

공시일	2020-04-07
기준일	2020-04-06

## 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	2020-04-07
기준일	2020-04-06

## 스마트인덱스모

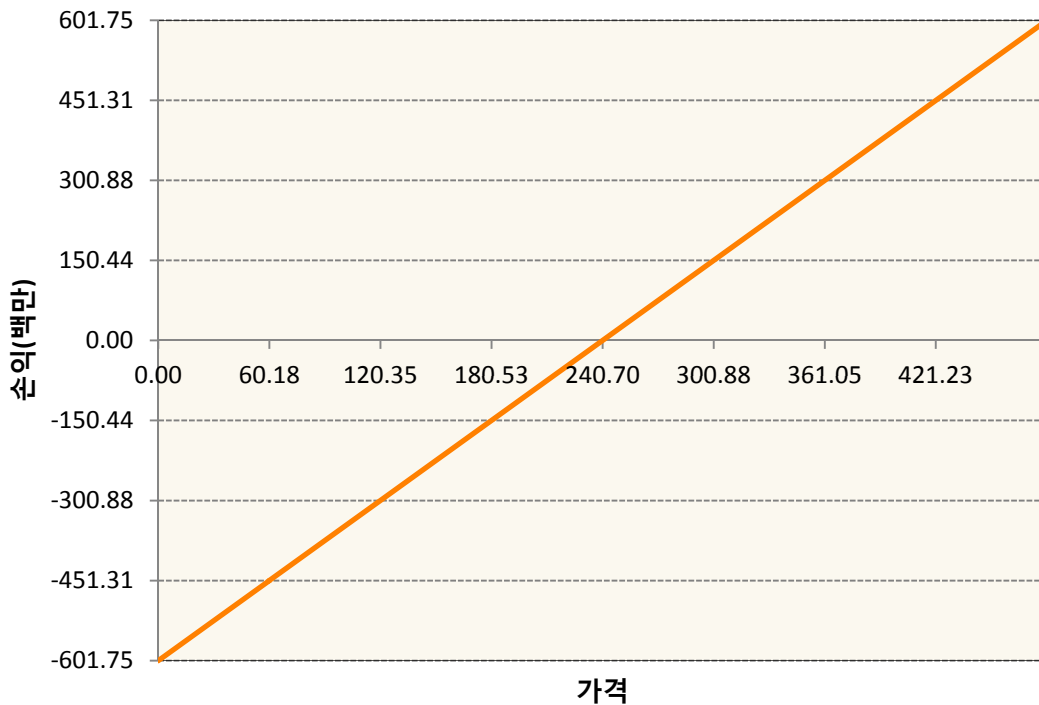
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

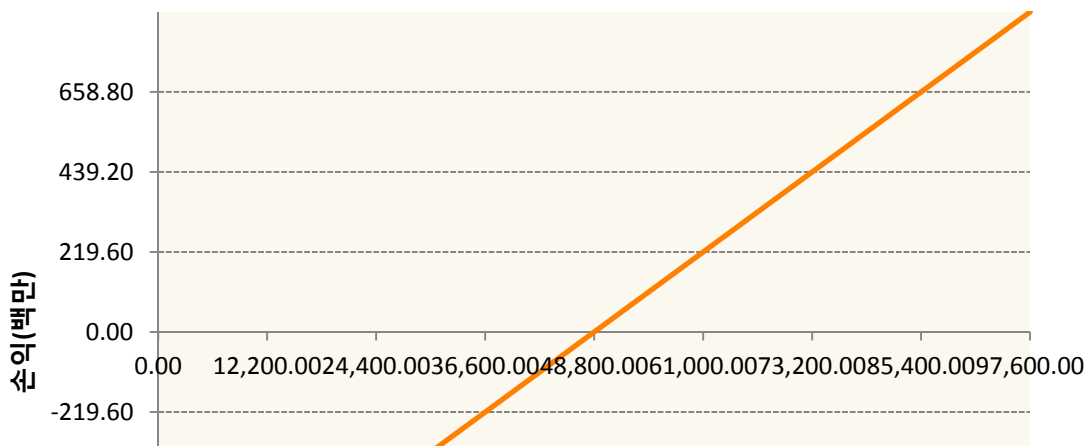
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,480	0	1,480	장내

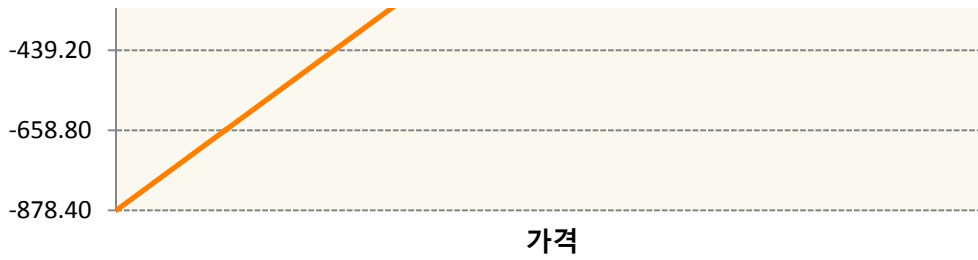
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



KR4111Q40003-2020-04 삼성전자개별선물





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						48
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48	
-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%	48	48	48	48	48	48	48	
KR4111Q40003		2020-04 삼성전자개별선물						70
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70	
-5.33%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47	
-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%	47	47	47	47	47	47	47	
8.00%	70	70	70	70	70	70	70	

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

**173**

공시일	2020-04-07
기준일	2020-04-06

## 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

853

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

959

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-07
기준일	2020-04-06

## 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

529
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

830
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-07
기준일	2020-04-06

## 유로인덱스모(주식-파생형)

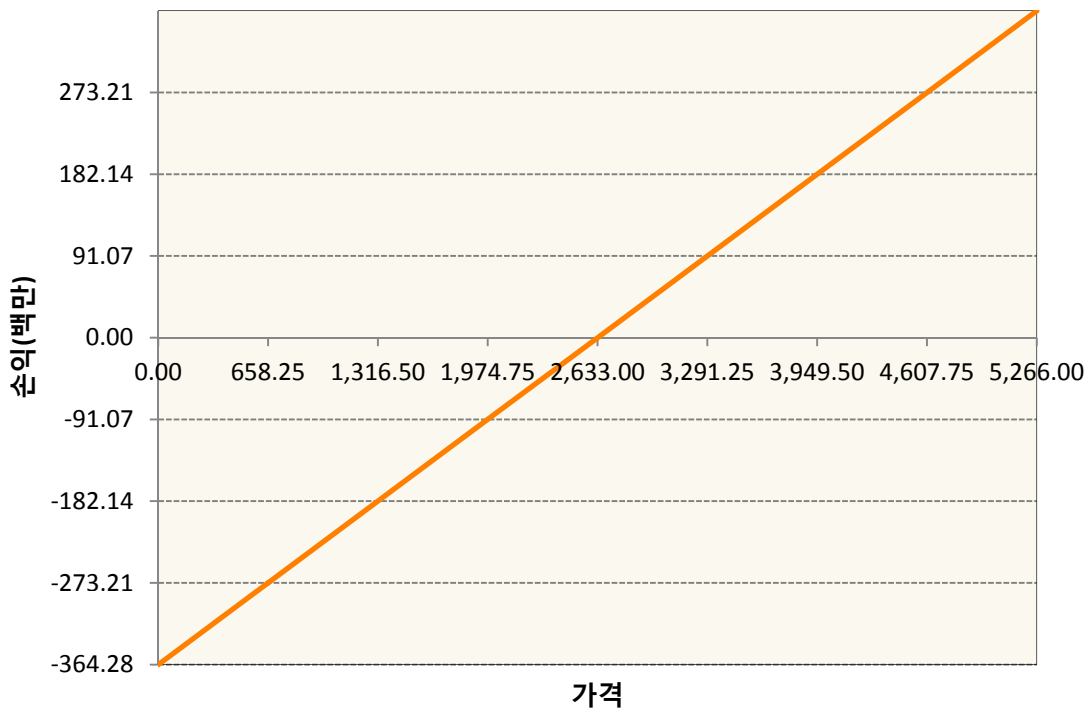
### 1. 계약금액

(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	2020-04-07
기준일	2020-04-06

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

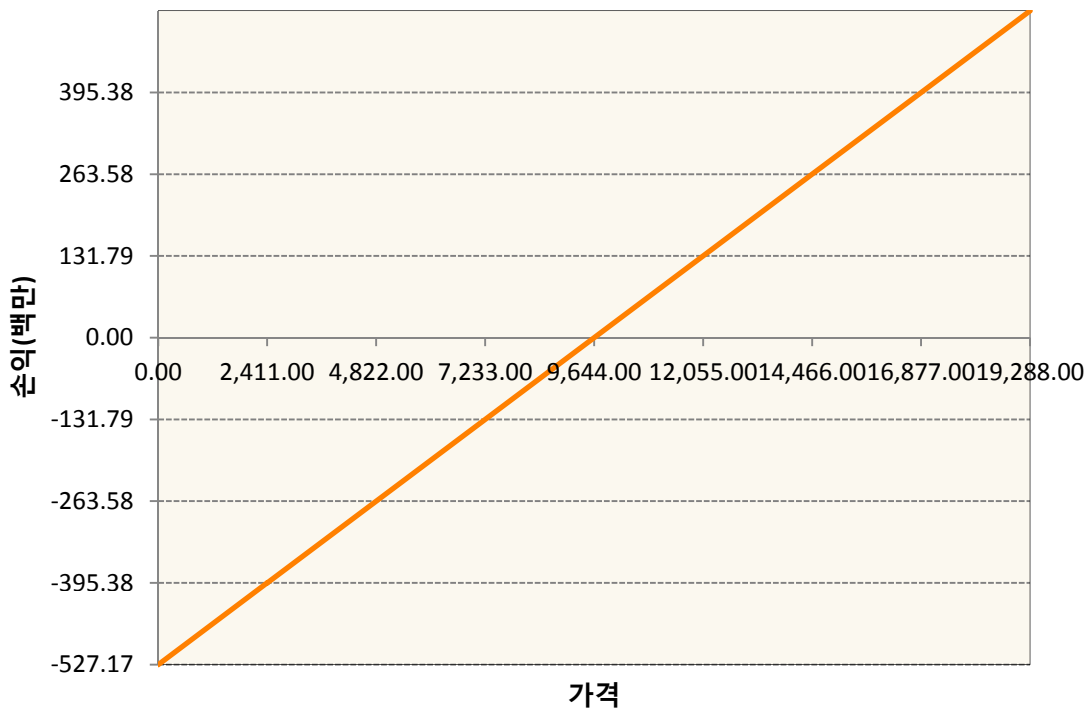
### 1. 계약금액

(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

HCJ0-HSCEI Futures Apr20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

45
----

공시일	2020-04-07
기준일	2020-04-06

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

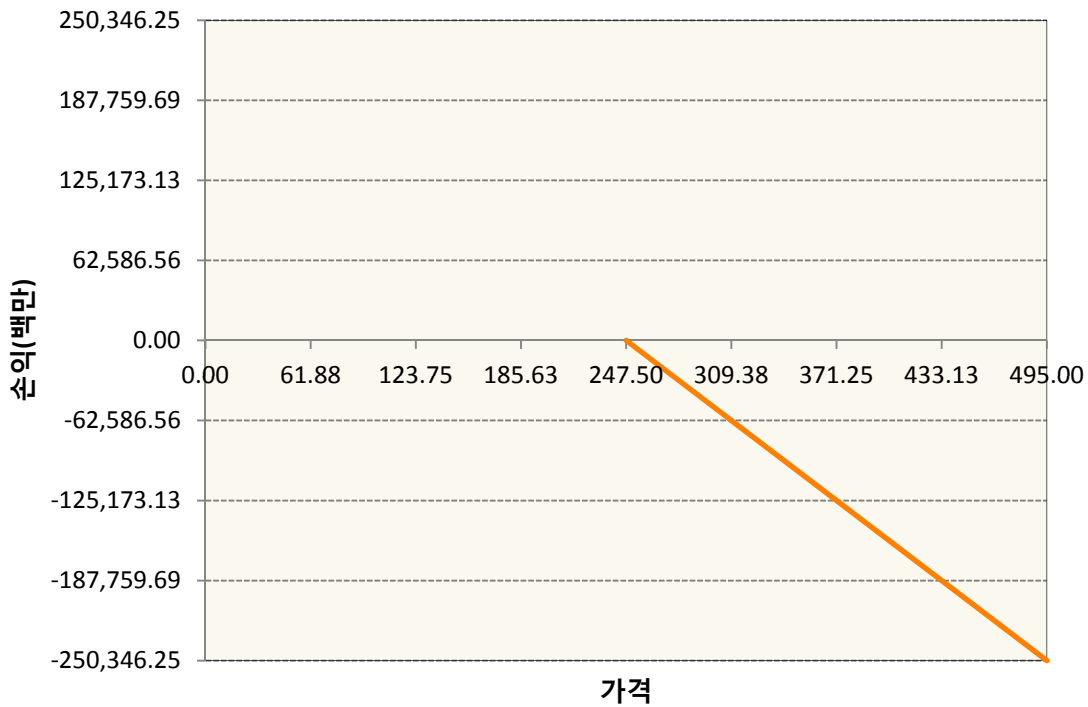
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

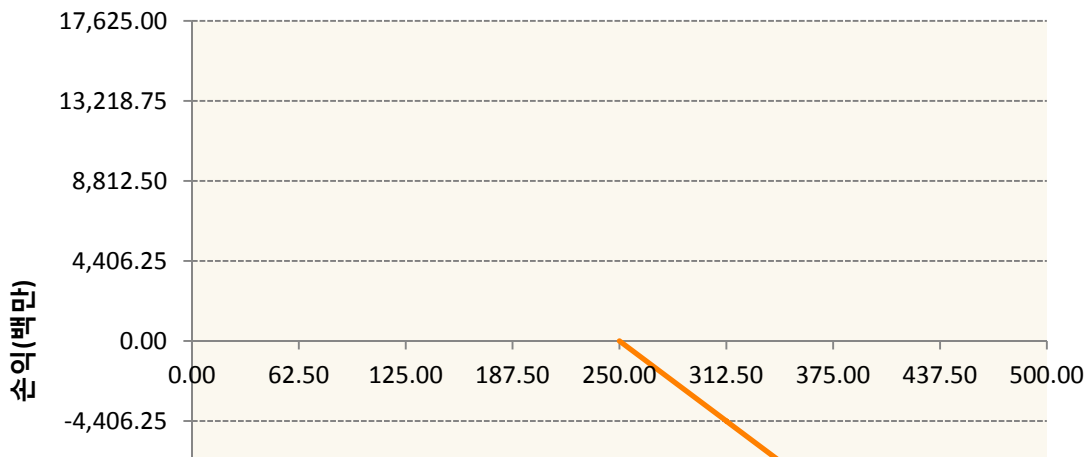
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	360,660	-360,660	장내

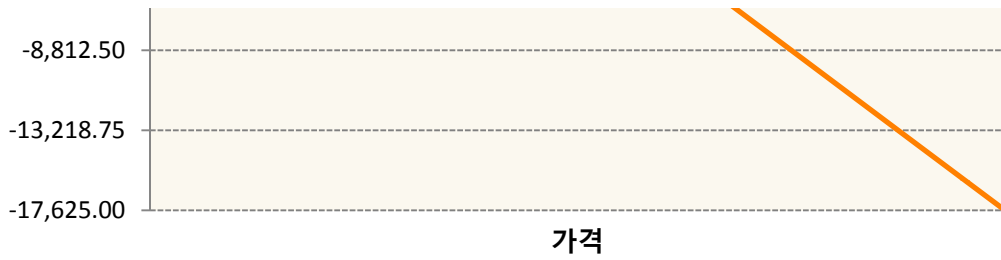
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

