

공시일	2020-03-26
기준일	2020-03-25

## 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	2020-03-26
기준일	2020-03-25

## 스마트인덱스모

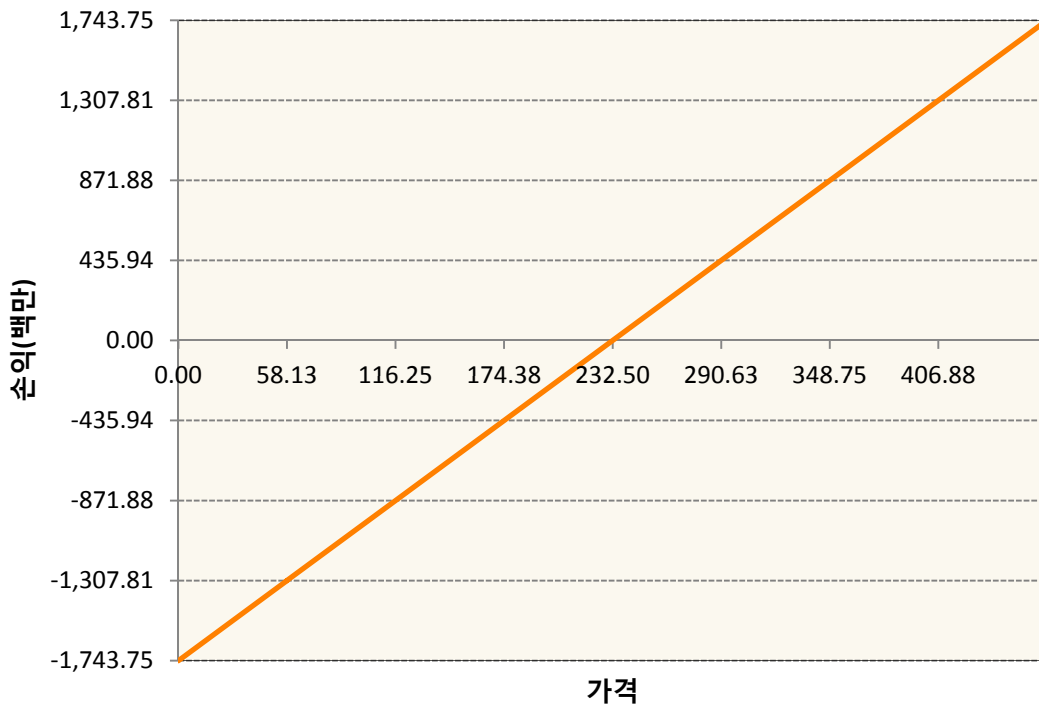
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

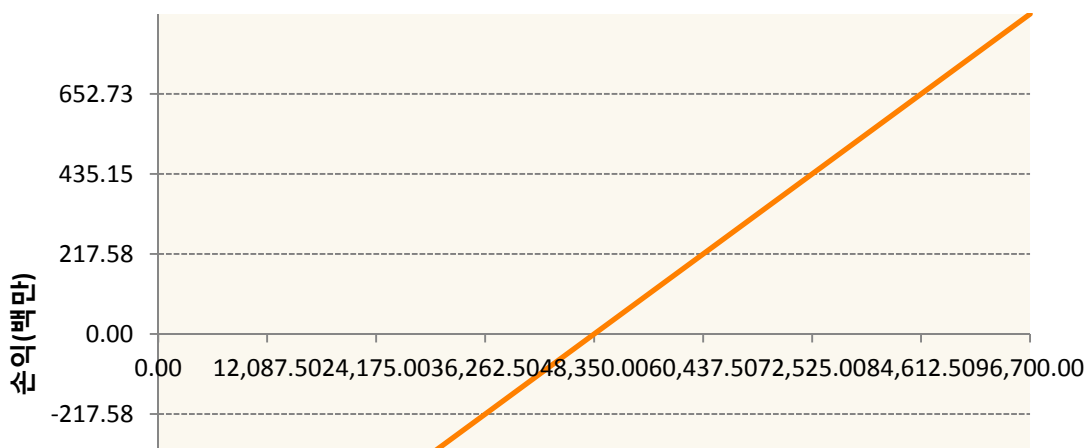
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	113	-113	장내
누계	유가증권	선물	2,614	0	2,614	장내

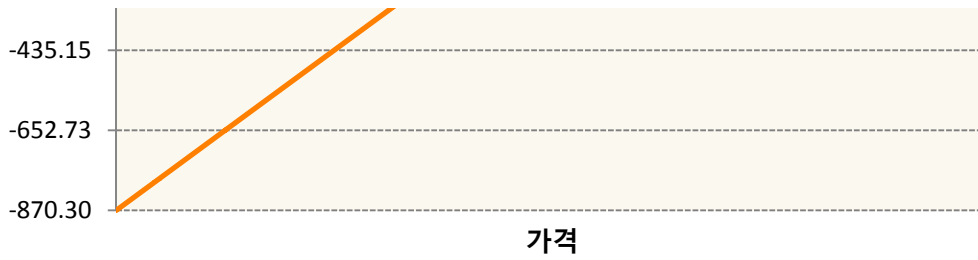
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



KR4111Q40003-2020-04 삼성전자개별선물





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

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						140
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-140	-140	-140	-140	-140	-140	-140	
-5.33%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93	
-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%	93	93	93	93	93	93	93	
8.00%	140	140	140	140	140	140	140	
KR4111Q40003		2020-04 삼성전자개별선물						70
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70	
-5.33%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47	
-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%	47	47	47	47	47	47	47	
8.00%	70	70	70	70	70	70	70	

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

**296**

공시일	2020-03-26
기준일	2020-03-25

## 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

836

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

902

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-26
기준일	2020-03-25

## 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

539
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

857
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-26
기준일	2020-03-25

## 유로인덱스모(주식-파생형)

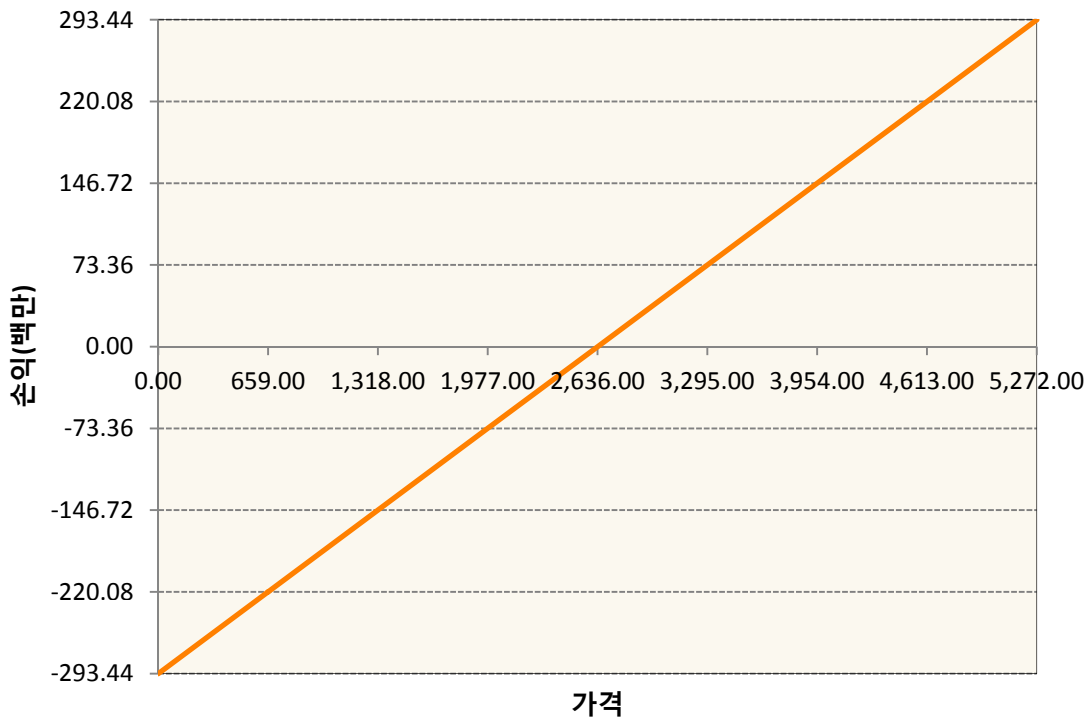
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	293	0	293	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	23
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

27
----

공시일	2020-03-26
기준일	2020-03-25

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

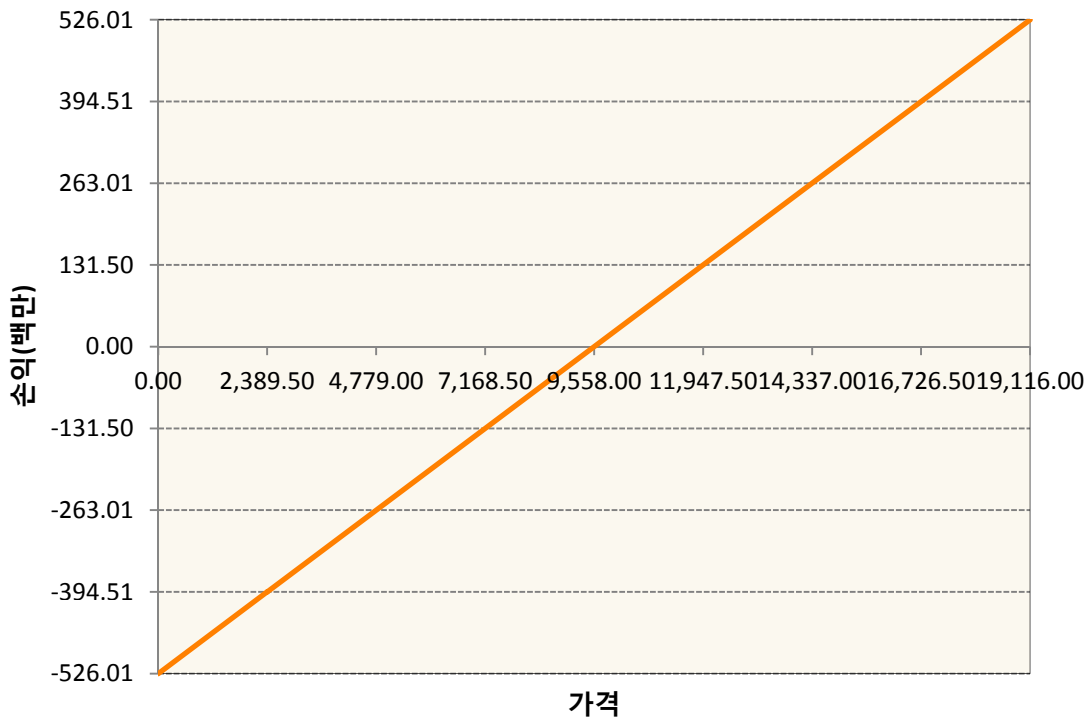
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	526	0	526	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH0	HSCEI Futures Mar20	42
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

45
----

공시일	2020-03-26
기준일	2020-03-25

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

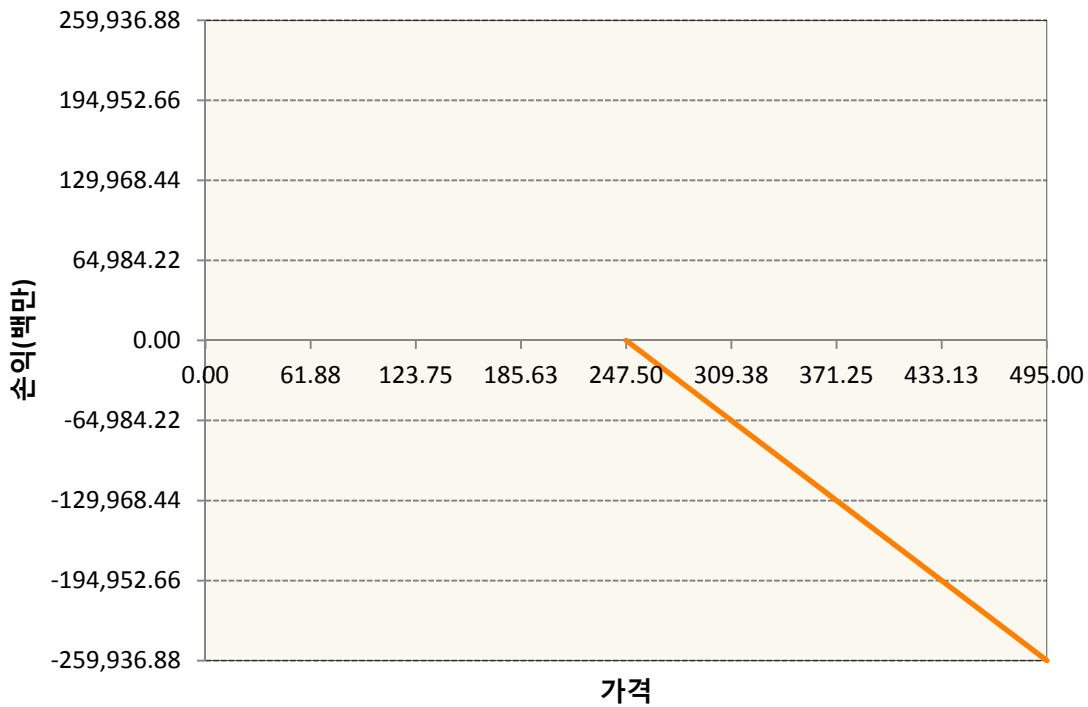
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

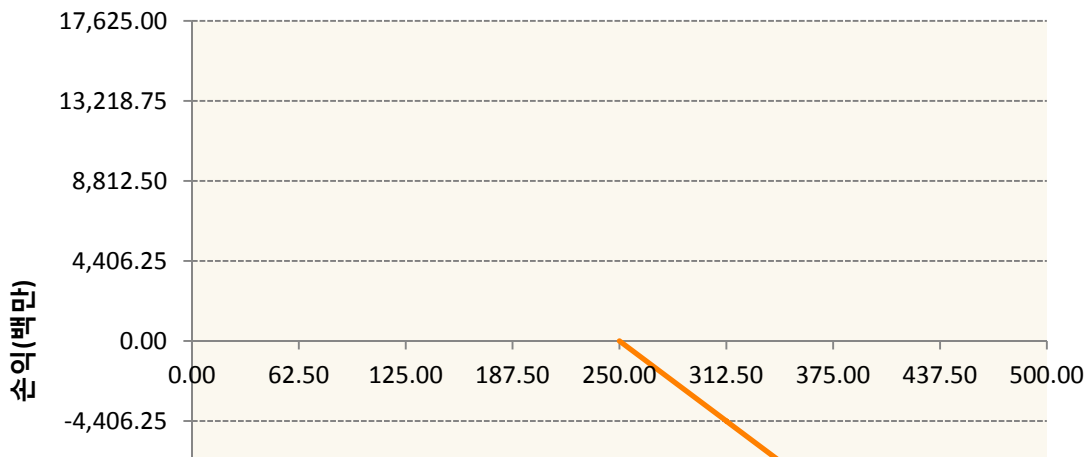
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	3,240	-3,240	장내
누계	유가증권	옵션	0	370,251	-370,251	장내

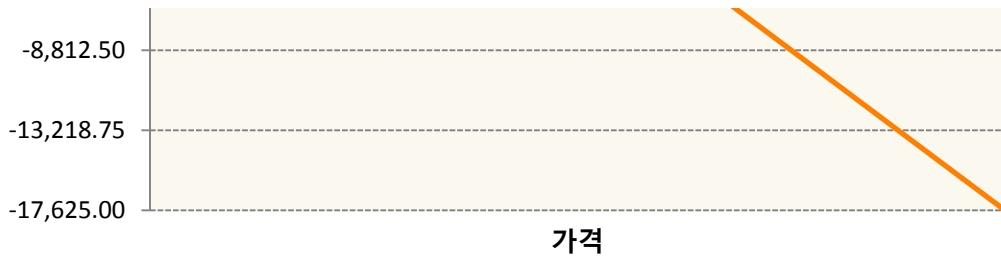
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

