

공시일	2020-03-27
기준일	2020-03-26

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	2020-03-27
기준일	2020-03-26

스마트인덱스모

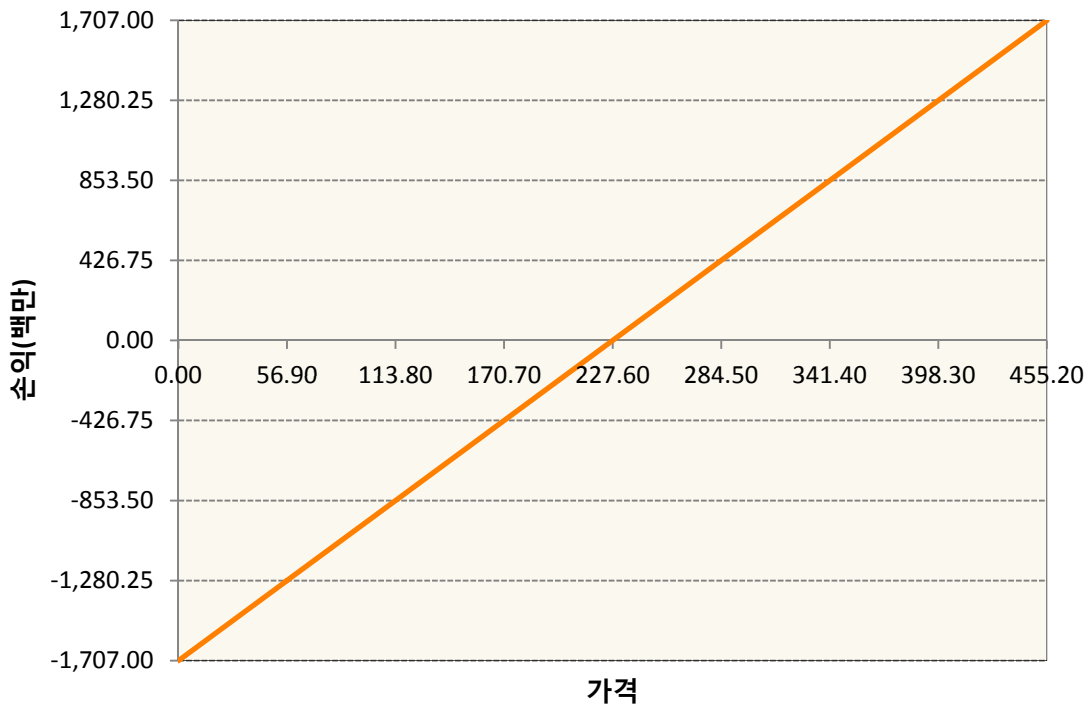
1. 계약금액

(단위:백만원)

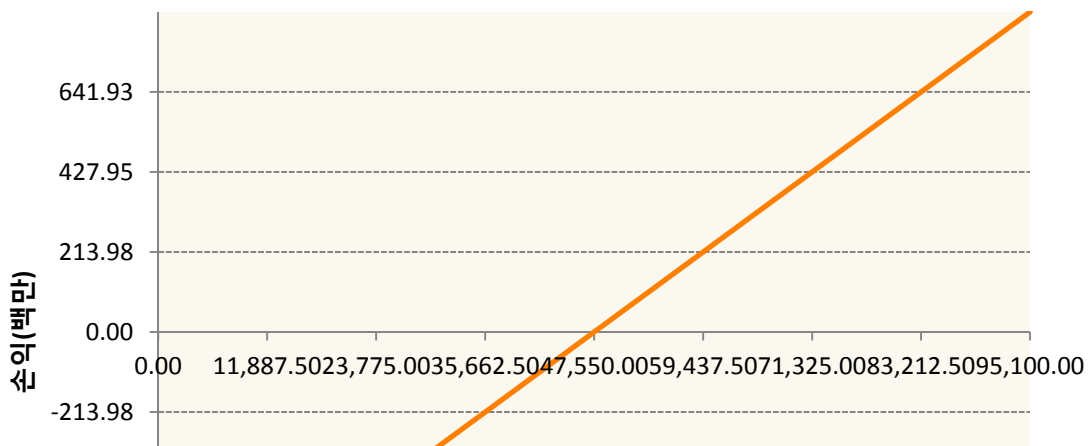
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,563	0	2,563	장내

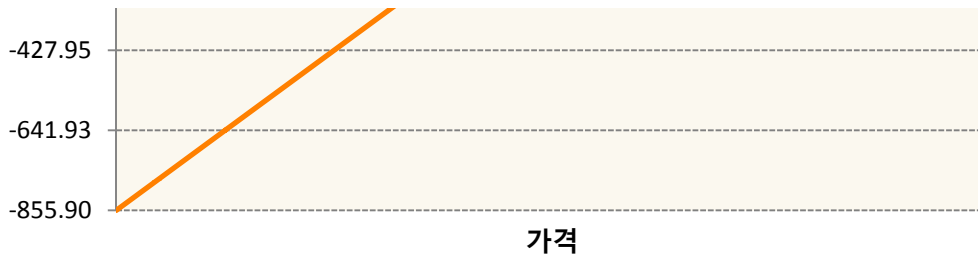
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



KR4111Q40003-2020-04 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						138
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-138	-138	-138	-138	-138	-138	-138	
-5.33%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92	
-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%	92	92	92	92	92	92	92	
8.00%	138	138	138	138	138	138	138	
KR4111Q40003		2020-04 삼성전자개별선물						69
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69	
-5.33%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46	
-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%	46	46	46	46	46	46	46	
8.00%	69	69	69	69	69	69	69	

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

292

공시일	2020-03-27
기준일	2020-03-26

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

858

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

930

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-27
기준일	2020-03-26

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

537

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

853

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-27
기준일	2020-03-26

유로인덱스모(주식-파생형)

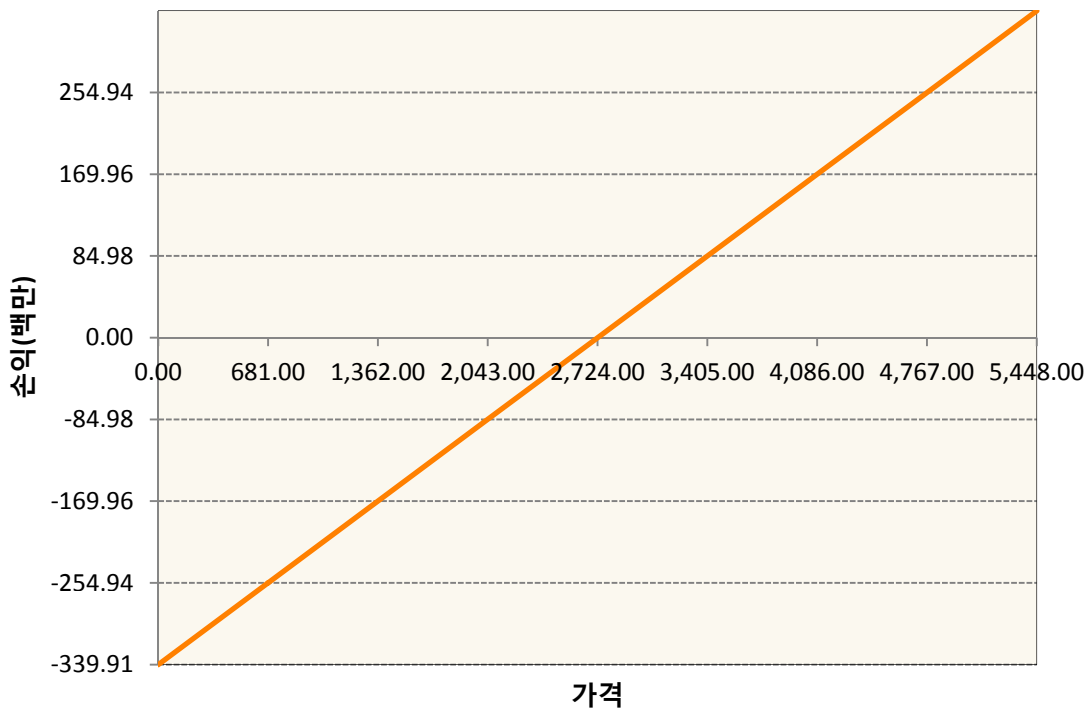
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	340	0	340	

2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	27
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

32

공시일	2020-03-27
기준일	2020-03-26

차이나인덱스모(주식-파생형)

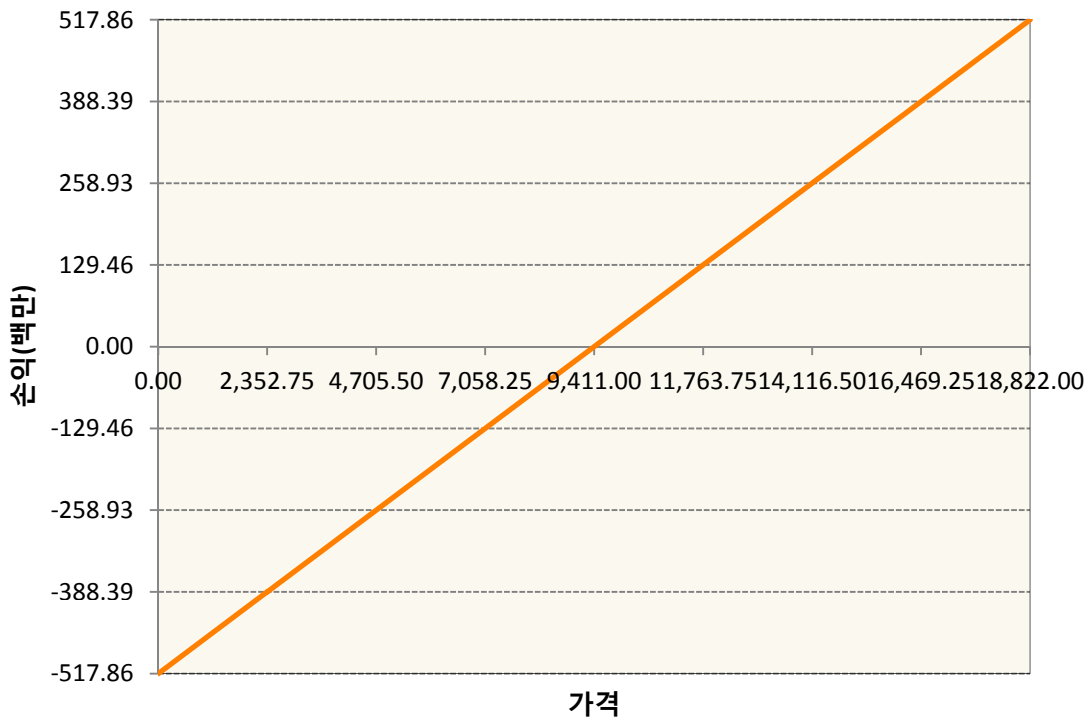
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	518	0	518	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)

44

공시일	2020-03-27
기준일	2020-03-26

커버드콜모(주식혼합-파생형)

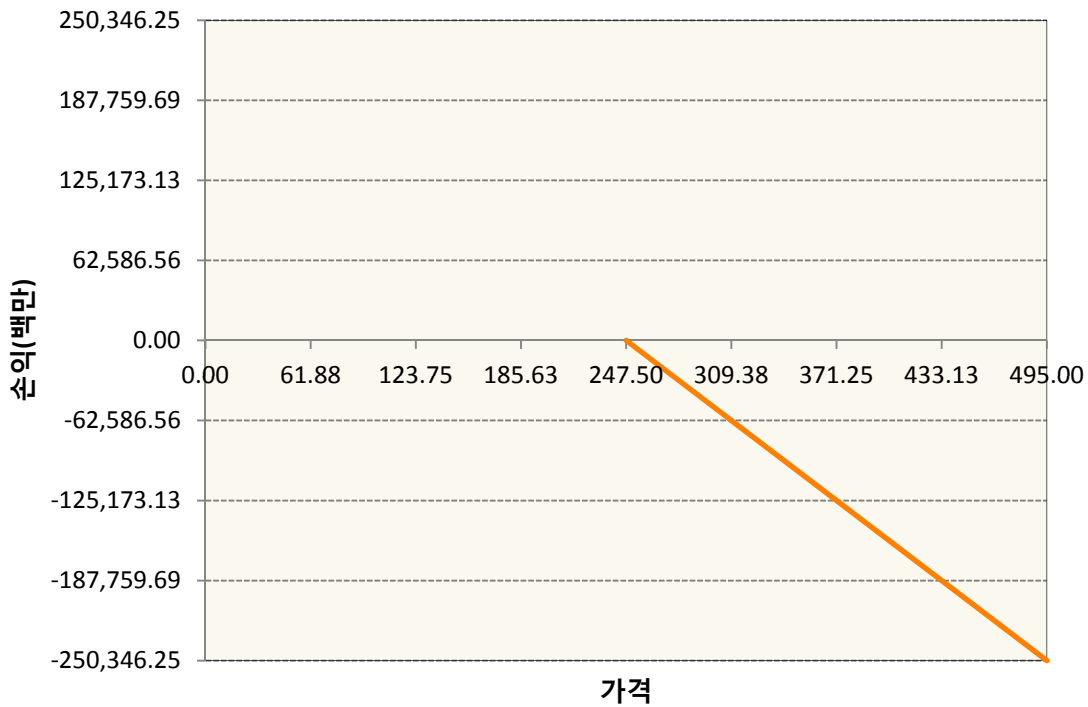
1. 계약금액

(단위:백만원)

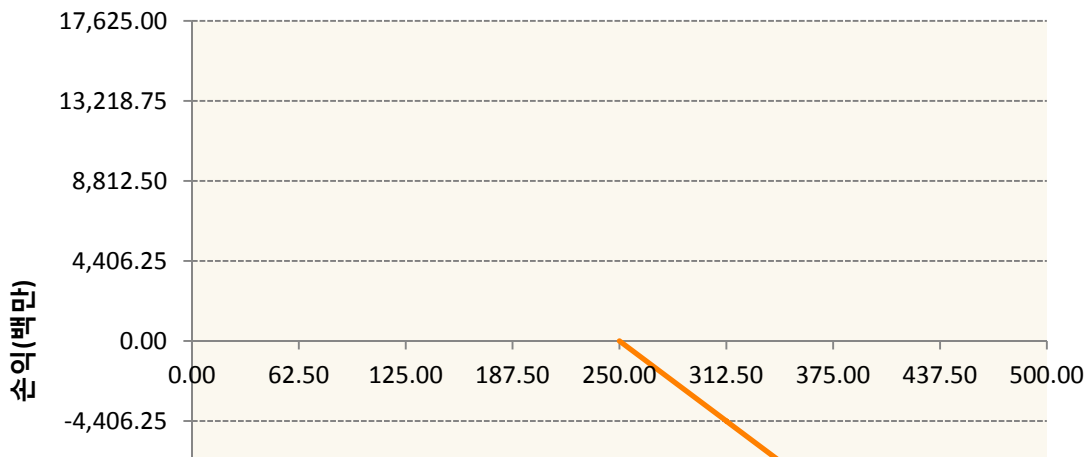
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	9,449	0	9,449	장내
누계	유가증권	옵션	0	360,660	-360,660	장내

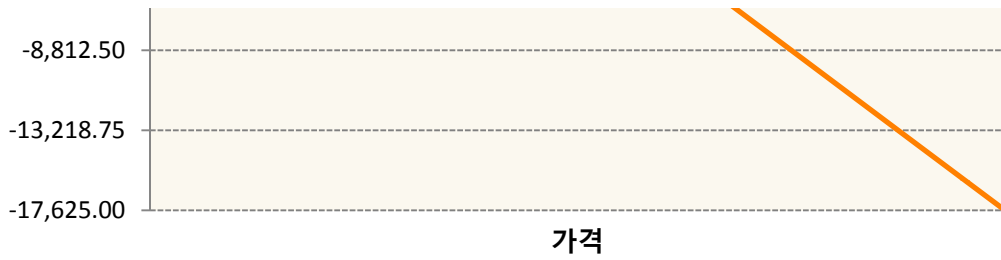
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

