

공시일	2020-03-31
기준일	2020-03-30

스마트인덱스모

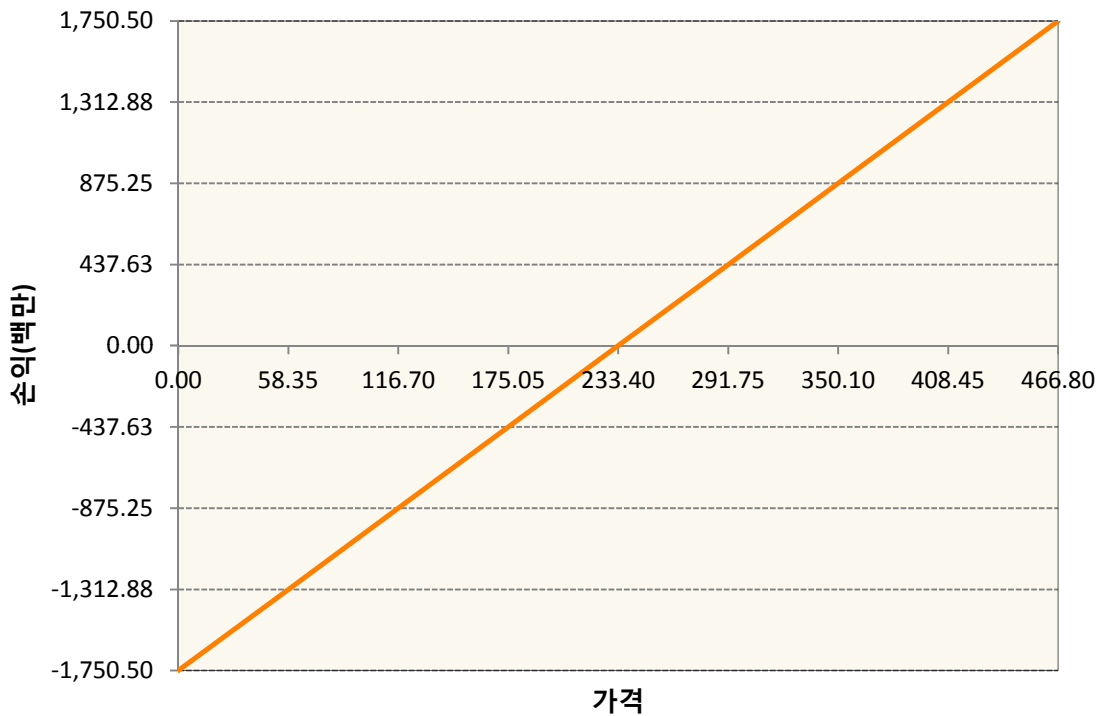
1. 계약금액

(단위:백만원)

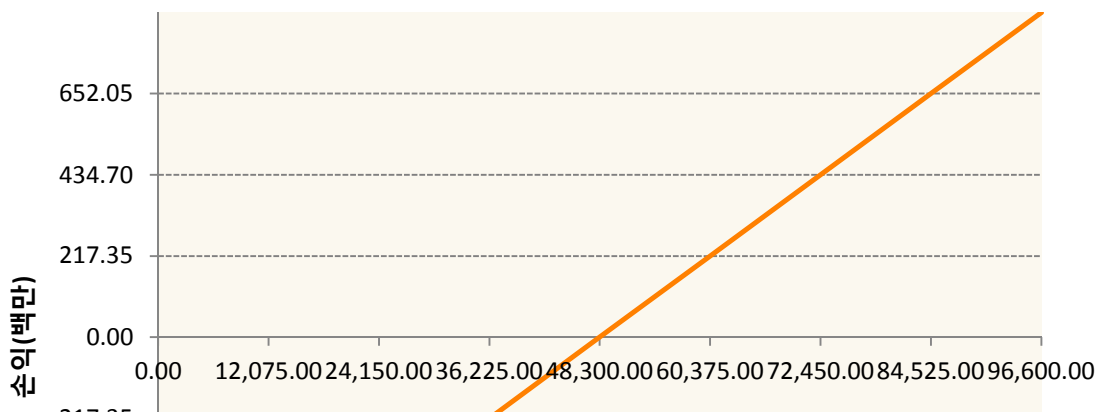
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,620	0	2,620	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



KR4111Q40003-2020-04 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						139
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-139	-139	-139	-139	-139	-139	-139	
-5.33%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93	
-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%	93	93	93	93	93	93	93	
8.00%	139	139	139	139	139	139	139	
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)

295

공시일	2020-03-31
기준일	2020-03-30

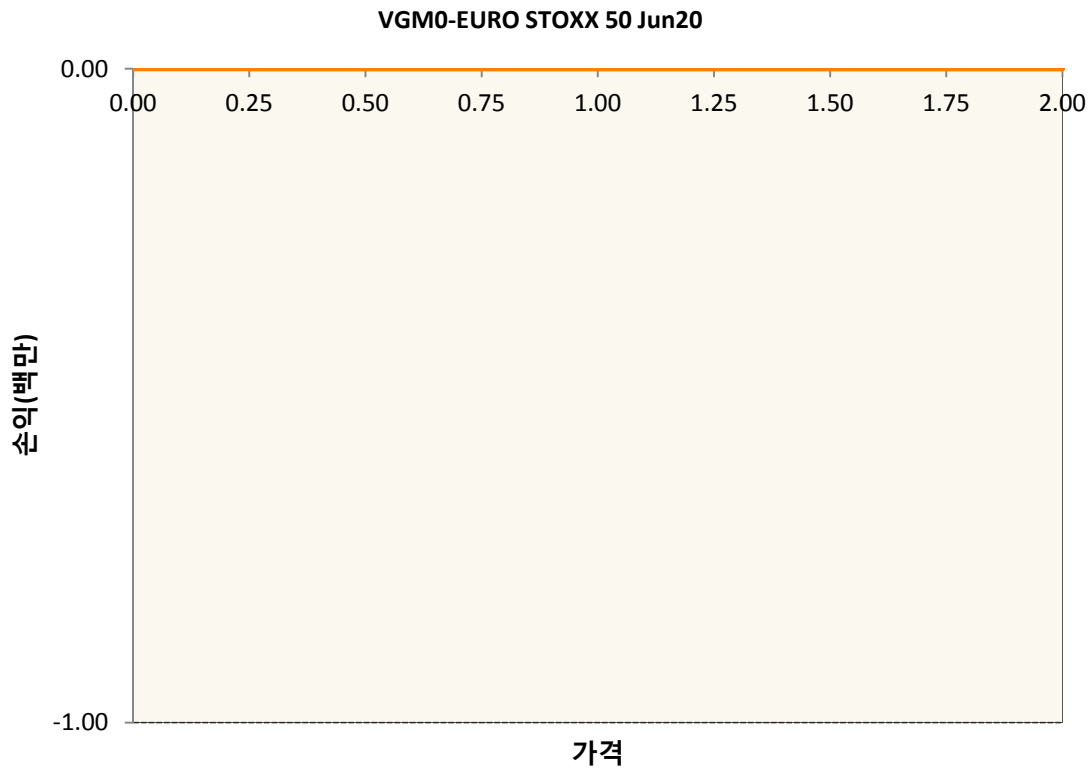
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	29
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

35

공시일	2020-03-31
기준일	2020-03-30

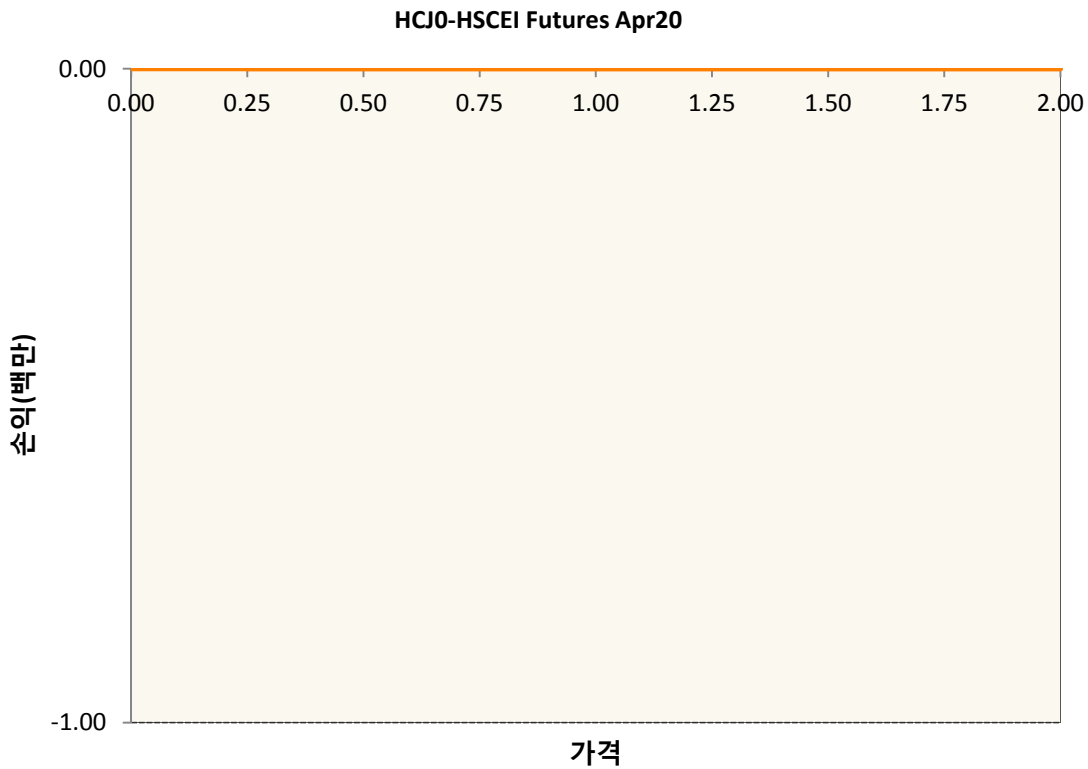
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	0	0	0	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ0	HSCEI Futures Apr20	41
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

43

공시일	2020-03-31
기준일	2020-03-30

커버드콜모(주식혼합-파생형)

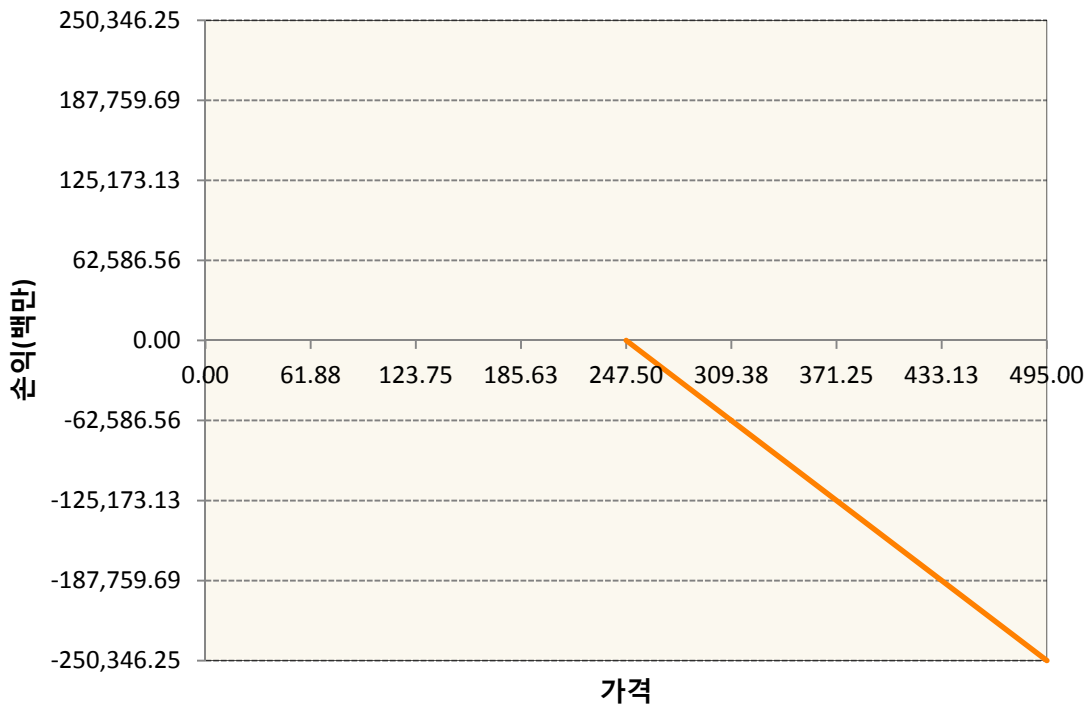
1. 계약금액

(단위:백만원)

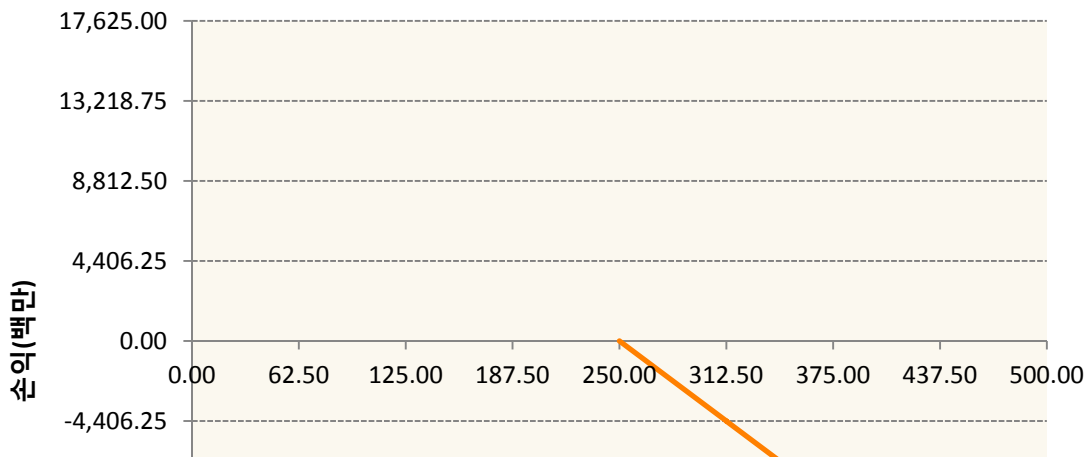
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	360,660	-360,660	장내

