

공시일	2020-04-03
기준일	2020-04-02

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	2020-04-03
기준일	2020-04-02

스마트인덱스모

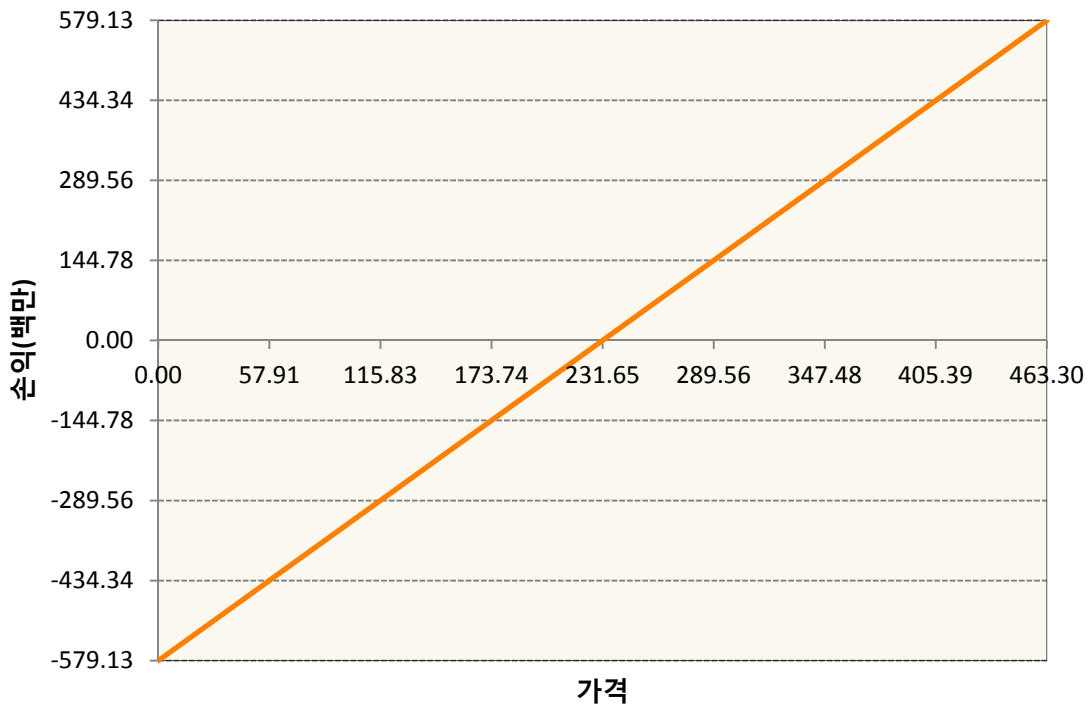
1. 계약금액

(단위:백만원)

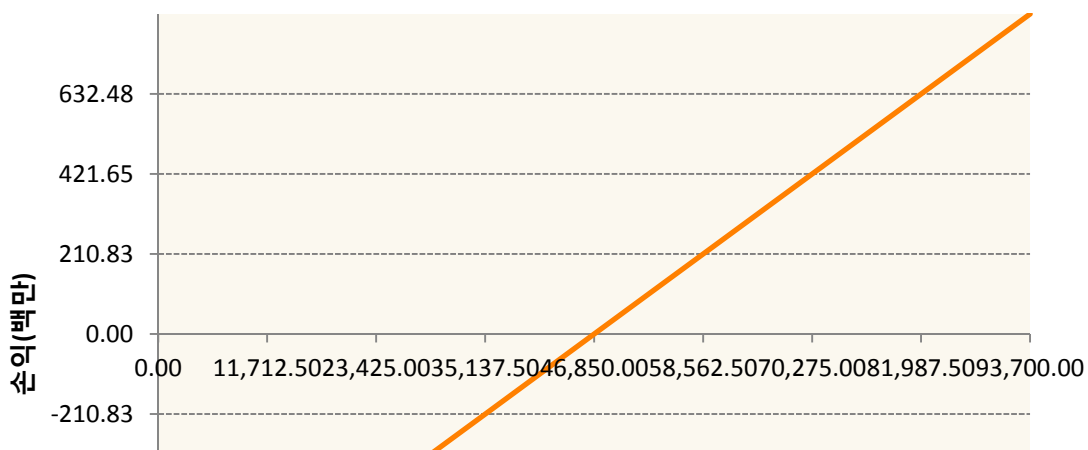
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,422	0	1,422	장내

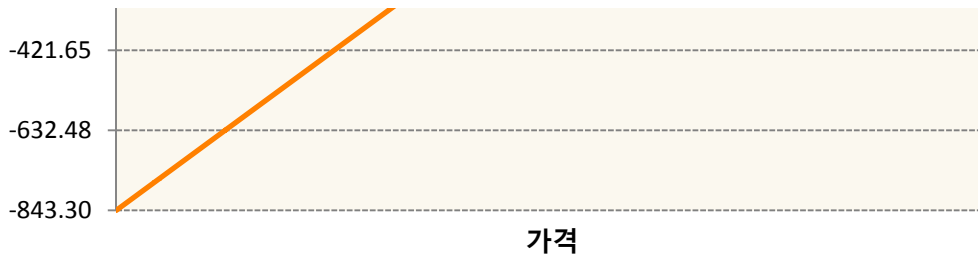
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



KR4111Q40003-2020-04 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						46
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46	
-5.33%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31	
-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%	31	31	31	31	31	31	31	
8.00%	46	46	46	46	46	46	46	
KR4111Q40003		2020-04 삼성전자개별선물						67
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67	
-5.33%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45	
-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%	45	45	45	45	45	45	45	
8.00%	67	67	67	67	67	67	67	

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

165

공시일	2020-04-03
기준일	2020-04-02

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

854

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

958

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-03
기준일	2020-04-02

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

532

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

833

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-03
기준일	2020-04-02

유로인덱스모(주식-파생형)

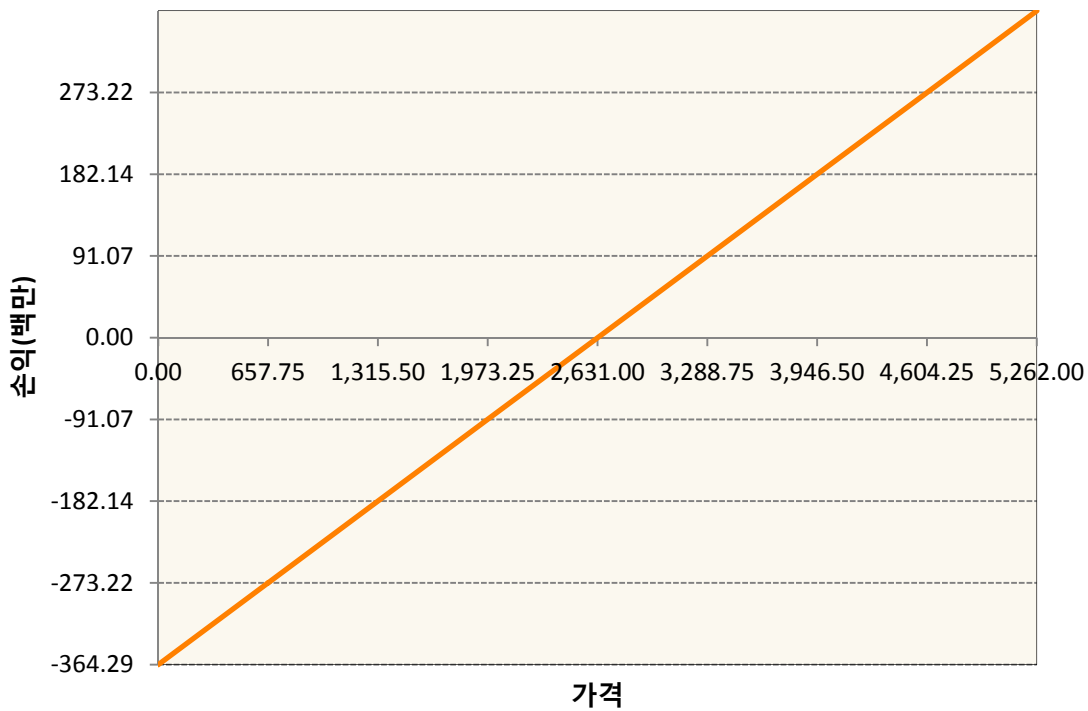
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	364	0	364	

2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

35

공시일	2020-04-03
기준일	2020-04-02

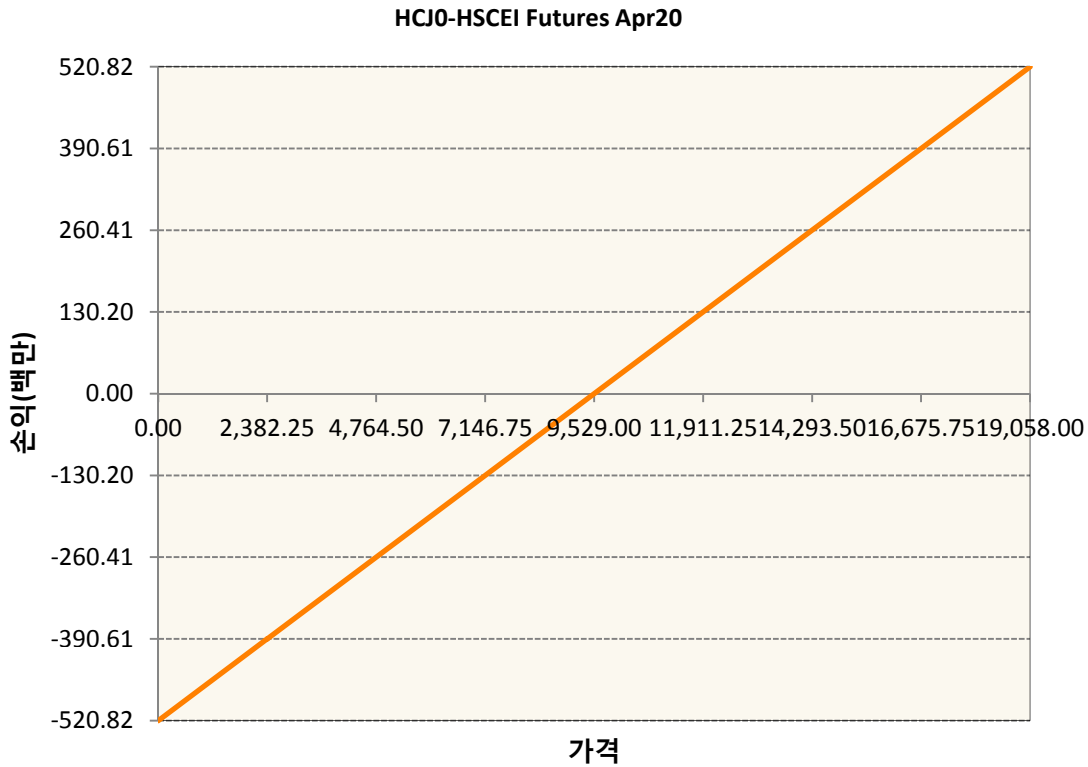
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	521	0	521	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	2020-04-03
기준일	2020-04-02

커버드콜모(주식혼합-파생형)

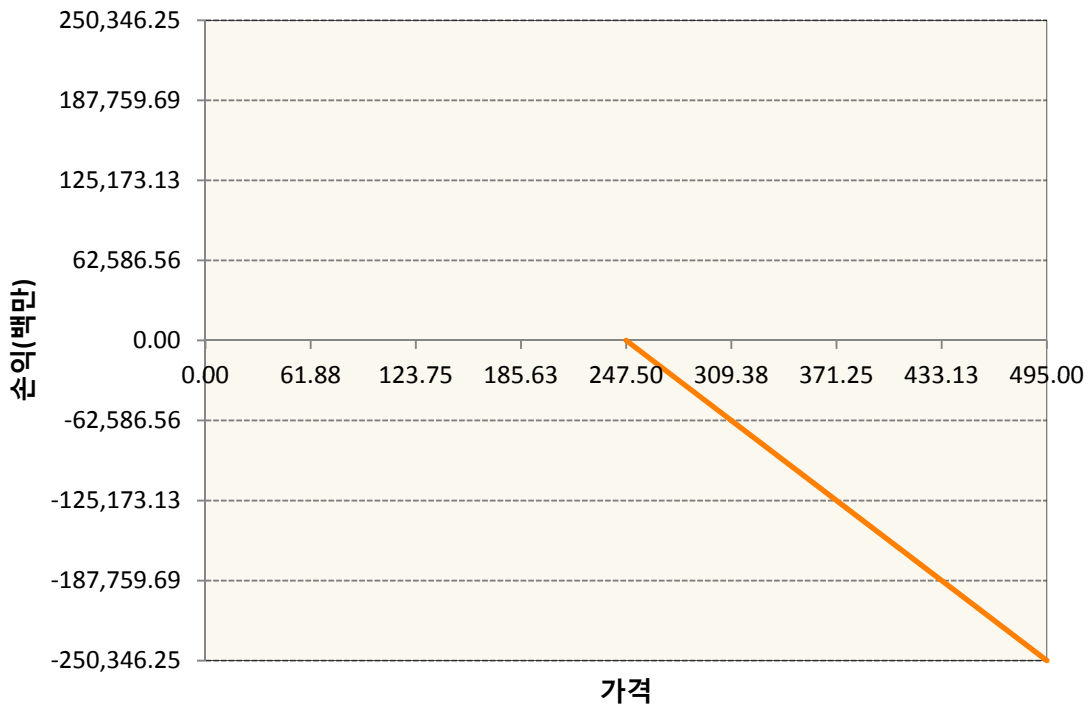
1. 계약금액

(단위:백만원)

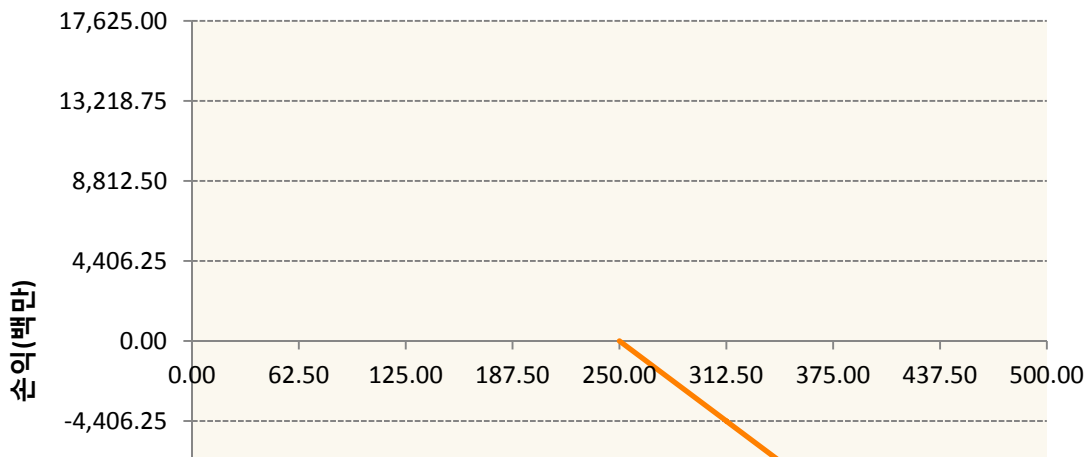
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	360,660	-360,660	장내

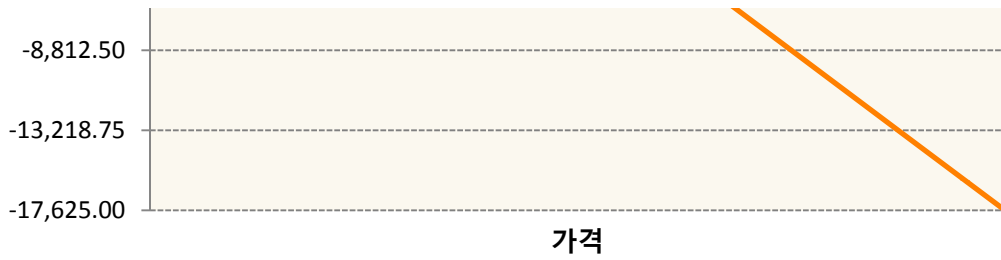
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