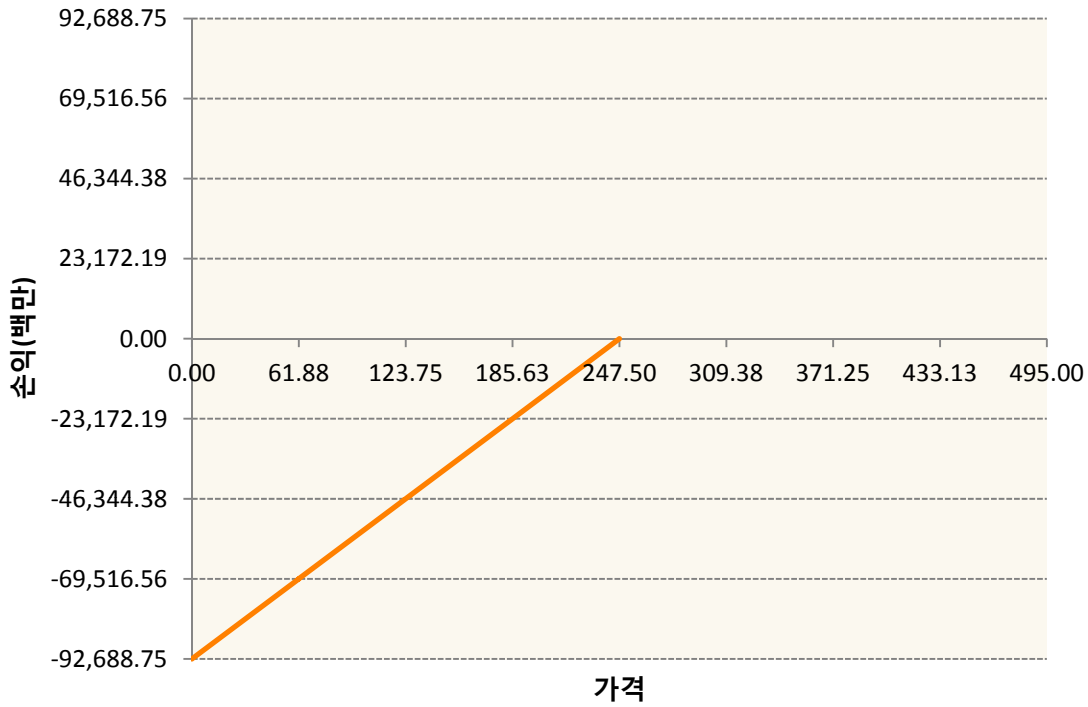


KR4201Q42503-2020-04 콜250





KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q42479		2020-04 콜247.5					10,450	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4,291	4,064	3,771	3,417	3,006	2,545	2,039	
-5.33%	3,924	3,560	3,129	2,638	2,096	1,509	885	
-2.67%	3,271	2,744	2,157	1,521	845	135	-603	
0%	2,212	1,514	774	0	-800	-1,622	-2,461	
2.67%	630	-220	-1,092	-1,981	-2,882	-3,794	-4,714	
5.33%	-1,568	-2,526	-3,489	-4,457	-5,428	-6,401	-7,377	
8.00%	-4,433	-5,436	-6,440	-7,443	-8,446	-9,448	-10,450	
KR4201Q42503		2020-04 콜250					688	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	264	251	233	211	185	156	123	

-5.33%	244	222	195	164	129	91	50
-2.67%	206	173	136	95	51	4	-45
0%	144	99	51	0	-53	-108	-165
2.67%	48	-8	-66	-126	-186	-248	-311
5.33%	-88	-152	-218	-284	-351	-418	-486
8.00%	-268	-338	-408	-478	-548	-618	-688

KR4301Q42477 2020-04 풋247.5 6,175

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,558	-5,613	-5,688	-5,783	-5,897	-6,028	-6,175
-5.33%	-3,364	-3,462	-3,582	-3,724	-3,883	-4,059	-4,249
-2.67%	-1,263	-1,417	-1,592	-1,785	-1,994	-2,216	-2,448
0%	695	478	246	0	-256	-520	-792
2.67%	2,454	2,179	1,896	1,605	1,310	1,010	707
5.33%	3,970	3,653	3,333	3,011	2,689	2,365	2,040
8.00%	5,215	4,880	4,544	4,210	3,875	3,540	3,205

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

(단위:백만원)

13,719

공시일	2020-03-27
기준일	2020-03-26

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

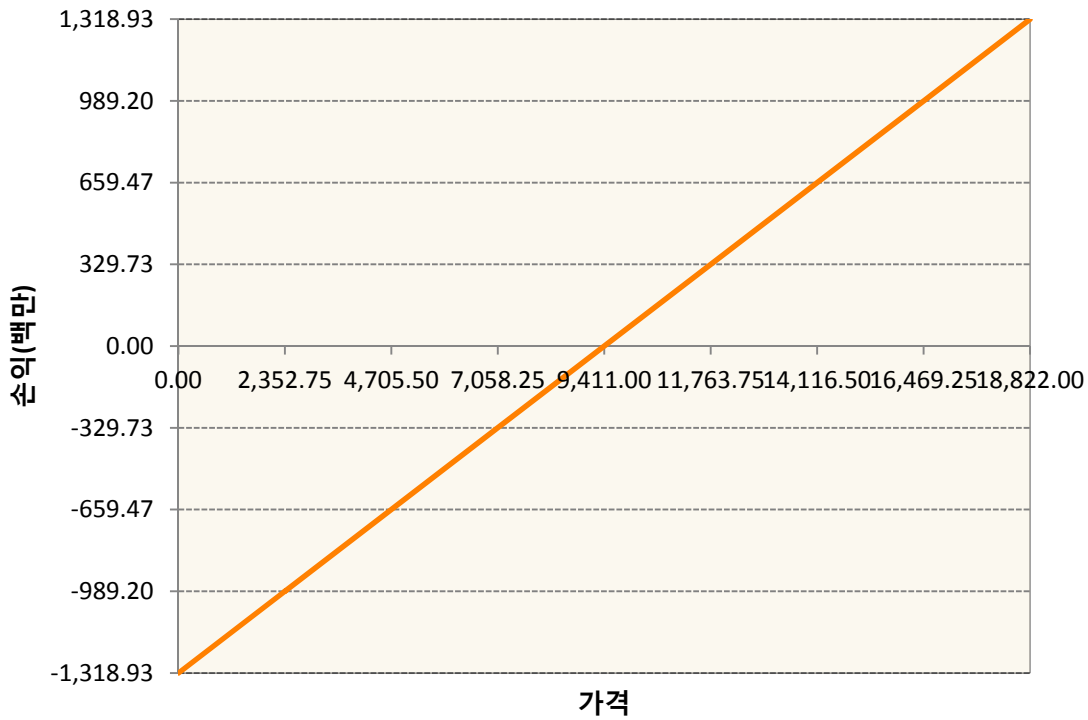
1. 계약금액

(단위:백만원)

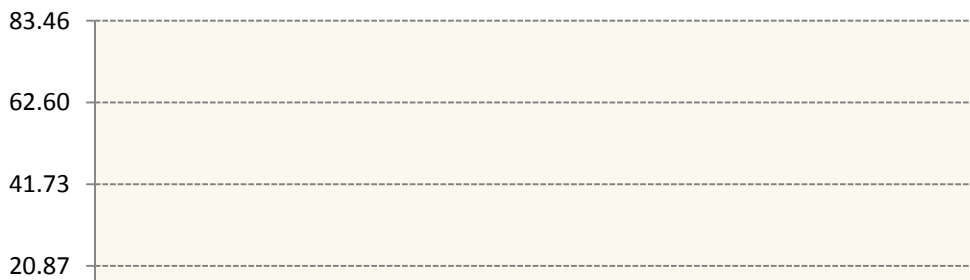
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,319	0	1,319	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,548	-4,548	장내
누계	통화	선도	700	2,238	-1,539	장외

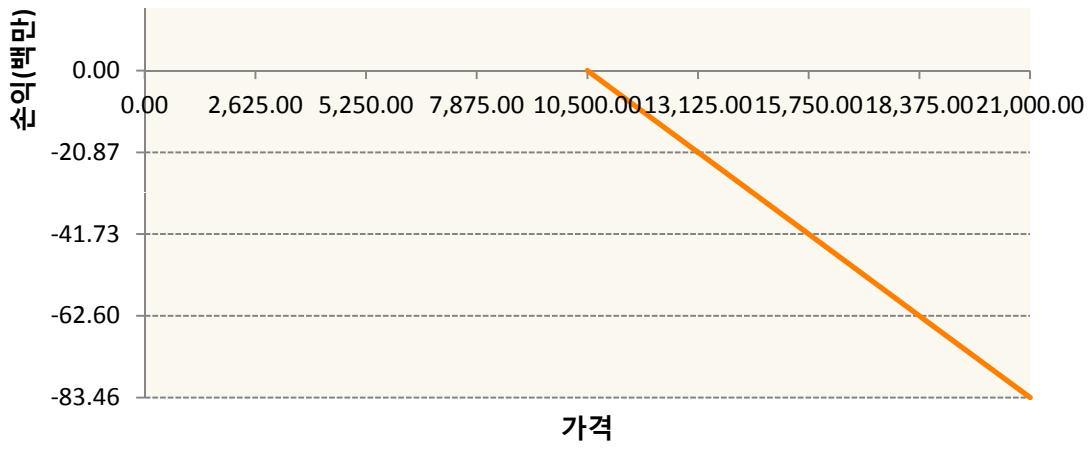
2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20

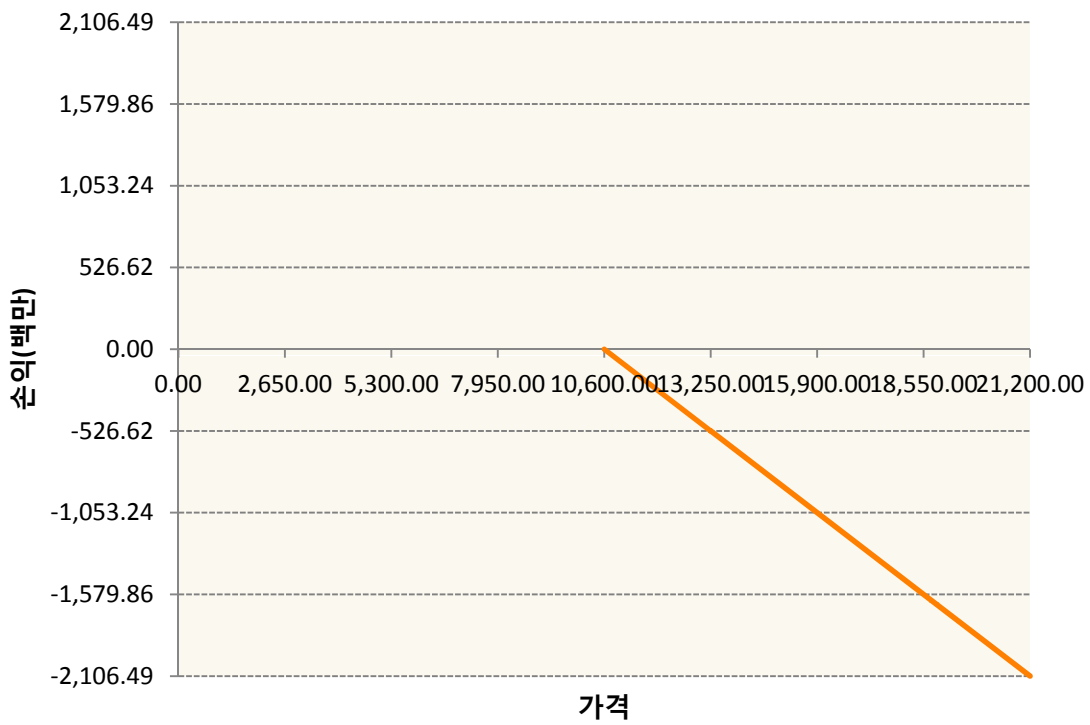


OHHIH0-C105-HSCEI

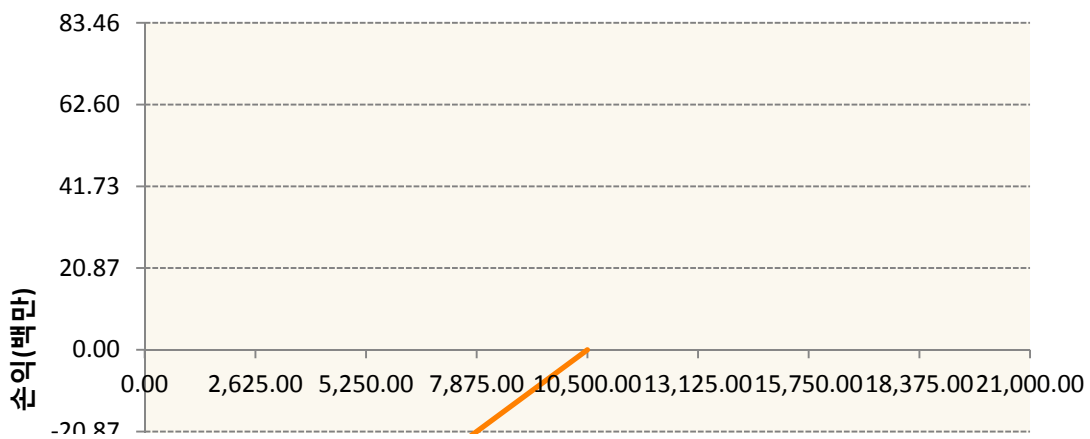


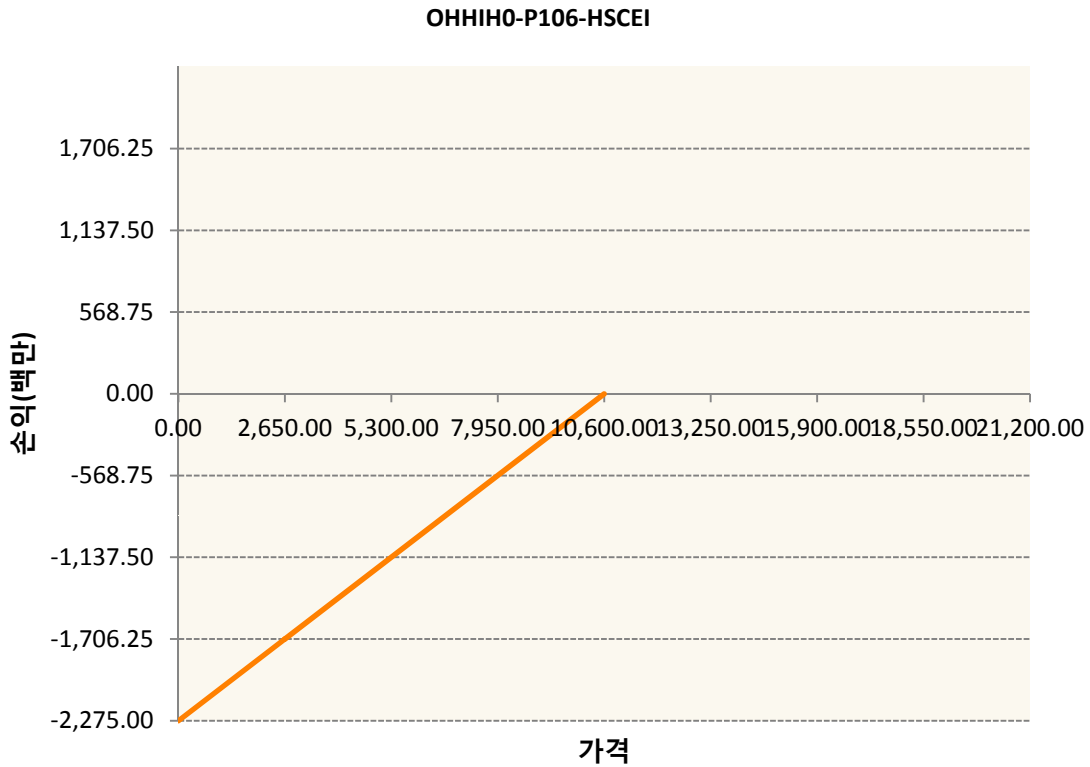
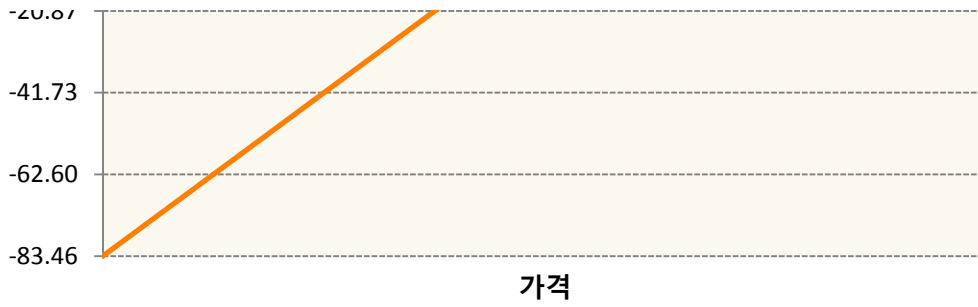


