

공시일	2020-04-23
기준일	2020-04-22

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	2020-04-23
기준일	2020-04-22

스마트인덱스모

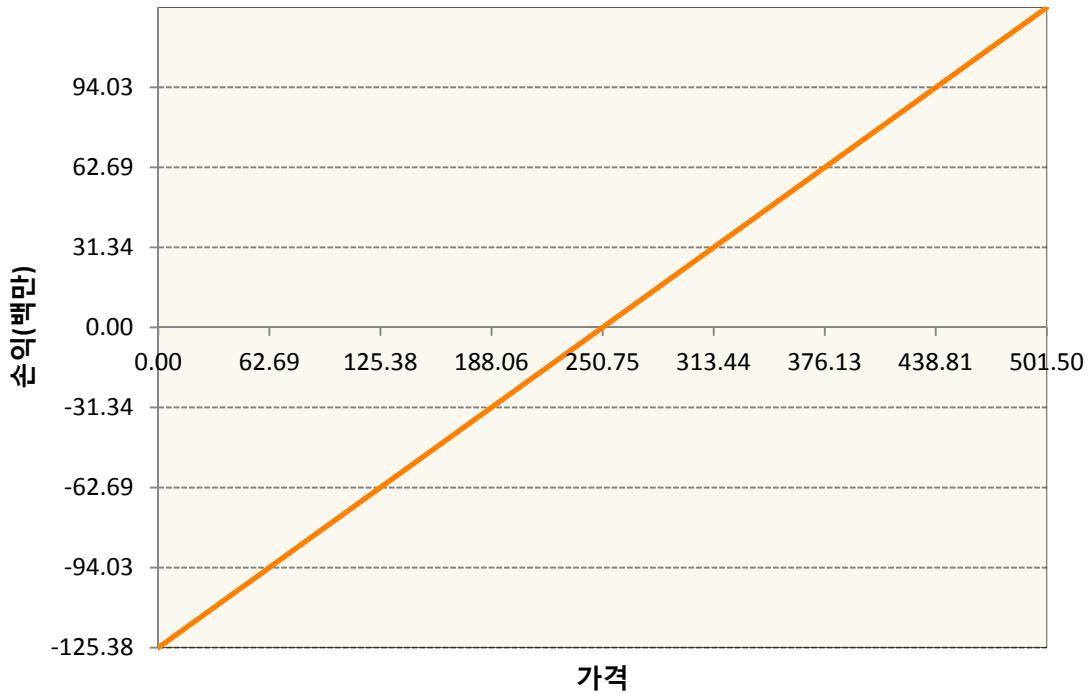
1. 계약금액

(단위:백만원)

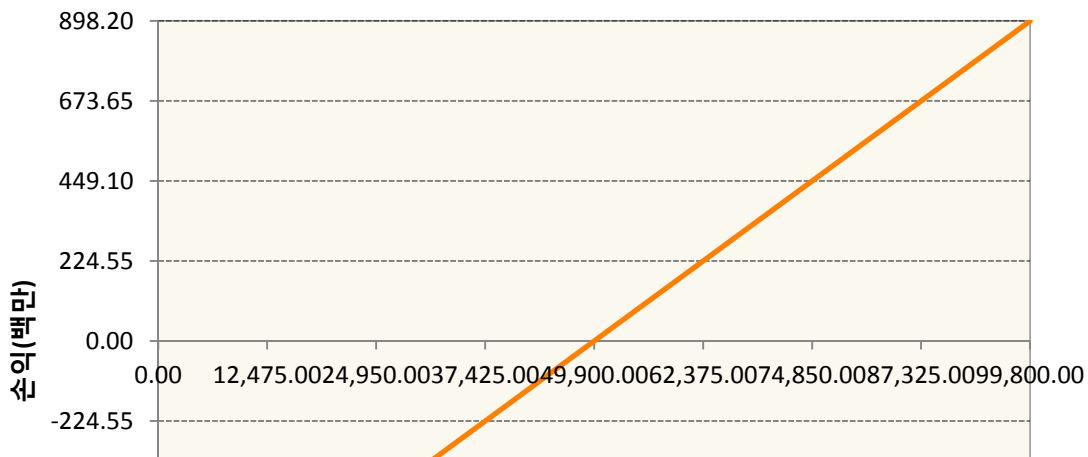
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,024	0	1,024	장내

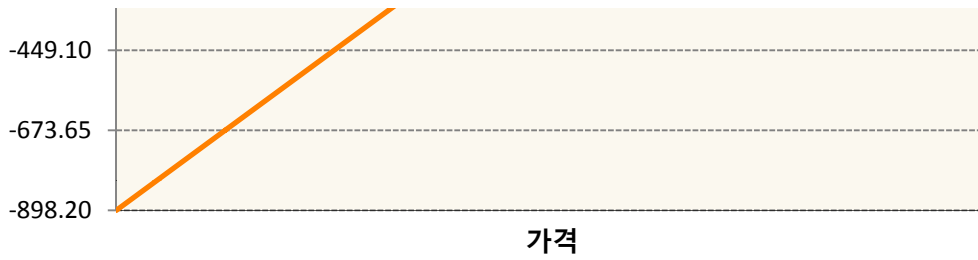
2. 만기시점의 손익구조

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	2020-04-23
기준일	2020-04-22

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

928

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,084

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-23
기준일	2020-04-22

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

561

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

888

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-23
기준일	2020-04-22

유로인덱스모(주식-파생형)

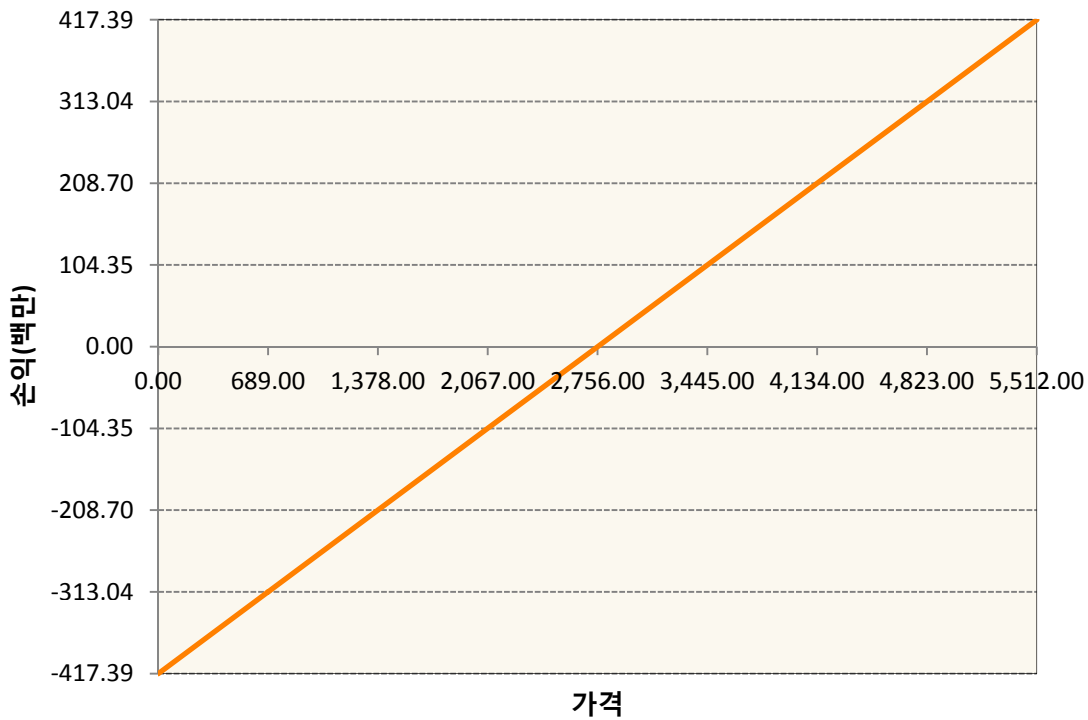
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	417	0	417	

2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	33
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

42

공시일	2020-04-23
기준일	2020-04-22

차이나인덱스모(주식-파생형)

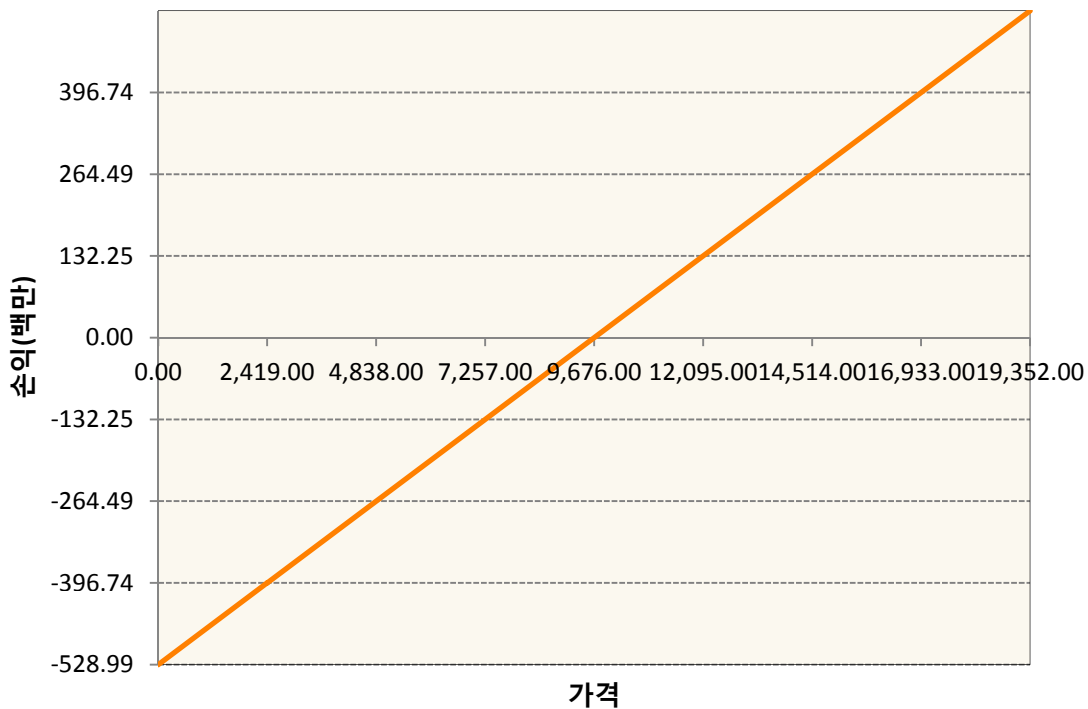
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	529	0	529	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)

45

공시일	2020-04-23
기준일	2020-04-22

커버드콜모(주식혼합-파생형)

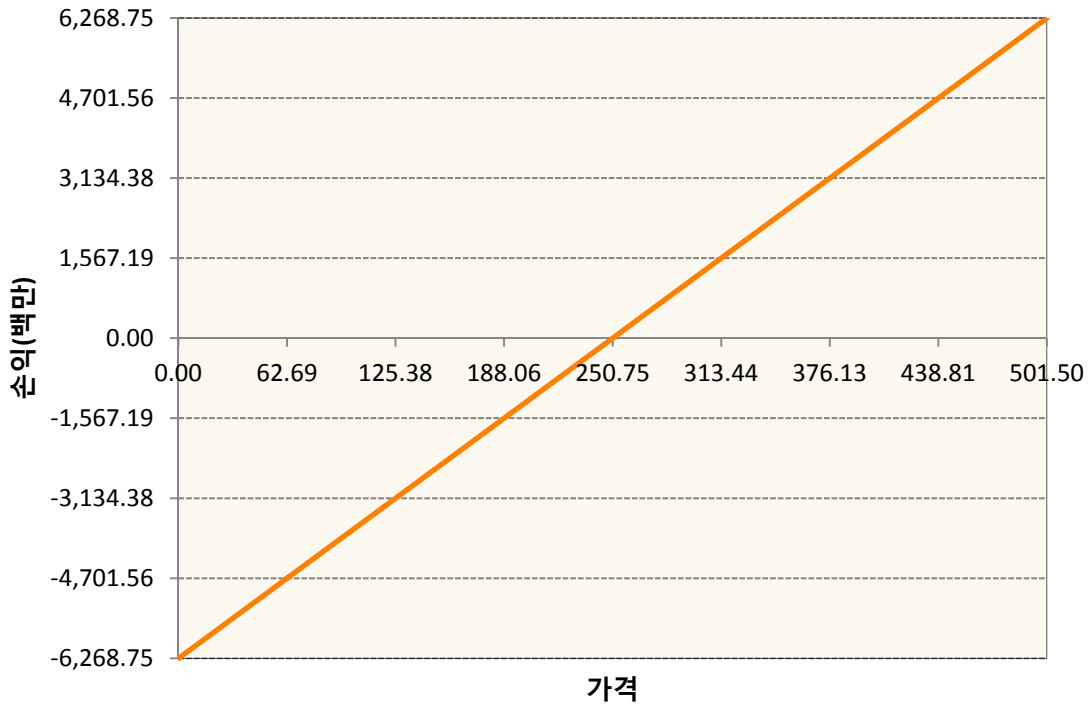
1. 계약금액

(단위:백만원)

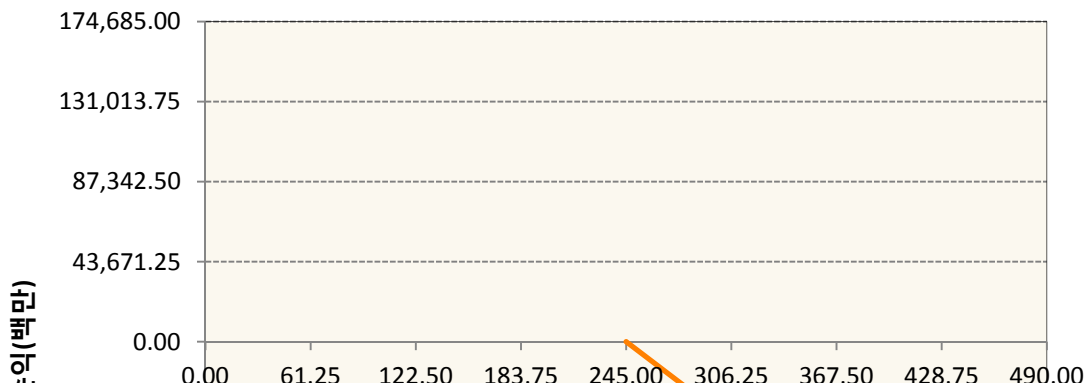
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	6,147	0	6,147	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,269	0	6,269	장내
누계	유가증권	옵션	0	358,345	-358,345	장내

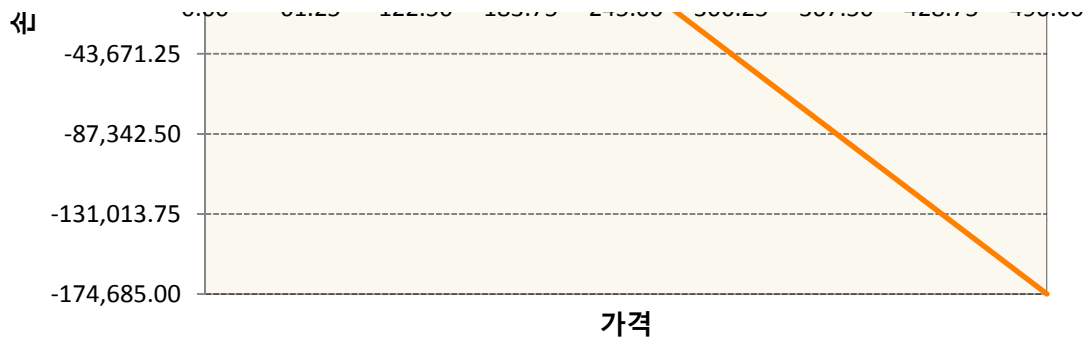
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

