

공시일	2020-03-20
기준일	2020-03-19

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	2020-03-20
기준일	2020-03-19

스마트인덱스모

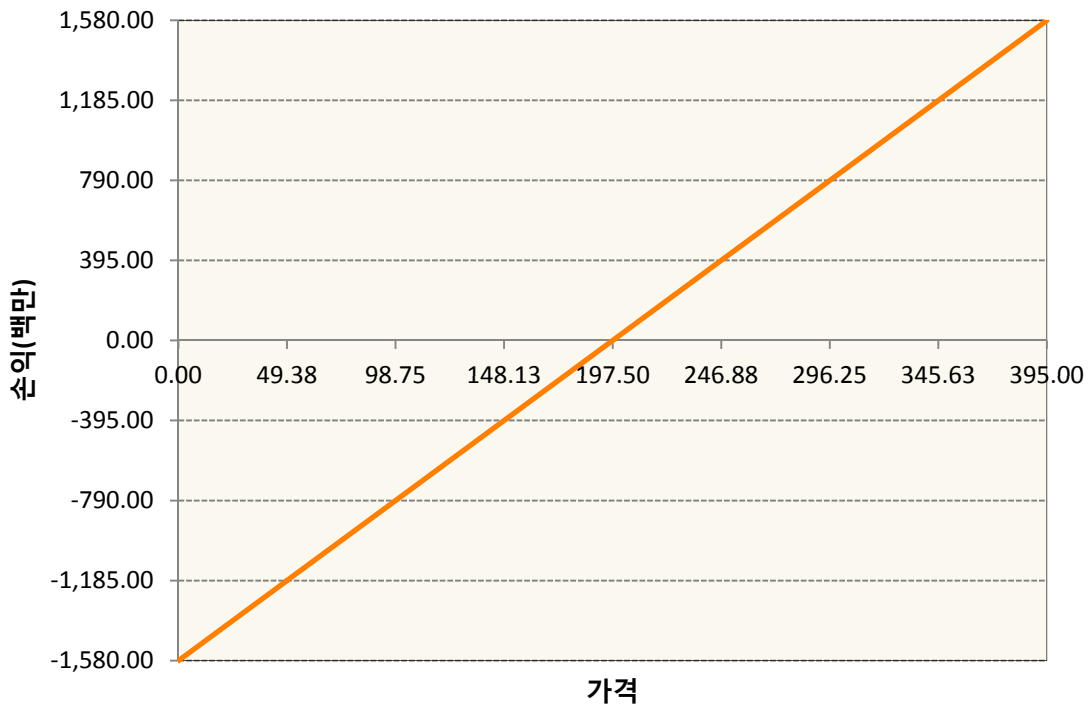
1. 계약금액

(단위:백만원)

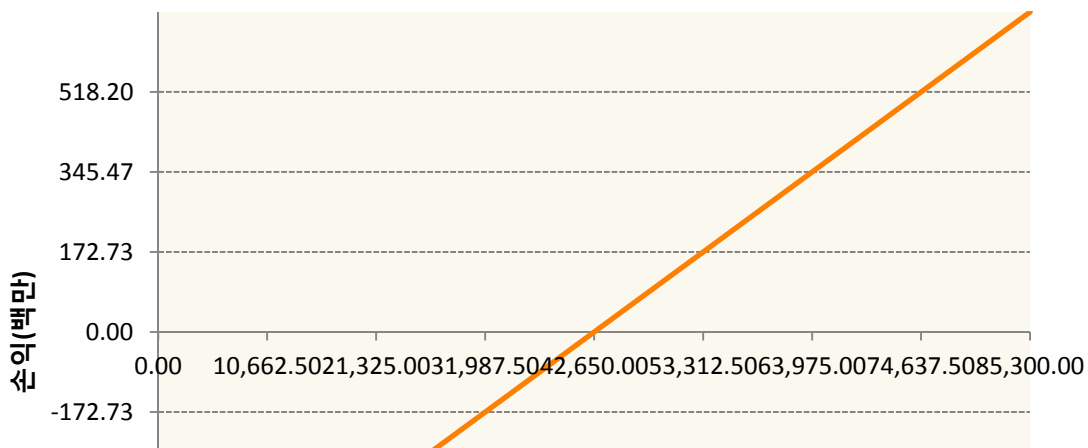
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	354	248	105	장내
누계	유가증권	선물	2,271	0	2,271	장내

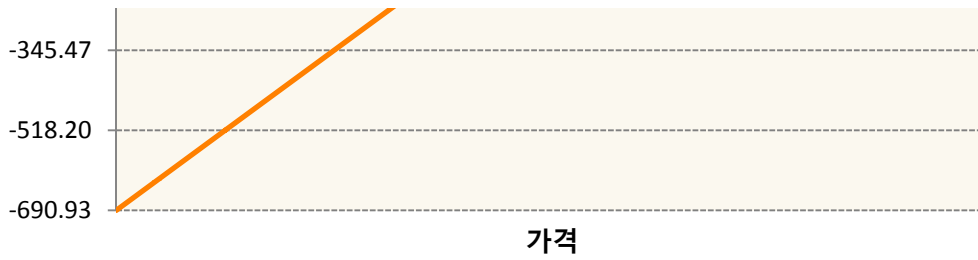
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



KR4111Q40003-2020-04 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						128
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128	
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85	
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	43	43	43	43	43	43	43	
5.33%	85	85	85	85	85	85	85	
8.00%	128	128	128	128	128	128	128	
KR4111Q40003		2020-04 삼성전자개별선물						56
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56	
-5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37	
-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%	37	37	37	37	37	37	37	
8.00%	56	56	56	56	56	56	56	

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

215

공시일	2020-03-20
기준일	2020-03-19

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

792

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

801

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-20
기준일	2020-03-19

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

534

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

833

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-20
기준일	2020-03-19

유로인덱스모(주식-파생형)

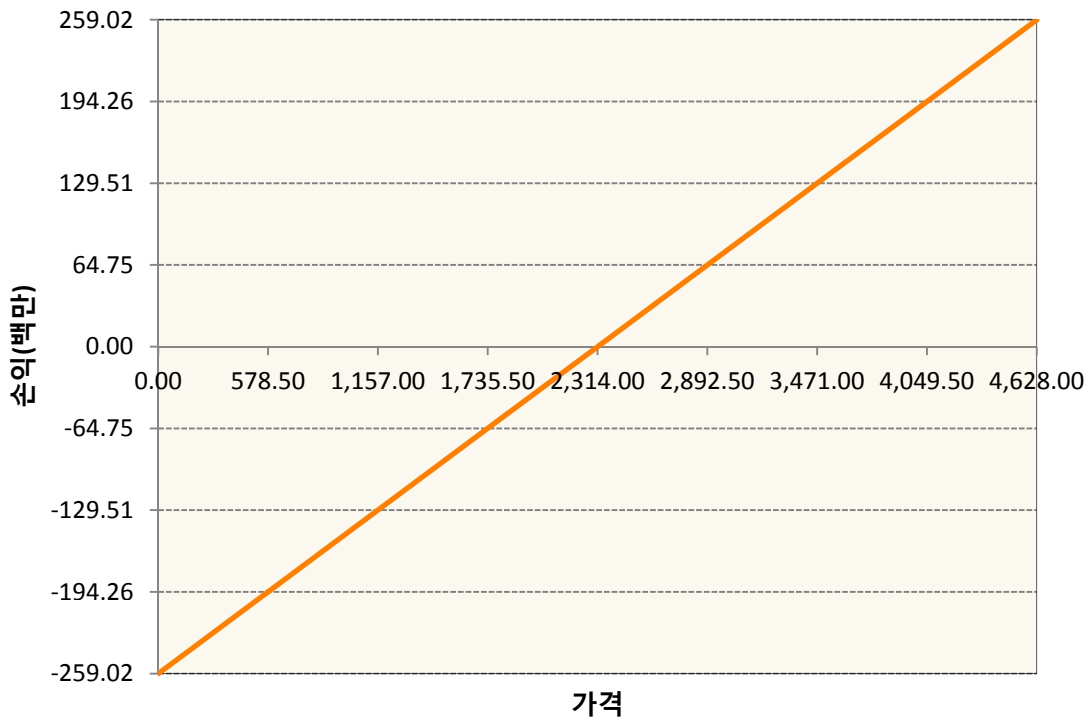
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	259	0	259	

2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	21
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

21

공시일	2020-03-20
기준일	2020-03-19

차이나인덱스모(주식-파생형)

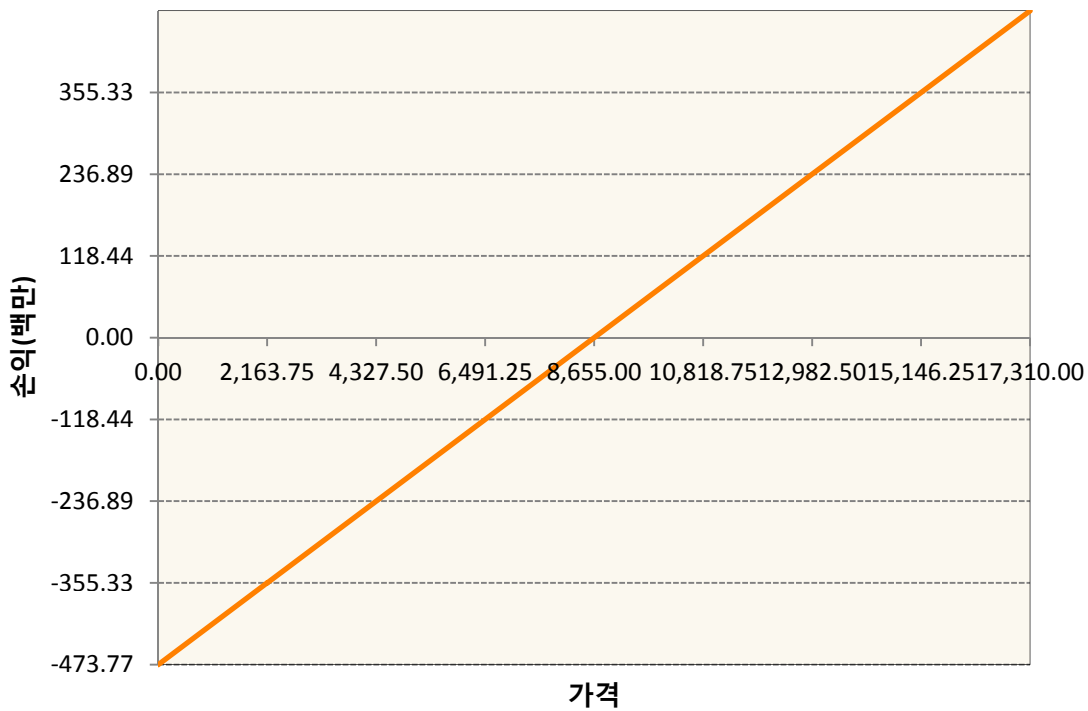
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	474	0	474	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH0	HSCEI Futures Mar20	38
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

37

공시일	2020-03-20
기준일	2020-03-19

커버드콜모(주식혼합-파생형)

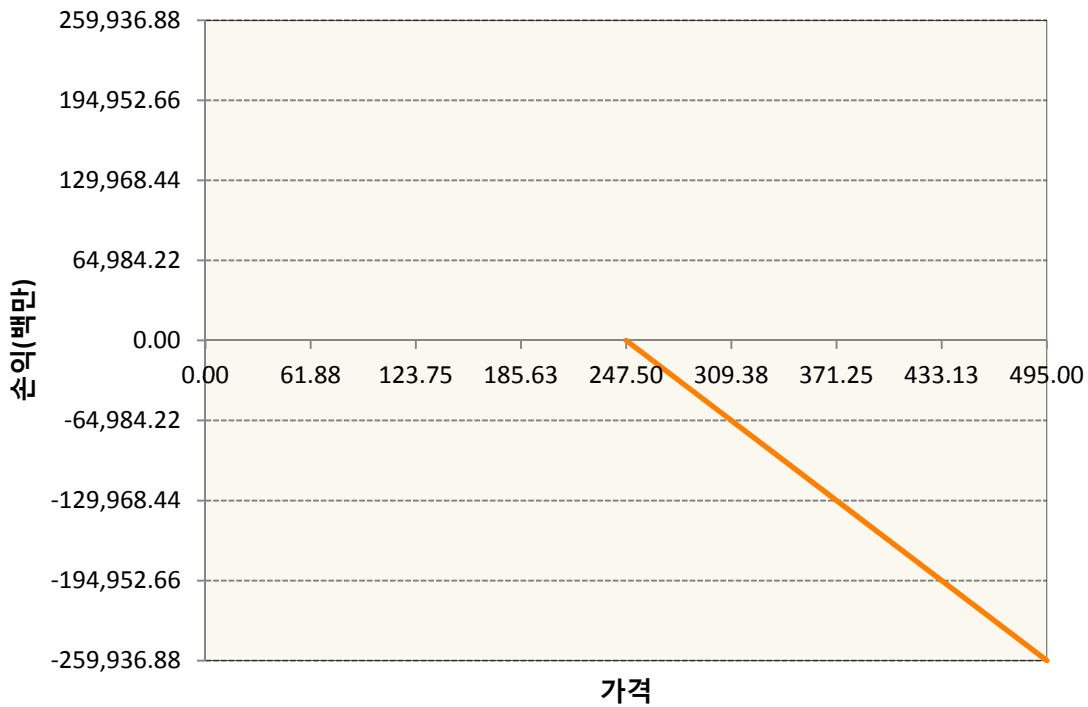
1. 계약금액

(단위:백만원)

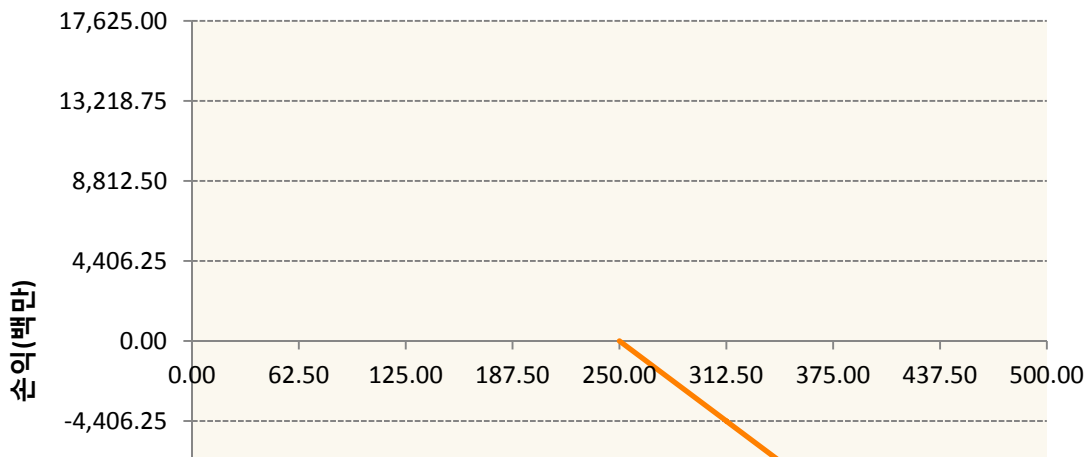
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	367,281	-367,281	장내

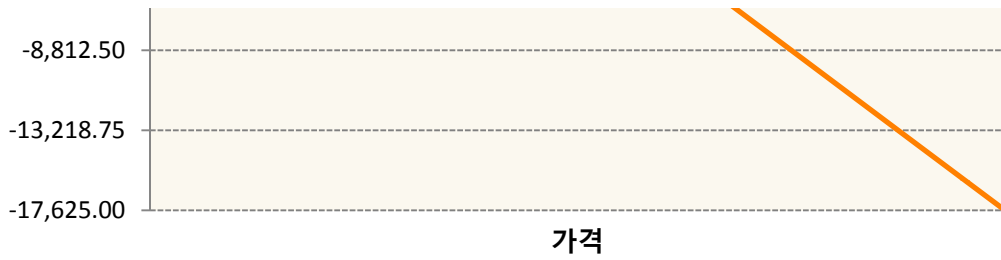
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

