

공시일	2020-04-14
기준일	2020-04-13

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	2020-04-14
기준일	2020-04-13

스마트인덱스모

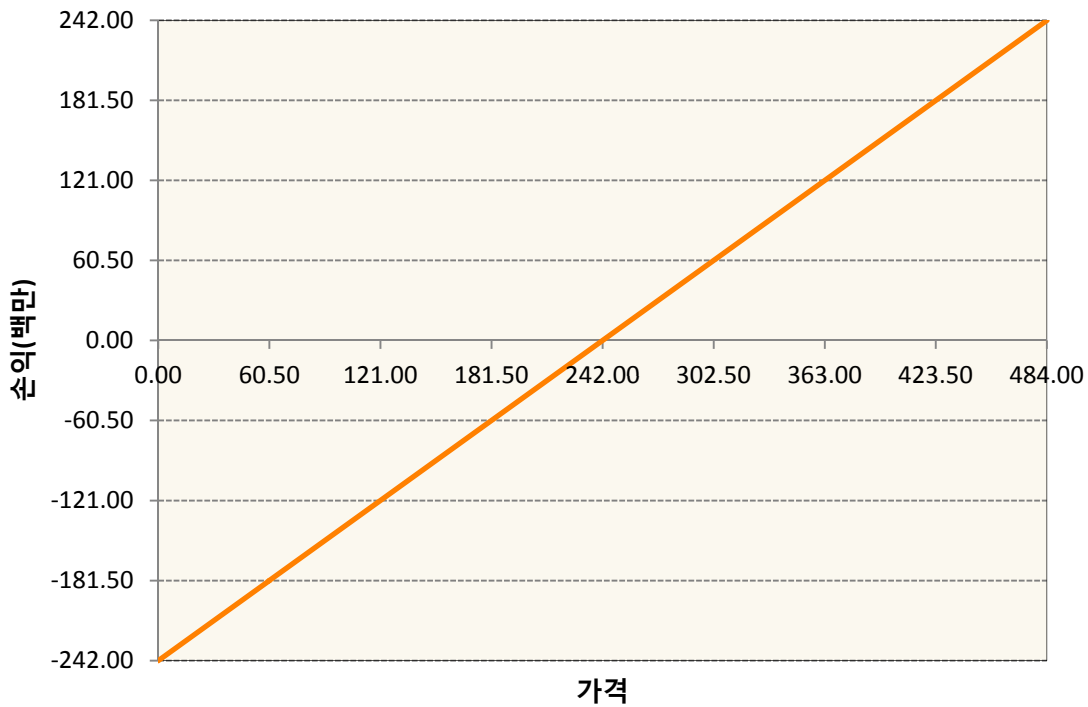
1. 계약금액

(단위:백만원)

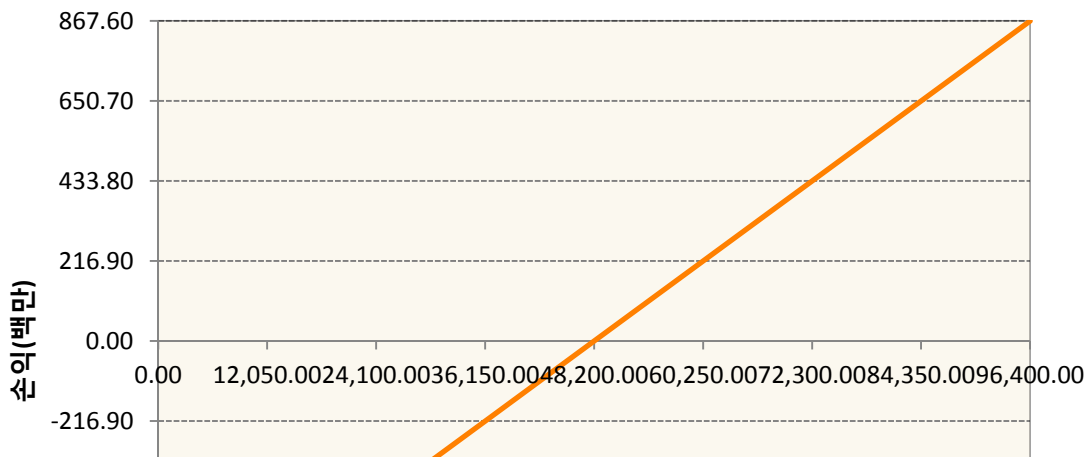
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,110	0	1,110	장내

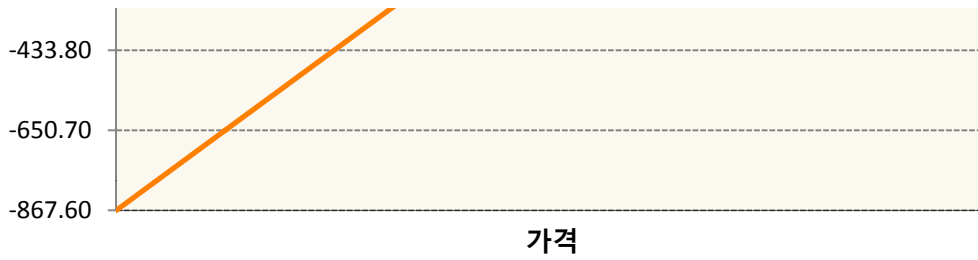
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



KR4111Q50002-2020-05 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						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	6	6	6	6	6	6	
5.33%	13	13	13	13	13	13	13	
8.00%	19	19	19	19	19	19	19	
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%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46	
-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%	46	46	46	46	46	46	46	
8.00%	70	70	70	70	70	70	70	

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

131

공시일	2020-04-14
기준일	2020-04-13

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)

1,095

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-14
기준일	2020-04-13

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

540

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

854

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-14
기준일	2020-04-13

유로인덱스모(주식-파생형)

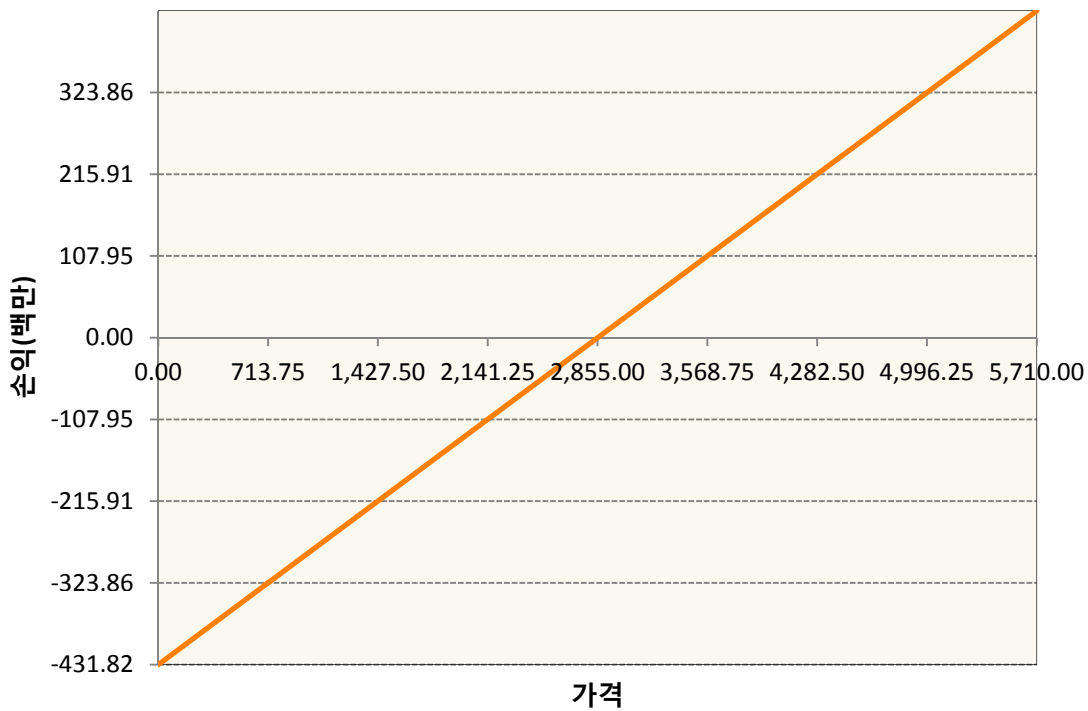
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	432	0	432	

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	2020-04-14
기준일	2020-04-13

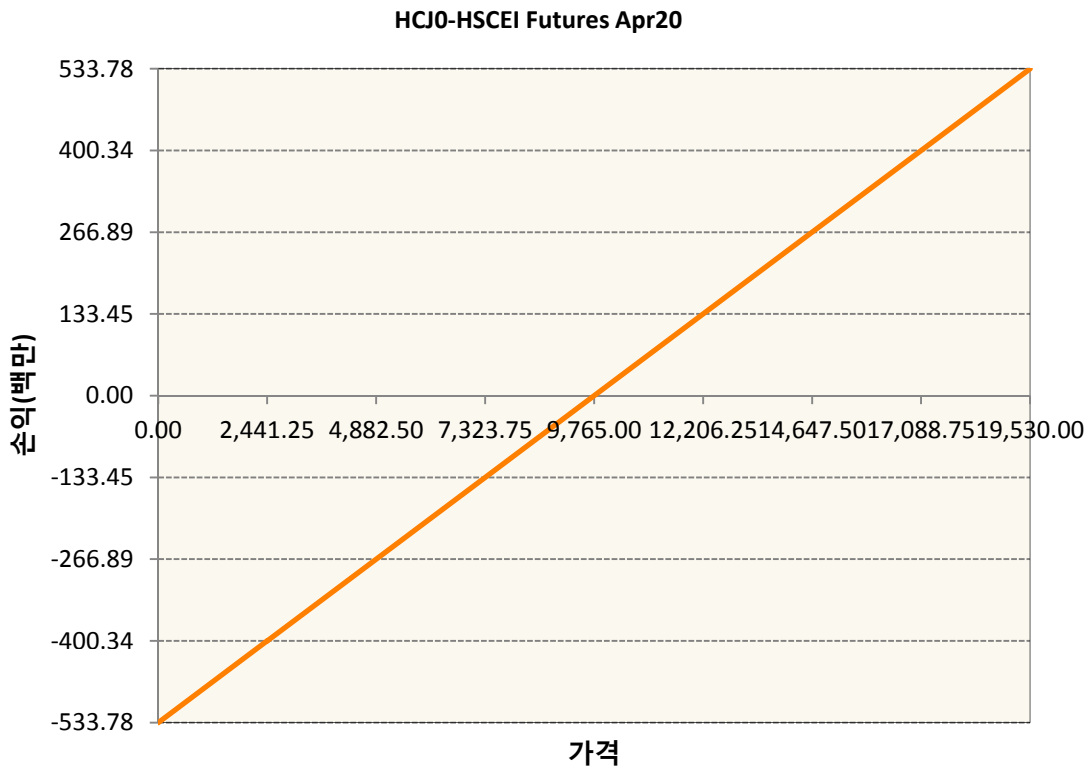
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2020-04-14
기준일	2020-04-13

커버드콜모(주식혼합-파생형)

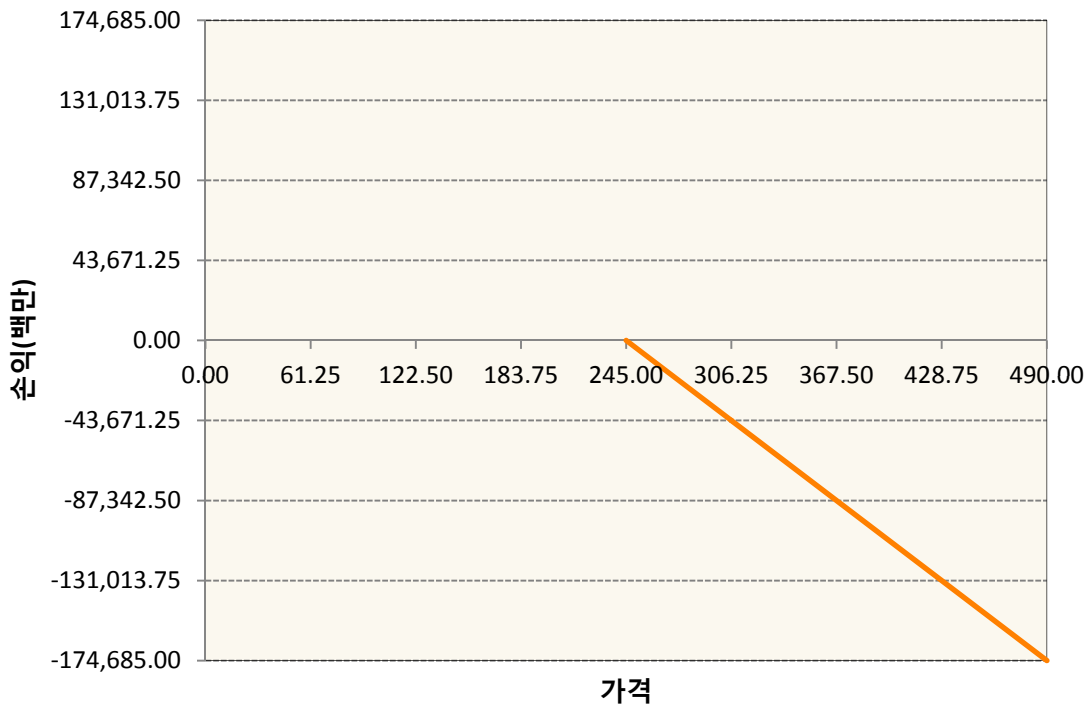
1. 계약금액

(단위:백만원)

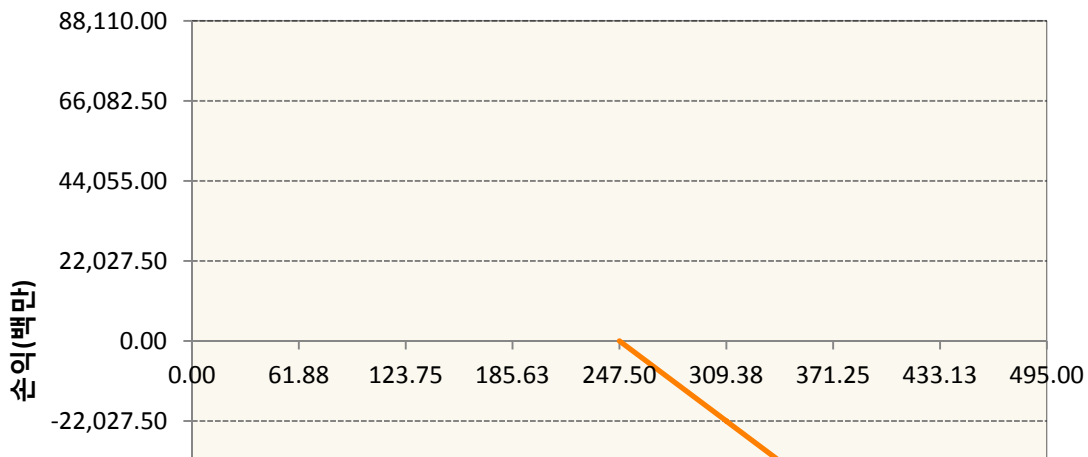
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	358,345	-358,345	장내

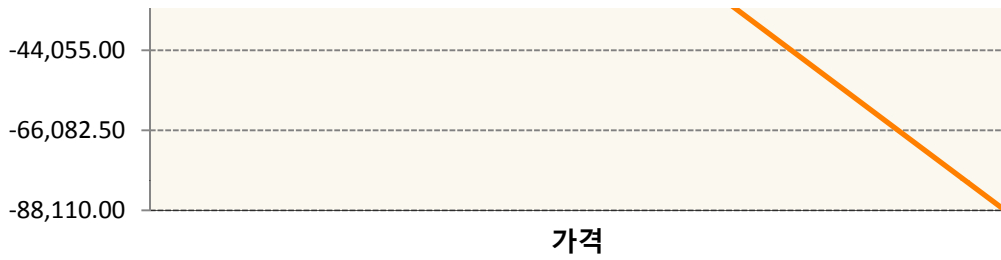
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q52452-2020-05 콜245

