

공시일	2020-03-19
기준일	2020-03-18

## 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	2020-03-19
기준일	2020-03-18

## 스마트인덱스모

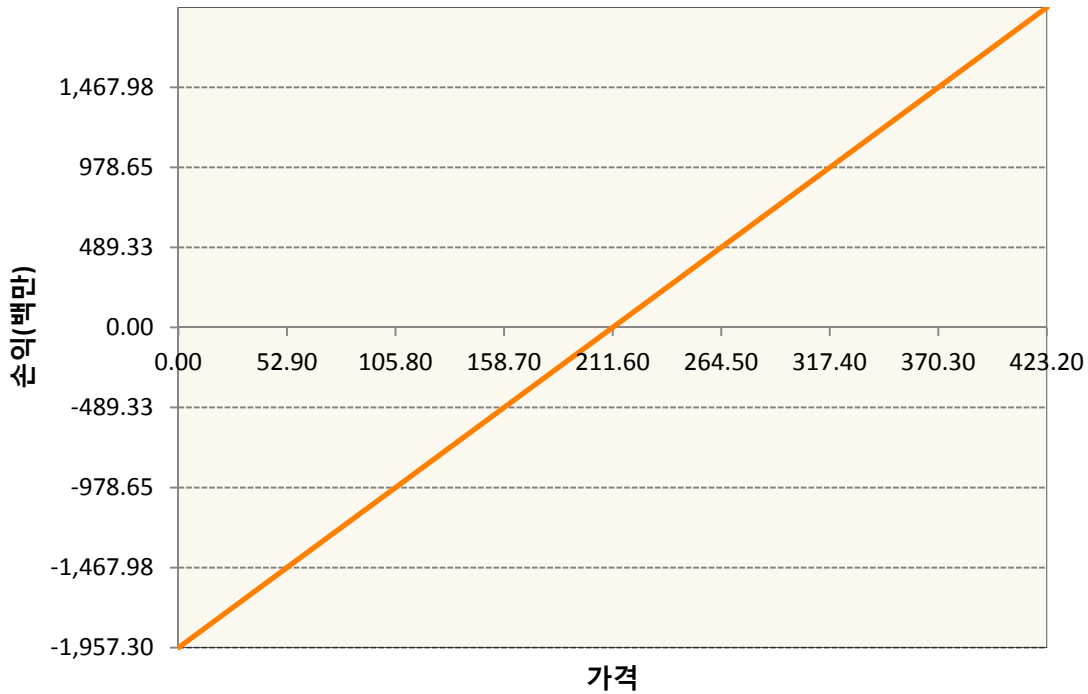
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

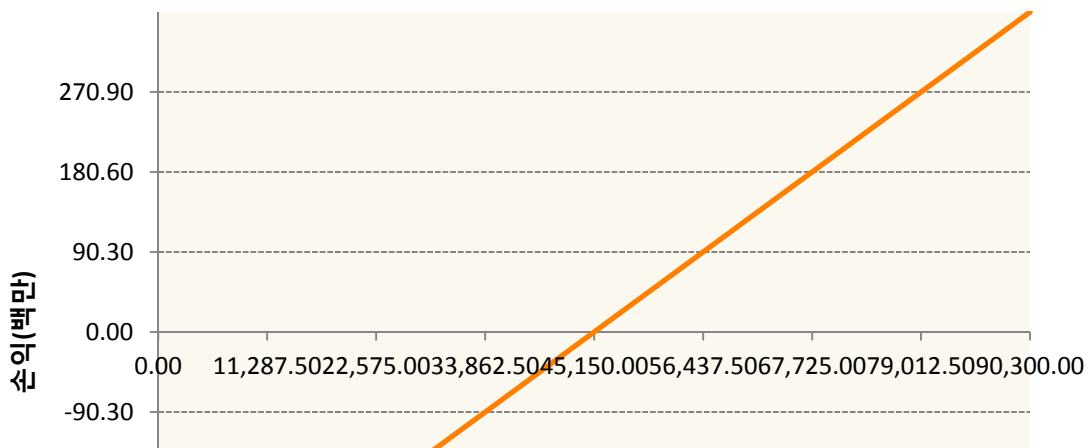
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,319	0	2,319	장내

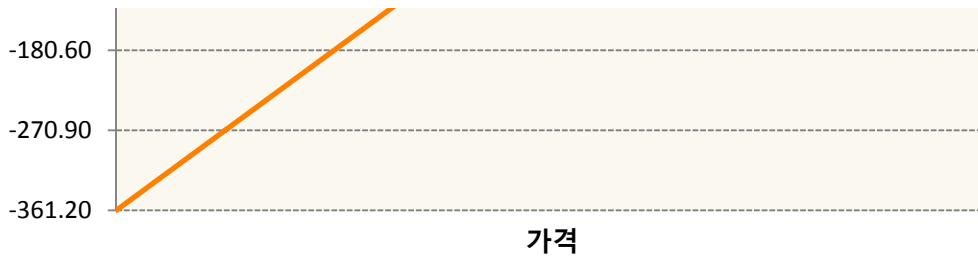
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



KR4111Q40003-2020-04 삼성전자개별선물





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

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						160
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-160	-160	-160	-160	-160	-160	-160	
-5.33%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106	
-2.67%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	53	53	53	53	53	53	53	
5.33%	106	106	106	106	106	106	106	
8.00%	160	160	160	160	160	160	160	
KR4111Q40003		2020-04 삼성전자개별선물						29
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29	
-5.33%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
-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%	19	19	19	19	19	19	19	
8.00%	29	29	29	29	29	29	29	

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

**203**

공시일	2020-03-19
기준일	2020-03-18

## 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

849

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

839

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-19
기준일	2020-03-18

## 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

535
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

832
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-19
기준일	2020-03-18

## 유로인덱스모(주식-파생형)

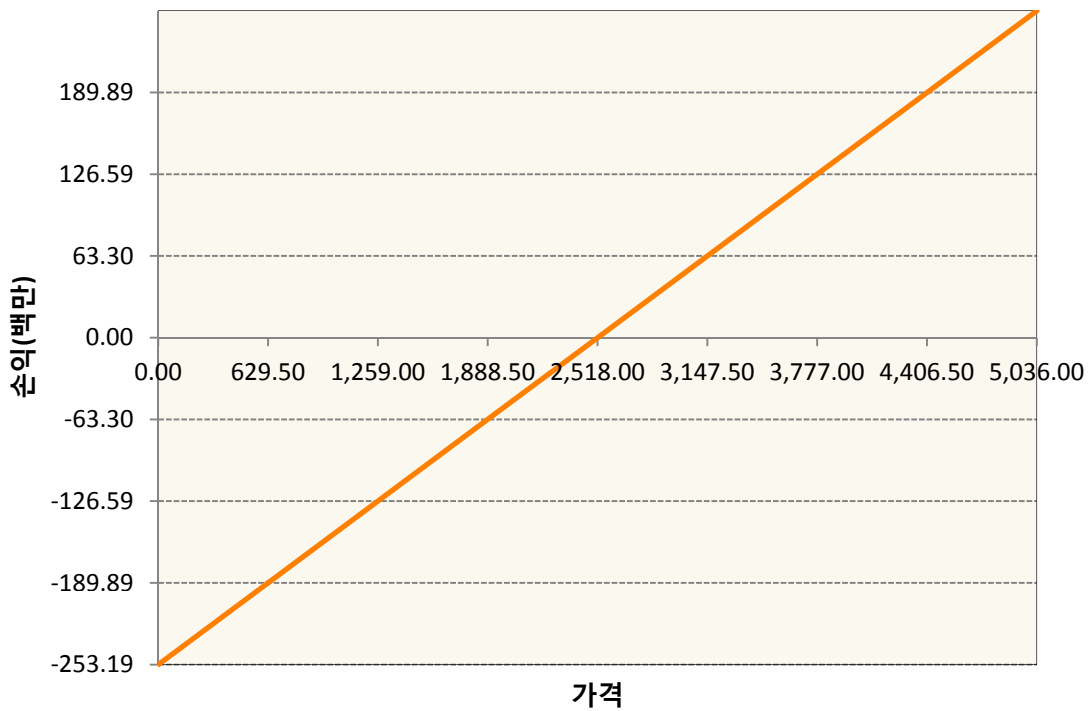
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

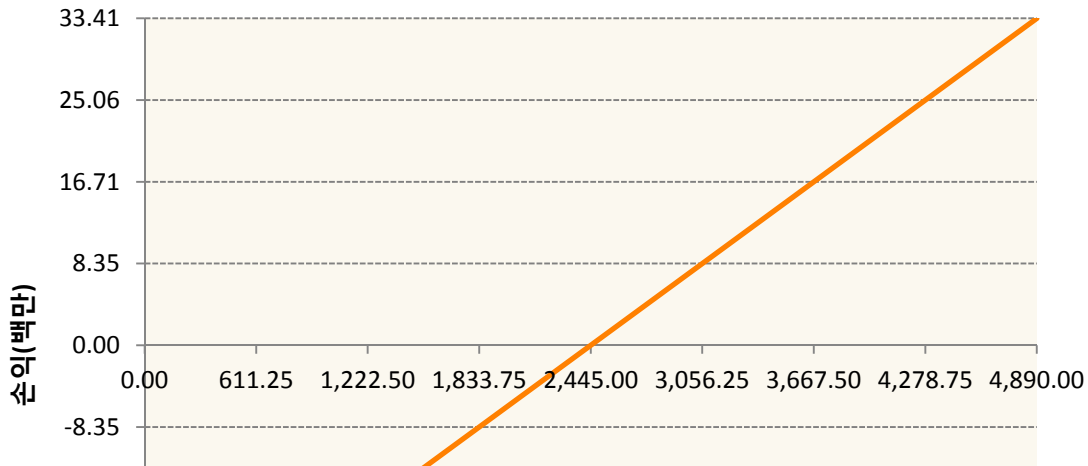
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	287	0	287	

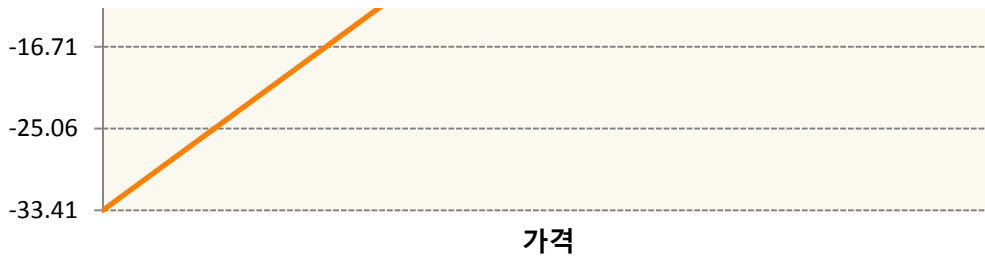
### 2. 만기시점의 손익구조

VGHO-EURO STOXX 50 Mar20



VGM0-EURO STOXX 50 Jun20





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

VGH0	EURO STOXX 50 Mar20	20
VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	3

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

23
----

공시일	2020-03-19
기준일	2020-03-18

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

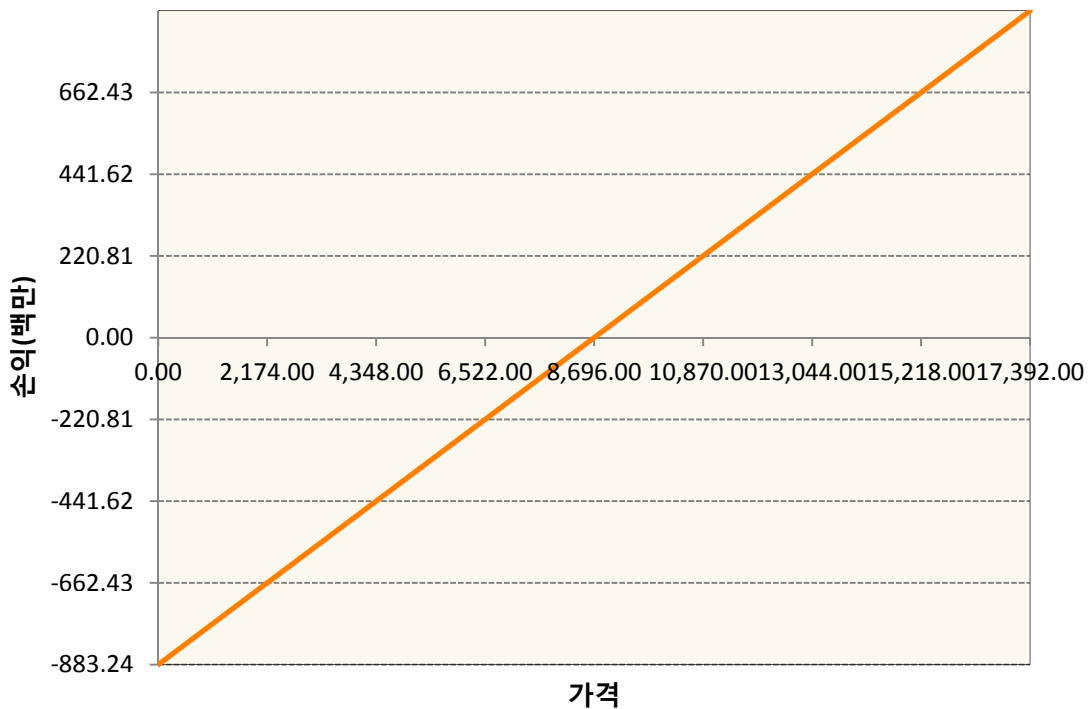
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	883	0	883	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH0	HSCEI Futures Mar20	71
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

68
----

공시일	2020-03-19
기준일	2020-03-18

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

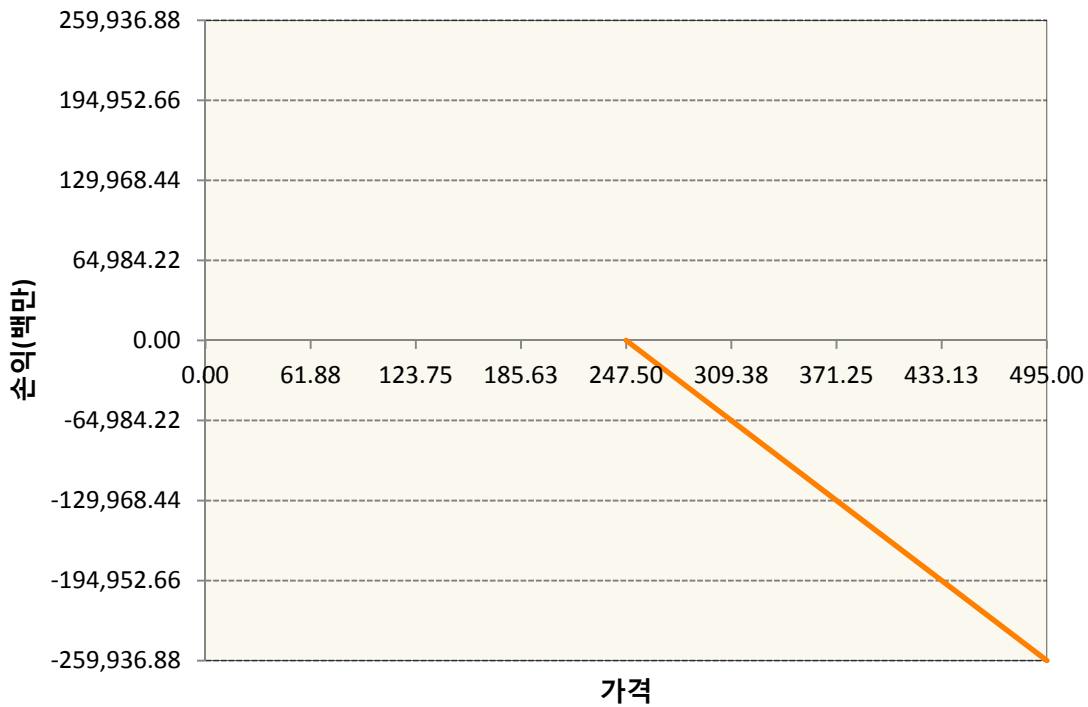
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

