

공시일	2020-04-01
기준일	2020-03-31

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	2020-04-01
기준일	2020-03-31

스마트인덱스모

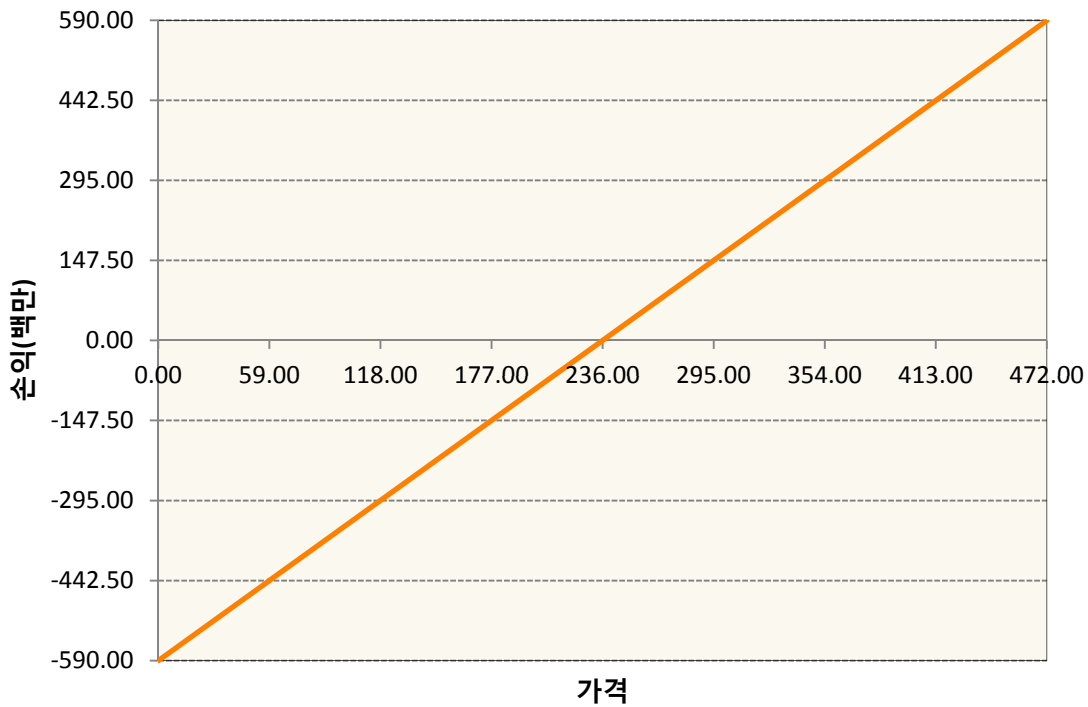
1. 계약금액

(단위:백만원)

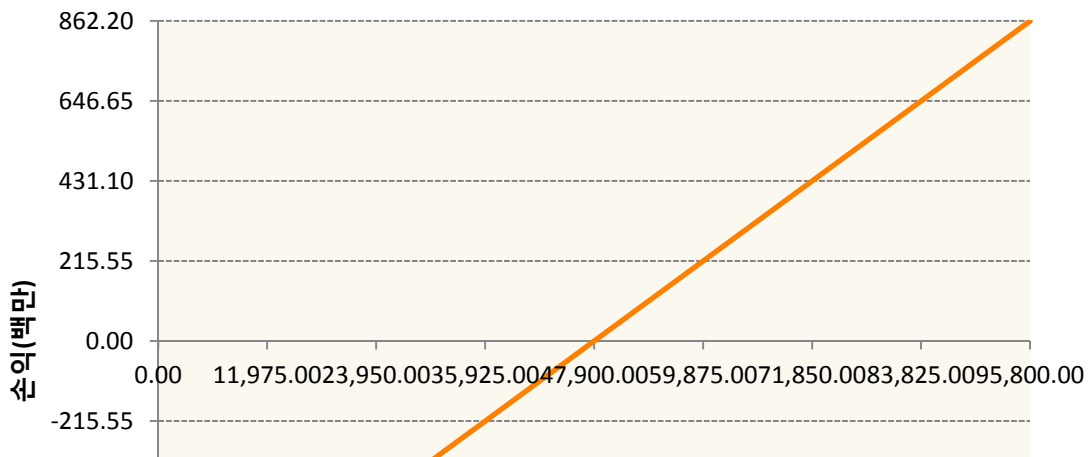
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	1,175	-1,175	장내
누계	유가증권	선물	1,452	0	1,452	장내

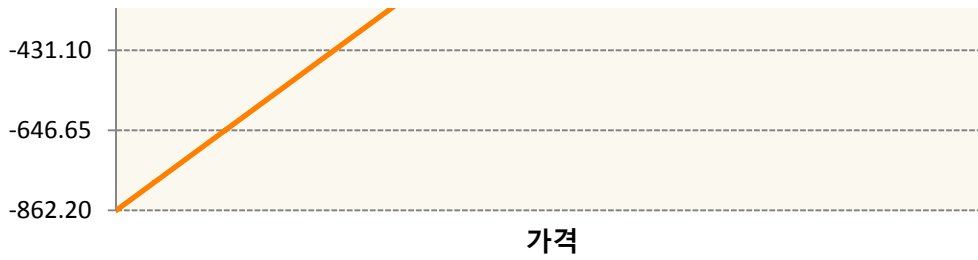
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



KR4111Q40003-2020-04 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						47
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47	
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	16	16	16	16	16	16	16	
5.33%	32	32	32	32	32	32	32	
8.00%	47	47	47	47	47	47	47	
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)

165

공시일	2020-04-01
기준일	2020-03-31

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

901

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,001

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-01
기준일	2020-03-31

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

522

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

826

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-01
기준일	2020-03-31

유로인덱스모(주식-파생형)

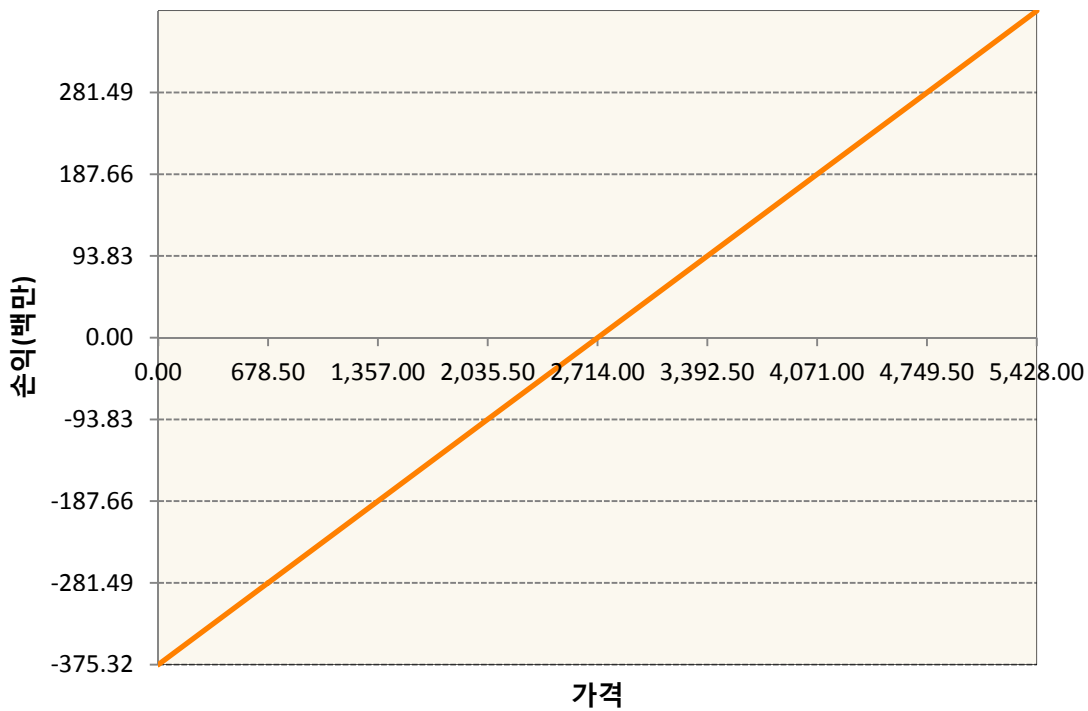
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	375	0	375	

2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	30
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

36

공시일	2020-04-01
기준일	2020-03-31

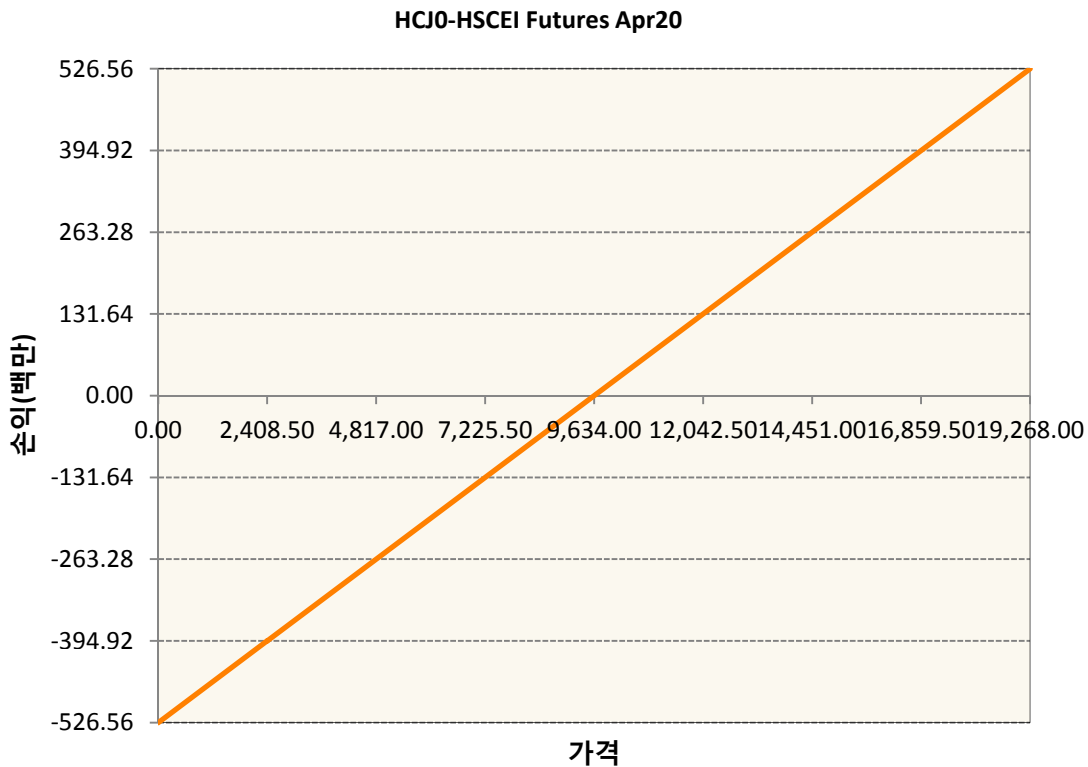
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	527	0	527	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

45

공시일	2020-04-01
기준일	2020-03-31

커버드콜모(주식혼합-파생형)

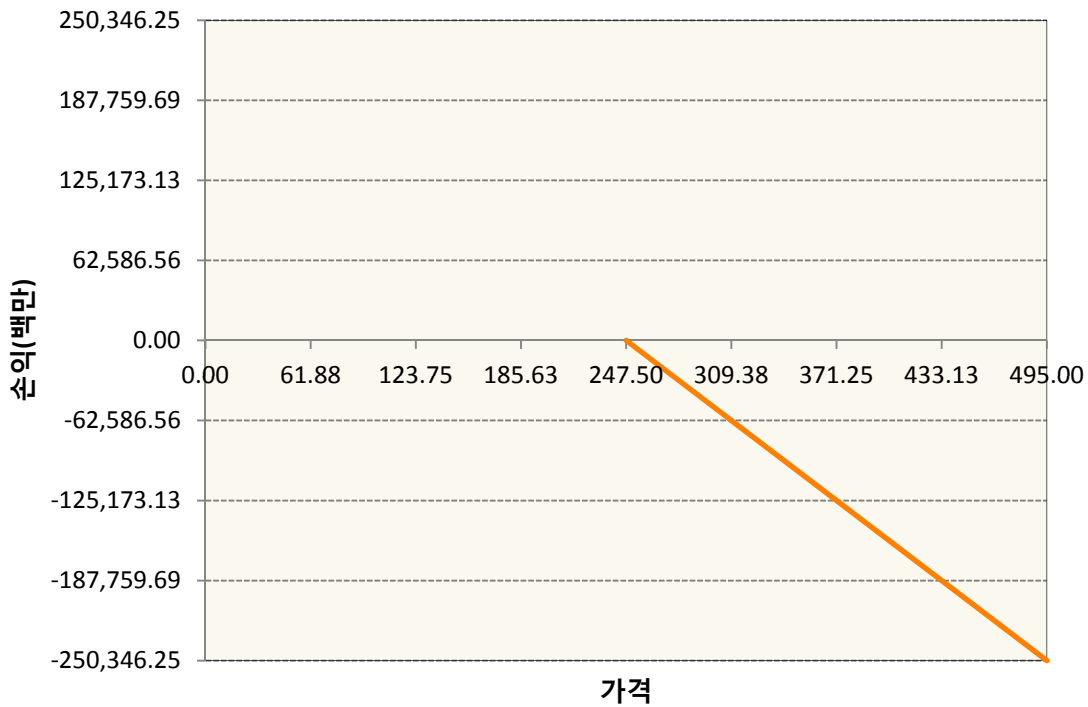
1. 계약금액

(단위:백만원)

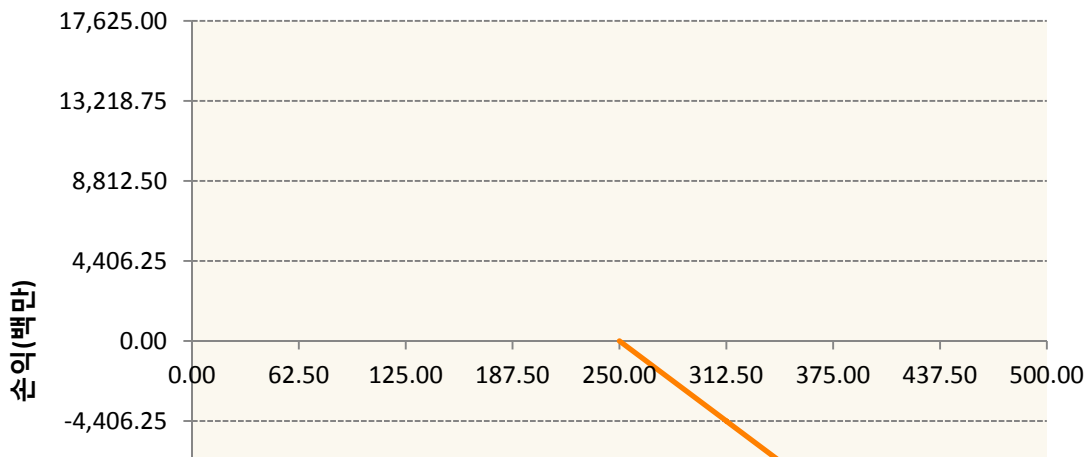
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	360,660	-360,660	장내

