

공시일	2020-04-27
기준일	2020-04-24

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	2020-04-27
기준일	2020-04-24

스마트인덱스모

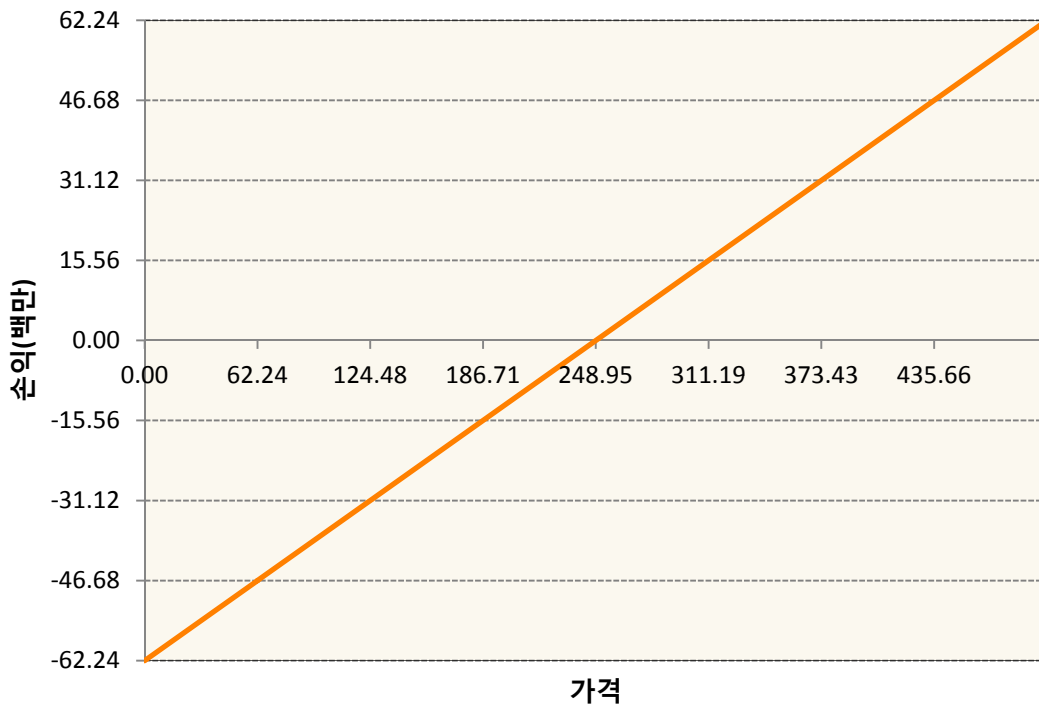
1. 계약금액

(단위:백만원)

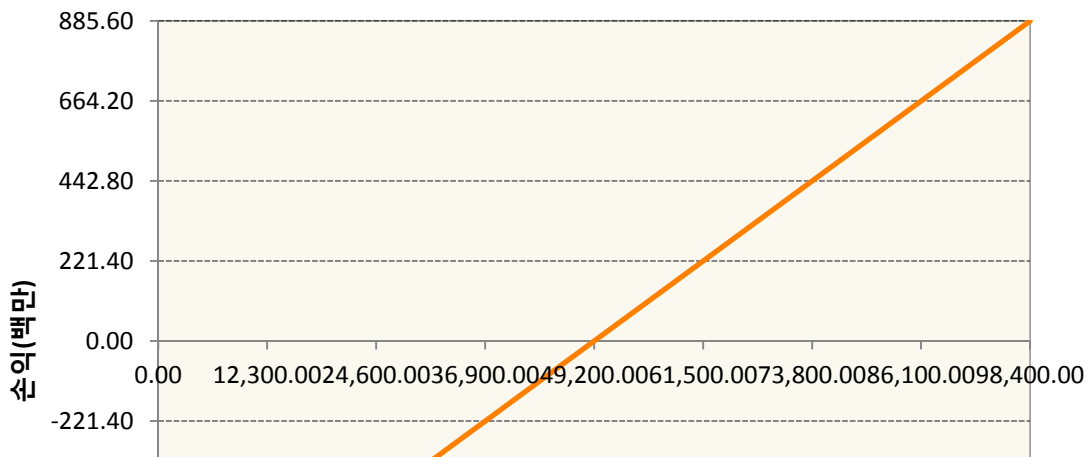
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	948	0	948	장내

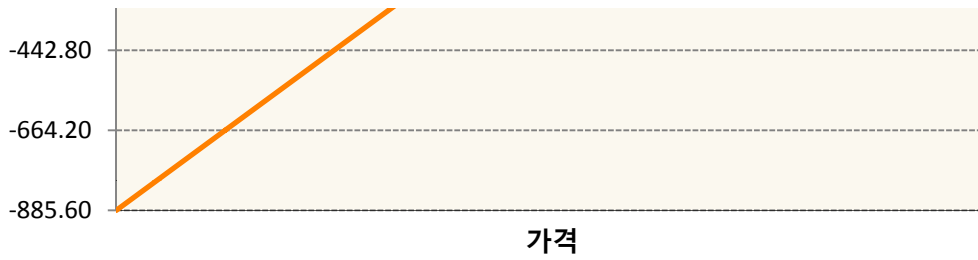
2. 만기시점의 손익구조

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	
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	2	2	2	2	2	2	2	
5.33%	3	3	3	3	3	3	3	
8.00%	5	5	5	5	5	5	5	
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)

114

공시일	2020-04-27
기준일	2020-04-24

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

949

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,109

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-27
기준일	2020-04-24

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

548

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

864

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-27
기준일	2020-04-24

유로인덱스모(주식-파생형)

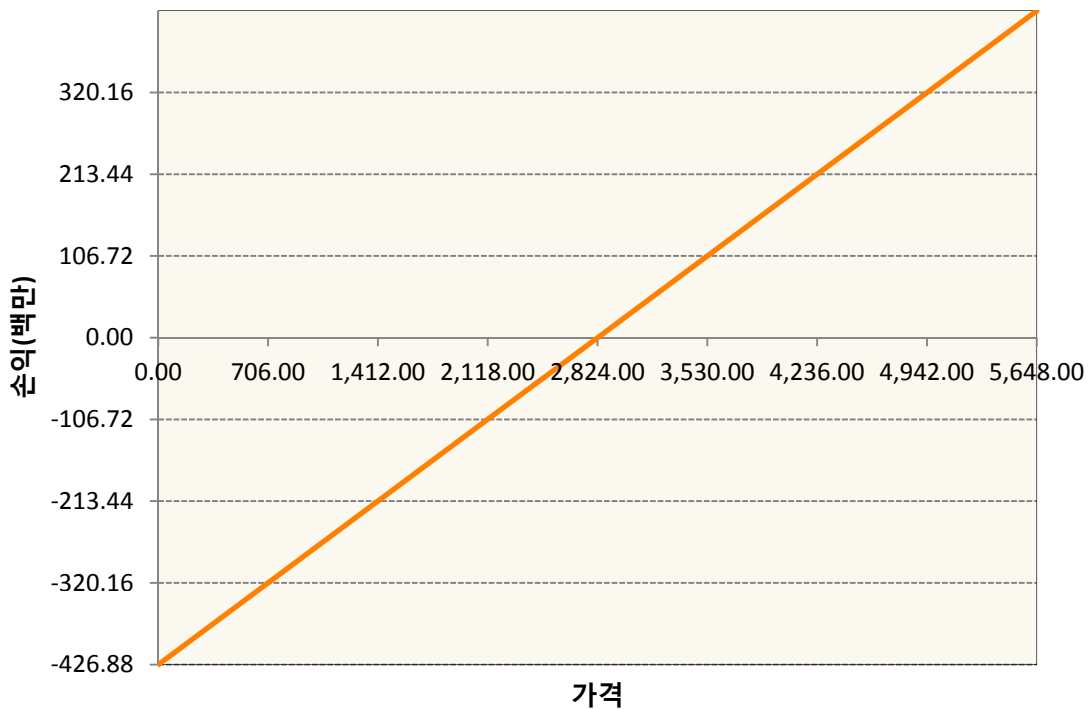
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	427	0	427	

2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

43

공시일	2020-04-27
기준일	2020-04-24

차이나인덱스모(주식-파생형)

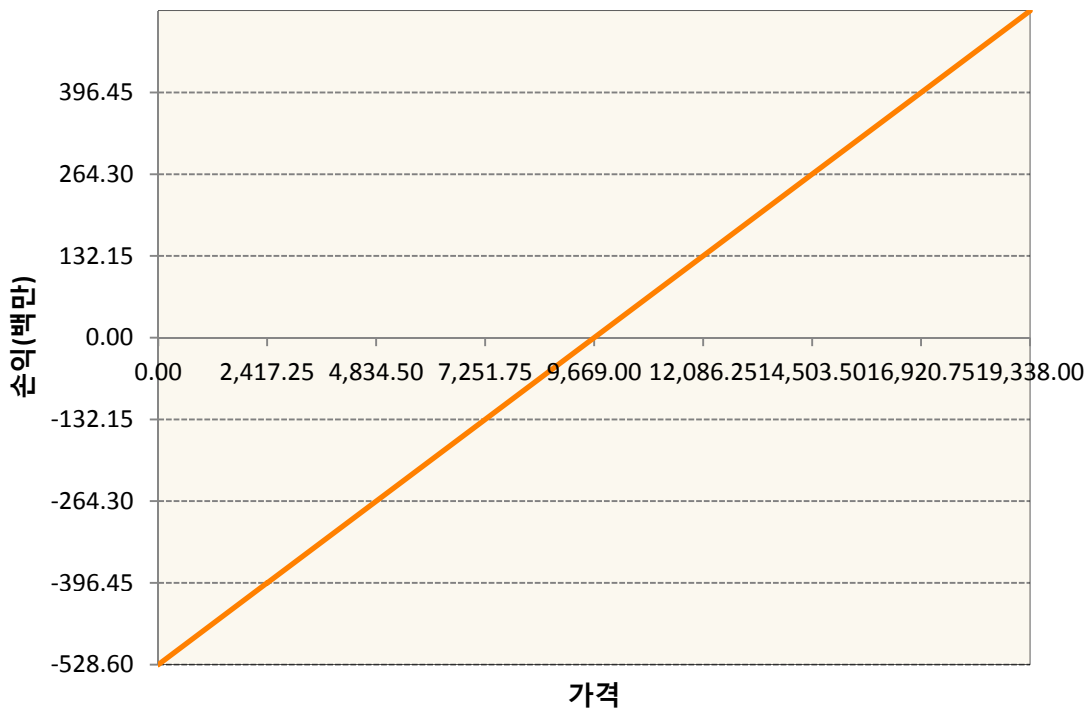
1. 계약금액

(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	2020-04-27
기준일	2020-04-24

커버드콜모(주식혼합-파생형)

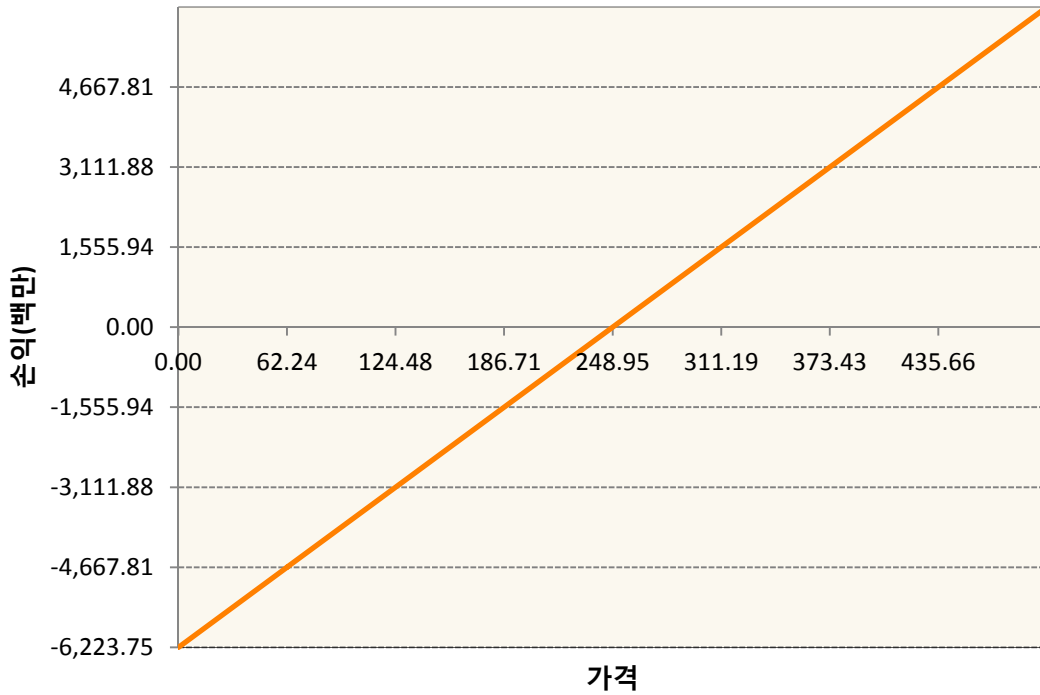
1. 계약금액

(단위:백만원)

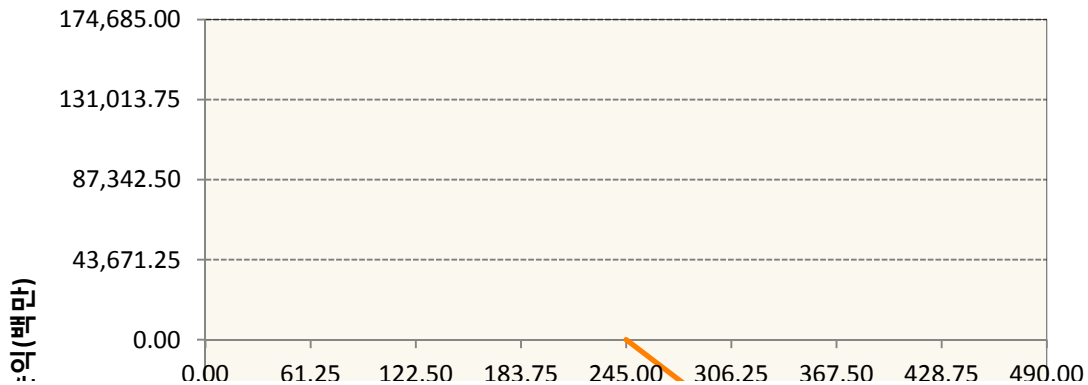
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,224	0	6,224	장내
누계	유가증권	옵션	0	358,345	-358,345	장내

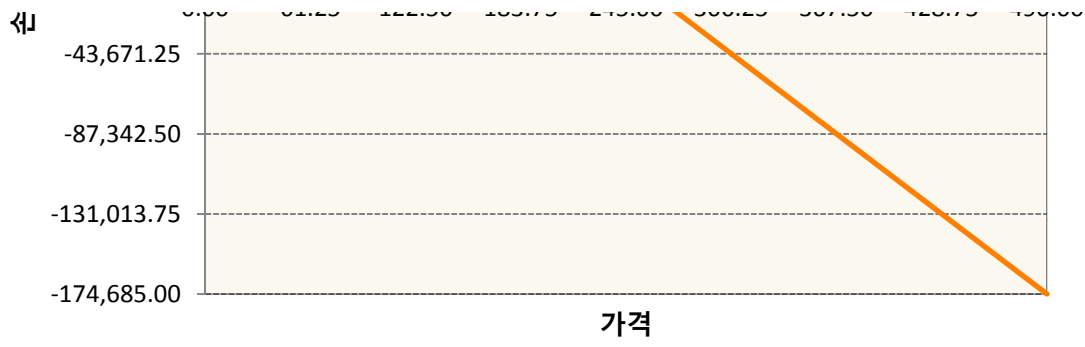
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

