

공시일	2020-04-22
기준일	2020-04-21

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	2020-04-22
기준일	2020-04-21

스마트인덱스모

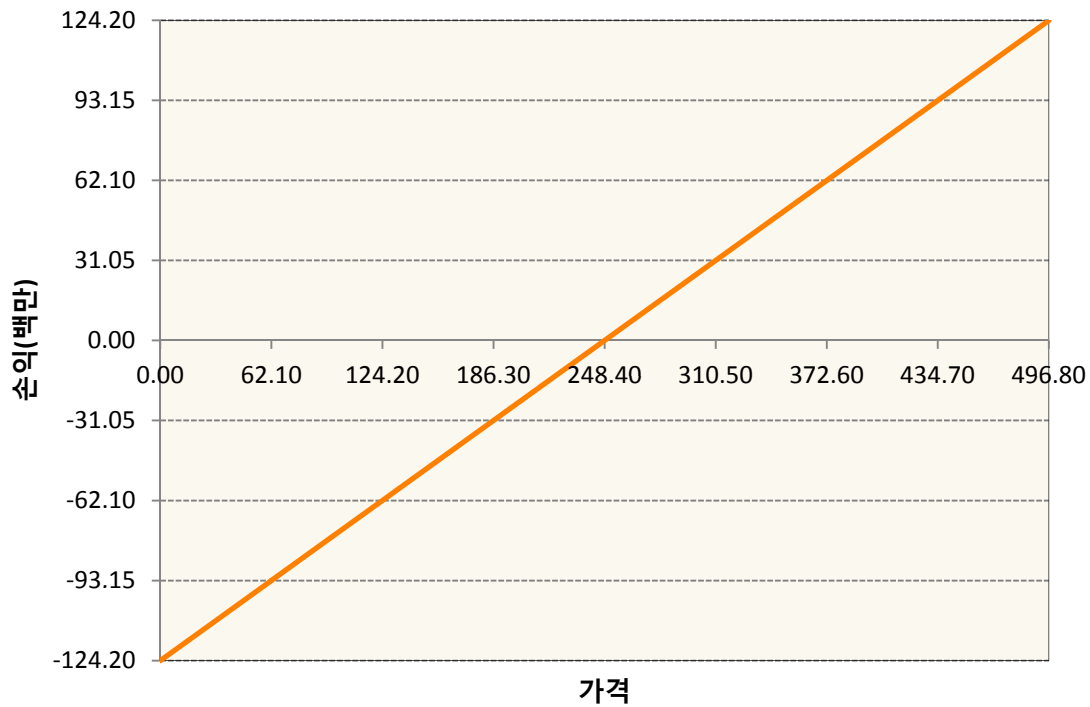
1. 계약금액

(단위:백만원)

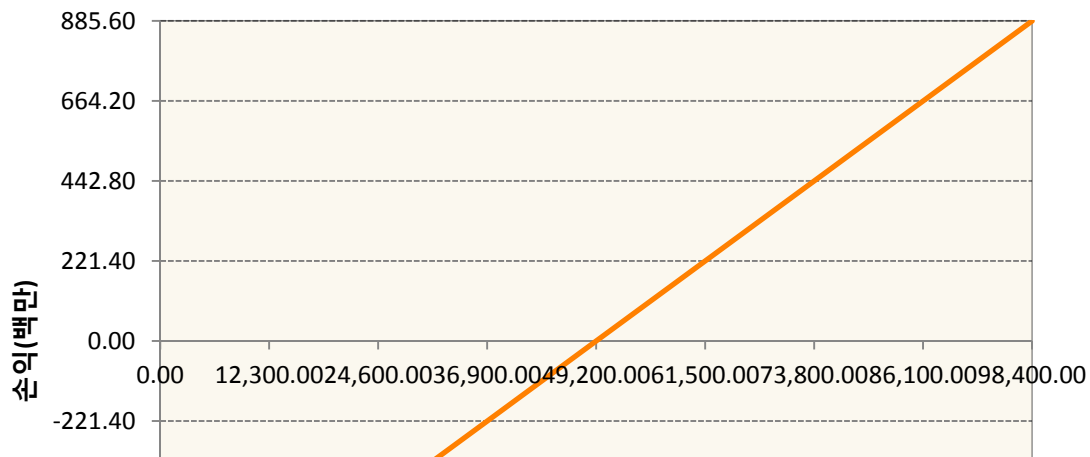
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,010	0	1,010	장내

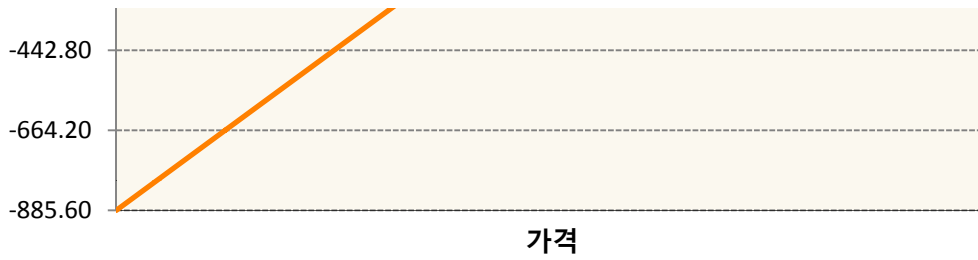
2. 만기시점의 손익구조

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						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)

121

공시일	2020-04-22
기준일	2020-04-21

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

959

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,113

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-22
기준일	2020-04-21

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

555

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

878

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-22
기준일	2020-04-21

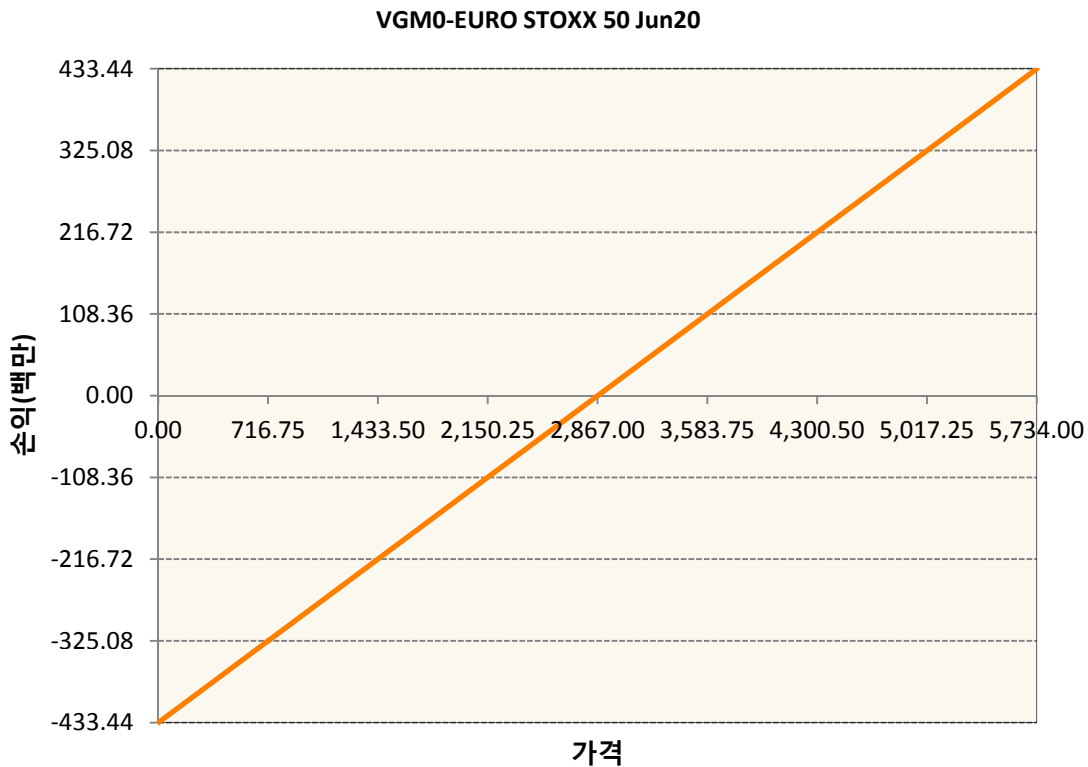
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	433	0	433	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	35
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

43

공시일	2020-04-22
기준일	2020-04-21

차이나인덱스모(주식-파생형)

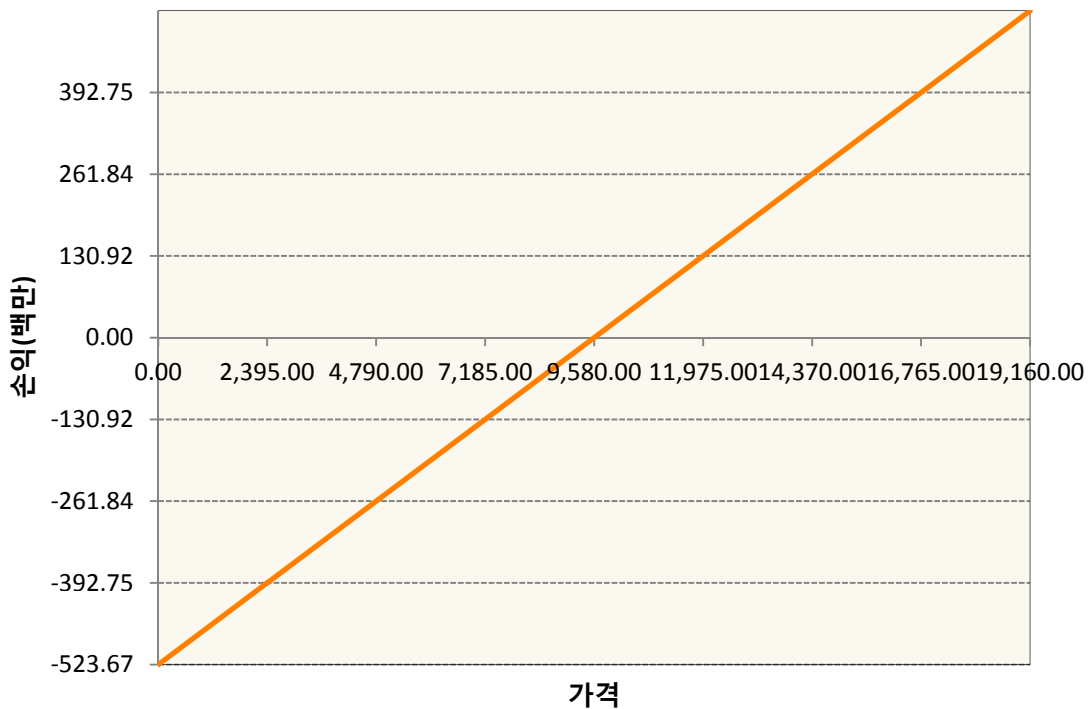
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	524	0	524	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCJ0-HSCEI Futures Apr20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

44

공시일	2020-04-22
기준일	2020-04-21

커버드콜모(주식혼합-파생형)

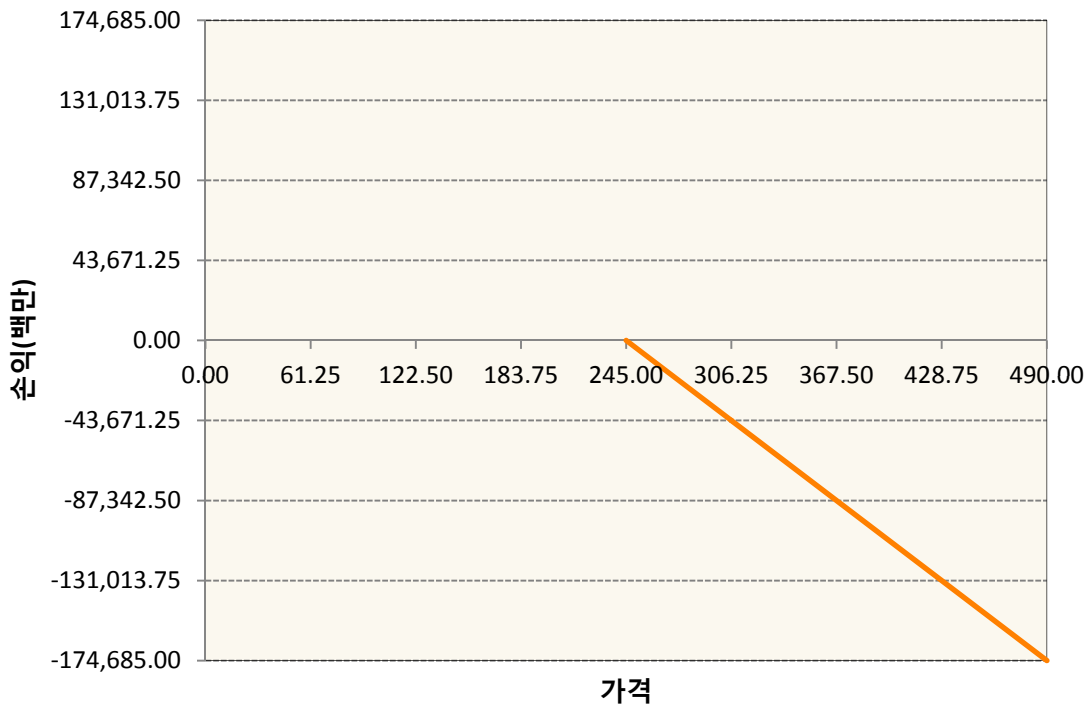
1. 계약금액

(단위:백만원)

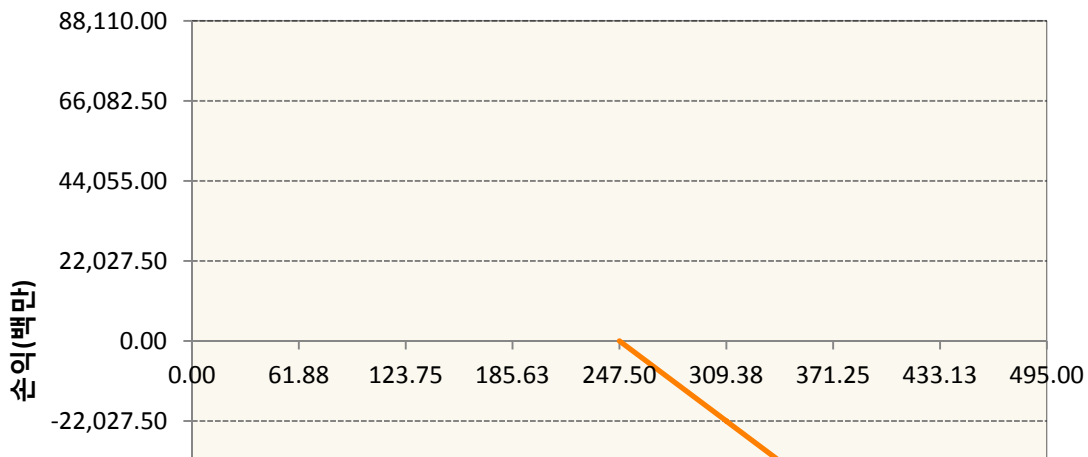
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	358,345	-358,345	장내

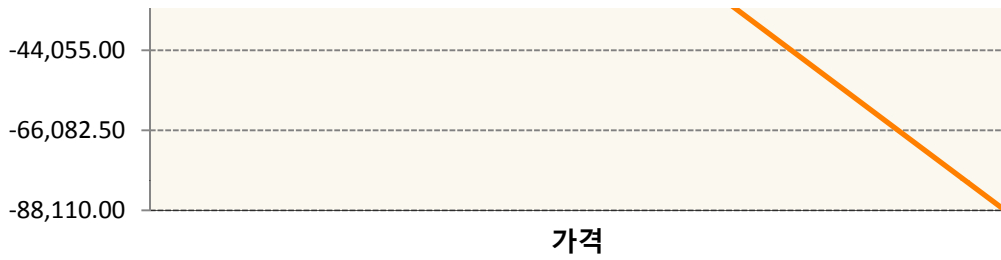
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q52452-2020-05 콜245

