

공시일	2020-04-08
기준일	2020-04-07

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	2020-04-08
기준일	2020-04-07

스마트인덱스모

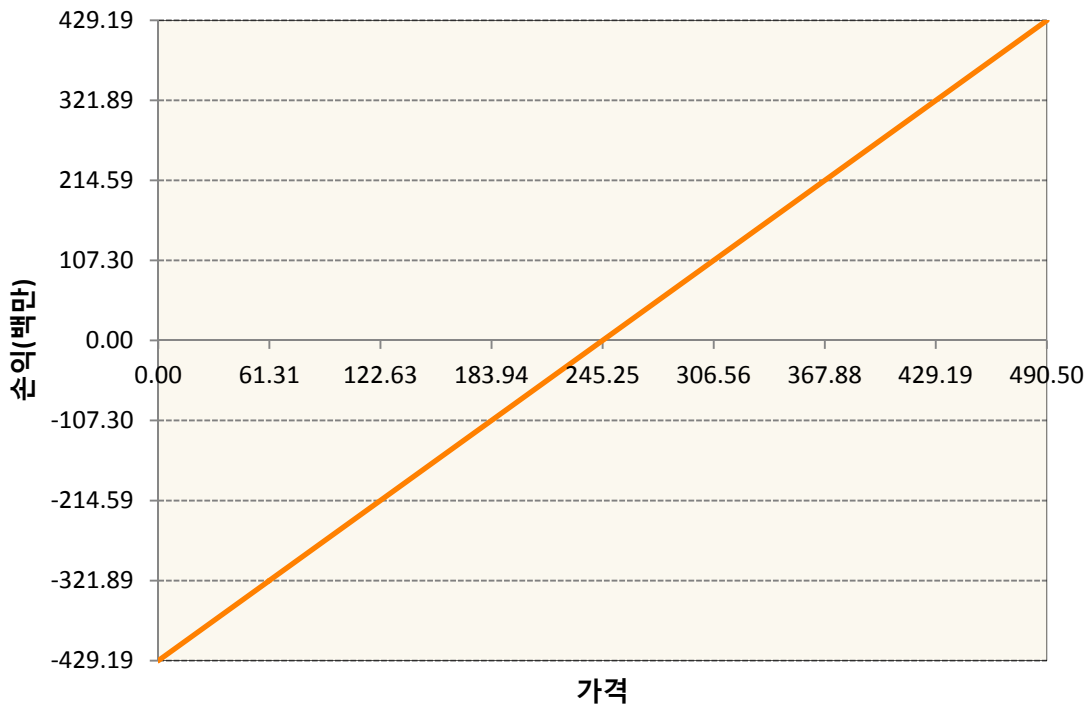
1. 계약금액

(단위:백만원)

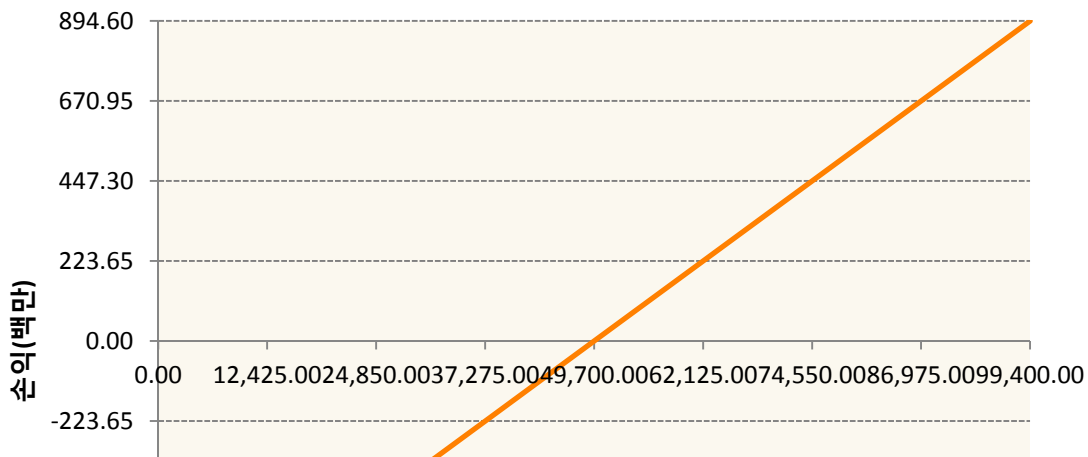
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	184	-184	장내
누계	유가증권	선물	1,324	0	1,324	장내

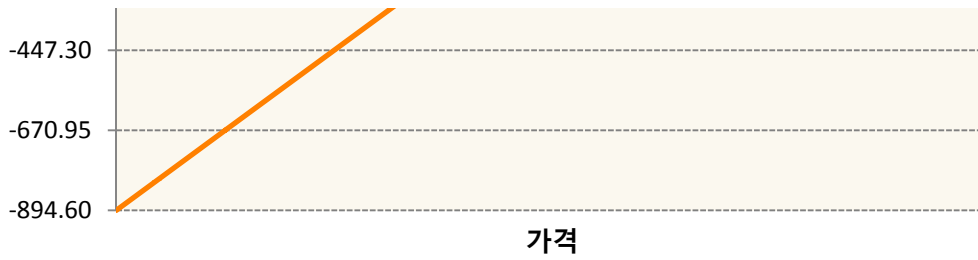
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



KR4111Q40003-2020-04 삼성전자개별선물





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						34
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	
-5.33%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23	
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	11	11	11	11	11	11	11	
5.33%	23	23	23	23	23	23	23	
8.00%	34	34	34	34	34	34	34	
KR4111Q40003		2020-04 삼성전자개별선물						71
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71	
-5.33%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48	
-2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	24	24	24	24	24	24	24	
5.33%	48	48	48	48	48	48	48	
8.00%	71	71	71	71	71	71	71	

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

155

공시일	2020-04-08
기준일	2020-04-07

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

906

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,039

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-08
기준일	2020-04-07

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

549

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

862

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-08
기준일	2020-04-07

유로인덱스모(주식-파생형)

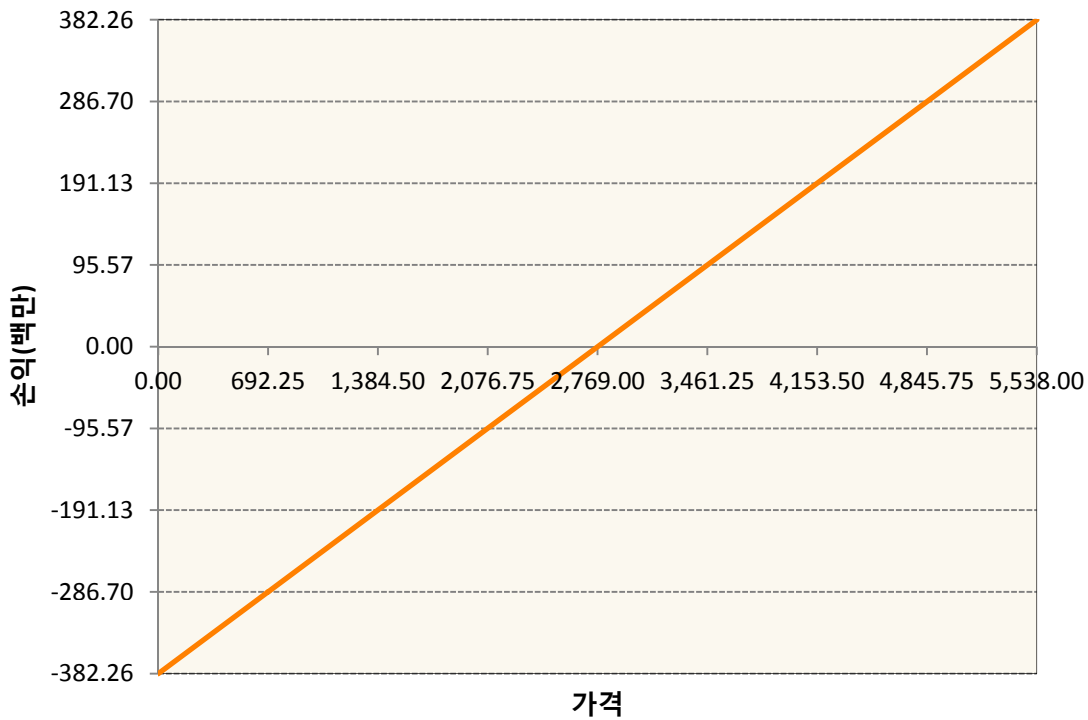
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	382	0	382	

2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	31
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

37

공시일	2020-04-08
기준일	2020-04-07

차이나인덱스모(주식-파생형)

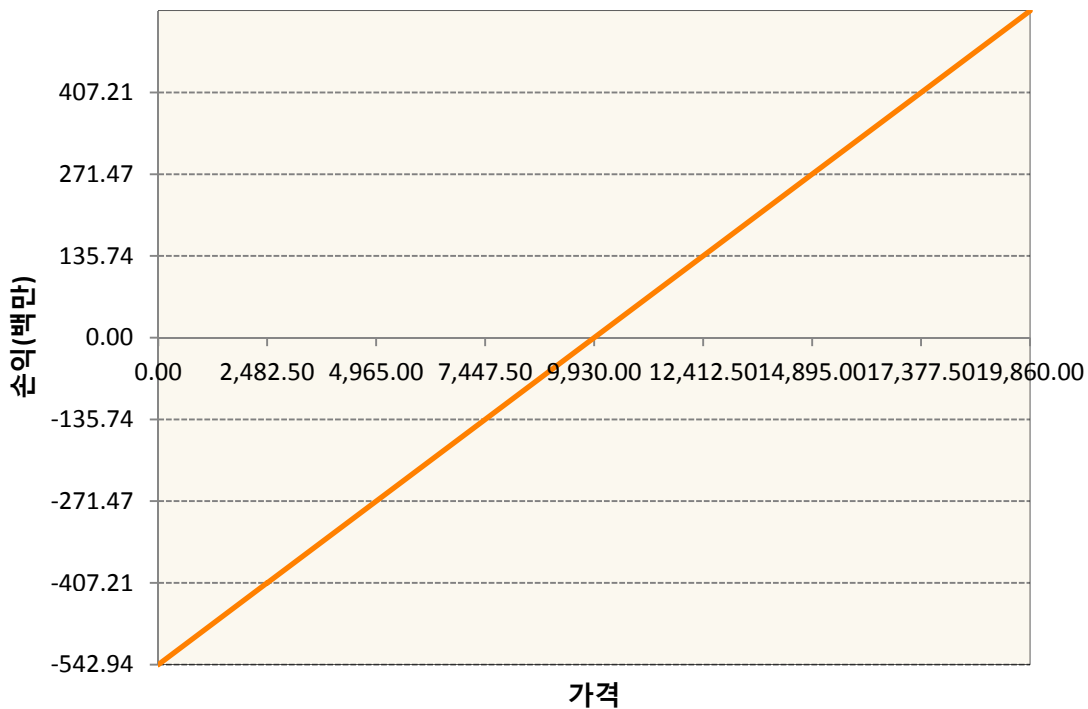
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	543	0	543	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCJ0-HSCEI Futures Apr20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ0	HSCEI Futures Apr20	43
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

46

공시일	2020-04-08
기준일	2020-04-07

커버드콜모(주식혼합-파생형)

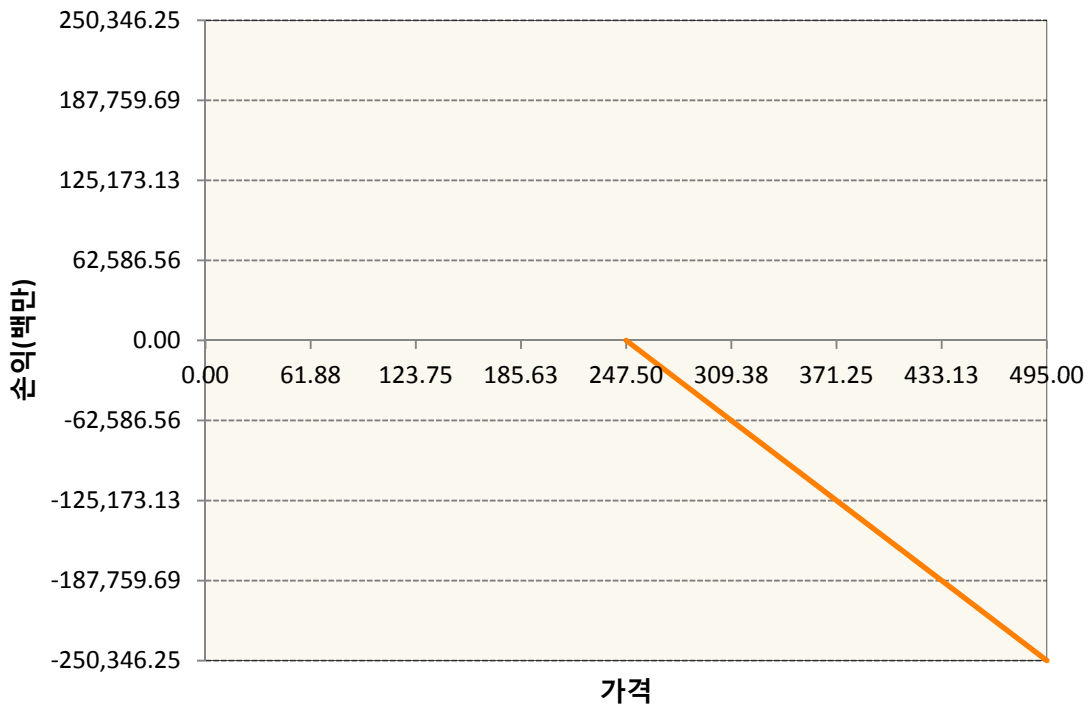
1. 계약금액

(단위:백만원)

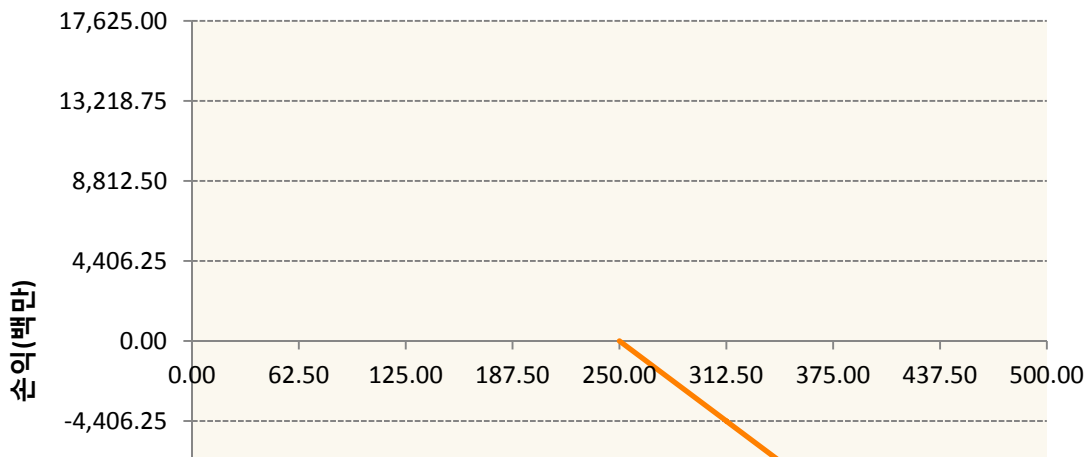
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	360,660	-360,660	장내

