

공시일	2020-04-09
기준일	2020-04-08

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	2020-04-09
기준일	2020-04-08

스마트인덱스모

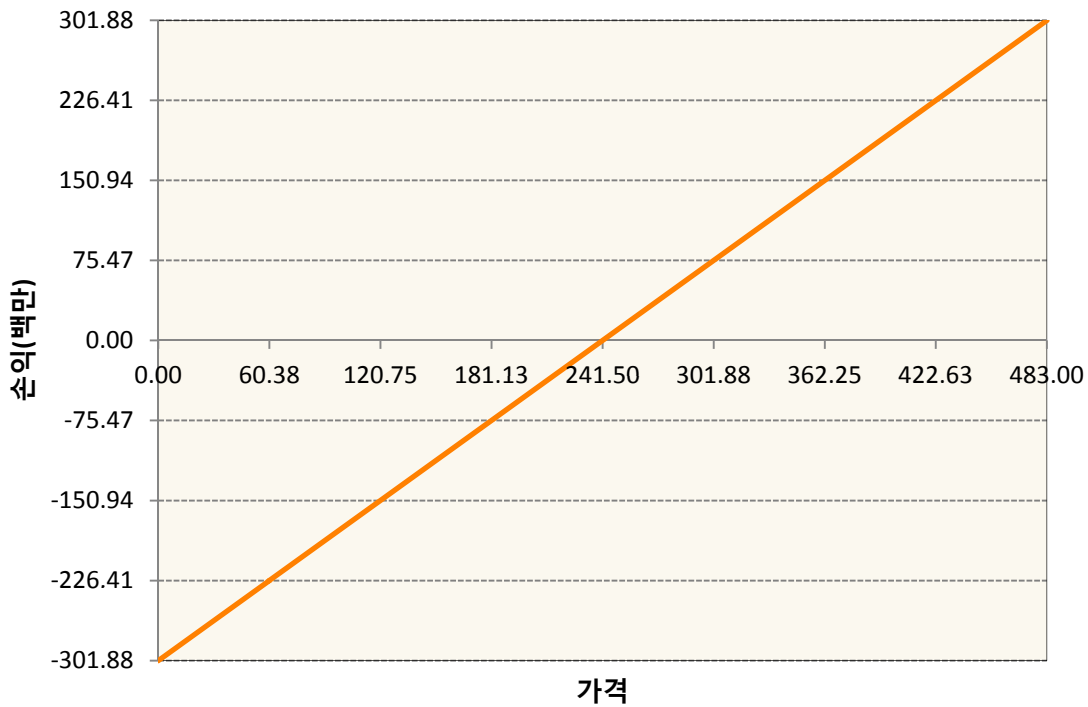
1. 계약금액

(단위:백만원)

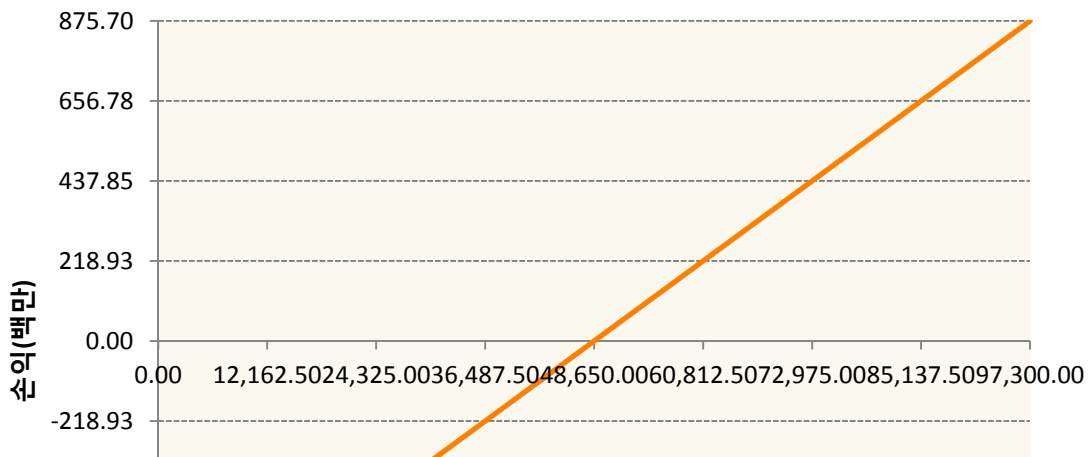
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	882	122	760	장내
누계	유가증권	선물	1,178	0	1,178	장내

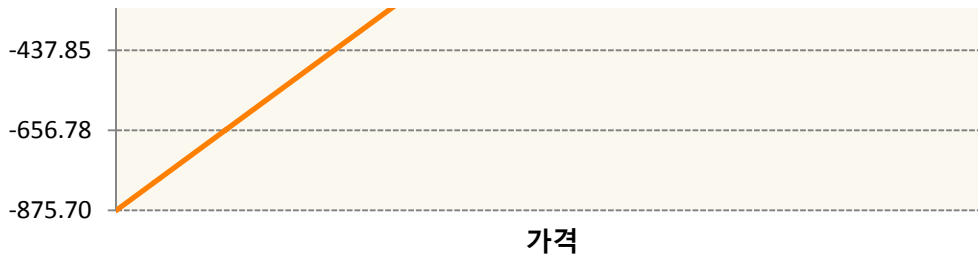
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



KR4111Q50002-2020-05 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						24
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24	
-5.33%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16	
-2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	8	8	8	8	8	8	8	
5.33%	16	16	16	16	16	16	16	
8.00%	24	24	24	24	24	24	24	
KR4111Q50002		2020-05 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)

138

공시일	2020-04-09
기준일	2020-04-08

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

913

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,048

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-09
기준일	2020-04-08

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

547

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

866

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-09
기준일	2020-04-08

유로인덱스모(주식-파생형)

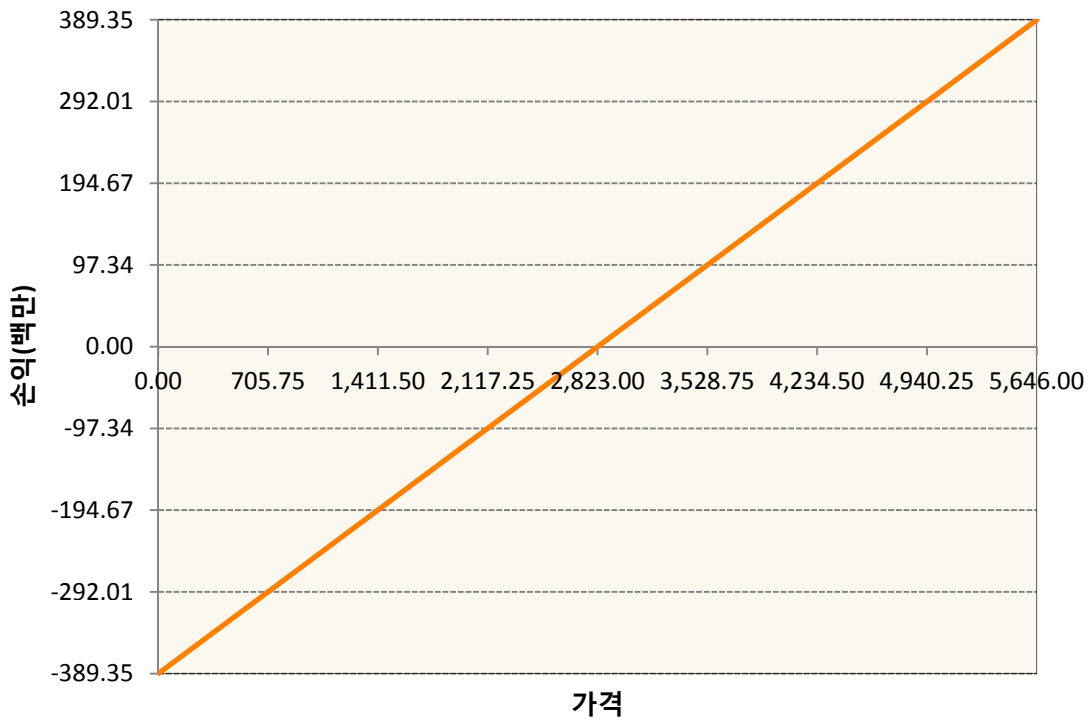
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

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)

38

공시일	2020-04-09
기준일	2020-04-08

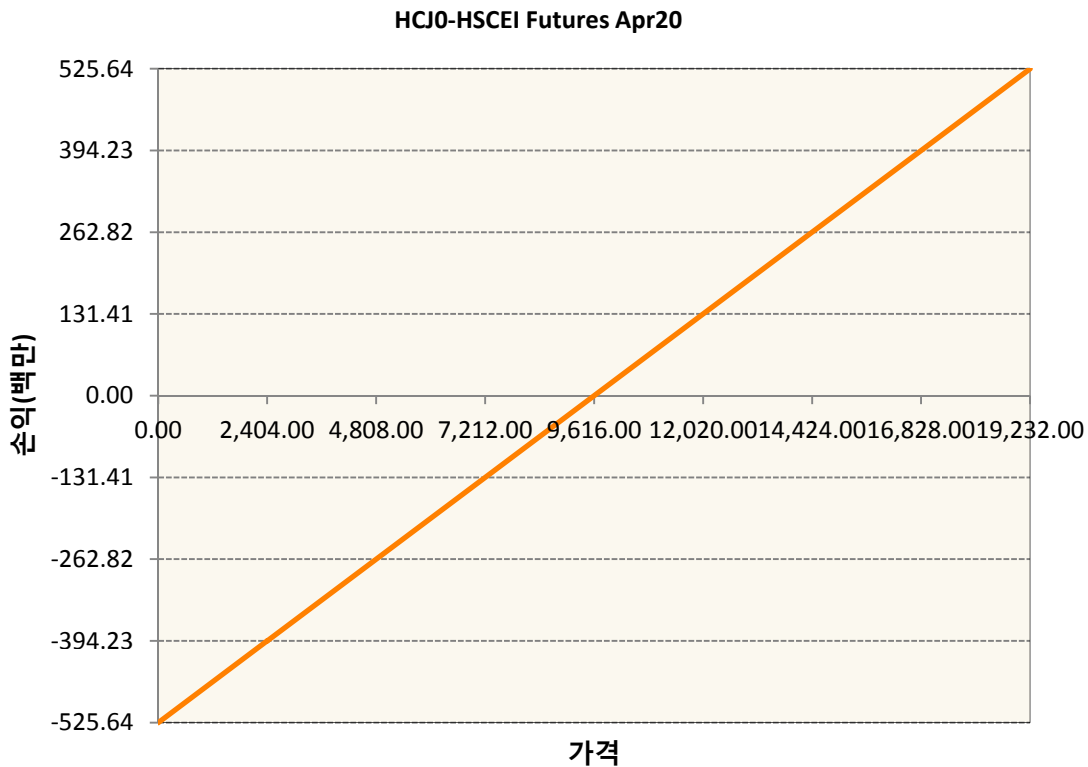
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	526	0	526	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	2020-04-09
기준일	2020-04-08

커버드콜모(주식혼합-파생형)

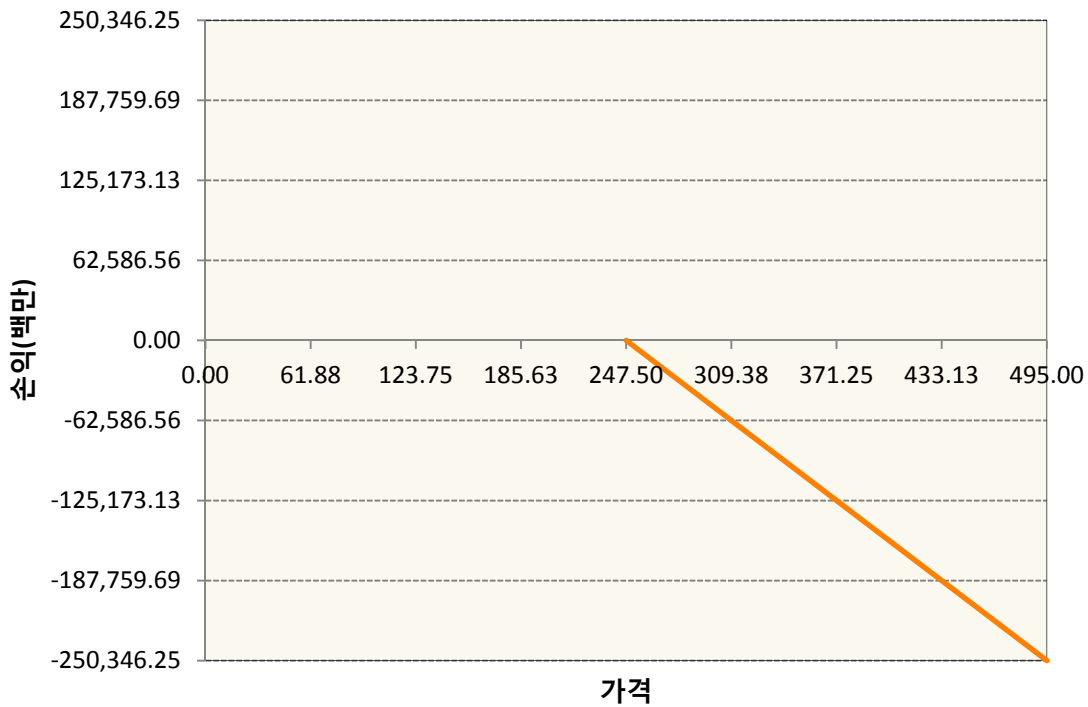
1. 계약금액

(단위:백만원)

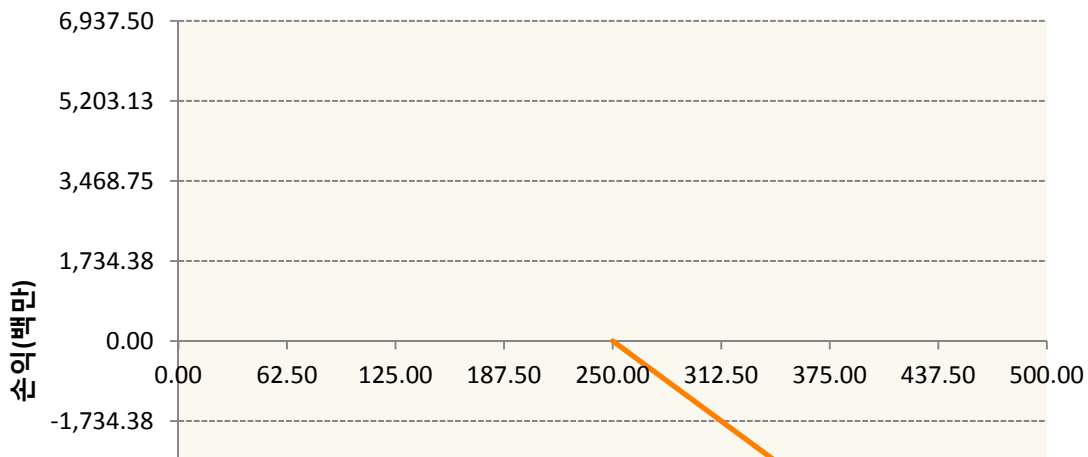
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	10,648	10,940	-292	장내
누계	유가증권	옵션	0	360,553	-360,553	장내

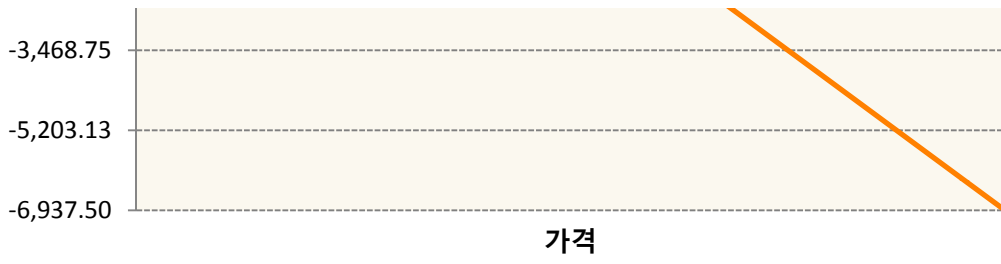
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

