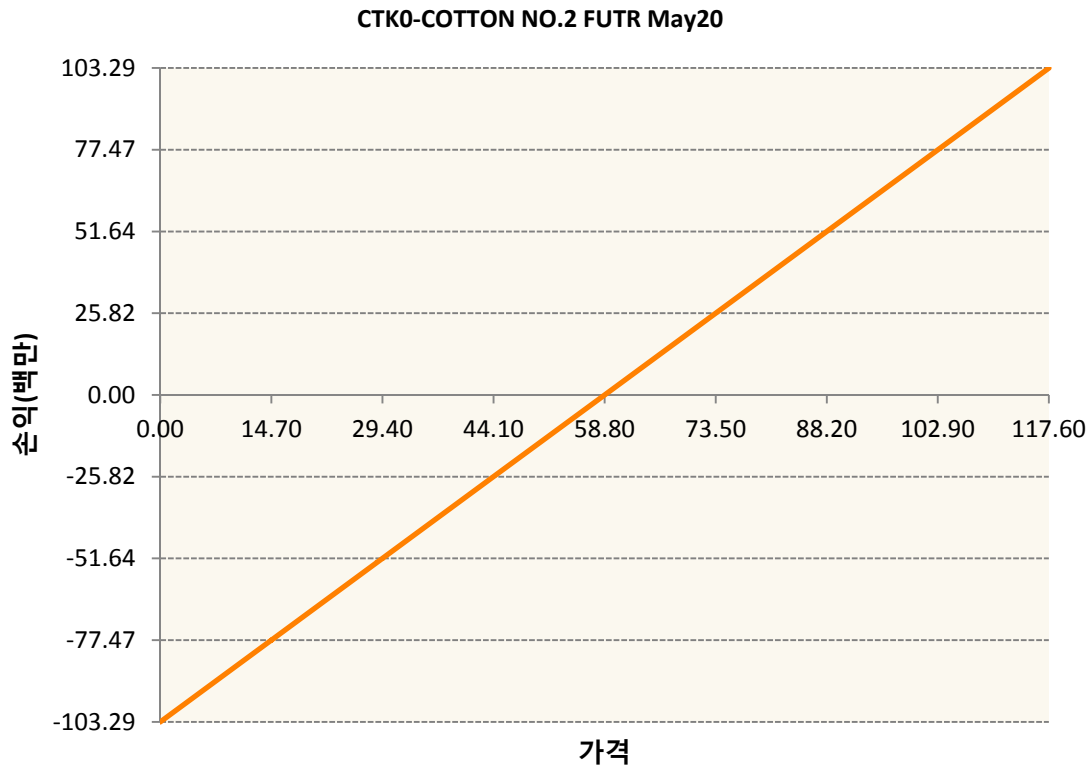
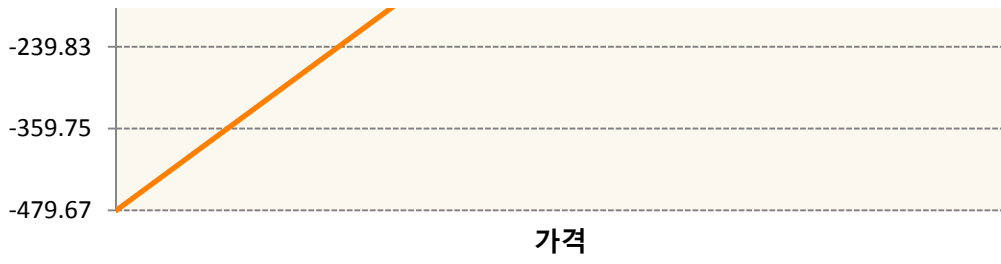
### 2. 만기시점의 손익구조

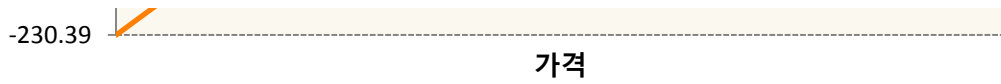
**BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20**



