

공시일	2020-04-24
기준일	2020-04-23

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	2020-04-24
기준일	2020-04-23

스마트인덱스모

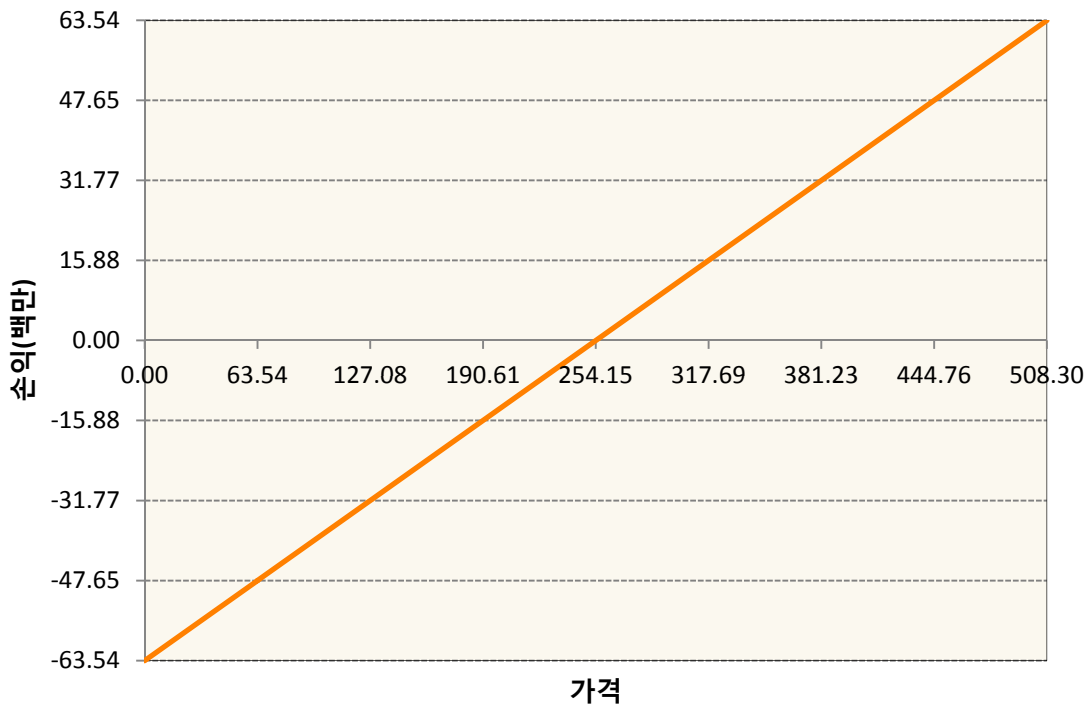
1. 계약금액

(단위:백만원)

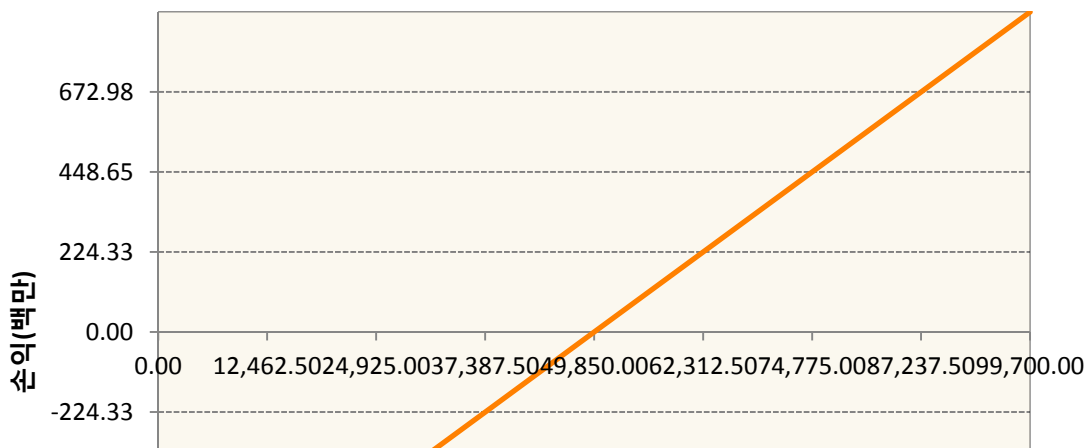
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	63	-63	장내
누계	유가증권	선물	961	0	961	장내

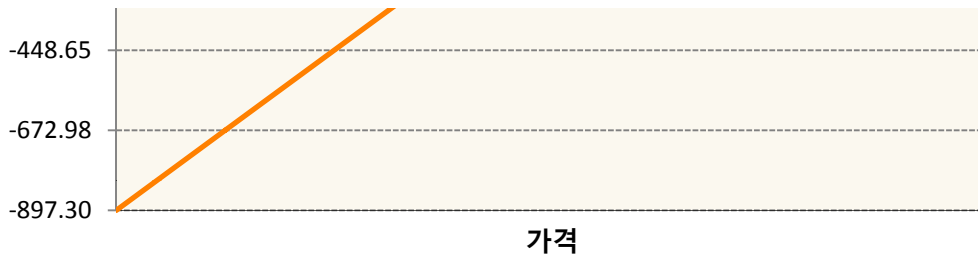
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



KR4111Q50002-2020-05 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						5
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	2	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	3	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	5	5	5	5	5	5	5	5
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	-72
-5.33%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
-2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	24	24	24	24	24	24	24	24
5.33%	48	48	48	48	48	48	48	48
8.00%	72	72	72	72	72	72	72	72

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

115

공시일	2020-04-24
기준일	2020-04-23

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)

1,107

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-24
기준일	2020-04-23

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

557

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

882

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-24
기준일	2020-04-23

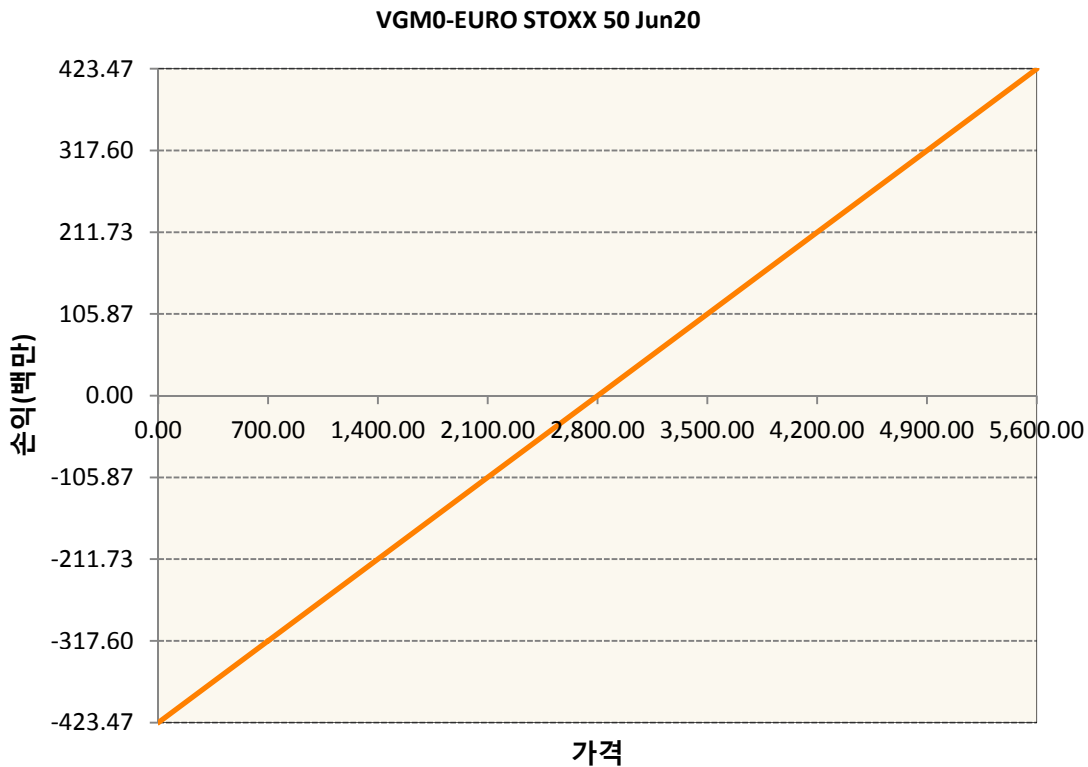
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	423	0	423	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

42

공시일	2020-04-24
기준일	2020-04-23

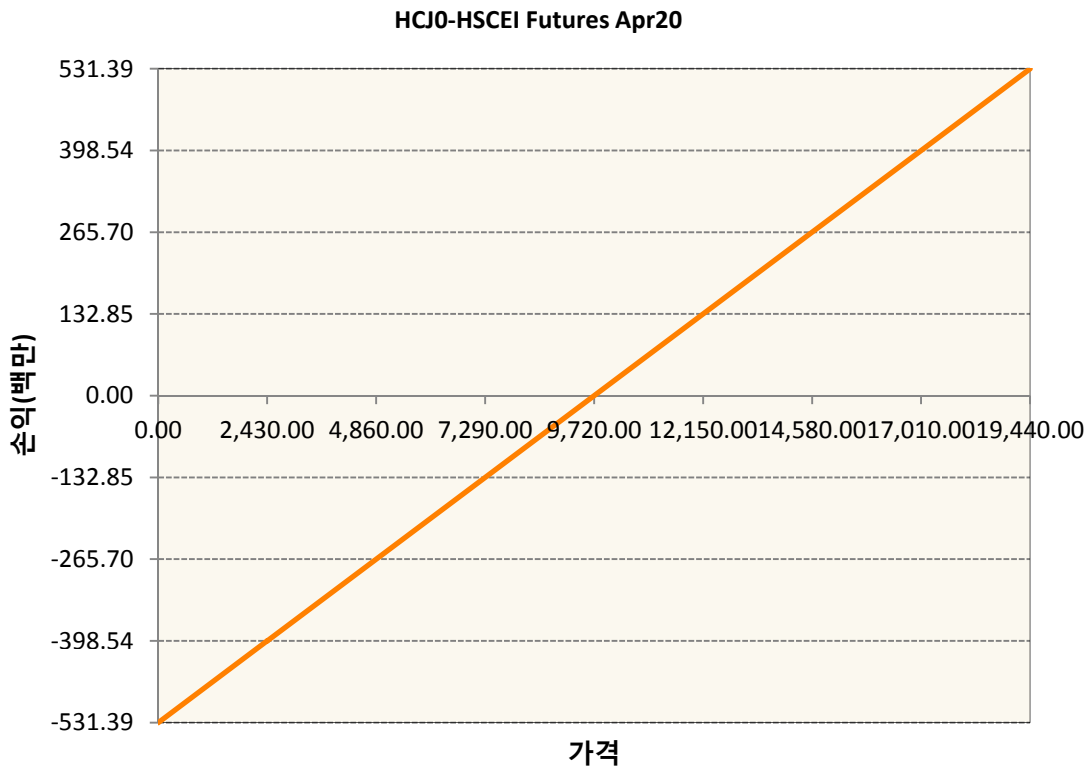
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	531	0	531	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ0	HSCEI Futures Apr20	43
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

45

공시일	2020-04-24
기준일	2020-04-23

커버드콜모(주식혼합-파생형)

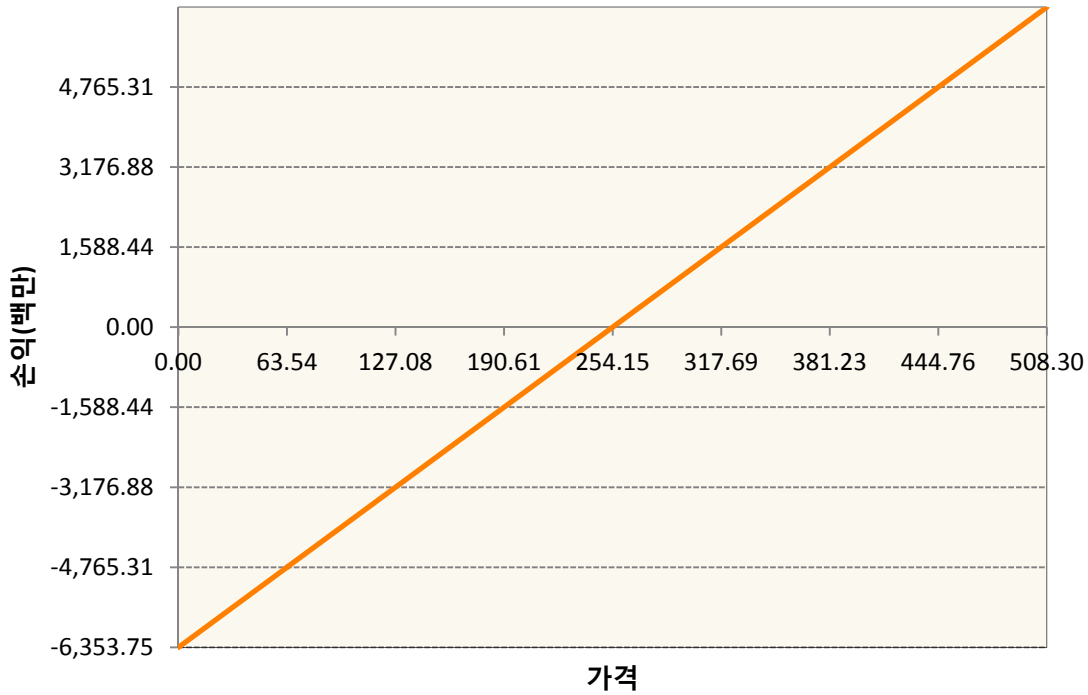
1. 계약금액

(단위:백만원)

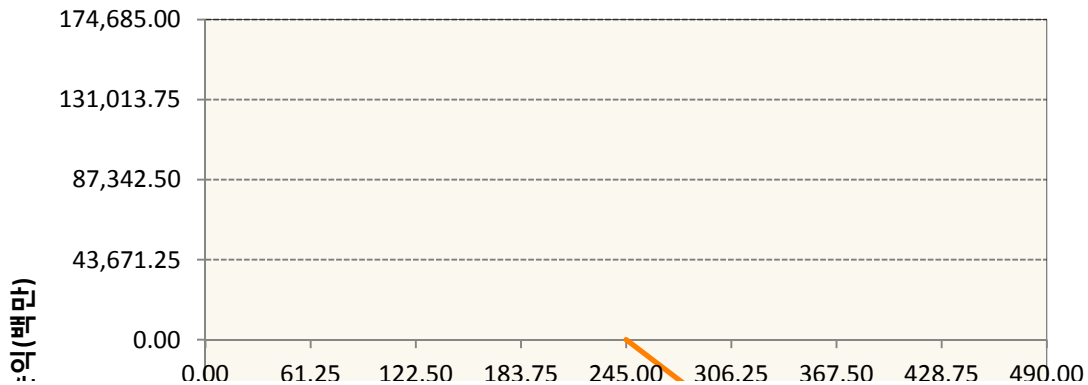
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,354	0	6,354	장내
누계	유가증권	옵션	0	358,345	-358,345	장내

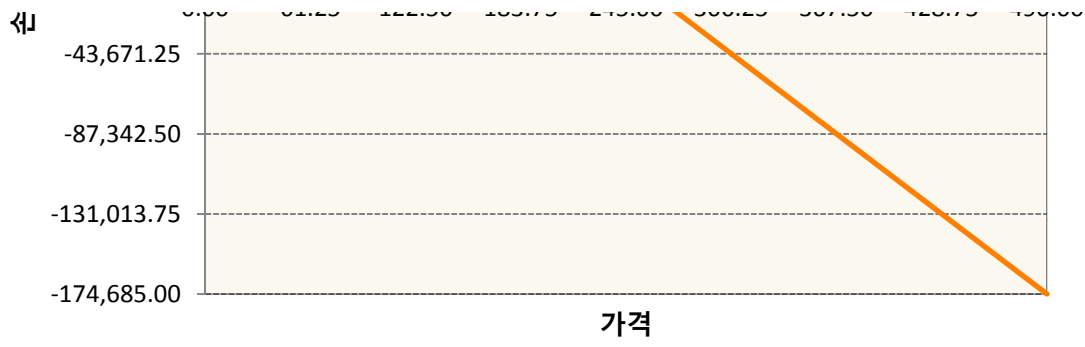
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

