공시일	2020-04-02
기준일	2020-04-01

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	2020-04-02
기준일	2020-04-01

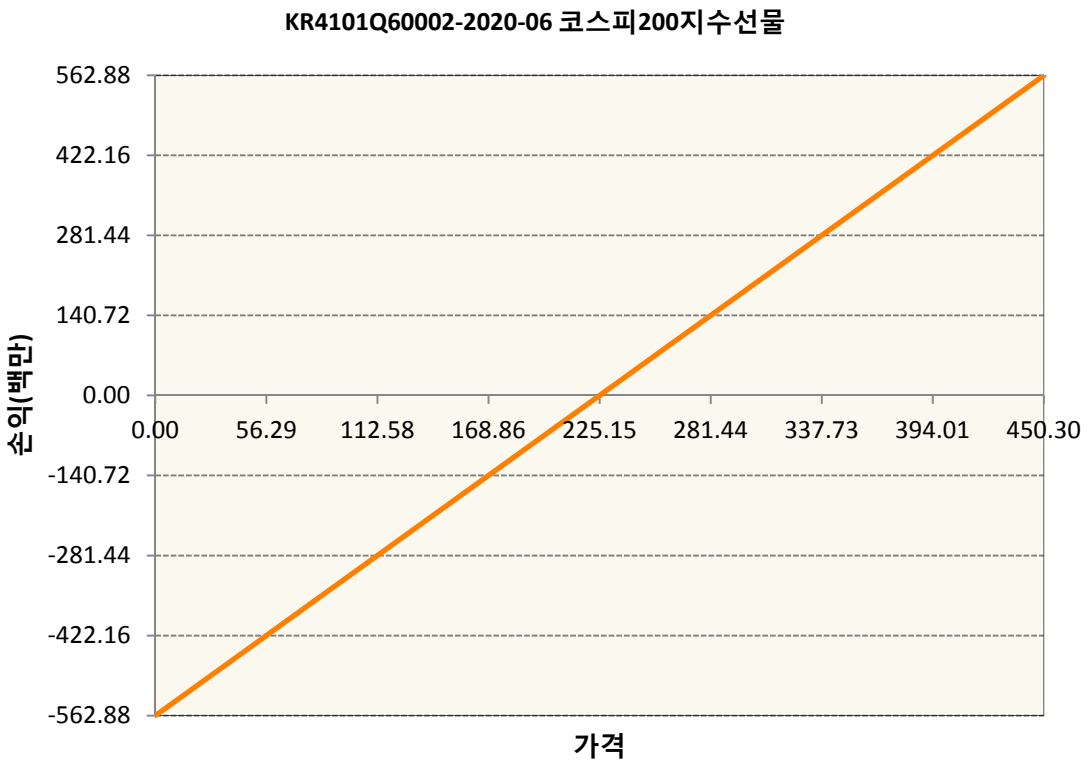
스마트인덱스모

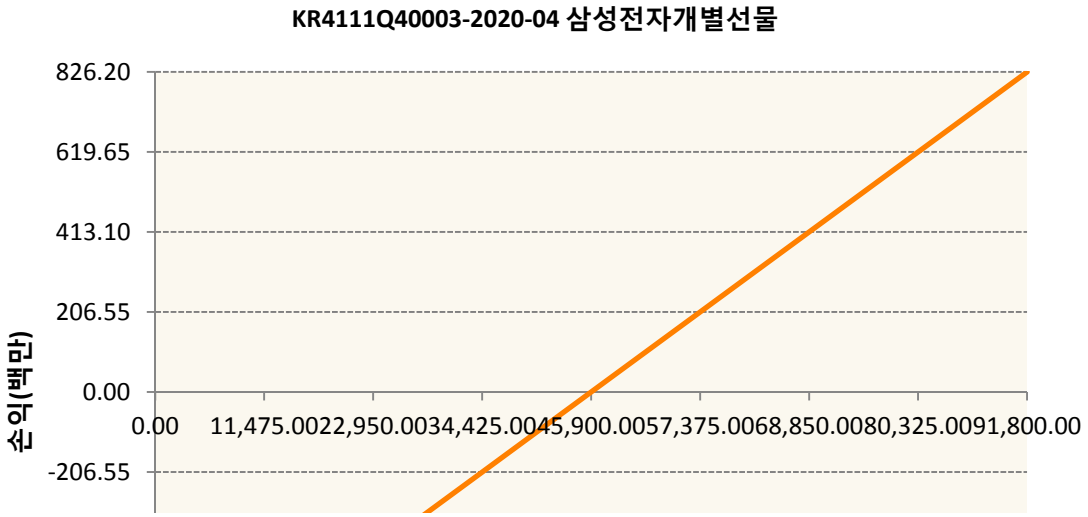
1. 계약금액

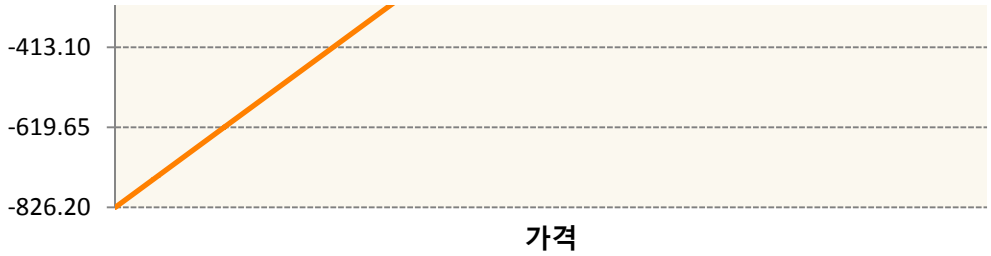
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,389	0	1,389	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002	2020-06 코스피200지수선물						45
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
-5.33%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	15	15	15	15	15	15	15
5.33%	30	30	30	30	30	30	30
8.00%	45	45	45	45	45	45	45
KR4111Q40003	2020-04 삼성전자개별선물						66
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
-5.33%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
-2.67%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	22	22	22	22	22	22	22
5.33%	44	44	44	44	44	44	44
8.00%	66	66	66	66	66	66	66

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

(단위:백만원)

160

공시일	2020-04-02
기준일	2020-04-01

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	892

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

991

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-04-02
기준일	2020-04-01

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	518

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

810

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-04-02
기준일	2020-04-01

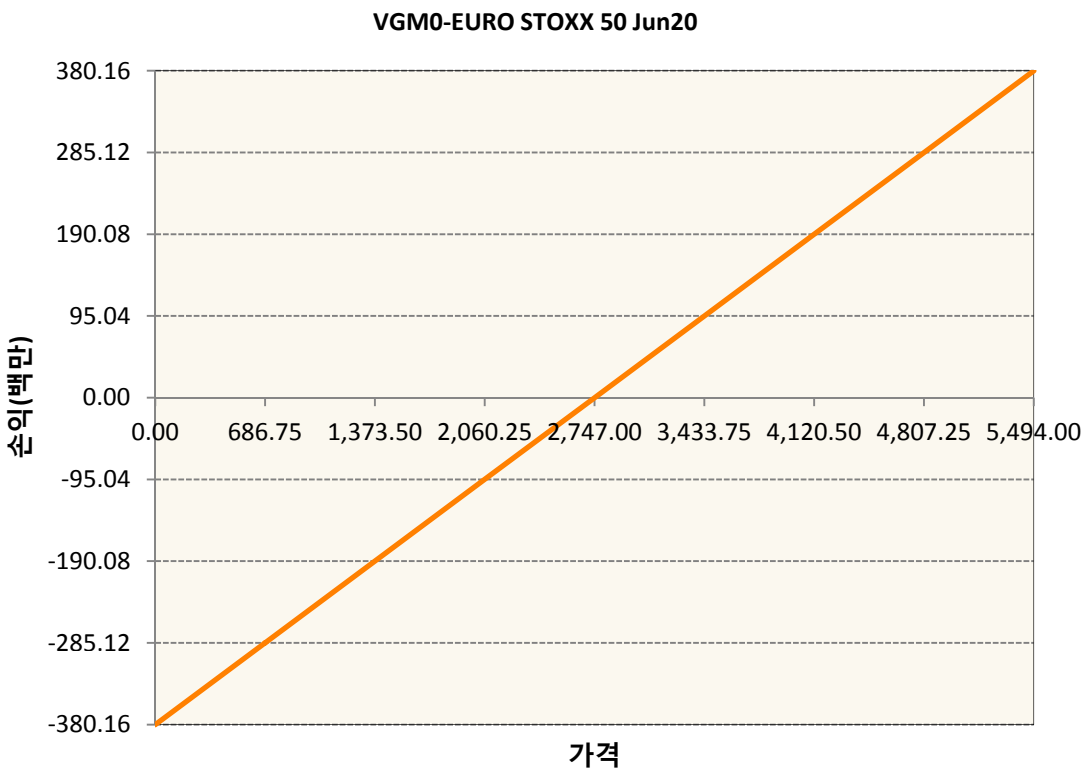
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	380	0	380	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	30

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

(단위:백만원)

36

공시일	2020-04-02
기준일	2020-04-01

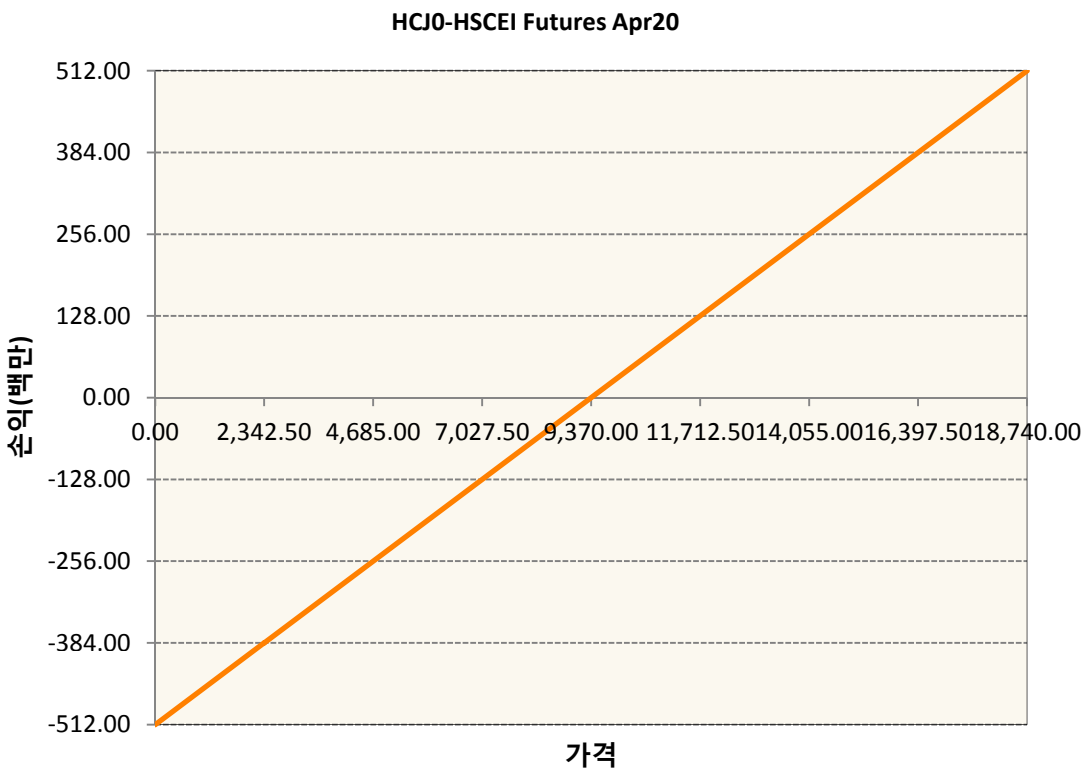
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	512	0	512	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ0	HSCEI Futures Apr20	41

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

(단위:백만원)

44

공시일	2020-04-02
기준일	2020-04-01

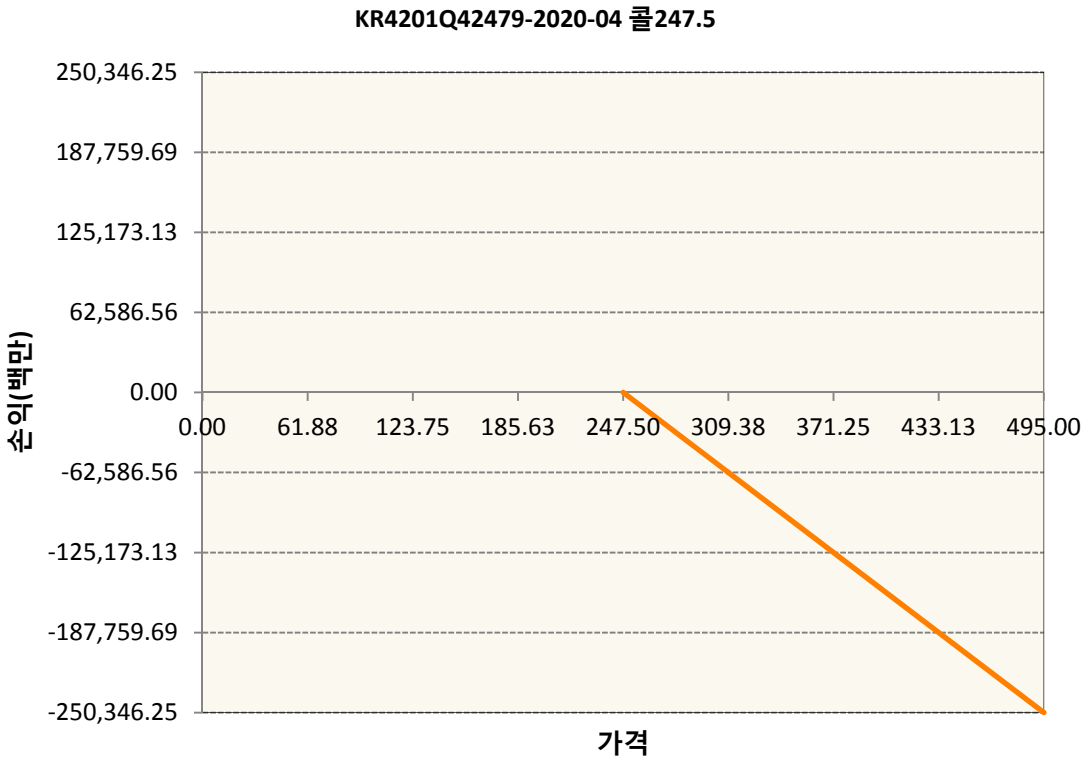
커버드콜모(주식혼합-파생형)

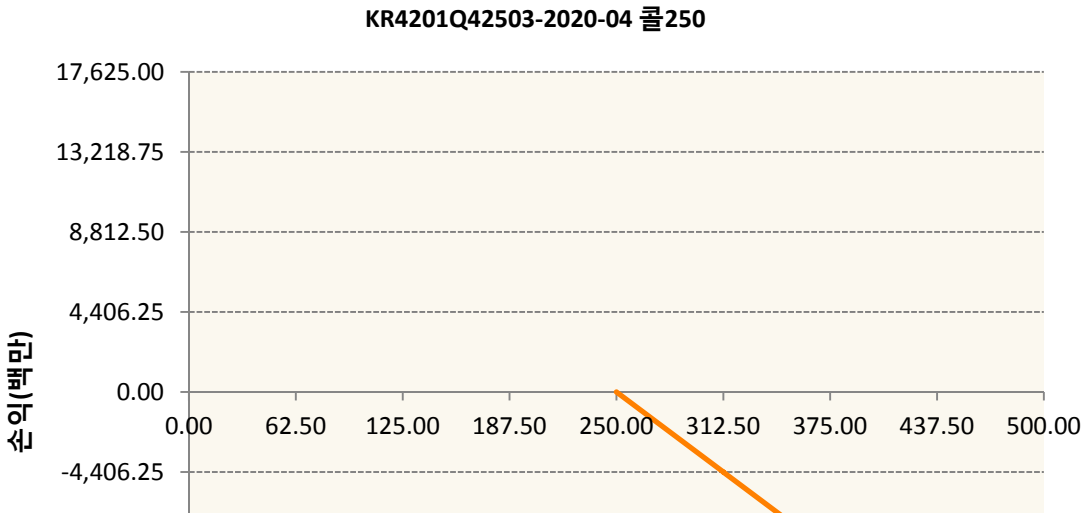
1. 계약금액

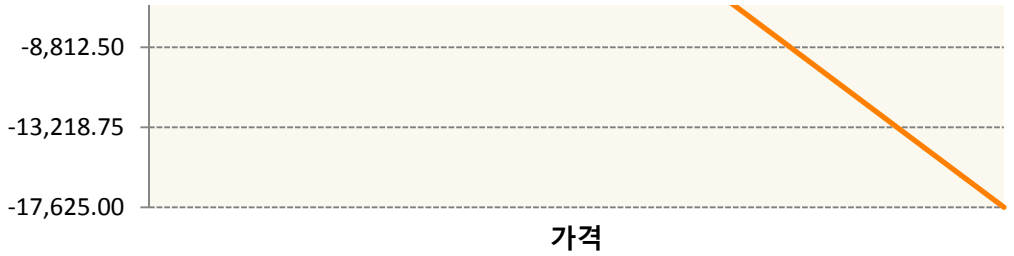
(단위:백만원)