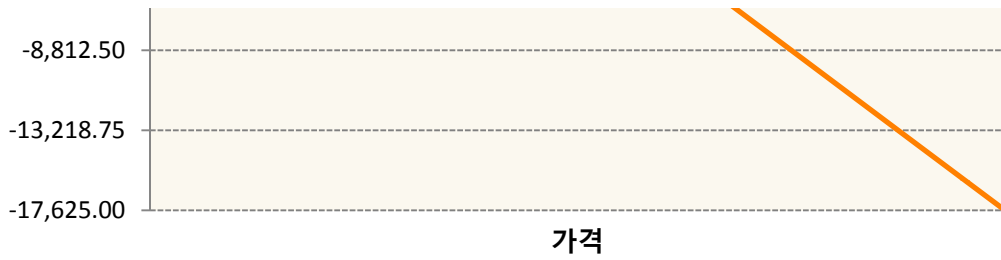
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

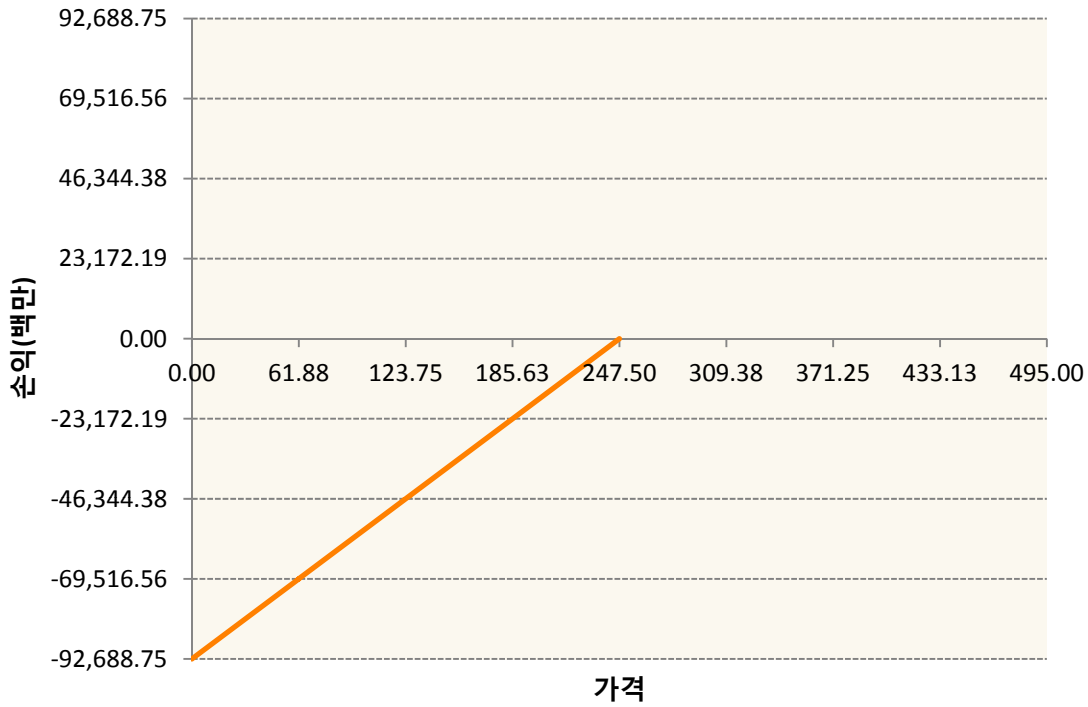


KR4201Q42503-2020-04 콜250





KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q42479		2020-04 콜247.5					11,737	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4,462	4,300	4,086	3,825	3,519	3,173	2,791	
-5.33%	4,095	3,797	3,445	3,046	2,609	2,137	1,637	
-2.67%	3,331	2,863	2,354	1,810	1,240	647	35	
0%	1,957	1,324	670	0	-683	-1,376	-2,077	
2.67%	-221	-967	-1,717	-2,470	-3,225	-3,982	-4,740	
5.33%	-3,311	-4,086	-4,861	-5,637	-6,413	-7,189	-7,965	
8.00%	-7,304	-8,019	-8,747	-9,485	-10,230	-10,981	-11,737	
KR4201Q42503		2020-04 콜250					767	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	266	257	245	229	211	189	165	

-5.33%	247	230	209	184	157	127	94
-2.67%	205	177	145	111	74	35	-5
0%	127	87	44	0	-45	-92	-139
2.67%	-2	-52	-103	-154	-206	-258	-310
5.33%	-192	-247	-301	-356	-410	-465	-519
8.00%	-446	-499	-552	-605	-659	-713	-767
KR4301Q42477 2020-04 풋247.5							6,160
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,729	-5,765	-5,815	-5,881	-5,960	-6,054	-6,160
-5.33%	-3,454	-3,531	-3,626	-3,737	-3,862	-4,000	-4,148
-2.67%	-1,307	-1,443	-1,594	-1,758	-1,932	-2,116	-2,306
0%	618	420	213	0	-218	-441	-667
2.67%	2,226	1,983	1,738	1,491	1,244	996	748
5.33%	3,458	3,204	2,949	2,694	2,439	2,184	1,929
8.00%	4,315	4,086	3,852	3,613	3,372	3,128	2,882

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

(단위:백만원)

16,080

공시일	2020-04-01
기준일	2020-03-31

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

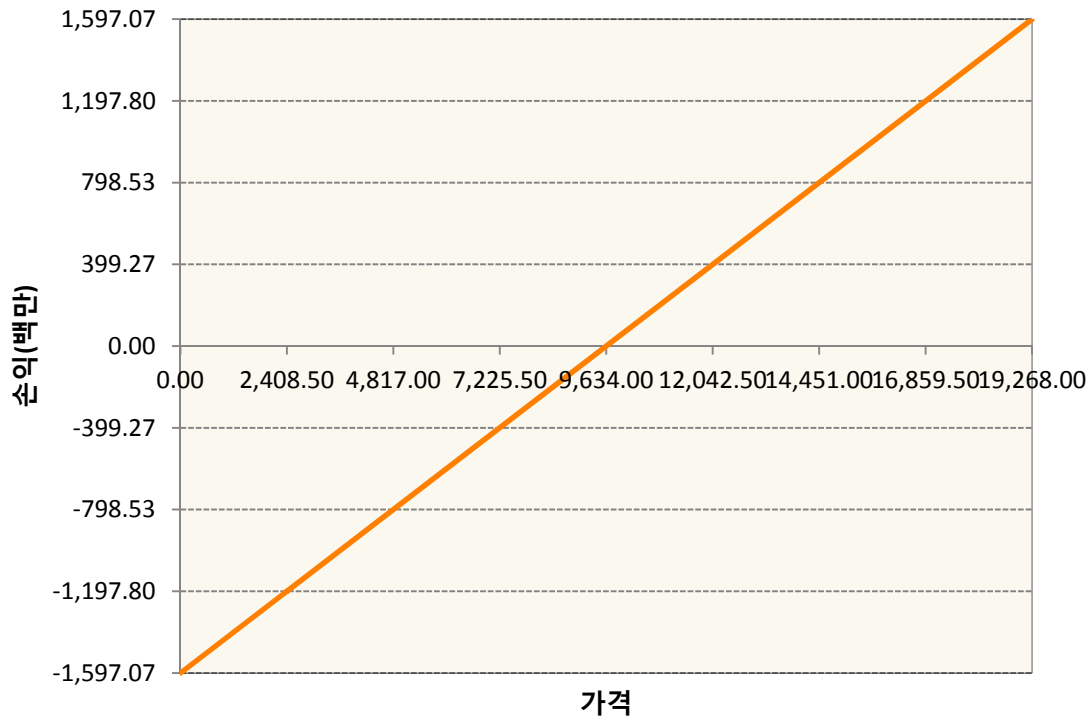
1. 계약금액

(단위:백만원)

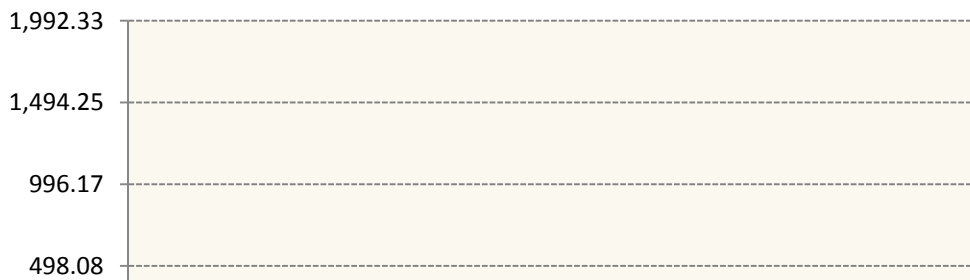
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,597	0	1,597	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,134	-4,134	장내
누계	통화	선도	691	2,211	-1,520	장외

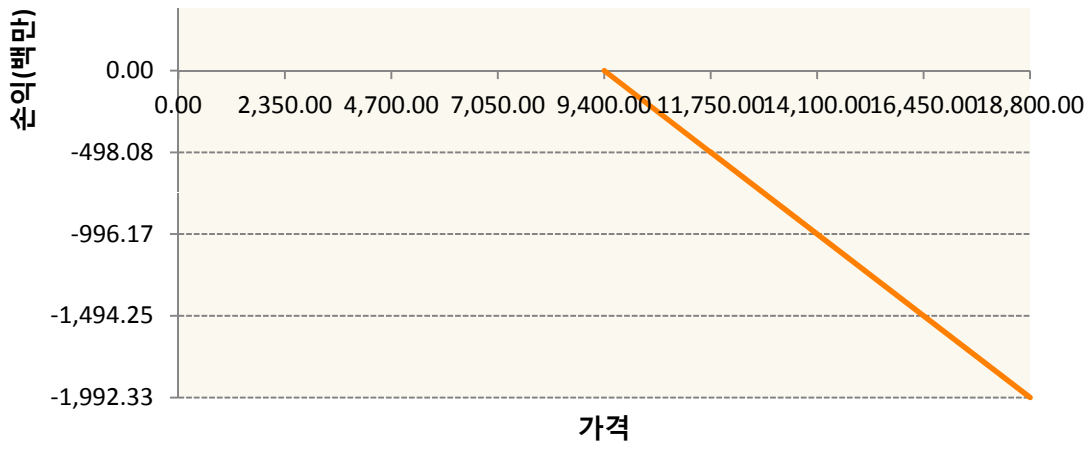
2. 만기시점의 손익구조

HCJ0-HSCEI Futures Apr20

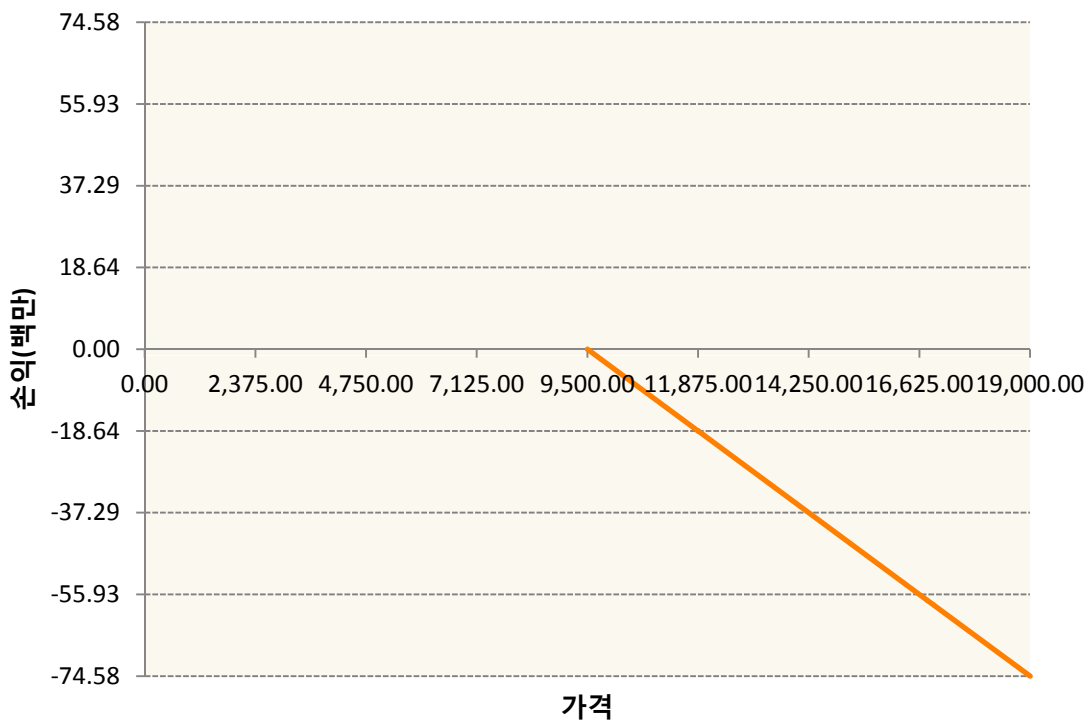


OHHIJ0-C94-HSCEI

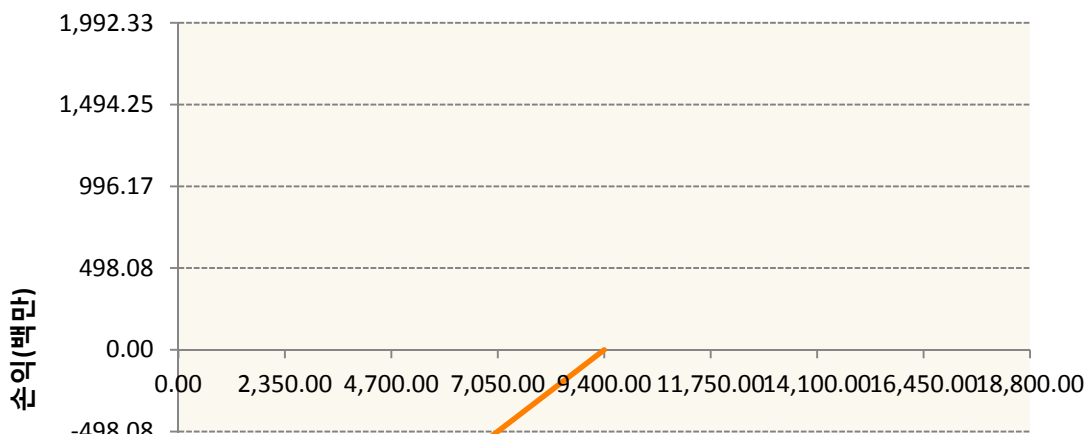


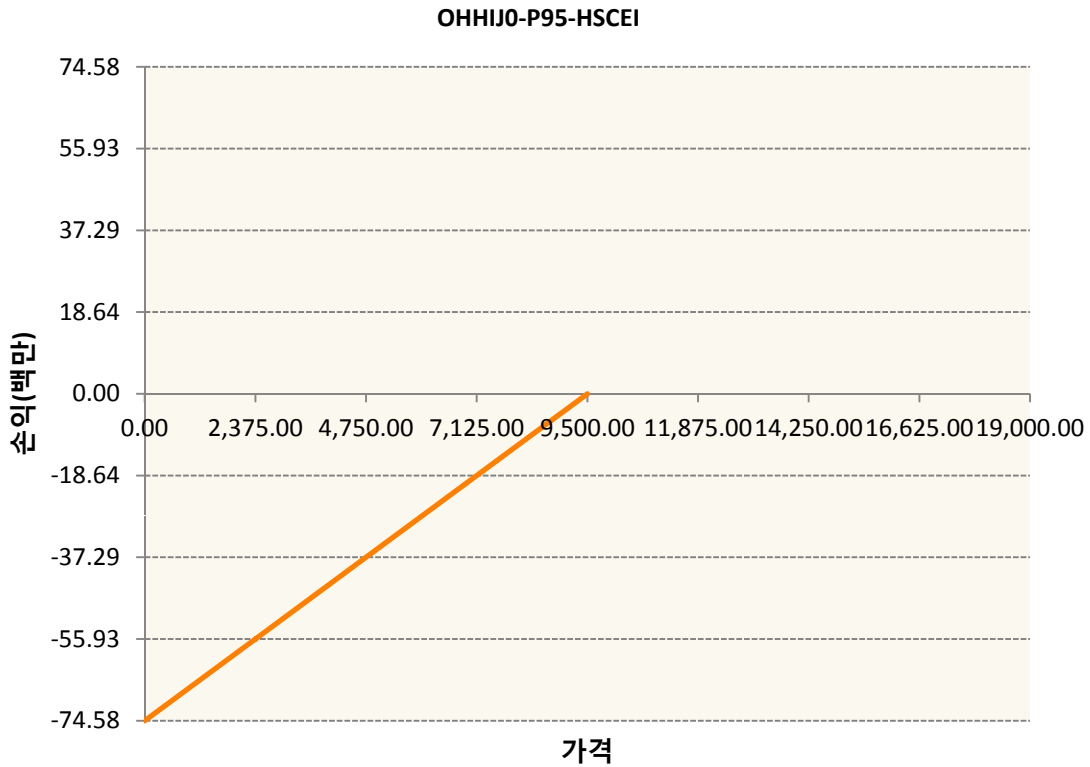


OHHIJO-C95-HSCEI



OHHIJO-P94-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E		177
FX21020H05 HKD/KRW 22-05-20E		55
HCJ0 HSCEI Futures Apr20		128
OHHIJ0-C94 HSCEI		159
OHHIJ0-C95 HSCEI		6
OHHIJ0-P94 HSCEI		159
OHHIJ0-P95 HSCEI		6

