

공시일	2020-03-23
기준일	2020-03-20

포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	1	-1	장외
누계	지수	스왑	4	0	4	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	2020-03-23
기준일	2020-03-20

스마트인덱스모

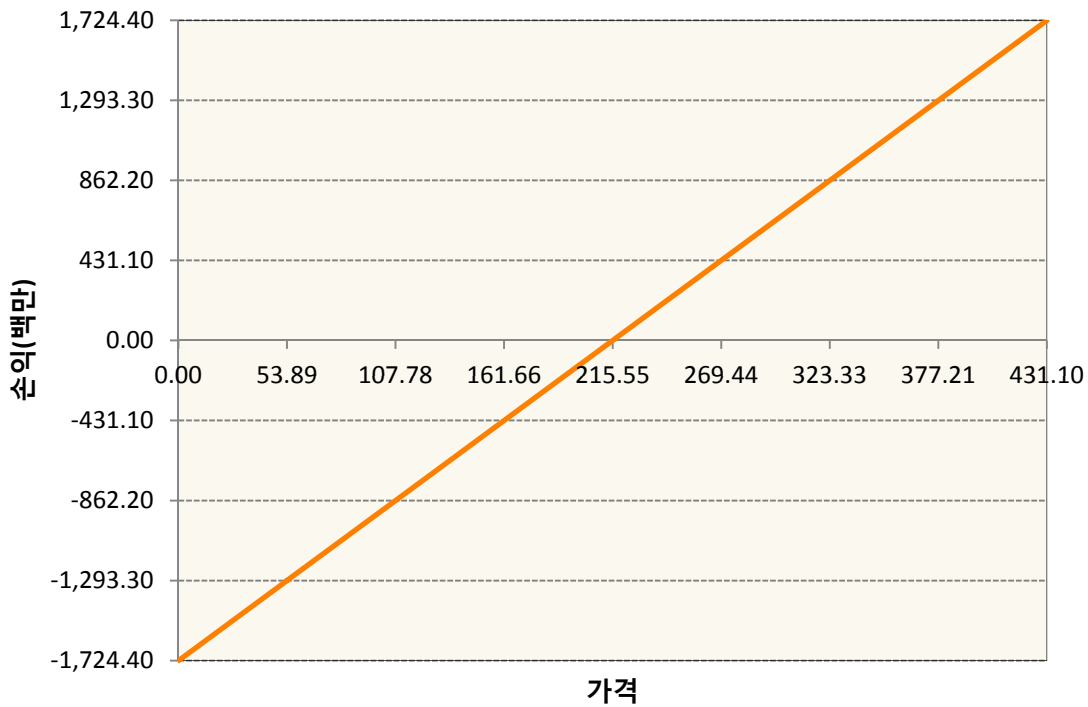
1. 계약금액

(단위:백만원)

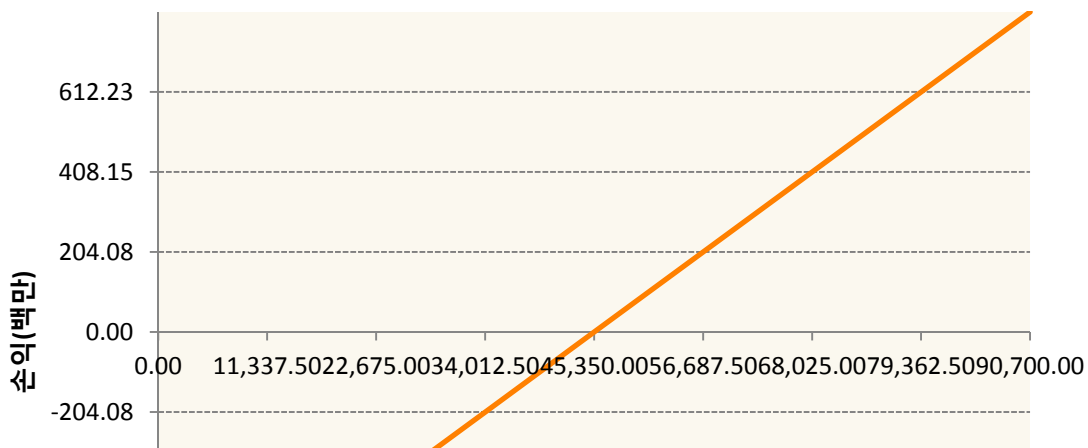
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	79	0	79	장내
누계	유가증권	선물	2,541	0	2,541	장내

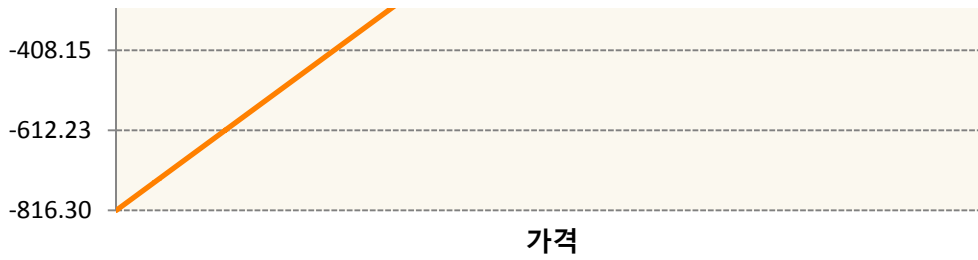
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



KR4111Q40003-2020-04 삼성전자개별선물





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						137
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-137	-137	-137	-137	-137	-137	-137	
-5.33%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91	
-2.67%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	46	46	46	46	46	46	46	
5.33%	91	91	91	91	91	91	91	
8.00%	137	137	137	137	137	137	137	
KR4111Q40003		2020-04 삼성전자개별선물						65
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65	
-5.33%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44	
-2.67%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	22	22	22	22	22	22	22	
5.33%	44	44	44	44	44	44	44	
8.00%	65	65	65	65	65	65	65	

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

249

공시일	2020-03-23
기준일	2020-03-20

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

806

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

815

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-23
기준일	2020-03-20

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)

850

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-23
기준일	2020-03-20

유로인덱스모(주식-파생형)

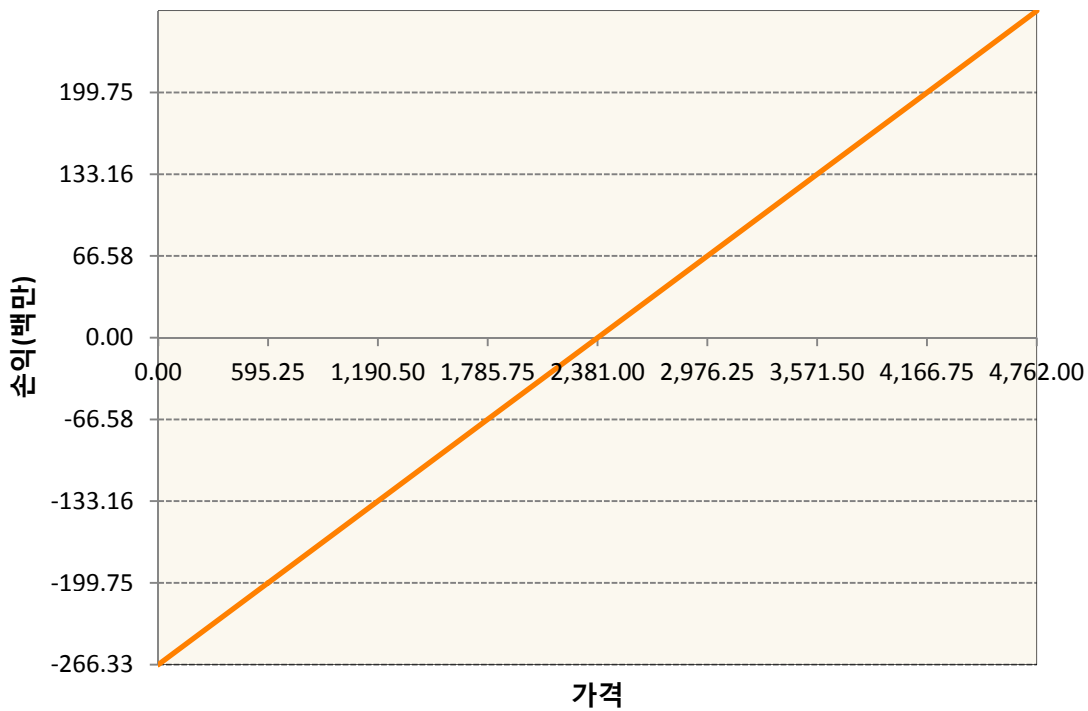
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	266	0	266	

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)

22

공시일	2020-03-23
기준일	2020-03-20

차이나인덱스모(주식-파생형)

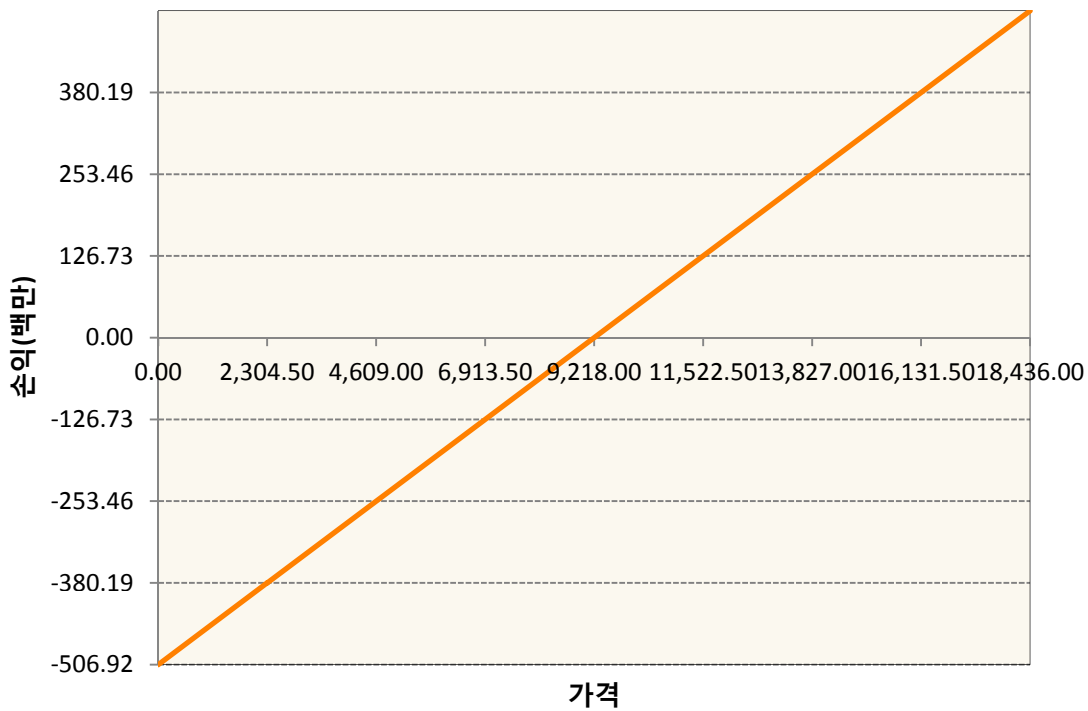
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	507	0	507	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH0	HSCEI Futures Mar20	41
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

39

공시일	2020-03-23
기준일	2020-03-20

커버드콜모(주식혼합-파생형)

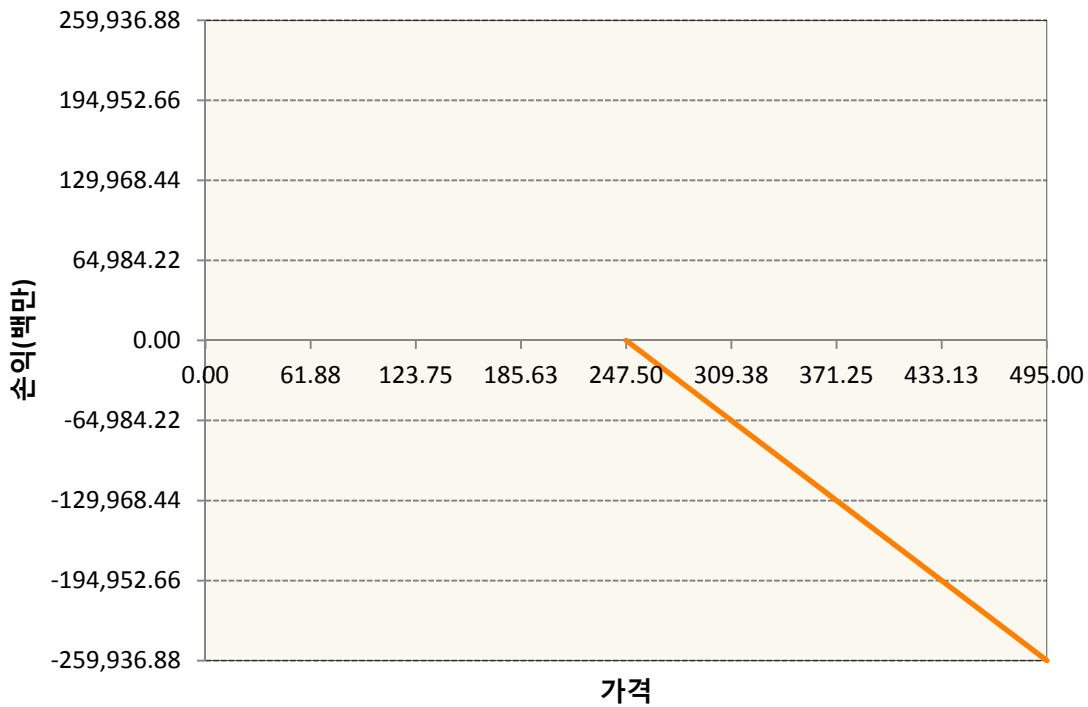
1. 계약금액

(단위:백만원)

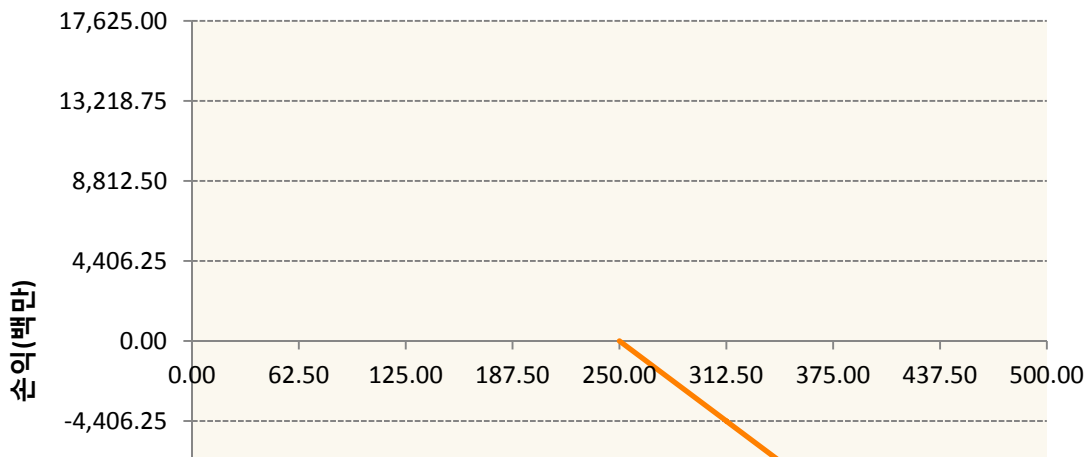
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	367,281	-367,281	장내

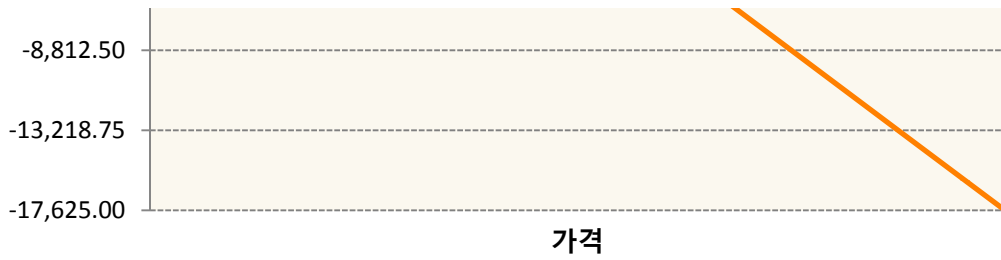
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

