

공시일	2020-04-20
기준일	2020-04-17

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	2020-04-20
기준일	2020-04-17

스마트인덱스모

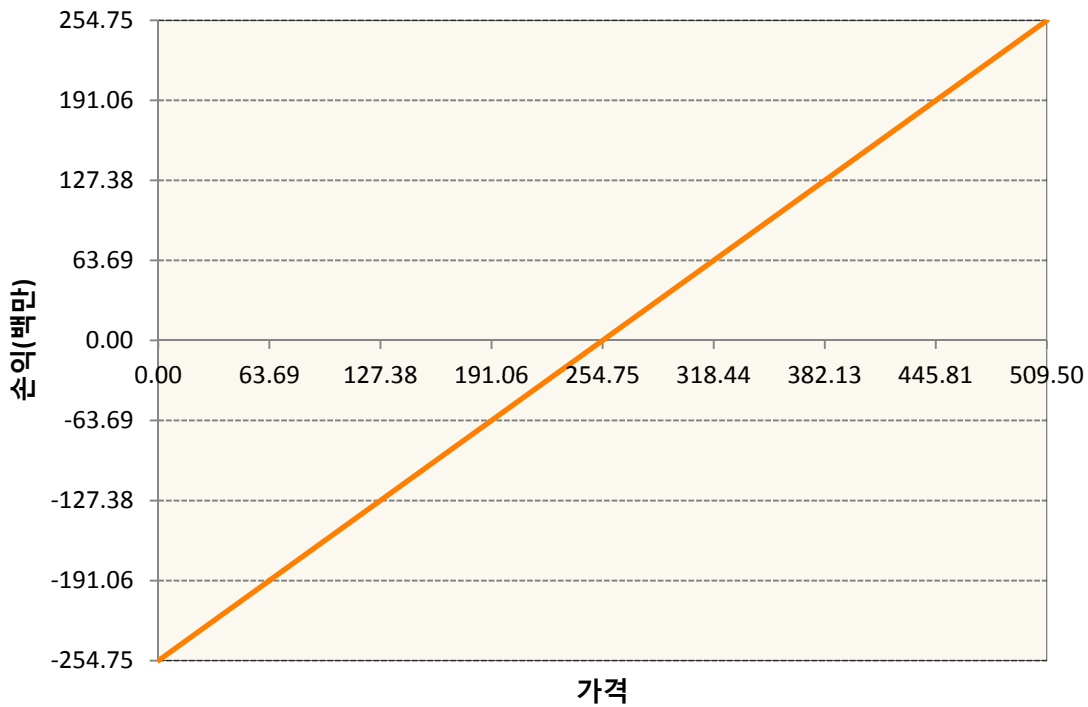
1. 계약금액

(단위:백만원)

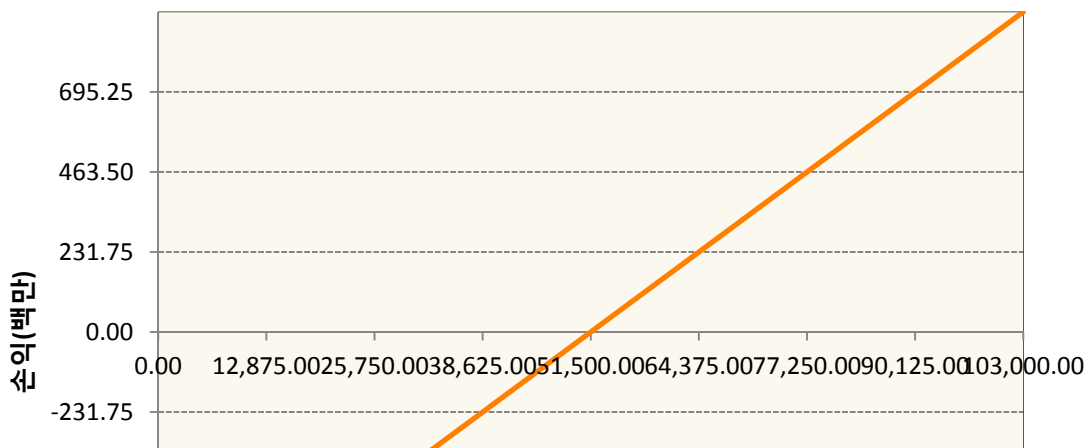
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,182	0	1,182	장내

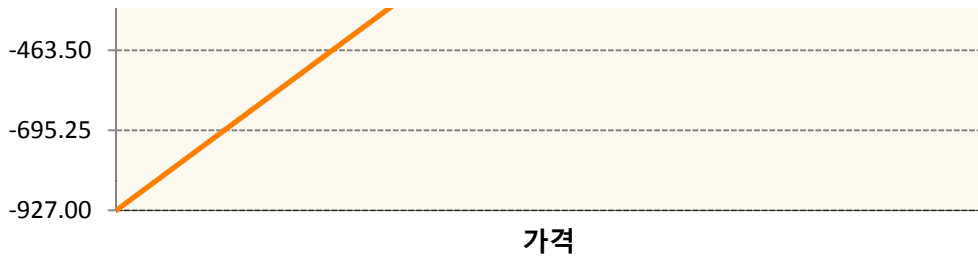
2. 만기시점의 손익구조

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%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14	
-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%	14	14	14	14	14	14	14	
8.00%	20	20	20	20	20	20	20	
KR4111Q50002		2020-05 삼성전자개별선물						74
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74	
-5.33%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	25	25	25	25	25	25	25	
5.33%	49	49	49	49	49	49	49	
8.00%	74	74	74	74	74	74	74	

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

141

공시일	2020-04-20
기준일	2020-04-17

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

947

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,098

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-20
기준일	2020-04-17

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)

876

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-20
기준일	2020-04-17

유로인덱스모(주식-파생형)

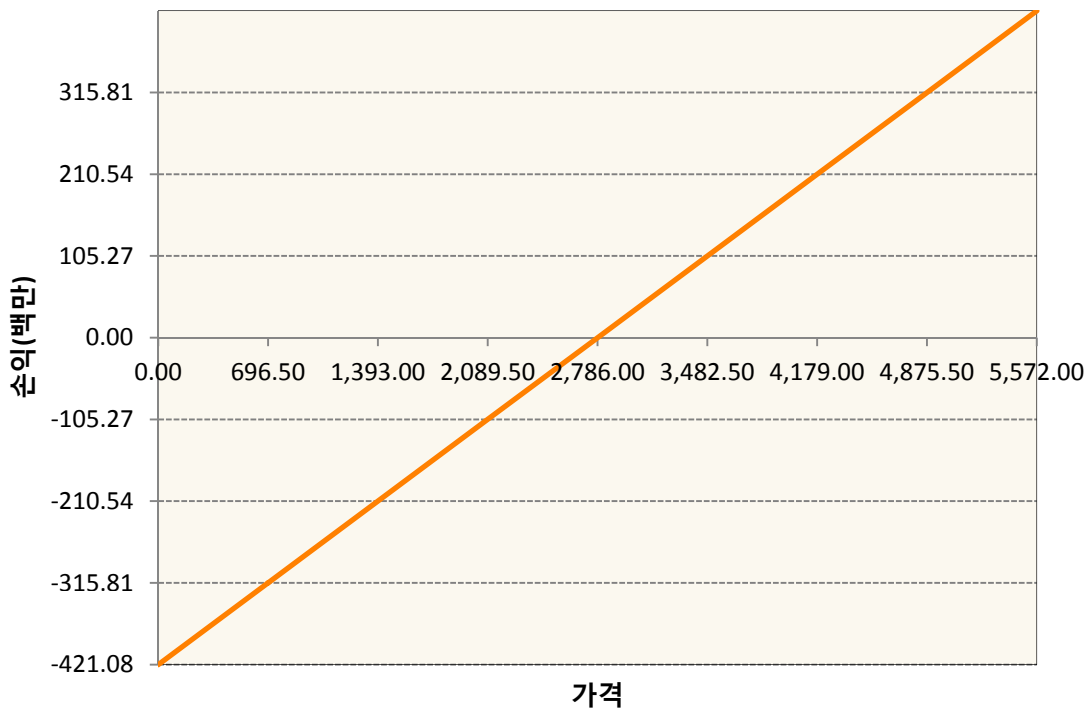
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	421	0	421	

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)

42

공시일	2020-04-20
기준일	2020-04-17

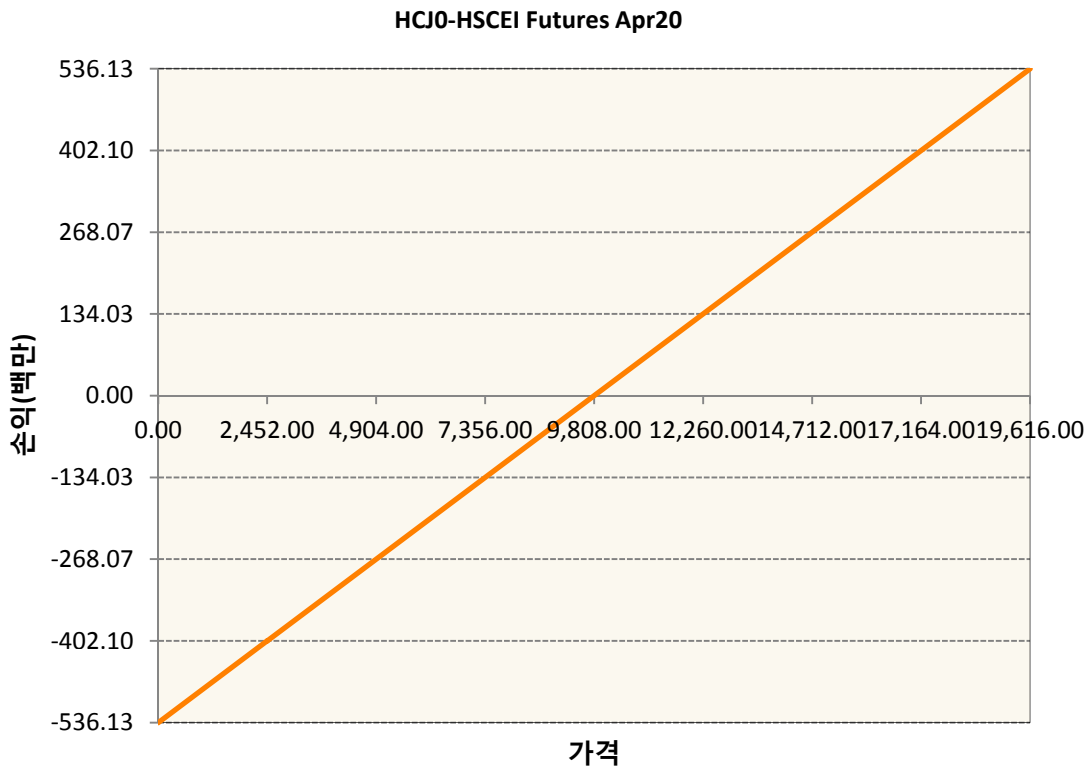
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	536	0	536	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	2020-04-20
기준일	2020-04-17

커버드콜모(주식혼합-파생형)

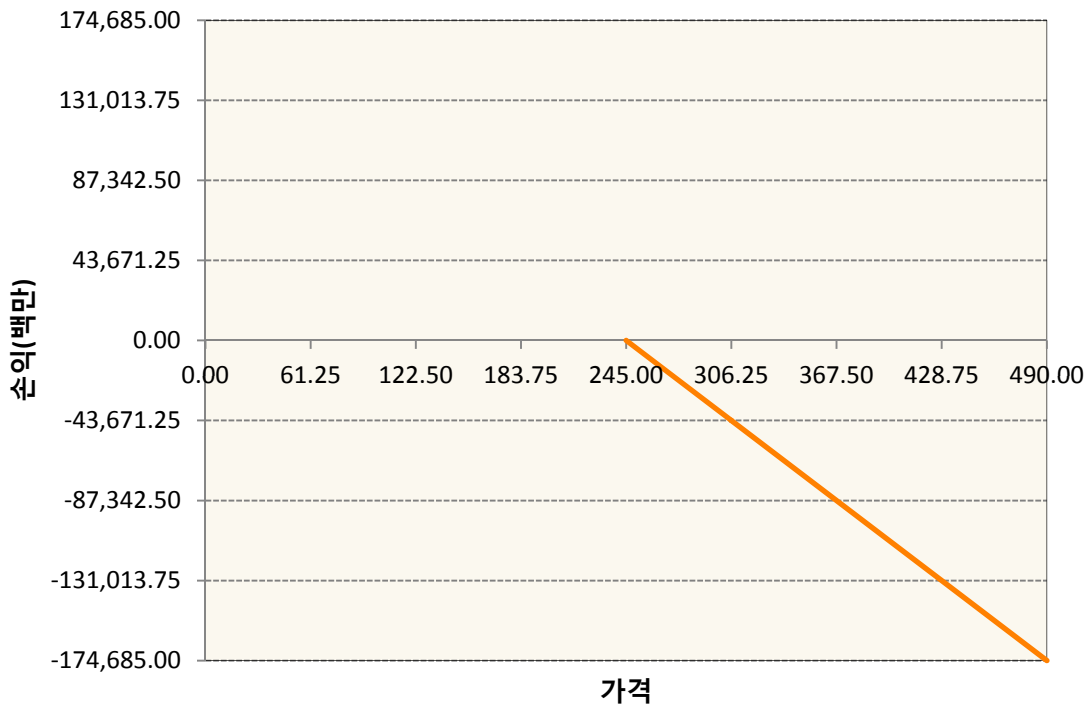
1. 계약금액

(단위:백만원)

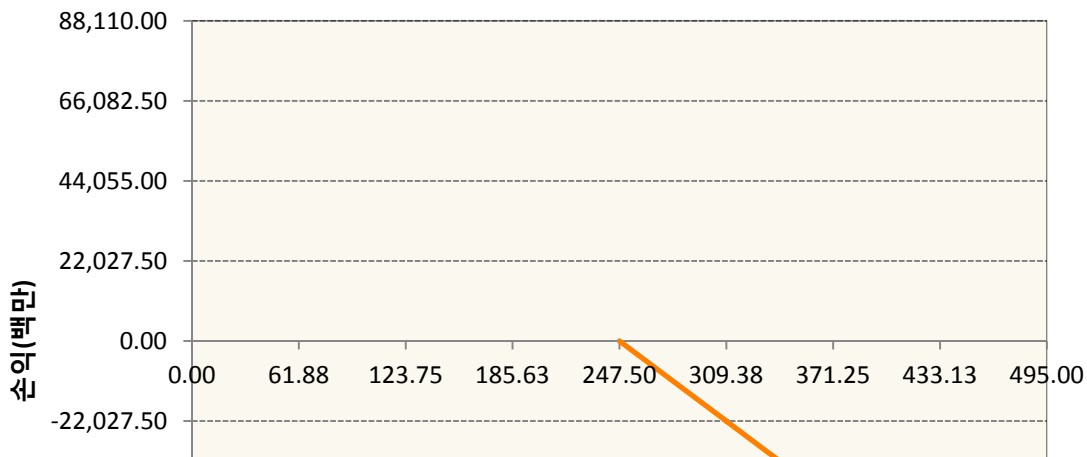
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	358,345	-358,345	장내

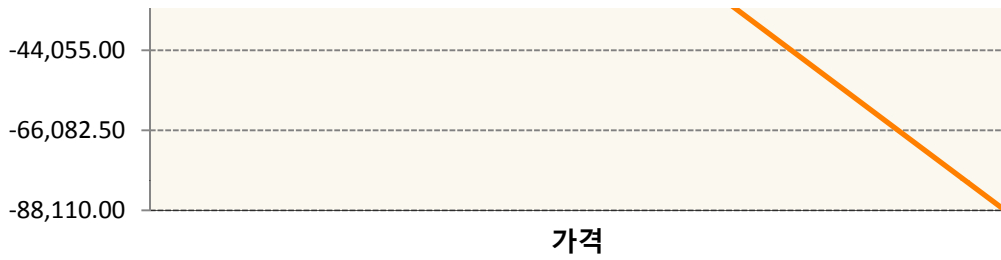
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q52452-2020-05 콜245