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	598

공시일	2020-04-01
기준일	2020-03-31

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

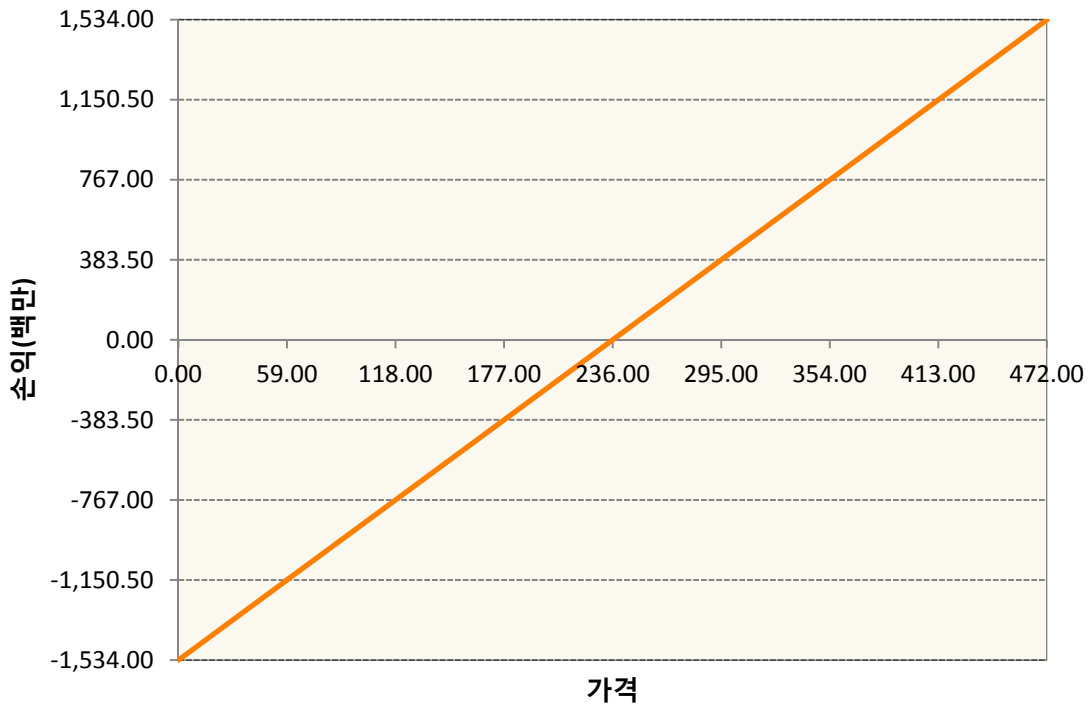
1. 계약금액

(단위:백만원)

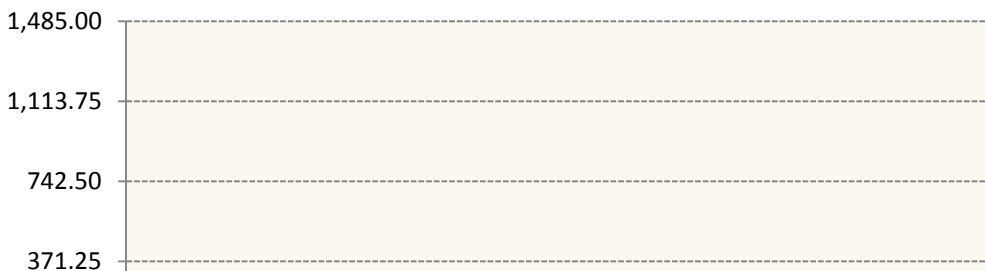
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,534	0	1,534	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,095	-3,095	장내

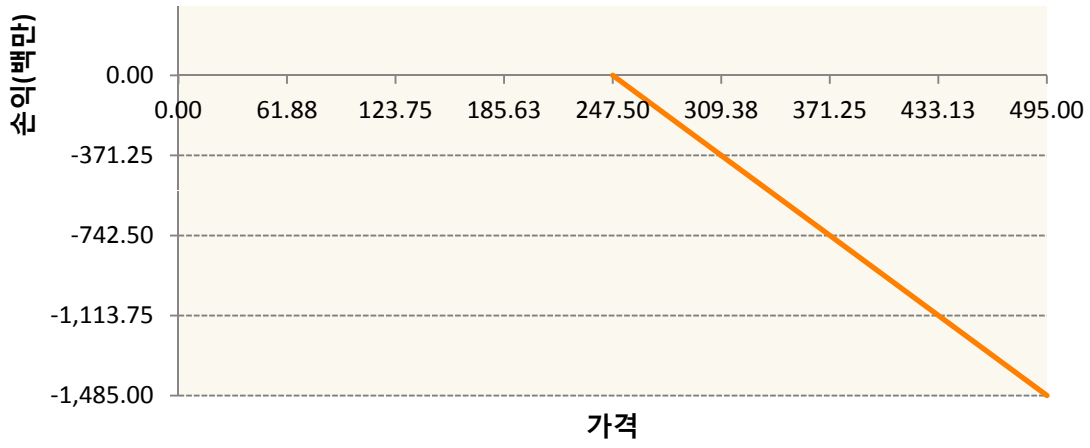
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

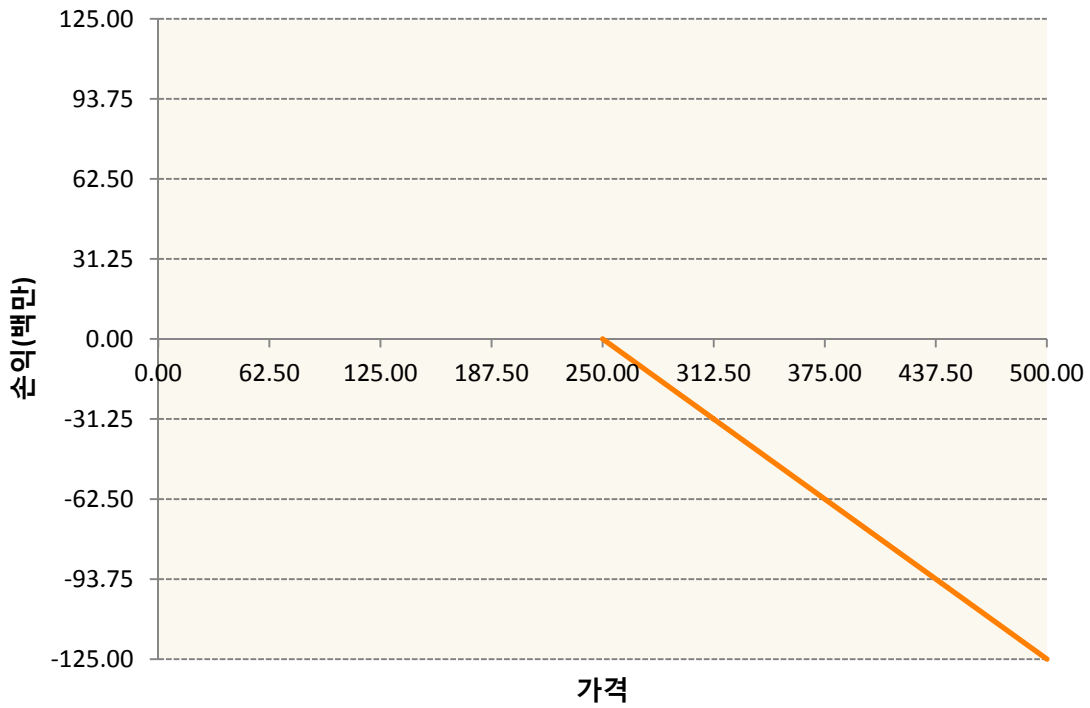


KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

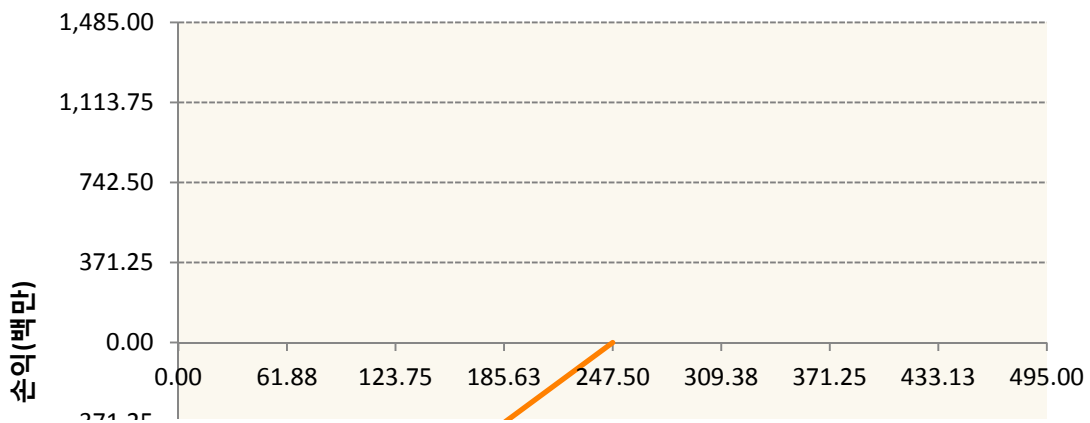




KR4201Q42503-2020-04 콜250



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						123
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123	
-5.33%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82	
-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%	82	82	82	82	82	82	82	
8.00%	123	123	123	123	123	123	123	
KR4201Q42479		2020-04 콜247.5						70
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	26	26	24	23	21	19	17	
-5.33%	24	23	20	18	15	13	10	
-2.67%	20	17	14	11	7	4	0	
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12	
2.67%	-1	-6	-10	-15	-19	-24	-28	
5.33%	-20	-24	-29	-33	-38	-43	-47	
8.00%	-43	-48	-52	-56	-61	-65	-70	
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	1	1	1
-5.33%	2	2	1	1	1	1	1
-2.67%	1	1	1	1	1	0	0
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	0	0	-1	-1	-1	-2	-2
5.33%	-1	-2	-2	-3	-3	-3	-4
8.00%	-3	-4	-4	-4	-5	-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%	-92	-92	-93	-94	-95	-97	-99
-5.33%	-55	-57	-58	-60	-62	-64	-66
-2.67%	-21	-23	-26	-28	-31	-34	-37
0%	10	7	3	0	-3	-7	-11
2.67%	36	32	28	24	20	16	12
5.33%	55	51	47	43	39	35	31
8.00%	69	65	62	58	54	50	46

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

(단위:백만원)

516

공시일	2020-04-01
기준일	2020-03-31

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

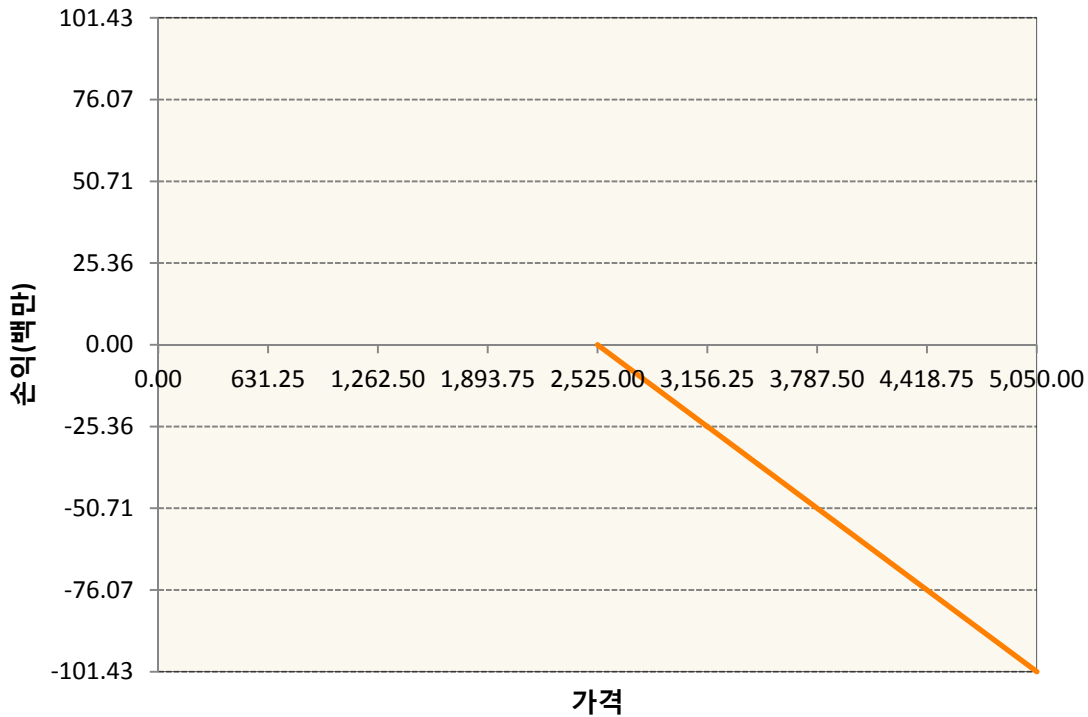
1. 계약금액

(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	259	0	259	
누계	유가증권	스왑	7,605	0	7,605	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,437	-4,437	장내
누계	통화	선도	0	2,710	-2,710	장외