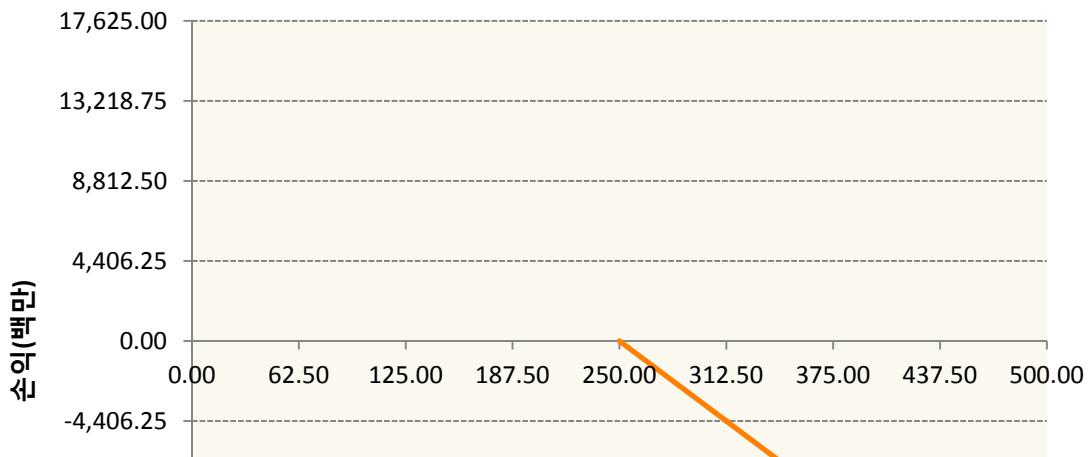
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	367,281	-367,281	장내

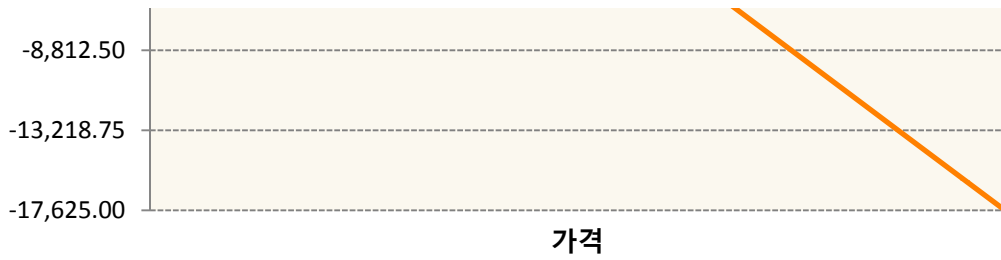
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

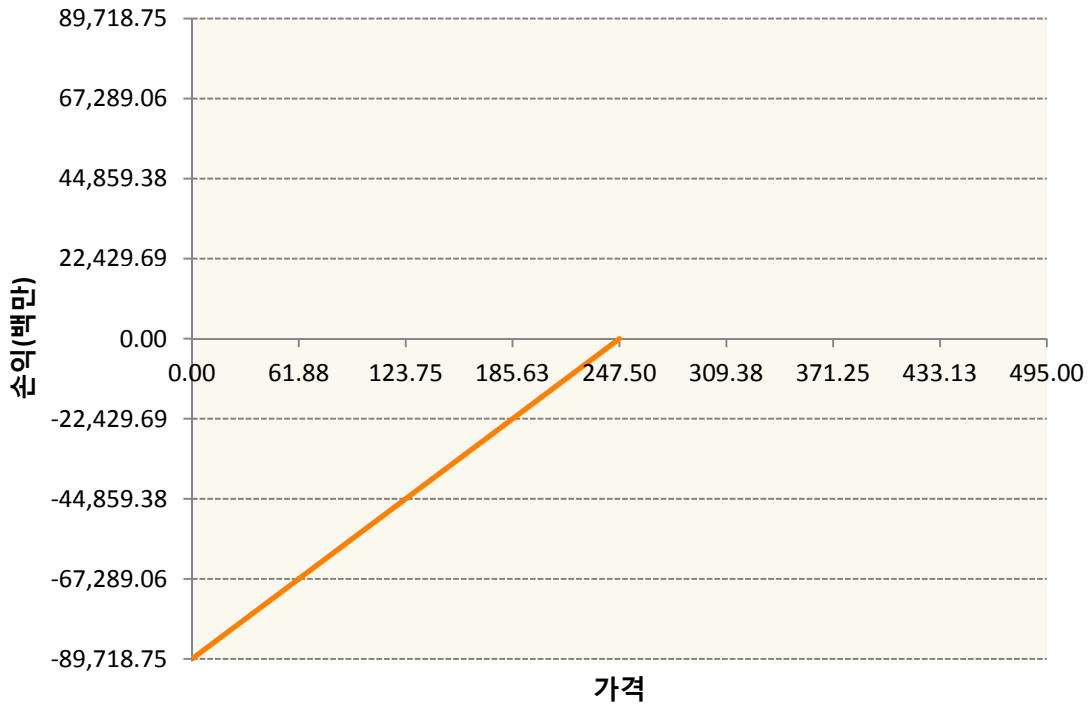


KR4201Q42503-2020-04 콜250





KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q42479		2020-04 콜247.5					8,458
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,131	2,943	2,682	2,350	1,949	1,483	959
-5.33%	2,920	2,626	2,249	1,796	1,273	687	47
-2.67%	2,562	2,132	1,617	1,027	372	-339	-1,099
0%	1,991	1,402	735	0	-790	-1,627	-2,503
2.67%	1,135	376	-449	-1,327	-2,247	-3,203	-4,188
5.33%	-78	-1,005	-1,978	-2,988	-4,026	-5,088	-6,169
8.00%	-1,714	-2,788	-3,889	-5,011	-6,148	-7,298	-8,458
KR4201Q42503		2020-04 콜250					536
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	187	176	161	141	117	88	55

-5.33%	176	159	136	108	76	39	-2
-2.67%	156	130	99	62	21	-24	-73
0%	123	87	46	0	-50	-104	-160
2.67%	74	27	-25	-81	-140	-202	-266
5.33%	2	-56	-119	-184	-251	-320	-391
8.00%	-96	-165	-236	-310	-384	-460	-536
KR4301Q42477                      2020-04 풋247.5							5,880
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,600	-4,738	-4,910	-5,114	-5,345	-5,602	-5,880
-5.33%	-2,661	-2,850	-3,073	-3,326	-3,605	-3,906	-4,227
-2.67%	-791	-1,036	-1,313	-1,618	-1,945	-2,291	-2,653
0%	994	689	355	0	-374	-762	-1,163
2.67%	2,675	2,310	1,923	1,520	1,103	676	240
5.33%	4,236	3,816	3,381	2,935	2,481	2,020	1,553
8.00%	5,665	5,197	4,722	4,241	3,756	3,267	2,775

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

(단위:백만원)

**10,365**

공시일	2020-03-19
기준일	2020-03-18

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

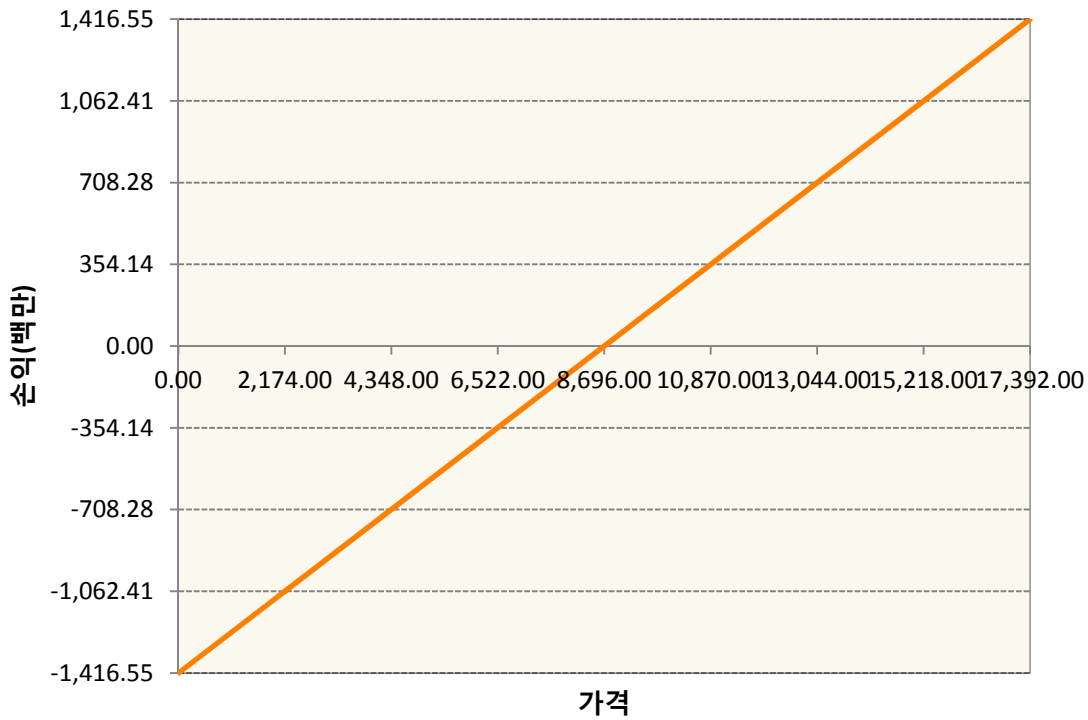
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

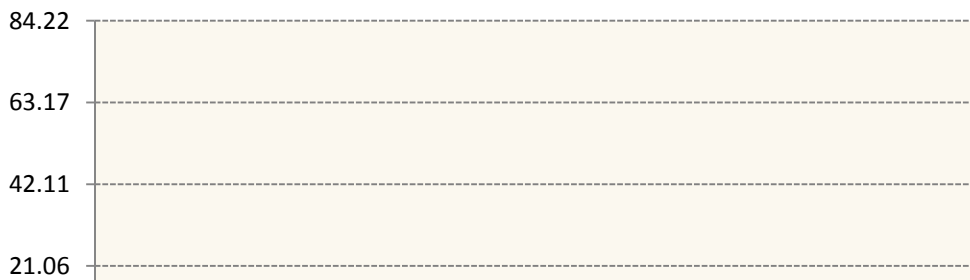
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,417	0	1,417	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,930	-4,930	장내
누계	통화	선도	706	2,259	-1,553	장외

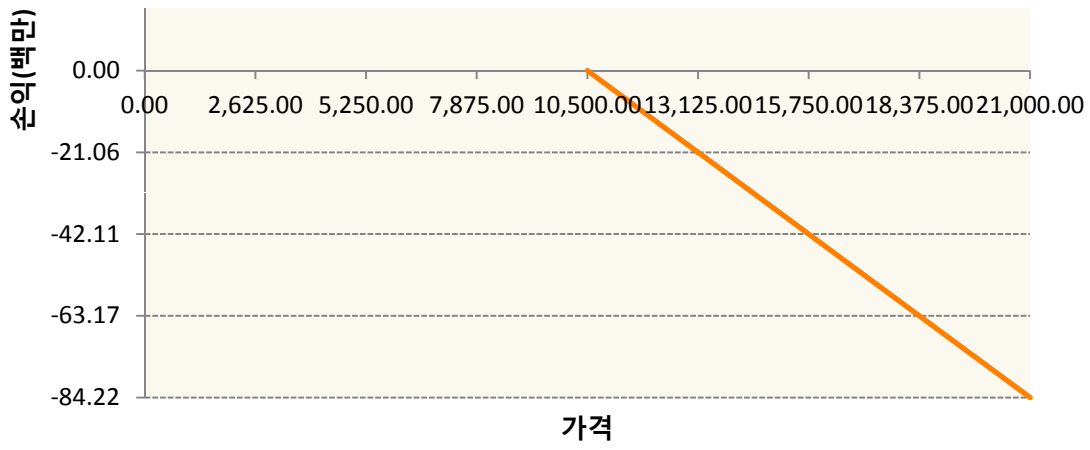
### 2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20

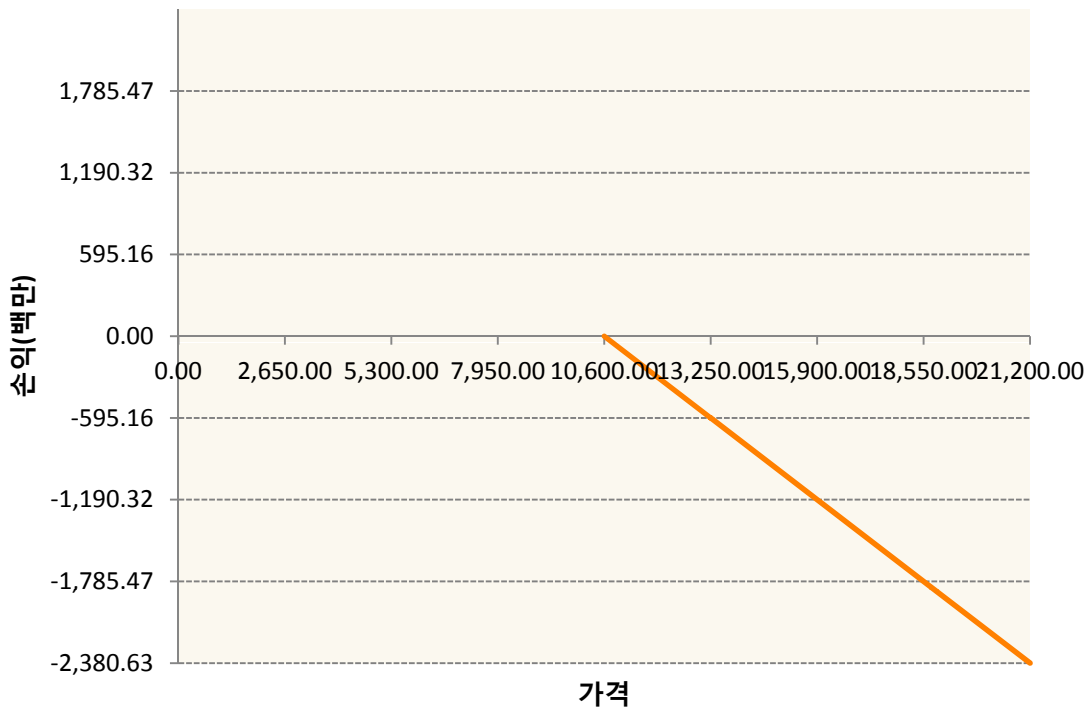


OHHIH0-C105-HSCEI

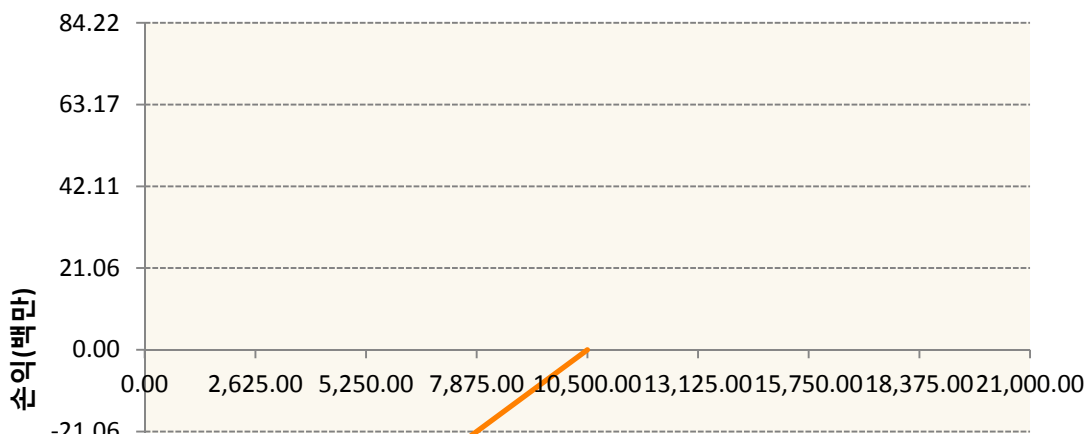


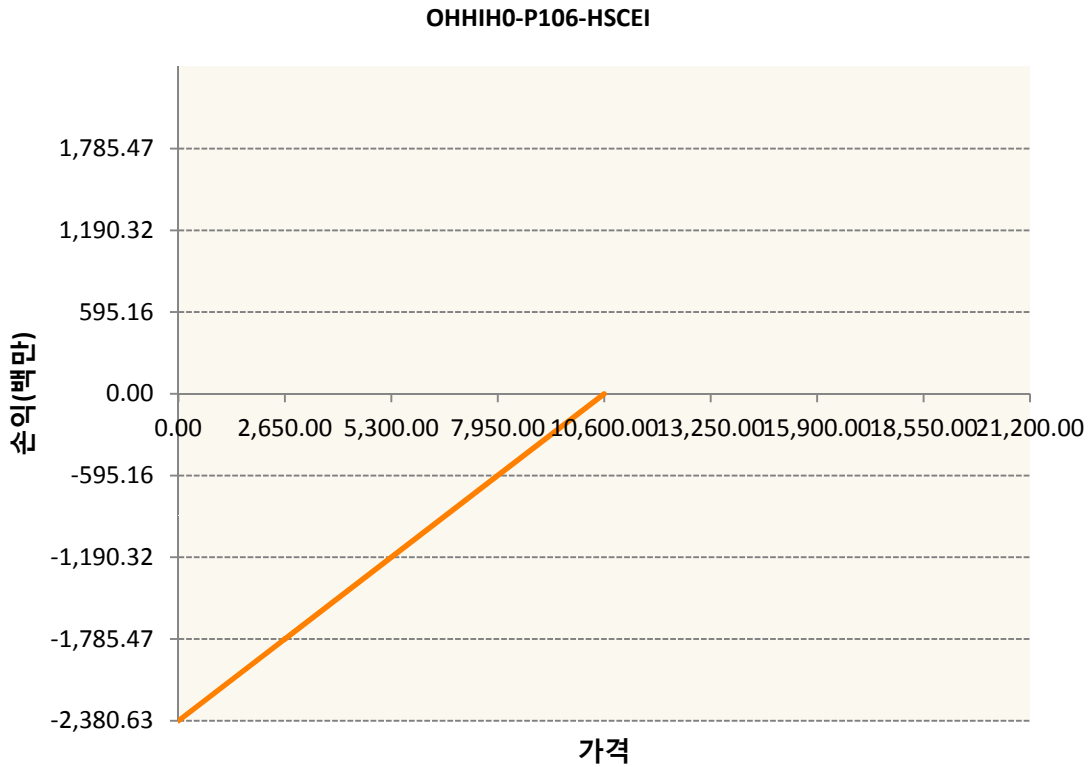


OHHIH0-C106-HSCEI



OHHIH0-P105-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E		181
FX21020H05 HKD/KRW 22-05-20E		56
HCH0 HSCEI Futures Mar20		113
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)
	577