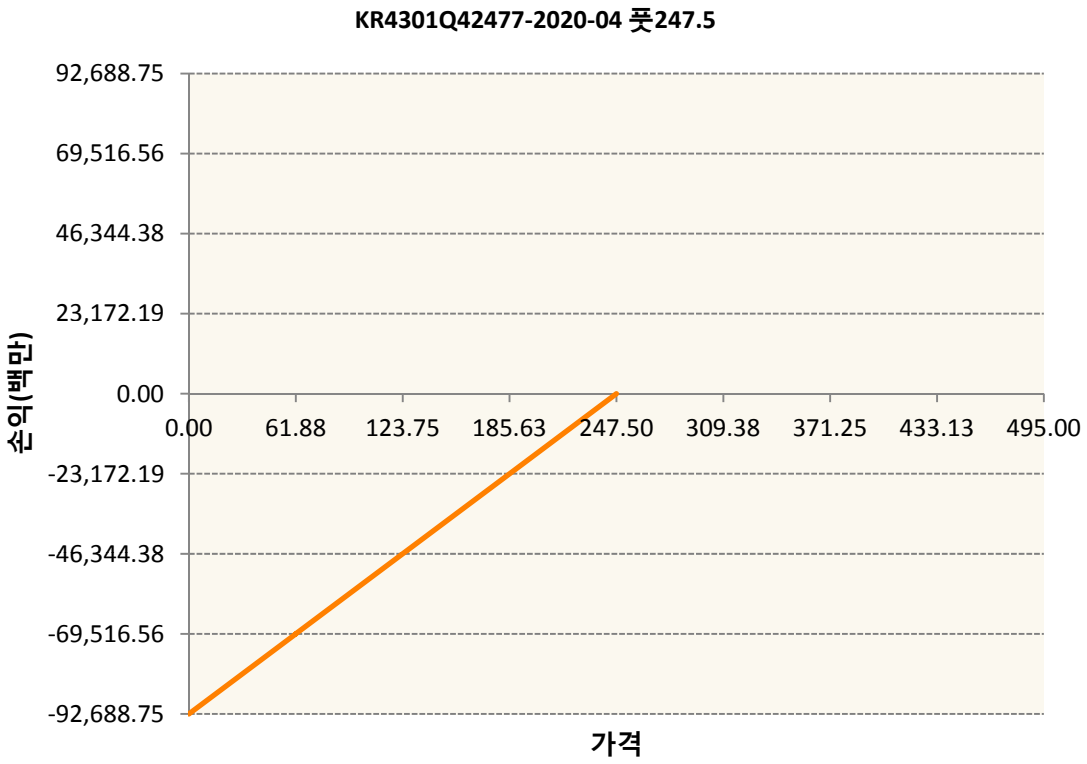
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	360,660	-360,660	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	KR4201Q42479		2020-04 콜247.5				7,747
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,701	1,668	1,612	1,528	1,412	1,262	1,080
-5.33%	1,642	1,560	1,439	1,278	1,077	838	563
-2.67%	1,474	1,300	1,076	807	495	146	-237
0%	1,073	763	403	0	-439	-908	-1,403
2.67%	259	-215	-725	-1,264	-1,828	-2,410	-3,008
5.33%	-1,175	-1,800	-2,442	-3,096	-3,760	-4,433	-5,111
8.00%	-3,406	-4,125	-4,847	-5,571	-6,295	-7,021	-7,747
	KR4201Q42503		2020-04 콜250				490
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	96	94	91	87	80	71	60

-5.33%	93	89	82	73	61	47	30
-2.67%	85	75	63	47	28	6	-18
0%	64	46	25	0	-27	-57	-89
2.67%	20	-9	-41	-75	-111	-149	-189
5.33%	-61	-101	-143	-186	-231	-276	-322
8.00%	-193	-242	-291	-341	-390	-440	-490
KR4301Q42477			2020-04 풋247.5				6,459
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,322	-6,327	-6,337	-6,355	-6,380	-6,415	-6,459
-5.33%	-4,073	-4,090	-4,116	-4,154	-4,204	-4,266	-4,340
-2.67%	-1,851	-1,892	-1,949	-2,021	-2,106	-2,205	-2,316
0%	304	219	117	0	-130	-272	-424
2.67%	2,321	2,178	2,021	1,853	1,676	1,492	1,301
5.33%	4,108	3,907	3,700	3,487	3,270	3,050	2,828
8.00%	5,580	5,341	5,102	4,862	4,621	4,380	4,139

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

12,065

공시일	2020-04-02
기준일	2020-04-01

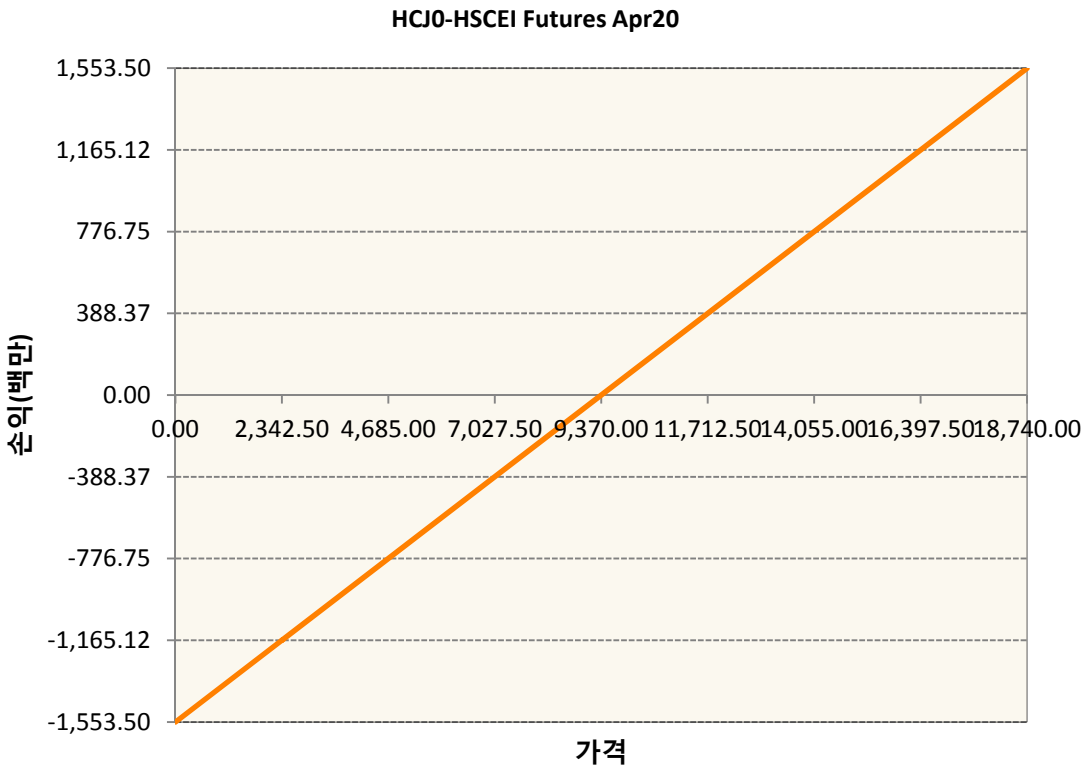
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

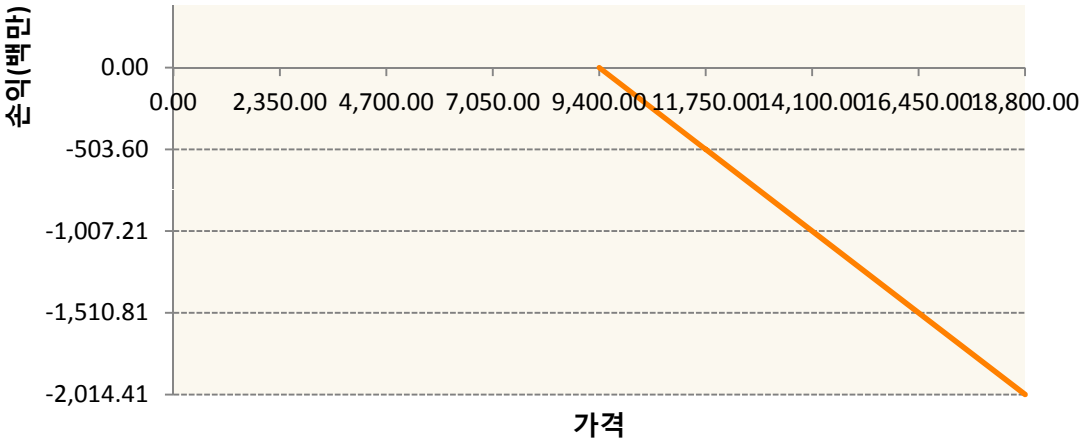
1. 계약금액

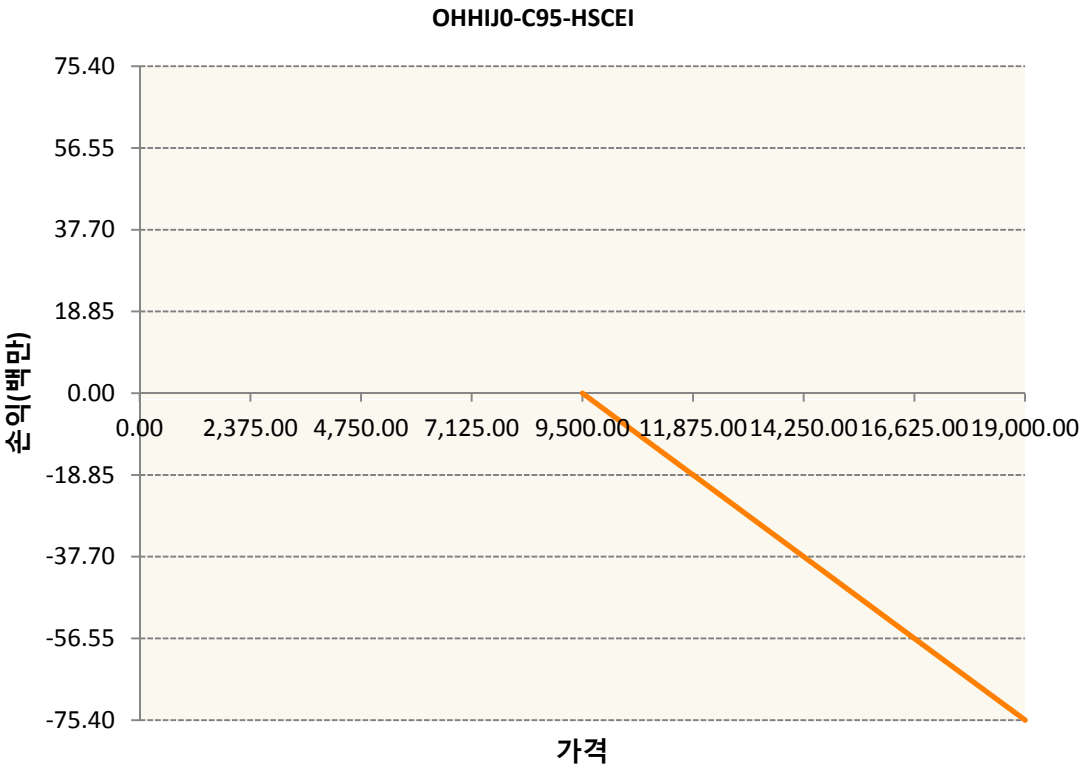
(단위:백만원)

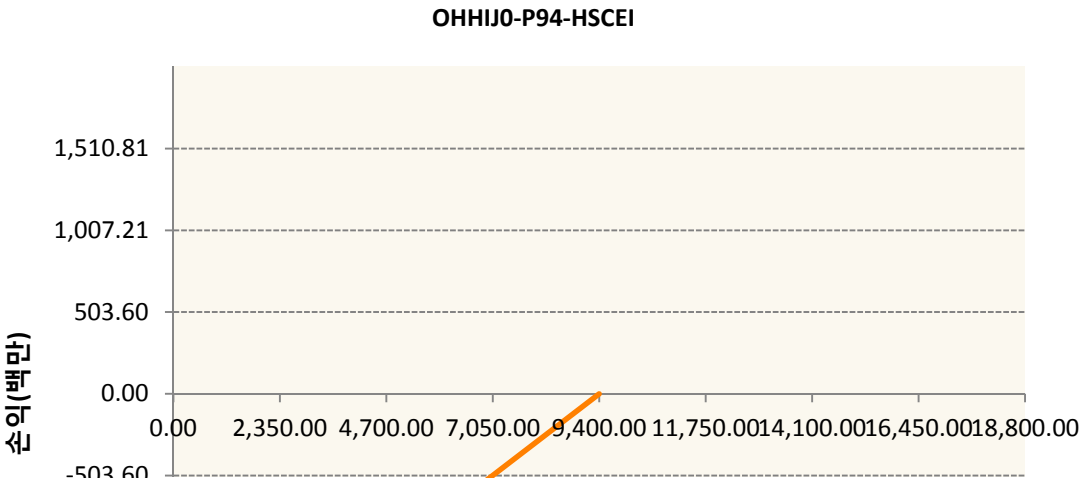
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,553	0	1,553	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,180	-4,180	장내
누계	통화	선도	699	2,235	-1,537	장외

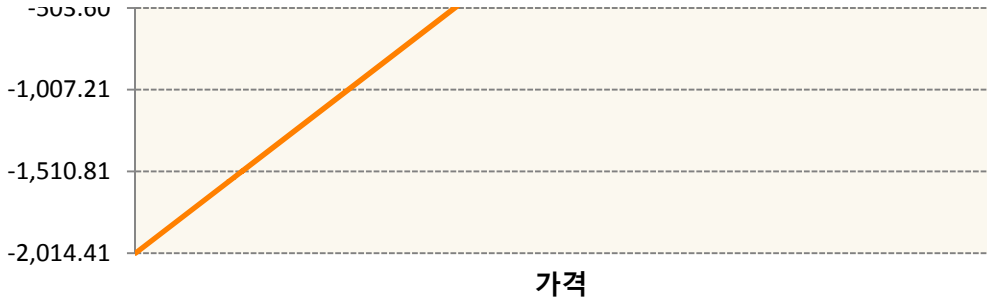
2. 만기시점의 손익구조

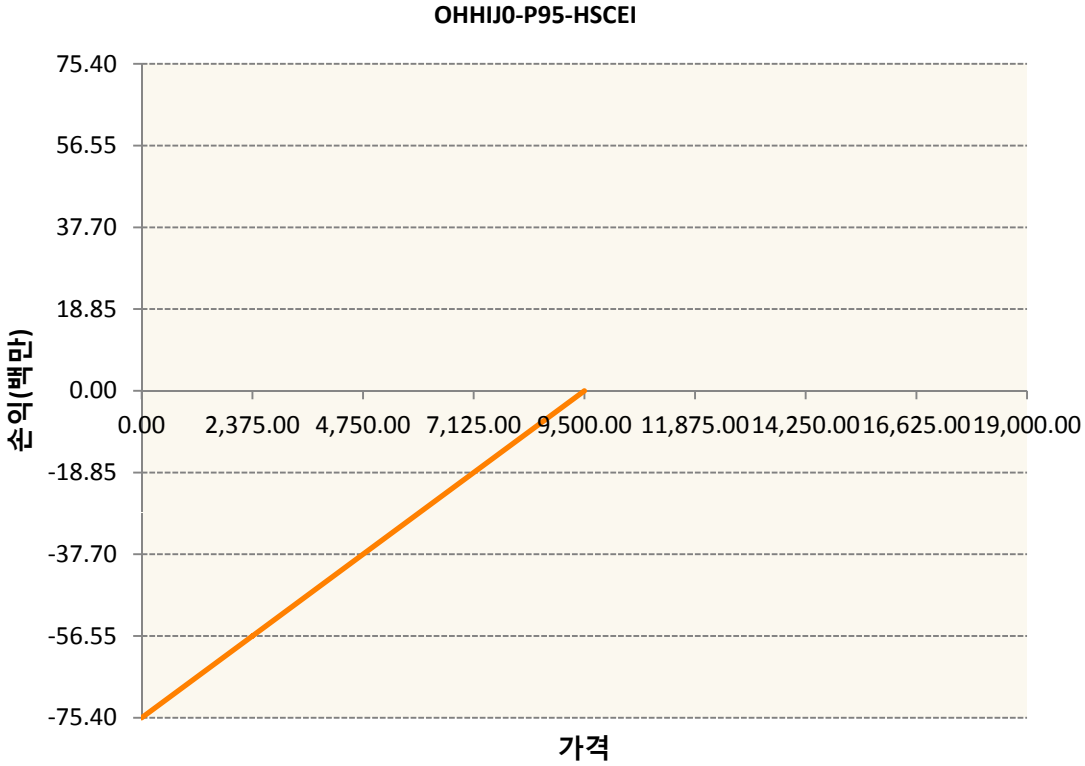



손익(백만)
0.00
-503.60
-1,007.21
-1,510.81
-2,014.41
0.00
2,350.00
4,700.00
7,050.00
9,400.00
11,750.00
14,100.00
16,450.00
18,800.00
가격


OHHIJ0-C95-HSCEI
손익(백만)
75.40
56.55
37.70
18.85
0.00
-18.85
-37.70
-56.55
-75.40
0.00
2,375.00
4,750.00
7,125.00
9,500.00
11,875.00
14,250.00
16,625.00
19,000.00
가격


OHHIJ0-P94-HSCEI
손익(백만)
1,510.81
1,007.21
503.60
0.00
0.00
2,350.00
4,700.00
7,050.00
9,400.00
11,750.00
14,100.00
16,450.00
18,800.00





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E	179
FX21020H05 HKD/KRW 22-05-20E	56
HCJ0 HSCEI Futures Apr20	124
OHHIJ0-C94 HSCEI	161
OHHIJ0-C95 HSCEI	6
OHHIJ0-P94 HSCEI	161
OHHIJ0-P95 HSCEI	6