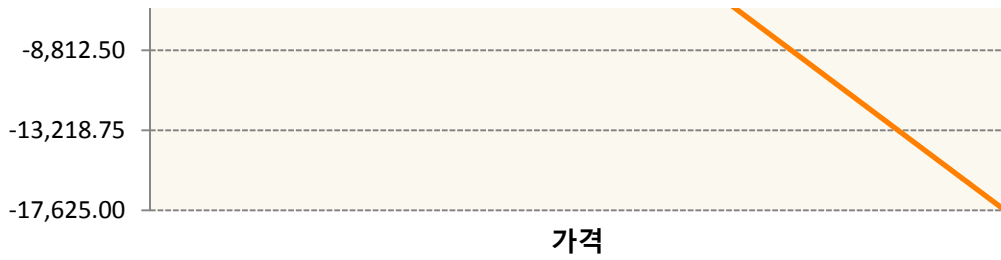
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

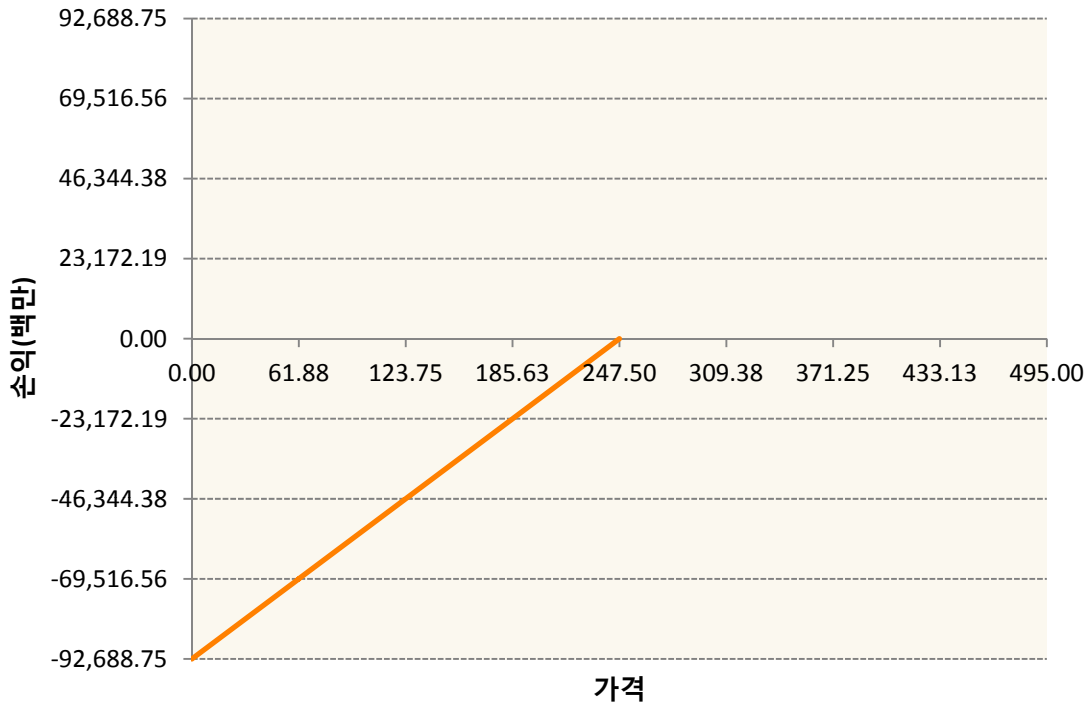


KR4201Q42503-2020-04 콜250





KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q42479		2020-04 콜247.5					10,772	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4,145	3,965	3,727	3,436	3,094	2,707	2,279	
-5.33%	3,808	3,497	3,124	2,699	2,227	1,715	1,169	
-2.67%	3,156	2,681	2,154	1,583	977	342	-317	
0%	2,031	1,386	706	0	-727	-1,471	-2,229	
2.67%	280	-508	-1,310	-2,122	-2,943	-3,769	-4,601	
5.33%	-2,209	-3,080	-3,953	-4,826	-5,700	-6,574	-7,449	
8.00%	-5,481	-6,359	-7,240	-8,121	-9,004	-9,888	-10,772	
KR4201Q42503		2020-04 콜250					706	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	251	240	226	209	188	163	136	

-5.33%	233	214	192	165	135	102	67
-2.67%	196	167	134	98	58	17	-27
0%	131	90	46	0	-48	-98	-149
2.67%	27	-25	-79	-133	-189	-245	-302
5.33%	-126	-185	-245	-306	-366	-427	-487
8.00%	-332	-394	-457	-519	-581	-643	-706
KR4301Q42477 2020-04 풋247.5							6,178
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,640	-5,687	-5,752	-5,834	-5,933	-6,049	-6,178
-5.33%	-3,413	-3,502	-3,611	-3,740	-3,885	-4,044	-4,216
-2.67%	-1,290	-1,436	-1,601	-1,782	-1,976	-2,181	-2,396
0%	663	454	232	0	-241	-488	-740
2.67%	2,378	2,114	1,845	1,572	1,295	1,016	734
5.33%	3,802	3,506	3,209	2,912	2,614	2,317	2,019
8.00%	4,912	4,614	4,314	4,014	3,714	3,413	3,112

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

(단위:백만원)

14,494

공시일	2020-03-31
기준일	2020-03-30

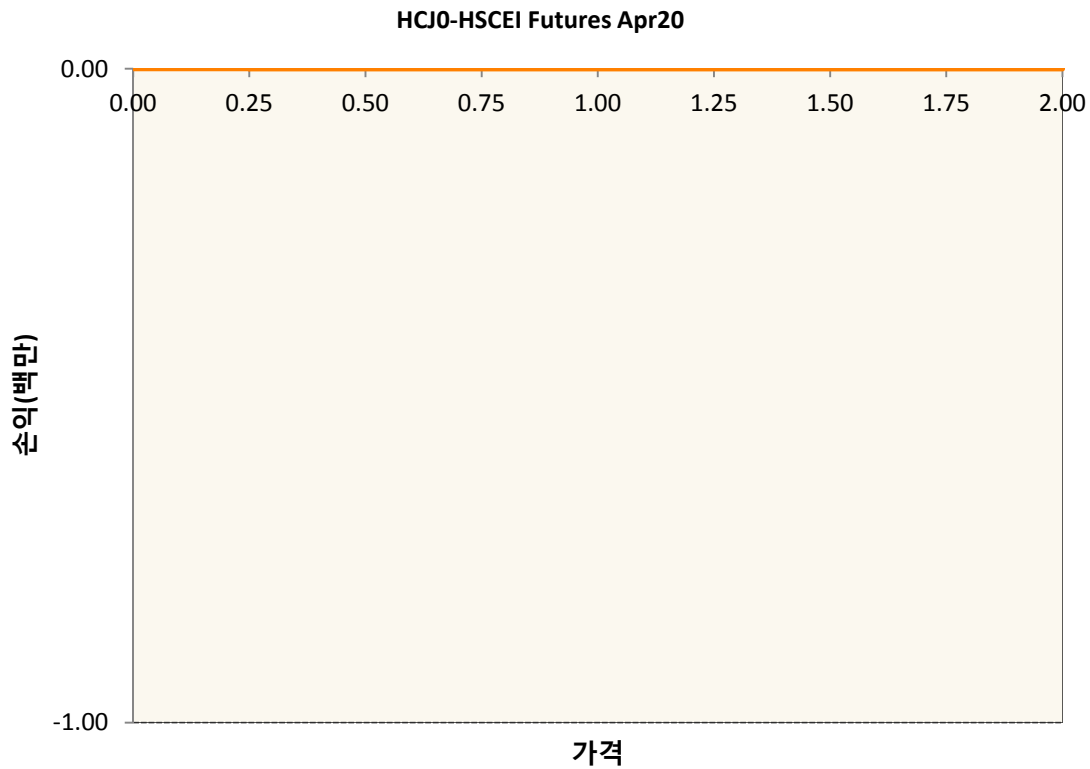
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ0	HSCEI Futures Apr20	124
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

131

공시일	2020-03-31
기준일	2020-03-30

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

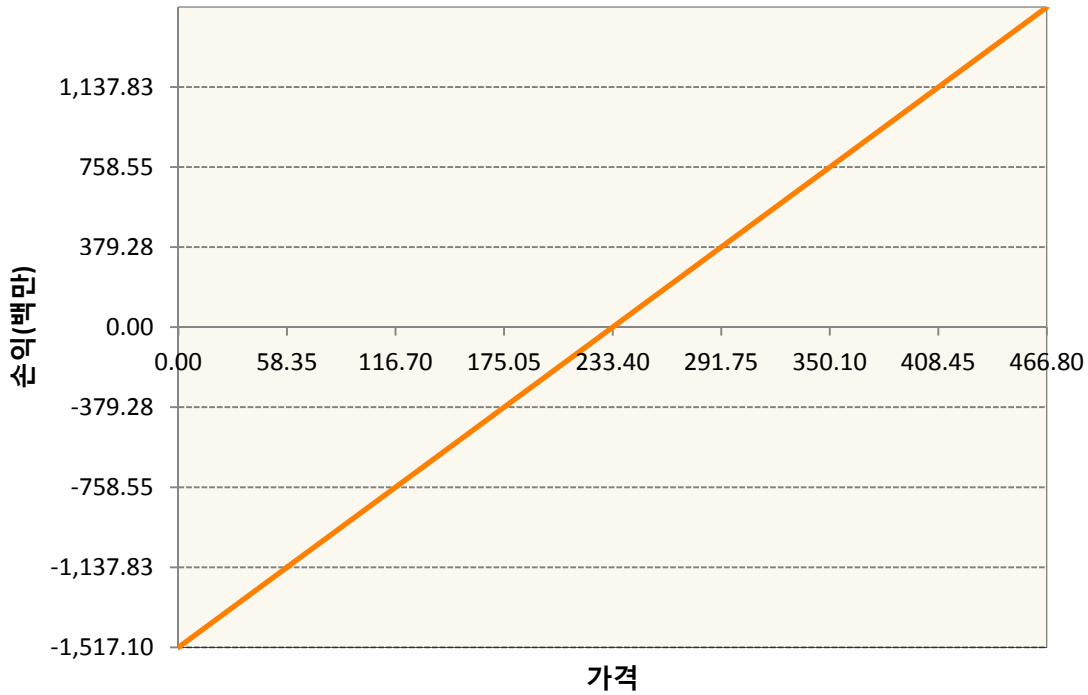
1. 계약금액

(단위:백만원)

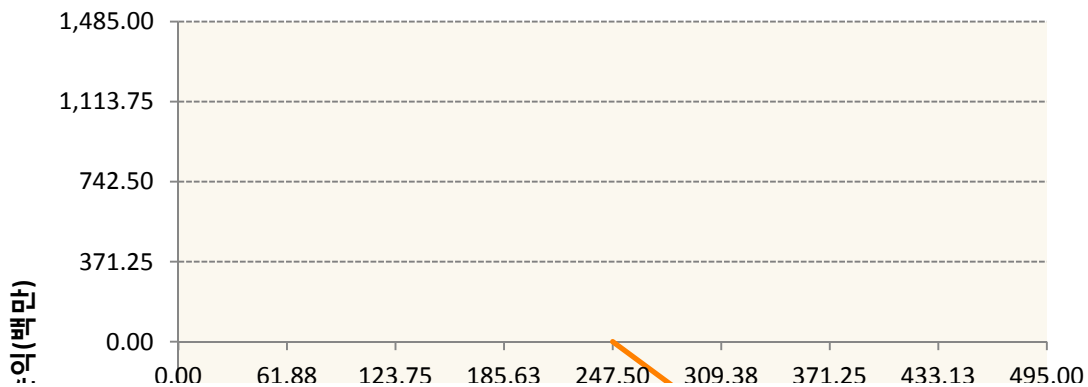
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,517	0	1,517	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,095	-3,095	장내

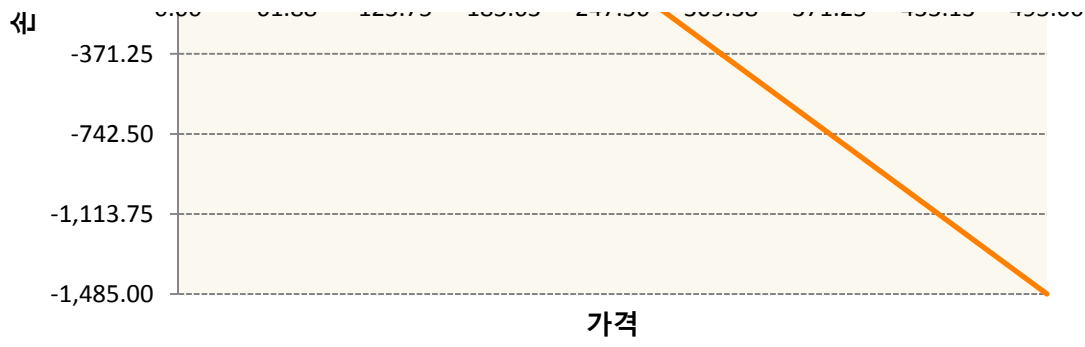
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