OHHIH0-C106-HSCEI



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	106
OHHIH0-C1(HSCEI	7
OHHIH0-C1(HSCEI	169
OHHIH0-P1(HSCEI	7
OHHIH0-P1(HSCEI	182

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	613

공시일	2020-03-27
기준일	2020-03-26

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

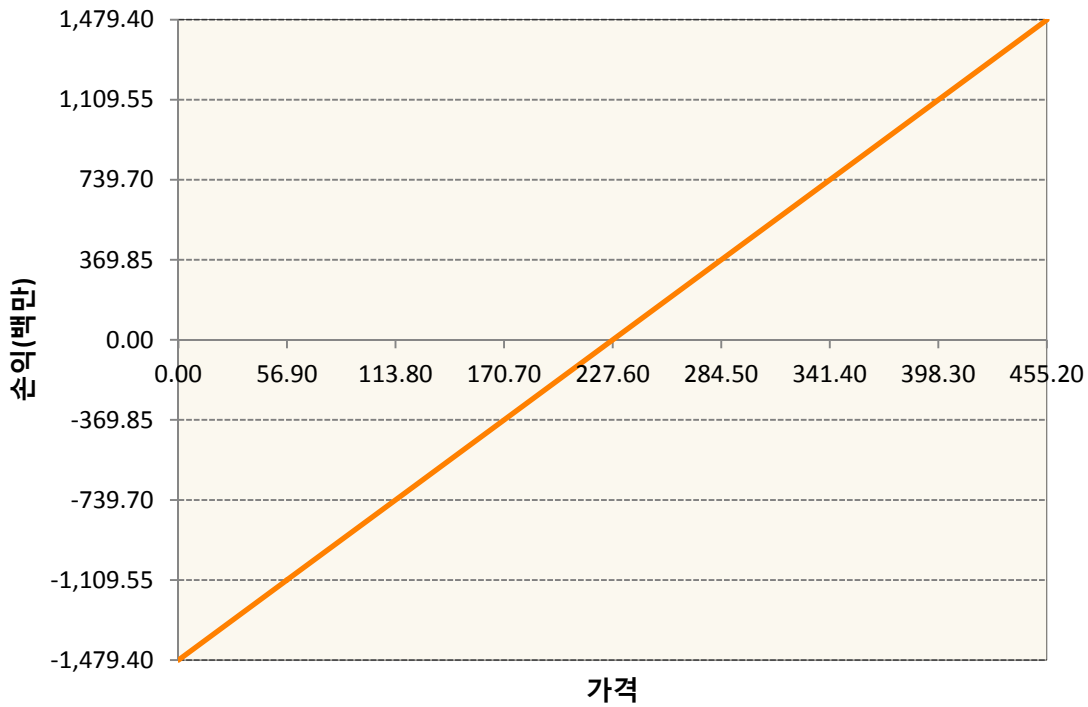
1. 계약금액

(단위:백만원)

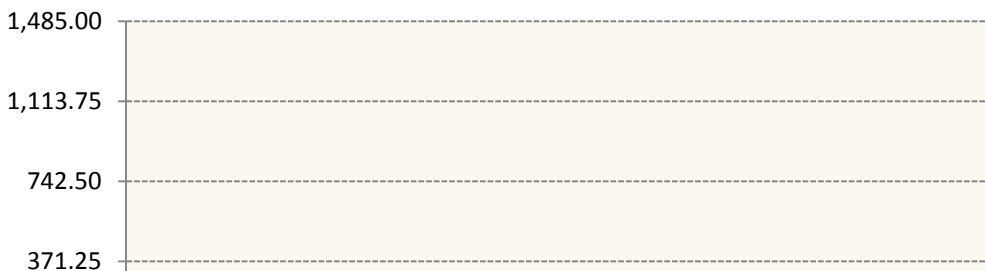
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,479	0	1,479	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,095	-3,095	장내

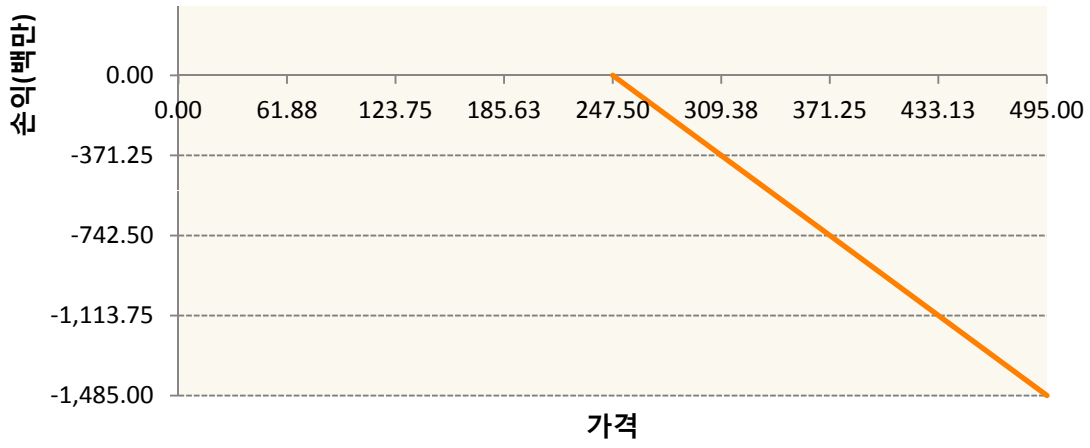
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

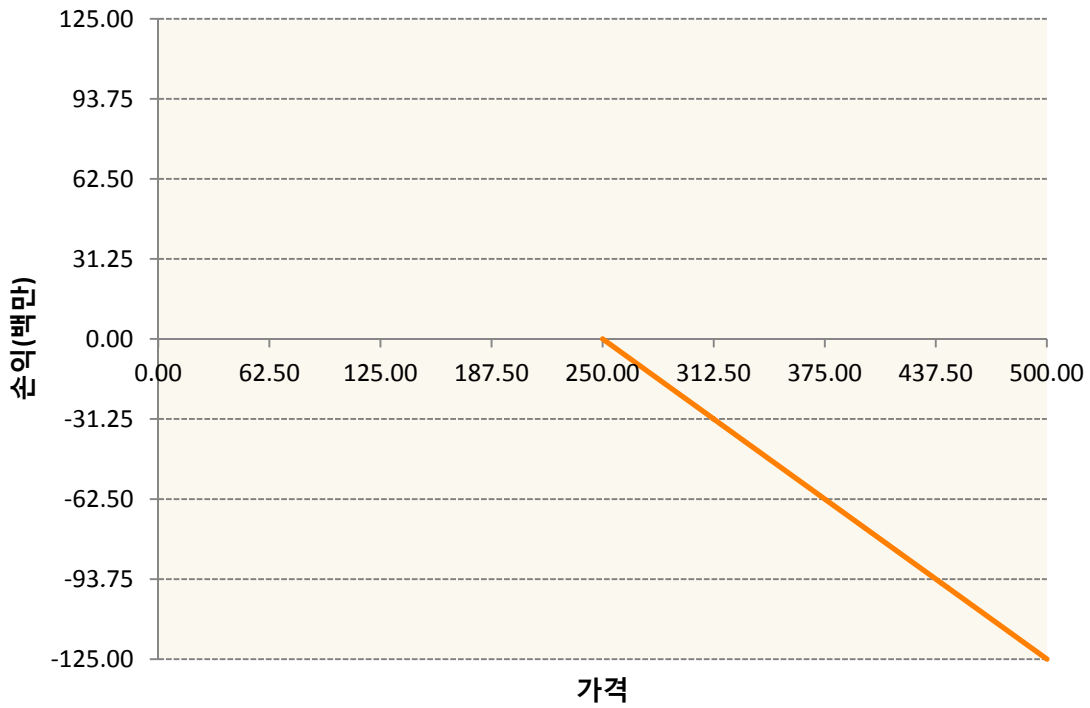


KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

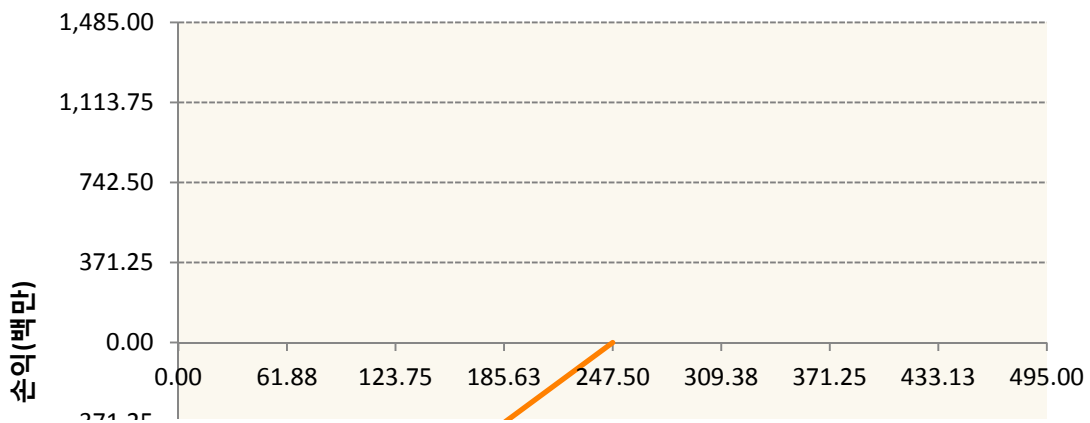




KR4201Q42503-2020-04 콜250



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						119
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119	
-5.33%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80	
-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%	80	80	80	80	80	80	80	
8.00%	119	119	119	119	119	119	119	
KR4201Q42479		2020-04 콜247.5						62
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	25	24	22	20	18	15	12	
-5.33%	23	21	19	16	12	9	5	
-2.67%	19	16	13	9	5	1	-4	
0%	13	9	5	0	-5	-10	-15	
2.67%	4	-1	-6	-12	-17	-23	-28	
5.33%	-9	-15	-21	-26	-32	-38	-44	
8.00%	-26	-32	-38	-44	-50	-56	-62	
KR4201Q42503		2020-04 콜250						5
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

공시일	2020-03-27
기준일	2020-03-26

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

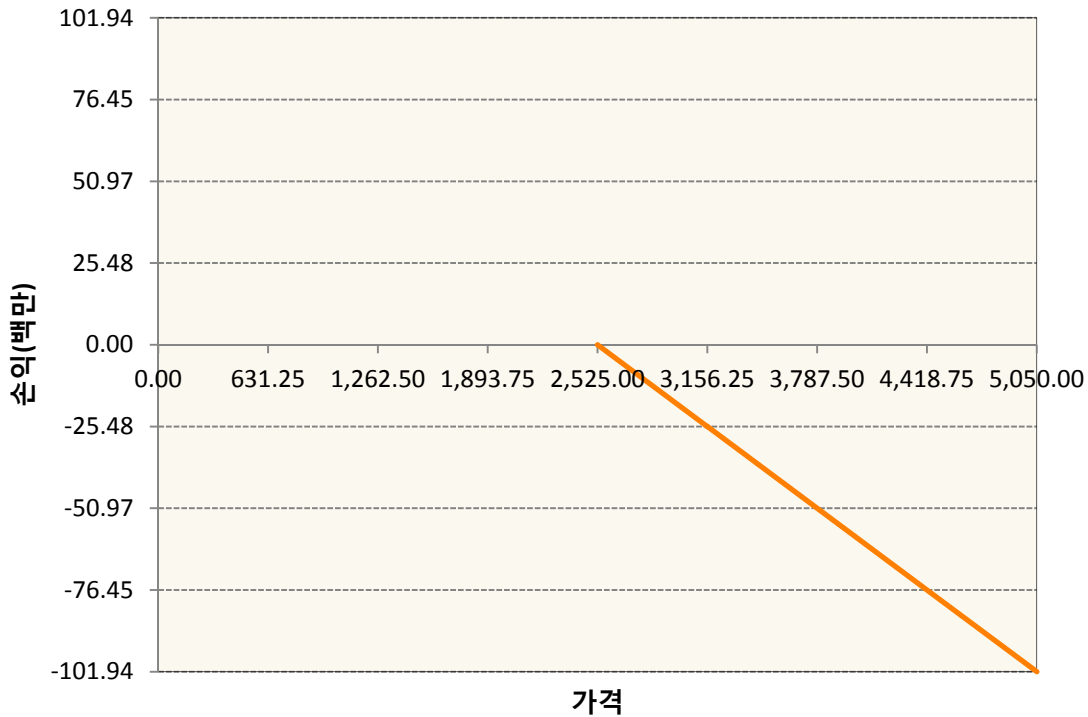
1. 계약금액

(단위:백만원)

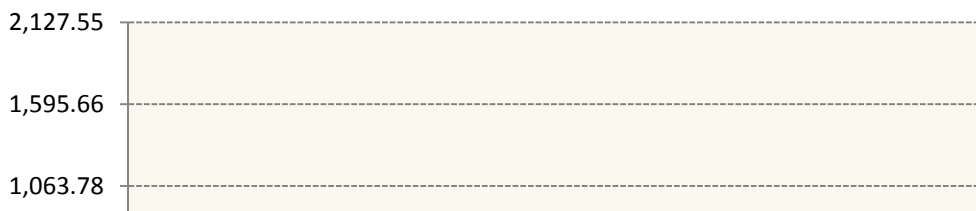
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	260	0	260	
누계	유가증권	스왑	7,644	0	7,644	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,459	-4,459	장내
누계	통화	선도	538	6,255	-5,716	장외