공시일	2020-03-19
기준일	2020-03-18

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

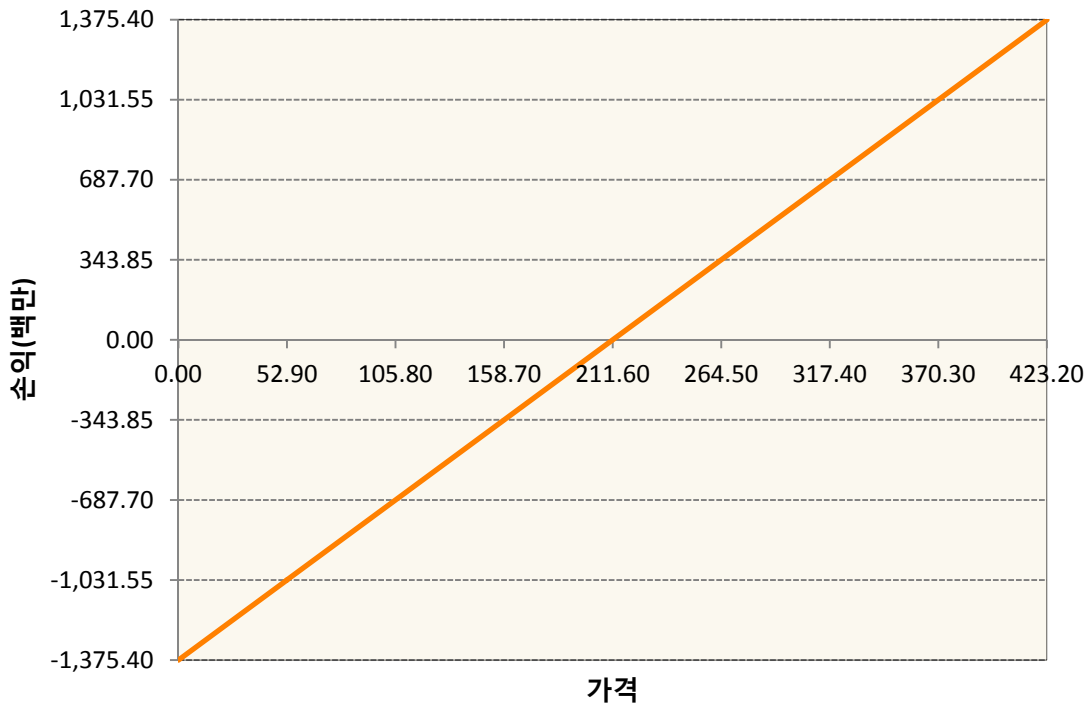
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

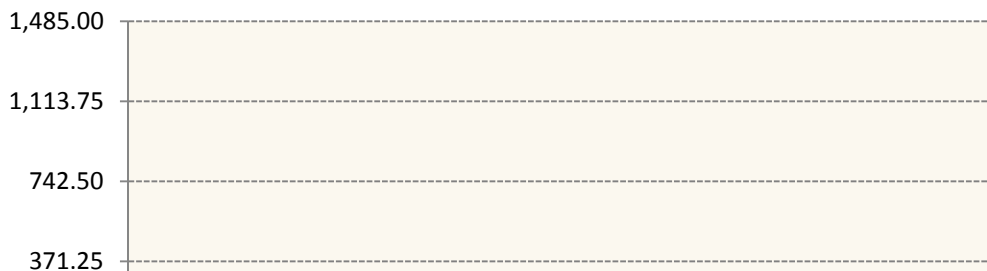
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,375	0	1,375	장내
누계	유가증권	스왑	3,125	0	3,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,095	-3,095	장내

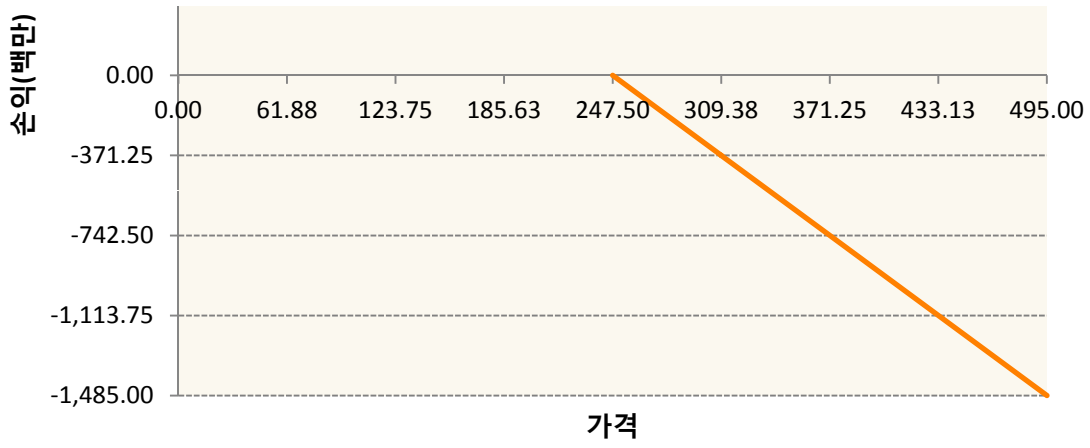
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

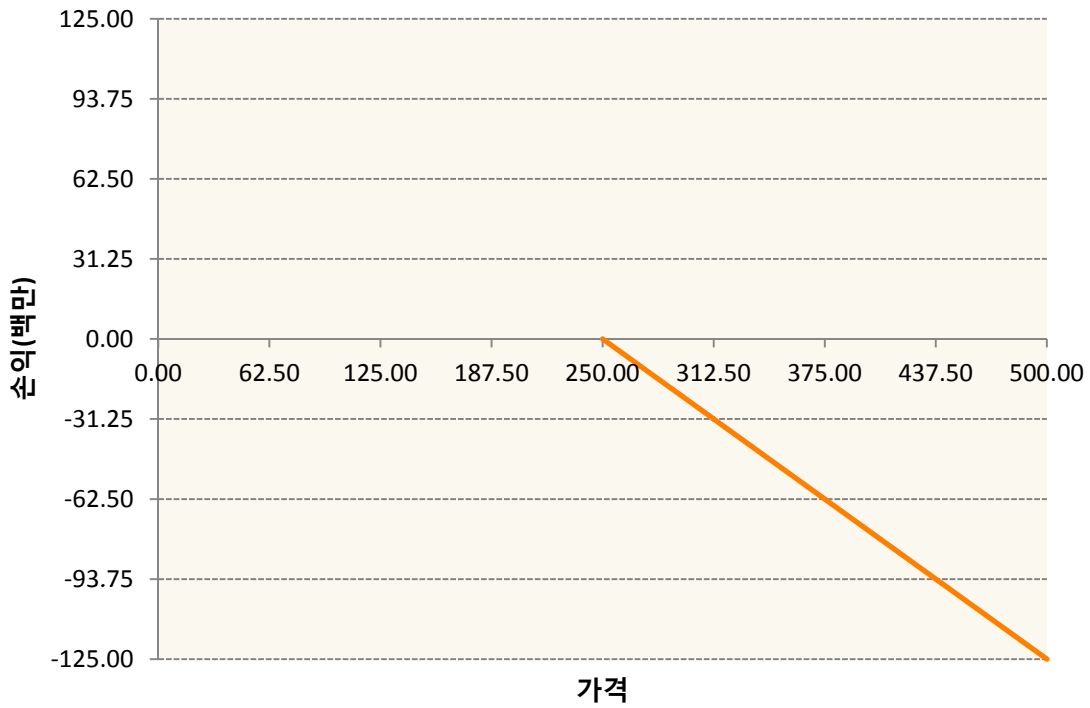


KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

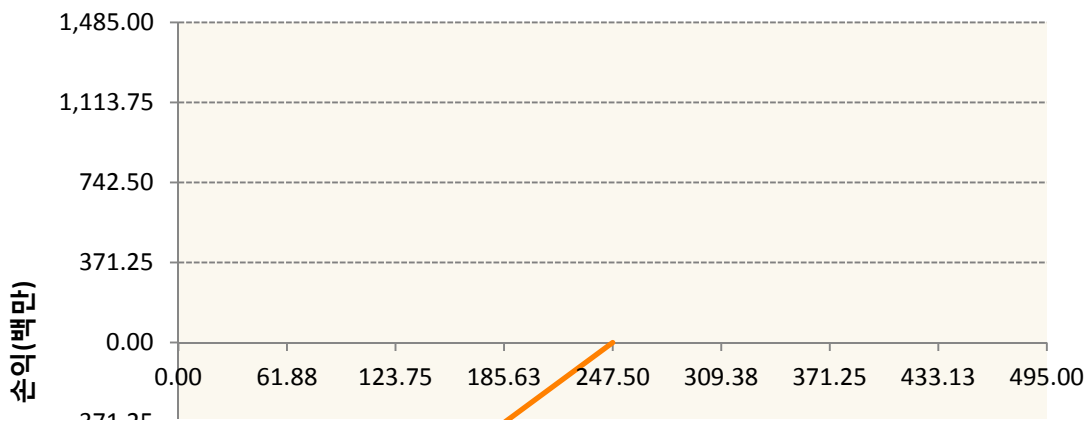




**KR4201Q42503-2020-04 콜250**



**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						112
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-112	-112	-112	-112	-112	-112	-112	
-5.33%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75	
-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%	75	75	75	75	75	75	75	
8.00%	112	112	112	112	112	112	112	
KR4201Q42479		2020-04 콜247.5						48
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	18	17	15	13	11	8	5	
-5.33%	17	15	13	10	7	4	0	
-2.67%	15	12	9	6	2	-2	-6	
0%	11	8	4	0	-5	-9	-14	
2.67%	6	2	-3	-8	-13	-18	-24	
5.33%	0	-6	-11	-17	-23	-29	-35	
8.00%	-10	-16	-22	-29	-35	-42	-48	
KR4201Q42503		2020-04 콜250						4
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	1	1	1	1	1	1	0
-5.33%	1	1	1	1	1	1	0
-2.67%	1	1	1	0	0	0	-1
0%	1	1	0	0	0	0	-1
2.67%	1	0	0	-1	-1	-1	-2
5.33%	0	0	-1	-1	-2	-2	-3
8.00%	-1	-1	-2	-2	-3	-3	-4
KR4301Q42477                      2020-04 풋247.5							97
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-76	-78	-81	-85	-88	-93	-97
-5.33%	-44	-47	-51	-55	-60	-65	-70
-2.67%	-13	-17	-22	-27	-32	-38	-44
0%	16	11	6	0	-6	-13	-19
2.67%	44	38	32	25	18	11	4
5.33%	70	63	56	49	41	33	26
8.00%	94	86	78	70	62	54	46

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

(단위:백만원)

**505**

공시일	2020-03-19
기준일	2020-03-18

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

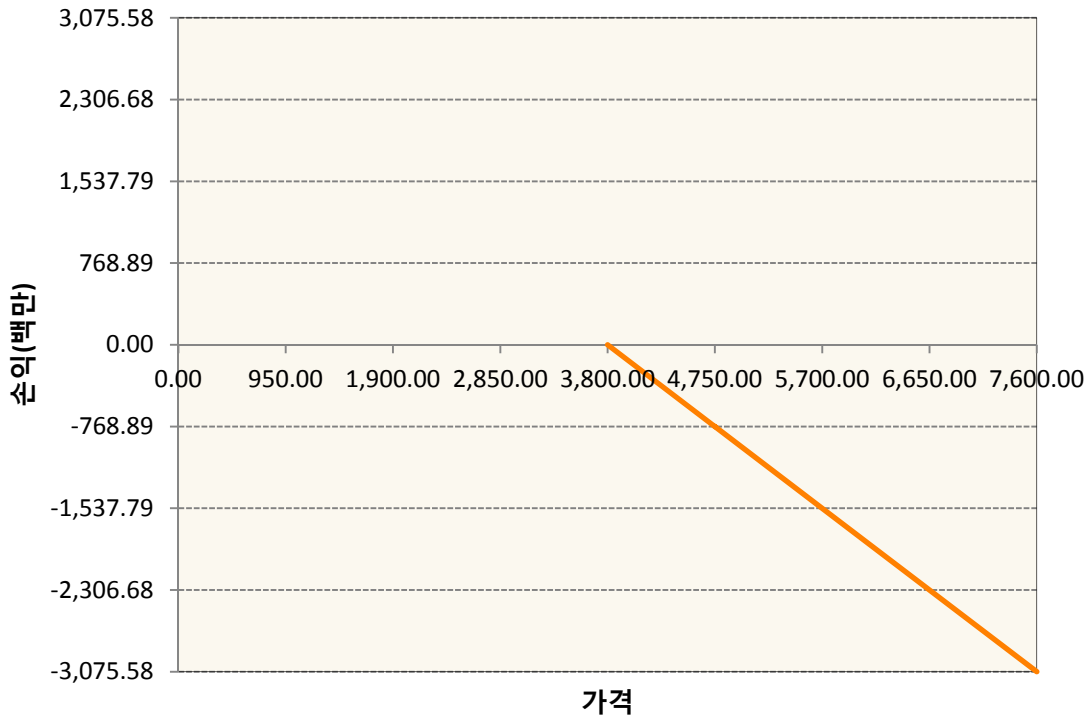
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

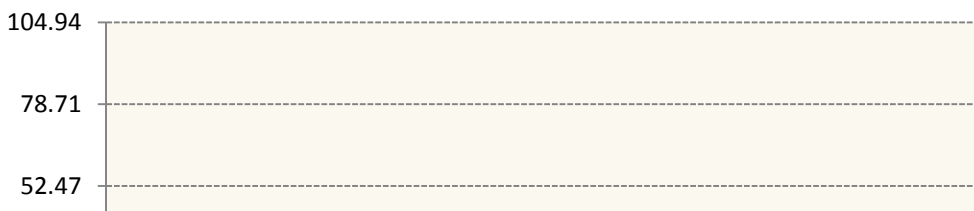
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	402	0	402	
누계	유가증권	스왑	7,792	0	7,792	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,361	-6,361	장내
누계	통화	선도	549	3,599	-3,051	장외