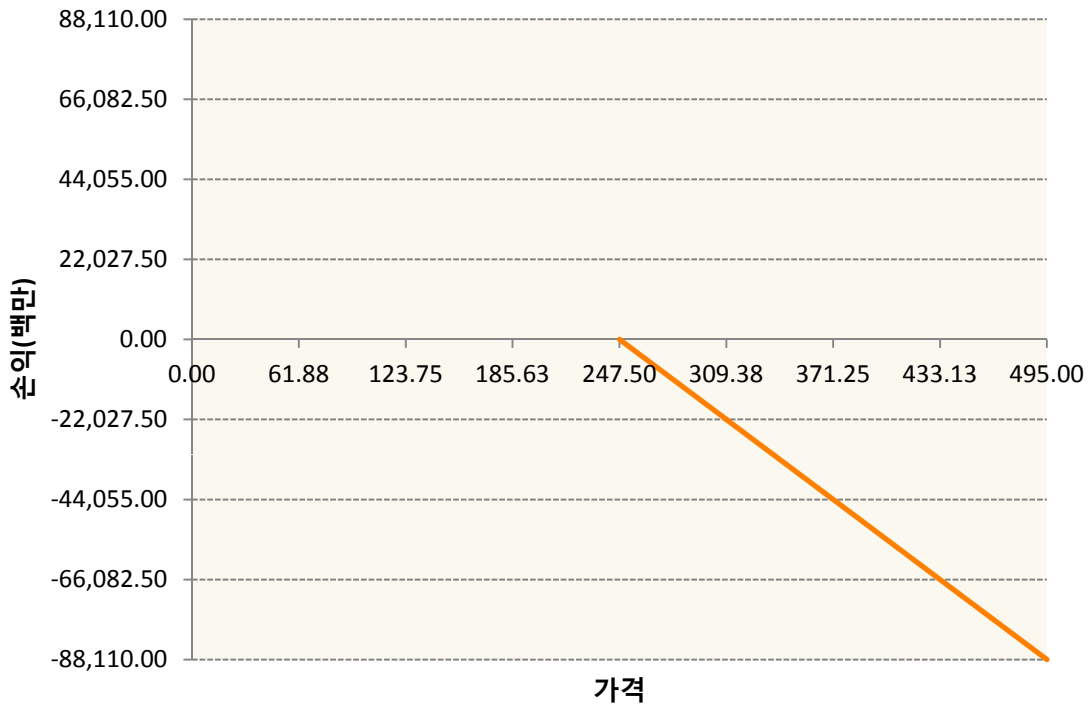


KR4201Q52452-2020-05 콜245

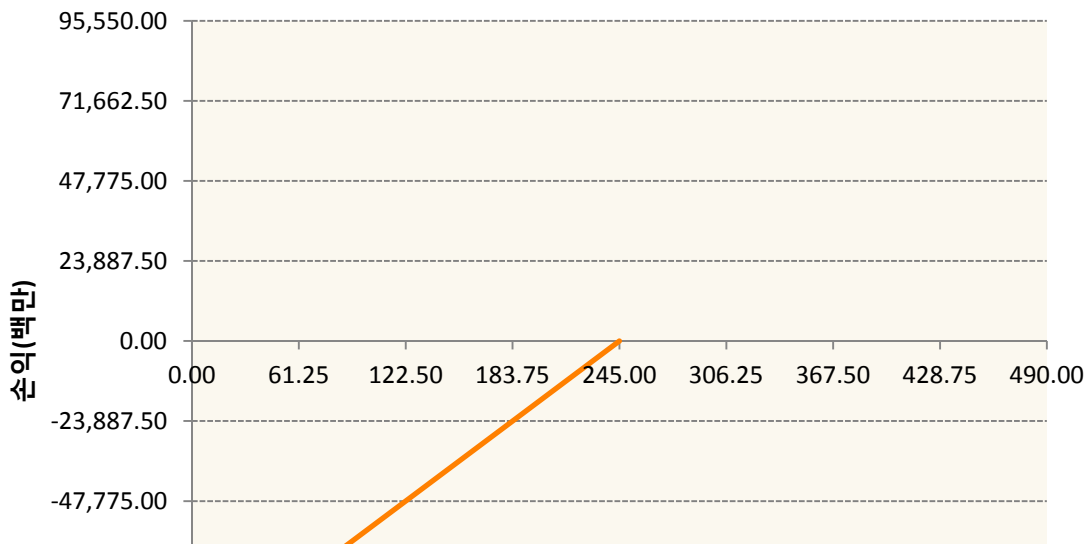


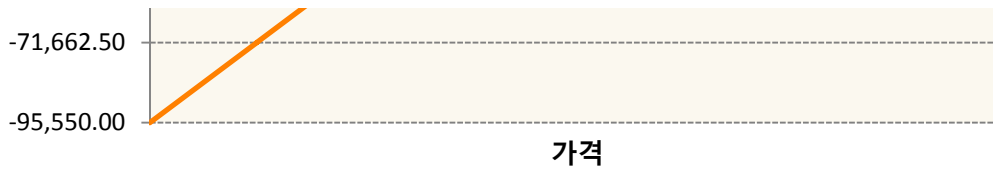


KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						504
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-504	-504	-504	-504	-504	-504	-504	
-5.33%	-336	-336	-336	-336	-336	-336	-336	
-2.67%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	168	168	168	168	168	168	168	
5.33%	336	336	336	336	336	336	336	
8.00%	504	504	504	504	504	504	504	

KR4201Q52452		2020-05 콜245						12,035
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	8,611	8,040	7,451	6,848	6,234	5,611	4,981	
-5.33%	6,997	6,336	5,670	5,000	4,328	3,653	2,976	
-2.67%	4,814	4,114	3,415	2,715	2,016	1,317	619	
0%	2,058	1,377	690	0	-693	-1,387	-2,084	
2.67%	-1,225	-1,840	-2,473	-3,119	-3,776	-4,441	-5,112	
5.33%	-4,954	-5,472	-6,023	-6,600	-7,197	-7,812	-8,440	
8.00%	-9,035	-9,444	-9,898	-10,390	-10,914	-11,464	-12,035	

KR4201Q52478		2020-05 콜247.5						5,857
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4,020	3,753	3,474	3,185	2,888	2,586	2,279	
-5.33%	3,309	2,990	2,665	2,338	2,007	1,675	1,341	
-2.67%	2,324	1,975	1,626	1,276	927	577	227	
0%	1,054	703	352	0	-353	-705	-1,058	
2.67%	-488	-814	-1,146	-1,482	-1,822	-2,165	-2,509	
5.33%	-2,268	-2,550	-2,846	-3,152	-3,466	-3,787	-4,114	
8.00%	-4,241	-4,469	-4,719	-4,985	-5,265	-5,556	-5,857	

KR4301Q52450		2020-05 풋245						4,988
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,583	-3,795	-4,018	-4,251	-4,491	-4,737	-4,988	
-5.33%	-1,712	-1,981	-2,253	-2,528	-2,806	-3,085	-3,365	
-2.67%	-231	-524	-817	-1,111	-1,404	-1,697	-1,991	

0%	844	566	284	0	-286	-574	-862
2.67%	1,554	1,323	1,080	828	569	305	36
5.33%	1,982	1,811	1,621	1,415	1,197	968	730
8.00%	2,216	2,103	1,967	1,811	1,638	1,450	1,250

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

(단위:백만원)

20,592

공시일	2020-04-23
기준일	2020-04-22

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

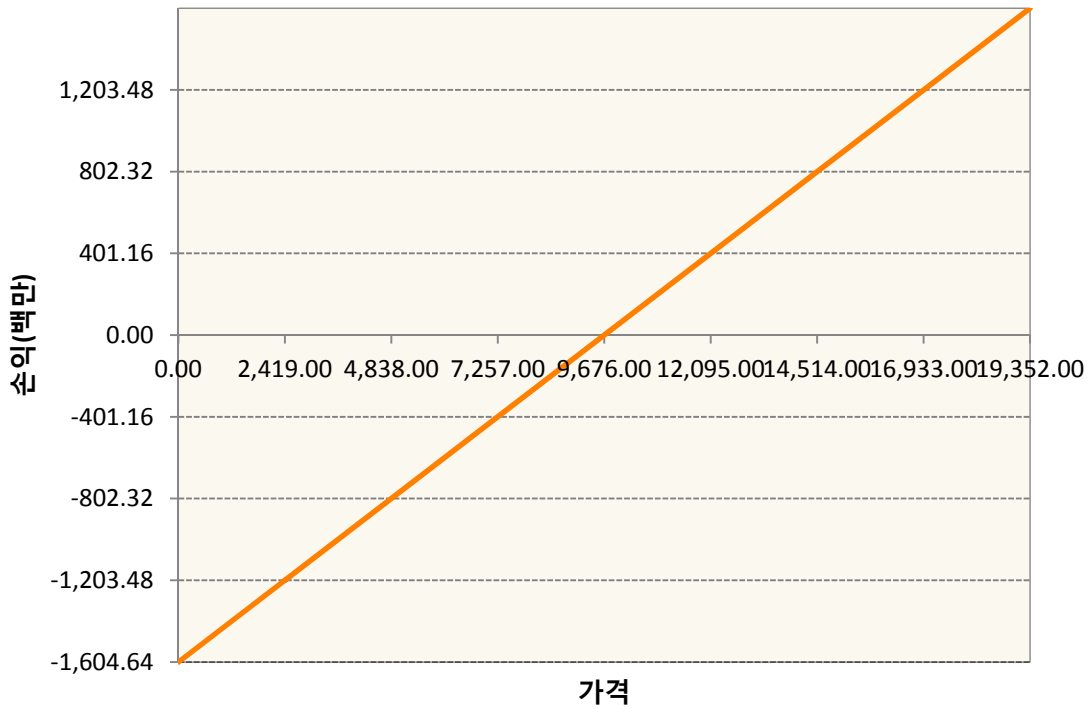
1. 계약금액

(단위:백만원)

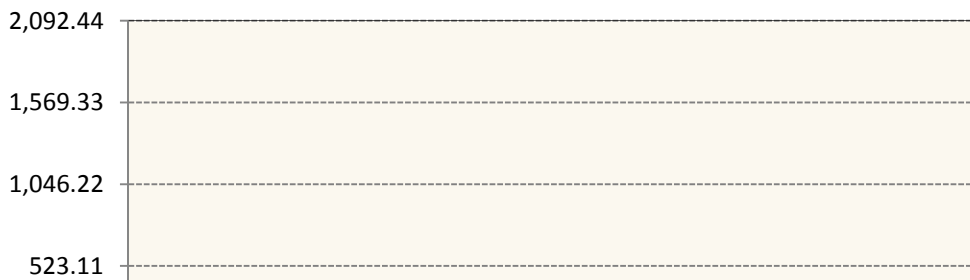
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,605	0	1,605	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,186	-4,186	장내
누계	통화	선도	700	2,239	-1,539	장외

