

공시일	2020-04-10
기준일	2020-04-09

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	2020-04-10
기준일	2020-04-09

스마트인덱스모

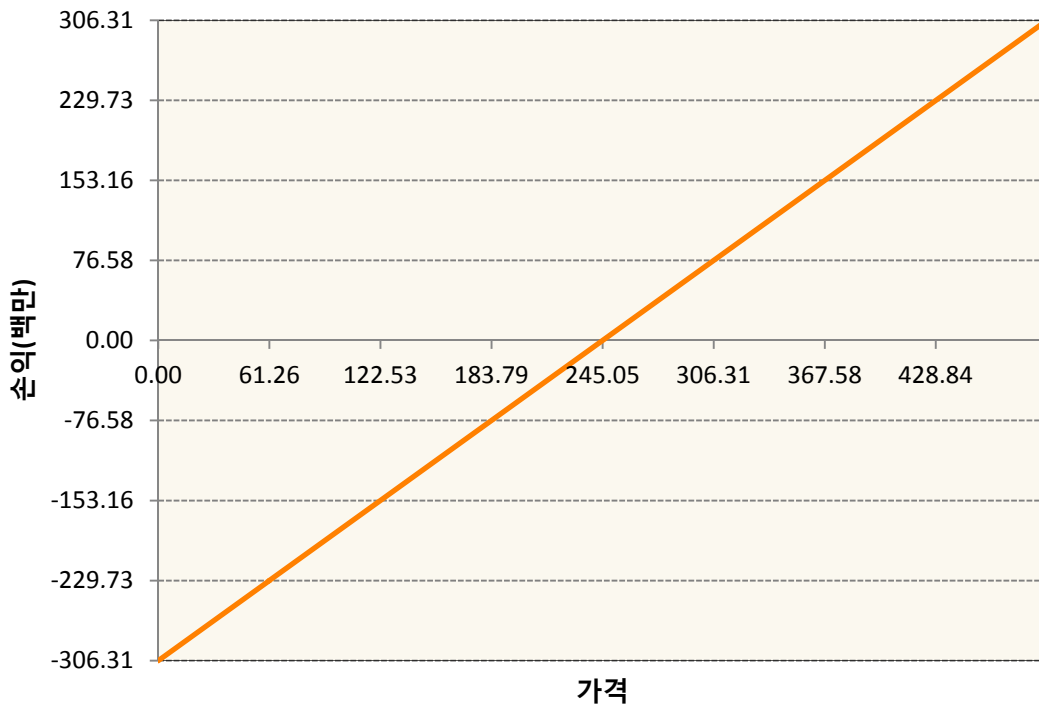
1. 계약금액

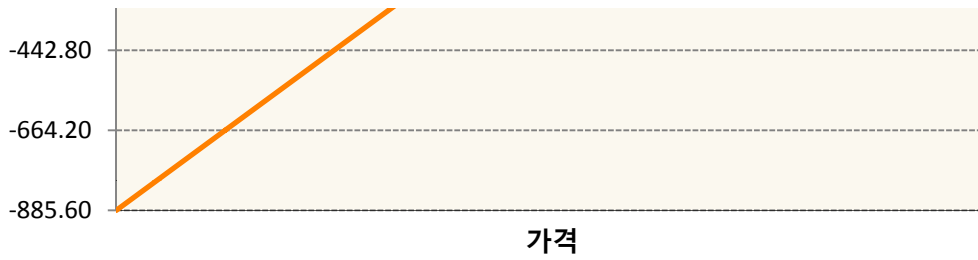
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,192	0	1,192	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						25
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25	
-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%	25	25	25	25	25	25	25	
KR4111Q50002		2020-05 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%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47	
-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%	47	47	47	47	47	47	47	
8.00%	71	71	71	71	71	71	71	

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

140

공시일	2020-04-10
기준일	2020-04-09

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

936

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,077

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-10
기준일	2020-04-09

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

555

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

878

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-10
기준일	2020-04-09

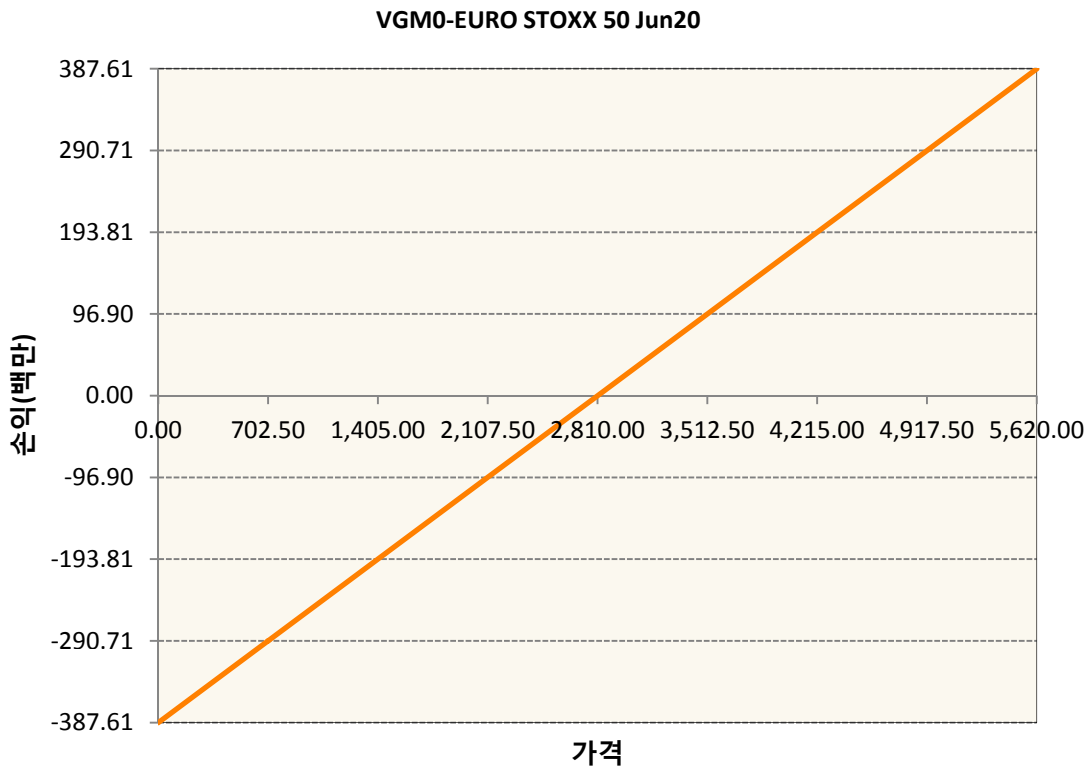
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	388	0	388	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

38

공시일	2020-04-10
기준일	2020-04-09

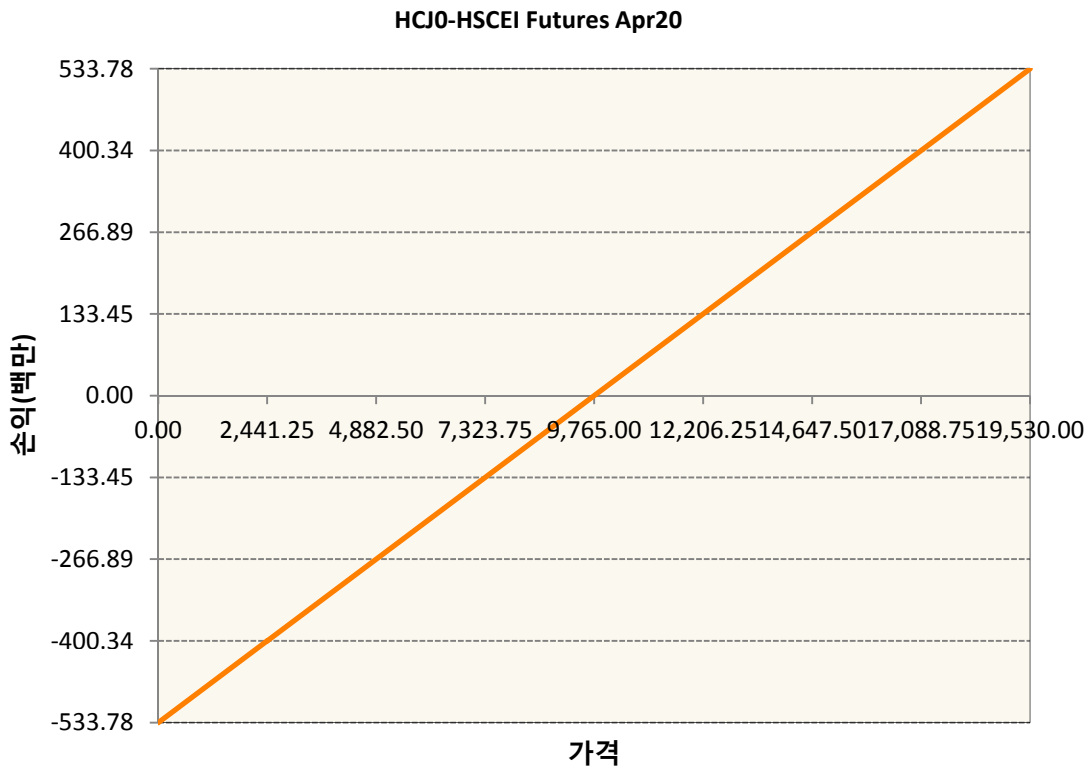
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	534	0	534	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

46

공시일	2020-04-10
기준일	2020-04-09

커버드콜모(주식혼합-파생형)

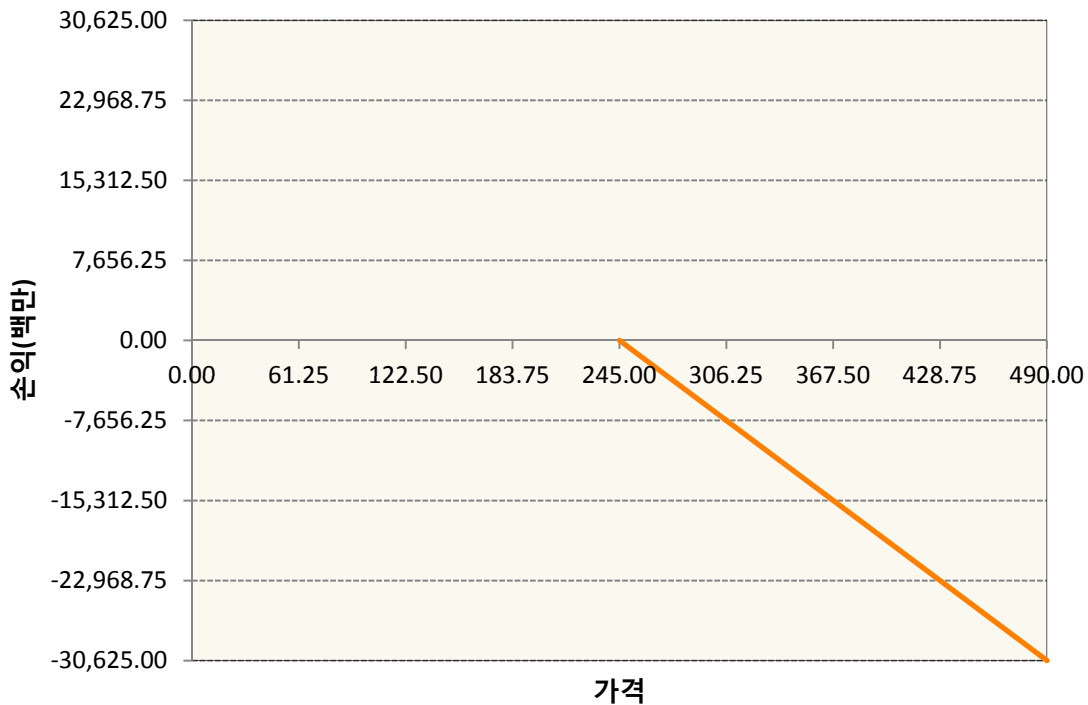
1. 계약금액

(단위:백만원)

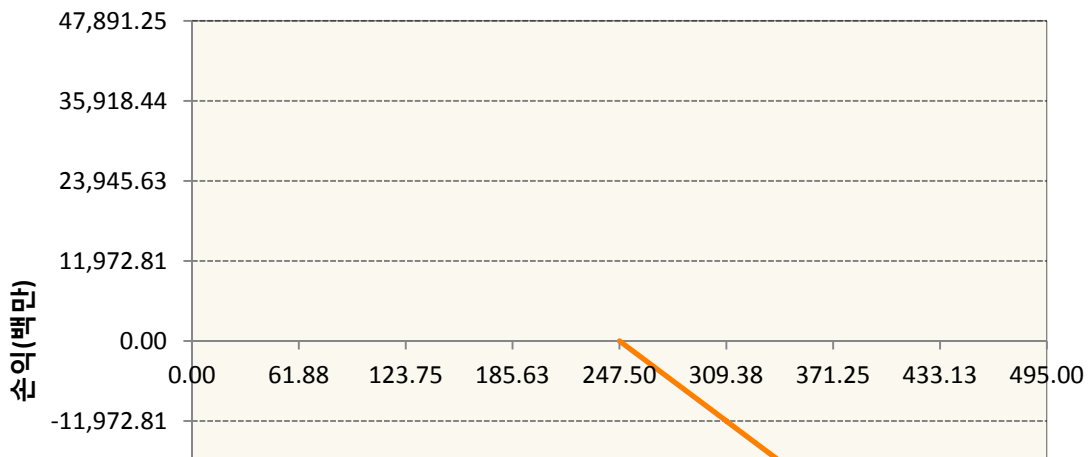
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	70,516	-70,516	장내
누계	유가증권	옵션	0	78,516	-78,516	장내

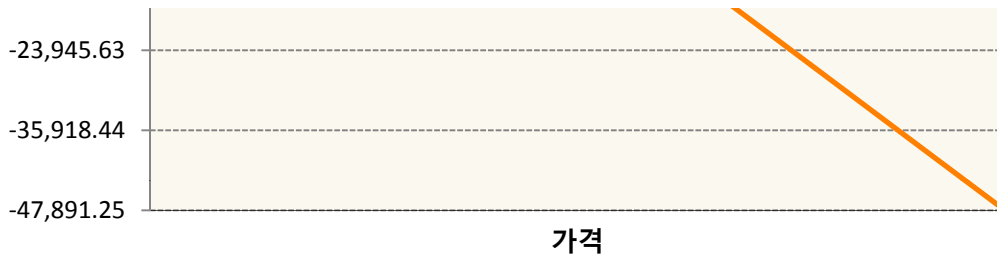
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q52452-2020-05 콜245



