

공시일	2020-04-21
기준일	2020-04-20

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	2020-04-21
기준일	2020-04-20

스마트인덱스모

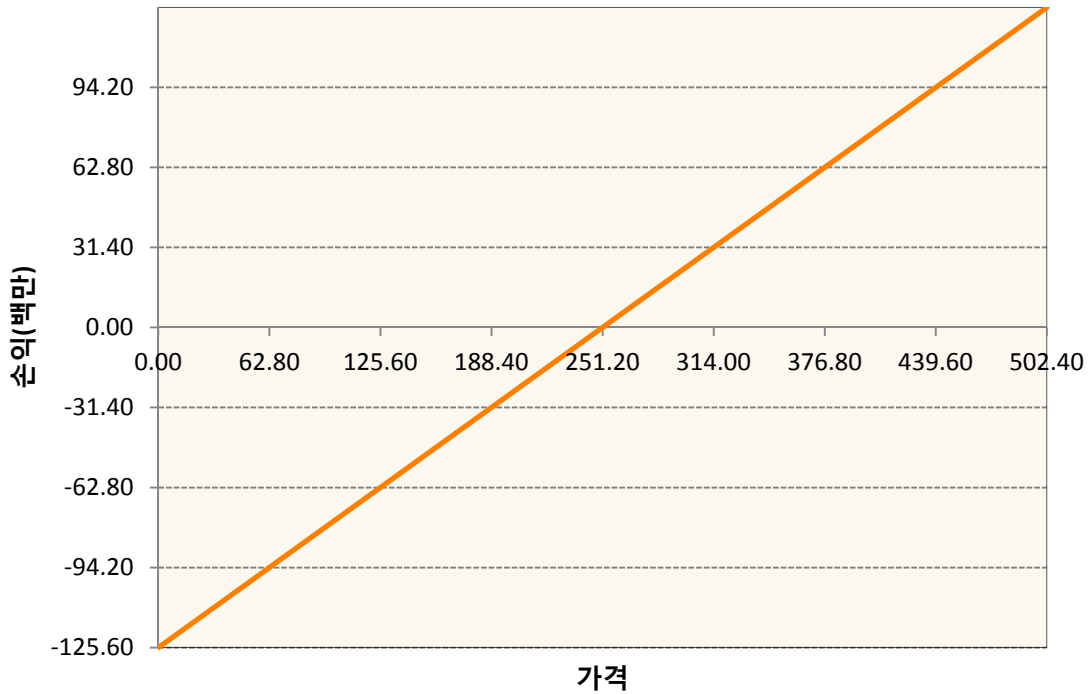
1. 계약금액

(단위:백만원)

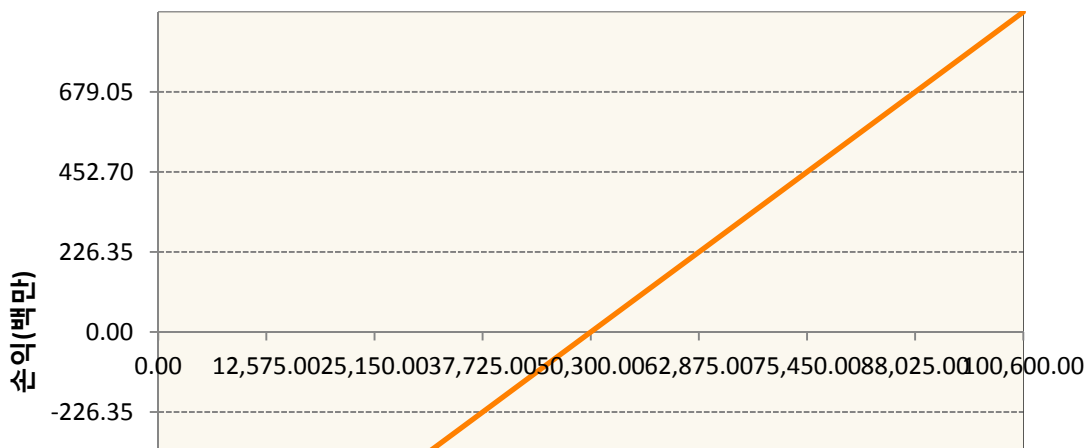
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	127	-127	장내
누계	유가증권	선물	1,031	0	1,031	장내

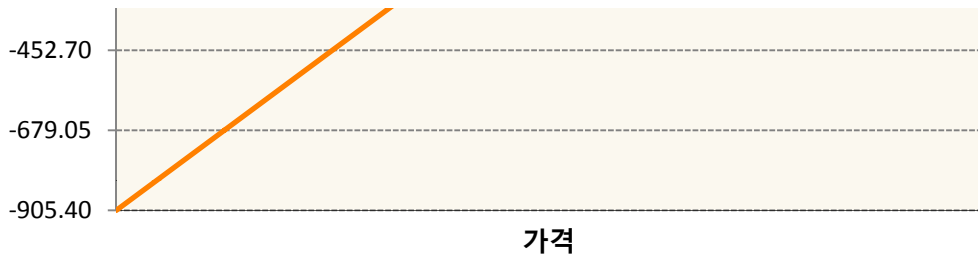
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



KR4111Q50002-2020-05 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						10
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10	
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7	
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	3	3	3	3	3	3	3	
5.33%	7	7	7	7	7	7	7	
8.00%	10	10	10	10	10	10	10	
KR4111Q50002		2020-05 삼성전자개별선물						72
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72	
-5.33%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48	
-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%	48	48	48	48	48	48	48	
8.00%	72	72	72	72	72	72	72	

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

123

공시일	2020-04-21
기준일	2020-04-20

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

973

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,132

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-21
기준일	2020-04-20

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

560

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

886

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-21
기준일	2020-04-20

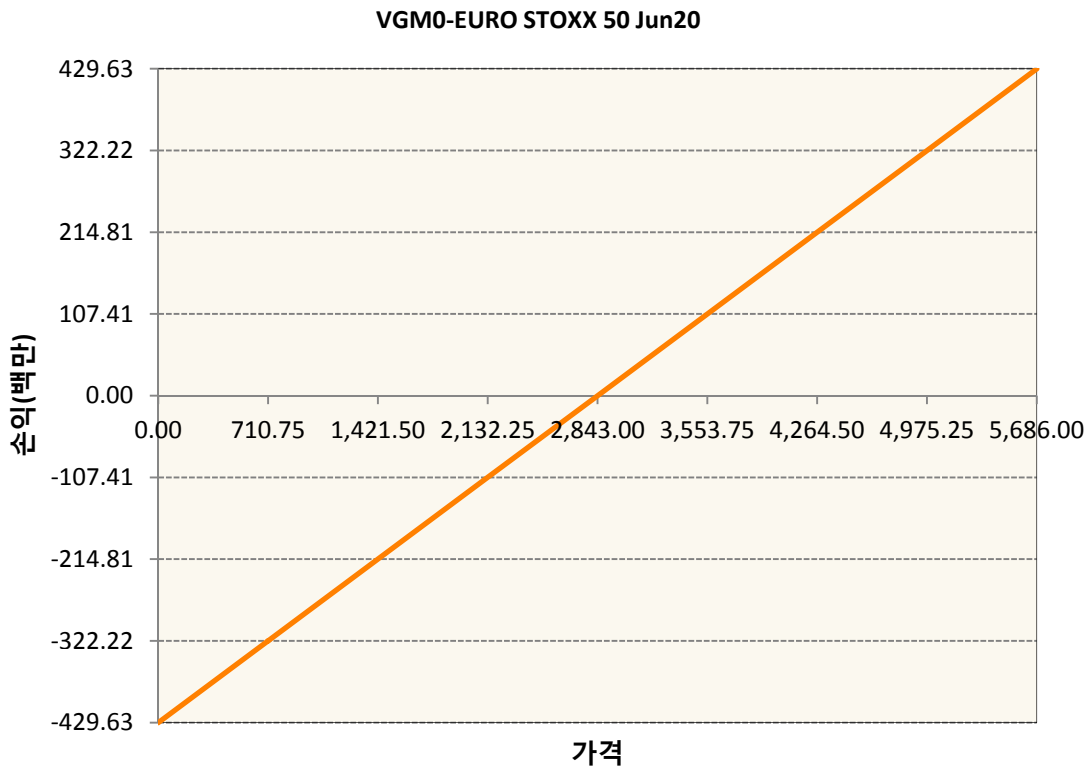
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	430	0	430	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

43

공시일	2020-04-21
기준일	2020-04-20

차이나인덱스모(주식-파생형)

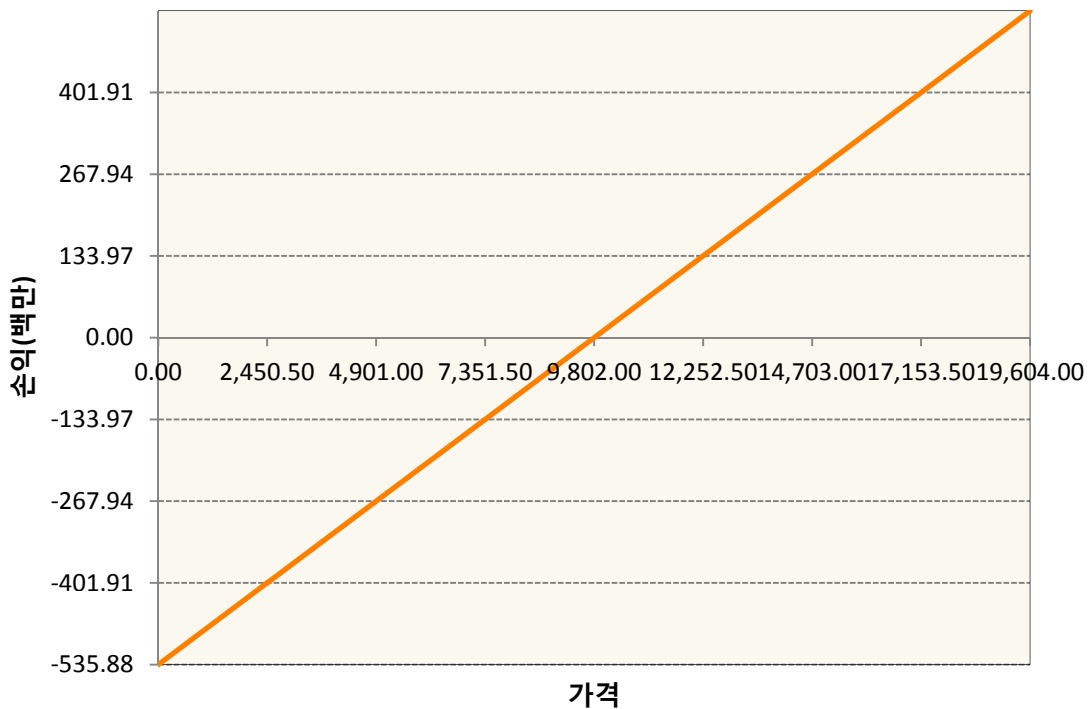
1. 계약금액

(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

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	2020-04-21
기준일	2020-04-20

커버드콜모(주식혼합-파생형)

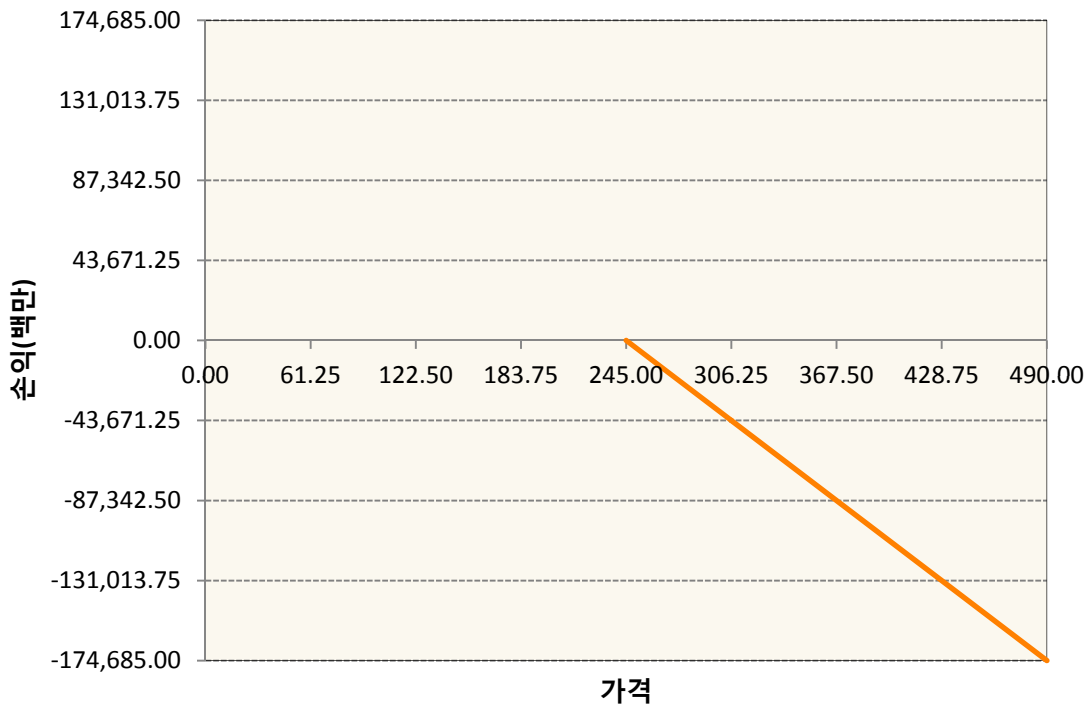
1. 계약금액

(단위:백만원)

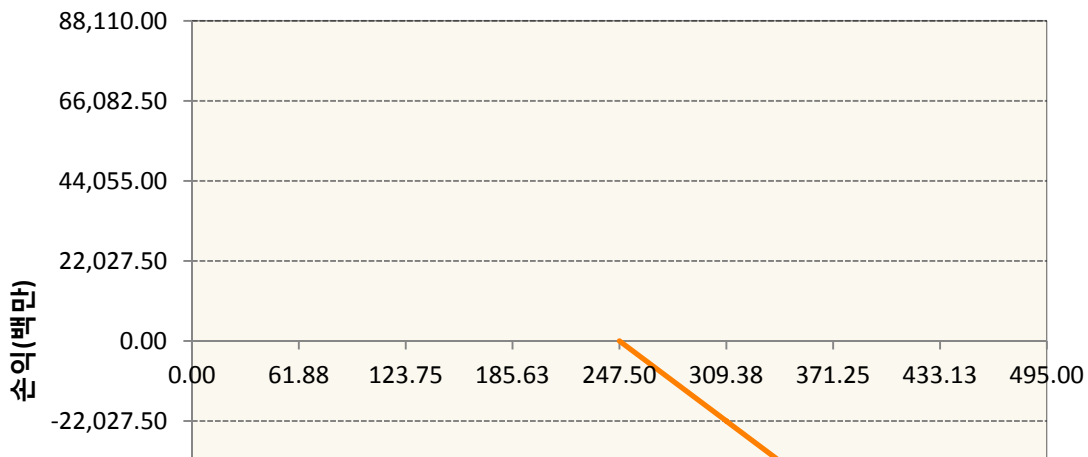
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	358,345	-358,345	장내

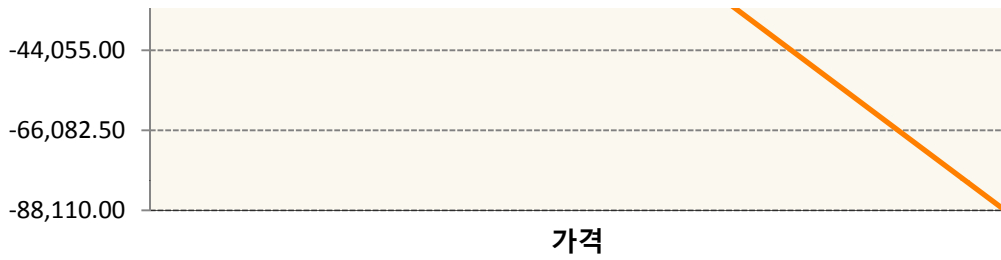
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q52452-2020-05 콜245

