

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-04-13 |
| 기준일 | 2020-04-10 |

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 | 2020-04-13 |
| 기준일 | 2020-04-10 |

스마트인덱스모

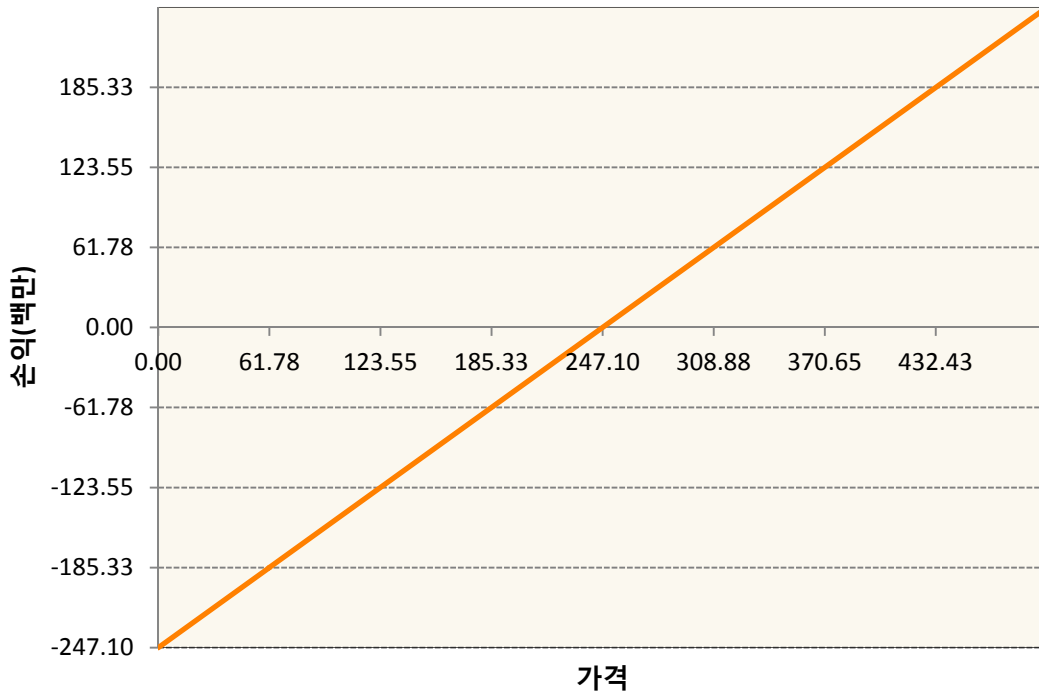
1. 계약금액

(단위:백만원)

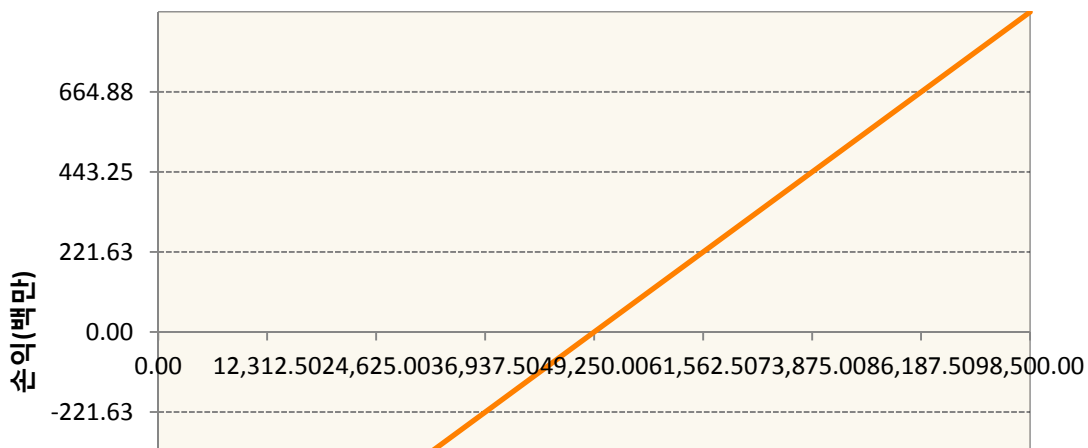
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 61 | -61 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,134 | 0 | 1,134 | 장내 |

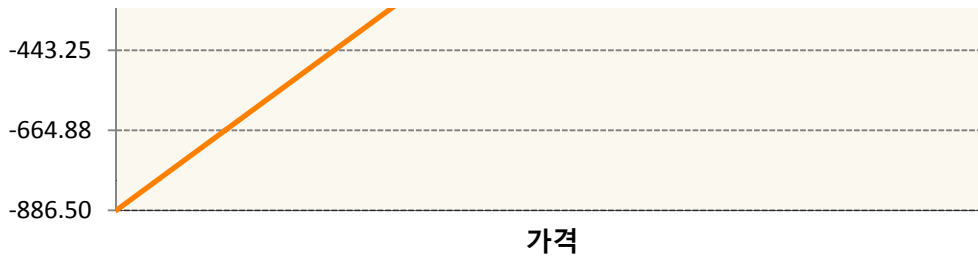
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



KR4111Q50002-2020-05 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101Q60002 | | 2020-06 코스피200지수선물 | | | | | | 20 |
|--------------|---------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|----|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -20 | -20 | -20 | -20 | -20 | -20 | -20 | |
| -5.33% | -13 | -13 | -13 | -13 | -13 | -13 | -13 | |
| -2.67% | -7 | -7 | -7 | -7 | -7 | -7 | -7 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 7 | 7 | 7 | 7 | 7 | 7 | 7 | |
| 5.33% | 13 | 13 | 13 | 13 | 13 | 13 | 13 | |
| 8.00% | 20 | 20 | 20 | 20 | 20 | 20 | 20 | |
| 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)

133

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-04-13 |
| 기준일 | 2020-04-10 |

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

951

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,097

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-04-13 |
| 기준일 | 2020-04-10 |

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

543

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

860

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-04-13 |
| 기준일 | 2020-04-10 |

유로인덱스모(주식-파생형)

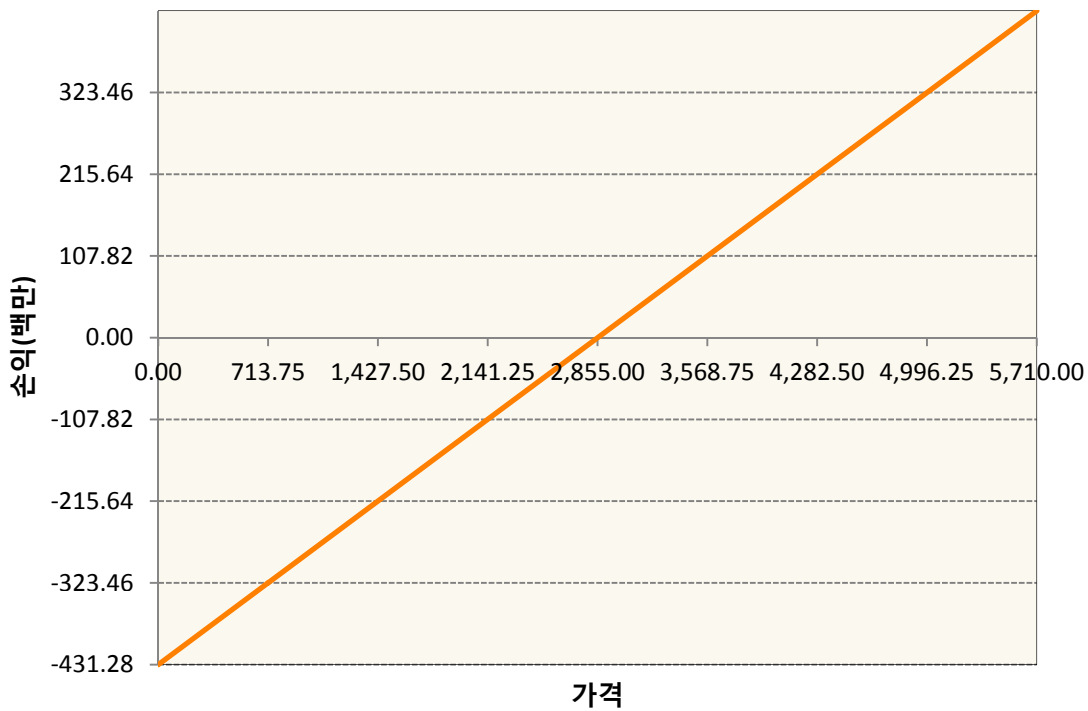
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 431 | 0 | 431 | |

2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------|---------------------|----|
| VGM0 | EURO STOXX 50 Jun20 | 35 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

| |
|----|
| 42 |
|----|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-04-13 |
| 기준일 | 2020-04-10 |

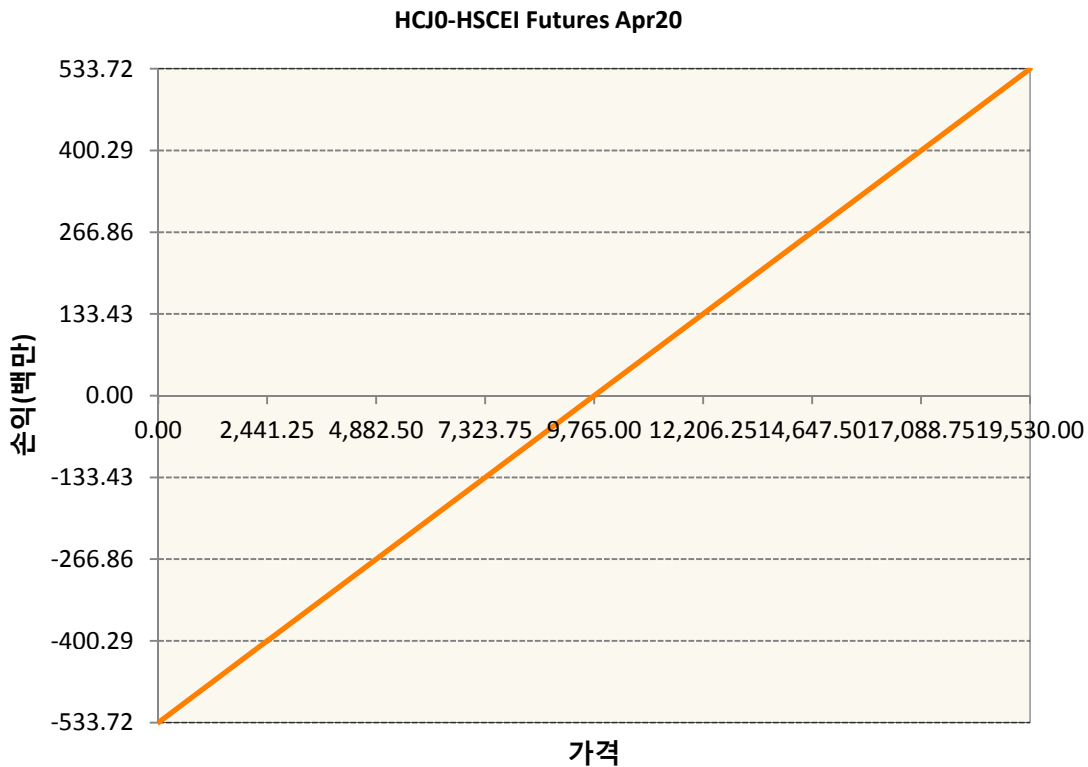
차이나인덱스모(주식-파생형)

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 | 2020-04-13 |
| 기준일 | 2020-04-10 |

커버드콜모(주식혼합-파생형)

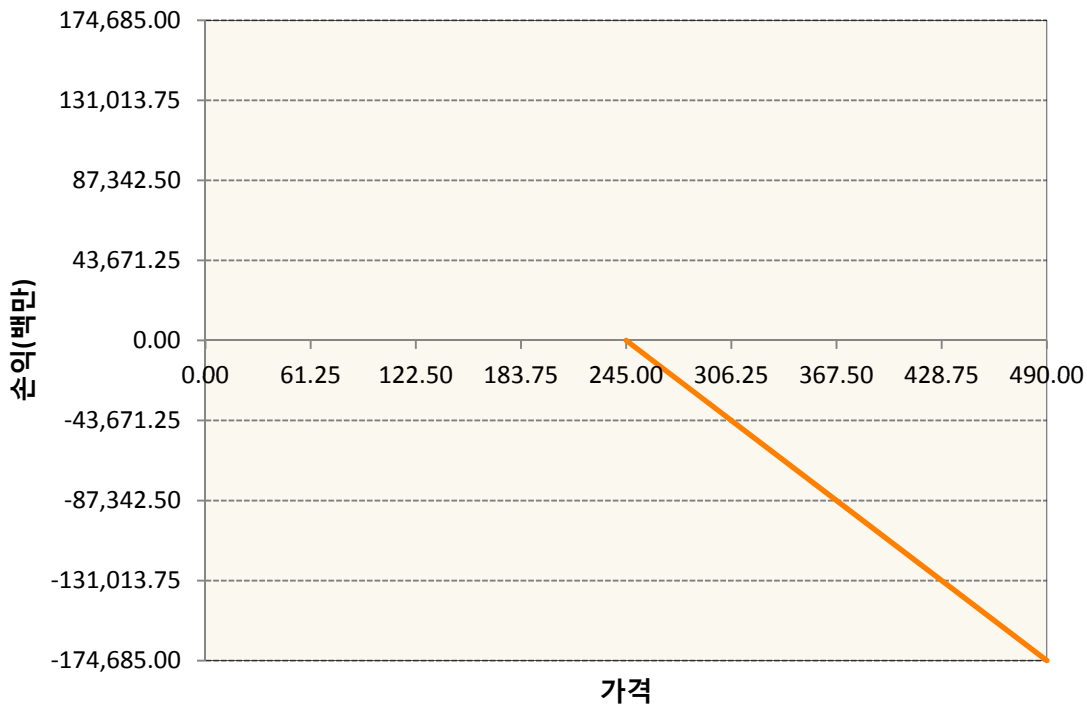
1. 계약금액

(단위:백만원)

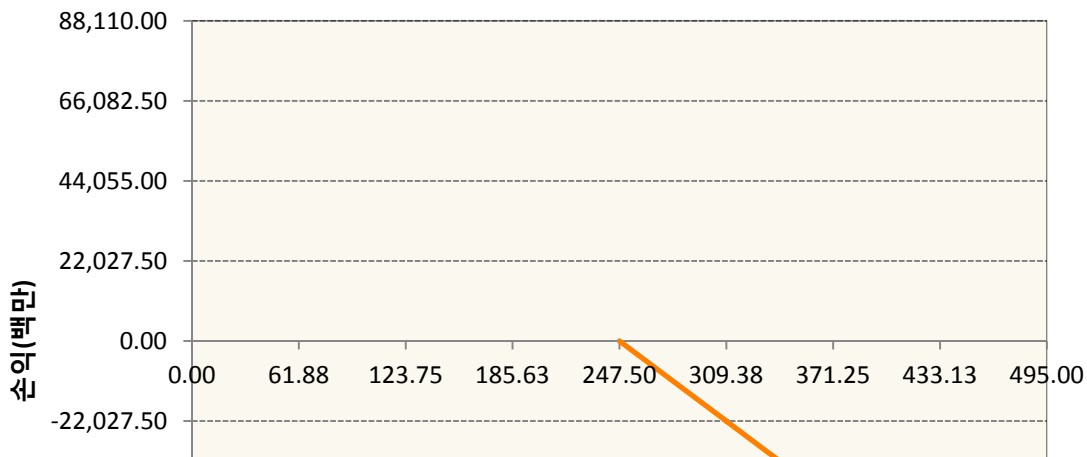
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 3,520 | 294,271 | -290,751 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 358,345 | -358,345 | 장내 |

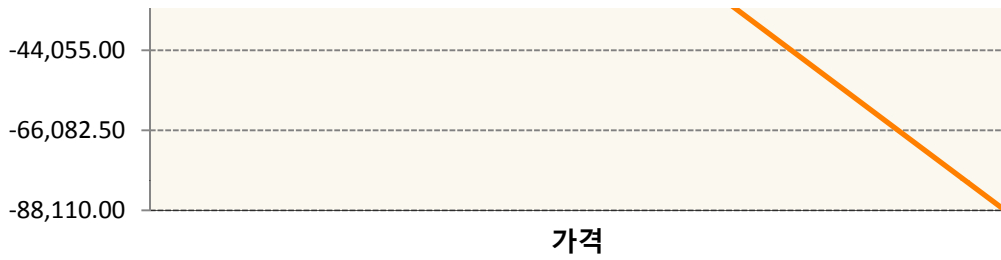
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q52452-2020-05 콜245