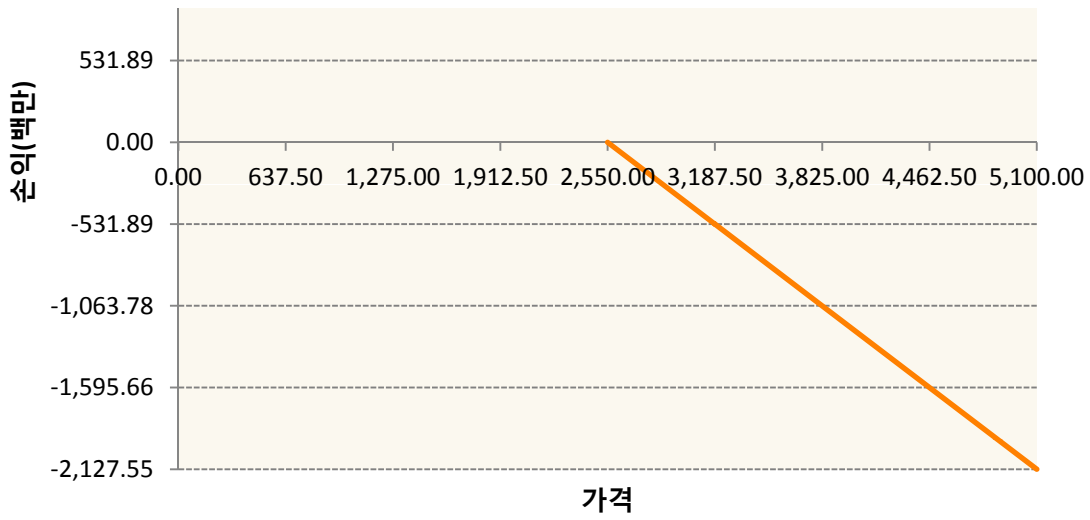
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ0-C2525-EURO STOXX 50

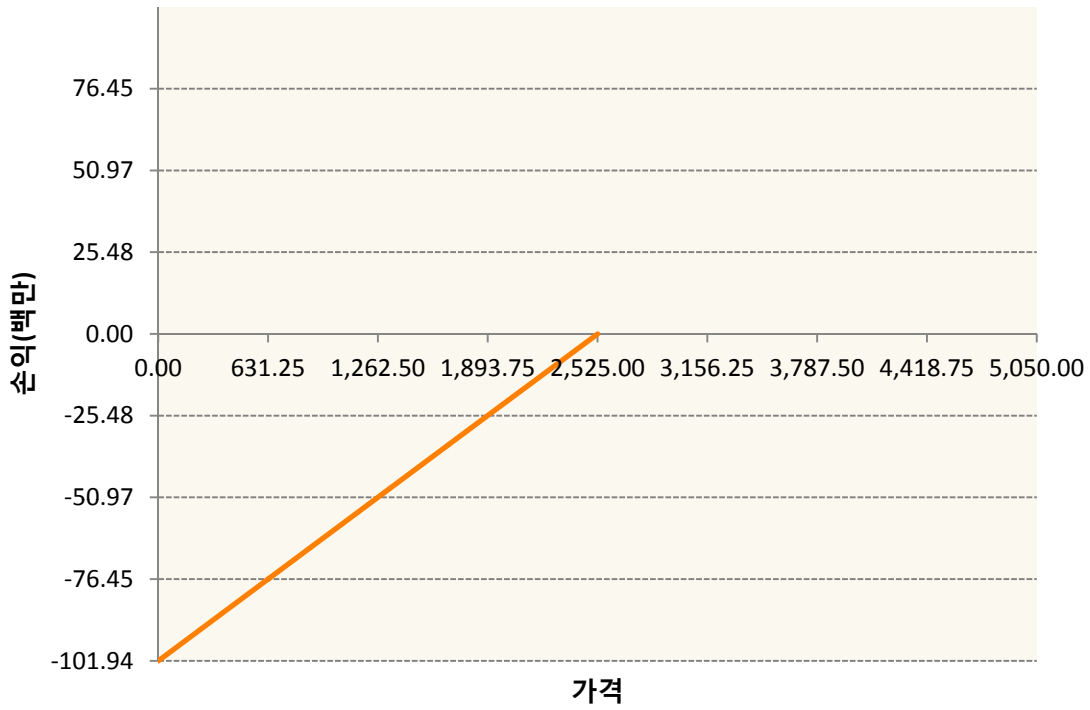


OESXJ0-C2550-EURO STOXX 50

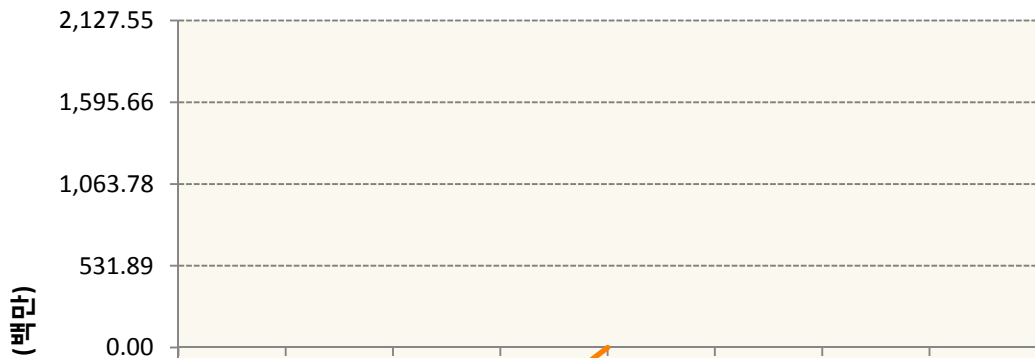


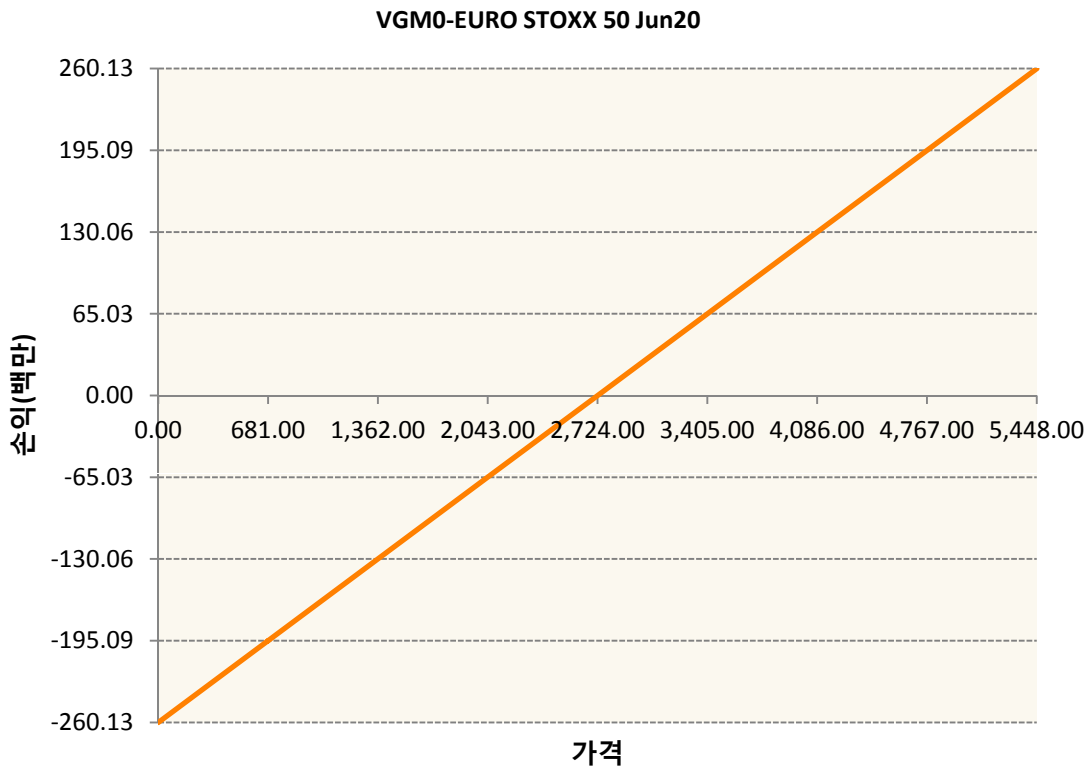
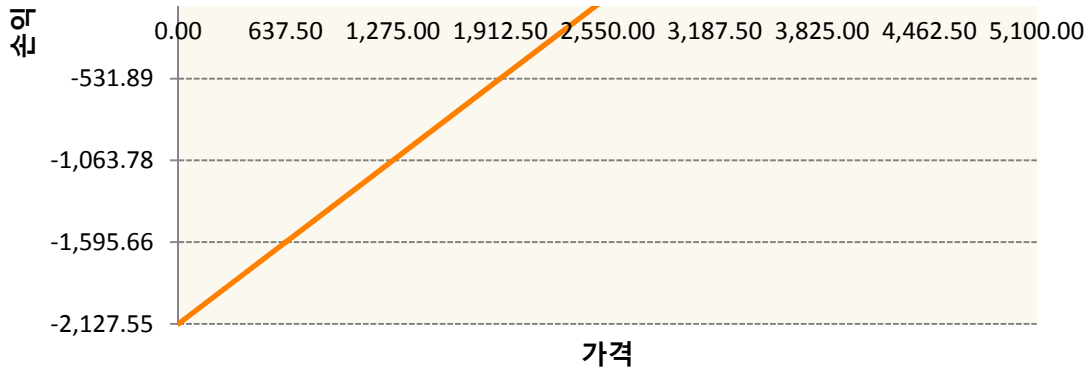


OESXJ0-P2525-EURO STOXX 50



OESXJ0-P2550-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	14
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	282
FX21020H00 EUR/KRW 27-03-20E	43
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E	218
OESXJ0-C25: EURO STOXX 50	8
OESXJ0-C25: EURO STOXX 50	170
OESXJ0-P25: EURO STOXX 50	8
OESXJ0-P25: EURO STOXX 50	170
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20	21

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

(단위:백만원)

768

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

(단위:백만원)

962

공시일	2020-03-27
기준일	2020-03-26

ETF스마트레버리지목표전환형9호

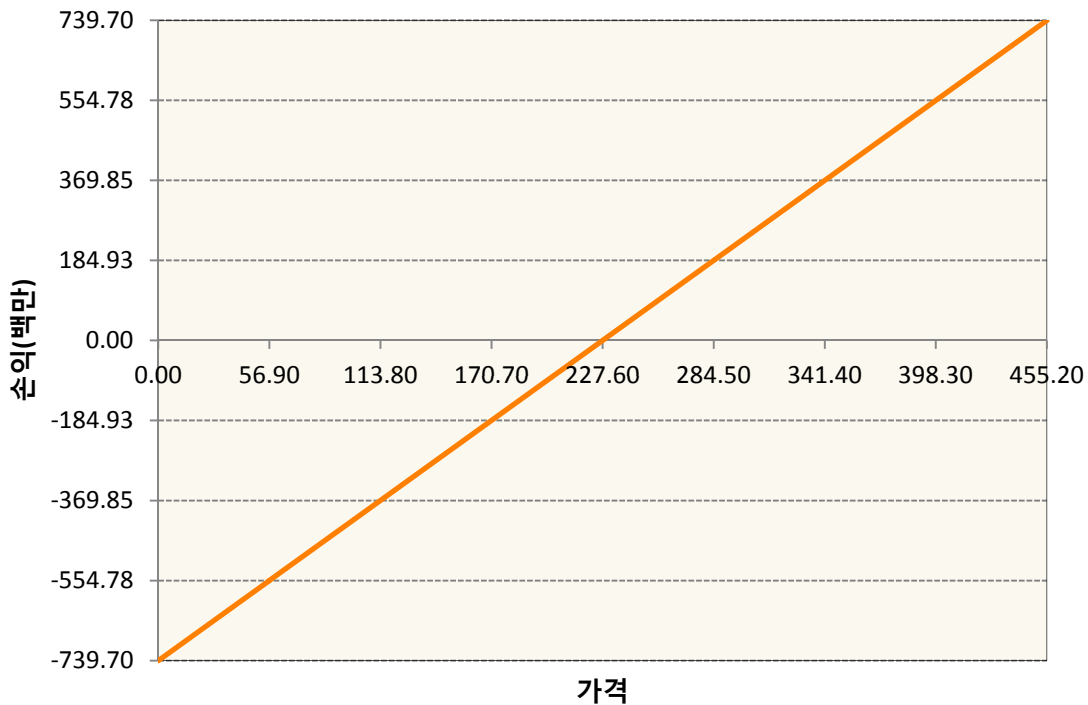
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	740	0	740	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						60
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60	
-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%	60	60	60	60	60	60	60	

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

(단위:백만원)

83

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

(단위:백만원)

122

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

(단위:백만원)

58

공시일	2020-03-27
기준일	2020-03-26

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

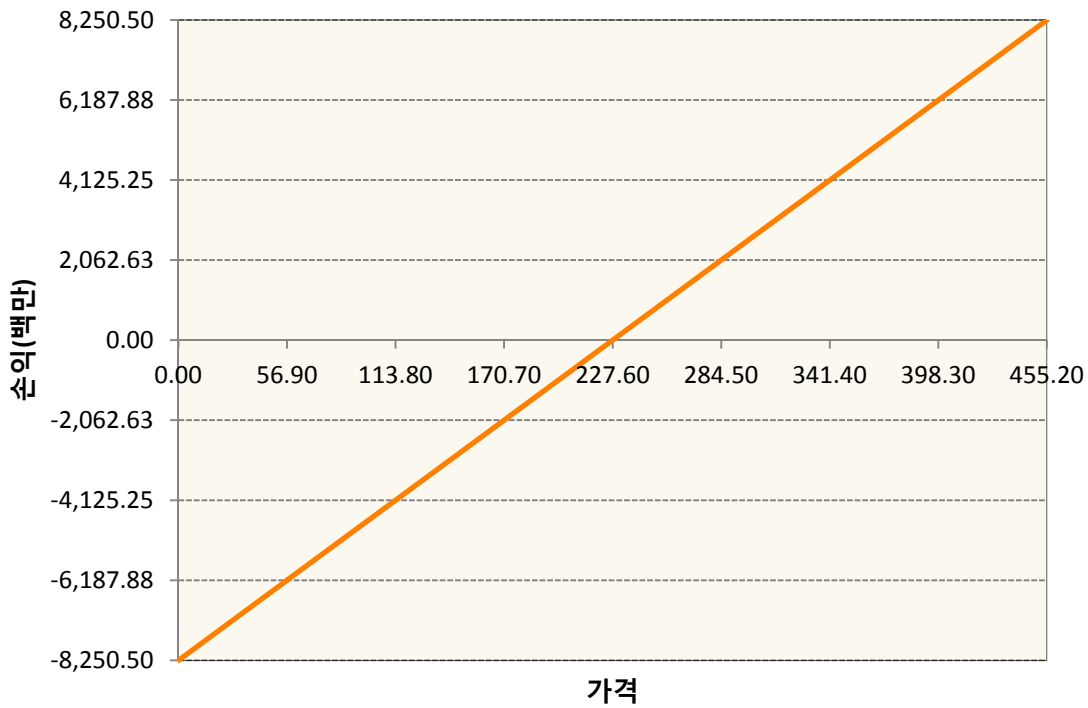
1. 계약금액

(단위:백만원)