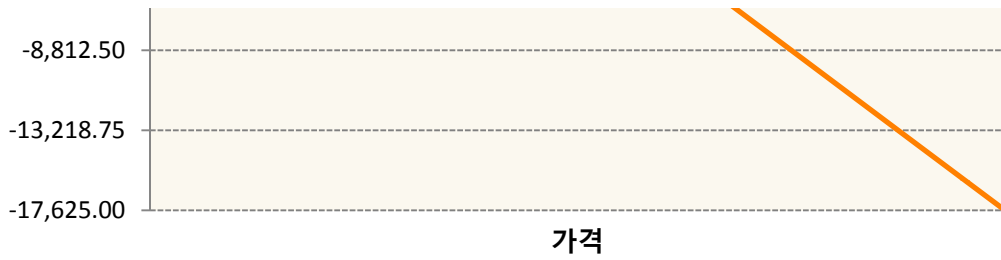
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

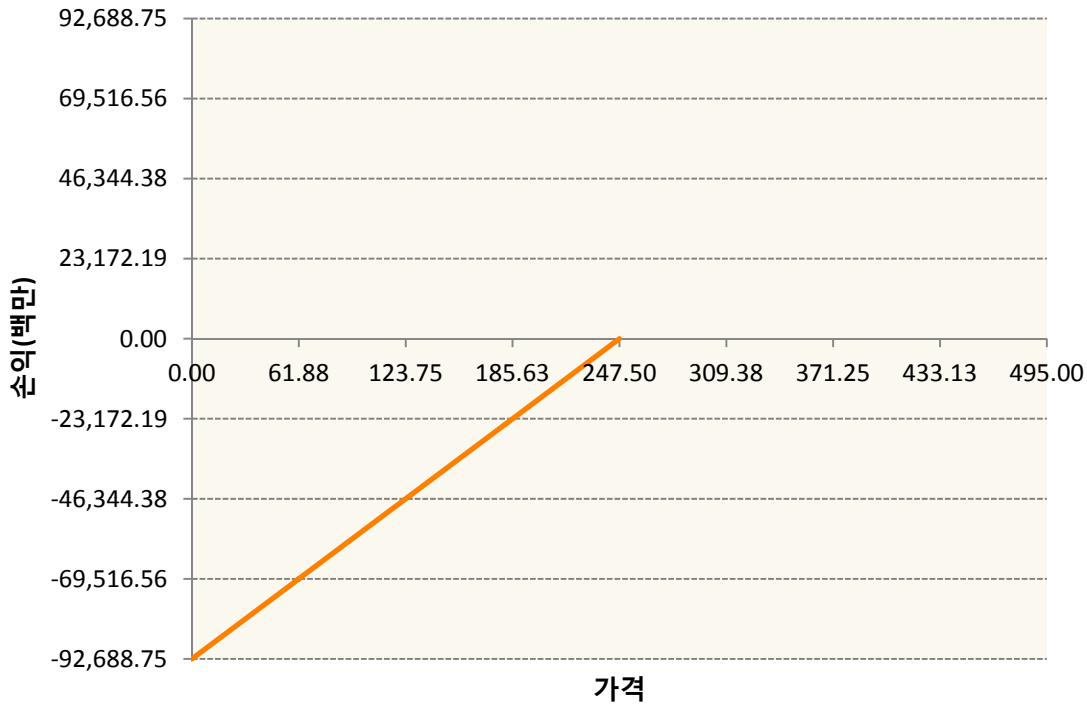


KR4201Q42503-2020-04 콜250





KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q42479		2020-04 콜247.5					15,019
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,554	2,552	2,547	2,537	2,520	2,494	2,459
-5.33%	2,531	2,504	2,462	2,403	2,328	2,237	2,129
-2.67%	2,263	2,125	1,966	1,788	1,594	1,388	1,170
0%	886	594	298	0	-300	-602	-906
2.67%	-2,672	-2,948	-3,230	-3,518	-3,811	-4,106	-4,404
5.33%	-8,206	-8,329	-8,476	-8,643	-8,827	-9,027	-9,239
8.00%	-14,601	-14,628	-14,672	-14,732	-14,810	-14,906	-15,019
KR4201Q42503		2020-04 콜250					947
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	120	120	119	119	119	118	116

-5.33%	119	118	117	114	111	107	101
-2.67%	111	105	97	88	78	67	54
0%	54	36	19	0	-19	-38	-58
2.67%	-132	-154	-176	-197	-219	-241	-263
5.33%	-472	-485	-500	-515	-532	-549	-566
8.00%	-903	-906	-912	-919	-927	-936	-947
KR4301Q42477 2020-04 풋247.5							6,676
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,670	-6,670	-6,670	-6,671	-6,672	-6,673	-6,676
-5.33%	-4,226	-4,228	-4,231	-4,238	-4,247	-4,260	-4,276
-2.67%	-1,817	-1,841	-1,872	-1,909	-1,952	-1,999	-2,050
0%	250	168	85	0	-85	-172	-259
2.67%	1,361	1,287	1,210	1,131	1,050	967	883
5.33%	1,631	1,611	1,585	1,552	1,514	1,471	1,423
8.00%	1,657	1,655	1,651	1,645	1,635	1,622	1,605

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

(단위:백만원)

24,626

공시일	2020-04-08
기준일	2020-04-07

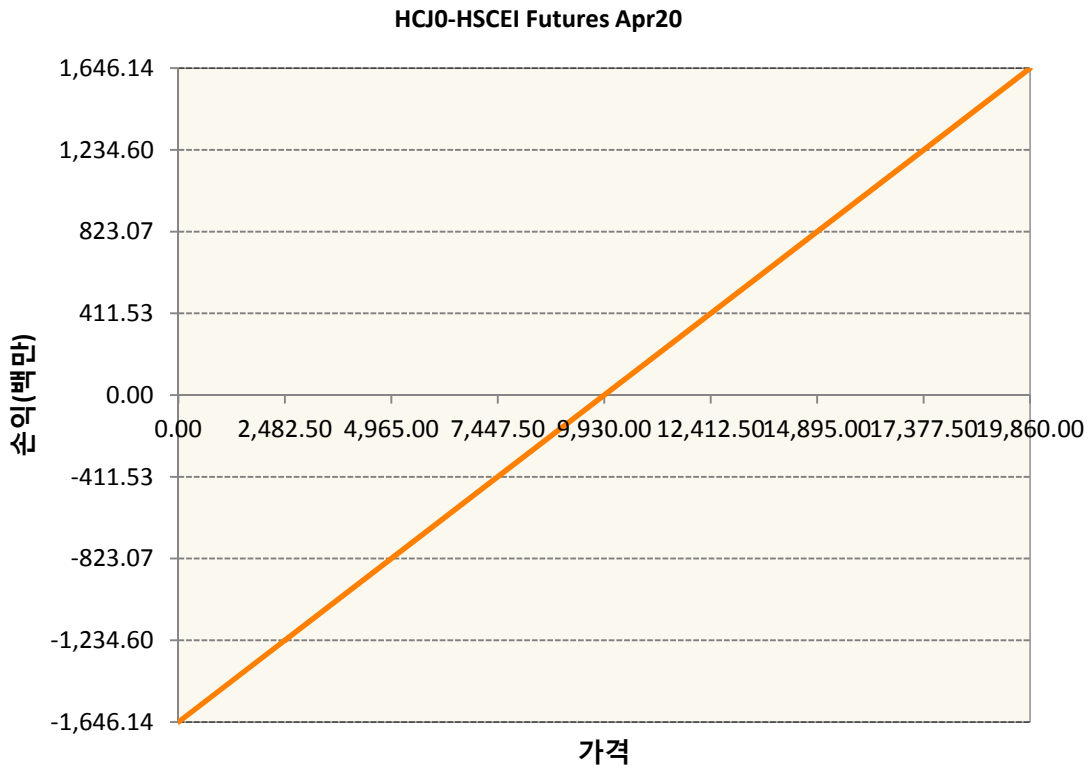
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

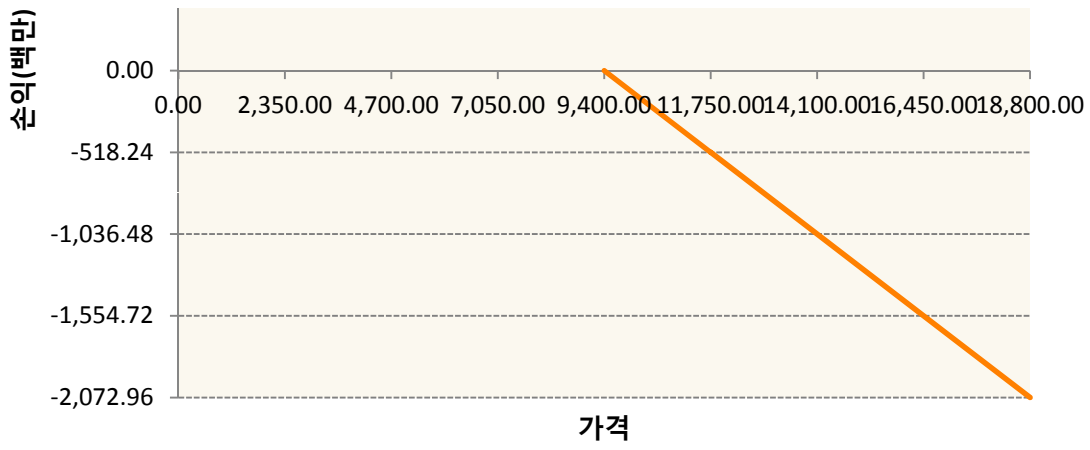
1. 계약금액

(단위:백만원)

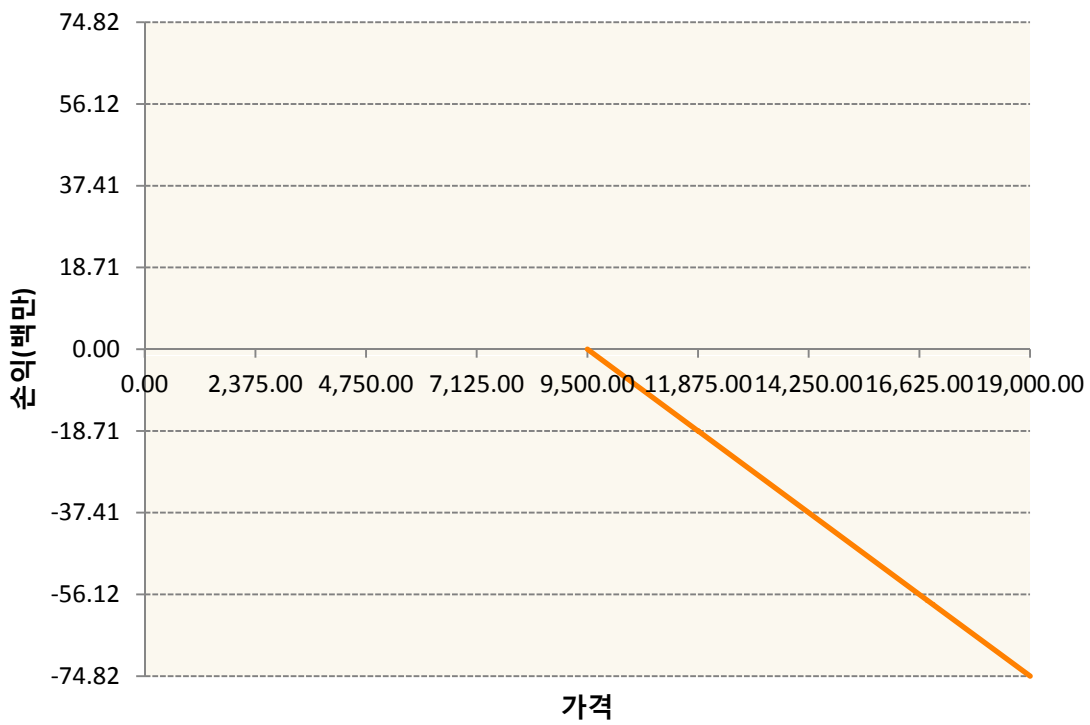
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,646	0	1,646	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,148	-4,148	장내
누계	통화	선도	693	2,218	-1,525	장외

2. 만기시점의 손익구조

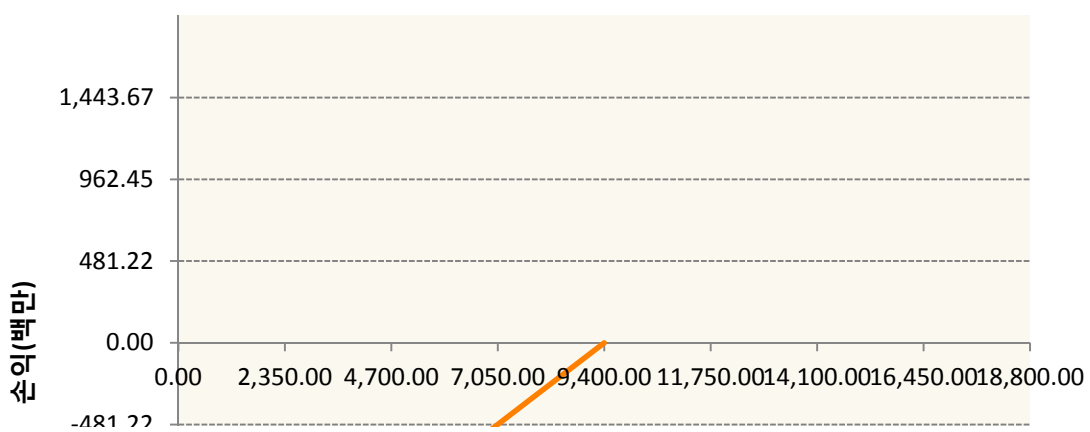


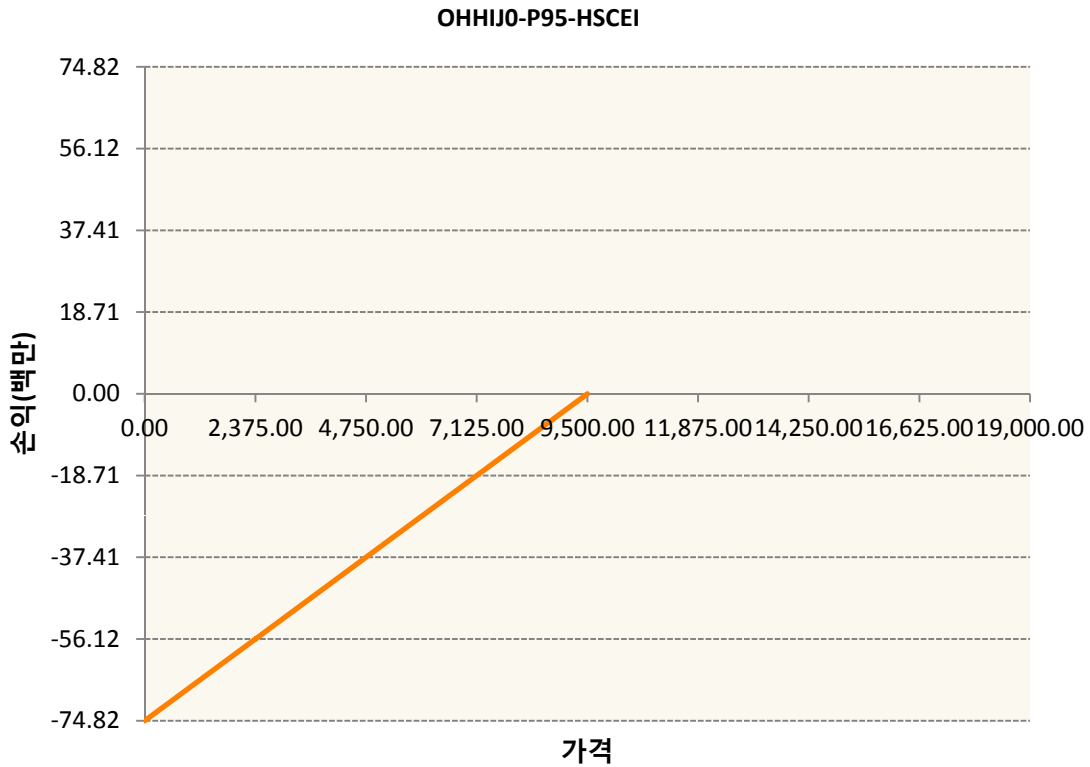


OHHIJO-C95-HSCEI



OHHIJO-P94-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E	177
FX21020H05 HKD/KRW 22-05-20E	55
HCJ0 HSCEI Futures Apr20	132
OHHIJ0-C94 HSCEI	166
OHHIJ0-C95 HSCEI	6
OHHIJ0-P94 HSCEI	154
OHHIJ0-P95 HSCEI	6