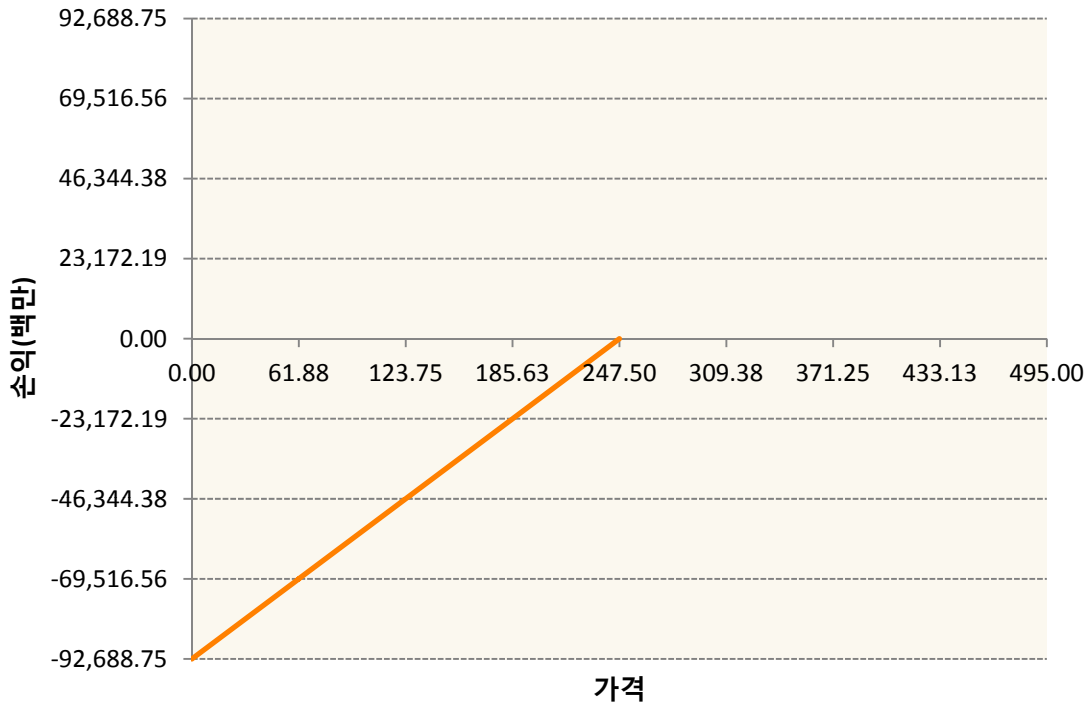


KR4201Q42503-2020-04 콜250





KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q42479		2020-04 콜247.5					9,386	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,342	2,297	2,224	2,119	1,982	1,811	1,607	
-5.33%	2,241	2,127	1,971	1,773	1,537	1,264	958	
-2.67%	1,956	1,722	1,440	1,117	756	364	-55	
0%	1,292	897	464	0	-490	-1,001	-1,530	
2.67%	-2	-558	-1,132	-1,721	-2,322	-2,931	-3,548	
5.33%	-2,163	-2,824	-3,489	-4,155	-4,823	-5,492	-6,161	
8.00%	-5,318	-5,993	-6,669	-7,347	-8,026	-8,706	-9,386	
KR4201Q42503		2020-04 콜250					598	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	132	130	126	120	112	102	90	

-5.33%	127	121	113	102	88	71	52
-2.67%	113	100	84	65	43	18	-8
0%	79	55	29	0	-31	-64	-99
2.67%	7	-28	-65	-103	-142	-183	-224
5.33%	-118	-162	-207	-252	-298	-344	-390
8.00%	-310	-358	-406	-454	-502	-550	-598

KR4301Q42477 2020-04 풋247.5 6,445

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,274	-6,282	-6,297	-6,319	-6,351	-6,393	-6,445
-5.33%	-3,979	-4,005	-4,042	-4,092	-4,154	-4,228	-4,314
-2.67%	-1,735	-1,796	-1,873	-1,964	-2,069	-2,184	-2,310
0%	389	273	142	0	-152	-312	-480
2.67%	2,285	2,108	1,924	1,733	1,538	1,340	1,138
5.33%	3,842	3,623	3,403	3,182	2,960	2,738	2,515
8.00%	4,993	4,769	4,544	4,319	4,094	3,868	3,642

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

(단위:백만원)

14,011

공시일	2020-04-03
기준일	2020-04-02

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

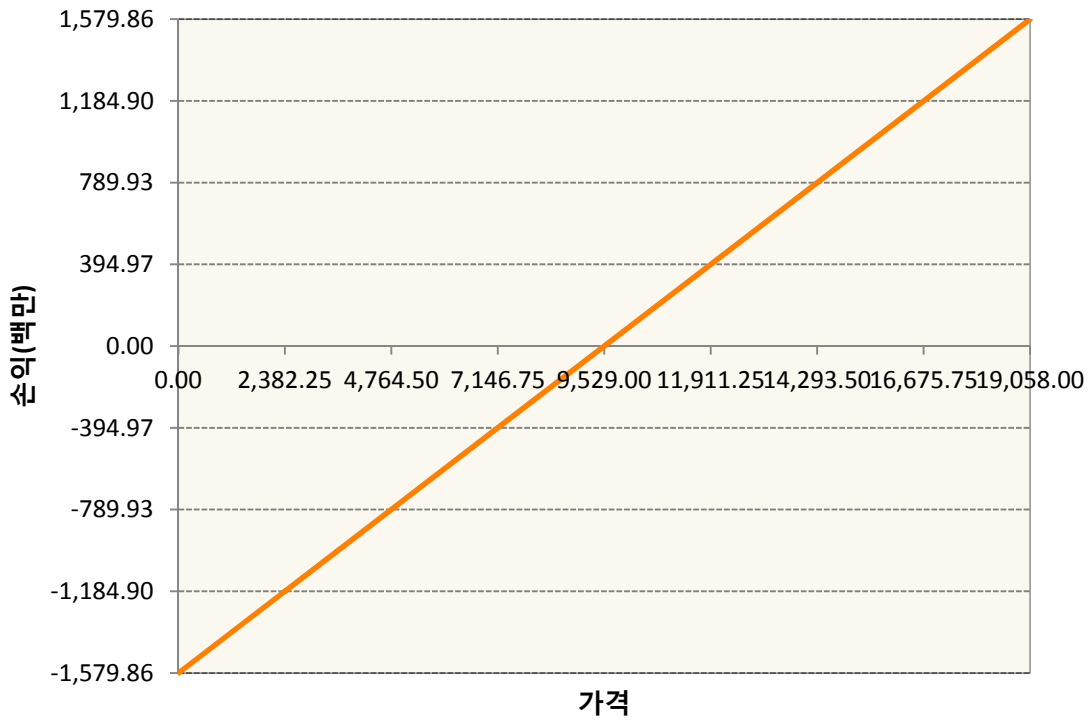
1. 계약금액

(단위:백만원)

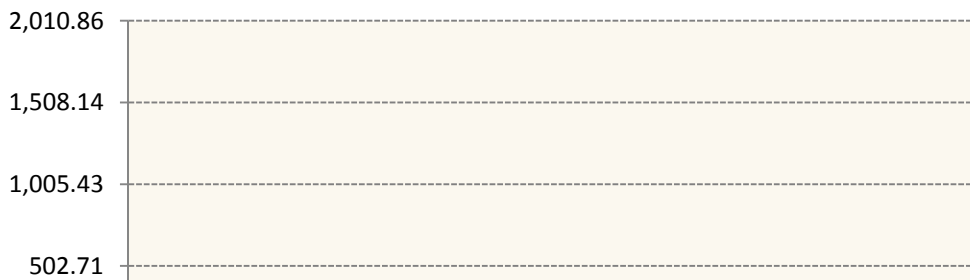
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,580	0	1,580	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,172	-4,172	장내
누계	통화	선도	697	2,231	-1,534	장외

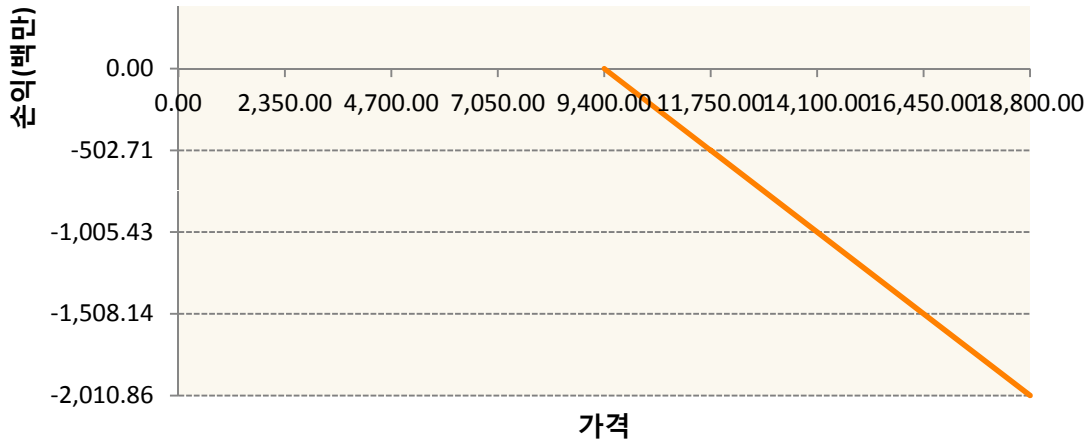
2. 만기시점의 손익구조

HCJ0-HSCEI Futures Apr20

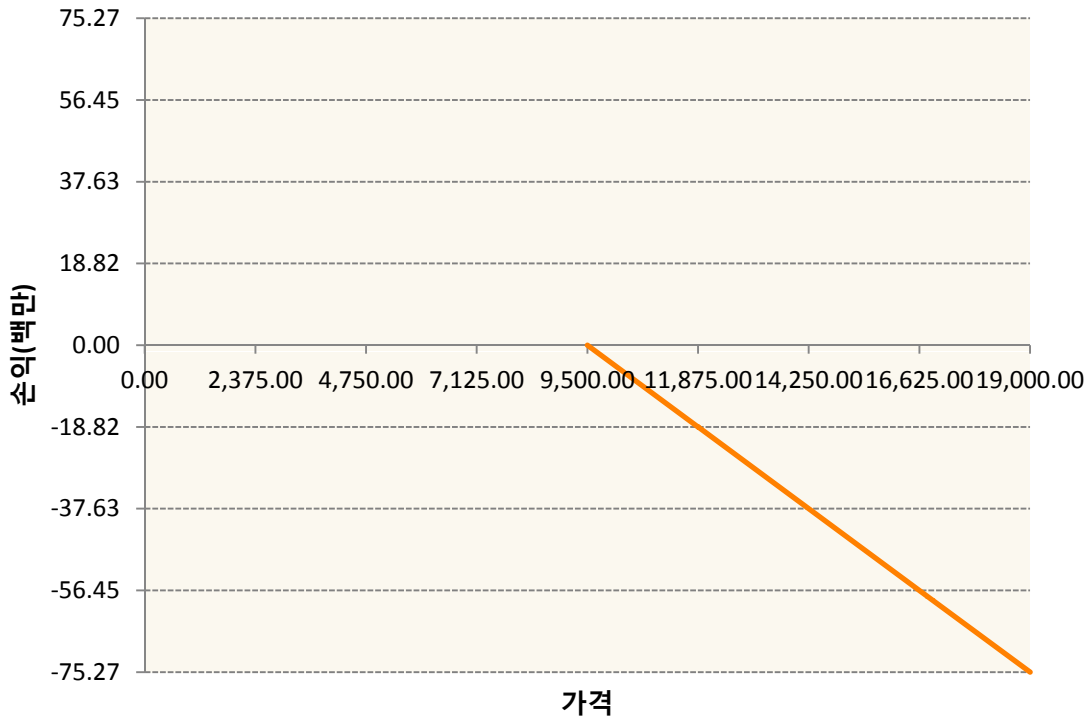


OHHIJ0-C94-HSCEI

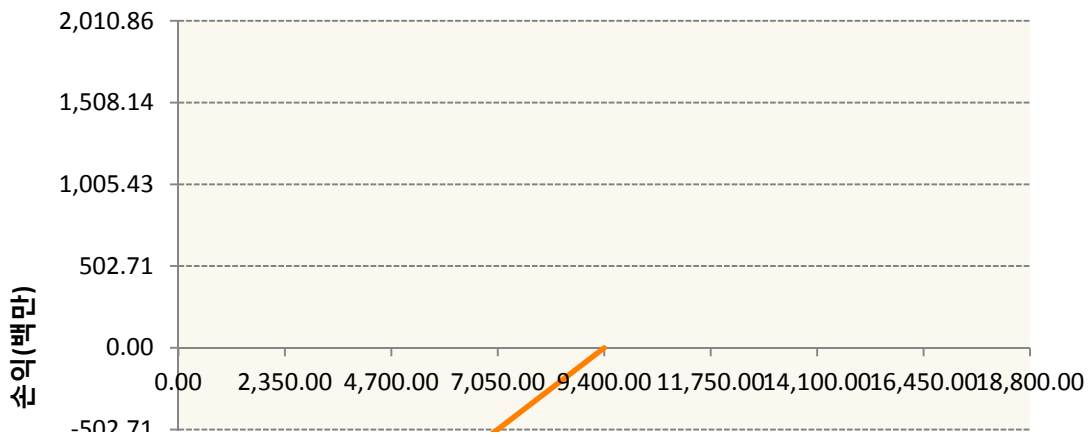


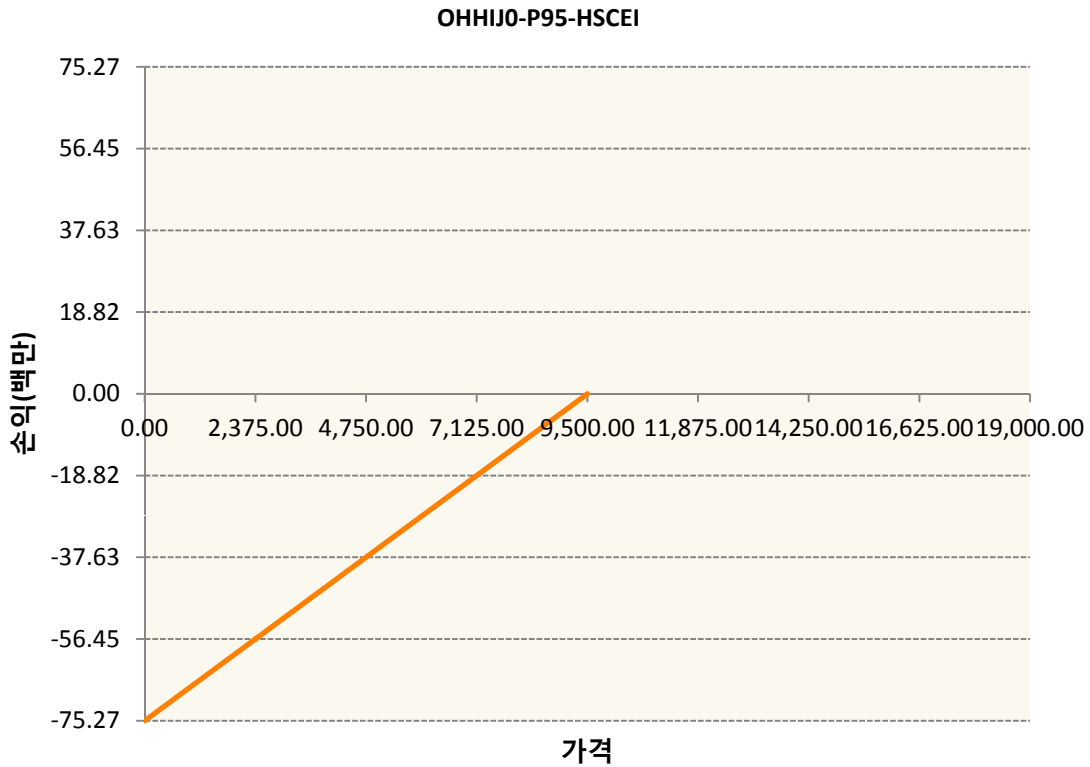


OHHIJO-C95-HSCEI



OHHIJO-P94-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E		178
FX21020H05 HKD/KRW 22-05-20E		56
HCJ0 HSCEI Futures Apr20		126
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)
	605