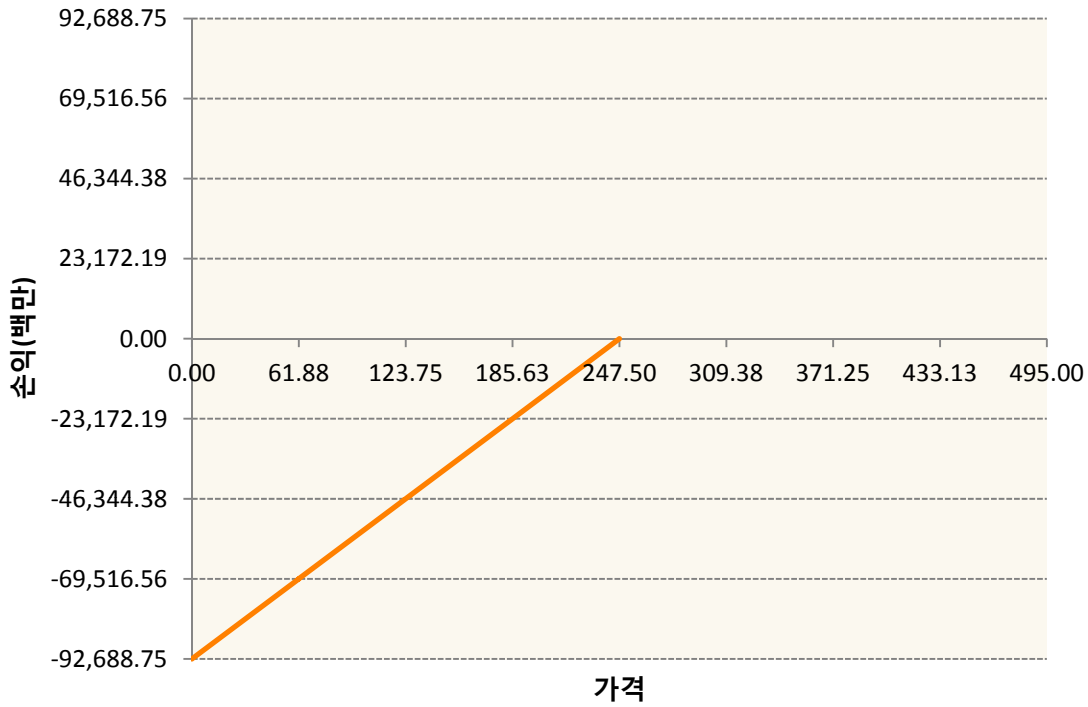


KR4201Q42503-2020-04 콜250





KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q42479		2020-04 콜247.5					11,969	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5,478	5,163	4,776	4,326	3,818	3,261	2,662	
-5.33%	4,931	4,454	3,909	3,307	2,658	1,969	1,245	
-2.67%	4,007	3,349	2,639	1,887	1,101	287	-549	
0%	2,576	1,746	885	0	-904	-1,823	-2,755	
2.67%	526	-439	-1,416	-2,401	-3,393	-4,390	-5,391	
5.33%	-2,218	-3,258	-4,299	-5,340	-6,381	-7,423	-8,464	
8.00%	-5,677	-6,722	-7,769	-8,818	-9,867	-10,918	-11,969	
KR4201Q42503		2020-04 콜250					764	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	328	310	287	260	229	194	156	

-5.33%	298	270	237	200	159	116	69
-2.67%	246	206	162	115	65	12	-42
0%	164	112	57	0	-59	-118	-179
2.67%	43	-20	-83	-148	-213	-279	-345
5.33%	-123	-192	-261	-331	-400	-470	-540
8.00%	-336	-407	-479	-550	-621	-693	-764
KR4301Q42477                      2020-04 풋247.5							6,059
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,210	-5,300	-5,412	-5,547	-5,701	-5,872	-6,059
-5.33%	-3,048	-3,192	-3,358	-3,545	-3,749	-3,967	-4,198
-2.67%	-1,015	-1,221	-1,446	-1,687	-1,940	-2,203	-2,475
0%	838	570	289	0	-296	-599	-905
2.67%	2,462	2,144	1,821	1,494	1,166	835	502
5.33%	3,825	3,479	3,132	2,785	2,438	2,091	1,744
8.00%	4,916	4,568	4,219	3,870	3,521	3,171	2,820

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

(단위:백만원)

**14,961**

공시일	2020-03-26
기준일	2020-03-25

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

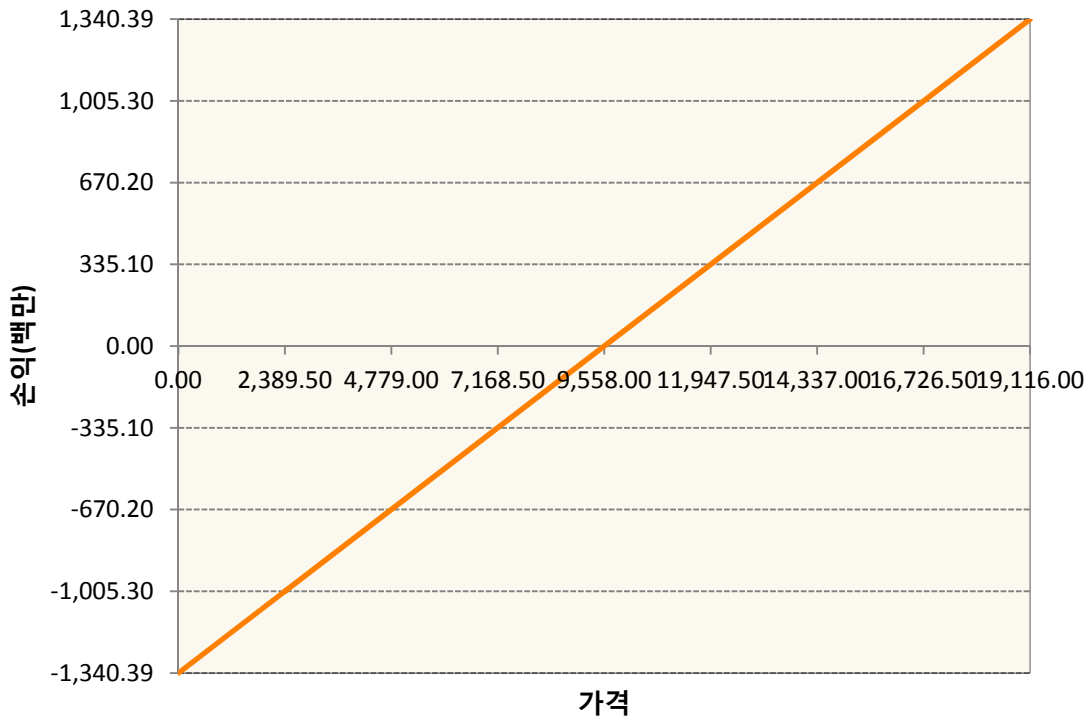
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

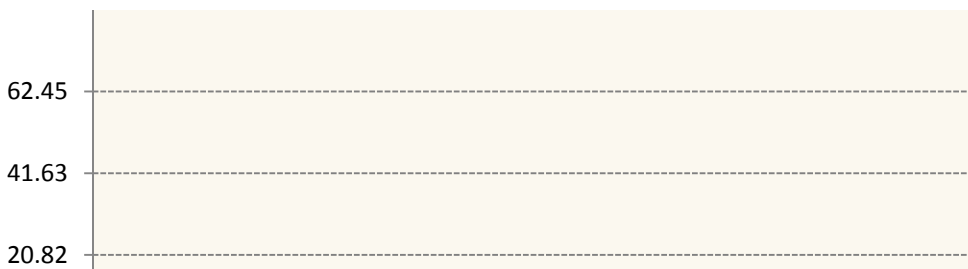
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,340	0	1,340	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,538	-4,538	장내
누계	통화	선도	698	2,233	-1,535	장외

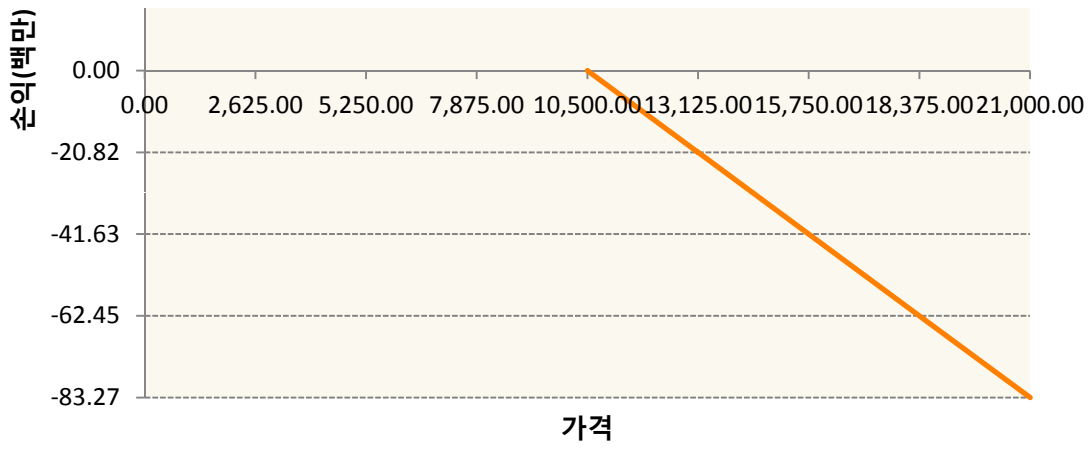
### 2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20

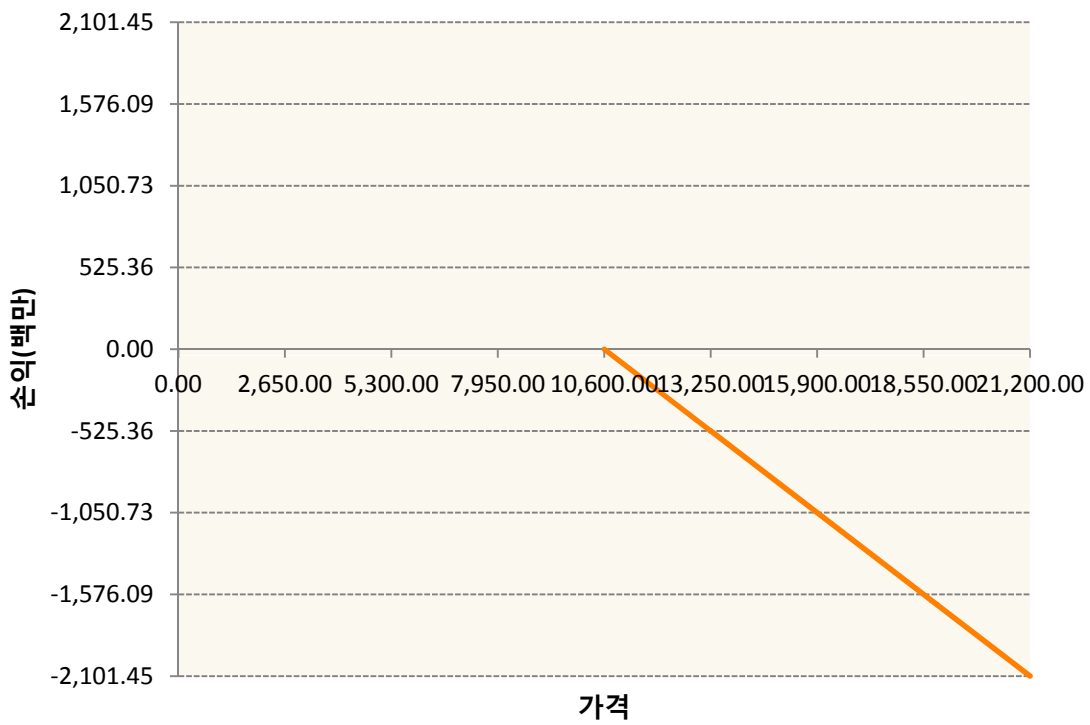


OHHIH0-C105-HSCEI

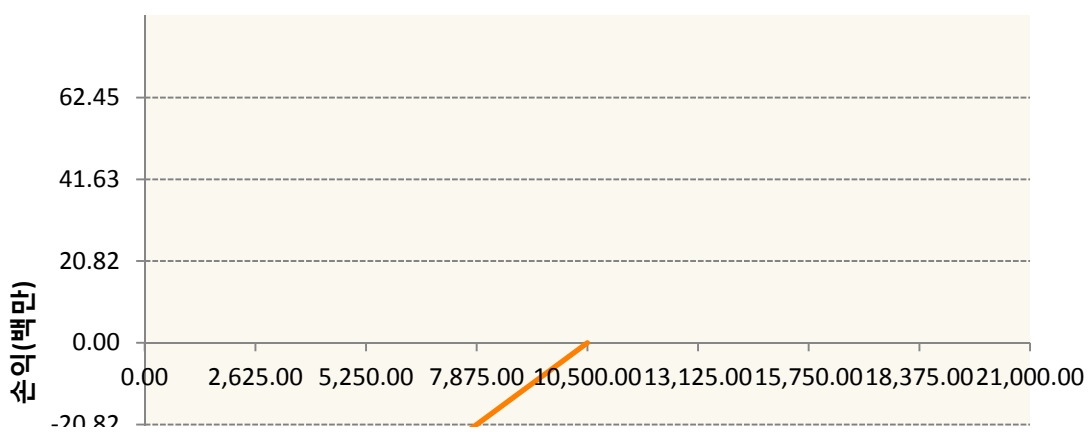


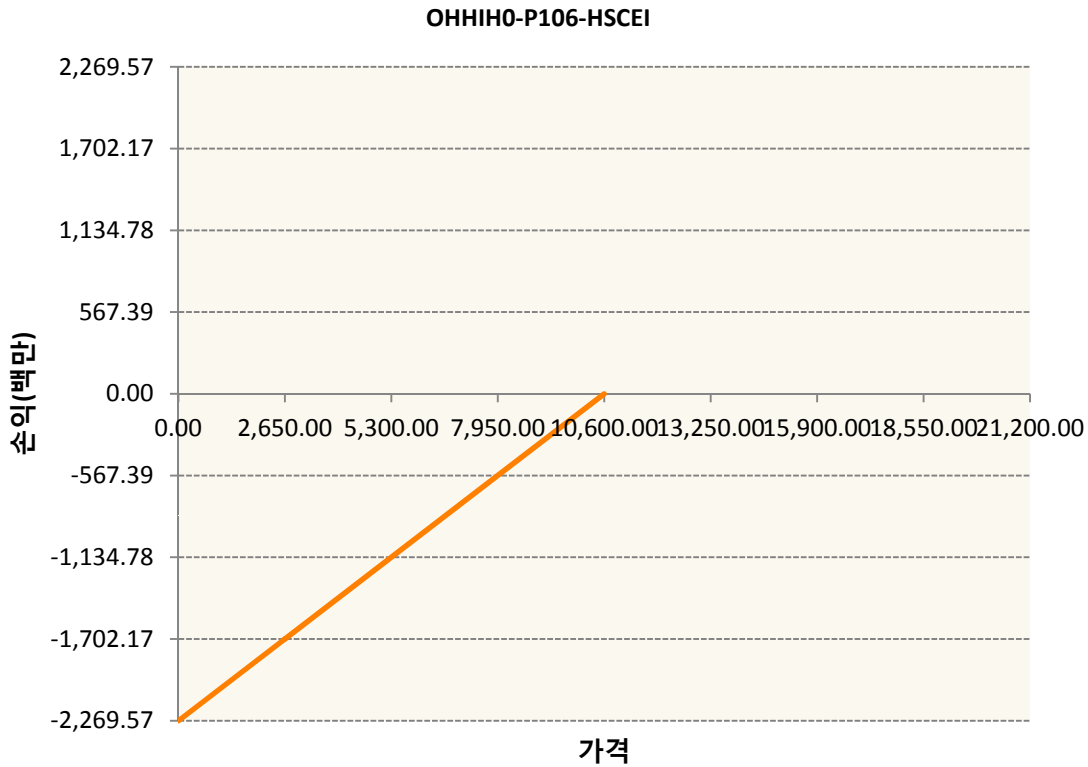
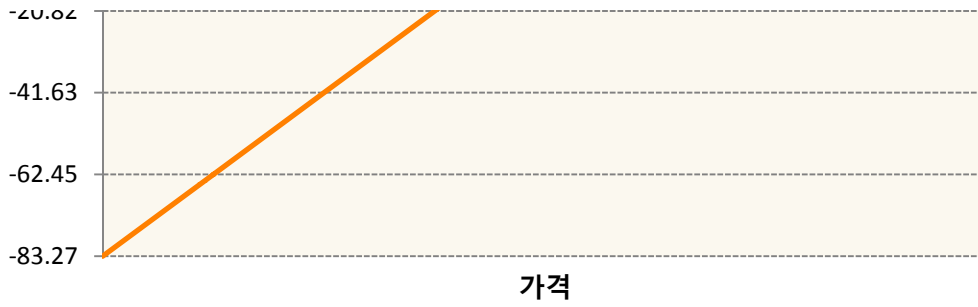