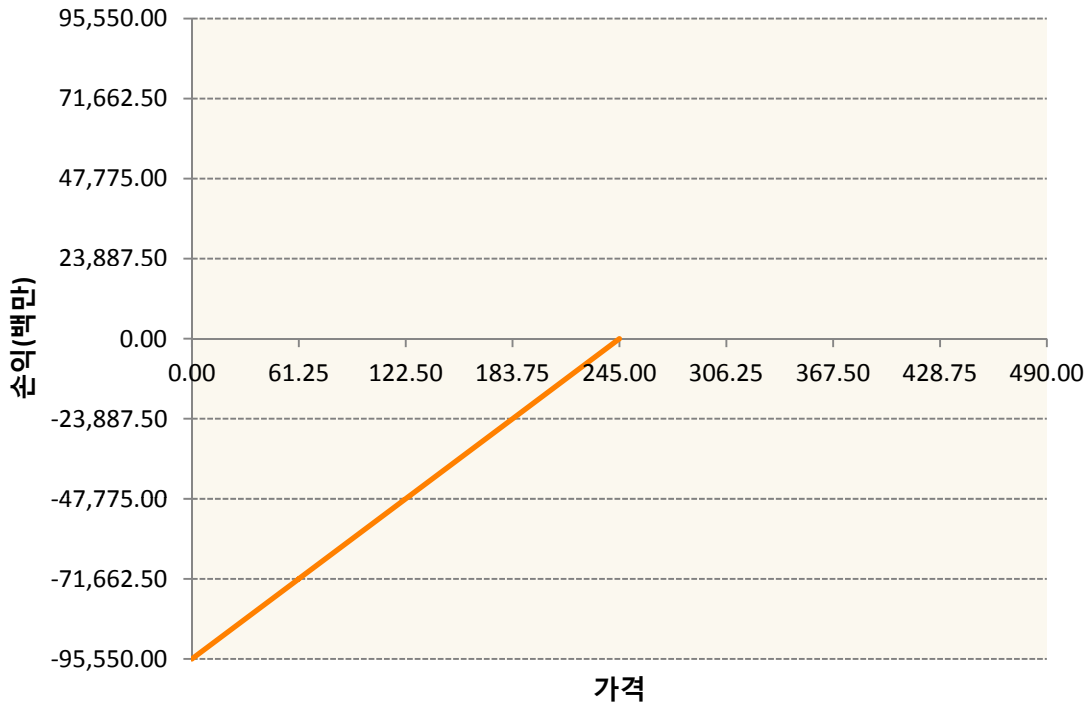


KR4201Q52478-2020-05 콜247.5





KR4301Q52450-2020-05 풋245



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q52452		2020-05 콜245					12,538
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,540	8,881	8,211	7,532	6,847	6,157	5,462
-5.33%	7,623	6,896	6,168	5,439	4,710	3,979	3,249
-2.67%	5,147	4,406	3,665	2,923	2,181	1,439	696
0%	2,131	1,429	718	0	-724	-1,451	-2,182
2.67%	-1,367	-1,989	-2,634	-3,298	-3,977	-4,667	-5,366
5.33%	-5,266	-5,783	-6,340	-6,929	-7,542	-8,177	-8,828
8.00%	-9,475	-9,882	-10,341	-10,842	-11,379	-11,946	-12,538
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5					6,126
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,502	4,188	3,865	3,535	3,201	2,863	2,521

-5.33%	3,642	3,285	2,926	2,565	2,203	1,840	1,477
-2.67%	2,507	2,133	1,759	1,385	1,011	637	264
0%	1,100	736	369	0	-370	-742	-1,114
2.67%	-559	-890	-1,230	-1,577	-1,930	-2,286	-2,646
5.33%	-2,432	-2,715	-3,015	-3,327	-3,651	-3,983	-4,322
8.00%	-4,476	-4,704	-4,956	-5,227	-5,515	-5,815	-6,126
KR4301Q52450 2020-05 풋245							4,678
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,170	-3,406	-3,650	-3,901	-4,156	-4,415	-4,678
-5.33%	-1,435	-1,717	-2,001	-2,285	-2,569	-2,855	-3,140
-2.67%	-120	-409	-698	-988	-1,278	-1,569	-1,860
0%	789	532	269	0	-273	-549	-828
2.67%	1,359	1,158	943	715	477	231	-22
5.33%	1,682	1,543	1,383	1,205	1,012	805	588
8.00%	1,849	1,763	1,654	1,525	1,377	1,214	1,035

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

(단위:백만원)

20,151

공시일	2020-04-20
기준일	2020-04-17

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

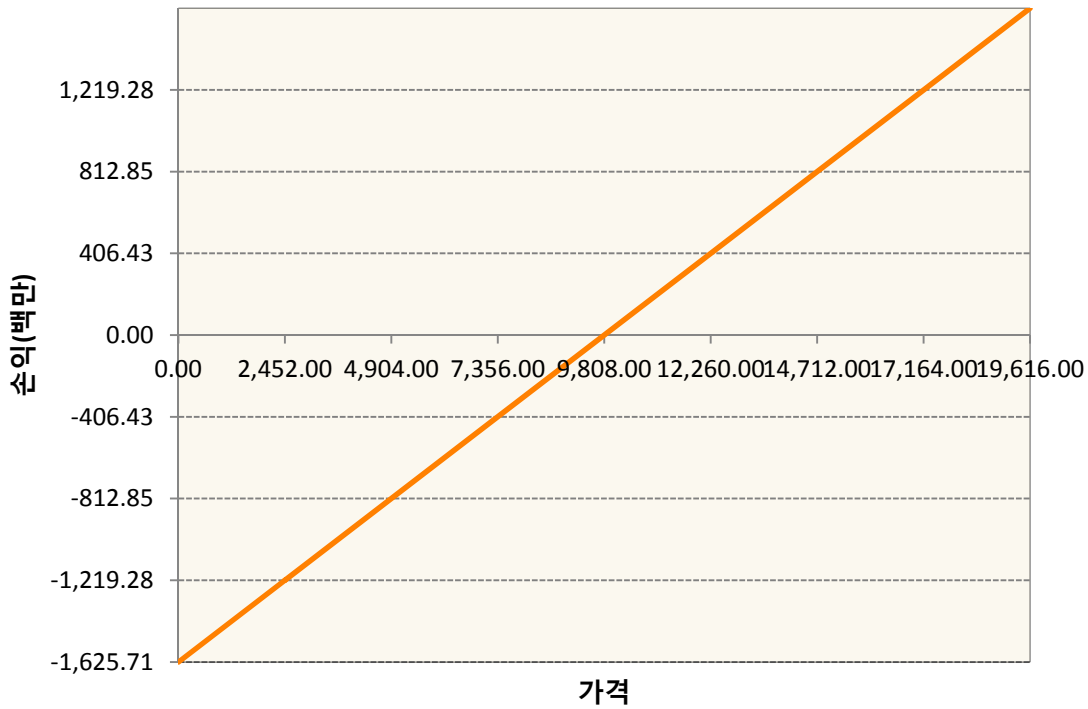
1. 계약금액

(단위:백만원)

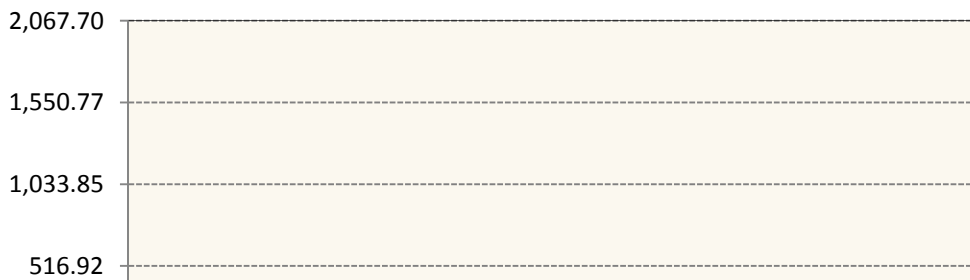
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,626	0	1,626	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,137	-4,137	장내
누계	통화	선도	691	2,212	-1,521	장외

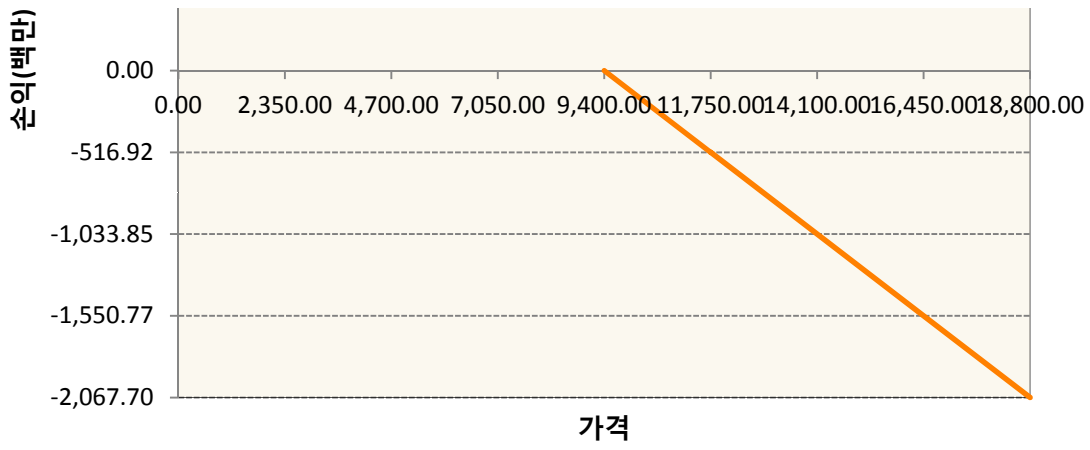
2. 만기시점의 손익구조

HCJ0-HSCEI Futures Apr20

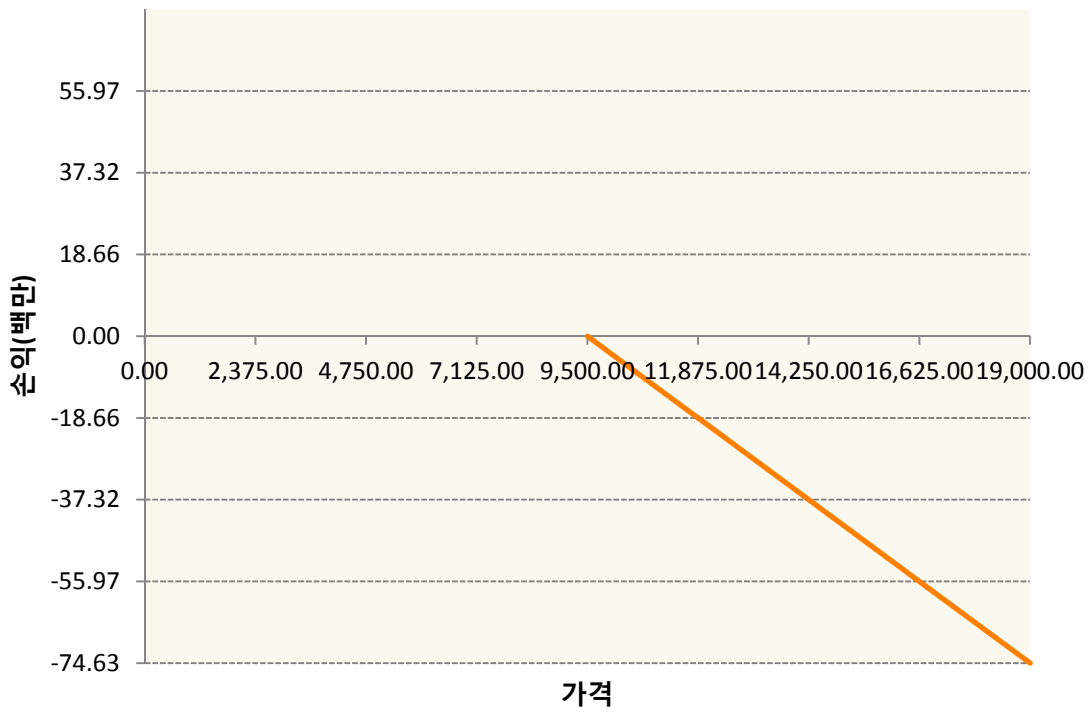


OHHIJ0-C94-HSCEI

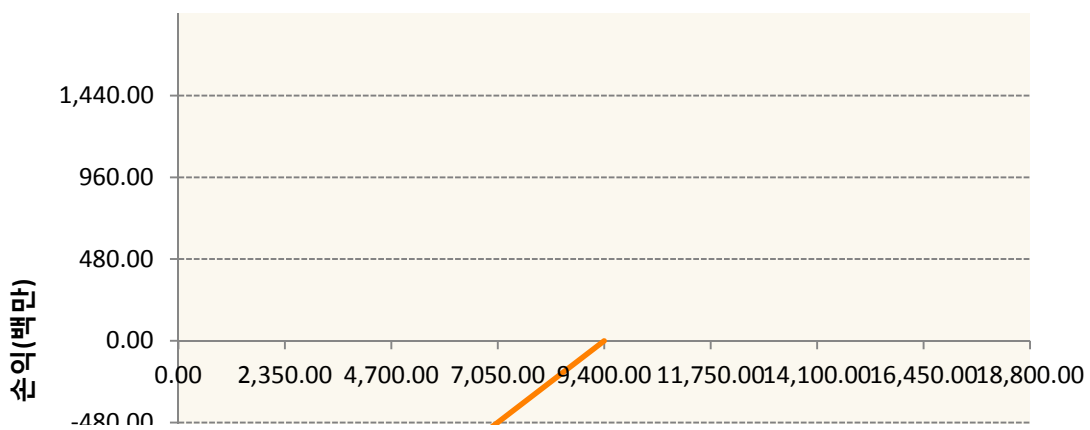


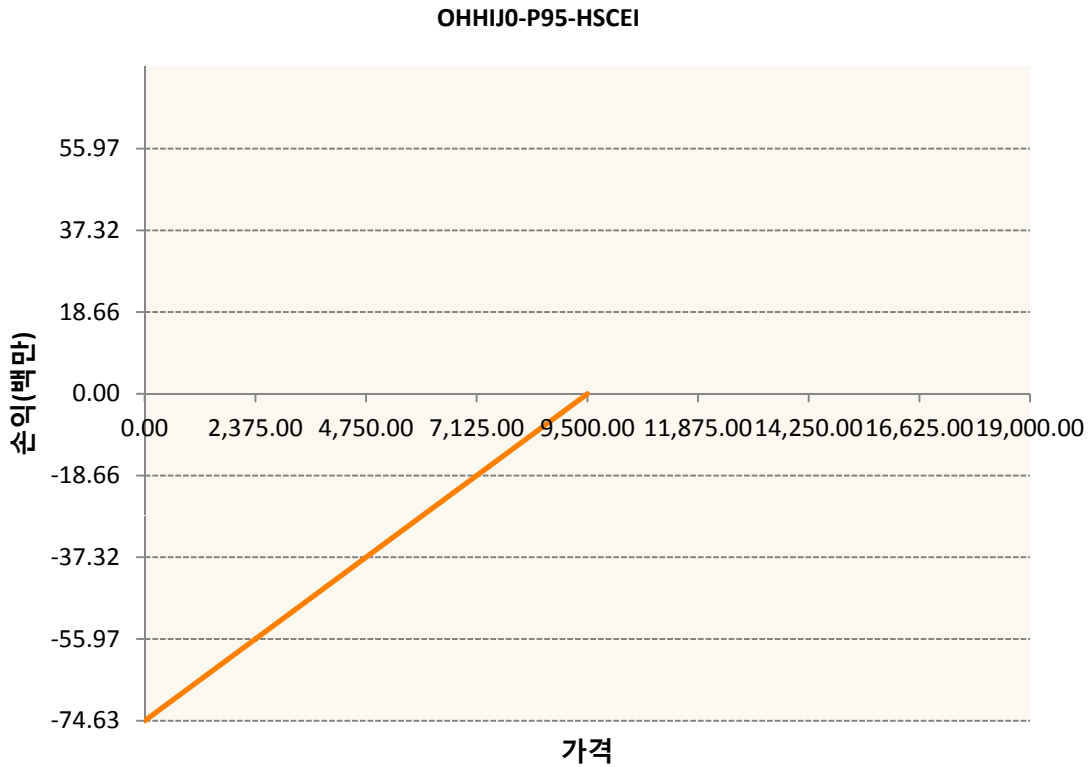


OHHIJO-C95-HSCEI



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		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	2020-04-20
기준일	2020-04-17