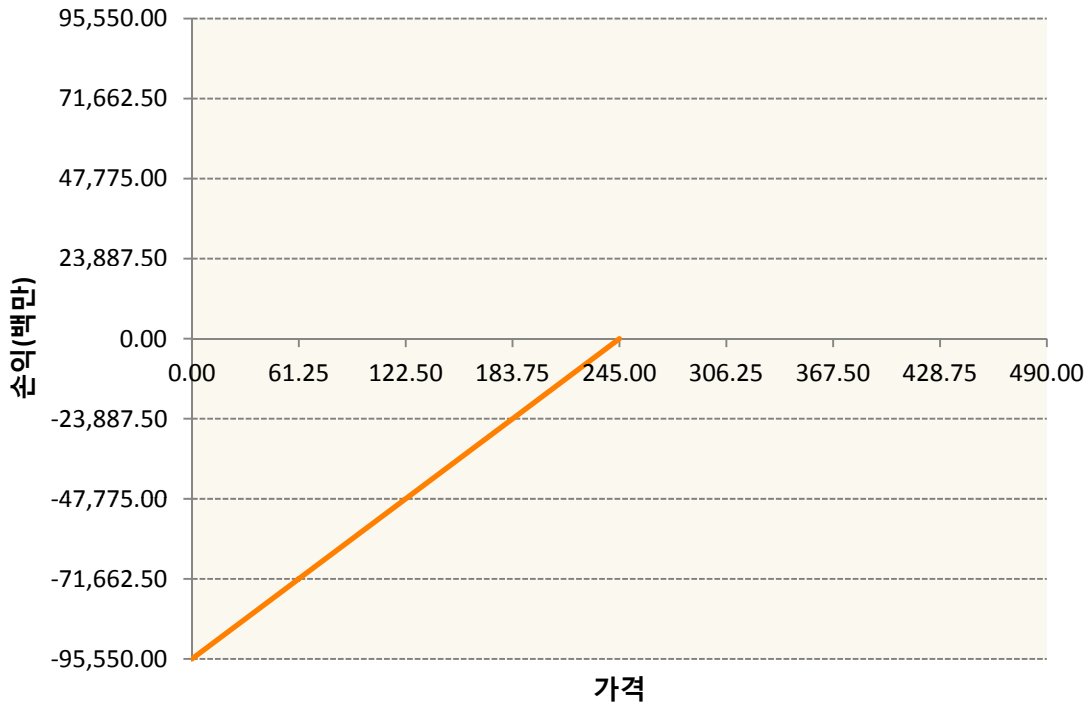


KR4201Q52478-2020-05 콜247.5





KR4301Q52450-2020-05 풋245



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4201Q52452 | | 2020-05 콜245 | | | | | 11,673 |
|--------------|---------|----------------|--------|--------|---------|---------|---------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 8,596 | 7,880 | 7,141 | 6,385 | 5,614 | 4,832 | 4,041 |
| -5.33% | 7,057 | 6,244 | 5,422 | 4,592 | 3,757 | 2,918 | 2,076 |
| -2.67% | 5,085 | 4,212 | 3,338 | 2,463 | 1,588 | 713 | -162 |
| 0% | 2,668 | 1,779 | 890 | 0 | -889 | -1,779 | -2,668 |
| 2.67% | -177 | -1,040 | -1,910 | -2,786 | -3,665 | -4,547 | -5,431 |
| 5.33% | -3,416 | -4,217 | -5,038 | -5,873 | -6,720 | -7,576 | -8,439 |
| 8.00% | -6,998 | -7,712 | -8,461 | -9,236 | -10,032 | -10,846 | -11,673 |
| KR4201Q52478 | | 2020-05 콜247.5 | | | | | 5,697 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 4,067 | 3,727 | 3,372 | 3,006 | 2,631 | 2,249 | 1,861 |

| | | | | | | | |
|--|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| -5.33% | 3,372 | 2,978 | 2,576 | 2,170 | 1,759 | 1,345 | 928 |
| -2.67% | 2,467 | 2,036 | 1,602 | 1,168 | 733 | 297 | -140 |
| 0% | 1,343 | 895 | 448 | 0 | -447 | -894 | -1,341 |
| 2.67% | 3 | -440 | -884 | -1,330 | -1,777 | -2,225 | -2,673 |
| 5.33% | -1,539 | -1,957 | -2,383 | -2,814 | -3,249 | -3,687 | -4,127 |
| 8.00% | -3,262 | -3,641 | -4,035 | -4,439 | -4,852 | -5,272 | -5,697 |
| KR4301Q52450 2020-05 풋245 | | | | | | | 5,386 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -3,595 | -3,865 | -4,150 | -4,447 | -4,753 | -5,067 | -5,386 |
| -5.33% | -1,722 | -2,053 | -2,390 | -2,733 | -3,079 | -3,428 | -3,780 |
| -2.67% | -140 | -509 | -879 | -1,249 | -1,620 | -1,991 | -2,362 |
| 0% | 1,131 | 755 | 377 | 0 | -378 | -755 | -1,133 |
| 2.67% | 2,103 | 1,747 | 1,387 | 1,022 | 655 | 286 | -86 |
| 5.33% | 2,807 | 2,495 | 2,170 | 1,836 | 1,494 | 1,145 | 792 |
| 8.00% | 3,291 | 3,035 | 2,759 | 2,466 | 2,160 | 1,842 | 1,515 |

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

(단위:백만원)

18,276

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-04-13 |
| 기준일 | 2020-04-10 |

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

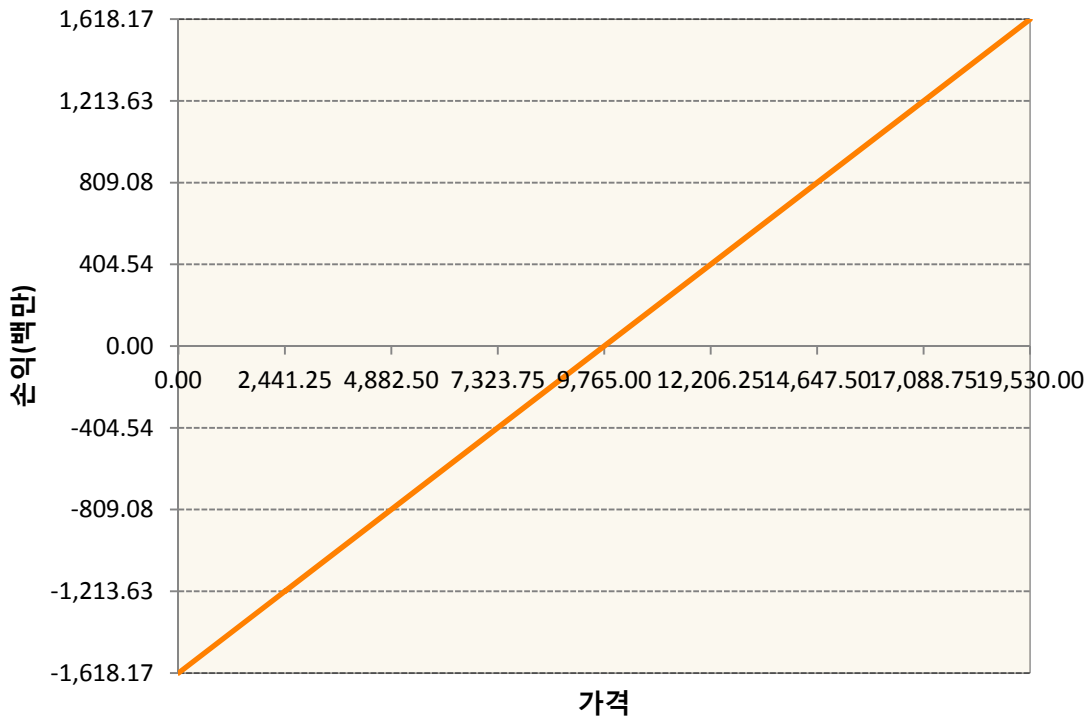
1. 계약금액

(단위:백만원)

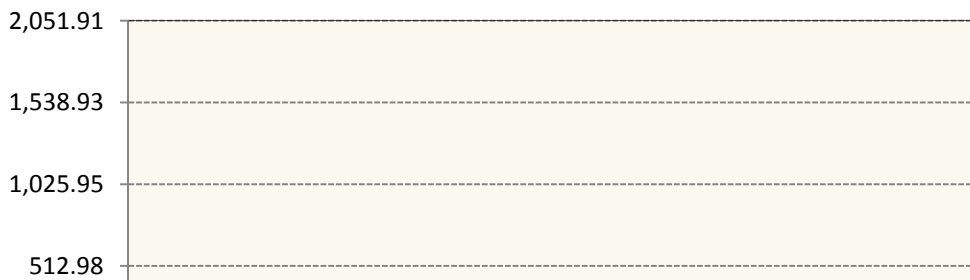
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,618 | 0 | 1,618 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 4,105 | -4,105 | 장내 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 686 | 2,195 | -1,509 | 장외 |

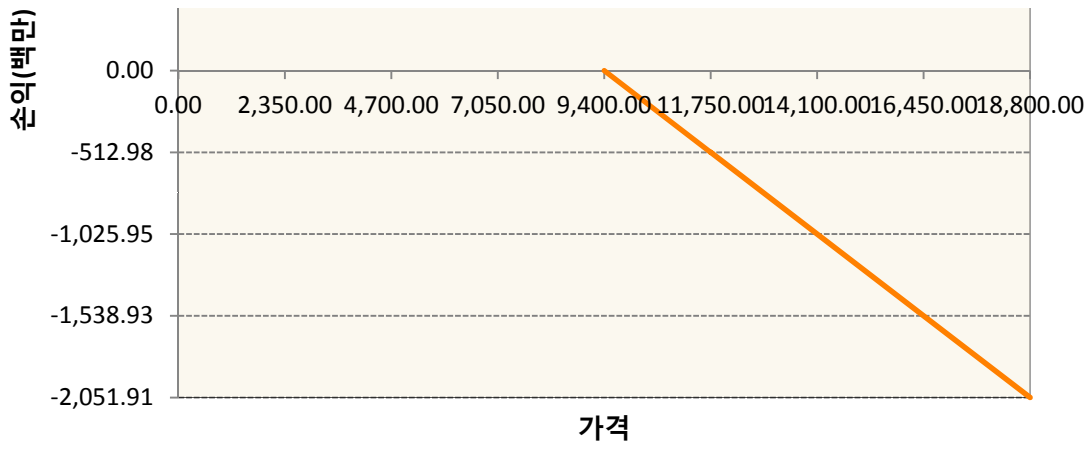
2. 만기시점의 손익구조

HCJ0-HSCEI Futures Apr20

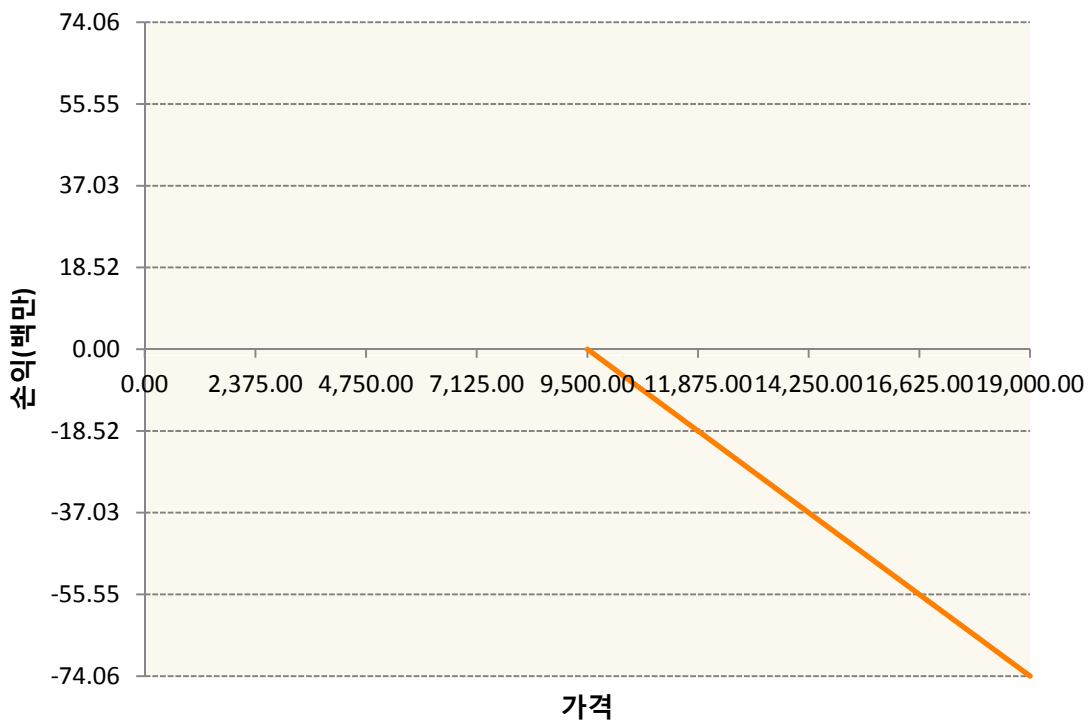


OHHIJ0-C94-HSCEI

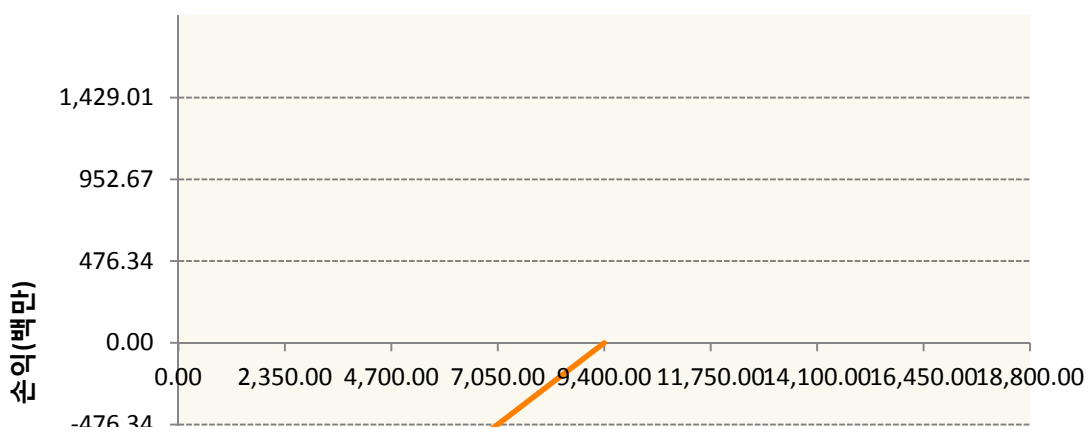


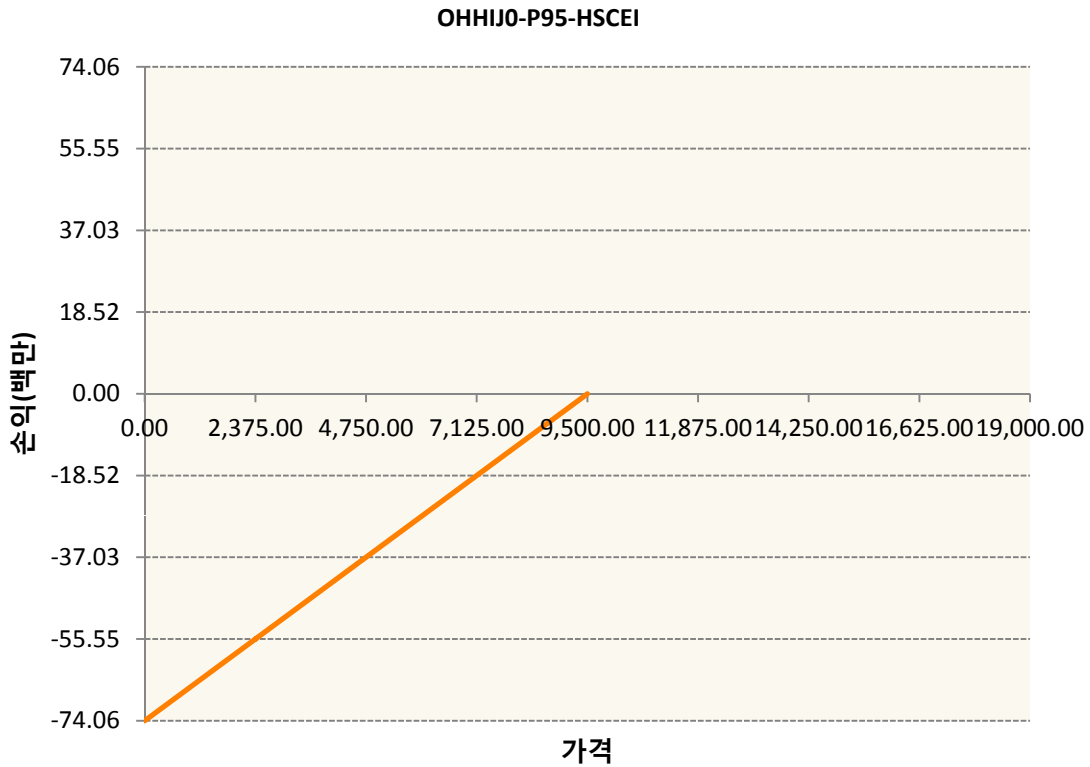


OHHIJO-C95-HSCEI



OHHIJO-P94-HSCEI





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | (단위:백만원) |
|------------------------------|----------|
| FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E | 176 |
| FX21020H05 HKD/KRW 22-05-20E | 55 |
| HCJ0 HSCEI Futures Apr20 | 129 |
| OHHIJ0-C94 HSCEI | 164 |
| OHHIJ0-C95 HSCEI | 6 |
| OHHIJ0-P94 HSCEI | 152 |
| OHHIJ0-P95 HSCEI | 6 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|--|----------|
| | 607 |

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-04-13 |
| 기준일 | 2020-04-10 |