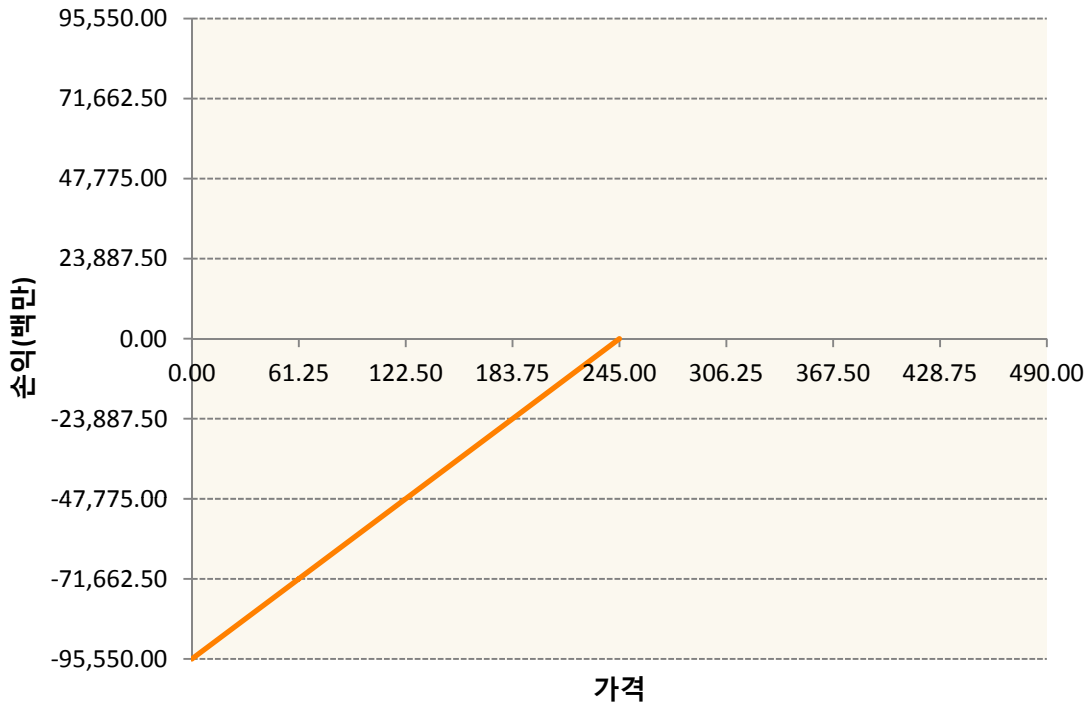


KR4201Q52478-2020-05 콜247.5





KR4301Q52450-2020-05 풋245



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q52452		2020-05 콜245					10,924
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,510	6,894	6,243	5,567	4,869	4,154	3,426
-5.33%	6,284	5,552	4,803	4,039	3,264	2,481	1,690
-2.67%	4,652	3,835	3,013	2,185	1,355	521	-314
0%	2,588	1,725	862	0	-862	-1,724	-2,586
2.67%	88	-778	-1,644	-2,512	-3,381	-4,250	-5,119
5.33%	-2,826	-3,654	-4,492	-5,337	-6,189	-7,045	-7,904
8.00%	-6,115	-6,872	-7,654	-8,453	-9,266	-10,091	-10,924
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5					5,310
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,523	3,234	2,926	2,602	2,266	1,919	1,564

-5.33%	2,976	2,627	2,266	1,895	1,517	1,133	745
-2.67%	2,238	1,839	1,436	1,029	619	207	-207
0%	1,288	860	430	0	-430	-861	-1,292
2.67%	123	-315	-754	-1,192	-1,631	-2,069	-2,507
5.33%	-1,252	-1,680	-2,110	-2,543	-2,977	-3,412	-3,849
8.00%	-2,822	-3,220	-3,627	-4,041	-4,460	-4,884	-5,310
KR4301Q52450 2020-05 풋245							5,666
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,072	-4,299	-4,545	-4,808	-5,084	-5,371	-5,666
-5.33%	-2,073	-2,367	-2,674	-2,989	-3,312	-3,640	-3,974
-2.67%	-329	-676	-1,028	-1,382	-1,740	-2,099	-2,460
0%	1,127	752	376	0	-376	-752	-1,128
2.67%	2,286	1,911	1,535	1,158	781	403	24
5.33%	3,163	2,816	2,462	2,103	1,740	1,374	1,005
8.00%	3,793	3,494	3,179	2,853	2,518	2,175	1,826

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

(단위:백만원)

17,452

공시일	2020-04-14
기준일	2020-04-13

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

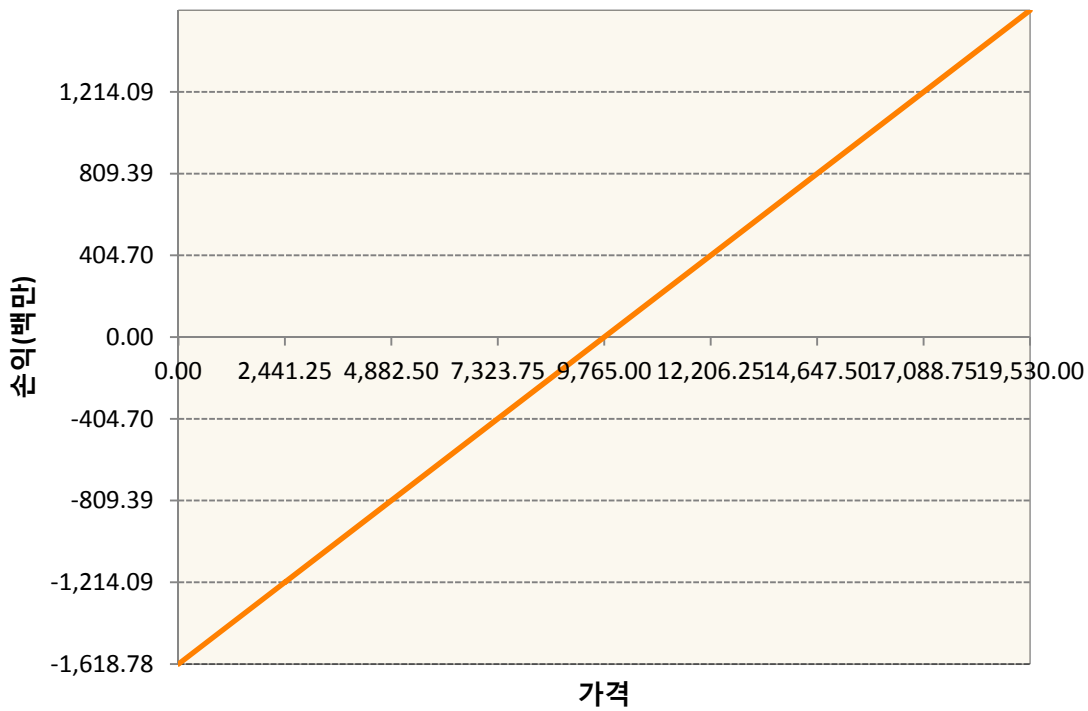
1. 계약금액

(단위:백만원)

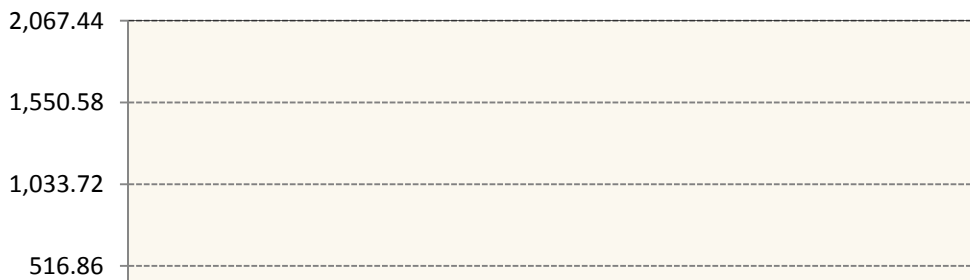
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,619	0	1,619	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,136	-4,136	장내
누계	통화	선도	691	2,212	-1,521	장외

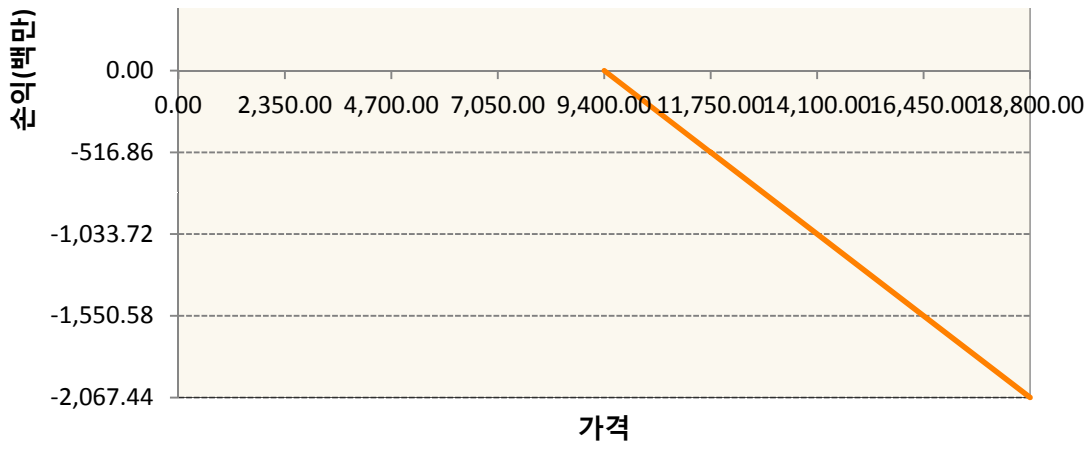
2. 만기시점의 손익구조

HCJ0-HSCEI Futures Apr20

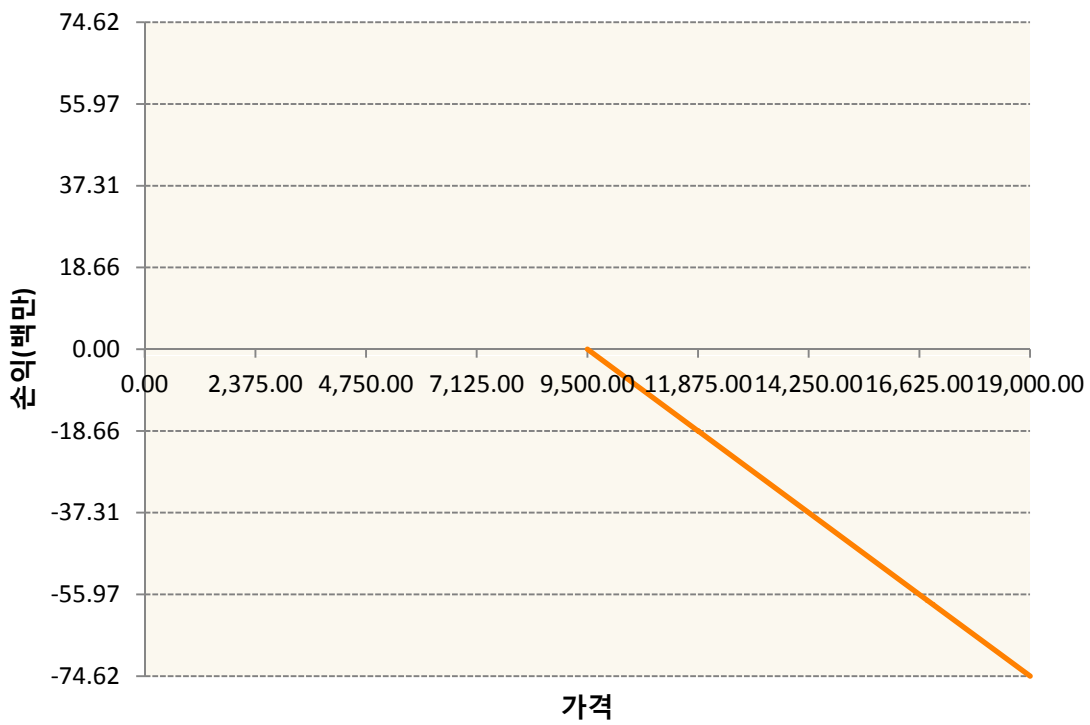


OHHIJ0-C94-HSCEI

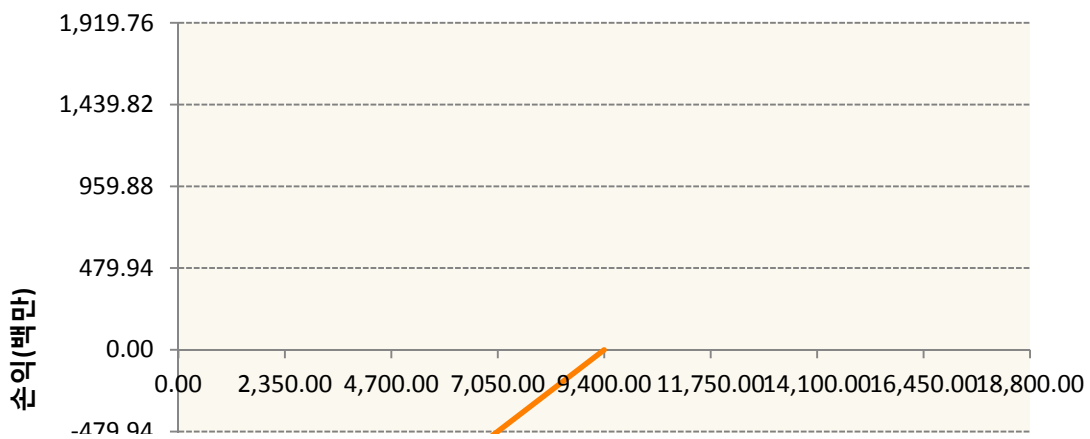


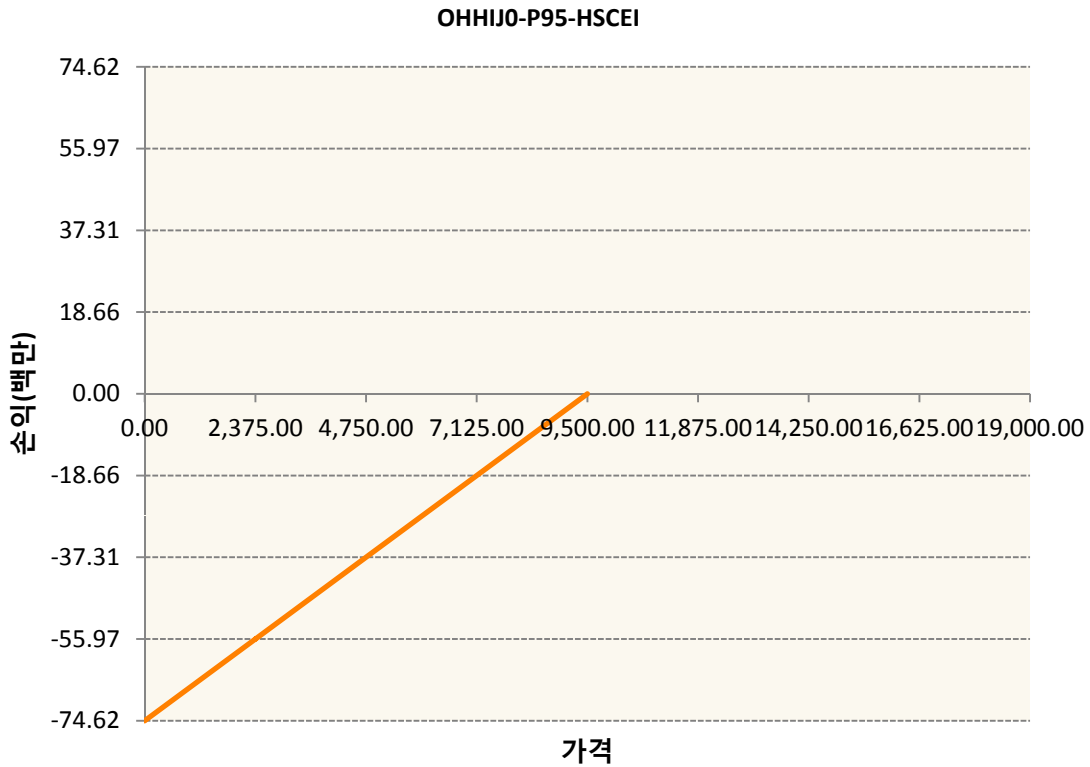


OHHIJO-C95-HSCEI



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	129
OHHIJ0-C94 HSCEI	165
OHHIJ0-C95 HSCEI	6
OHHIJ0-P94 HSCEI	154
OHHIJ0-P95 HSCEI	6