OHHIH0-C106-HSCEI



OHHIH0-P105-HSCEI





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

FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E	179
FX21020H05 HKD/KRW 22-05-20E	56
HCH0 HSCEI Futures Mar20	107
OHHIH0-C1(HSCEI	7
OHHIH0-C1(HSCEI	168
OHHIH0-P1(HSCEI	7
OHHIH0-P1(HSCEI	182

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

**606**

공시일	2020-03-26
기준일	2020-03-25

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

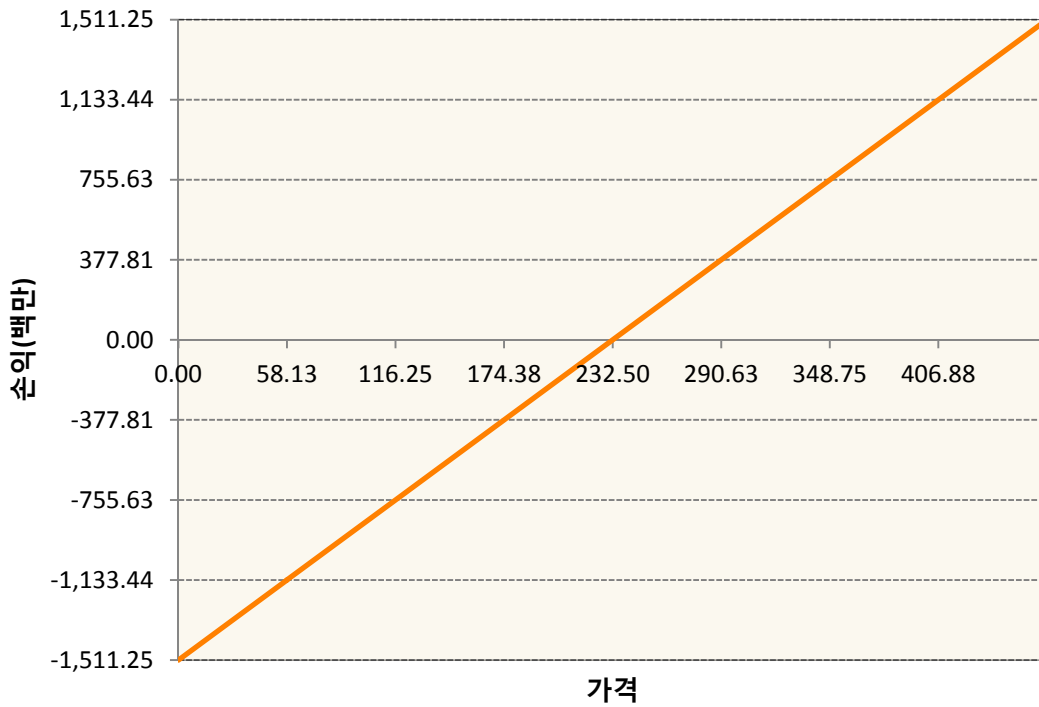
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

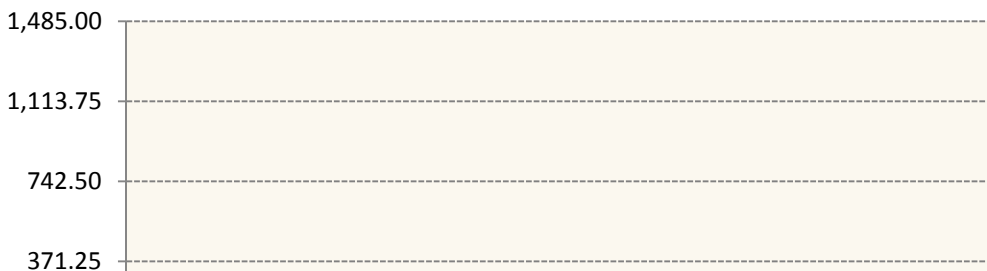
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,511	0	1,511	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,095	-3,095	장내

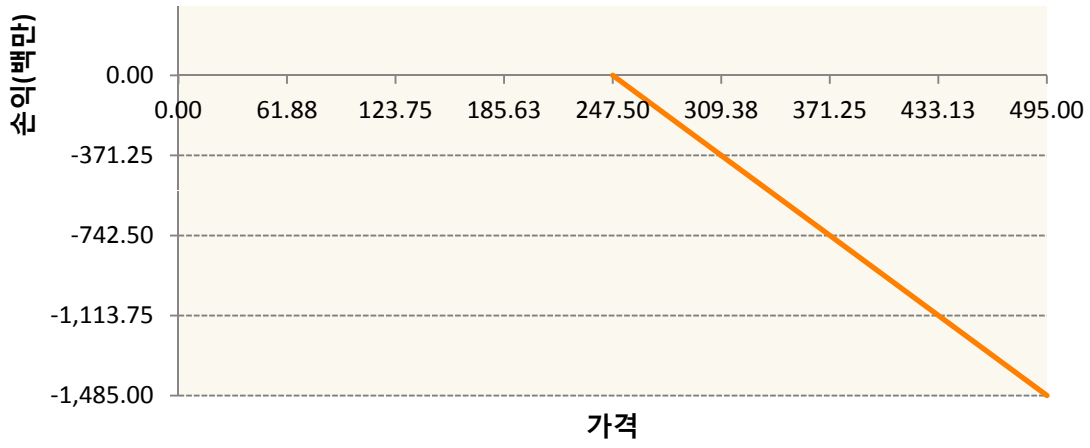
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

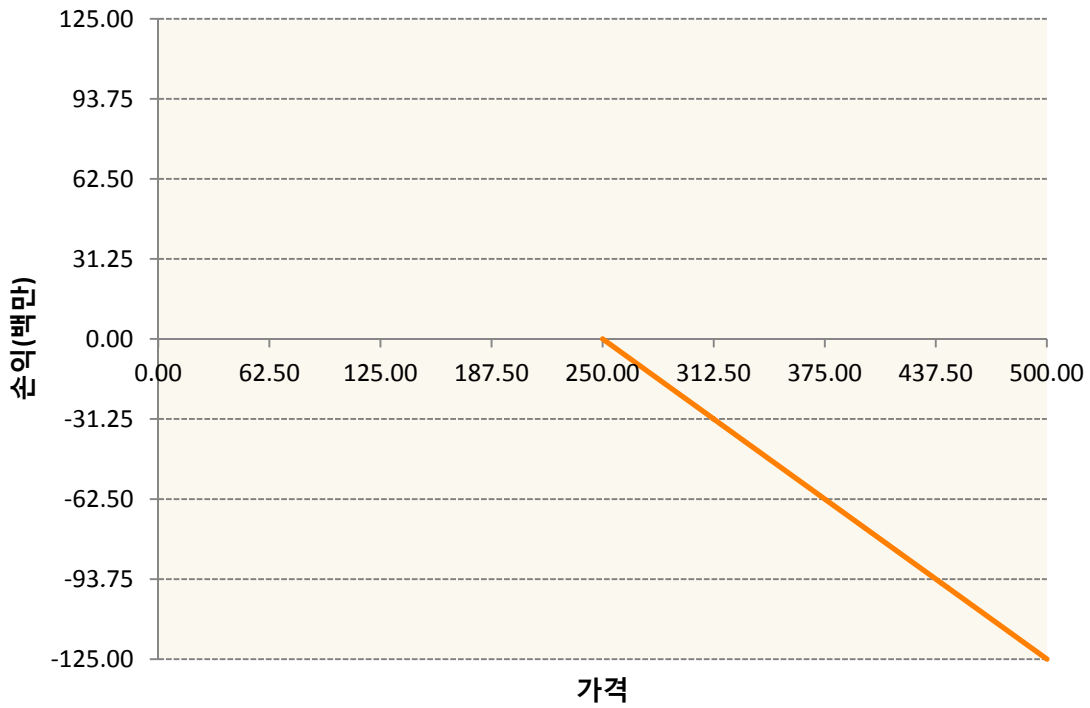


KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

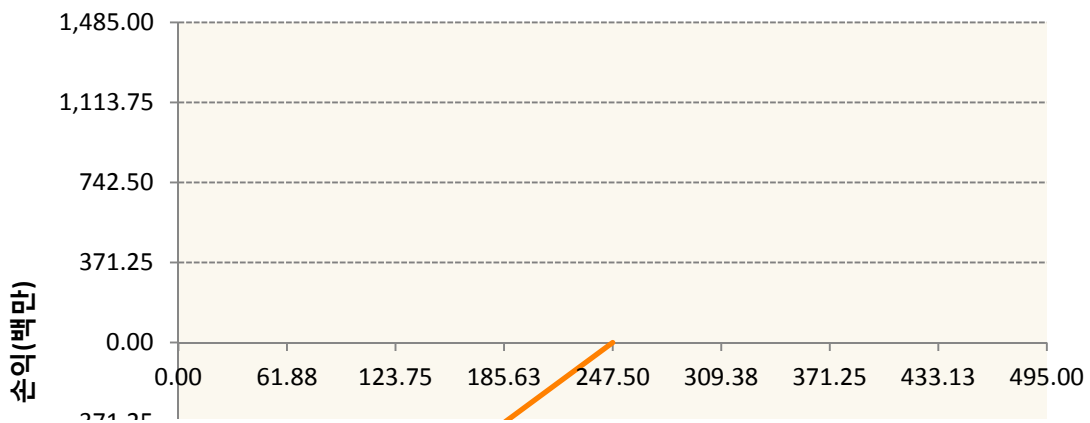




**KR4201Q42503-2020-04 콜250**



**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						121
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-121	-121	-121	-121	-121	-121	-121	
-5.33%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81	
-2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	40	40	40	40	40	40	40	
5.33%	81	81	81	81	81	81	81	
8.00%	121	121	121	121	121	121	121	
KR4201Q42479		2020-04 콜247.5						68
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	31	29	27	25	22	19	15	
-5.33%	28	25	22	19	15	11	7	
-2.67%	23	19	15	11	6	2	-3	
0%	15	10	5	0	-5	-10	-16	
2.67%	3	-3	-8	-14	-19	-25	-31	
5.33%	-13	-19	-25	-31	-36	-42	-48	
8.00%	-32	-38	-44	-50	-56	-62	-68	
KR4201Q42503		2020-04 콜250						5
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	2	2	2	2	2	1	1
-5.33%	2	2	2	1	1	1	0
-2.67%	2	1	1	1	0	0	0
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	0	0	-1	-1	-2	-2	-2
5.33%	-1	-1	-2	-2	-3	-3	-4
8.00%	-2	-3	-3	-4	-4	-5	-5

KR4301Q42477                      2020-04 풋247.5                      97

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-83	-85	-87	-89	-91	-94	-97
-5.33%	-49	-51	-54	-57	-60	-64	-67
-2.67%	-16	-20	-23	-27	-31	-35	-40
0%	13	9	5	0	-5	-10	-15
2.67%	39	34	29	24	19	13	8
5.33%	61	56	50	45	39	33	28
8.00%	79	73	68	62	56	51	45

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

(단위:백만원)

**498**

공시일	2020-03-26
기준일	2020-03-25

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

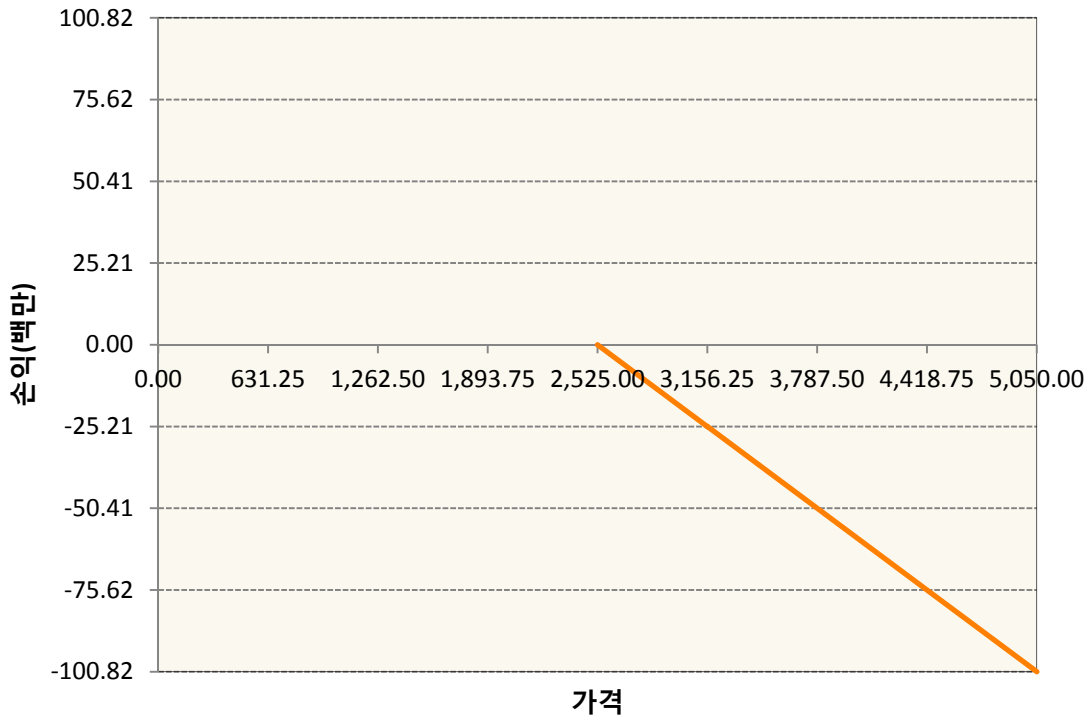
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

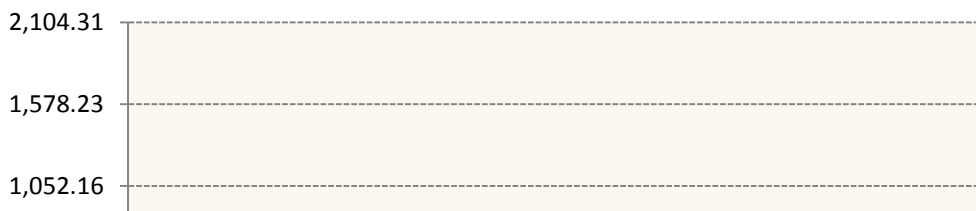
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	252	0	252	
누계	유가증권	스왑	7,560	0	7,560	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,410	-4,410	장내
누계	통화	선도	532	6,186	-5,654	장외

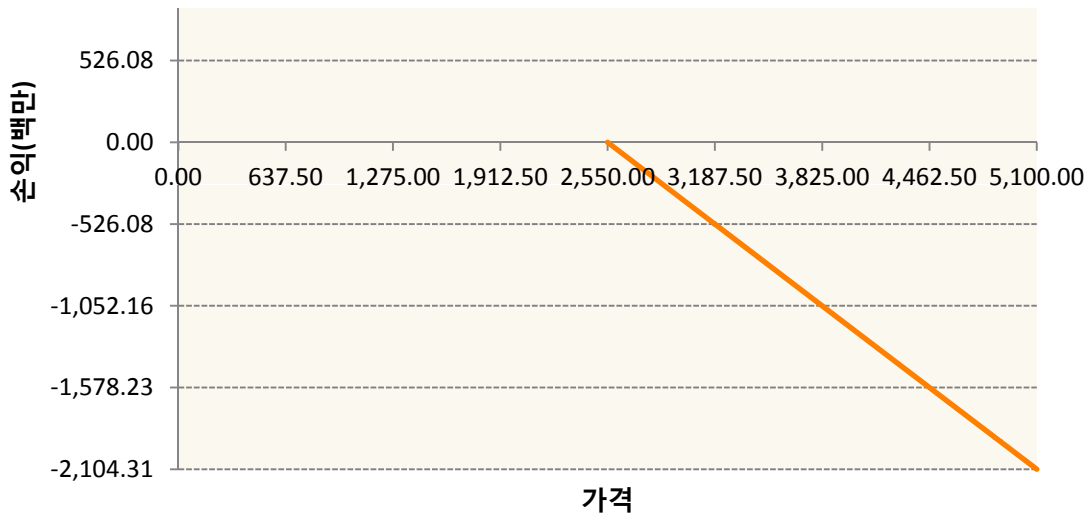
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXJ0-C2525-EURO STOXX 50