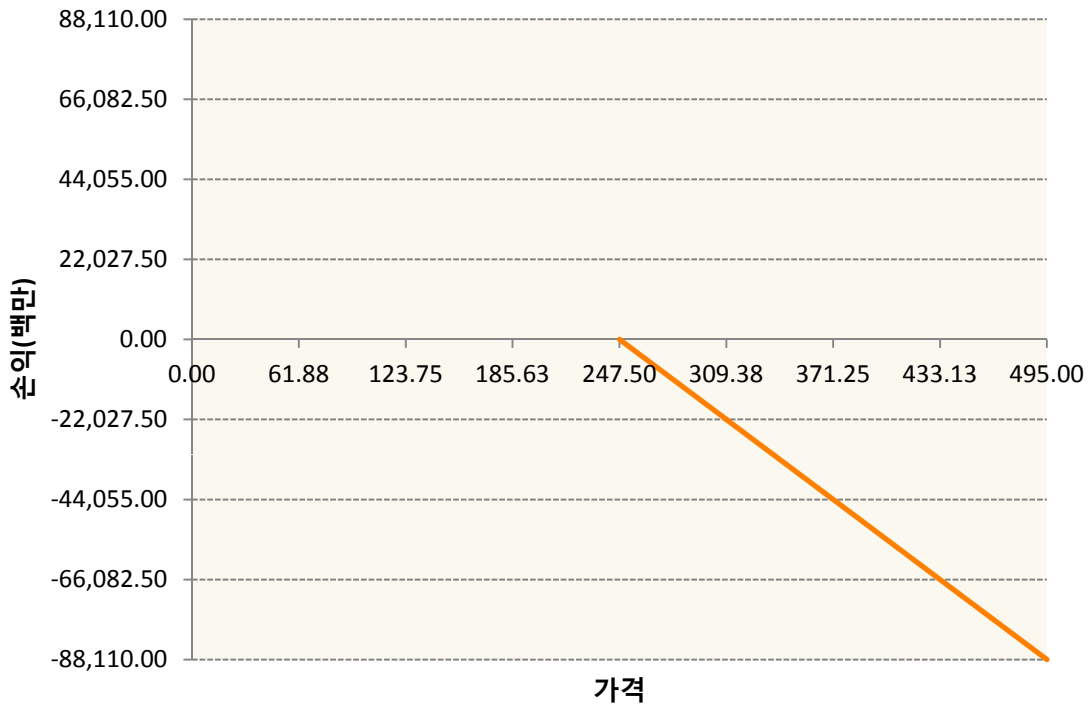


KR4201Q52452-2020-05 콜245

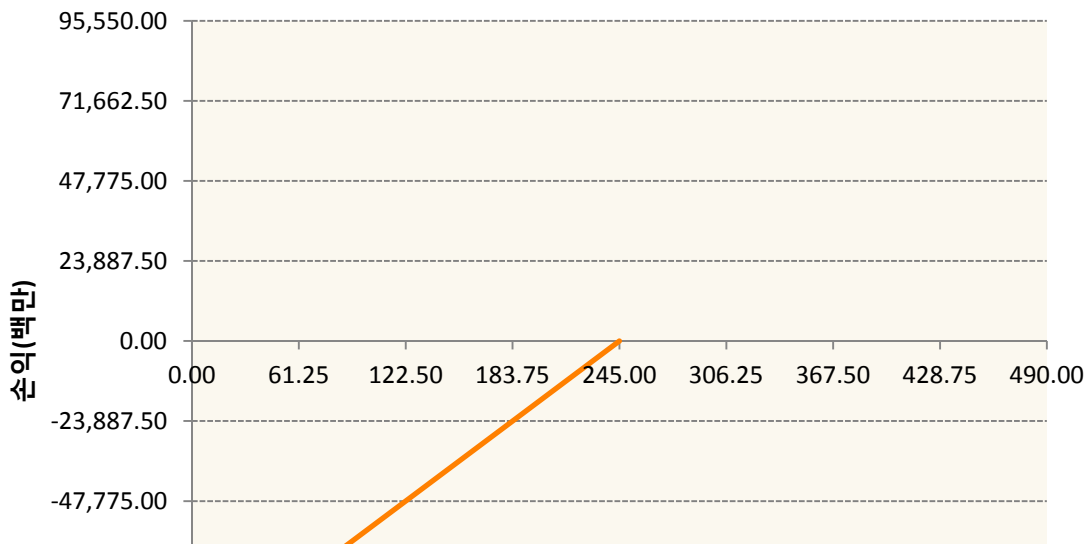


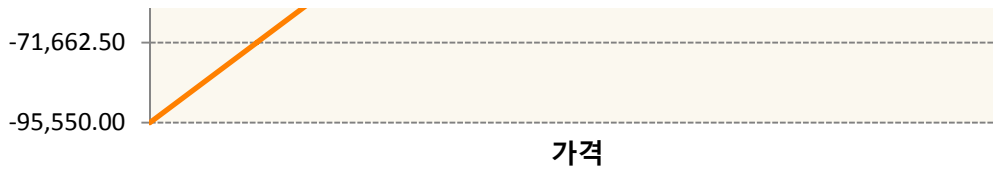


KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						501
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-501	-501	-501	-501	-501	-501	-501	
-5.33%	-334	-334	-334	-334	-334	-334	-334	
-2.67%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	167	167	167	167	167	167	167	
5.33%	334	334	334	334	334	334	334	
8.00%	501	501	501	501	501	501	501	

KR4201Q52452		2020-05 콜245						11,748
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	8,018	7,514	6,988	6,444	5,887	5,318	4,741	
-5.33%	6,587	5,981	5,368	4,748	4,124	3,497	2,867	
-2.67%	4,576	3,918	3,259	2,601	1,942	1,283	625	
0%	1,964	1,312	657	0	-659	-1,319	-1,979	
2.67%	-1,212	-1,804	-2,411	-3,029	-3,656	-4,290	-4,929	
5.33%	-4,868	-5,366	-5,894	-6,445	-7,014	-7,599	-8,197	
8.00%	-8,903	-9,292	-9,723	-10,190	-10,687	-11,208	-11,748	

KR4201Q52478		2020-05 콜247.5						5,700
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,710	3,478	3,232	2,974	2,708	2,434	2,154	
-5.33%	3,090	2,801	2,505	2,204	1,900	1,593	1,283	
-2.67%	2,194	1,869	1,542	1,215	887	559	231	
0%	1,002	668	334	0	-334	-669	-1,003	
2.67%	-480	-793	-1,111	-1,433	-1,757	-2,083	-2,411	
5.33%	-2,217	-2,489	-2,772	-3,065	-3,365	-3,671	-3,982	
8.00%	-4,162	-4,380	-4,618	-4,872	-5,138	-5,415	-5,700	

KR4301Q52450		2020-05 풋245						5,127
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,906	-4,083	-4,273	-4,475	-4,685	-4,903	-5,127	
-5.33%	-1,932	-2,172	-2,417	-2,667	-2,919	-3,175	-3,432	
-2.67%	-349	-623	-897	-1,172	-1,446	-1,721	-1,995	

0%	807	540	271	0	-272	-545	-819
2.67%	1,568	1,344	1,110	868	621	369	113
5.33%	2,019	1,854	1,672	1,476	1,268	1,050	824
8.00%	2,259	2,152	2,025	1,878	1,715	1,539	1,350

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

(단위:백만원)

20,523

공시일	2020-04-27
기준일	2020-04-24

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

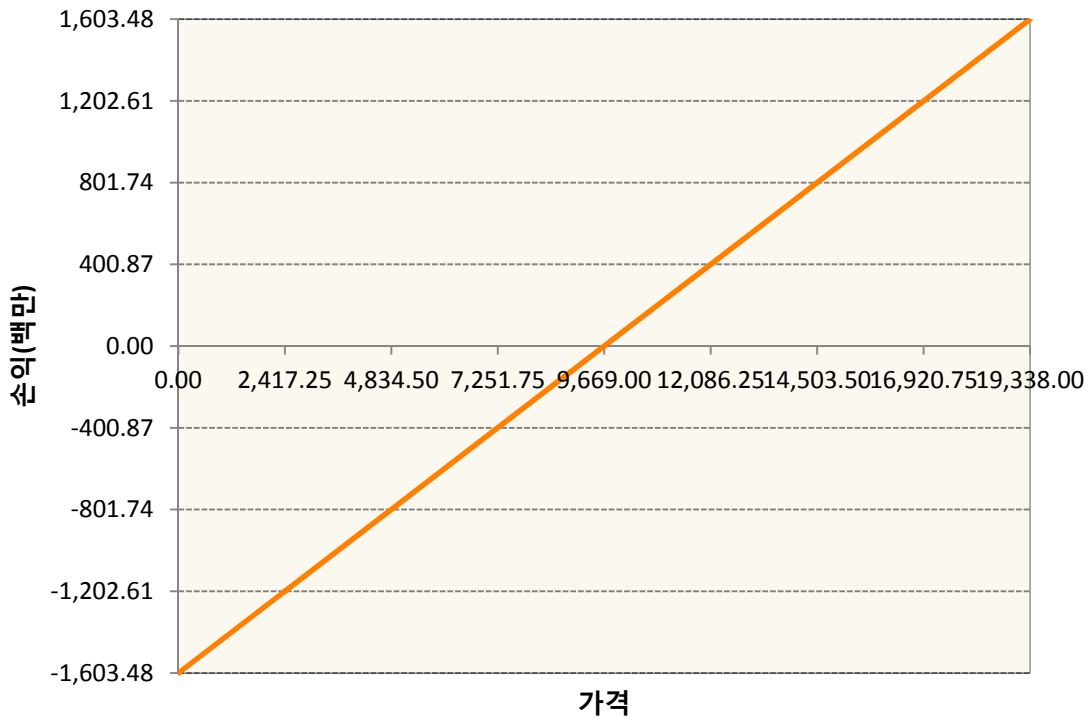
1. 계약금액

(단위:백만원)

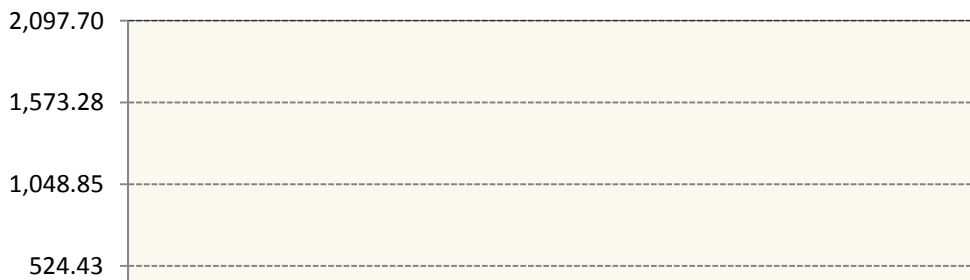
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,603	0	1,603	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,197	-4,197	장내
누계	통화	선도	701	2,244	-1,543	장외

