

공시일	2020-04-17
기준일	2020-04-16

## 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	2020-04-17
기준일	2020-04-16

## 스마트인덱스모

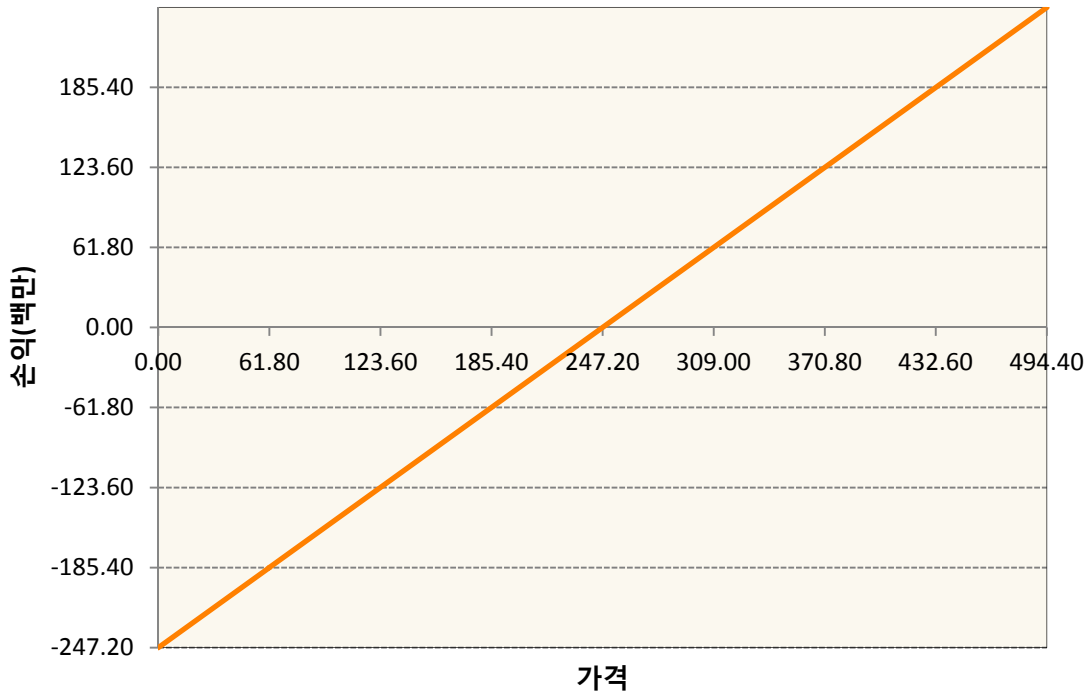
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

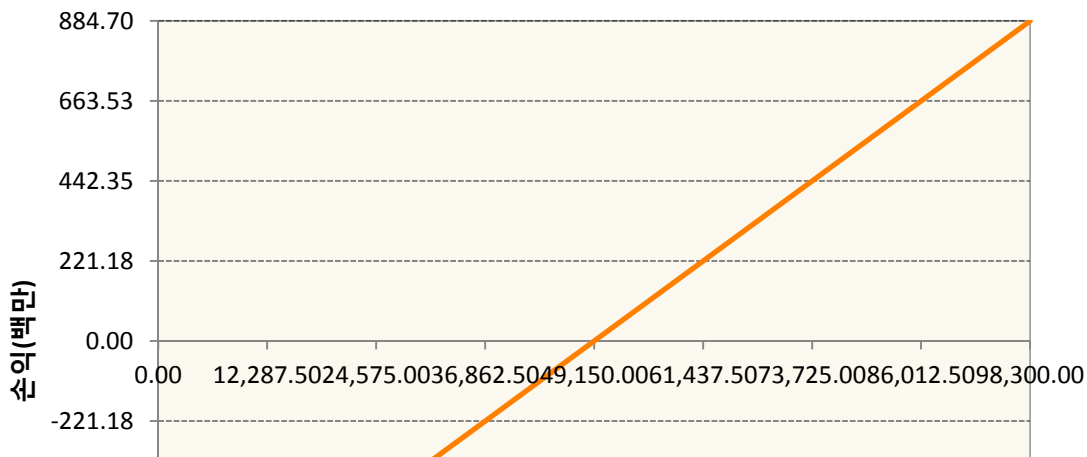
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,132	0	1,132	장내

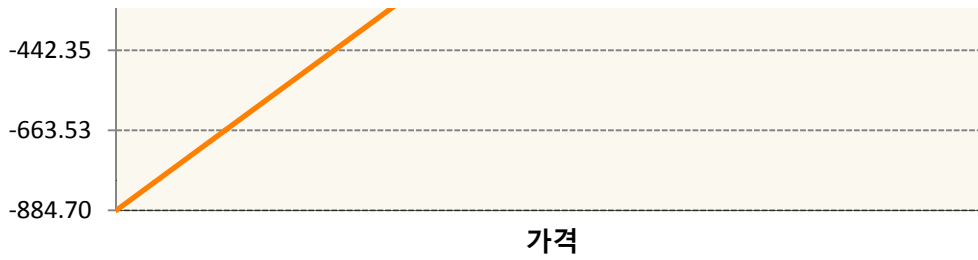
### 2. 만기시점의 손익구조

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	2020-04-17
기준일	2020-04-16

## 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

943

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,090

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-17
기준일	2020-04-16

## 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

554

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

879

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-17
기준일	2020-04-16

## 유로인덱스모(주식-파생형)

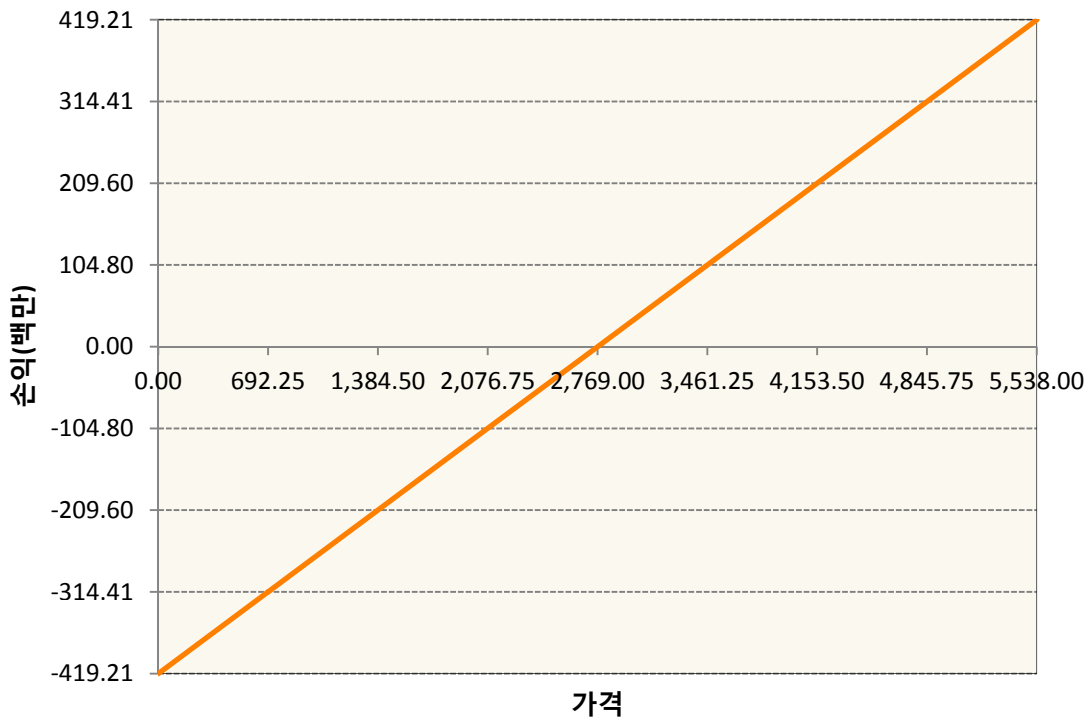
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	419	0	419	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	34
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

41
----

공시일	2020-04-17
기준일	2020-04-16

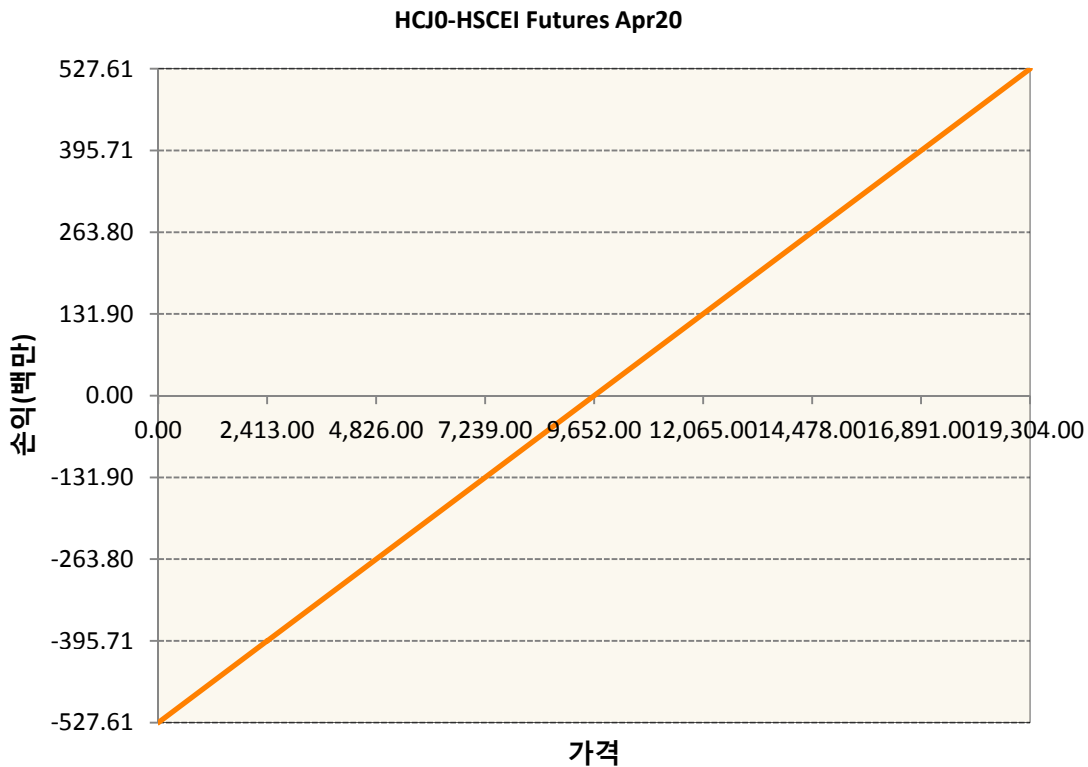
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	528	0	528	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ0	HSCEI Futures Apr20	42
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

45
----

공시일	2020-04-17
기준일	2020-04-16

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

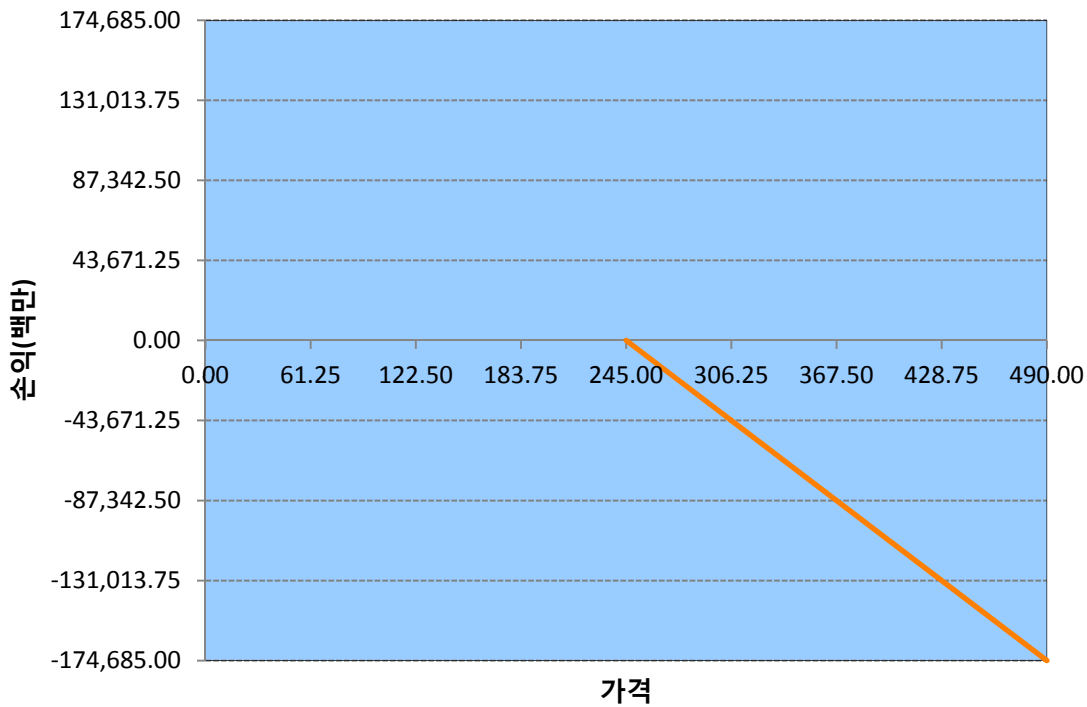
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

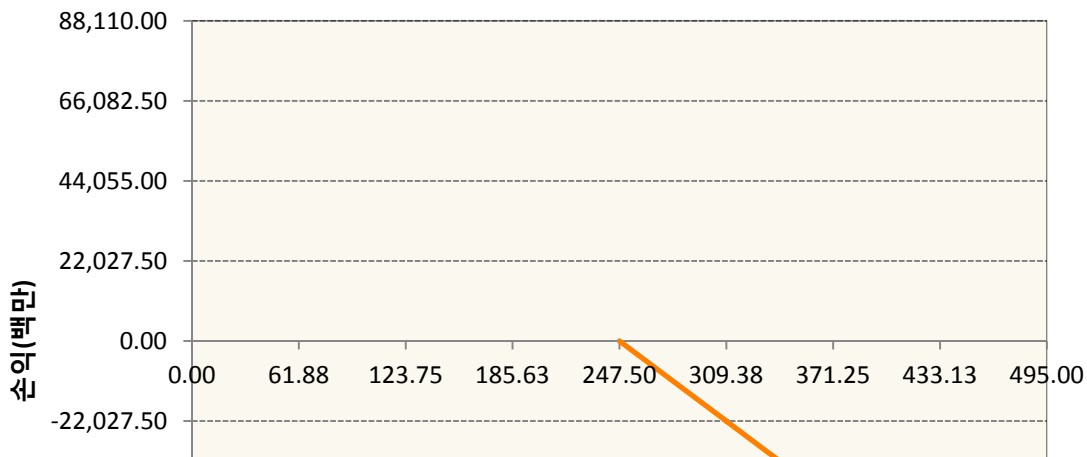
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	358,345	-358,345	장내

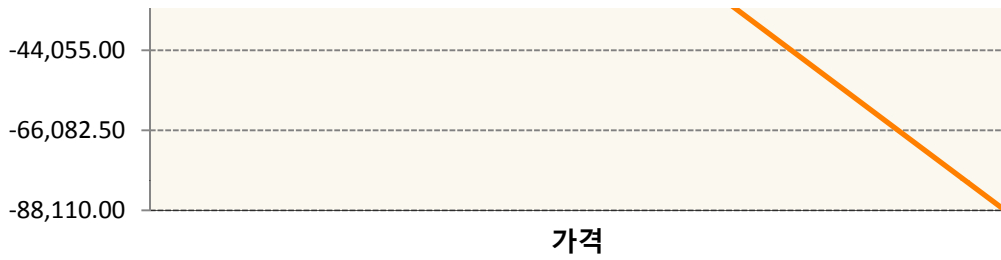
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q52452-2020-05 콜245