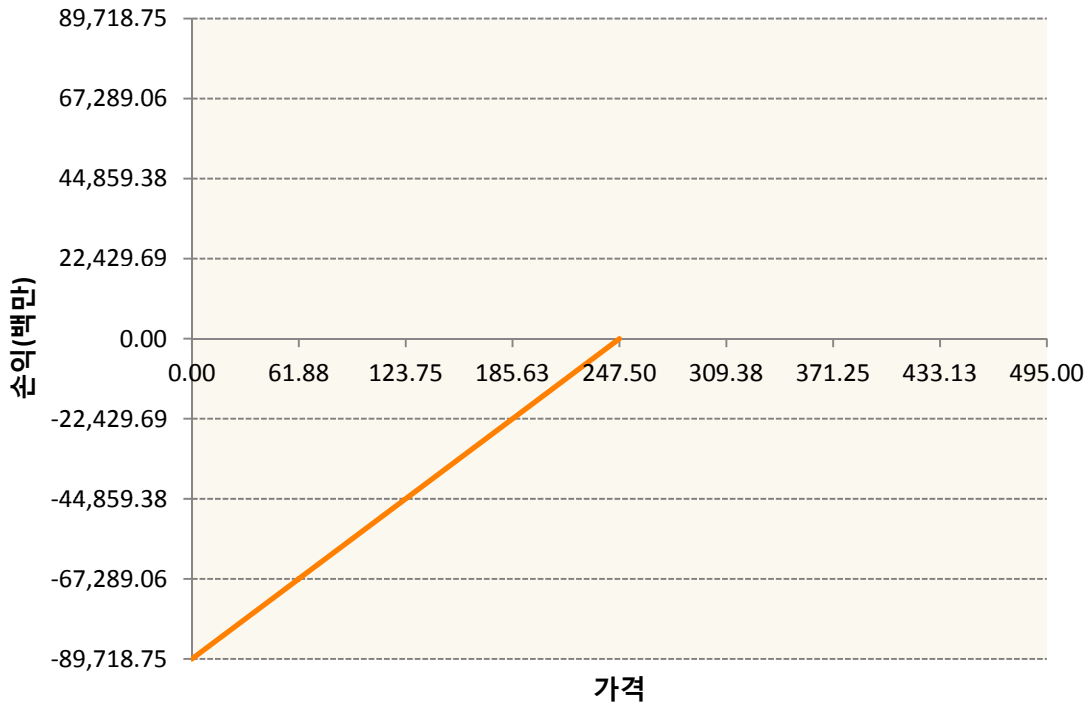


KR4201Q42503-2020-04 콜250





KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q42479		2020-04 콜247.5					5,012	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,231	1,177	1,083	941	746	495	188	
-5.33%	1,188	1,093	944	734	462	127	-267	
-2.67%	1,107	950	726	430	65	-366	-858	
0%	961	721	399	0	-472	-1,010	-1,608	
2.67%	719	369	-69	-587	-1,177	-1,829	-2,537	
5.33%	338	-145	-716	-1,364	-2,077	-2,848	-3,666	
8.00%	-232	-865	-1,579	-2,361	-3,200	-4,087	-5,012	
KR4201Q42503		2020-04 콜250					313	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	72	69	64	55	44	28	9	

-5.33%	70	64	56	43	27	6	-18
-2.67%	65	56	43	25	3	-24	-54
0%	57	43	24	0	-29	-63	-101
2.67%	44	23	-3	-35	-72	-113	-158
5.33%	22	-7	-42	-82	-127	-176	-229
8.00%	-10	-49	-94	-143	-196	-253	-313
KR4301Q42477 2020-04 풋247.5							5,726
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,726	-4,812	-4,930	-5,081	-5,263	-5,474	-5,712
-5.33%	-2,868	-2,989	-3,145	-3,336	-3,559	-3,810	-4,087
-2.67%	-1,043	-1,205	-1,405	-1,640	-1,906	-2,199	-2,516
0%	740	531	282	0	-311	-647	-1,004
2.67%	2,471	2,208	1,908	1,578	1,221	843	447
5.33%	4,136	3,817	3,465	3,086	2,686	2,267	1,833
8.00%	5,726	5,350	4,946	4,521	4,078	3,621	3,152

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

(단위:백만원)

7,502

공시일	2020-03-20
기준일	2020-03-19

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

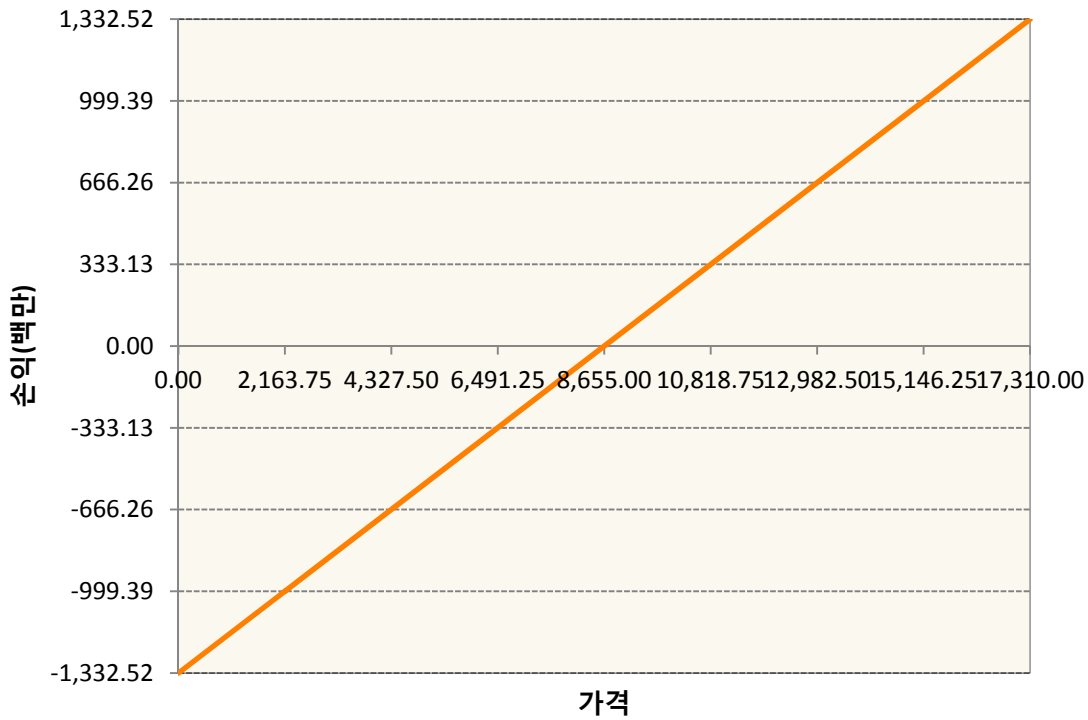
1. 계약금액

(단위:백만원)

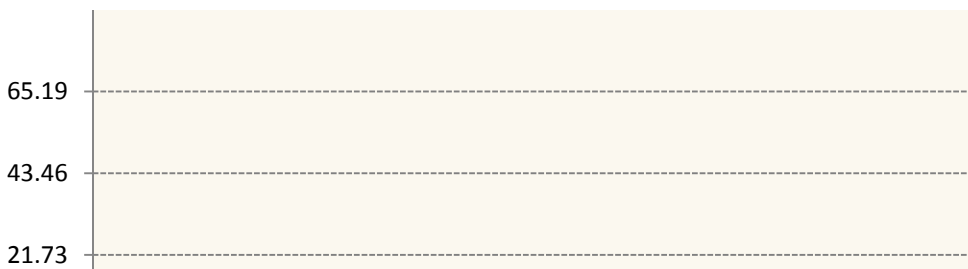
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,333	0	1,333	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,912	-4,912	장내
누계	통화	선도	729	2,331	-1,603	장외

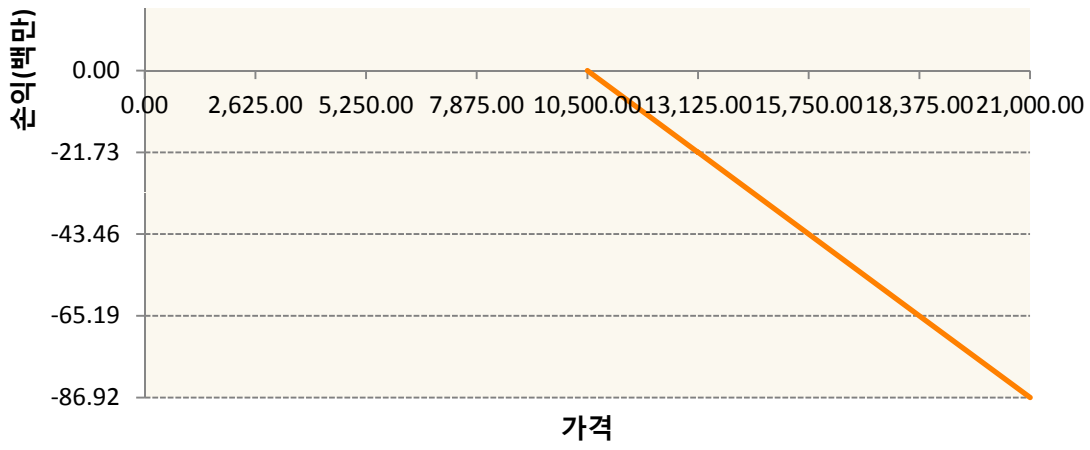
2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20

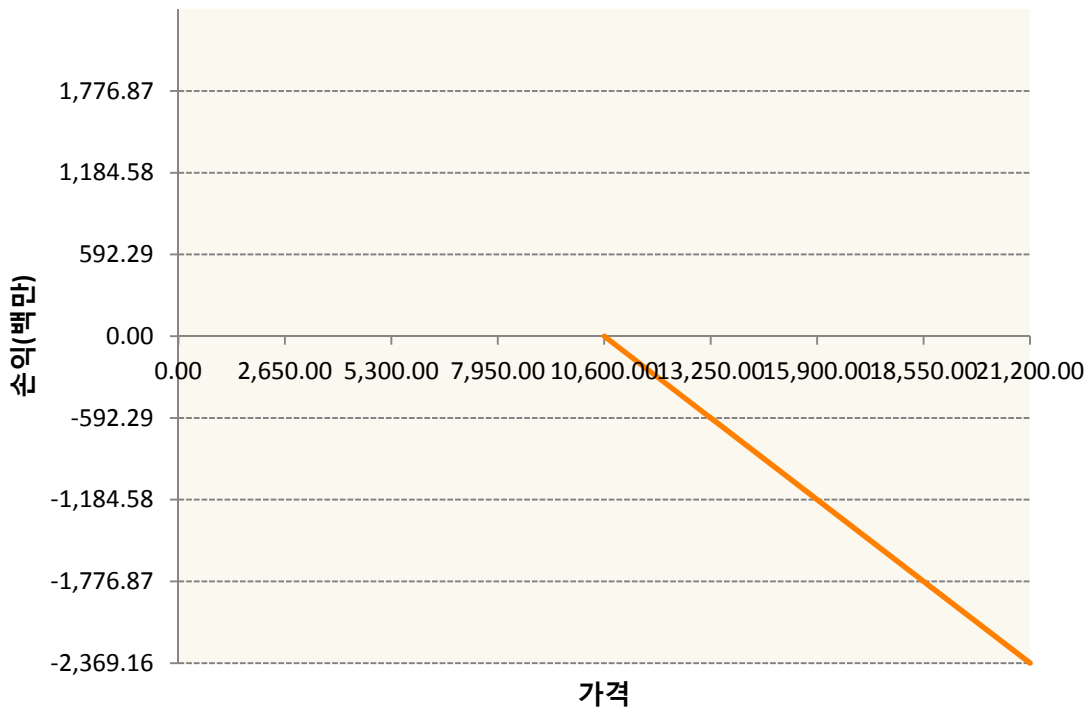


OHHIH0-C105-HSCEI

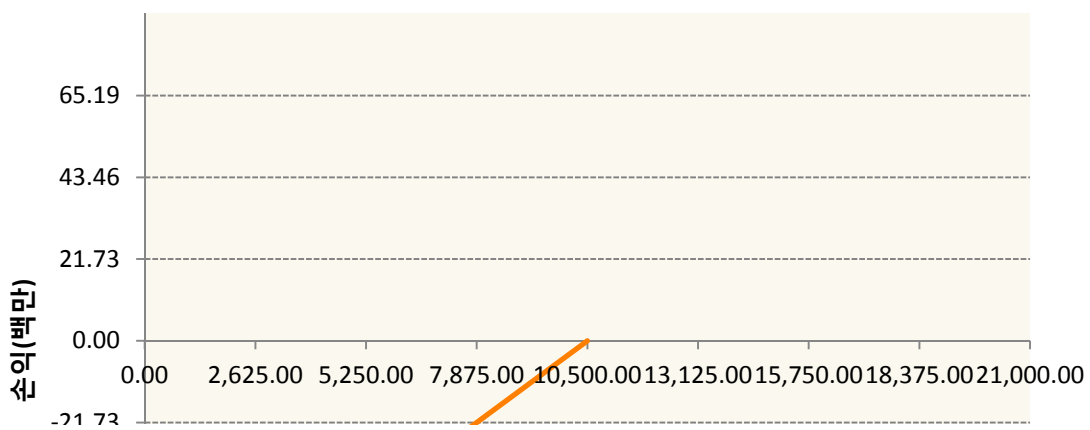


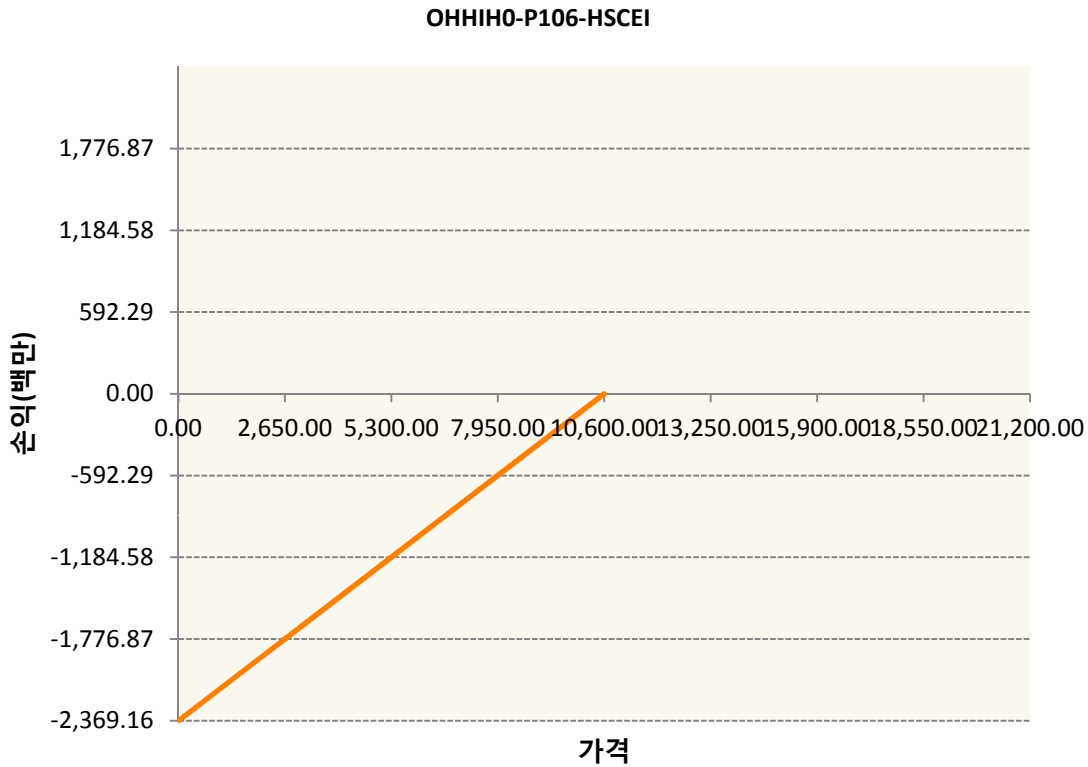
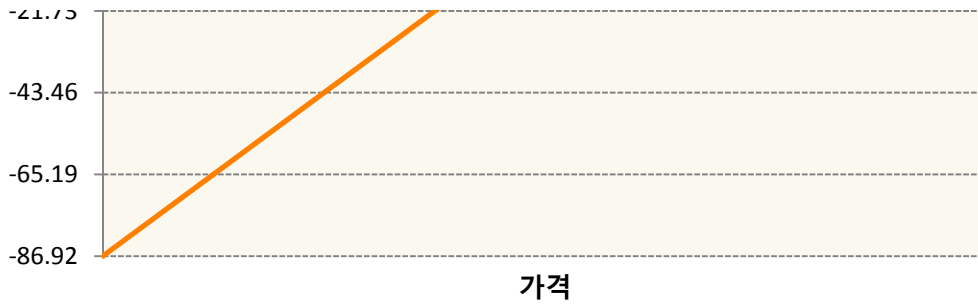


OHHIH0-C106-HSCEI



OHHIH0-P105-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E		186
FX21020H05 HKD/KRW 22-05-20E		58
HCH0 HSCEI Futures Mar20		107
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)
	581