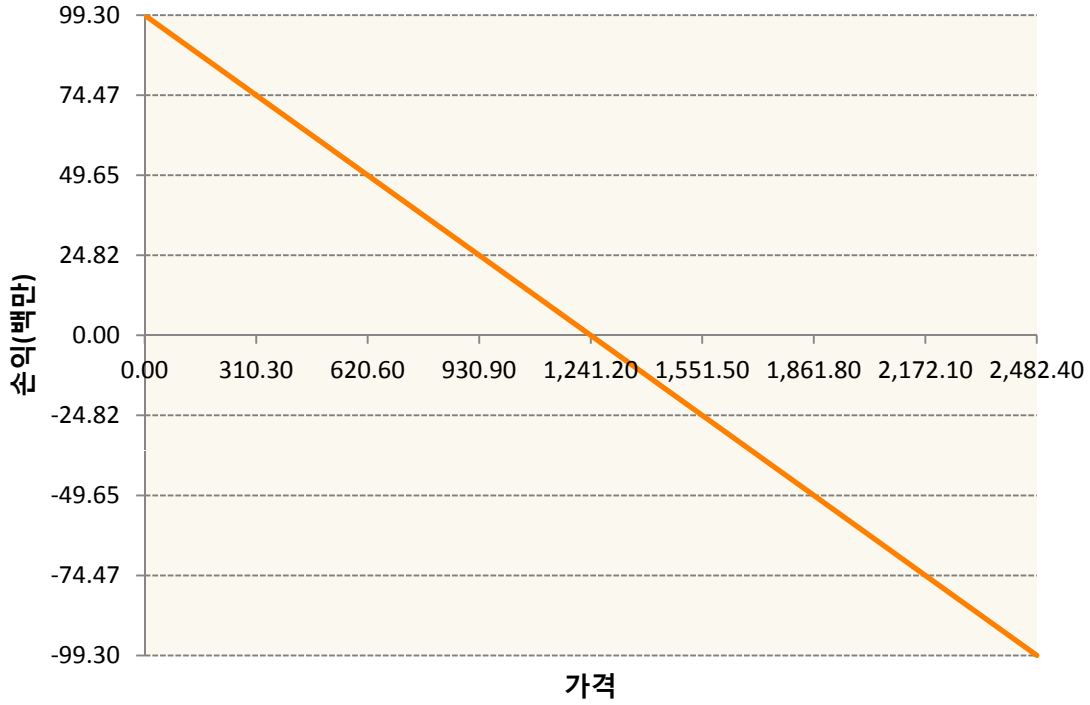
**CK0-CORN FUTURE May20**



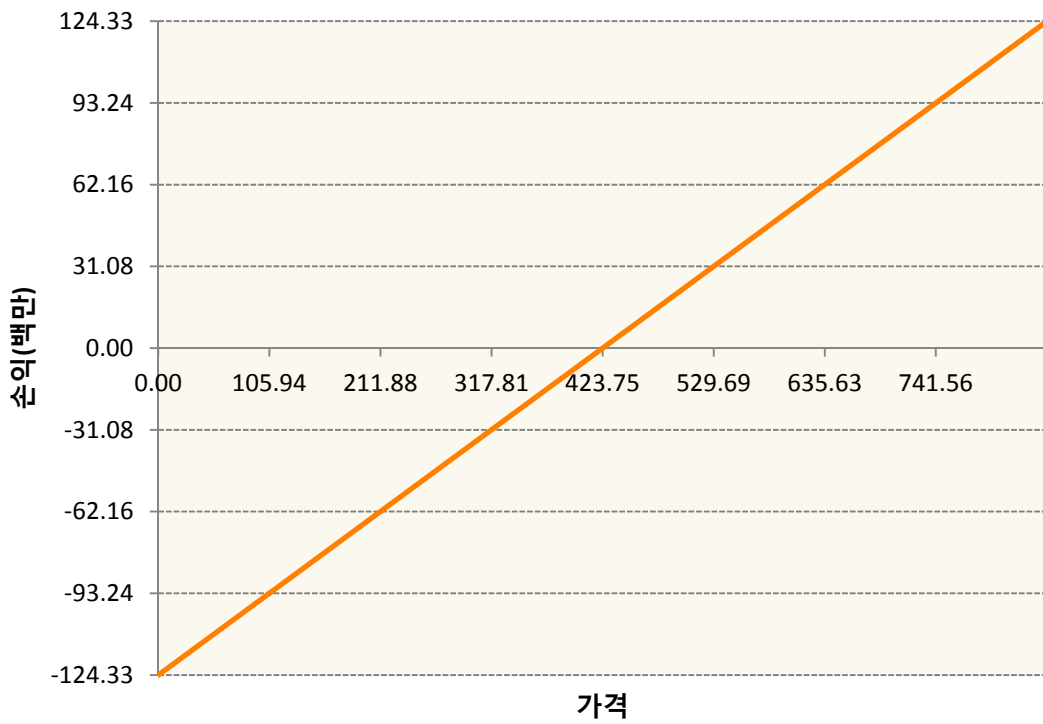




