

공시일	2020-03-24
기준일	2020-03-23

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	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	2020-03-24
기준일	2020-03-23

스마트인덱스모

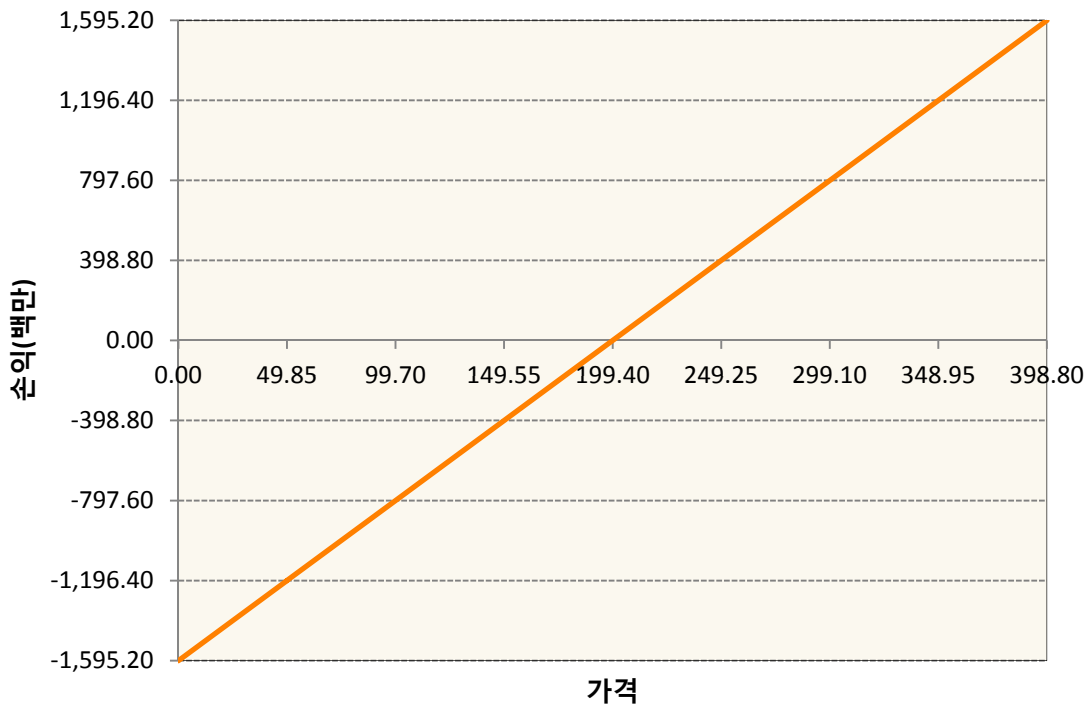
1. 계약금액

(단위:백만원)

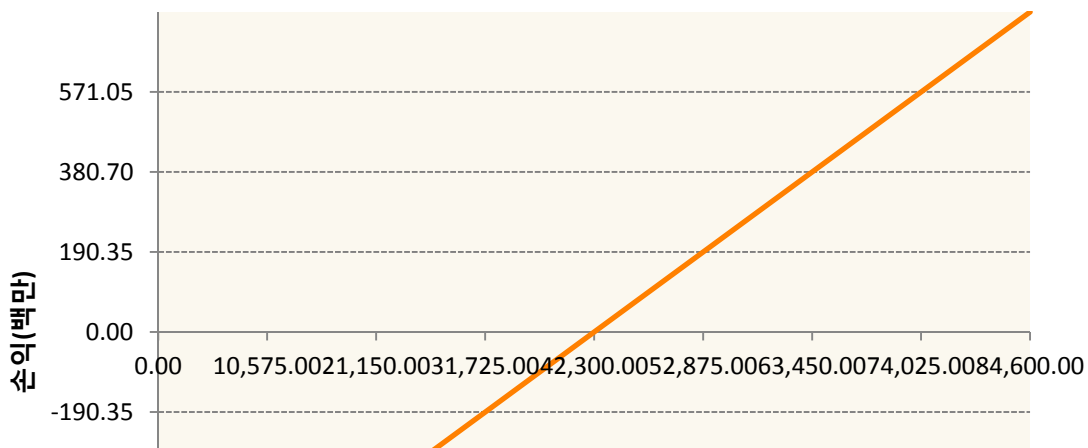
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,357	0	2,357	장내

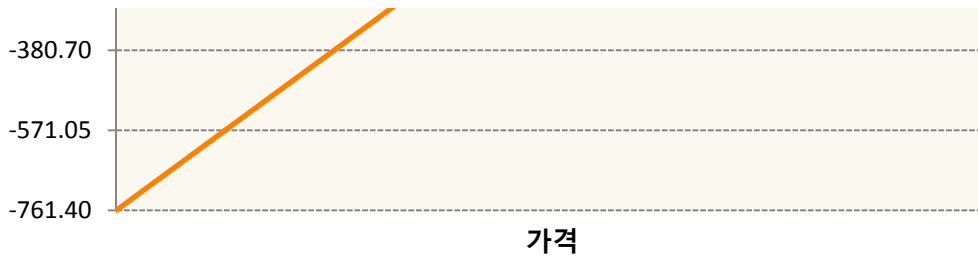
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



KR4111Q40003-2020-04 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						129
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-129	-129	-129	-129	-129	-129	-129	
-5.33%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86	
-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%	86	86	86	86	86	86	86	
8.00%	129	129	129	129	129	129	129	
KR4111Q40003		2020-04 삼성전자개별선물						61
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61	
-5.33%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41	
-2.67%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	20	20	20	20	20	20	20	
5.33%	41	41	41	41	41	41	41	
8.00%	61	61	61	61	61	61	61	

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

244

공시일	2020-03-24
기준일	2020-03-23

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

778

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

791

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-24
기준일	2020-03-23

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

515

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

802

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-24
기준일	2020-03-23

유로인덱스모(주식-파생형)

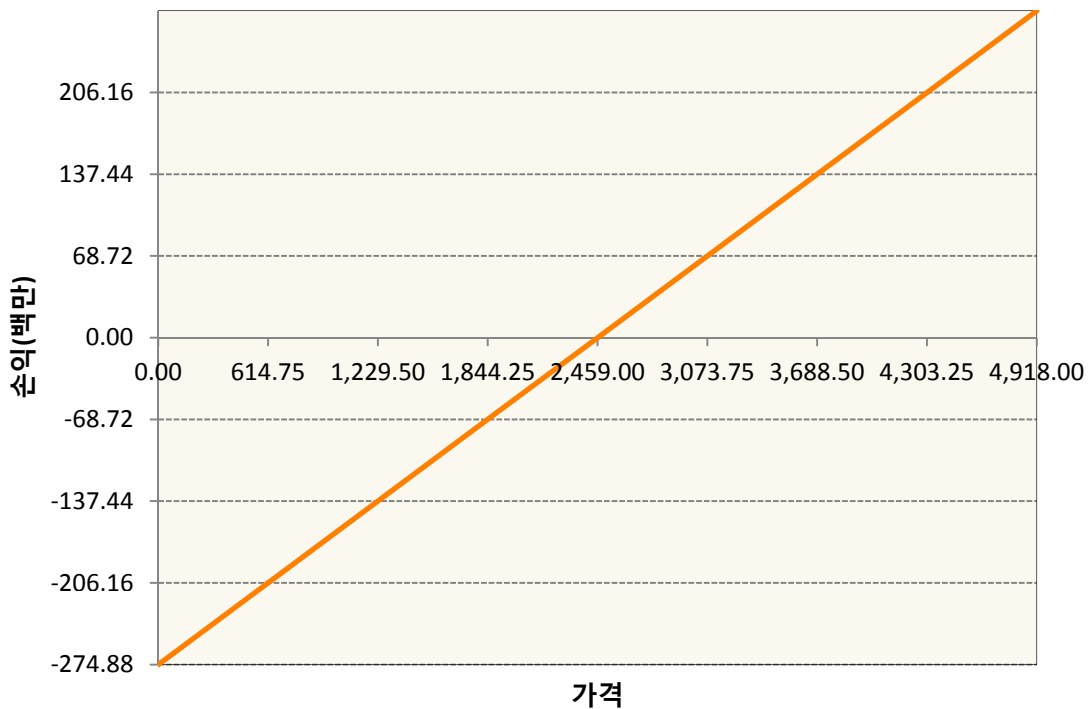
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	275	0	275	

2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	22
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

23

공시일	2020-03-24
기준일	2020-03-23

차이나인덱스모(주식-파생형)

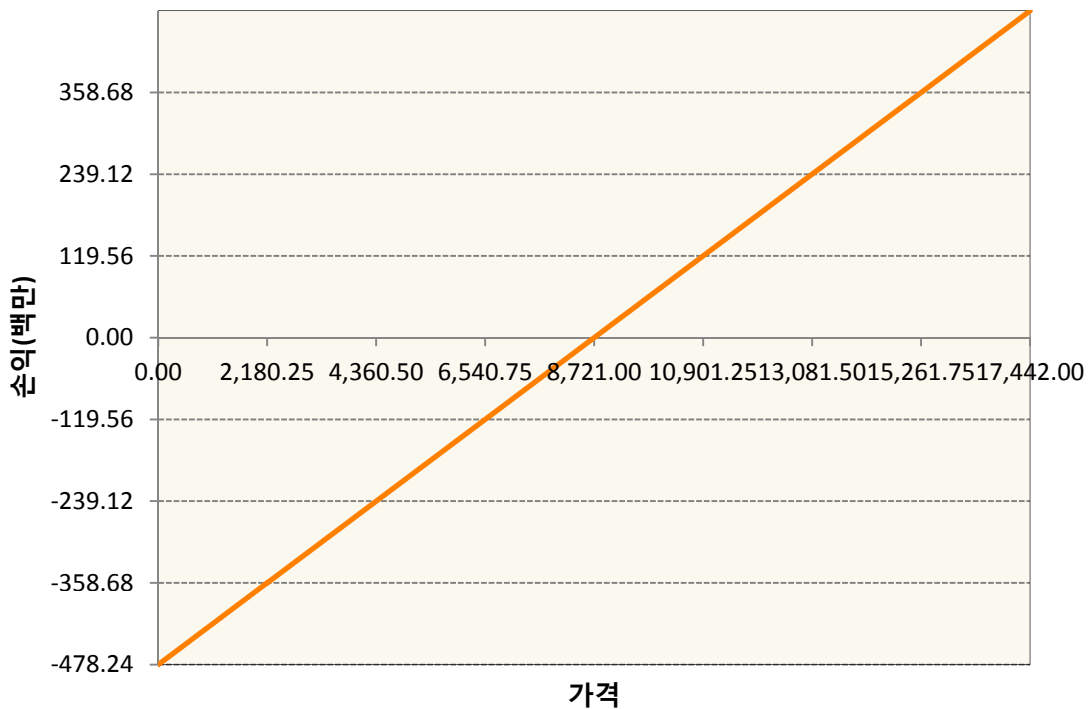
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	478	0	478	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)

39

공시일	2020-03-24
기준일	2020-03-23

커버드콜모(주식혼합-파생형)

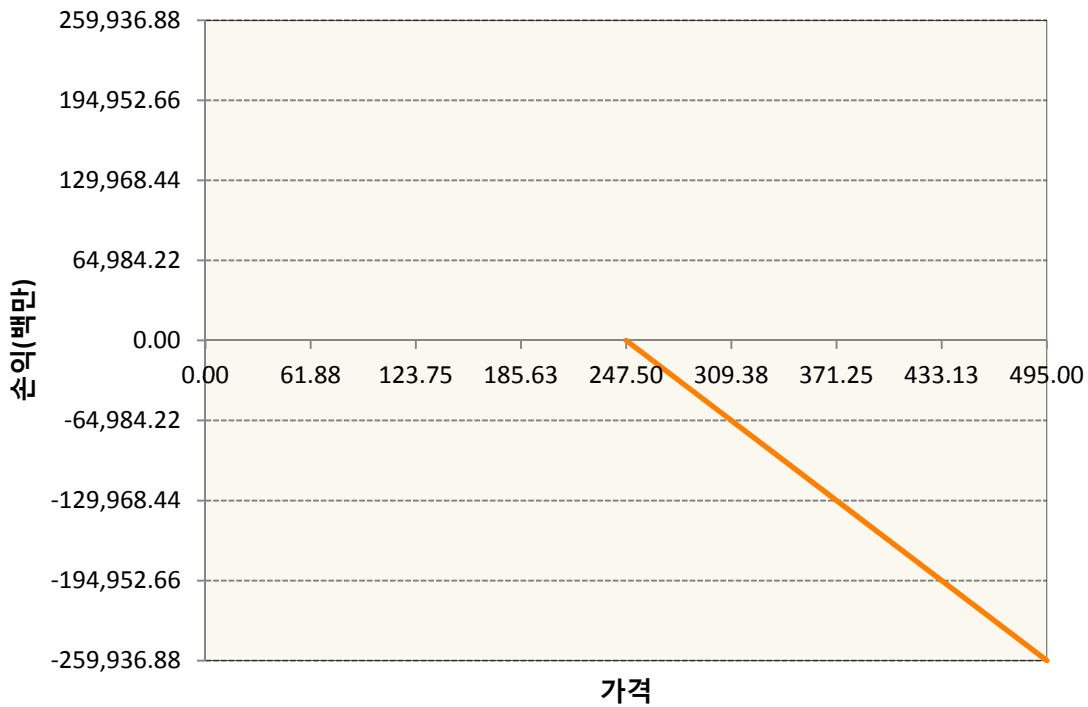
1. 계약금액

(단위:백만원)

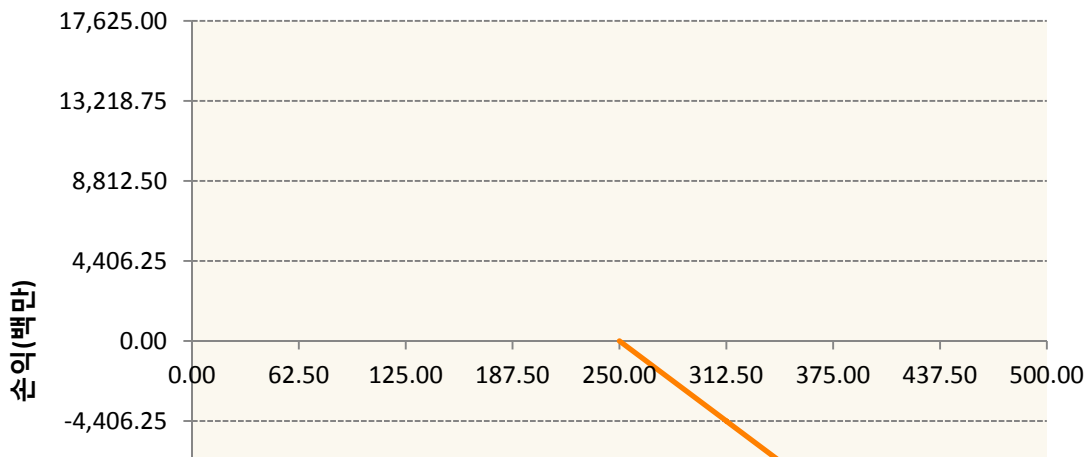
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	367,281	-367,281	장내