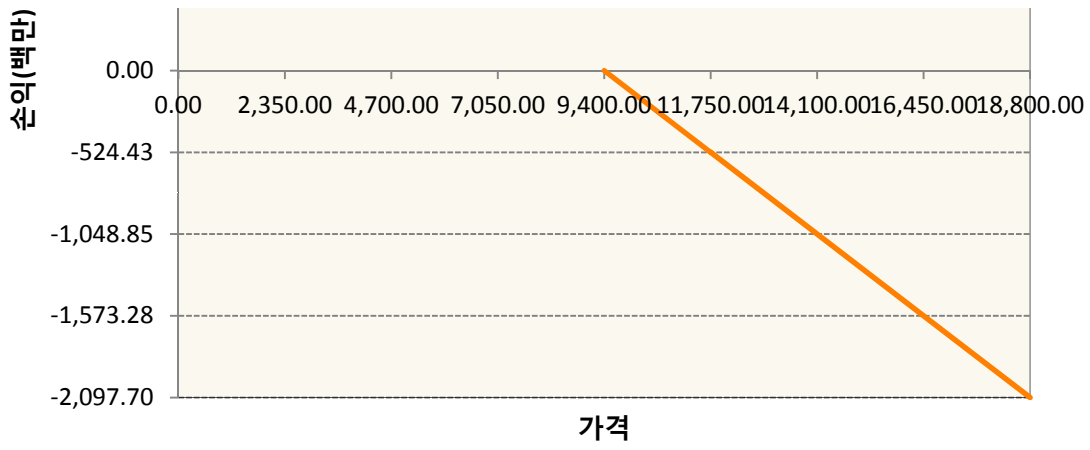
2. 만기시점의 손익구조

HCJ0-HSCEI Futures Apr20

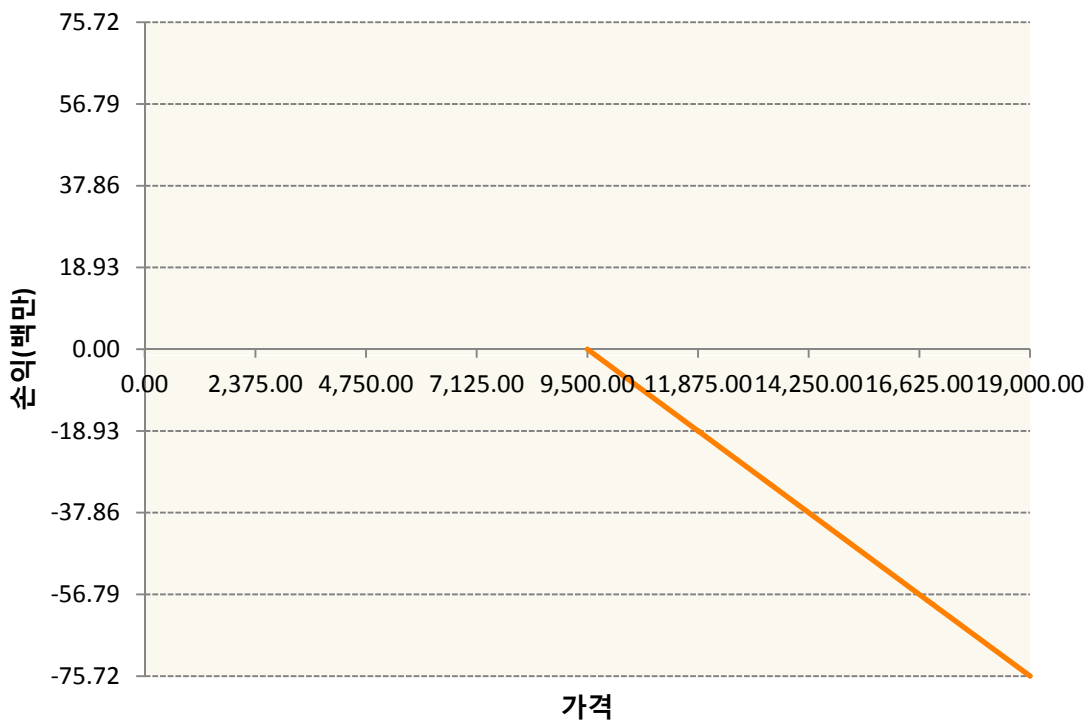


OHHIJ0-C94-HSCEI

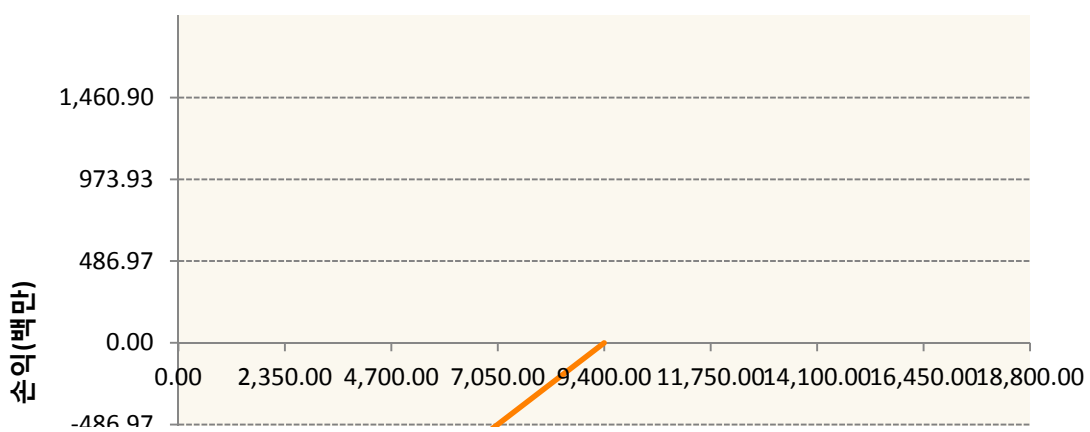


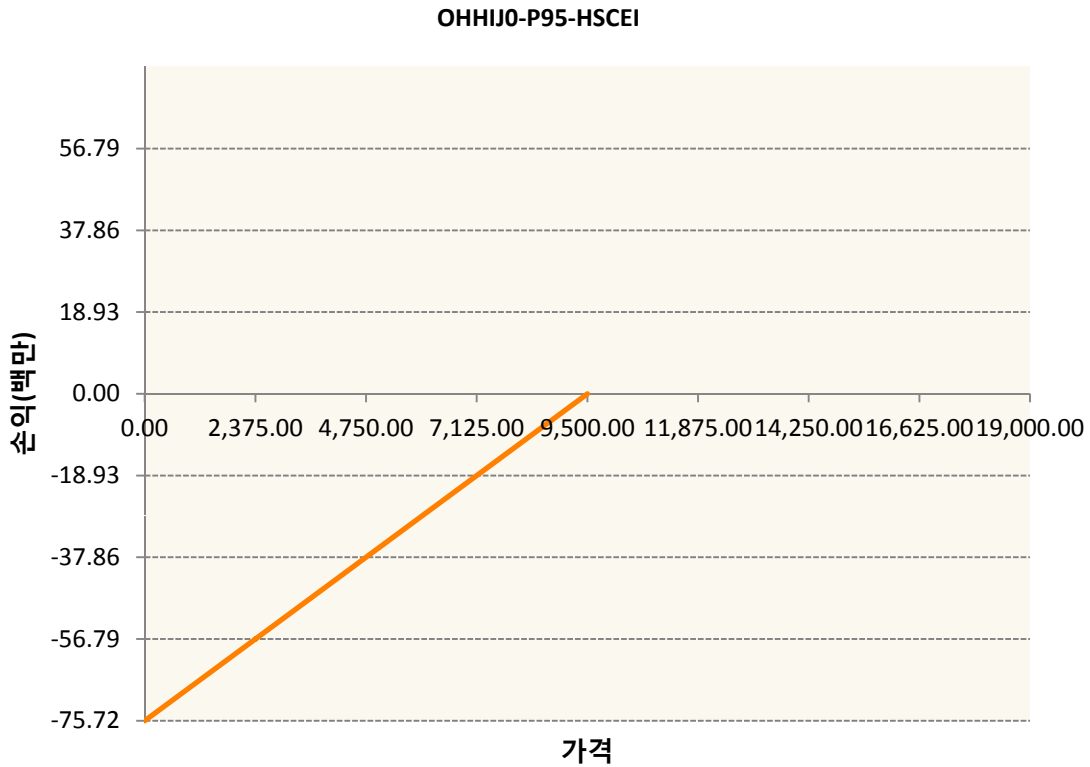


OHHIJO-C95-HSCEI



OHHIJO-P94-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E	180
FX21020H05 HKD/KRW 22-05-20E	56
HCJ0 HSCEI Futures Apr20	128
OHHIJ0-C94 HSCEI	168
OHHIJ0-C95 HSCEI	6
OHHIJ0-P94 HSCEI	156
OHHIJ0-P95 HSCEI	6

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	612

공시일	2020-04-27
기준일	2020-04-24

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

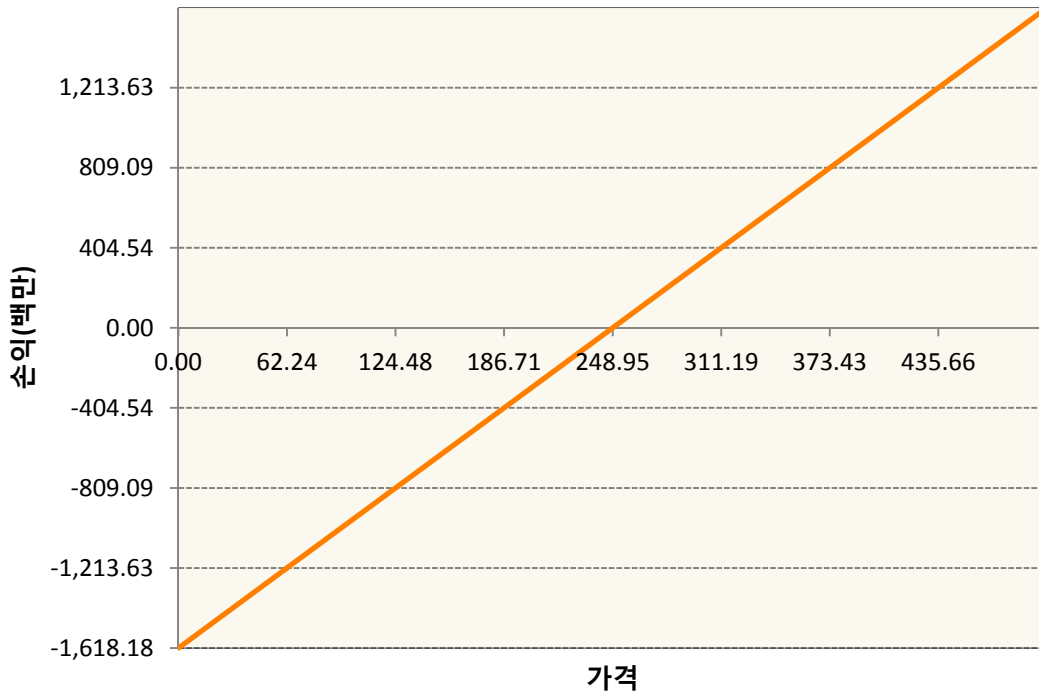
1. 계약금액

(단위:백만원)

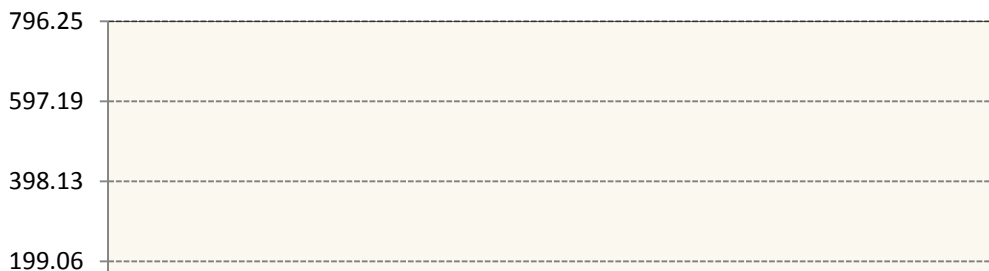
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,618	0	1,618	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,193	-3,193	장내

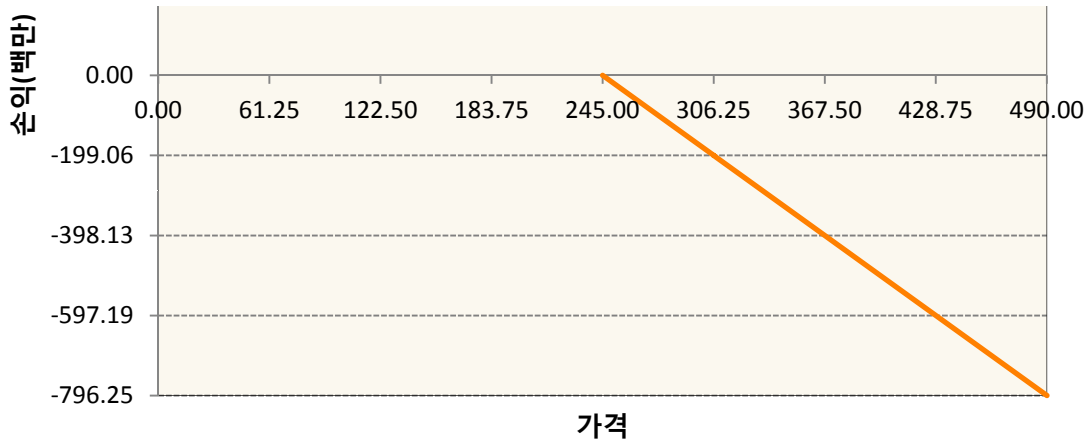
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

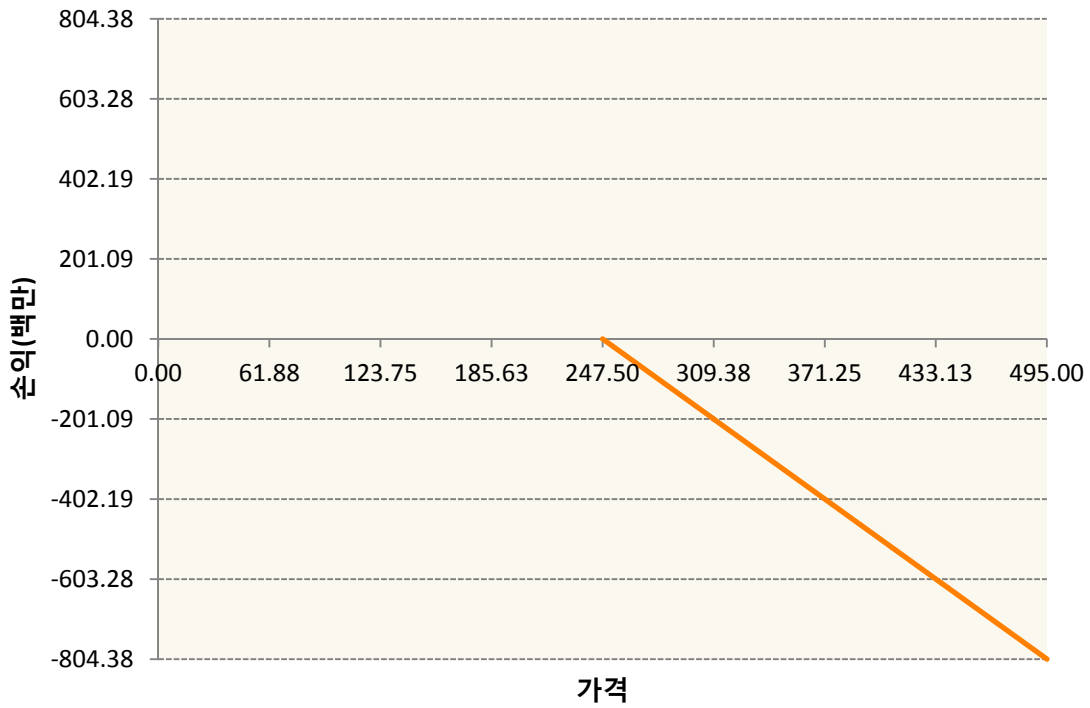


KR4201Q52452-2020-05 콜245

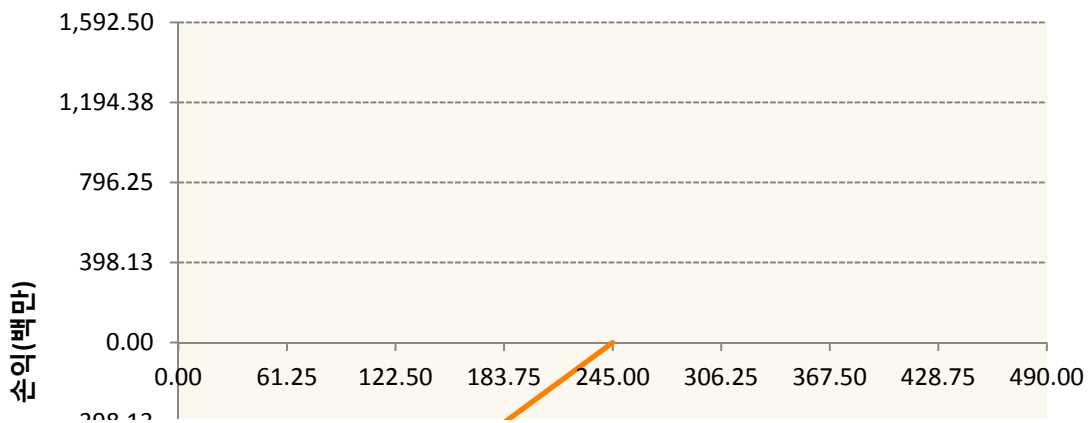




KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



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%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87	
-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%	87	87	87	87	87	87	87	
8.00%	130	130	130	130	130	130	130	
KR4201Q52452		2020-05 콜245						54
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	37	34	32	29	27	24	22	
-5.33%	30	27	24	22	19	16	13	
-2.67%	21	18	15	12	9	6	3	
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9	
2.67%	-6	-8	-11	-14	-17	-20	-22	
5.33%	-22	-24	-27	-29	-32	-35	-37	
8.00%	-41	-42	-44	-46	-49	-51	-54	
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	25	22	20
-5.33%	28	26	23	20	17	15	12
-2.67%	20	17	14	11	8	5	2
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	-4	-7	-10	-13	-16	-19	-22
5.33%	-20	-23	-25	-28	-31	-34	-36
8.00%	-38	-40	-42	-44	-47	-49	-52
KR4301Q52450 2020-05 풋245							85
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-65	-68	-71	-75	-78	-82	-85
-5.33%	-32	-36	-40	-44	-49	-53	-57
-2.67%	-6	-10	-15	-20	-24	-29	-33
0%	13	9	5	0	-5	-9	-14
2.67%	26	22	18	14	10	6	2
5.33%	34	31	28	25	21	18	14
8.00%	38	36	34	31	29	26	22

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

(단위:백만원)

547

공시일	2020-04-27
기준일	2020-04-24

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

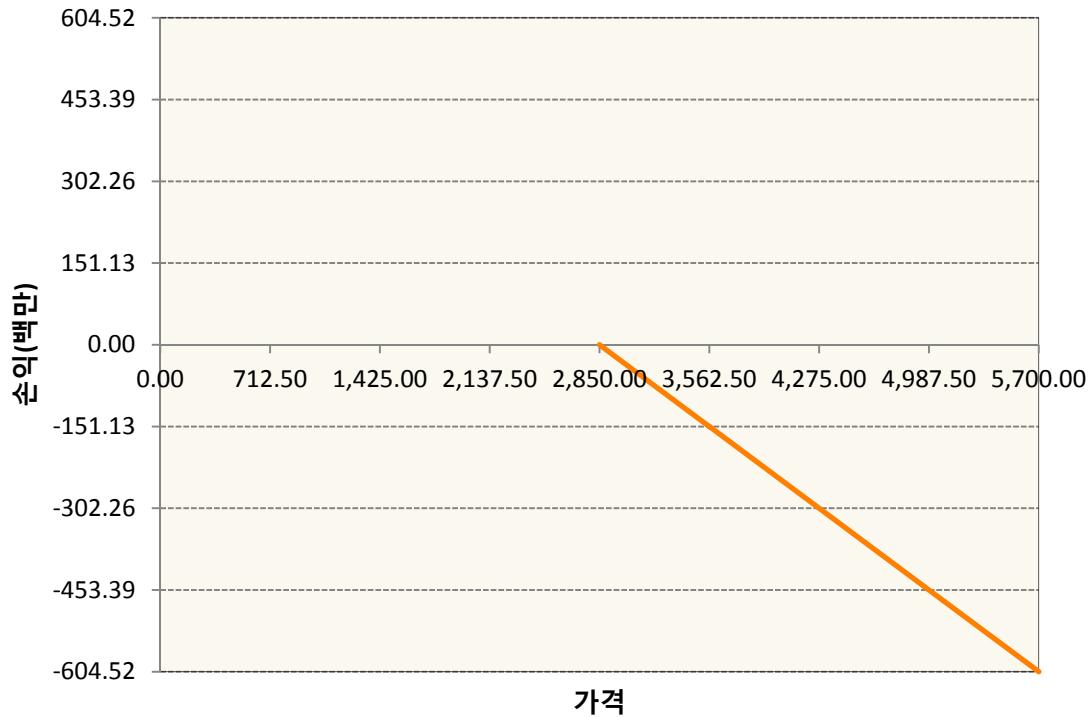
1. 계약금액

(단위:백만원)

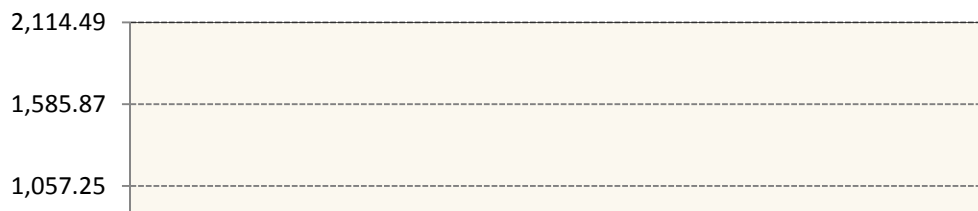
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	457	0	457	
누계	유가증권	스왑	7,907	0	7,907	장외
누계	유가증권	옵션	0	5,438	-5,438	장내
누계	통화	선도	0	2,683	-2,683	장외

