

공시일	2020-03-25
기준일	2020-03-24

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	2020-03-25
기준일	2020-03-24

스마트인덱스모

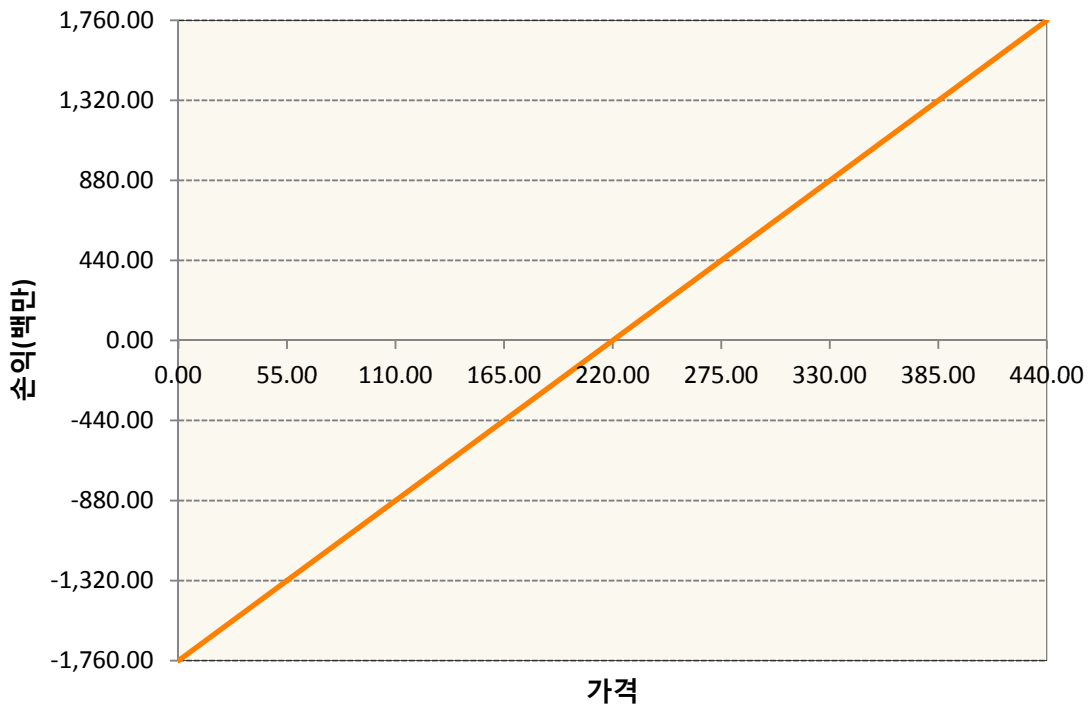
1. 계약금액

(단위:백만원)

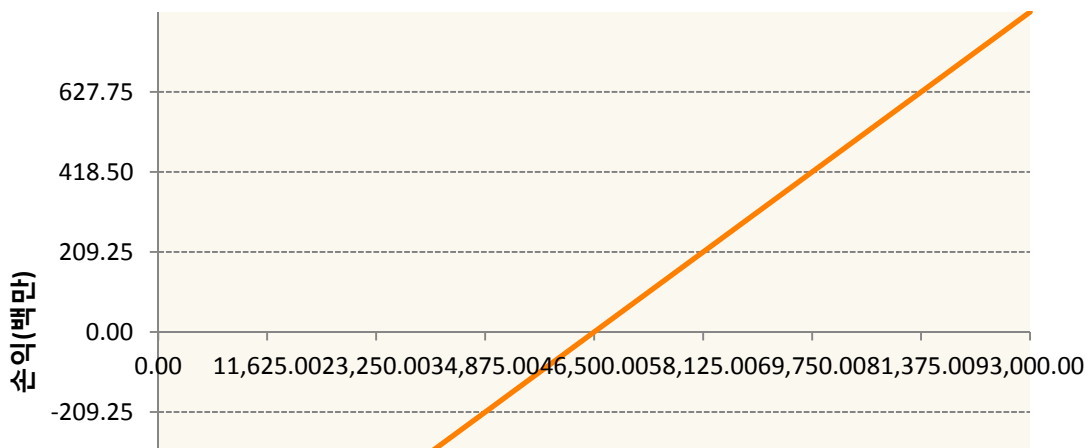
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,597	0	2,597	장내

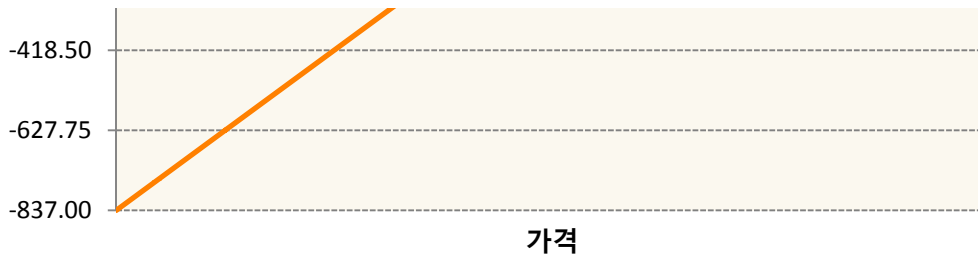
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



KR4111Q40003-2020-04 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						141
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-141	-141	-141	-141	-141	-141	-141	
-5.33%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94	
-2.67%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	47	47	47	47	47	47	47	
5.33%	94	94	94	94	94	94	94	
8.00%	141	141	141	141	141	141	141	
KR4111Q40003		2020-04 삼성전자개별선물						68
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68	
-5.33%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45	
-2.67%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	23	23	23	23	23	23	23	
5.33%	45	45	45	45	45	45	45	
8.00%	68	68	68	68	68	68	68	

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

289

공시일	2020-03-25
기준일	2020-03-24

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

759

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

777

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-25
기준일	2020-03-24

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

525

* 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	2020-03-25
기준일	2020-03-24

유로인덱스모(주식-파생형)

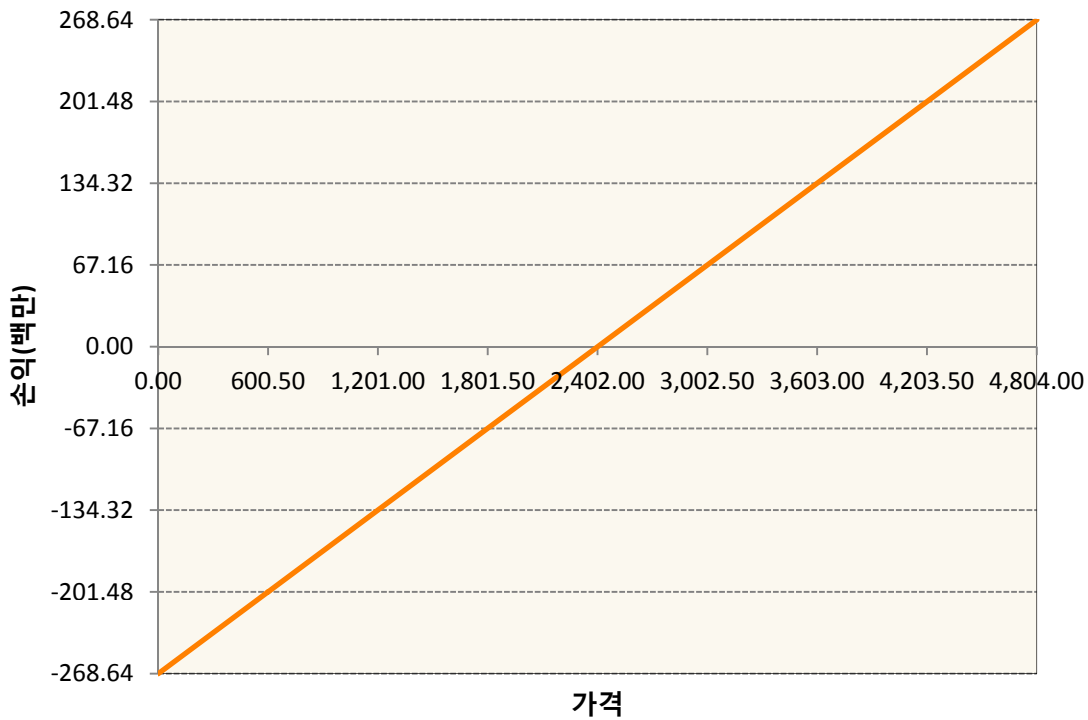
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	269	0	269	

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)

24

공시일	2020-03-25
기준일	2020-03-24

차이나인덱스모(주식-파생형)

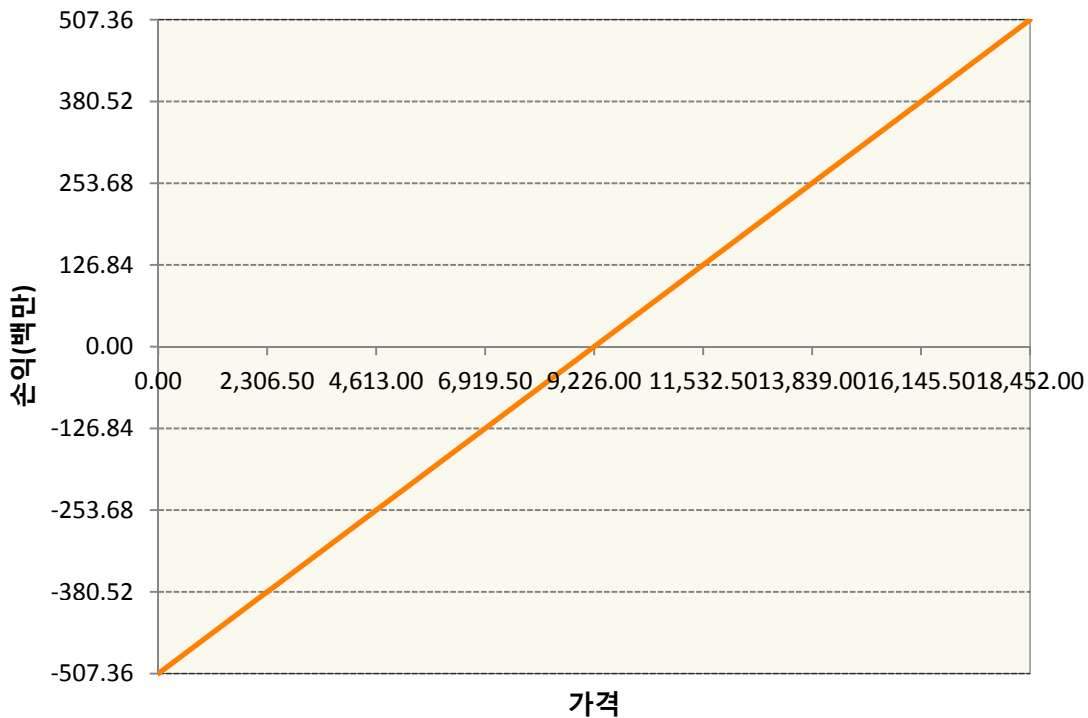
1. 계약금액

(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)

42

공시일	2020-03-25
기준일	2020-03-24

커버드콜모(주식혼합-파생형)

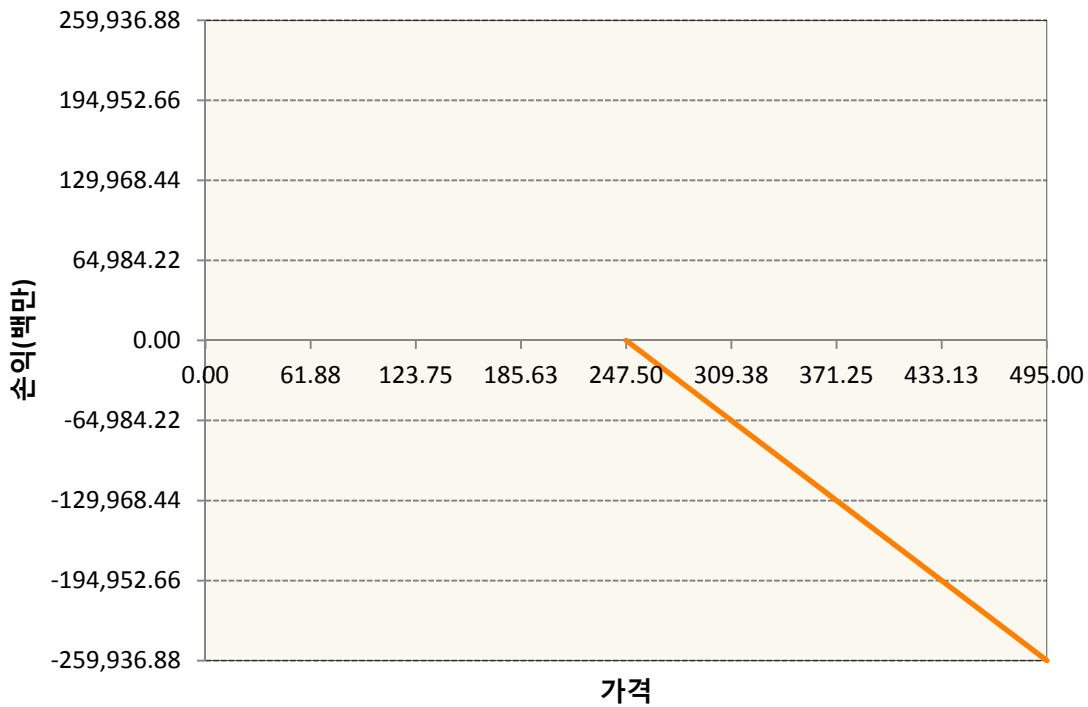
1. 계약금액

(단위:백만원)

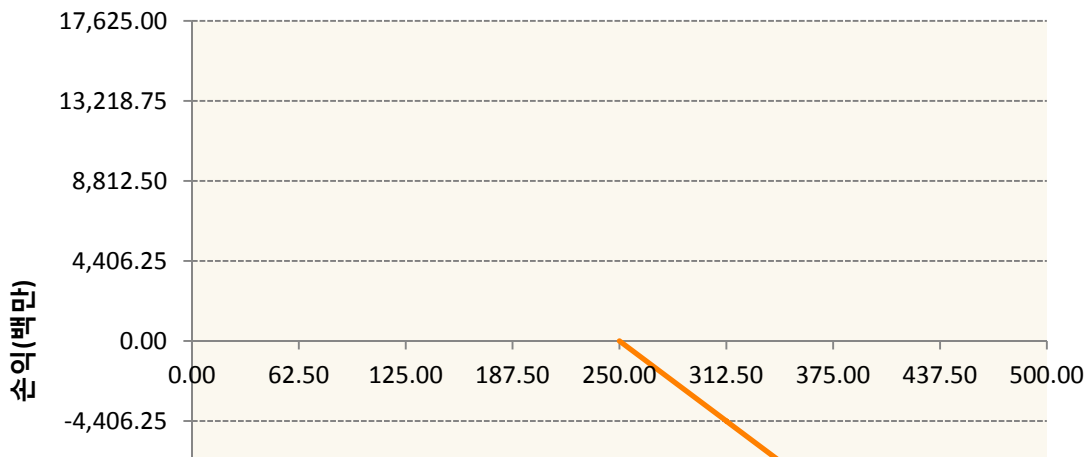
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	367,281	-367,281	장내

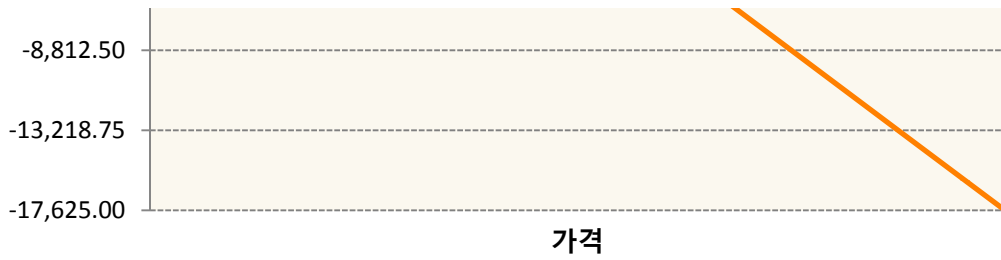
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

