

공시일	2020-03-30
기준일	2020-03-27

## 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	2020-03-30
기준일	2020-03-27

## 스마트인덱스모

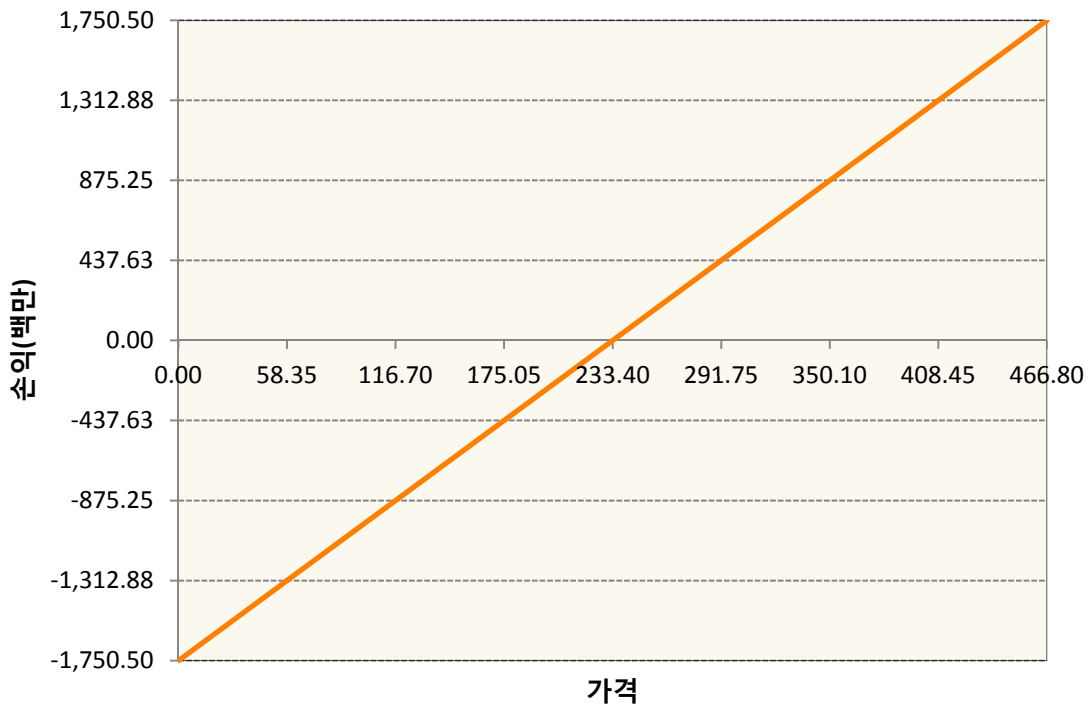
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

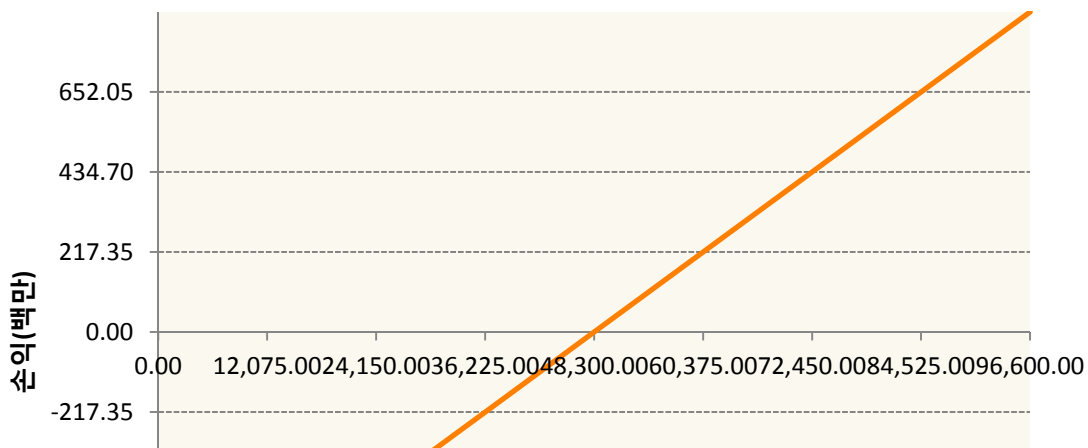
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,620	0	2,620	장내

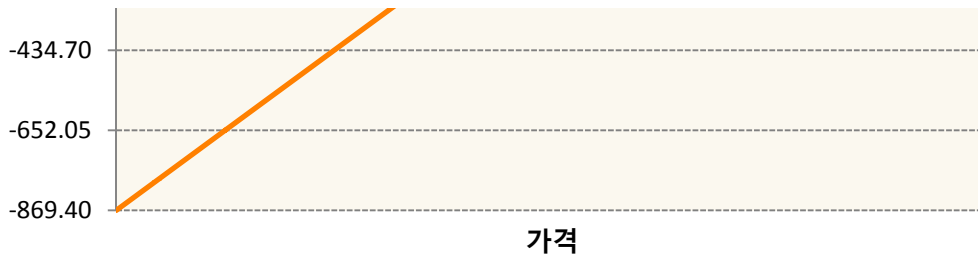
### 2. 만기시점의 손익구조

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%	-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%	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%	-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%	70	70	70	70	70	70	70	

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

297

공시일	2020-03-30
기준일	2020-03-27

## 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

904

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

997

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-30
기준일	2020-03-27

## 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

530
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

842
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-30
기준일	2020-03-27

## 유로인덱스모(주식-파생형)

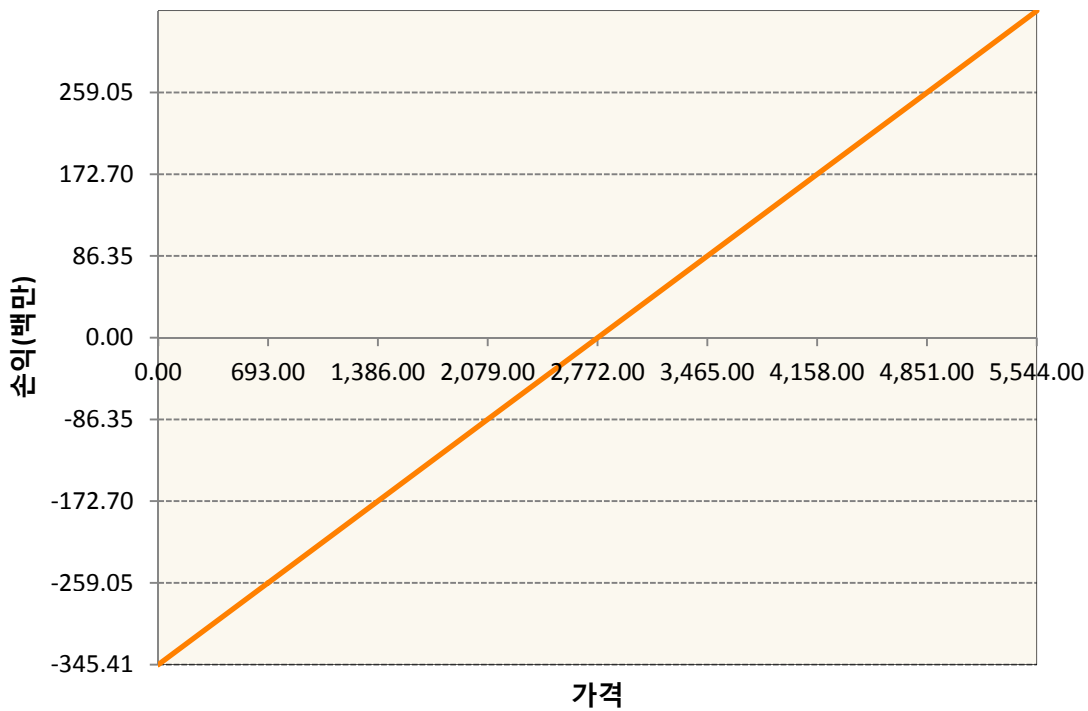
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	345	0	345	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	28
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

33
----

공시일	2020-03-30
기준일	2020-03-27

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

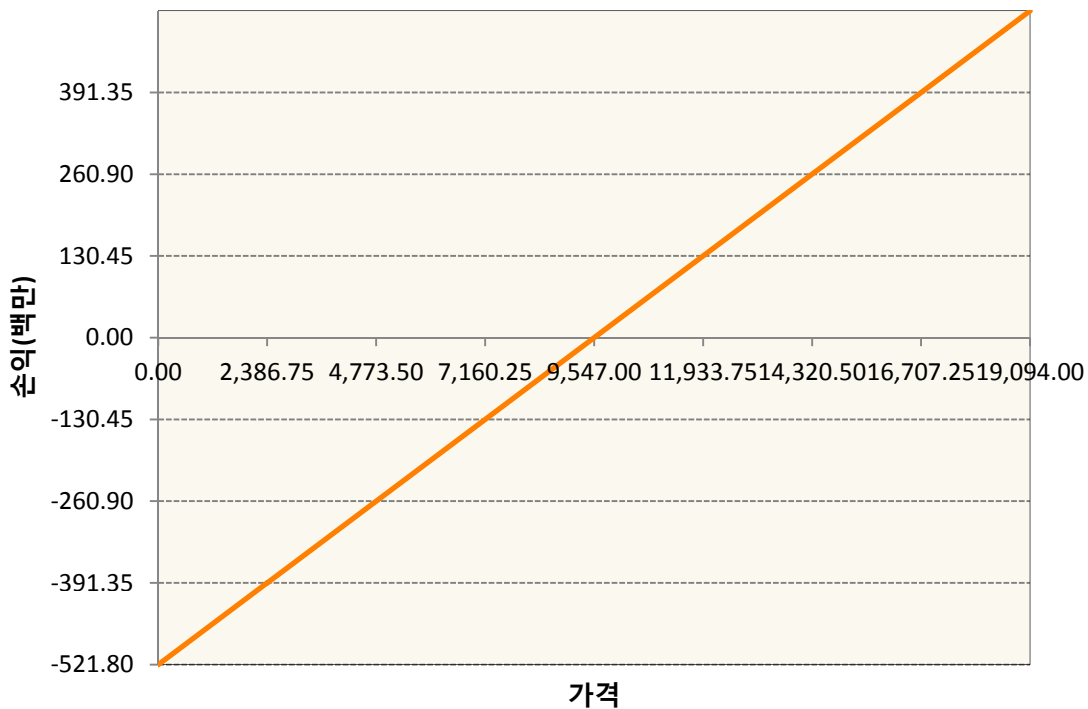
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	522	0	522	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCJ0-HSCEI Futures Apr20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ0	HSCEI Futures Apr20	42
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

44
----

공시일	2020-03-30
기준일	2020-03-27

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

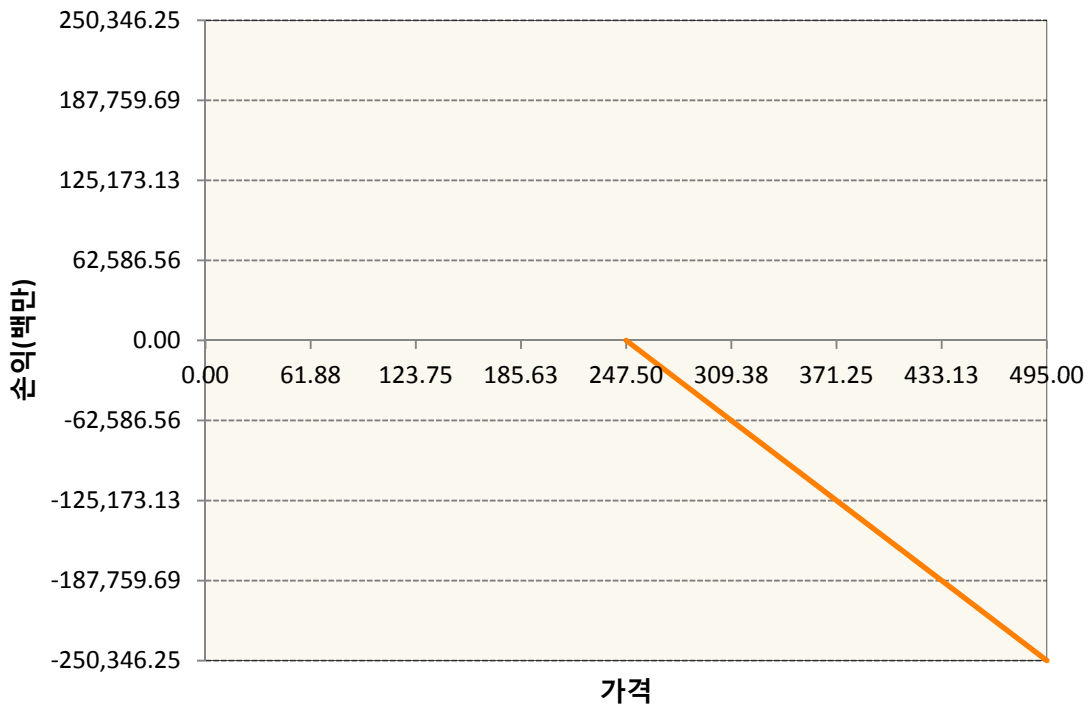
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

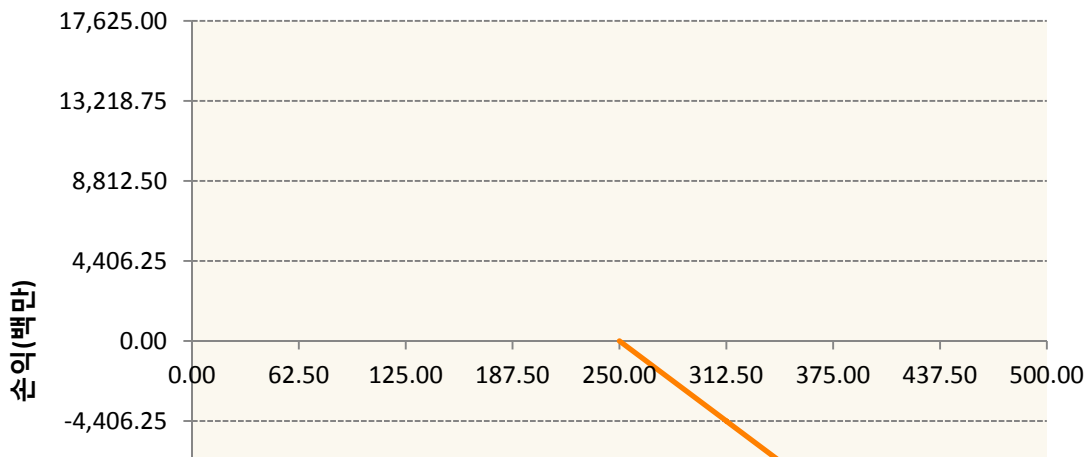
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	360,660	-360,660	장내

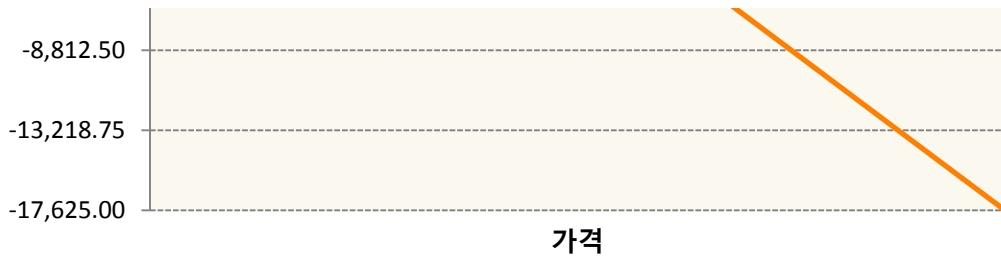
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

