

공시일	2020-04-16
기준일	2020-04-14

## 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	2020-04-16
기준일	2020-04-14

## 스마트인덱스모

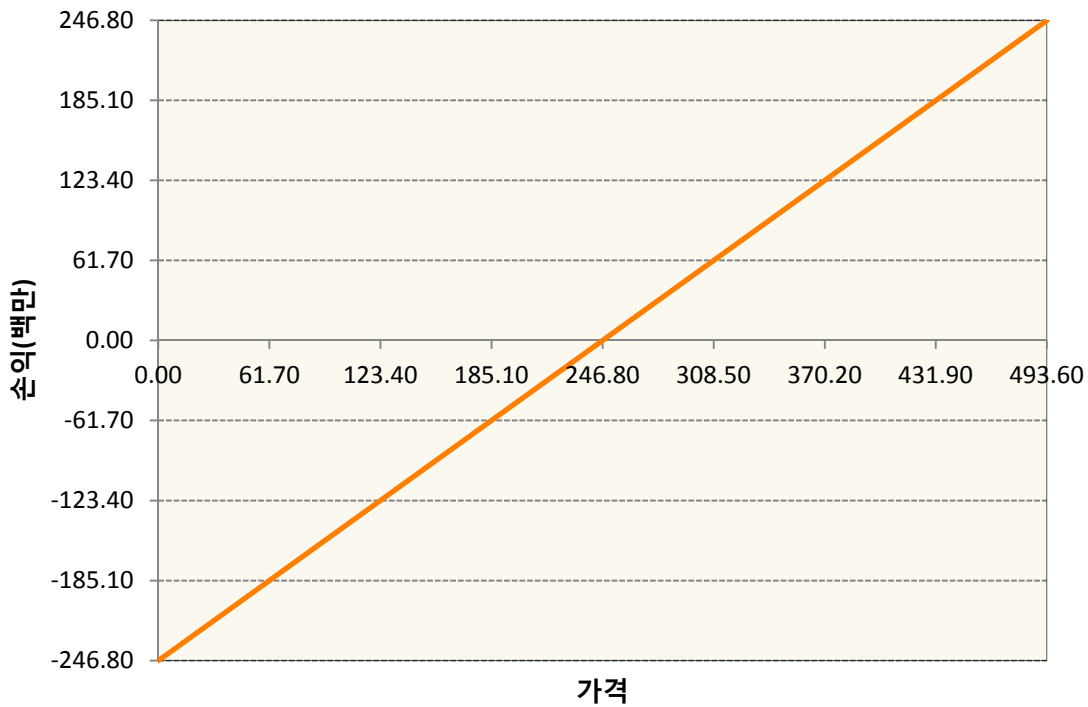
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

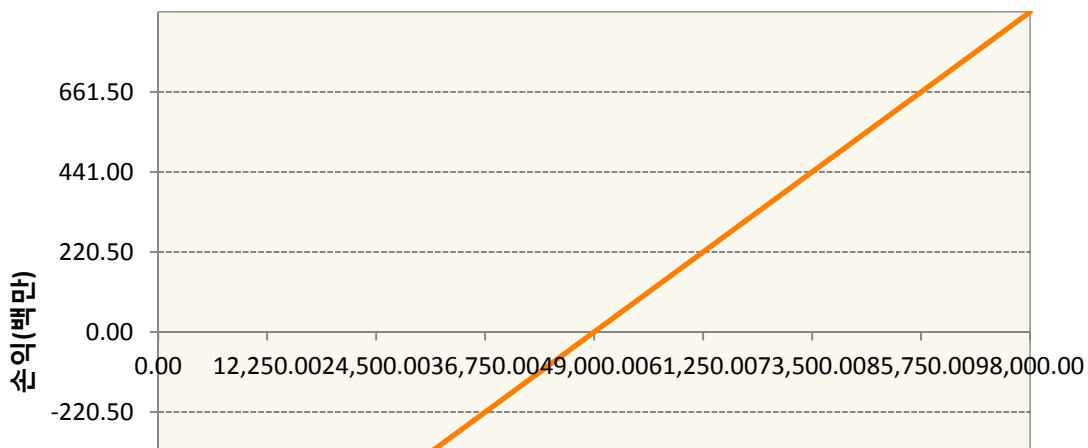
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,129	0	1,129	장내

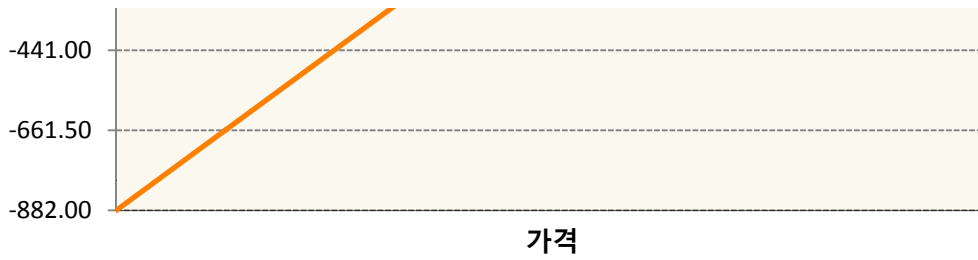
### 2. 만기시점의 손익구조

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	2020-04-16
기준일	2020-04-14

## 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

944

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,087

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-16
기준일	2020-04-14

## 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

552

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

873

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-16
기준일	2020-04-14

## 유로인덱스모(주식-파생형)

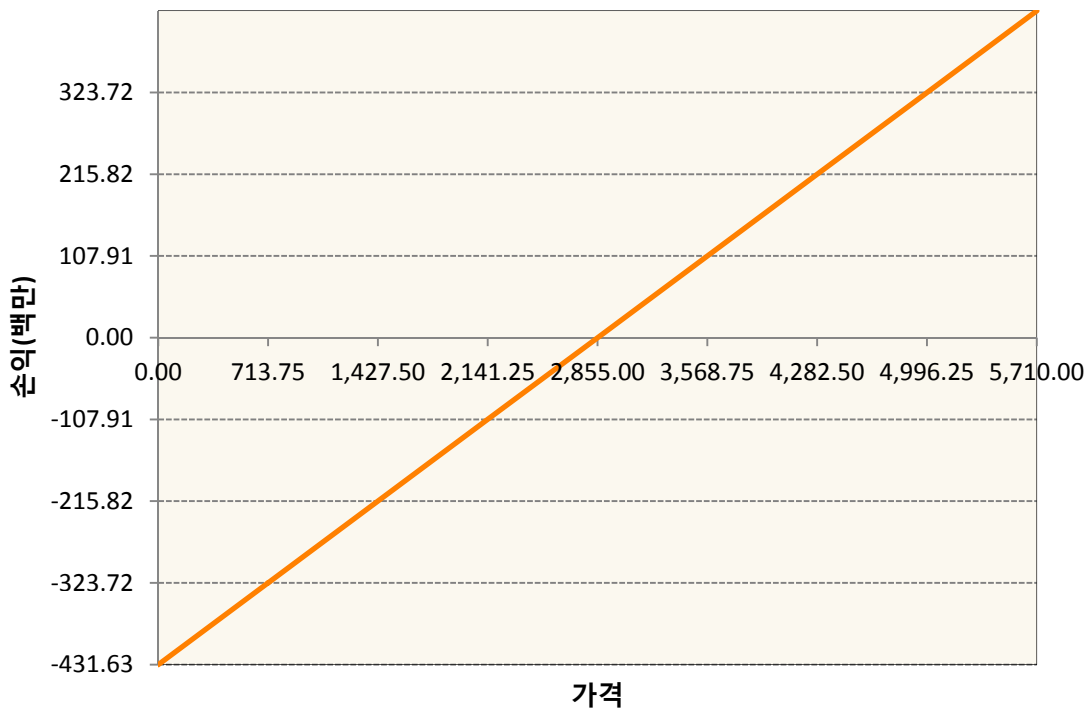
### 1. 계약금액

(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	2020-04-16
기준일	2020-04-14

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

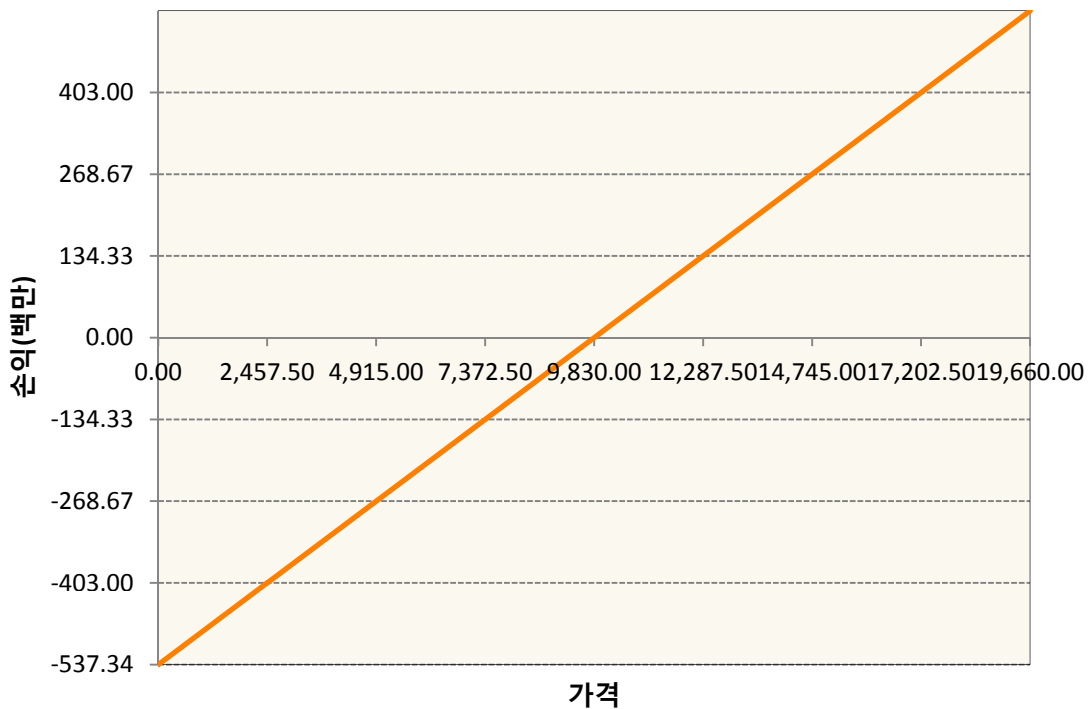
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	537	0	537	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCJ0-HSCEI Futures Apr20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

46
----

공시일	2020-04-16
기준일	2020-04-14

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

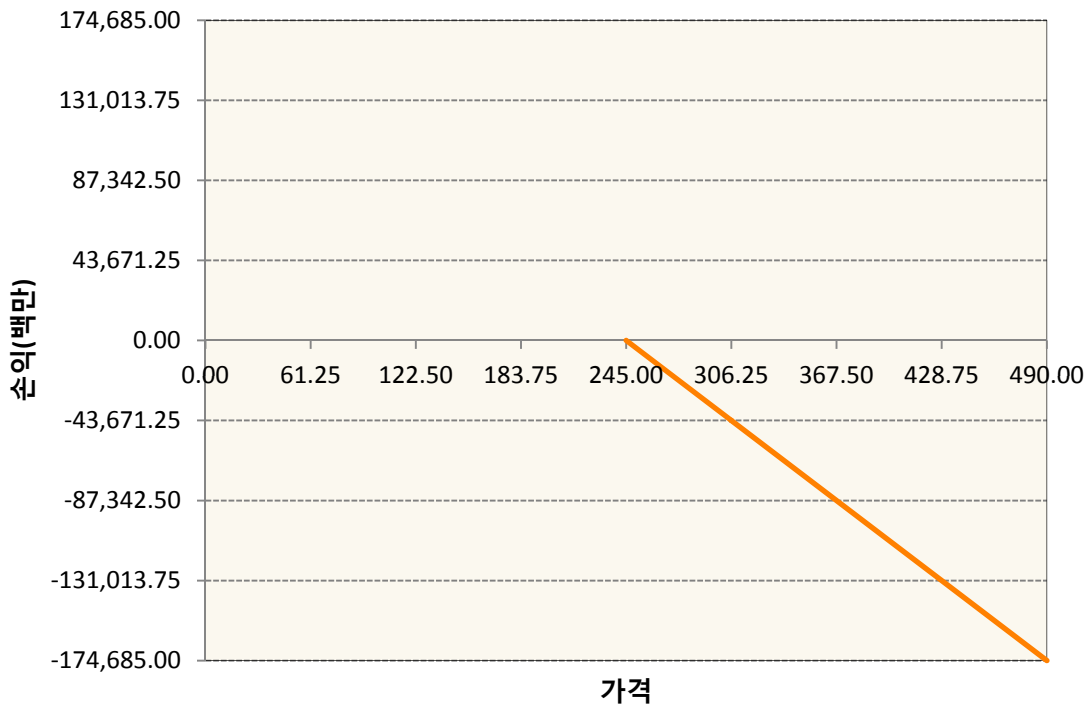
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

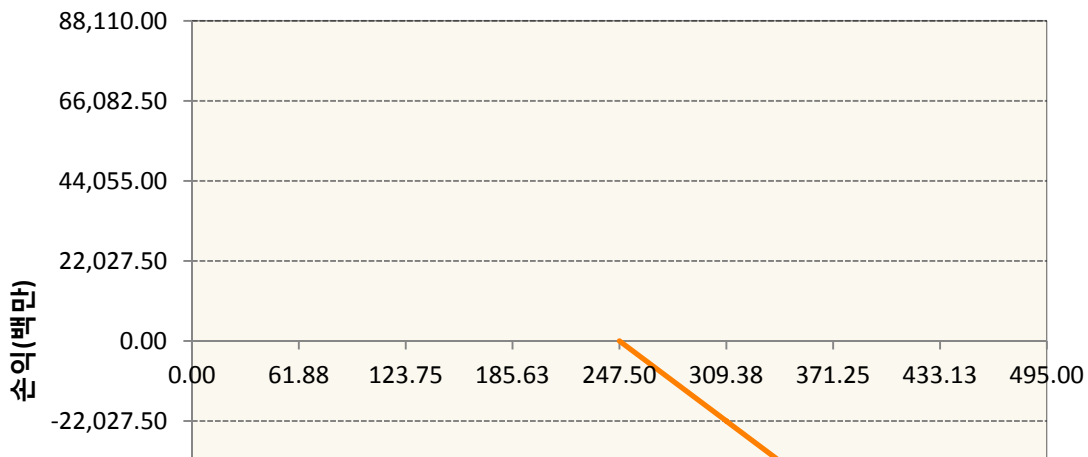
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	358,345	-358,345	장내

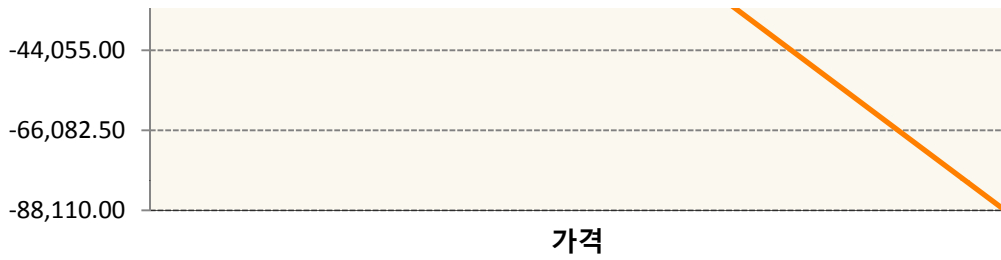
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q52452-2020-05 콜245

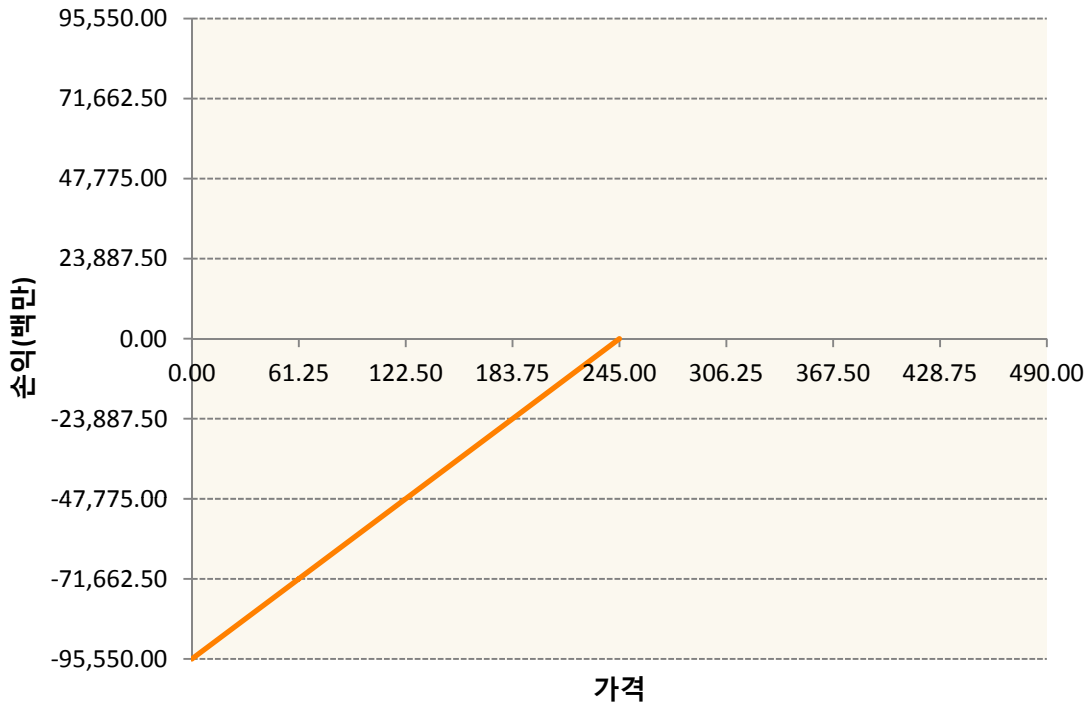


KR4201Q52478-2020-05 콜247.5





KR4301Q52450-2020-05 풋245



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q52452		2020-05 콜245					11,472
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,167	7,529	6,865	6,181	5,482	4,770	4,048
-5.33%	6,735	5,993	5,240	4,479	3,712	2,939	2,163
-2.67%	4,844	4,037	3,229	2,419	1,608	797	-14
0%	2,480	1,653	827	0	-826	-1,653	-2,479
2.67%	-346	-1,147	-1,954	-2,766	-3,581	-4,400	-5,221
5.33%	-3,595	-4,330	-5,086	-5,856	-6,637	-7,427	-8,225
8.00%	-7,208	-7,853	-8,533	-9,239	-9,967	-10,713	-11,472
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5					5,586
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,838	3,538	3,221	2,893	2,554	2,208	1,856