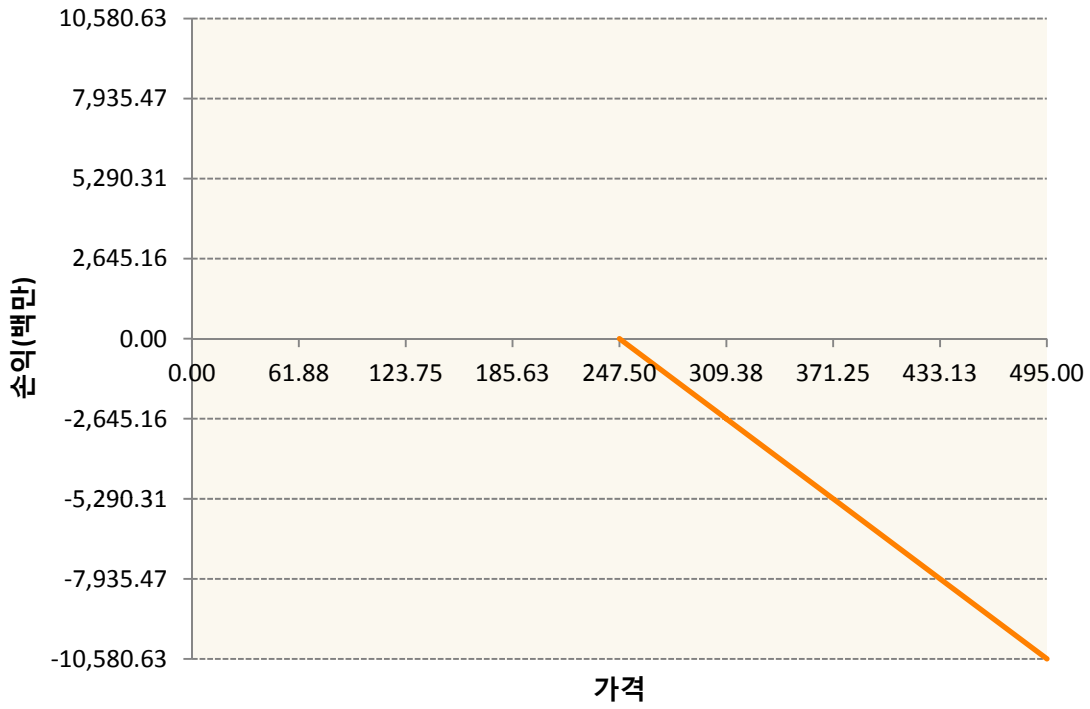


KR4201Q42503-2020-04 콜250

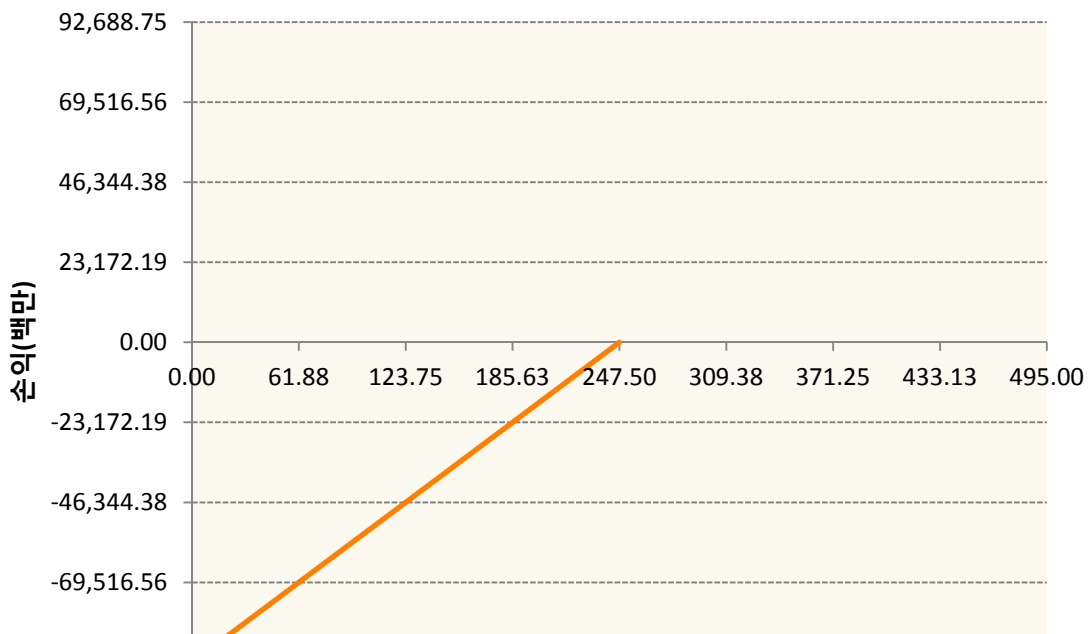




KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q42479 2020-04 콜247.5							13,341
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	766	766	766	765	765	765	763
-5.33%	765	765	764	761	756	746	732
-2.67%	753	737	711	675	626	566	495
0%	426	297	154	0	-164	-335	-513
2.67%	-1,741	-1,968	-2,194	-2,421	-2,649	-2,876	-3,104
5.33%	-6,787	-6,882	-6,994	-7,120	-7,259	-7,408	-7,566
8.00%	-13,129	-13,140	-13,159	-13,188	-13,227	-13,278	-13,341
KR4201Q42503 2020-04 콜250							313
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10	10	10	10	10	10	10
-5.33%	10	10	10	10	10	10	10
-2.67%	10	10	10	10	9	8	7
0%	7	5	3	0	-3	-7	-11
2.67%	-26	-32	-38	-44	-50	-57	-63
5.33%	-136	-141	-145	-150	-155	-161	-166
8.00%	-302	-303	-304	-306	-308	-310	-313
KR4201Q52478 2020-05 콜247.5							637
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	433	395	354	311	266	220	174
-5.33%	366	320	273	225	175	125	74
-2.67%	278	227	174	121	68	14	-40
0%	168	112	56	0	-56	-112	-168
2.67%	33	-24	-82	-139	-196	-254	-311
5.33%	-124	-181	-238	-295	-353	-410	-468
8.00%	-303	-357	-412	-468	-524	-581	-637
KR4301Q42477 2020-04 풋247.5							7,086
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,086	-7,086	-7,086	-7,086	-7,086	-7,086	-7,086
-5.33%	-4,671	-4,671	-4,671	-4,671	-4,671	-4,672	-4,673
-2.67%	-2,256	-2,257	-2,260	-2,264	-2,271	-2,280	-2,292
0%	101	72	38	0	-42	-86	-133
2.67%	1,789	1,722	1,654	1,586	1,518	1,450	1,382

5.33%	2,239	2,221	2,198	2,170	2,138	2,102	2,063
8.00%	2,265	2,264	2,263	2,260	2,255	2,248	2,239

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

(단위:백만원)

22,035

공시일	2020-04-09
기준일	2020-04-08

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

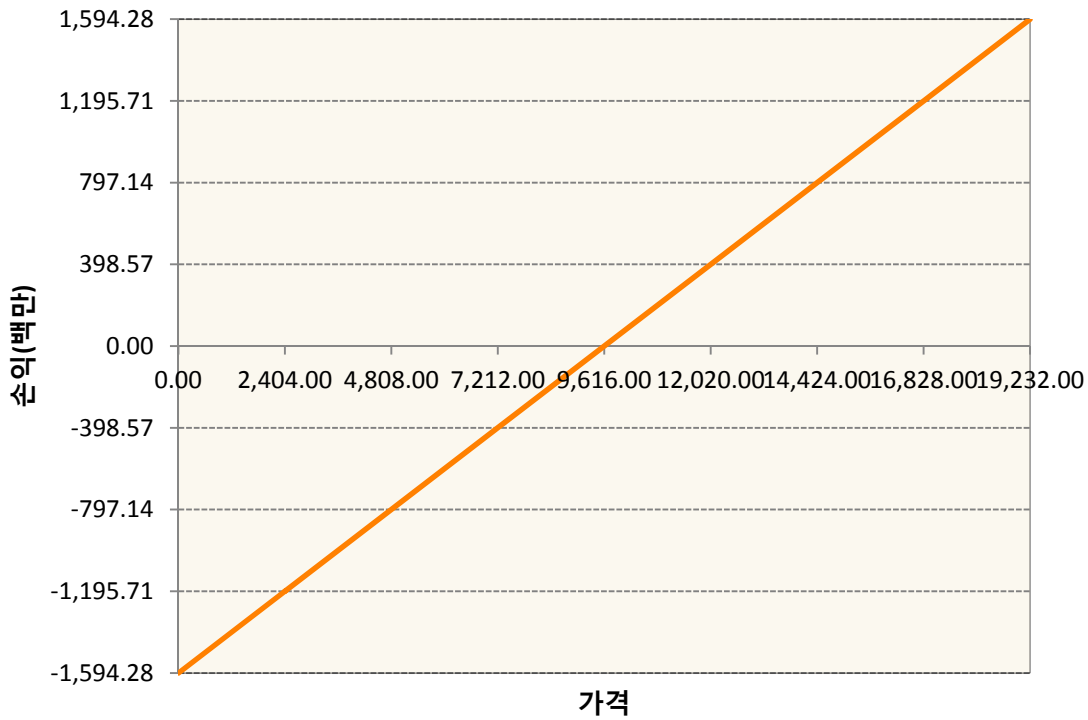
1. 계약금액

(단위:백만원)

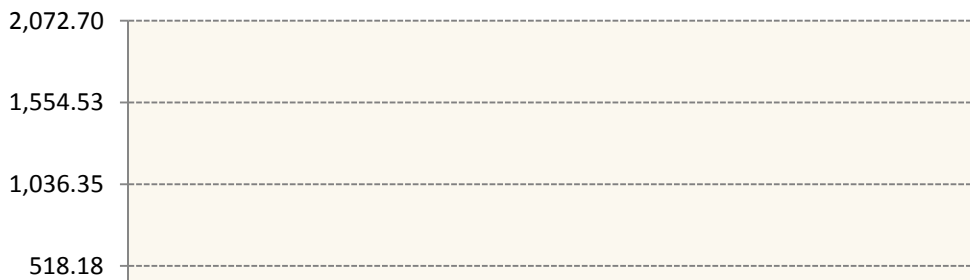
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,594	0	1,594	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,147	-4,147	장내
누계	통화	선도	693	2,217	-1,525	장외

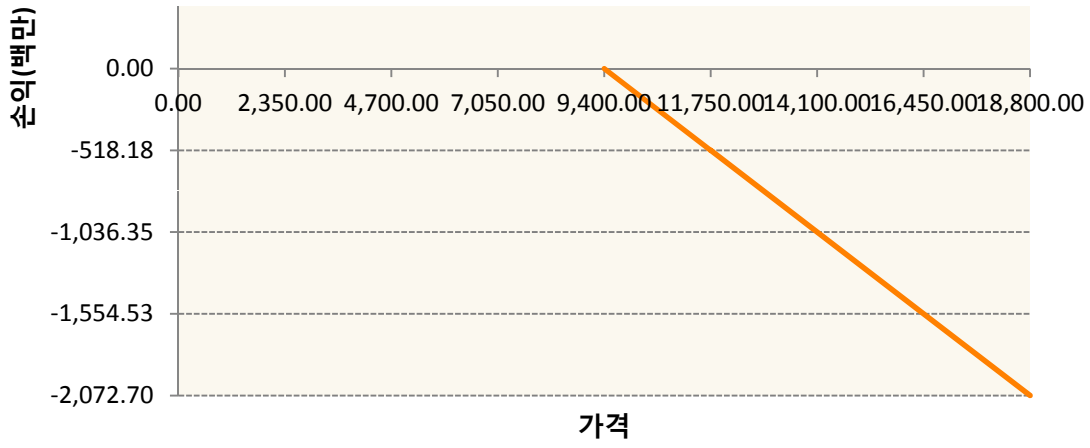
2. 만기시점의 손익구조

HCJ0-HSCEI Futures Apr20

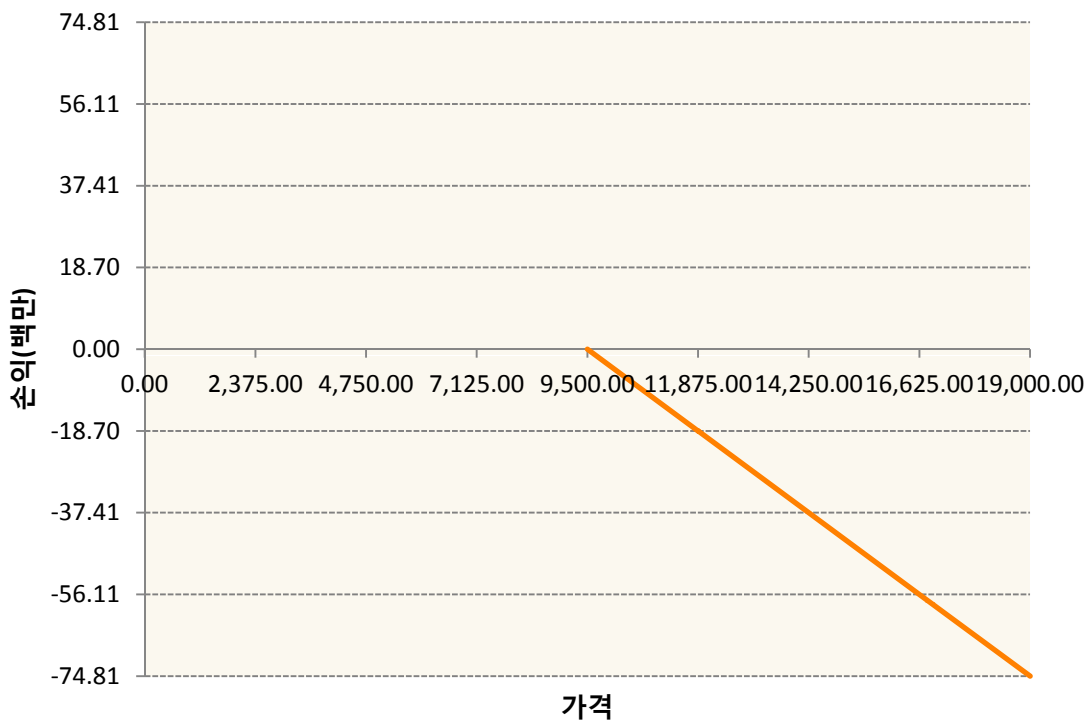


OHHIJ0-C94-HSCEI

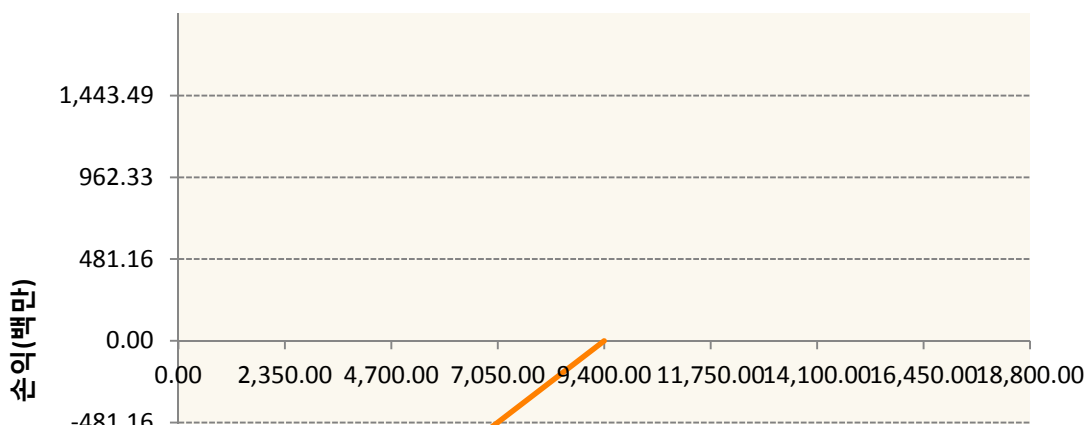


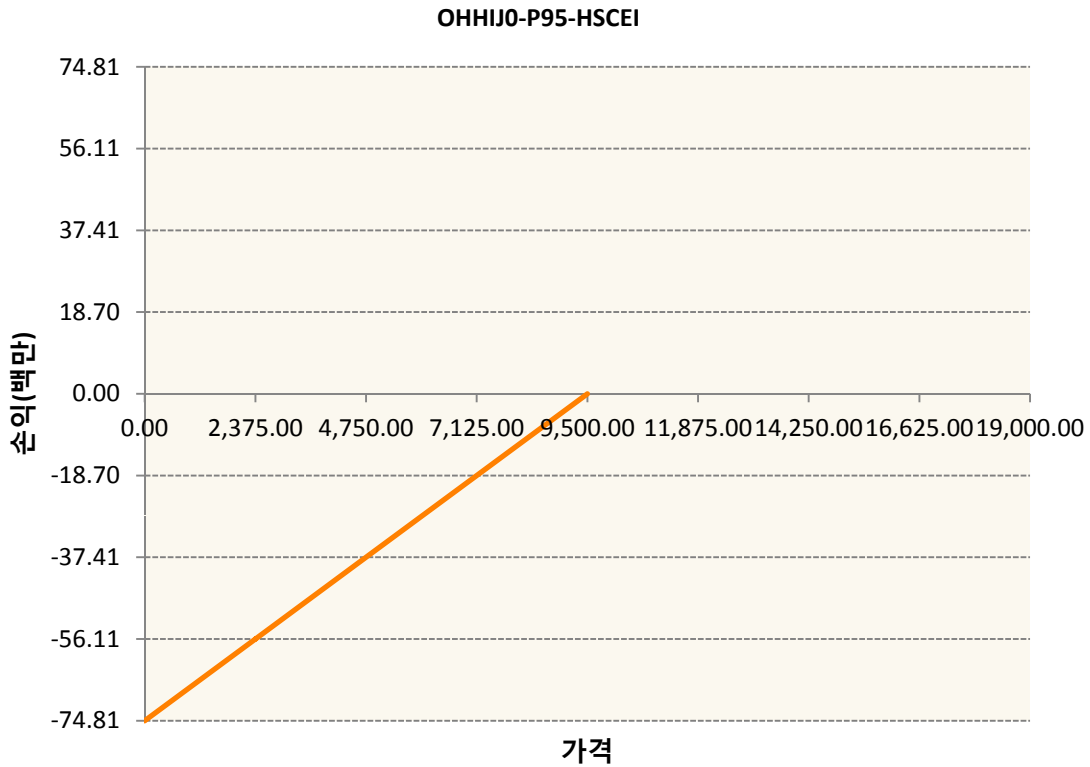


OHHIJO-C95-HSCEI



OHHIJO-P94-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E	177
FX21020H05 HKD/KRW 22-05-20E	55
HCJ0 HSCEI Futures Apr20	128
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)
	605