KR4201Q52478-2020-05 콜247.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q52452		2020-05 콜245						1,998
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,450	1,325	1,194	1,060	923	783	642	
-5.33%	1,200	1,056	910	762	613	463	312	
-2.67%	880	723	566	409	251	94	-64	
0%	486	324	162	0	-162	-323	-485	
2.67%	19	-141	-302	-463	-625	-787	-949	
5.33%	-515	-667	-821	-978	-1,135	-1,294	-1,454	
8.00%	-1,109	-1,248	-1,392	-1,540	-1,690	-1,843	-1,998	
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5						3,021
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,127	1,942	1,749	1,548	1,341	1,130	915	
-5.33%	1,777	1,562	1,341	1,117	889	660	428	
-2.67%	1,321	1,083	843	601	359	116	-128	
0%	754	503	251	0	-251	-502	-753	
2.67%	74	-178	-432	-685	-939	-1,192	-1,446	
5.33%	-712	-956	-1,203	-1,451	-1,701	-1,952	-2,203	
8.00%	-1,596	-1,823	-2,055	-2,292	-2,533	-2,776	-3,021	

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

3,872

공시일	2020-04-10
기준일	2020-04-09

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

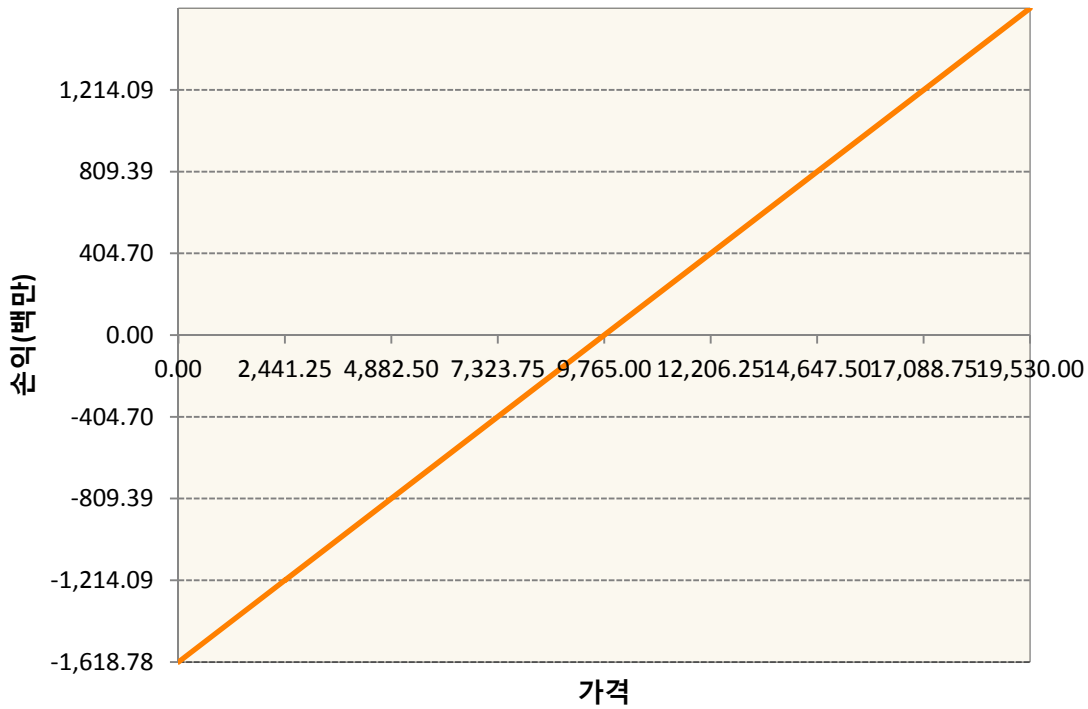
1. 계약금액

(단위:백만원)

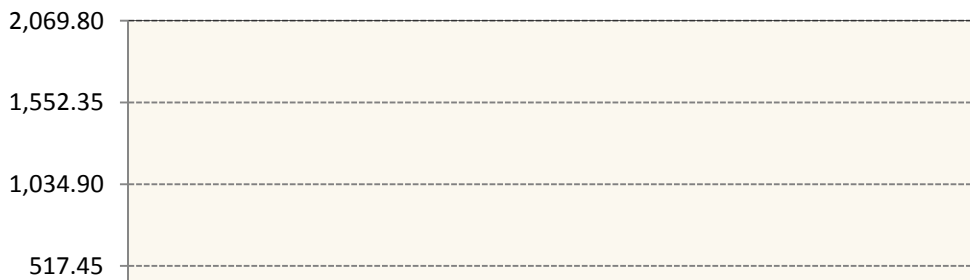
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,619	0	1,619	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,141	-4,141	장내
누계	통화	선도	692	2,215	-1,523	장외

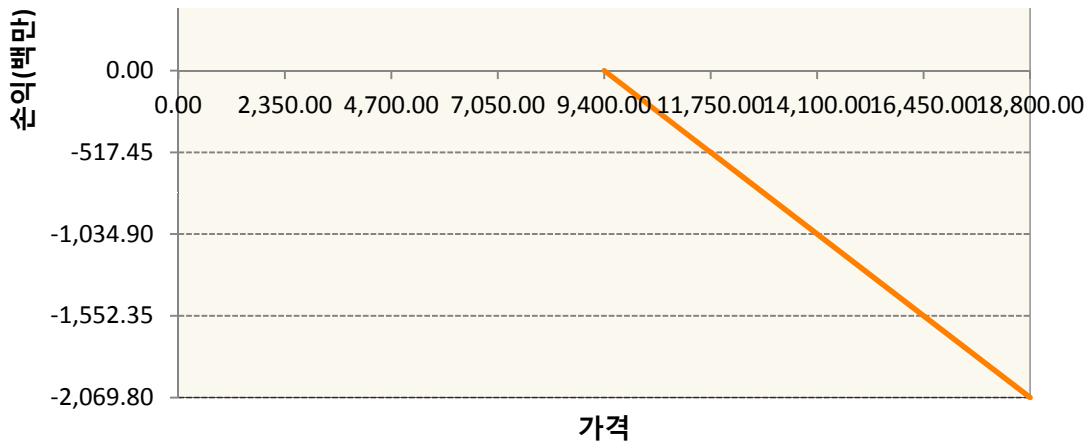
2. 만기시점의 손익구조

HCJ0-HSCEI Futures Apr20

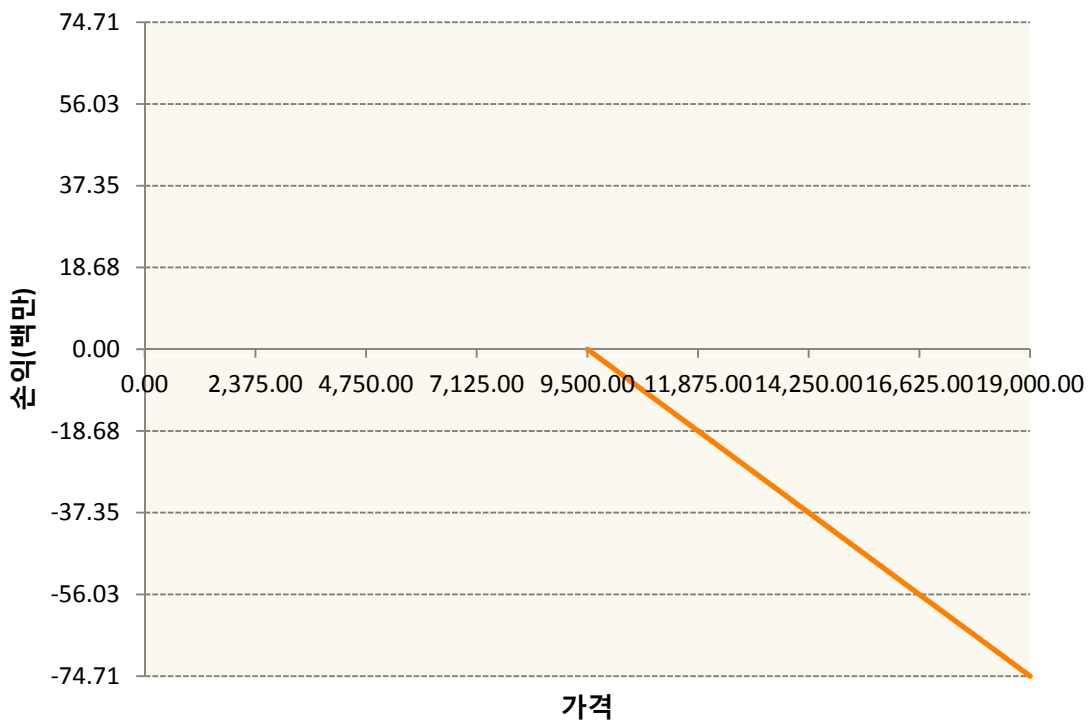


OHHIJ0-C94-HSCEI

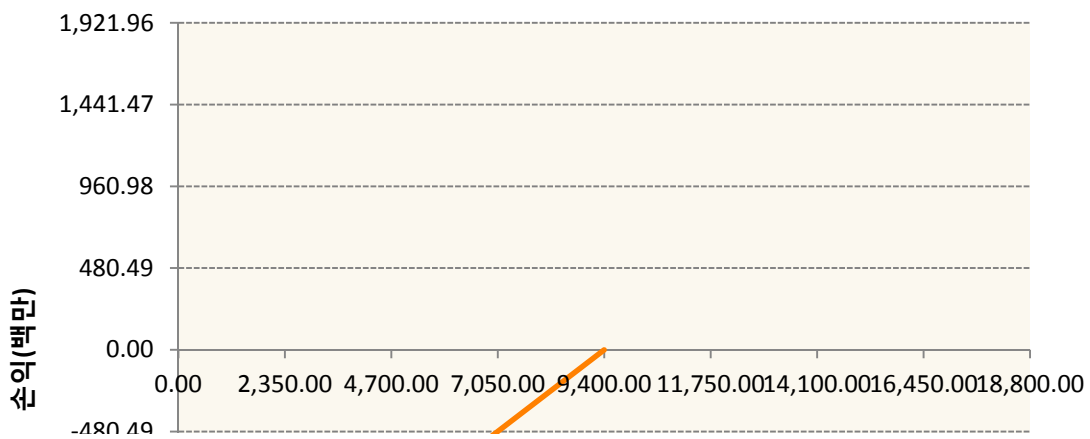


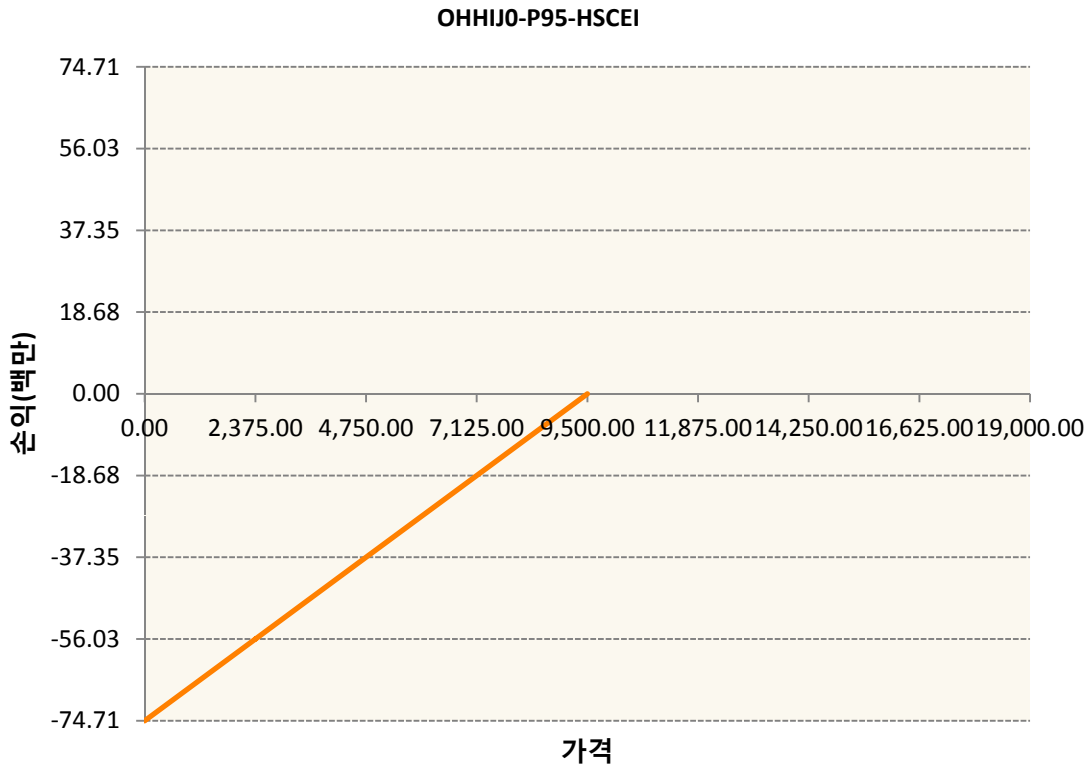


OHHIJO-C95-HSCEI



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	130
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)
	610

공시일	2020-04-10
기준일	2020-04-09

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

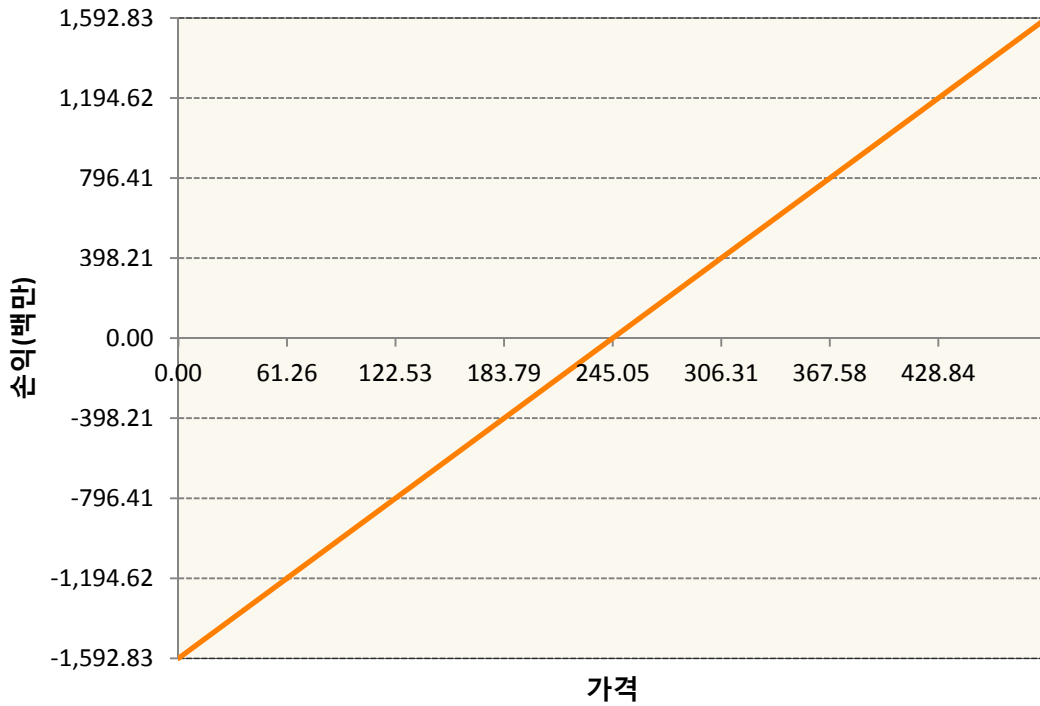
1. 계약금액

(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
누계	유가증권	선물	1,593	0	1,593	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