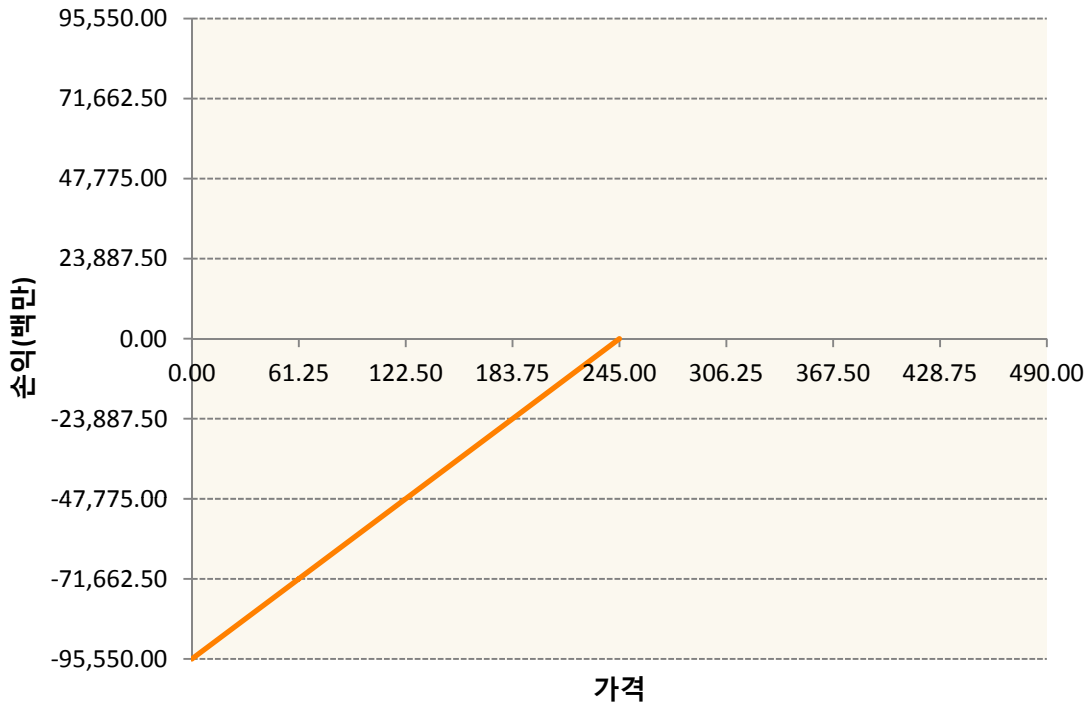


KR4201Q52478-2020-05 콜247.5





KR4301Q52450-2020-05 풋245



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q52452		2020-05 콜245					11,637
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,074	7,524	6,950	6,358	5,752	5,134	4,507
-5.33%	6,636	5,984	5,323	4,655	3,982	3,305	2,625
-2.67%	4,666	3,956	3,246	2,536	1,825	1,115	404
0%	2,142	1,429	715	0	-716	-1,433	-2,150
2.67%	-908	-1,573	-2,249	-2,934	-3,626	-4,323	-5,025
5.33%	-4,420	-4,999	-5,605	-6,232	-6,874	-7,530	-8,196
8.00%	-8,310	-8,784	-9,300	-9,848	-10,424	-11,022	-11,637
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5					5,653
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,759	3,503	3,232	2,950	2,659	2,360	2,056

-5.33%	3,128	2,815	2,496	2,171	1,842	1,510	1,175
-2.67%	2,243	1,893	1,542	1,189	836	482	128
0%	1,086	724	362	0	-362	-724	-1,086
2.67%	-339	-686	-1,037	-1,390	-1,746	-2,103	-2,461
5.33%	-2,006	-2,317	-2,639	-2,968	-3,303	-3,643	-3,988
8.00%	-3,878	-4,139	-4,418	-4,712	-5,017	-5,331	-5,653
KR4301Q52450 2020-05 풋245							5,223
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,873	-4,070	-4,282	-4,505	-4,737	-4,977	-5,223
-5.33%	-1,917	-2,177	-2,443	-2,714	-2,989	-3,266	-3,546
-2.67%	-317	-614	-911	-1,209	-1,507	-1,806	-2,104
0%	893	596	299	0	-299	-599	-900
2.67%	1,733	1,472	1,203	928	648	365	78
5.33%	2,268	2,063	1,842	1,608	1,363	1,110	850
8.00%	2,580	2,436	2,269	2,083	1,882	1,668	1,442

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

(단위:백만원)

19,278

공시일	2020-04-22
기준일	2020-04-21

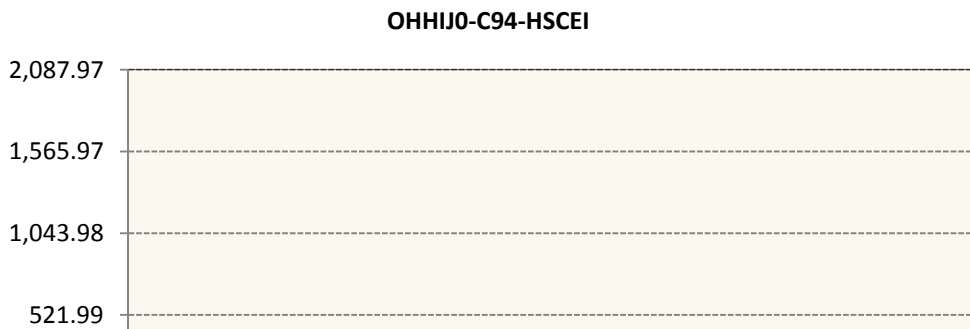
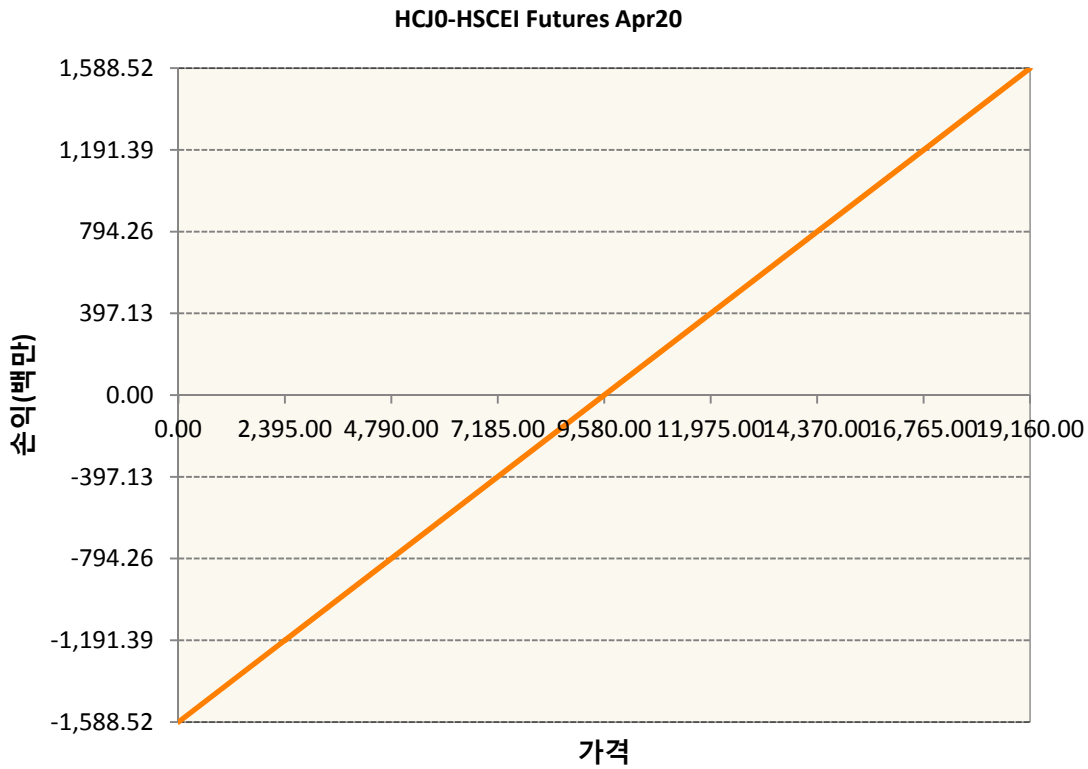
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

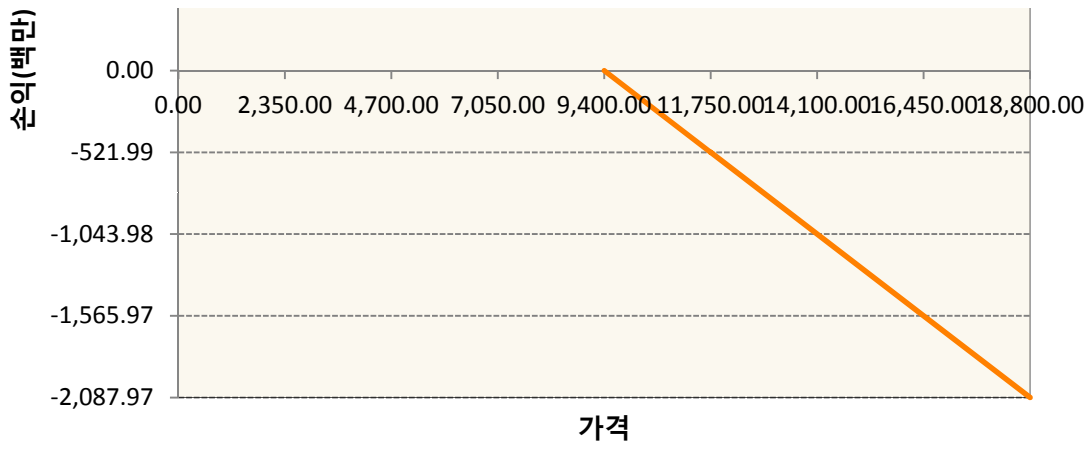
1. 계약금액

(단위:백만원)

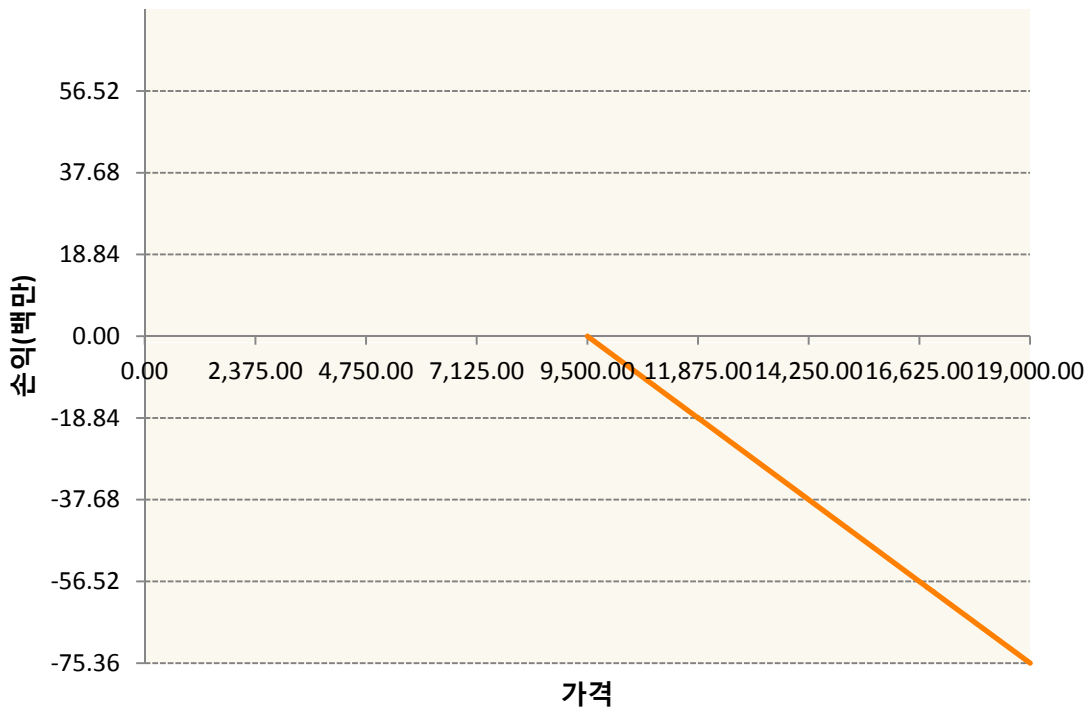
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,589	0	1,589	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,178	-4,178	장내
누계	통화	선도	698	2,234	-1,536	장외

2. 만기시점의 손익구조

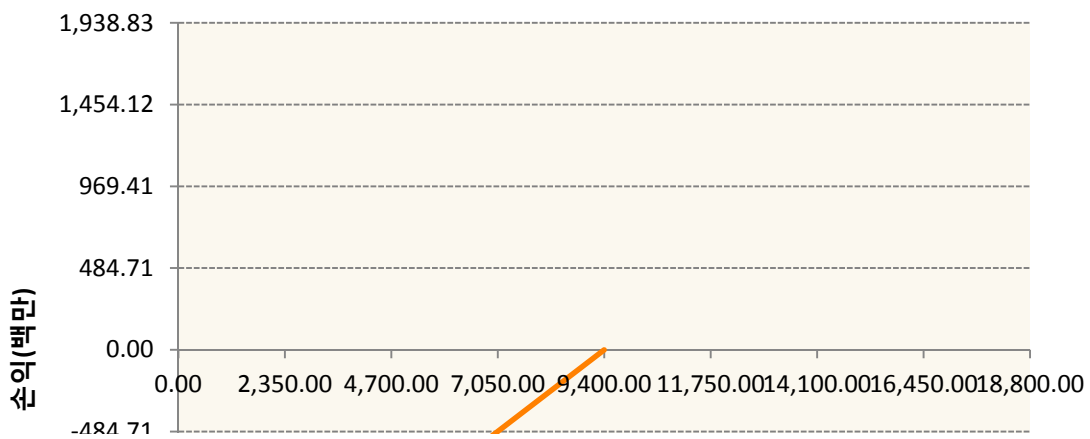


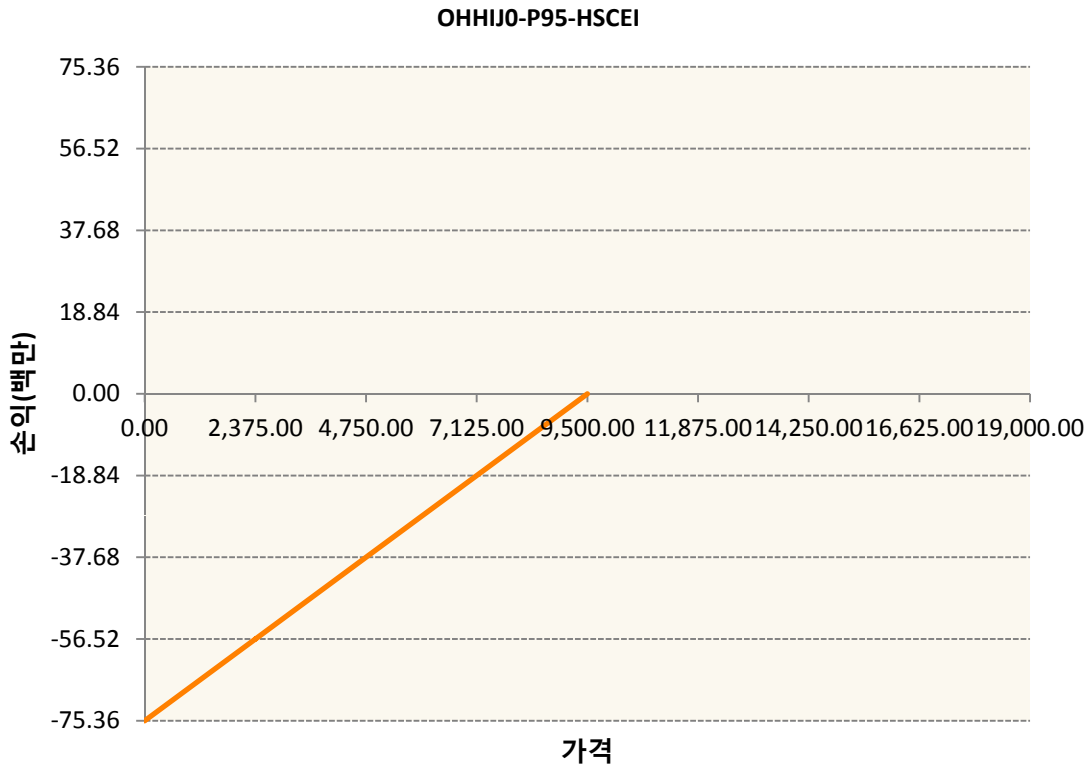


OHHIJO-C95-HSCEI



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		127
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)
	606