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	606

공시일	2020-04-08
기준일	2020-04-07

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

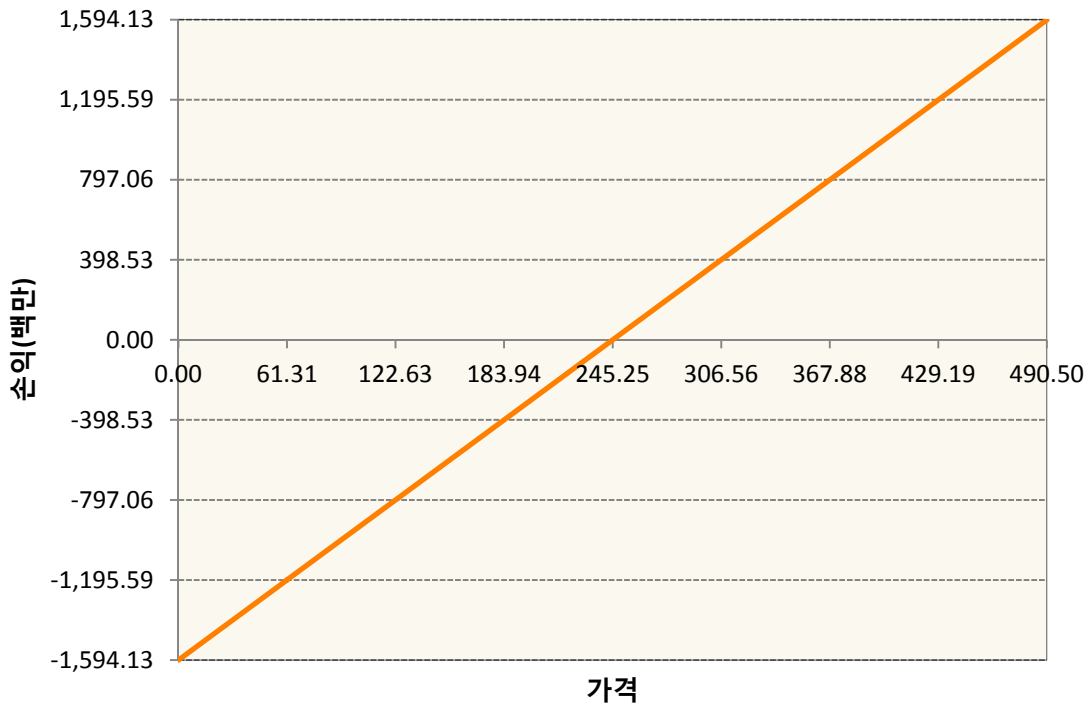
1. 계약금액

(단위:백만원)

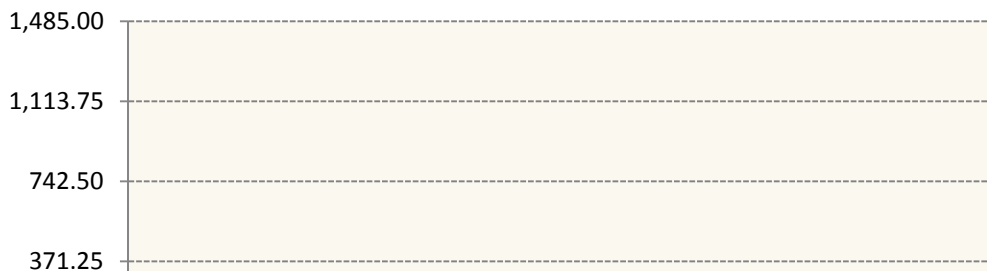
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,594	0	1,594	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,095	-3,095	장내

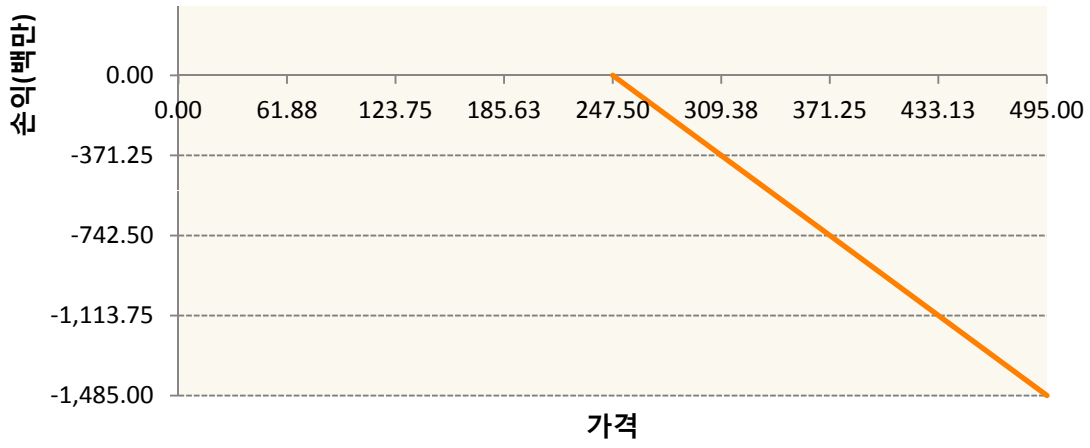
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

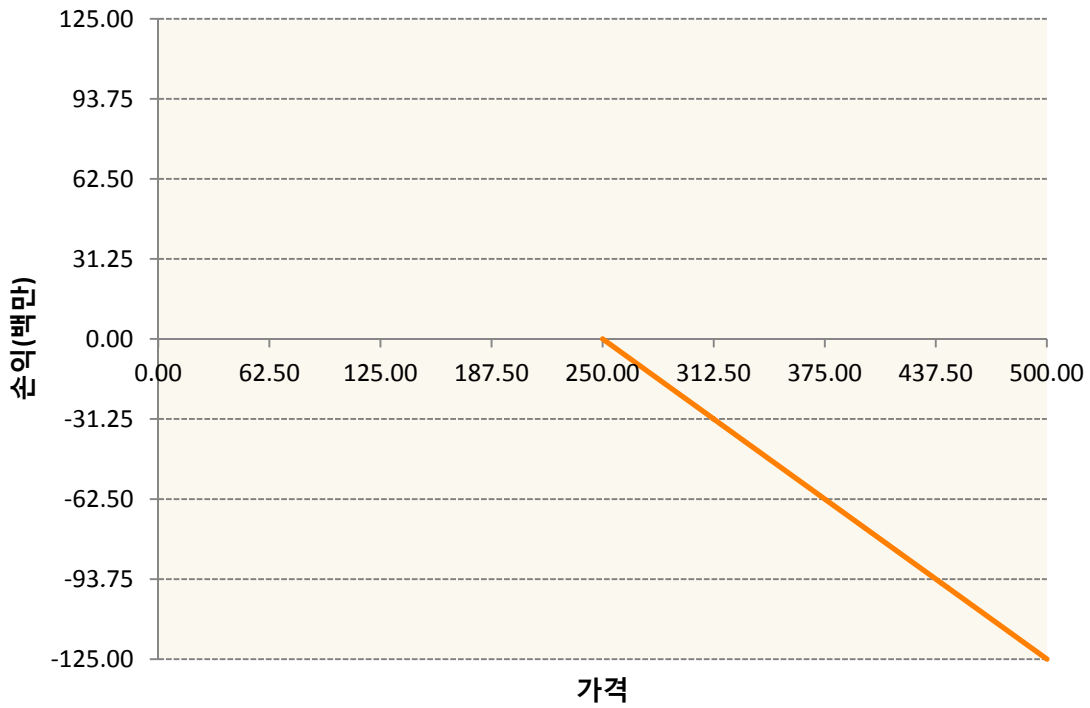


KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

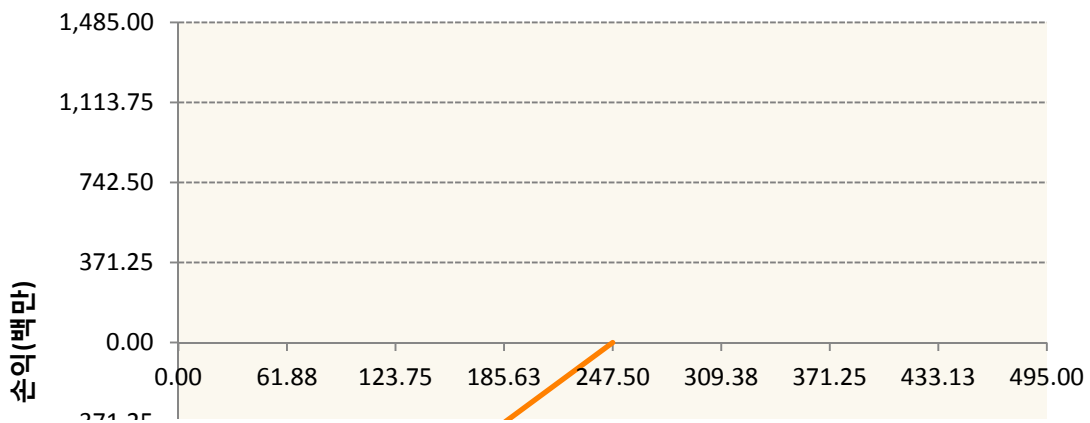




KR4201Q42503-2020-04 콜250



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						127
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127	
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85	
-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%	85	85	85	85	85	85	85	
8.00%	127	127	127	127	127	127	127	
KR4201Q42479		2020-04 콜247.5						89
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	15	15	15	15	15	15	15	
-5.33%	15	15	15	14	14	13	13	
-2.67%	13	13	12	11	9	8	7	
0%	5	4	2	0	-2	-4	-5	
2.67%	-16	-17	-19	-21	-23	-24	-26	
5.33%	-49	-49	-50	-51	-52	-54	-55	
8.00%	-87	-87	-87	-87	-88	-88	-89	
KR4201Q42503		2020-04 콜250						7
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	1	1	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-1	-1	-1	-1	-2	-2	-2
5.33%	-3	-3	-4	-4	-4	-4	-4
8.00%	-6	-6	-6	-7	-7	-7	-7
KR4301Q42477 2020-04 풋247.5							107
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107
-5.33%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-69
-2.67%	-29	-30	-30	-31	-31	-32	-33
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4
2.67%	22	21	19	18	17	15	14
5.33%	26	26	25	25	24	24	23
8.00%	27	27	26	26	26	26	26

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

(단위:백만원)

599

공시일	2020-04-08
기준일	2020-04-07

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

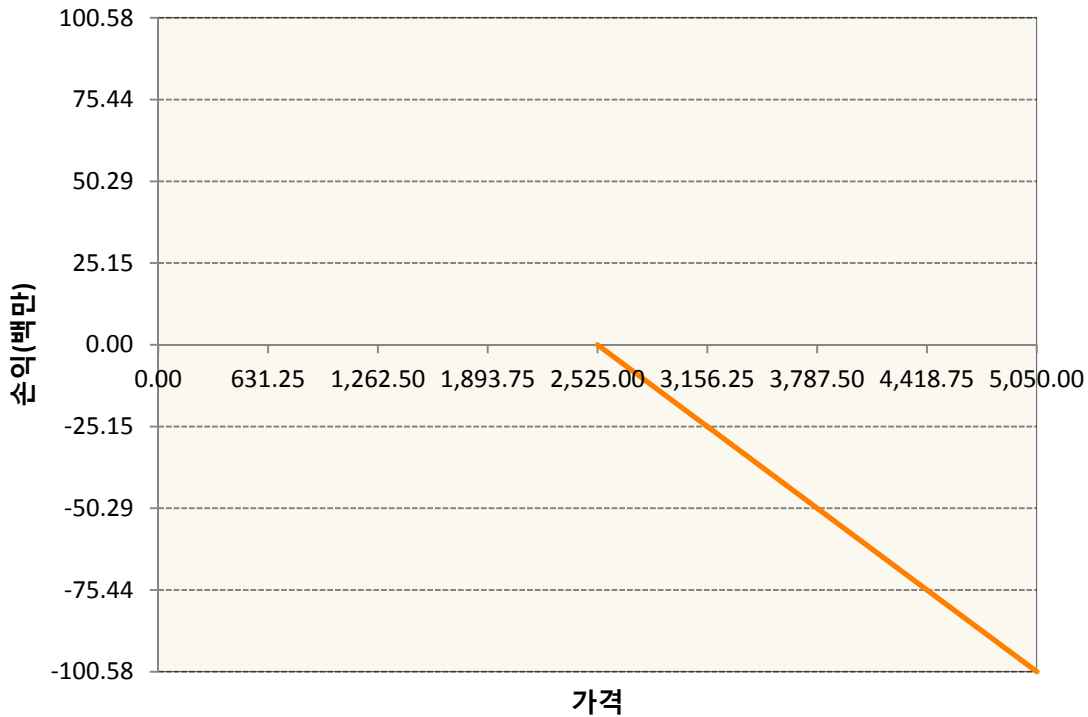
1. 계약금액

(단위:백만원)

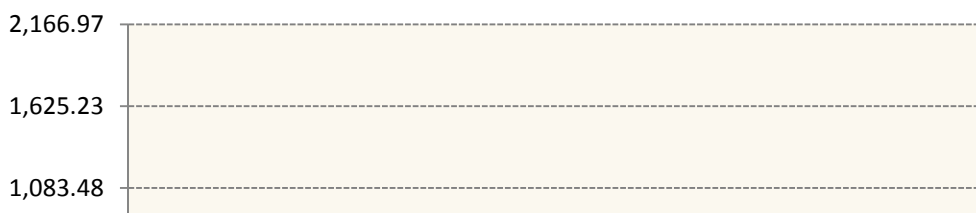
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	338	0	338	
누계	유가증권	스왑	7,542	0	7,542	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,569	-4,569	장내
누계	통화	선도	0	2,687	-2,687	장외