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

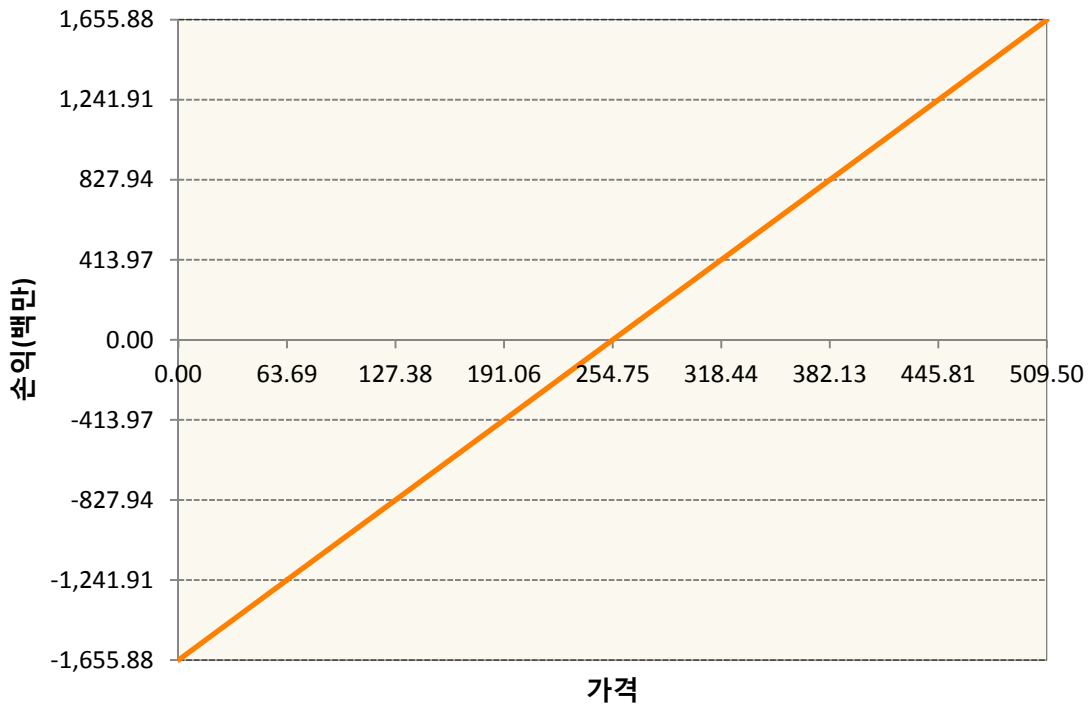
1. 계약금액

(단위:백만원)

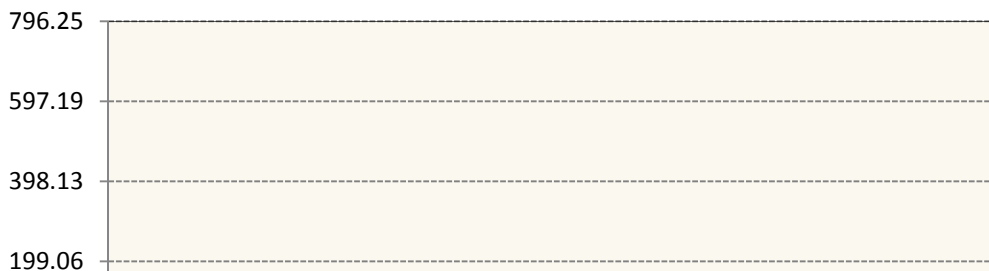
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,656	0	1,656	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,193	-3,193	장내

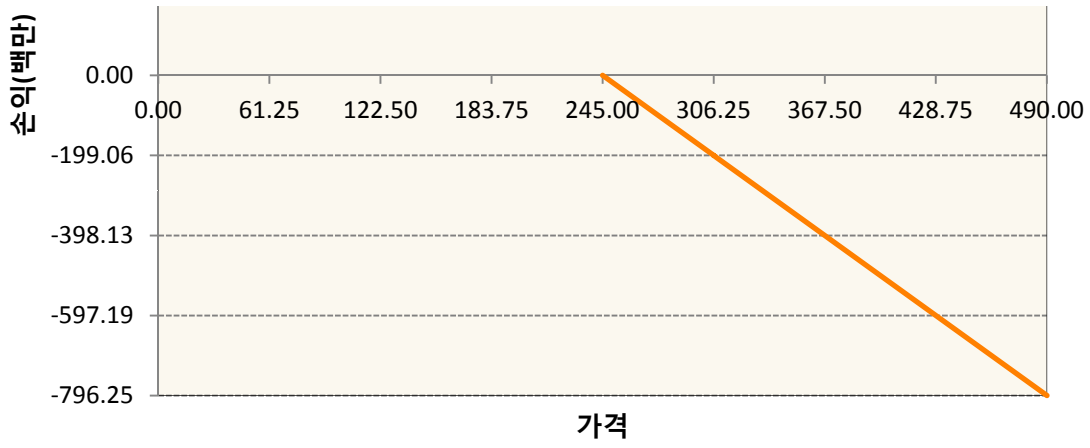
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

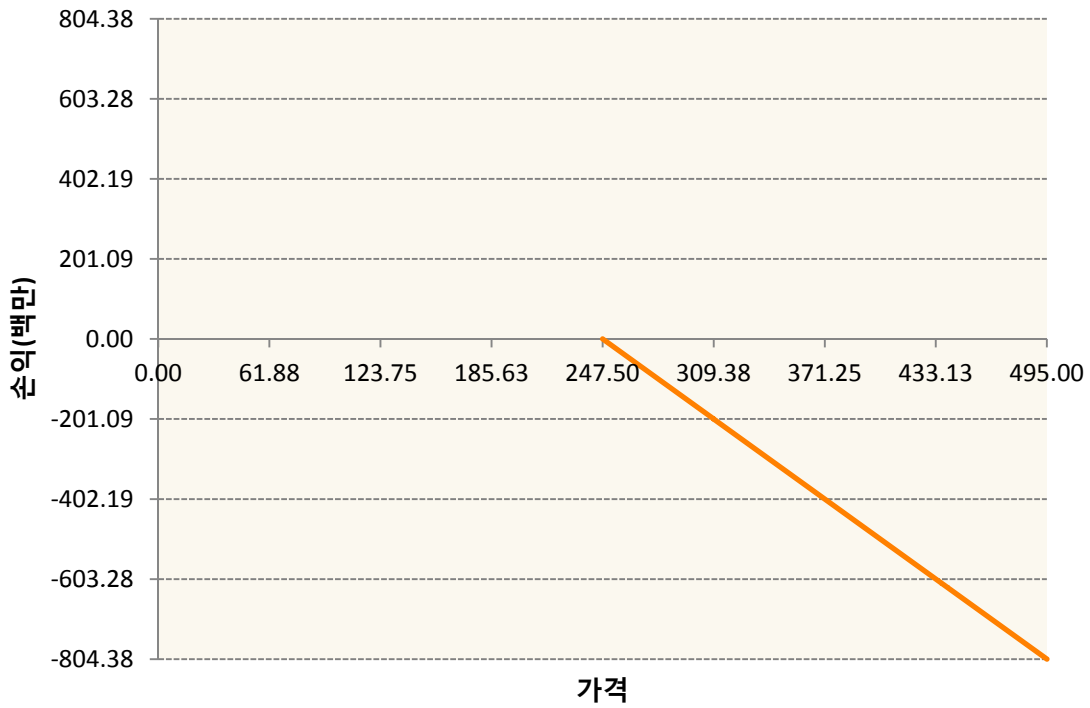


KR4201Q52452-2020-05 콜245

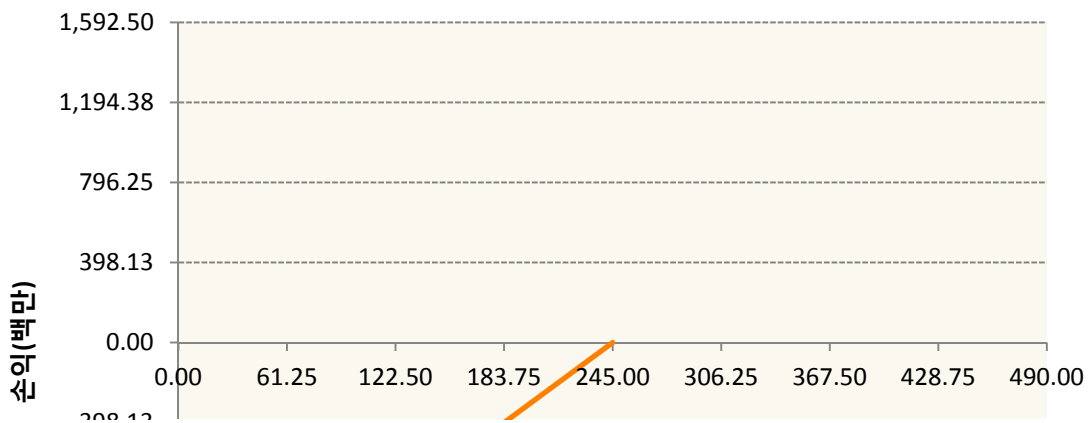




KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



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%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125	
-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%	125	125	125	125	125	125	125	
8.00%	187	187	187	187	187	187	187	
KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						133
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133	
-5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88	
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	44	44	44	44	44	44	44	
5.33%	88	88	88	88	88	88	88	
8.00%	133	133	133	133	133	133	133	
KR4201Q52452		2020-05 콜245						57
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	43	40	37	34	31	28	25	
-5.33%	35	31	28	25	21	18	15	
-2.67%	23	20	17	13	10	7	3	
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10	
2.67%	-6	-9	-12	-15	-18	-21	-24	
5.33%	-24	-26	-29	-32	-34	-37	-40	
8.00%	-43	-45	-47	-49	-52	-54	-57	
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5						56
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	41	38	35	32	29	26	23
-5.33%	33	30	27	23	20	17	13
-2.67%	23	19	16	13	9	6	2
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	-5	-8	-11	-14	-18	-21	-24
5.33%	-22	-25	-28	-30	-33	-36	-39
8.00%	-41	-43	-45	-48	-50	-53	-56
KR4301Q52450 2020-05 풋245							78
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-53	-57	-61	-65	-69	-74	-78
-5.33%	-24	-29	-33	-38	-43	-48	-52
-2.67%	-2	-7	-12	-16	-21	-26	-31
0%	13	9	4	0	-5	-9	-14
2.67%	23	19	16	12	8	4	0
5.33%	28	26	23	20	17	13	10
8.00%	31	29	28	25	23	20	17

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

(단위:백만원)

545

공시일	2020-04-20
기준일	2020-04-17

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

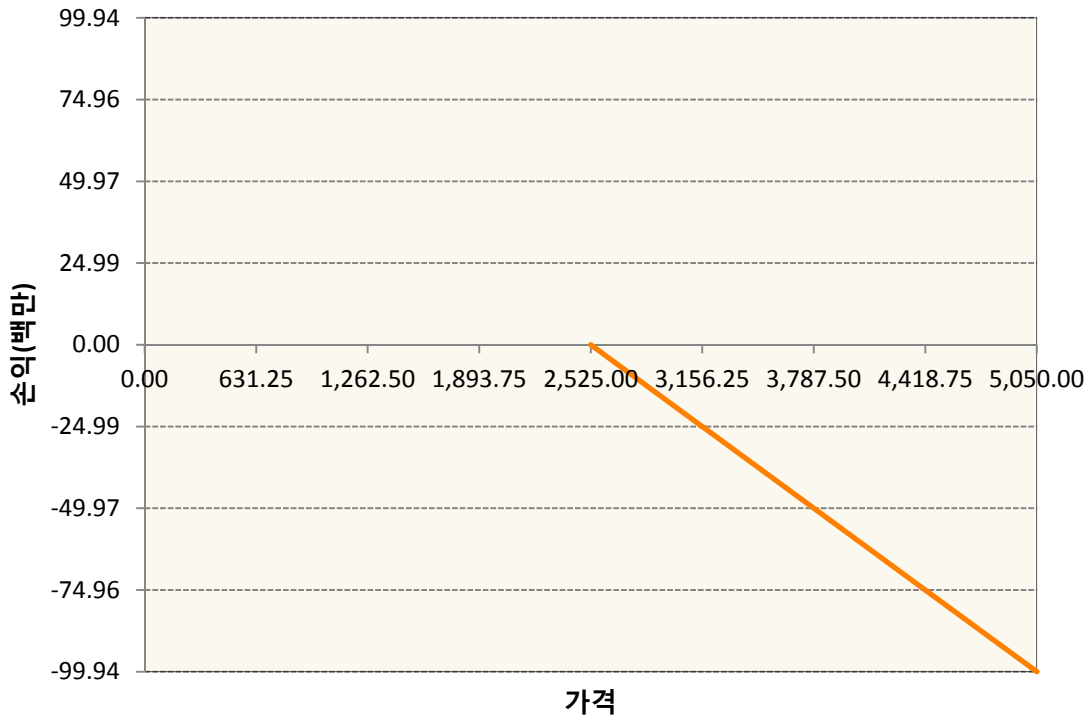
1. 계약금액

(단위:백만원)

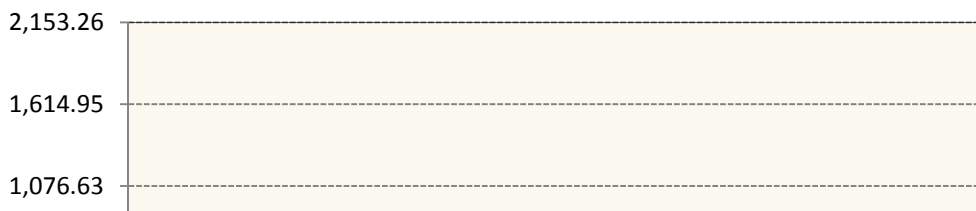
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	340	0	340	
누계	유가증권	스왑	7,494	0	7,494	장외
누계	유가증권	옵션	0	4,540	-4,540	장내
누계	통화	선도	0	2,670	-2,670	장외

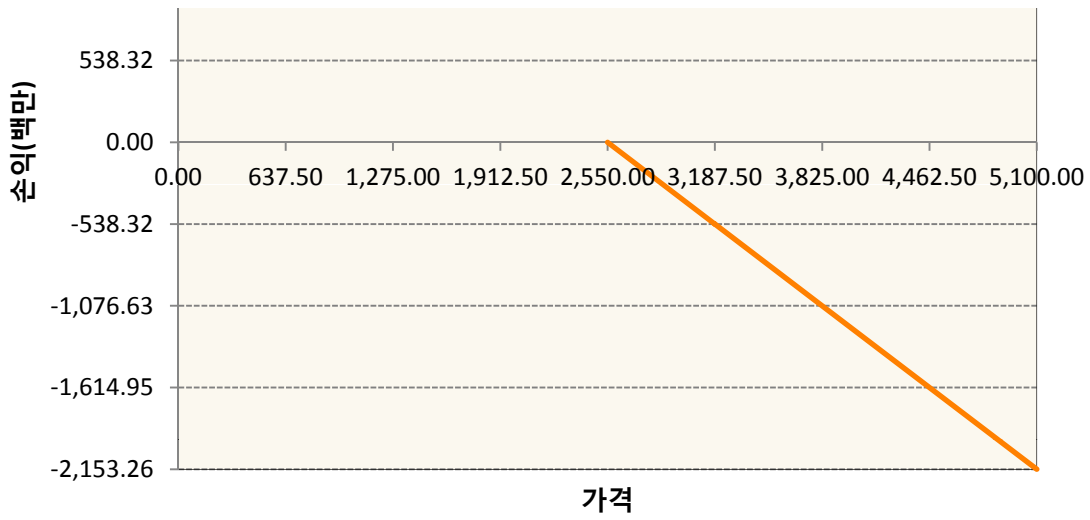
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ0-C2525-EURO STOXX 50