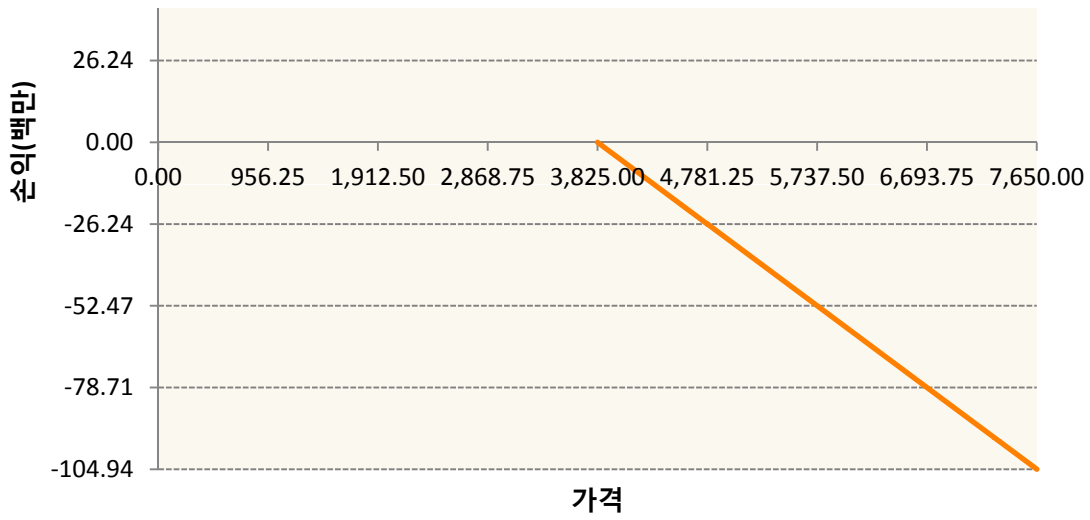
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXH0-C3800-EURO STOXX 50**

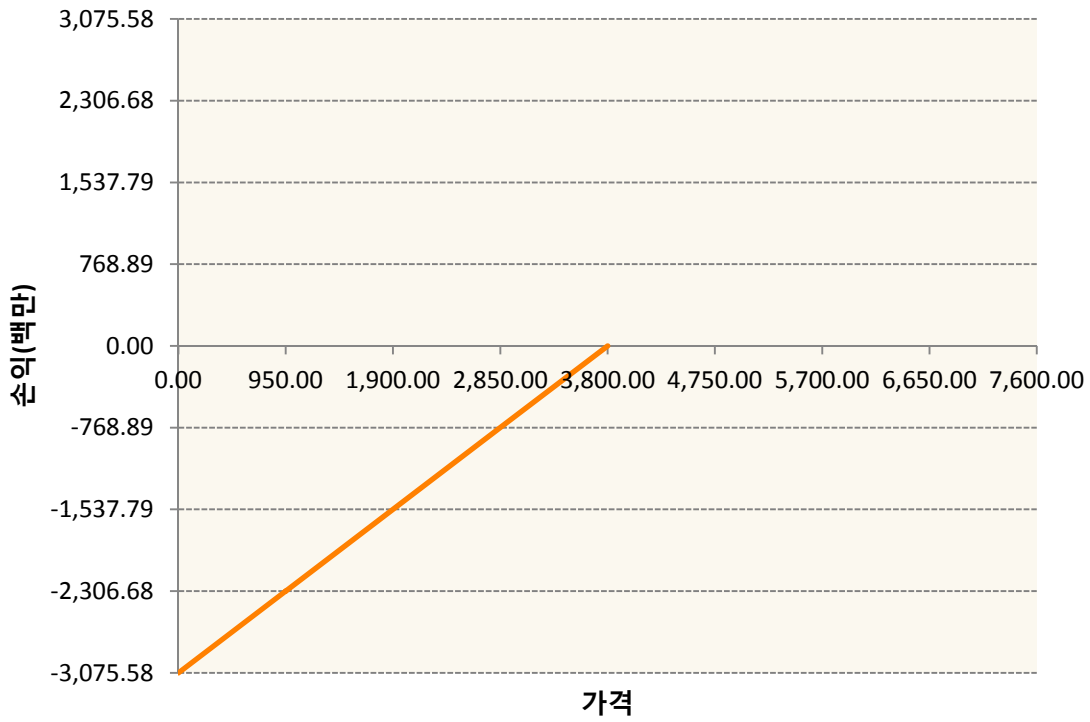


**OESXH0-C3825-EURO STOXX 50**

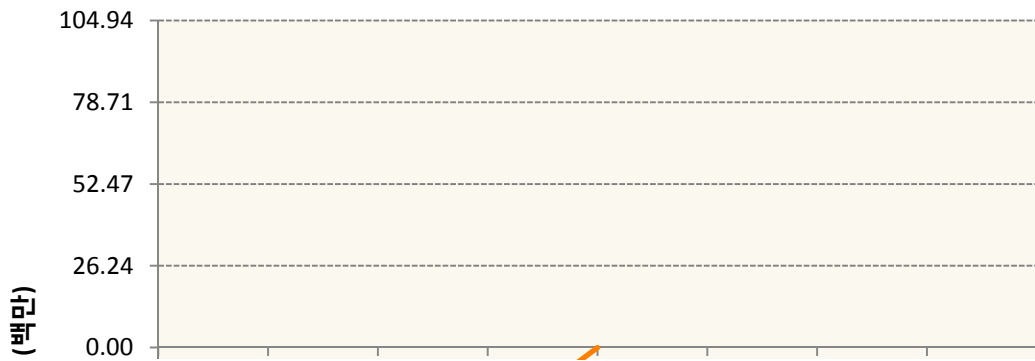


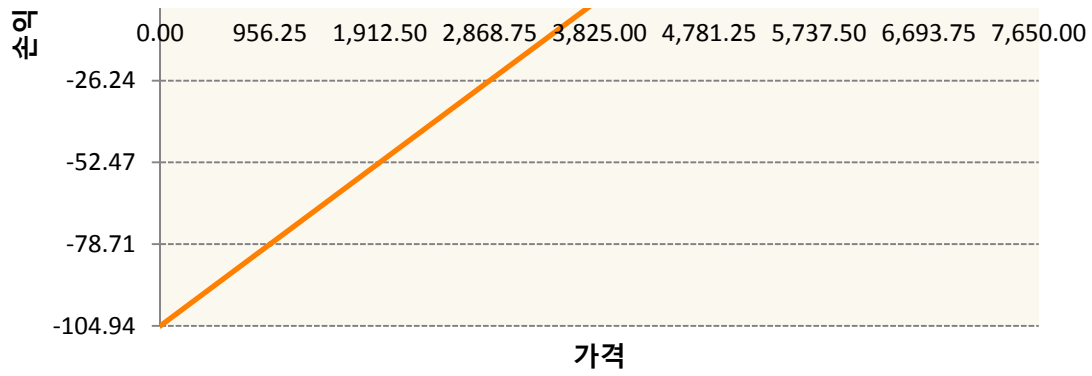


OESXH0-P3800-EURO STOXX 50

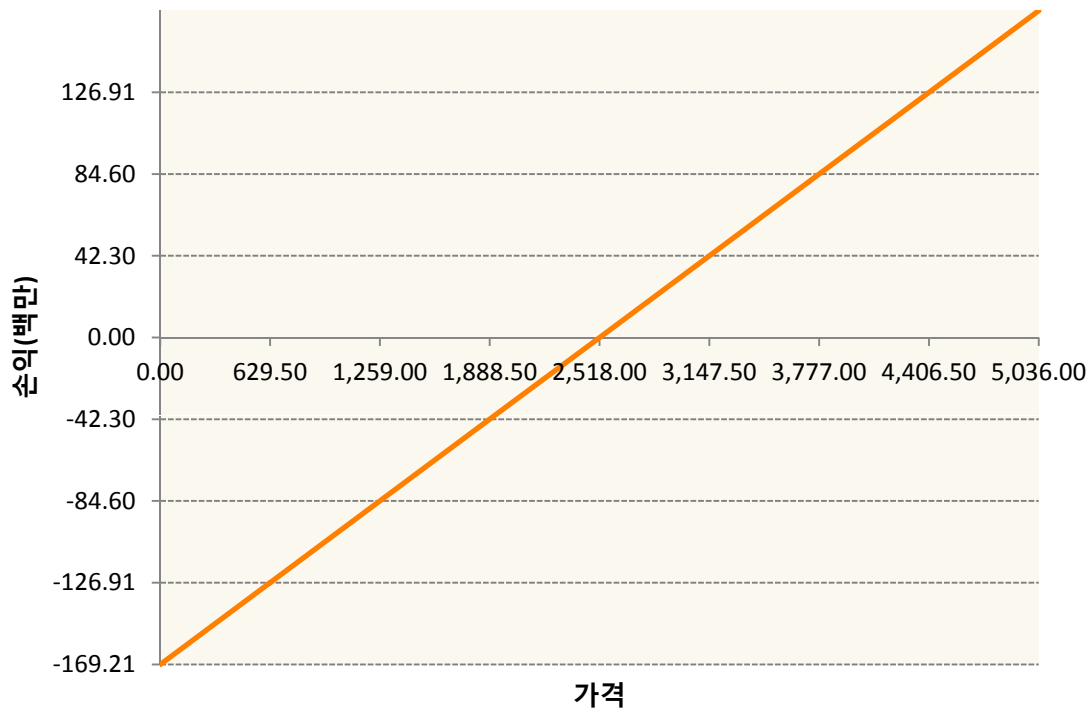


OESXH0-P3825-EURO STOXX 50

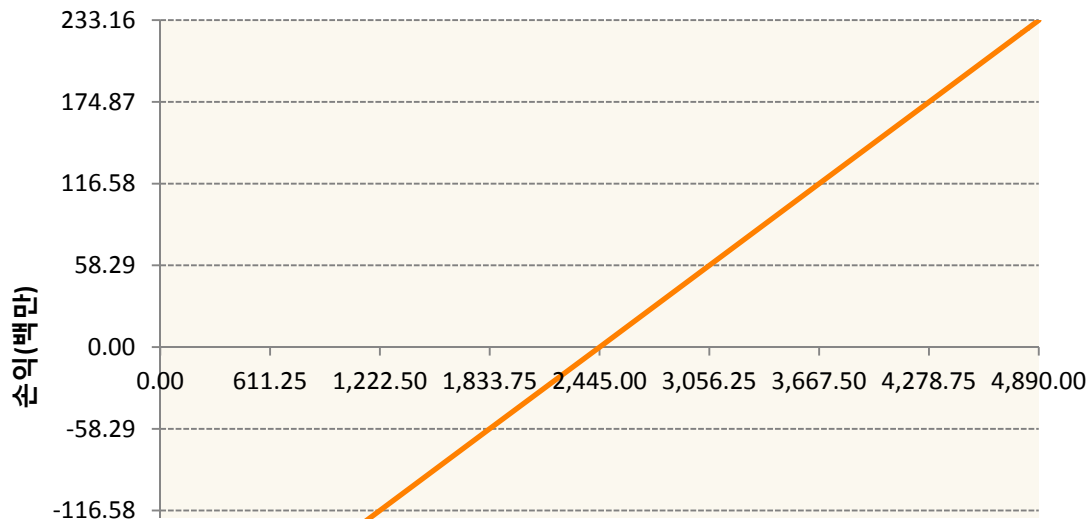


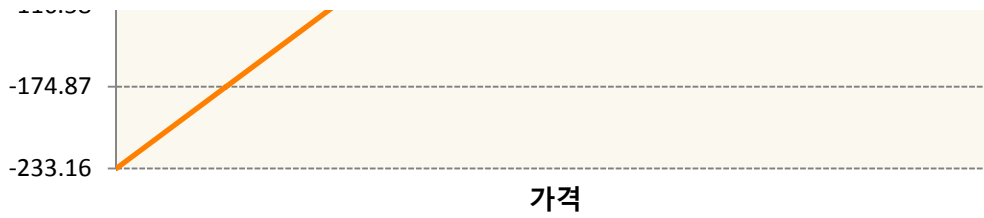


**VGHO-EURO STOXX 50 Mar20**



**VGM0-EURO STOXX 50 Jun20**





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

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	32
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	288
FX21020H00 EUR/KRW 27-03-20E	44
OESXH0-C3ξEURO STOXX 50	246
OESXH0-C3ξEURO STOXX 50	8
OESXH0-P3ξEURO STOXX 50	246
OESXH0-P3ξEURO STOXX 50	8
VGH0 EURO STOXX 50 Mar20	14
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20	19

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

**785**



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

(단위:백만원)

843

공시일	2020-03-19
기준일	2020-03-18

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

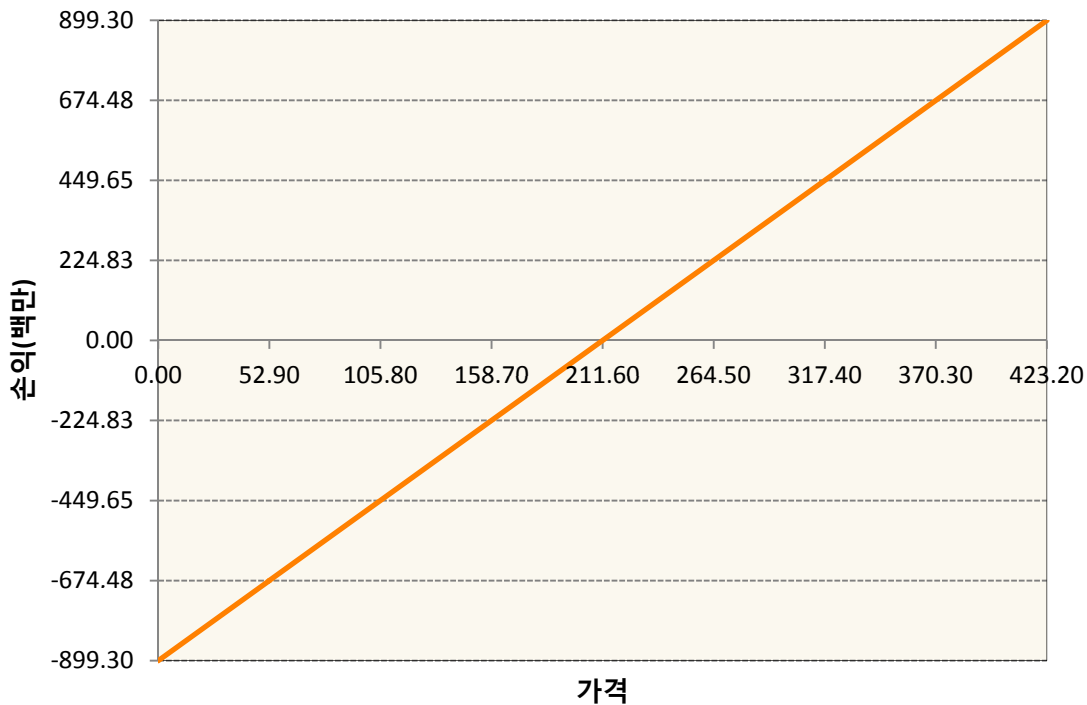
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	899	0	899	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						73
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73	
-5.33%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
-2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	24	24	24	24	24	24	24	
5.33%	49	49	49	49	49	49	49	
8.00%	73	73	73	73	73	73	73	

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

(단위:백만원)

77



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

(단위:백만원)

113



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

(단위:백만원)