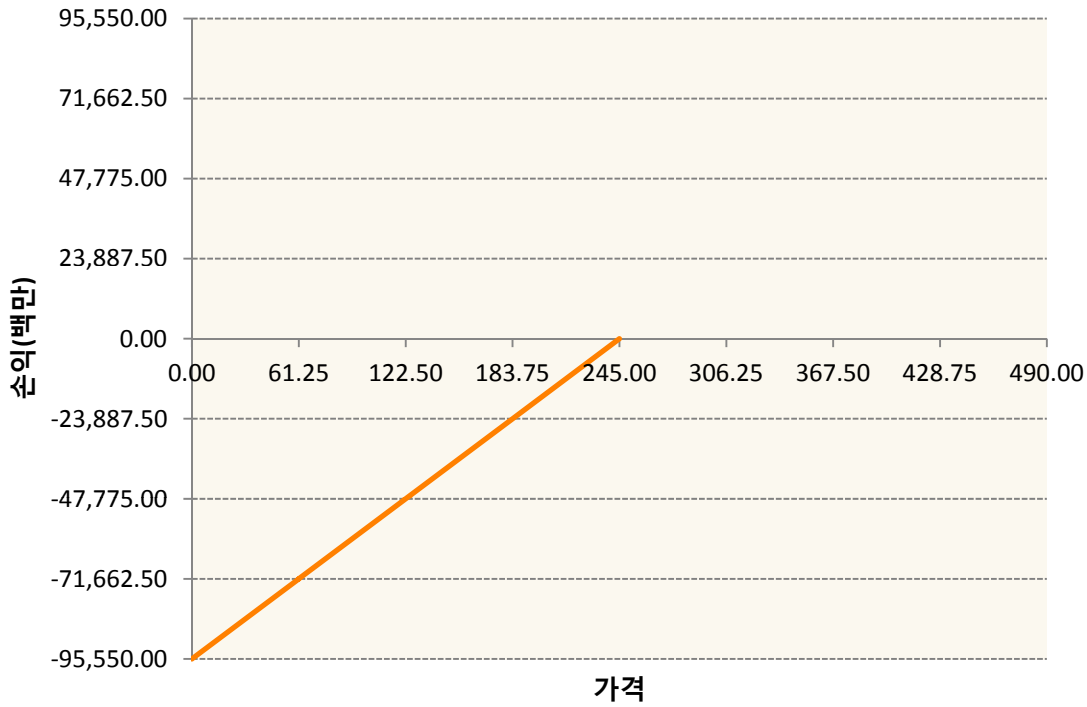


KR4201Q52478-2020-05 콜247.5





KR4301Q52450-2020-05 풋245



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q52452		2020-05 콜245					11,355
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,906	7,313	6,692	6,050	5,391	4,719	4,037
-5.33%	6,540	5,840	5,127	4,405	3,676	2,941	2,202
-2.67%	4,704	3,934	3,163	2,389	1,615	840	64
0%	2,374	1,583	792	0	-791	-1,583	-2,374
2.67%	-437	-1,202	-1,974	-2,751	-3,532	-4,315	-5,101
5.33%	-3,688	-4,388	-5,107	-5,841	-6,586	-7,340	-8,102
8.00%	-7,318	-7,925	-8,567	-9,236	-9,926	-10,634	-11,355
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5					5,520
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,699	3,421	3,127	2,820	2,503	2,177	1,845

-5.33%	3,094	2,758	2,413	2,062	1,706	1,345	982
-2.67%	2,265	1,886	1,506	1,124	740	355	-31
0%	1,194	796	398	0	-398	-795	-1,192
2.67%	-119	-513	-909	-1,305	-1,703	-2,101	-2,499
5.33%	-1,660	-2,028	-2,403	-2,783	-3,168	-3,555	-3,945
8.00%	-3,400	-3,726	-4,067	-4,419	-4,779	-5,147	-5,520
KR4301Q52450                      2020-05 풋245							5,421
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,989	-4,195	-4,418	-4,655	-4,902	-5,158	-5,421
-5.33%	-2,006	-2,278	-2,558	-2,845	-3,137	-3,432	-3,731
-2.67%	-335	-652	-970	-1,289	-1,610	-1,931	-2,252
0%	988	659	329	0	-329	-659	-988
2.67%	1,966	1,658	1,346	1,030	711	390	68
5.33%	2,640	2,379	2,105	1,822	1,530	1,233	930
8.00%	3,073	2,871	2,648	2,409	2,156	1,891	1,618

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

(단위:백만원)

**18,489**

공시일	2020-04-17
기준일	2020-04-16

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

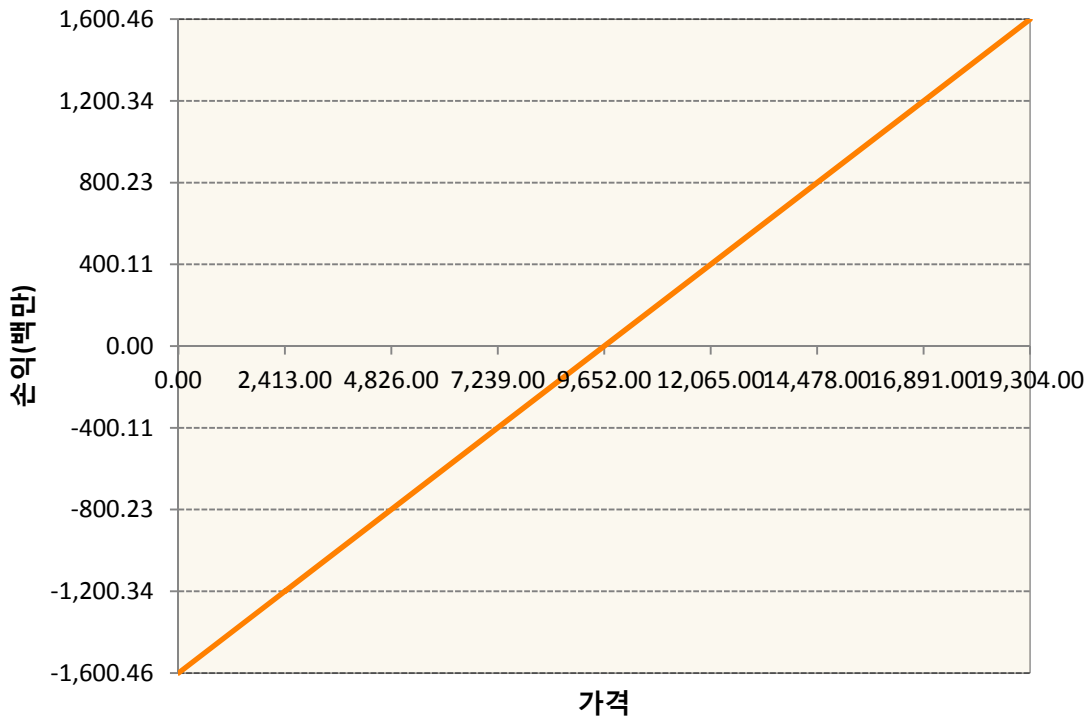
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

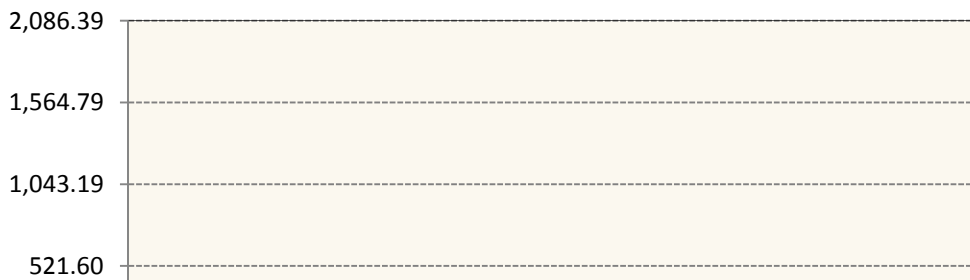
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,600	0	1,600	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,174	-4,174	장내
누계	통화	선도	698	2,232	-1,535	장외

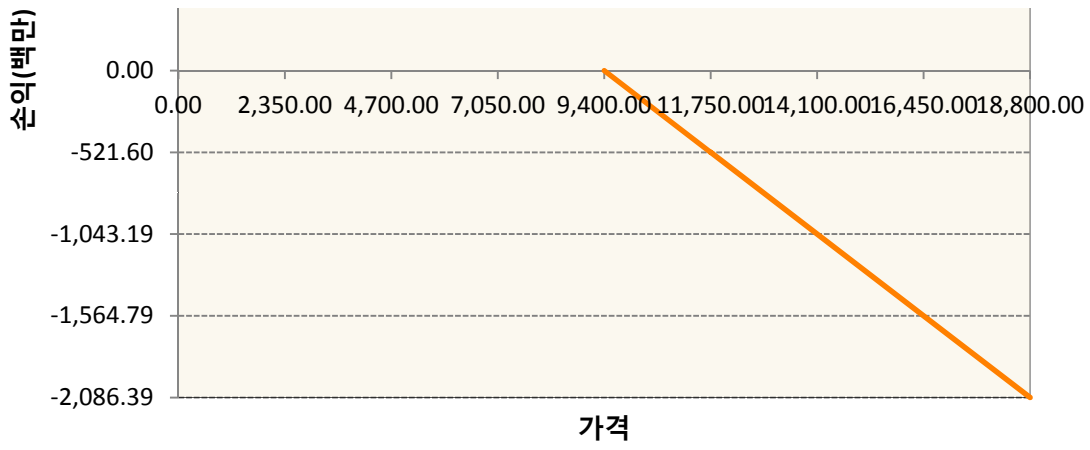
### 2. 만기시점의 손익구조

HCJ0-HSCEI Futures Apr20

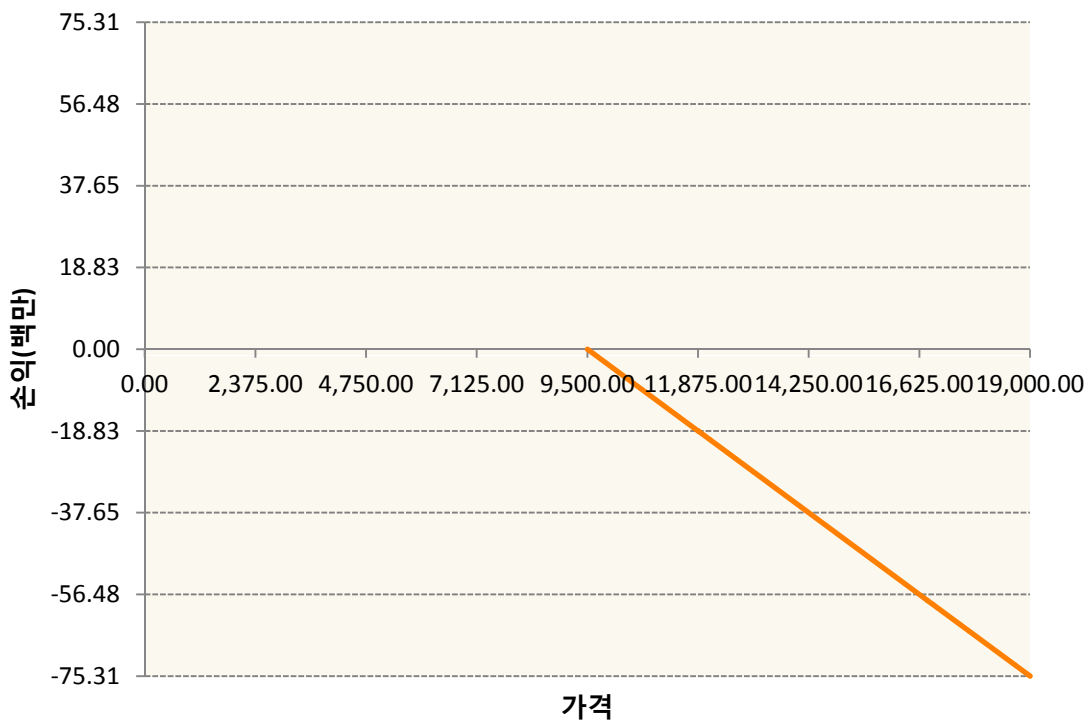


OHHIJ0-C94-HSCEI

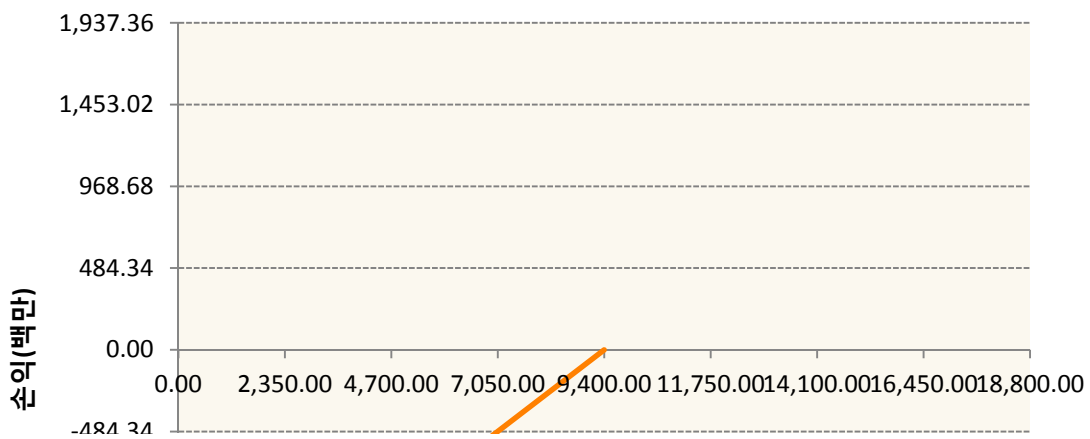


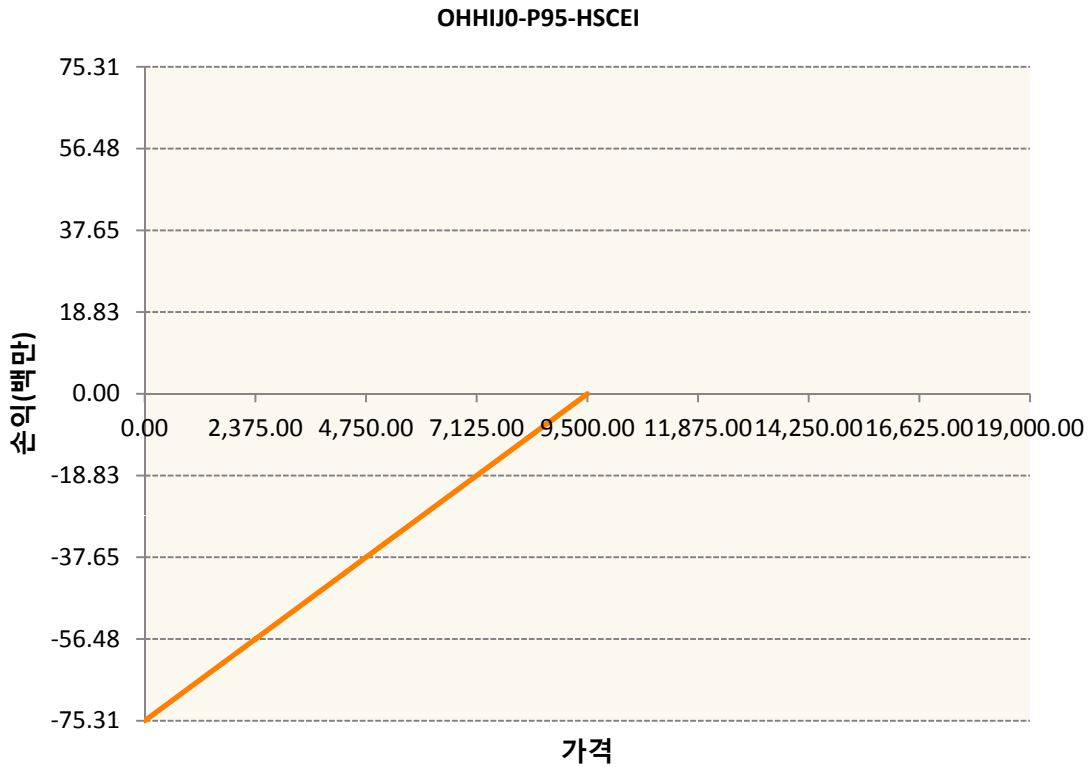


OHHIJO-C95-HSCEI



OHHIJO-P94-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E	179
FX21020H05 HKD/KRW 22-05-20E	56
HCJ0 HSCEI Futures Apr20	128
OHHIJ0-C94 HSCEI	167
OHHIJ0-C95 HSCEI	6
OHHIJ0-P94 HSCEI	155
OHHIJ0-P95 HSCEI	6

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	<b>613</b>

공시일	2020-04-17
기준일	2020-04-16

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

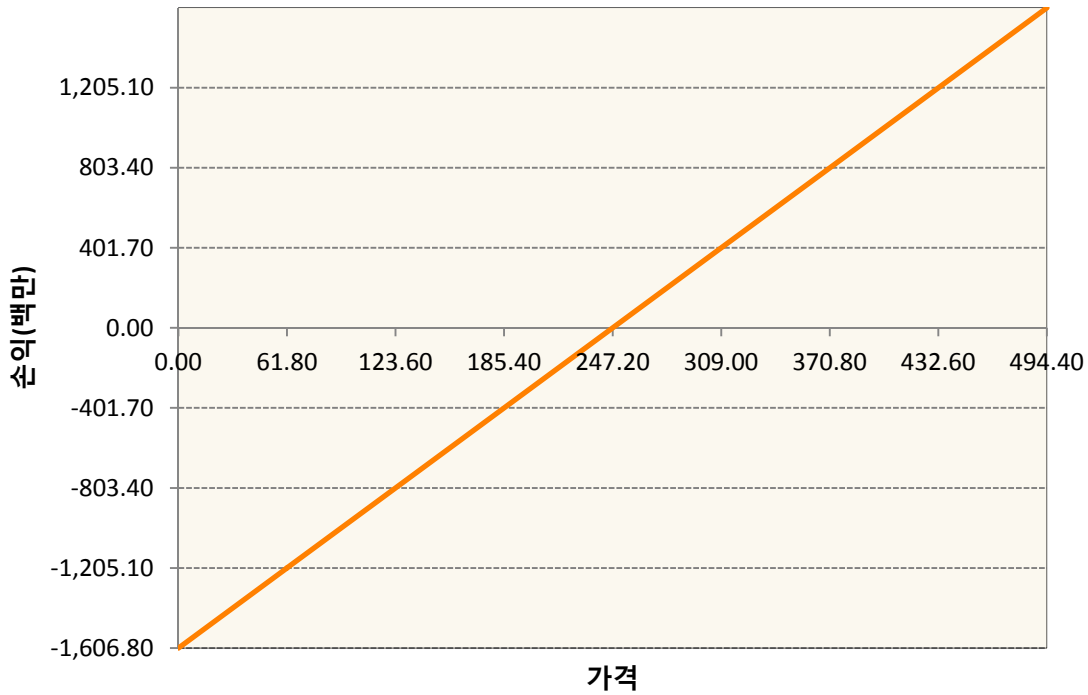
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