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	601

공시일	2020-04-02
기준일	2020-04-01

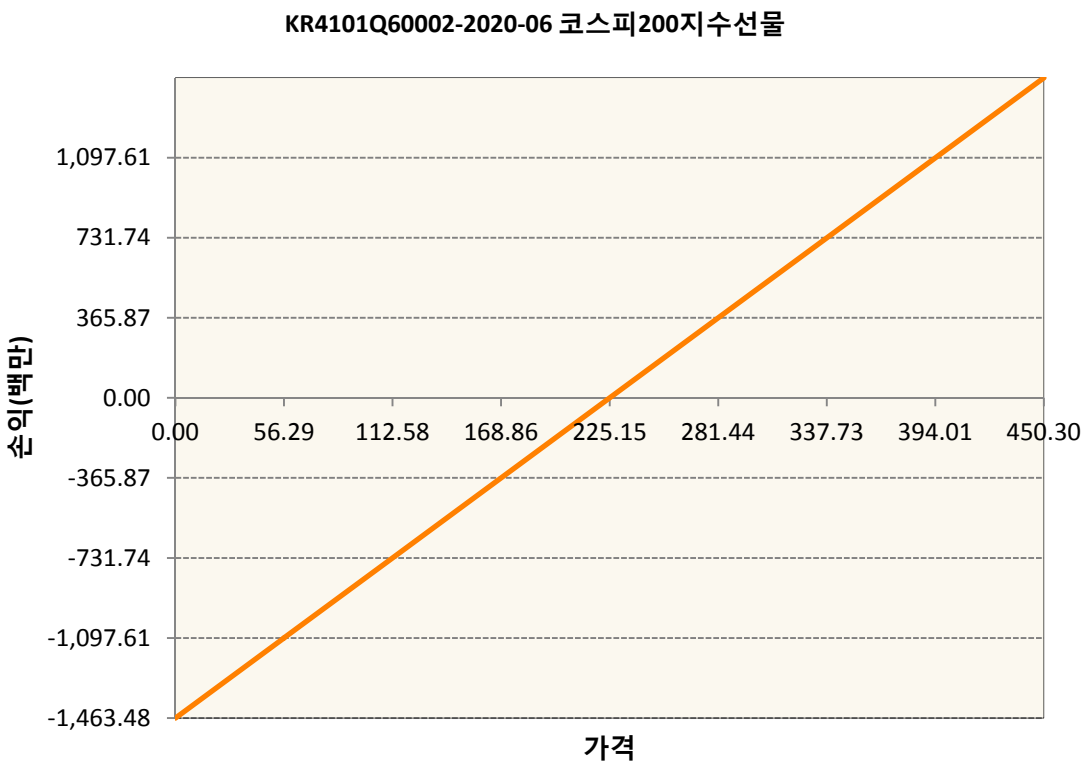
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

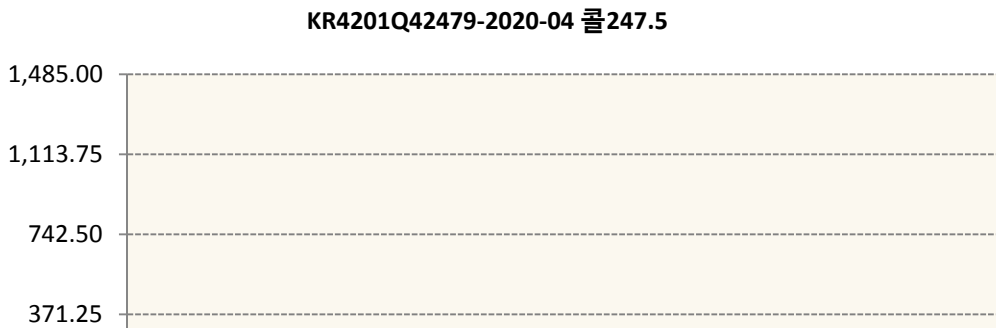
1. 계약금액

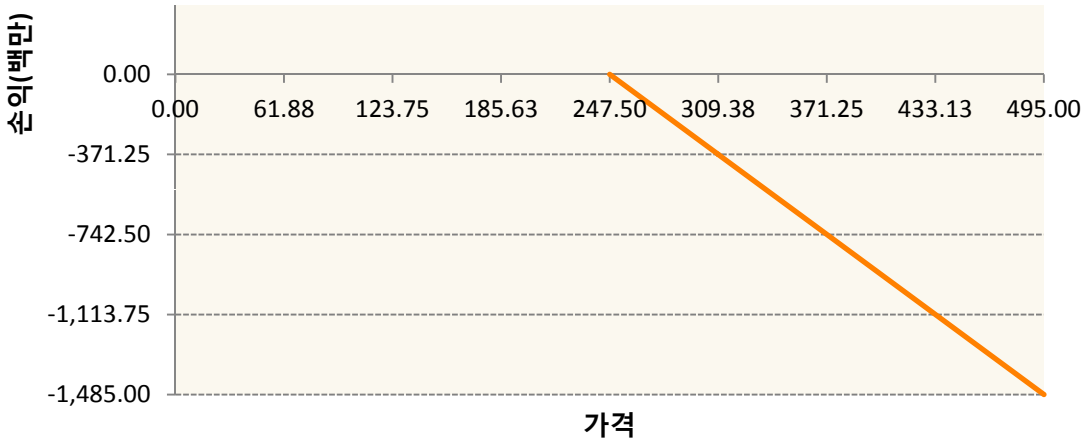
(단위:백만원)

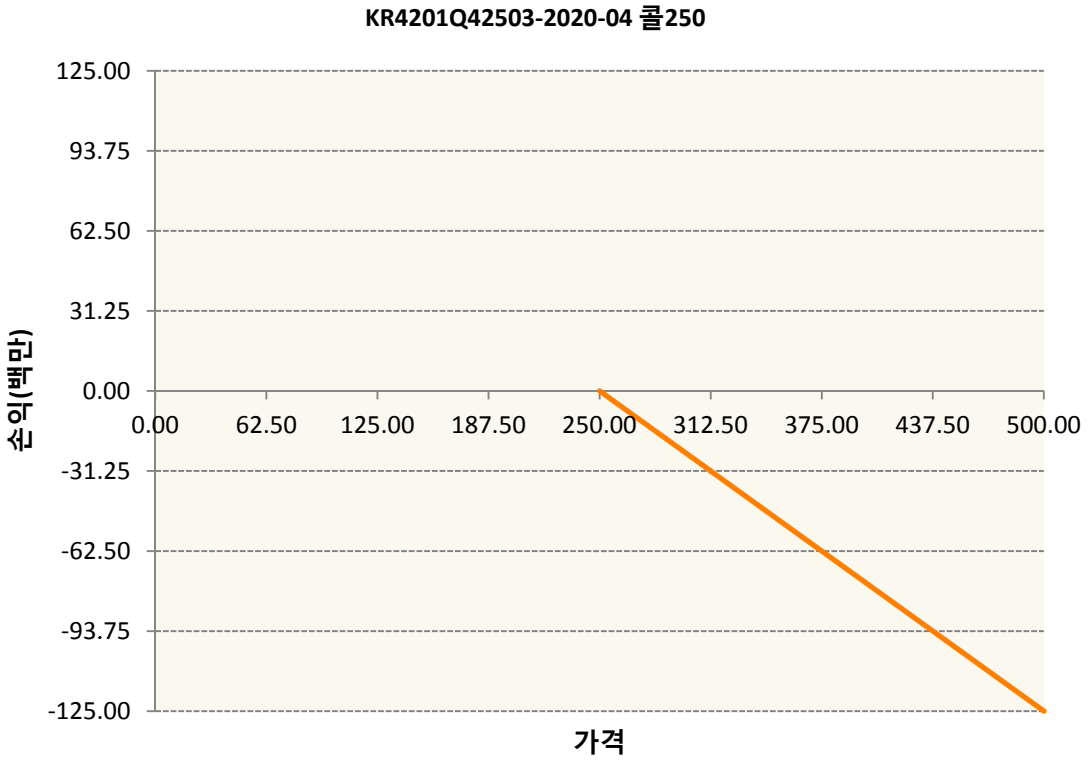
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,463	0	1,463	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,095	-3,095	장내

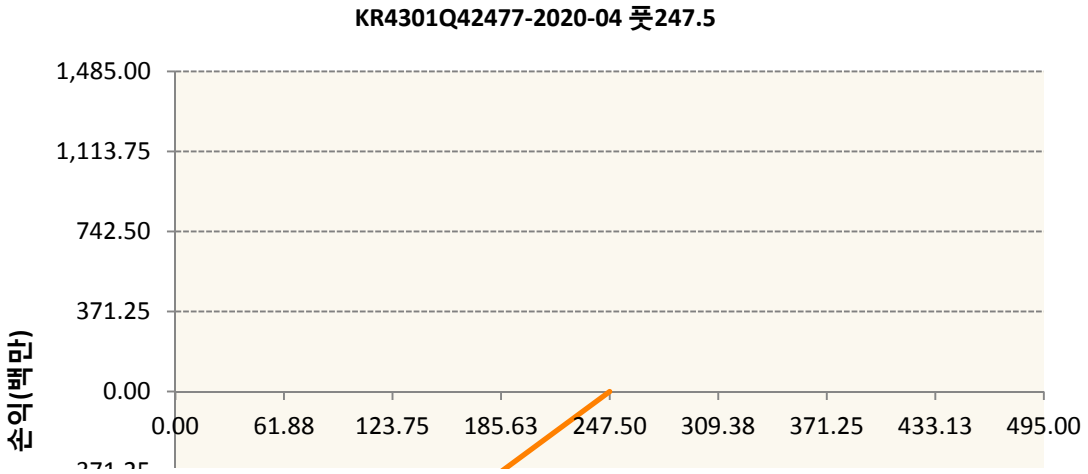
2. 만기시점의 손익구조






손익(백만)
0.00
-371.25
-742.50
-1,113.75
-1,485.00
0.00
61.88
123.75
185.63
247.50
309.38
371.25
433.13
495.00
가격


KR4201Q42503-2020-04 콜250
손익(백만)
125.00
93.75
62.50
31.25
0.00
-31.25
-62.50
-93.75
-125.00
0.00
62.50
125.00
187.50
250.00
312.50
375.00
437.50
500.00
가격


KR4301Q42477-2020-04 풋247.5
손익(백만)
1,485.00
1,113.75
742.50
371.25
0.00
0.00
61.88
123.75
185.63
247.50
309.38
371.25
433.13
495.00

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				118
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118
-5.33%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	39	39	39	39	39	39	39
5.33%	78	78	78	78	78	78	78
8.00%	118	118	118	118	118	118	118
	KR4201Q42479		2020-04 콜247.5				46
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10	10	10	9	8	7	6
-5.33%	10	9	9	8	6	5	3
-2.67%	9	8	6	5	3	1	-1
0%	6	5	2	0	-3	-5	-8
2.67%	2	-1	-4	-8	-11	-14	-18
5.33%	-7	-11	-14	-18	-22	-26	-30
8.00%	-20	-24	-29	-33	-37	-42	-46
	KR4201Q42503		2020-04 콜250				3
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	1	1	1	1	1	1	0
-5.33%	1	1	1	1	0	0	0
-2.67%	1	1	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	0	0	0	-1	-1	-1	-1
5.33%	0	-1	-1	-1	-2	-2	-2
8.00%	-1	-2	-2	-2	-3	-3	-3
	KR4301Q42477		2020-04 풋247.5				103
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-101	-101	-102	-102	-102	-103	-103
-5.33%	-65	-66	-66	-67	-67	-68	-70
-2.67%	-30	-30	-31	-32	-34	-35	-37
0%	5	4	2	0	-2	-4	-7
2.67%	37	35	32	30	27	24	21
5.33%	66	63	59	56	52	49	45
8.00%	89	86	82	78	74	70	66

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

491

공시일	2020-04-02
기준일	2020-04-01

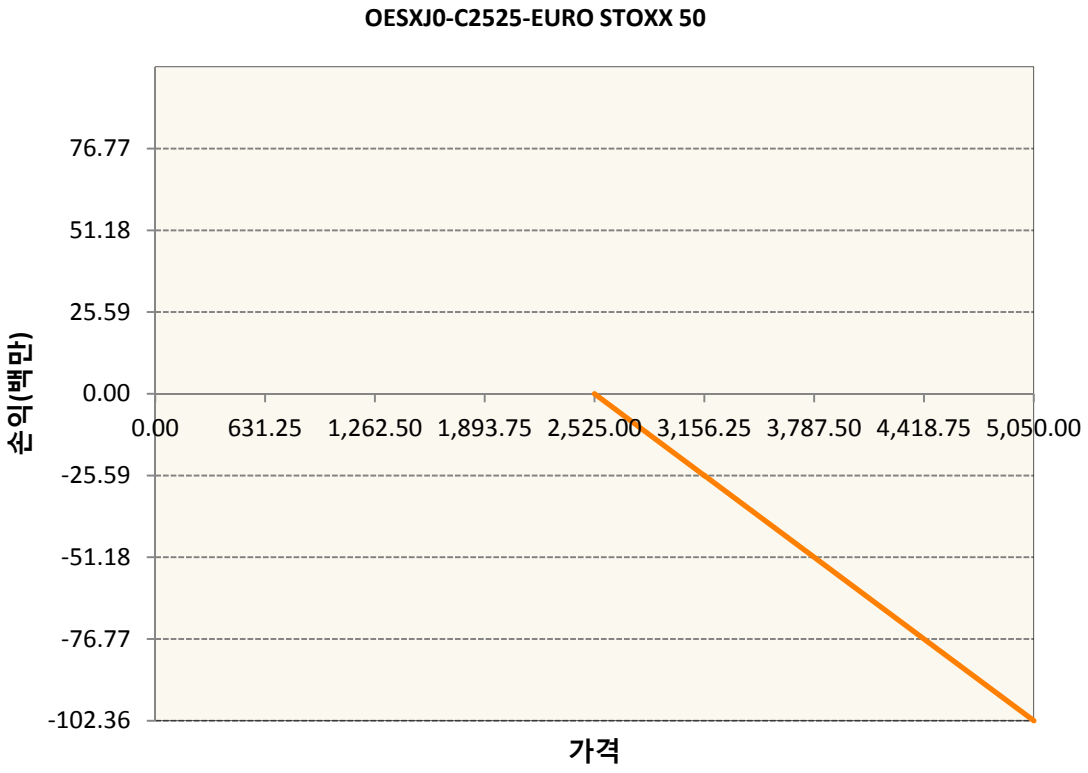
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

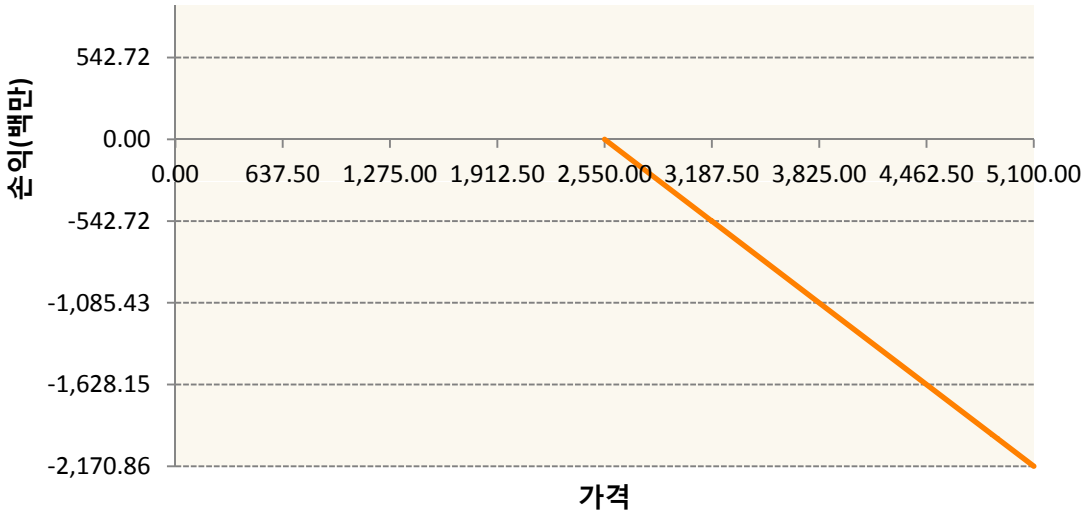
1. 계약금액

(단위:백만원)

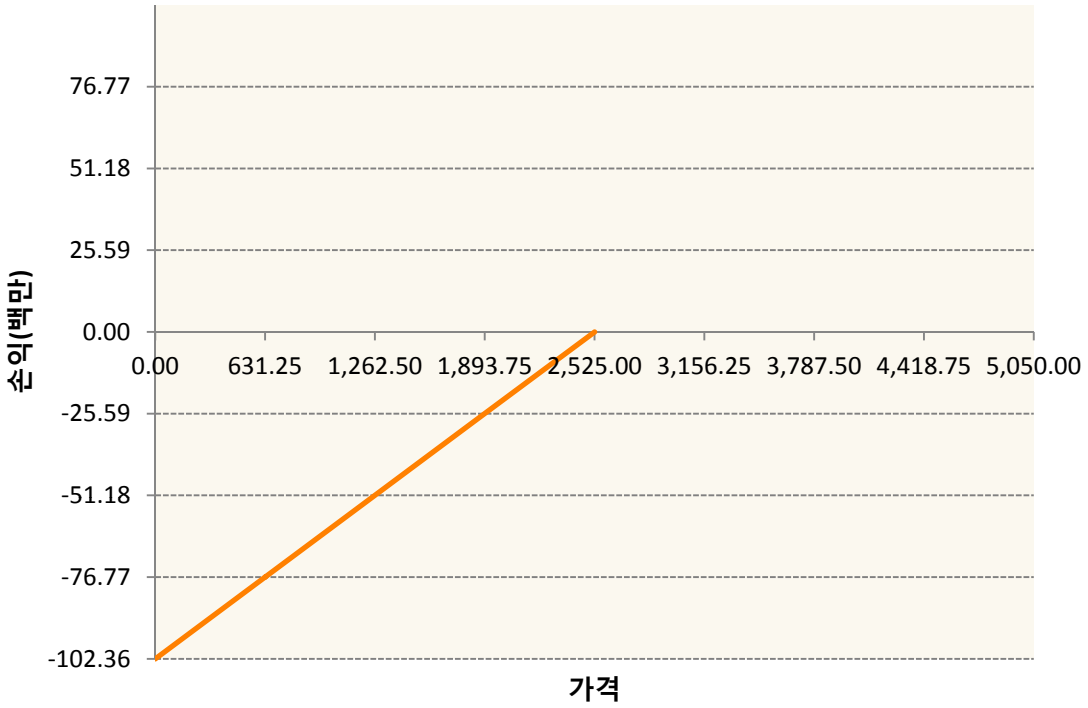
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	262	0	262	
누계	유가증권	스왑	7,676	0	7,676	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,546	-4,546	장내
누계	통화	선도	0	2,735	-2,735	장외