공시일	2020-03-20
기준일	2020-03-19

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

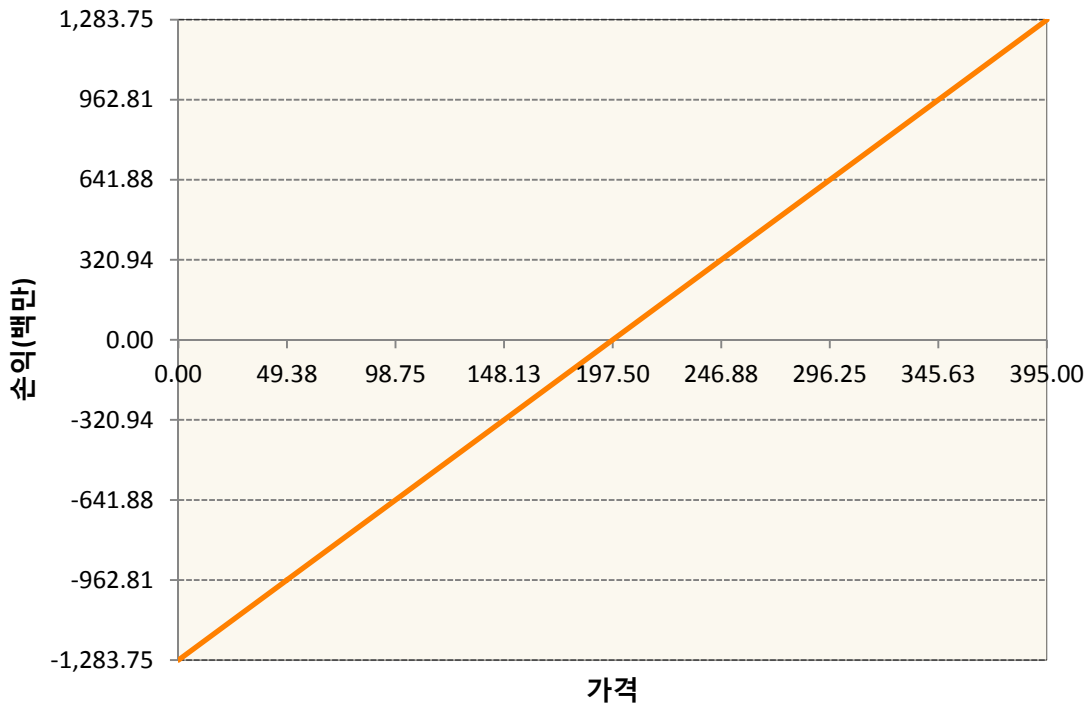
1. 계약금액

(단위:백만원)

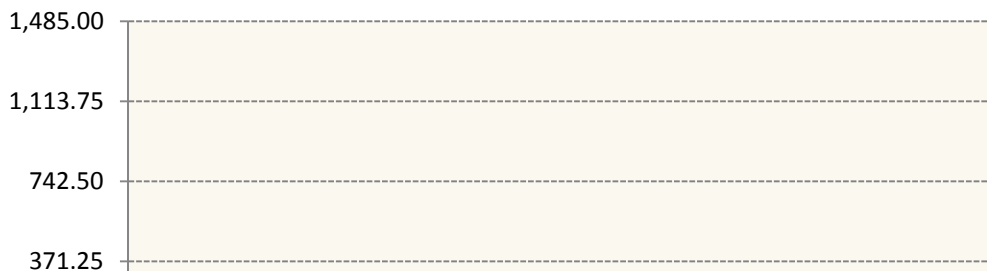
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,284	0	1,284	장내
누계	유가증권	스왑	3,125	0	3,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,095	-3,095	장내

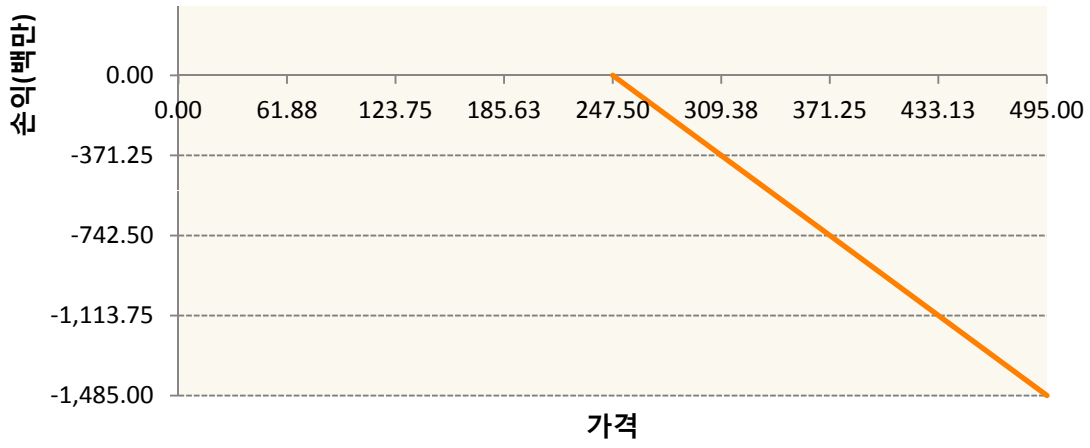
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

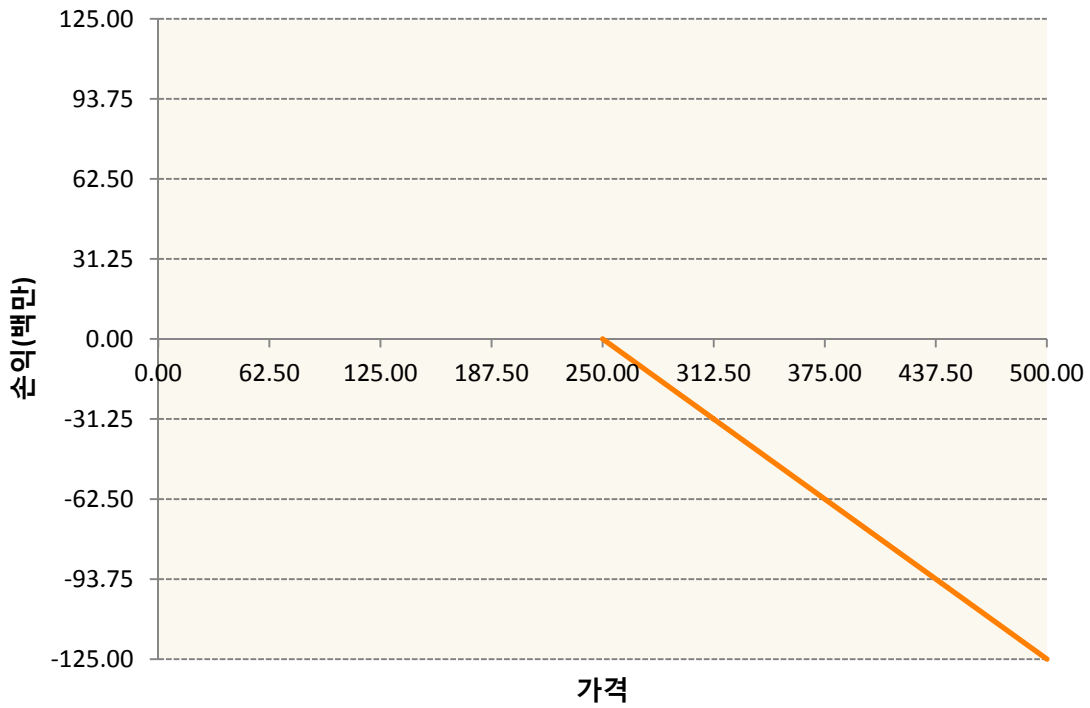


KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

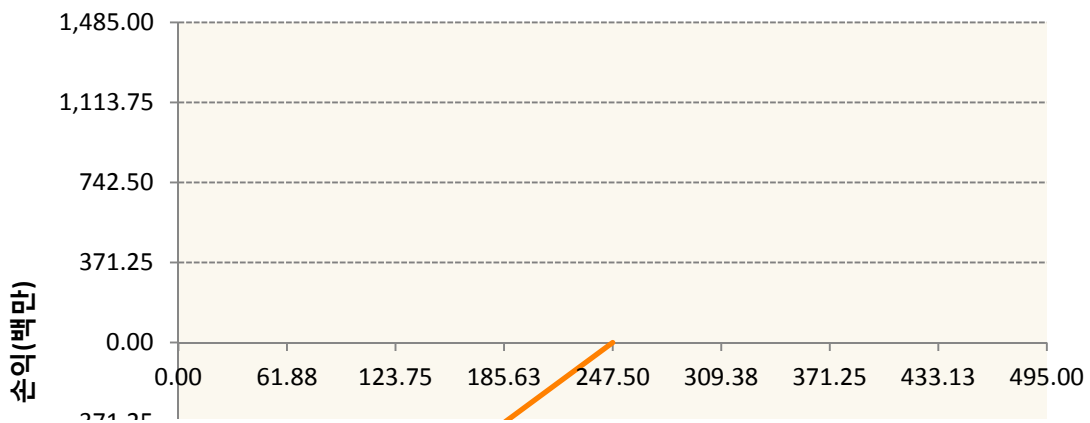




KR4201Q42503-2020-04 콜250



KR4301Q42477-2020-04 풋247.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						274
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-274	-274	-274	-274	-274	-274	-274	
-5.33%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183	
-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%	183	183	183	183	183	183	183	
8.00%	274	274	274	274	274	274	274	
KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						104
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104	
-5.33%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69	
-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%	69	69	69	69	69	69	69	
8.00%	104	104	104	104	104	104	104	
KR4201Q42479		2020-04 콜247.5						29
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	7	7	6	5	4	3	1	
-5.33%	7	6	5	4	3	1	-2	
-2.67%	6	5	4	2	0	-2	-5	
0%	5	4	2	0	-3	-6	-9	
2.67%	4	2	0	-3	-7	-10	-14	
5.33%	2	-1	-4	-8	-12	-16	-21	
8.00%	-1	-5	-9	-13	-18	-23	-29	
KR4201Q42503		2020-04 콜250						2
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	1	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	0	-1	-1	-1
5.33%	0	0	0	-1	-1	-1	-2
8.00%	0	0	-1	-1	-1	-2	-2
KR4301Q42477 2020-04 풋247.5							95
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-78	-80	-82	-84	-87	-91	-95
-5.33%	-47	-49	-52	-55	-59	-63	-68
-2.67%	-17	-20	-23	-27	-32	-36	-42
0%	12	9	5	0	-5	-11	-17
2.67%	41	37	32	26	20	14	7
5.33%	68	63	57	51	44	38	30
8.00%	95	89	82	75	67	60	52

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

(단위:백만원)

491

공시일	2020-03-20
기준일	2020-03-19

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

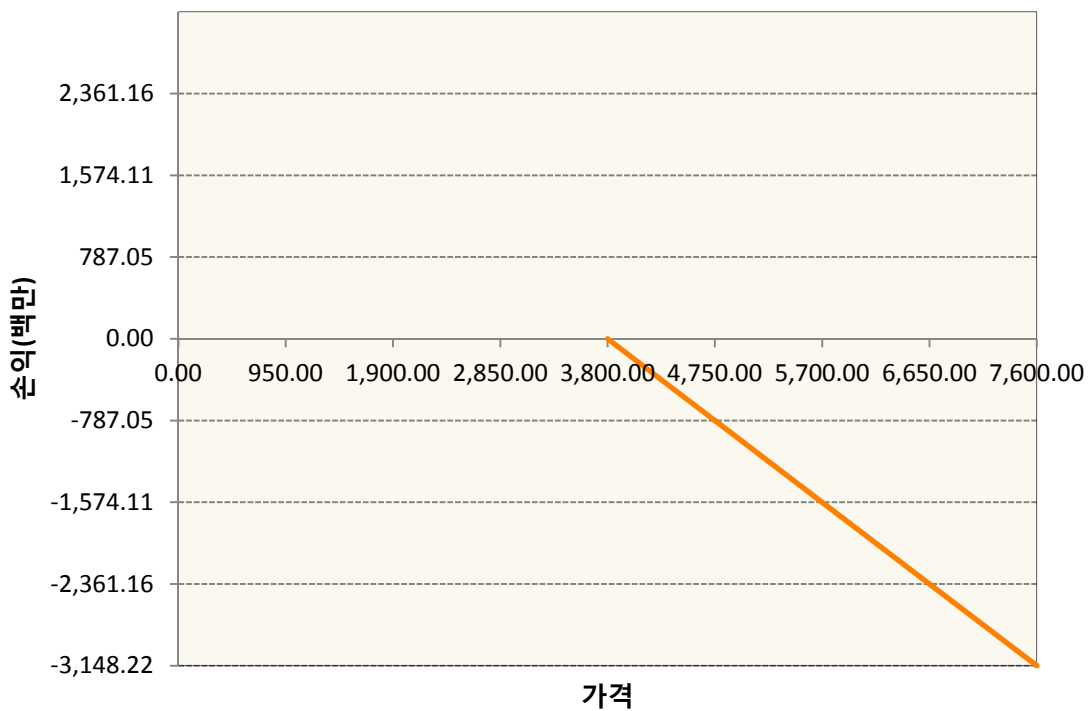
1. 계약금액

(단위:백만원)

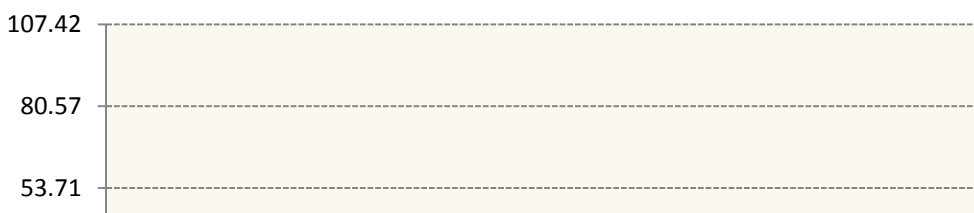
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	379	0	379	
누계	유가증권	스왑	7,976	0	7,976	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,511	-6,511	장내
누계	통화	선도	562	3,685	-3,123	장외