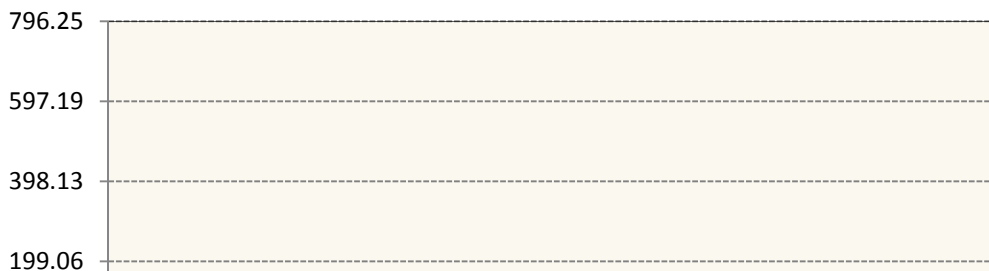
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,607	0	1,607	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,193	-3,193	장내

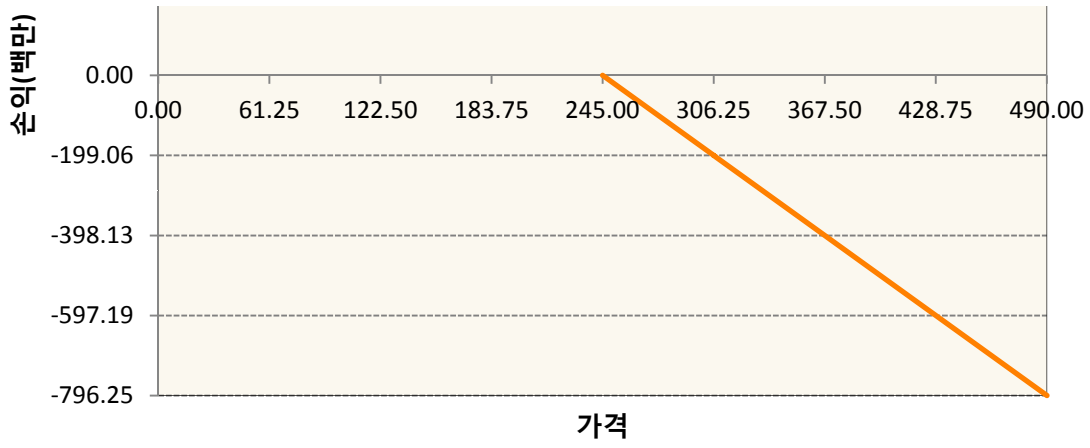
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

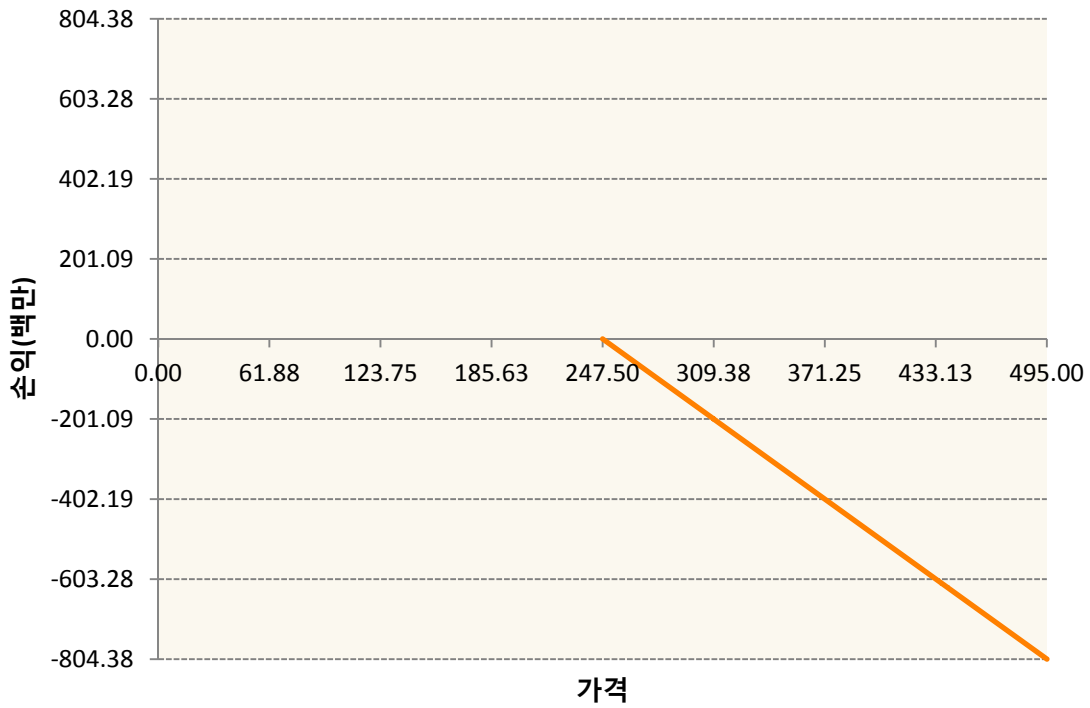


KR4201Q52452-2020-05 콜245

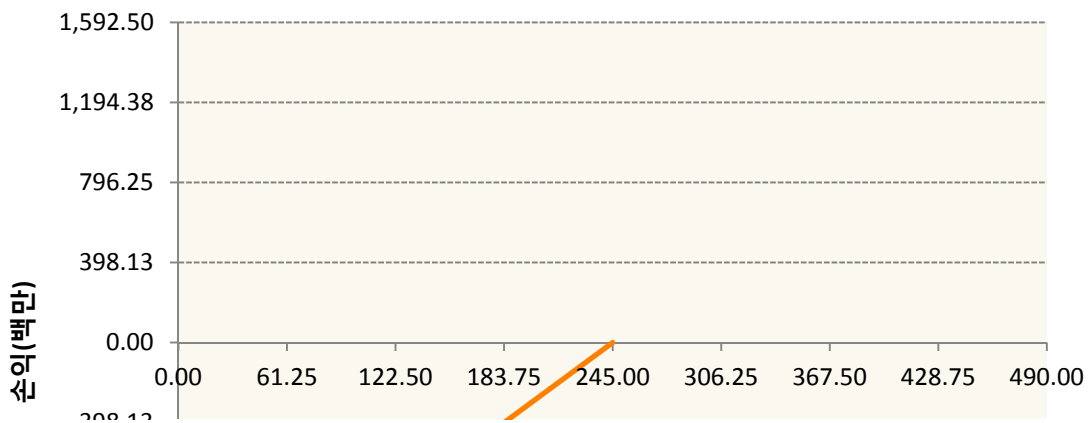




KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



KR4301Q52450-2020-05 풋245





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						187
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-187	-187	-187	-187	-187	-187	-187	
-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%	187	187	187	187	187	187	187	
KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						128
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128	
-5.33%	-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%	128	128	128	128	128	128	128	
KR4201Q52452		2020-05 콜245						52
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	36	33	31	28	25	22	18	
-5.33%	30	27	23	20	17	13	10	
-2.67%	21	18	14	11	7	4	0	
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11	
2.67%	-2	-5	-9	-13	-16	-20	-23	
5.33%	-17	-20	-23	-27	-30	-33	-37	
8.00%	-33	-36	-39	-42	-45	-48	-52	
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5						50
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	34	31	29	26	23	20	17
-5.33%	28	25	22	19	16	12	9
-2.67%	21	17	14	10	7	3	0
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	-1	-5	-8	-12	-16	-19	-23
5.33%	-15	-19	-22	-25	-29	-32	-36
8.00%	-31	-34	-37	-40	-44	-47	-50
KR4301Q52450                      2020-05 풋245							90
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-66	-70	-74	-78	-82	-86	-90
-5.33%	-33	-38	-43	-47	-52	-57	-62
-2.67%	-6	-11	-16	-21	-27	-32	-38
0%	16	11	5	0	-5	-11	-16
2.67%	33	28	22	17	12	7	1
5.33%	44	40	35	30	26	21	15
8.00%	51	48	44	40	36	32	27

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

(단위:백만원)

**536**

공시일	2020-04-17
기준일	2020-04-16

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

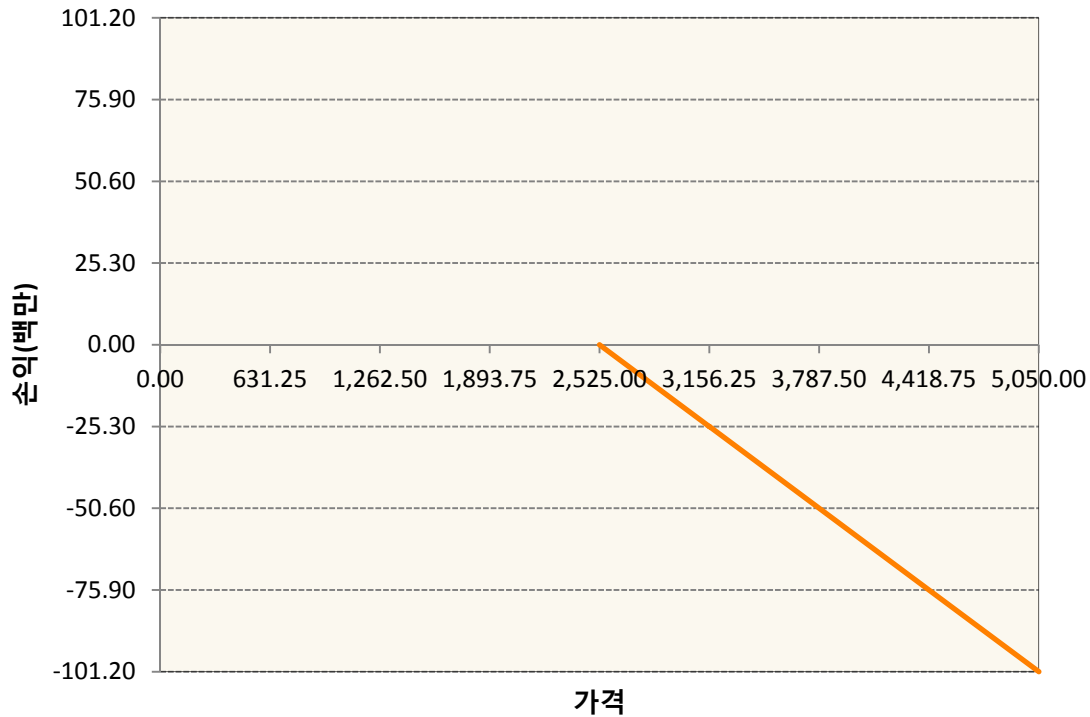
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

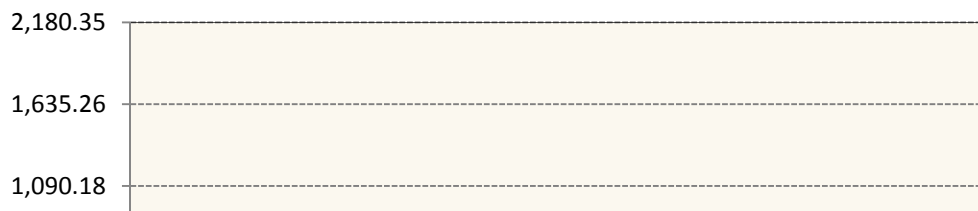
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	338	0	338	
누계	유가증권	스왑	7,588	0	7,588	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,597	-4,597	장내
누계	통화	선도	0	2,704	-2,704	장외

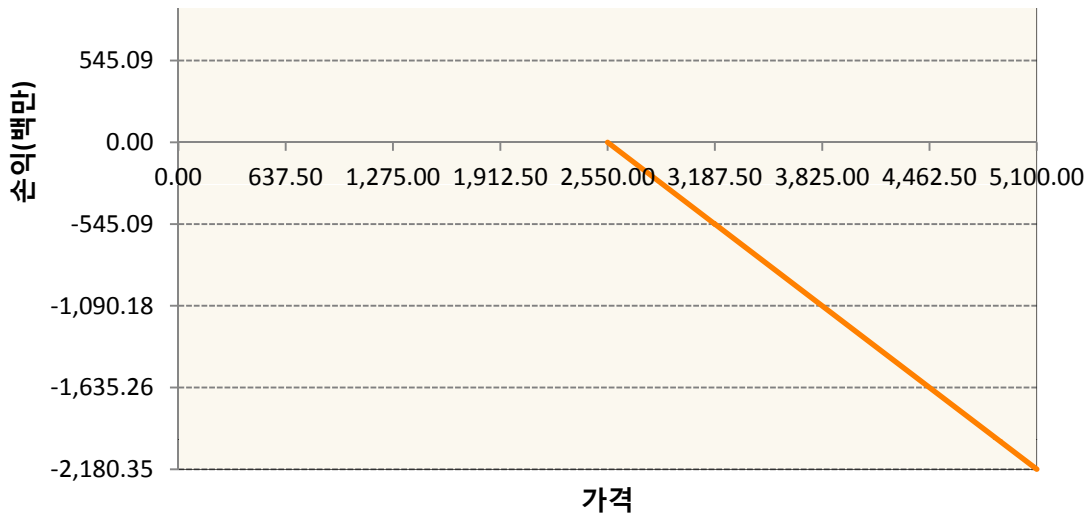
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXJ0-C2525-EURO STOXX 50