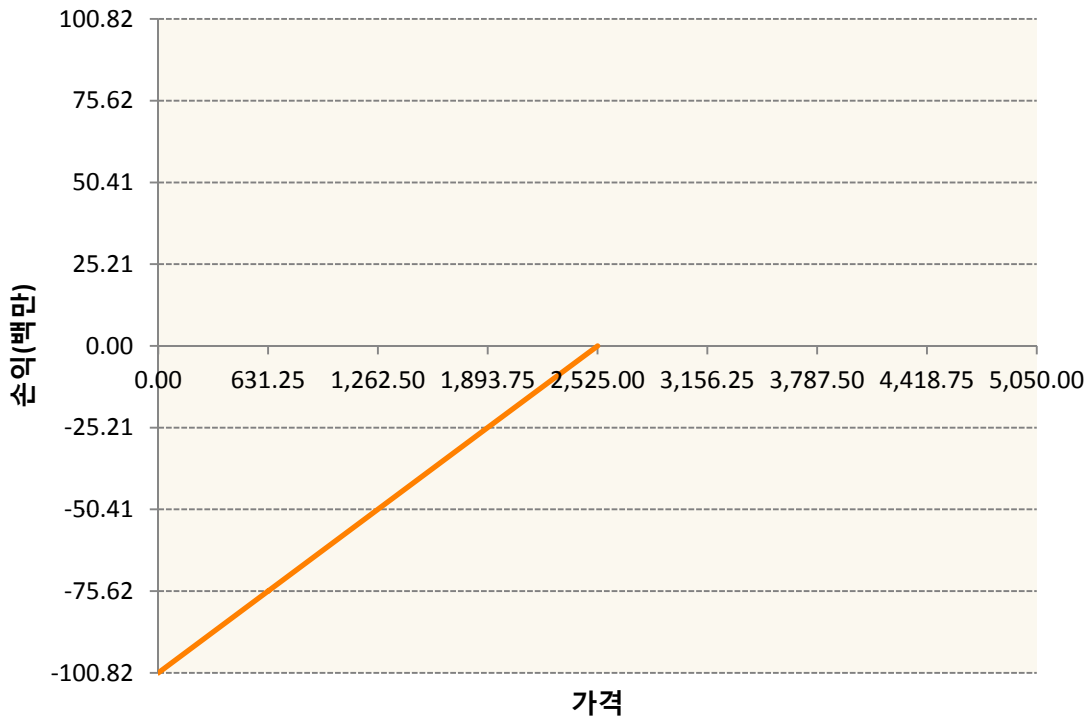


OESXJ0-C2550-EURO STOXX 50

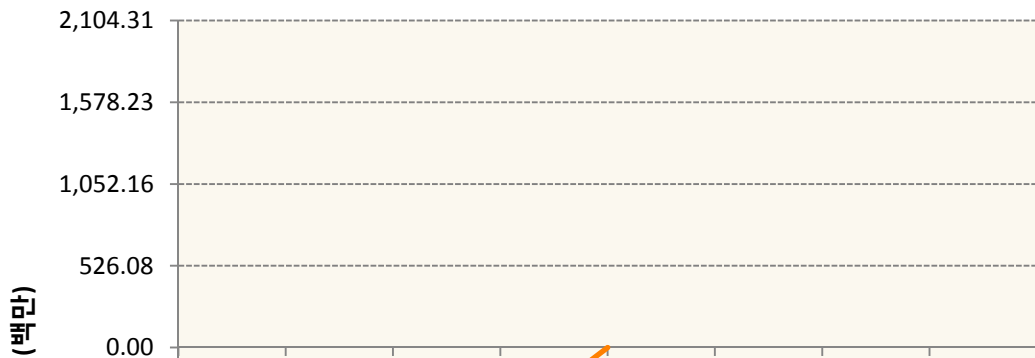


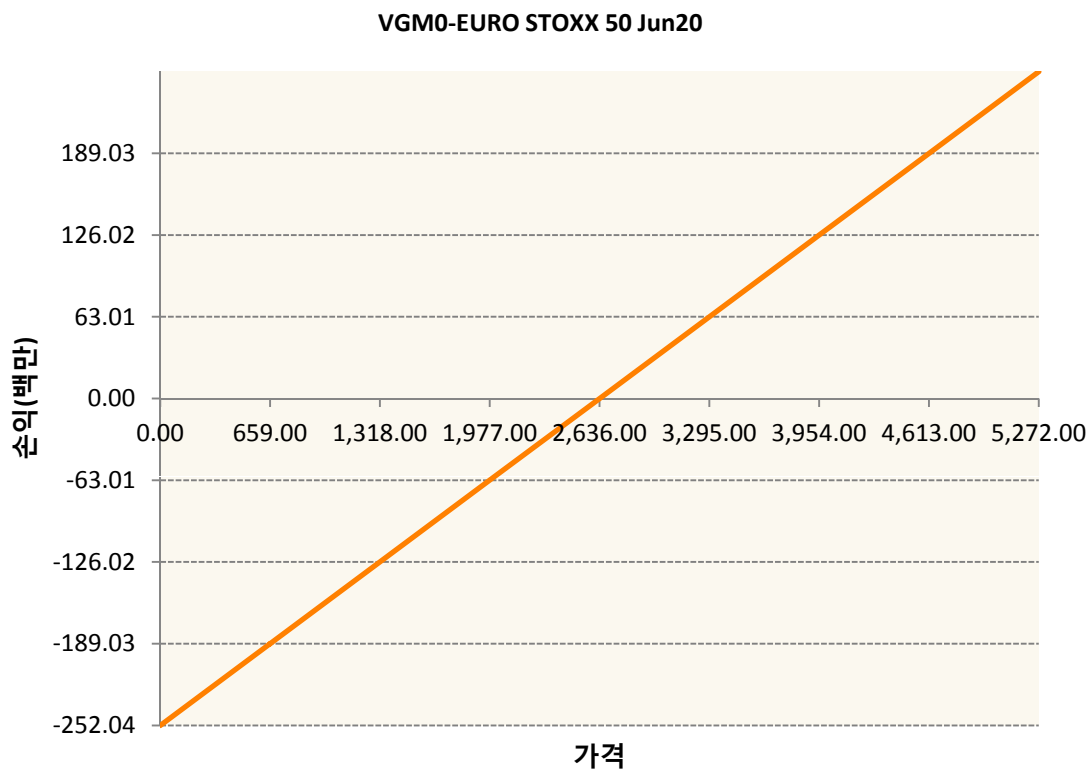
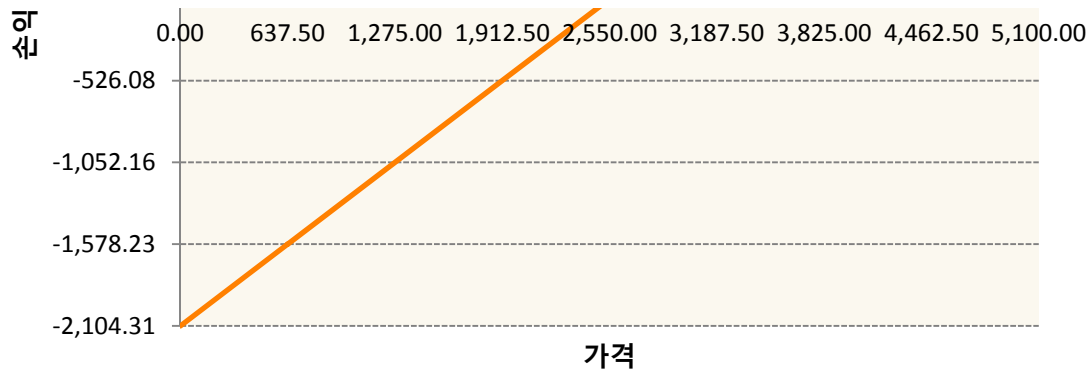


OESXJ0-P2525-EURO STOXX 50



OESXJ0-P2550-EURO STOXX 50





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	7
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	279
FX21020H00 EUR/KRW 27-03-20E	43
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E	216
OESXJ0-C25: EURO STOXX 50	8
OESXJ0-C25: EURO STOXX 50	168
OESXJ0-P25: EURO STOXX 50	8
OESXJ0-P25: EURO STOXX 50	168
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20	20

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

(단위:백만원)

735



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

(단위:백만원)

975

공시일	2020-03-26
기준일	2020-03-25

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

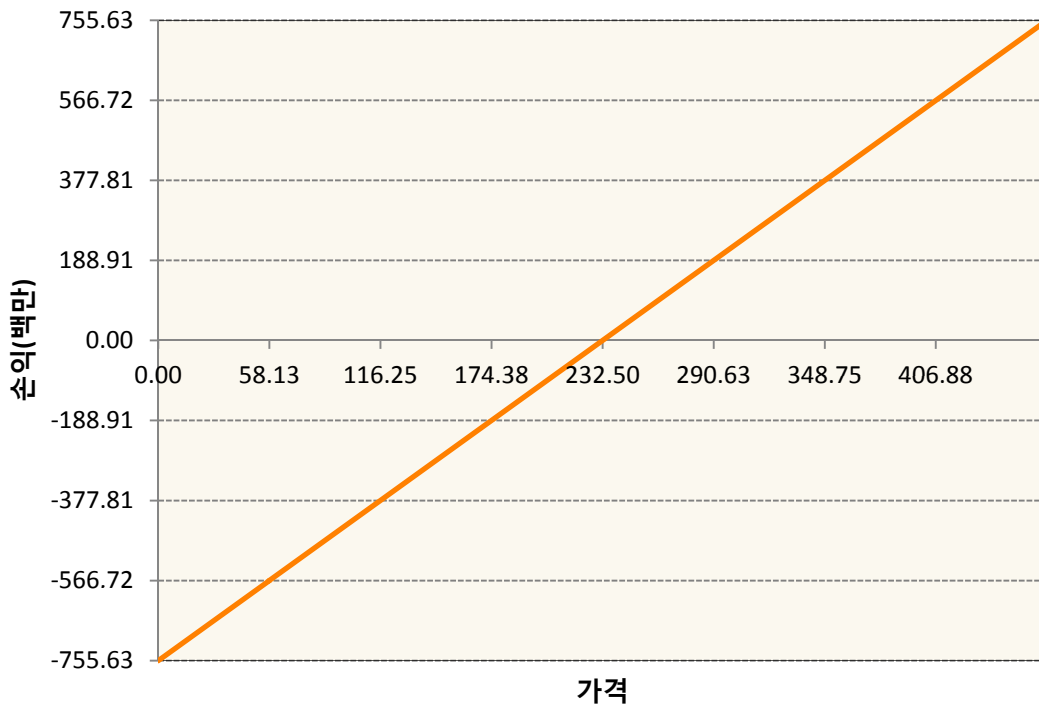
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	756	0	756	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						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%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40	
-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%	40	40	40	40	40	40	40	
8.00%	61	61	61	61	61	61	61	

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

(단위:백만원)

84

공시일	2020-03-26
기준일	2020-03-25

## ETF스마트레버리지목표전환형10호

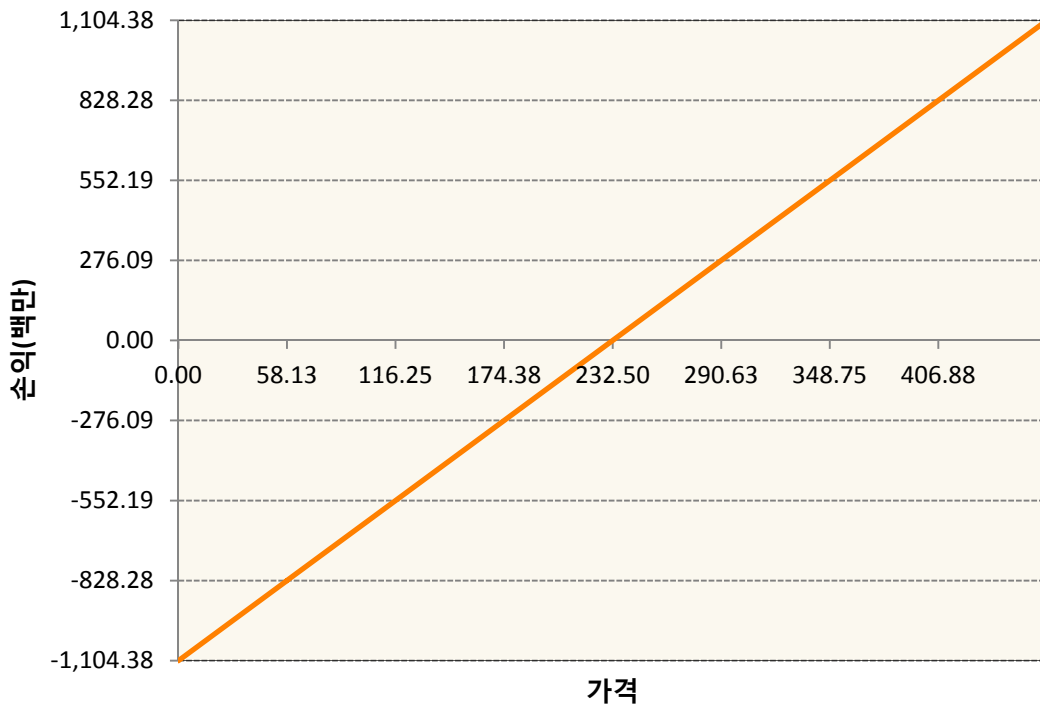
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,104	0	1,104	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						88
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88	
-5.33%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59	
-2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	29	29	29	29	29	29	29	
5.33%	59	59	59	59	59	59	59	
8.00%	88	88	88	88	88	88	88	

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

(단위:백만원)

123

공시일	2020-03-26
기준일	2020-03-25

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

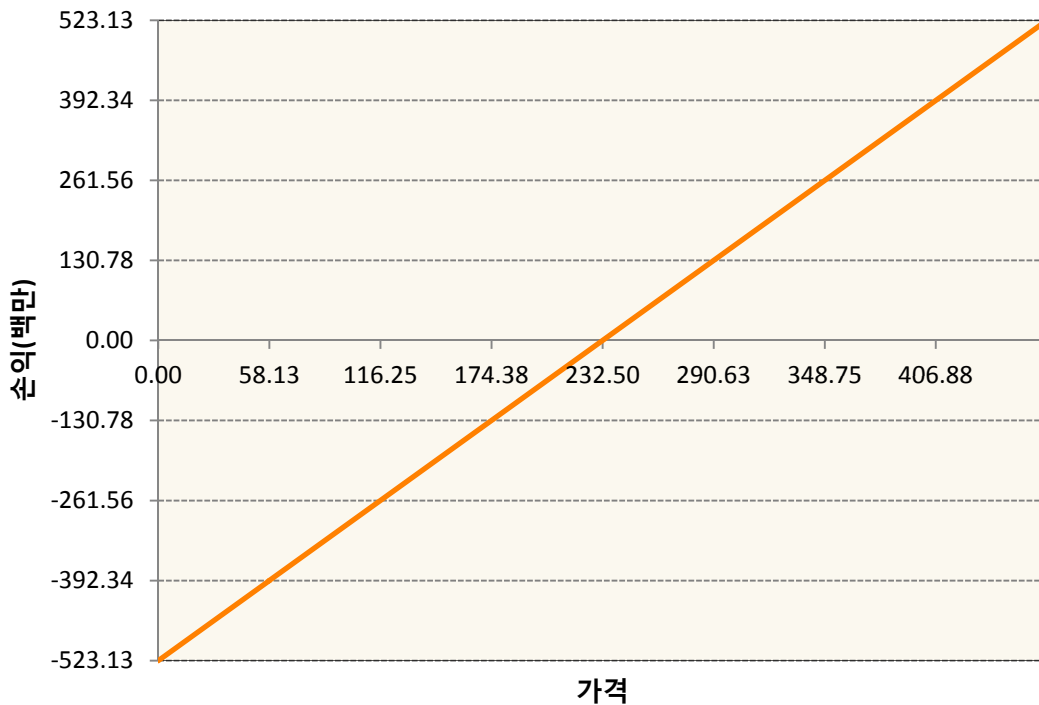
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	523	0	523	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						42
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42	
-5.33%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28	
-2.67%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	14	14	14	14	14	14	14	
5.33%	28	28	28	28	28	28	28	
8.00%	42	42	42	42	42	42	42	

