

공시일	2020-04-06
기준일	2020-04-03

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	2020-04-06
기준일	2020-04-03

스마트인덱스모

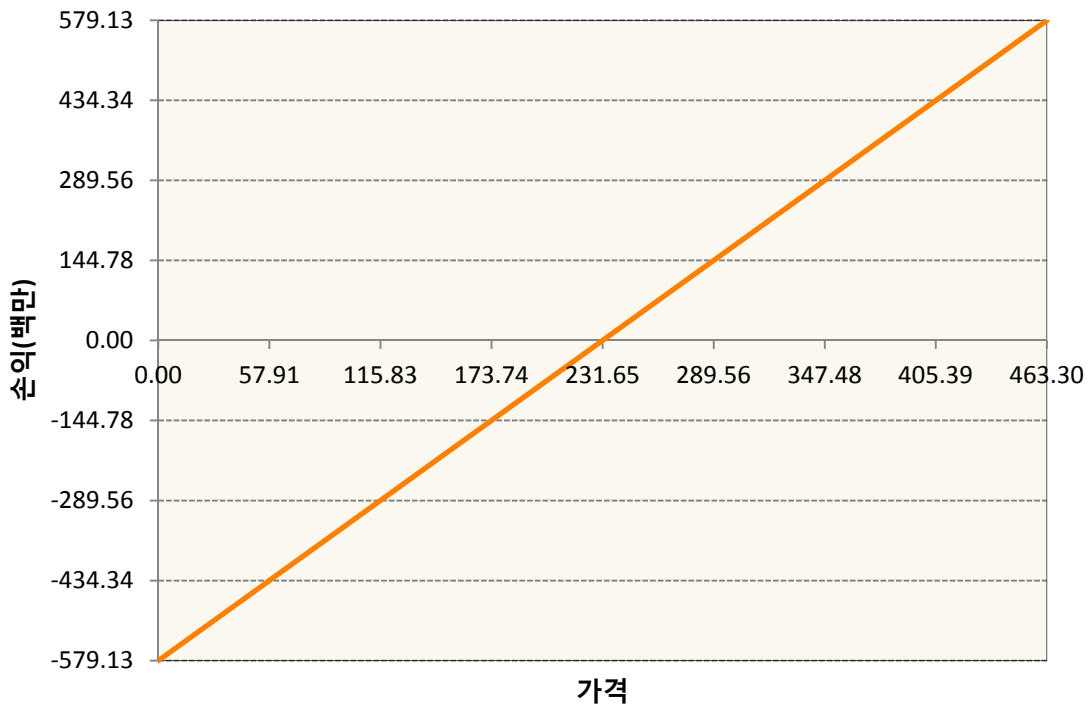
1. 계약금액

(단위:백만원)

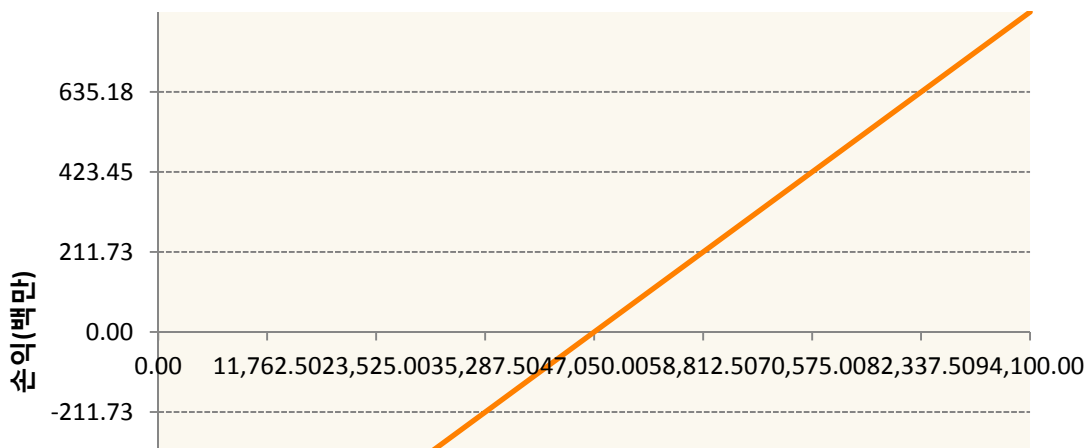
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,426	0	1,426	장내

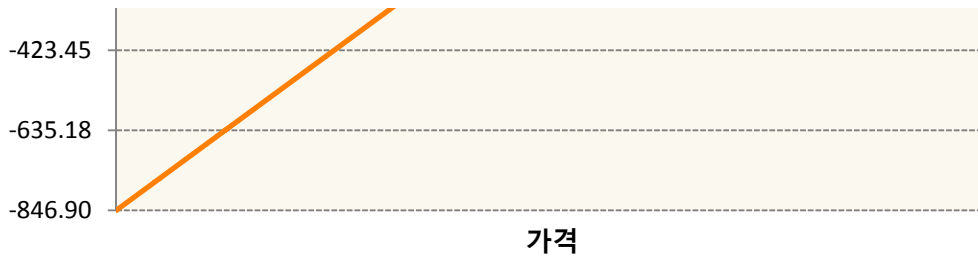
2. 만기시점의 손익구조

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						68
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68	
-5.33%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45	
-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%	45	45	45	45	45	45	45	
8.00%	68	68	68	68	68	68	68	

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

165

공시일	2020-04-06
기준일	2020-04-03

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

866

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

973

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-06
기준일	2020-04-03

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

528

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

828

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-06
기준일	2020-04-03

유로인덱스모(주식-파생형)

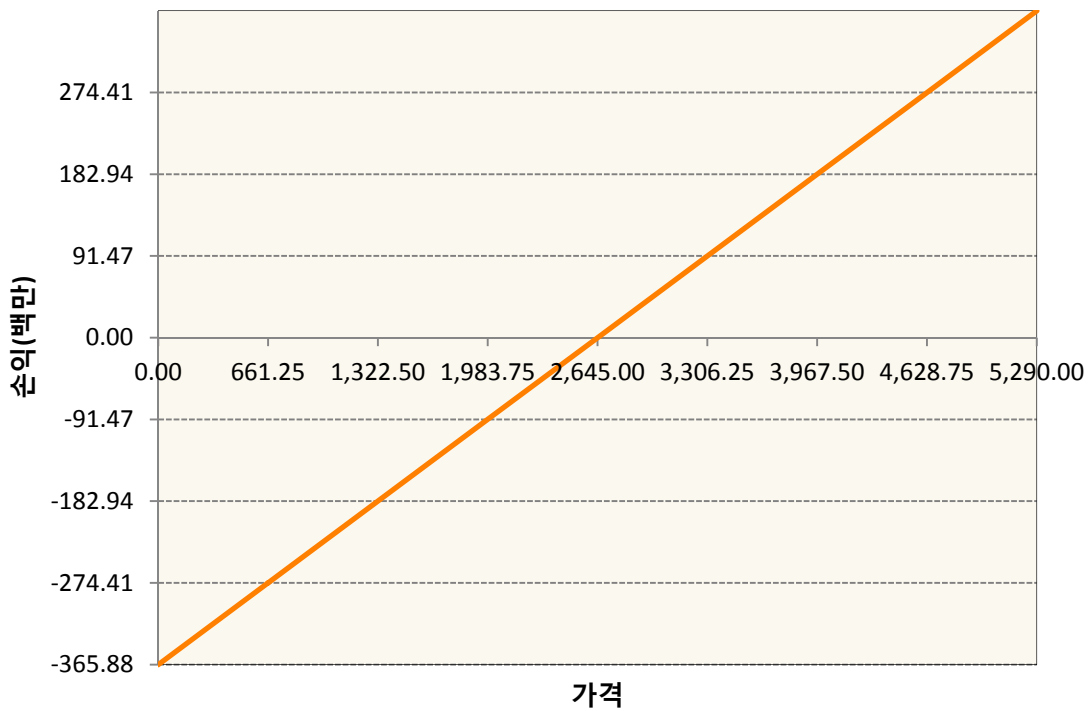
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	366	0	366	

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	2020-04-06
기준일	2020-04-03

차이나인덱스모(주식-파생형)

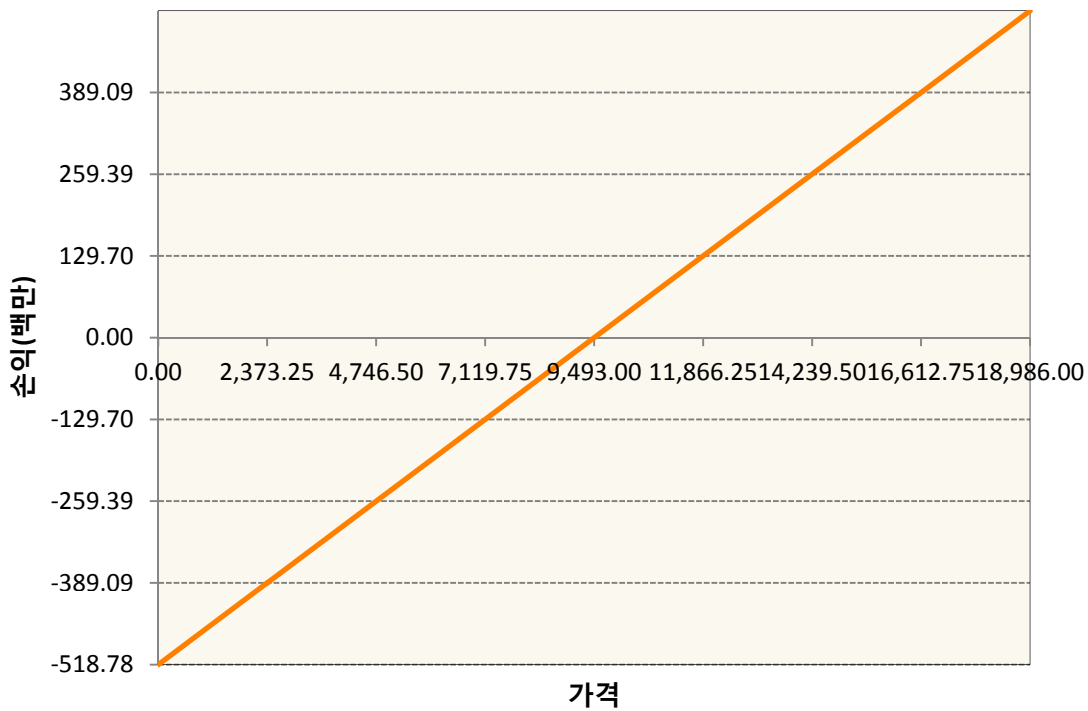
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	519	0	519	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCJ0-HSCEI Futures Apr20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

44

공시일	2020-04-06
기준일	2020-04-03

커버드콜모(주식혼합-파생형)

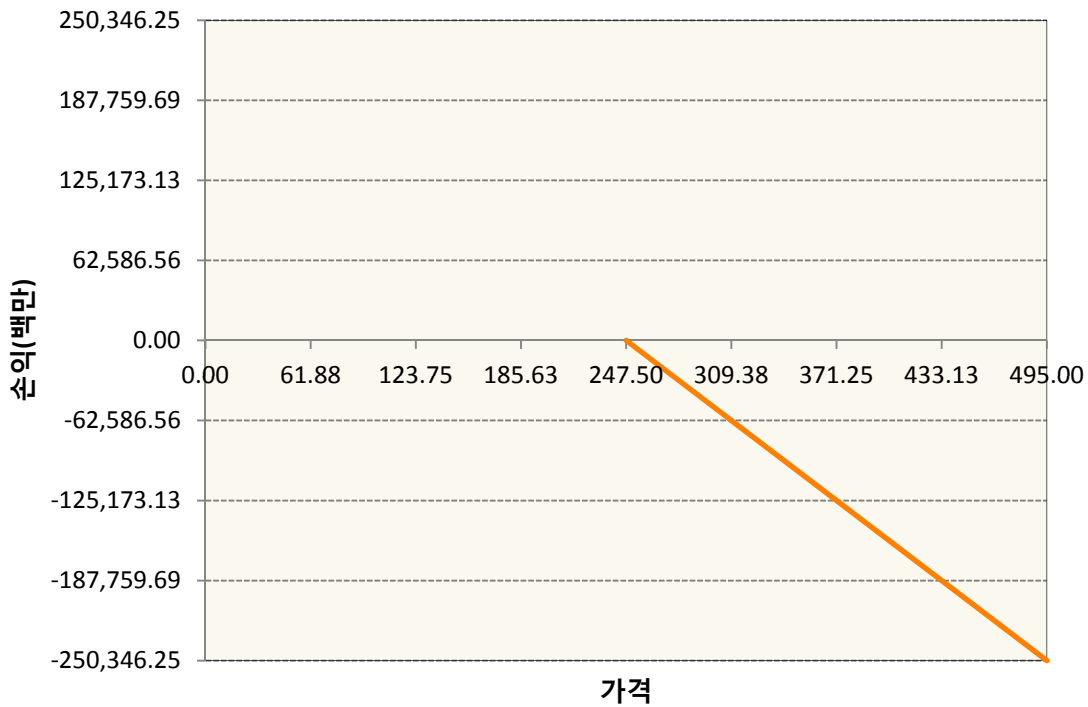
1. 계약금액

(단위:백만원)

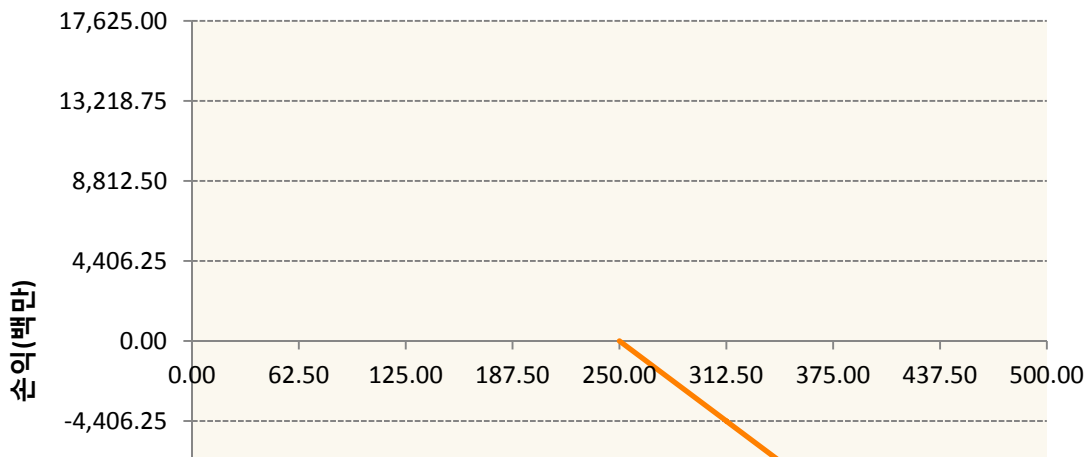
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	360,660	-360,660	장내

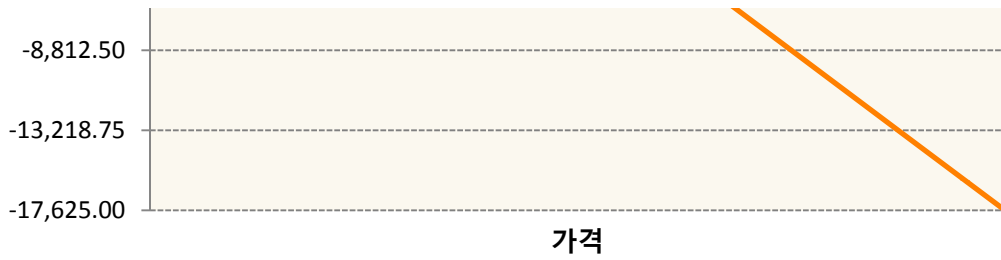
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