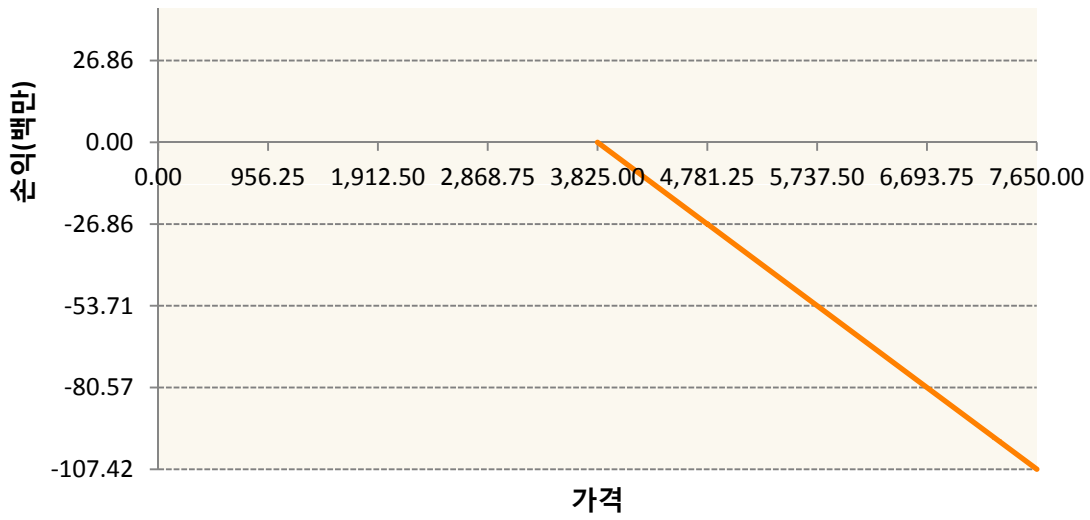
2. 만기시점의 손익구조

OESXH0-C3800-EURO STOXX 50

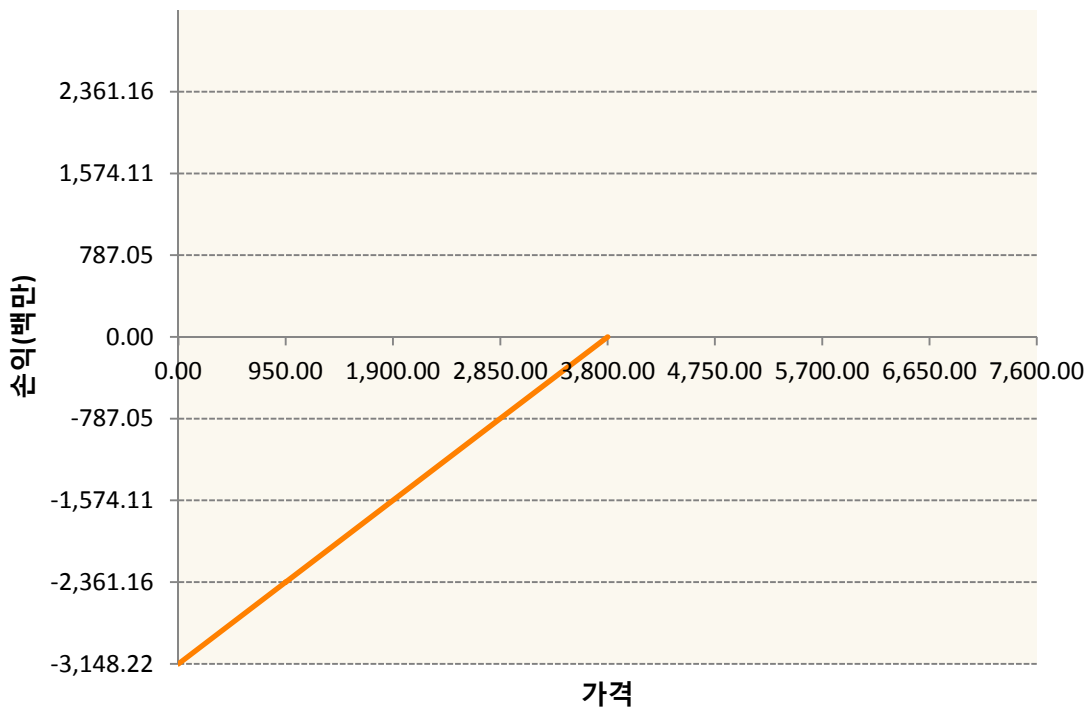


OESXH0-C3825-EURO STOXX 50

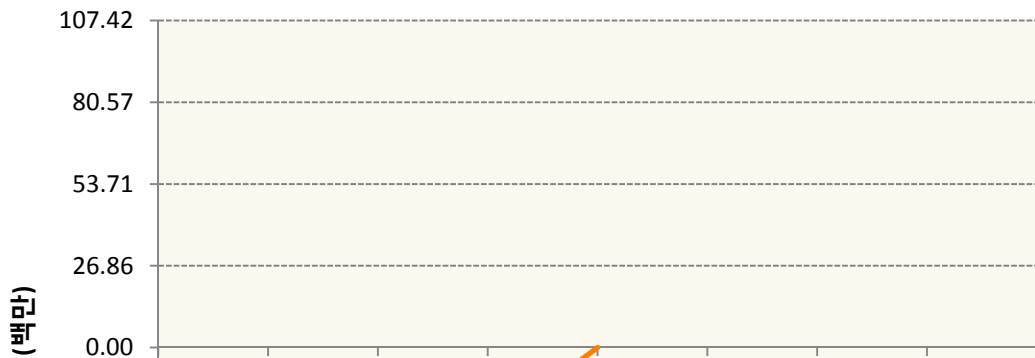


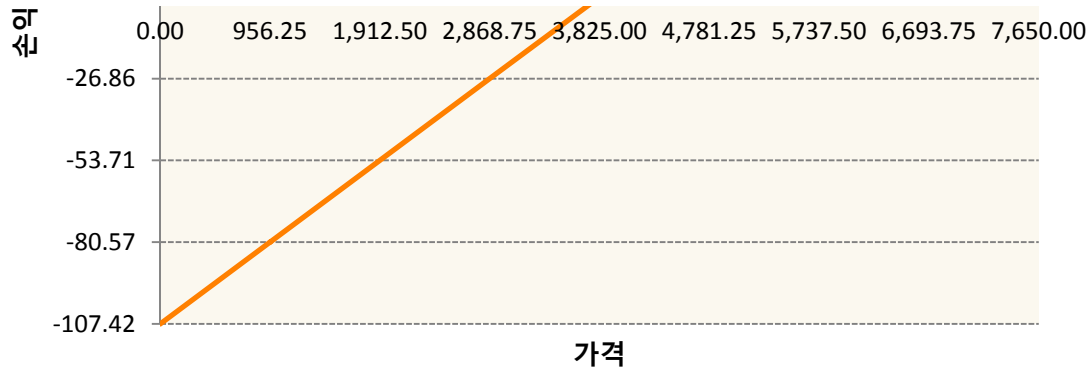


OESXH0-P3800-EURO STOXX 50

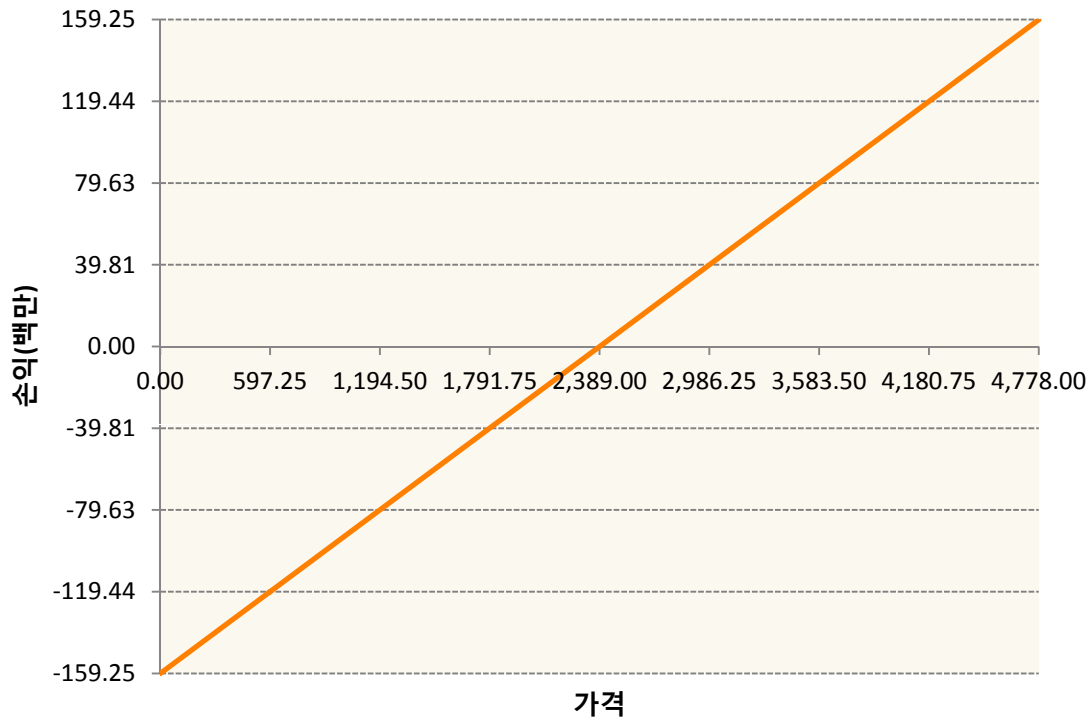


OESXH0-P3825-EURO STOXX 50

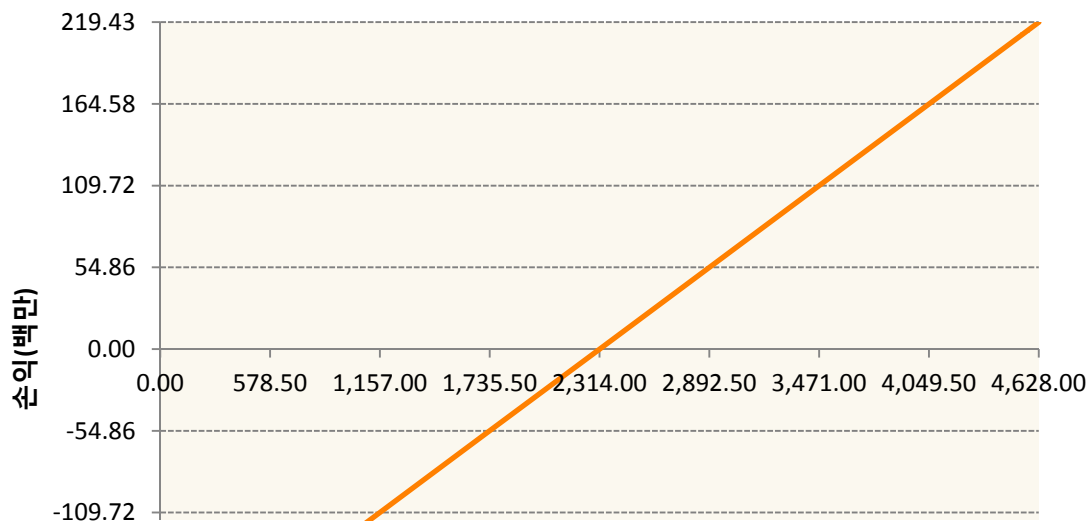


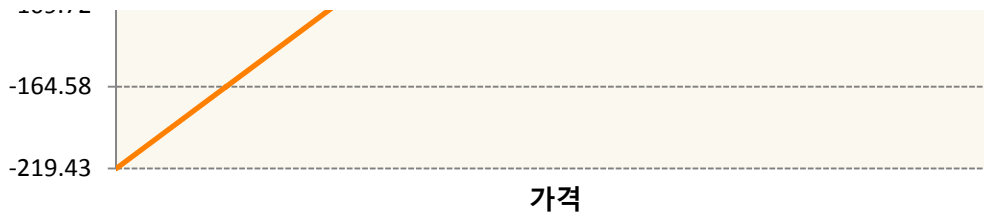


VGHO-EURO STOXX 50 Mar20



VGM0-EURO STOXX 50 Jun20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	48
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	295
FX21020H00 EUR/KRW 27-03-20E	45
OESXH0-C3€ EURO STOXX 50	252
OESXH0-C3€ EURO STOXX 50	9
OESXH0-P3€ EURO STOXX 50	252
OESXH0-P3€ EURO STOXX 50	9
VGH0 EURO STOXX 50 Mar20	13
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20	18

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

858

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

(단위:백만원)

685

공시일	2020-03-20
기준일	2020-03-19

ETF스마트레버리지목표전환형9호

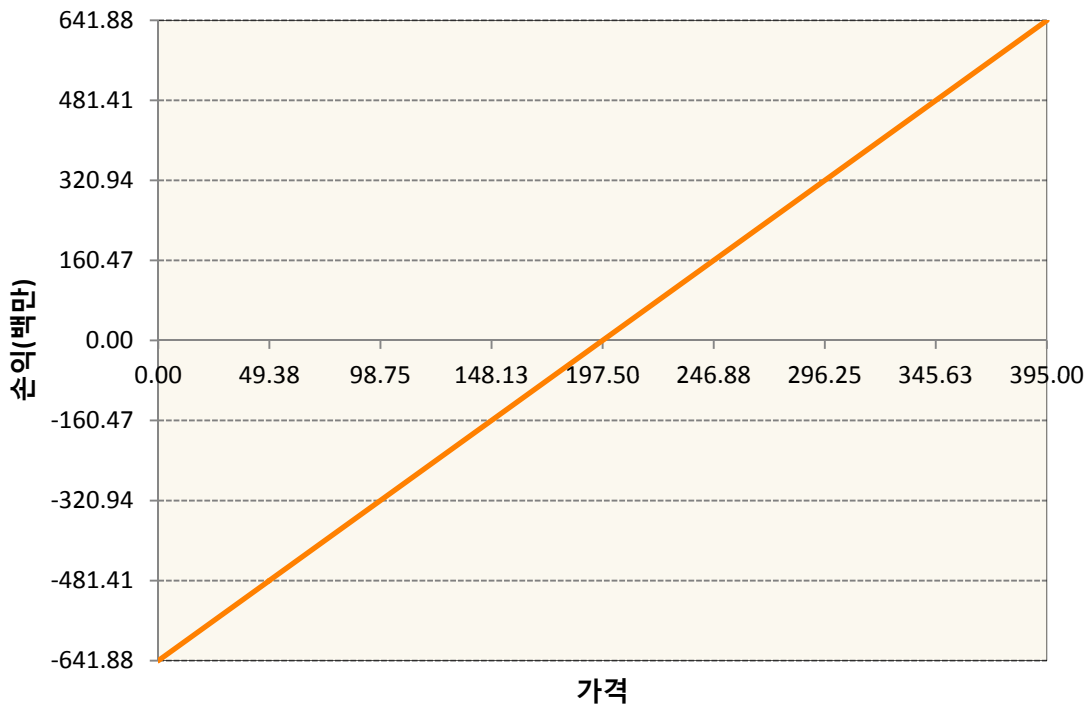
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	201	-201	장내
누계	유가증권	선물	642	0	642	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						52
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52	
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
-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%	35	35	35	35	35	35	35	
8.00%	52	52	52	52	52	52	52	

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

(단위:백만원)

59

공시일	2020-03-20
기준일	2020-03-19

ETF스마트레버리지목표전환형10호

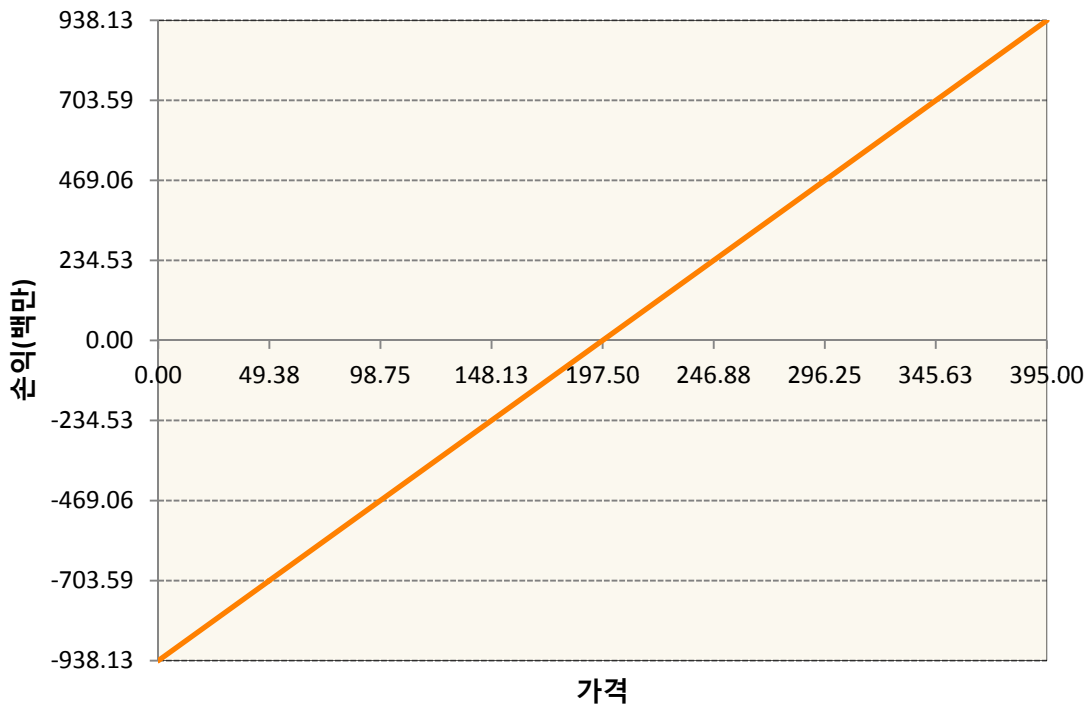
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	300	-300	장내
누계	유가증권	선물	938	0	938	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						76
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76	
-5.33%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	25	25	25	25	25	25	25	
5.33%	50	50	50	50	50	50	50	
8.00%	76	76	76	76	76	76	76	

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

(단위:백만원)

87

공시일	2020-03-20
기준일	2020-03-19

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

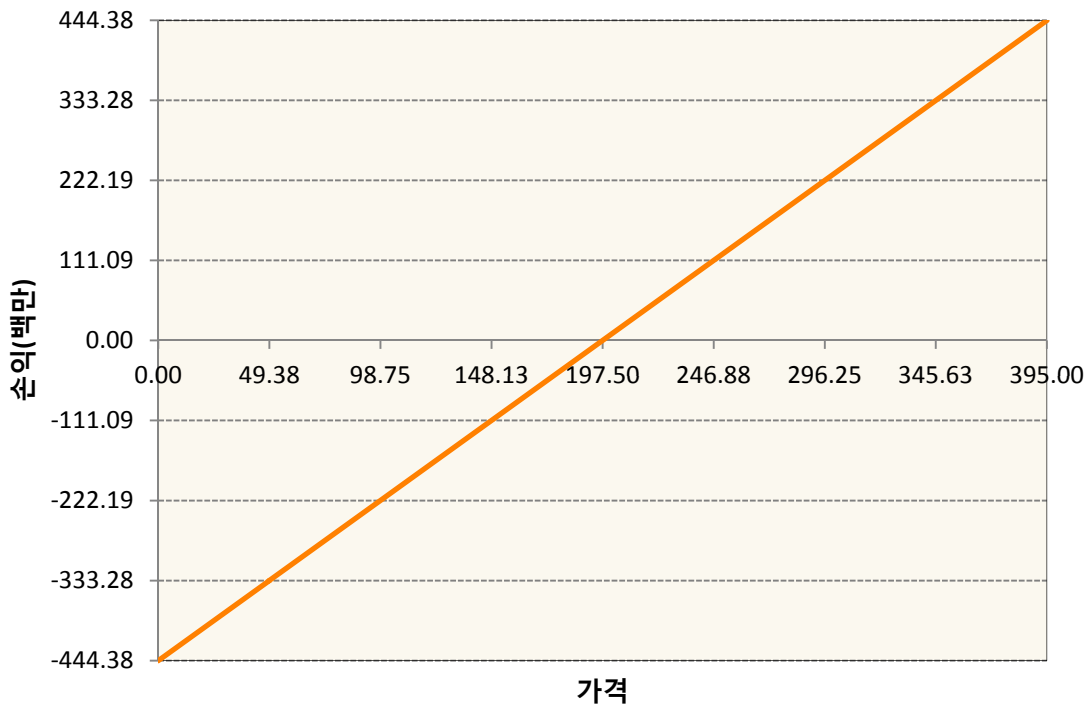
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	444	0	444	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						36
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	
-5.33%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24	
-2.67%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	12	12	12	12	12	12	12	
5.33%	24	24	24	24	24	24	24	
8.00%	36	36	36	36	36	36	36	