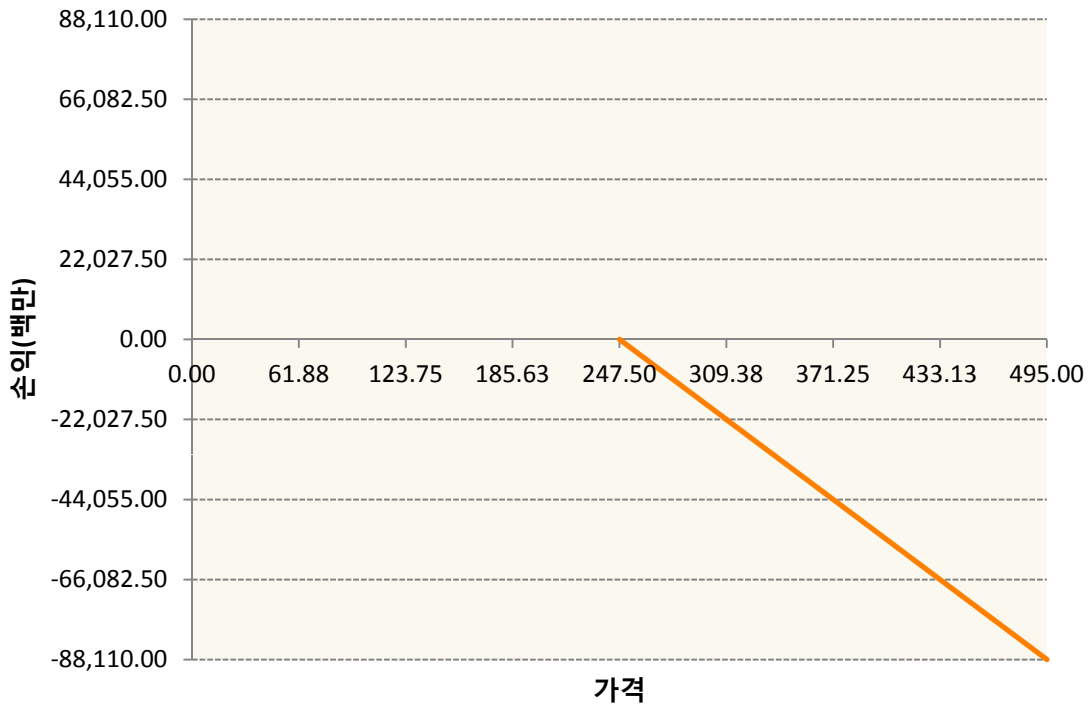


KR4201Q52452-2020-05 콜245

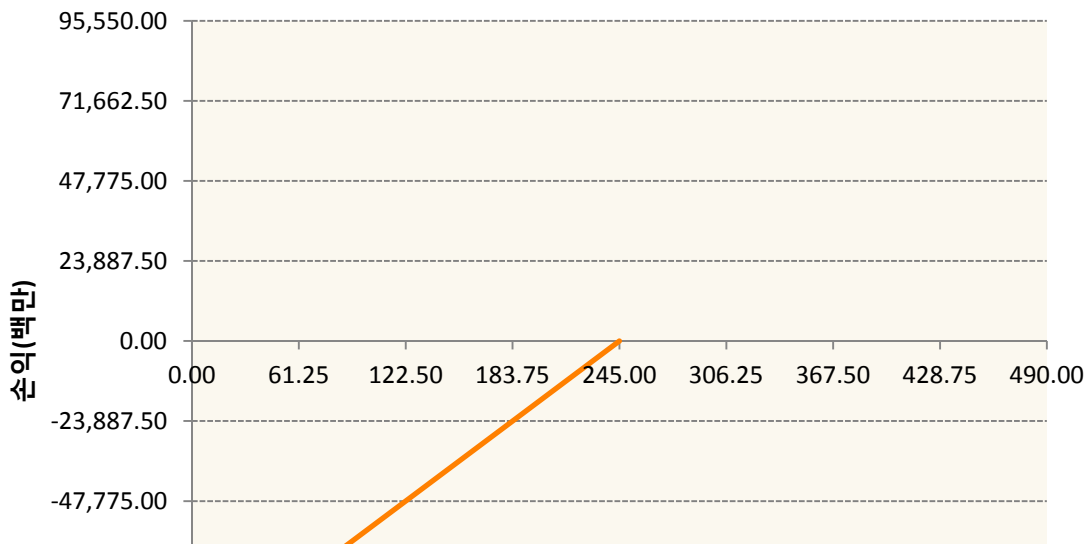


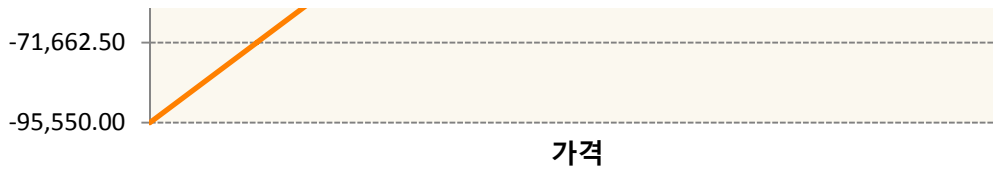


KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						507
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-507	-507	-507	-507	-507	-507	-507	
-5.33%	-338	-338	-338	-338	-338	-338	-338	
-2.67%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	169	169	169	169	169	169	169	
5.33%	338	338	338	338	338	338	338	
8.00%	507	507	507	507	507	507	507	
KR4201Q52452		2020-05 콜245						12,327
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	8,938	8,377	7,801	7,213	6,616	6,012	5,403	
-5.33%	7,205	6,563	5,917	5,270	4,621	3,971	3,320	
-2.67%	4,861	4,195	3,528	2,862	2,195	1,528	862	
0%	1,915	1,284	645	0	-650	-1,303	-1,959	
2.67%	-1,568	-2,117	-2,690	-3,279	-3,883	-4,497	-5,120	
5.33%	-5,489	-5,932	-6,413	-6,924	-7,460	-8,016	-8,589	
8.00%	-9,738	-10,071	-10,453	-10,875	-11,332	-11,817	-12,327	
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5						6,004
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4,172	3,908	3,634	3,353	3,065	2,771	2,474	
-5.33%	3,410	3,097	2,782	2,464	2,144	1,823	1,500	
-2.67%	2,351	2,016	1,681	1,346	1,011	676	341	
0%	990	662	332	0	-333	-667	-1,001	
2.67%	-651	-946	-1,250	-1,560	-1,875	-2,194	-2,516	
5.33%	-2,529	-2,775	-3,037	-3,312	-3,596	-3,889	-4,189	
8.00%	-4,591	-4,782	-4,995	-5,226	-5,473	-5,733	-6,004	
KR4301Q52450		2020-05 풋245						4,763
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,432	-3,635	-3,848	-4,068	-4,295	-4,527	-4,763	
-5.33%	-1,603	-1,859	-2,117	-2,377	-2,638	-2,900	-3,163	
-2.67%	-210	-481	-752	-1,022	-1,293	-1,564	-1,836	

0%	743	501	252	0	-256	-514	-775
2.67%	1,327	1,140	939	727	505	276	41
5.33%	1,646	1,520	1,375	1,212	1,036	846	647
8.00%	1,801	1,727	1,632	1,518	1,387	1,241	1,081

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

(단위:백만원)

21,150

공시일	2020-04-24
기준일	2020-04-23

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

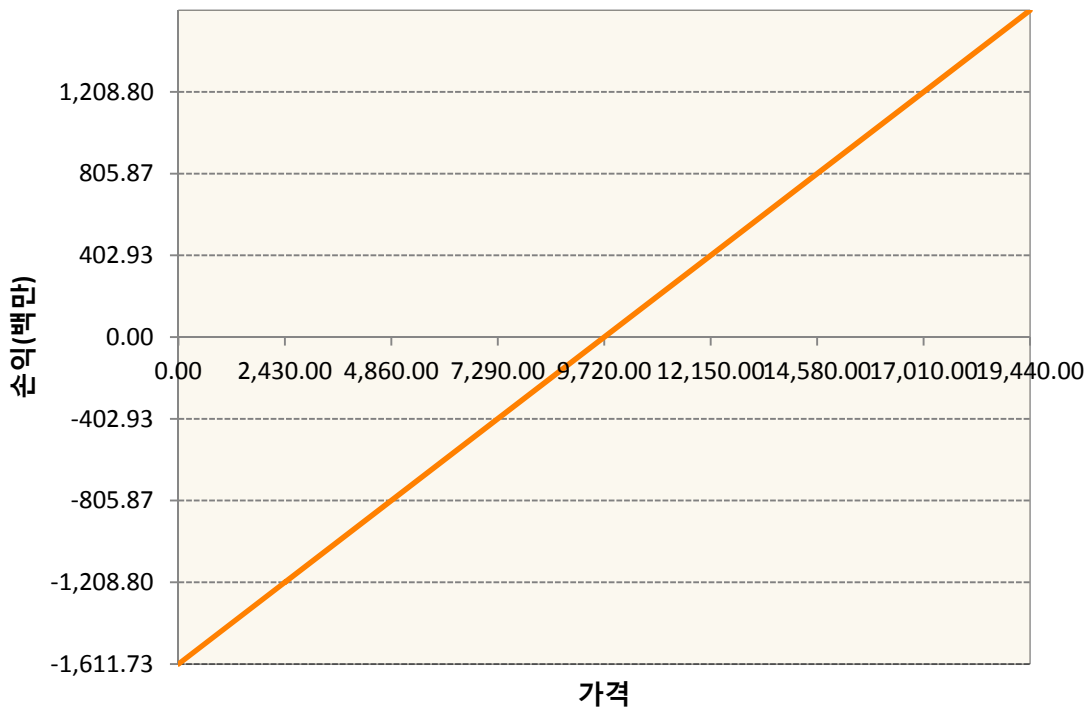
1. 계약금액

(단위:백만원)

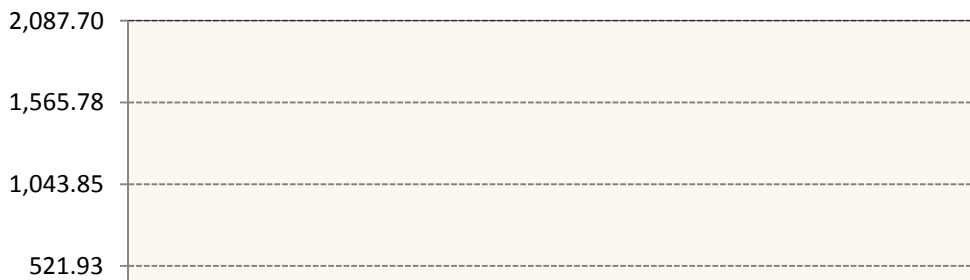
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,612	0	1,612	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,177	-4,177	장내
누계	통화	선도	698	2,234	-1,536	장외

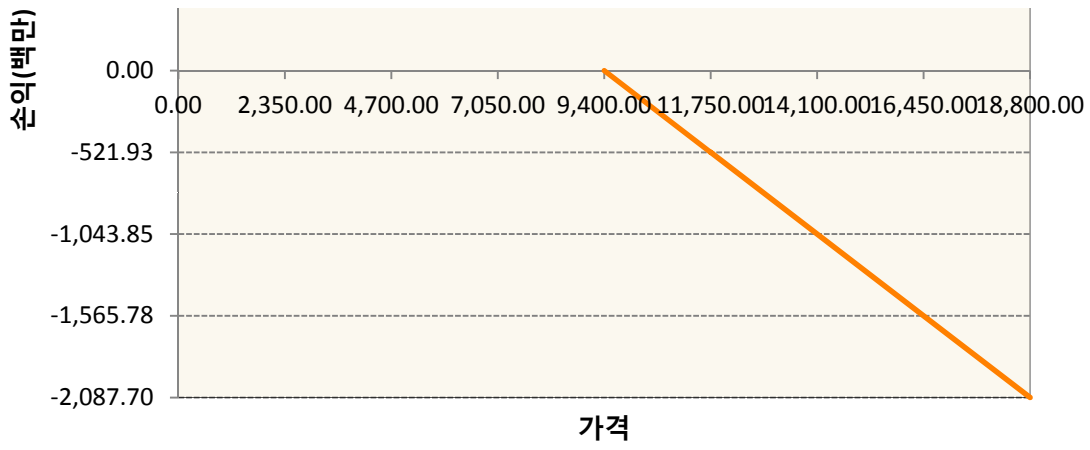
2. 만기시점의 손익구조

HCJ0-HSCEI Futures Apr20

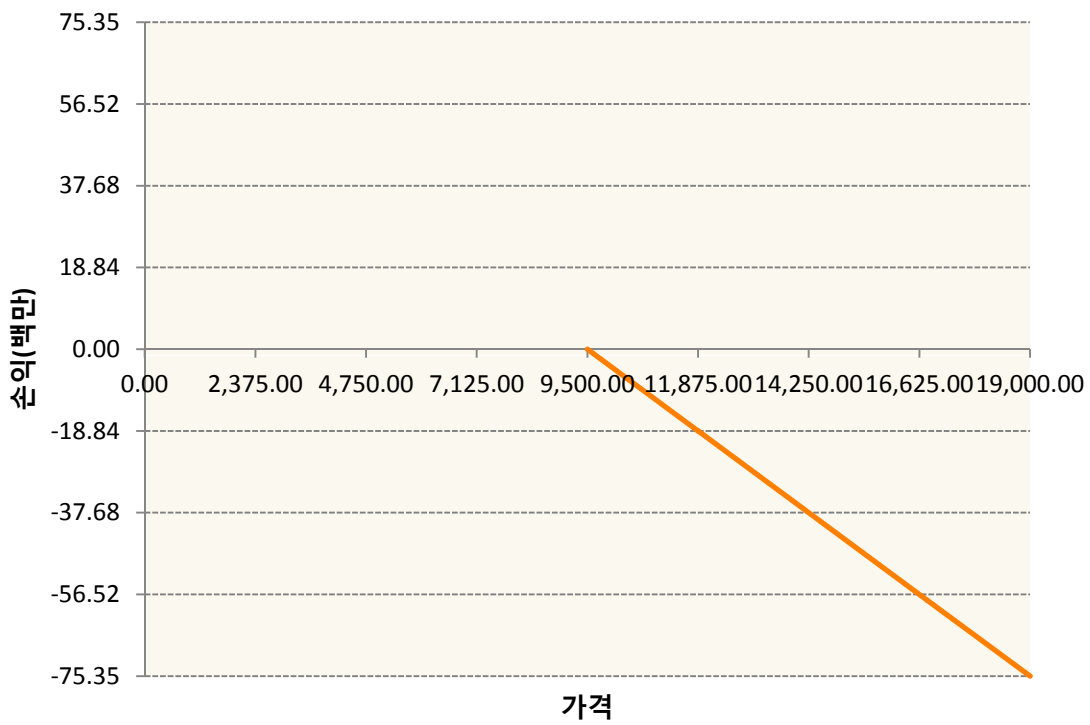


OHHIJ0-C94-HSCEI

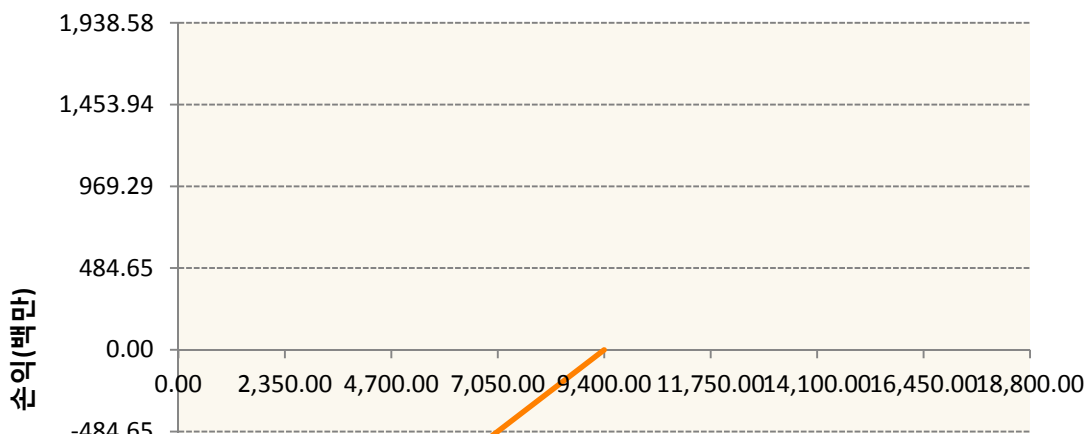


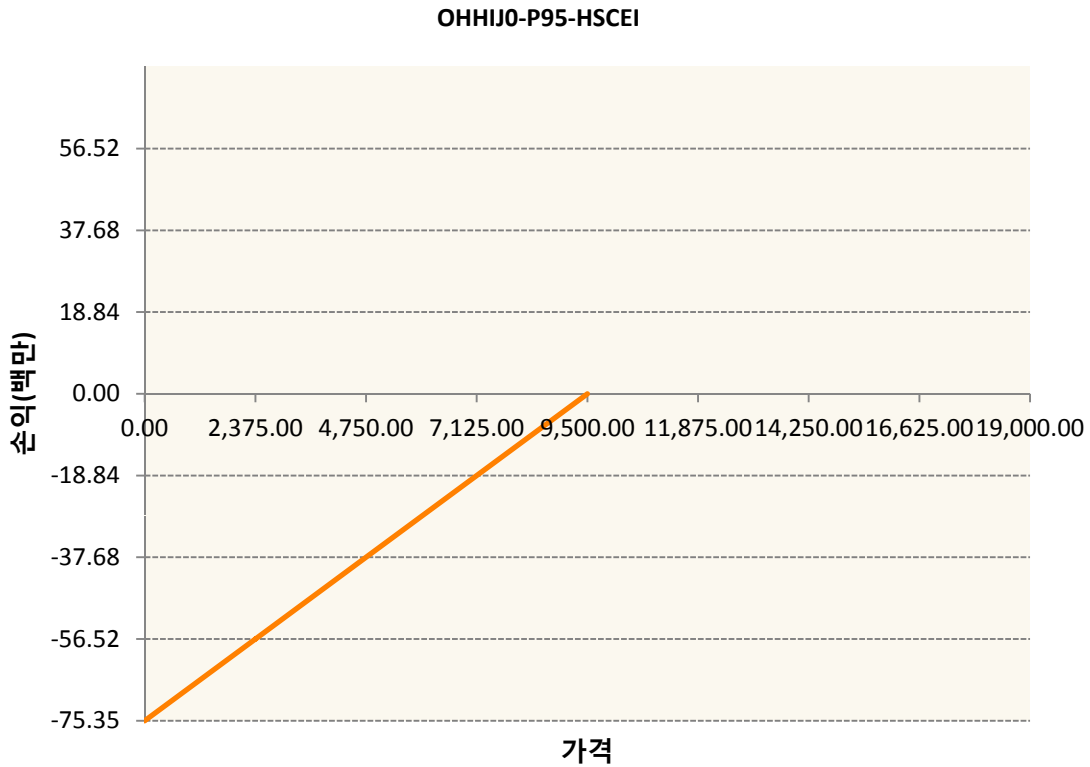


OHHIJO-C95-HSCEI



OHHIJO-P94-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E	179
FX21020H05 HKD/KRW 22-05-20E	56
HCJ0 HSCEI Futures Apr20	129
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	2020-04-24
기준일	2020-04-23