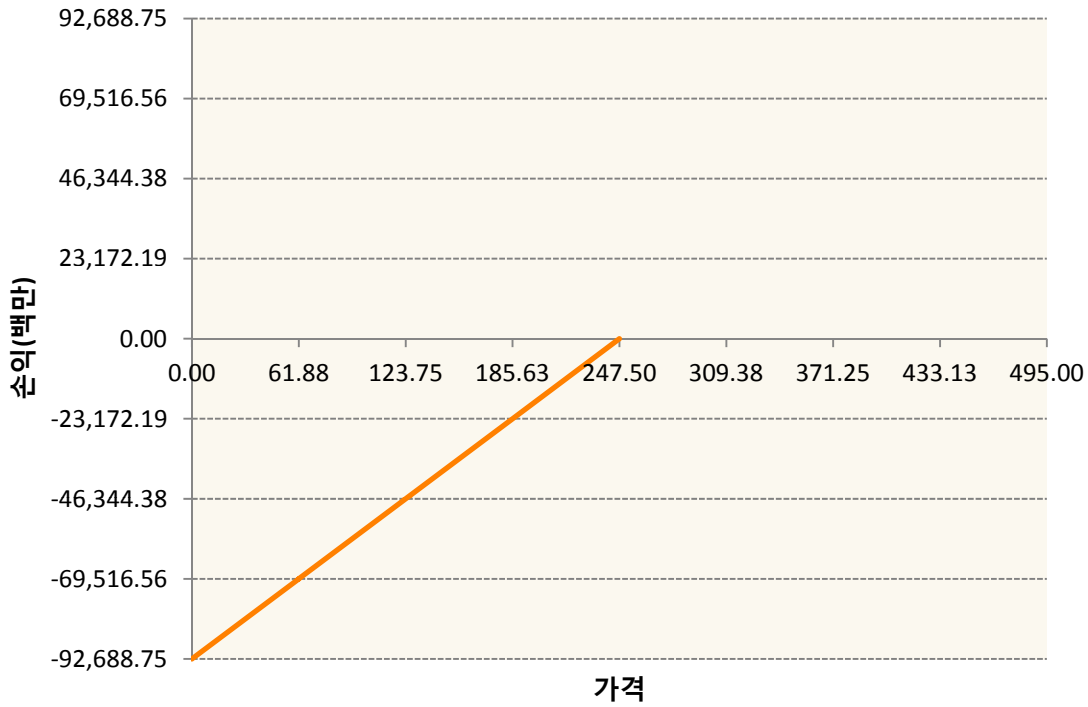


KR4201Q42503-2020-04 콜250





KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q42479		2020-04 콜247.5					8,884	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,805	1,783	1,743	1,681	1,594	1,480	1,338	
-5.33%	1,751	1,682	1,581	1,445	1,276	1,075	843	
-2.67%	1,564	1,398	1,189	942	659	345	4	
0%	1,053	738	385	0	-412	-846	-1,299	
2.67%	-67	-546	-1,045	-1,560	-2,088	-2,626	-3,172	
5.33%	-2,095	-2,689	-3,285	-3,885	-4,486	-5,088	-5,691	
8.00%	-5,211	-5,820	-6,430	-7,043	-7,656	-8,270	-8,884	
KR4201Q42503		2020-04 콜250					558	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	98	97	95	92	87	81	73	

-5.33%	96	93	87	80	70	59	45
-2.67%	87	79	67	53	36	17	-4
0%	62	44	23	0	-26	-53	-82
2.67%	3	-27	-58	-91	-125	-161	-197
5.33%	-112	-151	-191	-231	-272	-313	-354
8.00%	-298	-341	-385	-428	-471	-515	-558

KR4301Q42477 2020-04 풋247.5 6,552

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,459	-6,462	-6,468	-6,480	-6,497	-6,521	-6,552
-5.33%	-4,154	-4,167	-4,188	-4,218	-4,257	-4,307	-4,366
-2.67%	-1,880	-1,919	-1,971	-2,035	-2,111	-2,197	-2,294
0%	299	213	112	0	-122	-253	-391
2.67%	2,267	2,120	1,964	1,803	1,636	1,465	1,290
5.33%	3,882	3,689	3,494	3,299	3,102	2,906	2,708
8.00%	5,048	4,849	4,649	4,449	4,248	4,048	3,846

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

(단위:백만원)

13,749

공시일	2020-04-06
기준일	2020-04-03

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

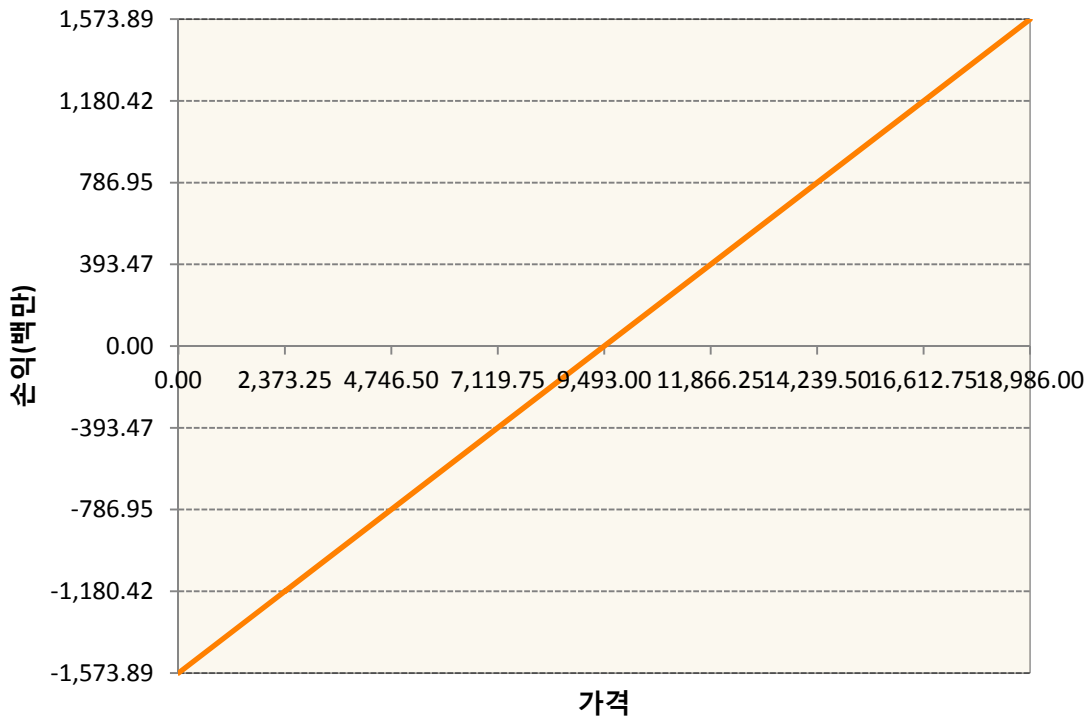
1. 계약금액

(단위:백만원)

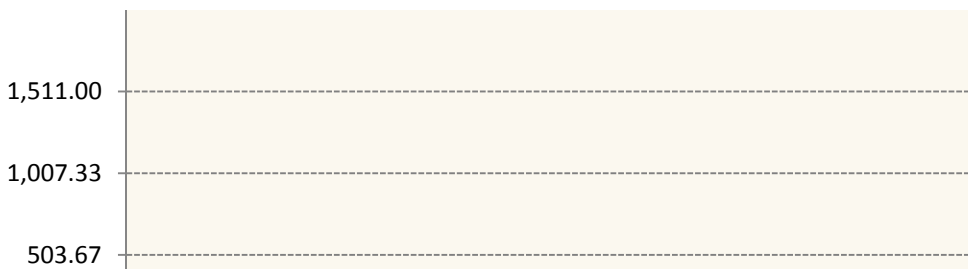
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,574	0	1,574	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,180	-4,180	장내
누계	통화	선도	699	2,235	-1,537	장외

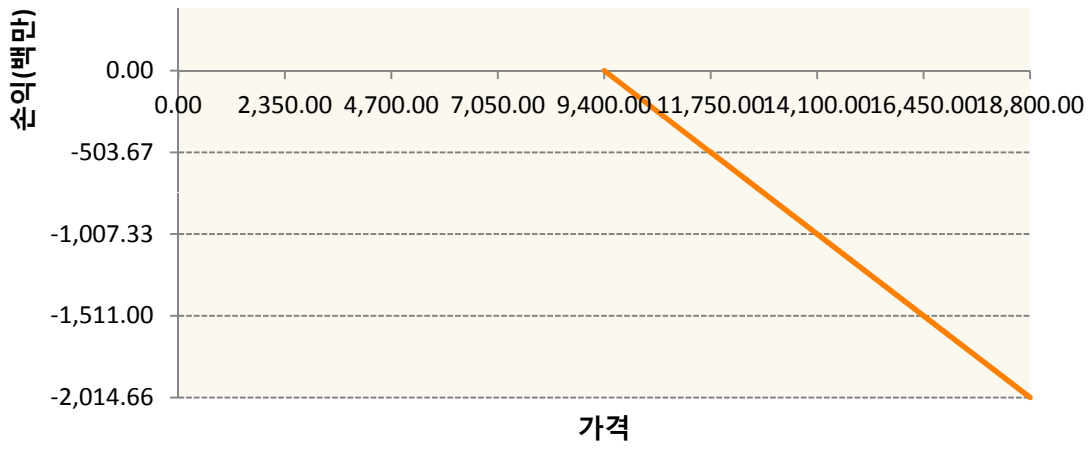
2. 만기시점의 손익구조

HCJ0-HSCEI Futures Apr20

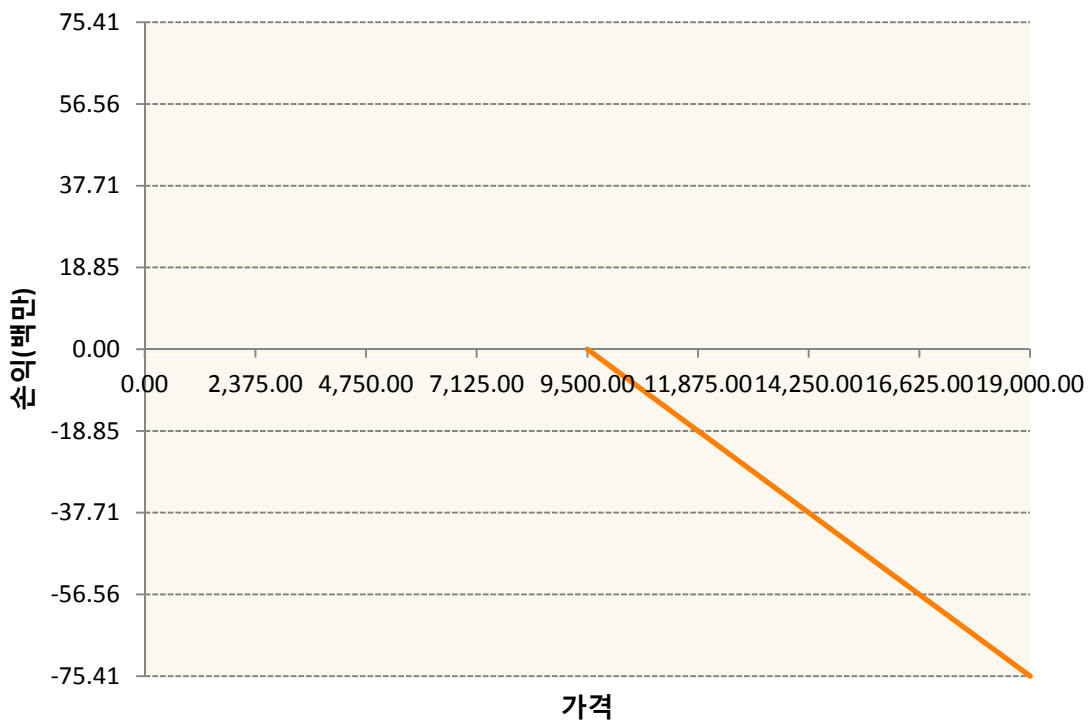


OHHIJ0-C94-HSCEI

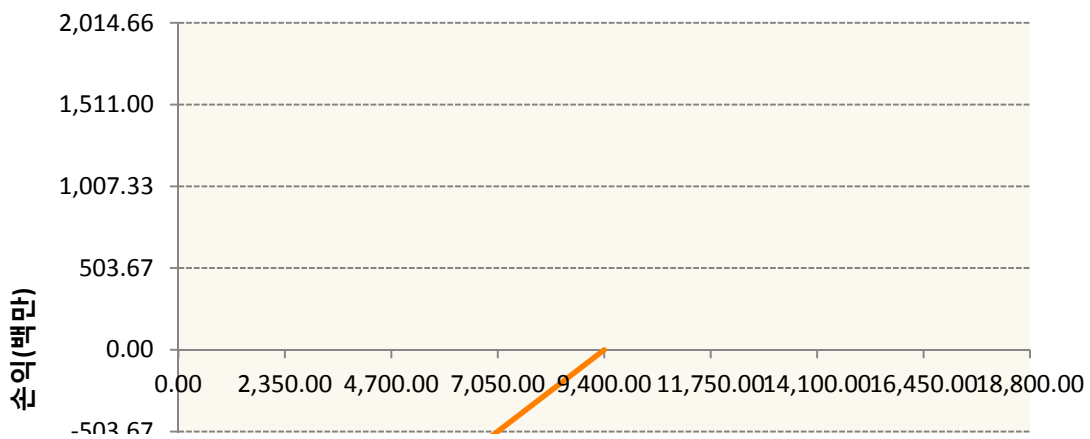


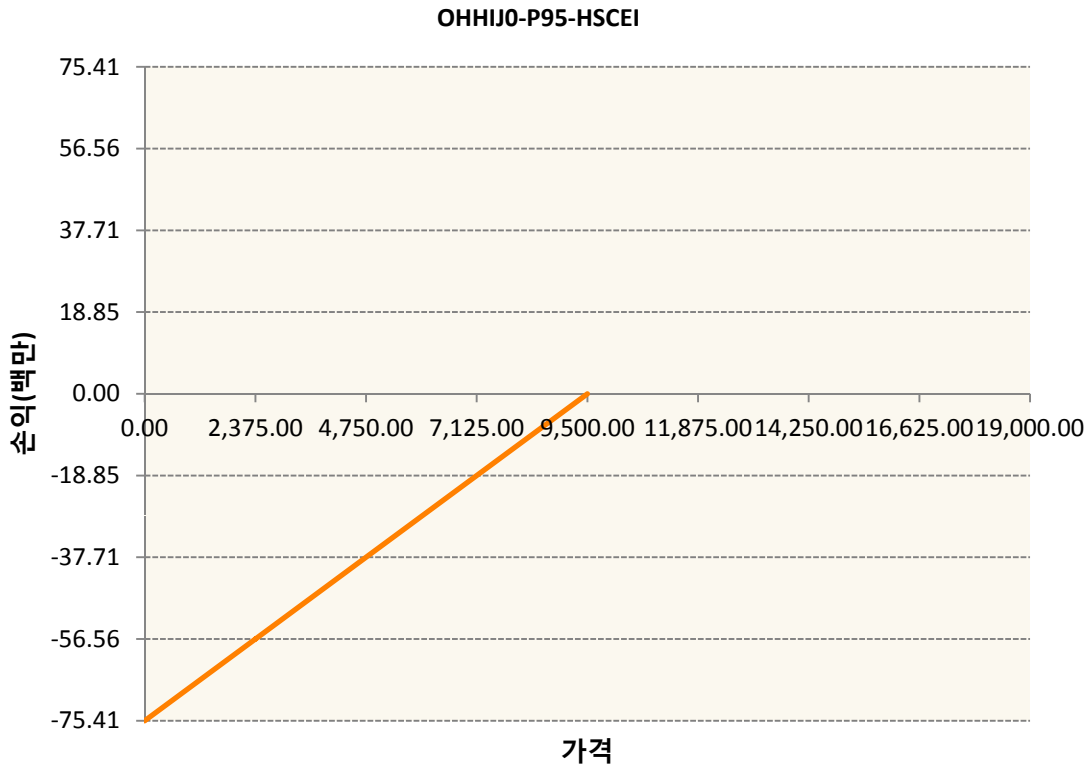


OHHIJO-C95-HSCEI



OHHIJO-P94-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E		179
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)
	607