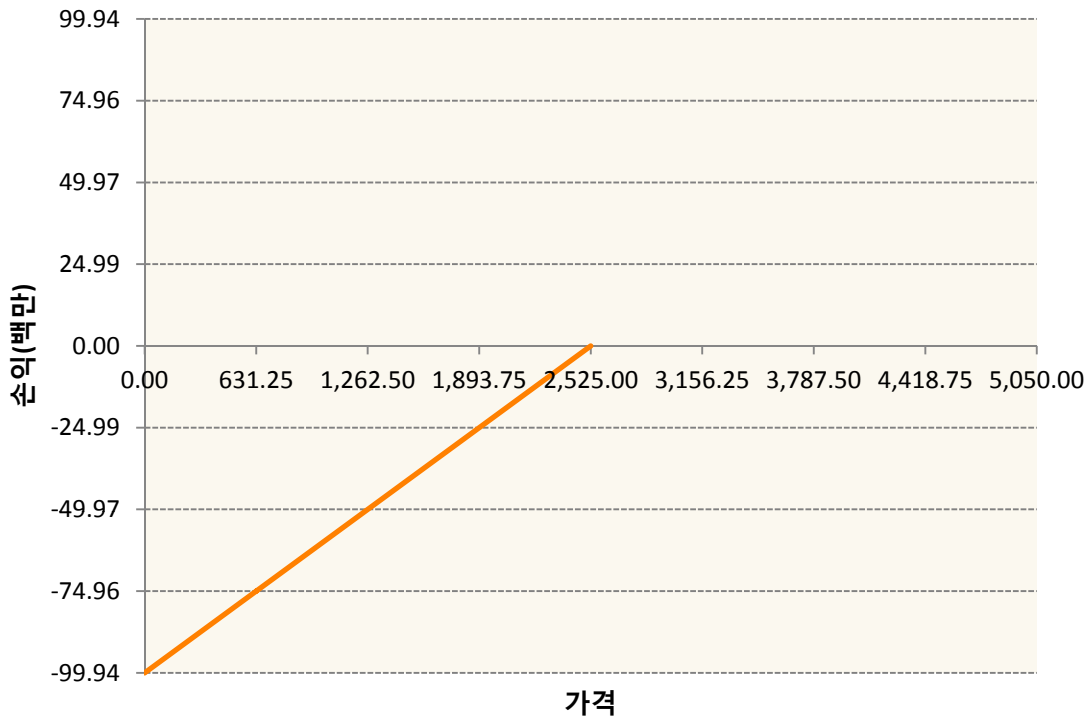


OESXJ0-C2550-EURO STOXX 50

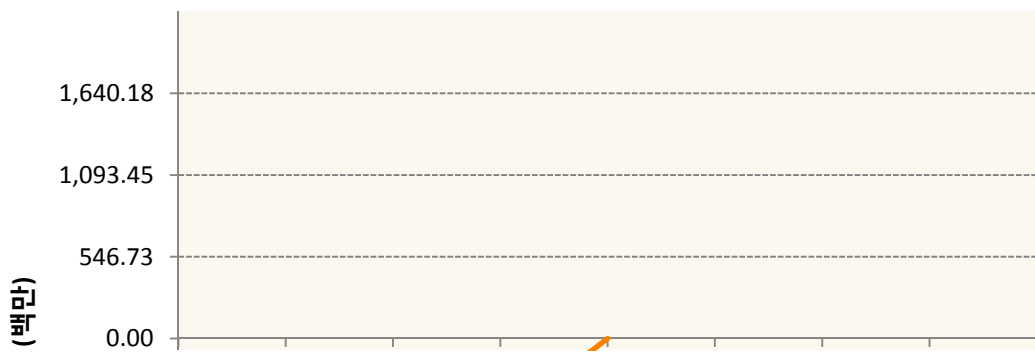


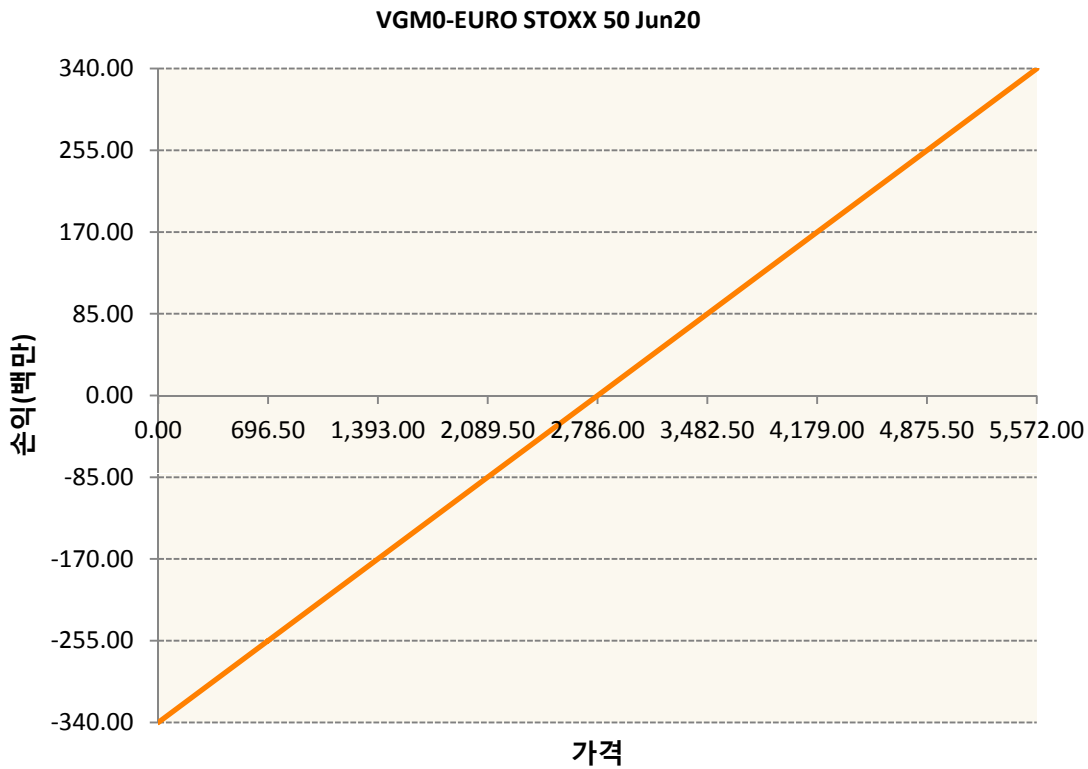
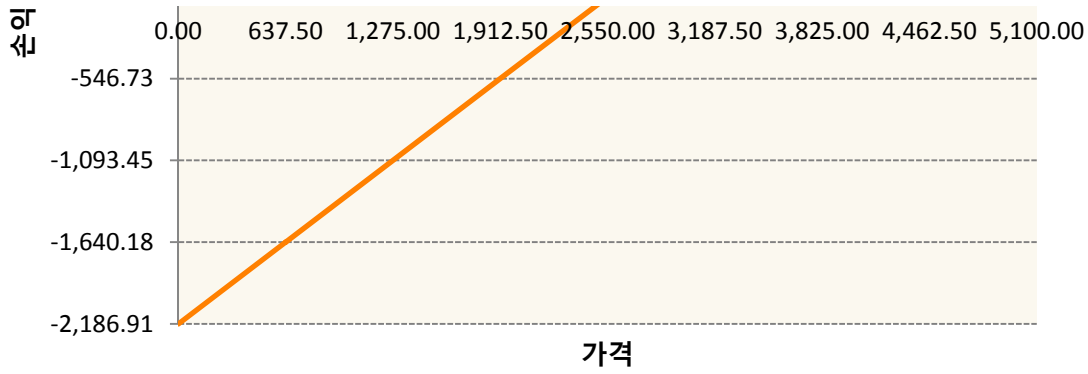


OESXJ0-P2525-EURO STOXX 50



OESXJ0-P2550-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		30
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E		214
OESXJ0-C25: EURO STOXX 50		8
OESXJ0-C25: EURO STOXX 50		172
OESXJ0-P25: EURO STOXX 50		8
OESXJ0-P25! EURO STOXX 50		175
VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	27

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

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

(단위:백만원)

1,130

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

(단위:백만원)

98

공시일	2020-04-20
기준일	2020-04-17

ETF스마트레버리지목표전환형10호

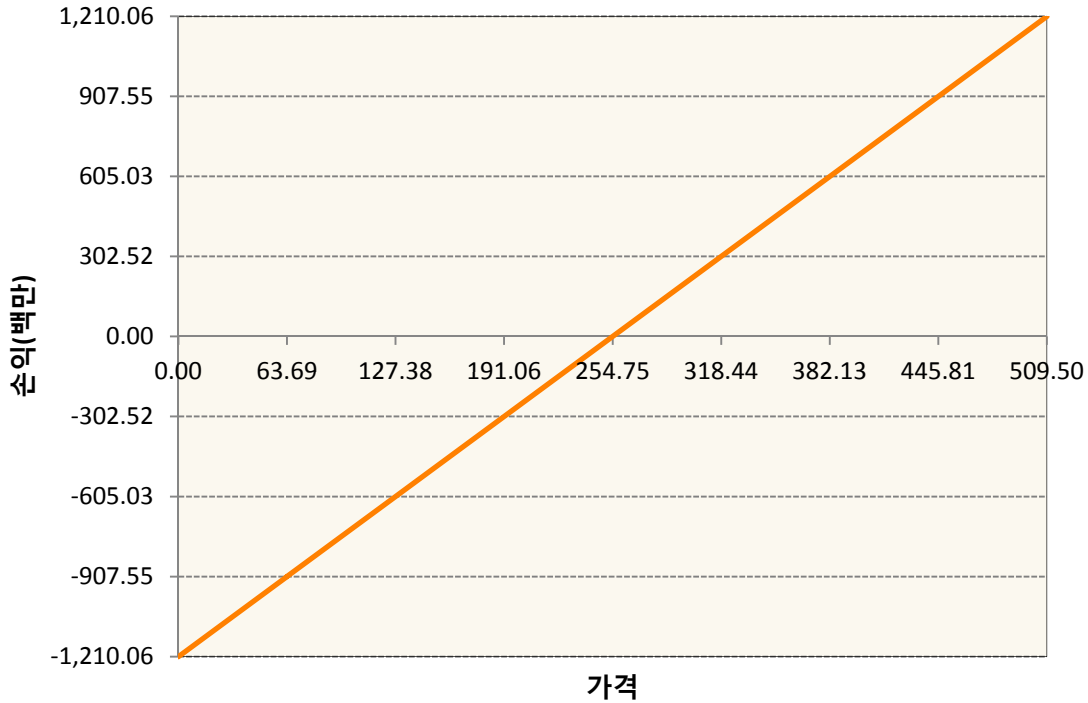
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,210	0	1,210	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						97
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97	
-5.33%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65	
-2.67%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	32	32	32	32	32	32	32	
5.33%	65	65	65	65	65	65	65	
8.00%	97	97	97	97	97	97	97	

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

(단위:백만원)

143

공시일	2020-04-20
기준일	2020-04-17

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

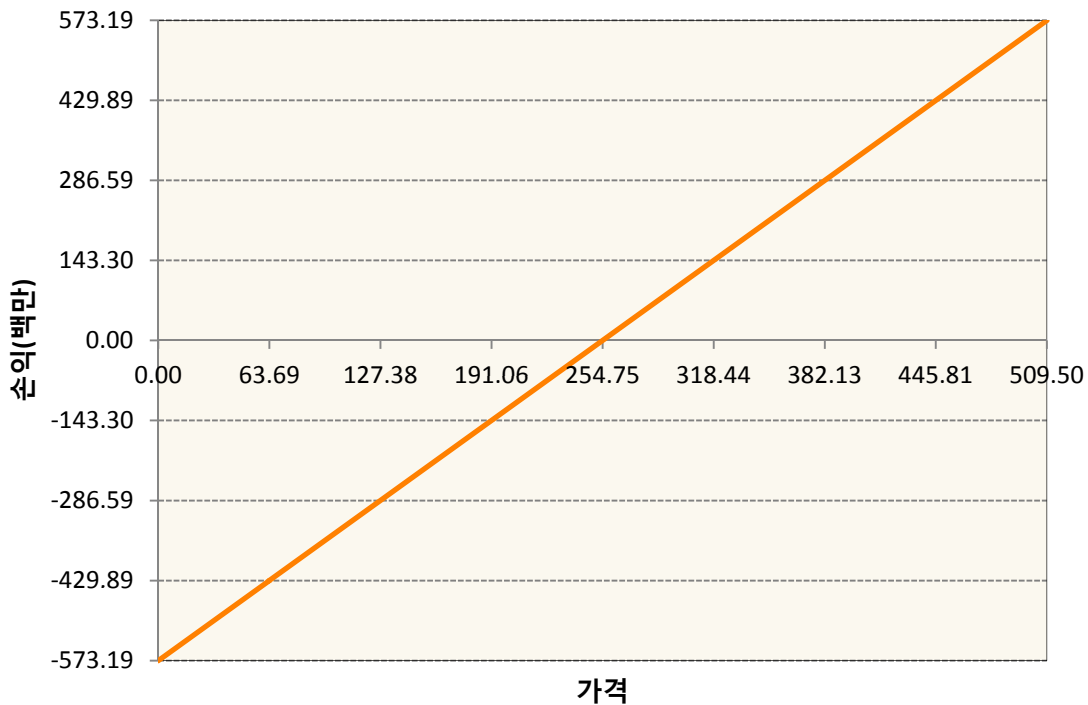
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	573	0	573	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						46
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46	
-5.33%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31	
-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%	31	31	31	31	31	31	31	
8.00%	46	46	46	46	46	46	46	

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

(단위:백만원)

68

공시일	2020-04-20
기준일	2020-04-17

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

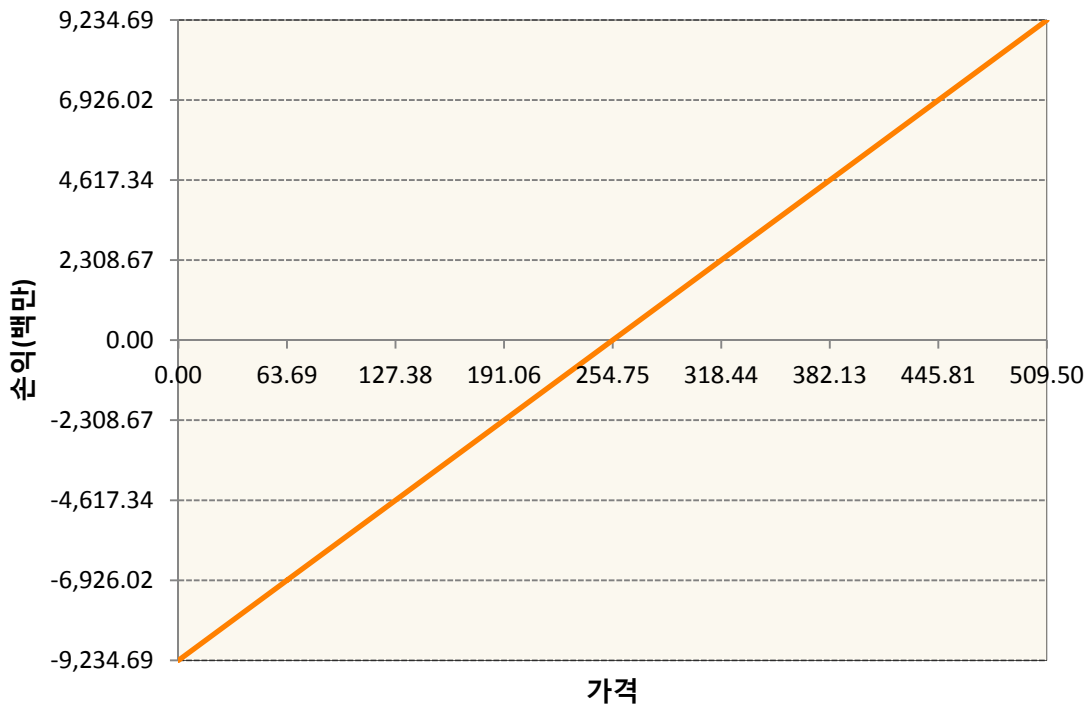
1. 계약금액

(단위:백만원)

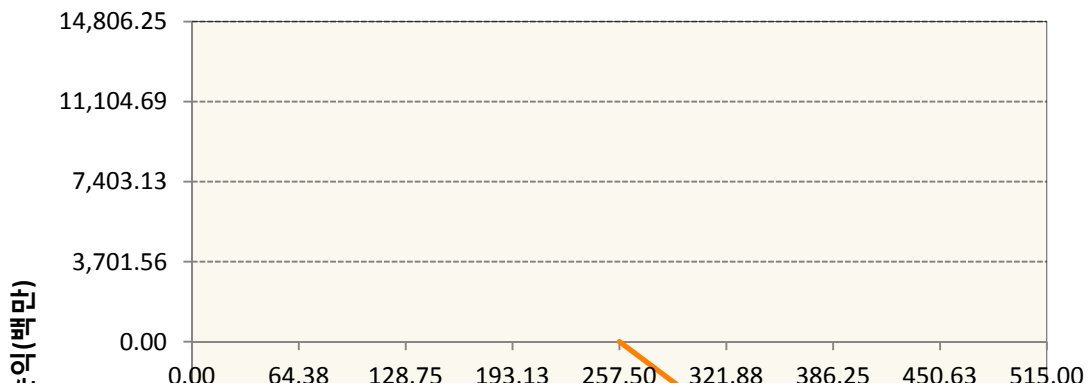
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,235	0	9,235	장내
누계	유가증권	옵션	6,201	17,536	-11,335	장내

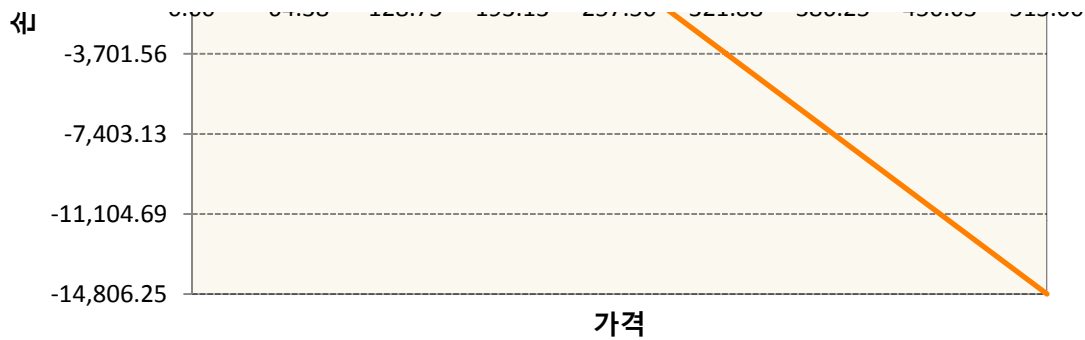
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