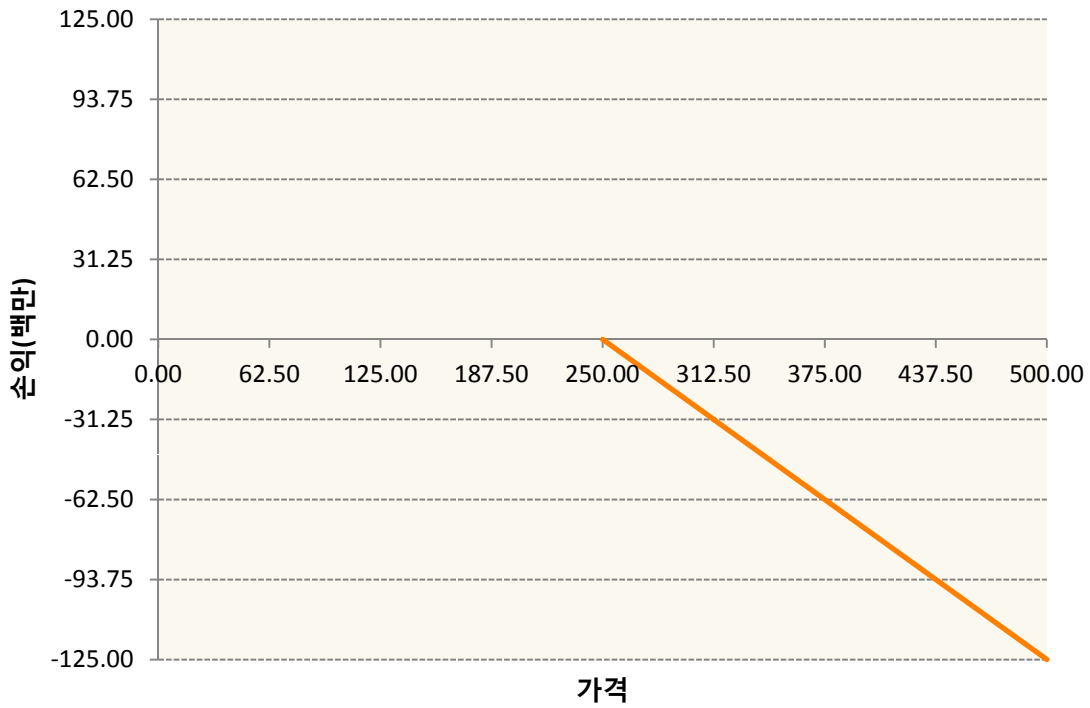


KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

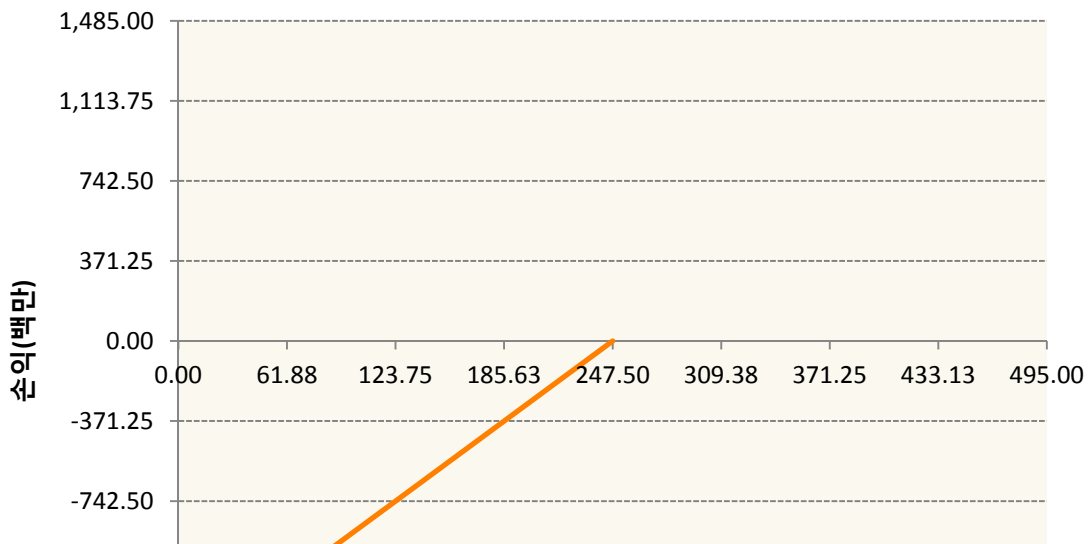


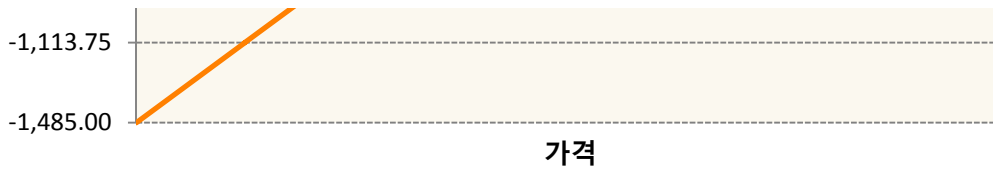


KR4201Q42503-2020-04 콜250



KR4301Q42477-2020-04 풋247.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

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						64
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	25	24	22	20	18	16	14	
-5.33%	23	21	19	16	13	10	7	
-2.67%	19	16	13	9	6	2	-2	
0%	12	8	4	0	-4	-9	-13	
2.67%	2	-3	-8	-13	-17	-22	-27	
5.33%	-13	-18	-23	-29	-34	-39	-44	
8.00%	-33	-38	-43	-48	-53	-59	-64	
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	1	1	1	1	
-5.33%	2	2	1	1	1	1	0	
-2.67%	1	1	1	1	0	0	0	
0%	1	1	0	0	0	-1	-1	
2.67%	0	0	-1	-1	-1	-2	-2	
5.33%	-1	-1	-2	-2	-3	-3	-3	
8.00%	-2	-3	-3	-4	-4	-5	-5	
KR4301Q42477		2020-04 풋247.5						99
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-90	-91	-92	-93	-95	-97	-99	
-5.33%	-55	-56	-58	-60	-62	-65	-68	
-2.67%	-21	-23	-26	-29	-32	-35	-38	

0%	11	7	4	0	-4	-8	-12
2.67%	38	34	30	25	21	16	12
5.33%	61	56	51	47	42	37	32
8.00%	79	74	69	64	60	55	50

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

(단위:백만원)

316

공시일	2020-03-31
기준일	2020-03-30

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

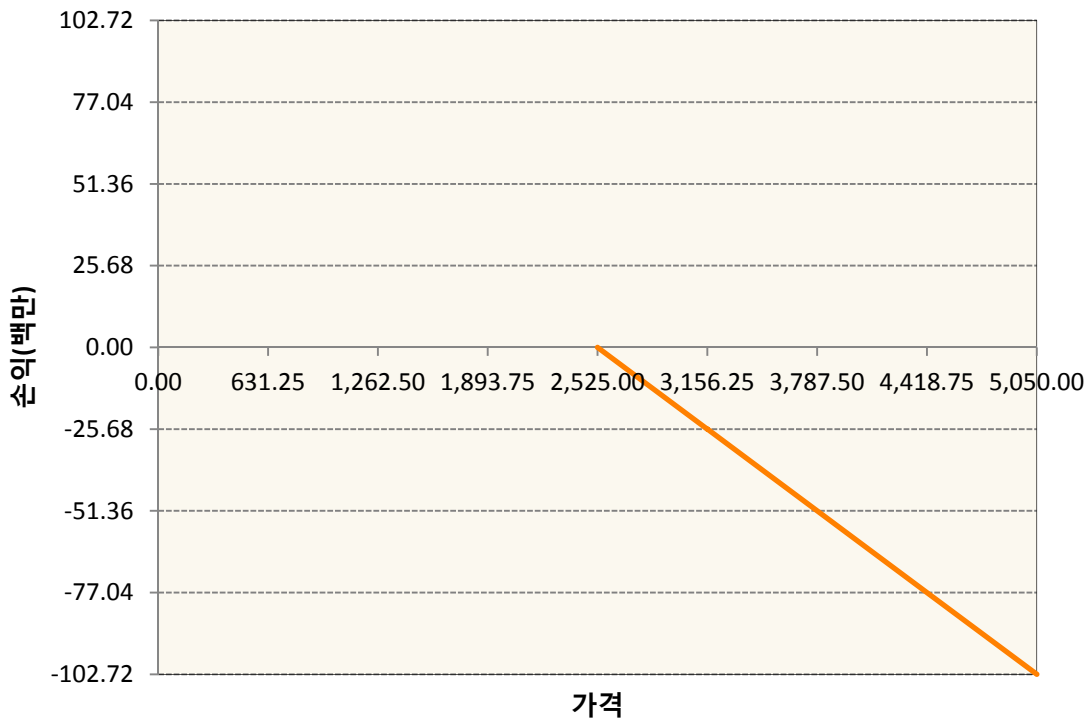
1. 계약금액

(단위:백만원)

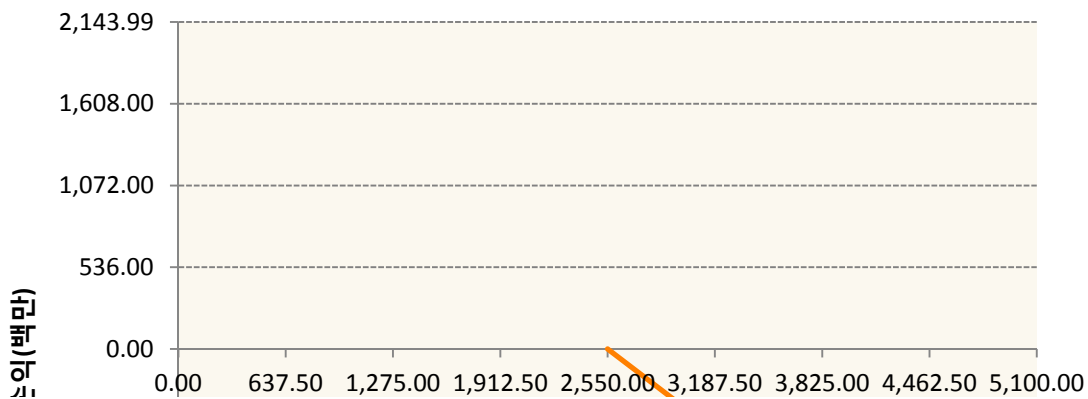
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	옵션	0	4,493	-4,493	장내

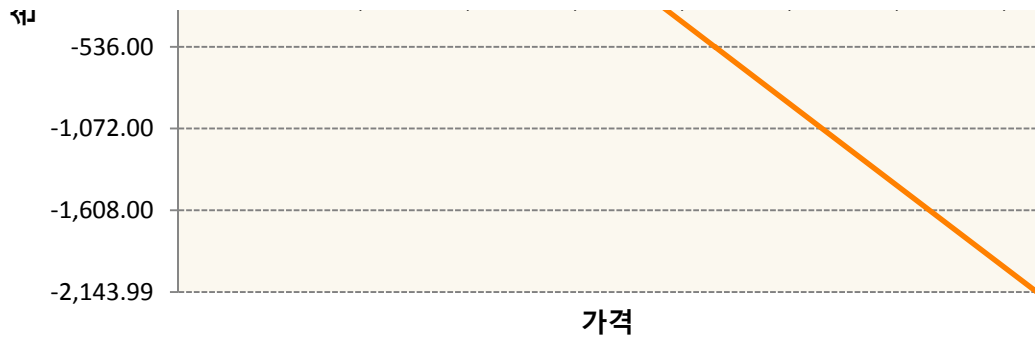
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ0-C2525-EURO STOXX 50