공시일	2020-04-06
기준일	2020-04-03

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

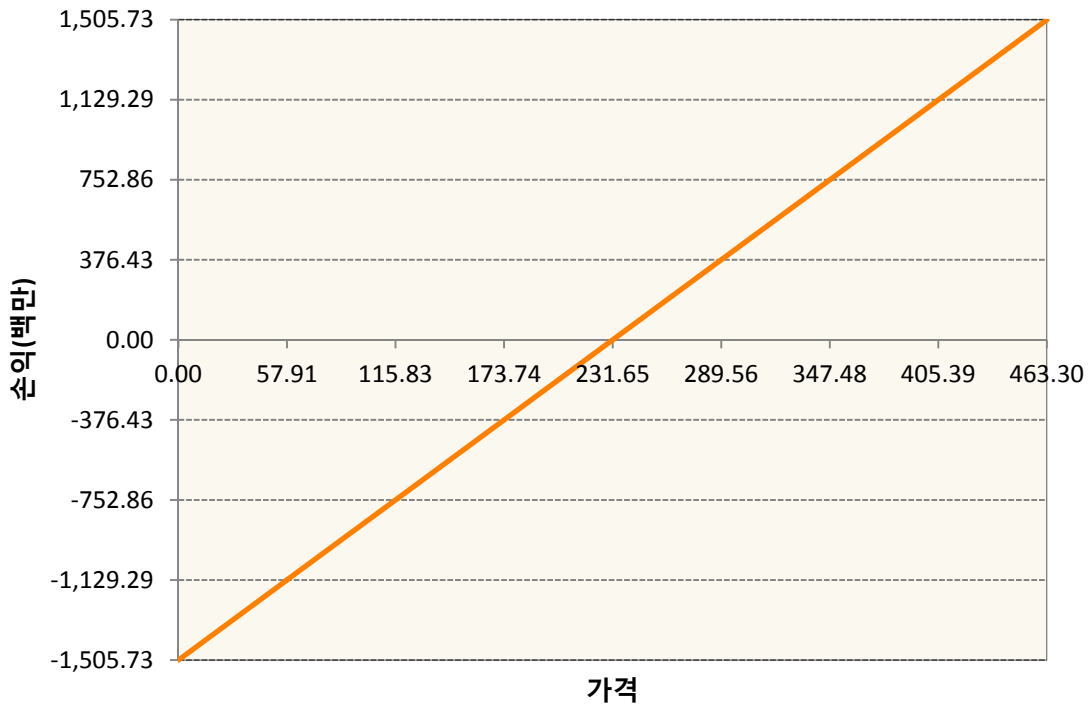
1. 계약금액

(단위:백만원)

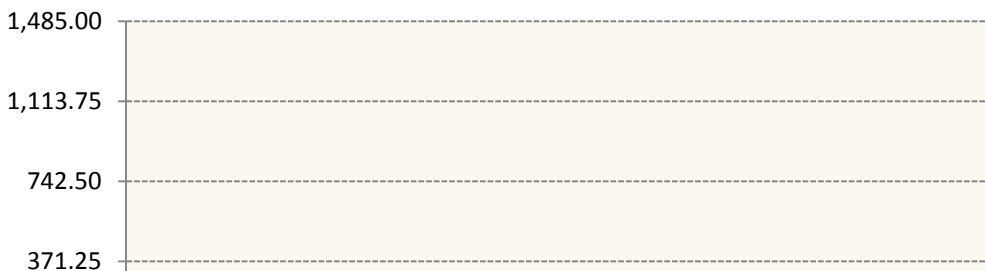
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,506	0	1,506	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,095	-3,095	장내

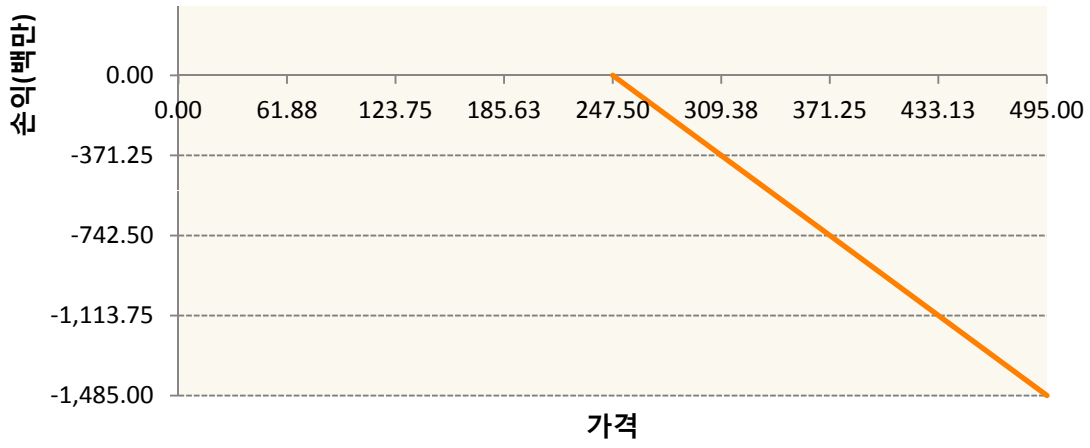
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

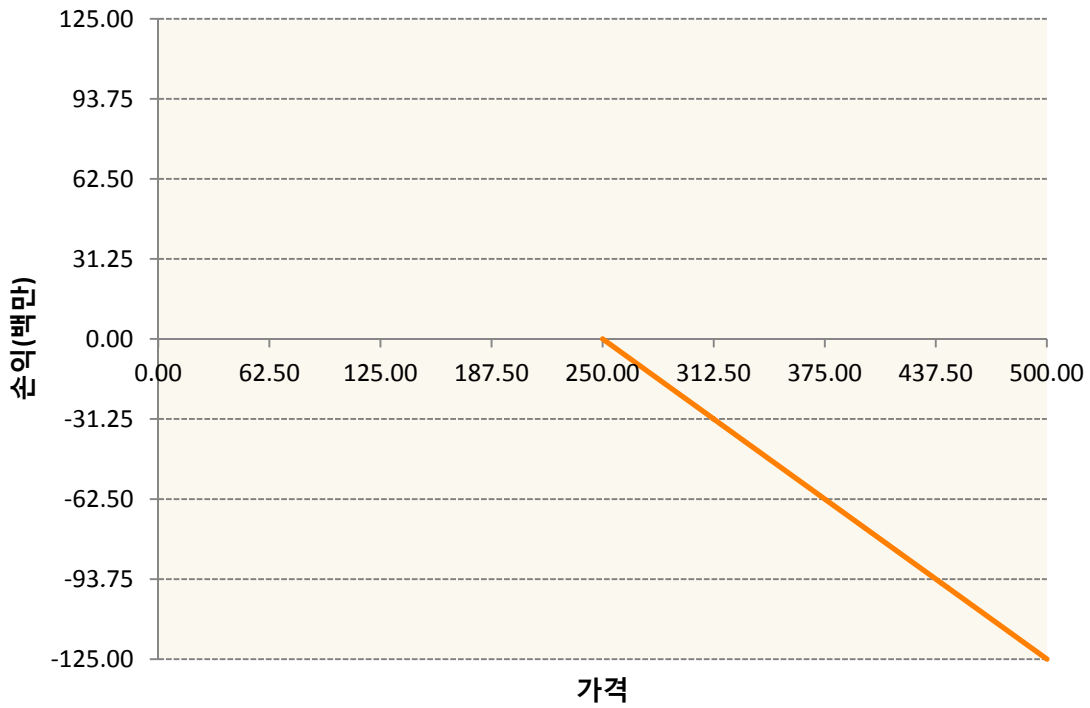


KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

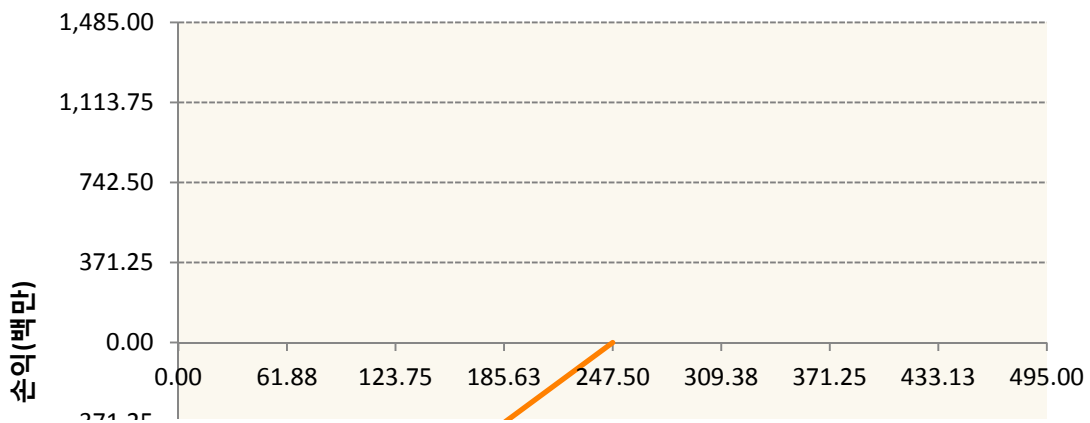




KR4201Q42503-2020-04 콜250



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						120
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120	
-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%	120	120	120	120	120	120	120	
KR4201Q42479		2020-04 콜247.5						53
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	11	11	10	10	9	9	8	
-5.33%	10	10	9	9	8	6	5	
-2.67%	9	8	7	6	4	2	0	
0%	6	4	2	0	-2	-5	-8	
2.67%	0	-3	-6	-9	-12	-16	-19	
5.33%	-12	-16	-19	-23	-27	-30	-34	
8.00%	-31	-35	-38	-42	-45	-49	-53	
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	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%	-1	-1	-1	-2	-2	-2	-3
8.00%	-2	-2	-3	-3	-3	-4	-4
KR4301Q42477 2020-04 풋247.5							105
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-103	-104	-104	-104	-104	-104	-105
-5.33%	-67	-67	-67	-68	-68	-69	-70
-2.67%	-30	-31	-32	-33	-34	-35	-37
0%	5	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	36	34	31	29	26	23	21
5.33%	62	59	56	53	50	47	43
8.00%	81	78	74	71	68	65	62

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

(단위:백만원)

509

공시일	2020-04-06
기준일	2020-04-03

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

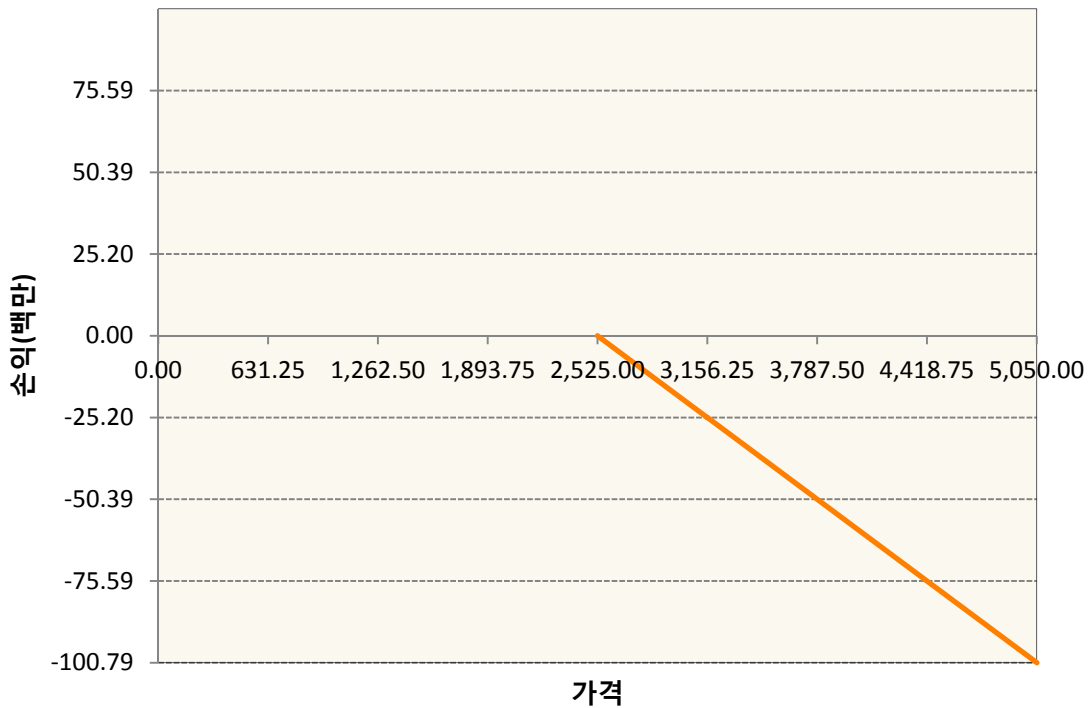
1. 계약금액

(단위:백만원)

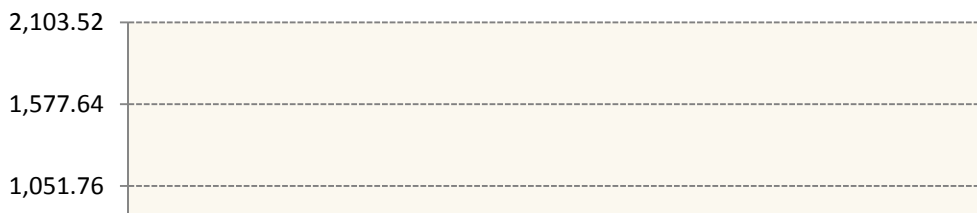
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	253	0	253	
누계	유가증권	스왑	7,557	0	7,557	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,443	-4,443	장내
누계	통화	선도	0	2,693	-2,693	장외