-5.33%	3,198	2,841	2,476	2,104	1,728	1,348	966
-2.67%	2,340	1,942	1,542	1,141	739	335	-68
0%	1,247	831	416	0	-415	-831	-1,246
2.67%	-77	-488	-901	-1,315	-1,731	-2,146	-2,563
5.33%	-1,619	-2,005	-2,398	-2,796	-3,198	-3,604	-4,012
8.00%	-3,353	-3,698	-4,058	-4,428	-4,808	-5,194	-5,586
KR4301Q52450                      2020-05 풋245							5,403
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,834	-4,064	-4,311	-4,570	-4,840	-5,118	-5,403
-5.33%	-1,895	-2,189	-2,491	-2,799	-3,111	-3,427	-3,746
-2.67%	-260	-596	-934	-1,273	-1,612	-1,952	-2,292
0%	1,041	694	347	0	-347	-695	-1,042
2.67%	2,016	1,691	1,360	1,026	690	351	10
5.33%	2,702	2,422	2,129	1,827	1,516	1,200	878
8.00%	3,155	2,933	2,690	2,431	2,158	1,874	1,580

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

(단위:백만원)

**18,407**

공시일	2020-04-16
기준일	2020-04-14

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

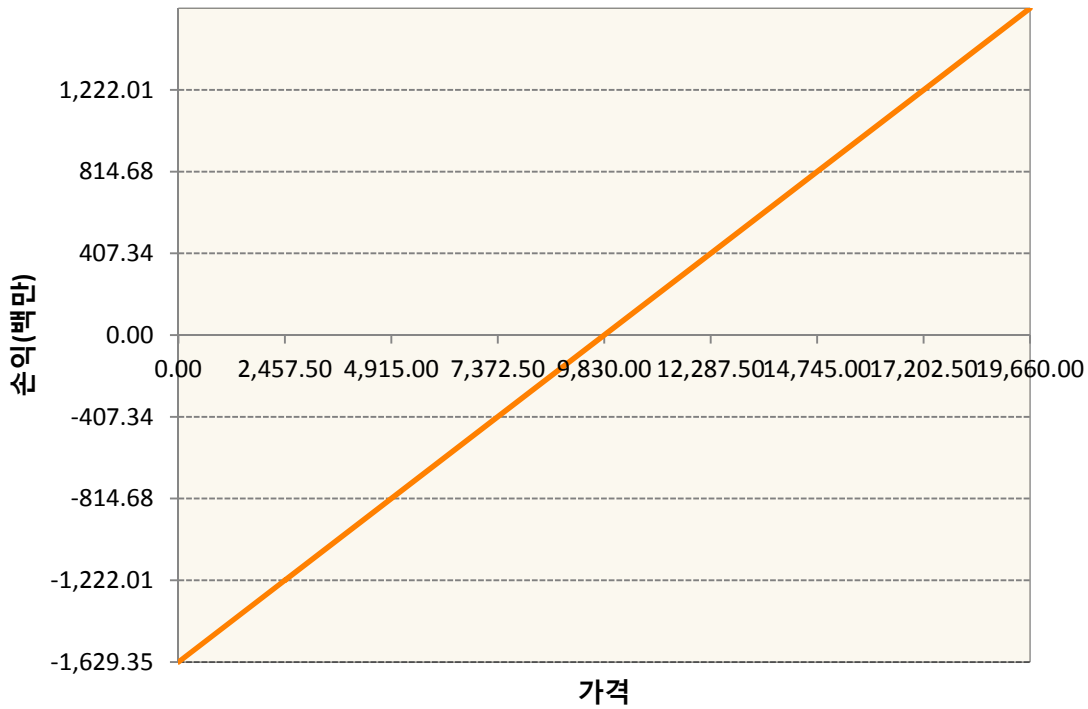
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

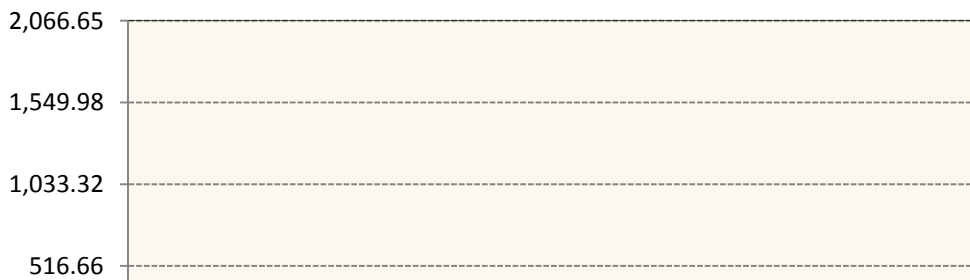
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,629	0	1,629	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,135	-4,135	장내
누계	통화	선도	691	2,211	-1,520	장외

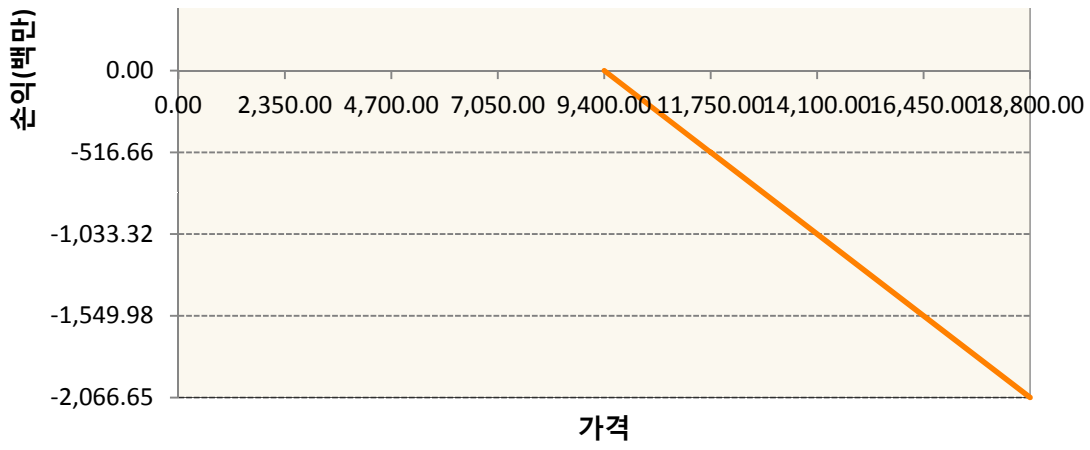
### 2. 만기시점의 손익구조

HCJ0-HSCEI Futures Apr20

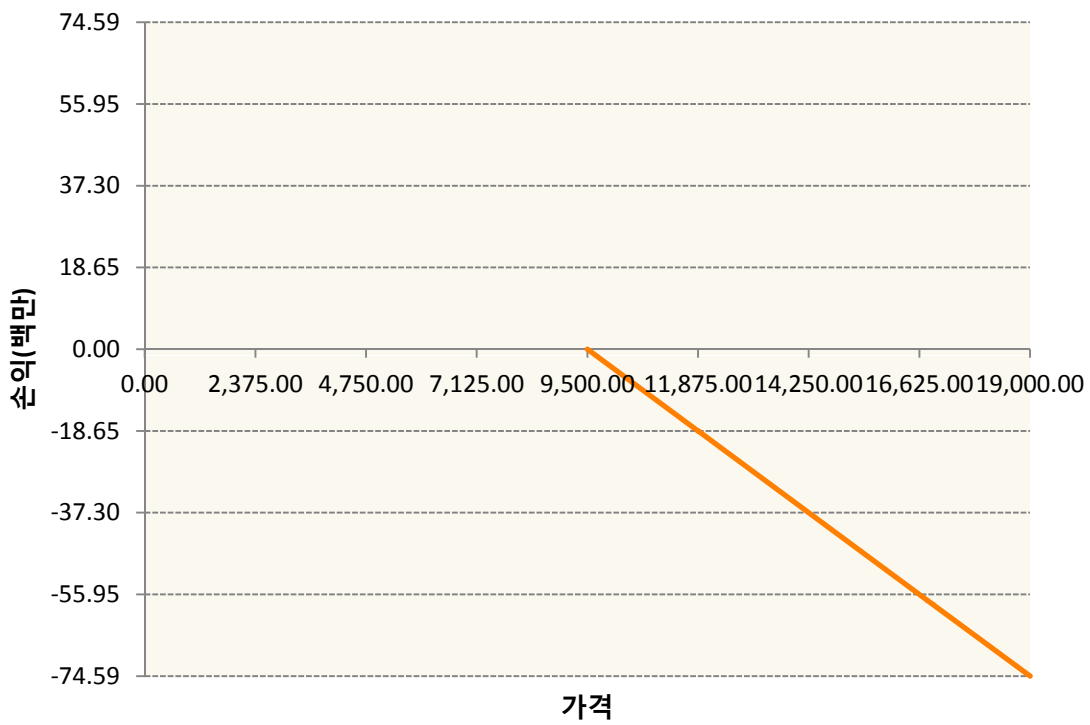


OHHIJ0-C94-HSCEI

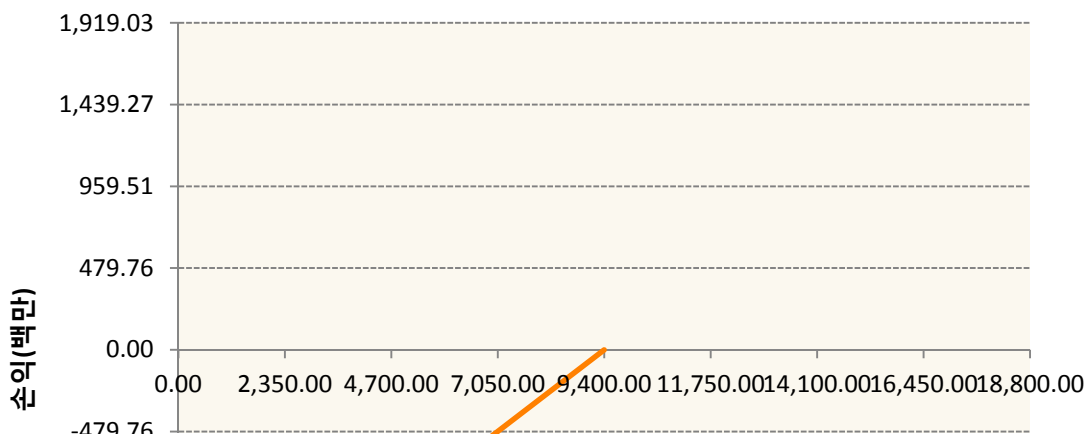


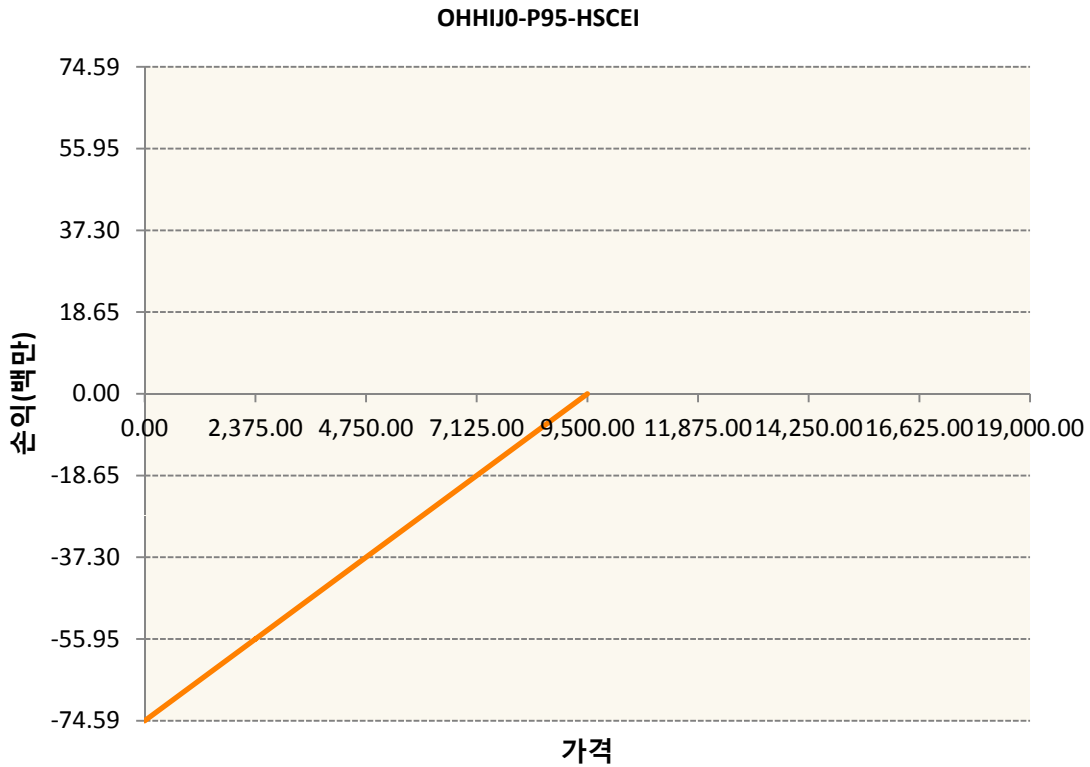


OHHIJO-C95-HSCEI



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

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	611

공시일	2020-04-16
기준일	2020-04-14

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

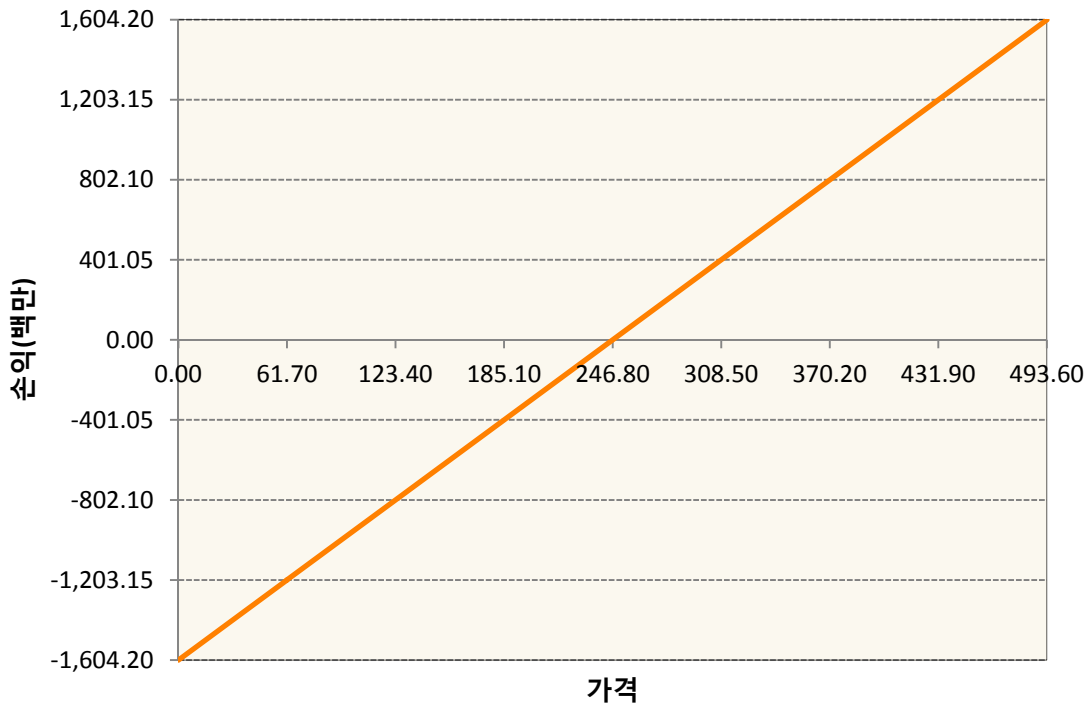
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