공시일	2020-04-09
기준일	2020-04-08

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

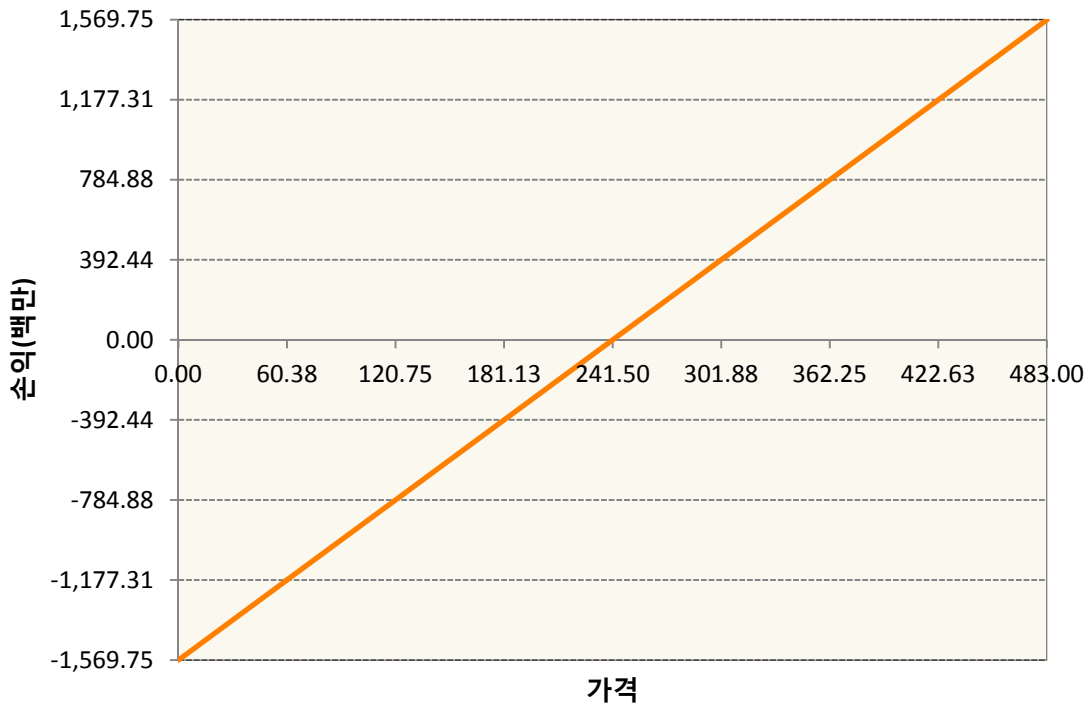
1. 계약금액

(단위:백만원)

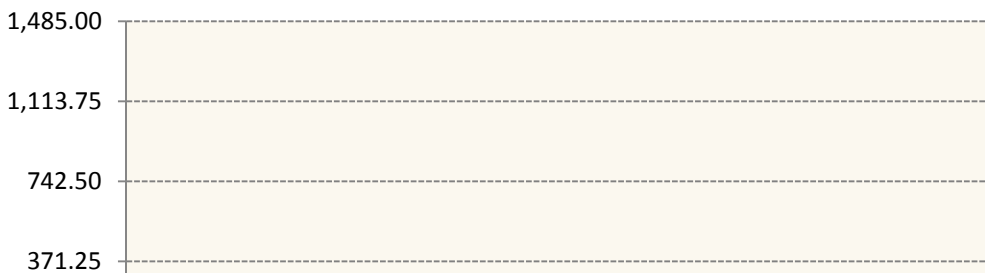
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,570	0	1,570	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,095	-3,095	장내

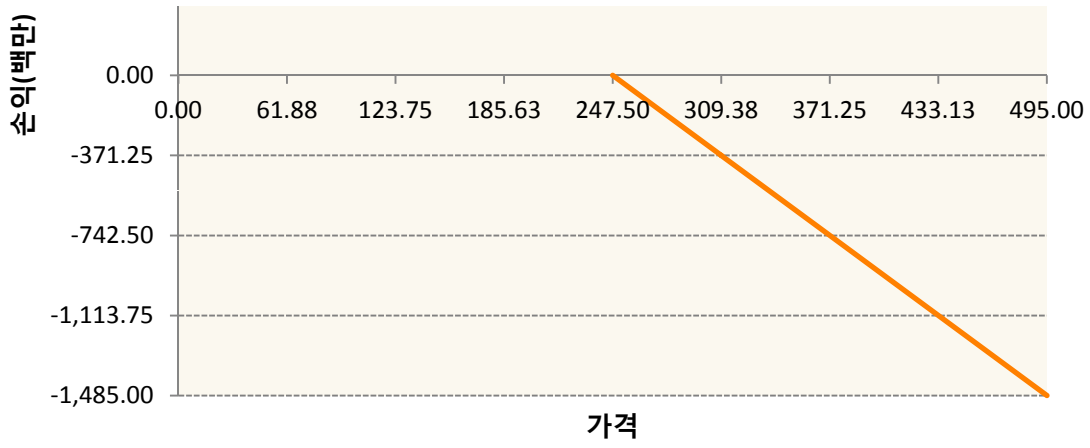
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

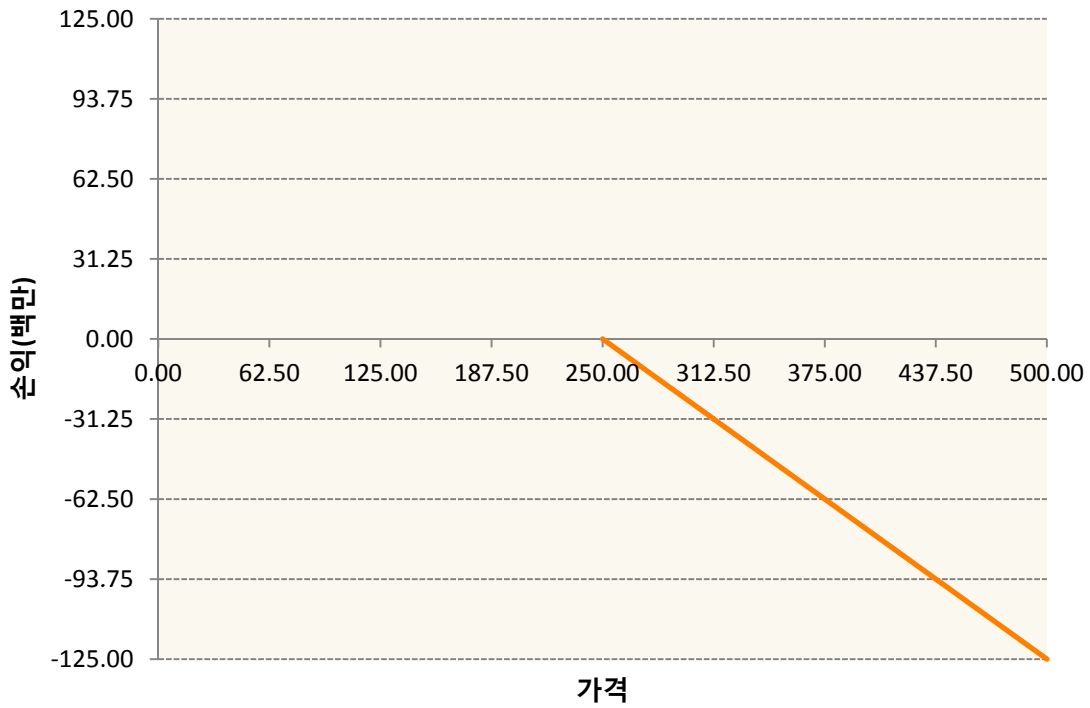


KR4201Q42479-2020-04 콜247.5

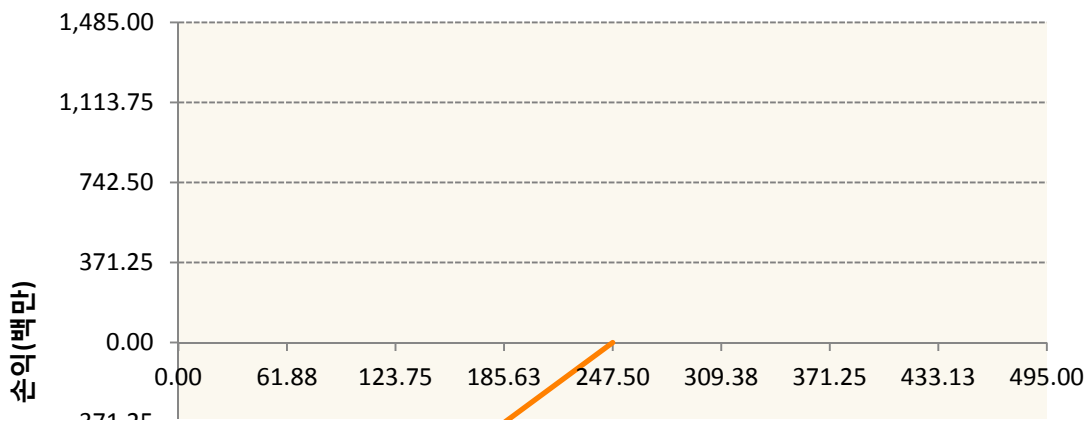




KR4201Q42503-2020-04 콜250



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						126
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126	
-5.33%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84	
-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%	84	84	84	84	84	84	84	
8.00%	126	126	126	126	126	126	126	
KR4201Q42479		2020-04 콜247.5						79
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5	
-5.33%	5	5	5	5	4	4	4	
-2.67%	4	4	4	4	4	3	3	
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3	
2.67%	-10	-12	-13	-14	-16	-17	-18	
5.33%	-40	-41	-41	-42	-43	-44	-45	
8.00%	-78	-78	-78	-78	-78	-79	-79	
KR4201Q42503		2020-04 콜250						6
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	-1	-1	-1	-1	-1	-1
5.33%	-2	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-5	-5	-5	-6	-6	-6	-6
KR4301Q42477 2020-04 풋247.5							114
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-114	-114	-114	-114	-114	-114	-114
-5.33%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-2.67%	-36	-36	-36	-36	-36	-37	-37
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	29	28	26	25	24	23	22
5.33%	36	36	35	35	34	34	33
8.00%	36	36	36	36	36	36	36

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

(단위:백만원)

588

공시일	2020-04-09
기준일	2020-04-08

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

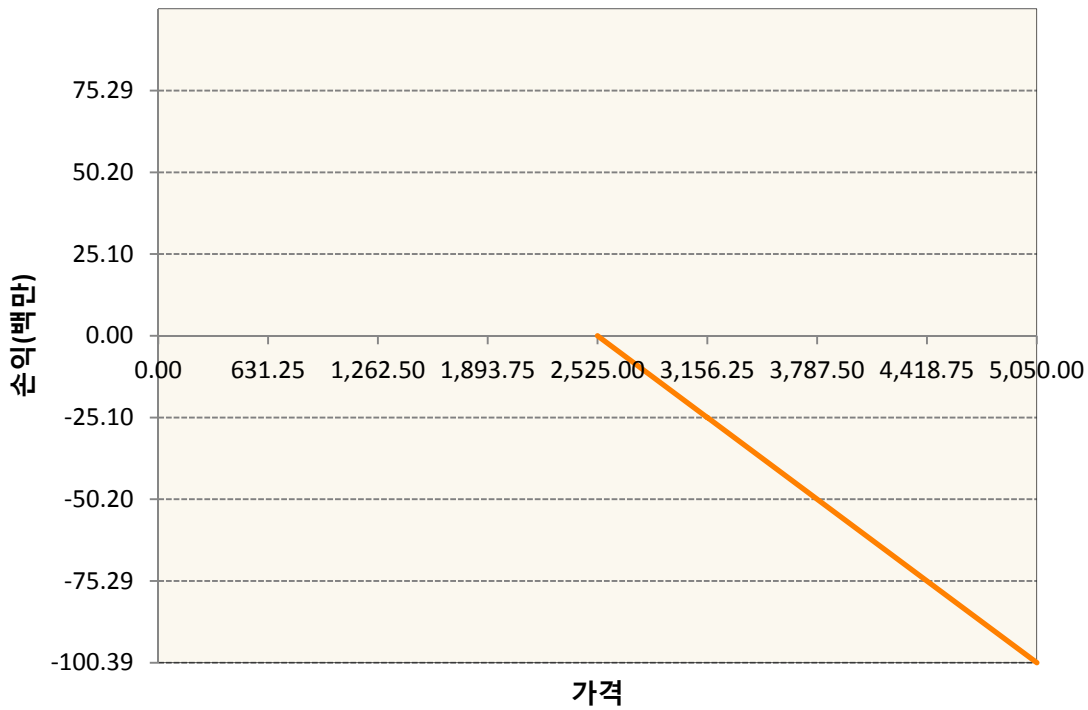
1. 계약금액

(단위:백만원)

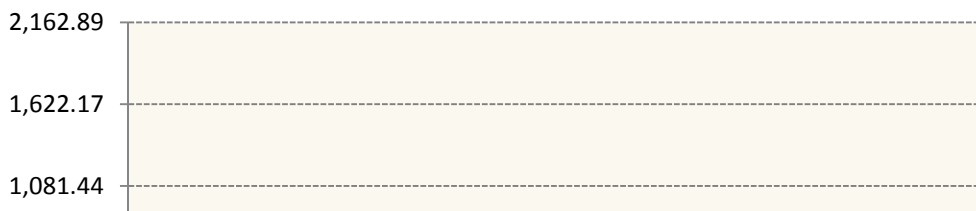
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	344	0	344	
누계	유가증권	스왑	7,528	0	7,528	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,560	-4,560	장내
누계	통화	선도	0	2,682	-2,682	장외