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							128
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	43	43	43	43	43	43	43
5.33%	85	85	85	85	85	85	85
8.00%	128	128	128	128	128	128	128

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

(단위:백만원)

372

공시일	2020-04-10
기준일	2020-04-09

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

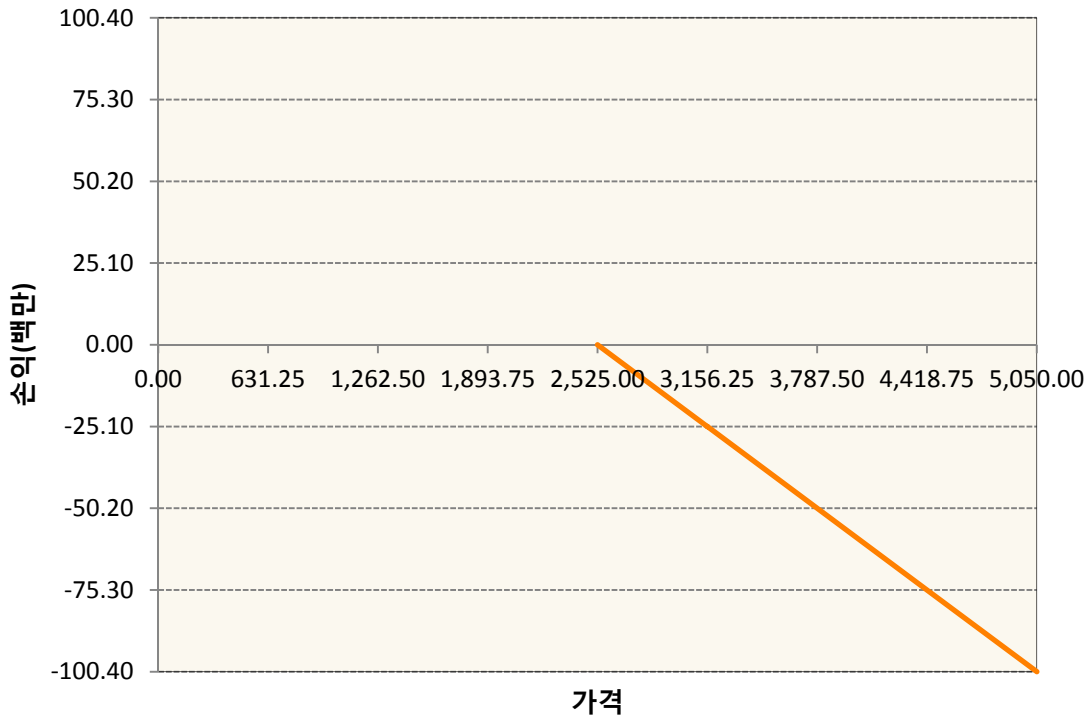
1. 계약금액

(단위:백만원)

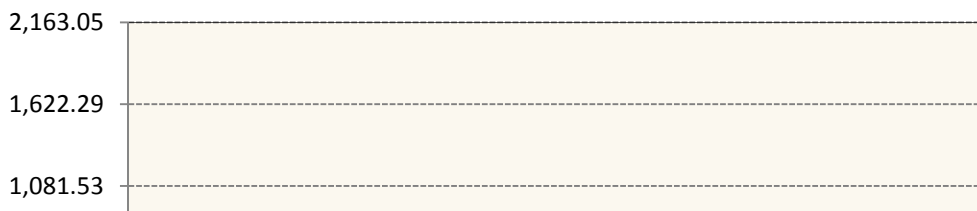
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	343	0	343	
누계	유가증권	스왑	7,528	0	7,528	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,561	-4,561	장내
누계	통화	선도	0	2,683	-2,683	장외

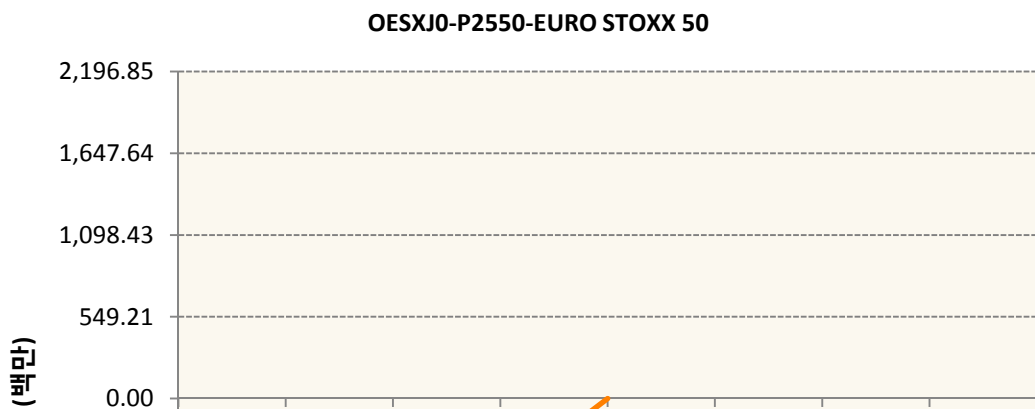
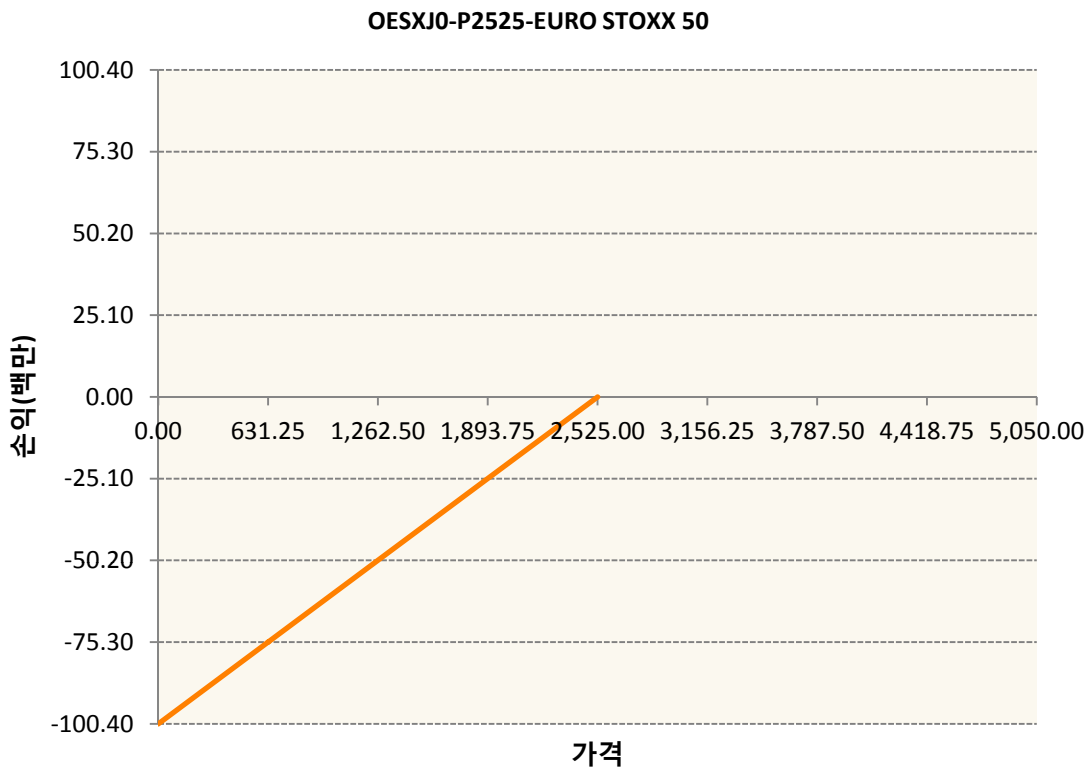
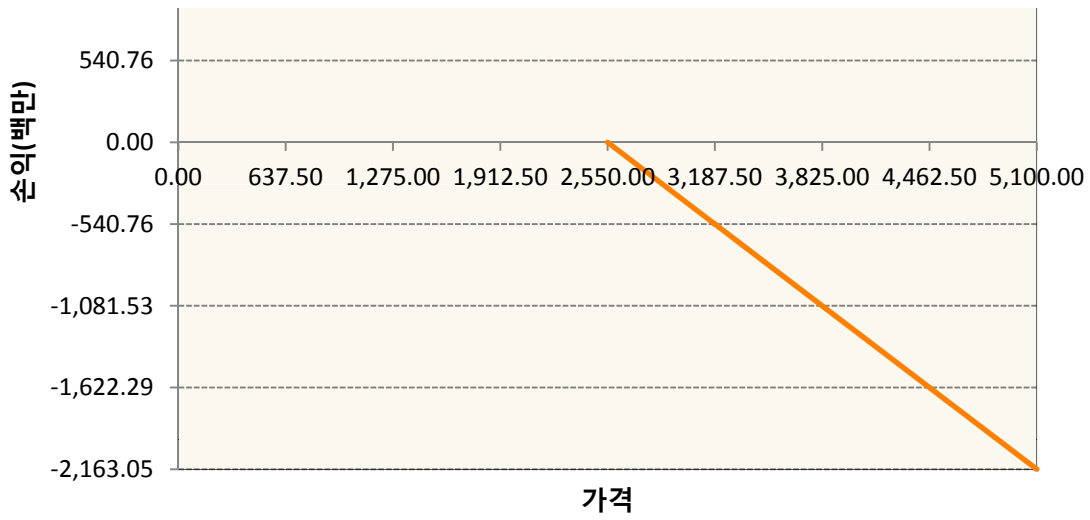
2. 만기시점의 손익구조

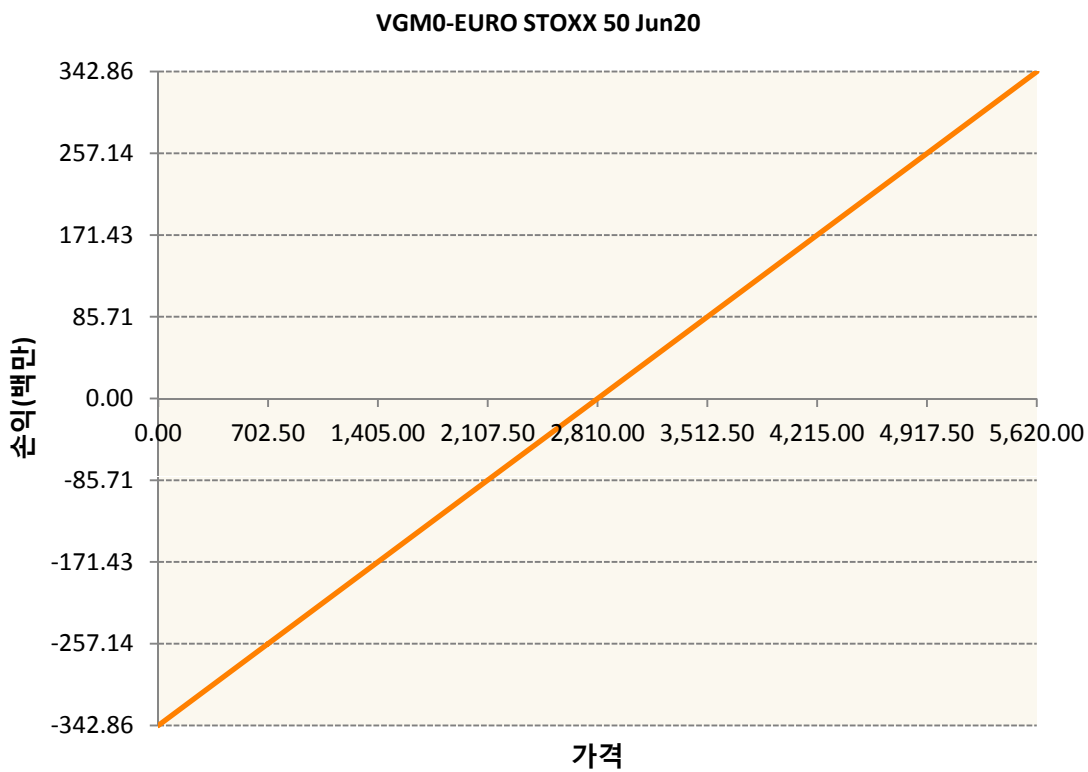
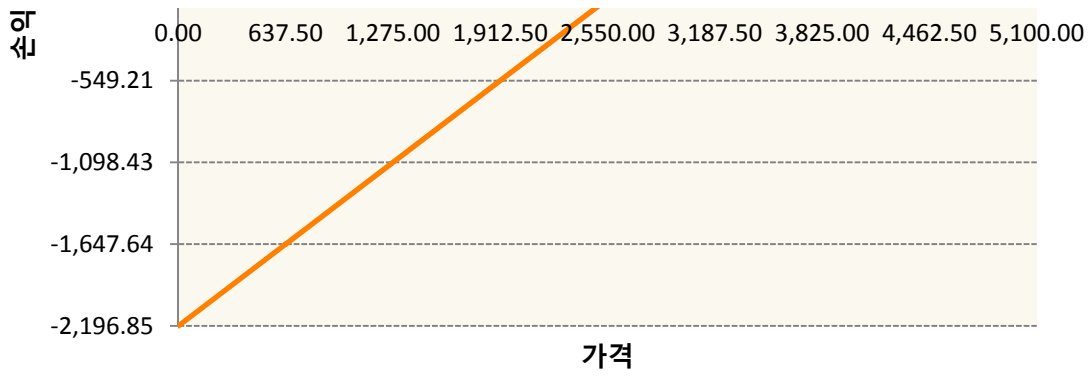
OESXJ0-C2525-EURO STOXX 50



OESXJ0-C2550-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		28
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)