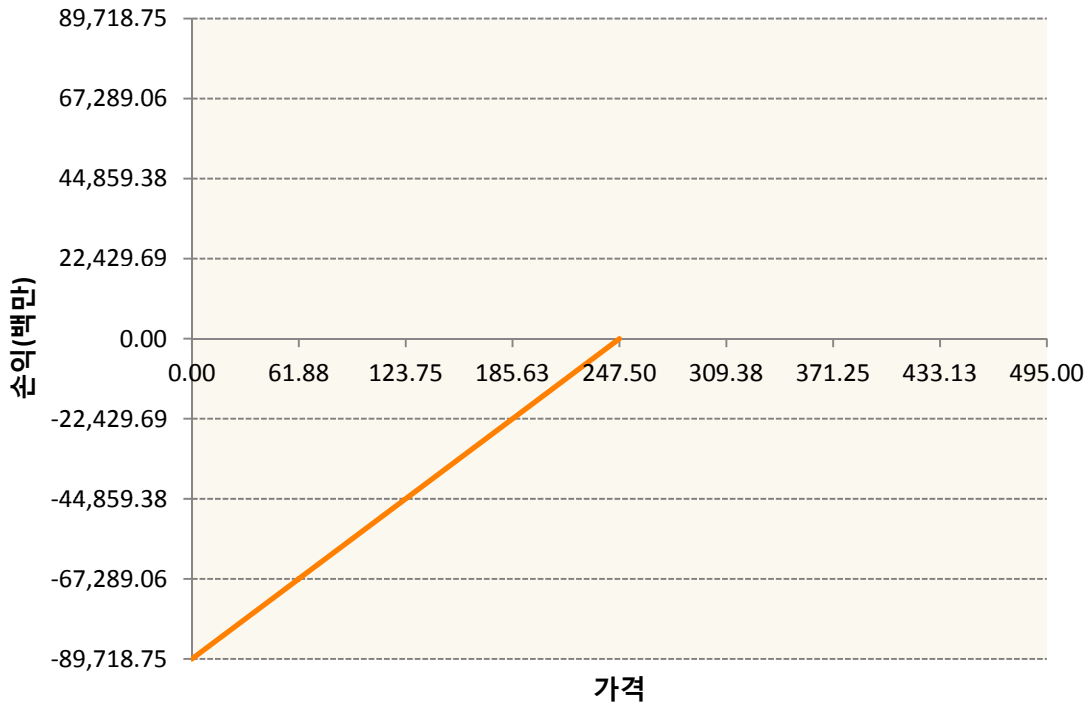


KR4201Q42503-2020-04 콜250





KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q42479		2020-04 콜247.5					8,961	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,292	3,112	2,865	2,550	2,172	1,734	1,243	
-5.33%	3,063	2,773	2,405	1,966	1,463	904	295	
-2.67%	2,658	2,225	1,713	1,134	497	-190	-919	
0%	1,993	1,394	725	0	-773	-1,584	-2,429	
2.67%	977	205	-620	-1,486	-2,386	-3,312	-4,261	
5.33%	-478	-1,411	-2,376	-3,366	-4,375	-5,398	-6,435	
8.00%	-2,448	-3,509	-4,584	-5,668	-6,760	-7,858	-8,961	
	KR4201Q42503					2020-04 콜250		567
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	195	185	171	152	129	102	71	

-5.33%	183	166	144	118	87	52	13
-2.67%	161	135	104	68	28	-15	-61
0%	123	87	45	0	-49	-101	-155
2.67%	65	17	-35	-90	-148	-208	-270
5.33%	-21	-80	-142	-206	-272	-339	-407
8.00%	-139	-208	-278	-349	-421	-494	-567
KR4301Q42477 2020-04 풋247.5							5,960
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,287	-5,345	-5,425	-5,528	-5,652	-5,797	-5,960
-5.33%	-3,234	-3,329	-3,449	-3,594	-3,761	-3,947	-4,150
-2.67%	-1,240	-1,383	-1,552	-1,745	-1,958	-2,188	-2,432
0%	666	467	243	0	-260	-533	-817
2.67%	2,452	2,193	1,915	1,623	1,320	1,007	686
5.33%	4,085	3,770	3,444	3,109	2,768	2,421	2,070
8.00%	5,539	5,180	4,816	4,448	4,077	3,705	3,330

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

(단위:백만원)

11,489

공시일	2020-03-25
기준일	2020-03-24

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

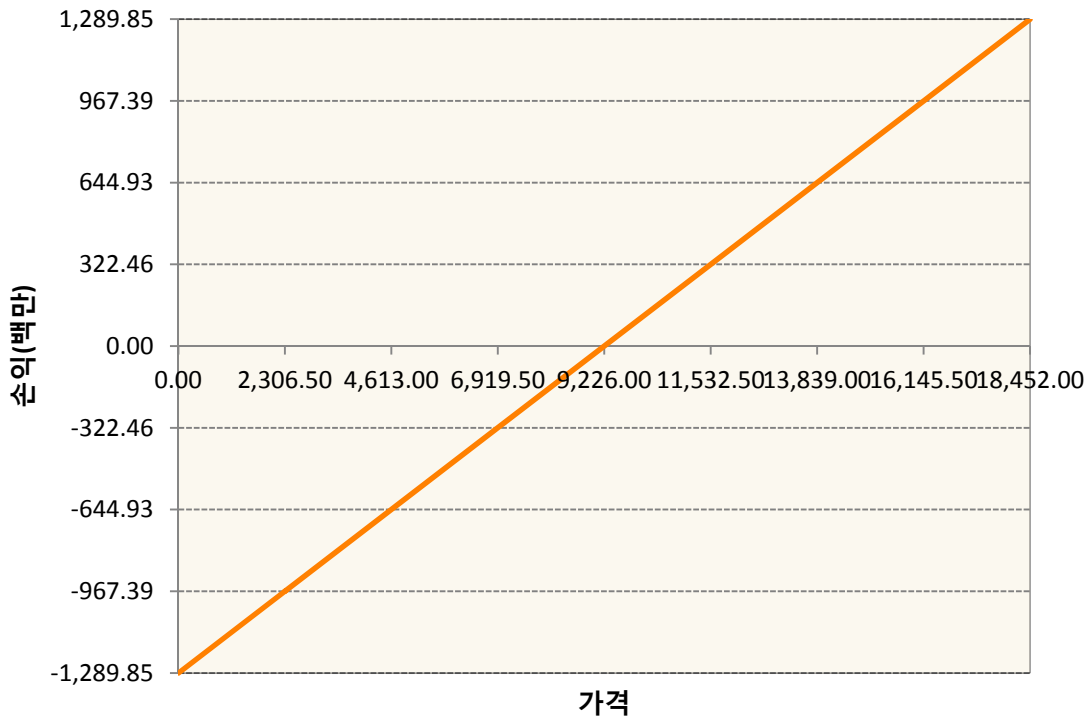
1. 계약금액

(단위:백만원)

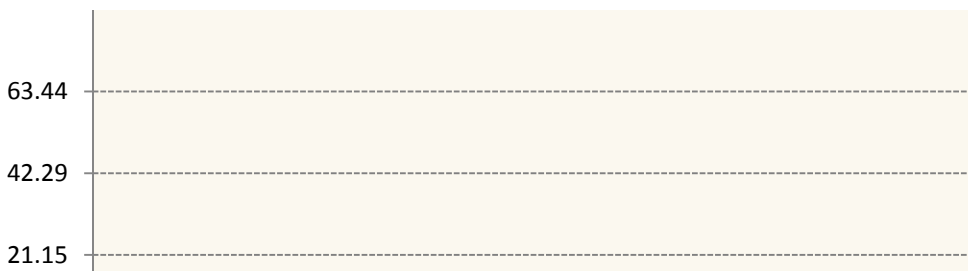
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,290	0	1,290	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,610	-4,610	장내
누계	통화	선도	709	2,269	-1,560	장외

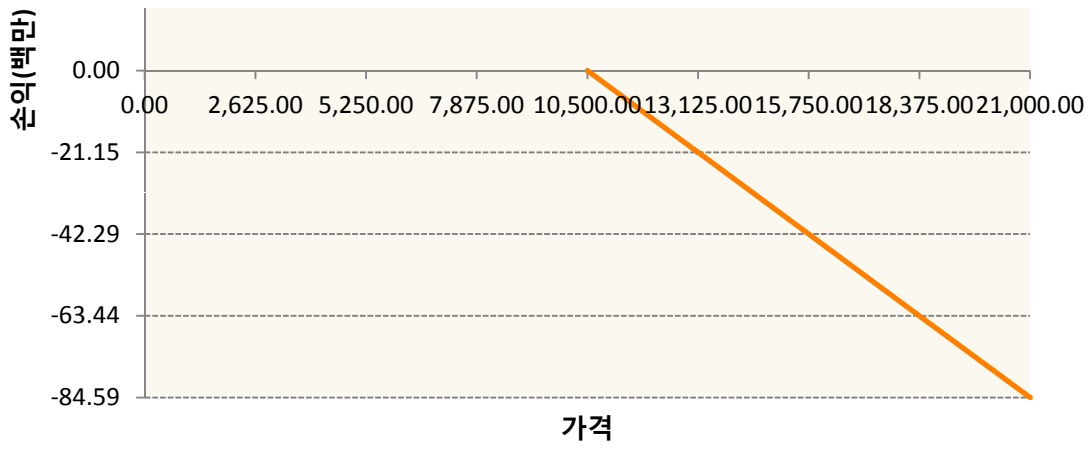
2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20

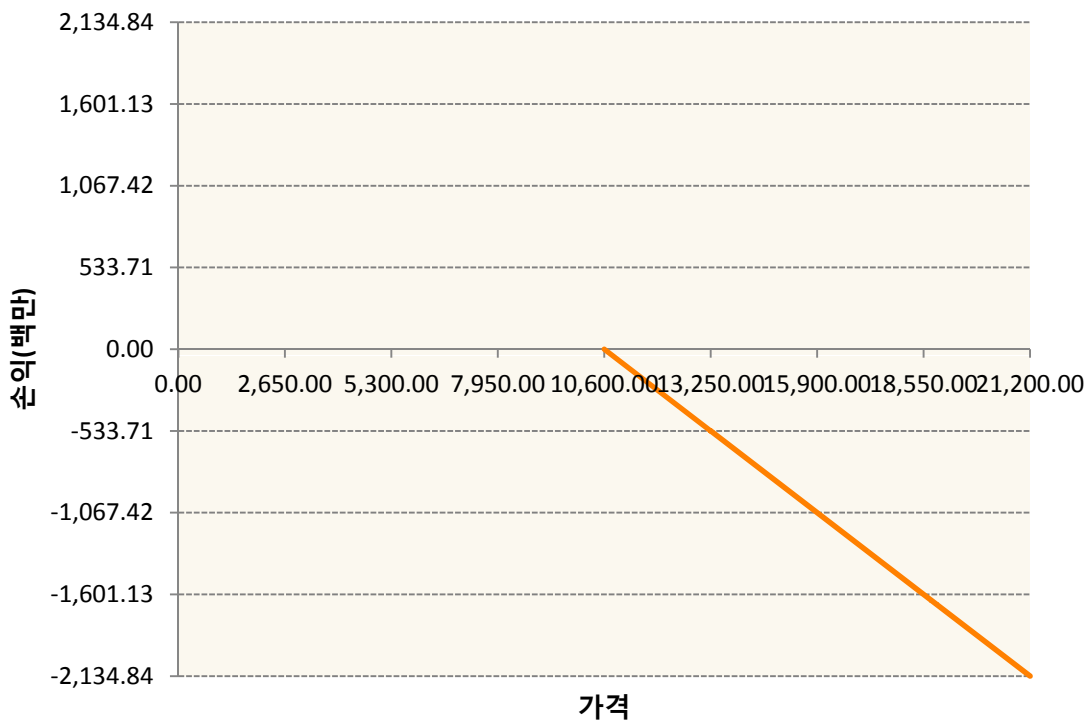


OHHIHO-C105-HSCEI

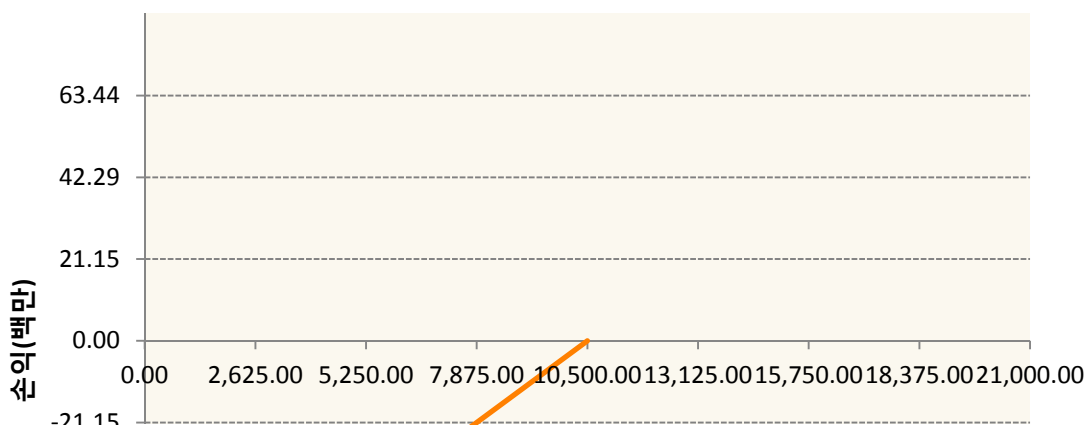


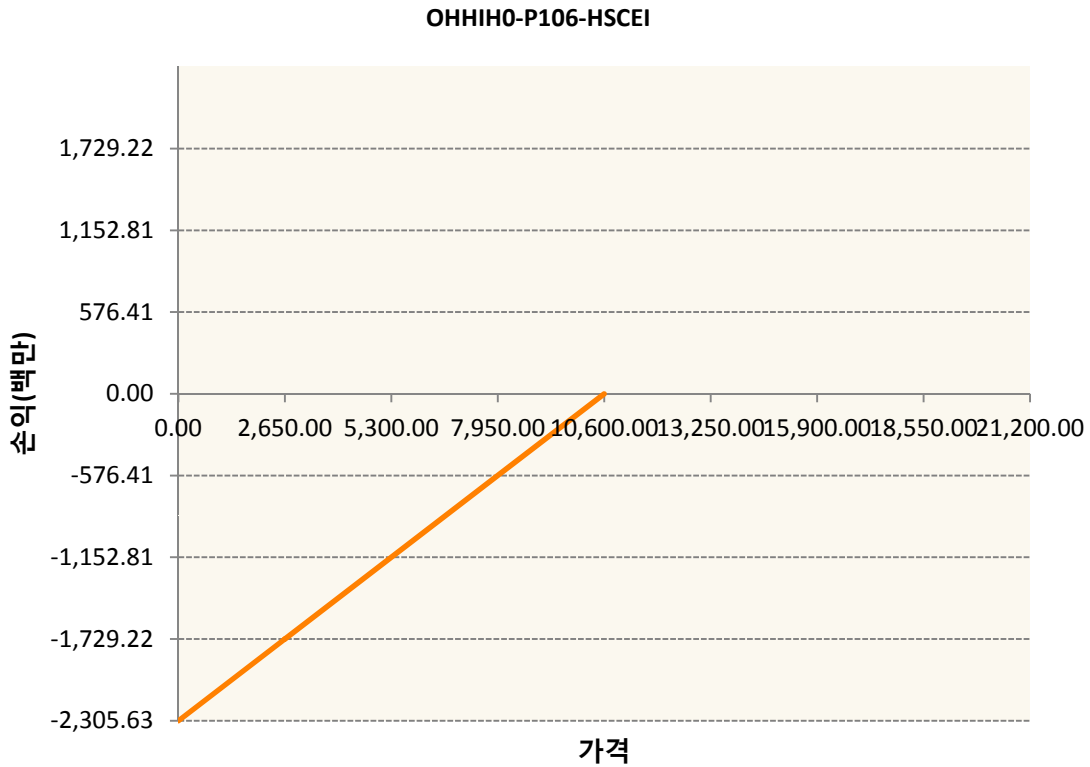
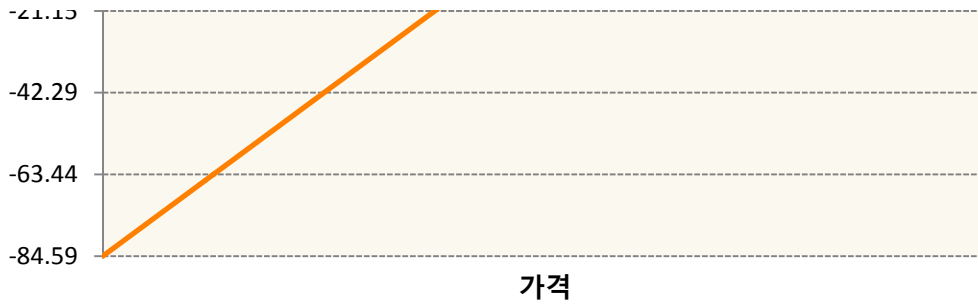


