

공시일	2020-04-28
기준일	2020-04-27

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	2020-04-28
기준일	2020-04-27

스마트인덱스모

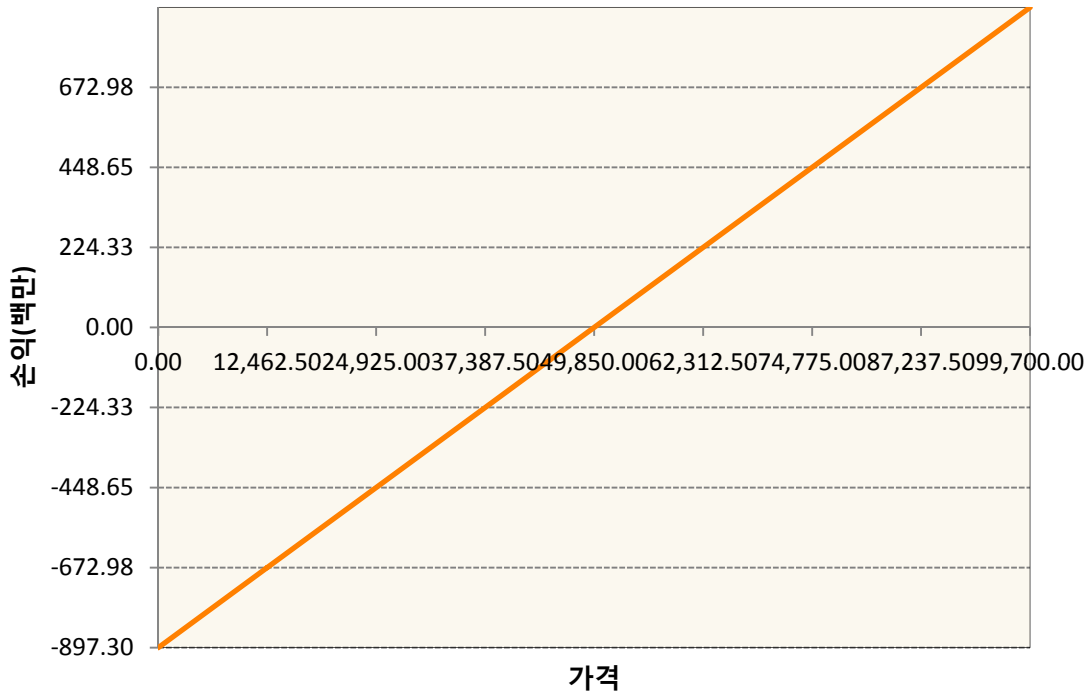
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	897	0	897	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111Q50002-2020-05 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111Q50002		2020-05 삼성전자개별선물						72
가격	기초자산의 변동성							
	-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)

108

공시일	2020-04-28
기준일	2020-04-27

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

956

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,117

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-28
기준일	2020-04-27

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

547

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

865

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-28
기준일	2020-04-27

유로인덱스모(주식-파생형)

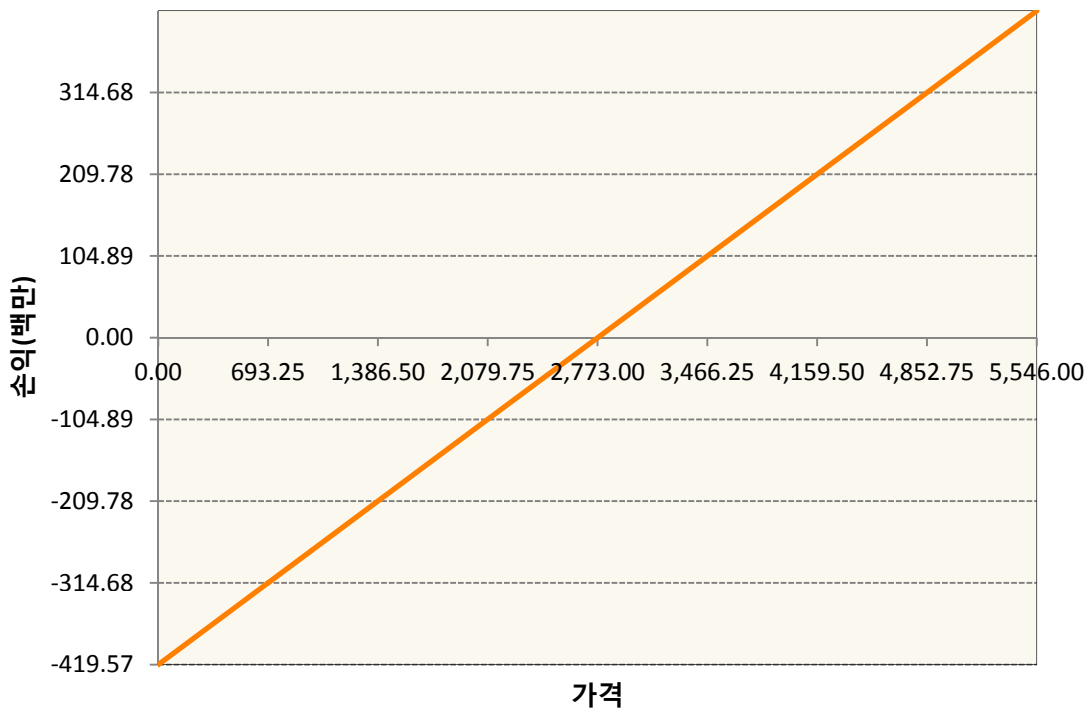
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	420	0	420	

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)

42

공시일	2020-04-28
기준일	2020-04-27

차이나인덱스모(주식-파생형)

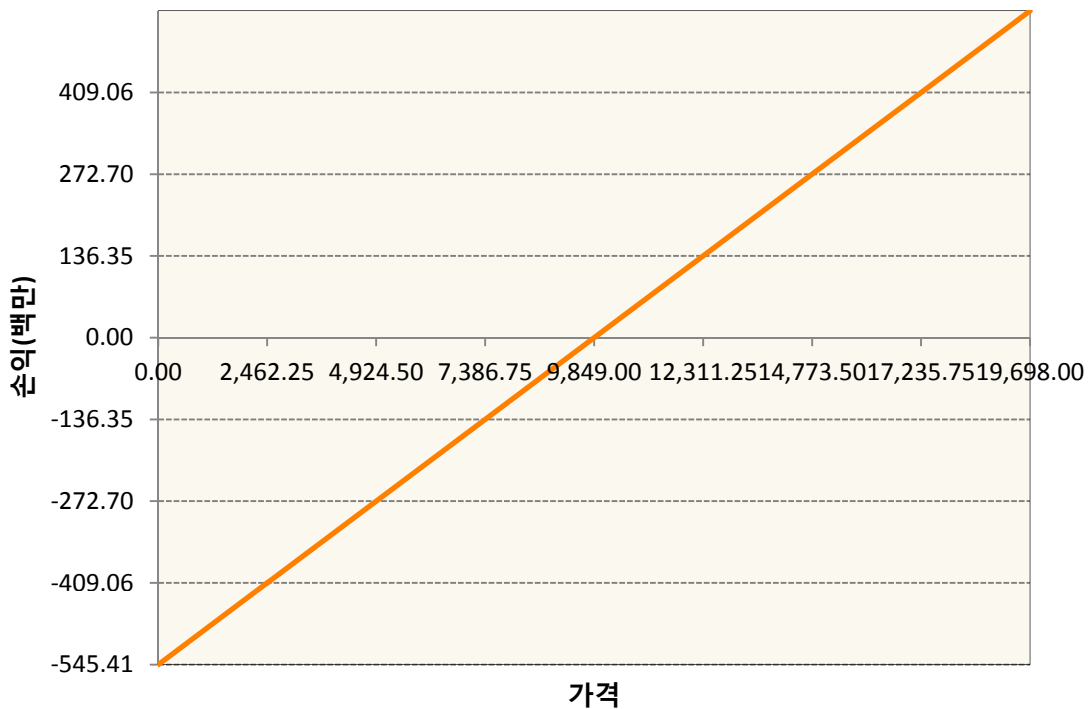
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	545	0	545	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCK0-HSCEI Futures May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK0	HSCEI Futures May20	44
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

46

공시일	2020-04-28
기준일	2020-04-27

커버드콜모(주식혼합-파생형)

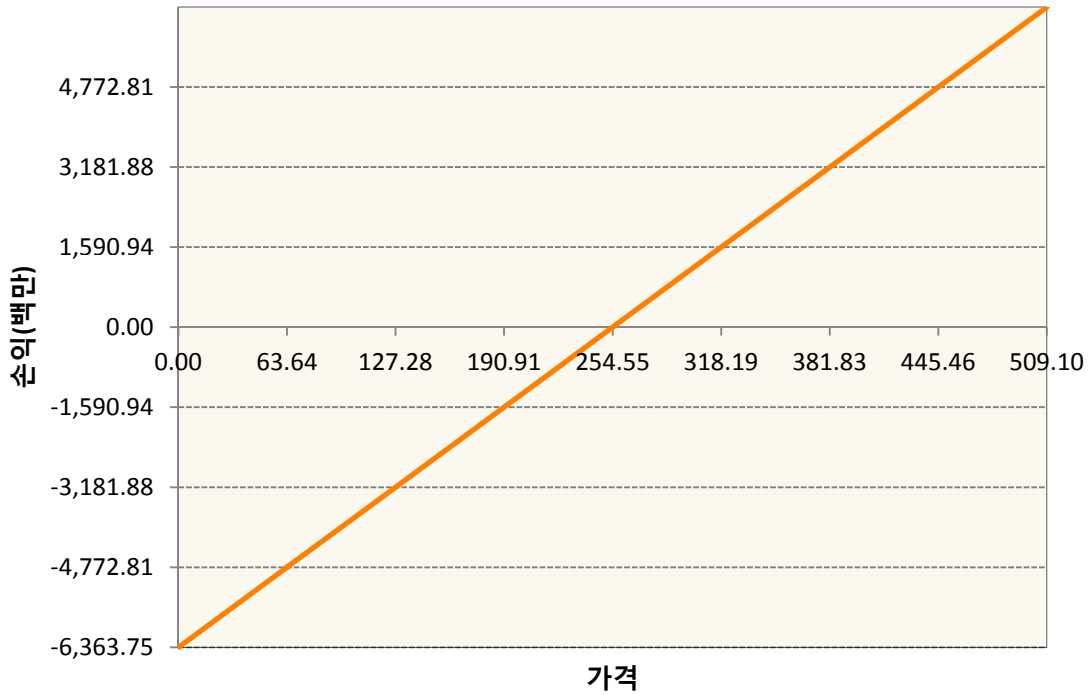
1. 계약금액

(단위:백만원)

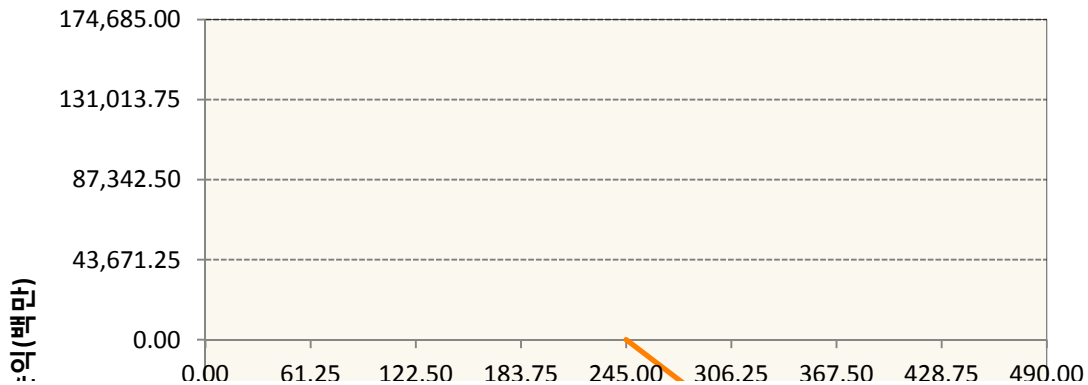
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,364	0	6,364	장내
누계	유가증권	옵션	0	358,345	-358,345	장내

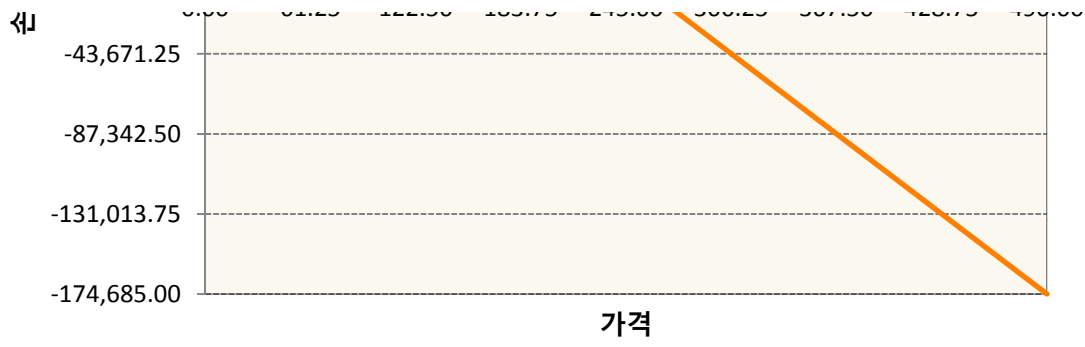
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