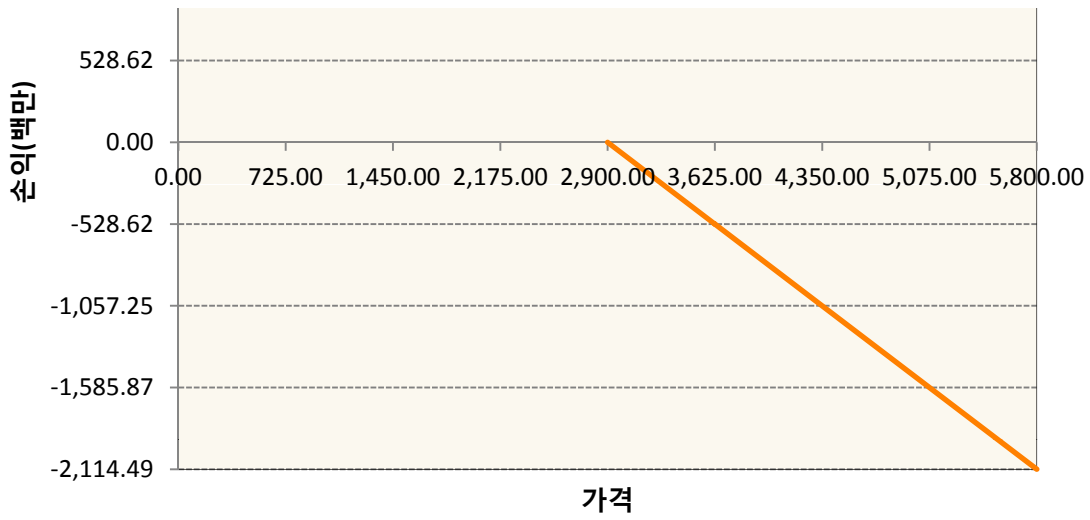
2. 만기시점의 손익구조

OESXK0-C2850-EURO STOXX 50

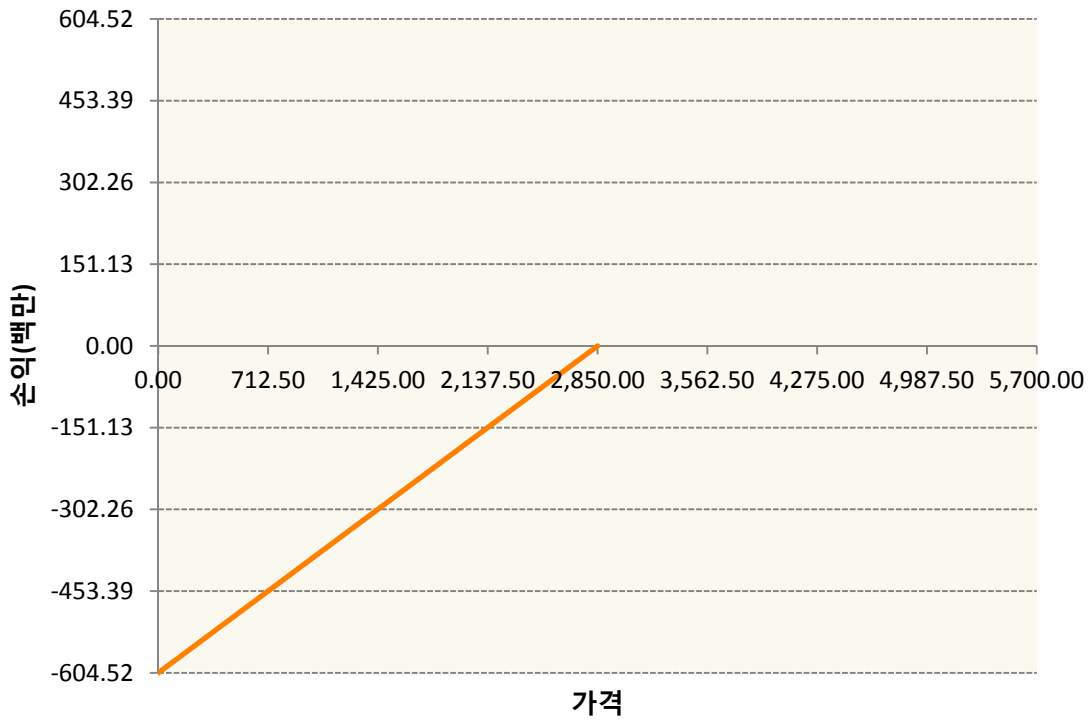


OESXK0-C2900-EURO STOXX 50

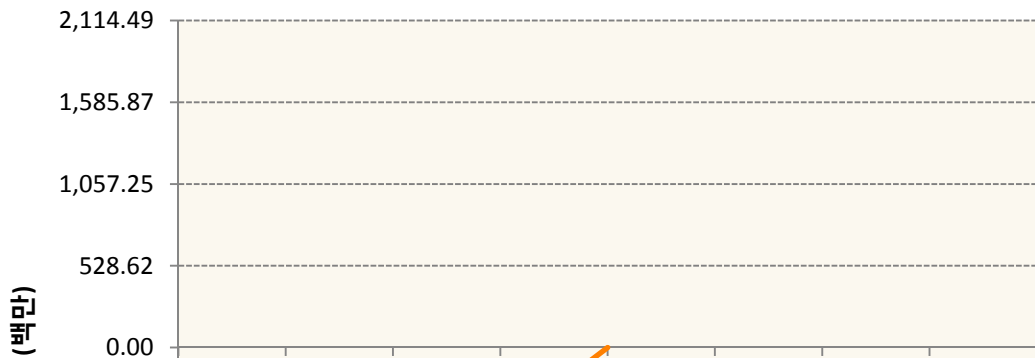


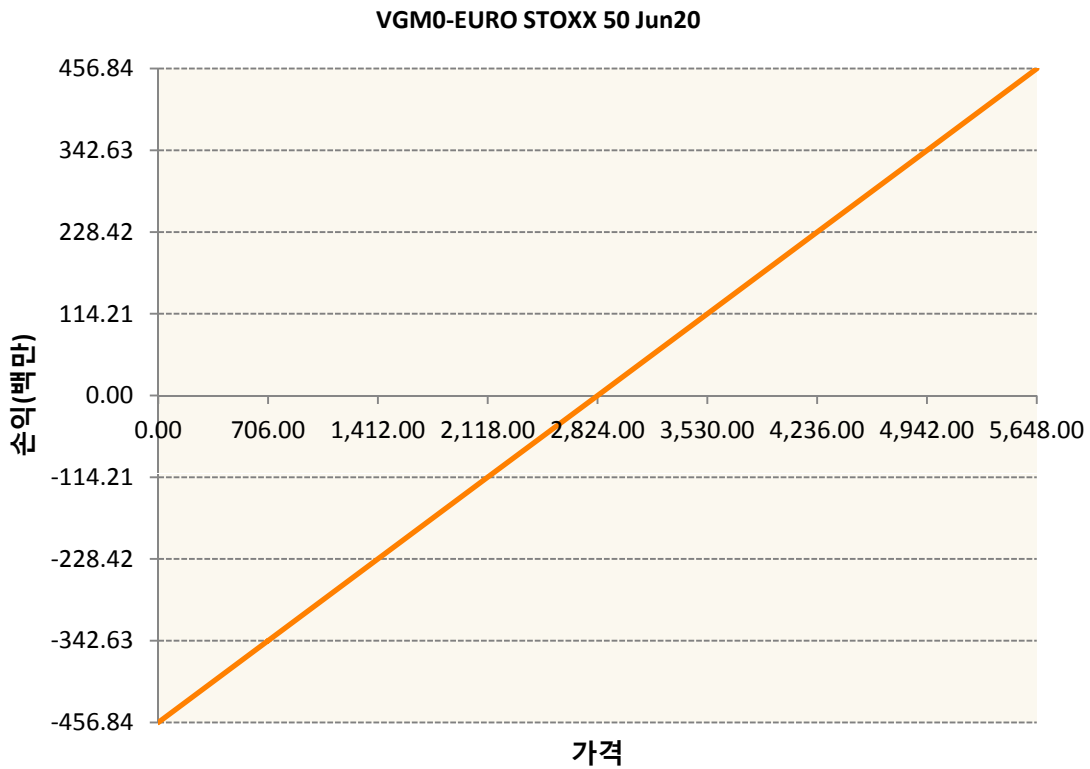
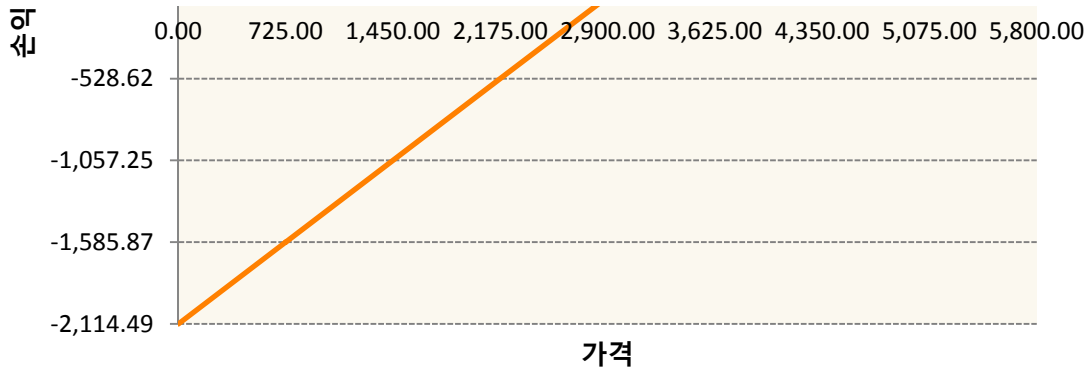


OESXK0-P2850-EURO STOXX 50



OESXK0-P2900-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		1
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E		215
OESXK0-C28 EURO STOXX 50		48
OESXK0-C29 EURO STOXX 50		169
OESXK0-P28 EURO STOXX 50		48
OESXK0-P29 EURO STOXX 50		169
VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	37

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

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

(단위:백만원)

1,112

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

(단위:백만원)

96

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

(단위:백만원)

141

공시일	2020-04-27
기준일	2020-04-24

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

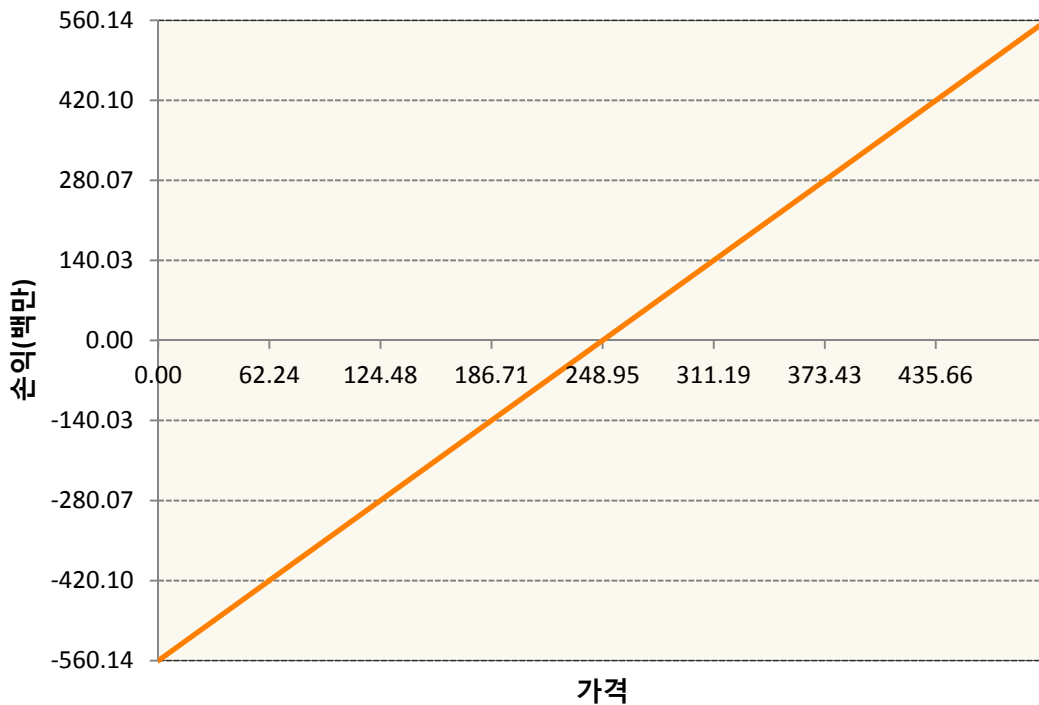
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	560	0	560	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	2020-04-27
기준일	2020-04-24

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

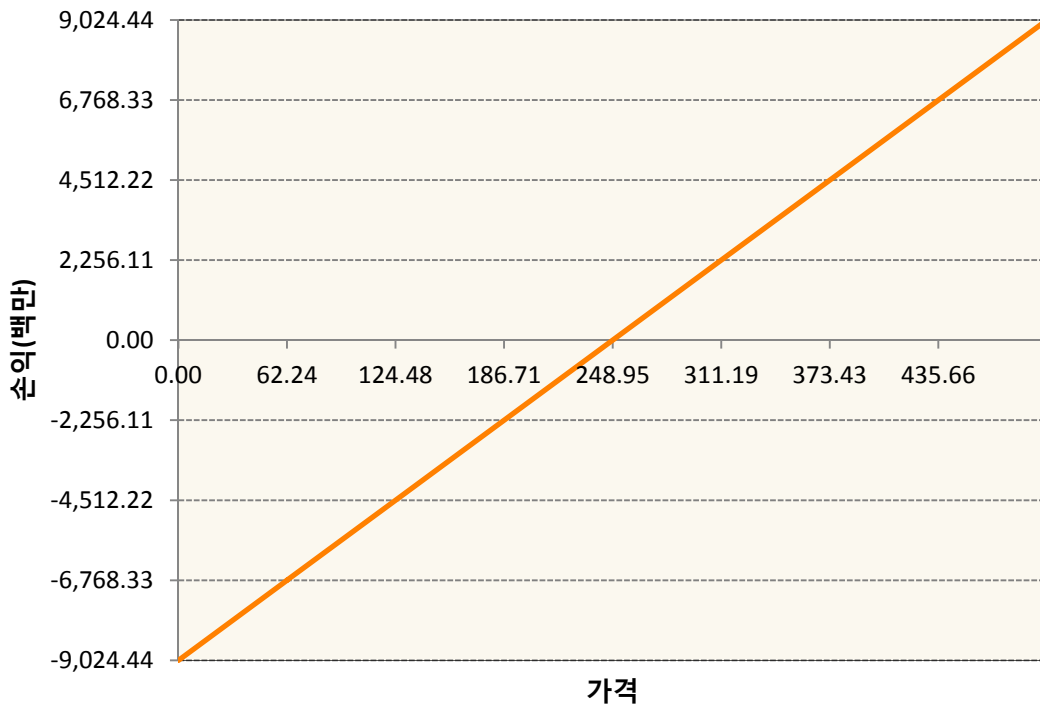
1. 계약금액

(단위:백만원)

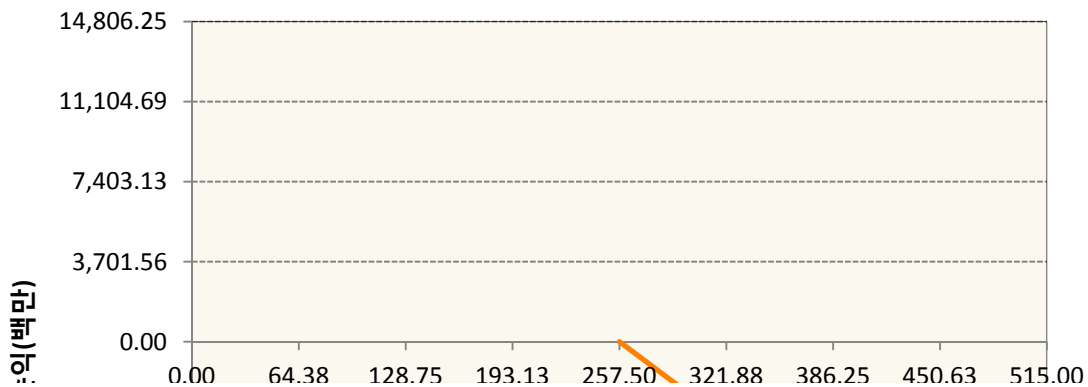
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,024	0	9,024	장내
누계	유가증권	옵션	6,201	17,536	-11,335	장내