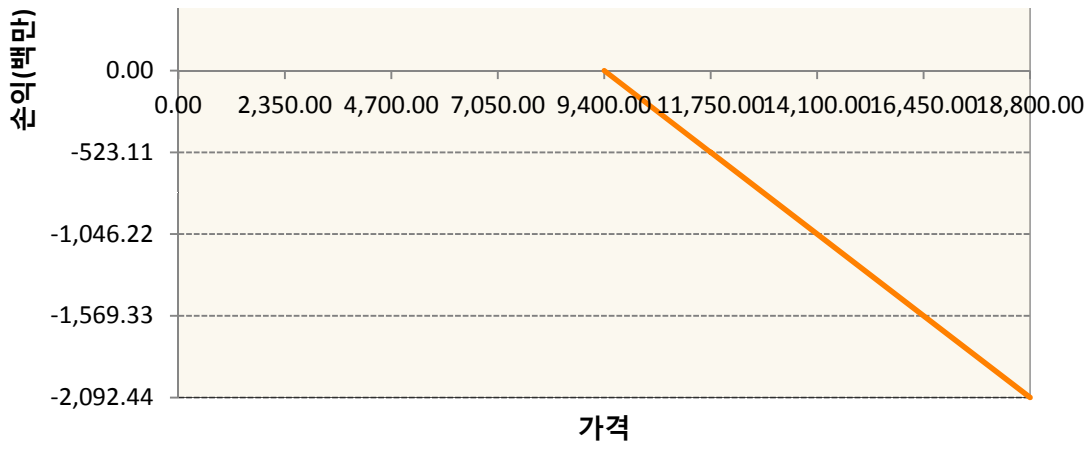
2. 만기시점의 손익구조

HCJ0-HSCEI Futures Apr20

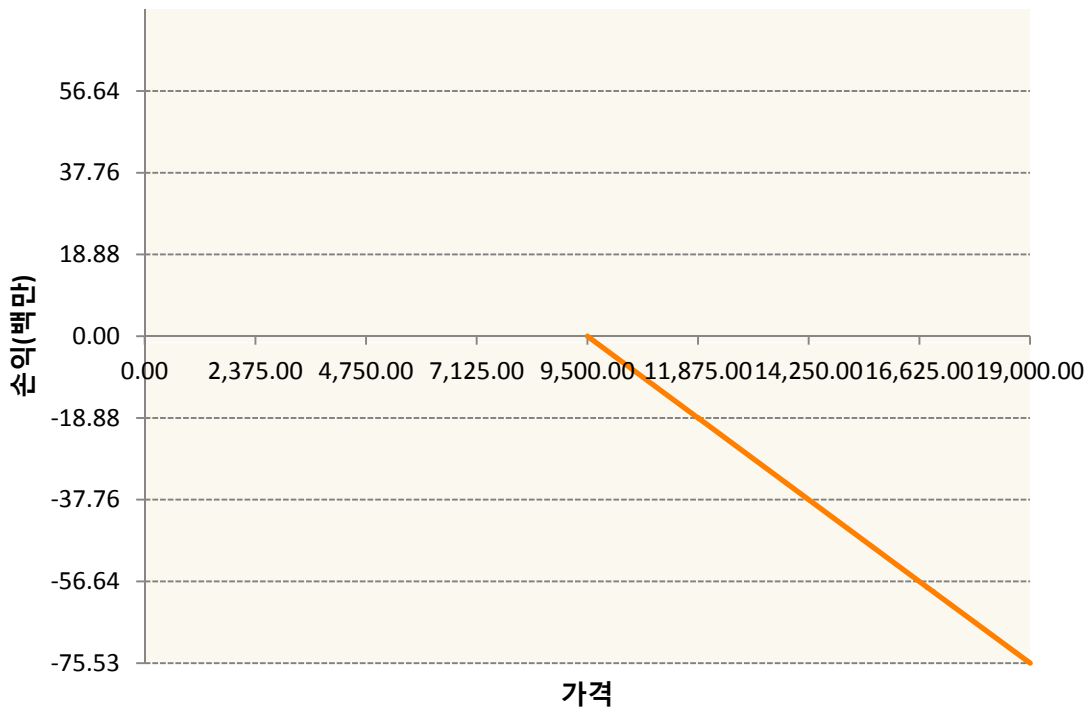


OHHIJ0-C94-HSCEI

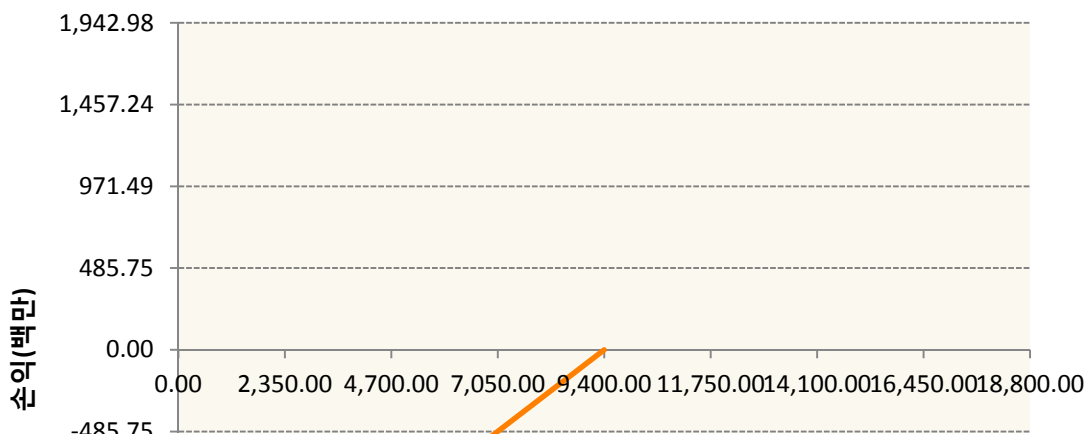


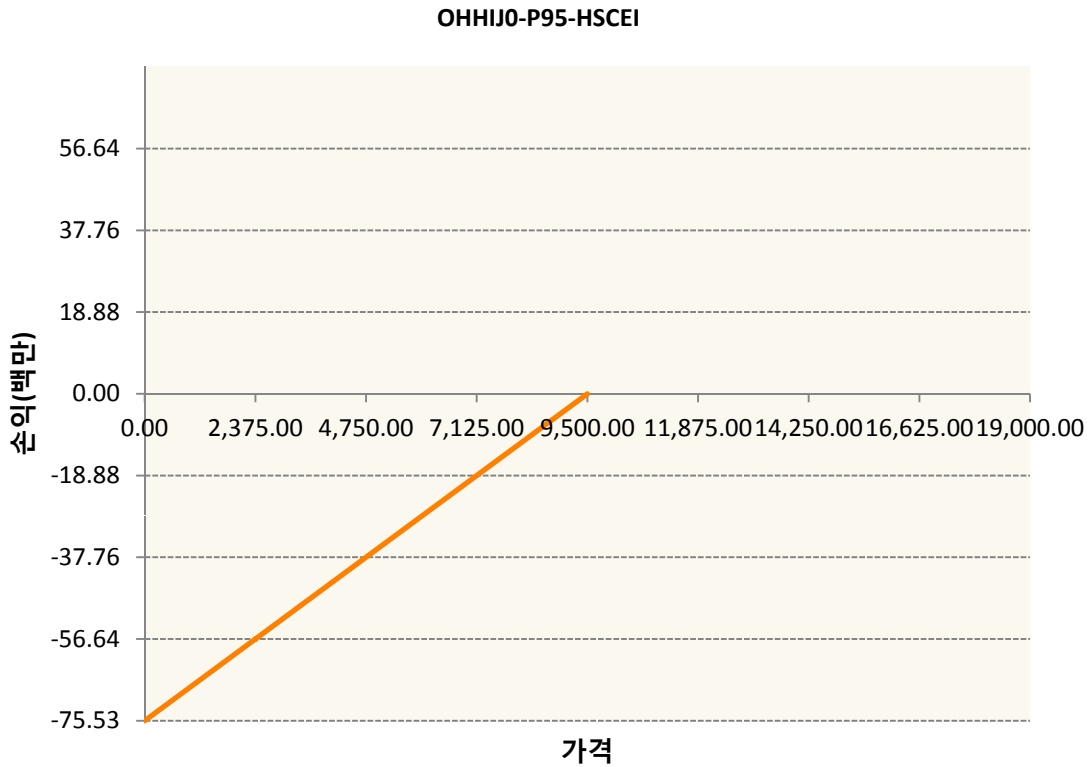


OHHI0-C95-HSCEI



OHHI0-P94-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E	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)
	611

공시일	2020-04-23
기준일	2020-04-22

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

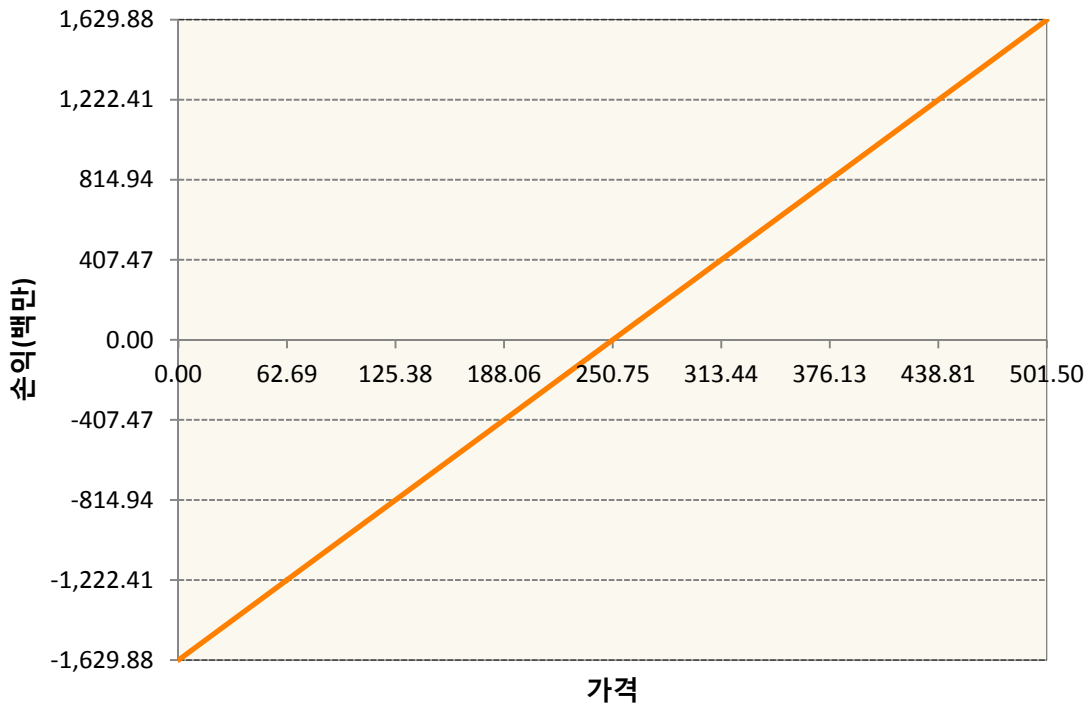
1. 계약금액

(단위:백만원)

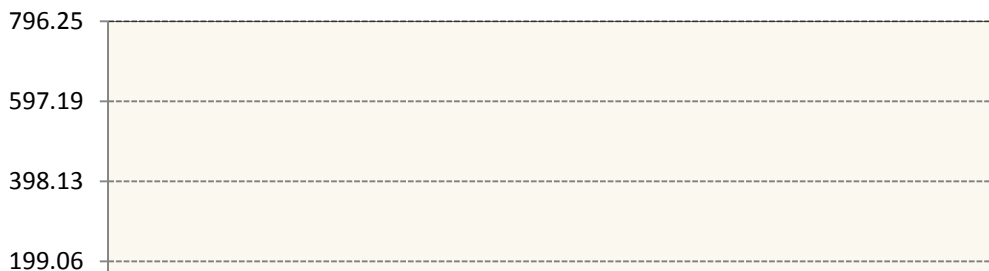
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,630	0	1,630	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,193	-3,193	장내

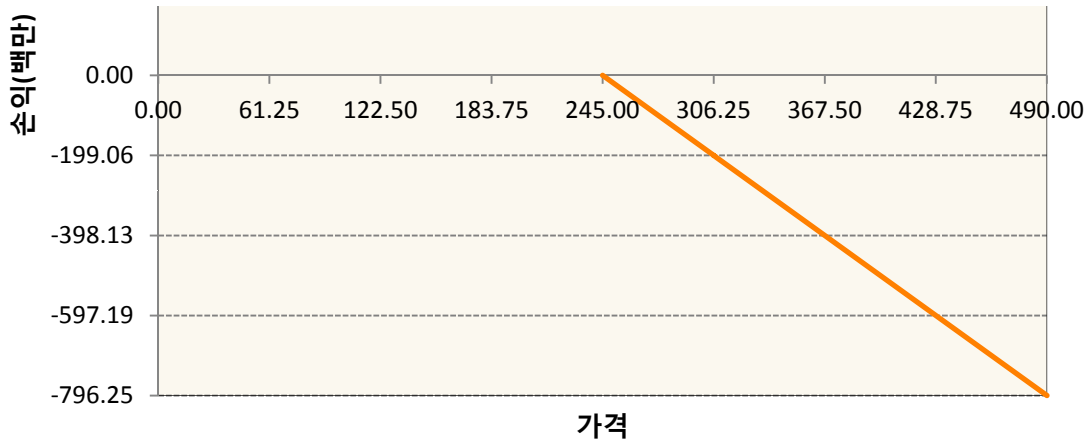
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

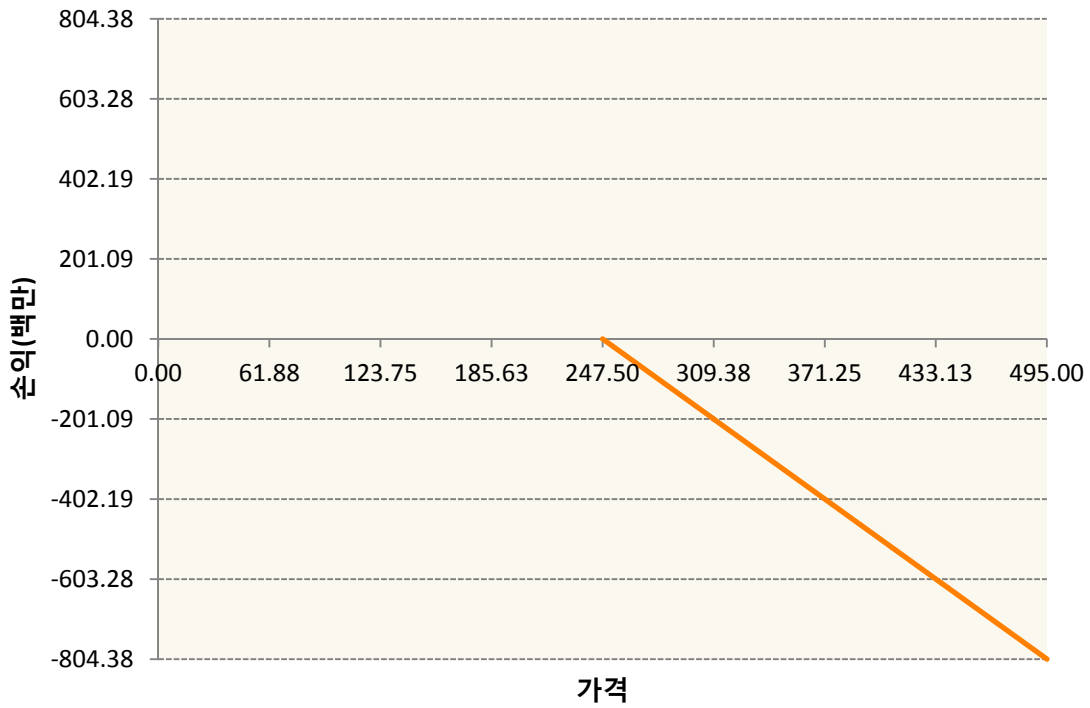


KR4201Q52452-2020-05 콜245

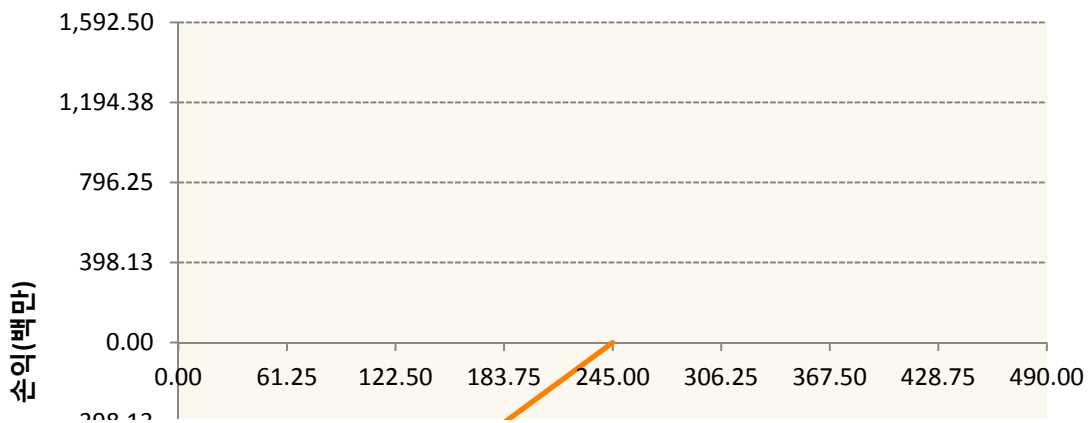




KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



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						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%	39	37	34	31	28	26	23	
-5.33%	32	29	26	23	20	17	14	
-2.67%	22	19	16	12	9	6	3	
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9	
2.67%	-6	-8	-11	-14	-17	-20	-23	
5.33%	-23	-25	-27	-30	-33	-36	-38	
8.00%	-41	-43	-45	-47	-50	-52	-55	
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5						53
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	37	34	32	29	26	24	21
-5.33%	30	27	24	21	18	15	12
-2.67%	21	18	15	12	8	5	2
0%	10	6	3	0	-3	-6	-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	-53
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%	-29	-33	-38	-42	-47	-51	-56
-2.67%	-4	-9	-14	-19	-23	-28	-33
0%	14	9	5	0	-5	-10	-14
2.67%	26	22	18	14	9	5	1
5.33%	33	30	27	24	20	16	12
8.00%	37	35	33	30	27	24	21

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

(단위:백만원)

546

공시일	2020-04-23
기준일	2020-04-22

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

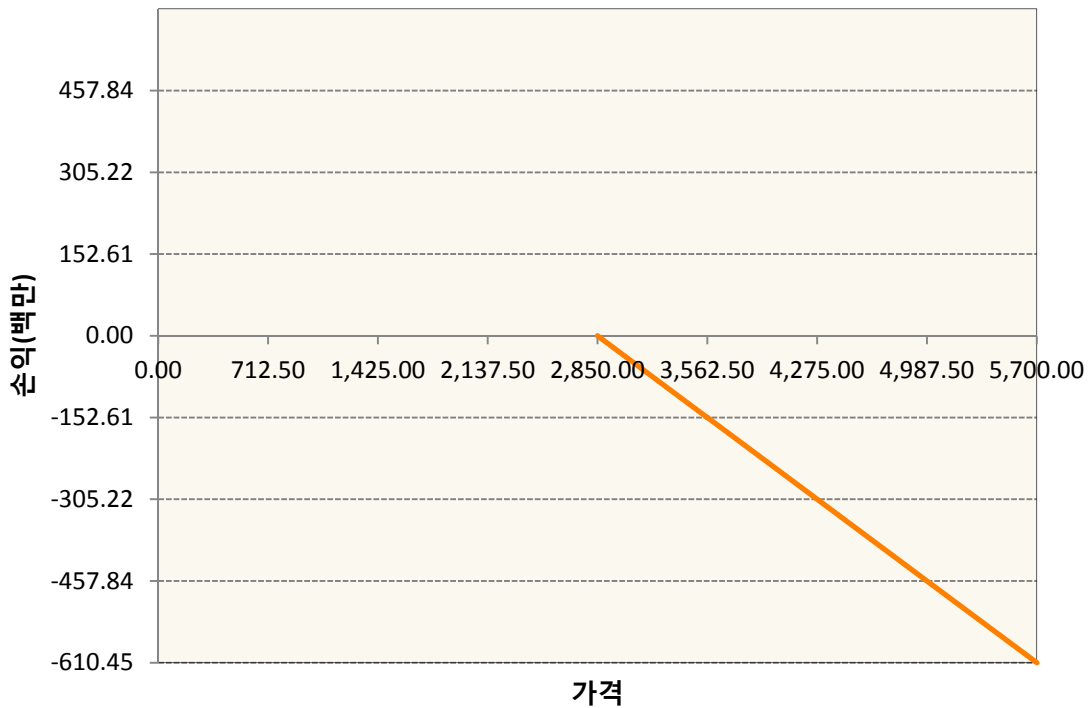
1. 계약금액

(단위:백만원)