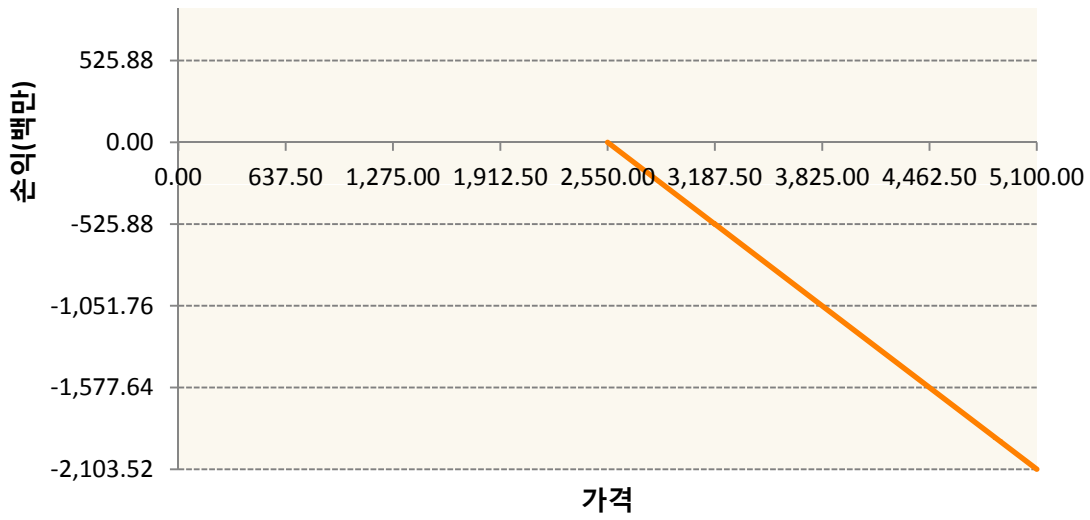
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ0-C2525-EURO STOXX 50

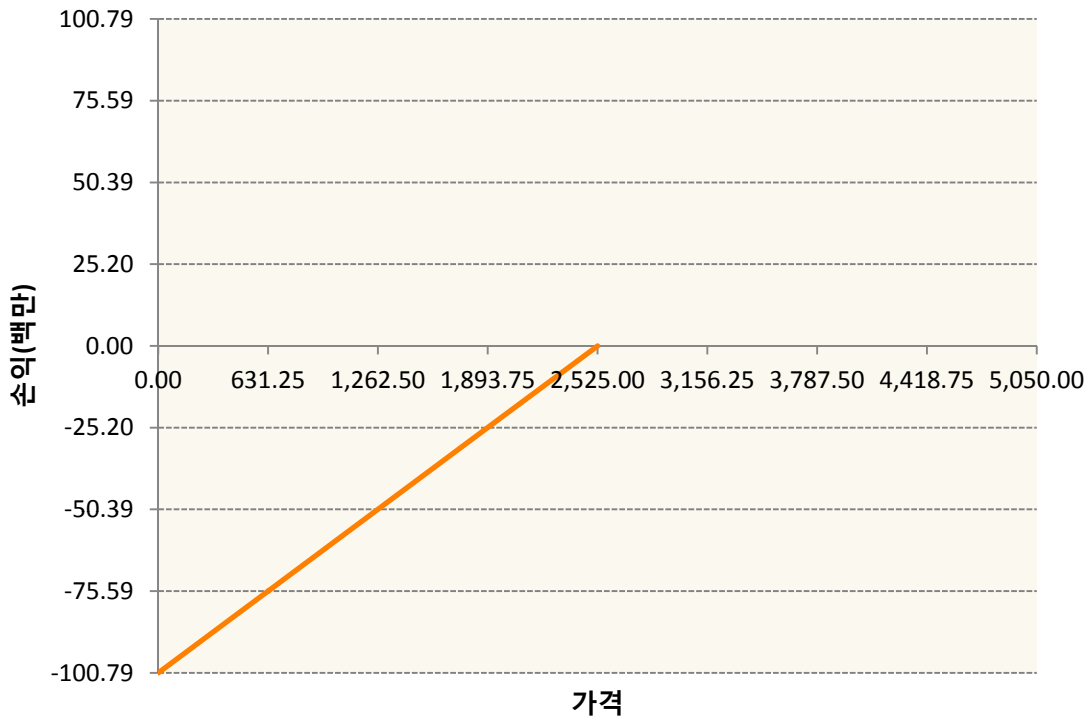


OESXJ0-C2550-EURO STOXX 50

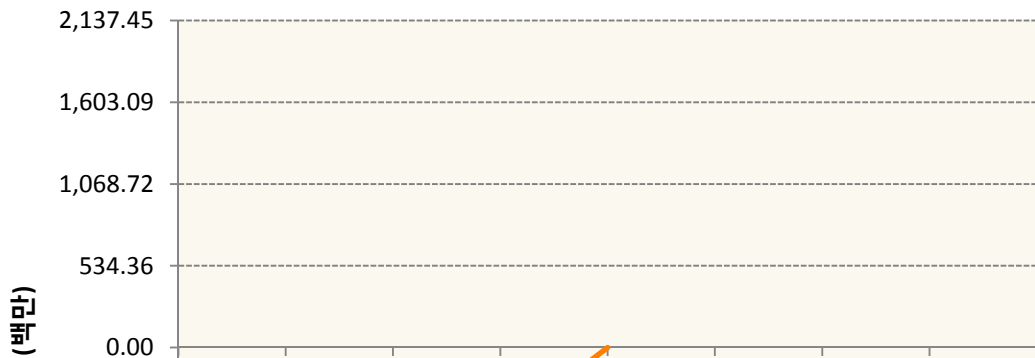


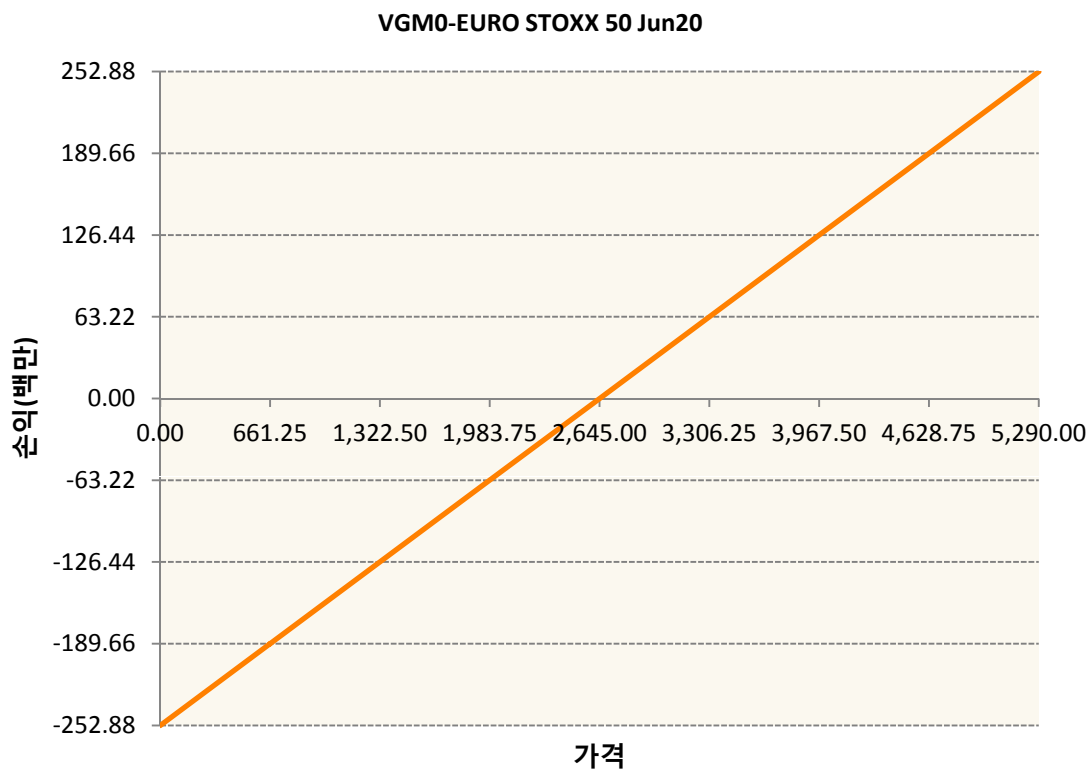
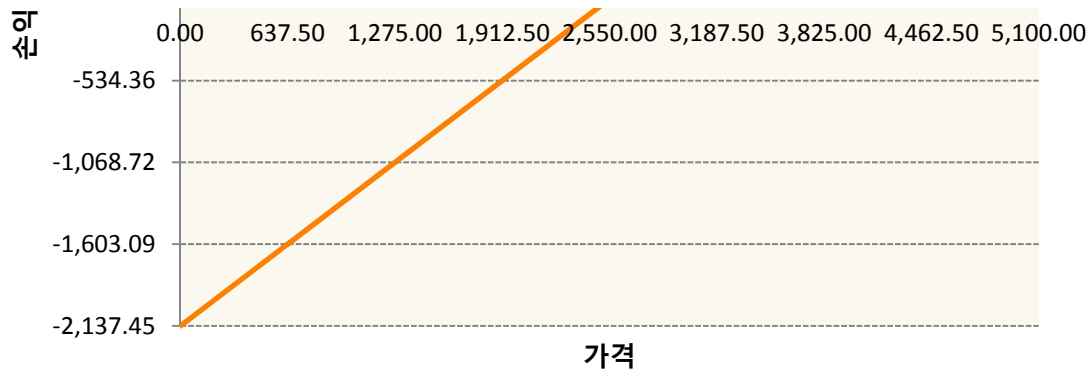


OESXJ0-P2525-EURO STOXX 50



OESXJ0-P2550-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	18
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E	215
OESXJ0-C25: EURO STOXX 50	8
OESXJ0-C25: EURO STOXX 50	168
OESXJ0-P25: EURO STOXX 50	8
OESXJ0-P25! EURO STOXX 50	171
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20	20

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

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

(단위:백만원)

995

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

(단위:백만원)

86

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

(단위:백만원)

126

공시일	2020-04-06
기준일	2020-04-03

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

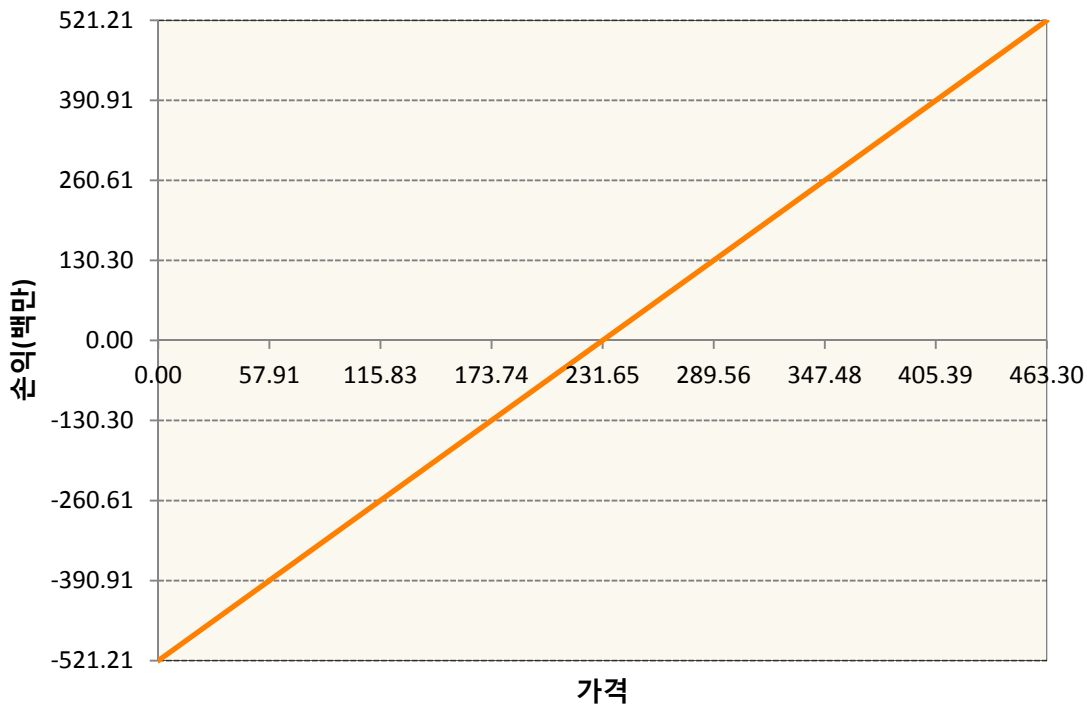
1. 계약금액

(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	2020-04-06
기준일	2020-04-03

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

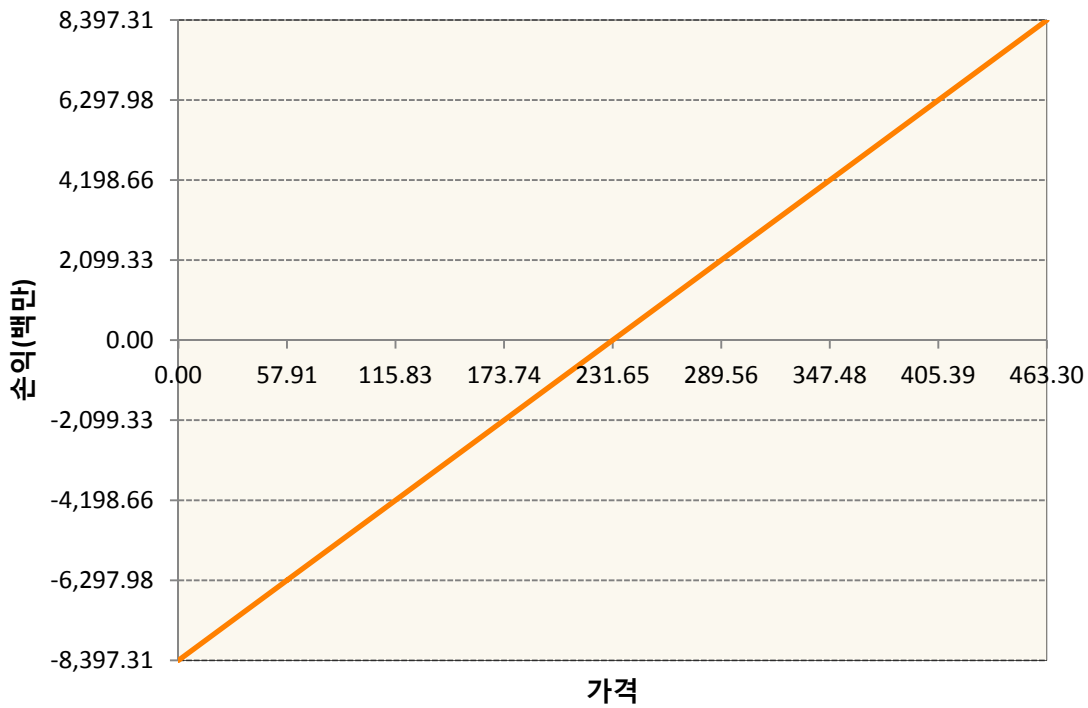
1. 계약금액

(단위:백만원)

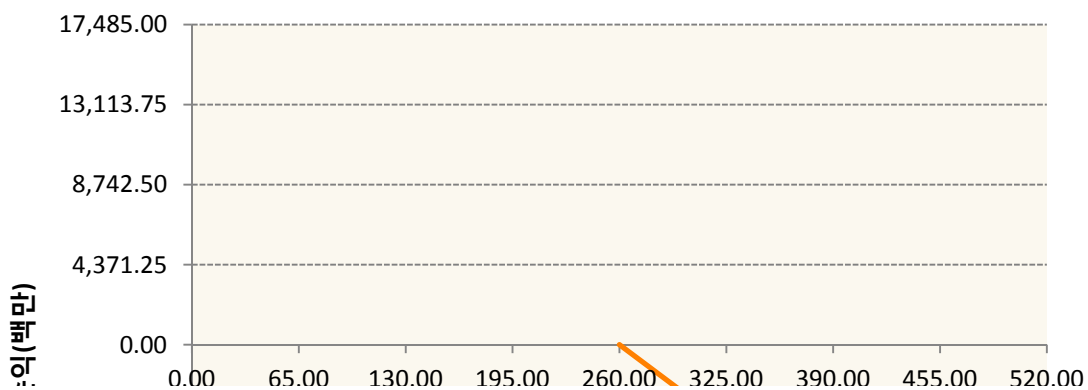
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,397	0	8,397	장내
누계	유가증권	옵션	6,004	17,485	-11,481	장내