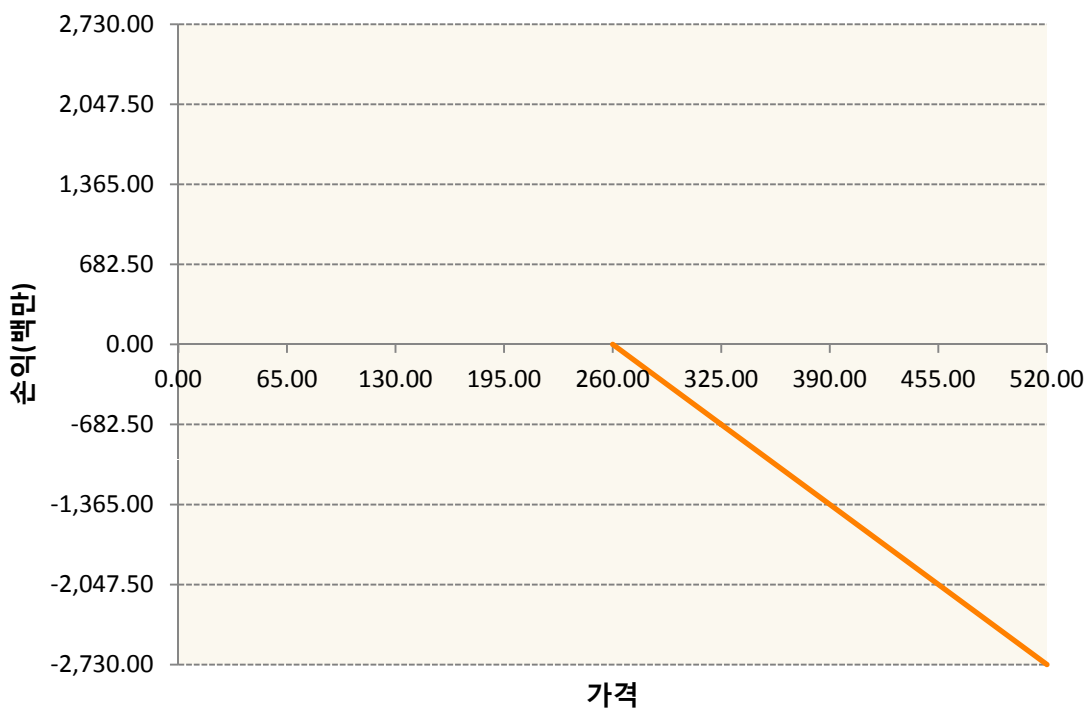


KR4201Q52577-2020-05 콜257.5

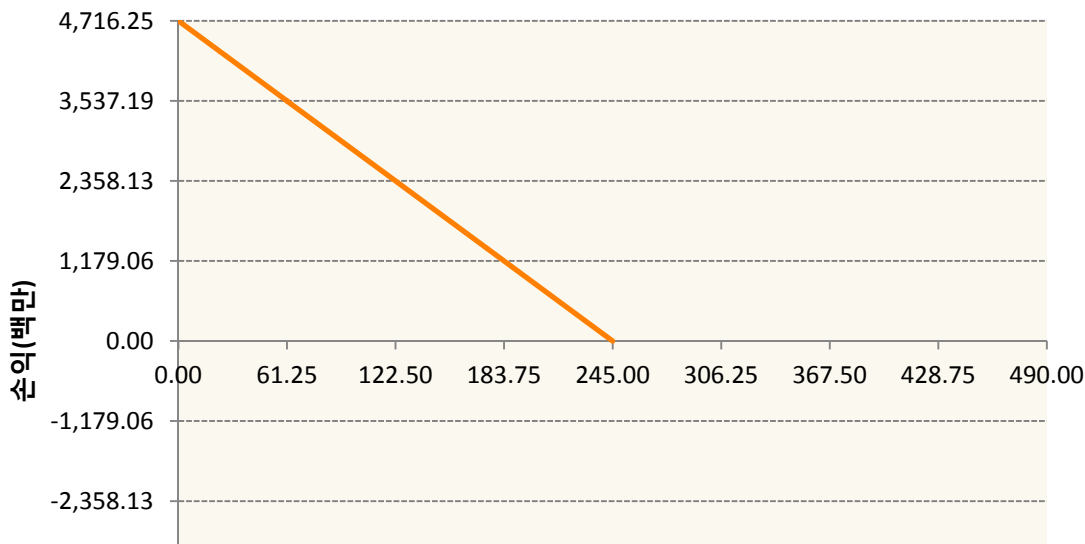


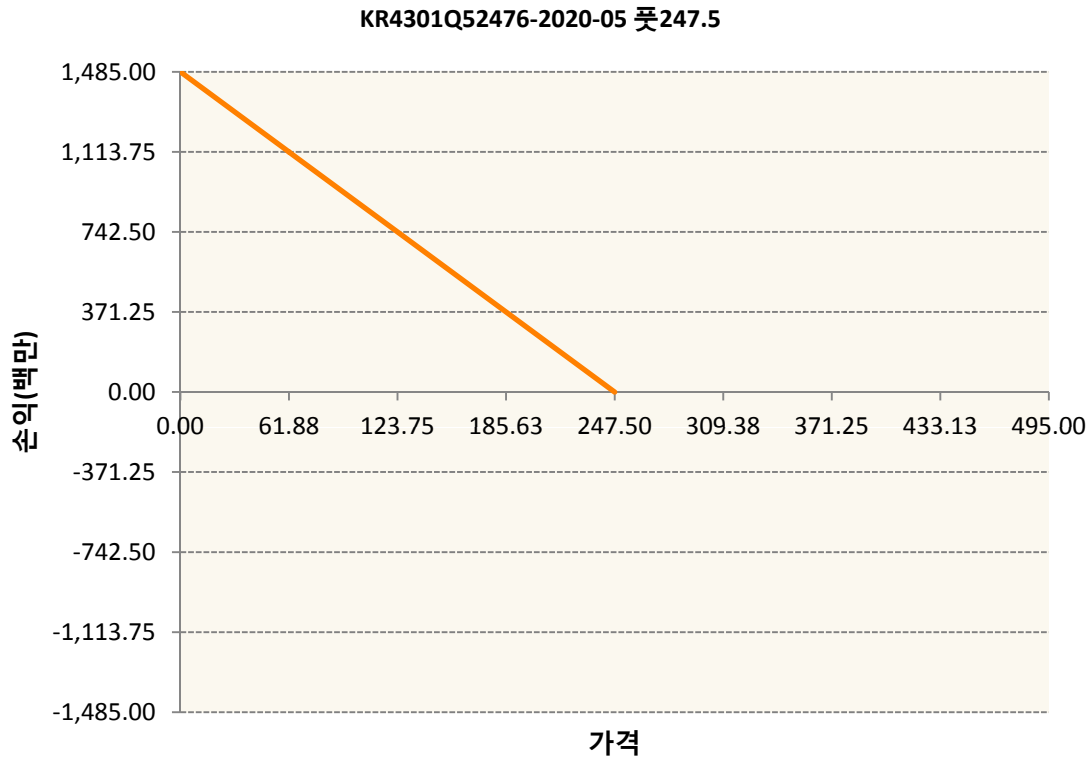
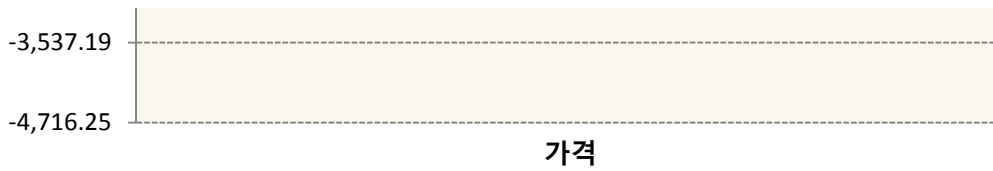


KR4201Q52601-2020-05 콜260



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						740
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-740	-740	-740	-740	-740	-740	-740	
-5.33%	-493	-493	-493	-493	-493	-493	-493	
-2.67%	-247	-247	-247	-247	-247	-247	-247	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	247	247	247	247	247	247	247	
5.33%	493	493	493	493	493	493	493	
8.00%	740	740	740	740	740	740	740	
KR4201Q52577		2020-05 콜257.5						890
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	557	518	476	432	385	337	287	
-5.33%	472	423	372	319	265	211	155	
-2.67%	350	293	235	176	117	57	-3	

0%	187	124	62	0	-62	-124	-187
2.67%	-20	-83	-145	-208	-271	-334	-397
5.33%	-268	-327	-387	-447	-508	-570	-632
8.00%	-552	-604	-659	-715	-772	-831	-890
KR4201Q52601 2020-05 콜260							157
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	94	88	81	73	65	56	48
-5.33%	81	72	63	54	45	35	25
-2.67%	61	51	40	30	19	9	-2
0%	34	23	11	0	-11	-23	-34
2.67%	-1	-13	-24	-36	-47	-59	-71
5.33%	-44	-55	-66	-77	-89	-100	-112
8.00%	-93	-103	-114	-124	-135	-146	-157
KR4301Q52450 2020-05 풋245							231
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	156	168	180	193	205	218	231
-5.33%	71	85	99	113	127	141	155
-2.67%	6	20	34	49	63	77	92
0%	-39	-26	-13	0	13	27	41
2.67%	-67	-57	-47	-35	-24	-11	1
5.33%	-83	-76	-68	-59	-50	-40	-29
8.00%	-91	-87	-82	-75	-68	-60	-51
KR4301Q52476 2020-05 풋247.5							77
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	55	58	62	65	69	73	77
-5.33%	26	30	34	39	43	47	52
-2.67%	3	8	12	17	21	26	31
0%	-13	-9	-4	0	4	9	13
2.67%	-23	-20	-16	-13	-9	-5	0
5.33%	-30	-27	-24	-21	-18	-15	-11
8.00%	-33	-32	-30	-27	-25	-22	-19

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

(단위:백만원)

2,112

공시일	2020-04-20
기준일	2020-04-17

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	147,315	0	147,315	

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	2020-04-20
기준일	2020-04-17

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	99,330	0	99,330	

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	2020-04-20
기준일	2020-04-17

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	438,859	0	438,859	
누계	통화	선도	71,247	554,023	-482,776	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
FX21020J02€ KRW/USD 10-06-20E	1,325
FX21020J027 KRW/USD 22-06-20E	1,500
FX21020J028 KRW/USD 22-06-20E	1,949

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

24,942

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

(단위:백만원)

195

공시일	2020-04-20
기준일	2020-04-17

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

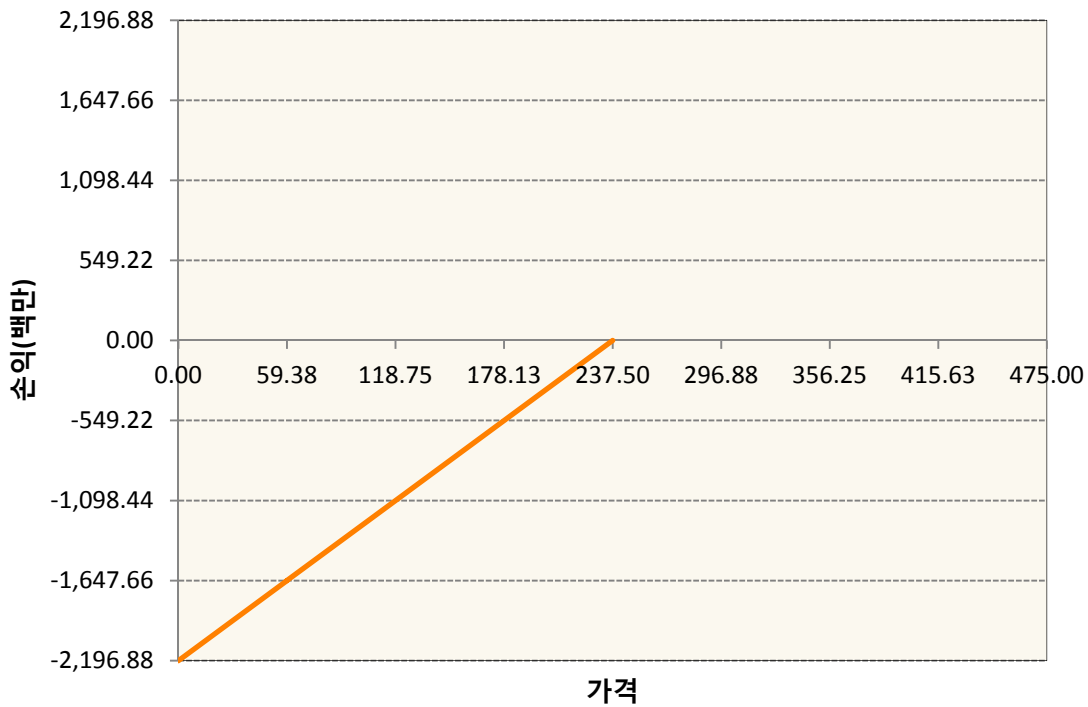
1. 계약금액

(단위:백만원)

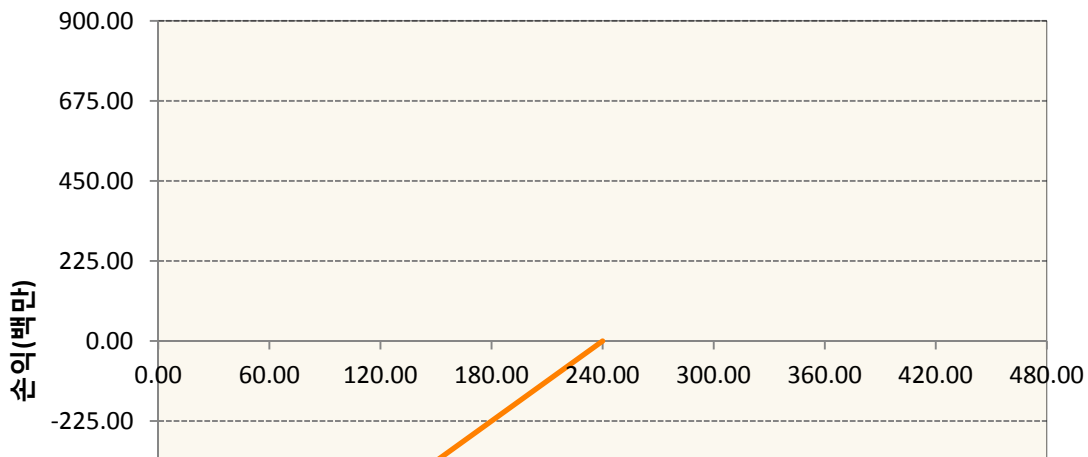
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,097	-3,097	장내

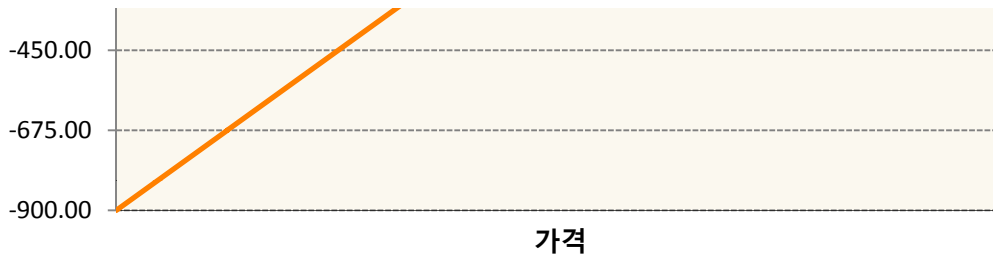
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q52377-2020-05 풋237.5



KR4301Q52401-2020-05 풋240





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q52377		2020-05 풋237.5						88
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-49	-55	-62	-68	-75	-82	-88	
-5.33%	-19	-25	-32	-38	-45	-52	-58	
-2.67%	2	-4	-10	-16	-22	-28	-35	
0%	14	10	5	0	-5	-11	-16	
2.67%	21	18	15	11	7	2	-3	
5.33%	24	23	20	18	14	11	7	
8.00%	26	25	23	22	19	17	14	
KR4301Q52401		2020-05 풋240						39
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-23	-26	-28	-31	-34	-36	-39	
-5.33%	-9	-12	-15	-18	-20	-23	-26	
-2.67%	0	-2	-5	-7	-10	-13	-15	
0%	6	4	2	0	-2	-5	-7	
2.67%	10	9	7	5	3	1	-1	
5.33%	12	11	10	8	7	5	4	
8.00%	13	12	11	11	9	8	7	

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

93

공시일	2020-04-20
기준일	2020-04-17

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	7,234	0	7,234	
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)