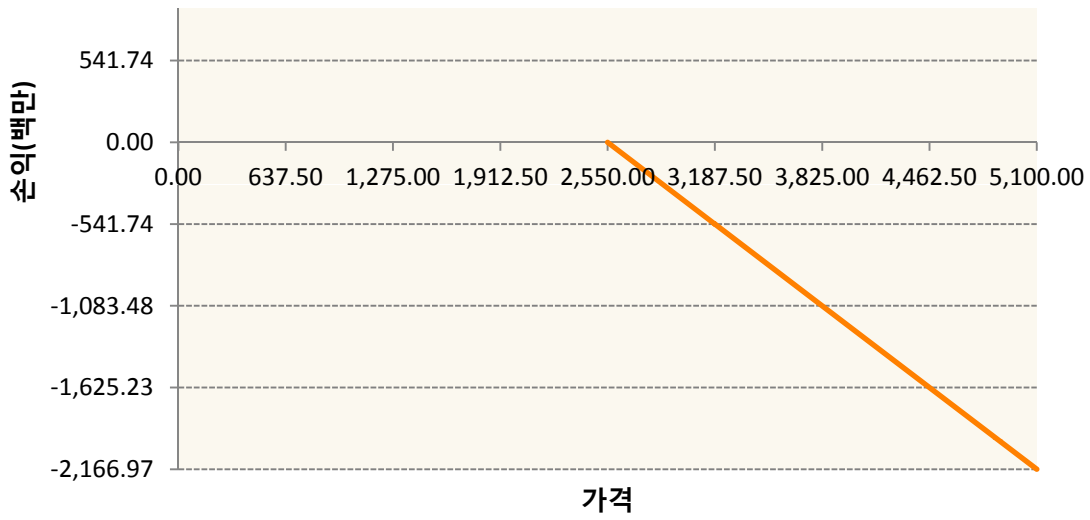
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ0-C2525-EURO STOXX 50

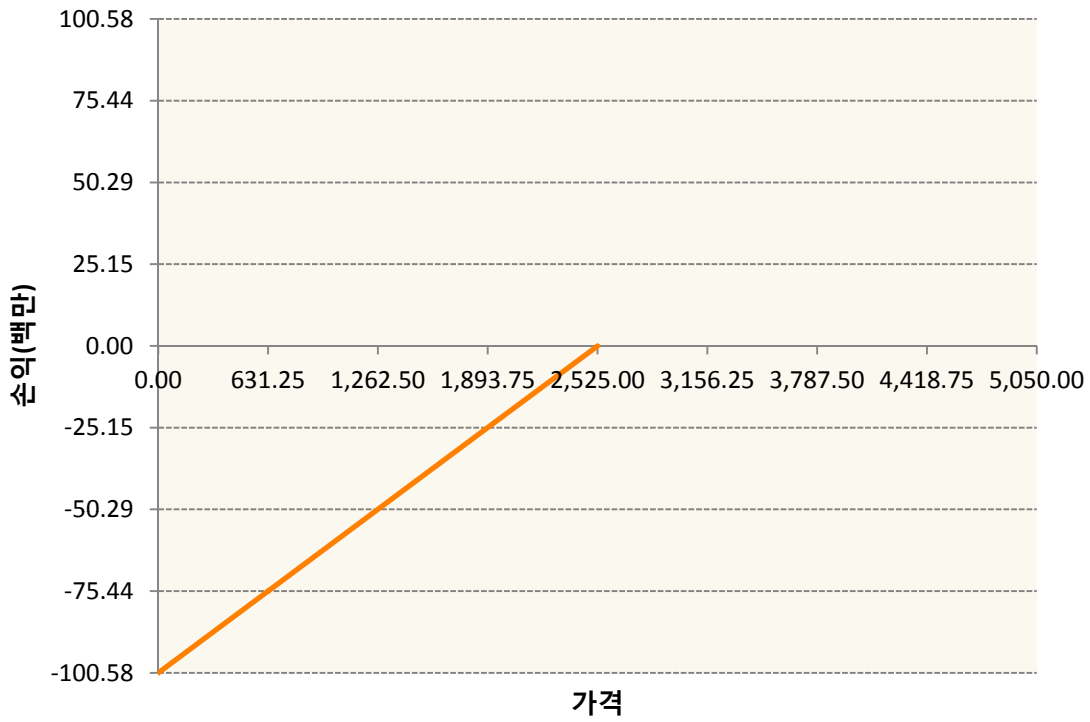


OESXJ0-C2550-EURO STOXX 50

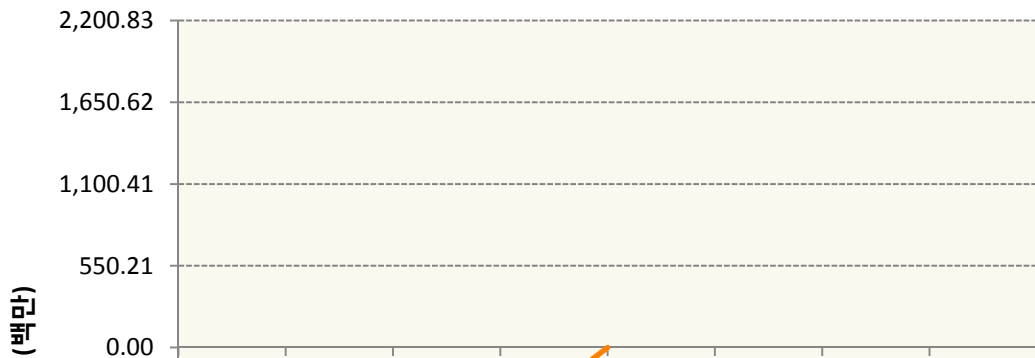


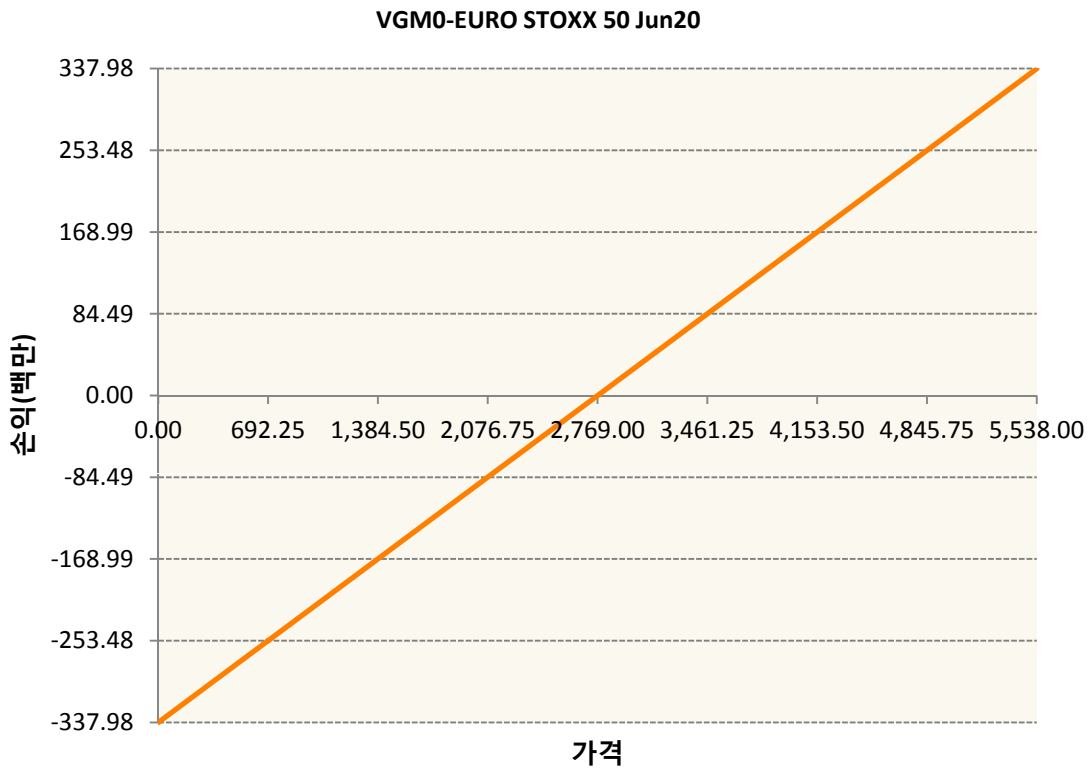
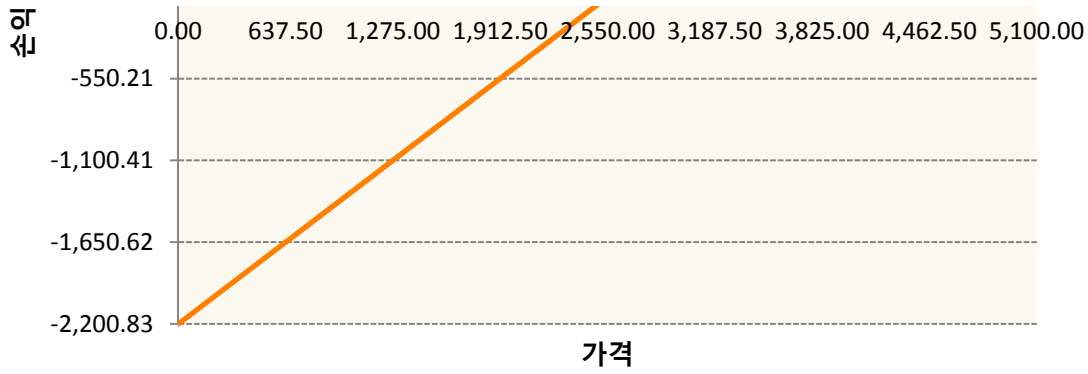


OESXJ0-P2525-EURO STOXX 50



OESXJ0-P2550-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		27
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E		215
OESXJ0-C25: EURO STOXX 50		8
OESXJ0-C25: EURO STOXX 50		173
OESXJ0-P25: EURO STOXX 50		8
OESXJ0-P25: EURO STOXX 50		176
VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	27

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

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

(단위:백만원)

1,068

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

(단위:백만원)

93

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

(단위:백만원)

135

공시일	2020-04-08
기준일	2020-04-07

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

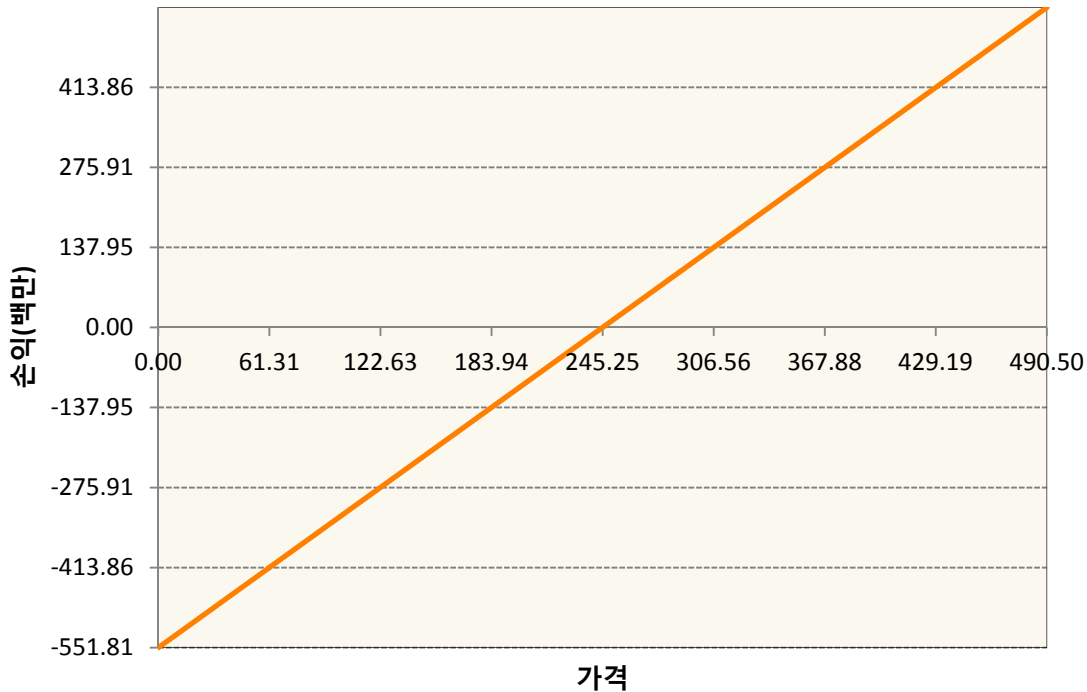
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	552	0	552	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						44
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44	
-5.33%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29	
-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%	29	29	29	29	29	29	29	
8.00%	44	44	44	44	44	44	44	

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

(단위:백만원)

64

공시일	2020-04-08
기준일	2020-04-07

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

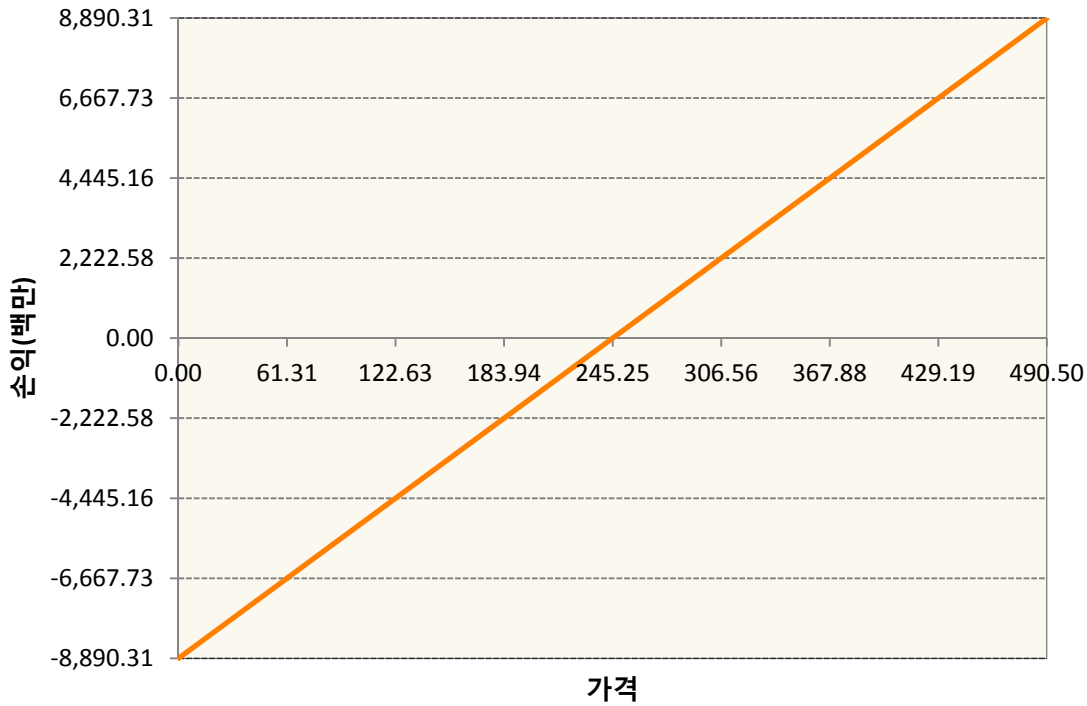
1. 계약금액

(단위:백만원)

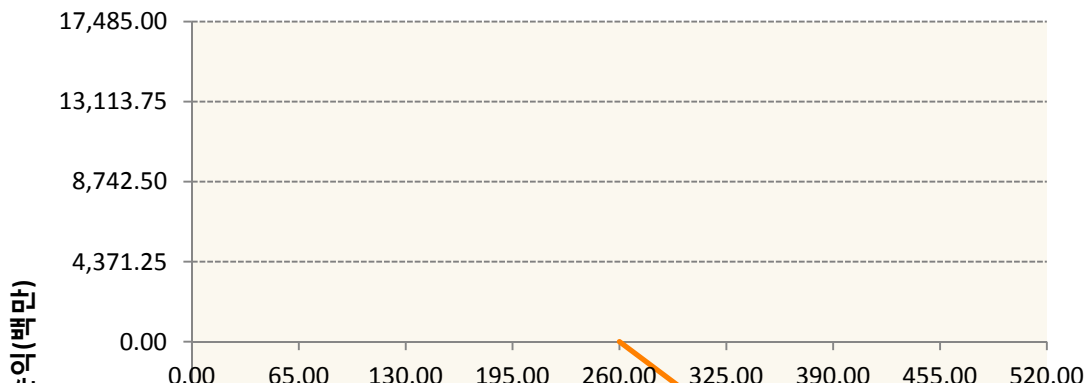
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,890	0	8,890	장내
누계	유가증권	옵션	6,004	17,485	-11,481	장내