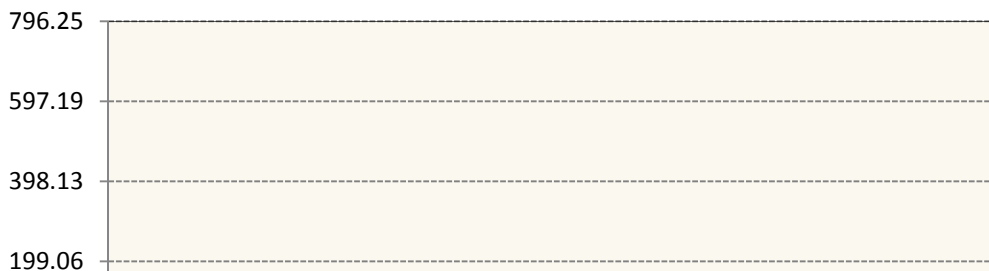
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,604	0	1,604	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,193	-3,193	장내

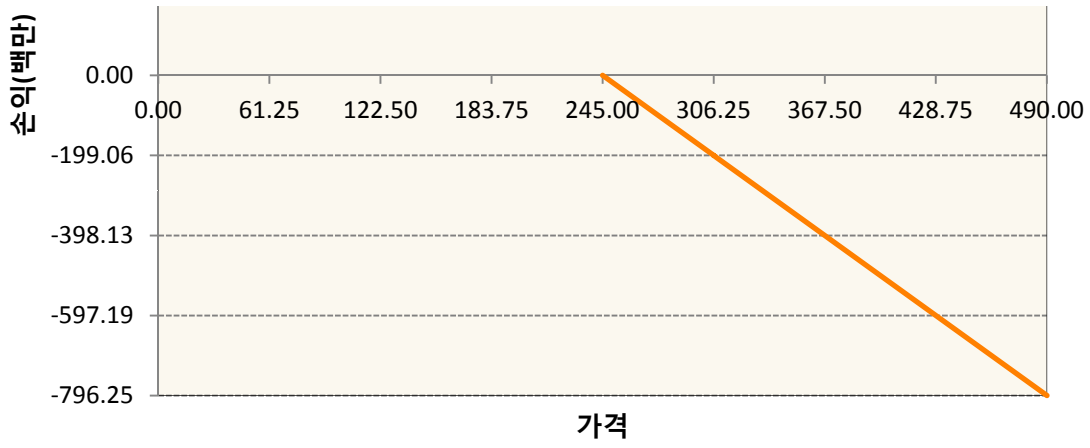
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

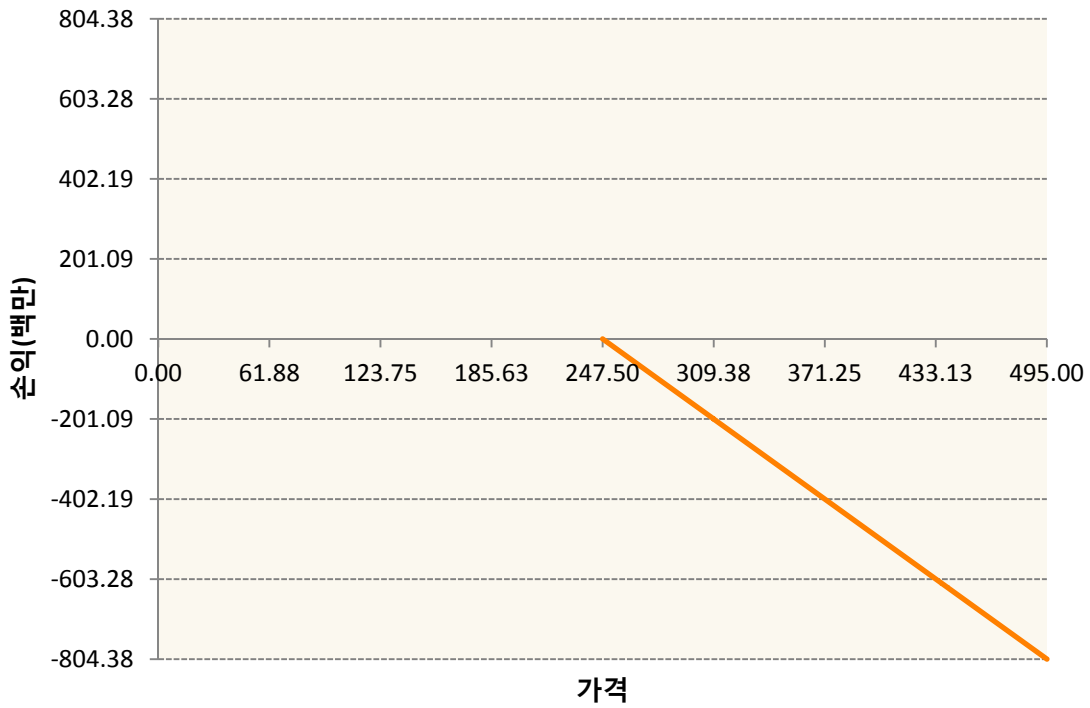


KR4201Q52452-2020-05 콜245

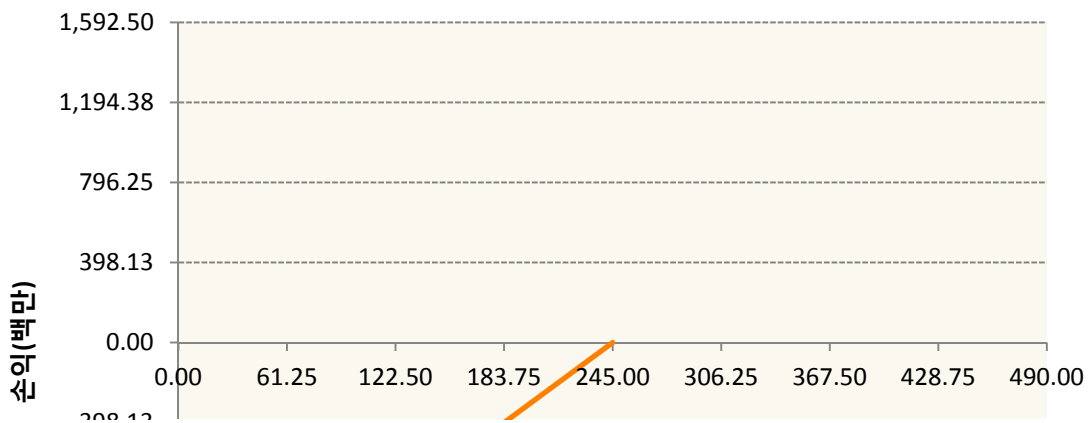




KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



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						52
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	37	34	31	28	25	22	18	
-5.33%	31	27	24	20	17	13	10	
-2.67%	22	18	15	11	7	4	0	
0%	11	8	4	0	-4	-8	-11	
2.67%	-2	-5	-9	-13	-16	-20	-24	
5.33%	-16	-20	-23	-27	-30	-34	-37	
8.00%	-33	-36	-39	-42	-45	-49	-52	
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5						51
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	35	32	29	26	23	20	17
-5.33%	29	26	23	19	16	12	9
-2.67%	21	18	14	10	7	3	-1
0%	11	8	4	0	-4	-8	-11
2.67%	-1	-4	-8	-12	-16	-20	-23
5.33%	-15	-18	-22	-26	-29	-33	-37
8.00%	-31	-34	-37	-40	-44	-47	-51
KR4301Q52450                      2020-05 풋245							90
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-64	-68	-72	-76	-81	-85	-90
-5.33%	-32	-36	-42	-47	-52	-57	-62
-2.67%	-4	-10	-16	-21	-27	-33	-38
0%	17	12	6	0	-6	-12	-17
2.67%	34	28	23	17	11	6	0
5.33%	45	40	35	30	25	20	15
8.00%	53	49	45	41	36	31	26

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

(단위:백만원)

**535**

공시일	2020-04-16
기준일	2020-04-14

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

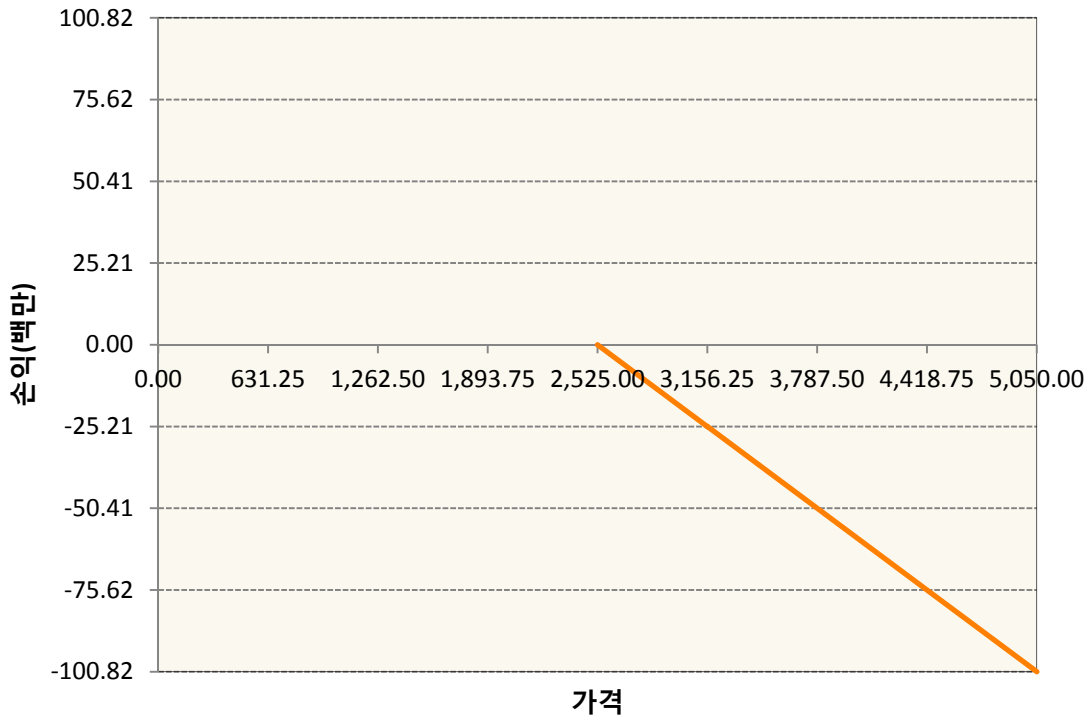
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

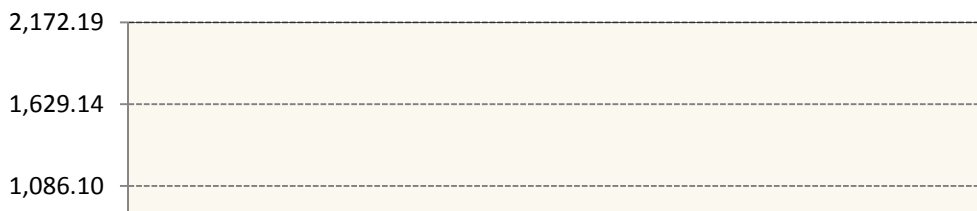
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	348	0	348	
누계	유가증권	스왑	7,560	0	7,560	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,580	-4,580	장내
누계	통화	선도	0	2,694	-2,694	장외

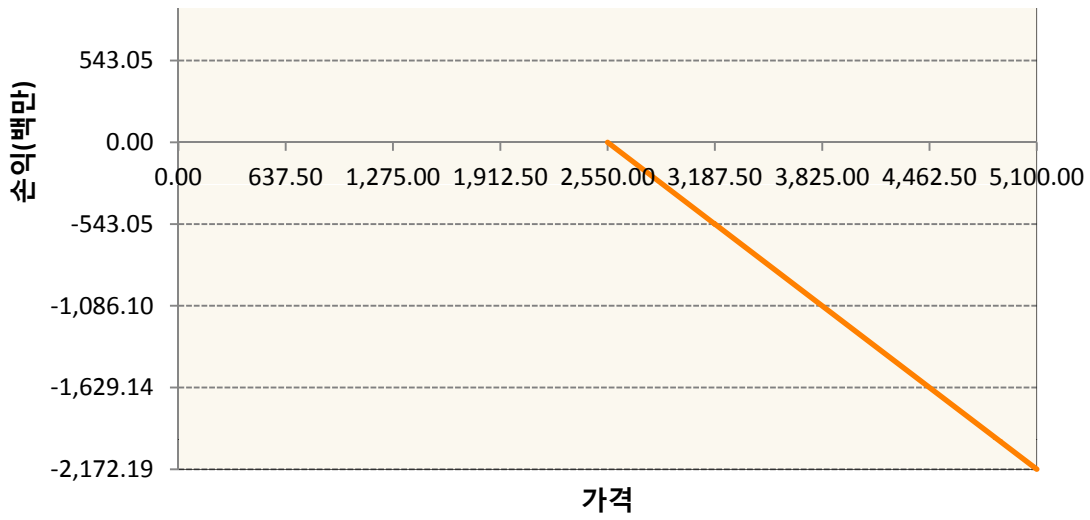
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXJ0-C2525-EURO STOXX 50