284

공시일	2020-04-20
기준일	2020-04-17

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

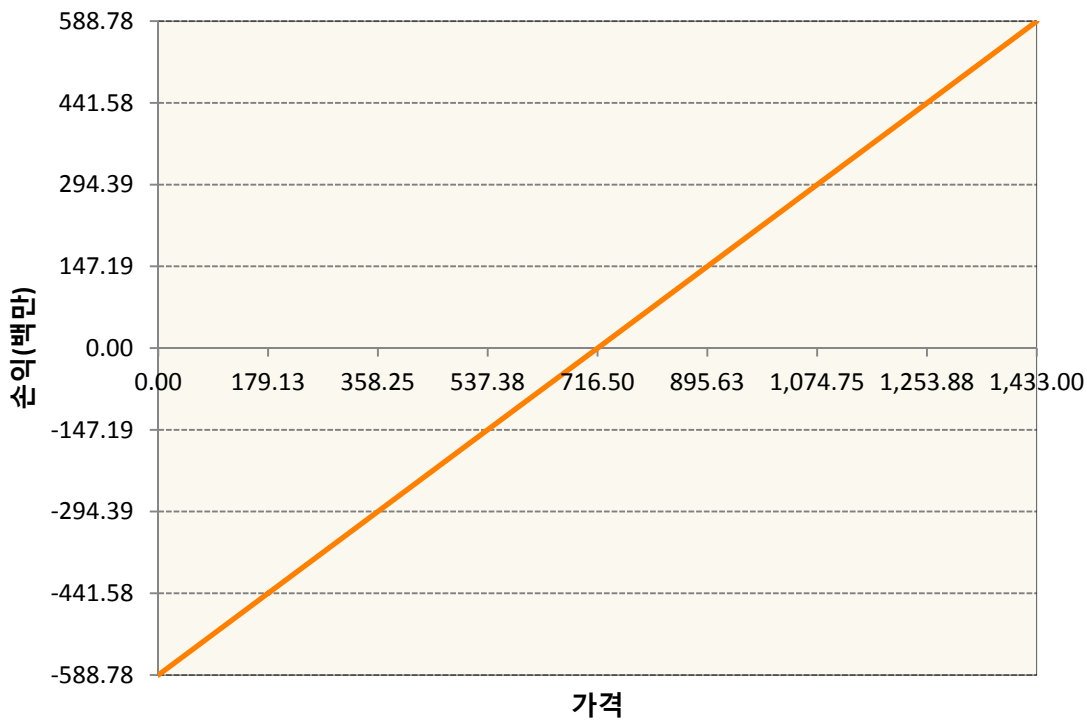
1. 계약금액

(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	589	0	589	
누계	유가증권	스왑	1,088	0	1,088	장외
누계	통화	선도	230	501	-272	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCK0-VN30 Index Future May20



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	8
FX21020J008 KRW/EUR 24-07-20E	3
FX21020J009 KRW/EUR 24-07-20E	5
FX21020J018 KRW/EUR 24-07-20E	3
FX21020J029 KRW/EUR 24-07-20E	5
VNCK0 VN30 Index Future May20	47

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

(단위:백만원)

151

공시일	2020-04-20
기준일	2020-04-17

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

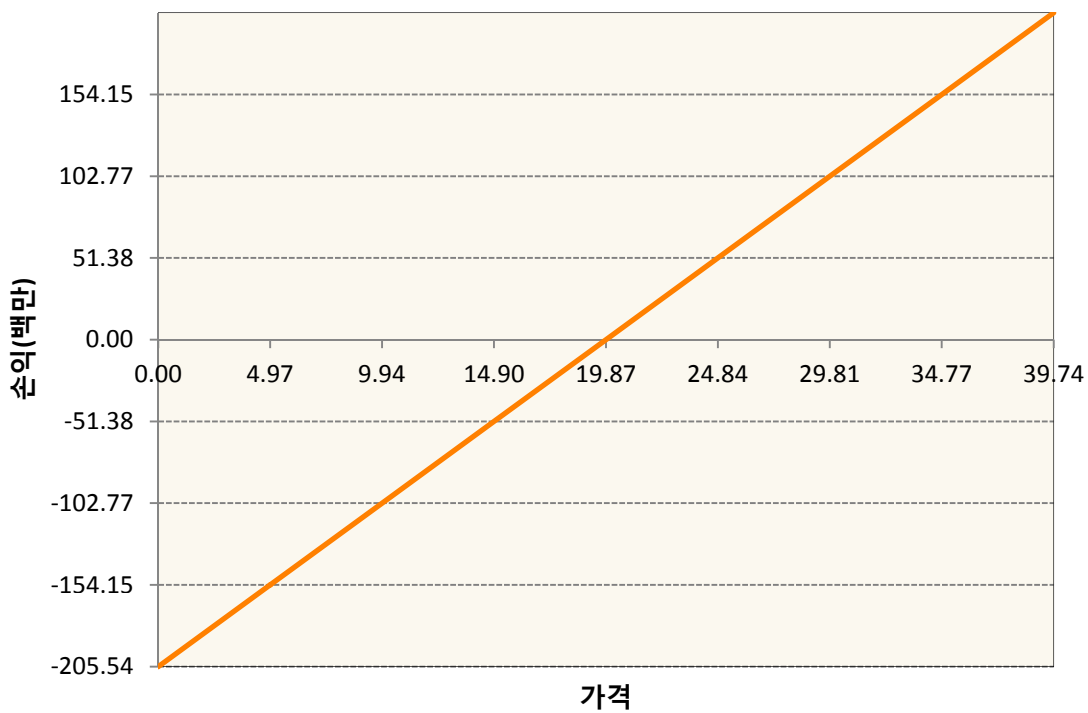
1. 계약금액

(단위:백만원)

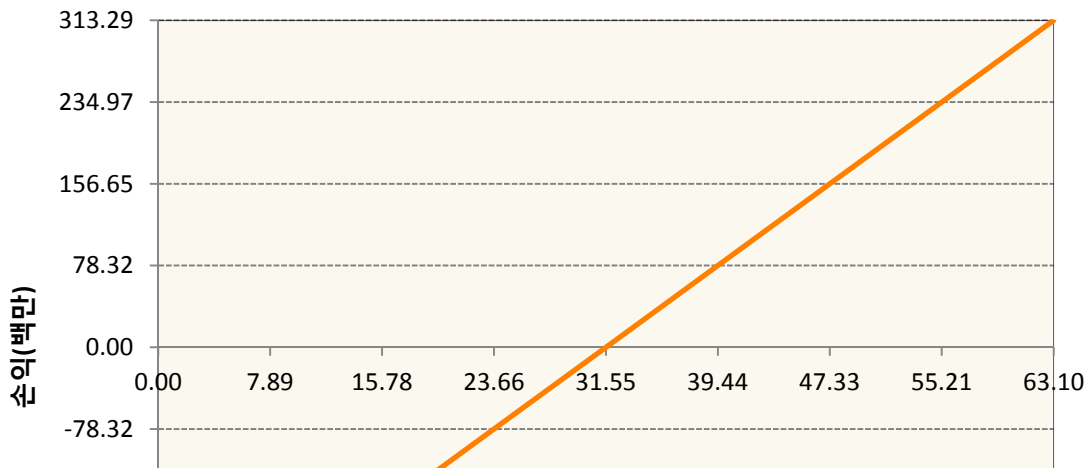
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,395	182	1,212	