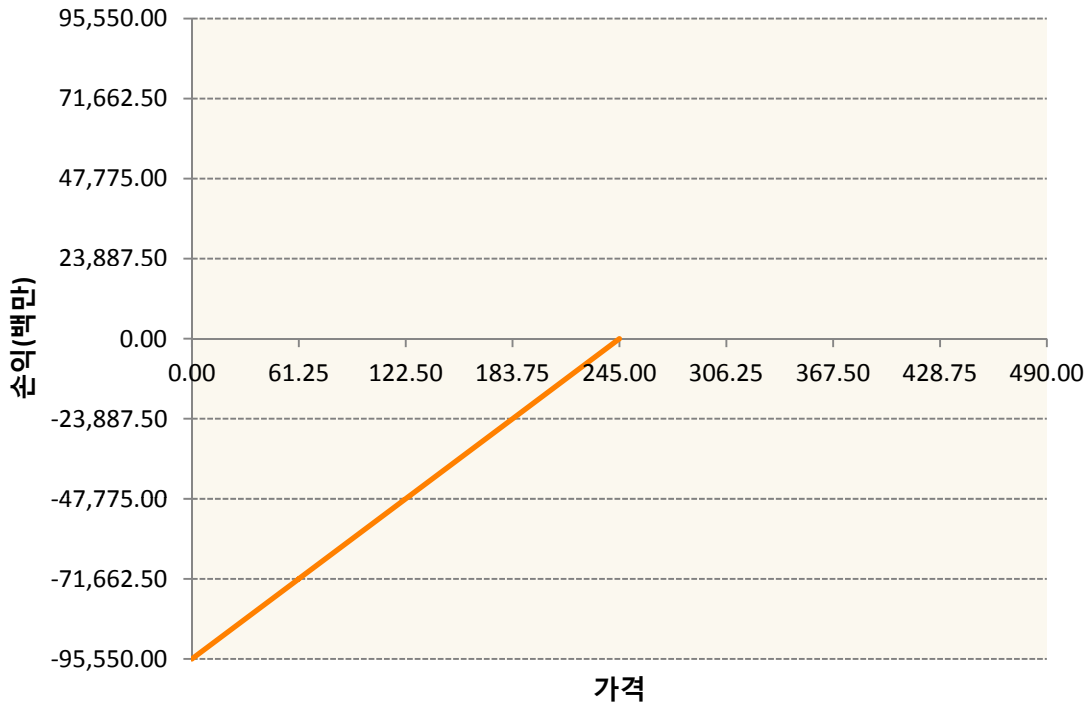


KR4201Q52478-2020-05 콜247.5





KR4301Q52450-2020-05 풋245



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201Q52452		2020-05 콜245					12,080
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,727	8,139	7,534	6,915	6,285	5,648	5,003
-5.33%	7,078	6,402	5,722	5,038	4,352	3,664	2,974
-2.67%	4,867	4,155	3,443	2,731	2,019	1,308	597
0%	2,093	1,400	702	0	-705	-1,411	-2,119
2.67%	-1,199	-1,826	-2,470	-3,127	-3,796	-4,472	-5,156
5.33%	-4,930	-5,459	-6,022	-6,610	-7,220	-7,846	-8,486
8.00%	-9,008	-9,428	-9,894	-10,399	-10,935	-11,497	-12,080
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5					5,883
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,083	3,806	3,518	3,221	2,917	2,607	2,293

-5.33%	3,354	3,026	2,694	2,359	2,022	1,682	1,341
-2.67%	2,353	1,998	1,642	1,286	929	573	217
0%	1,072	715	358	0	-359	-717	-1,077
2.67%	-477	-808	-1,145	-1,488	-1,833	-2,182	-2,533
5.33%	-2,258	-2,546	-2,848	-3,159	-3,480	-3,807	-4,140
8.00%	-4,230	-4,465	-4,720	-4,993	-5,279	-5,576	-5,883
KR4301Q52450 2020-05 풋245							4,957
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,581	-3,788	-4,007	-4,235	-4,470	-4,711	-4,957
-5.33%	-1,709	-1,973	-2,241	-2,511	-2,784	-3,057	-3,333
-2.67%	-236	-524	-811	-1,099	-1,387	-1,675	-1,962
0%	822	552	277	0	-279	-560	-843
2.67%	1,512	1,290	1,056	812	561	305	43
5.33%	1,920	1,758	1,578	1,381	1,172	951	722
8.00%	2,138	2,034	1,907	1,760	1,596	1,417	1,226

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

(단위:백만원)

19,835

공시일	2020-04-21
기준일	2020-04-20

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

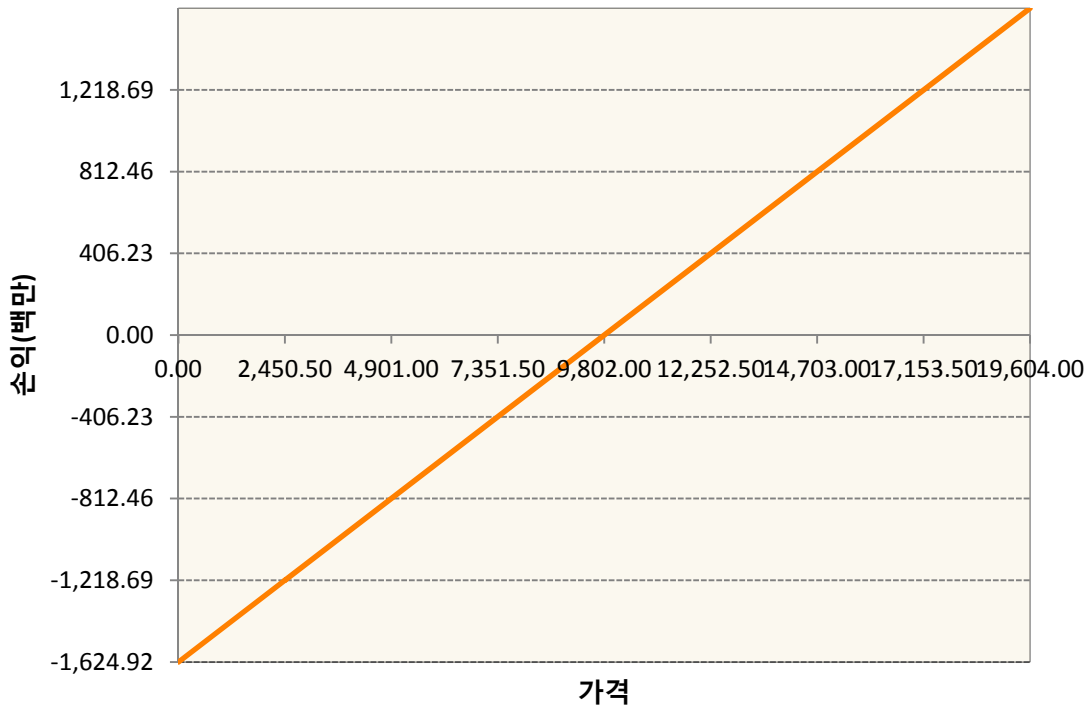
1. 계약금액

(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	1,625	0	1,625	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,146	-4,146	장내
누계	통화	선도	693	2,217	-1,524	장외

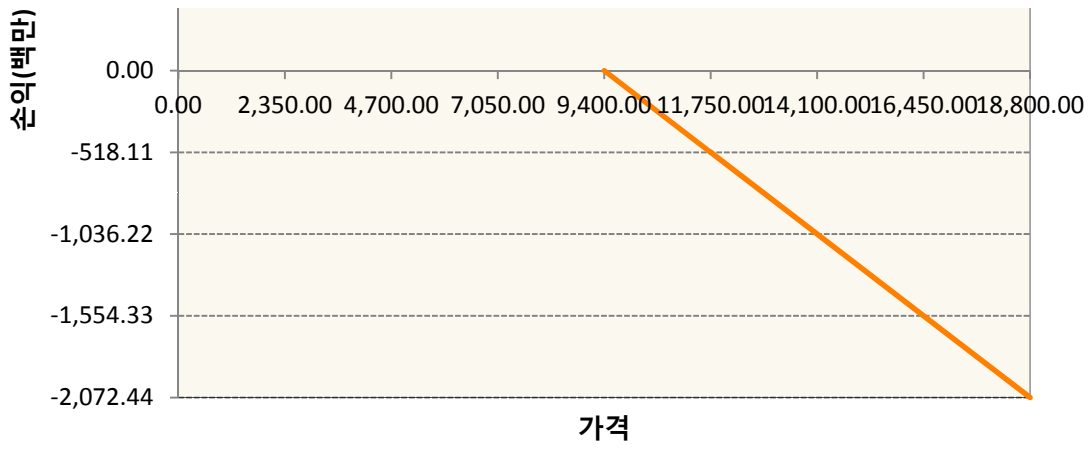
2. 만기시점의 손익구조

HCJ0-HSCEI Futures Apr20

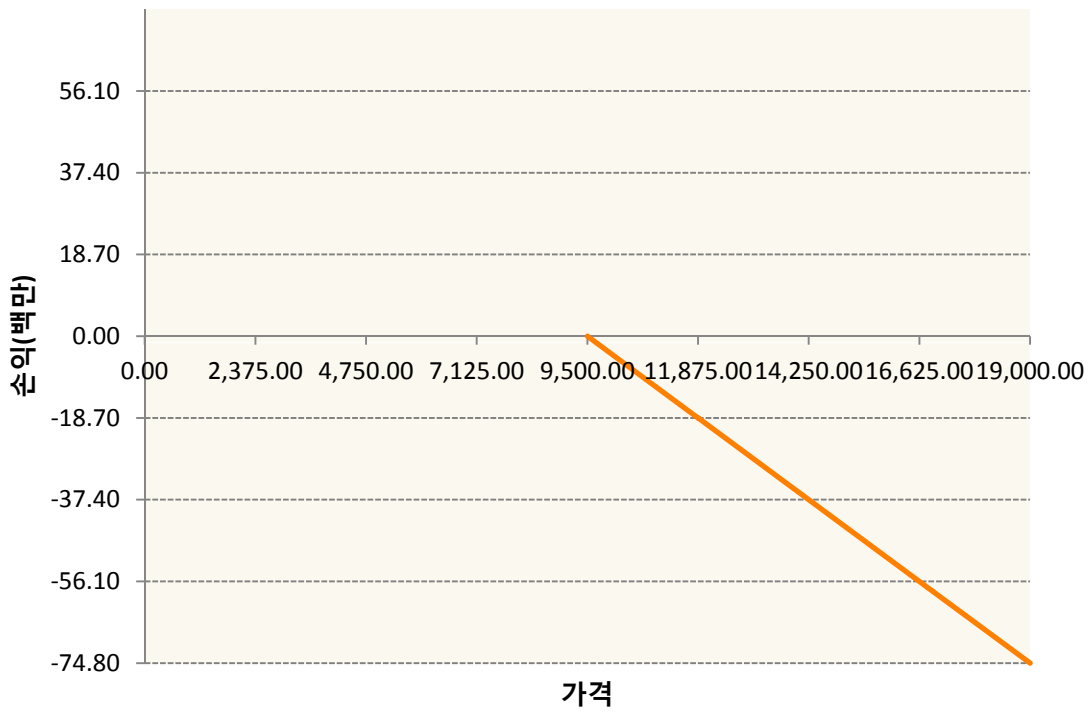


OHHIJ0-C94-HSCEI

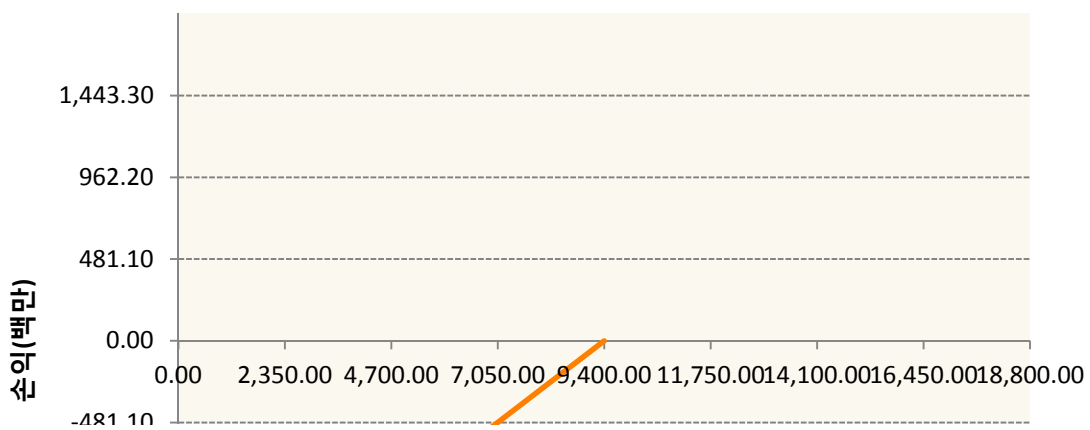


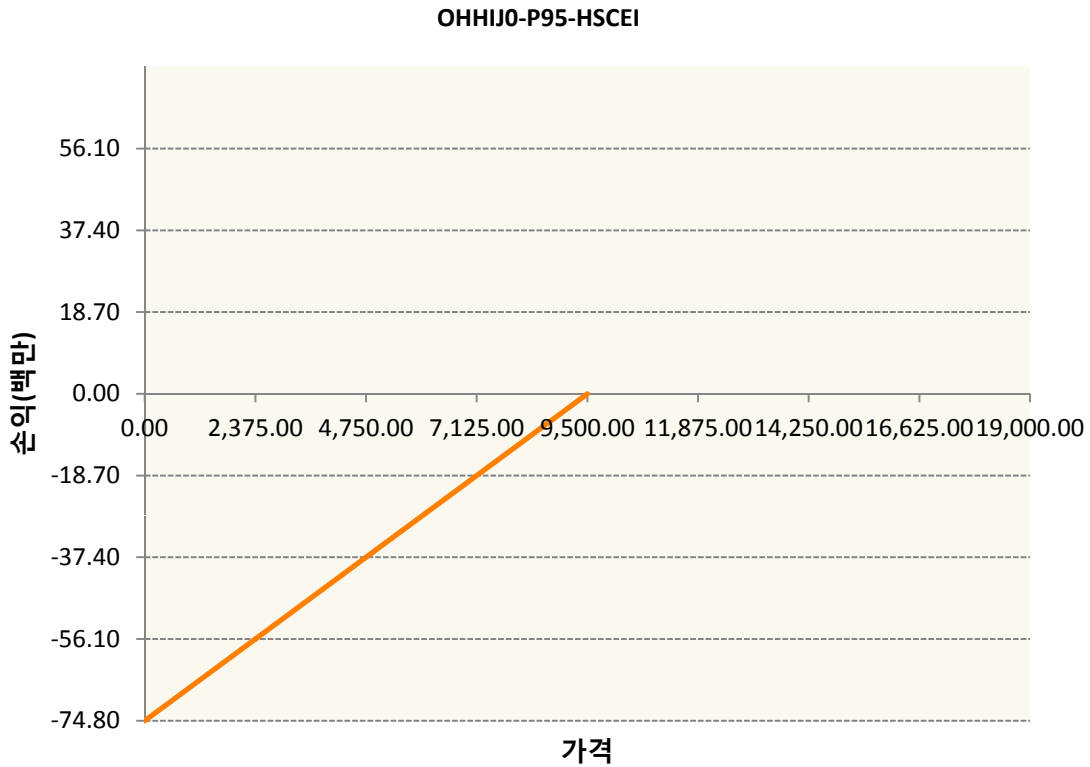


OHHI0-C95-HSCEI



OHHI0-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		166
OHHIJ0-C95 HSCEI		6
OHHIJ0-P94 HSCEI		154
OHHIJ0-P95 HSCEI		6