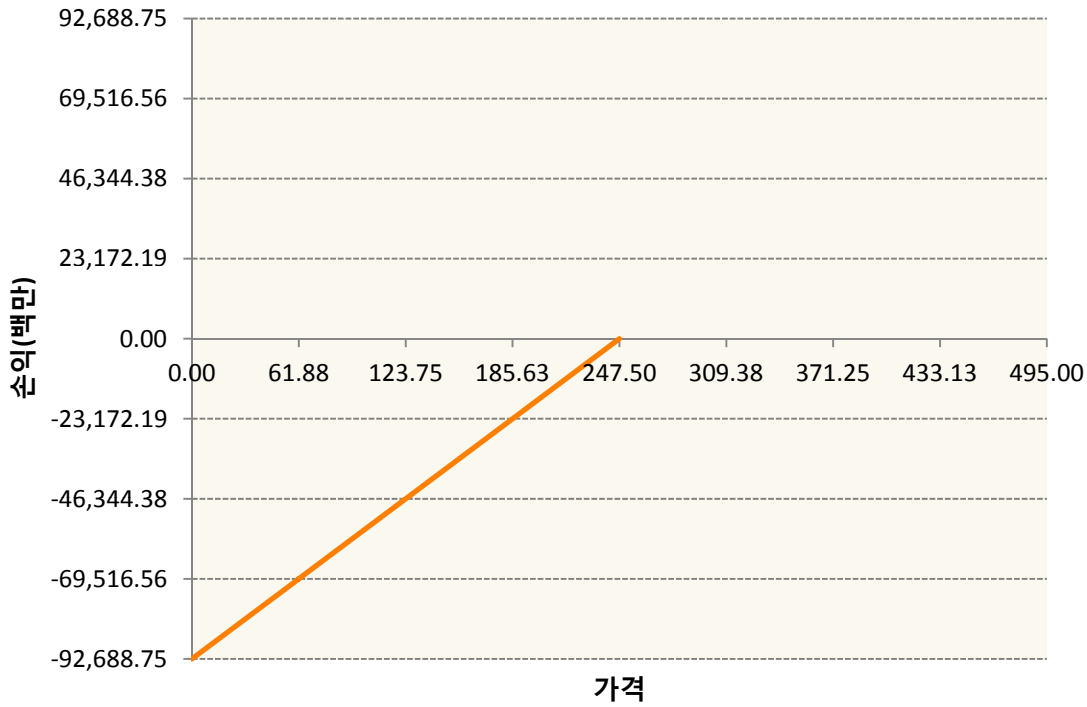


KR4201Q42503-2020-04 콜250





KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q42479		2020-04 콜247.5					12,368	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,029	2,024	2,013	1,995	1,965	1,922	1,865	
-5.33%	2,001	1,967	1,915	1,842	1,748	1,634	1,500	
-2.67%	1,798	1,665	1,504	1,319	1,111	884	641	
0%	931	634	323	0	-332	-672	-1,018	
2.67%	-1,363	-1,756	-2,150	-2,543	-2,937	-3,330	-3,724	
5.33%	-5,472	-5,794	-6,129	-6,474	-6,826	-7,185	-7,549	
8.00%	-10,994	-11,163	-11,361	-11,584	-11,828	-12,090	-12,368	
KR4201Q42503		2020-04 콜250					769	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	99	99	99	98	97	95	92	

-5.33%	99	97	95	92	87	81	74
-2.67%	91	85	77	67	56	43	29
0%	54	37	19	0	-20	-42	-63
2.67%	-62	-89	-115	-142	-169	-196	-223
5.33%	-300	-326	-352	-379	-405	-432	-459
8.00%	-651	-668	-686	-705	-726	-747	-769
KR4301Q42477                      2020-04 풋247.5							6,727
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,710	-6,710	-6,711	-6,712	-6,715	-6,719	-6,727
-5.33%	-4,307	-4,311	-4,317	-4,327	-4,342	-4,362	-4,386
-2.67%	-1,933	-1,957	-1,990	-2,030	-2,077	-2,131	-2,191
0%	255	176	90	0	-94	-191	-291
2.67%	1,883	1,763	1,643	1,523	1,403	1,283	1,164
5.33%	2,711	2,622	2,528	2,430	2,329	2,225	2,118
8.00%	2,968	2,934	2,891	2,840	2,781	2,716	2,645

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

(단위:백만원)

**19,553**

공시일	2020-04-07
기준일	2020-04-06

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

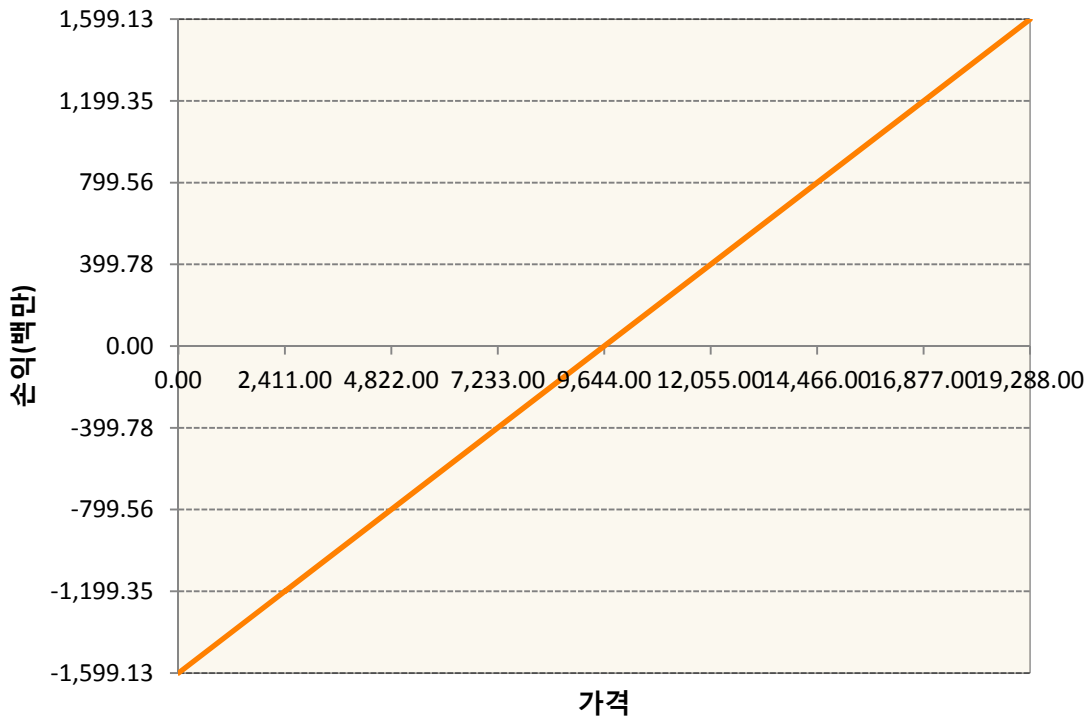
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

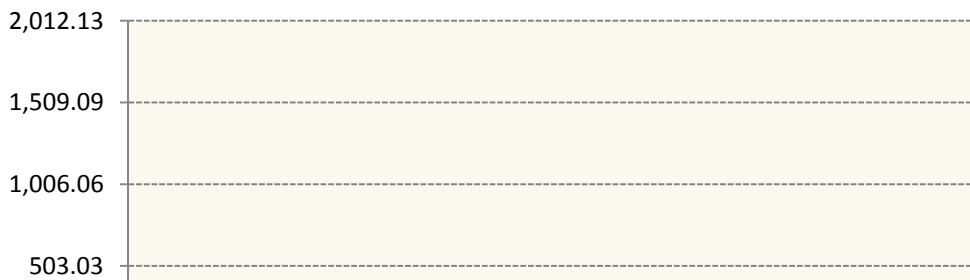
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,599	0	1,599	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,175	-4,175	장내
누계	통화	선도	698	2,233	-1,535	장외

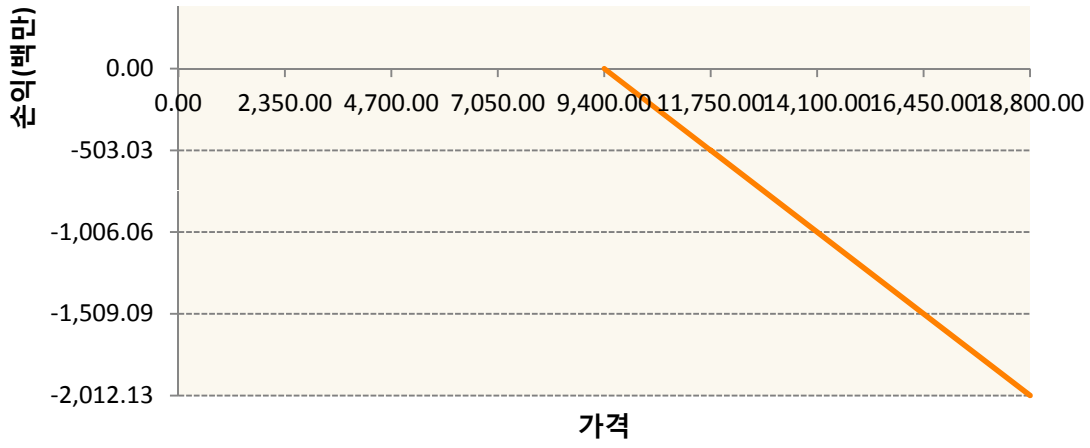
### 2. 만기시점의 손익구조

HCJ0-HSCEI Futures Apr20

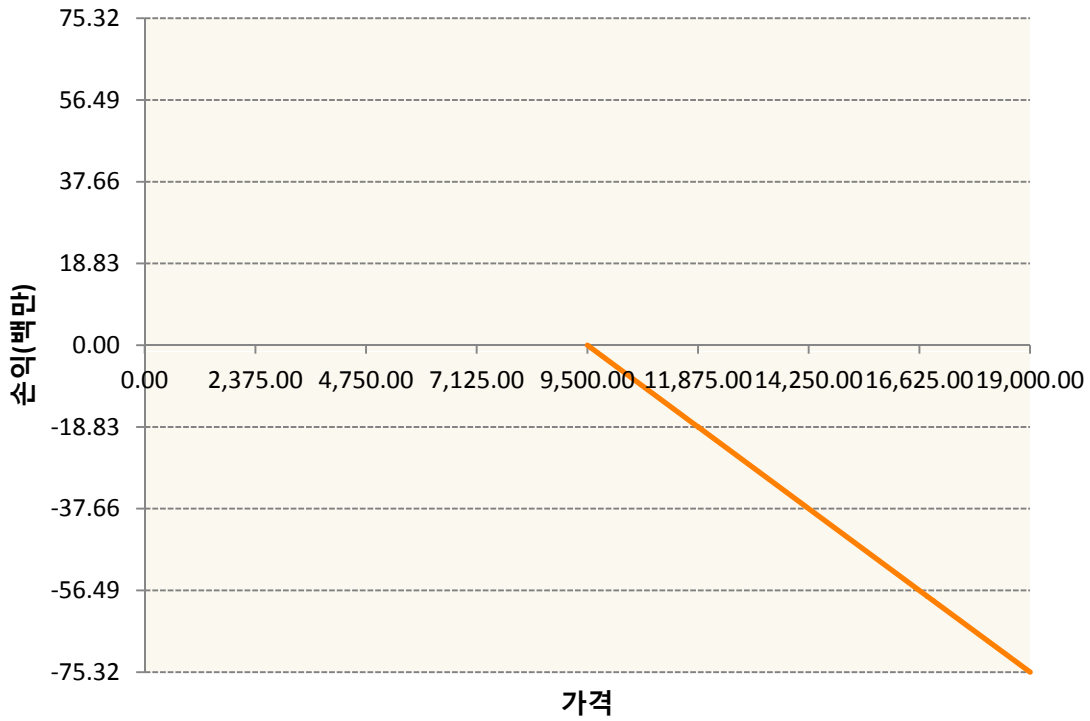


OHHIJ0-C94-HSCEI

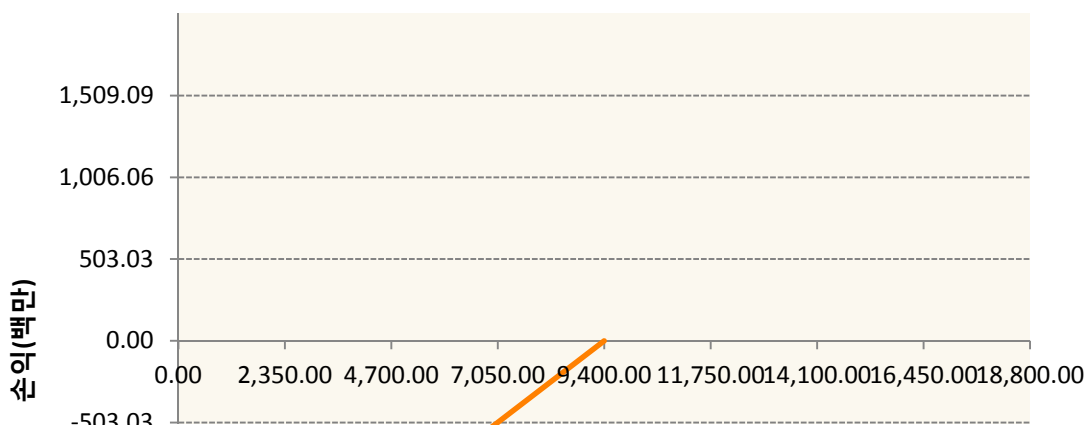


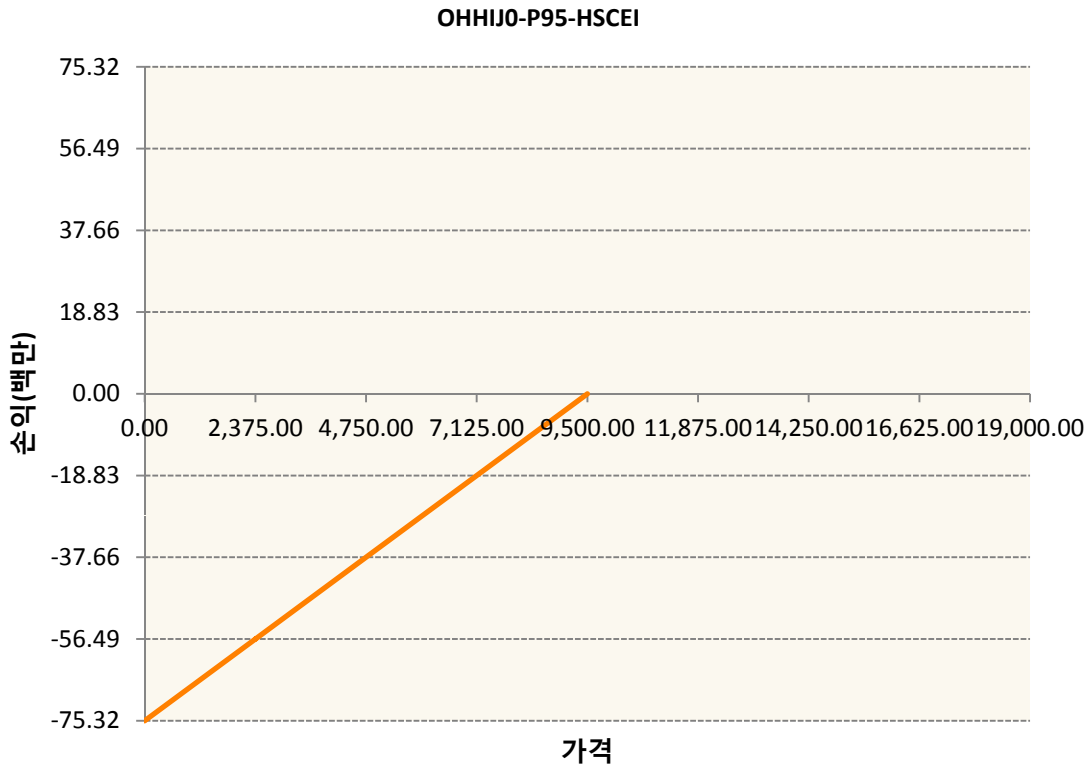


OHHIJO-C95-HSCEI



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	128
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)**