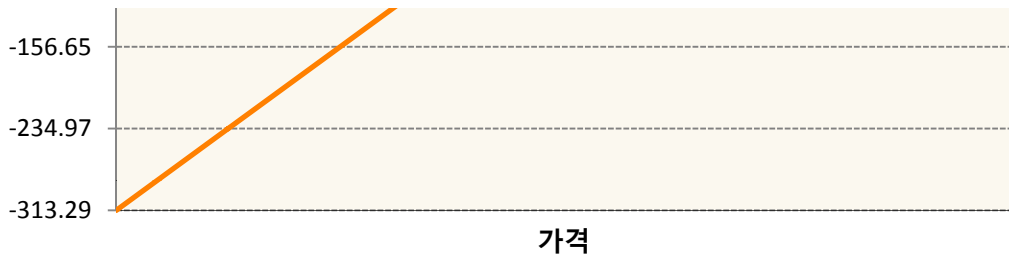
2. 만기시점의 손익구조

CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20

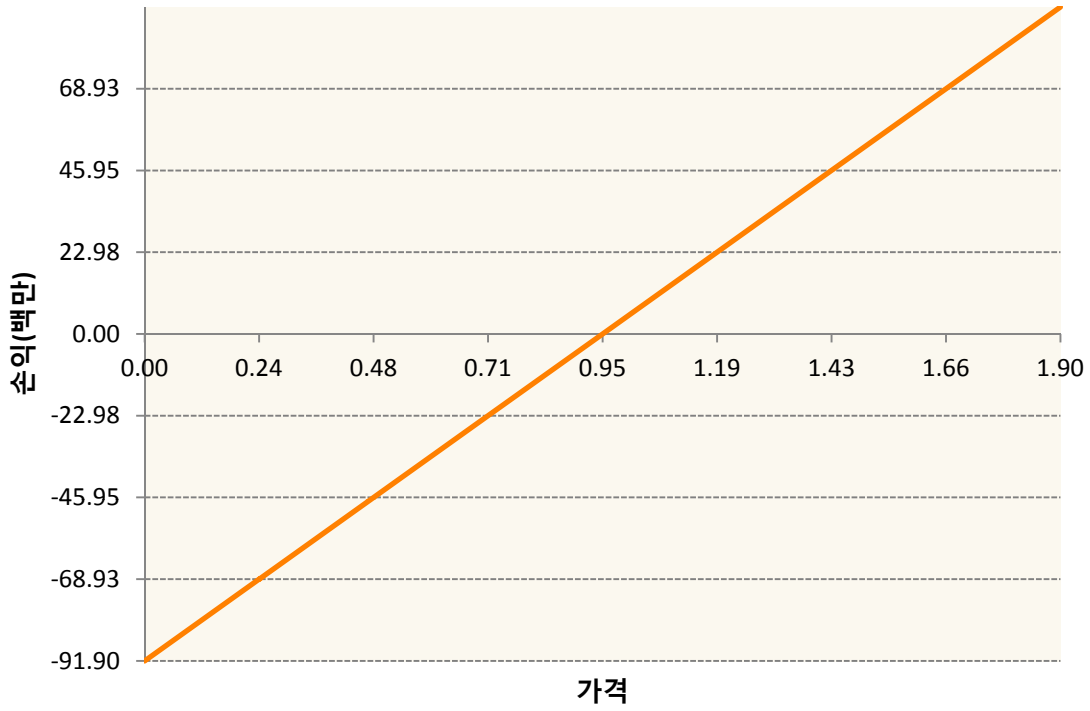


CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20

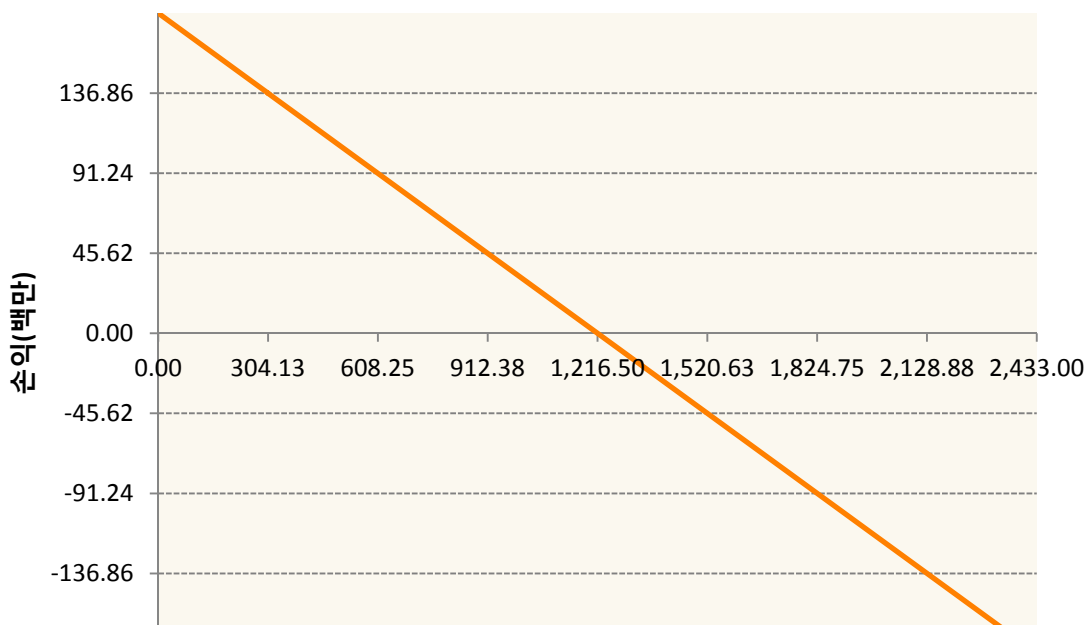


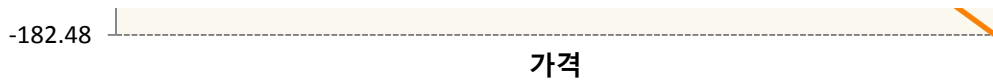


HOK0-NY Harb ULSD Fut May20

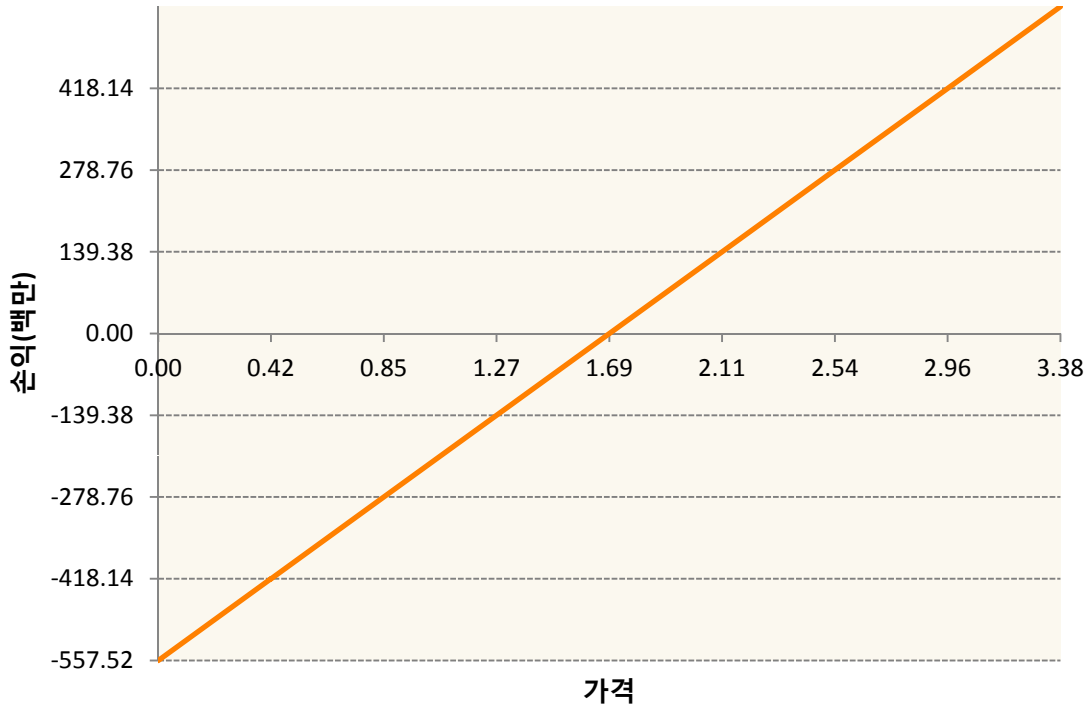


KR4175Q50007-2020-05 달러선물

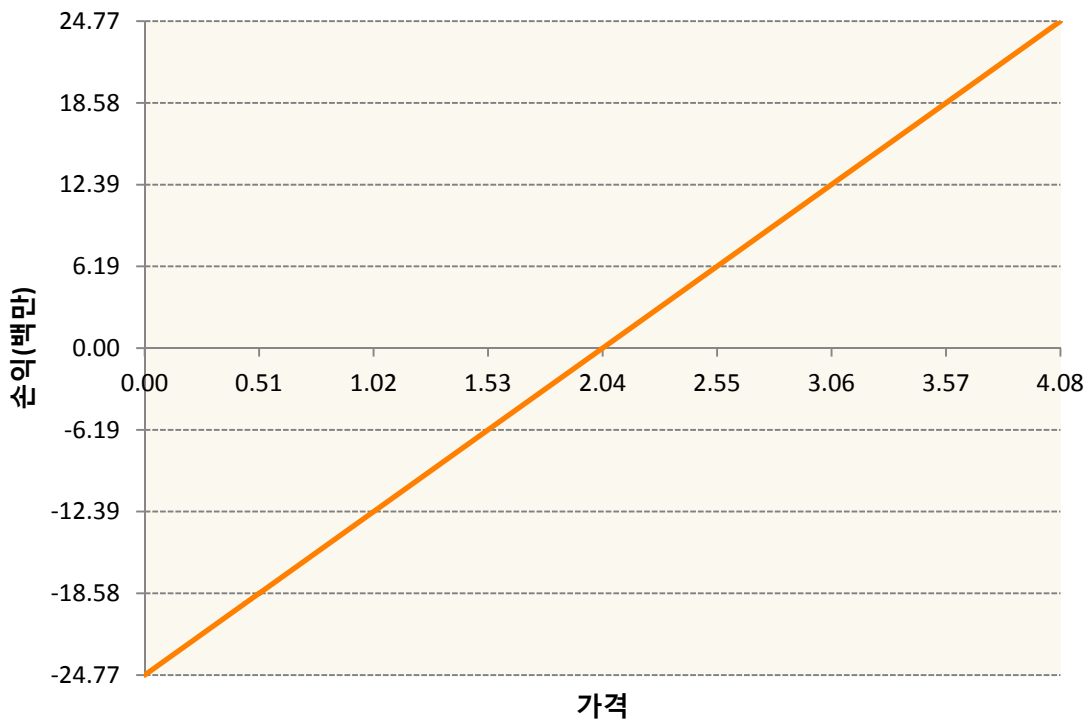




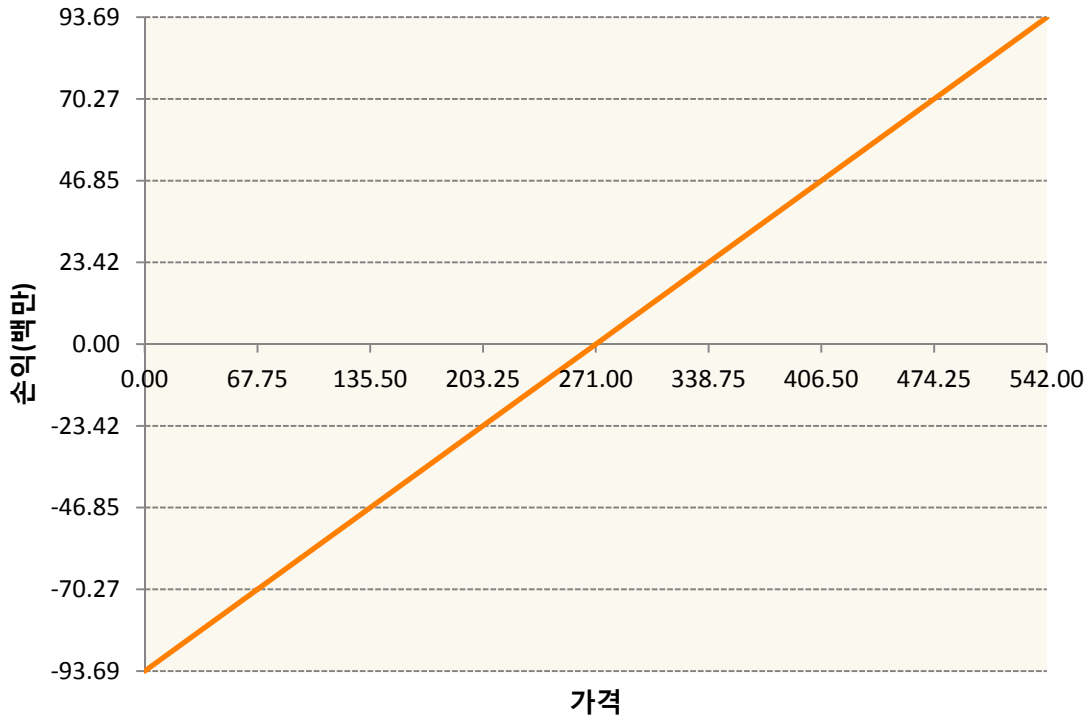
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



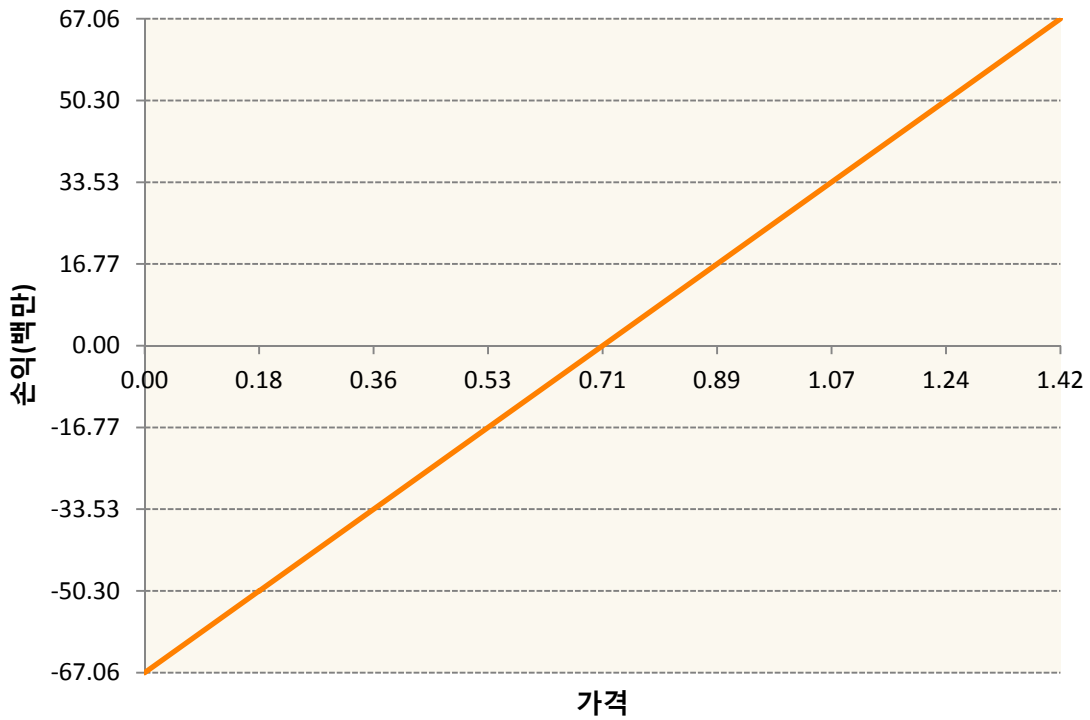
NGN20-NATURAL GAS FUTR Jul20



QSK0-Low Su Gasoil G Mar20

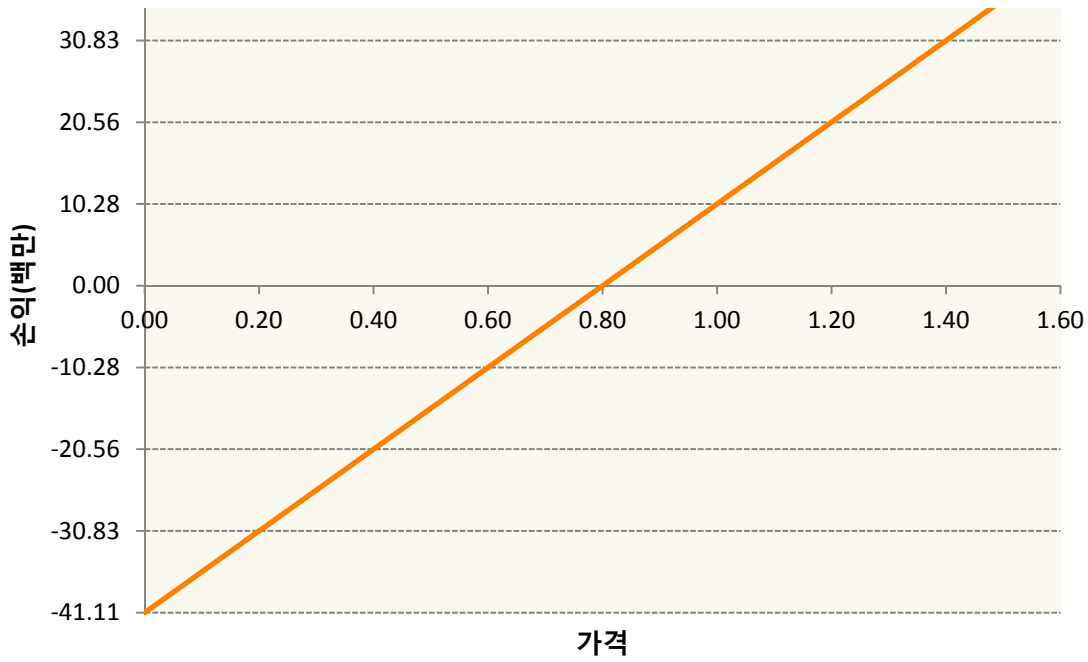


XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	16
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	25
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	7
KR4175Q50C	2020-05 달러선물	15
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	45
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)

339

공시일	2020-04-20
기준일	2020-04-17

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

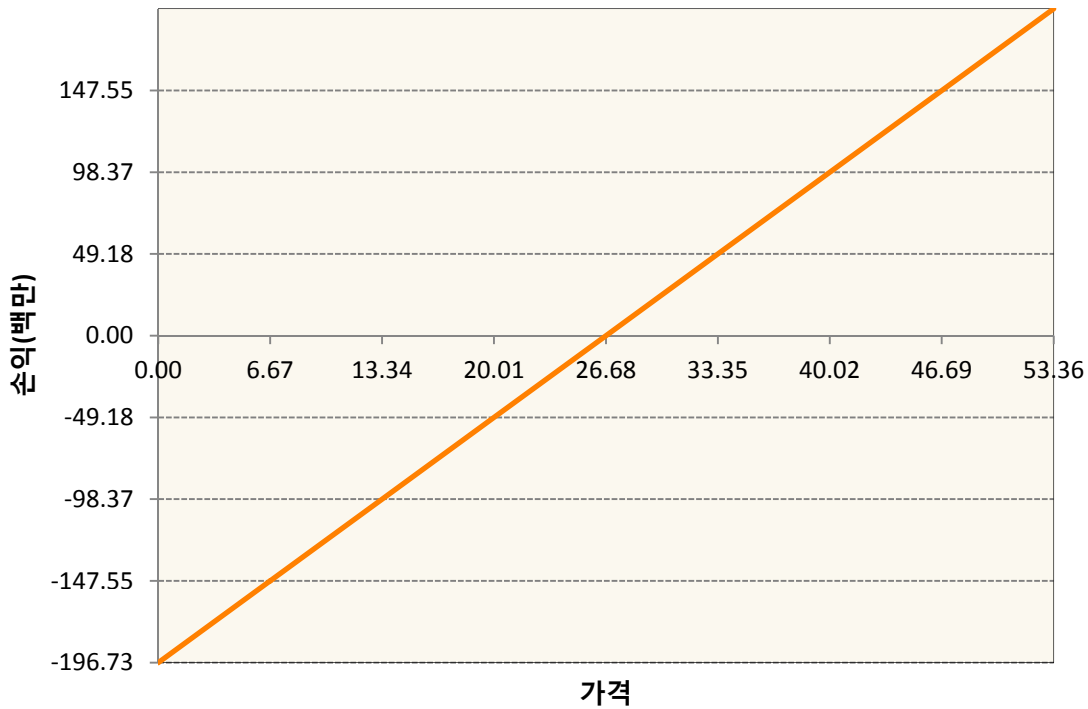
1. 계약금액

(단위:백만원)

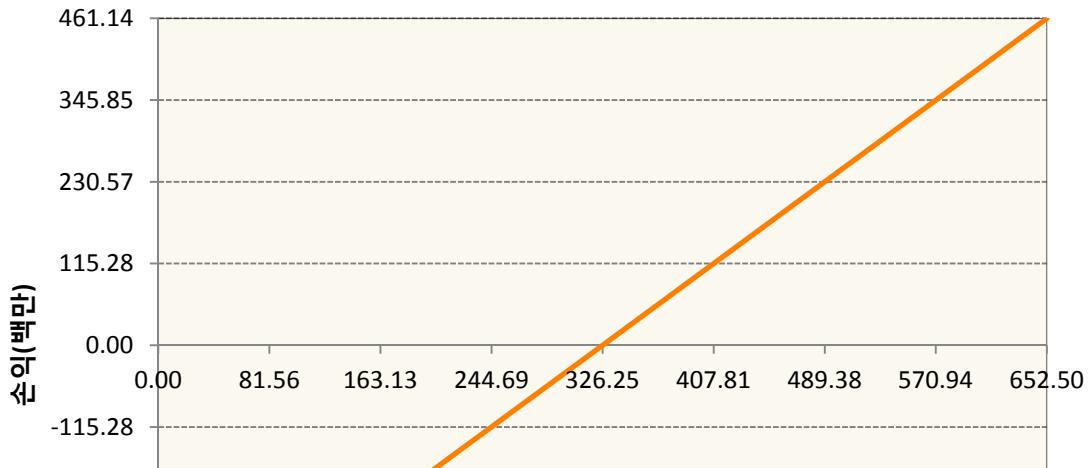
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,410	73	2,337	