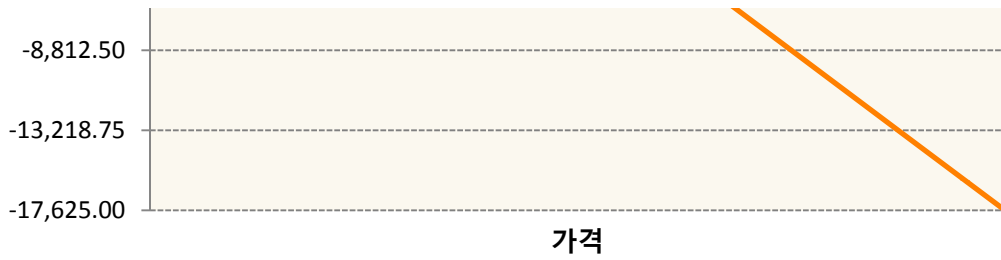
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

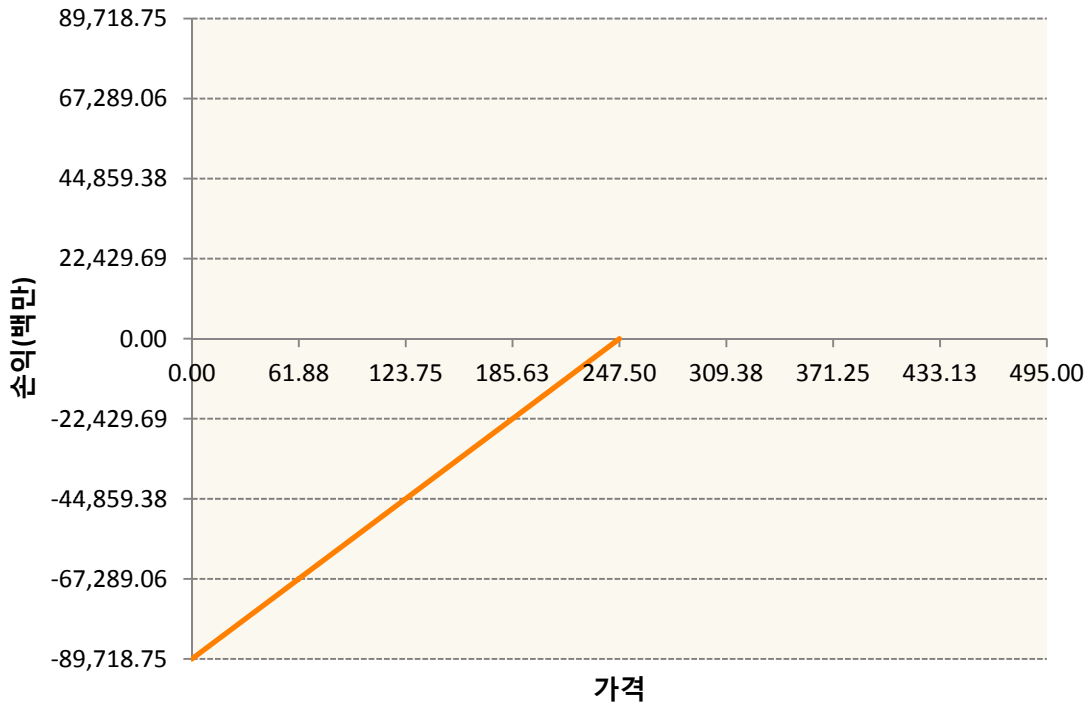


KR4201Q42503-2020-04 콜250





KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q42479		2020-04 콜247.5					5,573	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,493	1,421	1,304	1,132	902	613	266	
-5.33%	1,433	1,311	1,128	878	563	183	-258	
-2.67%	1,322	1,127	857	512	95	-389	-933	
0%	1,131	837	458	0	-531	-1,127	-1,781	
2.67%	818	401	-105	-690	-1,344	-2,058	-2,824	
5.33%	338	-223	-871	-1,591	-2,372	-3,206	-4,083	
8.00%	-364	-1,084	-1,879	-2,735	-3,642	-4,590	-5,573	
KR4201Q42503		2020-04 콜250					349	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	88	84	77	67	53	35	14	

-5.33%	85	78	67	52	33	9	-18
-2.67%	79	67	51	30	5	-25	-60
0%	68	51	28	0	-33	-71	-112
2.67%	51	26	-5	-41	-83	-128	-177
5.33%	23	-11	-51	-96	-146	-199	-256
8.00%	-18	-62	-112	-166	-224	-285	-349
KR4301Q42477 2020-04 풋247.5							5,750
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,245	-5,277	-5,329	-5,401	-5,495	-5,612	-5,750
-5.33%	-3,323	-3,376	-3,453	-3,555	-3,681	-3,831	-4,003
-2.67%	-1,422	-1,504	-1,614	-1,751	-1,915	-2,102	-2,311
0%	447	328	179	0	-204	-432	-679
2.67%	2,271	2,108	1,912	1,688	1,440	1,171	885
5.33%	4,035	3,819	3,573	3,302	3,010	2,700	2,375
8.00%	5,719	5,448	5,151	4,833	4,497	4,148	3,787

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

(단위:백만원)

8,229

공시일	2020-03-24
기준일	2020-03-23

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

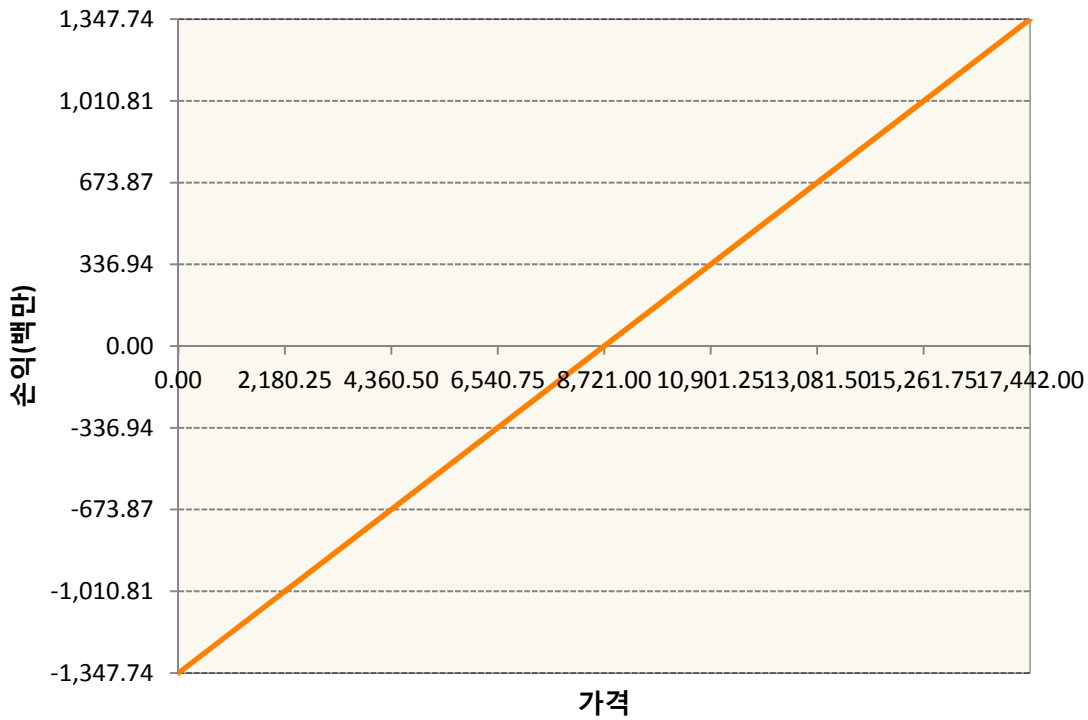
1. 계약금액

(단위:백만원)

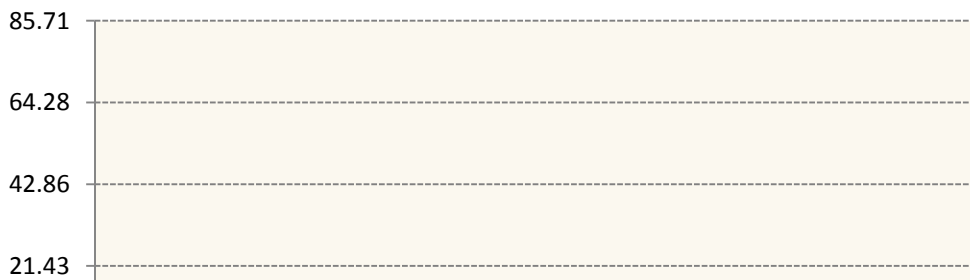
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,348	0	1,348	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,844	-4,844	장내
누계	통화	선도	718	2,299	-1,580	장외

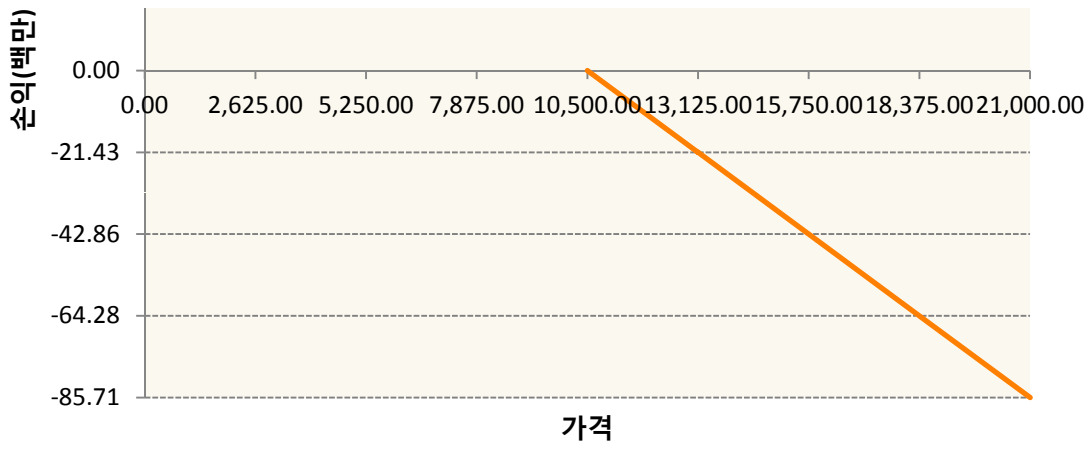
2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20