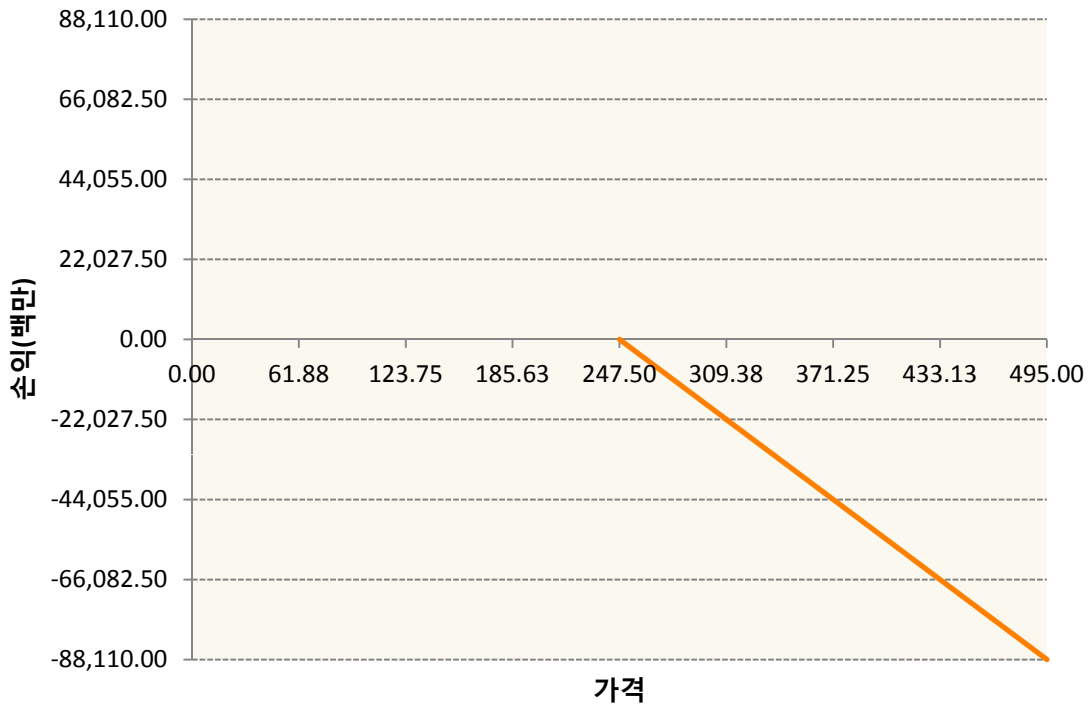


KR4201Q52452-2020-05 콜245

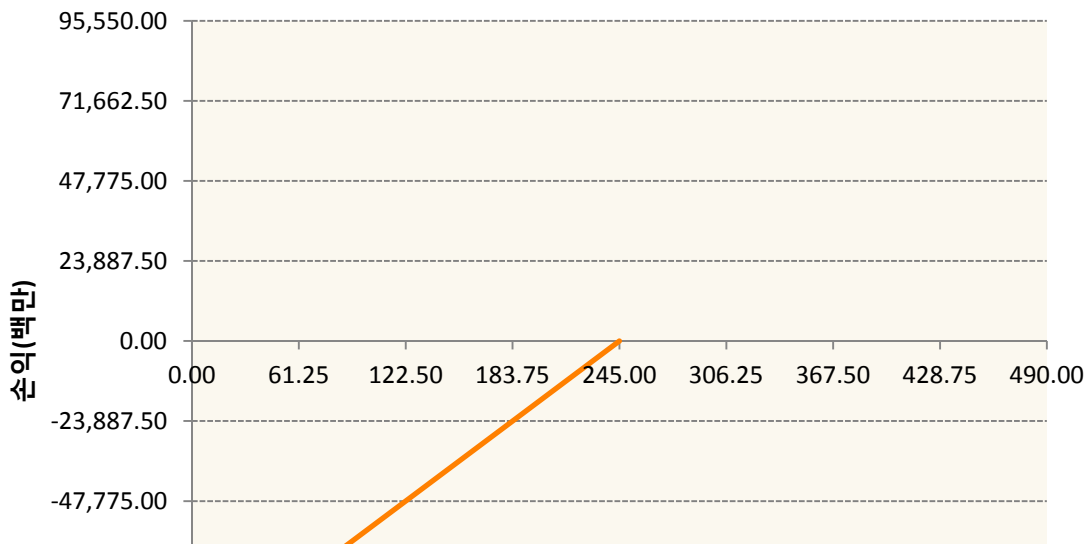


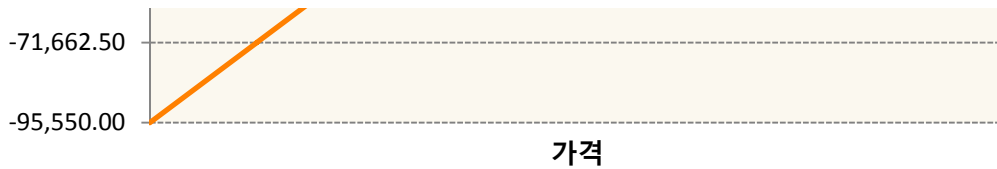


KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						510
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-510	-510	-510	-510	-510	-510	-510	
-5.33%	-340	-340	-340	-340	-340	-340	-340	
-2.67%	-170	-170	-170	-170	-170	-170	-170	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	170	170	170	170	170	170	170	
5.33%	340	340	340	340	340	340	340	
8.00%	510	510	510	510	510	510	510	
KR4201Q52452		2020-05 콜245						12,537
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	8,976	8,470	7,951	7,421	6,883	6,338	5,788	
-5.33%	7,218	6,634	6,048	5,461	4,873	4,283	3,694	
-2.67%	4,777	4,179	3,581	2,981	2,382	1,781	1,181	
0%	1,672	1,125	567	0	-573	-1,152	-1,734	
2.67%	-2,004	-2,456	-2,935	-3,434	-3,951	-4,481	-5,021	
5.33%	-6,119	-6,459	-6,839	-7,252	-7,693	-8,156	-8,638	
8.00%	-10,541	-10,776	-11,056	-11,378	-11,735	-12,123	-12,537	
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5						6,102
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4,162	3,927	3,682	3,429	3,170	2,907	2,640	
-5.33%	3,399	3,116	2,829	2,541	2,251	1,960	1,668	
-2.67%	2,306	2,003	1,700	1,397	1,094	792	489	
0%	876	587	294	0	-296	-594	-893	
2.67%	-857	-1,106	-1,365	-1,632	-1,905	-2,183	-2,465	
5.33%	-2,834	-3,028	-3,241	-3,467	-3,705	-3,953	-4,209	
8.00%	-4,988	-5,127	-5,289	-5,470	-5,667	-5,878	-6,102	
KR4301Q52450		2020-05 풋245						4,567
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,393	-3,571	-3,758	-3,953	-4,153	-4,358	-4,567	
-5.33%	-1,562	-1,792	-2,024	-2,257	-2,490	-2,725	-2,959	
-2.67%	-228	-466	-704	-943	-1,182	-1,422	-1,661	

0%	619	420	213	0	-217	-439	-663
2.67%	1,083	945	791	625	448	262	69
5.33%	1,302	1,222	1,123	1,007	877	734	580
8.00%	1,391	1,351	1,296	1,224	1,137	1,035	921

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

(단위:백만원)

21,822

공시일	2020-04-28
기준일	2020-04-27

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

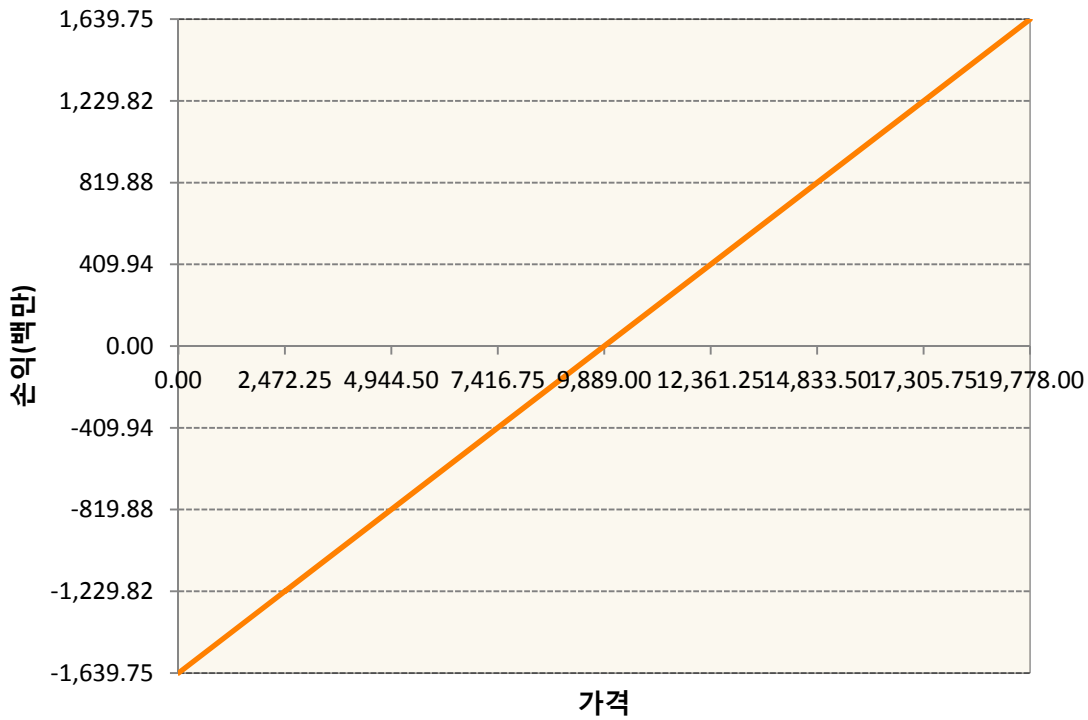
1. 계약금액

(단위:백만원)

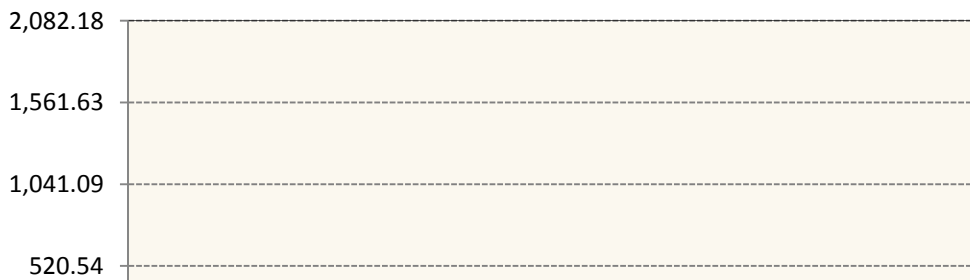
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,640	0	1,640	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,166	-4,166	장내
누계	통화	선도	696	2,228	-1,532	장외

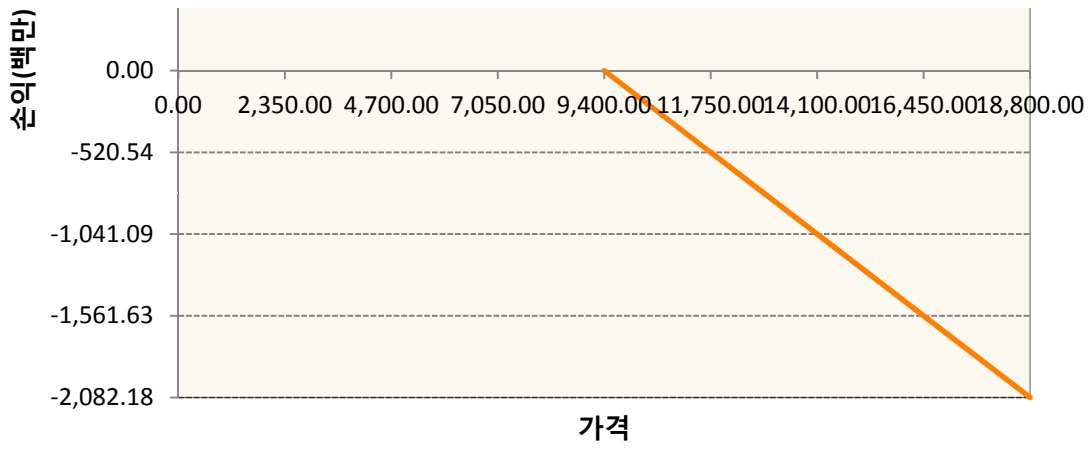
2. 만기시점의 손익구조

HCJ0-HSCEI Futures Apr20

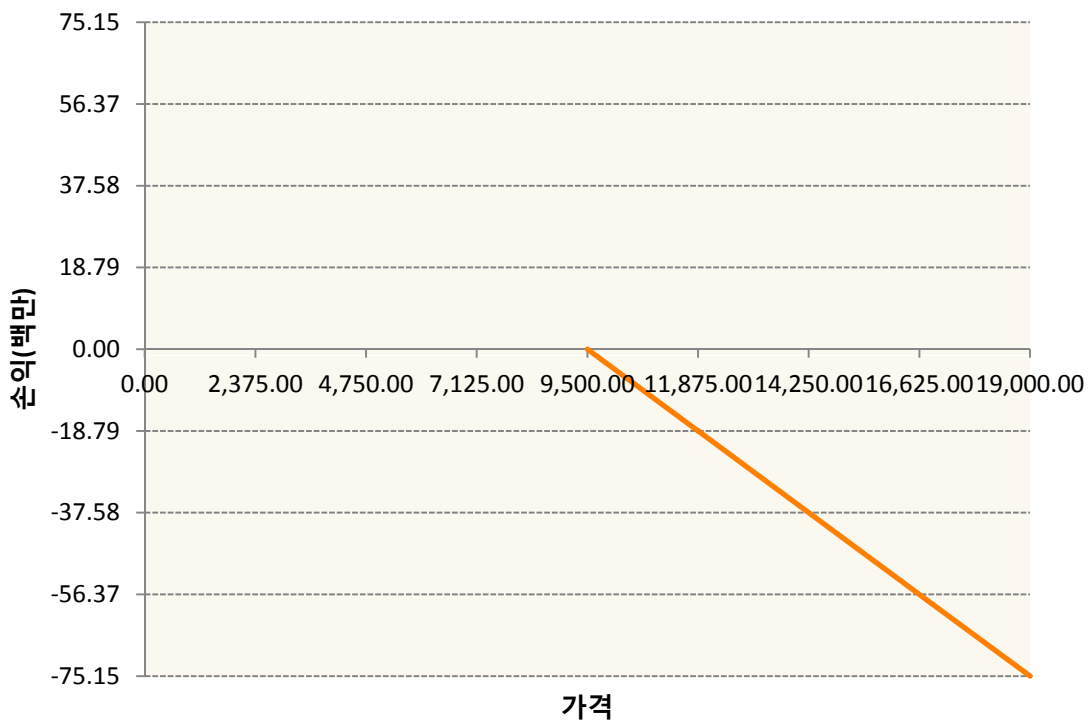


OHHIJ0-C94-HSCEI

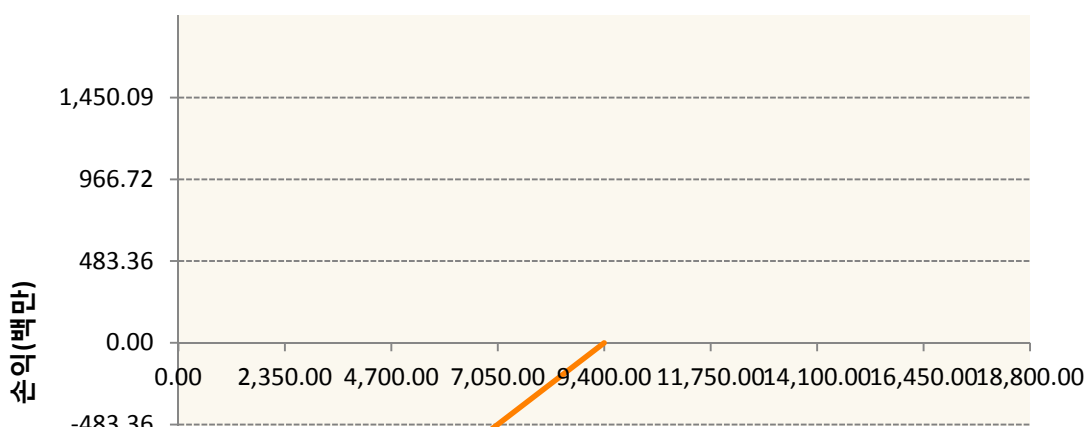


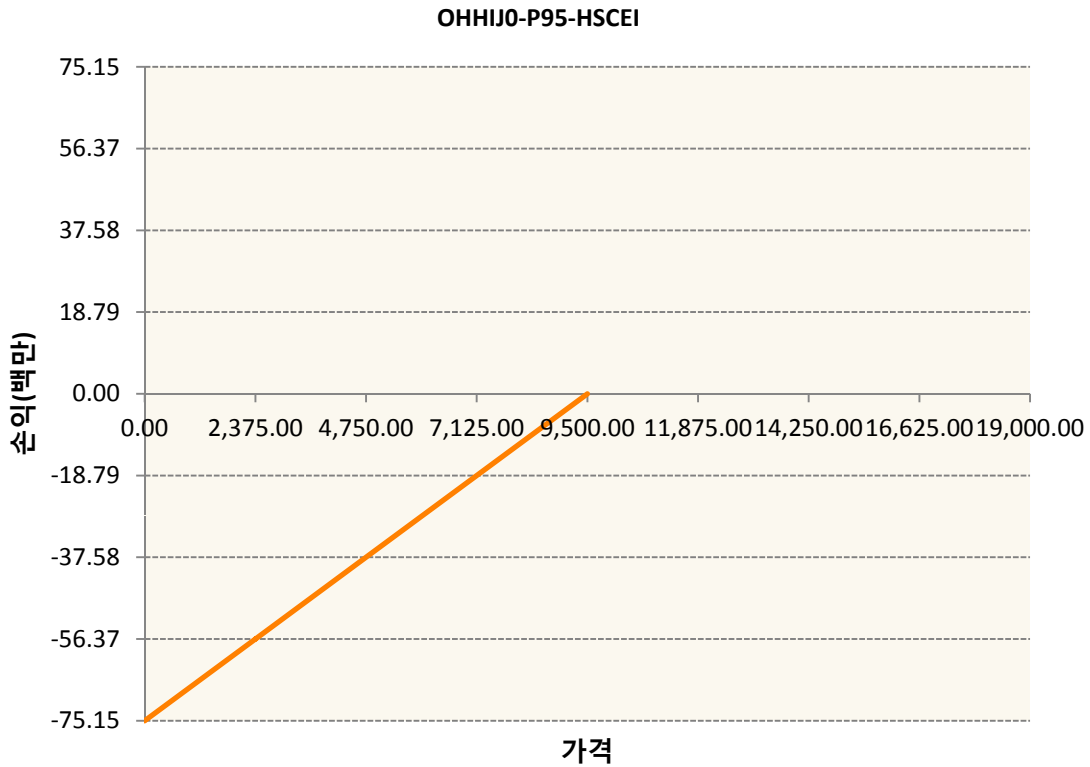


OHHIJO-C95-HSCEI



OHHIJO-P94-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E		178
FX21020H05 HKD/KRW 22-05-20E		56
HCJ0 HSCEI Futures Apr20		131
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)
	608