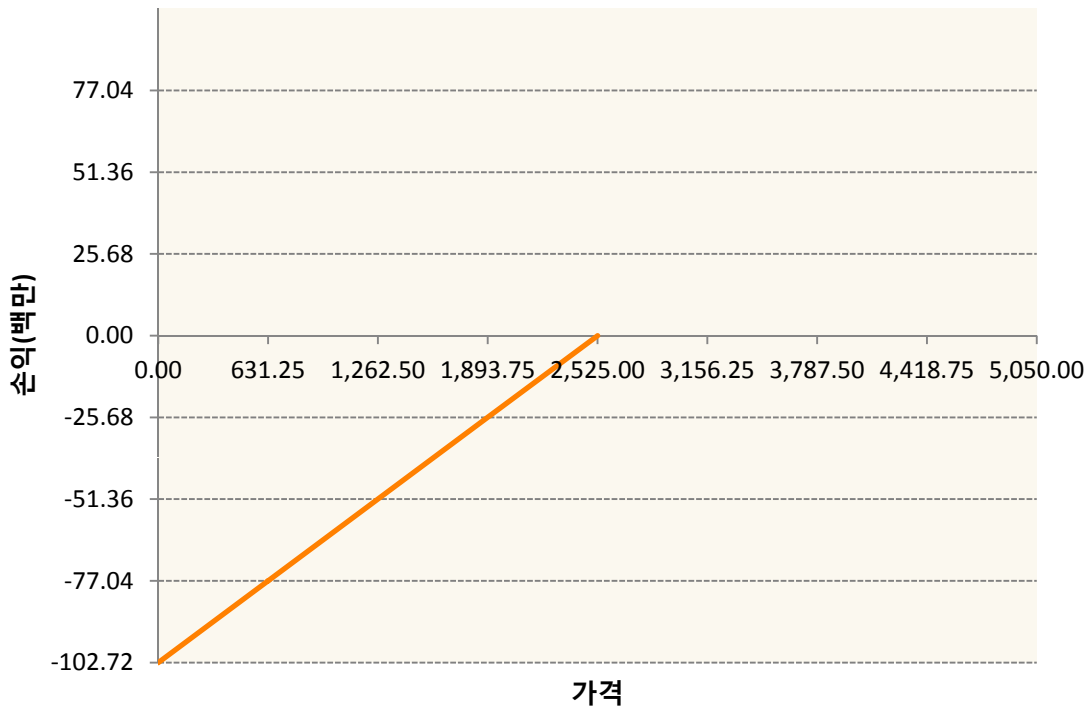


OESXJ0-C2550-EURO STOXX 50

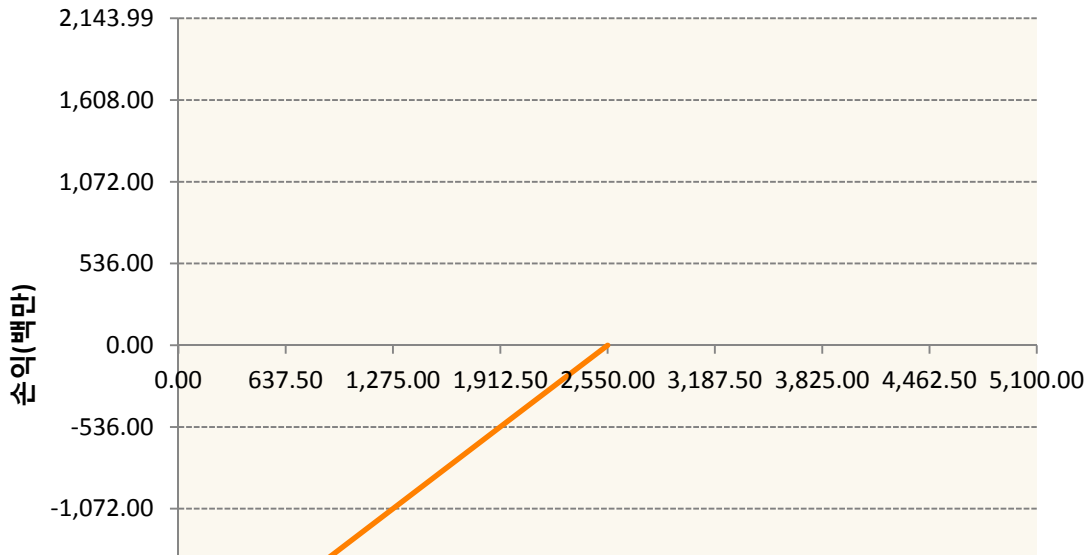


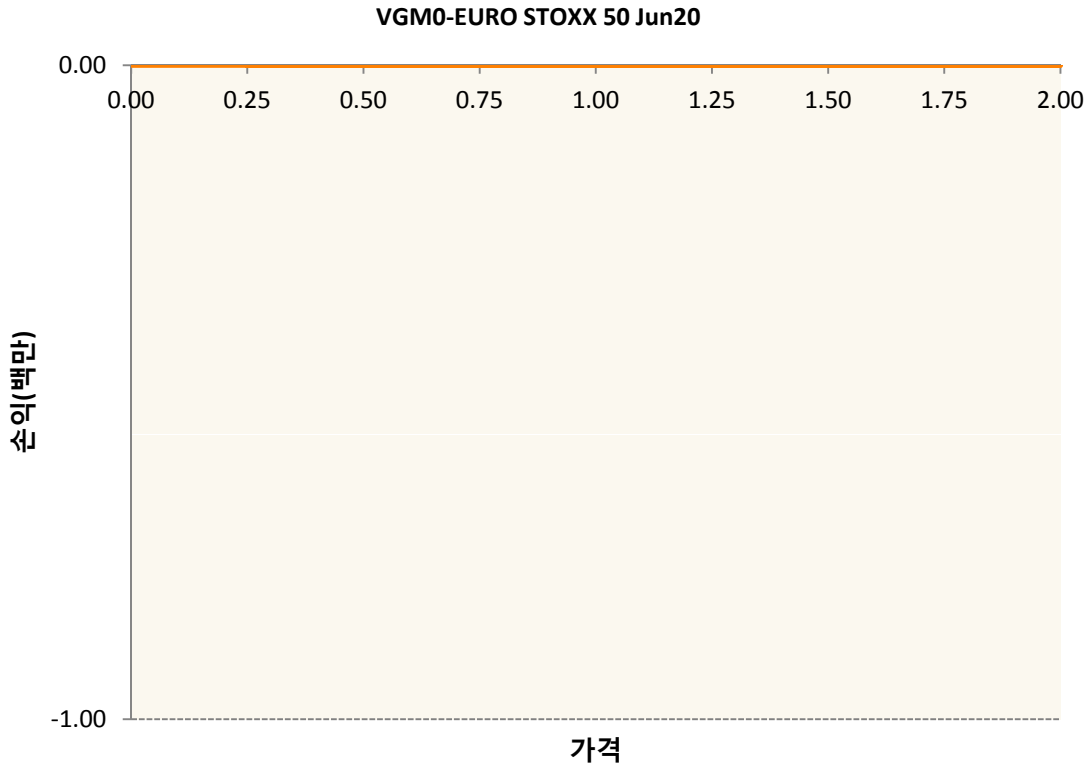
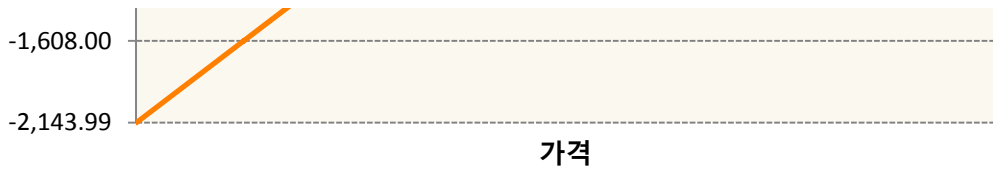


OESXJ0-P2525-EURO STOXX 50



OESXJ0-P2550-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
OESXJ0-C25: EURO STOXX 50		8
OESXJ0-C25: EURO STOXX 50		172
OESXJ0-P25: EURO STOXX 50		8
OESXJ0-P25: EURO STOXX 50		172
VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	20

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	453

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

(단위:백만원)

978

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

(단위:백만원)

85

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

(단위:백만원)

124

공시일	2020-03-31
기준일	2020-03-30

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

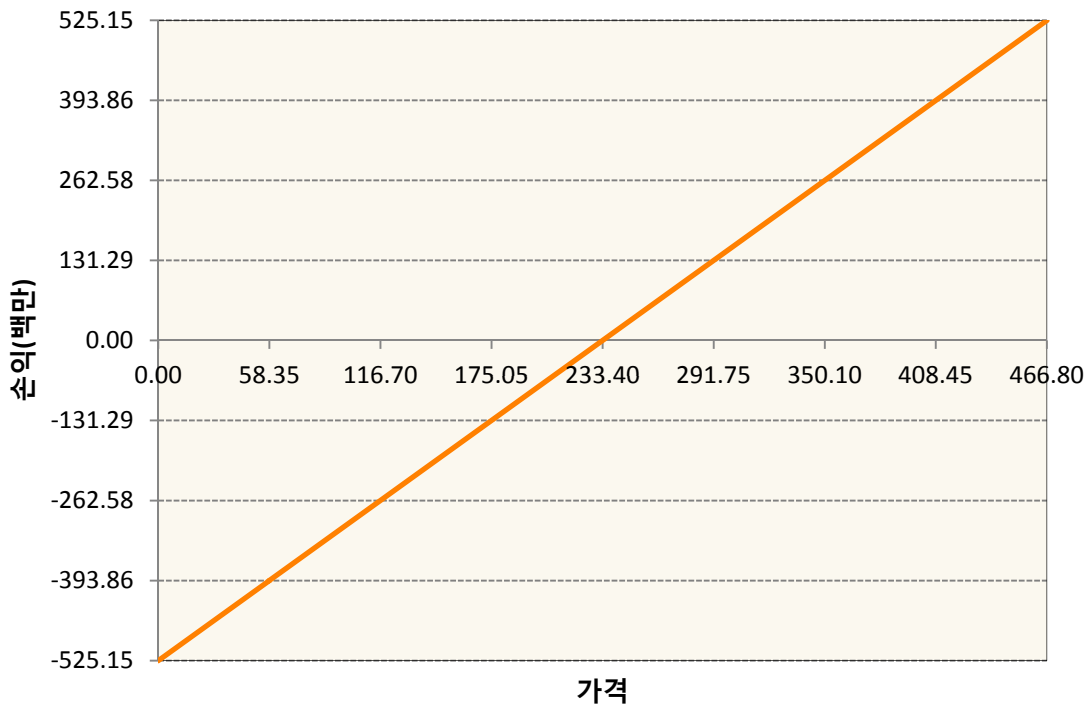
1. 계약금액

(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
가격	기초자산의 변동성							
	-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	2020-03-31
기준일	2020-03-30

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

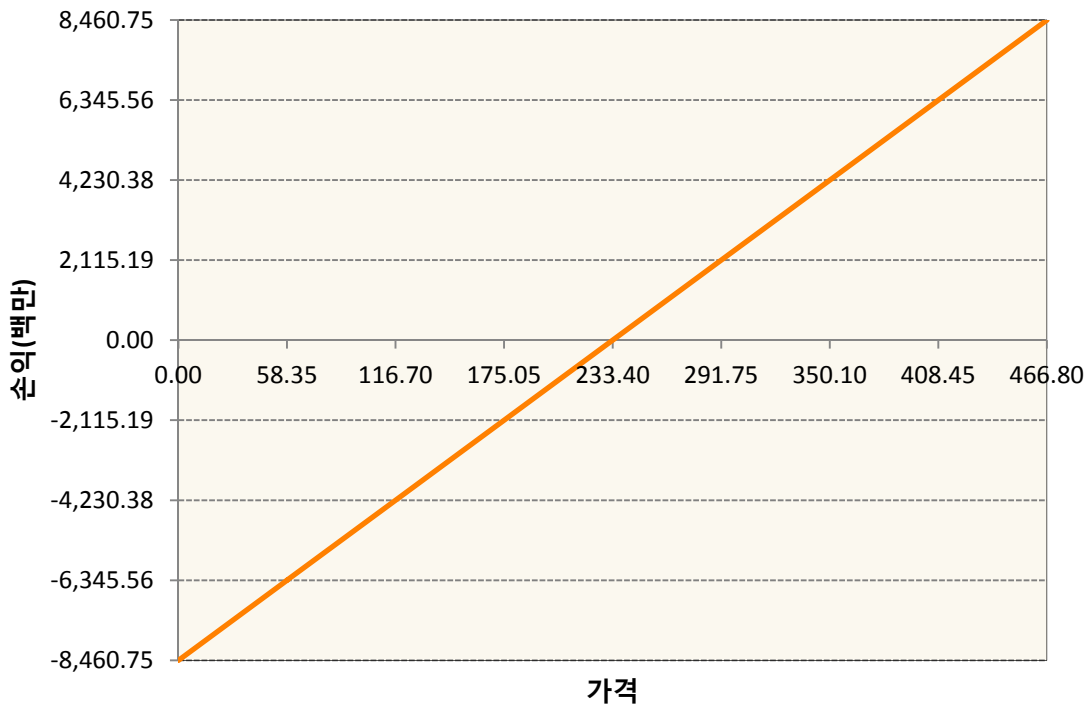
1. 계약금액

(단위:백만원)

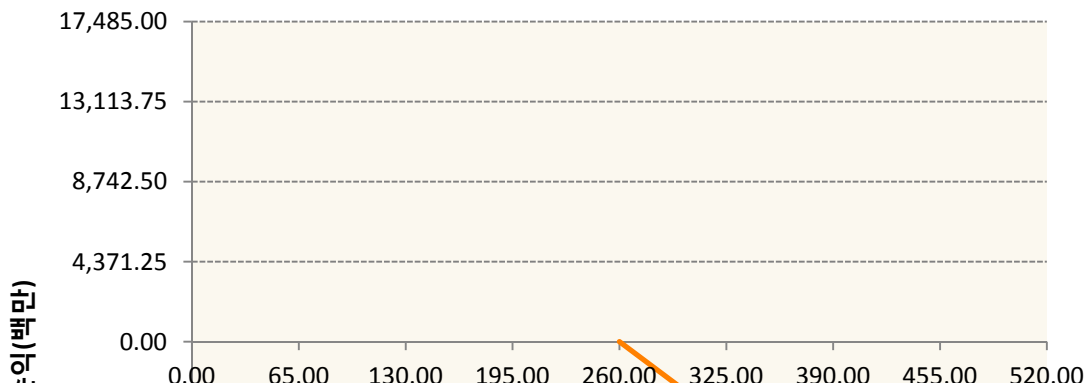
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,461	0	8,461	장내
누계	유가증권	옵션	6,004	17,485	-11,481	장내

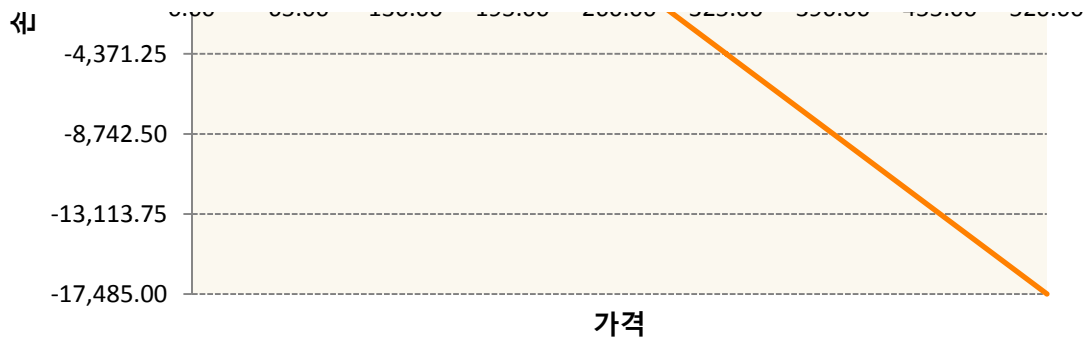
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