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	610

공시일	2020-04-14
기준일	2020-04-13

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

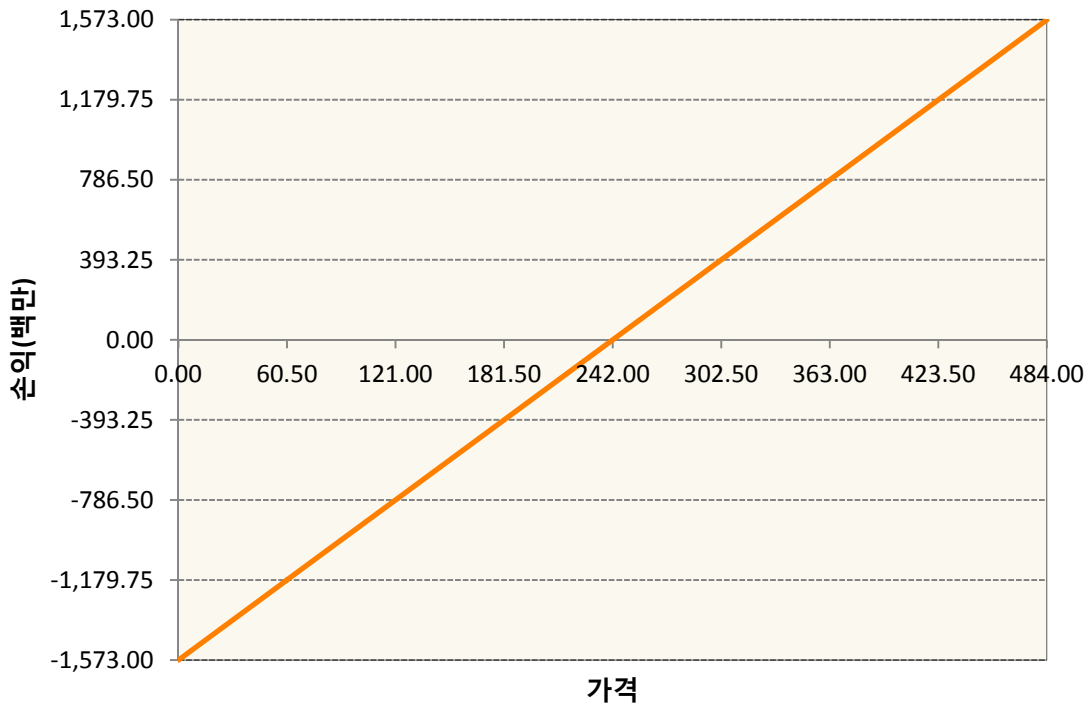
1. 계약금액

(단위:백만원)

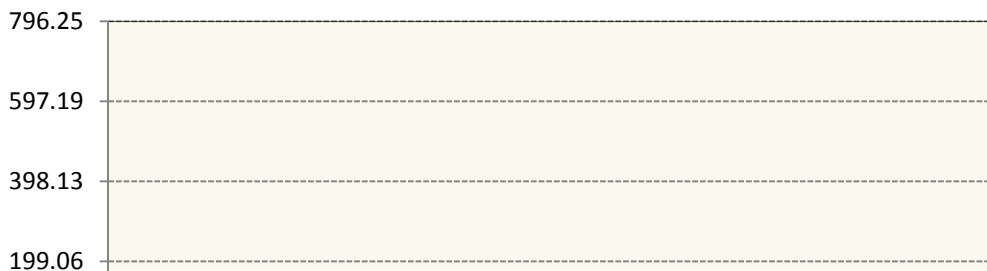
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,573	0	1,573	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,193	-3,193	장내

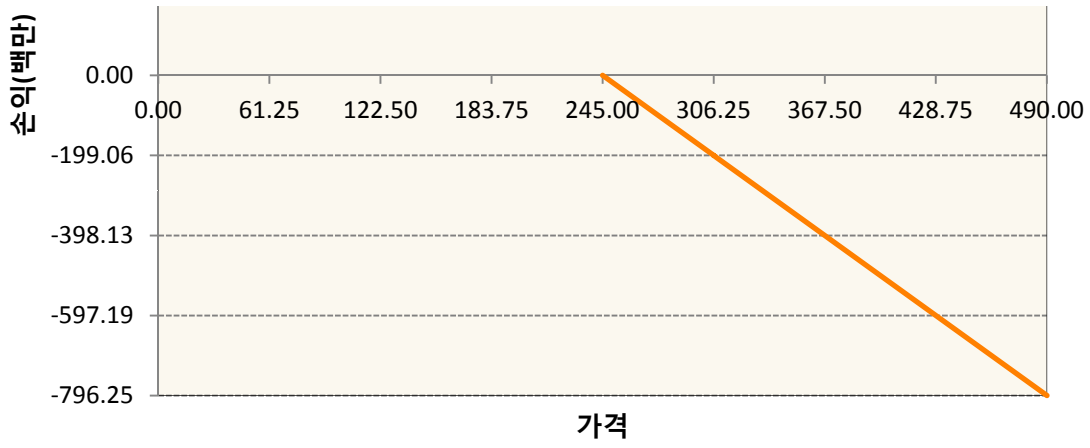
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

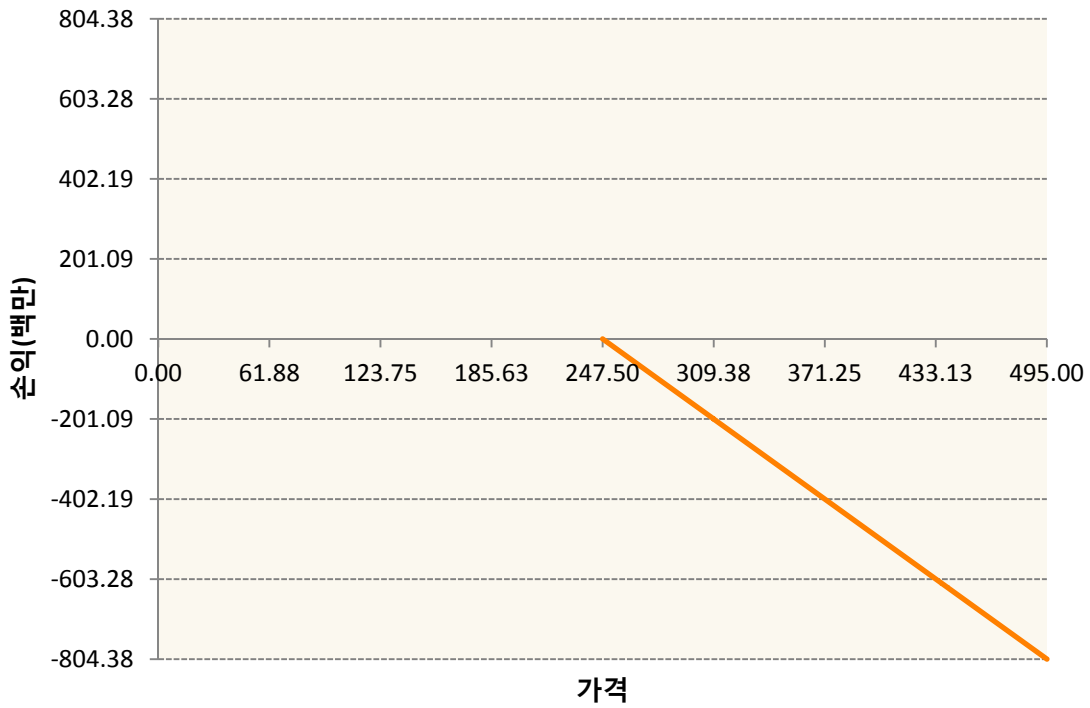


KR4201Q52452-2020-05 콜245

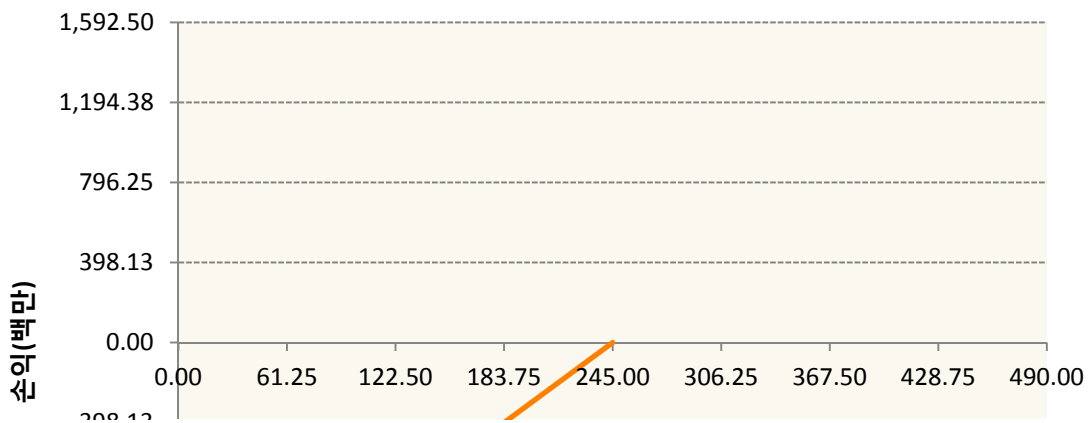




KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



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						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%	-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%	127	127	127	127	127	127	127	
KR4201Q52452		2020-05 콜245						50
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	34	31	28	25	22	19	16	
-5.33%	29	25	22	18	15	11	8	
-2.67%	21	17	14	10	6	2	-1	
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12	
2.67%	0	-4	-7	-11	-15	-19	-23	
5.33%	-13	-17	-20	-24	-28	-32	-36	
8.00%	-28	-31	-35	-39	-42	-46	-50	
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5						48
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	32	30	27	24	21	18	14
-5.33%	27	24	21	17	14	10	7
-2.67%	20	17	13	9	6	2	-2
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12
2.67%	1	-3	-7	-11	-15	-19	-23
5.33%	-11	-15	-19	-23	-27	-31	-35
8.00%	-26	-29	-33	-37	-41	-45	-48
KR4301Q52450 2020-05 풋245							94
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-68	-72	-76	-80	-85	-90	-94
-5.33%	-35	-39	-45	-50	-55	-61	-66
-2.67%	-5	-11	-17	-23	-29	-35	-41
0%	19	13	6	0	-6	-13	-19
2.67%	38	32	26	19	13	7	0
5.33%	53	47	41	35	29	23	17
8.00%	63	58	53	48	42	36	30

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

(단위:백만원)

527

공시일	2020-04-14
기준일	2020-04-13

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

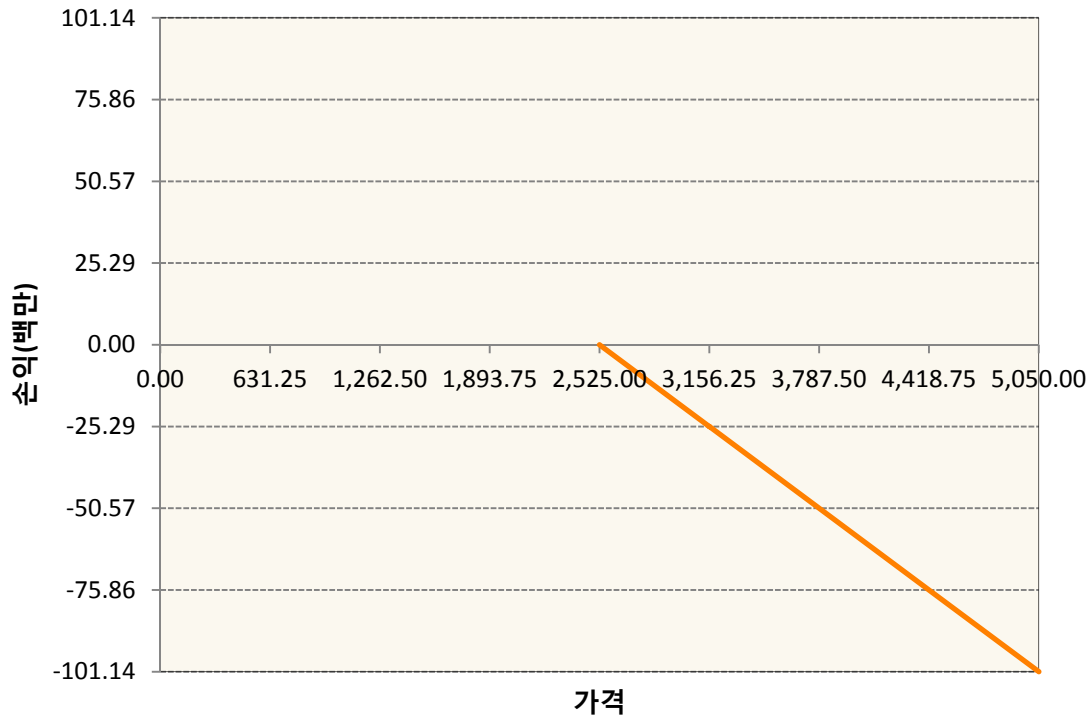
1. 계약금액

(단위:백만원)

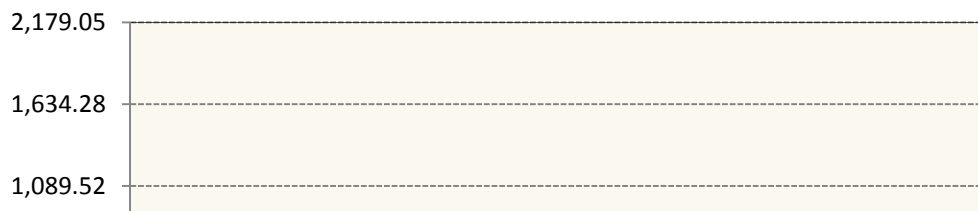
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	348	0	348	
누계	유가증권	스왑	7,584	0	7,584	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,594	-4,594	장내
누계	통화	선도	0	2,702	-2,702	장외

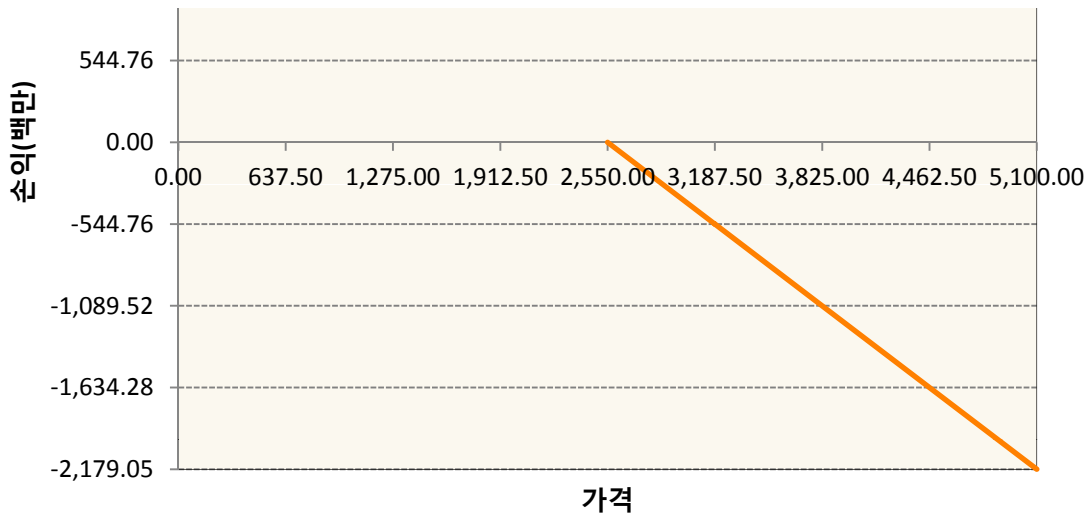
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ0-C2525-EURO STOXX 50