공시일	2020-04-22
기준일	2020-04-21

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

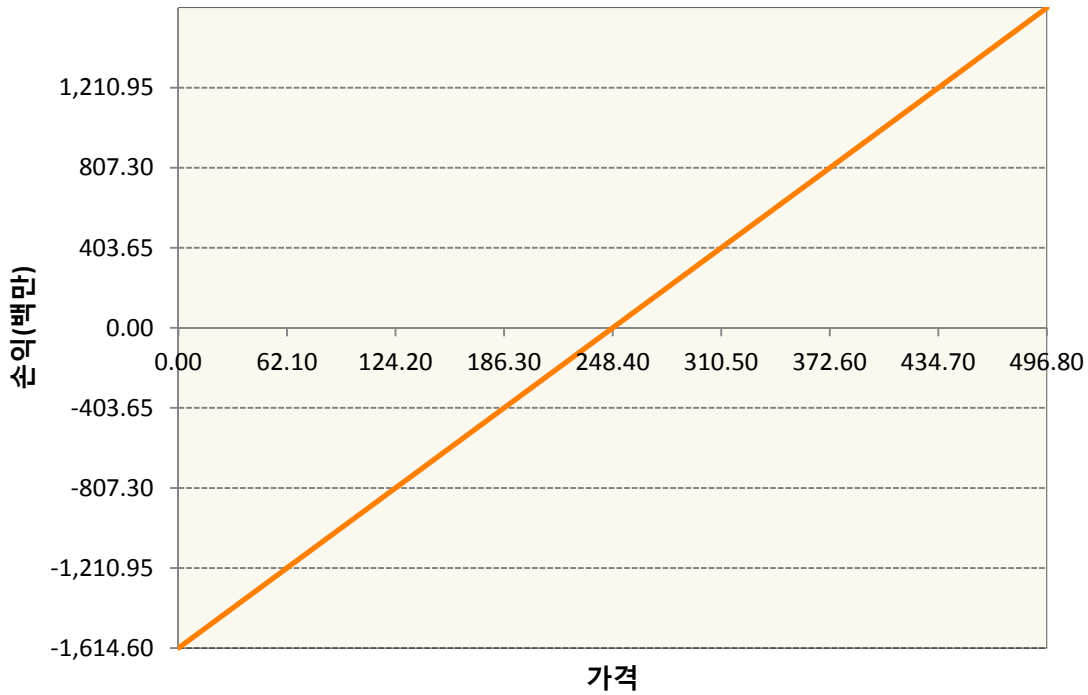
1. 계약금액

(단위:백만원)

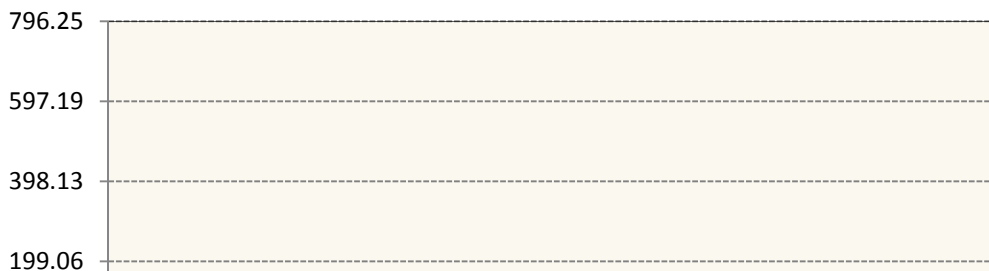
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,615	0	1,615	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,193	-3,193	장내

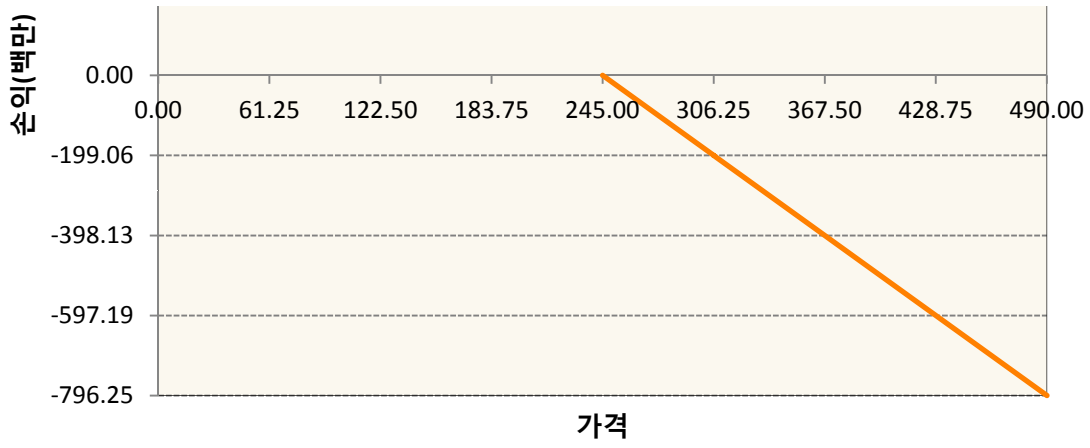
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

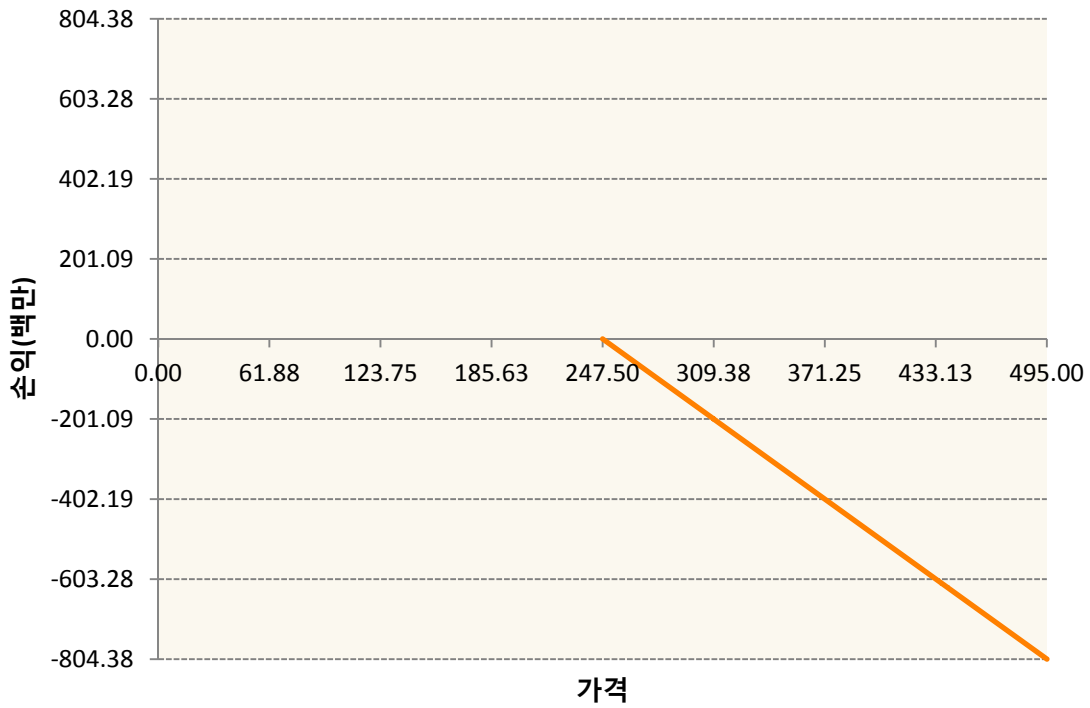


KR4201Q52452-2020-05 콜245

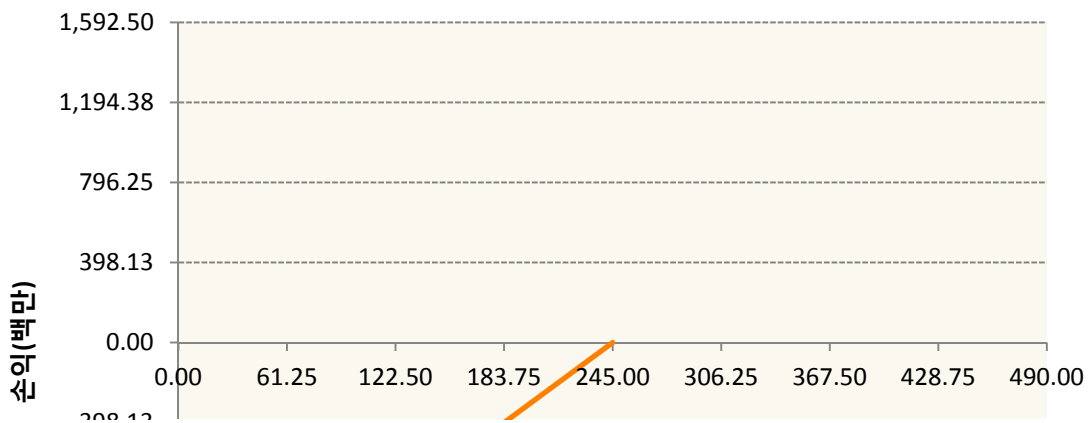




KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						188
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-188	-188	-188	-188	-188	-188	-188	
-5.33%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125	
-2.67%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	63	63	63	63	63	63	63	
5.33%	125	125	125	125	125	125	125	
8.00%	188	188	188	188	188	188	188	
KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						130
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130	
-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%	130	130	130	130	130	130	130	
KR4201Q52452		2020-05 콜245						53
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	37	34	32	29	26	23	21	
-5.33%	30	27	24	21	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	-13	-17	-20	-23	
5.33%	-20	-23	-26	-28	-31	-34	-37	
8.00%	-38	-40	-42	-45	-48	-50	-53	
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5						52
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	34	32	30	27	24	22	19
-5.33%	29	26	23	20	17	14	11
-2.67%	20	17	14	11	8	4	1
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	-3	-6	-9	-13	-16	-19	-22
5.33%	-18	-21	-24	-27	-30	-33	-36
8.00%	-35	-38	-40	-43	-46	-49	-52
KR4301Q52450 2020-05 풋245							87
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-65	-68	-71	-75	-79	-83	-87
-5.33%	-32	-36	-41	-45	-50	-54	-59
-2.67%	-5	-10	-15	-20	-25	-30	-35
0%	15	10	5	0	-5	-10	-15
2.67%	29	25	20	15	11	6	1
5.33%	38	34	31	27	23	18	14
8.00%	43	41	38	35	31	28	24

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

(단위:백만원)

544

공시일	2020-04-22
기준일	2020-04-21

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

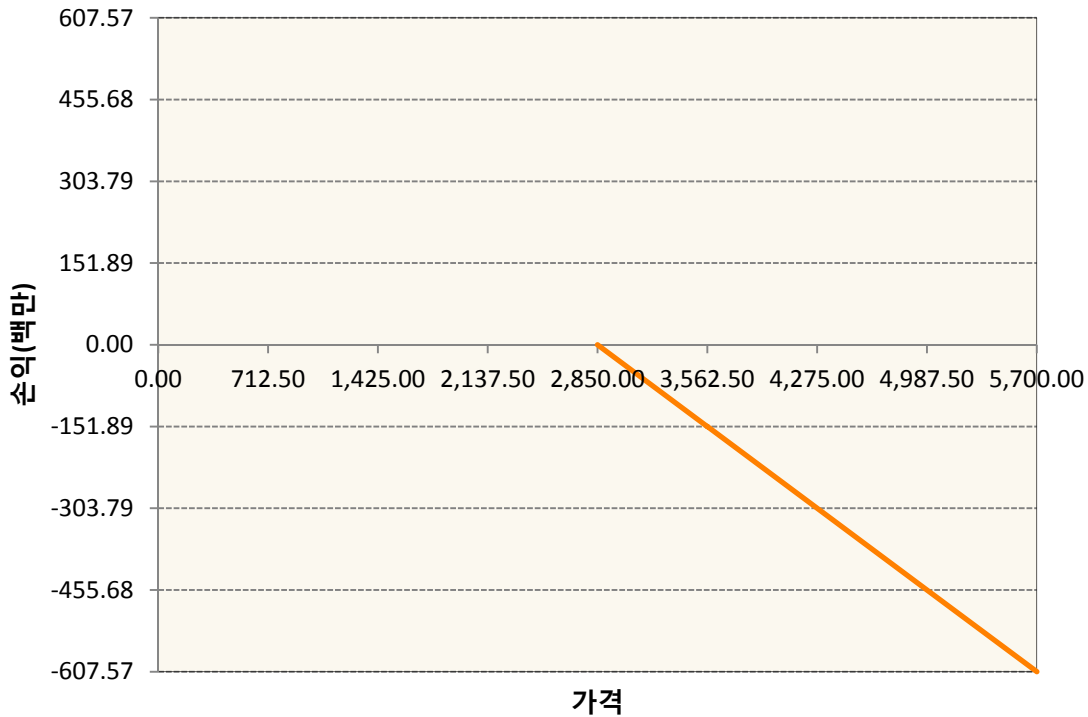
1. 계약금액

(단위:백만원)

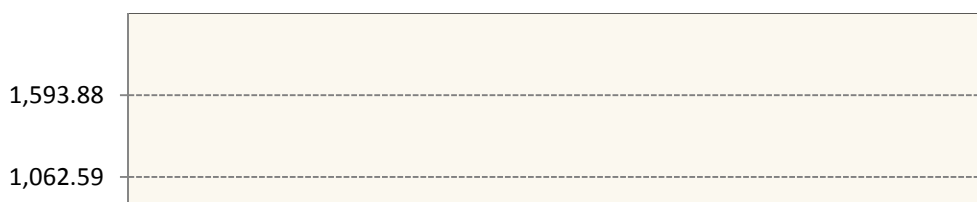
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	464	0	464	
누계	유가증권	스왑	7,947	0	7,947	장외
누계	유가증권	옵션	0	5,466	-5,466	장내
누계	통화	선도	0	2,697	-2,697	장외