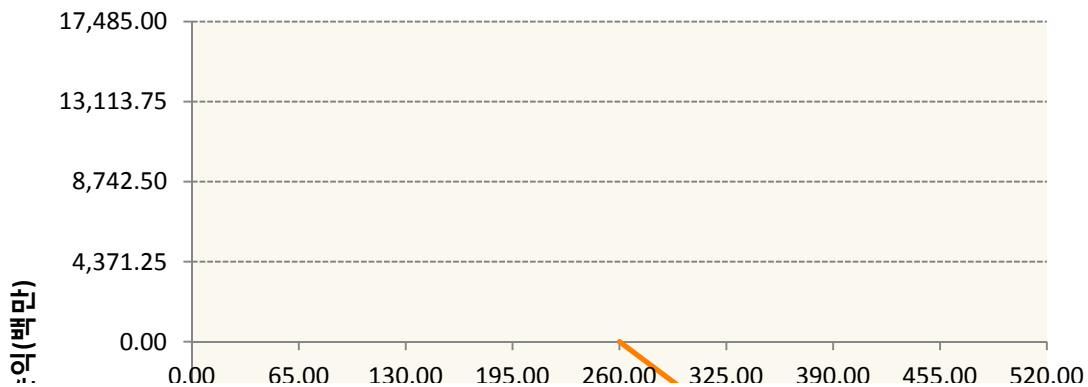
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,251	0	8,251	장내
누계	유가증권	옵션	6,004	17,485	-11,481	장내

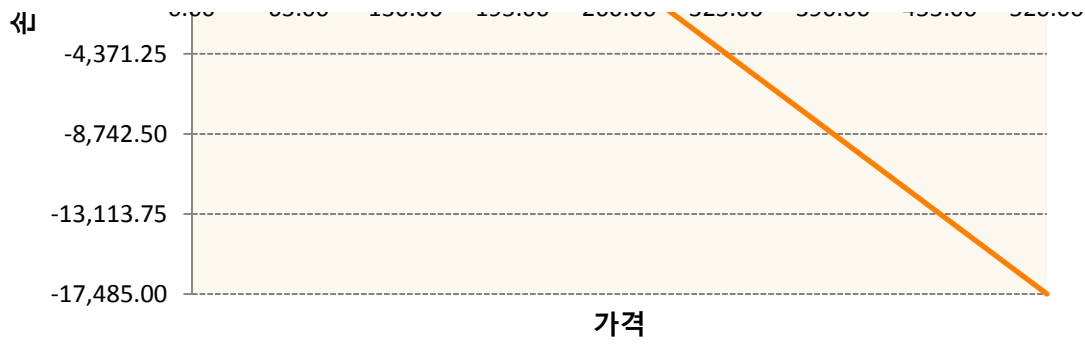
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

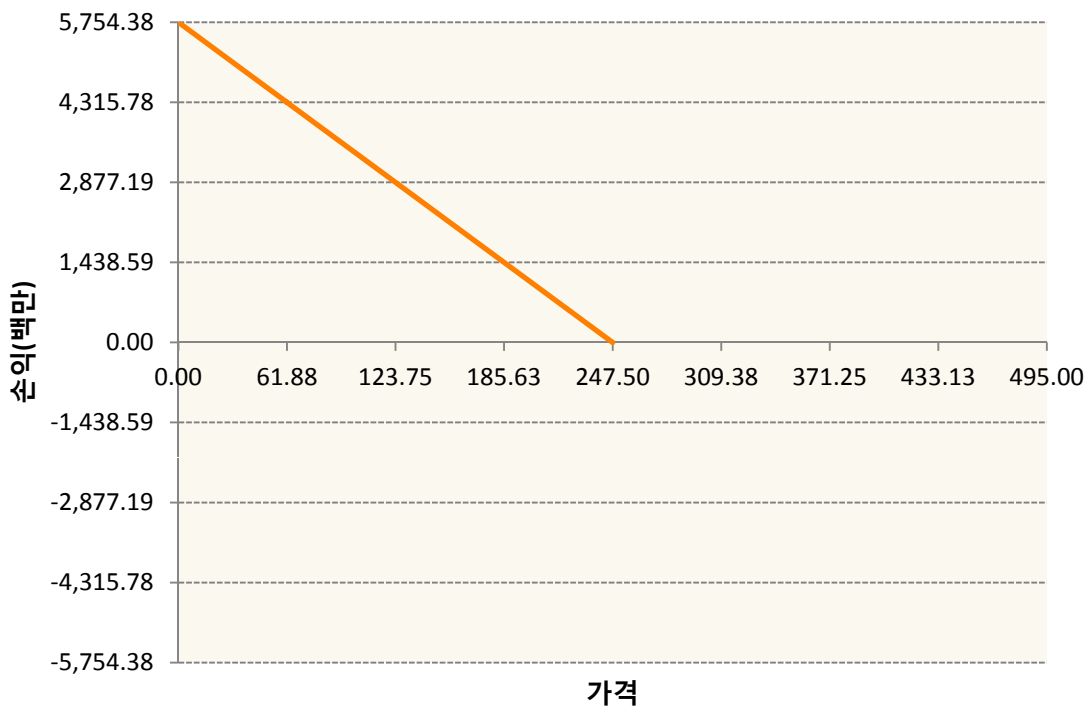


KR4201Q42602-2020-04 콜260

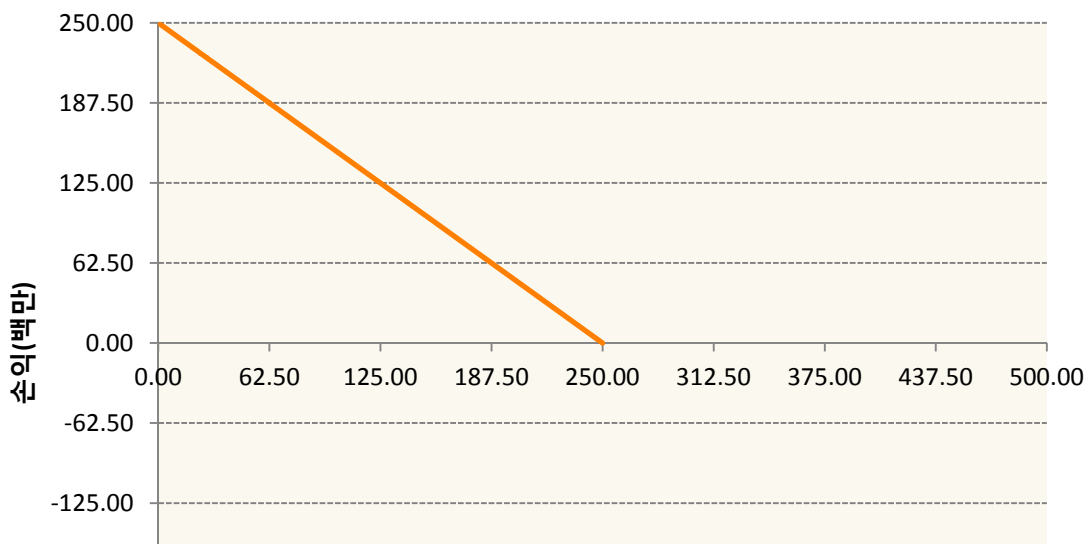


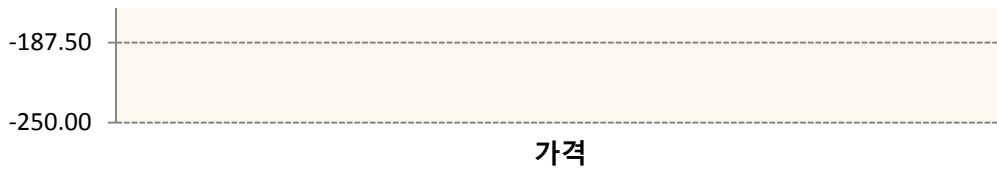


KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



KR4301Q42501-2020-04 풋250





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						665
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-665	-665	-665	-665	-665	-665	-665	
-5.33%	-443	-443	-443	-443	-443	-443	-443	
-2.67%	-222	-222	-222	-222	-222	-222	-222	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	222	222	222	222	222	222	222	
5.33%	443	443	443	443	443	443	443	
8.00%	665	665	665	665	665	665	665	
KR4201Q42602		2020-04 콜260						509
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	146	141	132	119	104	85	62	
-5.33%	139	128	114	95	72	46	16	
-2.67%	124	106	83	56	25	-9	-46	
0%	96	68	36	0	-40	-82	-128	
2.67%	49	10	-33	-79	-127	-178	-231	
5.33%	-26	-76	-128	-183	-240	-298	-357	
8.00%	-134	-194	-255	-318	-381	-445	-509	
KR4301Q42477		2020-04 풋247.5						383
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	345	348	353	359	366	374	383	
-5.33%	209	215	222	231	241	252	264	
-2.67%	78	88	99	111	124	138	152	
0%	-43	-30	-15	0	16	32	49	
2.67%	-152	-135	-118	-100	-81	-63	-44	
5.33%	-246	-227	-207	-187	-167	-147	-127	
8.00%	-324	-303	-282	-261	-241	-220	-199	
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	16	16	16	16	17	
-5.33%	9	10	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	-4	-4	-3	-2
5.33%	-11	-10	-9	-8	-8	-7	-6
8.00%	-15	-14	-13	-12	-11	-10	-9

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

(단위:백만원)

1,564

공시일	2020-03-27
기준일	2020-03-26

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	8,996	-8,996	
누계	유가증권	수익증권	143,220	0	143,220	

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	2020-03-27
기준일	2020-03-26

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	3,014	-3,014	
누계	유가증권	수익증권	96,571	0	96,571	

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	2020-03-27
기준일	2020-03-26

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	2,411	-2,411	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	426,676	0	426,676	
누계	통화	선도	90,611	495,462	-404,852	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020F03! KRW/USD 31-03-20E	3,156
FX21020F04! KRW/USD 31-03-20E	2,959
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,663
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,393
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,972
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,945
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,308
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,972
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	197
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	5,030
FX21020G06 USD/KRW 31-03-20E	493
FX21020H00 USD/KRW 31-03-20E	986
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,466
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,051
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,051
FX21020H04 USD/KRW 21-04-20E	1,479
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,406
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	986
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	986
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,564
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	848
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	740
FX21020H09 USD/KRW 24-04-20E	740
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	493

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

22,462

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

(단위:백만원)

165

공시일	2020-03-27
기준일	2020-03-26

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

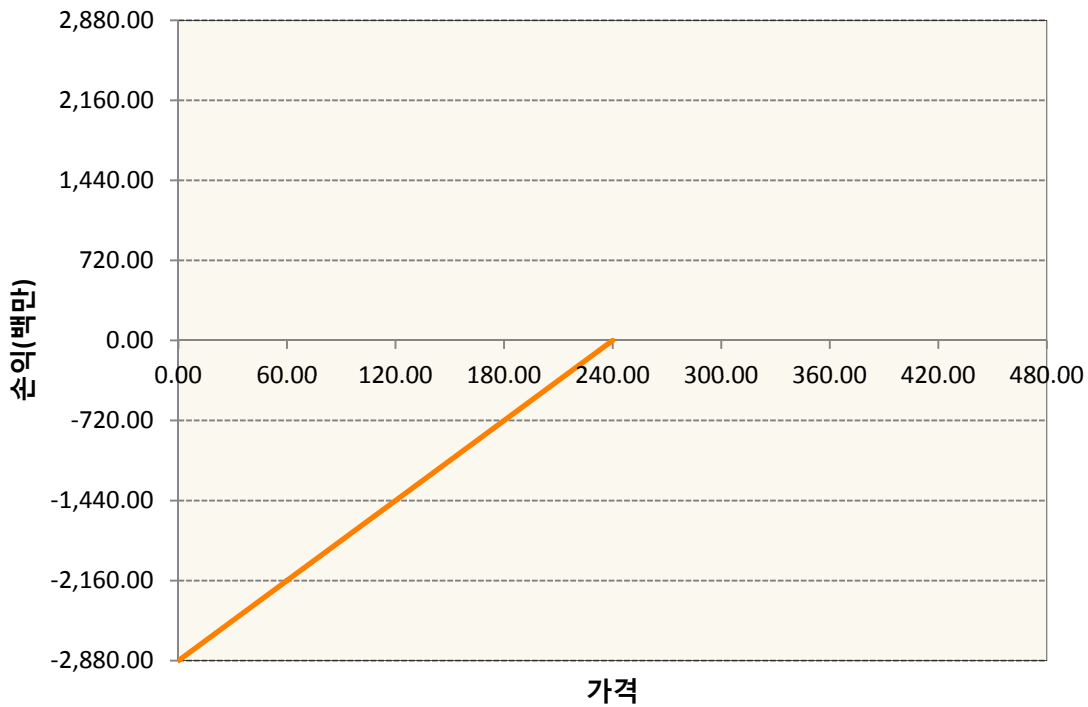
1. 계약금액

(단위:백만원)

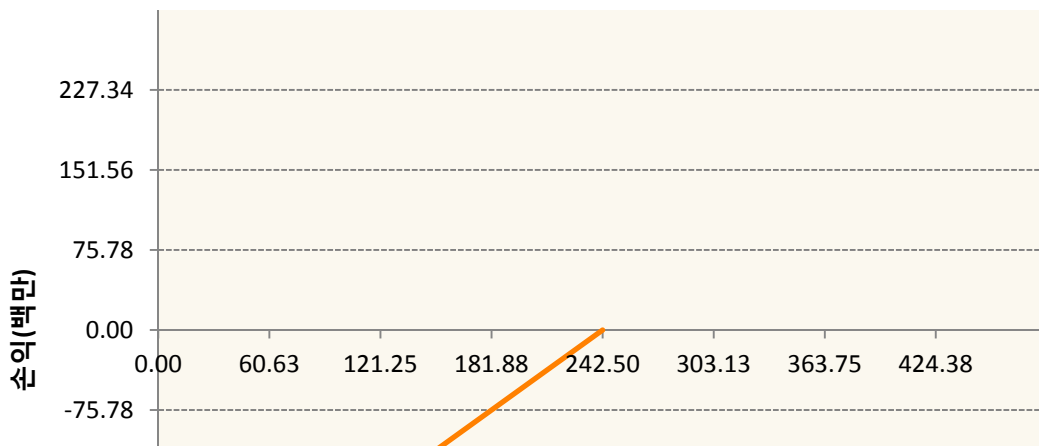
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,183	-3,183	장내

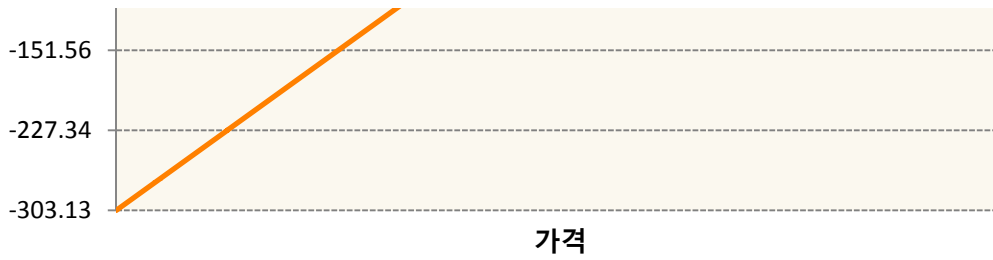
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q42402-2020-04 풋240



KR4301Q42428-2020-04 풋242.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q42402		2020-04 풋240						185
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-157	-160	-164	-169	-174	-179	-185	
-5.33%	-90	-95	-101	-107	-114	-121	-128	
-2.67%	-28	-35	-43	-50	-59	-67	-76	
0%	27	18	9	0	-9	-19	-28	
2.67%	74	64	54	44	34	24	13	
5.33%	112	102	91	81	70	60	49	
8.00%	141	131	121	111	101	91	80	
KR4301Q42428		2020-04 풋242.5						20
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-17	-17	-18	-18	-19	-19	-20	
-5.33%	-10	-10	-11	-12	-12	-13	-14	
-2.67%	-3	-4	-5	-6	-6	-7	-8	
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3	
2.67%	8	7	6	5	4	3	2	
5.33%	12	11	10	9	8	7	6	
8.00%	16	15	13	12	11	10	9	