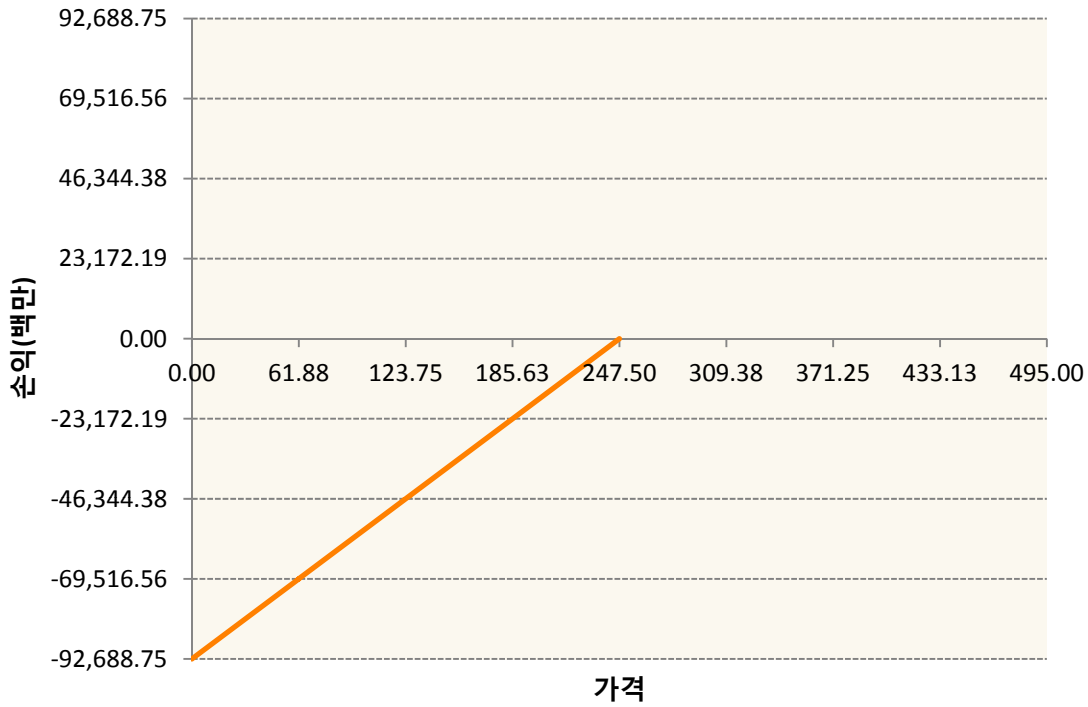


KR4201Q42503-2020-04 콜250





KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q42479		2020-04 콜247.5					11,766
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,480	5,164	4,779	4,333	3,833	3,287	2,700
-5.33%	4,918	4,442	3,902	3,310	2,673	1,998	1,293
-2.67%	3,973	3,322	2,623	1,886	1,118	326	-487
0%	2,518	1,704	862	0	-879	-1,770	-2,672
2.67%	445	-492	-1,439	-2,392	-3,351	-4,313	-5,278
5.33%	-2,311	-3,311	-4,312	-5,312	-6,312	-7,312	-8,312
8.00%	-5,764	-6,758	-7,756	-8,756	-9,758	-10,761	-11,766
KR4201Q42503		2020-04 콜250					780
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	341	322	298	270	239	203	165

-5.33%	309	280	246	208	166	122	75
-2.67%	254	213	167	119	68	15	-39
0%	167	113	58	0	-59	-119	-181
2.67%	39	-24	-88	-153	-219	-285	-351
5.33%	-134	-203	-273	-342	-412	-481	-551
8.00%	-355	-426	-497	-568	-639	-709	-780
KR4301Q42477                      2020-04 풋247.5							6,047
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,214	-5,302	-5,413	-5,545	-5,696	-5,864	-6,047
-5.33%	-3,046	-3,188	-3,353	-3,538	-3,739	-3,954	-4,181
-2.67%	-1,012	-1,218	-1,442	-1,680	-1,930	-2,190	-2,458
0%	832	565	286	0	-293	-591	-893
2.67%	2,436	2,121	1,802	1,480	1,156	831	504
5.33%	3,768	3,429	3,089	2,749	2,409	2,069	1,729
8.00%	4,820	4,483	4,145	3,806	3,466	3,126	2,785

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

(단위:백만원)

**14,932**

공시일	2020-03-30
기준일	2020-03-27

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

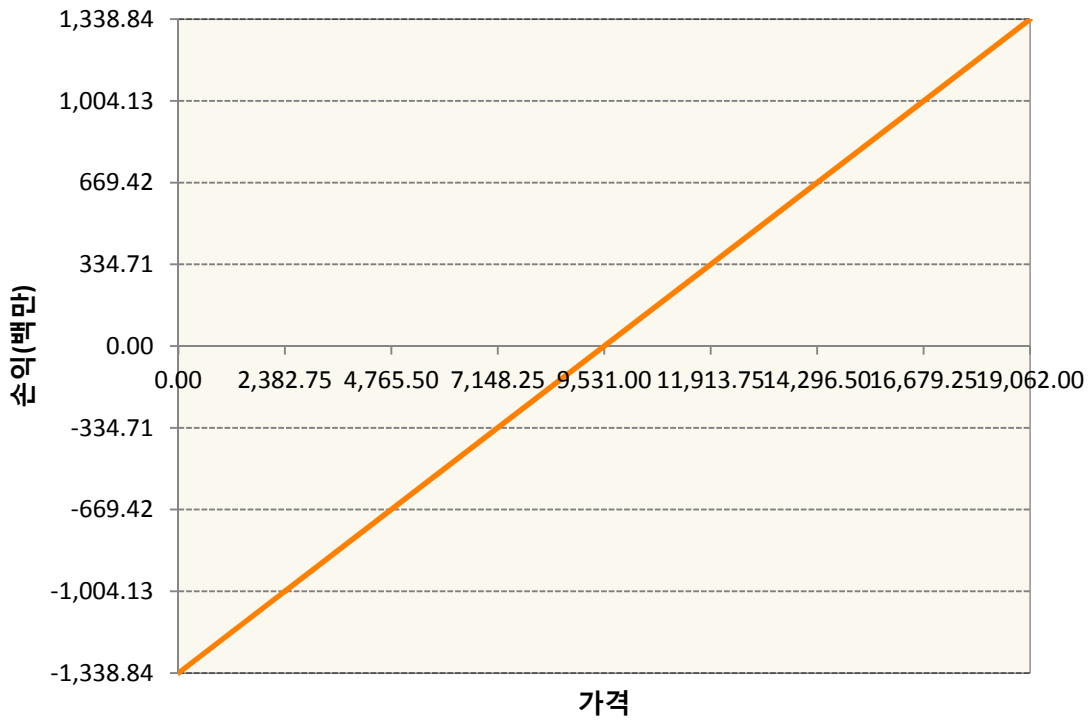
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

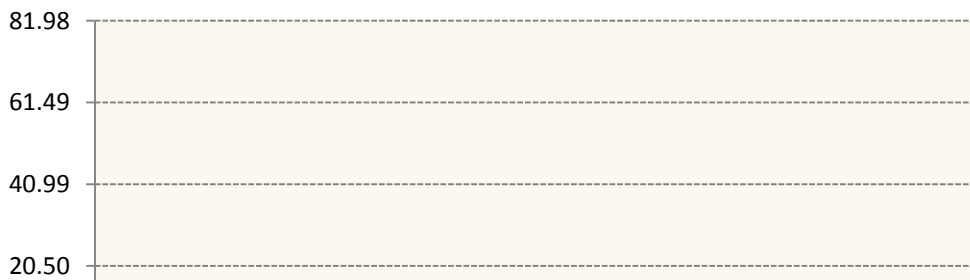
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,339	0	1,339	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,468	-4,468	장내
누계	통화	선도	687	2,199	-1,512	장외

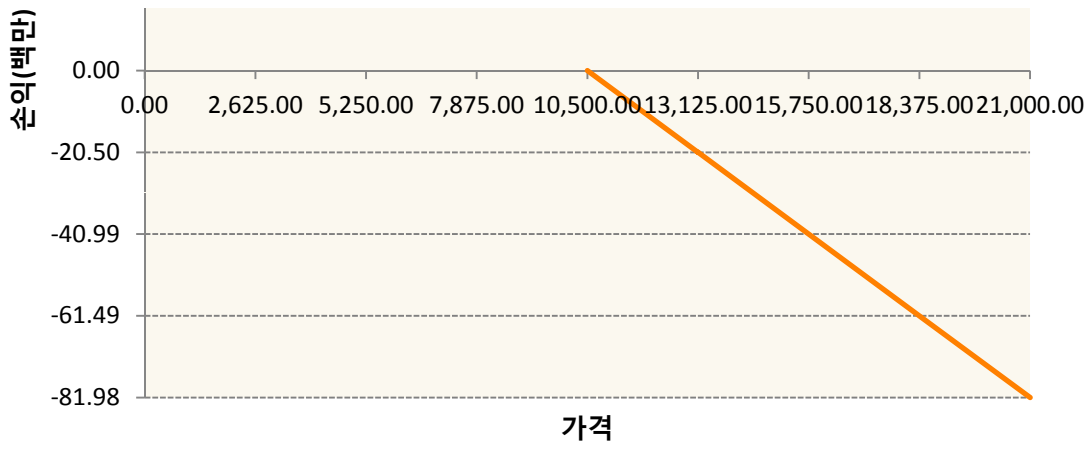
### 2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20

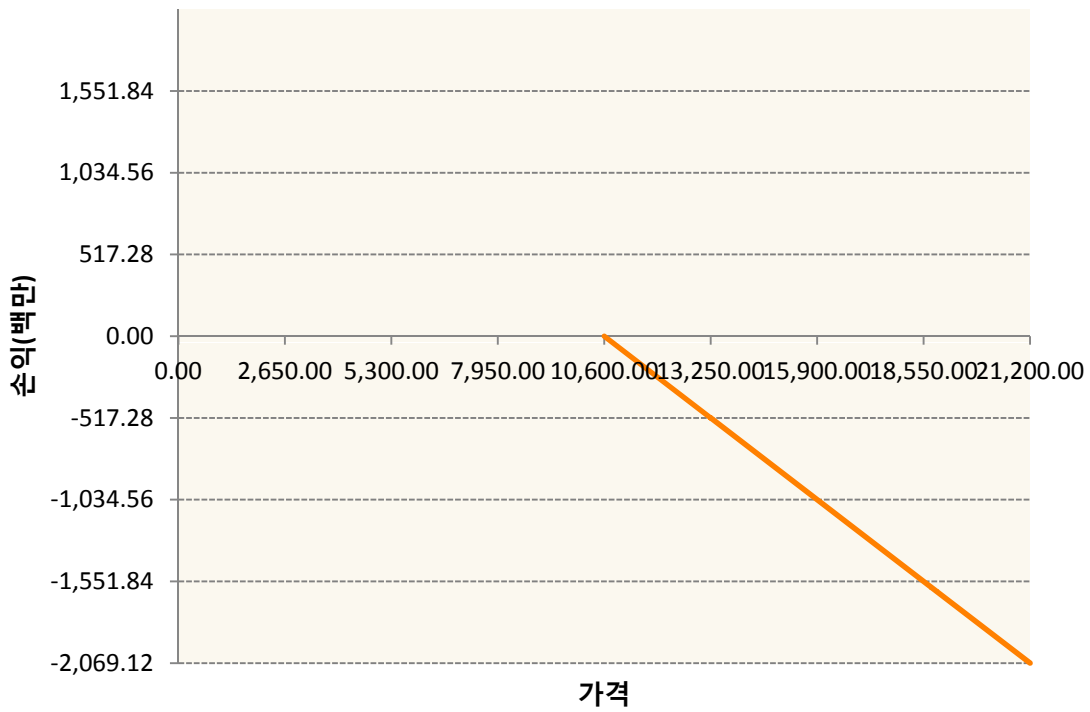


OHHIH0-C105-HSCEI

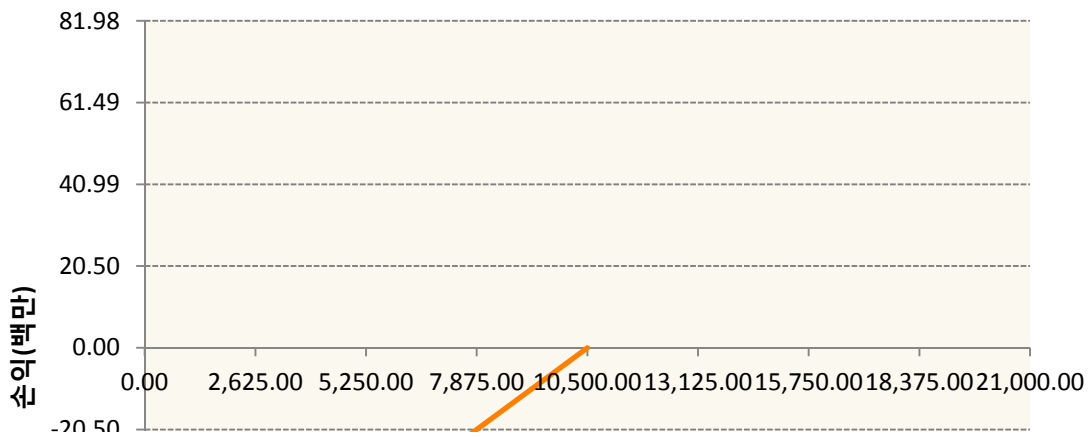


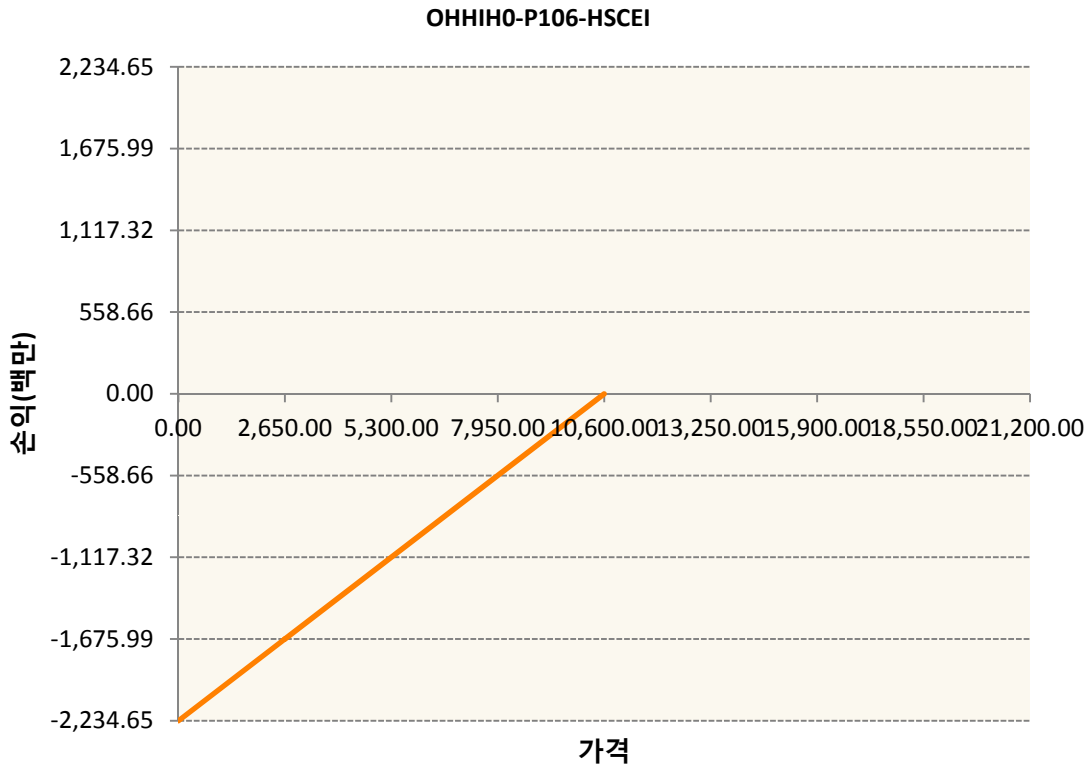
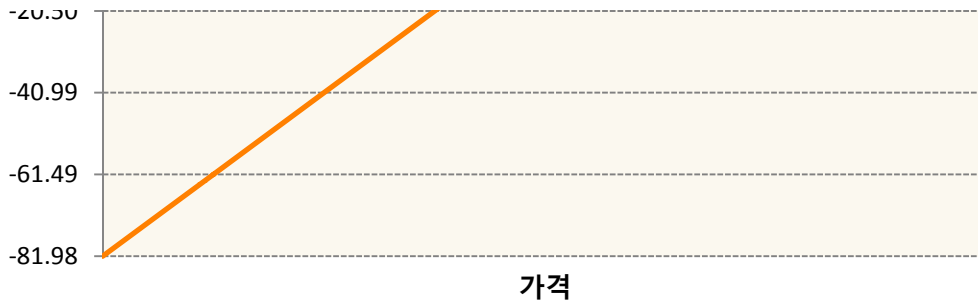