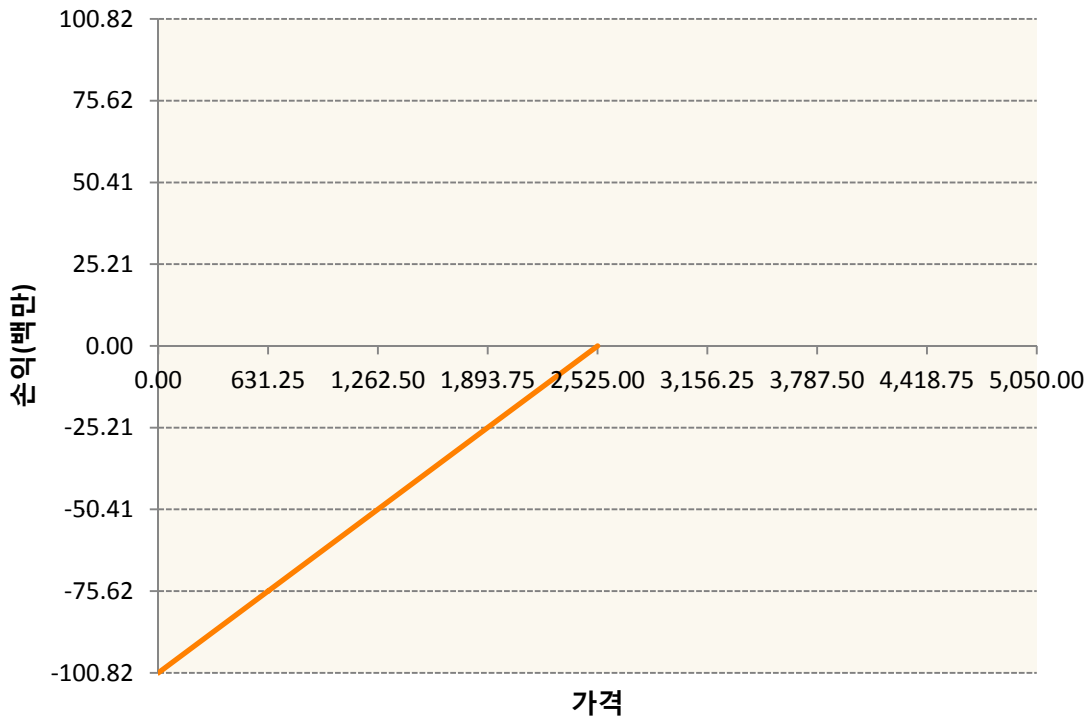


OESXJ0-C2550-EURO STOXX 50

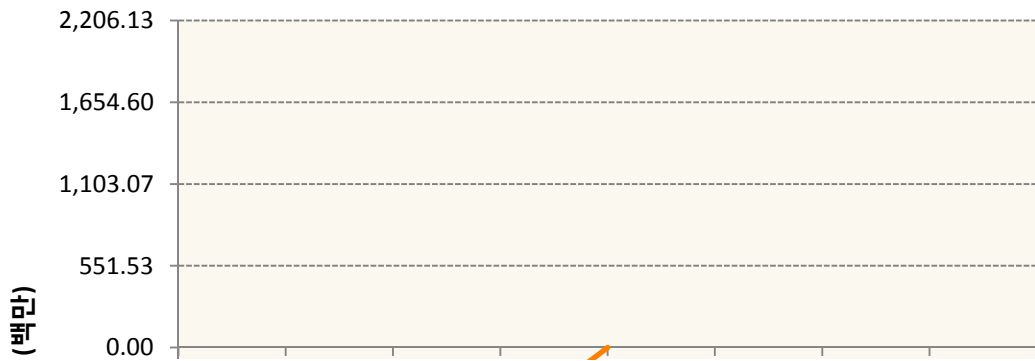


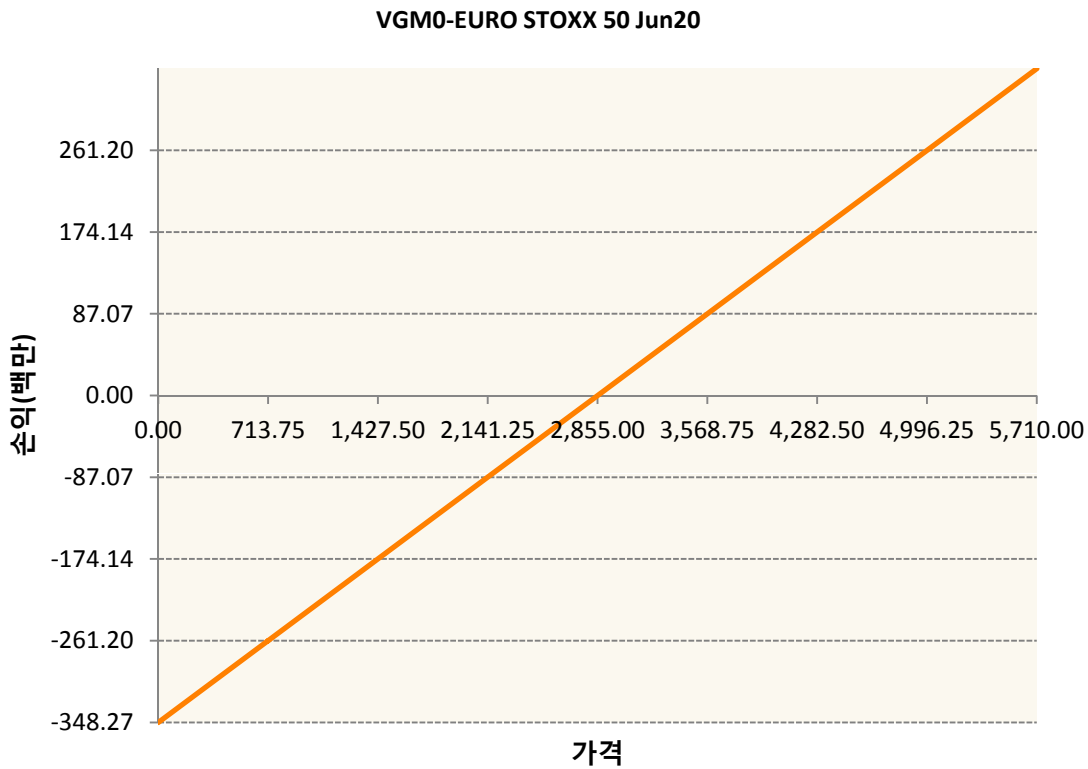
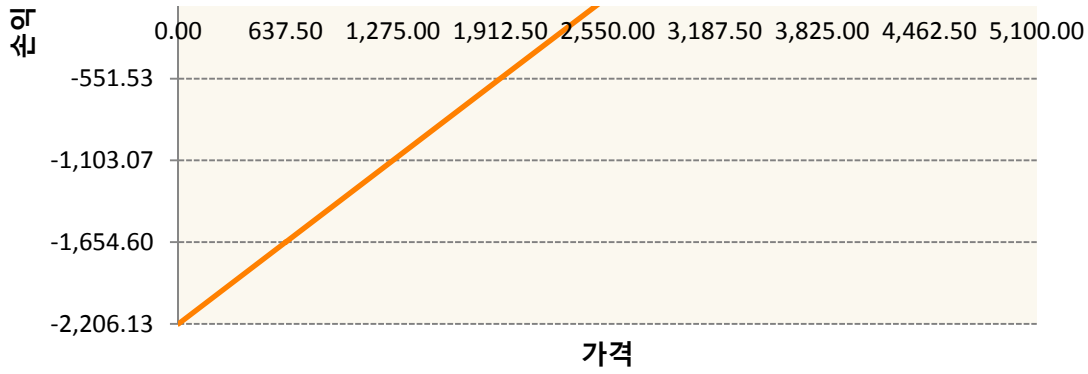


OESXJ0-P2525-EURO STOXX 50



OESXJ0-P2550-EURO STOXX 50





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	28
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E	216
OESXJ0-C25: EURO STOXX 50	8
OESXJ0-C25: EURO STOXX 50	174
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)

1,088

공시일	2020-04-16
기준일	2020-04-14

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

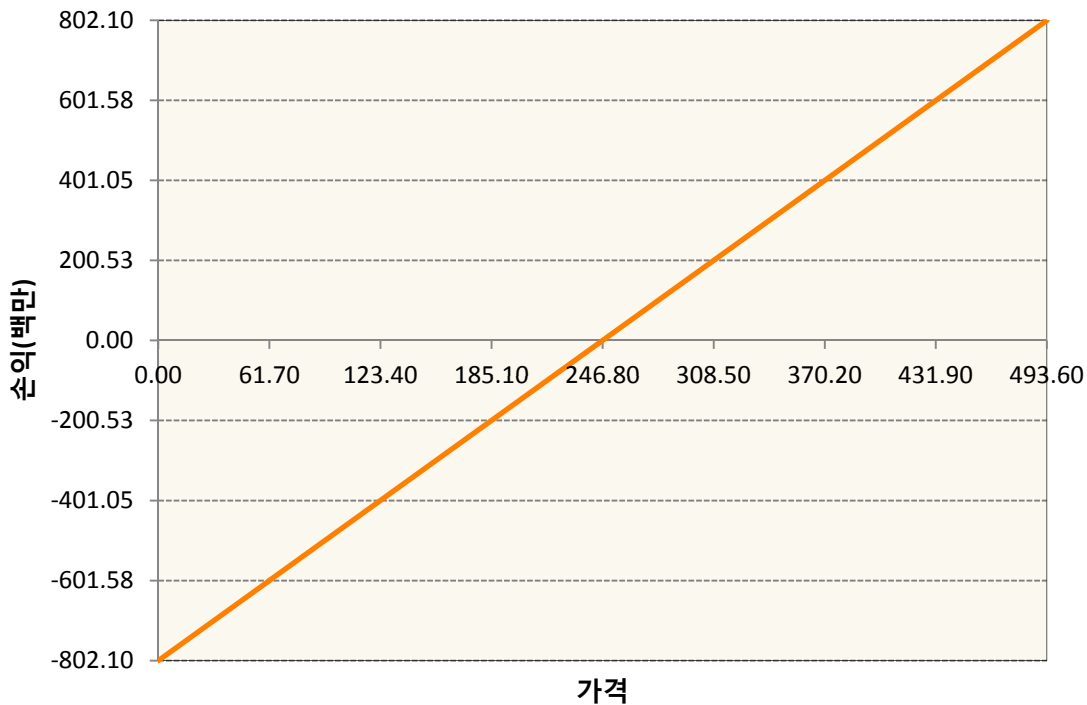
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	802	0	802	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						64
가격	기초자산의 변동성							
	-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)

94



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

(단위:백만원)

138

공시일	2020-04-16
기준일	2020-04-14

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

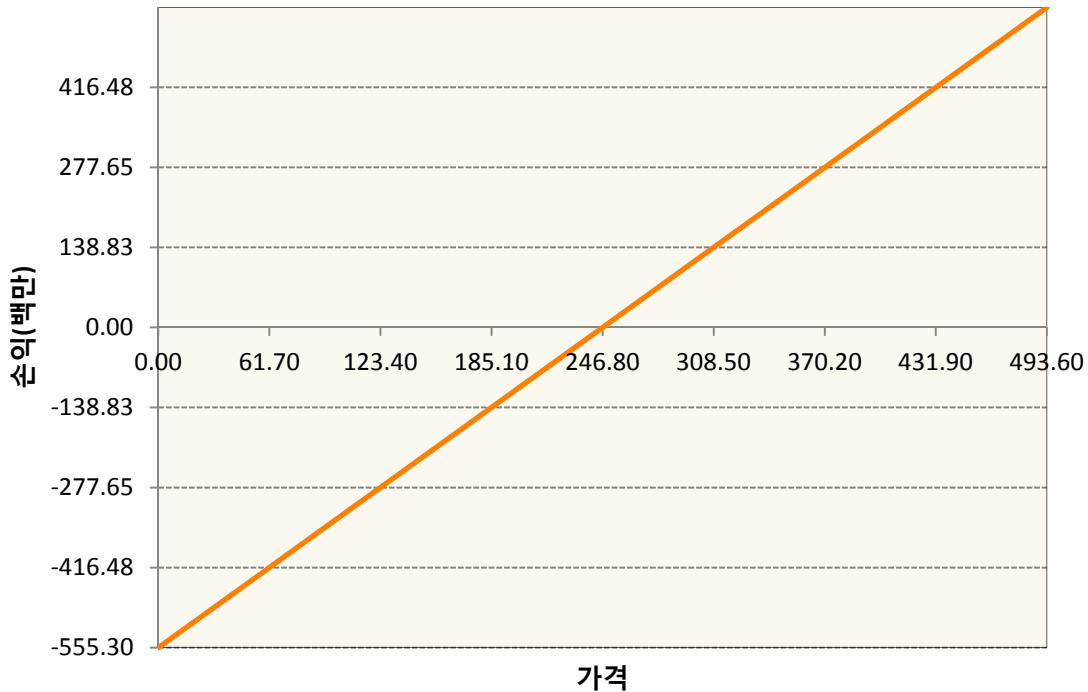
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	555	0	555	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002      2020-06 코스피200지수선물      45

가격	기초자산의 변동성						
	-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	2020-04-16
기준일	2020-04-14

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

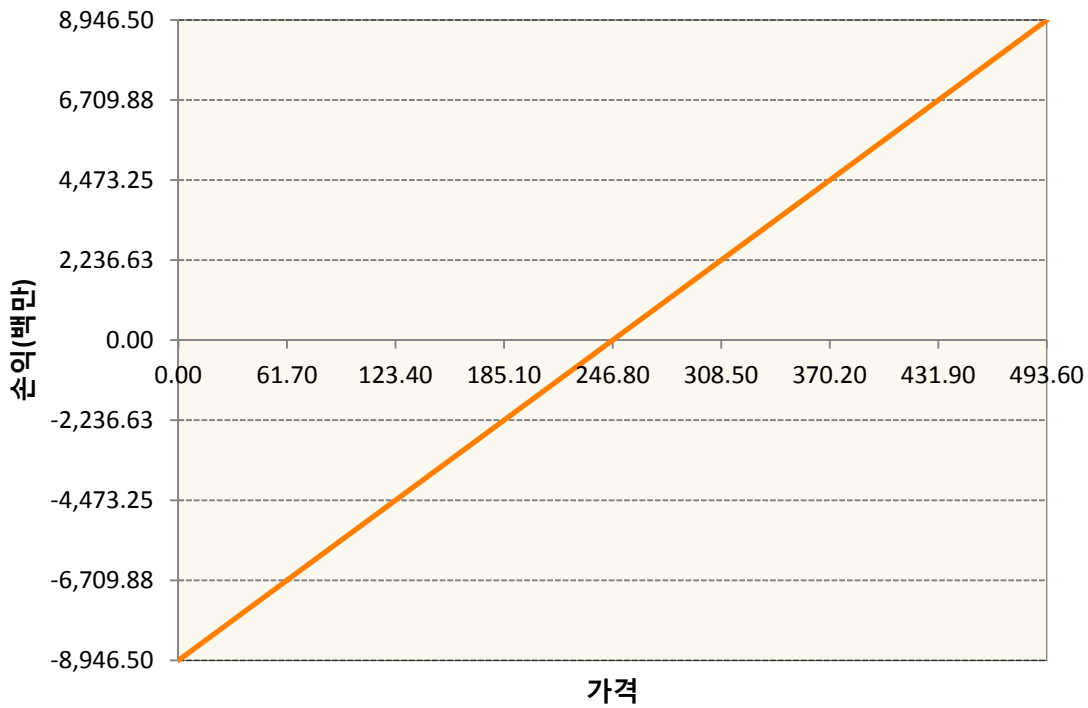
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

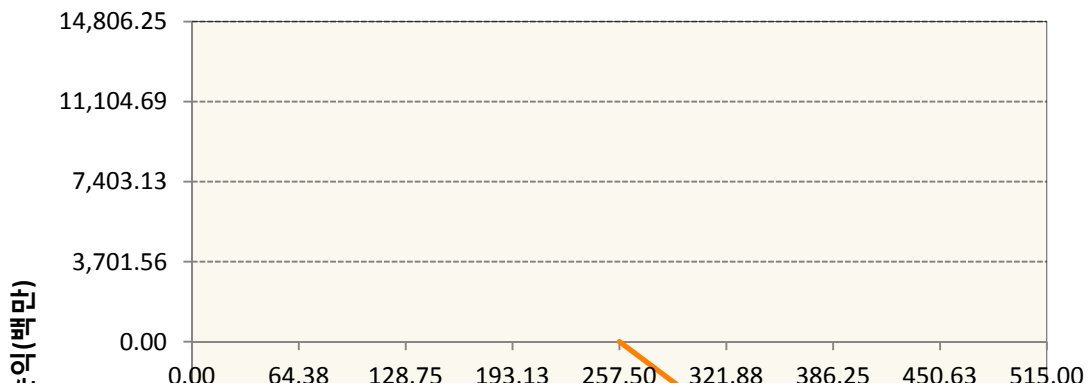
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,947	0	8,947	장내
누계	유가증권	옵션	6,201	17,536	-11,335	장내

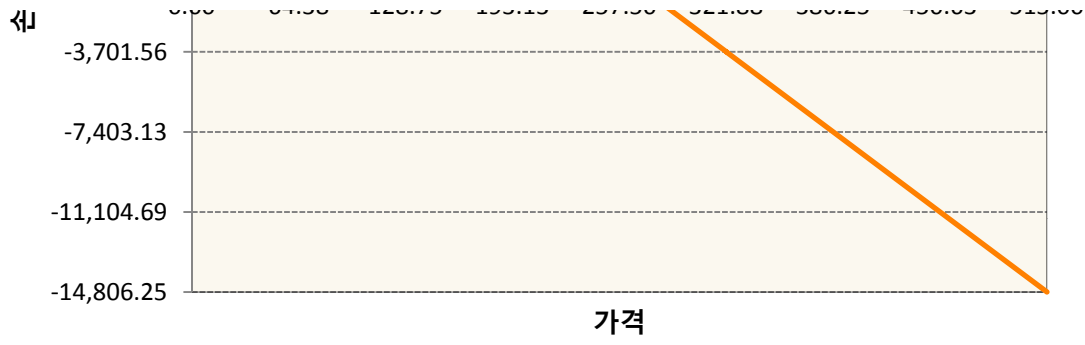
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