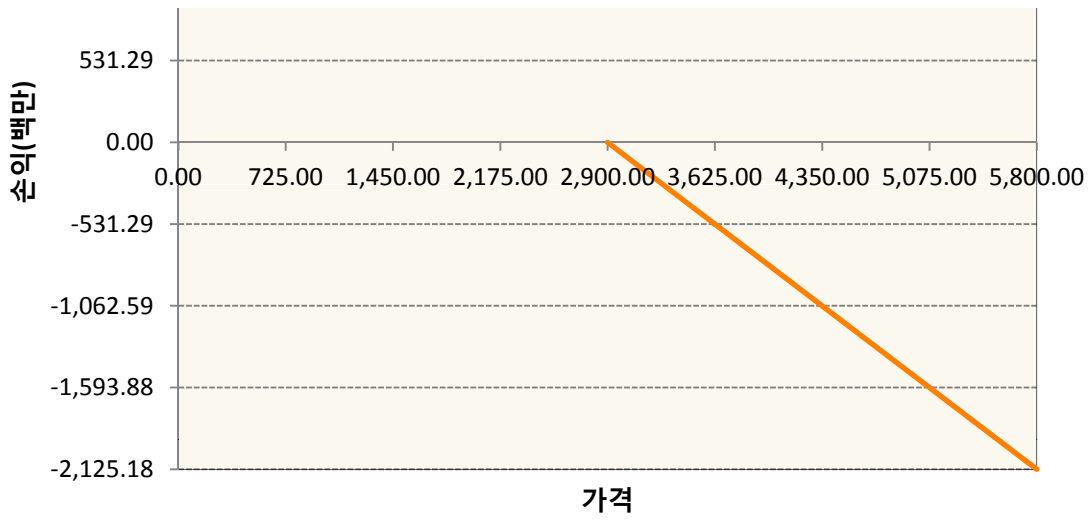
2. 만기시점의 손익구조

OESXK0-C2850-EURO STOXX 50

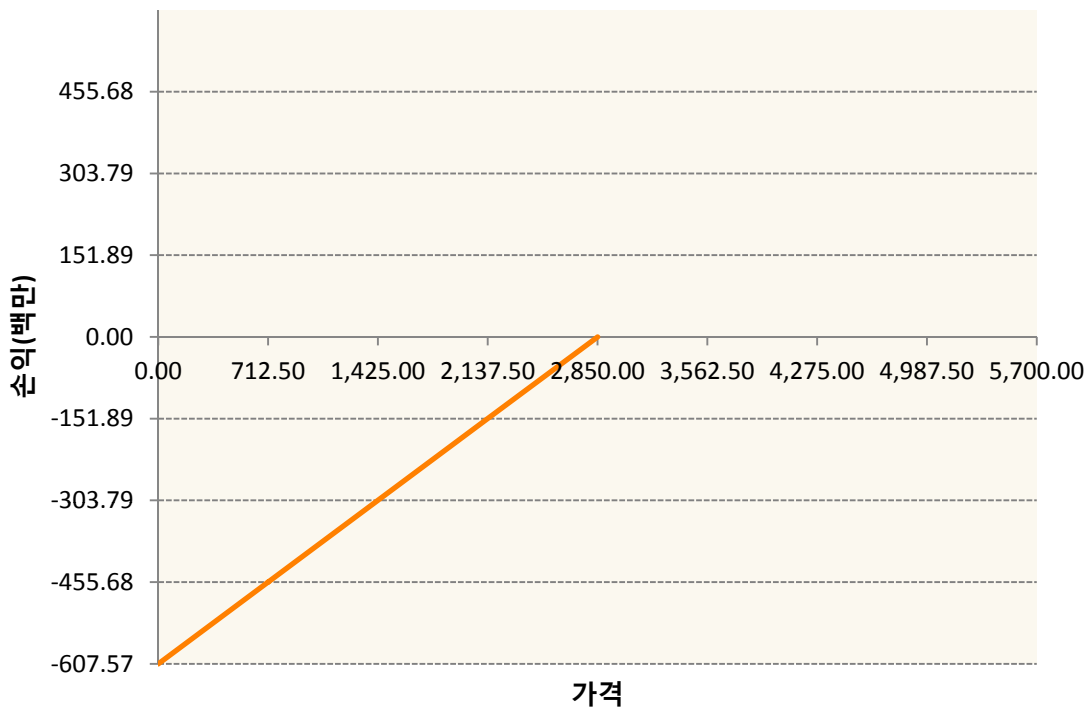


OESXK0-C2900-EURO STOXX 50

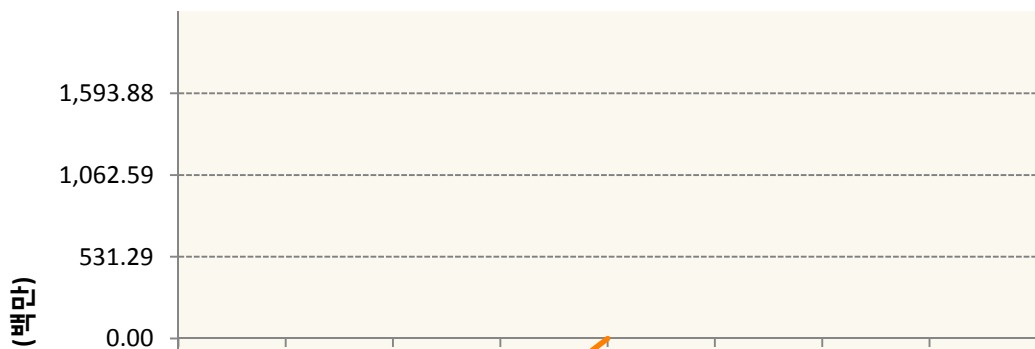


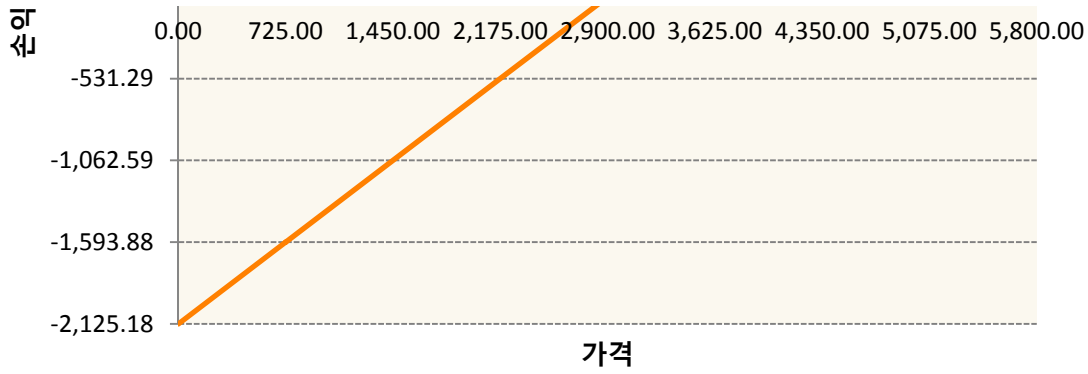


OESXK0-P2850-EURO STOXX 50

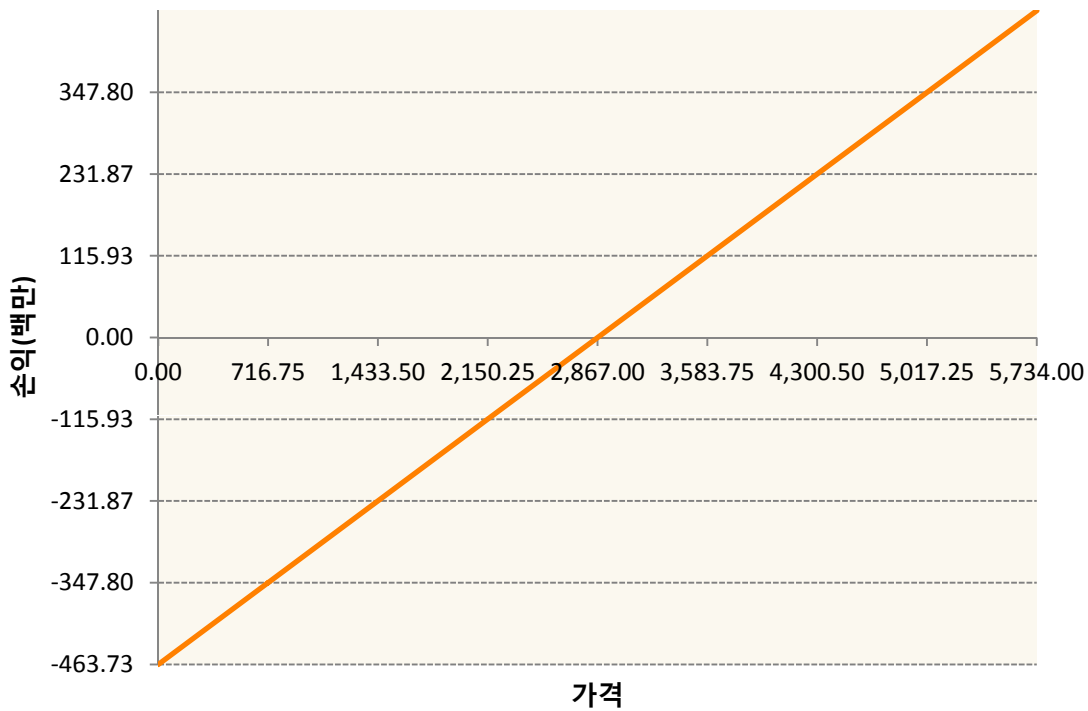


OESXK0-P2900-EURO STOXX 50





VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	3
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E	216
OESXK0-C28 EURO STOXX 50	49
OESXK0-C29 EURO STOXX 50	170
OESXK0-P28 EURO STOXX 50	49
OESXK0-P29 EURO STOXX 50	170
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20	37

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

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

(단위:백만원)

1,105

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

(단위:백만원)

96

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

(단위:백만원)

140

공시일	2020-04-22
기준일	2020-04-21

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

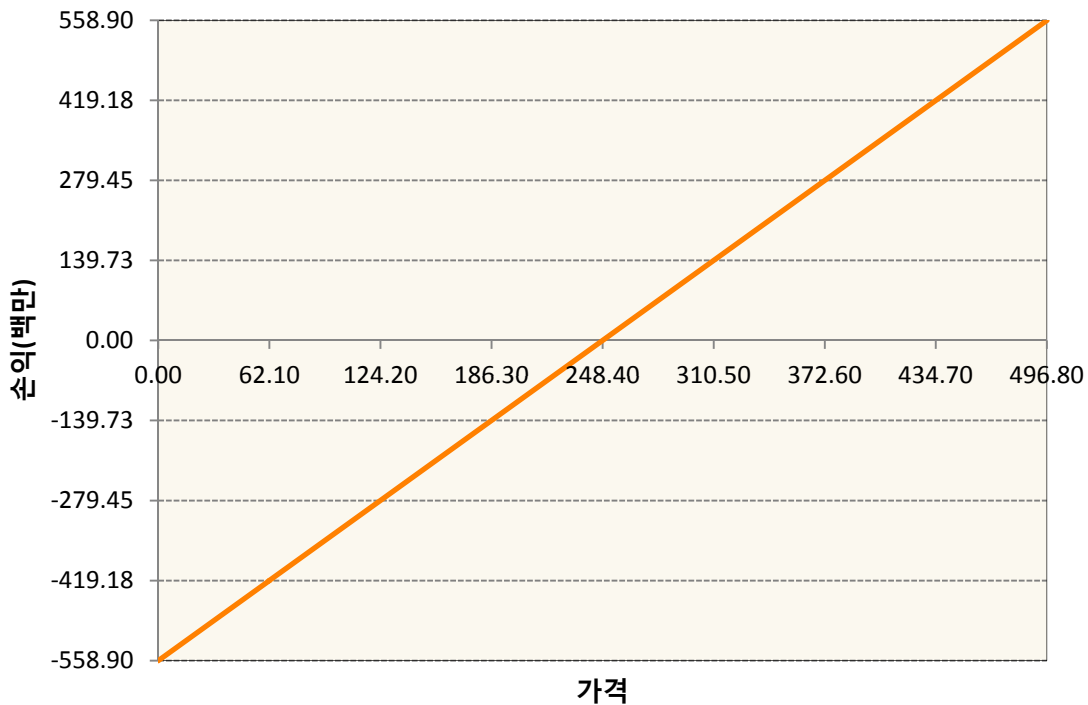
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	559	0	559	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)

66

공시일	2020-04-22
기준일	2020-04-21

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

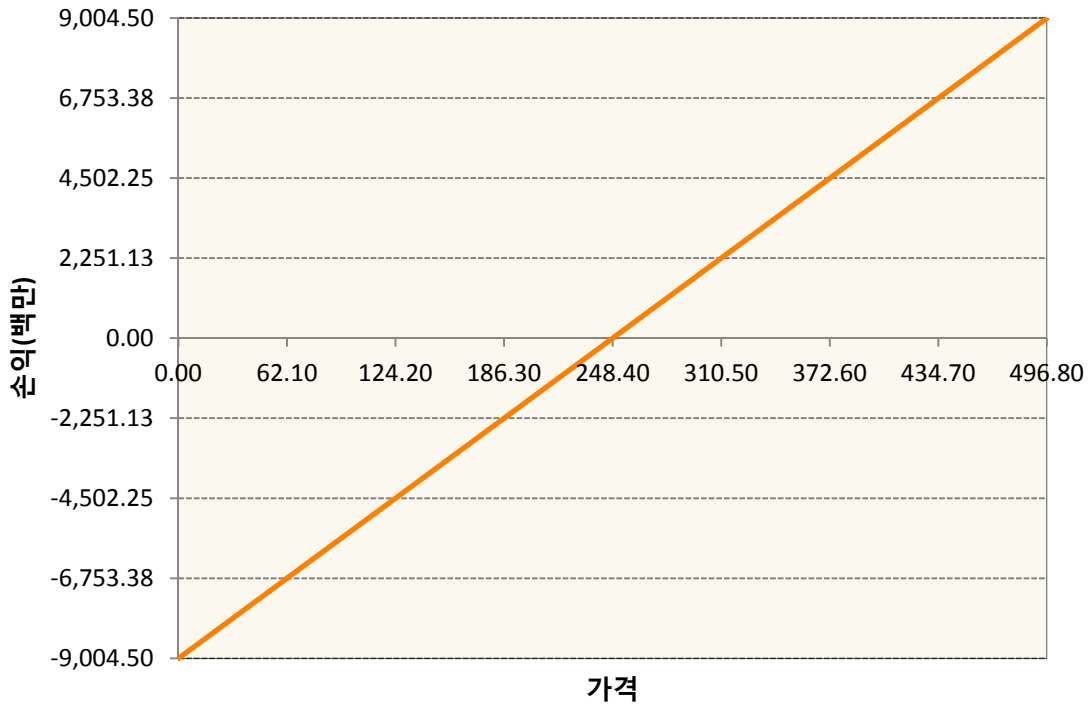
1. 계약금액

(단위:백만원)

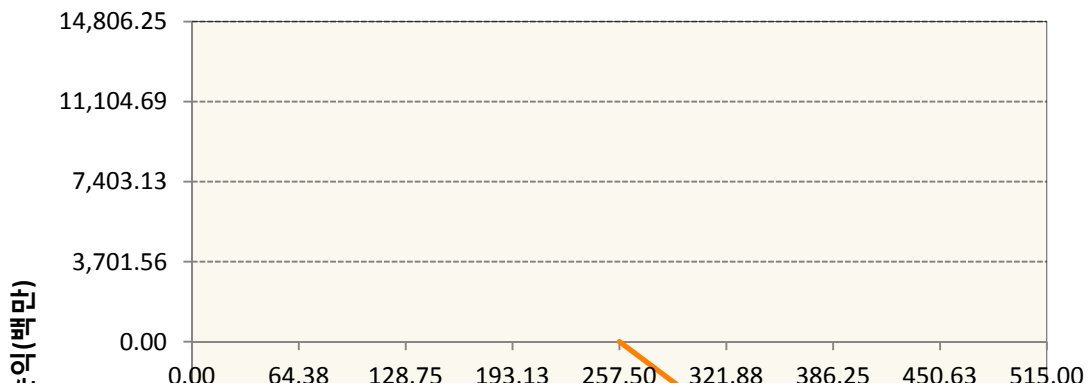
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,005	0	9,005	장내
누계	유가증권	옵션	6,201	17,536	-11,335	장내

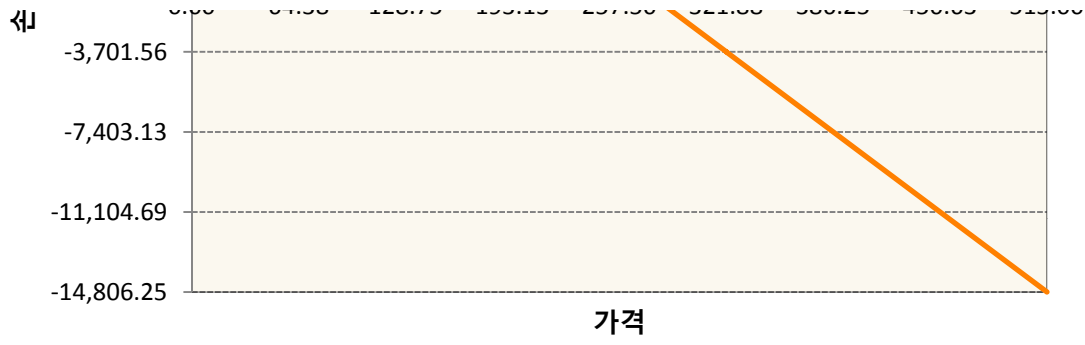
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