OHHIH0-C106-HSCEI



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		103
OHHIH0-C1(HSCEI		7
OHHIH0-C1(HSCEI		171
OHHIH0-P1(HSCEI		7
OHHIH0-P1(HSCEI		184

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	595

공시일	2020-03-25
기준일	2020-03-24

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

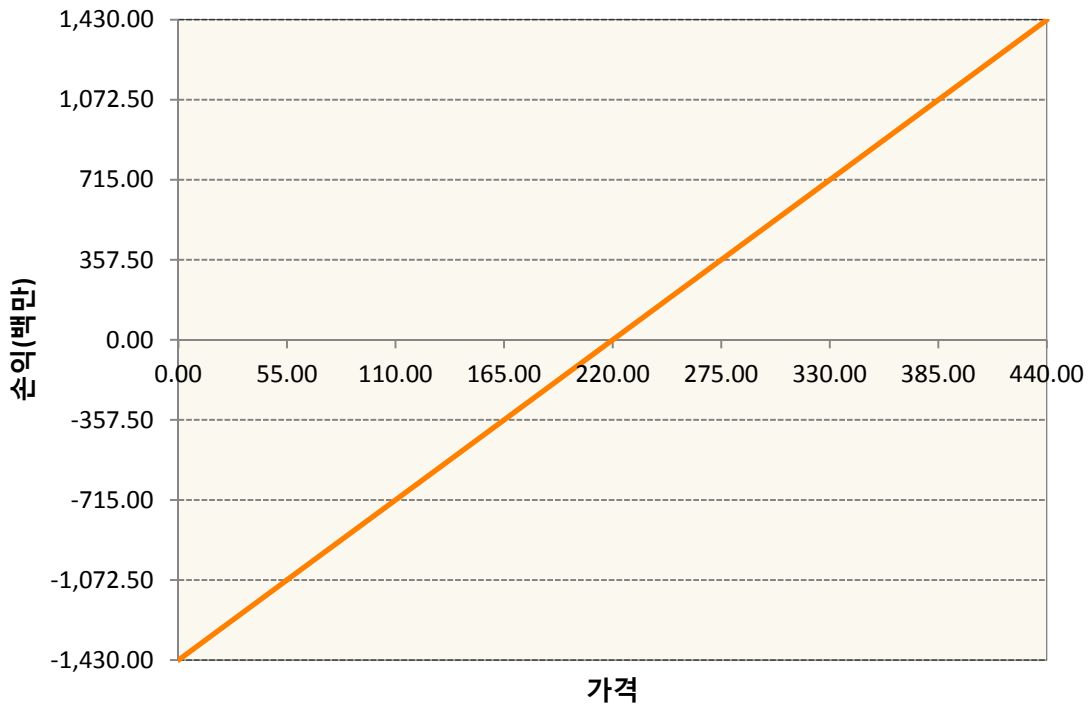
1. 계약금액

(단위:백만원)

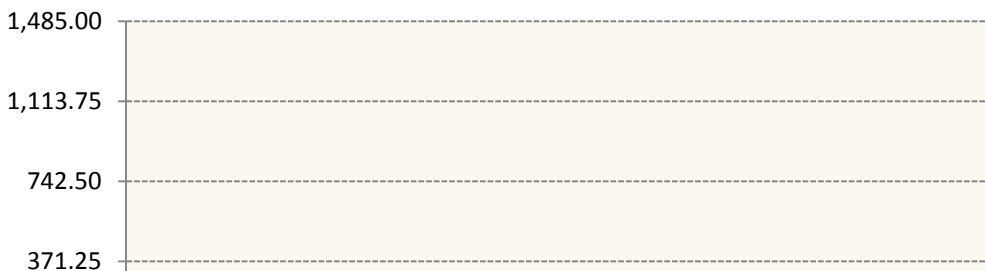
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,430	0	1,430	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,095	-3,095	장내

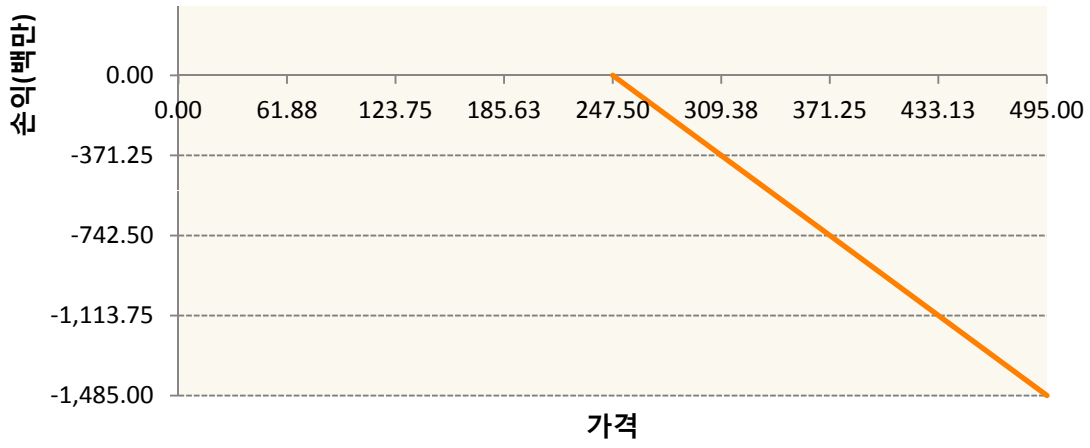
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

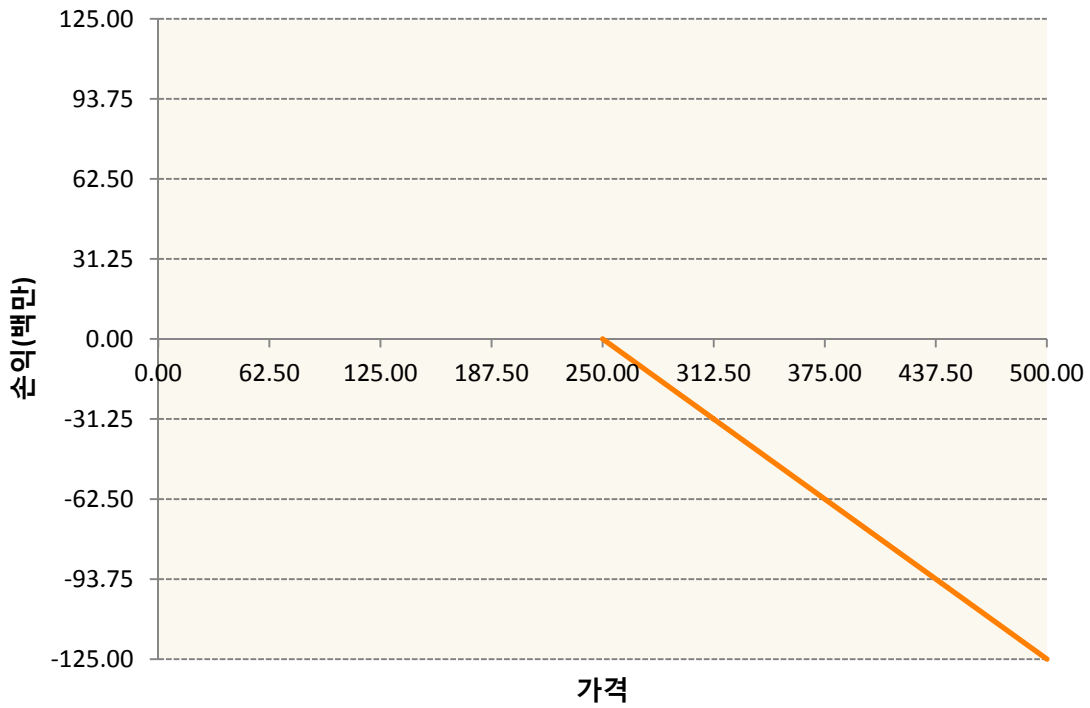


KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

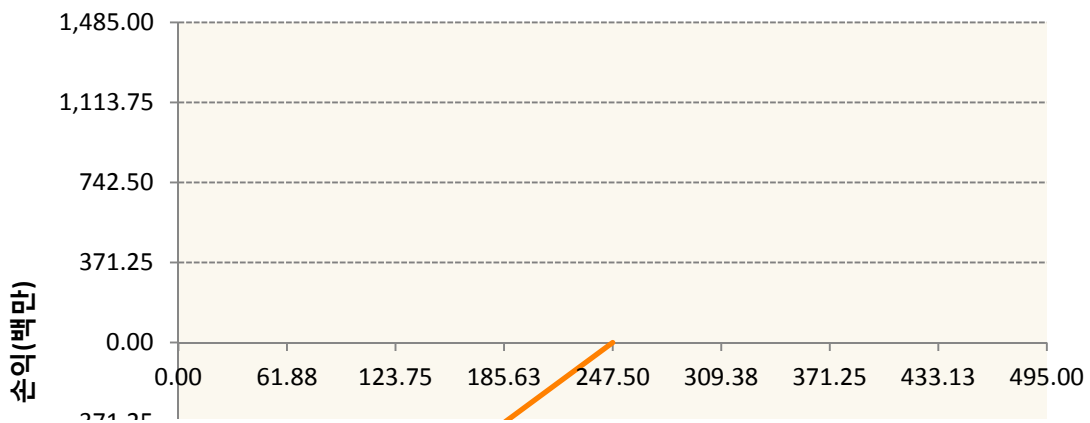




KR4201Q42503-2020-04 콜250



KR4301Q42477-2020-04 풋247.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						185
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-185	-185	-185	-185	-185	-185	-185	
-5.33%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123	
-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%	123	123	123	123	123	123	123	
8.00%	185	185	185	185	185	185	185	
KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						115
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-115	-115	-115	-115	-115	-115	-115	
-5.33%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76	
-2.67%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	38	38	38	38	38	38	38	
5.33%	76	76	76	76	76	76	76	
8.00%	115	115	115	115	115	115	115	
KR4201Q42479		2020-04 콜247.5						51
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	19	18	16	15	12	10	7	
-5.33%	18	16	14	11	8	5	2	
-2.67%	15	13	10	6	3	-1	-5	
0%	11	8	4	0	-4	-9	-14	
2.67%	6	1	-4	-8	-14	-19	-24	
5.33%	-3	-8	-14	-19	-25	-31	-37	
8.00%	-14	-20	-26	-32	-39	-45	-51	
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	1
-5.33%	1	1	1	1	1	1	0
-2.67%	1	1	1	0	0	0	0
0%	1	1	0	0	0	0	-1
2.67%	0	0	0	-1	-1	-1	-2
5.33%	0	-1	-1	-1	-2	-2	-3
8.00%	-1	-1	-2	-2	-3	-4	-4
KR4301Q42477 2020-04 풋247.5							99
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-88	-88	-90	-91	-94	-96	-99
-5.33%	-54	-55	-57	-59	-62	-65	-69
-2.67%	-21	-23	-26	-29	-32	-36	-40
0%	11	8	4	0	-4	-9	-14
2.67%	41	36	32	27	22	17	11
5.33%	68	62	57	51	46	40	34
8.00%	92	86	80	74	67	61	55

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

(단위:백만원)

468

공시일	2020-03-25
기준일	2020-03-24

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

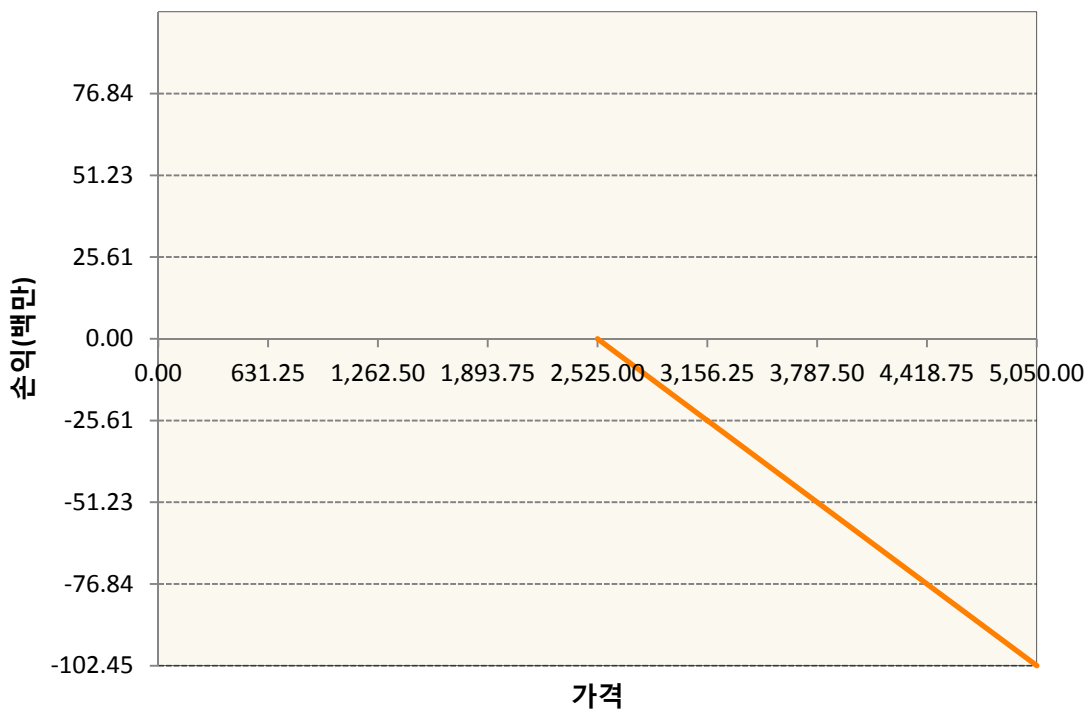
1. 계약금액

(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	230	0	230	
누계	유가증권	스왑	7,682	0	7,682	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,482	-4,482	장내
누계	통화	선도	541	3,549	-3,008	장외

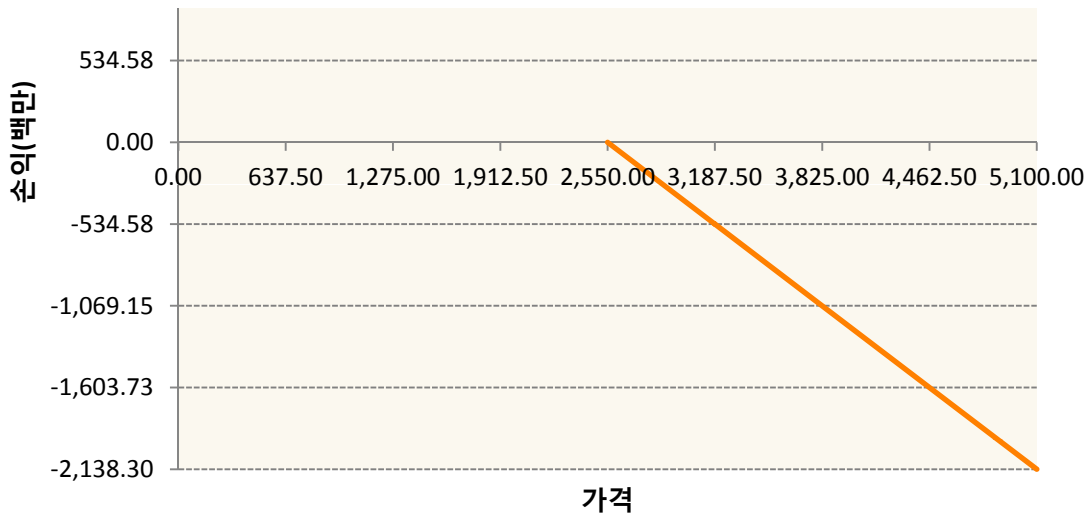
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ0-C2525-EURO STOXX 50