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

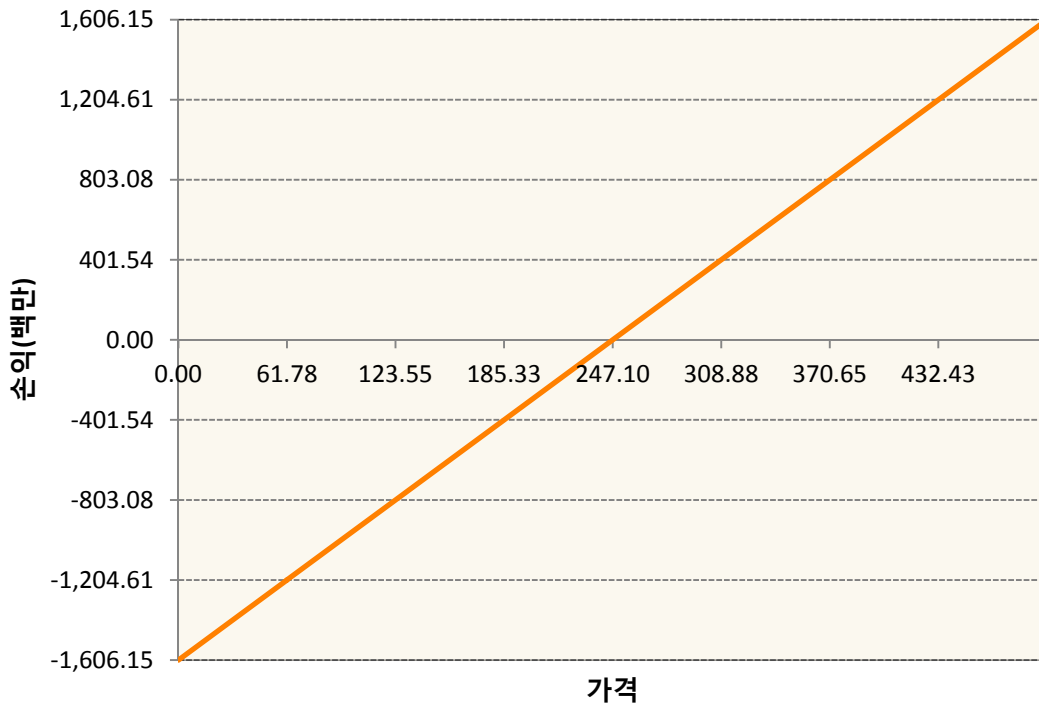
1. 계약금액

(단위:백만원)

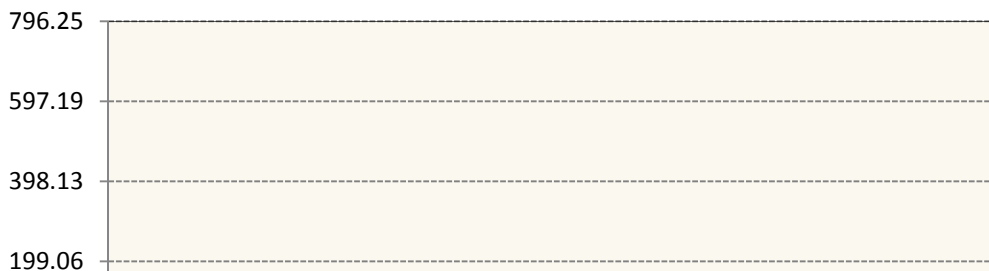
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 3,313 | -3,313 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,606 | 0 | 1,606 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 2,125 | 0 | 2,125 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 3,193 | -3,193 | 장내 |

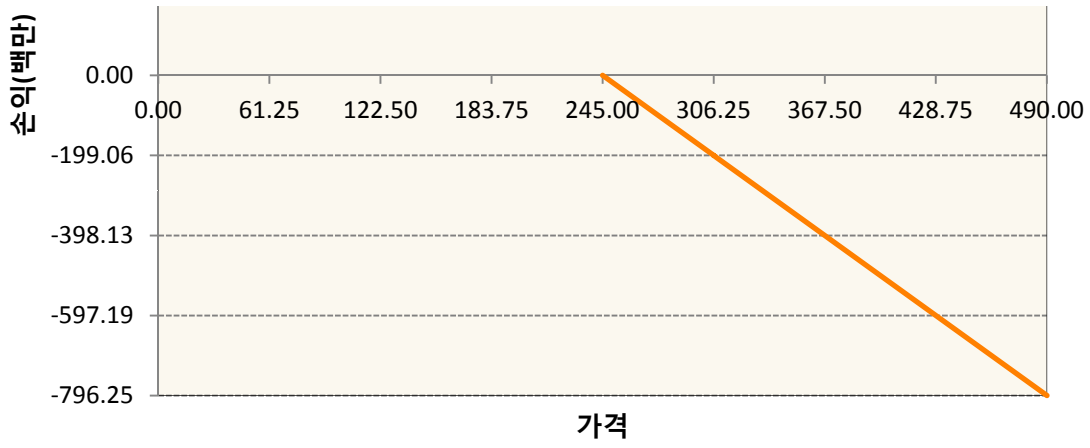
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

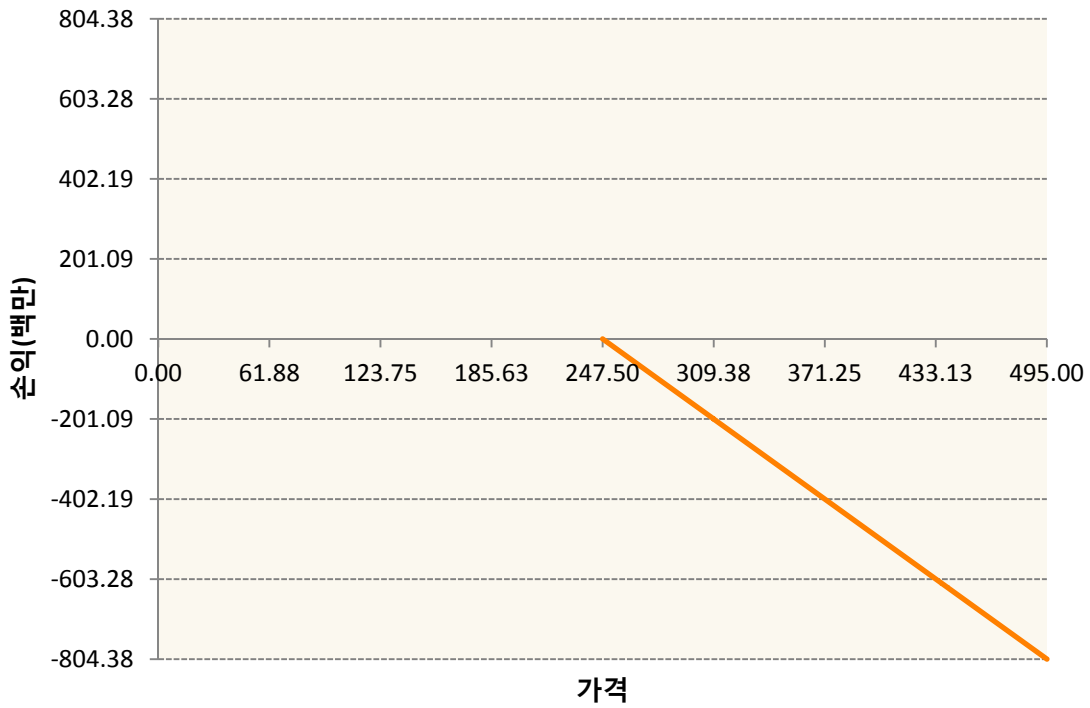


KR4201Q52452-2020-05 콜245

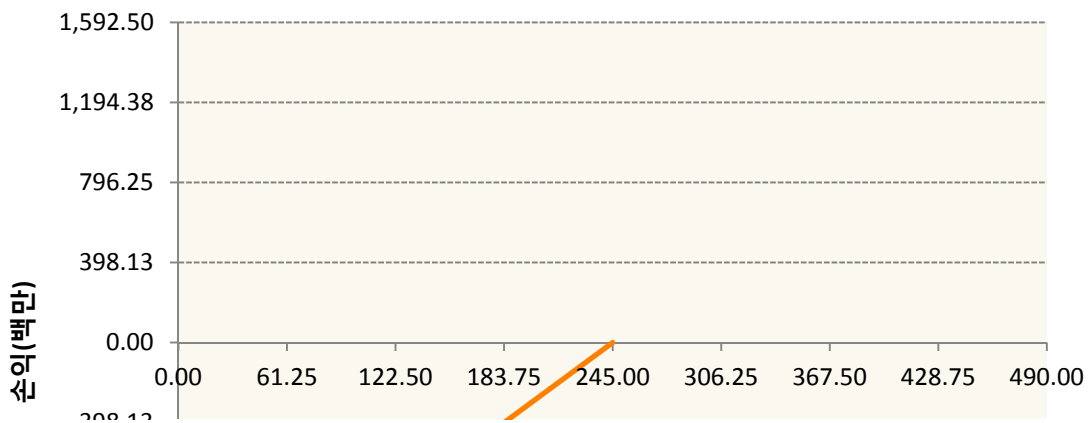




KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



KR4301Q52450-2020-05 풋245





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 | | | | | | 129 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -129 | -129 | -129 | -129 | -129 | -129 | -129 | |
| -5.33% | -86 | -86 | -86 | -86 | -86 | -86 | -86 | |
| -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% | 86 | 86 | 86 | 86 | 86 | 86 | 86 | |
| 8.00% | 129 | 129 | 129 | 129 | 129 | 129 | 129 | |
| KR4201Q52452 | | 2020-05 콜245 | | | | | | 53 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 39 | 36 | 33 | 29 | 26 | 22 | 18 | |
| -5.33% | 32 | 28 | 25 | 21 | 17 | 13 | 9 | |
| -2.67% | 23 | 19 | 15 | 11 | 7 | 3 | -1 | |
| 0% | 12 | 8 | 4 | 0 | -4 | -8 | -12 | |
| 2.67% | -1 | -5 | -9 | -13 | -17 | -21 | -25 | |
| 5.33% | -16 | -19 | -23 | -27 | -31 | -35 | -38 | |
| 8.00% | -32 | -35 | -39 | -42 | -46 | -49 | -53 | |
| KR4201Q52478 | | 2020-05 콜247.5 | | | | | | 52 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |

| | | | | | | | |
|--|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| -8.00% | 37 | 34 | 31 | 27 | 24 | 21 | 17 |
| -5.33% | 31 | 27 | 24 | 20 | 16 | 12 | 8 |
| -2.67% | 23 | 19 | 15 | 11 | 7 | 3 | -1 |
| 0% | 12 | 8 | 4 | 0 | -4 | -8 | -12 |
| 2.67% | 0 | -4 | -8 | -12 | -16 | -20 | -24 |
| 5.33% | -14 | -18 | -22 | -26 | -30 | -34 | -38 |
| 8.00% | -30 | -33 | -37 | -41 | -44 | -48 | -52 |
| KR4301Q52450 2020-05 풋245 | | | | | | | 90 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -60 | -64 | -69 | -74 | -79 | -84 | -90 |
| -5.33% | -29 | -34 | -40 | -46 | -51 | -57 | -63 |
| -2.67% | -2 | -8 | -15 | -21 | -27 | -33 | -39 |
| 0% | 19 | 13 | 6 | 0 | -6 | -13 | -19 |
| 2.67% | 35 | 29 | 23 | 17 | 11 | 5 | -1 |
| 5.33% | 47 | 42 | 36 | 31 | 25 | 19 | 13 |
| 8.00% | 55 | 51 | 46 | 41 | 36 | 31 | 25 |

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

(단위:백만원)

531

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-04-13 |
| 기준일 | 2020-04-10 |

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

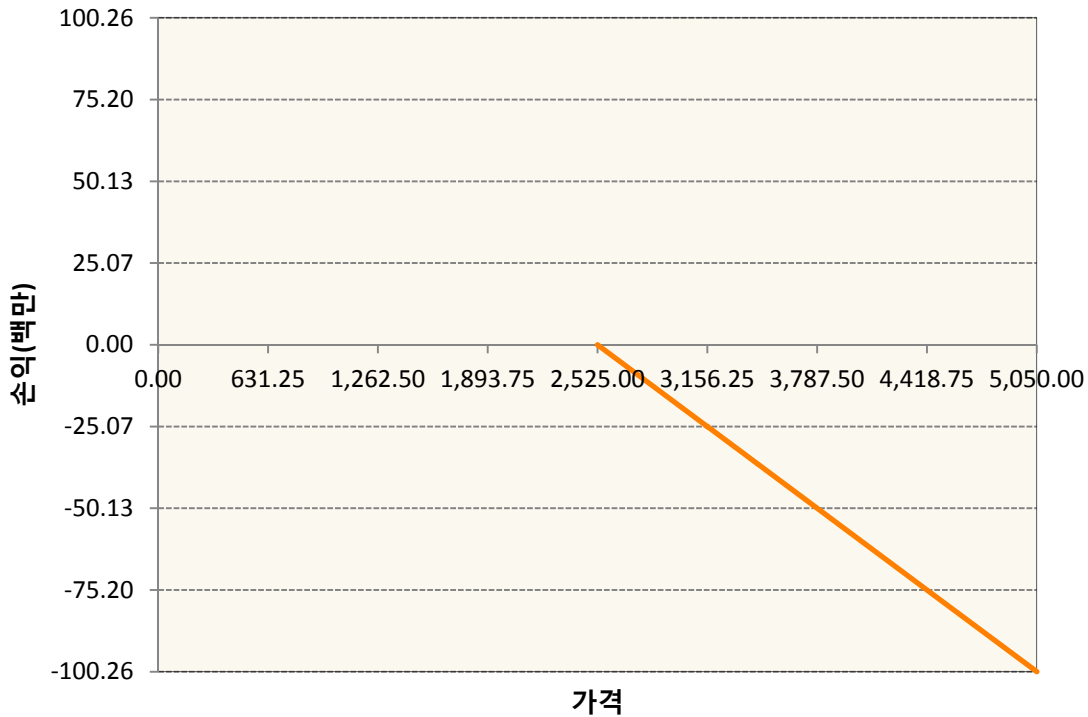
1. 계약금액

(단위:백만원)

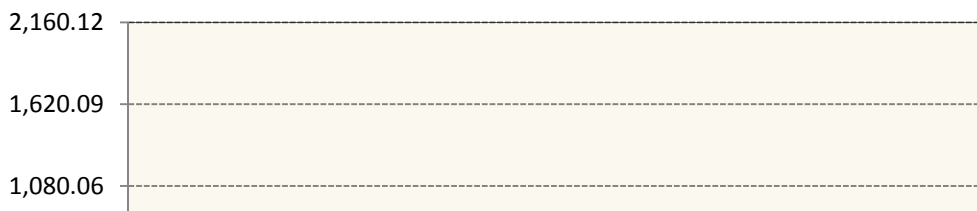
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 348 | 0 | 348 | |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 7,518 | 0 | 7,518 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 4,555 | -4,555 | 장내 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 2,679 | -2,679 | 장외 |

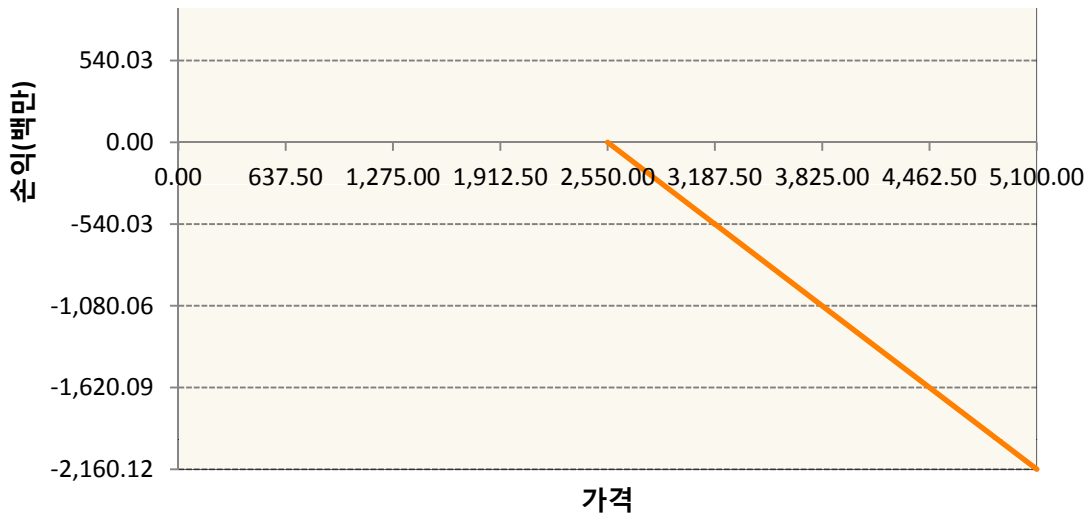
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ0-C2525-EURO STOXX 50