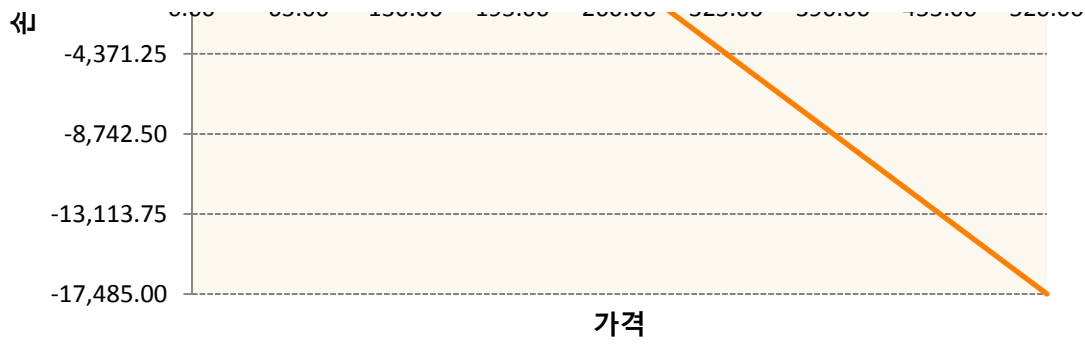
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

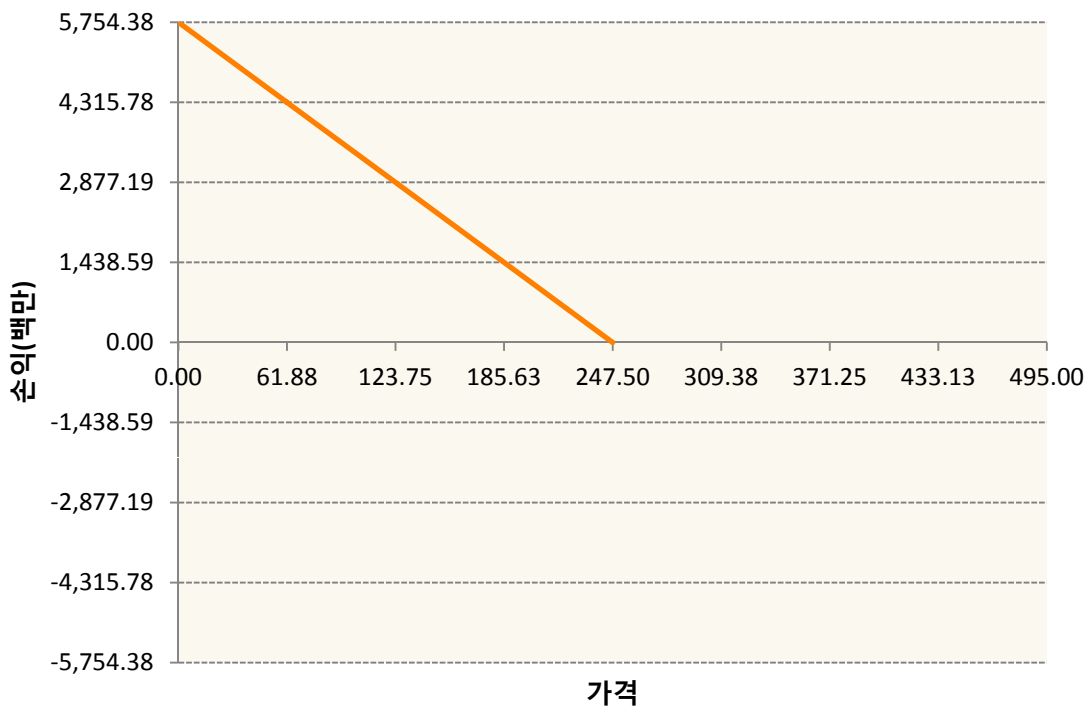


KR4201Q42602-2020-04 콜260

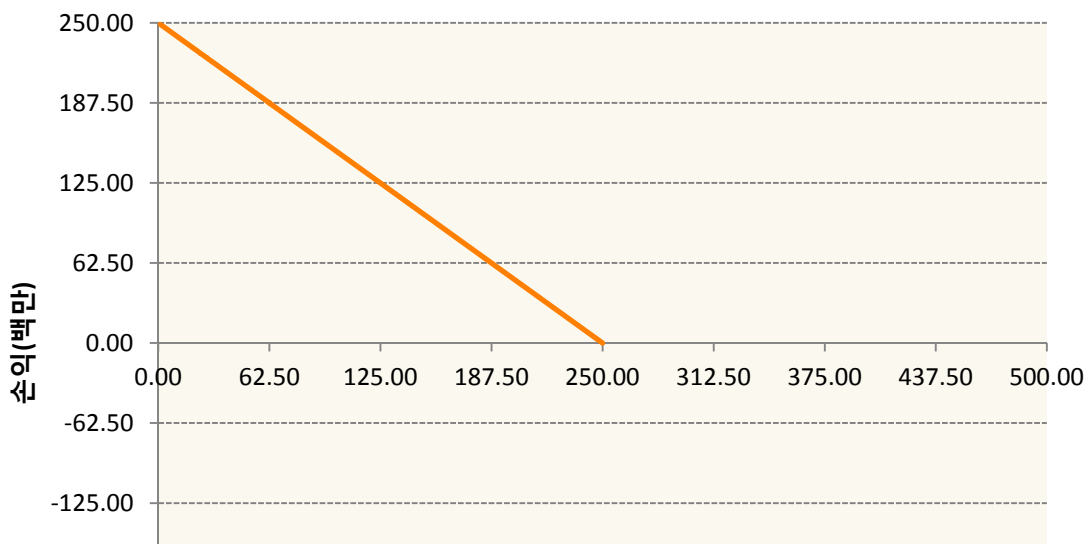


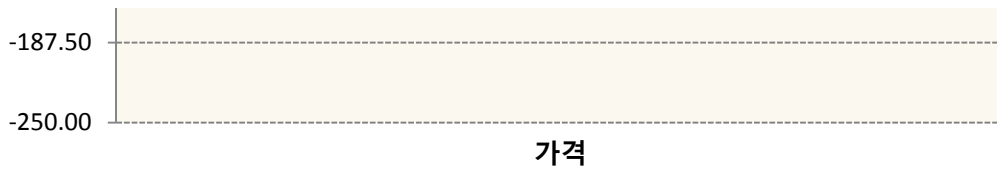


KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



KR4301Q42501-2020-04 풋250





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						710
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-710	-710	-710	-710	-710	-710	-710	
-5.33%	-473	-473	-473	-473	-473	-473	-473	
-2.67%	-237	-237	-237	-237	-237	-237	-237	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	237	237	237	237	237	237	237	
5.33%	473	473	473	473	473	473	473	
8.00%	710	710	710	710	710	710	710	
KR4201Q42602		2020-04 콜260						487
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	15	15	15	15	15	15	15	
-5.33%	15	15	15	15	15	14	13	
-2.67%	15	15	14	13	11	9	5	
0%	12	9	5	0	-7	-14	-23	
2.67%	-13	-24	-37	-51	-65	-81	-98	
5.33%	-119	-140	-161	-182	-204	-225	-247	
8.00%	-368	-386	-406	-425	-446	-466	-487	
KR4301Q42477		2020-04 풋247.5						414
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	414	414	414	414	414	414	414	
-5.33%	262	262	263	263	264	264	265	
-2.67%	113	114	116	119	121	124	127	
0%	-15	-10	-5	0	5	11	16	
2.67%	-84	-80	-75	-70	-65	-60	-55	
5.33%	-101	-100	-98	-96	-94	-91	-88	
8.00%	-103	-103	-103	-102	-102	-101	-100	
KR4301Q42501		2020-04 풋250						19
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	19	19	19	19	19	19	19	
-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%	-5	-4	-4	-4	-4	-3	-3
5.33%	-6	-6	-6	-6	-5	-5	-5
8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6

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

(단위:백만원)

1,600

공시일	2020-04-08
기준일	2020-04-07

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	145,410	0	145,410	

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	2020-04-08
기준일	2020-04-07

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	98,047	0	98,047	

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	2020-04-08
기준일	2020-04-07

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	433,195	0	433,195	
누계	통화	선도	71,440	495,685	-424,245	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,361
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,954
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,908
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,286
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,954
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,442
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,032
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,032
FX21020H04 USD/KRW 21-04-20E	1,465
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,384
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	977
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	977
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,540
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	840
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	733
FX21020H09 USD/KRW 24-04-20E	733
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	488
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,419
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,936
FX21020H11 KRW/USD 11-05-20E	977
FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E	2,931
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

22,385

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

(단위:백만원)

184

공시일	2020-04-08
기준일	2020-04-07

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

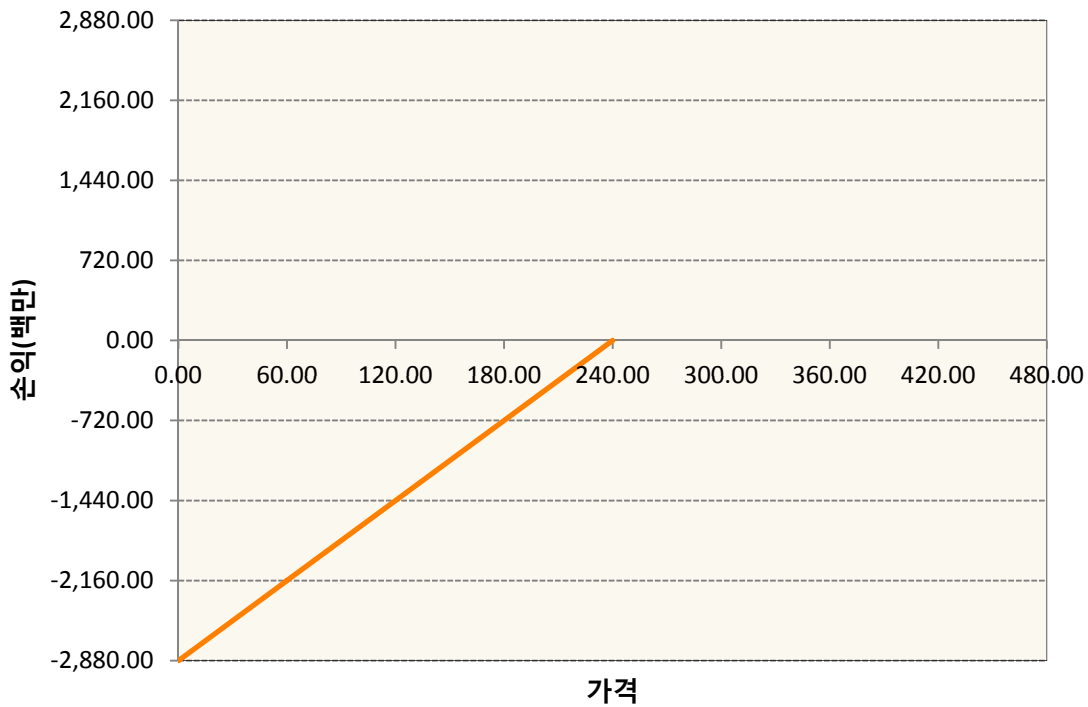
1. 계약금액

(단위:백만원)

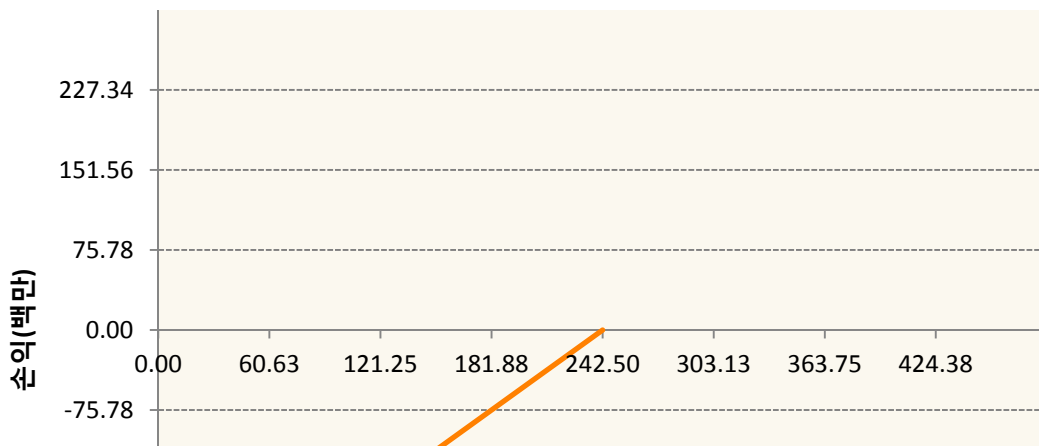
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,183	-3,183	장내

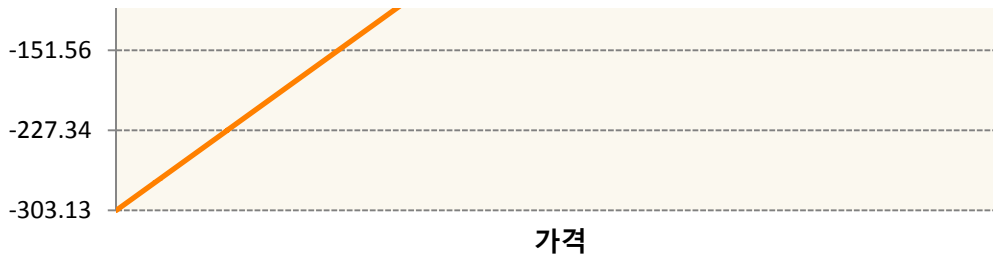
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q42402-2020-04 풋240



KR4301Q42428-2020-04 풋242.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q42402		2020-04 풋240						166
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-164	-164	-164	-164	-165	-165	-166	
-5.33%	-87	-88	-89	-91	-92	-94	-95	
-2.67%	-24	-27	-29	-32	-35	-38	-40	
0%	6	4	2	0	-2	-5	-7	
2.67%	12	12	11	11	10	9	7	
5.33%	13	13	13	13	12	12	12	
8.00%	13	13	13	13	13	13	13	
KR4301Q42428		2020-04 풋242.5						19
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
-5.33%	-11	-11	-11	-11	-11	-12	-12	
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-5	-5	-5	
0%	1	1	0	0	0	-1	-1	
2.67%	2	2	2	2	2	1	1	
5.33%	2	2	2	2	2	2	2	
8.00%	2	2	2	2	2	2	2	

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

183

공시일	2020-04-08
기준일	2020-04-07

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	7,141	0	7,141	
누계	통화	선도	440	7,584	-7,144	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H02 KRW/USD 13-04-20E	355
FX21020H10 USD/KRW 13-04-20E	35
FX21020H11 KRW/USD 29-04-20E	226
FX21020J004 KRW/USD 29-04-20E	26
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