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	606

공시일	2020-04-21
기준일	2020-04-20

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

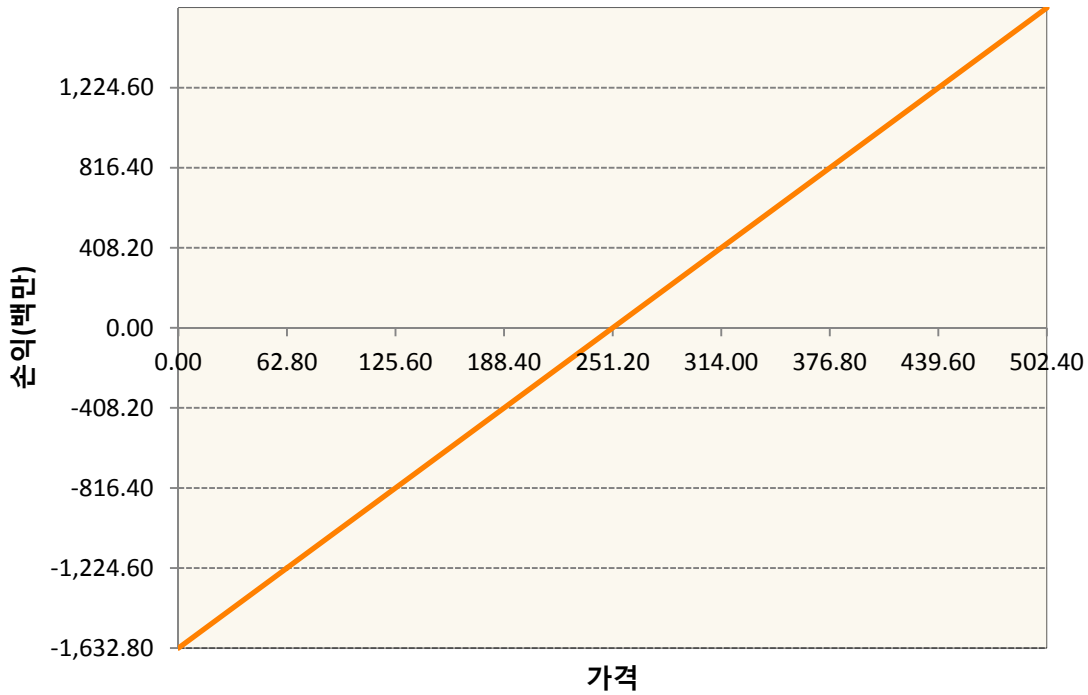
1. 계약금액

(단위:백만원)

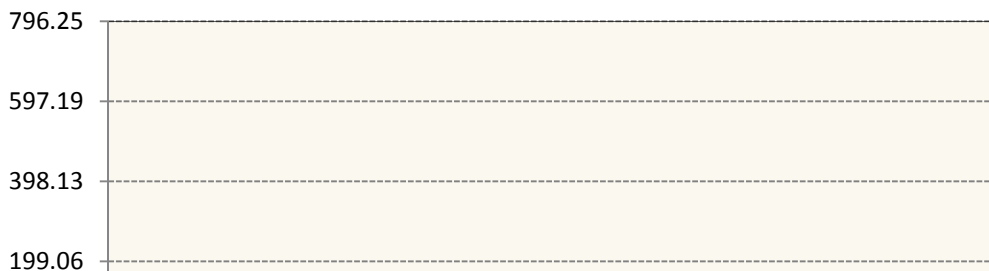
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,633	0	1,633	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,193	-3,193	장내

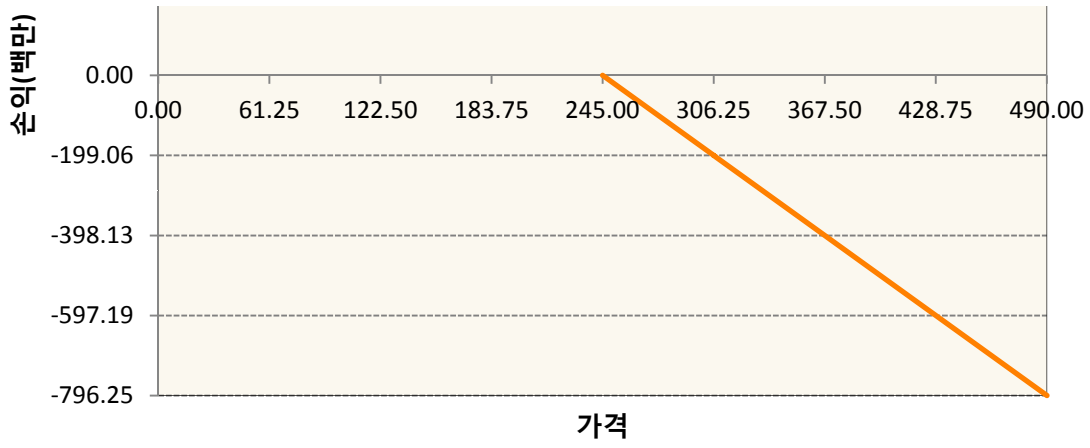
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

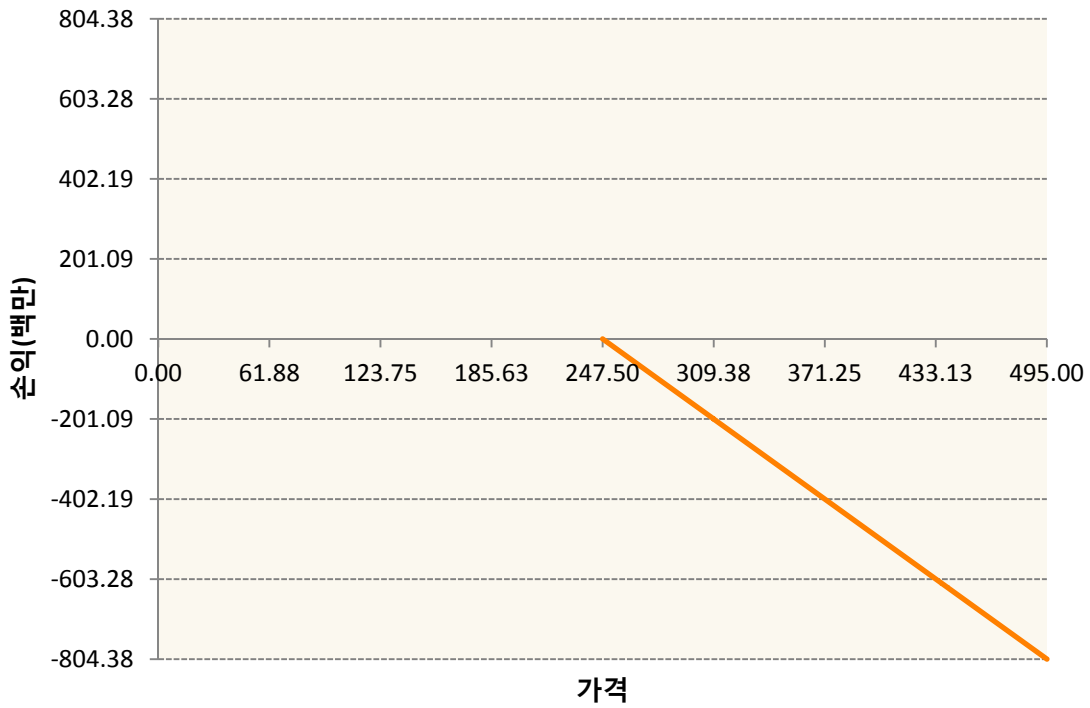


KR4201Q52452-2020-05 콜245

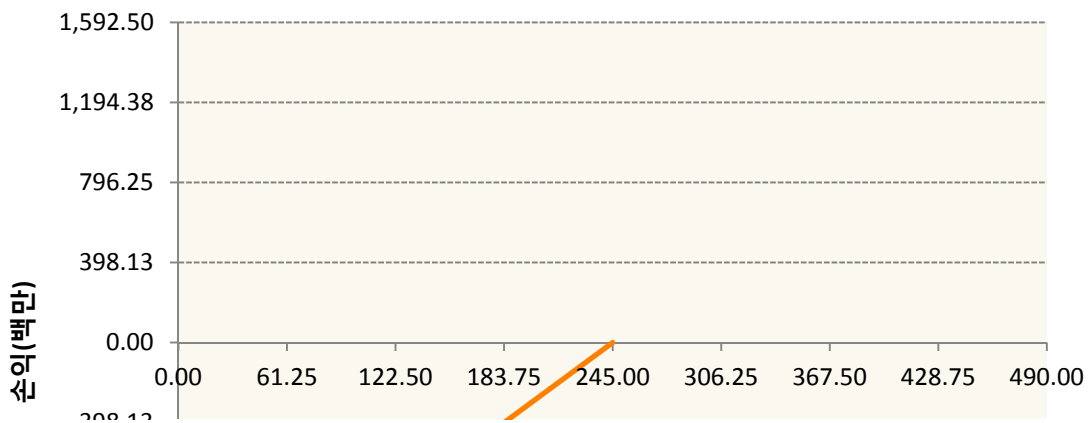




KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



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						131
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131	
-5.33%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87	
-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%	87	87	87	87	87	87	87	
8.00%	131	131	131	131	131	131	131	
KR4201Q52452		2020-05 콜245						55
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	40	37	34	32	29	26	23	
-5.33%	32	29	26	23	20	17	14	
-2.67%	22	19	16	12	9	6	3	
0%	10	6	3	0	-3	-6	-10	
2.67%	-5	-8	-11	-14	-17	-20	-24	
5.33%	-22	-25	-27	-30	-33	-36	-39	
8.00%	-41	-43	-45	-47	-50	-52	-55	
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5						54
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	37	35	32	29	27	24	21
-5.33%	31	28	25	22	18	15	12
-2.67%	21	18	15	12	8	5	2
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	-4	-7	-10	-14	-17	-20	-23
5.33%	-21	-23	-26	-29	-32	-35	-38
8.00%	-39	-41	-43	-46	-48	-51	-54
KR4301Q52450 2020-05 풋245							83
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-60	-63	-67	-71	-75	-79	-83
-5.33%	-28	-33	-37	-42	-46	-51	-56
-2.67%	-4	-9	-14	-18	-23	-28	-33
0%	14	9	5	0	-5	-9	-14
2.67%	25	21	18	14	9	5	1
5.33%	32	29	26	23	20	16	12
8.00%	36	34	32	29	27	24	20

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

(단위:백만원)

545

공시일	2020-04-21
기준일	2020-04-20

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

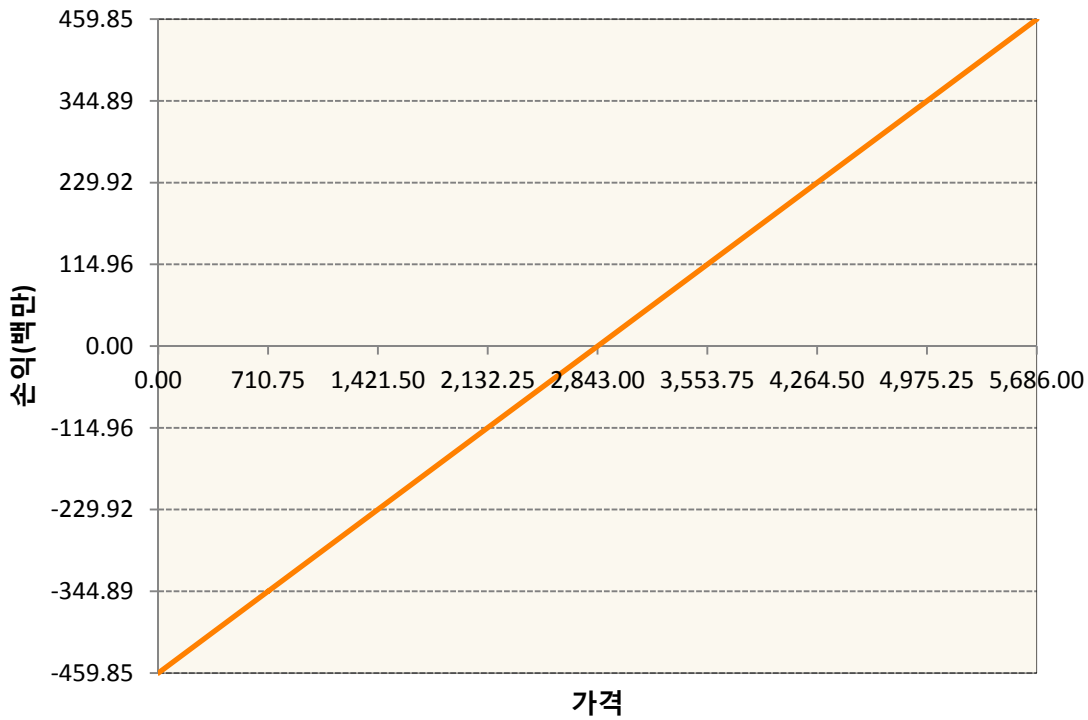
1. 계약금액

(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	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	460	0	460	
누계	유가증권	스왑	7,906	0	7,906	장외
누계	통화	선도	0	2,683	-2,683	장외

2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	0
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E	215
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20	37

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

(단위:백만원)

1,118

공시일	2020-04-21
기준일	2020-04-20

ETF스마트레버리지목표전환형9호

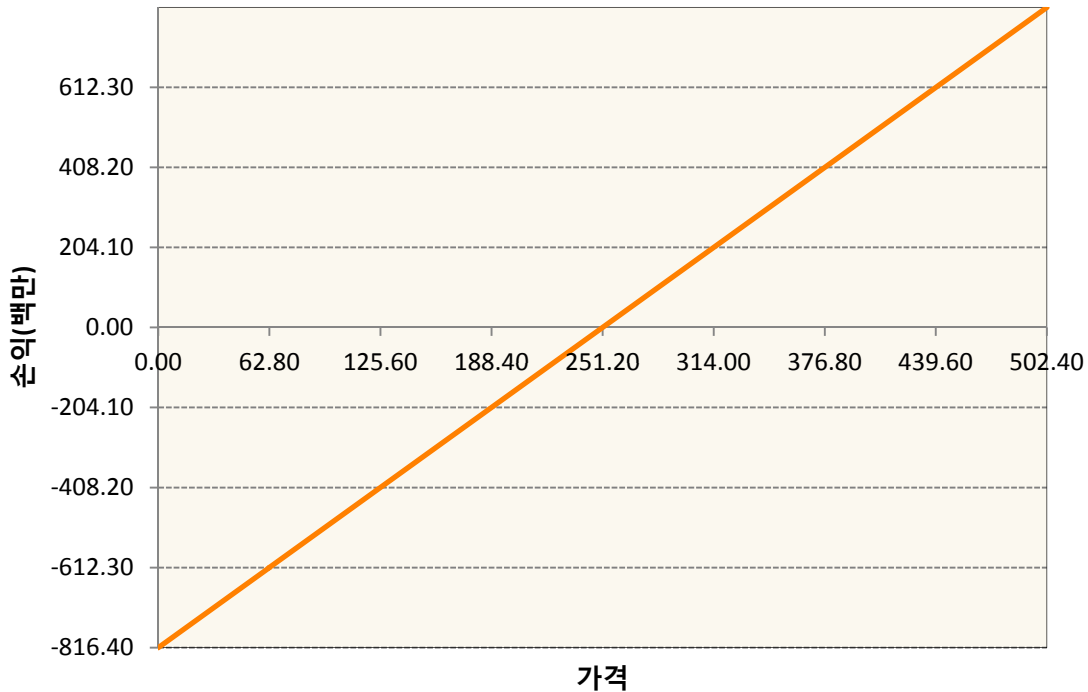
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	816	0	816	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						66
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66	
-5.33%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44	
-2.67%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	22	22	22	22	22	22	22	
5.33%	44	44	44	44	44	44	44	
8.00%	66	66	66	66	66	66	66	