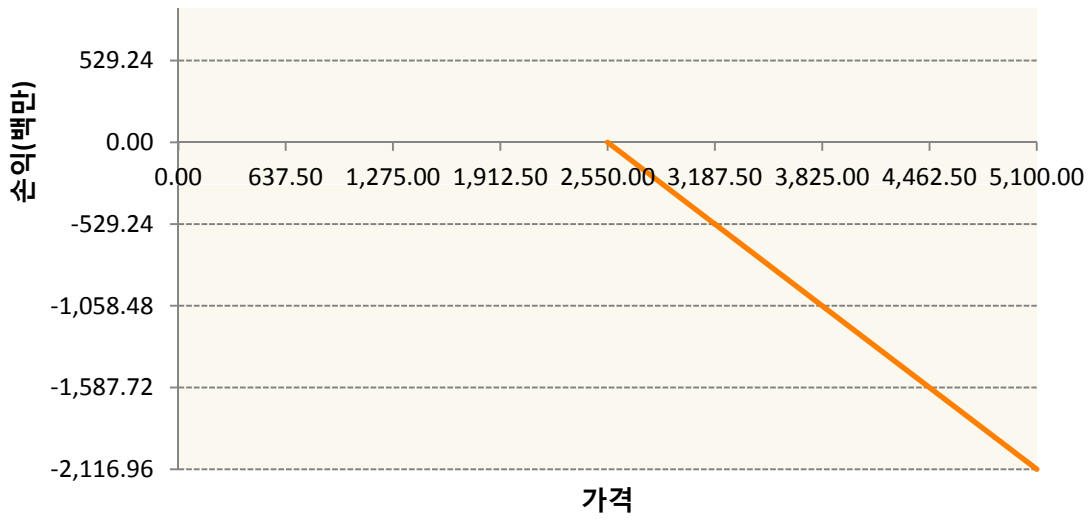
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ0-C2525-EURO STOXX 50

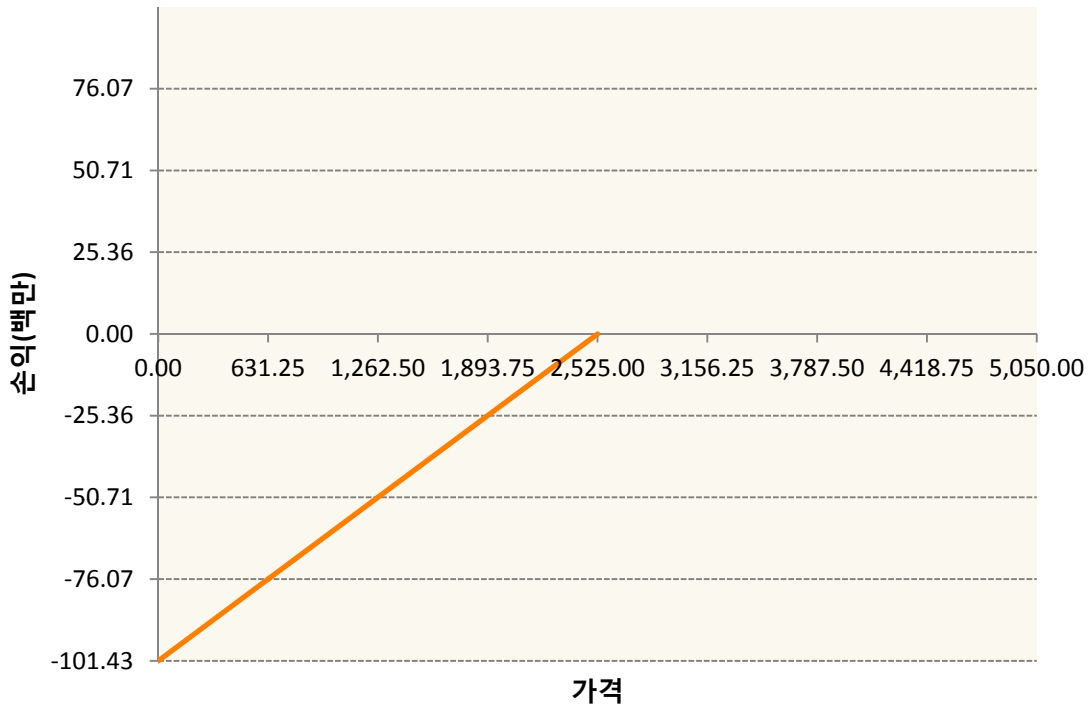


OESXJ0-C2550-EURO STOXX 50

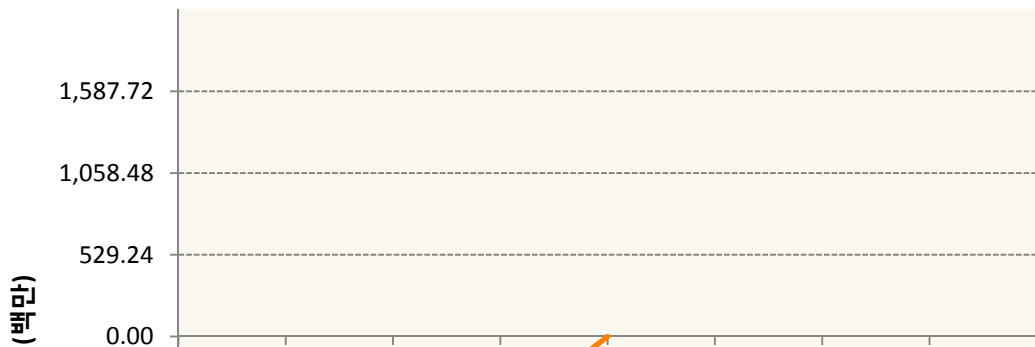


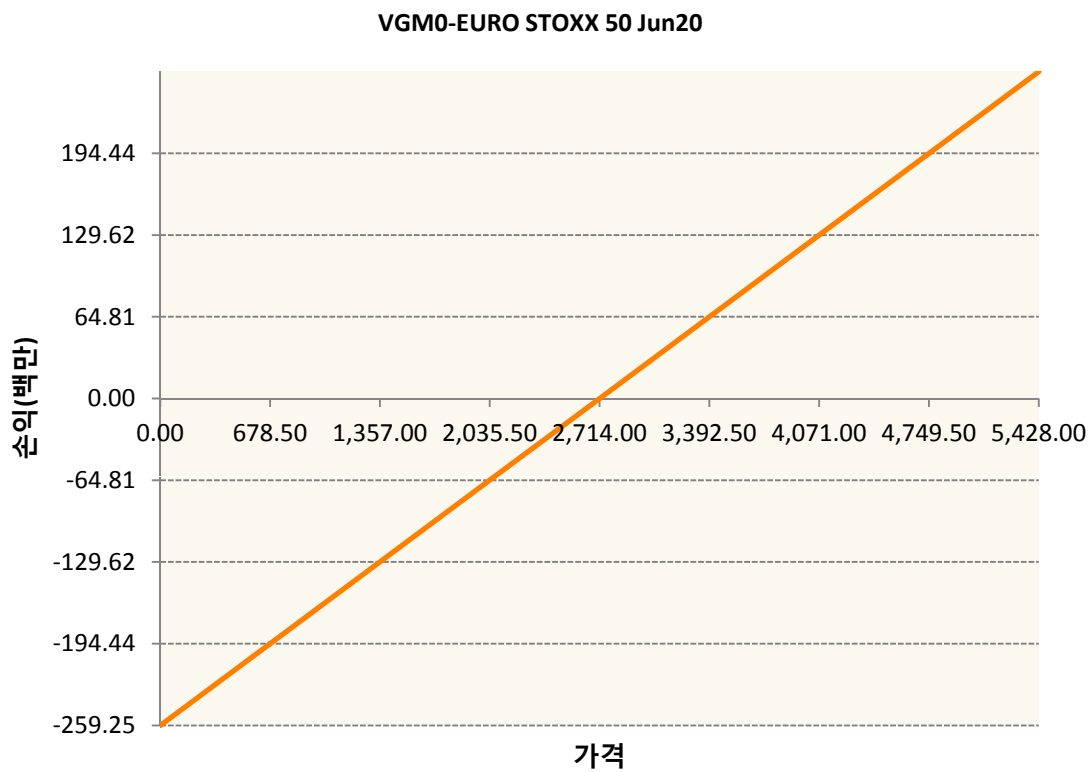
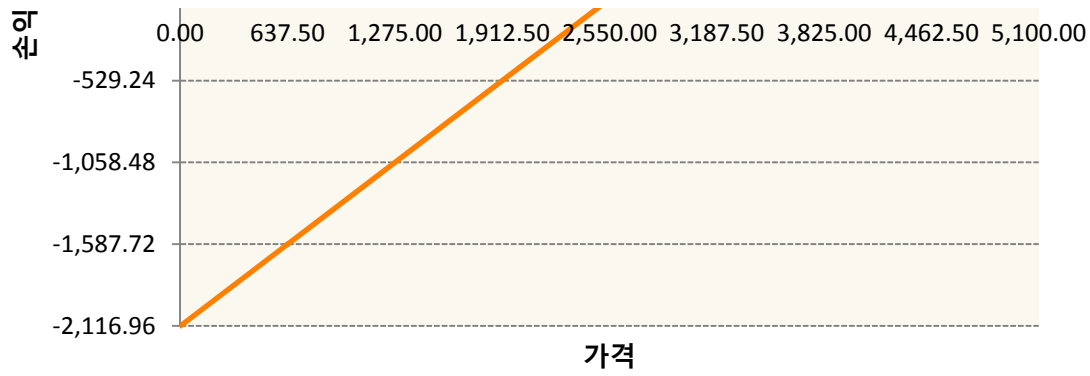


OESXJ0-P2525-EURO STOXX 50



OESXJ0-P2550-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		16
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E		217
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)

999

공시일	2020-04-01
기준일	2020-03-31

ETF스마트레버리지목표전환형9호

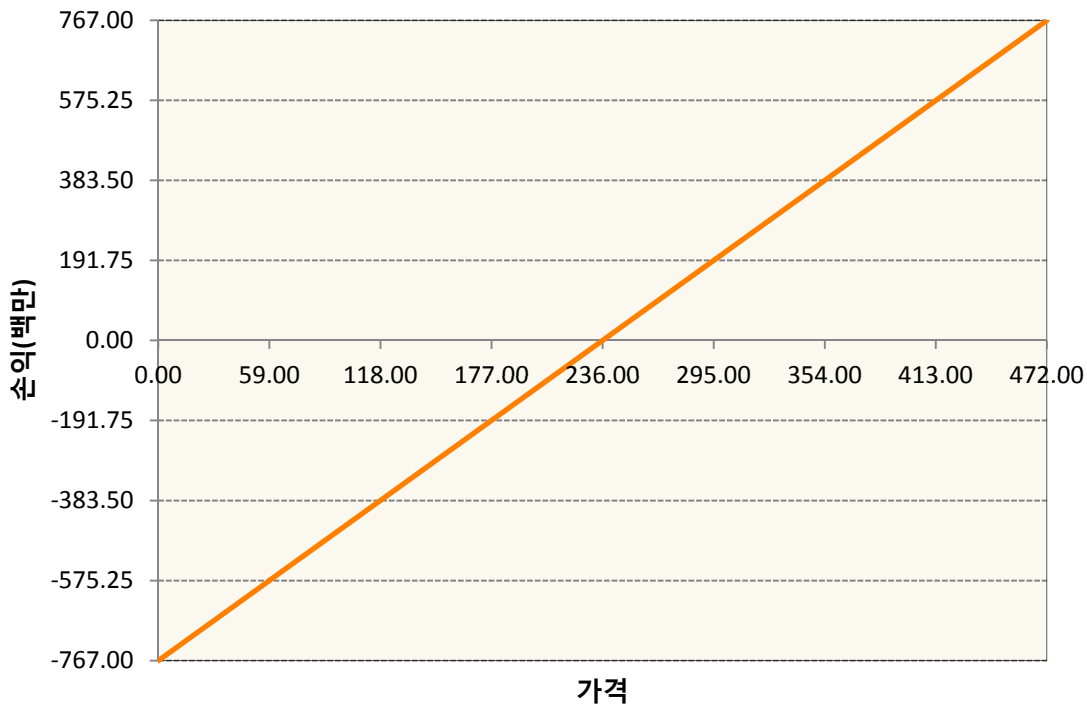
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	767	0	767	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						62
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62	
-5.33%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41	
-2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	21	21	21	21	21	21	21	
5.33%	41	41	41	41	41	41	41	
8.00%	62	62	62	62	62	62	62	

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

(단위:백만원)

87

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

(단위:백만원)

127

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

(단위:백만원)

60

공시일	2020-04-01
기준일	2020-03-31

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

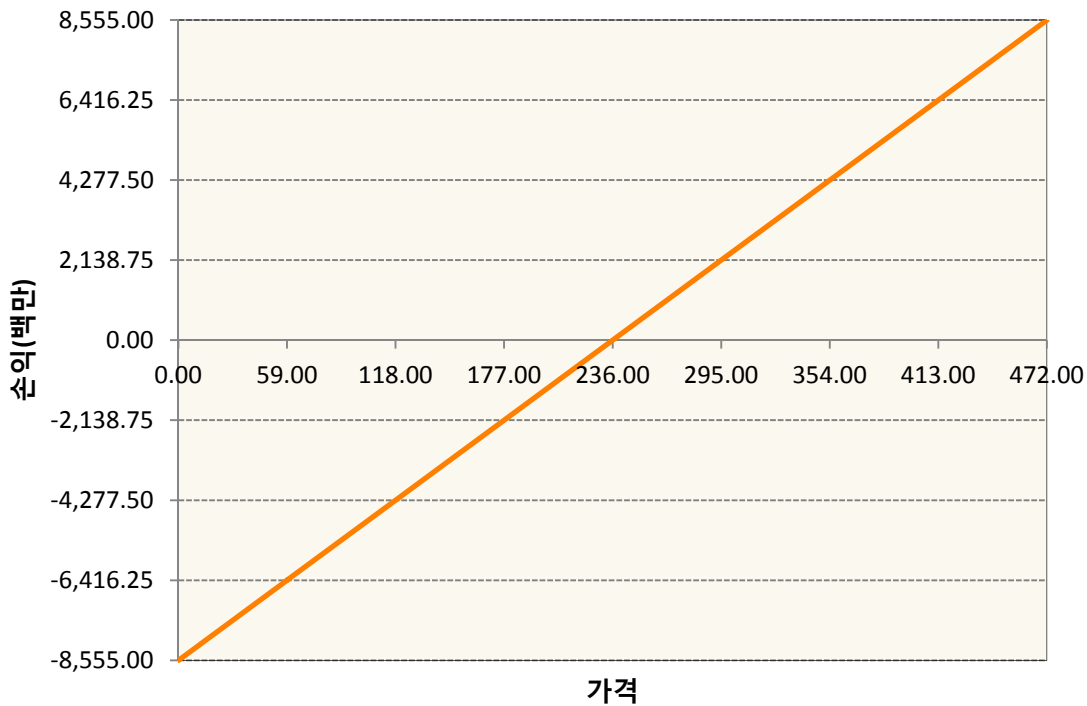
1. 계약금액

(단위:백만원)

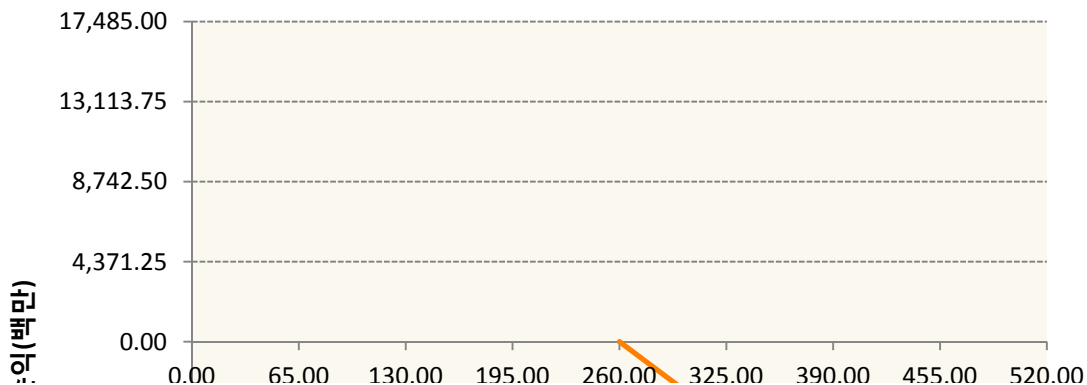
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,555	0	8,555	장내
누계	유가증권	옵션	6,004	17,485	-11,481	장내