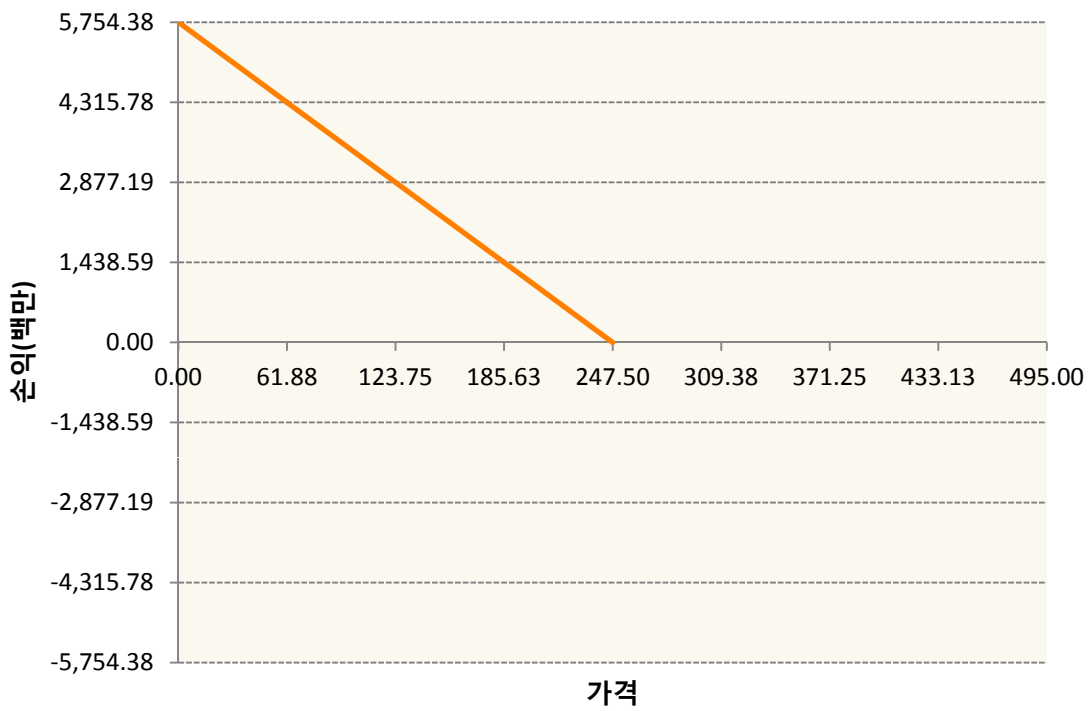


KR4201Q42602-2020-04 콜260

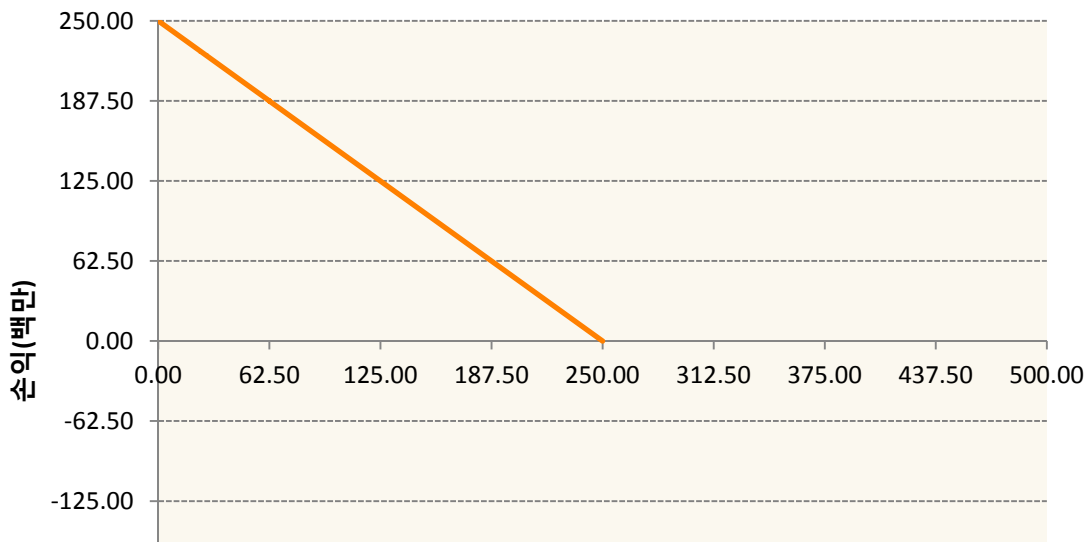


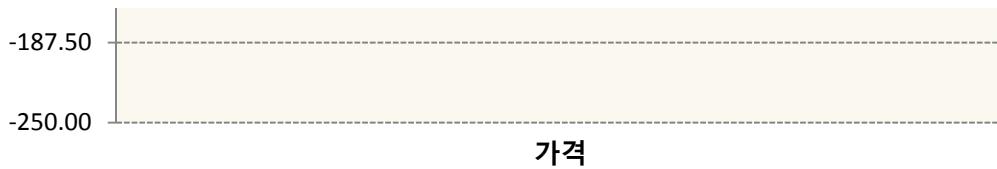


KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



KR4301Q42501-2020-04 풋250





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						674
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-674	-674	-674	-674	-674	-674	-674	
-5.33%	-449	-449	-449	-449	-449	-449	-449	
-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%	449	449	449	449	449	449	449	
8.00%	674	674	674	674	674	674	674	
KR4201Q42602		2020-04 콜260						506
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	128	124	118	109	98	83	65	
-5.33%	123	115	103	89	70	49	25	
-2.67%	110	95	77	54	28	-1	-33	
0%	84	60	32	0	-35	-72	-112	
2.67%	36	1	-38	-79	-123	-168	-216	
5.33%	-44	-90	-138	-189	-240	-293	-346	
8.00%	-164	-219	-276	-333	-390	-448	-506	
KR4301Q42477		2020-04 풋247.5						384
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	350	353	357	362	368	376	384	
-5.33%	212	217	224	232	241	251	262	
-2.67%	80	89	99	111	123	135	149	
0%	-41	-28	-14	0	15	30	46	
2.67%	-148	-131	-115	-98	-80	-63	-46	
5.33%	-236	-218	-199	-181	-162	-144	-125	
8.00%	-305	-286	-268	-249	-231	-212	-193	
KR4301Q42501		2020-04 풋250						17
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	16	16	16	16	16	17	17	
-5.33%	10	10	10	10	11	11	11	
-2.67%	4	4	5	5	5	6	6	

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

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

(단위:백만원)

1,586

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

(단위:백만원)

168

공시일	2020-03-31
기준일	2020-03-30

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

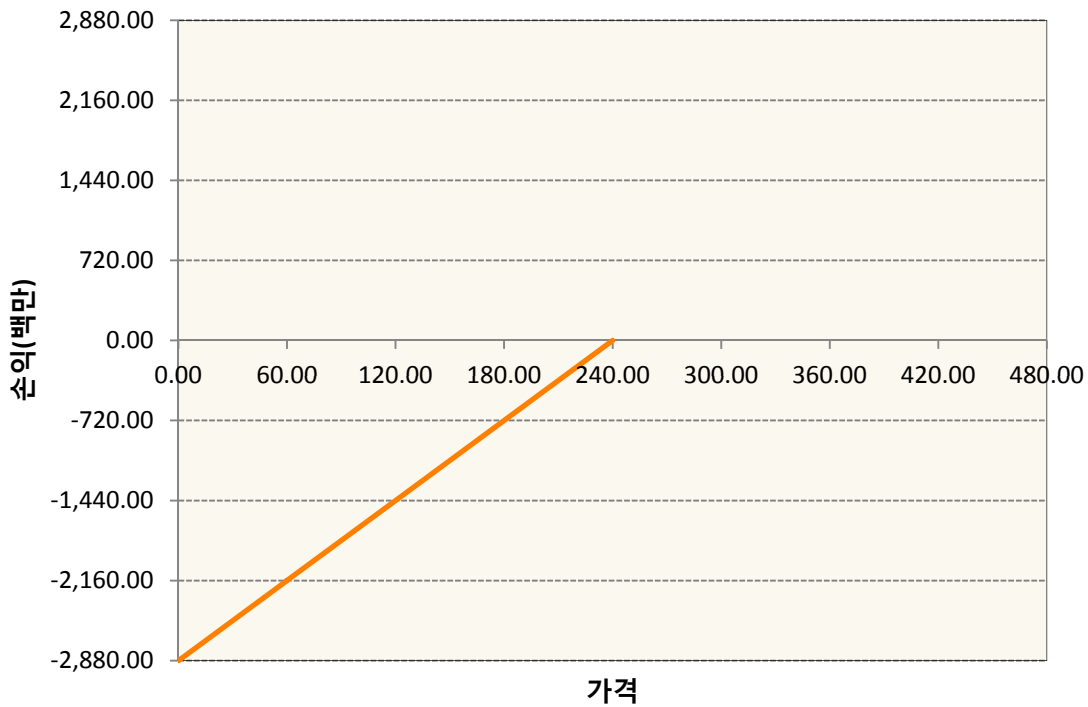
1. 계약금액

(단위:백만원)

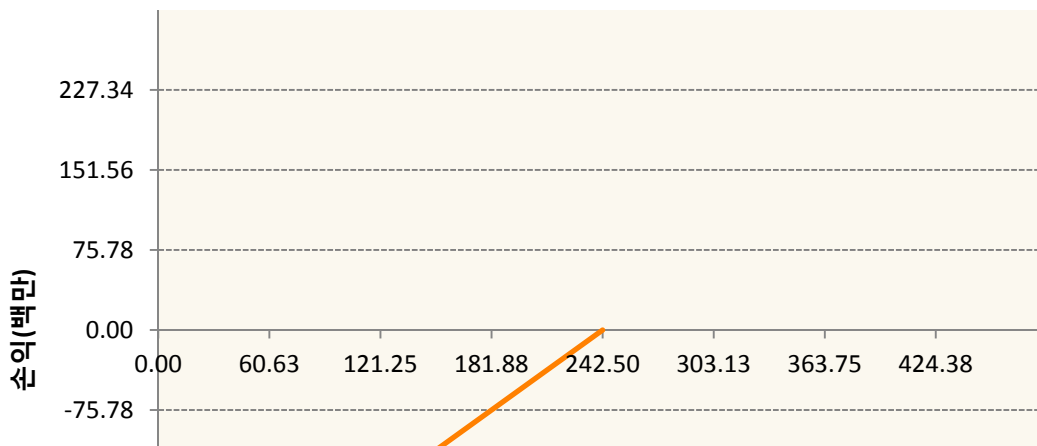
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,183	-3,183	장내

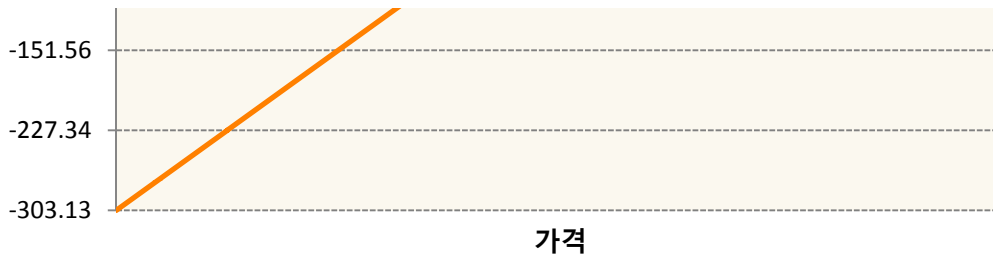
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q42402-2020-04 풋240



KR4301Q42428-2020-04 풋242.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q42402		2020-04 풋240						183
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-157	-160	-164	-168	-172	-177	-183	
-5.33%	-90	-94	-100	-106	-112	-118	-125	
-2.67%	-28	-35	-42	-49	-57	-65	-73	
0%	26	17	9	0	-9	-18	-26	
2.67%	69	60	51	42	32	23	14	
5.33%	103	94	84	75	66	57	47	
8.00%	126	118	110	101	93	84	75	
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	-18	-18	-18	-19	-19	-20	
-5.33%	-10	-10	-11	-12	-12	-13	-13	
-2.67%	-3	-4	-5	-5	-6	-7	-8	
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3	
2.67%	8	7	6	5	4	3	2	
5.33%	11	10	9	8	7	7	6	
8.00%	14	13	12	12	11	10	9	

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

190

공시일	2020-03-31
기준일	2020-03-30

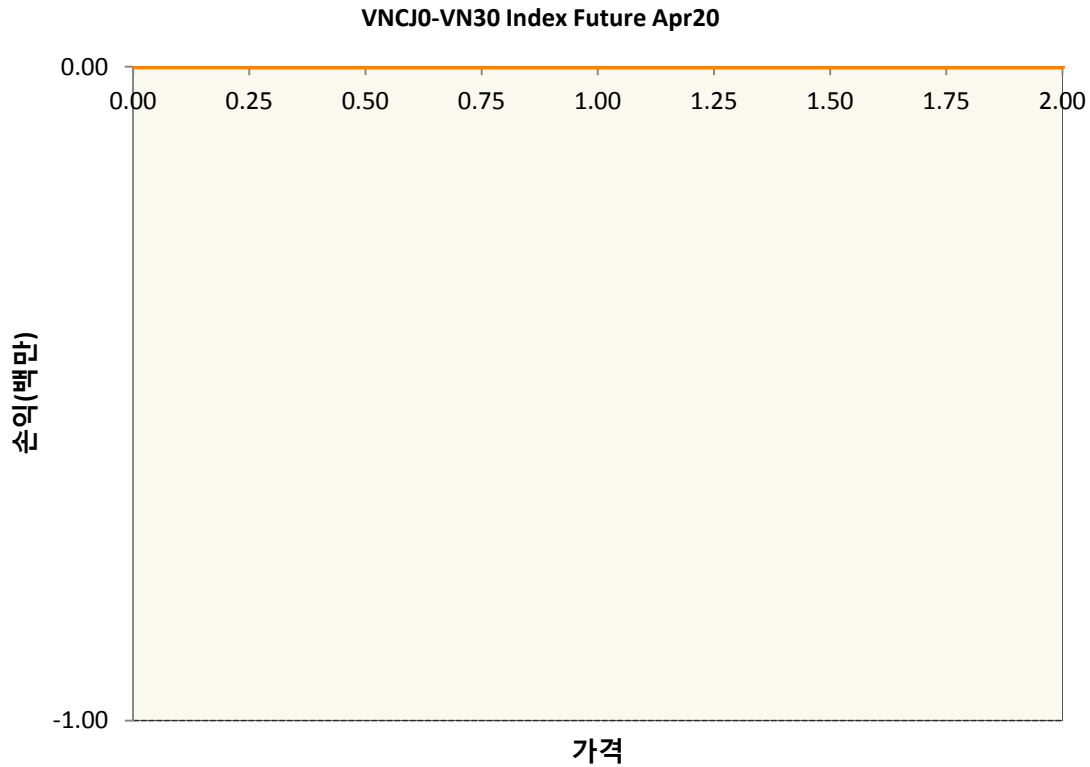
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VNCJ0	VN30 Index Future Apr20	30
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