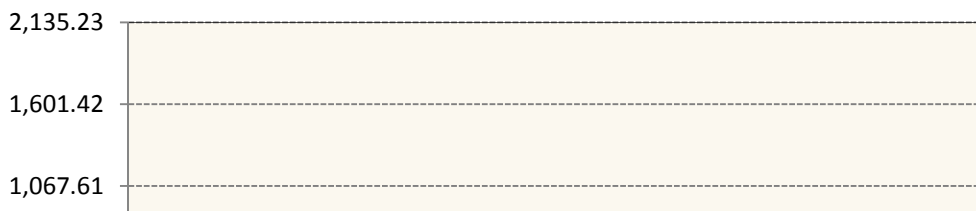
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	446	0	446	
누계	유가증권	스왑	7,984	0	7,984	장외
누계	유가증권	옵션	0	5,491	-5,491	장내
누계	통화	선도	0	2,710	-2,710	장외

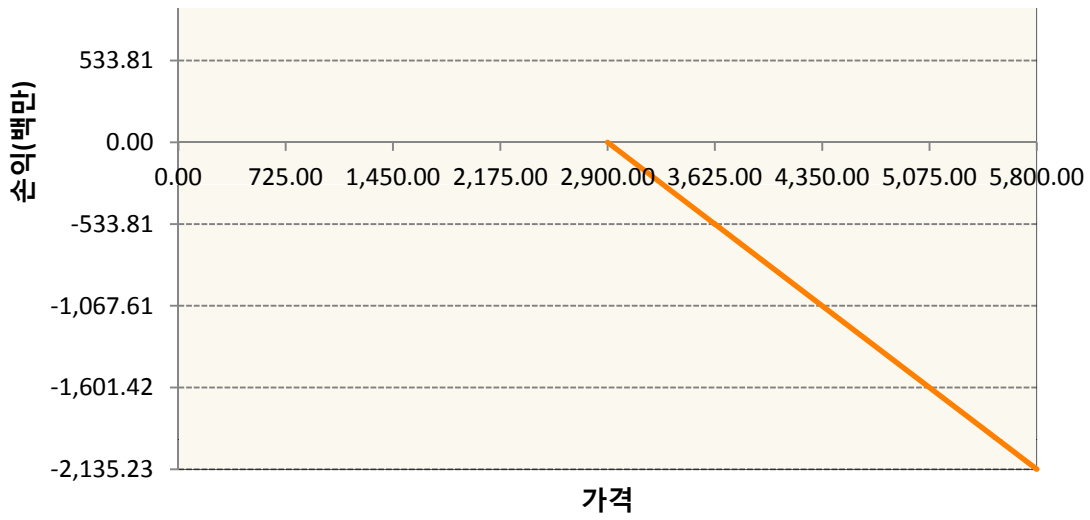
2. 만기시점의 손익구조

OESXK0-C2850-EURO STOXX 50

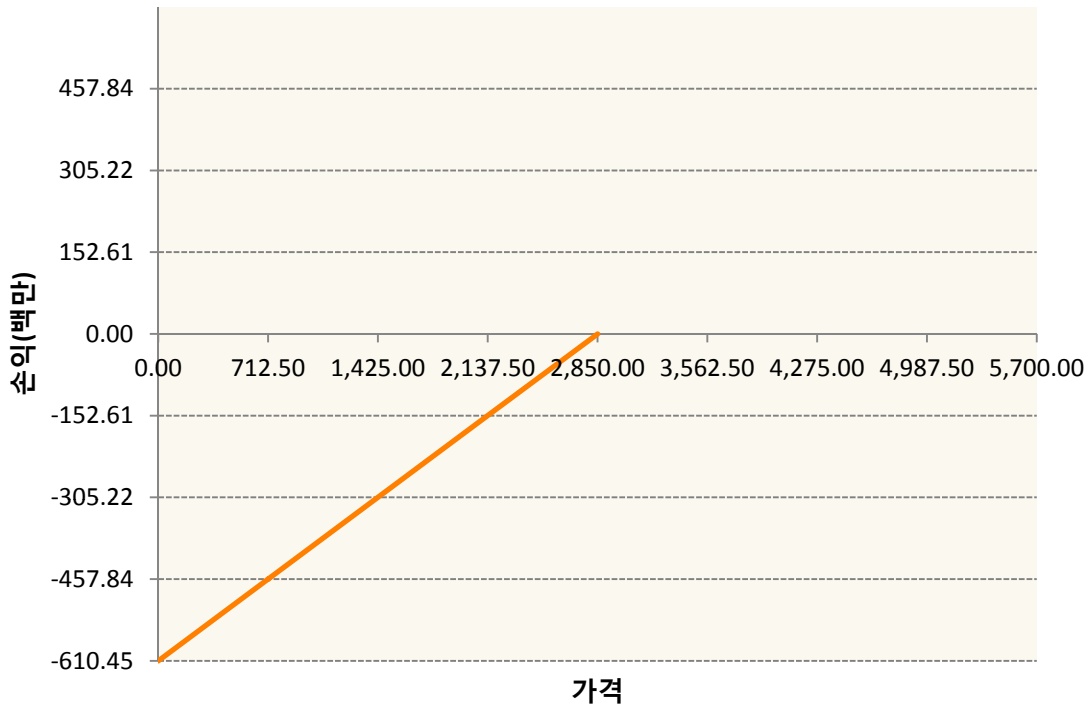


OESXK0-C2900-EURO STOXX 50

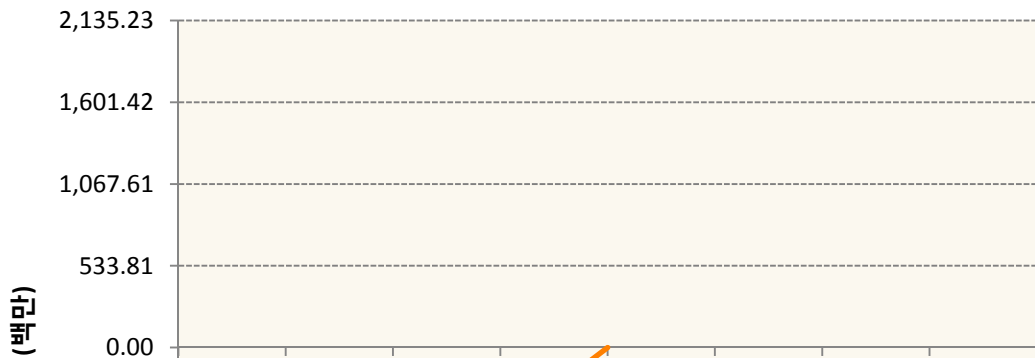


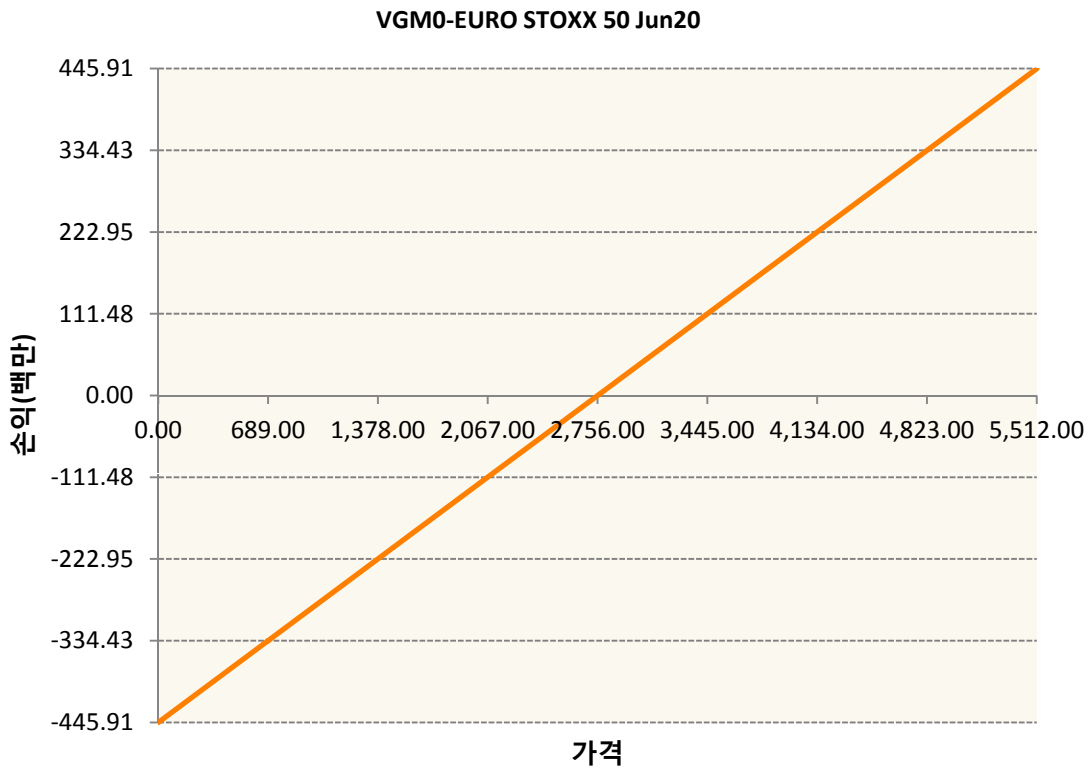
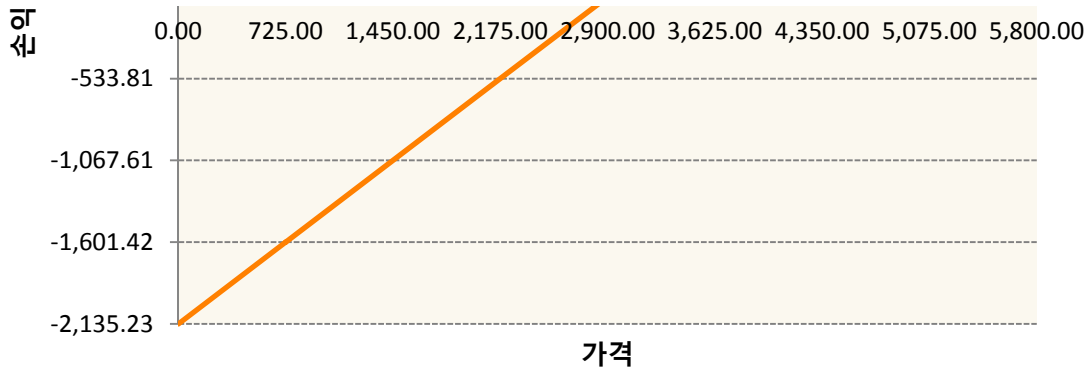


OESXK0-P2850-EURO STOXX 50



OESXK0-P2900-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		13
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E		217
OESXK0-C28 EURO STOXX 50		49
OESXK0-C29 EURO STOXX 50		171
OESXK0-P28 EURO STOXX 50		49
OESXK0-P29 EURO STOXX 50		171
VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	36

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

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

(단위:백만원)

1,117

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

(단위:백만원)

97

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

(단위:백만원)

141

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

(단위:백만원)

67

공시일	2020-04-23
기준일	2020-04-22

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

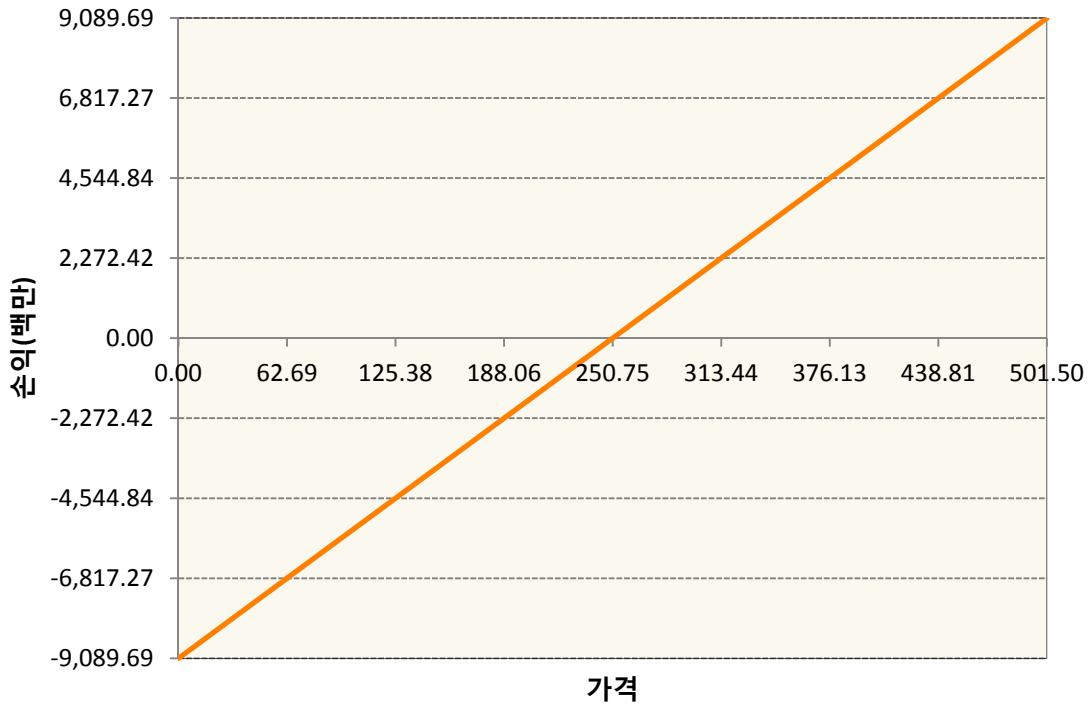
1. 계약금액

(단위:백만원)

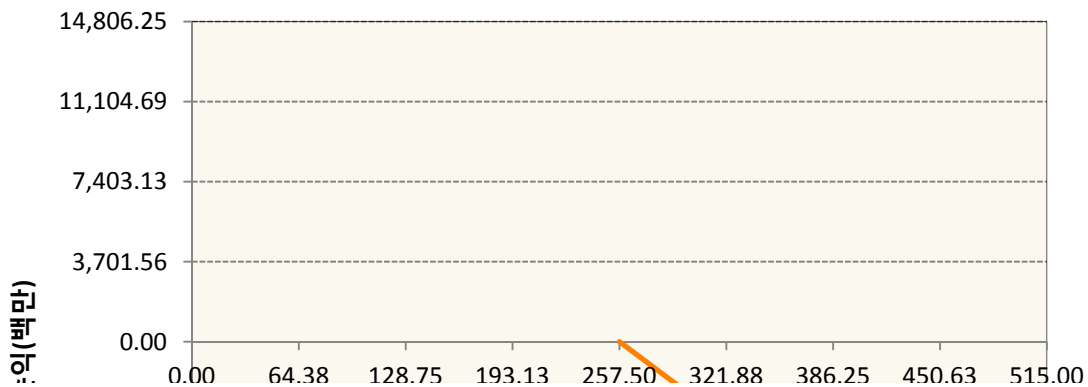
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,090	0	9,090	장내
누계	유가증권	옵션	6,201	17,536	-11,335	장내

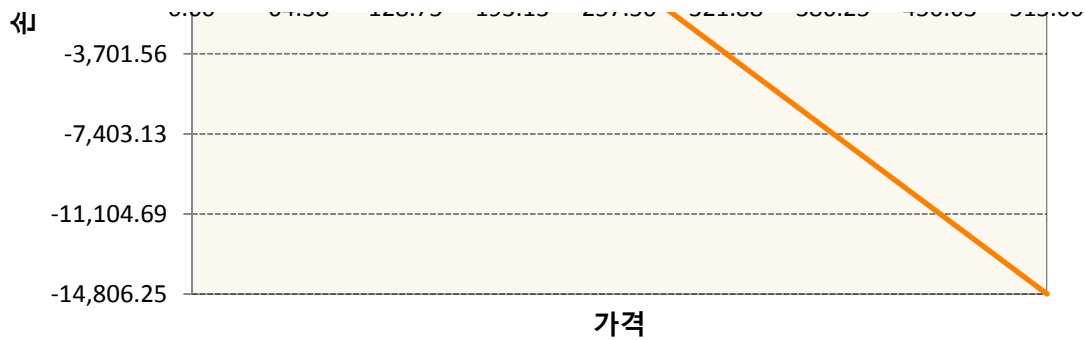
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