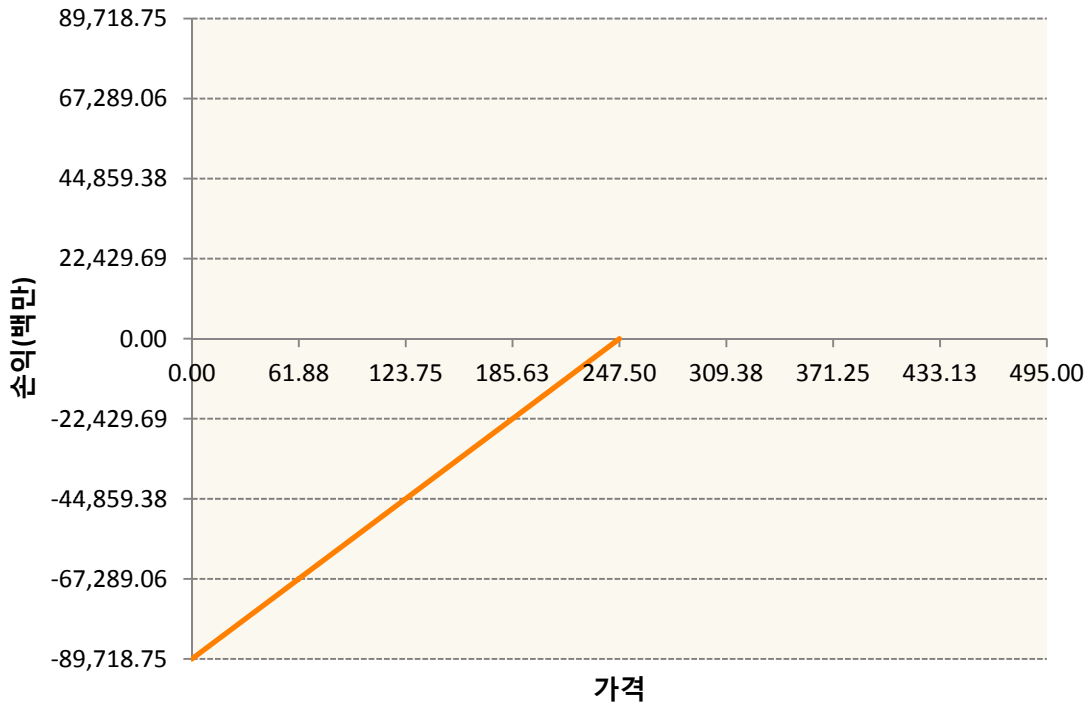


KR4201Q42503-2020-04 콜250





KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q42479		2020-04 콜247.5					7,964	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,805	2,642	2,411	2,109	1,740	1,306	813	
-5.33%	2,631	2,372	2,032	1,616	1,130	580	-26	
-2.67%	2,329	1,944	1,474	927	313	-360	-1,085	
0%	1,841	1,306	688	0	-748	-1,547	-2,388	
2.67%	1,100	399	-375	-1,206	-2,086	-3,006	-3,958	
5.33%	35	-835	-1,760	-2,728	-3,730	-4,760	-5,812	
8.00%	-1,420	-2,446	-3,507	-4,594	-5,702	-6,826	-7,964	
KR4201Q42503		2020-04 콜250					504	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	167	158	144	126	104	77	46	

-5.33%	158	143	122	97	67	33	-6
-2.67%	141	118	90	56	18	-25	-71
0%	113	81	43	0	-47	-98	-152
2.67%	71	27	-21	-74	-130	-189	-251
5.33%	8	-46	-105	-167	-232	-299	-368
8.00%	-79	-144	-212	-283	-355	-429	-504
KR4301Q42477 2020-04 풋247.5							5,882
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,946	-5,034	-5,151	-5,297	-5,469	-5,665	-5,882
-5.33%	-2,975	-3,104	-3,265	-3,455	-3,671	-3,910	-4,168
-2.67%	-1,057	-1,236	-1,447	-1,685	-1,948	-2,230	-2,531
0%	788	553	289	0	-309	-635	-976
2.67%	2,541	2,247	1,928	1,590	1,236	869	491
5.33%	4,180	3,829	3,459	3,075	2,680	2,276	1,865
8.00%	5,690	5,286	4,871	4,448	4,018	3,583	3,144

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

(단위:백만원)

10,107

공시일	2020-03-23
기준일	2020-03-20

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

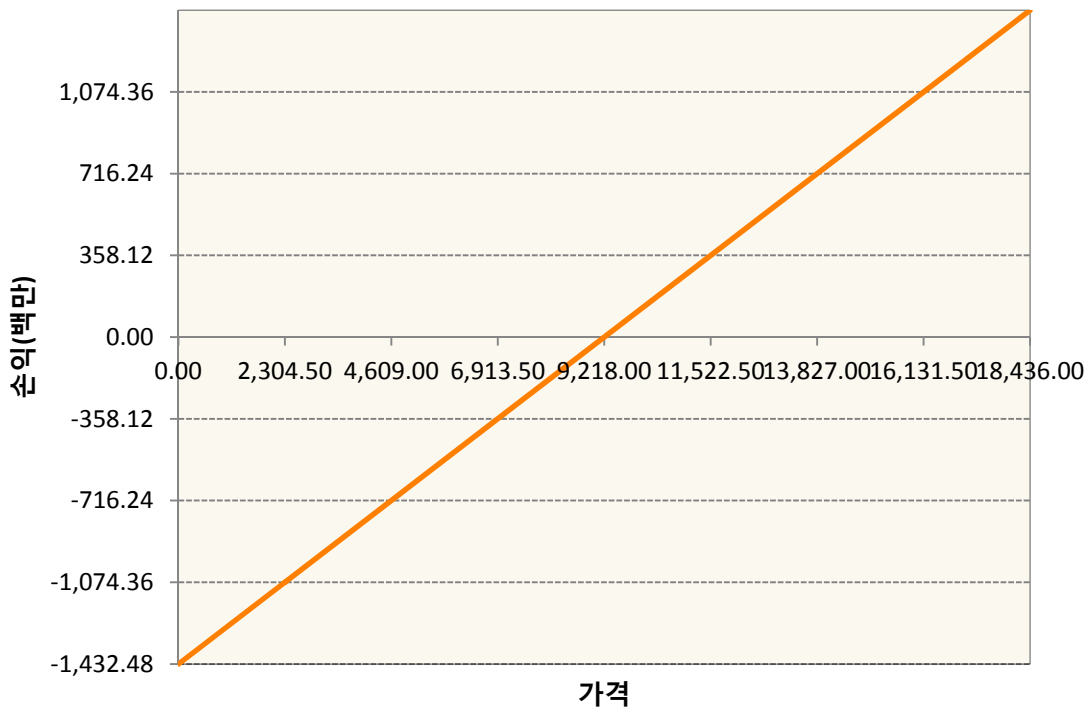
1. 계약금액

(단위:백만원)

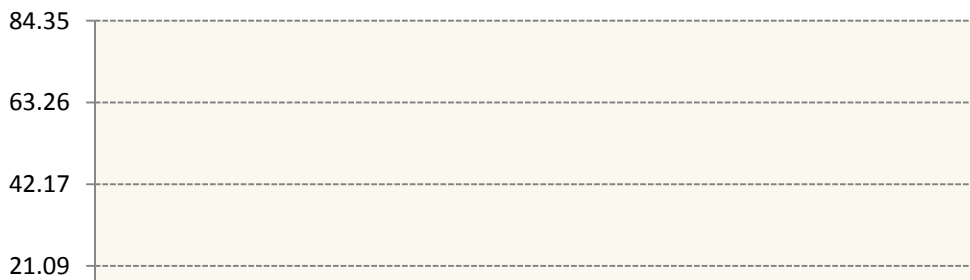
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,432	0	1,432	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,767	-4,767	장내
누계	통화	선도	707	2,262	-1,555	장외

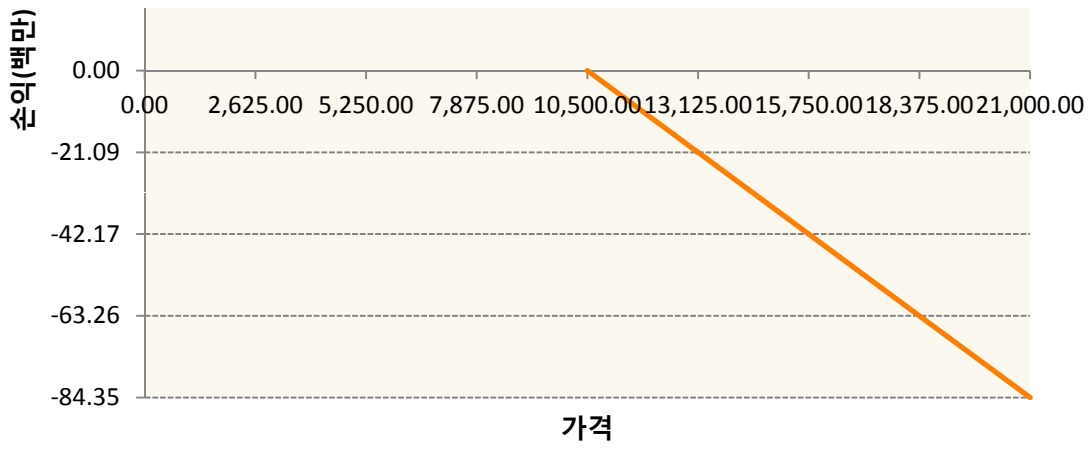
2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20

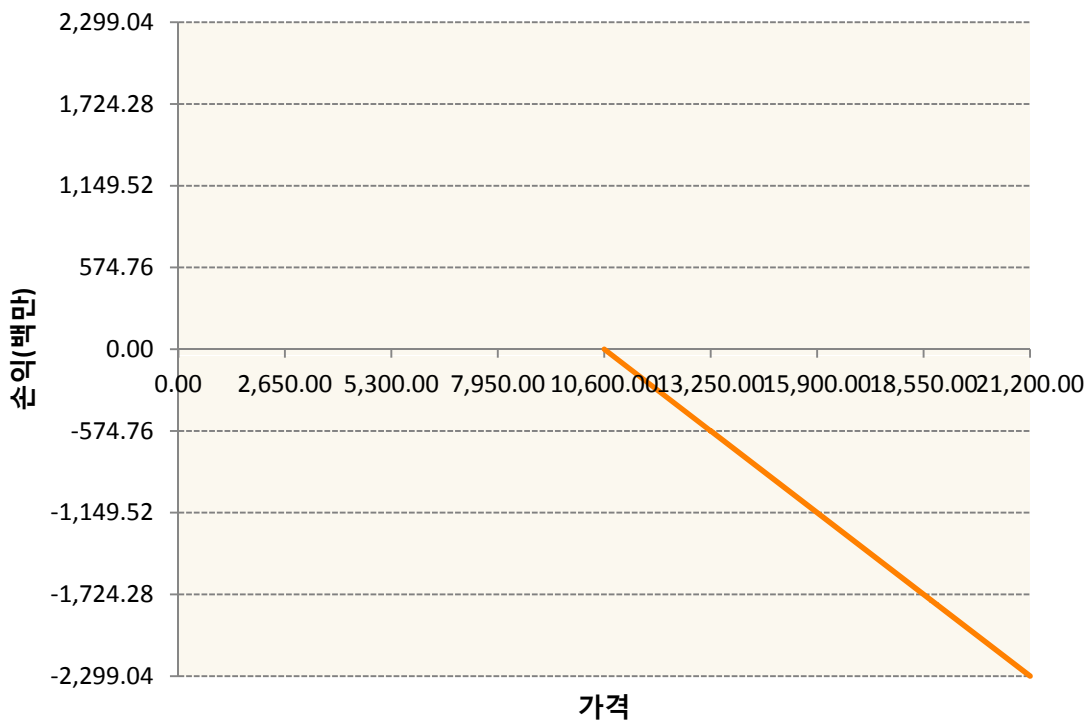


OHHIH0-C105-HSCEI

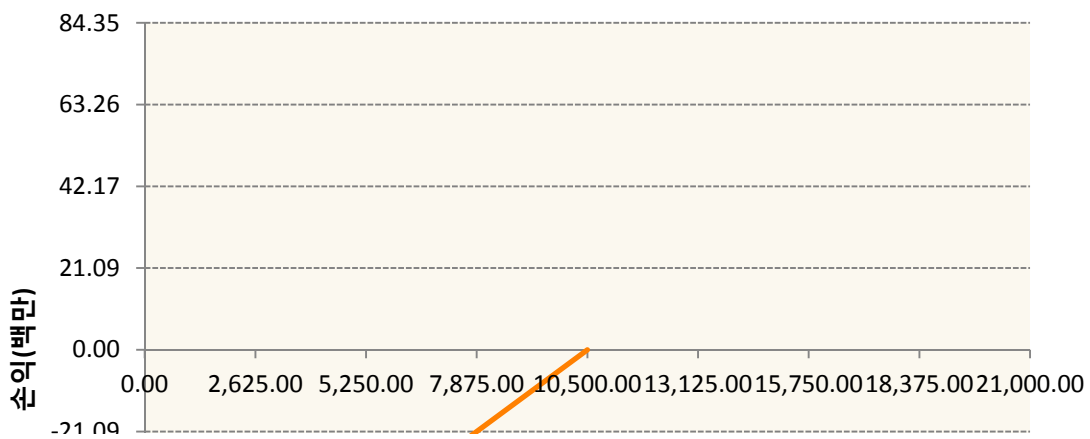


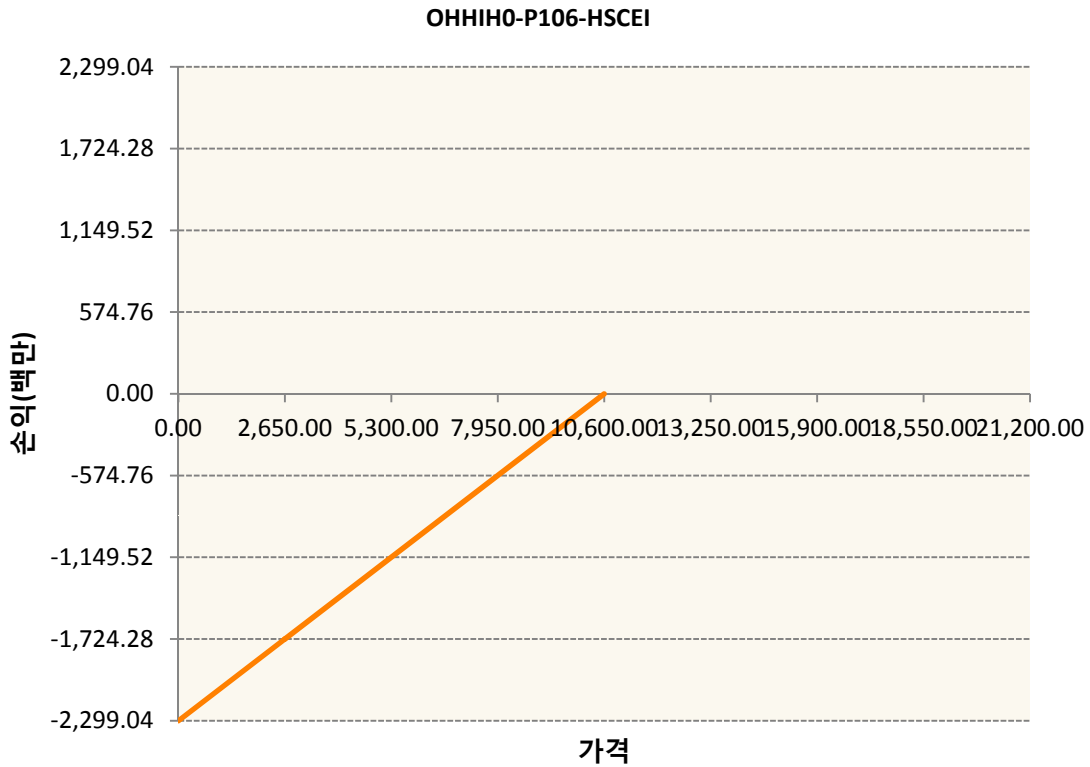


OHHIH0-C106-HSCEI



OHHIH0-P105-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E	181
FX21020H05 HKD/KRW 22-05-20E	57
HCH0 HSCEI Futures Mar20	115
OHHIH0-C1(HSCEI	7
OHHIH0-C1(HSCEI	184
OHHIH0-P1(HSCEI	7
OHHIH0-P1(HSCEI	184