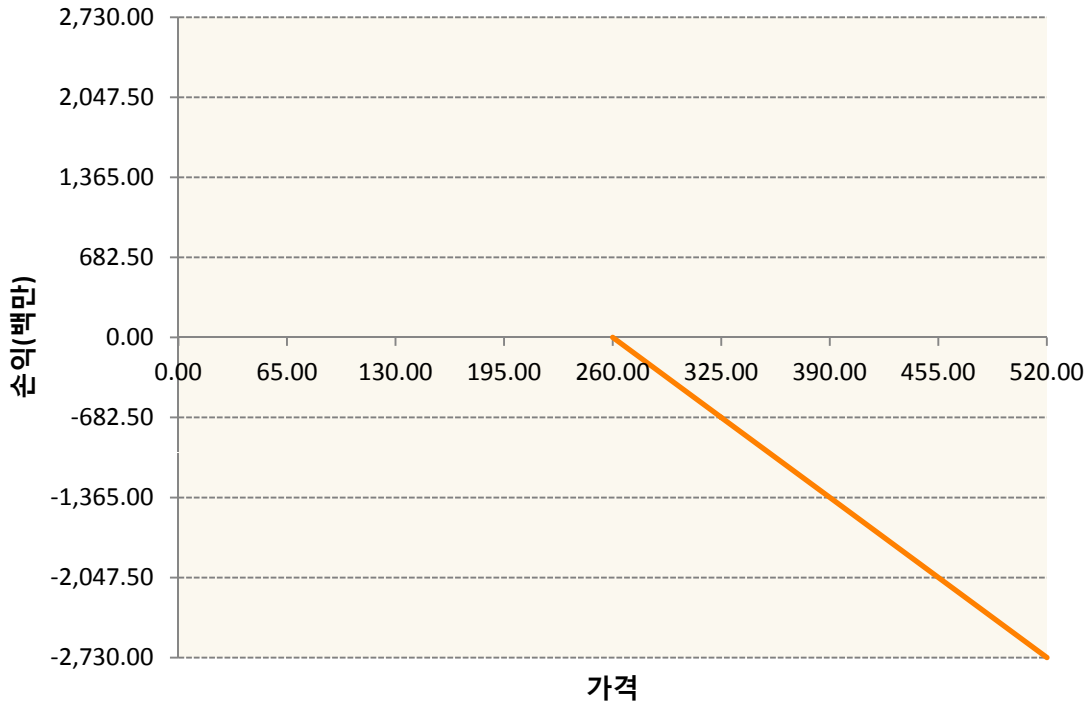


KR4201Q52577-2020-05 콜257.5

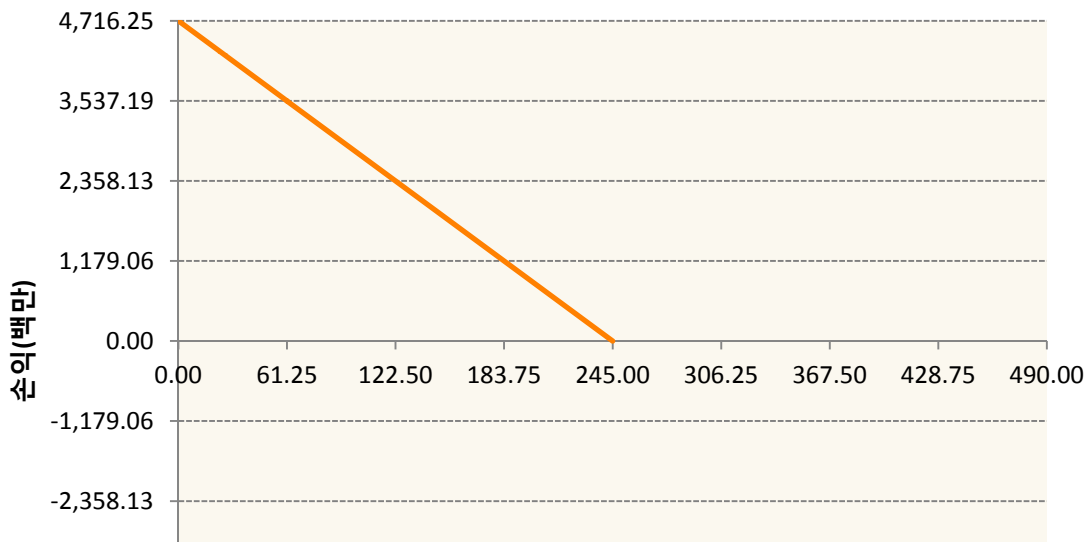


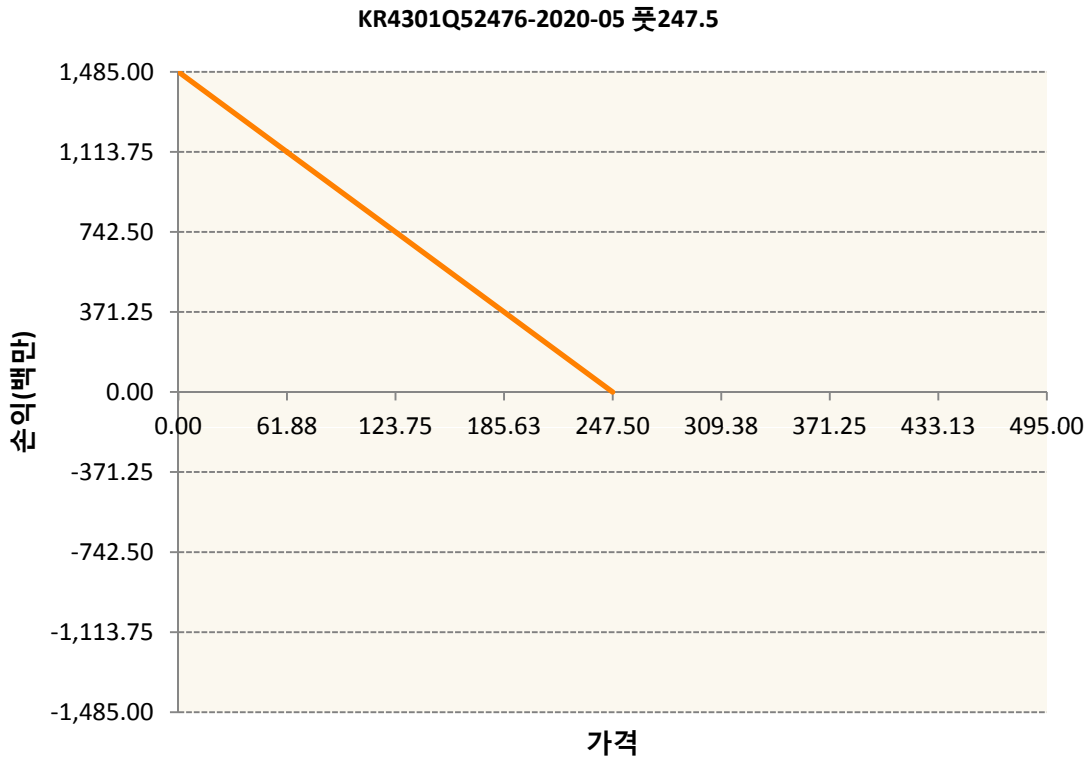
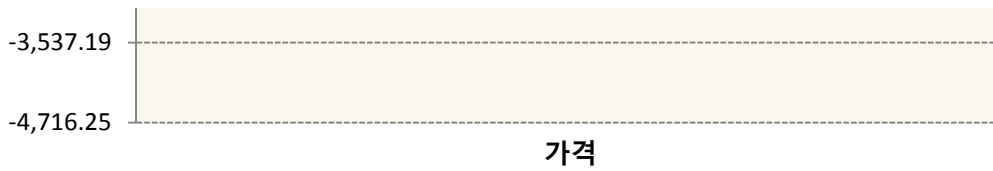


KR4201Q52601-2020-05 콜260



KR4301Q52450-2020-05 풋245





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						718
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-718	-718	-718	-718	-718	-718	-718	
-5.33%	-478	-478	-478	-478	-478	-478	-478	
-2.67%	-239	-239	-239	-239	-239	-239	-239	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	239	239	239	239	239	239	239	
5.33%	478	478	478	478	478	478	478	
8.00%	718	718	718	718	718	718	718	
KR4201Q52577		2020-05 콜257.5						801
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	470	434	394	351	305	256	206	
-5.33%	408	361	312	260	206	150	93	
-2.67%	317	261	203	143	82	21	-42	

0%	194	130	65	0	-66	-132	-199
2.67%	36	-33	-102	-171	-240	-309	-378
5.33%	-159	-229	-299	-369	-439	-509	-579
8.00%	-389	-456	-525	-593	-662	-732	-801
KR4201Q52601                      2020-05 콜260							141
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	79	74	67	59	51	43	34
-5.33%	70	62	53	44	35	25	15
-2.67%	55	45	35	24	14	3	-9
0%	35	23	12	0	-12	-24	-36
2.67%	8	-4	-17	-29	-42	-54	-67
5.33%	-25	-38	-51	-64	-77	-89	-102
8.00%	-65	-77	-90	-103	-116	-129	-141
KR4301Q52450                      2020-05 풋245							267
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	189	201	213	226	239	253	267
-5.33%	94	108	123	138	154	169	185
-2.67%	13	29	46	63	80	96	113
0%	-51	-34	-17	0	17	34	51
2.67%	-100	-83	-67	-51	-34	-17	0
5.33%	-133	-120	-105	-90	-75	-59	-43
8.00%	-156	-145	-133	-120	-107	-92	-78
KR4301Q52476                      2020-05 풋247.5							87
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	64	67	71	74	78	82	87
-5.33%	33	37	41	46	51	55	60
-2.67%	6	11	16	21	26	31	37
0%	-16	-11	-5	0	5	11	16
2.67%	-33	-28	-23	-17	-12	-7	-1
5.33%	-45	-41	-36	-31	-26	-21	-16
8.00%	-54	-50	-46	-41	-37	-32	-27

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

(단위:백만원)

1,980

공시일	2020-04-16
기준일	2020-04-14

## 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	147,363	0	147,363	

### 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	2020-04-16
기준일	2020-04-14

## 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	99,365	0	99,365	

### 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	2020-04-16
기준일	2020-04-14

## 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	439,021	0	439,021	
누계	통화	선도	71,212	494,102	-422,890	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,350
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,948
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,895
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,279
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,948
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,435
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,026
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,026
FX21020H04 USD/KRW 21-04-20E	1,461
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,376
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	974
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	974
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,532
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	838
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	730
FX21020H09 USD/KRW 24-04-20E	730
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	487
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,408
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,914
FX21020H11 KRW/USD 11-05-20E	974
FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E	2,922
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

22,491



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

(단위:백만원)

188

공시일	2020-04-16
기준일	2020-04-14

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

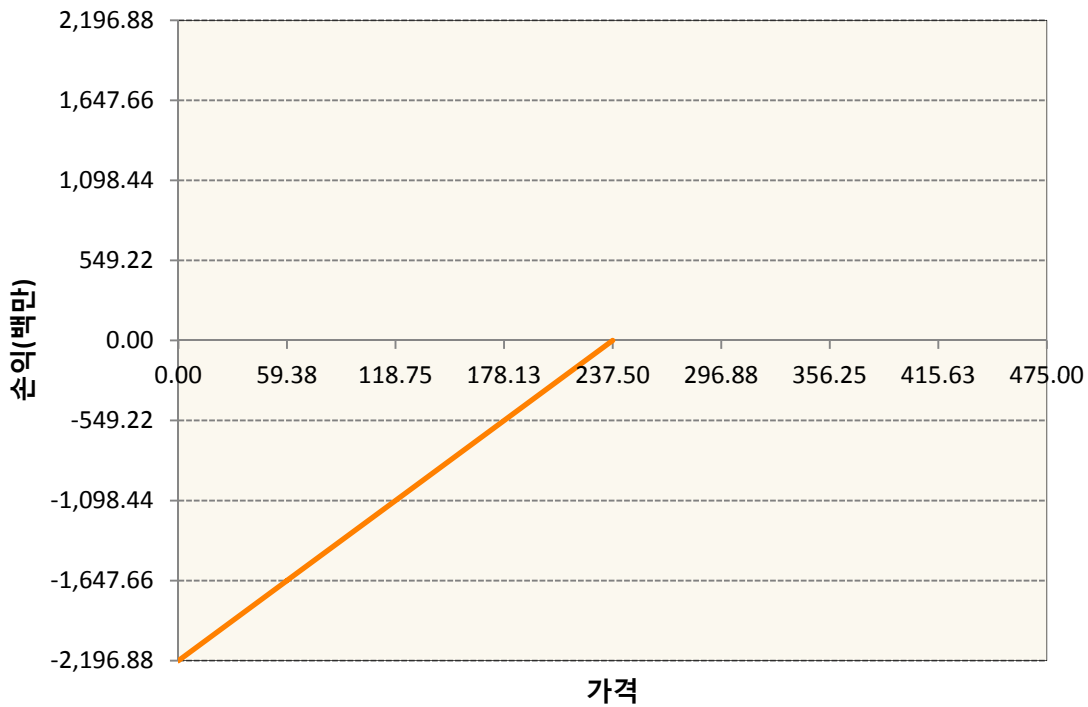
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

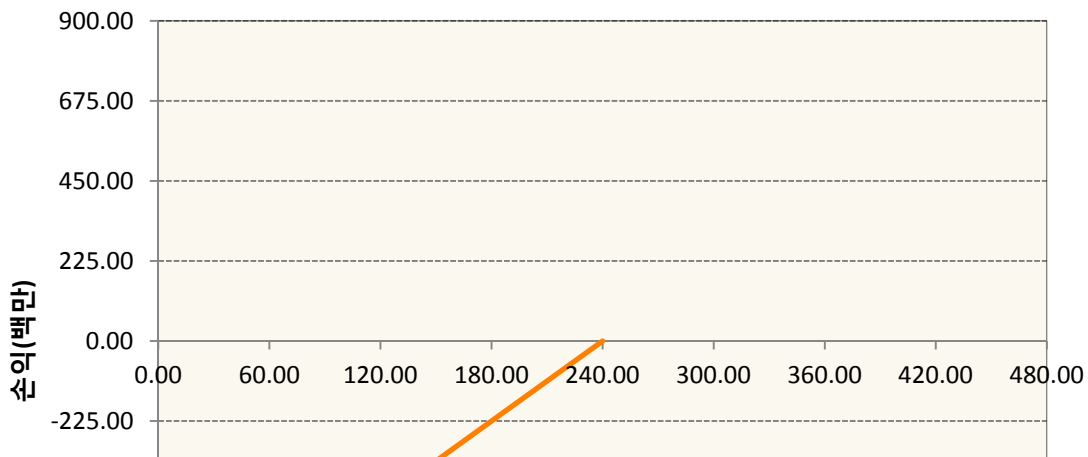
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,097	-3,097	장내

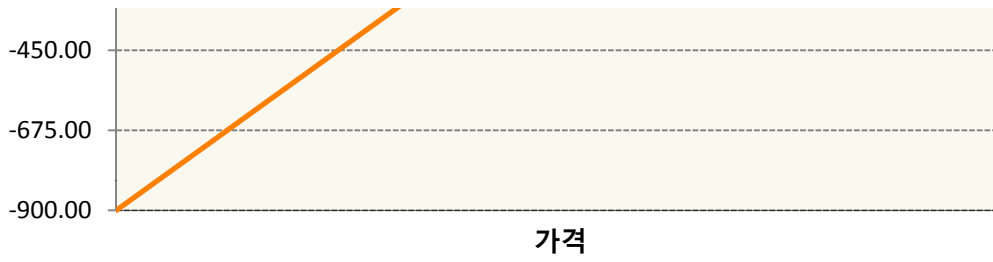
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q52377-2020-05 풋237.5



KR4301Q52401-2020-05 풋240





**3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4301Q52377		2020-05 풋237.5						110
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-67	-74	-81	-88	-96	-103	-110	
-5.33%	-29	-37	-45	-53	-61	-68	-76	
-2.67%	0	-7	-15	-23	-31	-39	-47	
0%	22	15	8	0	-8	-15	-23	
2.67%	37	31	25	18	11	4	-3	
5.33%	47	42	37	31	25	19	12	
8.00%	53	50	45	41	36	31	25	
KR4301Q52401		2020-05 풋240						47
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-30	-33	-36	-39	-41	-44	-47	
-5.33%	-14	-17	-20	-23	-26	-30	-33	
-2.67%	-1	-4	-7	-10	-14	-17	-20	
0%	9	6	3	0	-3	-6	-10	
2.67%	17	14	11	8	5	2	-1	
5.33%	21	19	17	14	12	9	6	
8.00%	24	23	21	19	17	14	12	

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

**125**

공시일	2020-04-16
기준일	2020-04-14

## 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	7,237	0	7,237	
누계	통화	선도	0	7,121	-7,121	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	318
IE00BD8RGM75	*

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

283
-----

공시일	2020-04-16
기준일	2020-04-14

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

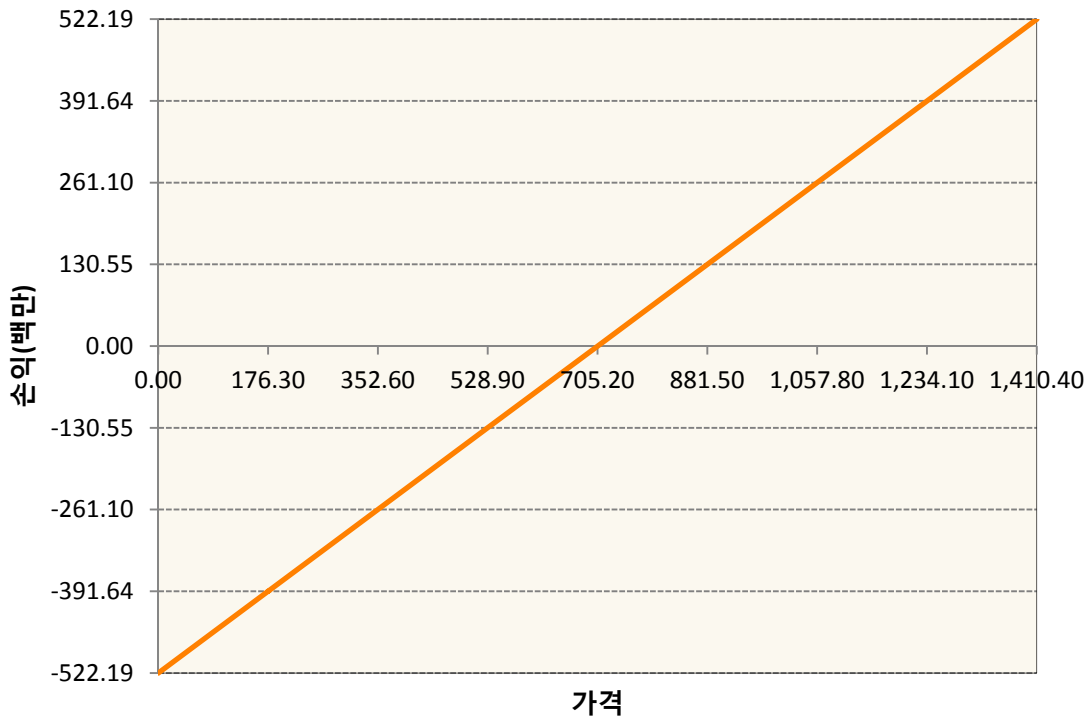
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

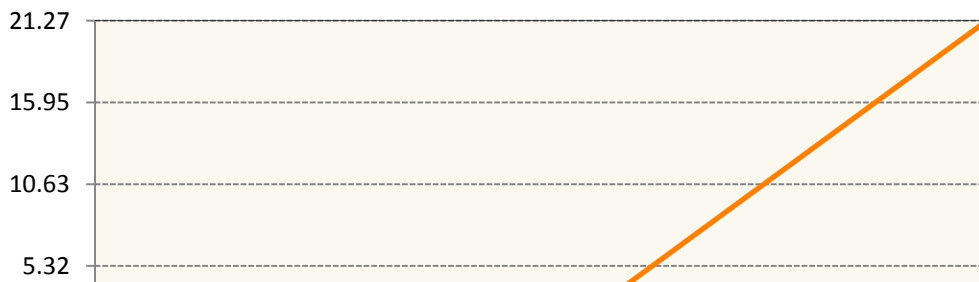
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	543	0	543	
누계	유가증권	스왑	1,098	0	1,098	장외
누계	통화	선도	232	439	-208	장외