공시일	2020-04-28
기준일	2020-04-27

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

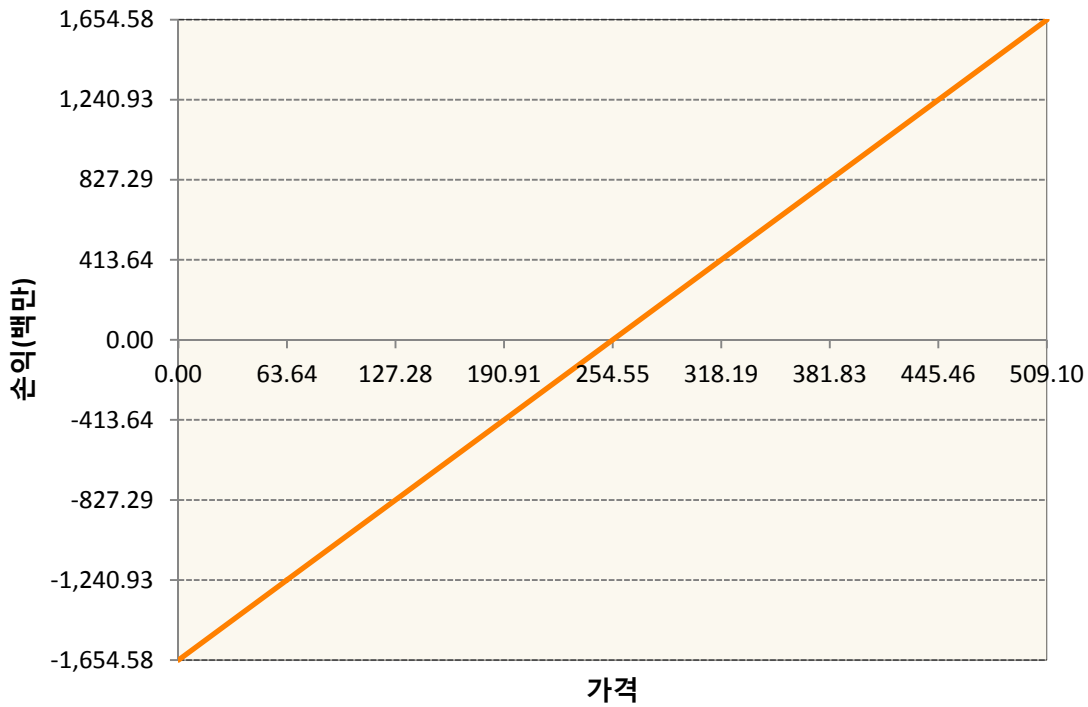
1. 계약금액

(단위:백만원)

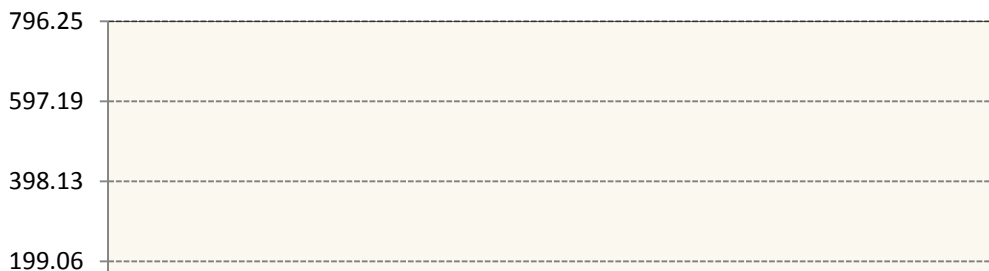
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,655	0	1,655	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,193	-3,193	장내

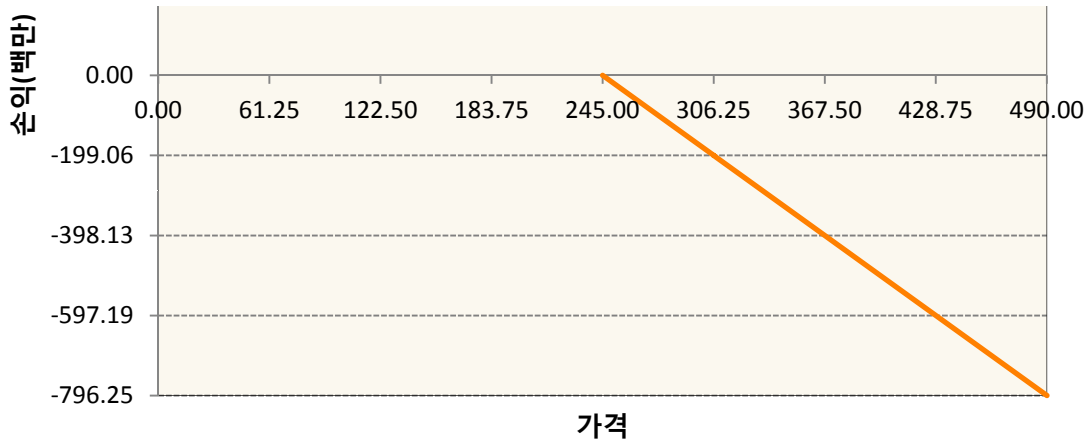
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

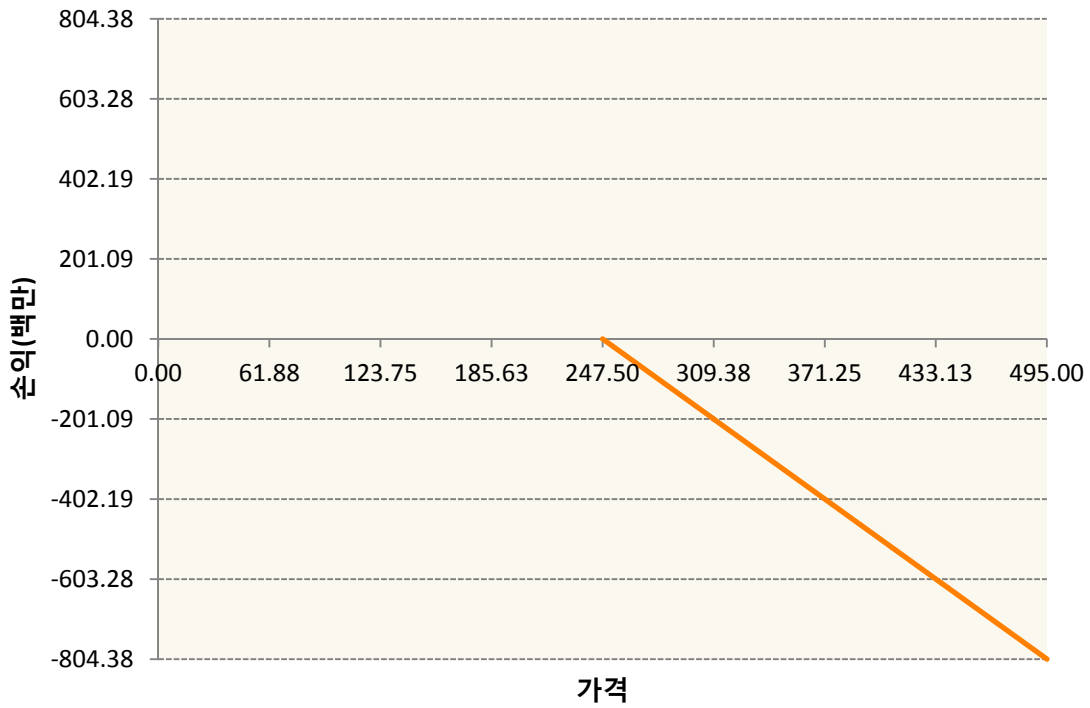


KR4201Q52452-2020-05 콜245

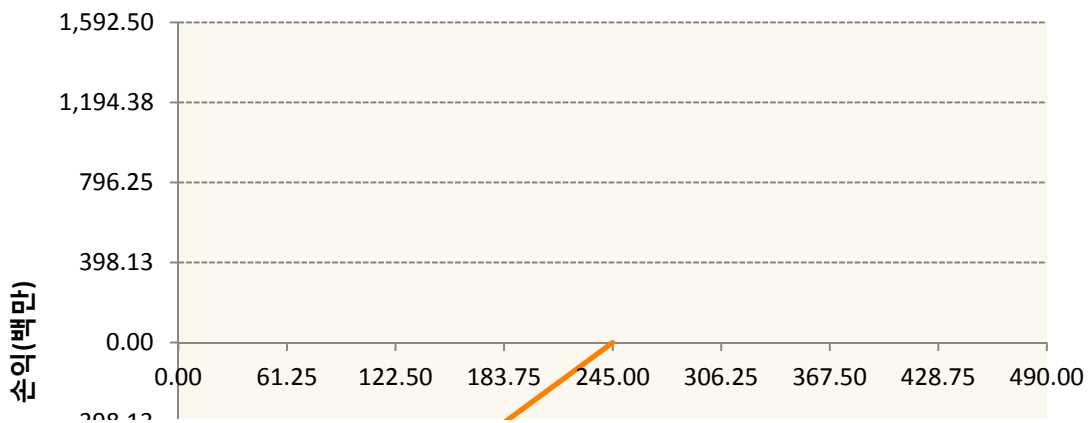




KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



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						133
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133	
-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%	133	133	133	133	133	133	133	
KR4201Q52452		2020-05 콜245						57
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	41	39	36	34	31	29	26	
-5.33%	33	30	28	25	22	20	17	
-2.67%	22	19	16	14	11	8	5	
0%	8	5	3	0	-3	-5	-8	
2.67%	-9	-11	-13	-16	-18	-20	-23	
5.33%	-28	-29	-31	-33	-35	-37	-39	
8.00%	-48	-49	-50	-52	-53	-55	-57	
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5						56
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	38	36	34	31	29	27	24
-5.33%	31	28	26	23	21	18	15
-2.67%	21	18	16	13	10	7	4
0%	8	5	3	0	-3	-5	-8
2.67%	-8	-10	-12	-15	-17	-20	-23
5.33%	-26	-28	-30	-32	-34	-36	-38
8.00%	-46	-47	-48	-50	-52	-54	-56
KR4301Q52450 2020-05 풋245							76
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-57	-60	-63	-66	-69	-73	-76
-5.33%	-26	-30	-34	-38	-42	-45	-49
-2.67%	-4	-8	-12	-16	-20	-24	-28
0%	10	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	18	16	13	10	7	4	1
5.33%	22	20	19	17	15	12	10
8.00%	23	23	22	20	19	17	15

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

(단위:백만원)

552

공시일	2020-04-28
기준일	2020-04-27

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

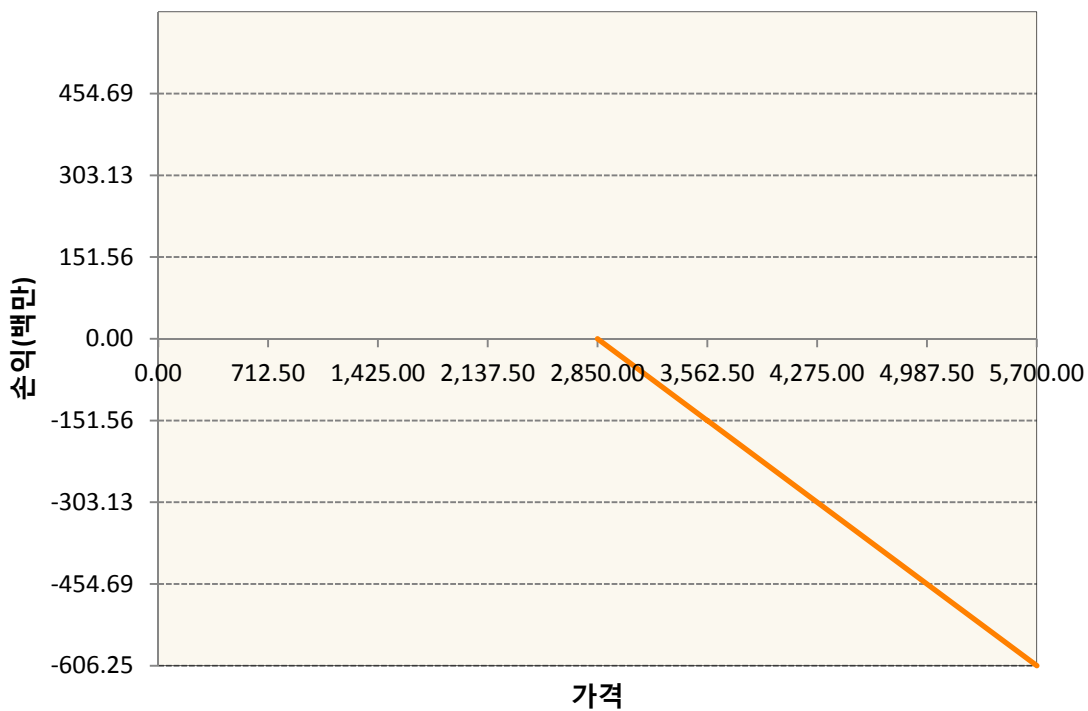
1. 계약금액

(단위:백만원)

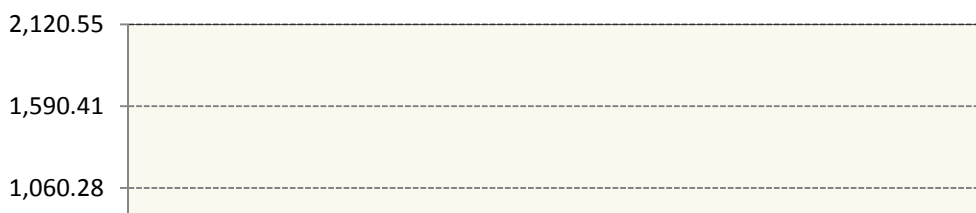
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	449	0	449	
누계	유가증권	스왑	7,929	0	7,929	장외
누계	유가증권	옵션	0	5,454	-5,454	장내
누계	통화	선도	0	2,691	-2,691	장외