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	584

공시일	2020-03-23
기준일	2020-03-20

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

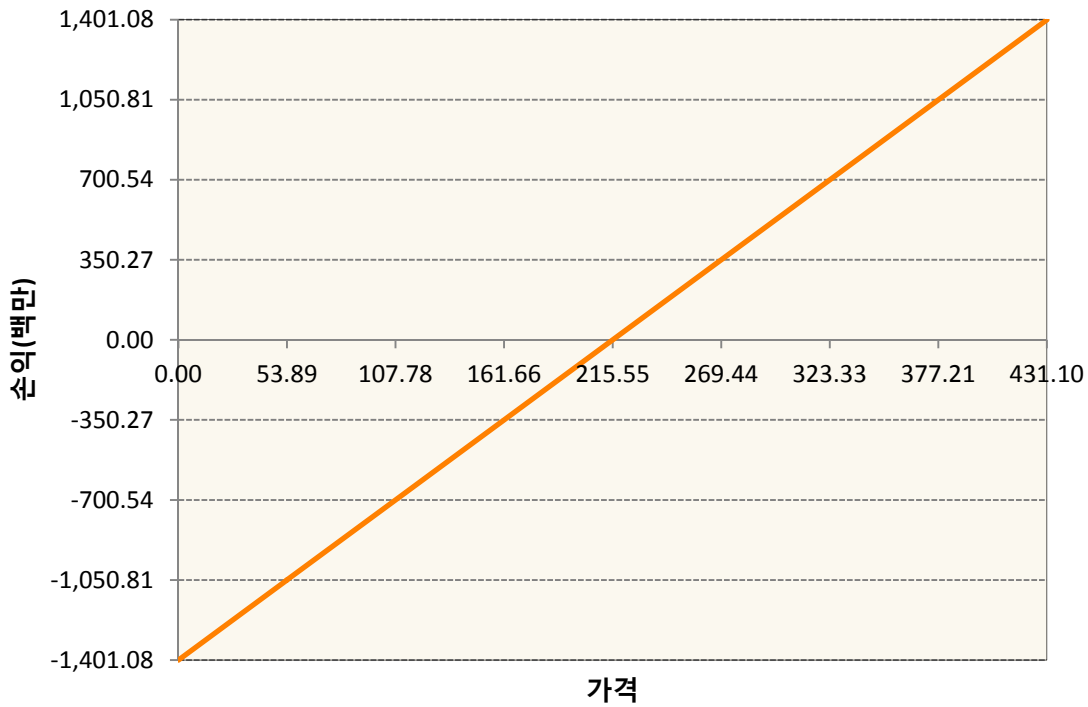
1. 계약금액

(단위:백만원)

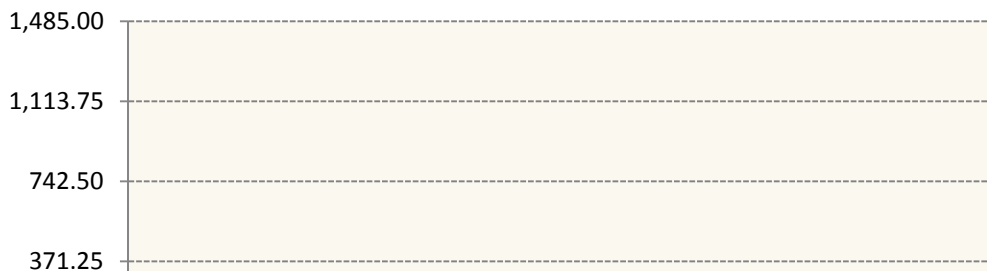
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,401	0	1,401	장내
누계	유가증권	스왑	3,125	0	3,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,095	-3,095	장내

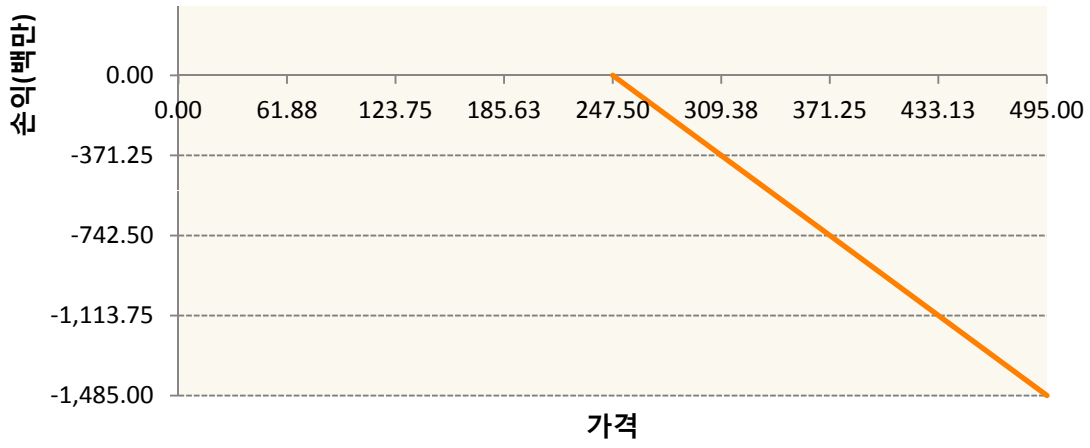
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

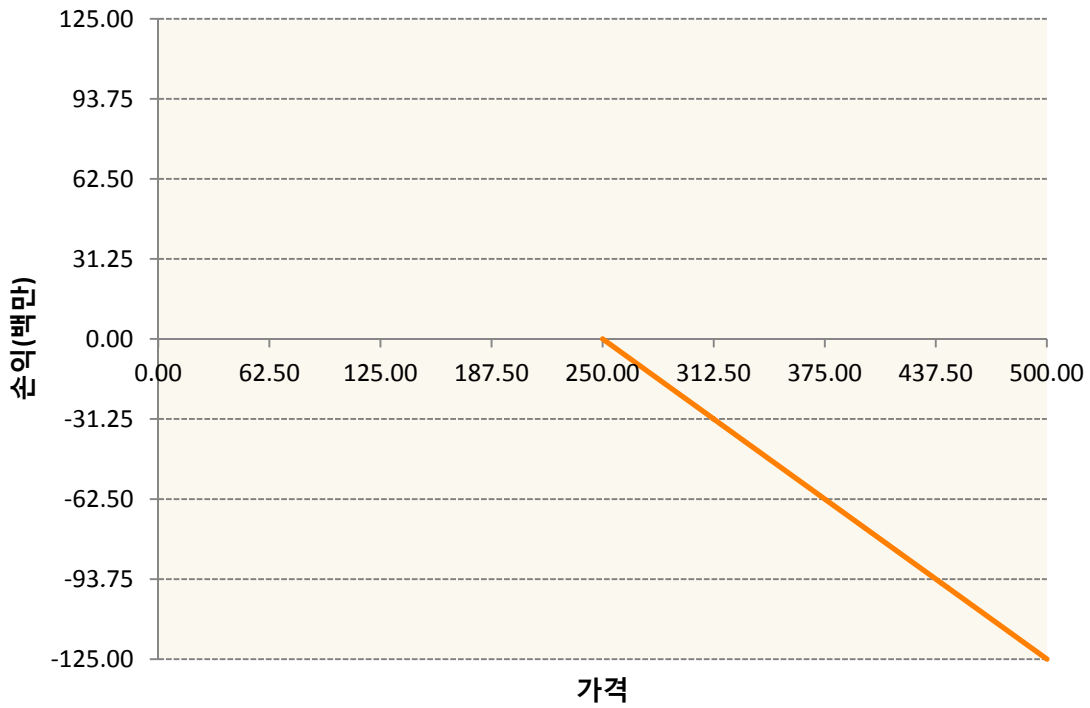


KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

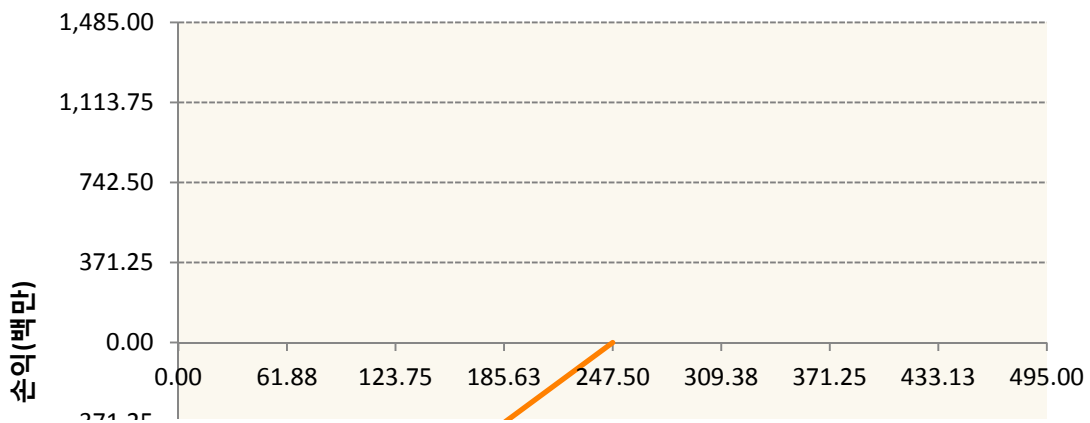




KR4201Q42503-2020-04 콜250



KR4301Q42477-2020-04 풋247.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						273
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-273	-273	-273	-273	-273	-273	-273	
-5.33%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182	
-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%	182	182	182	182	182	182	182	
8.00%	273	273	273	273	273	273	273	
KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						111
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111	
-5.33%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74	
-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%	74	74	74	74	74	74	74	
8.00%	111	111	111	111	111	111	111	
KR4201Q42479		2020-04 콜247.5						45
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	16	15	14	12	10	7	5	
-5.33%	15	14	12	9	6	3	0	
-2.67%	13	11	8	5	2	-2	-6	
0%	11	7	4	0	-4	-9	-14	
2.67%	6	2	-2	-7	-12	-17	-23	
5.33%	0	-5	-10	-16	-21	-27	-33	
8.00%	-8	-14	-20	-26	-33	-39	-45	
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	0	0	0
-2.67%	1	1	1	0	0	0	-1
0%	1	1	0	0	0	-1	-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%	-82	-83	-85	-88	-91	-94	-97
-5.33%	-49	-51	-54	-57	-61	-65	-69
-2.67%	-18	-20	-24	-28	-32	-37	-42
0%	13	9	5	0	-5	-11	-16
2.67%	42	37	32	26	20	14	8
5.33%	69	63	57	51	44	38	31
8.00%	94	87	81	74	67	59	52

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

(단위:백만원)

525

공시일	2020-03-23
기준일	2020-03-20

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

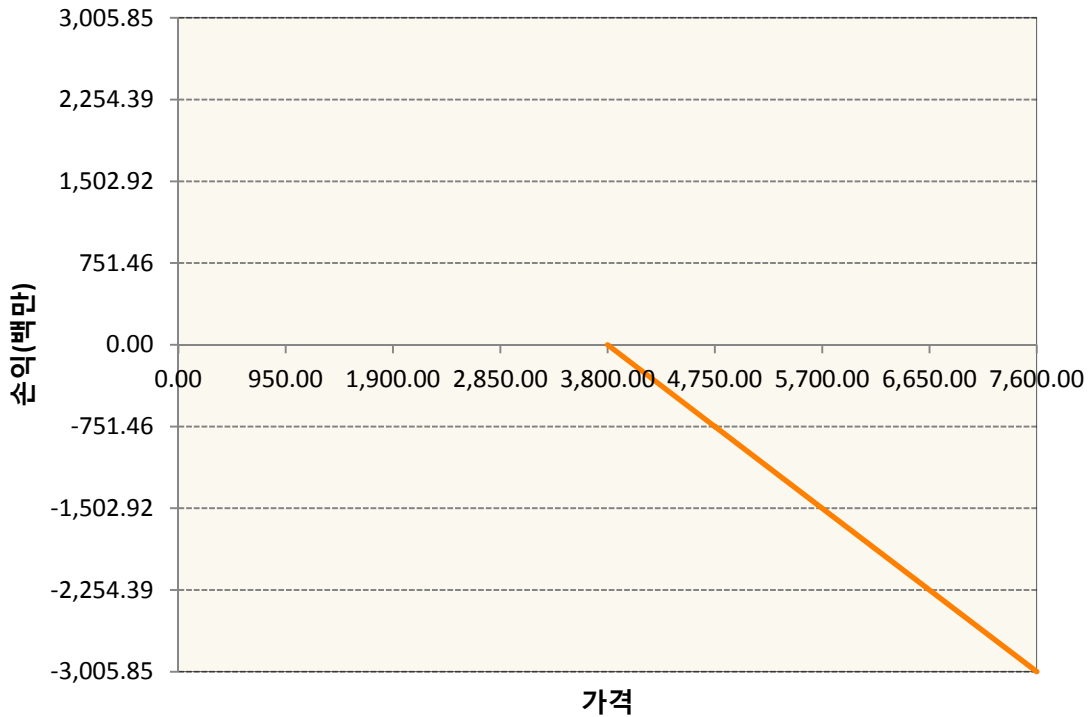
1. 계약금액

(단위:백만원)

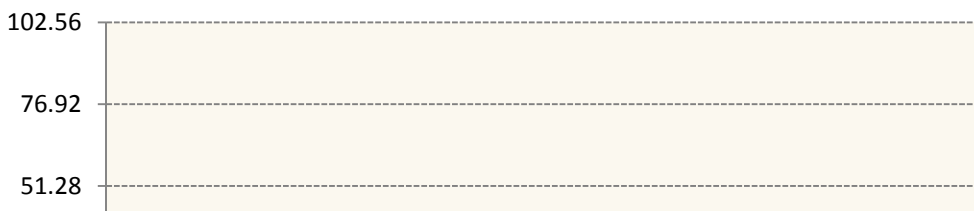
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	394	0	394	
누계	유가증권	스왑	7,615	0	7,615	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,217	-6,217	장내
누계	통화	선도	536	3,518	-2,982	장외