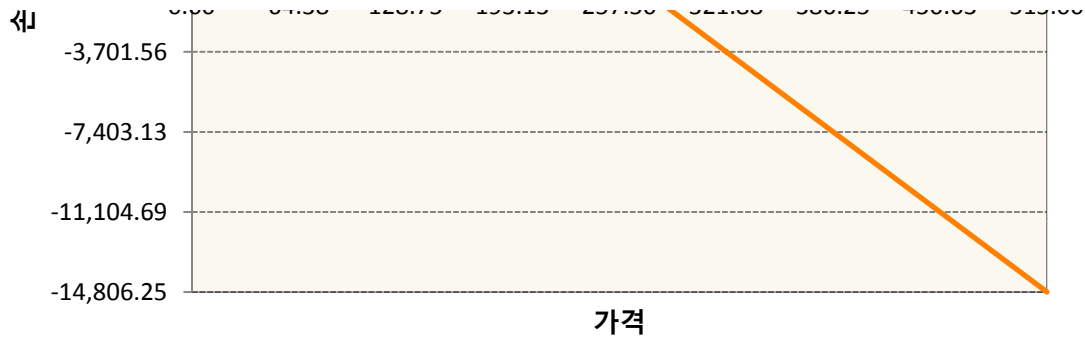
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

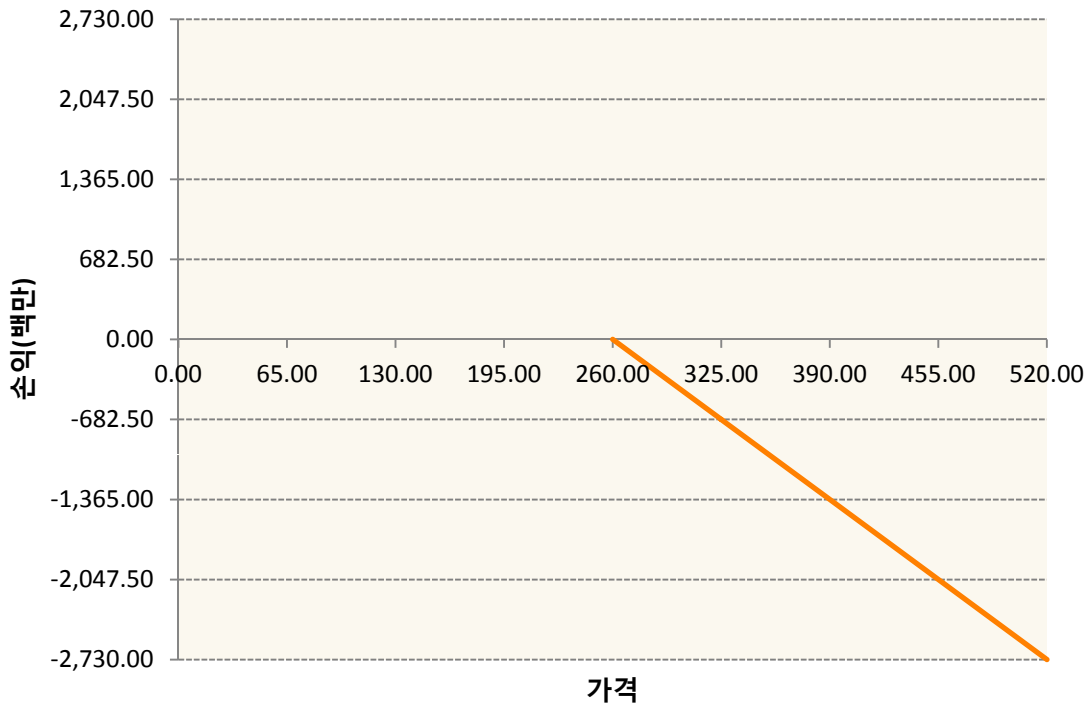


KR4201Q52577-2020-05 콜257.5

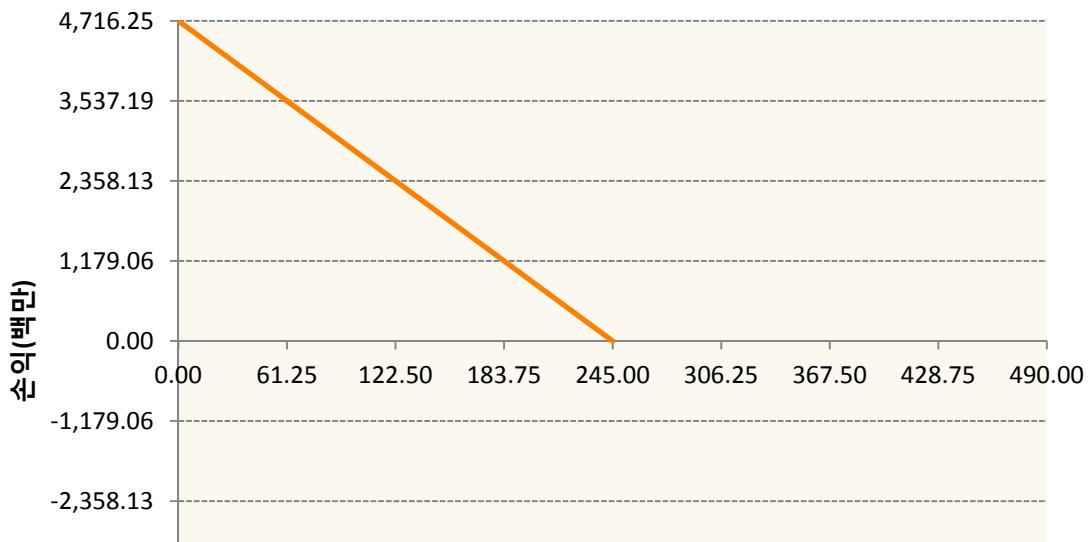


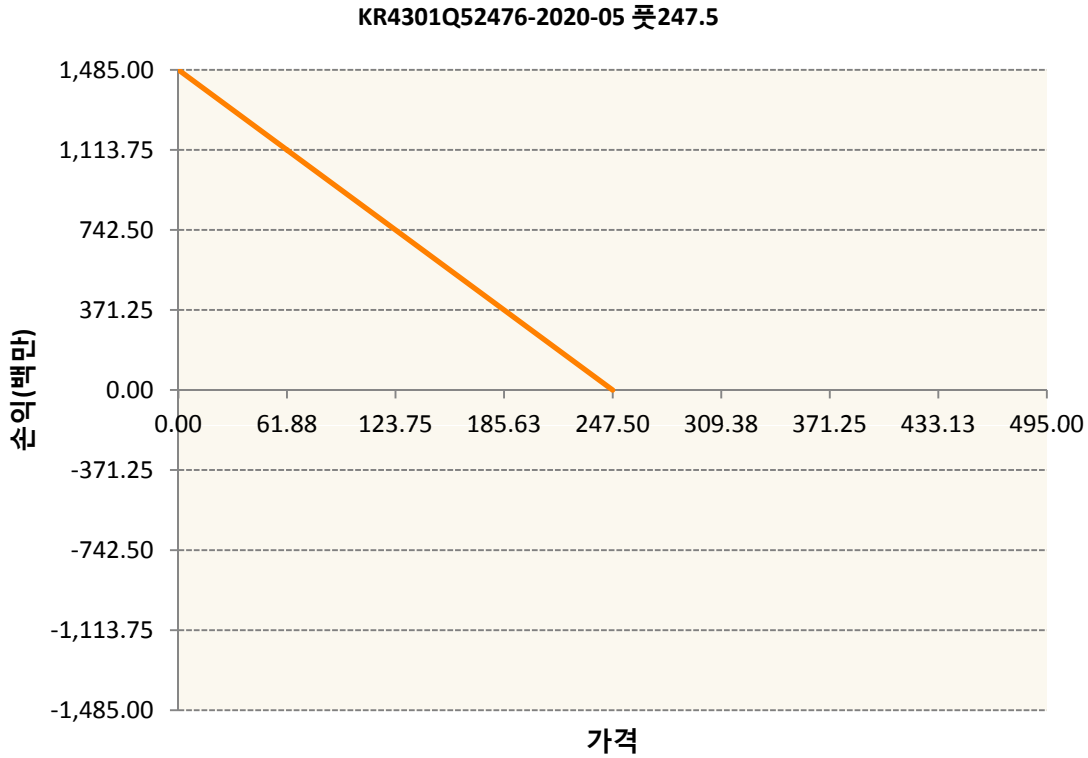
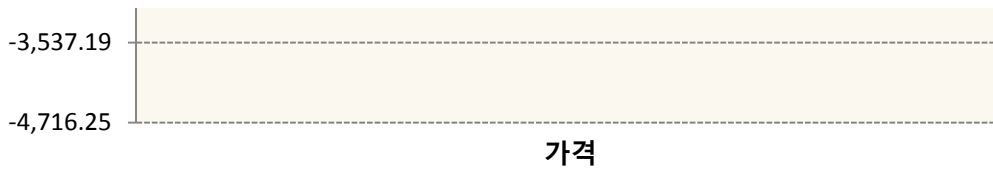


KR4201Q52601-2020-05 콜260



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						726
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-726	-726	-726	-726	-726	-726	-726	
-5.33%	-484	-484	-484	-484	-484	-484	-484	
-2.67%	-242	-242	-242	-242	-242	-242	-242	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	242	242	242	242	242	242	242	
5.33%	484	484	484	484	484	484	484	
8.00%	726	726	726	726	726	726	726	
KR4201Q52577		2020-05 콜257.5						799
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	420	395	367	336	302	266	228	
-5.33%	368	333	295	255	213	170	125	
-2.67%	283	238	192	144	95	46	-4	

0%	159	106	53	0	-54	-107	-161
2.67%	-11	-67	-123	-179	-235	-291	-347
5.33%	-227	-282	-337	-392	-448	-504	-560
8.00%	-485	-535	-586	-639	-692	-745	-799
KR4201Q52601 2020-05 콜260							140
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	69	65	61	56	50	44	37
-5.33%	61	56	49	42	35	28	20
-2.67%	48	40	32	24	16	7	-2
0%	28	19	10	0	-10	-19	-29
2.67%	0	-10	-20	-30	-41	-51	-61
5.33%	-36	-46	-57	-67	-77	-88	-98
8.00%	-80	-90	-100	-110	-120	-130	-140
KR4301Q52450 2020-05 풋245							253
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	193	202	211	221	231	242	253
-5.33%	95	107	119	132	144	157	169
-2.67%	17	31	44	58	71	85	98
0%	-40	-27	-13	0	13	27	40
2.67%	-77	-66	-55	-43	-31	-18	-6
5.33%	-100	-92	-83	-73	-63	-52	-41
8.00%	-112	-106	-100	-93	-85	-76	-67
KR4301Q52476 2020-05 풋247.5							83
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	66	69	71	74	77	80	83
-5.33%	34	37	41	45	48	52	56
-2.67%	7	12	16	20	24	28	32
0%	-13	-9	-4	0	4	9	13
2.67%	-27	-23	-19	-15	-11	-7	-3
5.33%	-35	-32	-29	-26	-22	-19	-15
8.00%	-40	-38	-36	-33	-30	-27	-24

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

(단위:백만원)

2,032

공시일	2020-04-27
기준일	2020-04-24

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	146,715	0	146,715	

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	2020-04-27
기준일	2020-04-24

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	98,925	0	98,925	

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	2020-04-27
기준일	2020-04-24

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	437,071	0	437,071	
누계	통화	선도	44,478	520,146	-475,668	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,313
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,977
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,471
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,056
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,056
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,412
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	988
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	988
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,570
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	850
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	741
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	494
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,459
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	7,018
FX21020H11 KRW/USD 11-05-20E	988
FX21020J00₩ KRW/USD 10-06-20E	2,965
FX21020J02₩ KRW/USD 10-06-20E	1,344
FX21020J02₯ KRW/USD 22-06-20E	1,522
FX21020J02₰ KRW/USD 22-06-20E	1,977
FX21020J03₱ KRW/USD 24-07-20E	2,224
FX21020J04₲ KRW/USD 24-07-20E	1,779
FX21020J04₳ KRW/USD 24-07-20E	1,977
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)

192

공시일	2020-04-27
기준일	2020-04-24

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

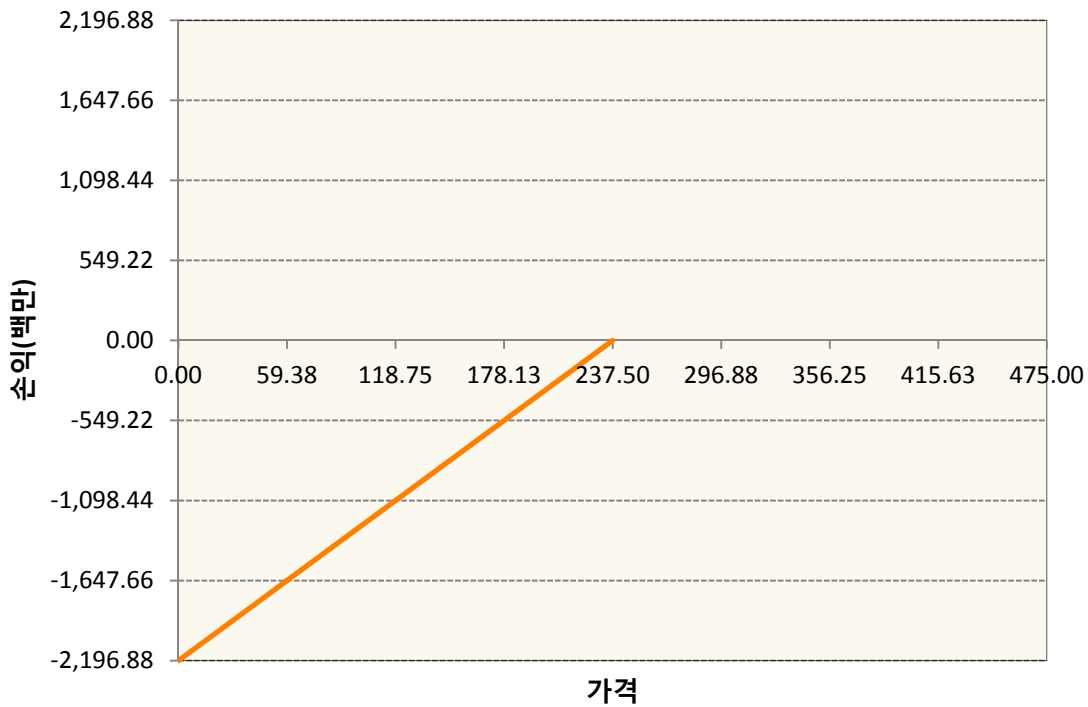
1. 계약금액

(단위:백만원)

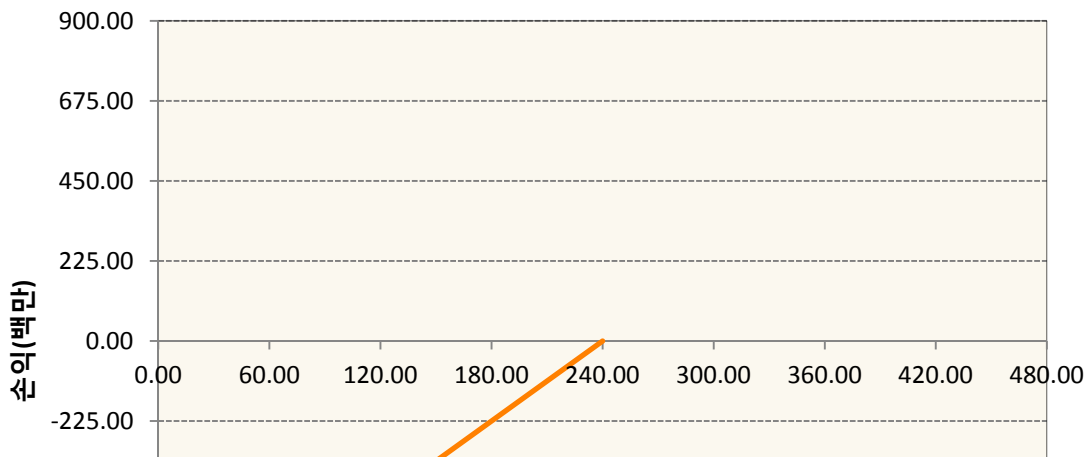
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,097	-3,097	장내