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

(단위:백만원)

41

공시일	2020-03-20
기준일	2020-03-19

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

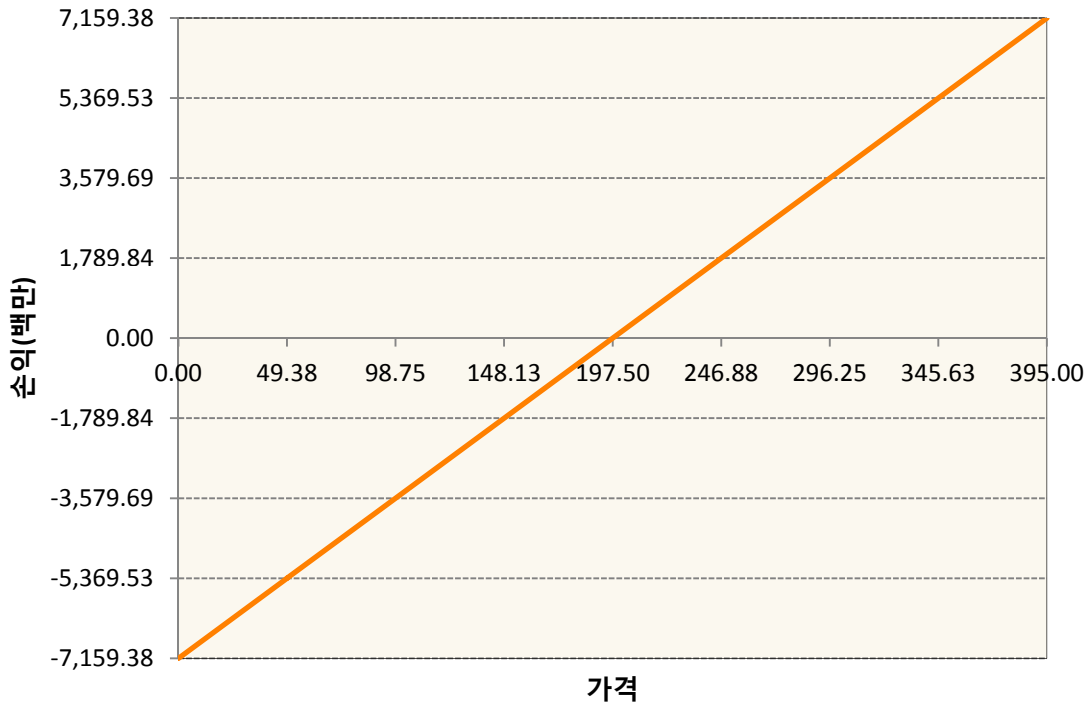
1. 계약금액

(단위:백만원)

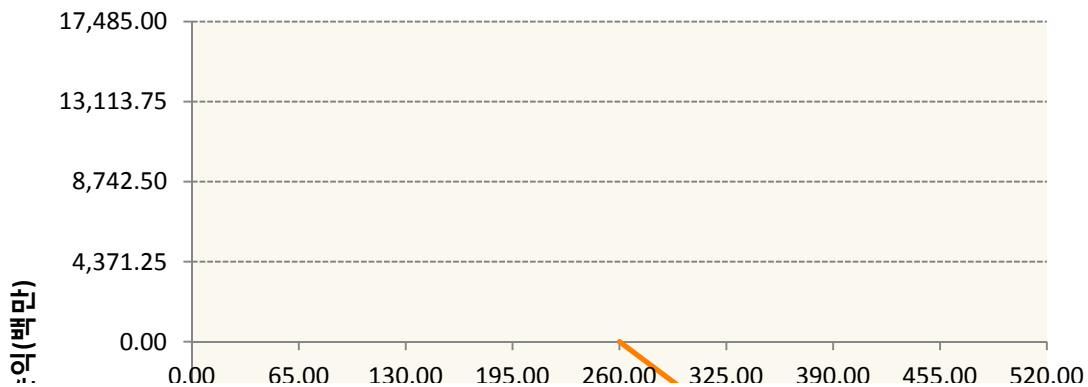
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,159	0	7,159	장내
누계	유가증권	옵션	6,004	17,485	-11,481	장내

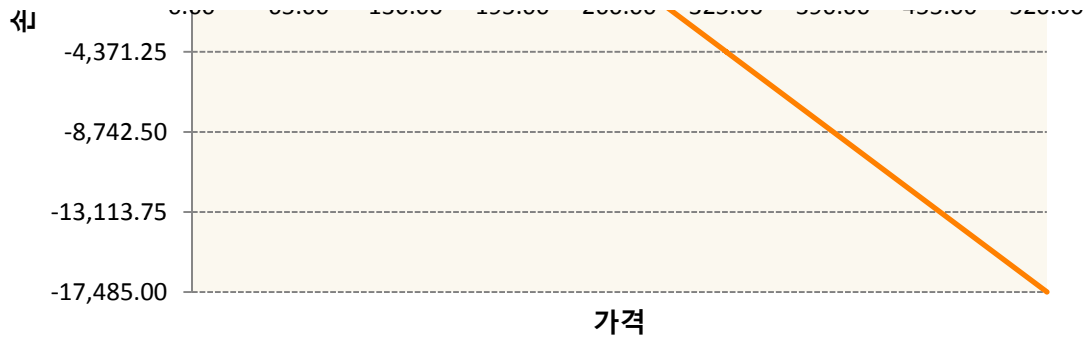
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

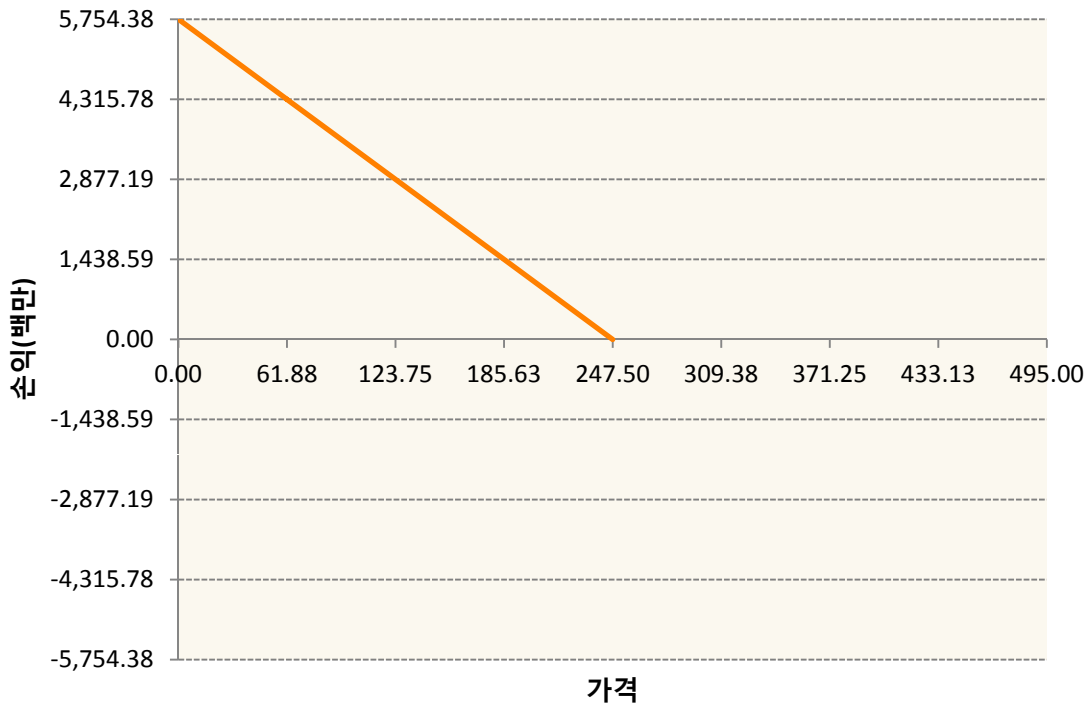


KR4201Q42602-2020-04 콜260

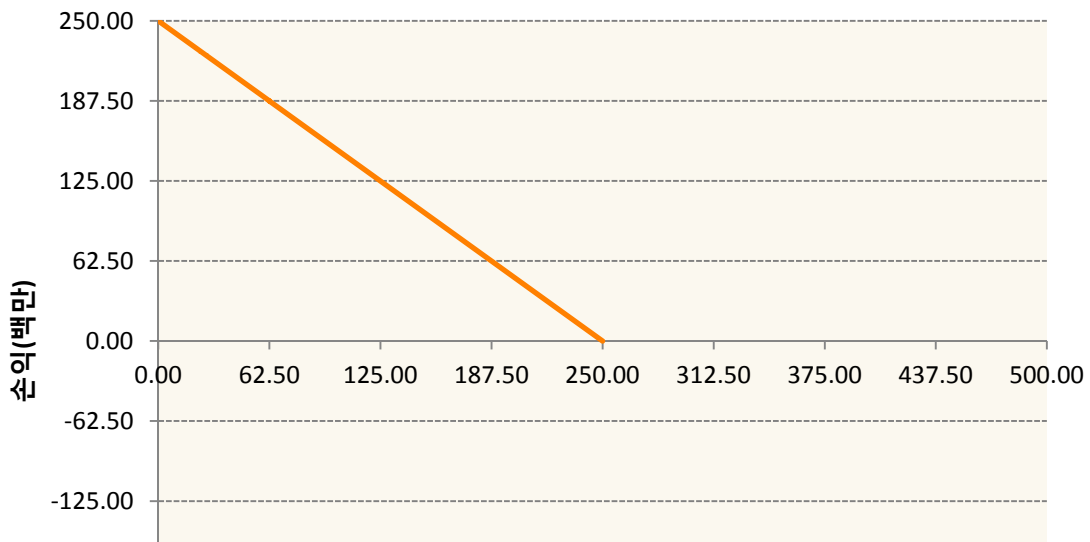


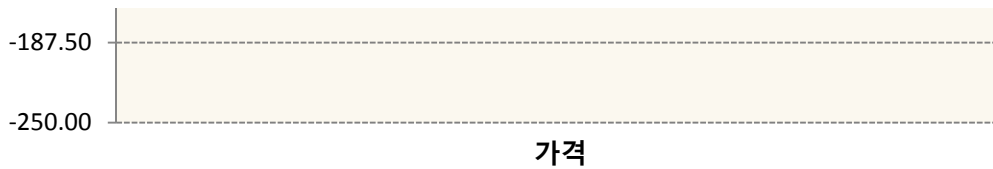


KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



KR4301Q42501-2020-04 풋250





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						578
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-578	-578	-578	-578	-578	-578	-578	
-5.33%	-385	-385	-385	-385	-385	-385	-385	
-2.67%	-193	-193	-193	-193	-193	-193	-193	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	193	193	193	193	193	193	193	
5.33%	385	385	385	385	385	385	385	
8.00%	578	578	578	578	578	578	578	
KR4201Q42602		2020-04 콜260						220
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	39	38	35	31	24	14	1	
-5.33%	38	36	31	24	14	1	-16	
-2.67%	36	32	25	14	0	-18	-40	
0%	33	26	15	0	-19	-43	-71	
2.67%	27	16	0	-21	-46	-76	-110	
5.33%	17	1	-22	-49	-82	-119	-160	
8.00%	1	-23	-53	-88	-128	-172	-220	
KR4301Q42477		2020-04 풋247.5						367
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	303	309	316	326	338	351	366	
-5.33%	184	192	202	214	228	244	262	
-2.67%	67	77	90	105	122	141	161	
0%	-47	-34	-18	0	20	41	64	
2.67%	-158	-142	-122	-101	-78	-54	-29	
5.33%	-265	-245	-222	-198	-172	-145	-118	
8.00%	-367	-343	-317	-290	-262	-232	-202	
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	15	16	
-5.33%	8	8	9	9	10	11	11	
-2.67%	3	3	4	5	5	6	7	

0%	-2	-1	-1	0	1	2	3
2.67%	-7	-6	-5	-4	-3	-2	-1
5.33%	-11	-11	-10	-9	-8	-6	-5
8.00%	-16	-15	-14	-13	-12	-10	-9

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

(단위:백만원)

1,067

공시일	2020-03-20
기준일	2020-03-19

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	196,621	0	196,621	

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	2020-03-20
기준일	2020-03-19

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	104,252	0	104,252	

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	2020-03-20
기준일	2020-03-19

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	494,022	0	494,022	
누계	통화	선도	84,856	529,580	-444,724	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,656
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,543
FX21020F03 KRW/USD 31-03-20E	3,291
FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E	3,086
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,777
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,538
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	2,057
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	4,114
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,407
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,057
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	206
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	5,246
FX21020G06 USD/KRW 31-03-20E	514
FX21020H00 USD/KRW 31-03-20E	1,029
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,571
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,139
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,139
FX21020H04 USD/KRW 21-04-20E	1,543
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,510
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	1,029
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	1,029
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,674
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)

117

공시일	2020-03-20
기준일	2020-03-19

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

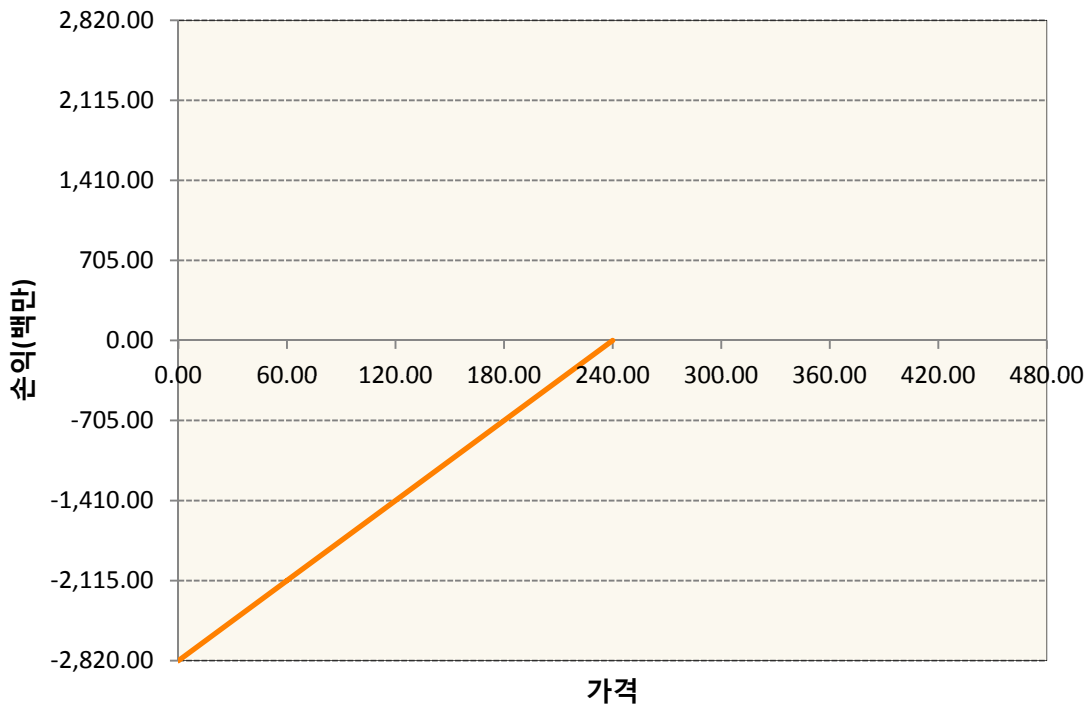
1. 계약금액

(단위:백만원)