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

(단위:백만원)

58

공시일	2020-03-26
기준일	2020-03-25

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

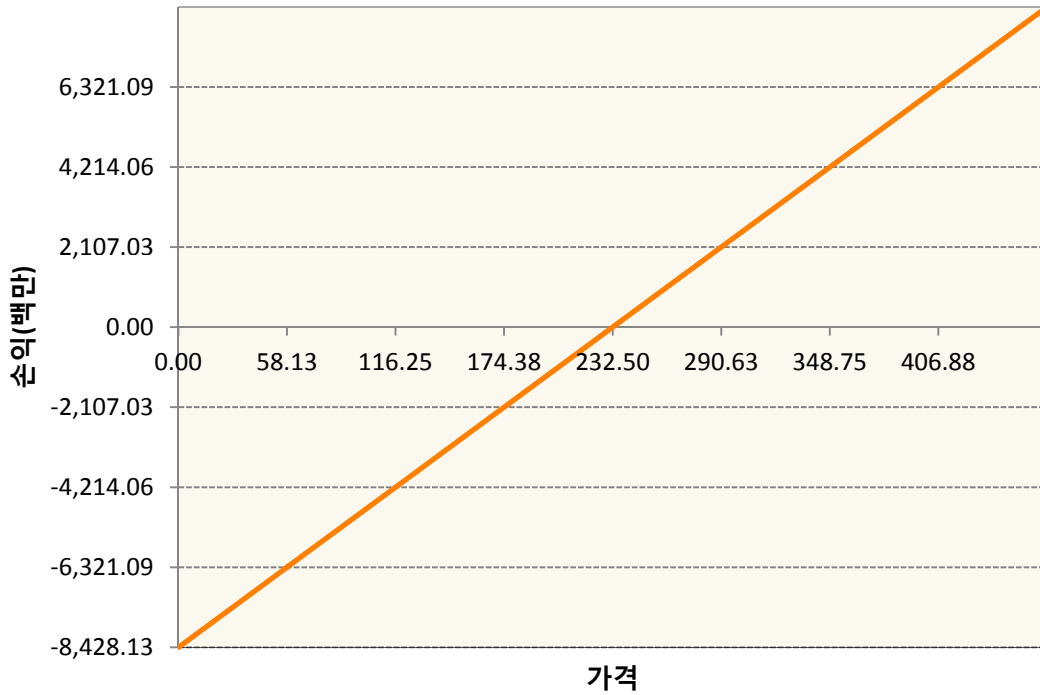
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

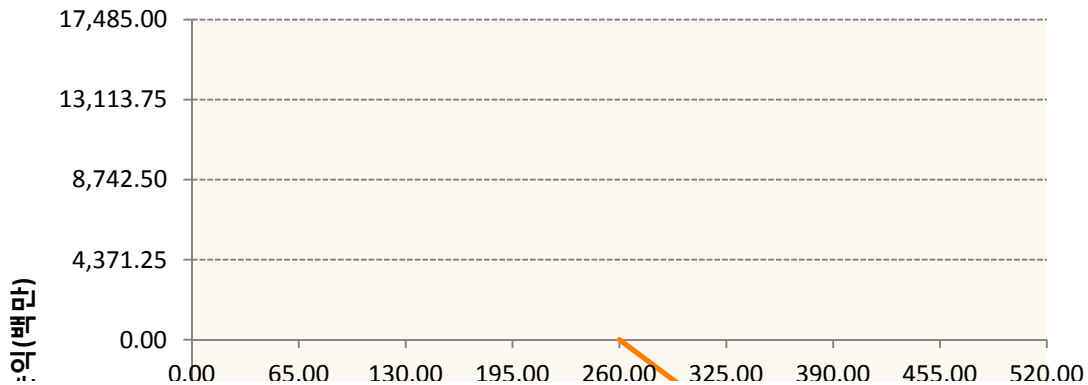
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,428	0	8,428	장내
누계	유가증권	옵션	6,004	17,485	-11,481	장내

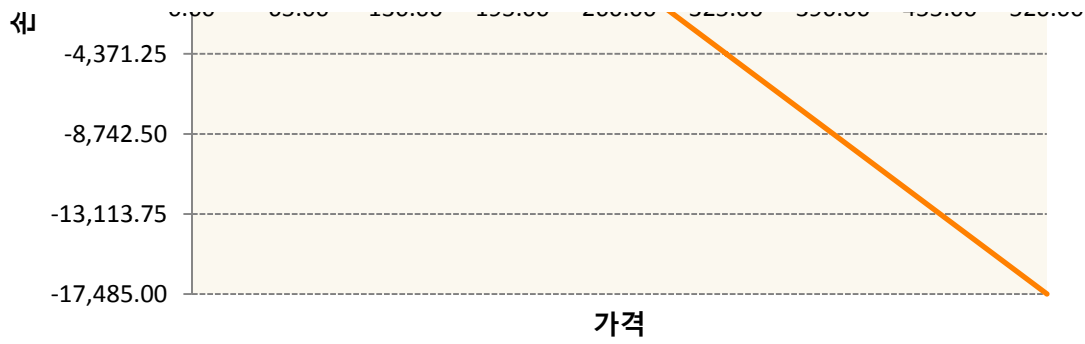
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

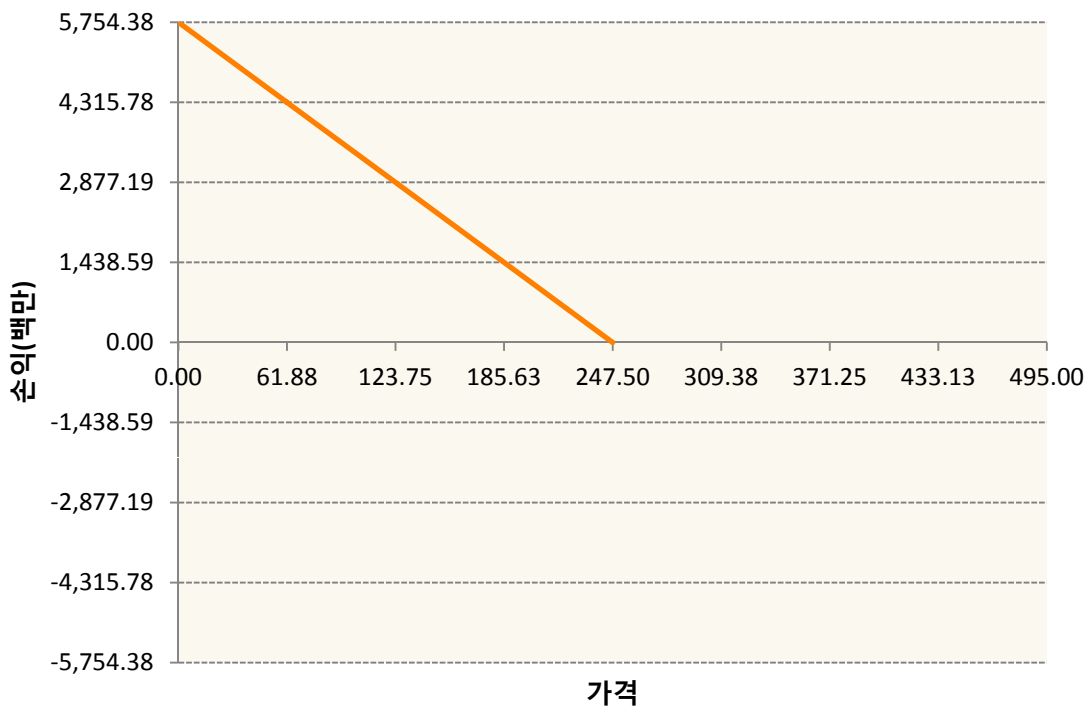


KR4201Q42602-2020-04 콜260

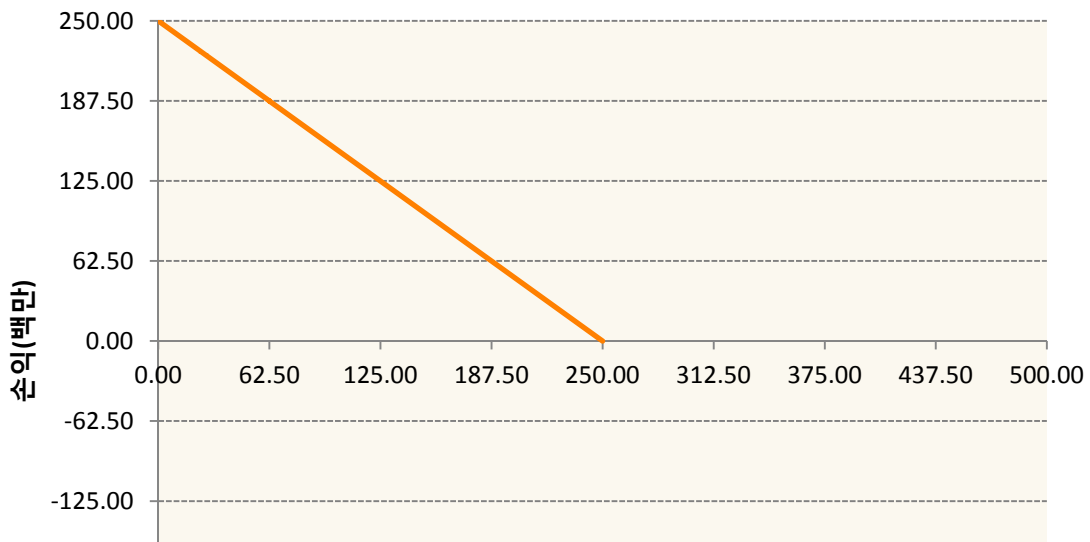


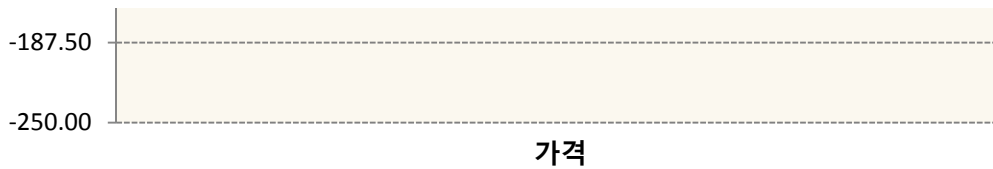


KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



KR4301Q42501-2020-04 풋250





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

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						675
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-675	-675	-675	-675	-675	-675	-675	
-5.33%	-450	-450	-450	-450	-450	-450	-450	
-2.67%	-225	-225	-225	-225	-225	-225	-225	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	225	225	225	225	225	225	225	
5.33%	450	450	450	450	450	450	450	
8.00%	675	675	675	675	675	675	675	
KR4201Q42602		2020-04 콜260						579
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	189	181	169	153	133	110	83	
-5.33%	178	163	144	120	92	61	27	
-2.67%	155	132	103	70	34	-6	-48	
0%	116	81	43	0	-46	-94	-144	
2.67%	52	6	-44	-96	-150	-206	-263	
5.33%	-45	-101	-160	-221	-282	-345	-408	
8.00%	-179	-244	-310	-377	-444	-511	-579	
KR4301Q42477		2020-04 풋247.5						376
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	323	329	336	344	354	365	376	
-5.33%	189	198	208	220	233	246	261	
-2.67%	63	76	90	105	120	137	154	
0%	-52	-35	-18	0	18	37	56	
2.67%	-153	-133	-113	-93	-72	-52	-31	
5.33%	-237	-216	-194	-173	-151	-130	-108	
8.00%	-305	-284	-262	-240	-219	-197	-175	
KR4301Q42501		2020-04 풋250						17
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	14	15	15	15	16	16	17	
-5.33%	9	9	9	10	10	11	11	
-2.67%	3	4	4	5	5	6	7	

0%	-2	-1	-1	0	1	2	2
2.67%	-7	-6	-5	-4	-3	-2	-2
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)

**1,617**

공시일	2020-03-26
기준일	2020-03-25

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	4,802	-4,802	
누계	유가증권	수익증권	149,941	0	149,941	

### 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	2020-03-26
기준일	2020-03-25

## 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	98,072	0	98,072	

### 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	2020-03-26
기준일	2020-03-25

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	16,807	-16,807	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	422,590	0	422,590	
누계	통화	선도	90,398	494,297	-403,899	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020F03! KRW/USD 31-03-20E	3,149
FX21020F04! KRW/USD 31-03-20E	2,952
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,657
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,385
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,968
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,936
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,302
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,968
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	197
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	5,018
FX21020G06 USD/KRW 31-03-20E	492
FX21020H00 USD/KRW 31-03-20E	984
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,460
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,047
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,047
FX21020H04 USD/KRW 21-04-20E	1,476
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,401
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	984
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	984
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,558
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	846
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	738
FX21020H09 USD/KRW 24-04-20E	738
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	492

IE00BD8RGM75

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

21,715



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

(단위:백만원)

167

공시일	2020-03-26
기준일	2020-03-25

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

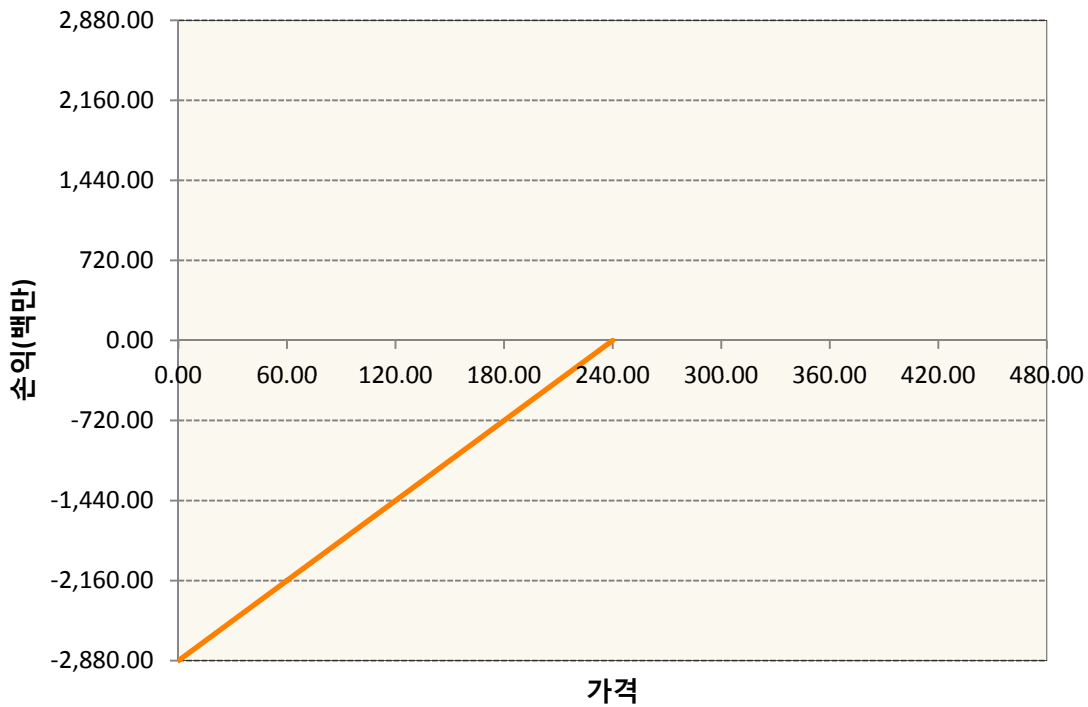
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

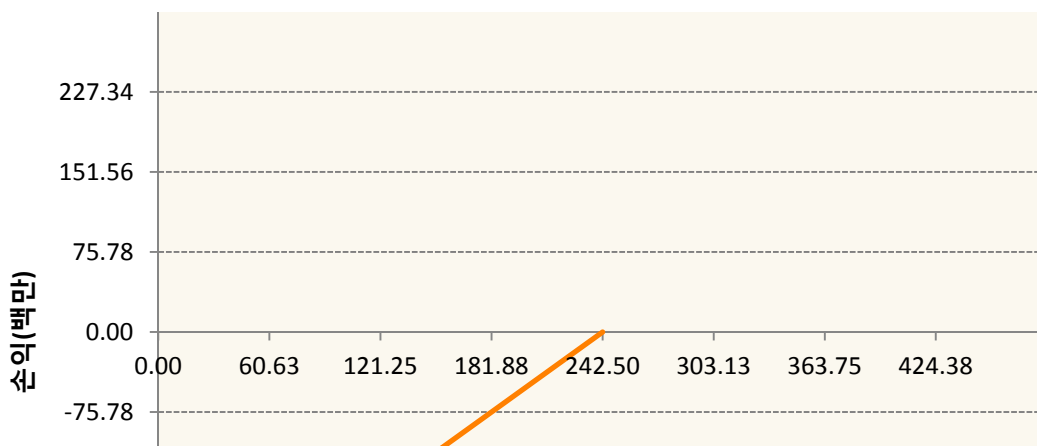
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	130	-130	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,183	-3,183	장내