25

공시일	2020-03-31
기준일	2020-03-30

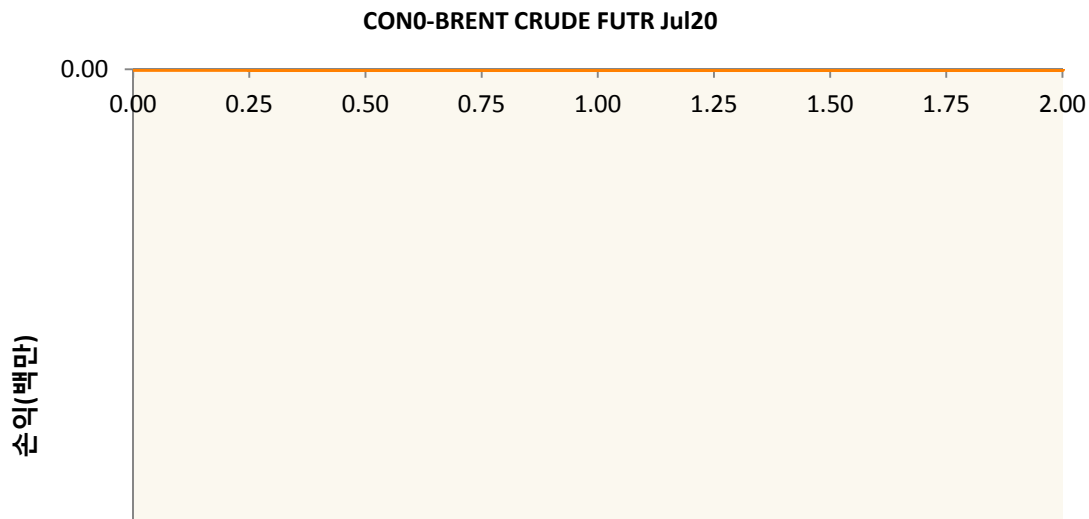
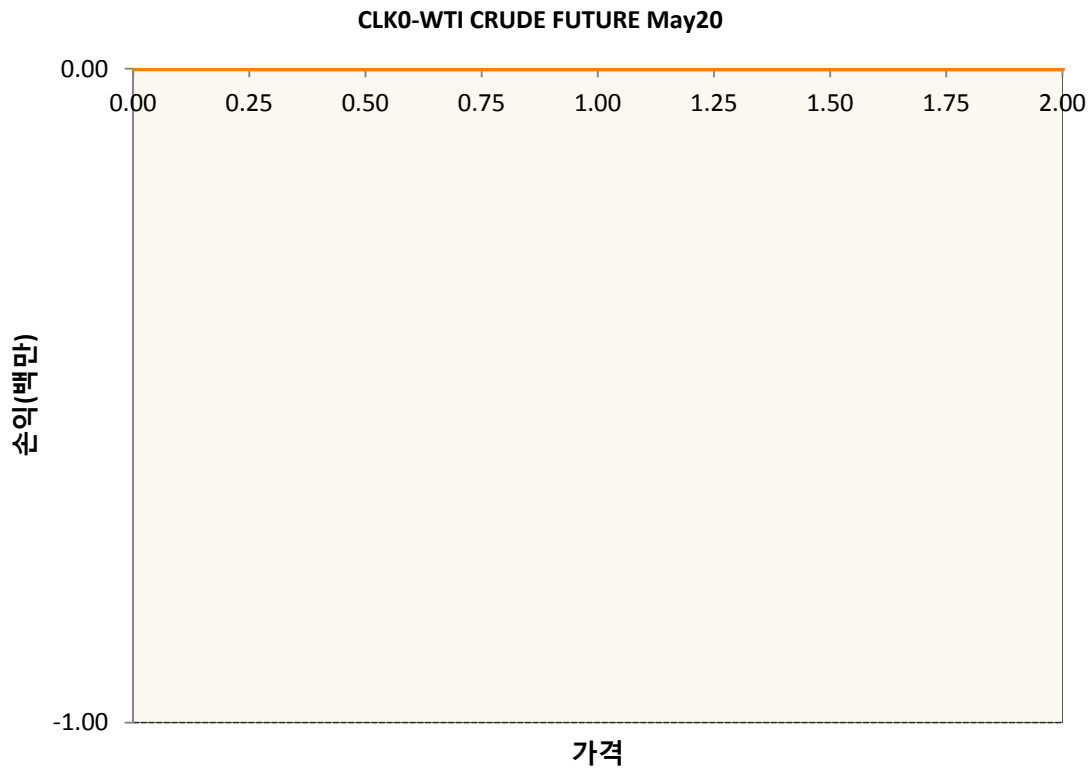
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

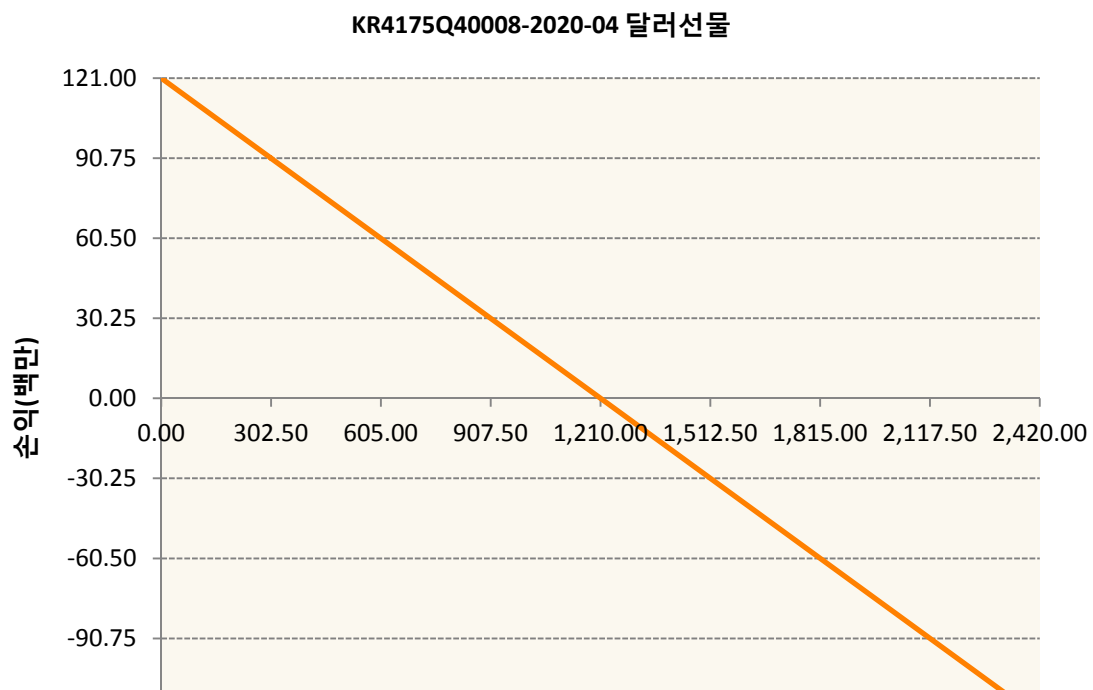
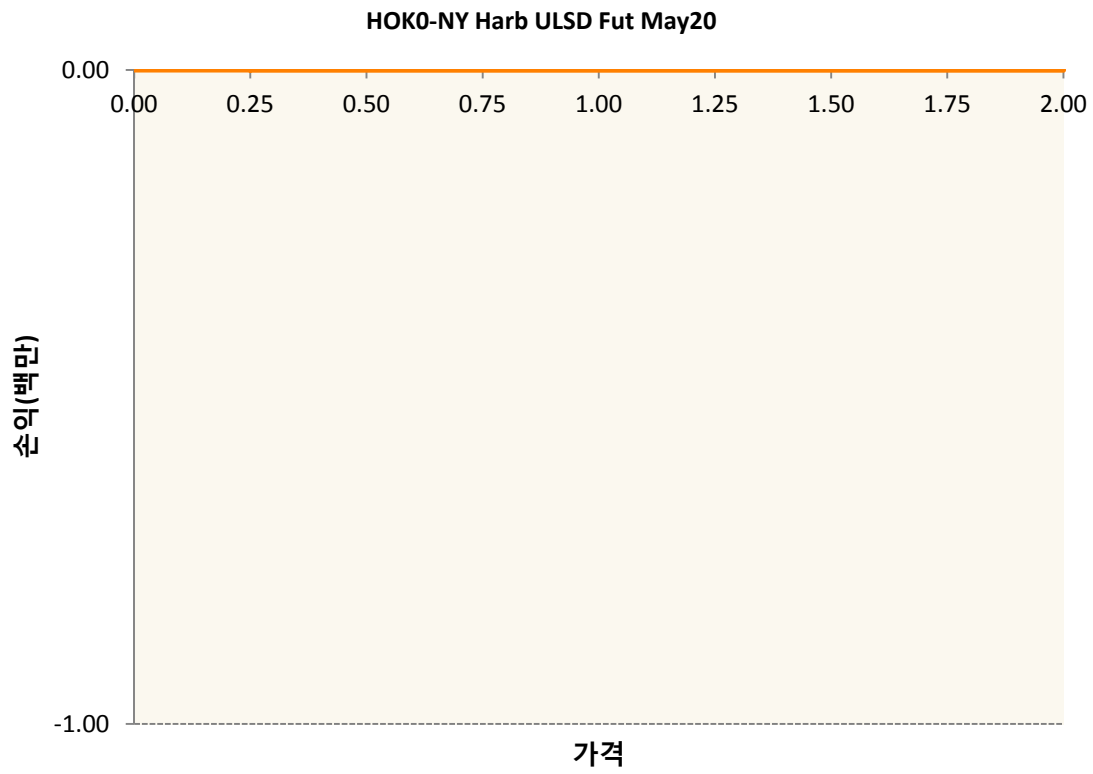
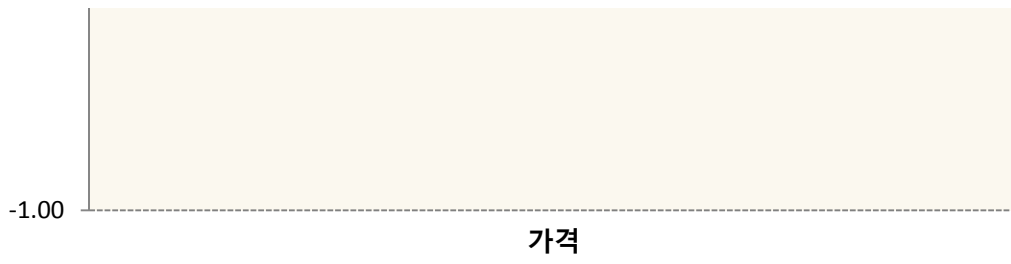
1. 계약금액

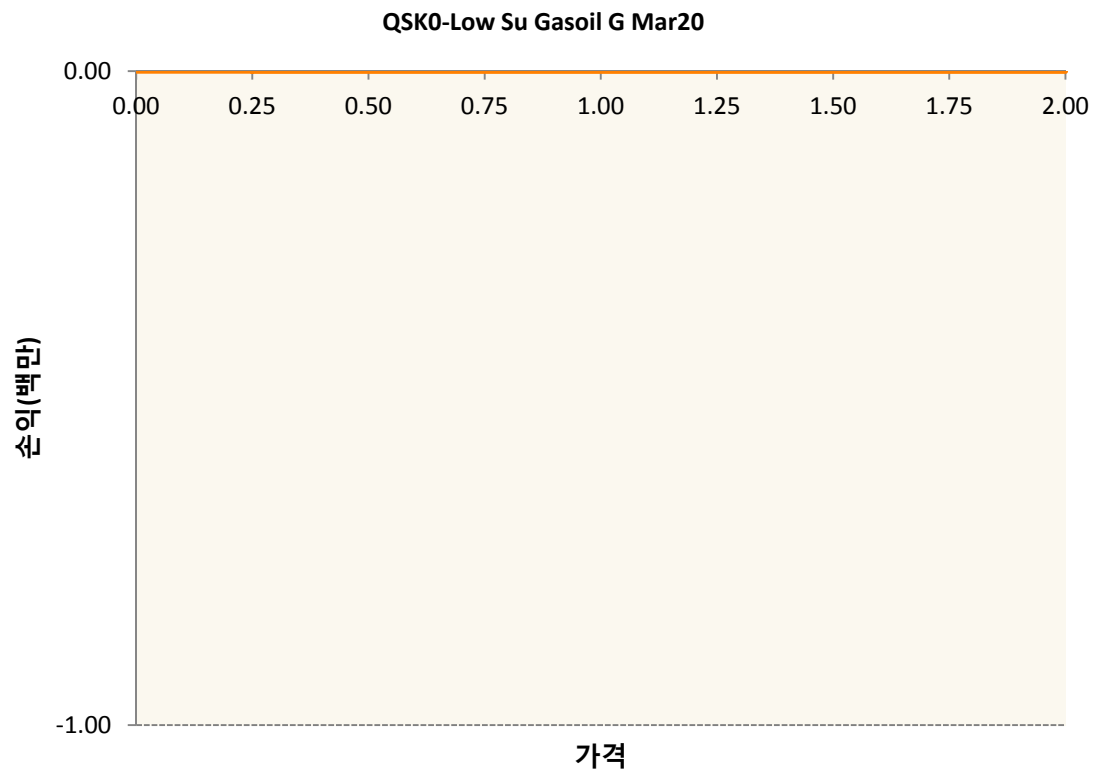
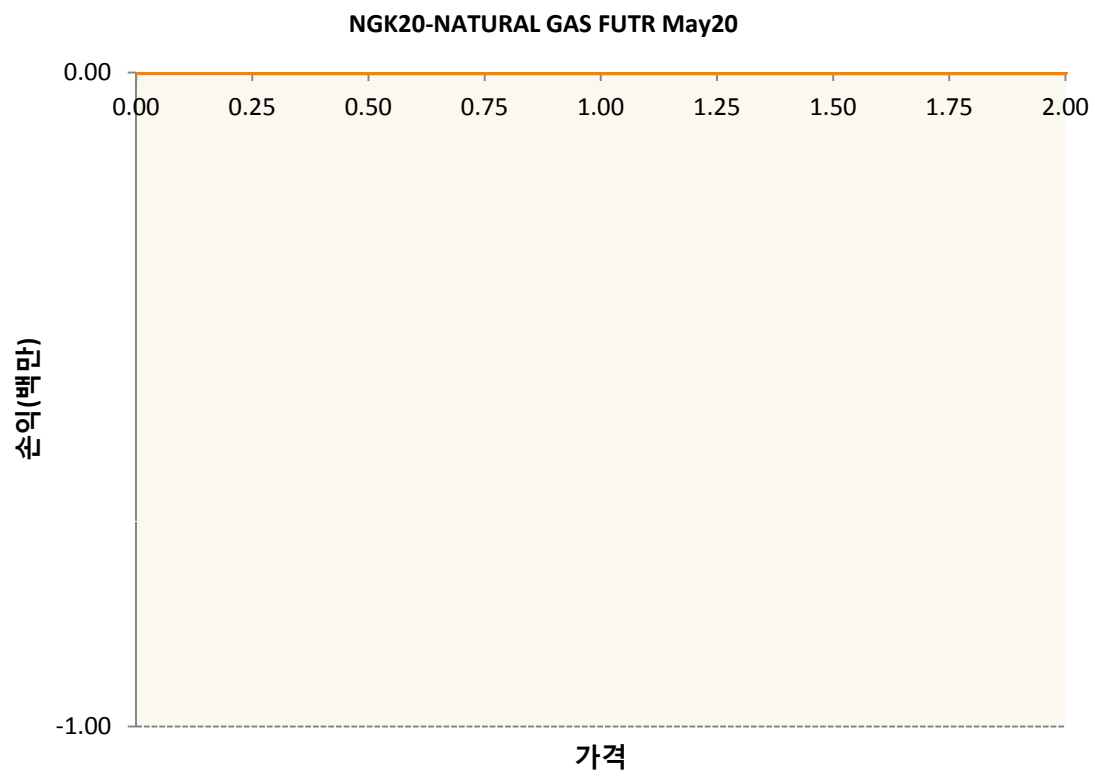
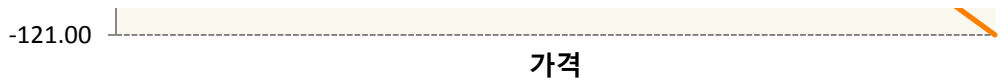
(단위:백만원)