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

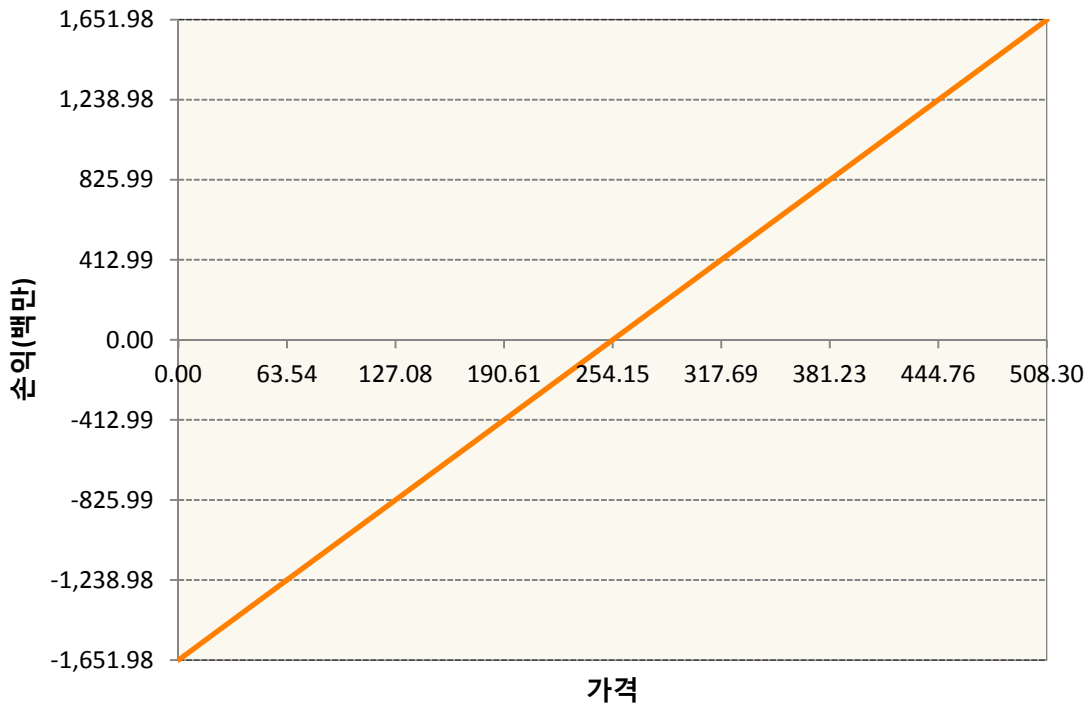
1. 계약금액

(단위:백만원)

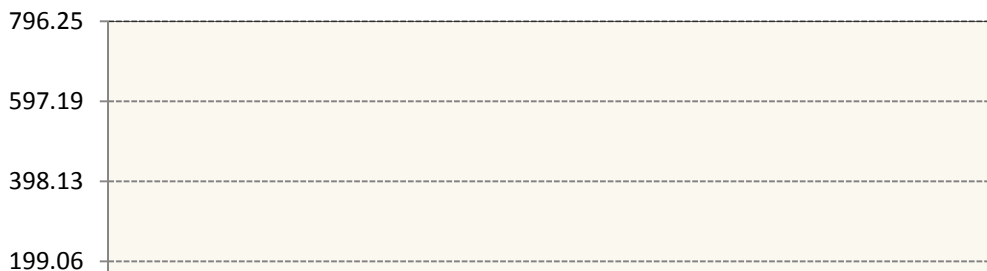
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,652	0	1,652	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,193	-3,193	장내

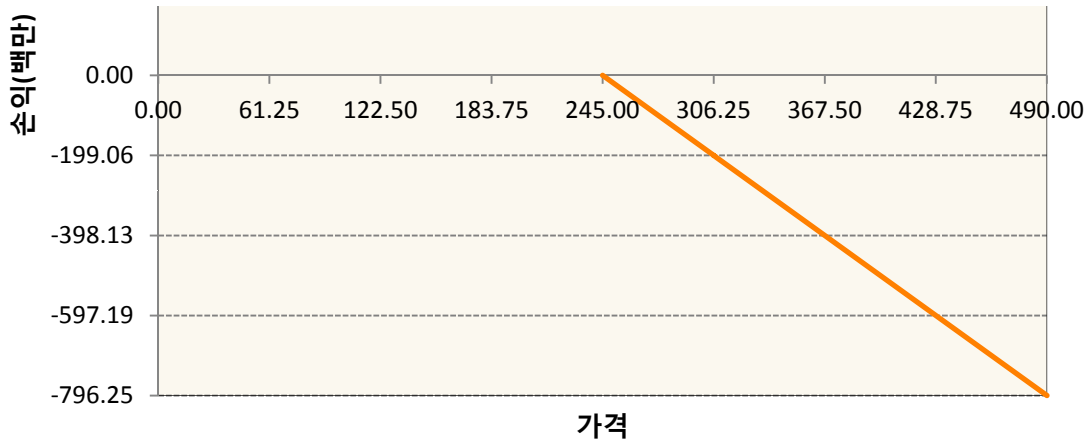
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

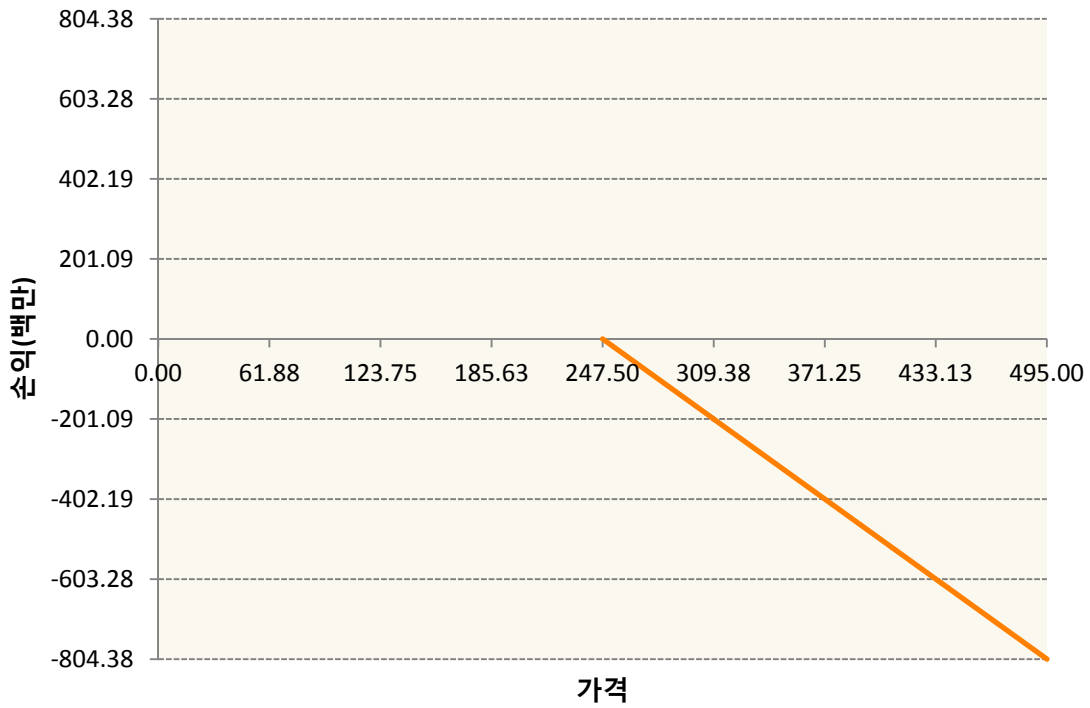


KR4201Q52452-2020-05 콜245

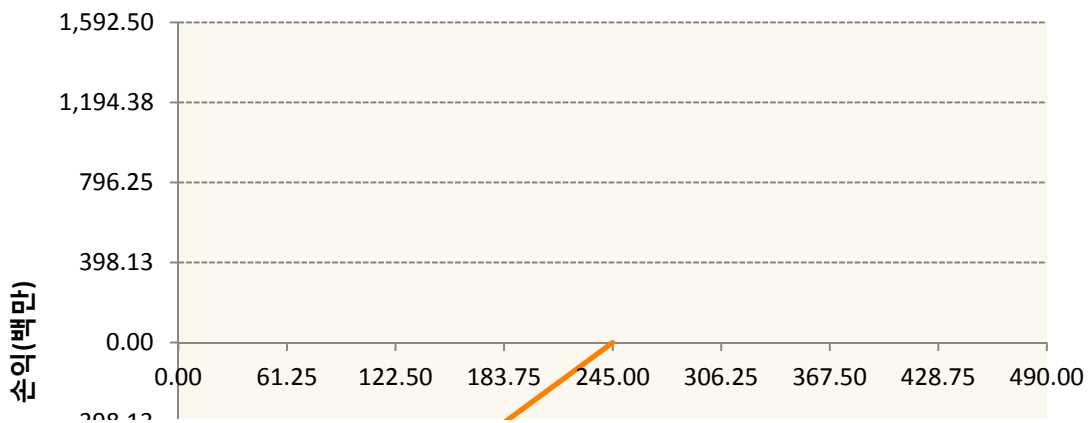




KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



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						132
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132	
-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%	132	132	132	132	132	132	132	
KR4201Q52452		2020-05 콜245						56
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	41	38	36	33	30	27	25	
-5.33%	33	30	27	24	21	18	15	
-2.67%	22	19	16	13	10	7	4	
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9	
2.67%	-7	-10	-12	-15	-18	-20	-23	
5.33%	-25	-27	-29	-32	-34	-37	-39	
8.00%	-44	-46	-48	-50	-52	-54	-56	
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5						55
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	38	36	33	31	28	25	23
-5.33%	31	28	25	22	20	17	14
-2.67%	21	18	15	12	9	6	3
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	-6	-9	-11	-14	-17	-20	-23
5.33%	-23	-25	-28	-30	-33	-36	-38
8.00%	-42	-44	-46	-48	-50	-52	-55
KR4301Q52450 2020-05 풋245							79
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-57	-61	-64	-68	-72	-75	-79
-5.33%	-27	-31	-35	-40	-44	-48	-53
-2.67%	-4	-8	-13	-17	-22	-26	-31
0%	12	8	4	0	-4	-9	-13
2.67%	22	19	16	12	8	5	1
5.33%	27	25	23	20	17	14	11
8.00%	30	29	27	25	23	21	18

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

(단위:백만원)

548

공시일	2020-04-24
기준일	2020-04-23

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

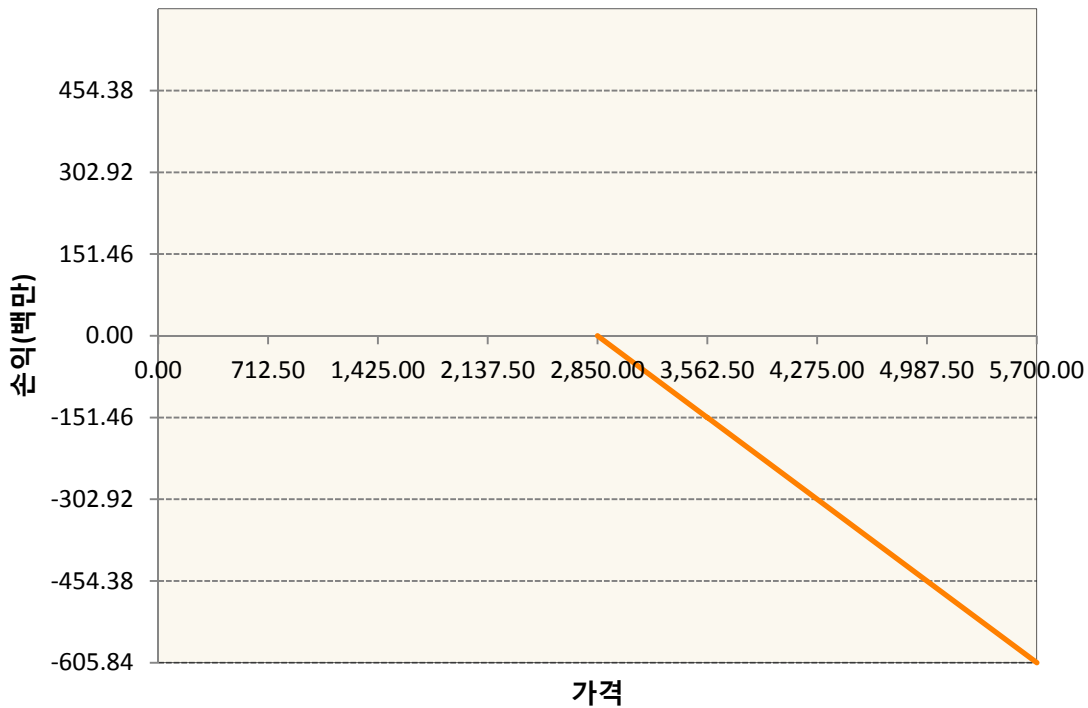
1. 계약금액

(단위:백만원)

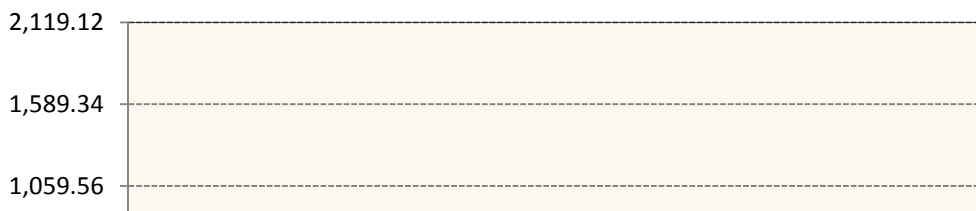
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	453	0	453	
누계	유가증권	스왑	7,924	0	7,924	장외
누계	유가증권	옵션	0	5,450	-5,450	장내
누계	통화	선도	0	2,689	-2,689	장외