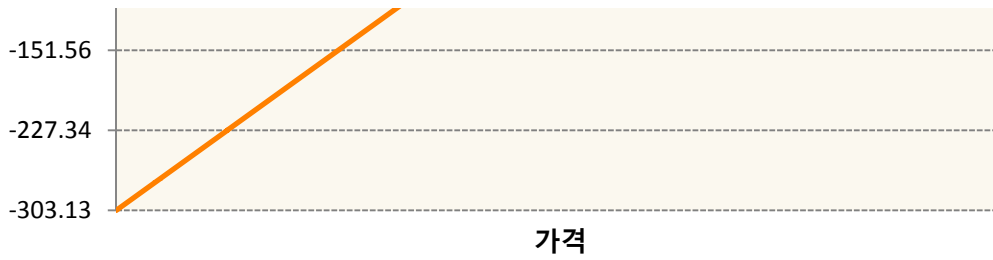
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q42402-2020-04 풋240



KR4301Q42428-2020-04 풋242.5





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

KR4301Q42402		2020-04 풋240						180
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-143	-148	-153	-159	-166	-173	-180	
-5.33%	-79	-85	-93	-100	-108	-117	-125	
-2.67%	-20	-29	-38	-47	-56	-66	-75	
0%	31	20	10	0	-10	-21	-31	
2.67%	73	62	51	40	29	18	8	
5.33%	106	95	84	73	63	52	41	
8.00%	130	121	111	100	90	80	69	
KR4301Q42428		2020-04 풋242.5						19
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-16	-16	-17	-17	-18	-19	-19	
-5.33%	-9	-10	-10	-11	-12	-13	-13	
-2.67%	-3	-3	-4	-5	-6	-7	-8	
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3	
2.67%	8	7	6	4	3	2	1	
5.33%	12	11	9	8	7	6	5	
8.00%	15	13	12	11	10	9	8	

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

179

공시일	2020-03-26
기준일	2020-03-25

## 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	6,927	0	6,927	
누계	통화	선도	2,226	9,532	-7,306	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	186
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	219
FX21020H01 USD/KRW 31-03-20E	50
FX21020H02 KRW/USD 13-04-20E	357
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)

437
-----

공시일	2020-03-26
기준일	2020-03-25

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

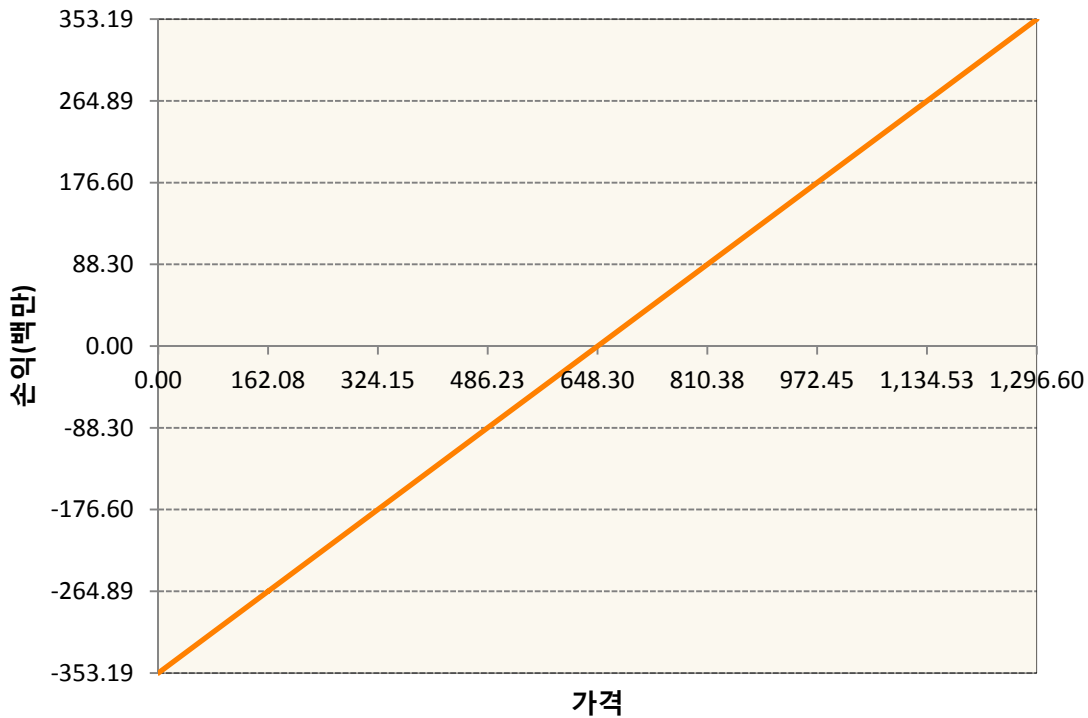
### 1. 계약금액

(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	353	0	353	
누계	유가증권	스왑	1,098	0	1,098	장외
누계	통화	선도	564	732	-168	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
FX21020H09 EUR/KRW 26-06-20E	8
VNCJ0 VN30 Index Future Apr20	28

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

(단위:백만원)

**150**

공시일	2020-03-26
기준일	2020-03-25

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

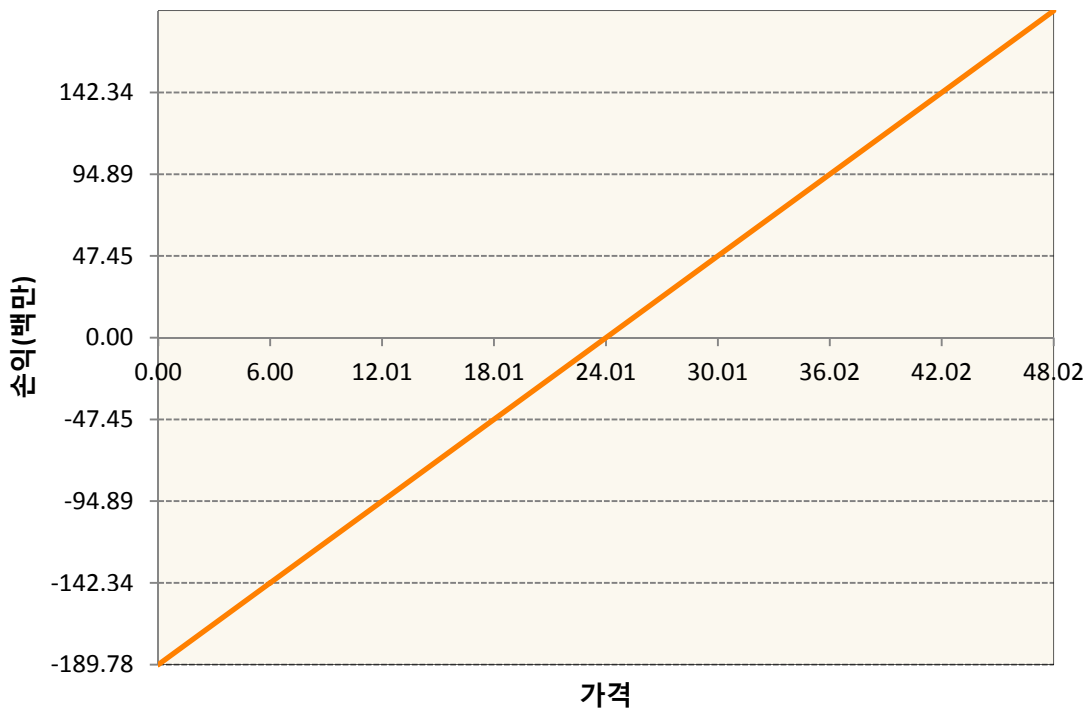
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

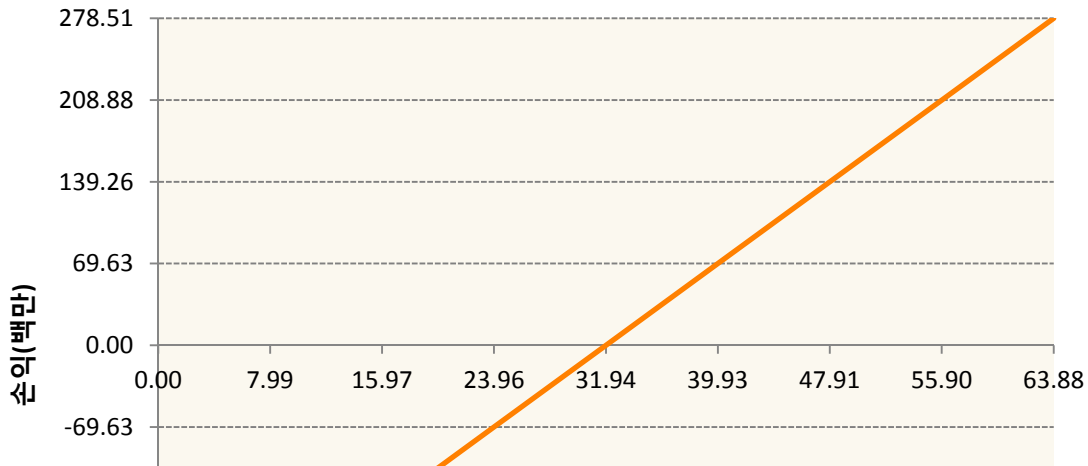
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,276	123	1,154	