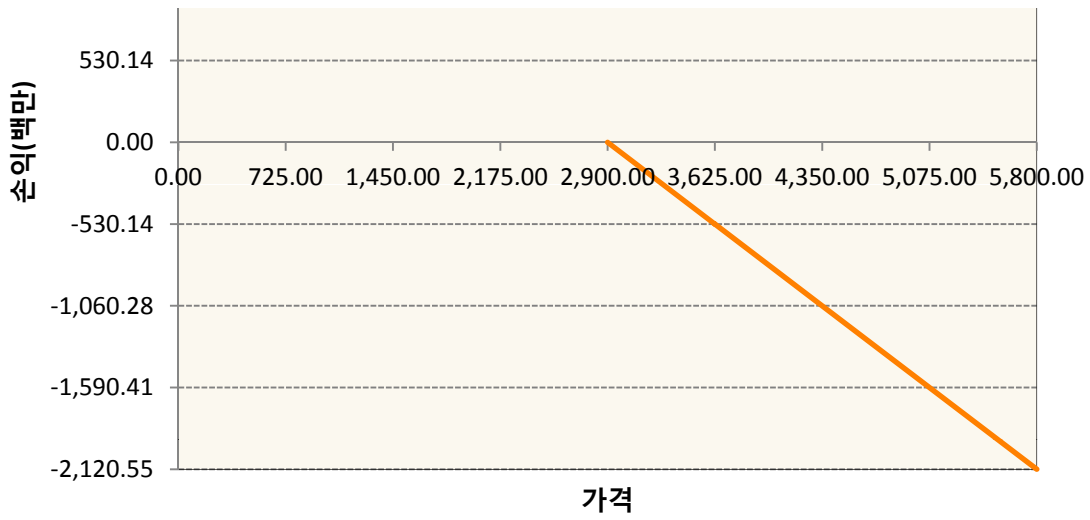
2. 만기시점의 손익구조

OESXK0-C2850-EURO STOXX 50

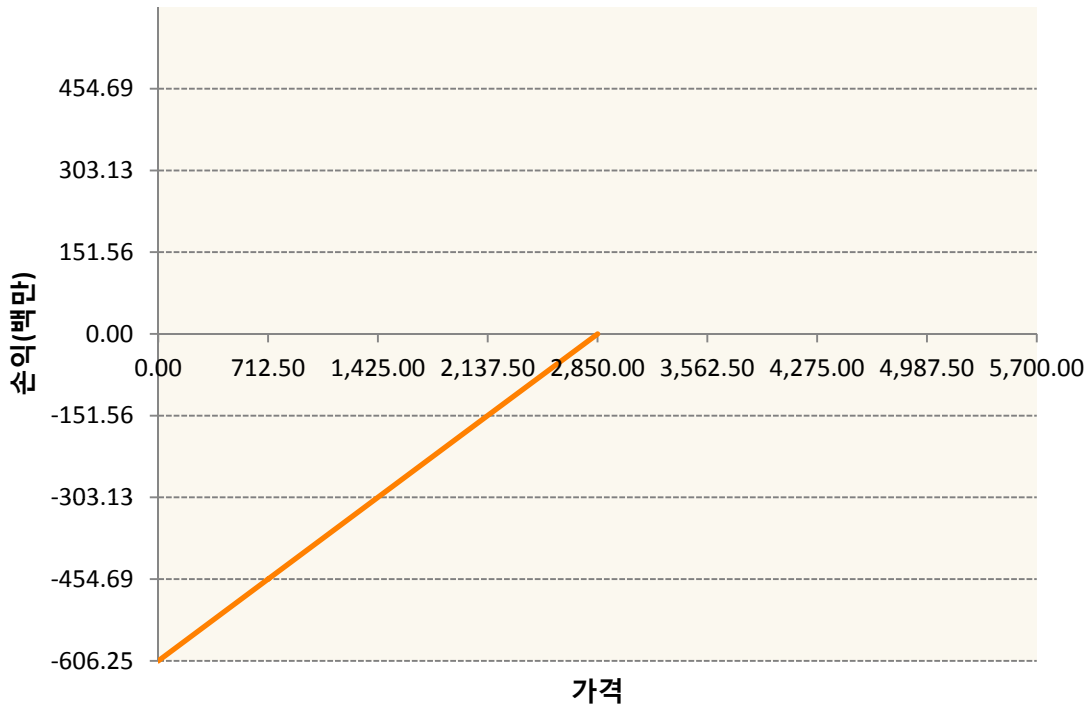


OESXK0-C2900-EURO STOXX 50

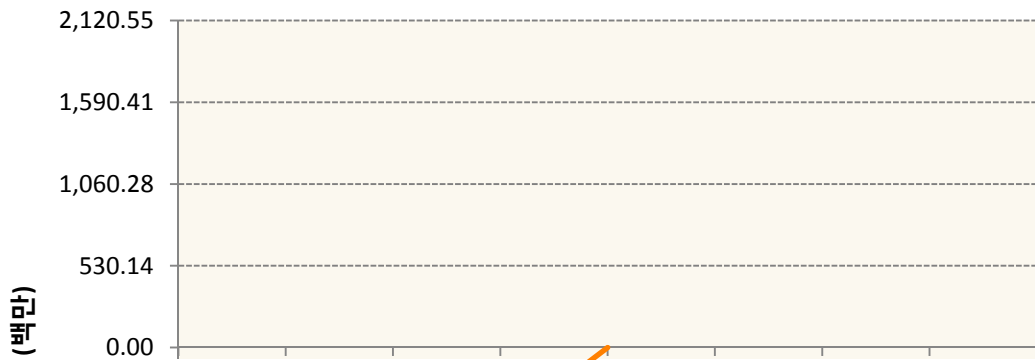


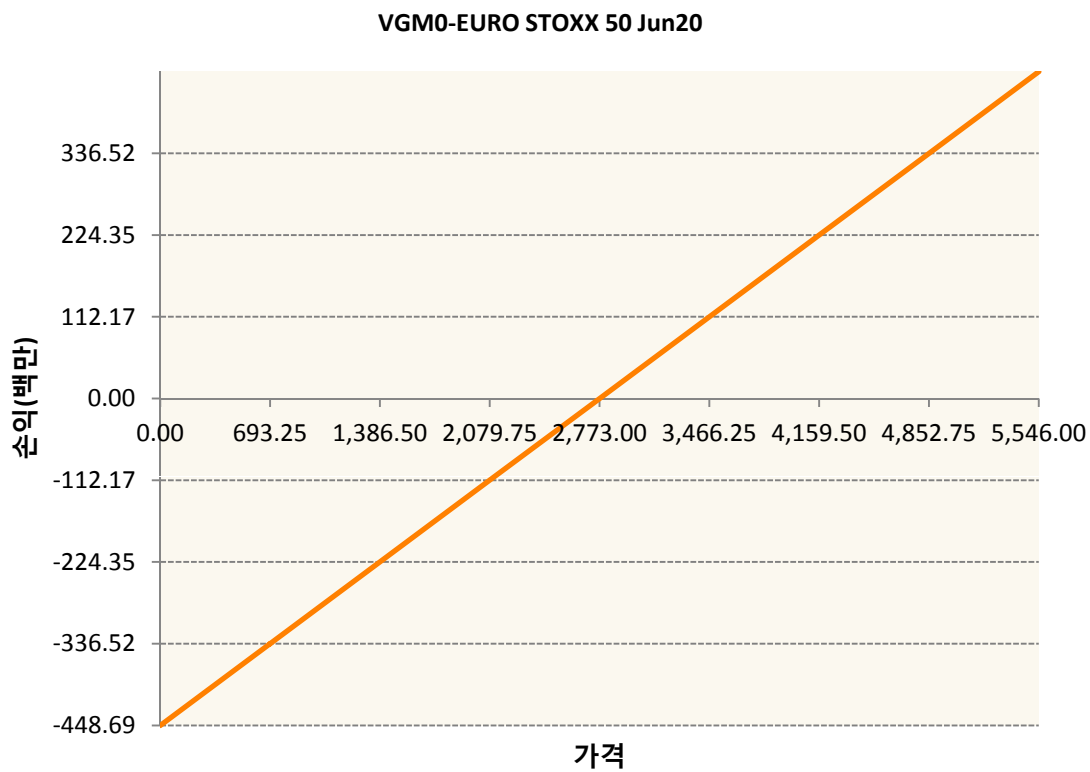
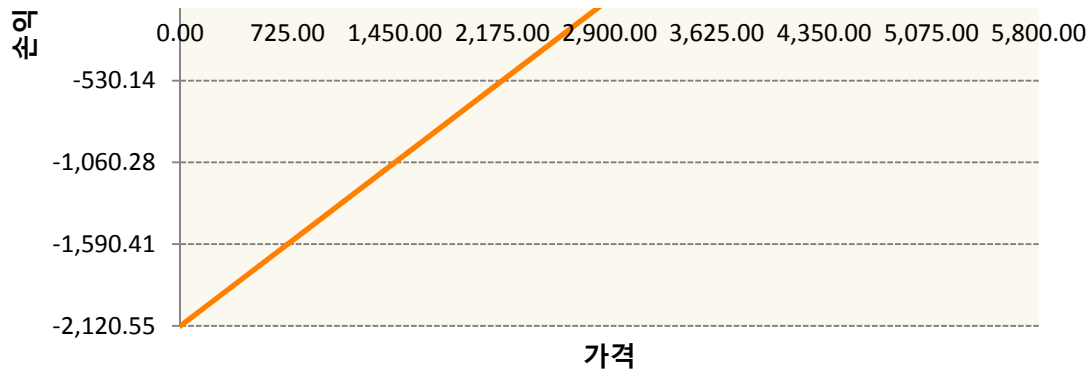


OESXK0-P2850-EURO STOXX 50



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		49
OESXK0-C29 EURO STOXX 50		170
OESXK0-P28 EURO STOXX 50		49
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)

1,134

공시일	2020-04-28
기준일	2020-04-27

ETF스마트레버리지목표전환형9호

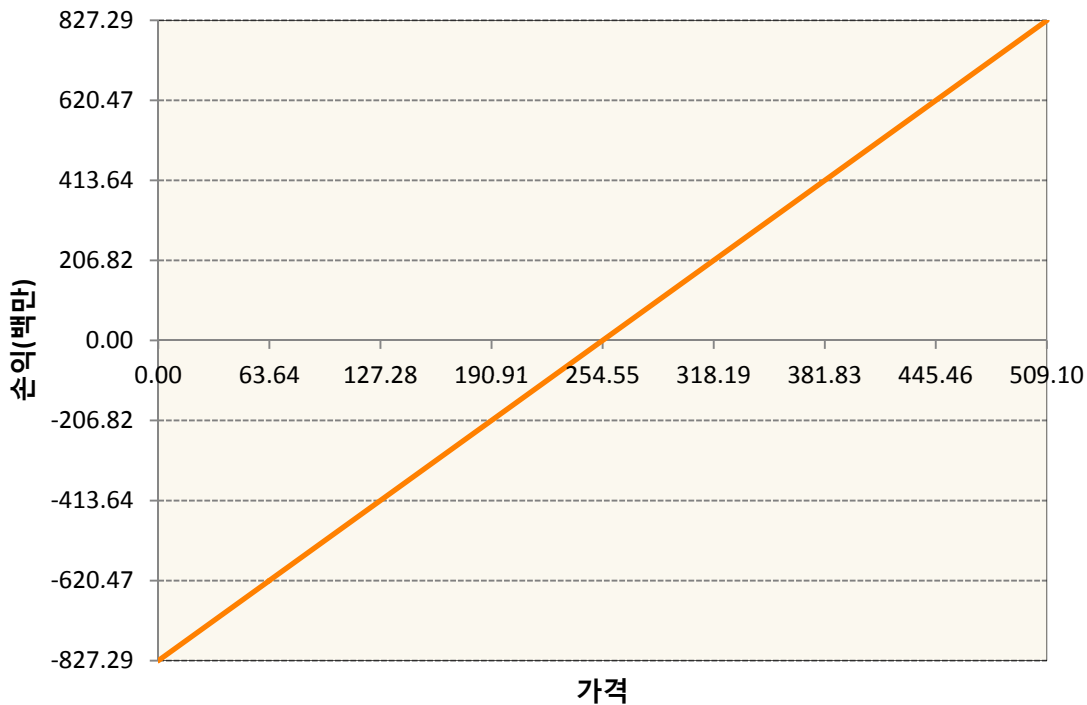
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	827	0	827	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

98

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

(단위:백만원)

144

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

(단위:백만원)

68

공시일	2020-04-28
기준일	2020-04-27

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

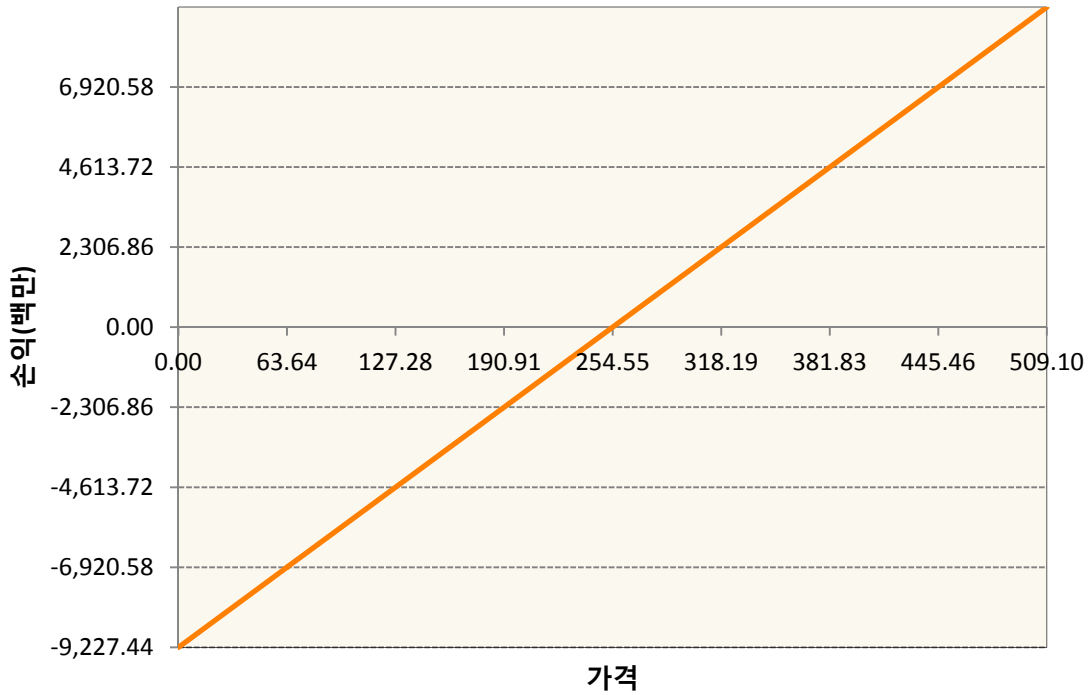
1. 계약금액

(단위:백만원)

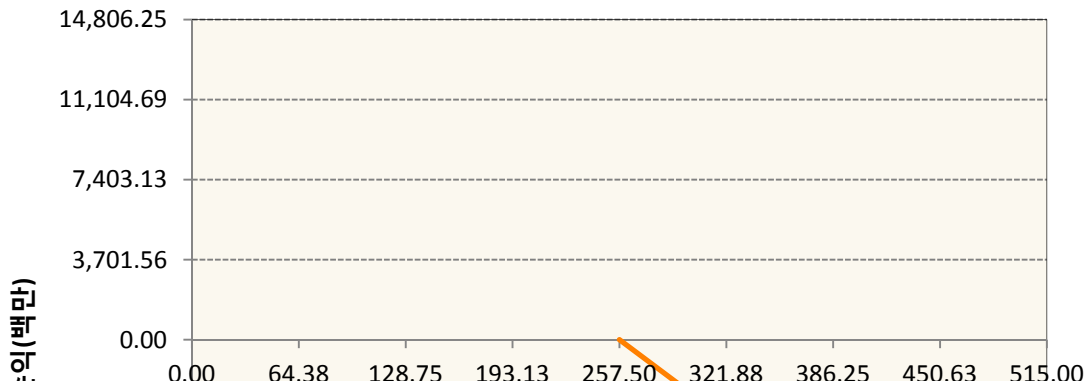
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,227	0	9,227	장내
누계	유가증권	옵션	6,201	17,536	-11,335	장내

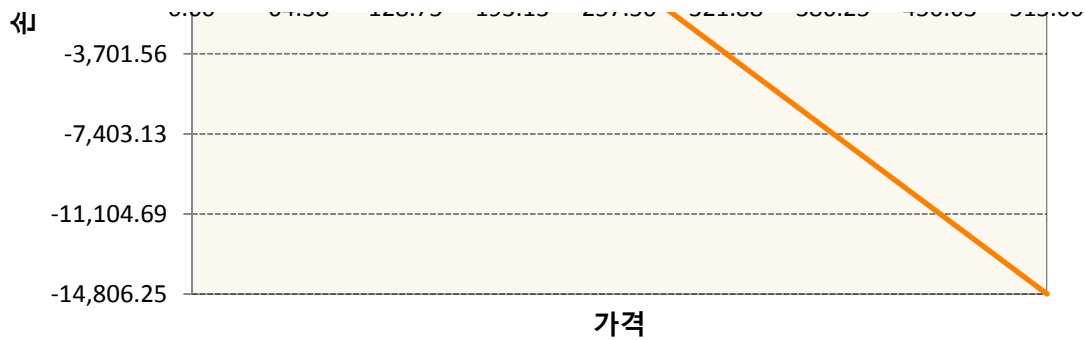
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