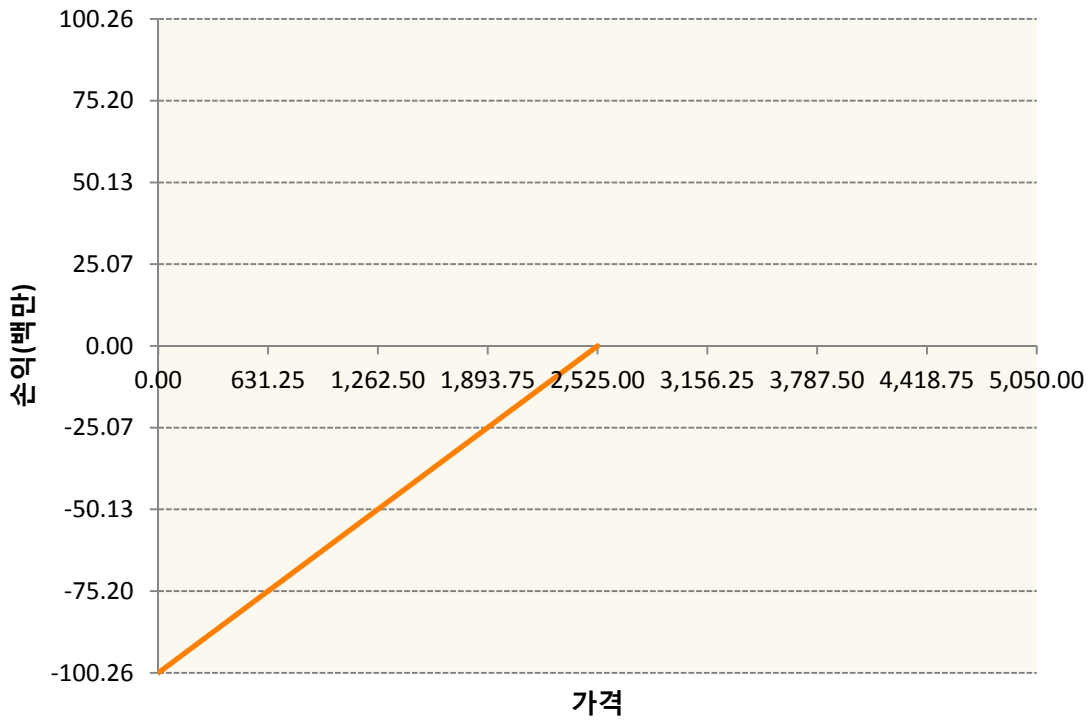


OESXJ0-C2550-EURO STOXX 50

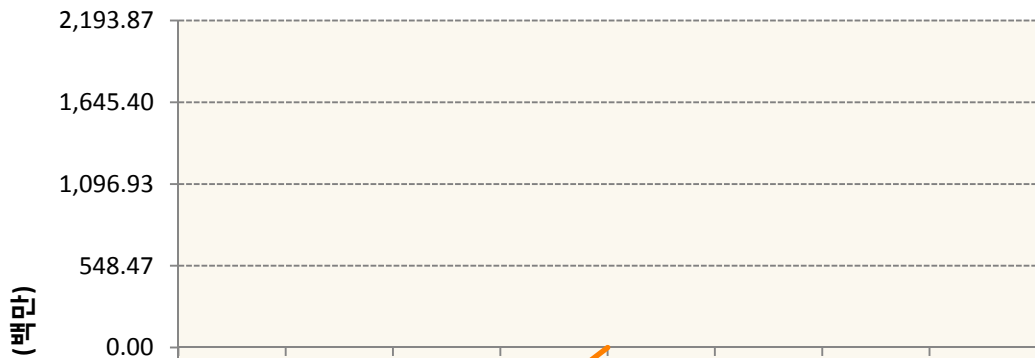


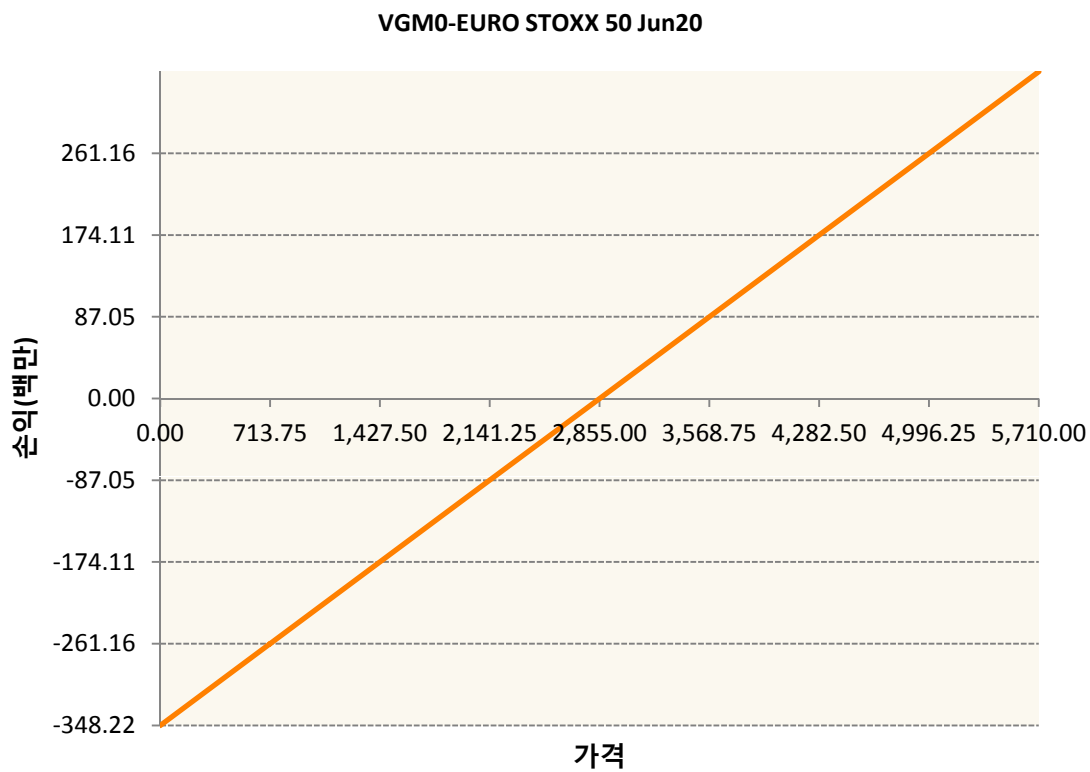
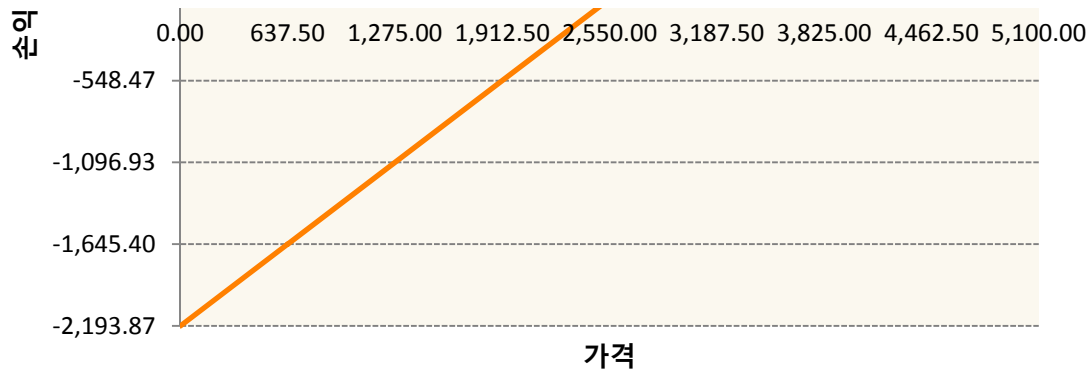


OESXJ0-P2525-EURO STOXX 50



OESXJ0-P2550-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | |
|---|-----|
| 260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY | 28 |
| FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E | 214 |
| 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)

1,085

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

(단위:백만원)

94

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-04-13 |
| 기준일 | 2020-04-10 |

ETF스마트레버리지목표전환형10호

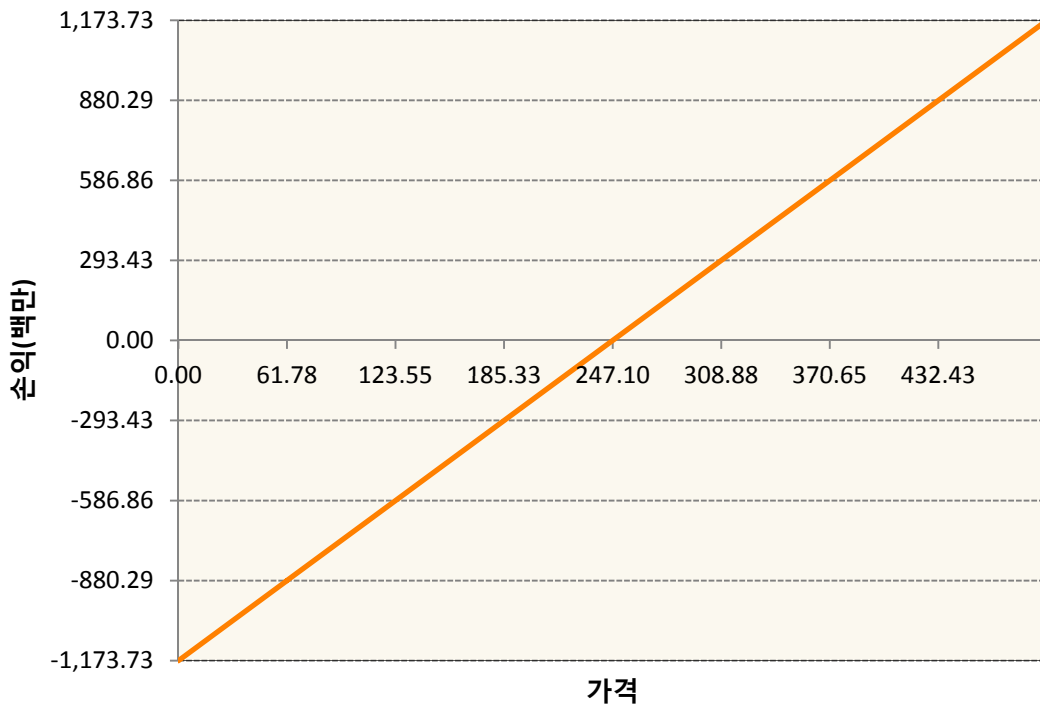
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,174 | 0 | 1,174 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101Q60002 | | 2020-06 코스피200지수선물 | | | | | | 94 |
|--------------|---------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|----|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -94 | -94 | -94 | -94 | -94 | -94 | -94 | |
| -5.33% | -63 | -63 | -63 | -63 | -63 | -63 | -63 | |
| -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% | 63 | 63 | 63 | 63 | 63 | 63 | 63 | |
| 8.00% | 94 | 94 | 94 | 94 | 94 | 94 | 94 | |

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

(단위:백만원)

137

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-04-13 |
| 기준일 | 2020-04-10 |

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

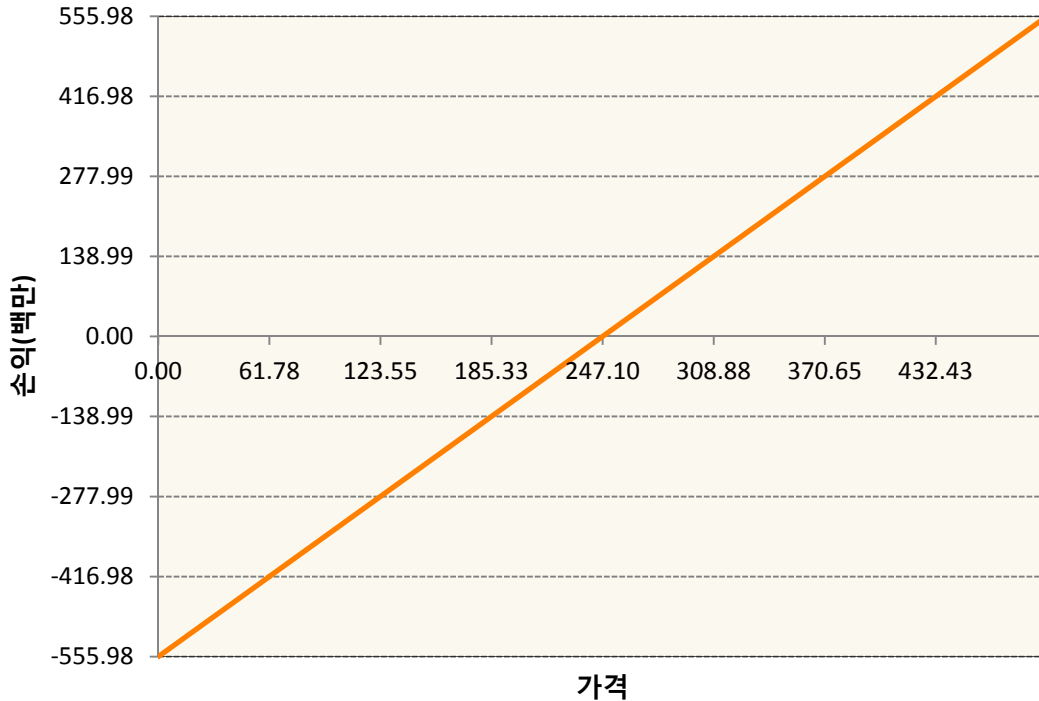
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 556 | 0 | 556 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101Q60002 | | 2020-06 코스피200지수선물 | | | | | | 45 |
|--------------|---------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|----|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -45 | -45 | -45 | -45 | -45 | -45 | -45 | |
| -5.33% | -30 | -30 | -30 | -30 | -30 | -30 | -30 | |
| -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% | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | |
| 8.00% | 45 | 45 | 45 | 45 | 45 | 45 | 45 | |

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

(단위:백만원)

65

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-04-13 |
| 기준일 | 2020-04-10 |

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

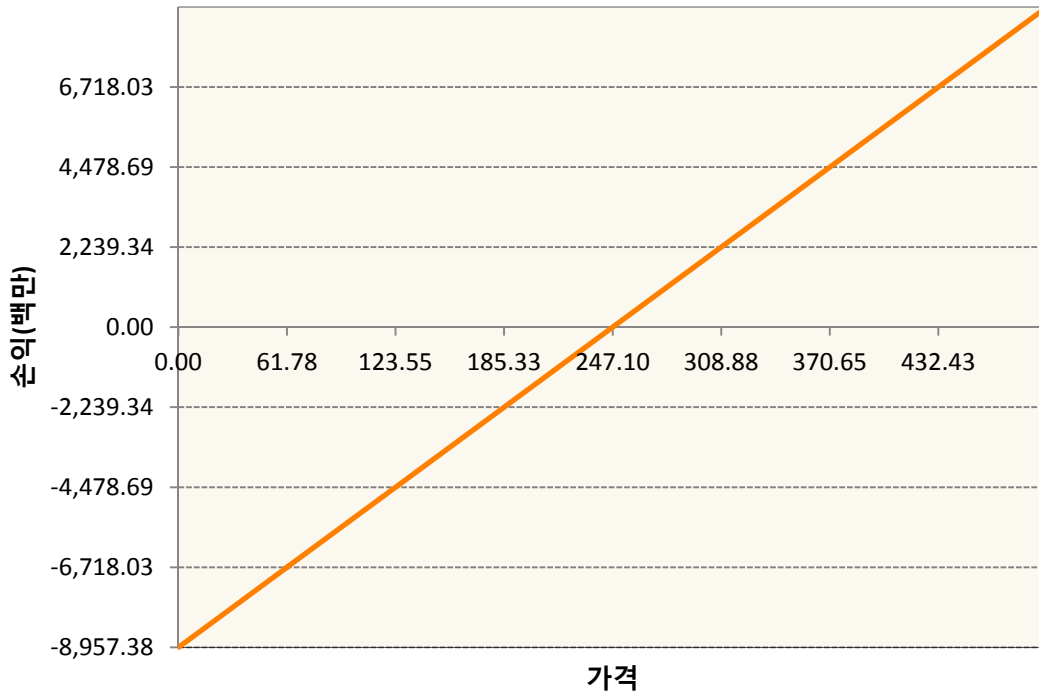
1. 계약금액

(단위:백만원)

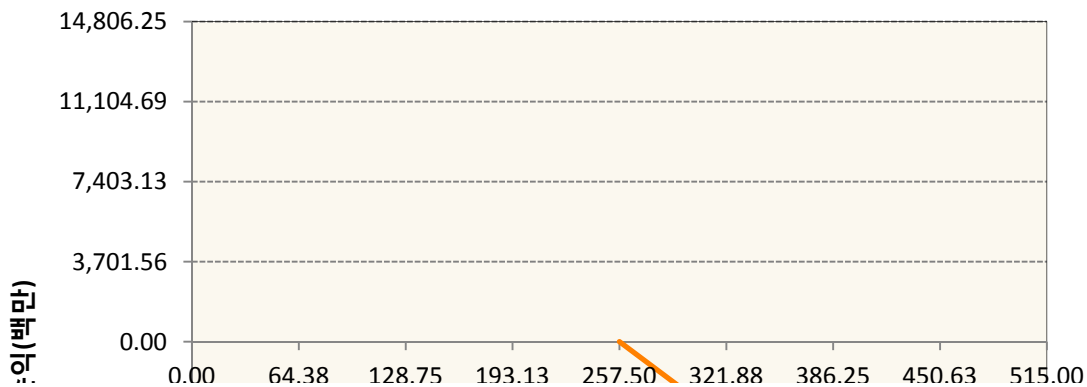
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 1,418 | 5,530 | -4,112 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 8,957 | 0 | 8,957 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 6,201 | 17,536 | -11,335 | 장내 |