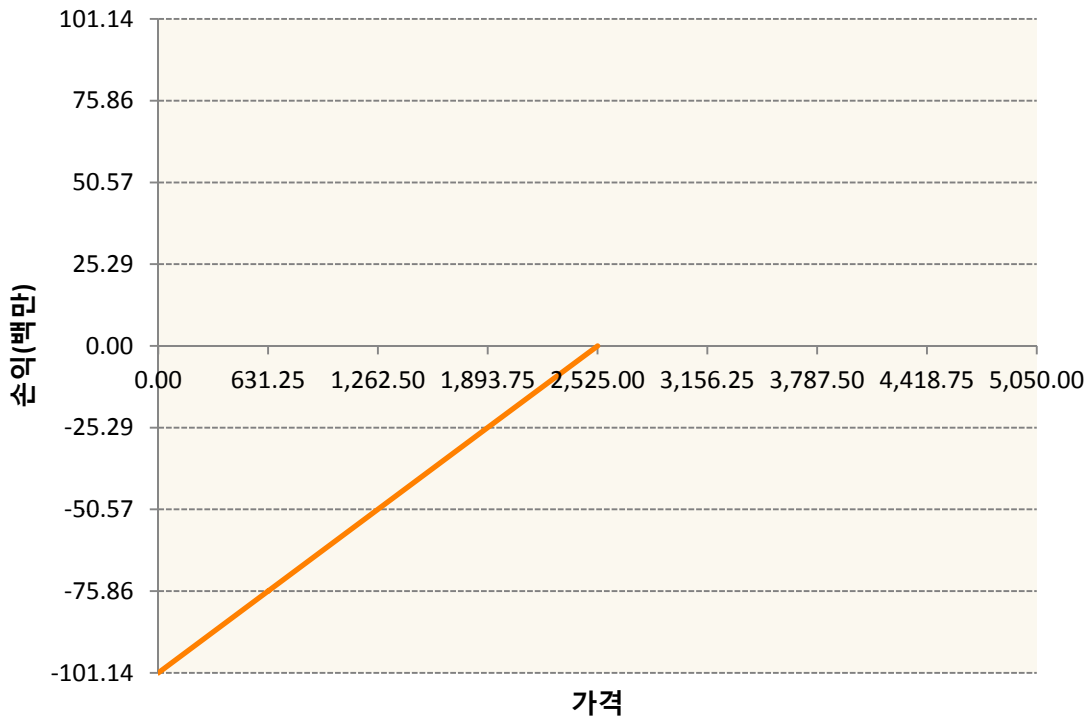


OESXJ0-C2550-EURO STOXX 50

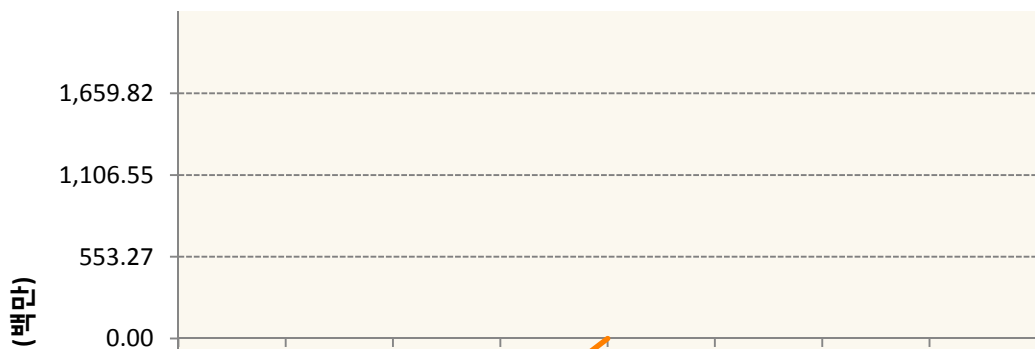


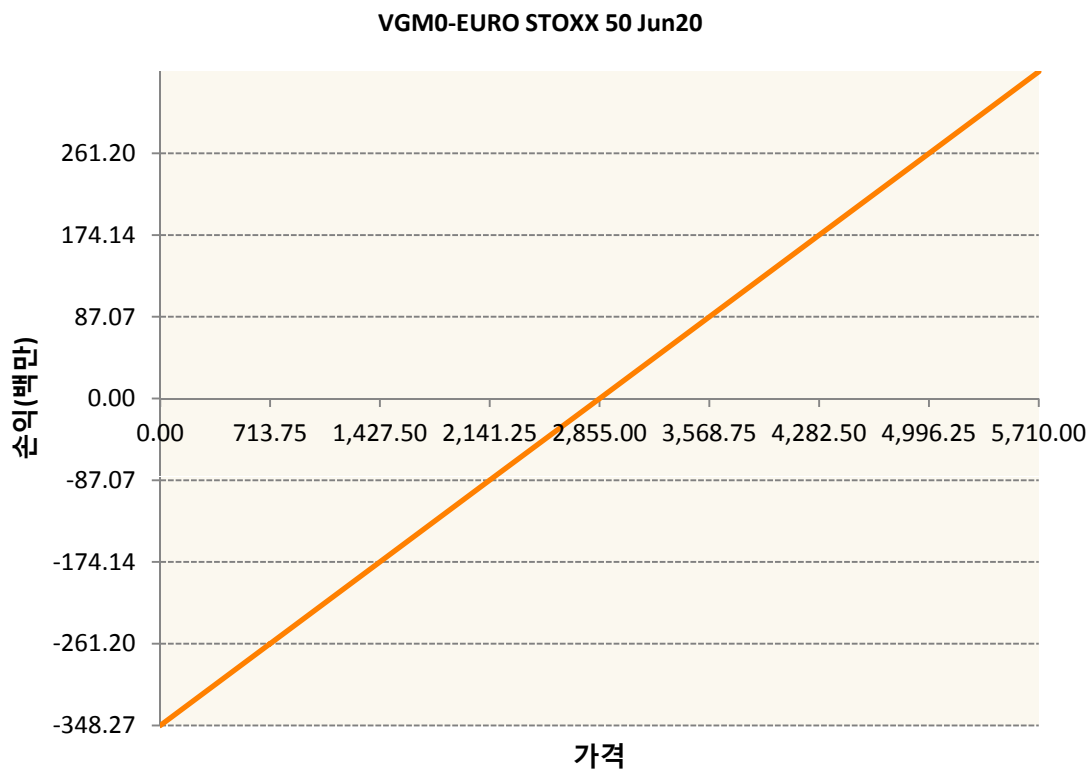
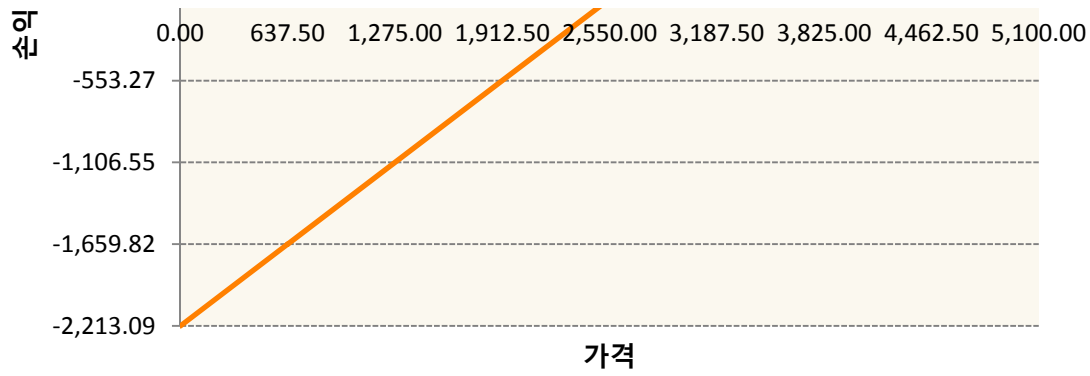


OESXJ0-P2525-EURO STOXX 50



OESXJ0-P2550-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	29
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E	216
OESXJ0-C25: EURO STOXX 50	8
OESXJ0-C25: EURO STOXX 50	174
OESXJ0-P25: EURO STOXX 50	8
OESXJ0-P25! EURO STOXX 50	177
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20	28

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

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

(단위:백만원)

1,068

공시일	2020-04-14
기준일	2020-04-13

ETF스마트레버리지목표전환형9호

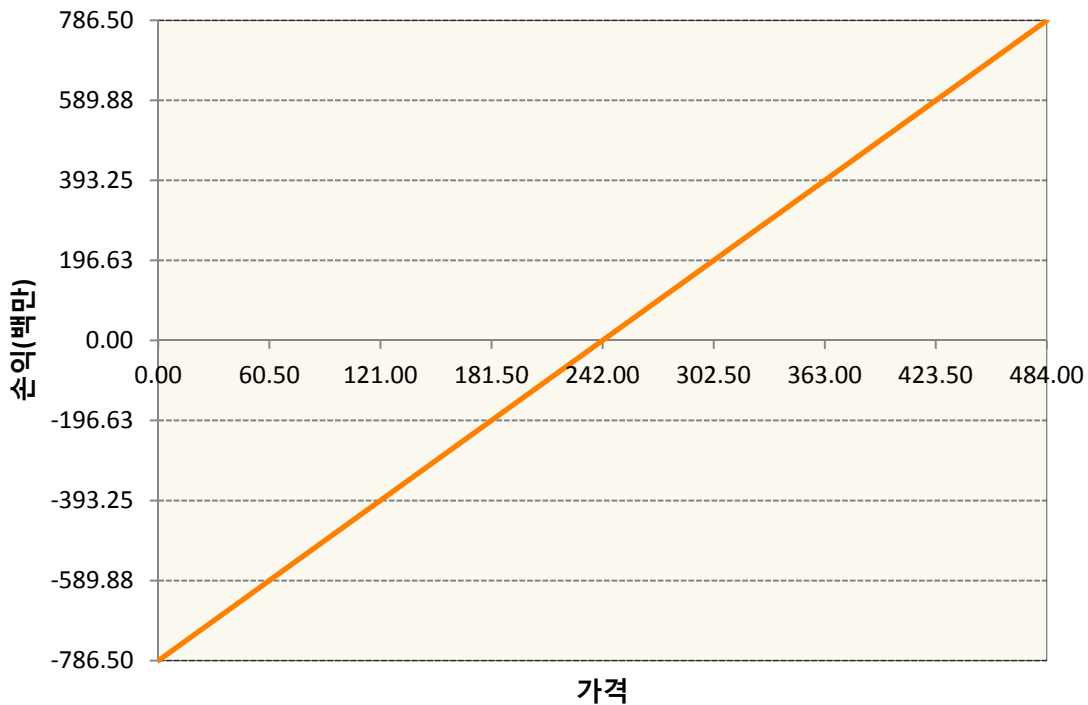
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	787	0	787	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						63
가격	기초자산의 변동성							
	-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)

93

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

(단위:백만원)

135

공시일	2020-04-14
기준일	2020-04-13

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

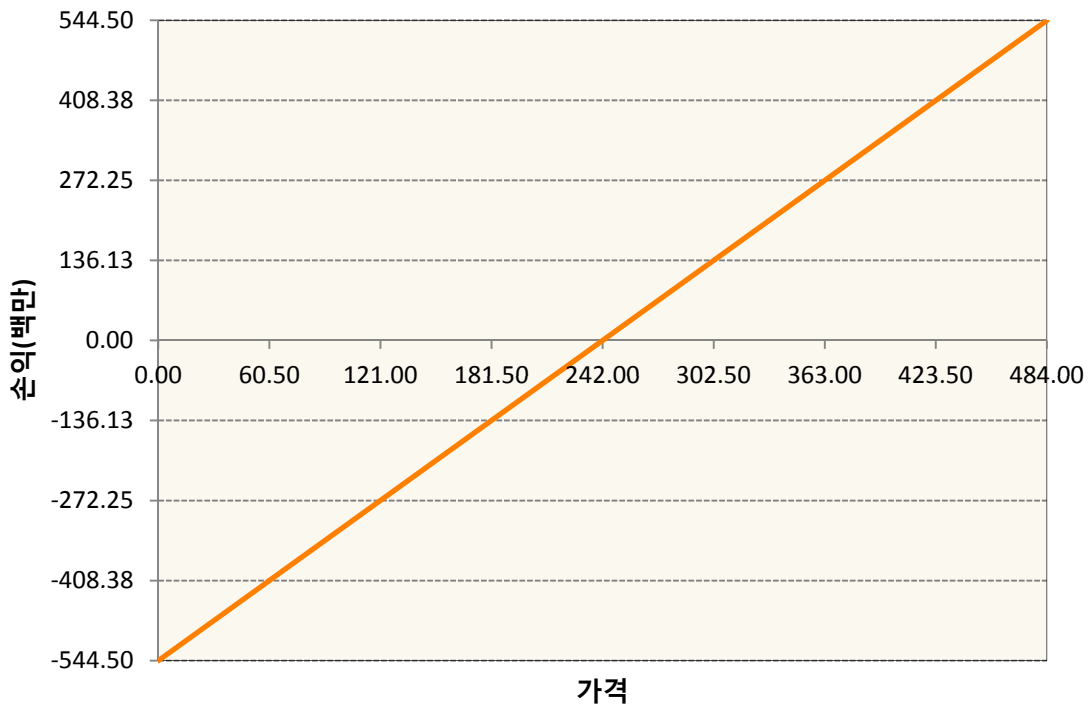
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	545	0	545	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	2020-04-14
기준일	2020-04-13

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

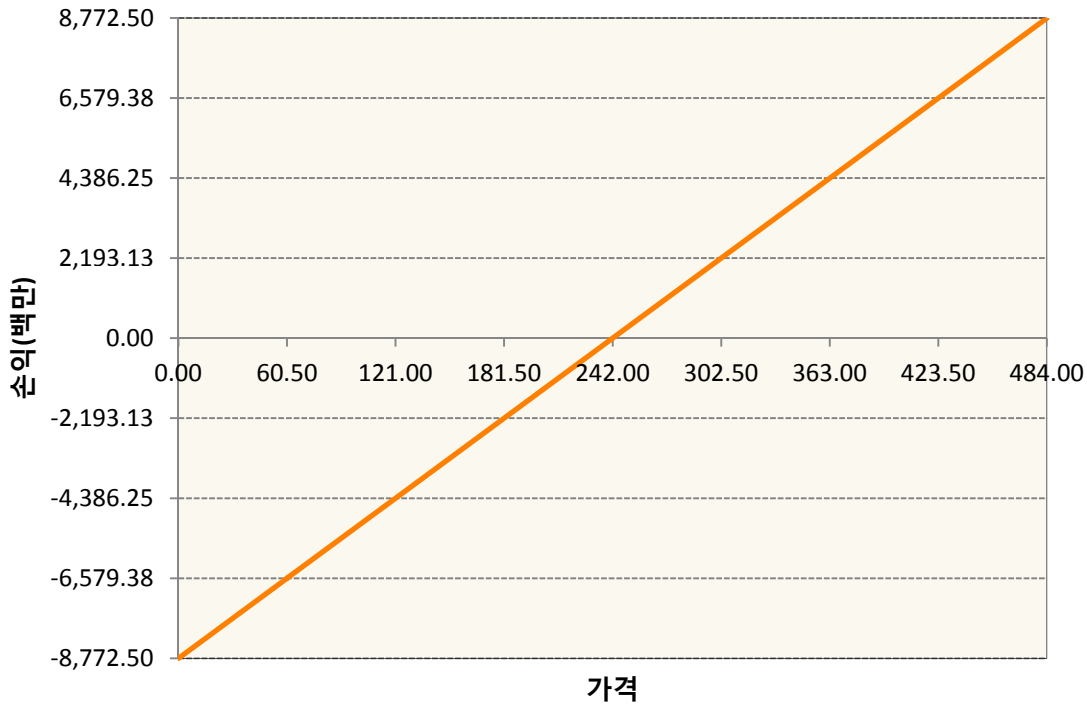
1. 계약금액

(단위:백만원)

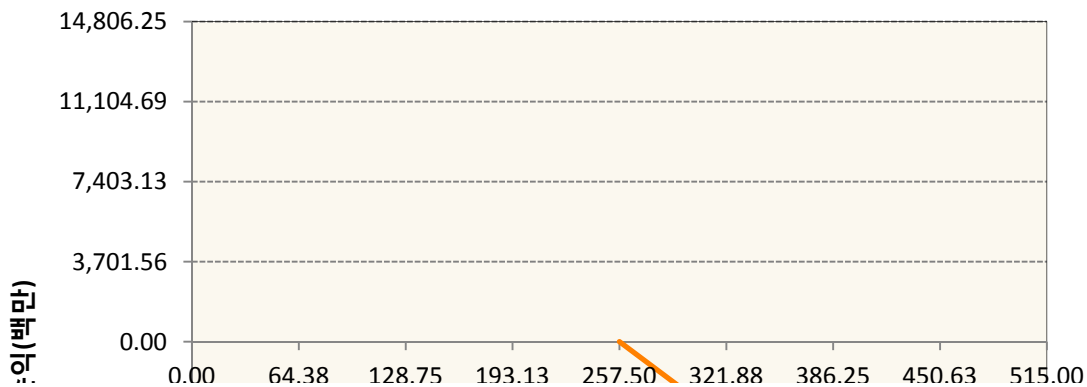
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,773	0	8,773	장내
누계	유가증권	옵션	6,201	17,536	-11,335	장내