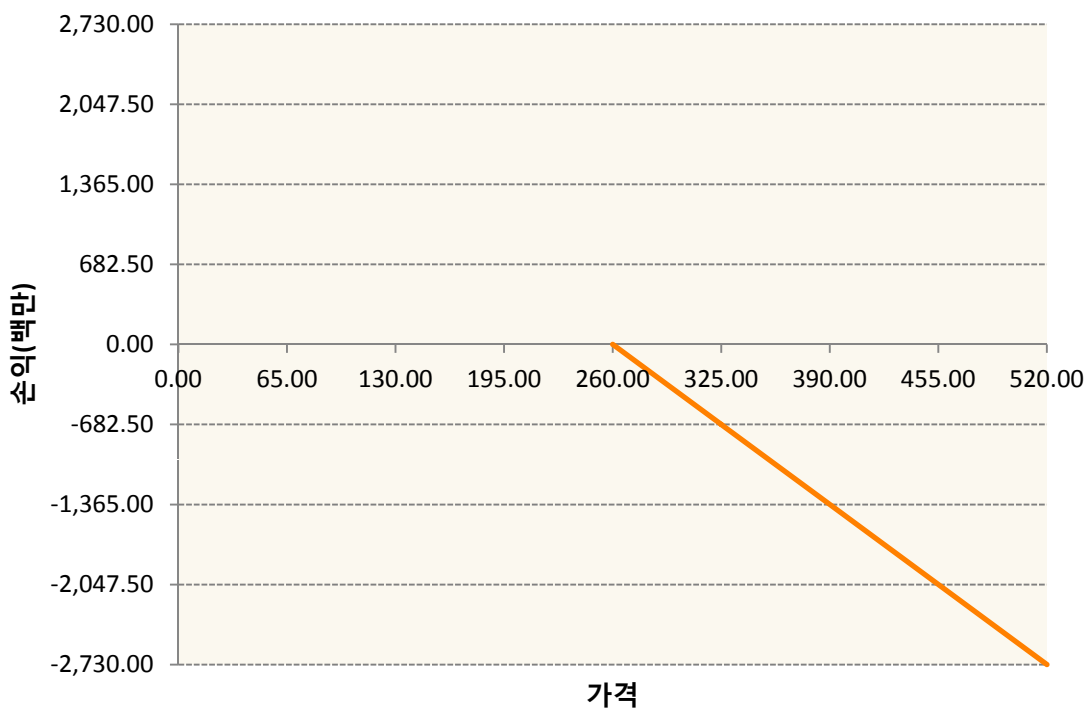


KR4201Q52577-2020-05 콜257.5

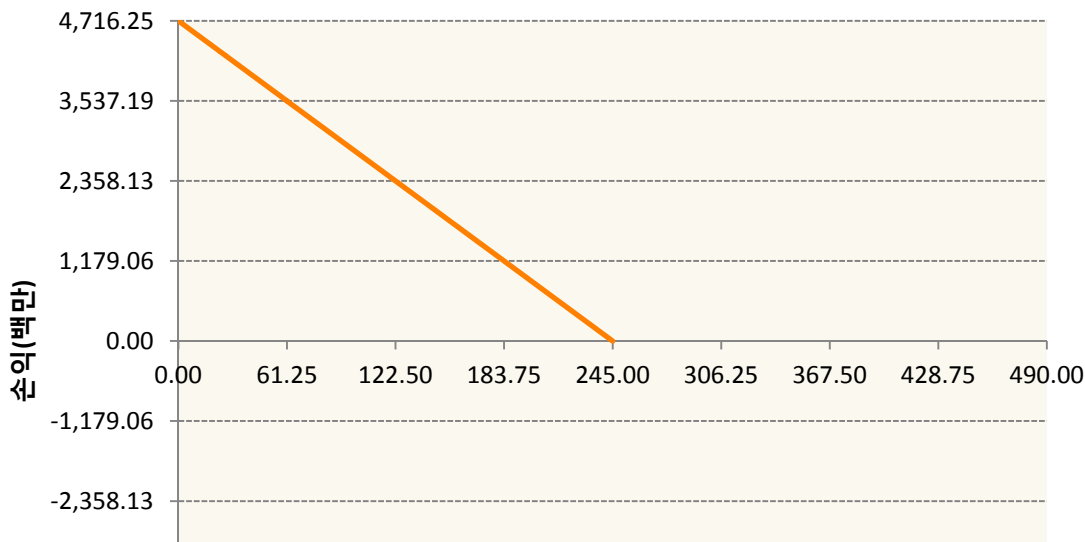


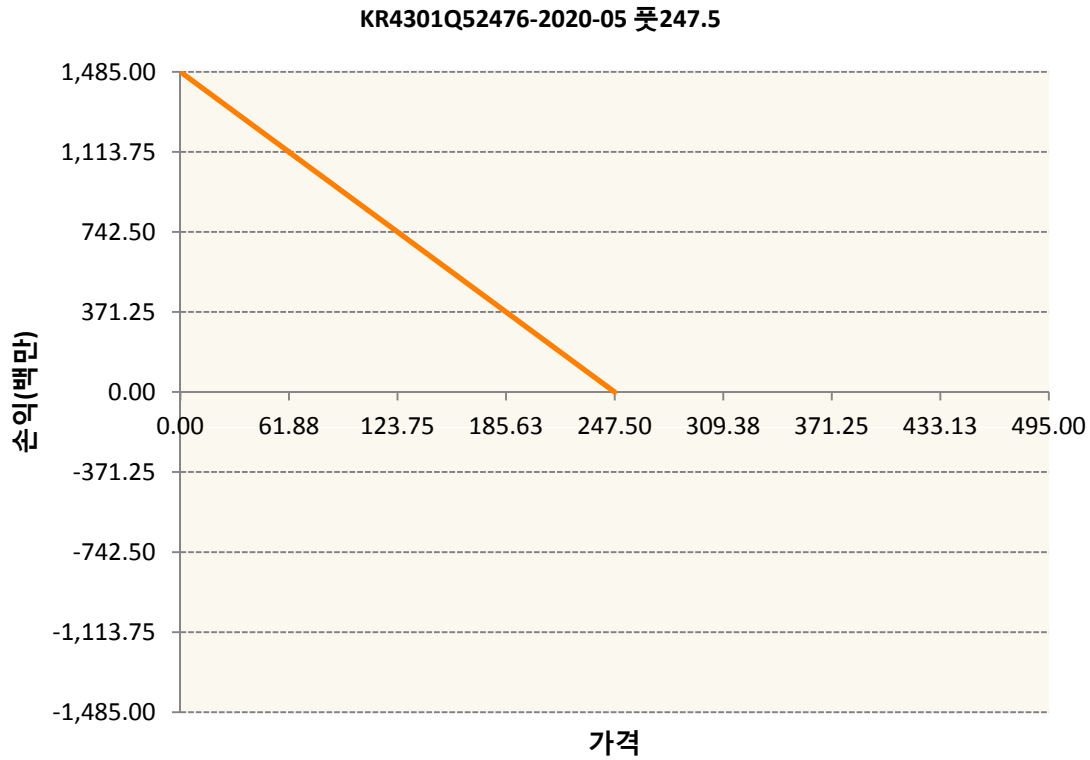
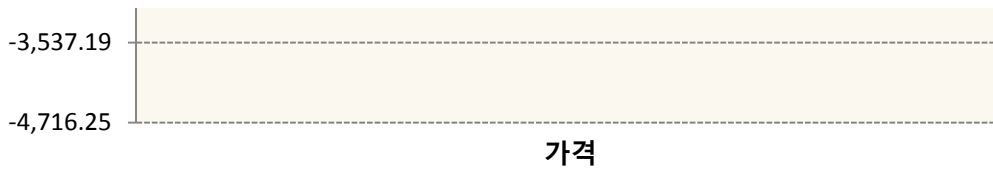


KR4201Q52601-2020-05 콜260



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						739
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-739	-739	-739	-739	-739	-739	-739	
-5.33%	-493	-493	-493	-493	-493	-493	-493	
-2.67%	-246	-246	-246	-246	-246	-246	-246	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	246	246	246	246	246	246	246	
5.33%	493	493	493	493	493	493	493	
8.00%	739	739	739	739	739	739	739	
KR4201Q52577		2020-05 콜257.5						864
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	470	445	417	386	353	318	282	
-5.33%	407	371	334	294	253	211	169	
-2.67%	303	259	213	167	120	72	25	

0%	151	100	50	0	-50	-101	-151
2.67%	-55	-105	-156	-206	-257	-308	-359
5.33%	-311	-356	-403	-451	-499	-548	-597
8.00%	-609	-648	-688	-730	-774	-818	-864
KR4201Q52601 2020-05 콜260							151
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	77	73	69	64	58	52	46
-5.33%	68	62	56	49	42	34	27
-2.67%	52	44	36	28	20	11	3
0%	27	18	9	0	-9	-18	-27
2.67%	-7	-16	-26	-35	-44	-54	-63
5.33%	-50	-59	-68	-77	-86	-95	-105
8.00%	-102	-110	-118	-126	-134	-143	-151
KR4301Q52450 2020-05 풋245							225
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	167	176	185	195	205	215	225
-5.33%	77	88	100	111	123	134	146
-2.67%	11	23	35	47	58	70	82
0%	-31	-21	-10	0	11	22	33
2.67%	-53	-47	-39	-31	-22	-13	-3
5.33%	-64	-60	-55	-50	-43	-36	-29
8.00%	-69	-67	-64	-60	-56	-51	-45
KR4301Q52476 2020-05 풋247.5							76
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	59	62	64	67	70	73	76
-5.33%	29	32	35	39	42	46	49
-2.67%	5	9	13	17	20	24	28
0%	-10	-7	-4	0	4	7	11
2.67%	-20	-17	-14	-11	-8	-5	-2
5.33%	-24	-23	-21	-19	-16	-14	-11
8.00%	-26	-25	-24	-23	-21	-19	-17

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

(단위:백만원)

2,123

공시일	2020-04-28
기준일	2020-04-27

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	146,963	0	146,963	

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	2020-04-28
기준일	2020-04-27

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	99,091	0	99,091	

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	2020-04-28
기준일	2020-04-27

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	437,801	0	437,801	
누계	통화	선도	44,143	463,013	-418,870	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,452
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,040
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,040
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,394
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	981
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	981
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,550
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	844
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	736
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	490
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,433
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,965
FX21020H11 KRW/USD 11-05-20E	981
FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E	2,943
FX21020J02€ KRW/USD 10-06-20E	1,334
FX21020J02₯ KRW/USD 22-06-20E	1,511
FX21020J02₯ KRW/USD 22-06-20E	1,962
FX21020J03₯ KRW/USD 24-07-20E	2,207
FX21020J04₯ KRW/USD 24-07-20E	1,766
FX21020J04₯ KRW/USD 24-07-20E	1,962

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

20,455

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

(단위:백만원)

196

공시일	2020-04-28
기준일	2020-04-27

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

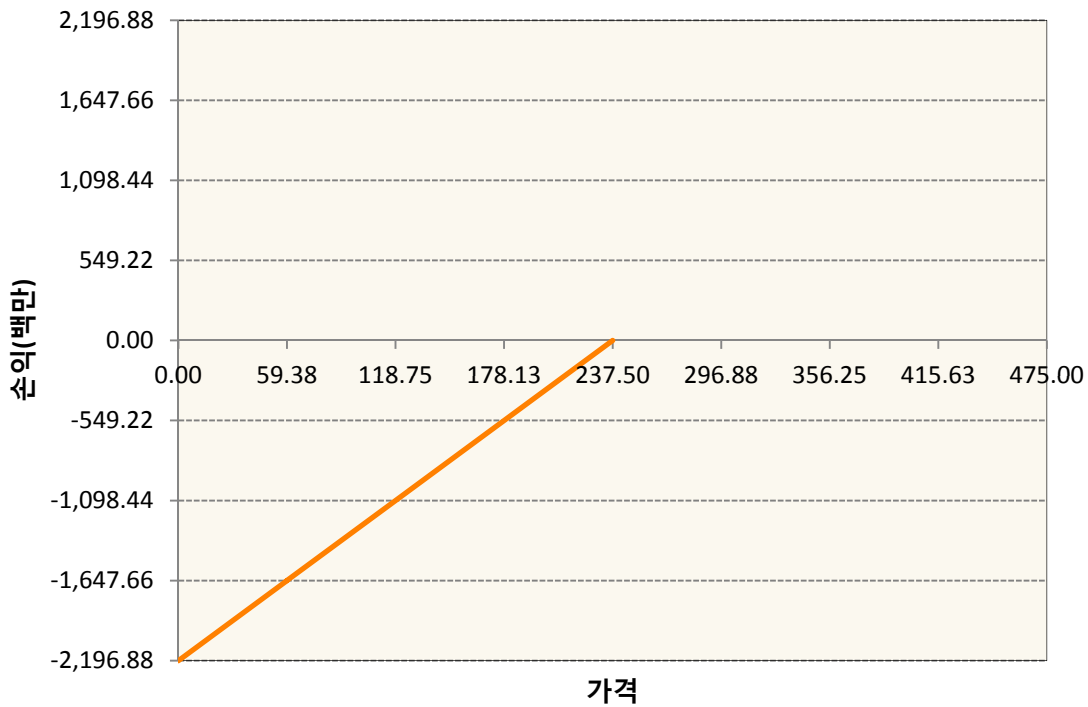
1. 계약금액

(단위:백만원)

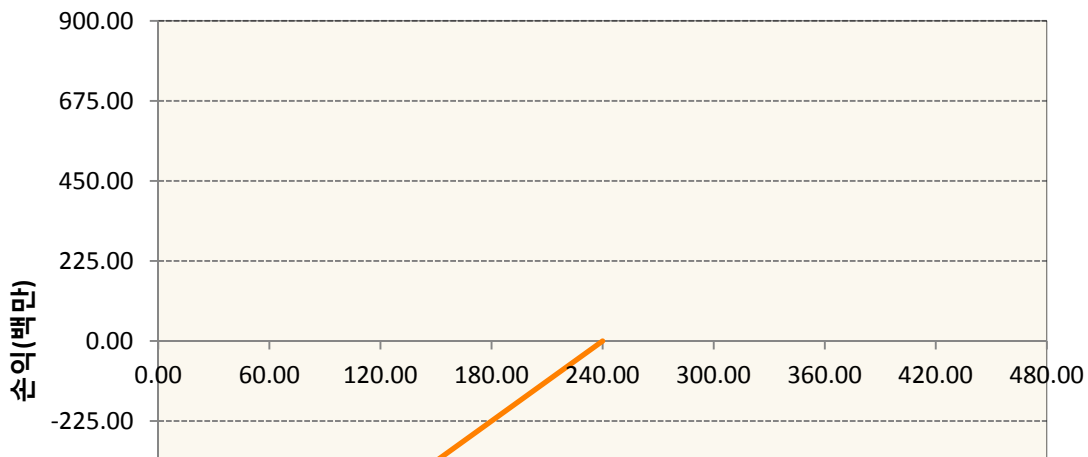
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,097	-3,097	장내

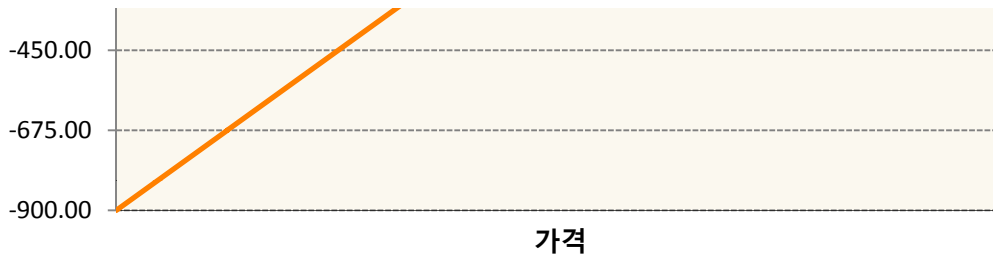
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q52377-2020-05 풋237.5