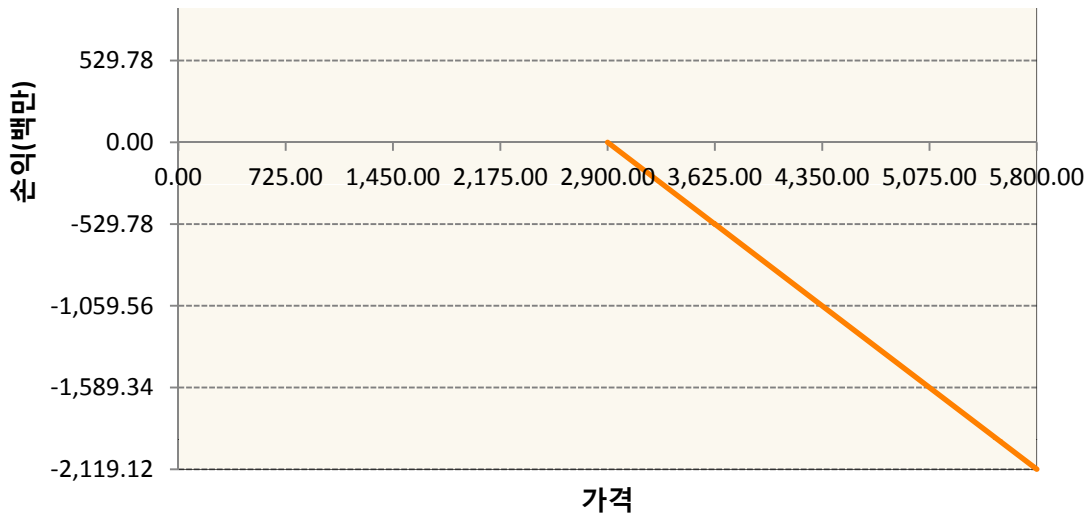
2. 만기시점의 손익구조

OESXK0-C2850-EURO STOXX 50

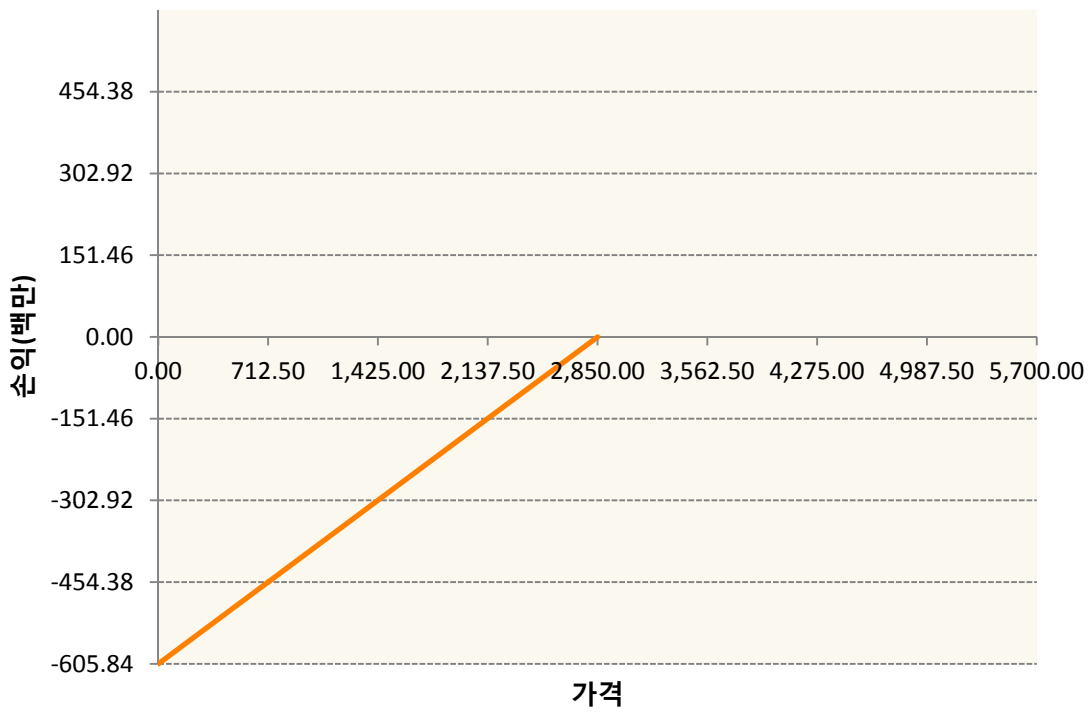


OESXK0-C2900-EURO STOXX 50

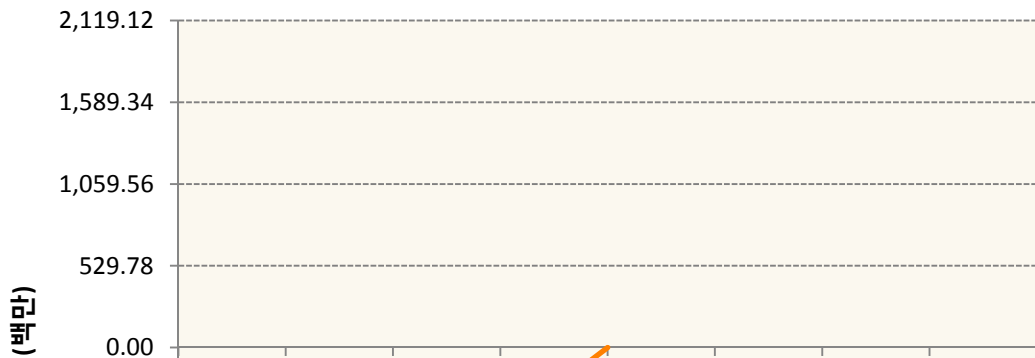


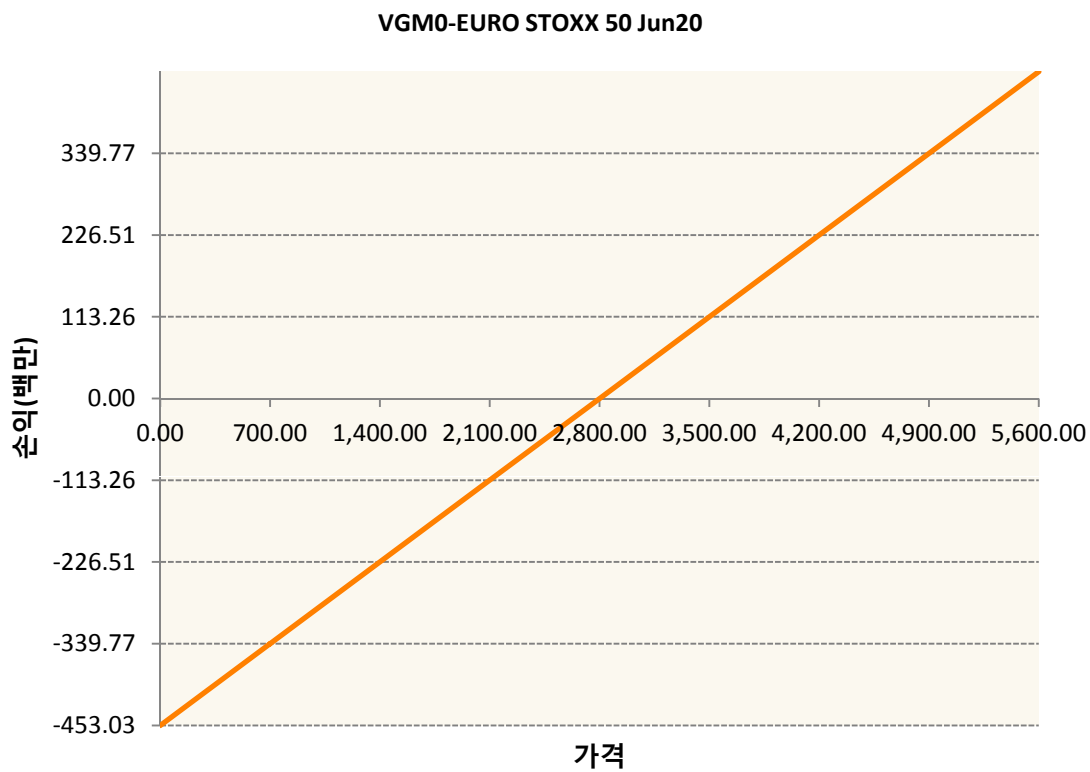
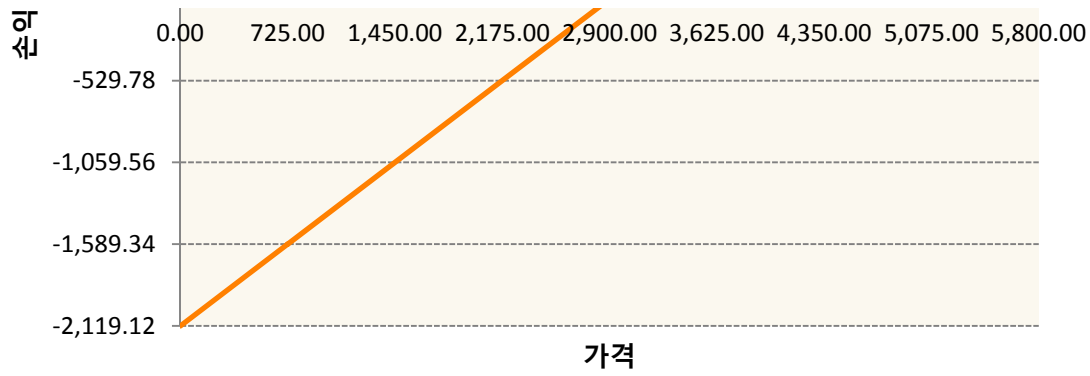


OESXK0-P2850-EURO STOXX 50



OESXK0-P2900-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	5
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E	215
OESXK0-C28 EURO STOXX 50	48
OESXK0-C29 EURO STOXX 50	170
OESXK0-P28 EURO STOXX 50	48
OESXK0-P29 EURO STOXX 50	170
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20	36

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

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

(단위:백만원)

1,126

공시일	2020-04-24
기준일	2020-04-23

ETF스마트레버리지목표전환형9호

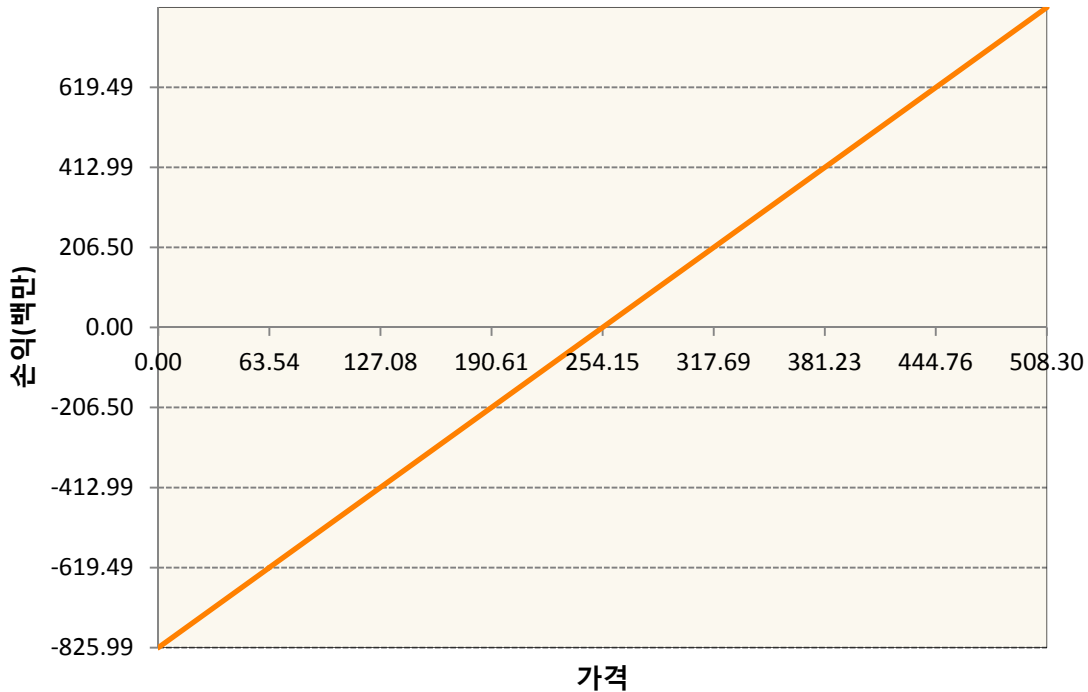
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	826	0	826	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						66
가격	기초자산의 변동성							
	-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)

98

공시일	2020-04-24
기준일	2020-04-23

ETF스마트레버리지목표전환형10호

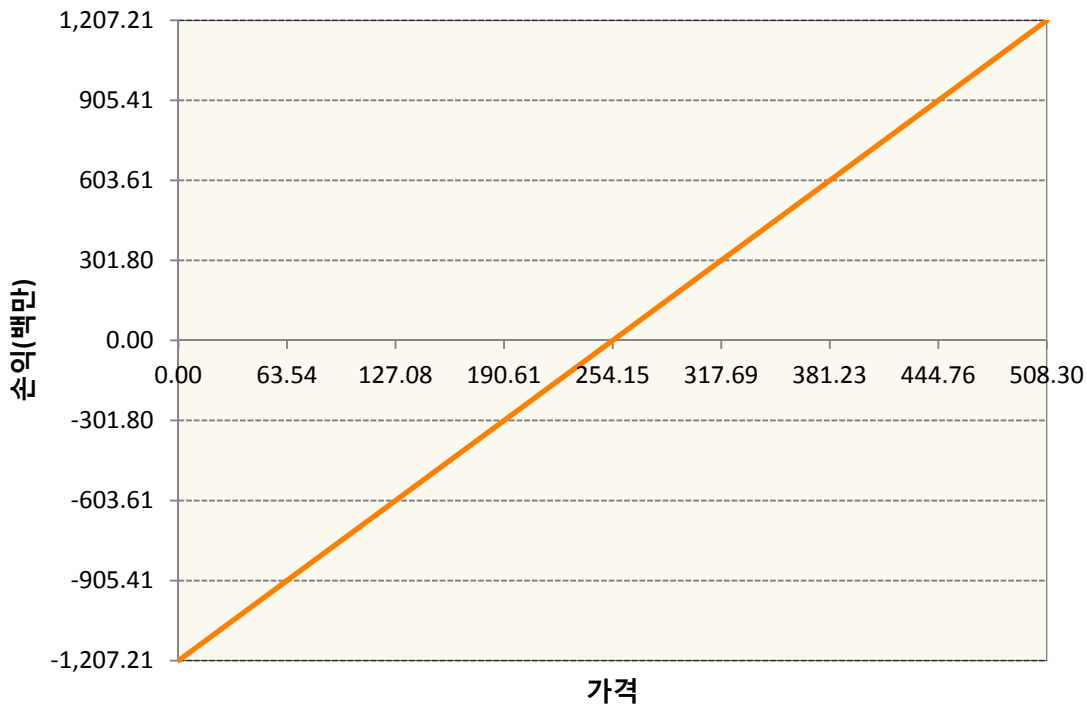
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,207	0	1,207	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)

143

공시일	2020-04-24
기준일	2020-04-23

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

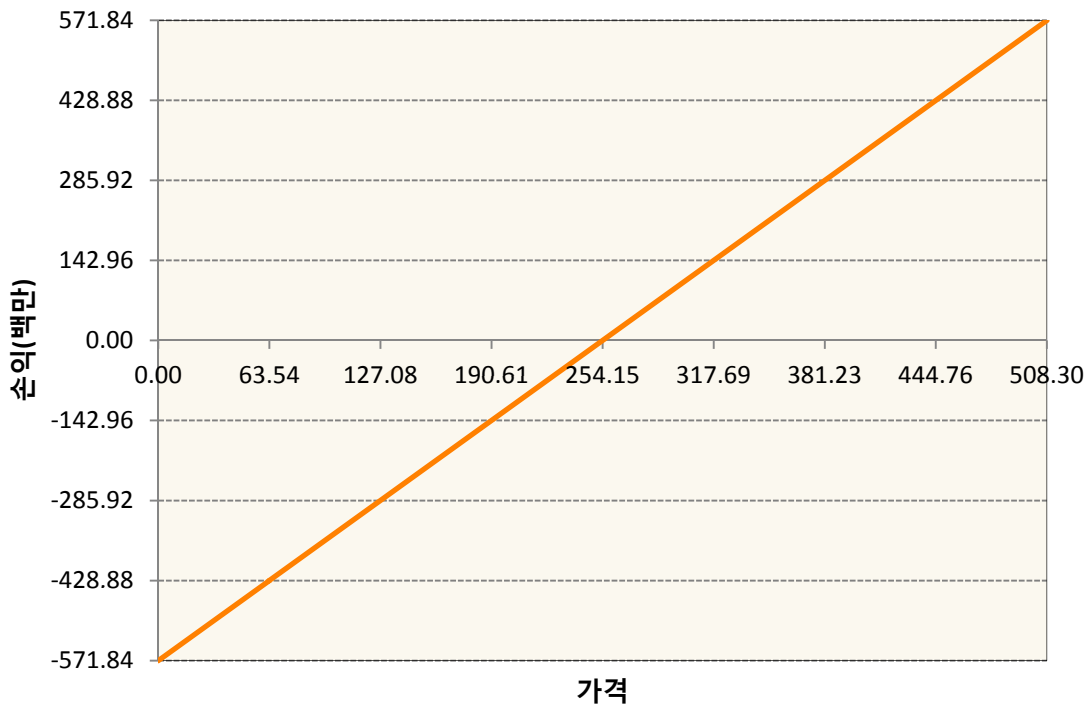
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	572	0	572	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%	-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%	46	46	46	46	46	46	46	

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

(단위:백만원)