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

190

공시일	2020-03-27
기준일	2020-03-26

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	7,033	0	7,033	
누계	통화	선도	2,675	9,554	-6,879	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	186
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	220
FX21020H01 USD/KRW 31-03-20E	50
FX21020H02 KRW/USD 13-04-20E	358
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
FX21020H10 USD/KRW 13-04-20E	36

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

469

공시일	2020-03-27
기준일	2020-03-26

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

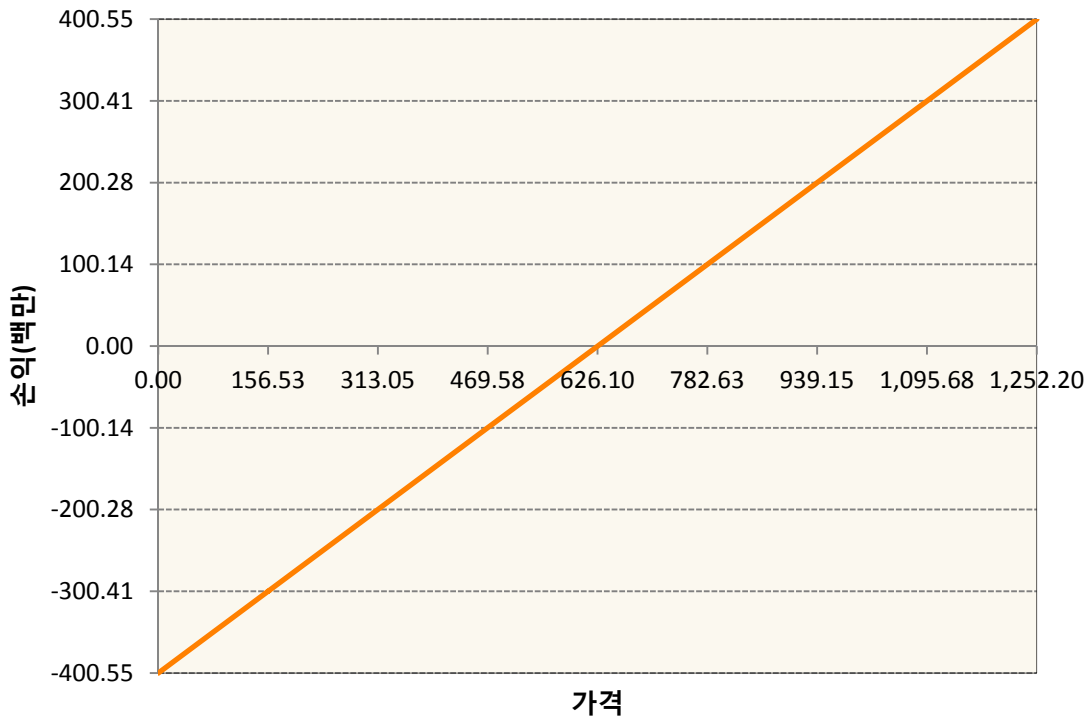
1. 계약금액

(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	401	0	401	
누계	유가증권	스왑	1,110	0	1,110	장외
누계	통화	선도	571	740	-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	32

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

(단위:백만원)

157

공시일	2020-03-27
기준일	2020-03-26

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

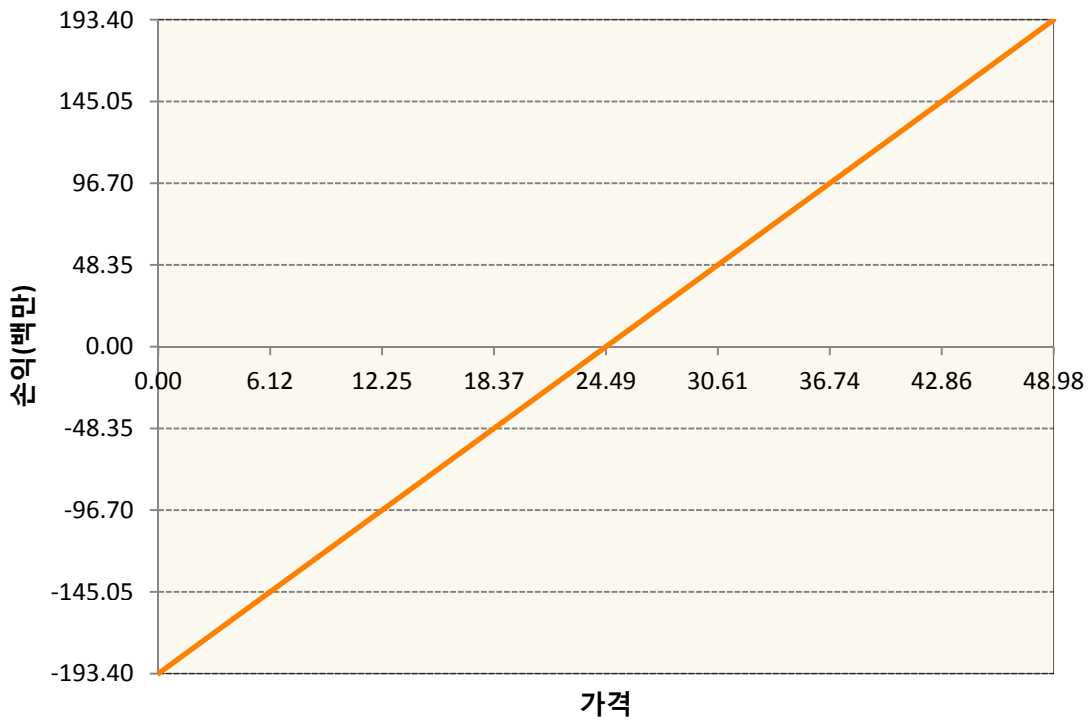
1. 계약금액

(단위:백만원)

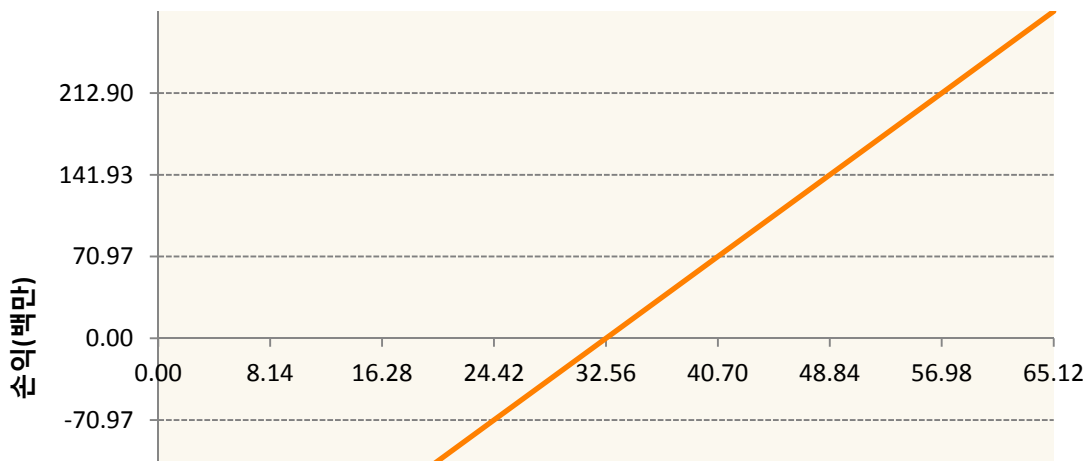
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,292	123	1,169	

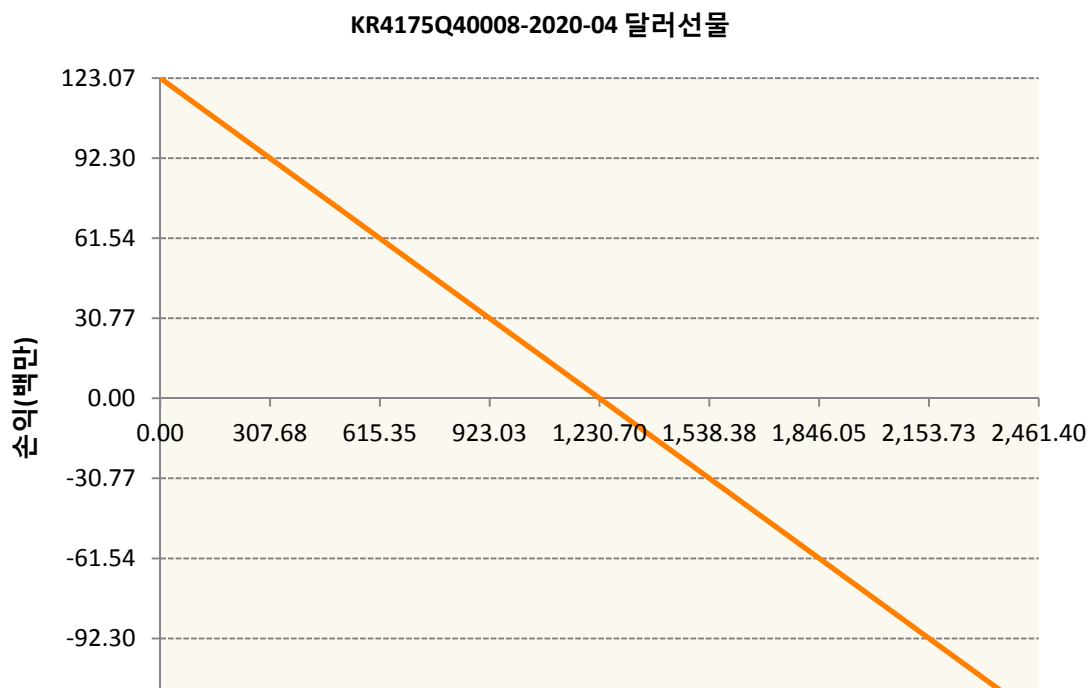
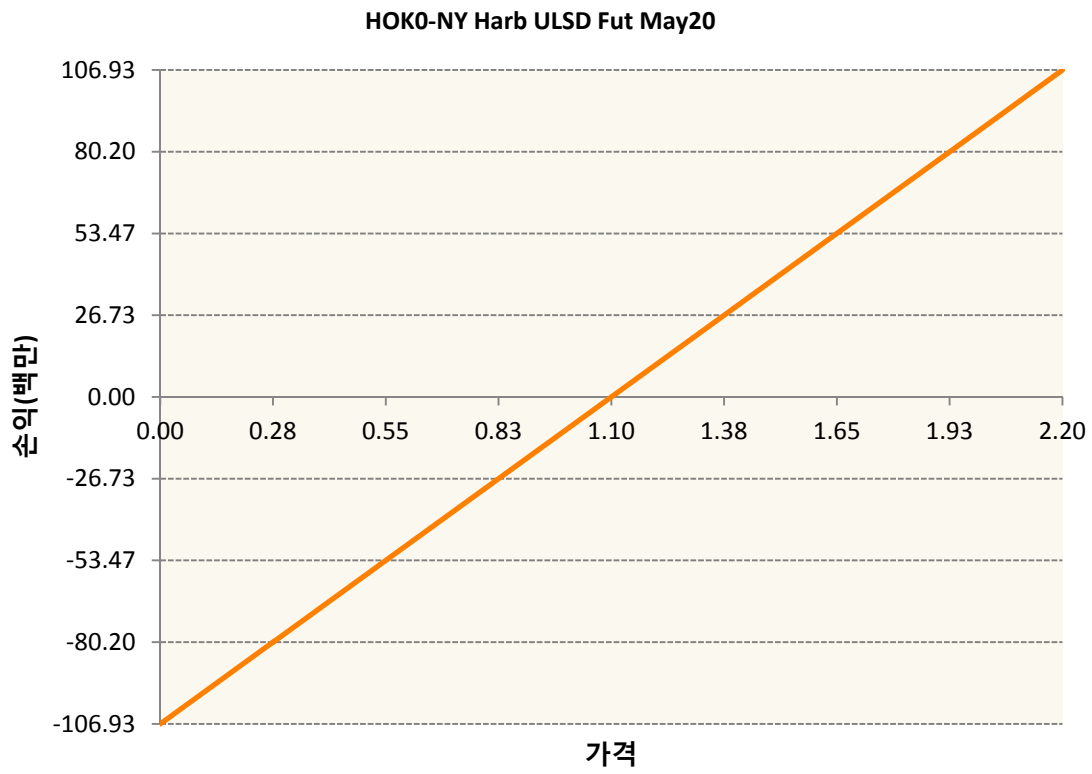
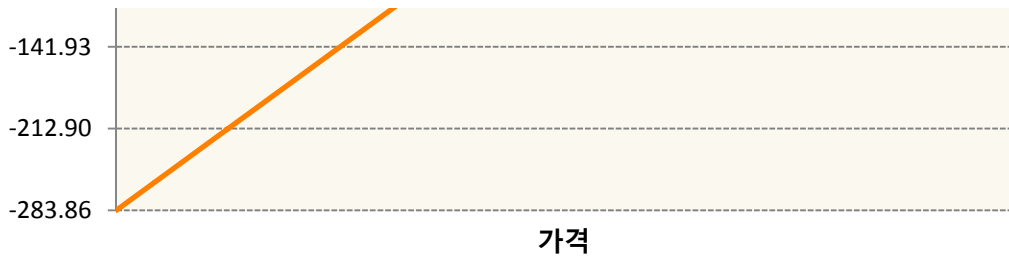
2. 만기시점의 손익구조

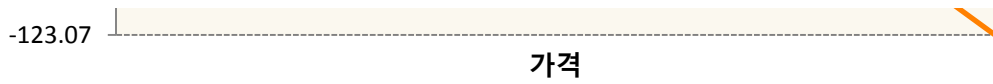
CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20



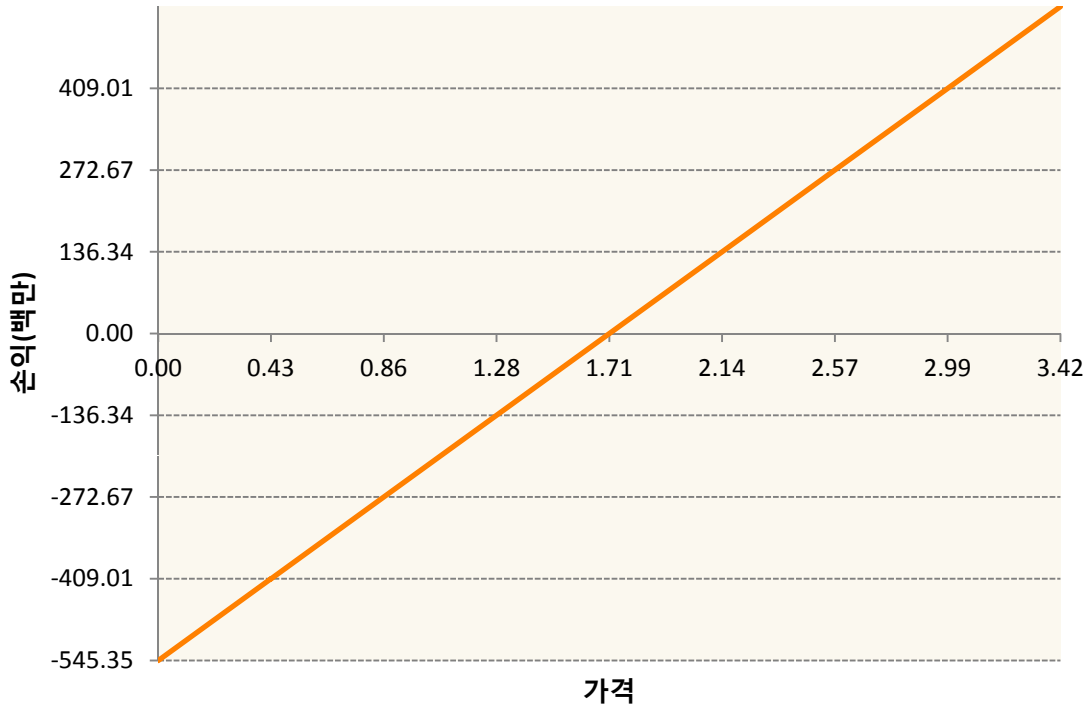
CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20