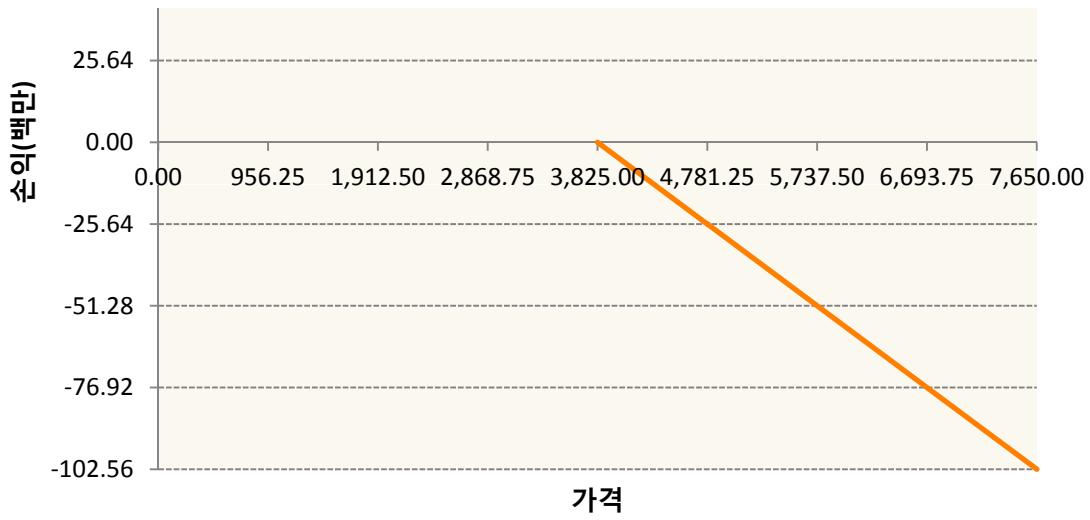
2. 만기시점의 손익구조

OESXH0-C3800-EURO STOXX 50

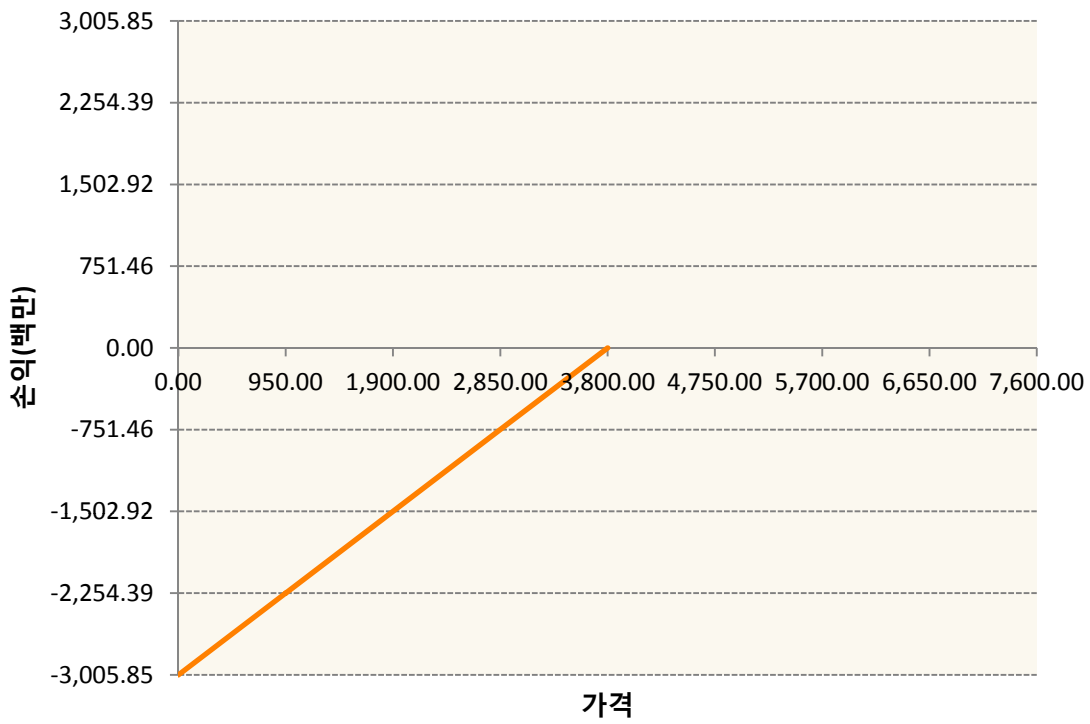


OESXH0-C3825-EURO STOXX 50

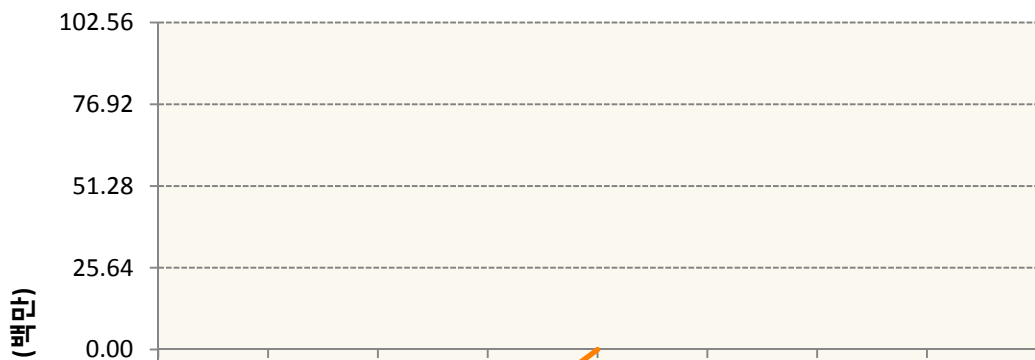


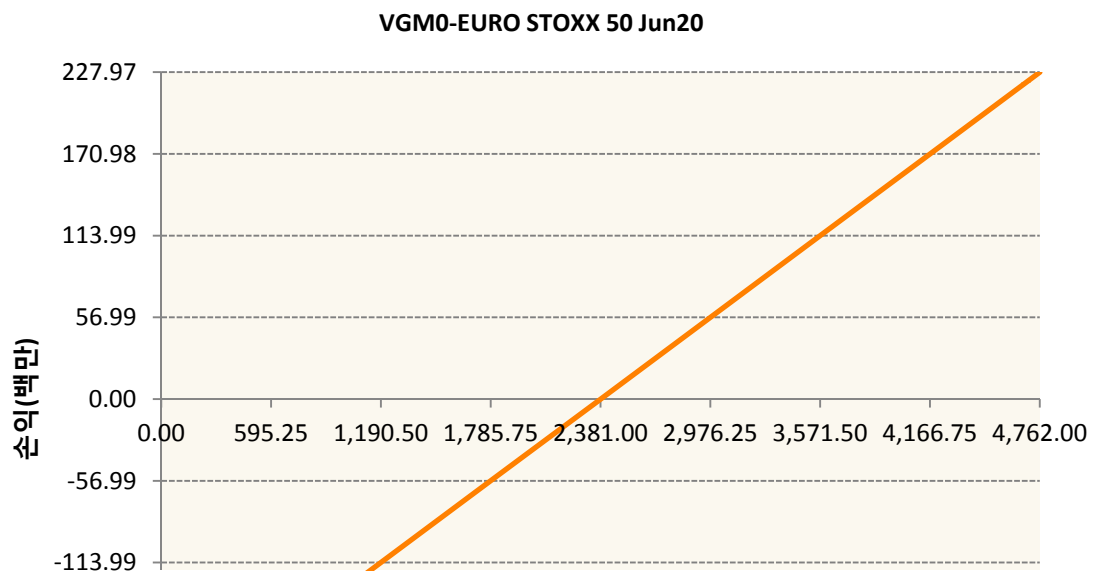
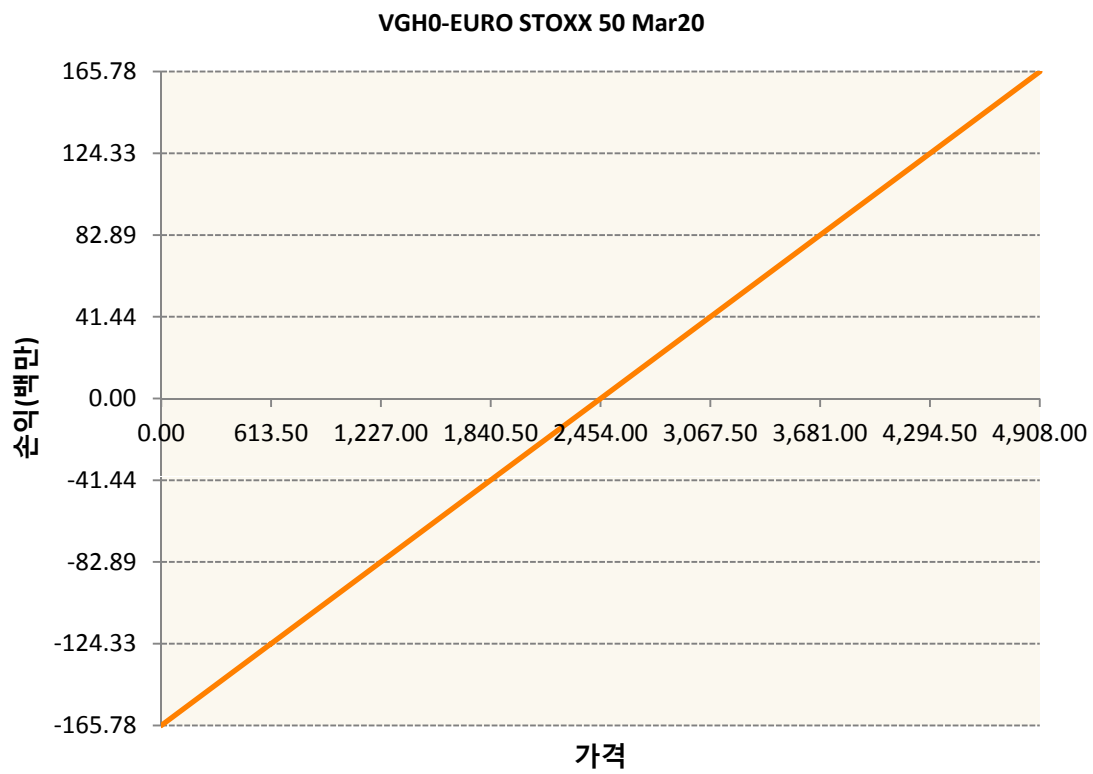
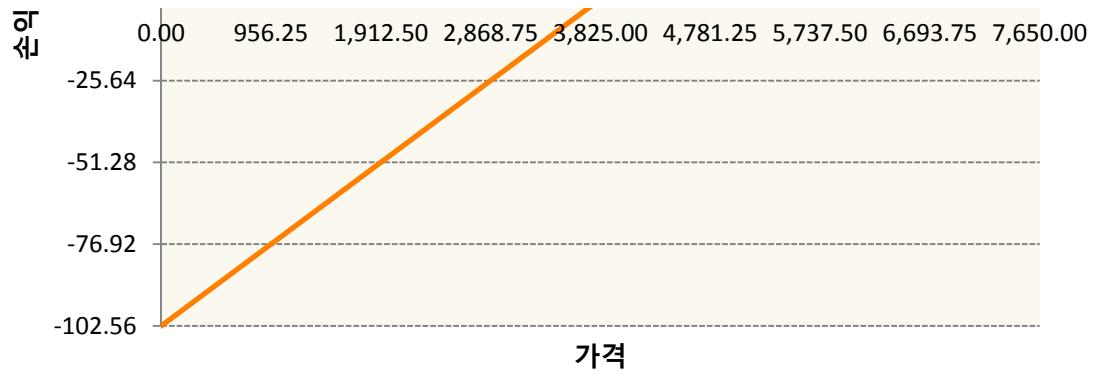


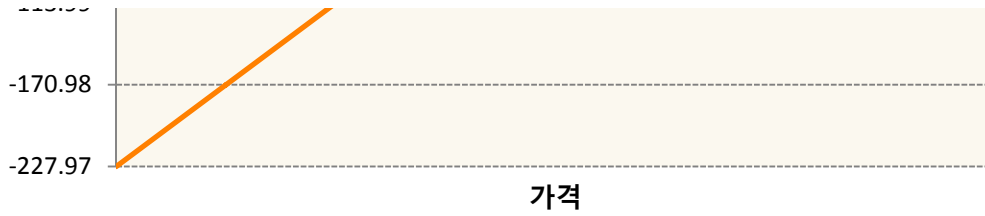
OESXH0-P3800-EURO STOXX 50



OESXH0-P3825-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	30
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	281
FX21020H00 EUR/KRW 27-03-20E	43
OESXH0-C3€EURO STOXX 50	240
OESXH0-C3€EURO STOXX 50	8
OESXH0-P3€EURO STOXX 50	240
OESXH0-P3€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)

788

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

(단위:백만원)

781

공시일	2020-03-23
기준일	2020-03-20

ETF스마트레버리지목표전환형9호

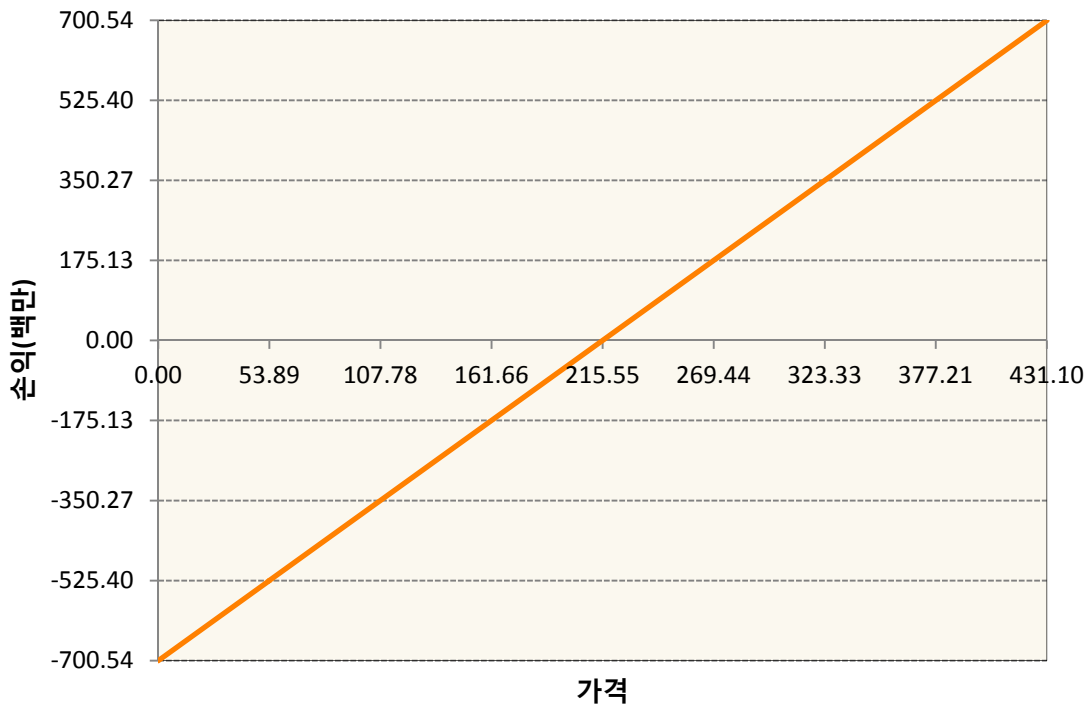
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	701	0	701	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						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)

68

공시일	2020-03-23
기준일	2020-03-20

ETF스마트레버리지목표전환형10호

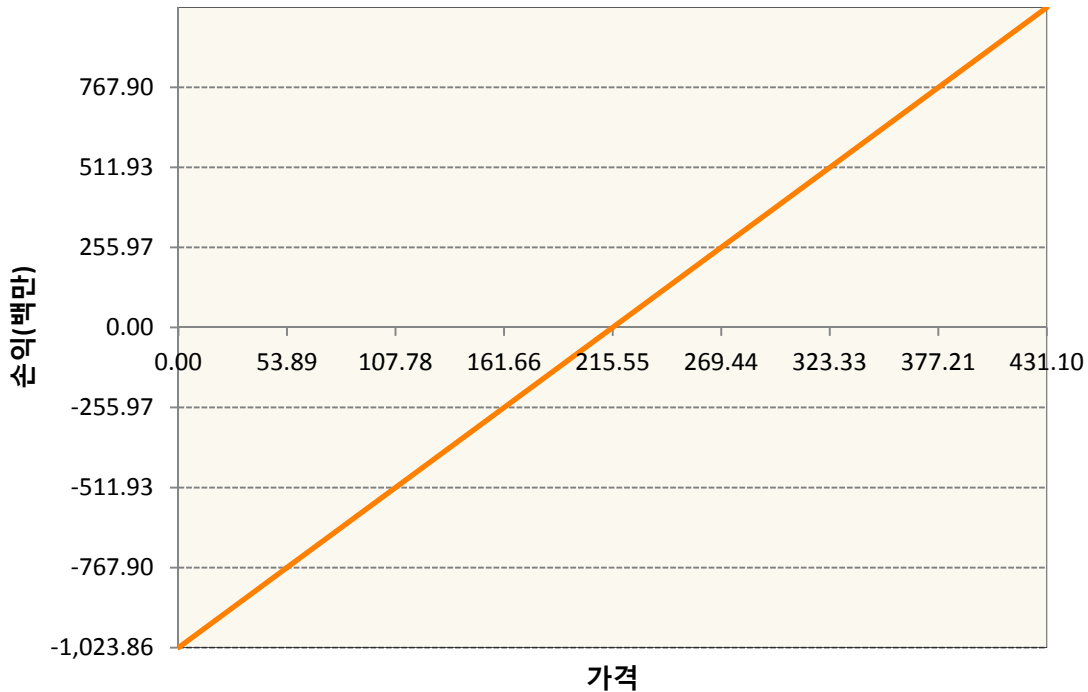
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,024	0	1,024	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						81
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81	
-5.33%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54	
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	27	27	27	27	27	27	27	
5.33%	54	54	54	54	54	54	54	
8.00%	81	81	81	81	81	81	81	

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

(단위:백만원)

99

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

(단위:백만원)