2. 만기시점의 손익구조

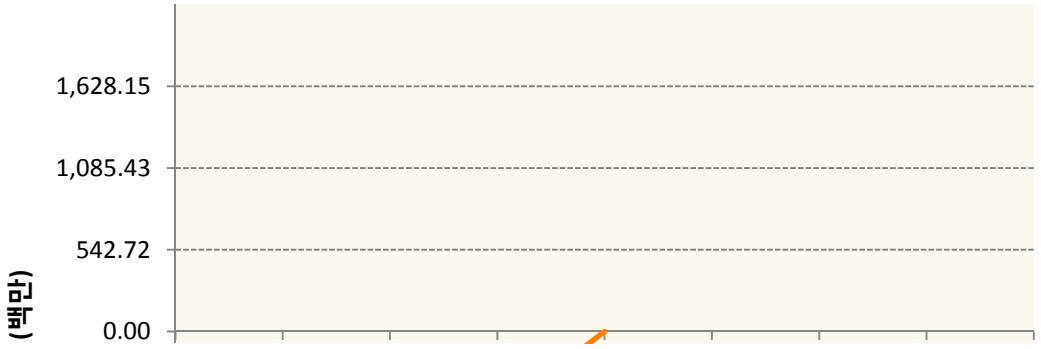


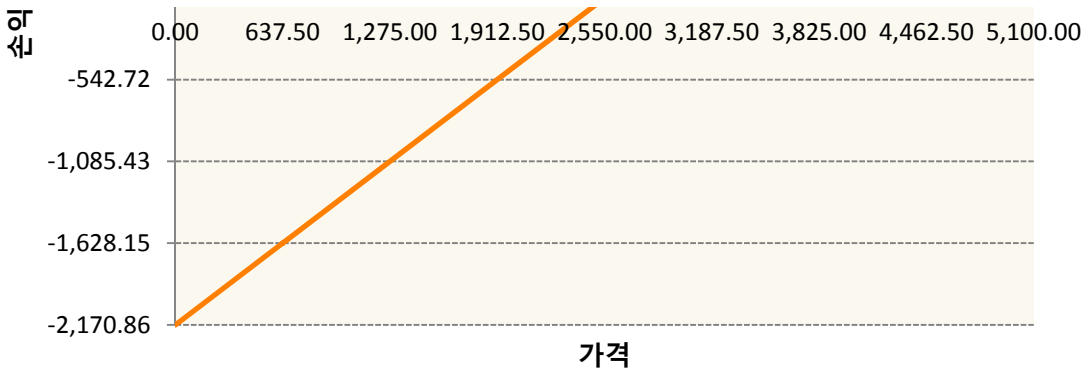


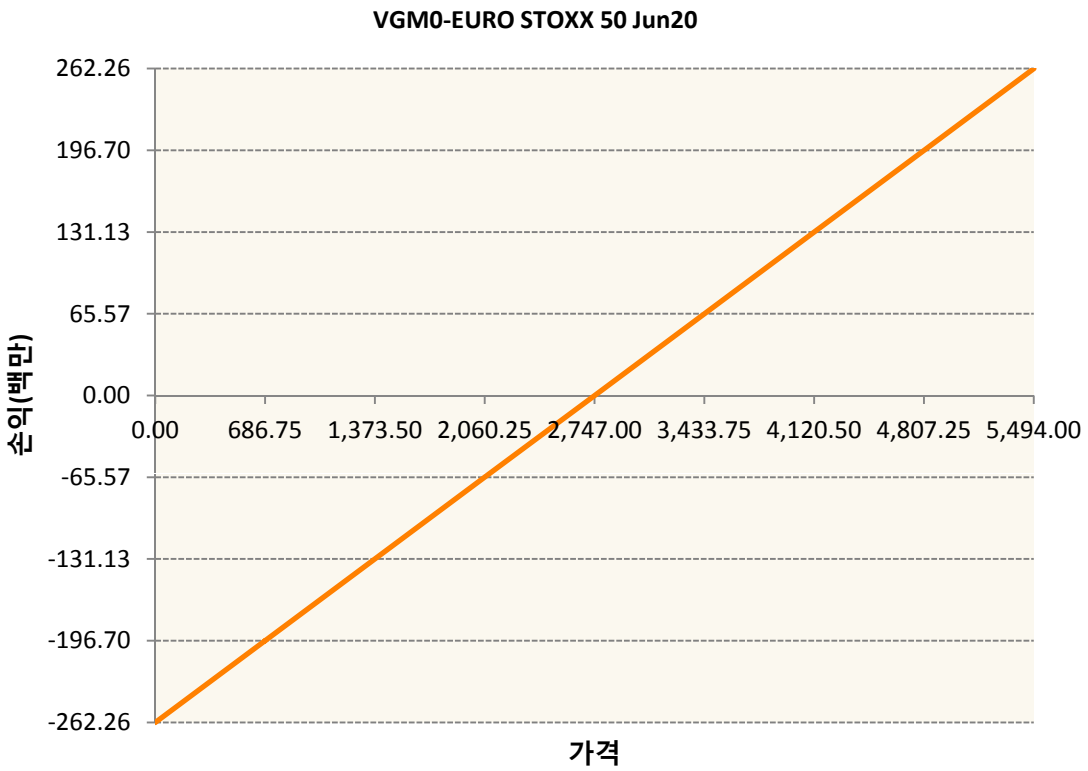
OESXJ0-P2525-EURO STOXX 50



OESXJ0-P2550-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	21
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E	219
OESXJ0-C25 EURO STOXX 50	8
OESXJ0-C25 EURO STOXX 50	174
OESXJ0-P25 EURO STOXX 50	8
OESXJ0-P25 EURO STOXX 50	174
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20	21

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

공시일	2020-04-02
기준일	2020-04-01

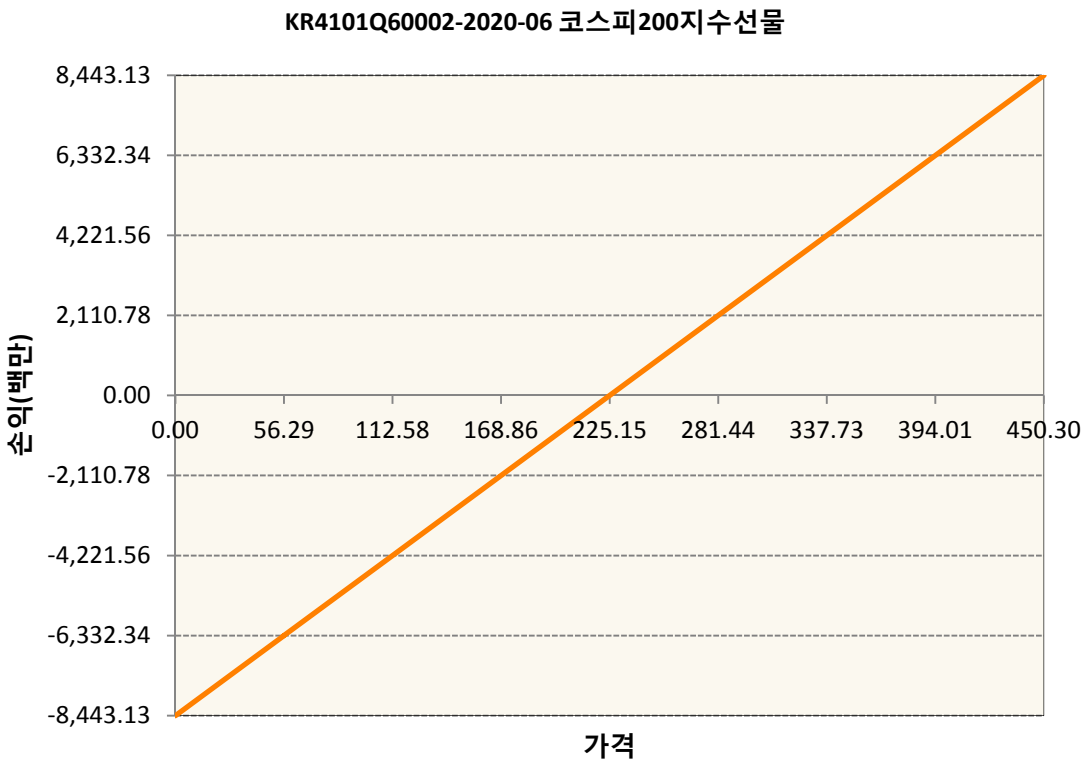
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	8,443	0	8,443	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002	2020-06 코스피200지수선물						679
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-679	-679	-679	-679	-679	-679	-679
-5.33%	-453	-453	-453	-453	-453	-453	-453
-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%	453	453	453	453	453	453	453
8.00%	679	679	679	679	679	679	679

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	969

공시일	2020-04-02
기준일	2020-04-01

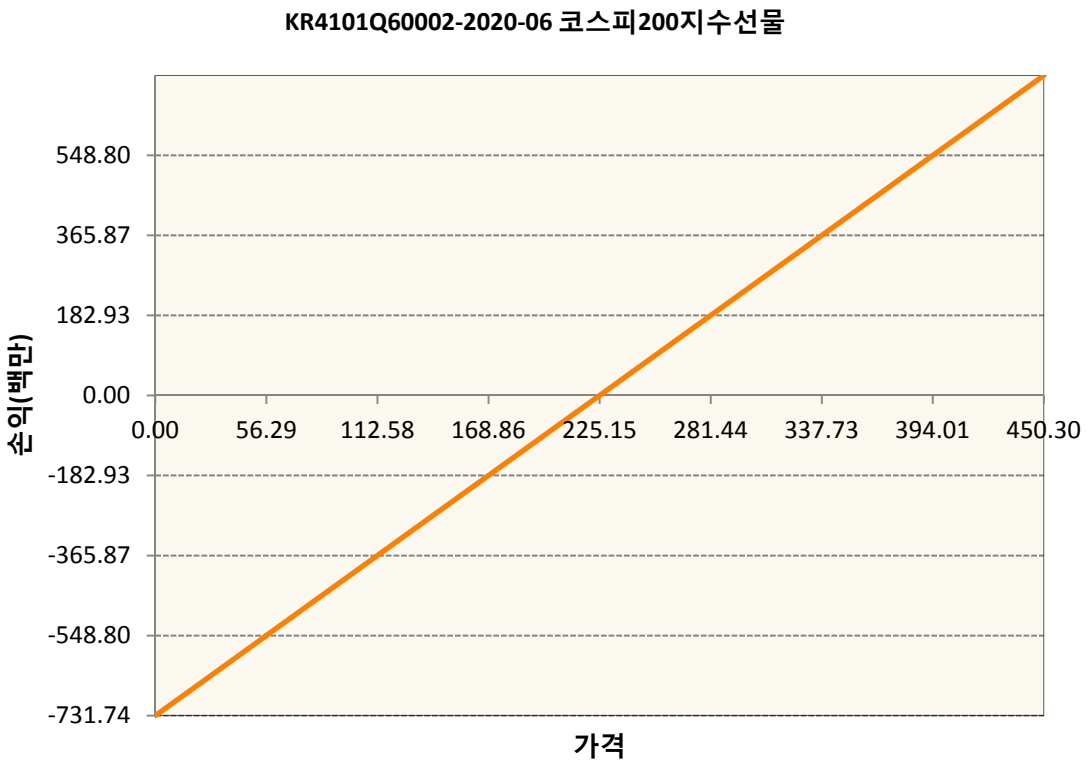
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	732	0	732	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002	2020-06 코스피200지수선물						59
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-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%	39	39	39	39	39	39	39
8.00%	59	59	59	59	59	59	59

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

84

공시일	2020-04-02
기준일	2020-04-01

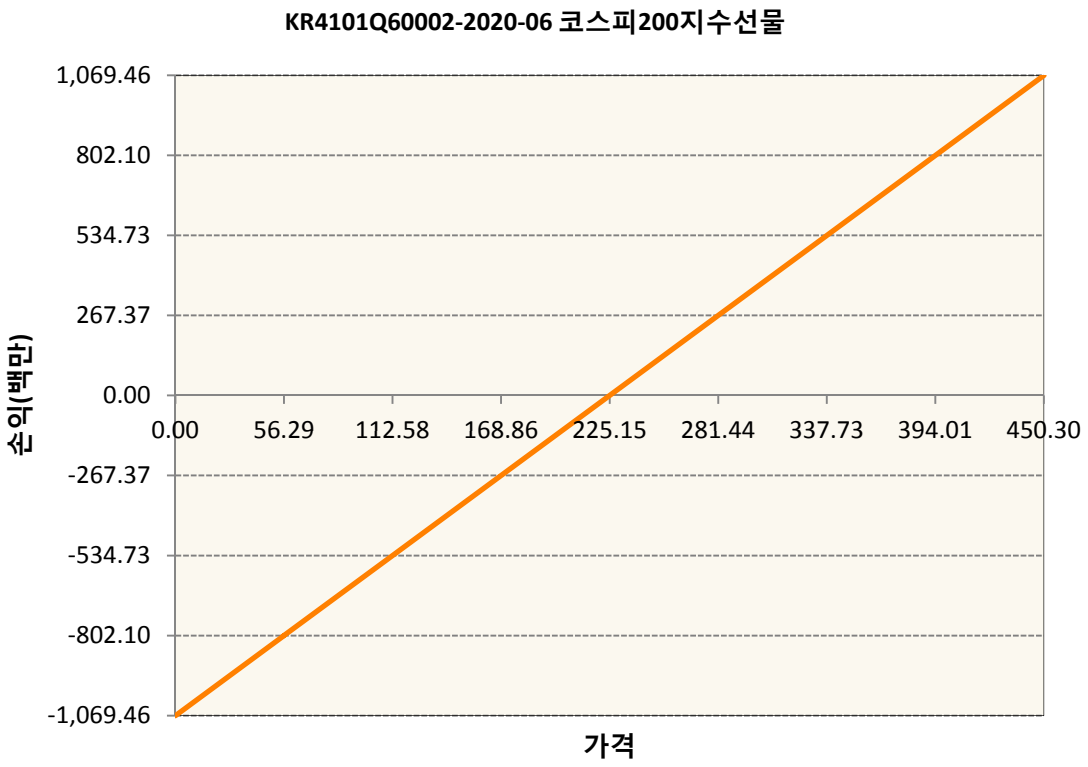
ETF스마트레버리지목표전환형10호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,069	0	1,069	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002	2020-06 코스피200지수선물						86
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
-5.33%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
-2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	29	29	29	29	29	29	29
5.33%	57	57	57	57	57	57	57
8.00%	86	86	86	86	86	86	86

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

123

공시일	2020-04-02
기준일	2020-04-01

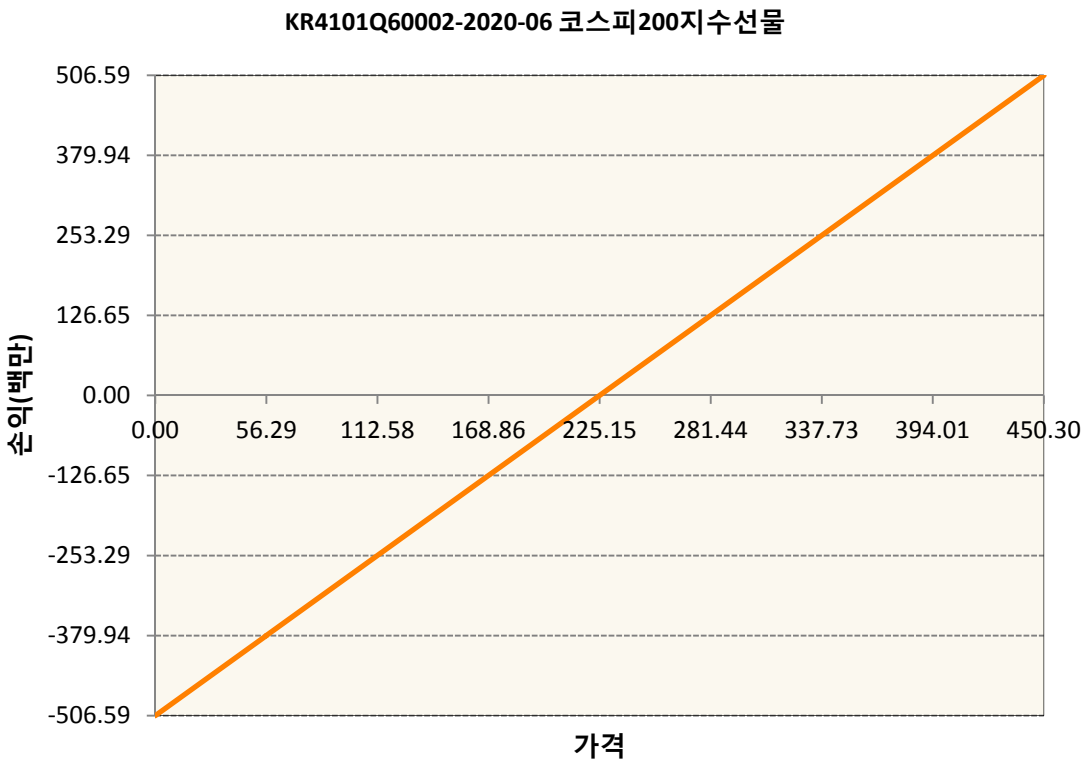
스마트KRX300인덱스목표전환형1호

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	507	0	507	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002	2020-06 코스피200지수선물						41
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
-5.33%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
-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%	27	27	27	27	27	27	27
8.00%	41	41	41	41	41	41	41