41

공시일	2020-03-19
기준일	2020-03-18

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

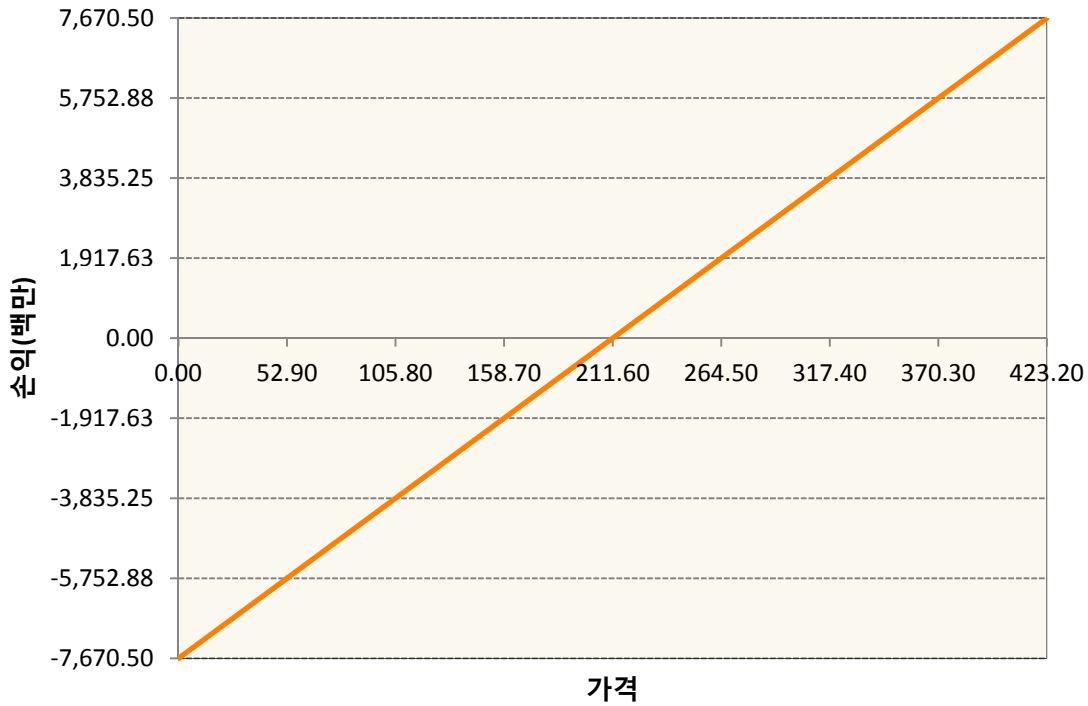
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

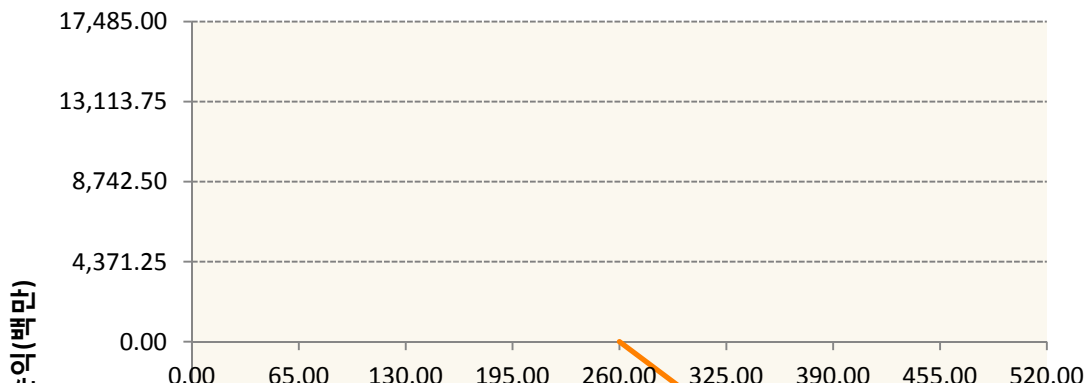
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,671	0	7,671	장내
누계	유가증권	옵션	6,004	17,485	-11,481	장내

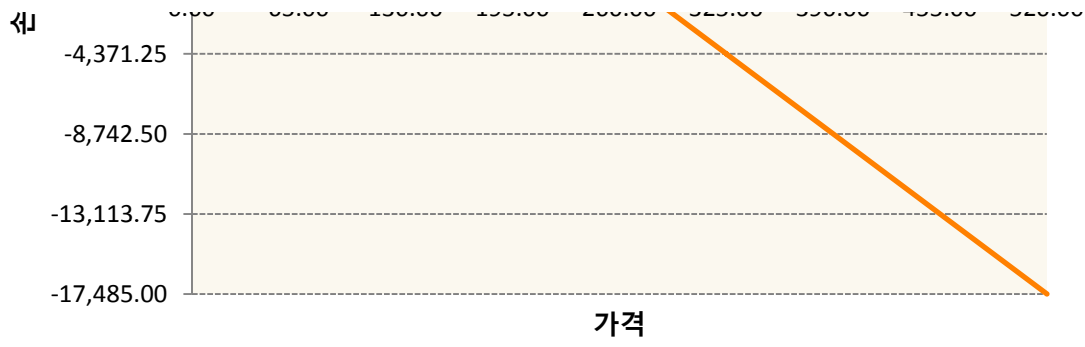
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

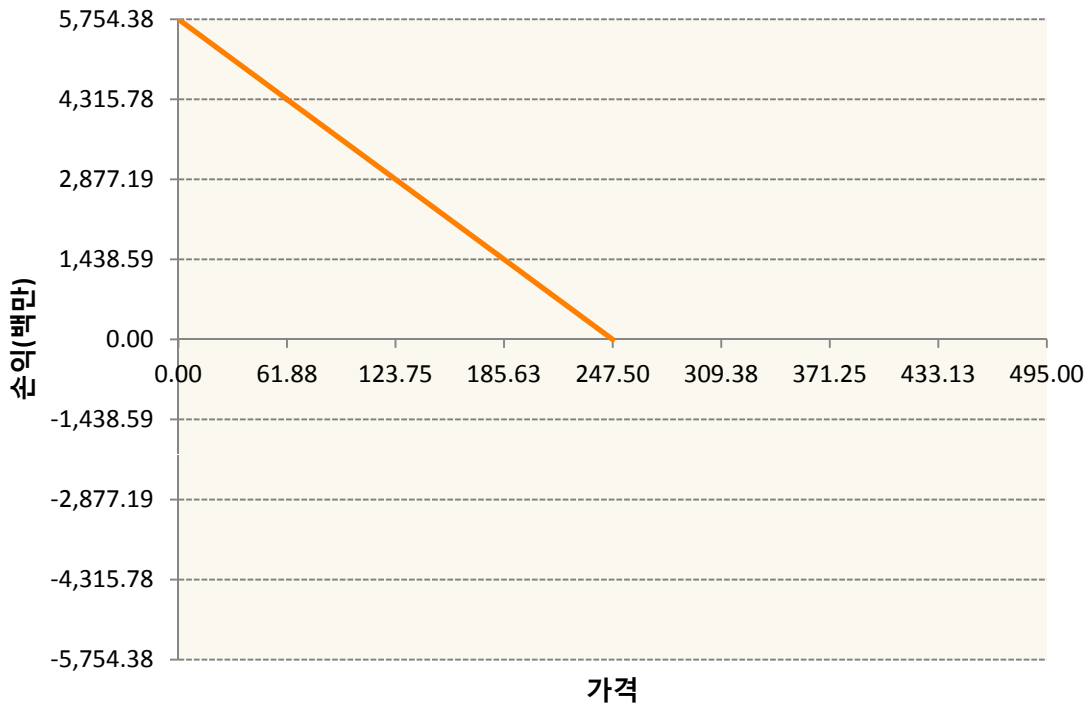


KR4201Q42602-2020-04 콜260

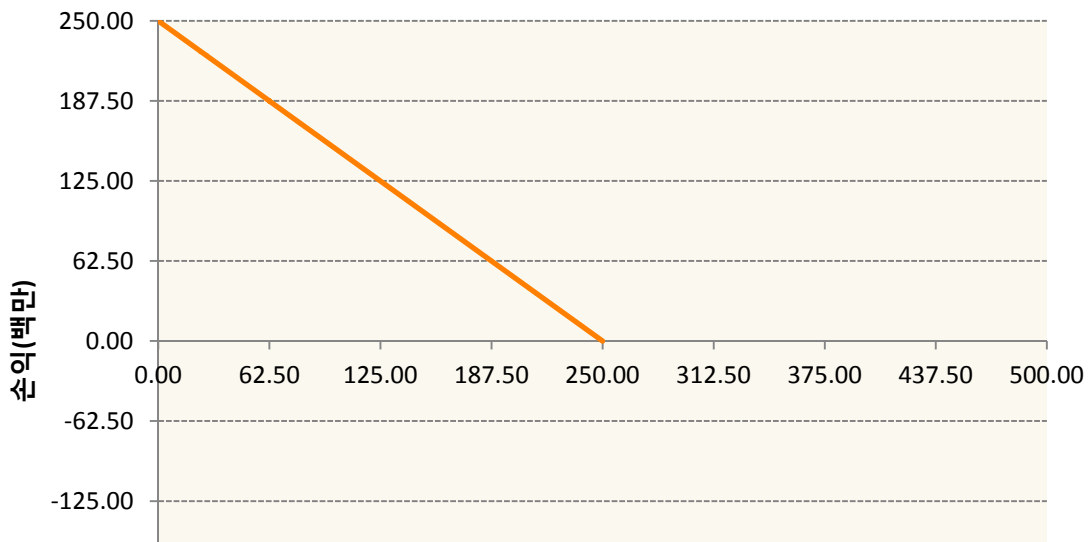


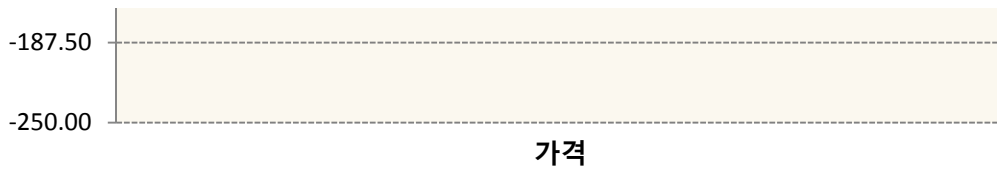


KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



KR4301Q42501-2020-04 풋250





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

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						626
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-626	-626	-626	-626	-626	-626	-626	
-5.33%	-417	-417	-417	-417	-417	-417	-417	
-2.67%	-209	-209	-209	-209	-209	-209	-209	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	209	209	209	209	209	209	209	
5.33%	417	417	417	417	417	417	417	
8.00%	626	626	626	626	626	626	626	
KR4201Q42602		2020-04 콜260						400
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	109	104	96	84	68	49	25	
-5.33%	105	96	83	65	44	18	-12	
-2.67%	96	82	63	38	9	-24	-61	
0%	81	59	32	0	-37	-78	-123	
2.67%	56	25	-11	-52	-97	-146	-199	
5.33%	17	-24	-69	-120	-174	-231	-291	
8.00%	-39	-91	-147	-206	-269	-333	-400	
KR4301Q42477		2020-04 풋247.5						377
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	295	304	315	328	343	359	377	
-5.33%	171	183	197	213	231	251	271	
-2.67%	51	66	84	104	125	147	170	
0%	-64	-44	-23	0	24	49	75	
2.67%	-172	-148	-123	-97	-71	-43	-15	
5.33%	-272	-245	-217	-188	-159	-130	-100	
8.00%	-363	-333	-303	-272	-241	-210	-178	
KR4301Q42501		2020-04 풋250						16
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	13	13	14	14	15	16	16	
-5.33%	8	8	9	9	10	11	12	
-2.67%	2	3	4	5	5	6	7	

0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-7	-6	-5	-4	-3	-2	-1
5.33%	-12	-11	-10	-8	-7	-6	-5
8.00%	-16	-15	-13	-12	-11	-9	-8

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

(단위:백만원)

**1,171**

공시일	2020-03-19
기준일	2020-03-18

## 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	197,200	0	197,200	

### 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	2020-03-19
기준일	2020-03-18

## 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	104,560	0	104,560	

### 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	2020-03-19
기준일	2020-03-18

## 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	495,480	0	495,480	
누계	통화	선도	37,371	513,104	-475,733	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,604
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,495
FX21020F03 KRW/USD 31-03-20E	3,189
FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E	2,990
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,691
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,428
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,993
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,986
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,332
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,993
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	199
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	5,082
FX21020G06 USD/KRW 31-03-20E	498
FX21020H00 USD/KRW 31-03-20E	997
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,491
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,073
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,073
FX21020H04 USD/KRW 21-04-20E	1,495
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,432
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	997

IE00BD8RGM75

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

**16,955**



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

(단위:백만원)

117

공시일	2020-03-19
기준일	2020-03-18

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

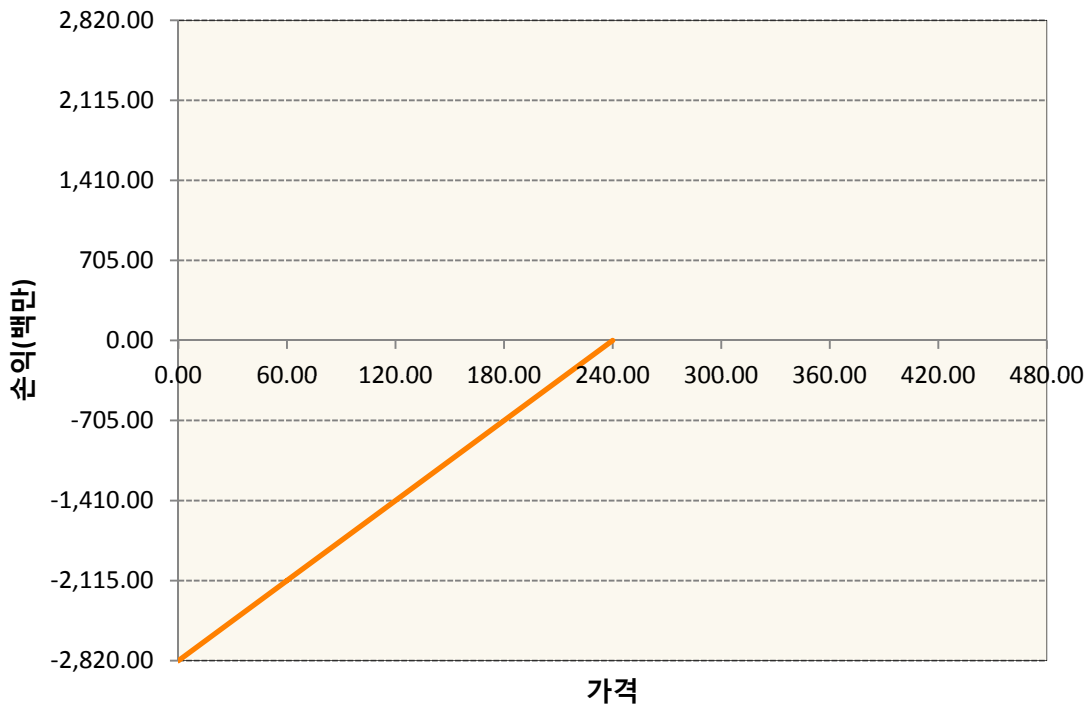
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

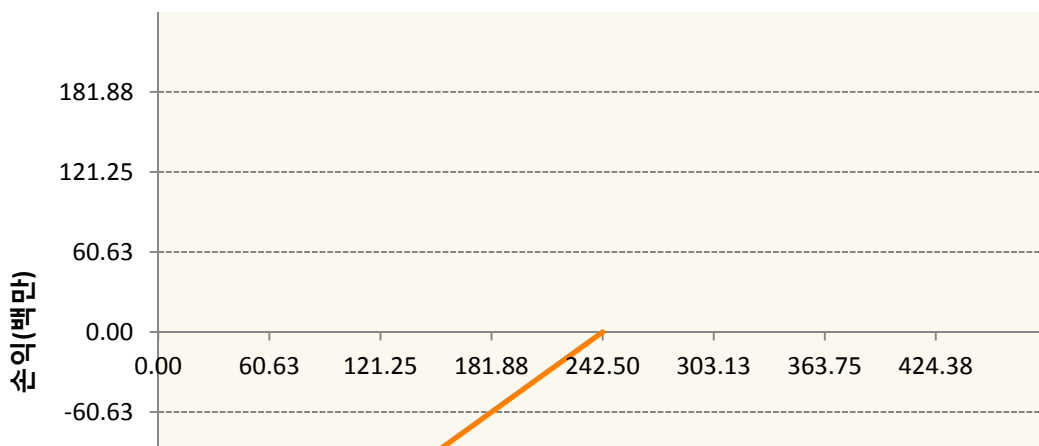
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,063	-3,063	장내