68

공시일	2020-04-24
기준일	2020-04-23

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

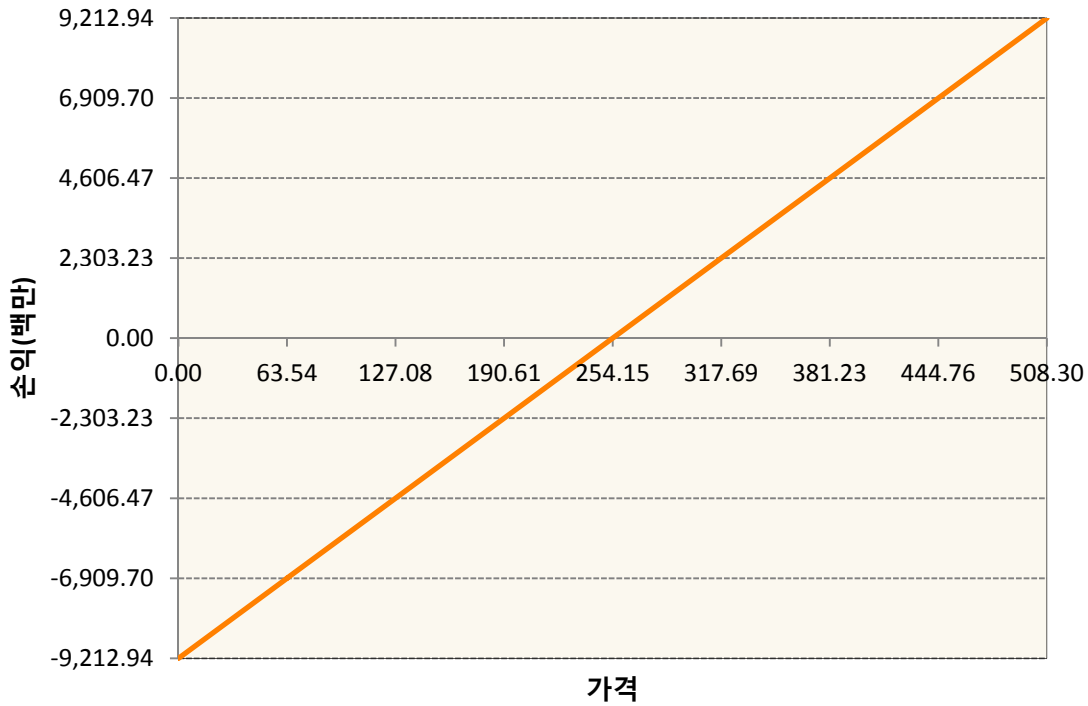
1. 계약금액

(단위:백만원)

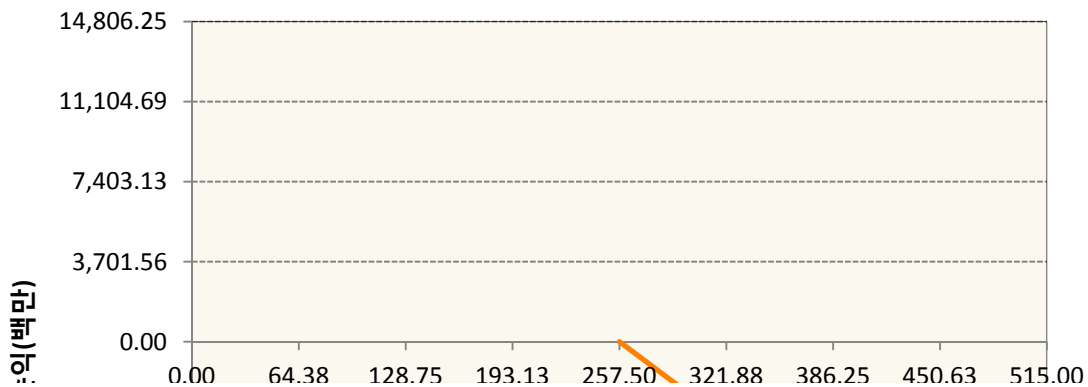
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,213	0	9,213	장내
누계	유가증권	옵션	6,201	17,536	-11,335	장내

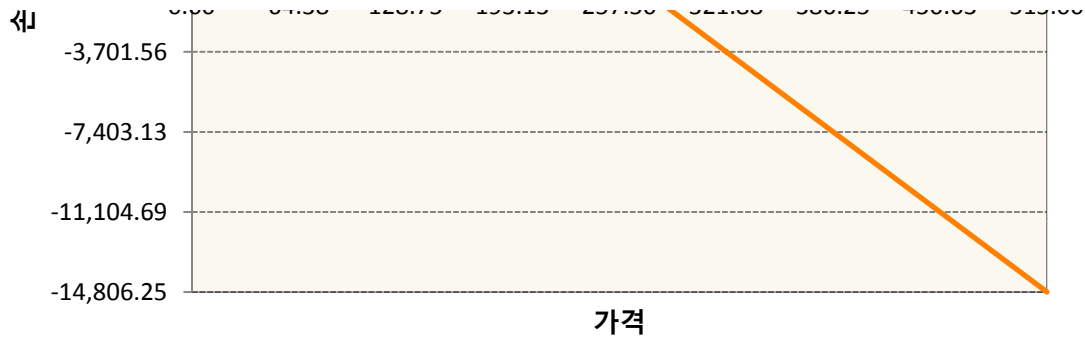
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

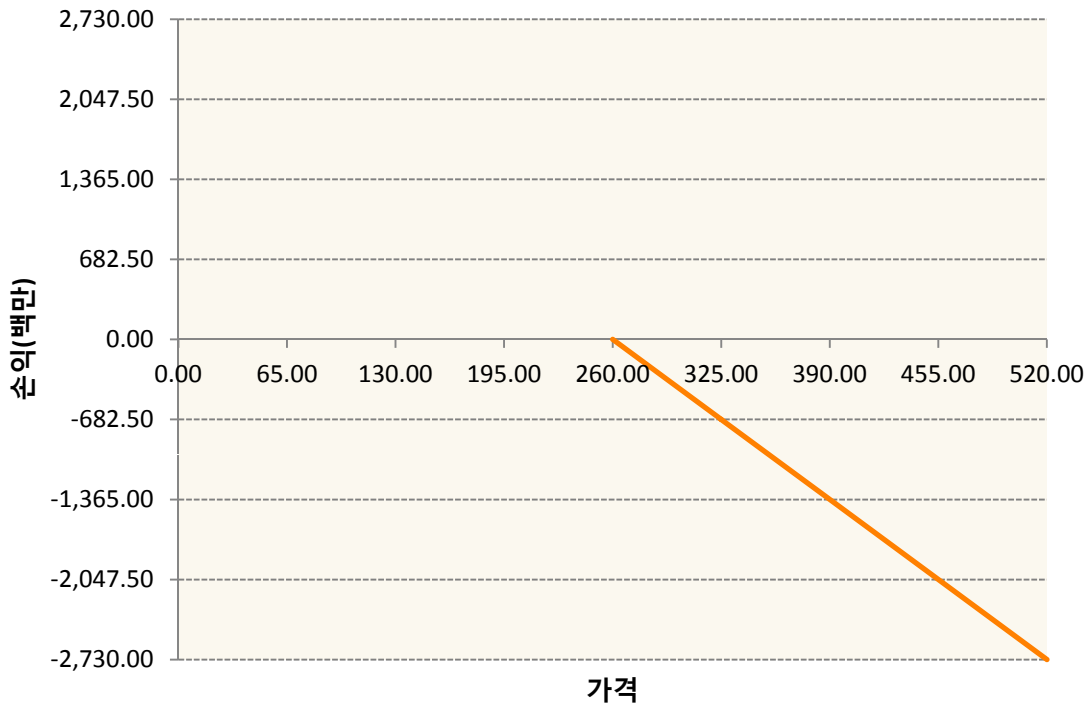


KR4201Q52577-2020-05 콜257.5

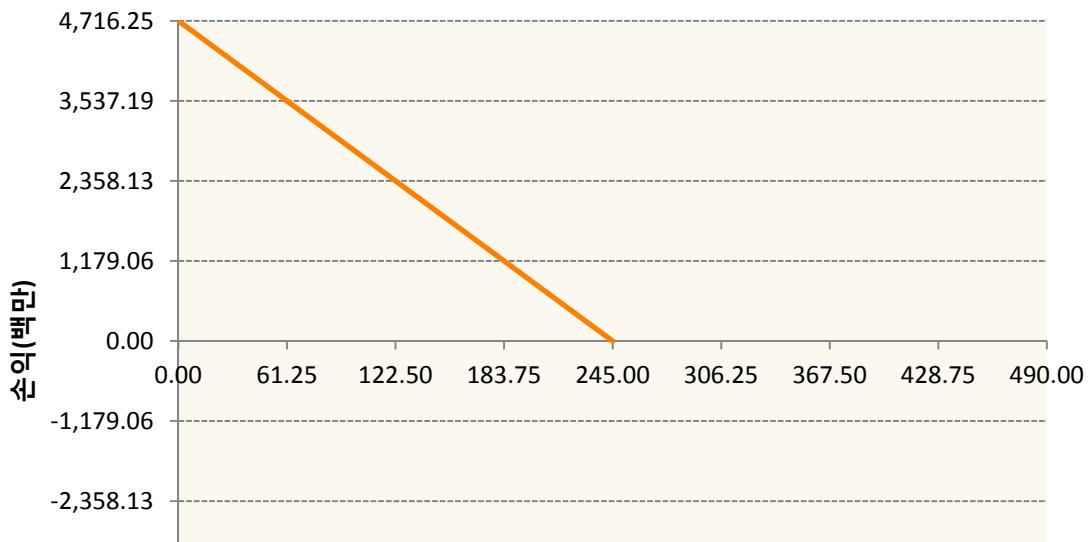


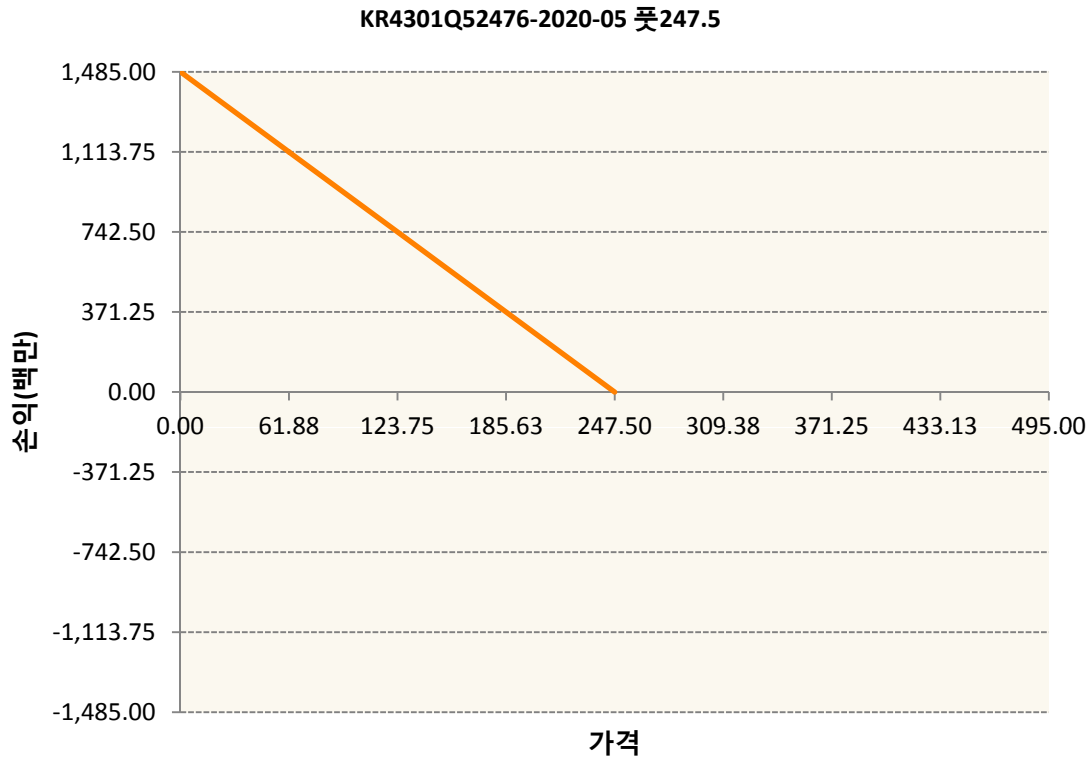
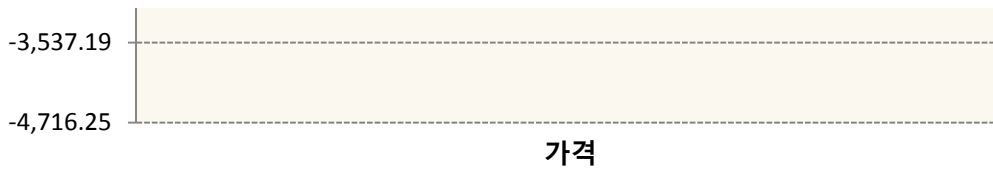


KR4201Q52601-2020-05 콜260



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						736
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-736	-736	-736	-736	-736	-736	-736	
-5.33%	-491	-491	-491	-491	-491	-491	-491	
-2.67%	-245	-245	-245	-245	-245	-245	-245	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	245	245	245	245	245	245	245	
5.33%	491	491	491	491	491	491	491	
8.00%	736	736	736	736	736	736	736	
KR4201Q52577		2020-05 콜257.5						857
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	489	459	426	390	352	312	271	
-5.33%	421	381	338	294	248	201	153	
-2.67%	316	266	216	164	112	60	8	

0%	166	111	55	0	-55	-111	-167
2.67%	-31	-87	-144	-200	-257	-313	-370
5.33%	-273	-326	-380	-435	-489	-545	-600
8.00%	-557	-603	-651	-701	-752	-804	-857
KR4201Q52601 2020-05 콜260							151
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	81	77	71	65	58	52	44
-5.33%	71	64	57	49	41	33	24
-2.67%	54	46	37	28	18	9	0
0%	30	20	10	0	-10	-20	-30
2.67%	-3	-13	-24	-34	-45	-55	-65
5.33%	-44	-54	-64	-75	-85	-95	-106
8.00%	-93	-102	-112	-121	-131	-141	-151
KR4301Q52450 2020-05 풋245							235
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	169	179	190	201	212	223	235
-5.33%	79	92	104	117	130	143	156
-2.67%	10	24	37	50	64	77	91
0%	-37	-25	-12	0	13	25	38
2.67%	-65	-56	-46	-36	-25	-14	-2
5.33%	-81	-75	-68	-60	-51	-42	-32
8.00%	-89	-85	-81	-75	-68	-61	-53
KR4301Q52476 2020-05 풋247.5							78
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	59	62	65	68	71	75	78
-5.33%	29	33	36	40	44	48	52
-2.67%	5	9	13	18	22	26	30
0%	-12	-8	-4	0	4	8	12
2.67%	-23	-20	-16	-13	-9	-5	-2
5.33%	-29	-27	-24	-22	-19	-15	-12
8.00%	-33	-31	-29	-27	-25	-23	-20

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

(단위:백만원)

2,095

공시일	2020-04-24
기준일	2020-04-23

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	146,204	0	146,204	

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	2020-04-24
기준일	2020-04-23

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	98,583	0	98,583	

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	2020-04-24
기준일	2020-04-23

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	435,565	0	435,565	
누계	통화	선도	53,492	566,892	-513,400	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
FX21020J02₯ KRW/USD 22-06-20E	1,515
FX21020J02₯ KRW/USD 22-06-20E	1,968
FX21020J03₯ KRW/USD 24-07-20E	2,213
FX21020J04₯ KRW/USD 24-07-20E	1,771
FX21020J04₯ KRW/USD 24-07-20E	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)

25,009

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

(단위:백만원)

194

공시일	2020-04-24
기준일	2020-04-23

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

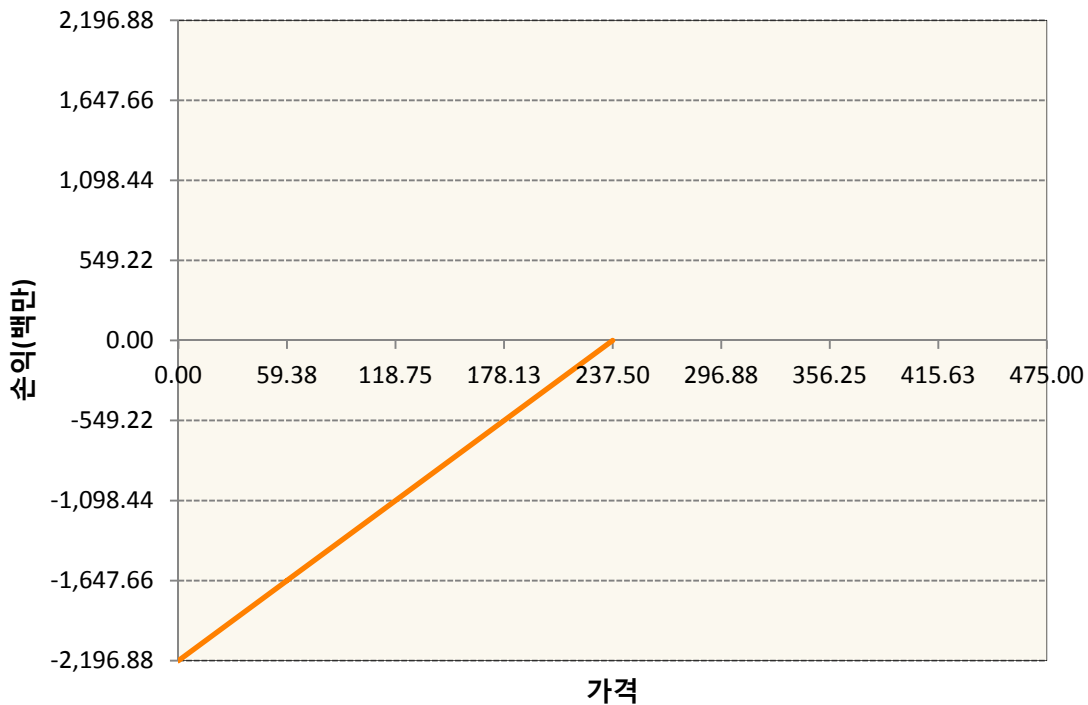
1. 계약금액

(단위:백만원)