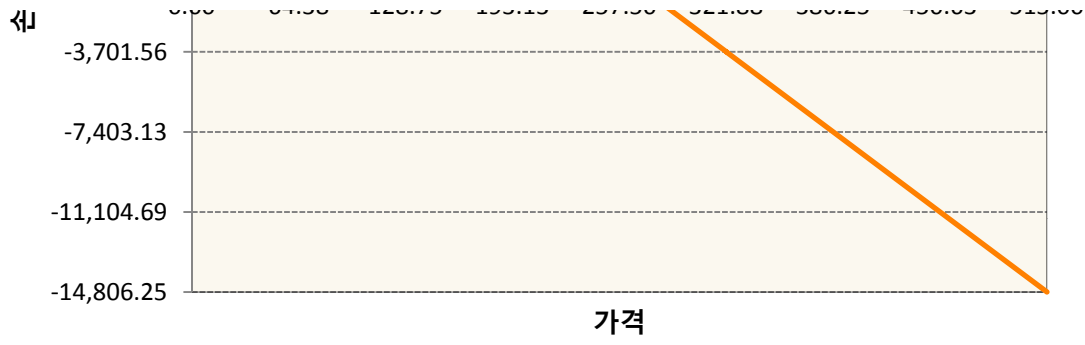
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

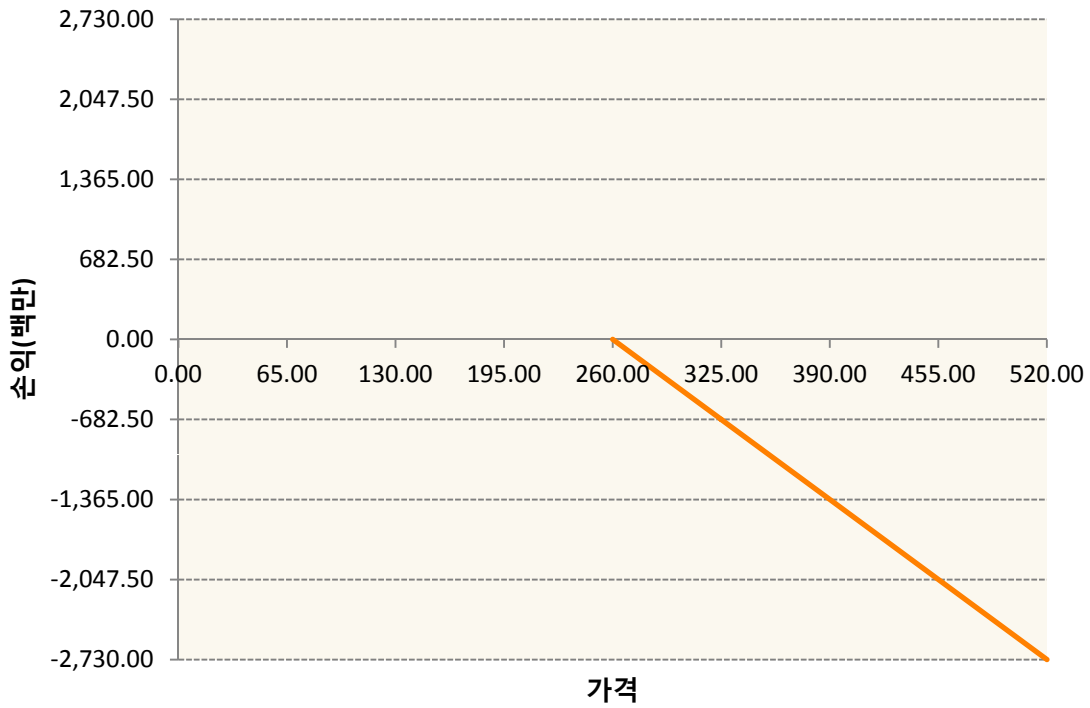


KR4201Q52577-2020-05 콜257.5

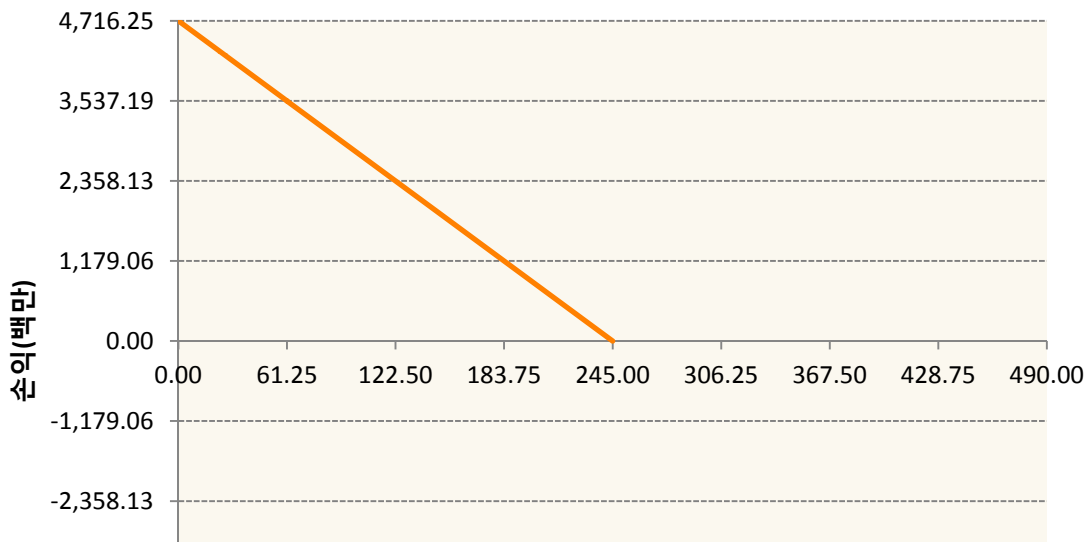


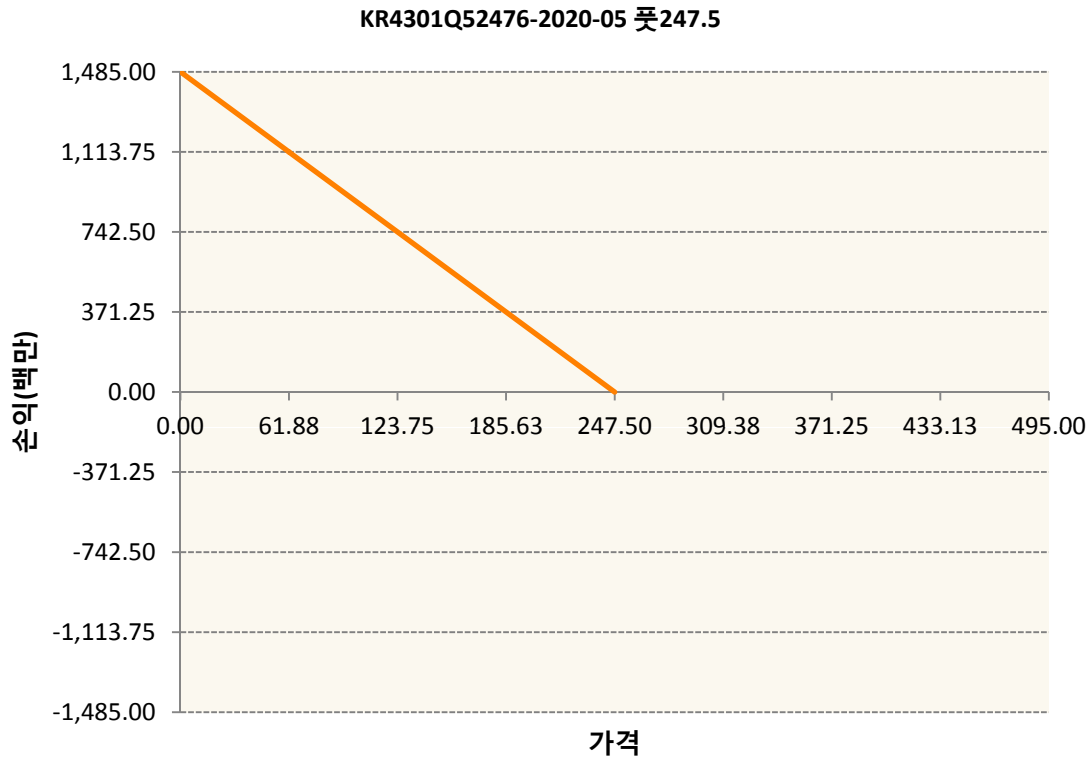
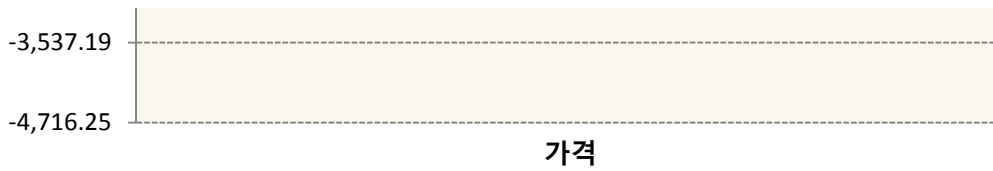


KR4201Q52601-2020-05 콜260



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						706
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-706	-706	-706	-706	-706	-706	-706	
-5.33%	-471	-471	-471	-471	-471	-471	-471	
-2.67%	-235	-235	-235	-235	-235	-235	-235	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	235	235	235	235	235	235	235	
5.33%	471	471	471	471	471	471	471	
8.00%	706	706	706	706	706	706	706	
KR4201Q52577		2020-05 콜257.5						758
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	430	396	357	315	270	221	171	
-5.33%	376	332	284	233	179	124	67	
-2.67%	299	245	188	128	68	6	-57	

0%	194	131	66	0	-67	-134	-202
2.67%	57	-13	-83	-154	-224	-296	-367
5.33%	-113	-186	-259	-333	-406	-479	-552
8.00%	-317	-390	-463	-537	-610	-684	-758
KR4201Q52601 2020-05 콜260							134
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	73	67	60	53	45	37	28
-5.33%	64	57	48	39	30	20	10
-2.67%	52	42	32	22	11	0	-11
0%	34	23	12	0	-12	-24	-36
2.67%	12	-1	-14	-26	-39	-52	-65
5.33%	-17	-31	-44	-57	-71	-84	-97
8.00%	-52	-66	-79	-93	-106	-120	-134
KR4301Q52450 2020-05 풋245							280
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	201	212	224	237	251	265	280
-5.33%	102	117	132	148	163	180	196
-2.67%	16	33	51	68	86	104	121
0%	-56	-37	-19	0	19	37	56
2.67%	-113	-94	-76	-57	-39	-20	-1
5.33%	-156	-139	-122	-104	-86	-68	-50
8.00%	-187	-172	-157	-141	-124	-107	-90
KR4301Q52476 2020-05 풋247.5							90
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	67	70	74	78	82	86	90
-5.33%	35	39	44	49	53	58	63
-2.67%	7	12	17	23	28	33	39
0%	-17	-11	-6	0	6	12	17
2.67%	-37	-31	-25	-19	-13	-7	-1
5.33%	-52	-46	-41	-35	-29	-23	-18
8.00%	-63	-58	-53	-48	-42	-37	-31

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

(단위:백만원)

1,915

공시일	2020-04-14
기준일	2020-04-13

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	147,436	0	147,436	

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	2020-04-14
기준일	2020-04-13

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	99,414	0	99,414	

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	2020-04-14
기준일	2020-04-13

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	439,238	0	439,238	
누계	통화	선도	71,247	494,346	-423,098	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,352
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,949
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,897
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,280
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,949
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,436
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,027
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,027
FX21020H04 USD/KRW 21-04-20E	1,461
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,377
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	974
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	974
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,533
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	838
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	731
FX21020H09 USD/KRW 24-04-20E	731
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	487
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,410
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,918
FX21020H11 KRW/USD 11-05-20E	974
FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E	2,923
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

22,469

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

(단위:백만원)

184

공시일	2020-04-14
기준일	2020-04-13

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

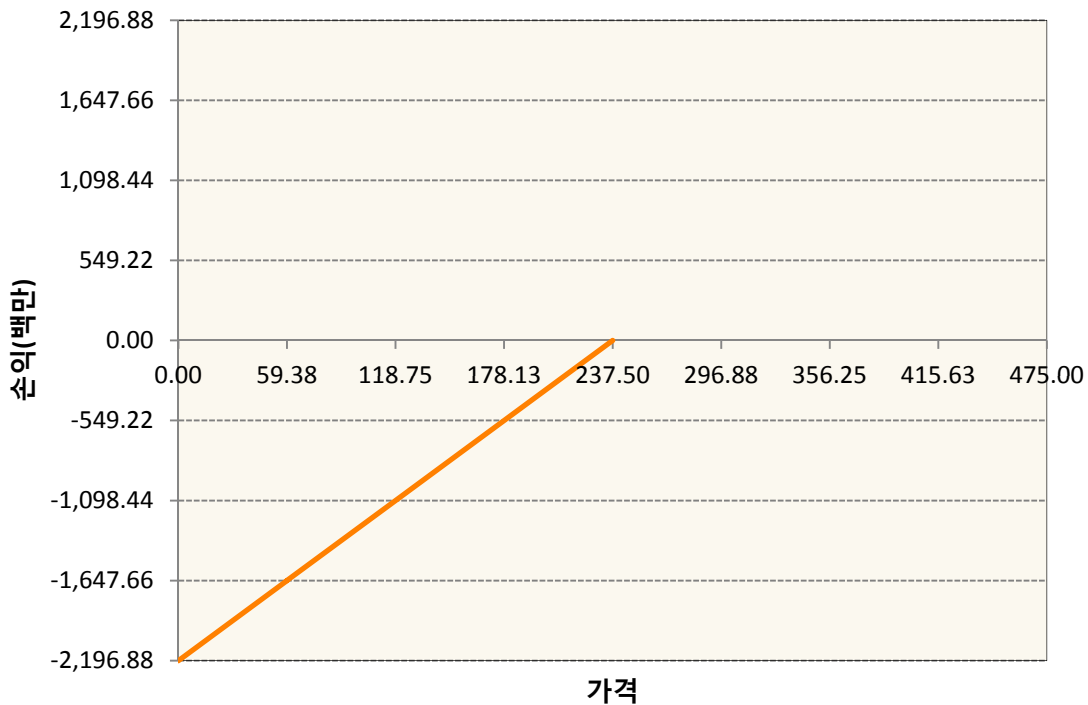
1. 계약금액

(단위:백만원)

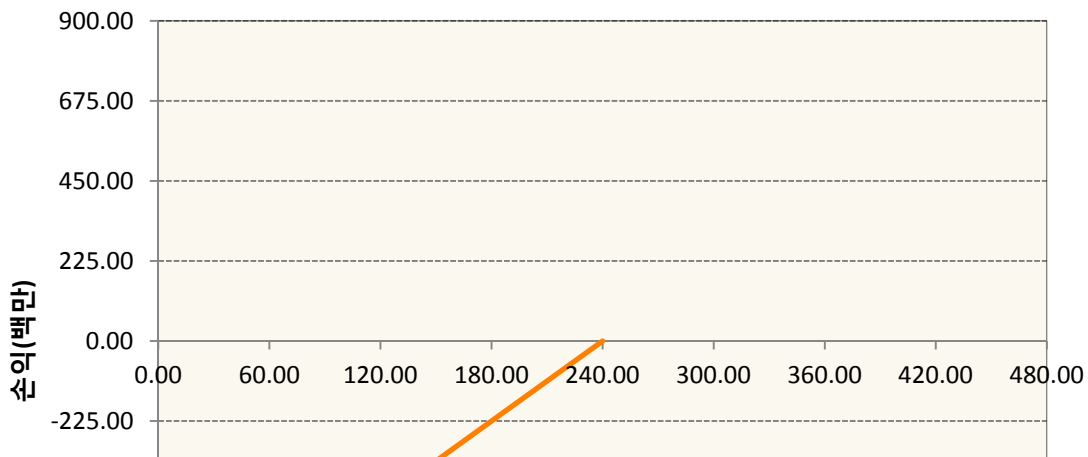
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,097	-3,097	장내

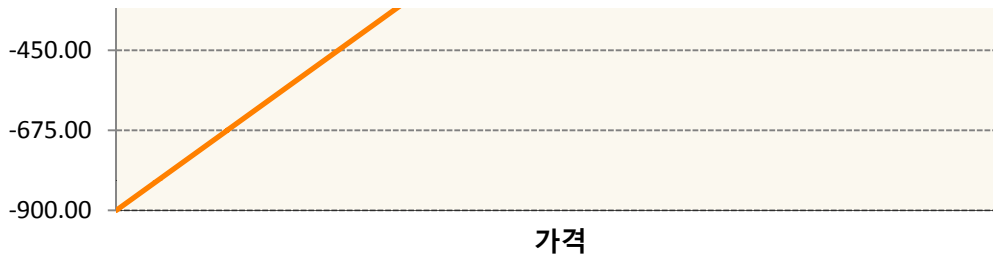
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q52377-2020-05 풋237.5