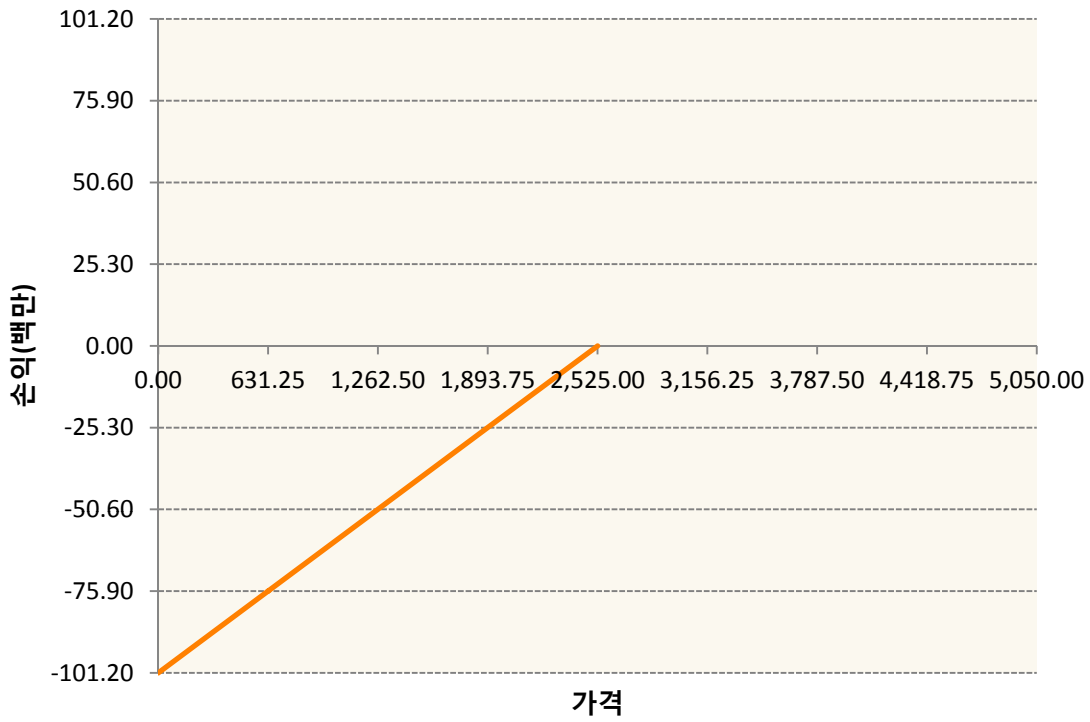


OESXJ0-C2550-EURO STOXX 50

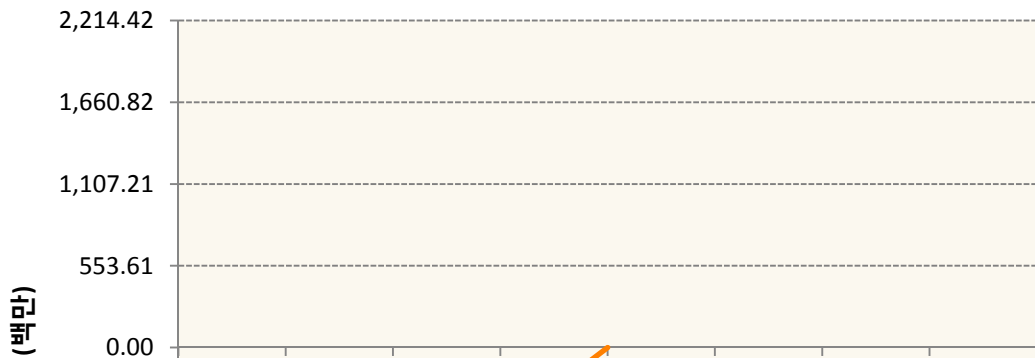


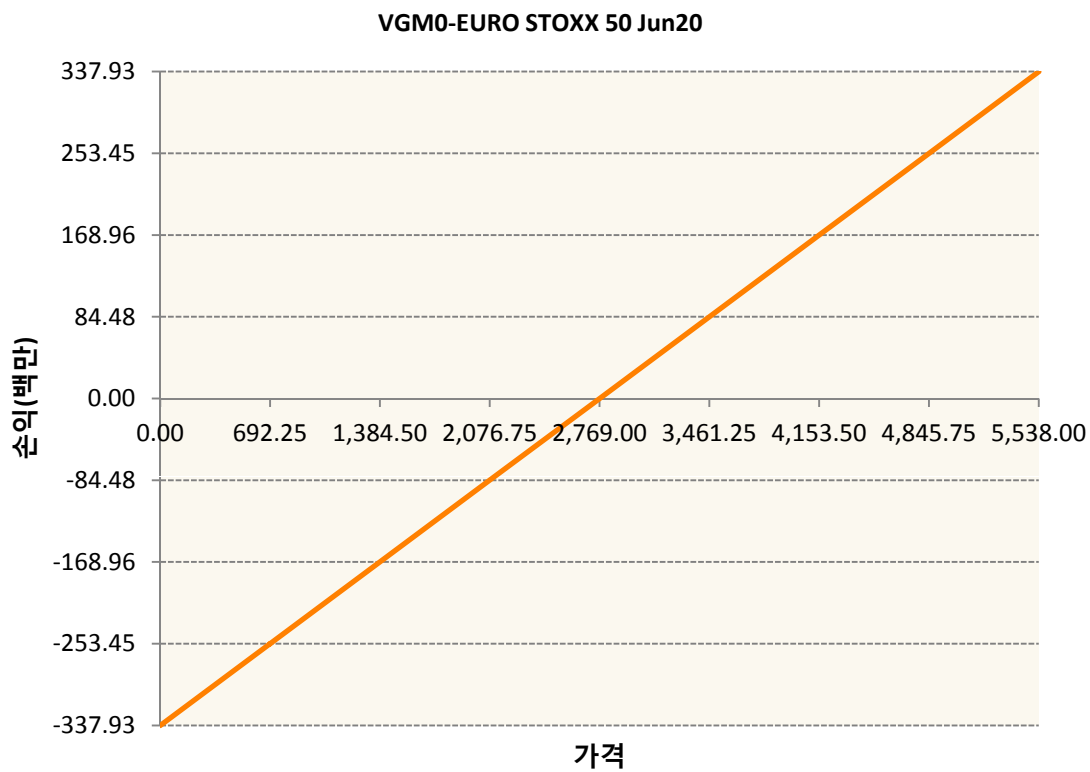
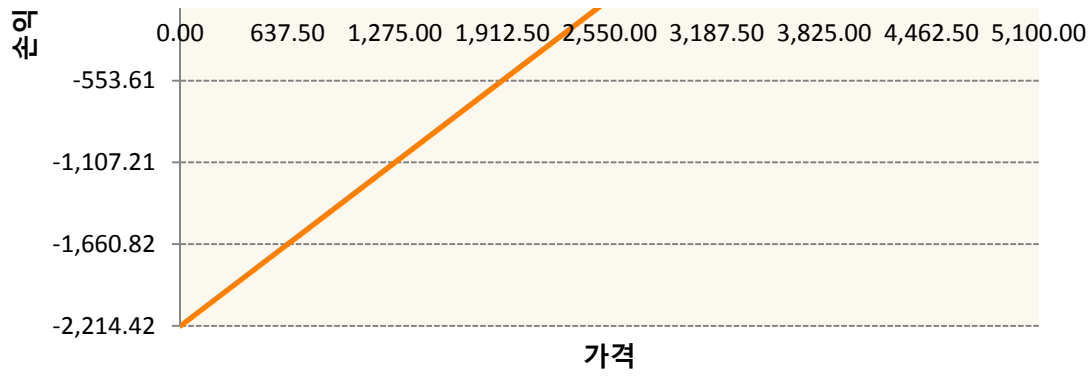


OESXJ0-P2525-EURO STOXX 50



OESXJ0-P2550-EURO STOXX 50





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	30
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	27

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





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

(단위:백만원)

1,086



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

(단위:백만원)

94

공시일	2020-04-17
기준일	2020-04-16

## ETF스마트레버리지목표전환형10호

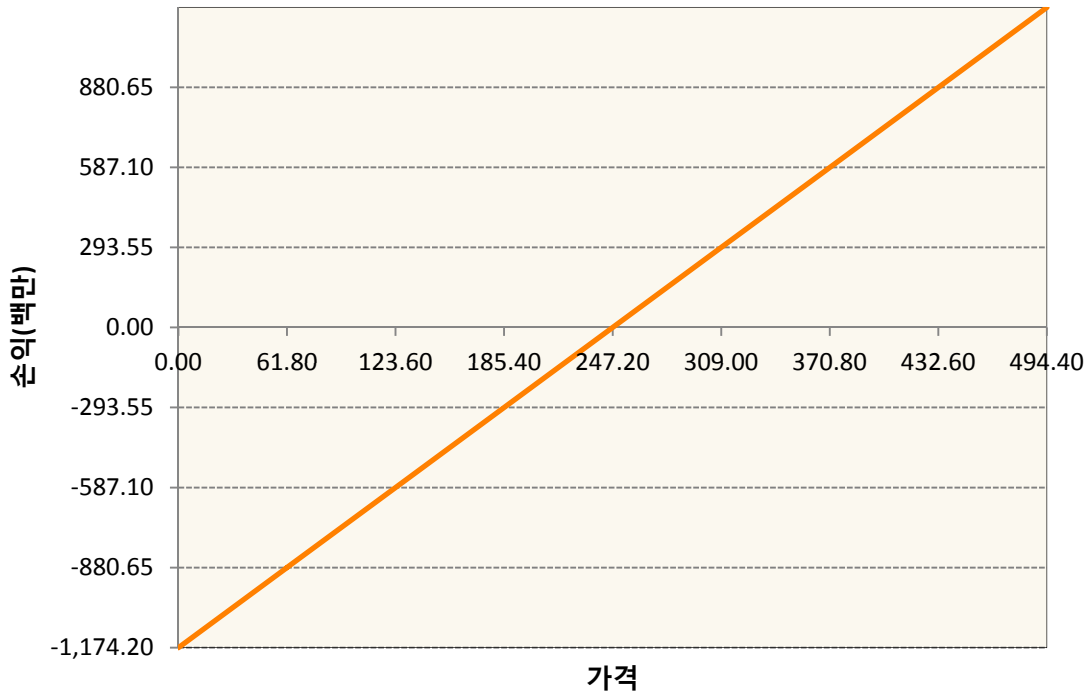
### 1. 계약금액

(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)

138

공시일	2020-04-17
기준일	2020-04-16

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

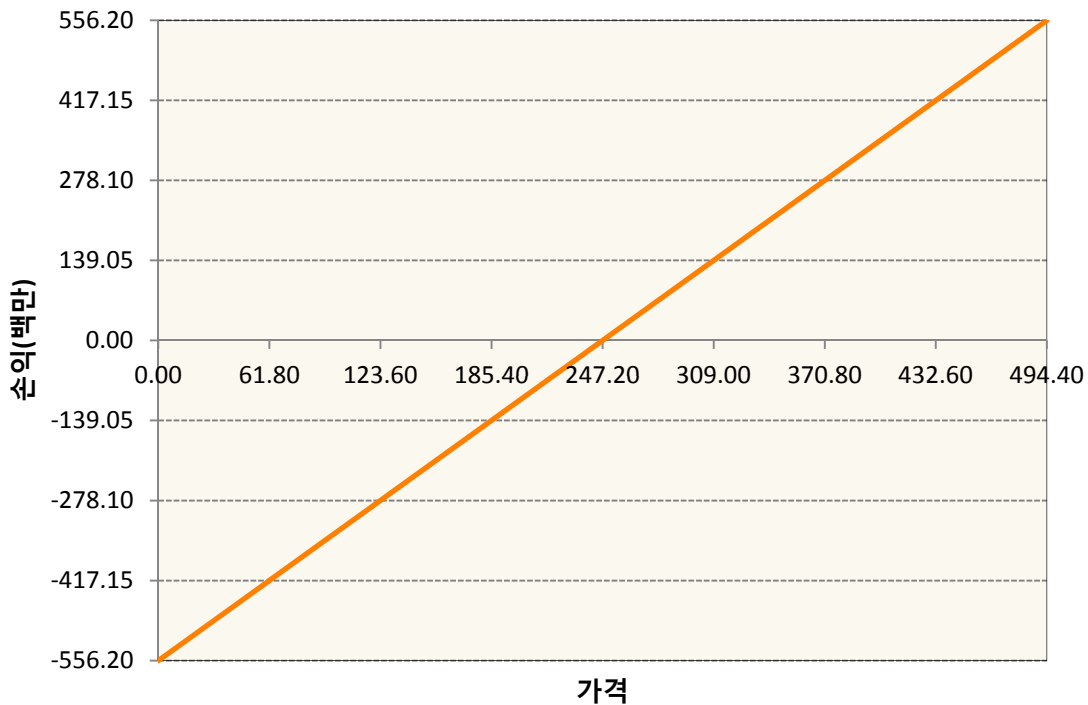
### 1. 계약금액

(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						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%	-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%	44	44	44	44	44	44	44	

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

(단위:백만원)

65

공시일	2020-04-17
기준일	2020-04-16

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

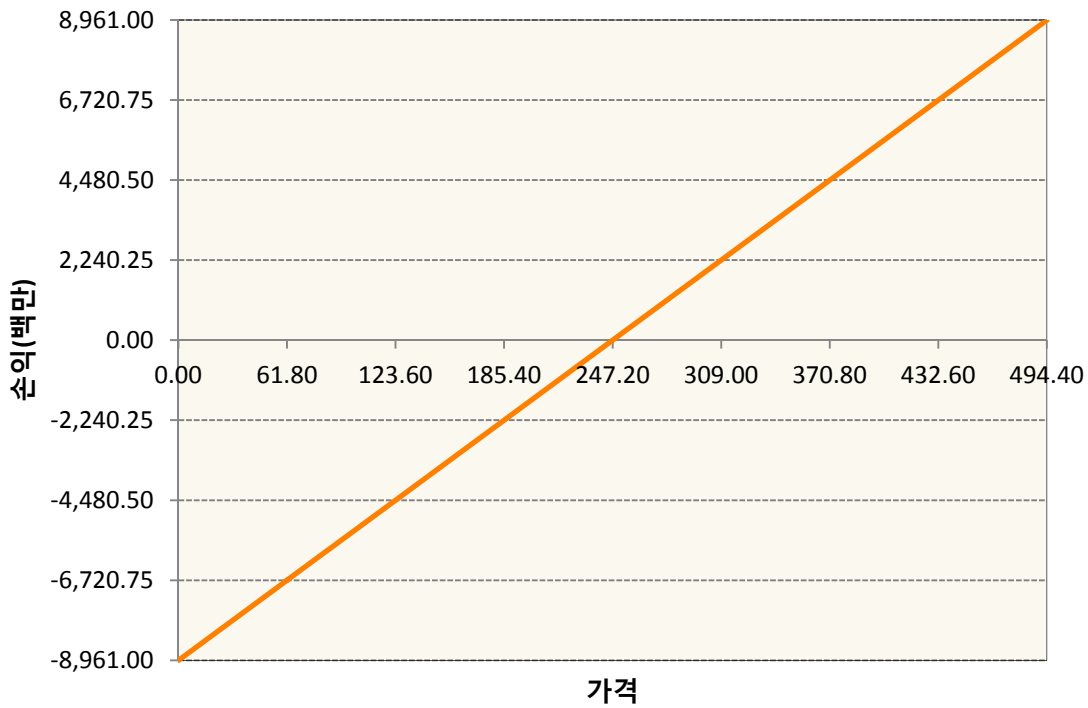
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

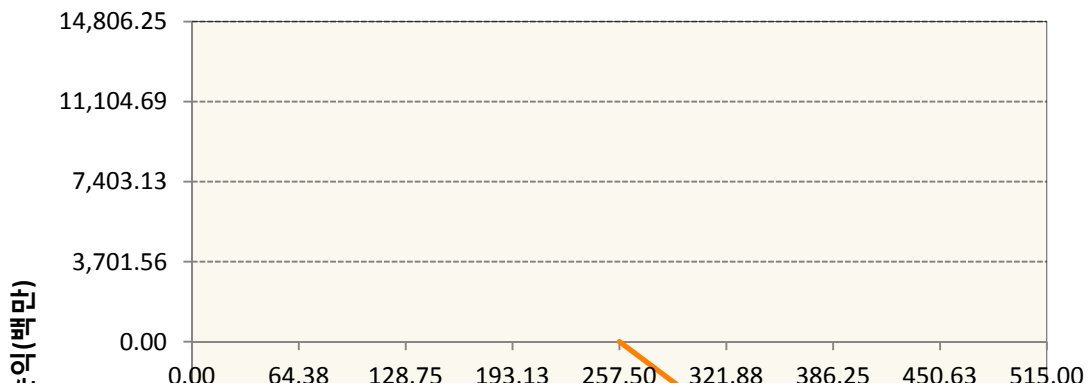
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,961	0	8,961	장내
누계	유가증권	옵션	6,201	17,536	-11,335	장내

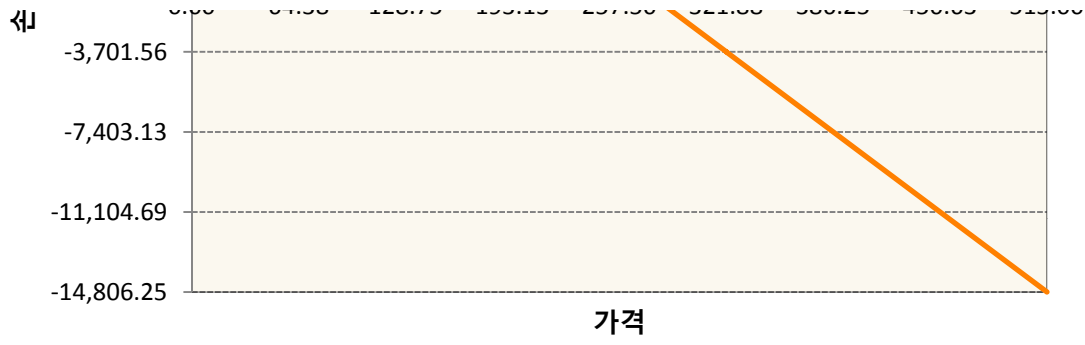
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