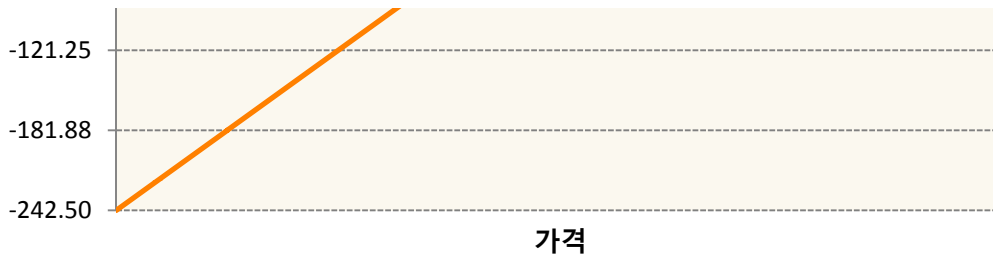
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q42402-2020-04 풋240



KR4301Q42428-2020-04 풋242.5





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

KR4301Q42402		2020-04 풋240						185
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-135	-141	-148	-156	-165	-174	-185	
-5.33%	-74	-82	-91	-101	-111	-122	-134	
-2.67%	-17	-27	-37	-49	-61	-73	-86	
0%	37	25	13	0	-13	-27	-41	
2.67%	87	73	59	45	31	16	1	
5.33%	132	117	102	87	71	56	40	
8.00%	173	157	141	125	108	92	76	
KR4301Q42428		2020-04 풋242.5						16
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-12	-12	-13	-14	-14	-15	-16	
-5.33%	-7	-7	-8	-9	-10	-11	-11	
-2.67%	-2	-2	-3	-4	-5	-6	-7	
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3	
2.67%	7	6	5	4	3	2	0	
5.33%	11	10	9	8	6	5	4	
8.00%	15	14	12	11	10	8	7	

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

**171**

공시일	2020-03-19
기준일	2020-03-18

## 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	8,411	0	8,411	
누계	통화	선도	1,657	9,654	-7,997	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	362
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)

348
-----

공시일	2020-03-19
기준일	2020-03-18

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

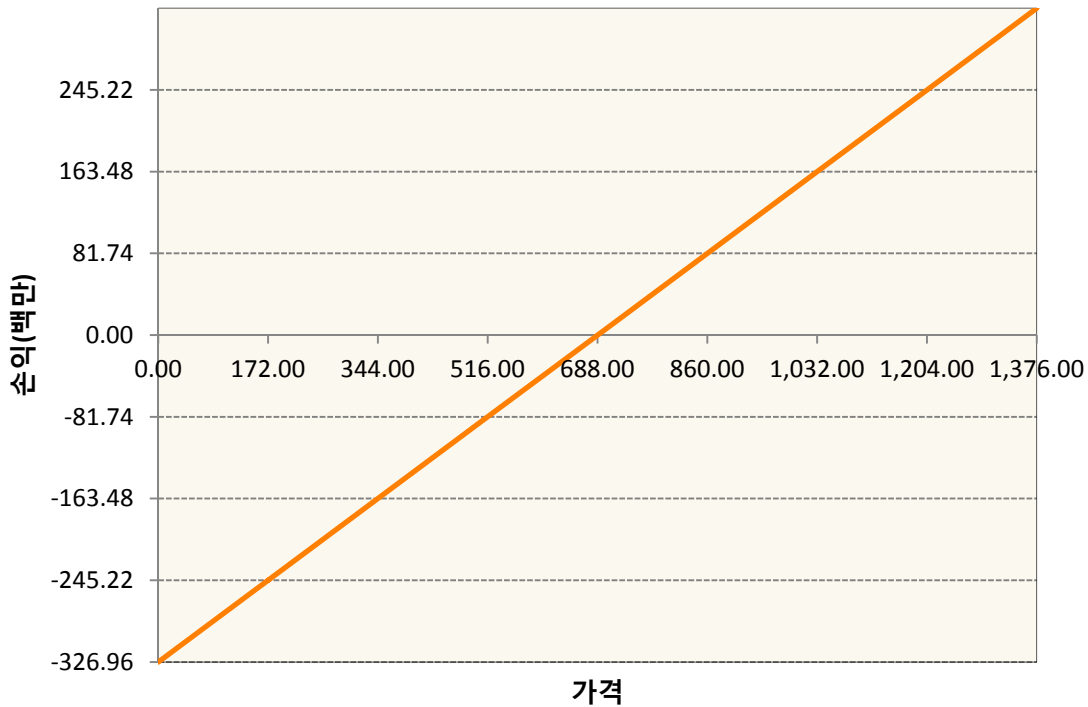
### 1. 계약금액

(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	327	0	327	
누계	유가증권	스왑	1,132	0	1,132	장외
누계	통화	선도	480	754	-274	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

VNCH0-VN30 Index Future Mar20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	91
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	5
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	26

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

(단위:백만원)

**142**

공시일	2020-03-19
기준일	2020-03-18

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

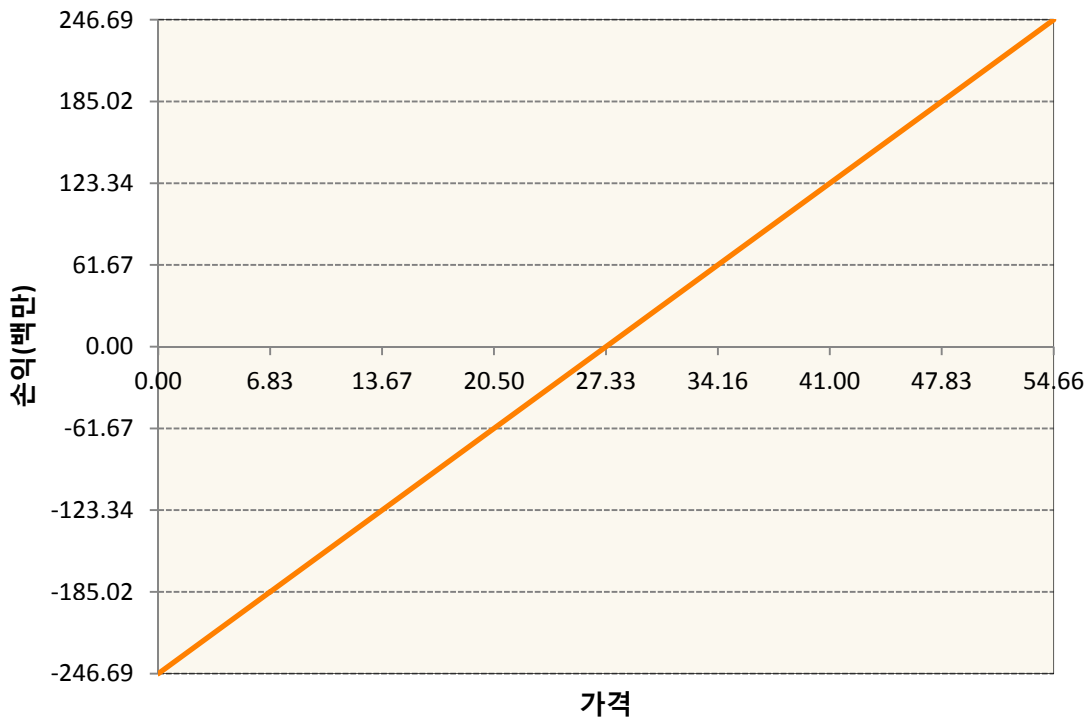
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

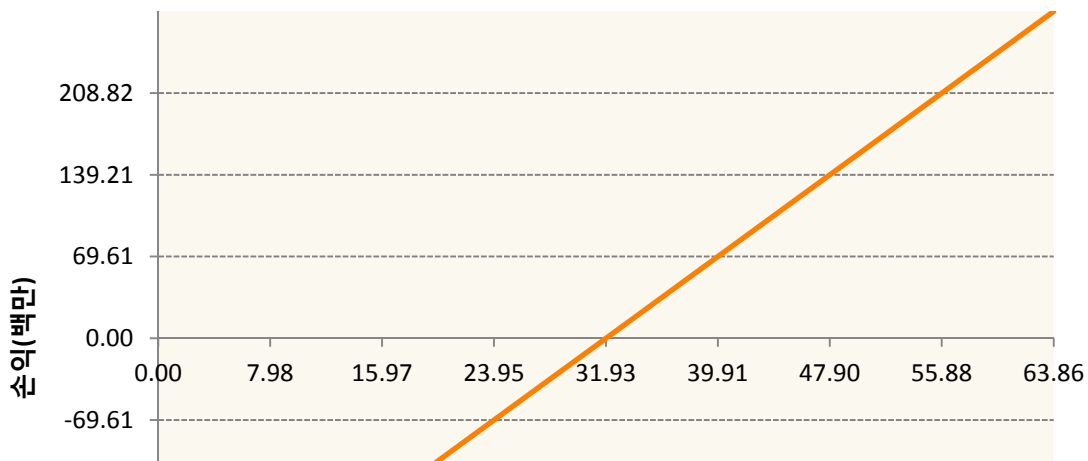
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,359	124	1,235	

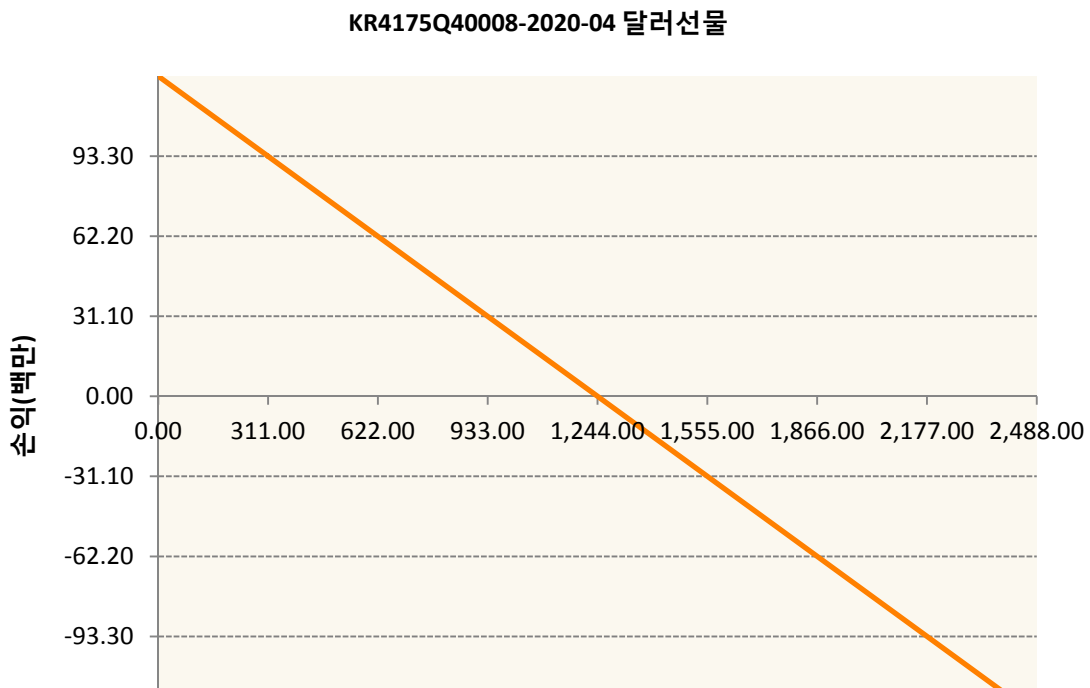
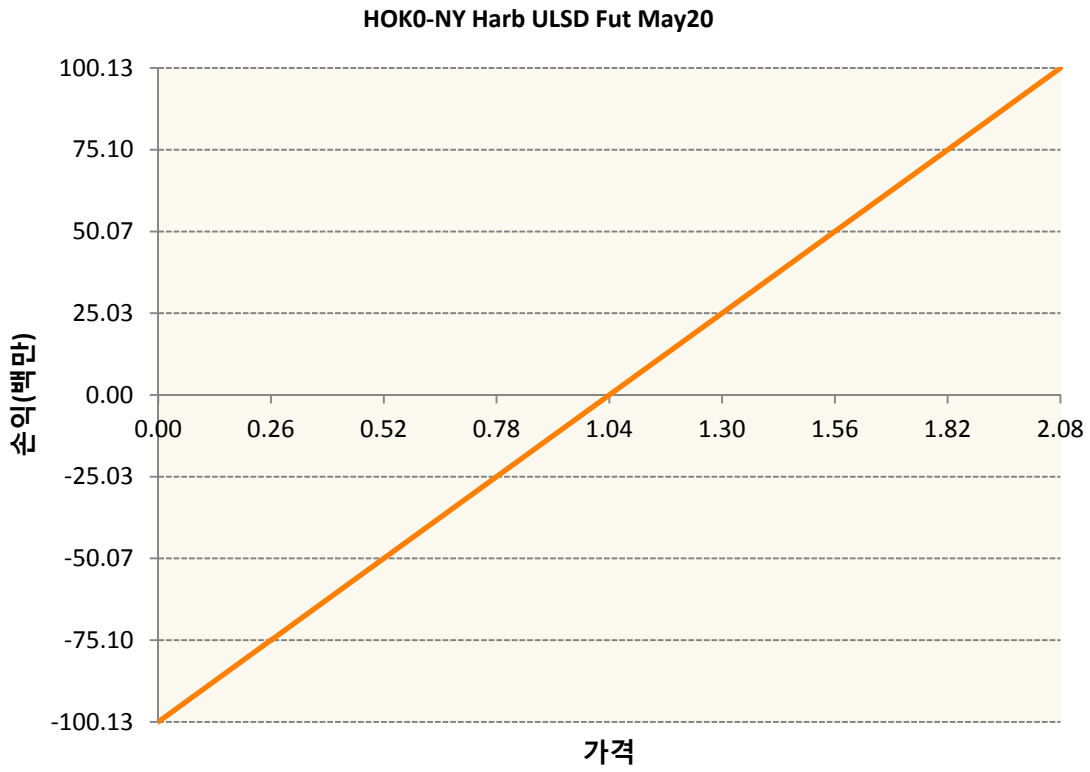
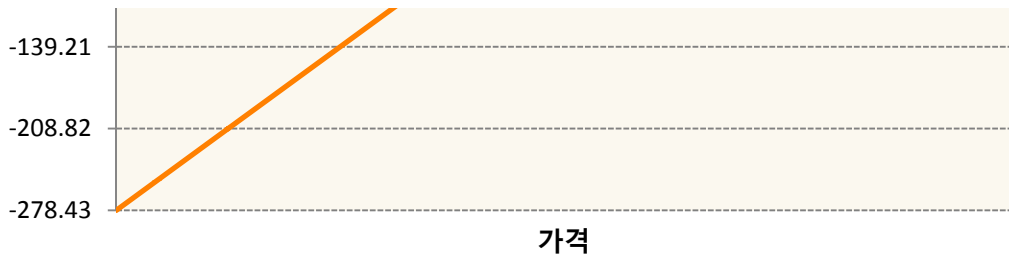
### 2. 만기시점의 손익구조

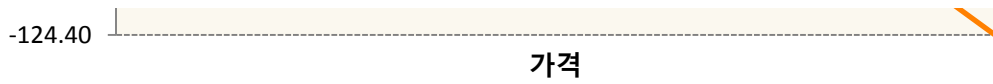
CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20