47

공시일	2020-03-23
기준일	2020-03-20

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

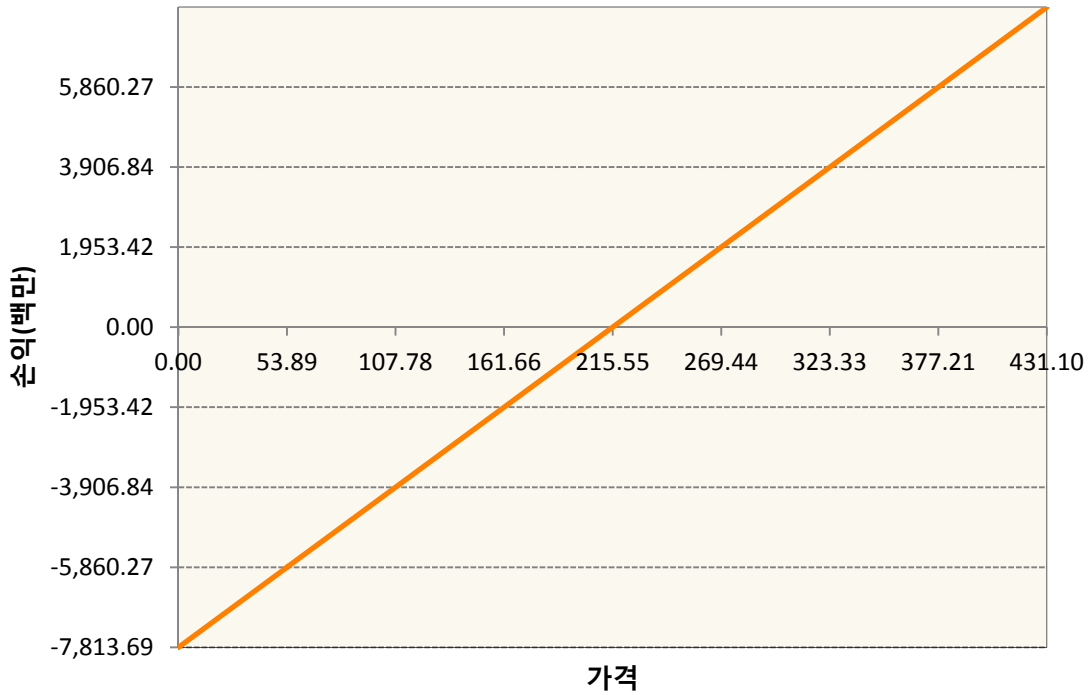
1. 계약금액

(단위:백만원)

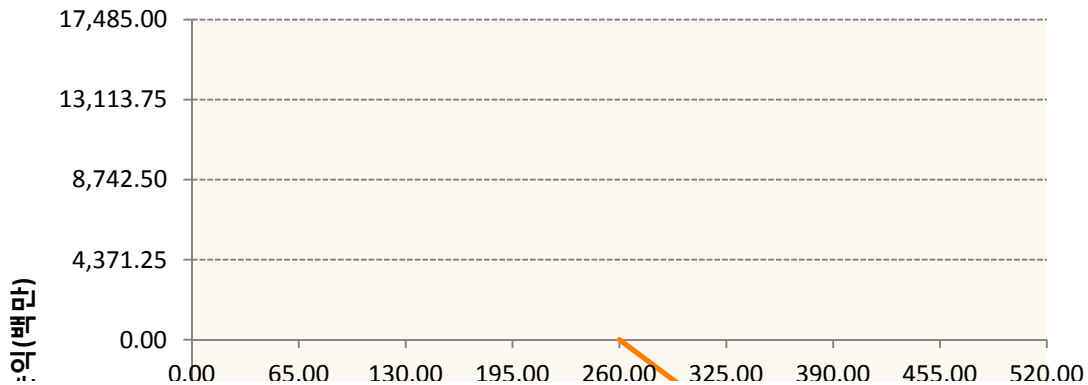
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,814	0	7,814	장내
누계	유가증권	옵션	6,004	17,485	-11,481	장내

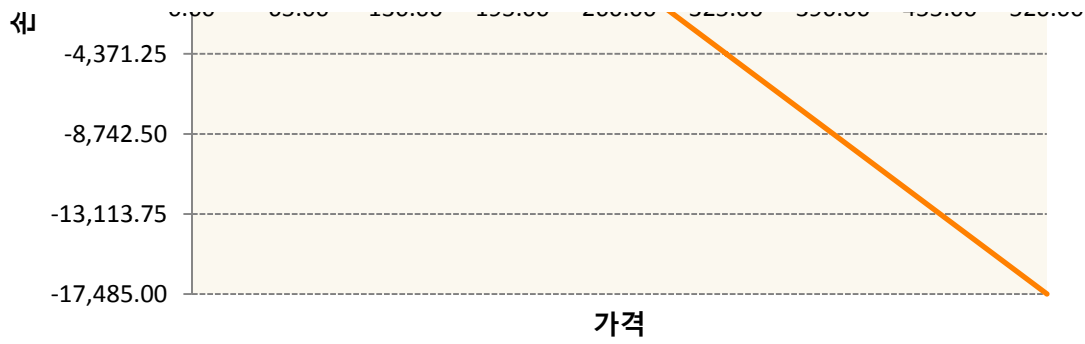
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

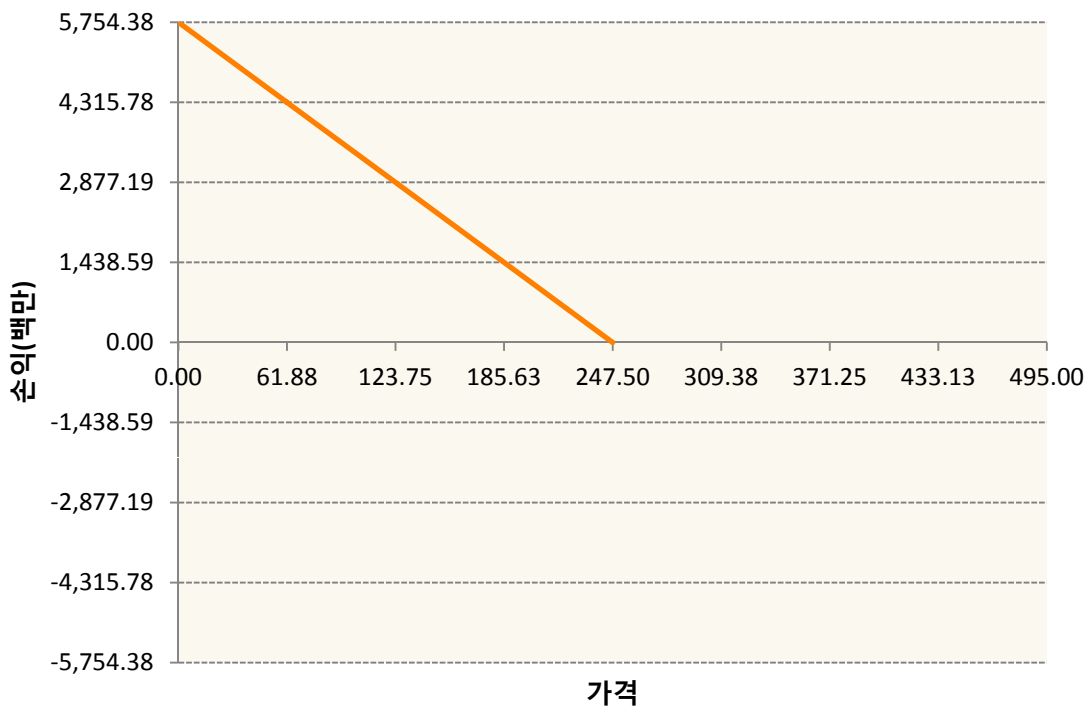


KR4201Q42602-2020-04 콜260

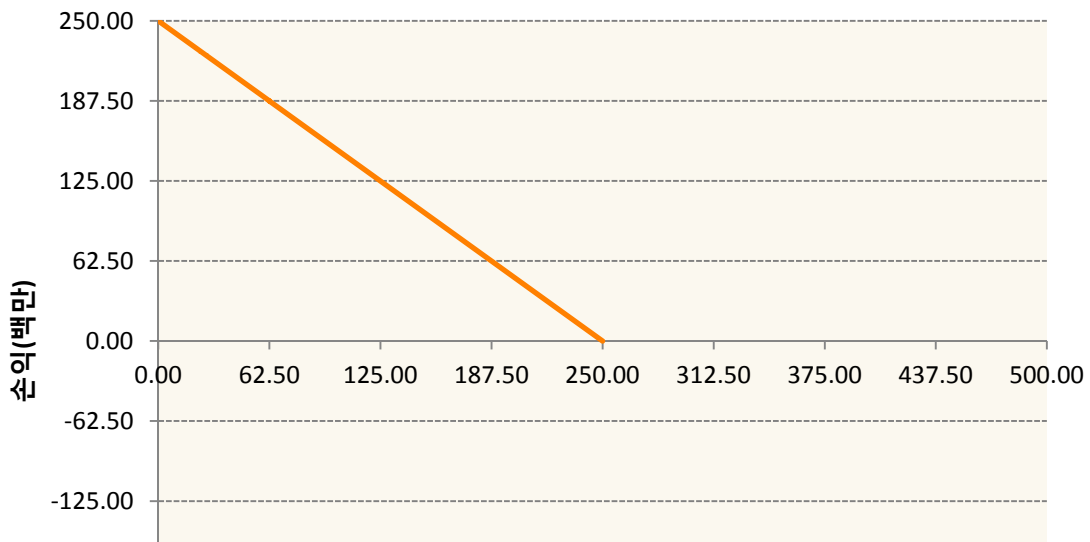


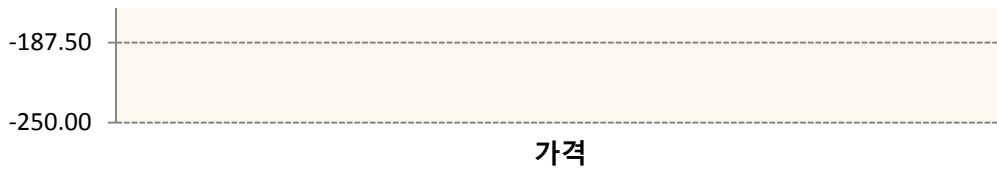


KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



KR4301Q42501-2020-04 풋250





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						620
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-620	-620	-620	-620	-620	-620	-620	
-5.33%	-413	-413	-413	-413	-413	-413	-413	
-2.67%	-207	-207	-207	-207	-207	-207	-207	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	207	207	207	207	207	207	207	
5.33%	413	413	413	413	413	413	413	
8.00%	620	620	620	620	620	620	620	
KR4201Q42602		2020-04 콜260						373
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	97	92	85	75	60	42	20	
-5.33%	93	85	74	58	38	14	-14	
-2.67%	86	73	56	34	7	-24	-59	
0%	73	54	30	0	-34	-73	-115	
2.67%	52	25	-8	-47	-89	-136	-186	
5.33%	19	-18	-61	-108	-159	-214	-271	
8.00%	-30	-78	-130	-187	-246	-309	-373	
KR4301Q42477		2020-04 풋247.5						377
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	317	323	330	340	351	363	377	
-5.33%	191	199	209	222	235	251	267	
-2.67%	68	79	93	108	125	143	162	
0%	-51	-35	-19	0	20	41	63	
2.67%	-163	-144	-124	-102	-79	-56	-31	
5.33%	-268	-246	-222	-197	-172	-146	-120	
8.00%	-365	-339	-312	-285	-258	-230	-202	
KR4301Q42501		2020-04 풋250						16
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	14	14	14	15	15	16	16	
-5.33%	8	9	9	10	10	11	12	
-2.67%	3	4	4	5	5	6	7	

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

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

(단위:백만원)

1,262

공시일	2020-03-23
기준일	2020-03-20

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	7,341	-7,341	
누계	유가증권	수익증권	177,512	0	177,512	

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	2020-03-23
기준일	2020-03-20

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	97,888	0	97,888	

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	2020-03-23
기준일	2020-03-20

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	463,860	0	463,860	
누계	통화	선도	82,269	513,433	-431,164	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,605
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,496
FX21020F03 KRW/USD 31-03-20E	3,191
FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E	2,992
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,692
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,430
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,994
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,989
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,333
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,994
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	199
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	5,086
FX21020G06 USD/KRW 31-03-20E	499
FX21020H00 USD/KRW 31-03-20E	997
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,493
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,074
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,074
FX21020H04 USD/KRW 21-04-20E	1,496
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,433
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	997
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	997
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,593
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)

135

공시일	2020-03-23
기준일	2020-03-20

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

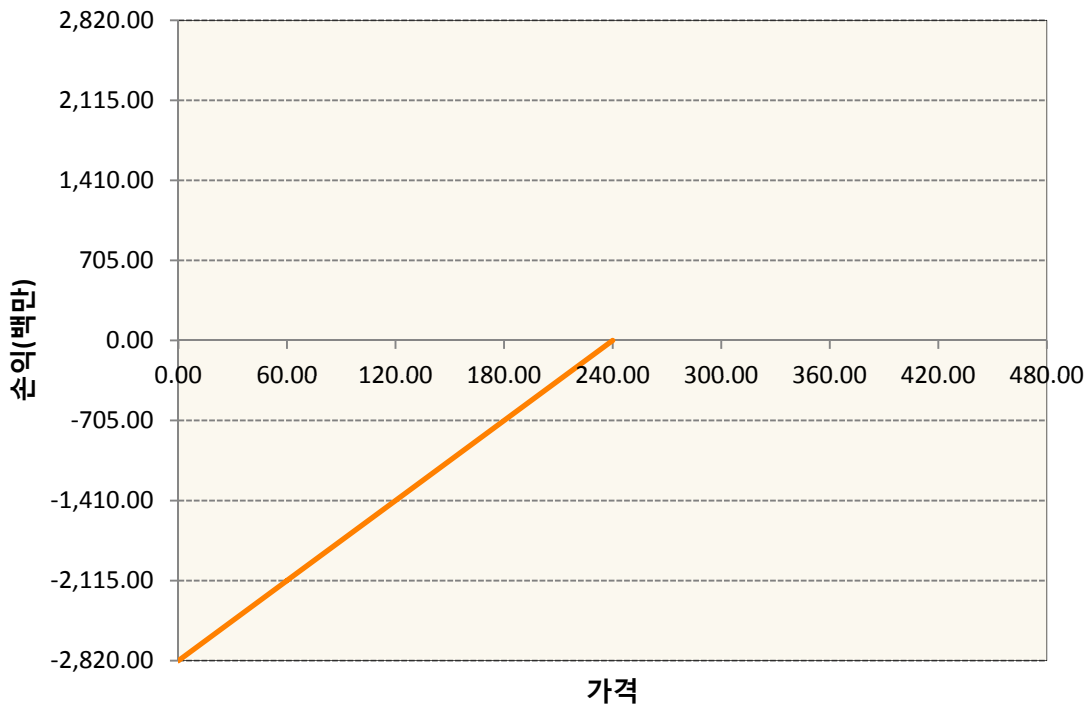
1. 계약금액

(단위:백만원)

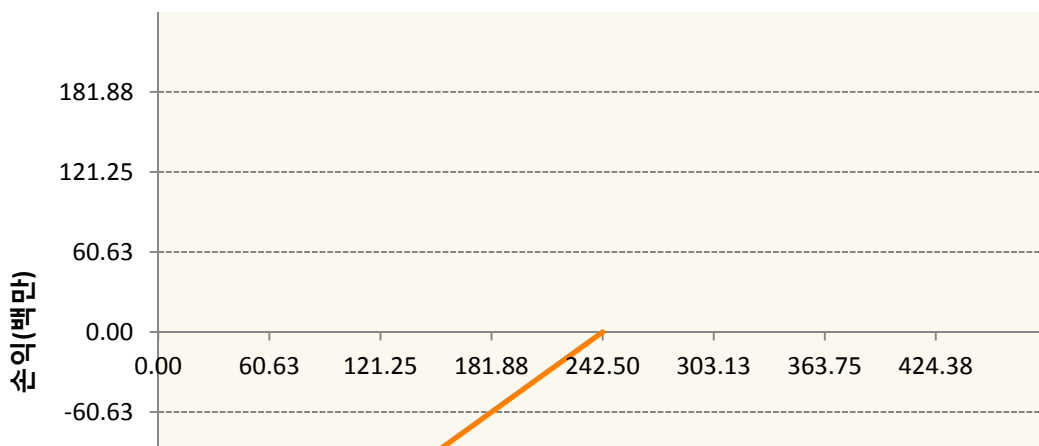
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,063	-3,063	장내