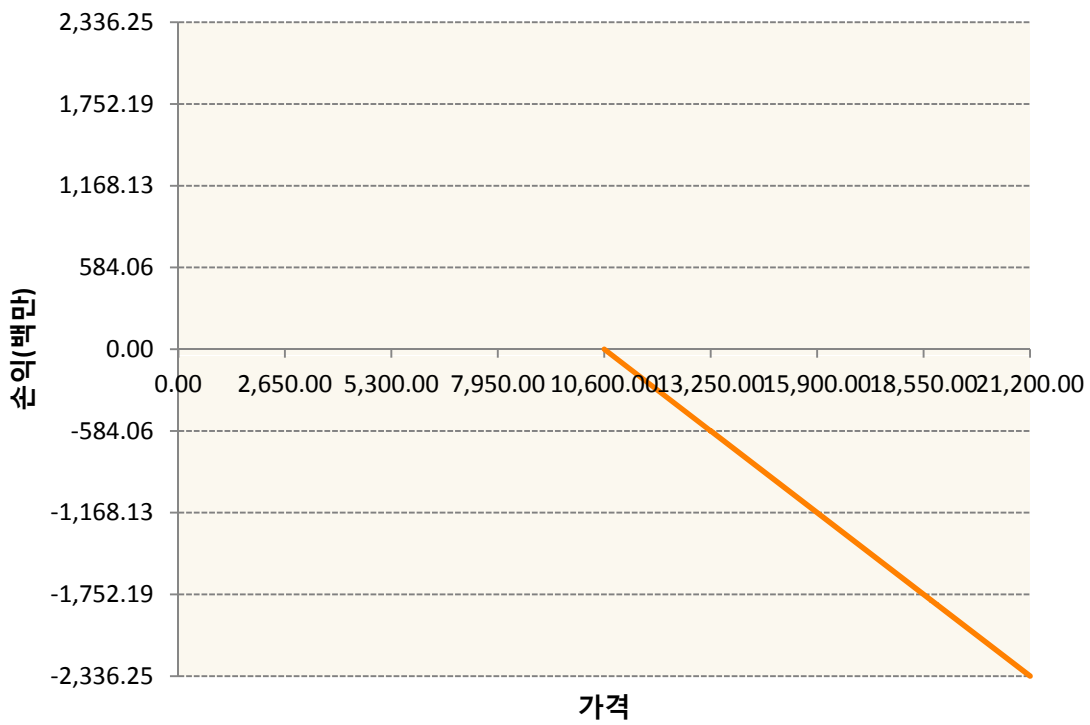


OHHIH0-C105-HSCEI

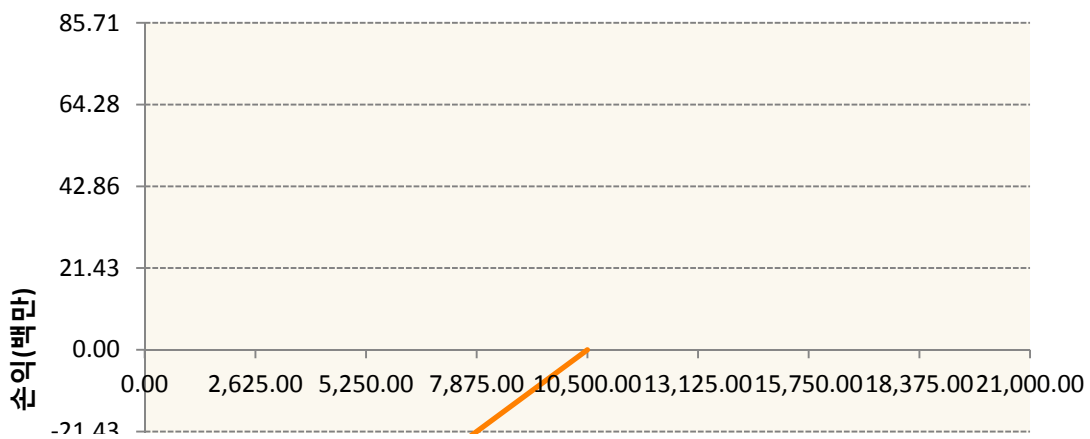


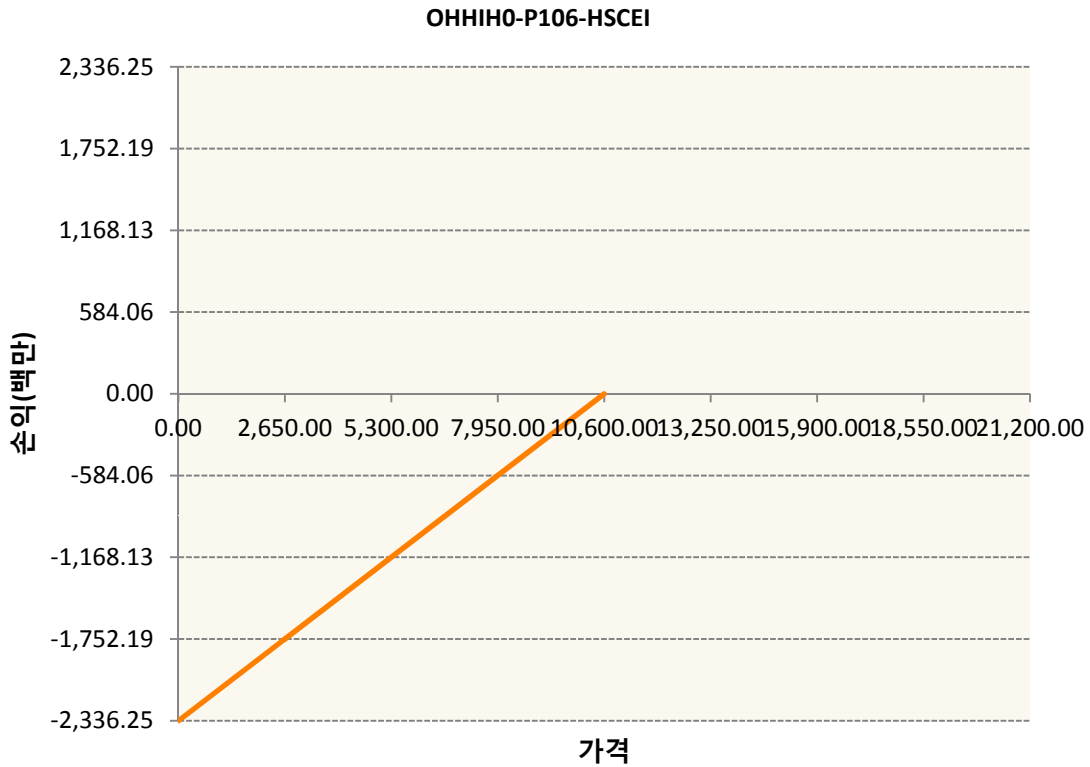
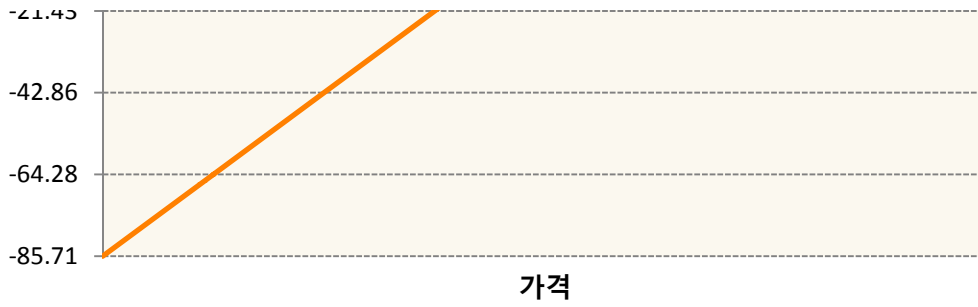


OHHIH0-C106-HSCEI



OHHIH0-P105-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E		184
FX21020H05 HKD/KRW 22-05-20E		57
HCH0 HSCEI Futures Mar20		108
OHHIH0-C1(HSCEI		7
OHHIH0-C1(HSCEI		187
OHHIH0-P1(HSCEI		7
OHHIH0-P1(HSCEI		187

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	607

공시일	2020-03-24
기준일	2020-03-23

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

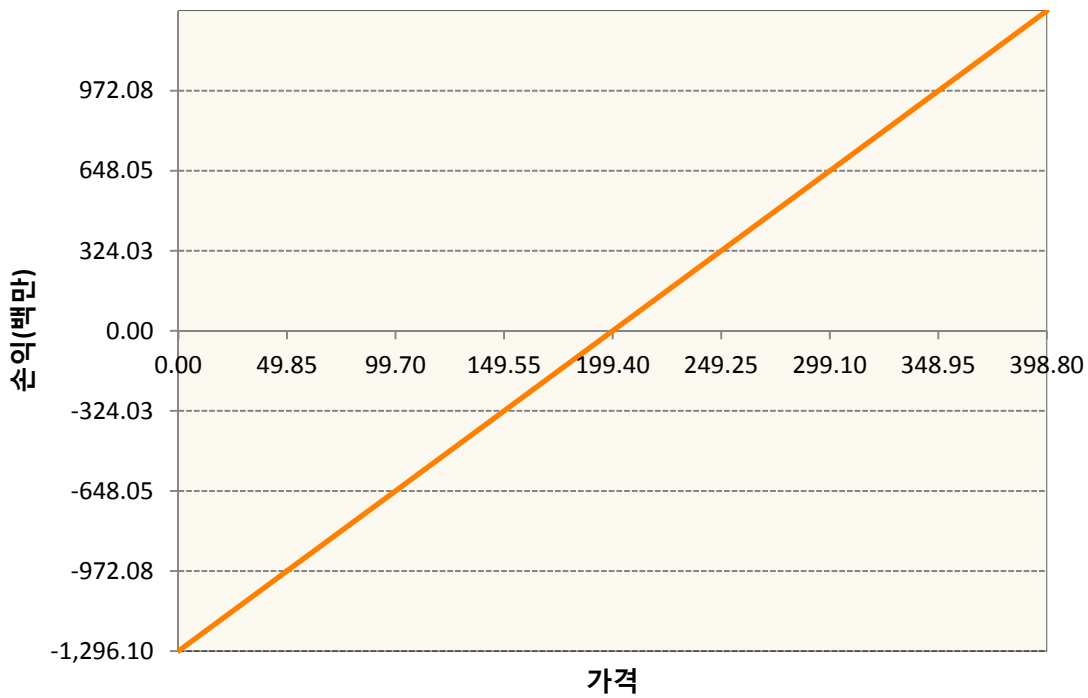
1. 계약금액

(단위:백만원)

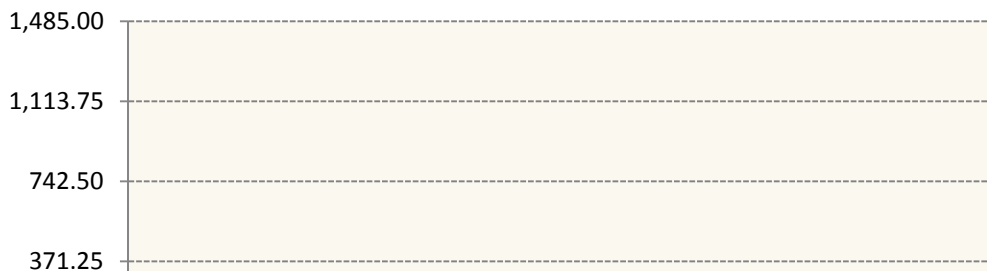
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	1,000	-1,000	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,296	0	1,296	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,095	-3,095	장내

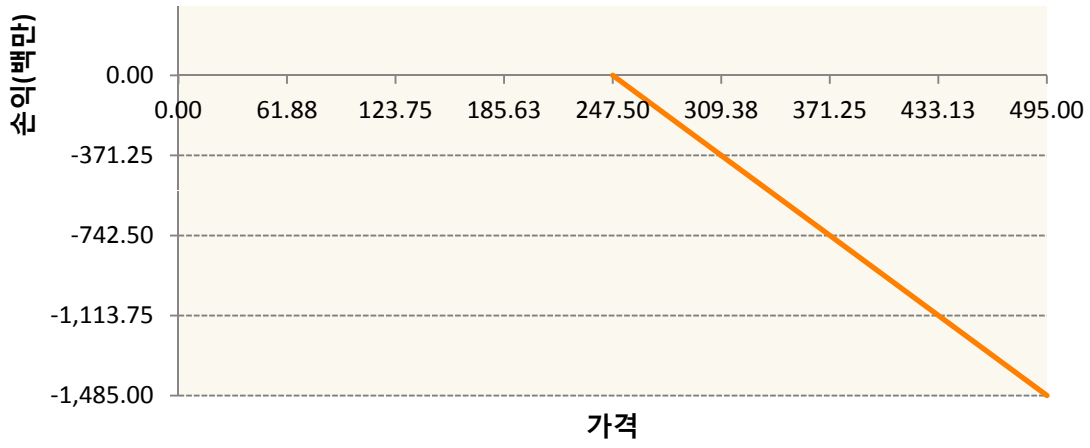
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

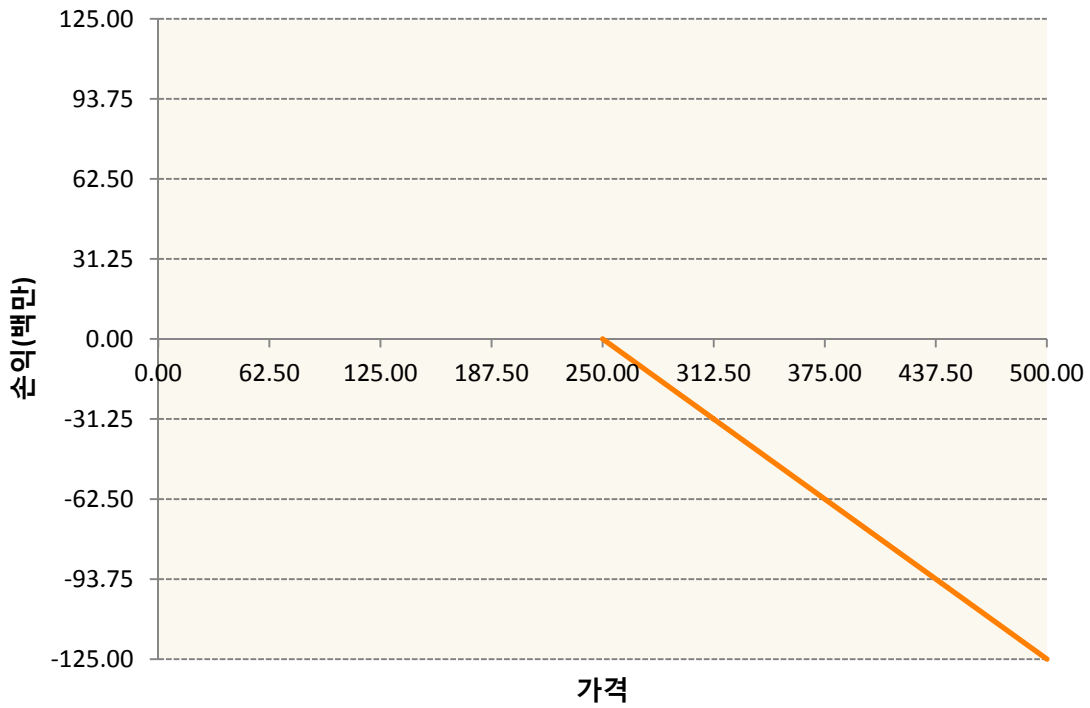


KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

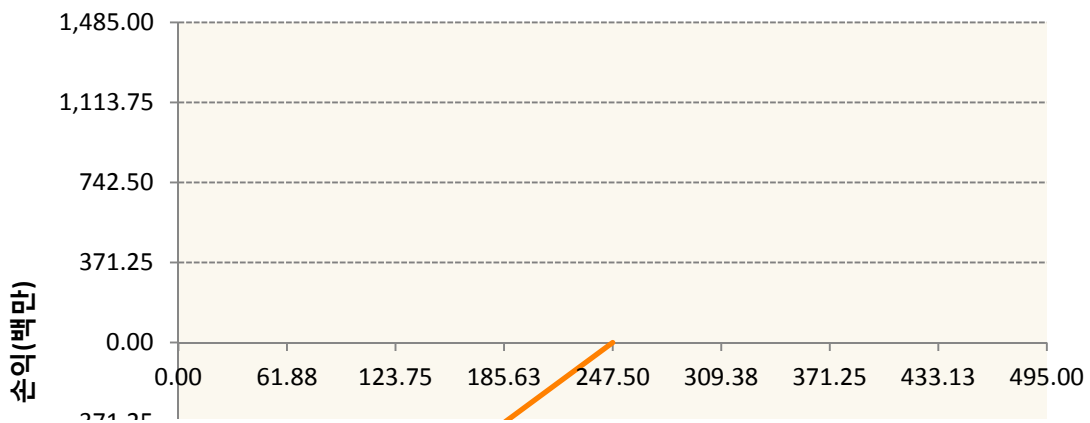




KR4201Q42503-2020-04 콜250



KR4301Q42477-2020-04 풋247.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						186
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-186	-186	-186	-186	-186	-186	-186	
-5.33%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124	
-2.67%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	62	62	62	62	62	62	62	
5.33%	124	124	124	124	124	124	124	
8.00%	186	186	186	186	186	186	186	
KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						105
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105	
-5.33%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70	
-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%	70	70	70	70	70	70	70	
8.00%	105	105	105	105	105	105	105	
KR4201Q42479		2020-04 콜247.5						32
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	9	8	7	6	5	4	2	
-5.33%	8	7	6	5	3	1	-1	
-2.67%	8	6	5	3	1	-2	-5	
0%	6	5	3	0	-3	-6	-10	
2.67%	5	2	-1	-4	-8	-12	-16	
5.33%	2	-1	-5	-9	-14	-18	-23	
8.00%	-2	-6	-11	-16	-21	-26	-32	
KR4201Q42503		2020-04 콜250						2
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	1	1	1	0	0	0	0
-5.33%	1	1	0	0	0	0	0
-2.67%	1	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	-1	-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	-2	-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%	-87	-87	-88	-89	-91	-93	-95
-5.33%	-55	-56	-57	-59	-61	-63	-66
-2.67%	-24	-25	-27	-29	-32	-35	-38
0%	7	5	3	0	-3	-7	-11
2.67%	38	35	32	28	24	19	15
5.33%	67	63	59	55	50	45	39
8.00%	95	90	85	80	74	69	63

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

(단위:백만원)