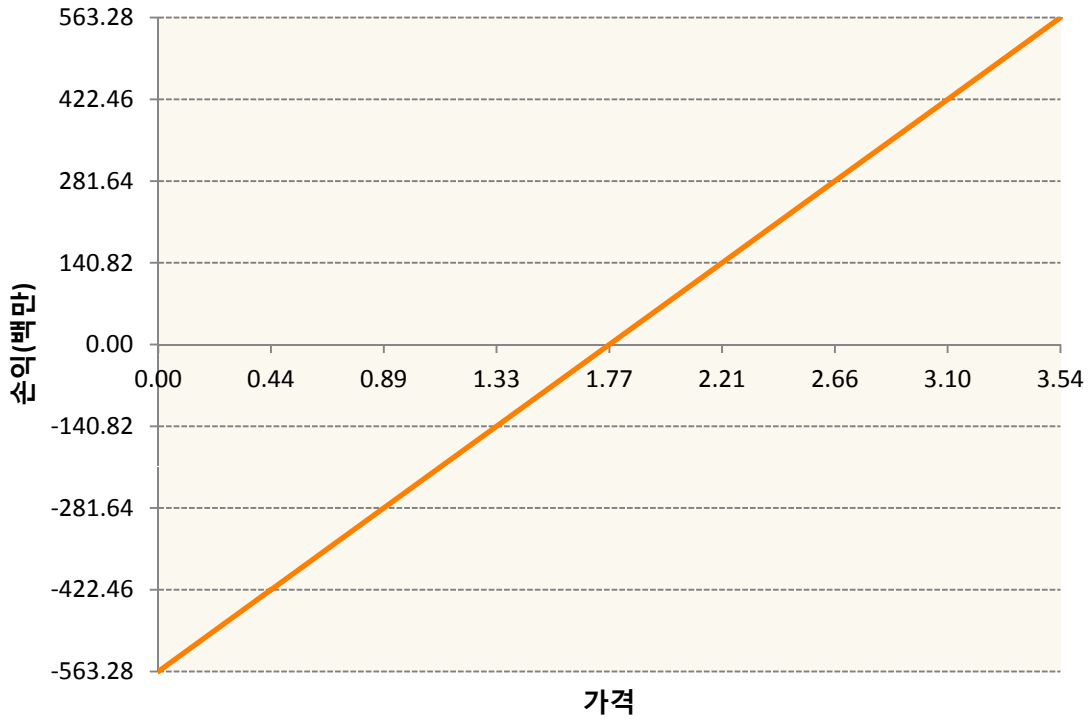
CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20



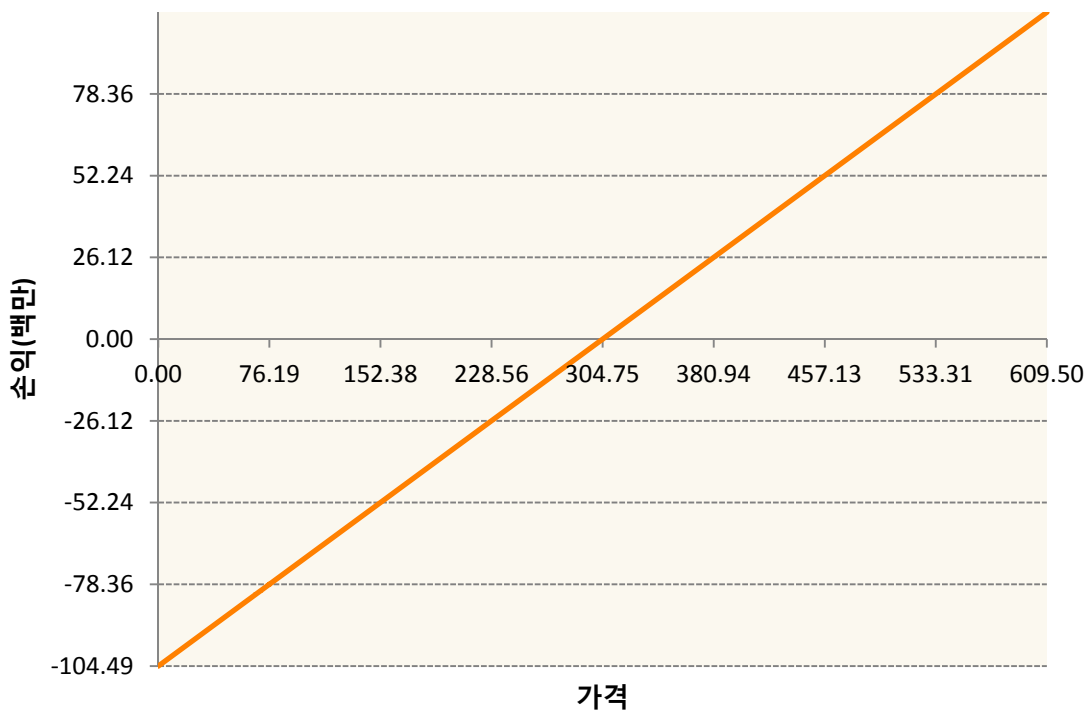




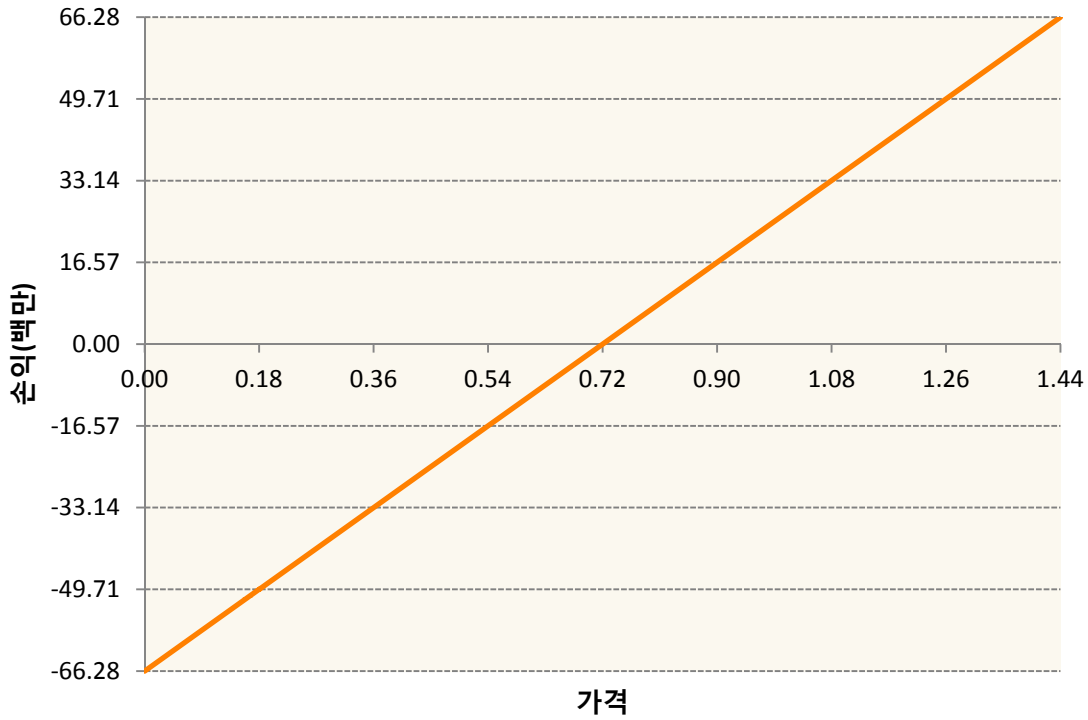
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



QSK0-Low Su Gasoil G Mar20



**XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20**



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	20
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	22
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	8
KR4175Q40C	2020-04 달러선물	10
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	45
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	8
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	5

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

(단위:백만원)

<b>277</b>
------------

공시일	2020-03-19
기준일	2020-03-18

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

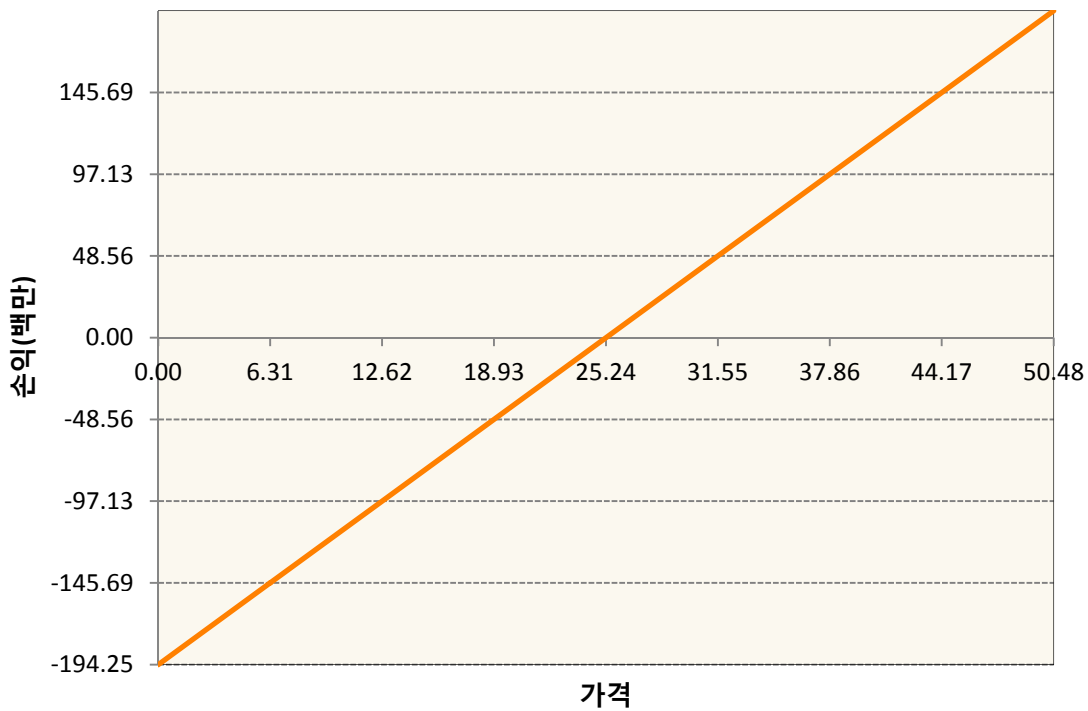
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

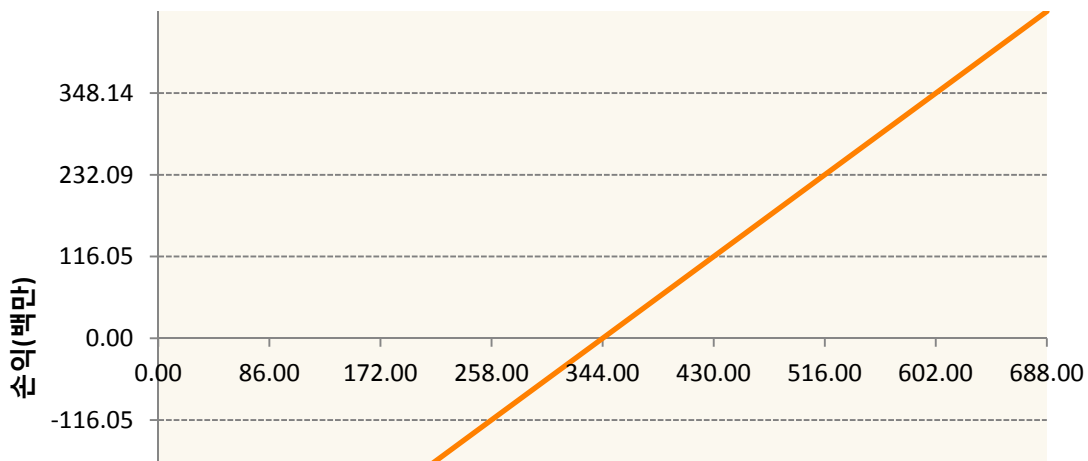
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,309	100	2,209	

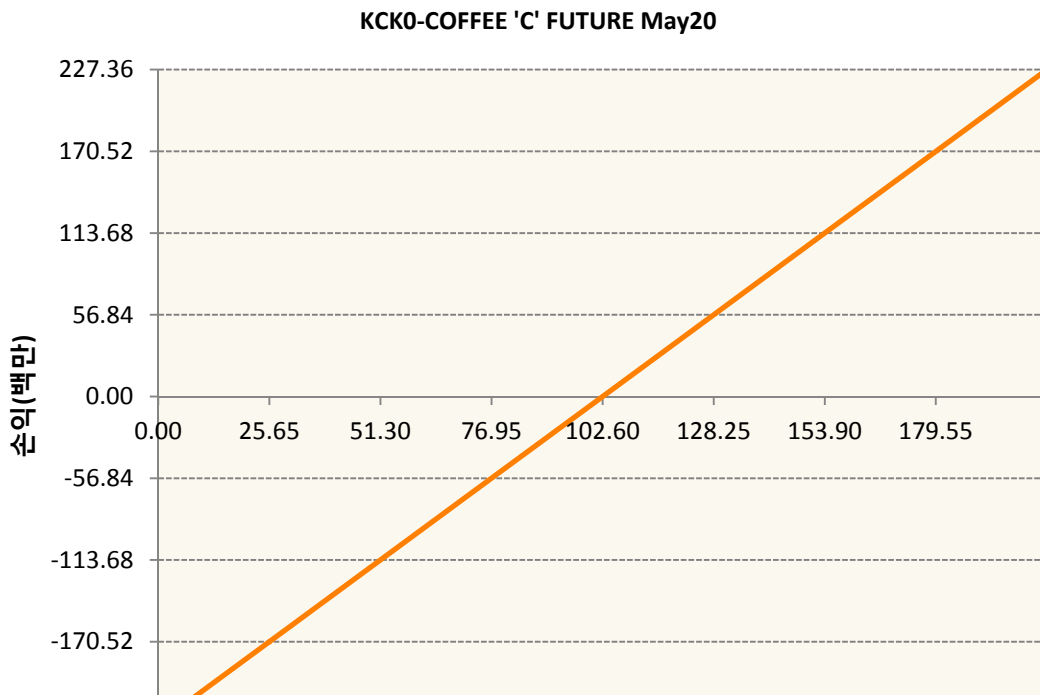
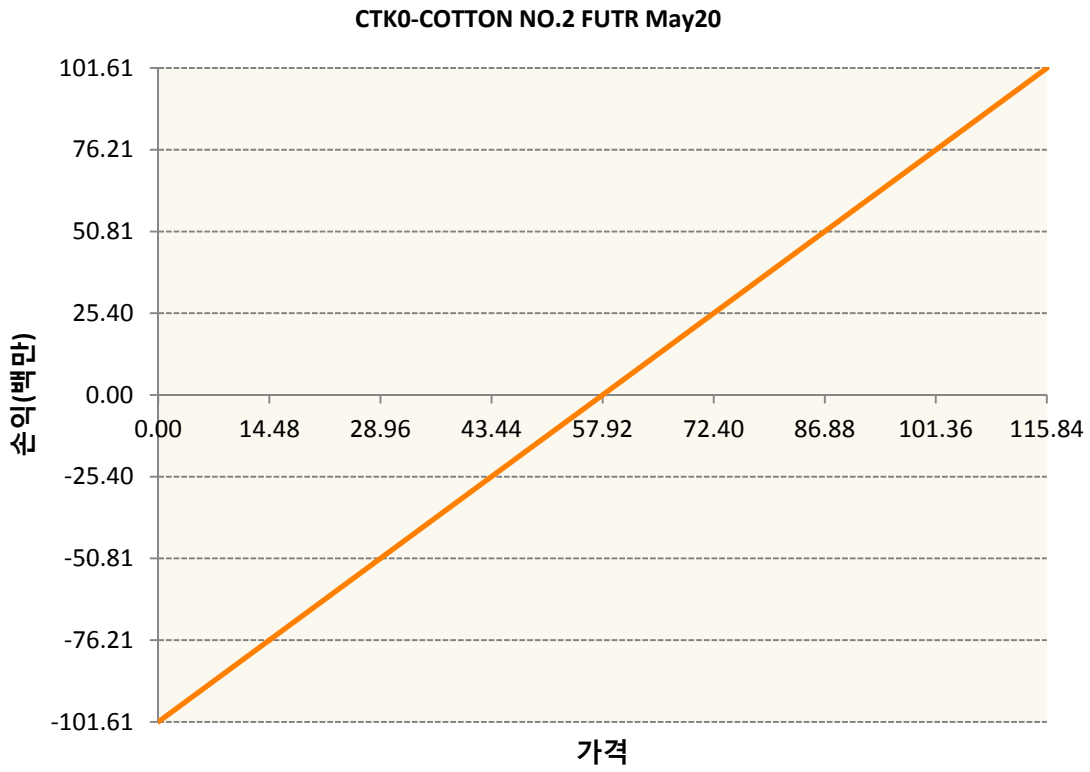
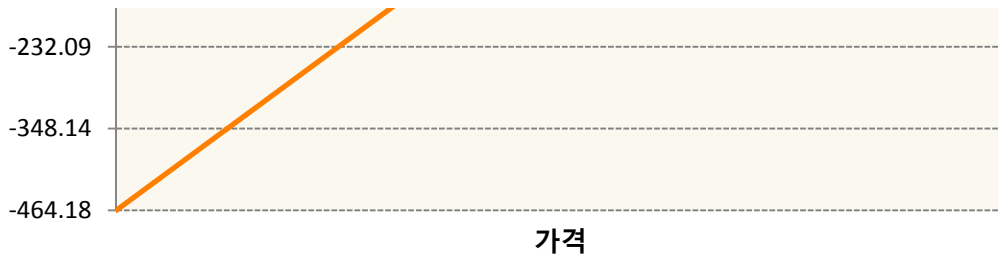
### 2. 만기시점의 손익구조