KR4301Q52401-2020-05 풋240





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q52377		2020-05 풋237.5						81
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-49	-54	-60	-65	-71	-76	-81	
-5.33%	-19	-24	-30	-35	-40	-46	-51	
-2.67%	0	-4	-9	-14	-19	-24	-29	
0%	10	7	4	0	-4	-8	-12	
2.67%	14	13	11	8	5	2	-1	
5.33%	16	15	14	13	11	9	6	
8.00%	16	16	16	15	14	12	11	
KR4301Q52401		2020-05 풋240						37
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-24	-26	-28	-30	-32	-34	-37	
-5.33%	-10	-12	-14	-17	-19	-21	-23	
-2.67%	-1	-3	-5	-7	-9	-11	-13	
0%	5	3	2	0	-2	-4	-5	
2.67%	7	6	5	4	3	1	0	
5.33%	8	8	7	6	6	5	3	
8.00%	9	8	8	8	7	6	6	

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

86

공시일	2020-04-28
기준일	2020-04-27

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	7,216	0	7,216	
누계	통화	선도	0	10,337	-10,337	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H11 KRW/USD 29-04-20E	227
FX21020J004 KRW/USD 29-04-20E	26
FX21020J015 KRW/USD 13-05-20E	321
FX21020J046 KRW/USD 29-05-20E	253
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

417

공시일	2020-04-28
기준일	2020-04-27

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

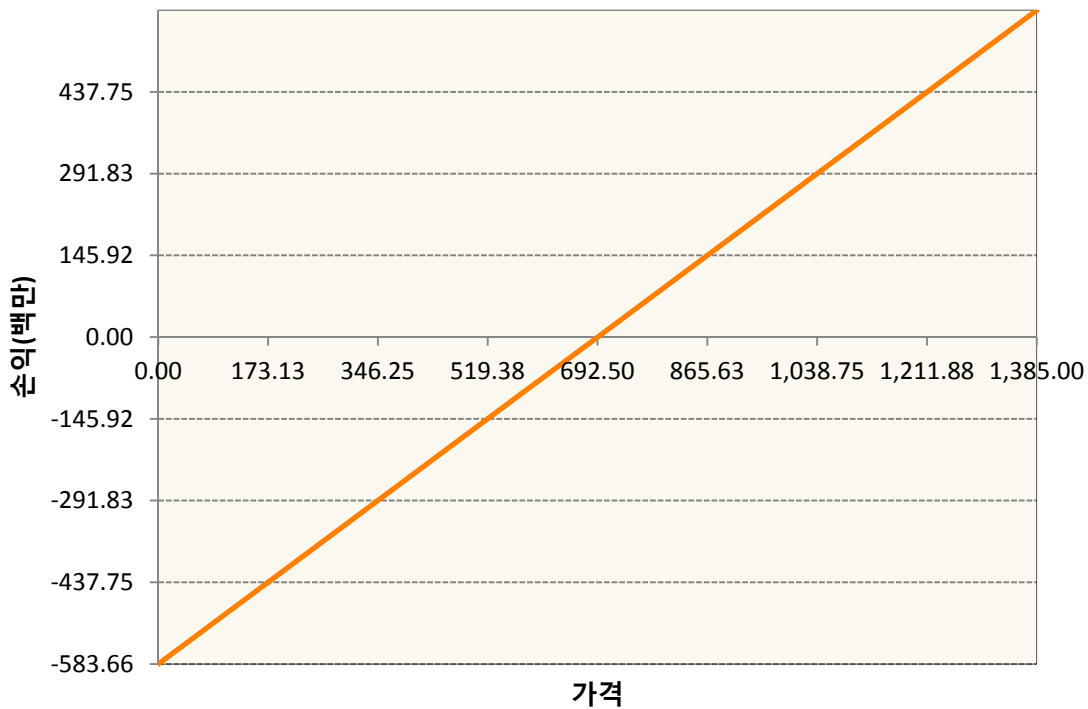
1. 계약금액

(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	584	0	584	
누계	유가증권	스왑	871	0	871	장외
누계	통화	선도	205	630	-425	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCK0-VN30 Index Future May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	70
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

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
FX21020J048 KRW/EUR 22-05-20E	11
VNCK0 VN30 Index Future May20	47

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

(단위:백만원)

141

공시일	2020-04-28
기준일	2020-04-27

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

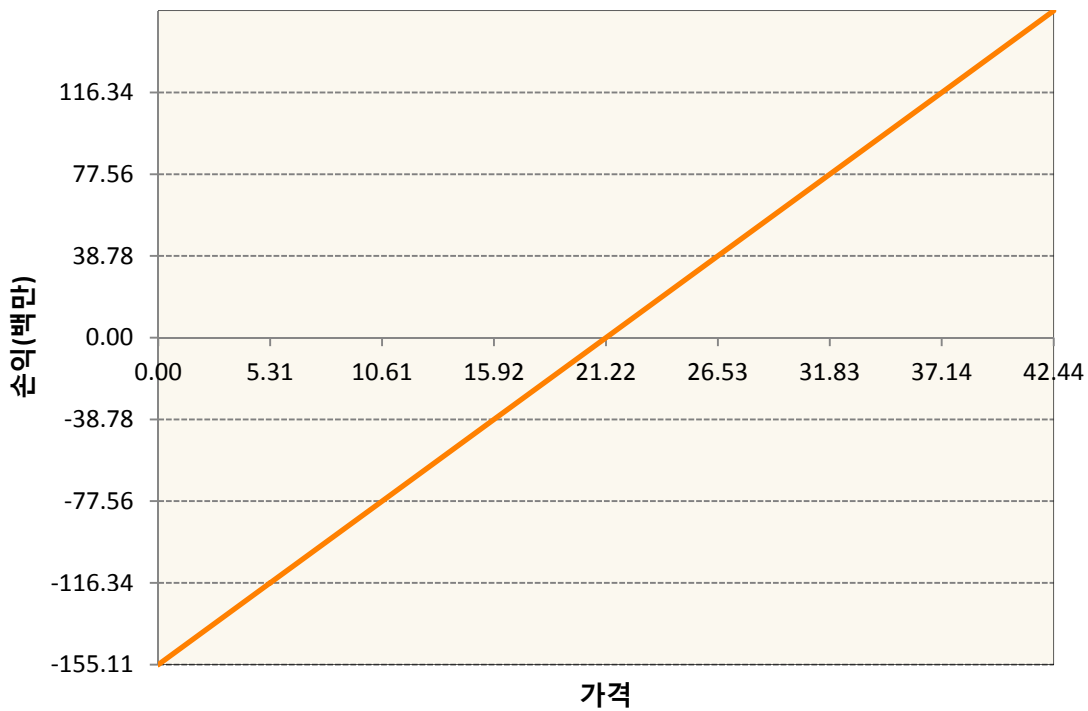
1. 계약금액

(단위:백만원)

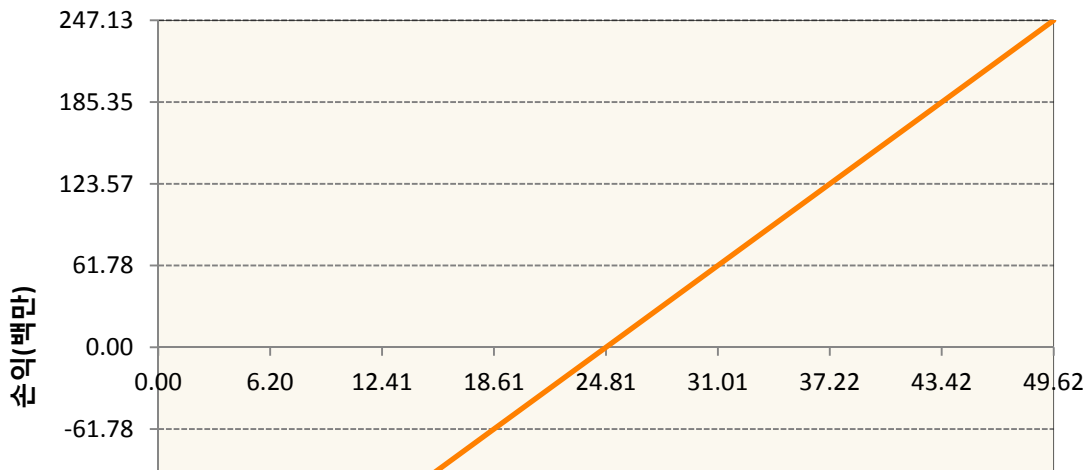
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,370	184	1,186	

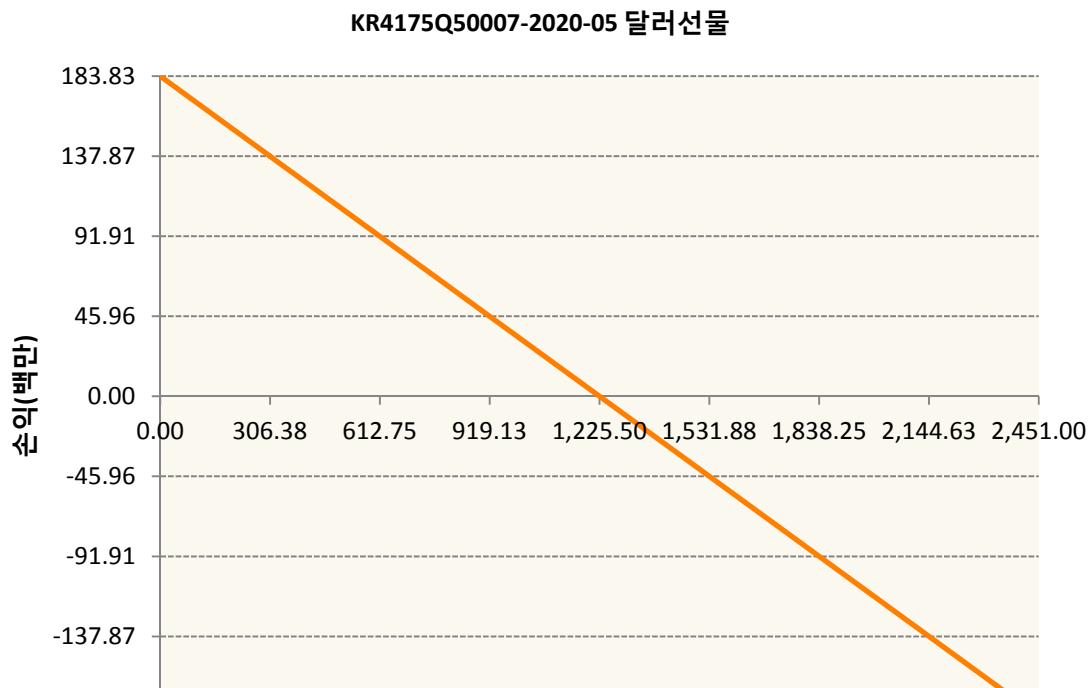
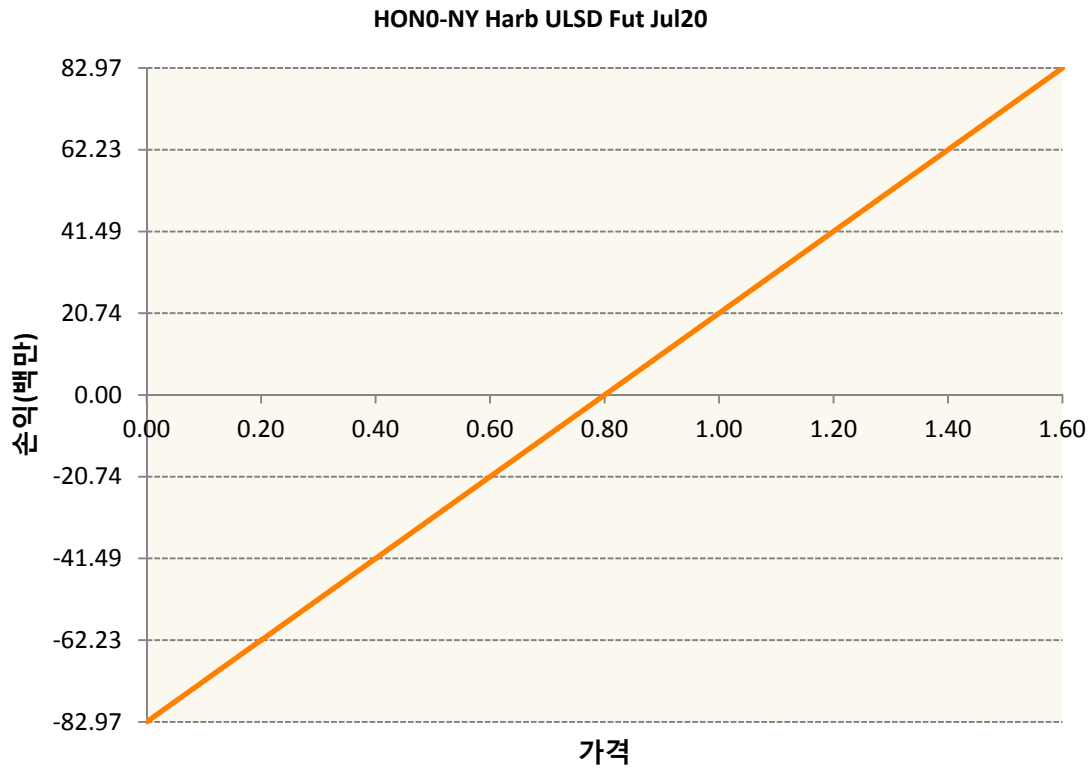
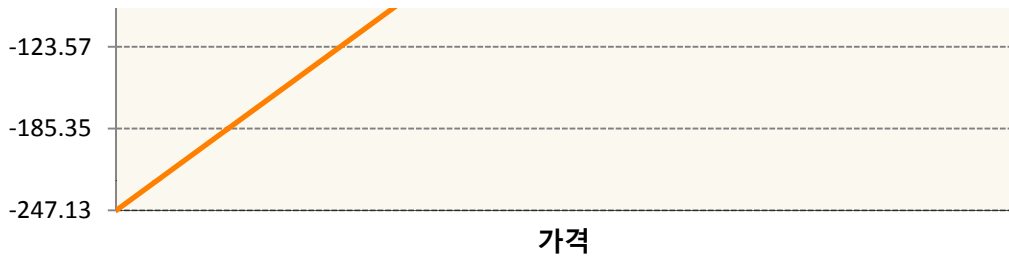
2. 만기시점의 손익구조

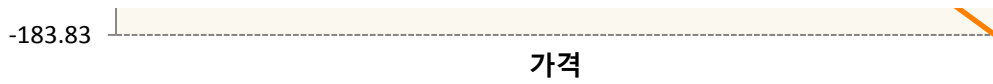
CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20



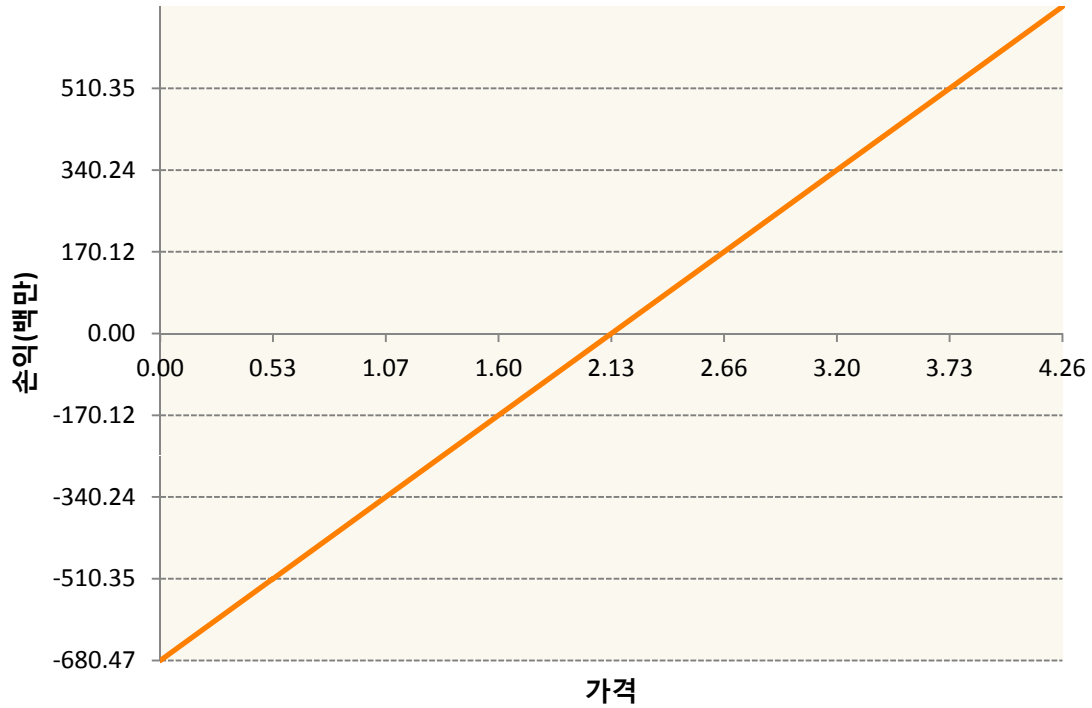
CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20