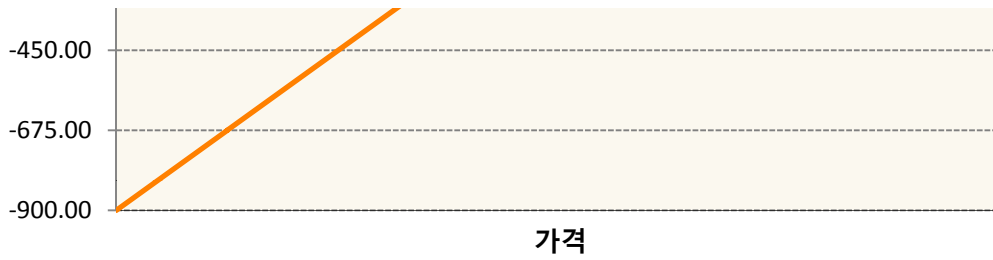
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q52377-2020-05 풋237.5



KR4301Q52401-2020-05 풋240





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q52377		2020-05 풋237.5						99
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-64	-69	-75	-81	-87	-93	-99	
-5.33%	-27	-34	-40	-46	-53	-59	-65	
-2.67%	-1	-7	-13	-19	-26	-32	-38	
0%	15	11	5	0	-6	-11	-17	
2.67%	25	22	18	13	9	4	-1	
5.33%	30	28	25	22	18	15	11	
8.00%	32	31	29	27	25	22	19	
KR4301Q52401		2020-05 풋240						43
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-30	-32	-34	-36	-39	-41	-43	
-5.33%	-13	-16	-18	-21	-24	-26	-29	
-2.67%	-1	-4	-6	-9	-12	-14	-17	
0%	7	5	2	0	-2	-5	-7	
2.67%	12	10	8	6	4	2	0	
5.33%	14	13	12	11	9	7	5	
8.00%	16	15	14	13	12	11	9	

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

112

공시일	2020-04-27
기준일	2020-04-24

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	7,204	0	7,204	
누계	통화	선도	0	7,228	-7,228	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	323
IE00BD8RGM75	*

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

291

공시일	2020-04-27
기준일	2020-04-24

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

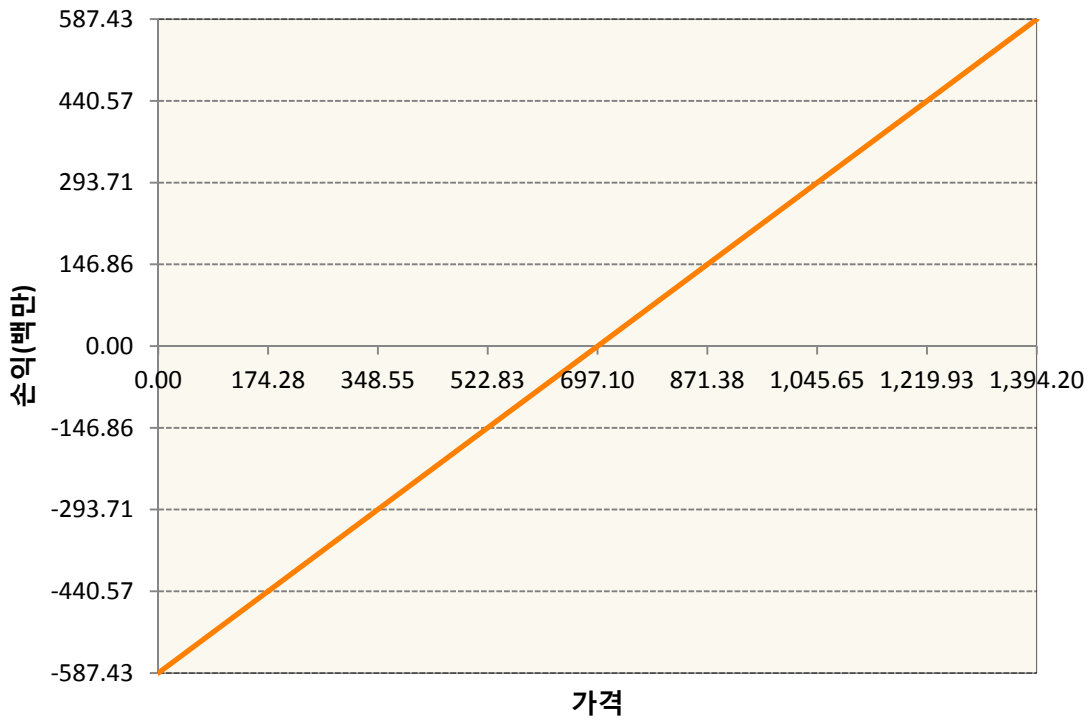
1. 계약금액

(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	587	0	587	
누계	유가증권	스왑	869	0	869	장외
누계	통화	선도	204	496	-292	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCK0-VN30 Index Future May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	69
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

FX21020J009 KRW/EUR 24-07-20E	5
FX21020J018 KRW/EUR 24-07-20E	3
FX21020J029 KRW/EUR 24-07-20E	5
FX21020J033 KRW/EUR 26-06-20E	5
FX21020J038 KRW/EUR 24-07-20E	1
VNCK0 VN30 Index Future May20	47

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

(단위:백만원)

136

공시일	2020-04-27
기준일	2020-04-24

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

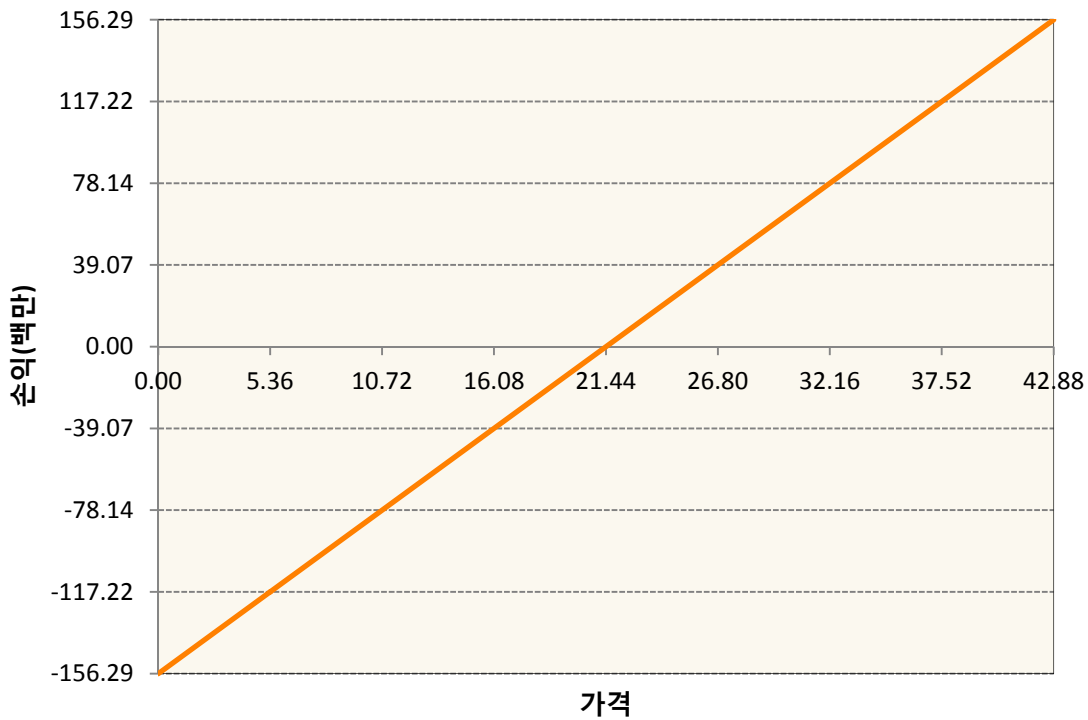
1. 계약금액

(단위:백만원)

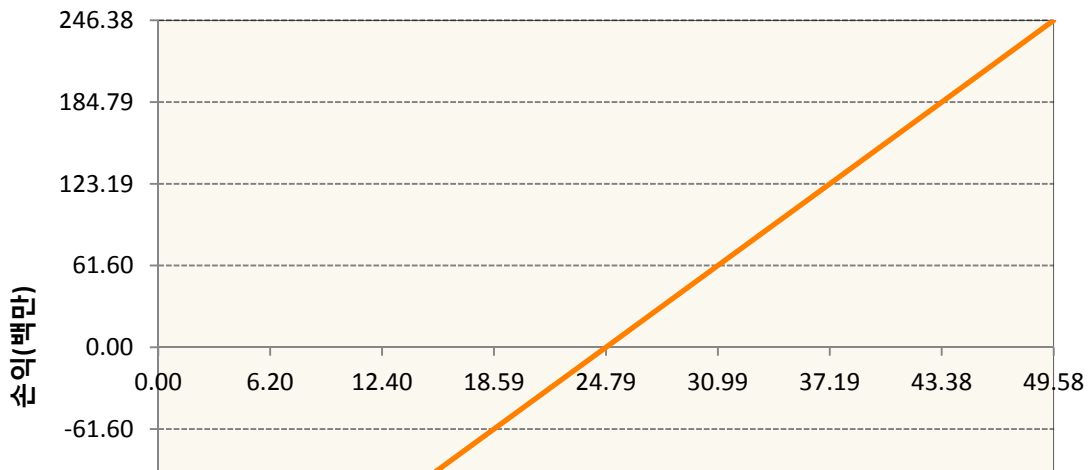
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,388	185	1,203	