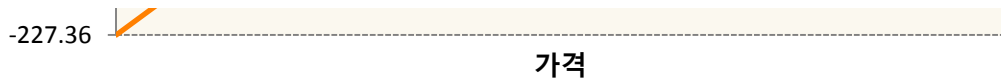
**BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20**



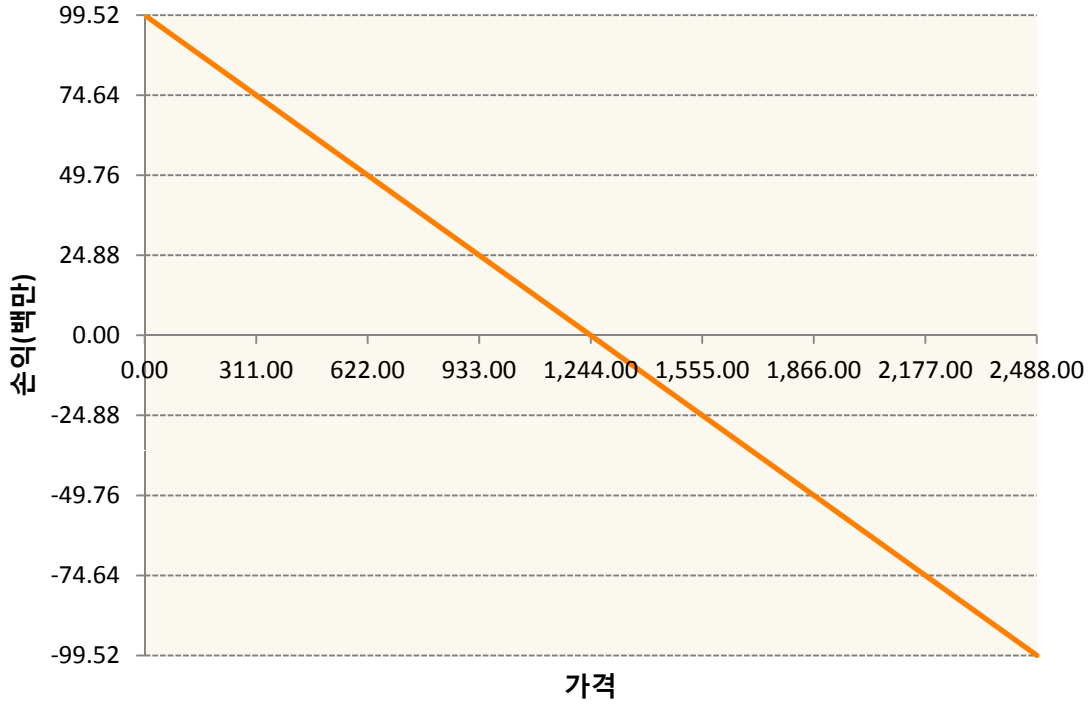
**CK0-CORN FUTURE May20**



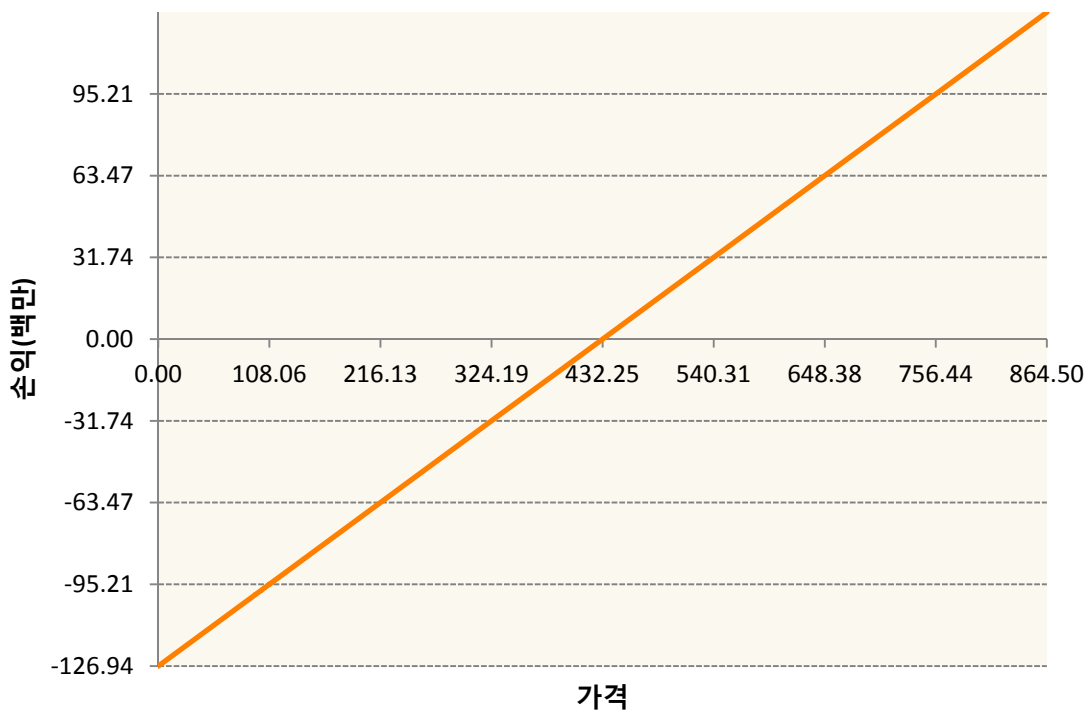




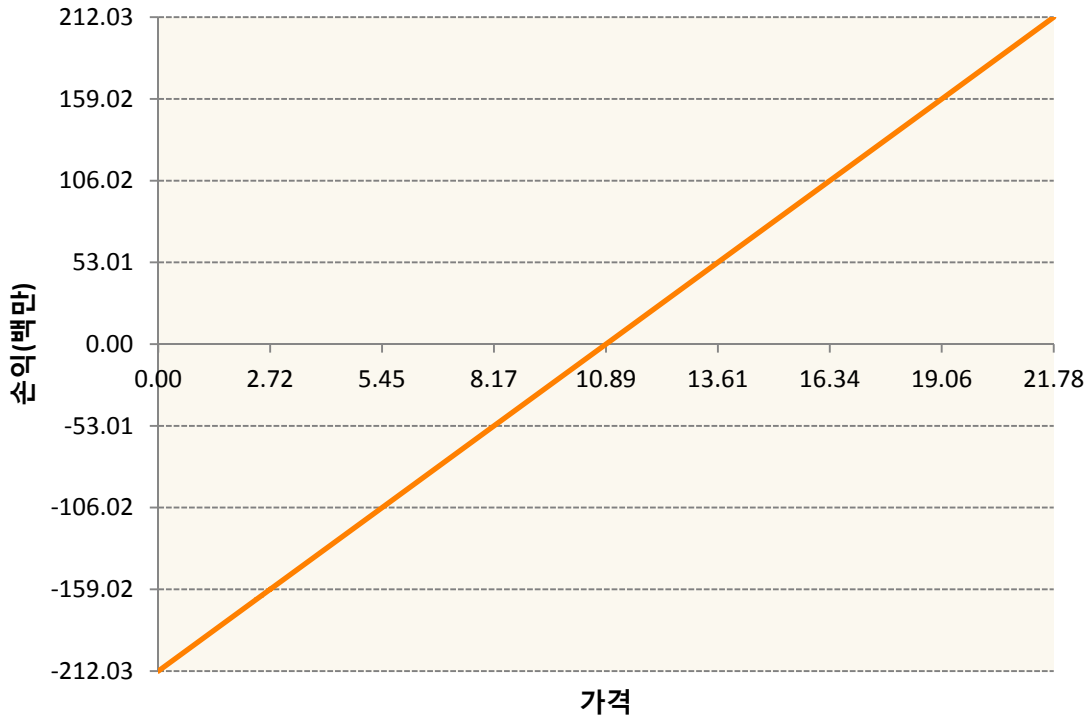
KR4175Q40008-2020-04 달러선물



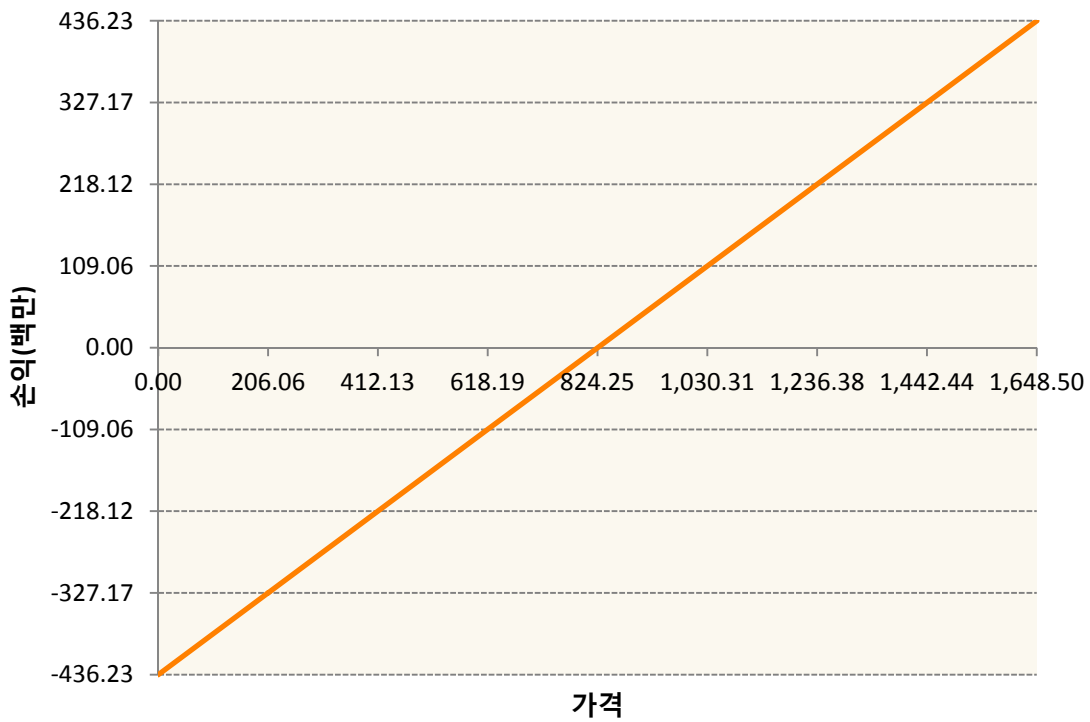
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



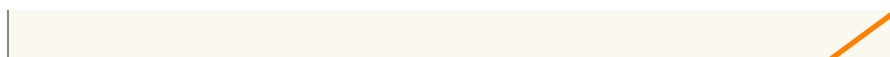
SBK0-Sugar May20

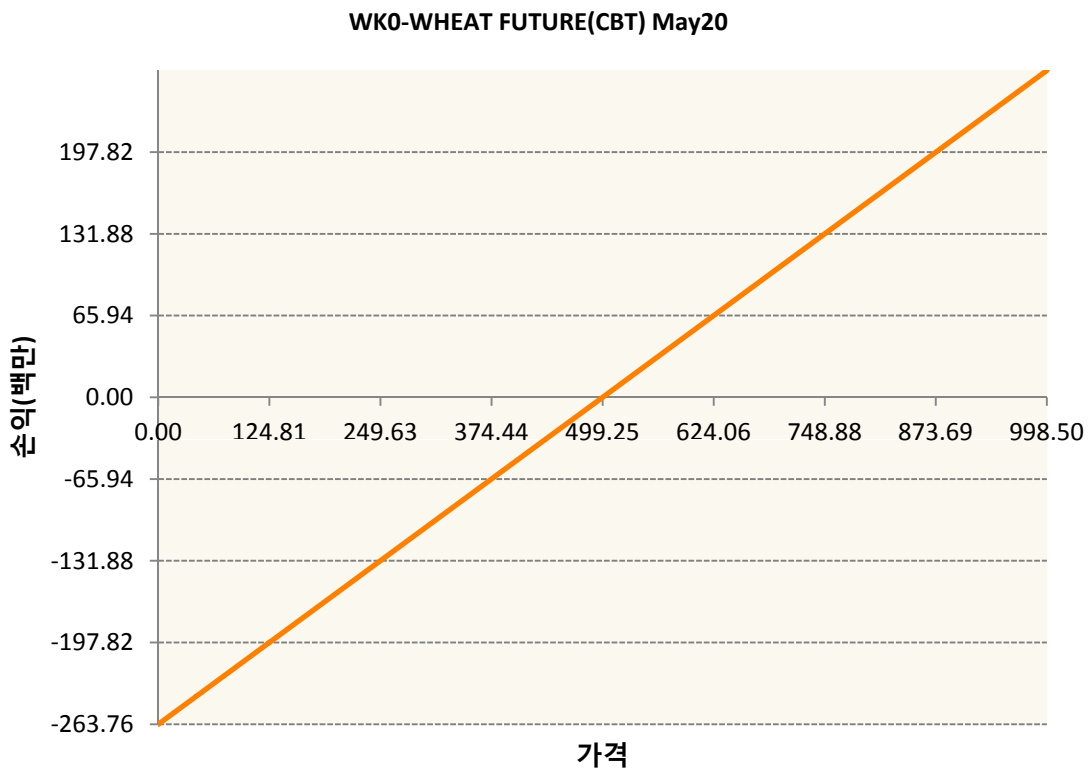
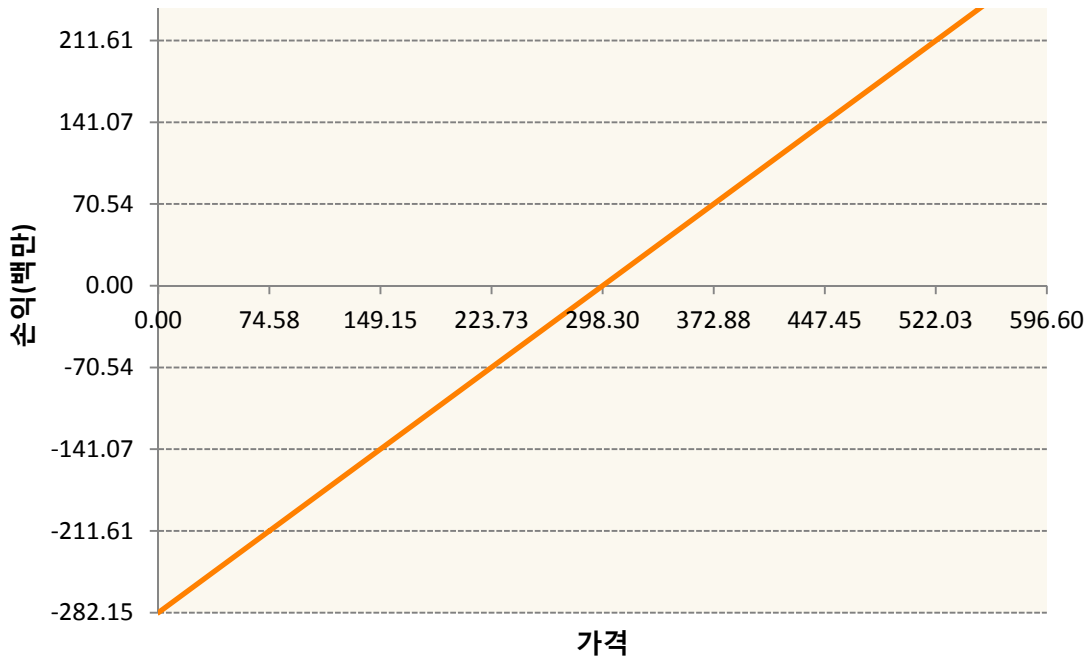


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	16
CK0	CORN FUTURE May20	37
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	23
WK0	WHEAT FUTURE(CBT) May20	21

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

(단위:백만원)

**207**