KR4301Q52401-2020-05 풋240





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q52377		2020-05 풋237.5						119
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-75	-82	-89	-96	-104	-111	-119	
-5.33%	-34	-42	-50	-59	-67	-75	-84	
-2.67%	-1	-9	-18	-27	-35	-44	-53	
0%	26	17	9	0	-9	-17	-26	
2.67%	45	38	30	21	13	5	-4	
5.33%	59	52	46	38	31	23	15	
8.00%	68	63	57	51	44	38	30	
KR4301Q52401		2020-05 풋240						50
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-33	-36	-39	-41	-44	-47	-50	
-5.33%	-16	-19	-22	-25	-29	-32	-35	
-2.67%	-1	-5	-8	-12	-15	-19	-22	
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11	
2.67%	20	16	13	9	6	3	-1	
5.33%	26	23	20	17	14	11	7	
8.00%	31	28	26	23	20	17	14	

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

137

공시일	2020-04-14
기준일	2020-04-13

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	7,240	0	7,240	
누계	통화	선도	0	7,125	-7,125	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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)

283

공시일	2020-04-14
기준일	2020-04-13

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

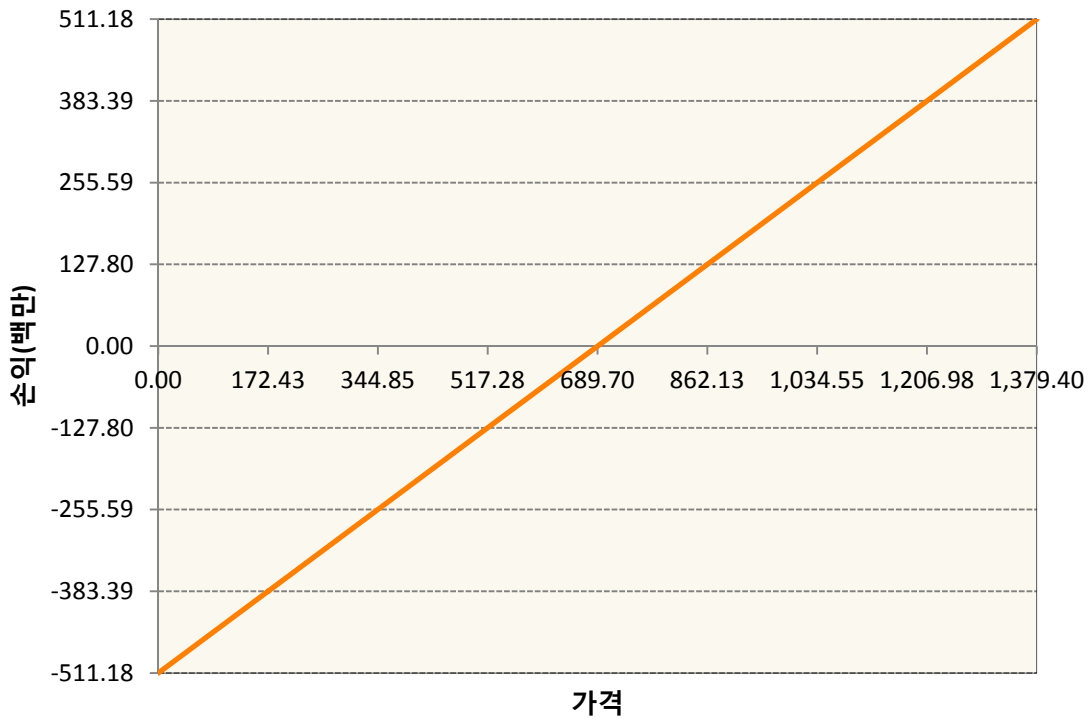
1. 계약금액

(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	511	0	511	
누계	유가증권	스왑	1,101	0	1,101	장외
누계	통화	선도	232	441	-208	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCJ0-VN30 Index Future Apr20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	88
FX21020F03(KRW/EUR 24-04-20E)	6
FX21020F04(EUR/KRW 24-04-20E)	2
FX21020G01(KRW/EUR 22-05-20E)	5
FX21020G05(KRW/EUR 26-06-20E)	12
FX21020H09(EUR/KRW 26-06-20E)	8

FX21020H11 EUR/KRW 26-06-20E
FX21020J00€ KRW/EUR 24-07-20E
FX21020J00€ KRW/EUR 24-07-20E
FX21020J01€ KRW/EUR 24-07-20E
VNCJ0 VN30 Index Future Apr20

9
3
5
3
41

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

(단위:백만원)

145

공시일	2020-04-14
기준일	2020-04-13

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

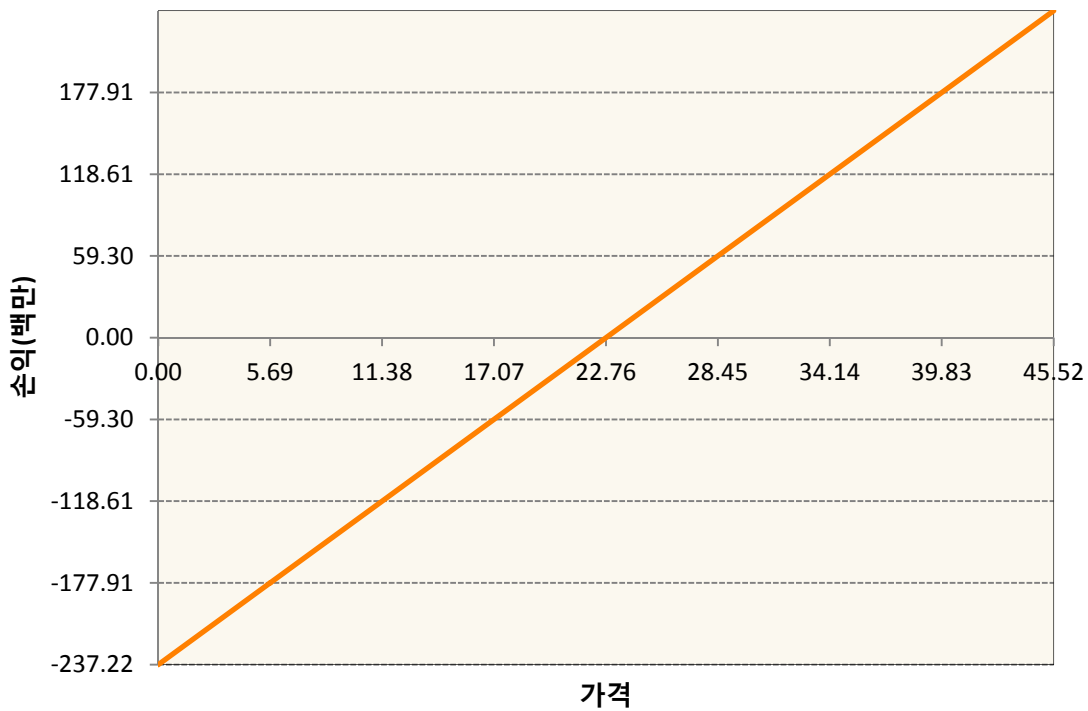
1. 계약금액

(단위:백만원)

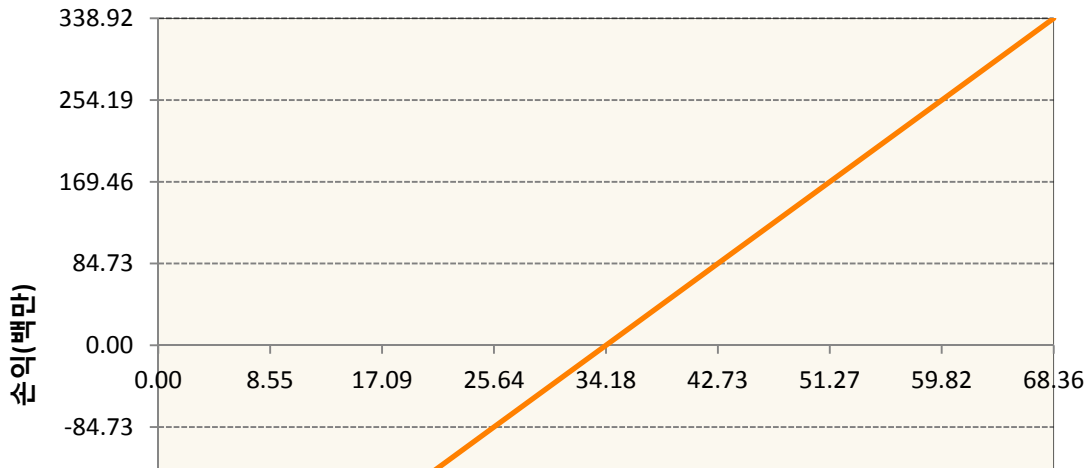
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,414	243	1,170	

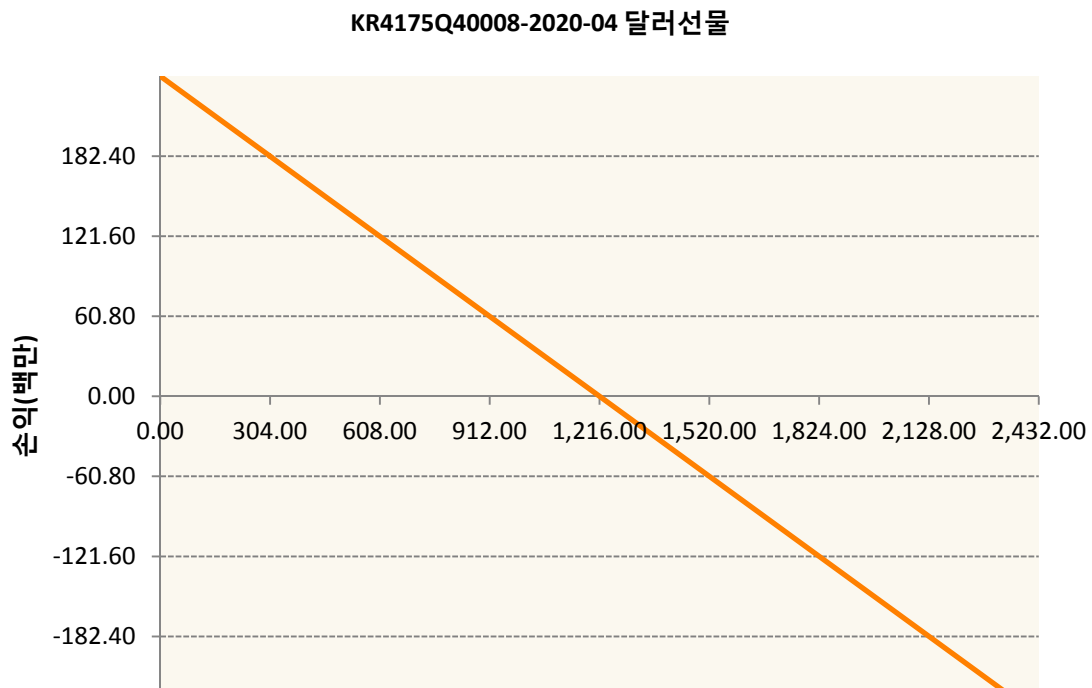
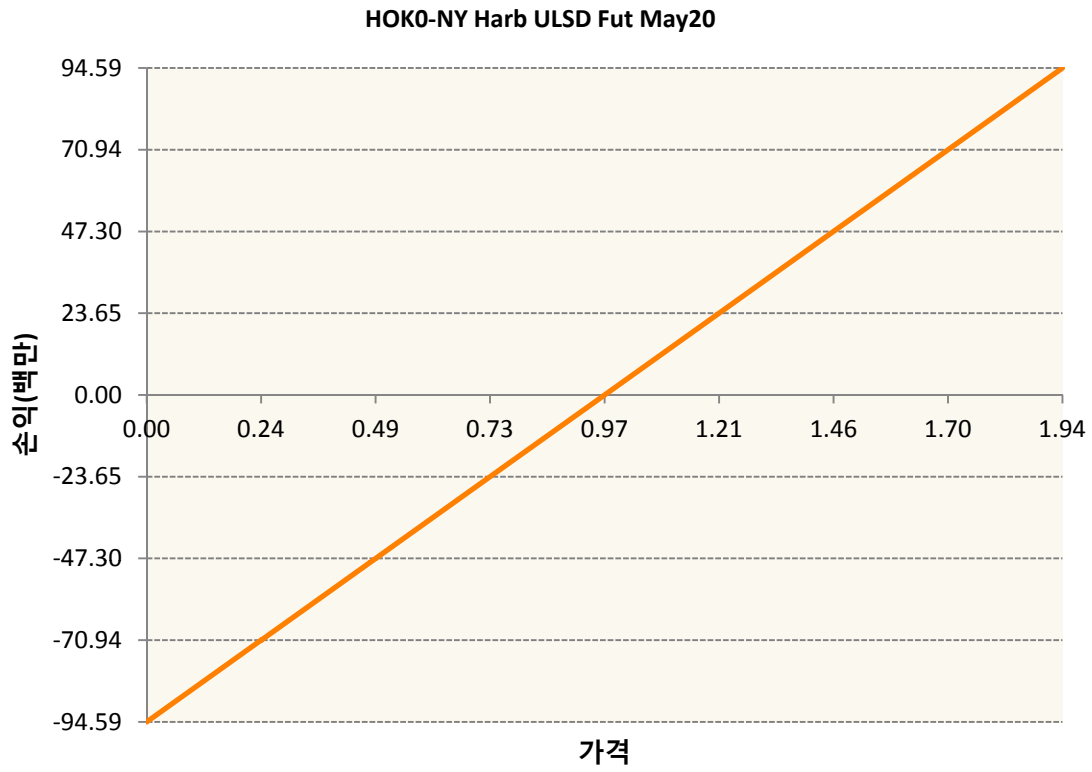
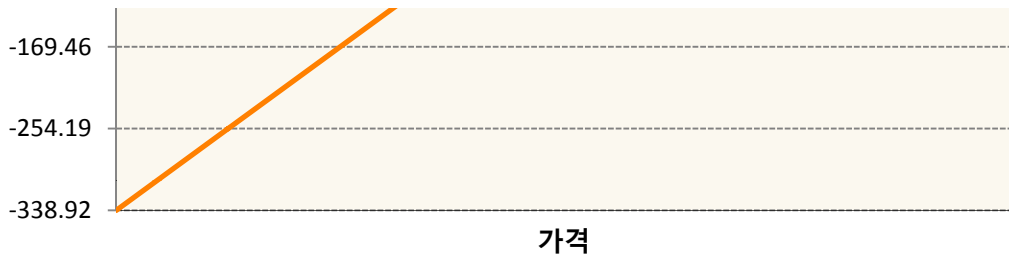
2. 만기시점의 손익구조

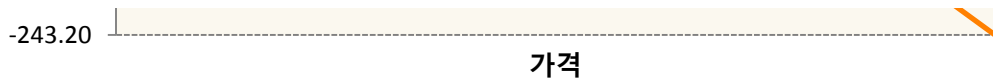
CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20



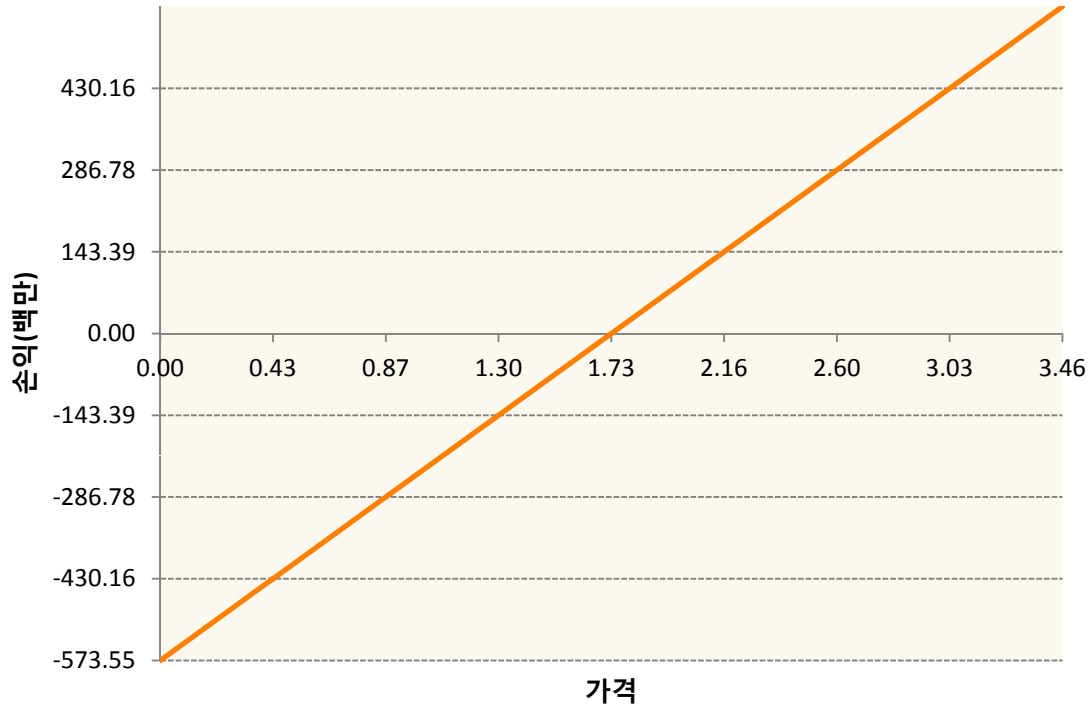
CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20