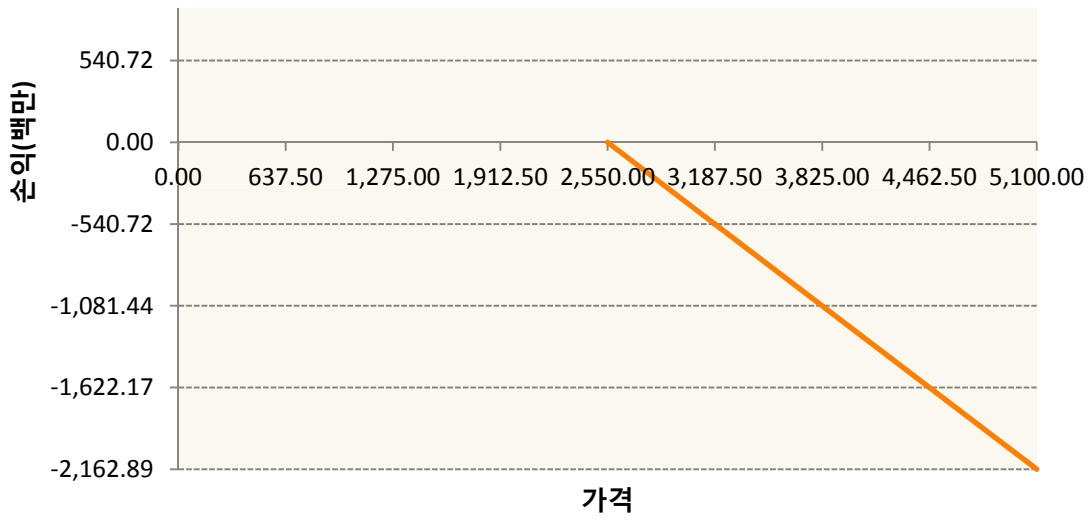
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ0-C2525-EURO STOXX 50

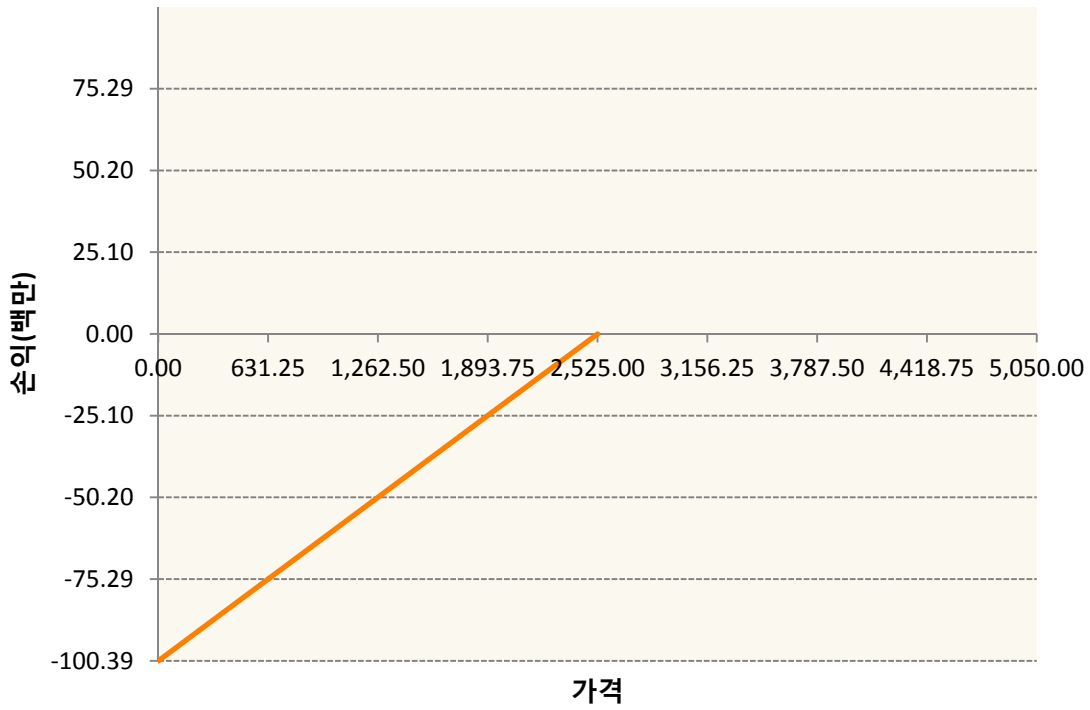


OESXJ0-C2550-EURO STOXX 50

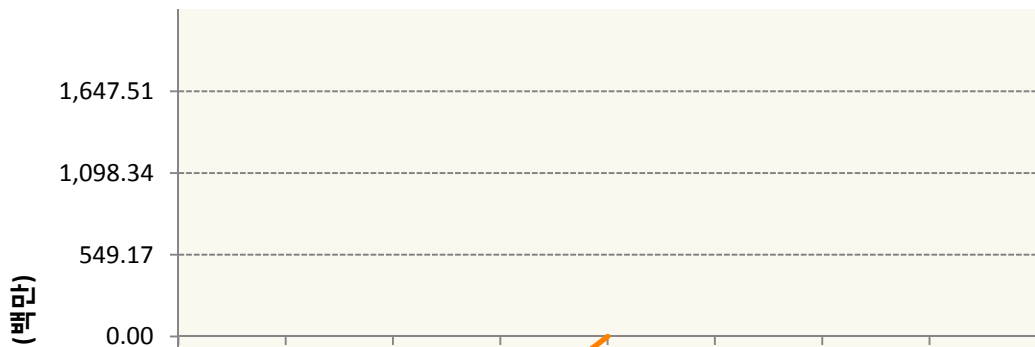


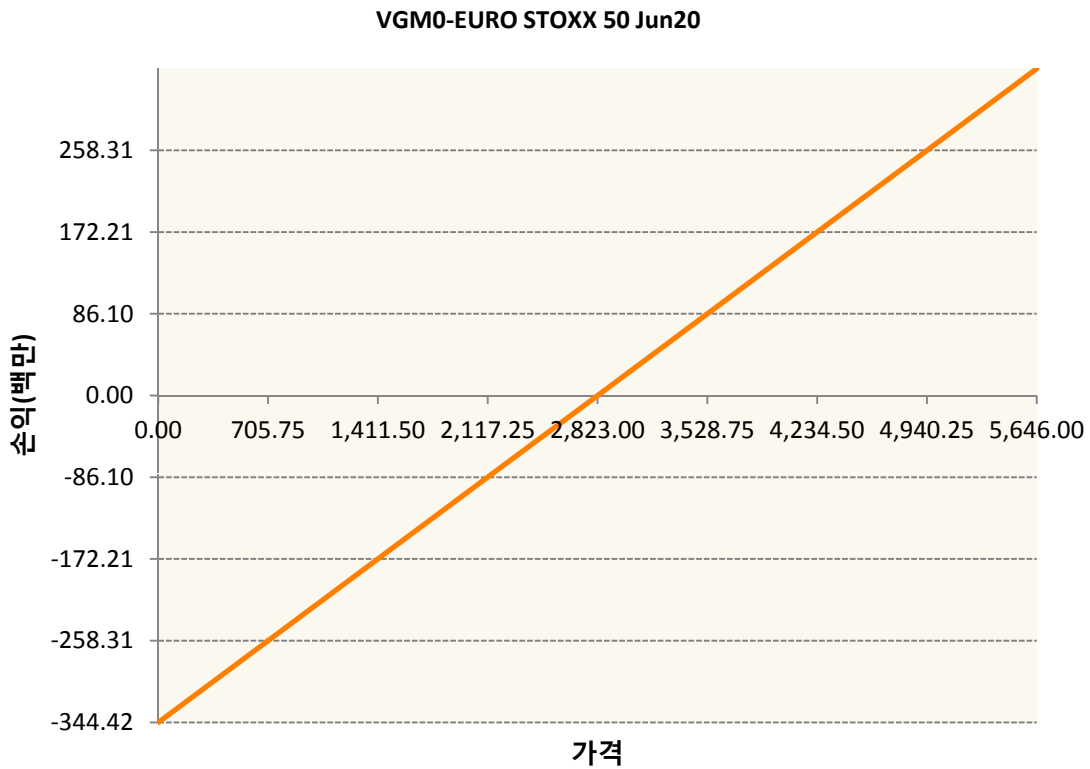
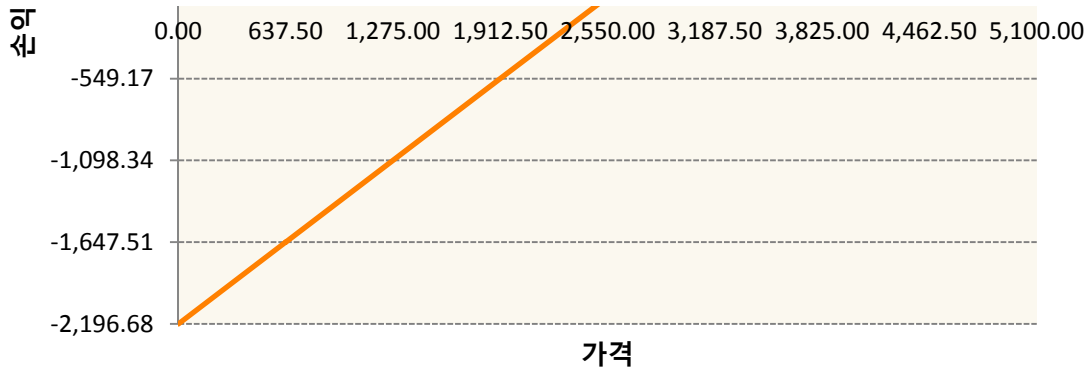


OESXJ0-P2525-EURO STOXX 50



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	28

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

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

(단위:백만원)

1,056

공시일	2020-04-09
기준일	2020-04-08

ETF스마트레버리지목표전환형9호

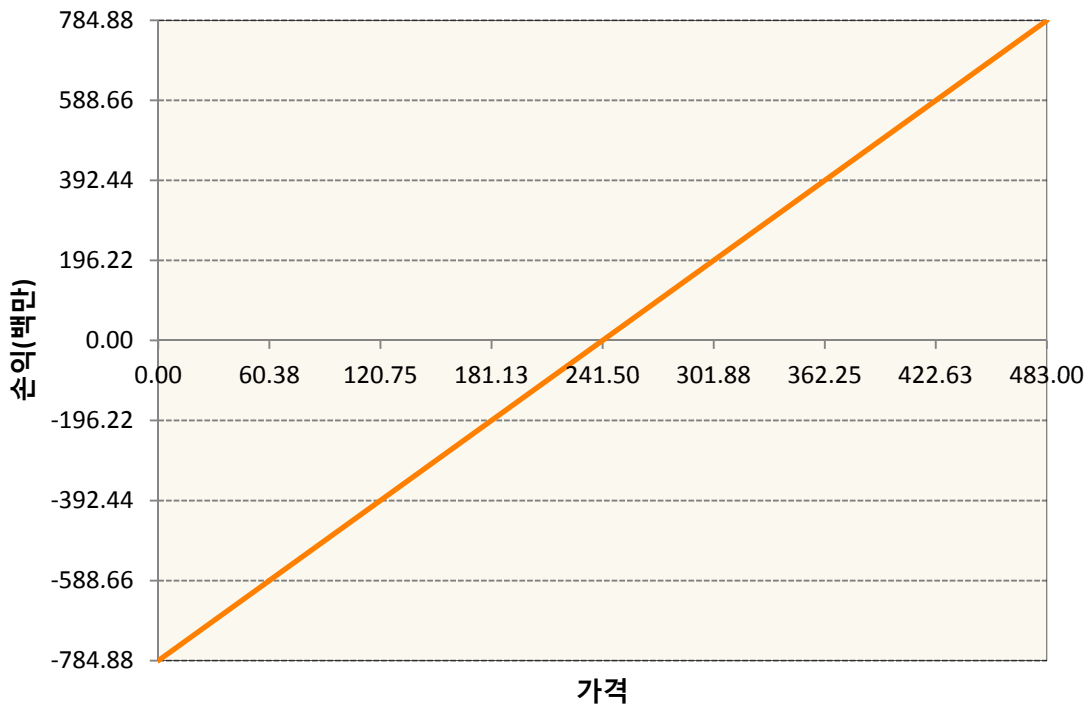
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	785	0	785	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

공시일	2020-04-09
기준일	2020-04-08

ETF스마트레버리지목표전환형10호

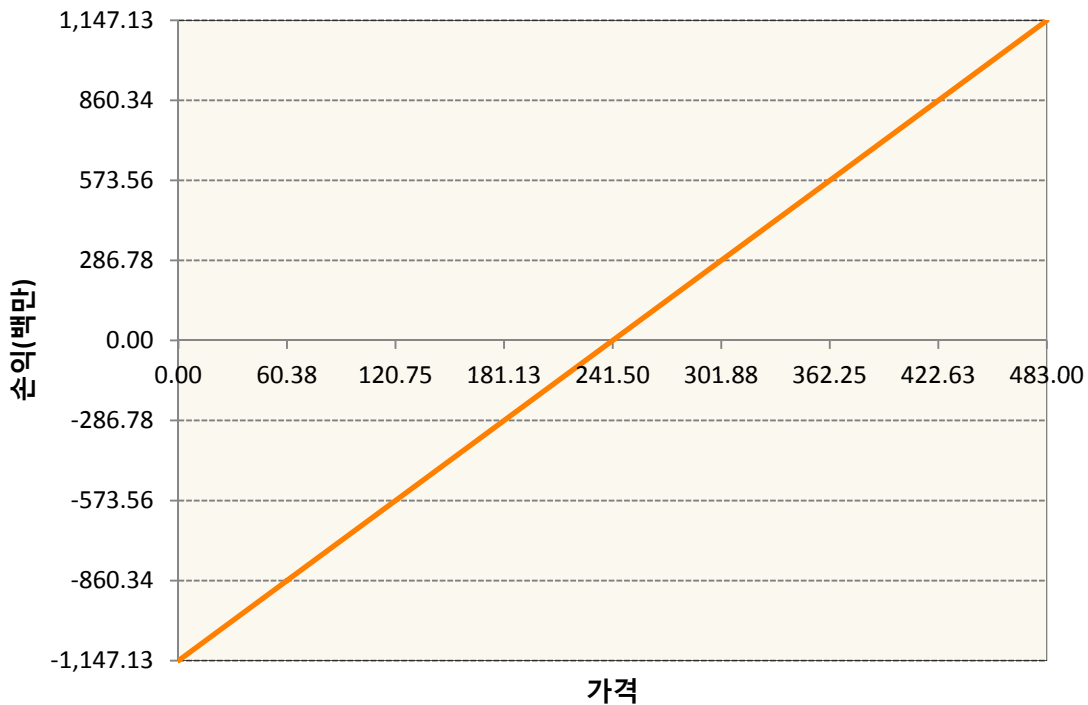
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,147	0	1,147	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						92
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92	
-5.33%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61	
-2.67%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	31	31	31	31	31	31	31	
5.33%	61	61	61	61	61	61	61	
8.00%	92	92	92	92	92	92	92	

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

(단위:백만원)

134

공시일	2020-04-09
기준일	2020-04-08

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

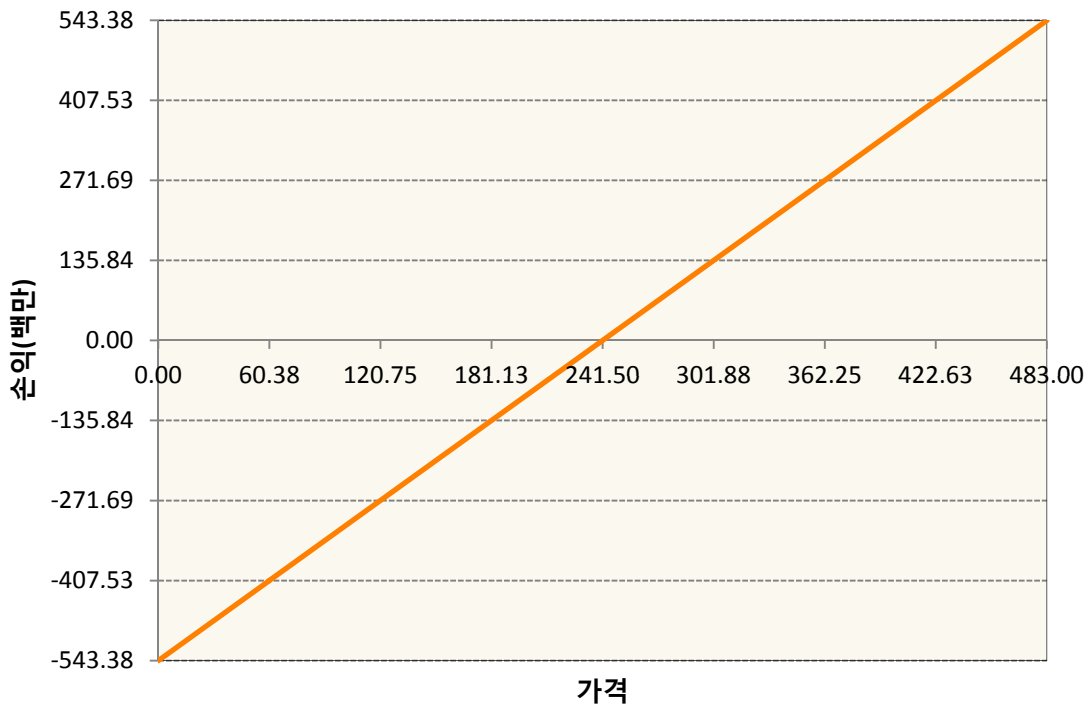
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002 2020-06 코스피200지수선물 44