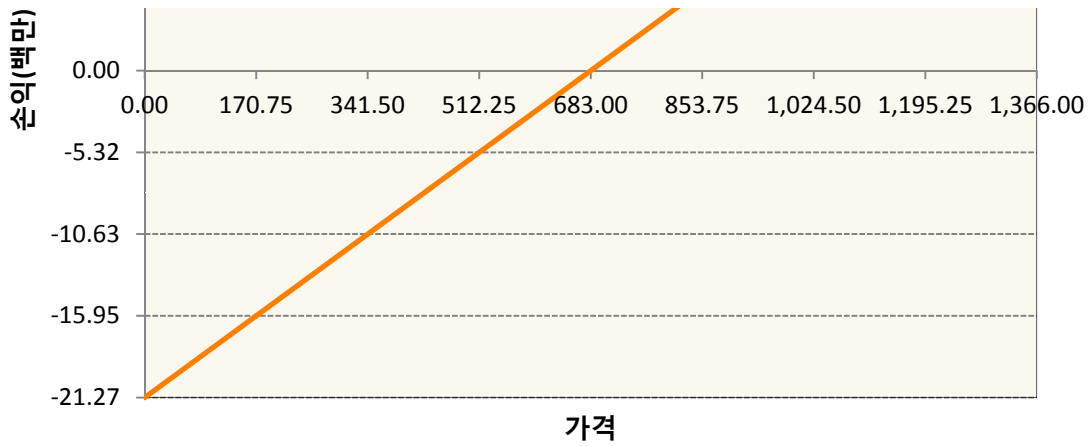
### 2. 만기시점의 손익구조

VNCJ0-VN30 Index Future Apr20



VNCK0-VN30 Index Future May20





**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	9
FX21020J00(KRW/EUR 24-07-20E)	3
FX21020J00(KRW/EUR 24-07-20E)	5
FX21020J01(KRW/EUR 24-07-20E)	3
VNCJ0 VN30 Index Future Apr20	42
VNCK0 VN30 Index Future May20	2

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

**146**

공시일	2020-04-16
기준일	2020-04-14

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

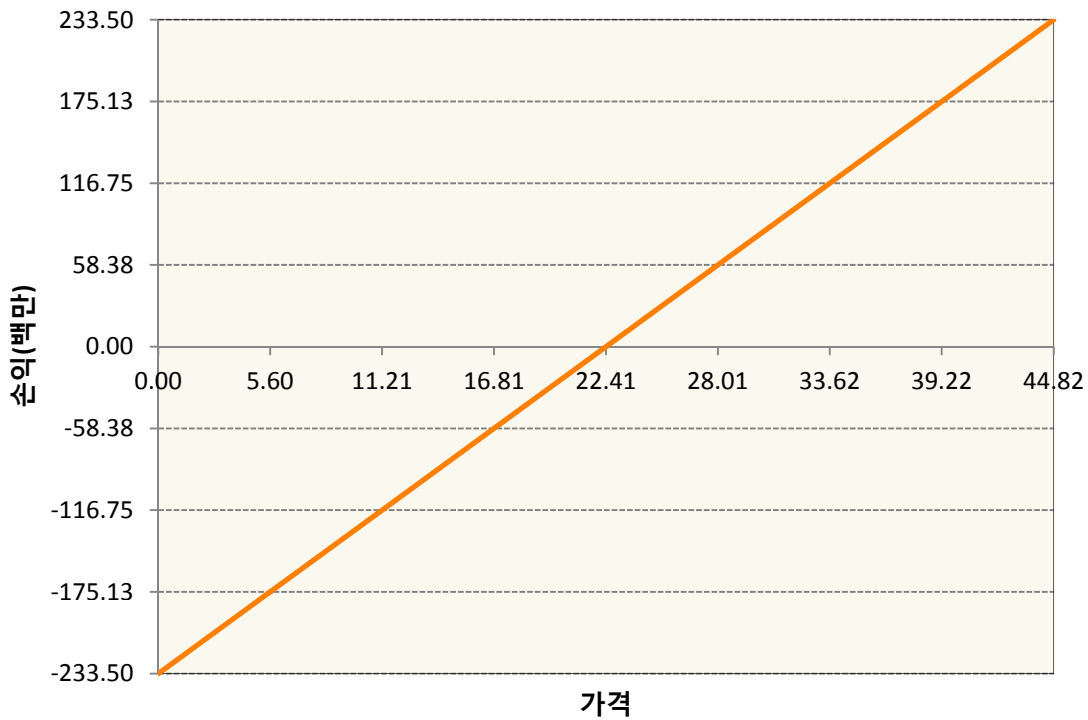
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

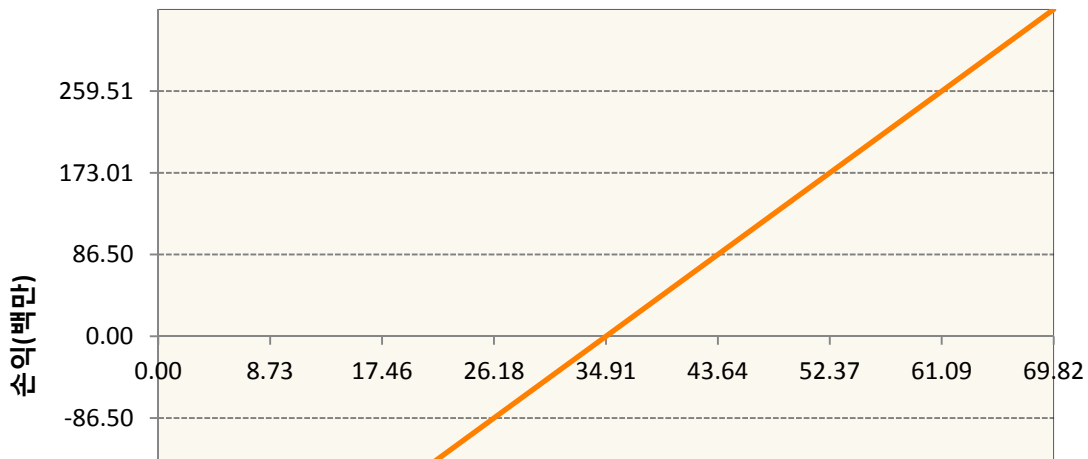
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,484	243	1,241	

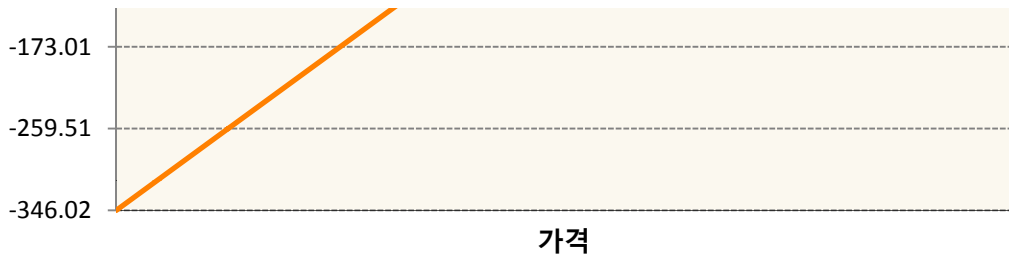
### 2. 만기시점의 손익구조

CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20

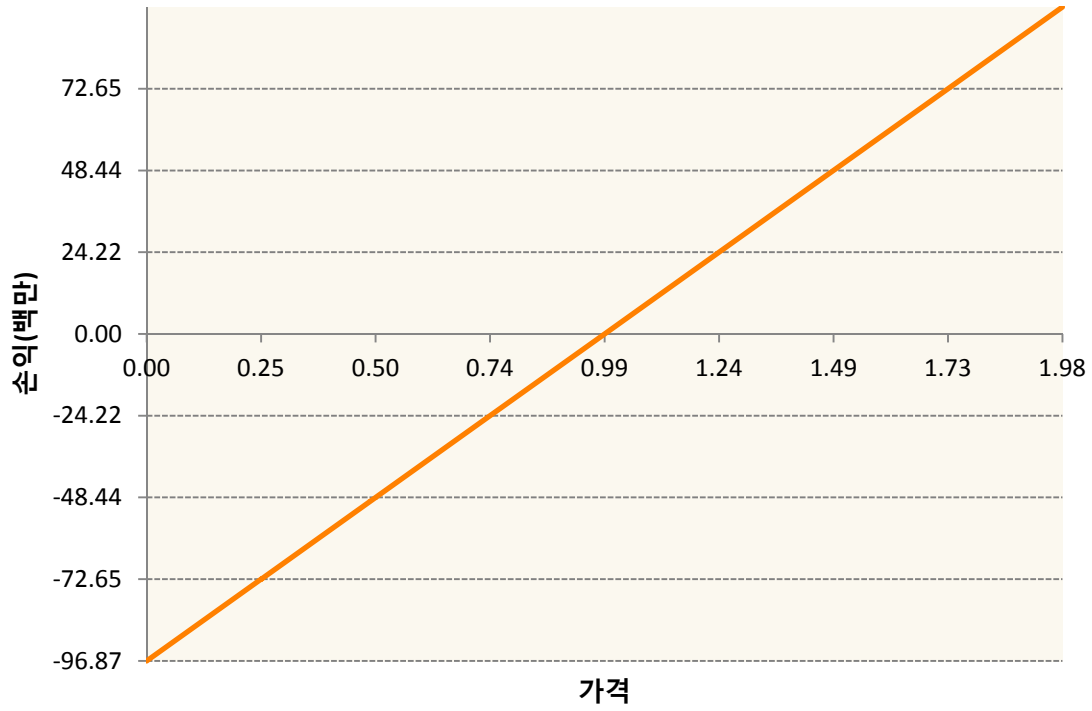


CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20

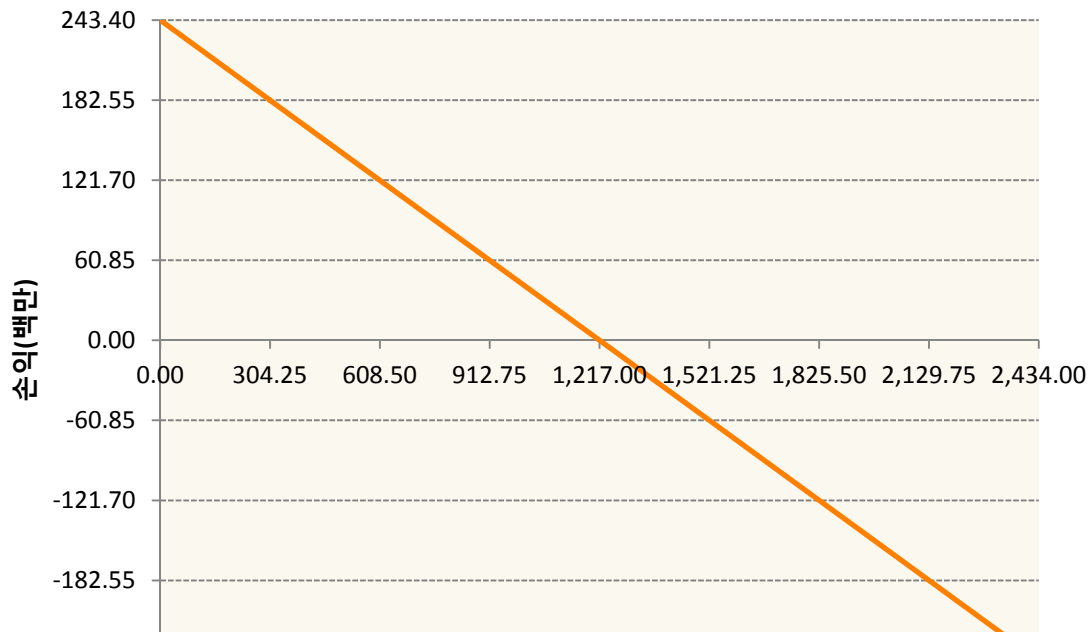


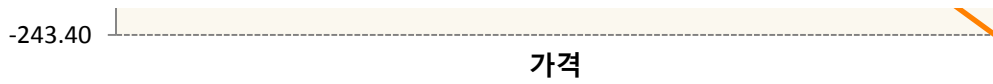


HOK0-NY Harb ULSD Fut May20

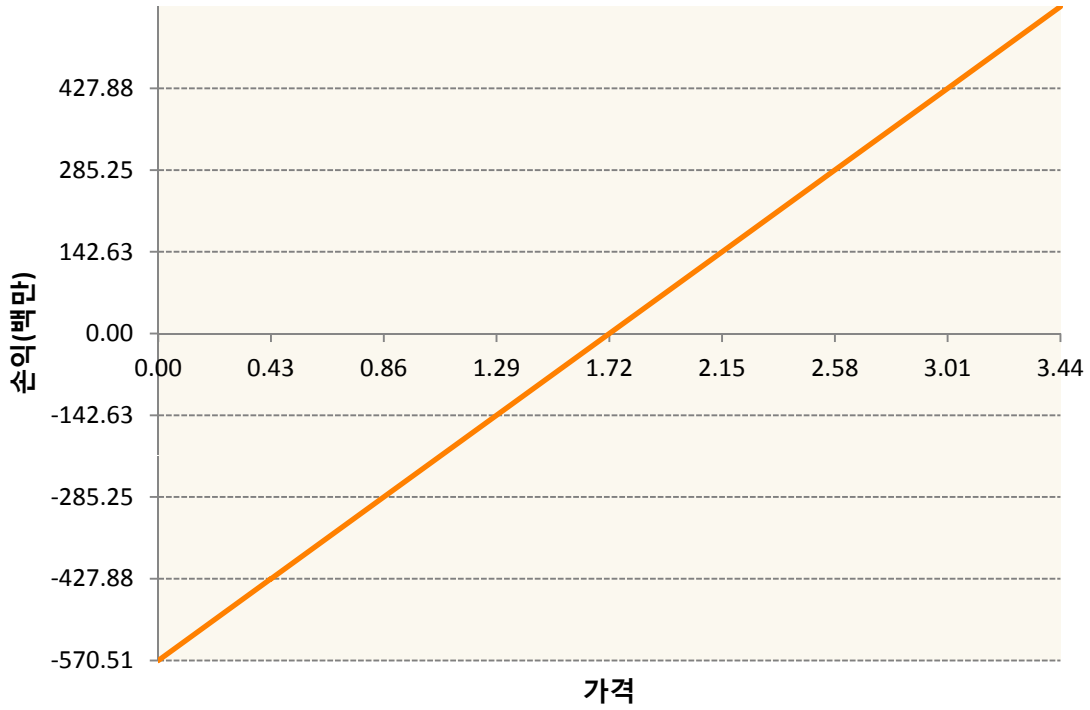


KR4175Q40008-2020-04 달러선물

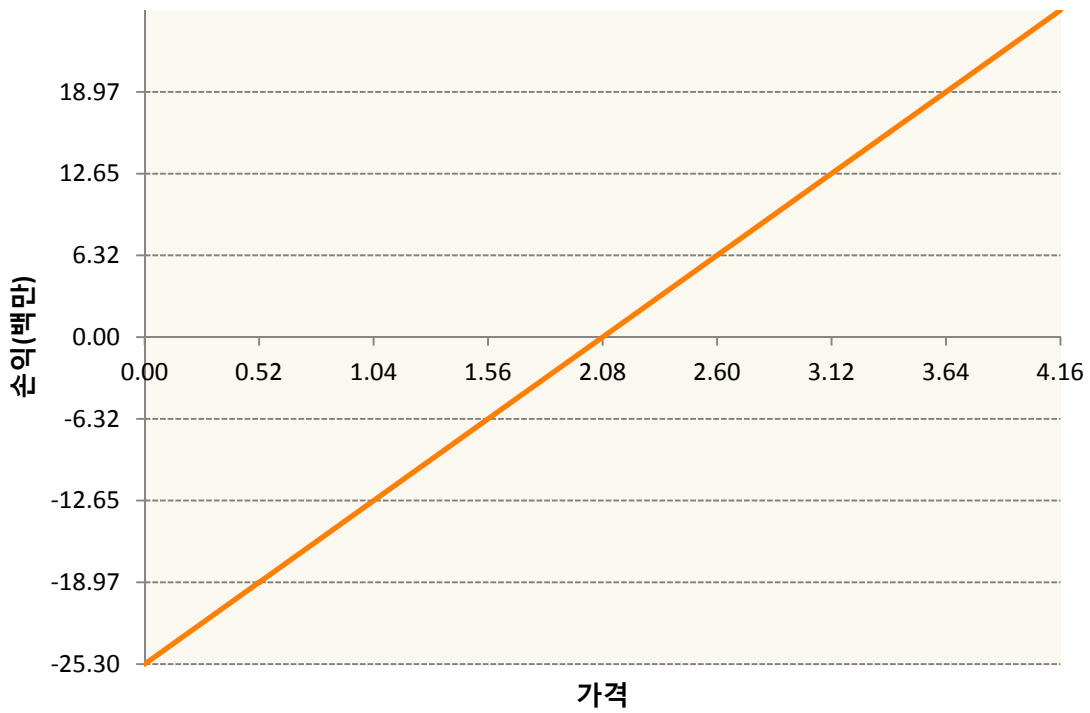




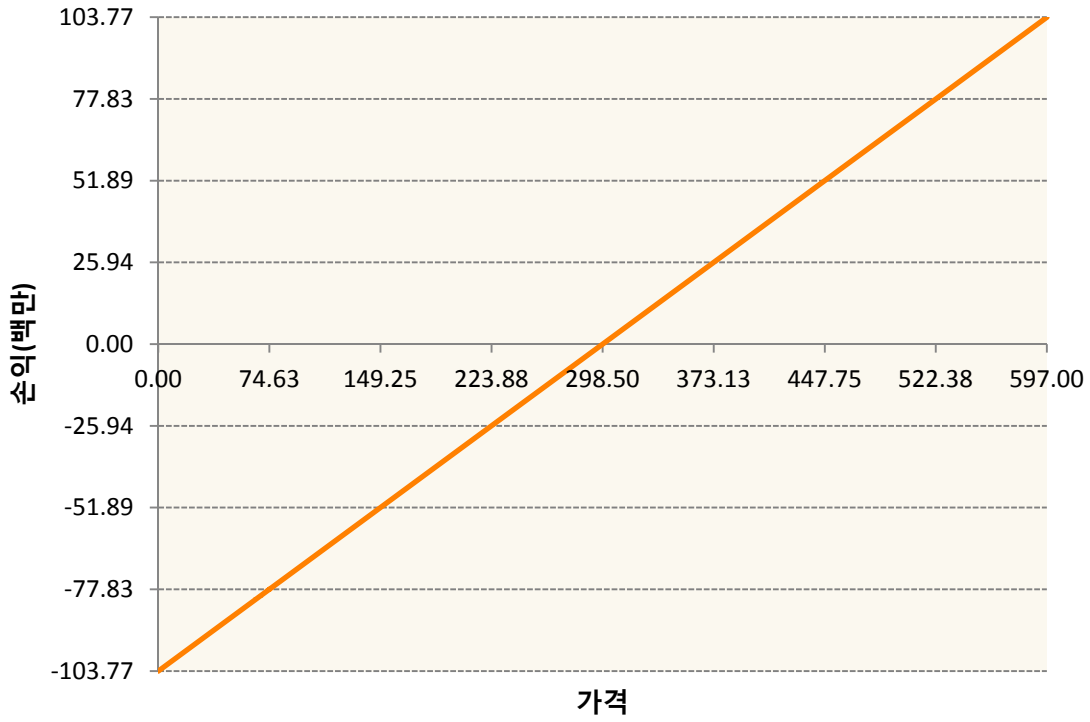
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