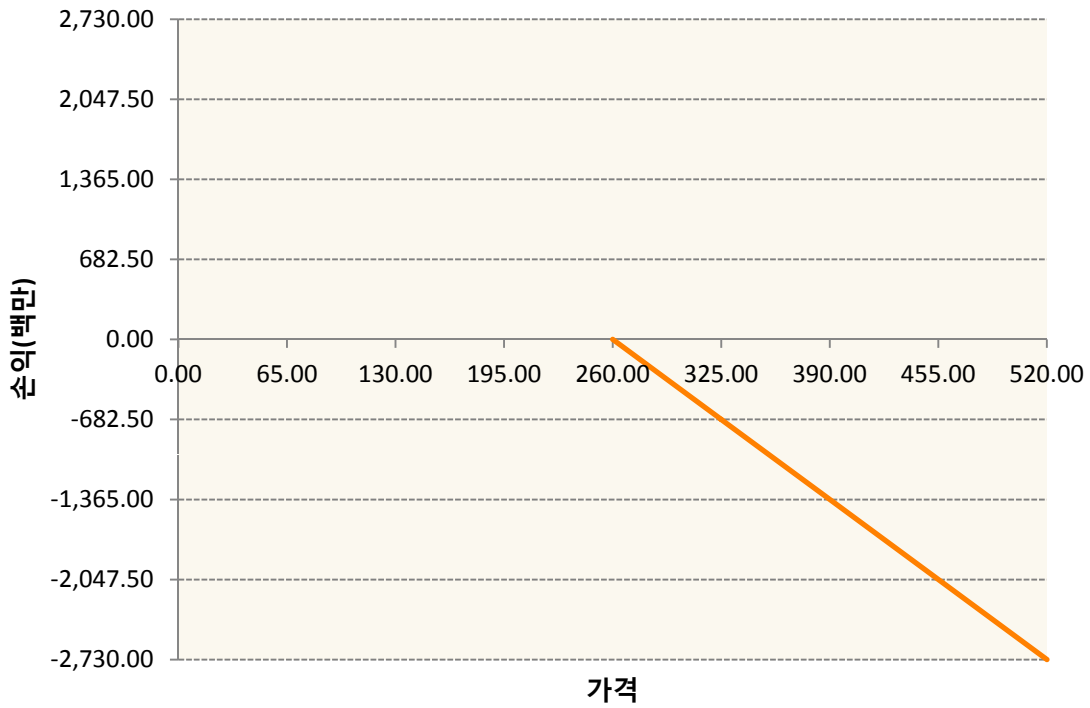


KR4201Q52577-2020-05 콜257.5

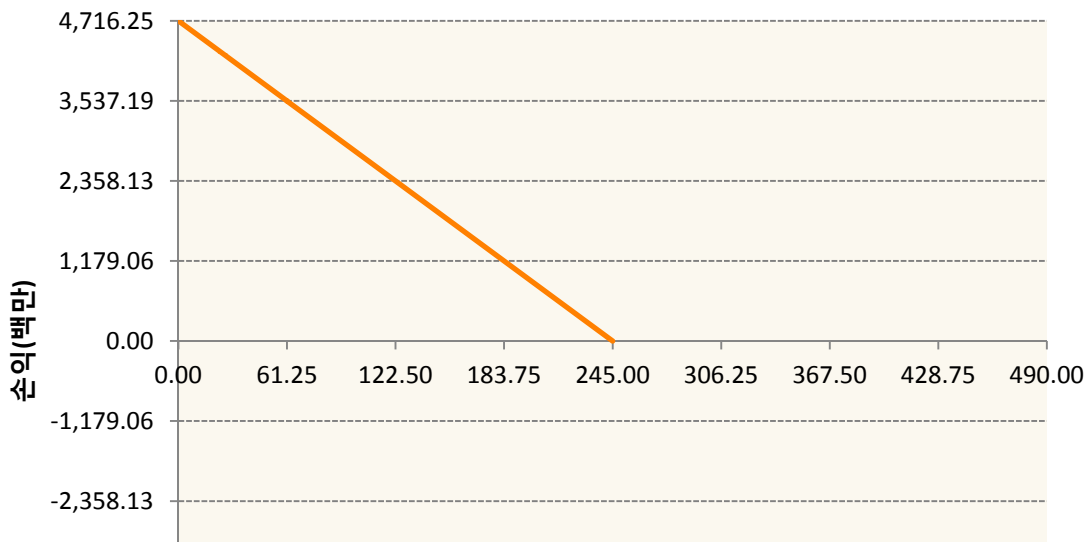


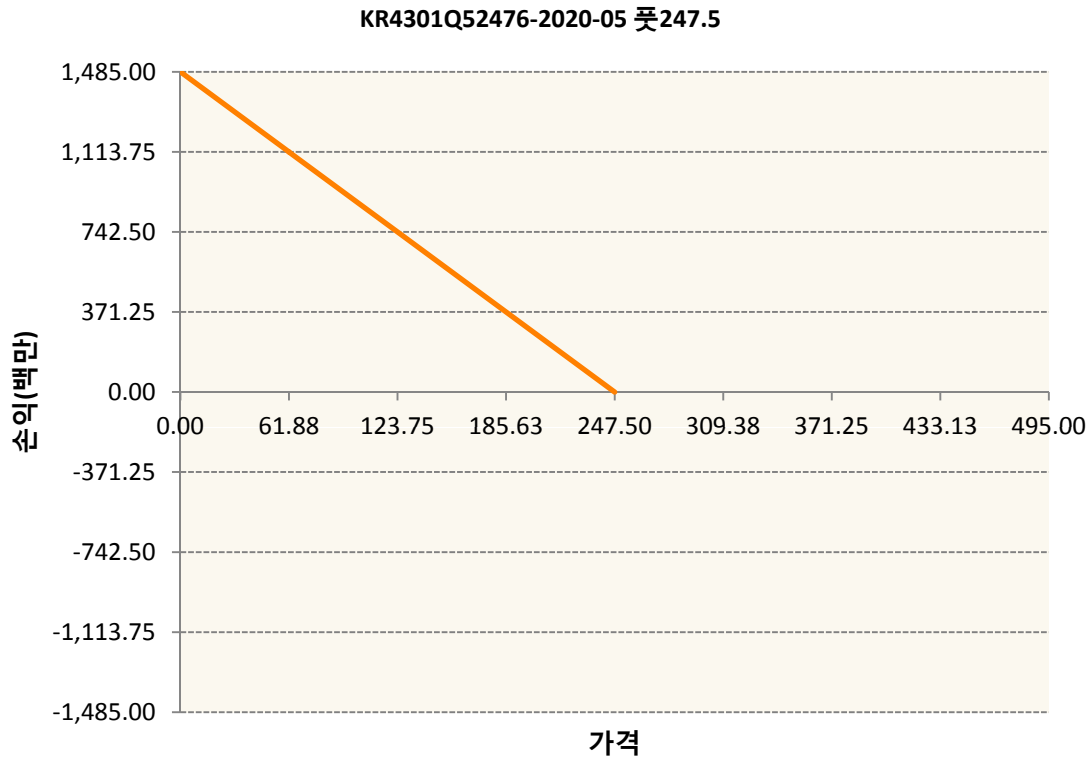
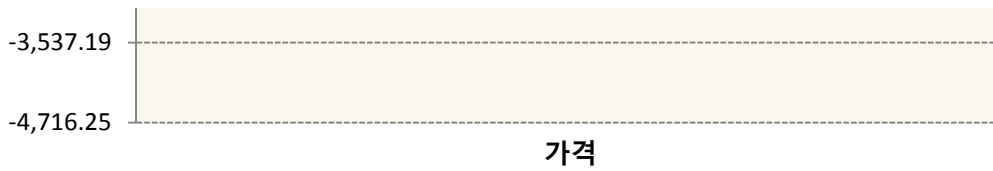


KR4201Q52601-2020-05 콜260



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						723
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-723	-723	-723	-723	-723	-723	-723	
-5.33%	-482	-482	-482	-482	-482	-482	-482	
-2.67%	-241	-241	-241	-241	-241	-241	-241	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	241	241	241	241	241	241	241	
5.33%	482	482	482	482	482	482	482	
8.00%	723	723	723	723	723	723	723	
KR4201Q52577		2020-05 콜257.5						800
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	439	410	378	343	305	264	222	
-5.33%	382	343	302	257	211	164	115	
-2.67%	295	247	196	144	91	38	-17	

0%	171	115	57	0	-58	-116	-174
2.67%	5	-55	-116	-176	-237	-297	-357
5.33%	-203	-263	-324	-384	-445	-506	-566
8.00%	-451	-508	-565	-623	-681	-740	-800
KR4201Q52601 2020-05 콜260							140
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	73	68	63	57	51	44	36
-5.33%	64	58	51	43	35	27	18
-2.67%	51	42	33	24	15	5	-4
0%	30	20	10	0	-10	-21	-31
2.67%	3	-8	-19	-30	-41	-52	-63
5.33%	-32	-43	-55	-66	-77	-88	-99
8.00%	-75	-86	-96	-107	-118	-129	-140
KR4301Q52450 2020-05 풋245							258
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	191	201	211	222	234	246	258
-5.33%	95	107	121	134	148	161	175
-2.67%	16	30	45	60	74	89	104
0%	-44	-29	-15	0	15	30	44
2.67%	-86	-73	-59	-46	-32	-18	-4
5.33%	-112	-102	-91	-79	-67	-55	-42
8.00%	-127	-120	-112	-103	-93	-82	-71
KR4301Q52476 2020-05 풋247.5							85
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	65	68	71	74	77	81	85
-5.33%	34	37	41	45	49	53	57
-2.67%	7	11	16	20	25	29	34
0%	-14	-9	-5	0	5	9	14
2.67%	-29	-25	-20	-16	-11	-7	-2
5.33%	-39	-35	-32	-28	-24	-20	-15
8.00%	-45	-42	-39	-36	-33	-29	-26

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

(단위:백만원)

2,015

공시일	2020-04-22
기준일	2020-04-21

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	149,169	0	149,169	

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	2020-04-22
기준일	2020-04-21

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	100,582	0	100,582	

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	2020-04-22
기준일	2020-04-21

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	444,397	0	444,397	
누계	통화	선도	53,492	492,495	-439,003	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,935
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,302
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,968
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,459
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,046
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,046
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,400
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	984
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	984
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,558
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	846
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	738
FX21020H09 USD/KRW 24-04-20E	738
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	492
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,443
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,985
FX21020H11 KRW/USD 11-05-20E	984
FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E	2,951
FX21020J02€ KRW/USD 10-06-20E	1,338
FX21020J027 KRW/USD 22-06-20E	1,515
FX21020J02€ KRW/USD 22-06-20E	1,968

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

21,851

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

(단위:백만원)

191

공시일	2020-04-22
기준일	2020-04-21

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

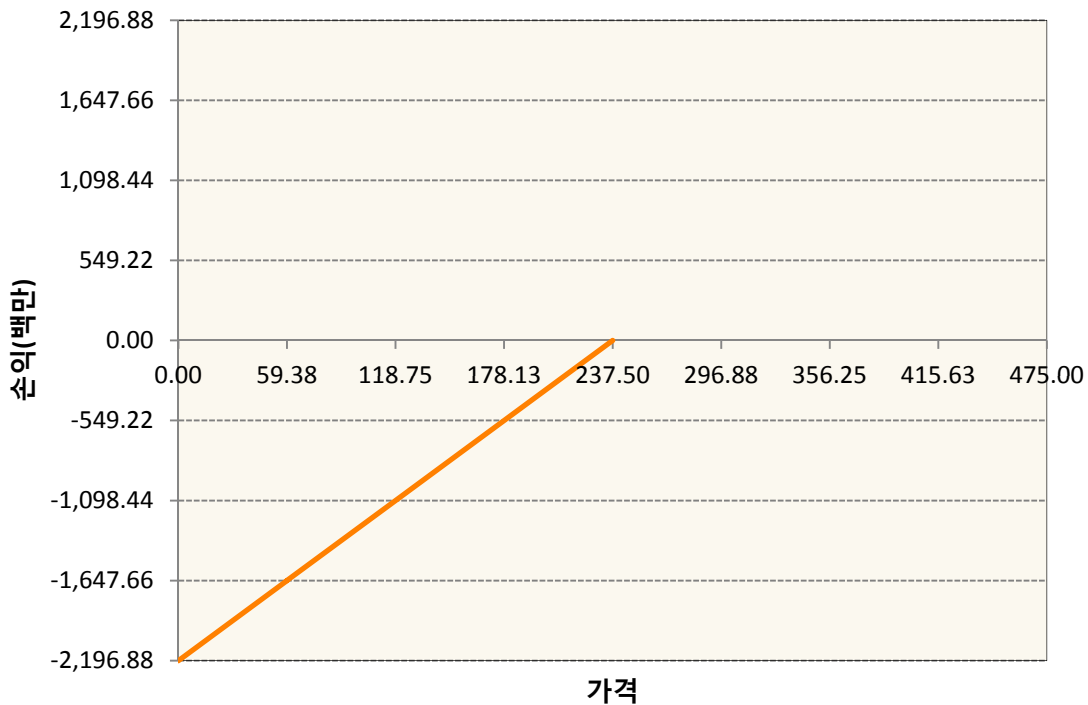
1. 계약금액

(단위:백만원)

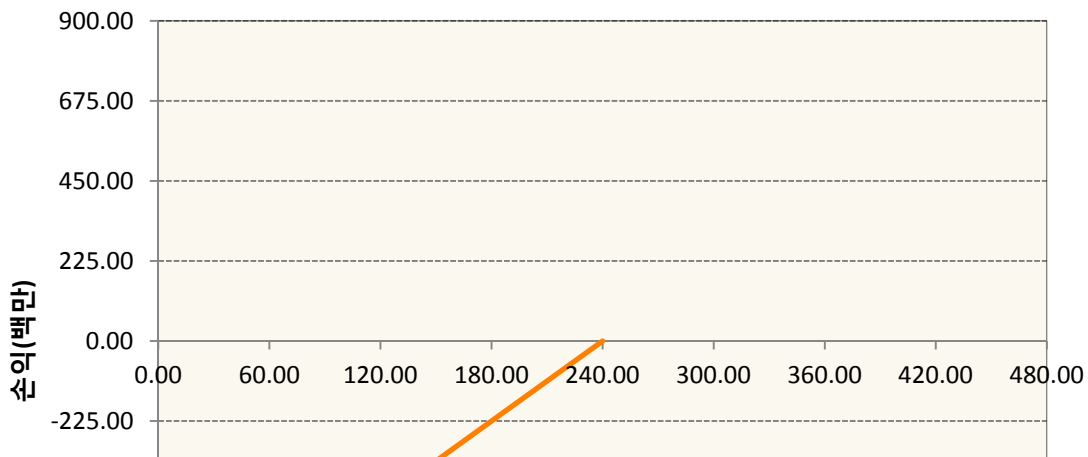
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,097	-3,097	장내

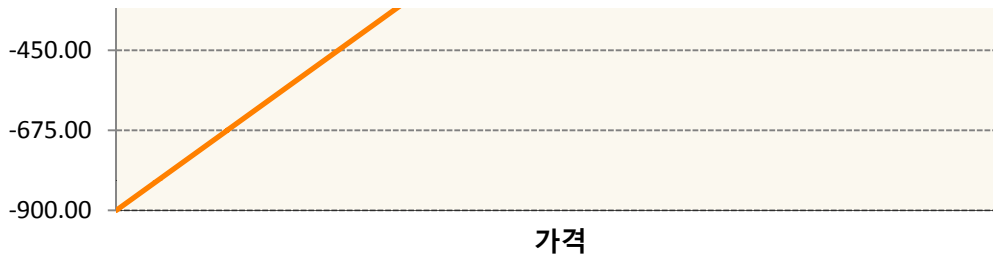
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q52377-2020-05 풋237.5