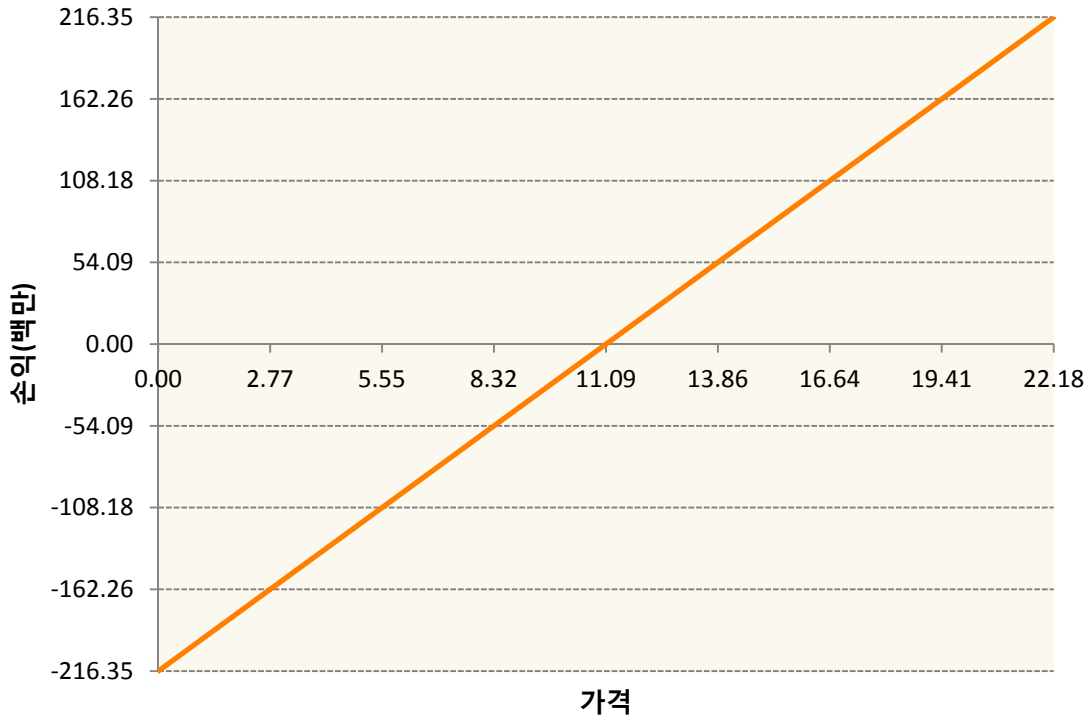
KR4175Q40008-2020-04 달러선물