317

공시일	2020-04-08
기준일	2020-04-07

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

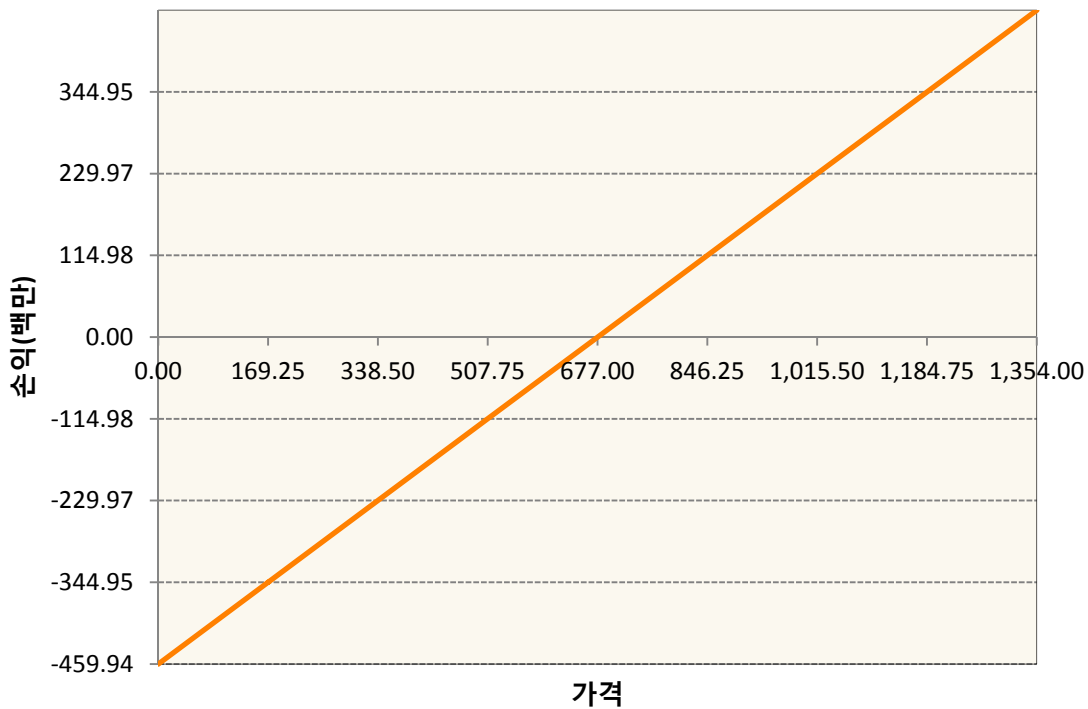
1. 계약금액

(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	460	0	460	
누계	유가증권	스왑	1,095	0	1,095	장외
누계	통화	선도	231	398	-167	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
FX21020J008 KRW/EUR 24-07-20E
FX21020J009 KRW/EUR 24-07-20E
VNCJ0 VN30 Index Future Apr20

8
3
5
37

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

(단위:백만원)

139

공시일	2020-04-08
기준일	2020-04-07

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

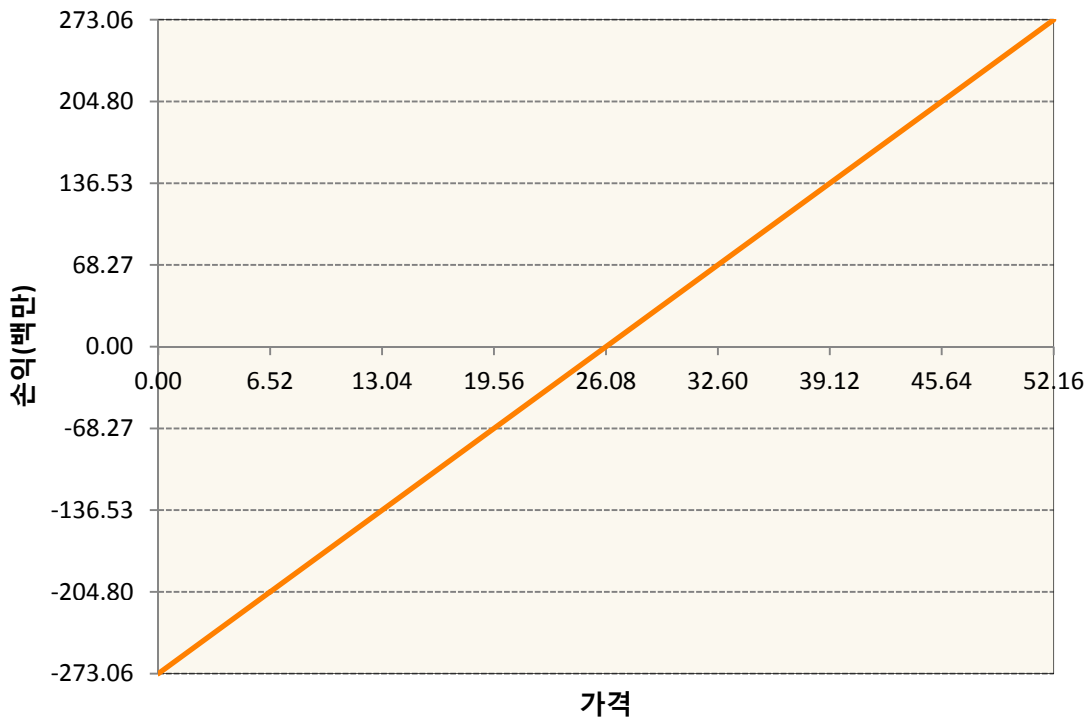
1. 계약금액

(단위:백만원)

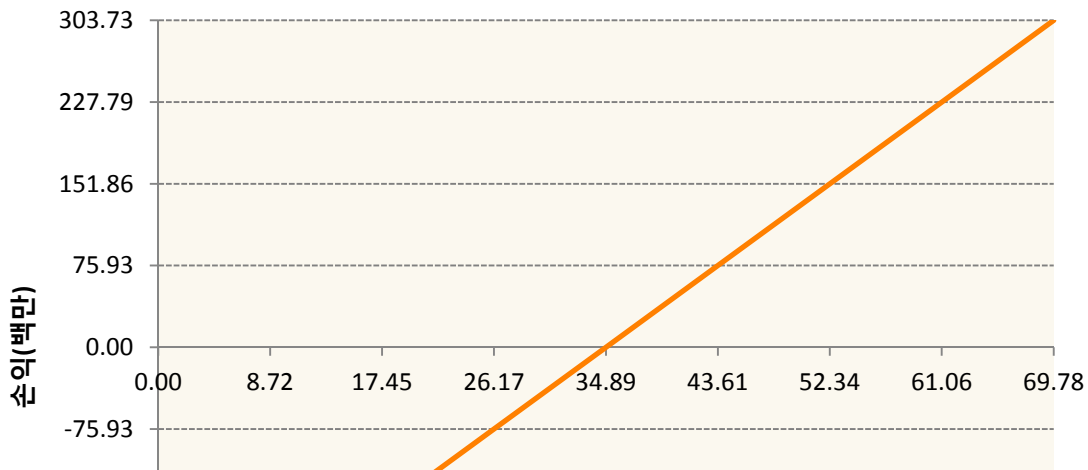
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,423	244	1,179	

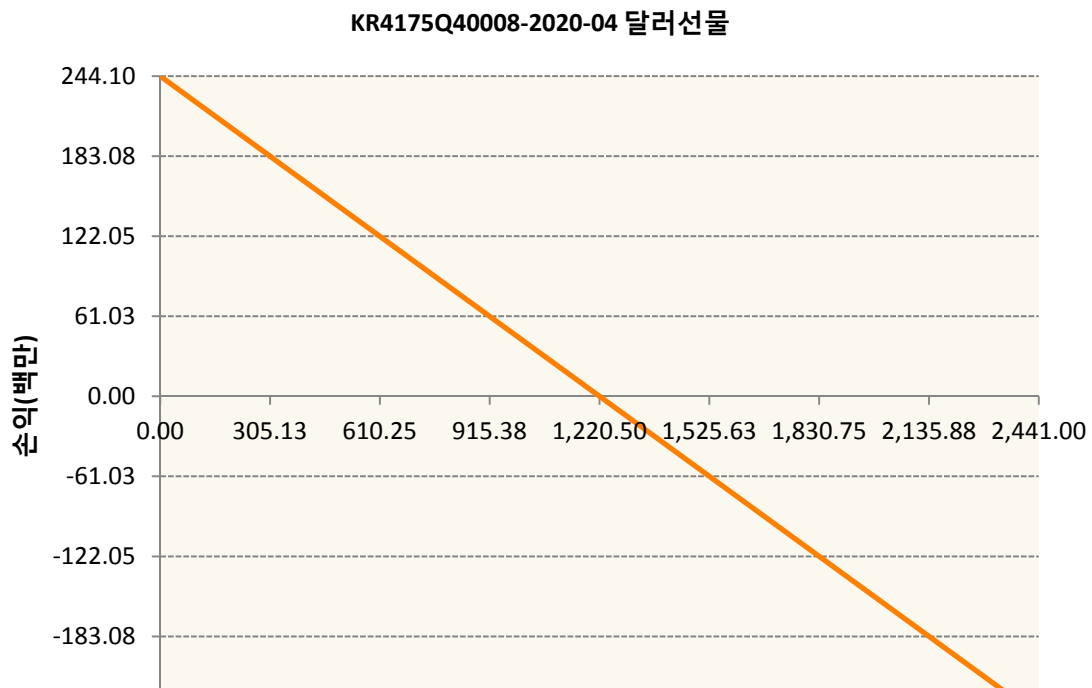
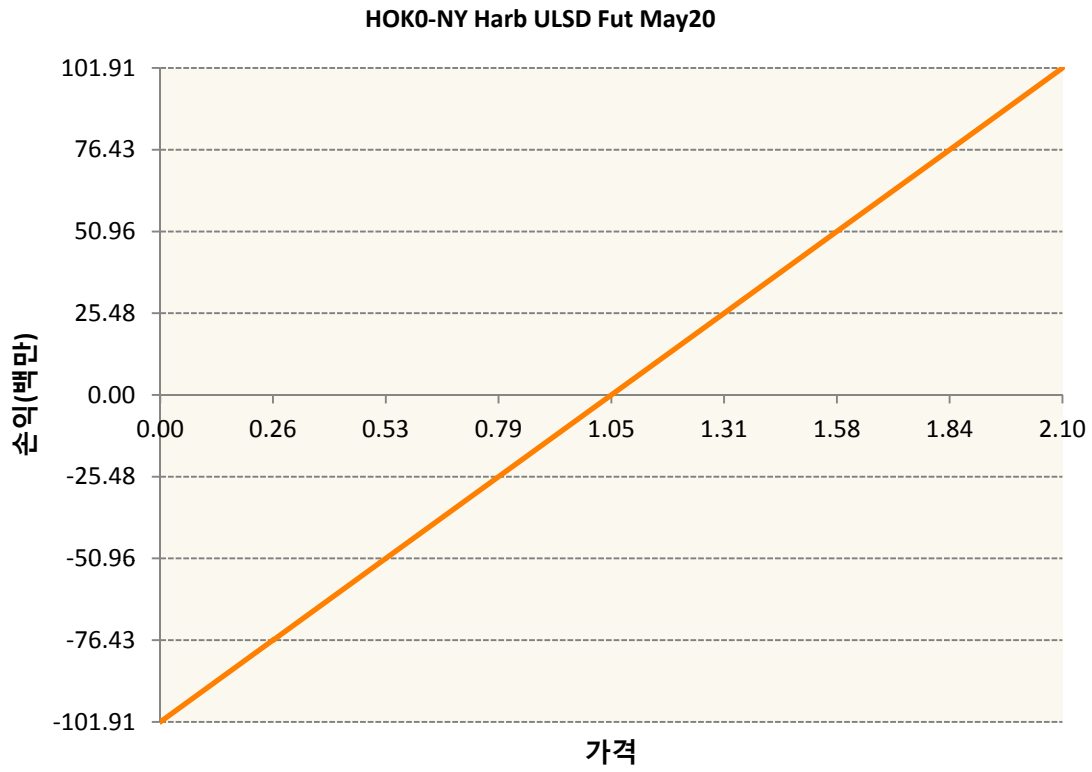
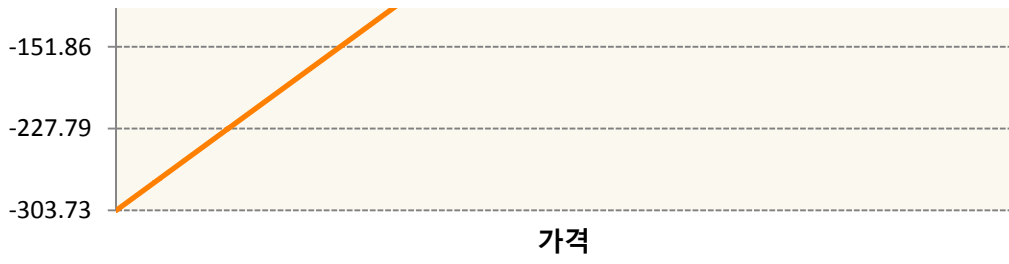
2. 만기시점의 손익구조

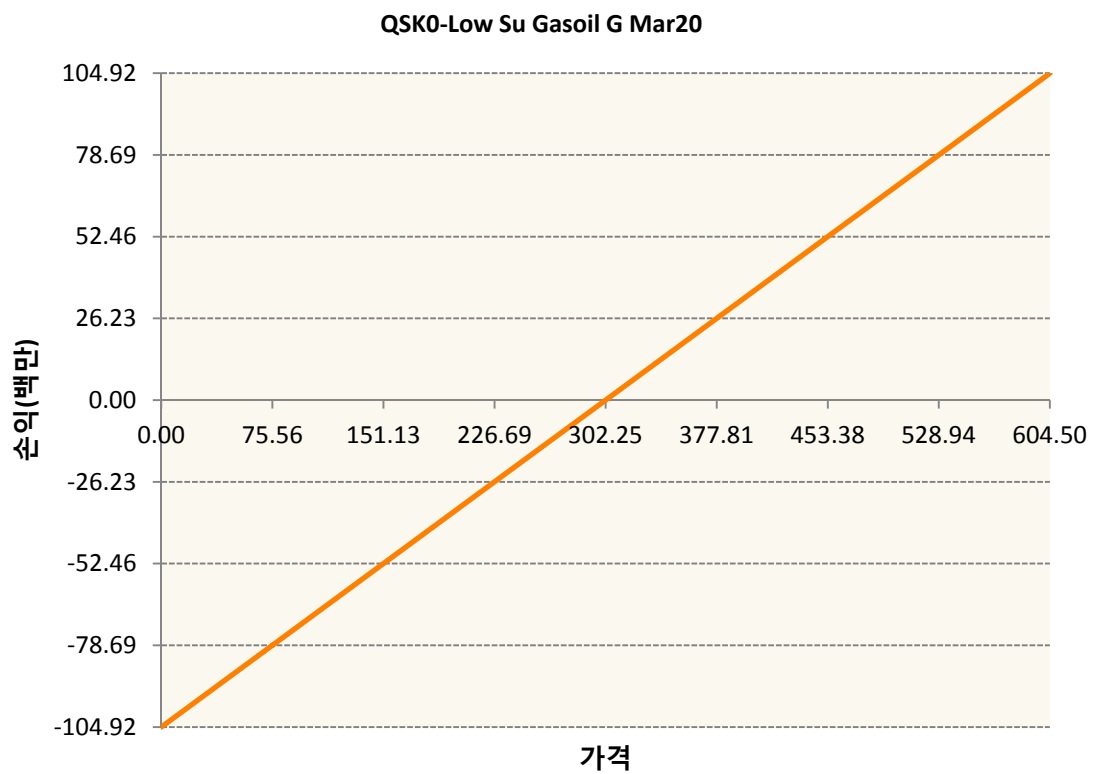
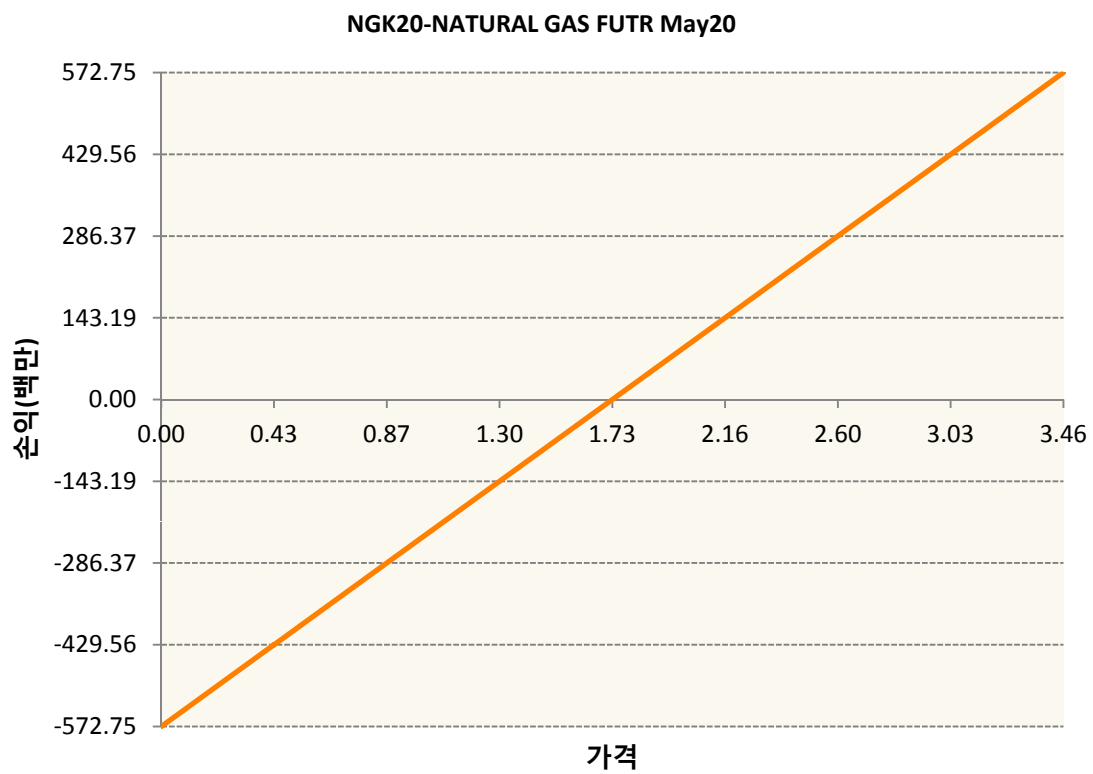
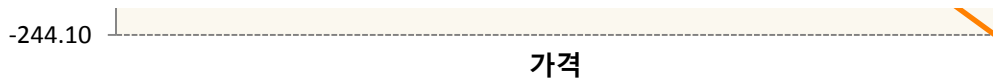
CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20