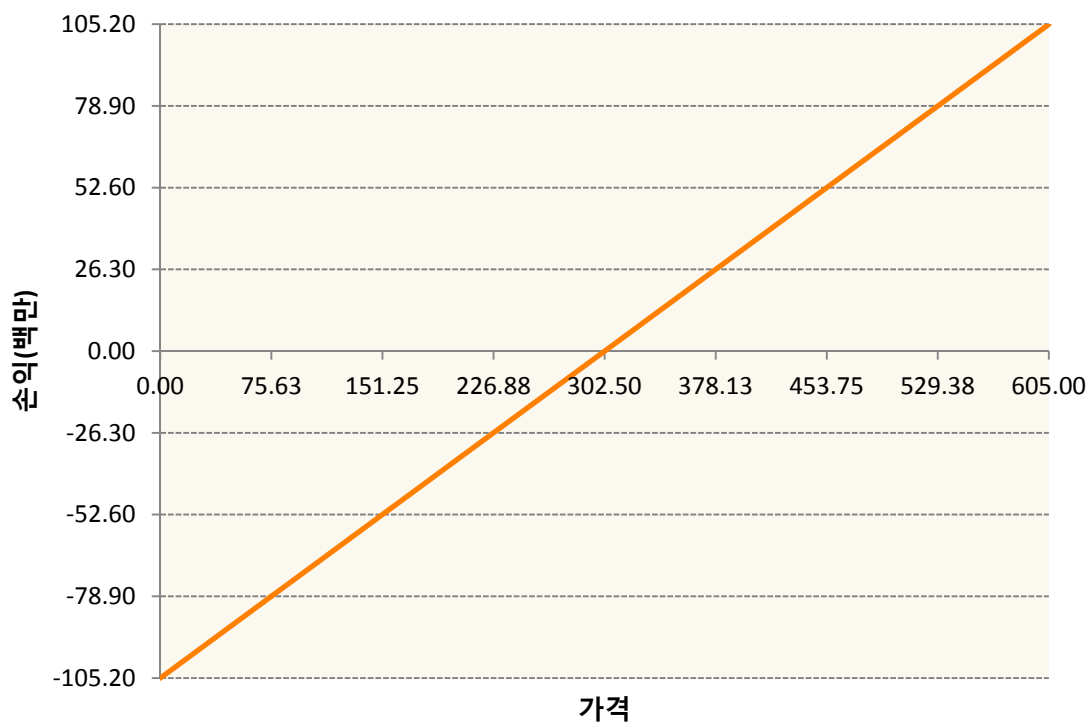




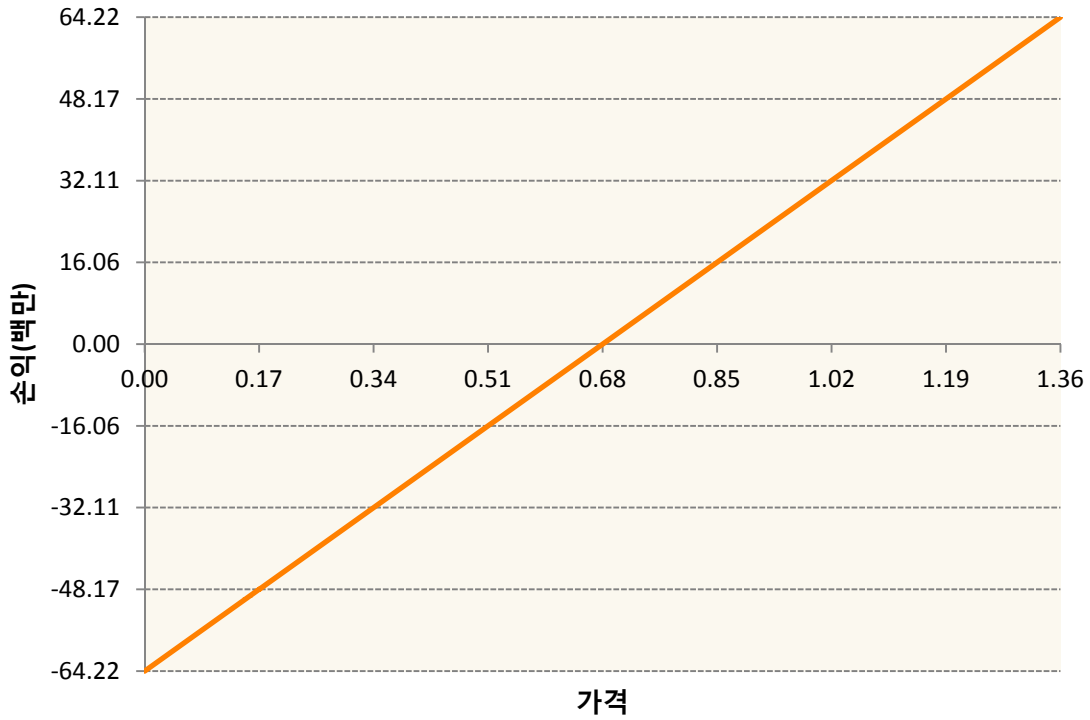
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



QSK0-Low Su Gasoil G Mar20



XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	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)

344

공시일	2020-04-14
기준일	2020-04-13

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

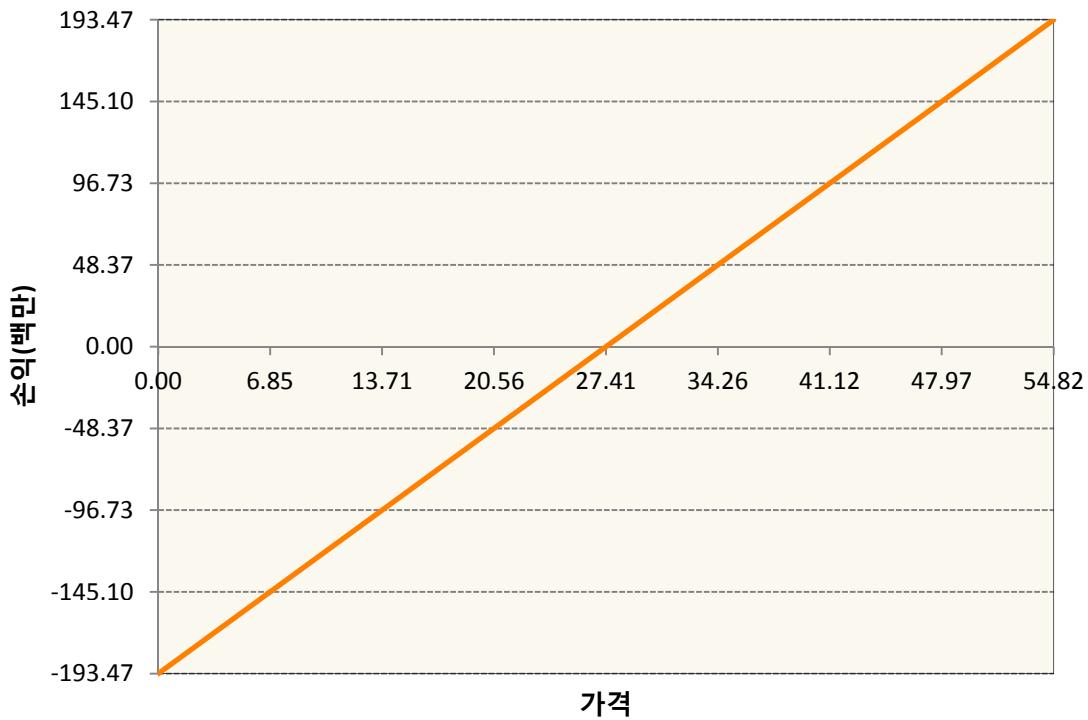
1. 계약금액

(단위:백만원)

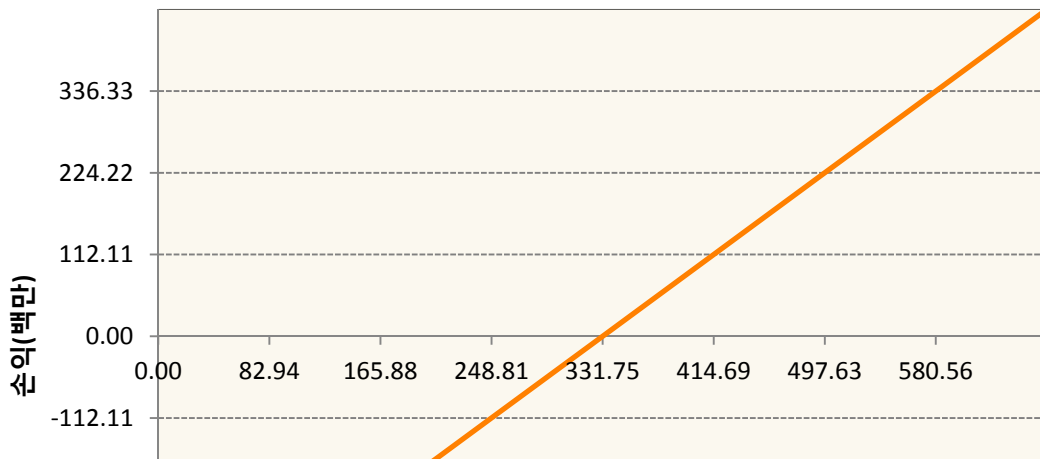
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,351	97	2,254	