**606**

공시일	2020-04-07
기준일	2020-04-06

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

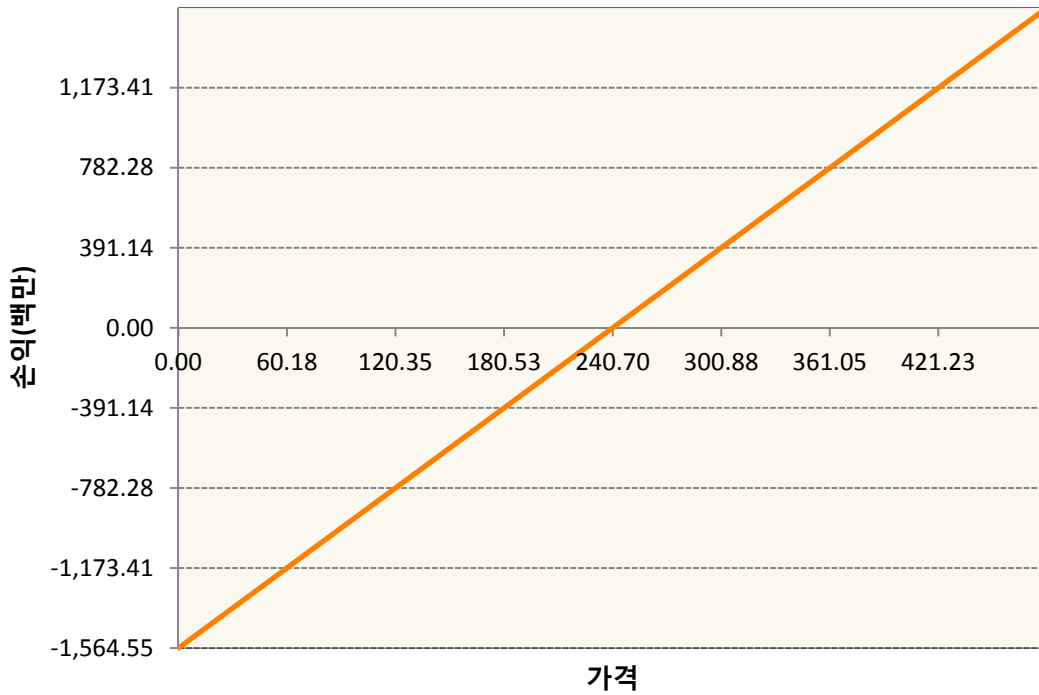
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

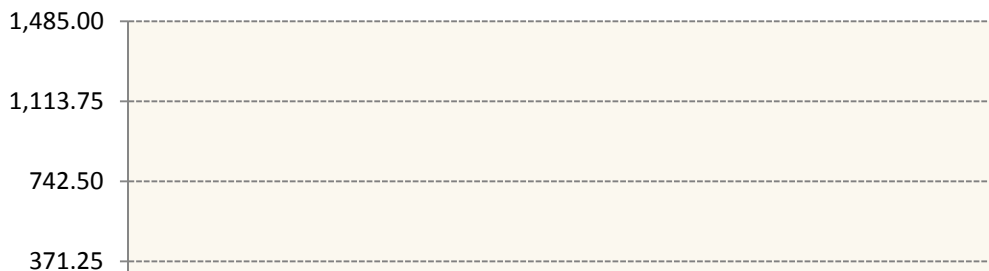
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,565	0	1,565	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,095	-3,095	장내

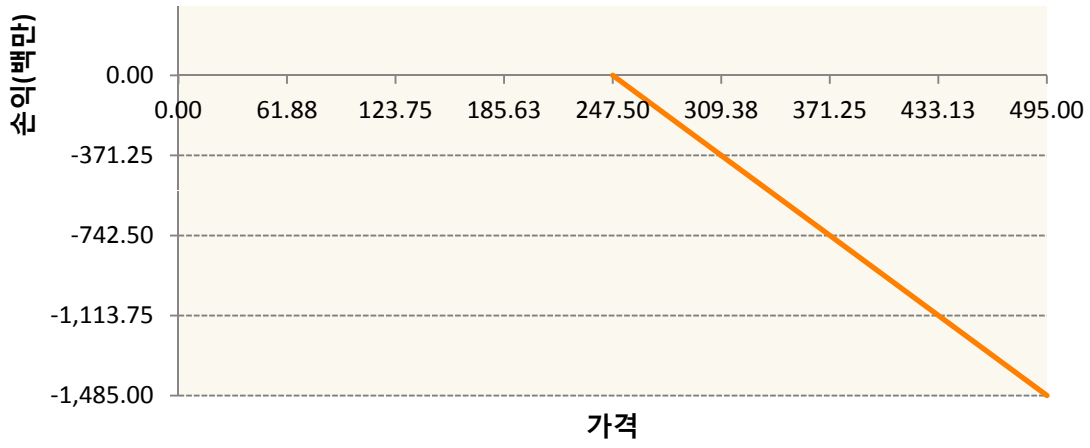
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

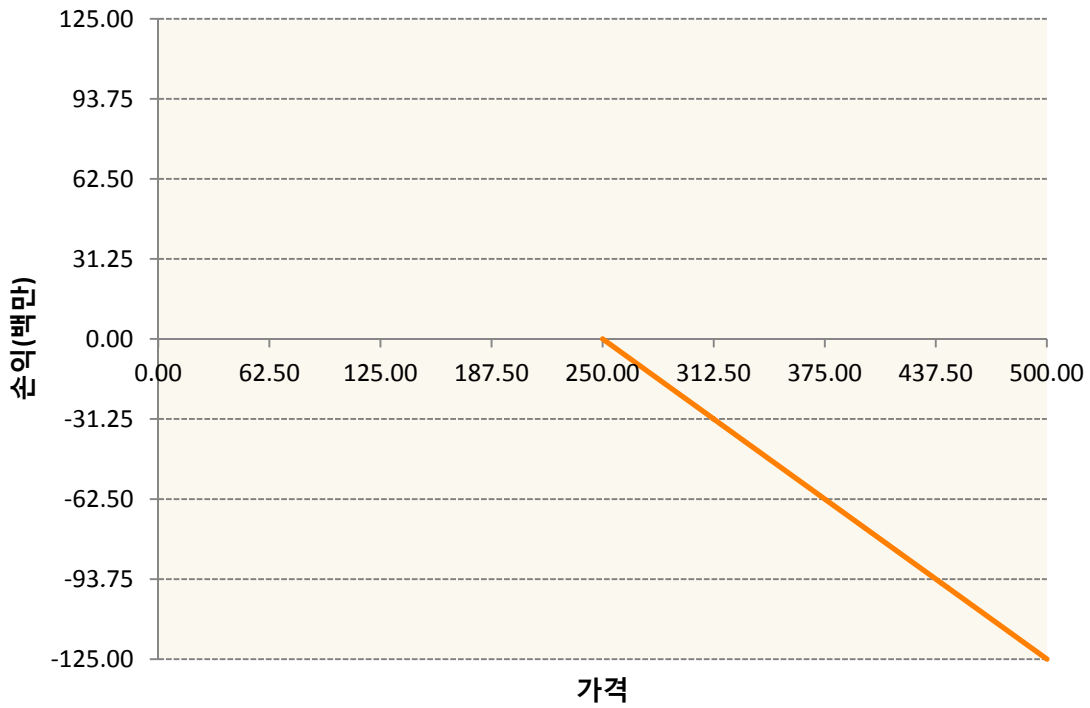


KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

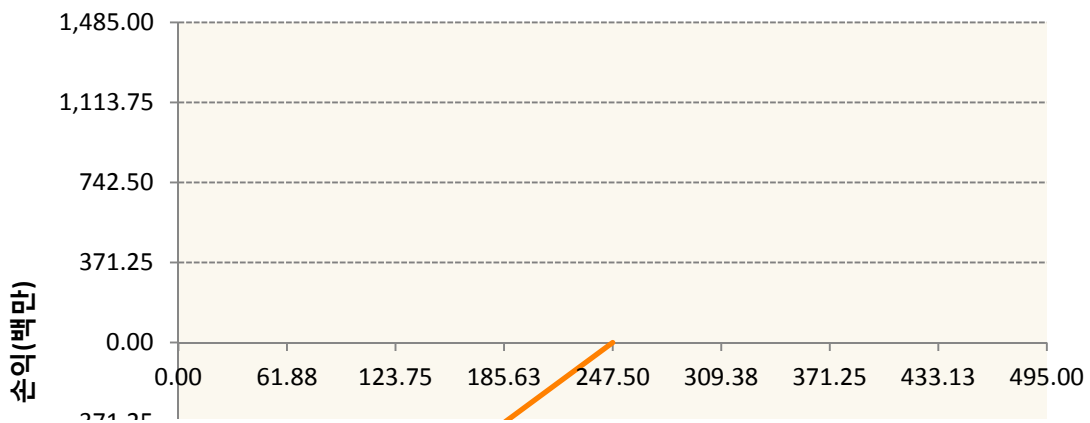




**KR4201Q42503-2020-04 콜250**



**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						125
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125	
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83	
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	42	42	42	42	42	42	42	
5.33%	83	83	83	83	83	83	83	
8.00%	125	125	125	125	125	125	125	
KR4201Q42479		2020-04 콜247.5						73
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	12	12	12	12	12	11	11	
-5.33%	12	12	11	11	10	10	9	
-2.67%	11	10	9	8	7	5	4	
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6	
2.67%	-8	-10	-13	-15	-17	-20	-22	
5.33%	-32	-34	-36	-38	-40	-43	-45	
8.00%	-65	-66	-67	-69	-70	-72	-73	
KR4201Q42503		2020-04 콜250						5
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	1
-2.67%	1	1	1	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	-1	-1	-1	-1	-1	-2
5.33%	-2	-2	-2	-3	-3	-3	-3
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
KR4301Q42477      2020-04 풋247.5							108
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-108	-108	-108	-108	-108	-108	-108
-5.33%	-69	-69	-69	-69	-70	-70	-70
-2.67%	-31	-31	-32	-33	-33	-34	-35
0%	4	3	1	0	-2	-3	-5
2.67%	30	28	26	24	22	21	19
5.33%	43	42	41	39	37	36	34
8.00%	48	47	46	45	45	44	42

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

(단위:백만원)

561

공시일	2020-04-07
기준일	2020-04-06

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

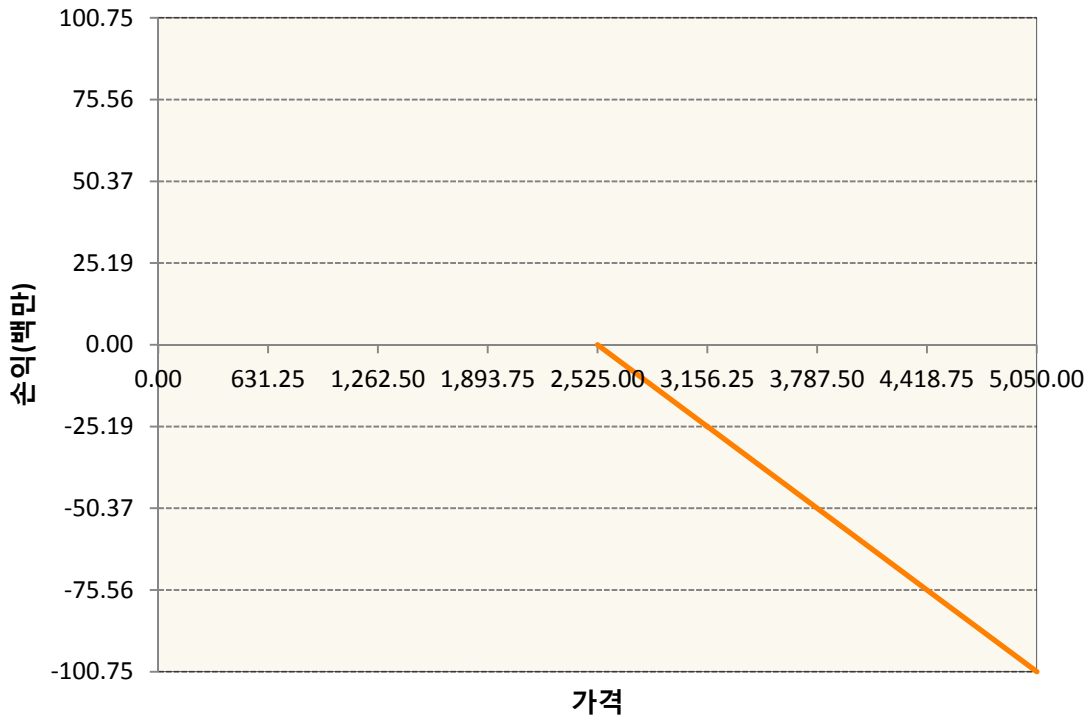
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

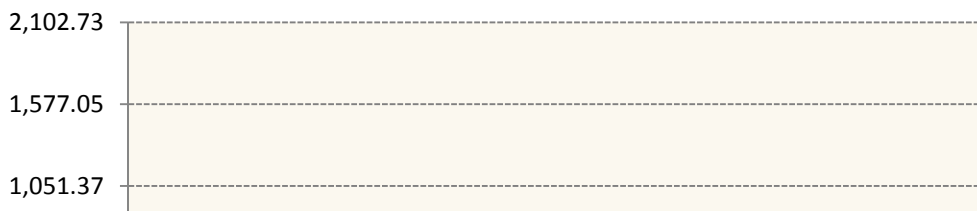
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	252	0	252	
누계	유가증권	스왑	7,554	0	7,554	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,441	-4,441	장내
누계	통화	선도	0	2,692	-2,692	장외

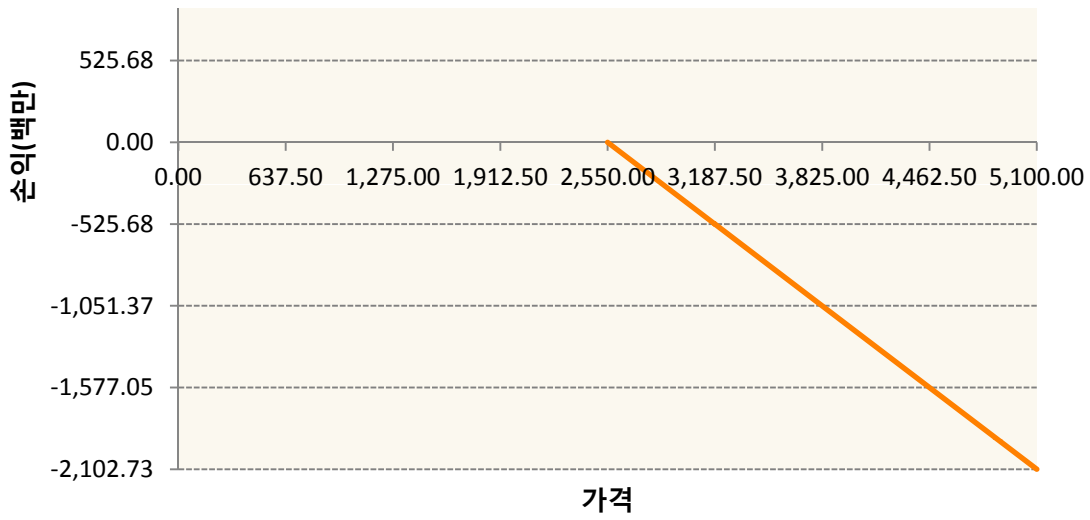
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXJ0-C2525-EURO STOXX 50**