KR4301Q52401-2020-05 풋240





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q52377		2020-05 풋237.5						103
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-65	-71	-77	-84	-90	-96	-103	
-5.33%	-28	-35	-42	-49	-56	-62	-69	
-2.67%	-1	-7	-14	-21	-28	-35	-42	
0%	18	12	6	0	-6	-13	-19	
2.67%	29	25	20	15	10	4	-2	
5.33%	36	33	29	25	21	16	11	
8.00%	39	37	35	32	29	25	21	
KR4301Q52401		2020-05 풋240						45
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-30	-32	-35	-37	-40	-42	-45	
-5.33%	-14	-16	-19	-22	-25	-27	-30	
-2.67%	-1	-4	-7	-10	-12	-15	-18	
0%	8	5	3	0	-3	-5	-8	
2.67%	14	11	9	7	5	2	0	
5.33%	17	15	14	12	10	8	6	
8.00%	19	18	17	15	14	12	10	

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

117

공시일	2020-04-22
기준일	2020-04-21

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	7,325	0	7,325	
누계	통화	선도	0	7,194	-7,194	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	322
IE00BD8RGM75	*

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

288

공시일	2020-04-22
기준일	2020-04-21

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

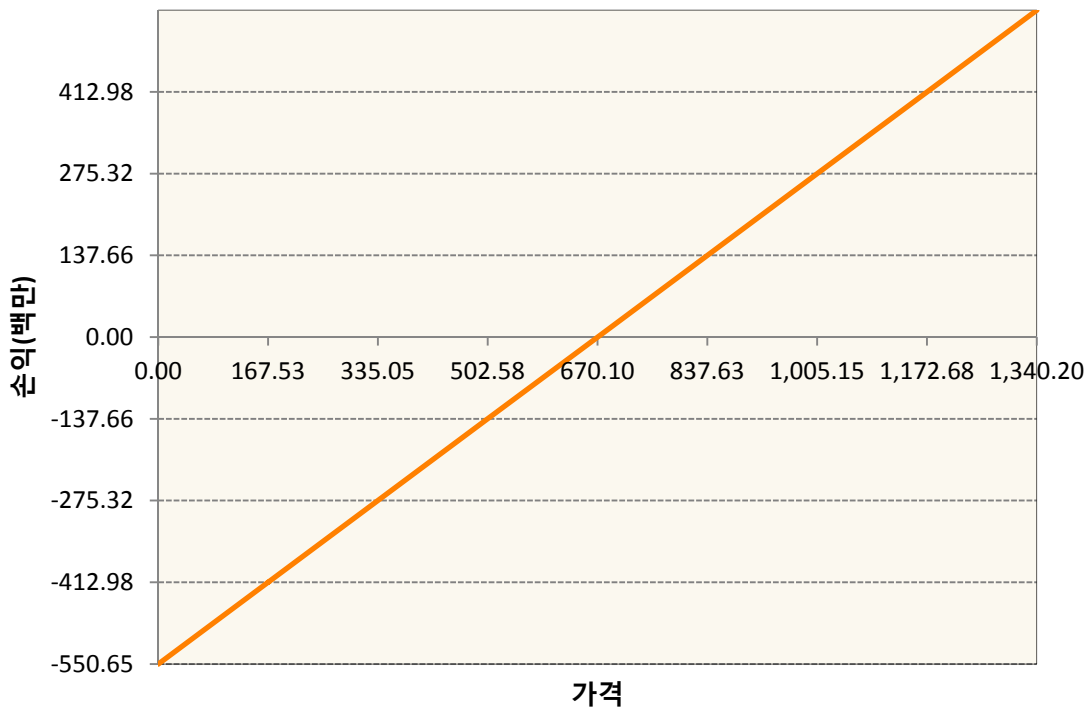
1. 계약금액

(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	551	0	551	
누계	유가증권	스왑	1,099	0	1,099	장외
누계	통화	선도	232	565	-333	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
FX21020J02€ KRW/EUR 24-07-20E	5
FX21020J03₩ KRW/EUR 26-06-20E	5
VNCK0 VN30 Index Future May20	44

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

(단위:백만원)

152

공시일	2020-04-22
기준일	2020-04-21

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

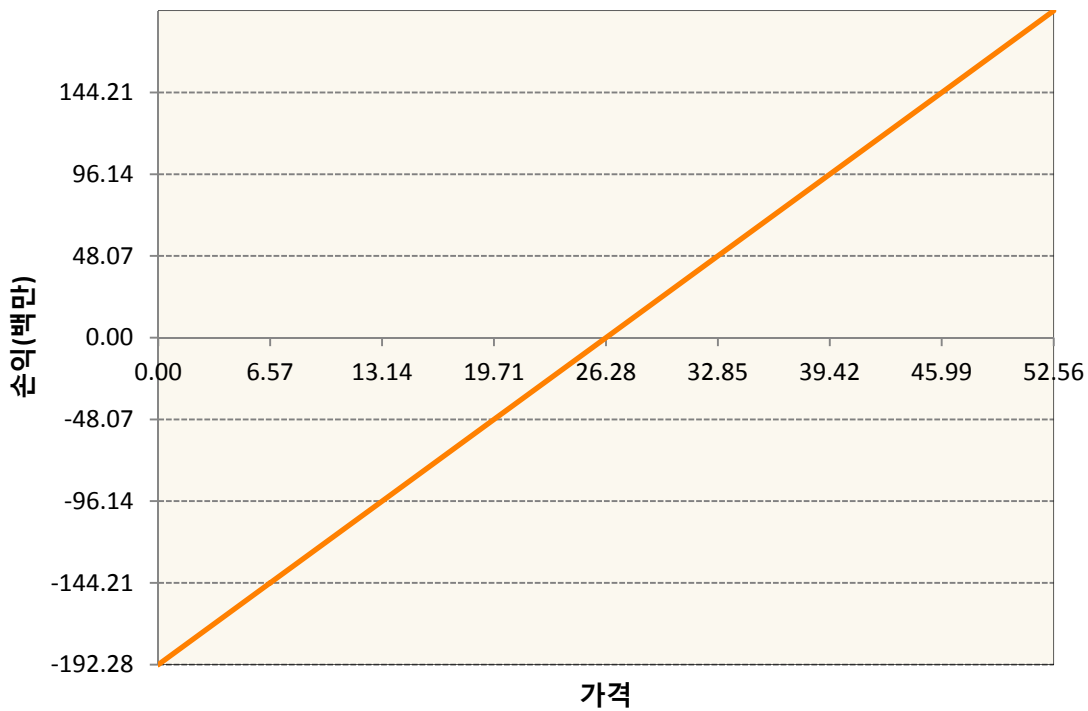
1. 계약금액

(단위:백만원)

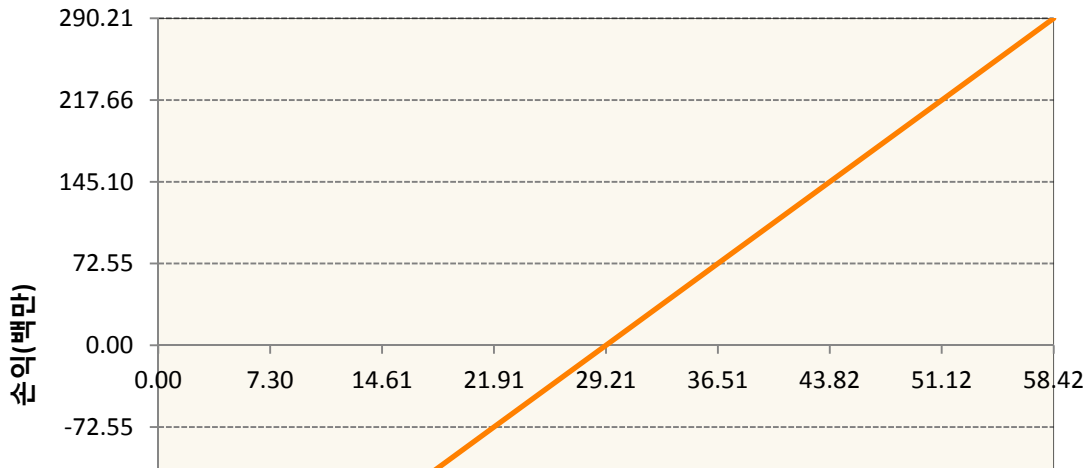
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,552	184	1,367	

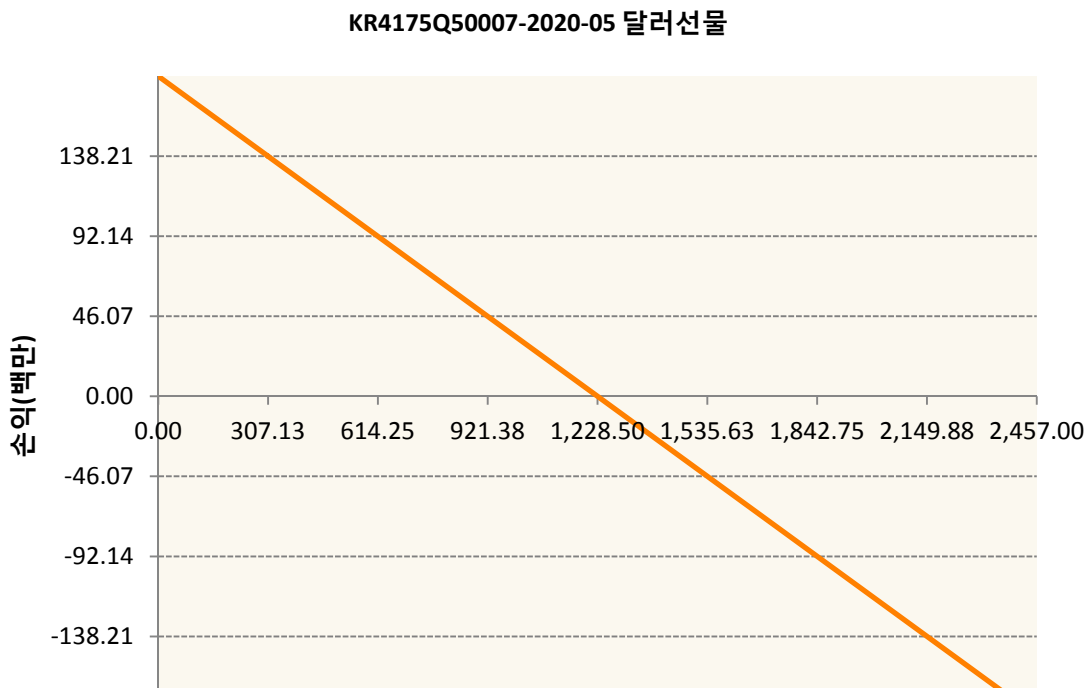
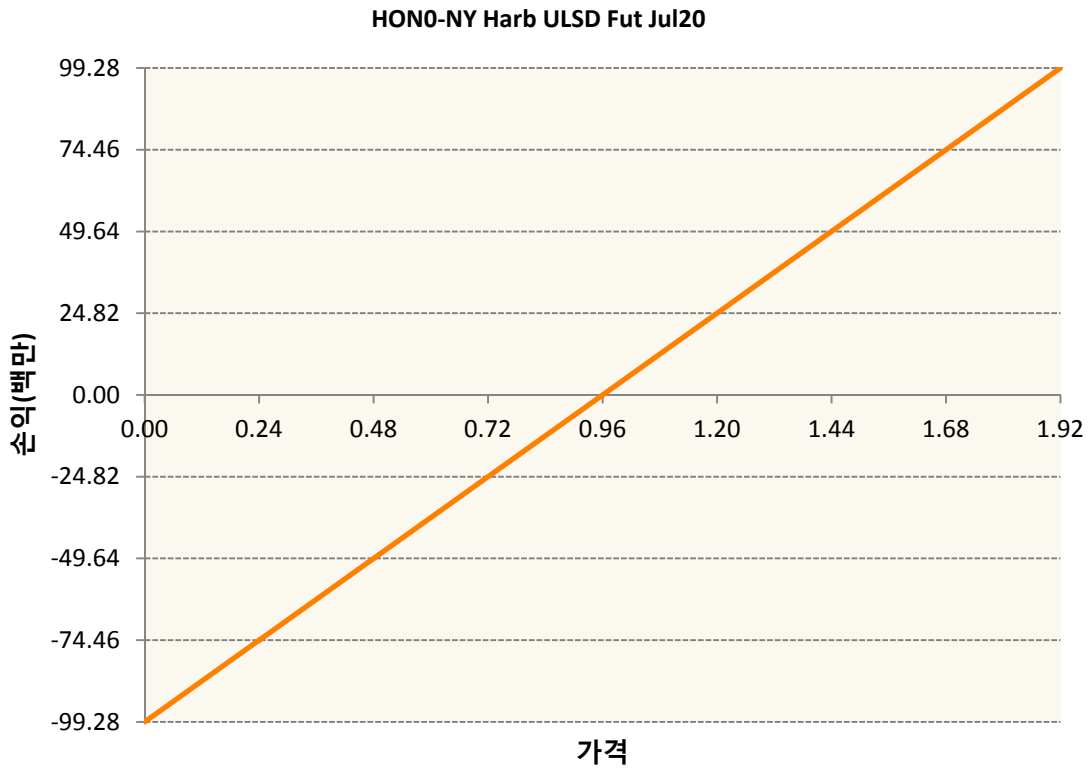
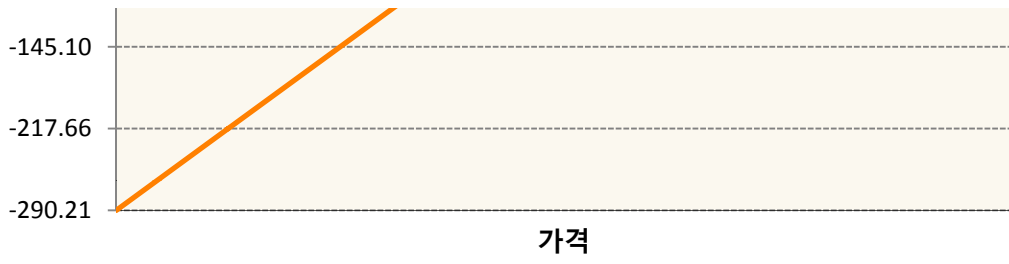
2. 만기시점의 손익구조

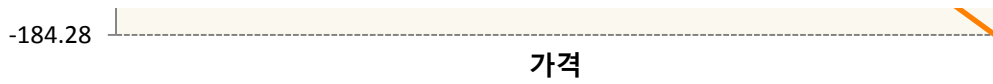
CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20



CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20

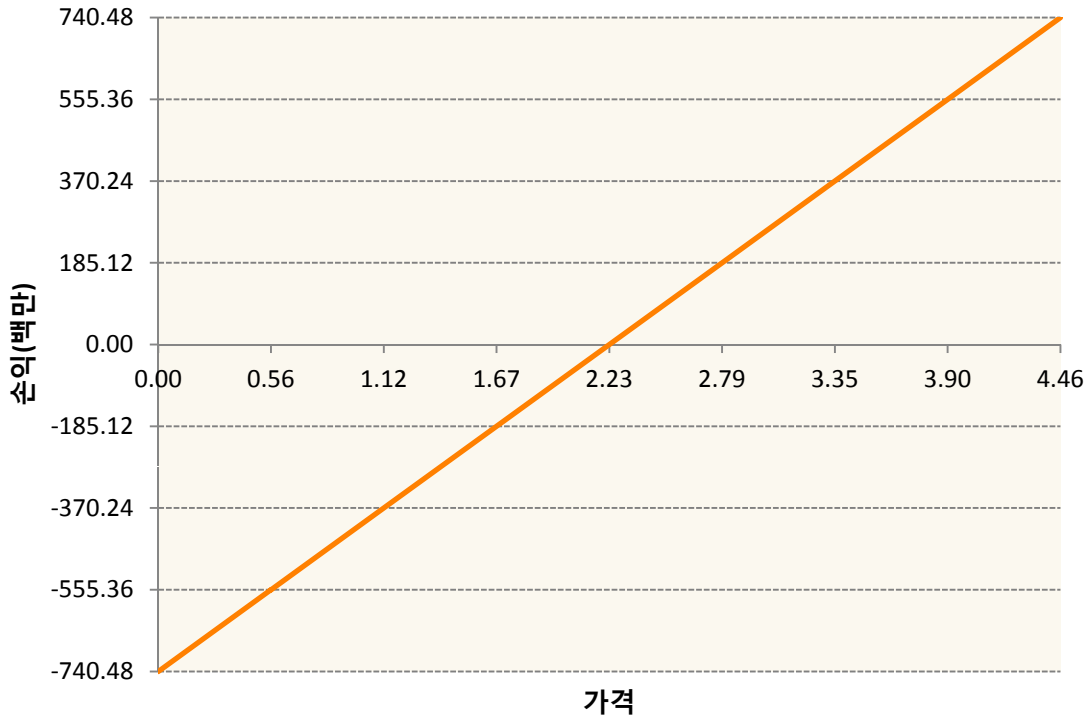






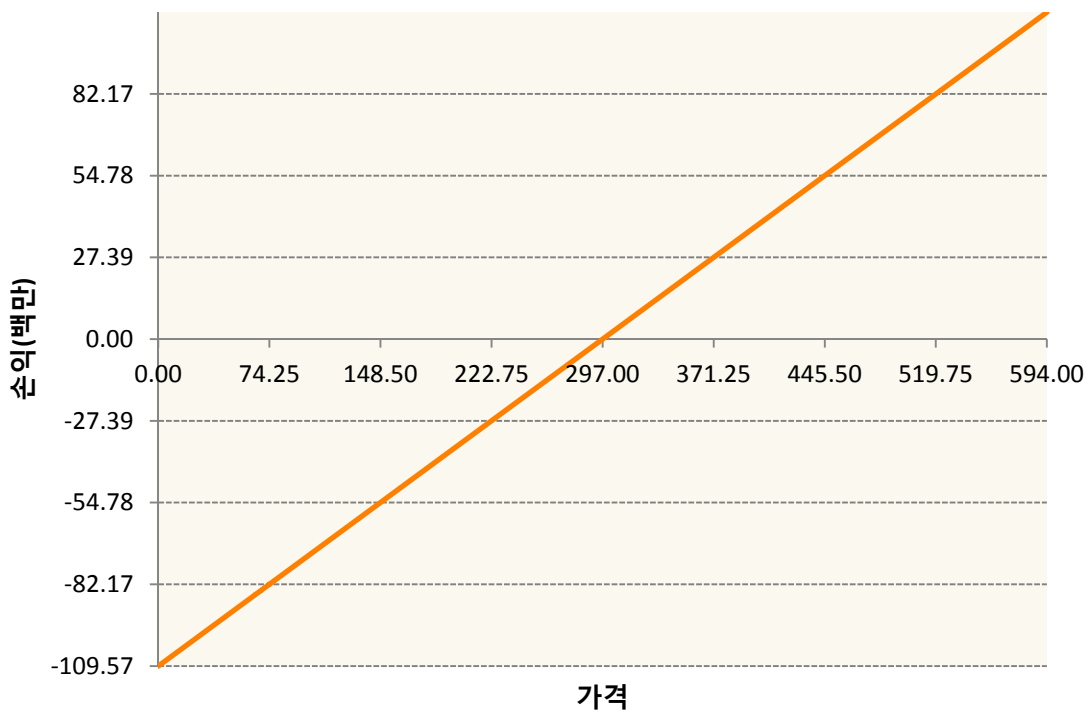
가격

NGN20-NATURAL GAS FUTR Jul20



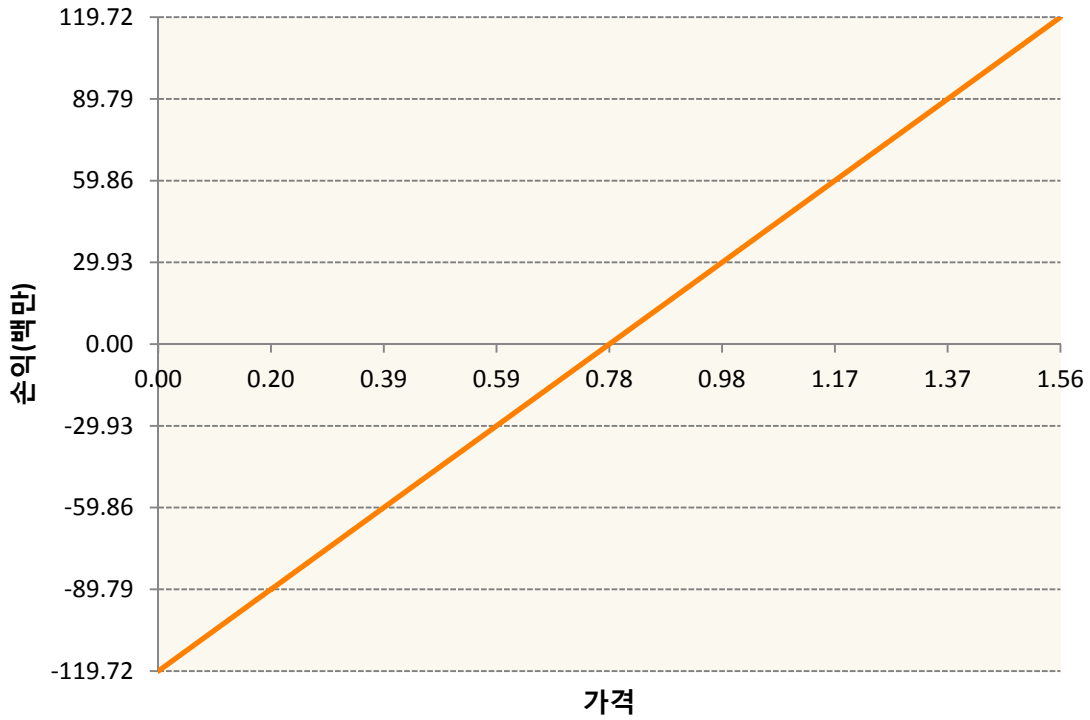
가격

QSN0-Low Su Gasoil G Jul20



가격

XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN0	WTI CRUDE FUTURE Jul20	15
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	23
HON0	NY Harb ULSD Fut Jul20	8
KR4175Q50C	2020-05 달러선물	15
NGN20	NATURAL GAS FUTR Jul20	59
QSN0	Low Su Gasoil G Jul20	9
XBN0	GASOLINE RBOB FUT Jul20	10

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

(단위:백만원)

575

공시일	2020-04-22
기준일	2020-04-21

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

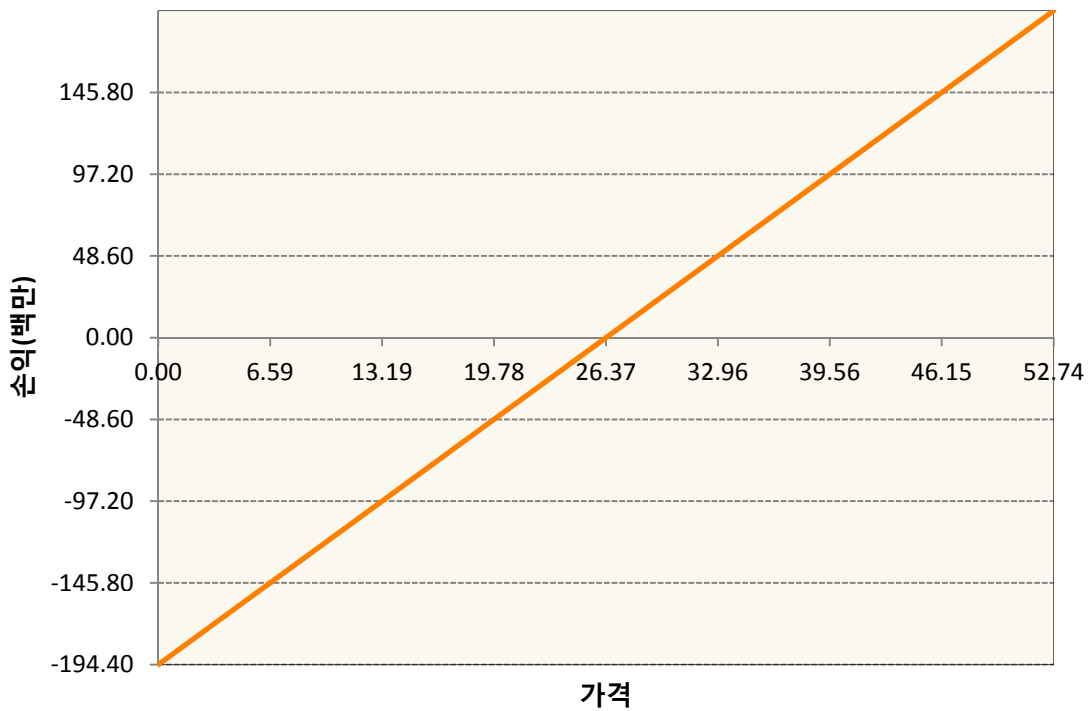
1. 계약금액

(단위:백만원)

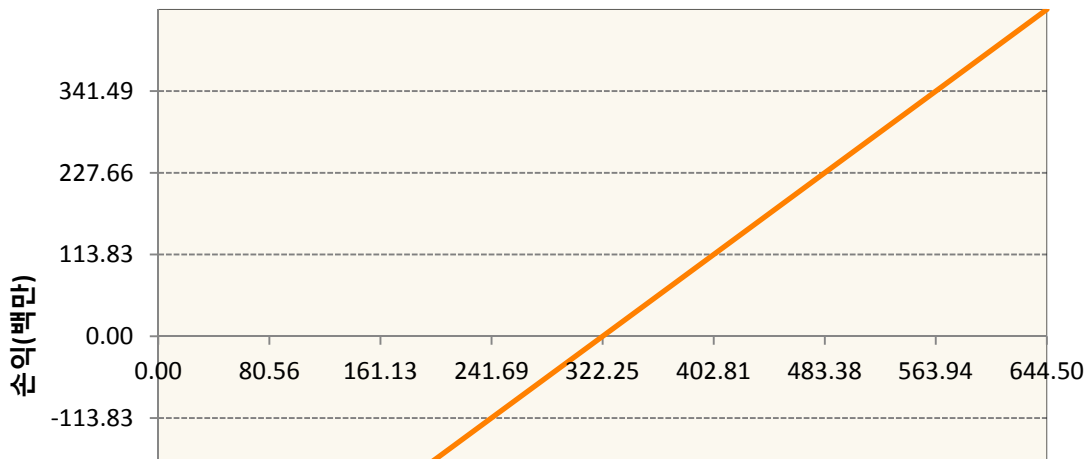
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,397	74	2,324	