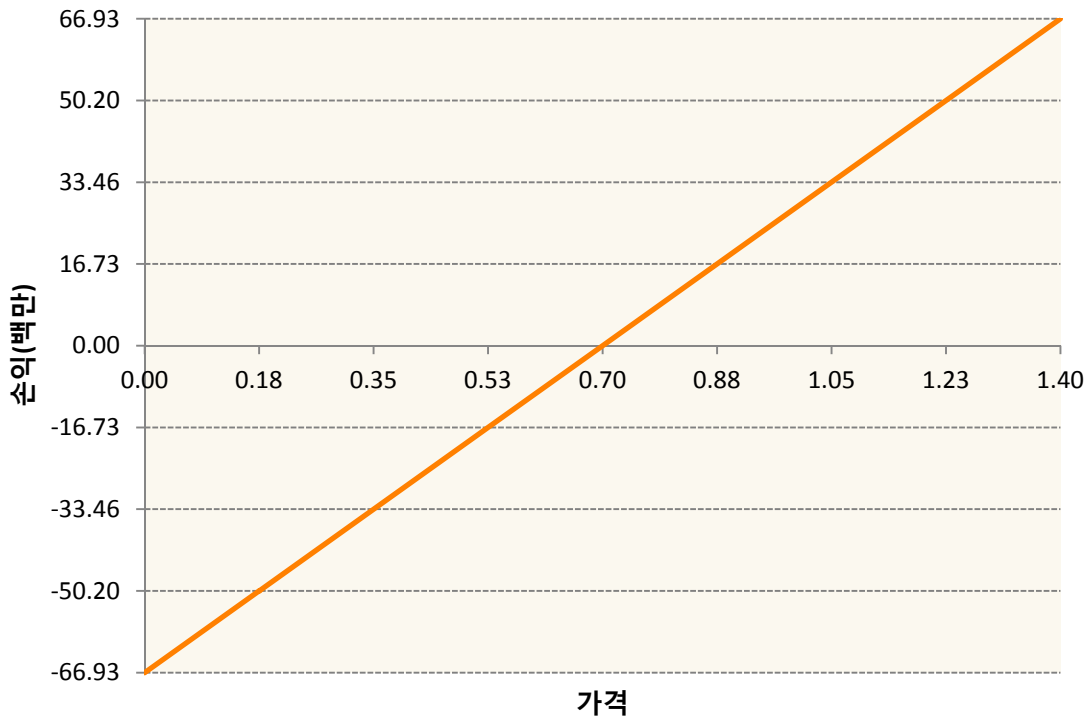
NGN20-NATURAL GAS FUTR Jul20



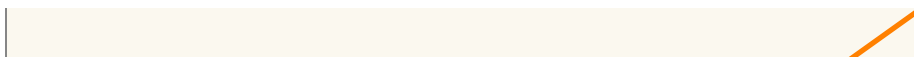
QSK0-Low Su Gasoil G Mar20

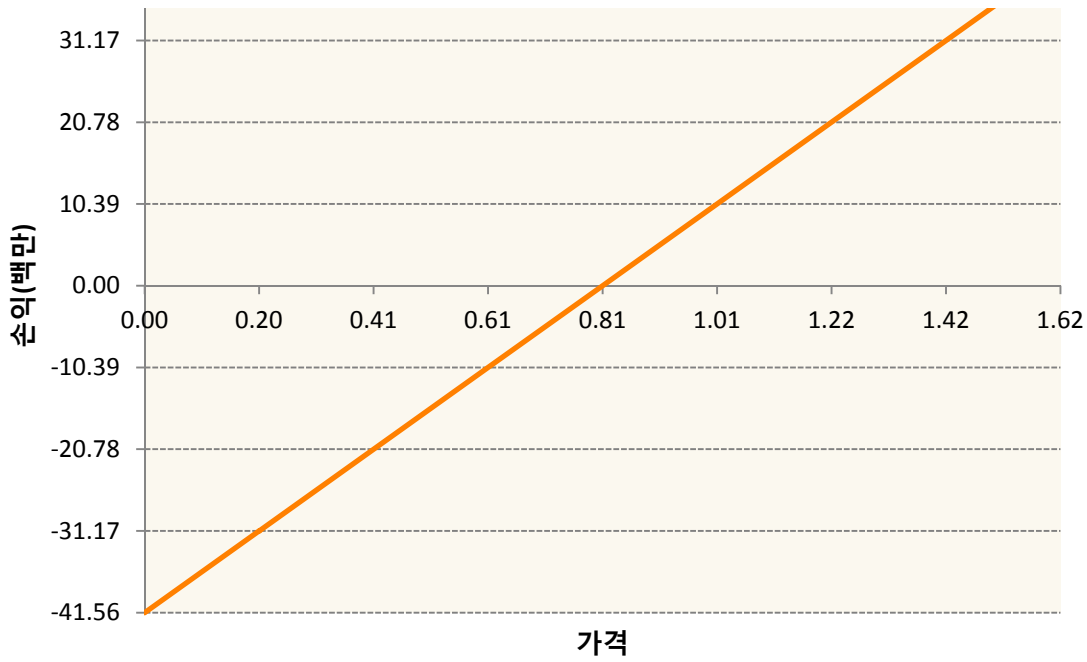


XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	19
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	28
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	8
KR4175Q40C	2020-04 달러선물	19
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	46
NGN20	NATURAL GAS FUTR Jul20	2
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	8
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	5
XBN0	GASOLINE RBOB FUT Jul20	3

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

**361**

공시일	2020-04-16
기준일	2020-04-14

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

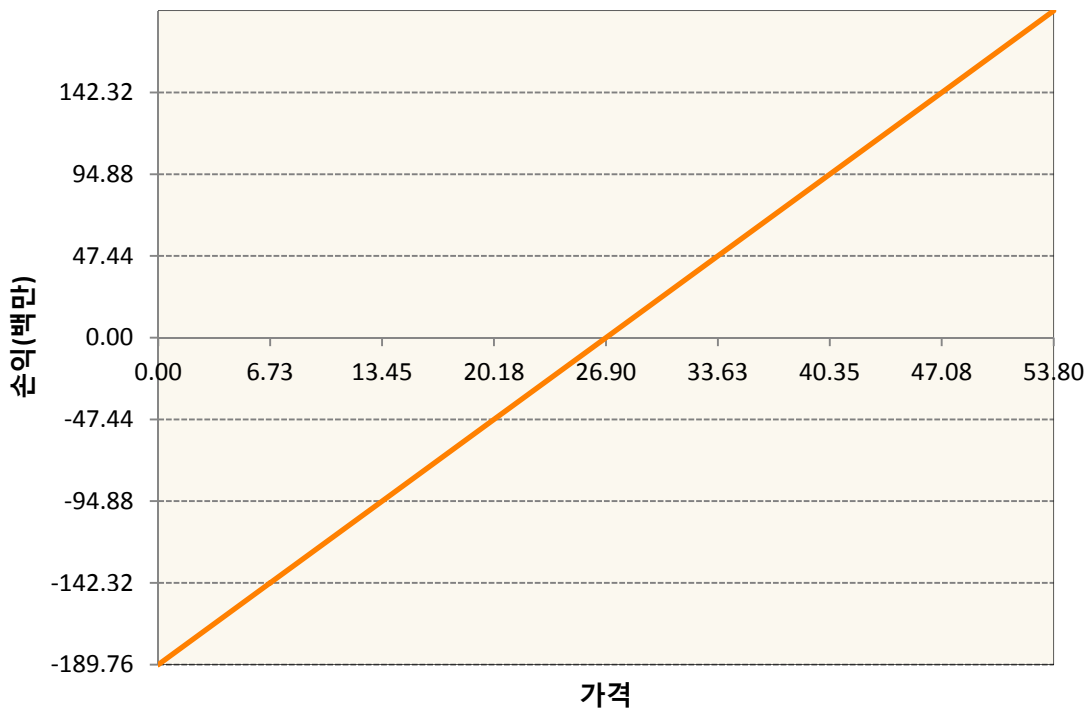
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

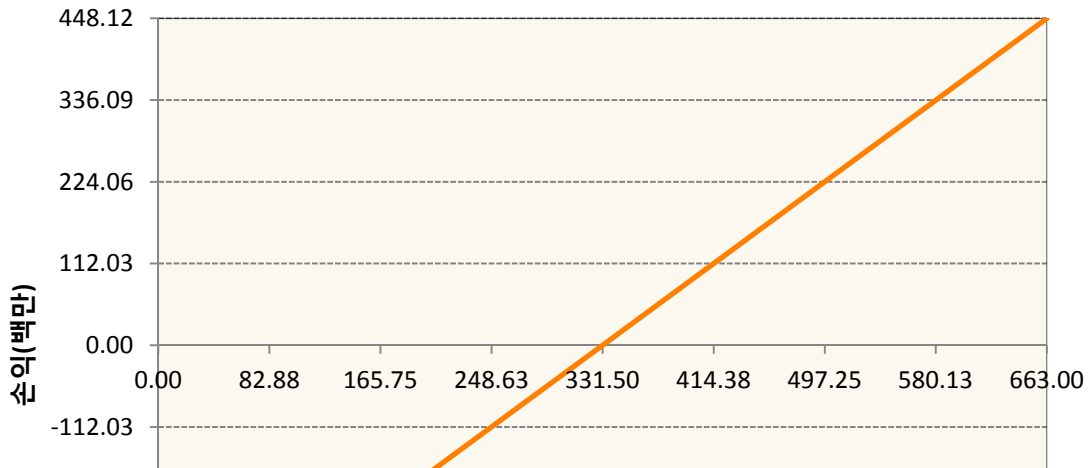
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,332	97	2,235	

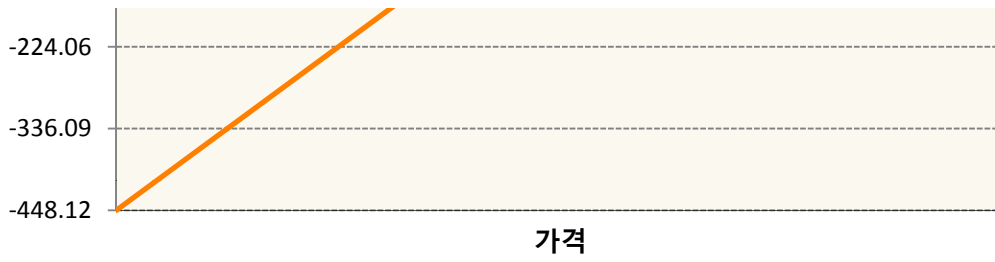
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20**