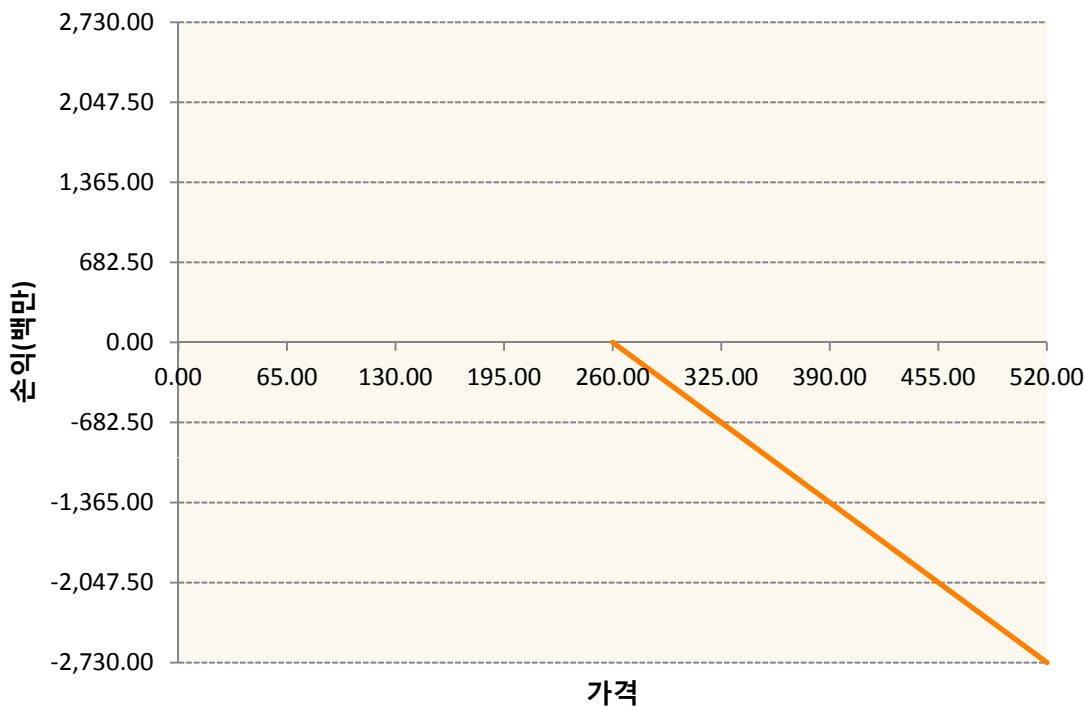


KR4201Q52577-2020-05 콜257.5

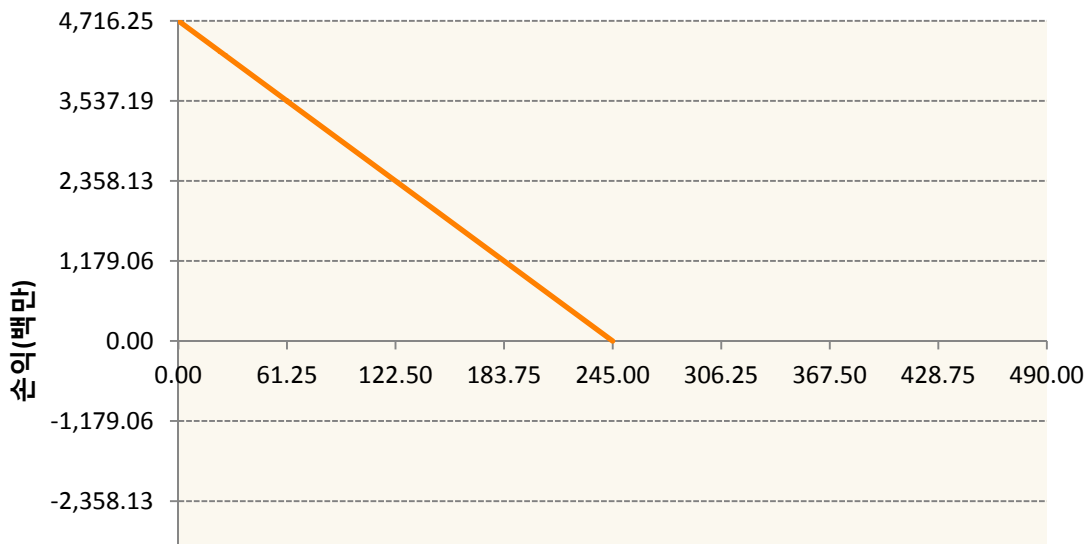


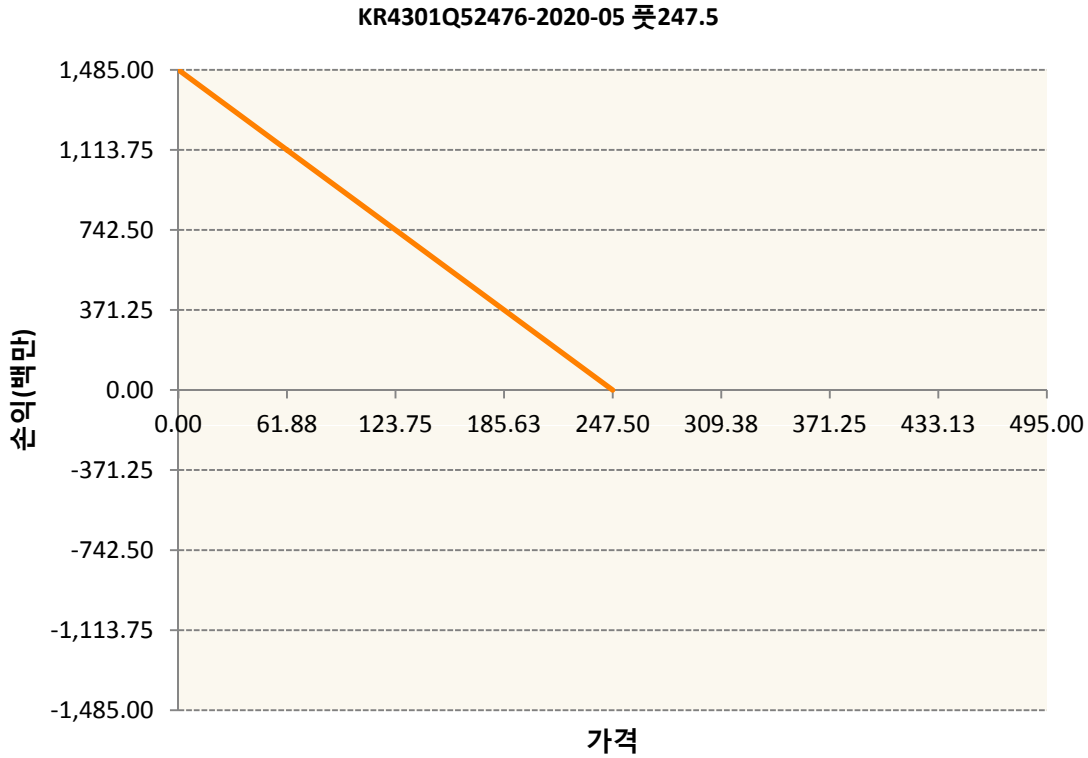
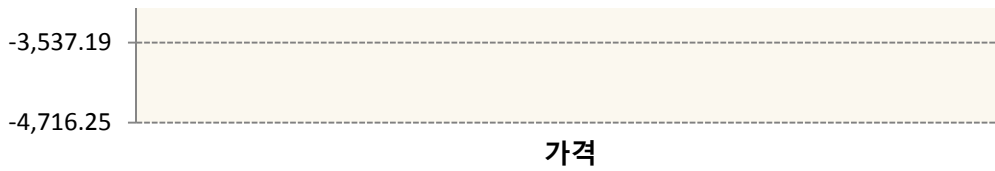


KR4201Q52601-2020-05 콜260



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						730
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-730	-730	-730	-730	-730	-730	-730	
-5.33%	-487	-487	-487	-487	-487	-487	-487	
-2.67%	-243	-243	-243	-243	-243	-243	-243	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	243	243	243	243	243	243	243	
5.33%	487	487	487	487	487	487	487	
8.00%	730	730	730	730	730	730	730	
KR4201Q52577		2020-05 콜257.5						834
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	474	444	410	373	334	292	249	
-5.33%	410	369	325	280	233	184	135	
-2.67%	311	261	209	156	103	49	-6	

0%	172	115	57	0	-58	-115	-173
2.67%	-12	-71	-130	-190	-249	-308	-368
5.33%	-239	-296	-354	-412	-471	-530	-589
8.00%	-506	-558	-611	-666	-721	-777	-834
KR4201Q52601 2020-05 콜260							147
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	79	74	69	62	56	48	41
-5.33%	69	62	55	47	39	30	21
-2.67%	53	45	36	26	17	7	-2
0%	31	21	10	0	-10	-21	-31
2.67%	0	-11	-22	-32	-43	-54	-65
5.33%	-38	-49	-60	-71	-82	-93	-104
8.00%	-84	-94	-105	-115	-125	-136	-147
KR4301Q52450 2020-05 풋245							246
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	177	187	198	210	222	234	246
-5.33%	84	98	111	125	138	152	166
-2.67%	11	26	40	55	69	84	98
0%	-42	-28	-14	0	14	28	43
2.67%	-77	-65	-53	-41	-28	-15	-2
5.33%	-98	-89	-80	-70	-59	-48	-36
8.00%	-109	-104	-97	-89	-81	-72	-62
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	78	81
-5.33%	30	34	38	42	47	51	55
-2.67%	5	10	14	19	23	28	32
0%	-14	-9	-5	0	5	9	14
2.67%	-26	-23	-18	-14	-10	-6	-2
5.33%	-35	-32	-28	-25	-21	-17	-13
8.00%	-39	-37	-35	-32	-29	-26	-22

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

(단위:백만원)

2,061

공시일	2020-04-23
기준일	2020-04-22

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	148,600	0	148,600	

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	2020-04-23
기준일	2020-04-22

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	100,193	0	100,193	

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	2020-04-23
기준일	2020-04-22

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	442,660	0	442,660	
누계	통화	선도	53,601	521,221	-467,620	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,943
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,307
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,972
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,464
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,050
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,050
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,405
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	986
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	986
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,563
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	848
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	739
FX21020H09 USD/KRW 24-04-20E	739
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	493
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,450
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,999
FX21020H11 KRW/USD 11-05-20E	986
FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E	2,957
FX21020J02€ KRW/USD 10-06-20E	1,341
FX21020J02₯ KRW/USD 22-06-20E	1,518
FX21020J02₯ KRW/USD 22-06-20E	1,972
FX21020J03₯ KRW/USD 24-07-20E	2,218
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)

193

공시일	2020-04-23
기준일	2020-04-22

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

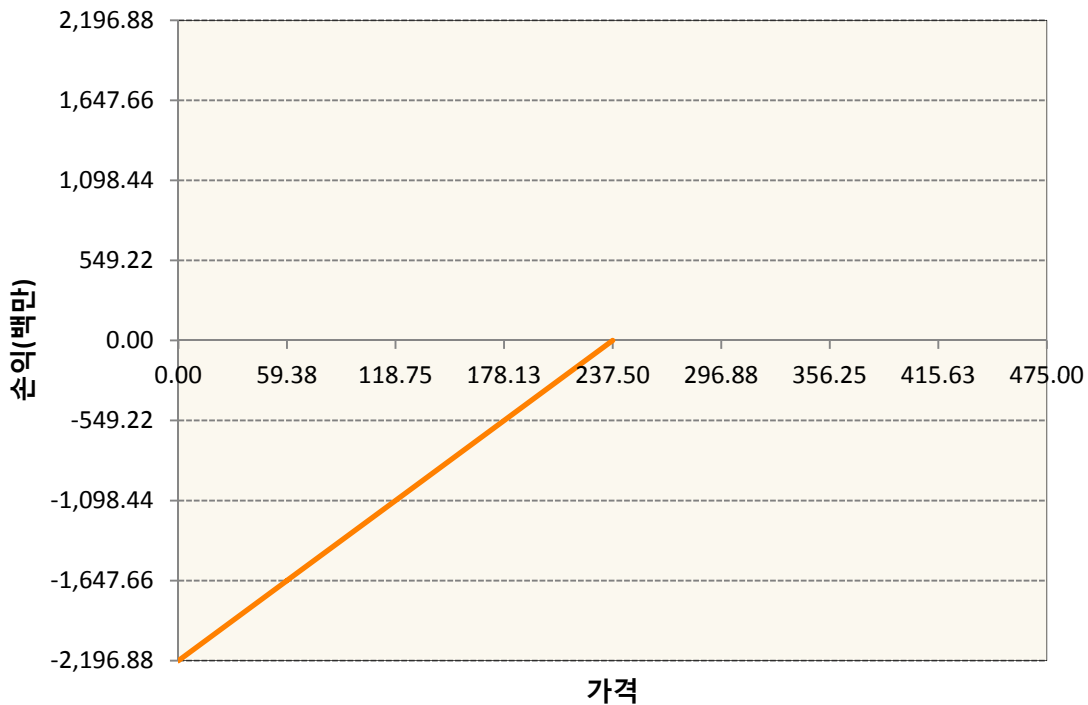
1. 계약금액

(단위:백만원)

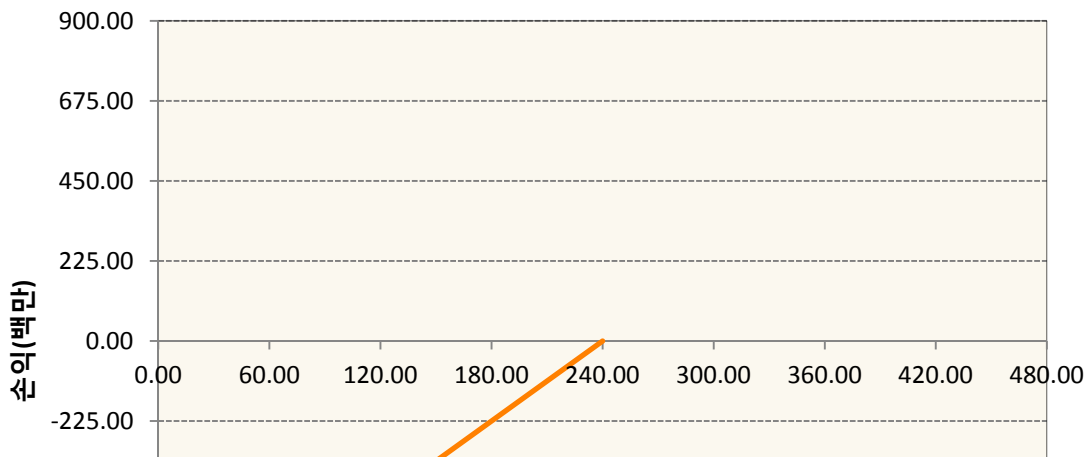
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,097	-3,097	장내

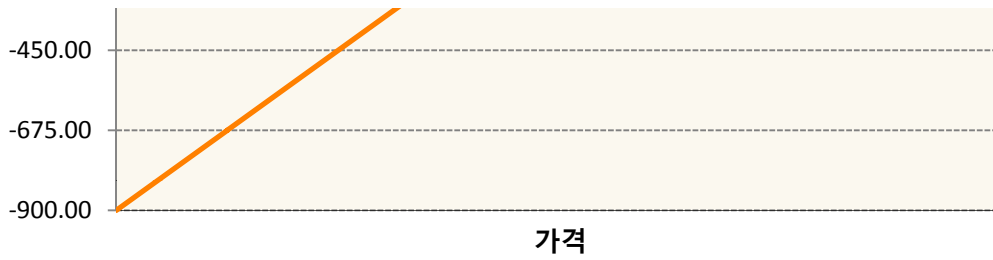
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q52377-2020-05 풋237.5