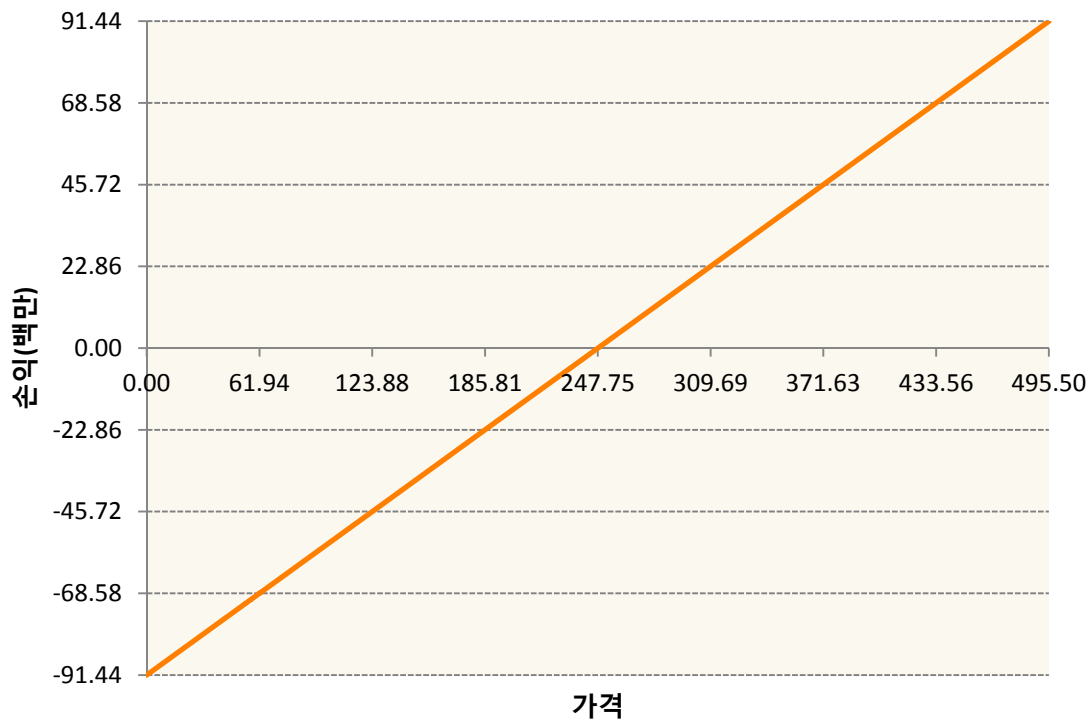




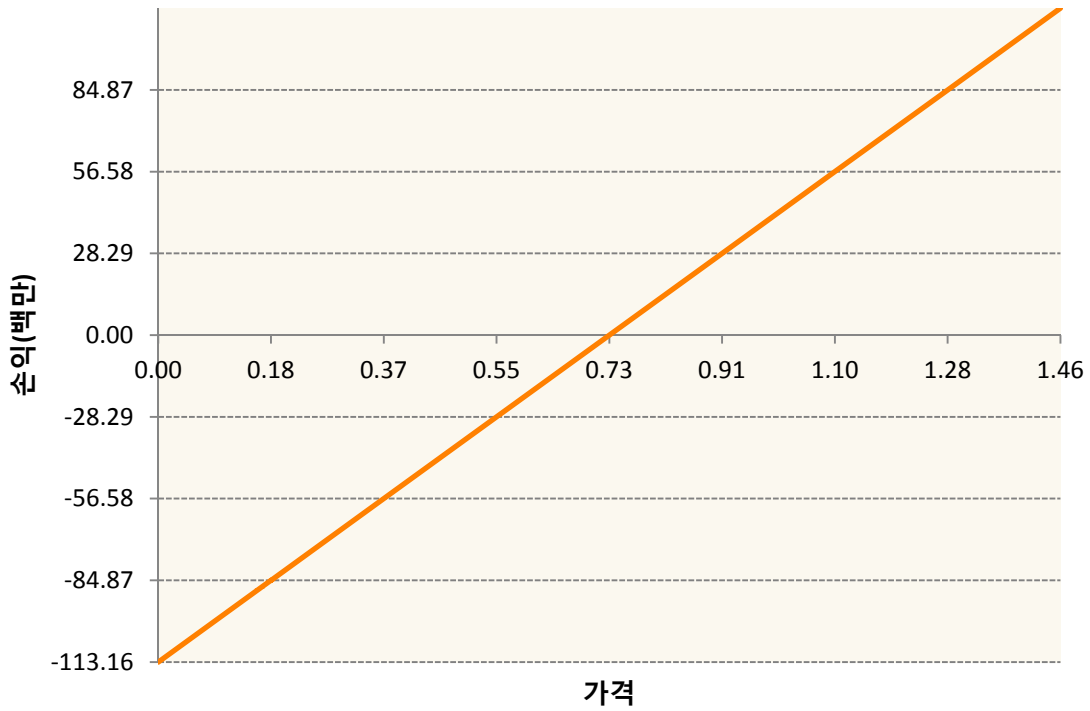
NGN20-NATURAL GAS FUTR Jul20



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	20
HON0	NY Harb ULSD Fut Jul20	7
KR4175Q50C	2020-05 달러선물	15
NGN20	NATURAL GAS FUTR Jul20	54
QSN0	Low Su Gasoil G Jul20	7
XBN0	GASOLINE RBOB FUT Jul20	9

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

(단위:백만원)

495

공시일	2020-04-28
기준일	2020-04-27

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

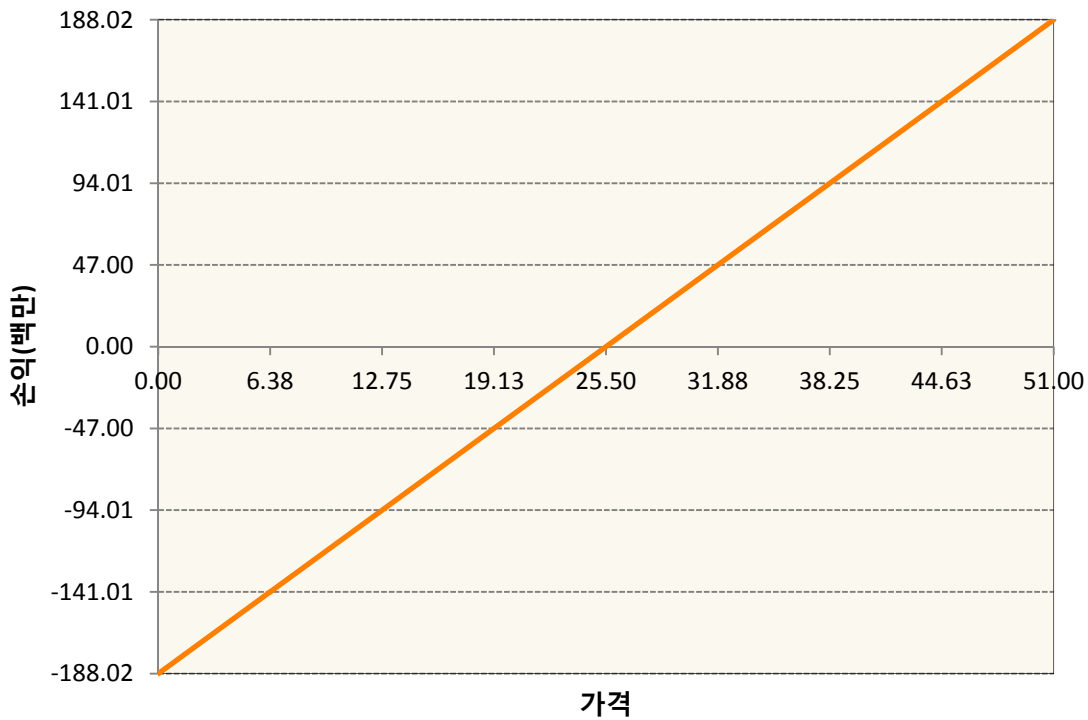
1. 계약금액

(단위:백만원)

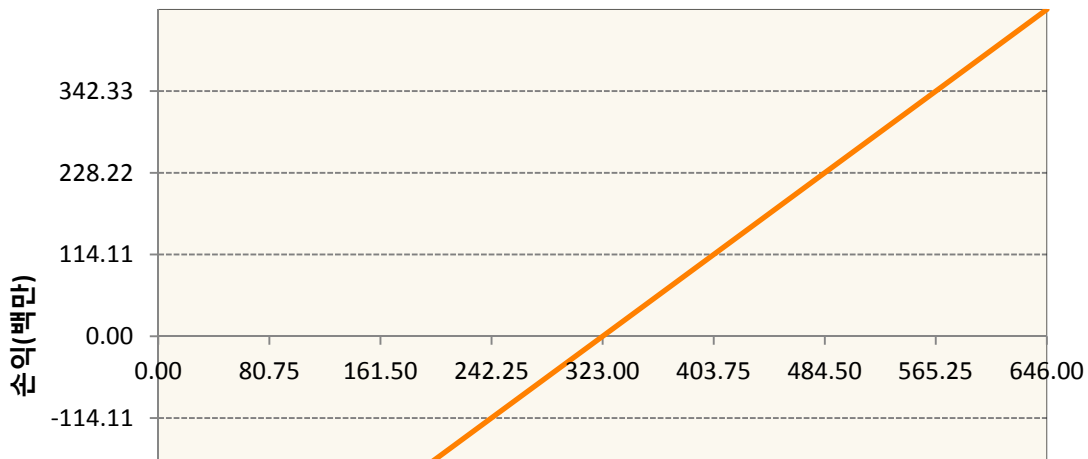
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,356	74	2,282	

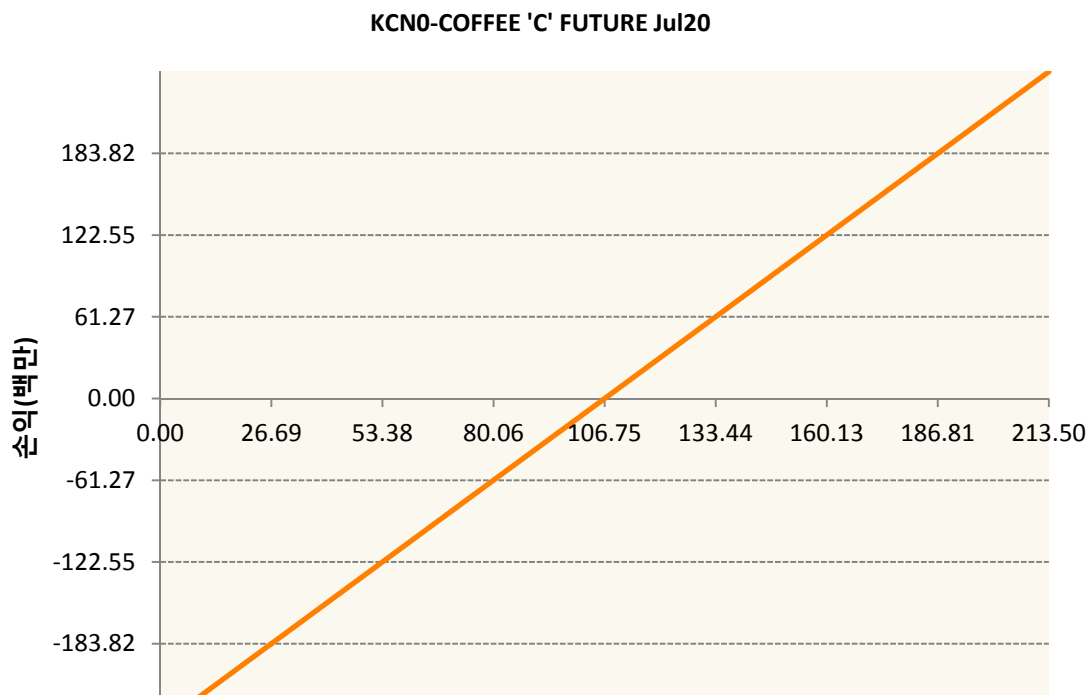
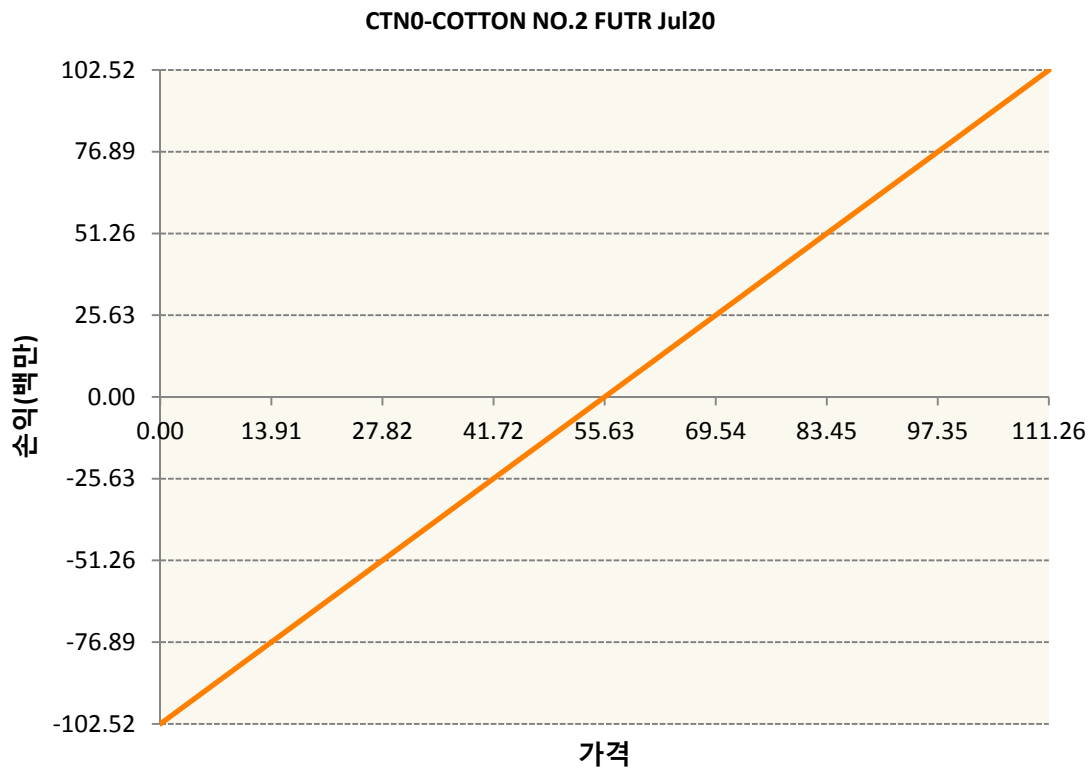
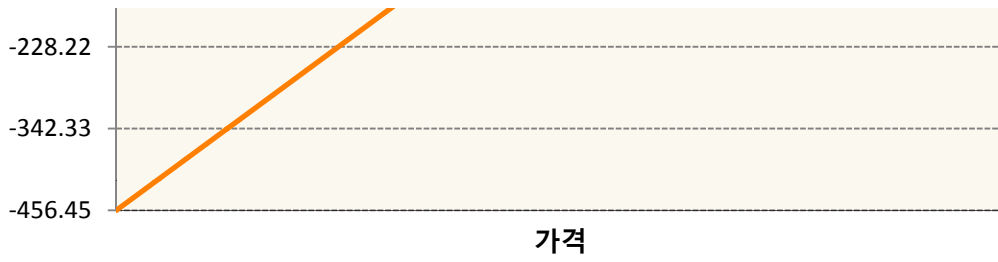
2. 만기시점의 손익구조