공시일	2020-04-03
기준일	2020-04-02

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

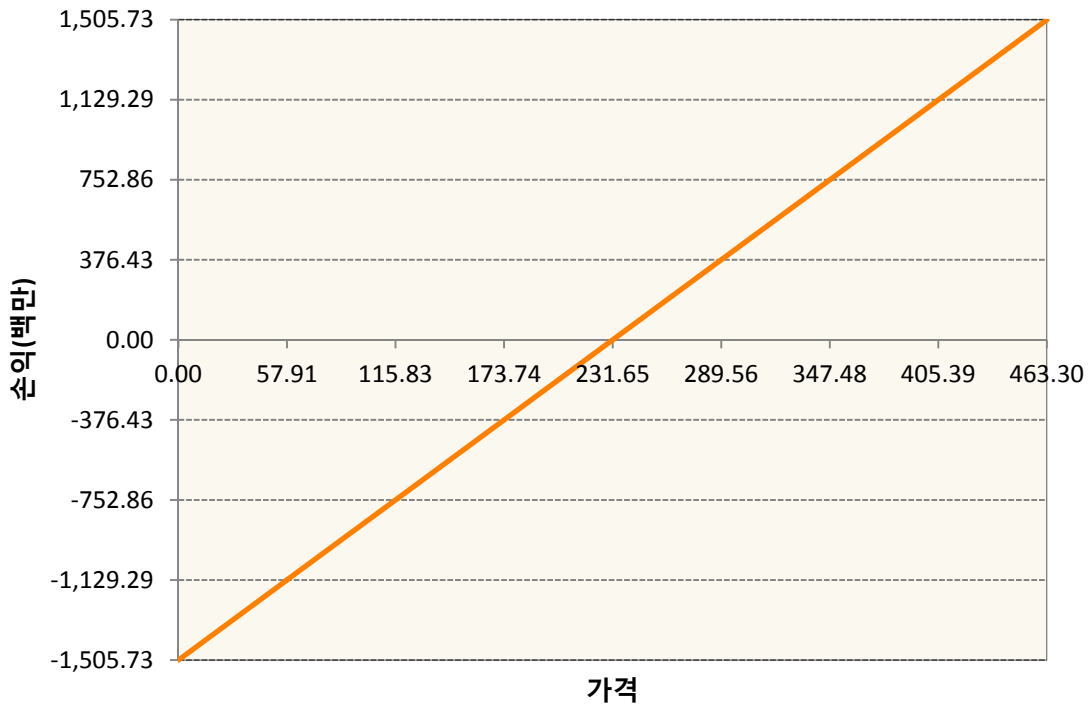
1. 계약금액

(단위:백만원)

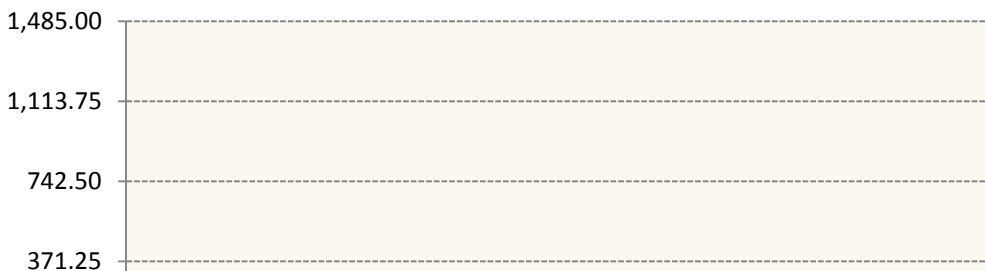
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,506	0	1,506	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,095	-3,095	장내

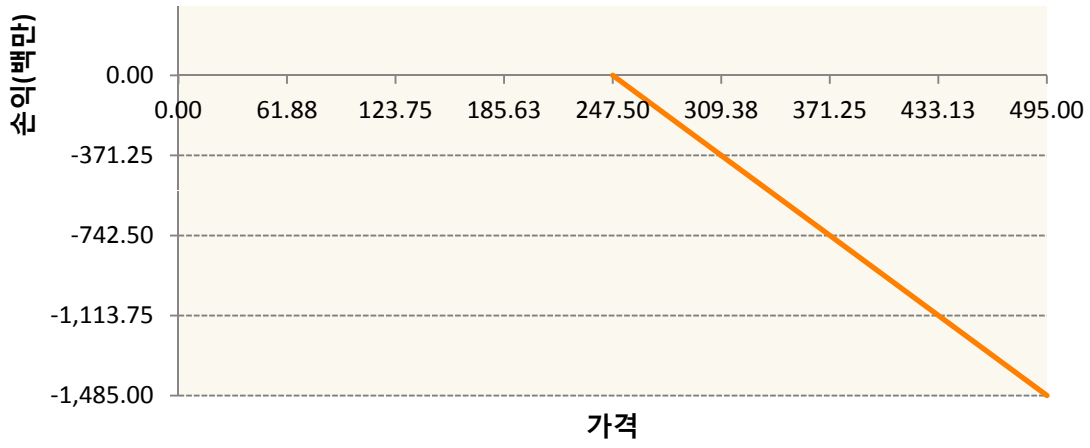
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

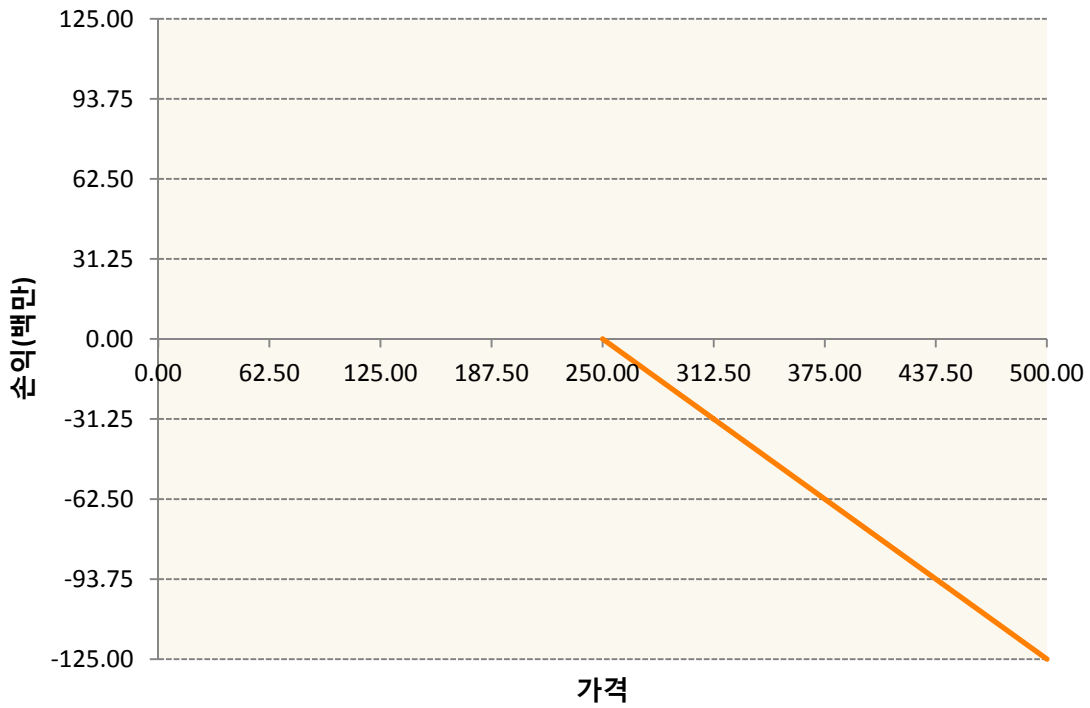


KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

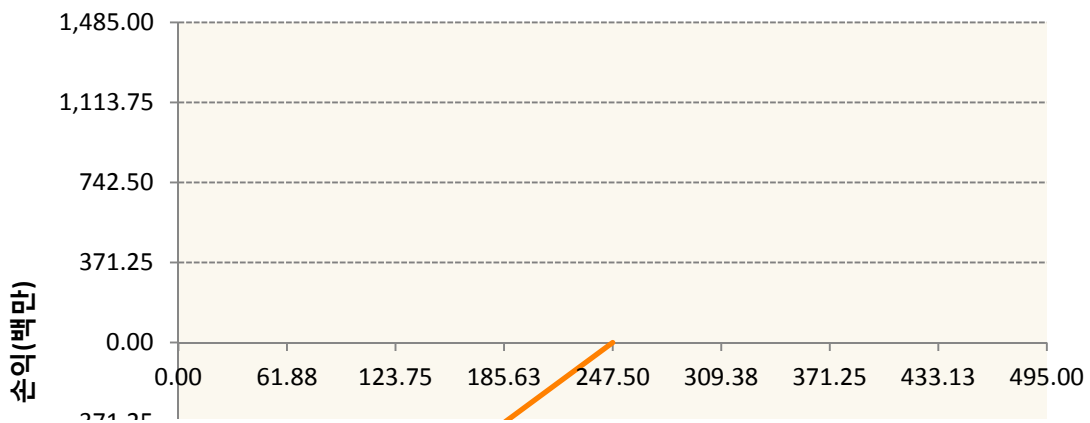




KR4201Q42503-2020-04 콜250



KR4301Q42477-2020-04 풋247.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						186
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-186	-186	-186	-186	-186	-186	-186	
-5.33%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124	
-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%	124	124	124	124	124	124	124	
8.00%	186	186	186	186	186	186	186	
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%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80	
-2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	40	40	40	40	40	40	40	
5.33%	80	80	80	80	80	80	80	
8.00%	121	121	121	121	121	121	121	
KR4201Q42479		2020-04 콜247.5						56
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	14	14	13	13	12	11	10	
-5.33%	13	13	12	11	9	7	6	
-2.67%	12	10	9	7	4	2	0	
0%	8	5	3	0	-3	-6	-9	
2.67%	0	-3	-7	-10	-14	-17	-21	
5.33%	-13	-17	-21	-25	-29	-33	-37	
8.00%	-32	-36	-40	-44	-48	-52	-56	
KR4201Q42503		2020-04 콜250						4
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	1	1	1	1	1	1	1
-5.33%	1	1	1	1	1	1	0
-2.67%	1	1	1	0	0	0	0
0%	1	0	0	0	0	0	-1
2.67%	0	0	0	-1	-1	-1	-2
5.33%	-1	-1	-1	-2	-2	-2	-3
8.00%	-2	-3	-3	-3	-4	-4	-4
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	-101	-101	-102	-102	-103
-5.33%	-64	-64	-65	-66	-67	-68	-69
-2.67%	-28	-29	-30	-31	-33	-35	-37
0%	6	4	2	0	-2	-5	-8
2.67%	37	34	31	28	25	21	18
5.33%	62	58	55	51	47	44	40
8.00%	80	76	73	69	66	62	58

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

(단위:백만원)

509

공시일	2020-04-03
기준일	2020-04-02

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

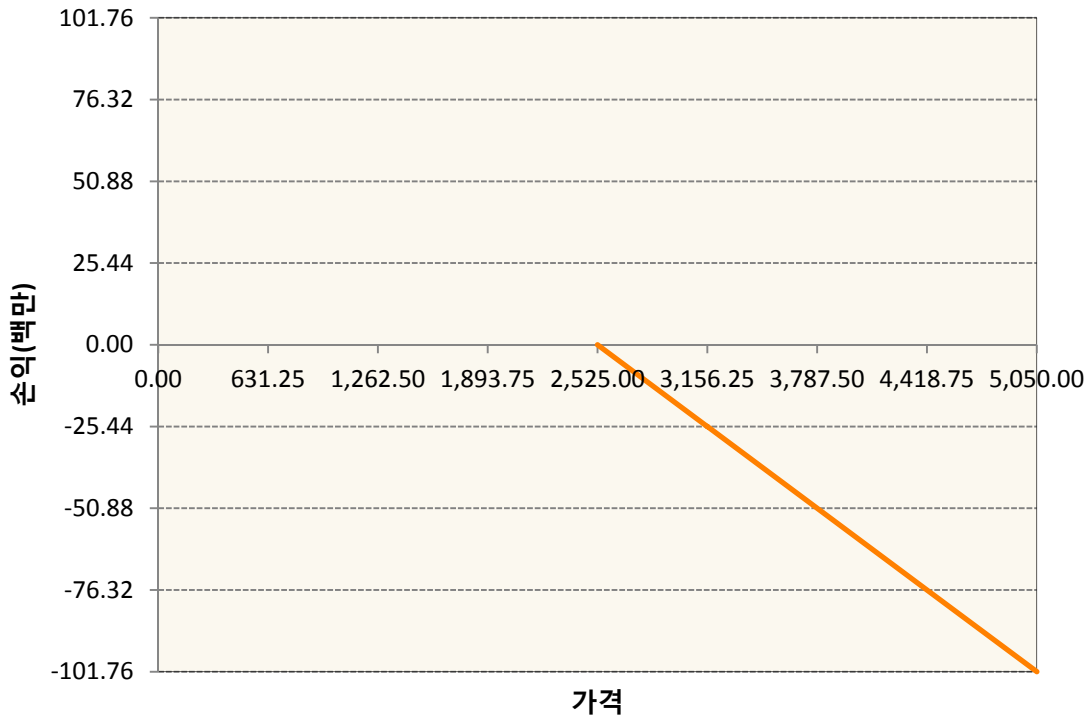
1. 계약금액

(단위:백만원)

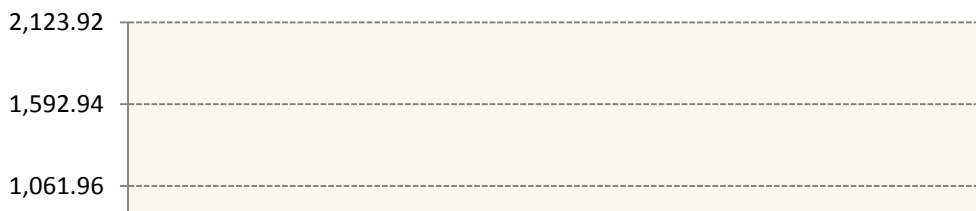
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	251	0	251	
누계	유가증권	스왑	7,631	0	7,631	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,486	-4,486	장내
누계	통화	선도	0	2,719	-2,719	장외

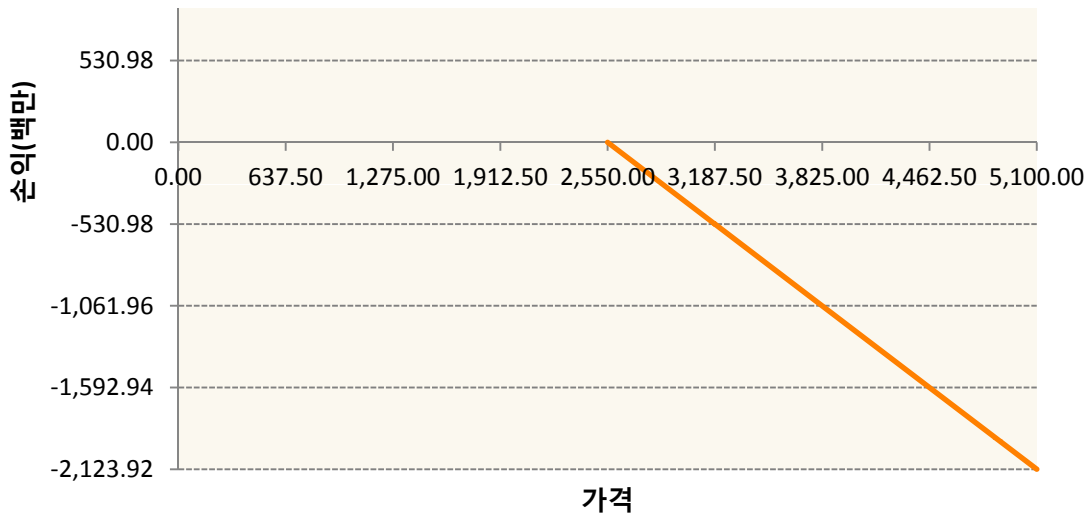
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ0-C2525-EURO STOXX 50