KR4301Q52401-2020-05 풋240





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q52377		2020-05 풋237.5						96
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-58	-64	-70	-77	-83	-90	-96	
-5.33%	-24	-30	-37	-44	-51	-57	-64	
-2.67%	0	-6	-12	-19	-25	-32	-38	
0%	16	11	6	0	-6	-12	-18	
2.67%	25	21	17	13	8	3	-2	
5.33%	30	28	25	21	18	14	9	
8.00%	32	31	29	27	24	21	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	-23	-25	-28	
-2.67%	0	-3	-6	-9	-11	-14	-17	
0%	7	5	2	0	-3	-5	-8	
2.67%	12	10	8	6	4	2	-1	
5.33%	14	13	12	10	9	7	5	
8.00%	16	15	14	13	12	10	9	

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

106

공시일	2020-04-23
기준일	2020-04-22

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	7,297	0	7,297	
누계	통화	선도	0	7,208	-7,208	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H11 KRW/USD 29-04-20E	228
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)

290

공시일	2020-04-23
기준일	2020-04-22

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

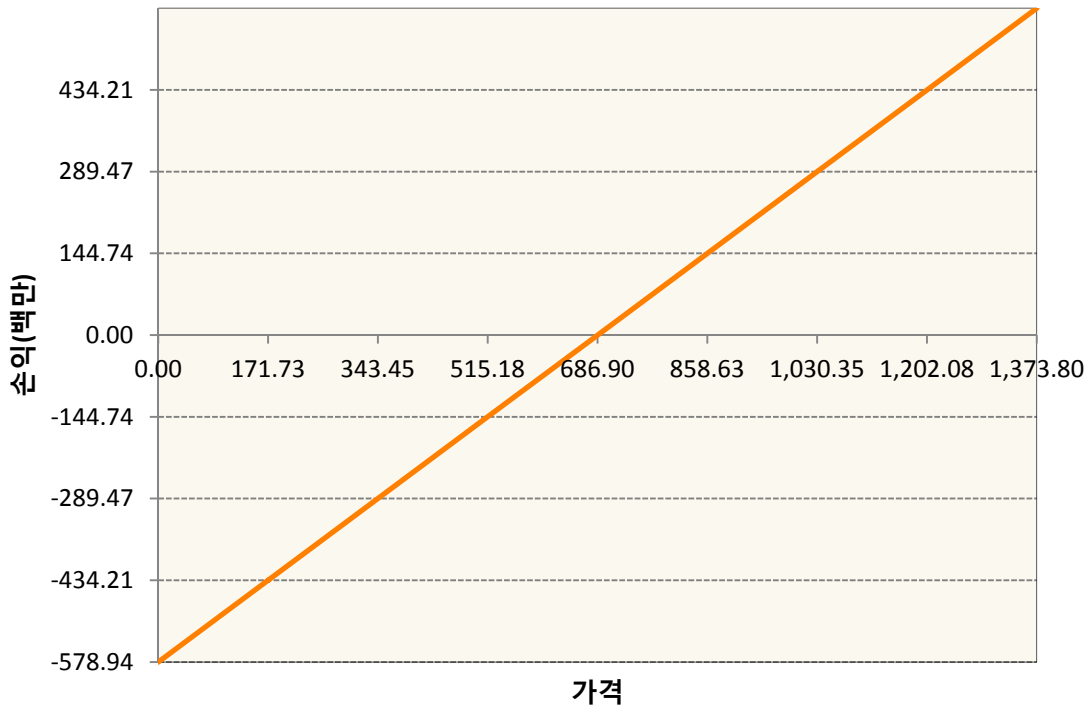
1. 계약금액

(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	579	0	579	
누계	유가증권	스왑	1,104	0	1,104	장외
누계	통화	선도	233	581	-348	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
FX21020J03₩ KRW/EUR 24-07-20E	1
VNCK0 VN30 Index Future May20	46

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

(단위:백만원)

157

공시일	2020-04-23
기준일	2020-04-22

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

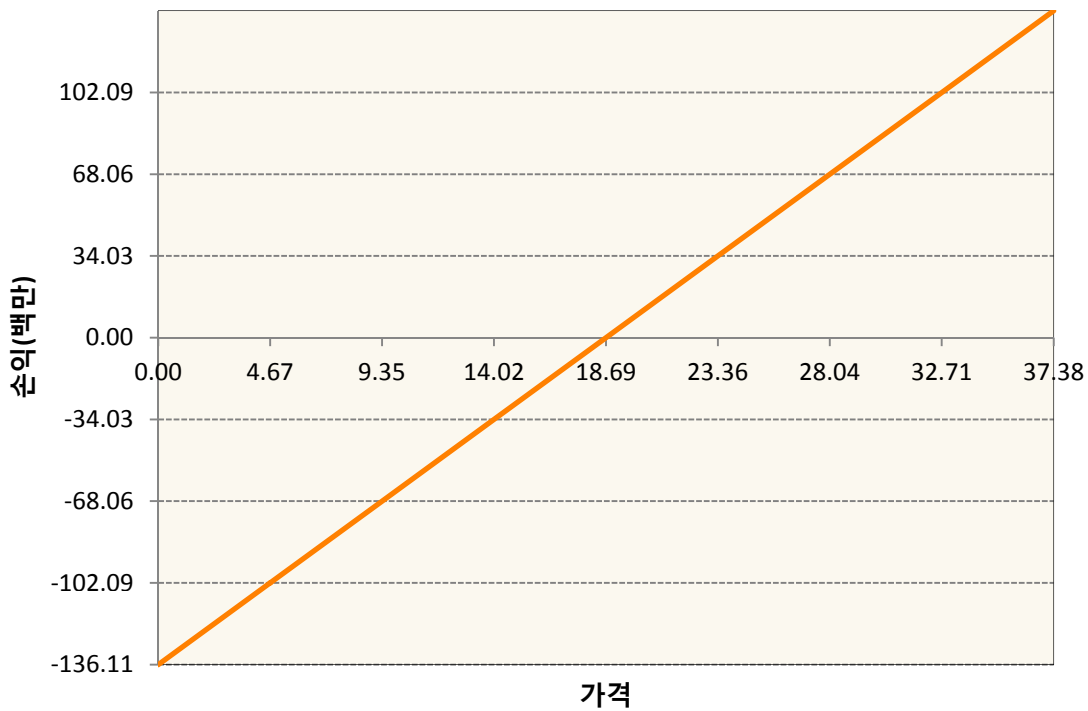
1. 계약금액

(단위:백만원)

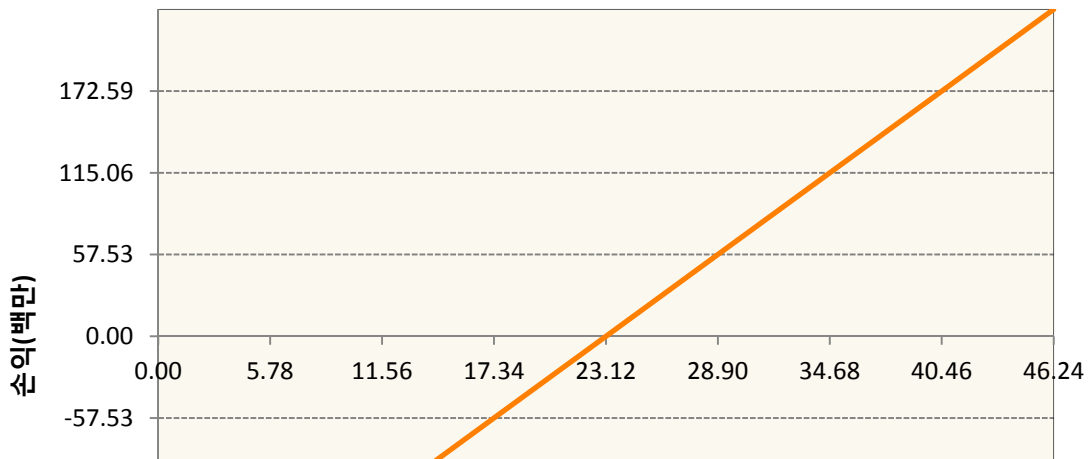
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,363	185	1,178	