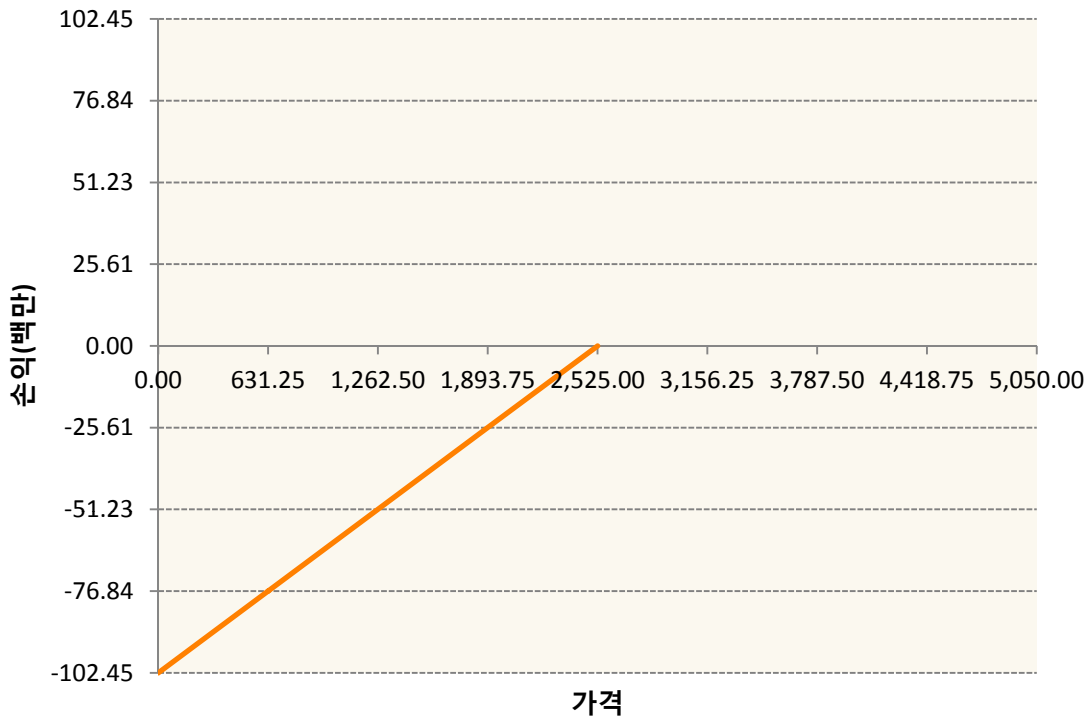


OESXJ0-C2550-EURO STOXX 50

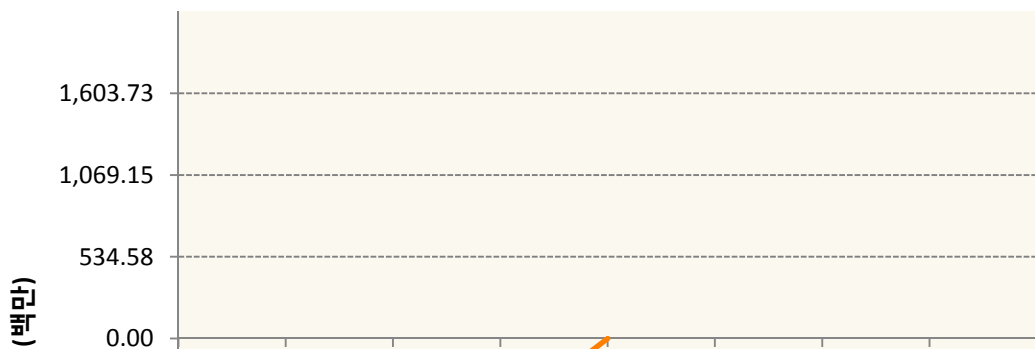


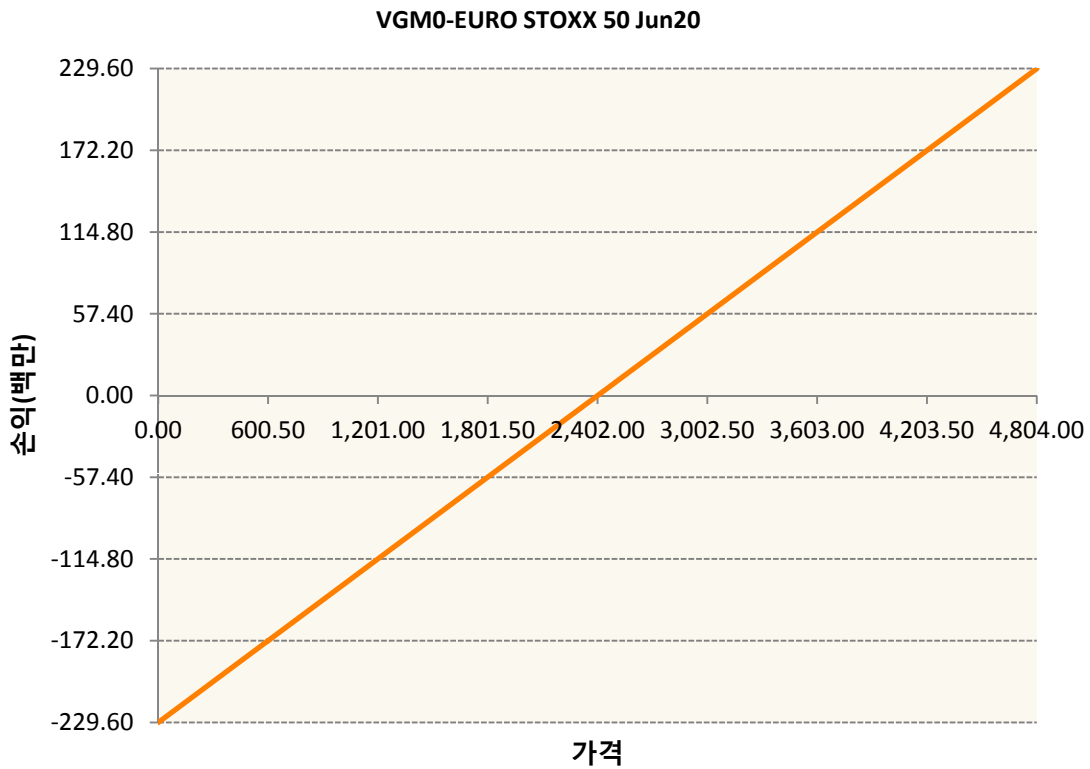
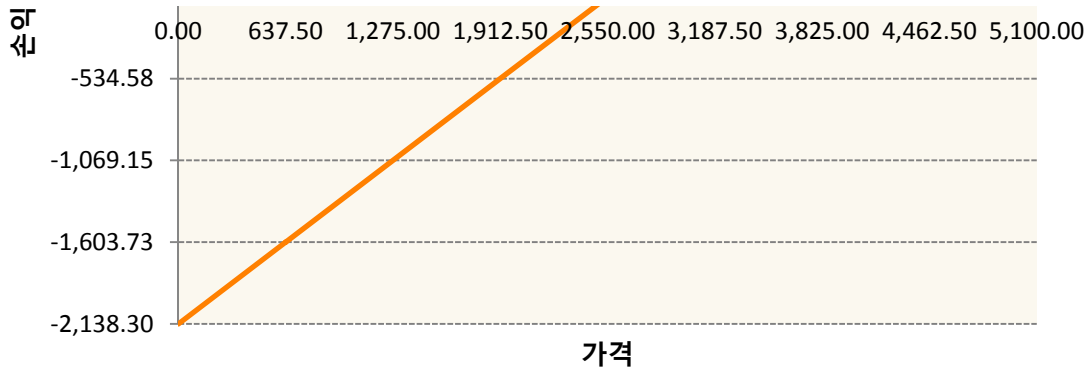


OESXJ0-P2525-EURO STOXX 50



OESXJ0-P2550-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		12
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E		284
FX21020H00 EUR/KRW 27-03-20E		43
OESXJ0-C25:EURO STOXX 50		8
OESXJ0-C25:EURO STOXX 50		171
OESXJ0-P25:EURO STOXX 50		8
OESXJ0-P25:EURO STOXX 50		171
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20		18

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

(단위:백만원)

618

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

(단위:백만원)

899

공시일	2020-03-25
기준일	2020-03-24

ETF스마트레버리지목표전환형9호

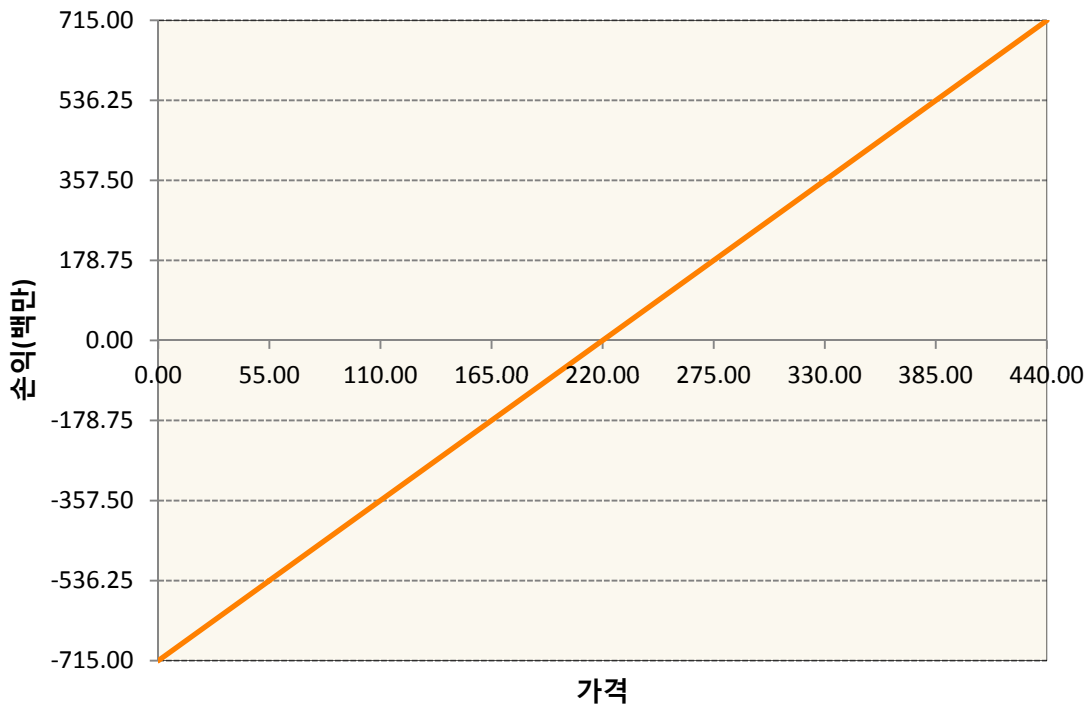
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	715	0	715	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						57
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57	
-5.33%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38	
-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%	38	38	38	38	38	38	38	
8.00%	57	57	57	57	57	57	57	

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

(단위:백만원)

78

공시일	2020-03-25
기준일	2020-03-24

ETF스마트레버리지목표전환형10호

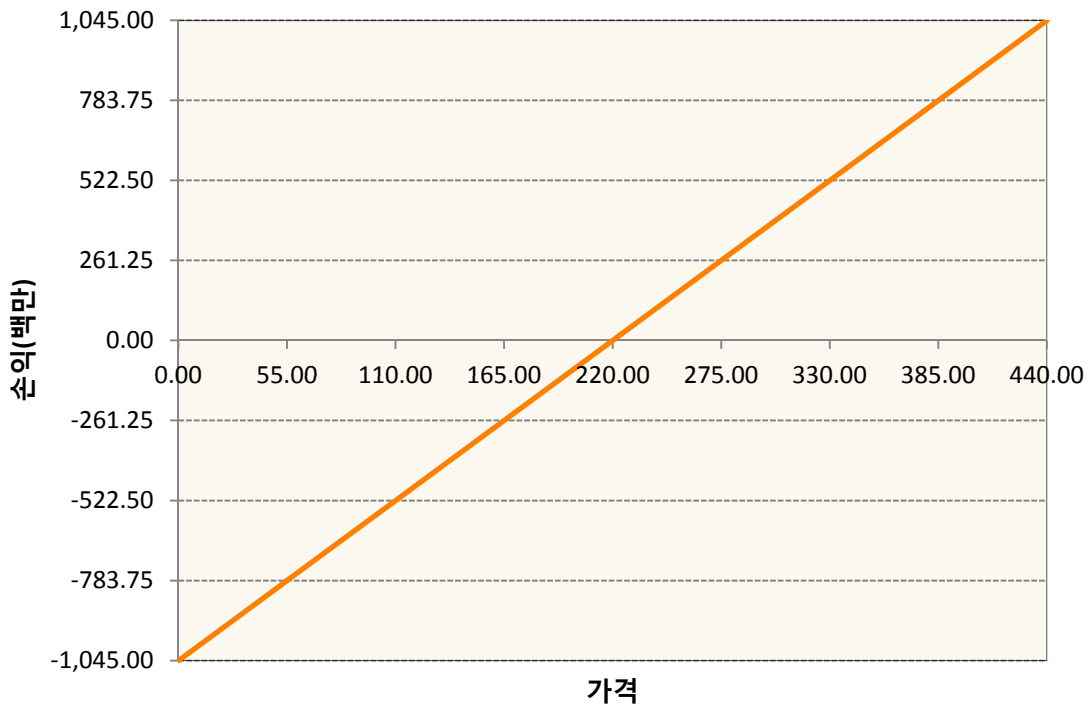
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,045	0	1,045	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						84
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84	
-5.33%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56	
-2.67%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	28	28	28	28	28	28	28	
5.33%	56	56	56	56	56	56	56	
8.00%	84	84	84	84	84	84	84	

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

(단위:백만원)

114

공시일	2020-03-25
기준일	2020-03-24

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

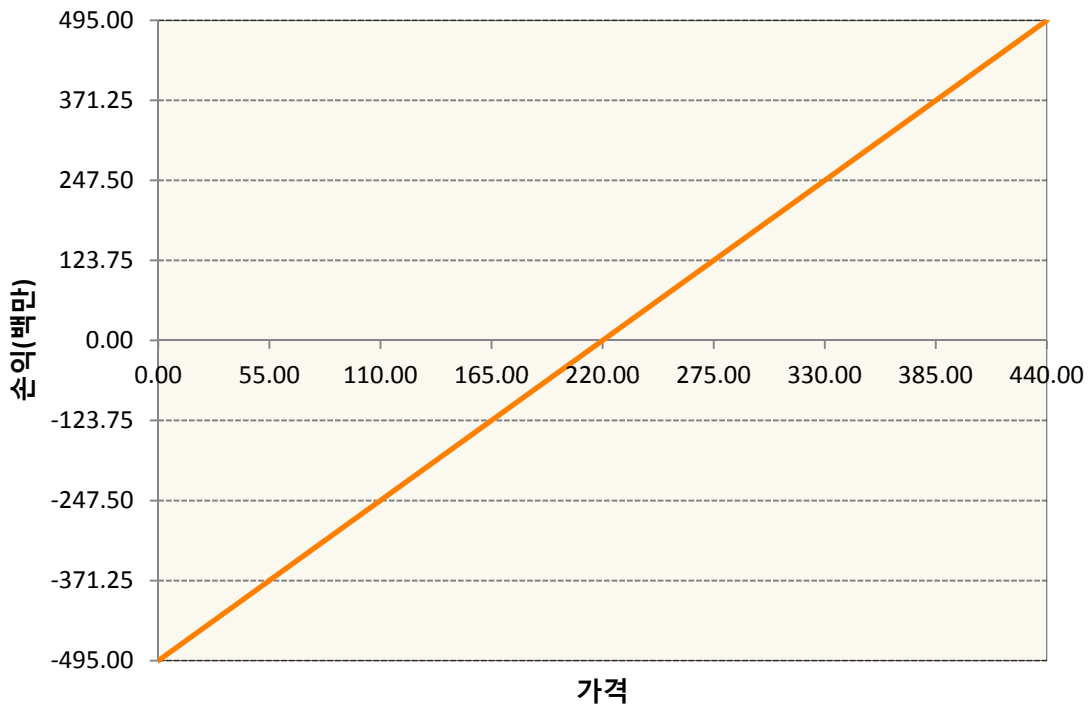
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	495	0	495	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						40
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40	
-5.33%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26	
-2.67%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	13	13	13	13	13	13	13	
5.33%	26	26	26	26	26	26	26	
8.00%	40	40	40	40	40	40	40	