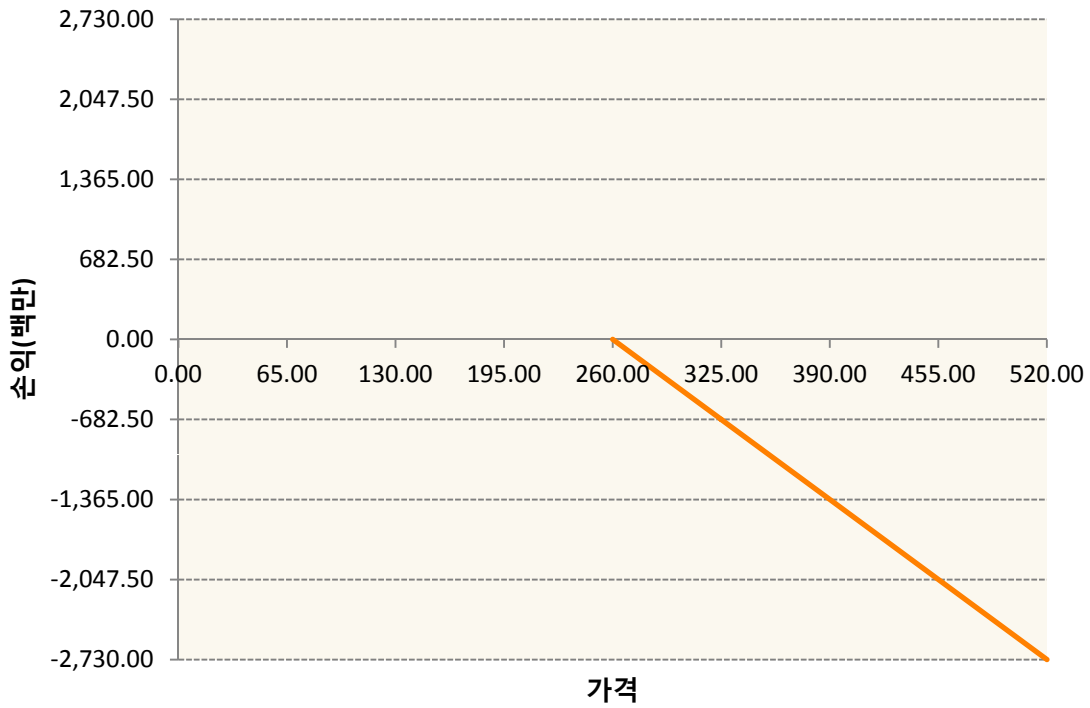


KR4201Q52577-2020-05 콜257.5

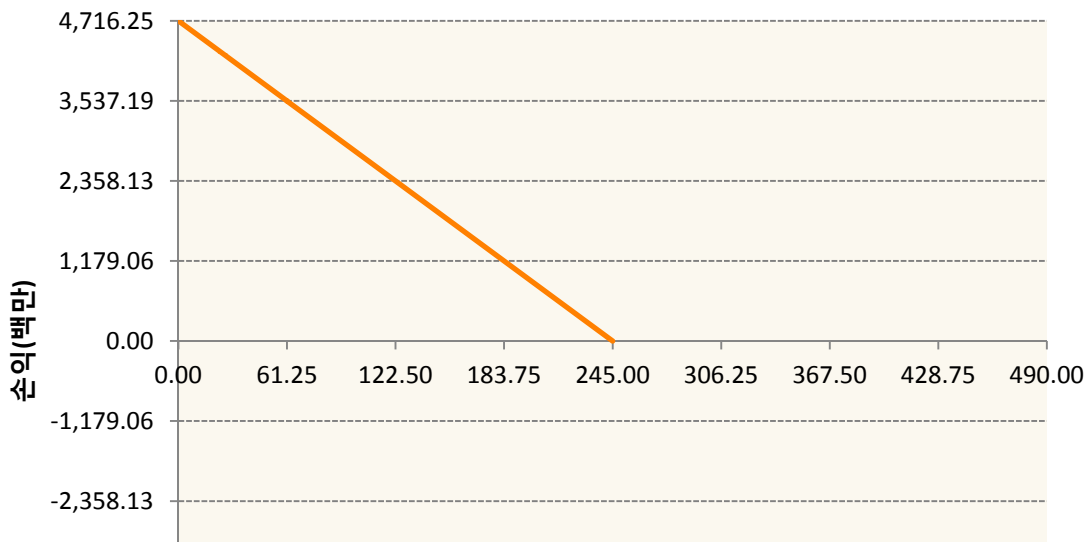


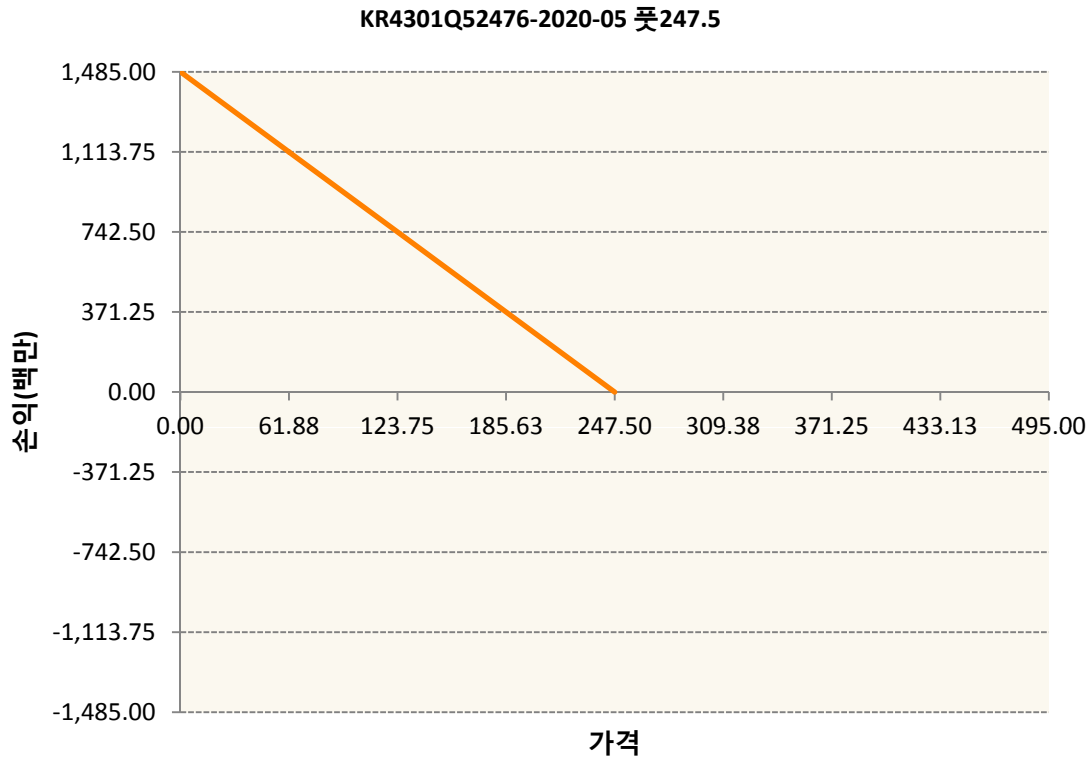
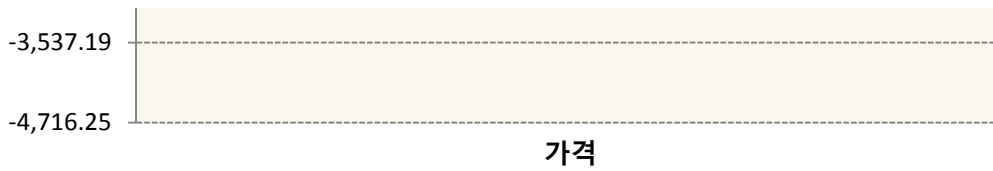


KR4201Q52601-2020-05 콜260



KR4301Q52450-2020-05 풋245





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

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						717
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-717	-717	-717	-717	-717	-717	-717	
-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%	717	717	717	717	717	717	717	
KR4201Q52577		2020-05 콜257.5						786
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	443	412	376	336	294	249	202	
-5.33%	387	344	298	250	200	147	94	
-2.67%	302	249	195	139	81	23	-36	

0%	184	124	62	0	-63	-126	-189
2.67%	30	-35	-101	-167	-233	-299	-365
5.33%	-162	-229	-296	-363	-430	-497	-564
8.00%	-391	-456	-521	-587	-653	-719	-786
KR4201Q52601                      2020-05 콜260							138
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	75	69	63	56	49	41	33
-5.33%	66	58	51	42	33	24	15
-2.67%	52	43	33	24	13	3	-8
0%	33	22	11	0	-11	-23	-34
2.67%	7	-5	-17	-29	-41	-53	-65
5.33%	-25	-38	-50	-62	-75	-87	-99
8.00%	-65	-77	-89	-101	-114	-126	-138
KR4301Q52450                      2020-05 풋245							268
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	197	207	218	230	242	255	268
-5.33%	99	112	126	140	155	169	184
-2.67%	17	32	48	64	79	95	111
0%	-49	-33	-16	0	16	33	49
2.67%	-97	-82	-66	-51	-35	-19	-3
5.33%	-130	-117	-104	-90	-76	-61	-46
8.00%	-152	-142	-131	-119	-106	-93	-80
KR4301Q52476                      2020-05 풋247.5							87
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	67	69	73	76	79	83	87
-5.33%	35	38	43	47	51	55	60
-2.67%	7	12	17	21	26	31	36
0%	-15	-10	-5	0	5	10	15
2.67%	-32	-27	-22	-17	-12	-7	-2
5.33%	-44	-40	-36	-31	-26	-21	-17
8.00%	-52	-49	-45	-41	-37	-33	-28

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

(단위:백만원)

1,971

공시일	2020-04-17
기준일	2020-04-16

## 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	150,202	0	150,202	

### 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	2020-04-17
기준일	2020-04-16

## 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	101,279	0	101,279	

### 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	2020-04-17
기준일	2020-04-16

## 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	447,481	0	447,481	
누계	통화	선도	71,879	515,440	-443,561	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,381
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,966
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,932
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,300
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,966
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,457
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,045
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,045
FX21020H04 USD/KRW 21-04-20E	1,474
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,398
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	983
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	983
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,556
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	845
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	737
FX21020H09 USD/KRW 24-04-20E	737
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	491
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,440
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,979
FX21020H11 KRW/USD 11-05-20E	983
FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E	2,949
FX21020J02€ KRW/USD 10-06-20E	1,337

IE00BD8RGM75

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)





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

(단위:백만원)

188

공시일	2020-04-17
기준일	2020-04-16

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

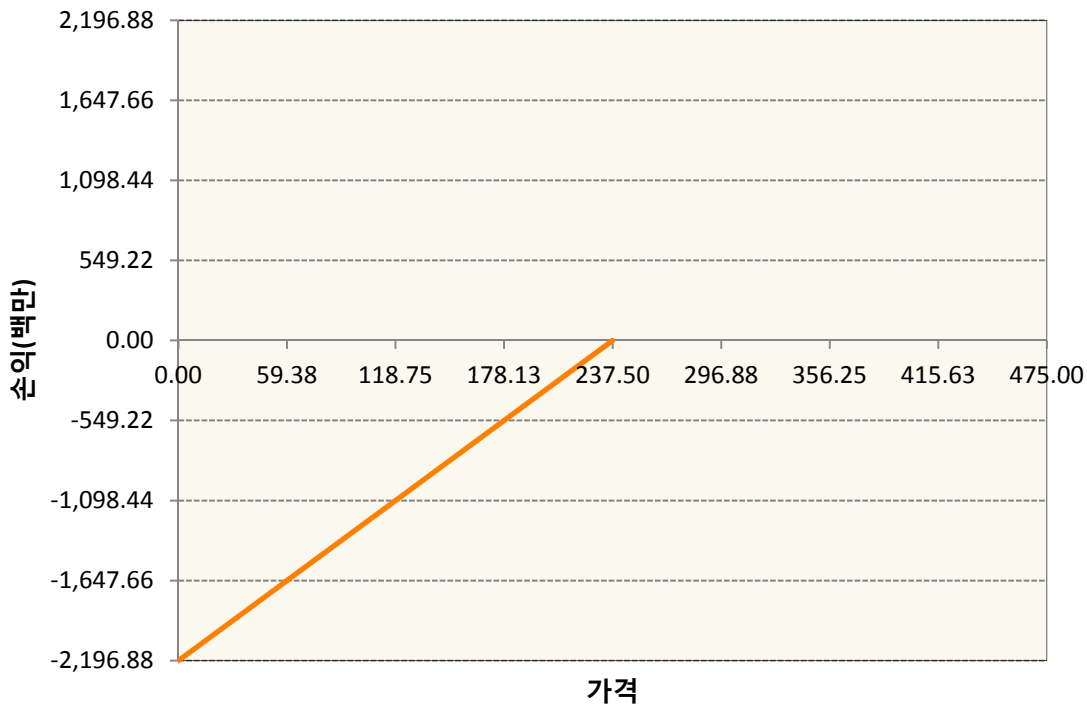
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

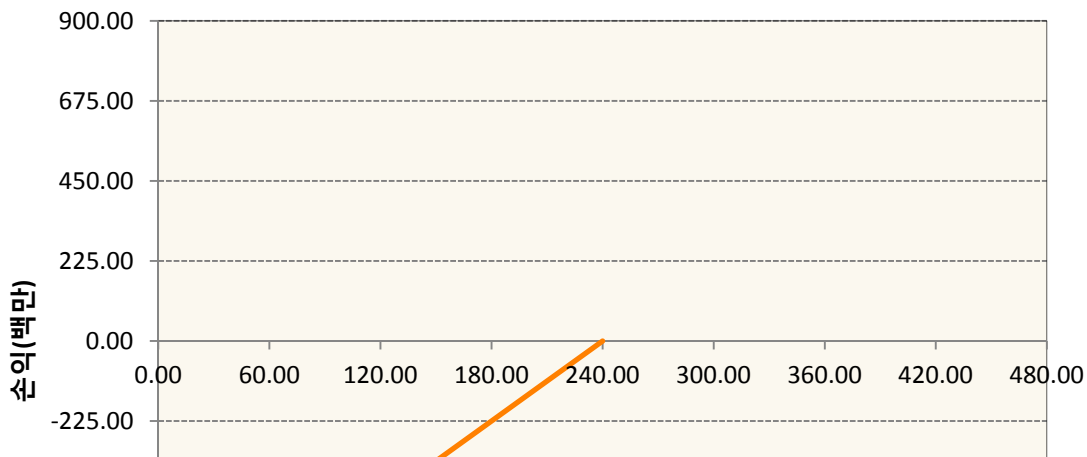
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,097	-3,097	장내

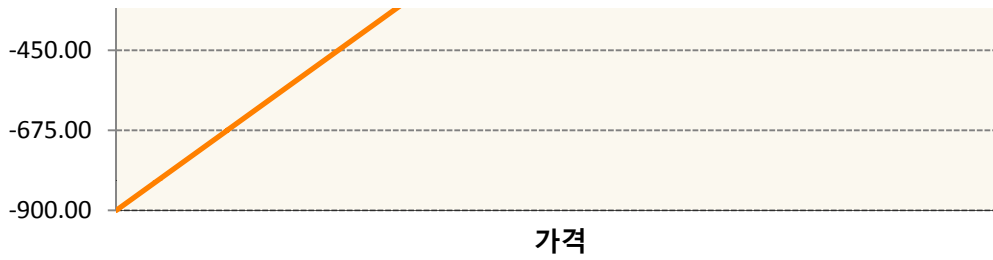
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q52377-2020-05 풋237.5



KR4301Q52401-2020-05 풋240





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

KR4301Q52377		2020-05 풋237.5						110
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-70	-76	-83	-89	-96	-103	-110	
-5.33%	-31	-38	-46	-53	-61	-68	-75	
-2.67%	-1	-8	-16	-23	-31	-39	-46	
0%	21	14	7	0	-7	-15	-22	
2.67%	36	30	24	18	11	5	-2	
5.33%	45	41	36	31	25	19	13	
8.00%	50	47	44	40	35	30	25	
KR4301Q52401		2020-05 풋240						47
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-32	-34	-37	-39	-42	-44	-47	
-5.33%	-15	-18	-21	-23	-26	-29	-32	
-2.67%	-1	-4	-7	-10	-14	-17	-20	
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9	
2.67%	16	13	11	8	5	2	0	
5.33%	21	19	16	14	12	9	6	
8.00%	23	22	20	18	16	14	12	

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

**126**

공시일	2020-04-17
기준일	2020-04-16

## 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	7,376	0	7,376	
누계	통화	선도	0	7,188	-7,188	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H11 KRW/USD 29-04-20E	227
FX21020J004 KRW/USD 29-04-20E	27
FX21020J015 KRW/USD 13-05-20E	321
IE00BD8RGM75	*