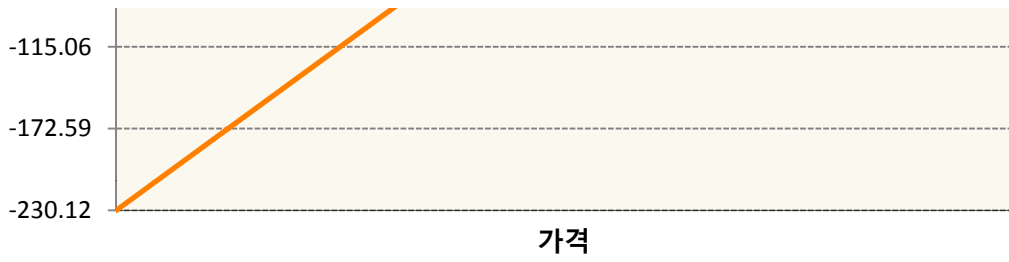
2. 만기시점의 손익구조

CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20

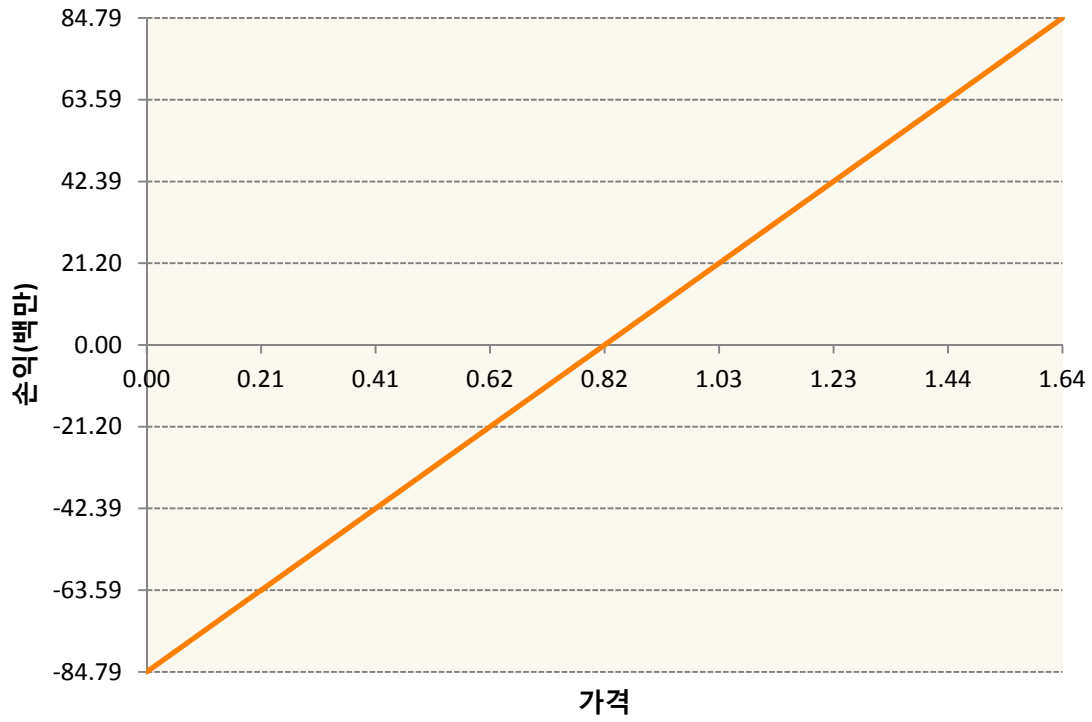


CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20

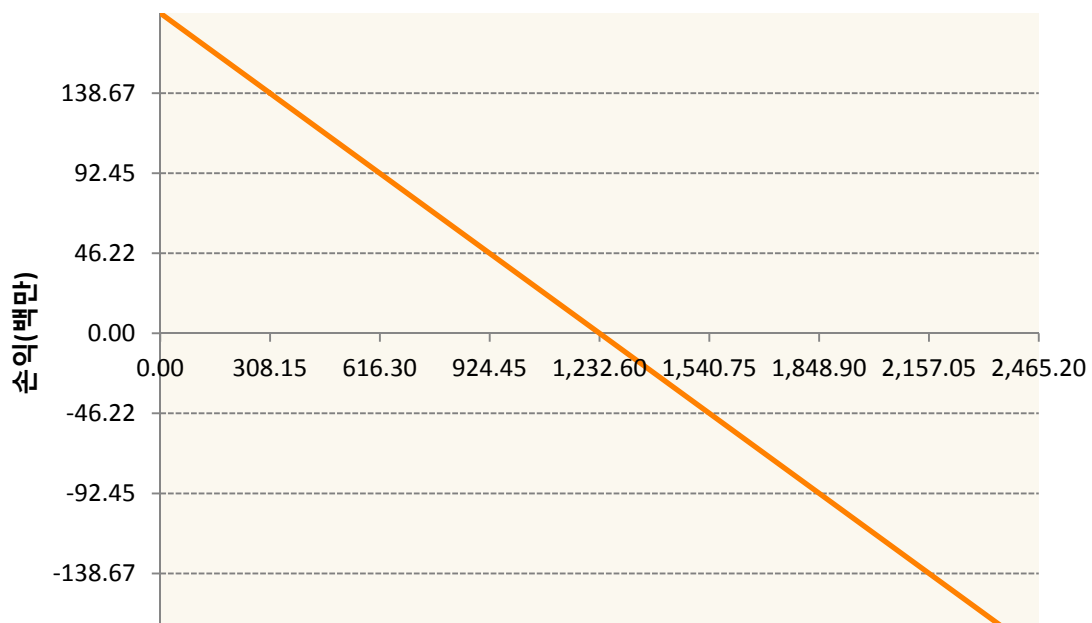


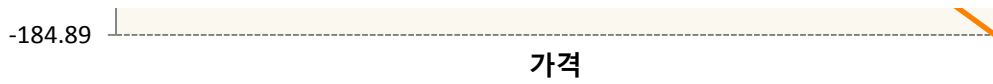


HON0-NY Harb ULSD Fut Jul20



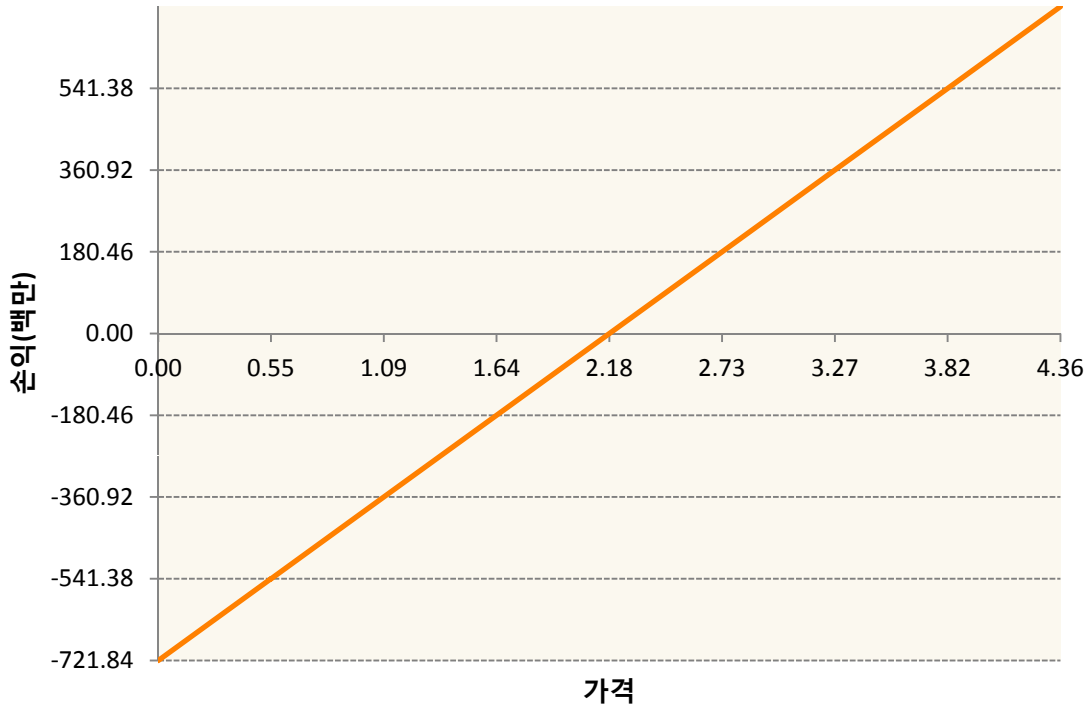
KR4175Q50007-2020-05 달러선물





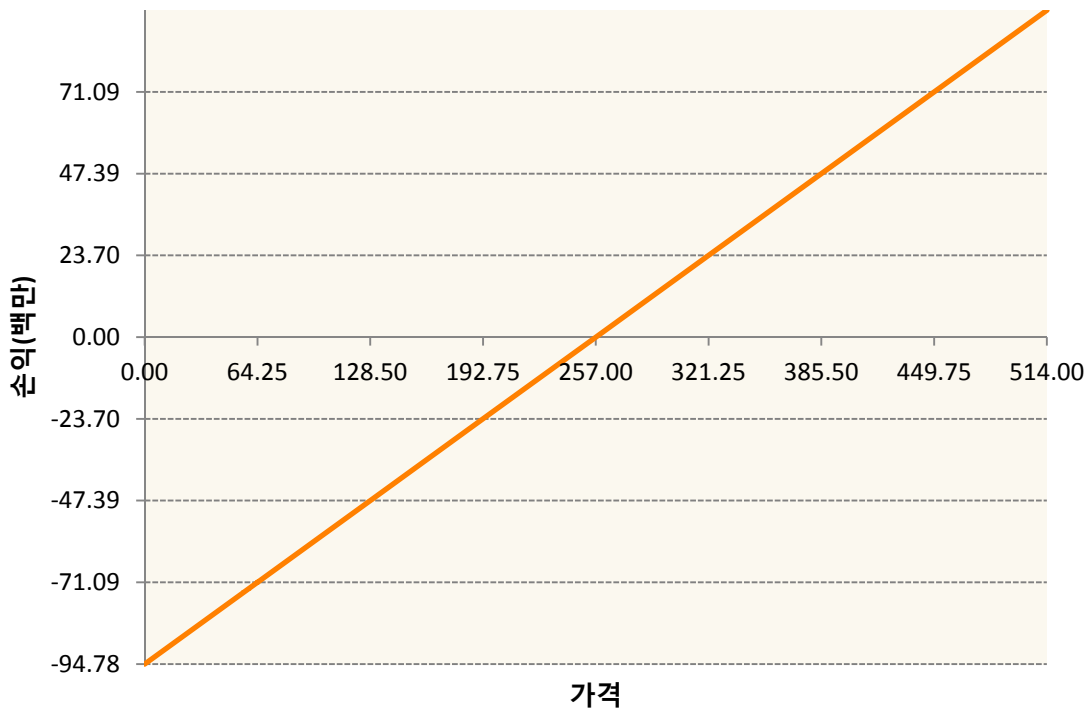
가격

NGN20-NATURAL GAS FUTR Jul20



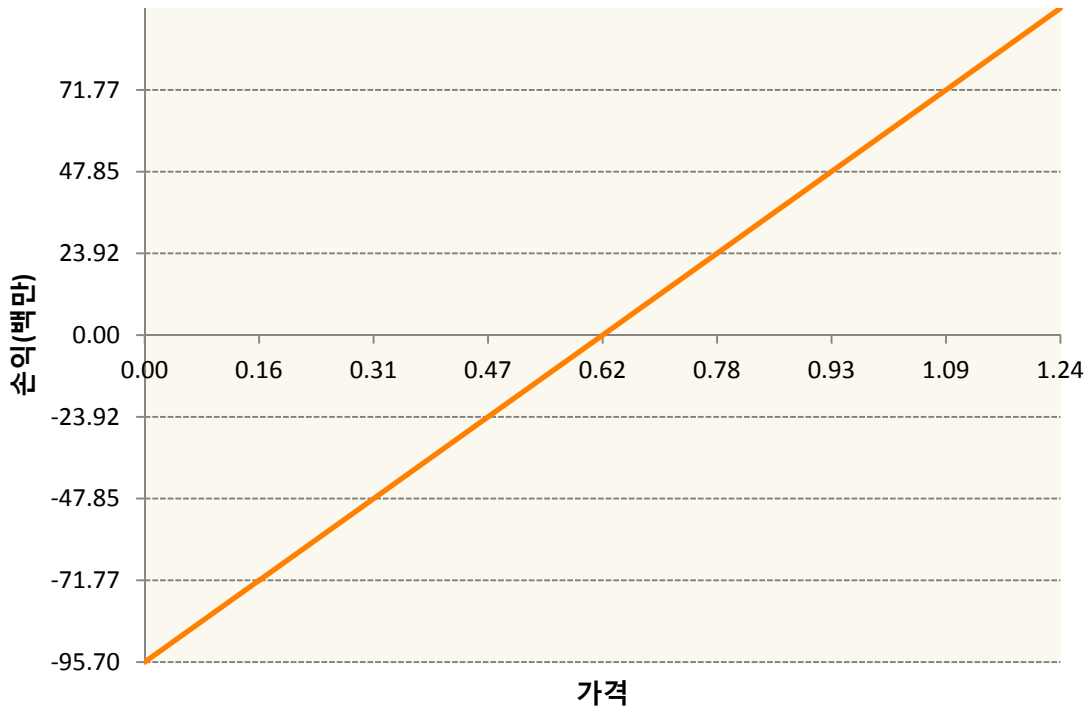
가격

QSN0-Low Su Gasoil G Jul20



가격

XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN0	WTI CRUDE FUTURE Jul20	11
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	18
HON0	NY Harb ULSD Fut Jul20	7
	KR4175Q50C 2020-05 달러선물	15
NGN20	NATURAL GAS FUTR Jul20	58
QSN0	Low Su Gasoil G Jul20	8
XBN0	GASOLINE RBOB FUT Jul20	8

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

(단위:백만원)

471

공시일	2020-04-23
기준일	2020-04-22

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

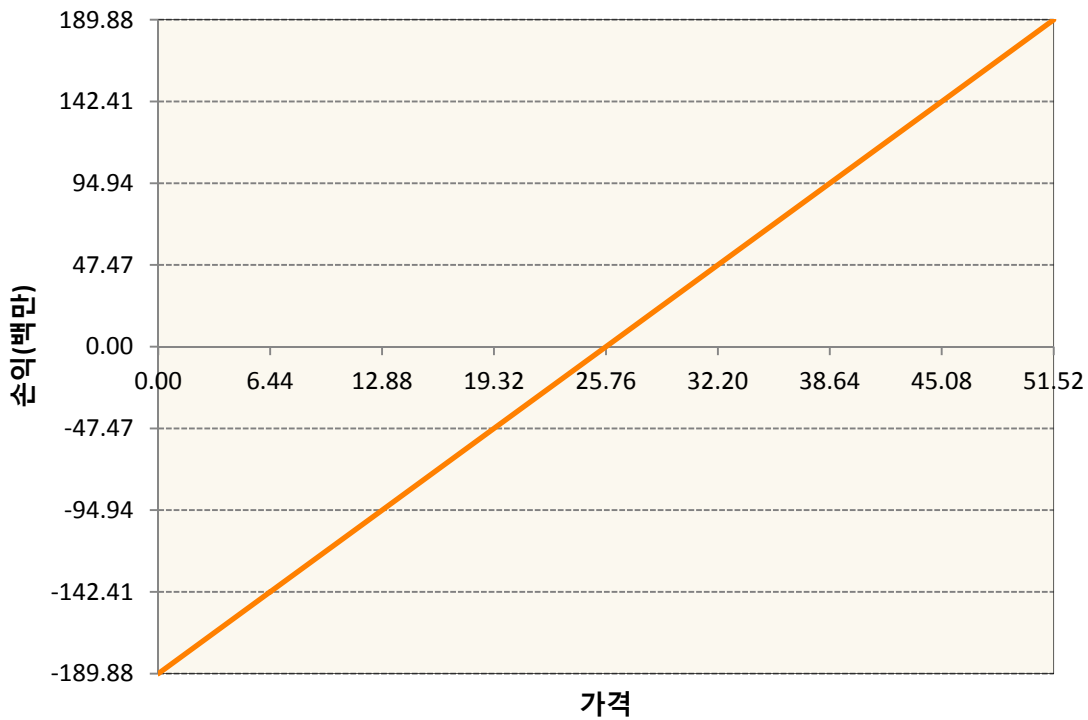
1. 계약금액

(단위:백만원)

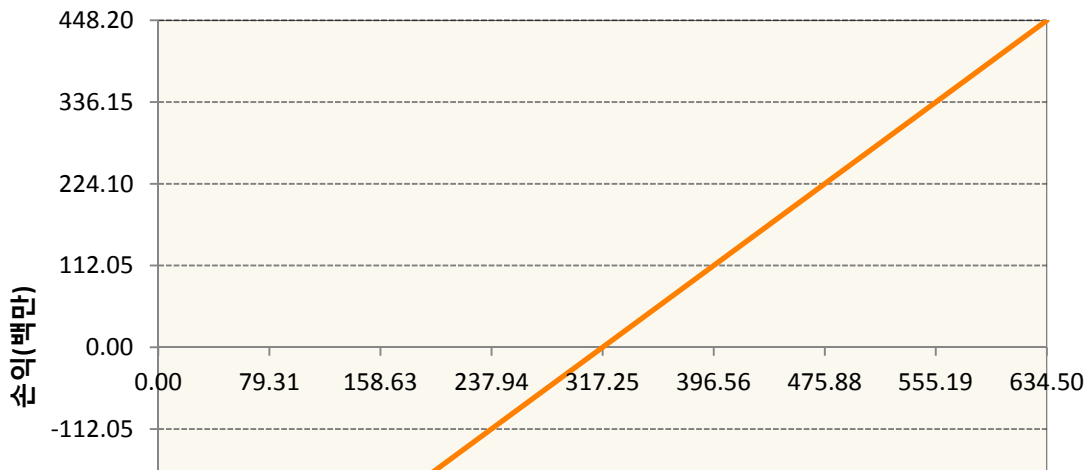
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,376	74	2,302	