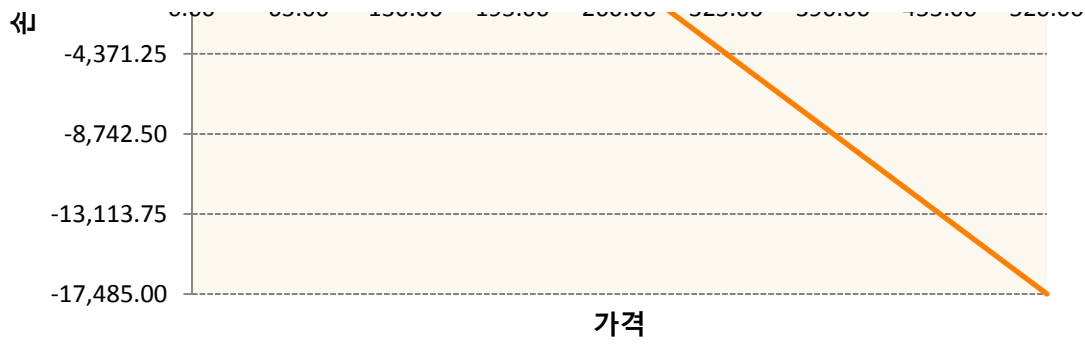
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

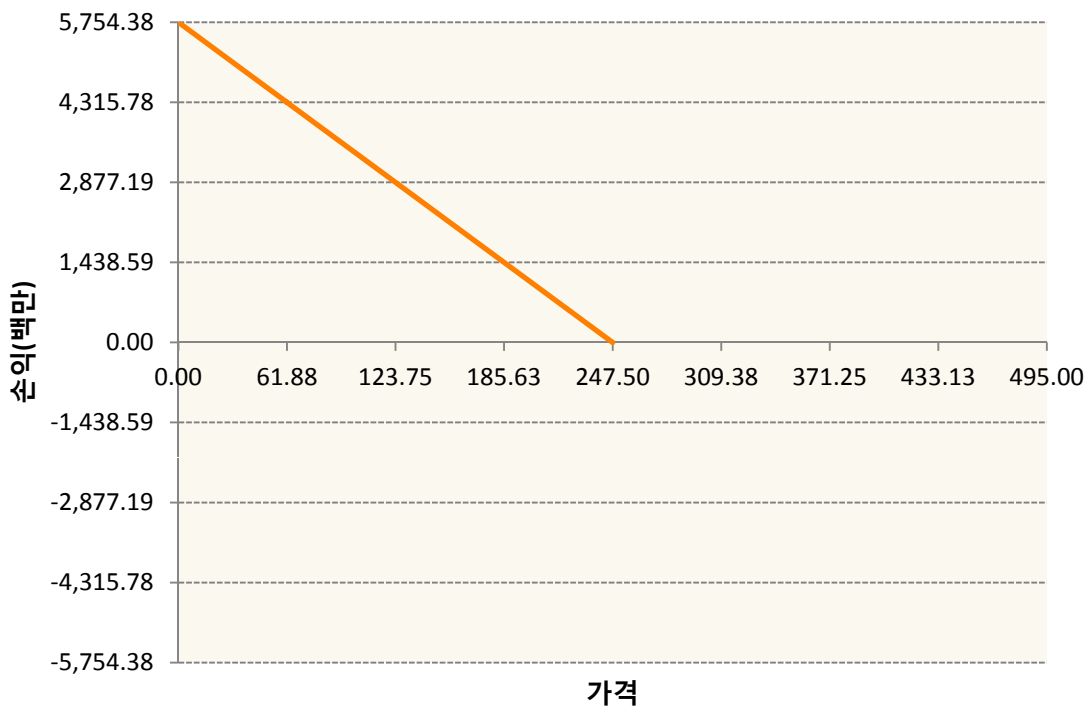


KR4201Q42602-2020-04 콜260

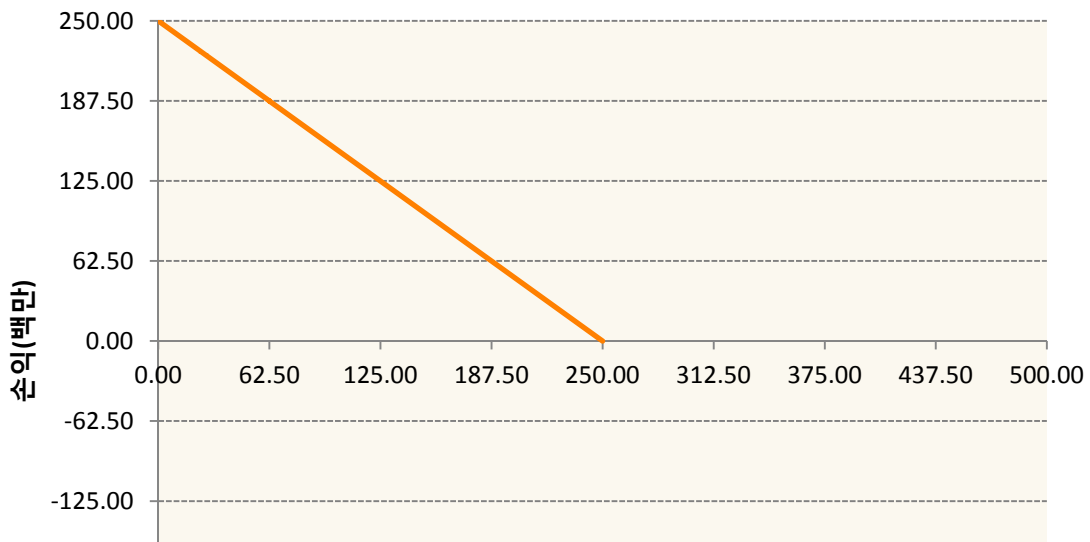


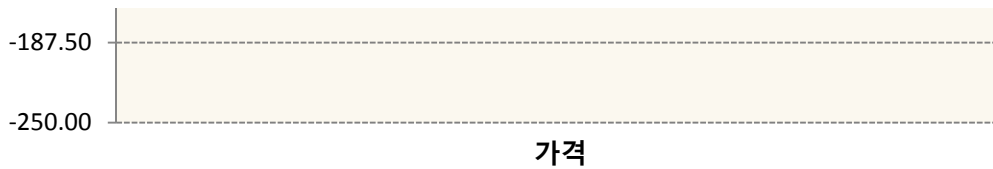


KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



KR4301Q42501-2020-04 풋250





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						687
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-687	-687	-687	-687	-687	-687	-687	
-5.33%	-458	-458	-458	-458	-458	-458	-458	
-2.67%	-229	-229	-229	-229	-229	-229	-229	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	229	229	229	229	229	229	229	
5.33%	458	458	458	458	458	458	458	
8.00%	687	687	687	687	687	687	687	
KR4201Q42602		2020-04 콜260						541
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	126	124	119	112	102	90	76	
-5.33%	122	115	105	93	77	58	37	
-2.67%	109	95	78	58	34	8	-21	
0%	80	57	30	0	-32	-67	-104	
2.67%	23	-12	-49	-88	-129	-172	-216	
5.33%	-75	-120	-166	-214	-262	-311	-361	
8.00%	-224	-276	-329	-382	-434	-487	-541	
KR4301Q42477		2020-04 풋247.5						382
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	356	358	361	365	370	376	382	
-5.33%	214	219	225	232	240	248	258	
-2.67%	81	90	99	109	120	131	143	
0%	-38	-26	-13	0	14	27	41	
2.67%	-138	-123	-108	-93	-77	-62	-46	
5.33%	-215	-199	-183	-167	-151	-136	-120	
8.00%	-268	-254	-239	-224	-209	-194	-179	
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%	-10	-9	-8	-8	-7	-6	-6
8.00%	-13	-12	-11	-11	-10	-9	-9

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

(단위:백만원)

1,640

공시일	2020-04-01
기준일	2020-03-31

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	147,664	0	147,664	

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	2020-04-01
기준일	2020-03-31

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	99,568	0	99,568	

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	2020-04-01
기준일	2020-03-31

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	439,919	0	439,919	
누계	통화	선도	71,218	490,490	-419,273	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,630
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,350
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,948
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,896
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,279
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,948
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,435
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,026
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,026
FX21020H04 USD/KRW 21-04-20E	1,461
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,376
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	974
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	974
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,532
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	838
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	730
FX21020H09 USD/KRW 24-04-20E	730
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	487
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,409
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,915
FX21020H11 KRW/USD 11-05-20E	974
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

21,881

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

(단위:백만원)

172

공시일	2020-04-01
기준일	2020-03-31

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

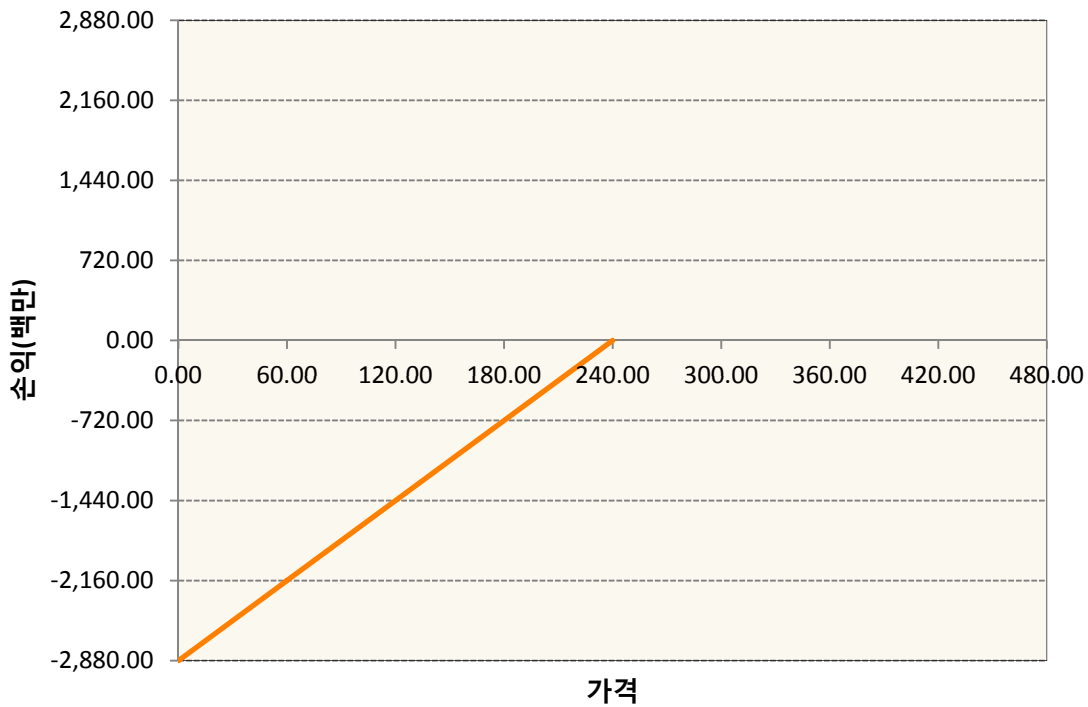
1. 계약금액

(단위:백만원)

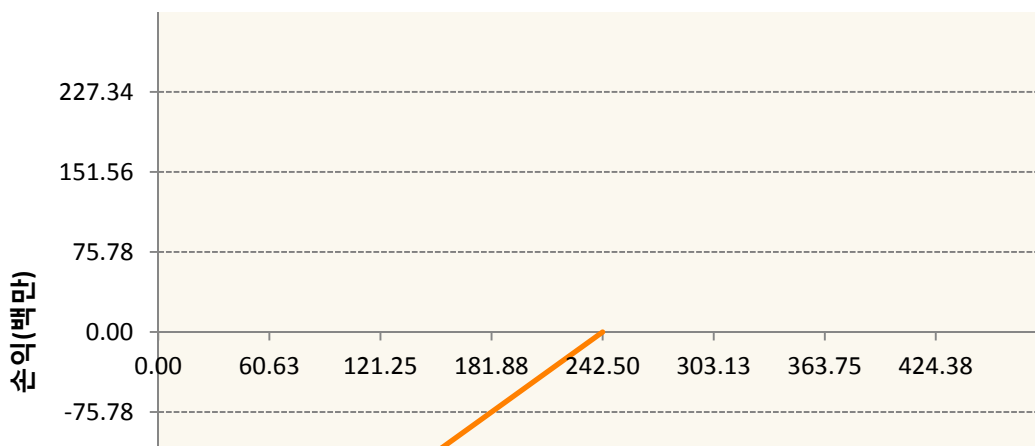
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,183	-3,183	장내

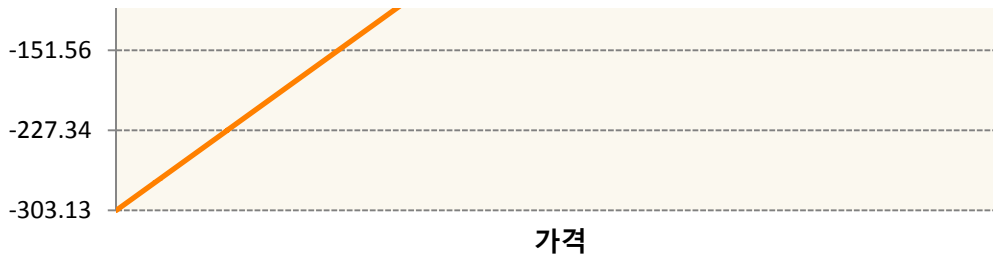
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q42402-2020-04 풋240



KR4301Q42428-2020-04 풋242.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q42402		2020-04 풋240						178
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-155	-158	-161	-165	-169	-173	-178	
-5.33%	-87	-92	-96	-102	-107	-113	-119	
-2.67%	-27	-33	-40	-46	-53	-60	-68	
0%	23	15	8	0	-8	-16	-23	
2.67%	60	53	45	37	29	21	13	
5.33%	85	79	72	64	57	50	42	
8.00%	101	95	90	84	78	71	64	
KR4301Q42428		2020-04 풋242.5						19
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-17	-17	-18	-18	-18	-19	-19	
-5.33%	-10	-10	-11	-11	-12	-12	-13	
-2.67%	-3	-4	-5	-5	-6	-7	-7	
0%	2	2	1	0	-1	-2	-2	
2.67%	7	6	5	4	3	3	2	
5.33%	10	9	8	7	7	6	5	
8.00%	12	11	11	10	9	8	8	

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

186

공시일	2020-04-01
기준일	2020-03-31

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	7,252	0	7,252	
누계	통화	선도	438	7,231	-6,793	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H02 KRW/USD 13-04-20E	354
FX21020H10 USD/KRW 13-04-20E	35
FX21020H11 KRW/USD 29-04-20E	225
IE00BD8RGM75	*