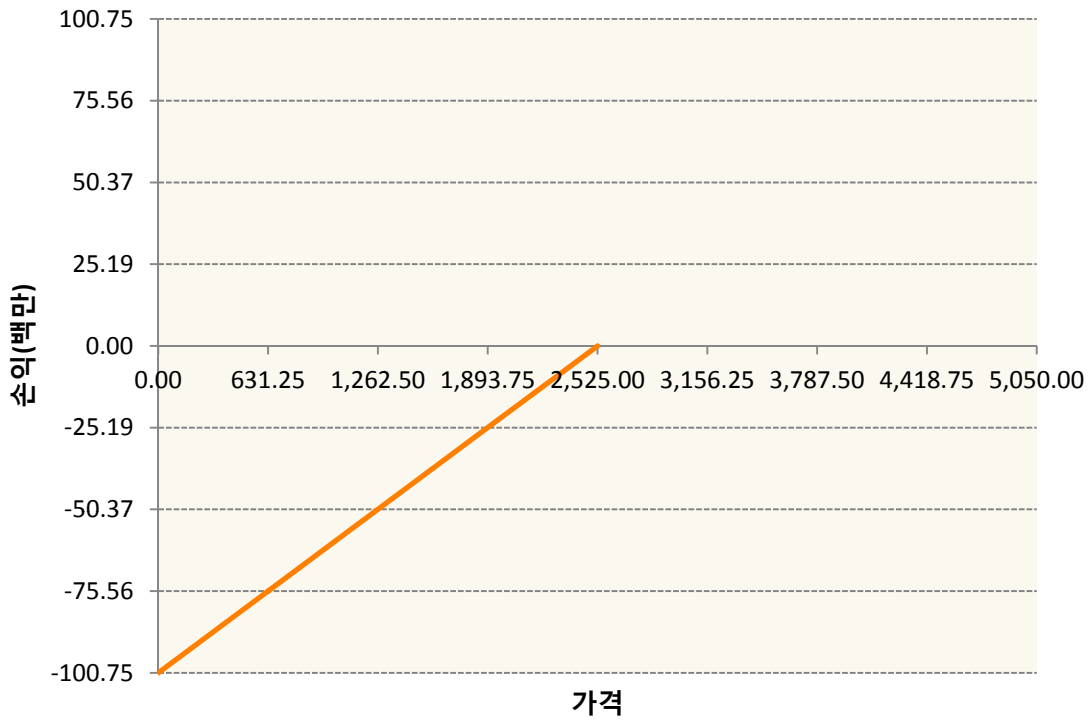


**OESXJ0-C2550-EURO STOXX 50**

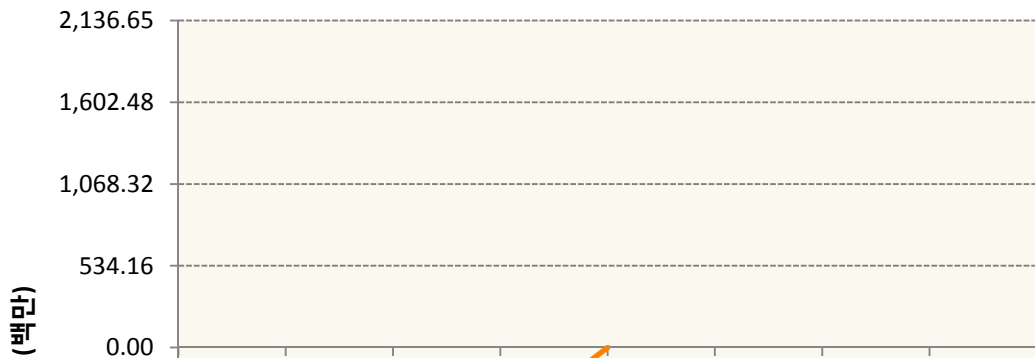


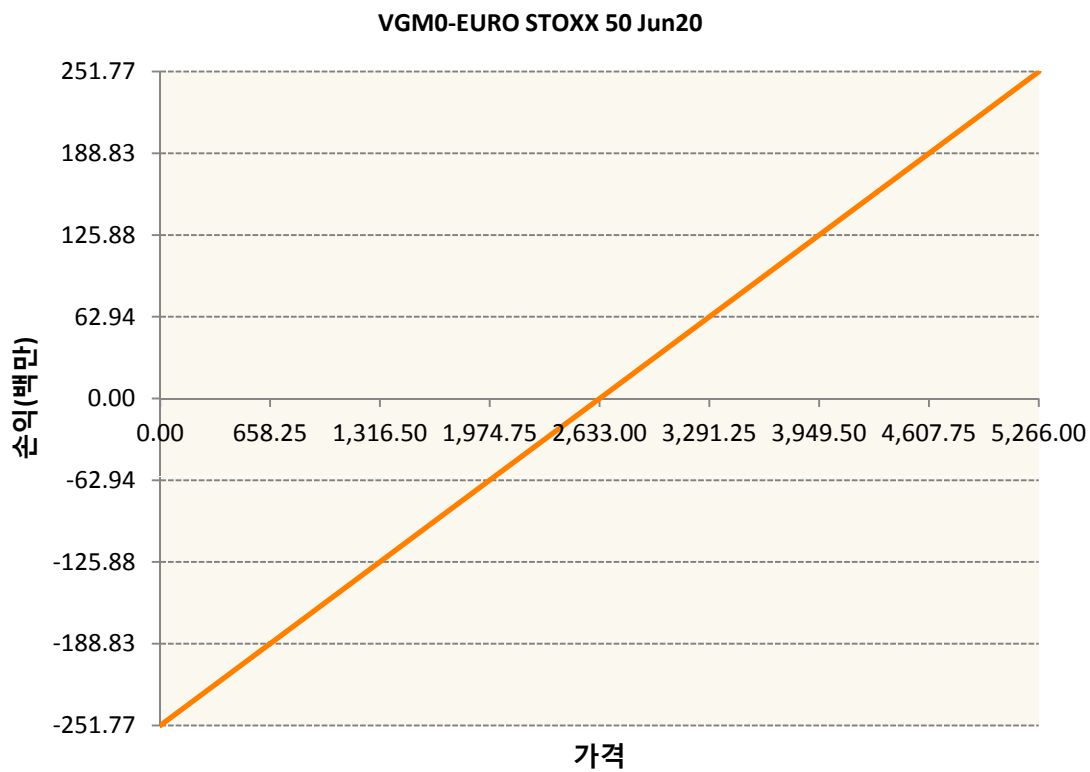
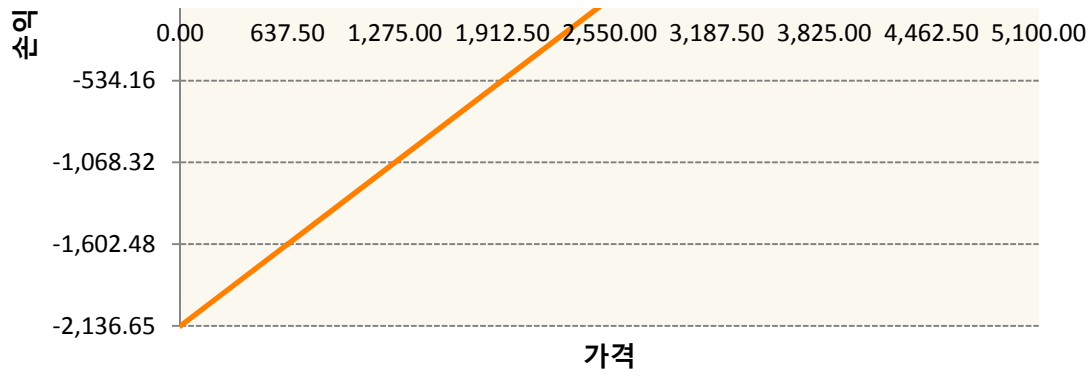


OESXJ0-P2525-EURO STOXX 50



OESXJ0-P2550-EURO STOXX 50





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	19
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)

1,047

공시일	2020-04-07
기준일	2020-04-06

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

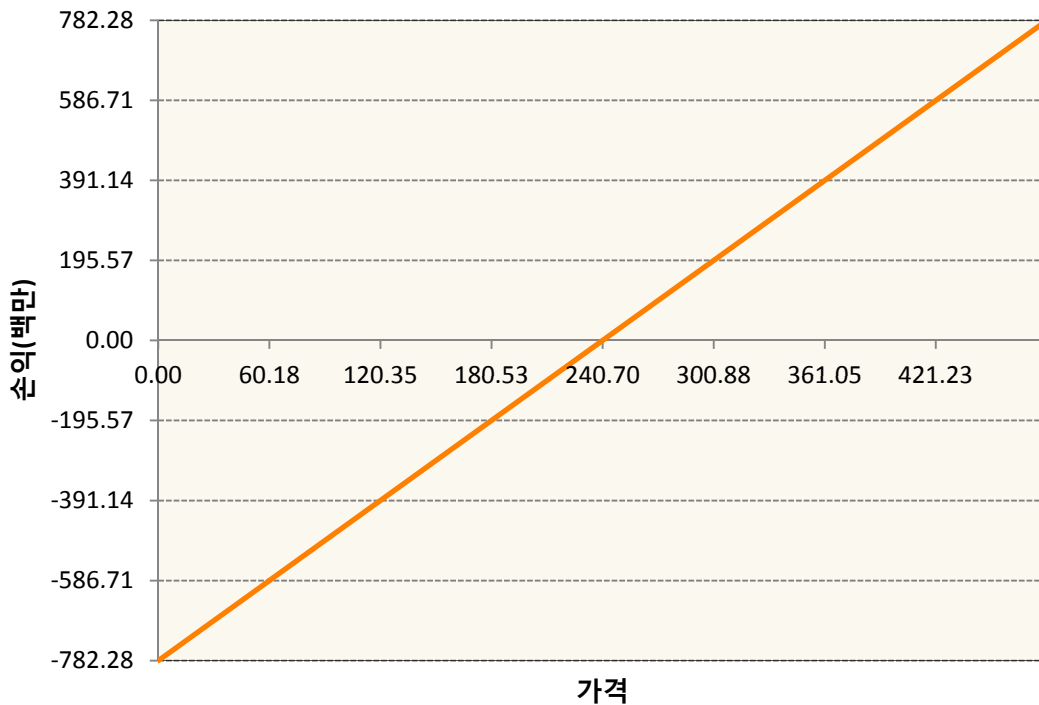
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	782	0	782	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						63
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63	
-5.33%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42	
-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%	42	42	42	42	42	42	42	
8.00%	63	63	63	63	63	63	63	

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

(단위:백만원)

91



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

(단위:백만원)

133

공시일	2020-04-07
기준일	2020-04-06

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

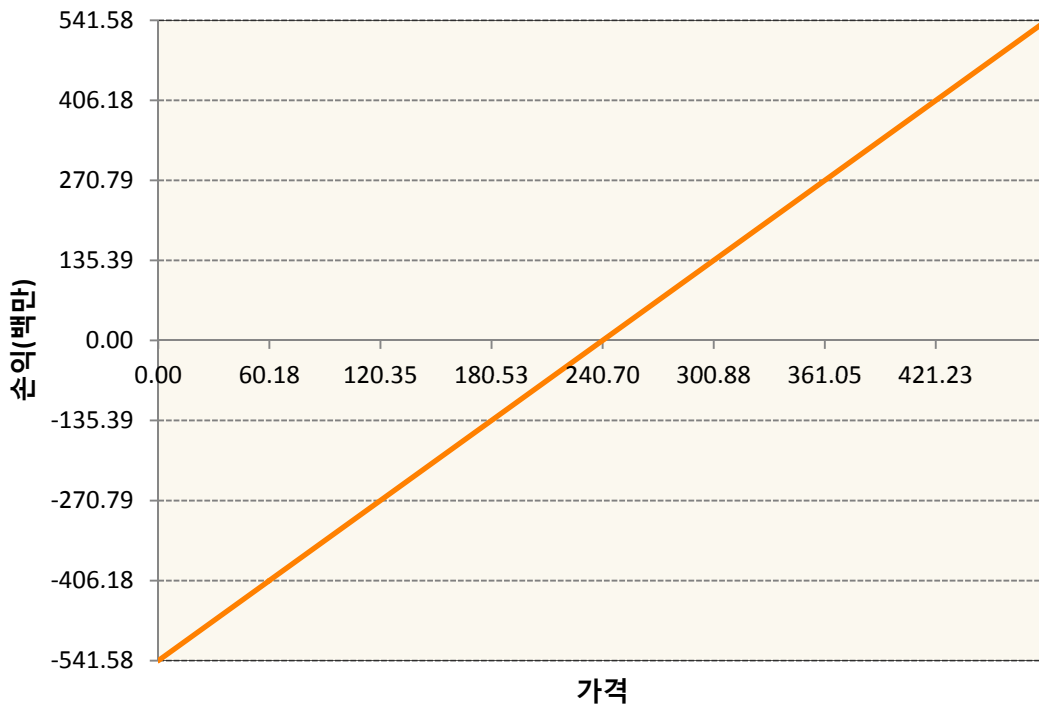
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	542	0	542	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002      2020-06 코스피200지수선물      43

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
-5.33%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
-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%	29	29	29	29	29	29	29
8.00%	43	43	43	43	43	43	43

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

(단위:백만원)

63

공시일	2020-04-07
기준일	2020-04-06

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

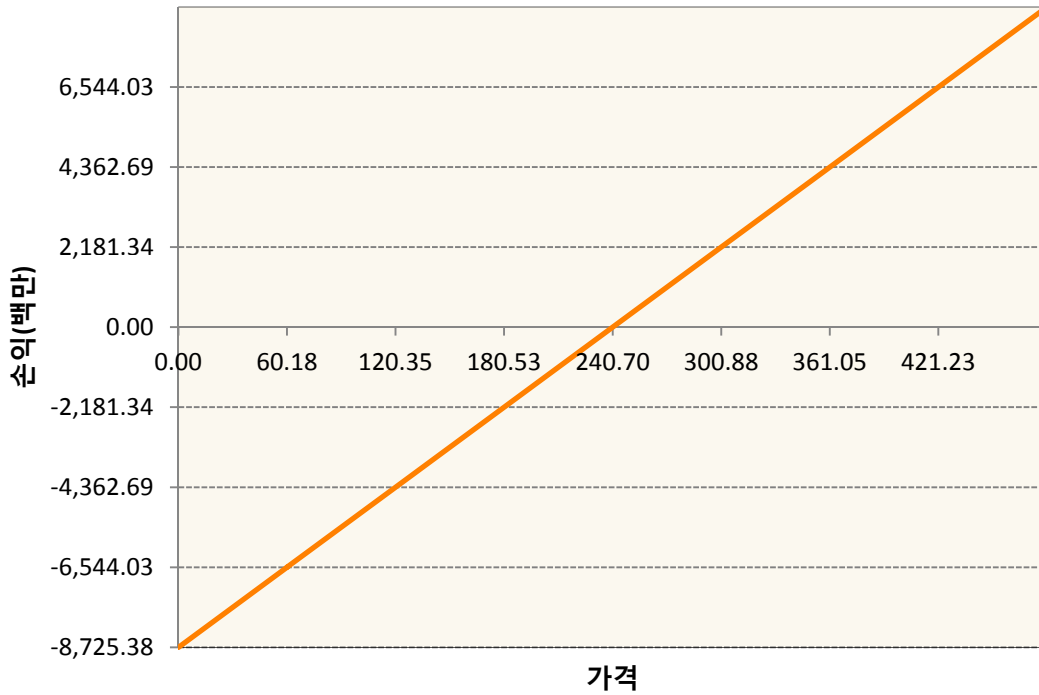
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