OHHIH0-C106-HSCEI



OHHIH0-P105-HSCEI





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

FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E	176
FX21020H05 HKD/KRW 22-05-20E	55
HCH0 HSCEI Futures Mar20	107
OHHIH0-C1(HSCEI	7
OHHIH0-C1(HSCEI	166
OHHIH0-P1(HSCEI	7
OHHIH0-P1(HSCEI	179

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

<b>602</b>
------------

공시일	2020-03-30
기준일	2020-03-27

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

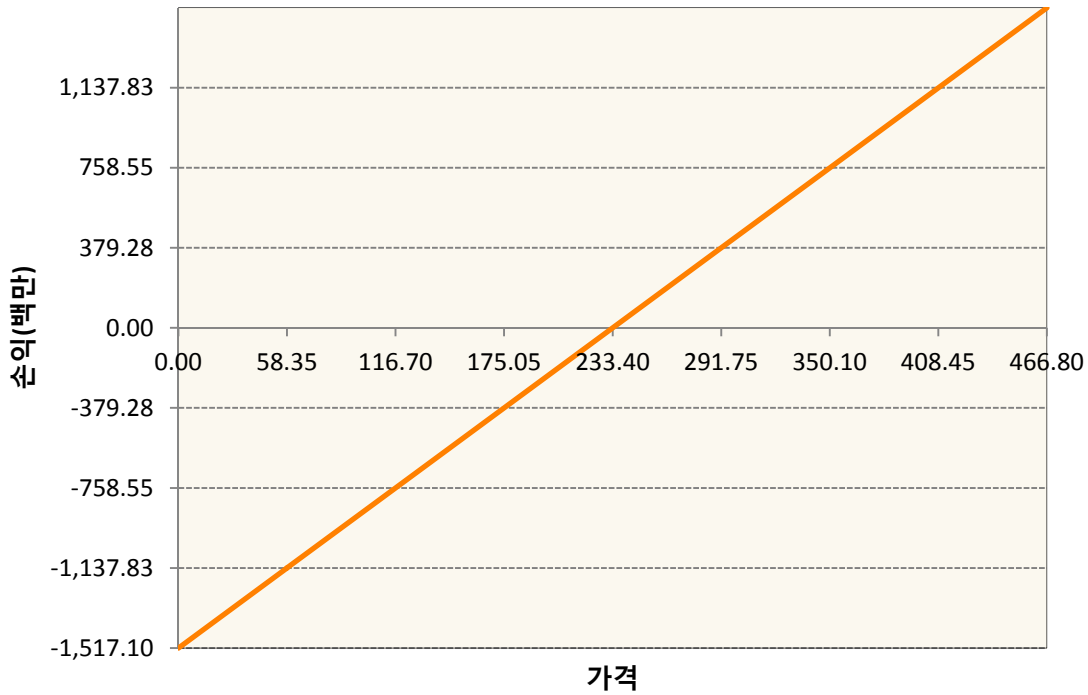
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

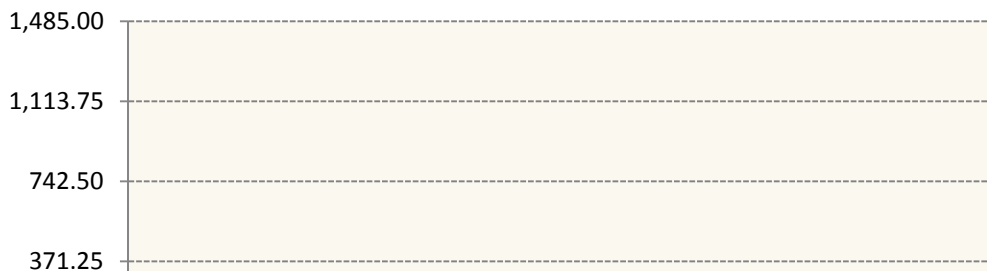
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,517	0	1,517	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,095	-3,095	장내

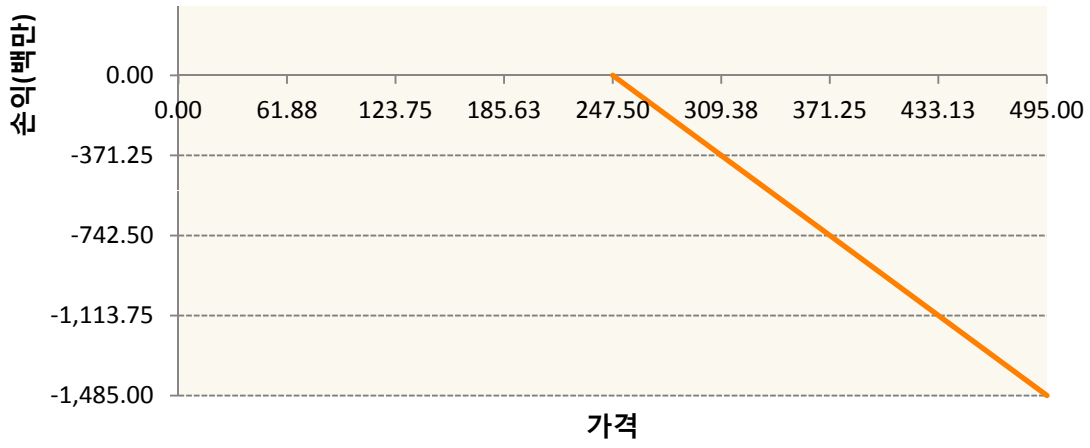
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

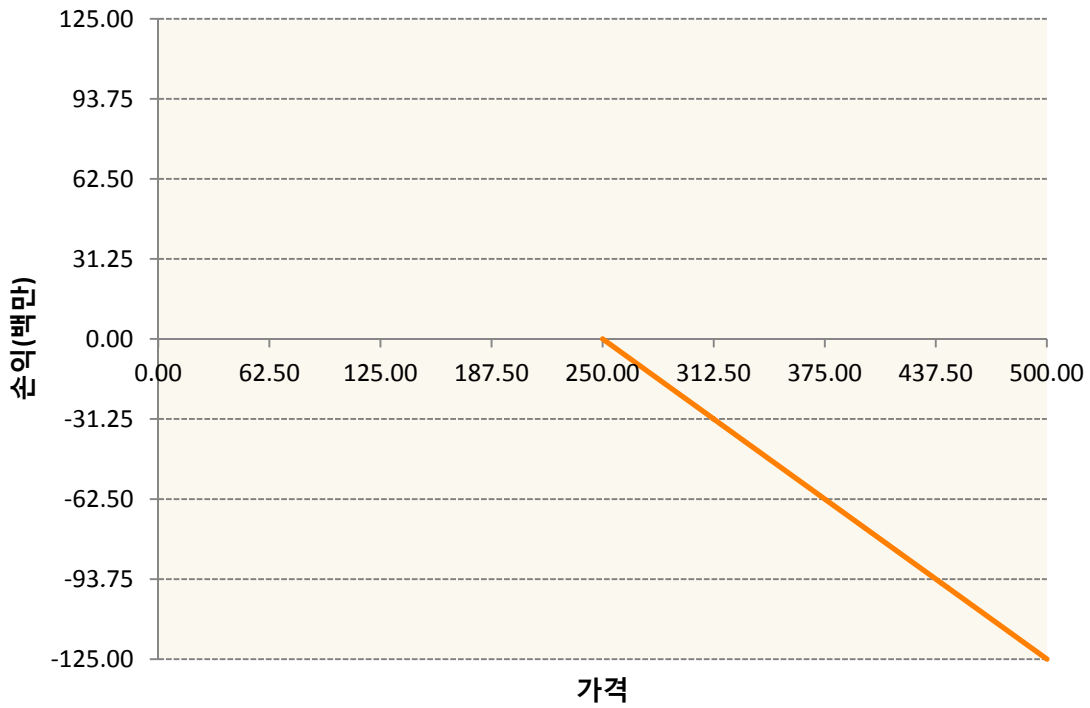


KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

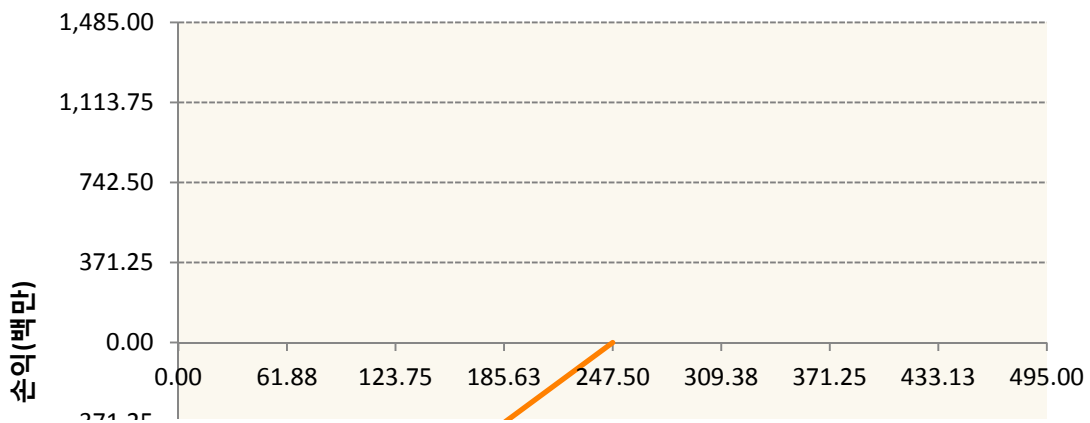




**KR4201Q42503-2020-04 콜250**



**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						122
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-122	-122	-122	-122	-122	-122	-122	
-5.33%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81	
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	41	41	41	41	41	41	41	
5.33%	81	81	81	81	81	81	81	
8.00%	122	122	122	122	122	122	122	
KR4201Q42479		2020-04 콜247.5						70
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	33	31	28	26	23	19	16	
-5.33%	29	26	23	20	16	12	8	
-2.67%	24	20	16	11	7	2	-3	
0%	15	10	5	0	-5	-10	-16	
2.67%	3	-3	-9	-14	-20	-26	-31	
5.33%	-14	-20	-26	-32	-37	-43	-49	
8.00%	-34	-40	-46	-52	-58	-64	-70	
KR4201Q42503		2020-04 콜250						6
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	1
-2.67%	2	2	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%	-3	-3	-4	-4	-5	-5	-6

KR4301Q42477                      2020-04 풋247.5    97

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-84	-85	-87	-89	-91	-94	-97
-5.33%	-49	-51	-54	-57	-60	-63	-67
-2.67%	-16	-20	-23	-27	-31	-35	-39
0%	13	9	5	0	-5	-9	-14
2.67%	39	34	29	24	19	13	8
5.33%	60	55	49	44	39	33	28
8.00%	77	72	66	61	56	50	45

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

(단위:백만원)

**501**

공시일	2020-03-30
기준일	2020-03-27

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

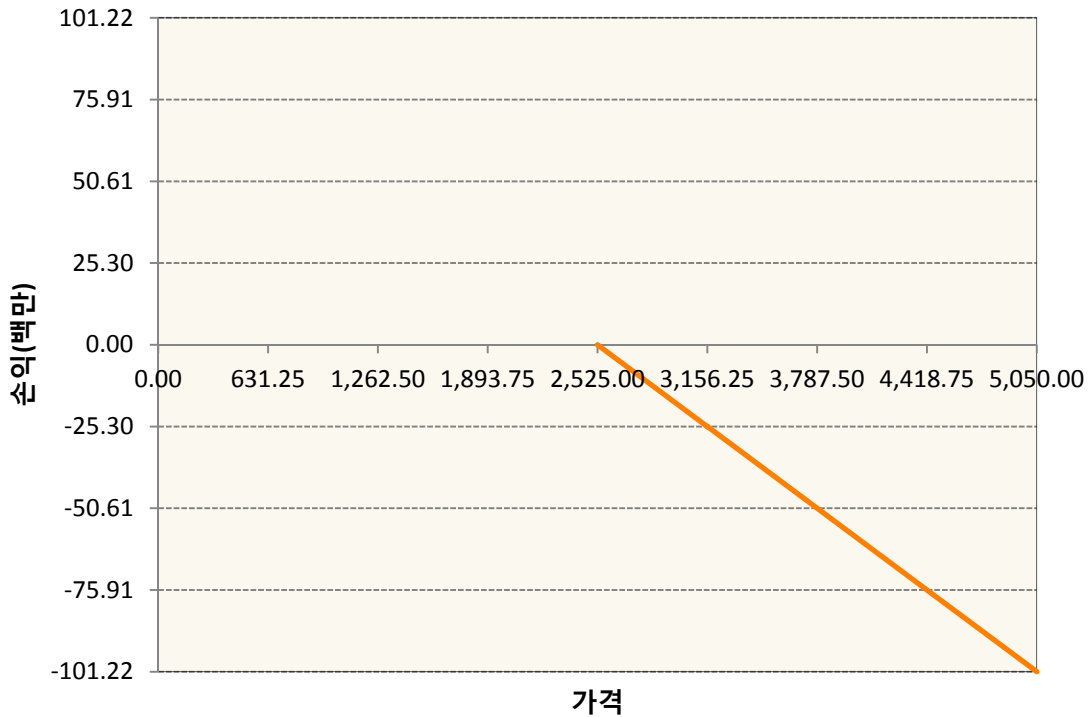
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

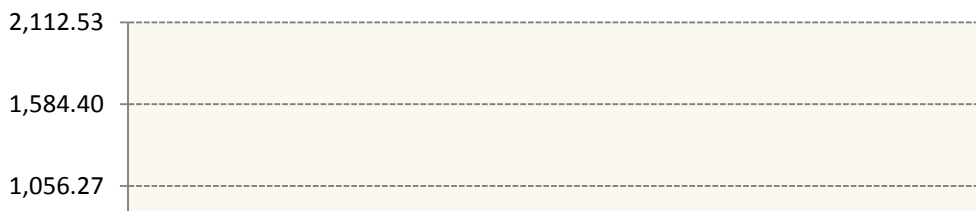
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	265	0	265	
누계	유가증권	스왑	7,590	0	7,590	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,427	-4,427	장내
누계	통화	선도	0	2,704	-2,704	장외

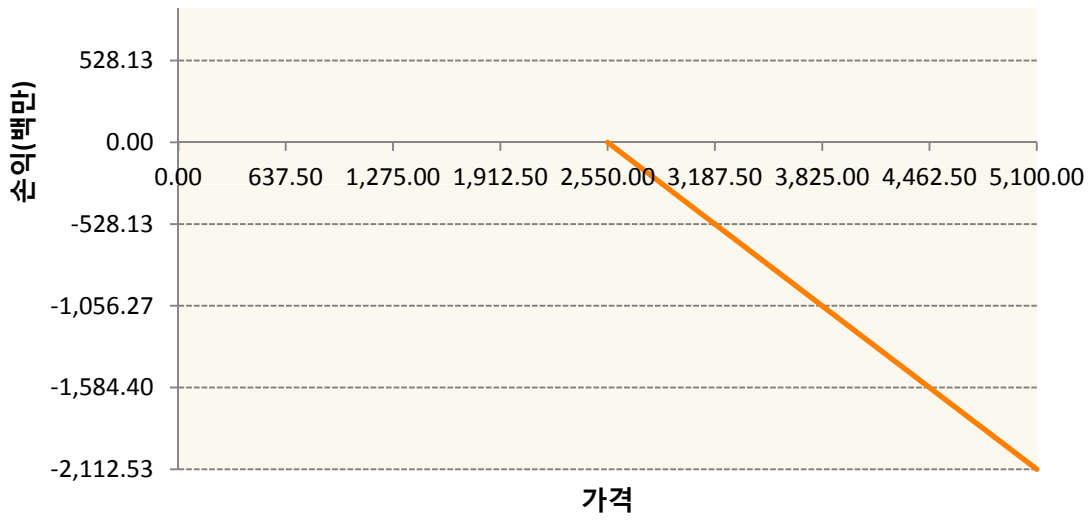
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXJ0-C2525-EURO STOXX 50