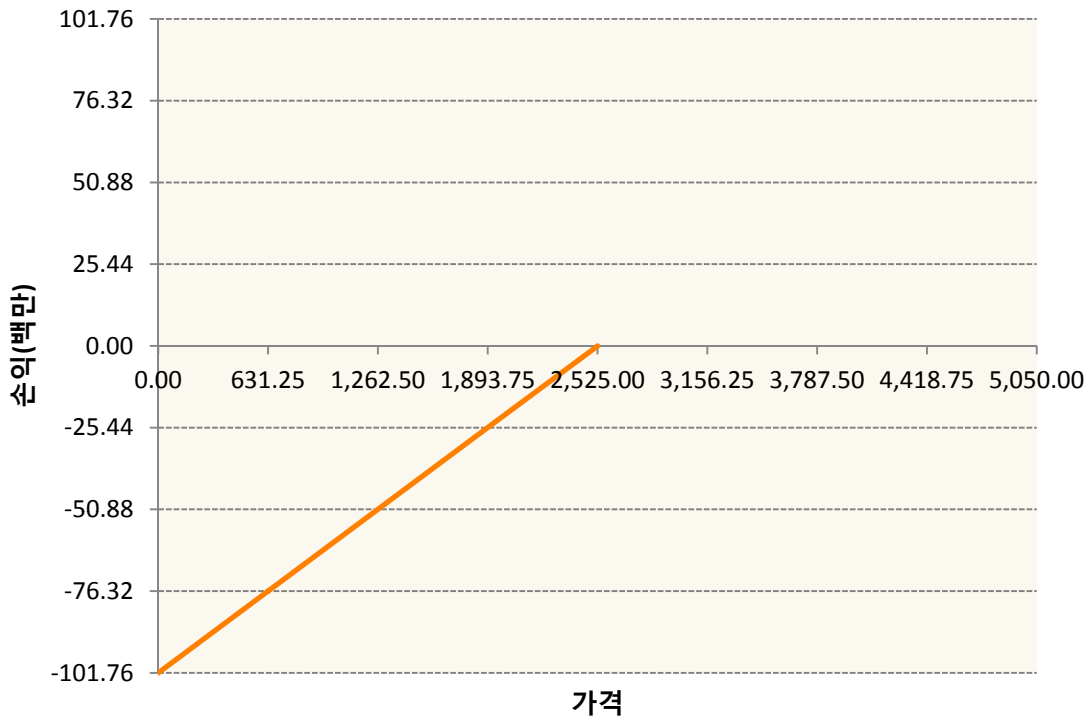


OESXJ0-C2550-EURO STOXX 50

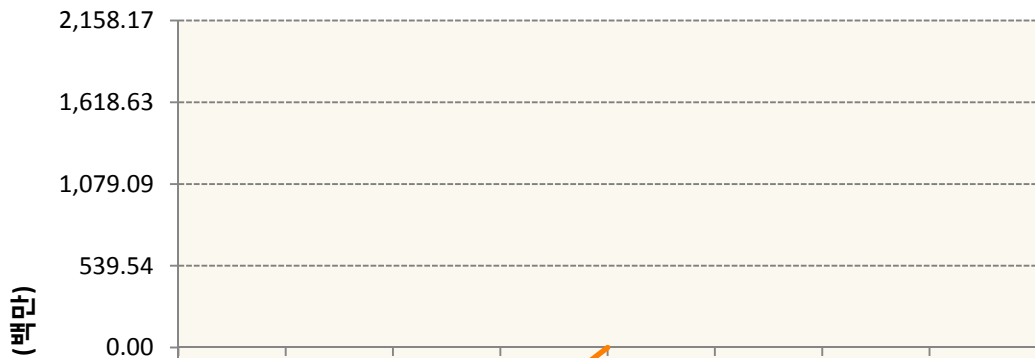


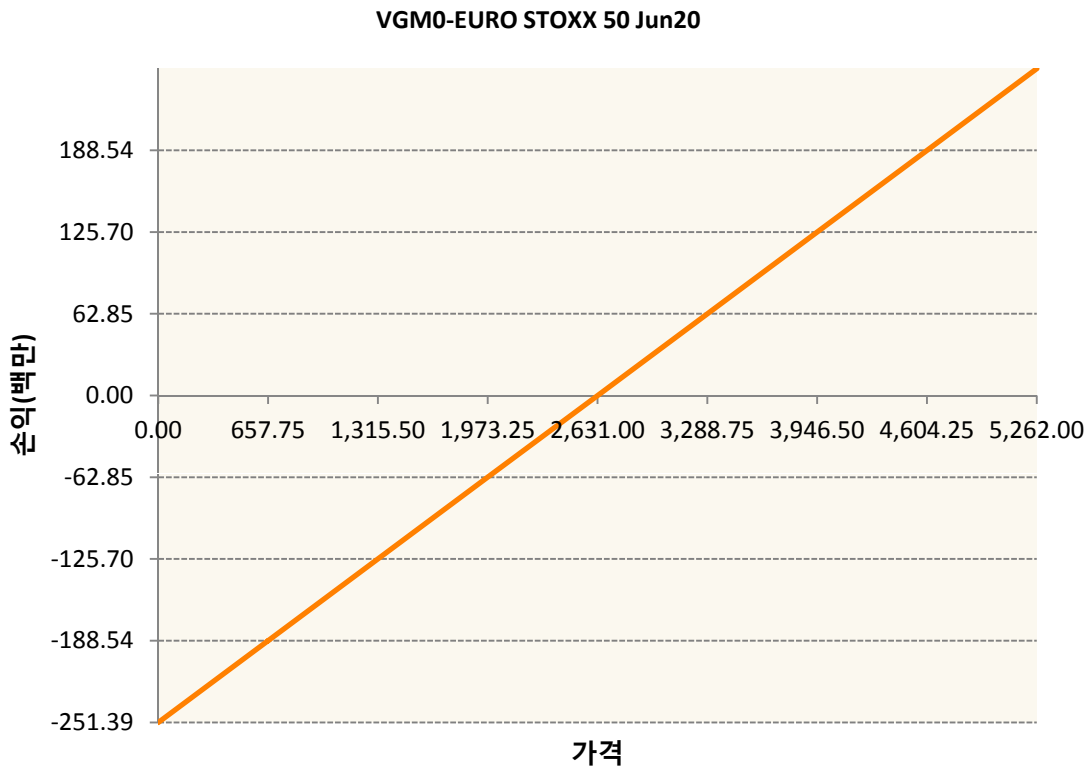
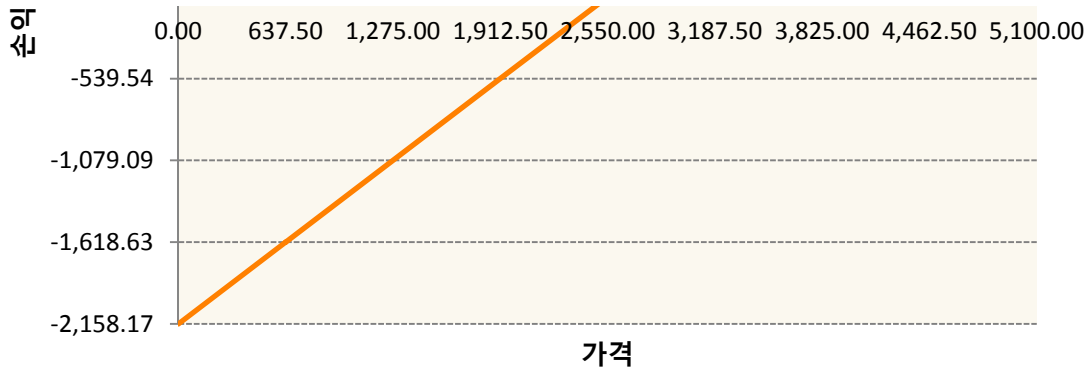


OESXJ0-P2525-EURO STOXX 50



OESXJ0-P2550-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		16
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E		218
OESXJ0-C25: EURO STOXX 50		8
OESXJ0-C25: EURO STOXX 50		170
OESXJ0-P25: EURO STOXX 50		8
OESXJ0-P25! EURO STOXX 50		173
VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	20

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

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

(단위:백만원)

998

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

(단위:백만원)

86

공시일	2020-04-03
기준일	2020-04-02

ETF스마트레버리지목표전환형10호

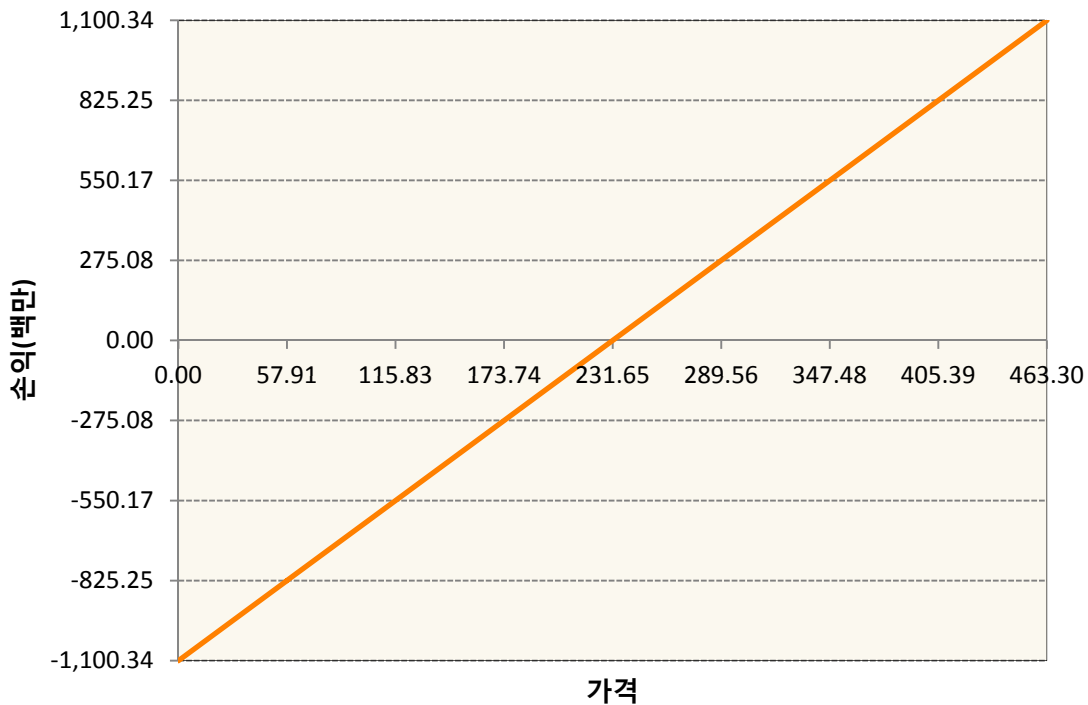
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,100	0	1,100	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						88
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88	
-5.33%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59	
-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%	59	59	59	59	59	59	59	
8.00%	88	88	88	88	88	88	88	

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

(단위:백만원)

126

공시일	2020-04-03
기준일	2020-04-02

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

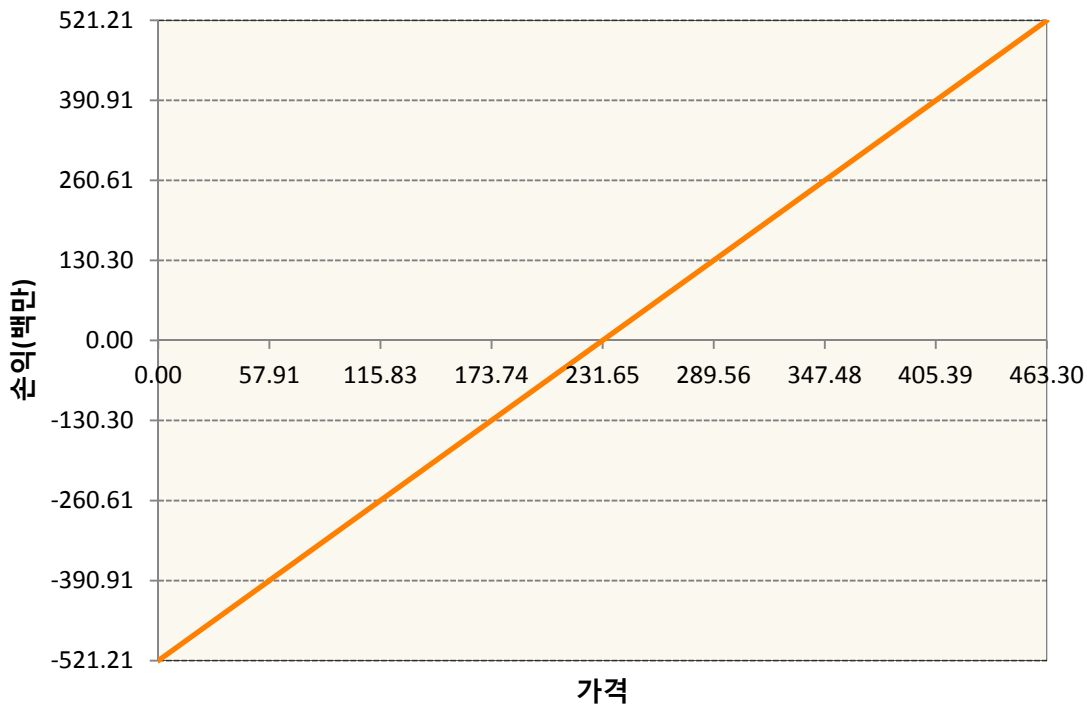
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	521	0	521	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)

60

공시일	2020-04-03
기준일	2020-04-02

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

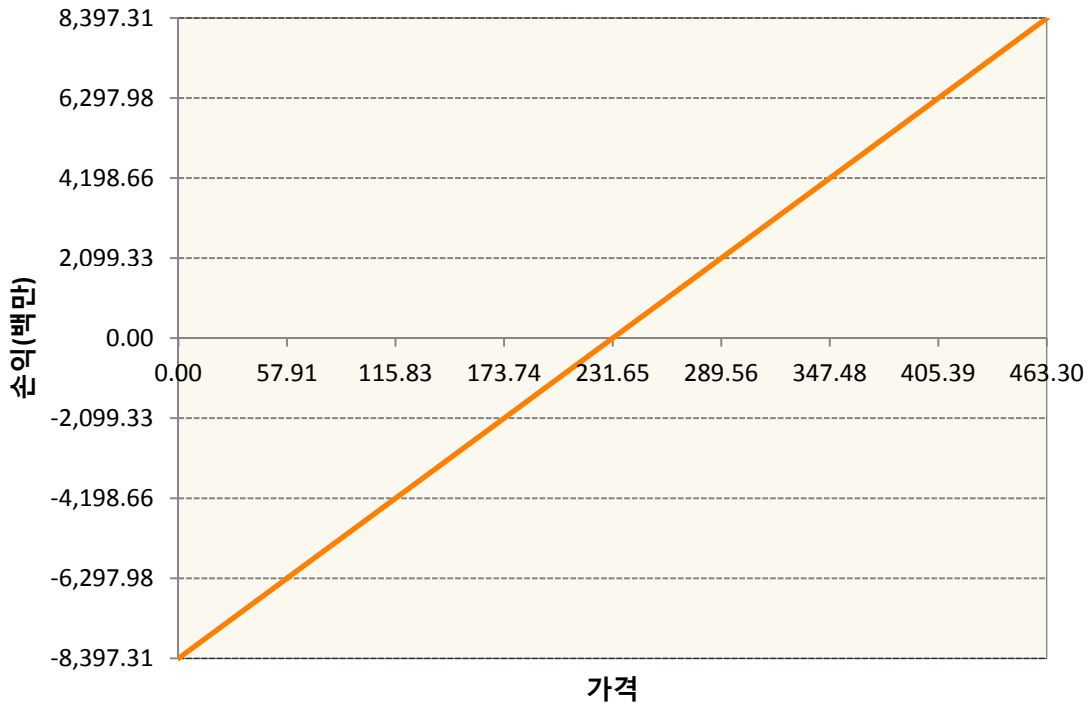
1. 계약금액

(단위:백만원)