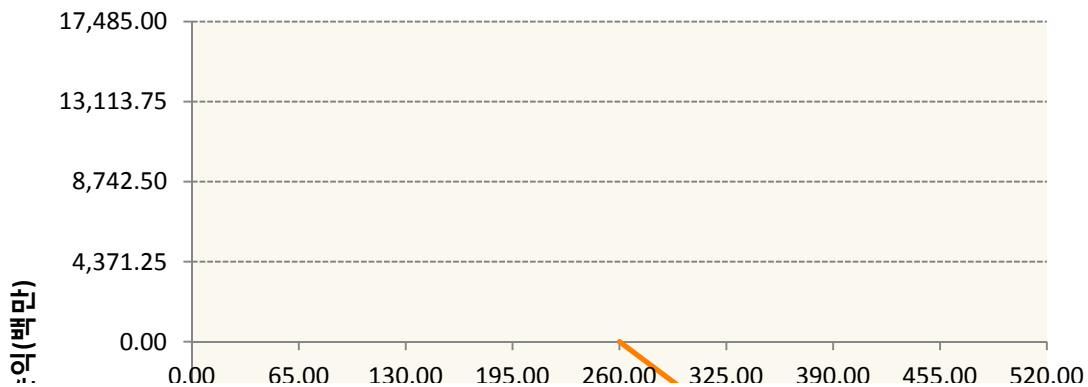
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,725	0	8,725	장내
누계	유가증권	옵션	6,004	17,485	-11,481	장내

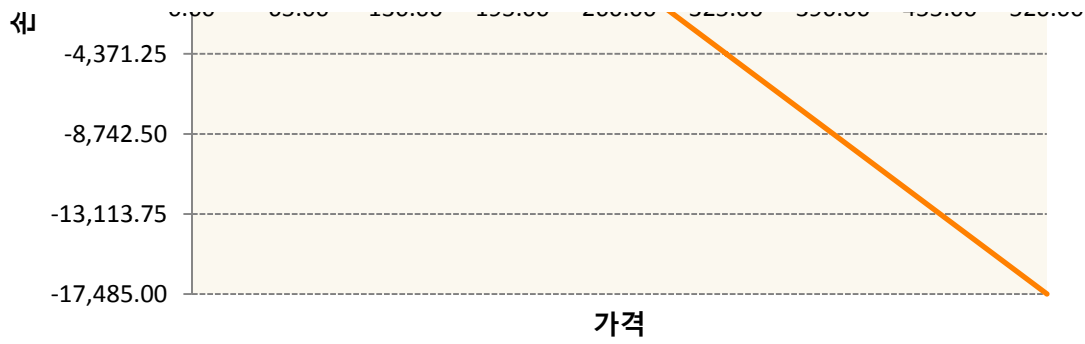
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

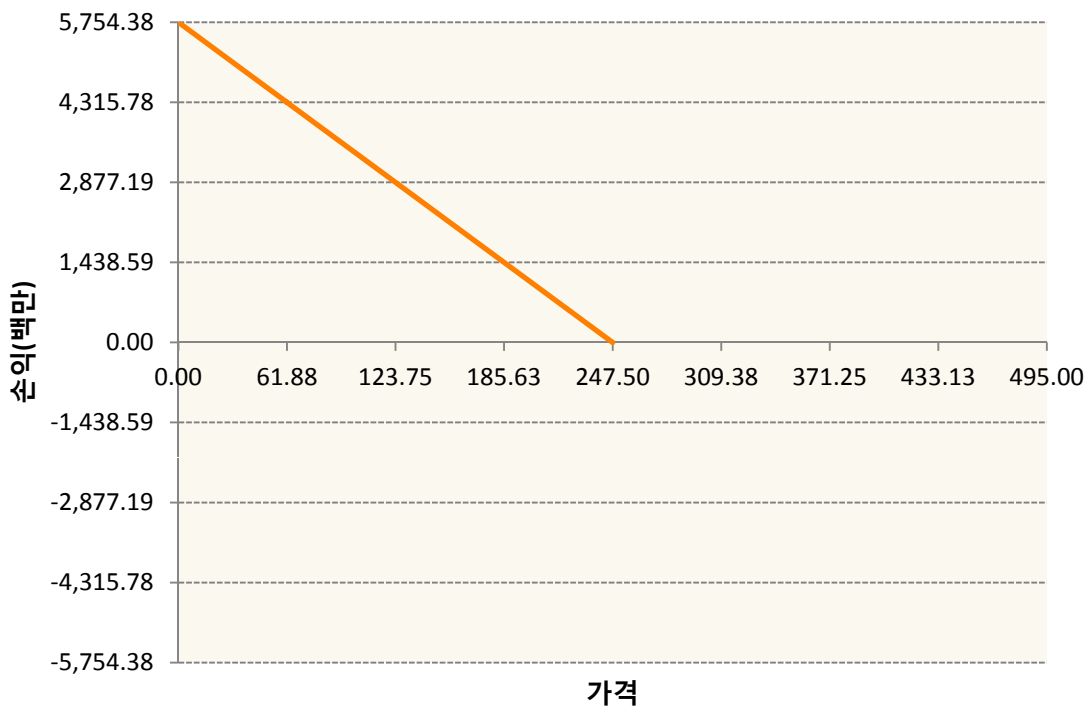


KR4201Q42602-2020-04 콜260

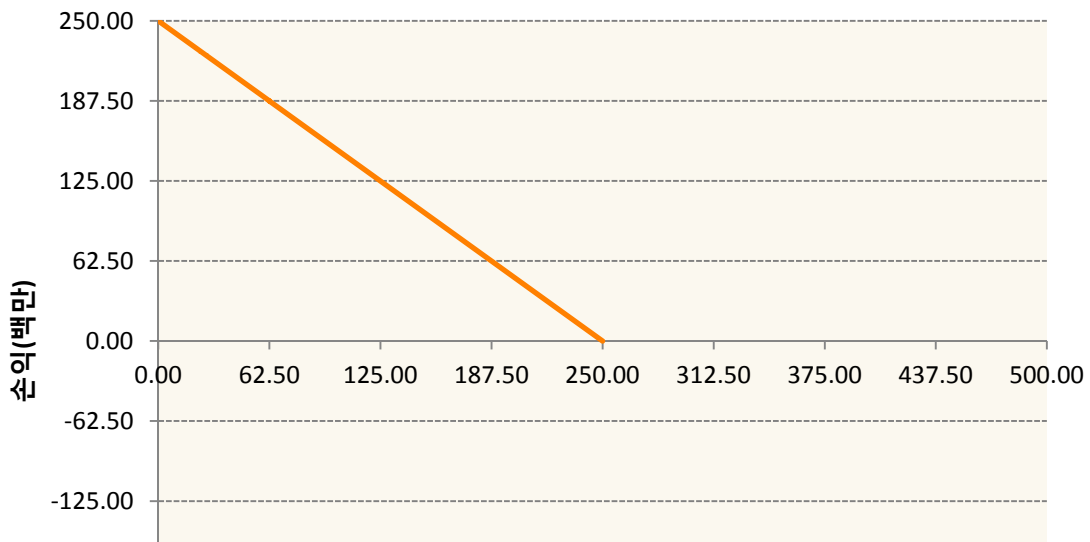


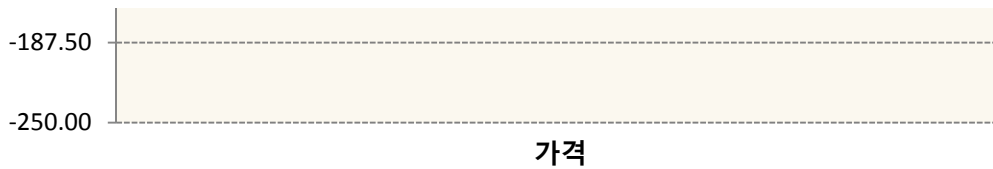


KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



KR4301Q42501-2020-04 풋250





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						698
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-698	-698	-698	-698	-698	-698	-698	
-5.33%	-466	-466	-466	-466	-466	-466	-466	
-2.67%	-233	-233	-233	-233	-233	-233	-233	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	233	233	233	233	233	233	233	
5.33%	466	466	466	466	466	466	466	
8.00%	698	698	698	698	698	698	698	
KR4201Q42602		2020-04 콜260						397
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	18	18	18	17	17	17	17	
-5.33%	18	17	17	17	16	15	13	
-2.67%	17	17	16	14	11	7	2	
0%	14	11	6	0	-8	-17	-28	
2.67%	-4	-14	-27	-42	-57	-75	-93	
5.33%	-70	-92	-115	-138	-162	-186	-211	
8.00%	-231	-259	-287	-314	-342	-369	-397	
KR4301Q42477		2020-04 풋247.5						418
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	417	417	417	417	417	417	418	
-5.33%	267	268	268	269	270	271	272	
-2.67%	120	122	124	126	129	132	136	
0%	-16	-11	-6	0	6	12	18	
2.67%	-117	-109	-102	-95	-87	-80	-72	
5.33%	-168	-163	-157	-151	-145	-138	-132	
8.00%	-184	-182	-179	-176	-173	-169	-164	
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%	12	12	12	12	12	12	12	
-2.67%	6	6	6	6	6	6	6	

0%	-1	0	0	0	0	0	1
2.67%	-6	-5	-5	-5	-4	-4	-4
5.33%	-9	-8	-8	-8	-7	-7	-7
8.00%	-10	-10	-9	-9	-9	-9	-9

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

(단위:백만원)

**1,570**

공시일	2020-04-07
기준일	2020-04-06

## 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	147,439	0	147,439	

### 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	2020-04-07
기준일	2020-04-06

## 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	99,413	0	99,413	

### 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	2020-04-07
기준일	2020-04-06

## 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	439,228	0	439,228	
누계	통화	선도	71,914	498,973	-427,059	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,383
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,967
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,934
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,301
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,967
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,459
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,046
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,046
FX21020H04 USD/KRW 21-04-20E	1,475
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,400
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	983
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	983
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,557
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	846
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	3,442
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,982
FX21020H11 KRW/USD 11-05-20E	983
FX21020J00 KRW/USD 10-06-20E	2,950
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

22,523



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

(단위:백만원)

181

공시일	2020-04-07
기준일	2020-04-06

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

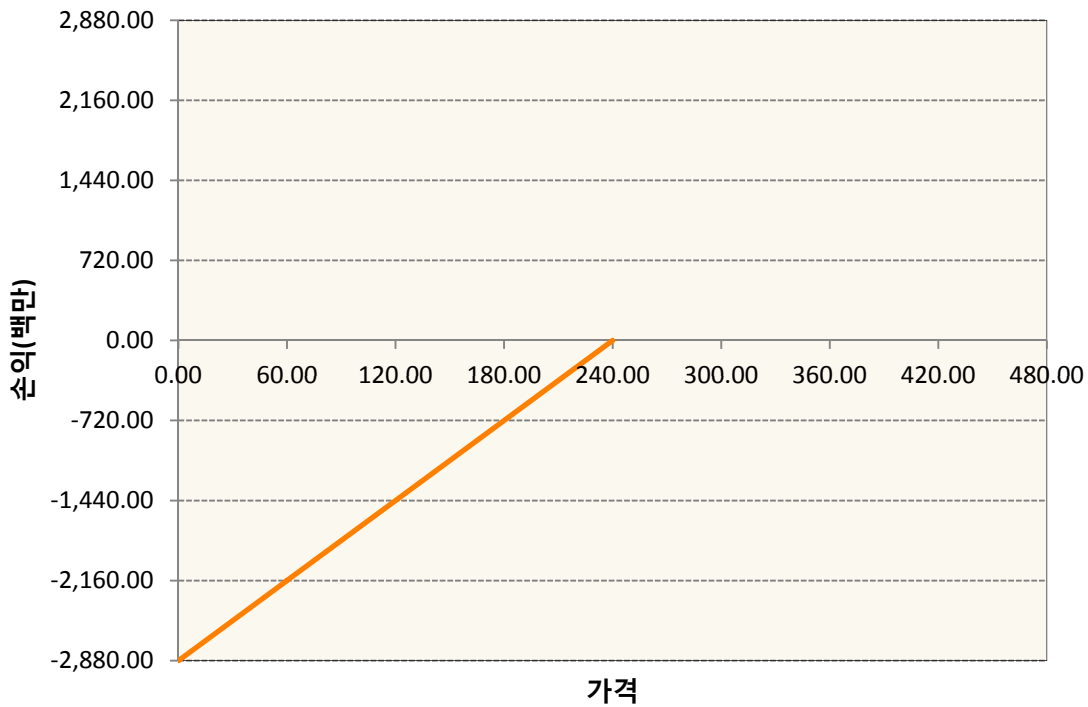
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

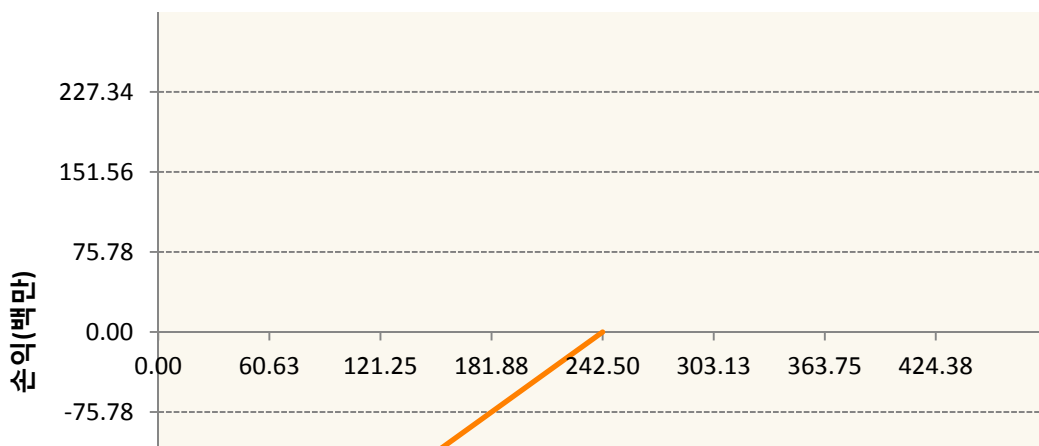
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,183	-3,183	장내

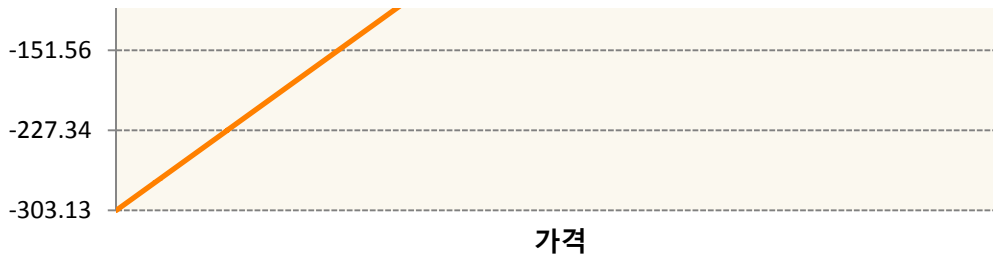
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q42402-2020-04 풋240



KR4301Q42428-2020-04 풋242.5





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4301Q42402		2020-04 풋240						184
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-182	-182	-182	-182	-183	-183	-184	
-5.33%	-106	-107	-108	-109	-111	-113	-115	
-2.67%	-37	-40	-43	-46	-49	-52	-55	
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11	
2.67%	33	31	28	26	23	20	17	
5.33%	39	39	38	36	35	33	31	
8.00%	40	40	40	39	39	38	37	
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	-13	-13	-13	-13	-13	
-2.67%	-5	-5	-5	-6	-6	-6	-6	
0%	1	1	0	0	0	-1	-1	
2.67%	4	4	4	3	3	3	2	
5.33%	6	5	5	5	5	5	4	
8.00%	6	6	6	6	6	5	5	