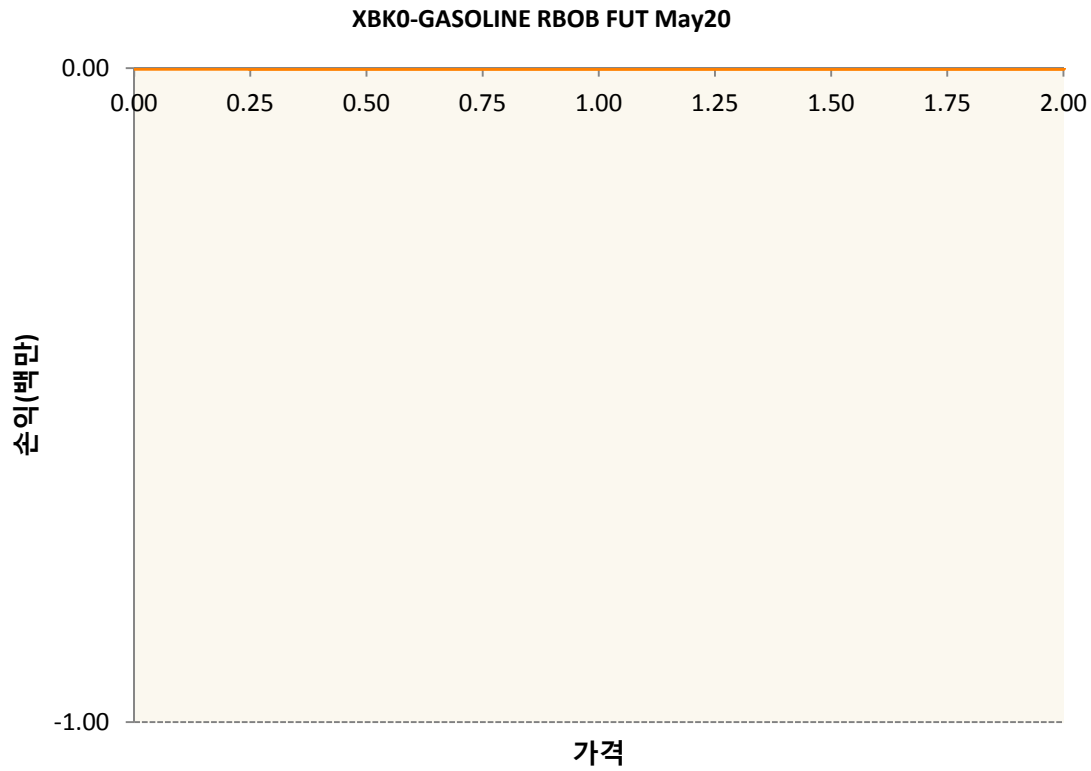
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	0	121	-121	

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	16
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	8
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	5

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

280

공시일	2020-03-31
기준일	2020-03-30

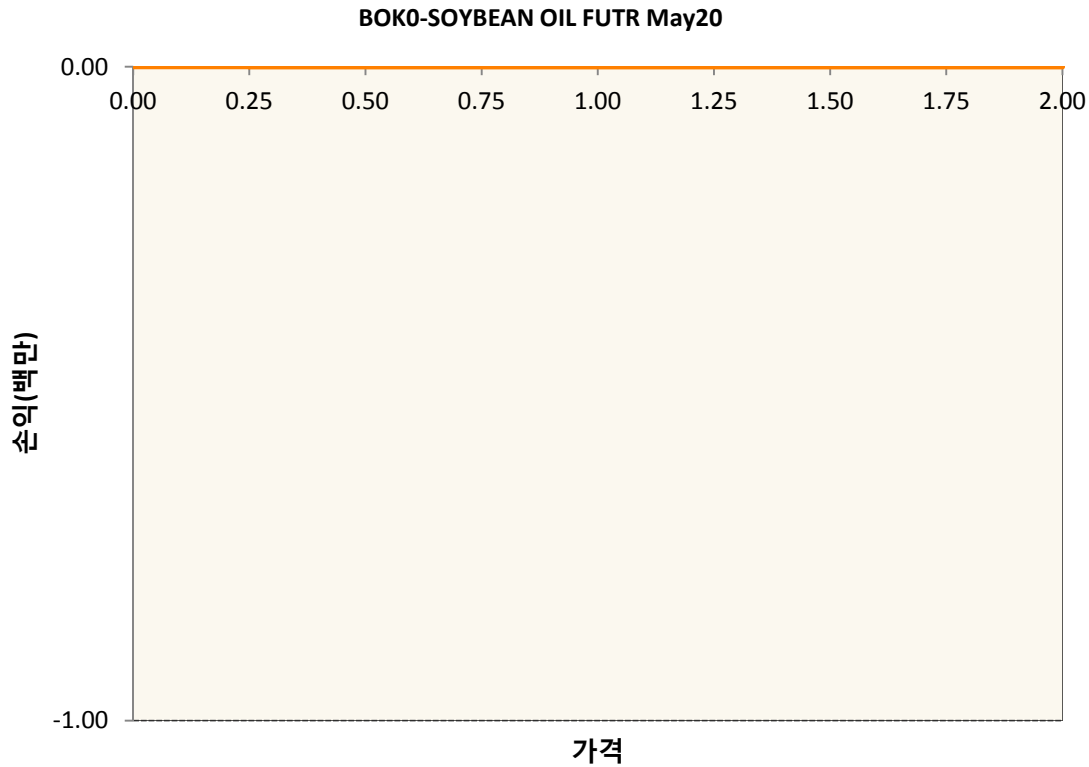
애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

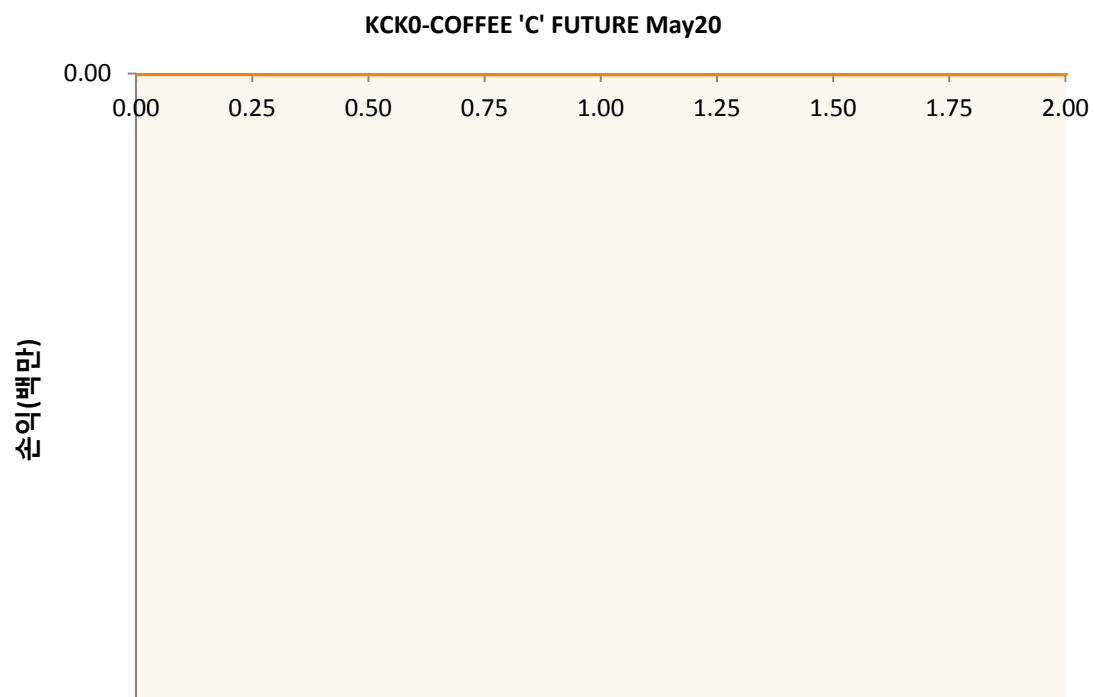
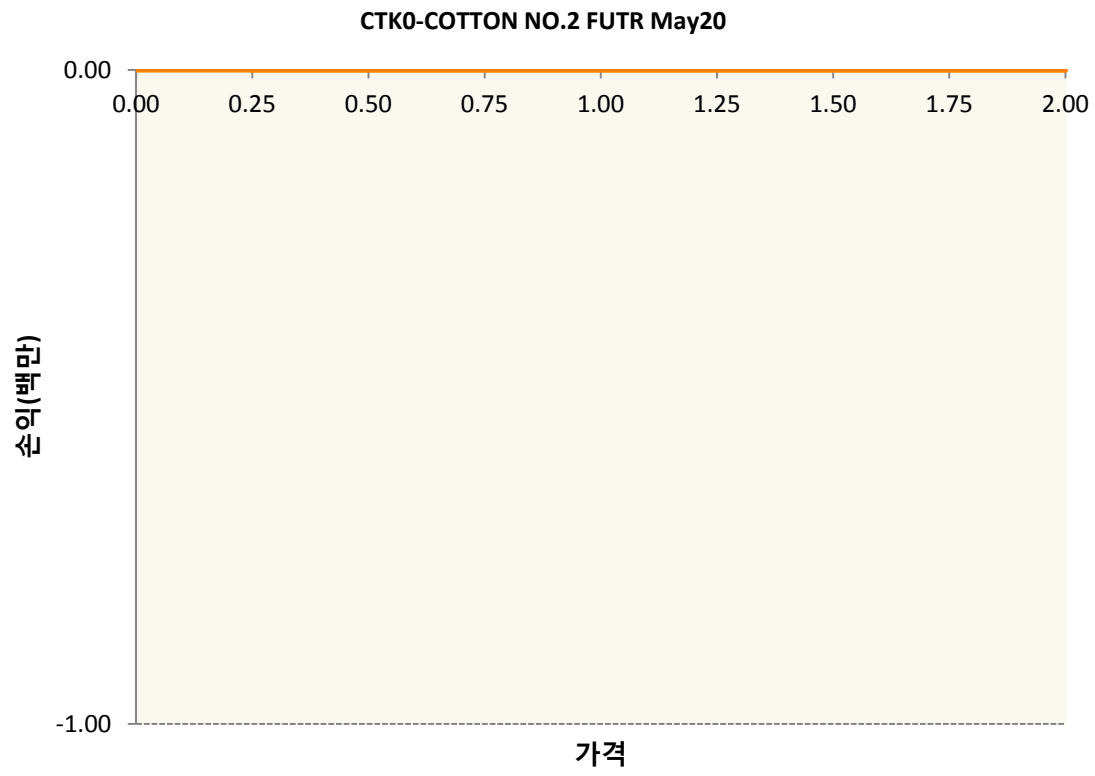
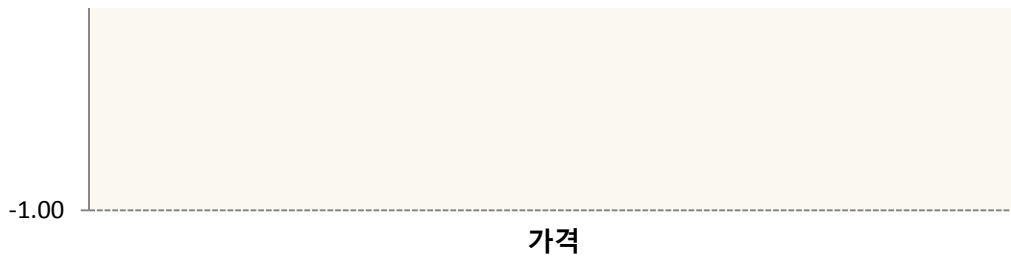
1. 계약금액