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

299

공시일	2020-04-01
기준일	2020-03-31

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

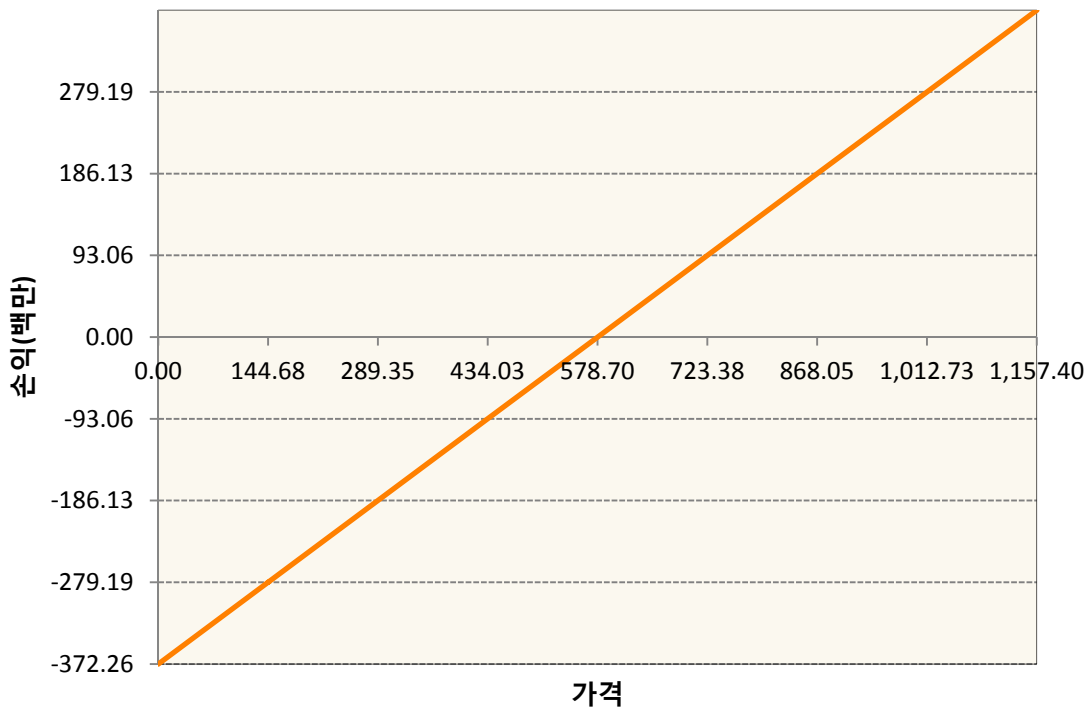
1. 계약금액

(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	372	0	372	
누계	유가증권	스왑	1,105	0	1,105	장외
누계	통화	선도	233	295	-62	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

FX21020H11 EUR/KRW 26-06-20E
VNCJ0 VN30 Index Future Apr20

9
30

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

(단위:백만원)

124

공시일	2020-04-01
기준일	2020-03-31

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

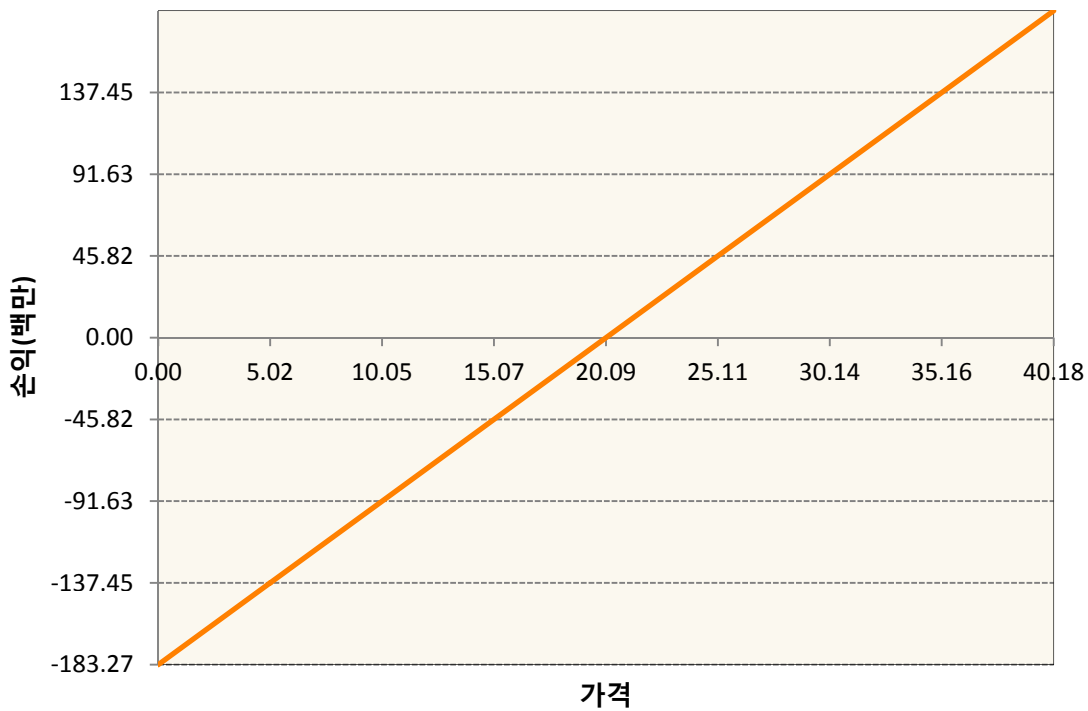
1. 계약금액

(단위:백만원)

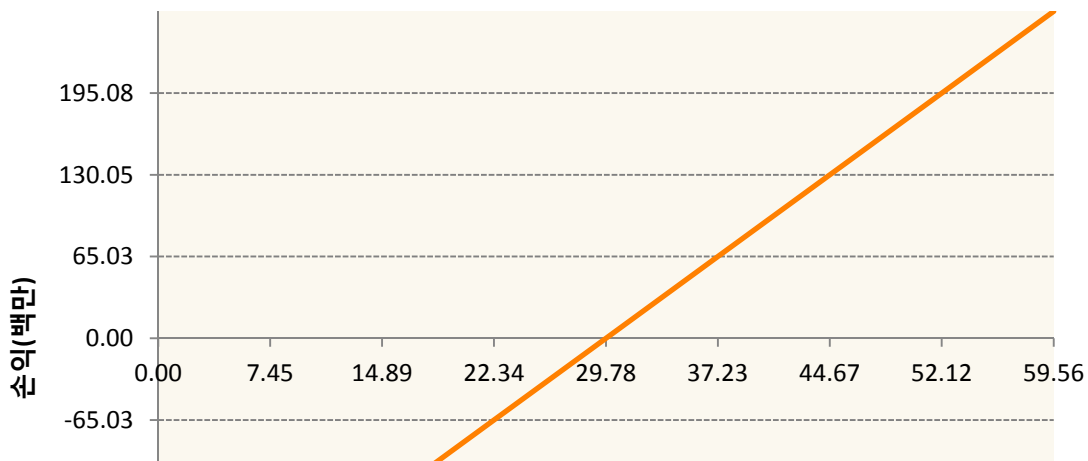
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,238	122	1,116	

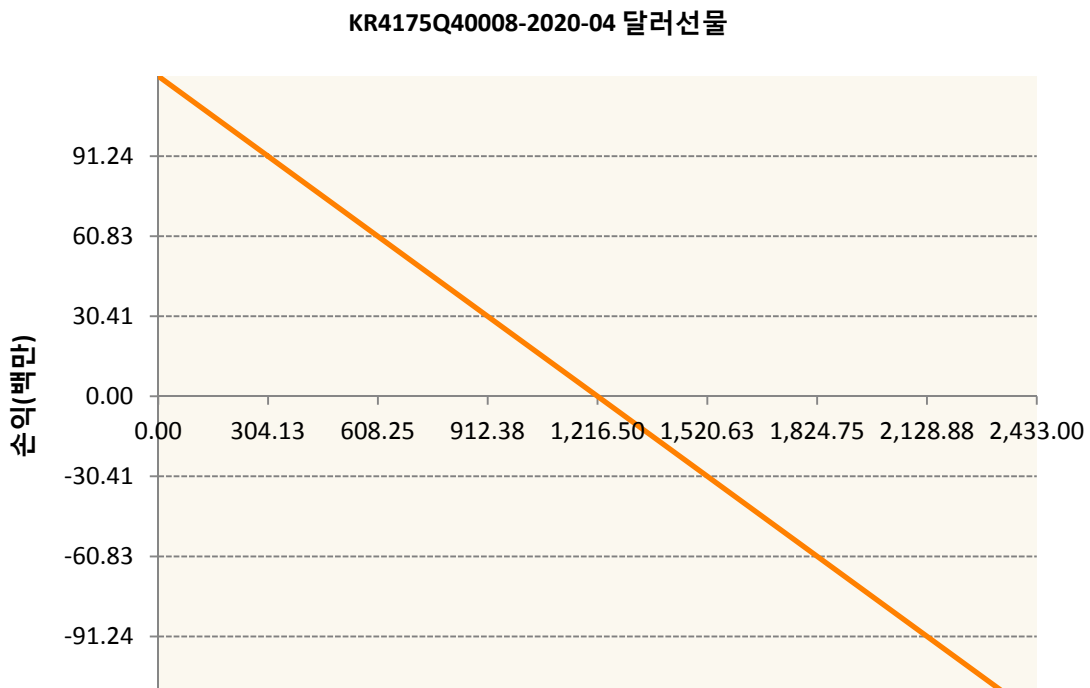
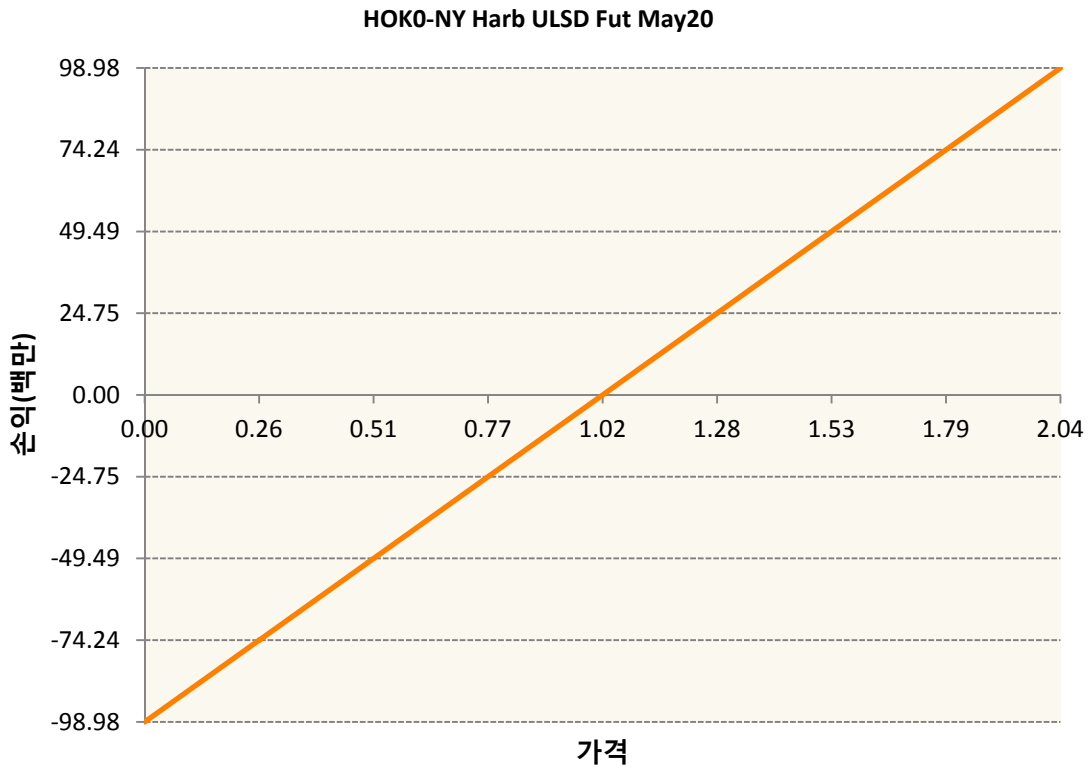
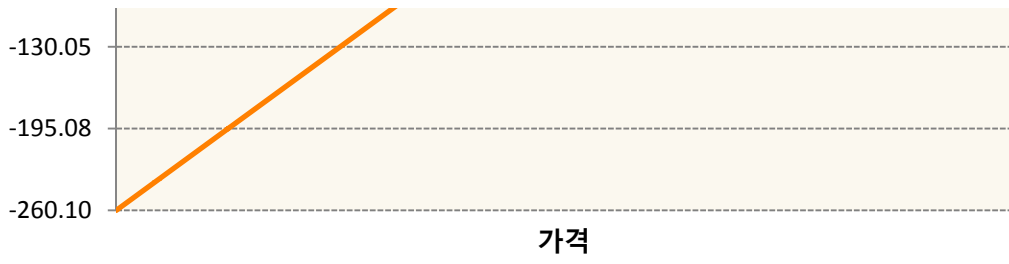
2. 만기시점의 손익구조

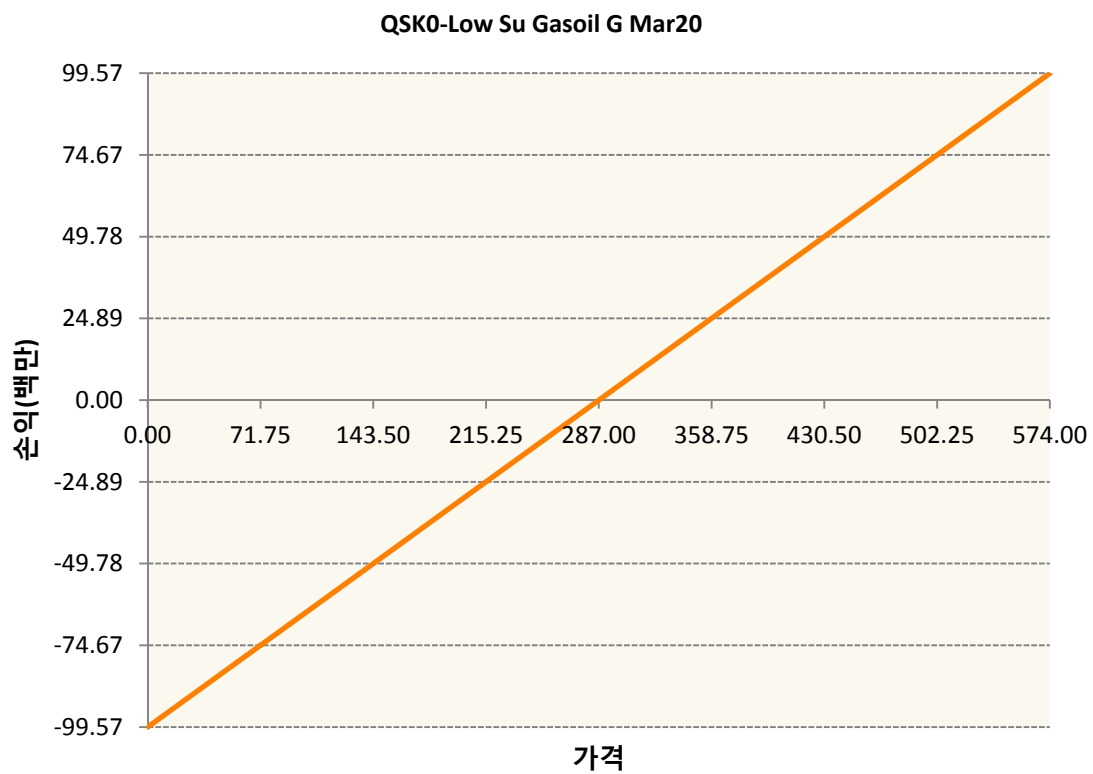
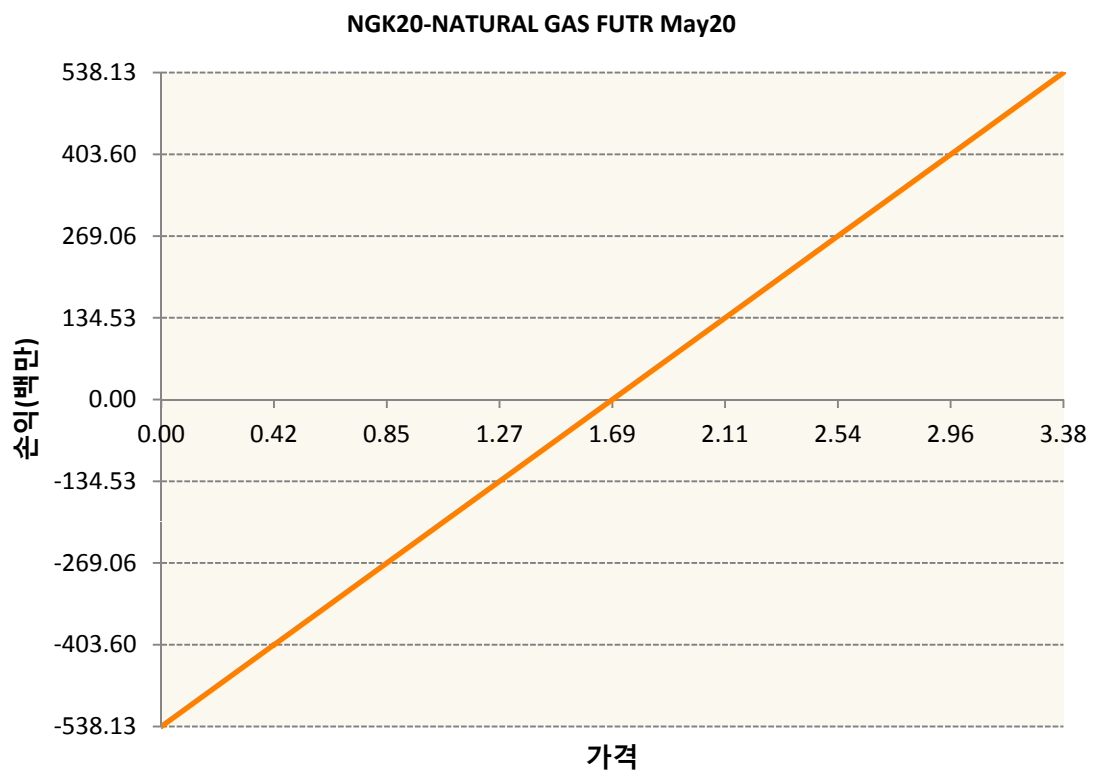
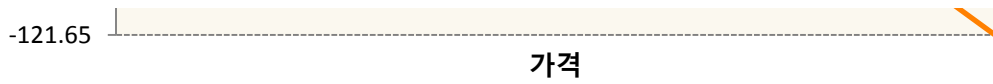
CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20