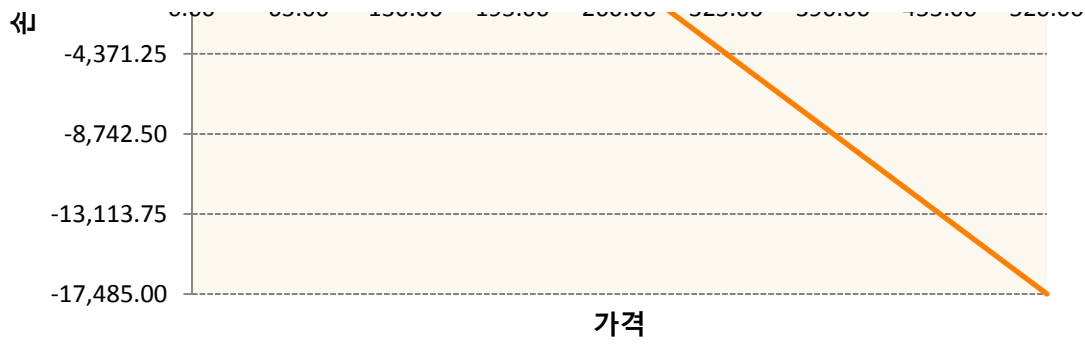
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

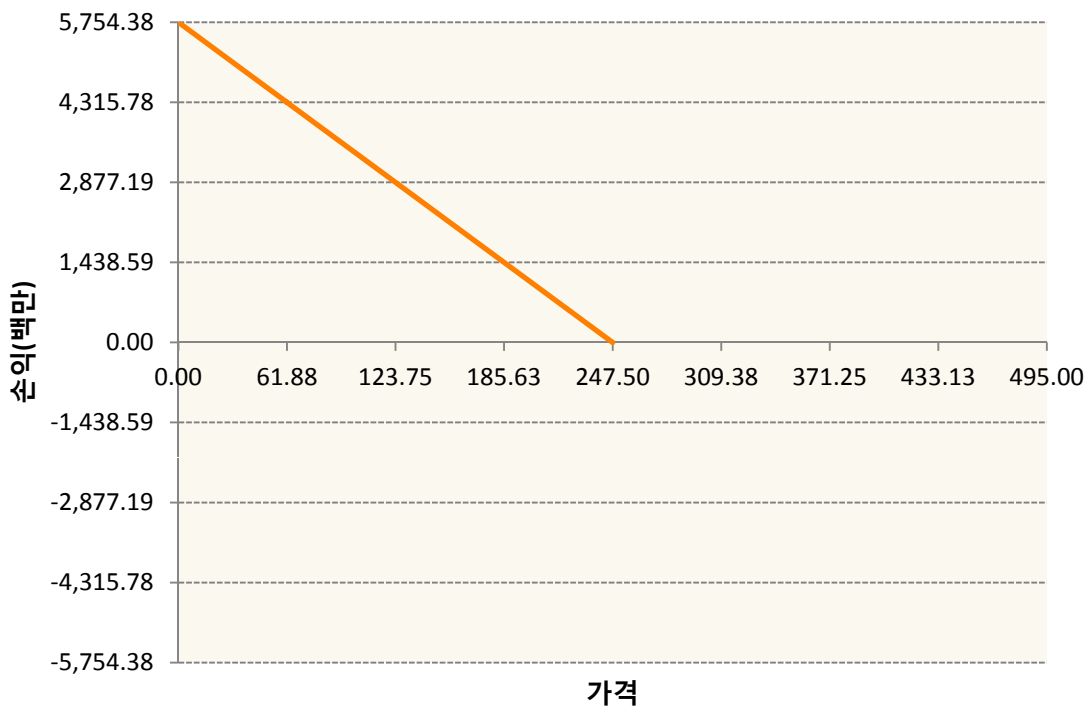


KR4201Q42602-2020-04 콜260

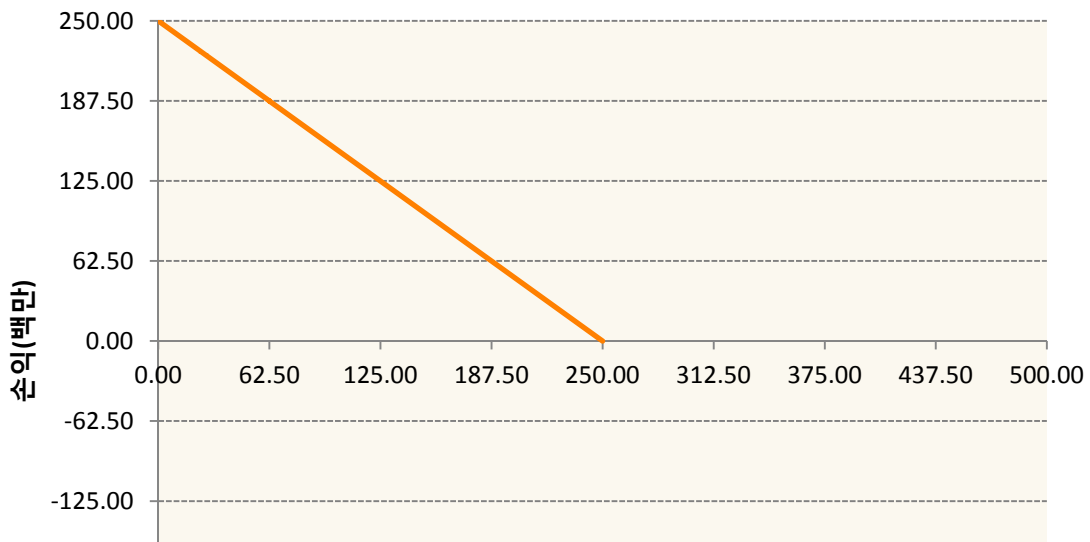


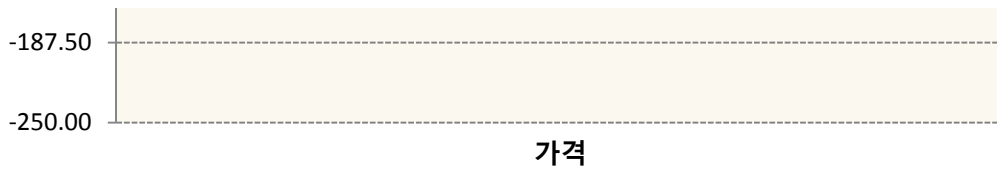


KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



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						326
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	31	31	31	30	28	26	23	
-5.33%	31	30	29	27	23	18	12	
-2.67%	30	28	24	19	11	2	-9	
0%	25	19	11	0	-13	-29	-46	
2.67%	10	-3	-19	-38	-59	-82	-107	
5.33%	-28	-51	-77	-105	-134	-165	-198	
8.00%	-106	-140	-176	-212	-249	-287	-326	
KR4301Q42477		2020-04 풋247.5						407
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	401	401	402	402	403	405	407	
-5.33%	258	259	260	262	264	267	271	
-2.67%	117	119	122	126	131	136	142	
0%	-19	-13	-7	0	8	16	24	
2.67%	-141	-132	-122	-112	-102	-91	-80	
5.33%	-241	-229	-217	-205	-193	-180	-168	
8.00%	-313	-301	-289	-276	-264	-251	-239	
KR4301Q42501		2020-04 풋250						18
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	18	18	18	18	18	18	18	
-5.33%	11	11	11	12	12	12	12	
-2.67%	5	5	5	6	6	6	6	

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

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

(단위:백만원)

1,506

공시일	2020-04-06
기준일	2020-04-03

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	147,002	0	147,002	

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	2020-04-06
기준일	2020-04-03

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	99,119	0	99,119	

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	2020-04-06
기준일	2020-04-03

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	437,928	0	437,928	
누계	통화	선도	72,008	532,857	-460,849	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,659
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,387
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,969
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,939
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,304
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,969
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,462
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	2,403
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	985
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	985
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,560
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	847
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	739
FX21020H09 USD/KRW 24-04-20E	739
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	492
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,447
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,992
FX21020H11 KRW/USD 11-05-20E	985
FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E	2,954
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	2020-04-06
기준일	2020-04-03

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

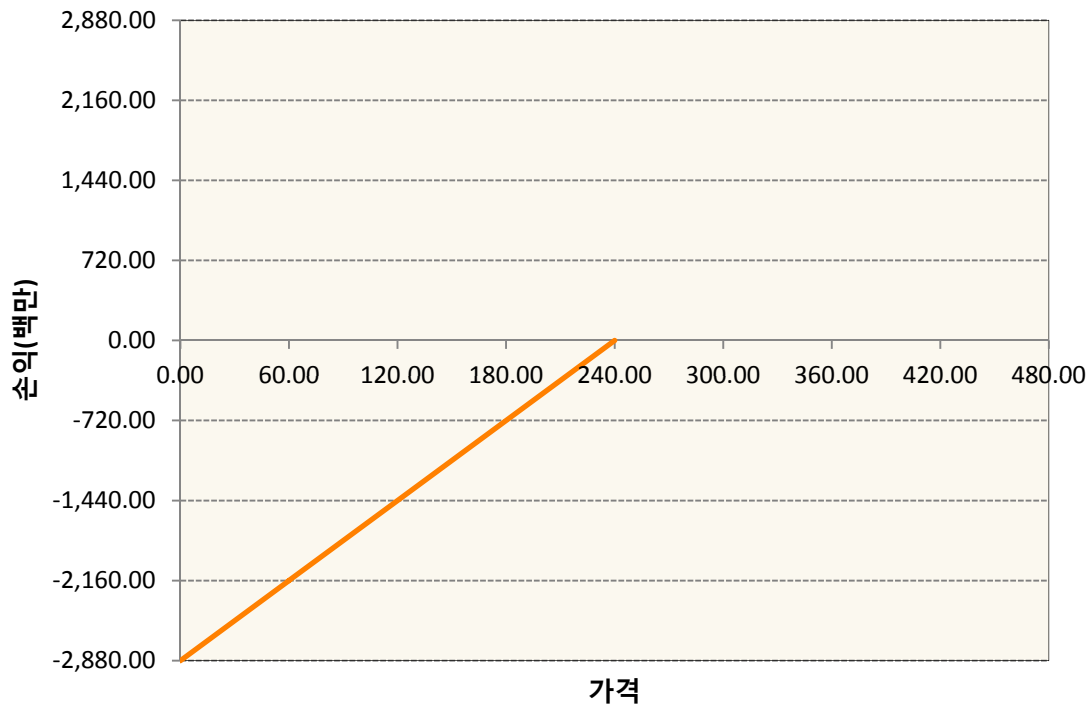
1. 계약금액

(단위:백만원)

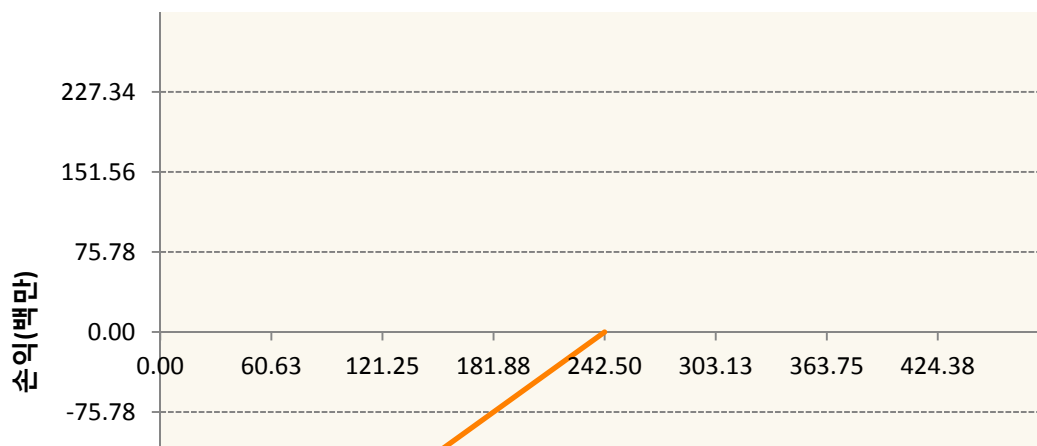
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,183	-3,183	장내

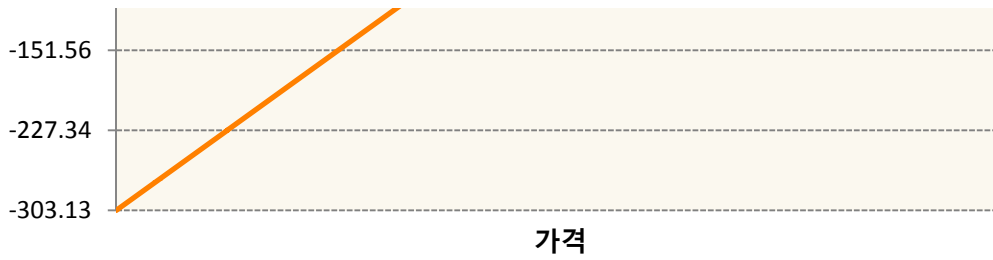
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q42402-2020-04 풋240



KR4301Q42428-2020-04 풋242.5





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q42402		2020-04 풋240						195
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-188	-189	-189	-190	-192	-193	-195	
-5.33%	-116	-117	-119	-121	-123	-126	-129	
-2.67%	-46	-49	-53	-56	-60	-65	-69	
0%	15	10	5	0	-5	-11	-16	
2.67%	64	58	52	46	40	34	27	
5.33%	99	93	86	80	74	68	62	
8.00%	119	114	109	104	99	93	88	
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	-21	-21	-21	-21	
-5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-14	-14	
-2.67%	-5	-6	-6	-6	-7	-7	-7	
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2	
2.67%	7	6	6	5	5	4	3	
5.33%	11	11	10	9	9	8	7	
8.00%	14	13	13	12	12	11	10	

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

222

공시일	2020-04-06
기준일	2020-04-03

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	7,219	0	7,219	
누계	통화	선도	443	7,644	-7,201	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)