1,074

공시일	2020-04-10
기준일	2020-04-09

ETF스마트레버리지목표전환형9호

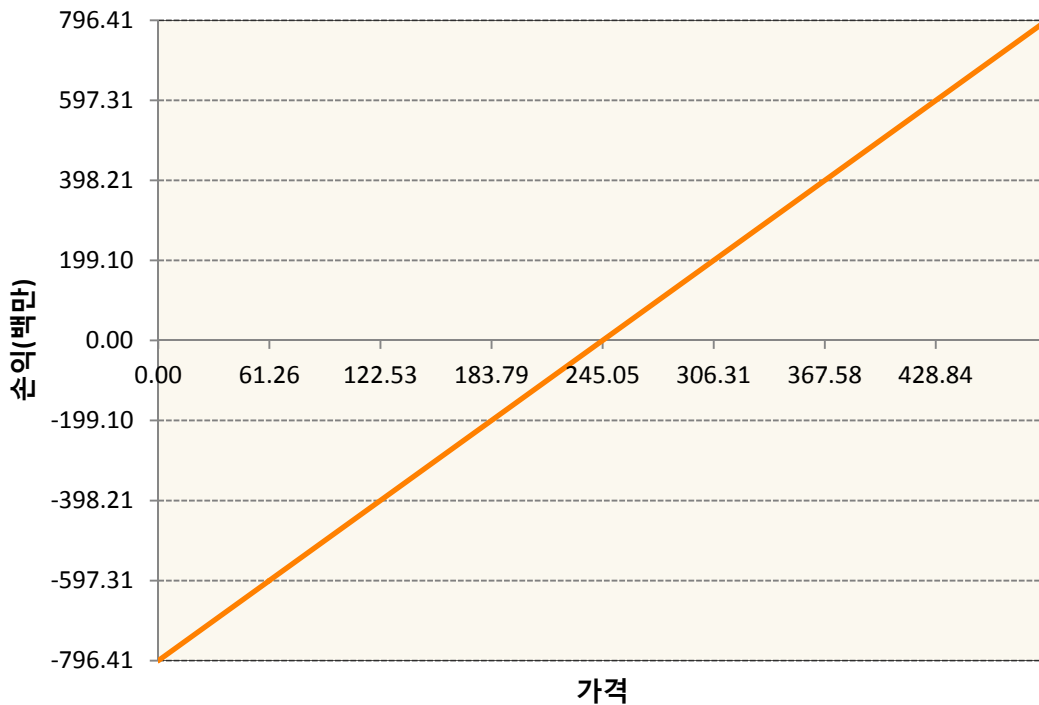
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	796	0	796	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						64
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64	
-5.33%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43	
-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%	43	43	43	43	43	43	43	
8.00%	64	64	64	64	64	64	64	

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

(단위:백만원)

93

공시일	2020-04-10
기준일	2020-04-09

ETF스마트레버리지목표전환형10호

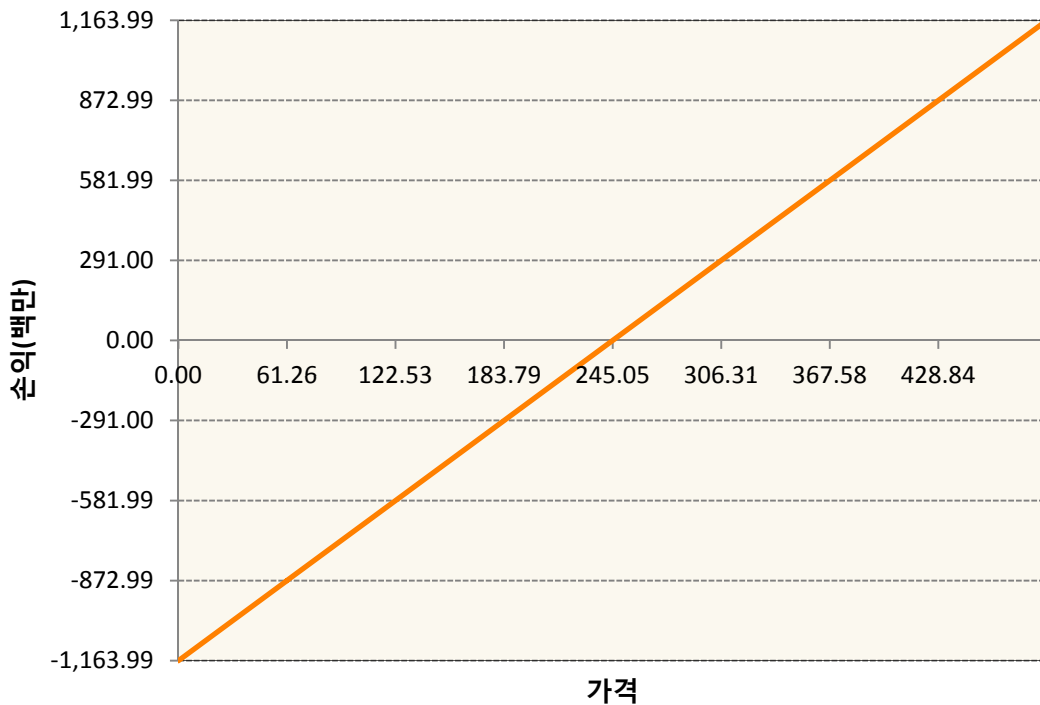
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,164	0	1,164	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						93
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93	
-5.33%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62	
-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%	62	62	62	62	62	62	62	
8.00%	93	93	93	93	93	93	93	

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

(단위:백만원)

136

공시일	2020-04-10
기준일	2020-04-09

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

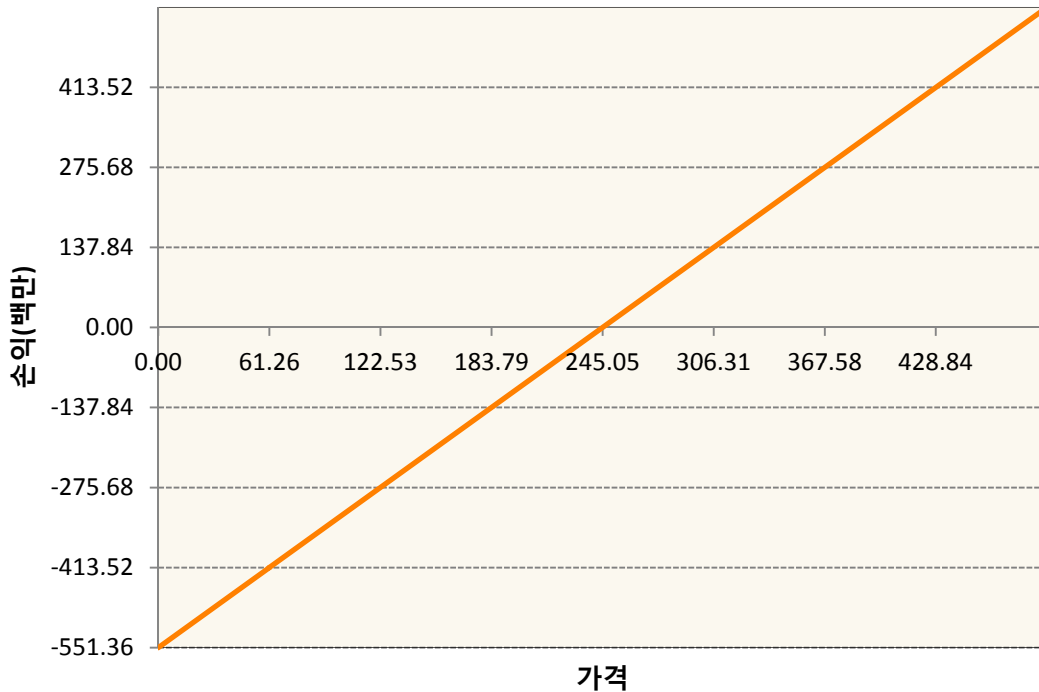
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	551	0	551	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)

64

공시일	2020-04-10
기준일	2020-04-09

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

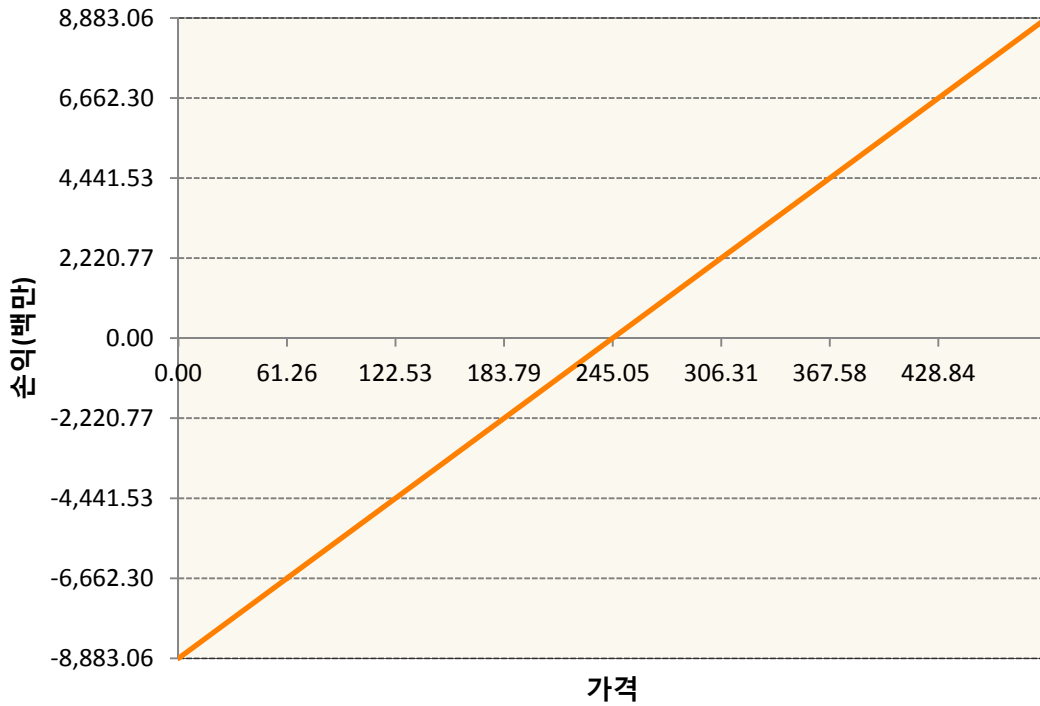
1. 계약금액

(단위:백만원)

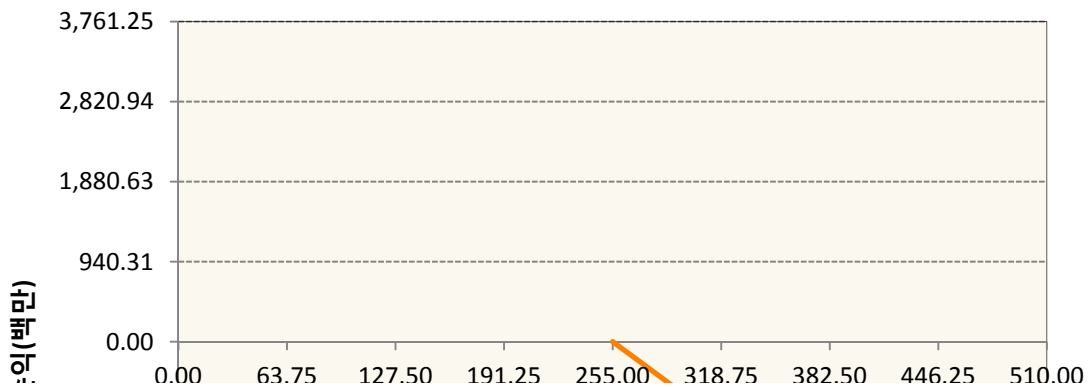
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	6,798	17,752	-10,955	장내
누계	유가증권	선물	8,883	0	8,883	장내
누계	유가증권	옵션	7,097	17,473	-10,376	장내

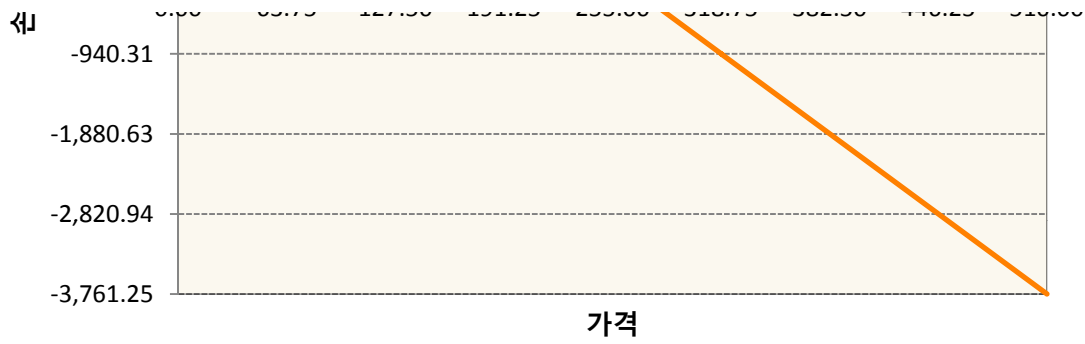
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