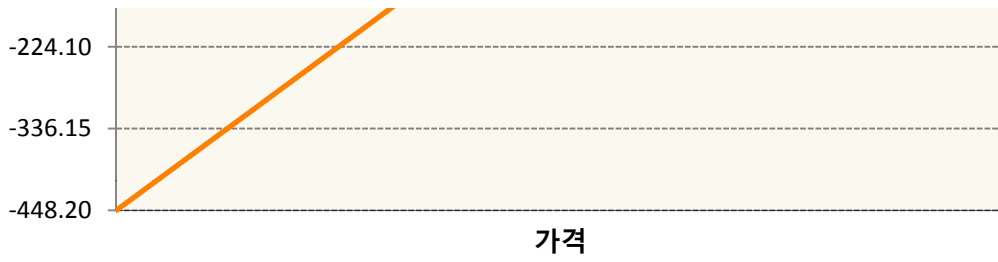
2. 만기시점의 손익구조

BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20

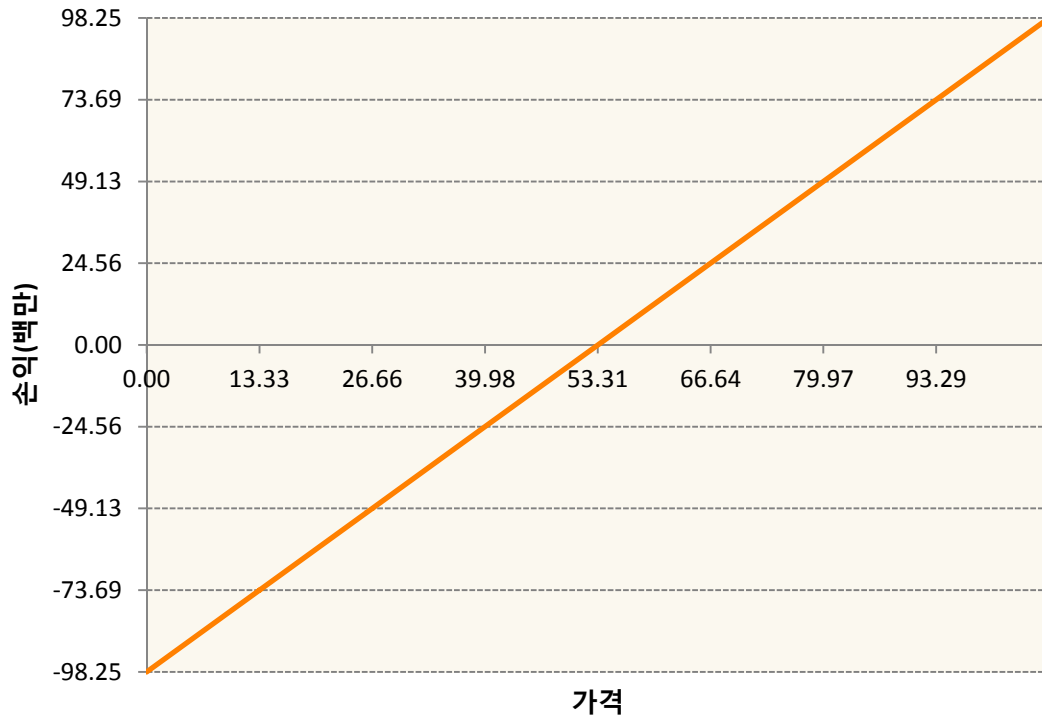


CNO-CORN FUTURE Jul20

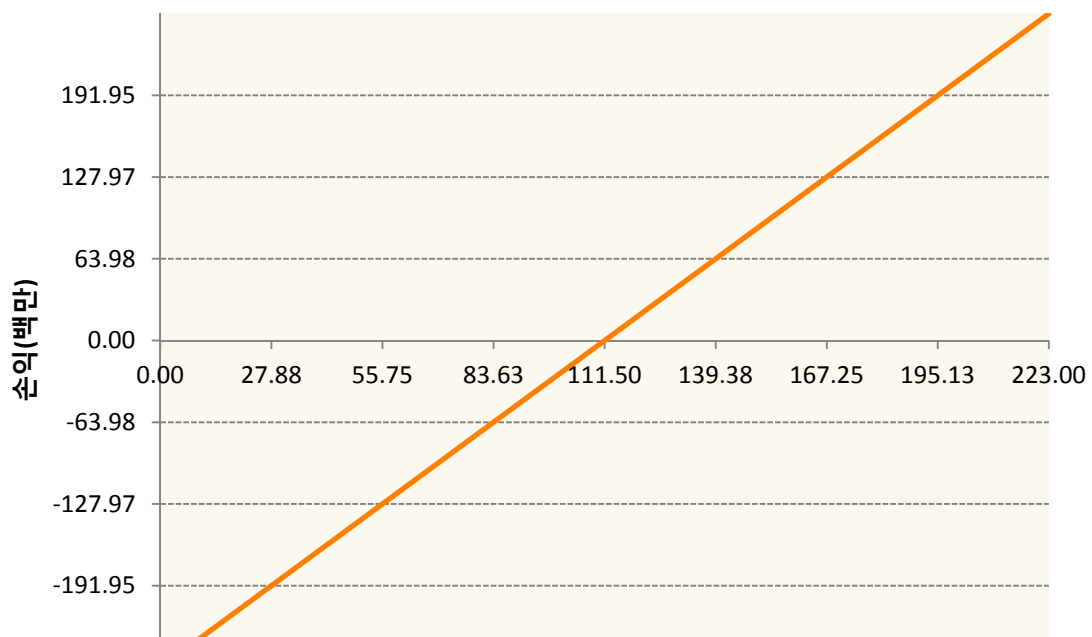


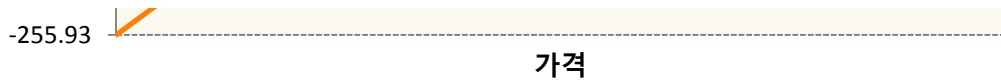


CTN0-COTTON NO.2 FUTR Jul20

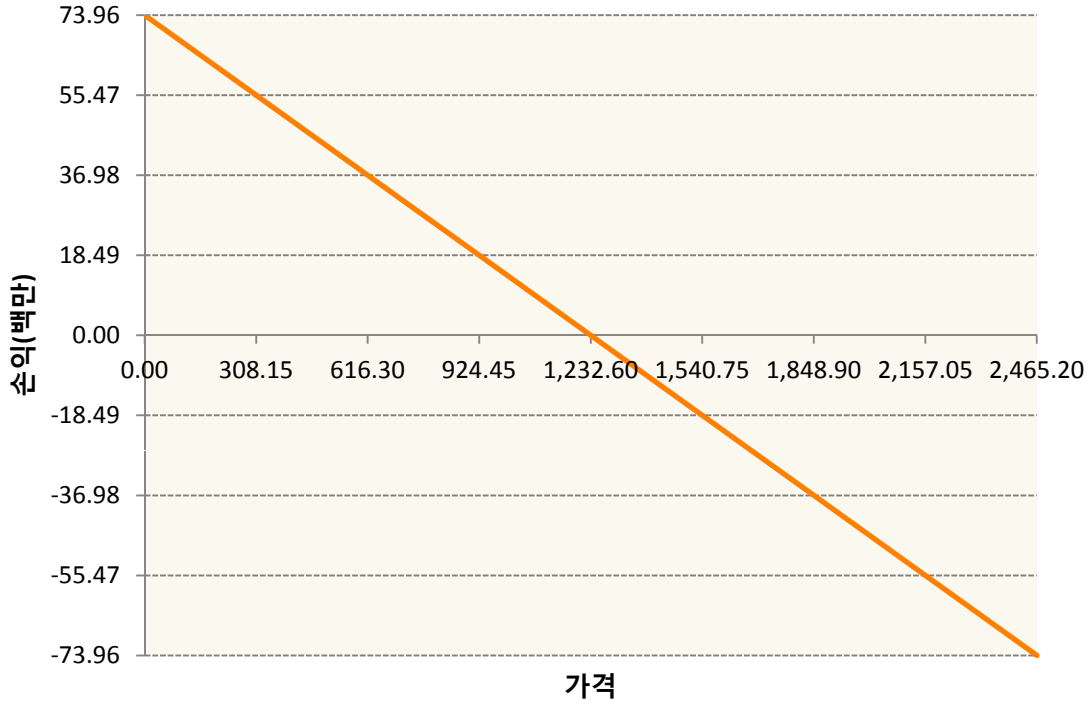


KCN0-COFFEE 'C' FUTURE Jul20

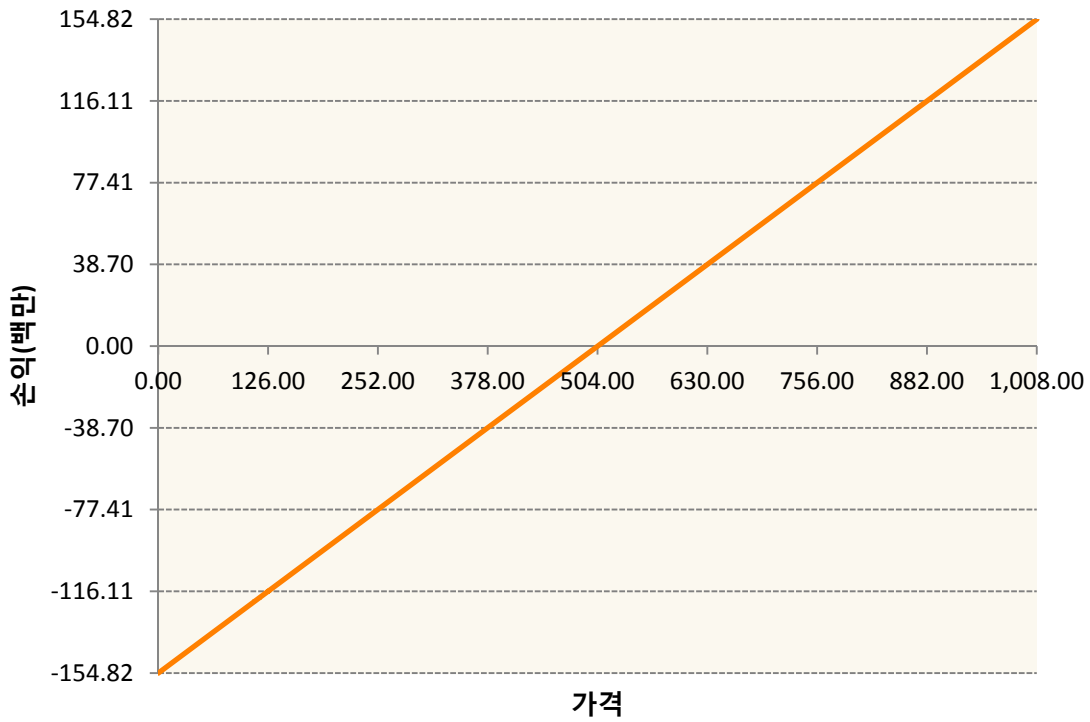




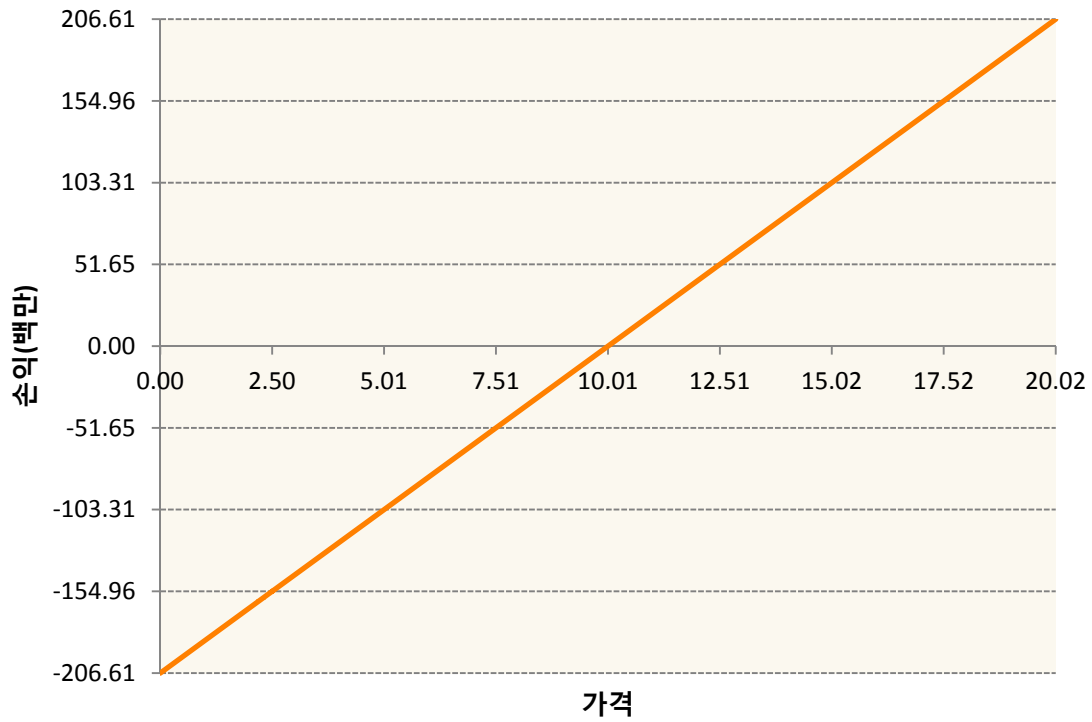
KR4175Q50007-2020-05 달러선물



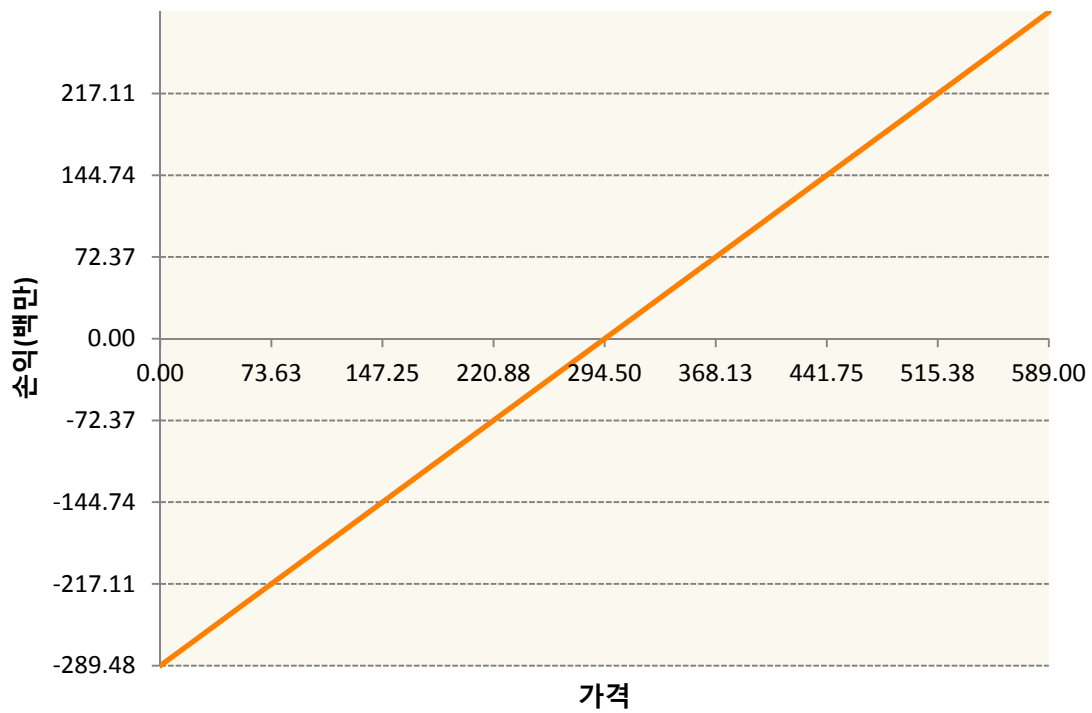
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



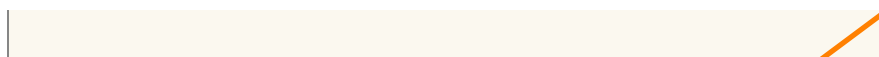
SBN0-Sugar Jul20

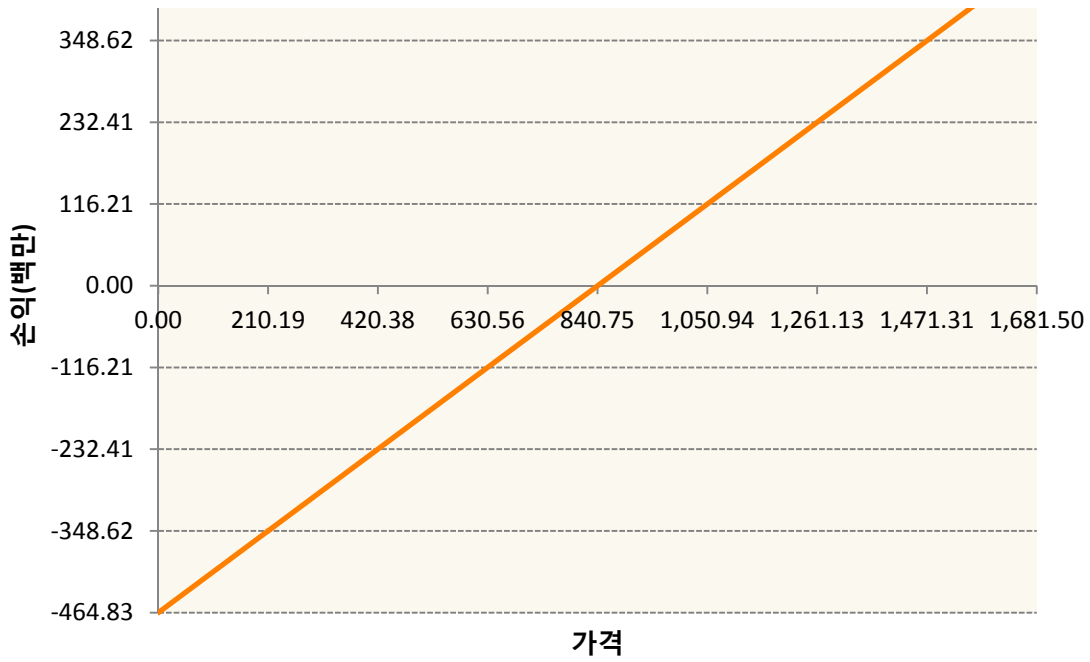


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20

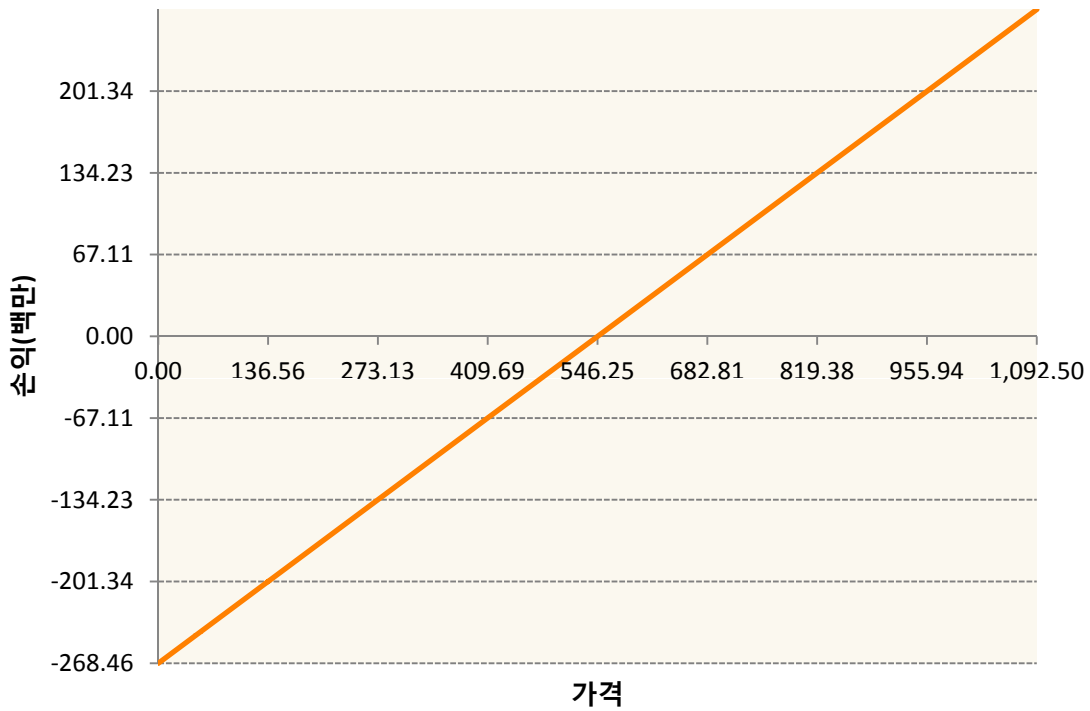


SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





WN0-WHEAT FUTURE(CBT) Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON0	SOYBEAN OIL FUTR Jul20	15
CN0	CORN FUTURE Jul20	36
CTN0	COTTON NO.2 FUTR Jul20	8
KCN0	COFFEE 'C' FUTURE Jul20	20
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)

224