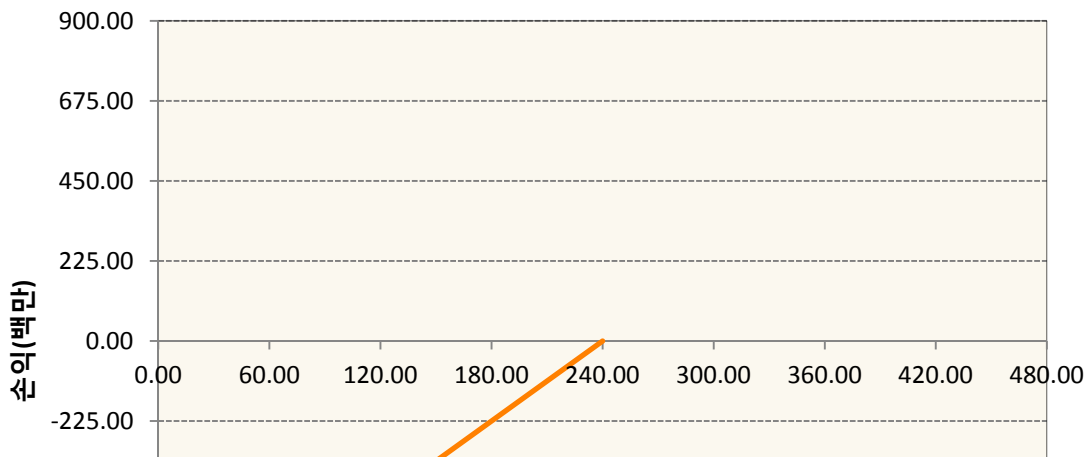
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,097	-3,097	장내

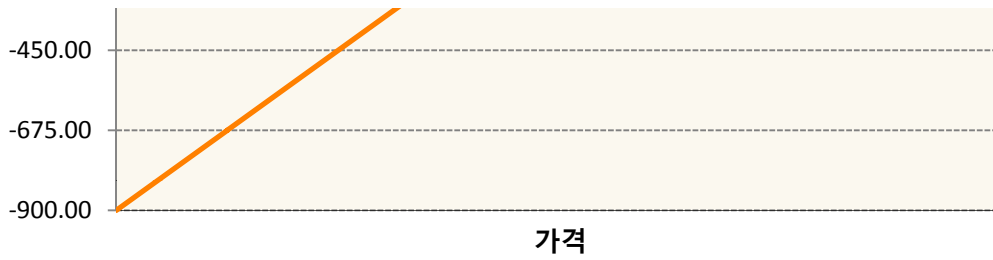
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q52377-2020-05 풋237.5



KR4301Q52401-2020-05 풋240





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q52377		2020-05 풋237.5						89
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-53	-59	-65	-71	-77	-83	-89	
-5.33%	-21	-27	-33	-39	-46	-52	-58	
-2.67%	0	-5	-10	-16	-22	-28	-34	
0%	13	9	5	0	-5	-10	-15	
2.67%	20	17	14	11	7	3	-2	
5.33%	23	21	19	17	14	11	8	
8.00%	24	23	22	21	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%	-25	-27	-30	-32	-35	-37	-39	
-5.33%	-11	-13	-16	-18	-21	-23	-26	
-2.67%	0	-3	-5	-8	-10	-13	-15	
0%	6	4	2	0	-2	-4	-7	
2.67%	9	8	7	5	3	1	0	
5.33%	11	10	9	8	7	6	4	
8.00%	12	12	11	10	9	8	7	

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

96

공시일	2020-04-24
기준일	2020-04-23

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	7,180	0	7,180	
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)

290

공시일	2020-04-24
기준일	2020-04-23

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

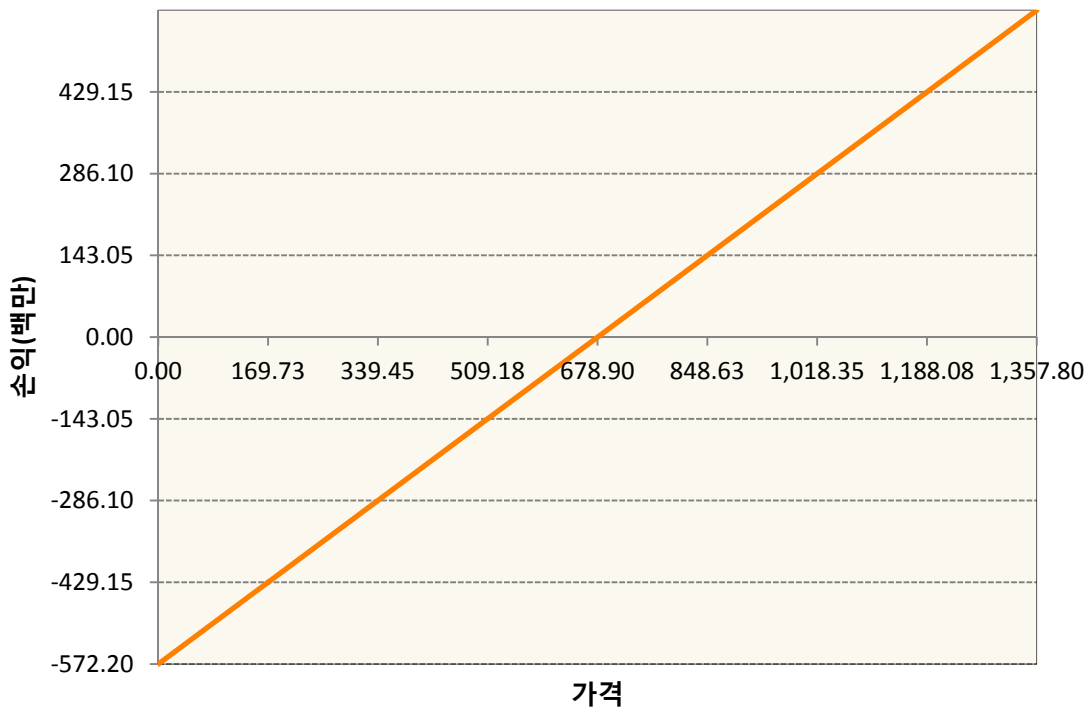
1. 계약금액

(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	572	0	572	
누계	유가증권	스왑	871	0	871	장외
누계	통화	선도	231	577	-345	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCK0-VN30 Index Future May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	70
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)

139

공시일	2020-04-24
기준일	2020-04-23

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

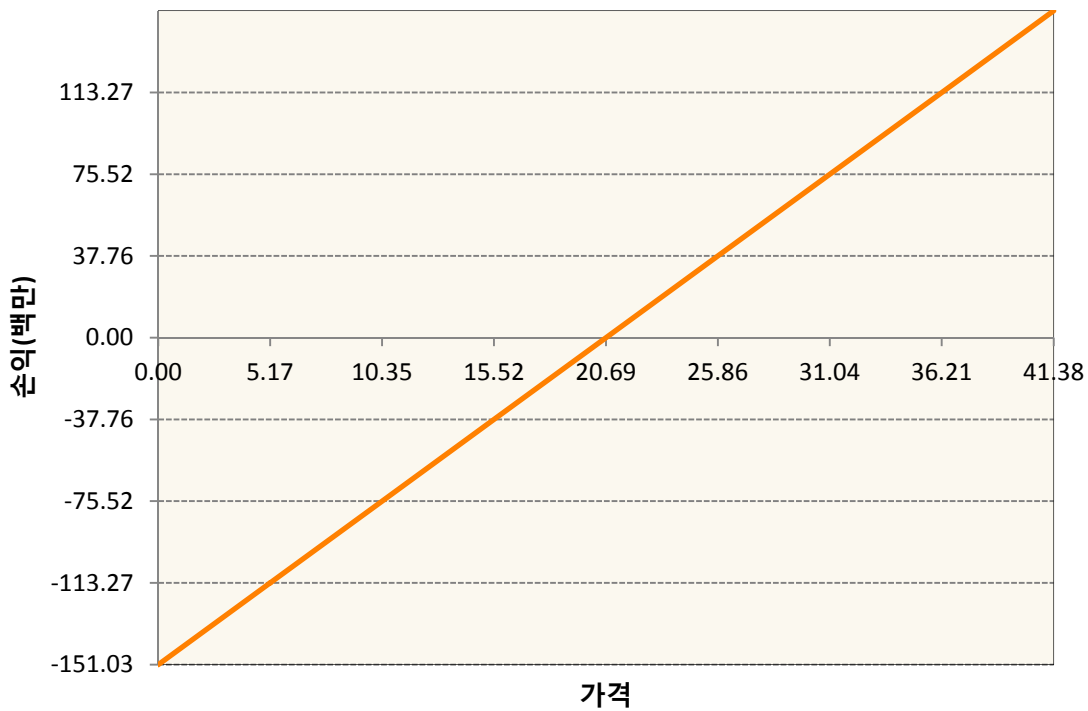
1. 계약금액

(단위:백만원)

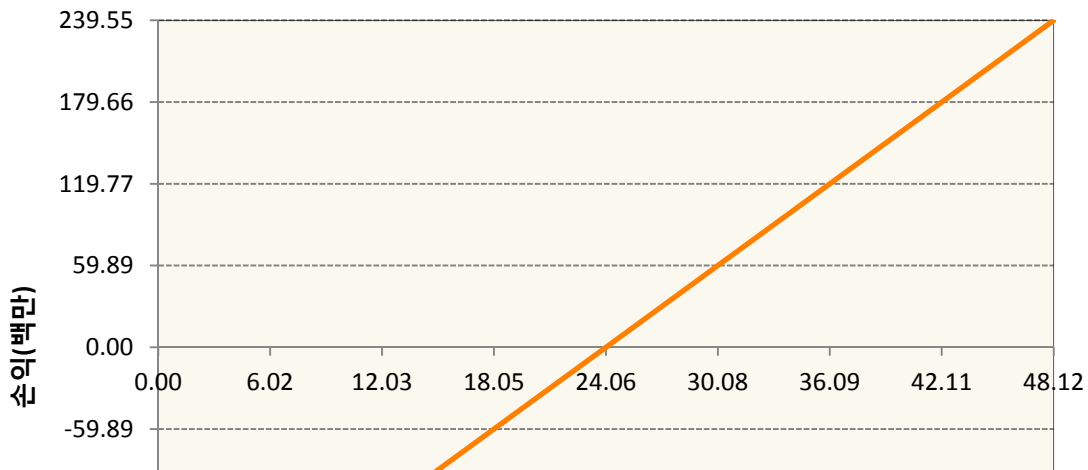
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,425	184	1,240	