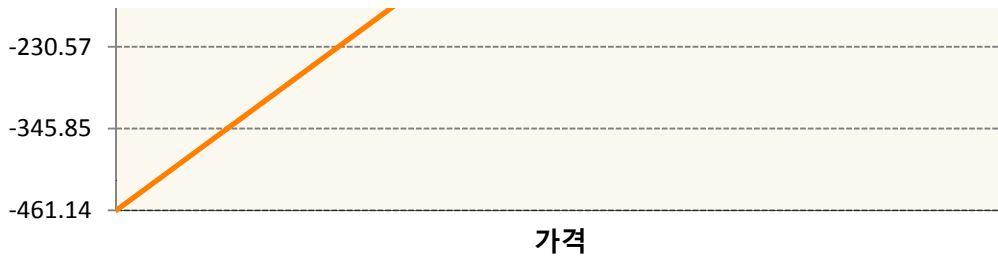
2. 만기시점의 손익구조

BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20

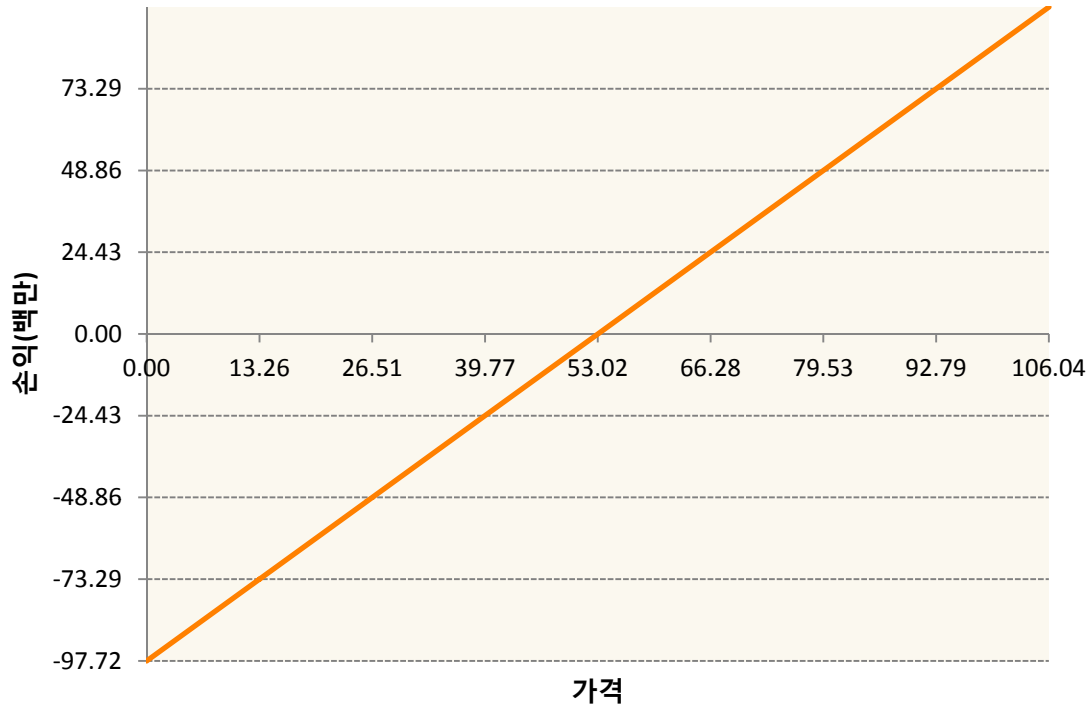


CNO-CORN FUTURE Jul20

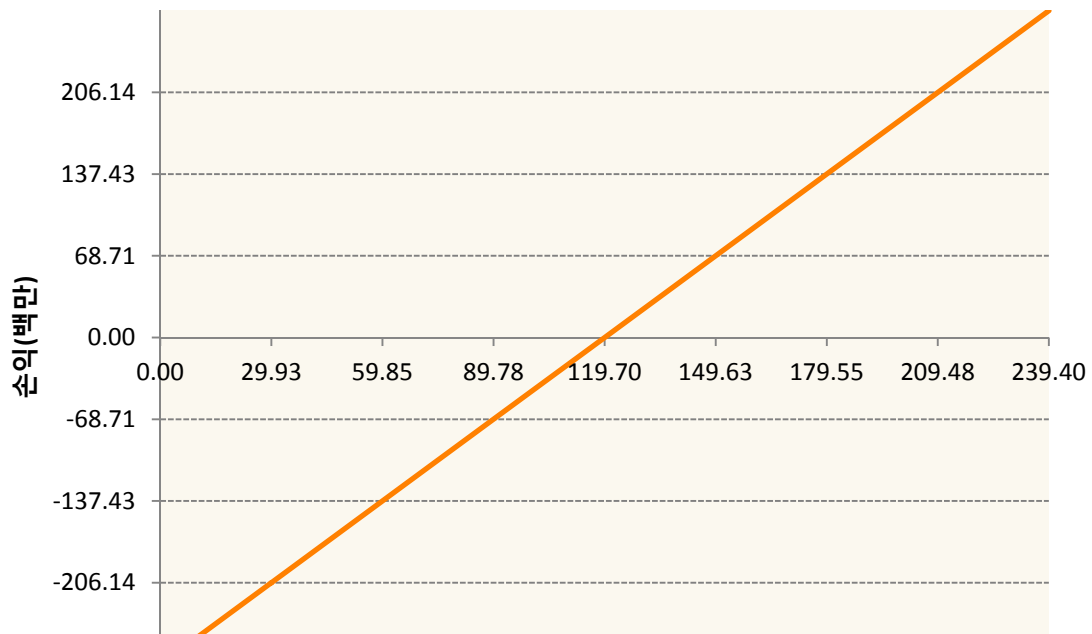


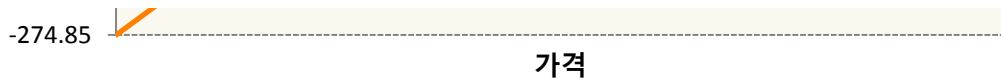


CTN0-COTTON NO.2 FUTR Jul20

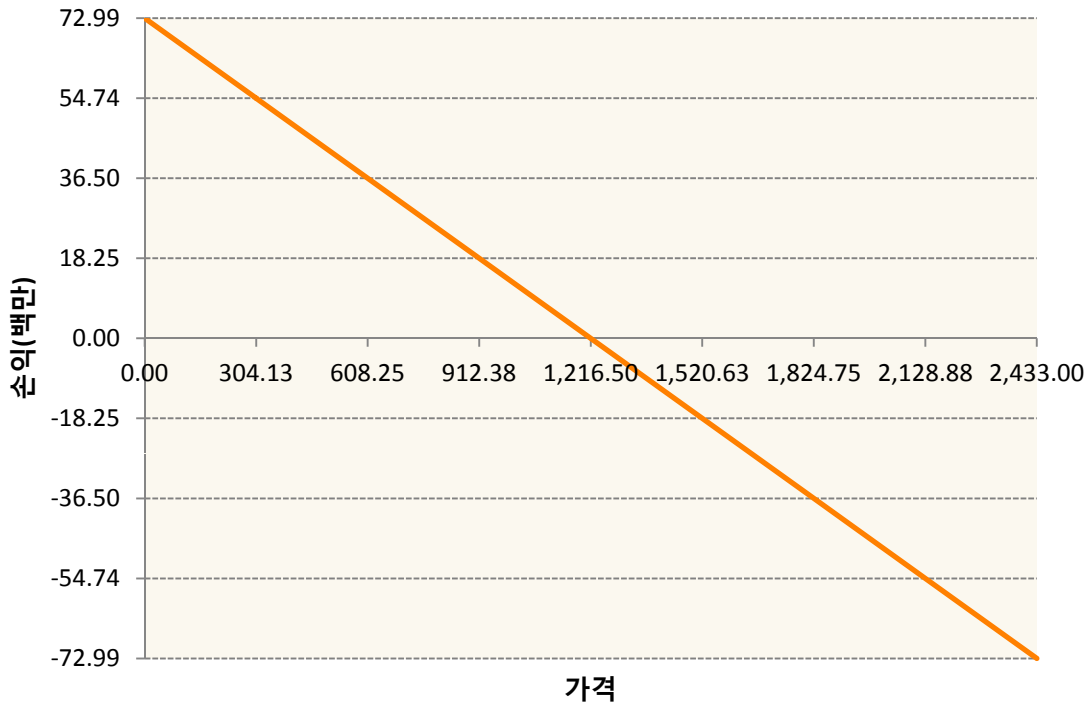


KCN0-COFFEE 'C' FUTURE Jul20

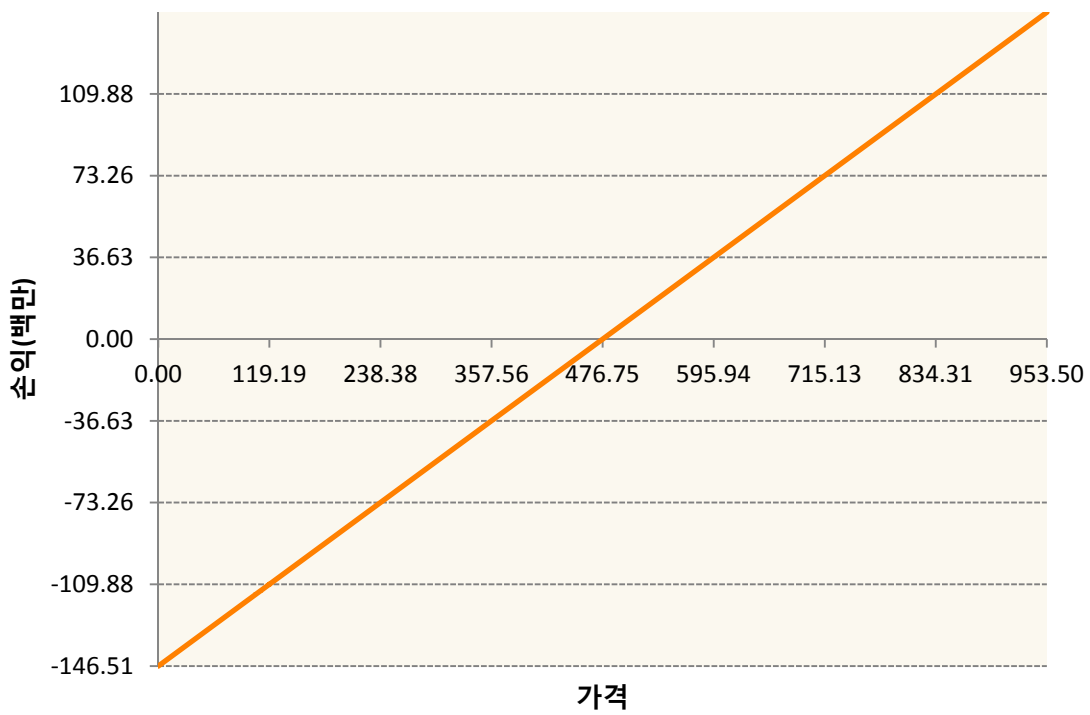




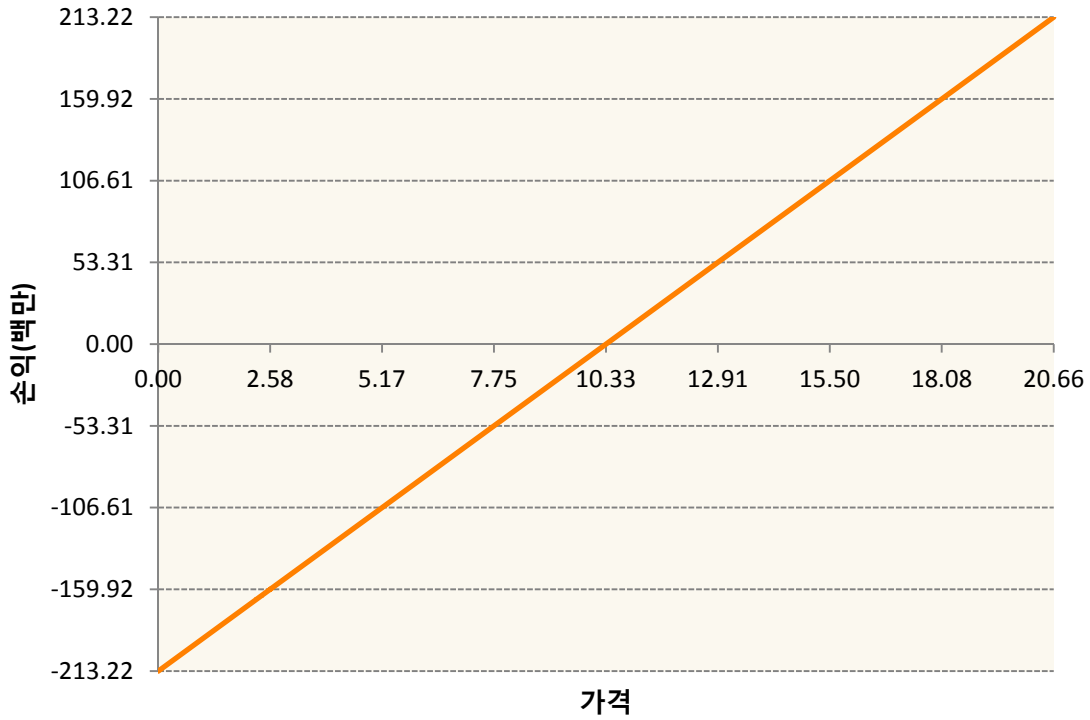
KR4175Q50007-2020-05 달러선물



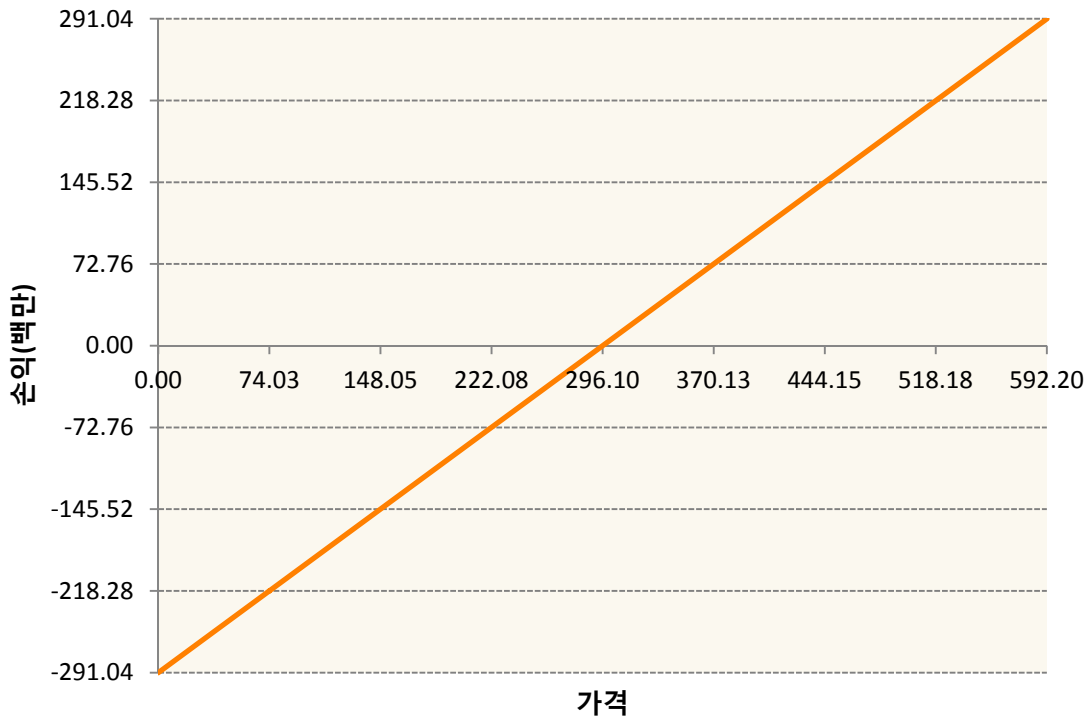
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



SBN0-Sugar Jul20

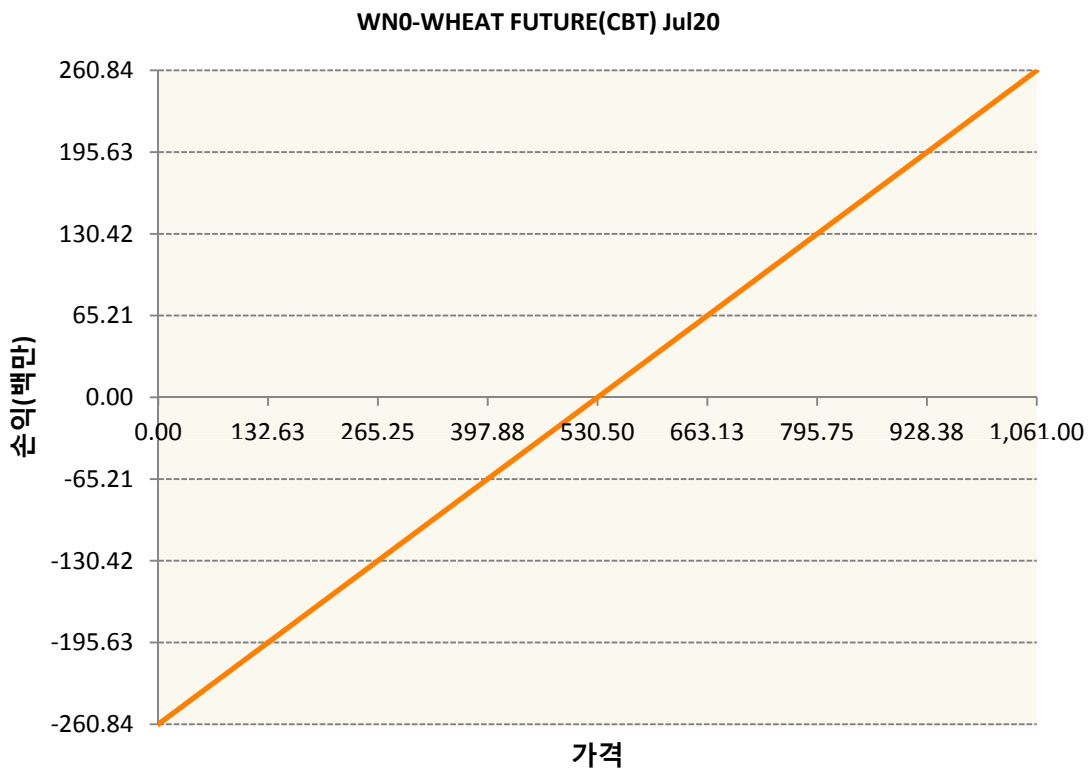
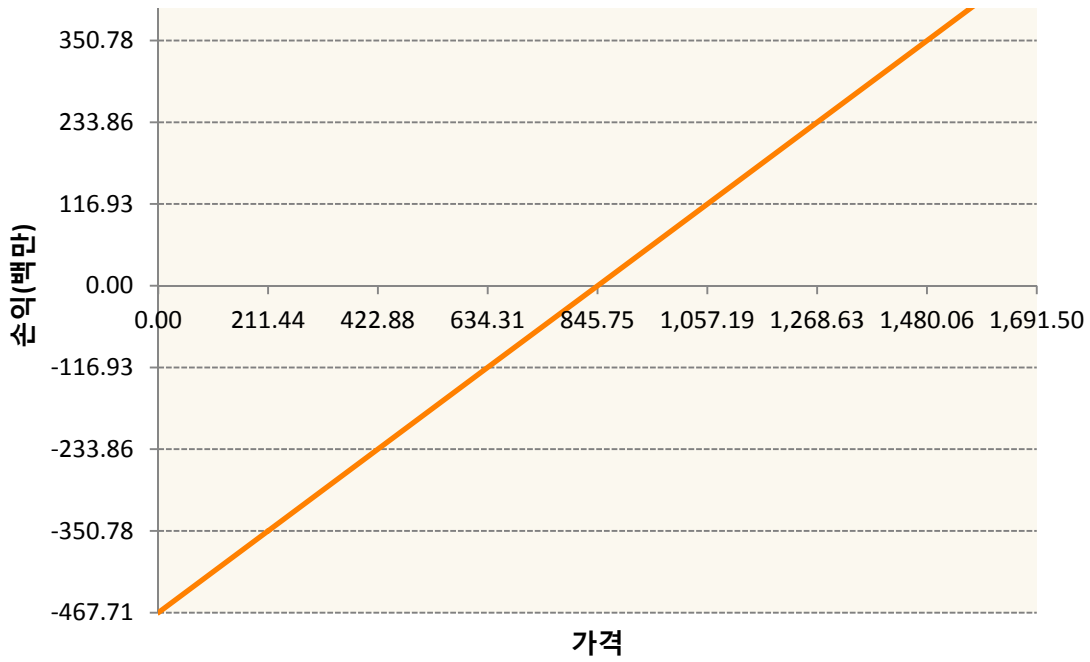


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20



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
KR4175Q50(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	37
WN0	WHEAT FUTURE(CBT) Jul20	21

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

(단위:백만원)

227