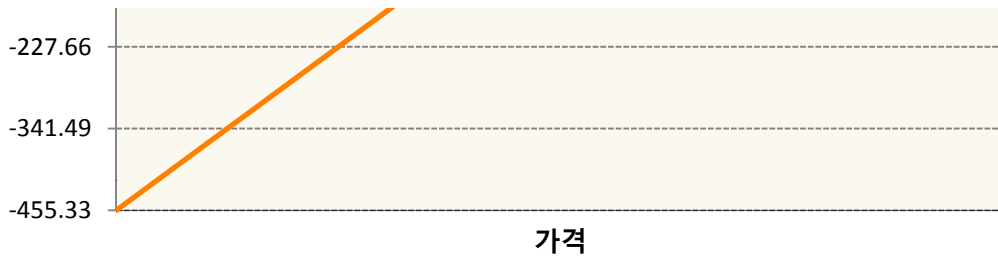
2. 만기시점의 손익구조

BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20

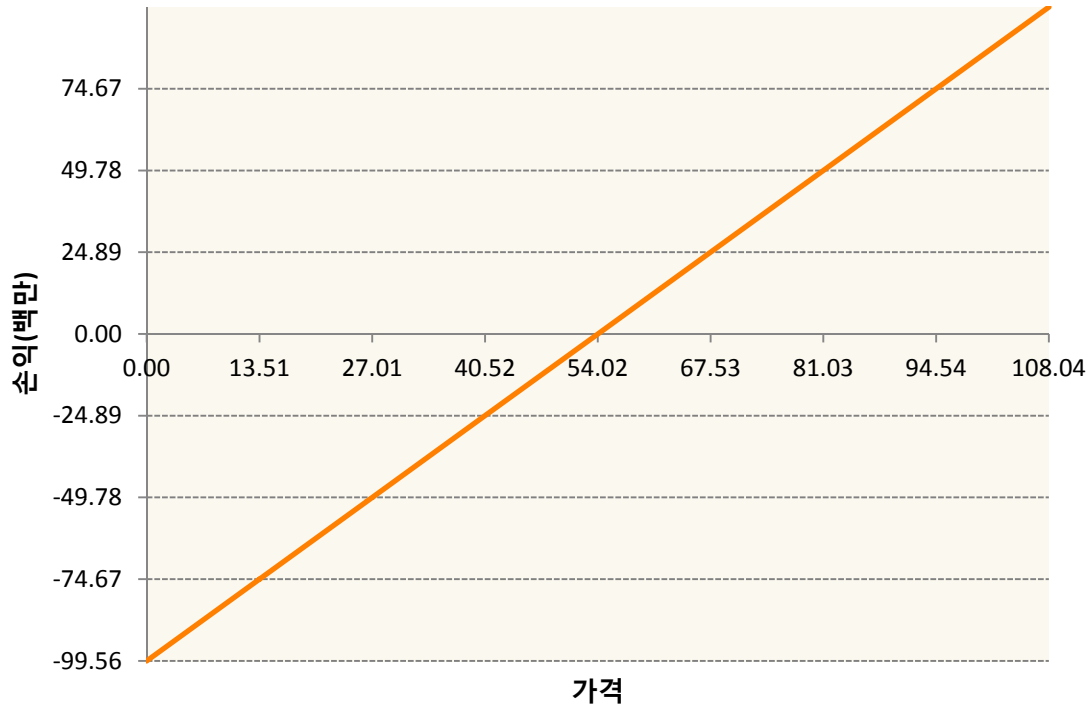


CNO-CORN FUTURE Jul20

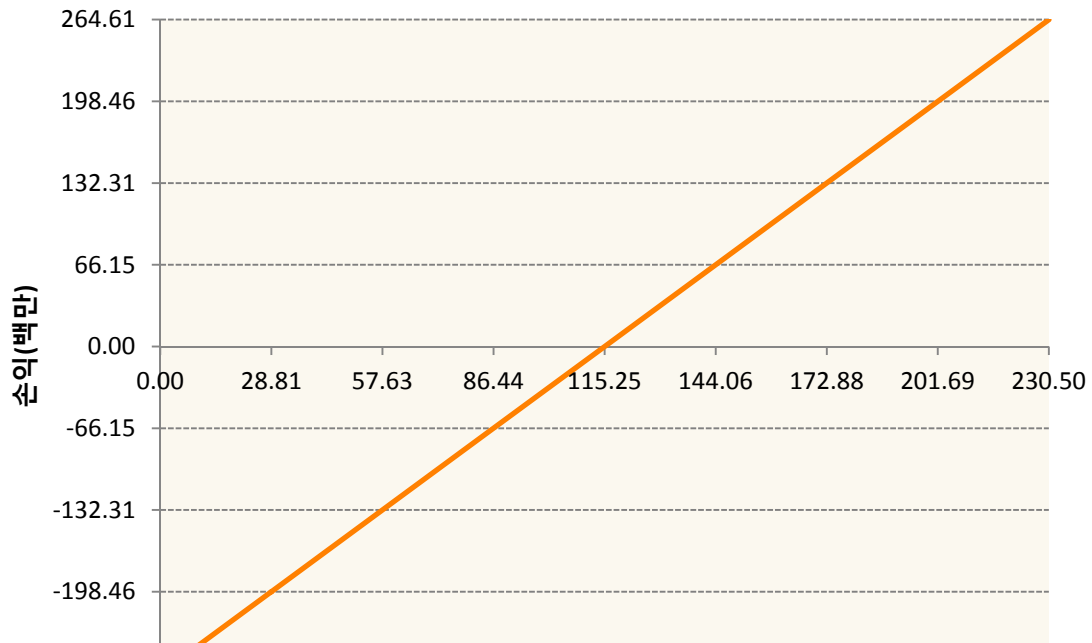


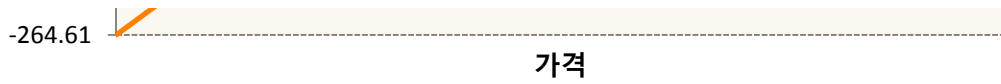


CTN0-COTTON NO.2 FUTR Jul20

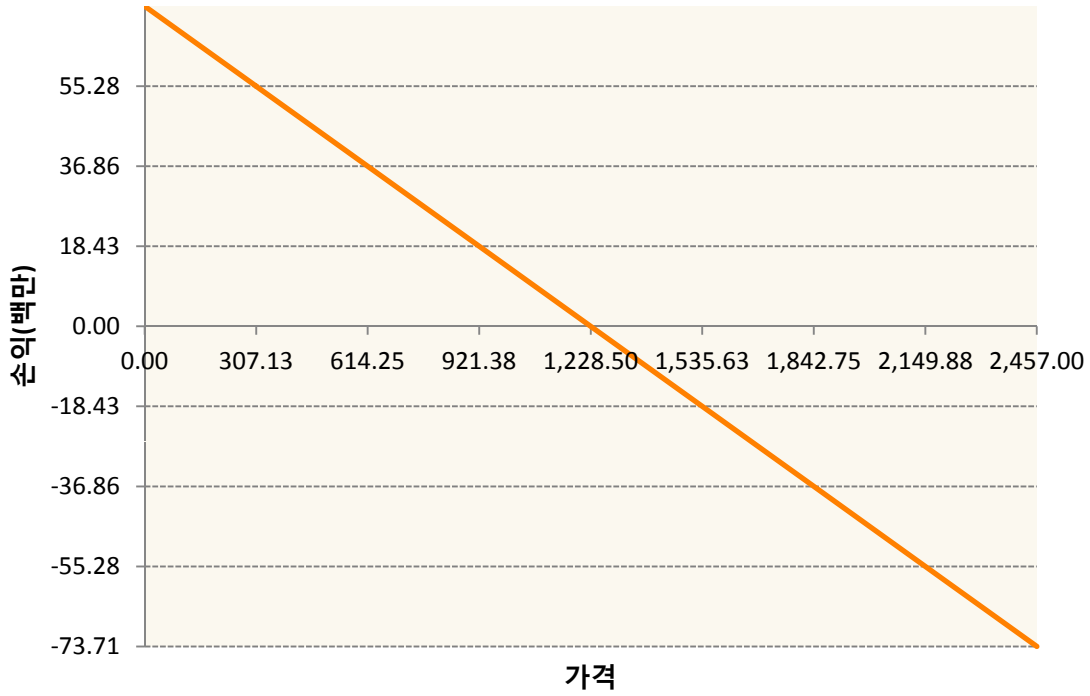


KCN0-COFFEE 'C' FUTURE Jul20

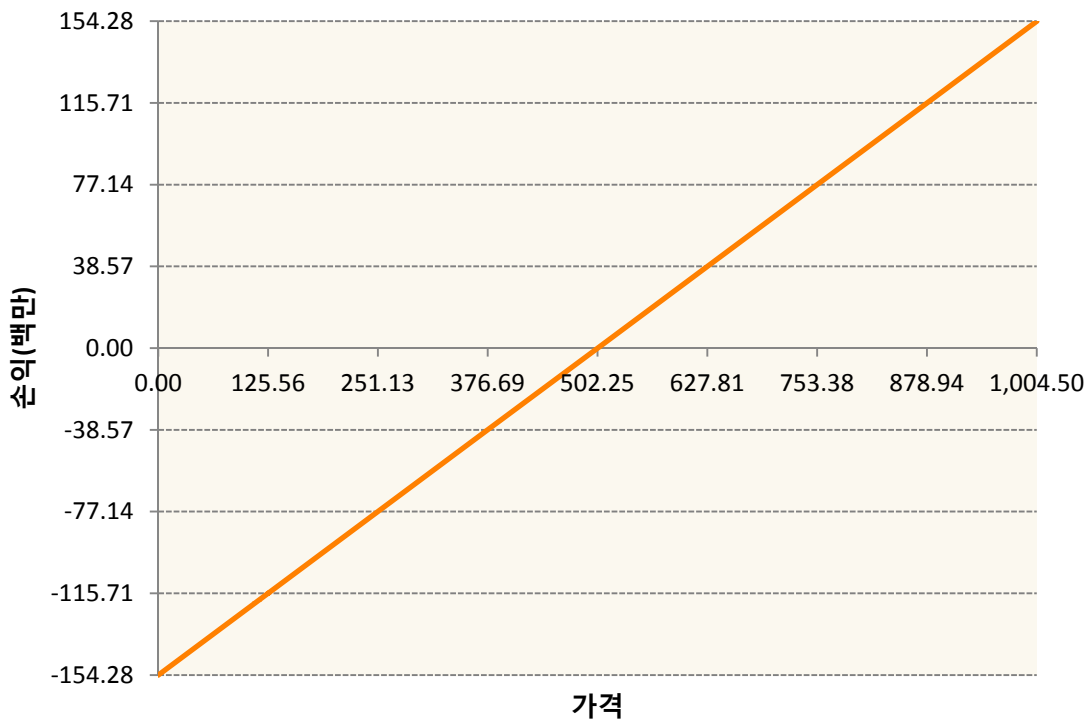




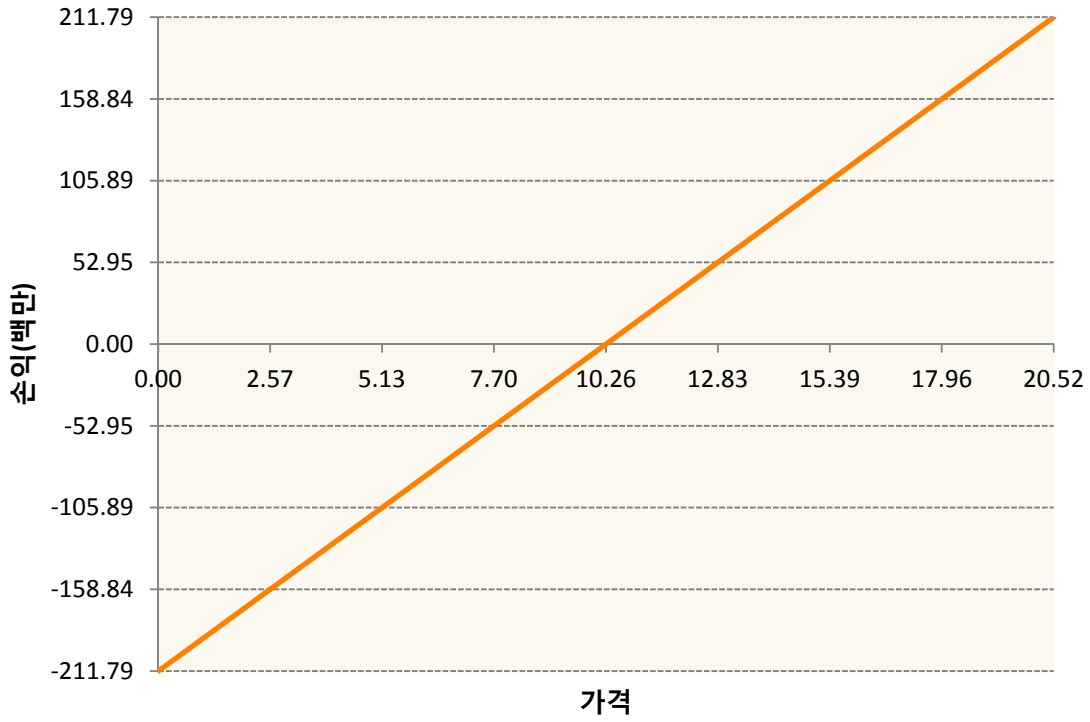
KR4175Q50007-2020-05 달러선물



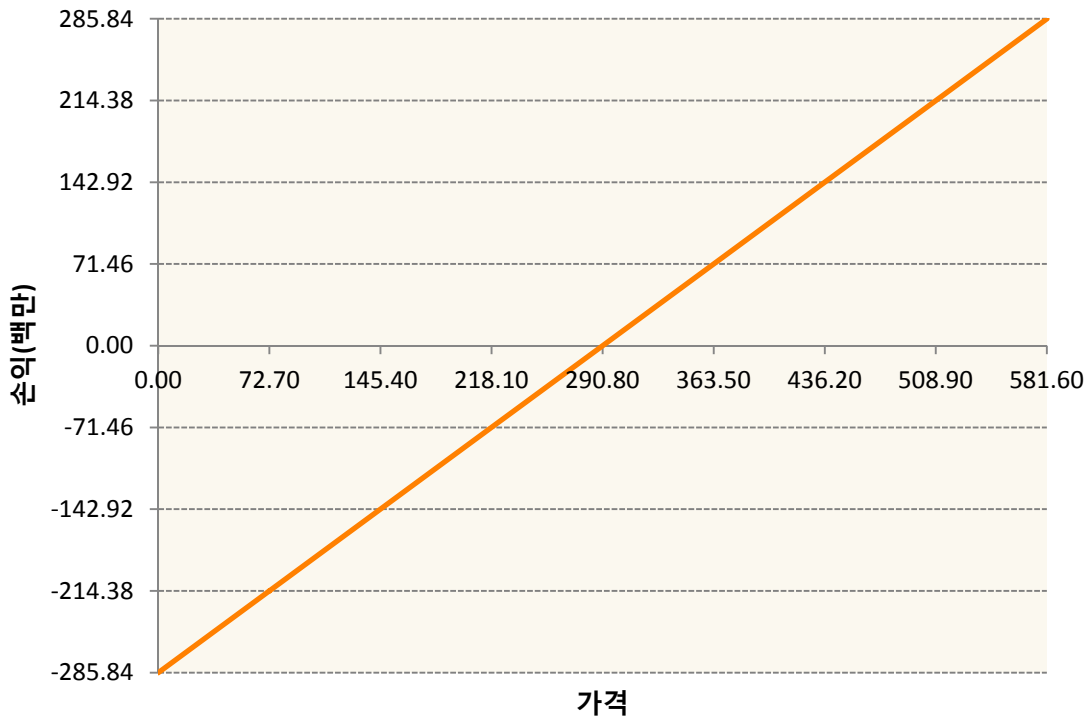
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



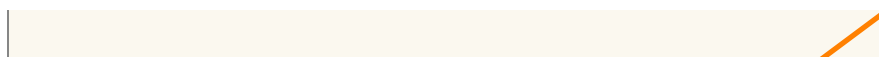
SBN0-Sugar Jul20

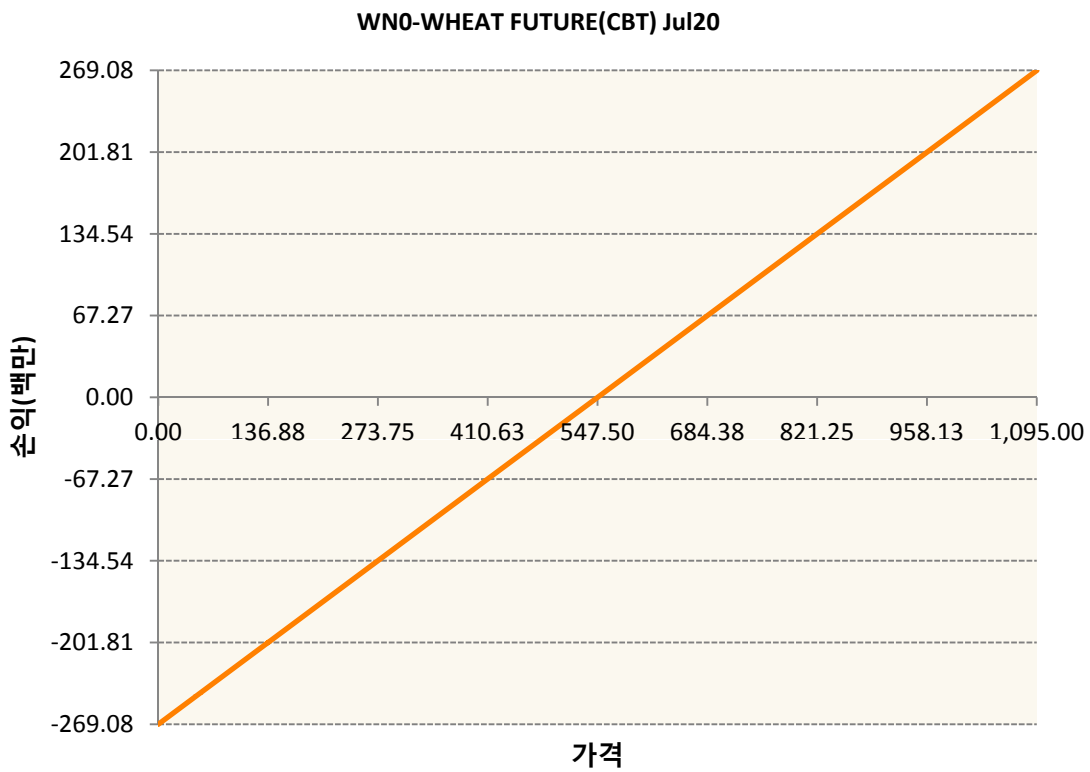
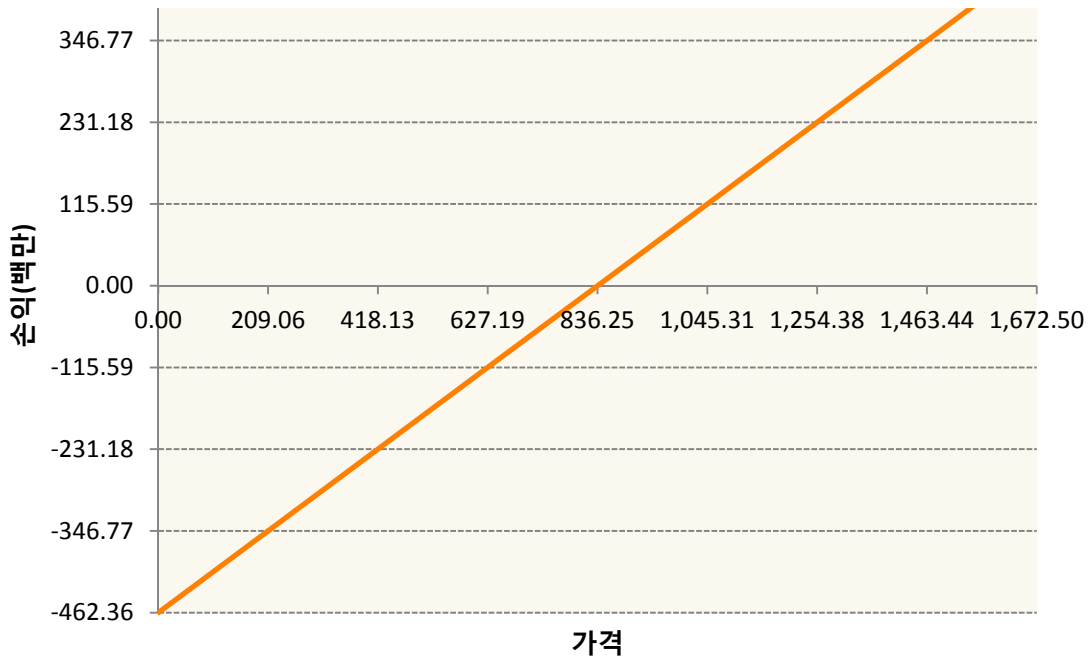


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20



SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BON0	SOYBEAN OIL FUTR Jul20	16
CN0	CORN FUTURE Jul20	36
CTN0	COTTON NO.2 FUTR Jul20	8
KCN0	COFFEE 'C' FUTURE Jul20	21
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	22

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

(단위:백만원)

226