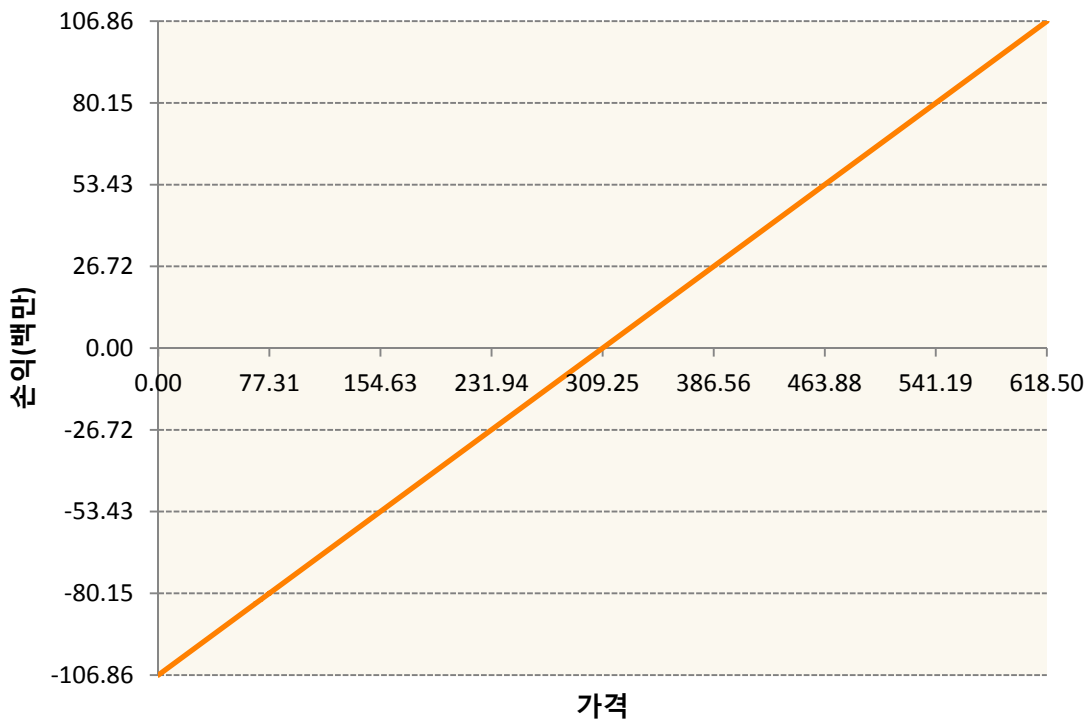




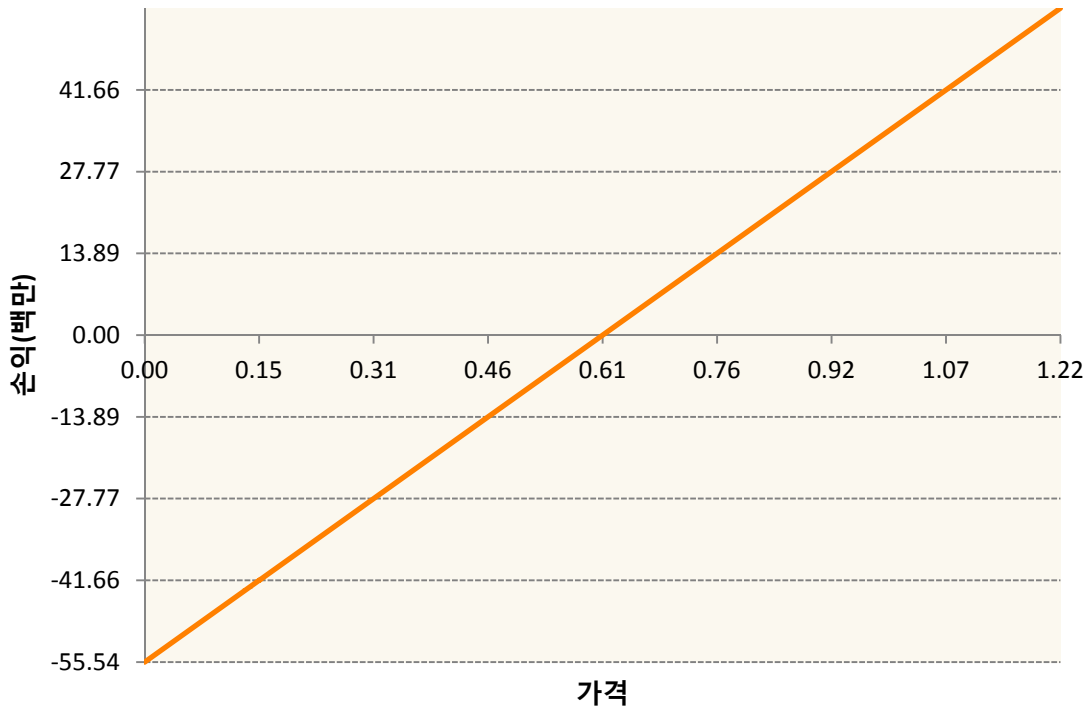
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



QSK0-Low Su Gasoil G Mar20



XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	15
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	23
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	9
KR4175Q40C	2020-04 달러선물	10
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	44
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	9
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	4

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

(단위:백만원)

285

공시일	2020-03-27
기준일	2020-03-26

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

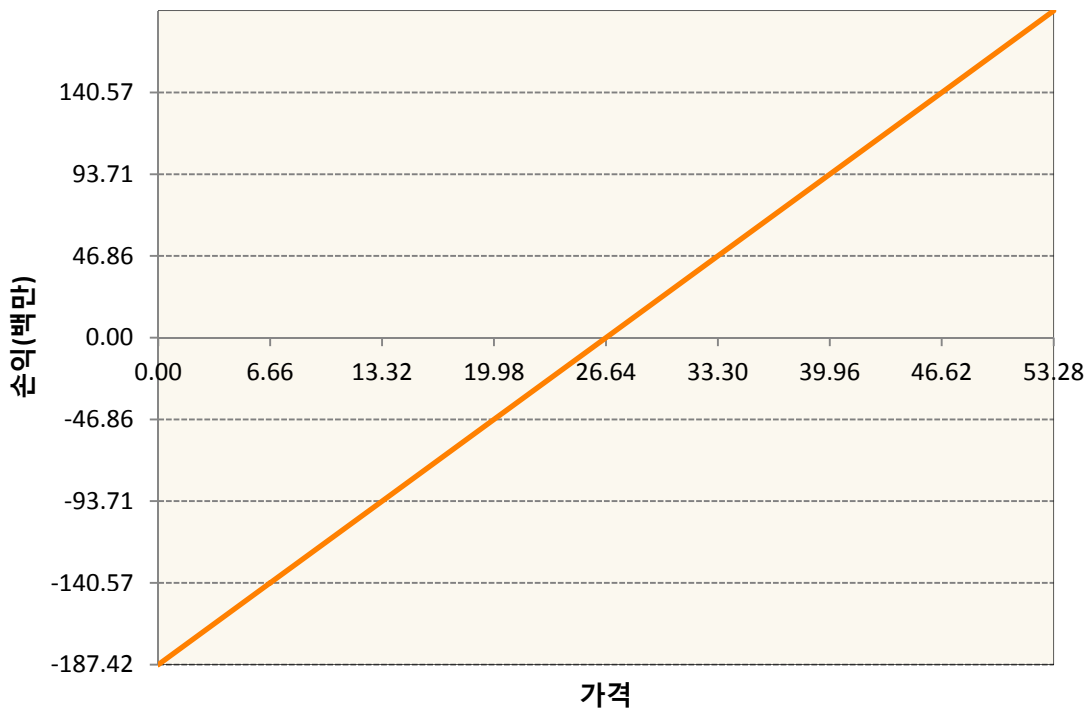
1. 계약금액

(단위:백만원)

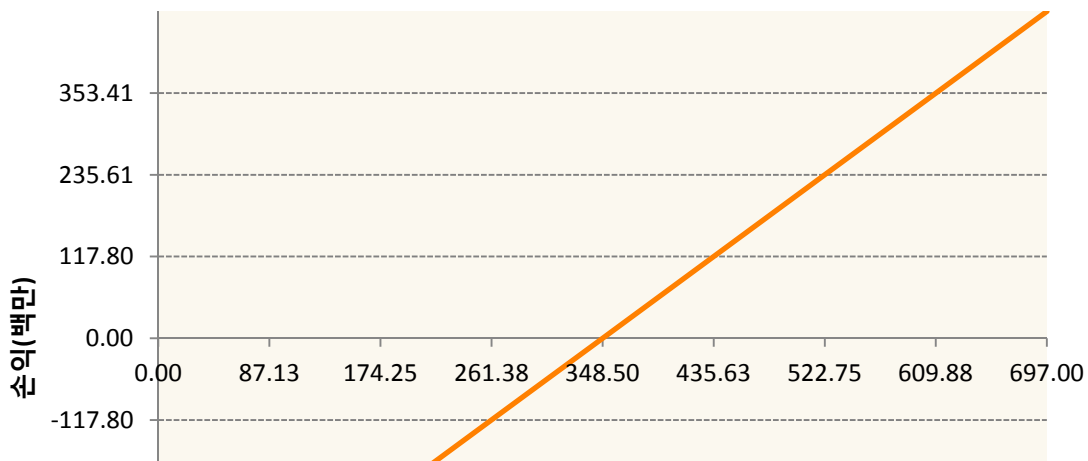
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,405	98	2,306	

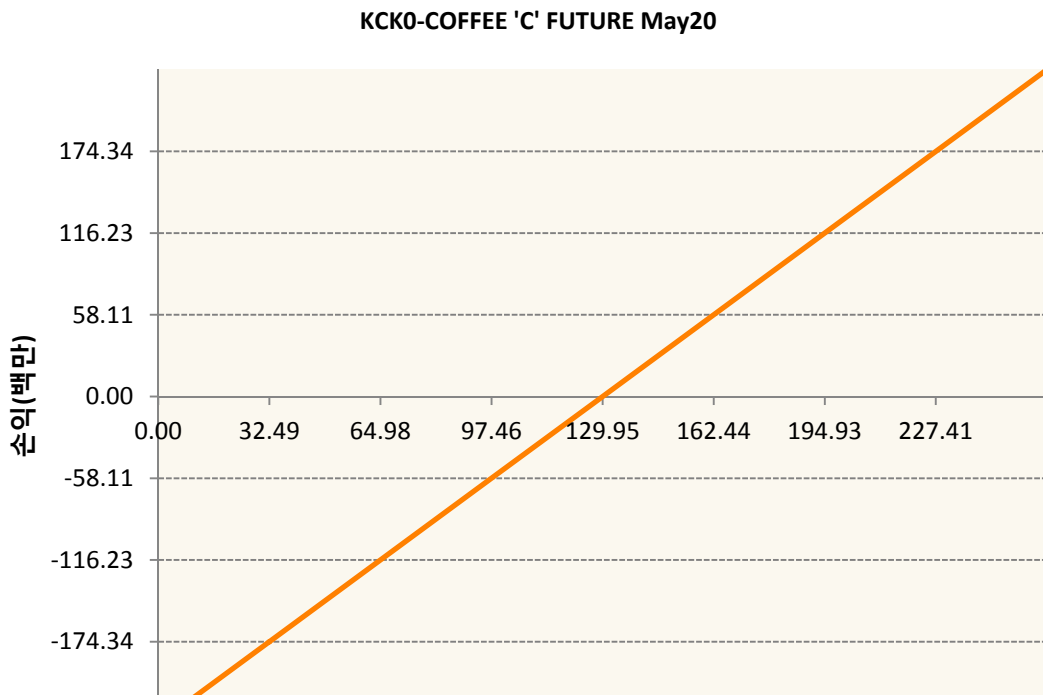
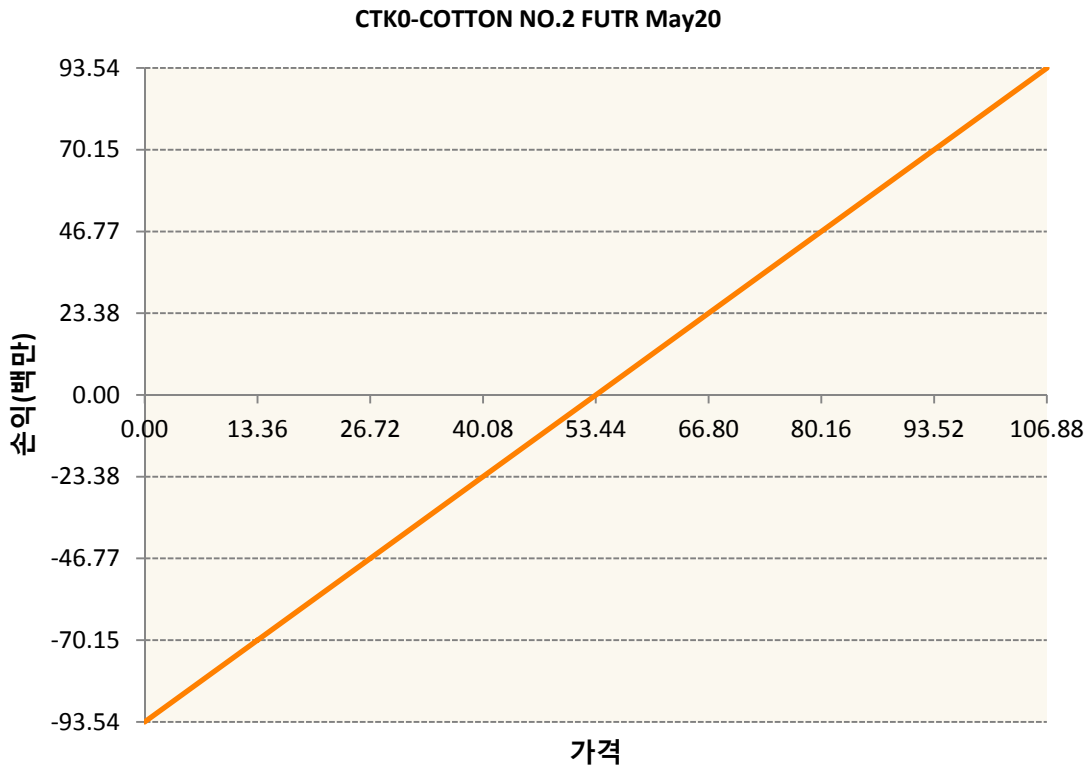
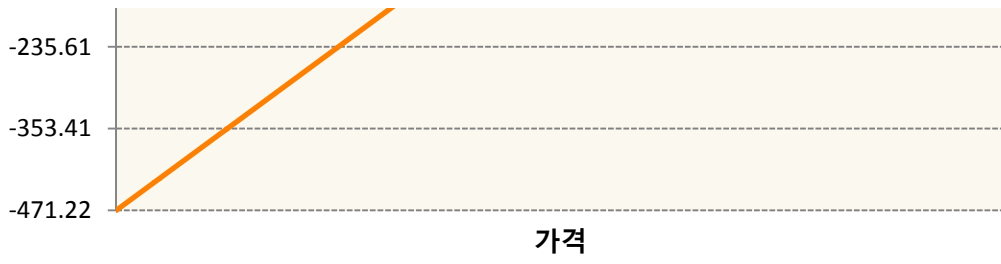
2. 만기시점의 손익구조