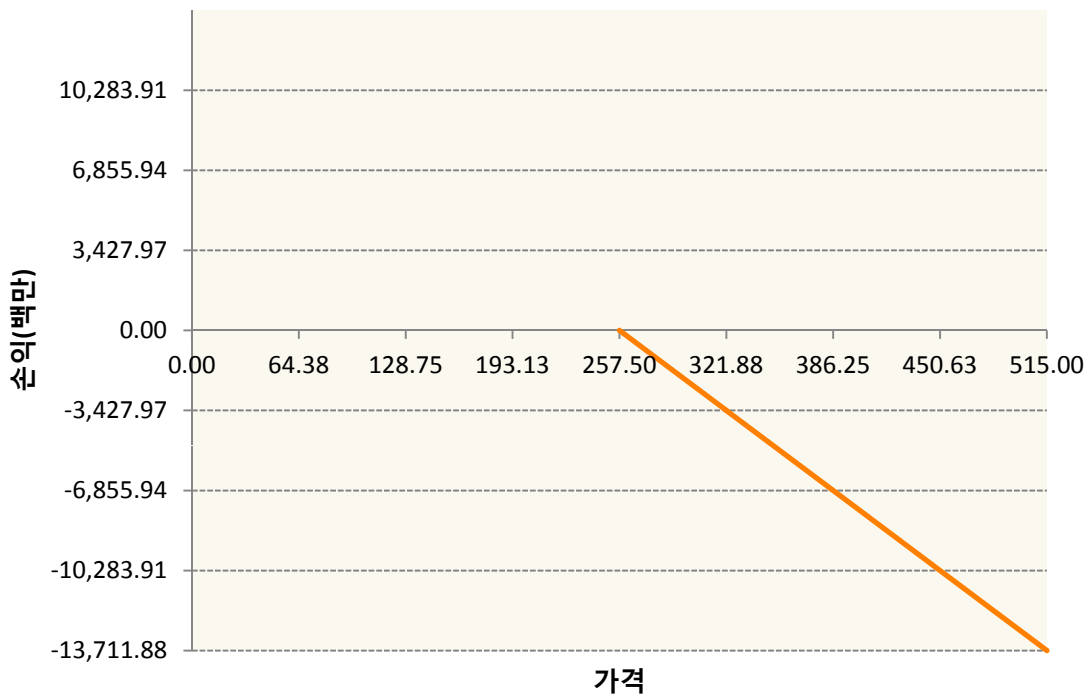


KR4201Q52551-2020-05 콜255

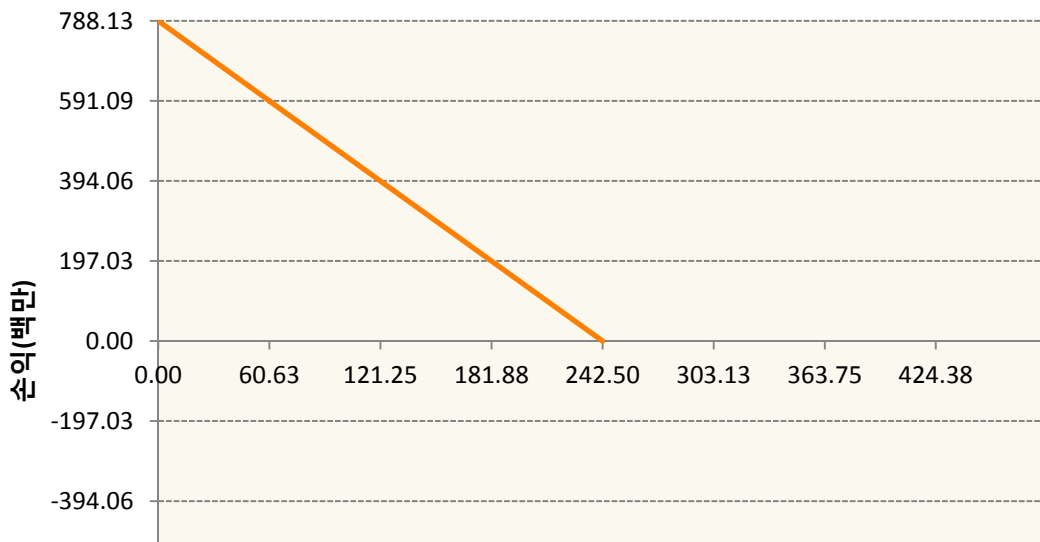


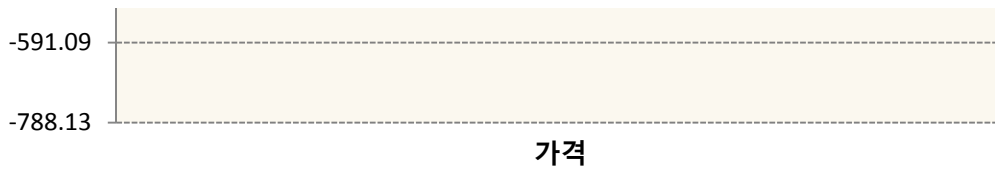


KR4201Q52577-2020-05 콜257.5

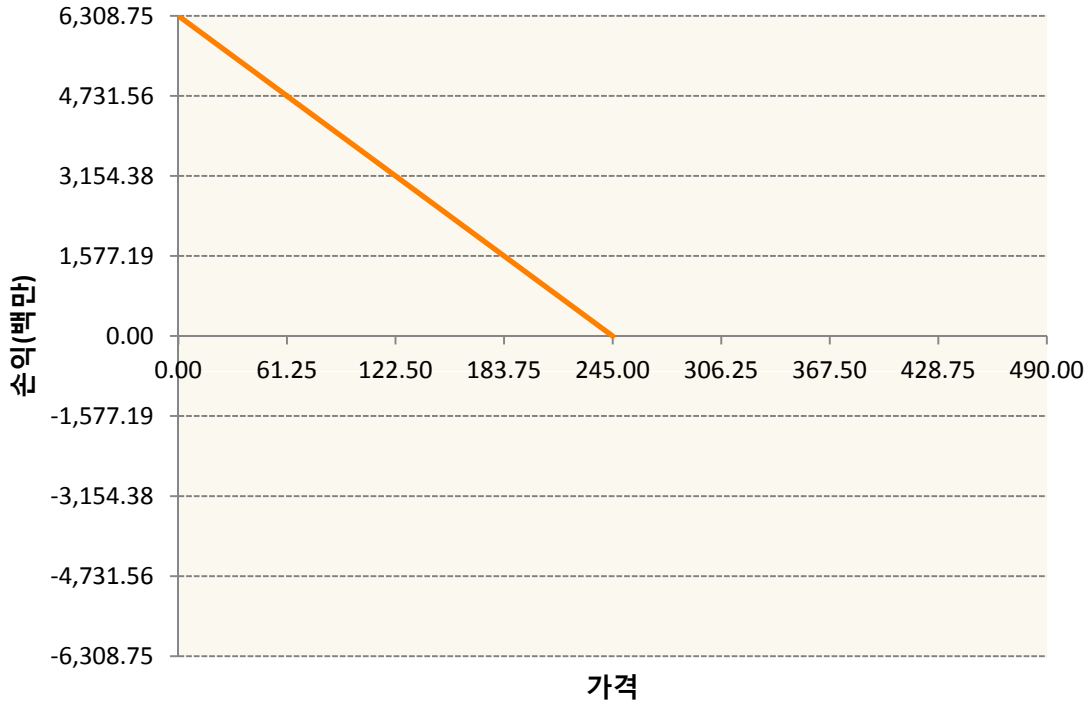


KR4301Q52427-2020-05 풋242.5





KR4301Q52450-2020-05 풋245



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						712
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-712	-712	-712	-712	-712	-712	-712	
-5.33%	-475	-475	-475	-475	-475	-475	-475	
-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%	475	475	475	475	475	475	475	
8.00%	712	712	712	712	712	712	712	
KR4201Q52551		2020-05 콜255						213
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	136	124	111	98	84	69	53	
-5.33%	116	102	87	71	55	39	22	
-2.67%	90	73	56	39	21	3	-15	

0%	56	38	19	0	-19	-38	-57
2.67%	14	-6	-25	-45	-65	-84	-104
5.33%	-37	-57	-76	-96	-116	-136	-156
8.00%	-95	-115	-134	-154	-173	-193	-213
KR4201Q52577 2020-05 콜257.5							747
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	459	420	377	330	281	229	176
-5.33%	397	348	296	241	185	127	67
-2.67%	312	253	193	132	69	5	-59
0%	199	134	67	0	-68	-136	-204
2.67%	58	-13	-83	-154	-225	-296	-367
5.33%	-113	-186	-258	-331	-403	-476	-548
8.00%	-314	-385	-457	-530	-602	-674	-747
KR4301Q52427 2020-05 풋242.5							45
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	28	31	33	36	39	42	45
-5.33%	13	16	19	22	25	28	32
-2.67%	0	4	7	10	13	17	20
0%	-10	-7	-3	0	3	7	10
2.67%	-18	-15	-12	-8	-5	-2	1
5.33%	-24	-21	-18	-15	-12	-9	-6
8.00%	-28	-26	-23	-21	-18	-15	-12
KR4301Q52450 2020-05 풋245							366
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	244	262	281	302	323	344	366
-5.33%	118	141	164	187	211	235	259
-2.67%	10	35	61	86	112	138	164
0%	-80	-53	-27	0	27	53	80
2.67%	-151	-125	-99	-72	-46	-20	7
5.33%	-205	-181	-157	-132	-107	-81	-55
8.00%	-244	-223	-202	-179	-156	-132	-108

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

(단위:백만원)

1,993

공시일	2020-04-10
기준일	2020-04-09

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	147,071	0	147,071	

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	2020-04-10
기준일	2020-04-09

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	99,171	0	99,171	

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	2020-04-10
기준일	2020-04-09

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	438,179	0	438,179	
누계	통화	선도	71,341	494,995	-423,654	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,356
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,951
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,902
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,283
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,951
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,439
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,029
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,029
FX21020H04 USD/KRW 21-04-20E	1,463
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,380
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	976
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	976
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,537
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	839
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	732
FX21020H09 USD/KRW 24-04-20E	732
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	488
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,415
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,927
FX21020H11 KRW/USD 11-05-20E	976
FX21020J00 KRW/USD 10-06-20E	2,927

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

22,471

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

(단위:백만원)

185

공시일	2020-04-10
기준일	2020-04-09

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

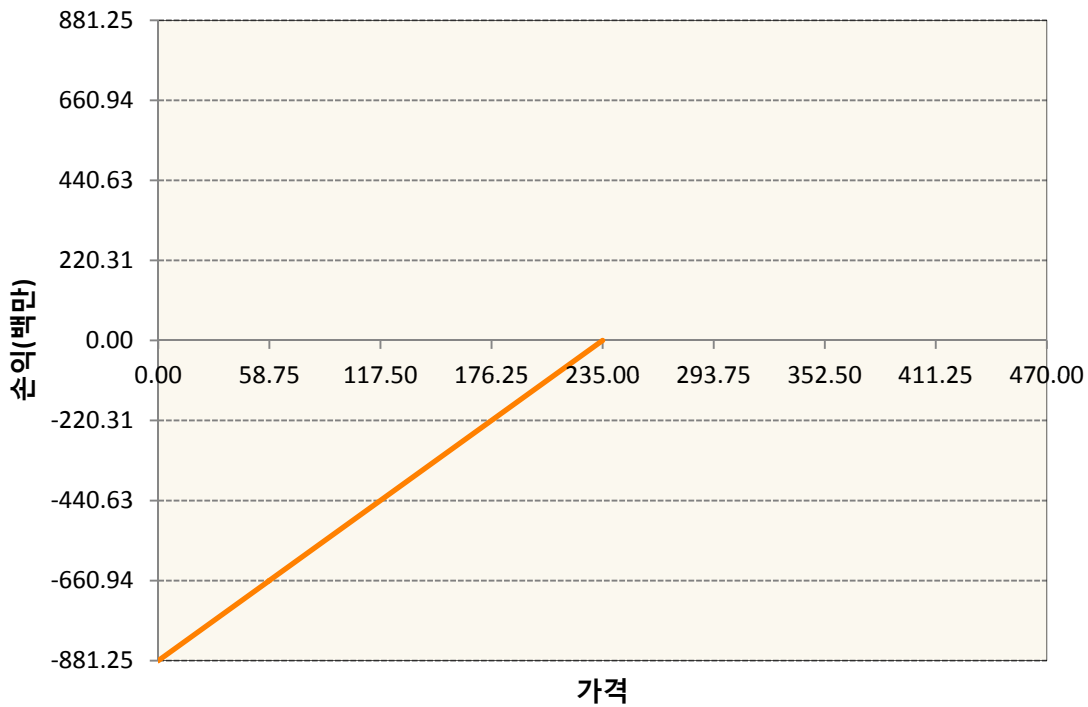
1. 계약금액

(단위:백만원)

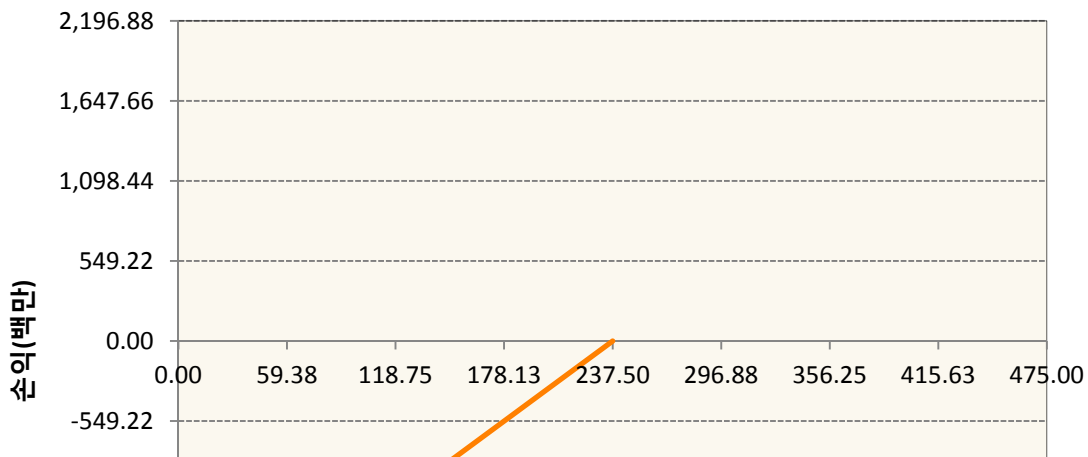
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	3,174	-3,174	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,078	-3,078	장내

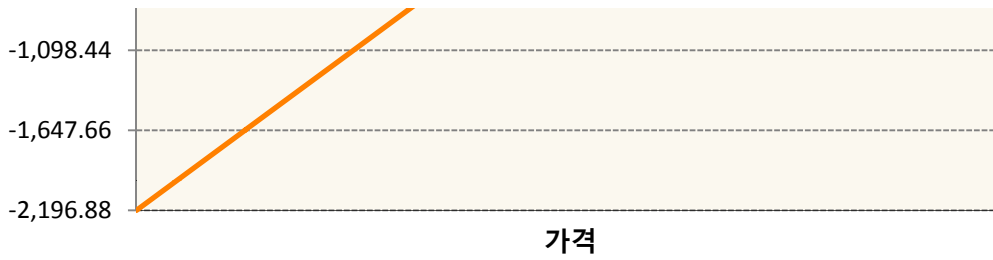
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q52351-2020-05 풋235



KR4301Q52377-2020-05 풋237.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q52351		2020-05 풋235						45
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-24	-28	-31	-35	-38	-42	-45	
-5.33%	-10	-14	-17	-21	-25	-28	-32	
-2.67%	2	-2	-6	-9	-13	-17	-21	
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11	
2.67%	17	14	11	8	4	1	-3	
5.33%	21	19	16	13	10	7	4	
8.00%	24	23	20	18	15	12	10	
KR4301Q52377		2020-05 풋237.5						117
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-67	-75	-83	-91	-100	-108	-117	
-5.33%	-29	-38	-47	-56	-65	-74	-83	
-2.67%	3	-7	-16	-25	-34	-44	-53	
0%	27	18	9	0	-9	-18	-27	
2.67%	45	37	29	20	12	3	-6	
5.33%	58	51	44	37	29	21	12	
8.00%	67	61	55	49	42	35	27	

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

124

공시일	2020-04-10
기준일	2020-04-09

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	7,223	0	7,223	
누계	통화	선도	439	11,561	-11,122	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H02 KRW/USD 13-04-20E	354
FX21020H10 USD/KRW 13-04-20E	35
FX21020H11 KRW/USD 29-04-20E	225
FX21020J004 KRW/USD 29-04-20E	26
FX21020J015 KRW/USD 13-05-20E	319
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

476

공시일	2020-04-10
기준일	2020-04-09

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

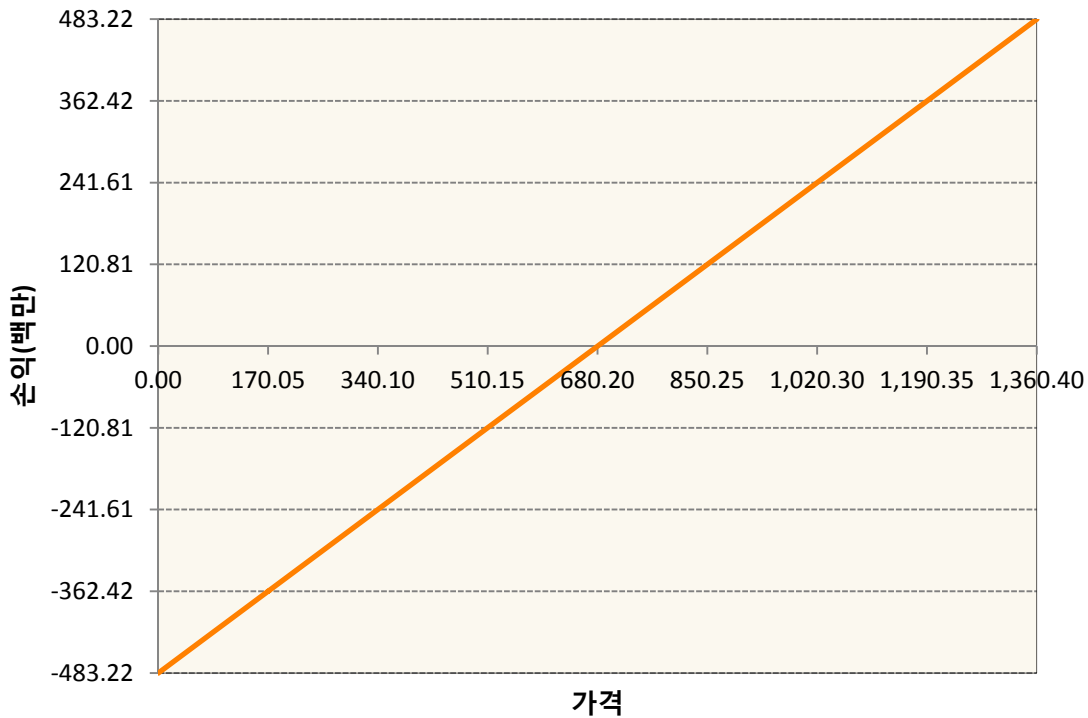
1. 계약금액

(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	483	0	483	
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
39