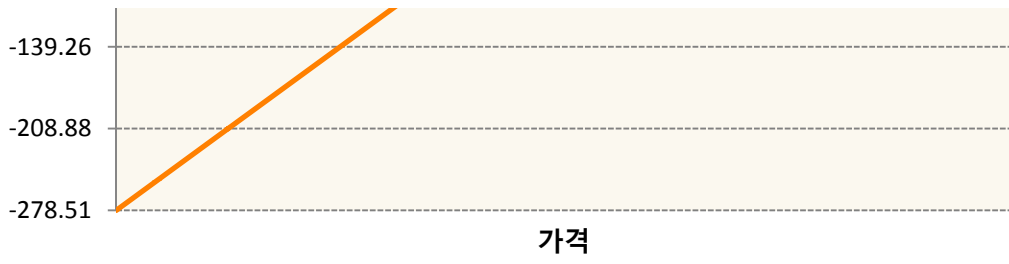
### 2. 만기시점의 손익구조

CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20

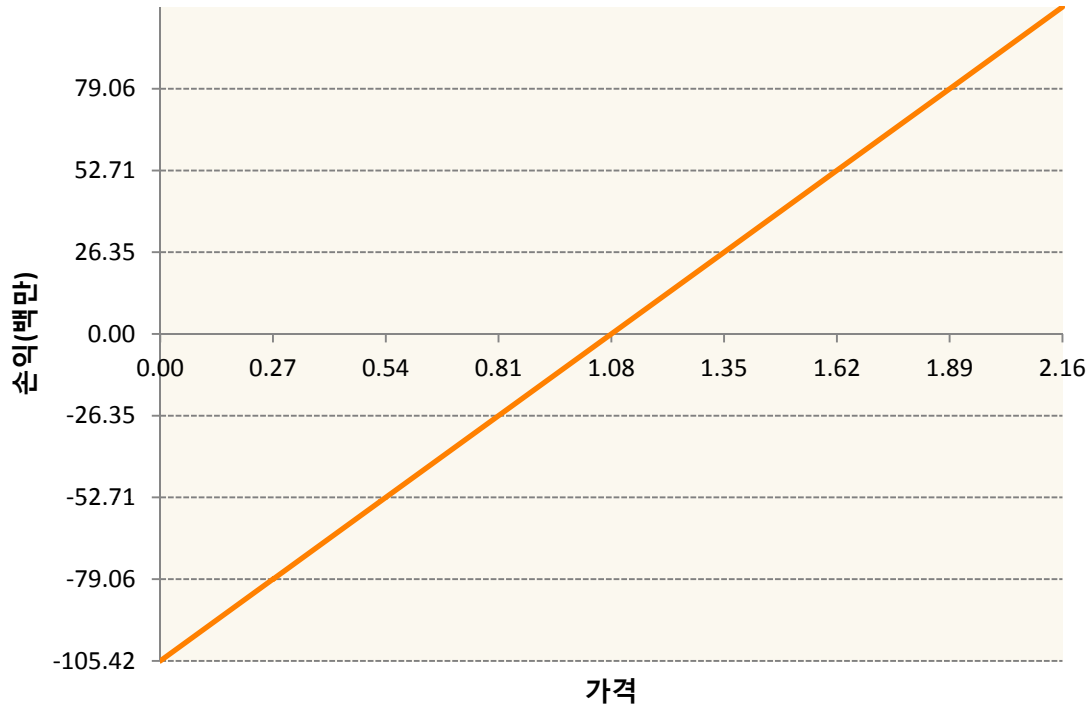


CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20

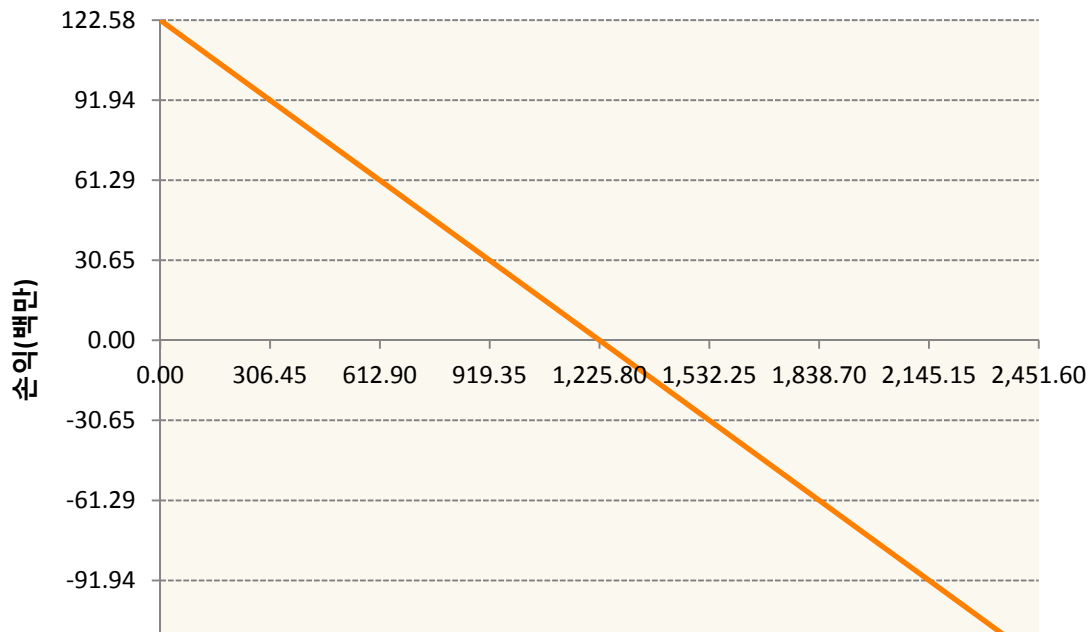


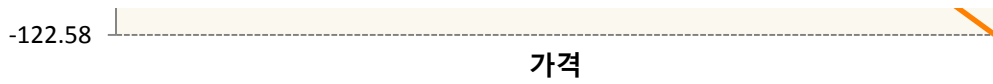


HOK0-NY Harb ULSD Fut May20

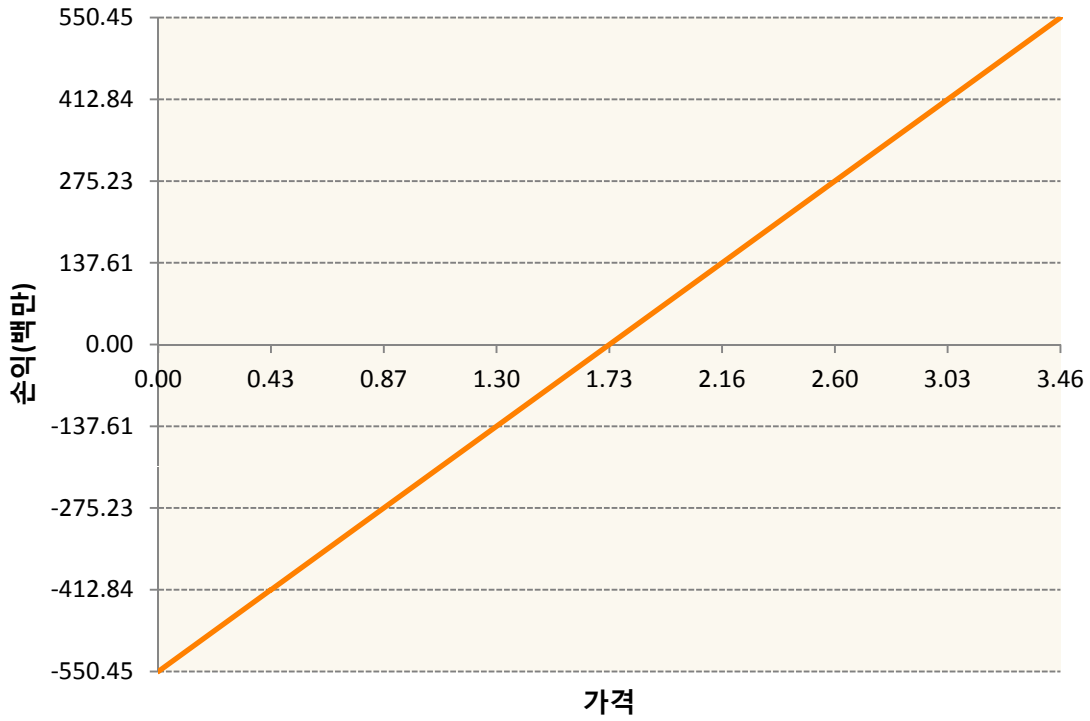


KR4175Q40008-2020-04 달러선물

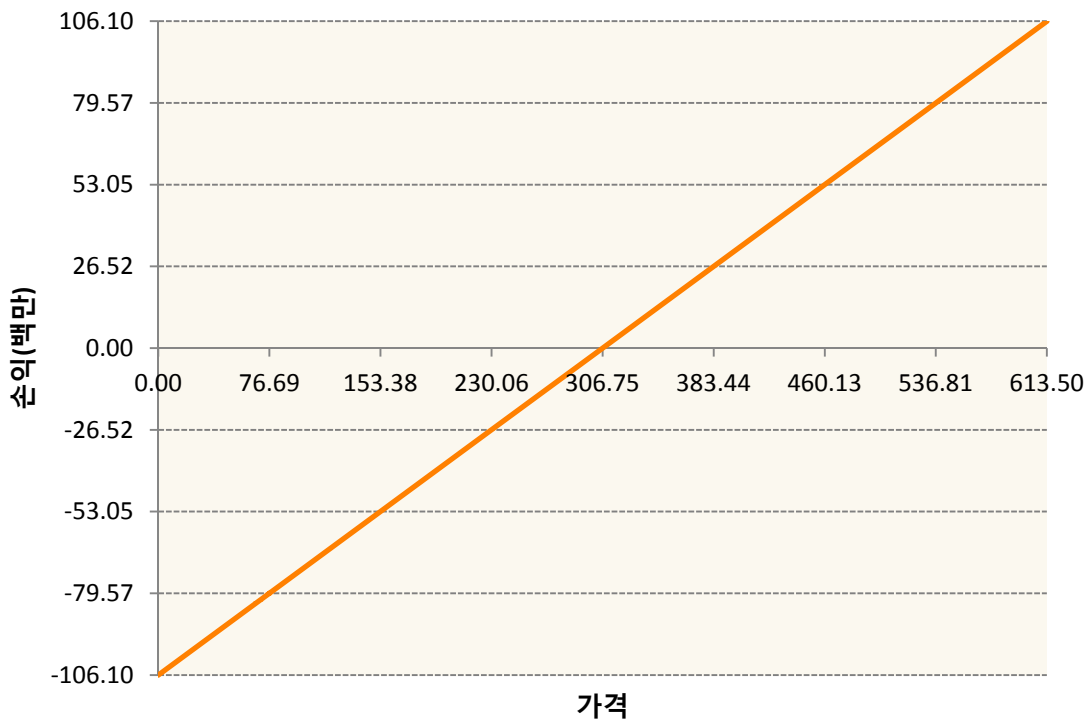




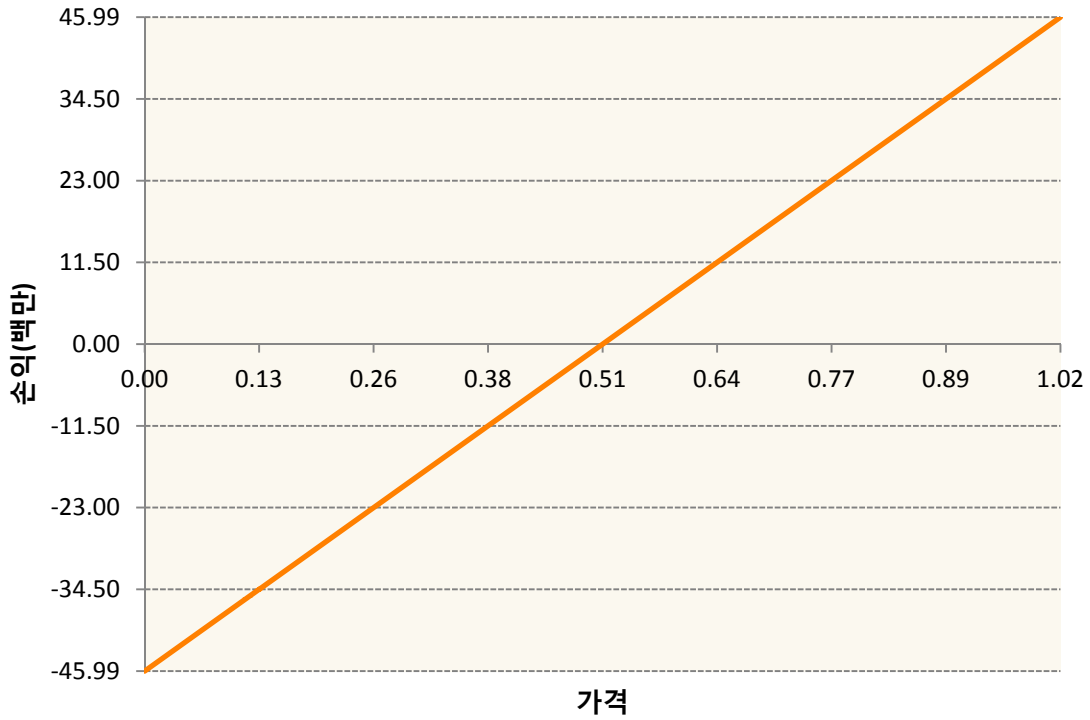
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



QSK0-Low Su Gasoil G Mar20



**XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20**



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	15
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	4

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

(단위:백만원)

<b>280</b>
------------

공시일	2020-03-26
기준일	2020-03-25

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

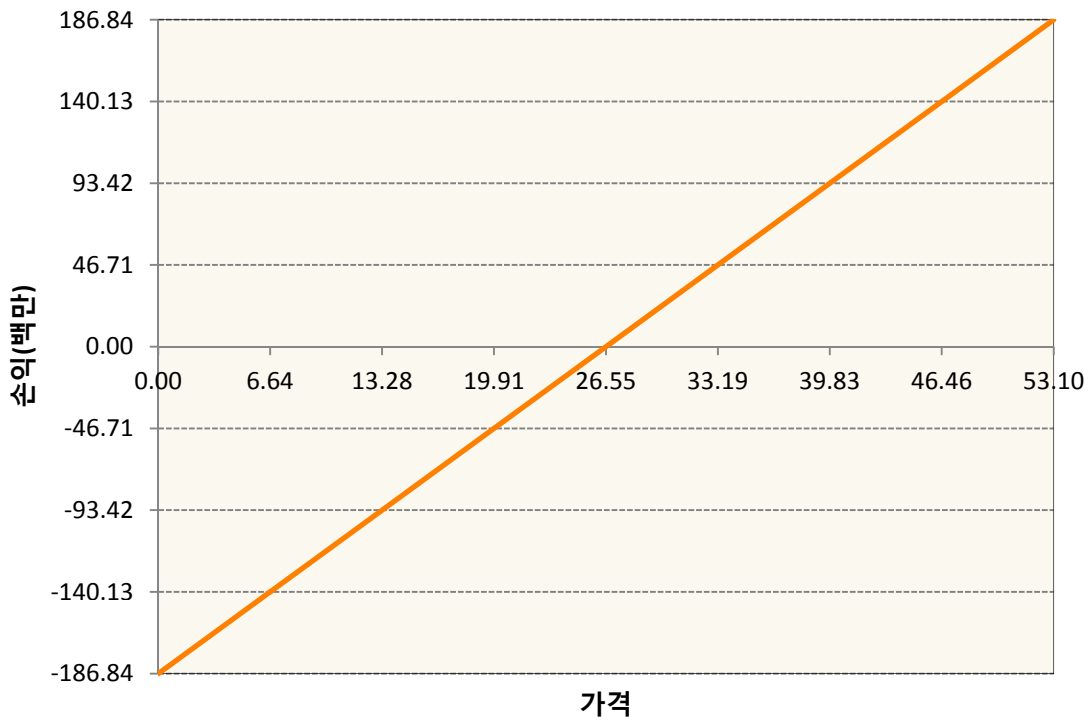
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

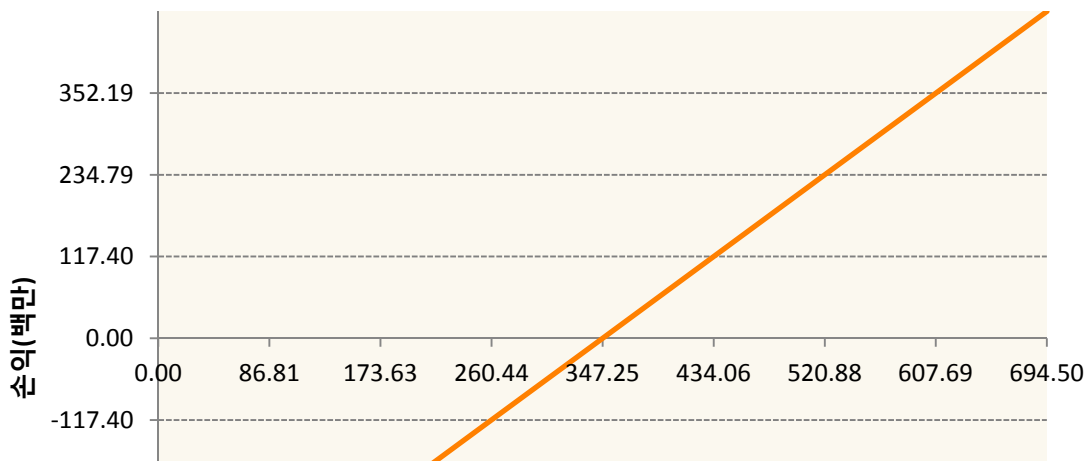
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,391	98	2,293	

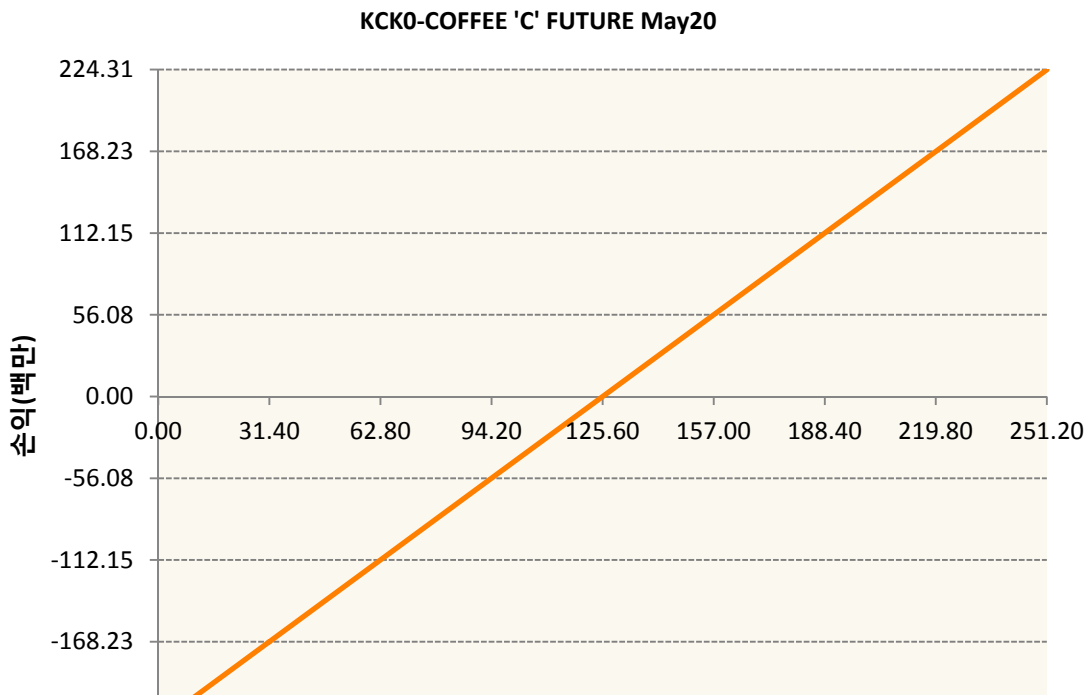
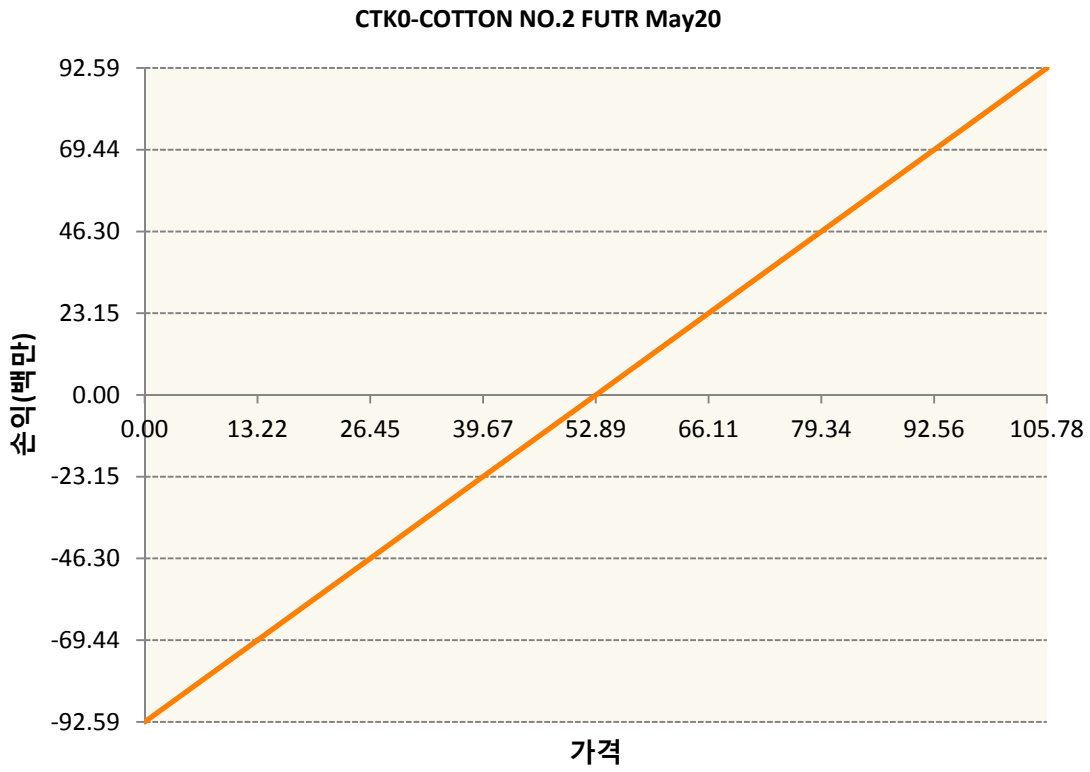
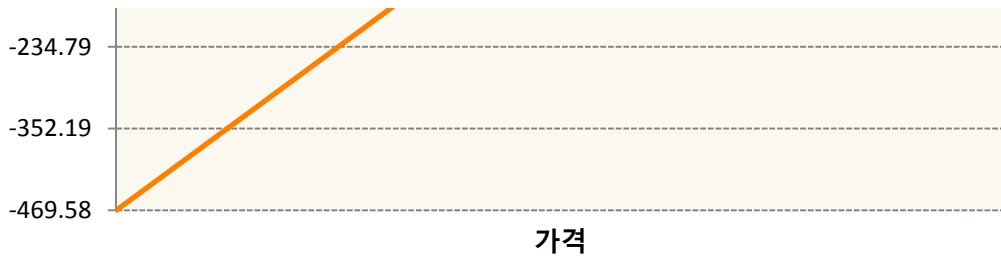
### 2. 만기시점의 손익구조