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

(단위:백만원)

97

공시일	2020-04-21
기준일	2020-04-20

ETF스마트레버리지목표전환형10호

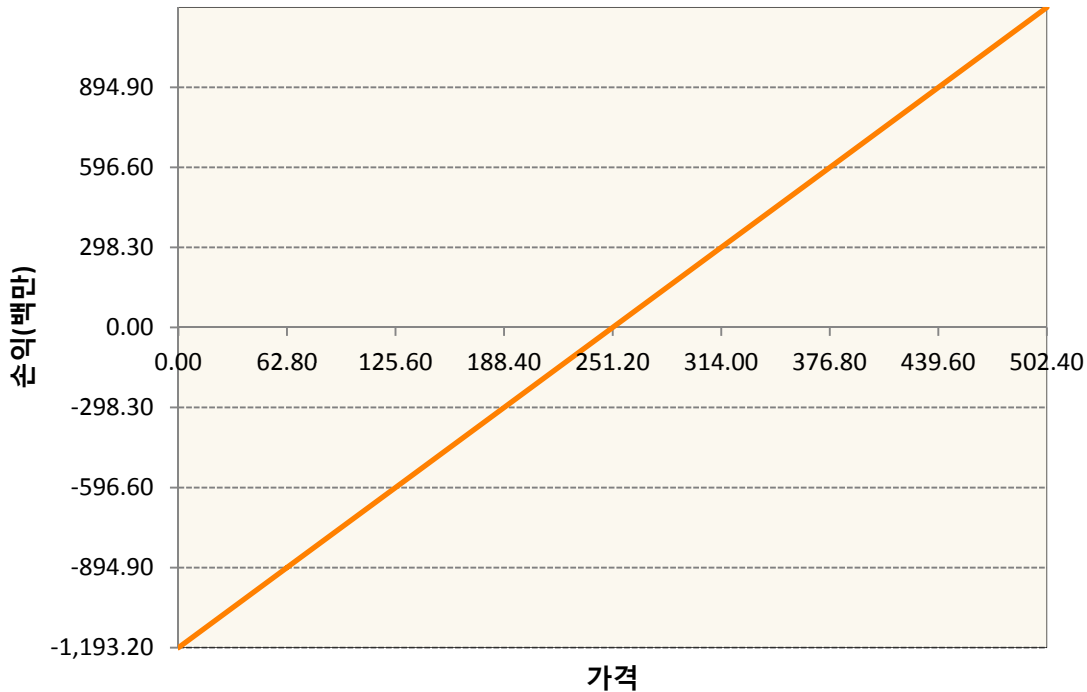
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,193	0	1,193	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						96
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96	
-5.33%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64	
-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%	64	64	64	64	64	64	64	
8.00%	96	96	96	96	96	96	96	

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

(단위:백만원)

142

공시일	2020-04-21
기준일	2020-04-20

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

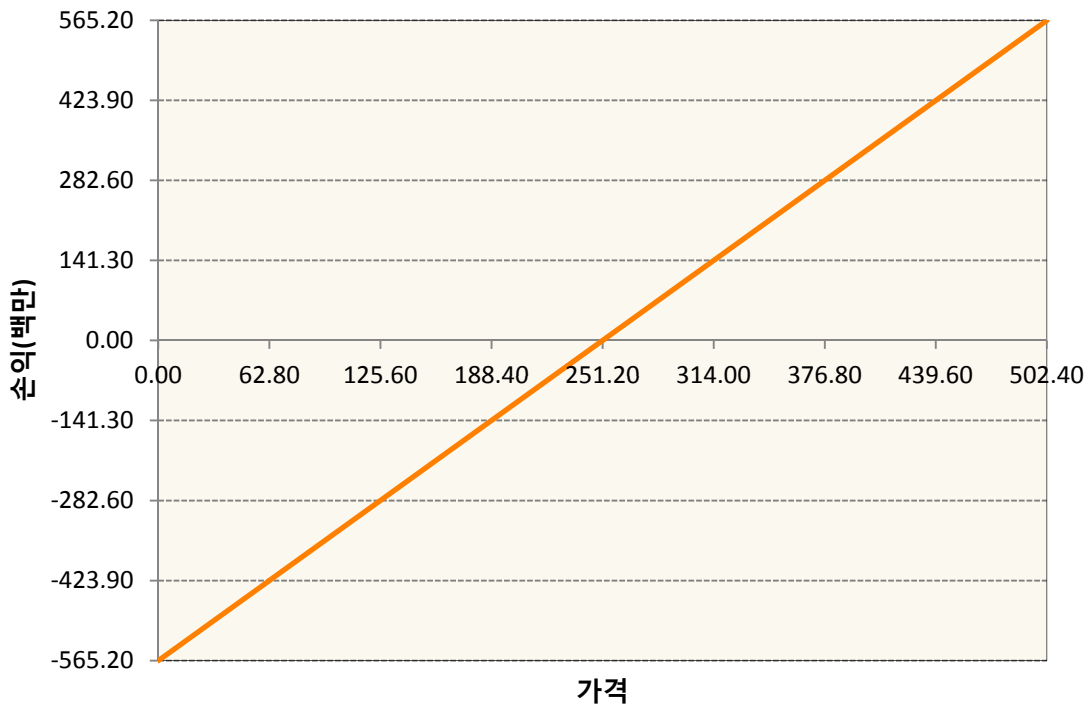
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	565	0	565	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						45
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45	
-5.33%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30	
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	15	15	15	15	15	15	15	
5.33%	30	30	30	30	30	30	30	
8.00%	45	45	45	45	45	45	45	

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

(단위:백만원)

67

공시일	2020-04-21
기준일	2020-04-20

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

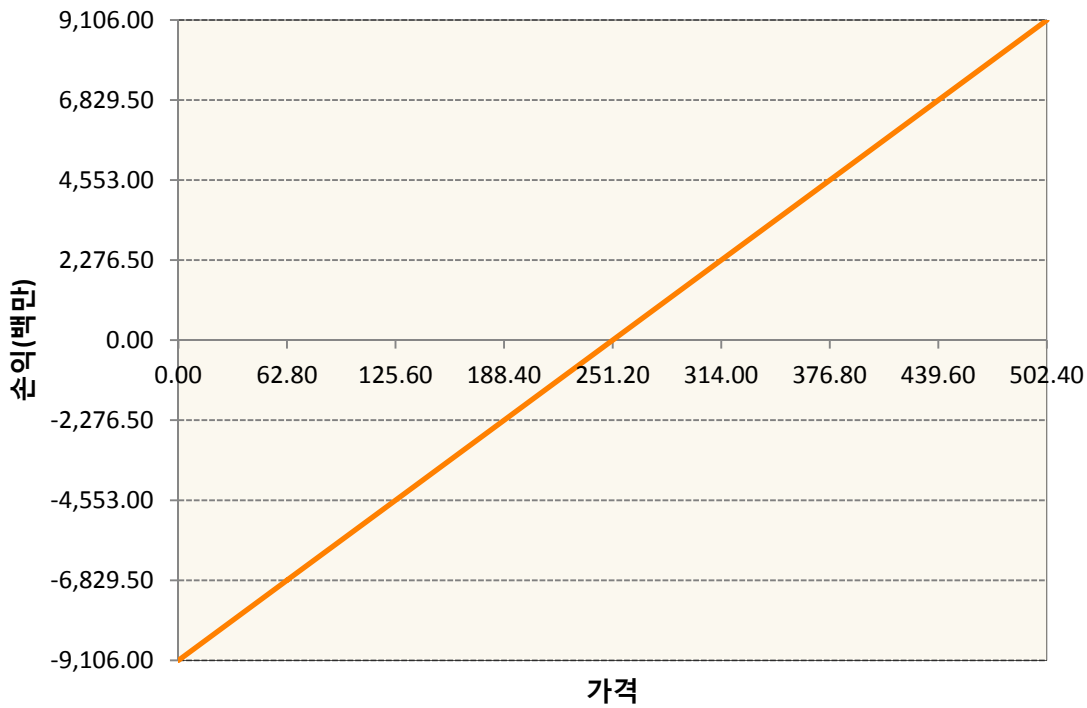
1. 계약금액

(단위:백만원)

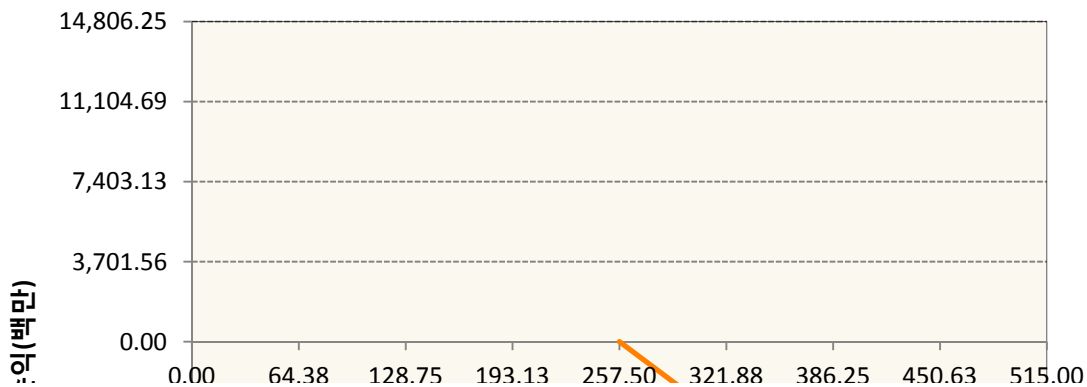
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,106	0	9,106	장내
누계	유가증권	옵션	6,201	17,536	-11,335	장내

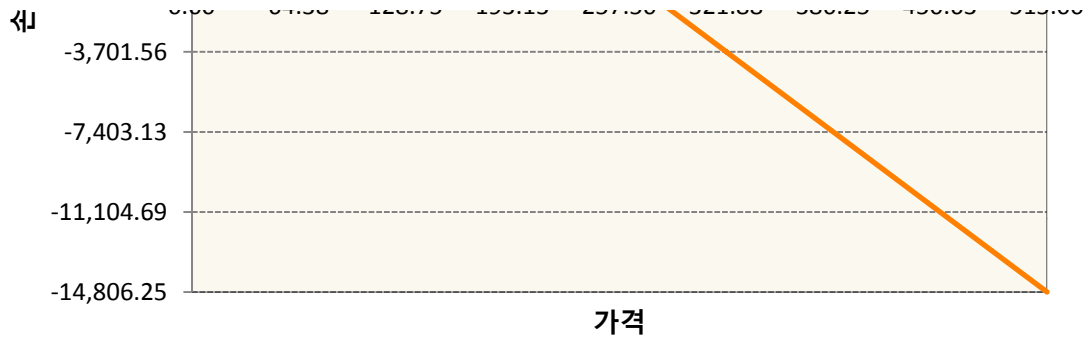
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