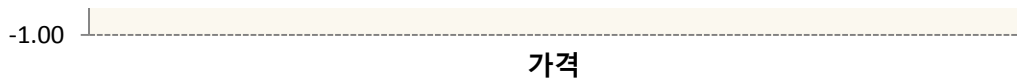
(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

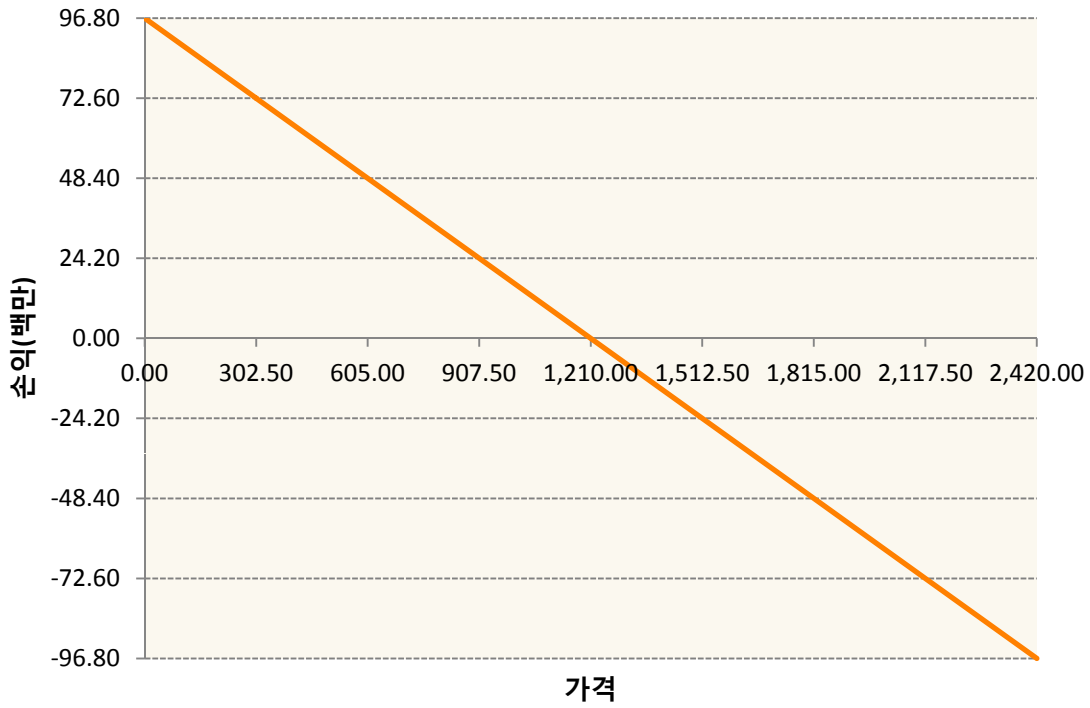






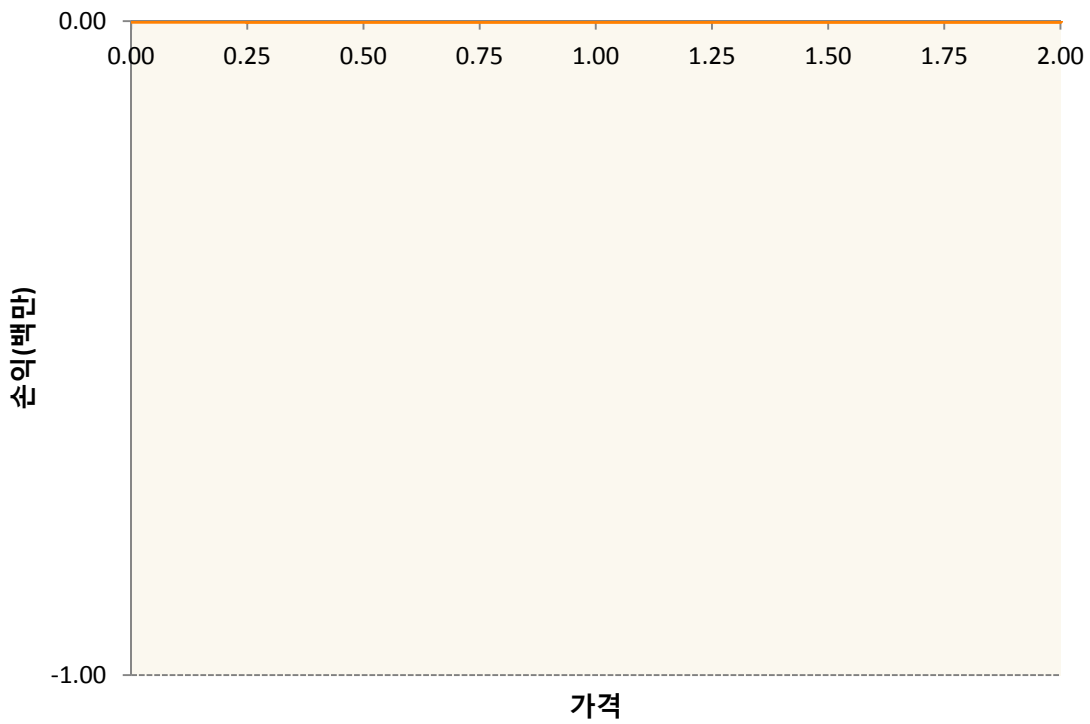
가격

KR4175Q40008-2020-04 달러선물



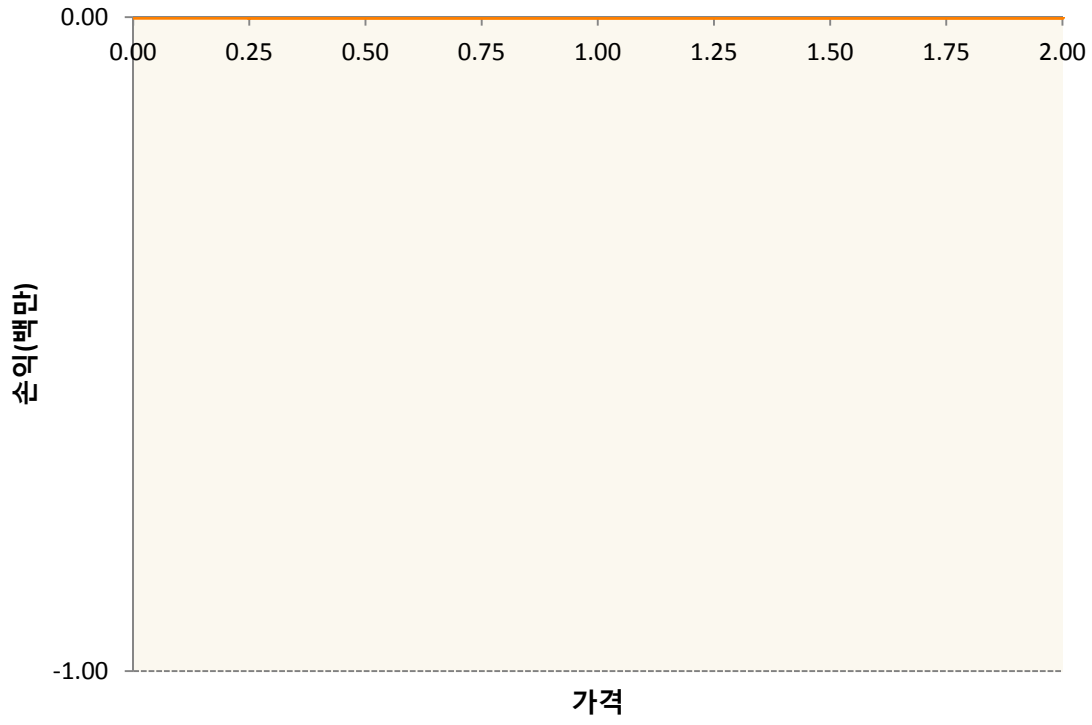
가격

KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20

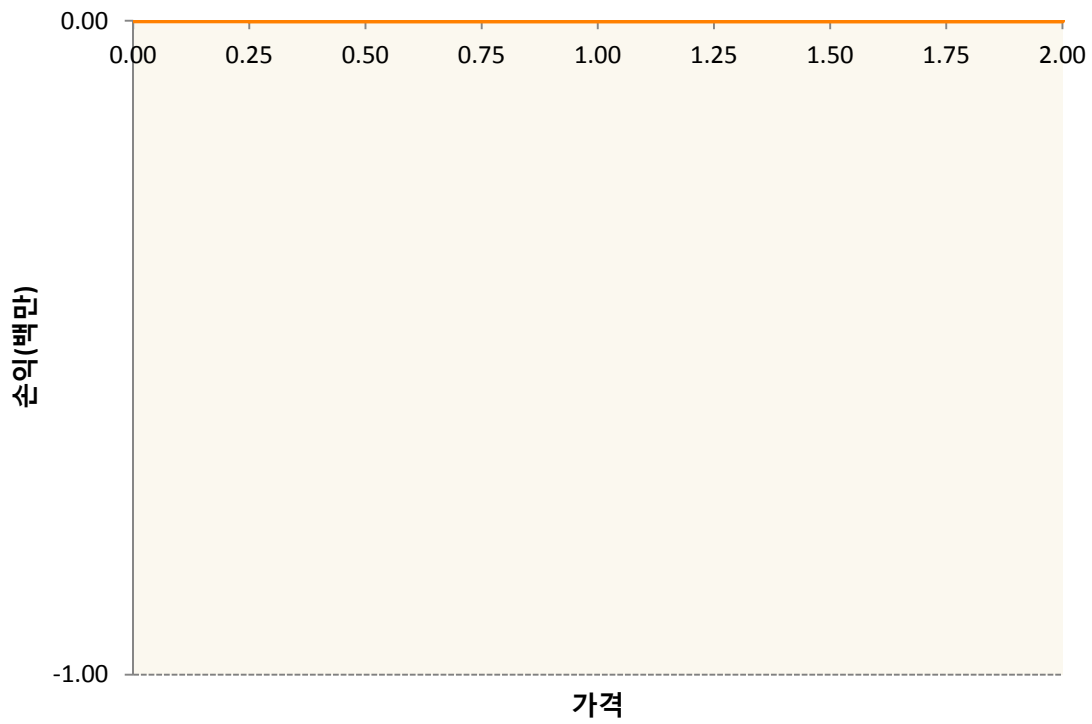


가격

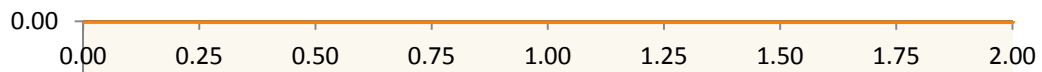
SBK0-Sugar May20

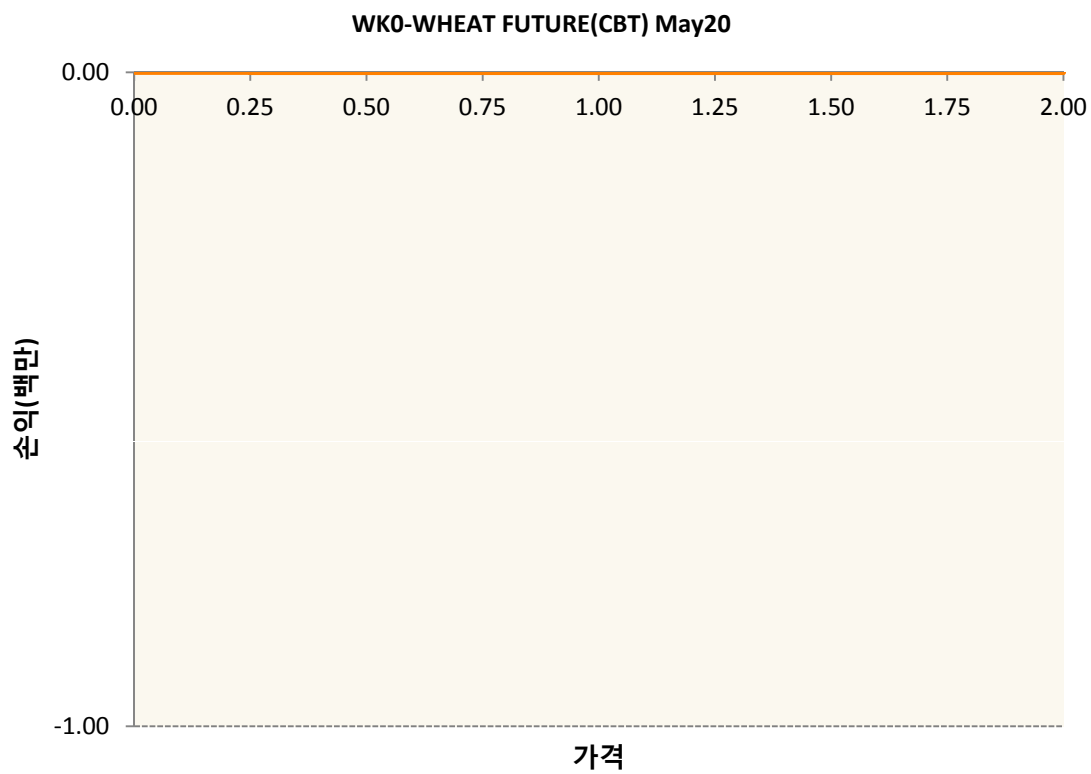


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	15
CK0	CORN FUTURE May20	37
CTK0	COTTON NO.2 FUTR May20	7
KCK0	COFFEE 'C' FUTURE May20	16
KR4175Q40C	2020-04 달러선물	8

KWK0	KC HRW WHEAT FUT May20	12
SBK0	Sugar May20	17
SK0	SOYBEAN FUTURE May20	37
SMK0	SOYBEAN MEAL FUTR May20	25
WK0	WHEAT FUTURE(CBT) May20	22

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

(단위:백만원)

219