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	58

공시일	2020-04-02
기준일	2020-04-01

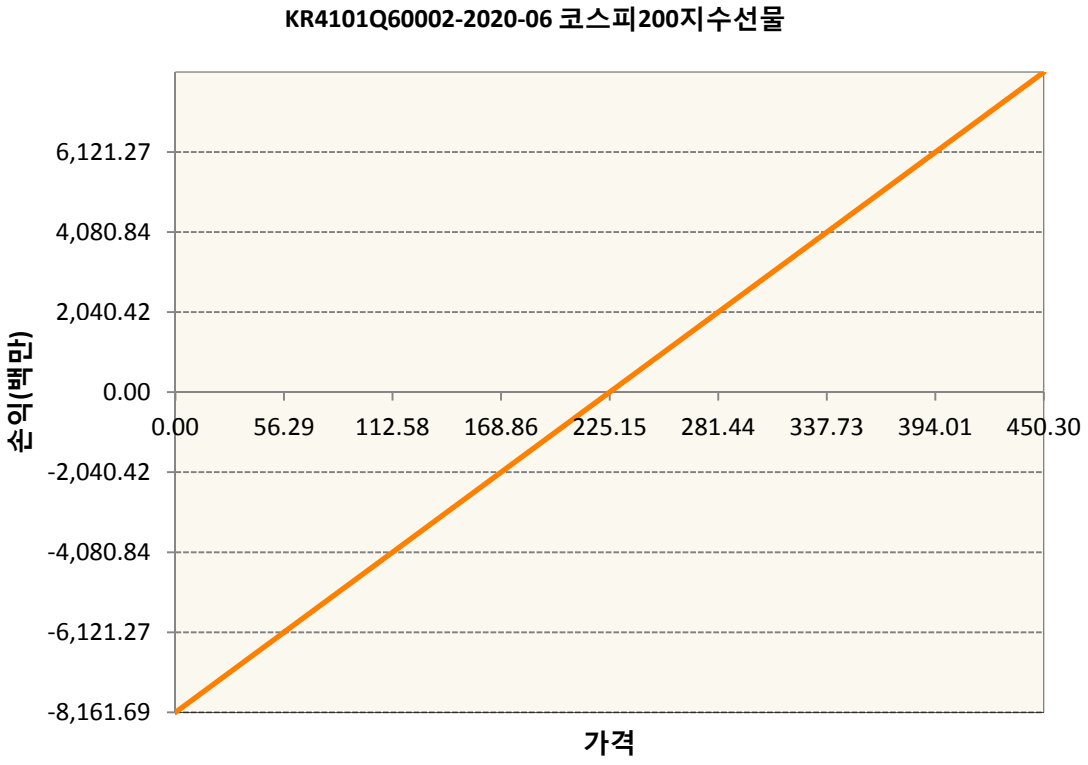
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

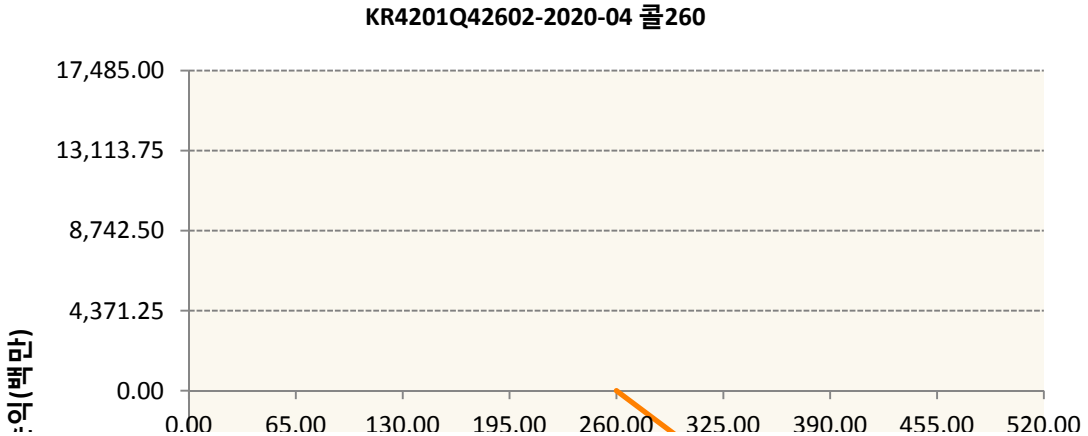
1. 계약금액

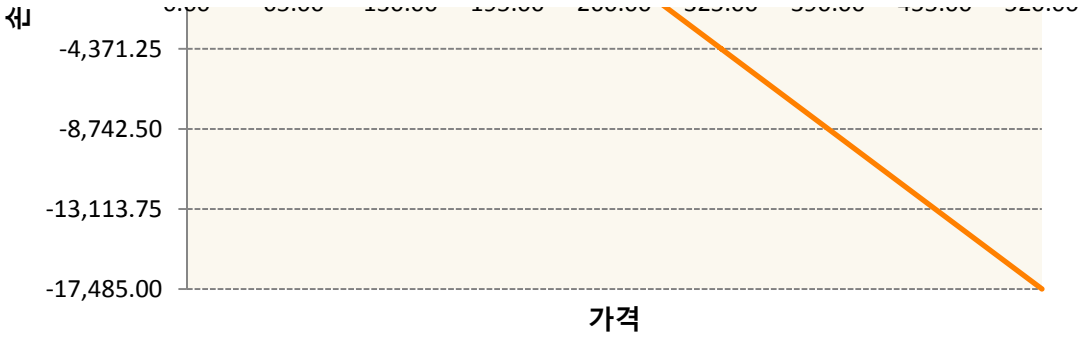
(단위:백만원)

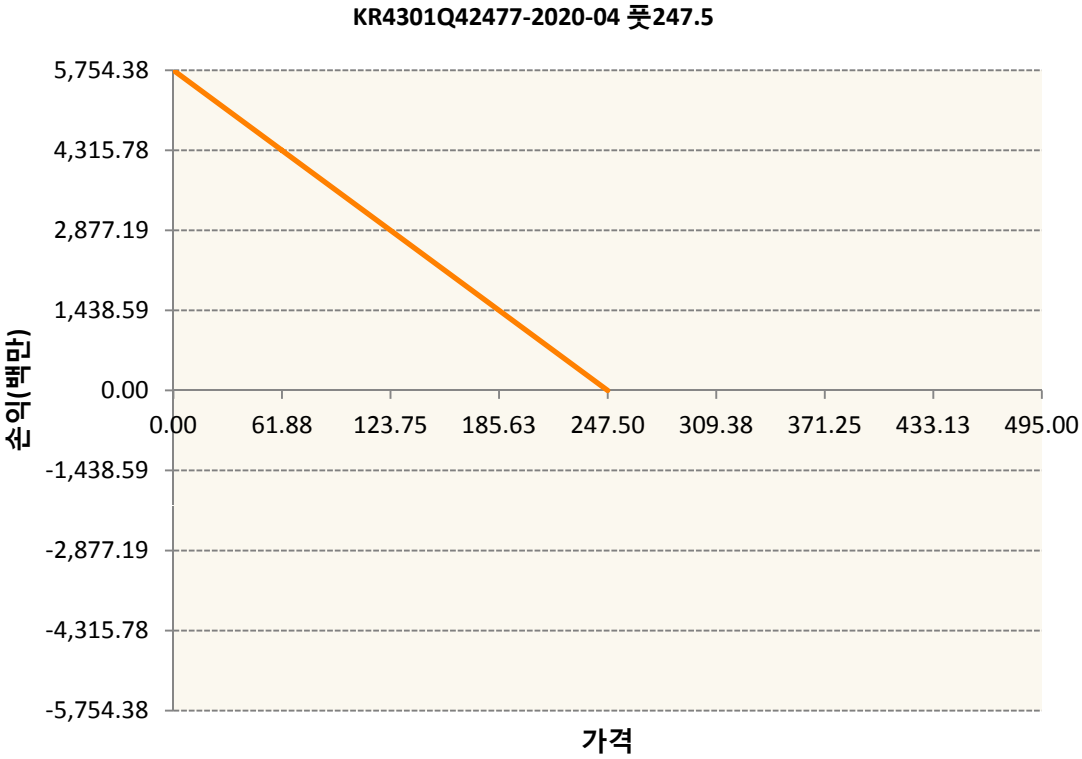
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,162	0	8,162	장내
누계	유가증권	옵션	6,004	17,485	-11,481	장내

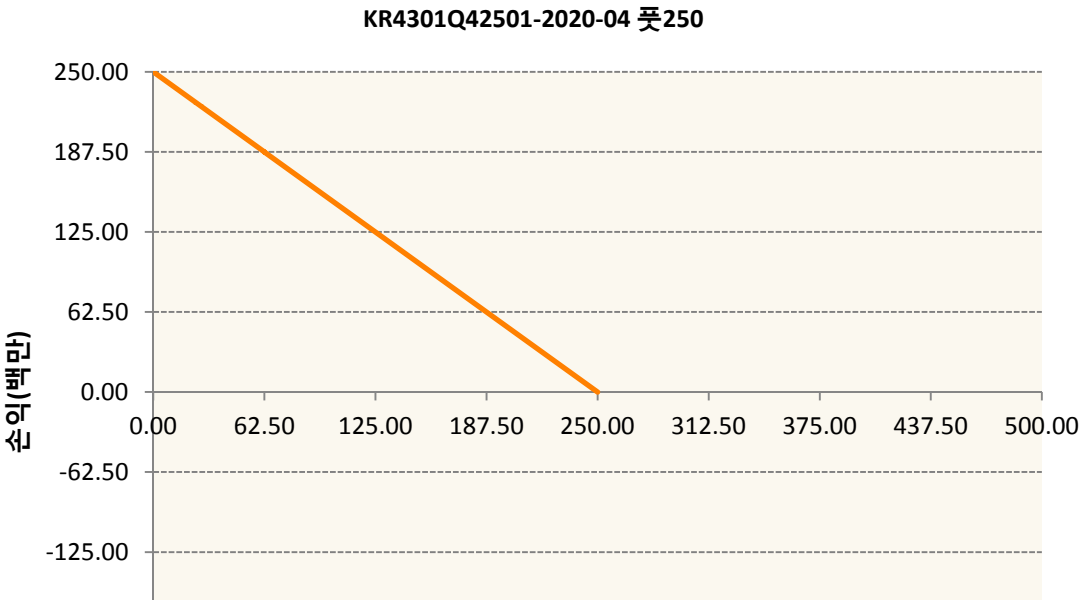
2. 만기시점의 손익구조

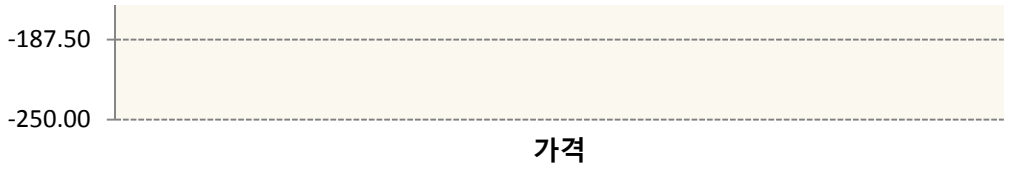





-4,371.25
-8,742.50
-13,113.75
-17,485.00
가격


KR4301Q42477-2020-04 풋247.5
5,754.38
4,315.78
2,877.19
1,438.59
0.00
-1,438.59
-2,877.19
-4,315.78
-5,754.38
0.00
61.88
123.75
185.63
247.50
309.38
371.25
433.13
495.00
손익(백만)
가격


KR4301Q42501-2020-04 풋250
250.00
187.50
125.00
62.50
0.00
-62.50
-125.00
0.00
62.50
125.00
187.50
250.00
312.50
375.00
437.50
500.00
손익(백만)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

	KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물				656
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-656	-656	-656	-656	-656	-656	-656
-5.33%	-438	-438	-438	-438	-438	-438	-438
-2.67%	-219	-219	-219	-219	-219	-219	-219
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	219	219	219	219	219	219	219
5.33%	438	438	438	438	438	438	438
8.00%	656	656	656	656	656	656	656
	KR4201Q42602		2020-04 콜260				301
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	36	36	35	33	31	27	22
-5.33%	36	34	32	29	24	17	8
-2.67%	34	31	26	19	10	-2	-16
0%	29	22	13	0	-15	-34	-54
2.67%	16	2	-14	-35	-58	-83	-111
5.33%	-13	-36	-62	-92	-123	-157	-192
8.00%	-70	-104	-140	-178	-218	-259	-301
	KR4301Q42477		2020-04 풋247.5				401
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	392	393	393	395	396	398	401
-5.33%	253	254	256	258	261	265	269
-2.67%	115	117	121	125	131	137	144
0%	-19	-14	-7	0	8	17	26
2.67%	-144	-135	-125	-115	-104	-93	-81
5.33%	-255	-243	-230	-216	-203	-189	-176
8.00%	-346	-332	-317	-302	-287	-272	-257
	KR4301Q42501		2020-04 풋250				17
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17	17	17	17	17	17	17
-5.33%	11	11	11	11	11	12	12
-2.67%	5	5	5	6	6	6	6

0%	-1	0	0	0	0	1	1
2.67%	-6	-6	-6	-5	-5	-4	-4
5.33%	-11	-11	-10	-10	-9	-9	-8
8.00%	-16	-15	-14	-14	-13	-12	-12

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

1,465

공시일	2020-04-02
기준일	2020-04-01

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	146,373	0	146,373	

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	2020-04-02
기준일	2020-04-01

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	98,697	0	98,697	

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	2020-04-02
기준일	2020-04-01

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	436,073	0	436,073	
누계	통화	선도	71,984	495,768	-423,784	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,658
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,386
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,969
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,938
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,303
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,969
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,461
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,048
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,048
FX21020H04 USD/KRW 21-04-20E	1,477
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,402
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	984
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	984
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,559
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	847
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	738
FX21020H09 USD/KRW 24-04-20E	738
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	492
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,445
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,989
FX21020H11 KRW/USD 11-05-20E	984
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

22,121

공시일	2020-04-02
기준일	2020-04-01

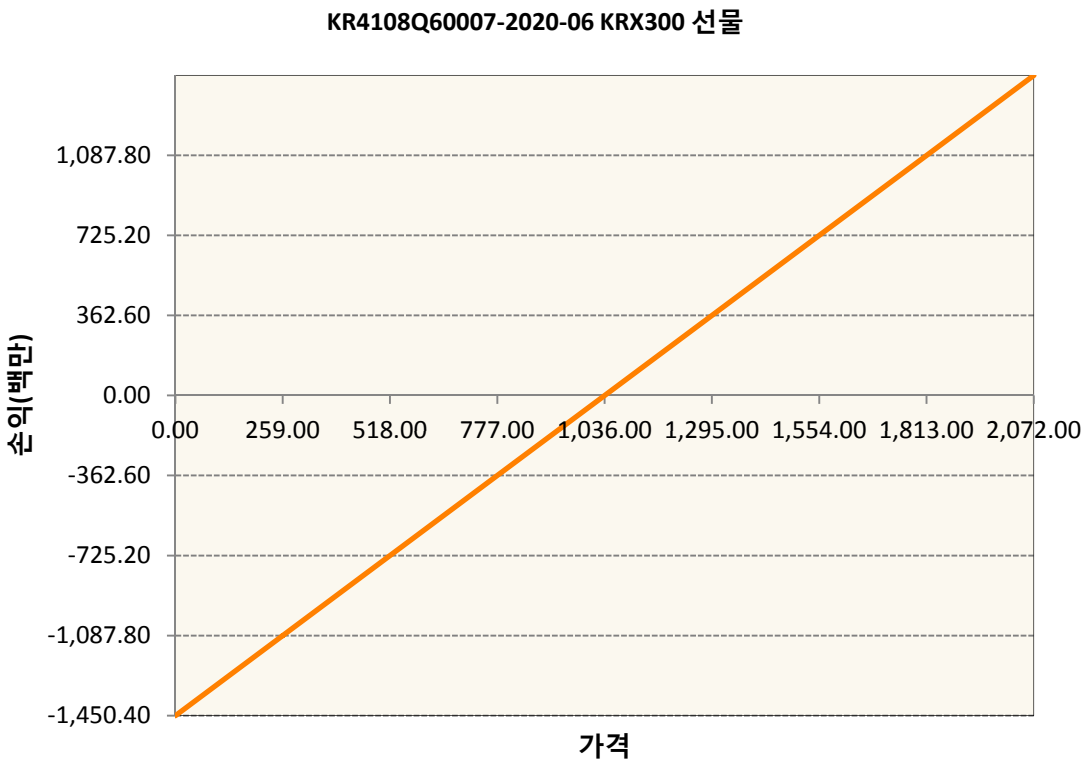
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,450	0	1,450	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4108Q60007	2020-06 KRX300 선물						117
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117
-5.33%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	39	39	39	39	39	39	39
5.33%	78	78	78	78	78	78	78
8.00%	117	117	117	117	117	117	117

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	167

공시일	2020-04-02
기준일	2020-04-01

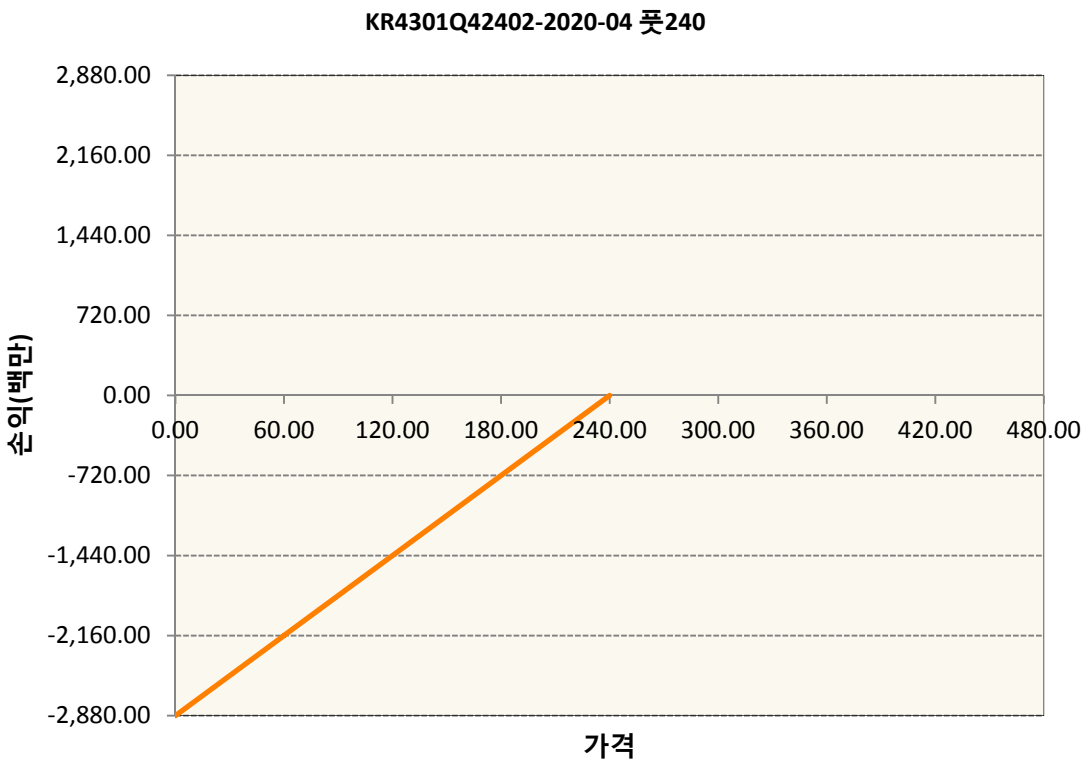
커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