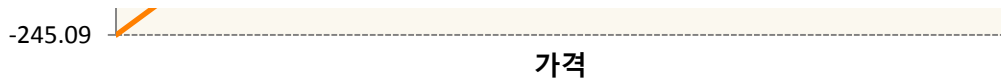
BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20



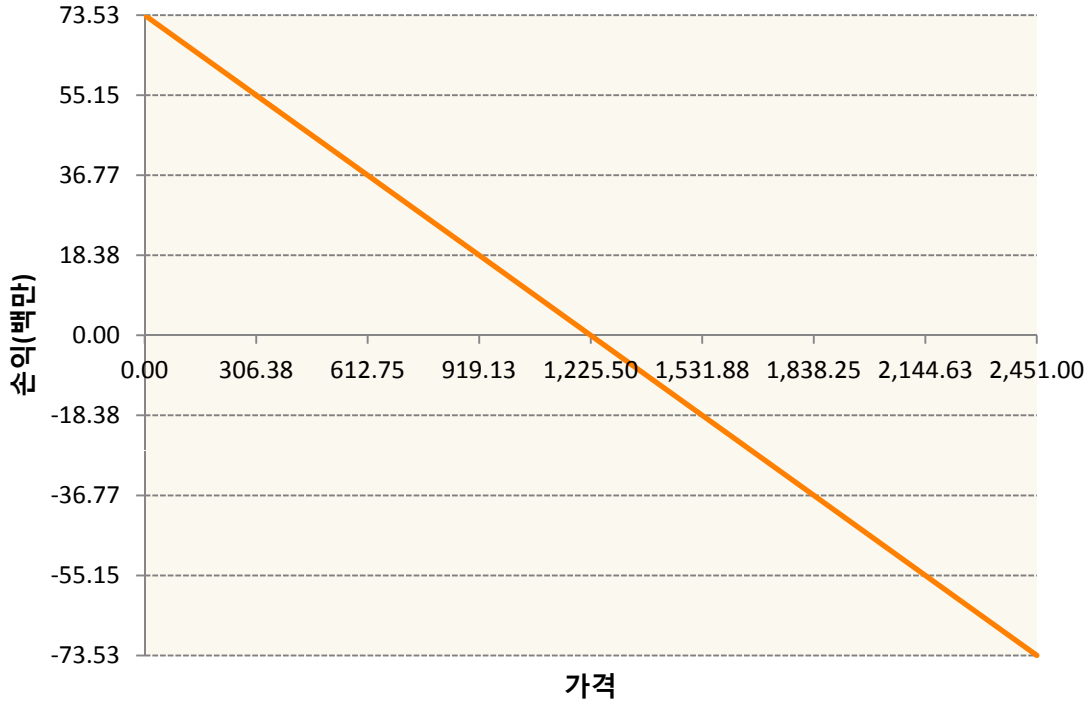
CNO-CORN FUTURE Jul20



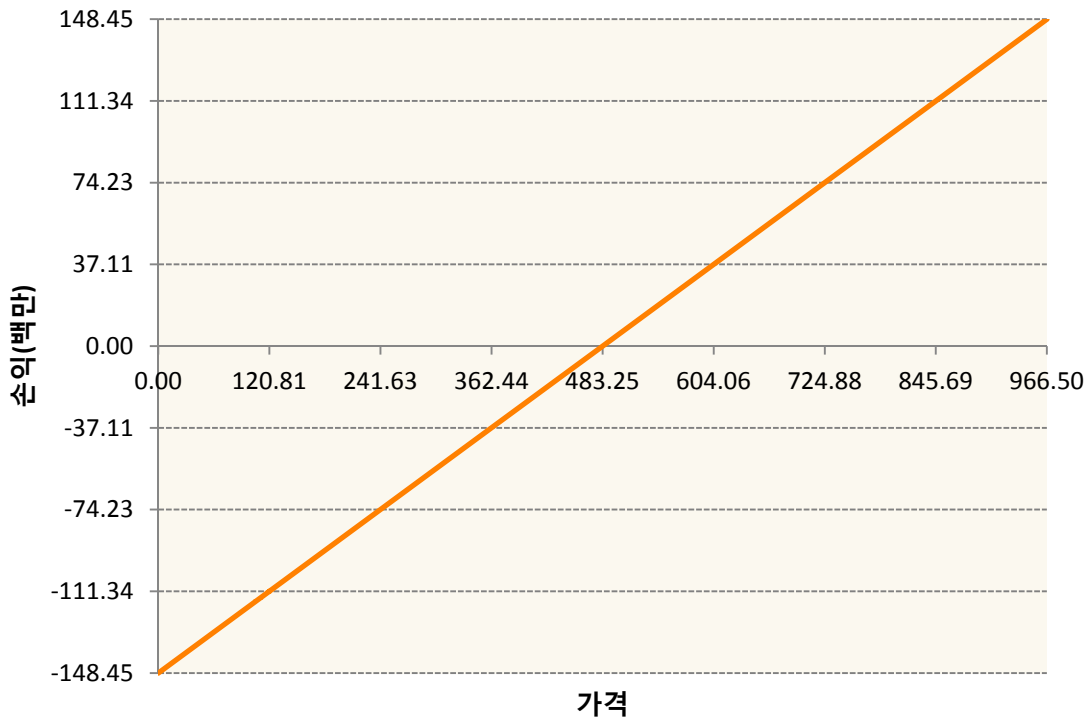




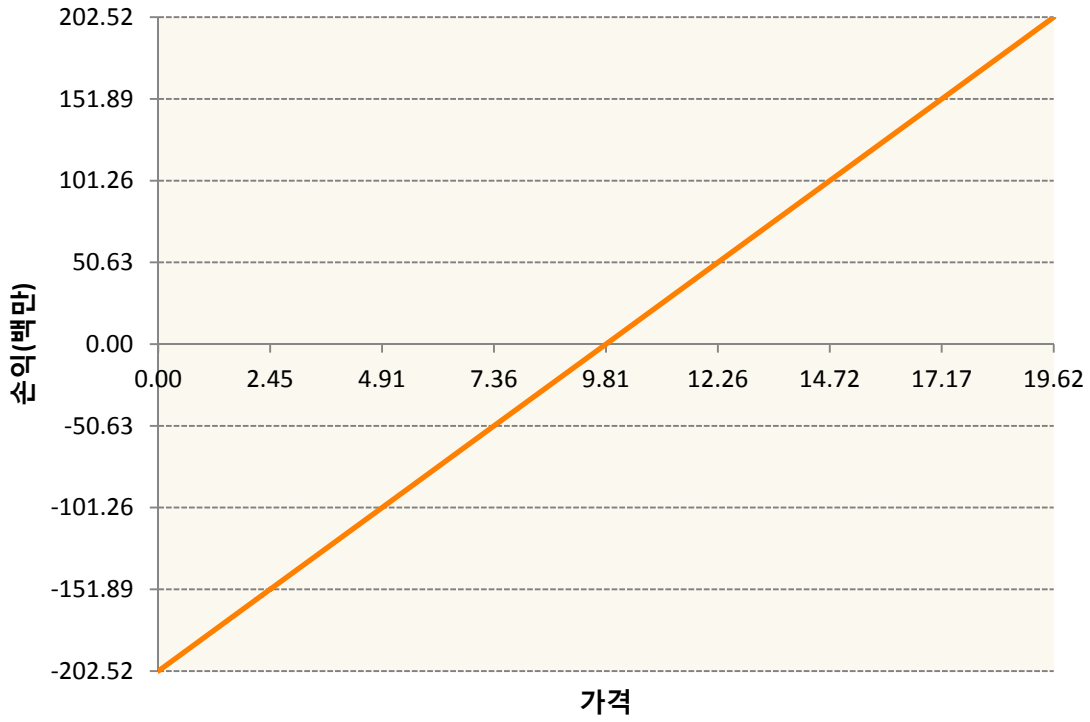
KR4175Q50007-2020-05 달러선물



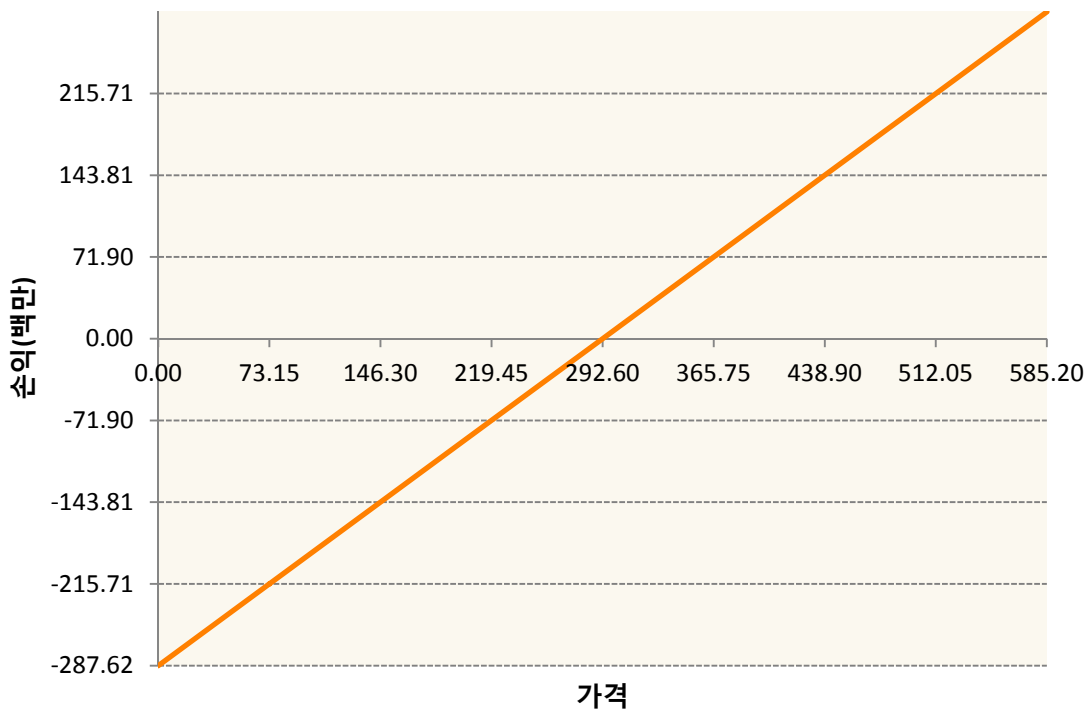
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



SBN0-Sugar Jul20

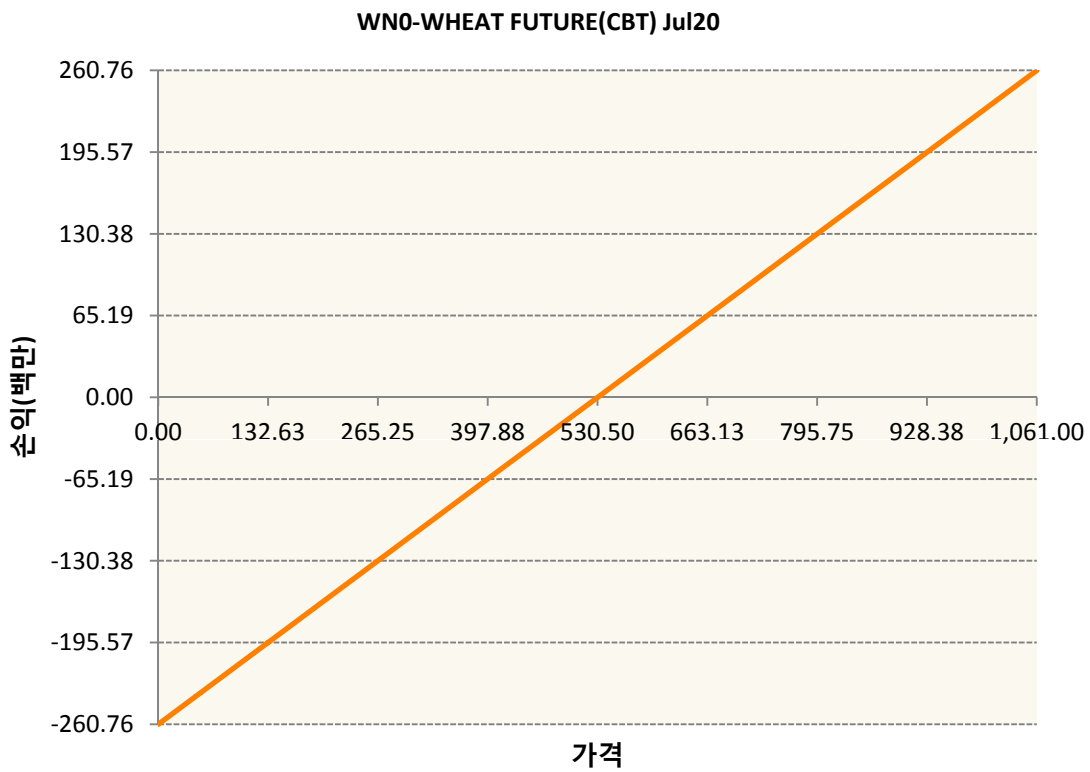
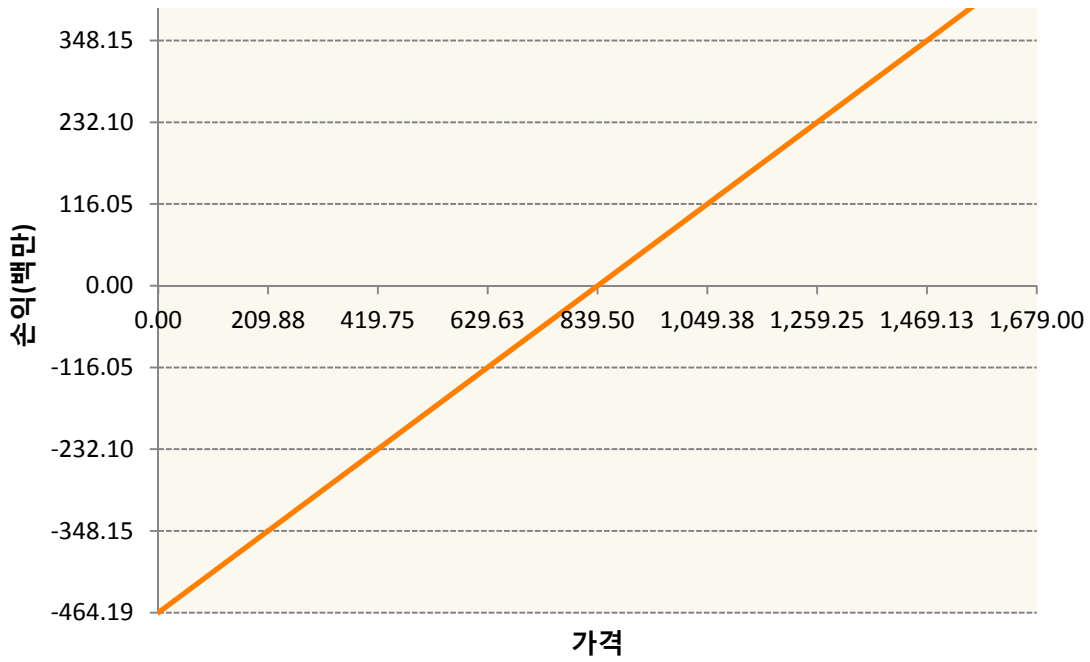


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20



SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





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	20
KR4175Q50C	2020-05 달러선물	6

KWN0	KC HRW WHEAT FUT Jul20	12
SBN0	Sugar Jul20	16
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)

222