318

공시일	2020-04-06
기준일	2020-04-03

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

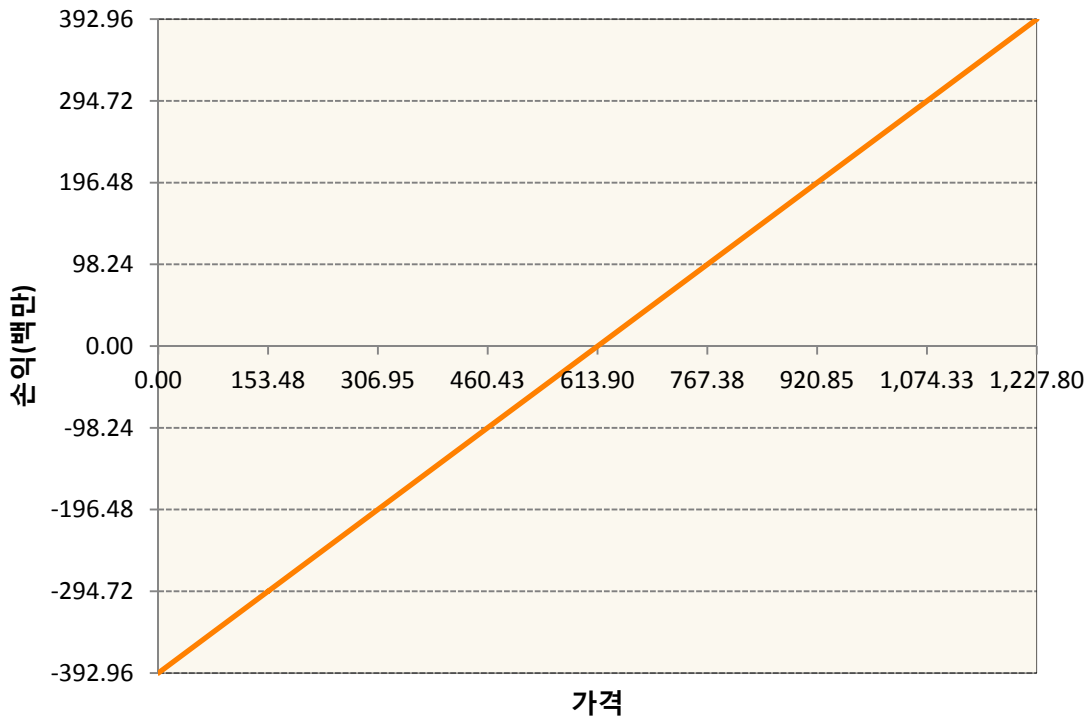
1. 계약금액

(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	393	0	393	
누계	유가증권	스왑	1,098	0	1,098	장외
누계	통화	선도	232	293	-61	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
31

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

(단위:백만원)

126

공시일	2020-04-06
기준일	2020-04-03

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

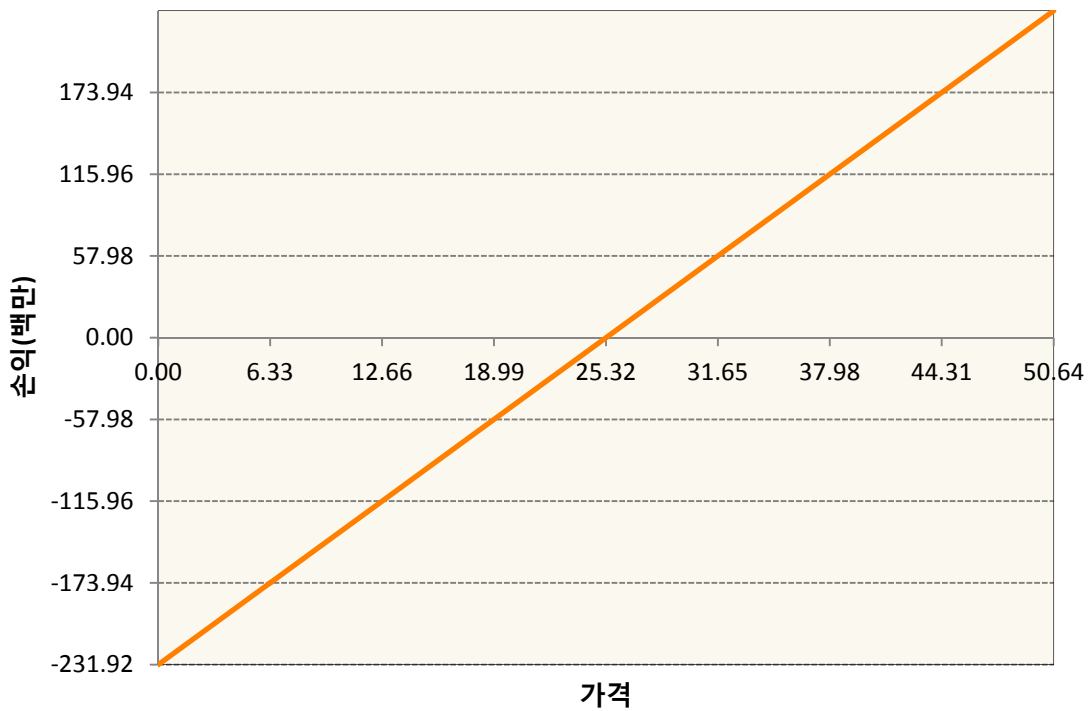
1. 계약금액

(단위:백만원)

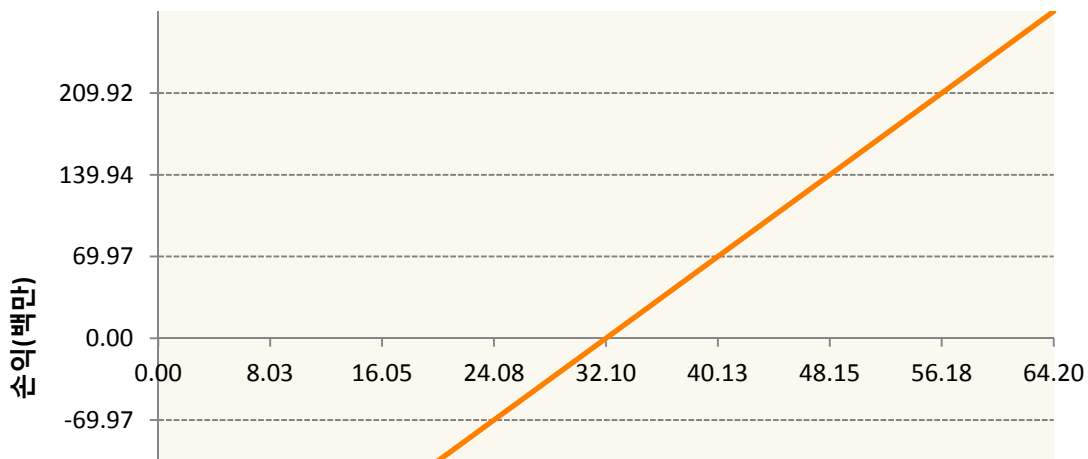
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,278	123	1,155	

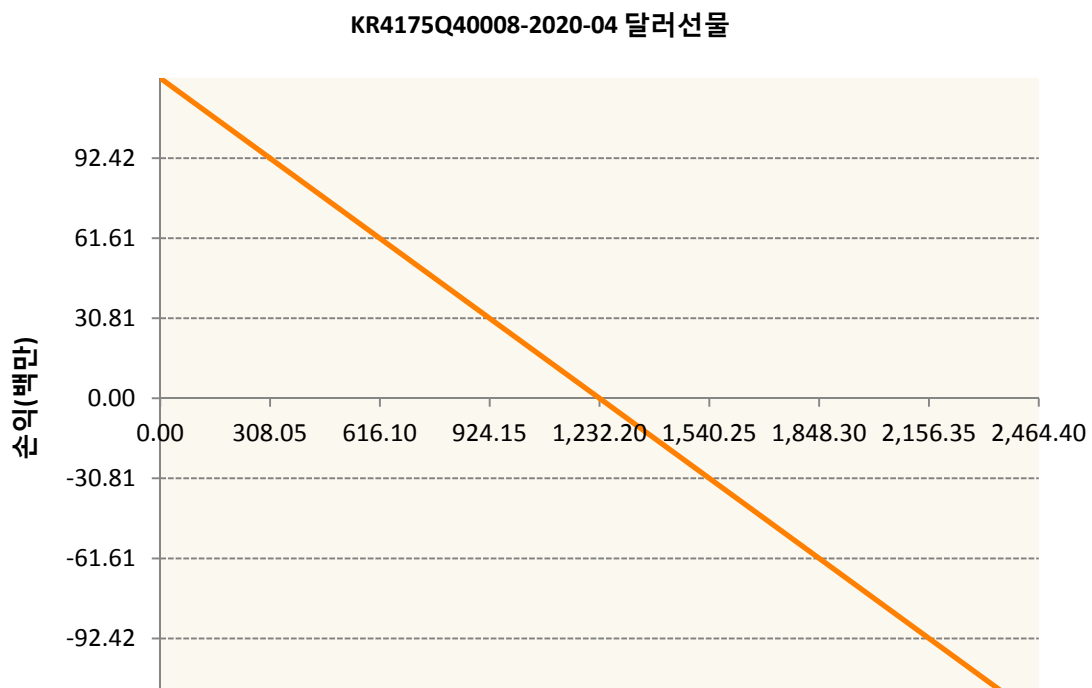
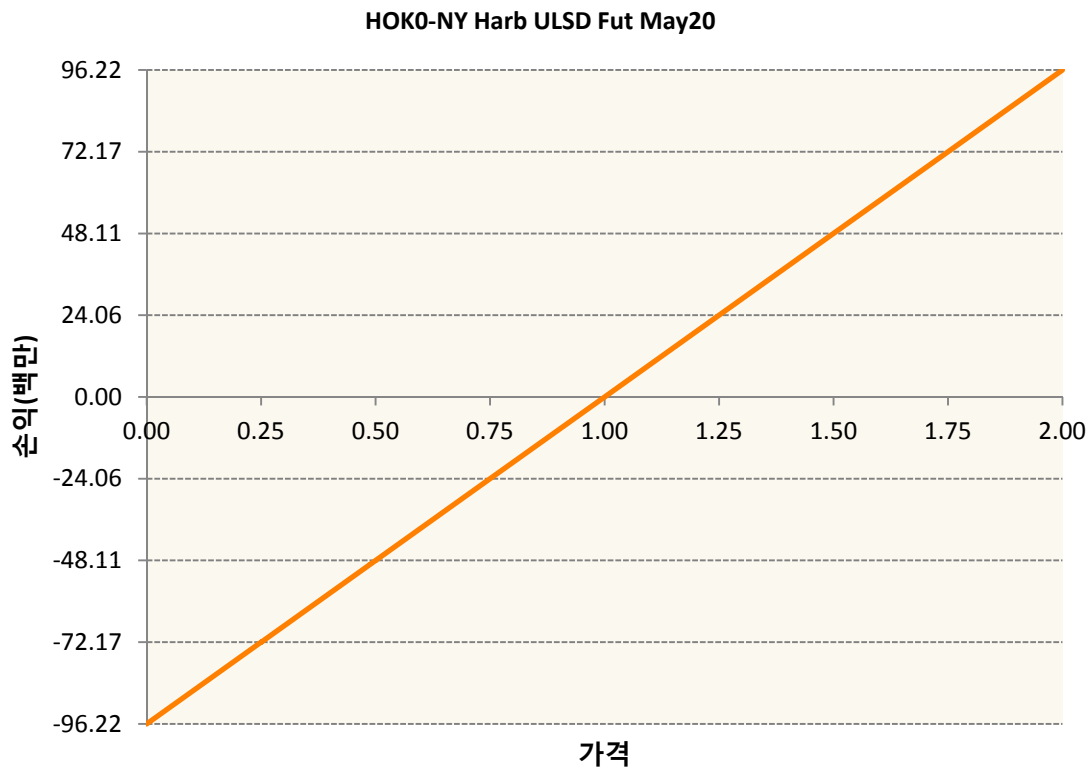
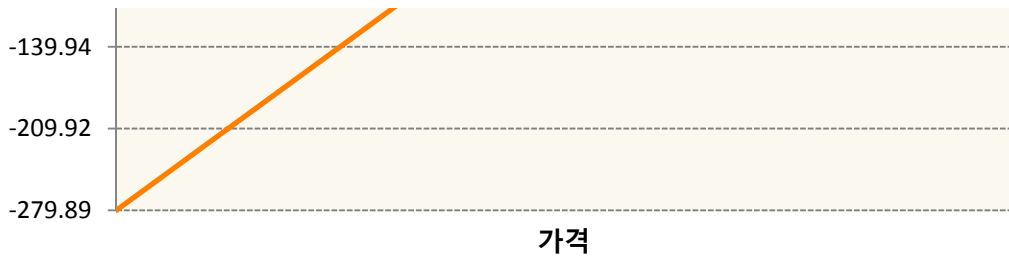
2. 만기시점의 손익구조

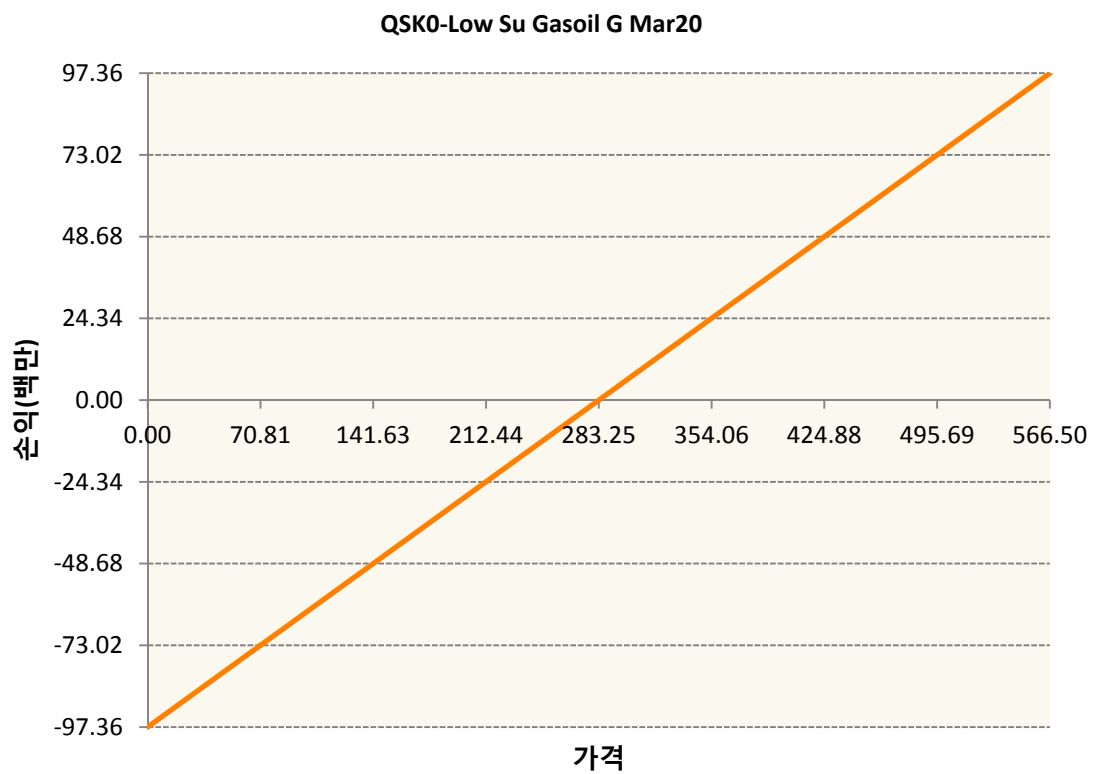
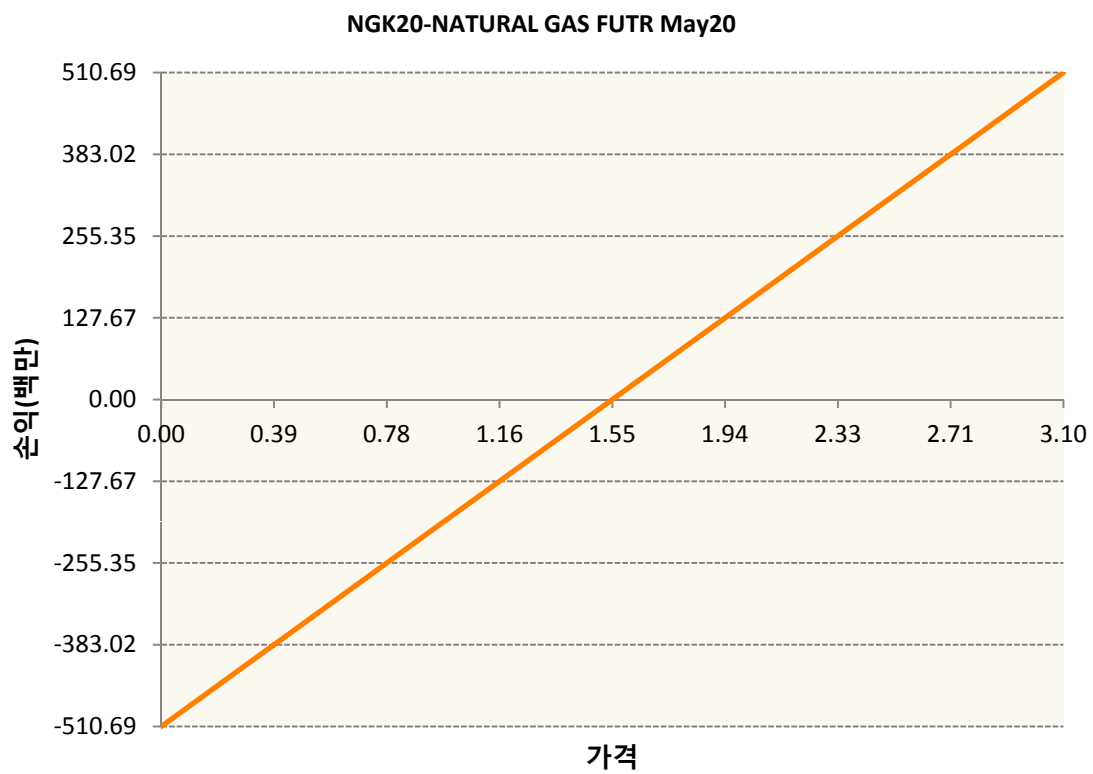
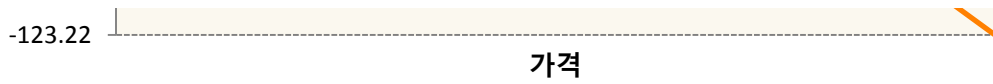
CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20