가격	기초자산의 변동성						
	-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)

63

공시일	2020-04-09
기준일	2020-04-08

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

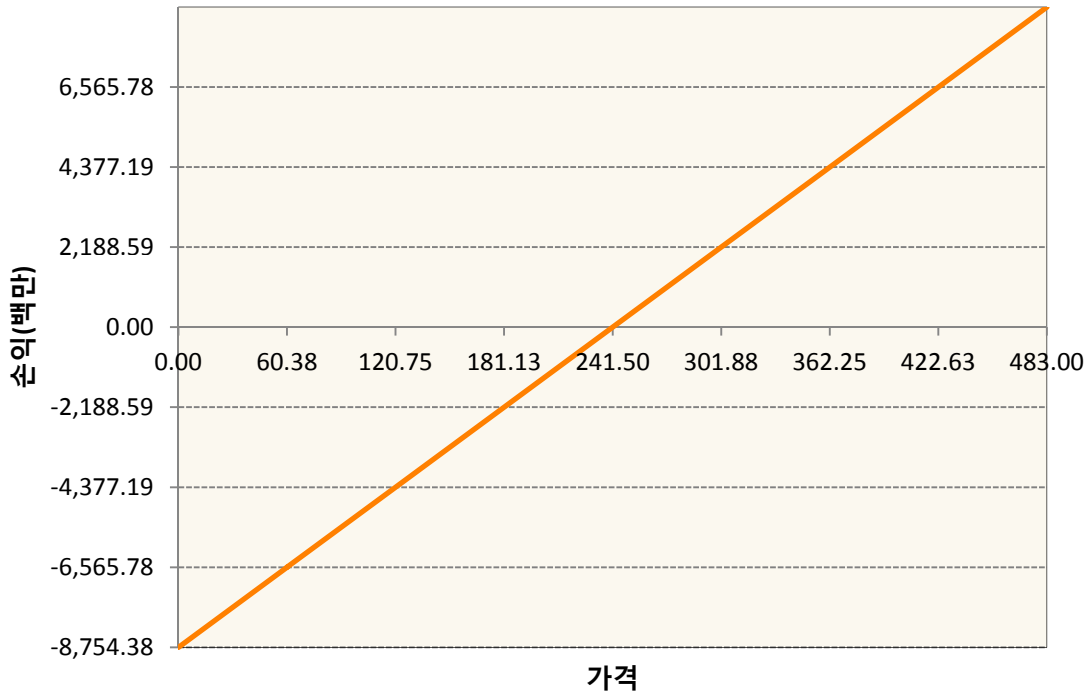
1. 계약금액

(단위:백만원)

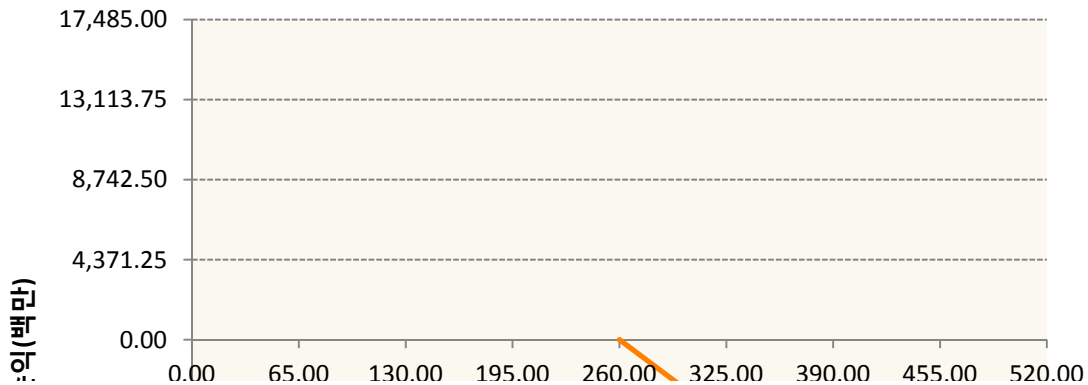
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,754	0	8,754	장내
누계	유가증권	옵션	6,004	17,485	-11,481	장내

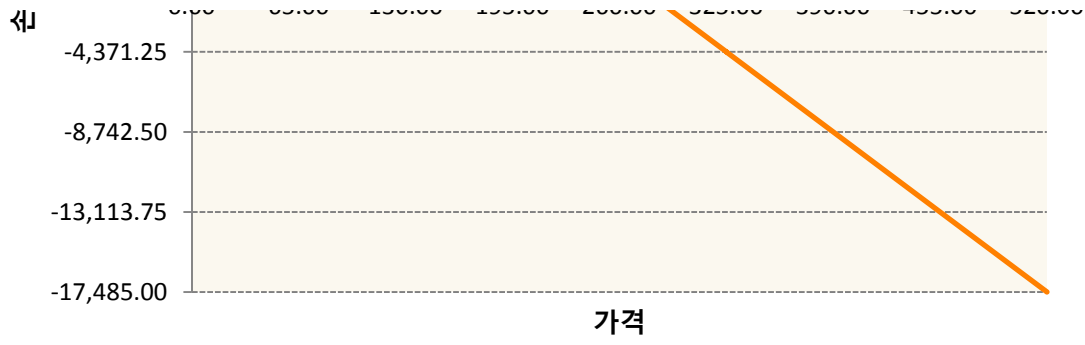
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

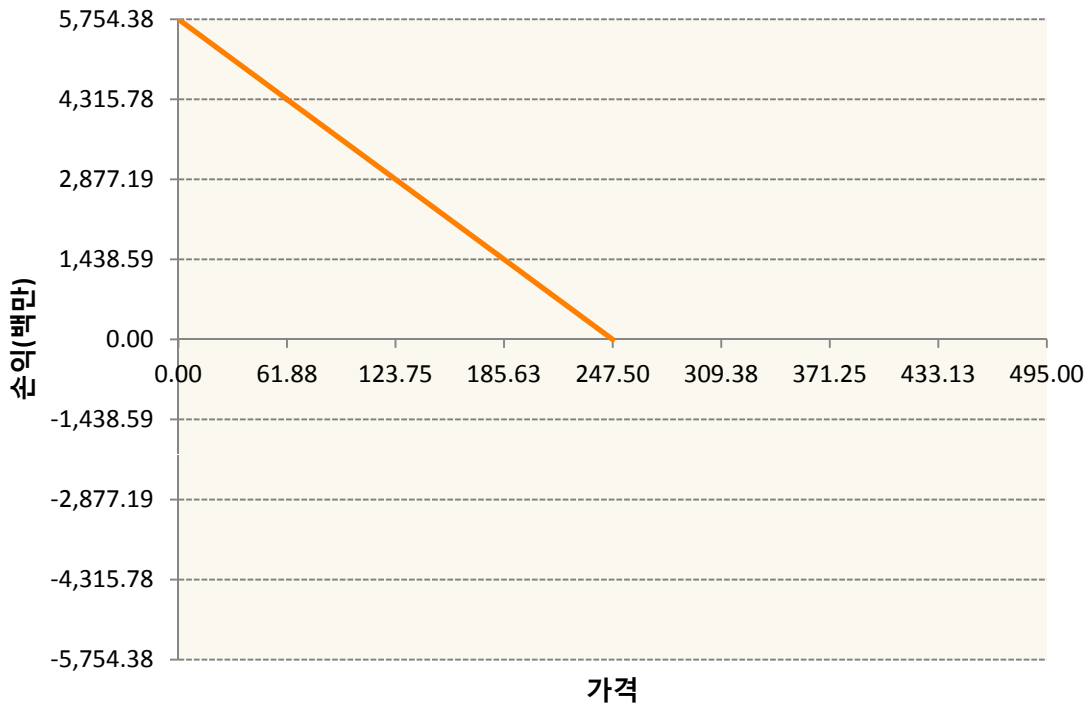


KR4201Q42602-2020-04 콜260

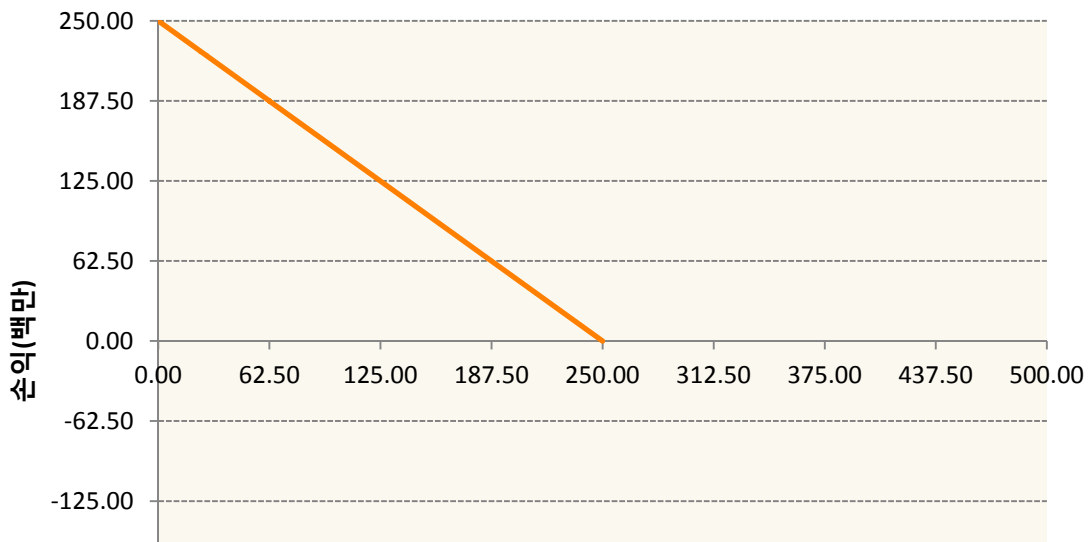


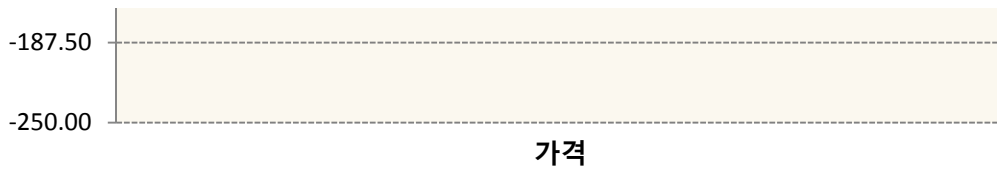


KR4301Q42477-2020-04 풋247.5



KR4301Q42501-2020-04 풋250





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						701
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-701	-701	-701	-701	-701	-701	-701	
-5.33%	-468	-468	-468	-468	-468	-468	-468	
-2.67%	-234	-234	-234	-234	-234	-234	-234	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	234	234	234	234	234	234	234	
5.33%	468	468	468	468	468	468	468	
8.00%	701	701	701	701	701	701	701	
KR4201Q42602		2020-04 콜260						283
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%	1	1	0	0	-1	-2	-3	
2.67%	-1	-3	-5	-9	-13	-18	-24	
5.33%	-30	-40	-51	-63	-75	-88	-101	
8.00%	-189	-204	-220	-236	-251	-267	-283	
KR4301Q42477		2020-04 풋247.5						440
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	440	440	440	440	440	440	440	
-5.33%	290	290	290	290	290	290	290	
-2.67%	140	140	140	141	141	142	142	
0%	-6	-4	-2	0	3	5	8	
2.67%	-111	-107	-103	-98	-94	-90	-86	
5.33%	-139	-138	-136	-135	-133	-131	-128	
8.00%	-141	-141	-140	-140	-140	-140	-139	
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%	13	13	13	13	13	13	13	
-2.67%	6	6	6	6	6	6	6	

0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-6	-5	-5	-5	-5	-5	-5
5.33%	-8	-8	-8	-8	-8	-7	-7
8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8

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

(단위:백만원)

1,446

공시일	2020-04-09
기준일	2020-04-08

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	146,041	0	146,041	

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	2020-04-09
기준일	2020-04-08

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	98,472	0	98,472	

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	2020-04-09
기준일	2020-04-08

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	435,073	0	435,073	
누계	통화	선도	71,423	495,563	-424,141	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,360
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,953
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,907
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,286
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,953
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	2,383
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	977
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	977
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,539
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	6,935
FX21020H11 KRW/USD 11-05-20E	977
FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E	2,930
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

22,513

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

(단위:백만원)

182

공시일	2020-04-09
기준일	2020-04-08

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

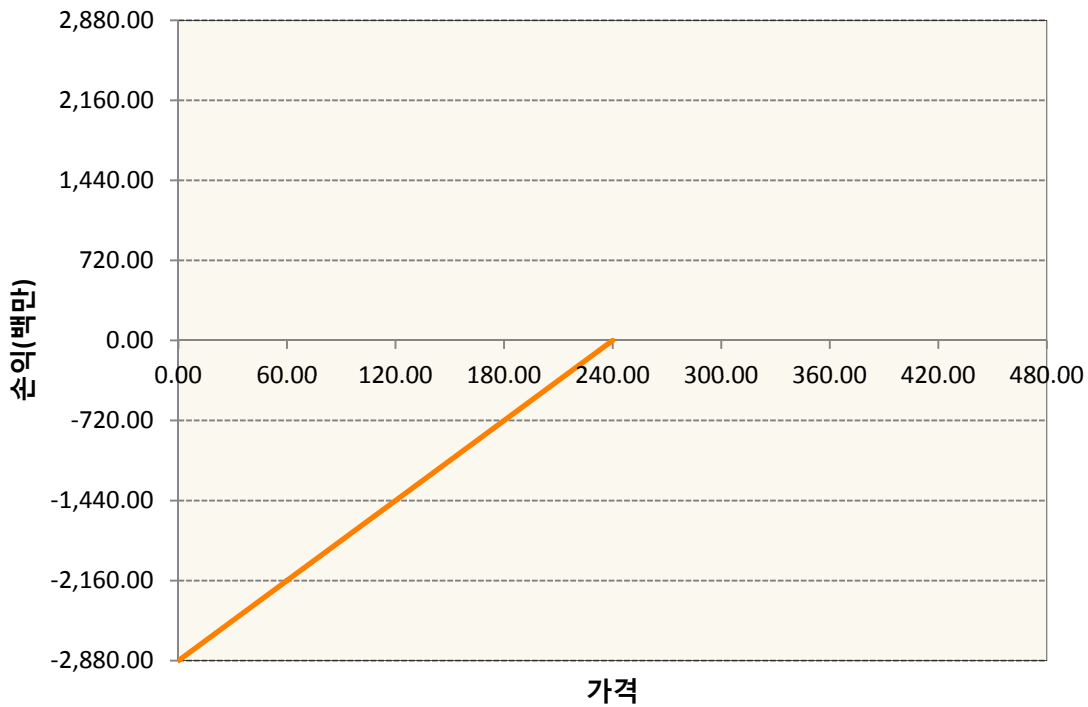
1. 계약금액

(단위:백만원)