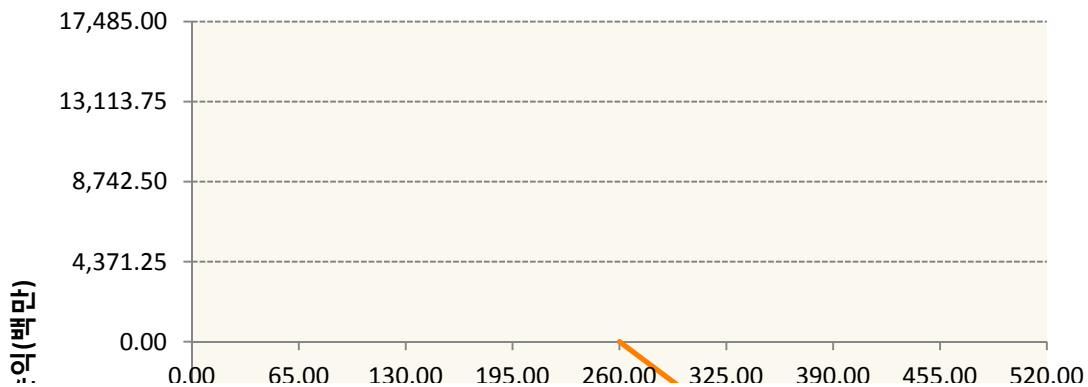
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,397	0	8,397	장내
누계	유가증권	옵션	6,004	17,485	-11,481	장내

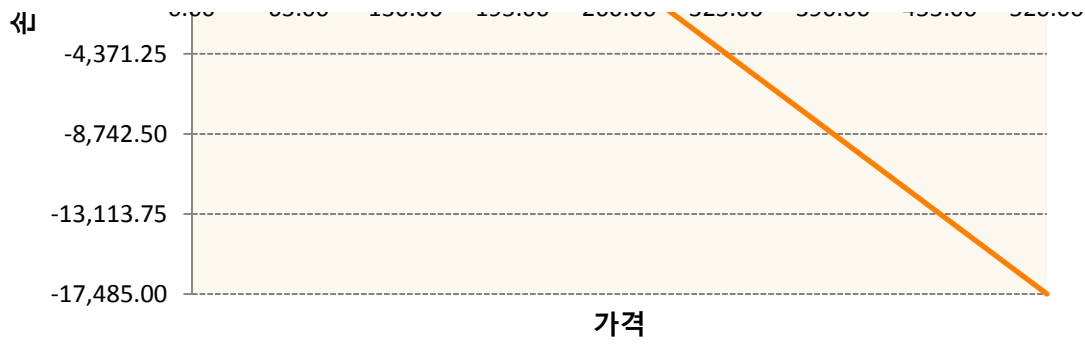
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

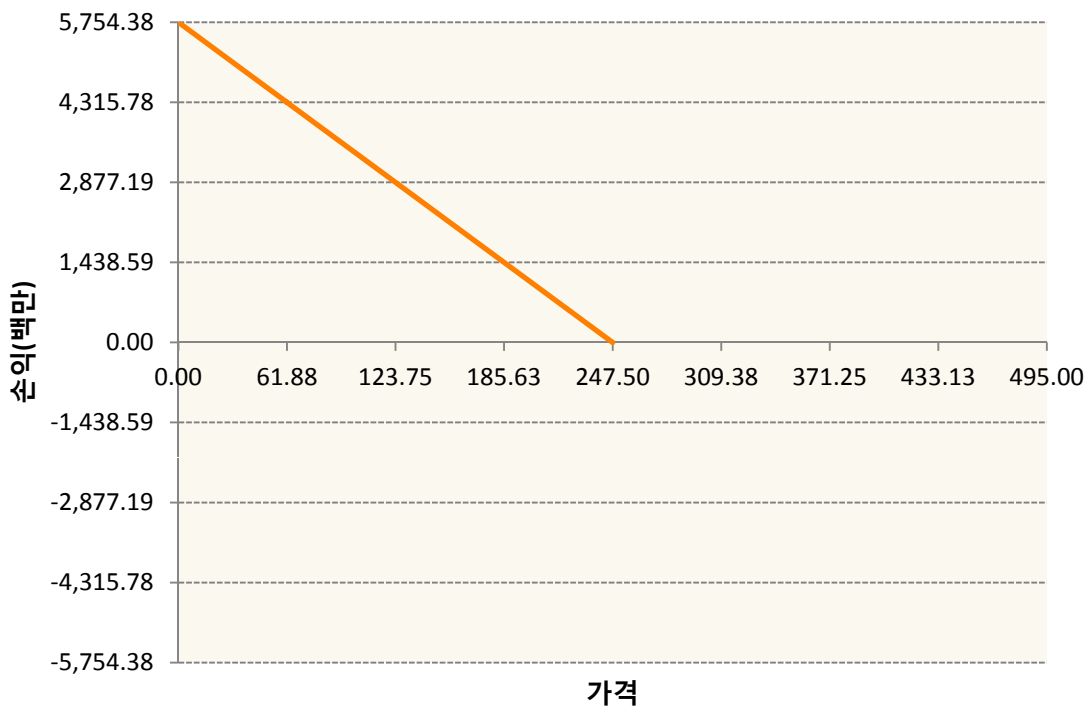


KR4201Q42602-2020-04 콜260

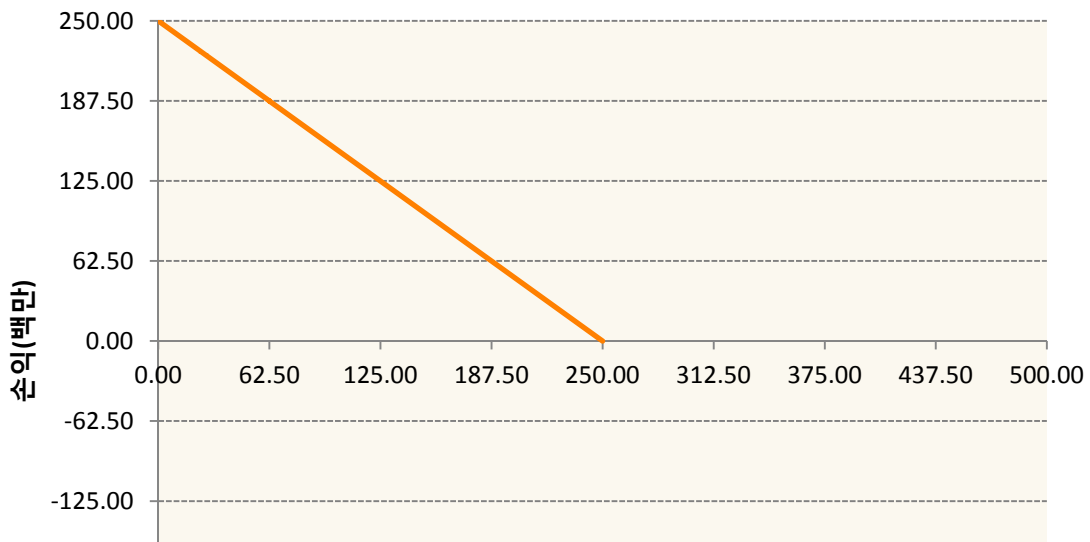


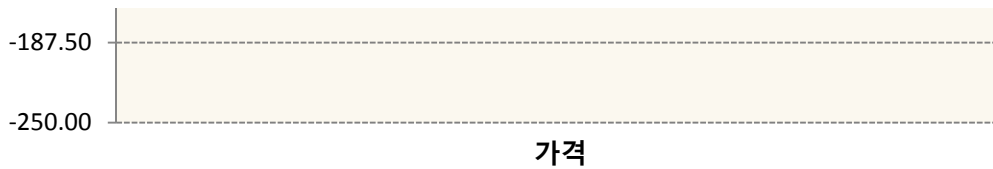


KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



KR4301Q42501-2020-04 풋250





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						672
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-672	-672	-672	-672	-672	-672	-672	
-5.33%	-448	-448	-448	-448	-448	-448	-448	
-2.67%	-224	-224	-224	-224	-224	-224	-224	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	224	224	224	224	224	224	224	
5.33%	448	448	448	448	448	448	448	
8.00%	672	672	672	672	672	672	672	
KR4201Q42602		2020-04 콜260						373
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	49	49	48	46	43	39	33	
-5.33%	48	47	44	40	34	26	16	
-2.67%	46	42	35	27	16	2	-14	
0%	37	28	15	0	-18	-39	-62	
2.67%	15	-3	-24	-48	-75	-103	-134	
5.33%	-33	-62	-94	-127	-162	-198	-236	
8.00%	-123	-163	-203	-245	-287	-330	-373	
KR4301Q42477		2020-04 풋247.5						400
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	389	390	391	392	394	397	400	
-5.33%	247	249	251	254	258	263	268	
-2.67%	108	111	116	122	128	136	143	
0%	-24	-17	-9	0	9	19	30	
2.67%	-142	-131	-119	-108	-96	-83	-71	
5.33%	-239	-225	-211	-198	-184	-170	-156	
8.00%	-310	-296	-282	-268	-254	-240	-226	
KR4301Q42501		2020-04 풋250						18
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	17	17	17	17	17	17	18	
-5.33%	11	11	11	11	11	12	12	
-2.67%	5	5	5	5	6	6	6	

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

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

(단위:백만원)

1,534

공시일	2020-04-03
기준일	2020-04-02

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	148,158	0	148,158	

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	2020-04-03
기준일	2020-04-02

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	99,903	0	99,903	

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	2020-04-03
기준일	2020-04-02

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	441,408	0	441,408	
누계	통화	선도	71,856	531,731	-459,876	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,653
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,380
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,965
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,931
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,299
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,965
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,457
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,044
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,044
FX21020H04 USD/KRW 21-04-20E	1,474
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,398
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	983
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	983
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,555
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	845
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	737
FX21020H09 USD/KRW 24-04-20E	737
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	491
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,439
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,977
FX21020H11 KRW/USD 11-05-20E	983
FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E	2,948
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

172

공시일	2020-04-03
기준일	2020-04-02

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

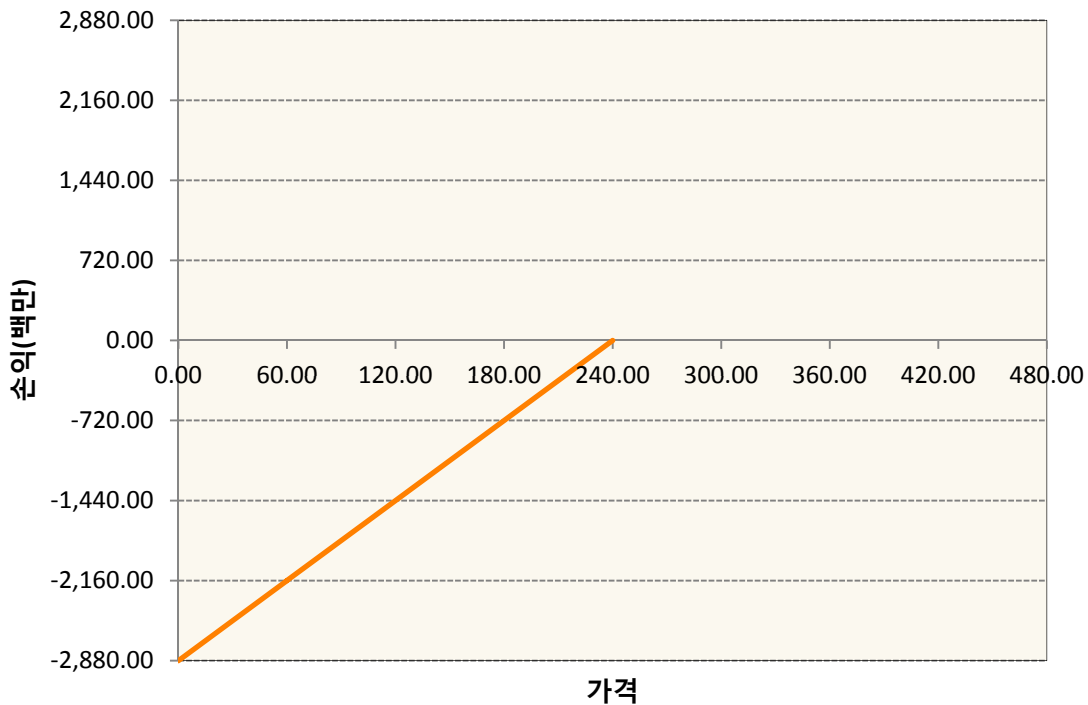
1. 계약금액

(단위:백만원)

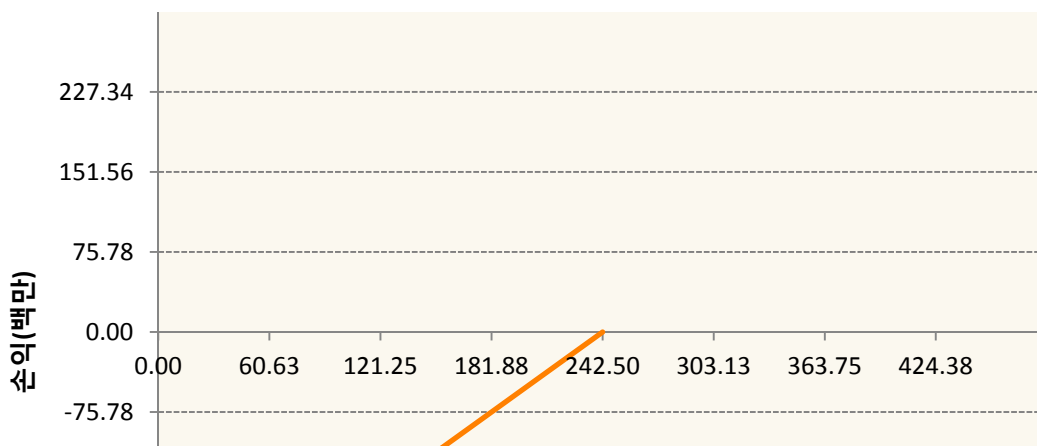
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,183	-3,183	장내

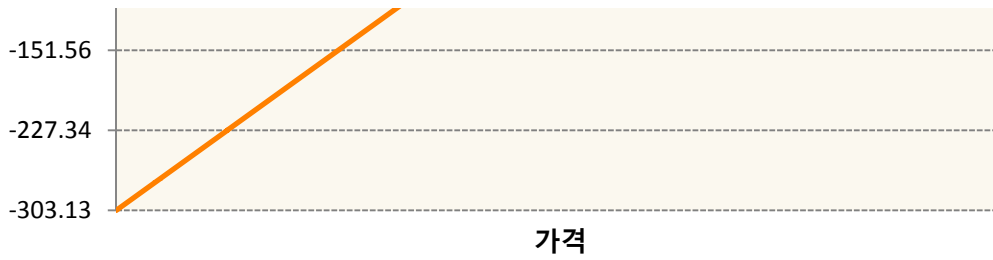
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q42402-2020-04 풋240