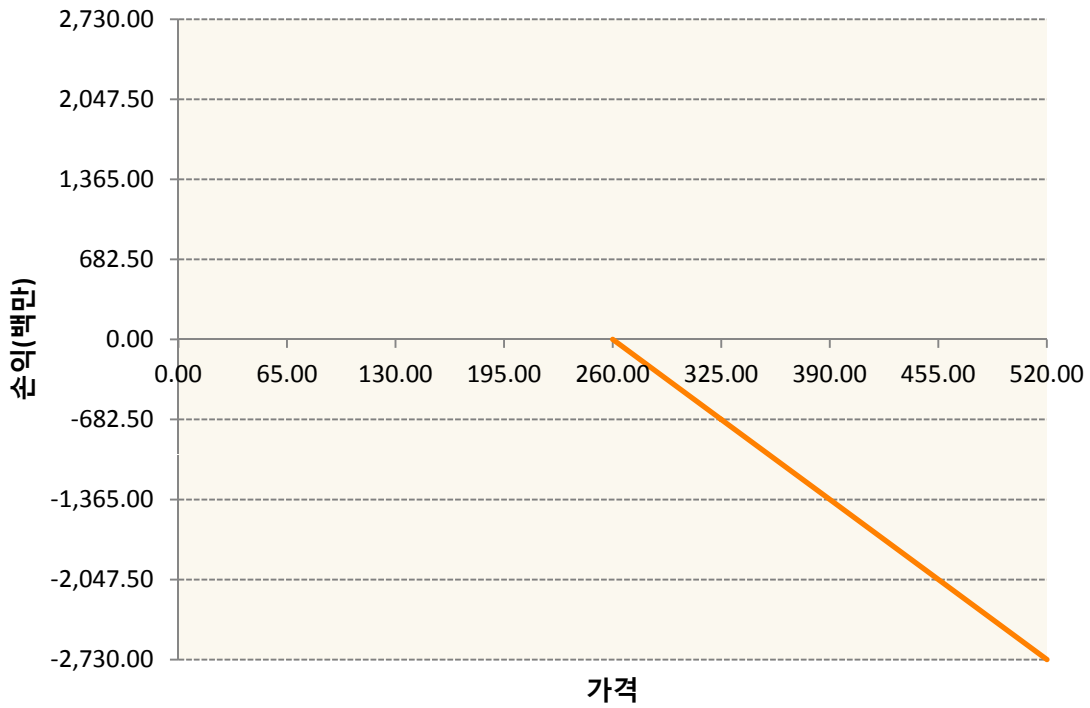


KR4201Q52577-2020-05 콜257.5

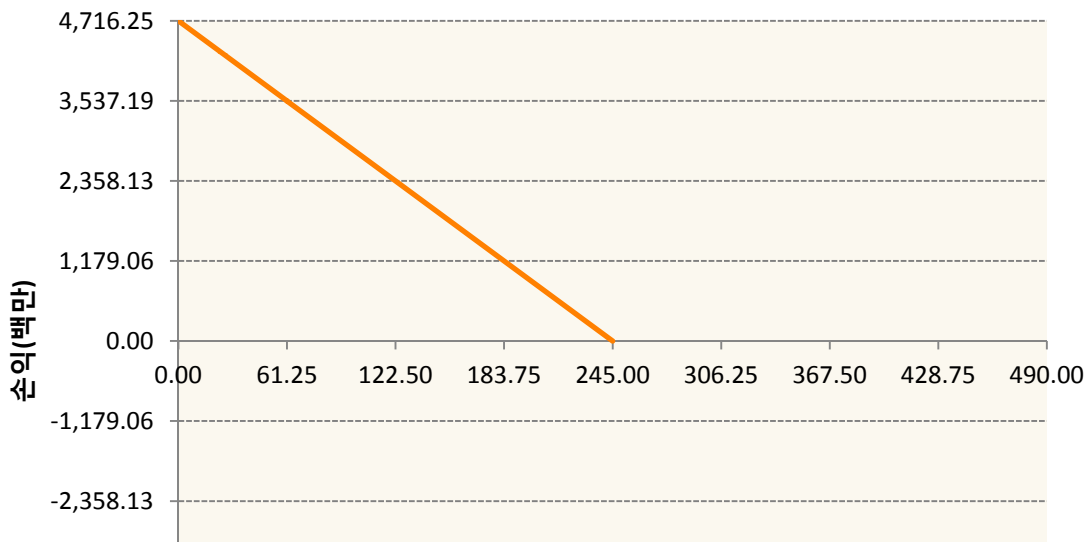


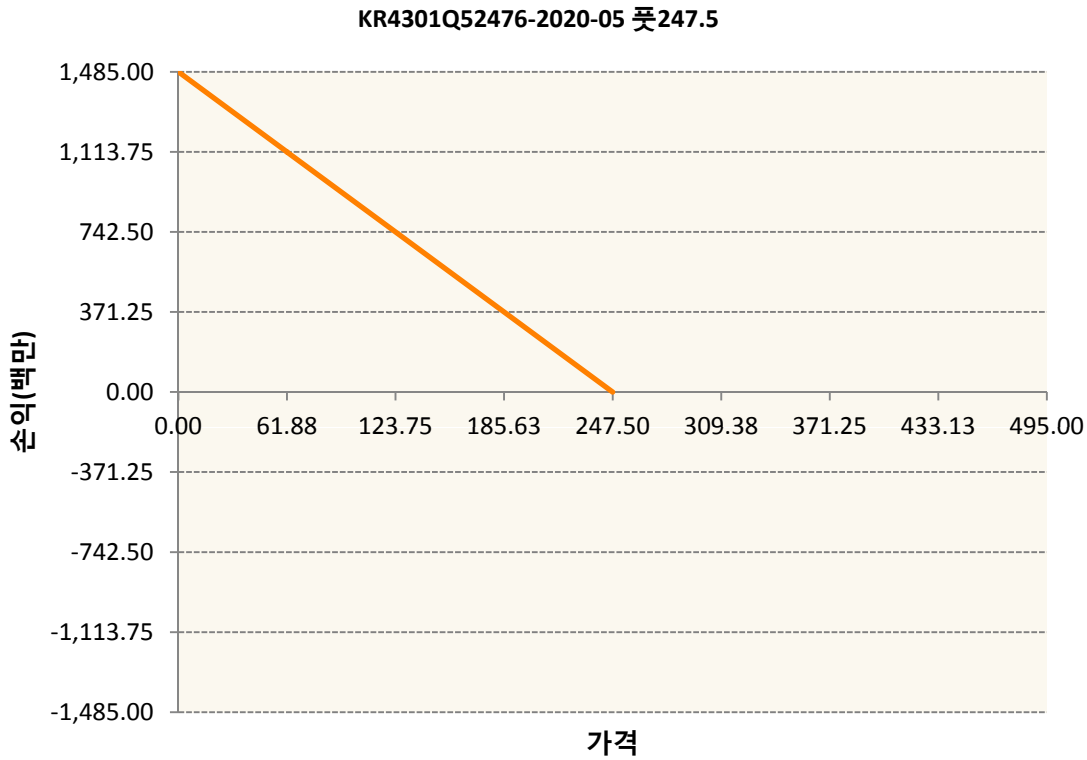
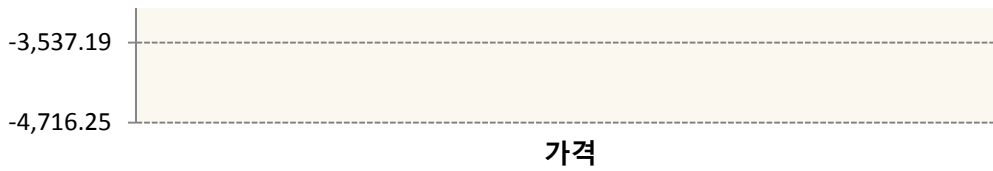


KR4201Q52601-2020-05 콜260



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						731
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-731	-731	-731	-731	-731	-731	-731	
-5.33%	-487	-487	-487	-487	-487	-487	-487	
-2.67%	-244	-244	-244	-244	-244	-244	-244	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	244	244	244	244	244	244	244	
5.33%	487	487	487	487	487	487	487	
8.00%	731	731	731	731	731	731	731	
KR4201Q52577		2020-05 콜257.5						841
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	486	454	419	380	340	297	253	
-5.33%	419	376	331	284	236	186	136	
-2.67%	317	265	212	158	104	48	-7	

0%	175	117	59	0	-59	-118	-177
2.67%	-10	-71	-131	-191	-252	-312	-373
5.33%	-239	-297	-356	-415	-475	-535	-594
8.00%	-506	-559	-614	-669	-726	-783	-841
KR4201Q52601 2020-05 콜260							148
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	81	76	70	64	57	49	42
-5.33%	71	64	56	48	39	31	22
-2.67%	55	46	36	27	17	7	-3
0%	31	21	11	0	-11	-21	-32
2.67%	0	-11	-22	-33	-44	-55	-66
5.33%	-38	-49	-60	-71	-83	-94	-105
8.00%	-85	-95	-105	-116	-126	-137	-148
KR4301Q52450 2020-05 풋245							245
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	177	187	198	209	221	233	245
-5.33%	84	97	111	124	137	151	164
-2.67%	12	26	40	54	68	83	97
0%	-41	-27	-14	0	14	28	42
2.67%	-75	-64	-52	-40	-28	-15	-2
5.33%	-95	-87	-78	-68	-58	-47	-36
8.00%	-106	-100	-94	-87	-79	-70	-60
KR4301Q52476 2020-05 풋247.5							81
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	61	64	67	70	74	77	81
-5.33%	30	34	38	42	46	50	54
-2.67%	5	10	14	19	23	28	32
0%	-13	-9	-4	0	4	9	13
2.67%	-26	-22	-18	-14	-10	-6	-2
5.33%	-34	-31	-28	-24	-21	-17	-13
8.00%	-38	-36	-34	-31	-28	-25	-22

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

(단위:백만원)

2,064

공시일	2020-04-21
기준일	2020-04-20

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	148,396	0	148,396	

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	2020-04-21
기준일	2020-04-20

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	100,057	0	100,057	

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	2020-04-21
기준일	2020-04-20

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	442,069	0	442,069	
누계	통화	선도	71,399	555,205	-483,806	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,359
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,953
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,906
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,285
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,953
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,441
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,031
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,031
FX21020H04 USD/KRW 21-04-20E	1,465
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,382
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	976
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	976
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,539
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	840
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	732
FX21020H09 USD/KRW 24-04-20E	732
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	488
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,417
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,932
FX21020H11 KRW/USD 11-05-20E	976
FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E	2,929
FX21020J02€ KRW/USD 10-06-20E	1,328
FX21020J027 KRW/USD 22-06-20E	1,504
FX21020J028 KRW/USD 22-06-20E	1,953

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

25,076

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

(단위:백만원)

193

공시일	2020-04-21
기준일	2020-04-20

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

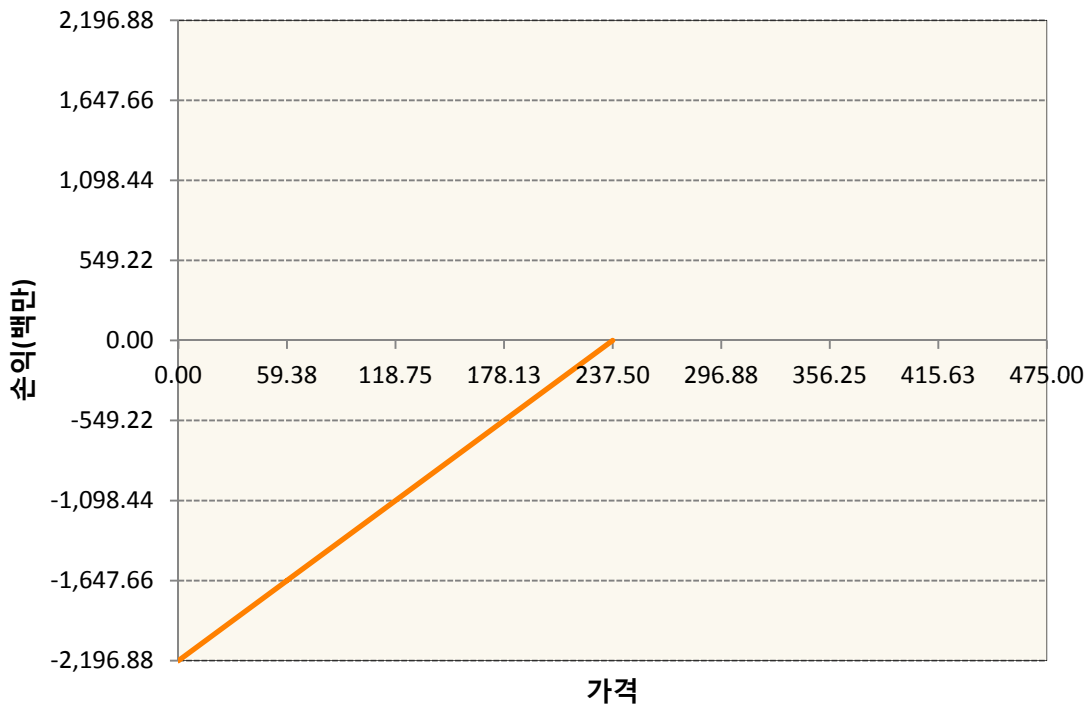
1. 계약금액

(단위:백만원)

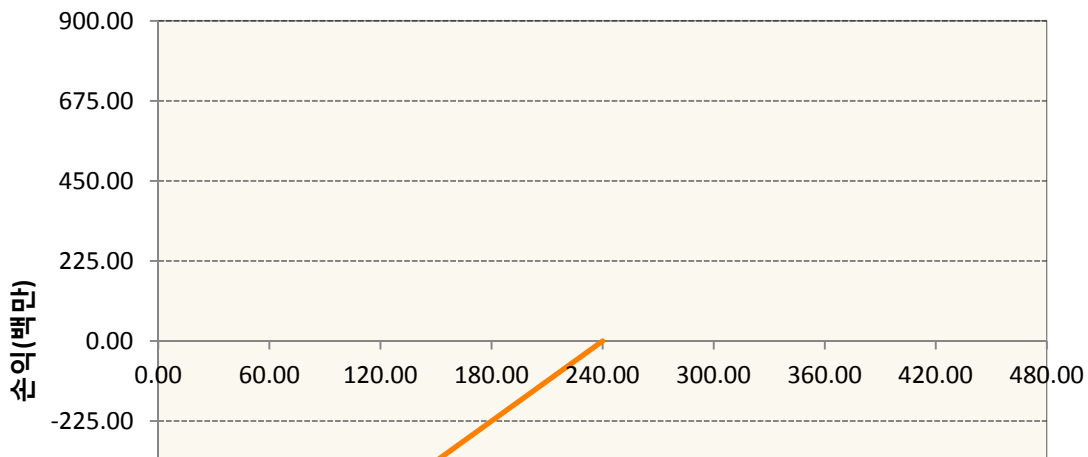
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,097	-3,097	장내

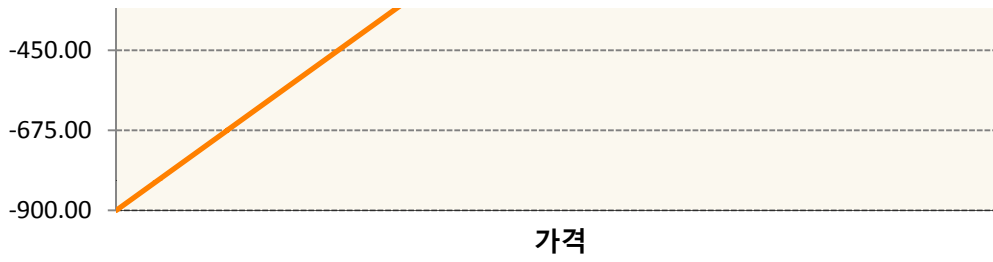
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q52377-2020-05 풋237.5



KR4301Q52401-2020-05 풋240





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q52377		2020-05 풋237.5						95
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-57	-63	-70	-76	-82	-89	-95	
-5.33%	-23	-30	-37	-43	-50	-57	-63	
-2.67%	0	-6	-12	-18	-25	-31	-37	
0%	15	11	5	0	-6	-11	-17	
2.67%	24	21	17	12	8	3	-2	
5.33%	28	26	24	21	17	13	9	
8.00%	31	29	28	26	23	20	17	

KR4301Q52401		2020-05 풋240						42
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-27	-29	-32	-34	-37	-39	-42	
-5.33%	-12	-14	-17	-20	-22	-25	-28	
-2.67%	0	-3	-6	-8	-11	-14	-16	
0%	7	5	2	0	-2	-5	-7	
2.67%	11	10	8	6	4	2	-1	
5.33%	14	13	11	10	8	6	5	
8.00%	15	14	13	12	11	10	8	

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

105

공시일	2020-04-21
기준일	2020-04-20

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	7,287	0	7,287	
누계	통화	선도	0	7,140	-7,140	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H11 KRW/USD 29-04-20E	226
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)

286

공시일	2020-04-21
기준일	2020-04-20

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

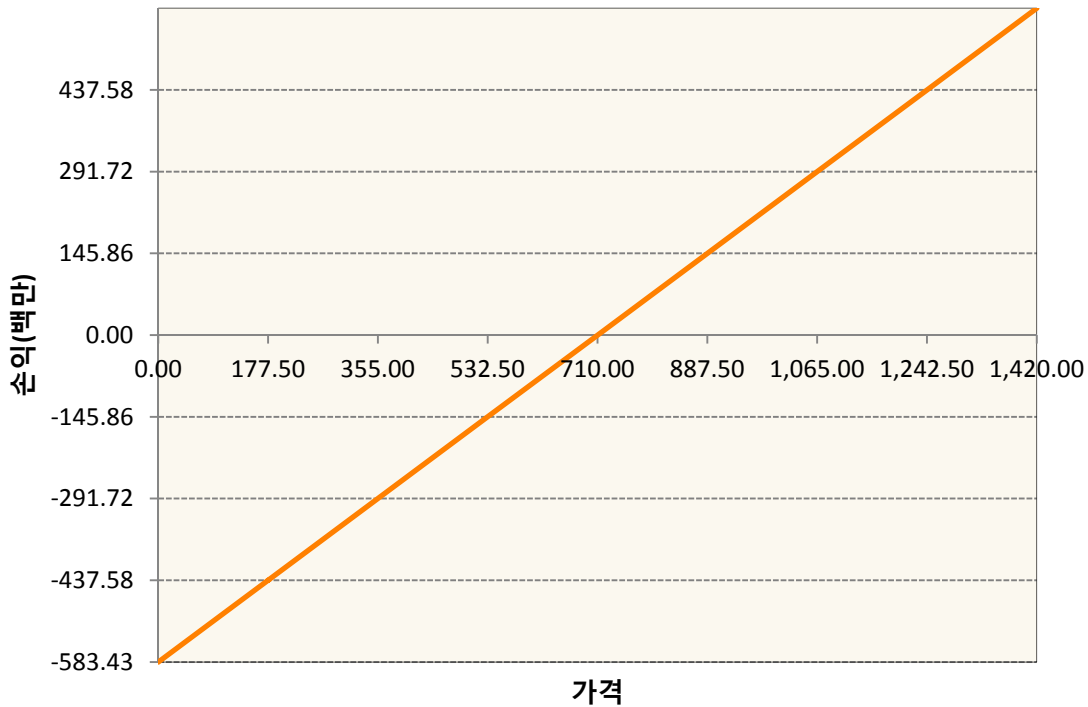
1. 계약금액

(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	583	0	583	
누계	유가증권	스왑	1,093	0	1,093	장외
누계	통화	선도	231	562	-331	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
FX21020J00₩ KRW/EUR 24-07-20E	3
FX21020J00€ KRW/EUR 24-07-20E	5
FX21020J01₩ KRW/EUR 24-07-20E	3
FX21020J02€ KRW/EUR 24-07-20E	5
FX21020J03₩ KRW/EUR 26-06-20E	5
VNCK0 VN30 Index Future May20	47

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

(단위:백만원)