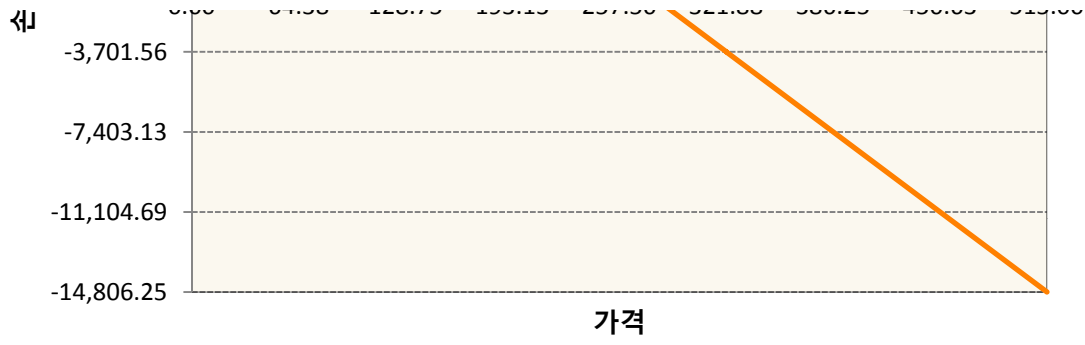
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

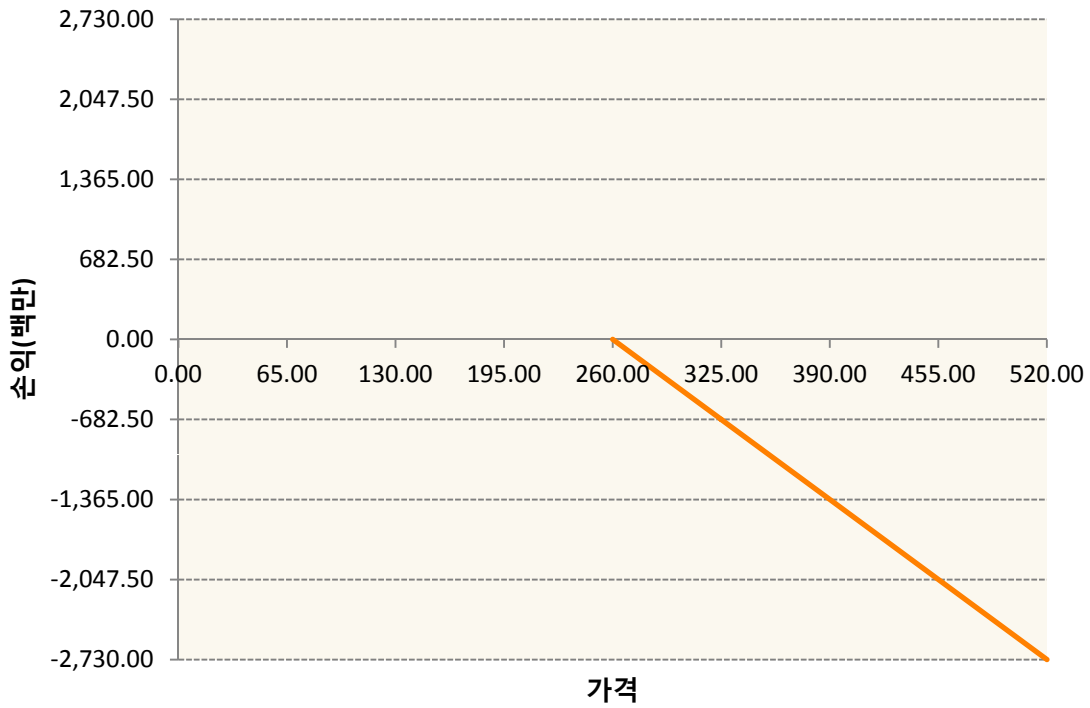


KR4201Q52577-2020-05 콜257.5

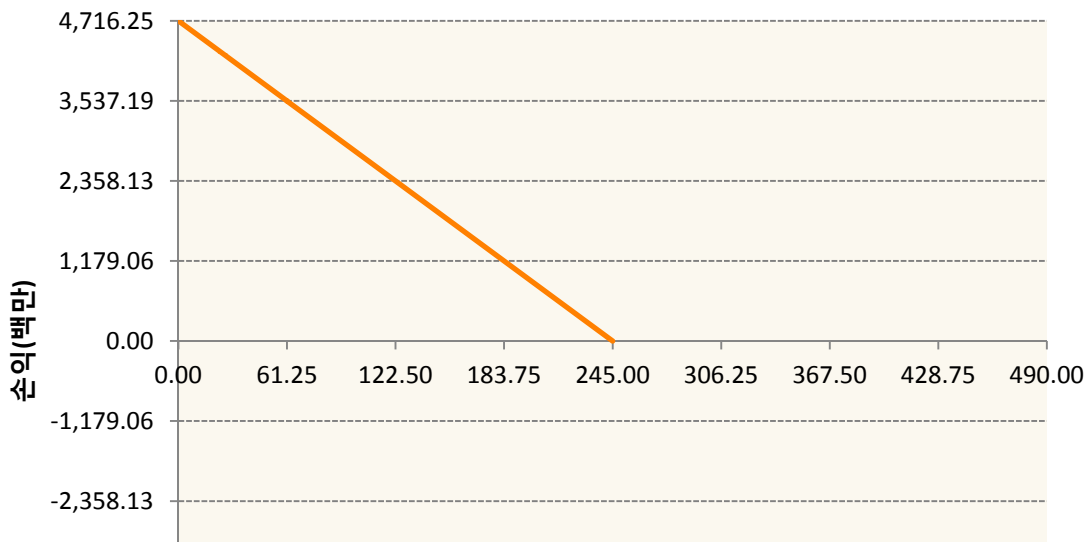


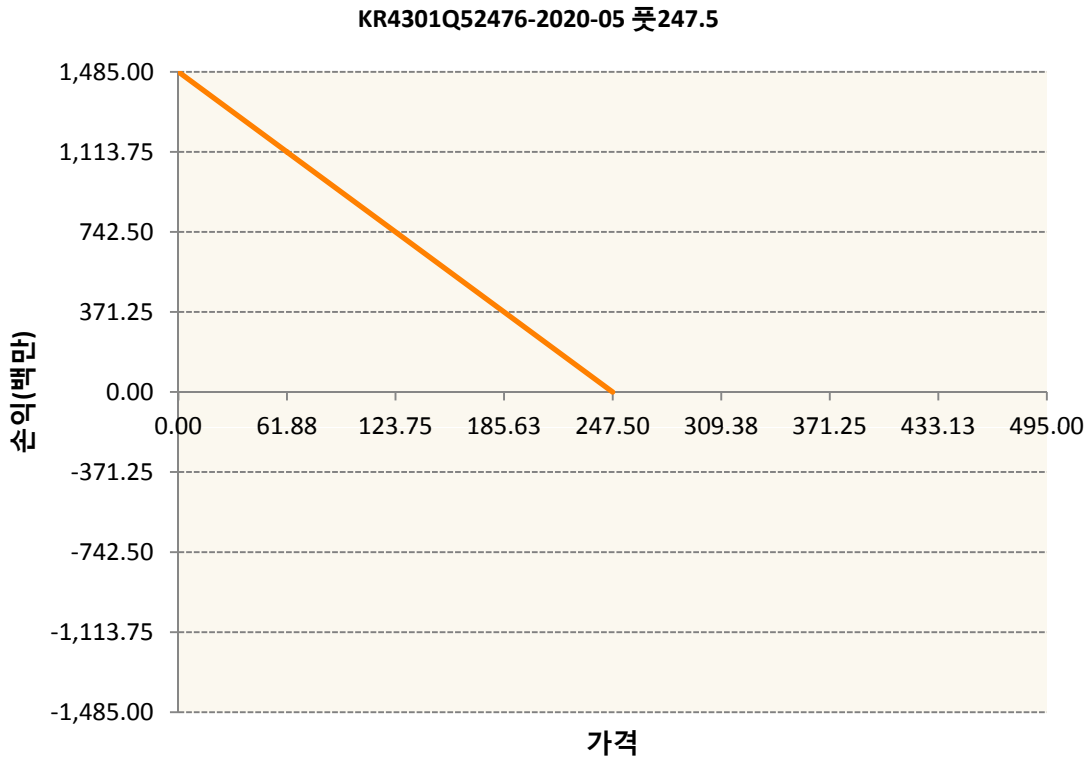
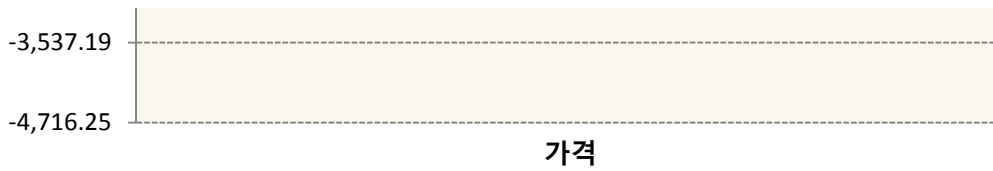


KR4201Q52601-2020-05 콜260



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101Q60002 | | 2020-06 코스피200지수선물 | | | | | | 719 |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -719 | -719 | -719 | -719 | -719 | -719 | -719 | |
| -5.33% | -479 | -479 | -479 | -479 | -479 | -479 | -479 | |
| -2.67% | -240 | -240 | -240 | -240 | -240 | -240 | -240 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 240 | 240 | 240 | 240 | 240 | 240 | 240 | |
| 5.33% | 479 | 479 | 479 | 479 | 479 | 479 | 479 | |
| 8.00% | 719 | 719 | 719 | 719 | 719 | 719 | 719 | |
| KR4201Q52577 | | 2020-05 콜257.5 | | | | | | 828 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 515 | 472 | 425 | 375 | 323 | 268 | 211 | |
| -5.33% | 443 | 389 | 333 | 275 | 214 | 153 | 90 | |
| -2.67% | 343 | 280 | 216 | 150 | 83 | 16 | -52 | |

| | | | | | | | |
|--|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 0% | 212 | 142 | 71 | 0 | -72 | -143 | -215 |
| 2.67% | 47 | -27 | -101 | -176 | -250 | -325 | -399 |
| 5.33% | -151 | -227 | -302 | -377 | -453 | -528 | -604 |
| 8.00% | -383 | -456 | -529 | -604 | -678 | -753 | -828 |
| KR4201Q52601 2020-05 콜260 | | | | | | | 147 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 88 | 81 | 73 | 64 | 55 | 45 | 35 |
| -5.33% | 76 | 67 | 57 | 47 | 36 | 25 | 14 |
| -2.67% | 60 | 49 | 37 | 26 | 14 | 2 | -11 |
| 0% | 38 | 25 | 13 | 0 | -13 | -26 | -39 |
| 2.67% | 10 | -3 | -17 | -30 | -44 | -58 | -71 |
| 5.33% | -24 | -38 | -52 | -65 | -79 | -93 | -107 |
| 8.00% | -64 | -77 | -91 | -105 | -119 | -133 | -147 |
| KR4301Q52450 2020-05 풋245 | | | | | | | 266 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 177 | 191 | 205 | 219 | 235 | 250 | 266 |
| -5.33% | 85 | 101 | 118 | 135 | 152 | 169 | 187 |
| -2.67% | 7 | 25 | 43 | 62 | 80 | 98 | 117 |
| 0% | -56 | -37 | -19 | 0 | 19 | 37 | 56 |
| 2.67% | -104 | -86 | -68 | -50 | -32 | -14 | 4 |
| 5.33% | -139 | -123 | -107 | -91 | -74 | -57 | -39 |
| 8.00% | -162 | -150 | -136 | -122 | -107 | -91 | -75 |
| KR4301Q52476 2020-05 풋247.5 | | | | | | | 86 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 60 | 64 | 68 | 72 | 77 | 81 | 86 |
| -5.33% | 30 | 35 | 40 | 45 | 50 | 55 | 60 |
| -2.67% | 4 | 9 | 15 | 21 | 26 | 32 | 38 |
| 0% | -18 | -12 | -6 | 0 | 6 | 12 | 18 |
| 2.67% | -34 | -29 | -23 | -17 | -11 | -5 | 0 |
| 5.33% | -47 | -41 | -36 | -31 | -25 | -20 | -14 |
| 8.00% | -55 | -51 | -46 | -42 | -37 | -31 | -26 |

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

(단위:백만원)

1,987

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-04-13 |
| 기준일 | 2020-04-10 |

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 | 146,334 | 0 | 146,334 | |

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 | 2020-04-13 |
| 기준일 | 2020-04-10 |

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 | 98,671 | 0 | 98,671 | |

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 | 2020-04-13 |
| 기준일 | 2020-04-10 |

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 | 435,956 | 0 | 435,956 | |
| 누계 | 통화 | 선도 | 70,715 | 490,652 | -419,937 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|-------------------------------|-------|
| FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E | 3,327 |
| FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E | 1,934 |
| FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E | 3,868 |
| FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E | 2,263 |
| FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E | 1,934 |
| FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E | 2,418 |
| FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E | 2,011 |
| FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E | 2,011 |
| FX21020H04 USD/KRW 21-04-20E | 1,451 |
| FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E | 2,360 |
| FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E | 967 |
| FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E | 967 |
| FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E | 2,514 |
| FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E | 832 |
| FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E | 725 |
| FX21020H09 USD/KRW 24-04-20E | 725 |
| FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E | 484 |
| FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E | 3,385 |
| FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E | 6,866 |
| FX21020H11 KRW/USD 11-05-20E | 967 |
| FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E | 2,901 |

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

22,286

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

(단위:백만원)

187

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-04-13 |
| 기준일 | 2020-04-10 |

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

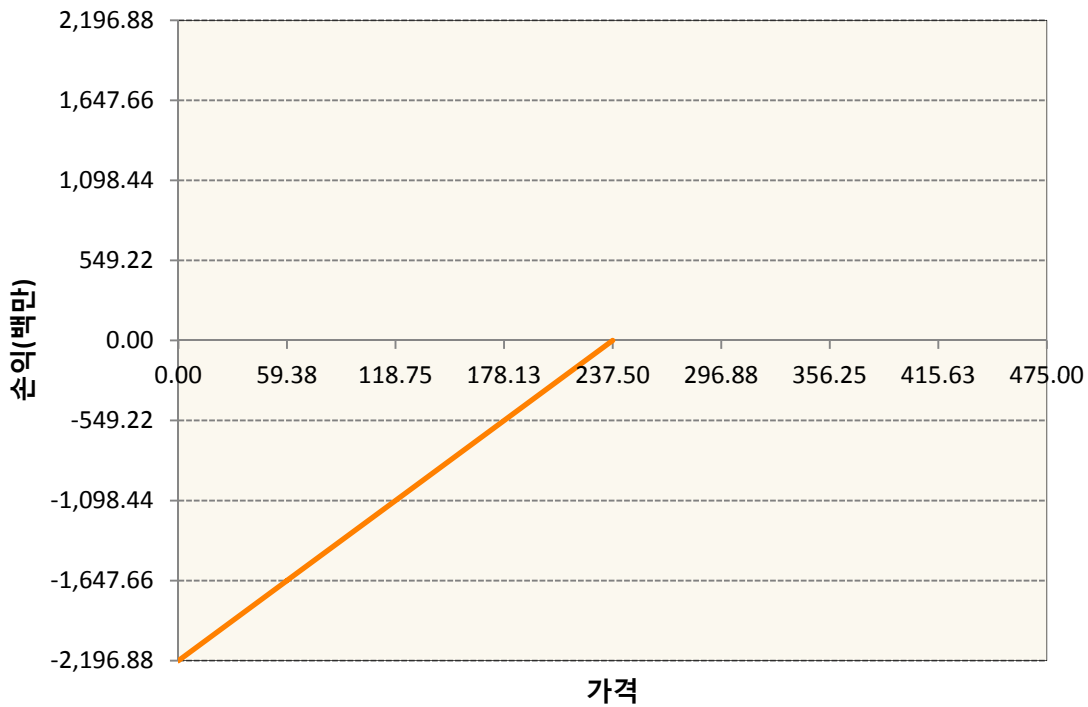
1. 계약금액

(단위:백만원)

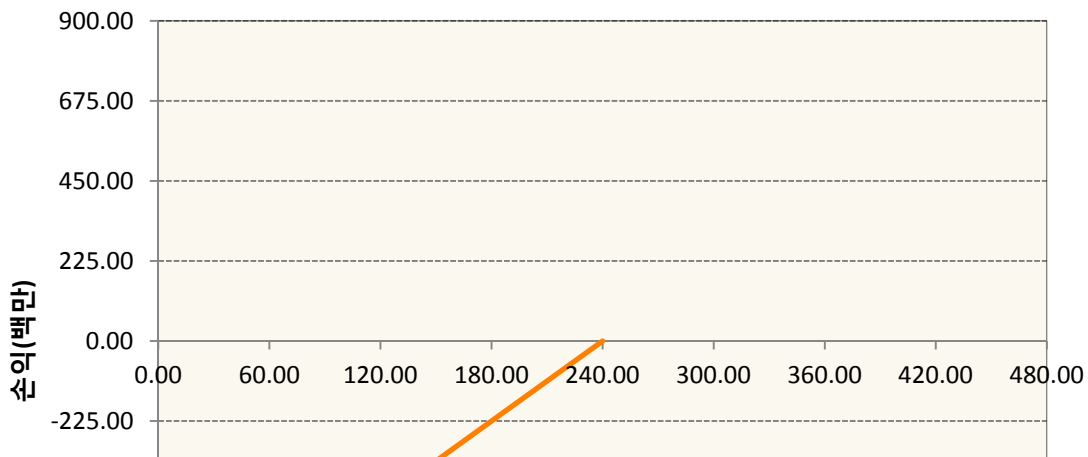
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 929 | -929 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 3,097 | -3,097 | 장내 |