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

(단위:백만원)

140

공시일	2020-04-10
기준일	2020-04-09

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

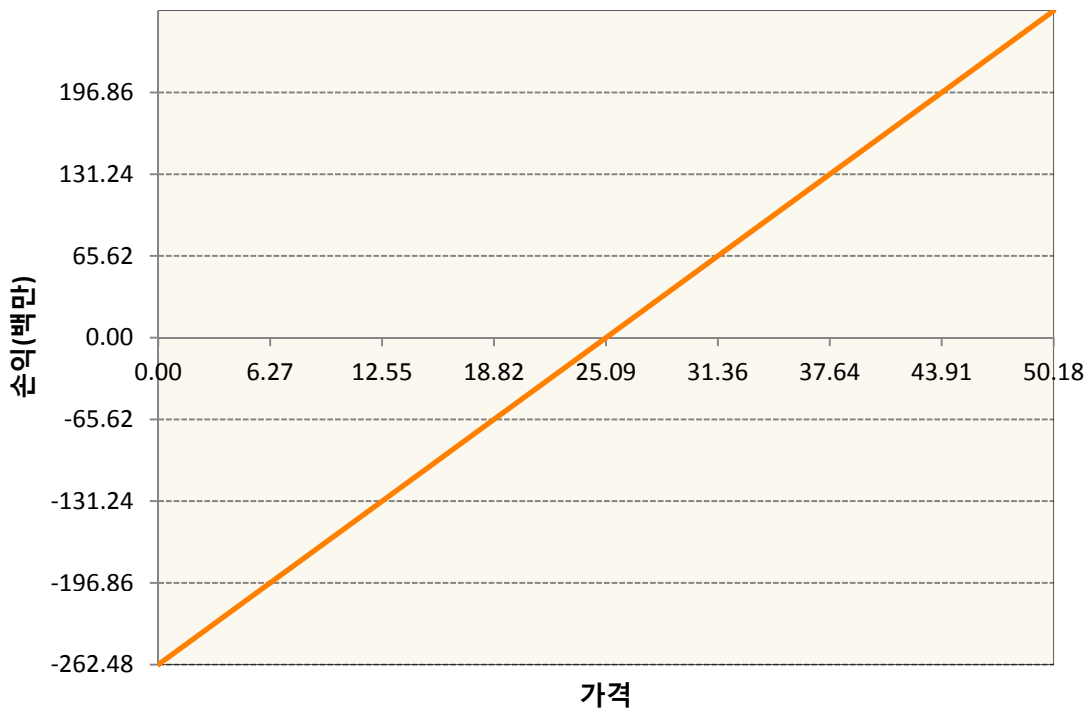
1. 계약금액

(단위:백만원)

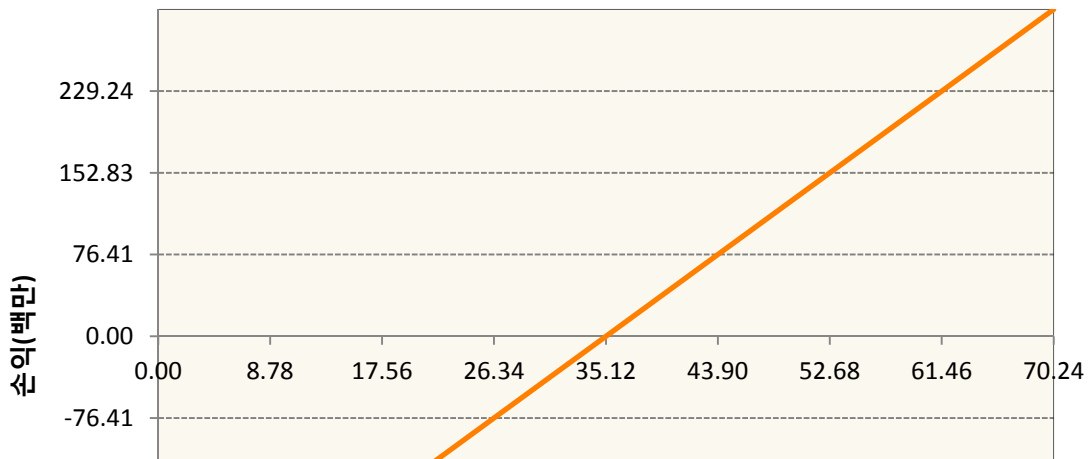
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,425	244	1,181	

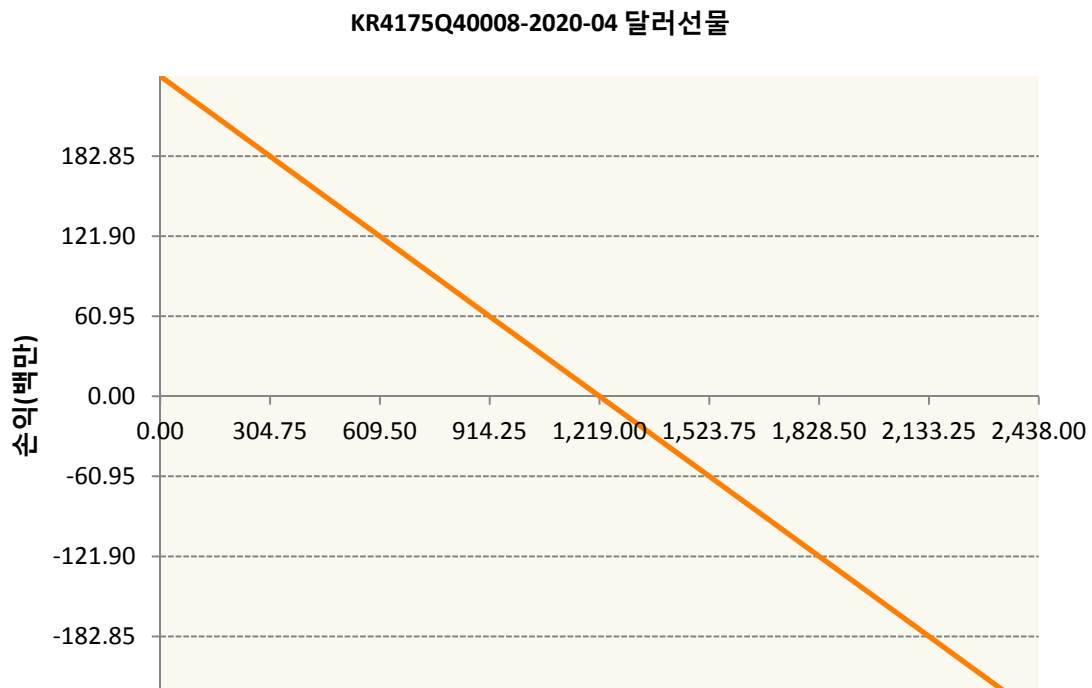
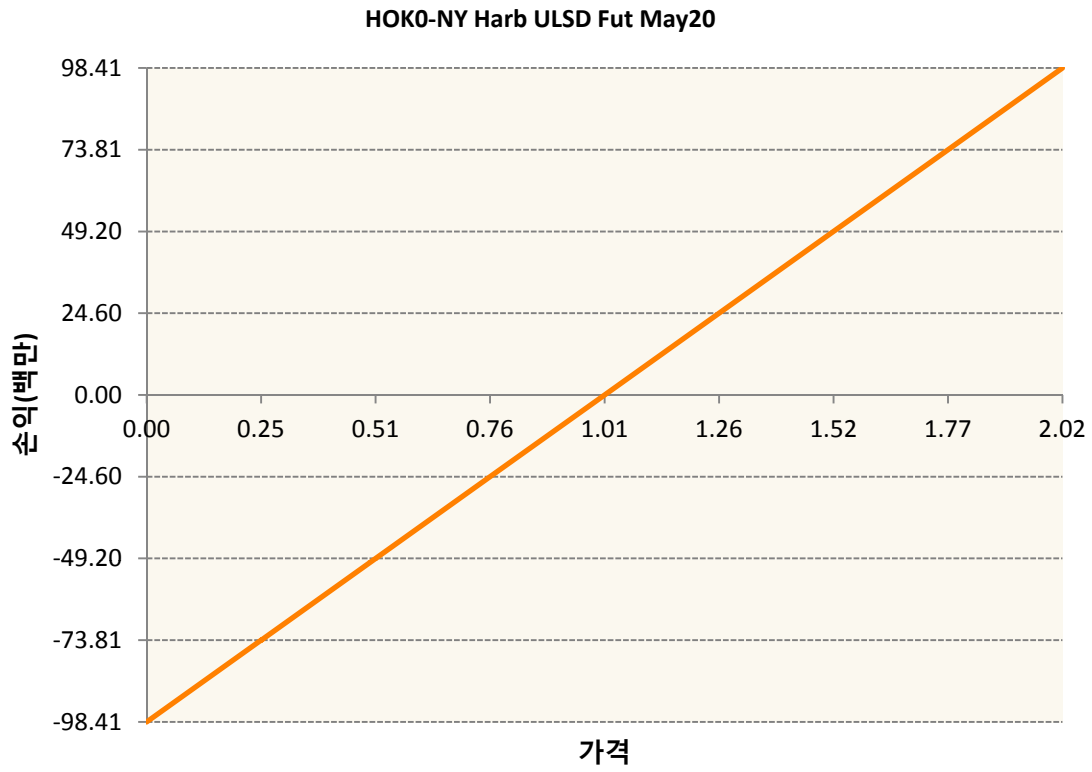
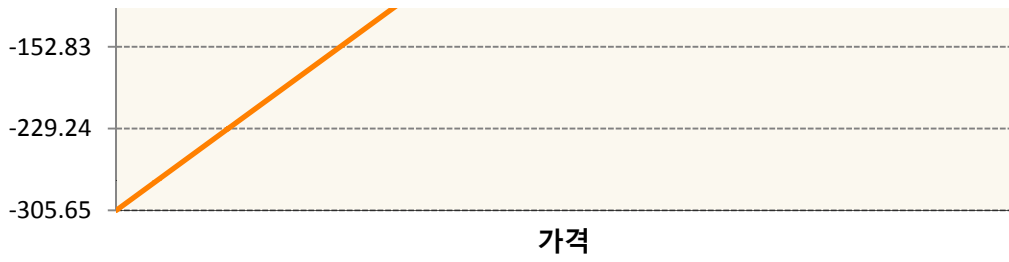
2. 만기시점의 손익구조

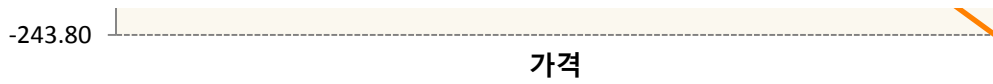
CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20



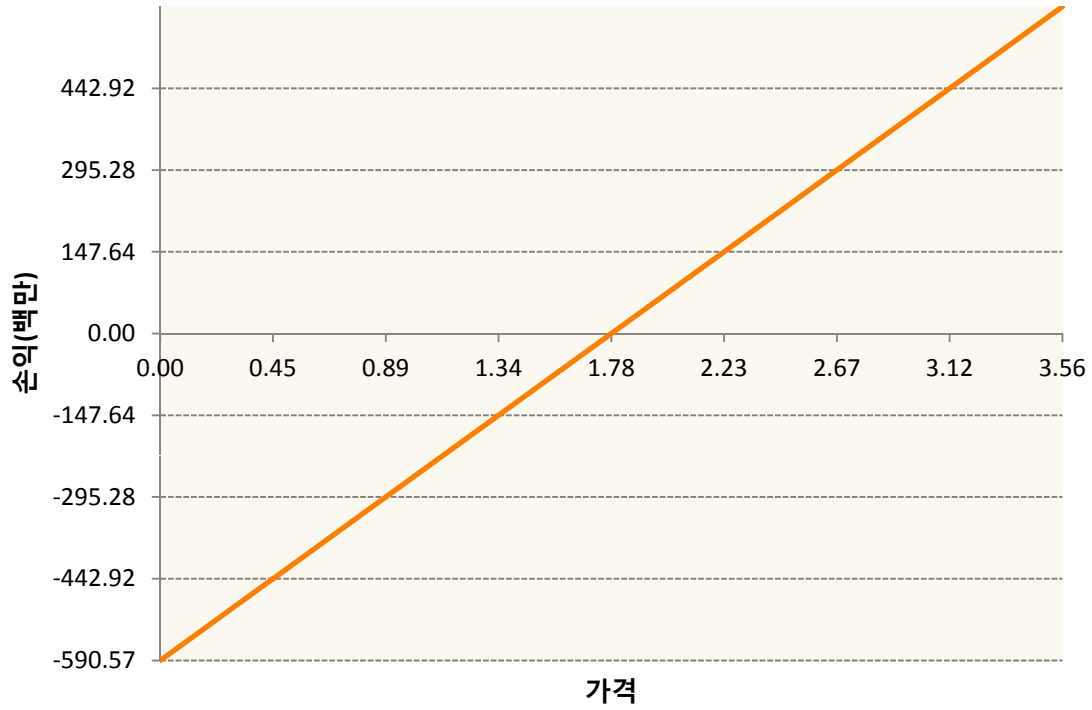
CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20