154

공시일	2020-04-21
기준일	2020-04-20

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

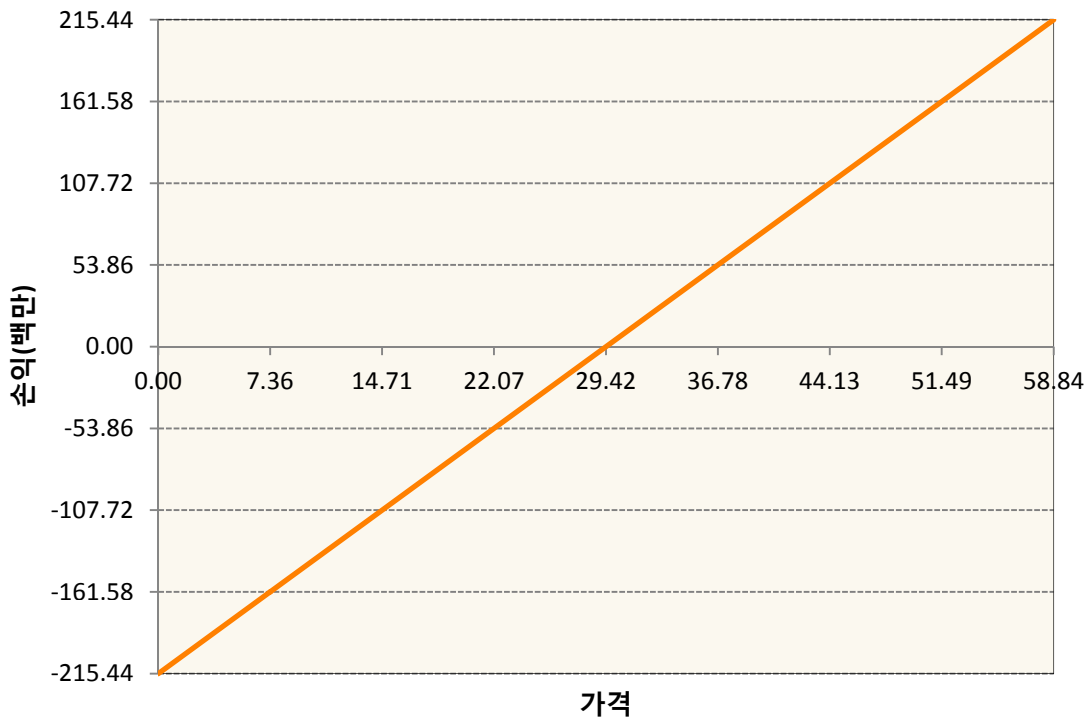
1. 계약금액

(단위:백만원)

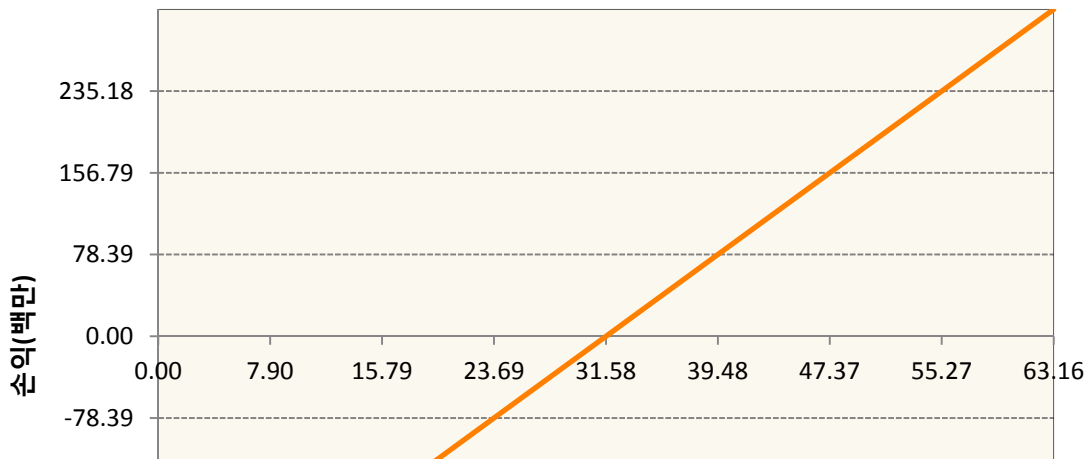
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,432	183	1,249	

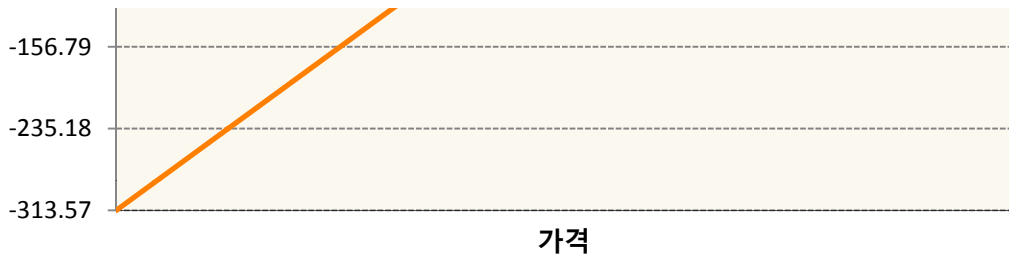
2. 만기시점의 손익구조

CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20

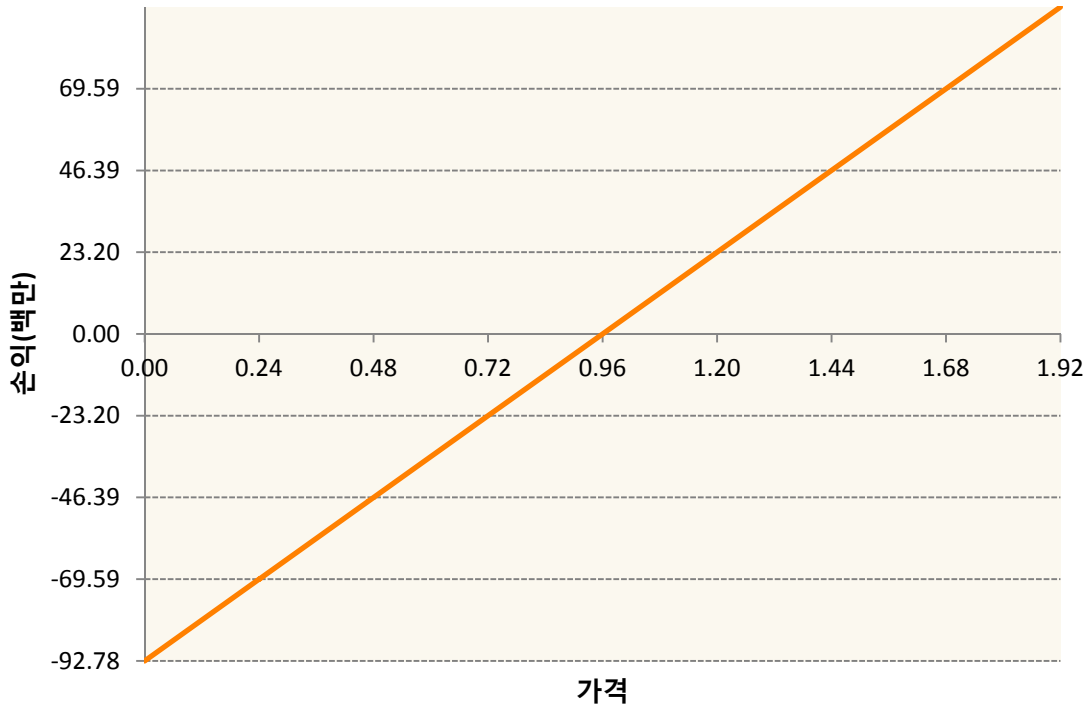


CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20

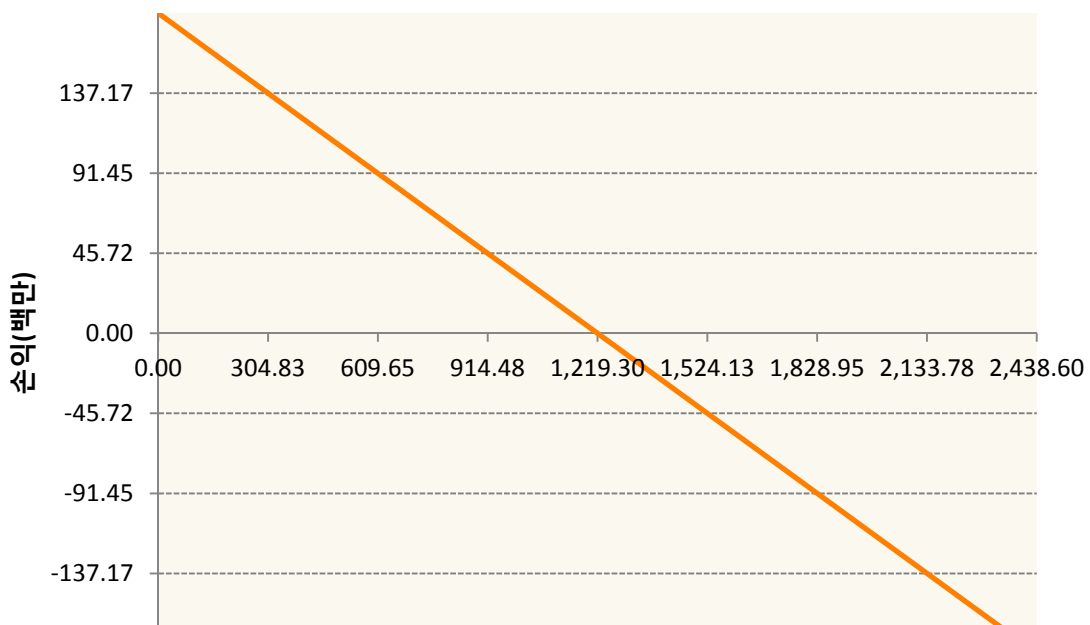


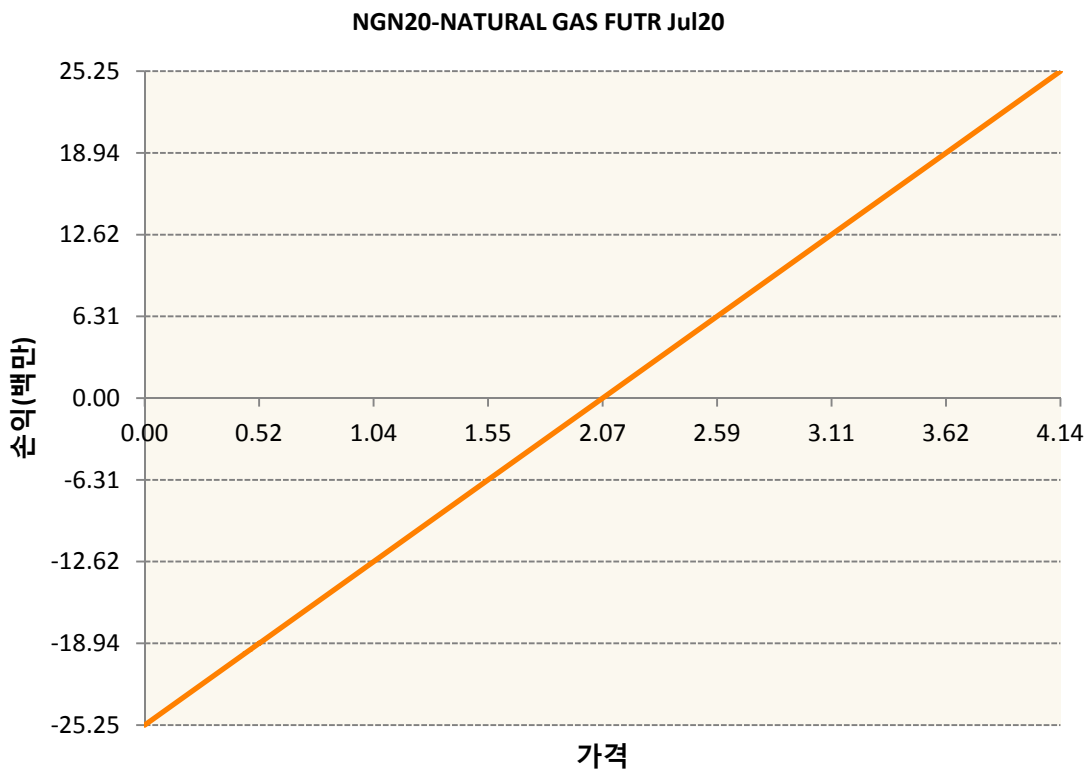
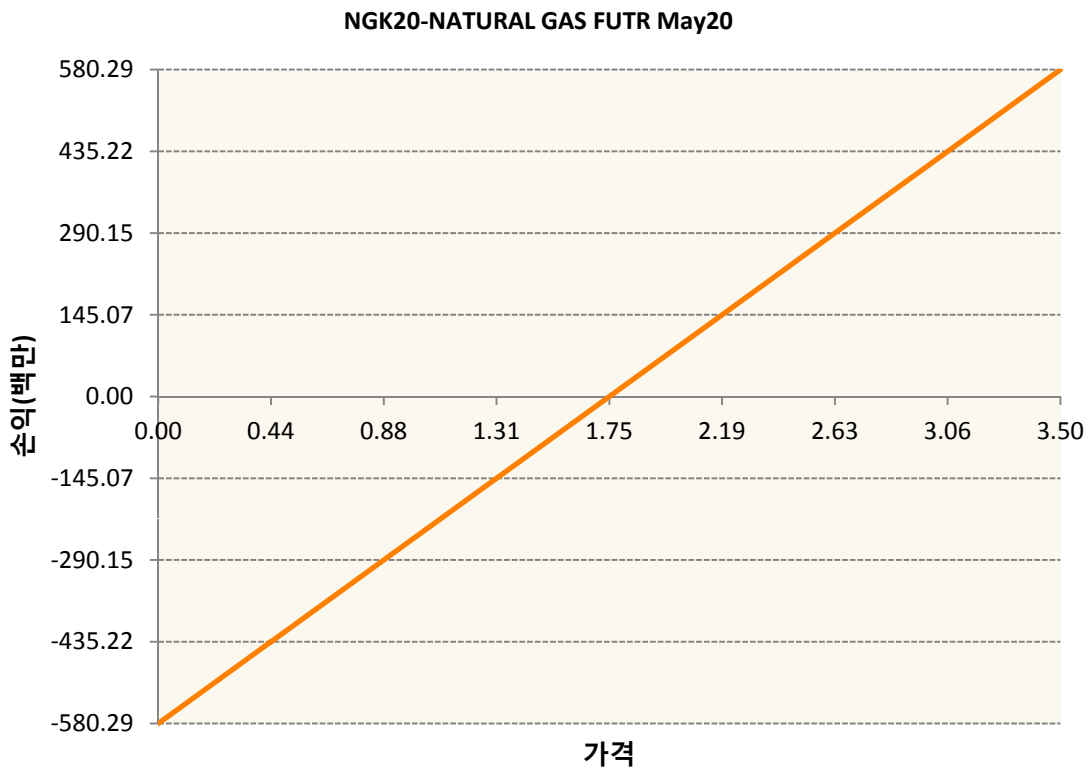
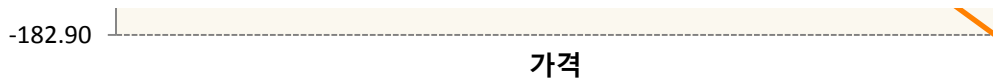