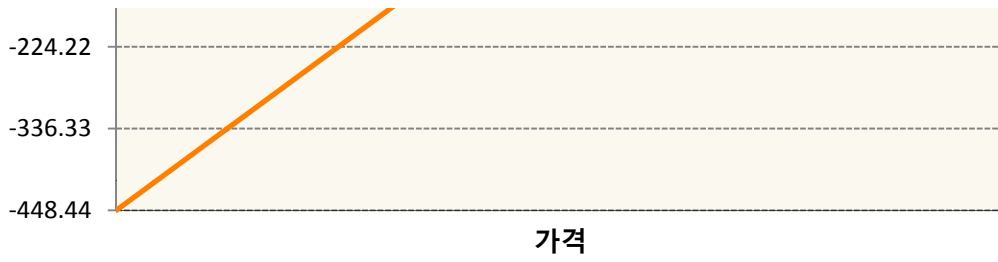
2. 만기시점의 손익구조

BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20

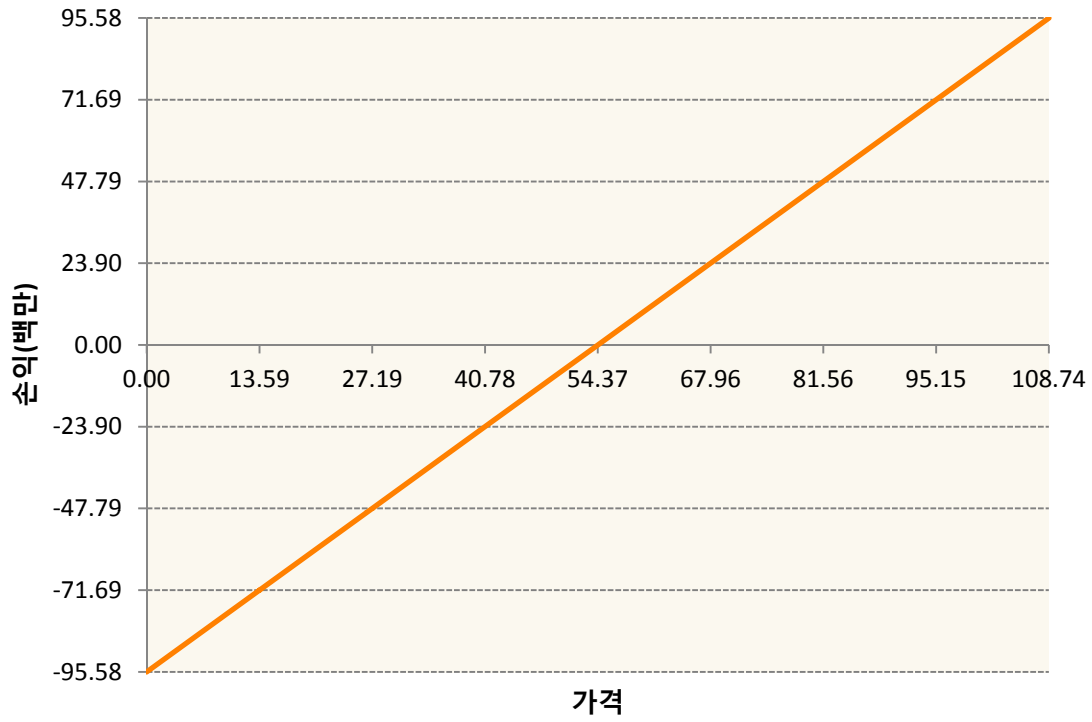


CK0-CORN FUTURE May20

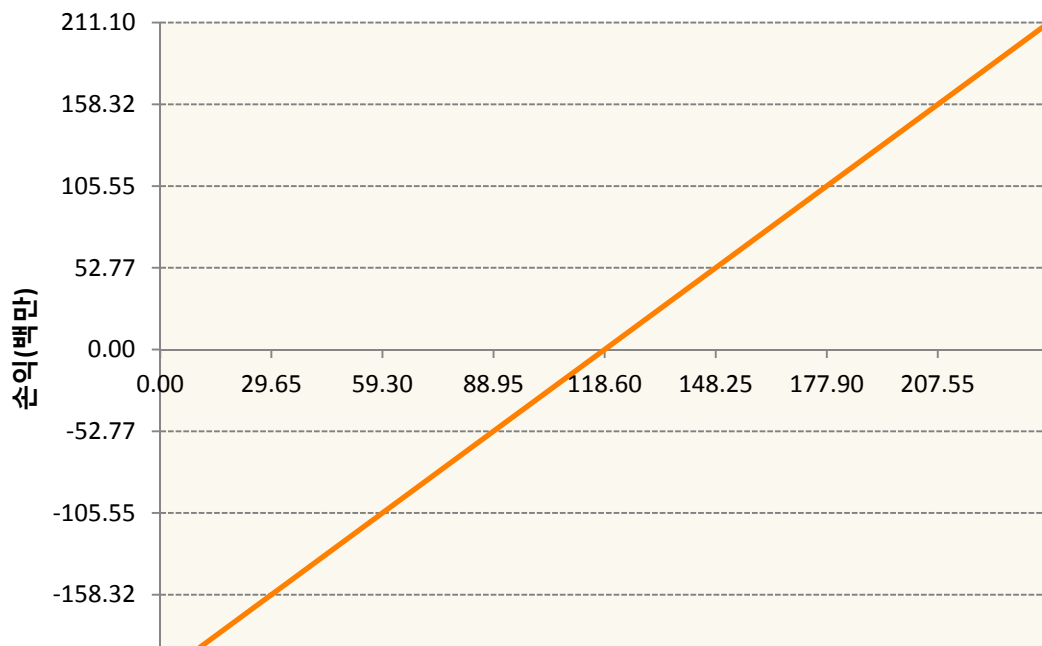


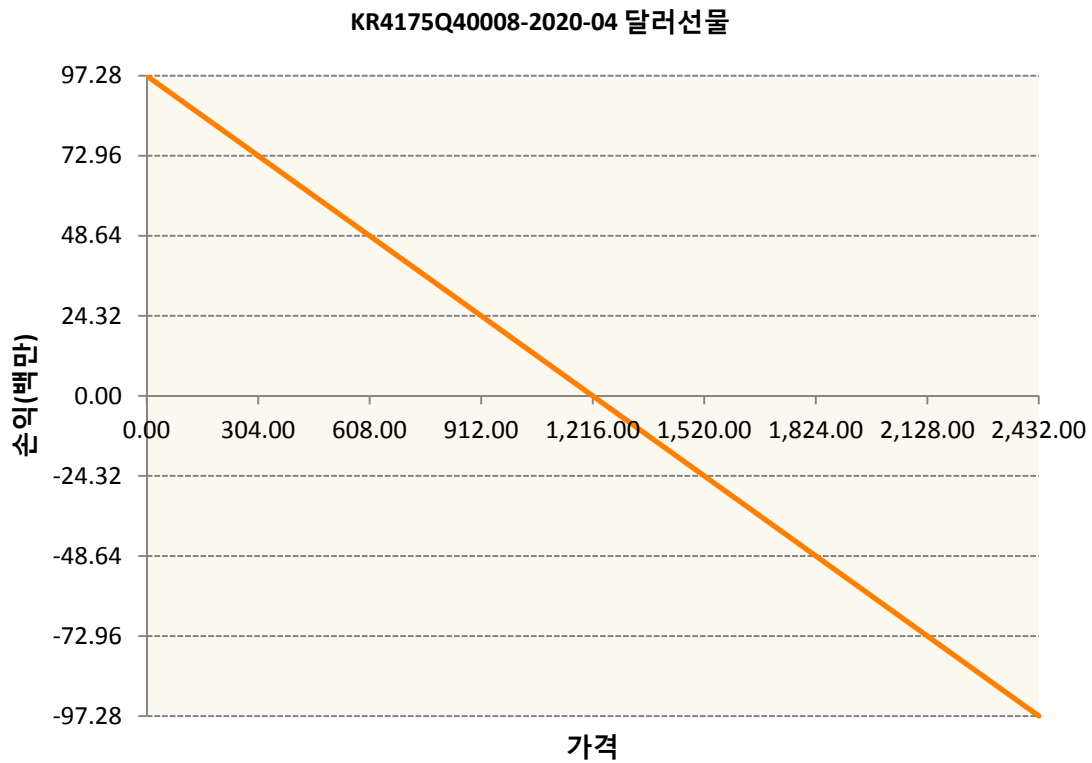
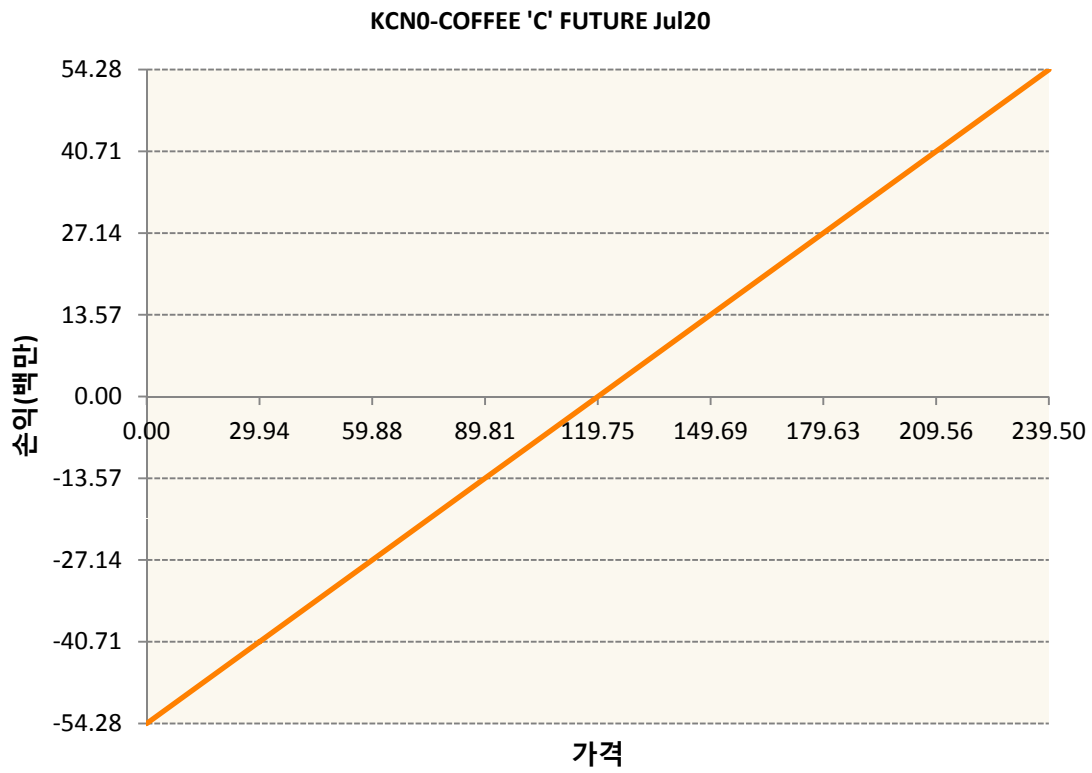
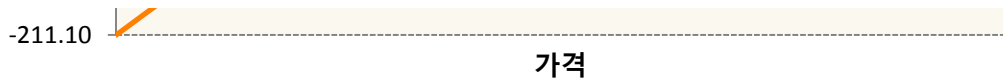


CTK0-COTTON NO.2 FUTR May20

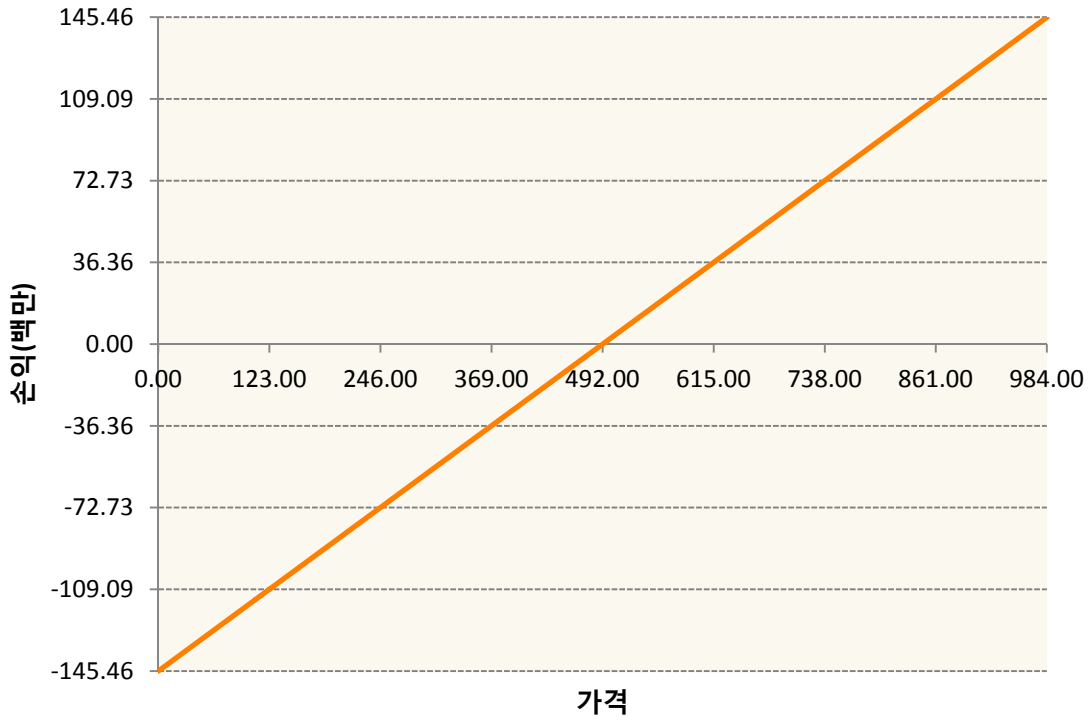


KCK0-COFFEE 'C' FUTURE May20

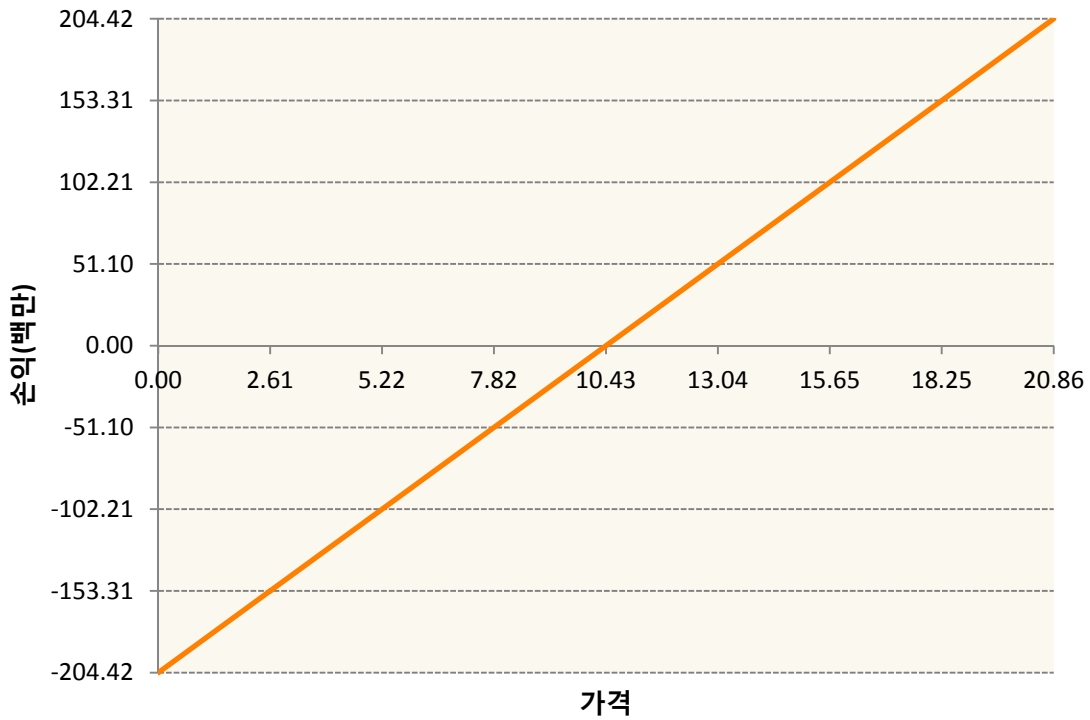




KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20

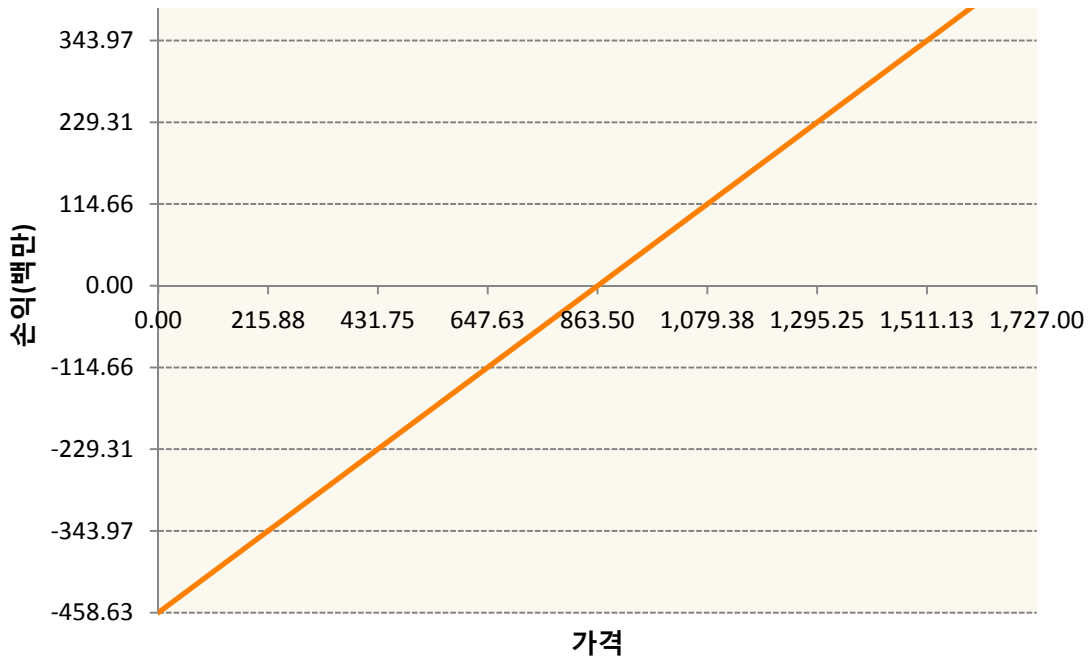


SBK0-Sugar May20

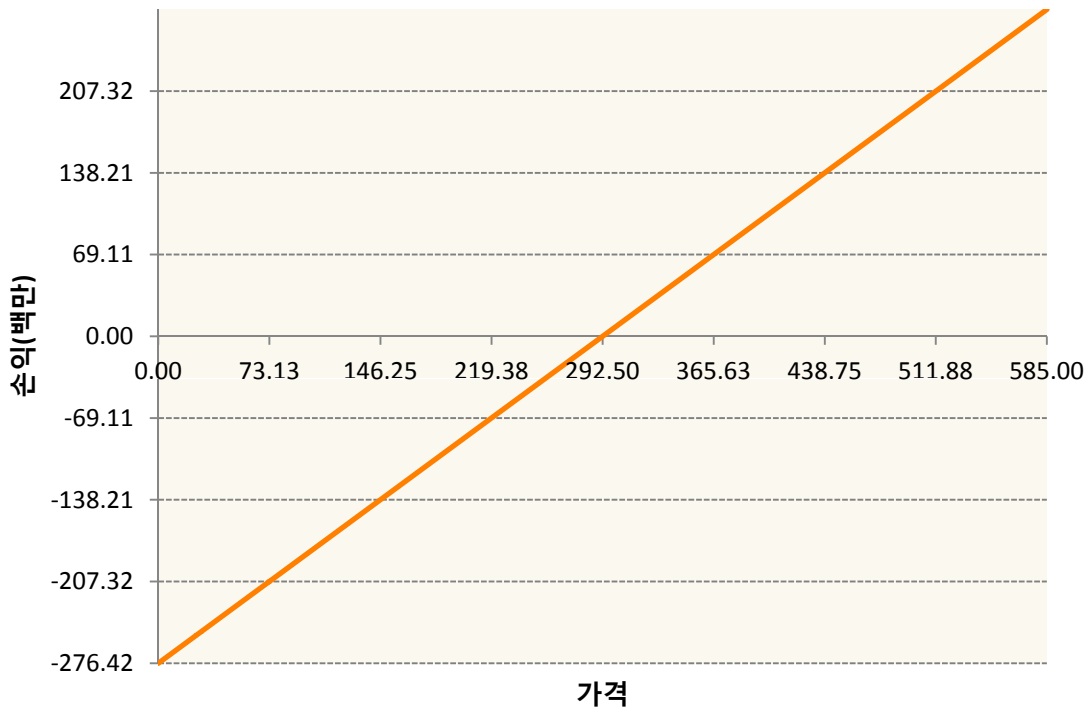


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



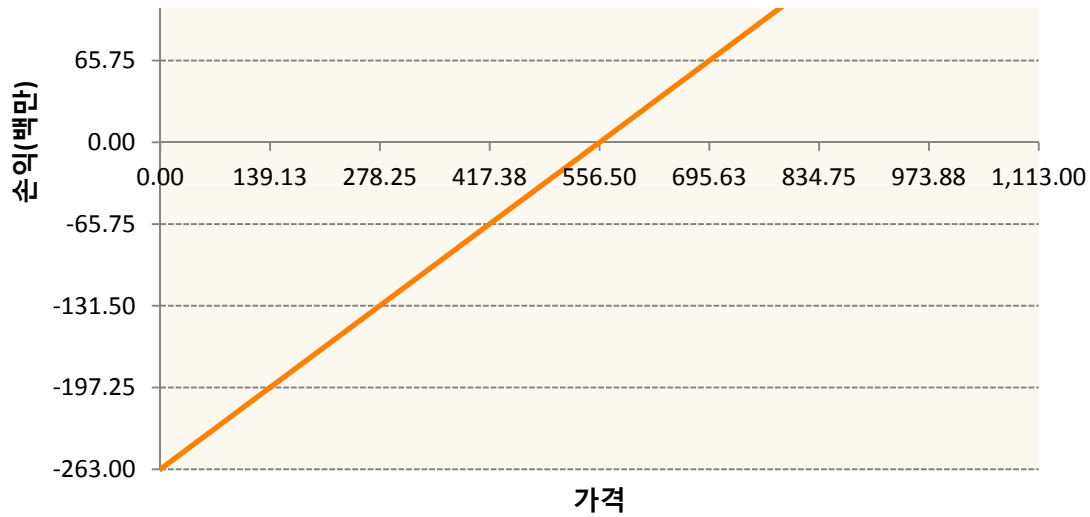


SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20



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