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

220

공시일	2020-04-07
기준일	2020-04-06

## 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	7,240	0	7,240	
누계	통화	선도	443	7,634	-7,191	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)

<b>319</b>
------------

공시일	2020-04-07
기준일	2020-04-06

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

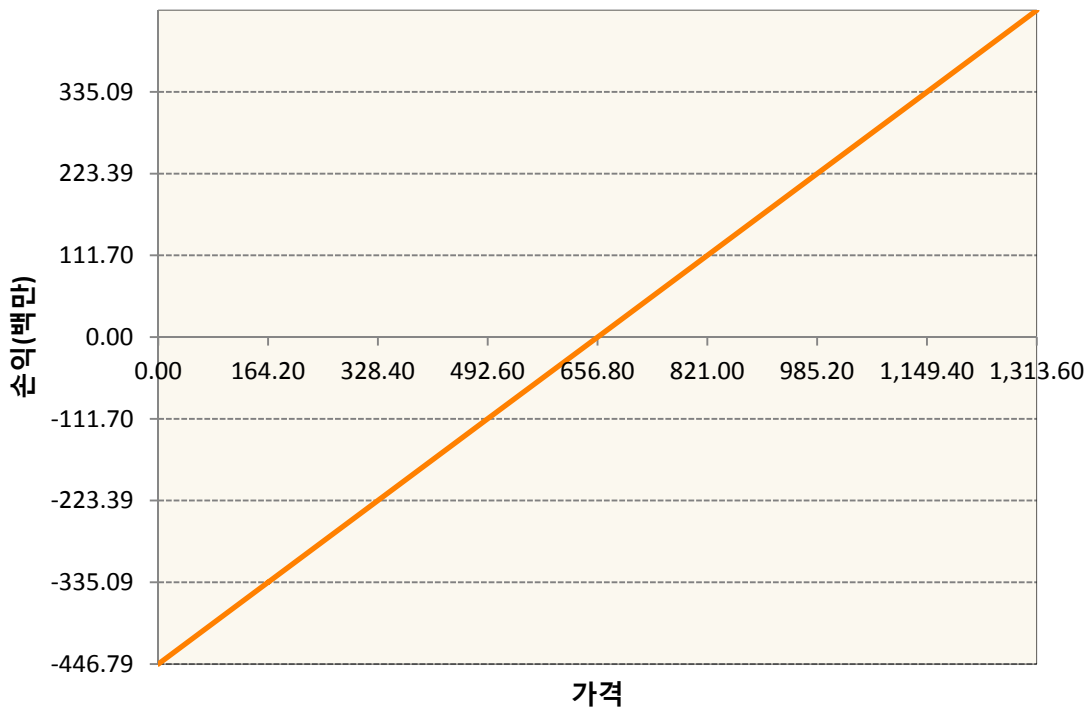
### 1. 계약금액

(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	447	0	447	
누계	유가증권	스왑	1,097	0	1,097	장외
누계	통화	선도	231	332	-101	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  
FX21020J00 KRW/EUR 24-07-20E  
VNCJ0 VN30 Index Future Apr20

9
3
36

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

(단위:백만원)

<b>132</b>
------------

공시일	2020-04-07
기준일	2020-04-06

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

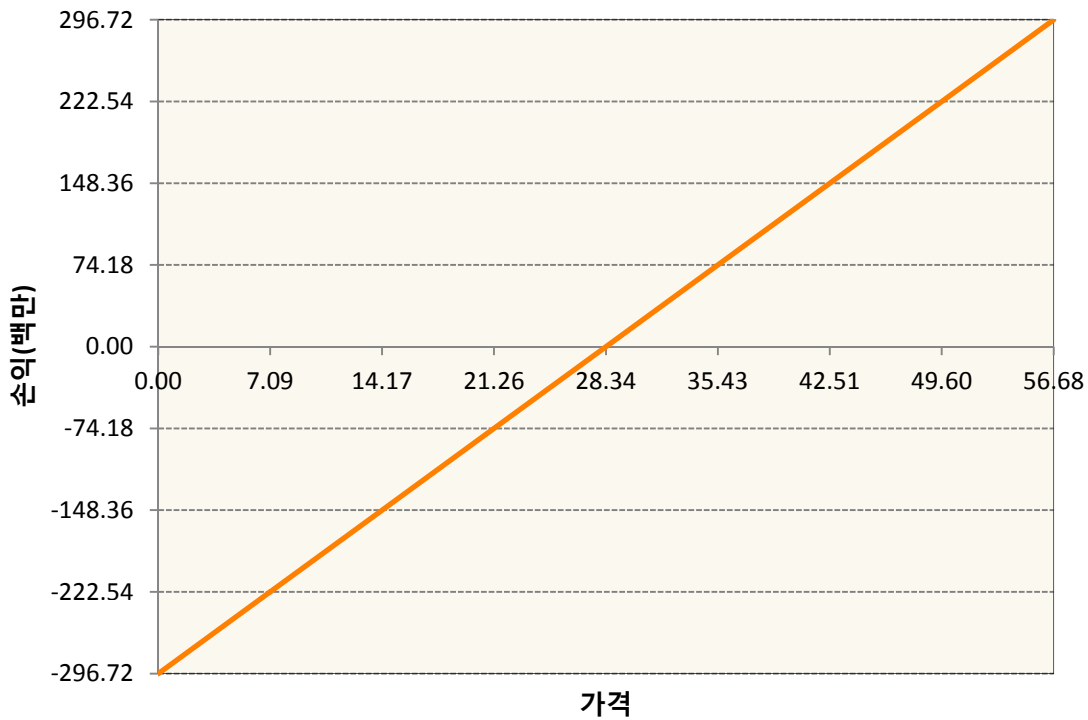
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

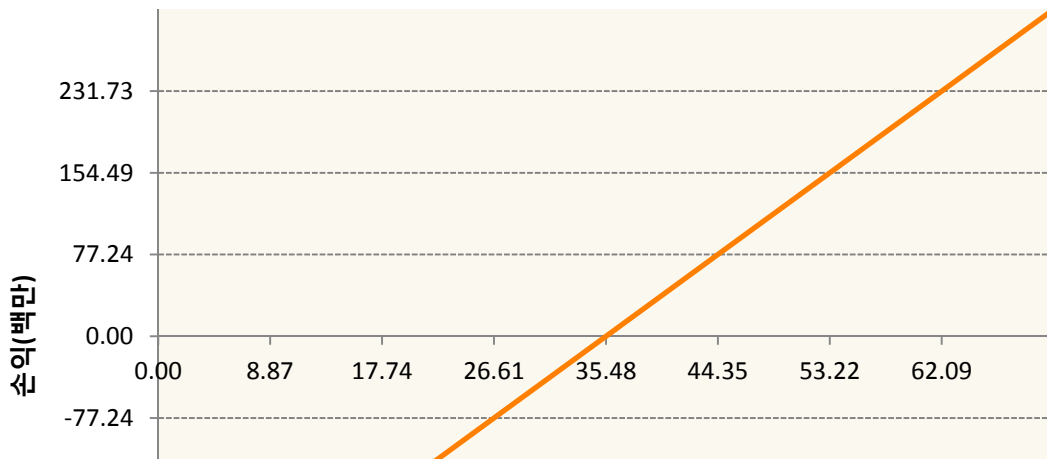
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,414	123	1,291	

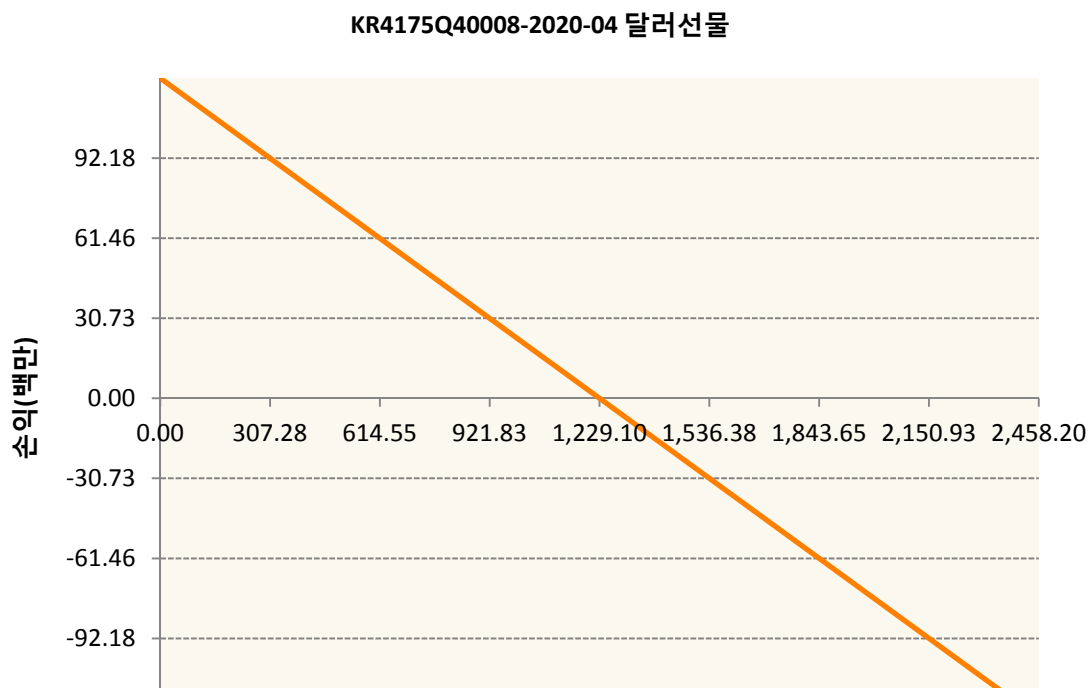
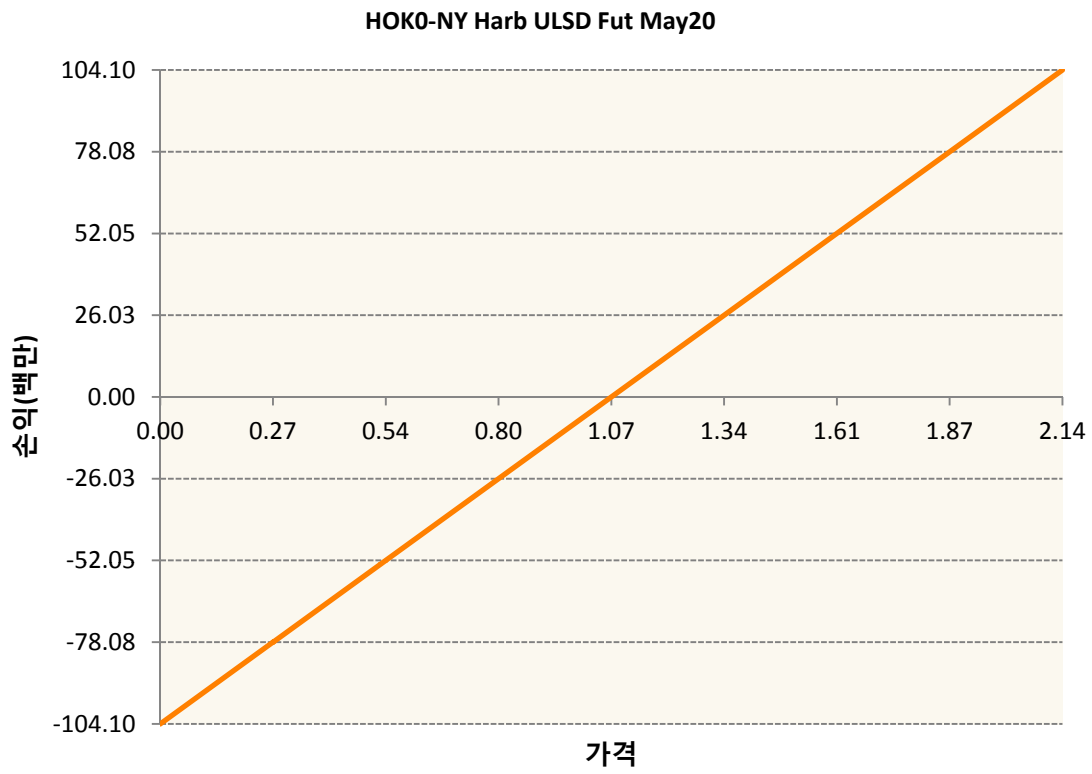
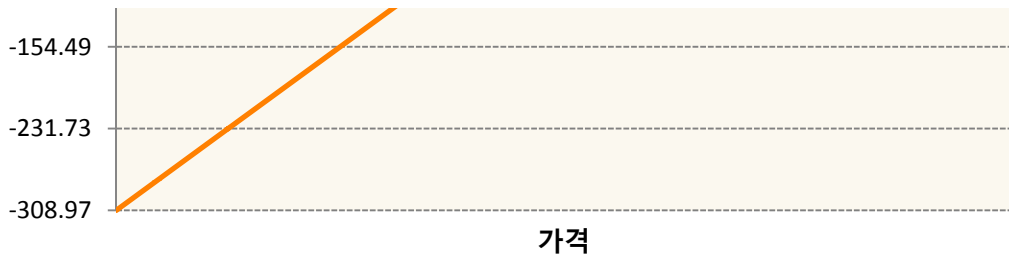
### 2. 만기시점의 손익구조