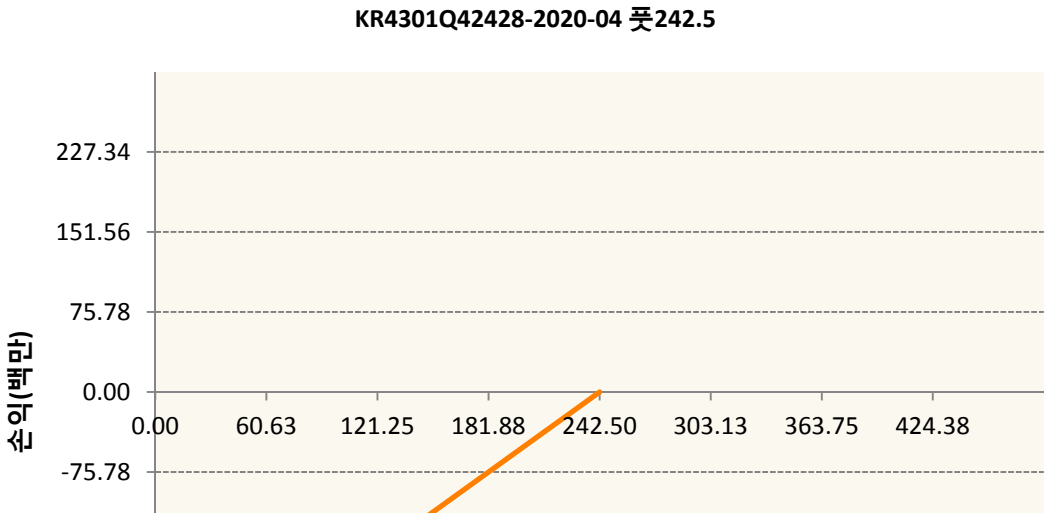
1. 계약금액

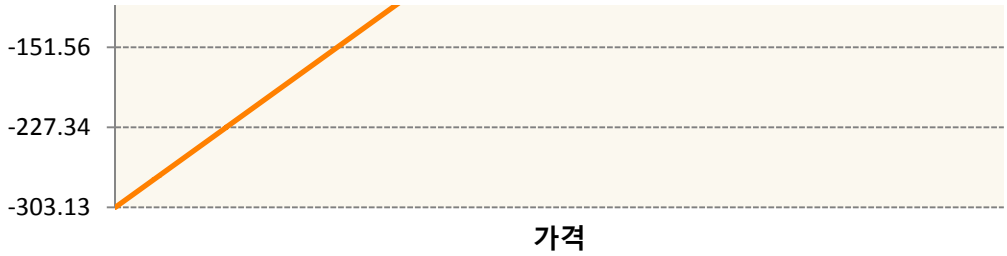
(단위:백만원)

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







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4301Q42402	2020-04 풋240						197
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-188	-189	-189	-191	-192	-194	-197
-5.33%	-117	-118	-120	-123	-125	-129	-132
-2.67%	-48	-51	-55	-58	-63	-67	-72
0%	15	11	5	0	-6	-12	-18
2.67%	71	64	58	51	44	37	30
5.33%	116	108	101	93	85	78	70
8.00%	148	141	133	126	119	111	103
KR4301Q42428	2020-04 풋242.5						21
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20	-20	-20	-20	-21	-21	-21
-5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-14	-14
-2.67%	-5	-6	-6	-6	-7	-7	-8
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	8	7	6	6	5	4	4
5.33%	13	12	11	10	10	9	8
8.00%	17	16	15	14	13	13	12

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

(단위:백만원)

219

공시일	2020-04-02
기준일	2020-04-01

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	7,188	0	7,188	
누계	통화	선도	443	7,309	-6,866	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H02 KRW/USD 13-04-20E	357
FX21020H10 USD/KRW 13-04-20E	35
FX21020H11 KRW/USD 29-04-20E	227
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

302

공시일	2020-04-02
기준일	2020-04-01

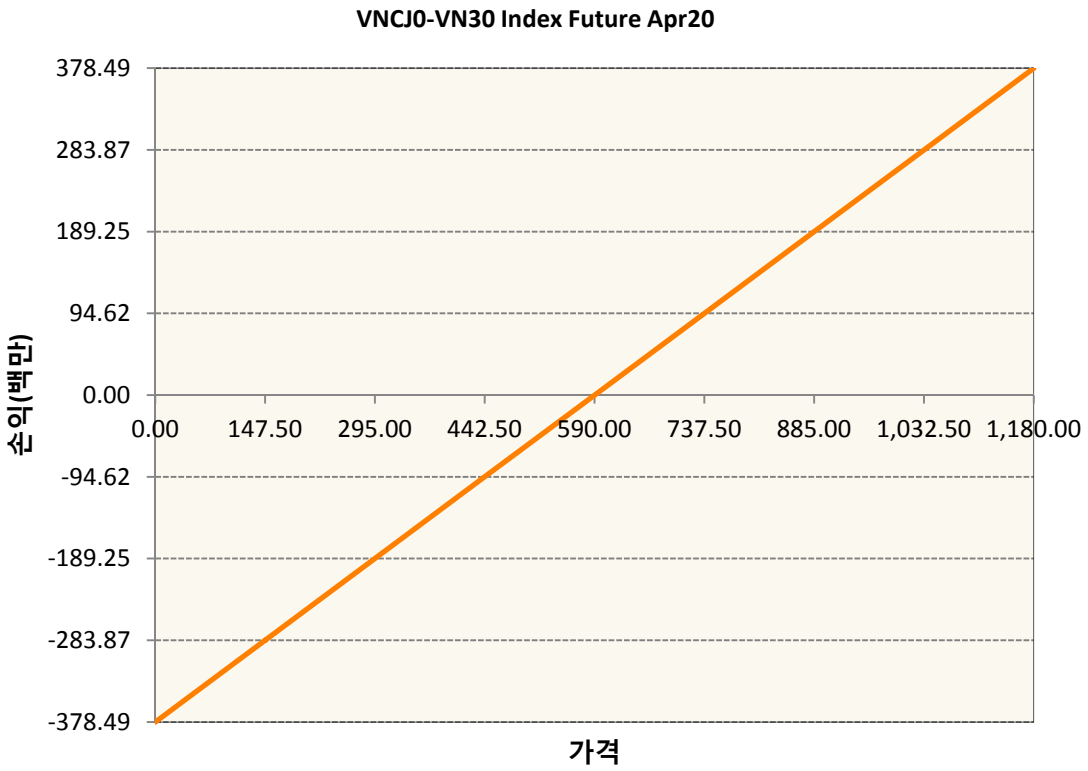
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	378	0	378	
누계	유가증권	스왑	1,115	0	1,115	장외
누계	통화	선도	235	297	-62	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	89
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	9
VNCJ0	VN30 Index Future Apr20	30

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

125

공시일	2020-04-02
기준일	2020-04-01

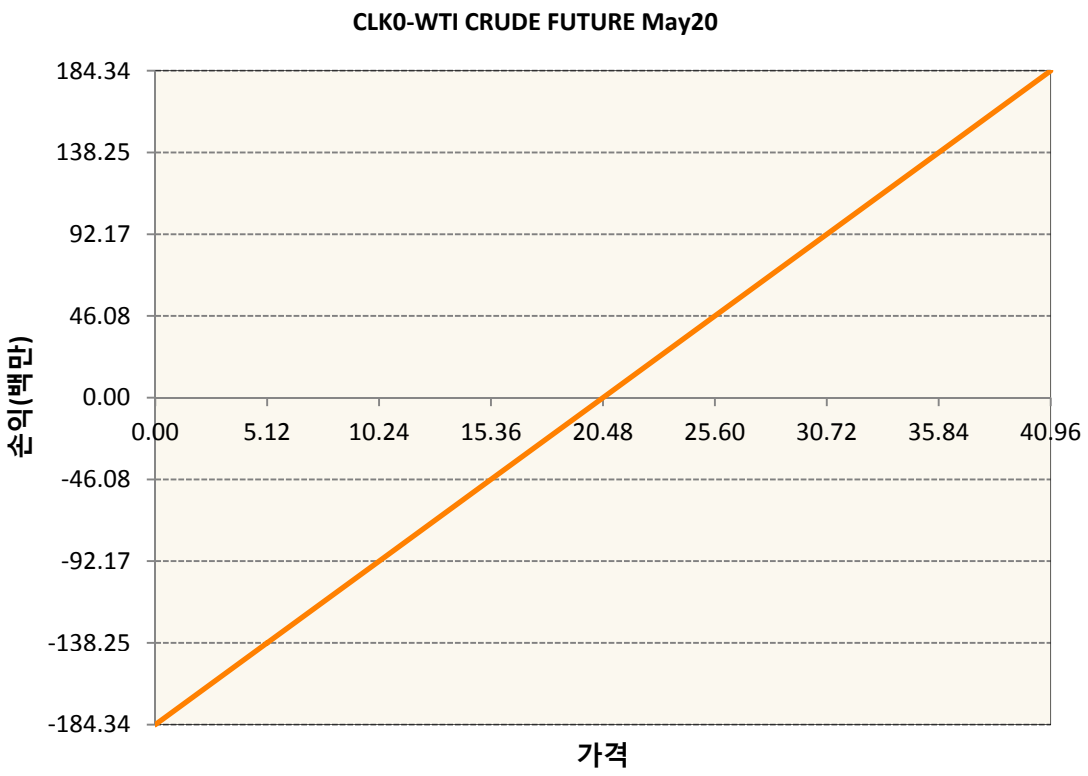
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

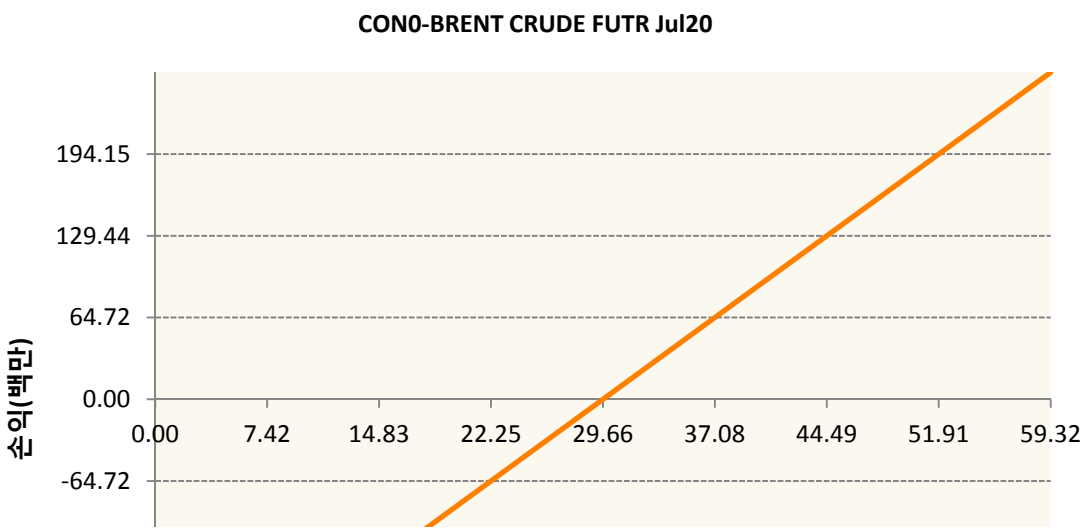
1. 계약금액

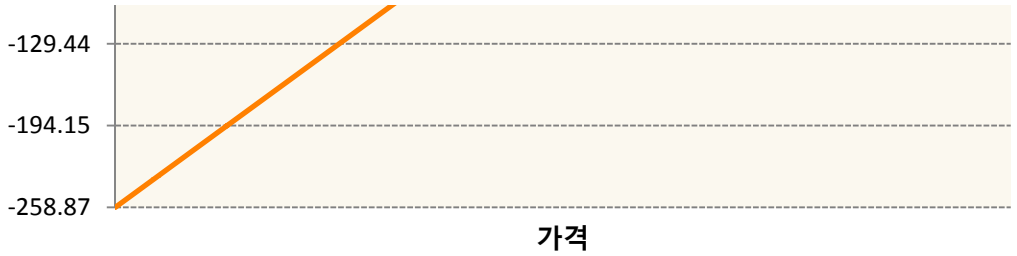
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,217	123	1,094	