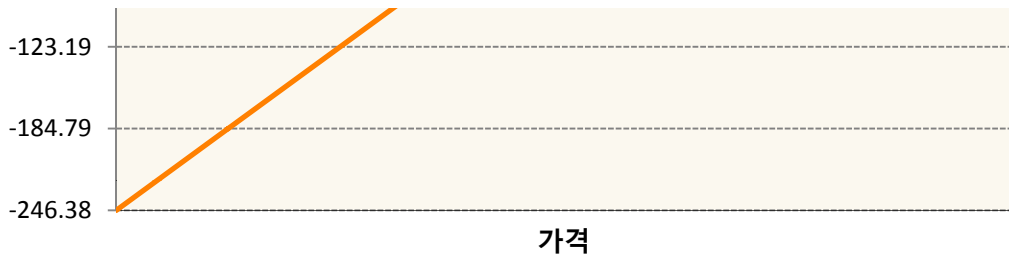
2. 만기시점의 손익구조

CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20

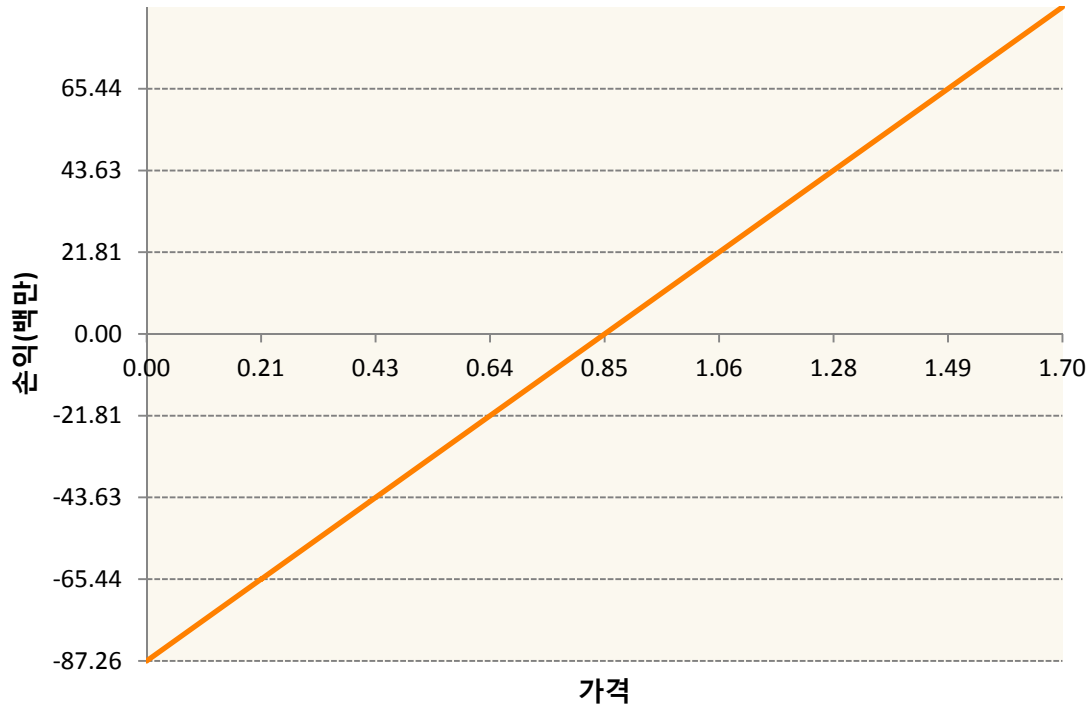


CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20

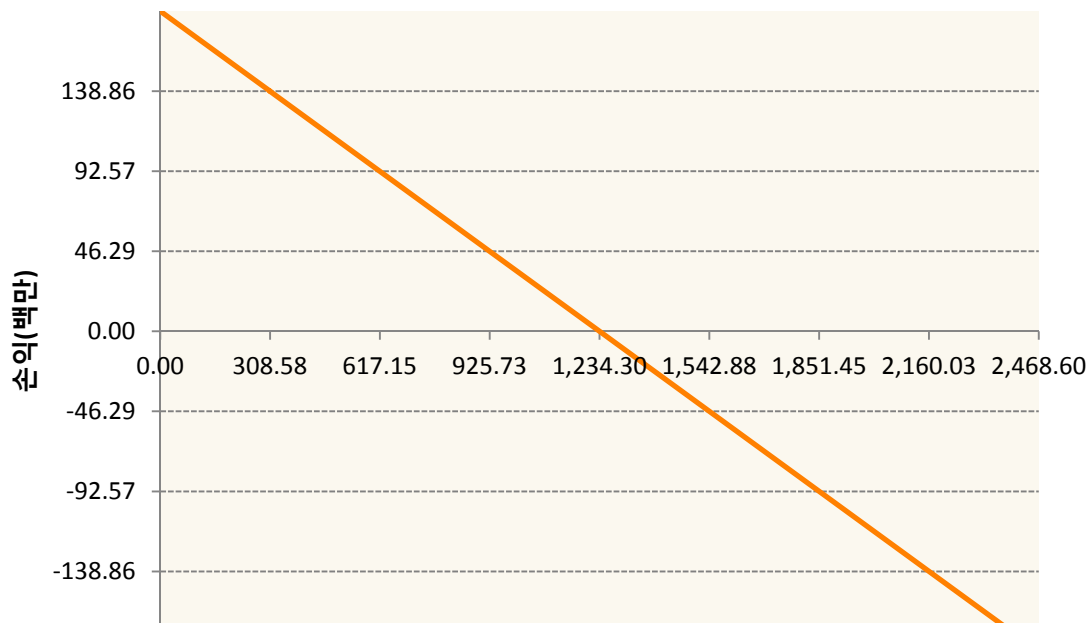


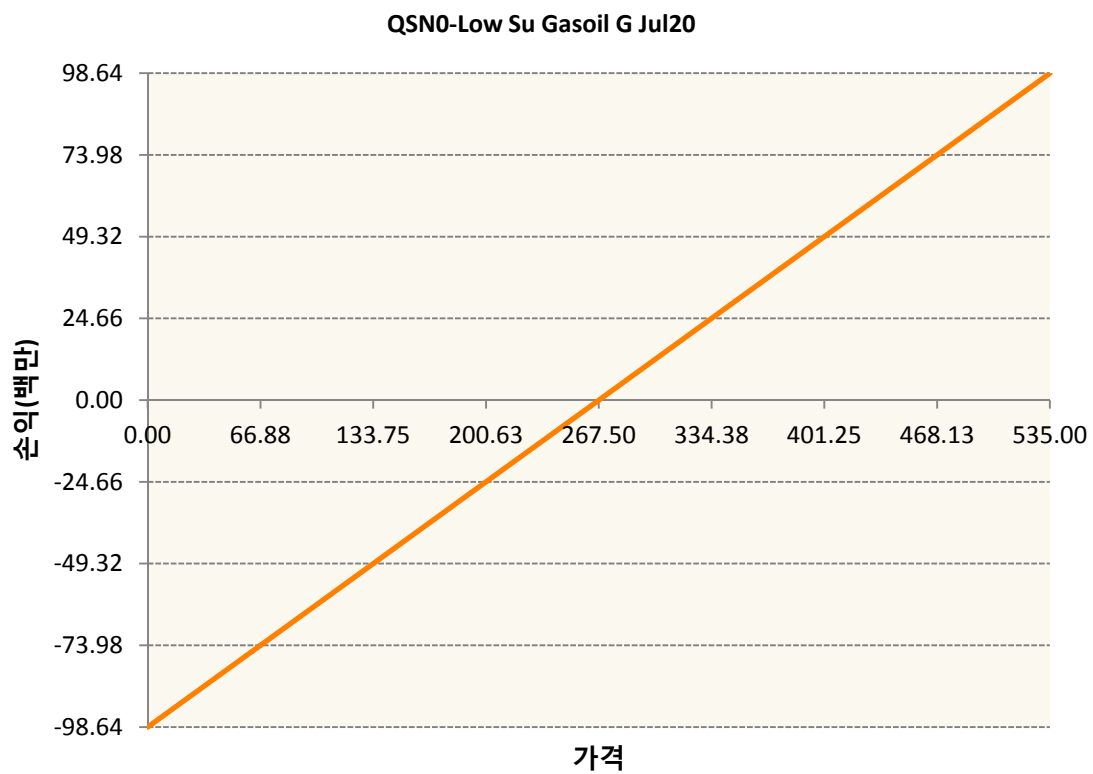
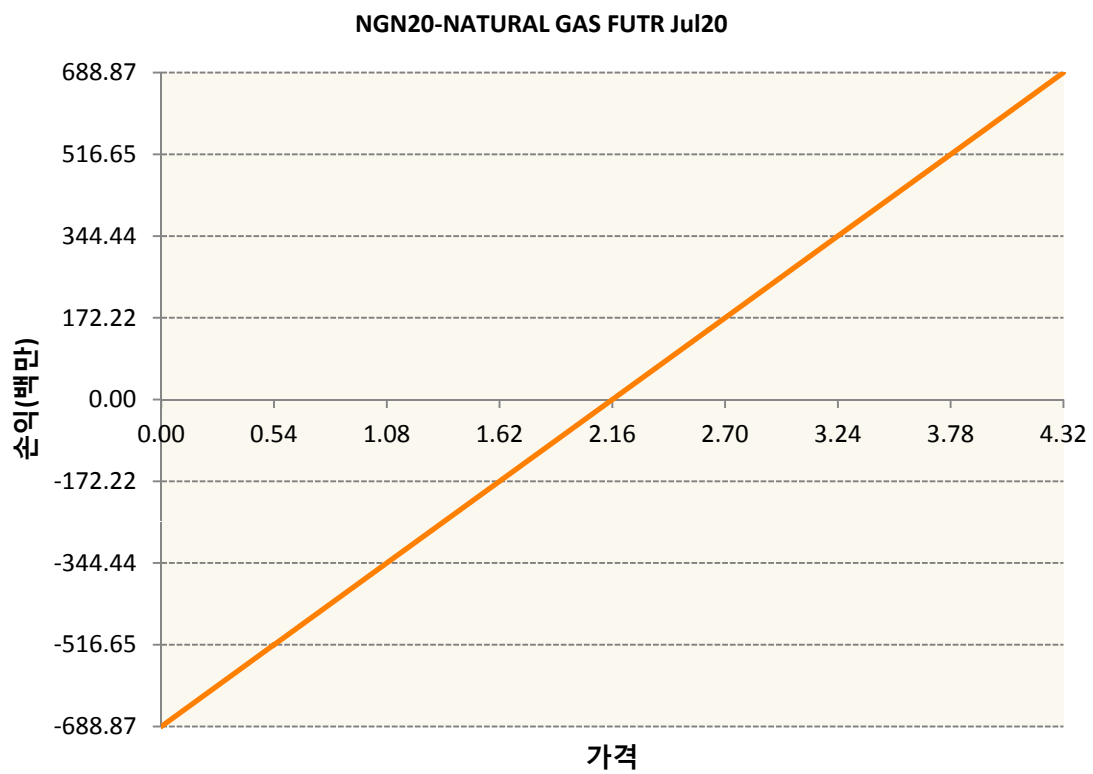
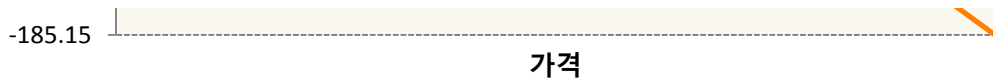


HON0-NY Harb ULSD Fut Jul20

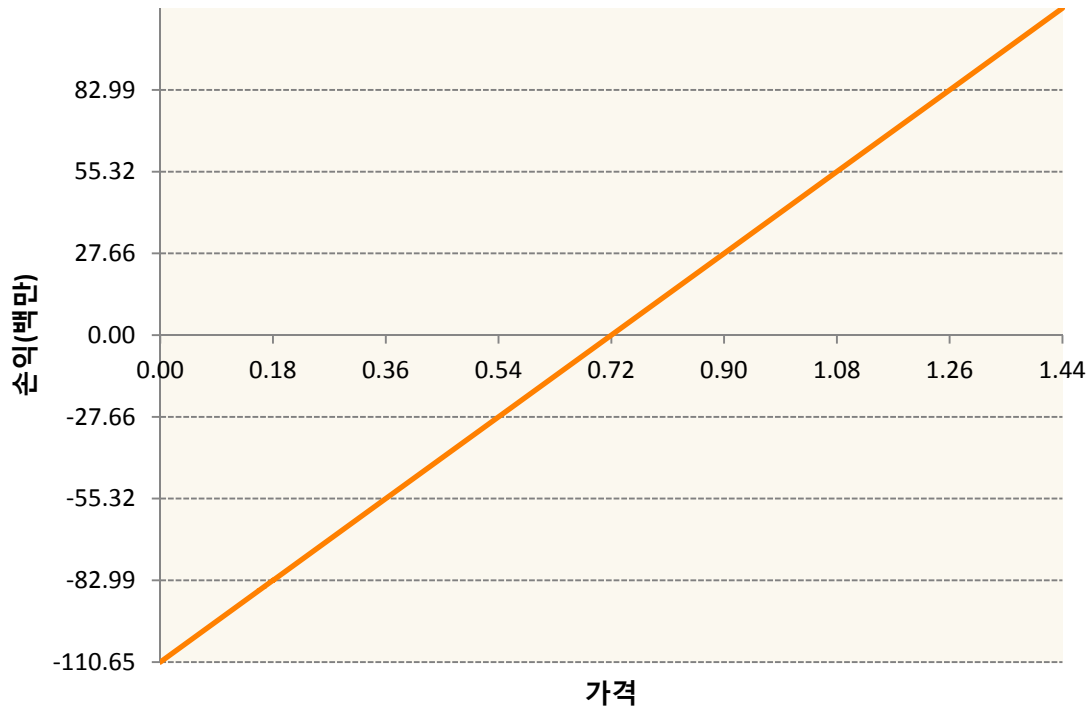


KR4175Q50007-2020-05 달러선물





XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN0	WTI CRUDE FUTURE Jul20	13
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	20
HON0	NY Harb ULSD Fut Jul20	7
	KR4175Q50C 2020-05 달러선물	15
NGN20	NATURAL GAS FUTR Jul20	55
QSN0	Low Su Gasoil G Jul20	8
XBN0	GASOLINE RBOB FUT Jul20	9

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

(단위:백만원)

501

공시일	2020-04-27
기준일	2020-04-24

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

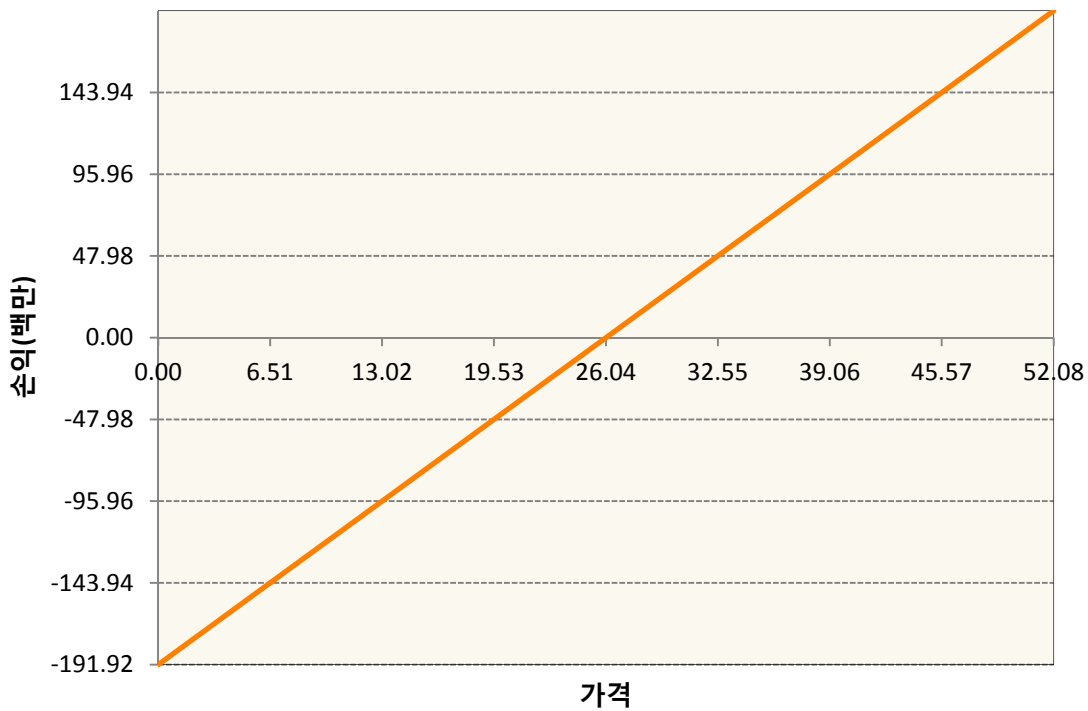
1. 계약금액

(단위:백만원)

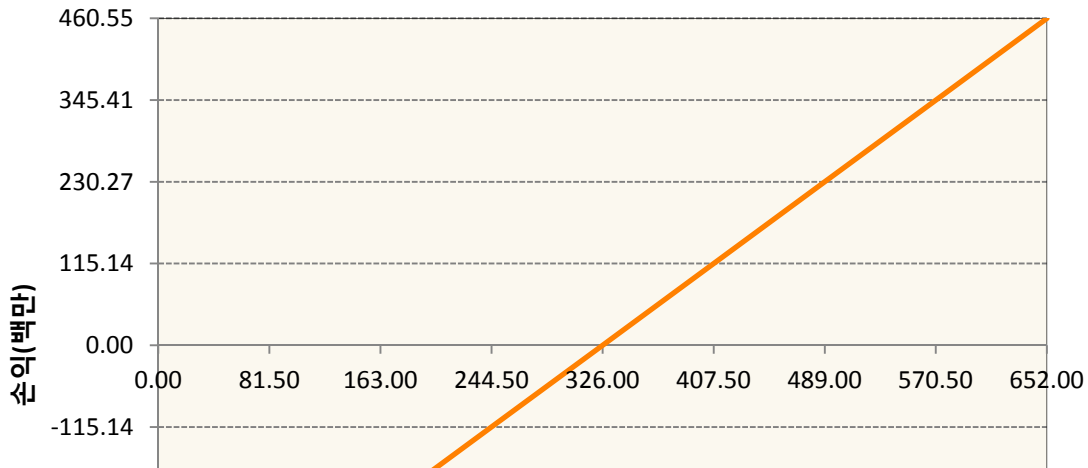
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,396	74	2,322	

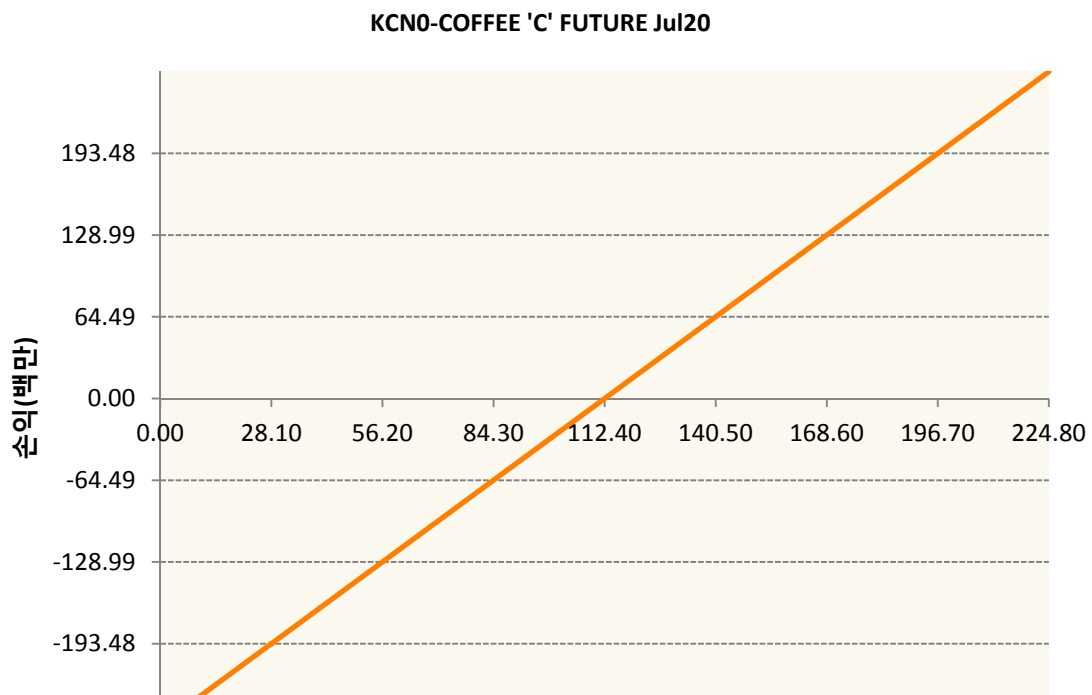
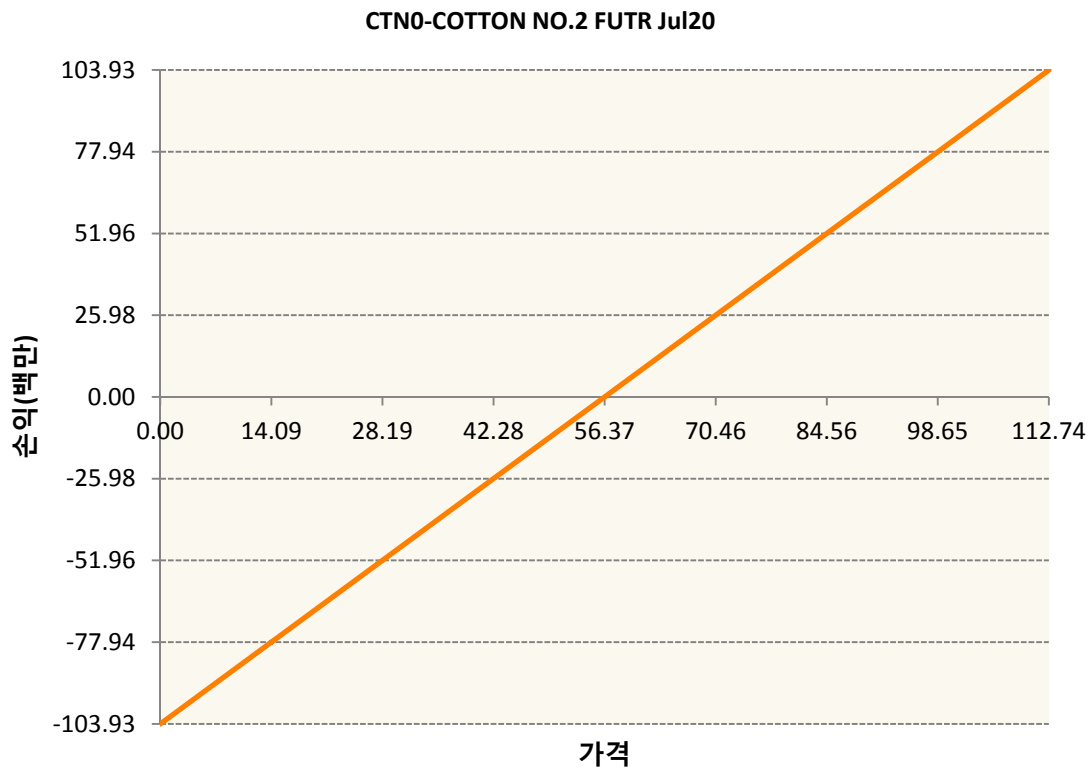
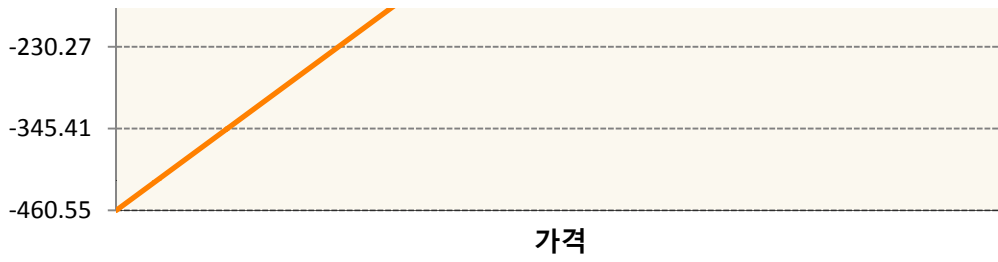
2. 만기시점의 손익구조