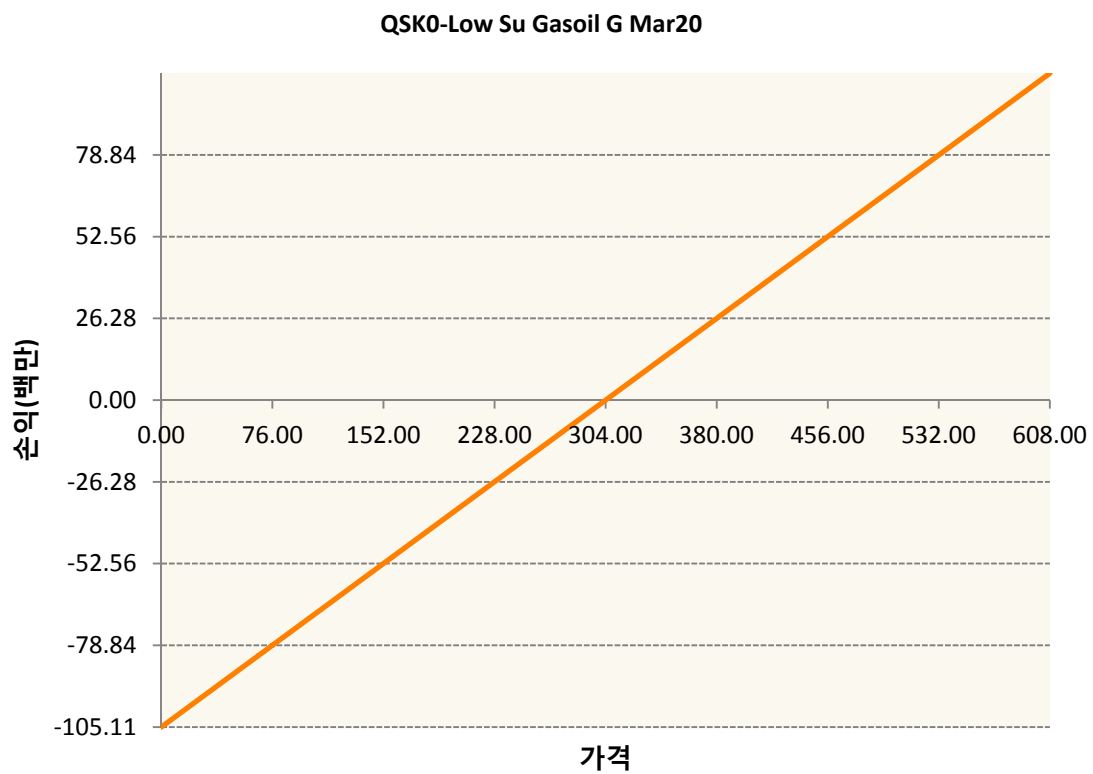
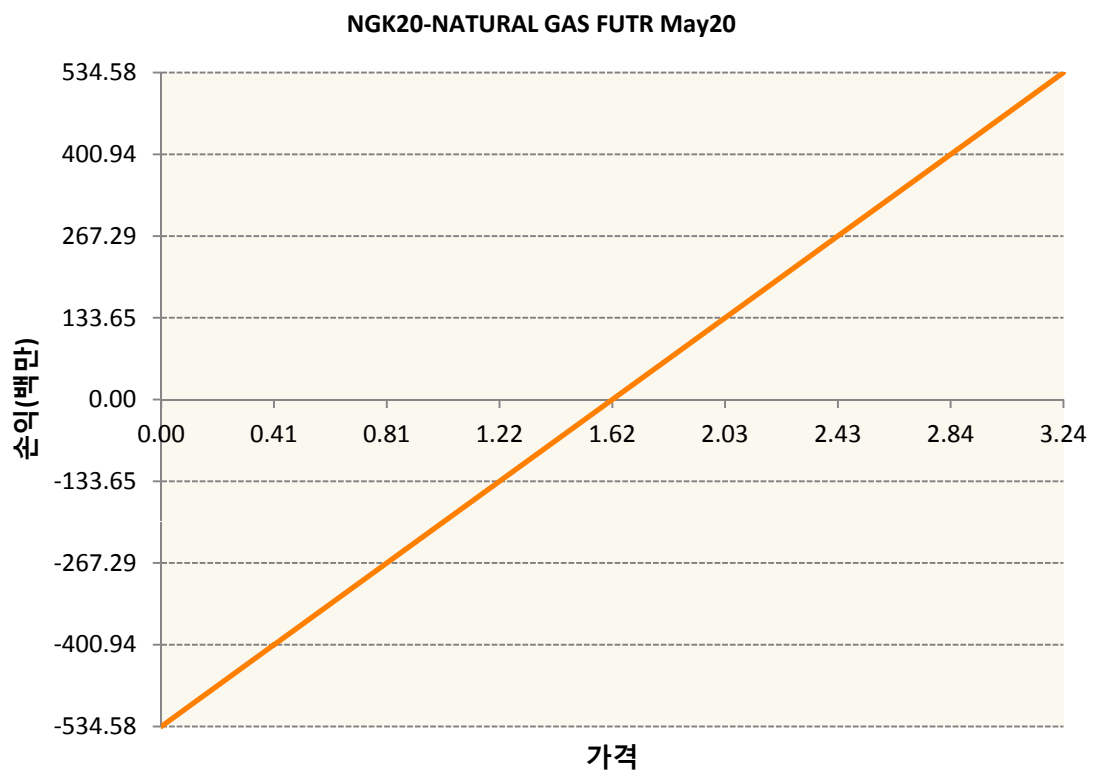
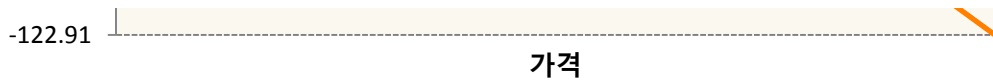
CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20



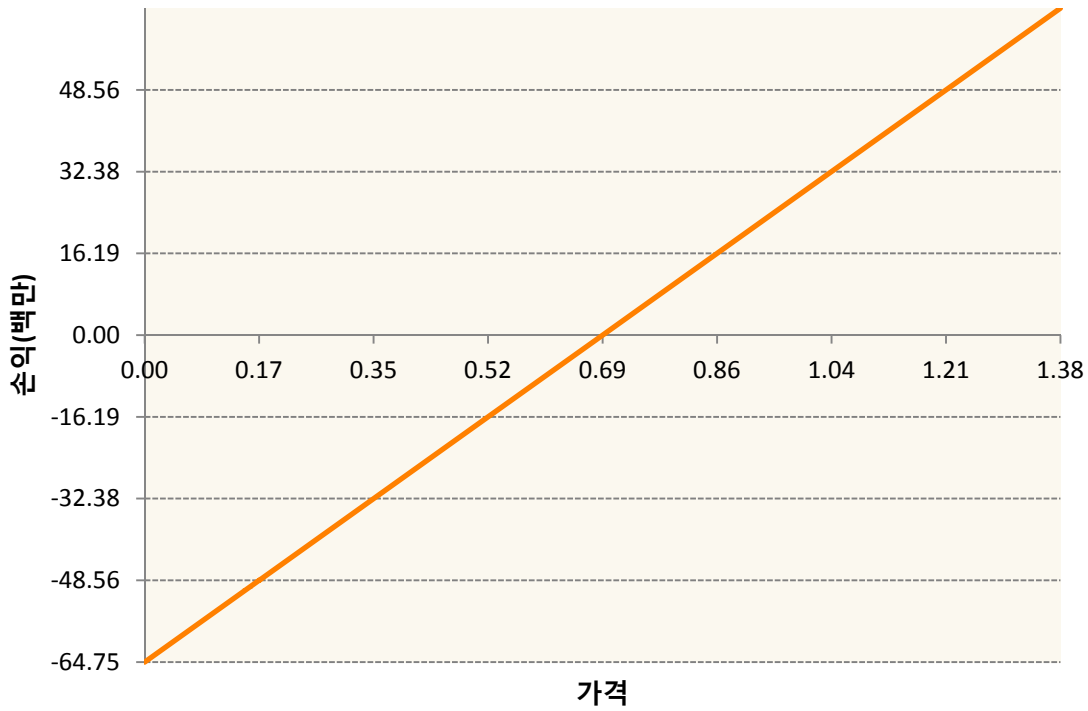
CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20







**XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20**



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	24
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	25
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)

**340**

공시일	2020-04-07
기준일	2020-04-06

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

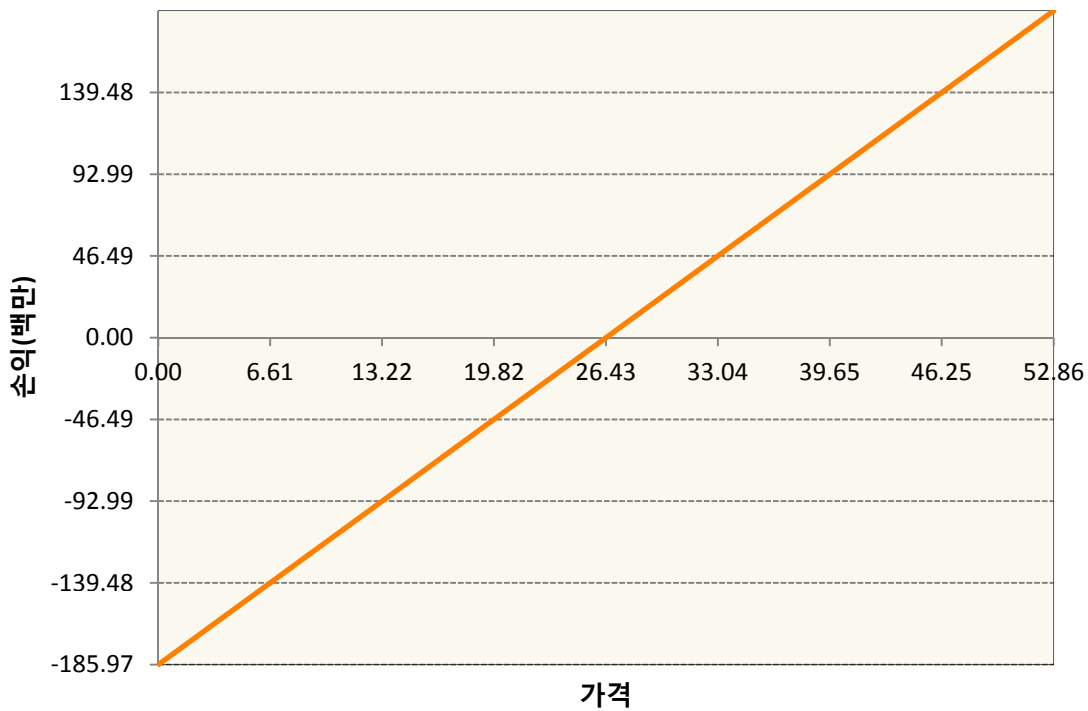
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

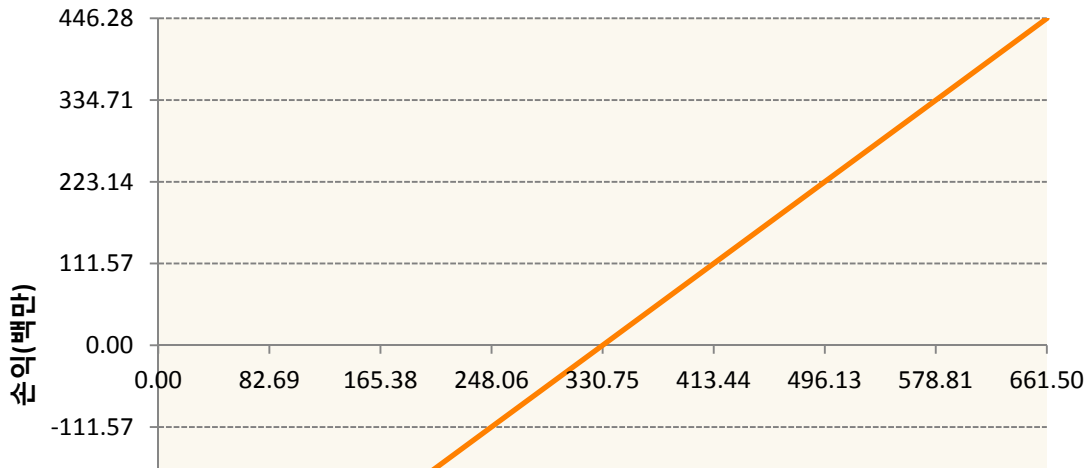
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,266	98	2,168	

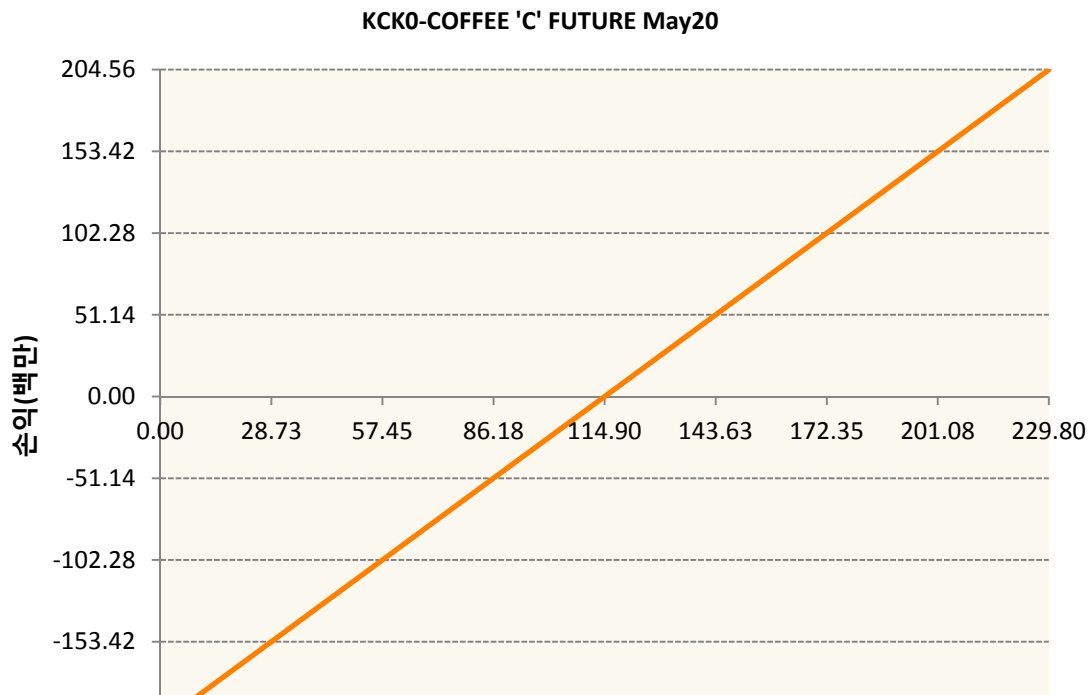
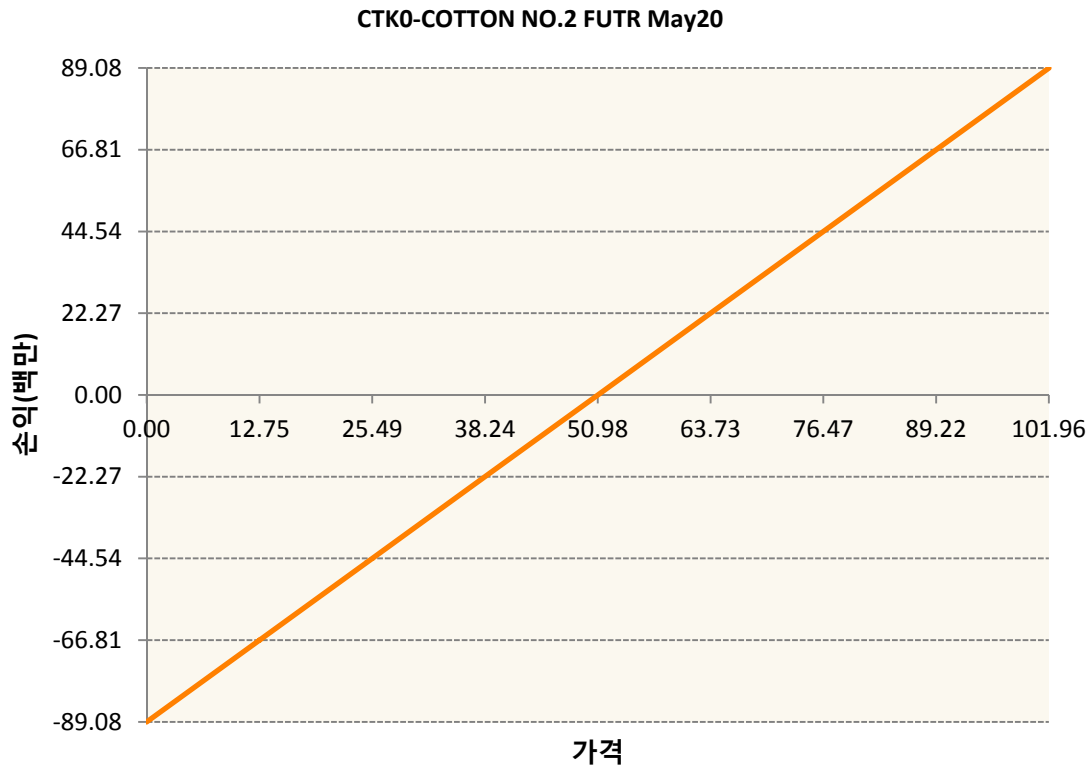
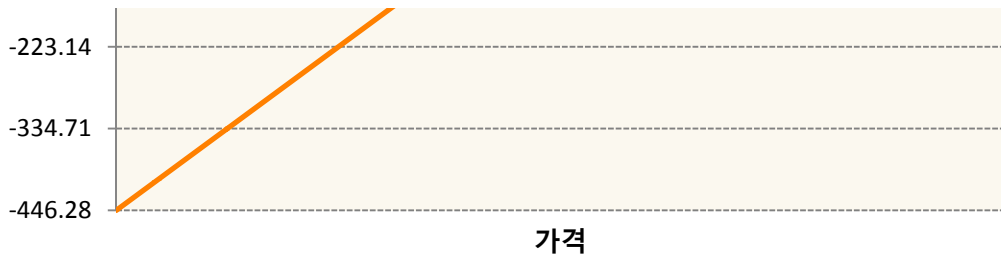
### 2. 만기시점의 손익구조