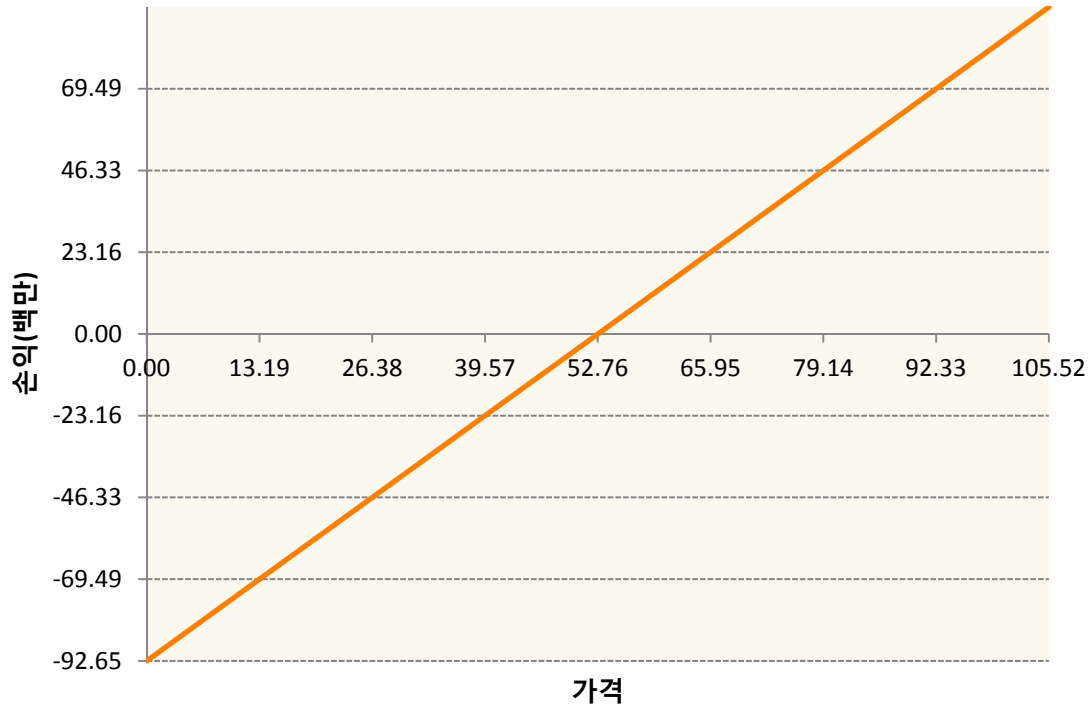


**CK0-CORN FUTURE May20**

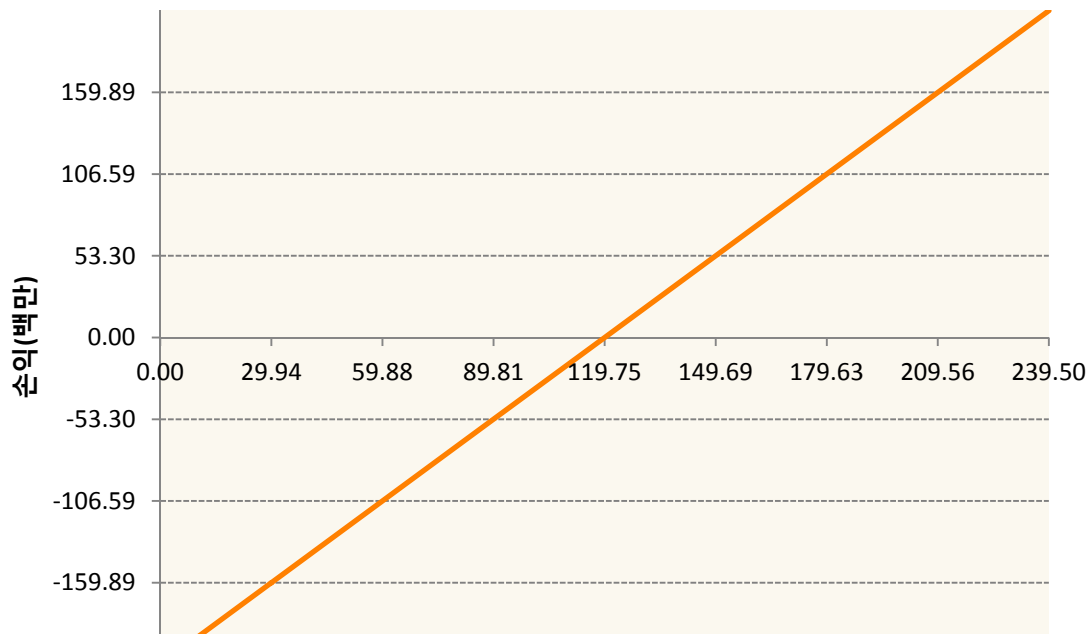


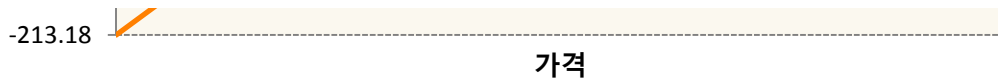


CTK0-COTTON NO.2 FUTR May20

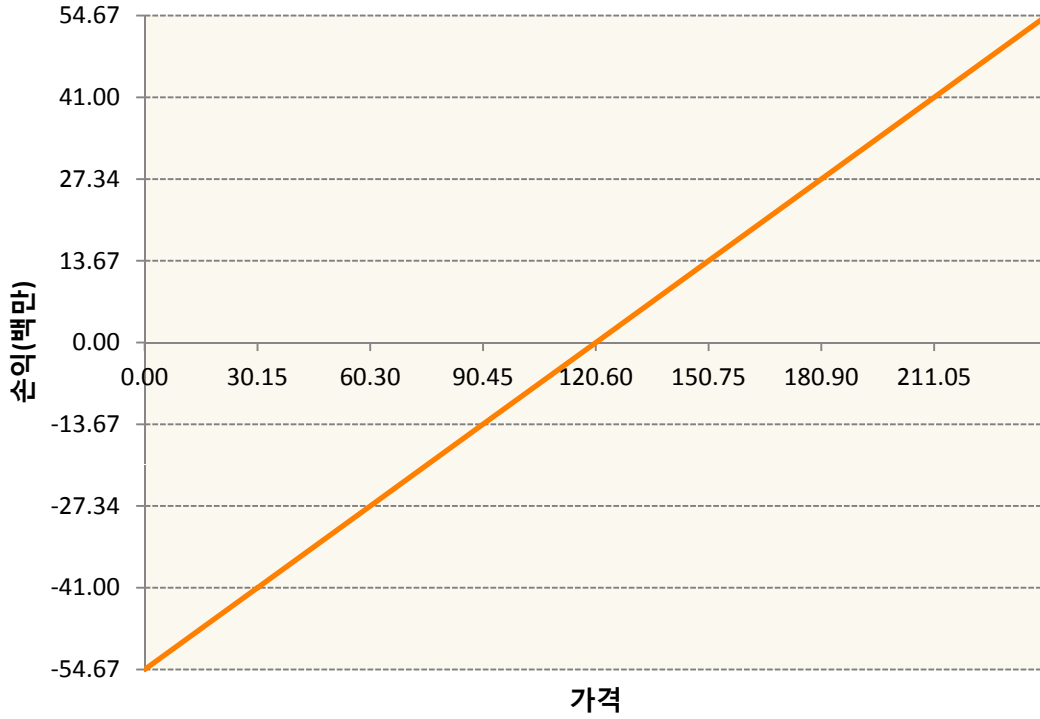


KCK0-COFFEE 'C' FUTURE May20

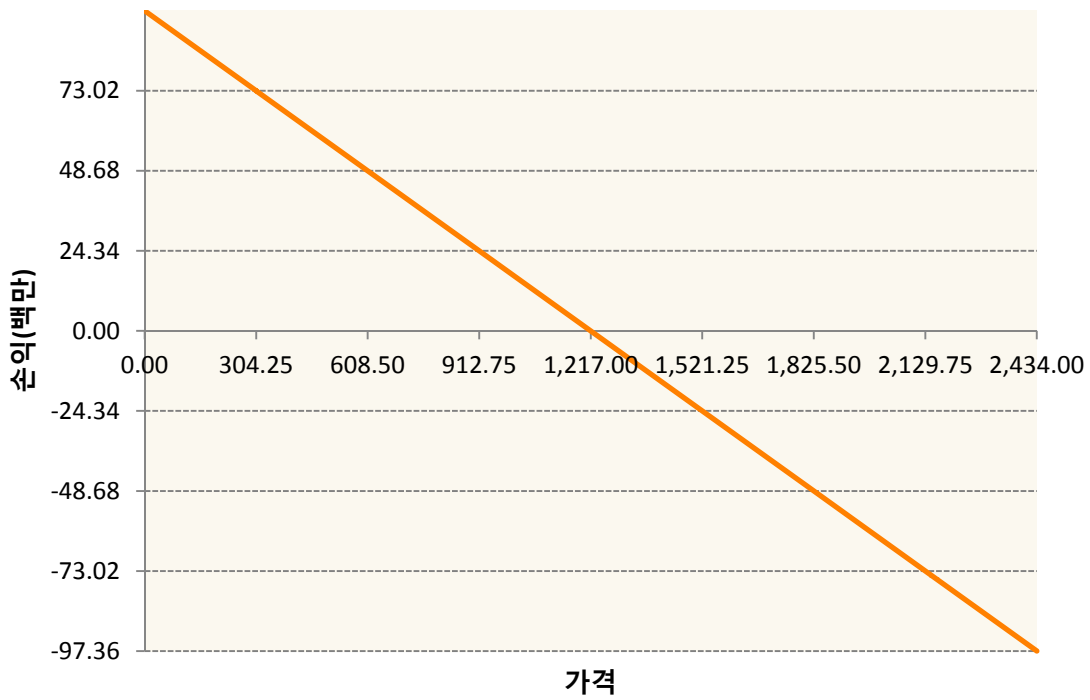




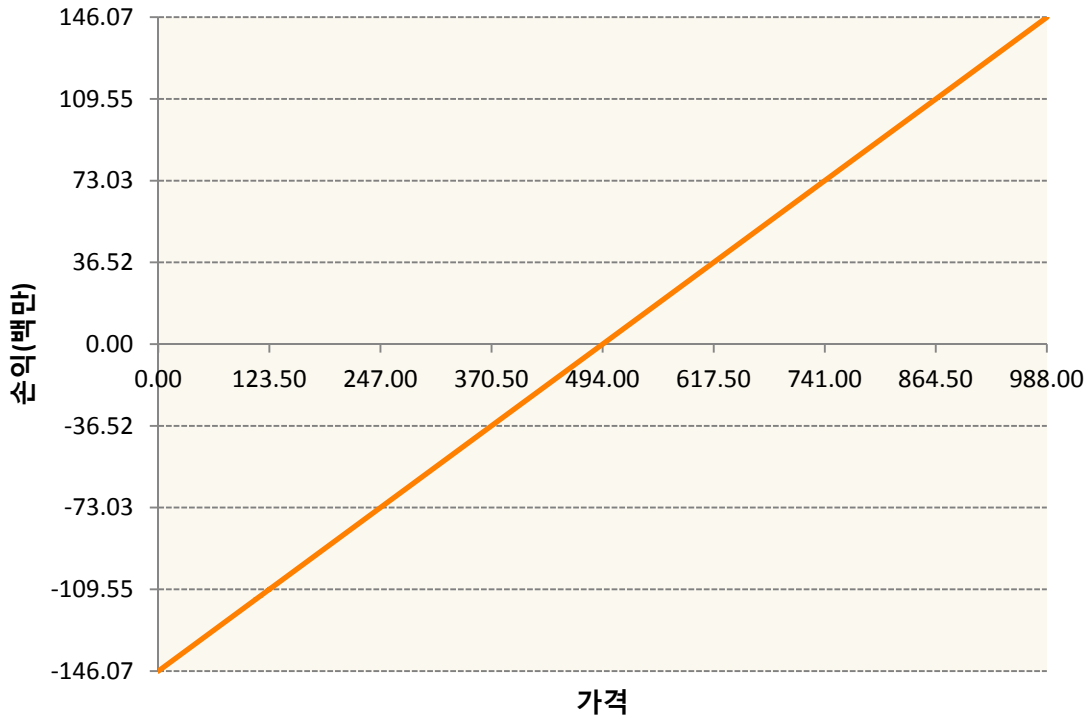
KCN0-COFFEE 'C' FUTURE Jul20



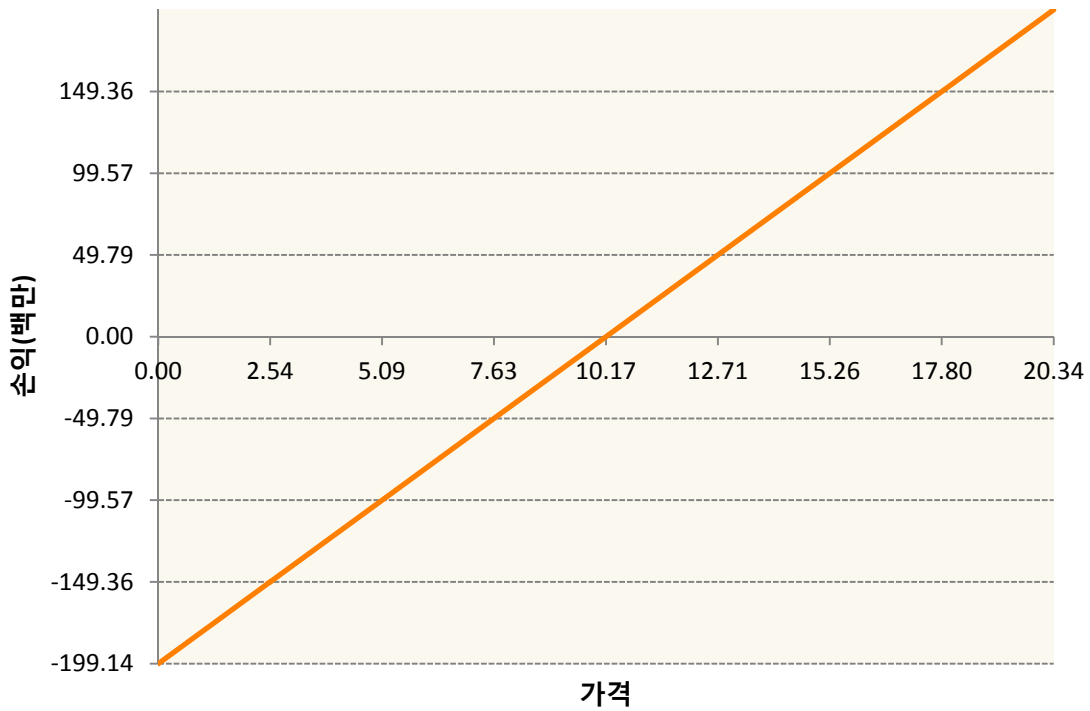
KR4175Q40008-2020-04 달러선물



KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20

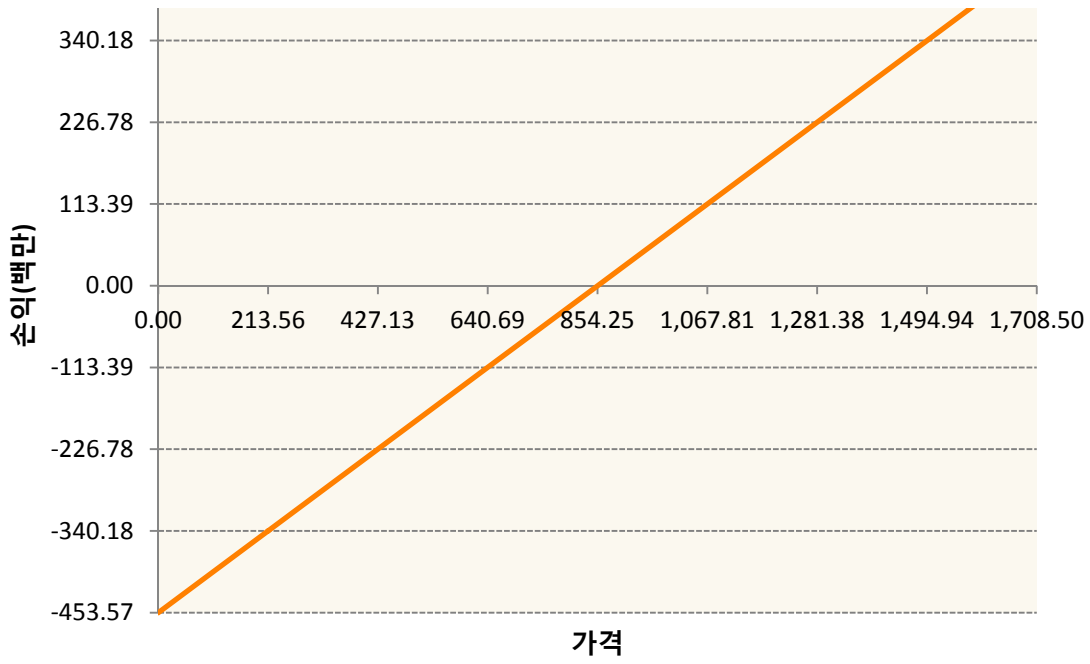


SBK0-Sugar May20

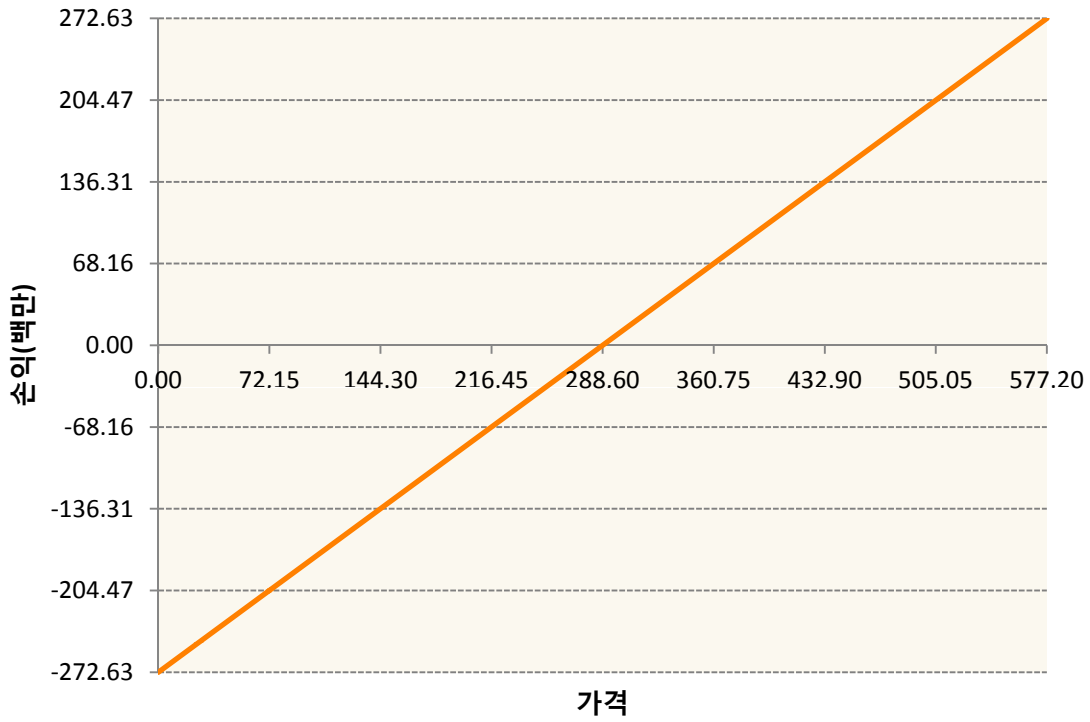


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



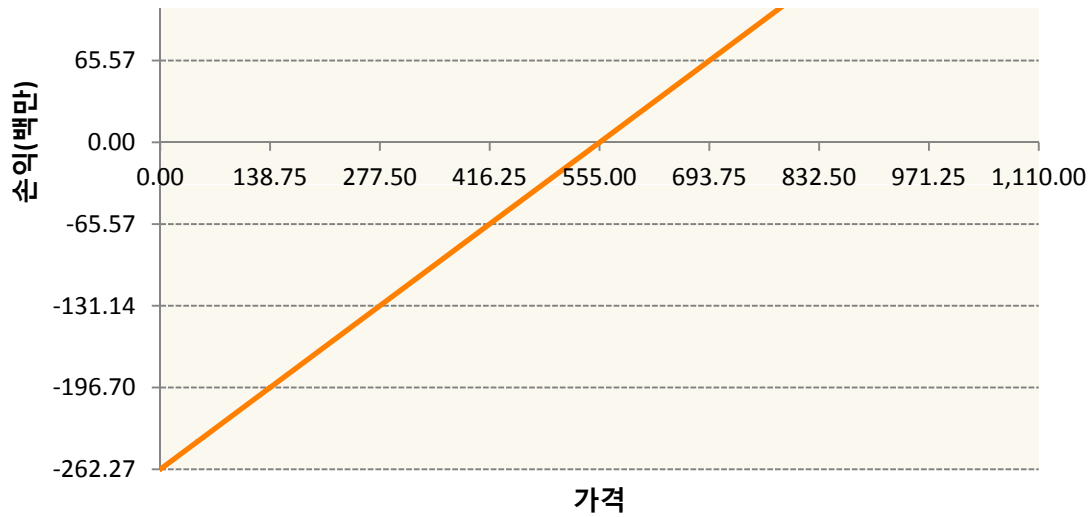


SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20



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	7
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	36
SMK0	SOYBEAN MEAL FUTR May20	22
WK0	WHEAT FUTURE(CBT) May20	21

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

220