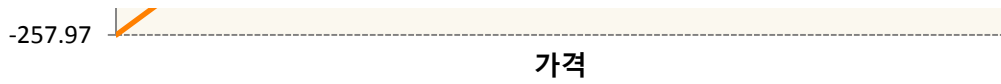
BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20



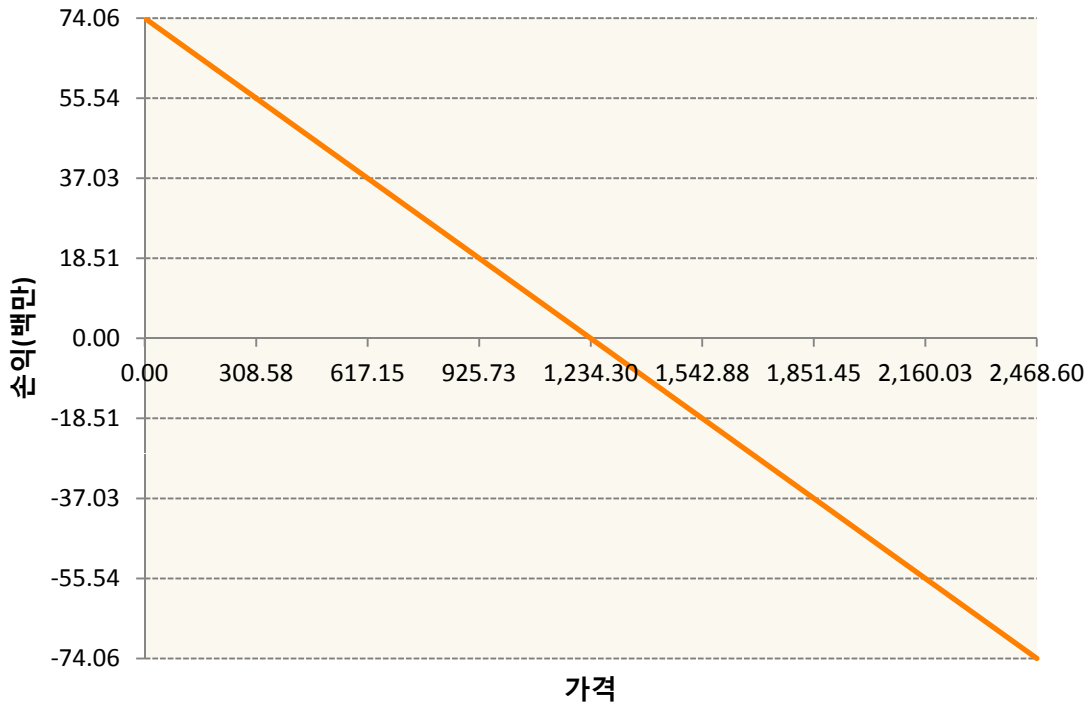
CNO-CORN FUTURE Jul20



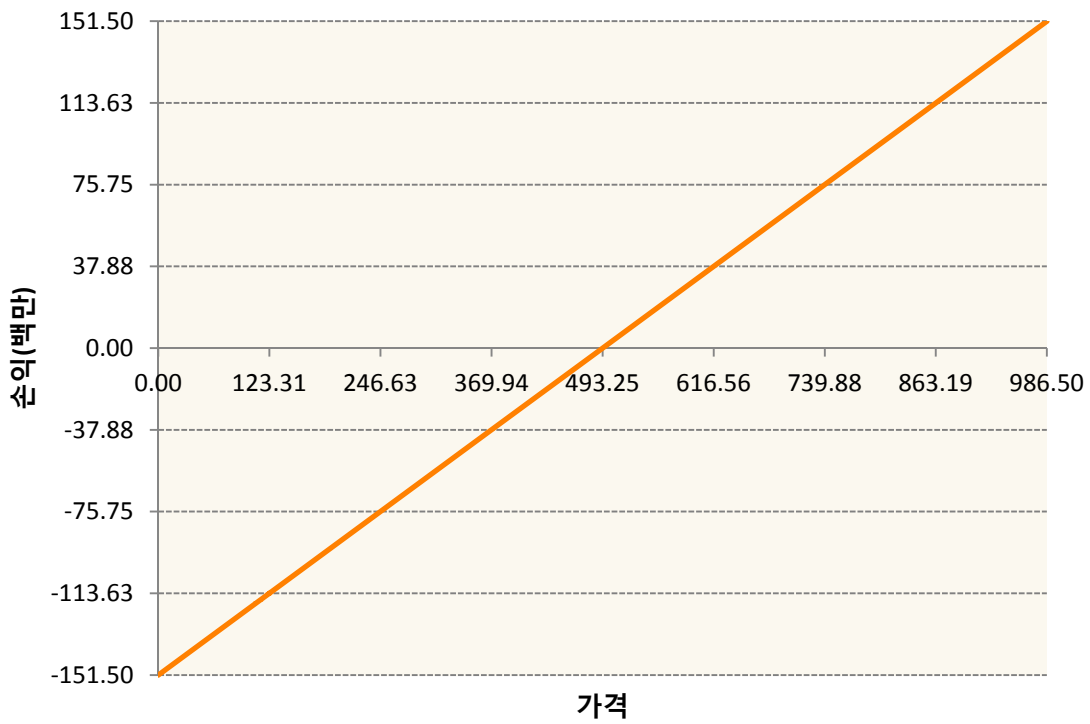




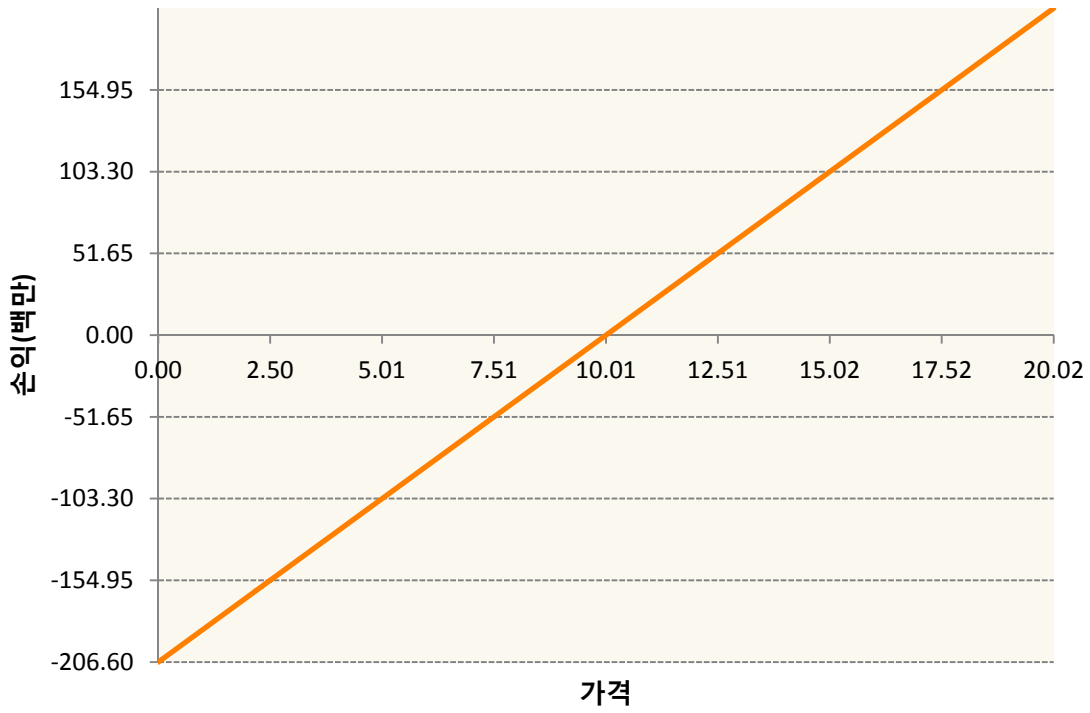
KR4175Q50007-2020-05 달러선물



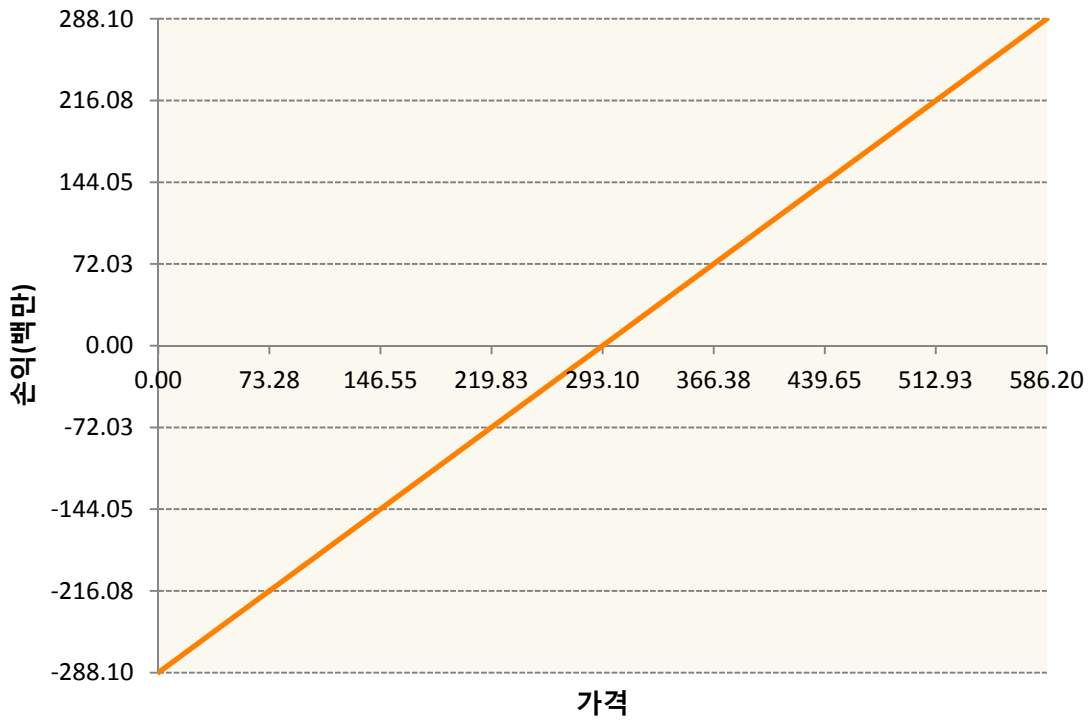
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



SBN0-Sugar Jul20

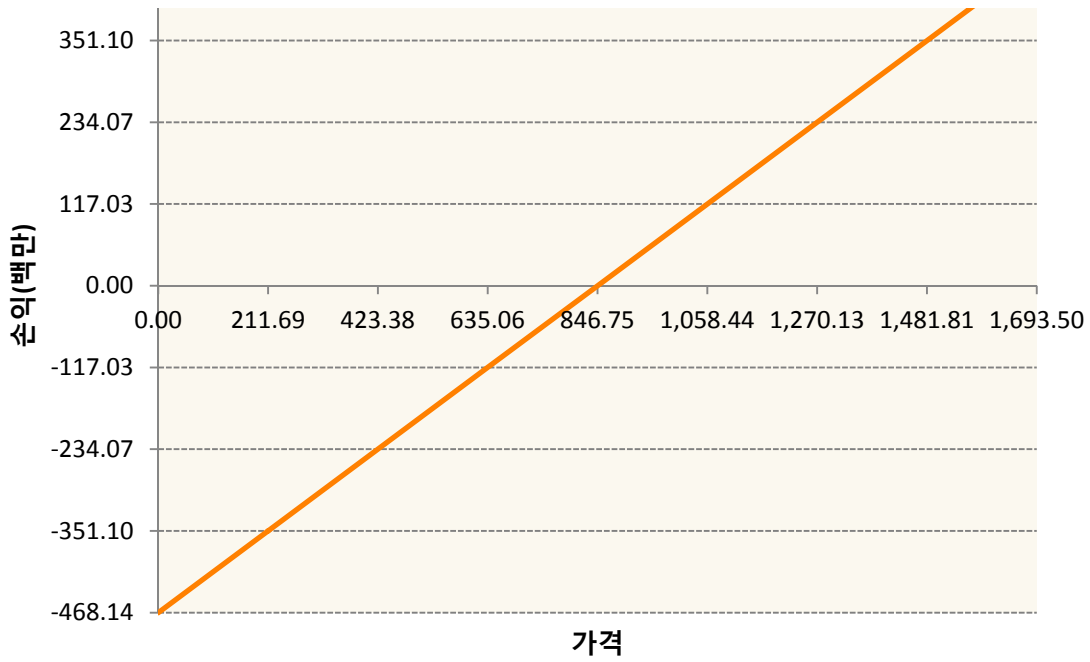


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20

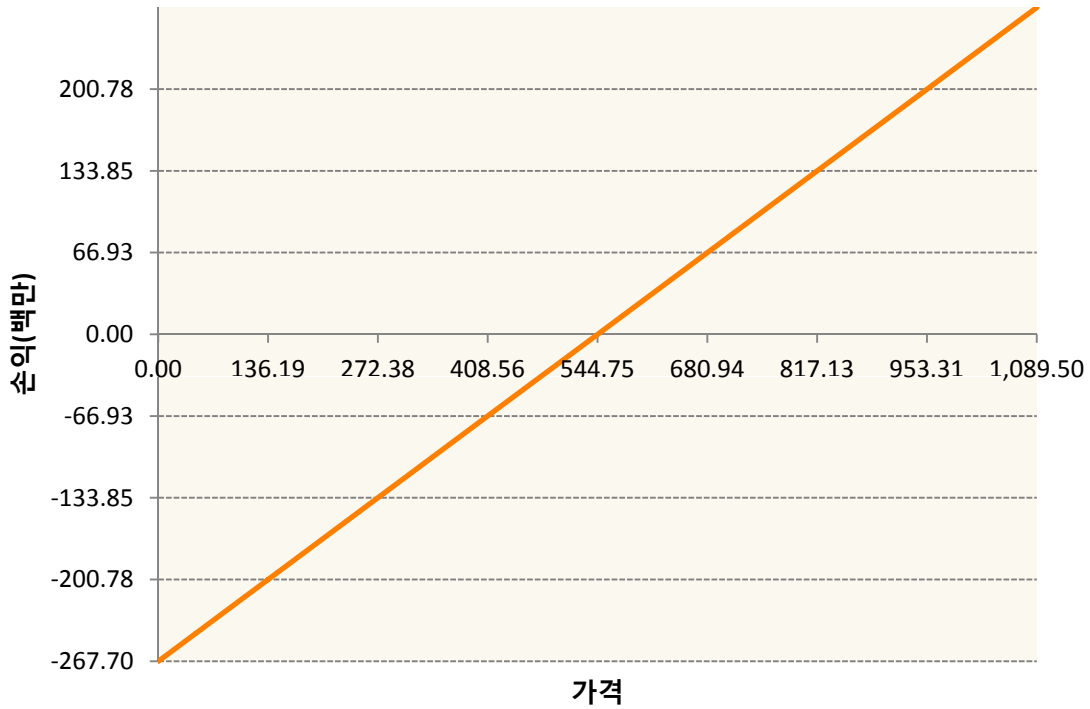


SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





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)

226