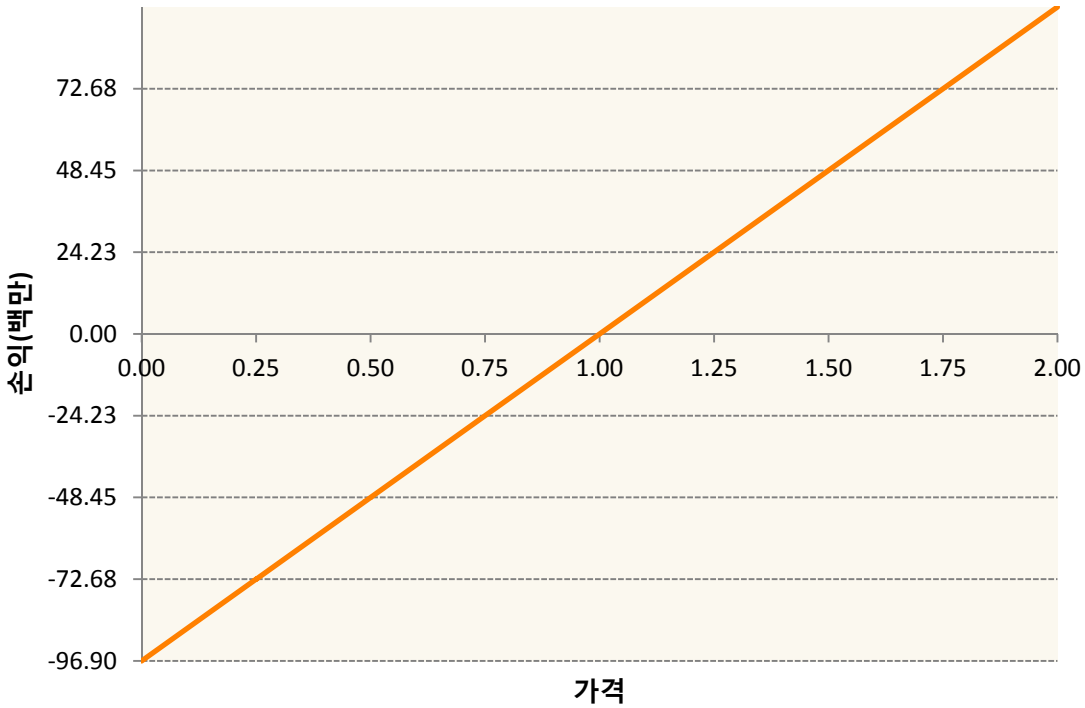
2. 만기시점의 손익구조



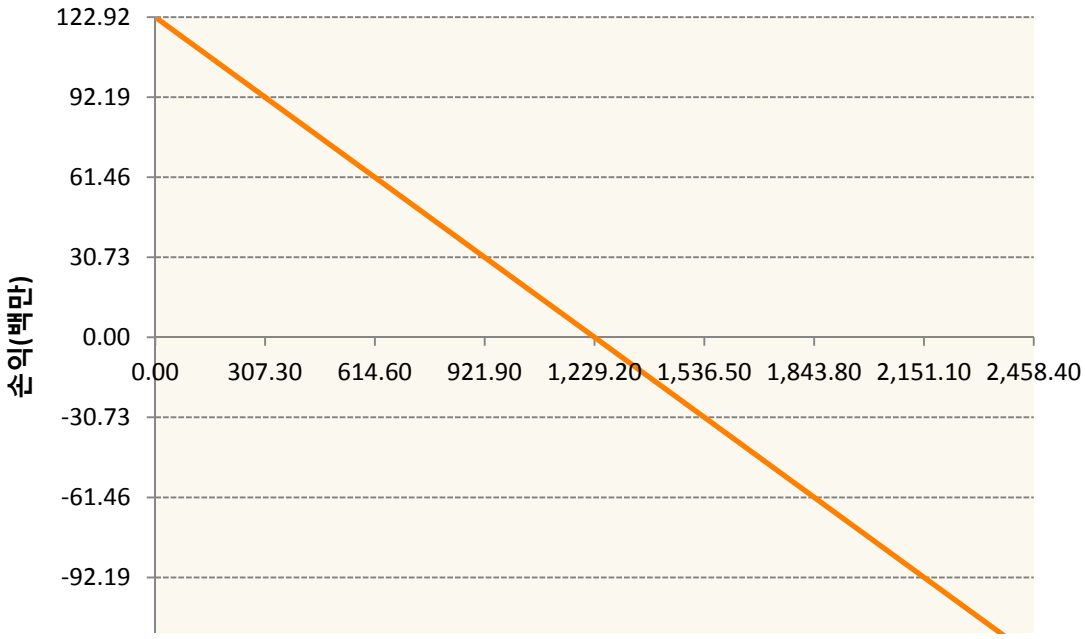


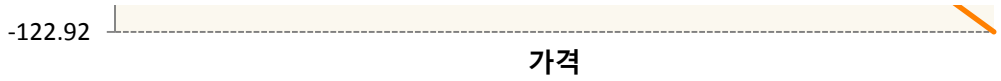


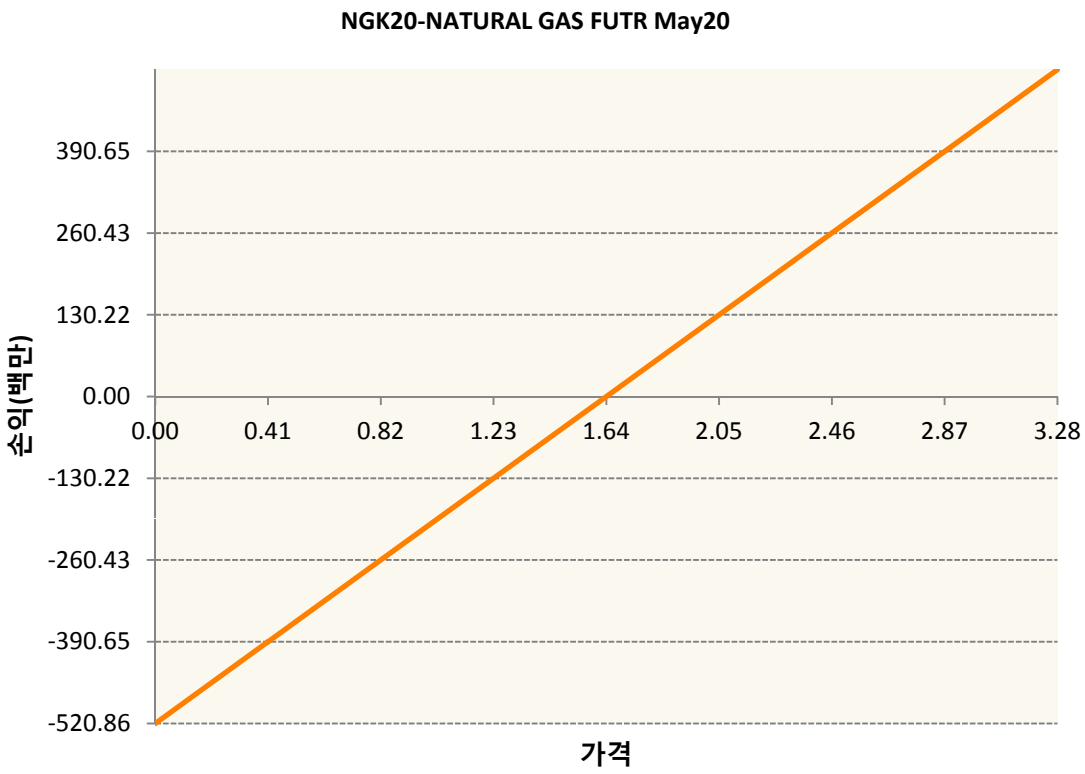
HOK0-NY Harb ULSD Fut May20

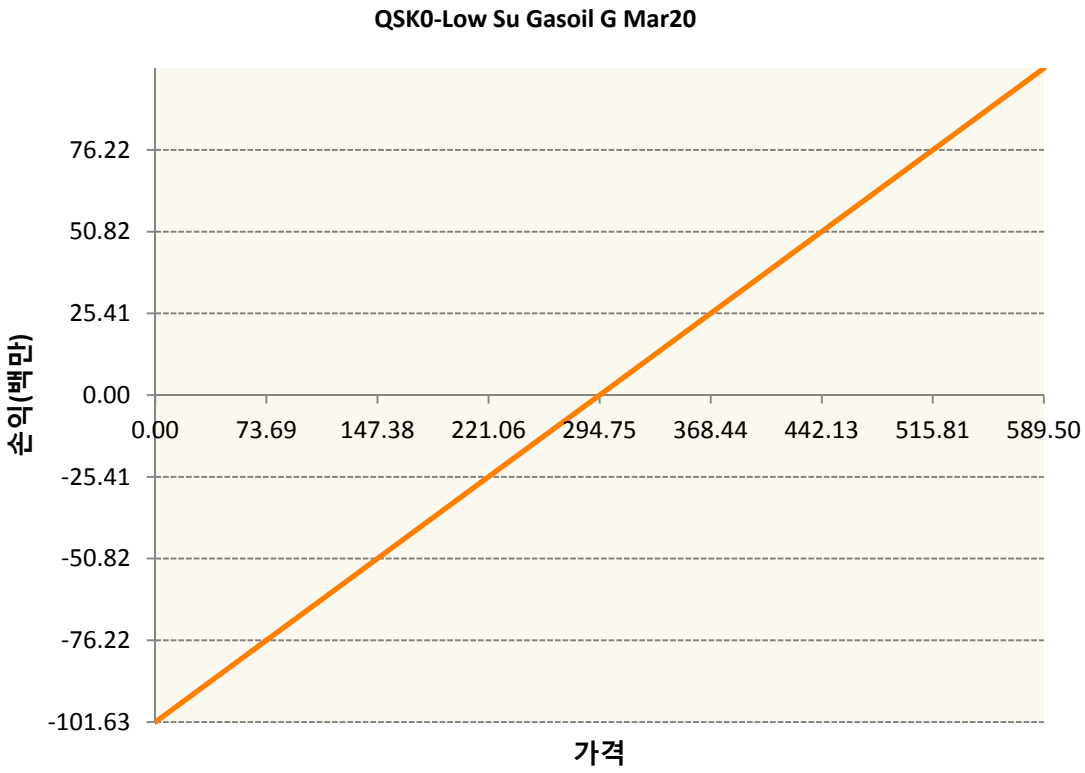


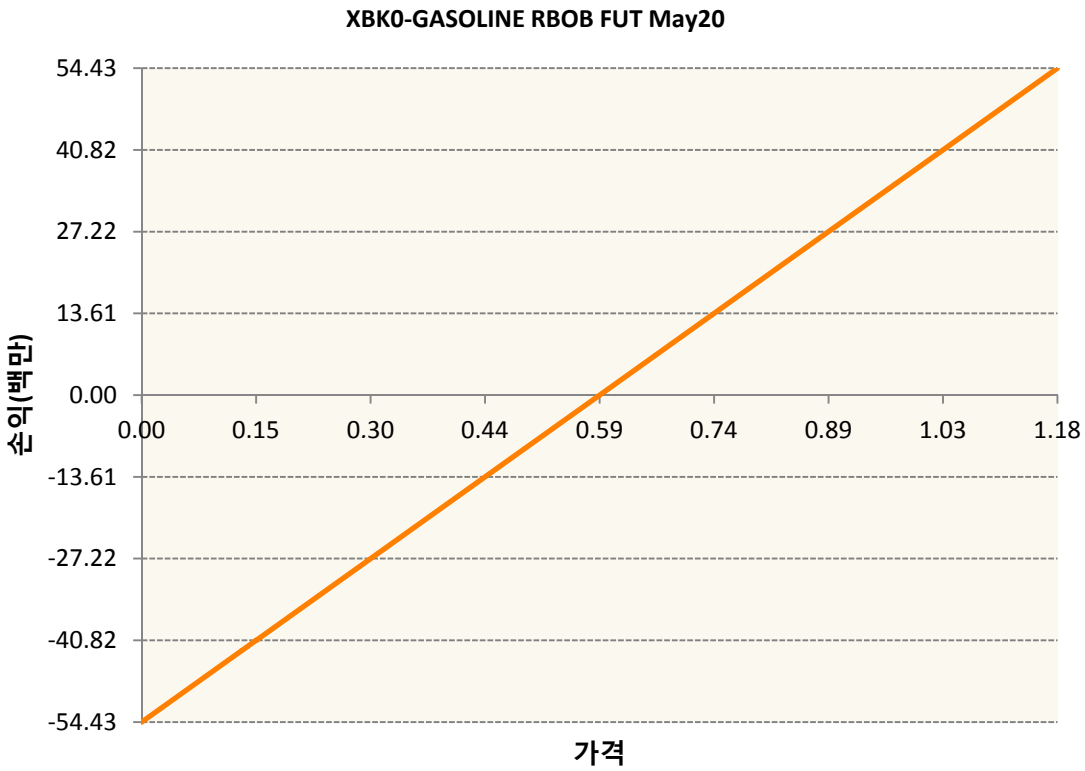
KR4175Q40008-2020-04 달러선물




-122.92
가격


NGK20-NATURAL GAS FUTR May20
390.65
260.43
130.22
0.00
-130.22
-260.43
-390.65
-520.86
0.00
0.41
0.82
1.23
1.64
2.05
2.46
2.87
3.28
손익(백만)
가격


QSK0-Low Su Gasoil G Mar20
76.22
50.82
25.41
0.00
-25.41
-50.82
-76.22
-101.63
0.00
73.69
147.38
221.06
294.75
368.44
442.13
515.81
589.50
손익(백만)
가격



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
KR4175Q40(	2020-04 달러선물	10
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	42
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	8
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	4

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	271

공시일	2020-04-02
기준일	2020-04-01

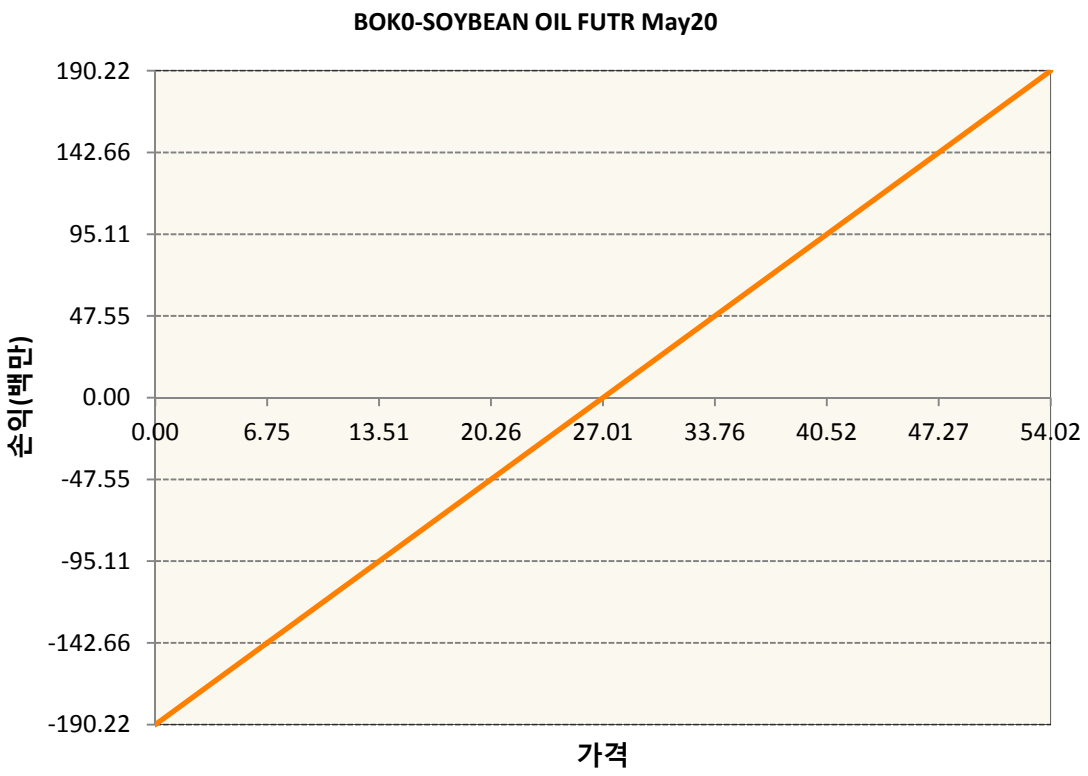
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

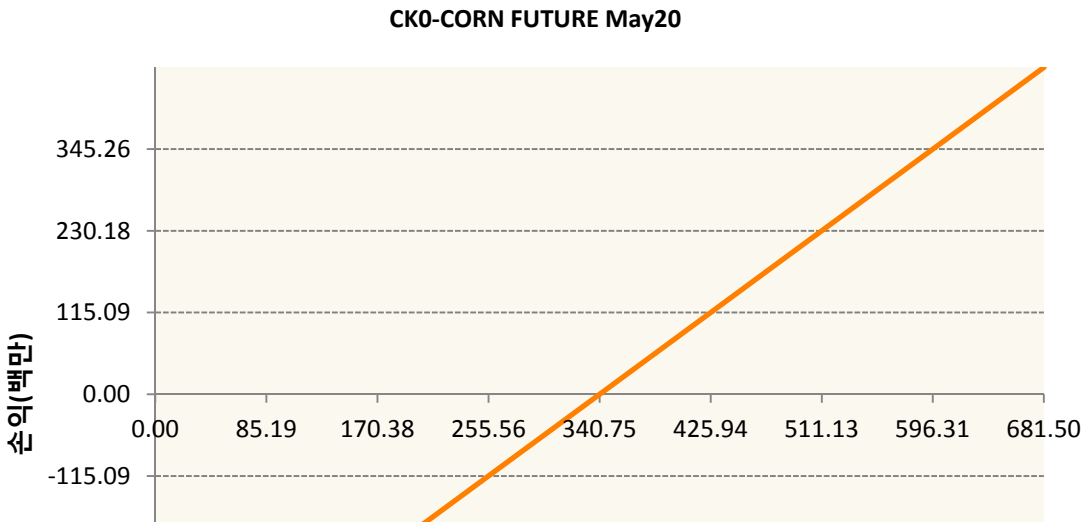
1. 계약금액

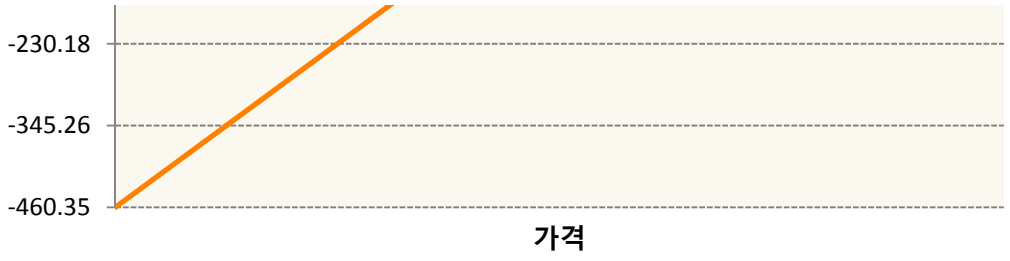
(단위:백만원)

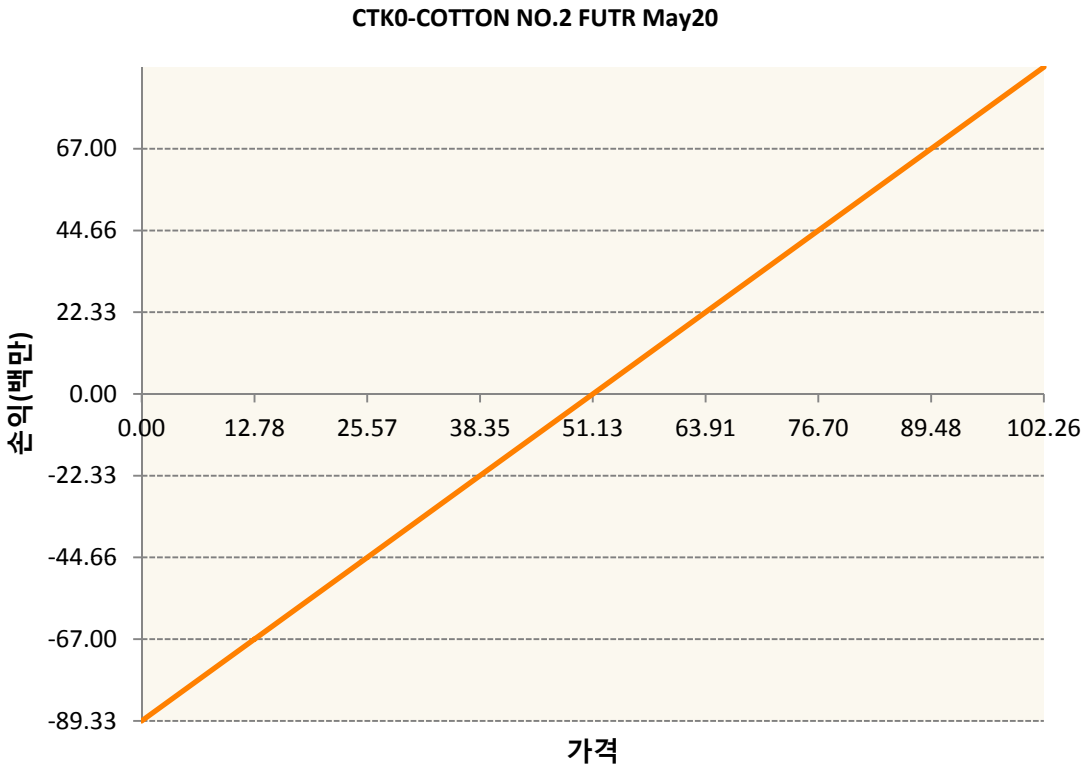
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,347	98	2,249	