425

공시일	2020-03-24
기준일	2020-03-23

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

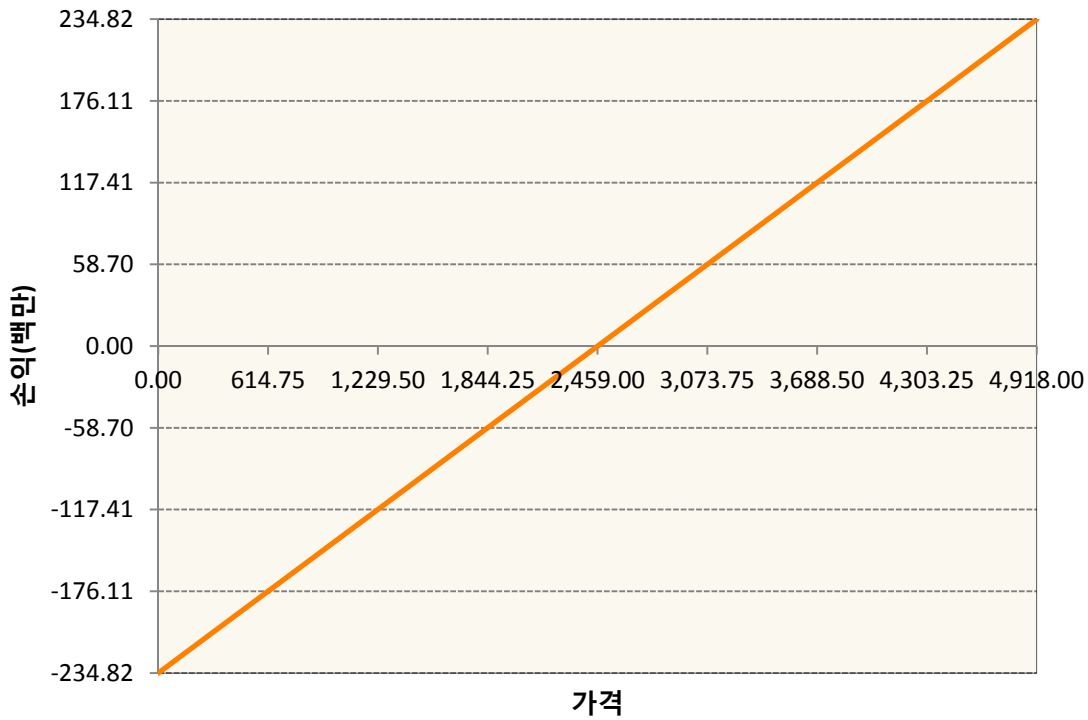
1. 계약금액

(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	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	235	0	235	
누계	유가증권	스왑	7,721	0	7,721	장외
누계	통화	선도	544	3,567	-3,023	장외

2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	31
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	285
FX21020H00 EUR/KRW 27-03-20E	43
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20	19

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

(단위:백만원)

263

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

(단위:백만원)

762

공시일	2020-03-24
기준일	2020-03-23

ETF스마트레버리지목표전환형9호

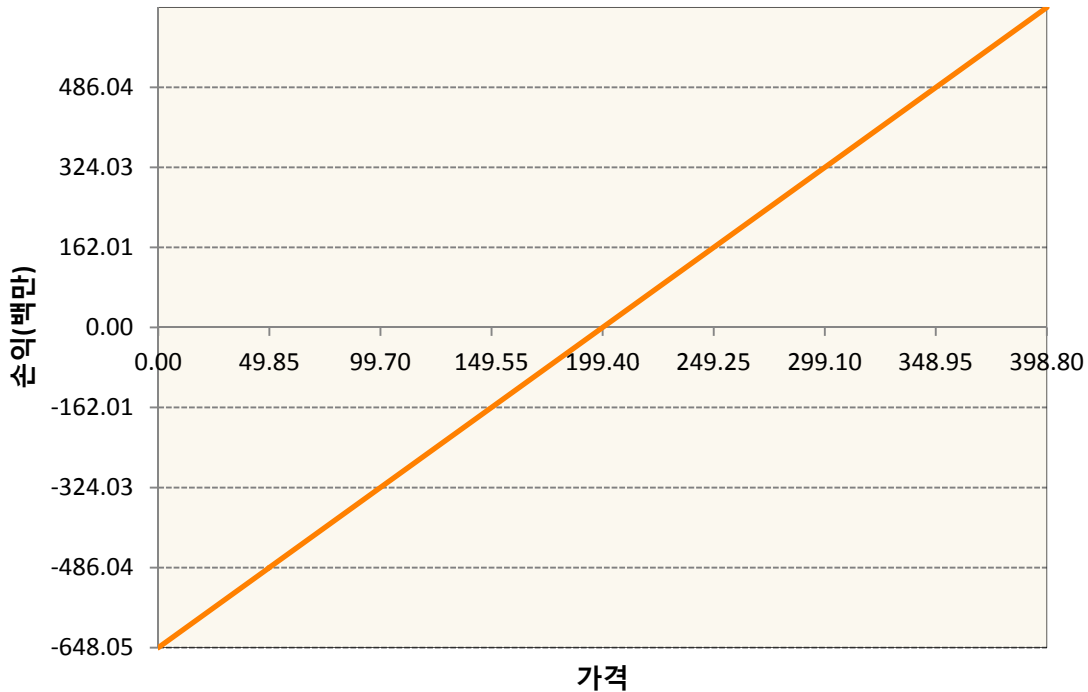
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

66

공시일	2020-03-24
기준일	2020-03-23

ETF스마트레버리지목표전환형10호

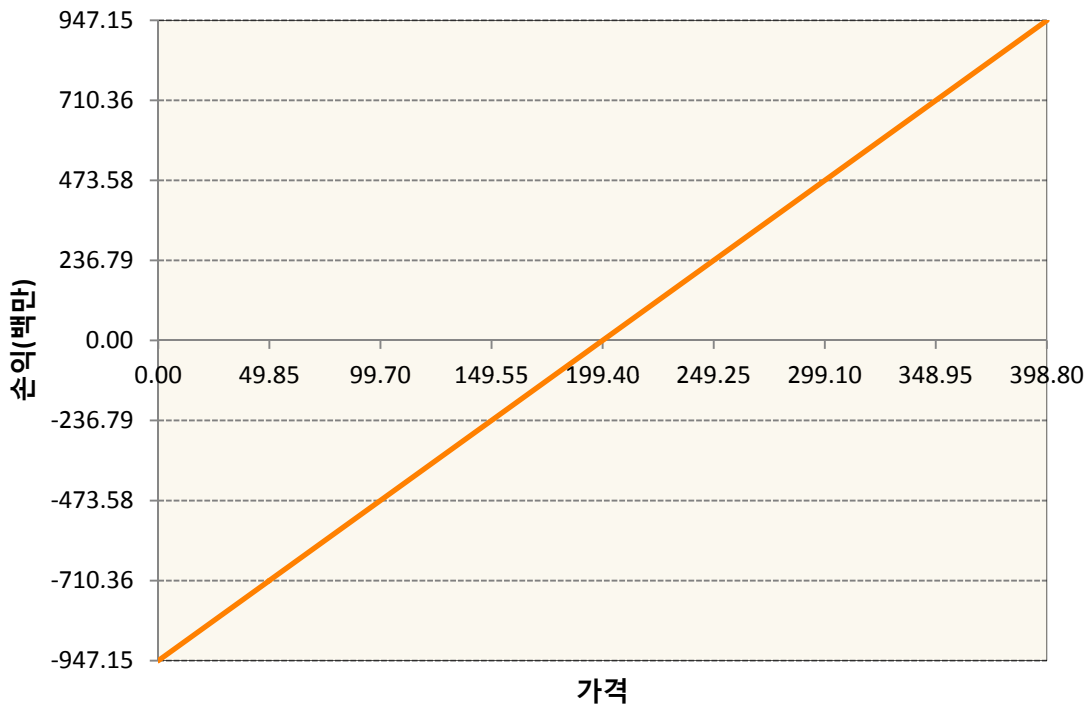
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	947	0	947	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)

97

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

(단위:백만원)

46

공시일	2020-03-24
기준일	2020-03-23

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

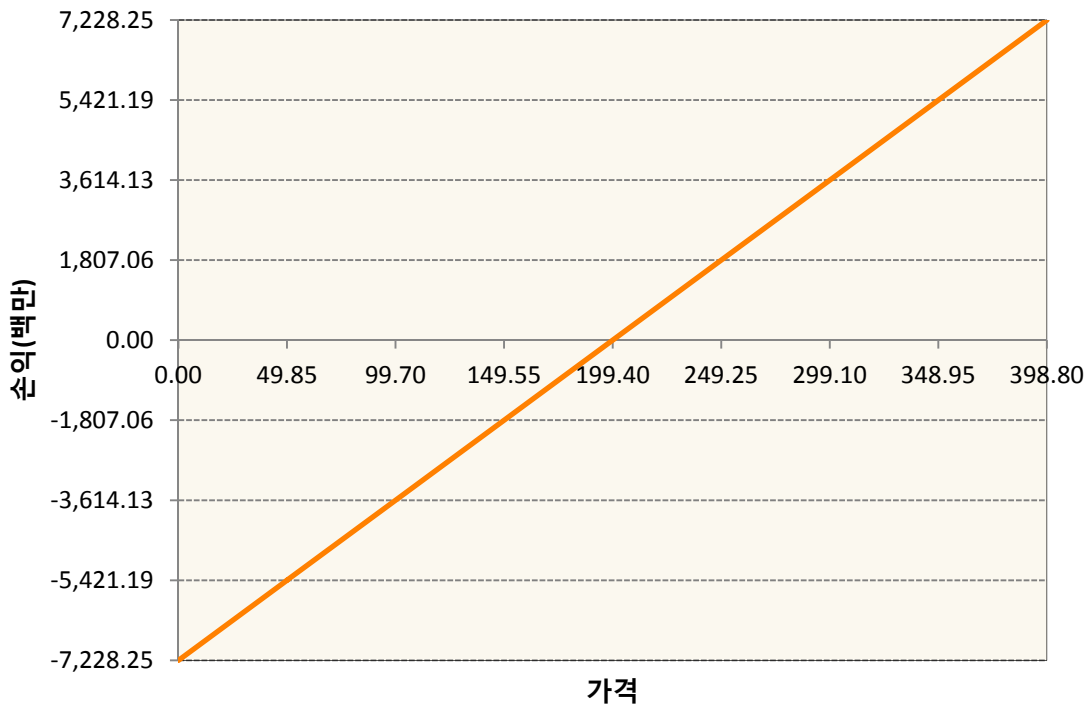
1. 계약금액

(단위:백만원)

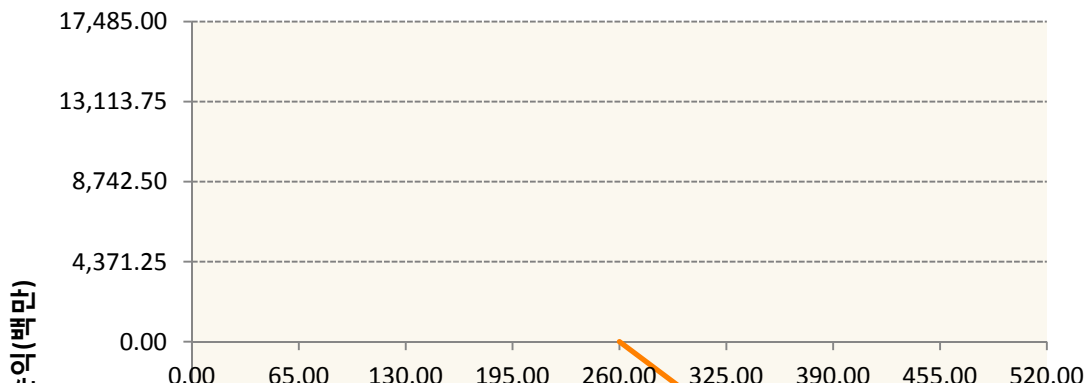
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,228	0	7,228	장내
누계	유가증권	옵션	6,004	17,485	-11,481	장내

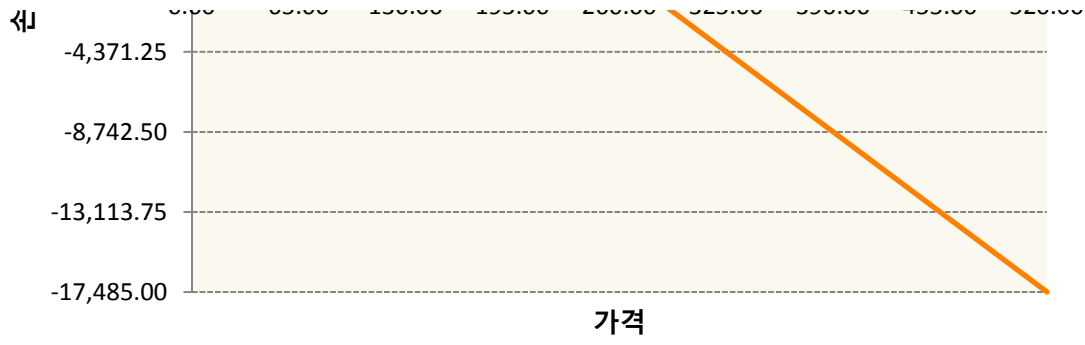
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