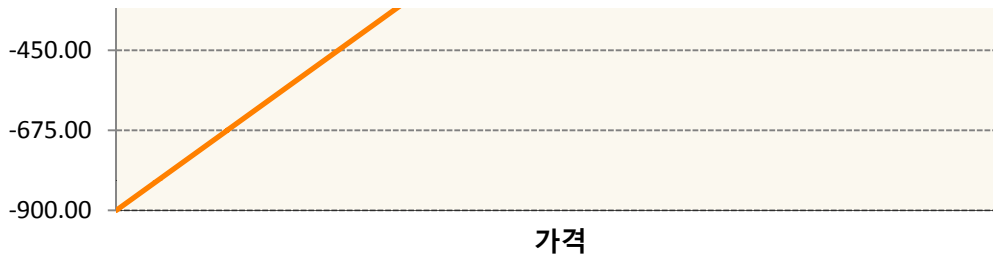
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q52377-2020-05 풋237.5



KR4301Q52401-2020-05 풋240





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4301Q52377 | | 2020-05 풋237.5 | | | | | | 111 |
|--------------|---------|----------------|--------|-----|-------|--------|--------|-----|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -63 | -71 | -79 | -87 | -95 | -103 | -111 | |
| -5.33% | -27 | -35 | -44 | -52 | -61 | -69 | -78 | |
| -2.67% | 3 | -6 | -15 | -23 | -32 | -41 | -49 | |
| 0% | 24 | 16 | 8 | 0 | -8 | -17 | -25 | |
| 2.67% | 40 | 33 | 26 | 18 | 11 | 3 | -5 | |
| 5.33% | 50 | 45 | 39 | 32 | 26 | 18 | 11 | |
| 8.00% | 57 | 53 | 48 | 43 | 37 | 31 | 24 | |
| KR4301Q52401 | | 2020-05 풋240 | | | | | | 47 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -29 | -32 | -35 | -38 | -41 | -44 | -47 | |
| -5.33% | -13 | -16 | -19 | -23 | -26 | -30 | -33 | |
| -2.67% | 0 | -3 | -7 | -10 | -14 | -17 | -21 | |
| 0% | 10 | 7 | 3 | 0 | -3 | -7 | -11 | |
| 2.67% | 18 | 15 | 11 | 8 | 5 | 2 | -2 | |
| 5.33% | 23 | 20 | 17 | 15 | 12 | 9 | 5 | |
| 8.00% | 26 | 24 | 22 | 19 | 17 | 14 | 11 | |

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

123

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-04-13 |
| 기준일 | 2020-04-10 |

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 | 7,186 | 0 | 7,186 | |
| 누계 | 통화 | 선도 | 435 | 11,459 | -11,024 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|-------------------------------|-----|
| FX21020H02 KRW/USD 13-04-20E | 351 |
| FX21020H10 USD/KRW 13-04-20E | 35 |
| FX21020H11 KRW/USD 29-04-20E | 223 |
| FX21020J004 KRW/USD 29-04-20E | 26 |
| FX21020J015 KRW/USD 13-05-20E | 316 |
| IE00BD8RGM75 | |

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

| |
|-----|
| 472 |
|-----|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-04-13 |
| 기준일 | 2020-04-10 |

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

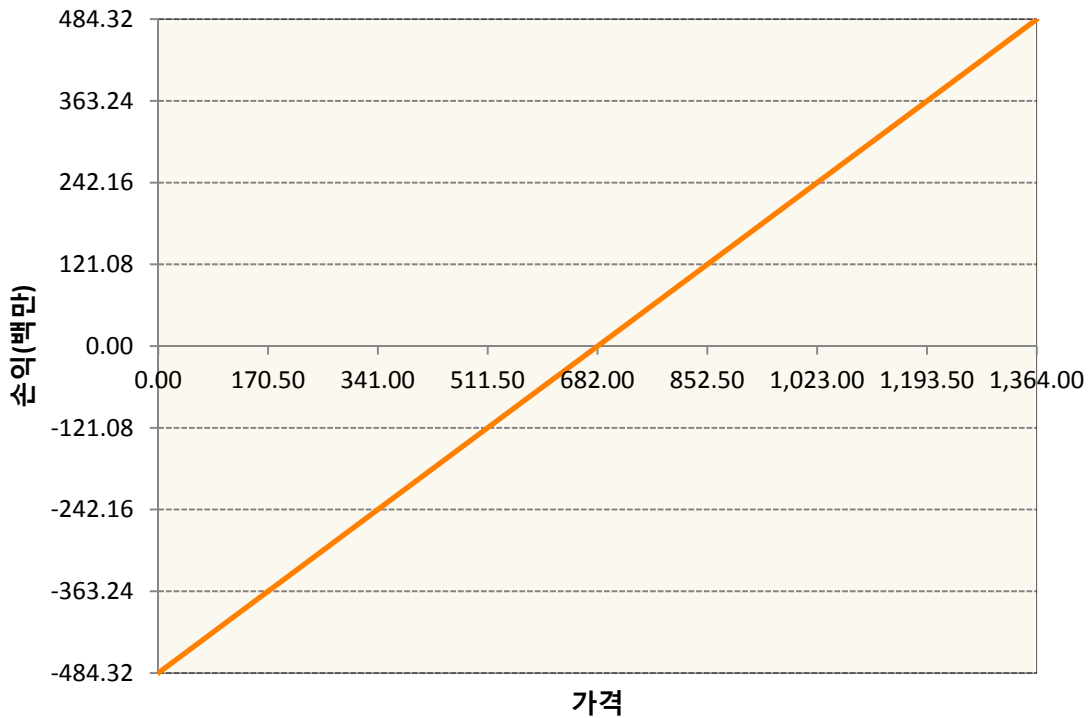
1. 계약금액

(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 | 484 | 0 | 484 | |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 1,092 | 0 | 1,092 | 장외 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 230 | 437 | -206 | 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
FX21020J018 KRW/EUR 24-07-20E
VNCJ0 VN30 Index Future Apr20

| |
|----|
| 8 |
| 3 |
| 5 |
| 3 |
| 39 |

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

(단위:백만원)

| |
|------------|
| 142 |
|------------|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-04-13 |
| 기준일 | 2020-04-10 |

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

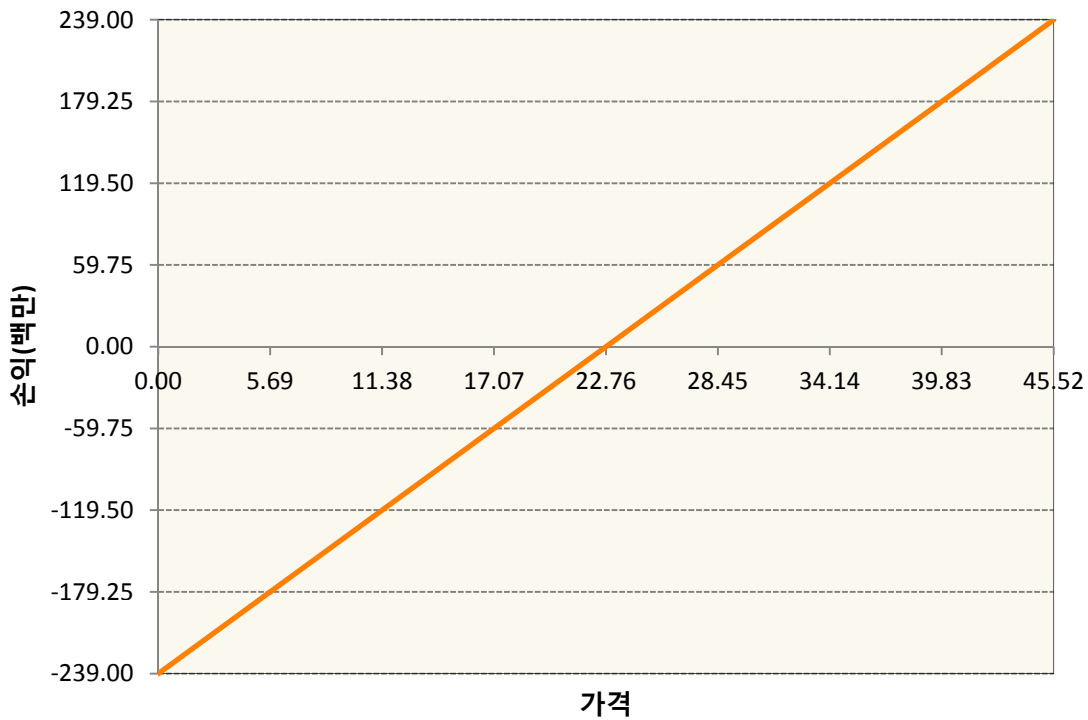
1. 계약금액

(단위:백만원)

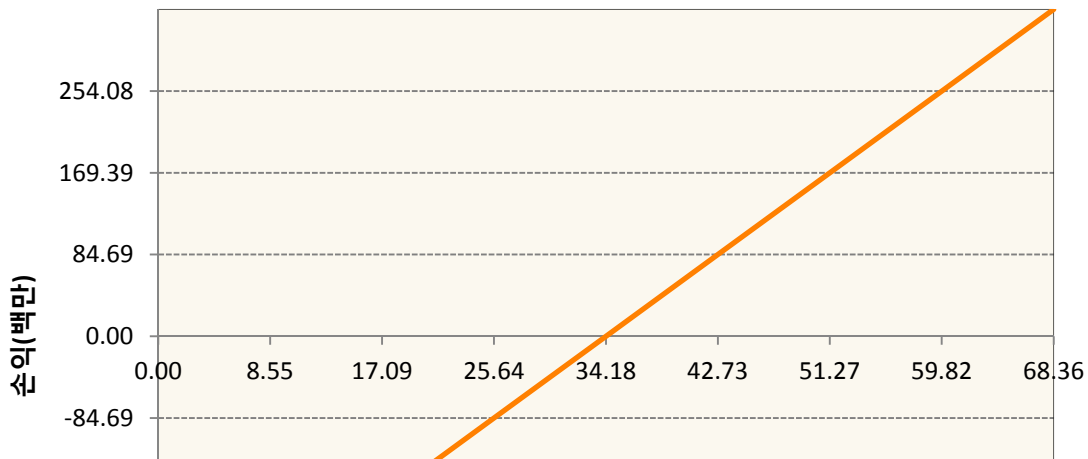
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,417 | 242 | 1,175 | |

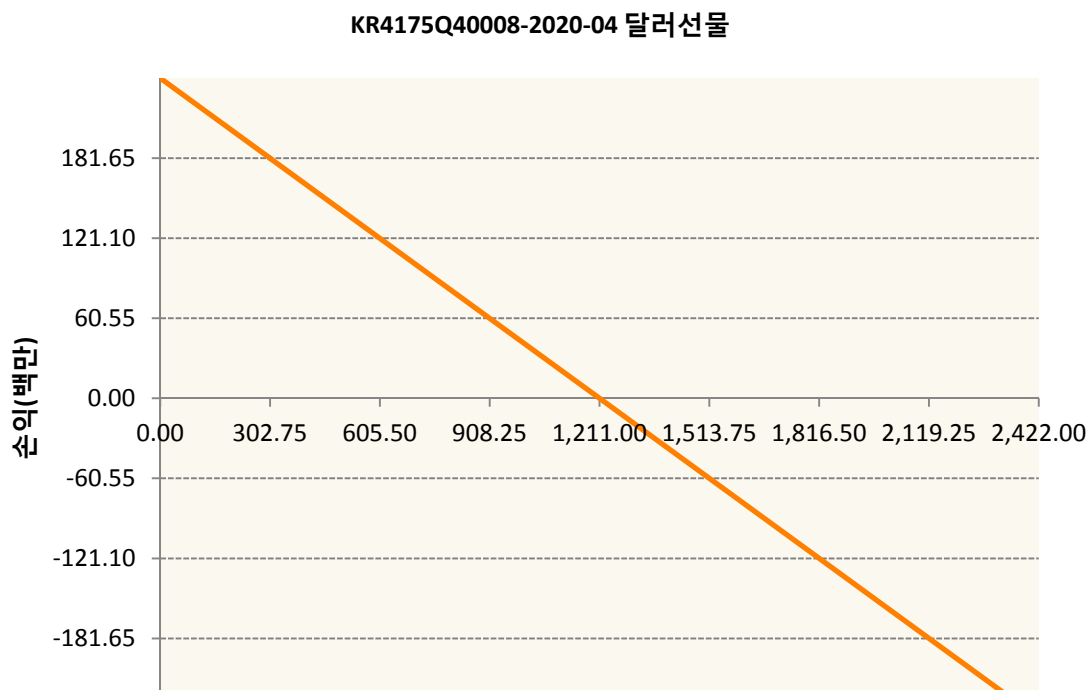
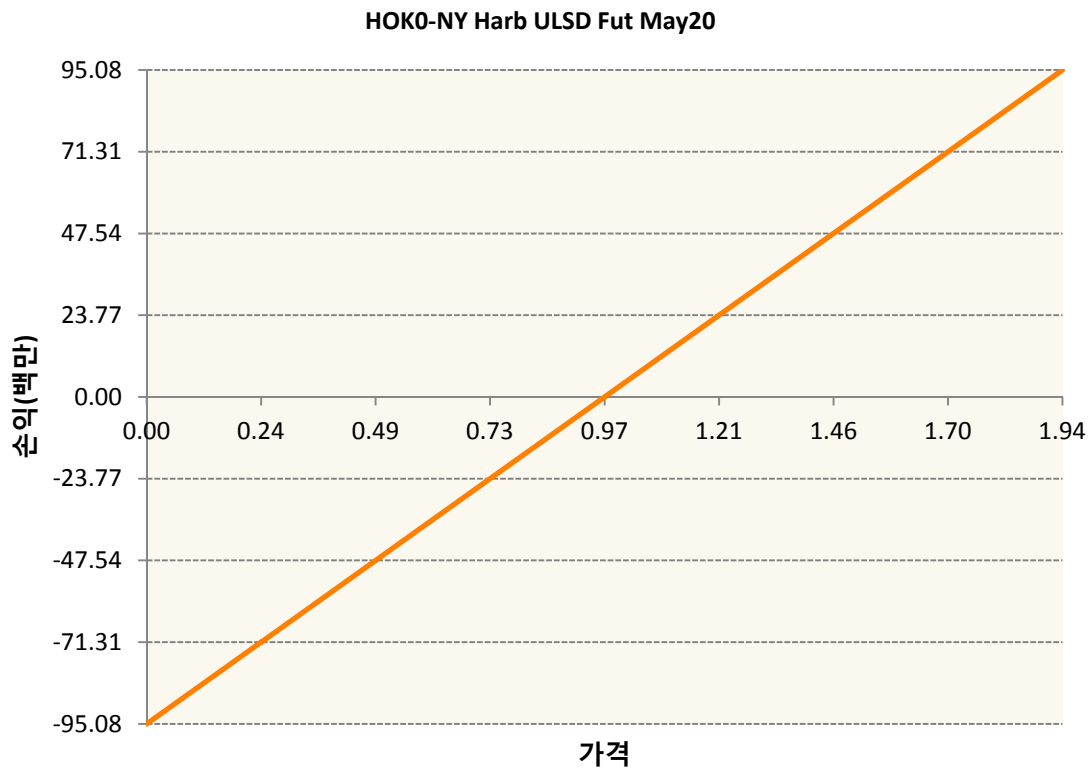
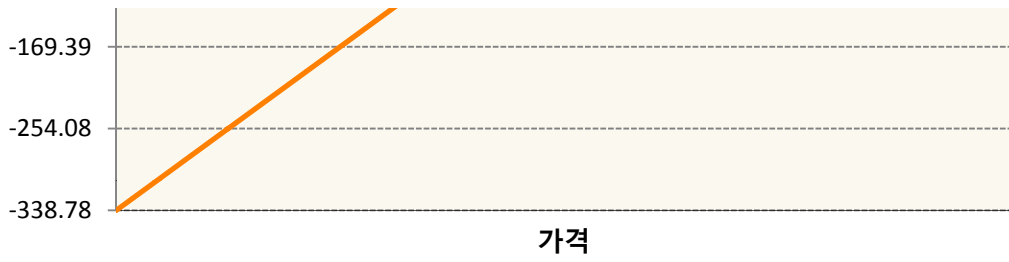
2. 만기시점의 손익구조