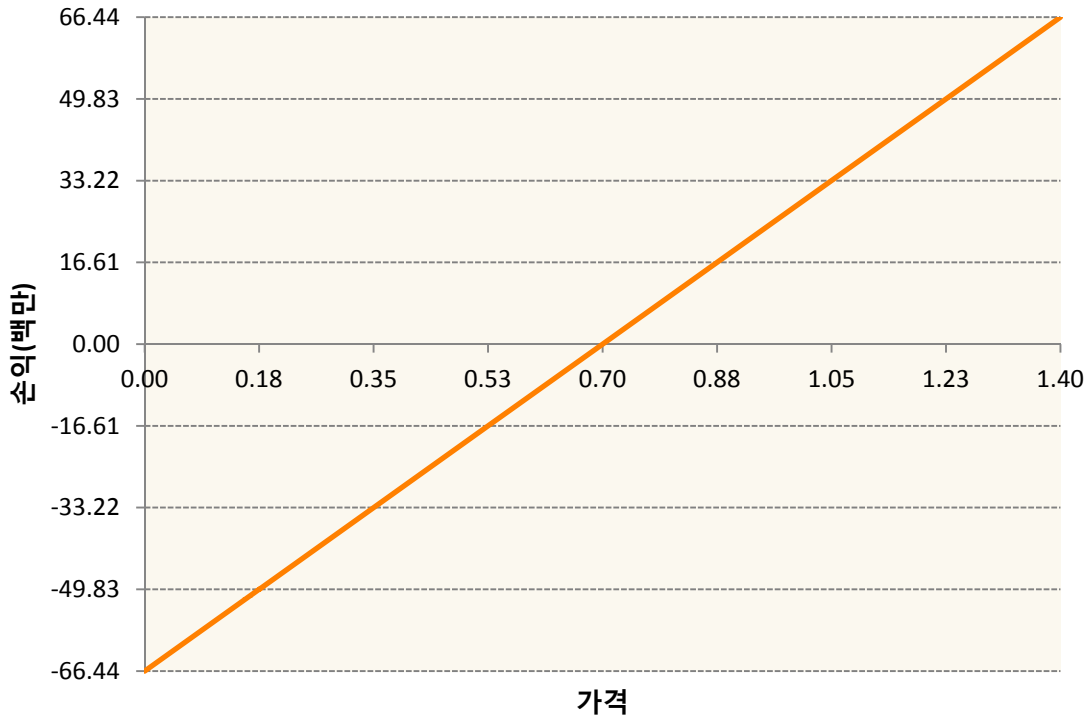
CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20







XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	22
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	24
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	8
KR4175Q40C	2020-04 달러선물	20
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	46
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	8
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	5

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

(단위:백만원)

344

공시일	2020-04-08
기준일	2020-04-07

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

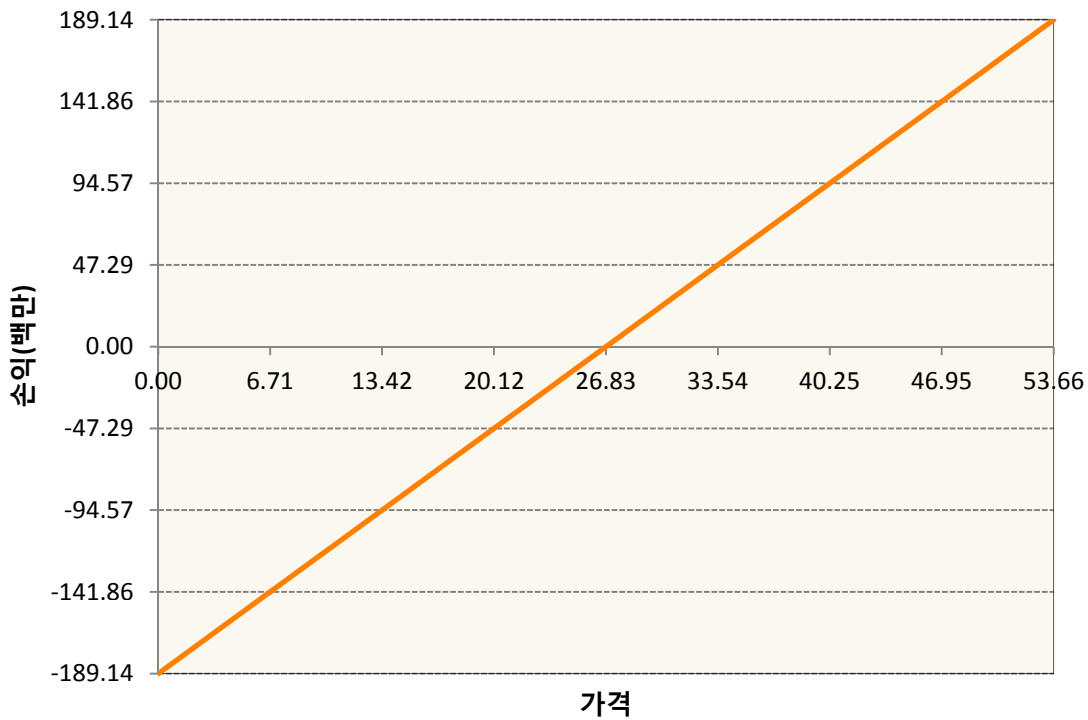
1. 계약금액

(단위:백만원)

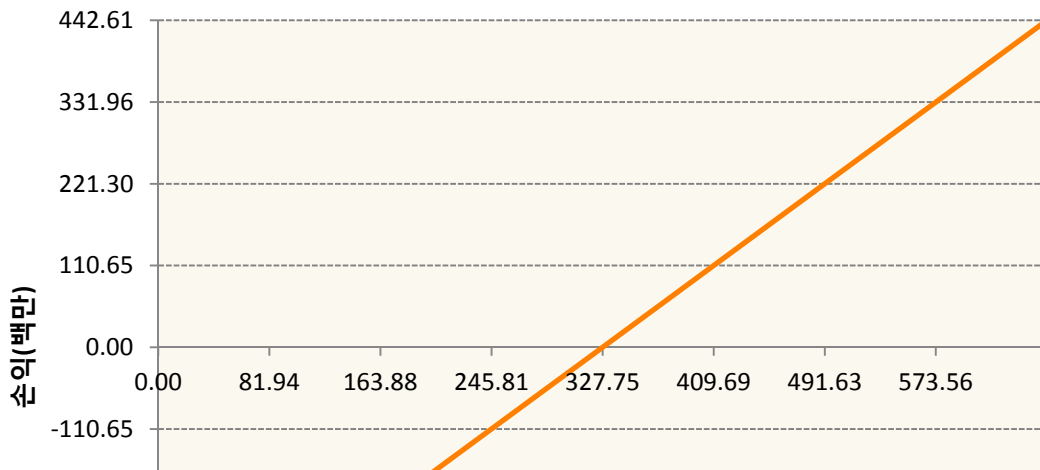
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,275	98	2,178	

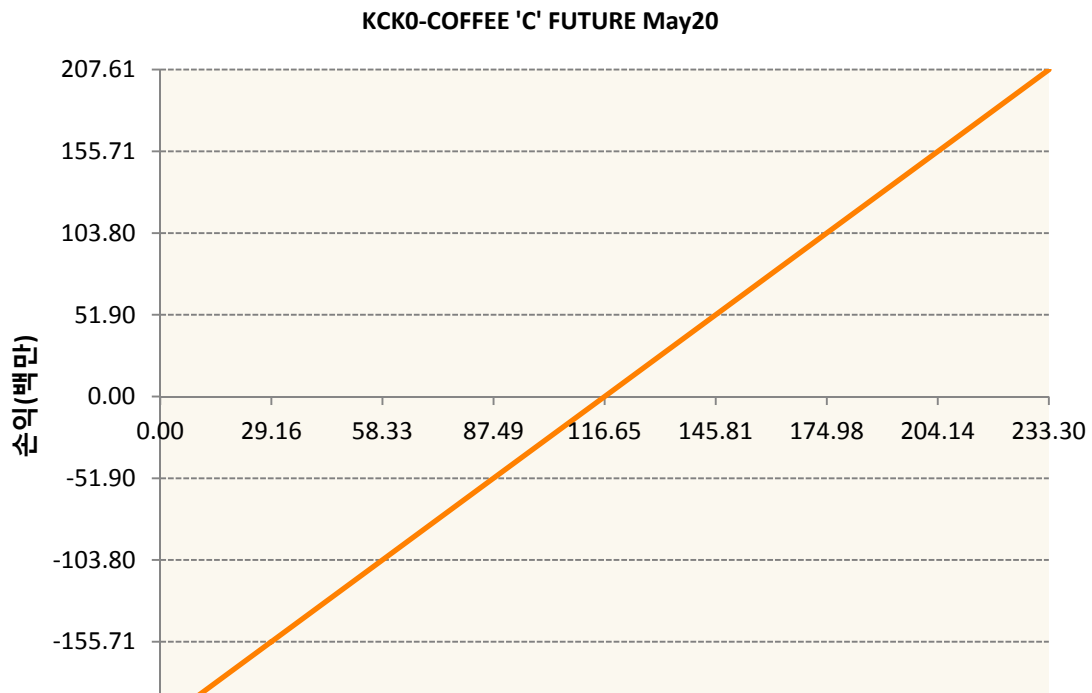
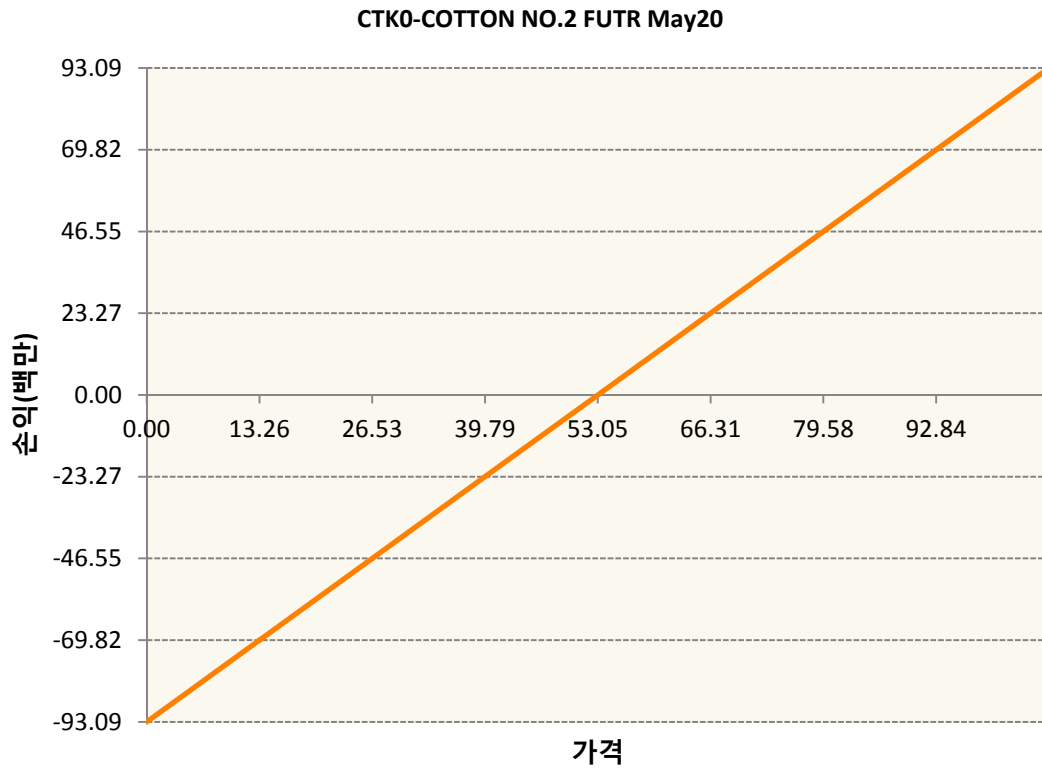
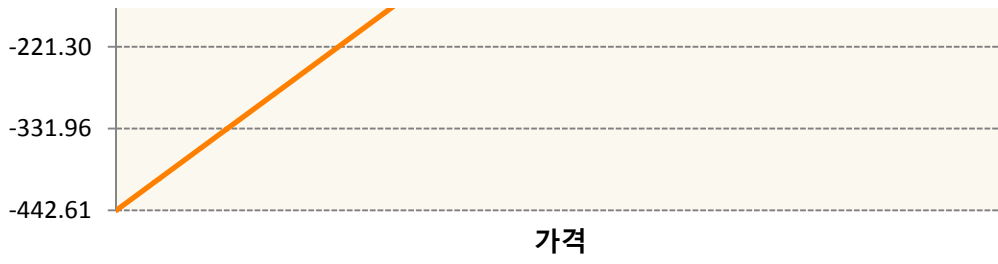
2. 만기시점의 손익구조