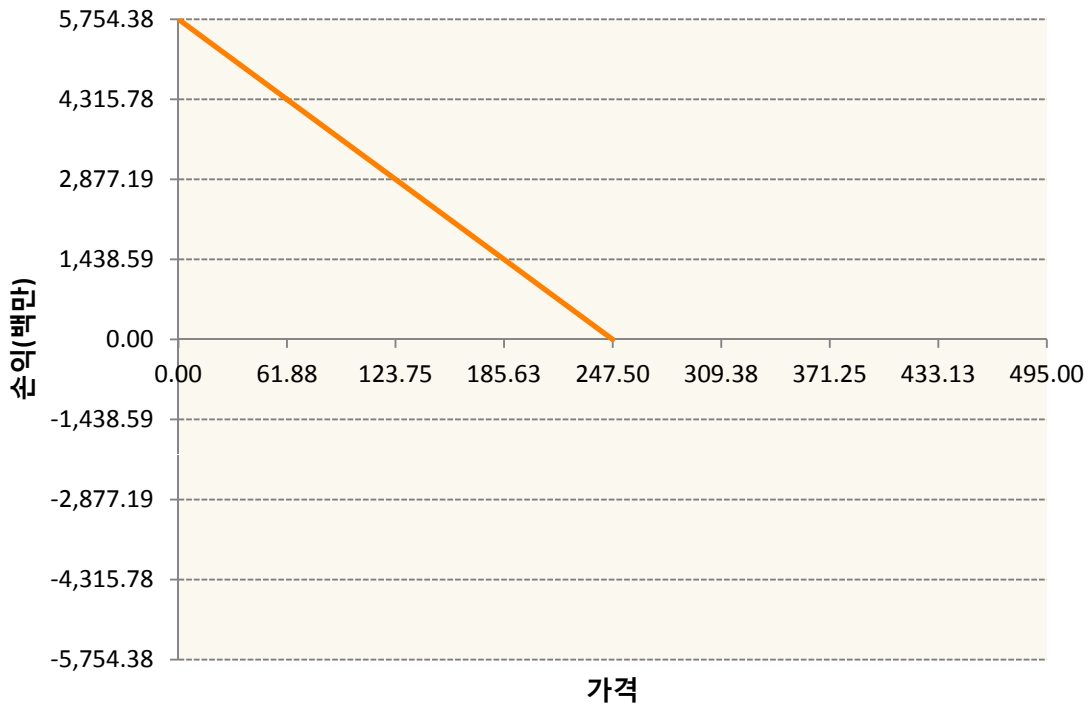


KR4201Q42602-2020-04 콜260

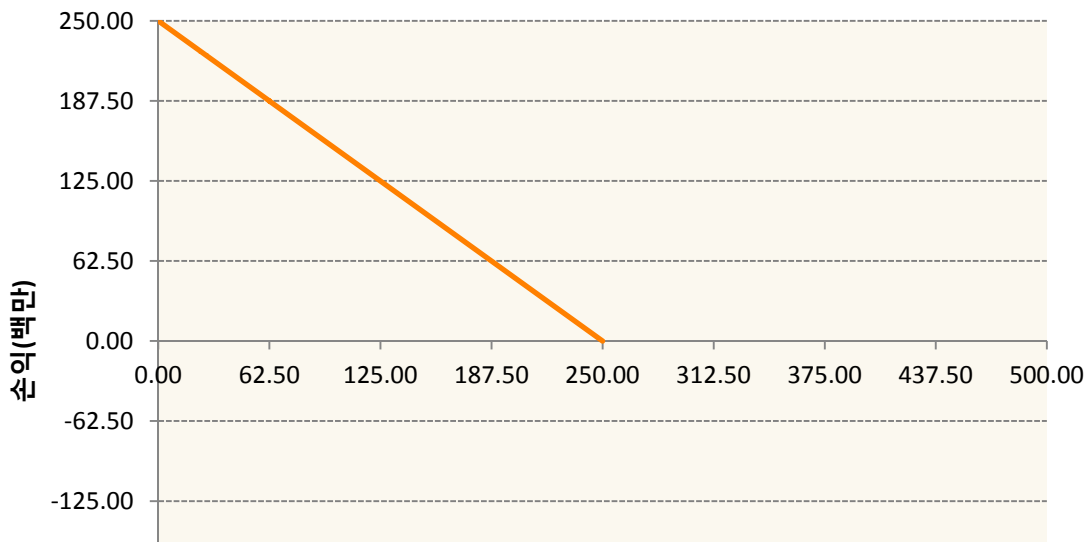


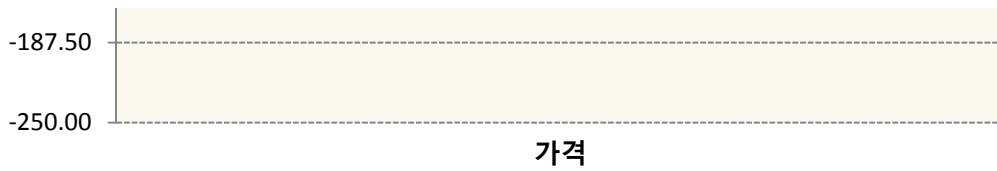


KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



KR4301Q42501-2020-04 풋250





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						585
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-585	-585	-585	-585	-585	-585	-585	
-5.33%	-390	-390	-390	-390	-390	-390	-390	
-2.67%	-195	-195	-195	-195	-195	-195	-195	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	195	195	195	195	195	195	195	
5.33%	390	390	390	390	390	390	390	
8.00%	585	585	585	585	585	585	585	
KR4201Q42602		2020-04 콜260						249
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	48	47	43	38	29	18	3	
-5.33%	47	44	38	30	18	2	-17	
-2.67%	45	39	30	18	1	-20	-45	
0%	40	31	18	0	-22	-49	-80	
2.67%	33	19	-1	-25	-54	-88	-125	
5.33%	19	-1	-27	-59	-96	-136	-181	
8.00%	-1	-30	-64	-104	-149	-197	-249	
KR4301Q42477		2020-04 풋247.5						369
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	336	338	342	346	352	360	369	
-5.33%	213	217	221	228	236	246	257	
-2.67%	91	96	104	112	123	135	148	
0%	-29	-21	-11	0	13	28	44	
2.67%	-146	-135	-123	-108	-92	-75	-57	
5.33%	-259	-245	-229	-212	-193	-173	-152	
8.00%	-367	-349	-330	-310	-288	-266	-243	
KR4301Q42501		2020-04 풋250						16
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	15	15	15	15	15	16	16	
-5.33%	9	9	10	10	10	11	11	
-2.67%	4	4	5	5	5	6	6	

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

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

(단위:백만원)

1,180

공시일	2020-03-24
기준일	2020-03-23

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	6,622	-6,622	
누계	유가증권	수익증권	177,136	0	177,136	

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	2020-03-24
기준일	2020-03-23

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	101,404	0	101,404	

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	2020-03-24
기준일	2020-03-23

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	10,235	-10,235	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	470,085	0	470,085	
누계	통화	선도	93,088	502,674	-409,586	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020F03! KRW/USD 31-03-20E	3,242
FX21020F04! KRW/USD 31-03-20E	3,040
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,736
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,485
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	2,026
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	4,053
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,371
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,026
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	203
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	5,167
FX21020G06 USD/KRW 31-03-20E	507
FX21020H00 USD/KRW 31-03-20E	1,013
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,533
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,107
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,107
FX21020H04 USD/KRW 21-04-20E	1,520
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,472
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	1,013
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	1,013
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,634
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	871
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	760
FX21020H09 USD/KRW 24-04-20E	760
IE00BD8RGM75	*
IE00BHNZKL13	*

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

21,332

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

(단위:백만원)

132

공시일	2020-03-24
기준일	2020-03-23

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

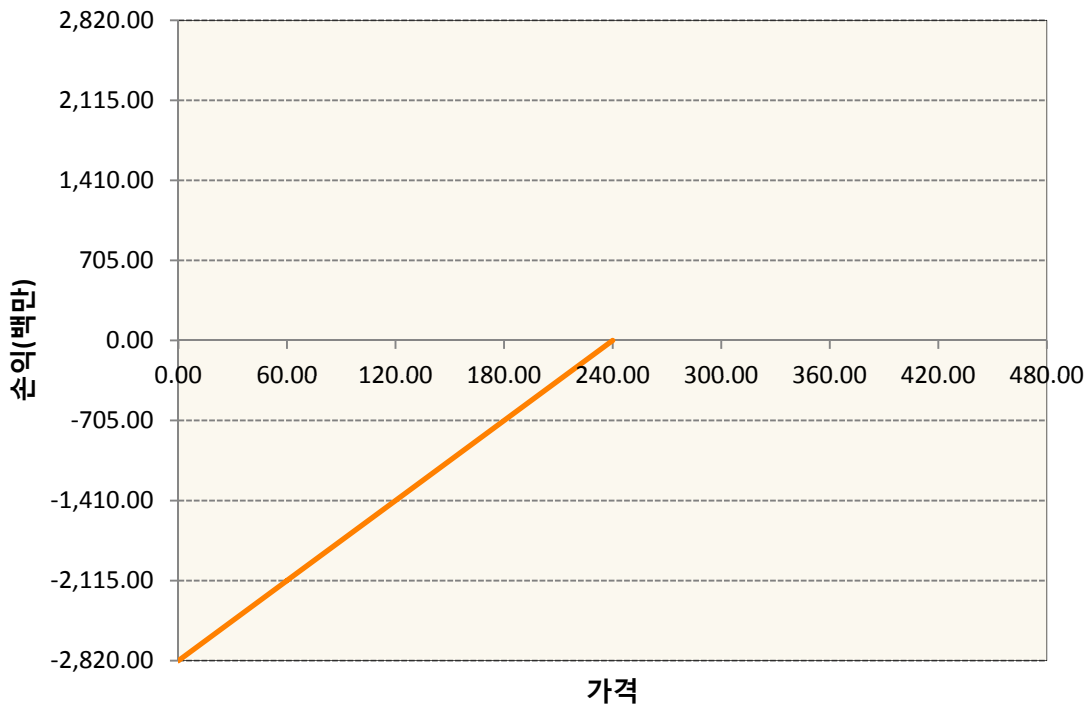
1. 계약금액

(단위:백만원)

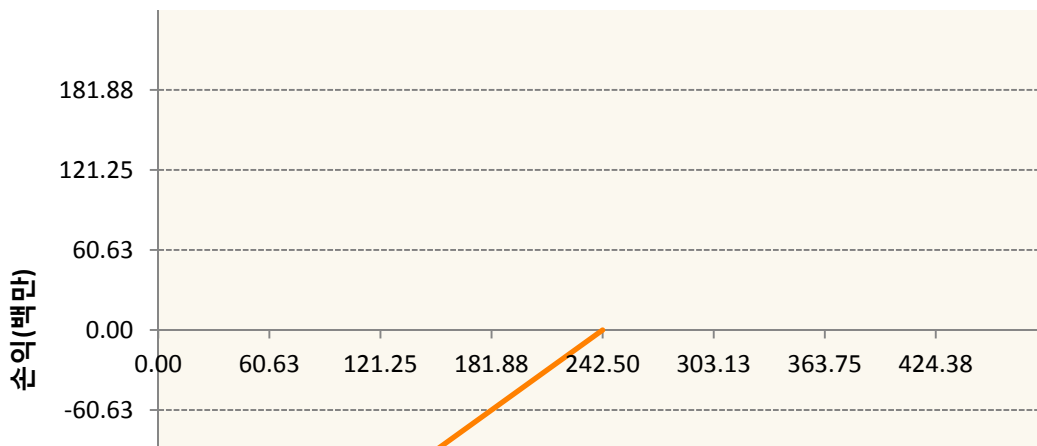
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,063	-3,063	장내

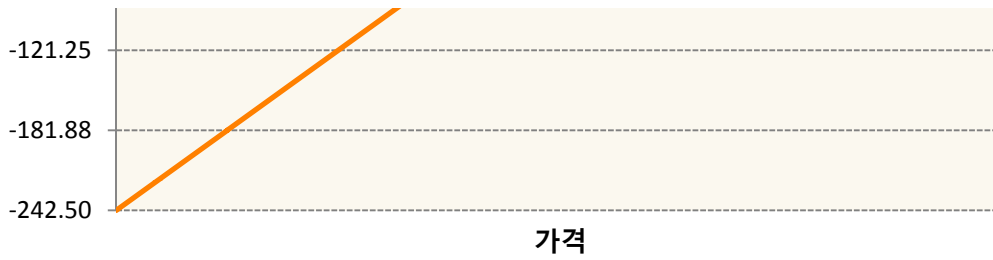
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q42402-2020-04 풋240



KR4301Q42428-2020-04 풋242.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q42402		2020-04 풋240						184
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-162	-163	-166	-169	-173	-178	-184	
-5.33%	-100	-103	-106	-111	-116	-122	-129	
-2.67%	-40	-44	-49	-54	-61	-68	-76	
0%	19	14	7	0	-8	-17	-26	
2.67%	76	69	61	52	42	32	22	
5.33%	130	121	111	101	90	79	67	
8.00%	180	170	158	147	135	122	110	
KR4301Q42428		2020-04 풋242.5						16
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-14	-14	-14	-15	-15	-15	-16	
-5.33%	-9	-9	-9	-10	-10	-10	-11	
-2.67%	-4	-4	-4	-5	-5	-6	-6	
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2	
2.67%	6	6	5	4	4	3	2	
5.33%	11	10	10	9	8	7	6	
8.00%	16	15	14	13	12	11	10	

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

186

공시일	2020-03-24
기준일	2020-03-23

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	244	-244	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	7,908	0	7,908	
누계	통화	선도	2,292	9,815	-7,523	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	191
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	226
FX21020H01 USD/KRW 31-03-20E	52
FX21020H02 KRW/USD 13-04-20E	368
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
FX21020H09 USD/KRW 31-03-20E	5
FX21020H09 USD/KRW 31-03-20E	20
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

434

공시일	2020-03-24
기준일	2020-03-23

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

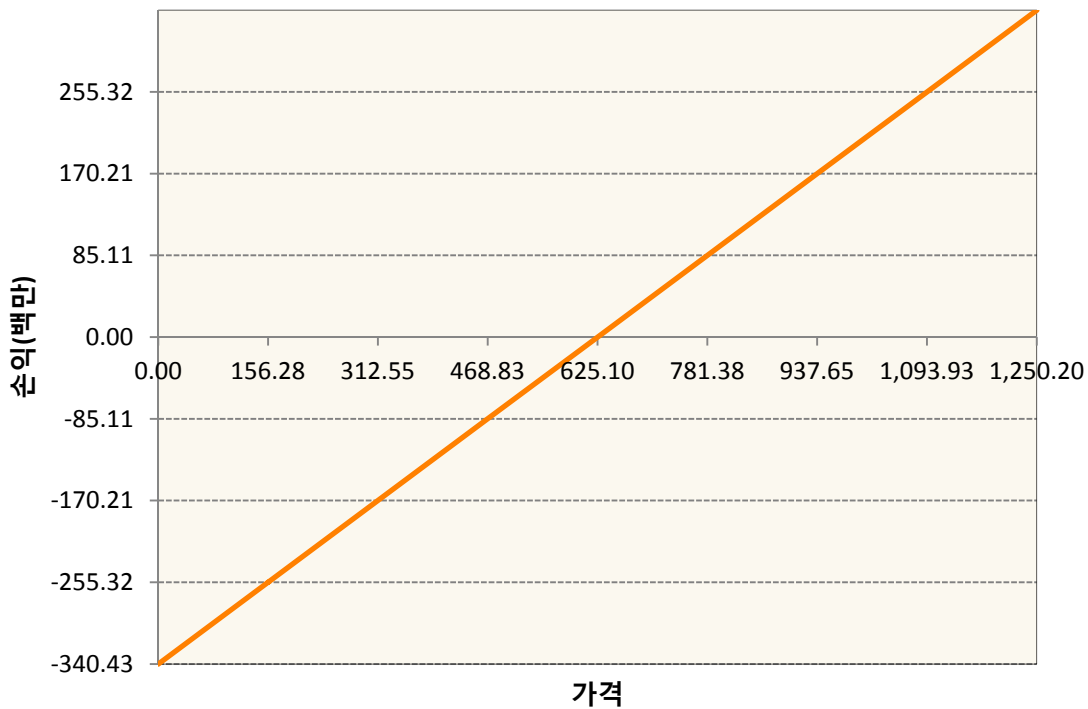
1. 계약금액

(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	340	0	340	
누계	유가증권	스왑	1,121	0	1,121	장외
누계	통화	선도	476	748	-272	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCJ0-VN30 Index Future Apr20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	90
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
VNCJ0 VN30 Index Future Apr20	27

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

(단위:백만원)