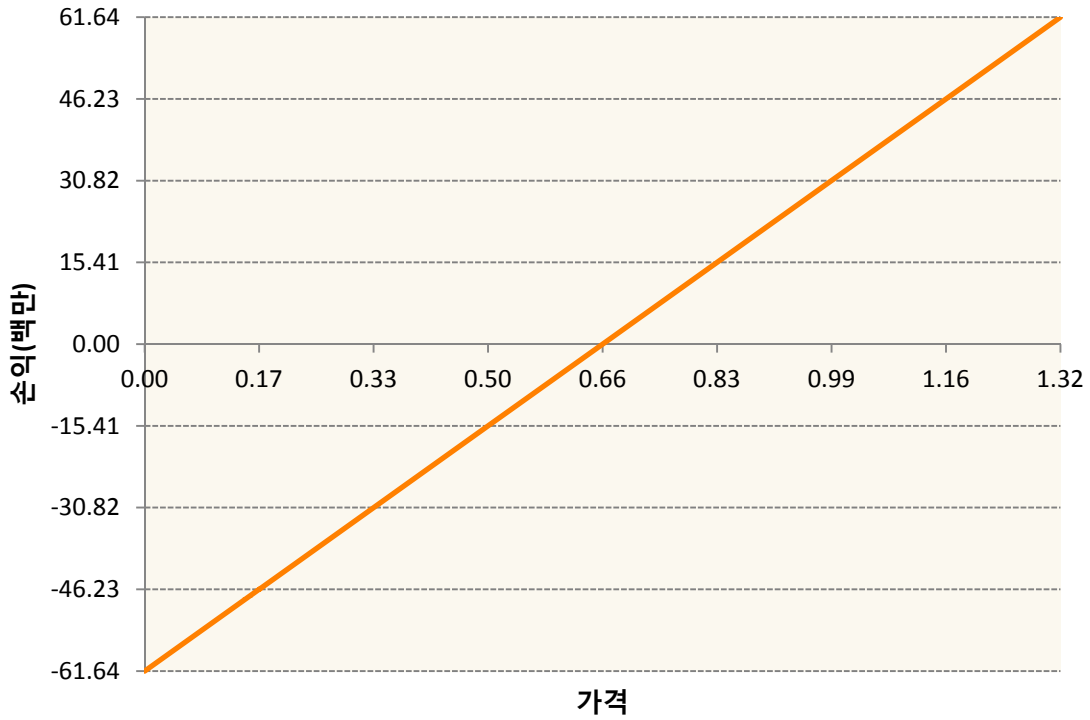
CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20







XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	19
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	22
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	8
KR4175Q40C	2020-04 달러선물	10
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	41
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	8
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	5

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

(단위:백만원)

300

공시일	2020-04-06
기준일	2020-04-03

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

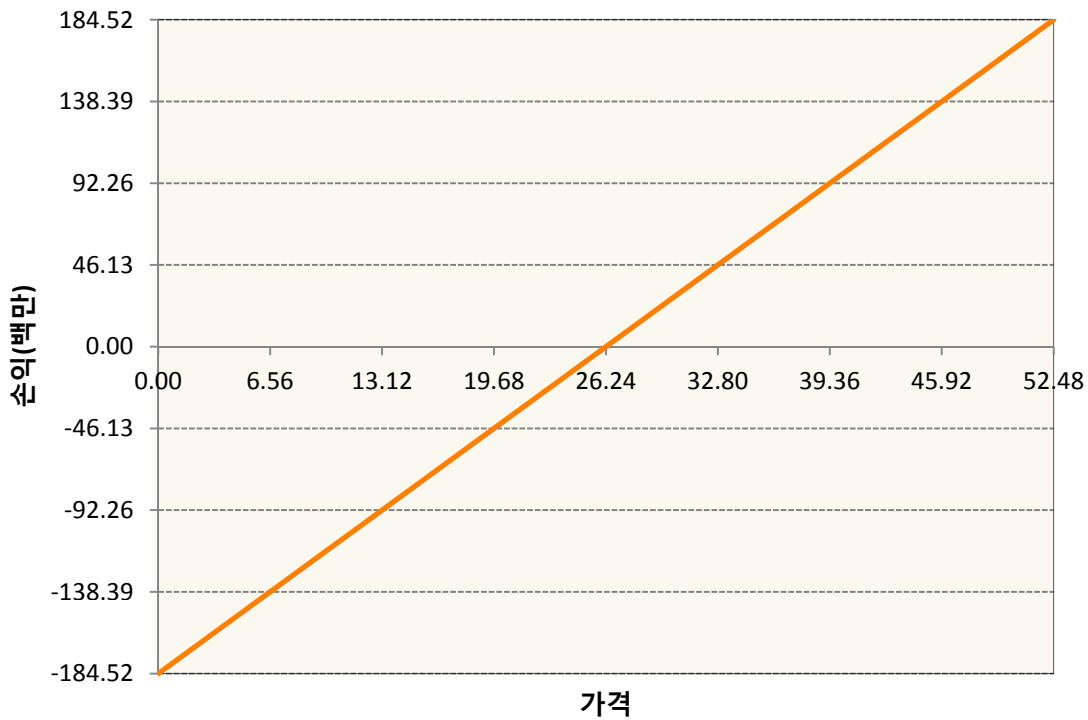
1. 계약금액

(단위:백만원)

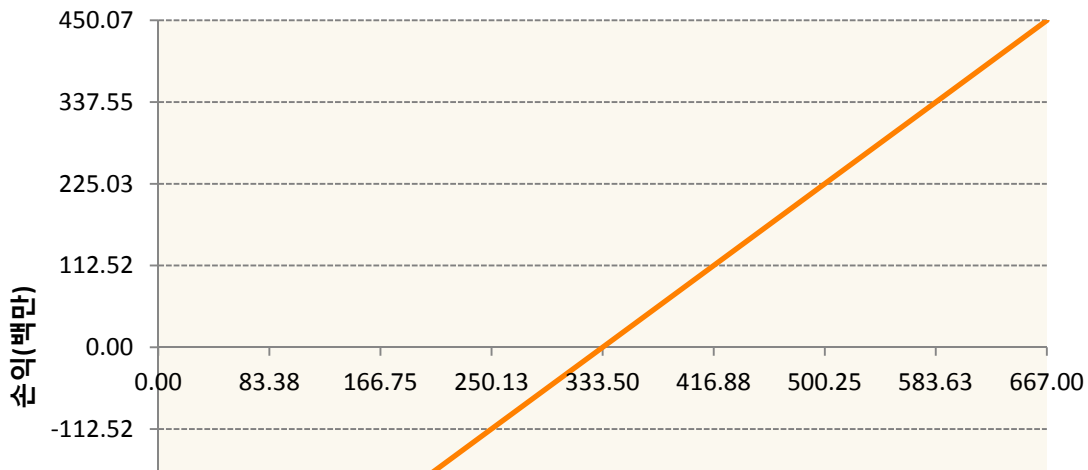
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,276	99	2,178	

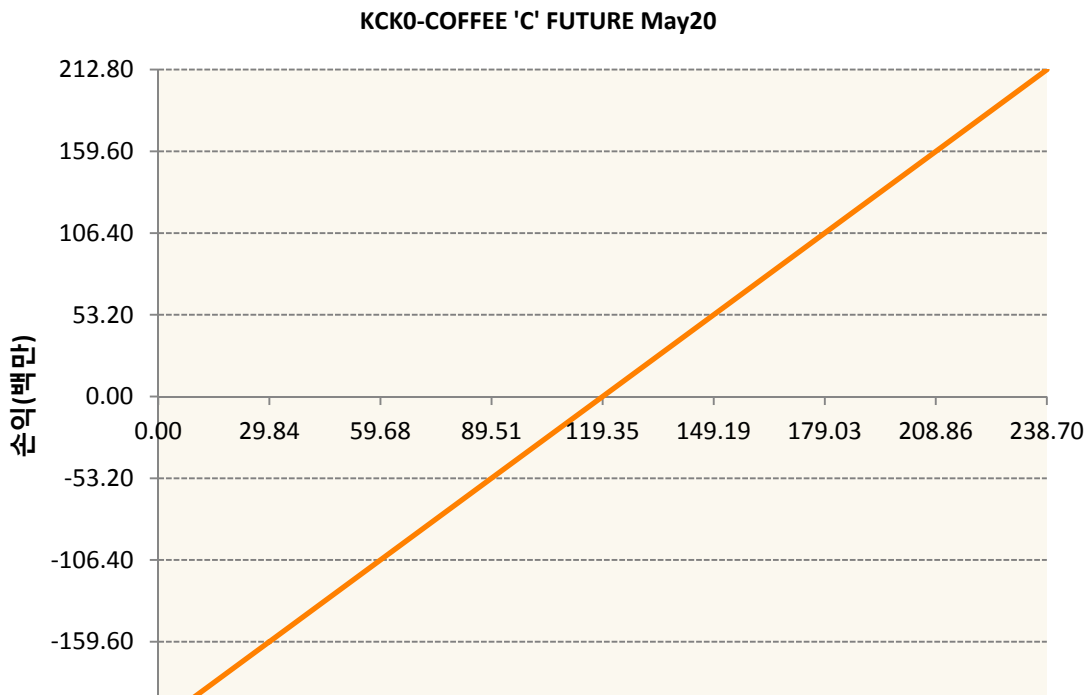
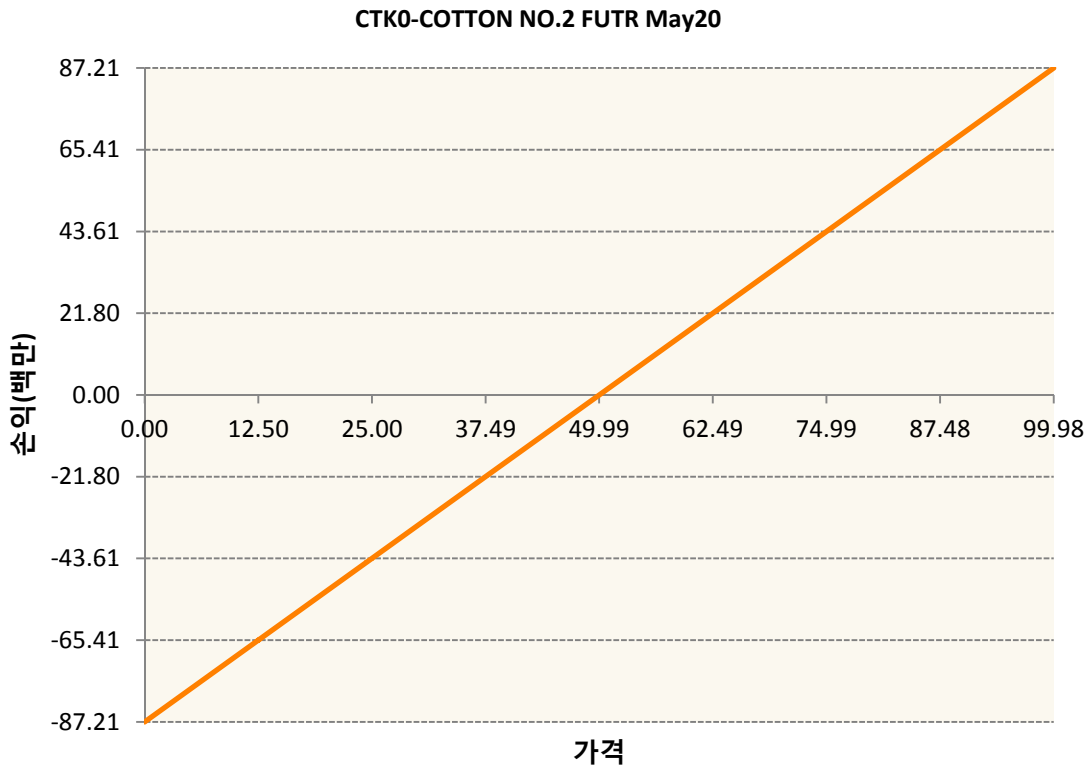
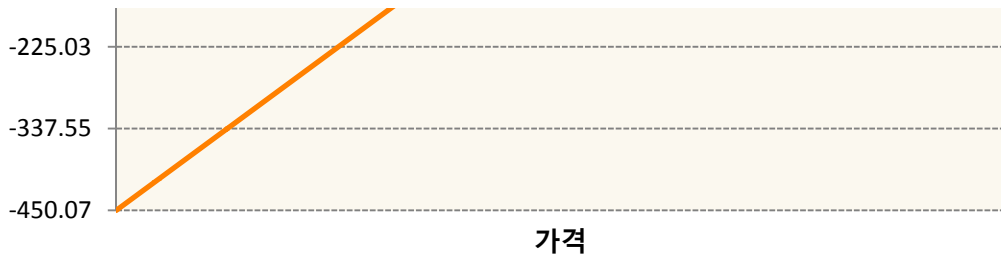
2. 만기시점의 손익구조