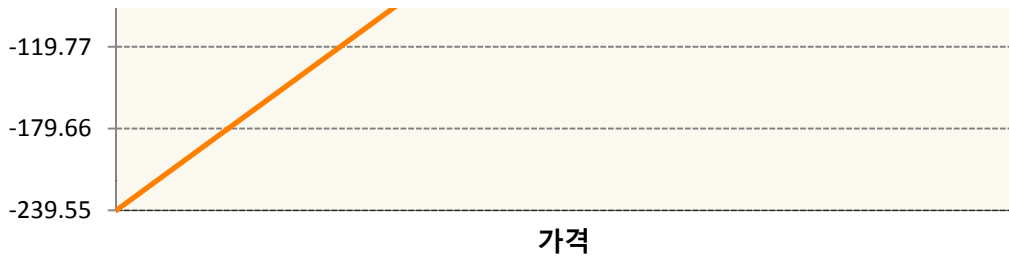
2. 만기시점의 손익구조

CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20

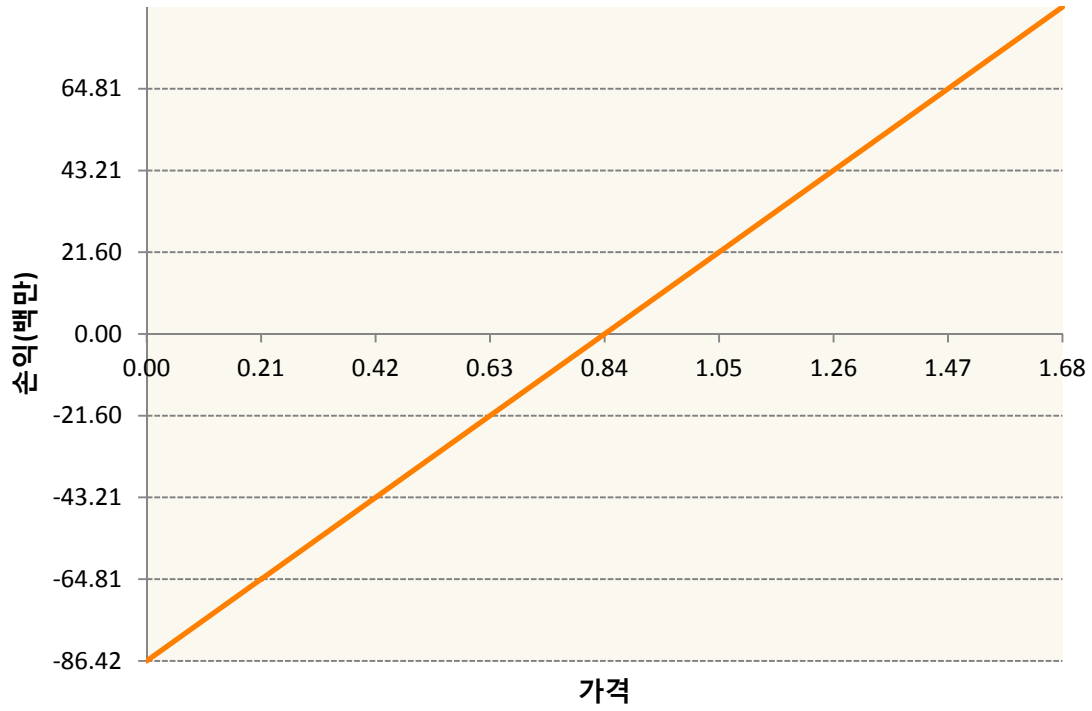


CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20

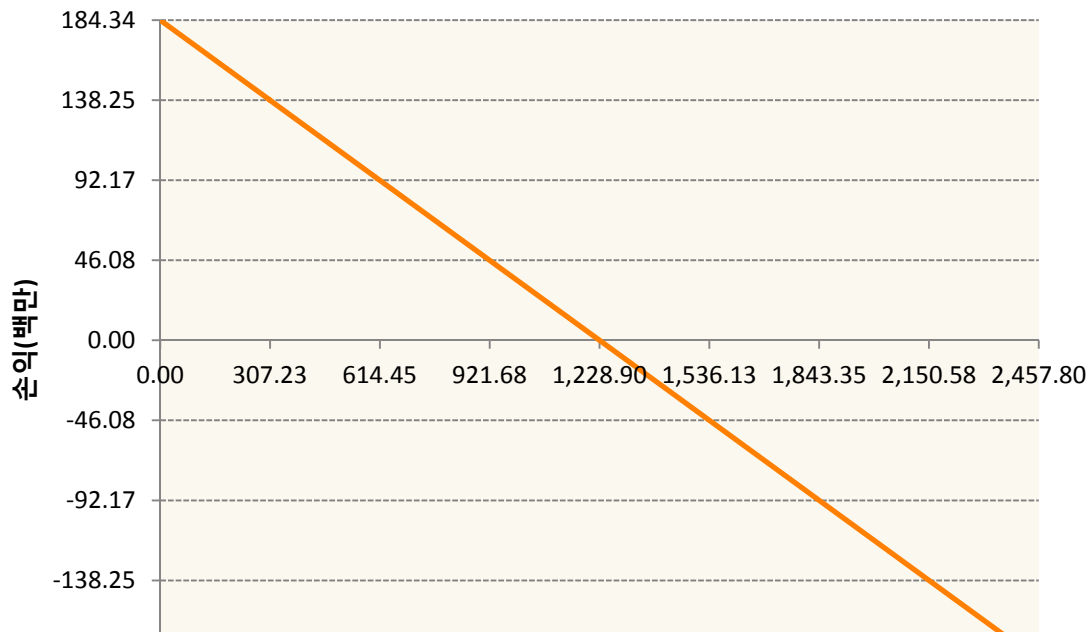


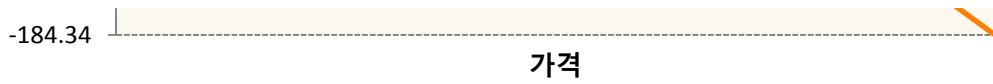


HON0-NY Harb ULSD Fut Jul20

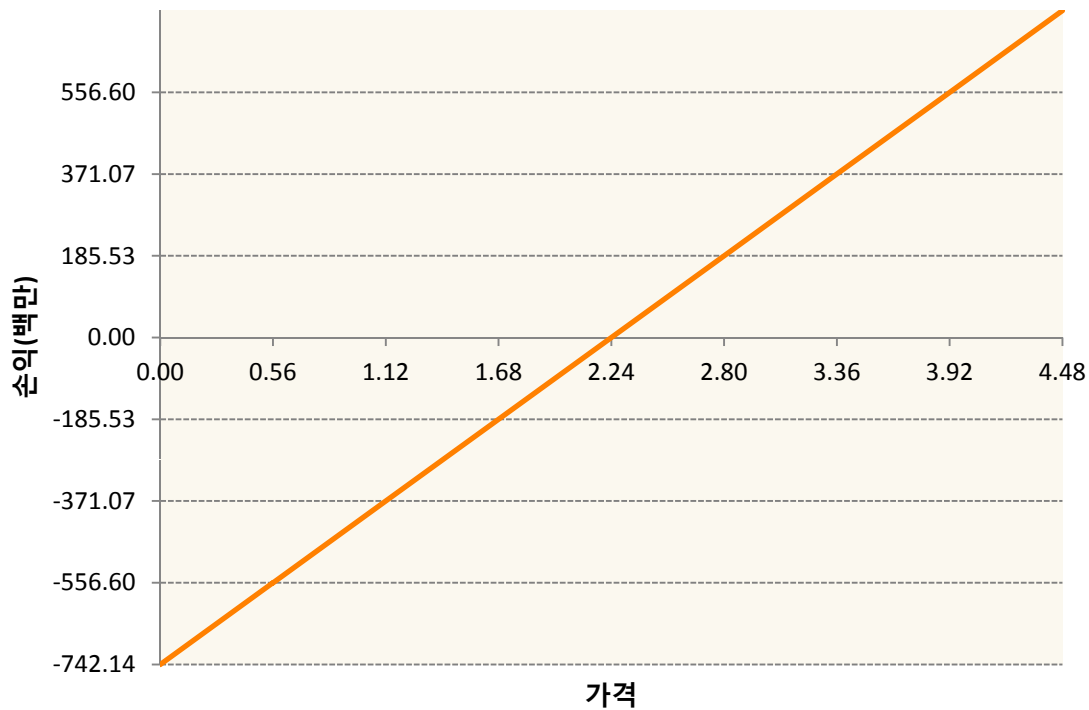


KR4175Q50007-2020-05 달러선물

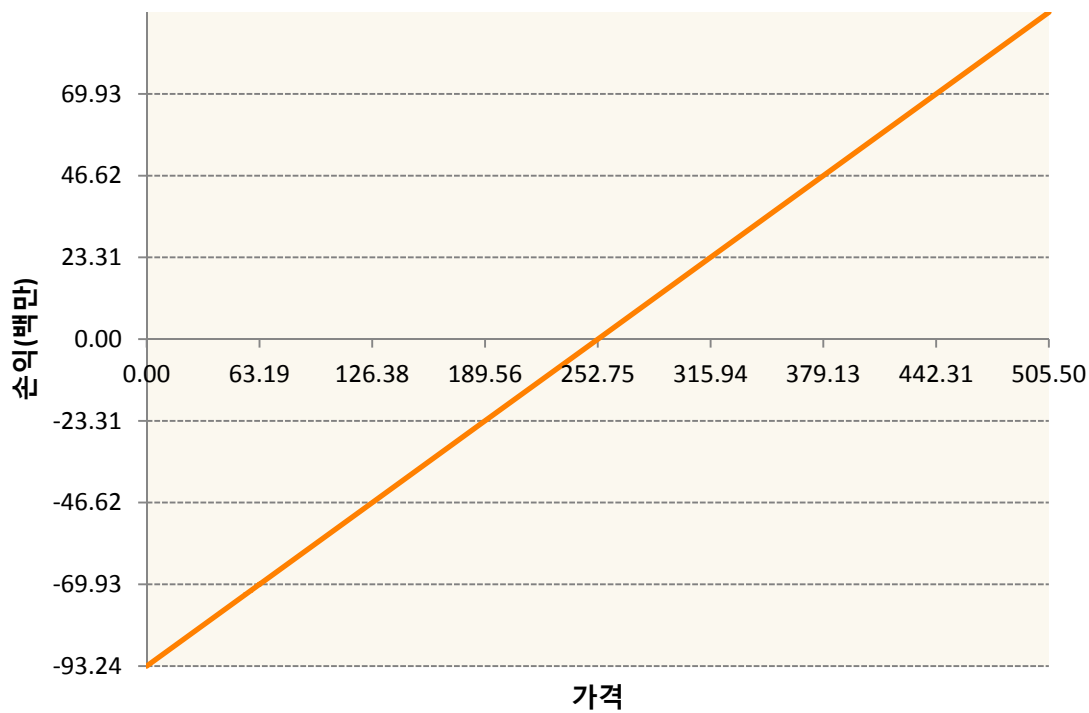




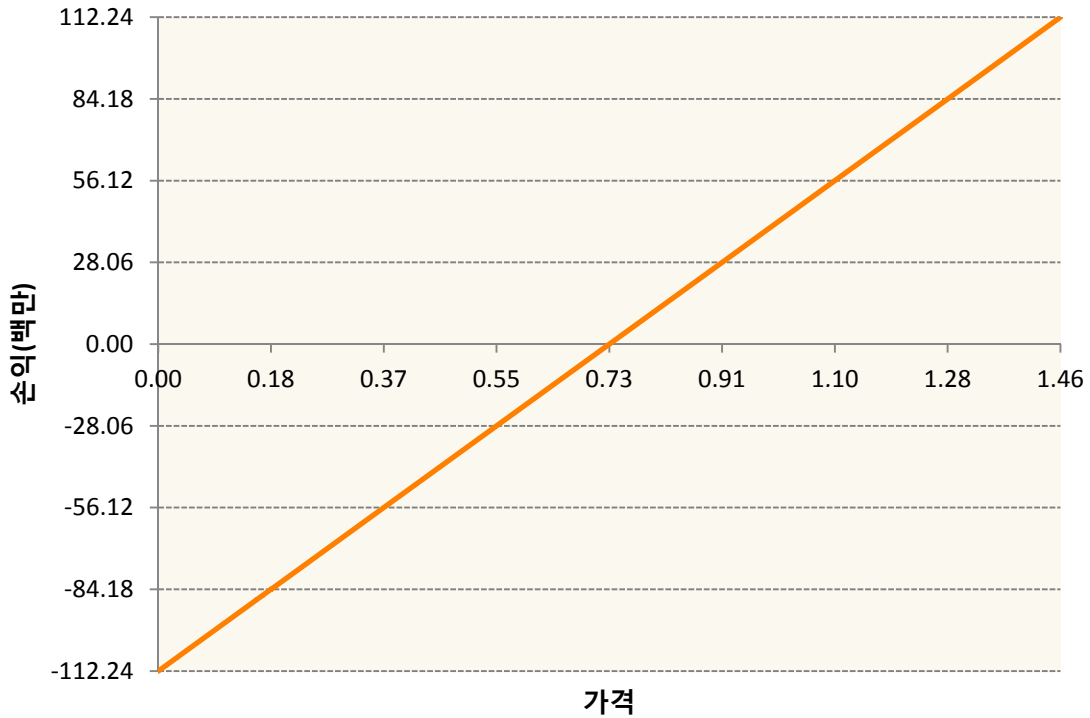
NGN20-NATURAL GAS FUTR Jul20



QSN0-Low Su Gasoil G Jul20



XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN0	WTI CRUDE FUTURE Jul20	12
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	19
HON0	NY Harb ULSD Fut Jul20	7
KR4175Q50C	2020-05 달러선물	15
NGN20	NATURAL GAS FUTR Jul20	59
QSN0	Low Su Gasoil G Jul20	7
XBN0	GASOLINE RBOB FUT Jul20	9

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

500

공시일	2020-04-24
기준일	2020-04-23

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

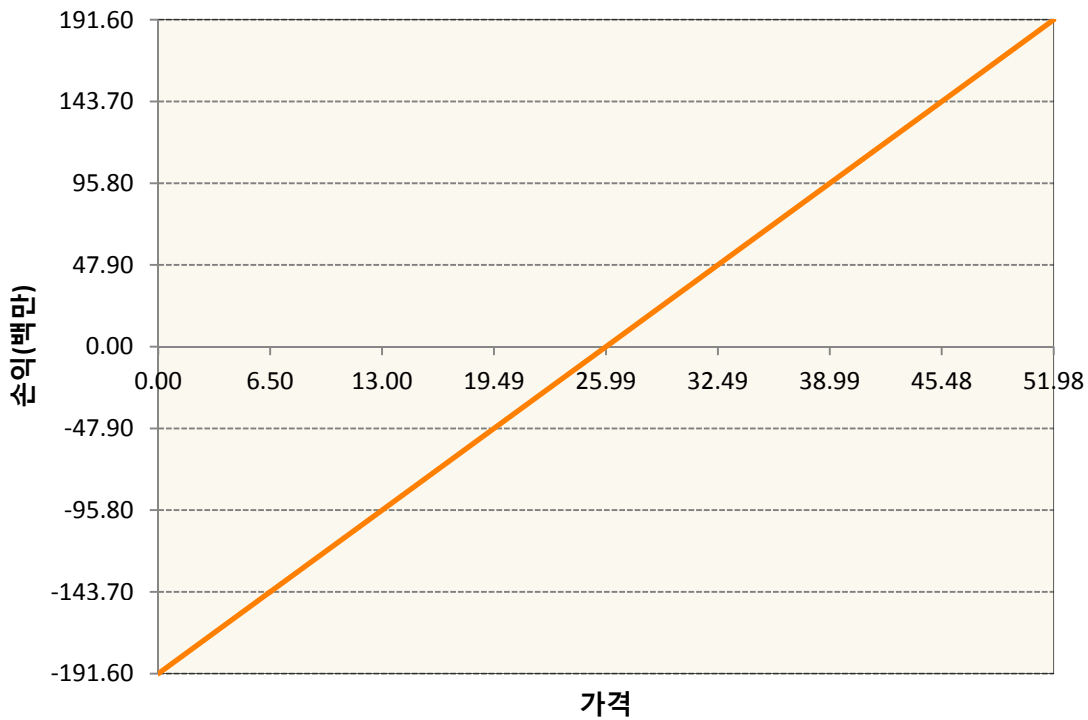
1. 계약금액

(단위:백만원)

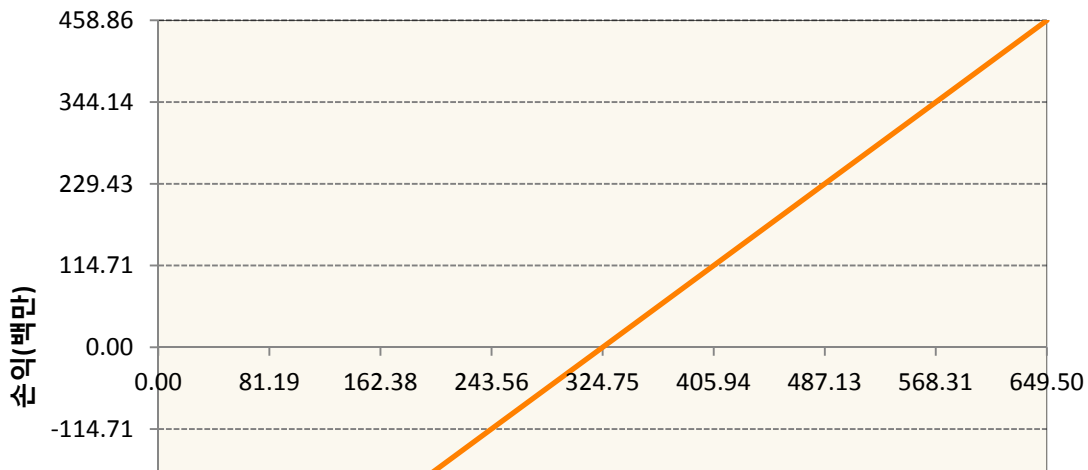
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,392	74	2,318	

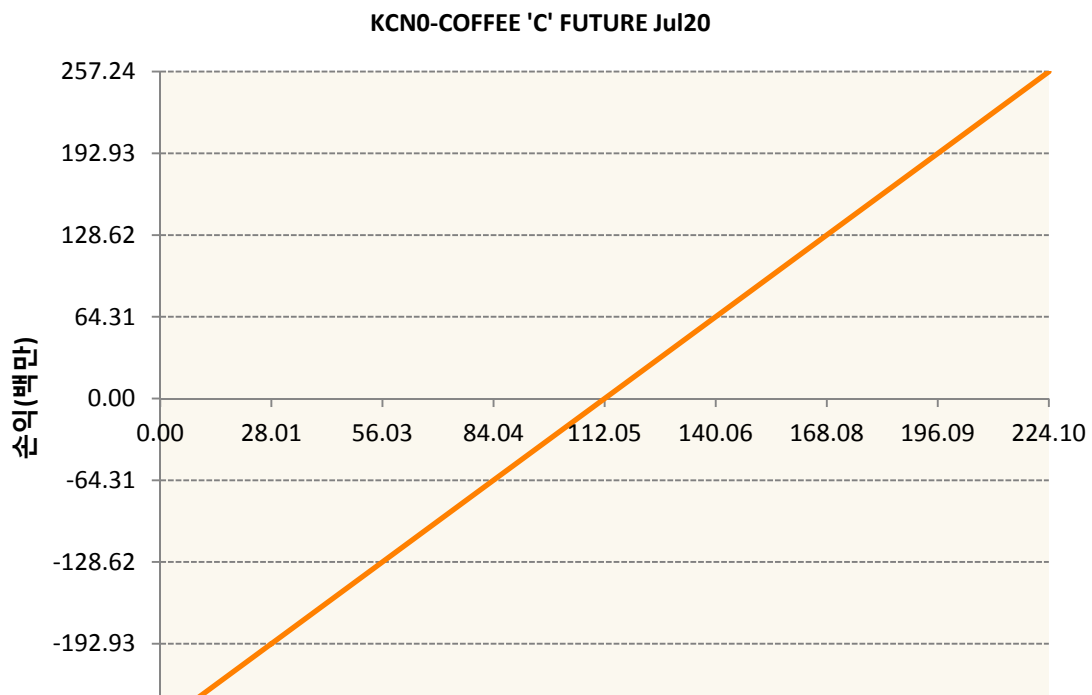
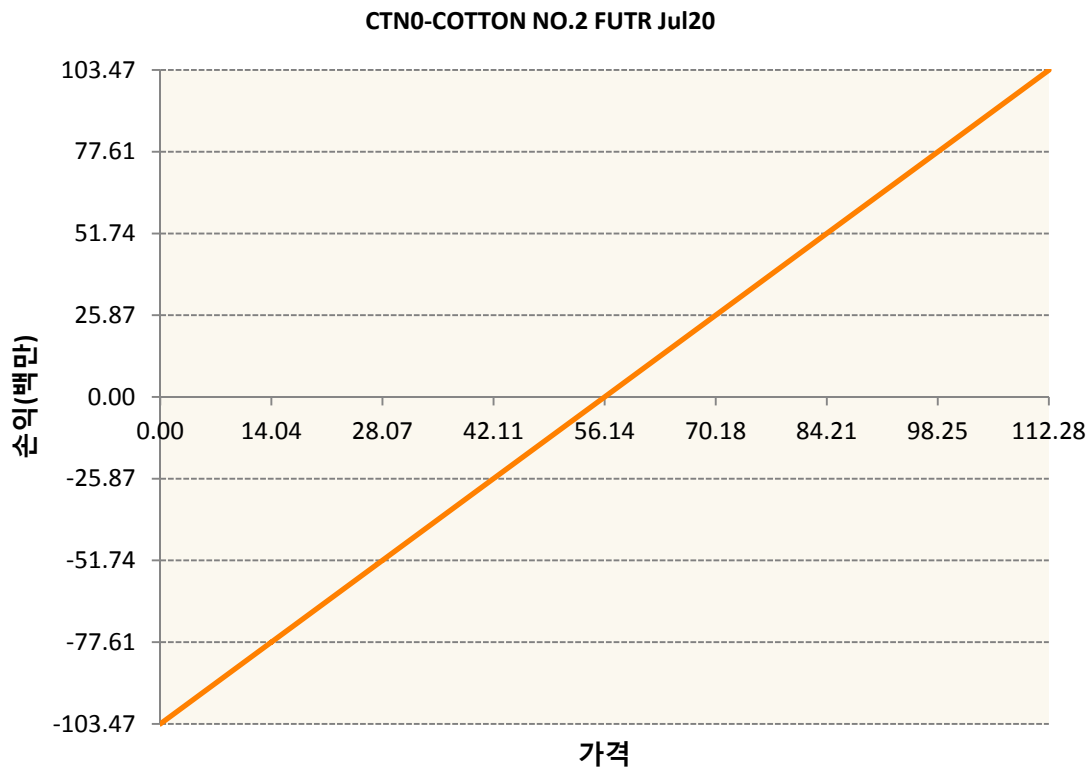
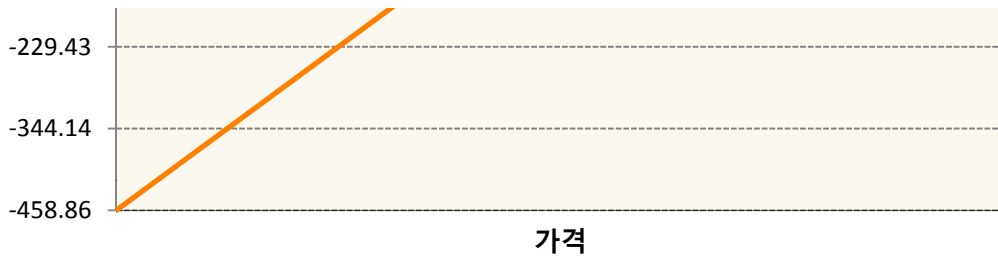
2. 만기시점의 손익구조