145

공시일	2020-03-24
기준일	2020-03-23

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

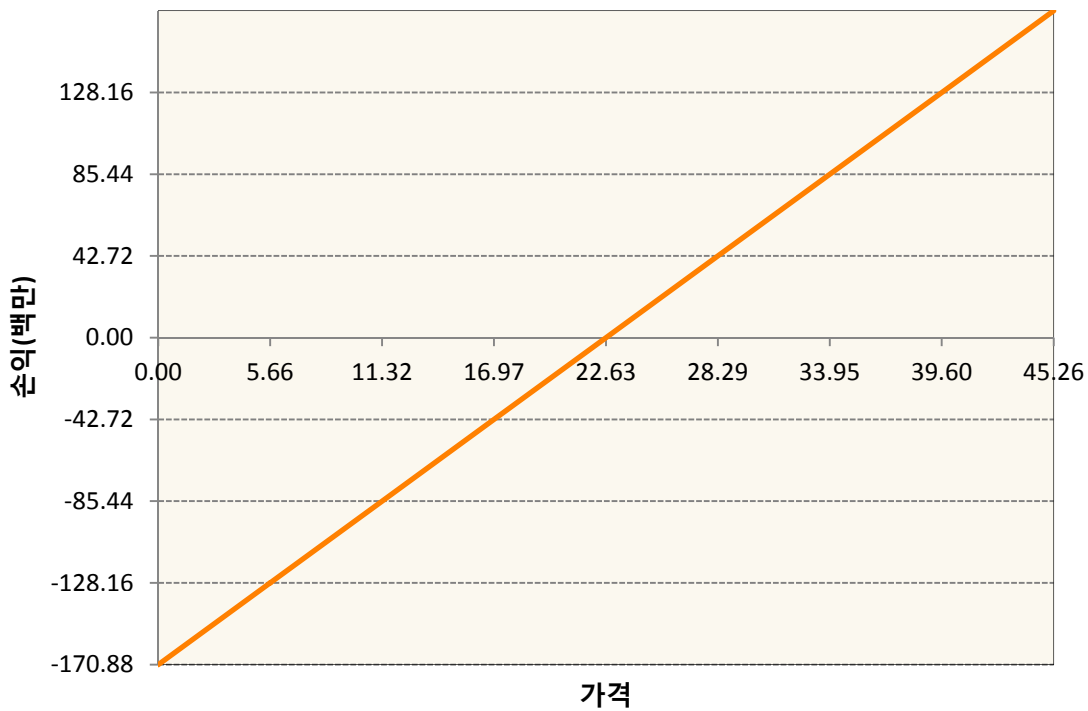
1. 계약금액

(단위:백만원)

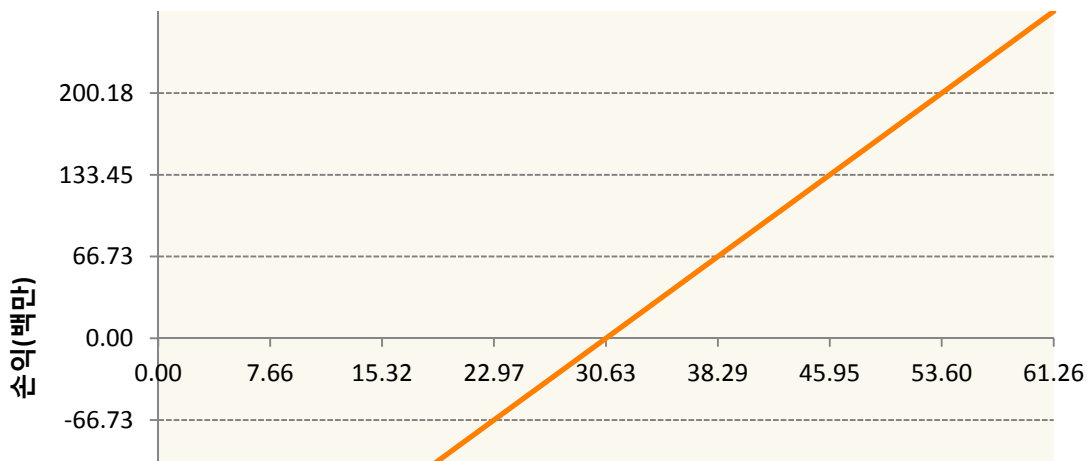
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,223	126	1,096	

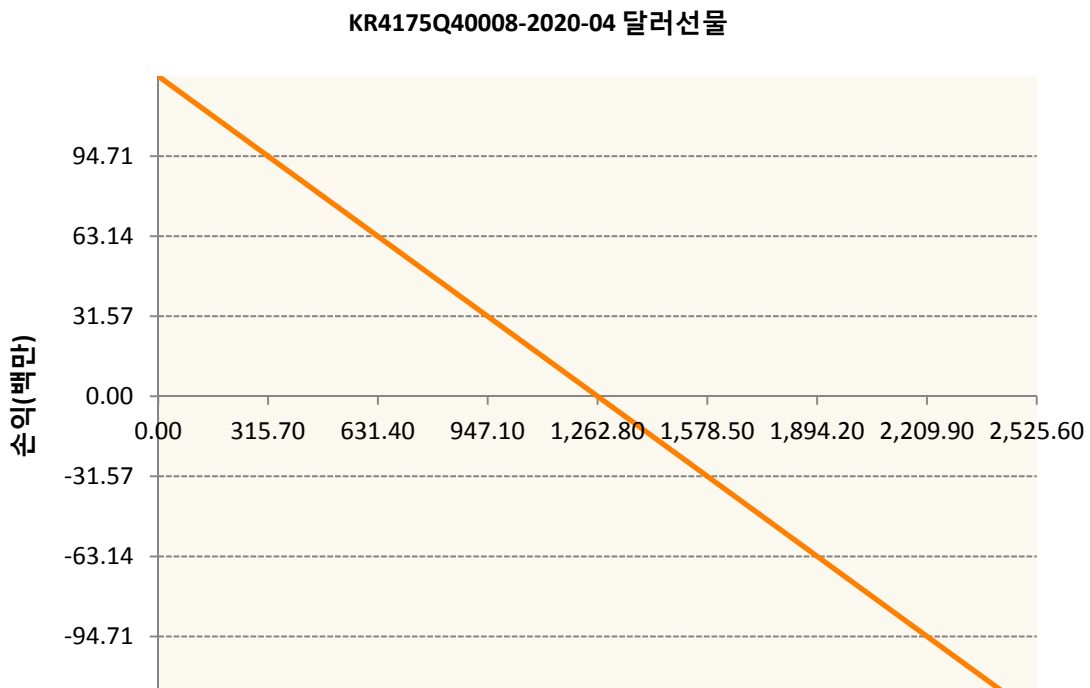
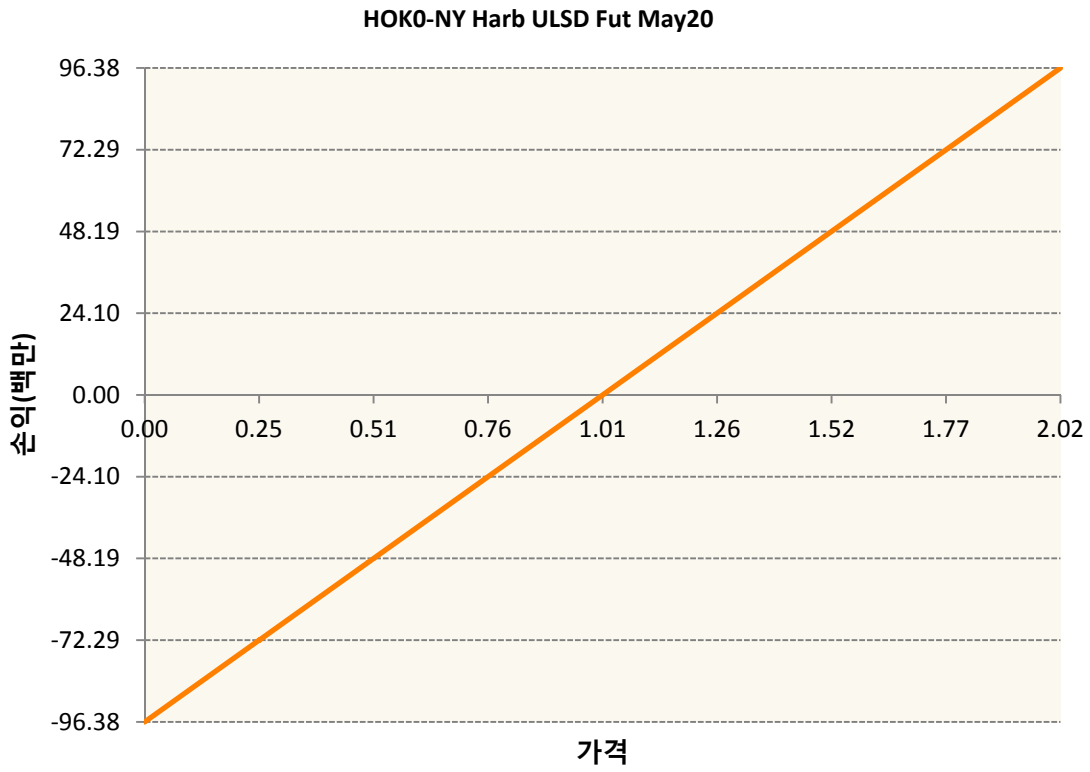
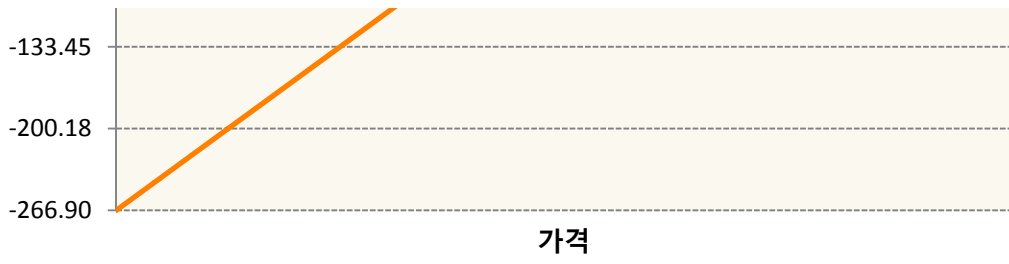
2. 만기시점의 손익구조

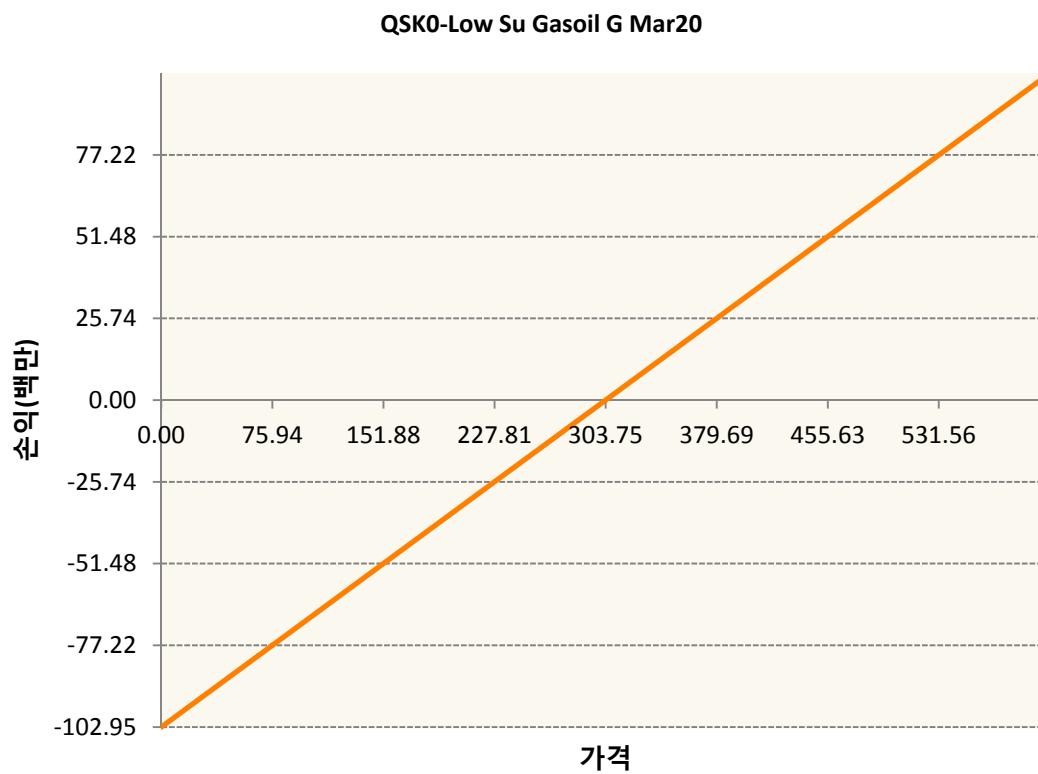
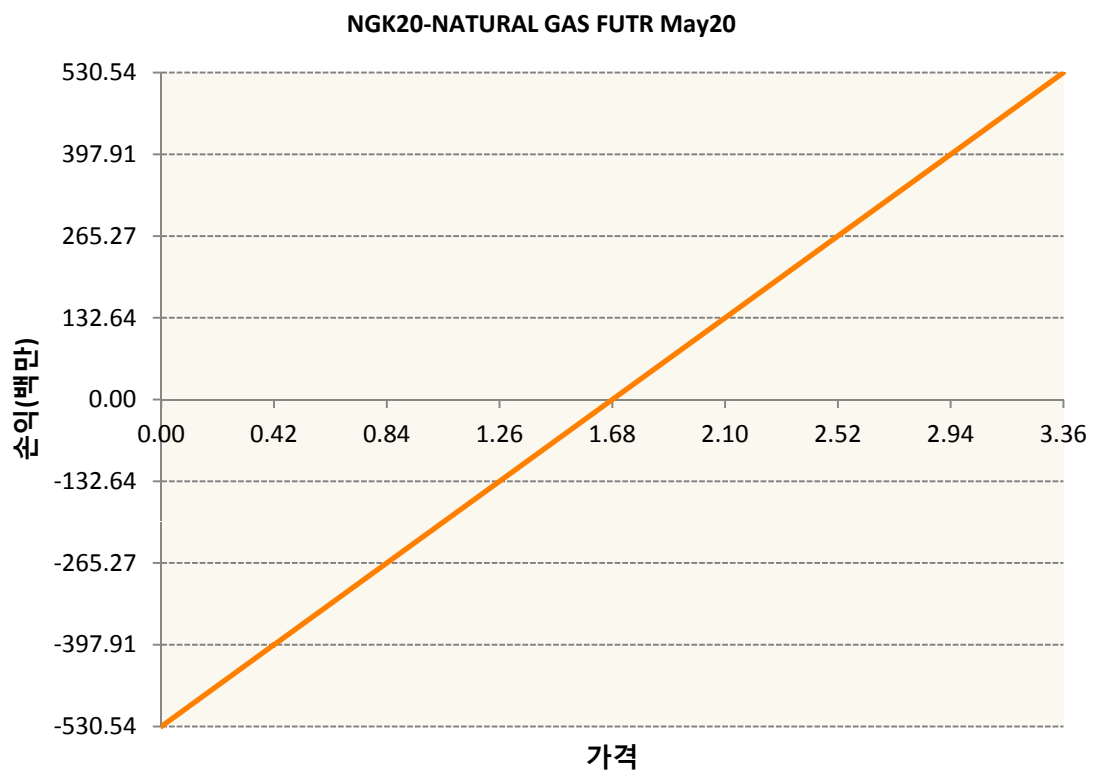
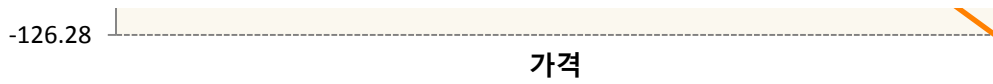
CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20