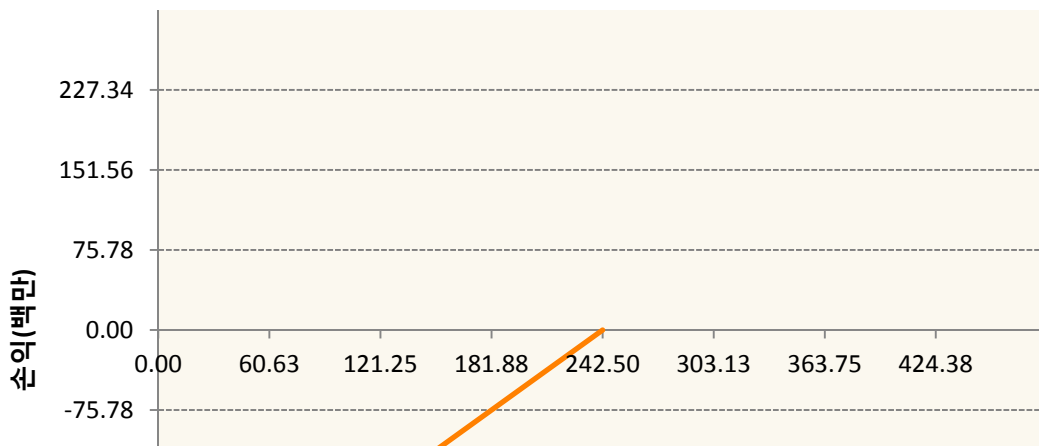
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,183	-3,183	장내

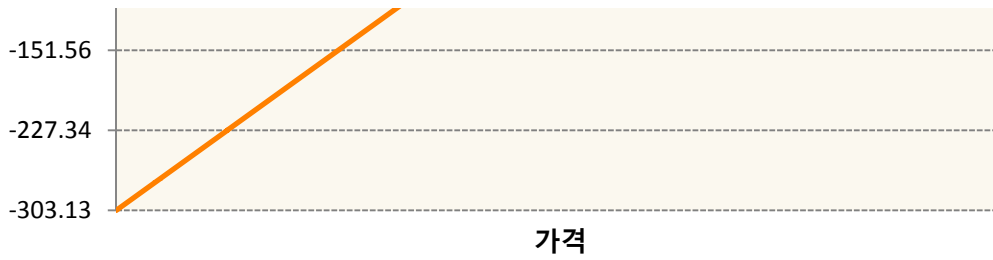
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q42402-2020-04 풋240



KR4301Q42428-2020-04 풋242.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q42402		2020-04 풋240						194
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-194	-194	-194	-194	-194	-194	-194	
-5.33%	-116	-116	-116	-117	-117	-117	-118	
-2.67%	-42	-43	-44	-46	-47	-49	-50	
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6	
2.67%	16	15	15	14	13	13	12	
5.33%	16	16	16	16	16	16	16	
8.00%	16	16	16	16	16	16	16	
KR4301Q42428		2020-04 풋242.5						22
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22	
-5.33%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14	
-2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6	
0%	1	0	0	0	0	0	-1	
2.67%	3	3	3	3	2	2	2	
5.33%	3	3	3	3	3	3	3	
8.00%	3	3	3	3	3	3	3	

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

258

공시일	2020-04-09
기준일	2020-04-08

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	7,172	0	7,172	
누계	통화	선도	440	7,582	-7,142	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)

318

공시일	2020-04-09
기준일	2020-04-08

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

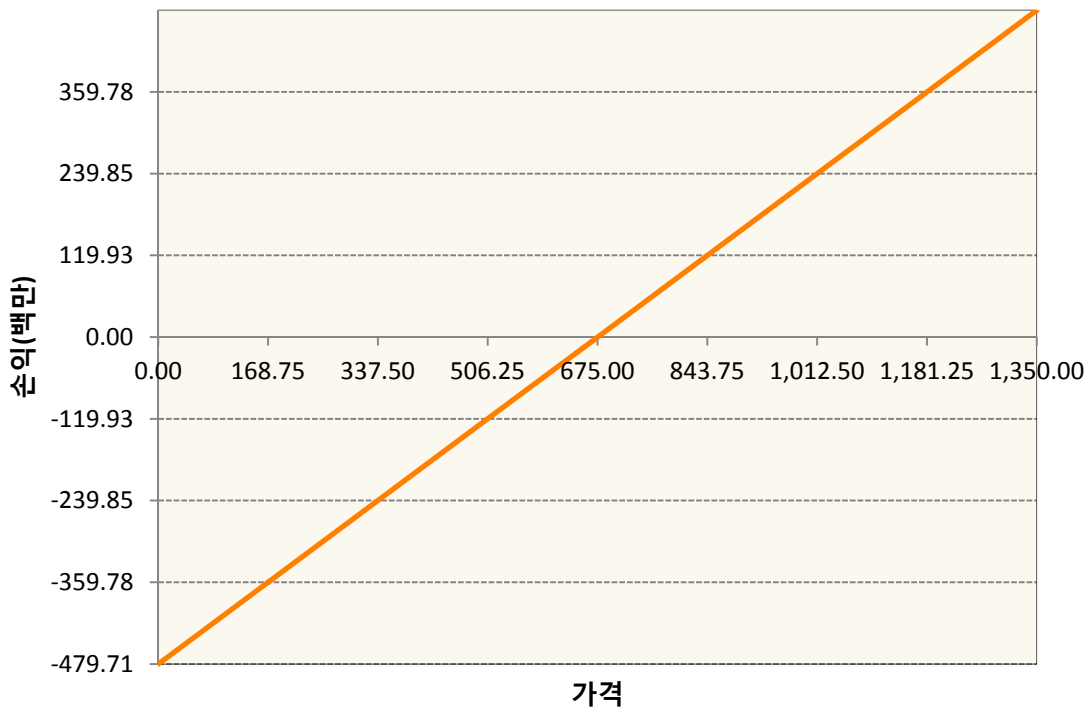
1. 계약금액

(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	480	0	480	
누계	유가증권	스왑	1,093	0	1,093	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)	87
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
38

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

(단위:백만원)

140

공시일	2020-04-09
기준일	2020-04-08

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

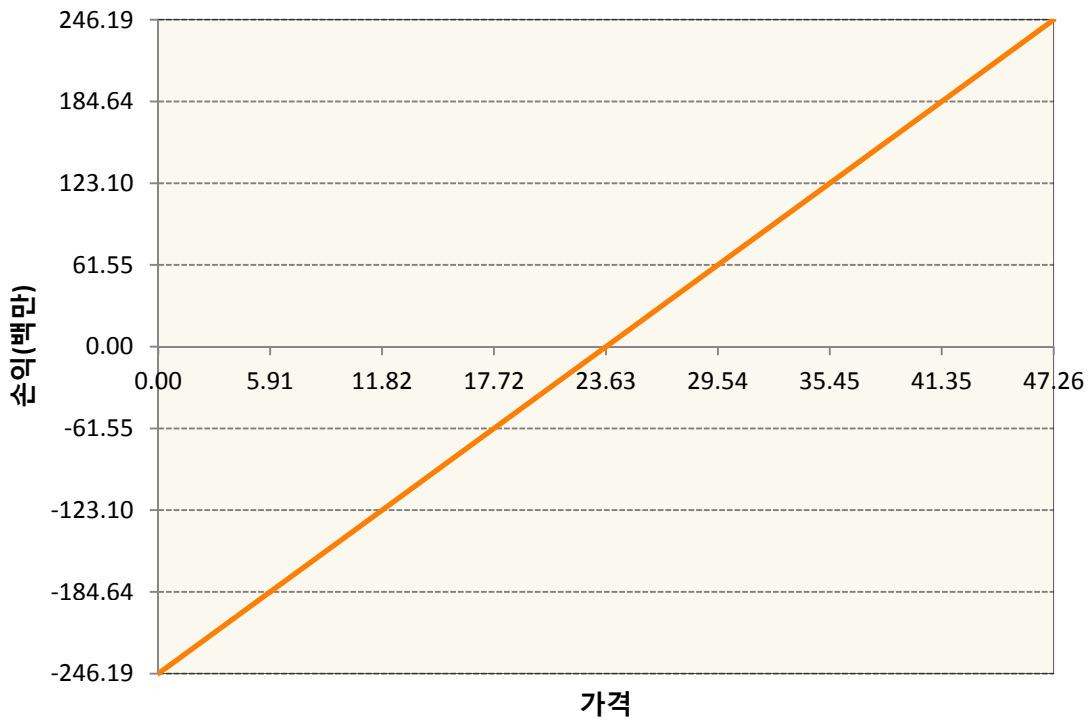
1. 계약금액

(단위:백만원)

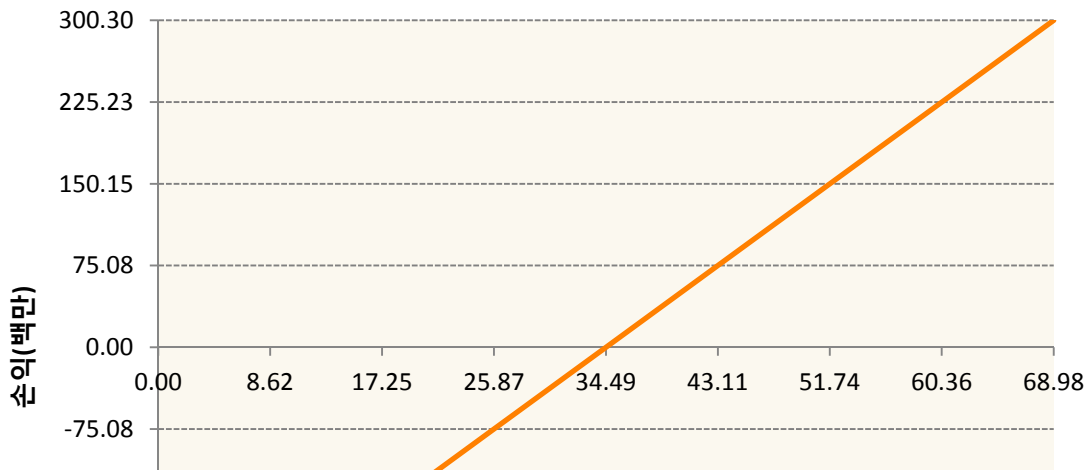
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,428	245	1,183	