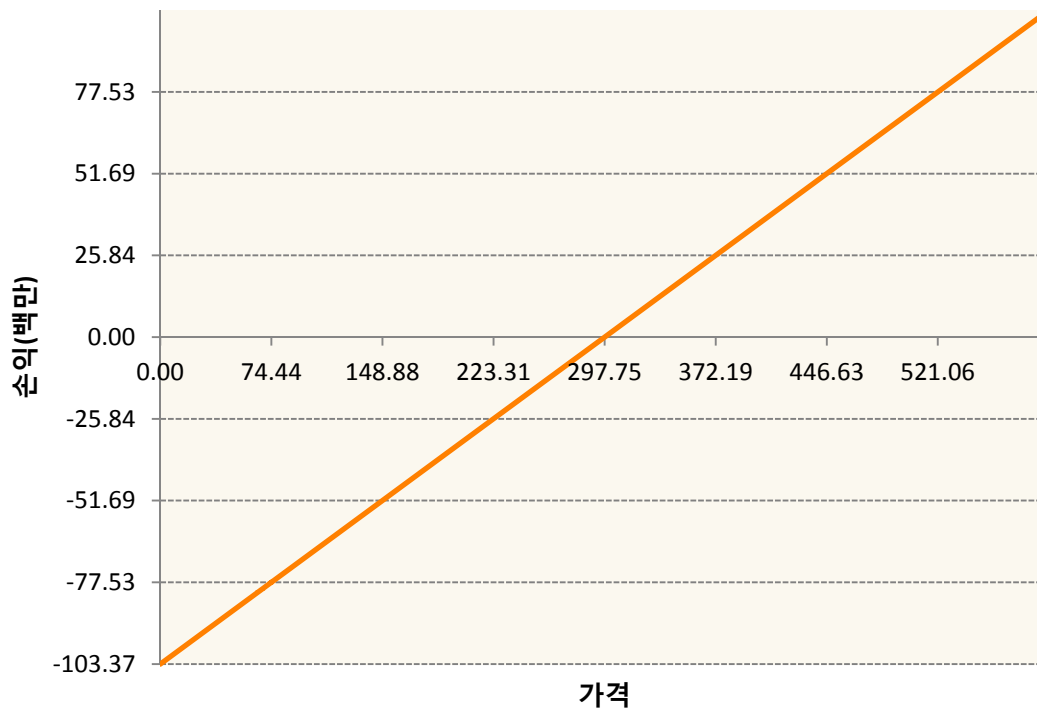




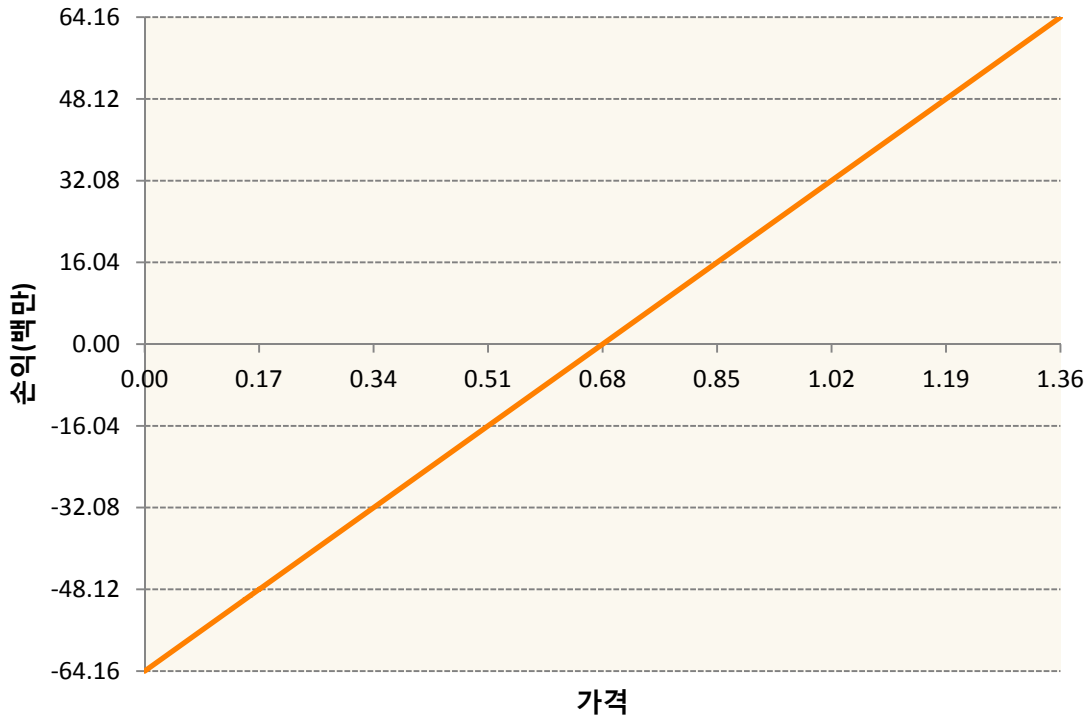
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



QSK0-Low Su Gasoil G Mar20



XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	21
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	24
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	8
KR4175Q40C	2020-04 달러선물	20
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	47
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	8
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	5

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

(단위:백만원)

347

공시일	2020-04-10
기준일	2020-04-09

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

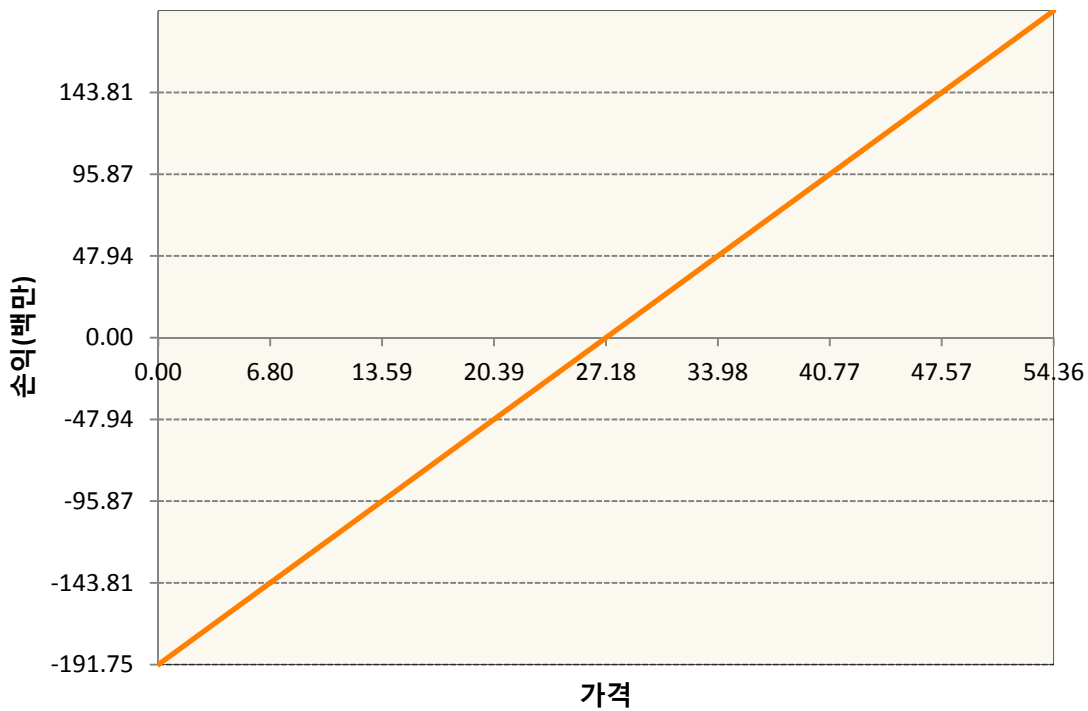
1. 계약금액

(단위:백만원)

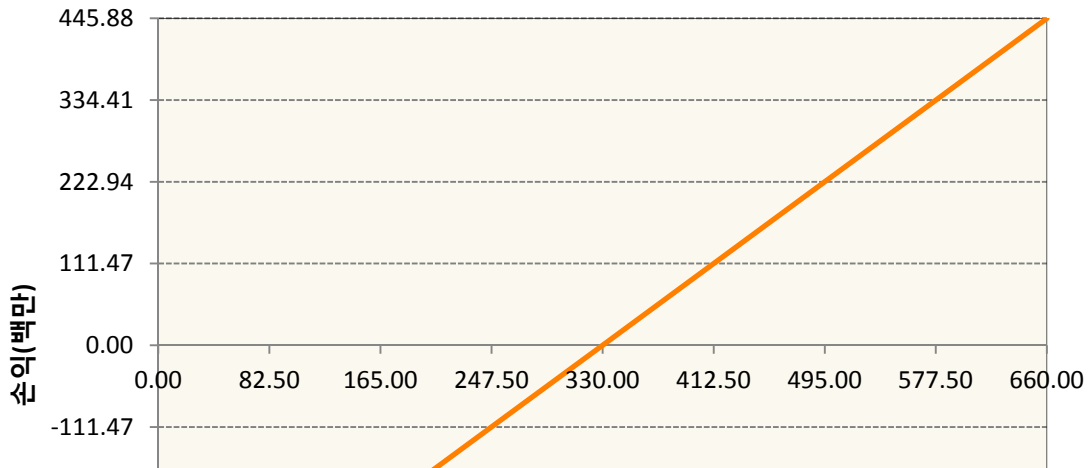
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,279	98	2,182	