HOK0-NY Harb ULSD Fut May20

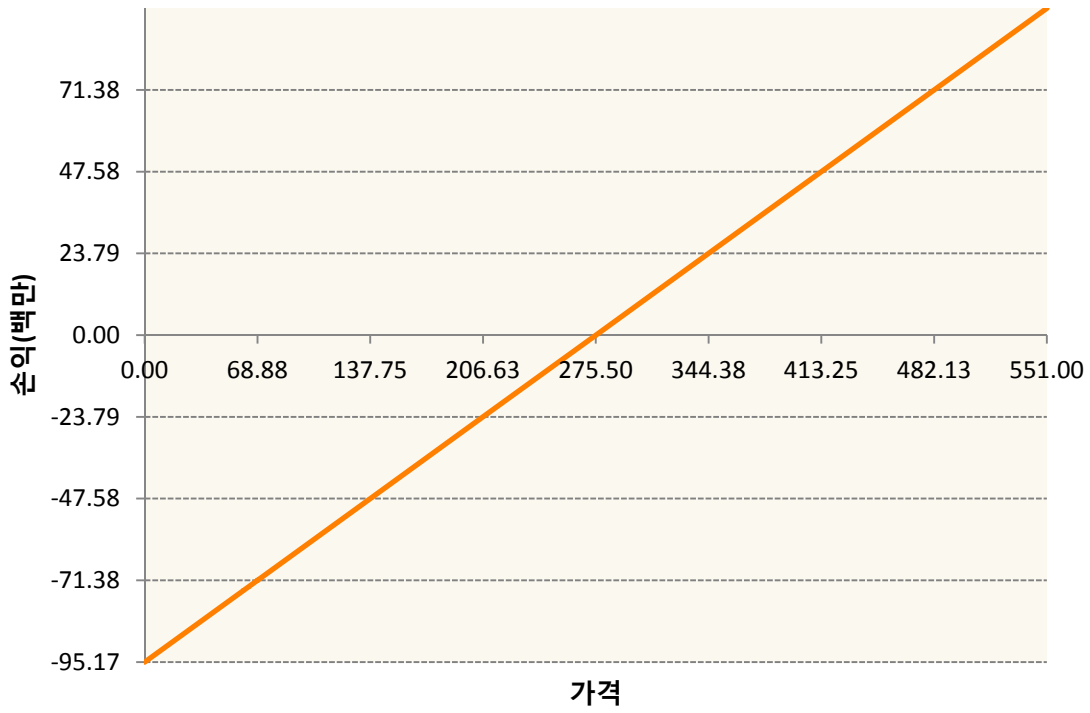


KR4175Q50007-2020-05 달러선물

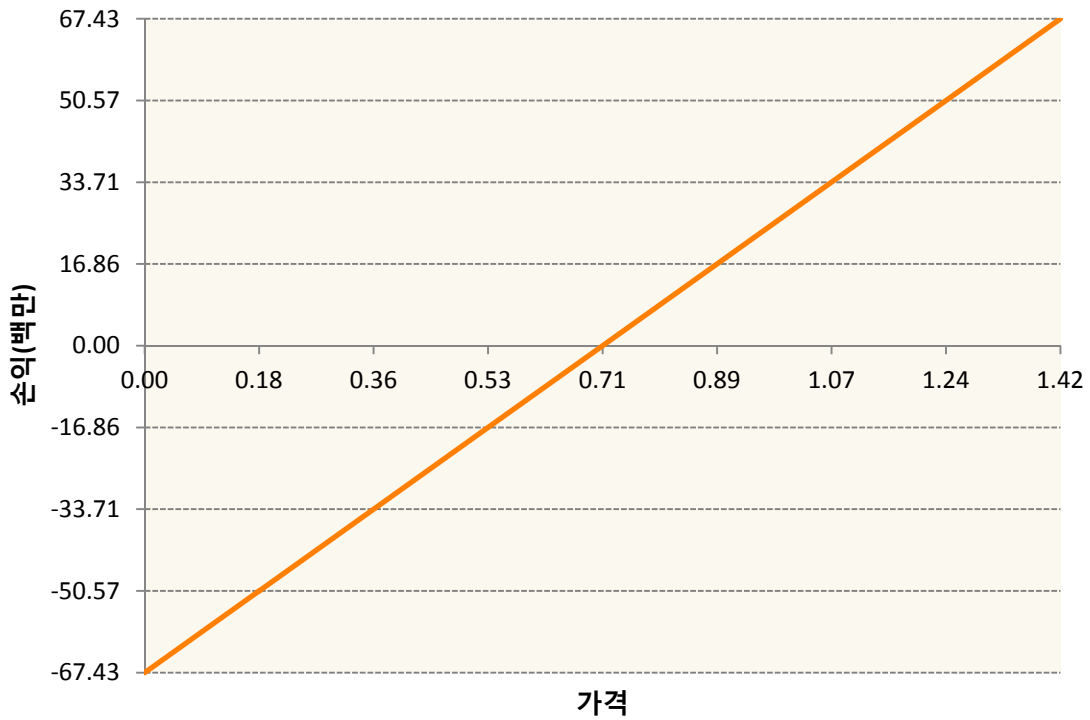




QSK0-Low Su Gasoil G Mar20

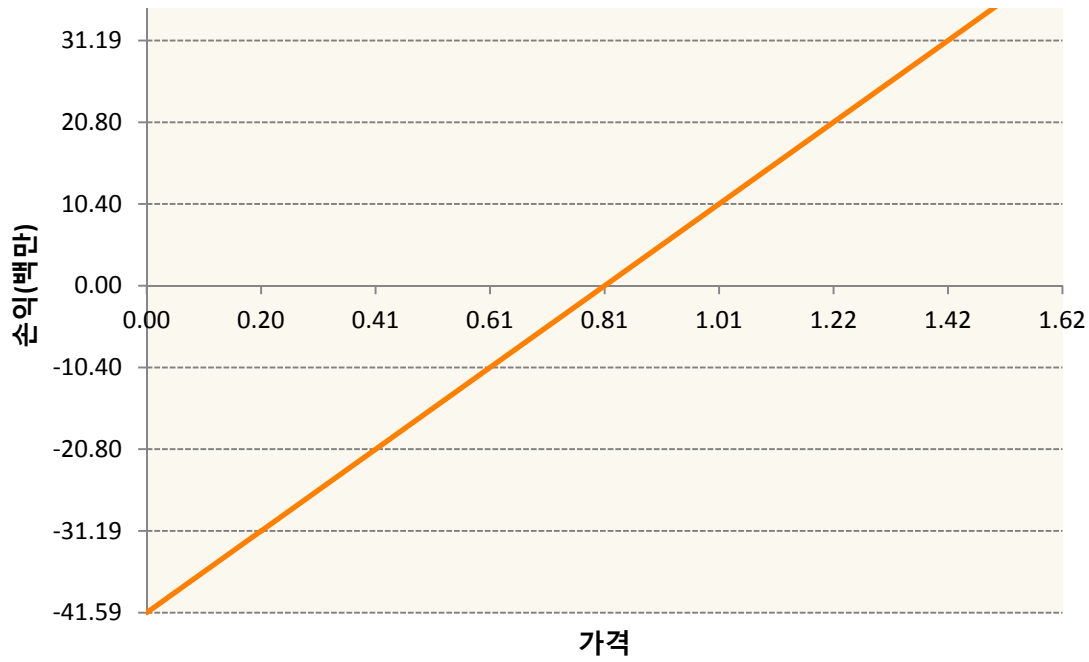


XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN0	WTI CRUDE FUTURE Jul20	17
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	25
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	7
KR4175Q50C	2020-05 달러선물	15
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)

348

공시일	2020-04-21
기준일	2020-04-20

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

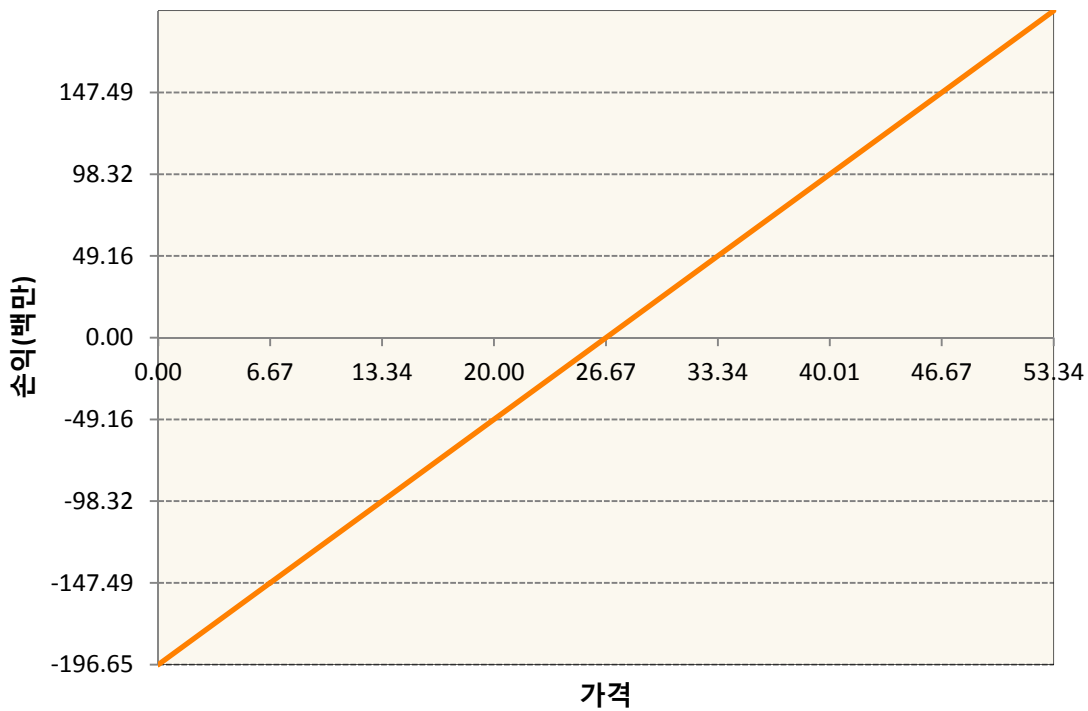
1. 계약금액

(단위:백만원)

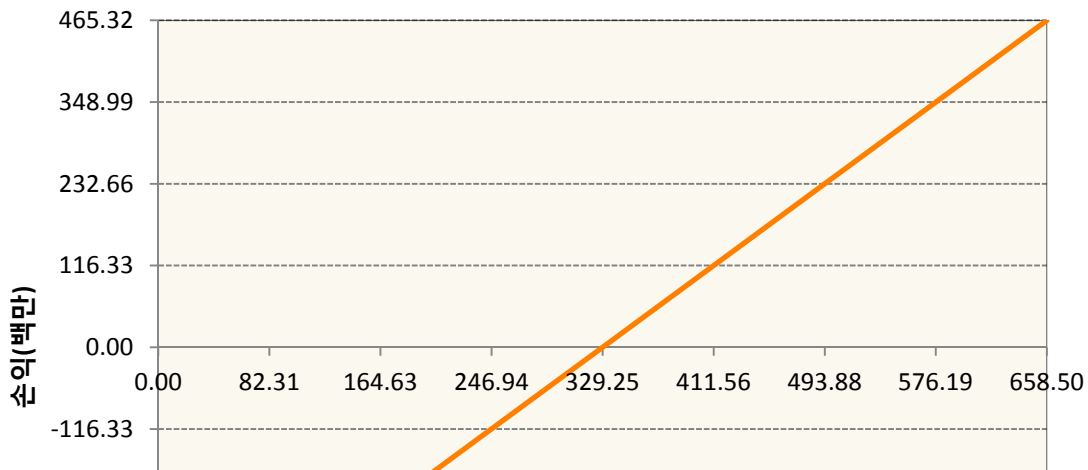
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,412	73	2,339	

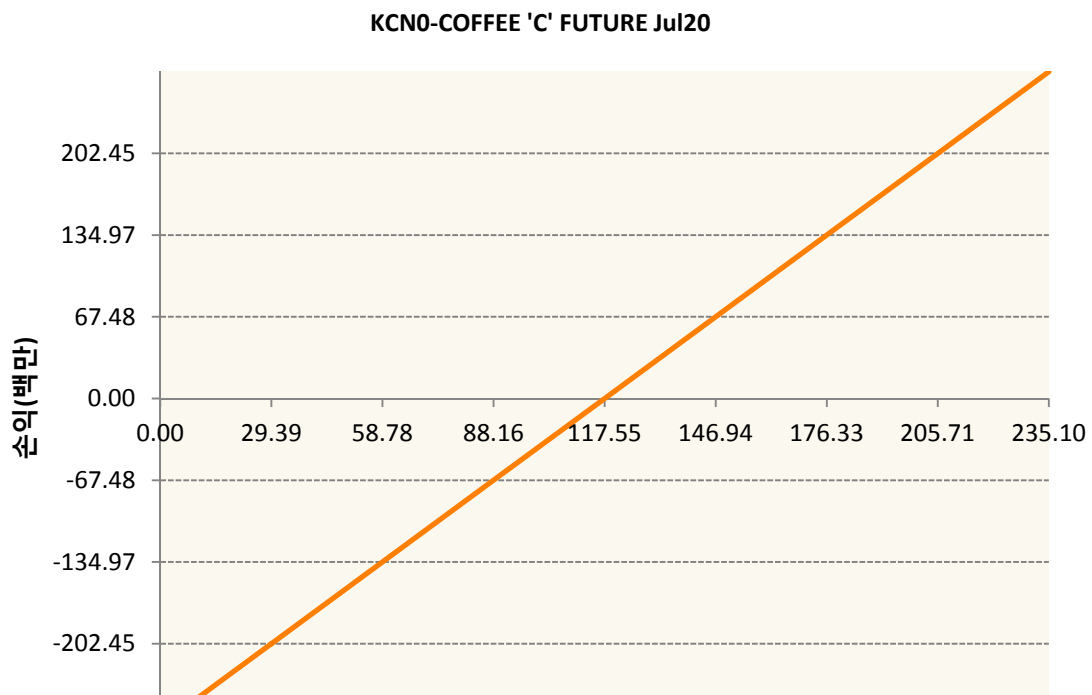
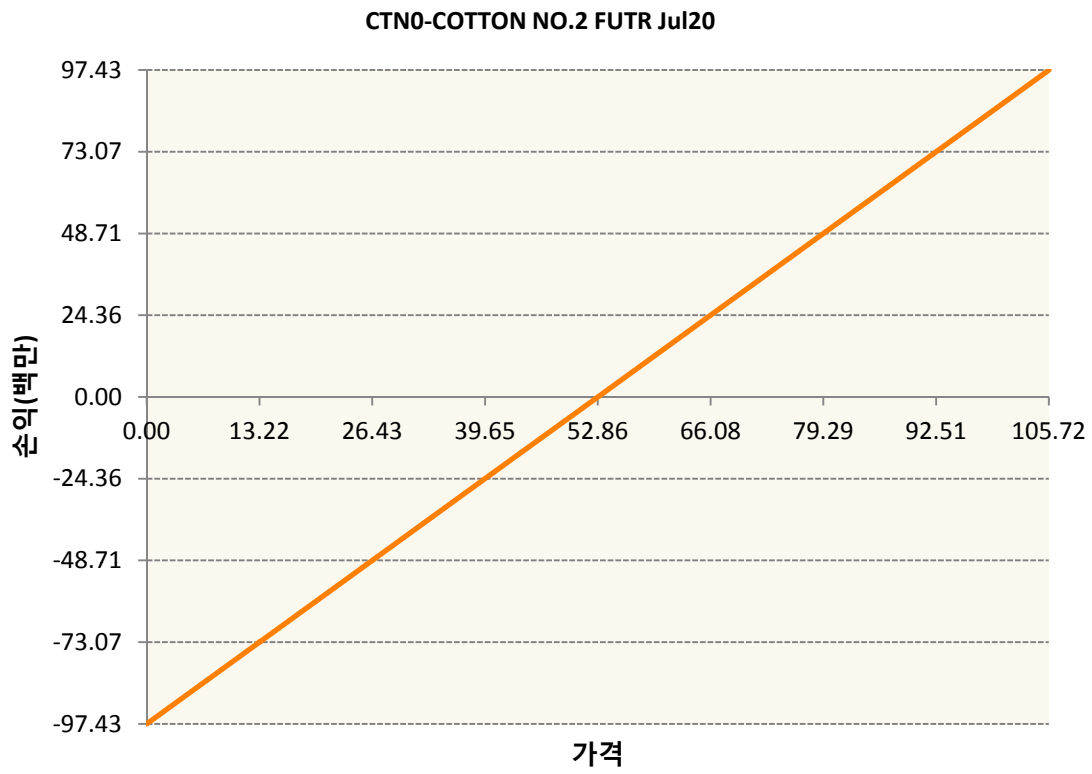
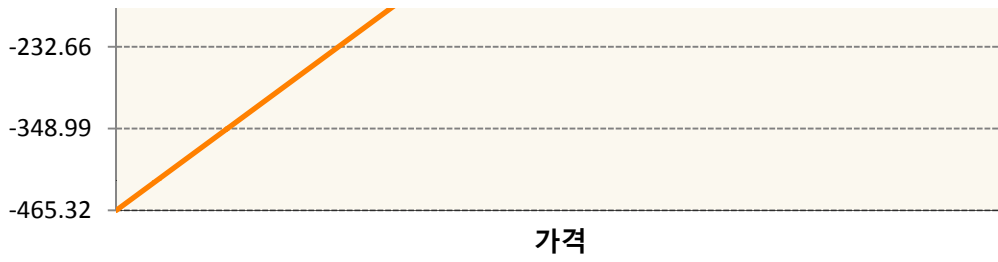
2. 만기시점의 손익구조