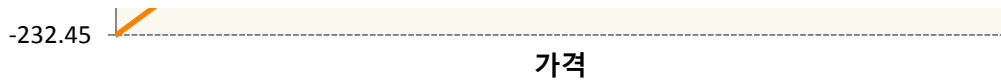
BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20



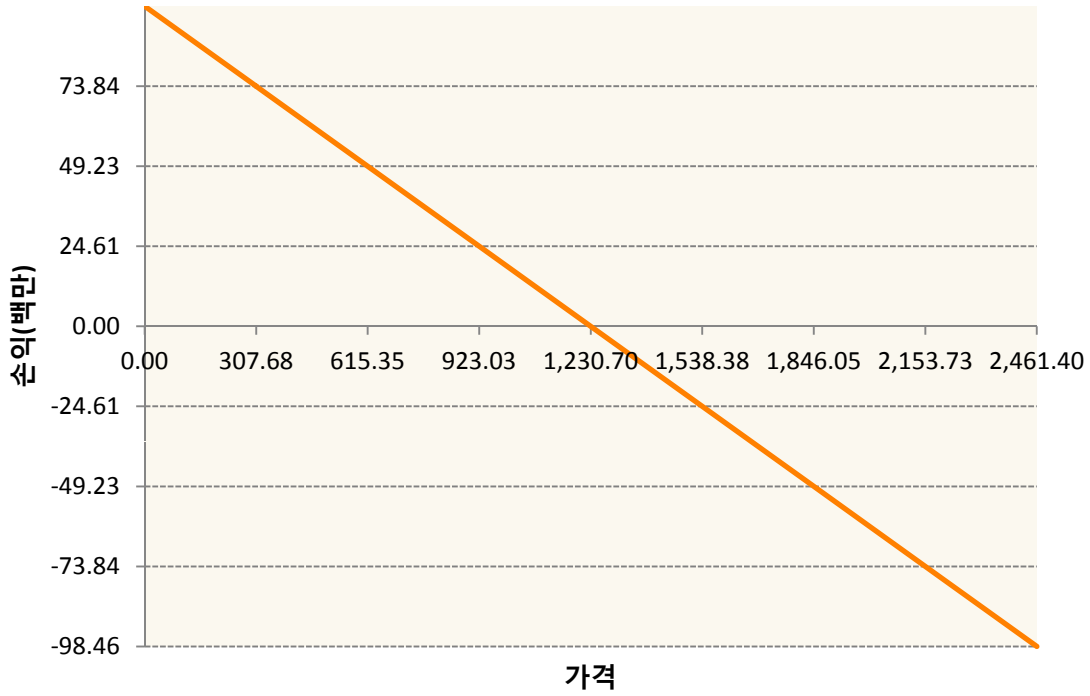
CK0-CORN FUTURE May20



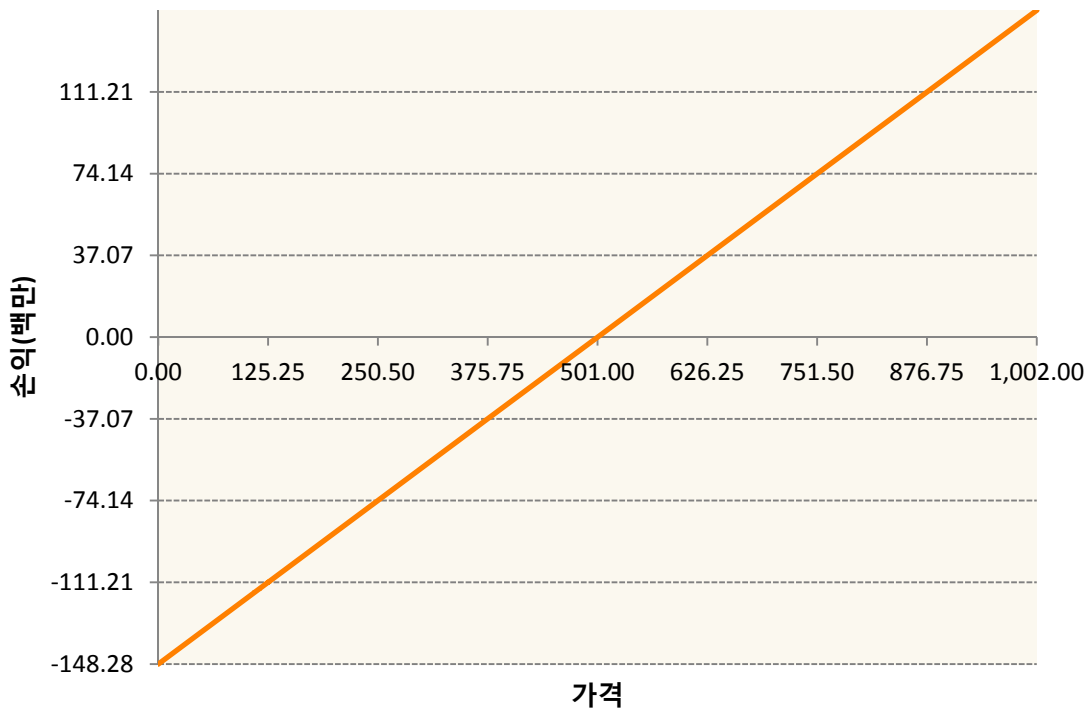




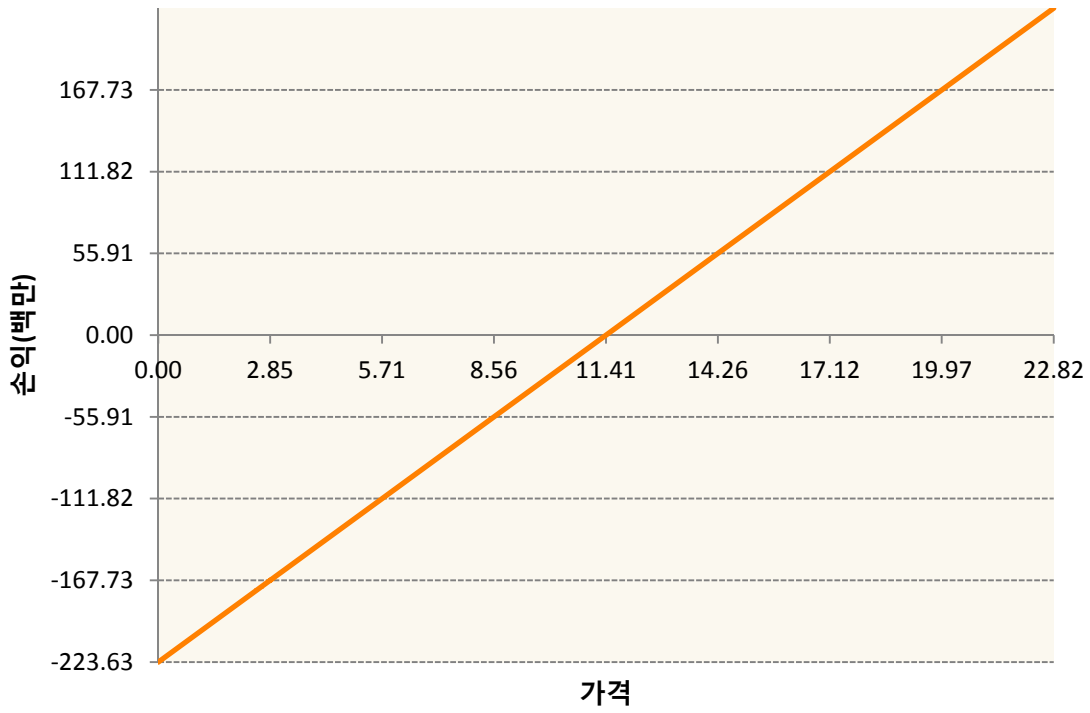
KR4175Q40008-2020-04 달러선물



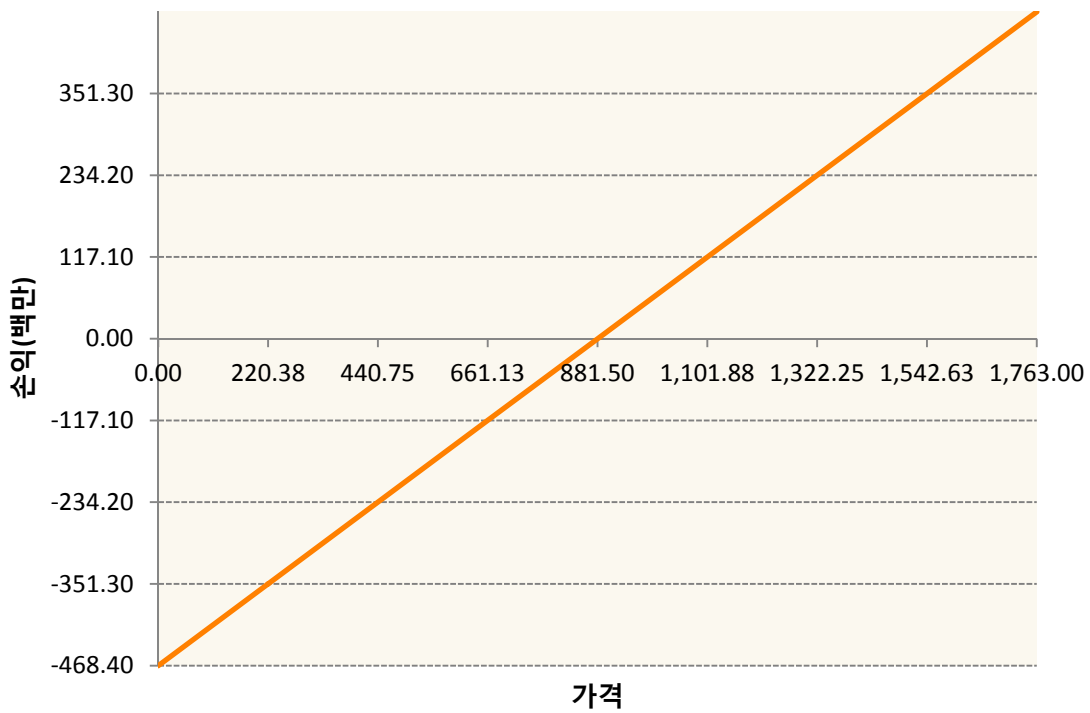
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



SBK0-Sugar May20

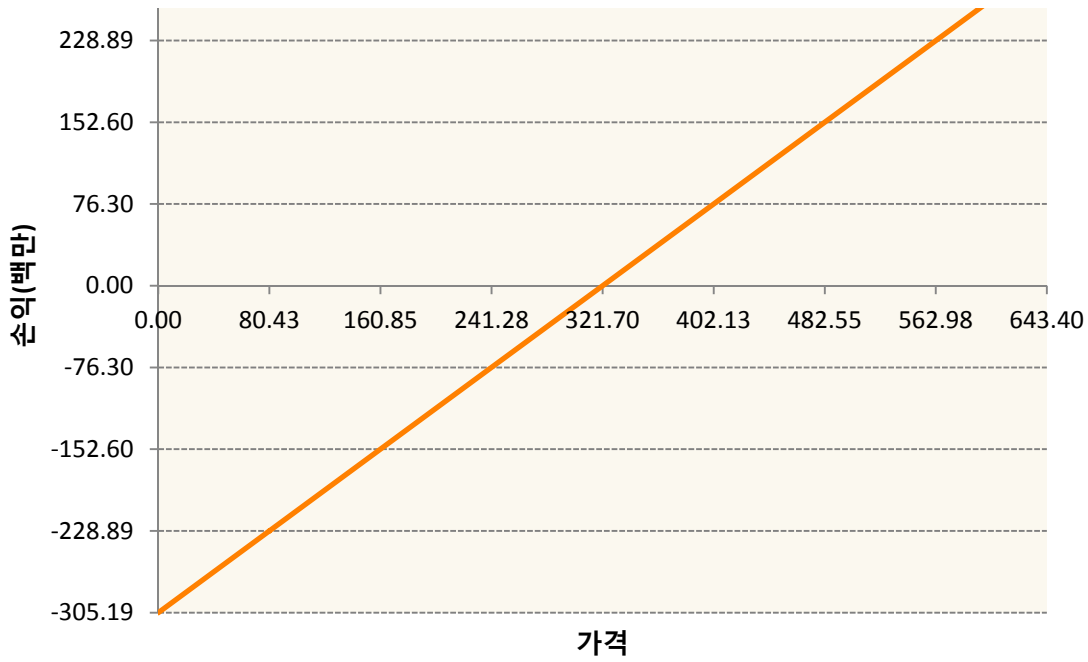


SK0-SOYBEAN FUTURE May20

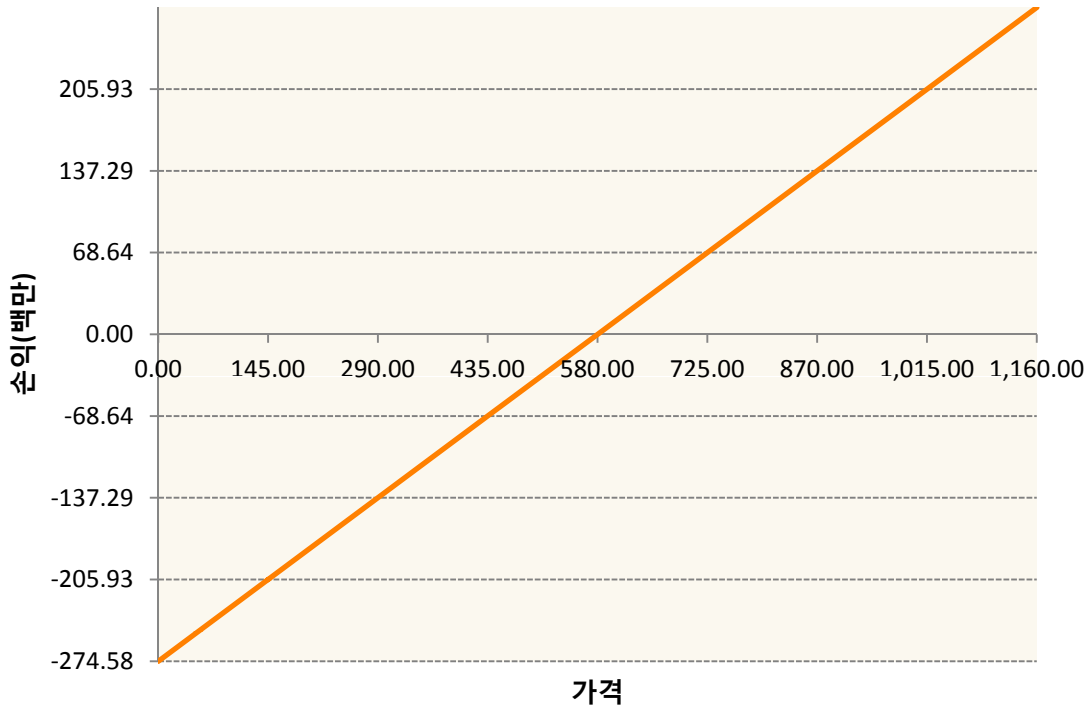


SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





WK0-WHEAT FUTURE(CBT) 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	19
KR4175Q40C	2020-04 달러선물	8

KWK0	KC HRW WHEAT FUT May20	12
SBK0	Sugar May20	18
SK0	SOYBEAN FUTURE May20	37
SMK0	SOYBEAN MEAL FUTR May20	24
WK0	WHEAT FUTURE(CBT) May20	22

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

(단위:백만원)

224