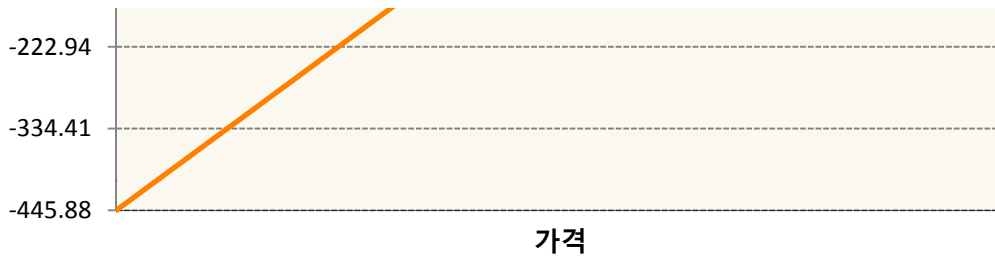
2. 만기시점의 손익구조

BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20

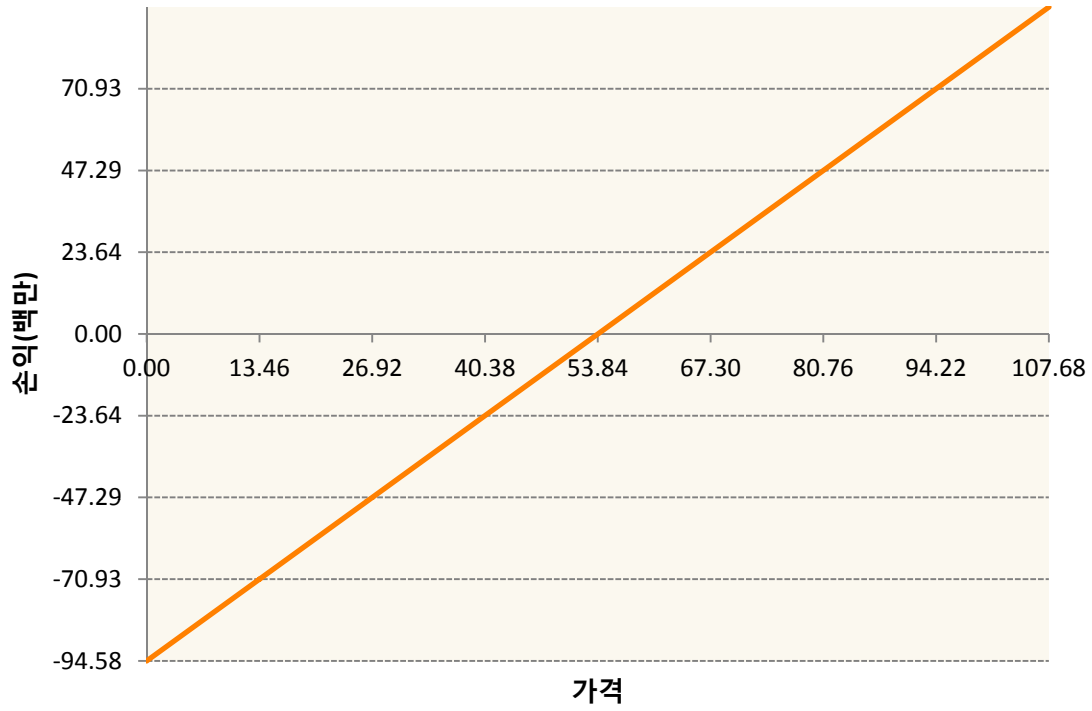


CK0-CORN FUTURE May20

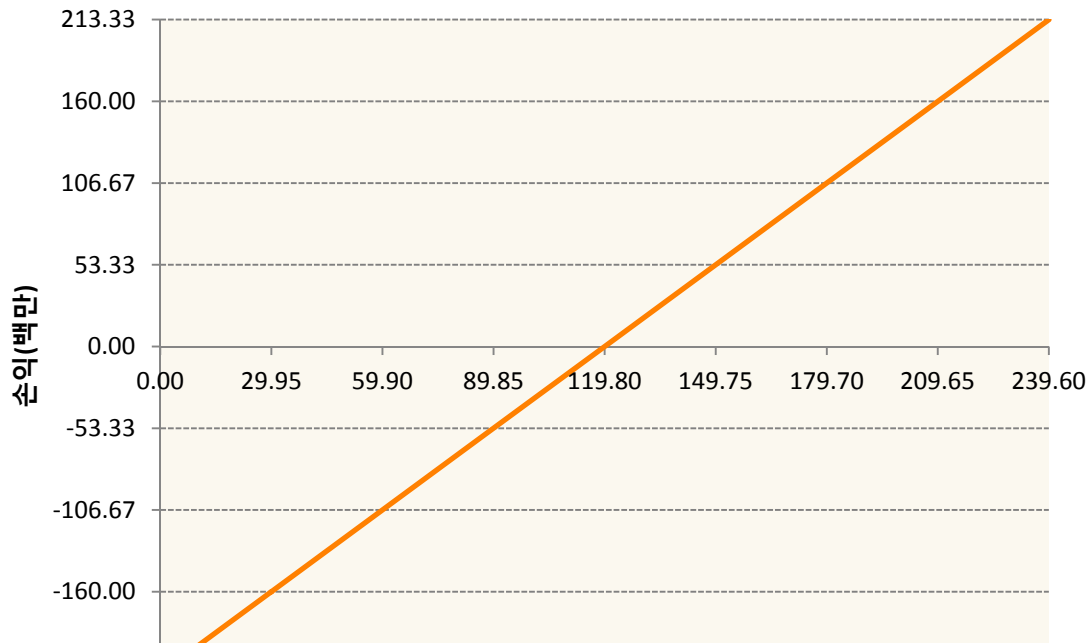


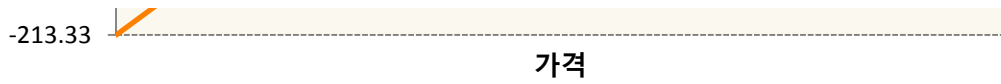


CTK0-COTTON NO.2 FUTR May20

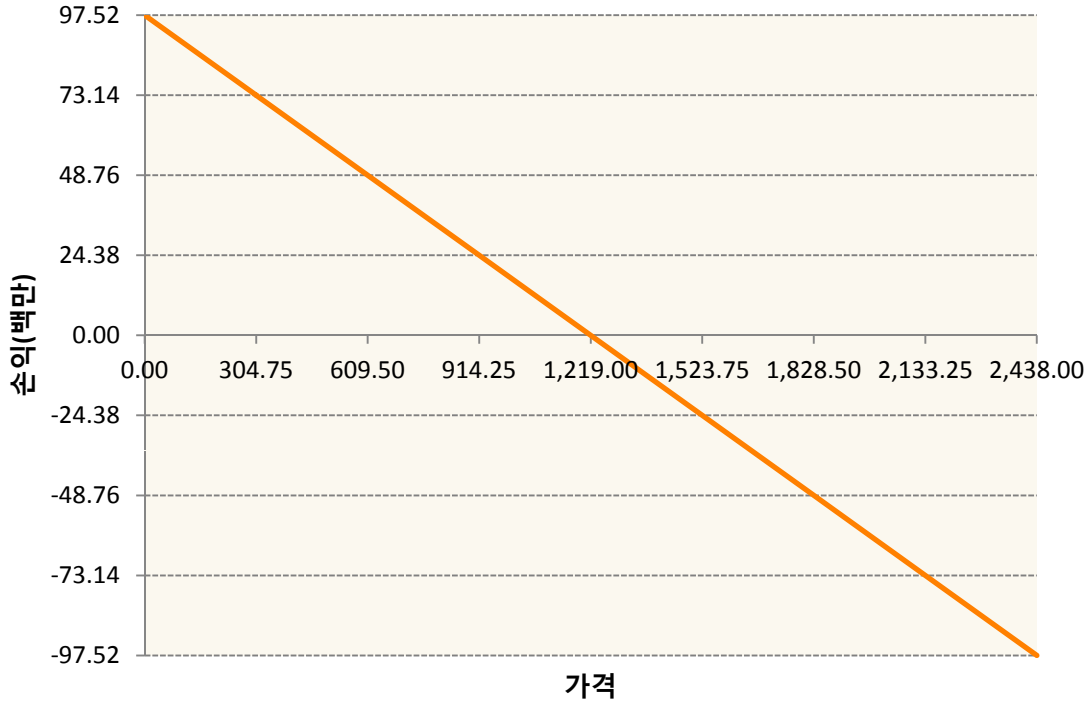


KCK0-COFFEE 'C' FUTURE May20

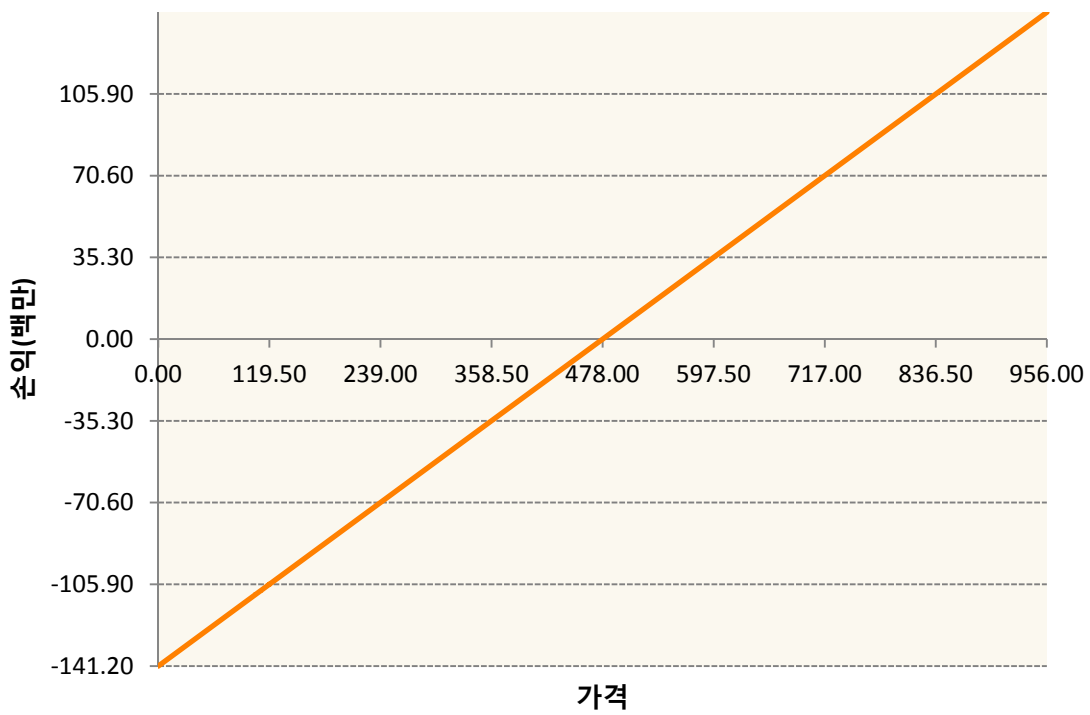




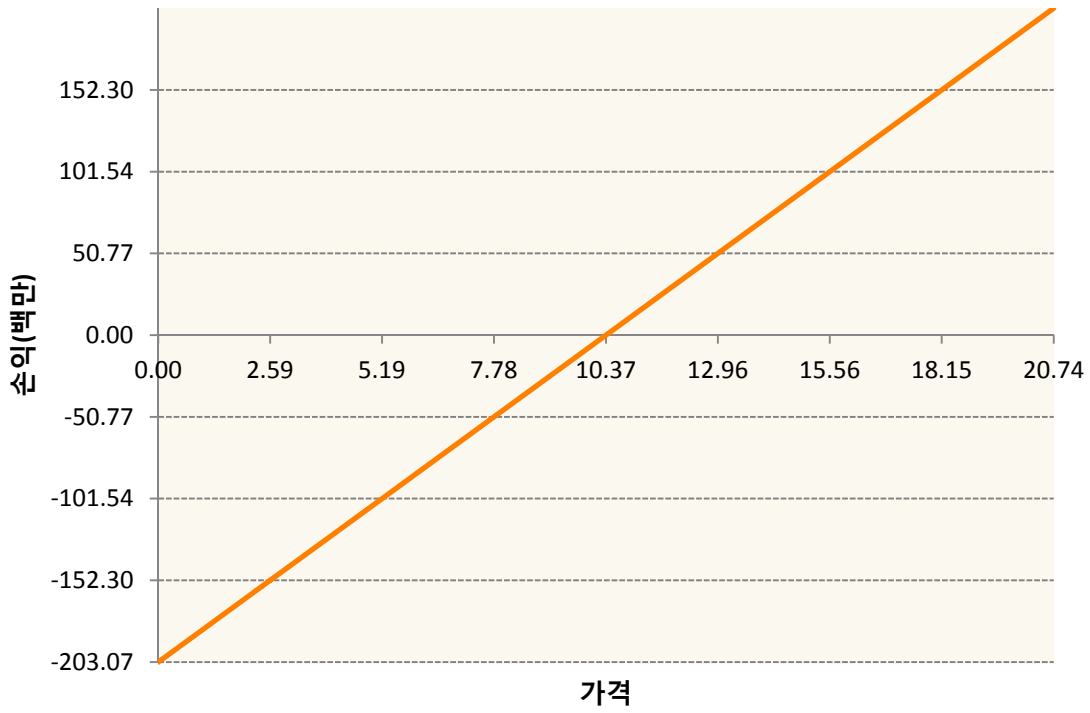
KR4175Q40008-2020-04 달러선물



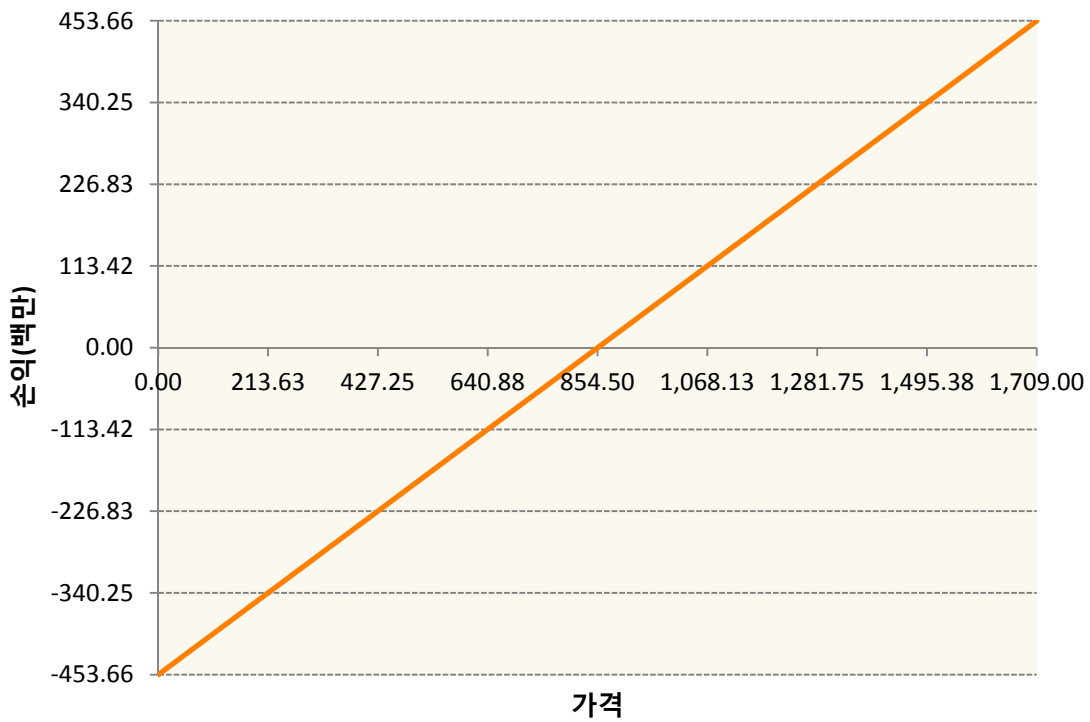
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



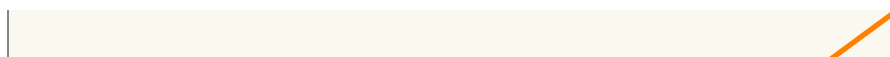
SBK0-Sugar May20

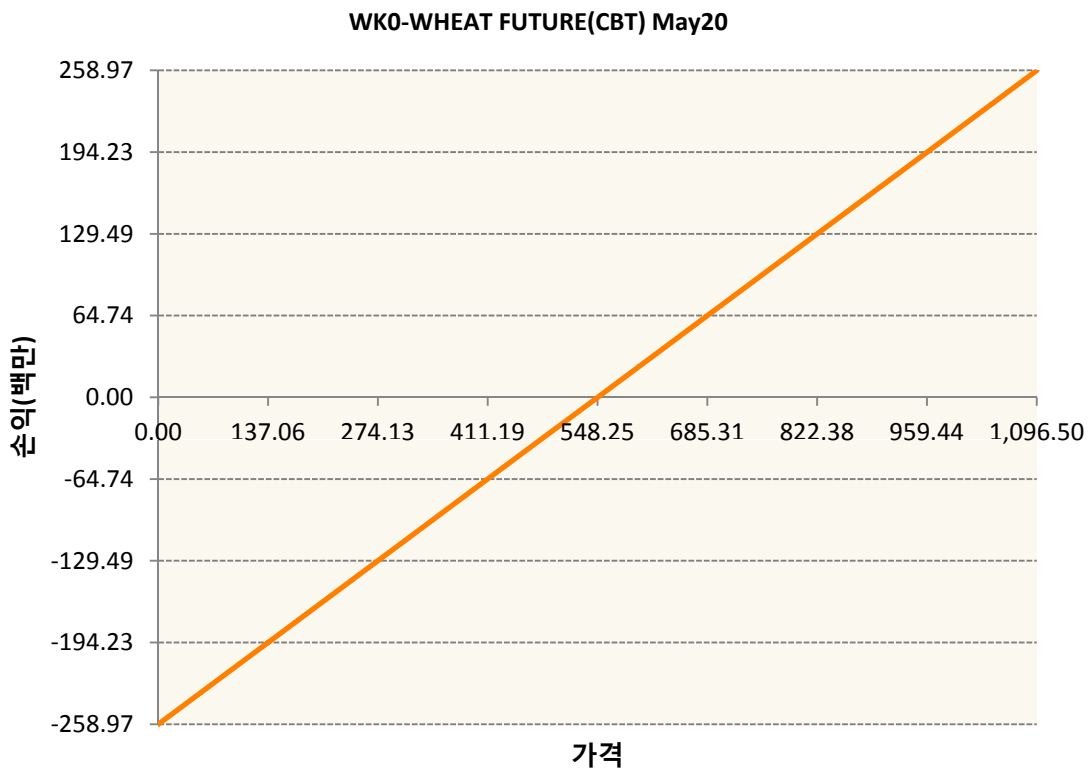
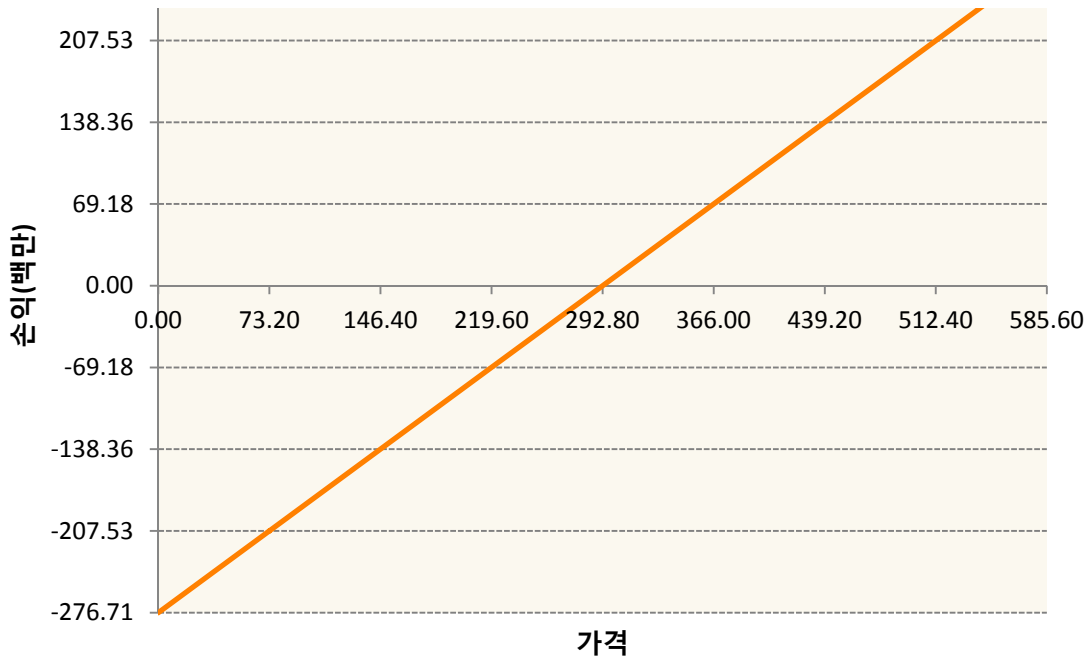


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	15
CK0	CORN FUTURE May20	36
CTK0	COTTON NO.2 FUTR May20	8
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)

212