KR4301Q42428-2020-04 풋242.5





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q42402		2020-04 풋240						191
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-180	-181	-182	-184	-186	-189	-191	
-5.33%	-109	-111	-113	-116	-120	-123	-128	
-2.67%	-41	-45	-50	-54	-59	-64	-70	
0%	18	12	6	0	-6	-13	-19	
2.67%	65	58	52	45	38	31	24	
5.33%	99	93	86	79	72	65	58	
8.00%	121	115	109	103	97	91	84	
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	-20	-20	-21	
-5.33%	-12	-12	-12	-13	-13	-13	-14	
-2.67%	-5	-5	-6	-6	-6	-7	-7	
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2	
2.67%	7	6	6	5	4	4	3	
5.33%	11	11	10	9	8	8	7	
8.00%	14	13	13	12	11	11	10	

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

212

공시일	2020-04-03
기준일	2020-04-02

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	7,276	0	7,276	
누계	통화	선도	442	7,628	-7,186	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
FX21020J004 KRW/USD 29-04-20E	27
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

314

공시일	2020-04-03
기준일	2020-04-02

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

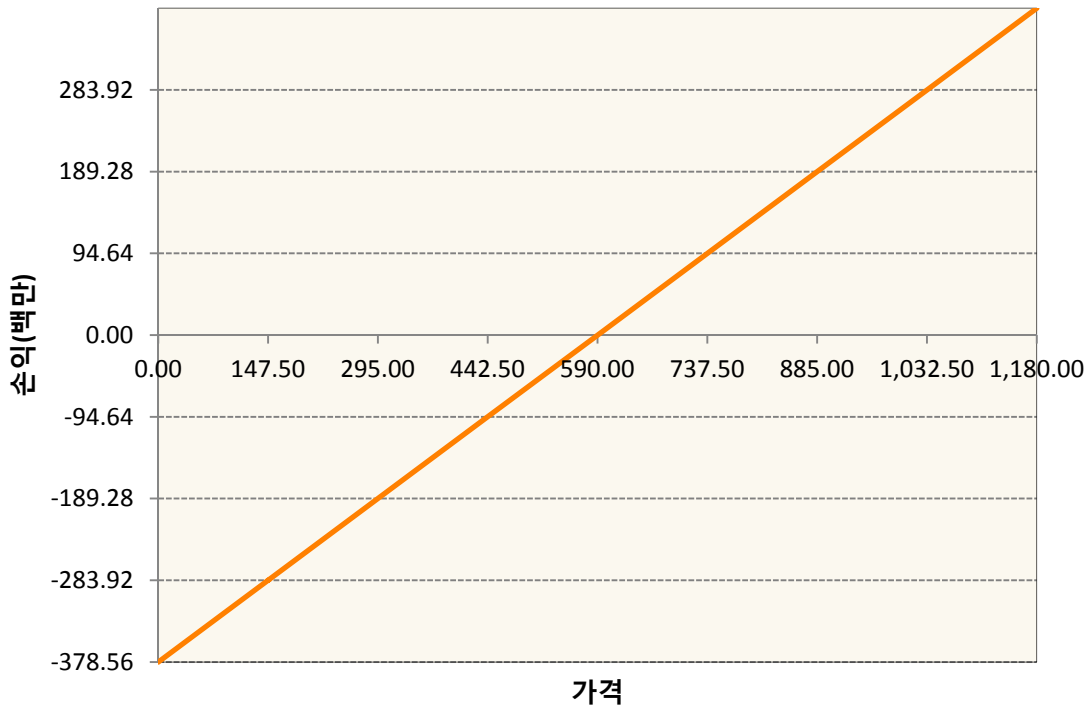
1. 계약금액

(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	379	0	379	
누계	유가증권	스왑	1,108	0	1,108	장외
누계	통화	선도	234	296	-62	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCJ0-VN30 Index Future Apr20



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
VNCJ0 VN30 Index Future Apr20

9
30

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

(단위:백만원)

125

공시일	2020-04-03
기준일	2020-04-02

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

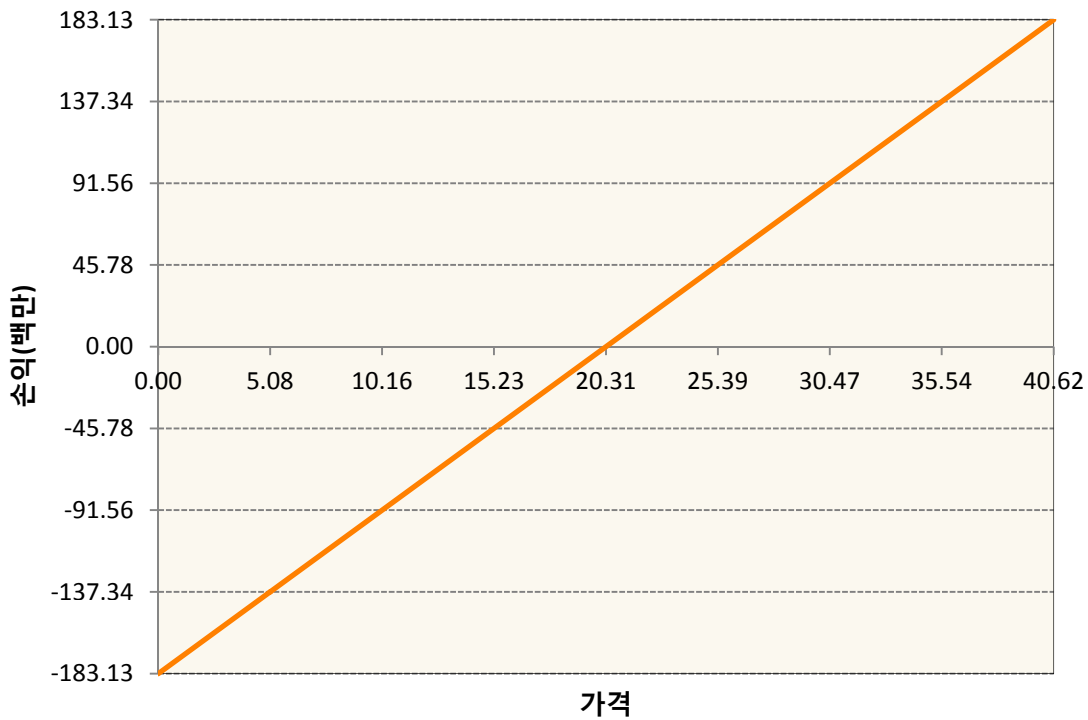
1. 계약금액

(단위:백만원)

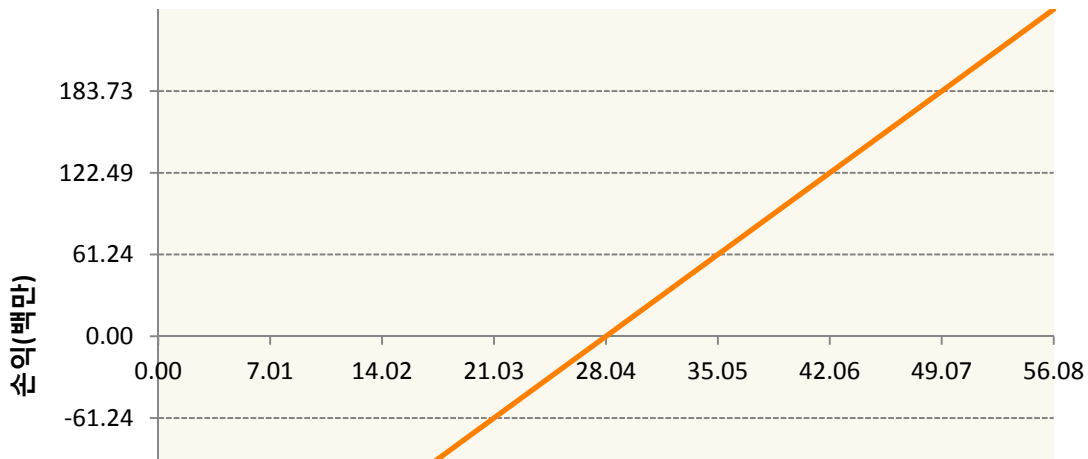
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,166	123	1,043	

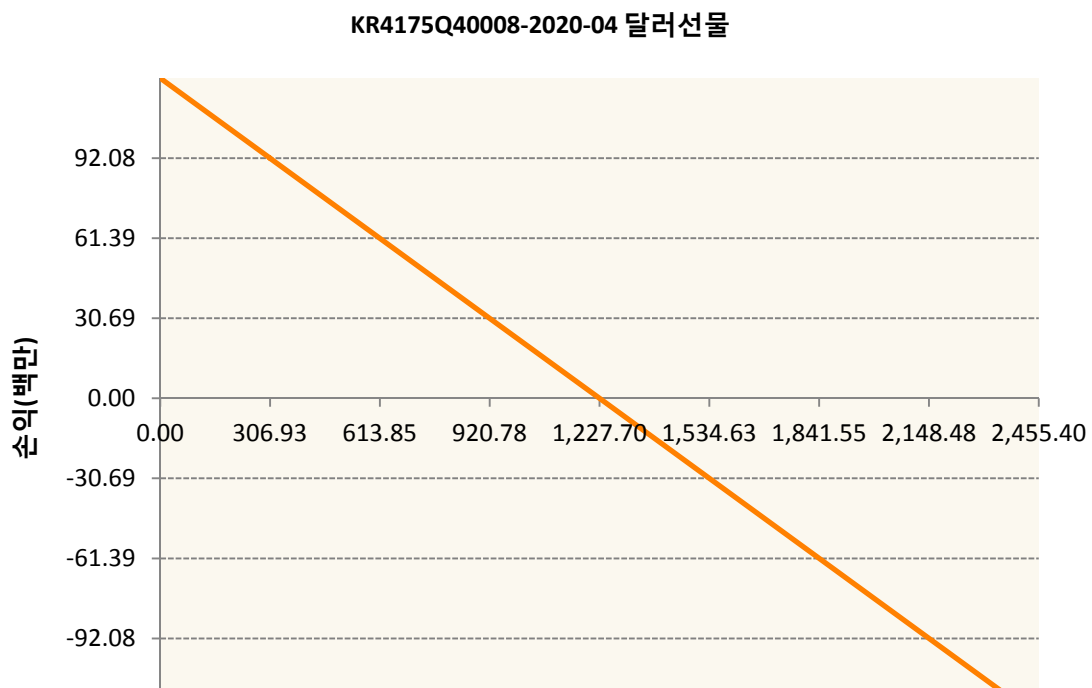
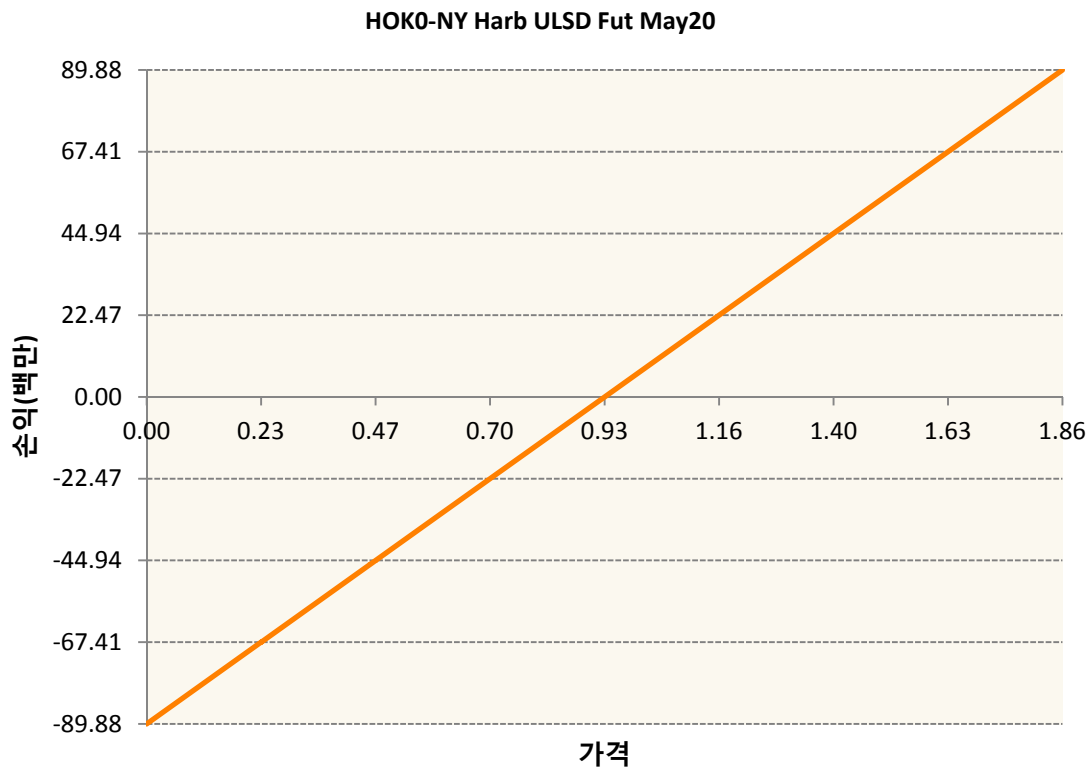
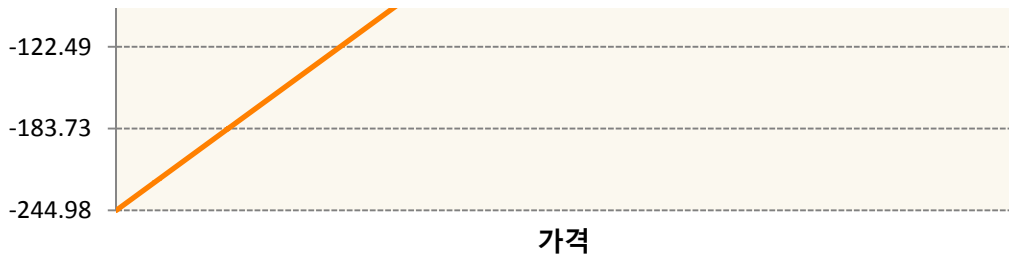
2. 만기시점의 손익구조

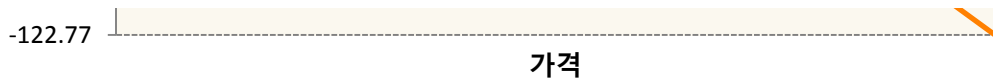
CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20



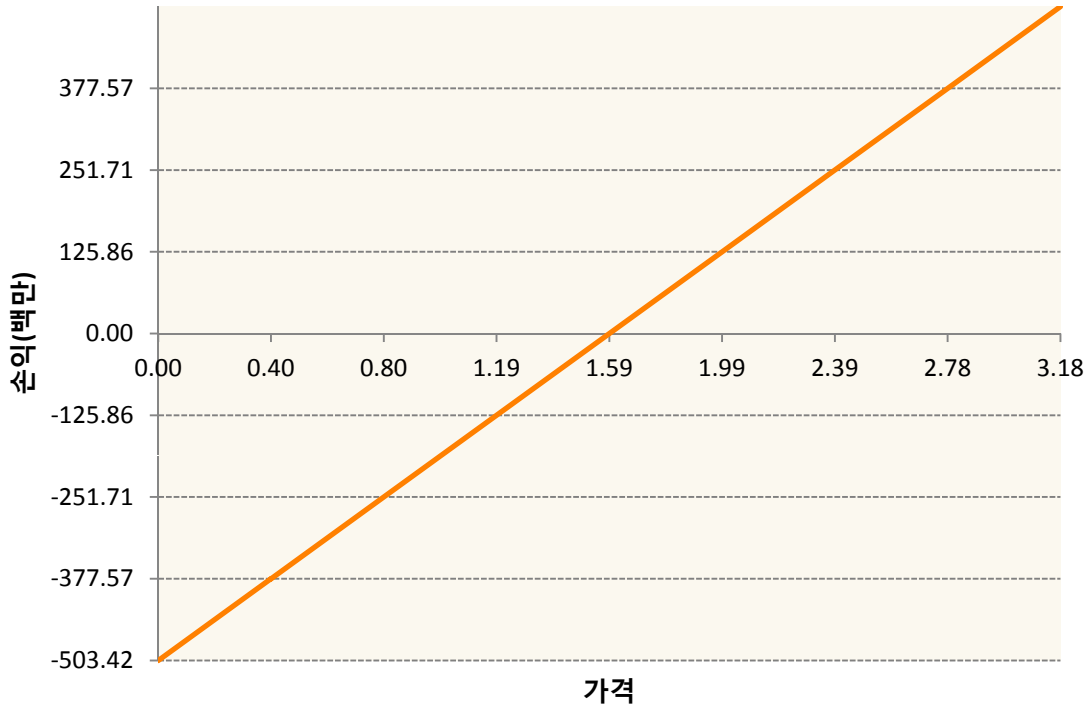
CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20