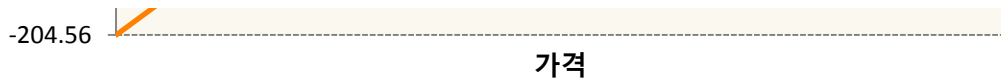
**BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20**



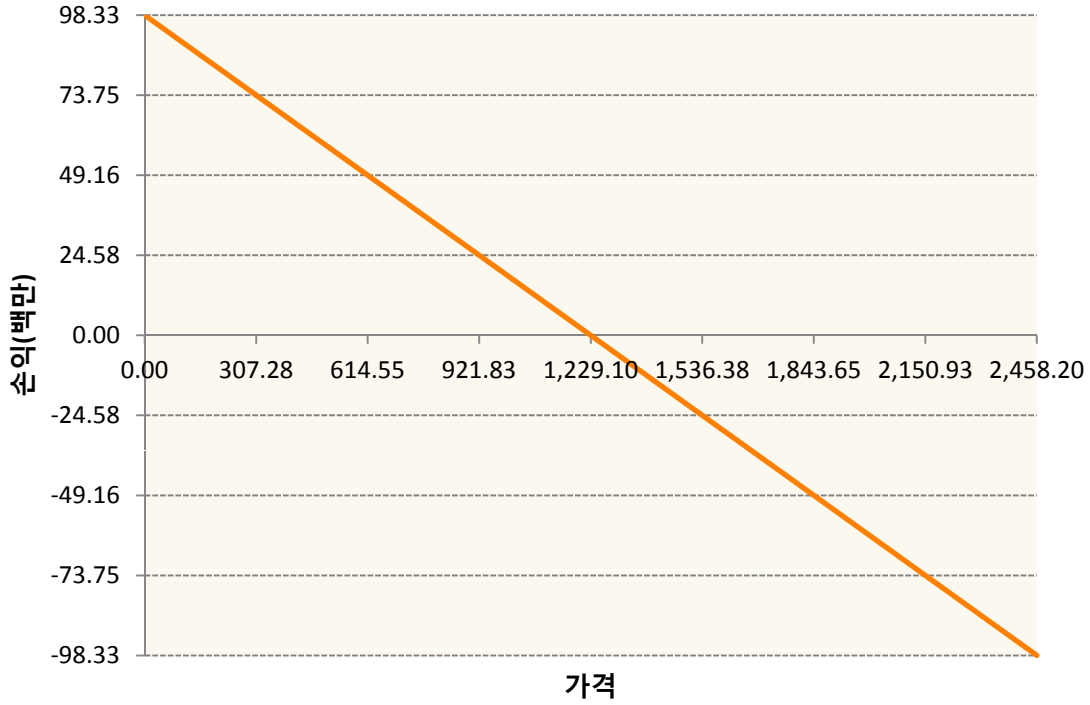
**CK0-CORN FUTURE May20**



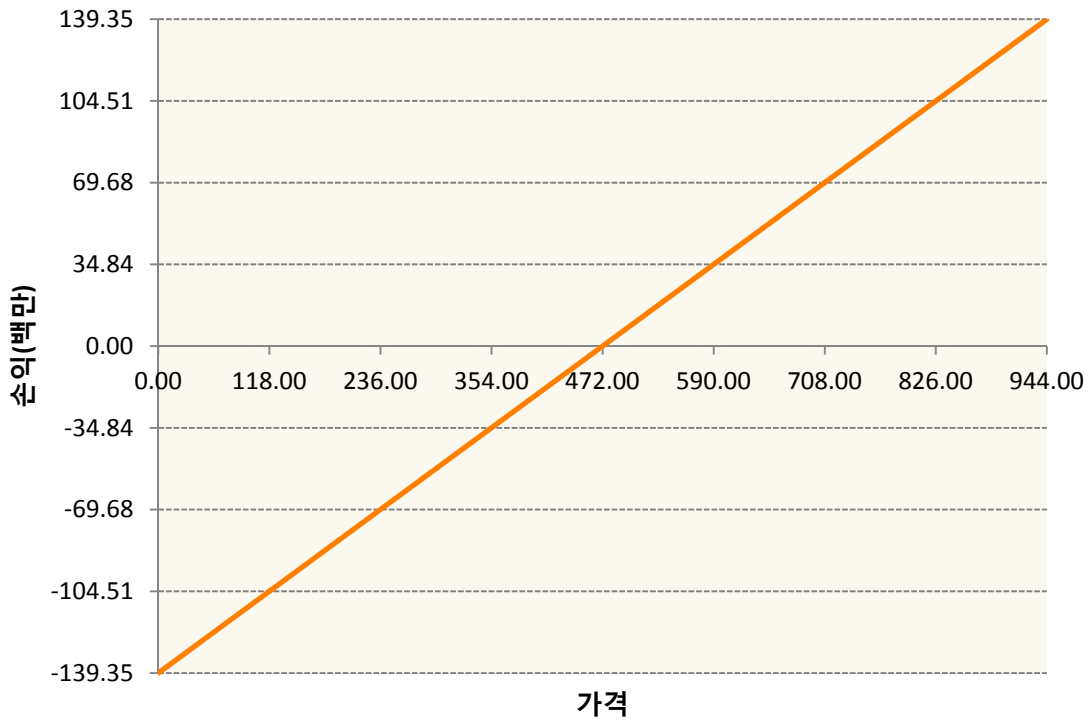




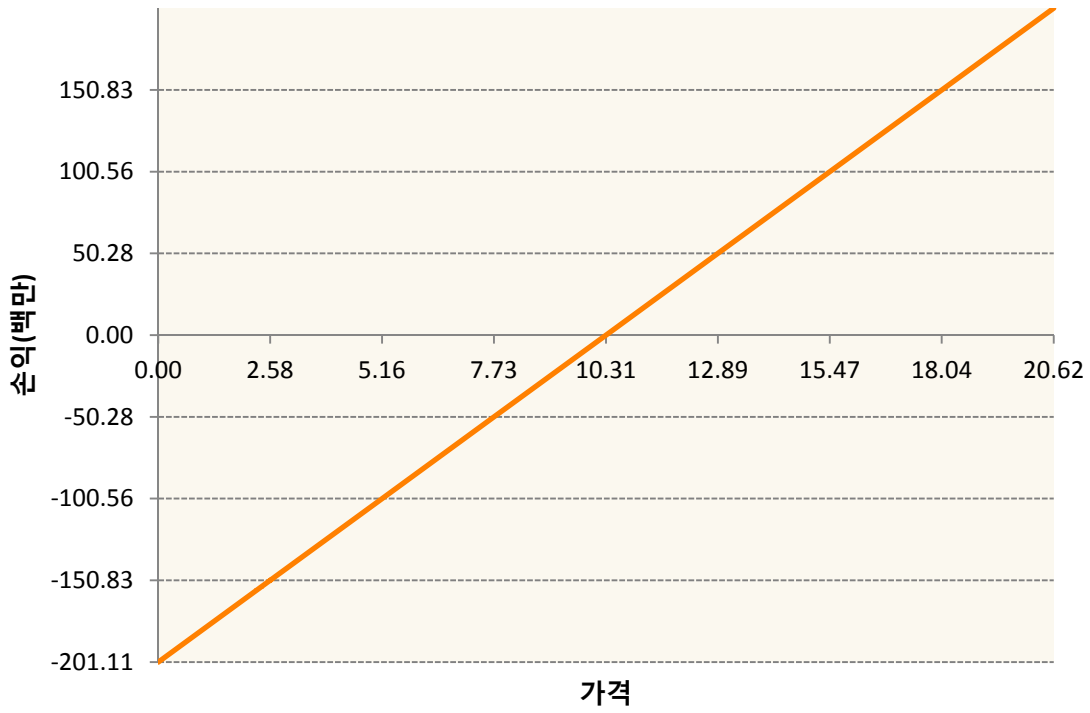
KR4175Q40008-2020-04 달러선물



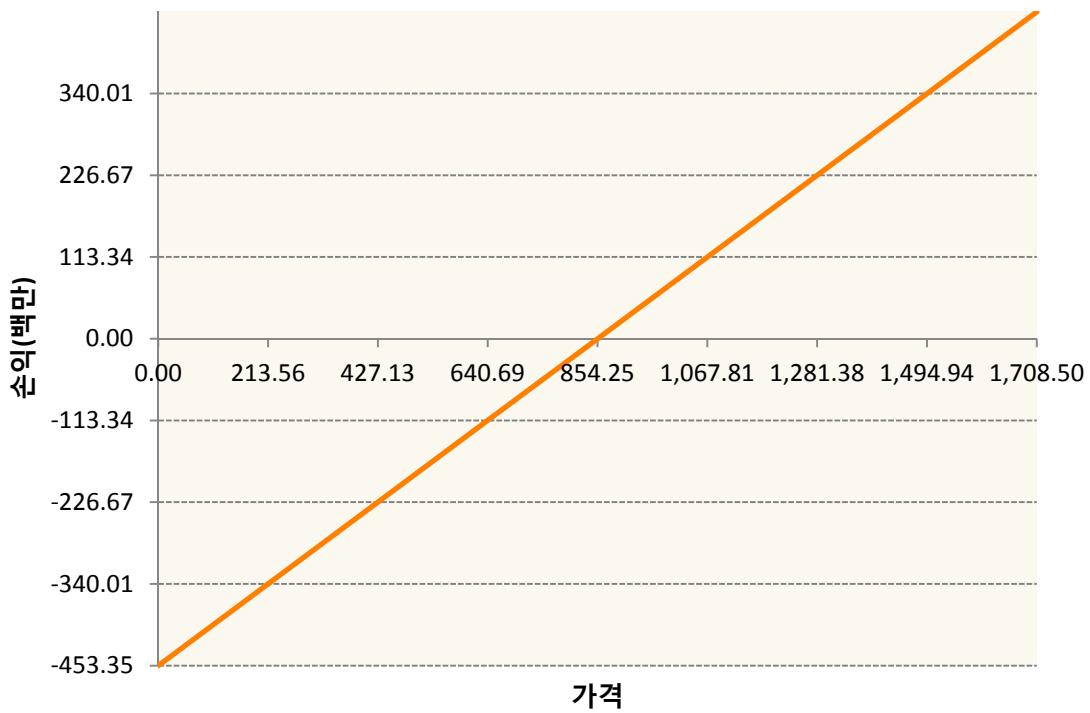
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



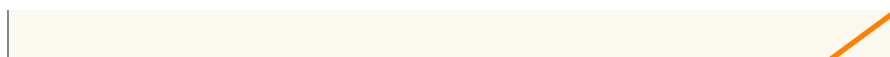
SBK0-Sugar May20

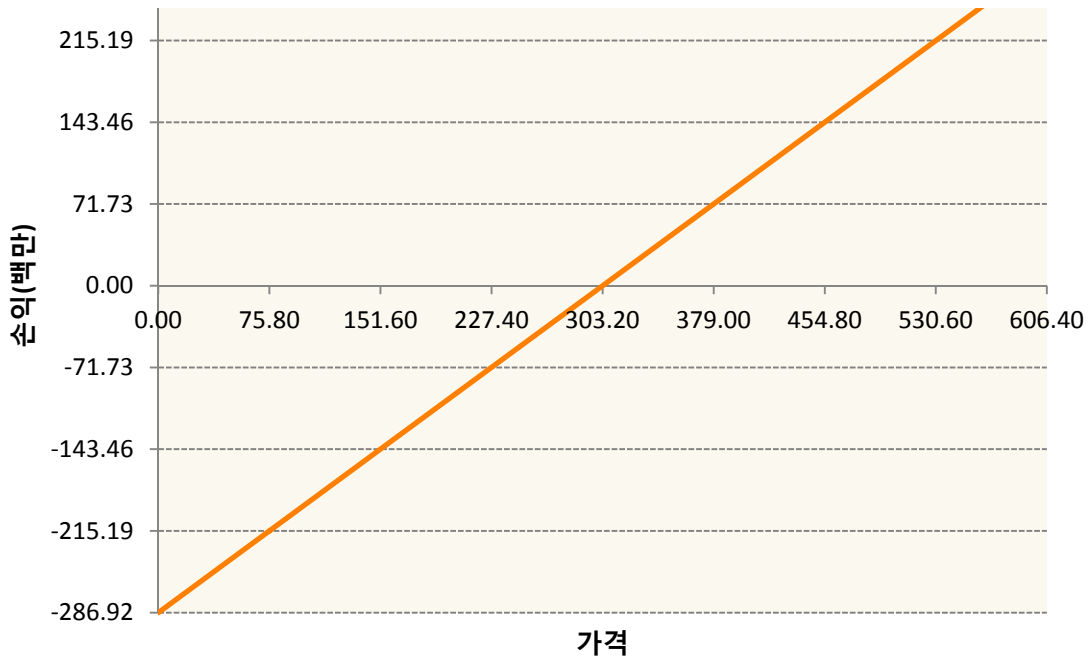


SK0-SOYBEAN FUTURE May20

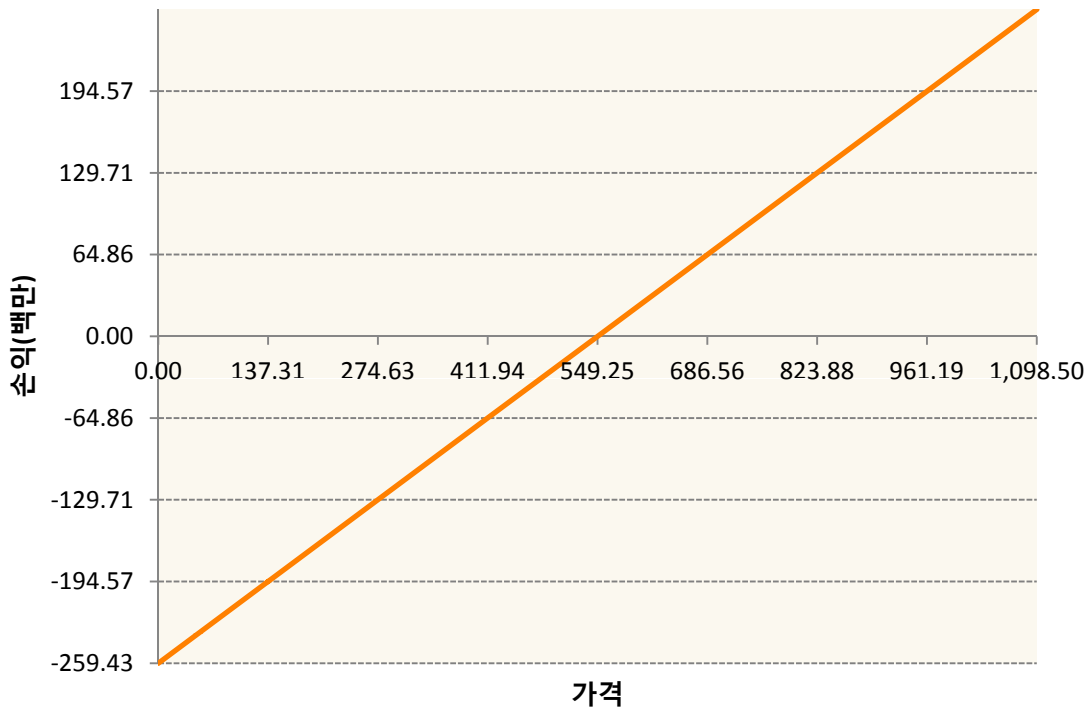


SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





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	16
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	21

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

(단위:백만원)

**211**