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

(단위:백만원)

54

공시일	2020-03-25
기준일	2020-03-24

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

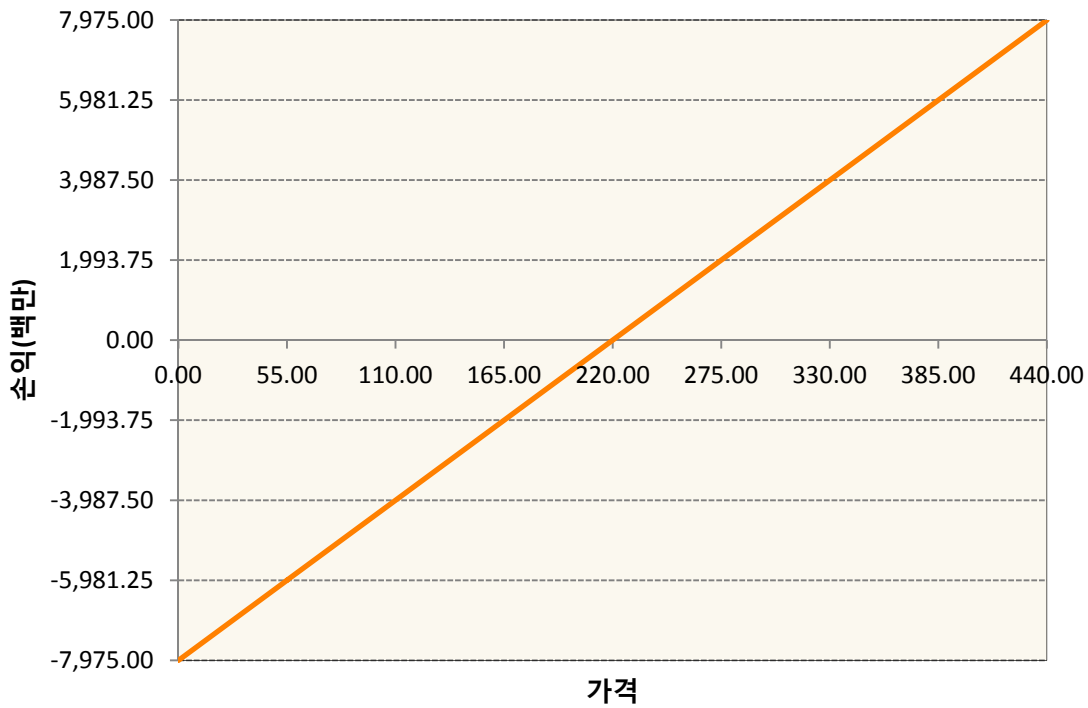
1. 계약금액

(단위:백만원)

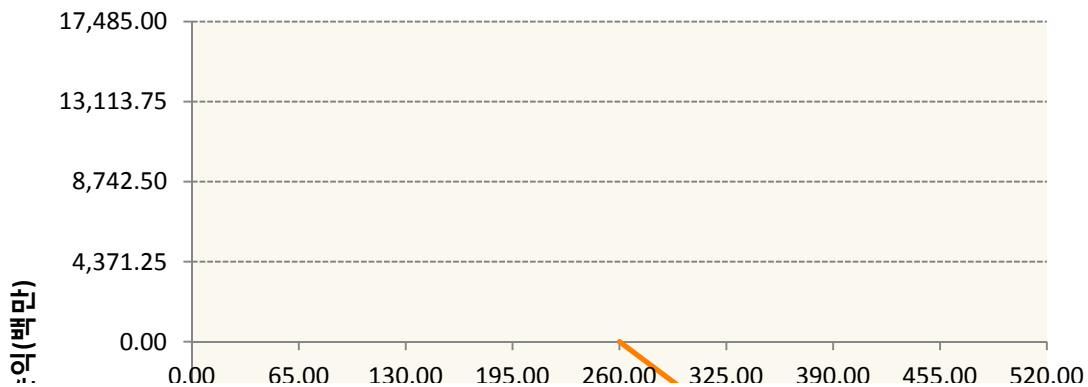
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,975	0	7,975	장내
누계	유가증권	옵션	6,004	17,485	-11,481	장내

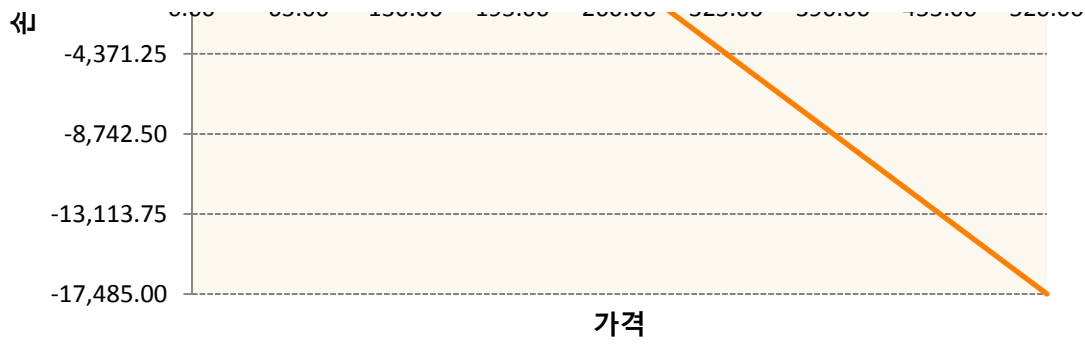
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

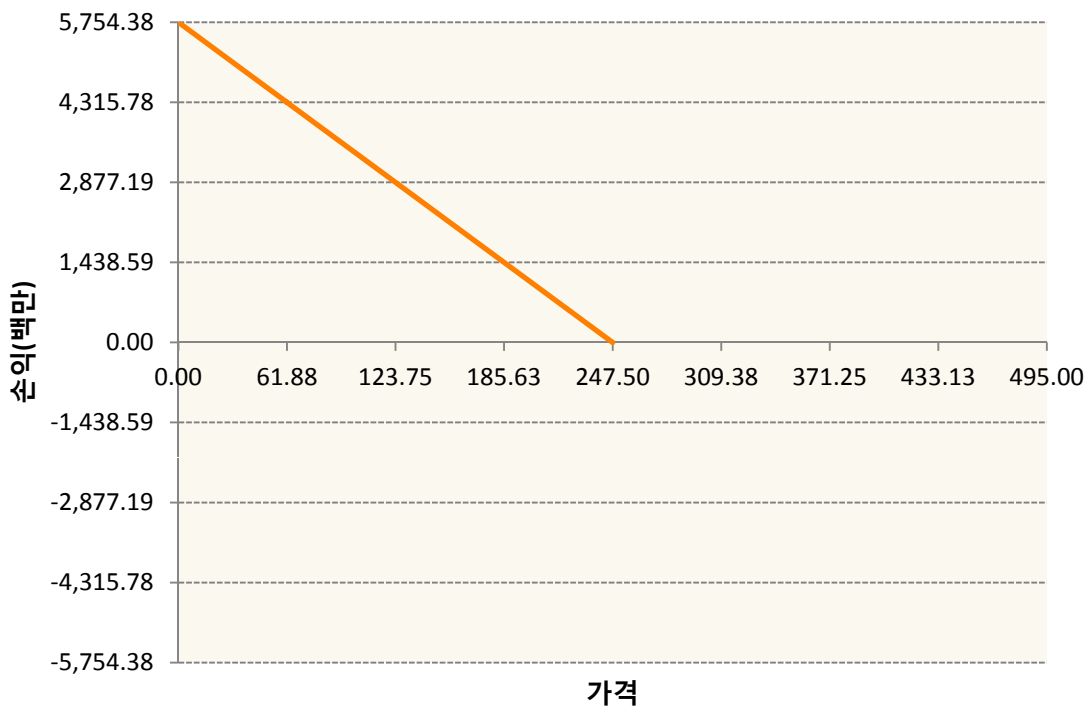


KR4201Q42602-2020-04 콜260

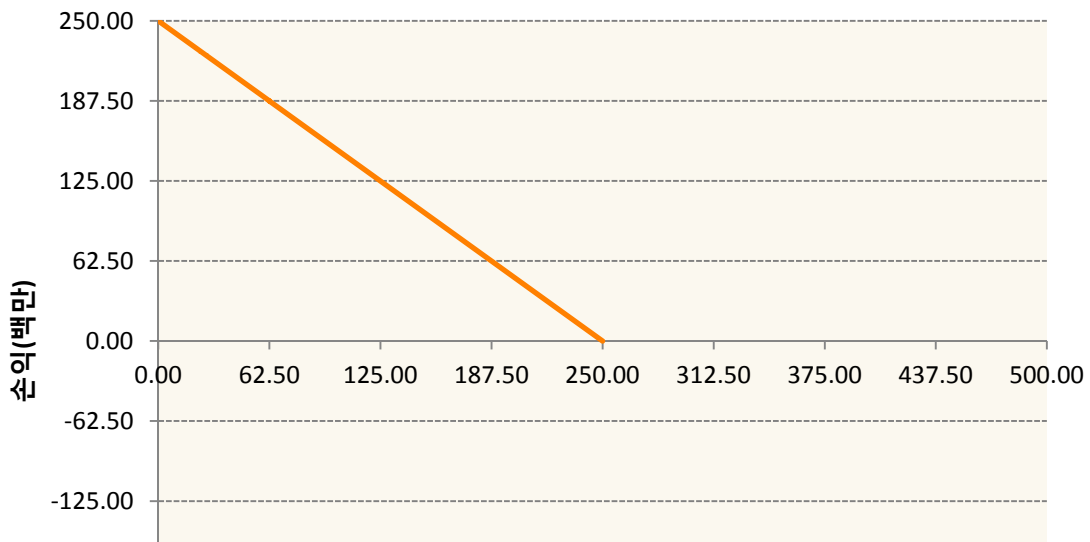


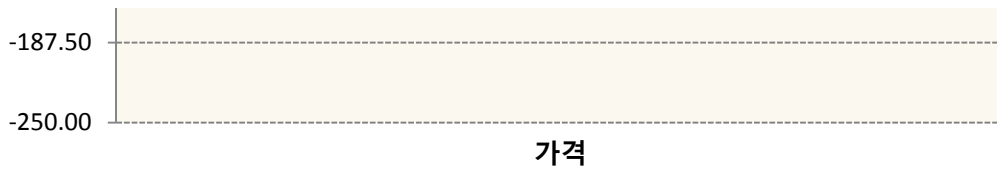


KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



KR4301Q42501-2020-04 풋250





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						639
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-639	-639	-639	-639	-639	-639	-639	
-5.33%	-426	-426	-426	-426	-426	-426	-426	
-2.67%	-213	-213	-213	-213	-213	-213	-213	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	213	213	213	213	213	213	213	
5.33%	426	426	426	426	426	426	426	
8.00%	639	639	639	639	639	639	639	
KR4201Q42602		2020-04 콜260						416
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	110	105	98	87	73	55	34	
-5.33%	105	97	85	69	48	24	-3	
-2.67%	96	82	64	41	13	-18	-53	
0%	79	58	31	0	-36	-75	-117	
2.67%	51	20	-16	-56	-101	-148	-198	
5.33%	6	-36	-82	-132	-184	-240	-297	
8.00%	-61	-114	-170	-229	-290	-352	-416	
KR4301Q42477		2020-04 풋247.5						382
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	339	343	348	355	363	372	382	
-5.33%	207	213	221	231	241	253	266	
-2.67%	80	89	100	112	126	140	156	
0%	-43	-30	-16	0	17	34	52	
2.67%	-157	-141	-123	-104	-85	-65	-44	
5.33%	-262	-242	-221	-199	-178	-155	-133	
8.00%	-355	-332	-309	-285	-262	-238	-214	
KR4301Q42501		2020-04 풋250						17
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	15	15	15	16	16	16	17	
-5.33%	9	9	10	10	11	11	12	
-2.67%	4	4	4	5	5	6	7	

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

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

(단위:백만원)

1,426

공시일	2020-03-25
기준일	2020-03-24

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	16,957	-16,957	
누계	유가증권	수익증권	158,919	0	158,919	

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	2020-03-25
기준일	2020-03-24

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	100,749	0	100,749	

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	2020-03-25
기준일	2020-03-24

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	15,746	-15,746	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	451,185	0	451,185	
누계	통화	선도	91,846	502,214	-410,369	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020F03! KRW/USD 31-03-20E	3,199
FX21020F04! KRW/USD 31-03-20E	2,999
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,699
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,439
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,999
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,999
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,339
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,999
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	200
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	5,098
FX21020G06 USD/KRW 31-03-20E	500
FX21020H00 USD/KRW 31-03-20E	1,000
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,499
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,079
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,079
FX21020H04 USD/KRW 21-04-20E	1,500
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,439
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	1,000
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	1,000
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,599
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	860
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	750
FX21020H09 USD/KRW 24-04-20E	750
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	500

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

21,677

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

(단위:백만원)

154

공시일	2020-03-25
기준일	2020-03-24

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

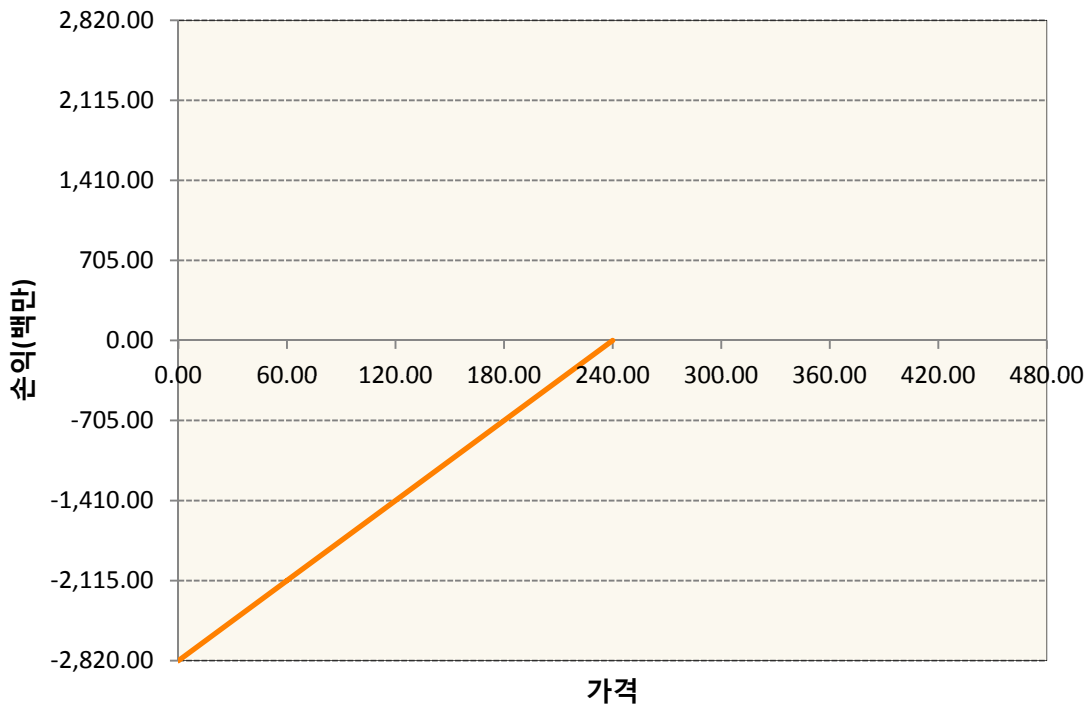
1. 계약금액

(단위:백만원)

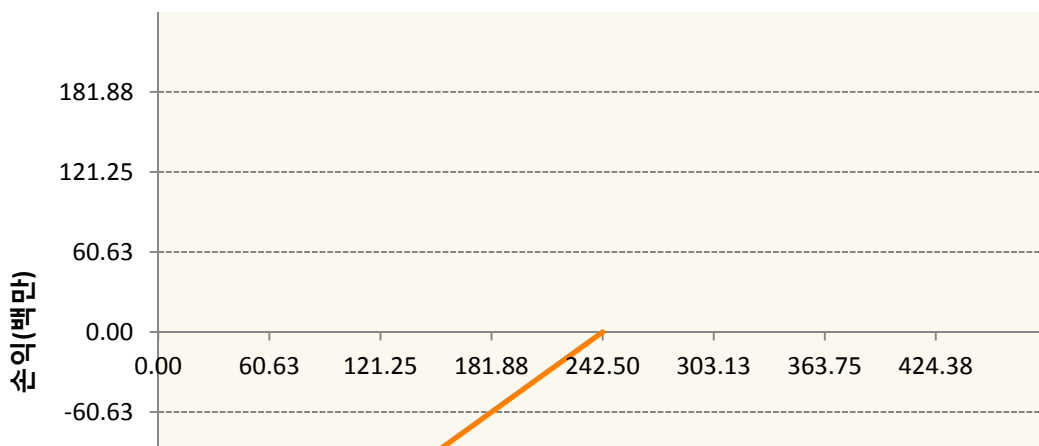
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,063	-3,063	장내