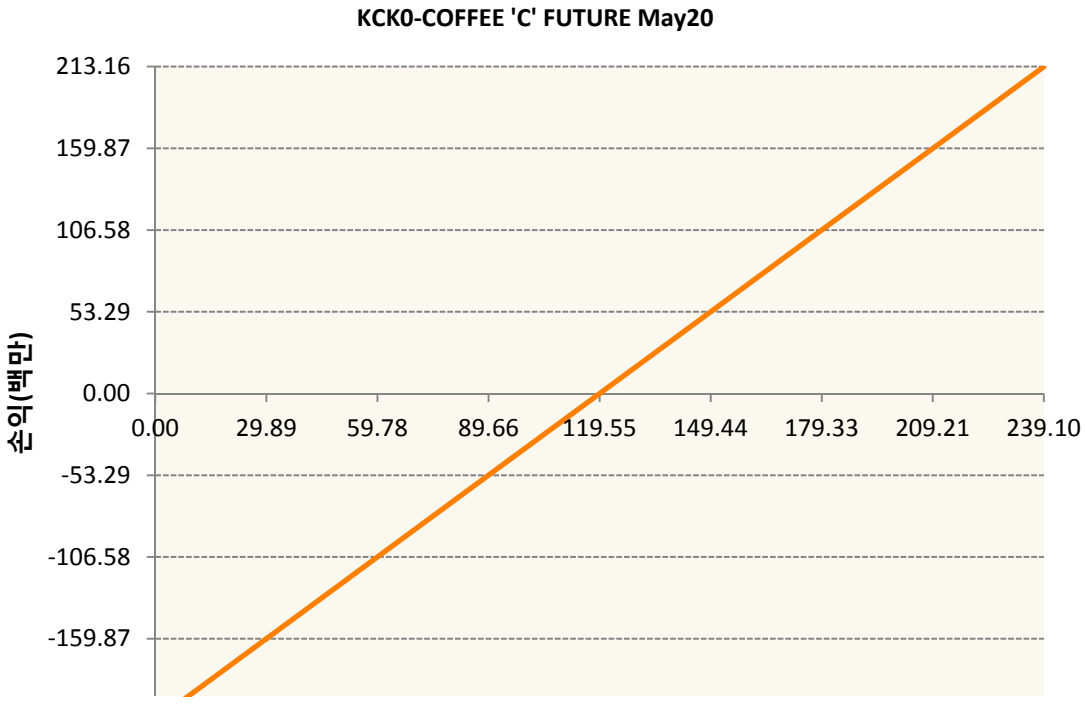
2. 만기시점의 손익구조

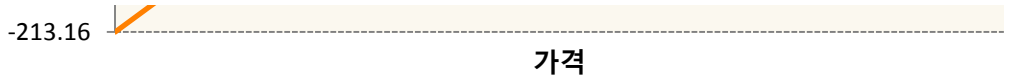


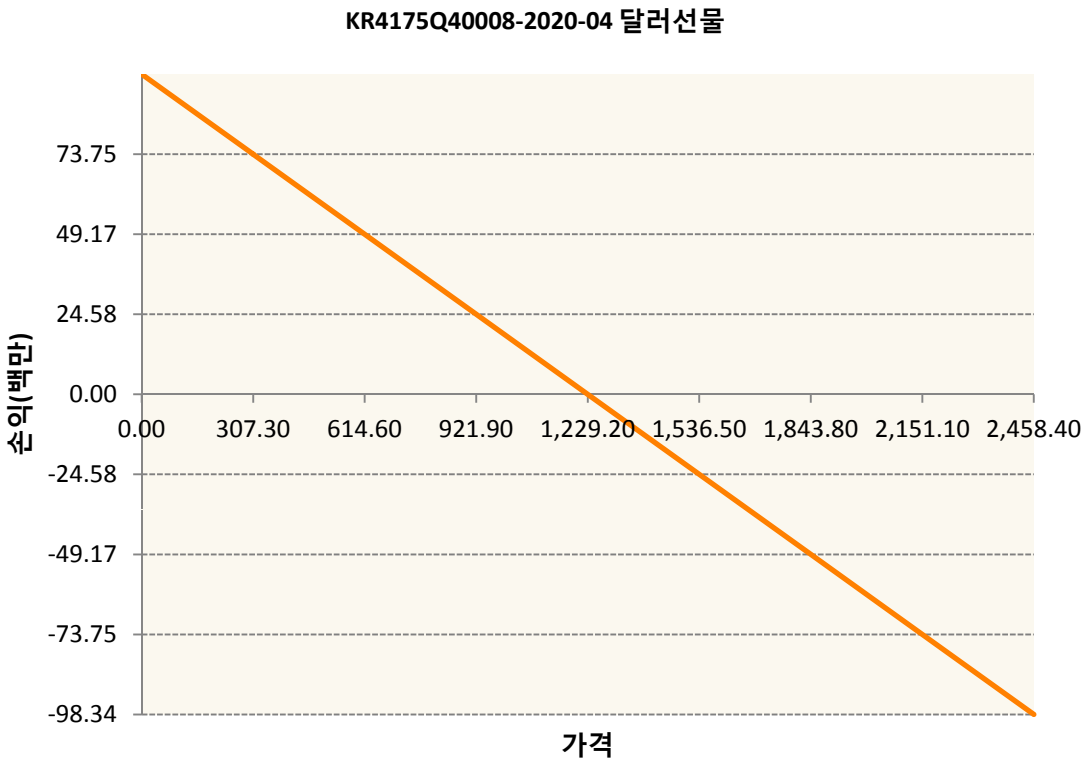


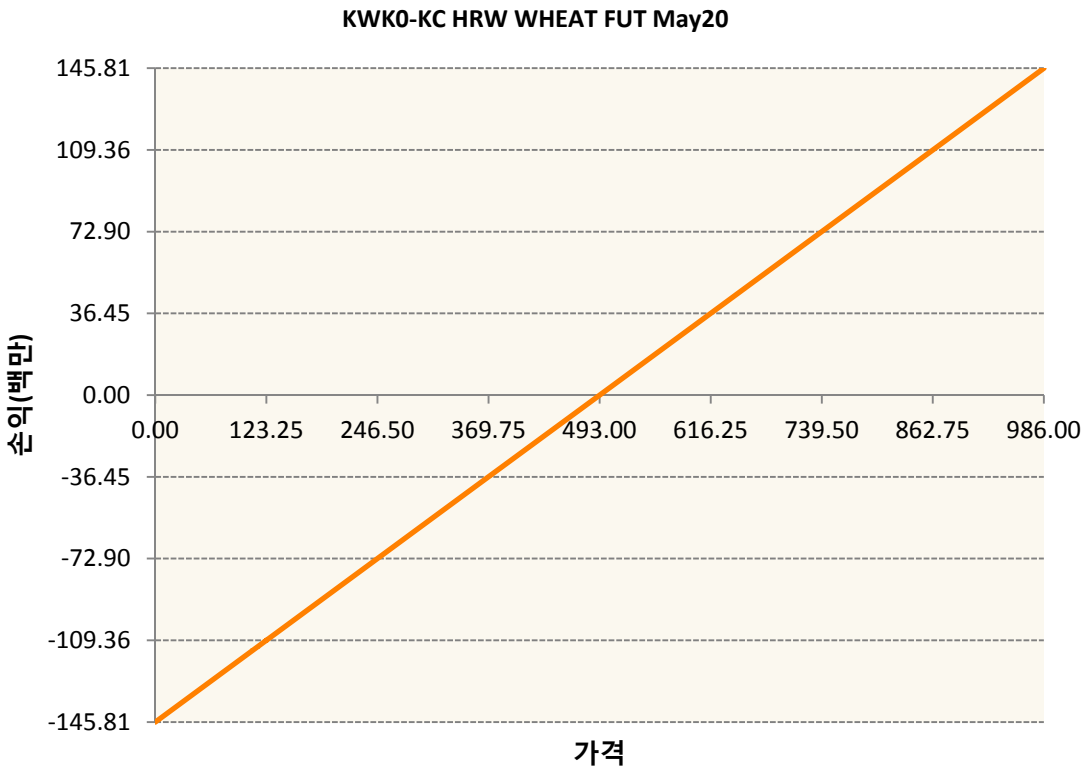

-230.18
-345.26
-460.35
가격

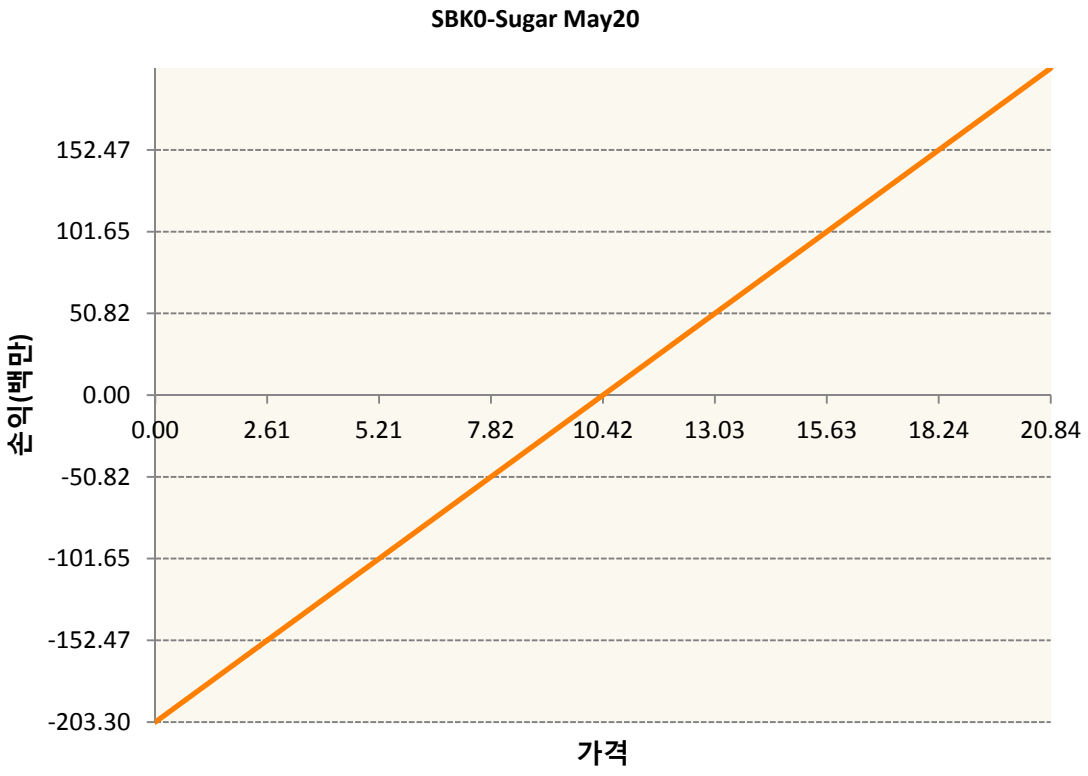

CTK0-COTTON NO.2 FUTR May20
손익(백만)
67.00
44.66
22.33
0.00
-22.33
-44.66
-67.00
-89.33
0.00
12.78
25.57
38.35
51.13
63.91
76.70
89.48
102.26
가격

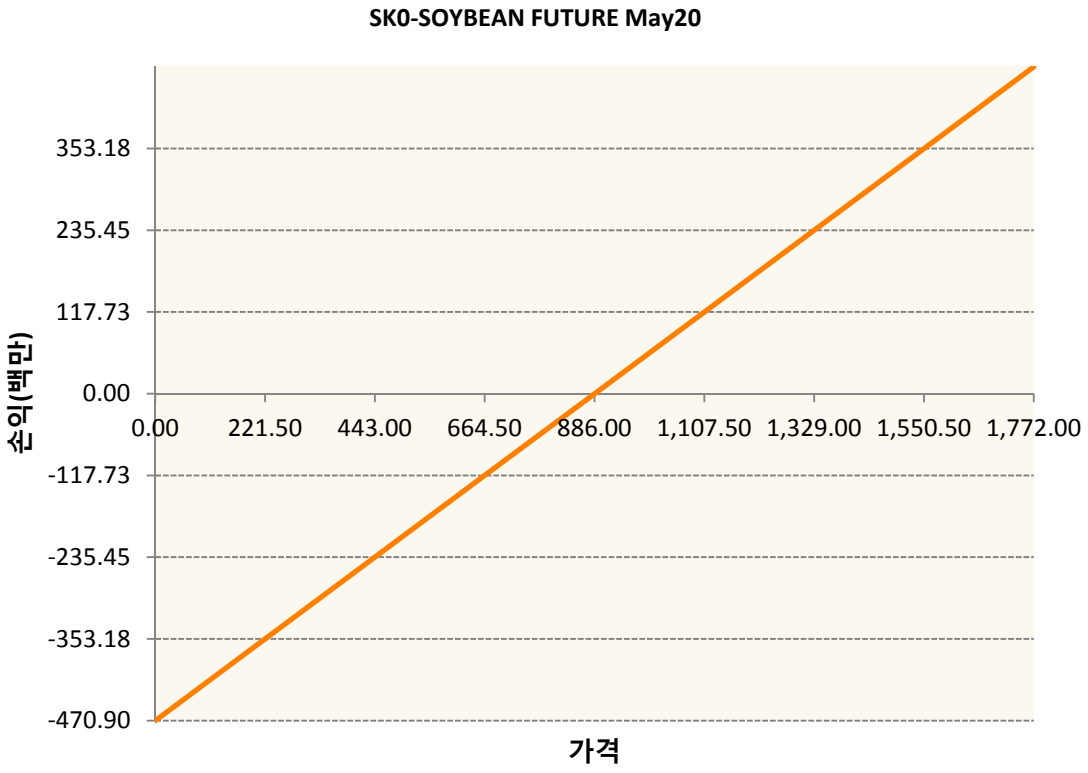

KCK0-COFFEE 'C' FUTURE May20
손익(백만)
213.16
159.87
106.58
53.29
0.00
-53.29
-106.58
-159.87
0.00
29.89
59.78
89.66
119.55
149.44
179.33
209.21
239.10


-213.16
가격

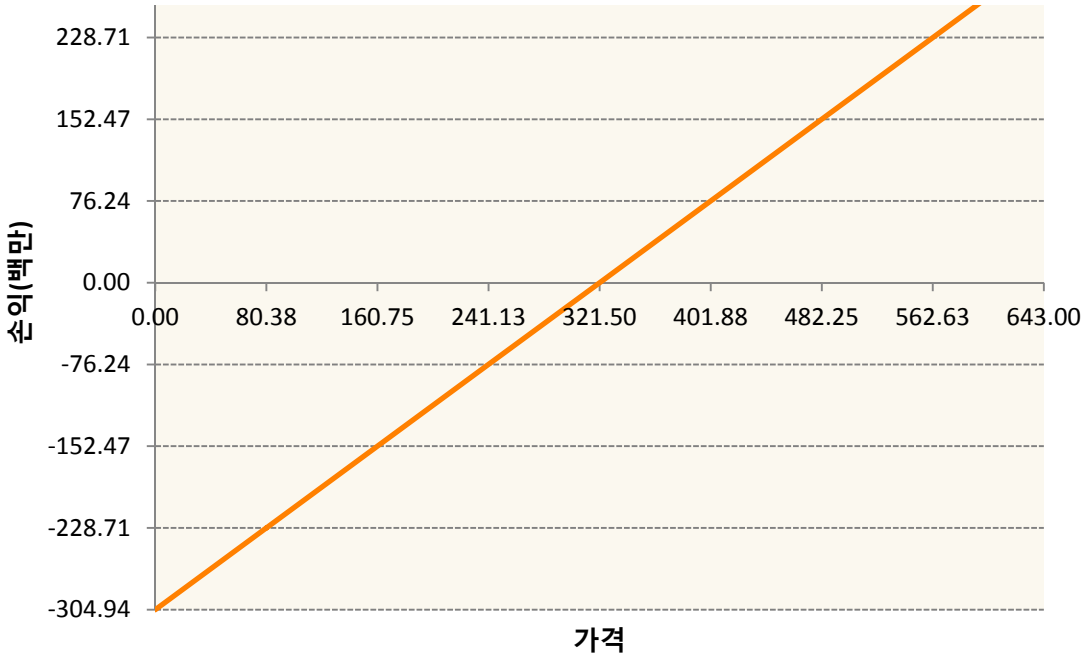

KR4175Q40008-2020-04 달러선물
73.75
49.17
24.58
0.00
-24.58
-49.17
-73.75
-98.34
손익(백만)
0.00
307.30
614.60
921.90
1,229.20
1,536.50
1,843.80
2,151.10
2,458.40
가격

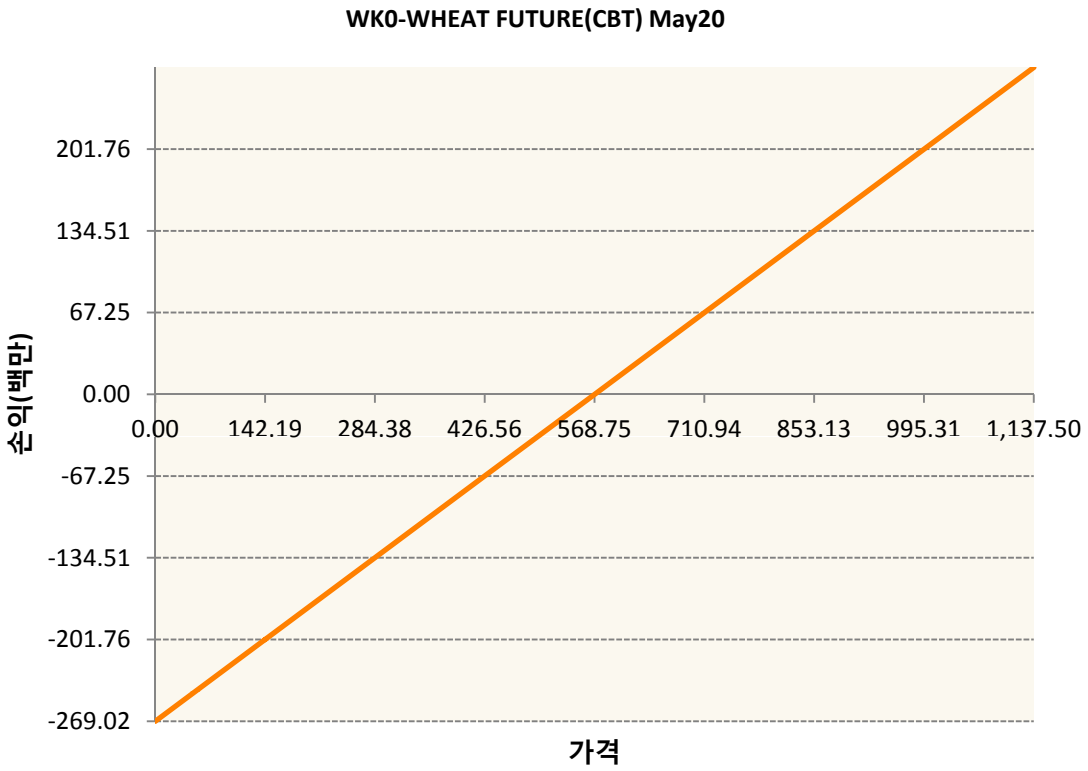

KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20
145.81
109.36
72.90
36.45
0.00
-36.45
-72.90
-109.36
-145.81
손익(백만)
0.00
123.25
246.50
369.75
493.00
616.25
739.50
862.75
986.00
가격


SBK0-Sugar May20
152.47
101.65
50.82
0.00
-50.82
-101.65
-152.47
-203.30
0.00
2.61
5.21
7.82
10.42
13.03
15.63
18.24
20.84
손익(백만)
가격


SK0-SOYBEAN FUTURE May20
353.18
235.45
117.73
0.00
-117.73
-235.45
-353.18
-470.90
0.00
221.50
443.00
664.50
886.00
1,107.50
1,329.00
1,550.50
1,772.00
손익(백만)
가격

SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20
304.94





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
KR4175Q40(	2020-04 달러선물	8

KWK0	KC HRW WHEAT FUT May20	12
SBK0	Sugar May20	16
SK0	SOYBEAN FUTURE May20	38
SMK0	SOYBEAN MEAL FUTR May20	24
WK0	WHEAT FUTURE(CBT) May20	22

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

218