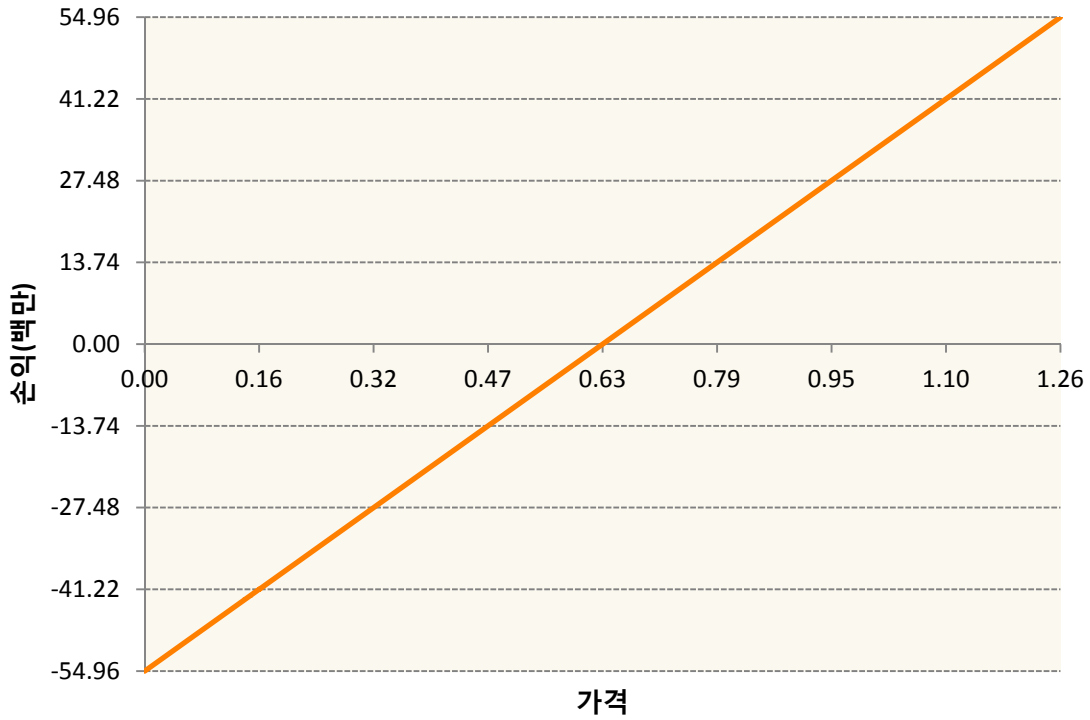
CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20







XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	14
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	21
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	8
KR4175Q40C	2020-04 달러선물	10
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	42
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	8
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	4

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

(단위:백만원)

266

공시일	2020-03-24
기준일	2020-03-23

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

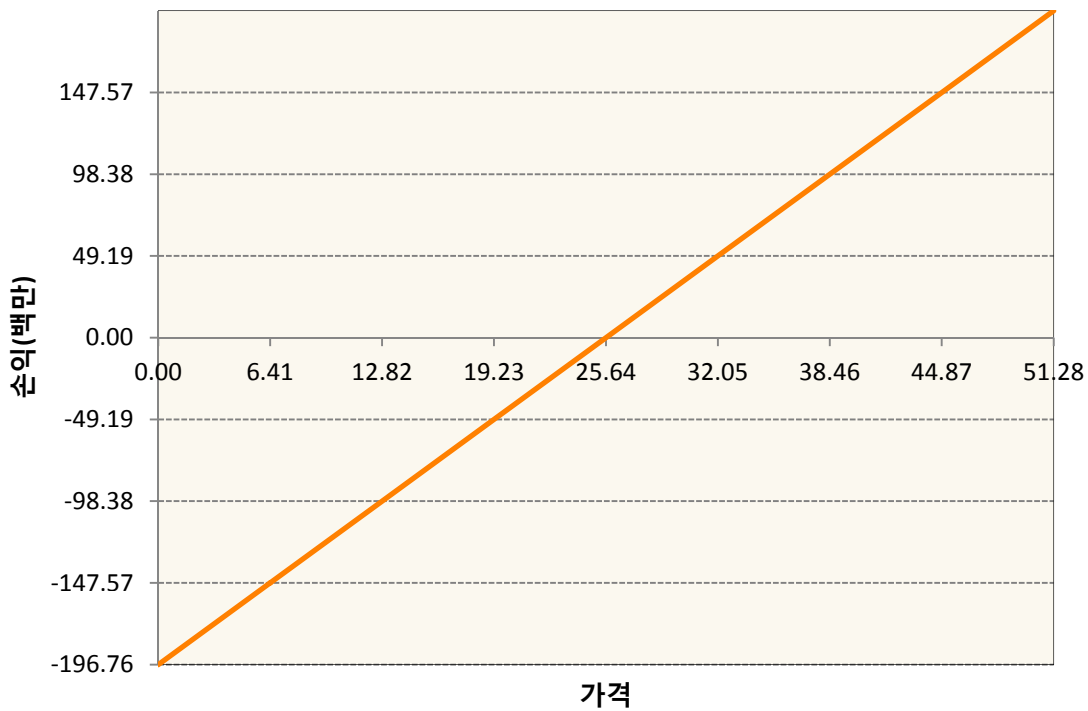
1. 계약금액

(단위:백만원)

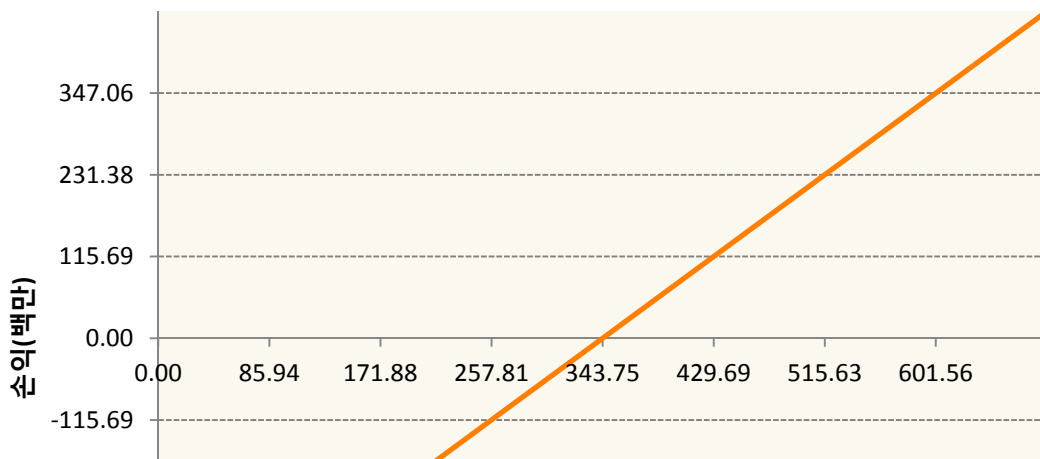
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,369	101	2,268	