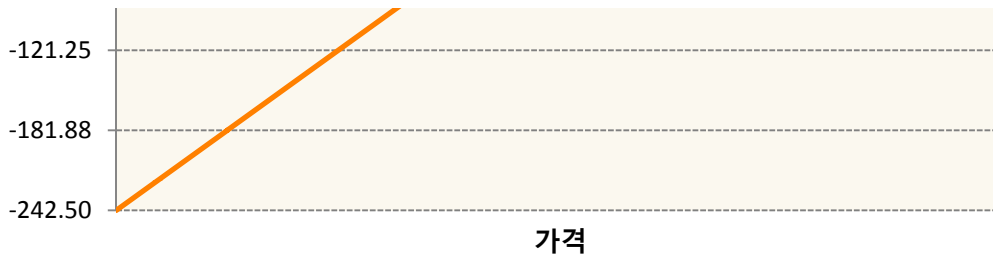
2. 만기시점의 손익구조

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%	-156	-159	-163	-168	-173	-179	-185	
-5.33%	-92	-96	-102	-108	-115	-122	-130	
-2.67%	-30	-37	-44	-52	-60	-69	-78	
0%	27	18	9	0	-10	-20	-30	
2.67%	79	69	58	47	36	25	14	
5.33%	125	113	101	90	78	66	54	
8.00%	164	151	139	127	114	102	90	
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	-16	-16	
-5.33%	-8	-9	-9	-9	-10	-11	-11	
-2.67%	-3	-3	-4	-5	-5	-6	-7	
0%	2	1	1	0	-1	-2	-2	
2.67%	7	6	5	4	3	2	1	
5.33%	11	10	9	8	7	6	5	
8.00%	14	13	12	11	10	9	8	

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

185

공시일	2020-03-25
기준일	2020-03-24

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	736	-736	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	7,116	0	7,116	
누계	통화	선도	2,262	9,684	-7,423	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	189
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	223
FX21020H01 USD/KRW 31-03-20E	51
FX21020H02 KRW/USD 13-04-20E	363
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)

436

공시일	2020-03-25
기준일	2020-03-24

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

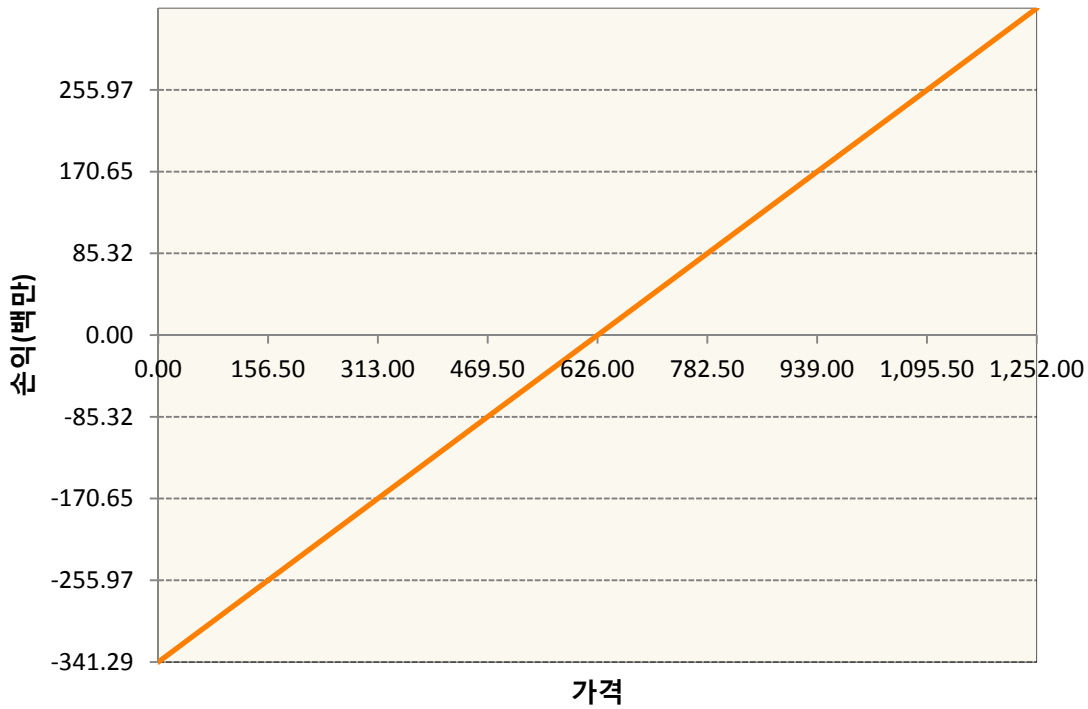
1. 계약금액

(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	1,116	0	1,116	장외
누계	통화	선도	573	744	-170	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCJ0-VN30 Index Future Apr20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	89
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
FX21020H09 EUR/KRW 26-06-20E	8
VNCJ0 VN30 Index Future Apr20	27

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

(단위:백만원)

151

공시일	2020-03-25
기준일	2020-03-24

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

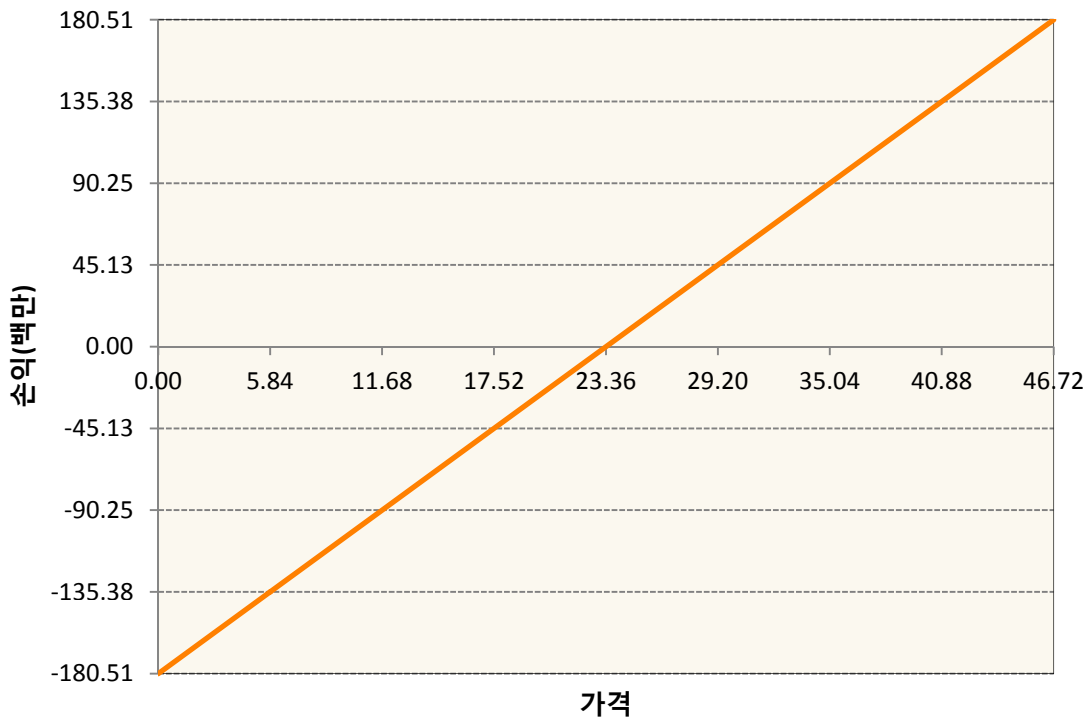
1. 계약금액

(단위:백만원)

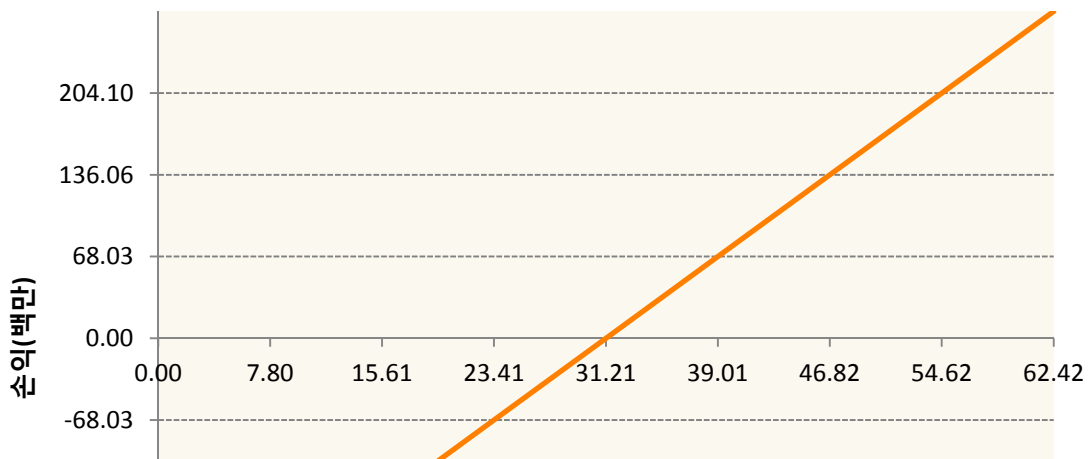
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,223	125	1,098	

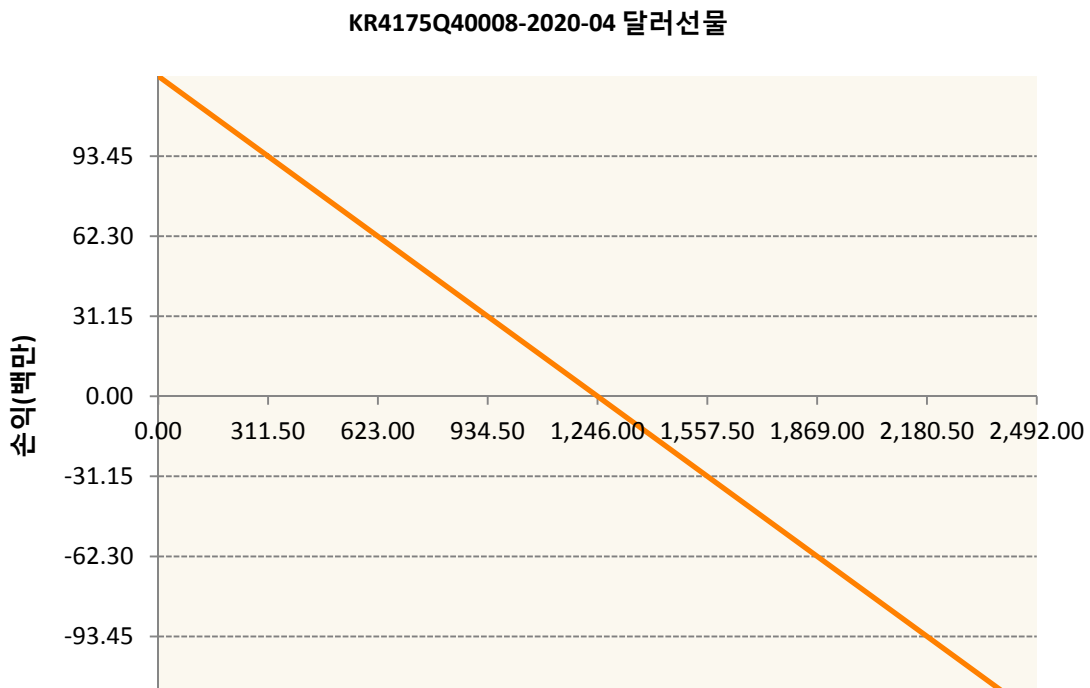
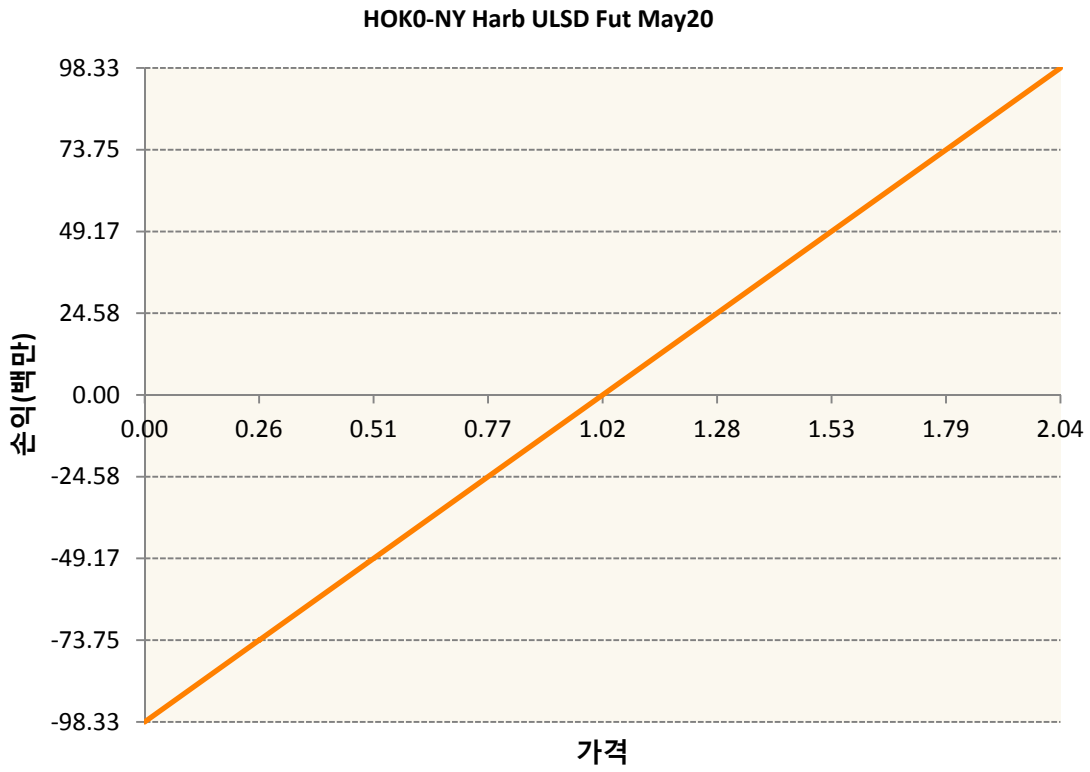
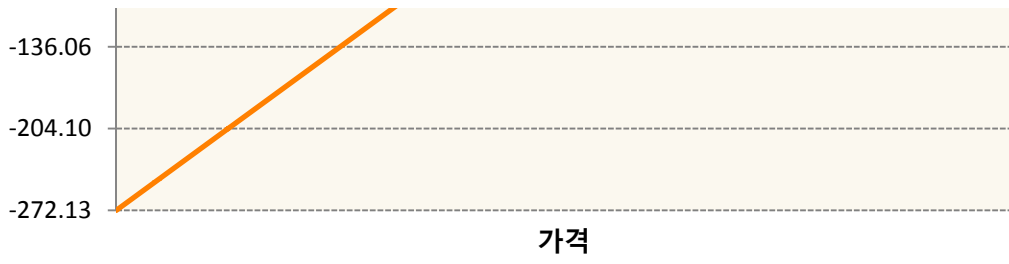
2. 만기시점의 손익구조

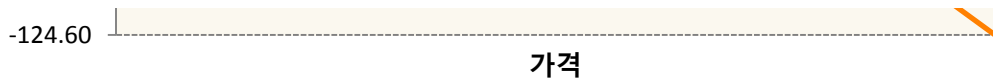
CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20