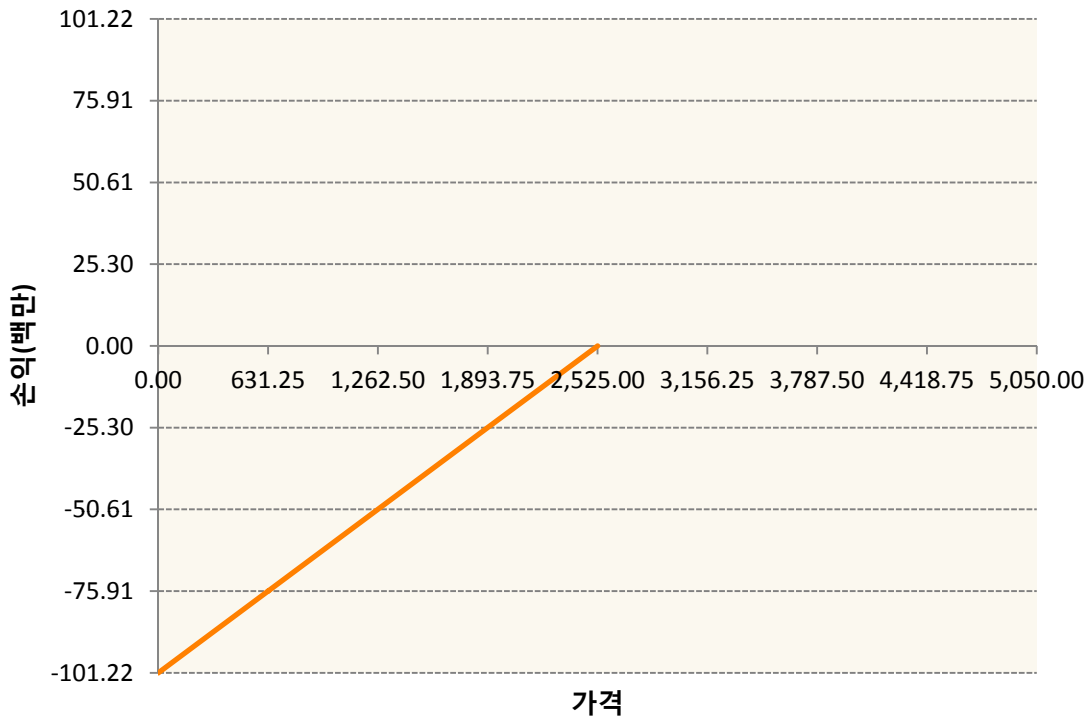


OESXJ0-C2550-EURO STOXX 50

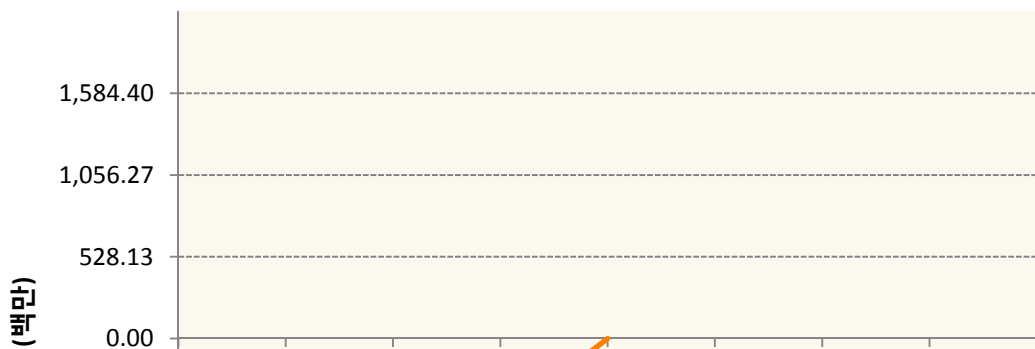


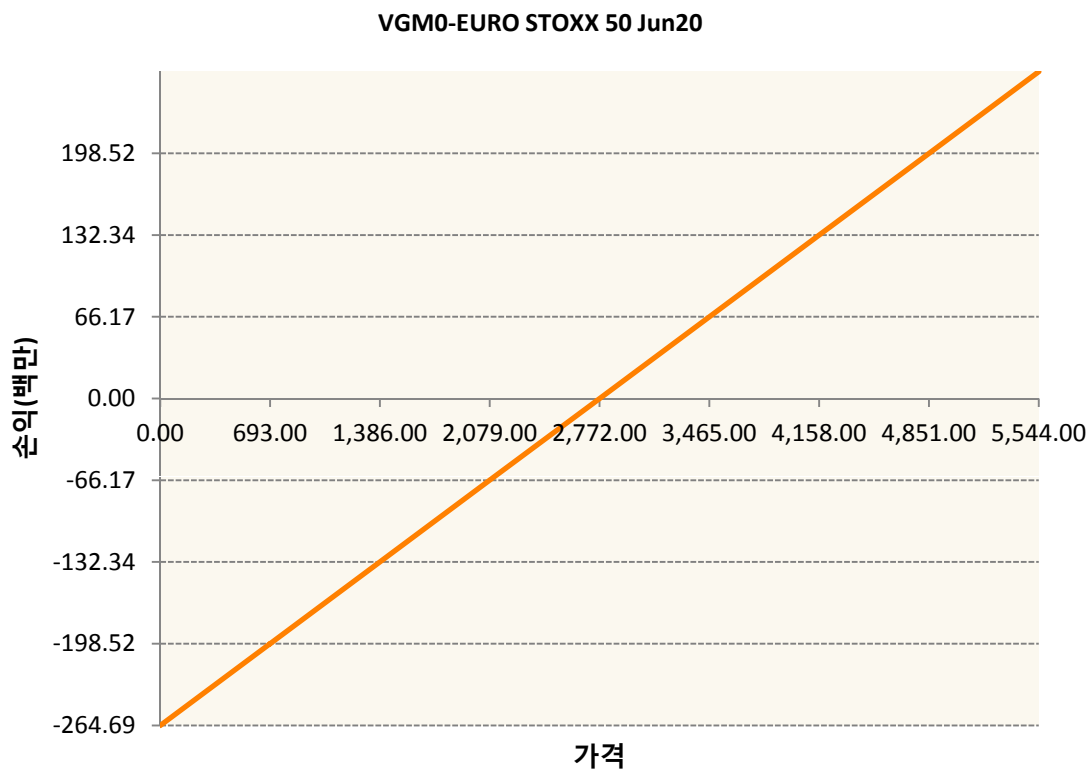
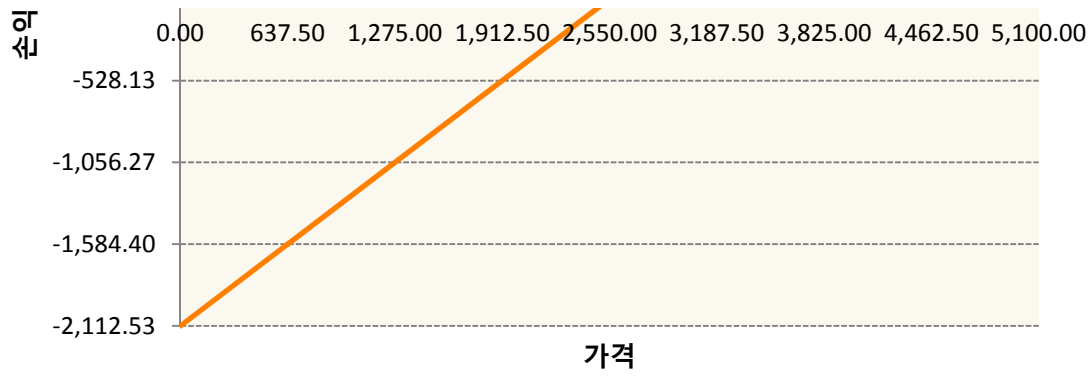


OESXJ0-P2525-EURO STOXX 50



OESXJ0-P2550-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		18
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E		216
OESXJ0-C25: EURO STOXX 50		8
OESXJ0-C25: EURO STOXX 50		169
OESXJ0-P25: EURO STOXX 50		8
OESXJ0-P25! EURO STOXX 50		169
VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	21

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





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

(단위:백만원)

984

공시일	2020-03-30
기준일	2020-03-27

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

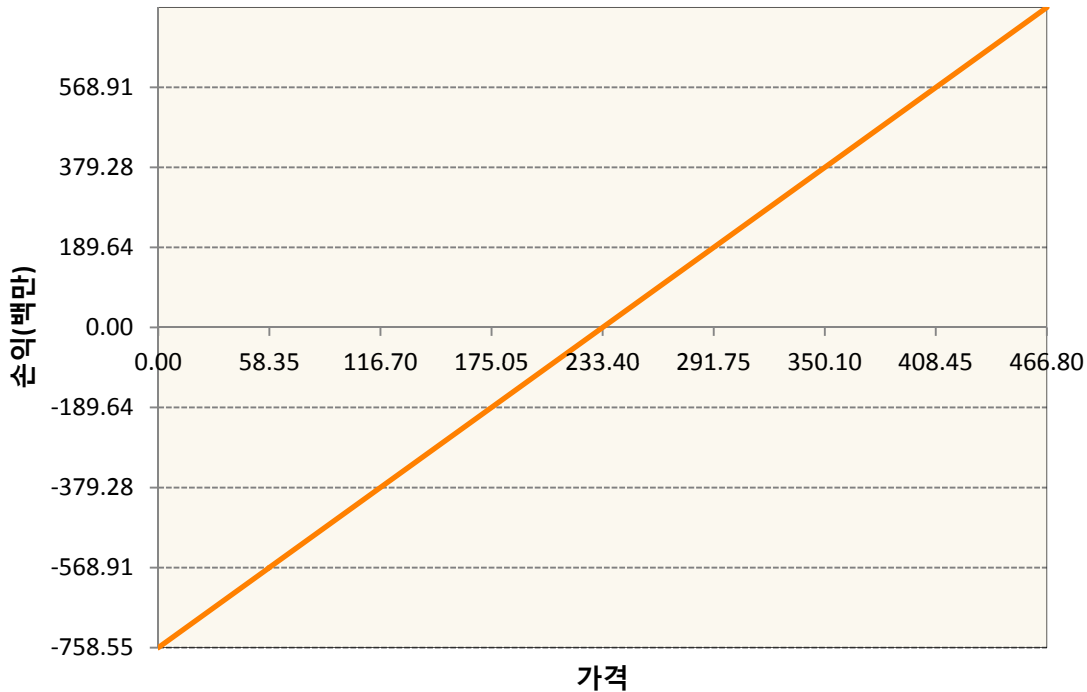
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	759	0	759	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%	-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)

85



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

(단위:백만원)

125

공시일	2020-03-30
기준일	2020-03-27

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

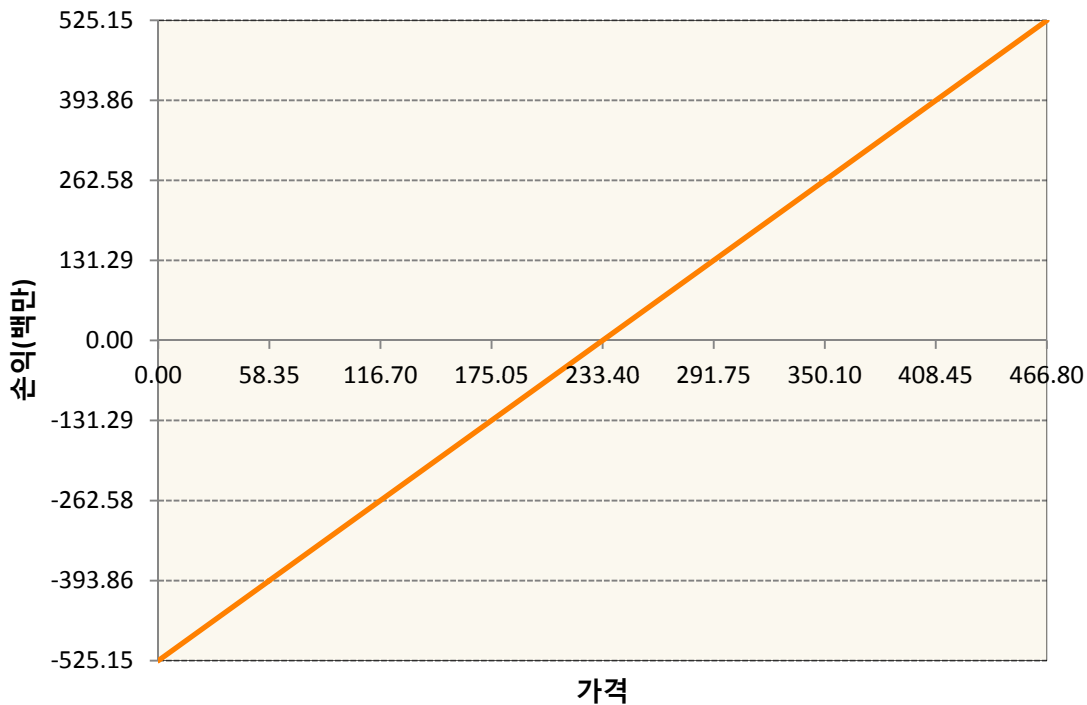
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	525	0	525	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)

59

공시일	2020-03-30
기준일	2020-03-27

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

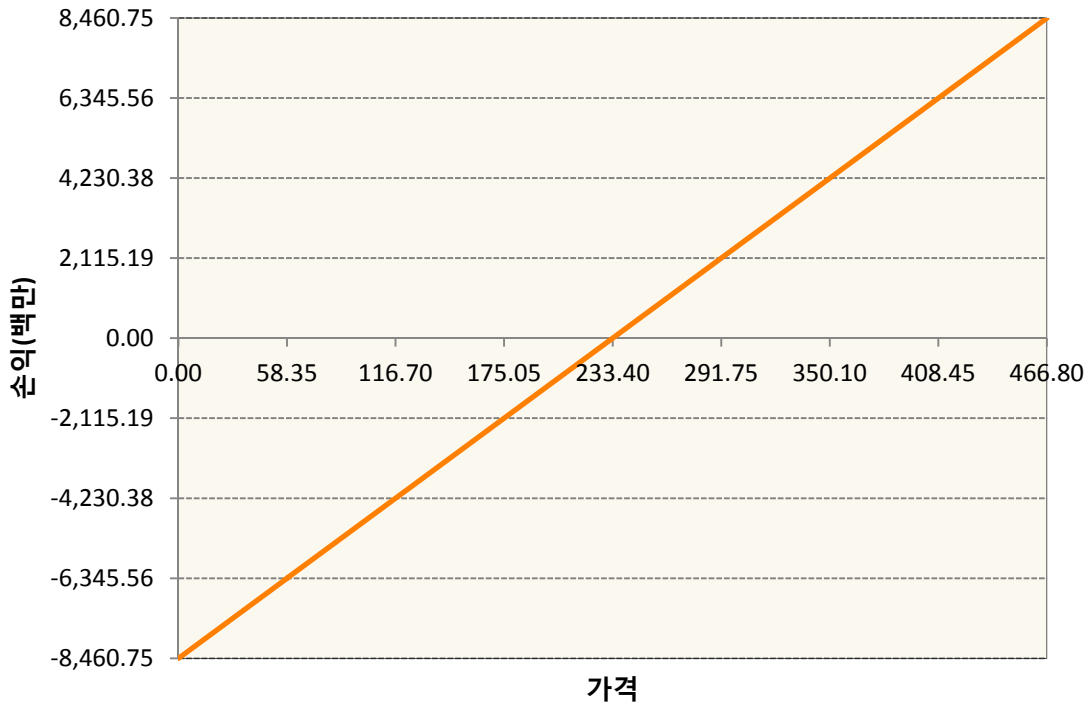
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