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

<b>286</b>
------------

공시일	2020-04-17
기준일	2020-04-16

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

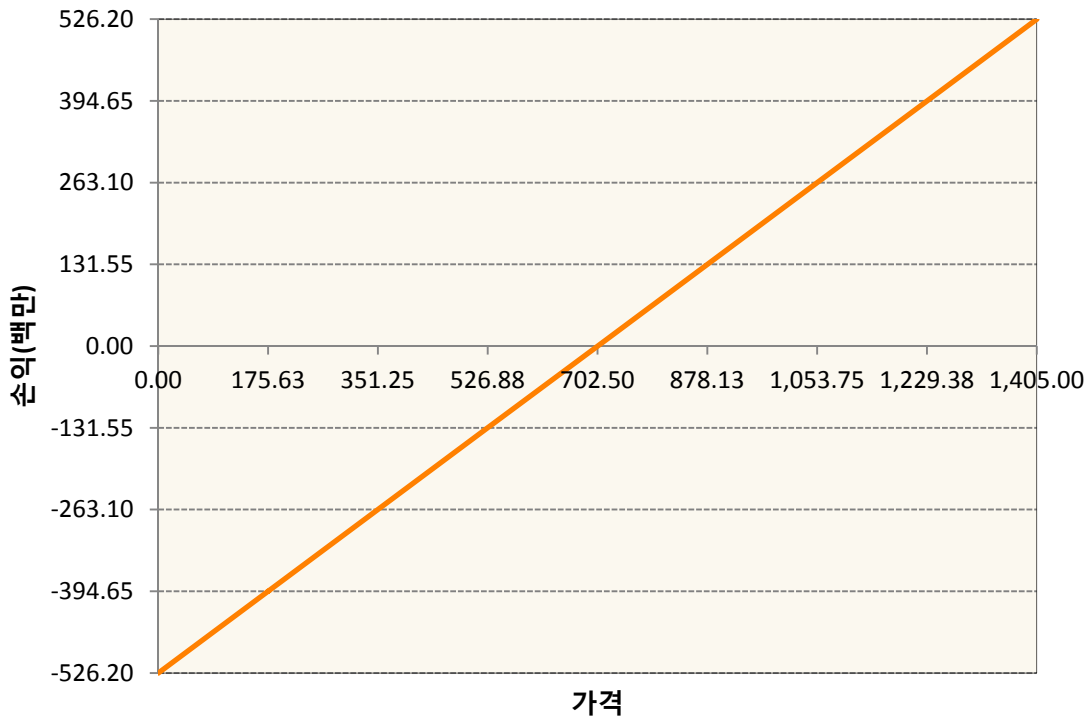
### 1. 계약금액

(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	526	0	526	
누계	유가증권	스왑	1,102	0	1,102	장외
누계	통화	선도	232	441	-208	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

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
VNCK0 VN30 Index Future May20	42

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

(단위:백만원)

**145**

공시일	2020-04-17
기준일	2020-04-16

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

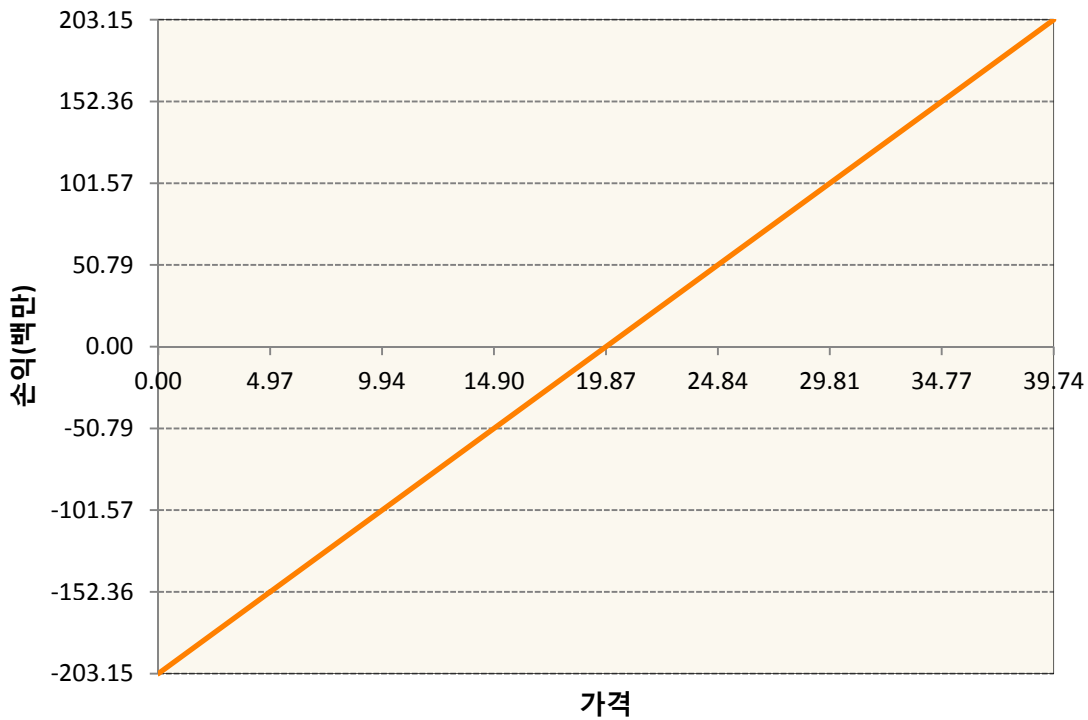
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

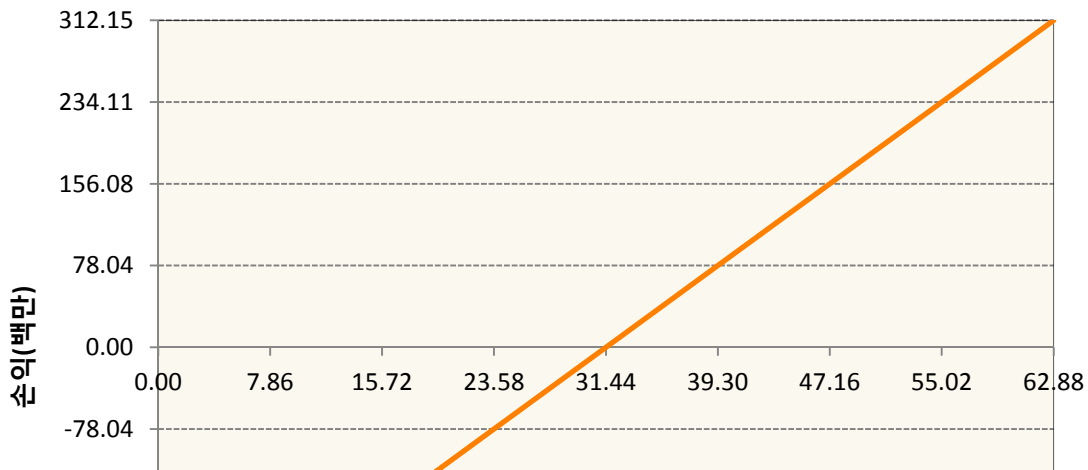
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,352	184	1,168	

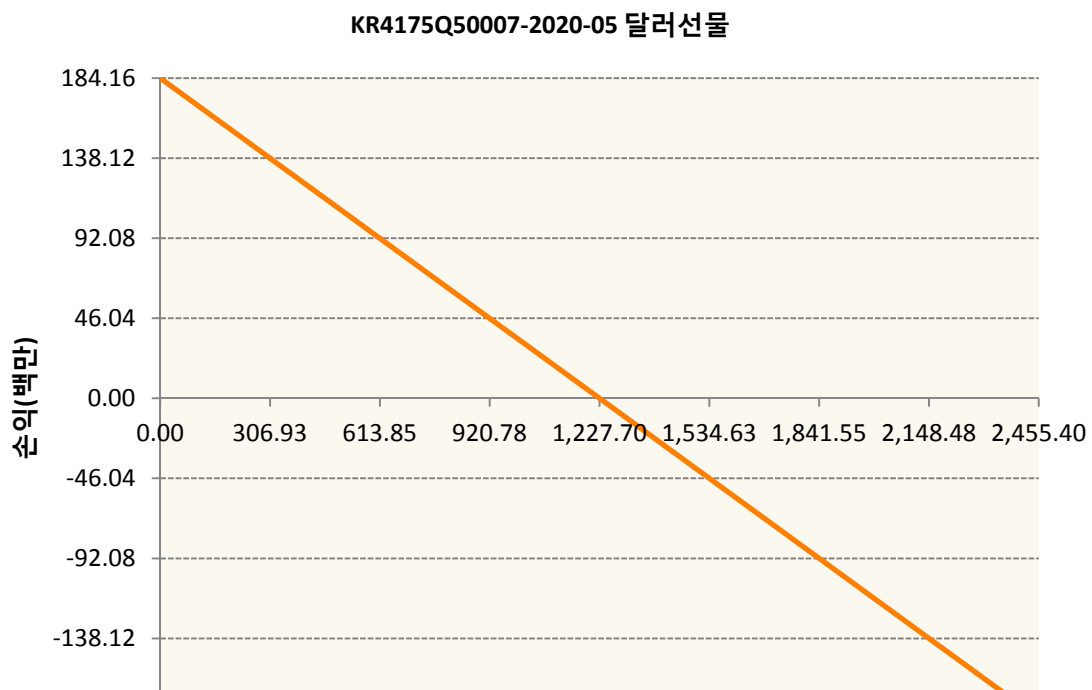
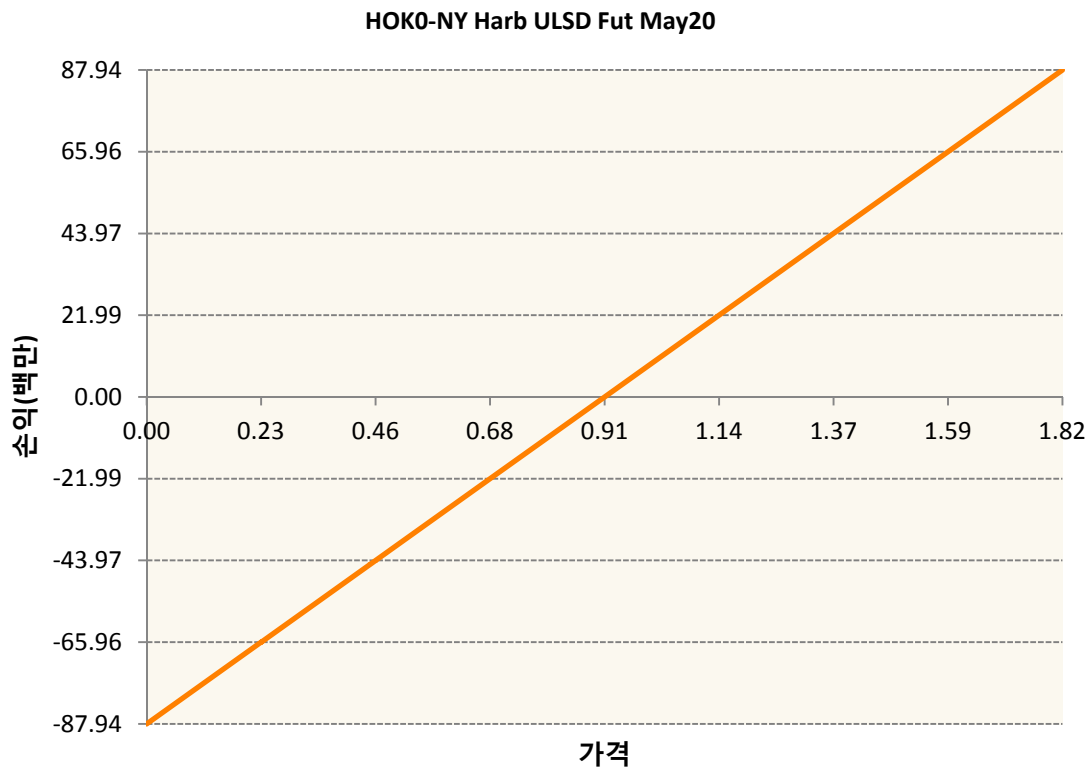
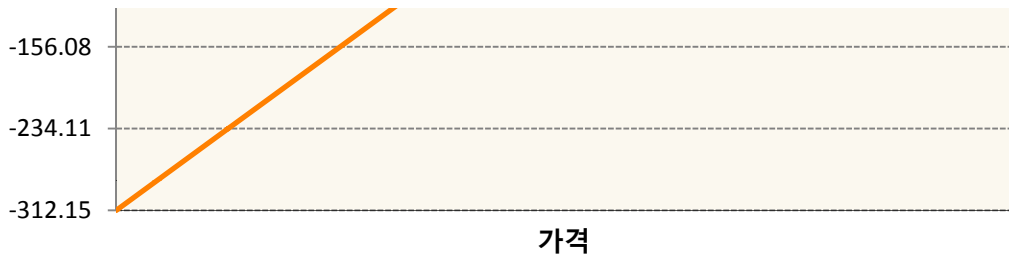
### 2. 만기시점의 손익구조

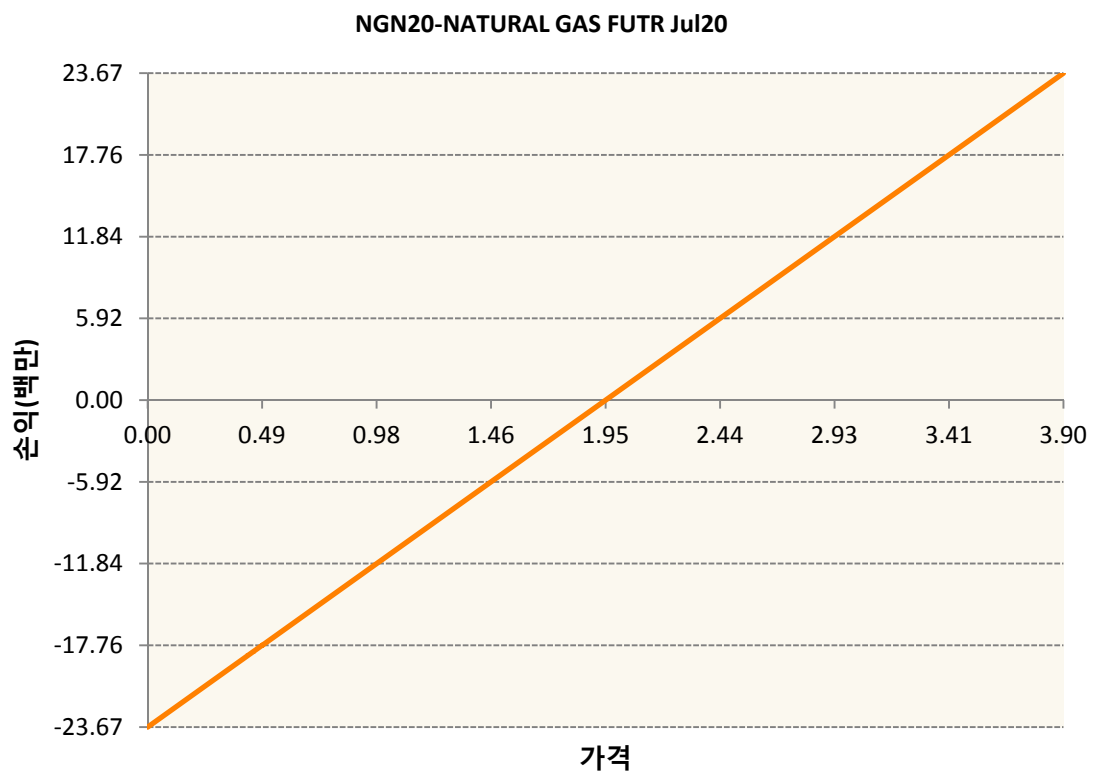
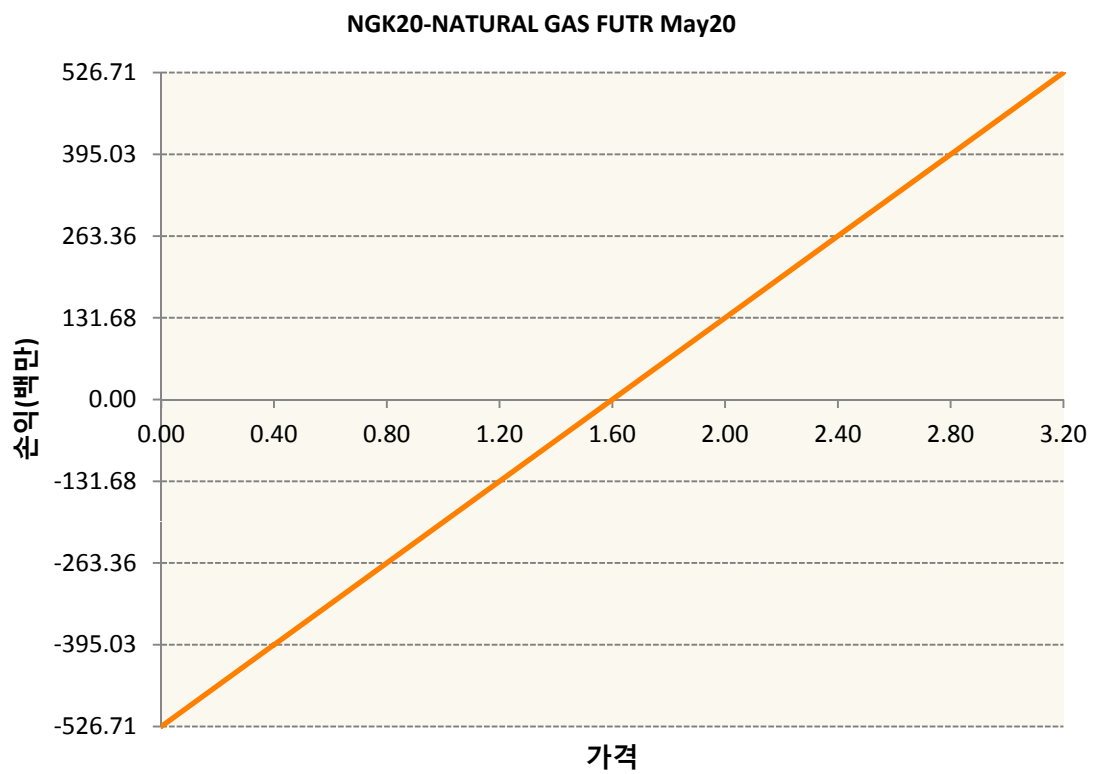
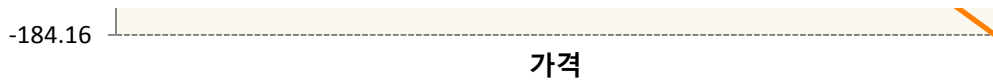
CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20