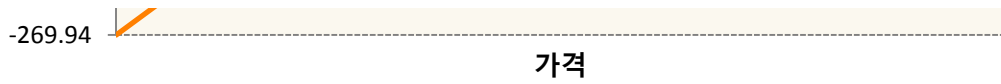
BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20



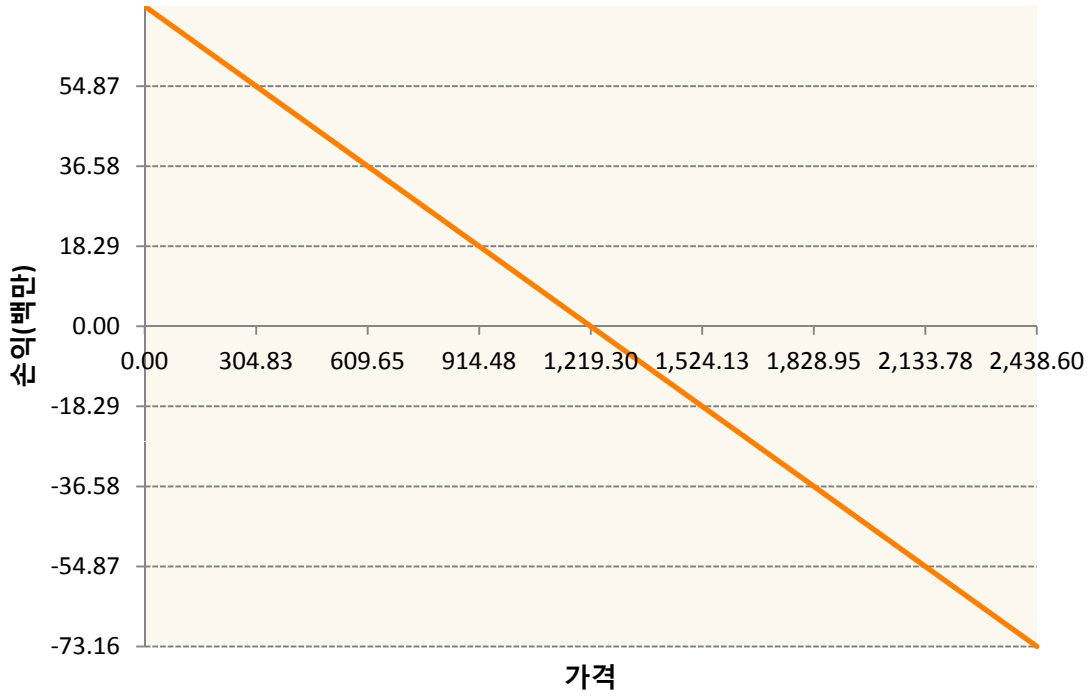
CN0-CORN FUTURE Jul20



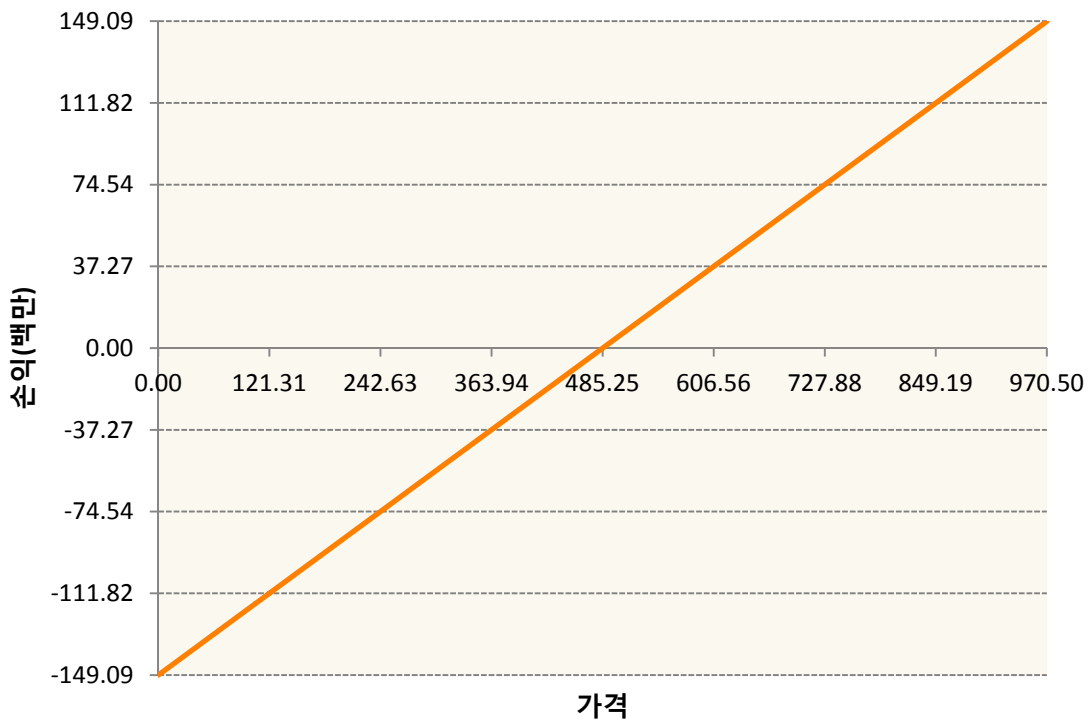




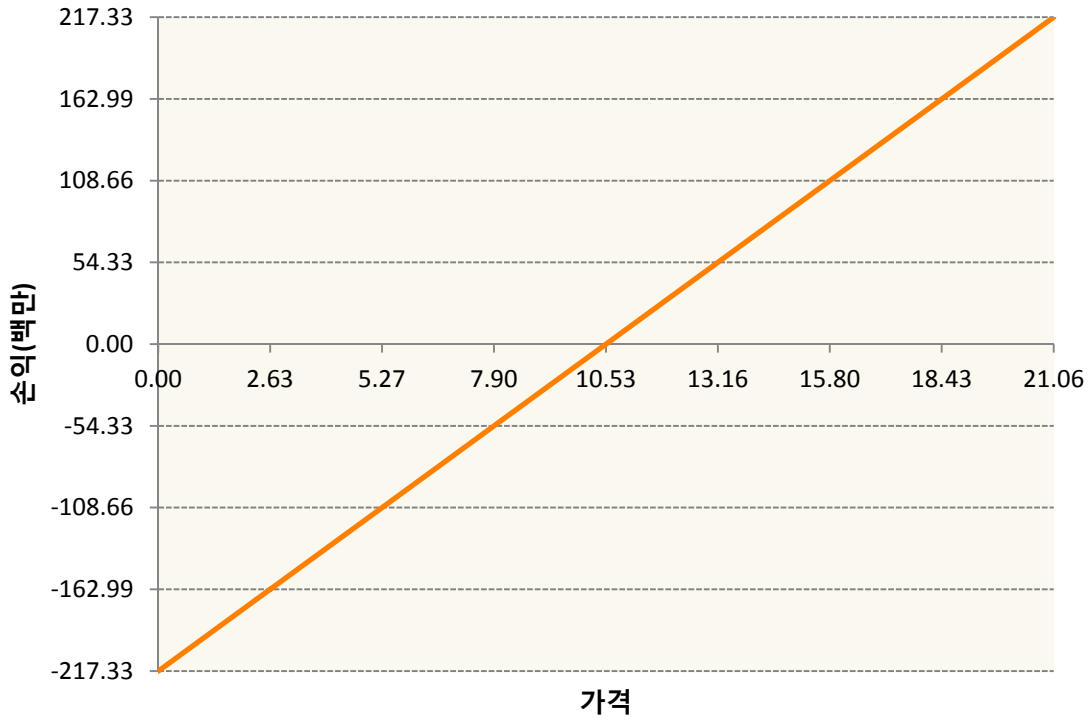
KR4175Q50007-2020-05 달러선물



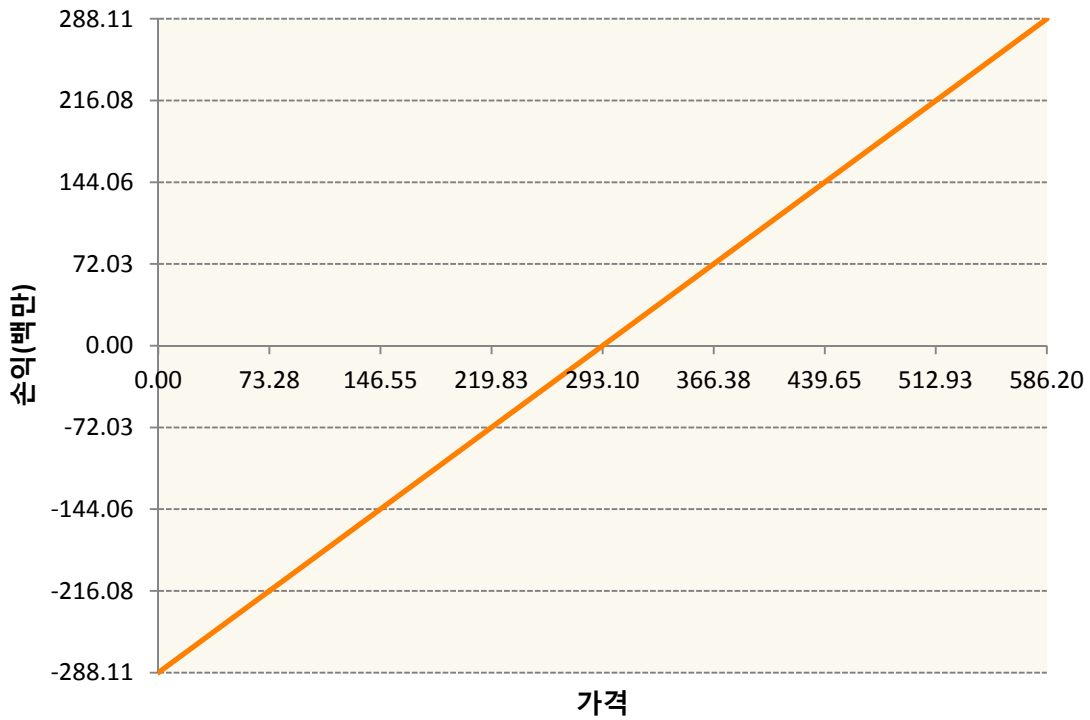
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



SBN0-Sugar Jul20

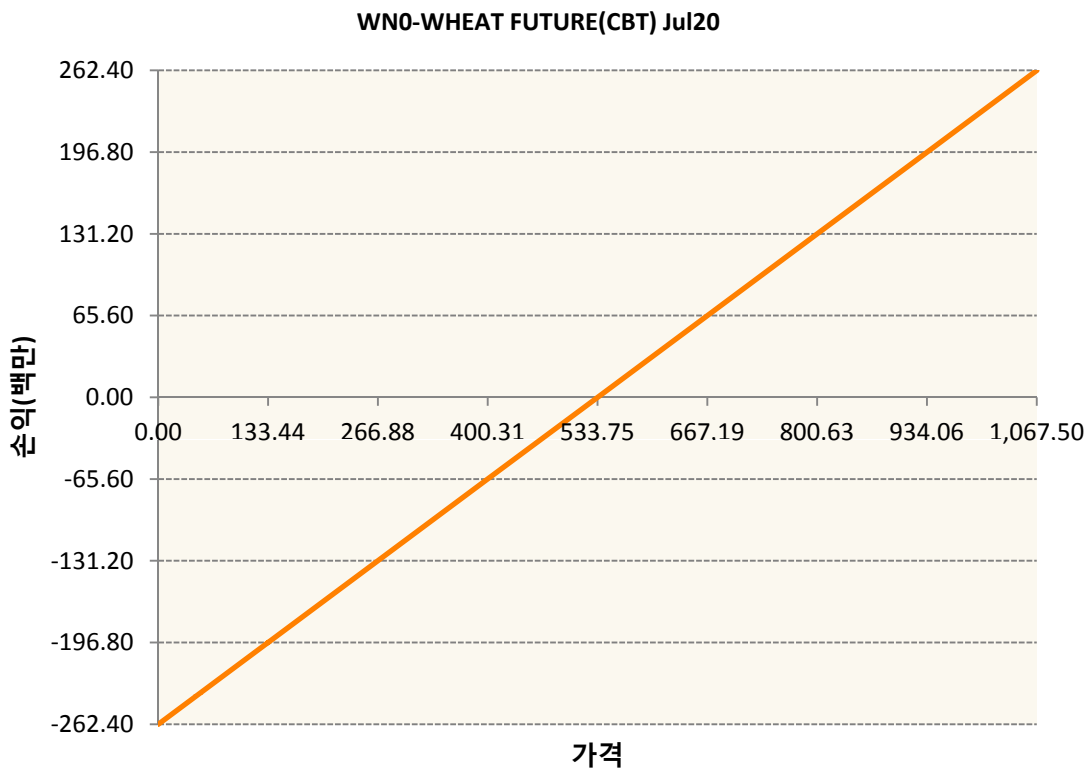
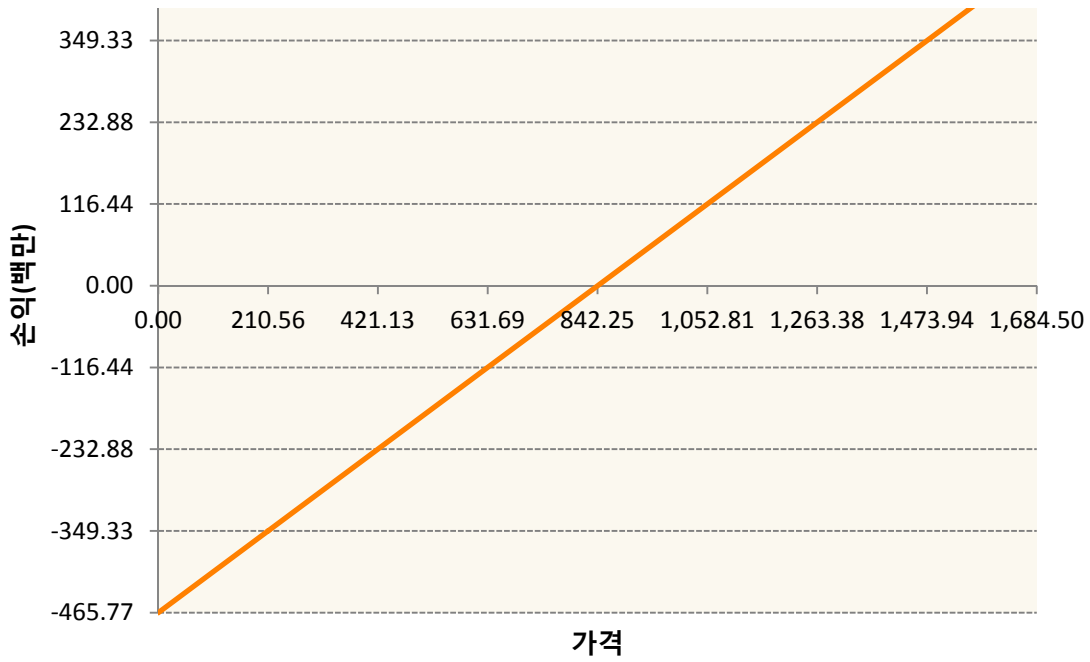


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20



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	37
WNO	WHEAT FUTURE(CBT) Jul20	21

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

(단위:백만원)

227