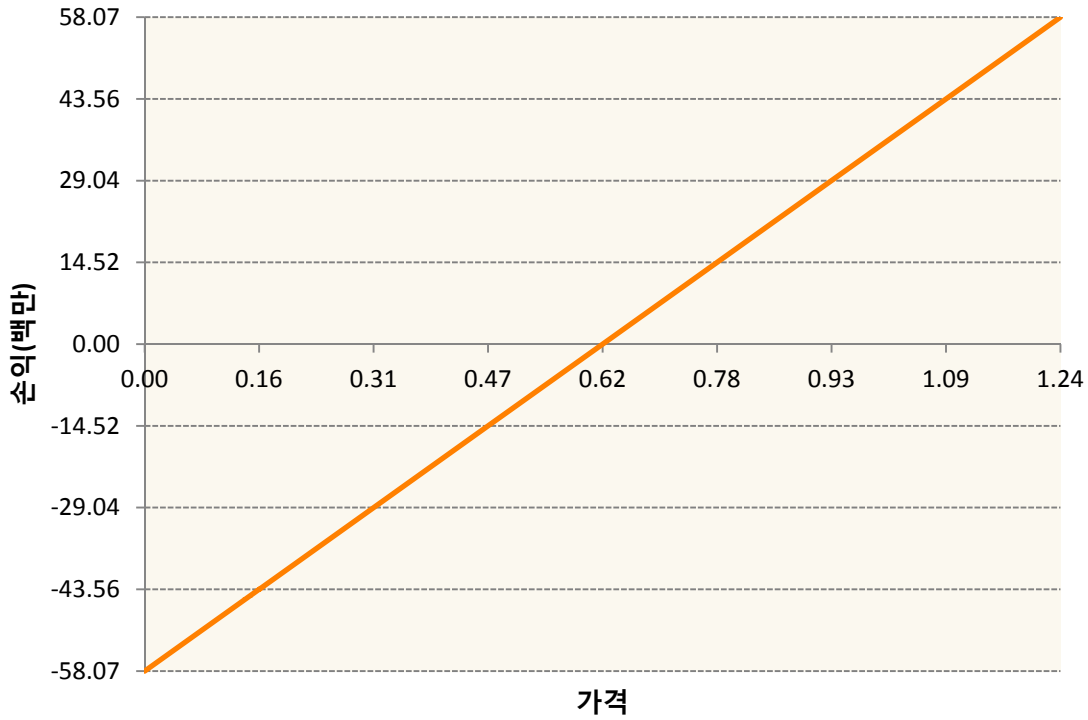
CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20







XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	15
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	21
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)

276

공시일	2020-04-01
기준일	2020-03-31

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

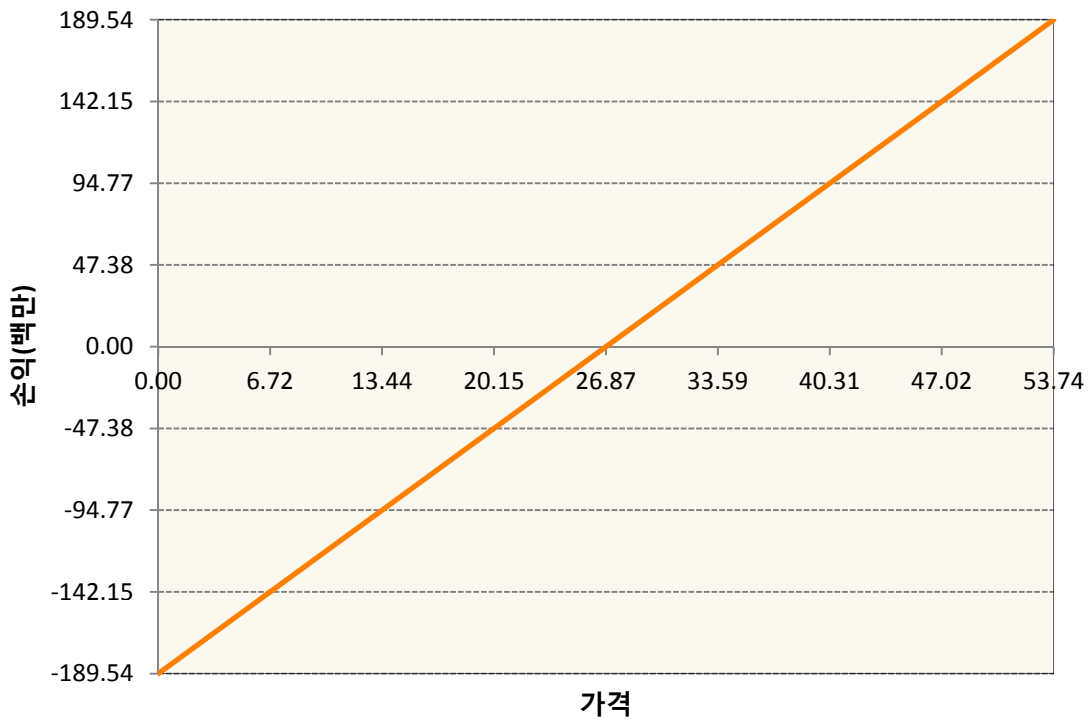
1. 계약금액

(단위:백만원)

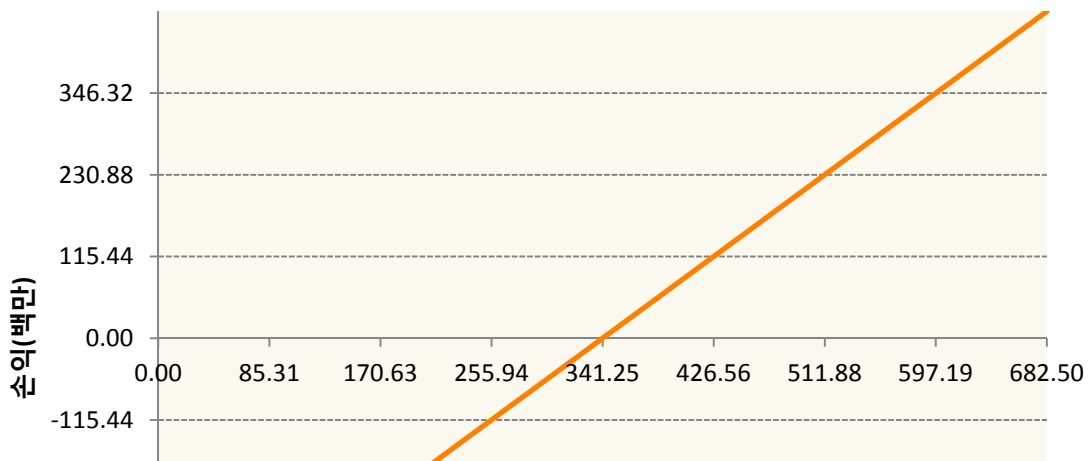
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,354	97	2,256	

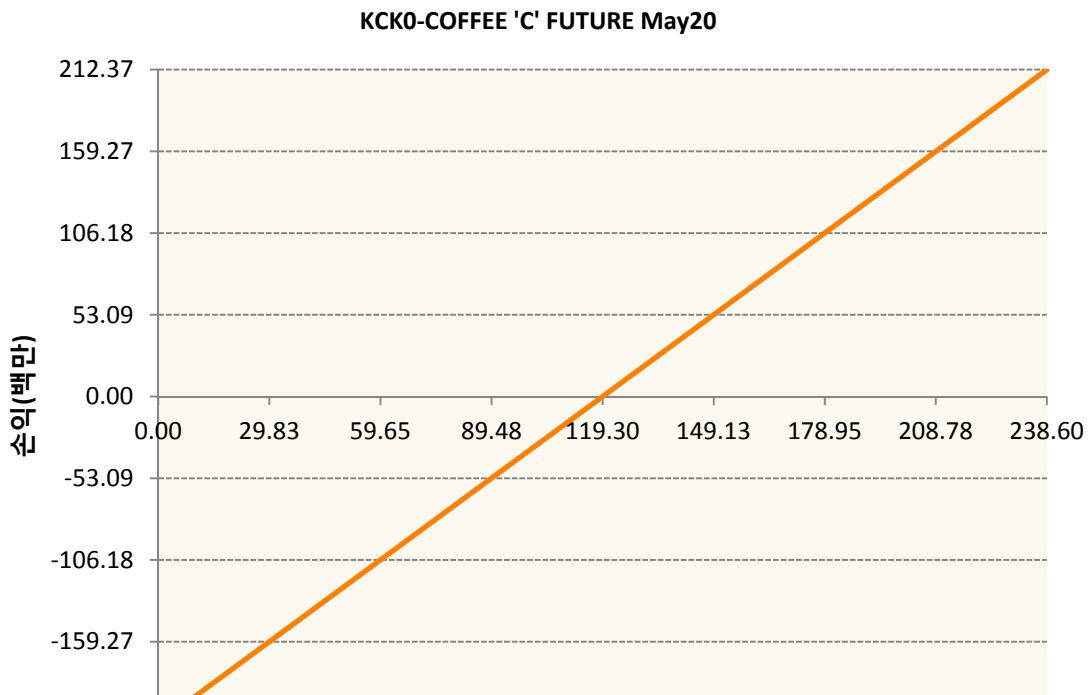
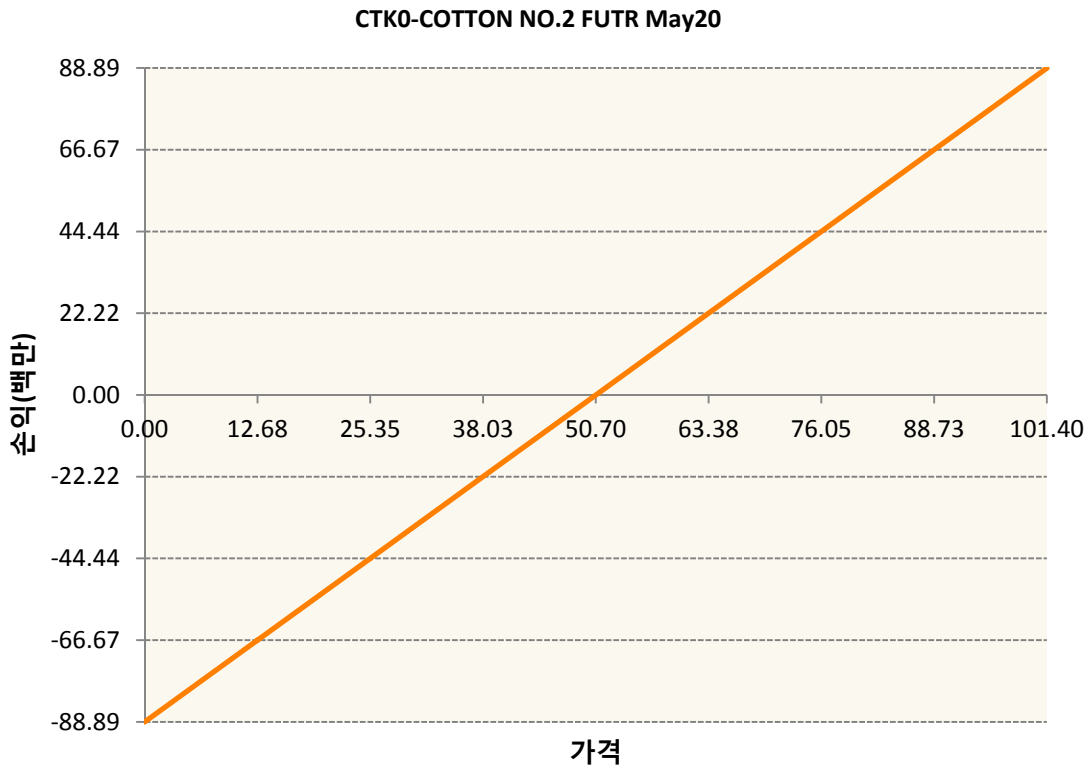
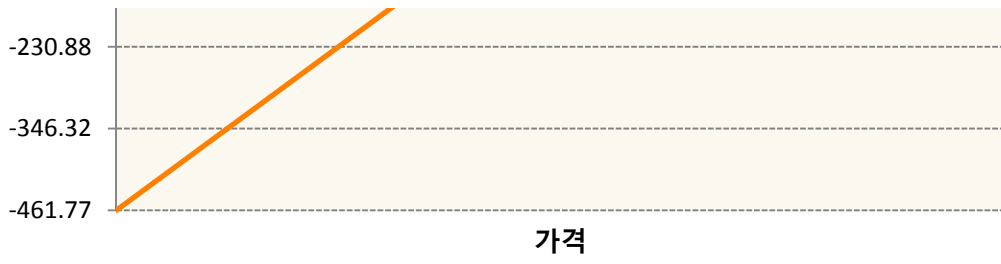
2. 만기시점의 손익구조

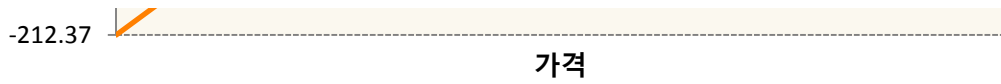
BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20