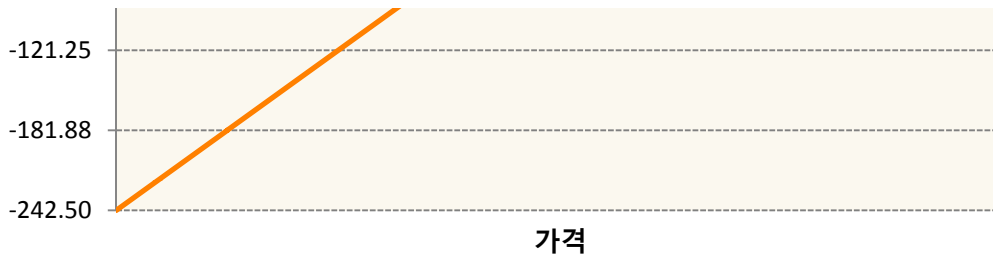
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q42402-2020-04 풋240



KR4301Q42428-2020-04 풋242.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q42402		2020-04 풋240						185
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-147	-151	-156	-162	-169	-177	-185	
-5.33%	-85	-91	-98	-105	-114	-123	-132	
-2.67%	-26	-33	-42	-51	-61	-71	-82	
0%	31	21	11	0	-11	-23	-35	
2.67%	83	72	60	47	35	22	9	
5.33%	131	118	105	91	77	64	50	
8.00%	174	160	145	131	116	102	87	
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	-14	-14	-15	-15	-16	
-5.33%	-8	-8	-9	-9	-10	-11	-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%	15	14	13	12	10	9	8	

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

178

공시일	2020-03-23
기준일	2020-03-20

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	7,874	0	7,874	
누계	통화	선도	1,945	9,660	-7,716	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
FX21020H07 USD/KRW 31-03-20E	23
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

400

공시일	2020-03-23
기준일	2020-03-20

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

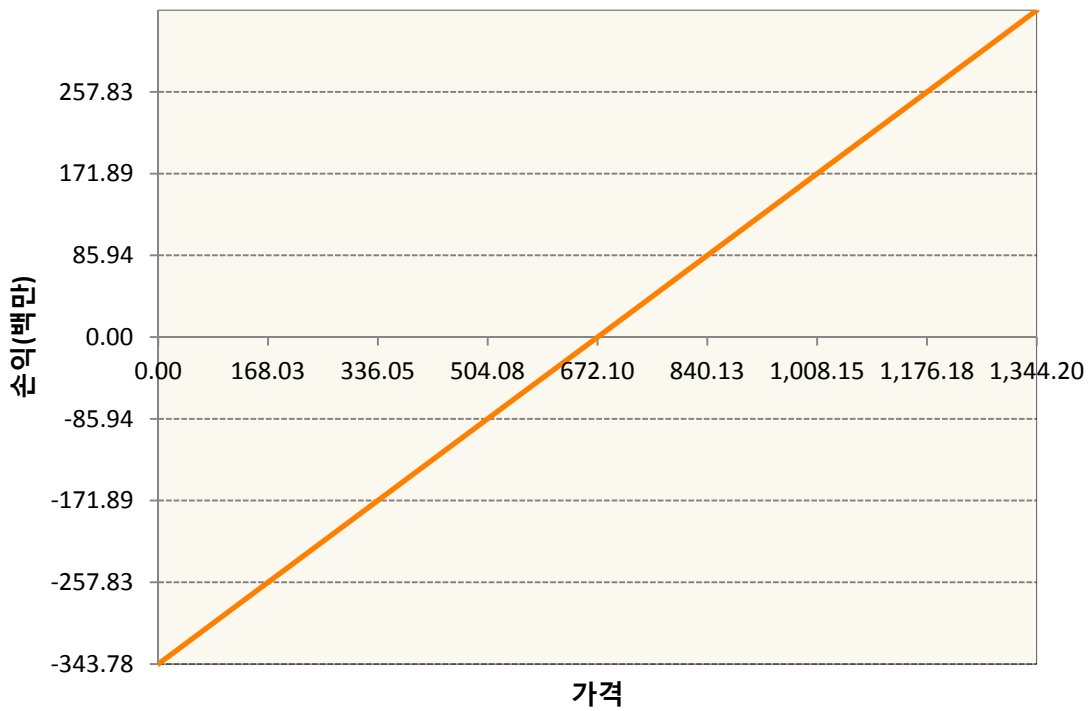
1. 계약금액

(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	344	0	344	
누계	유가증권	스왑	1,106	0	1,106	장외
누계	통화	선도	469	737	-268	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCJ0-VN30 Index Future Apr20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	88
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
FX21020H04 EUR/KRW 27-03-20E	13
VNCJ0 VN30 Index Future Apr20	28

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

(단위:백만원)

142

공시일	2020-03-23
기준일	2020-03-20

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

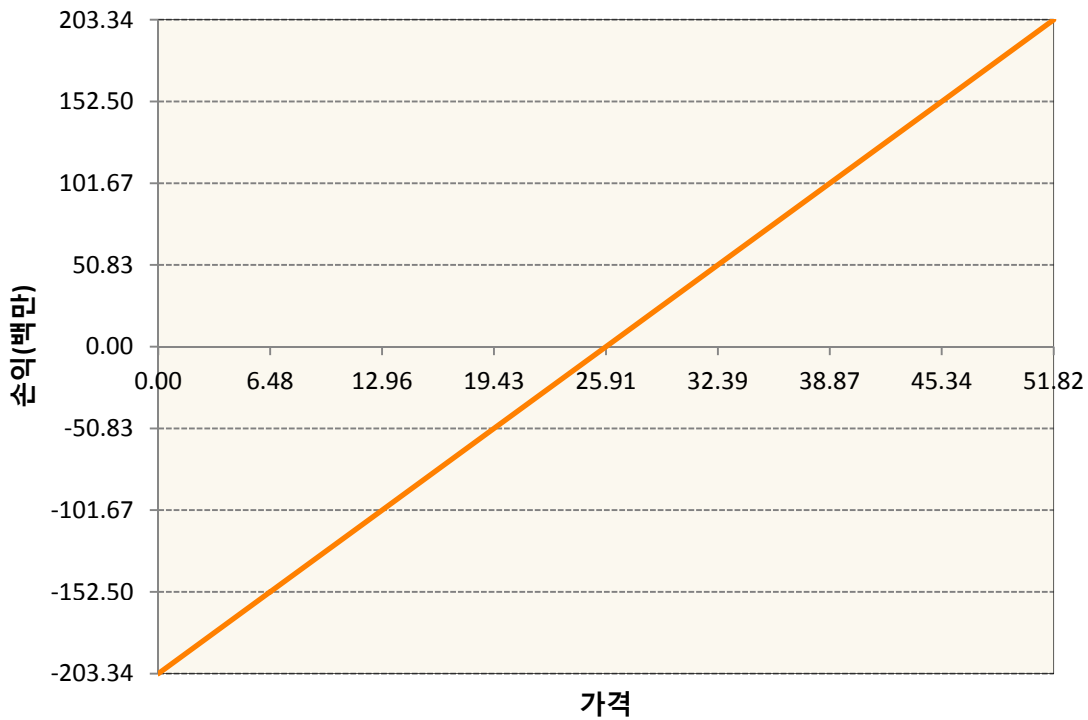
1. 계약금액

(단위:백만원)

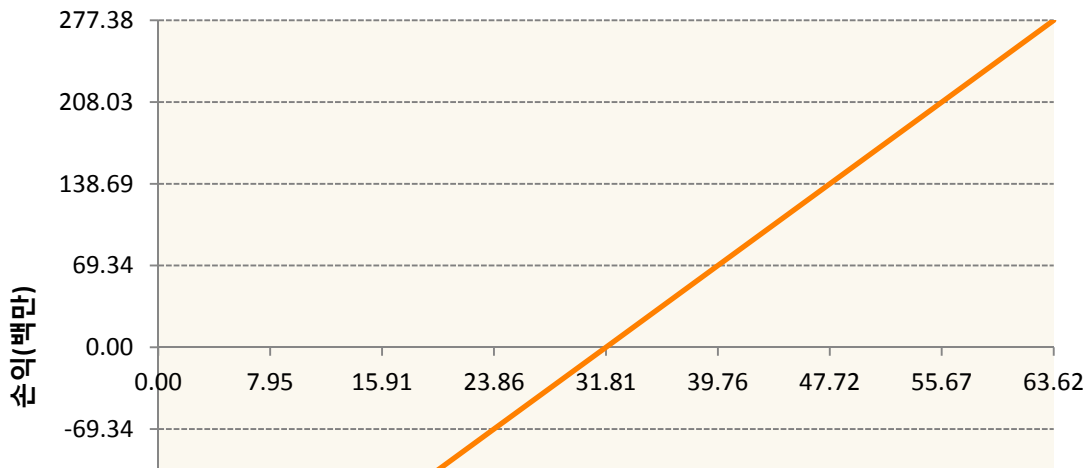
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,294	124	1,169	

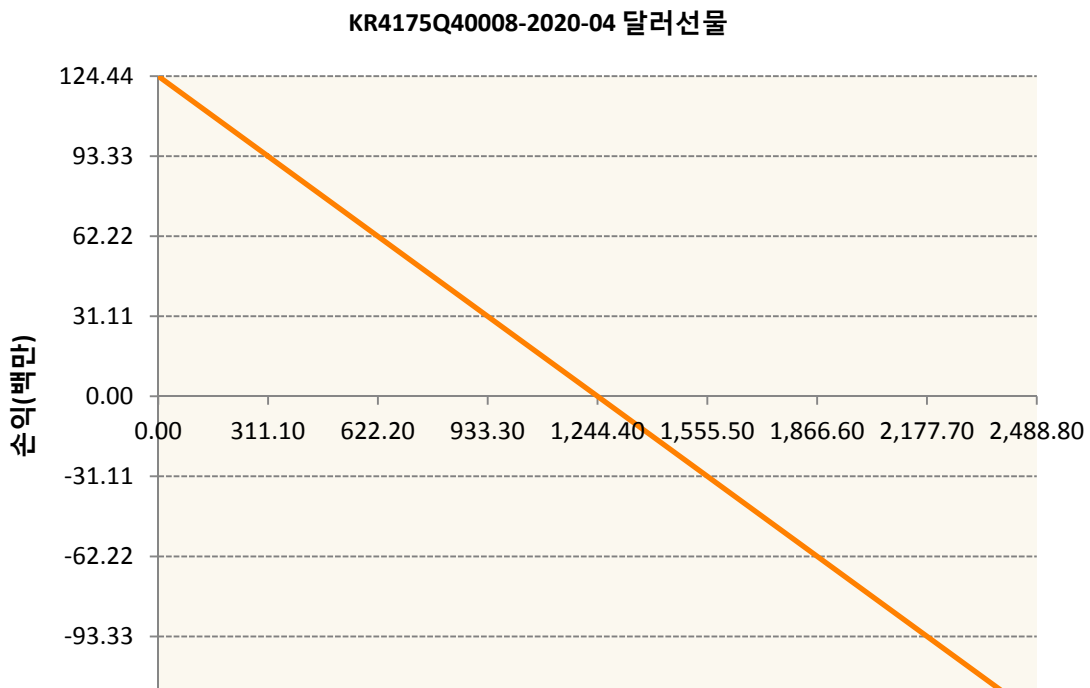
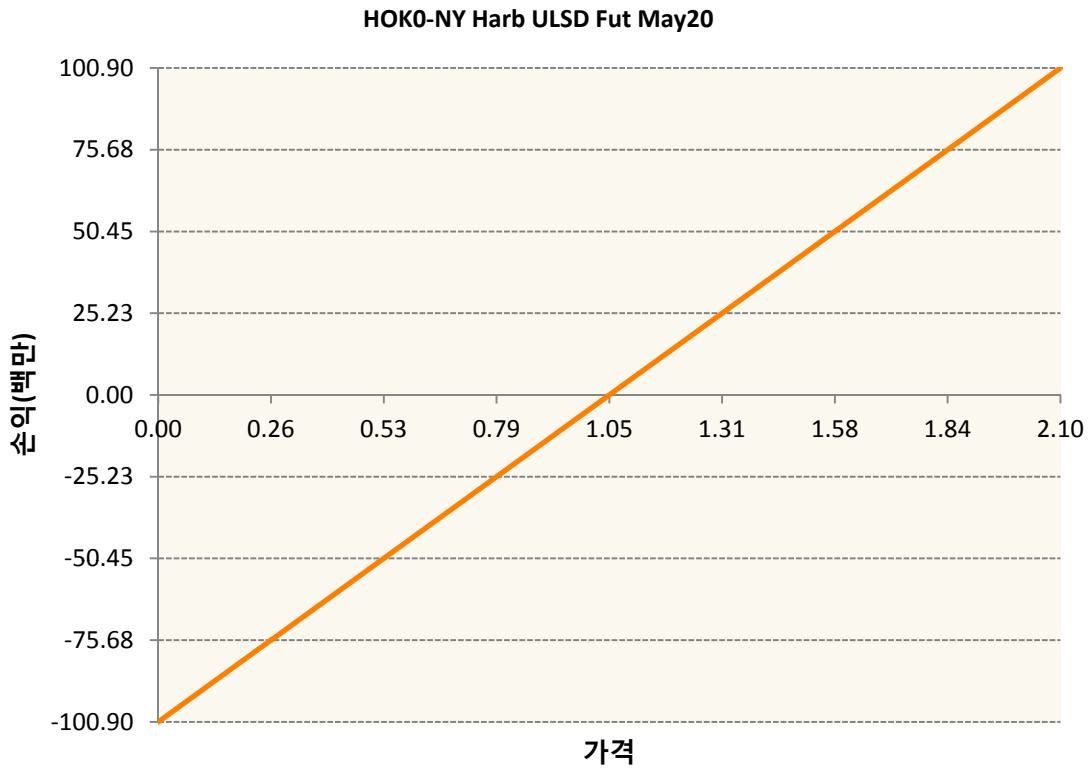
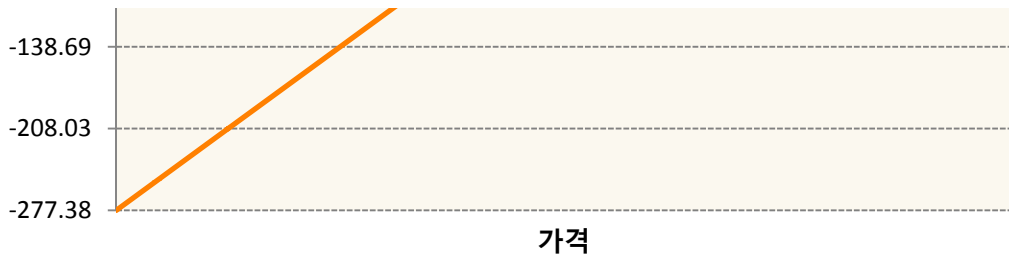
2. 만기시점의 손익구조