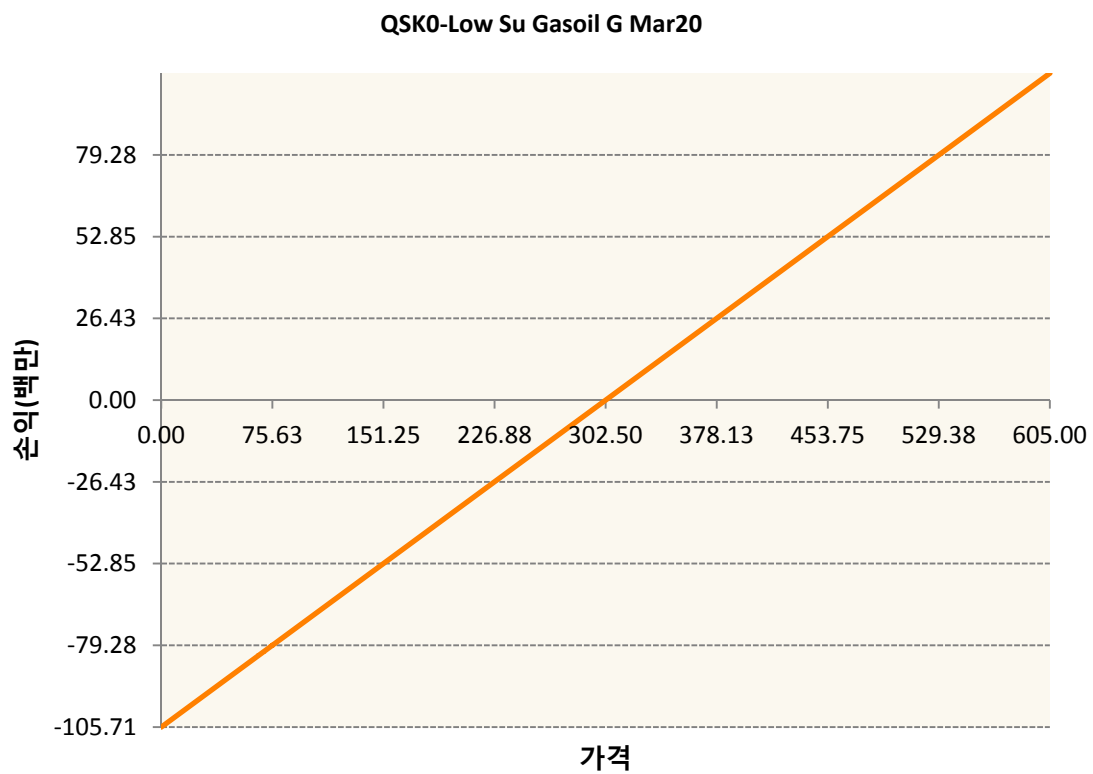
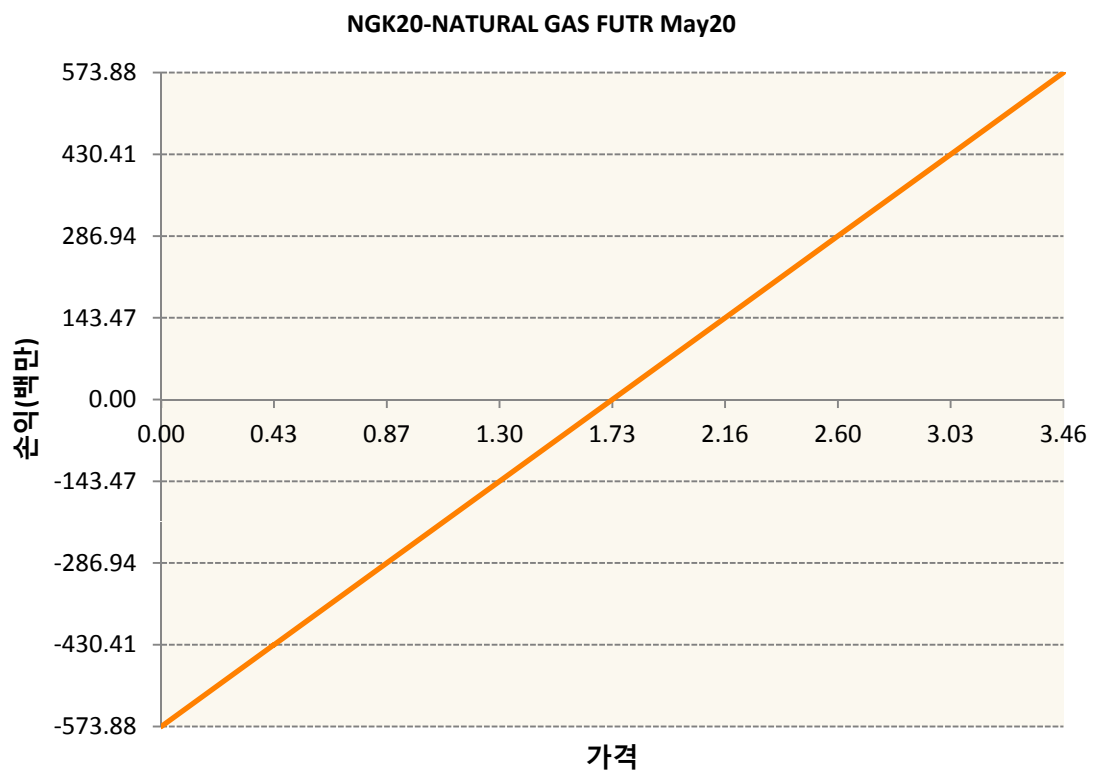
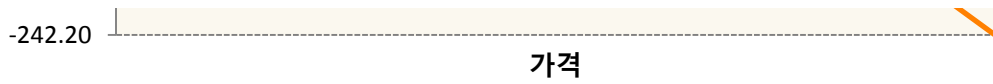
CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20



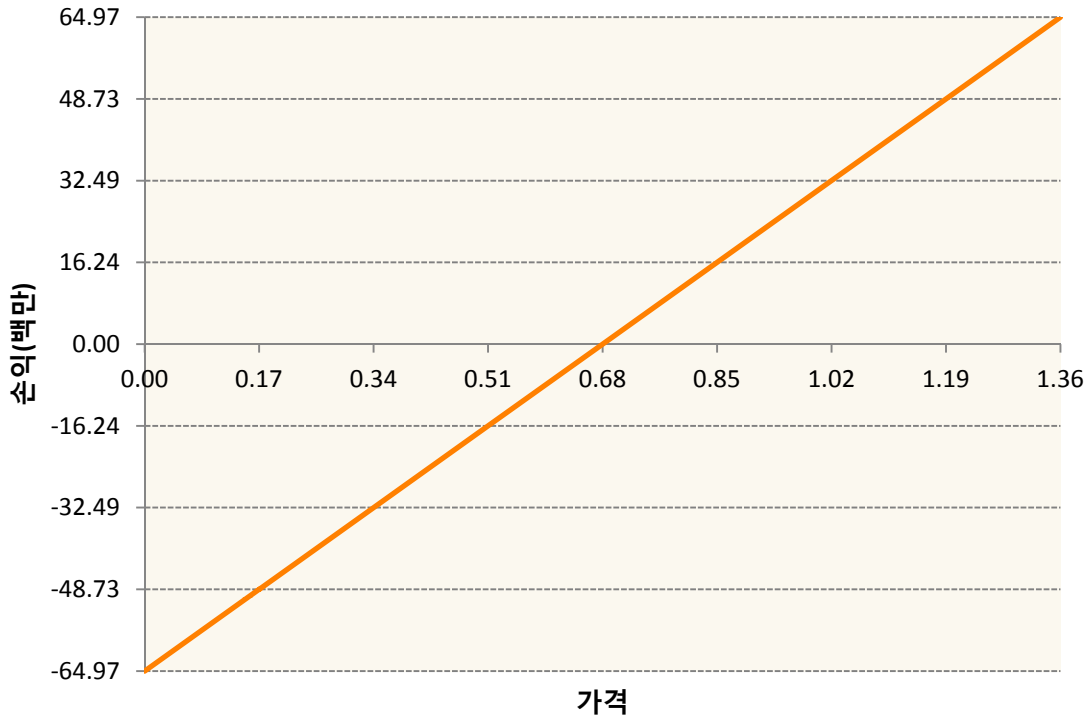
CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20







XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| CLK0 | WTI CRUDE FUTURE May20 | 19 |
| CON0 | BRENT CRUDE FUTR Jul20 | 27 |
| HOK0 | NY Harb ULSD Fut May20 | 8 |
| KR4175Q40C | 2020-04 달러선물 | 19 |
| 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)

345

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-04-13 |
| 기준일 | 2020-04-10 |

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

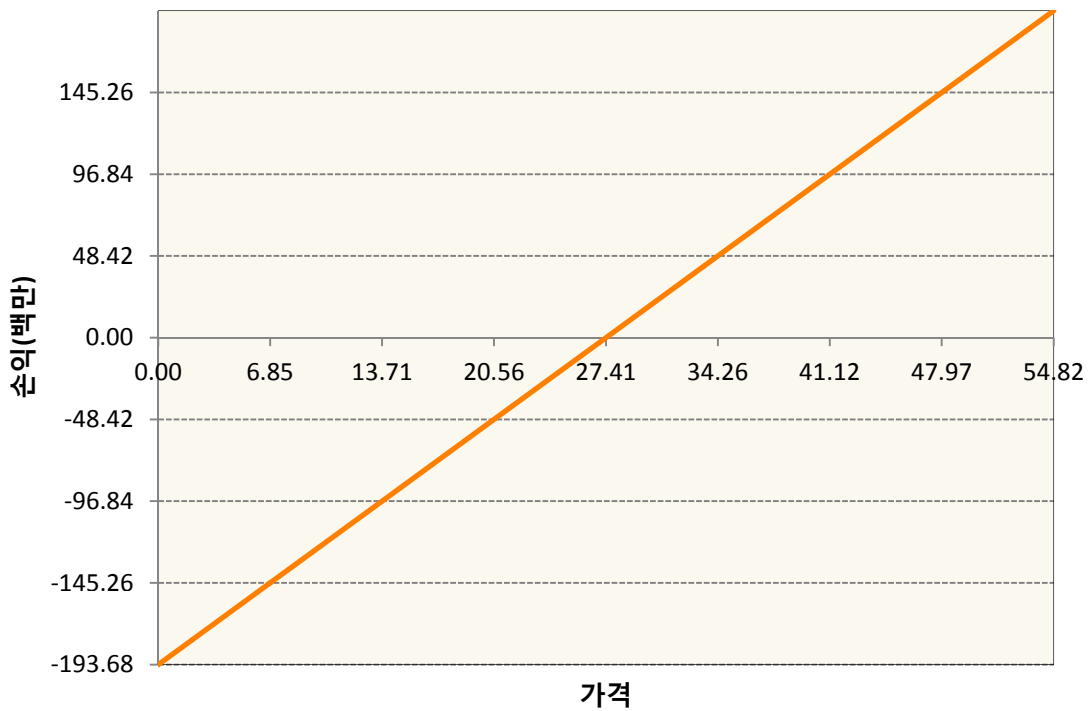
1. 계약금액

(단위:백만원)

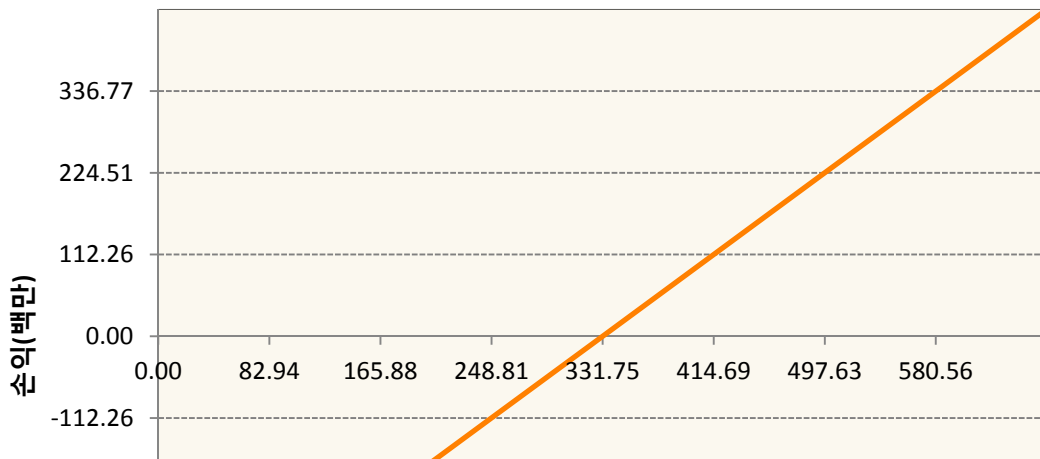
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,352 | 97 | 2,255 | |