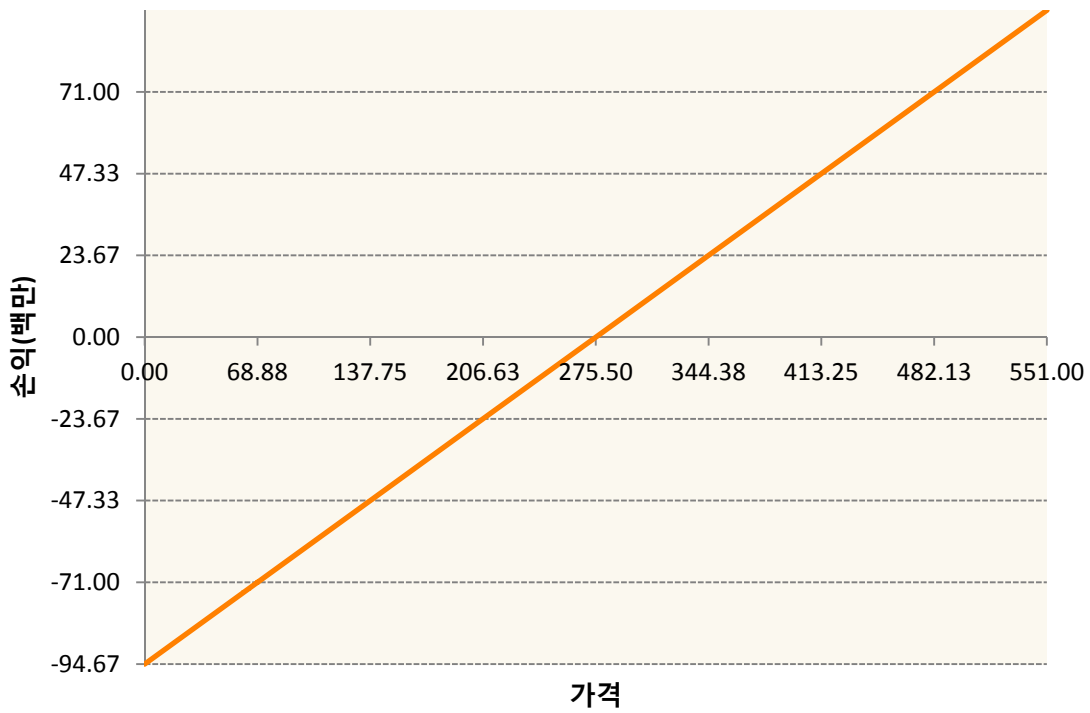




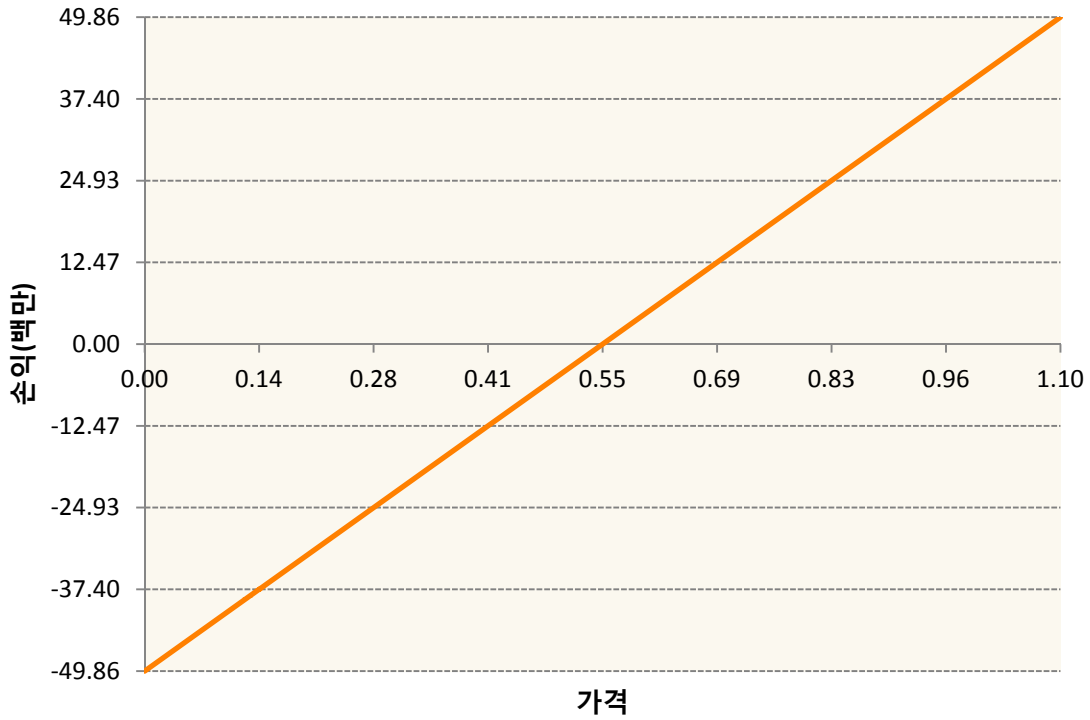
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



QSK0-Low Su Gasoil G Mar20



XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	15
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	20
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	7
KR4175Q40C	2020-04 달러선물	10
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	40
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	8
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	4

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

262

공시일	2020-04-03
기준일	2020-04-02

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

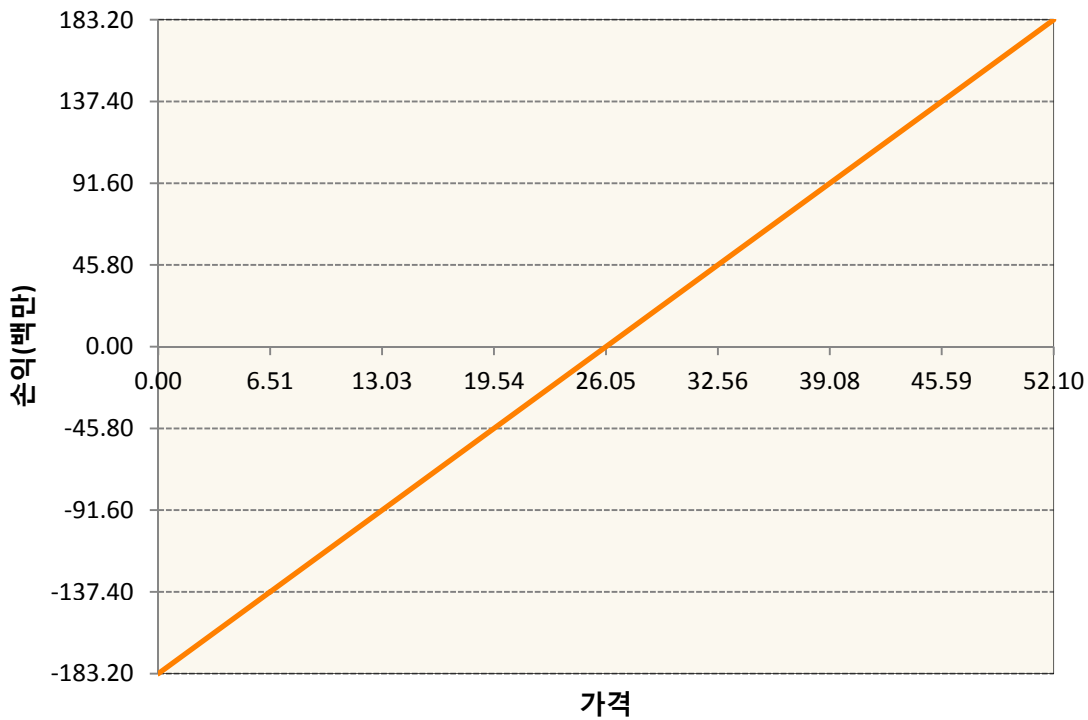
1. 계약금액

(단위:백만원)

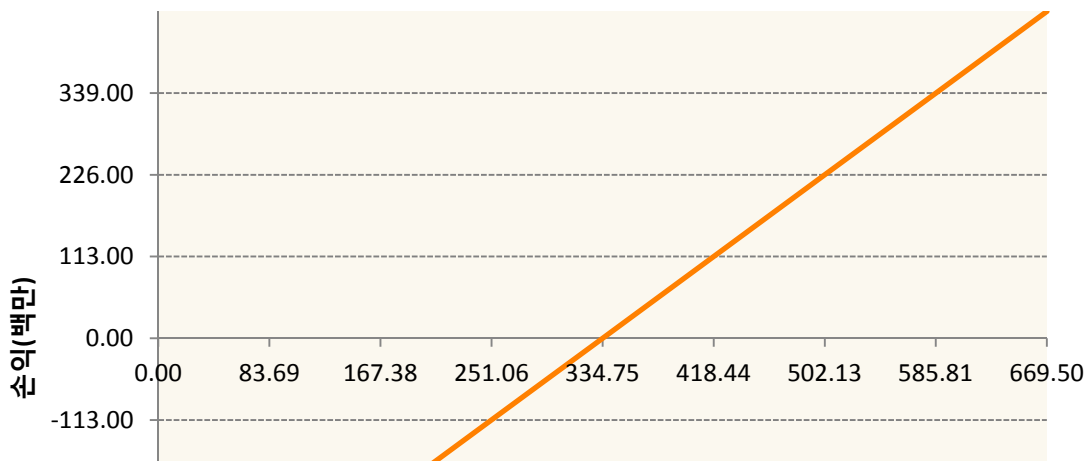
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,278	98	2,180	