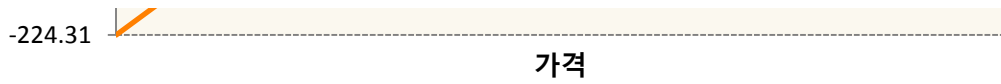
**BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20**



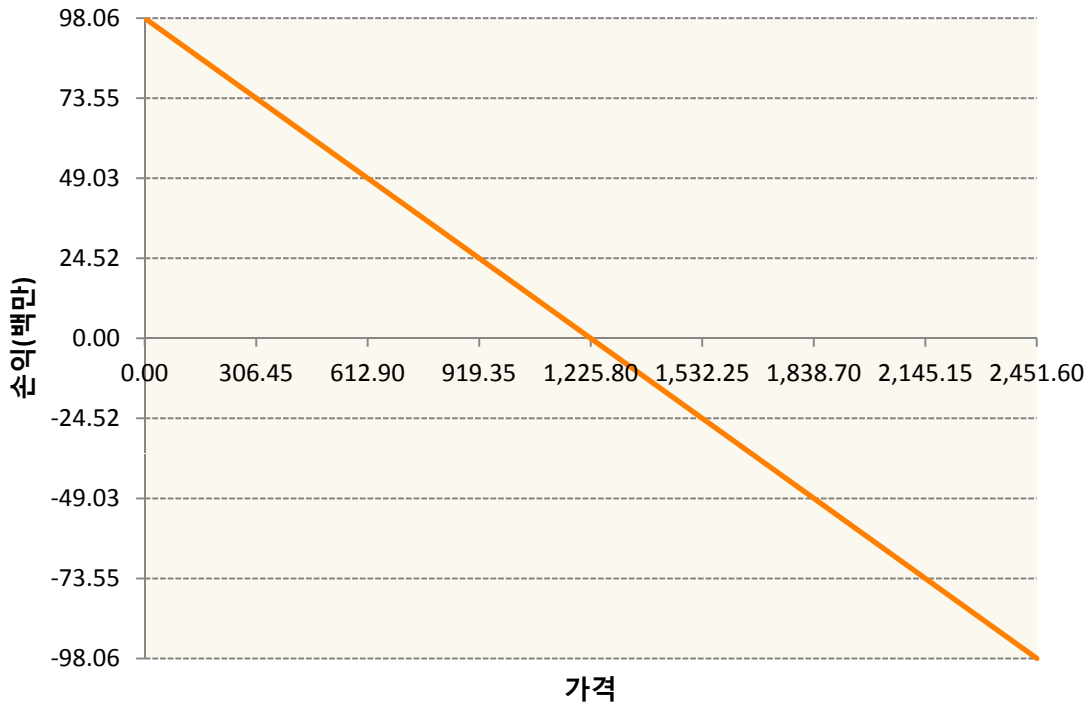
**CK0-CORN FUTURE May20**



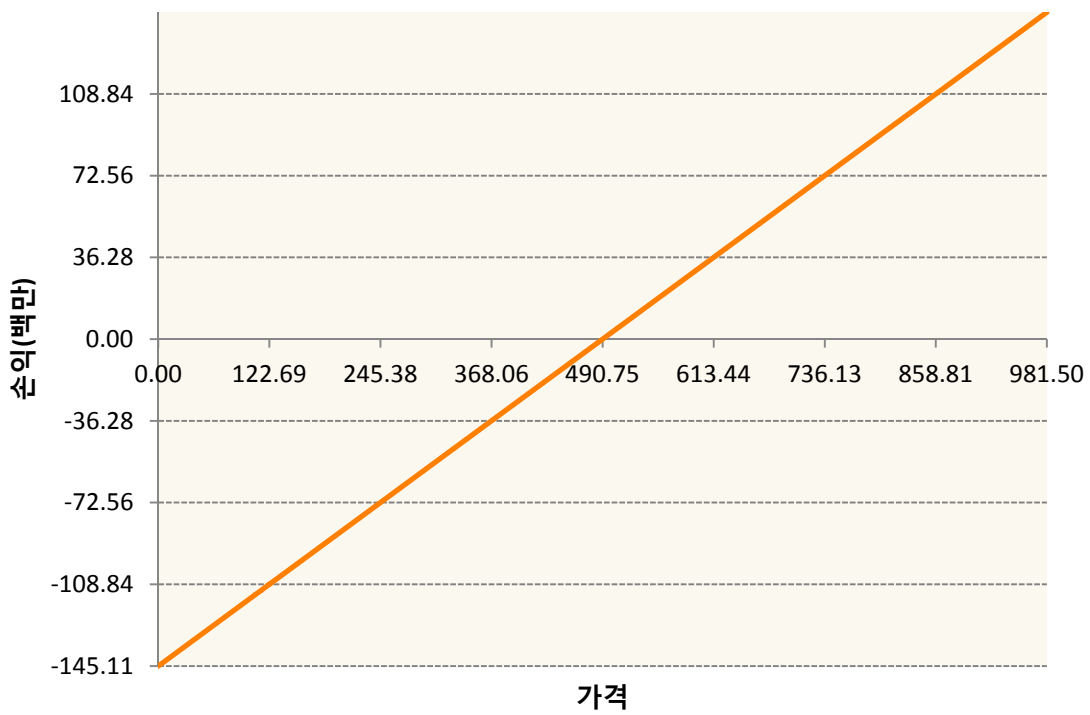




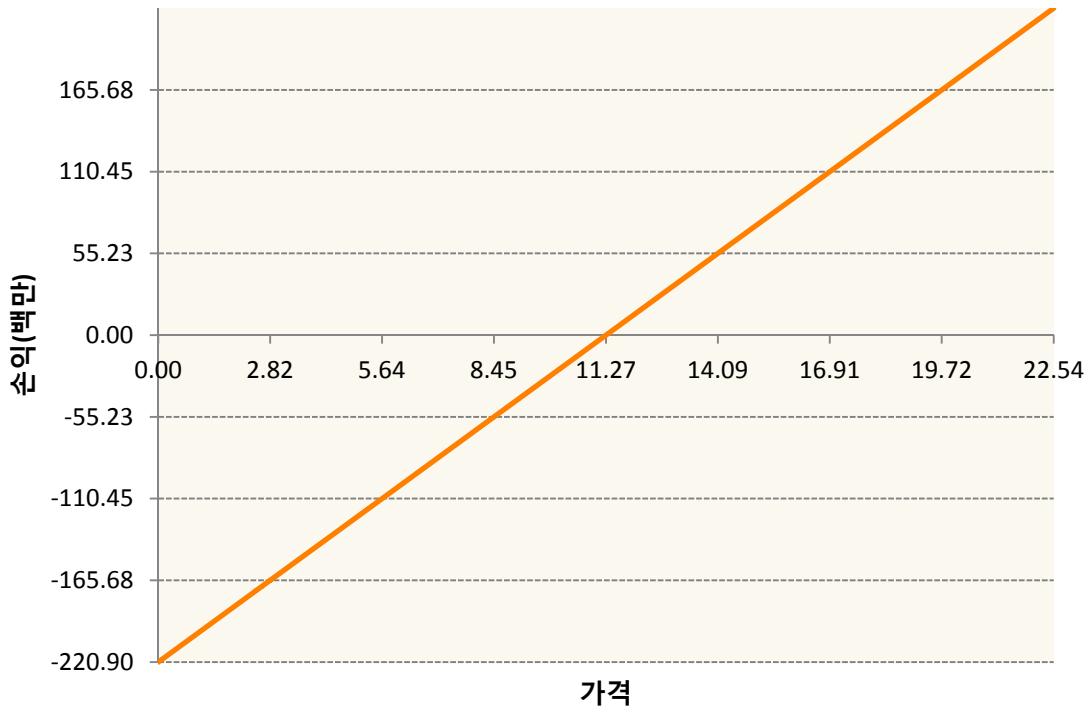
KR4175Q40008-2020-04 달러선물



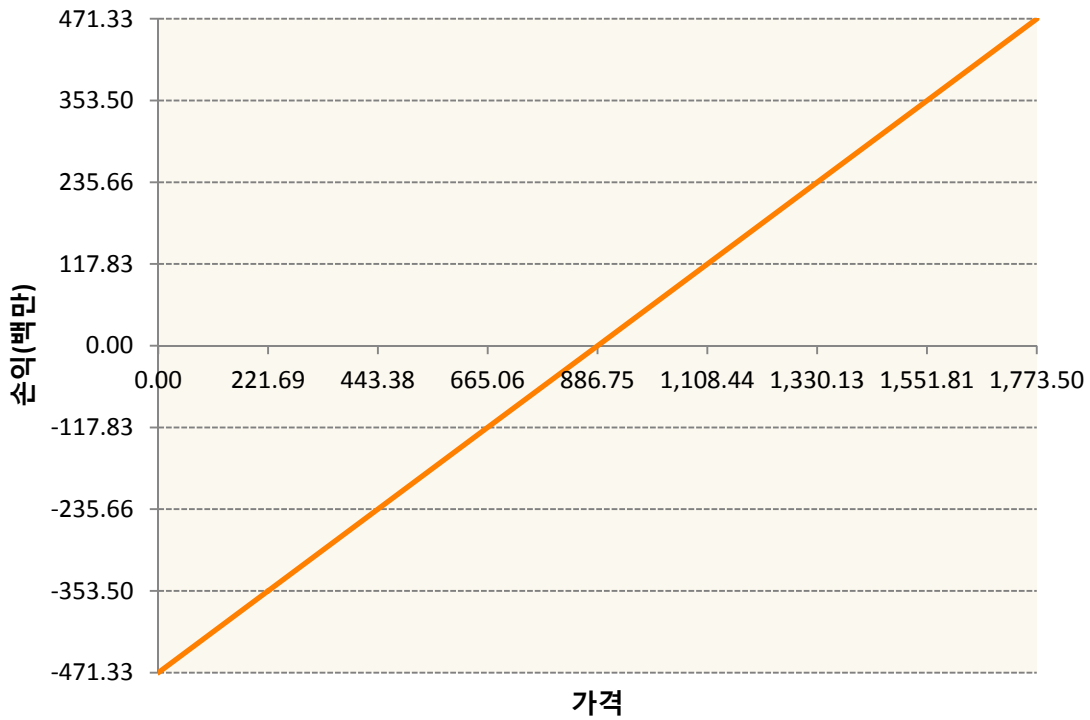
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



SBK0-Sugar May20

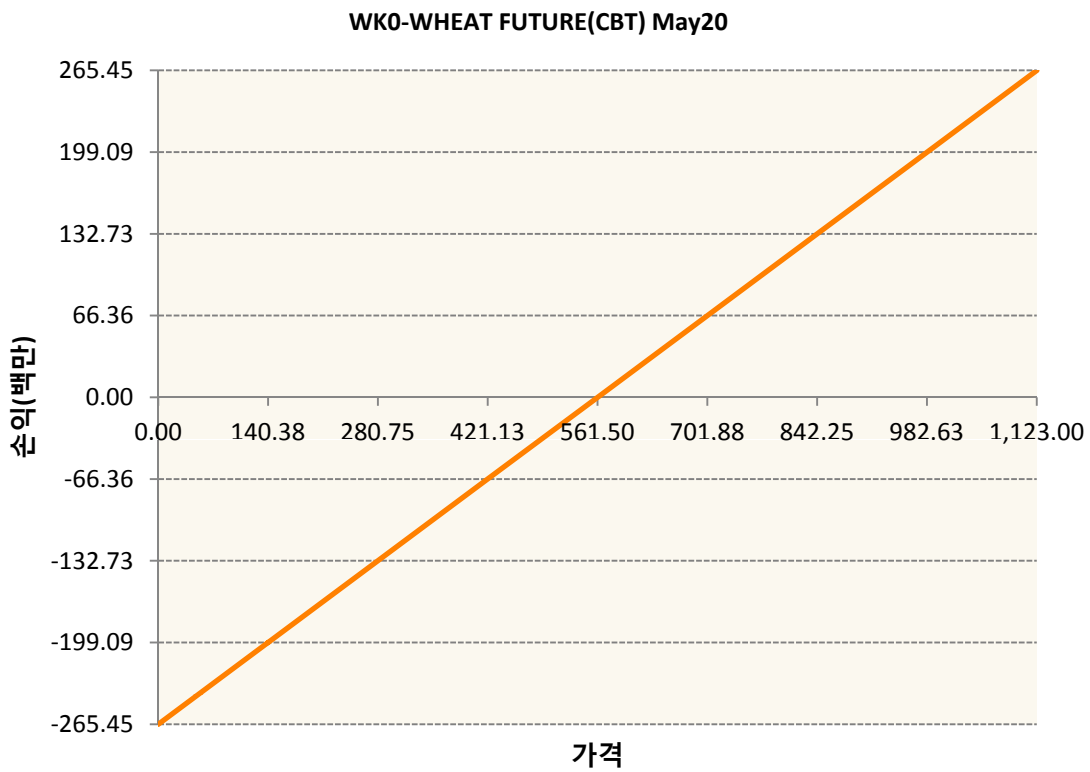
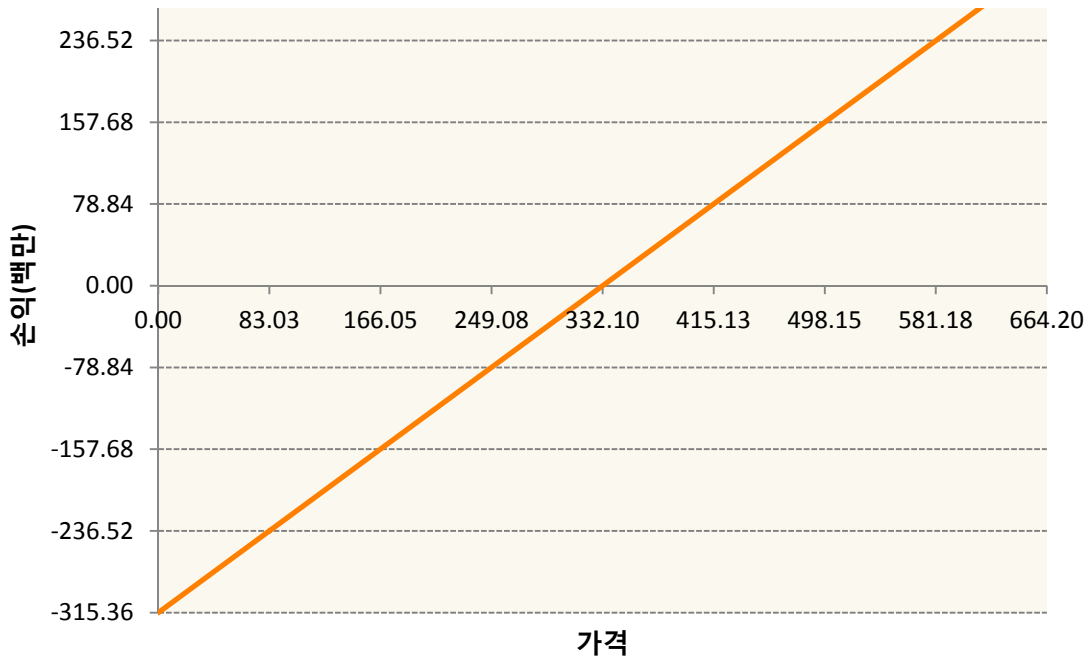


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	15
CK0	CORN FUTURE May20	38
CTK0	COTTON NO.2 FUTR May20	7
KCK0	COFFEE 'C' FUTURE May20	18
KR4175Q40C	2020-04 달러선물	8

KWK0	KC HRW WHEAT FUT May20	12
SBK0	Sugar May20	18
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)

**221**