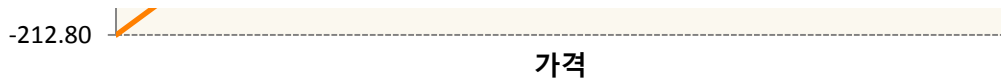
BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20



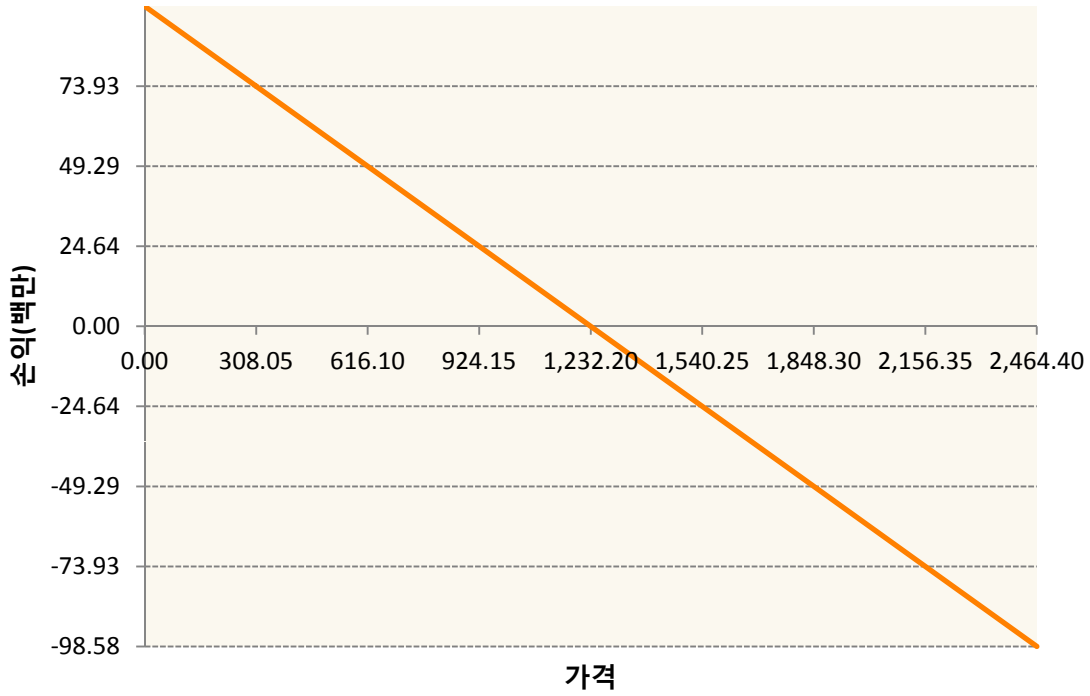
CK0-CORN FUTURE May20



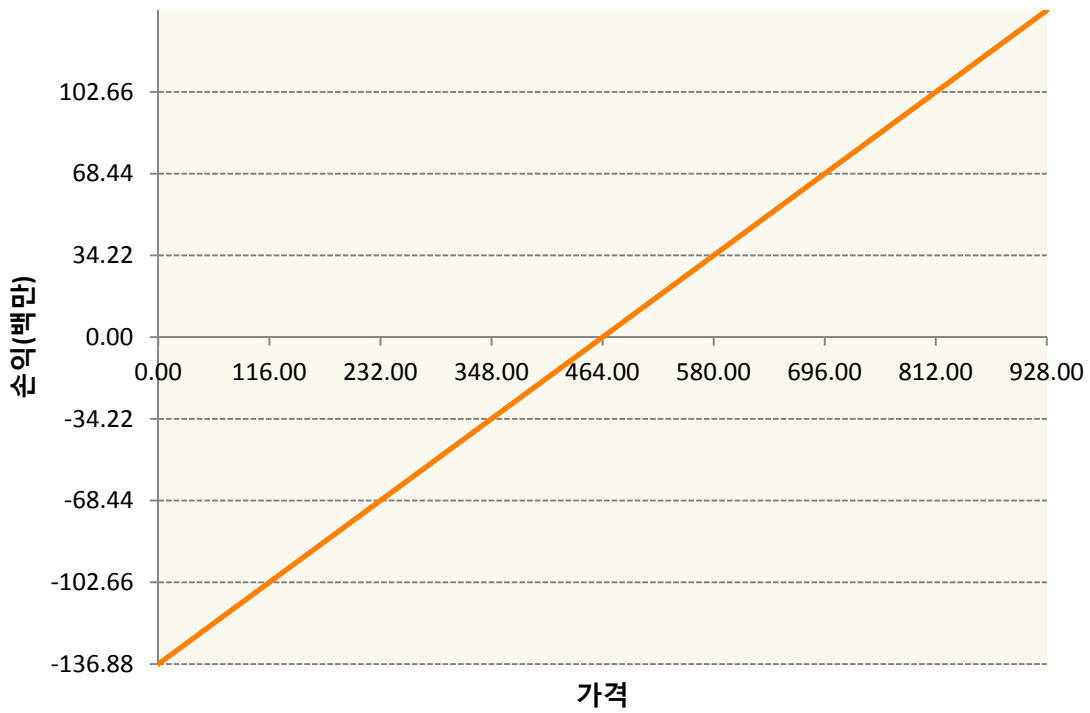




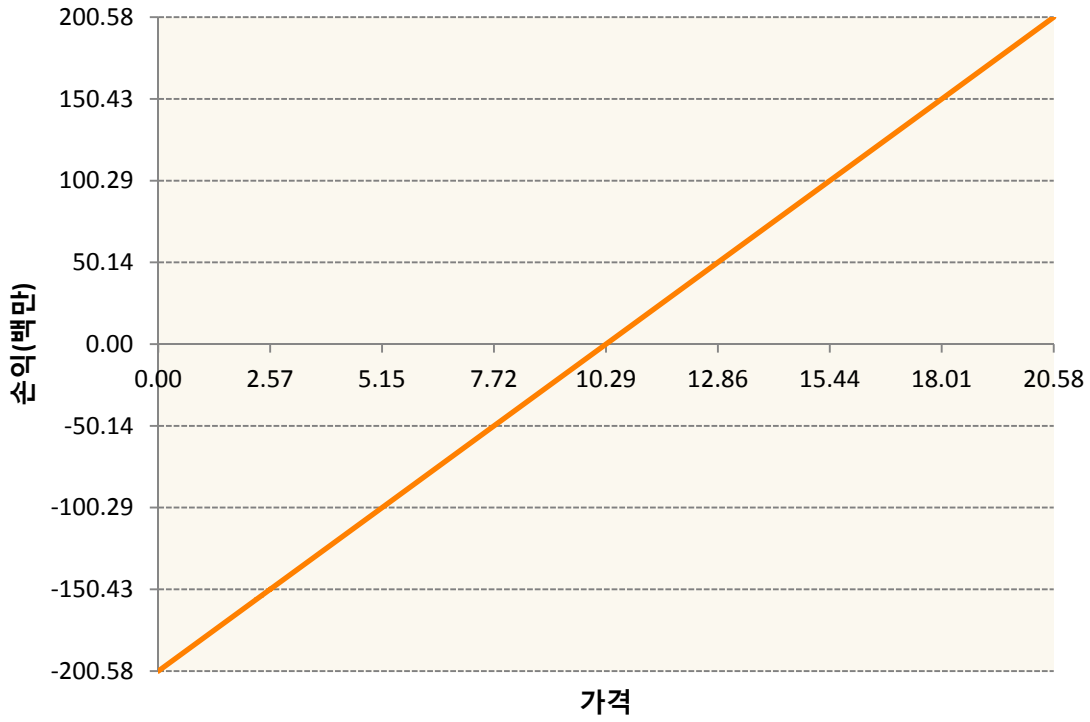
KR4175Q40008-2020-04 달러선물



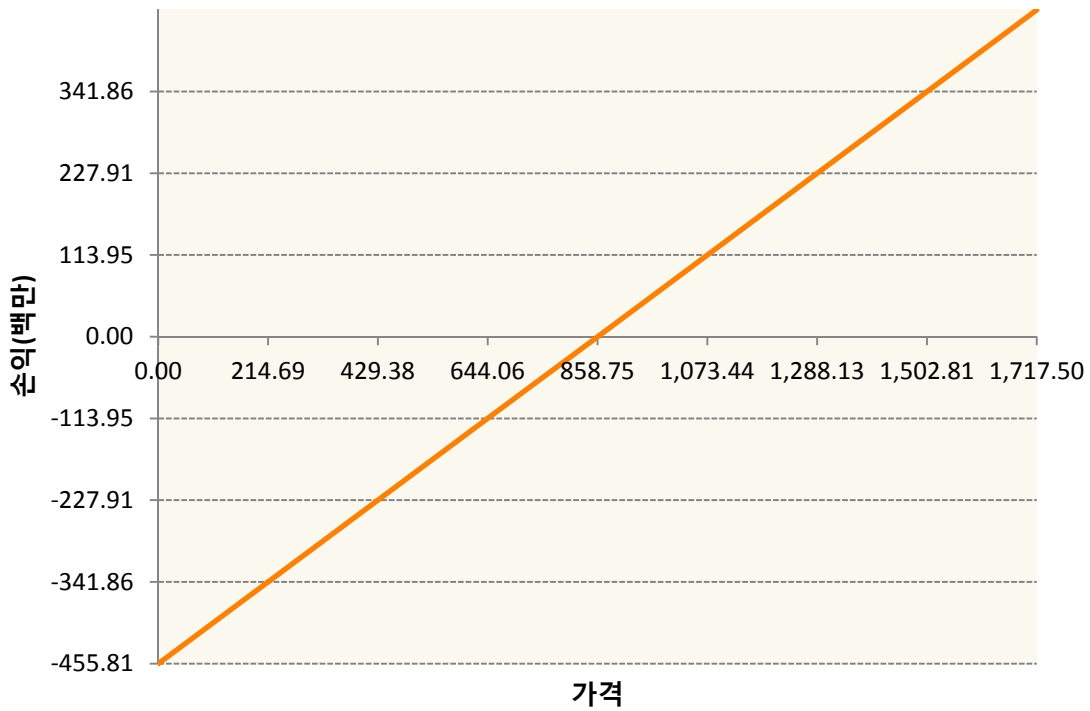
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



SBK0-Sugar May20

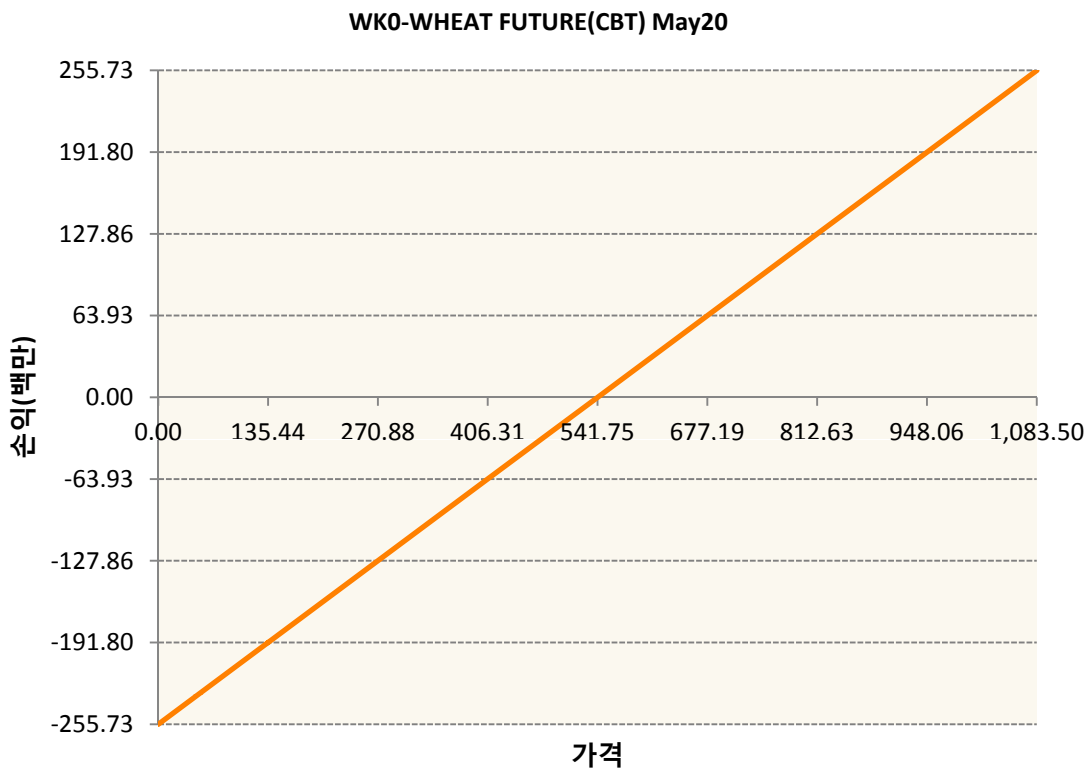
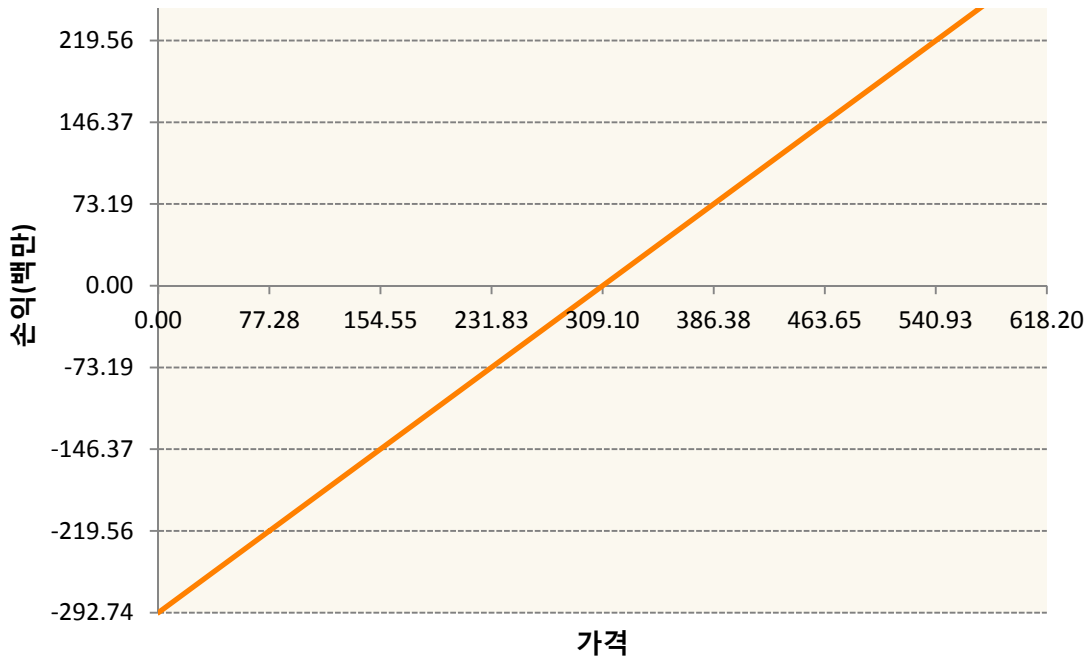


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	15
CK0	CORN FUTURE May20	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	36
SMK0	SOYBEAN MEAL FUTR May20	23
WK0	WHEAT FUTURE(CBT) May20	20

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

(단위:백만원)

212