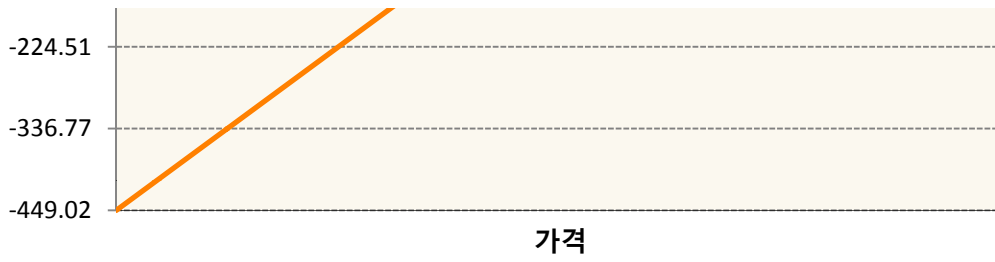
2. 만기시점의 손익구조

BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20

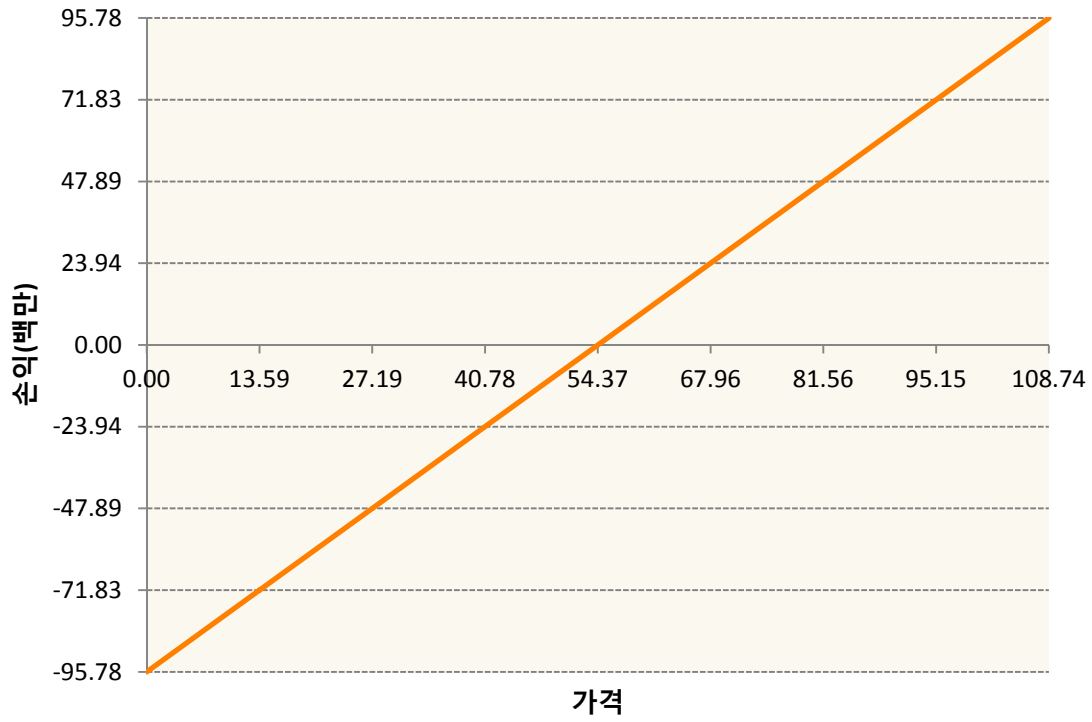


CK0-CORN FUTURE May20

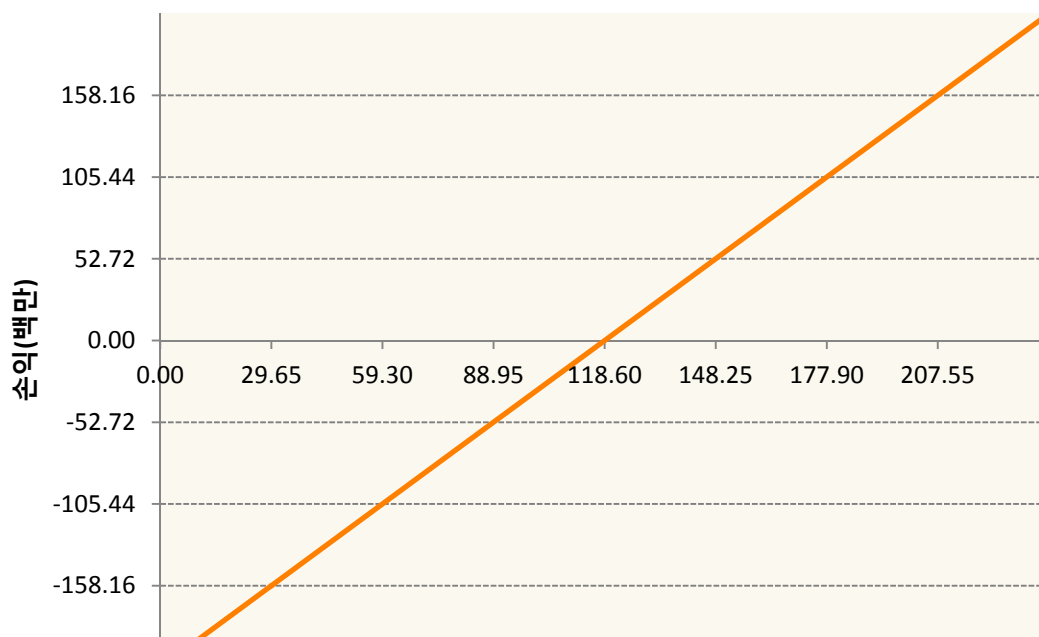


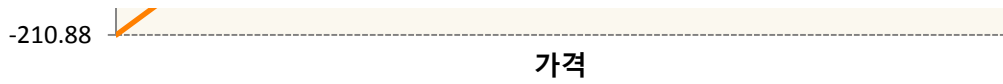


CTK0-COTTON NO.2 FUTR May20

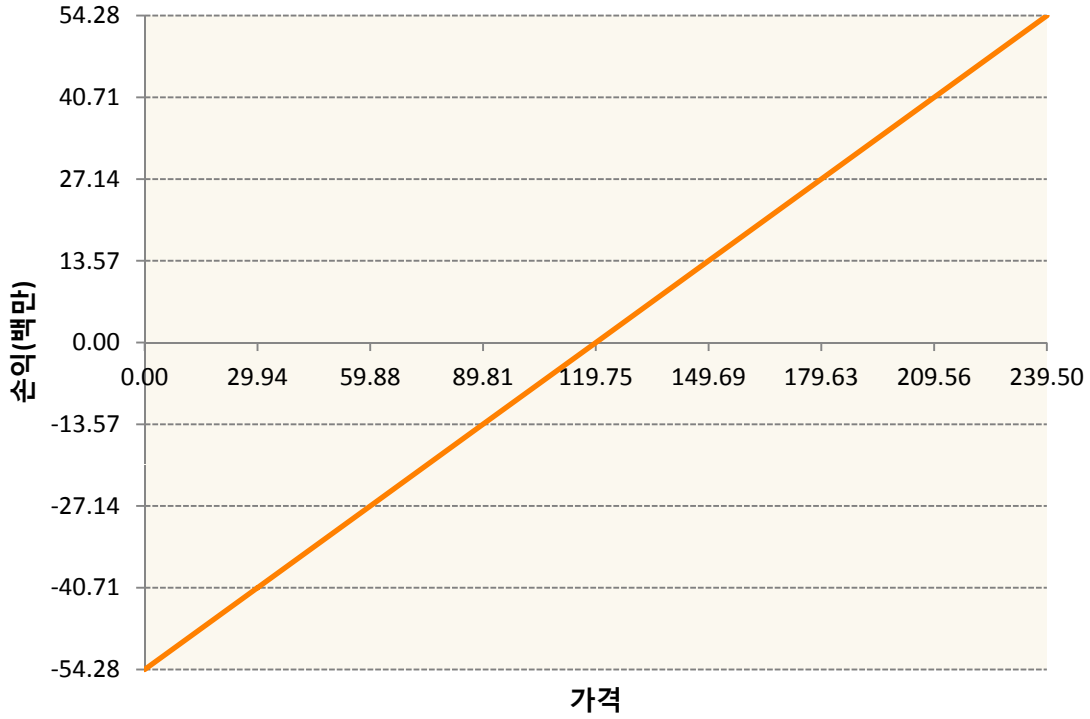


KCK0-COFFEE 'C' FUTURE May20

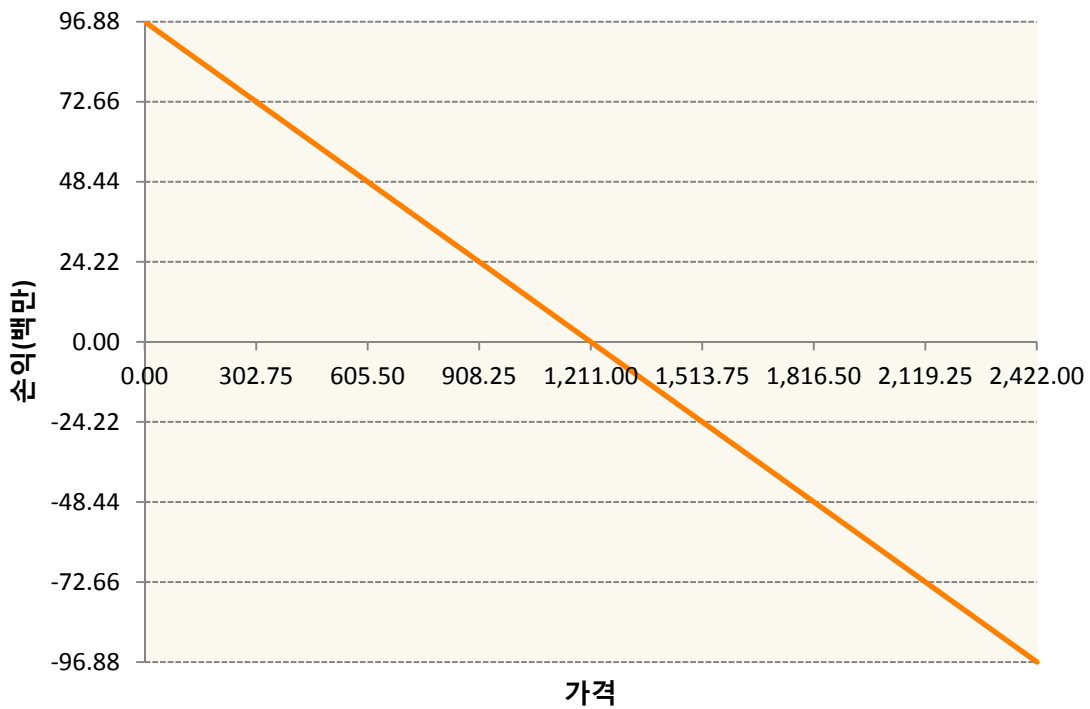




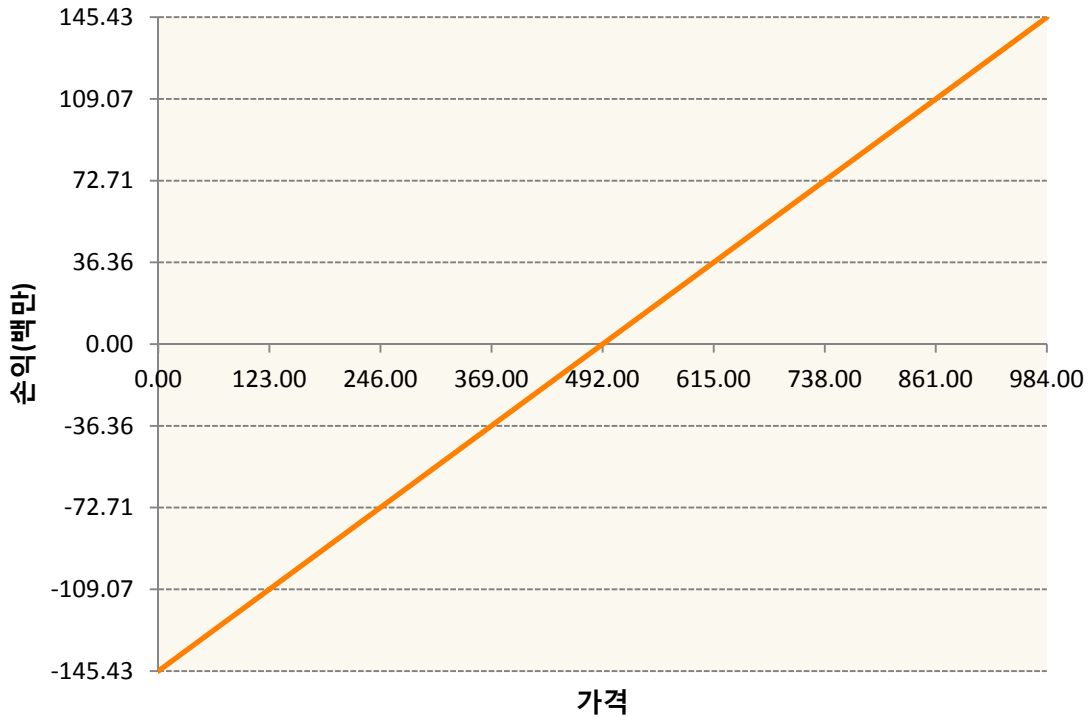
KCN0-COFFEE 'C' FUTURE Jul20



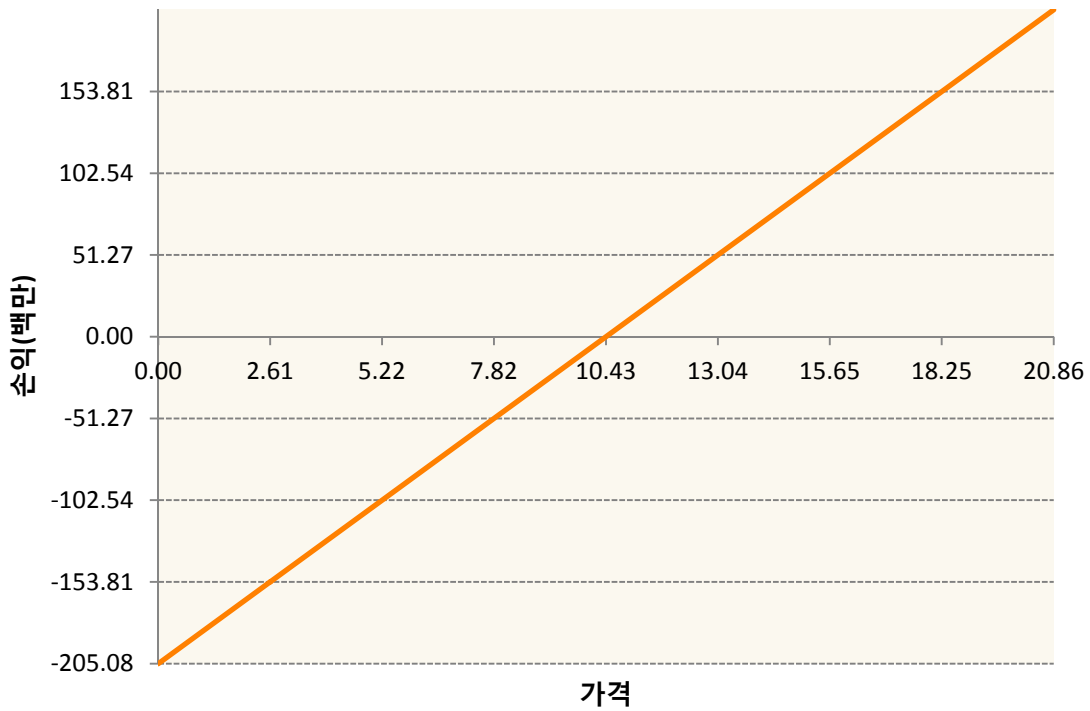
KR4175Q40008-2020-04 달러선물



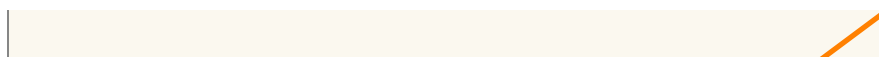
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20

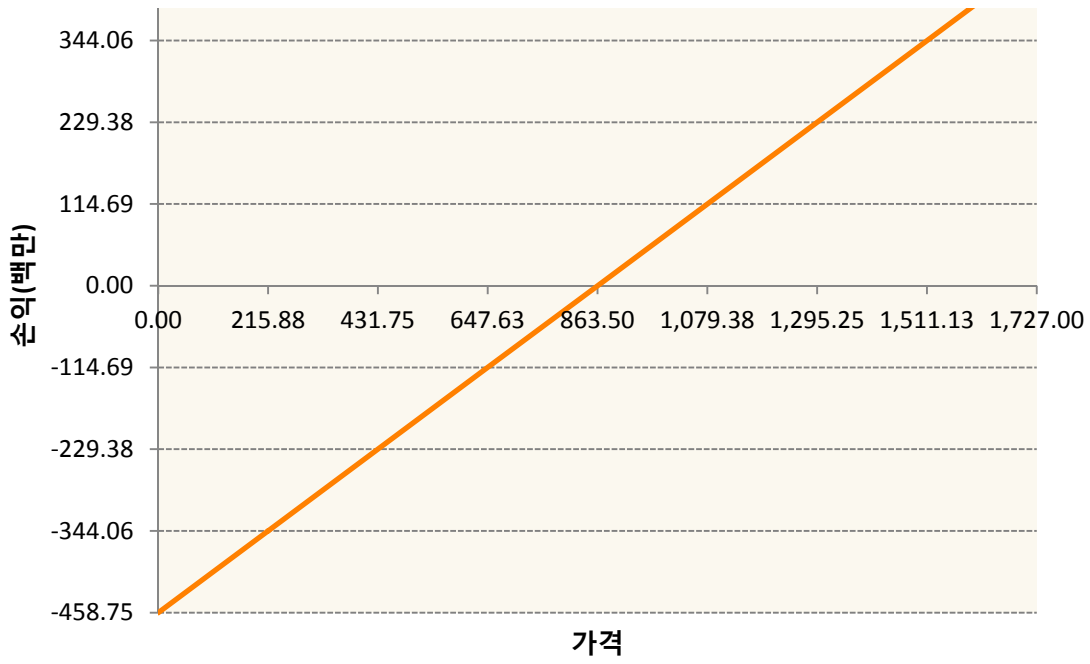


SBK0-Sugar May20

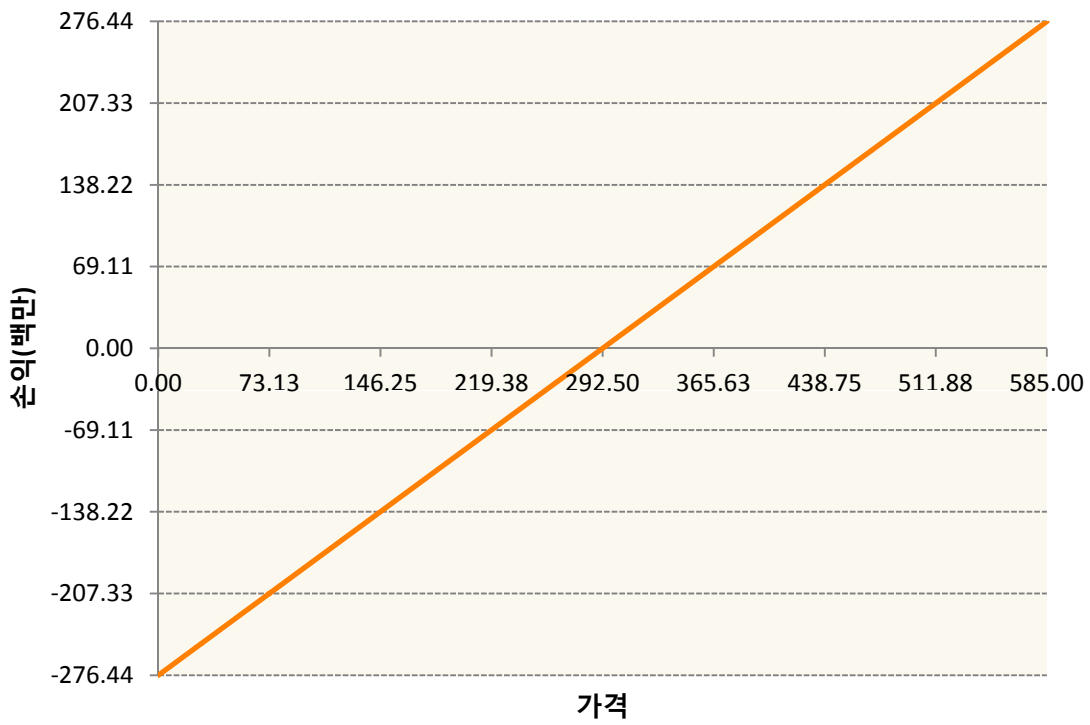


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



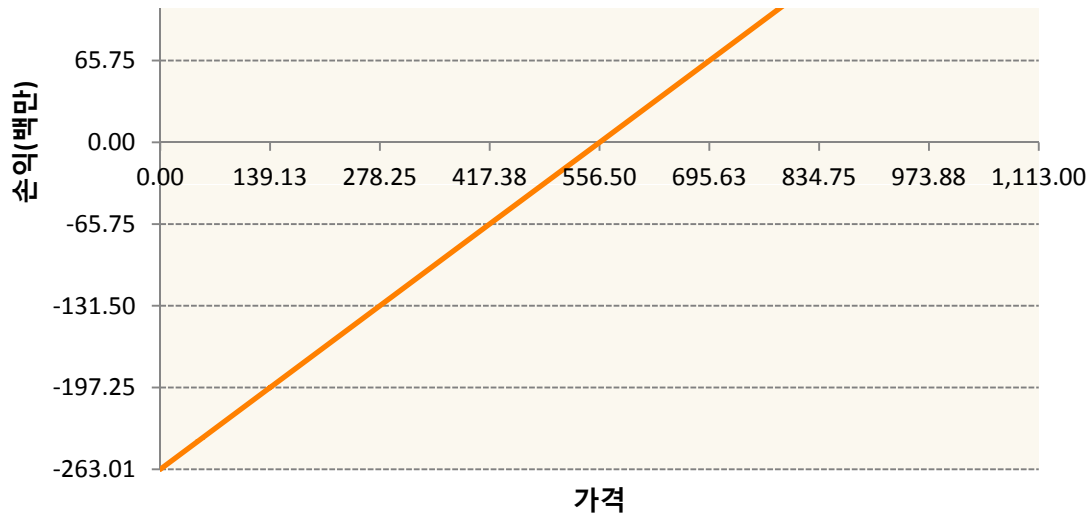


SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20



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 | 8 |
| KCK0 | COFFEE 'C' FUTURE May20 | 17 |
| KCN0 | COFFEE 'C' FUTURE Jul20 | 4 |
| KR4175Q40C | 2020-04 달러선물 | 8 |
| KWK0 | KC HRW WHEAT FUT May20 | 12 |
| SBK0 | Sugar May20 | 16 |
| SK0 | SOYBEAN FUTURE May20 | 37 |
| SMK0 | SOYBEAN MEAL FUTR May20 | 22 |
| WK0 | WHEAT FUTURE(CBT) May20 | 21 |

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

(단위:백만원)

222