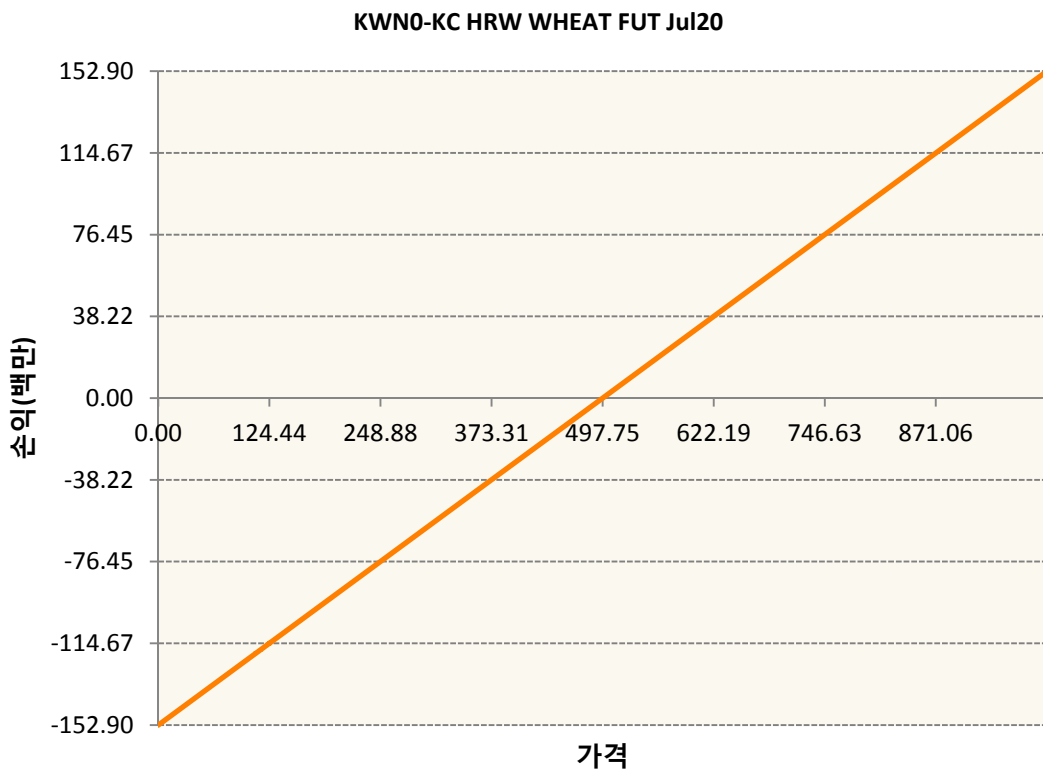
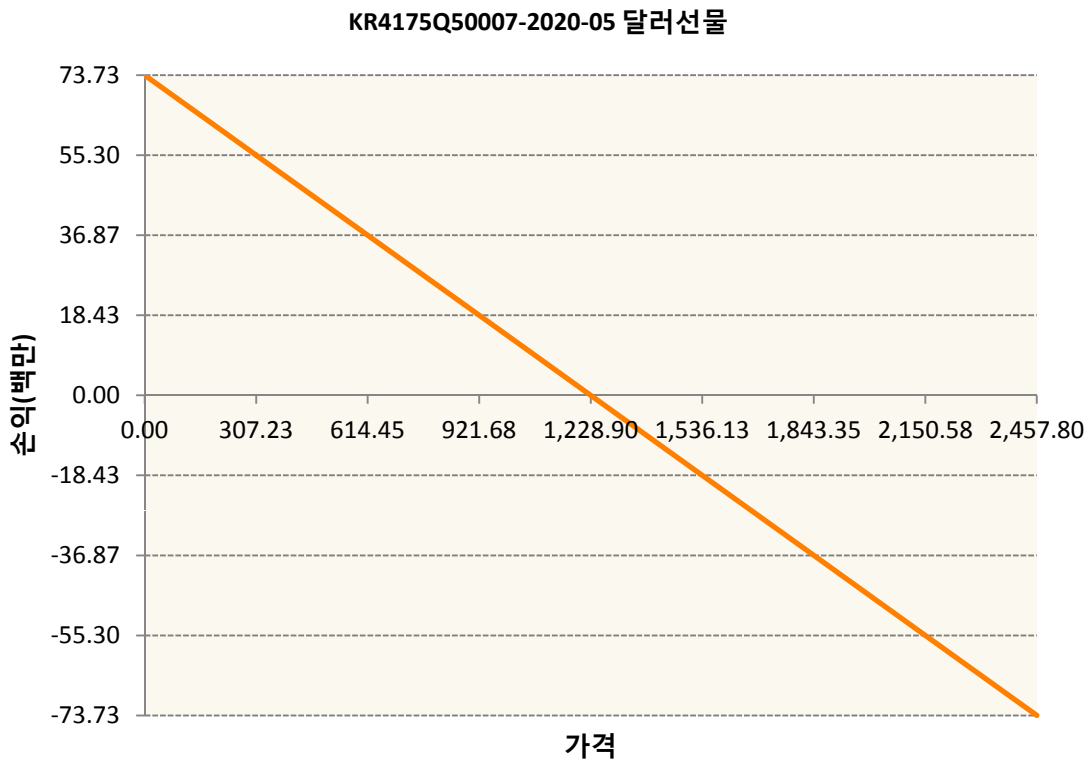
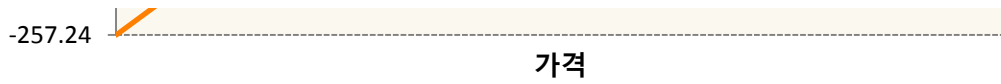
BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20



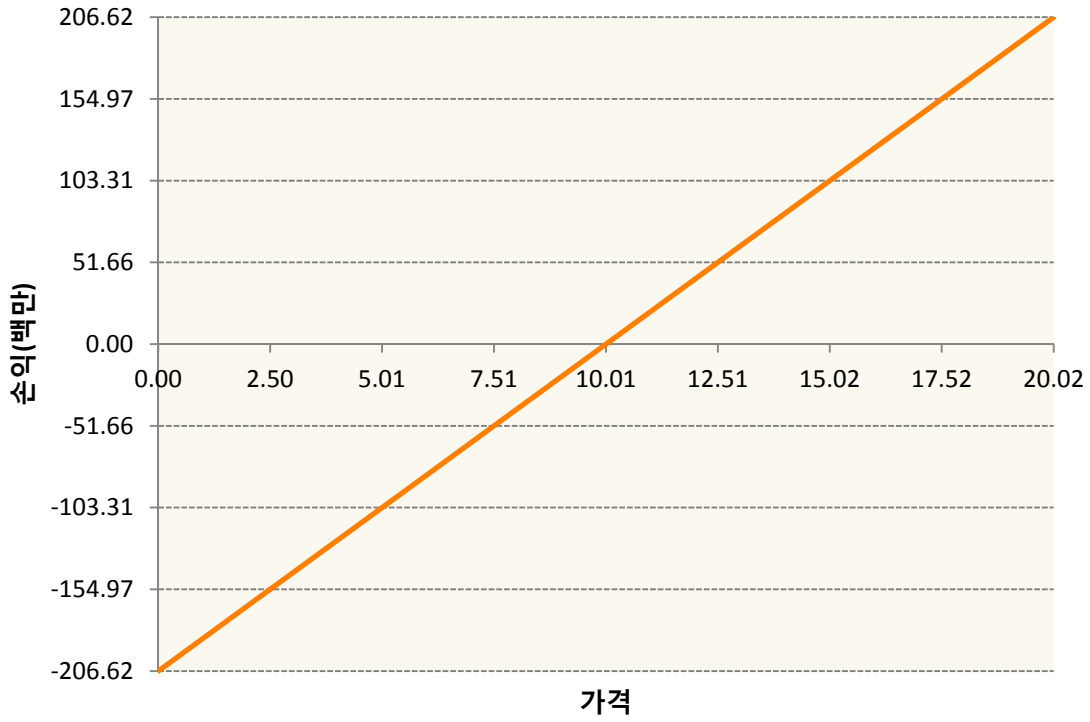
CN0-CORN FUTURE Jul20



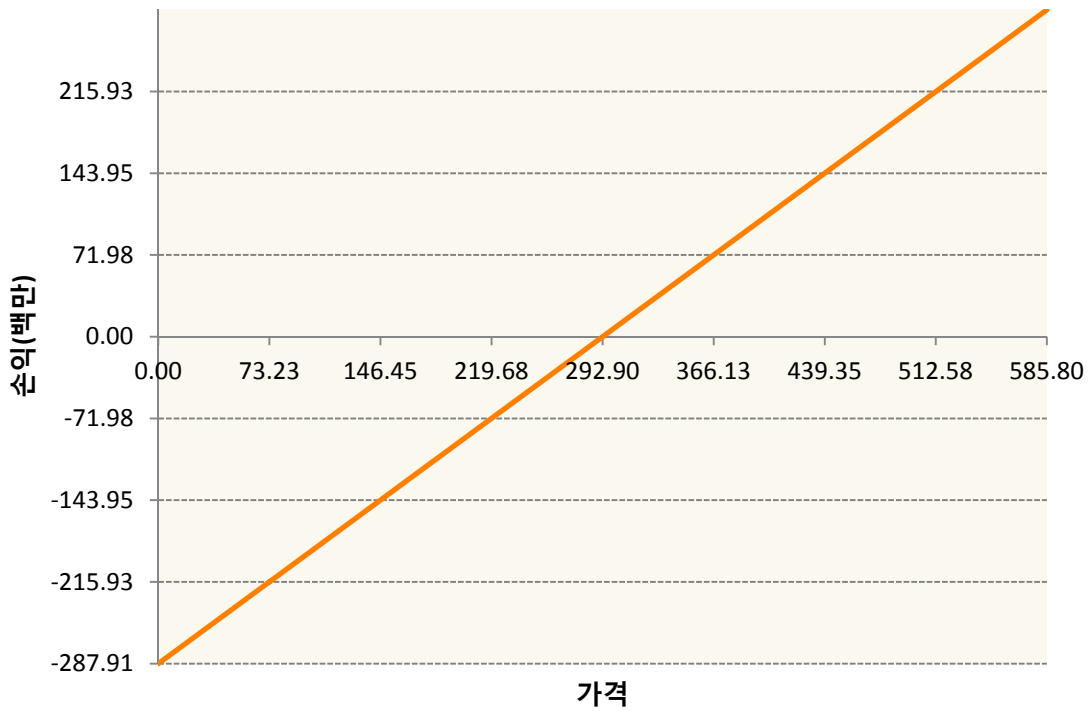




SBN0-Sugar Jul20

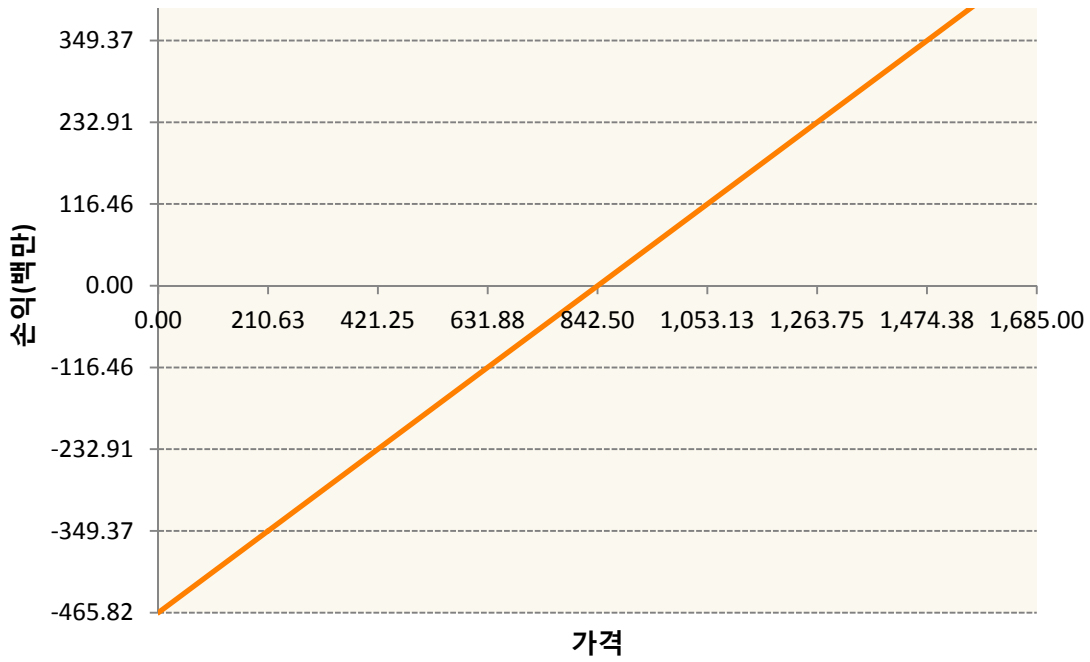


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20

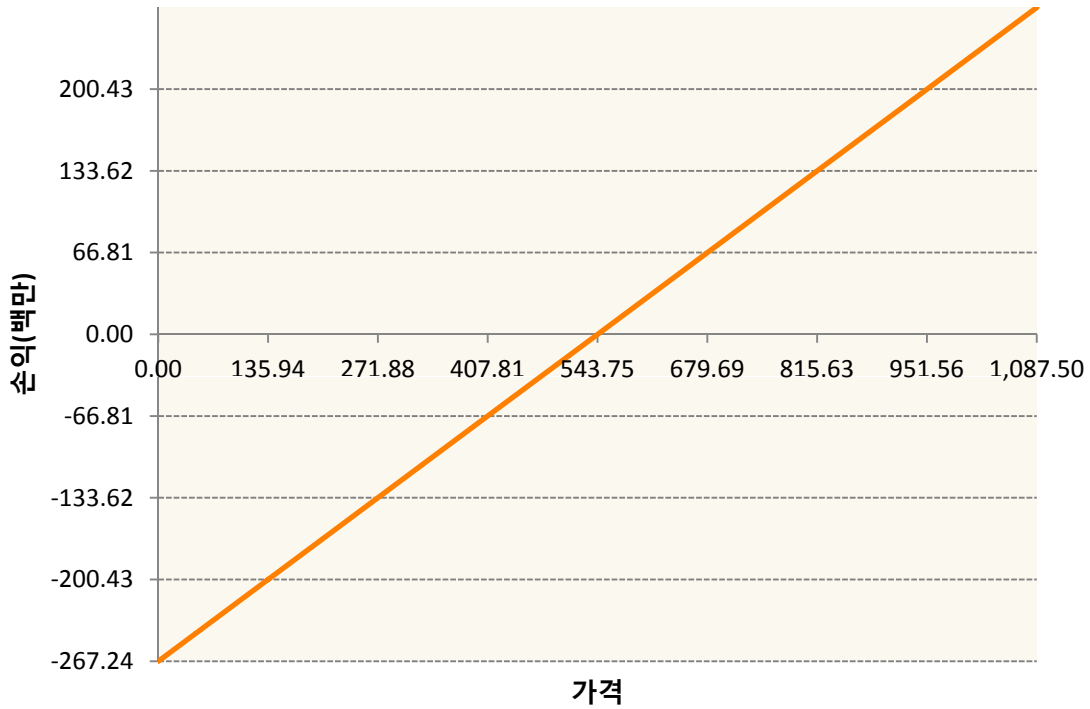


SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





WN0-WHEAT FUTURE(CBT) Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON0	SOYBEAN OIL FUTR Jul20	15
CN0	CORN FUTURE Jul20	37
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	21

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

(단위:백만원)

225