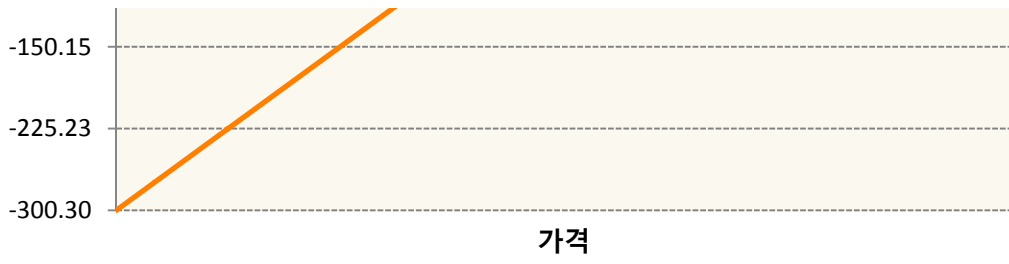
2. 만기시점의 손익구조

CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20

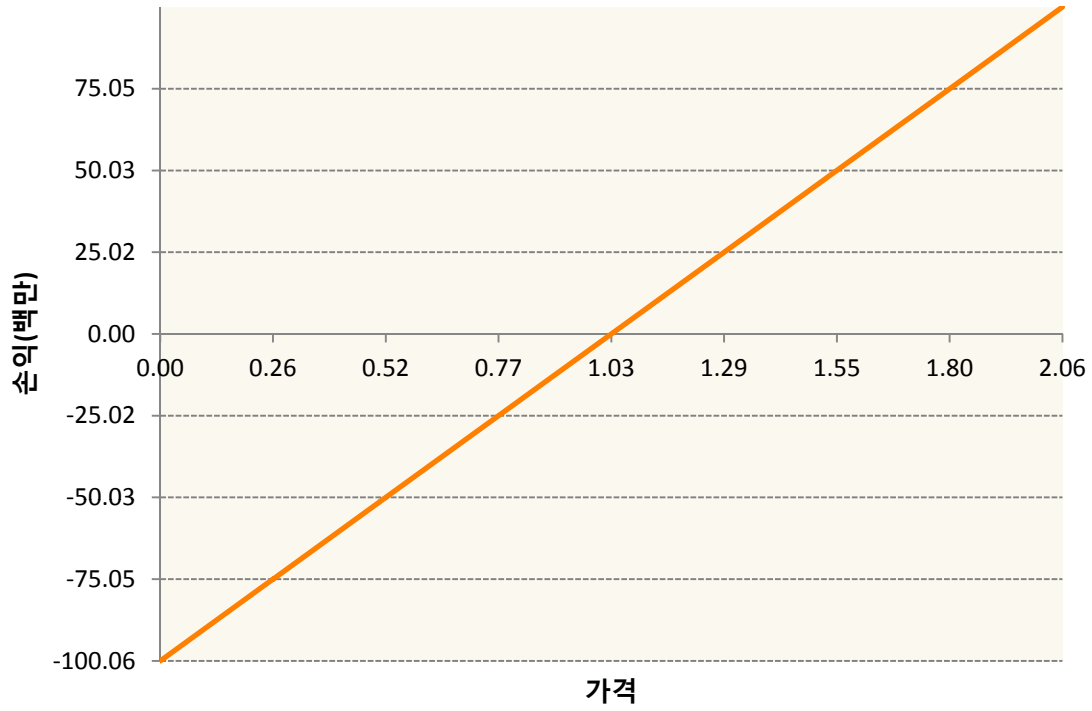


CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20

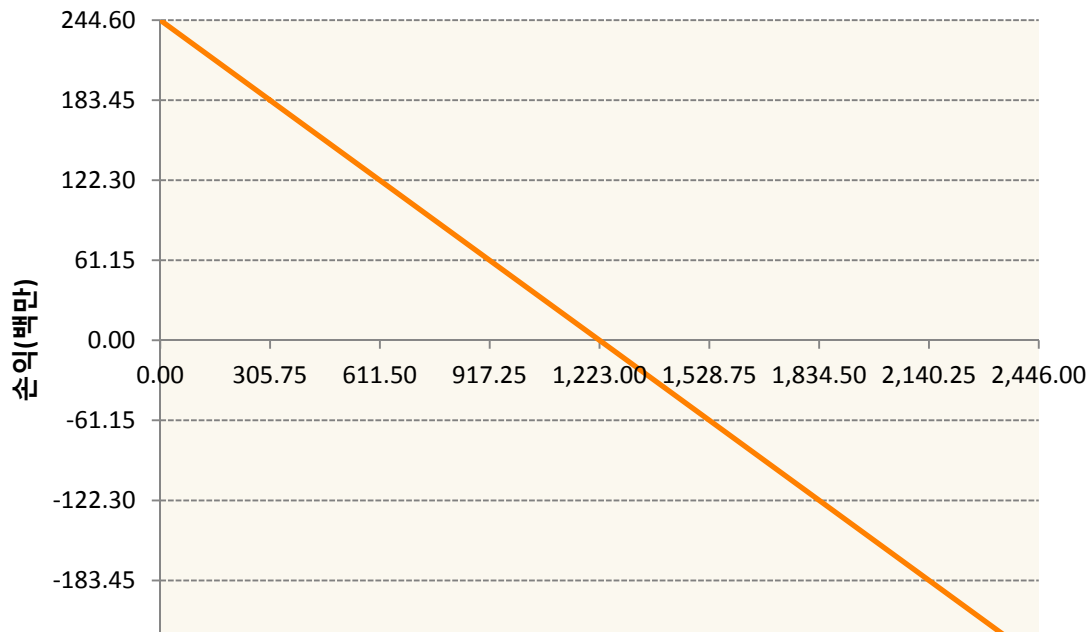


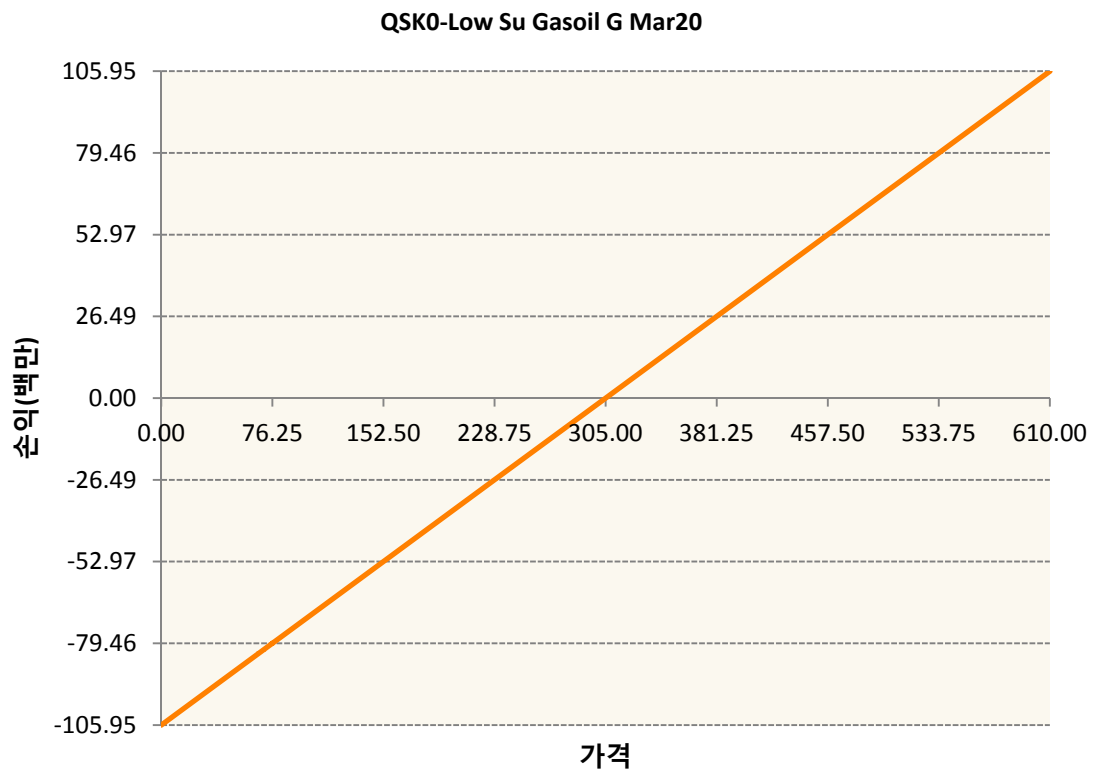
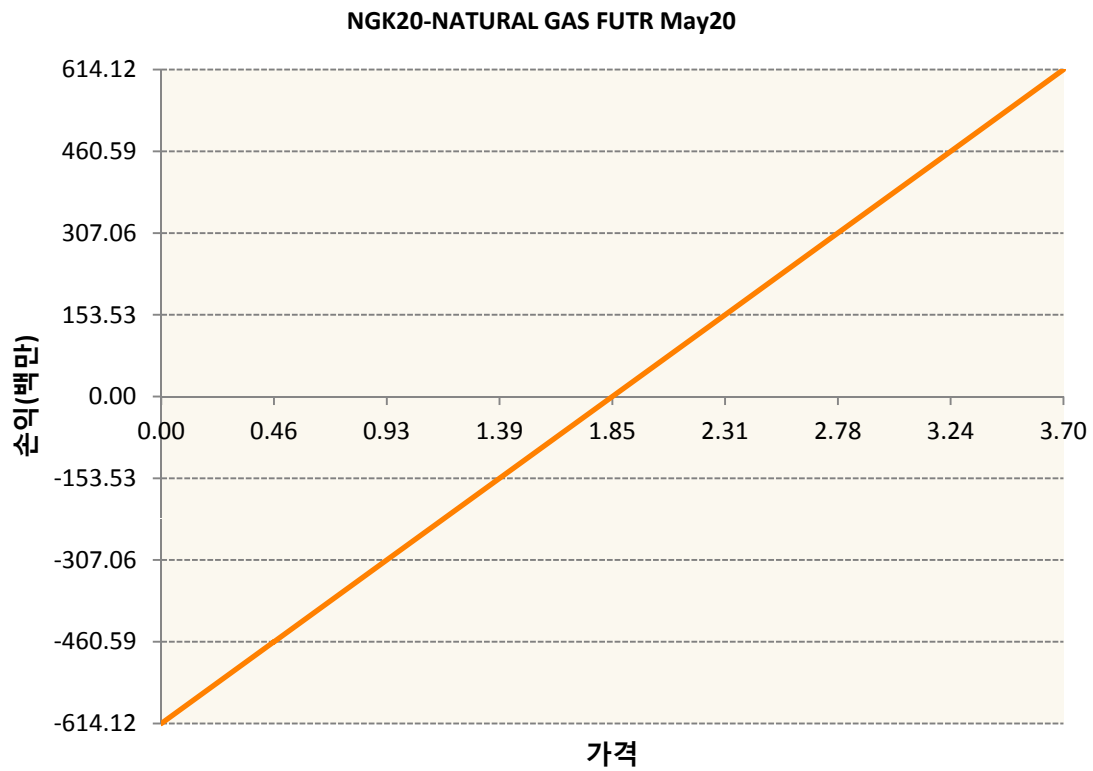
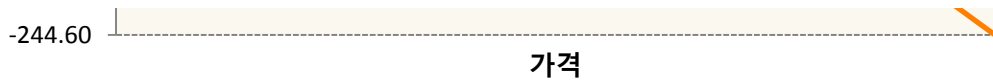


HOK0-NY Harb ULSD Fut May20

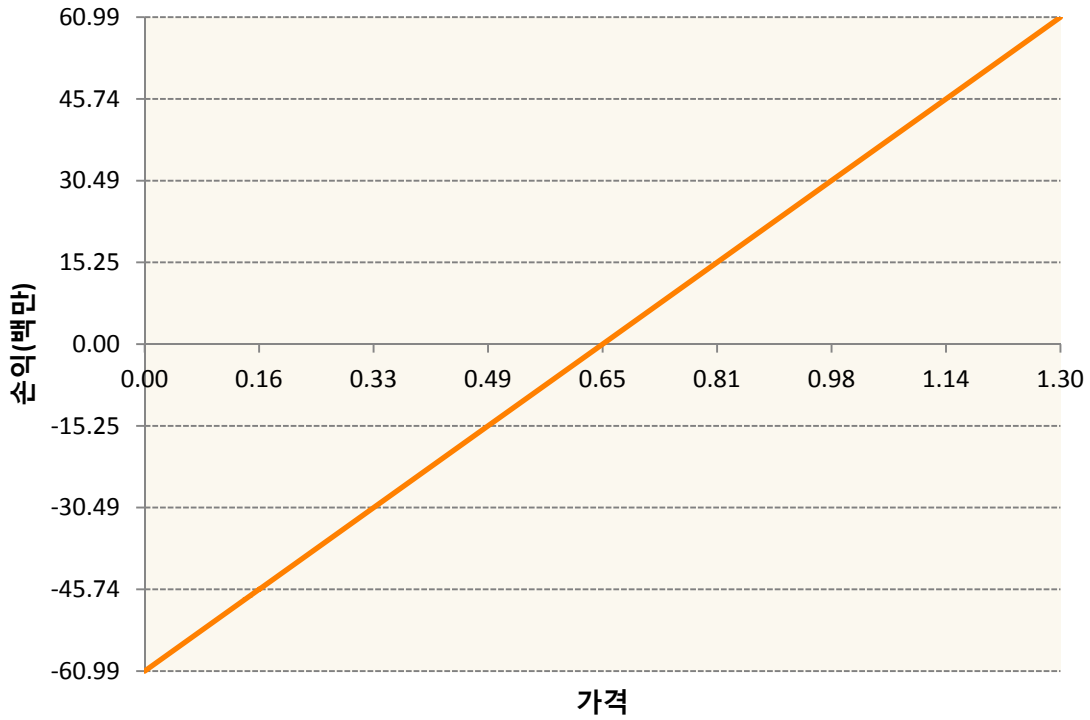


KR4175Q40008-2020-04 달러선물





XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	20
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	24
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	8
KR4175Q40C	2020-04 달러선물	20
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	49
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	8
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	5

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

(단위:백만원)

344

공시일	2020-04-09
기준일	2020-04-08

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

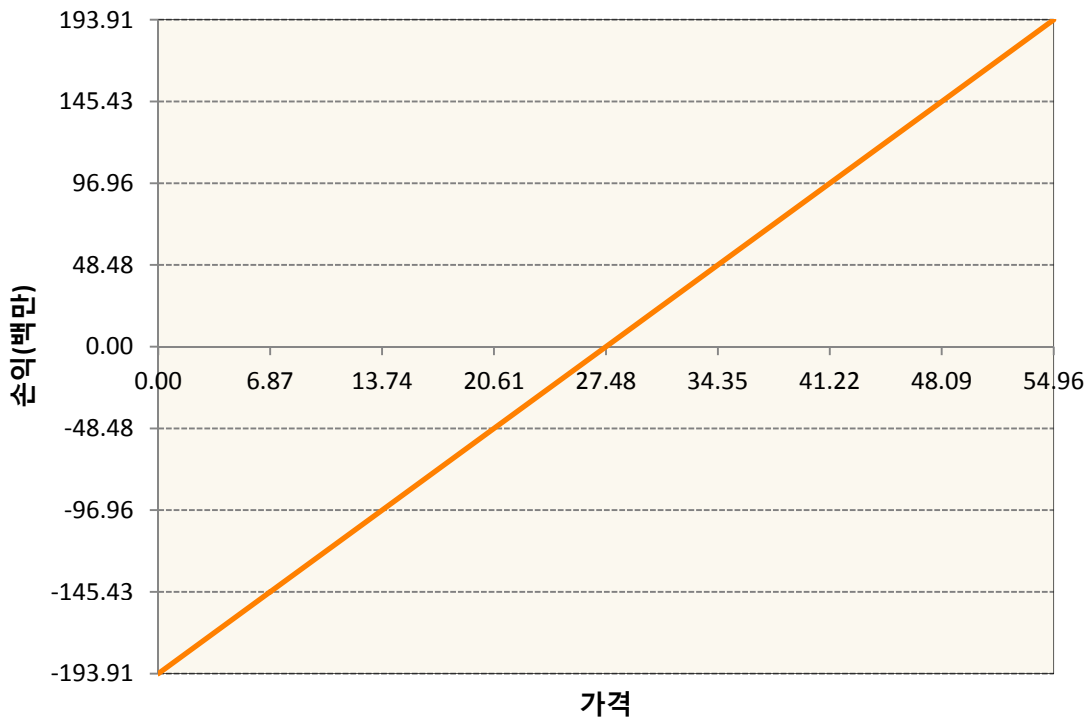
1. 계약금액

(단위:백만원)

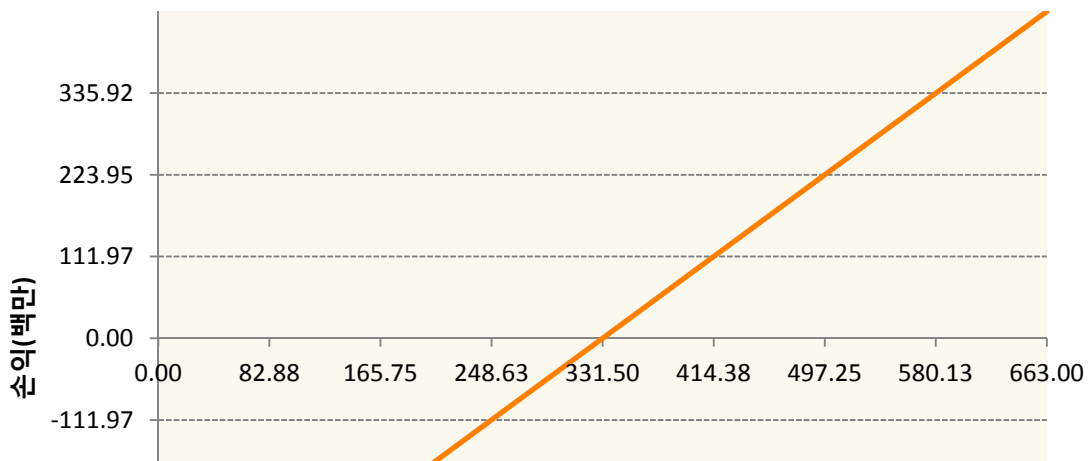
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,282	98	2,184	