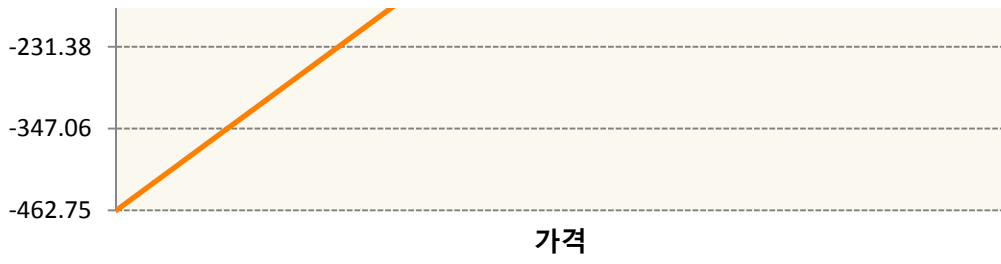
2. 만기시점의 손익구조

BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20

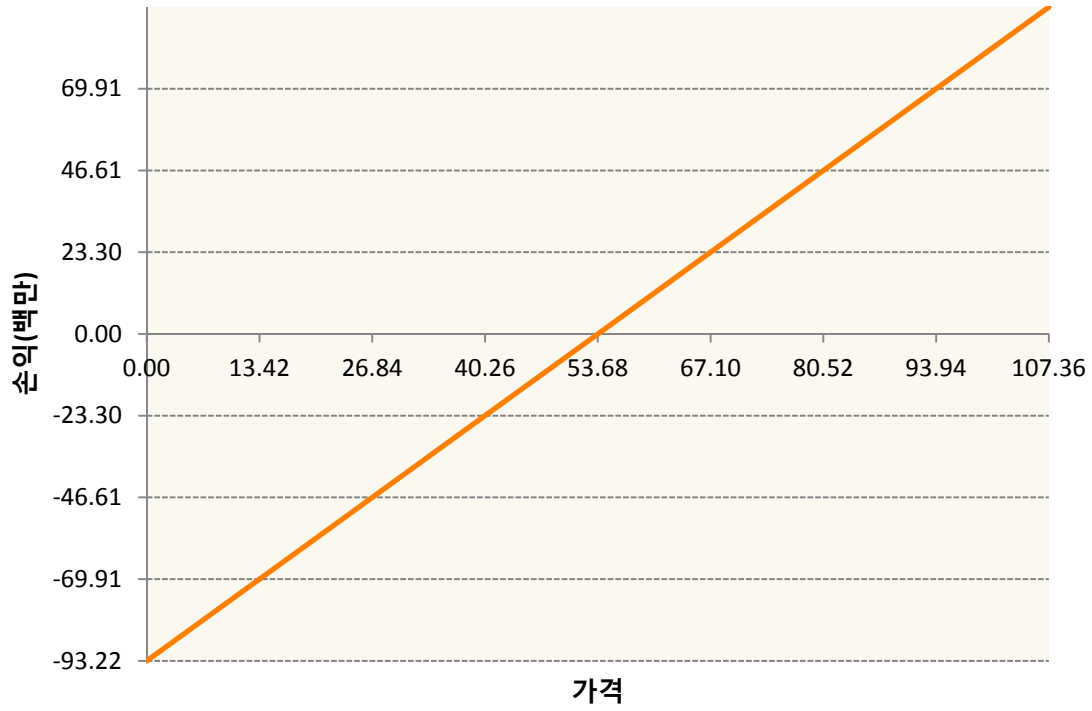


CK0-CORN FUTURE May20

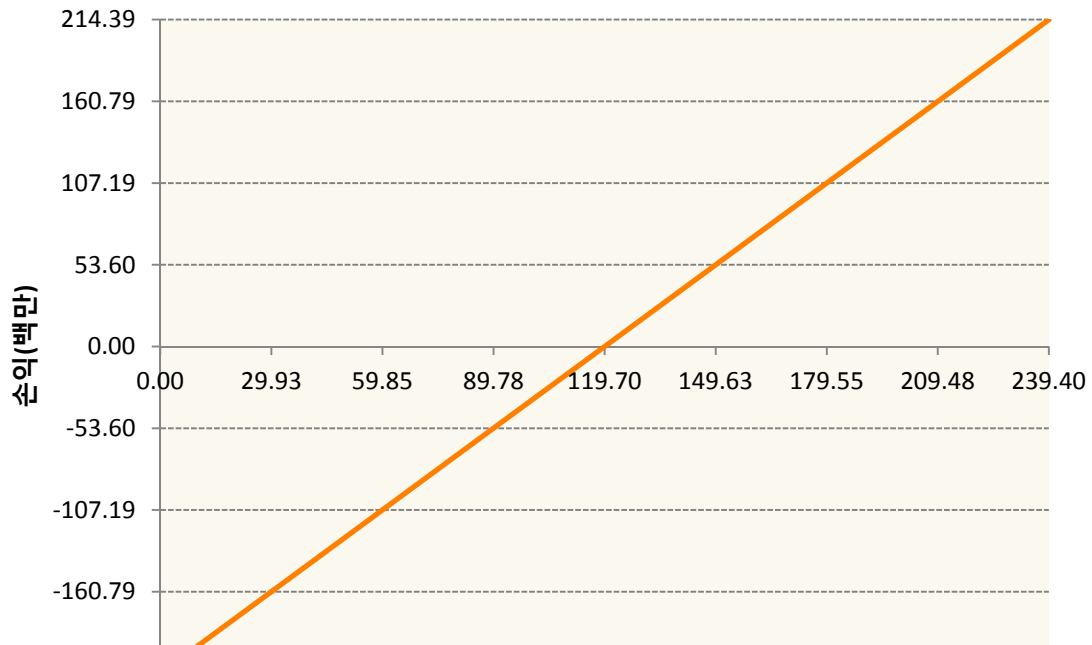


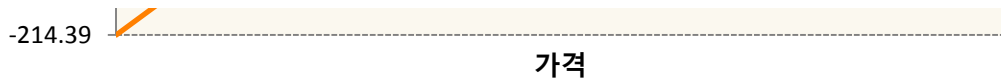


CTK0-COTTON NO.2 FUTR May20

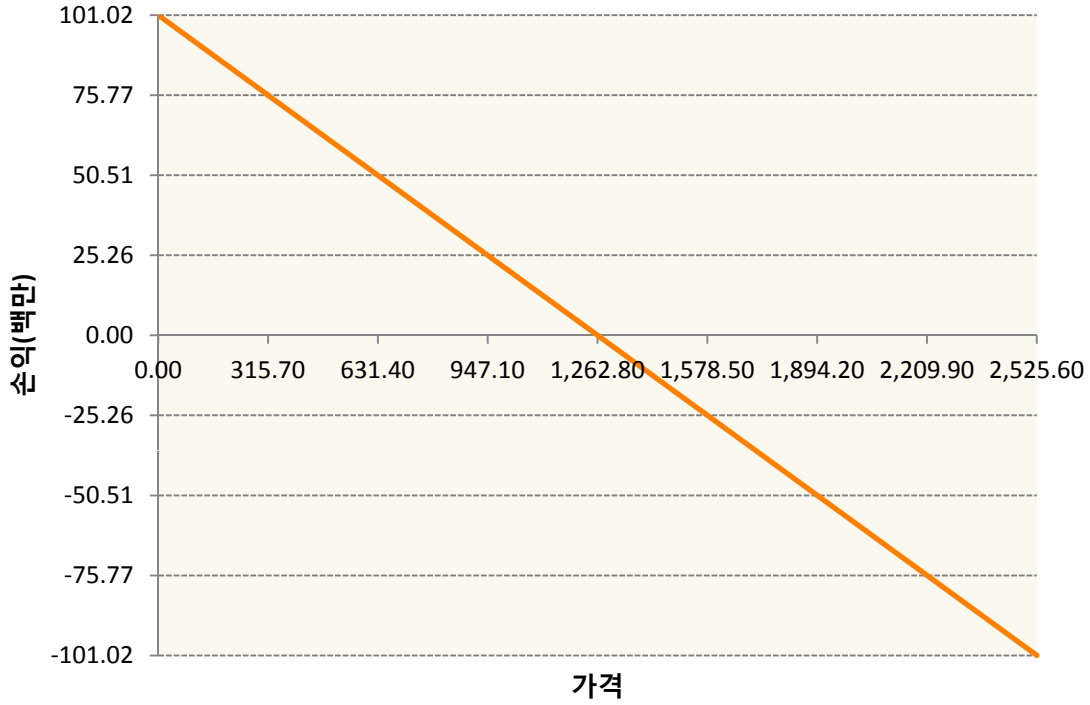


KCK0-COFFEE 'C' FUTURE May20

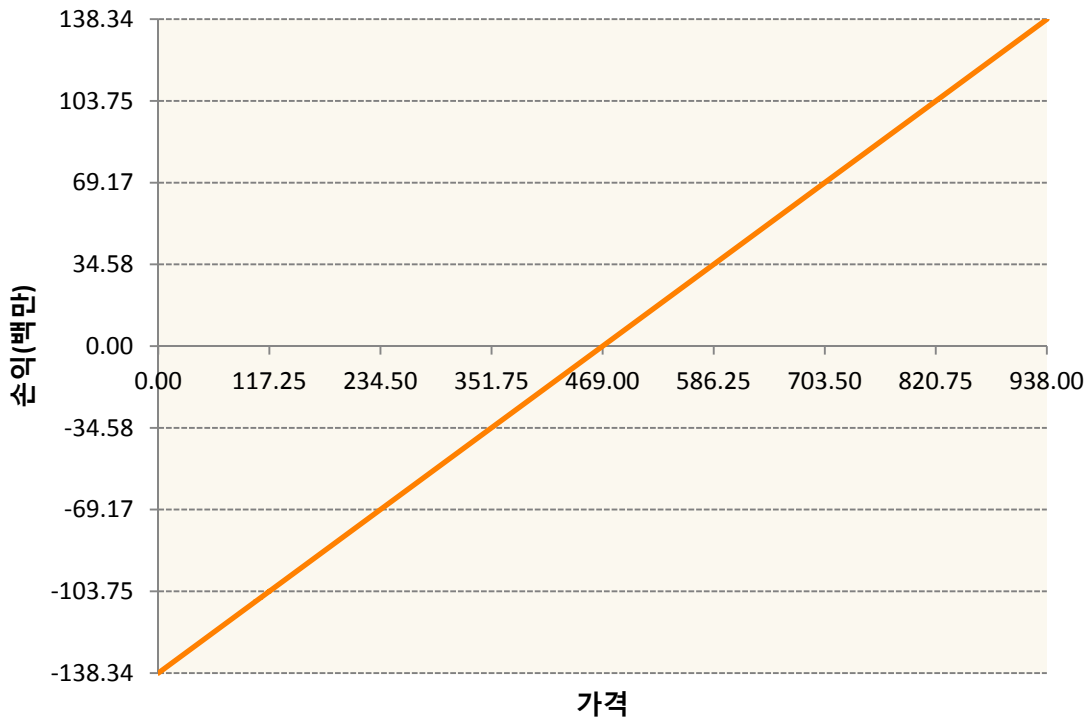




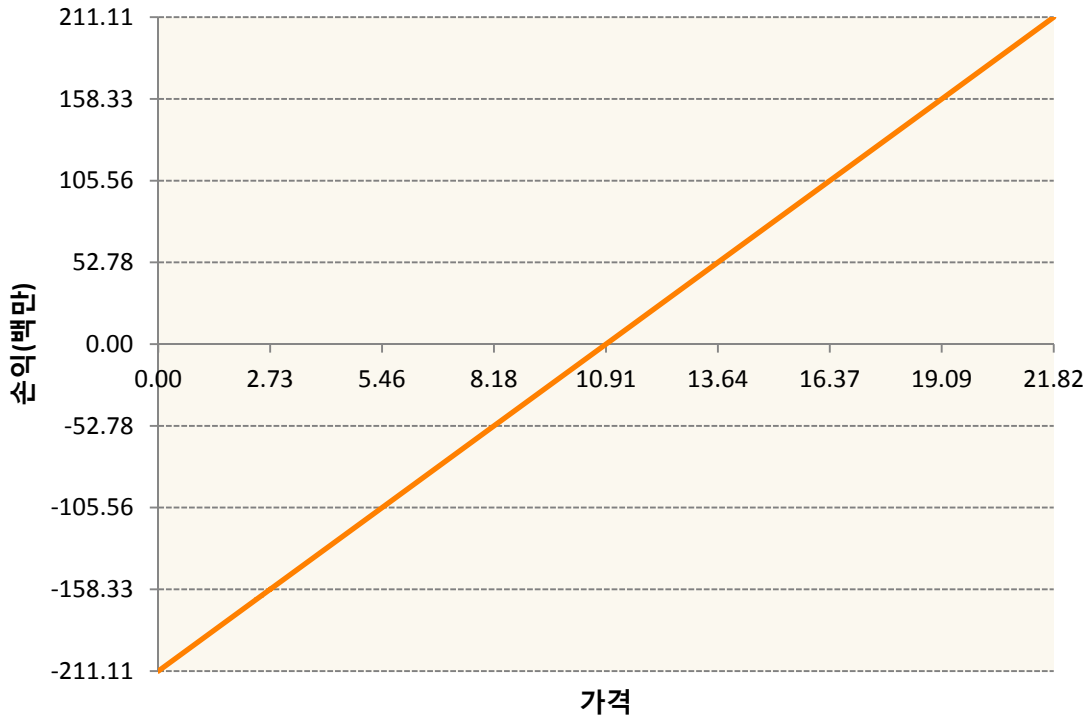
KR4175Q40008-2020-04 달러선물



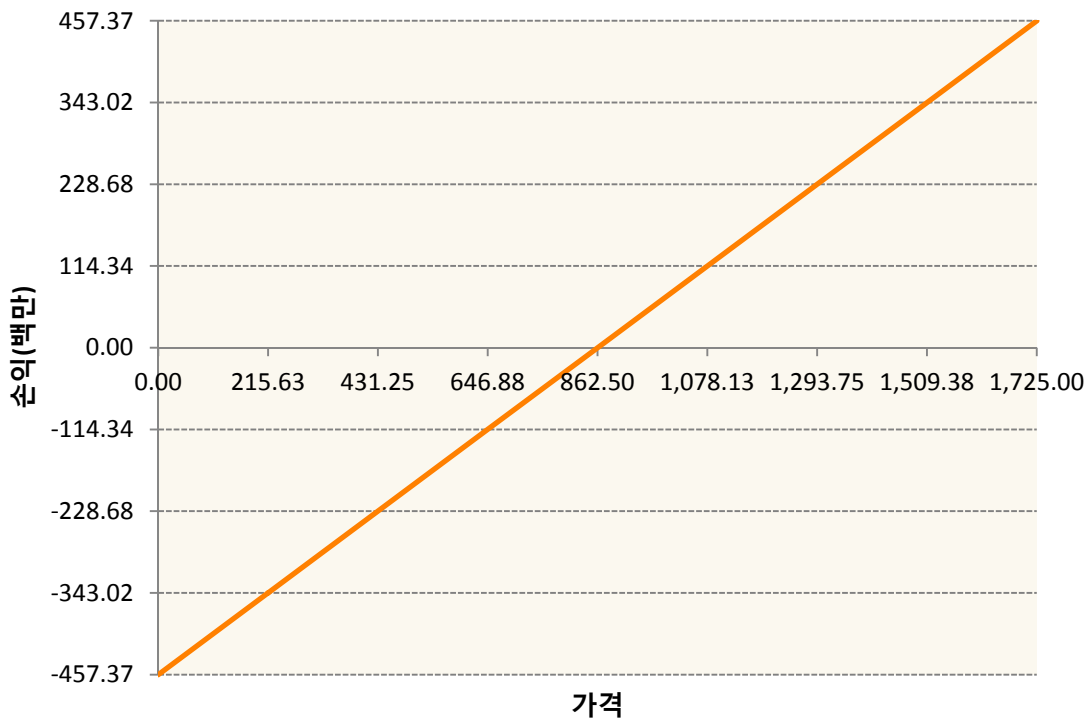
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



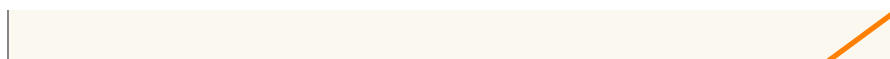
SBK0-Sugar May20

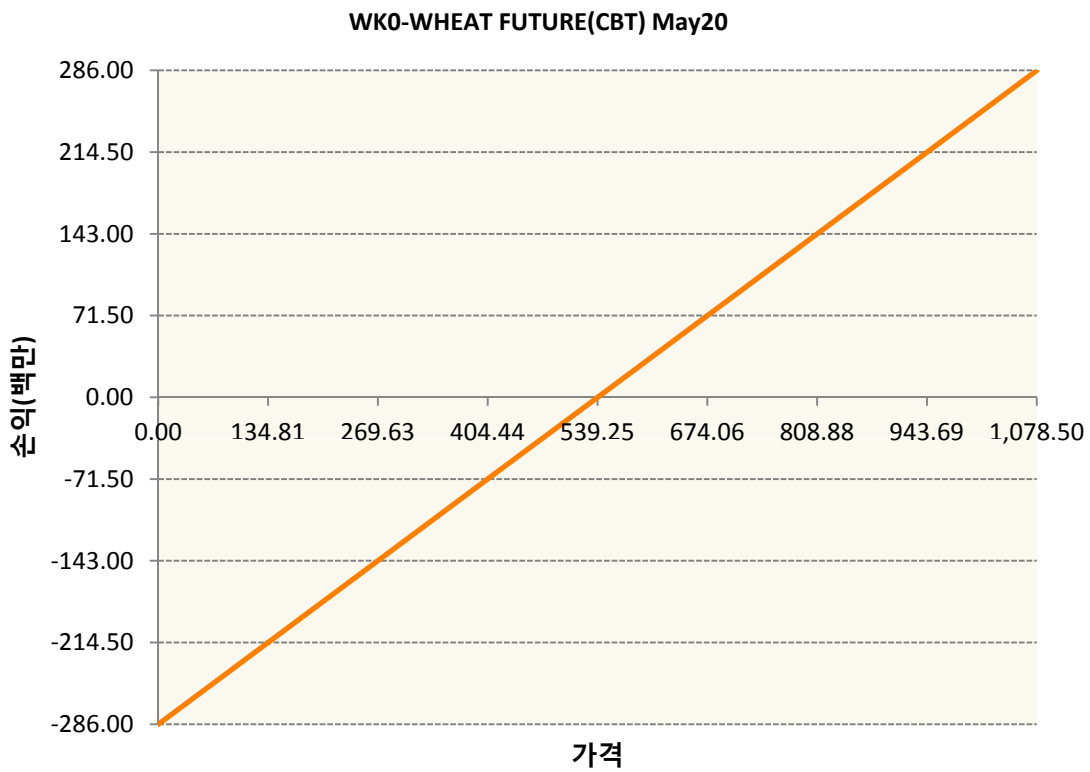
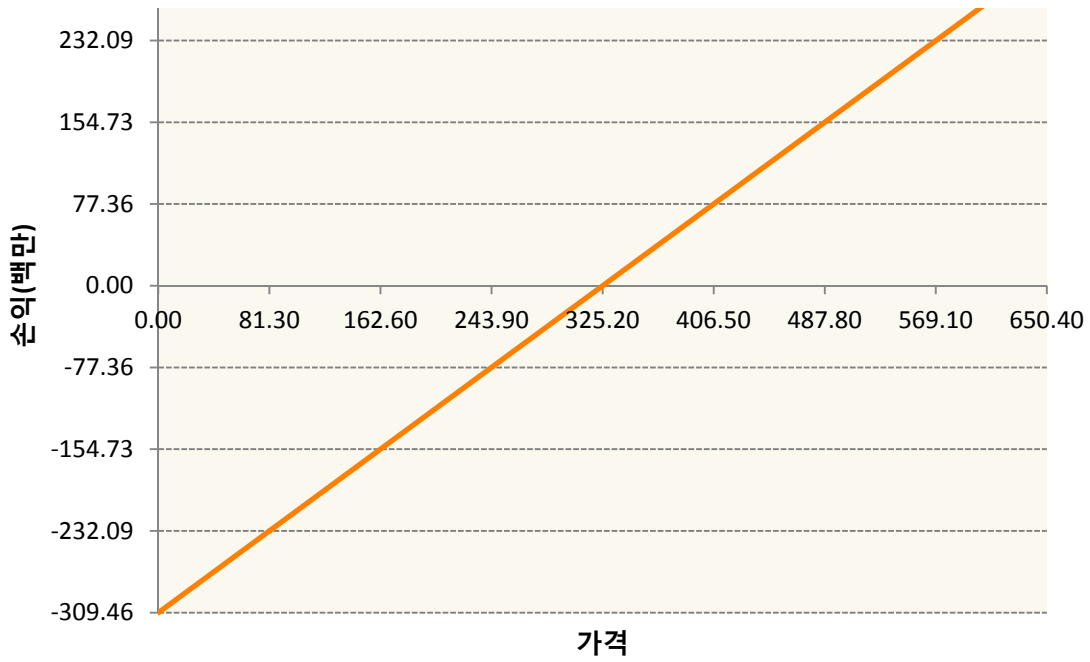


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	16
CK0	CORN FUTURE May20	37
CTK0	COTTON NO.2 FUTR May20	7
KCK0	COFFEE 'C' FUTURE May20	17
KR4175Q40C	2020-04 달러선물	8

KWK0	KC HRW WHEAT FUT May20	11
SBK0	Sugar May20	17
SK0	SOYBEAN FUTURE May20	37
SMK0	SOYBEAN MEAL FUTR May20	25
WK0	WHEAT FUTURE(CBT) May20	23

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

(단위:백만원)

215