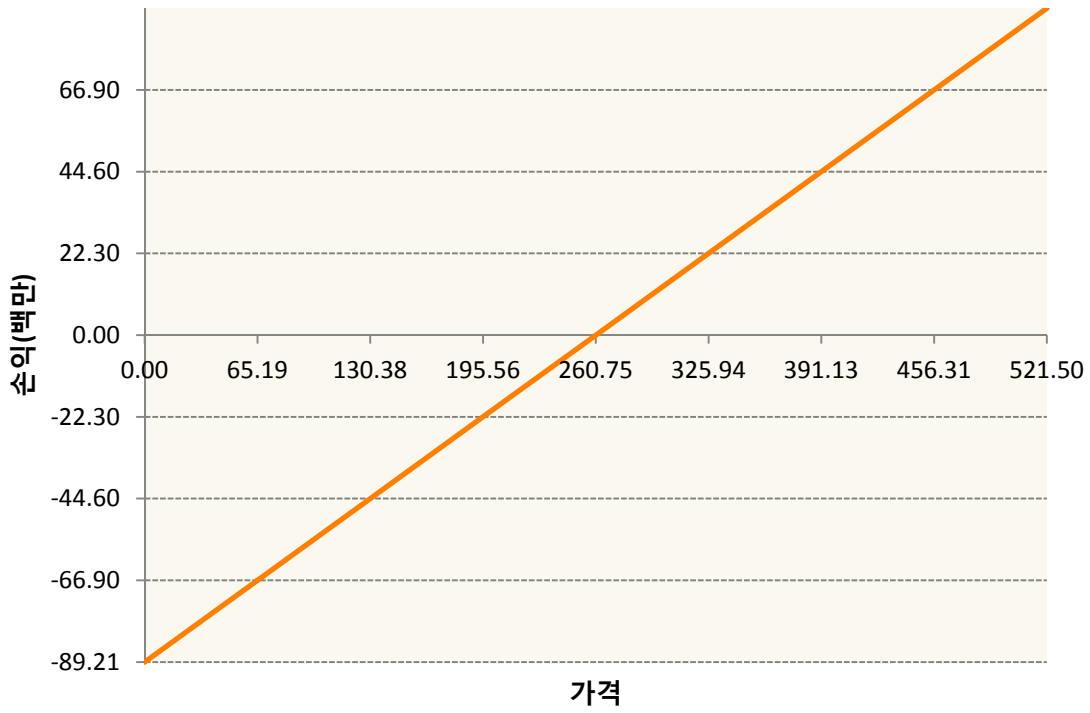
CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20



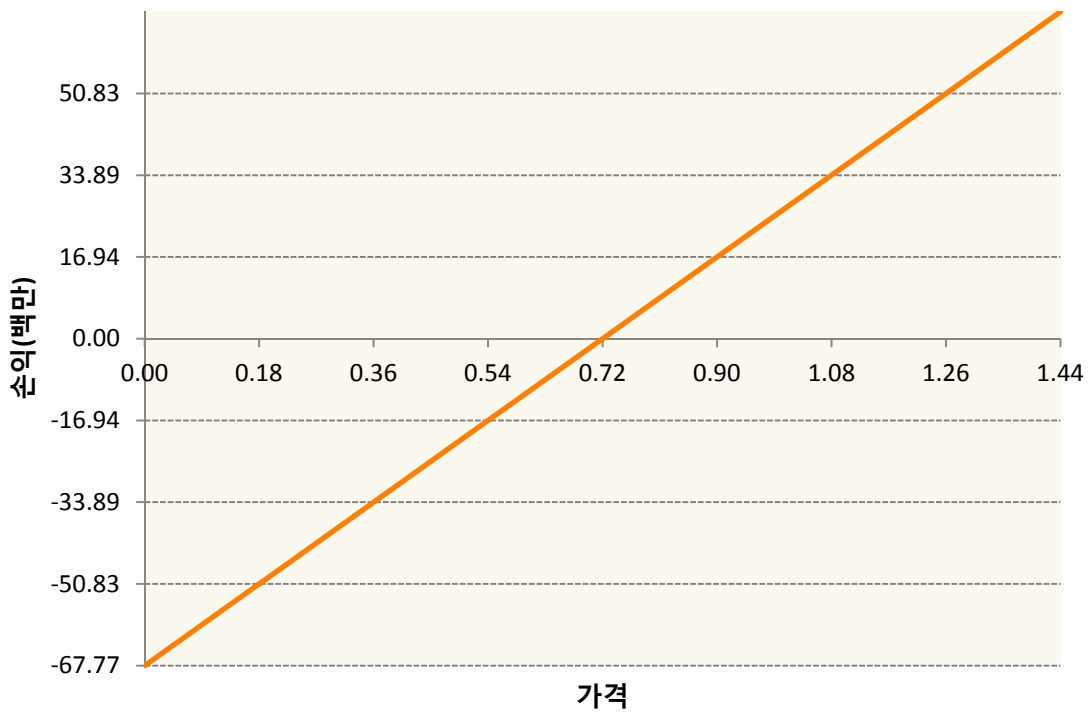




QSK0-Low Su Gasoil G Mar20

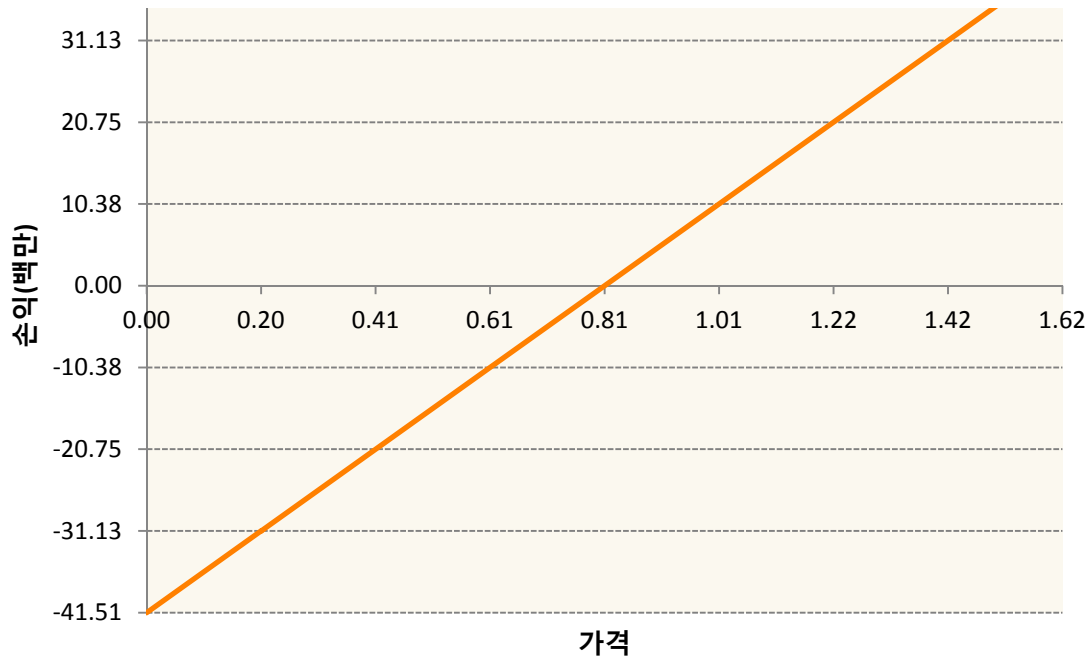


XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20





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

CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	16
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	25
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	7
KR4175Q50C	2020-05 달러선물	15
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	42
NGN20	NATURAL GAS FUTR Jul20	2
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	7
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	5
XBN0	GASOLINE RBOB FUT Jul20	3

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

**329**

공시일	2020-04-17
기준일	2020-04-16

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

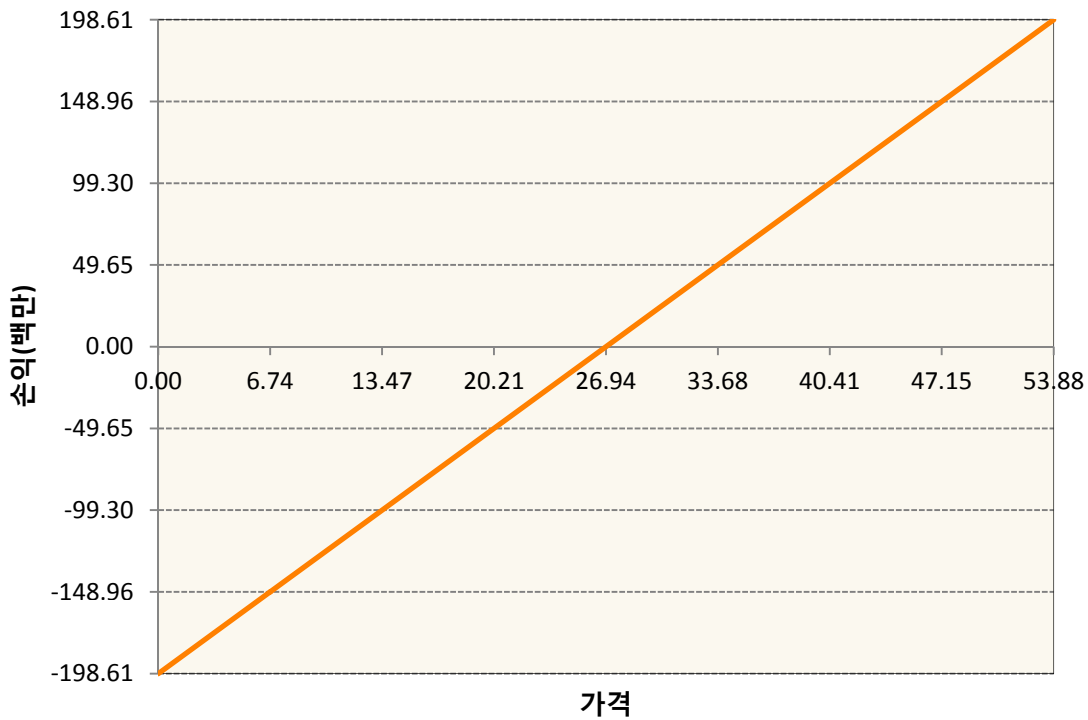
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

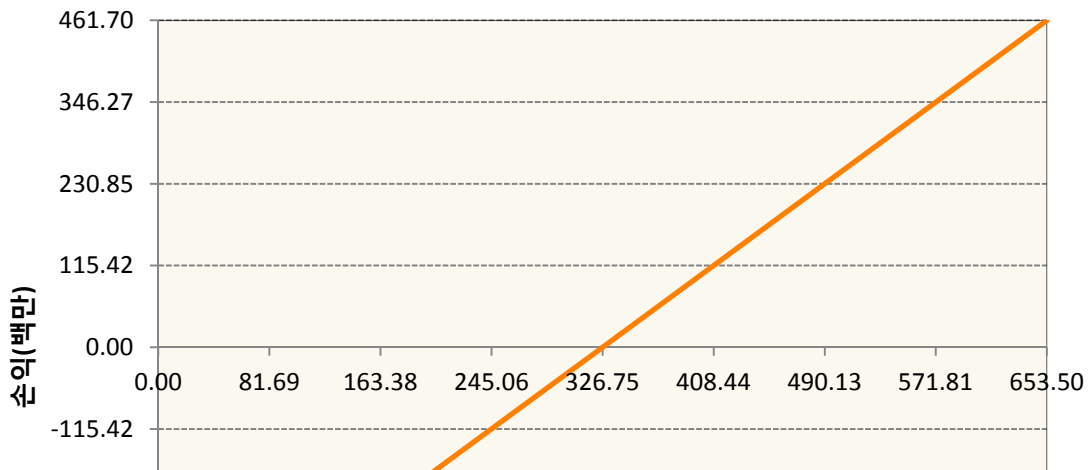
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,426	74	2,352	