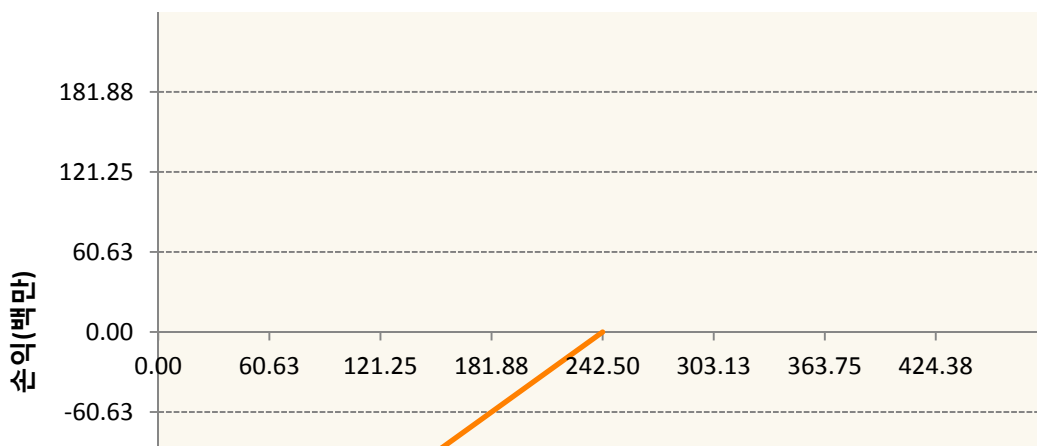
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,063	-3,063	장내

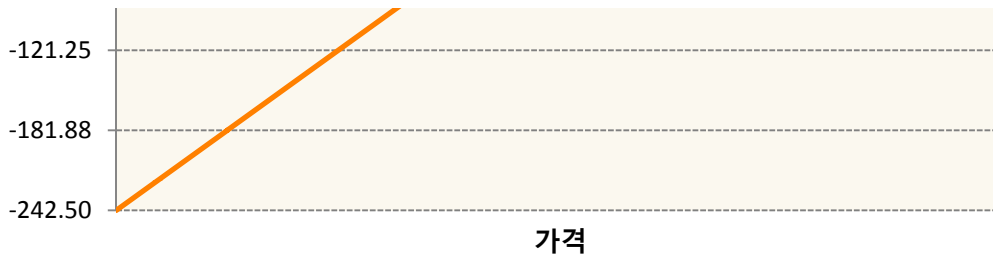
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q42402-2020-04 풋240



KR4301Q42428-2020-04 풋242.5





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q42402		2020-04 풋240						182
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-144	-147	-152	-159	-166	-174	-182	
-5.33%	-84	-90	-96	-104	-112	-122	-132	
-2.67%	-27	-34	-42	-51	-61	-72	-83	
0%	29	20	11	0	-11	-24	-36	
2.67%	82	72	61	48	36	22	8	
5.33%	133	121	108	94	80	66	51	
8.00%	181	167	153	138	122	107	91	
KR4301Q42428		2020-04 풋242.5						16
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-13	-13	-13	-14	-14	-15	-16	
-5.33%	-7	-8	-8	-9	-10	-10	-11	
-2.67%	-2	-3	-4	-4	-5	-6	-7	
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3	
2.67%	7	6	5	4	3	2	1	
5.33%	11	10	9	8	7	6	5	
8.00%	16	14	13	12	11	9	8	

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

173

공시일	2020-03-20
기준일	2020-03-19

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	8,386	0	8,386	
누계	통화	선도	2,006	9,964	-7,958	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	194
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	229
FX21020H01 USD/KRW 31-03-20E	52
FX21020H02 KRW/USD 13-04-20E	373
FX21020H04 USD/KRW 31-03-20E	27
FX21020H05 USD/KRW 31-03-20E	29
FX21020H05 USD/KRW 31-03-20E	29
FX21020H07 USD/KRW 31-03-20E	24
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

369

공시일	2020-03-20
기준일	2020-03-19

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

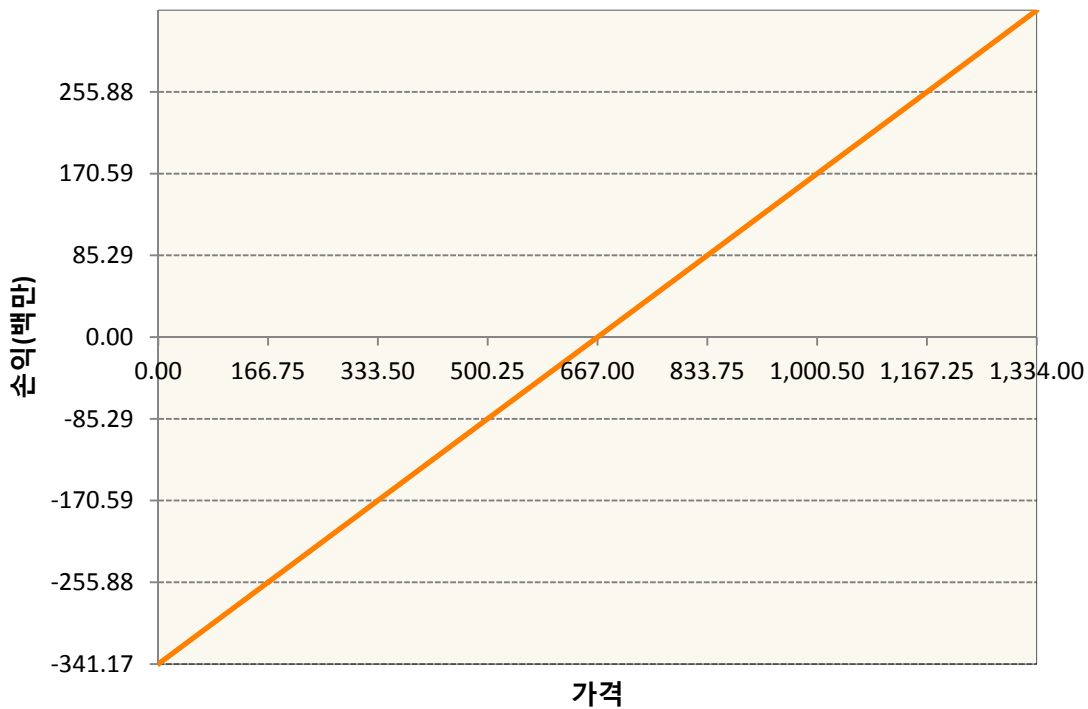
1. 계약금액

(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	341	0	341	
누계	유가증권	스왑	1,158	0	1,158	장외
누계	통화	선도	491	772	-281	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCJ0-VN30 Index Future Apr20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	93
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
VNCJ0 VN30 Index Future Apr20	27

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

(단위:백만원)

146

공시일	2020-03-20
기준일	2020-03-19

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

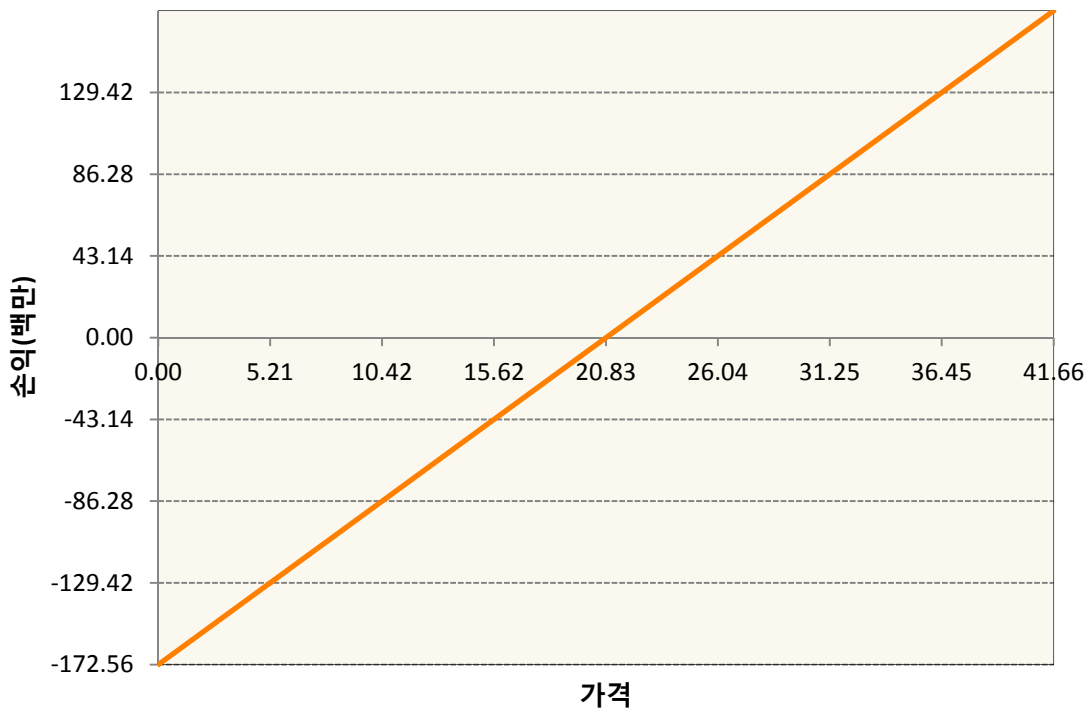
1. 계약금액

(단위:백만원)

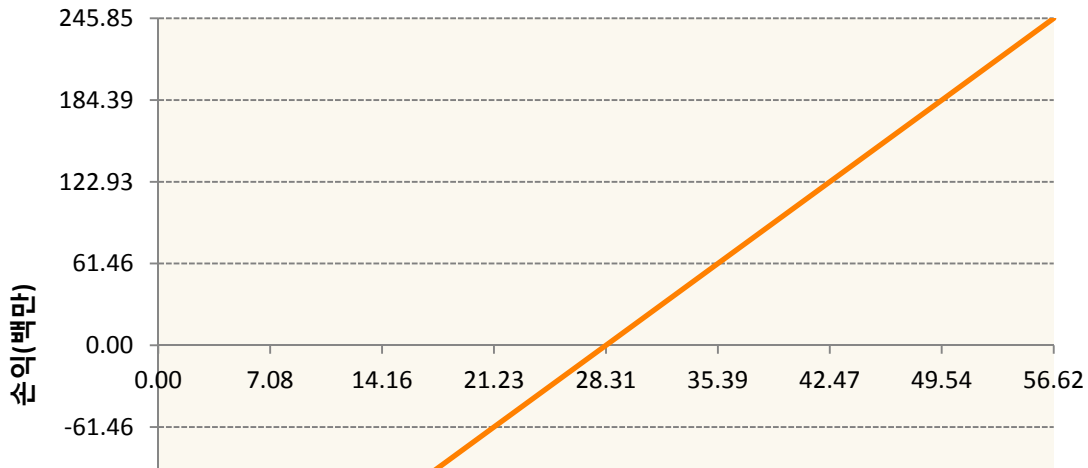
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,175	128	1,046	

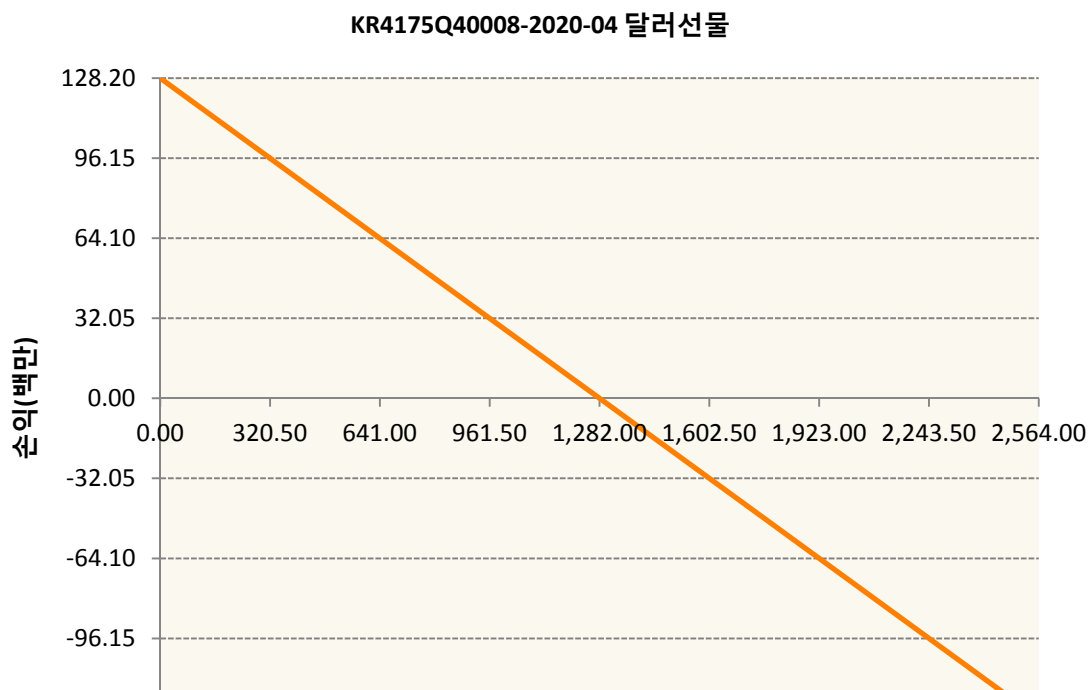
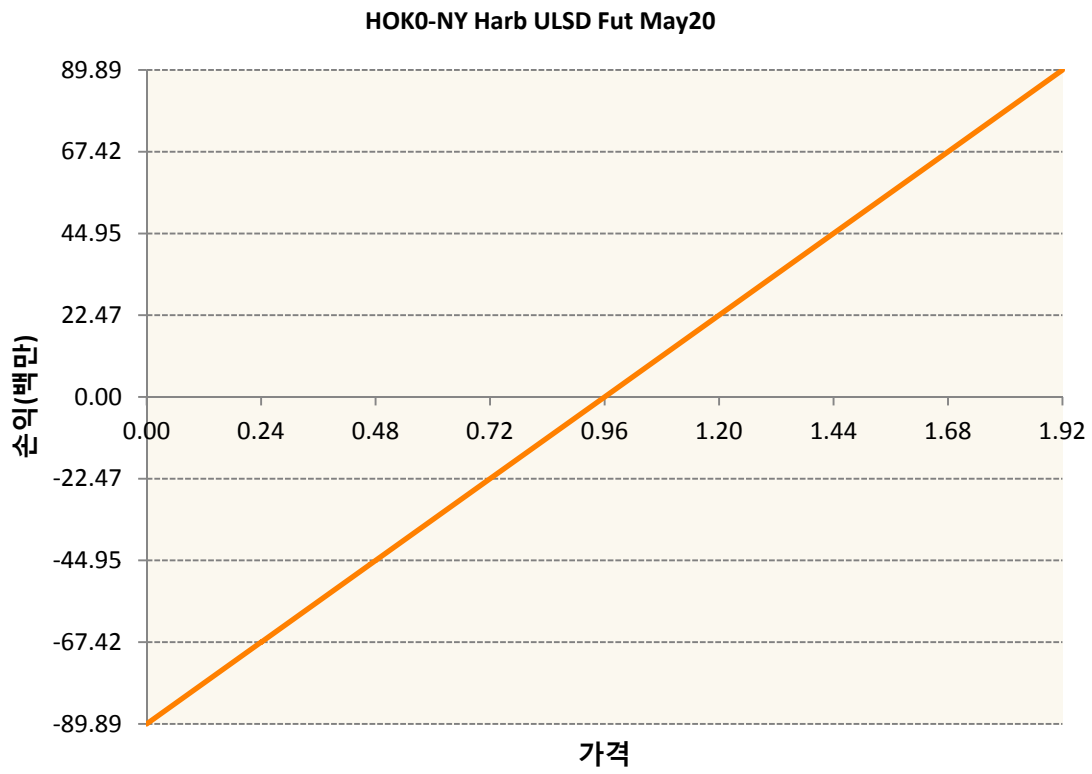
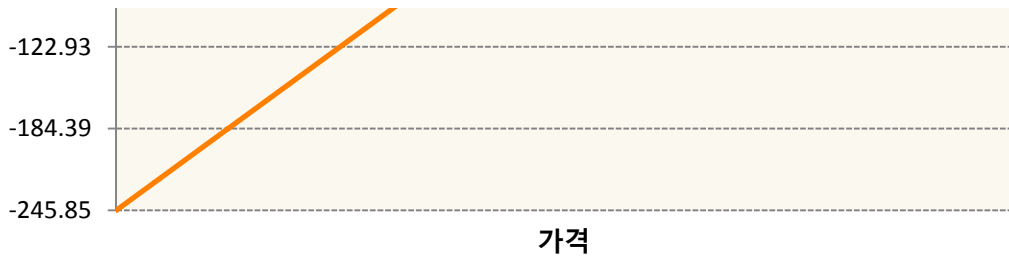
2. 만기시점의 손익구조

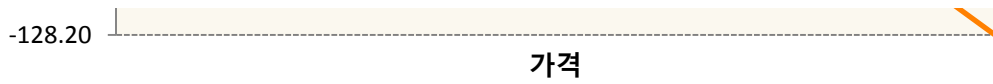
CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20