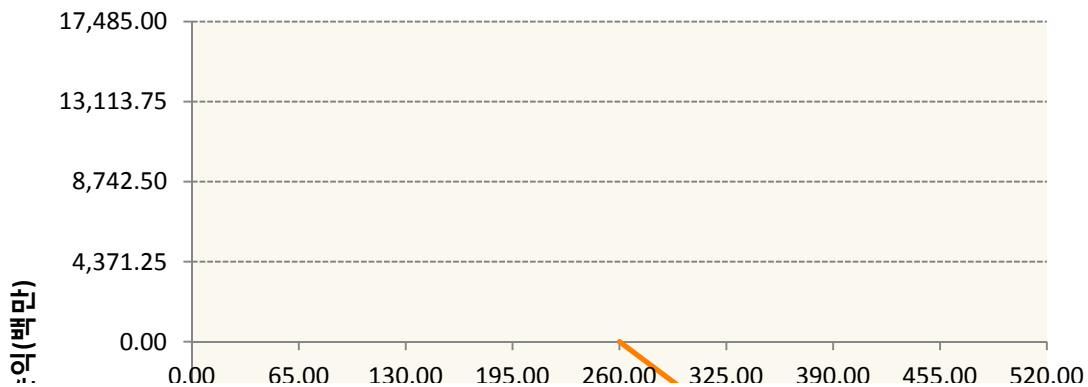
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,461	0	8,461	장내
누계	유가증권	옵션	6,004	17,485	-11,481	장내

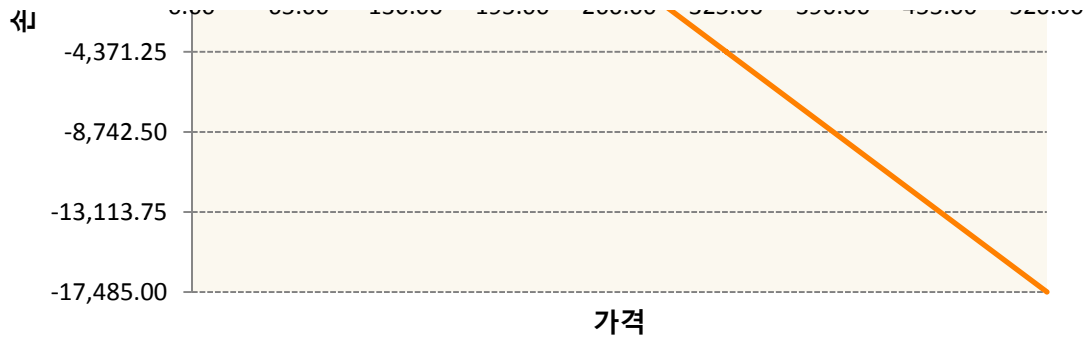
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

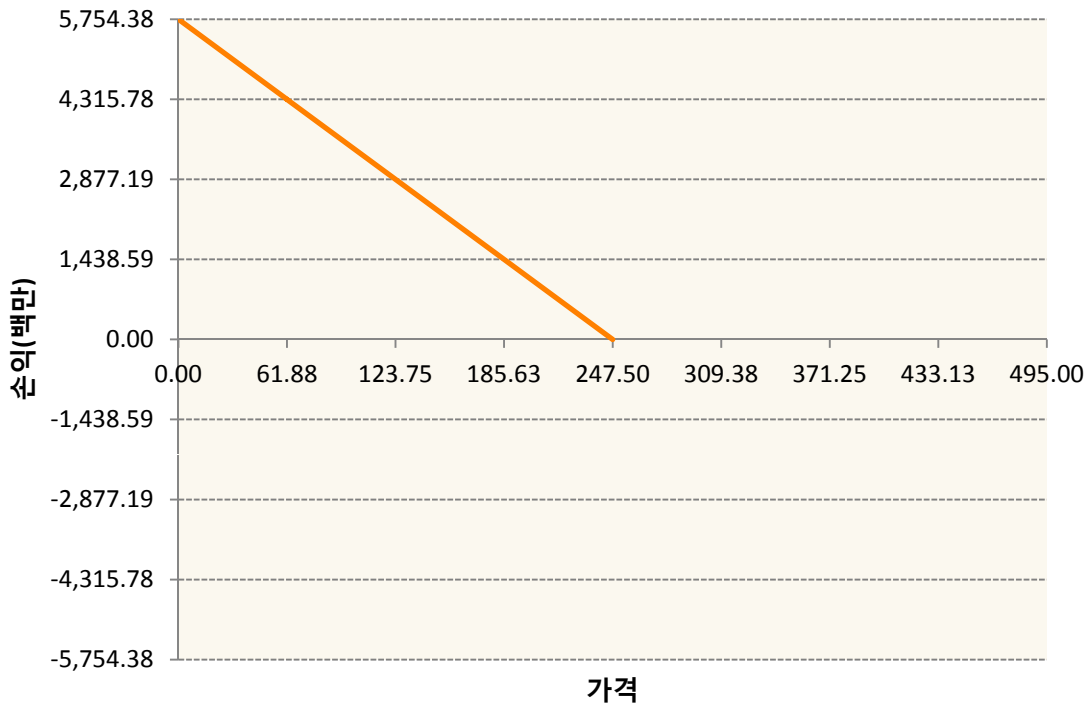


KR4201Q42602-2020-04 콜260

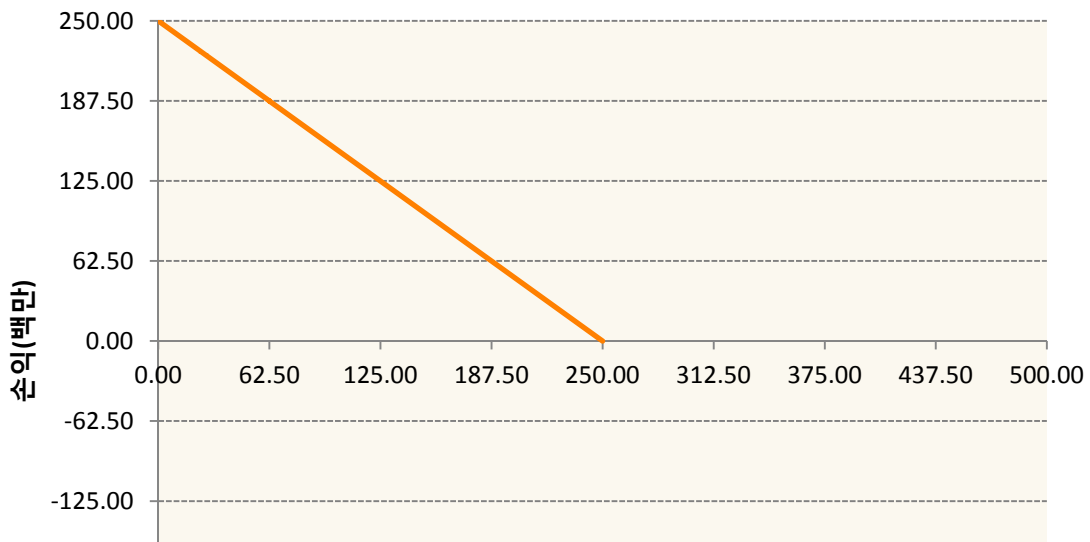


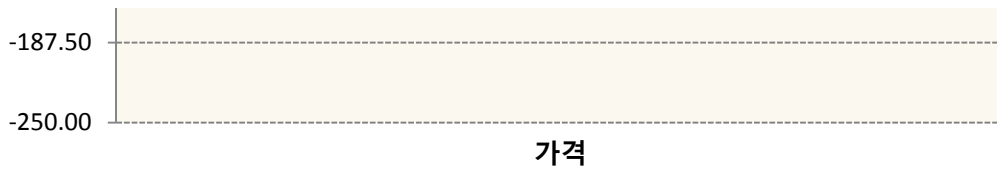


KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



KR4301Q42501-2020-04 풋250





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

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						678
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-678	-678	-678	-678	-678	-678	-678	
-5.33%	-452	-452	-452	-452	-452	-452	-452	
-2.67%	-226	-226	-226	-226	-226	-226	-226	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	226	226	226	226	226	226	226	
5.33%	452	452	452	452	452	452	452	
8.00%	678	678	678	678	678	678	678	
KR4201Q42602		2020-04 콜260						593
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	198	189	176	160	139	115	88	
-5.33%	185	170	150	125	97	65	30	
-2.67%	161	137	107	73	36	-4	-47	
0%	119	83	43	0	-46	-95	-146	
2.67%	51	4	-47	-100	-155	-211	-269	
5.33%	-51	-109	-168	-229	-291	-354	-418	
8.00%	-192	-258	-324	-391	-458	-525	-593	
KR4301Q42477		2020-04 풋247.5						375
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	324	329	336	344	354	364	375	
-5.33%	189	198	208	220	232	245	260	
-2.67%	63	76	89	104	120	136	153	
0%	-52	-35	-18	0	18	37	55	
2.67%	-151	-132	-112	-92	-72	-52	-31	
5.33%	-234	-213	-192	-171	-150	-128	-107	
8.00%	-299	-278	-257	-236	-215	-194	-173	
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	16	16	16	
-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%	-10	-10	-9	-8	-7	-6	-5
8.00%	-14	-13	-12	-11	-10	-9	-8

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

(단위:백만원)

**1,638**

공시일	2020-03-30
기준일	2020-03-27

## H2O글로벌본드(USD)(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	142,632	0	142,632	

### 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	2020-03-30
기준일	2020-03-27

## 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	96,178	0	96,178	

### 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	2020-03-30
기준일	2020-03-27

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	424,953	0	424,953	
누계	통화	선도	88,979	614,864	-525,885	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020F03! KRW/USD 31-03-20E	3,099
FX21020F04! KRW/USD 31-03-20E	2,905
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,615
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,332
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,937
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,874
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,266
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,937
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	194
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	4,939
FX21020G06 USD/KRW 31-03-20E	484
FX21020H00 USD/KRW 31-03-20E	968
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,421
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,014
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,014
FX21020H04 USD/KRW 21-04-20E	1,453
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,363
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	968
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	968
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,518
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	833
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	726
FX21020H09 USD/KRW 24-04-20E	726
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	484
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,390
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,876

IE00BD8RGM75

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

26,973



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

(단위:백만원)

169

공시일	2020-03-30
기준일	2020-03-27

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

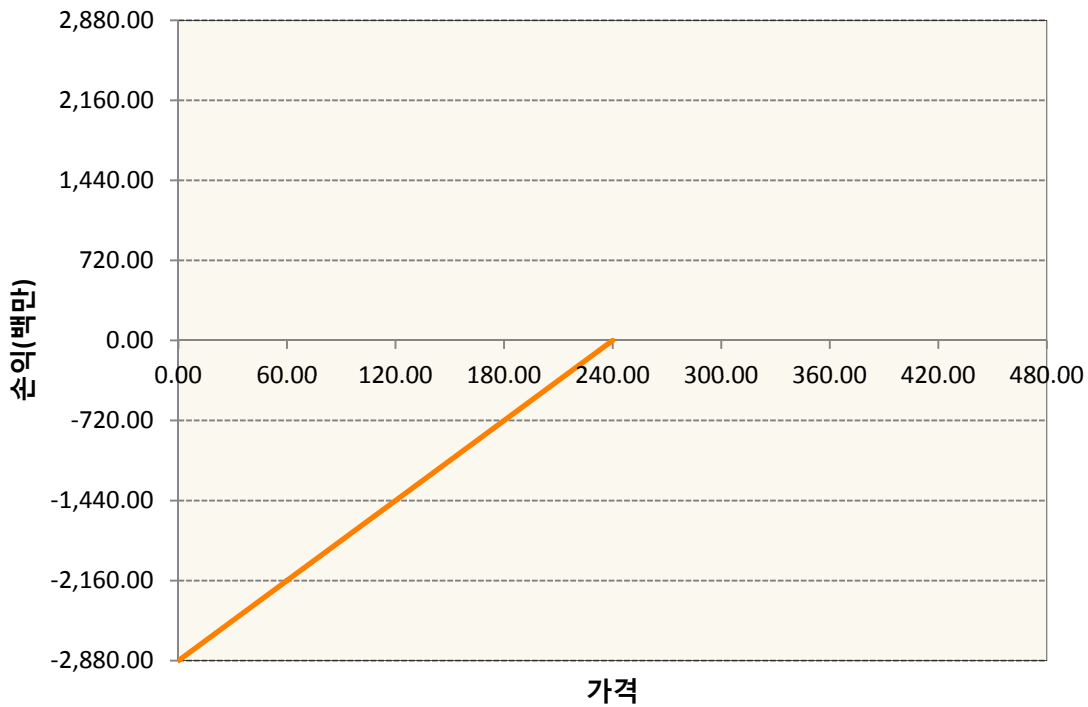
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

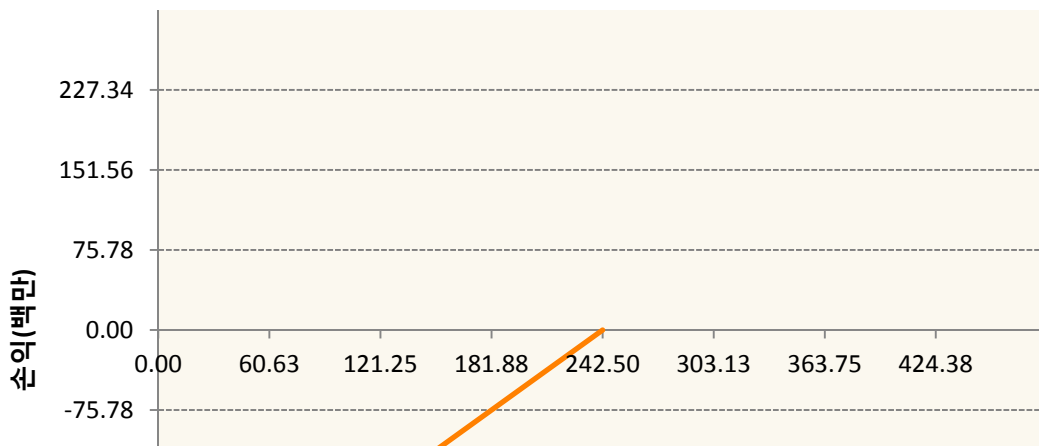
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,183	-3,183	장내

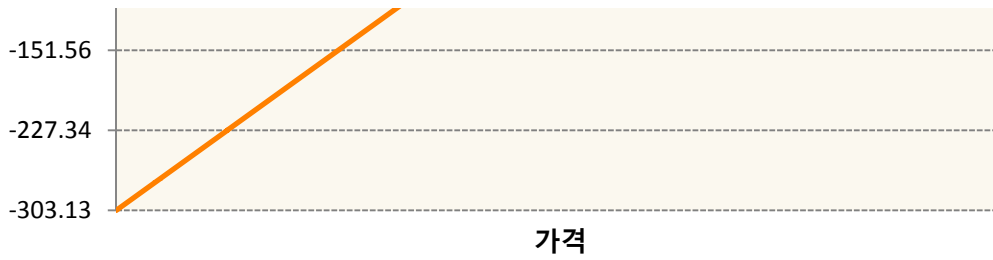
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q42402-2020-04 풋240