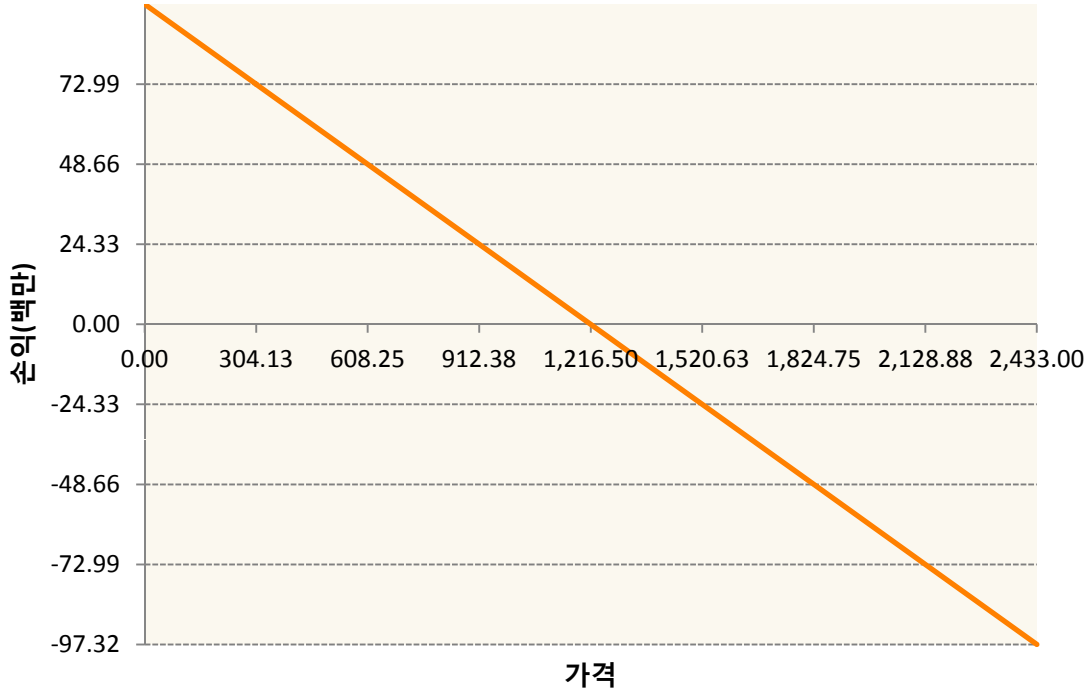
CK0-CORN FUTURE May20



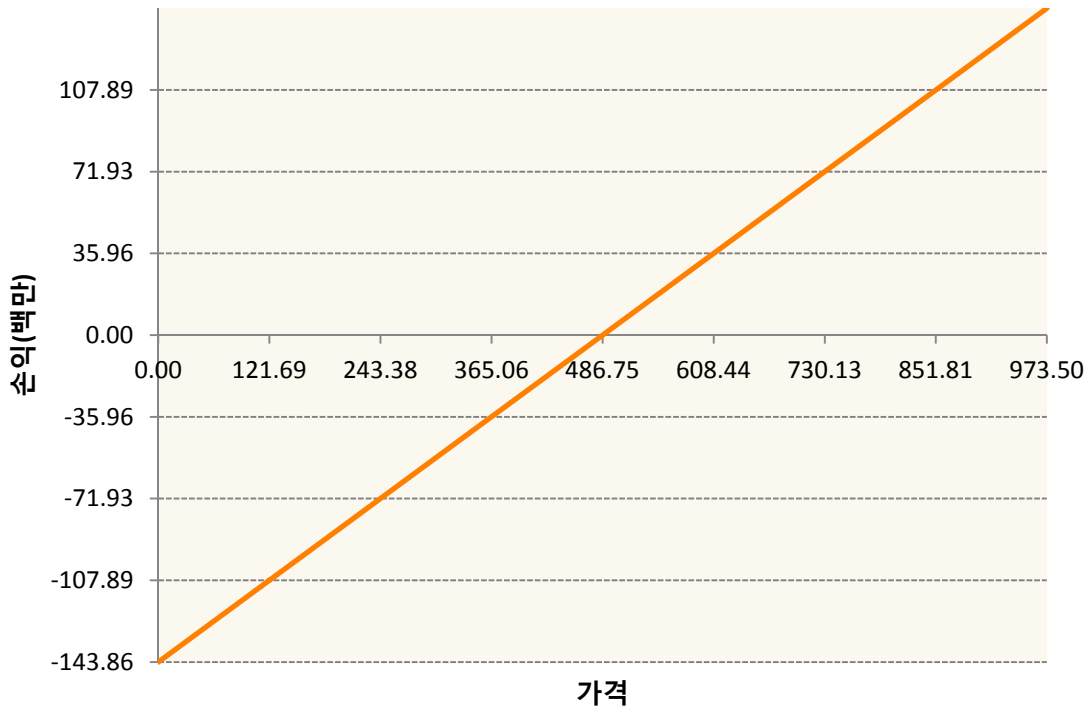




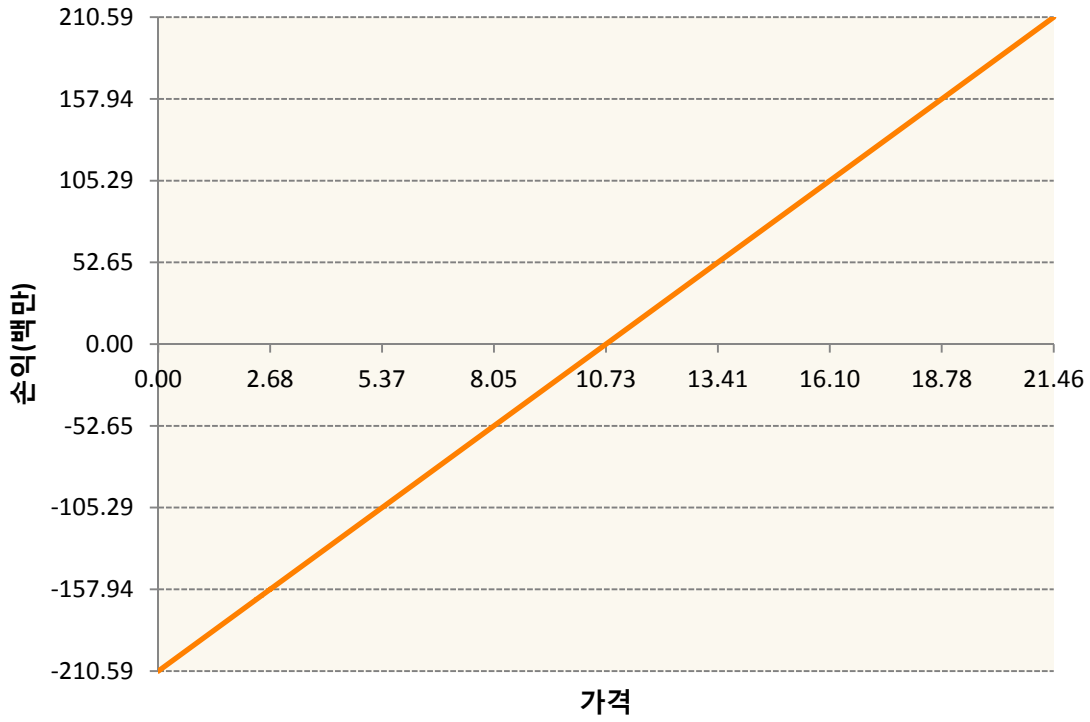
KR4175Q40008-2020-04 달러선물



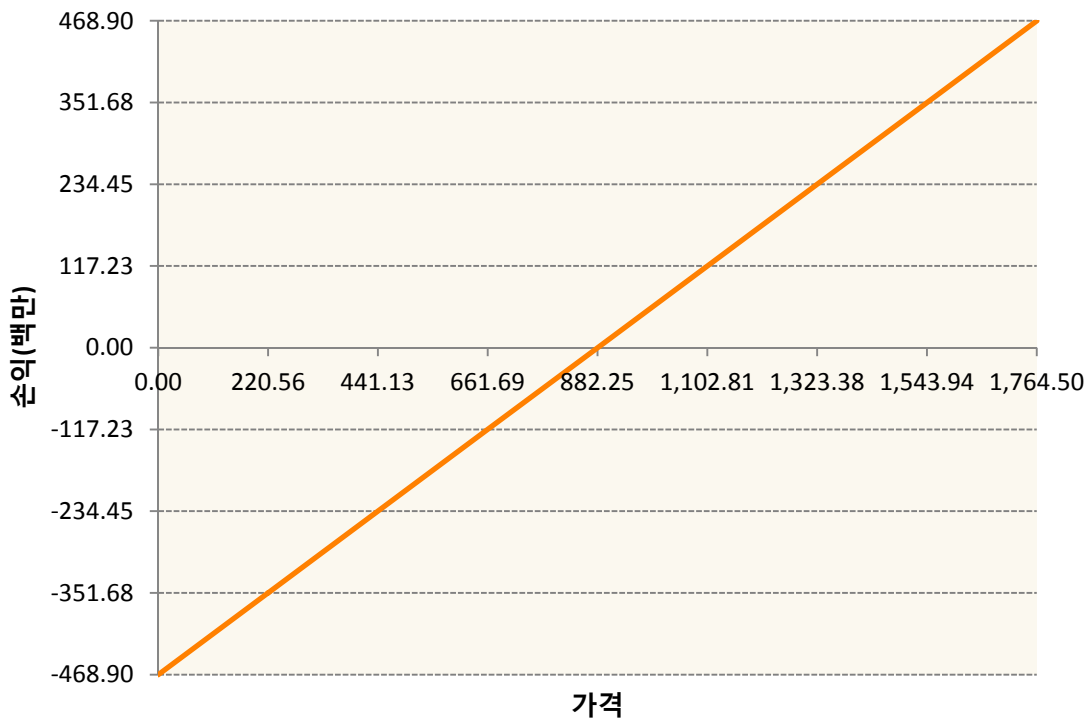
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



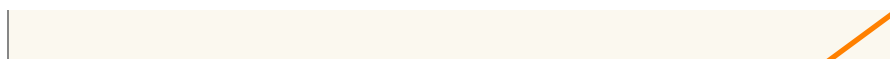
SBK0-Sugar May20

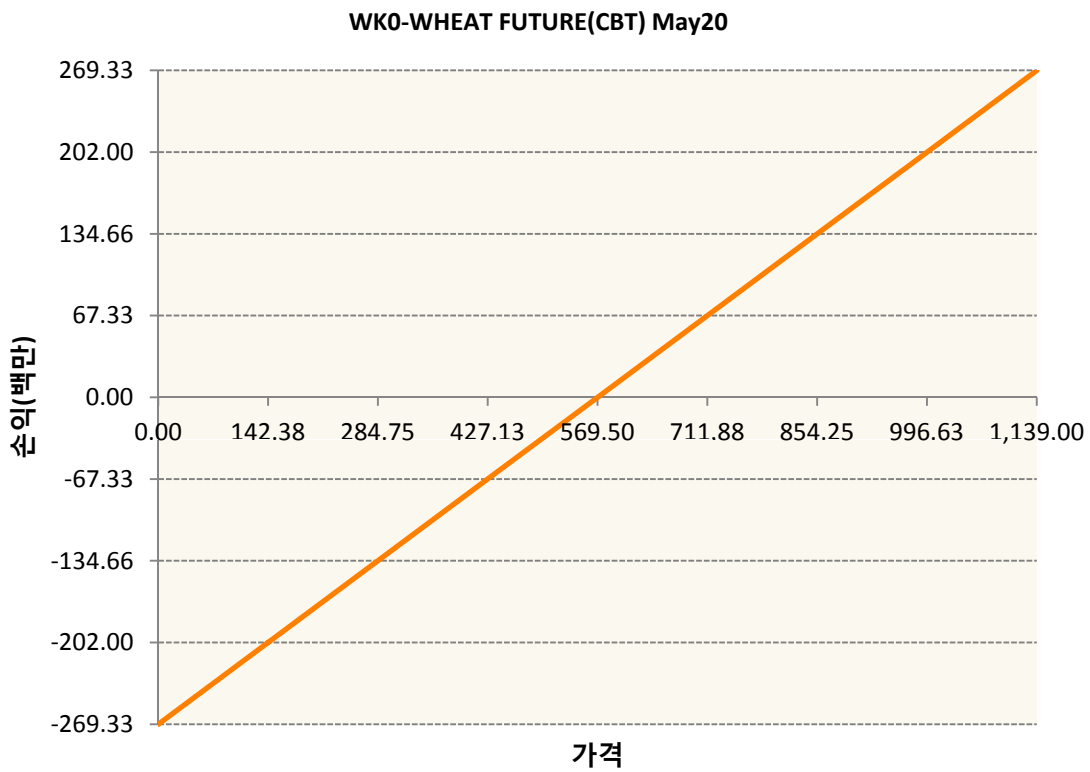
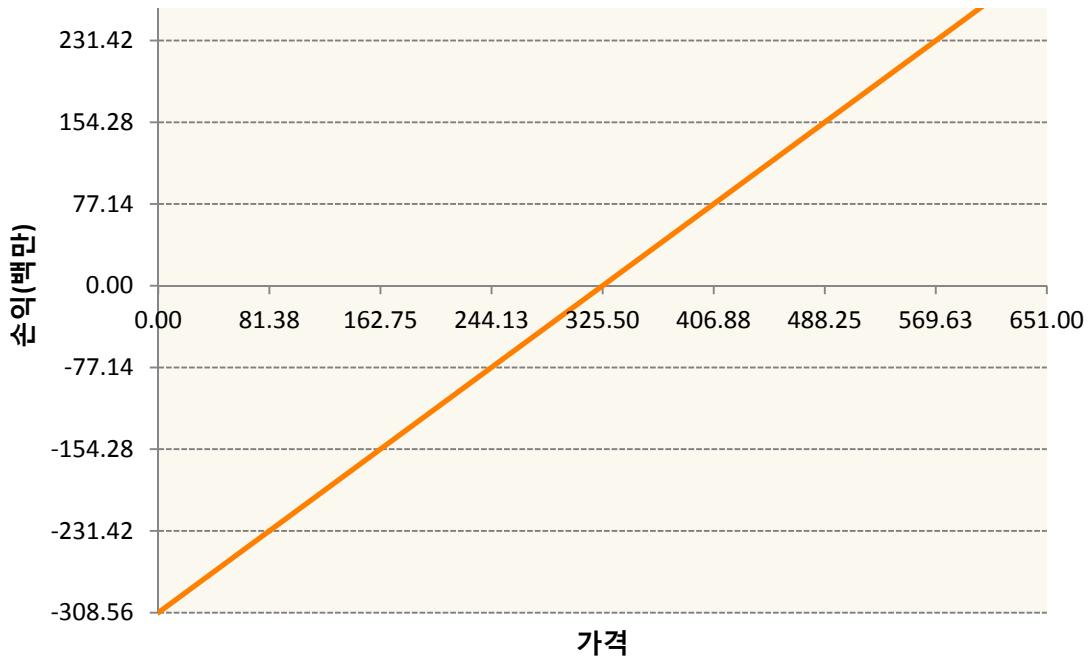


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	15
CK0	CORN FUTURE May20	37
CTK0	COTTON NO.2 FUTR May20	7
KCK0	COFFEE 'C' FUTURE May20	17
KR4175Q40C	2020-04 달러선물	8

KWK0	KC HRW WHEAT FUT May20	12
SBK0	Sugar May20	17
SK0	SOYBEAN FUTURE May20	38
SMK0	SOYBEAN MEAL FUTR May20	25
WK0	WHEAT FUTURE(CBT) May20	22

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

(단위:백만원)

219