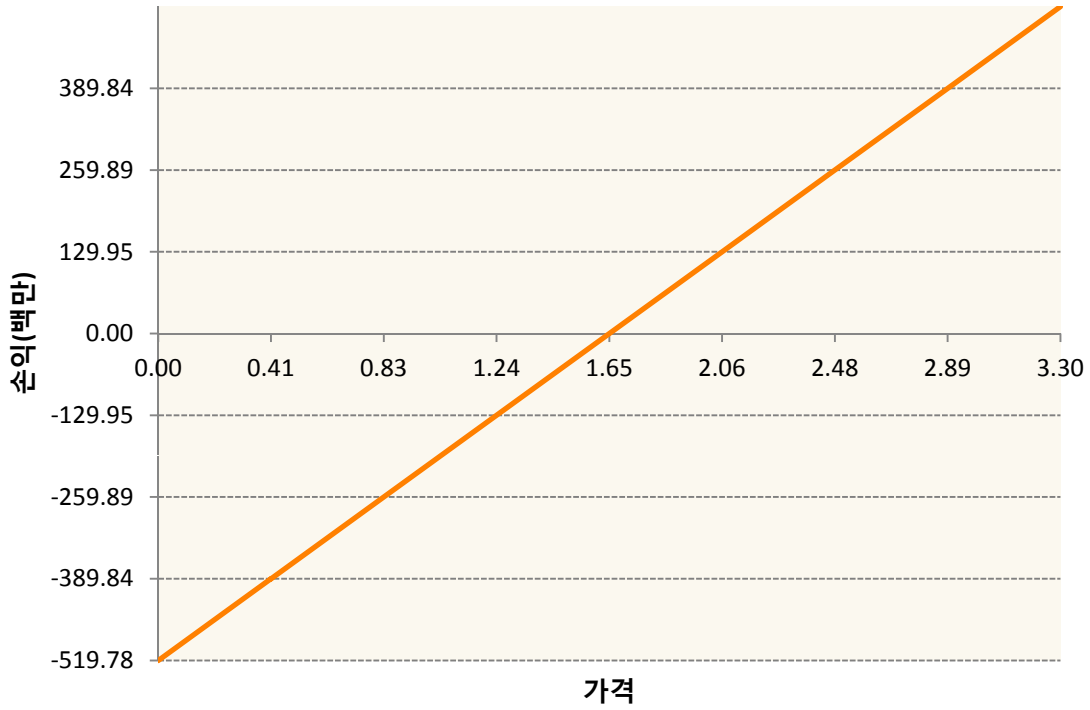
CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20



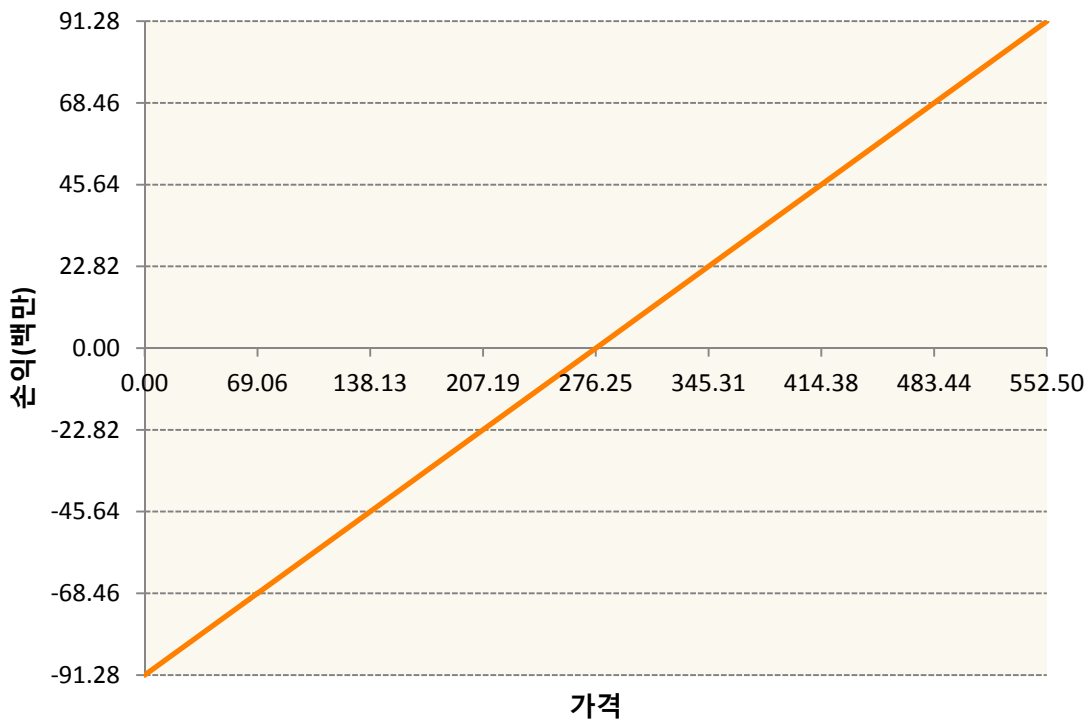




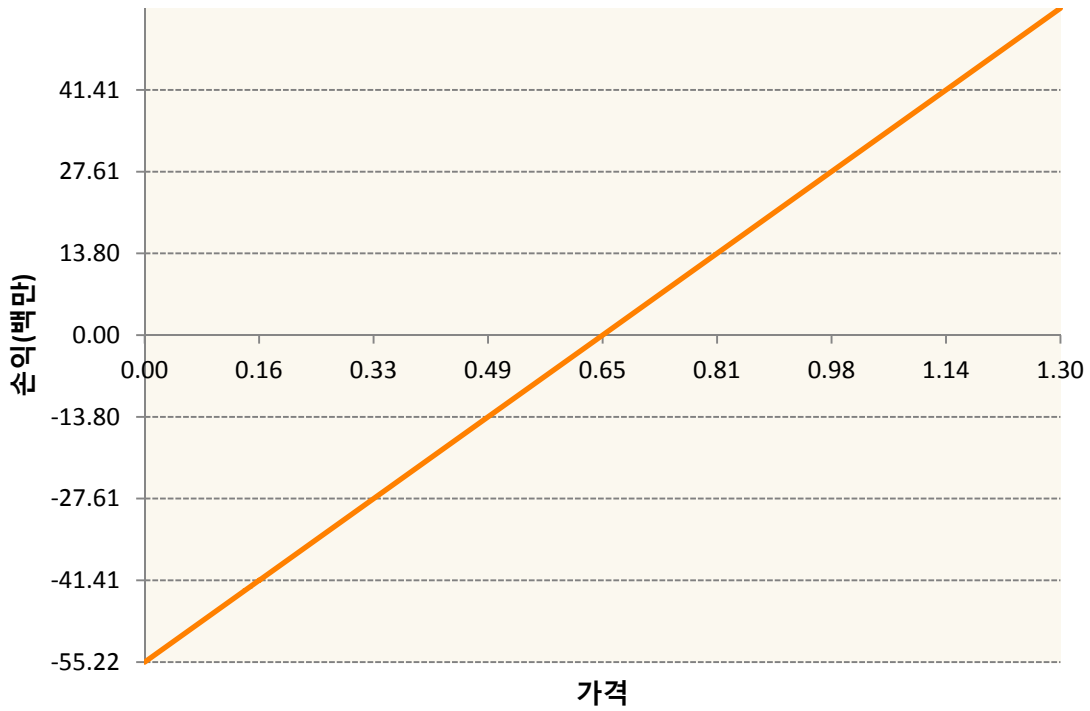
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



QSK0-Low Su Gasoil G Mar20



XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	14
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	20
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	7
KR4175Q40C	2020-04 달러선물	10
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	42
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	7
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	4

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

(단위:백만원)

249

공시일	2020-03-20
기준일	2020-03-19

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

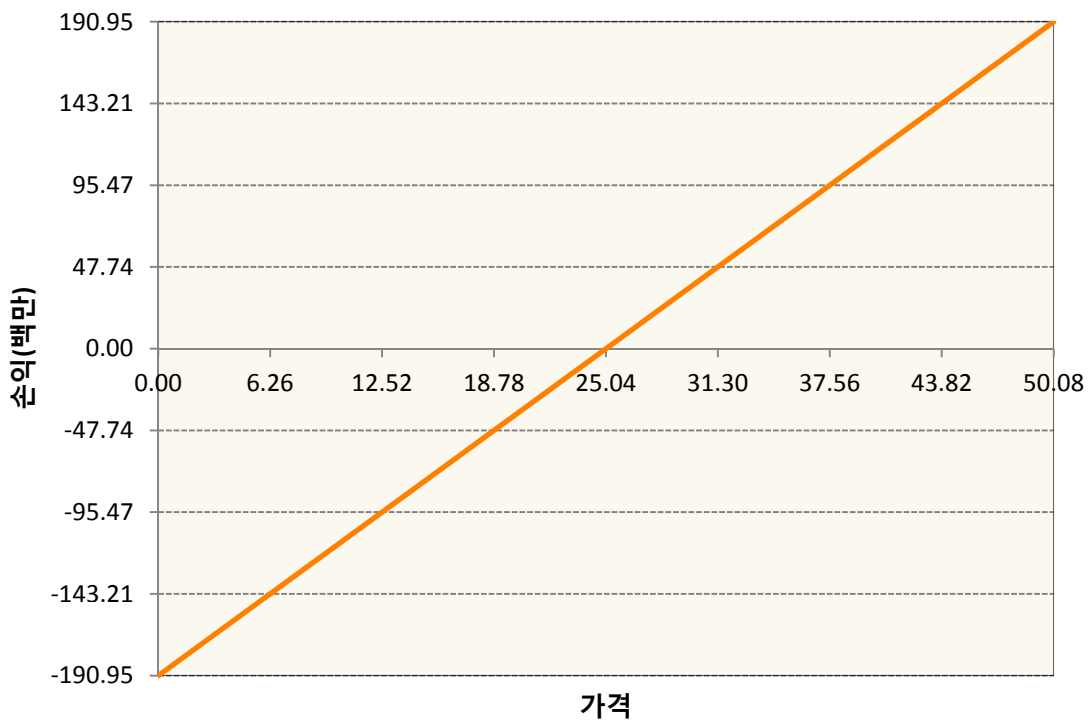
1. 계약금액

(단위:백만원)

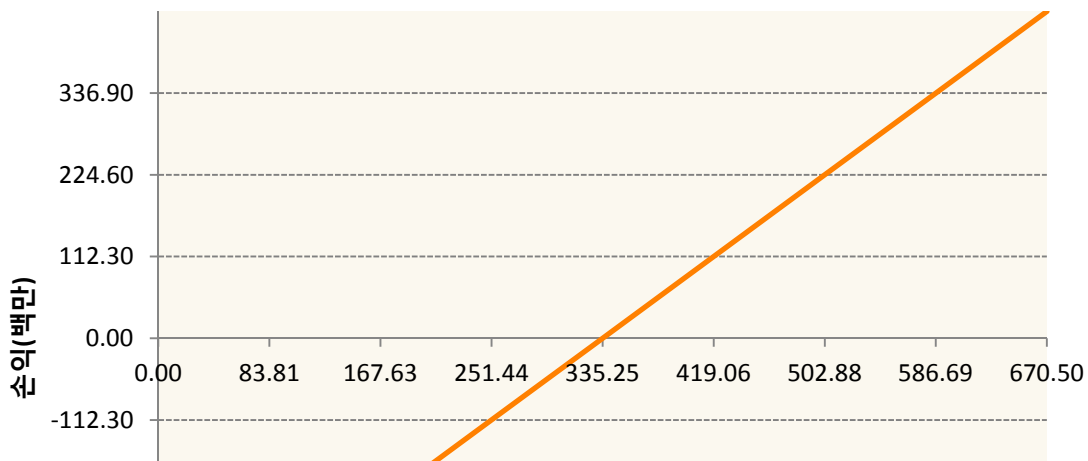
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,307	103	2,205	

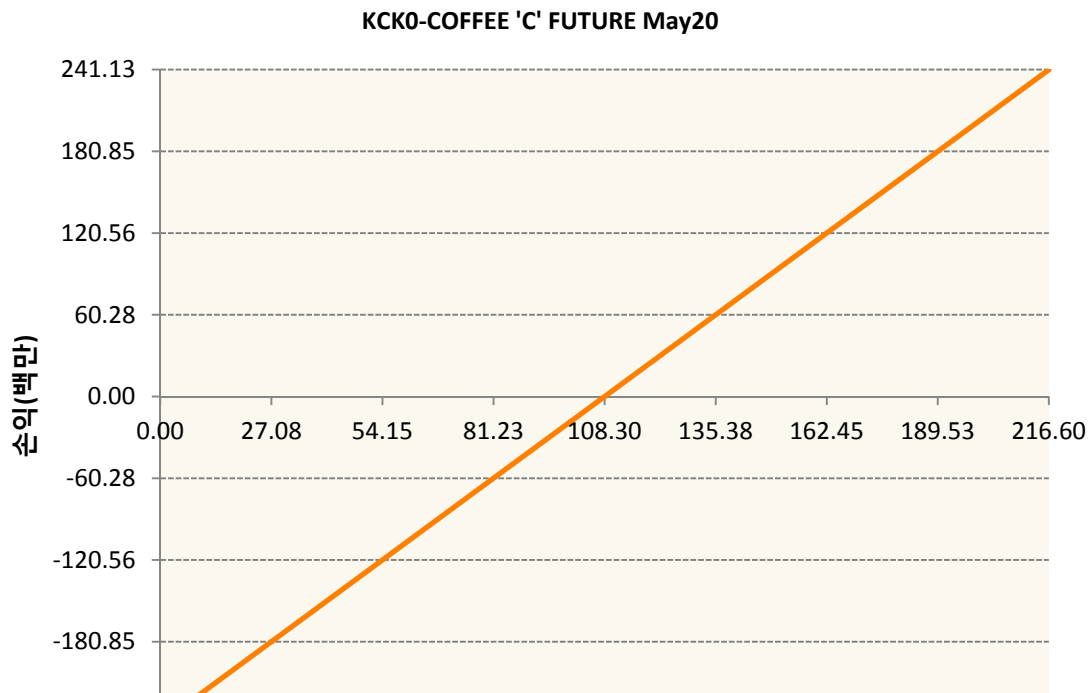
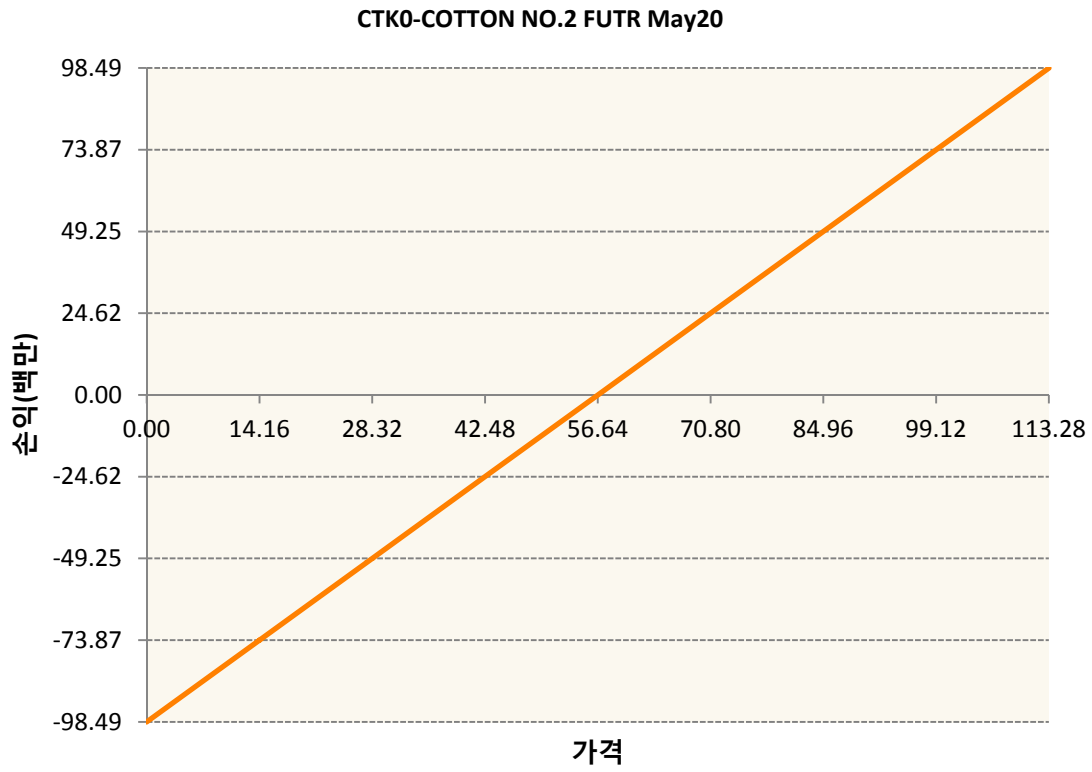
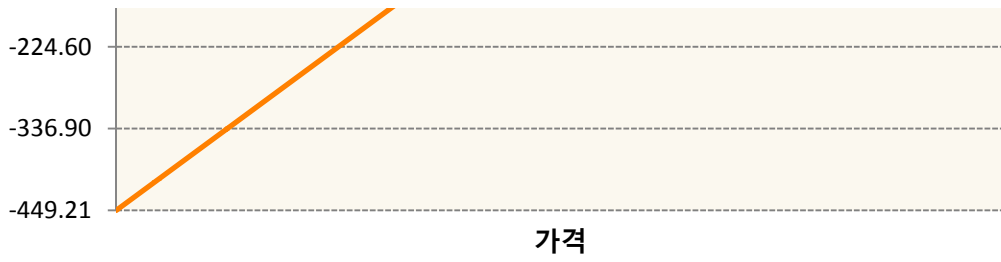
2. 만기시점의 손익구조