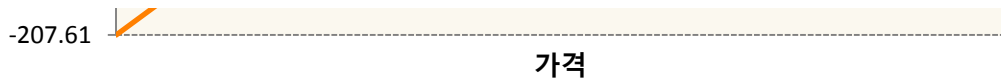
BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20



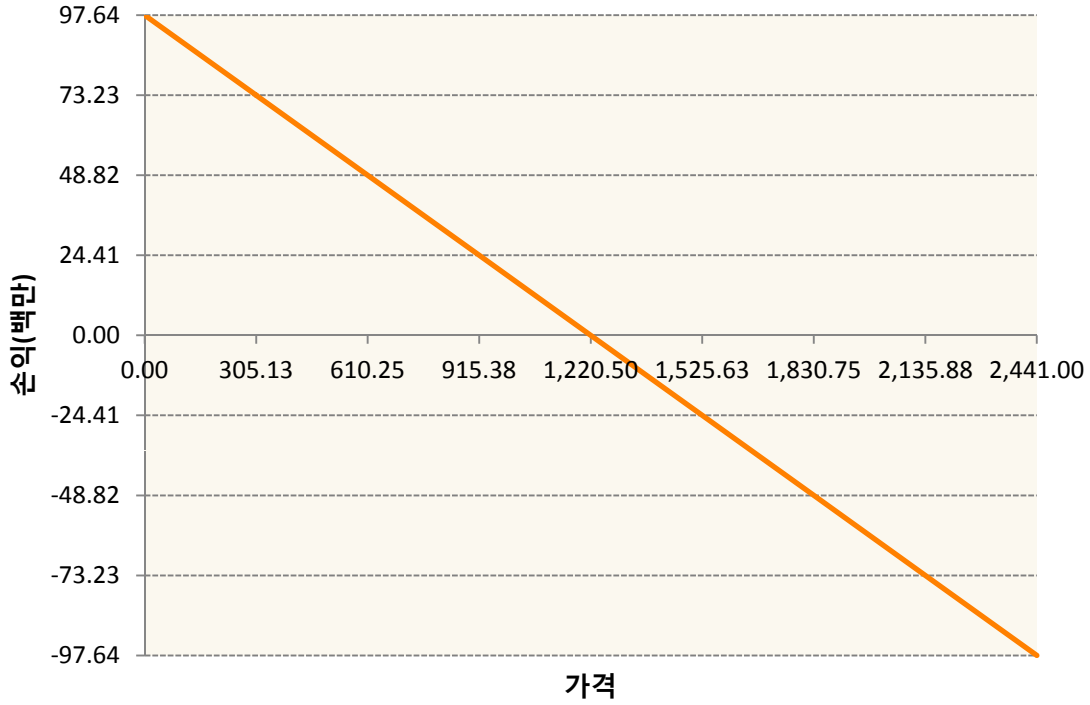
CK0-CORN FUTURE May20



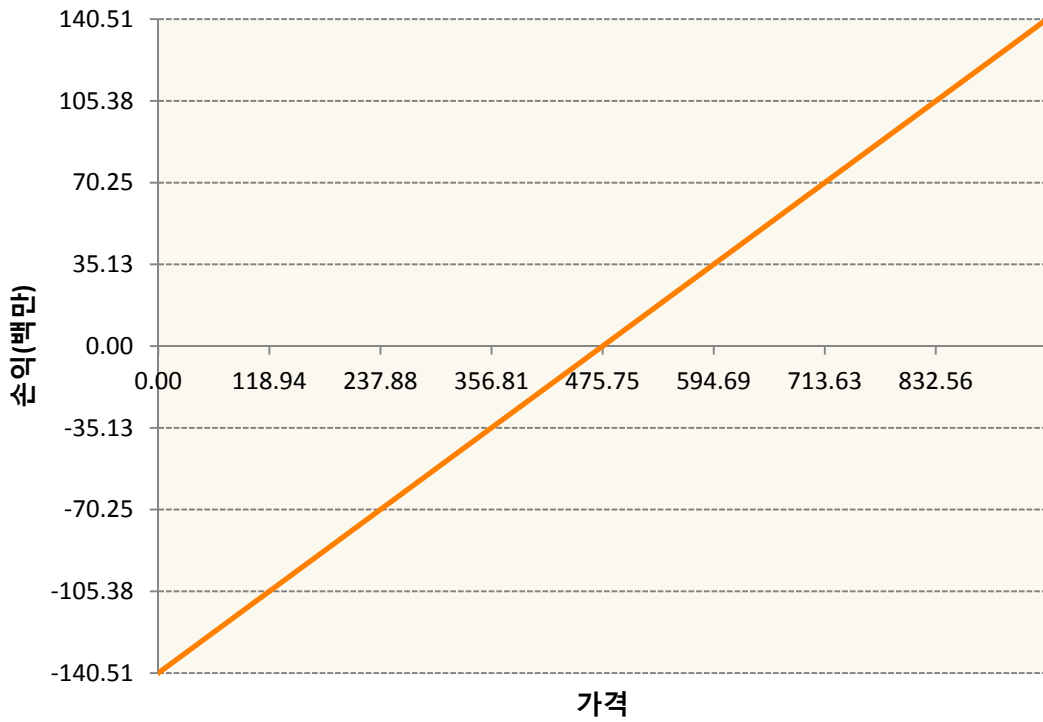




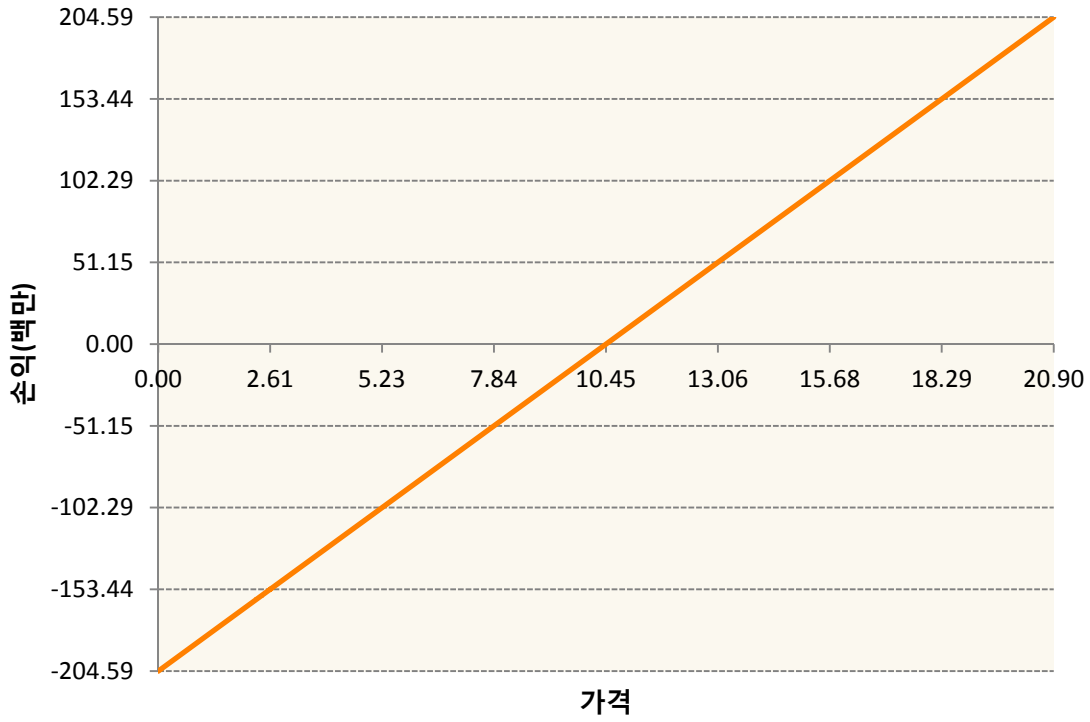
KR4175Q40008-2020-04 달러선물



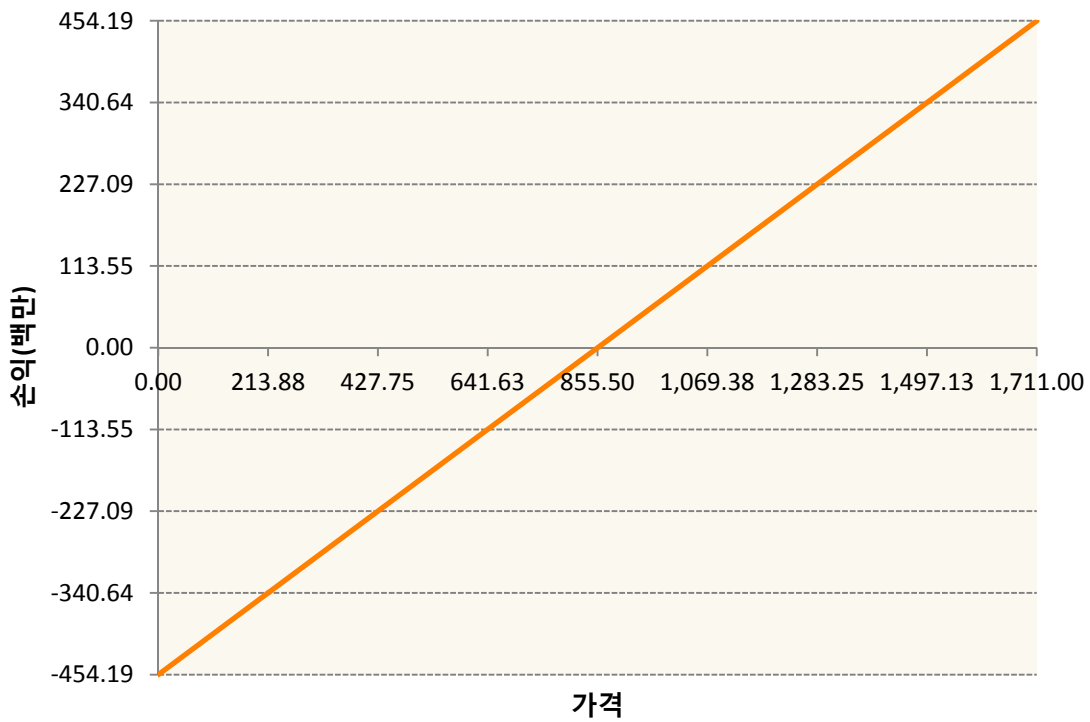
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



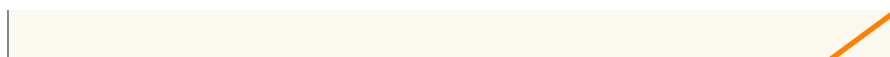
SBK0-Sugar May20

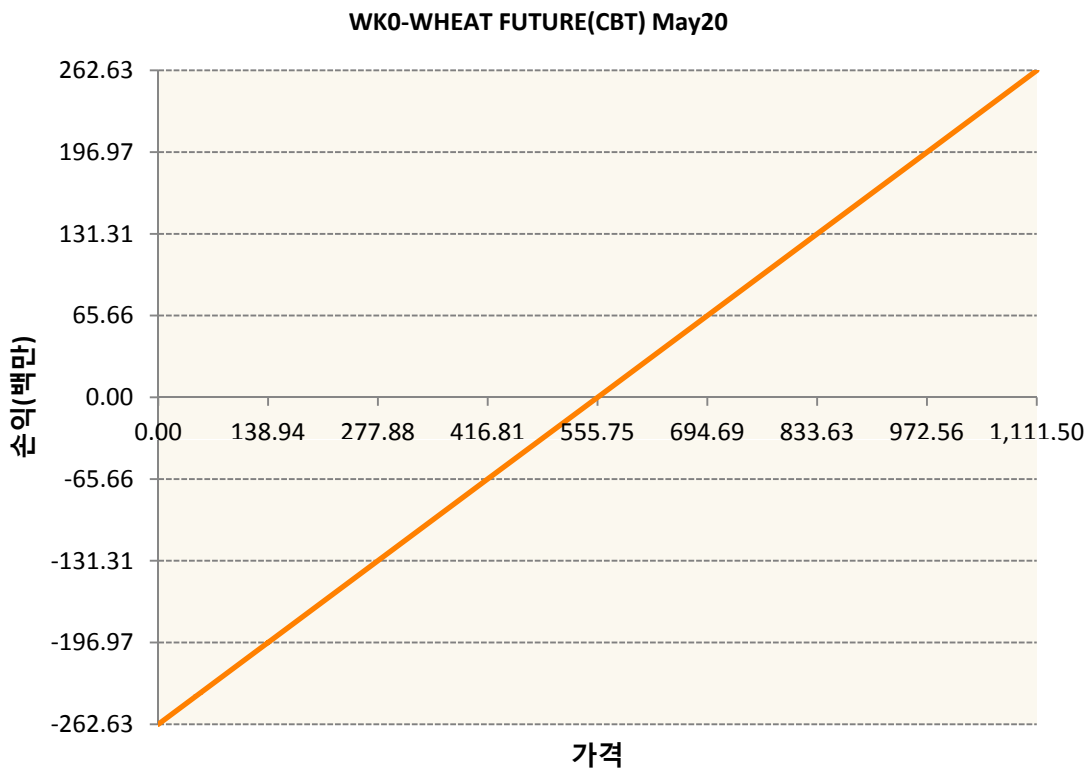
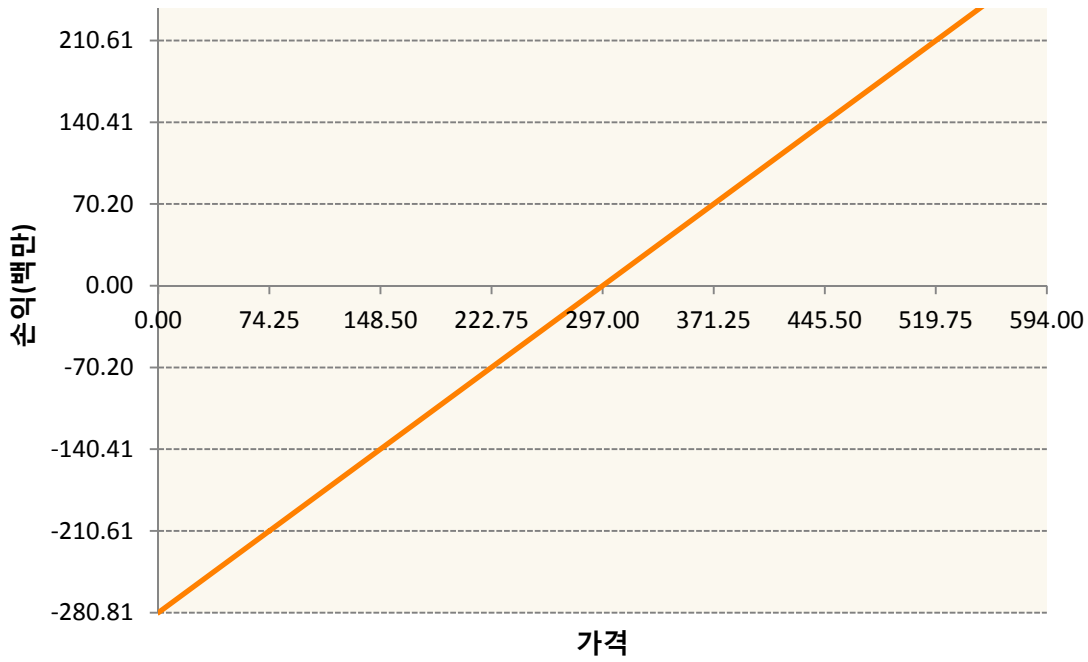


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	15
CK0	CORN FUTURE May20	35
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	22
WK0	WHEAT FUTURE(CBT) May20	21

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

(단위:백만원)

213