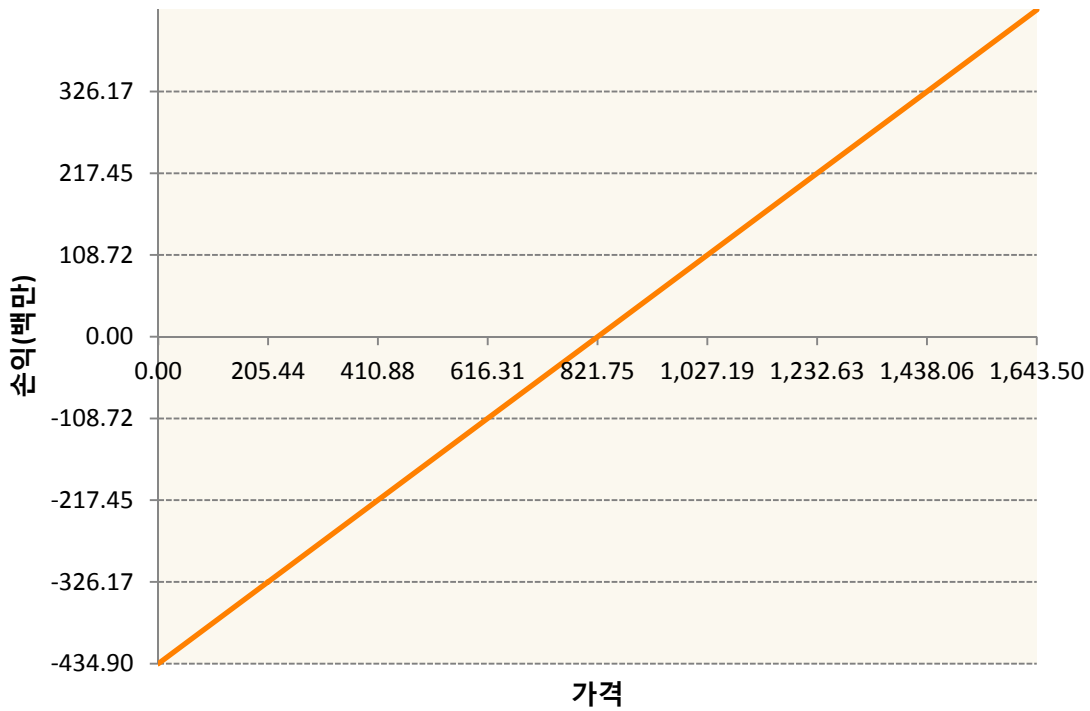
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