KR4301Q42428-2020-04 풋242.5





**3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4301Q42402		2020-04 풋240						179
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-143	-147	-153	-158	-165	-172	-179	
-5.33%	-78	-85	-92	-99	-107	-116	-124	
-2.67%	-20	-28	-37	-46	-56	-65	-75	
0%	30	20	10	0	-10	-20	-31	
2.67%	71	61	50	39	29	18	8	
5.33%	103	93	82	72	61	51	40	
8.00%	126	117	107	98	88	78	68	
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	-18	-19	
-5.33%	-9	-9	-10	-11	-12	-12	-13	
-2.67%	-3	-3	-4	-5	-6	-7	-8	
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3	
2.67%	8	7	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)

178

공시일	2020-03-30
기준일	2020-03-27

## 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	7,005	0	7,005	
누계	통화	선도	2,627	12,179	-9,552	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	183
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	216
FX21020H01 USD/KRW 31-03-20E	49
FX21020H02 KRW/USD 13-04-20E	352
FX21020H04 USD/KRW 31-03-20E	25
FX21020H05 USD/KRW 31-03-20E	27
FX21020H05 USD/KRW 31-03-20E	27
FX21020H07 USD/KRW 31-03-20E	22
FX21020H09 USD/KRW 31-03-20E	5
FX21020H09 USD/KRW 31-03-20E	19
FX21020H10 USD/KRW 13-04-20E	35
FX21020H11 KRW/USD 29-04-20E	224
IE00BD8RGM75	

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

567
-----

공시일	2020-03-30
기준일	2020-03-27

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

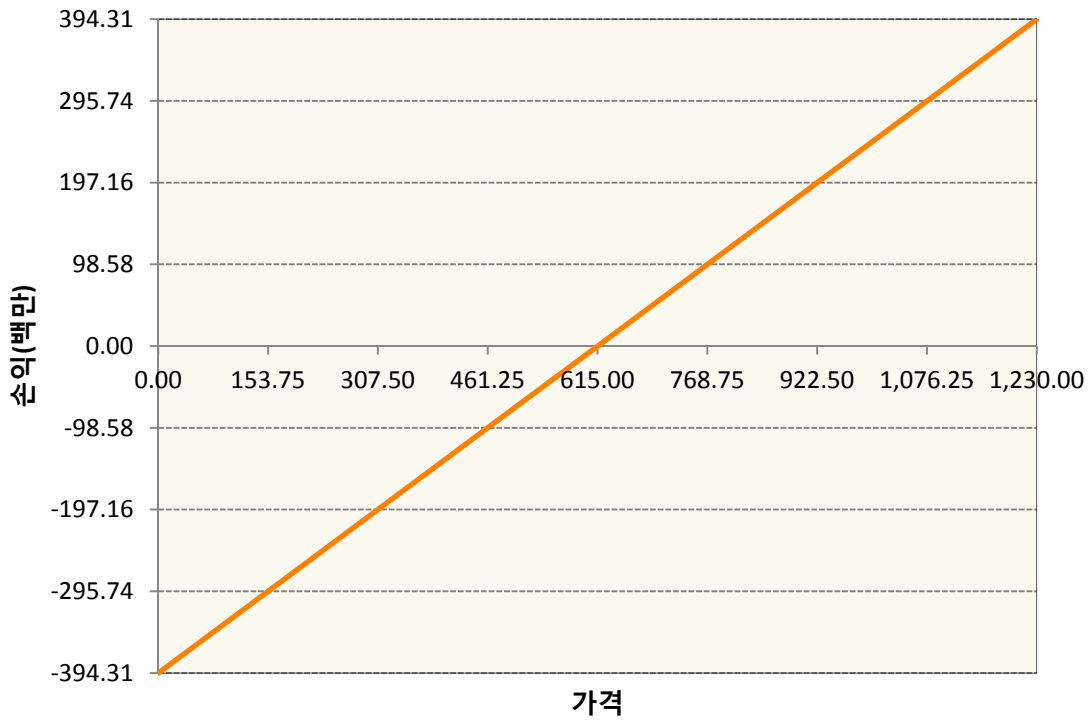
### 1. 계약금액

(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	394	0	394	
누계	유가증권	스왑	1,102	0	1,102	장외
누계	통화	선도	126	294	-168	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

VNCJ0-VN30 Index Future Apr20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	88
FX21020F03(KRW/EUR 24-04-20E)	6
FX21020F04(EUR/KRW 24-04-20E)	2
FX21020G01(KRW/EUR 22-05-20E)	5
FX21020G05(KRW/EUR 26-06-20E)	12
FX21020H09(EUR/KRW 26-06-20E)	8

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

(단위:백만원)

**118**

공시일	2020-03-30
기준일	2020-03-27

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

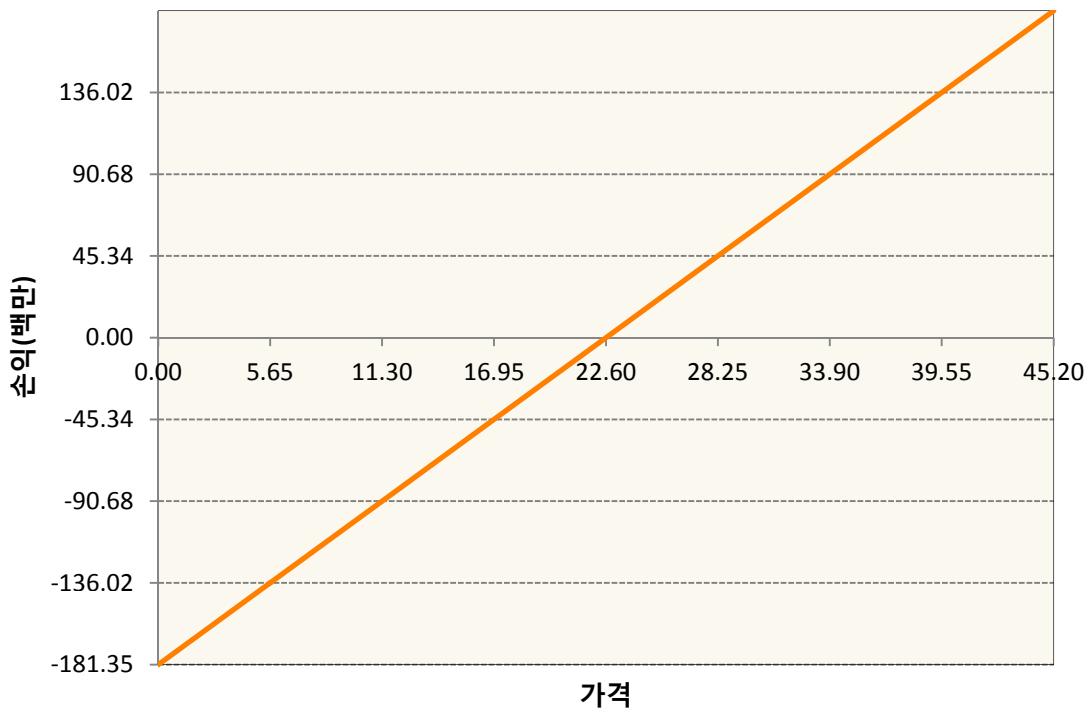
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

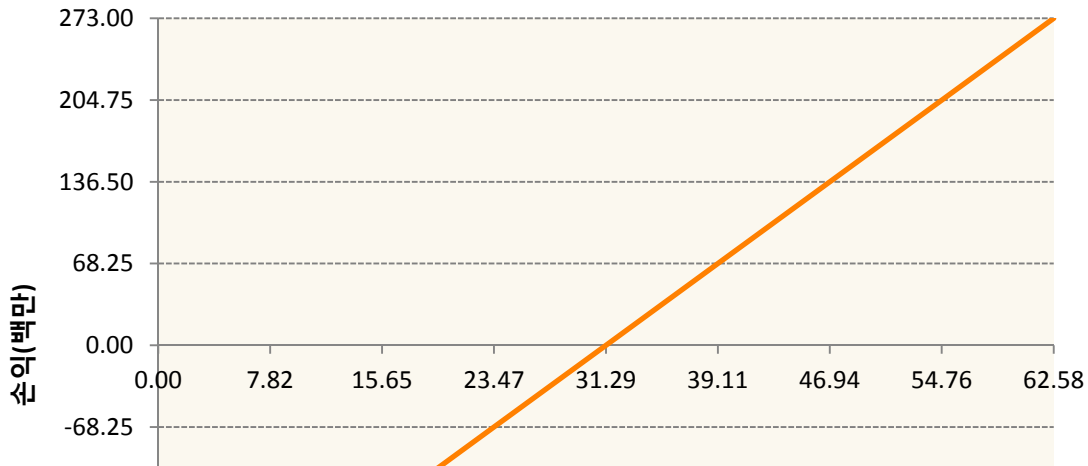
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,259	121	1,138	