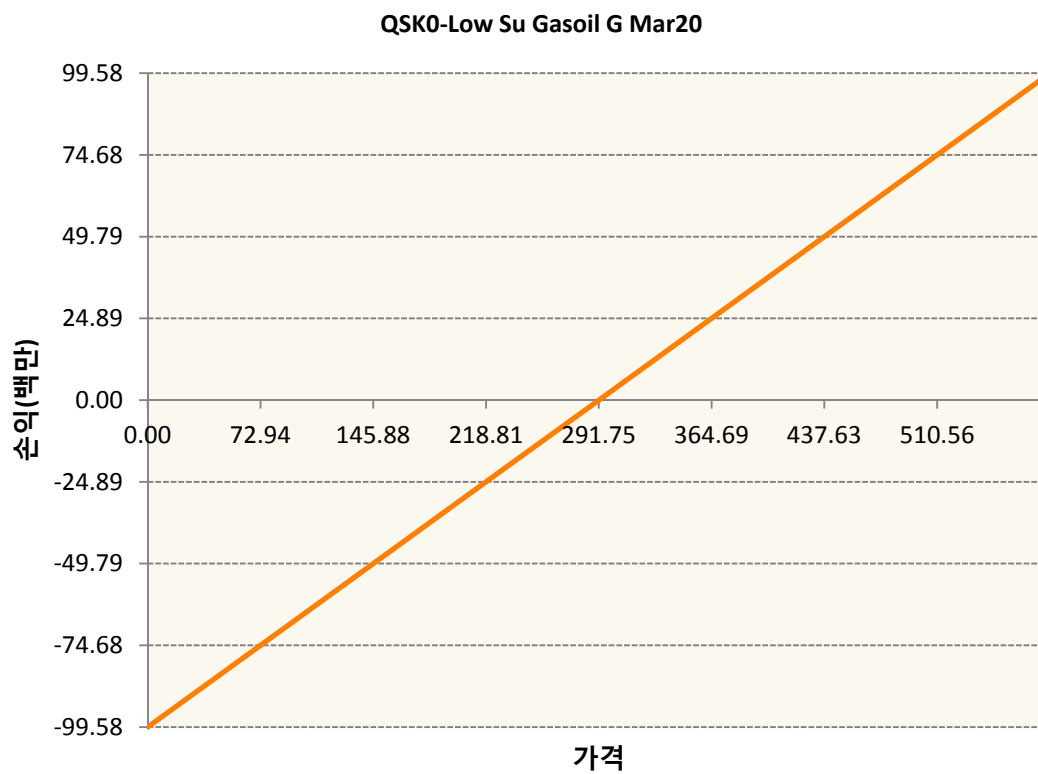
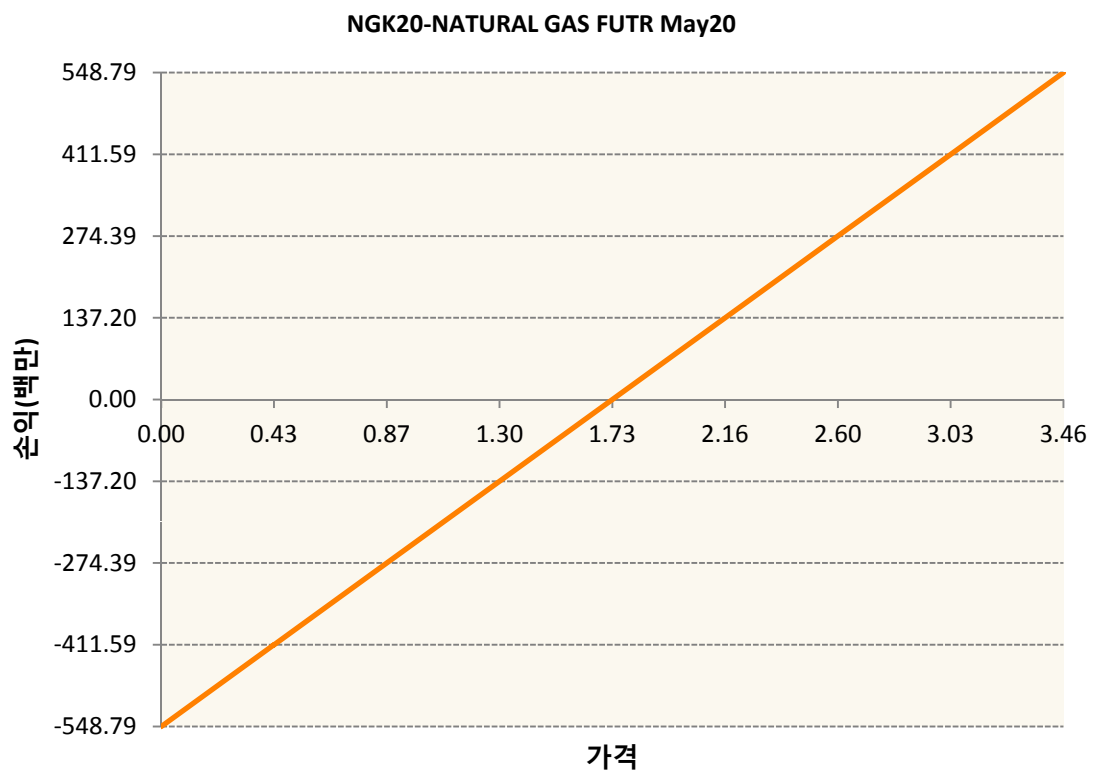
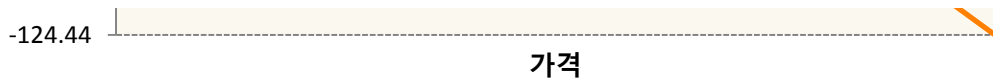
CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20



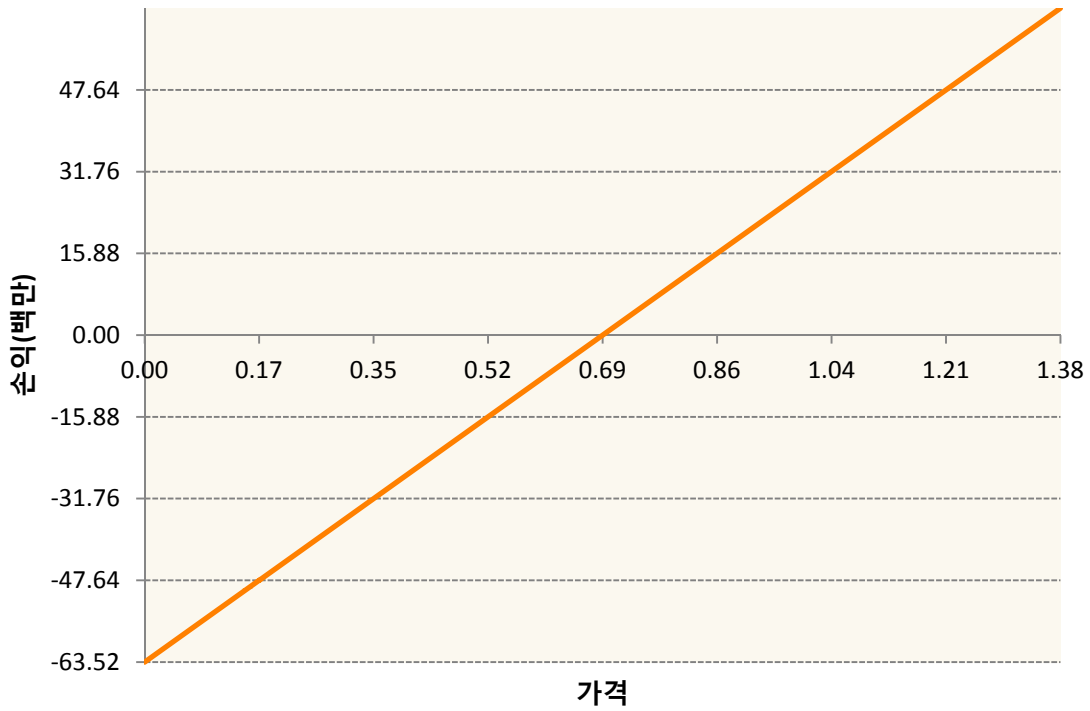
CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20







XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	16
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	22
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	8
KR4175Q40C	2020-04 달러선물	10
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	44
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	8
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	5

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

(단위:백만원)

282

공시일	2020-03-23
기준일	2020-03-20

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

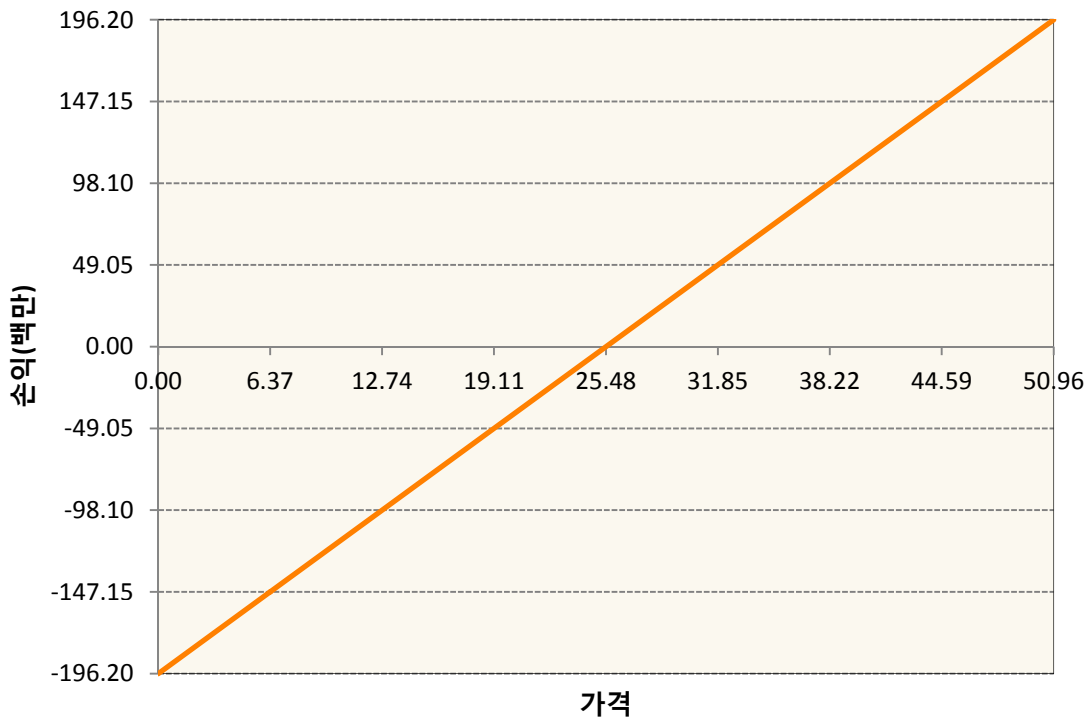
1. 계약금액

(단위:백만원)

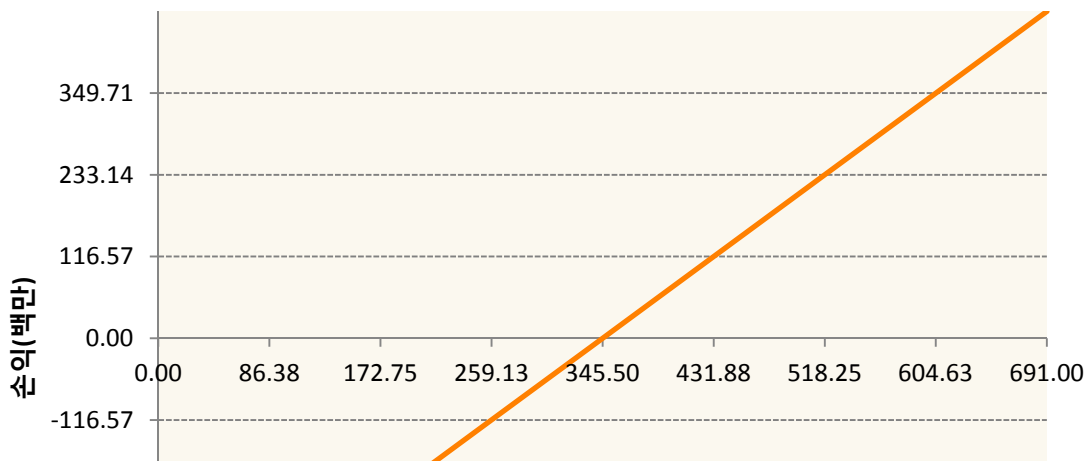
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,332	100	2,232	