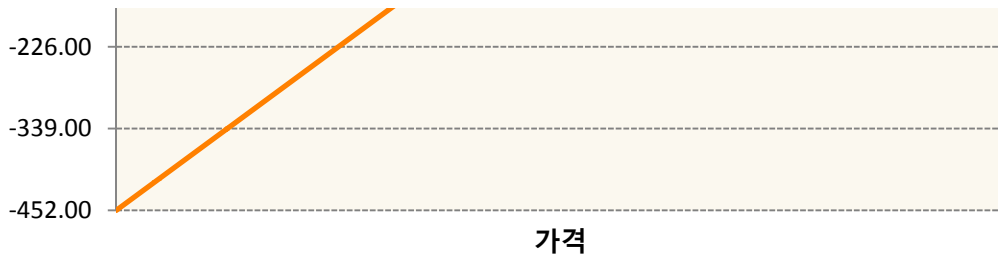
2. 만기시점의 손익구조

BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20

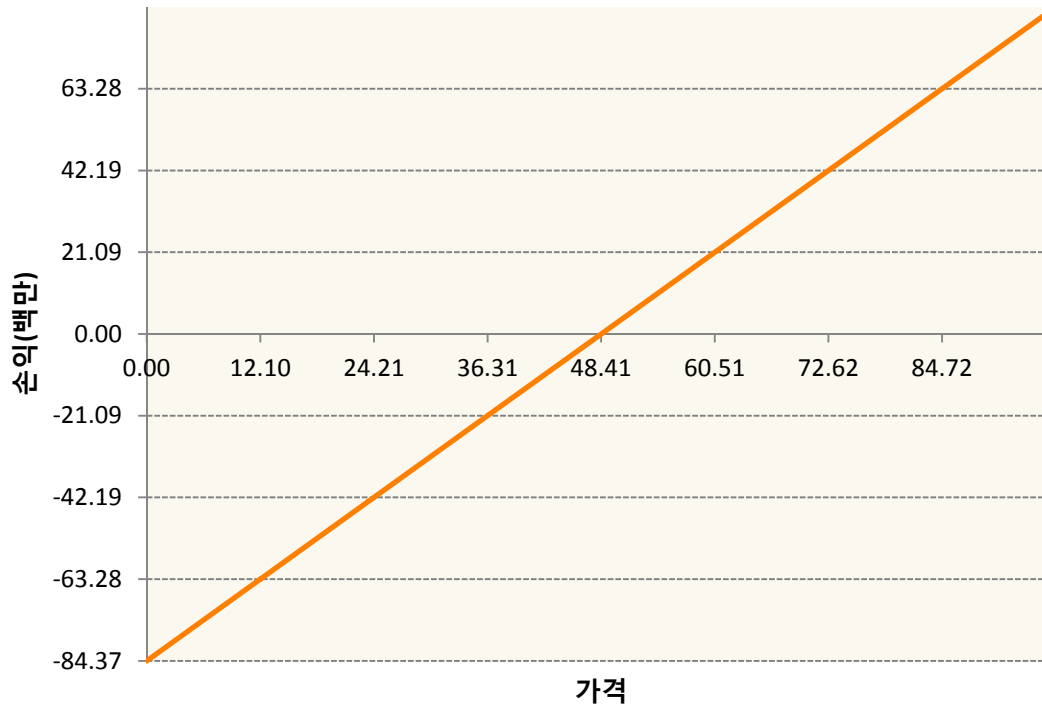


CK0-CORN FUTURE May20

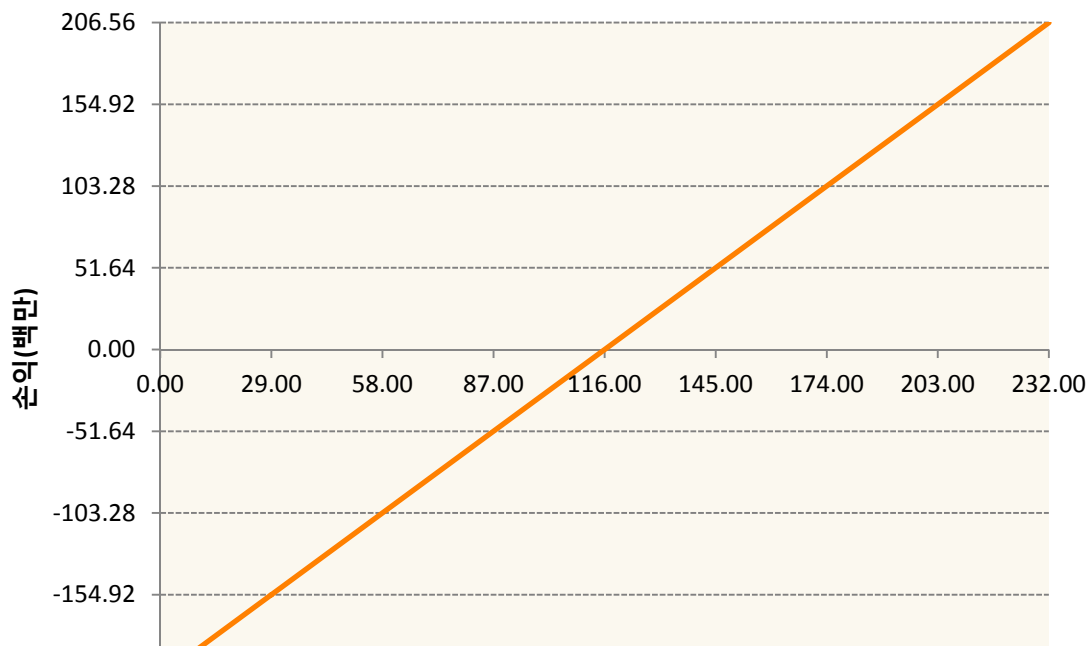


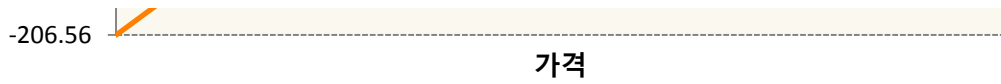


CTK0-COTTON NO.2 FUTR May20

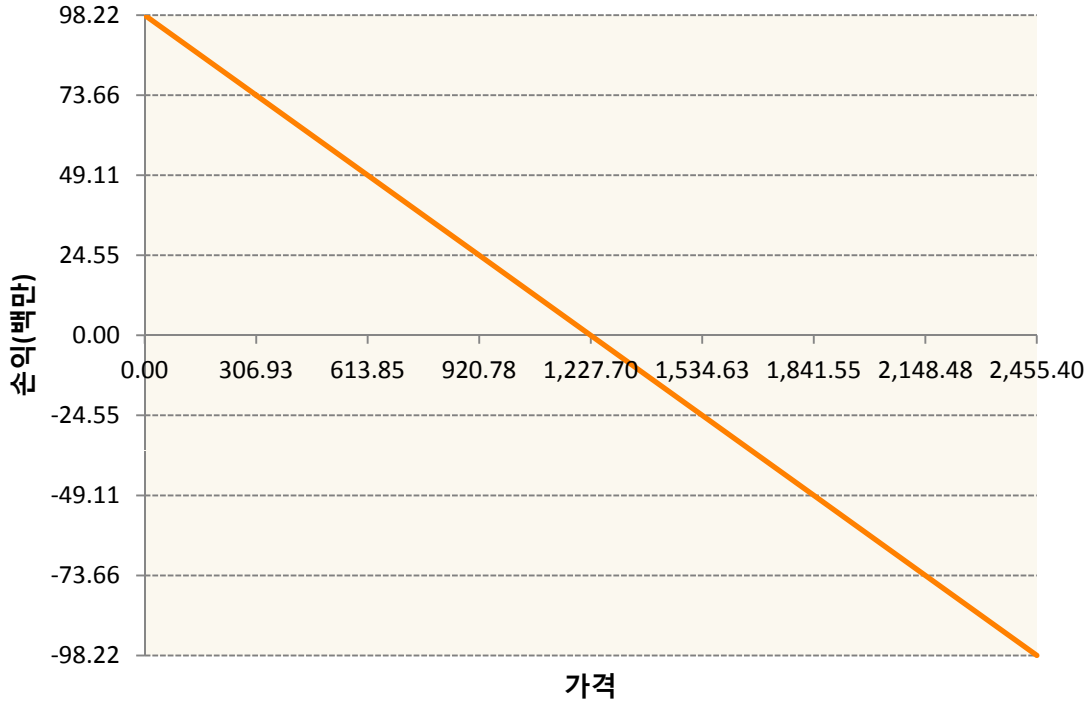


KCK0-COFFEE 'C' FUTURE May20

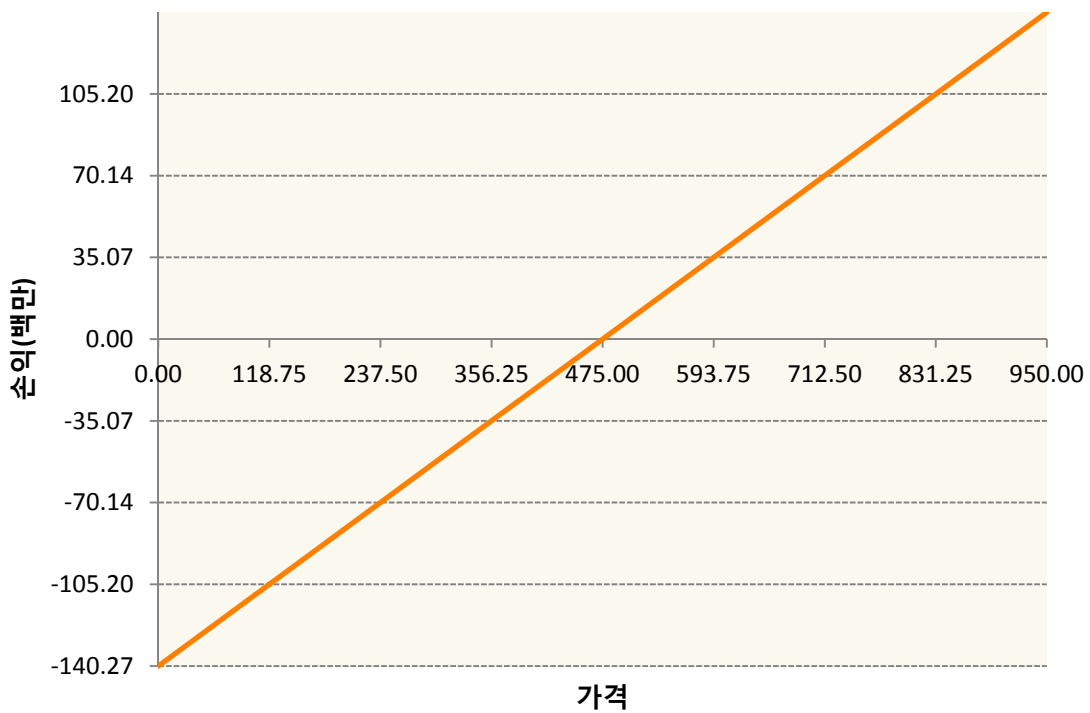




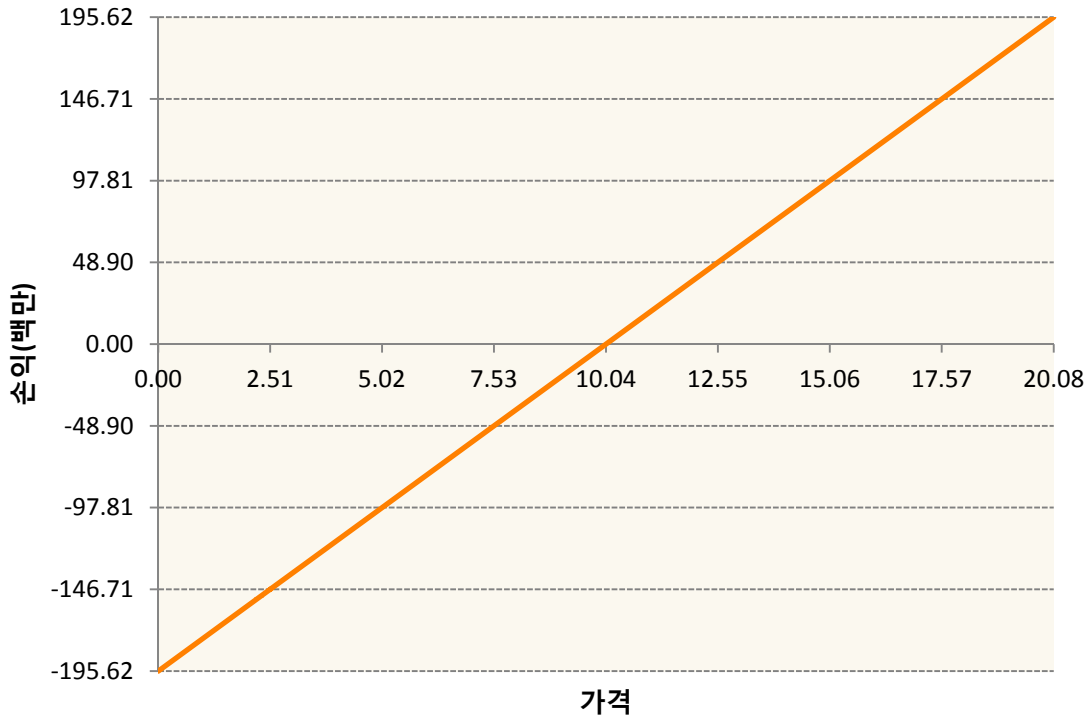
KR4175Q40008-2020-04 달러선물



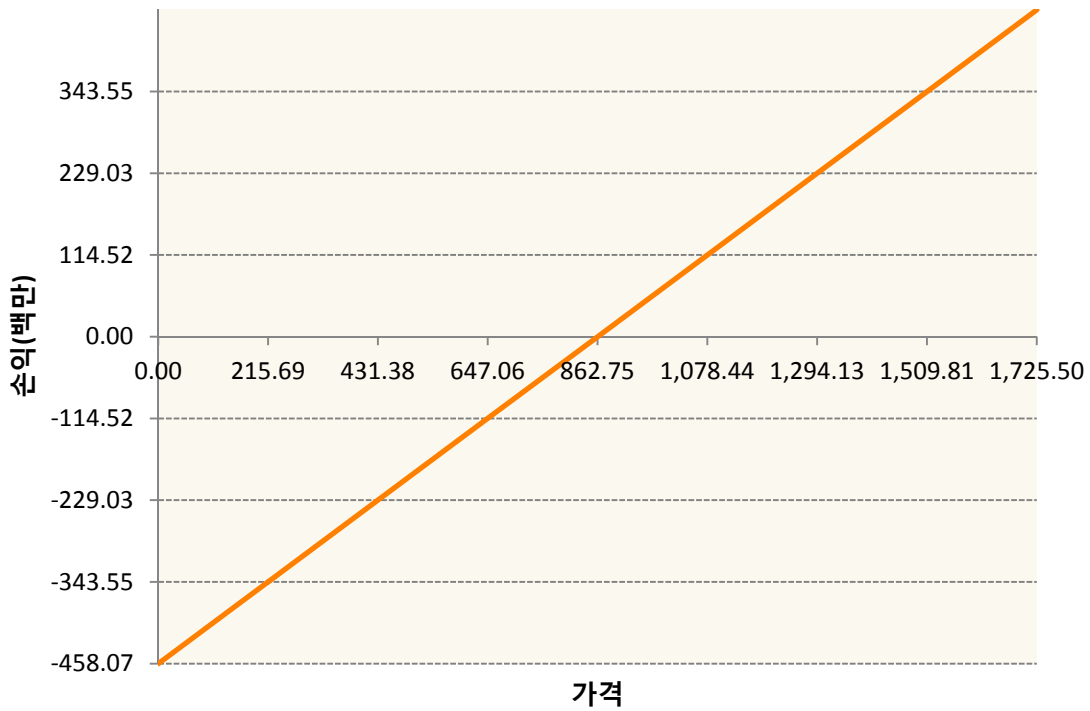
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



SBK0-Sugar May20

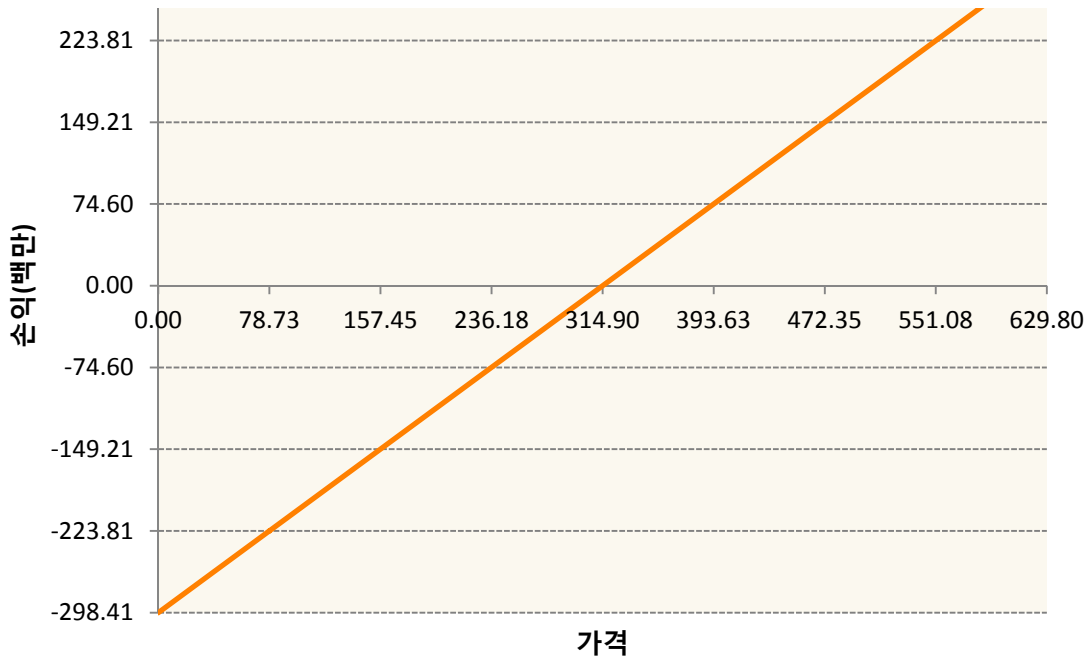


SK0-SOYBEAN FUTURE May20

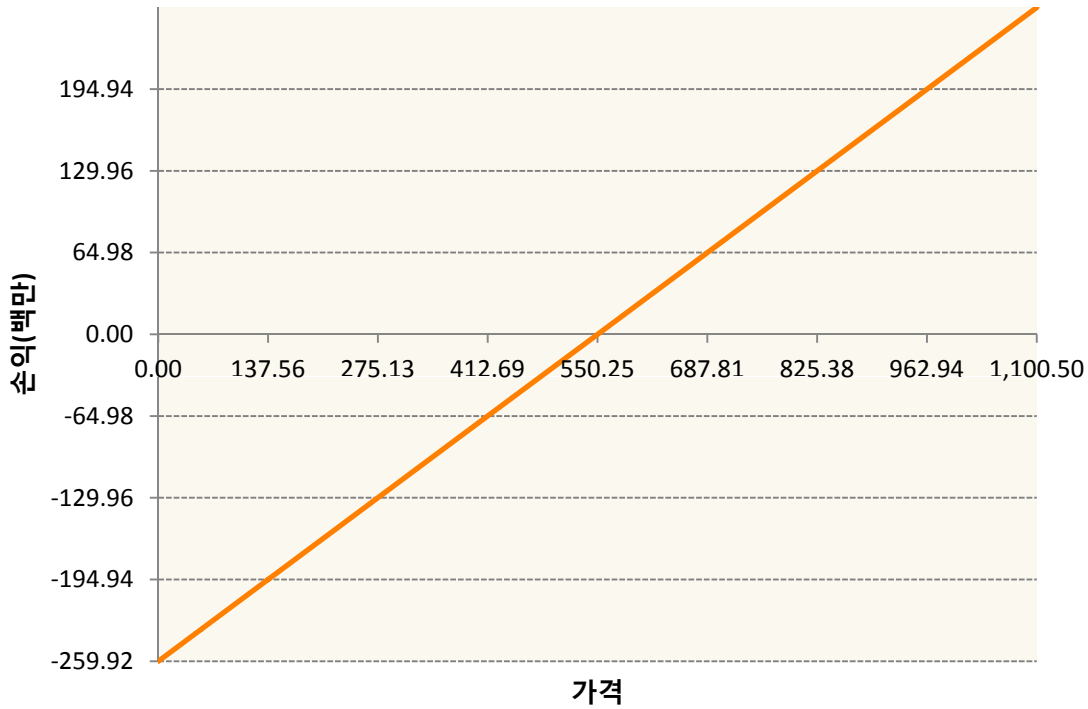


SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





WK0-WHEAT FUTURE(CBT) May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	15
CK0	CORN FUTURE May20	36
CTK0	COTTON NO.2 FUTR May20	7
KCK0	COFFEE 'C' FUTURE May20	17
KR4175Q40C	2020-04 달러선물	8

KWK0	KC HRW WHEAT FUT May20	11
SBK0	Sugar May20	16
SK0	SOYBEAN FUTURE May20	37
SMK0	SOYBEAN MEAL FUTR May20	24
WK0	WHEAT FUTURE(CBT) May20	21

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

(단위:백만원)

212