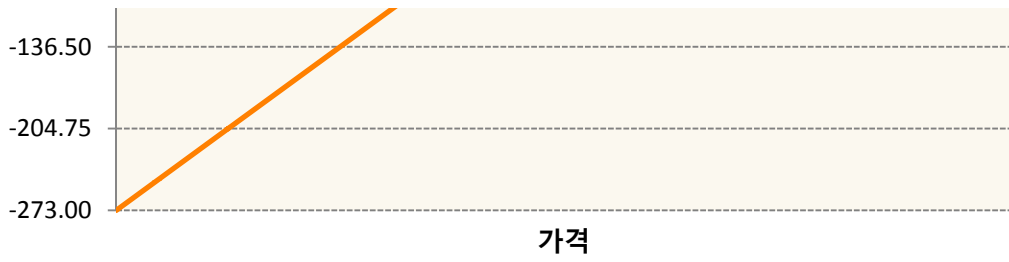
### 2. 만기시점의 손익구조

CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20

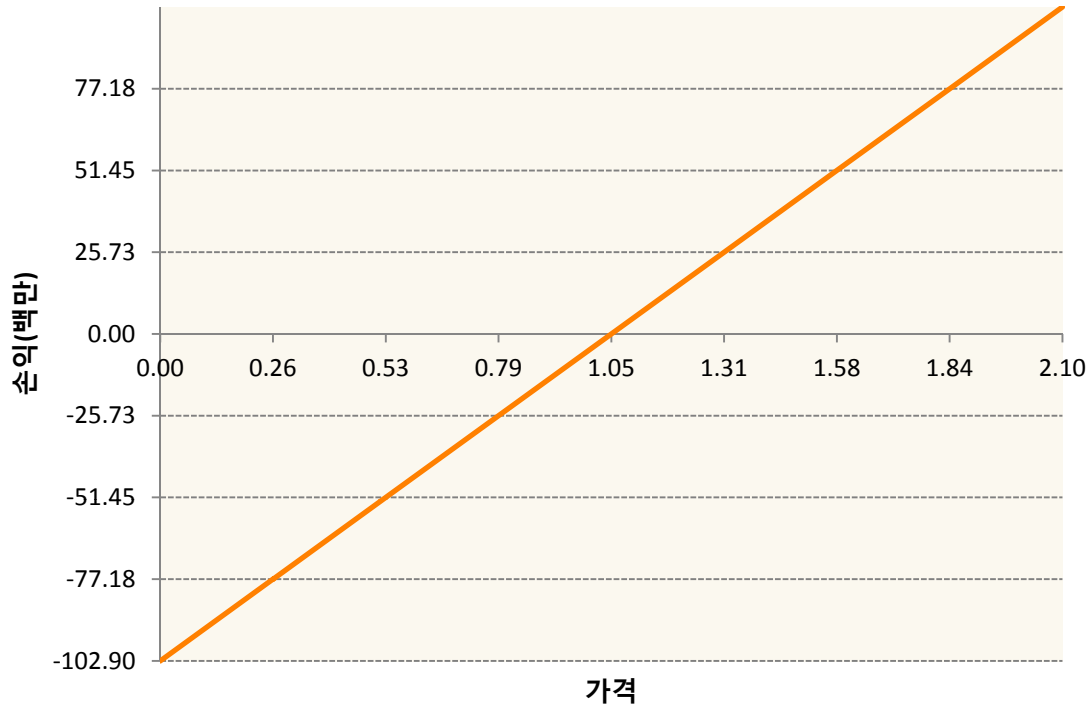


CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20

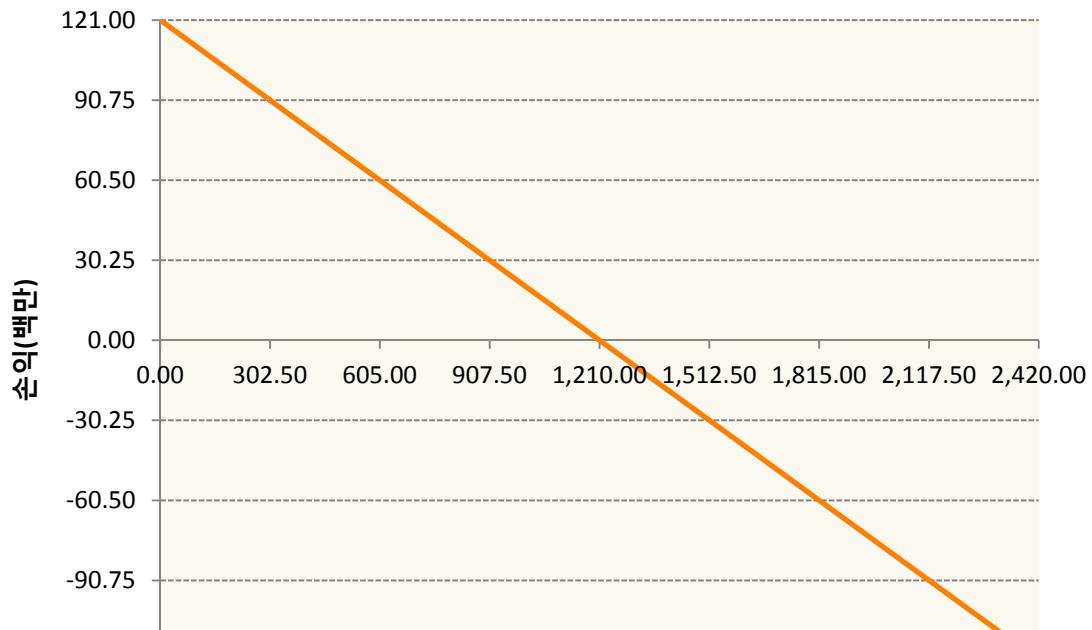


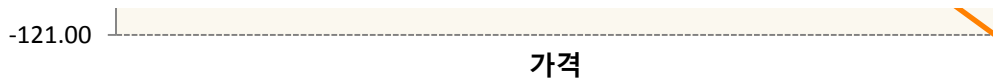


HOK0-NY Harb ULSD Fut May20

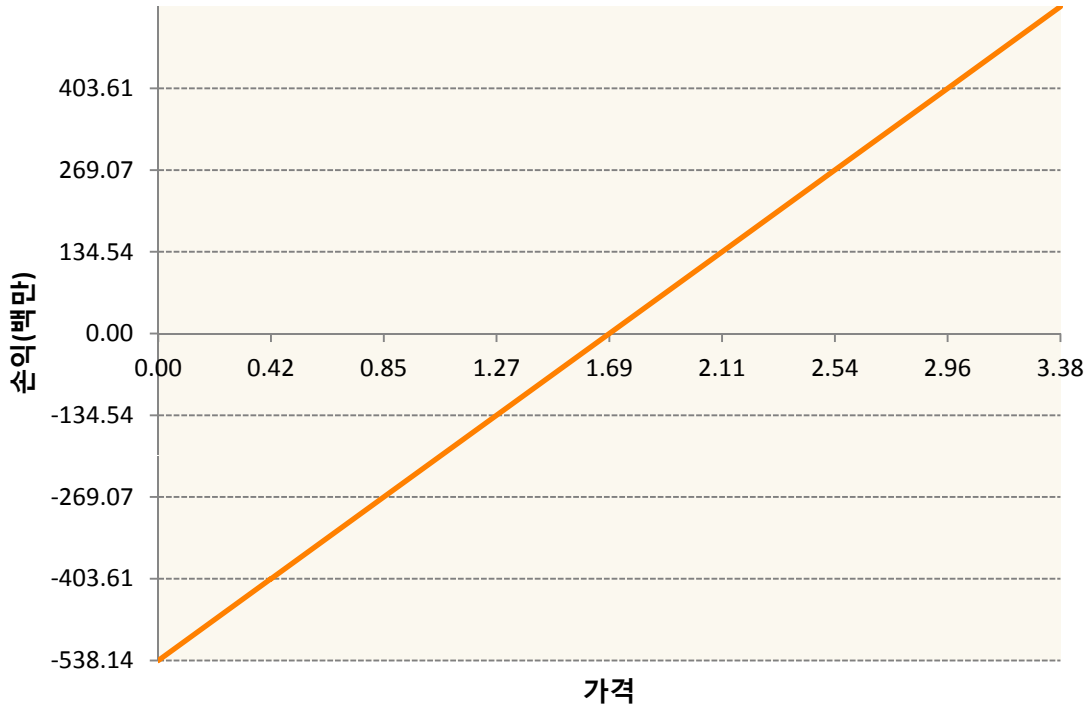


KR4175Q40008-2020-04 달러선물

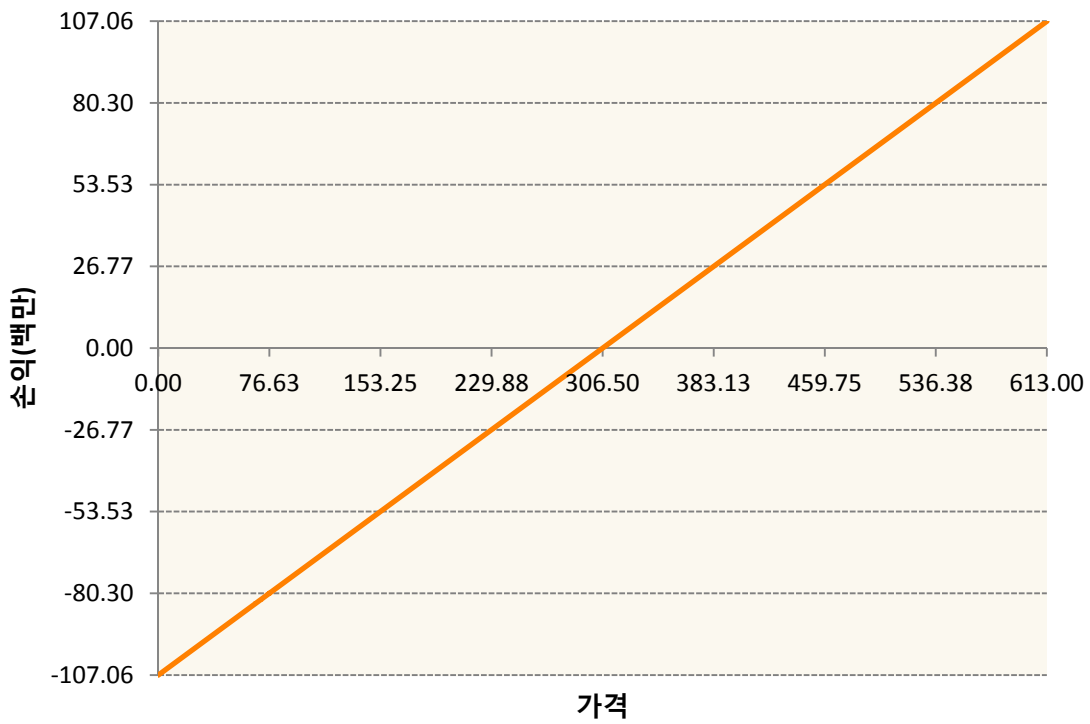




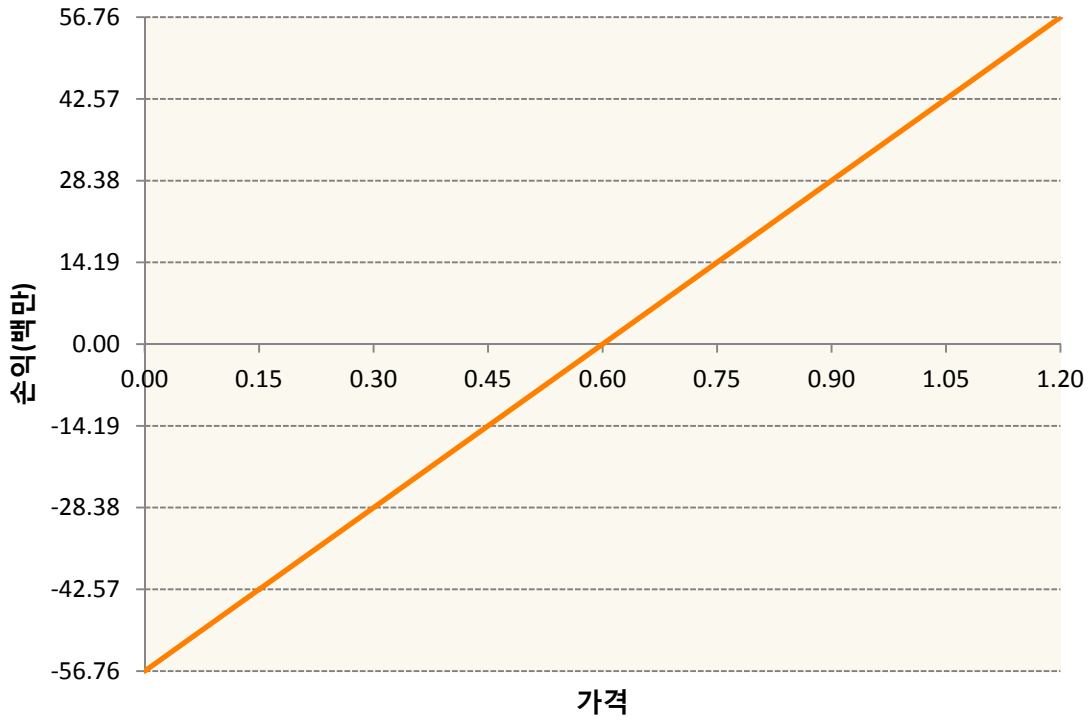
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



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	43
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	9
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	5

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

(단위:백만원)

**278**

공시일	2020-03-30
기준일	2020-03-27

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

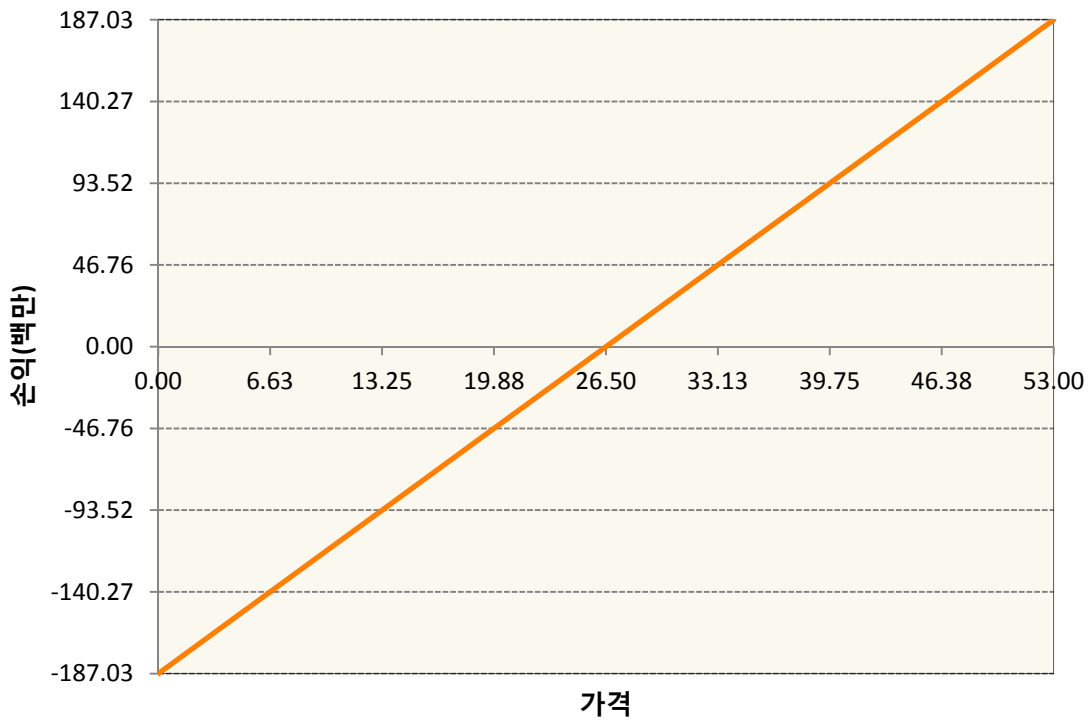
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

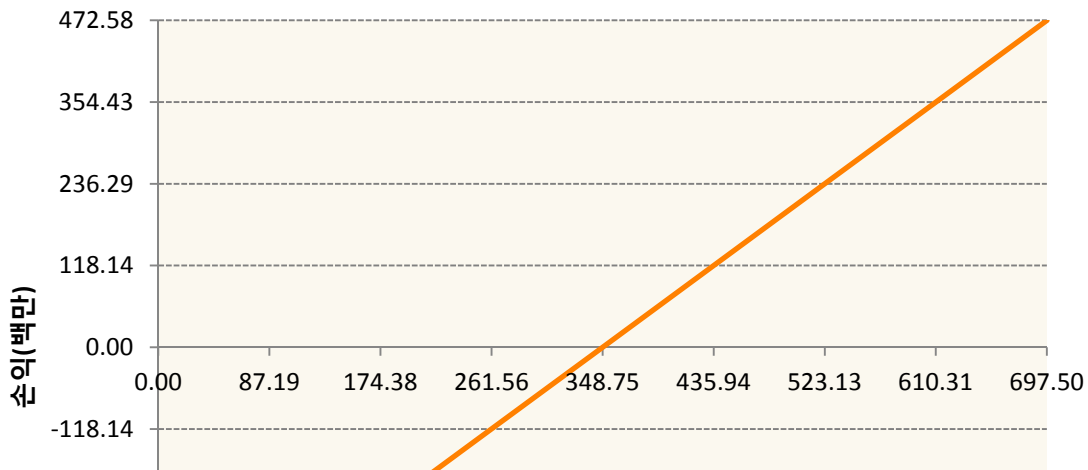
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,384	97	2,288	

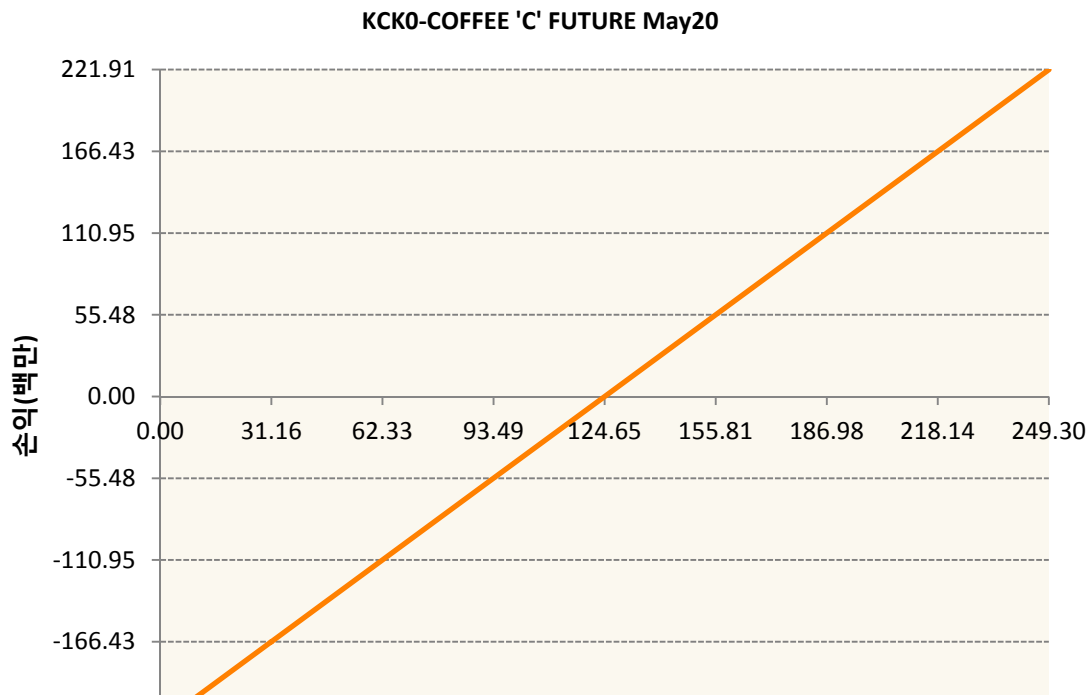
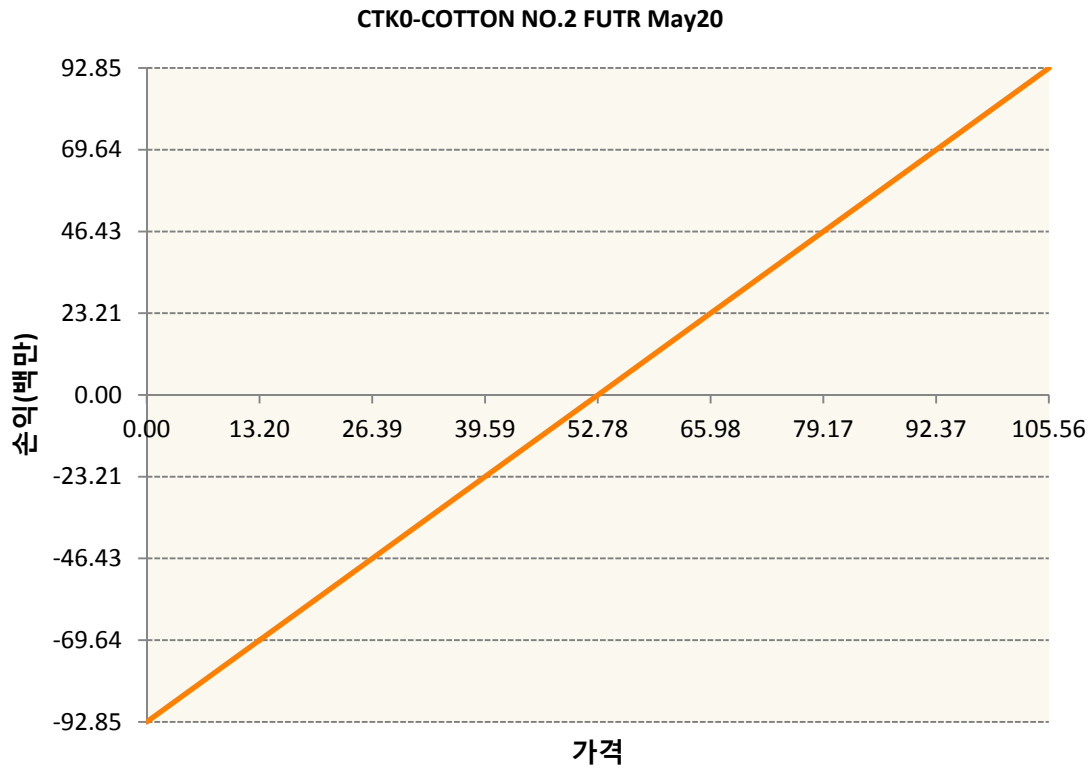
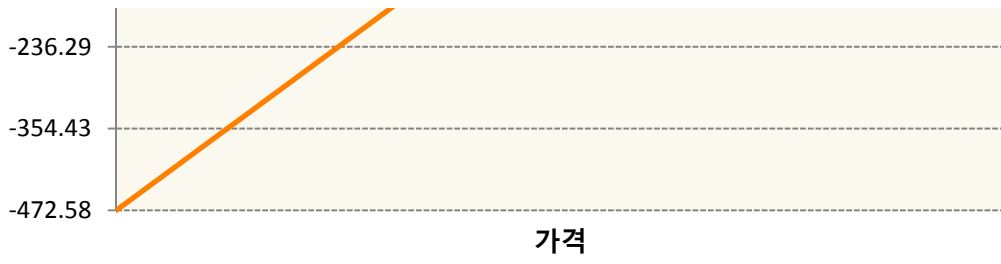
### 2. 만기시점의 손익구조