SBK0-Sugar May20

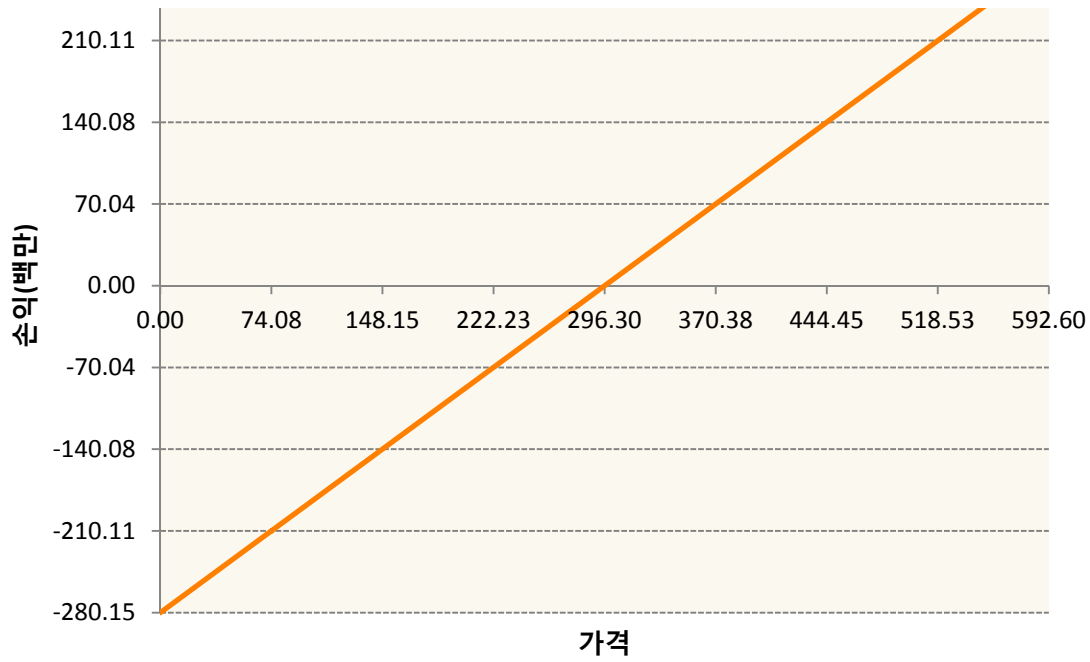


SK0-SOYBEAN FUTURE May20

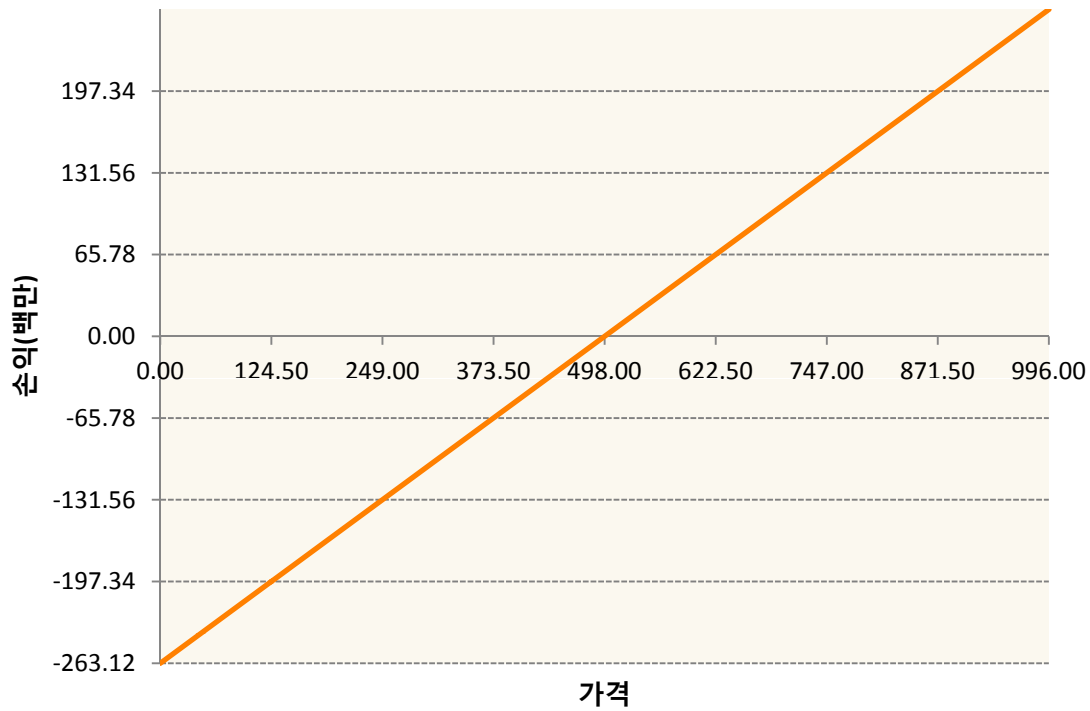


SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





WK0-WHEAT FUTURE(CBT) May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	15
CK0	CORN FUTURE May20	38
CTK0	COTTON NO.2 FUTR May20	8
KCK0	COFFEE 'C' FUTURE May20	18
KR4175Q40C	2020-04 달러선물	8

KWK0	KC HRW WHEAT FUT May20	10
SBK0	Sugar May20	17
SK0	SOYBEAN FUTURE May20	35
SMK0	SOYBEAN MEAL FUTR May20	22
WK0	WHEAT FUTURE(CBT) May20	21

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

(단위:백만원)

**209**