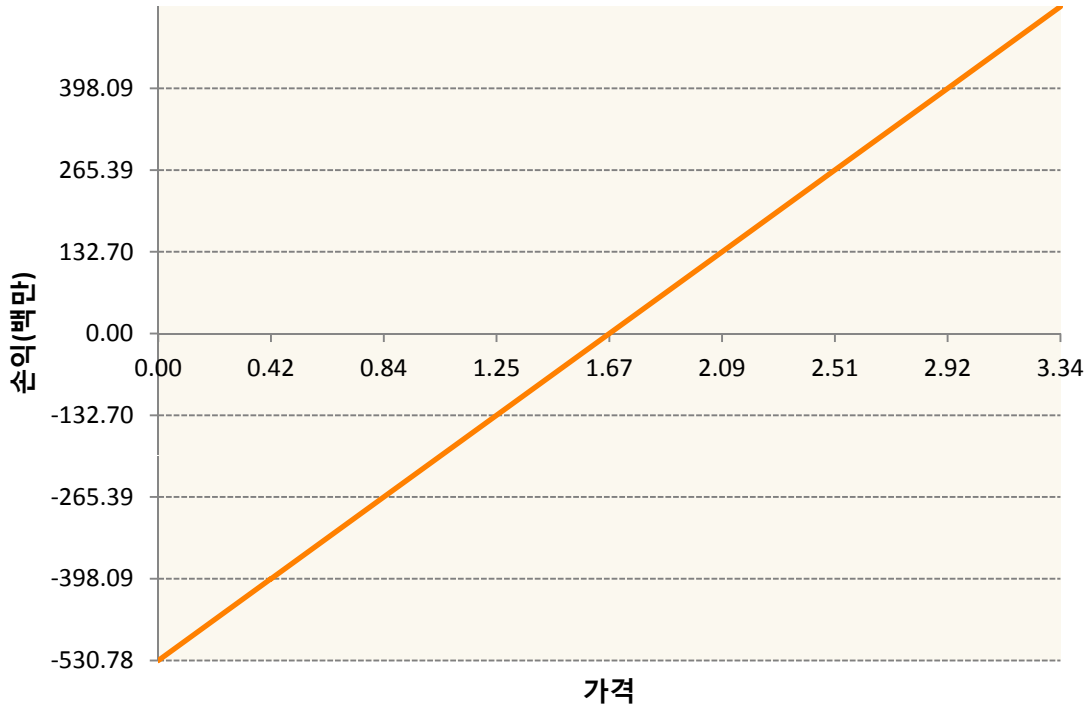
CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20



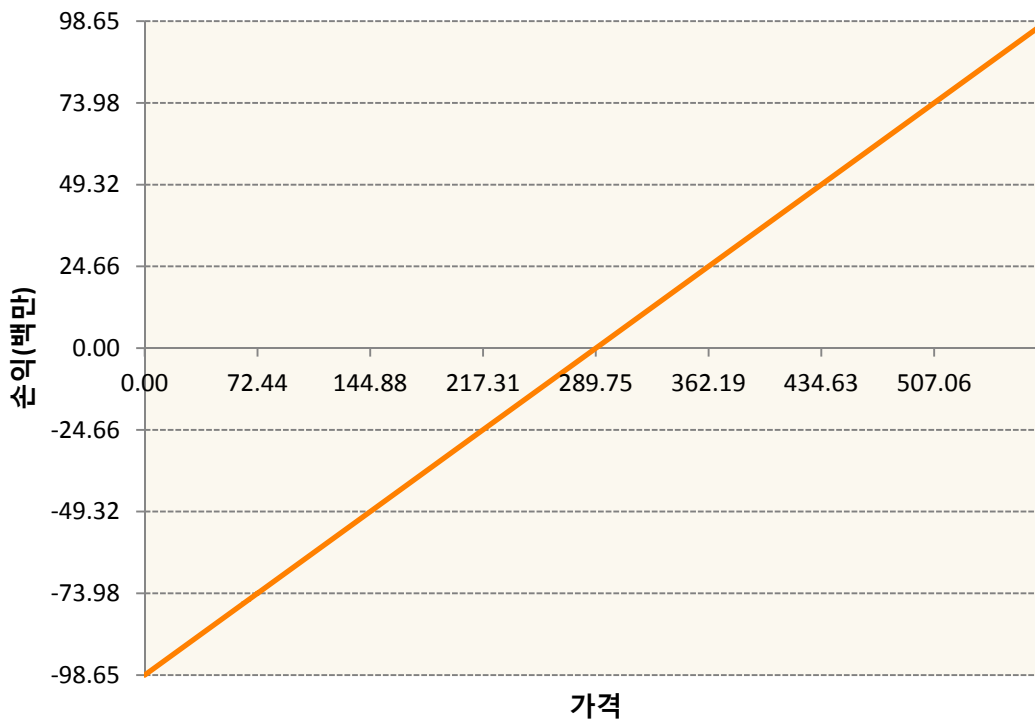




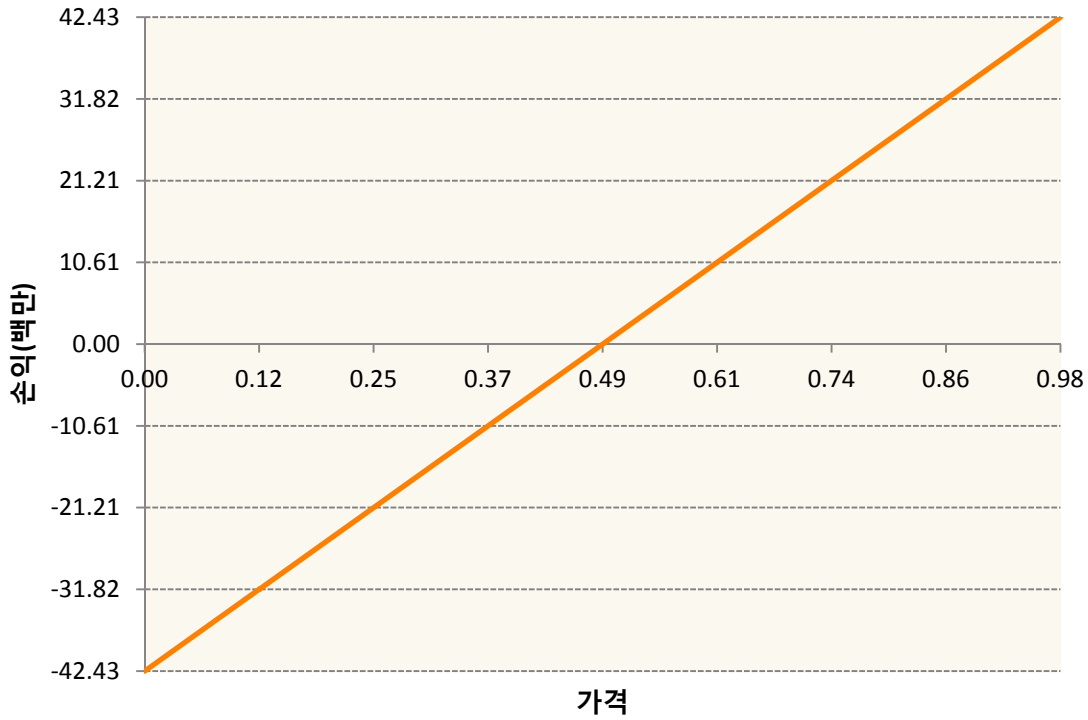
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



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	22
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	3

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

(단위:백만원)

269

공시일	2020-03-25
기준일	2020-03-24

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

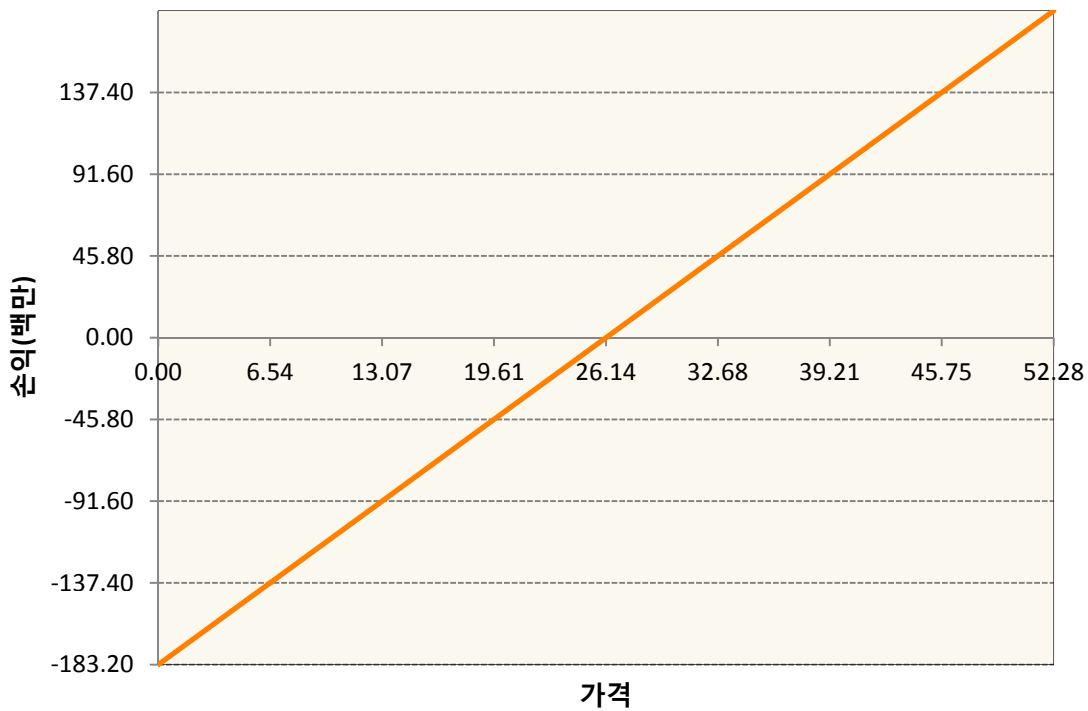
1. 계약금액

(단위:백만원)

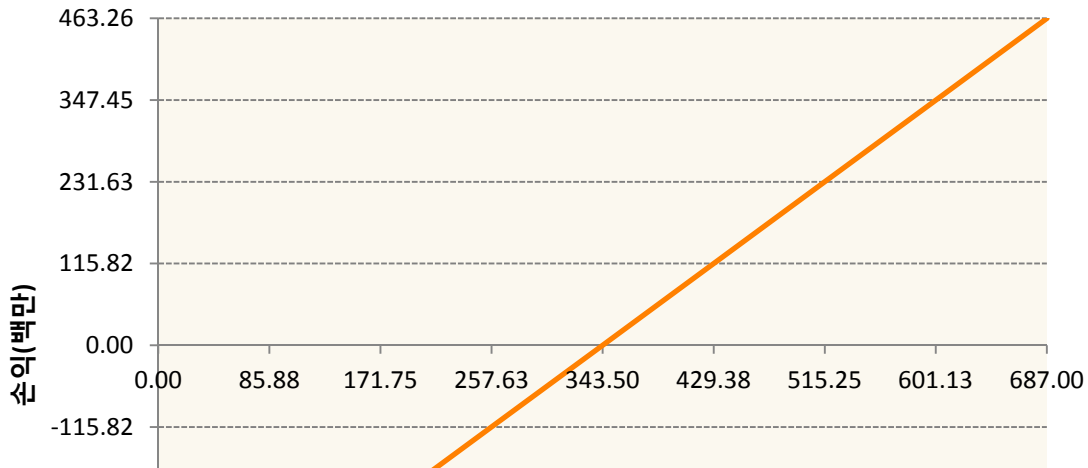
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,367	100	2,267	