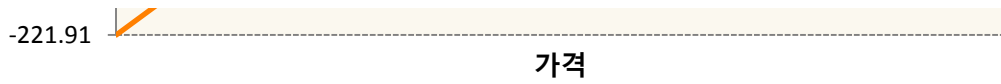
**BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20**



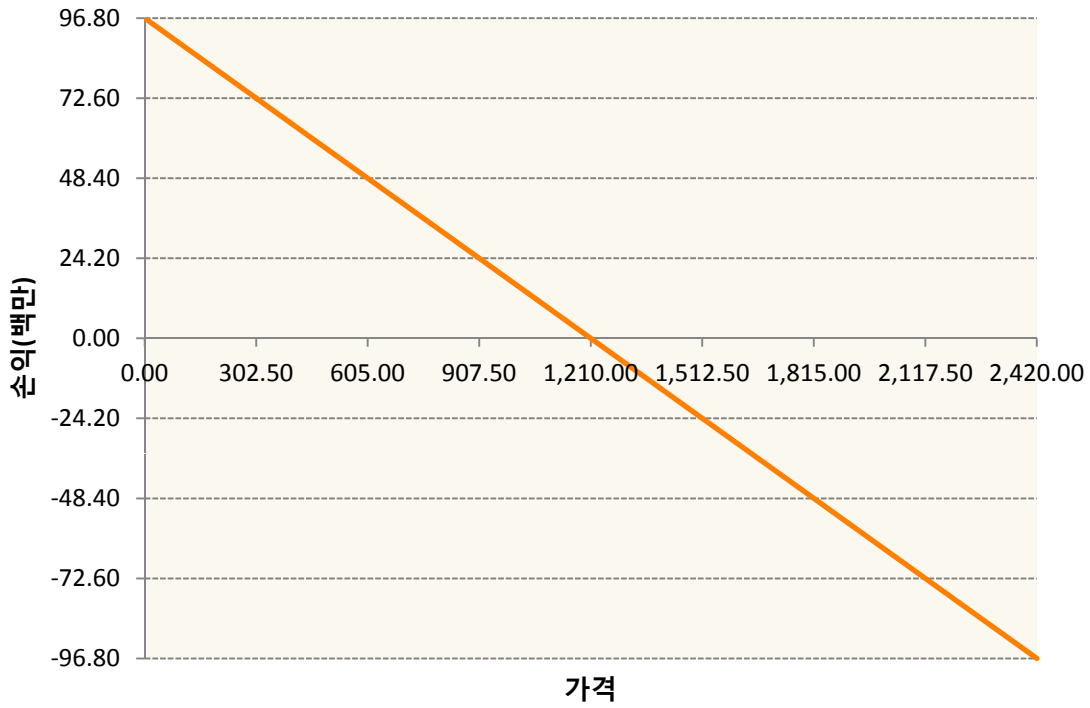
**CK0-CORN FUTURE May20**



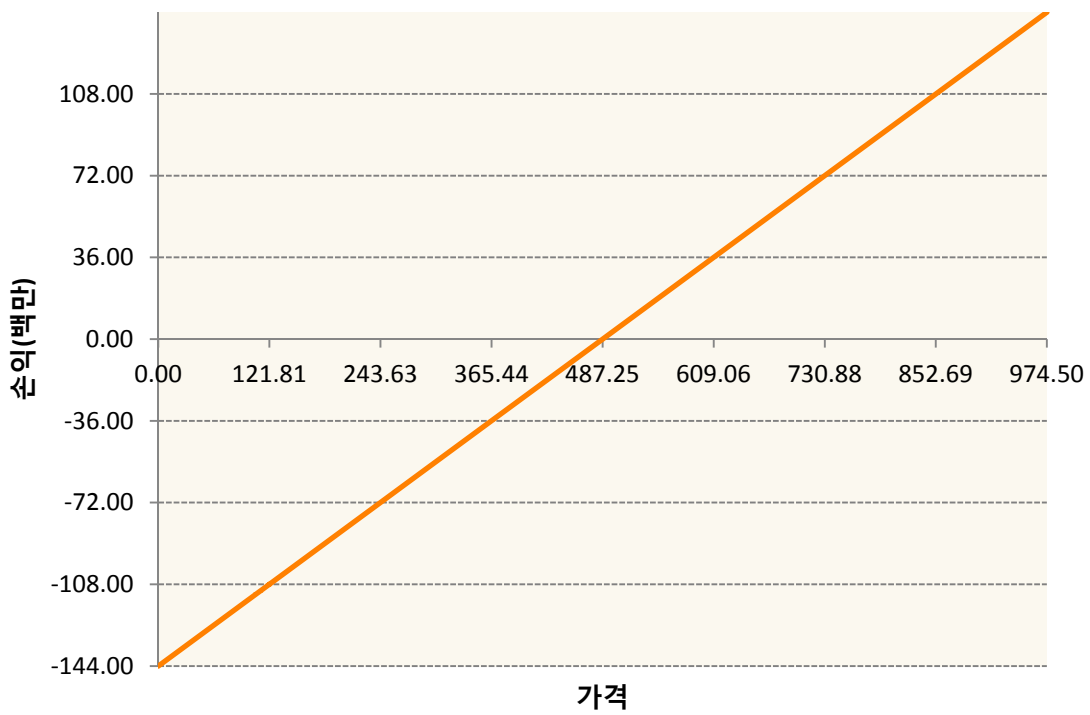




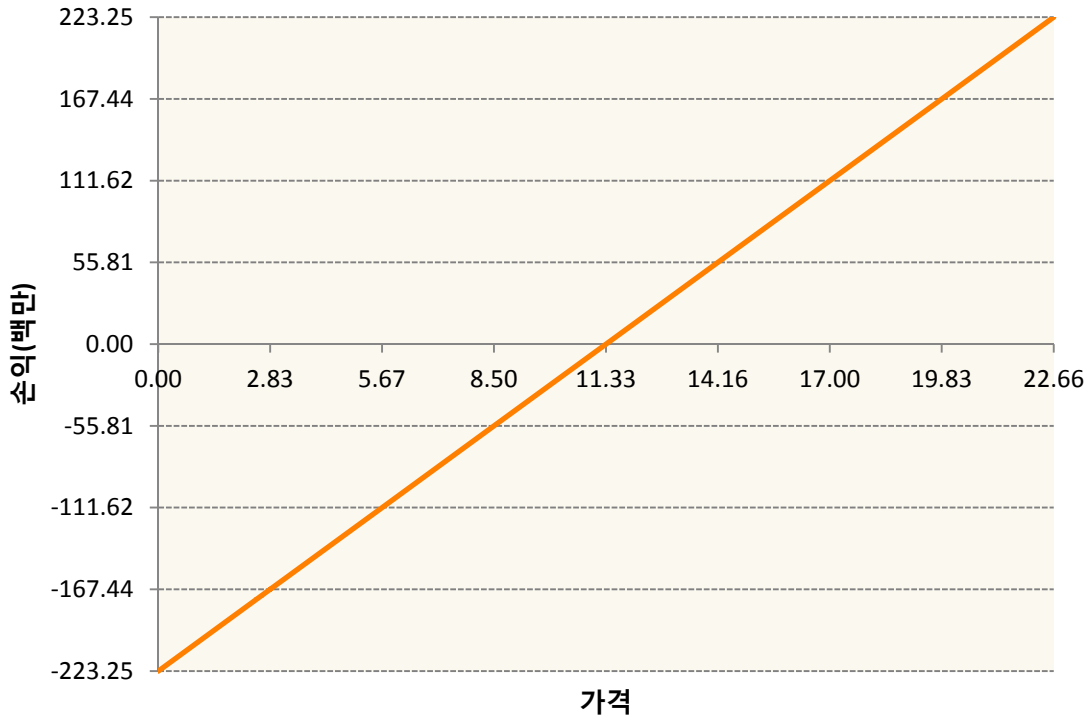
KR4175Q40008-2020-04 달러선물



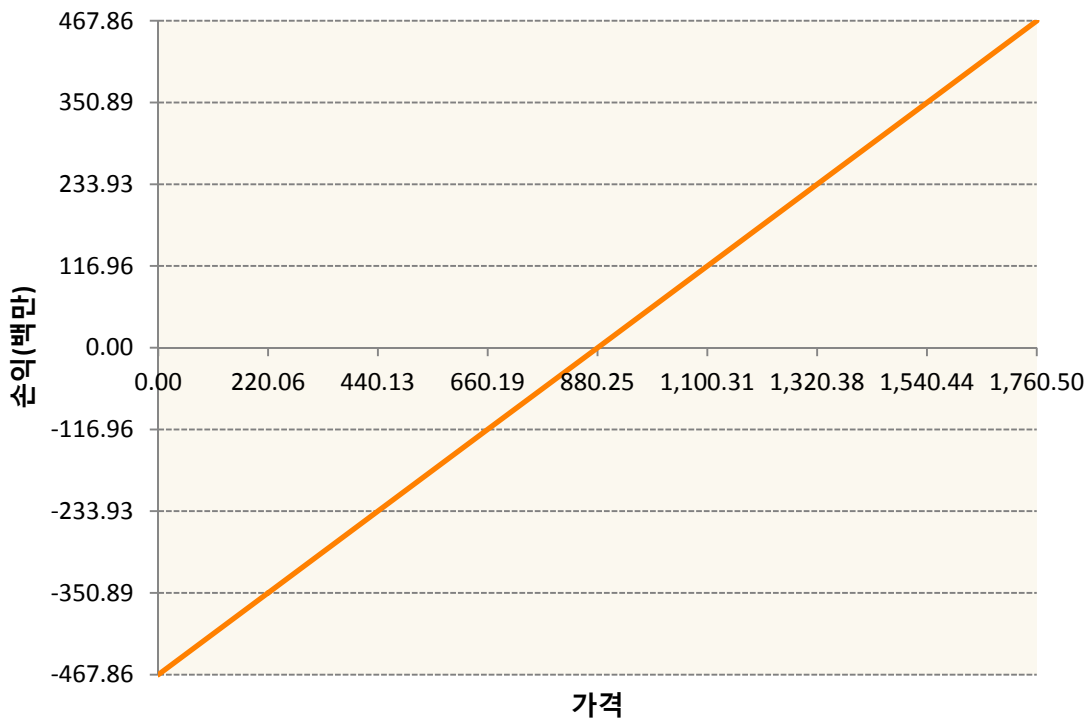
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



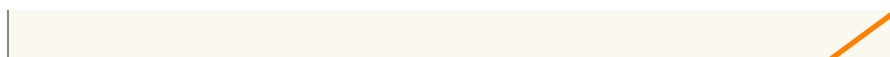
SBK0-Sugar May20

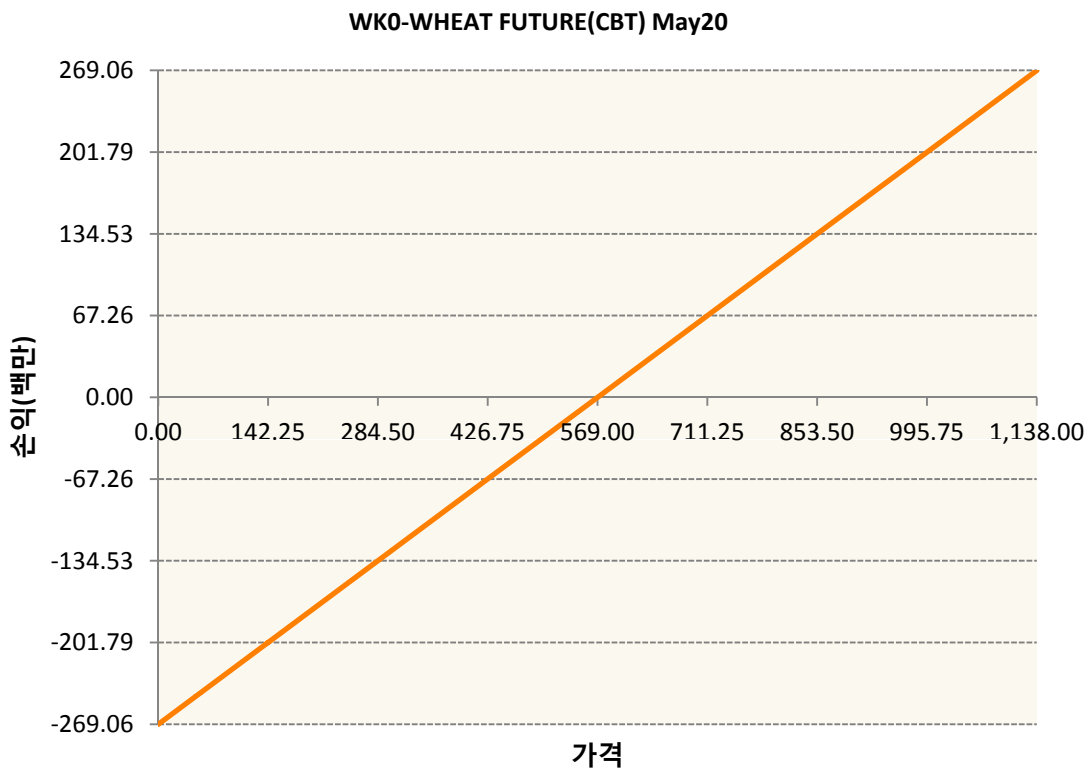
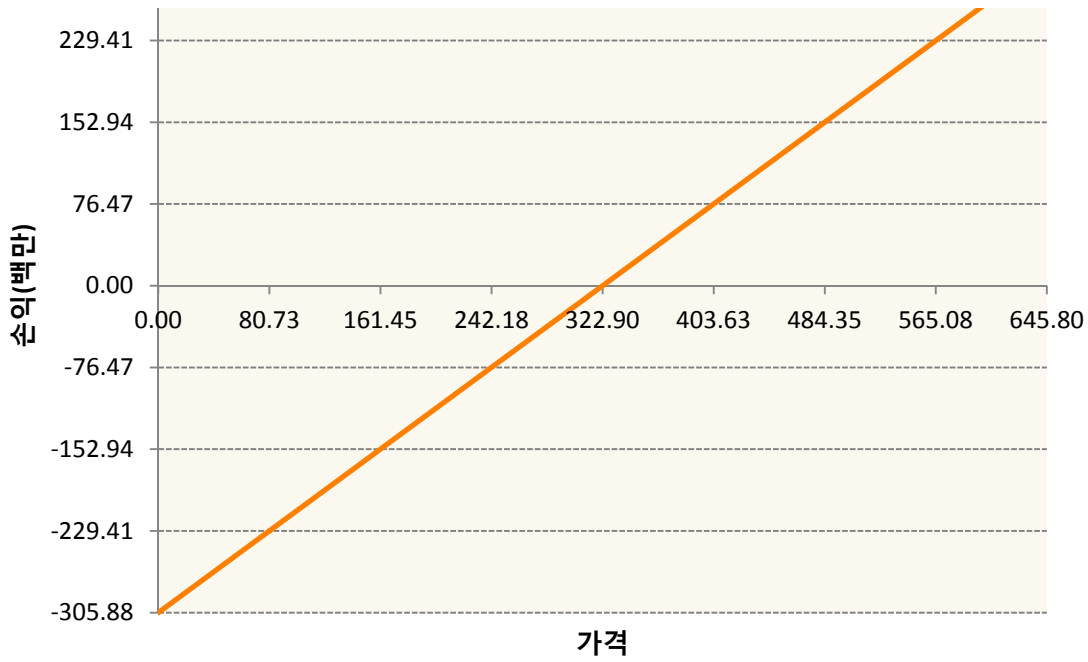


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



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	37
SMK0	SOYBEAN MEAL FUTR May20	24
WK0	WHEAT FUTURE(CBT) May20	22

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

(단위:백만원)

**221**