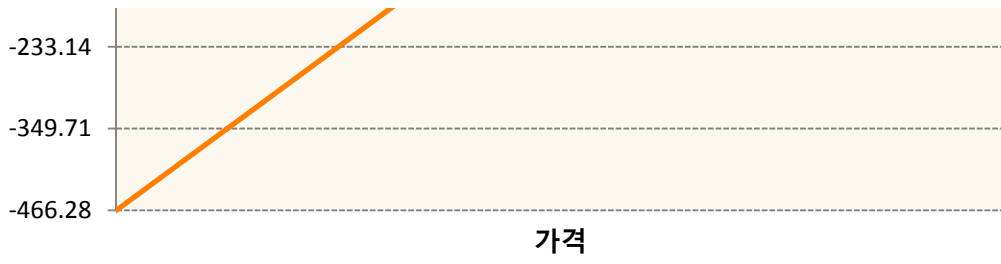
2. 만기시점의 손익구조

BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20

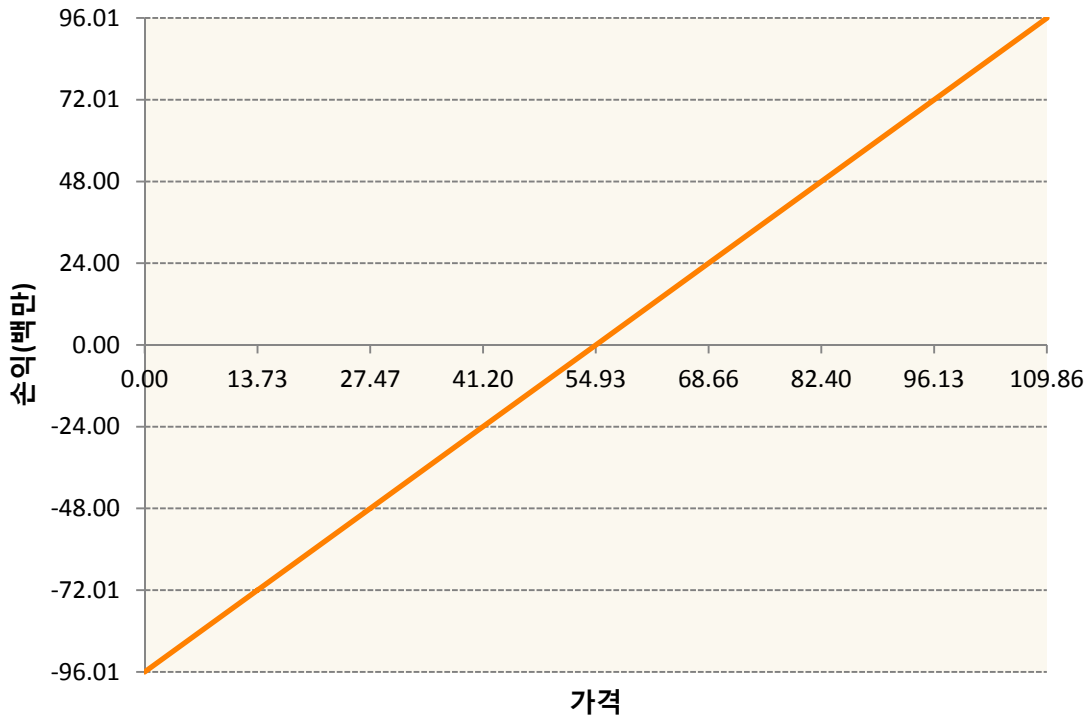


CK0-CORN FUTURE May20

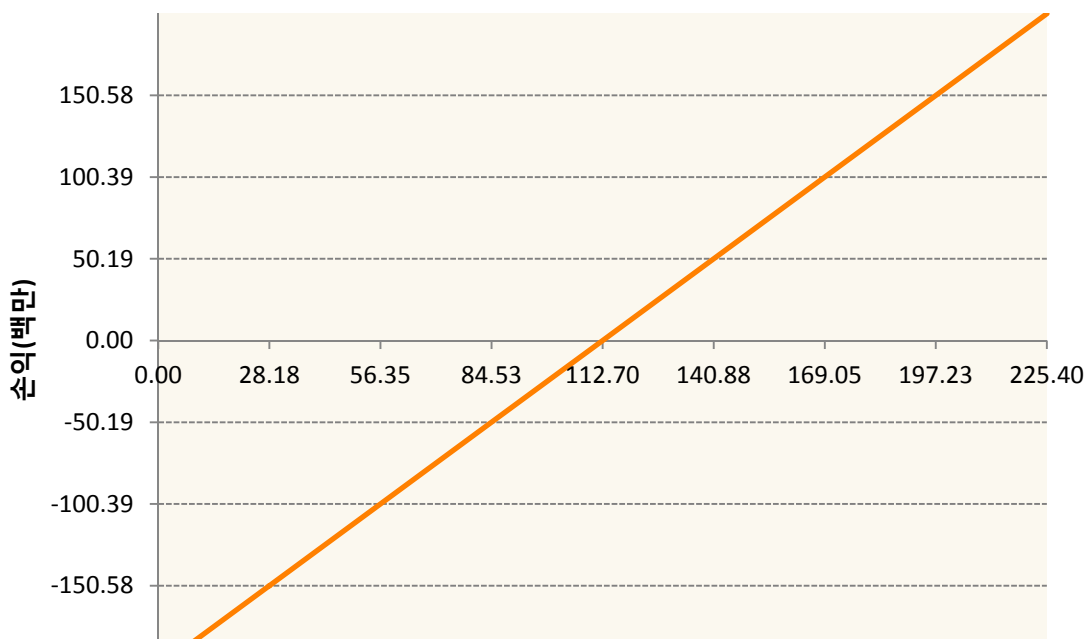


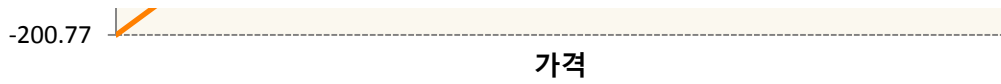


CTK0-COTTON NO.2 FUTR May20

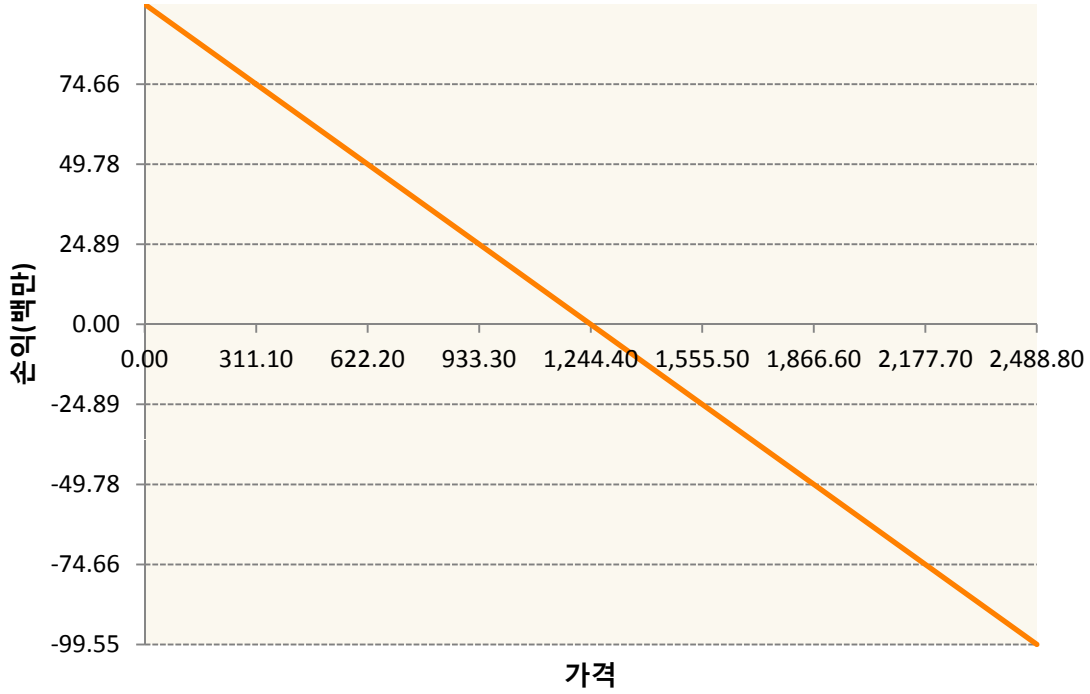


KCK0-COFFEE 'C' FUTURE May20

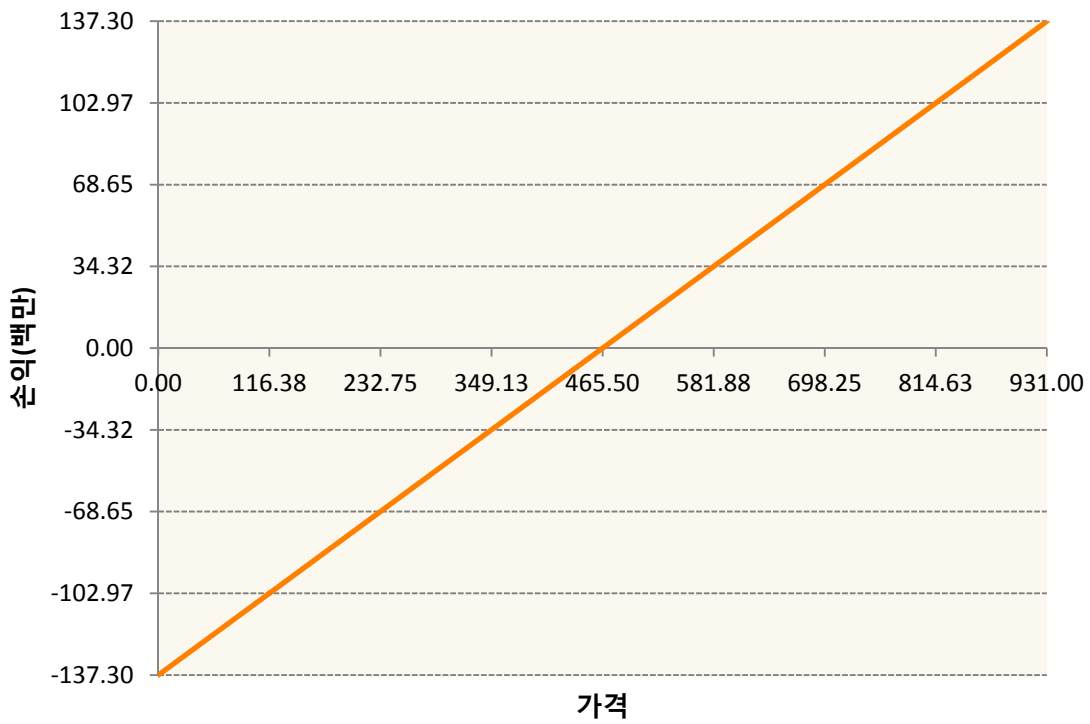




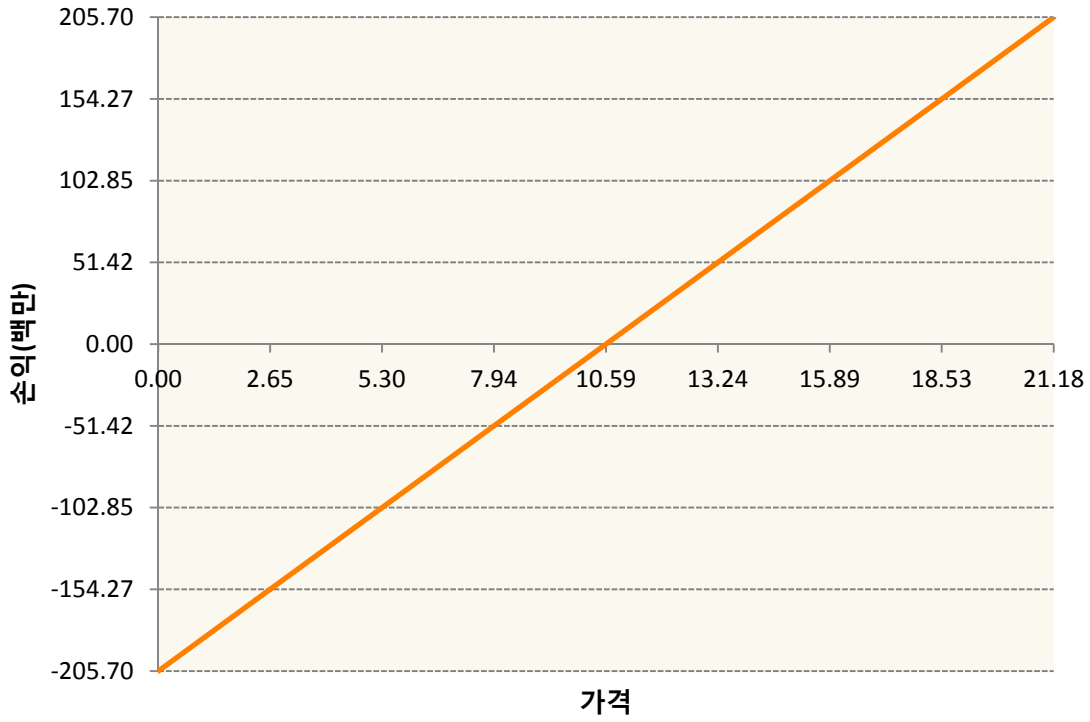
KR4175Q40008-2020-04 달러선물



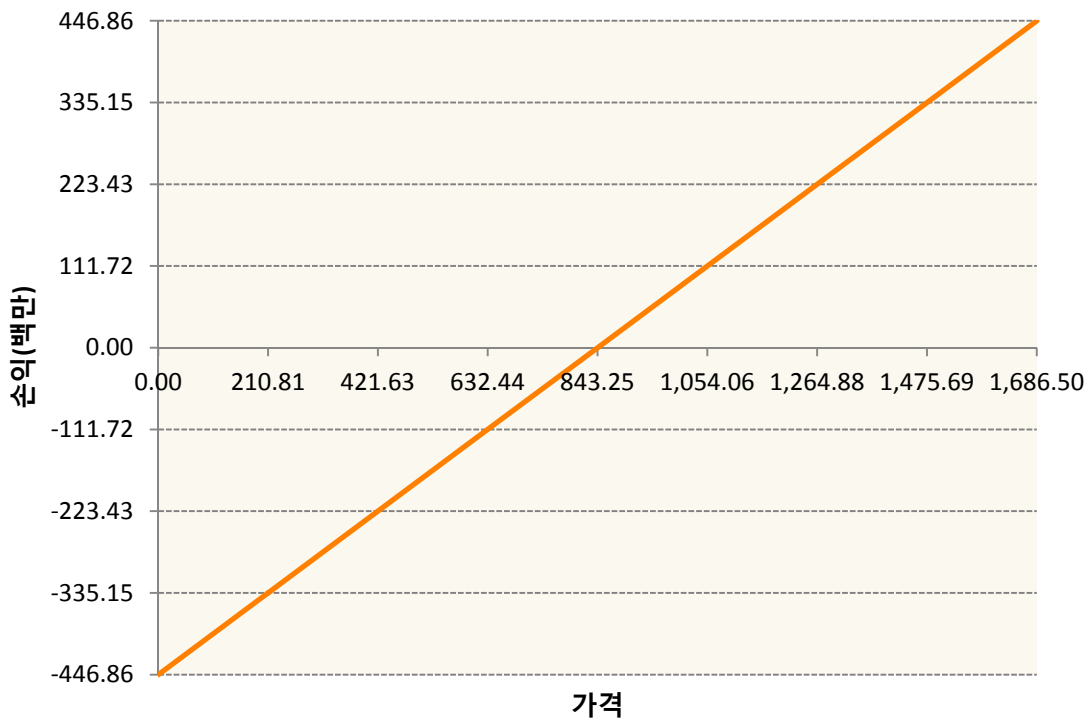
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



SBK0-Sugar May20

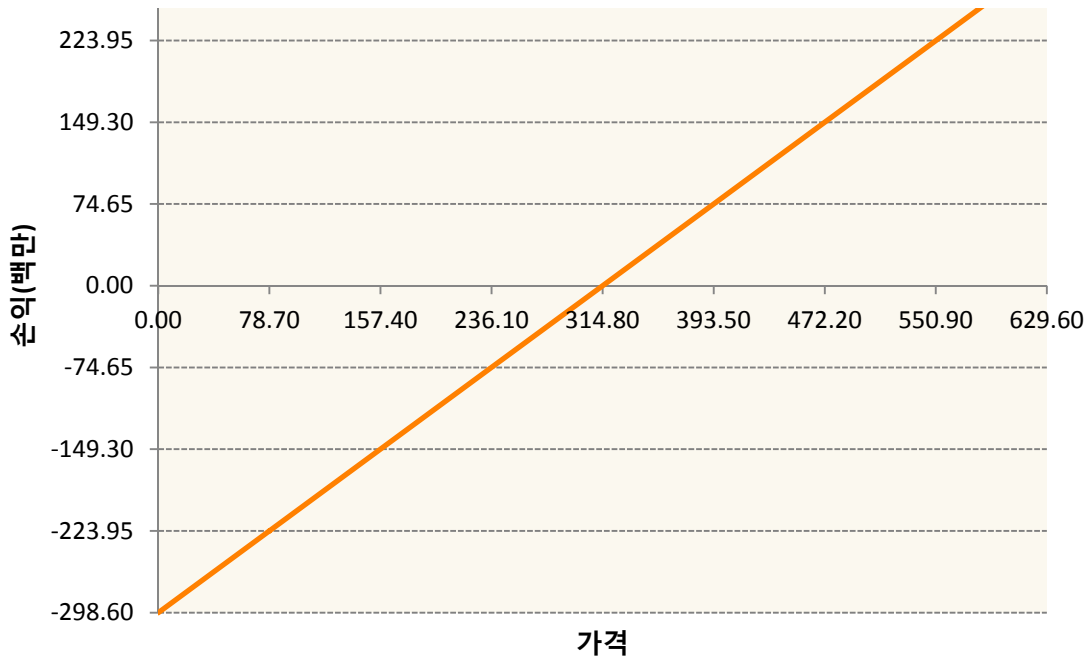


SK0-SOYBEAN FUTURE May20

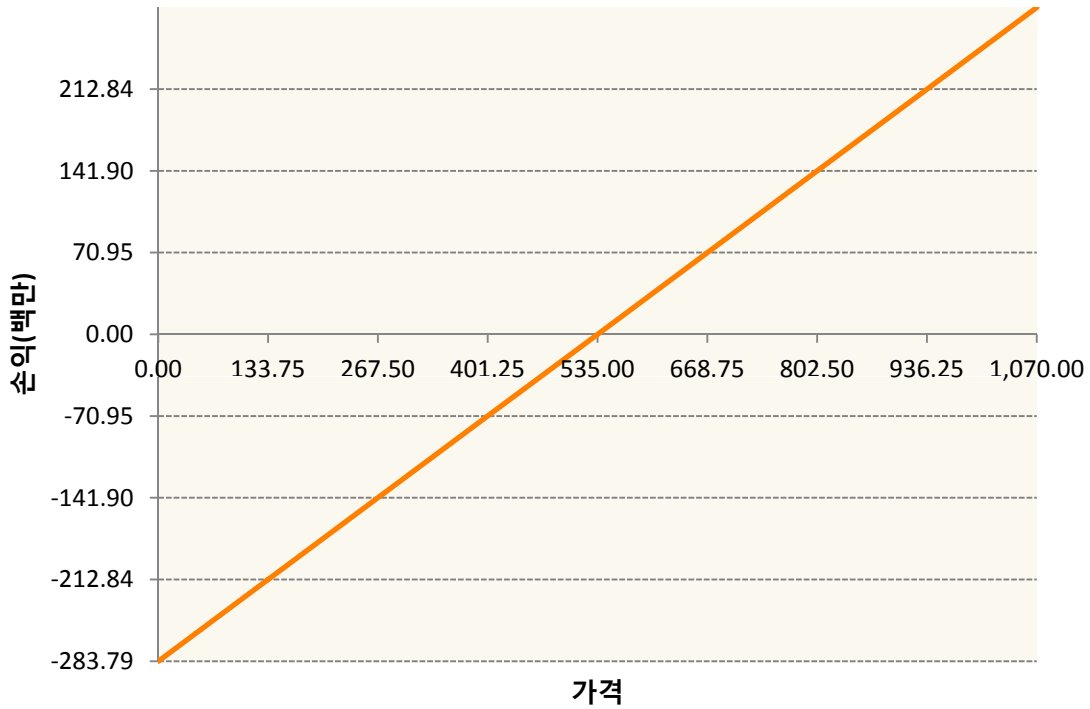


SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





WK0-WHEAT FUTURE(CBT) May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	16
CK0	CORN FUTURE May20	37
CTK0	COTTON NO.2 FUTR May20	8
KCK0	COFFEE 'C' FUTURE May20	16
KR4175Q40C	2020-04 달러선물	8

KWK0	KC HRW WHEAT FUT May20	11
SBK0	Sugar May20	16
SK0	SOYBEAN FUTURE May20	36
SMK0	SOYBEAN MEAL FUTR May20	24
WK0	WHEAT FUTURE(CBT) May20	23

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

(단위:백만원)

210