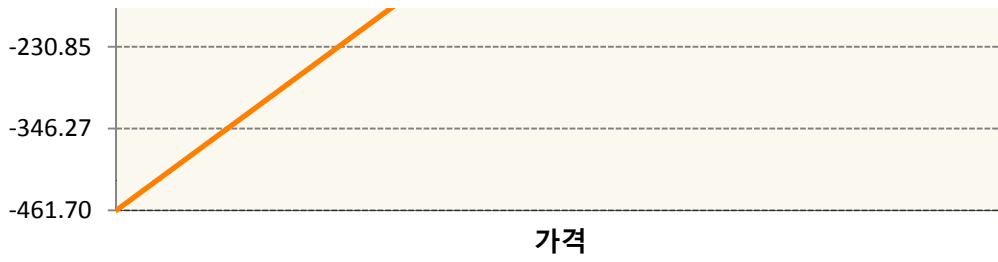
### 2. 만기시점의 손익구조

**BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20**

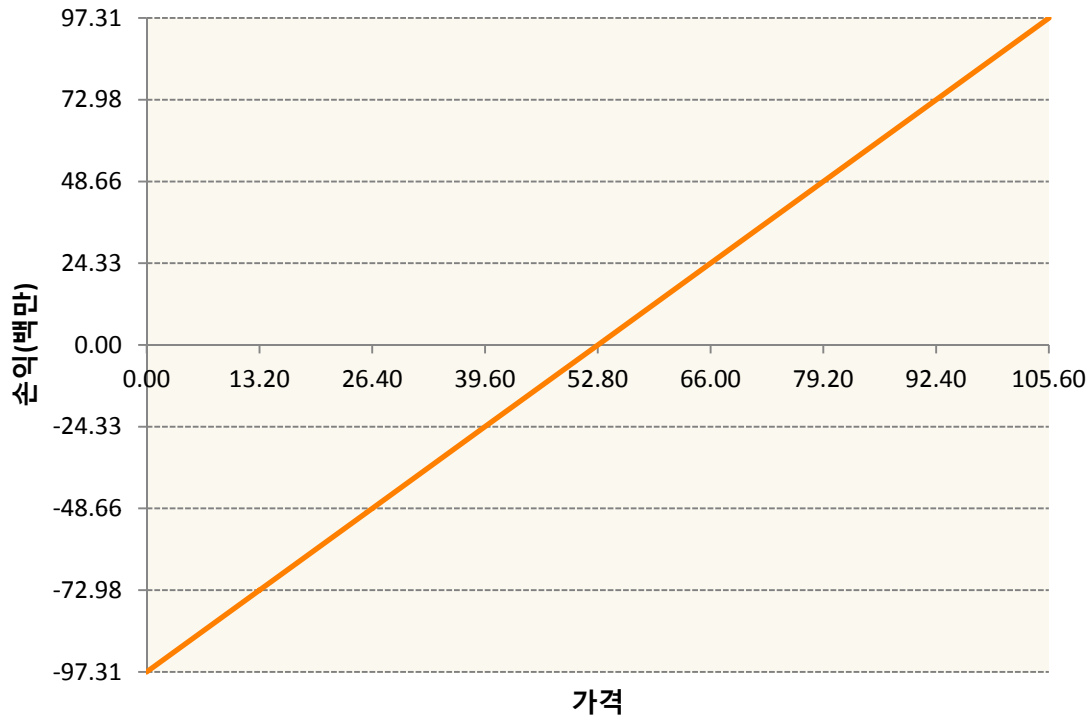


**CNO-CORN FUTURE Jul20**

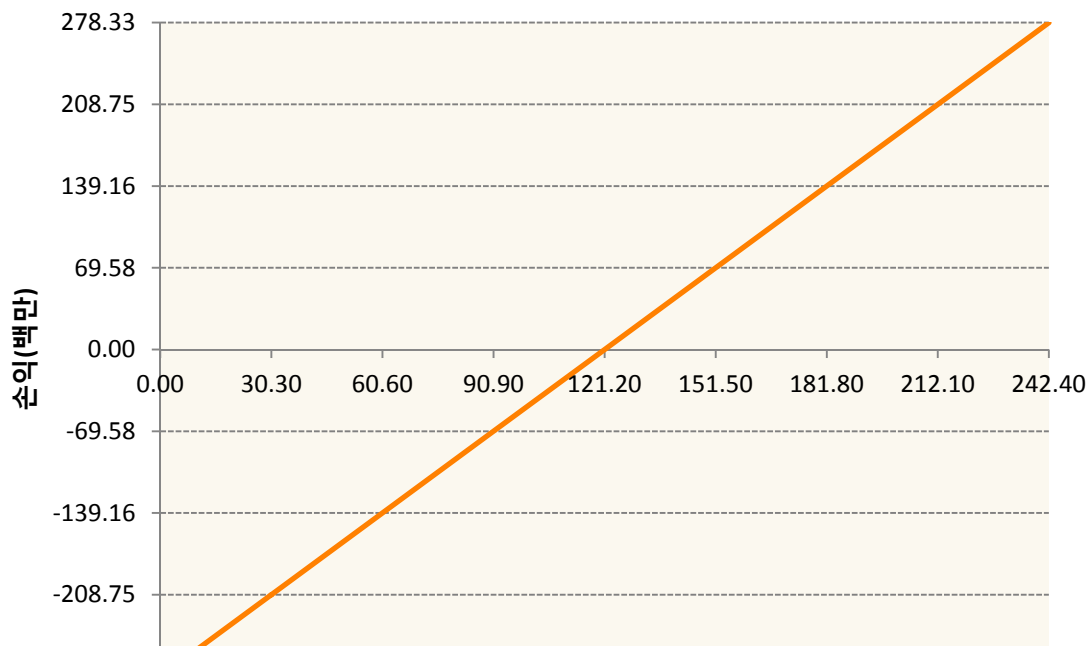


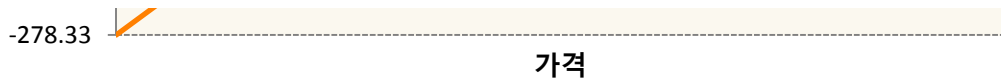


CTN0-COTTON NO.2 FUTR Jul20

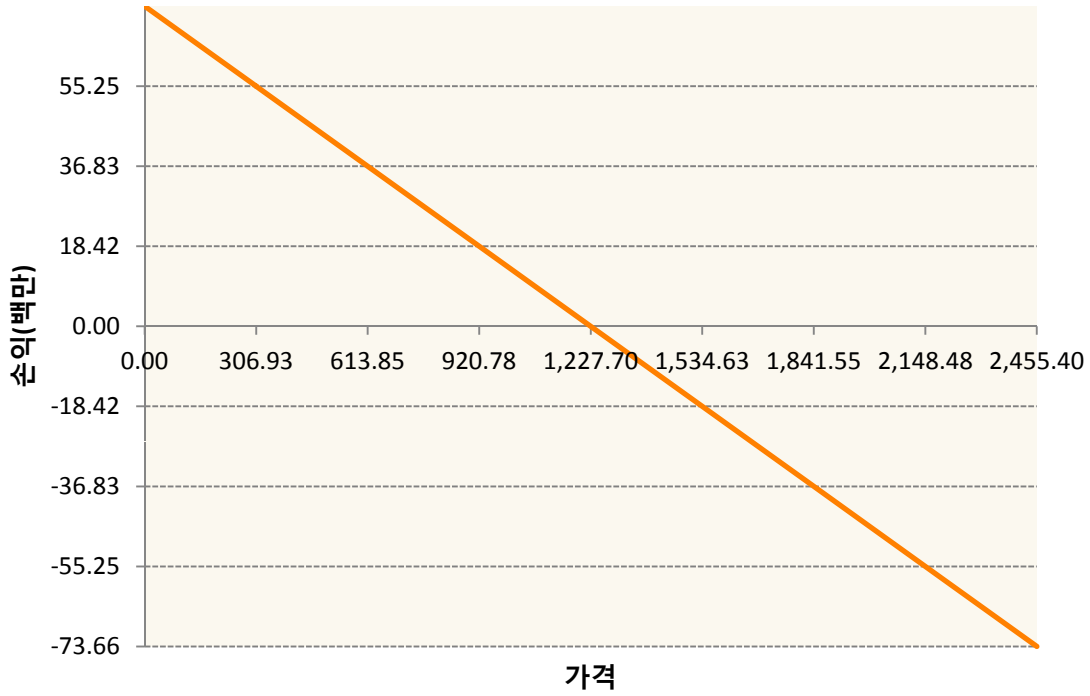


KCN0-COFFEE 'C' FUTURE Jul20

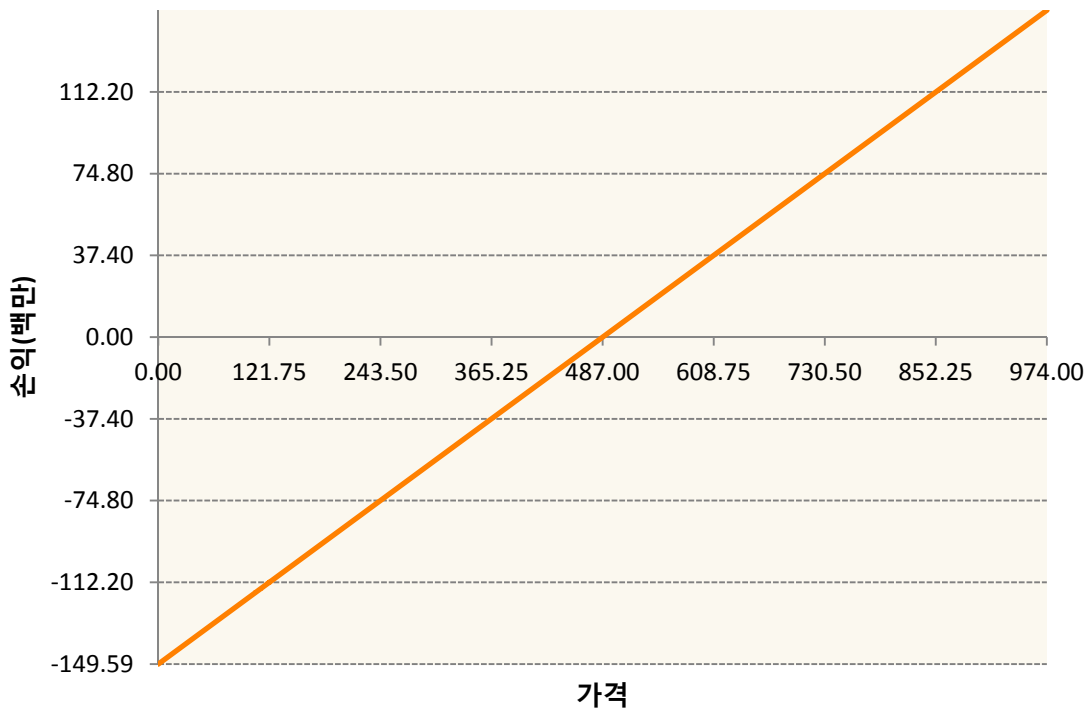




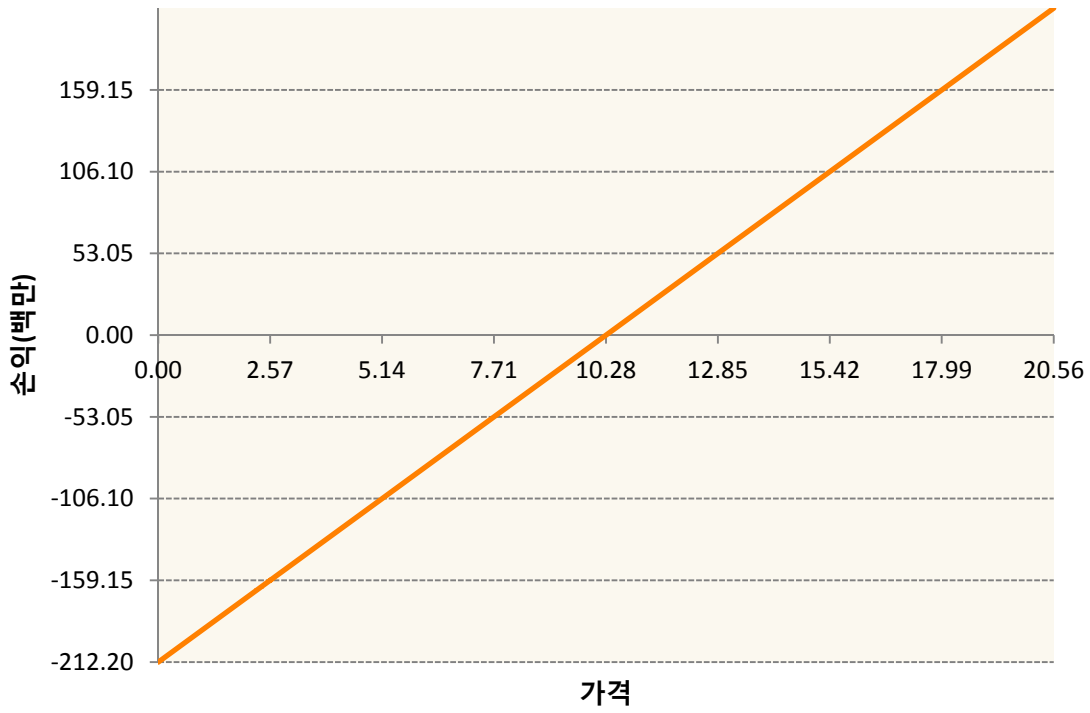
KR4175Q50007-2020-05 달러선물



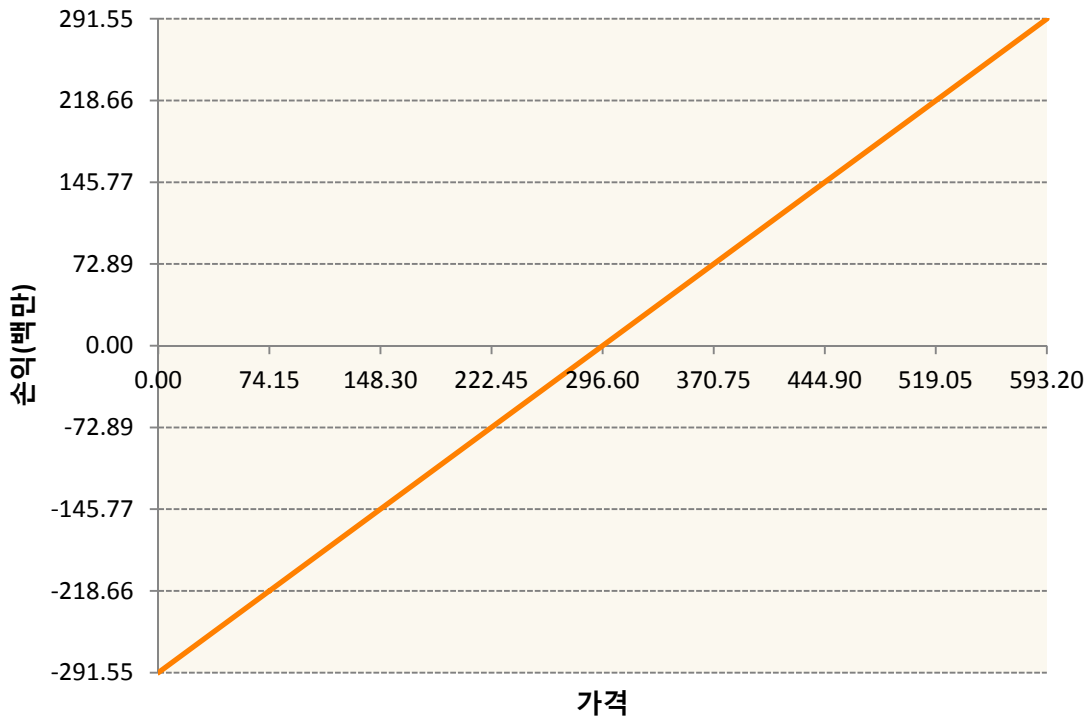
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



SBN0-Sugar Jul20

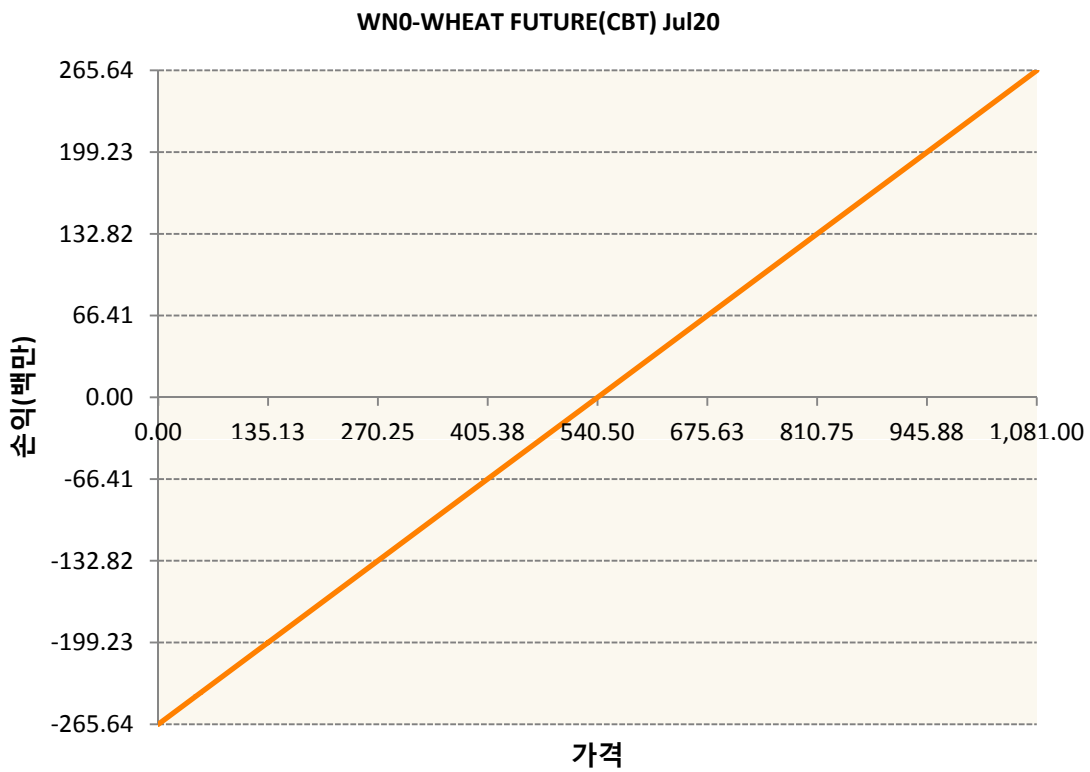
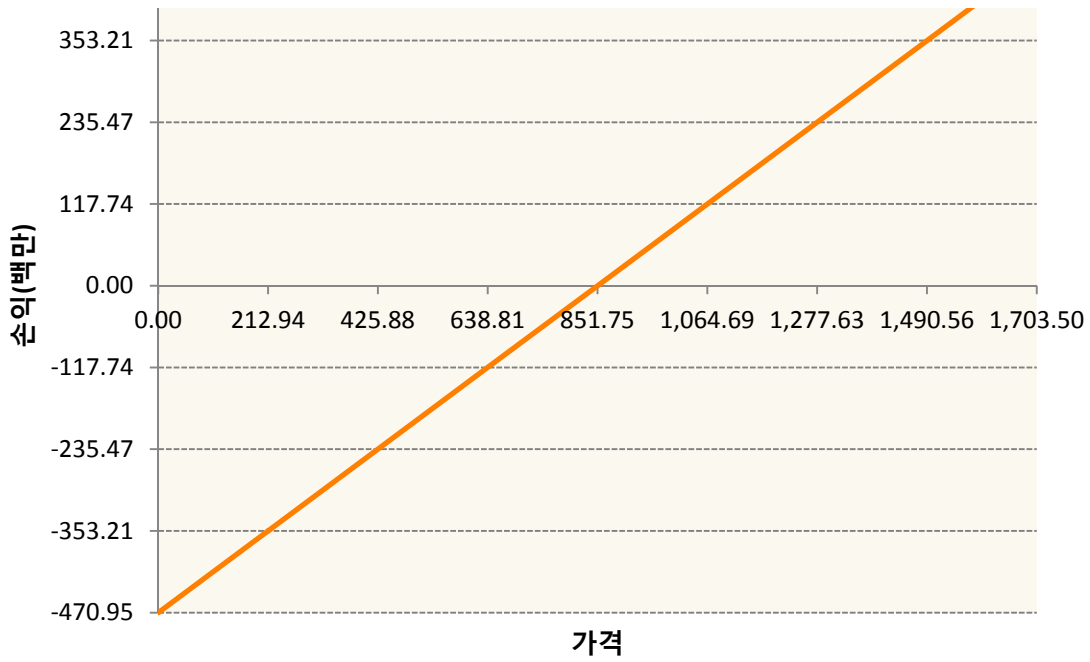


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20



SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BON0	SOYBEAN OIL FUTR Jul20	16
CN0	CORN FUTURE Jul20	37
CTN0	COTTON NO.2 FUTR Jul20	8
KCN0	COFFEE 'C' FUTURE Jul20	22
KR4175Q50C	2020-05 달러선물	6

KWN0	KC HRW WHEAT FUT Jul20	12
SBN0	Sugar Jul20	17
SMN0	SOYBEAN MEAL FUTR Jul20	23
SN0	SOYBEAN FUTURE Jul20	38
WNO	WHEAT FUTURE(CBT) Jul20	21

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

(단위:백만원)

**228**