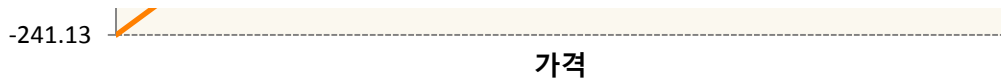
BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20



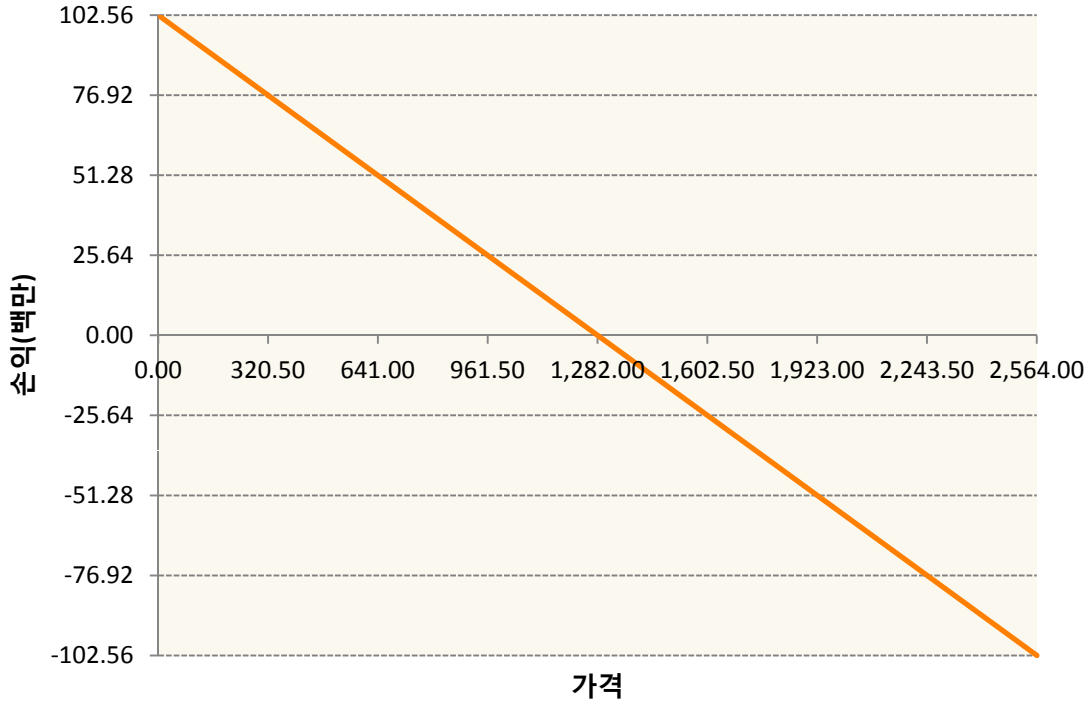
CK0-CORN FUTURE May20



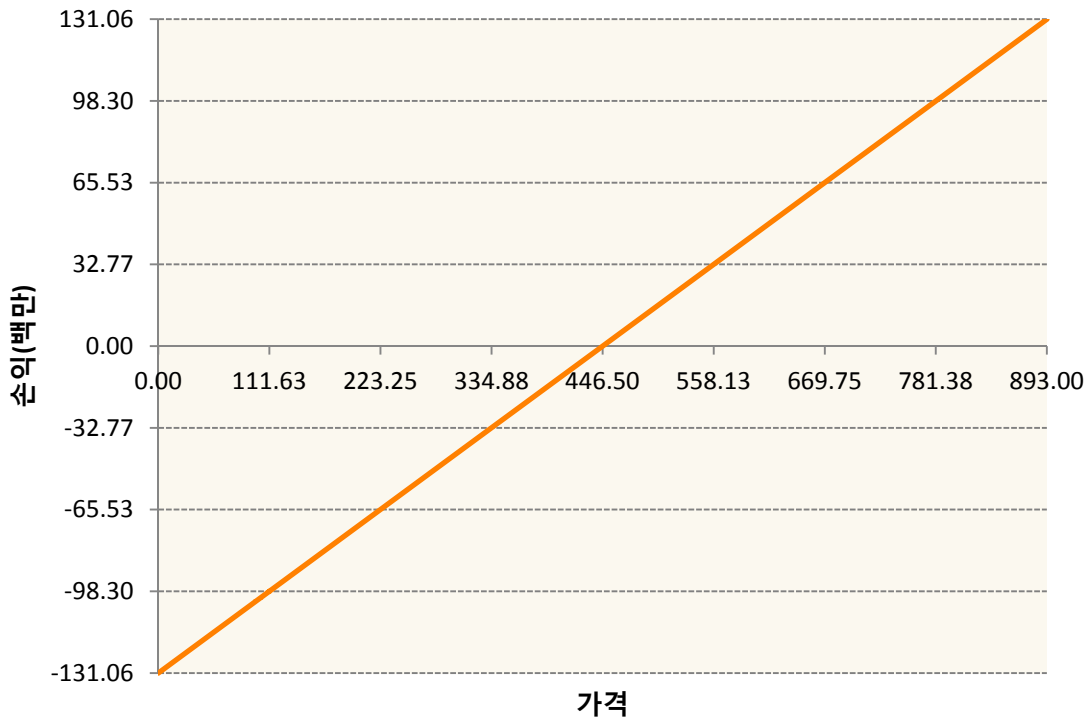




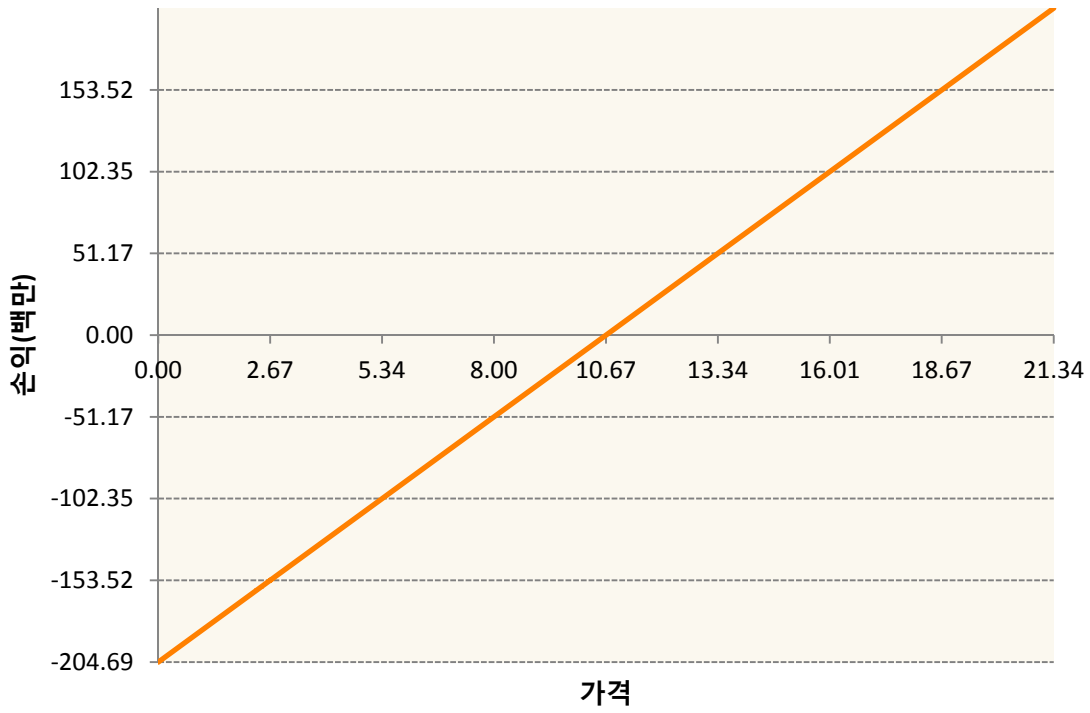
KR4175Q40008-2020-04 달러선물



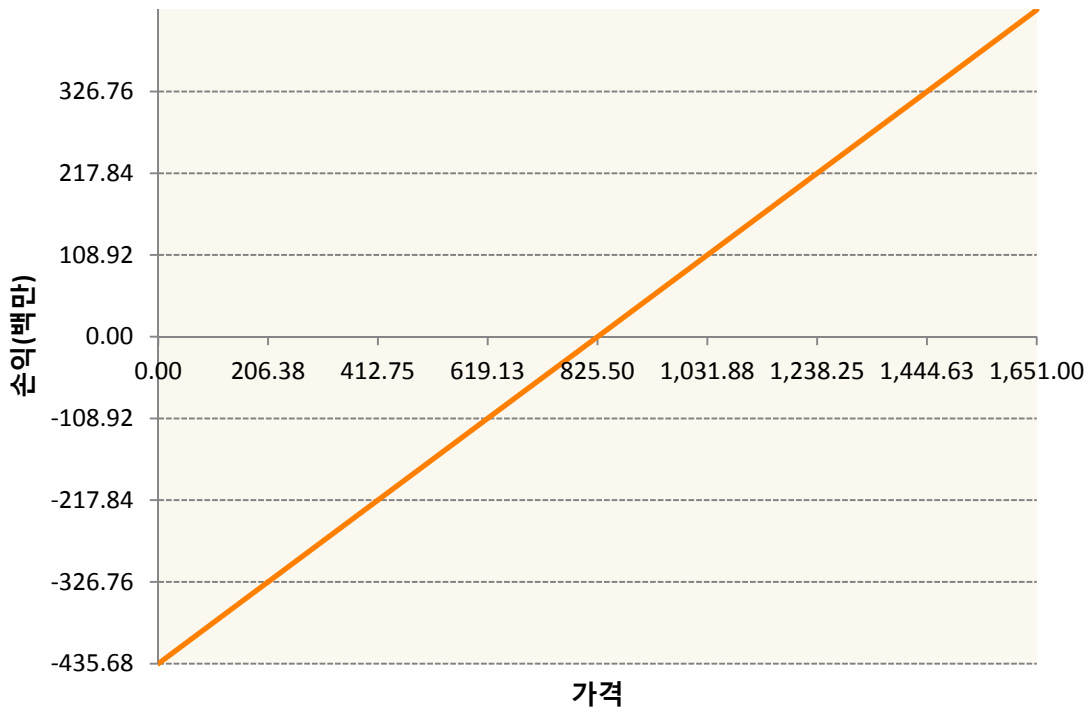
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



SBK0-Sugar May20

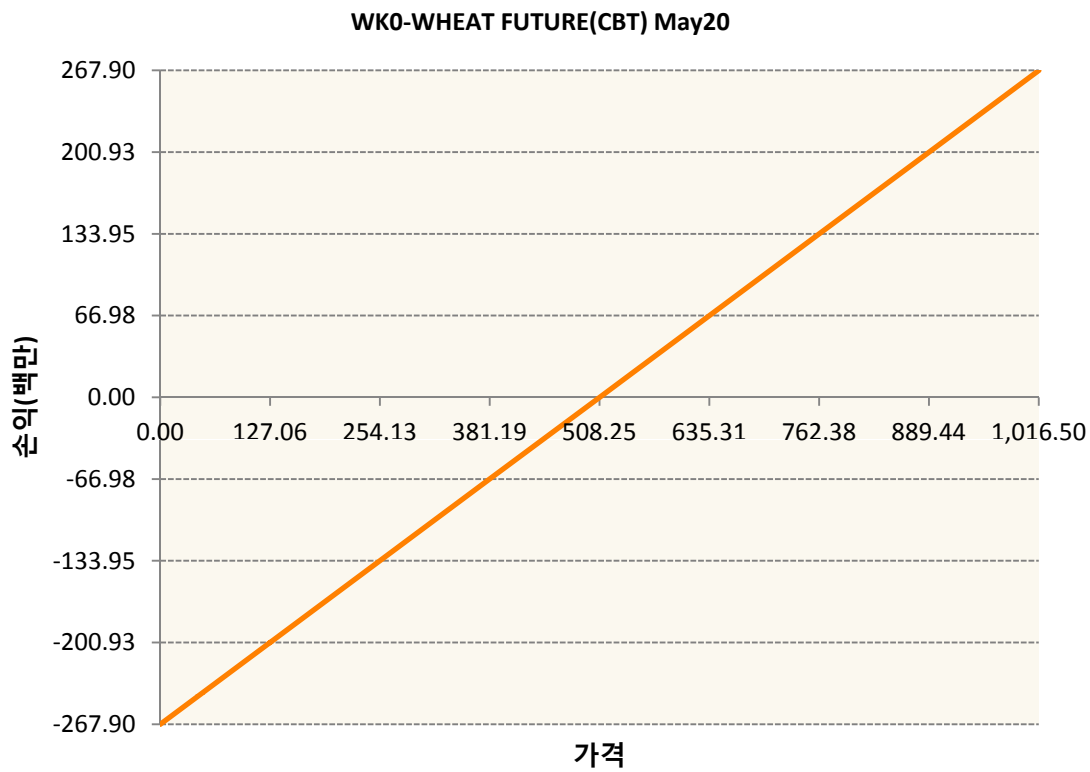
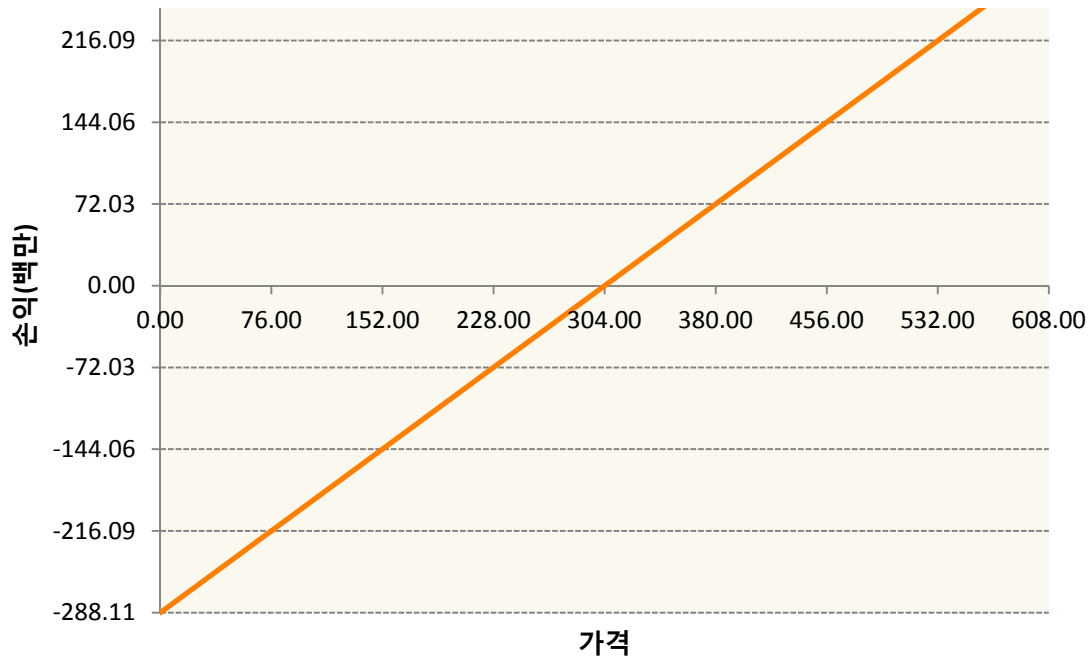


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	15
CK0	CORN FUTURE May20	36
CTK0	COTTON NO.2 FUTR May20	8
KCK0	COFFEE 'C' FUTURE May20	19
KR4175Q40C	2020-04 달러선물	8

KWK0	KC HRW WHEAT FUT May20	10
SBK0	Sugar May20	16
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)

209