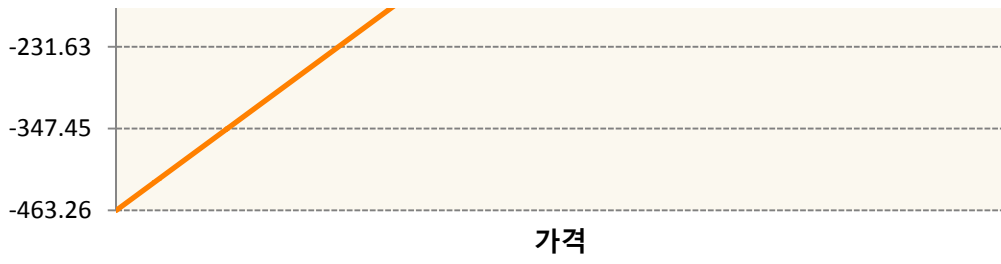
2. 만기시점의 손익구조

BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20

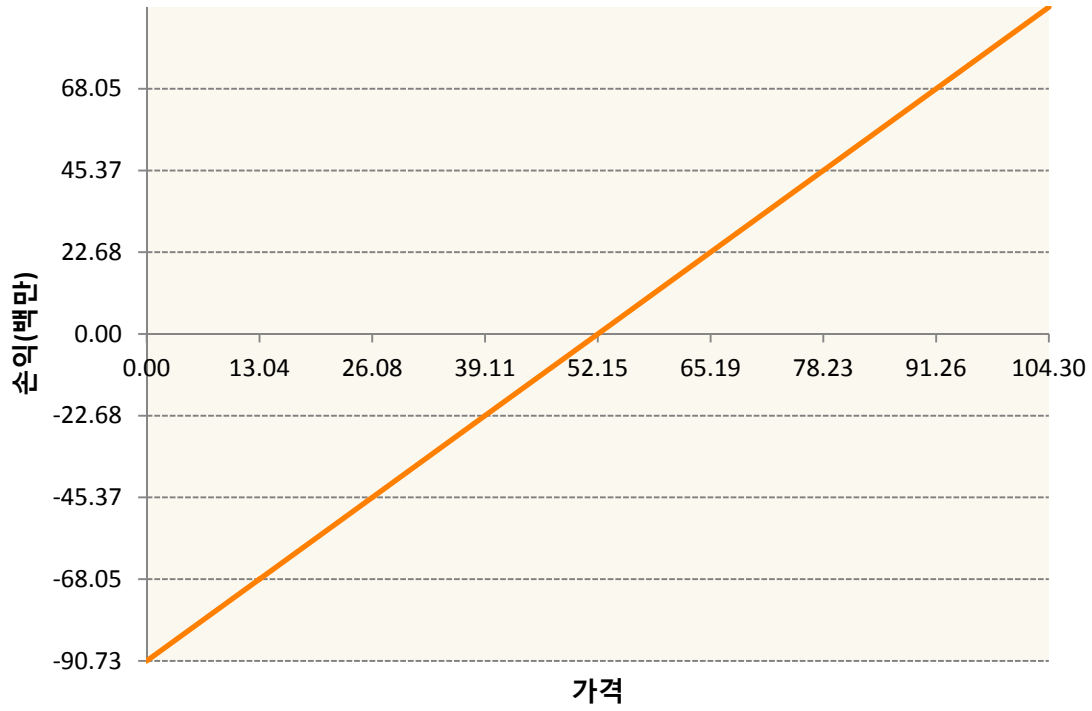


CK0-CORN FUTURE May20

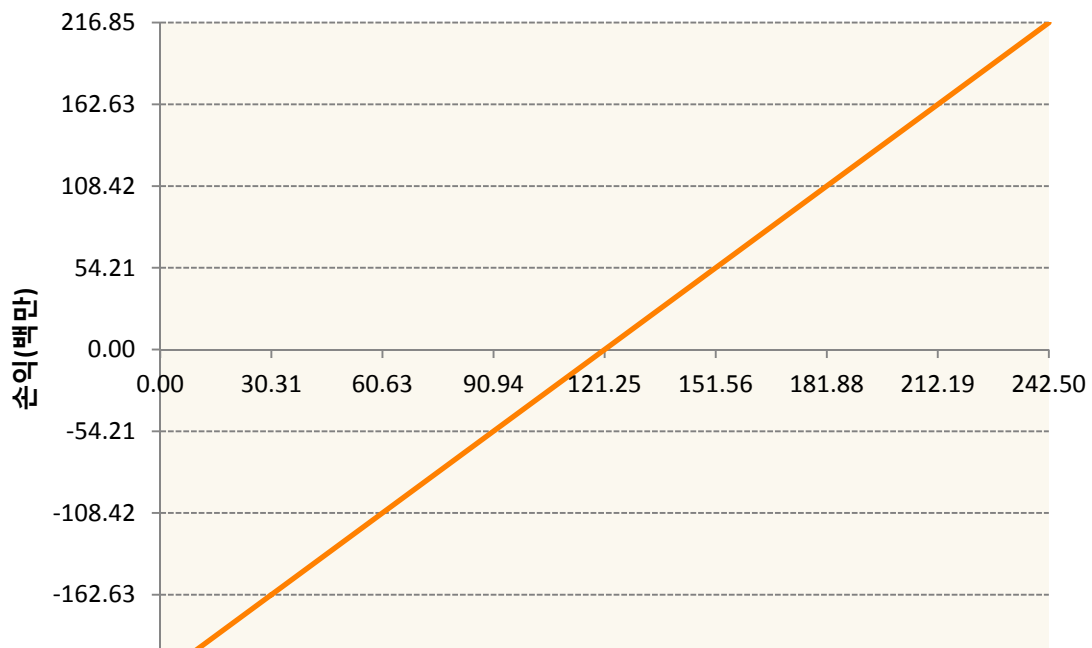


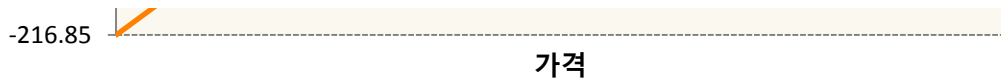


CTK0-COTTON NO.2 FUTR May20

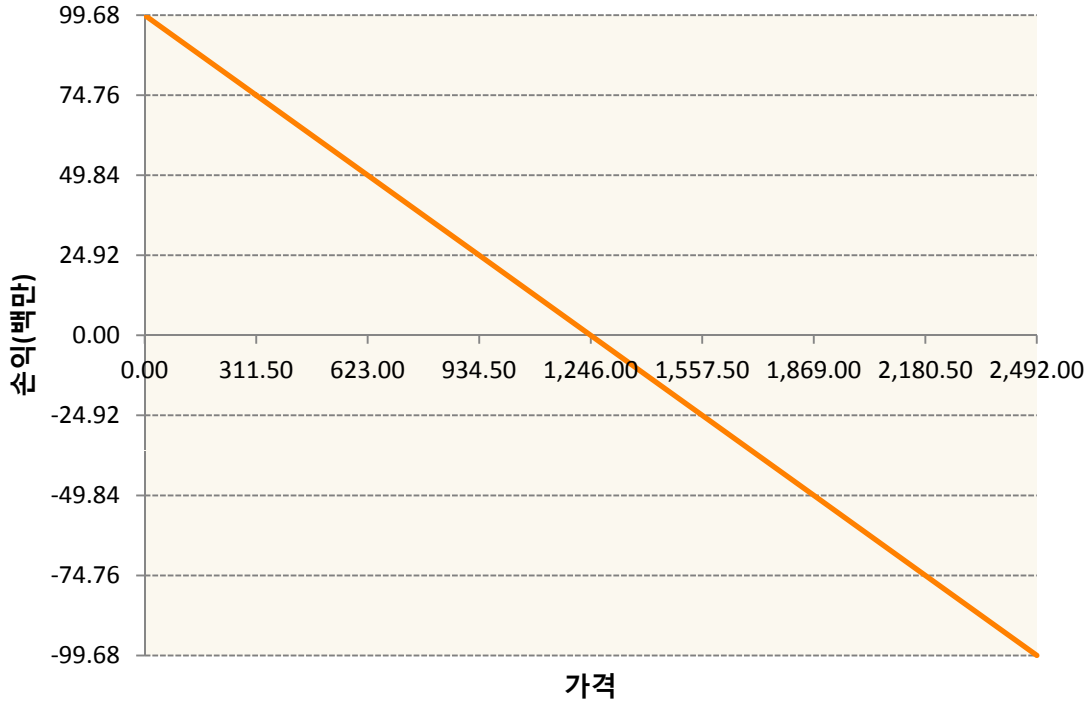


KCK0-COFFEE 'C' FUTURE May20

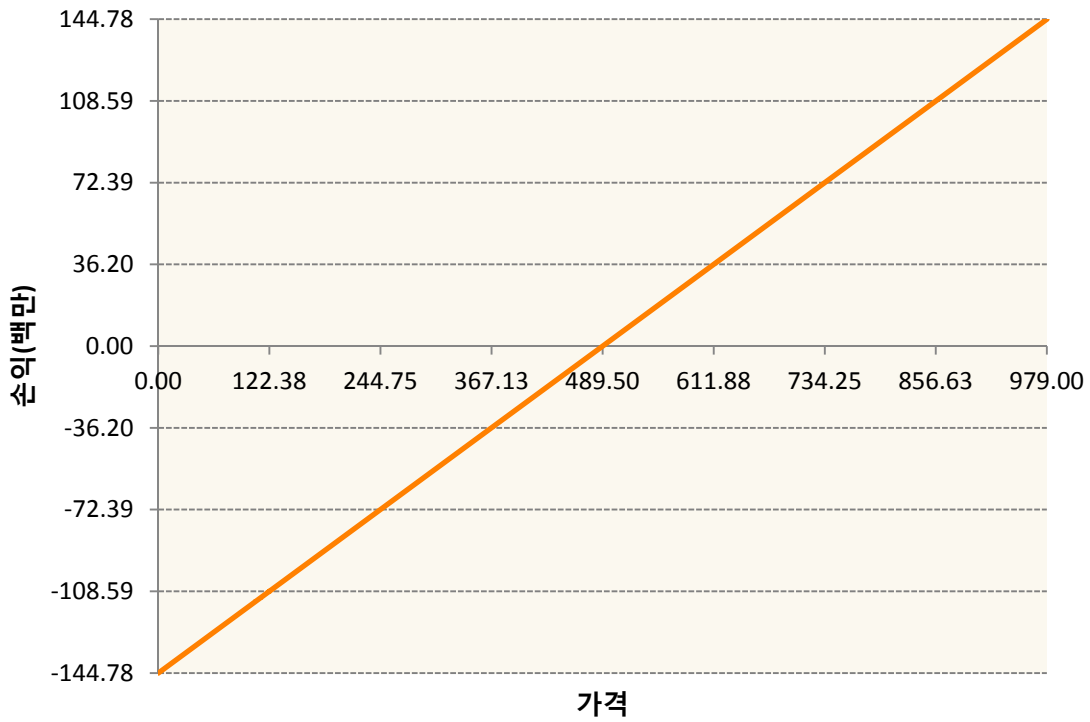




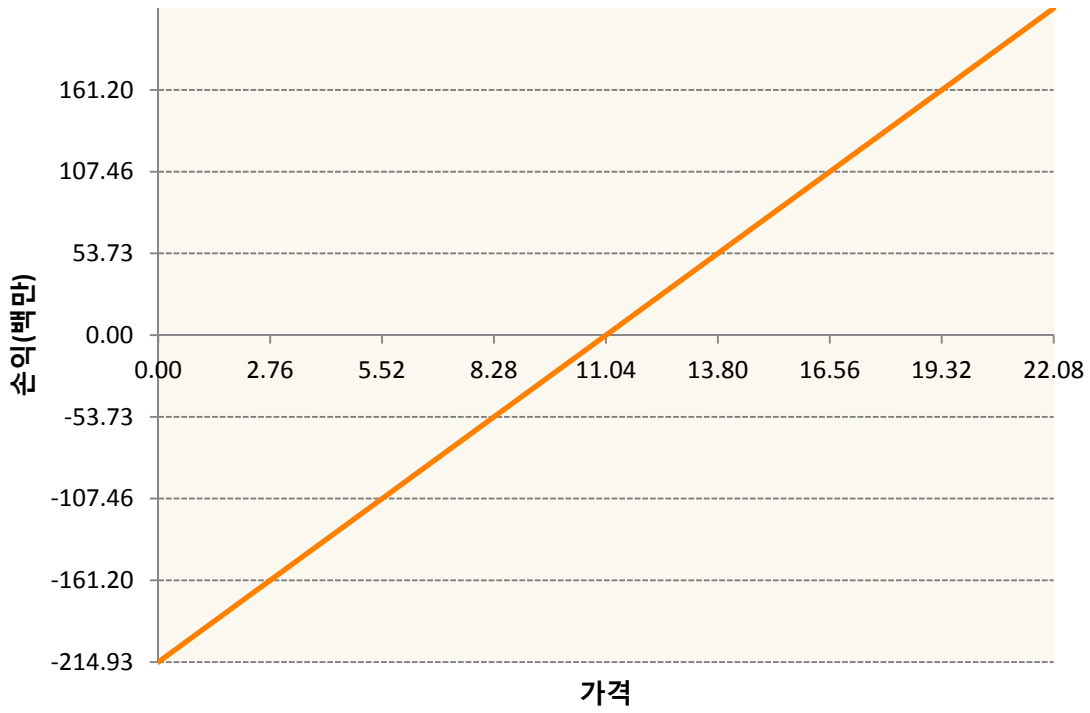
KR4175Q40008-2020-04 달러선물



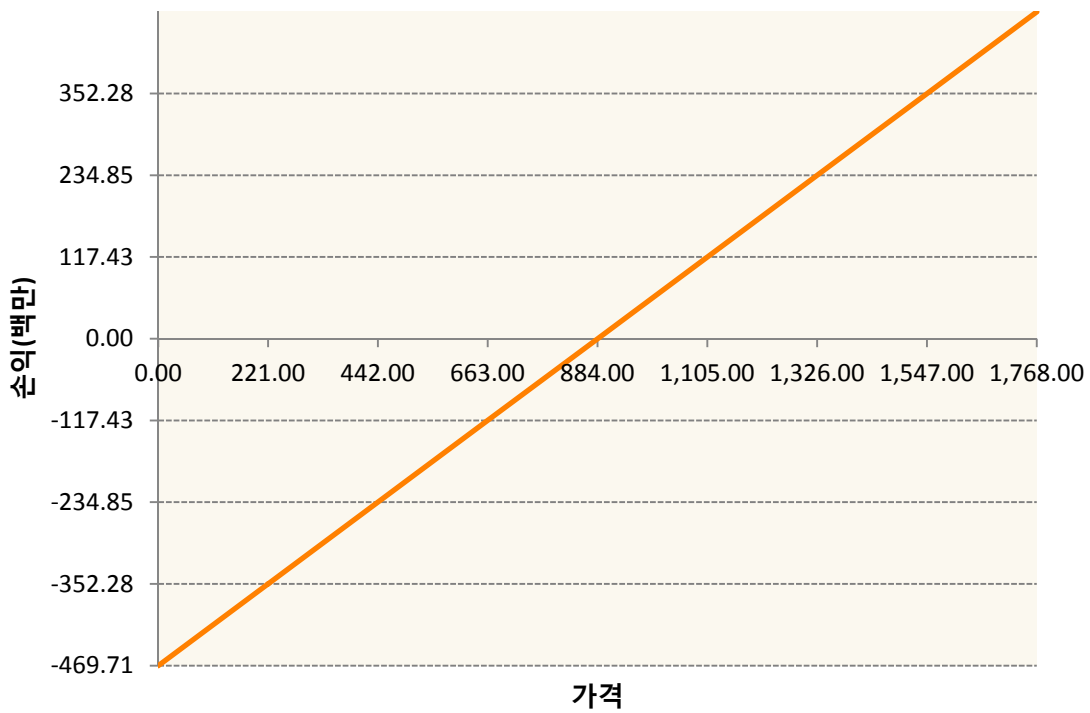
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



SBK0-Sugar May20

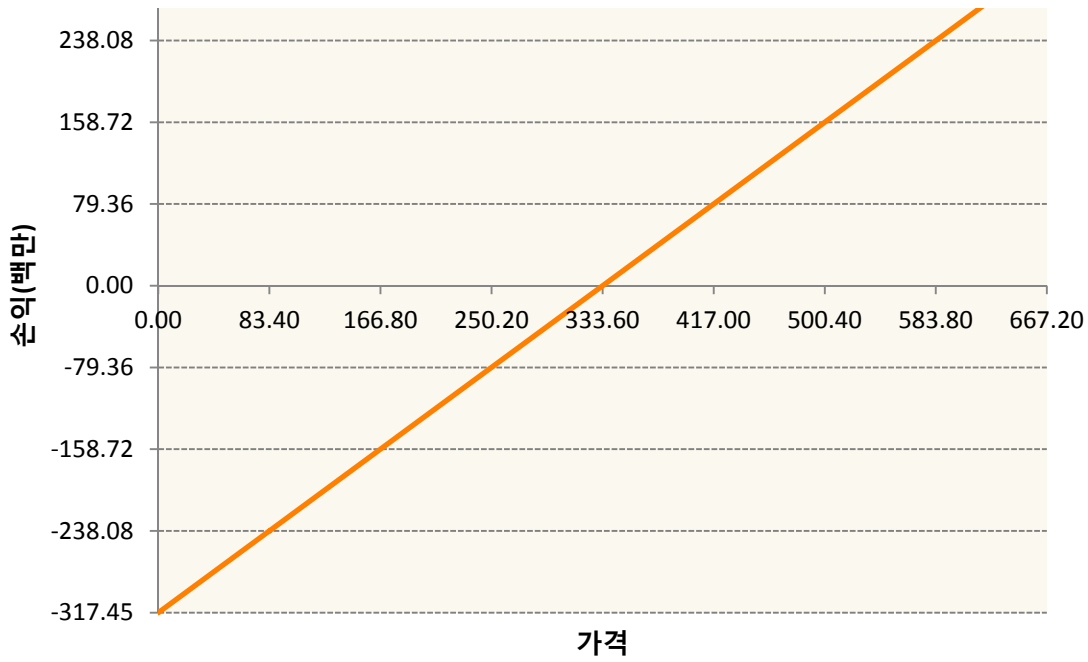


SK0-SOYBEAN FUTURE May20

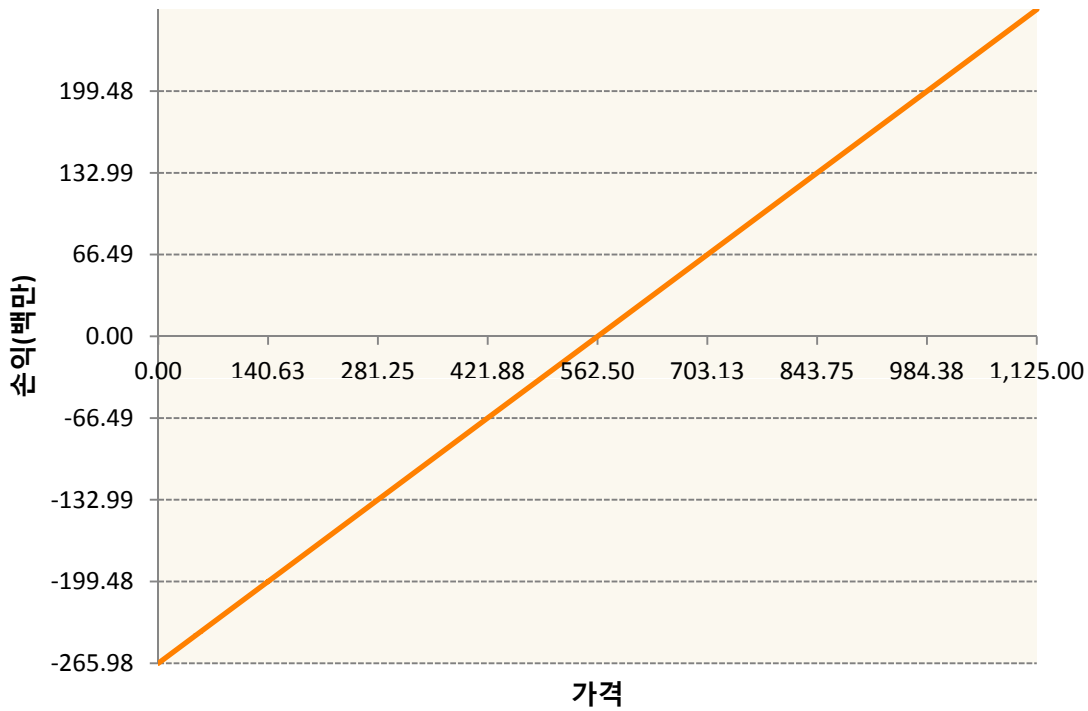


SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





WK0-WHEAT FUTURE(CBT) May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	15
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	12
SBK0	Sugar May20	17
SK0	SOYBEAN FUTURE May20	38
SMK0	SOYBEAN MEAL FUTR May20	25
WK0	WHEAT FUTURE(CBT) May20	21

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

(단위:백만원)

219