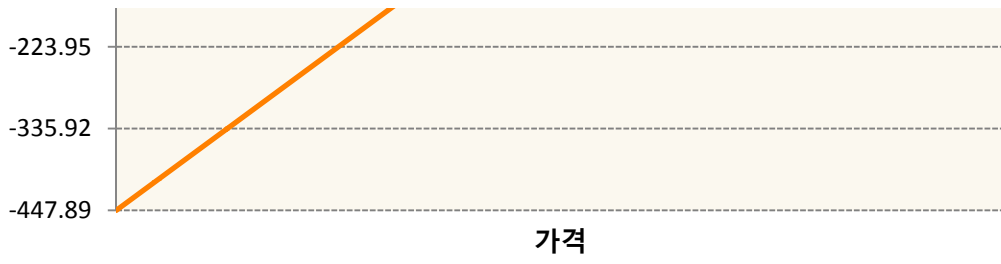
2. 만기시점의 손익구조

BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20

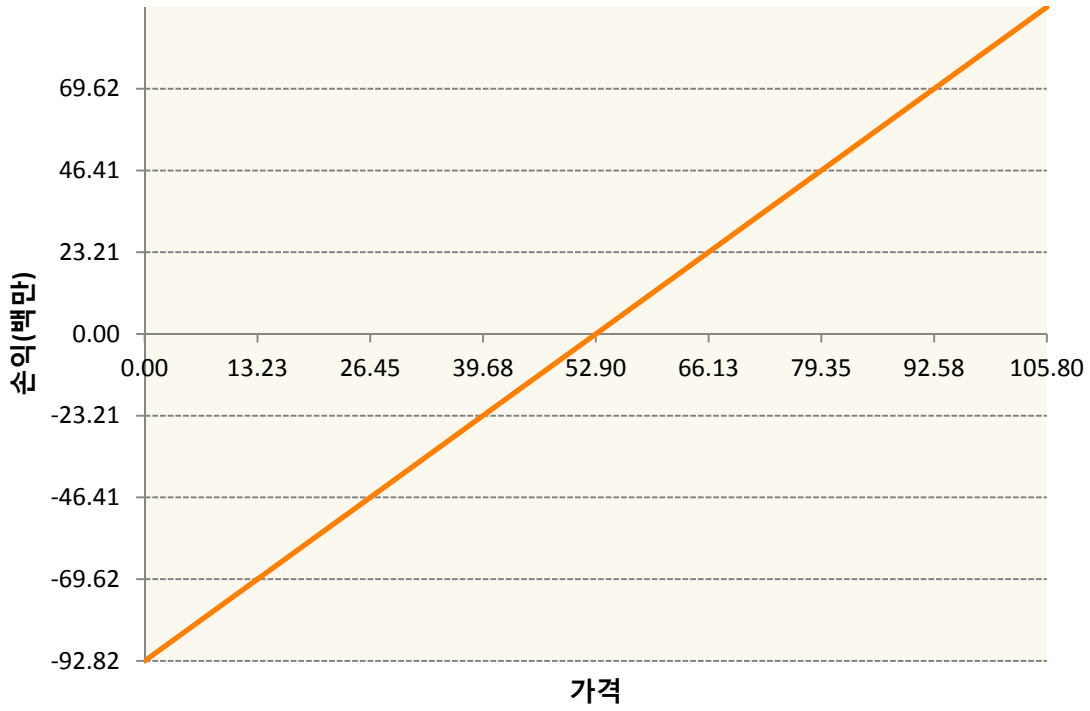


CK0-CORN FUTURE May20

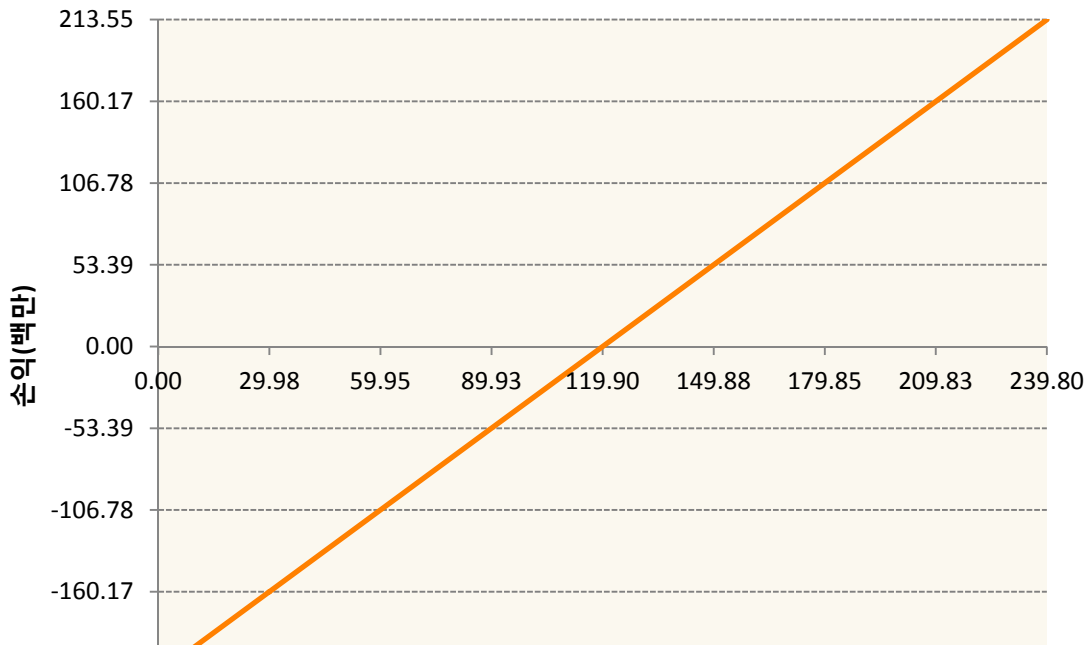


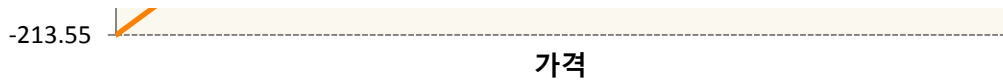


CTK0-COTTON NO.2 FUTR May20

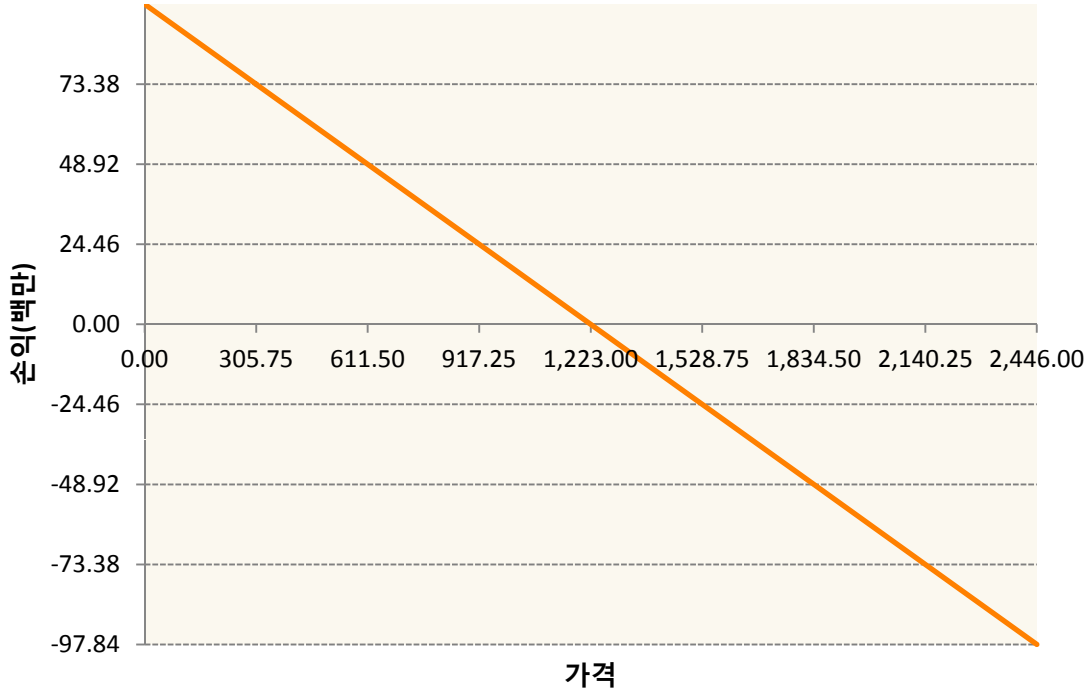


KCK0-COFFEE 'C' FUTURE May20

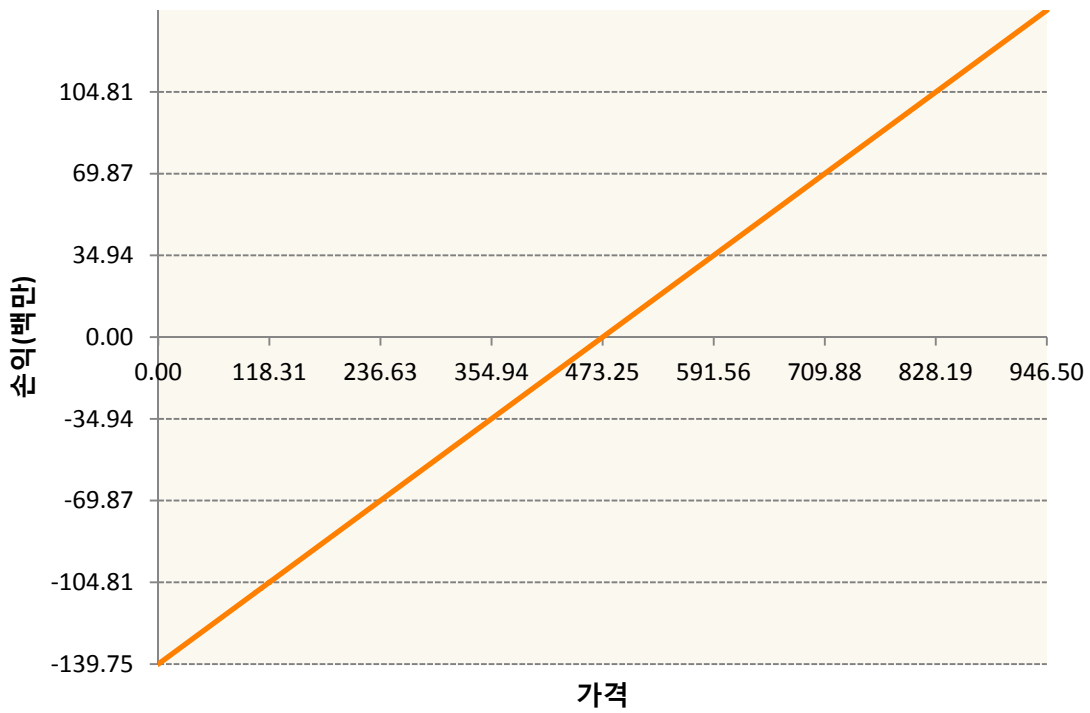




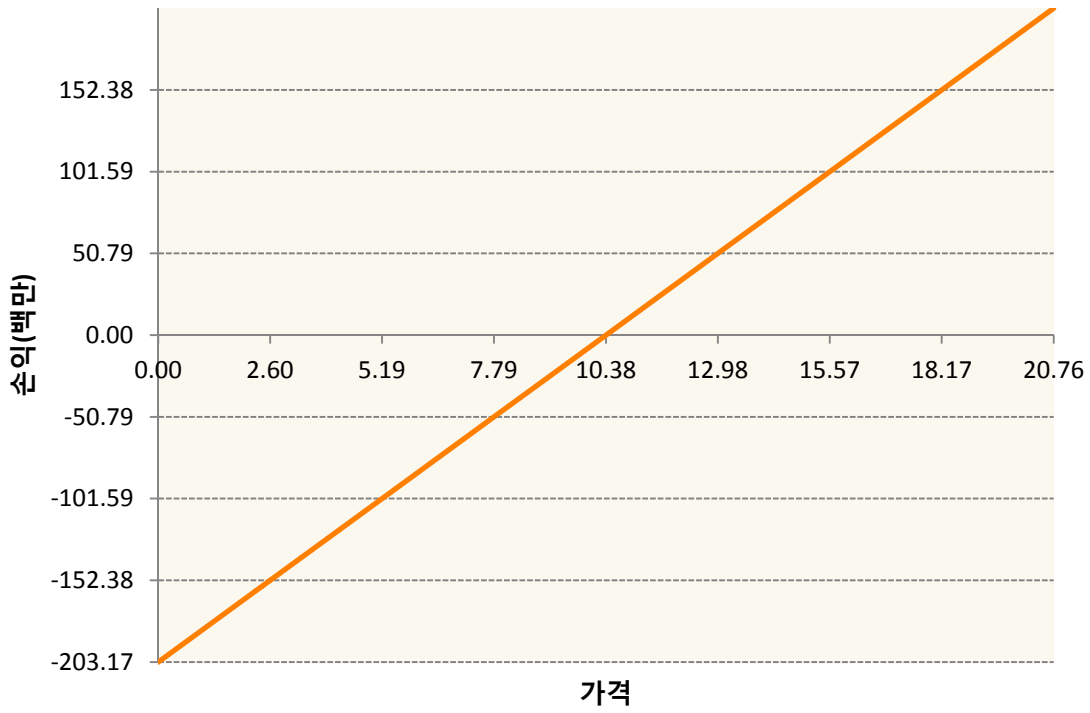
KR4175Q40008-2020-04 달러선물



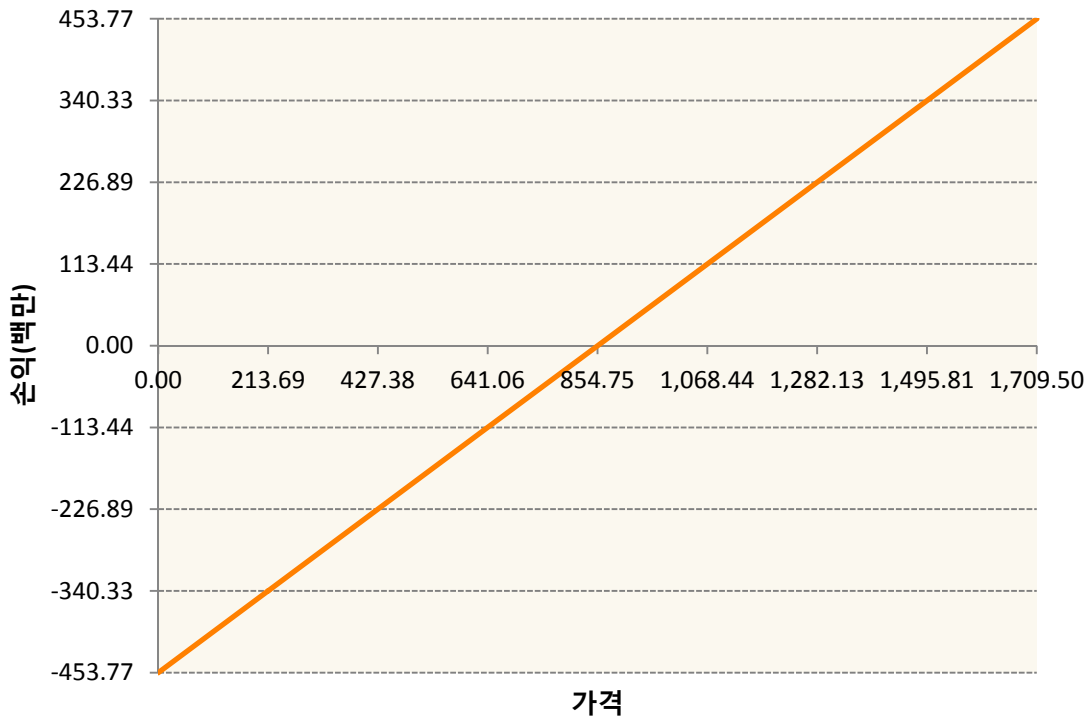
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



SBK0-Sugar May20

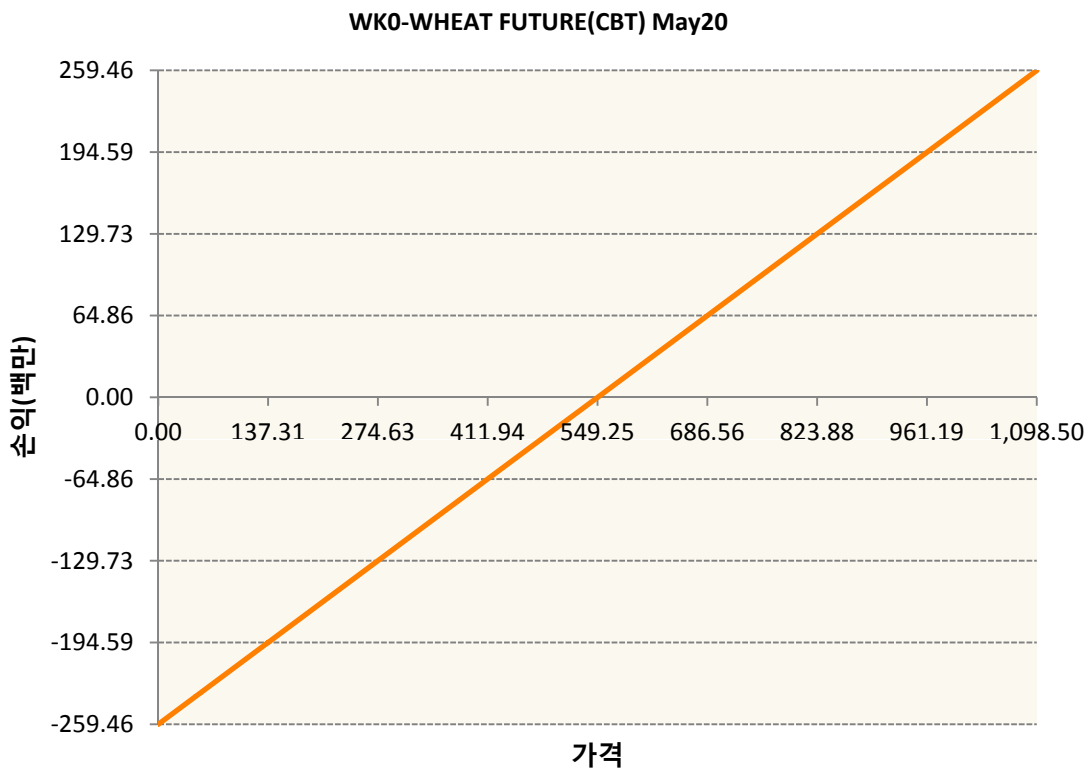
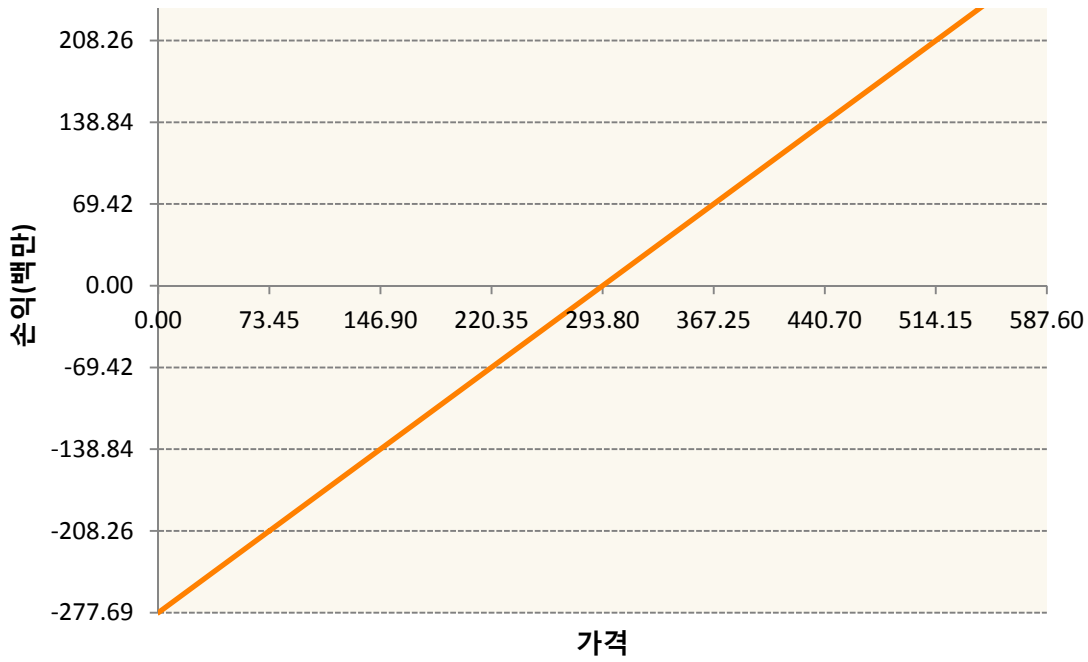


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	16
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	22
WK0	WHEAT FUTURE(CBT) May20	21

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

(단위:백만원)

213