

공시일	2020-04-29
기준일	2020-04-28

## 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	2020-04-29
기준일	2020-04-28

## 스마트인덱스모

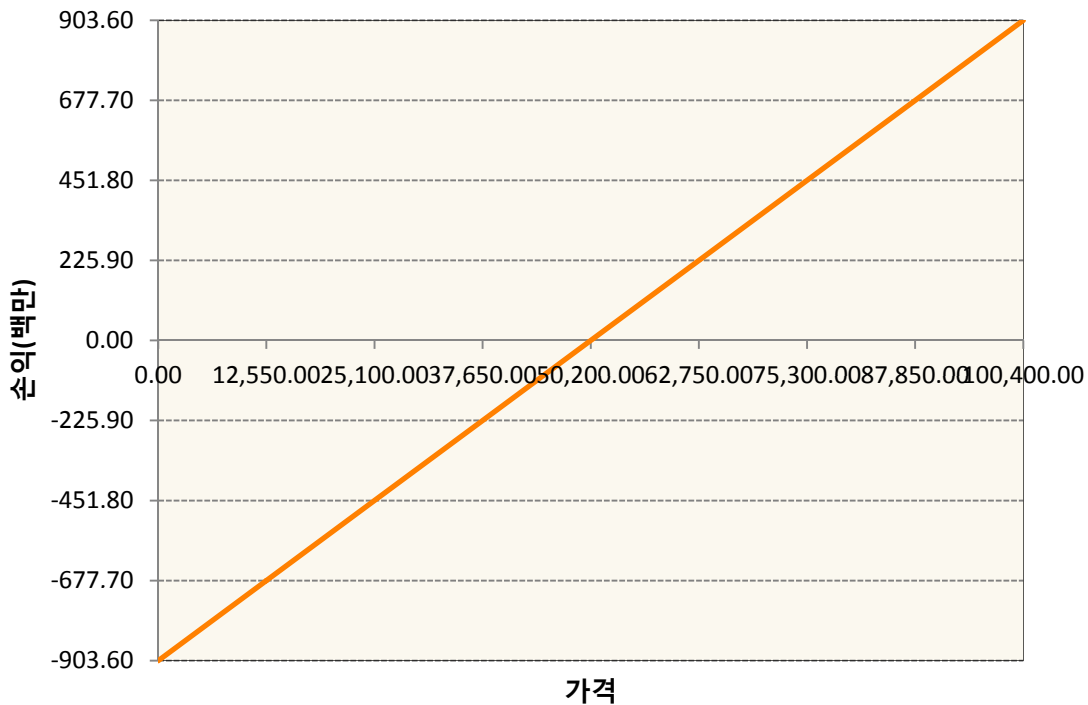
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	904	0	904	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	2020-04-29
기준일	2020-04-28

## 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

974

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,138

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-29
기준일	2020-04-28

## 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

544

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

851

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-04-29
기준일	2020-04-28

## 유로인덱스모(주식-파생형)

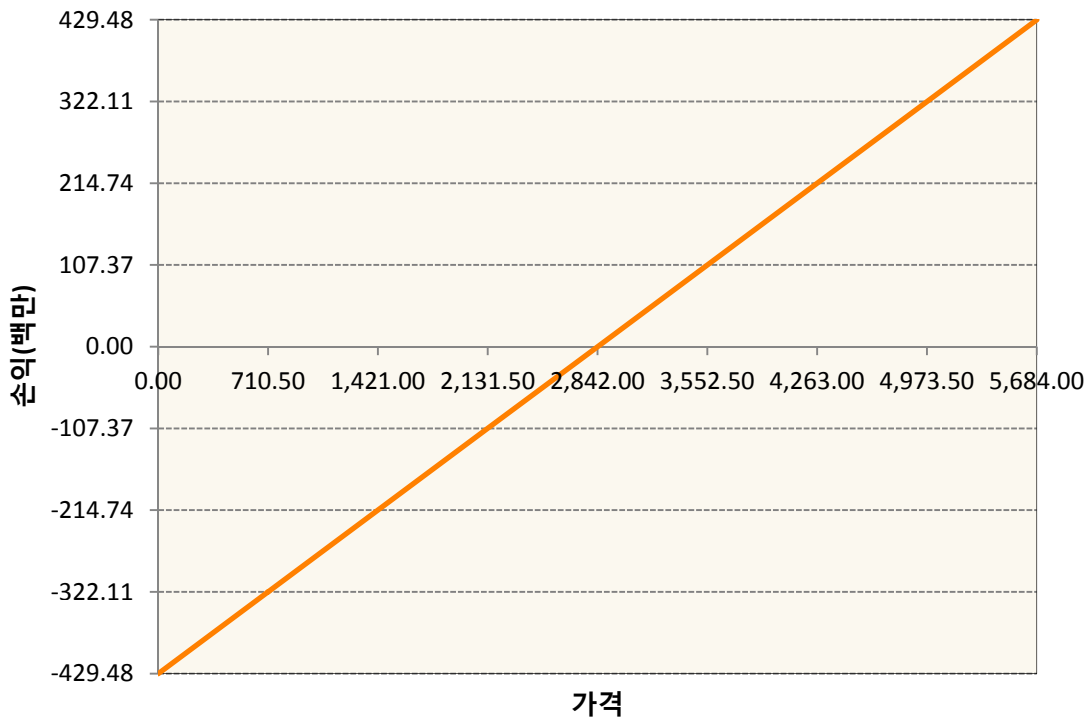
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	429	0	429	

### 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	2020-04-29
기준일	2020-04-28

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

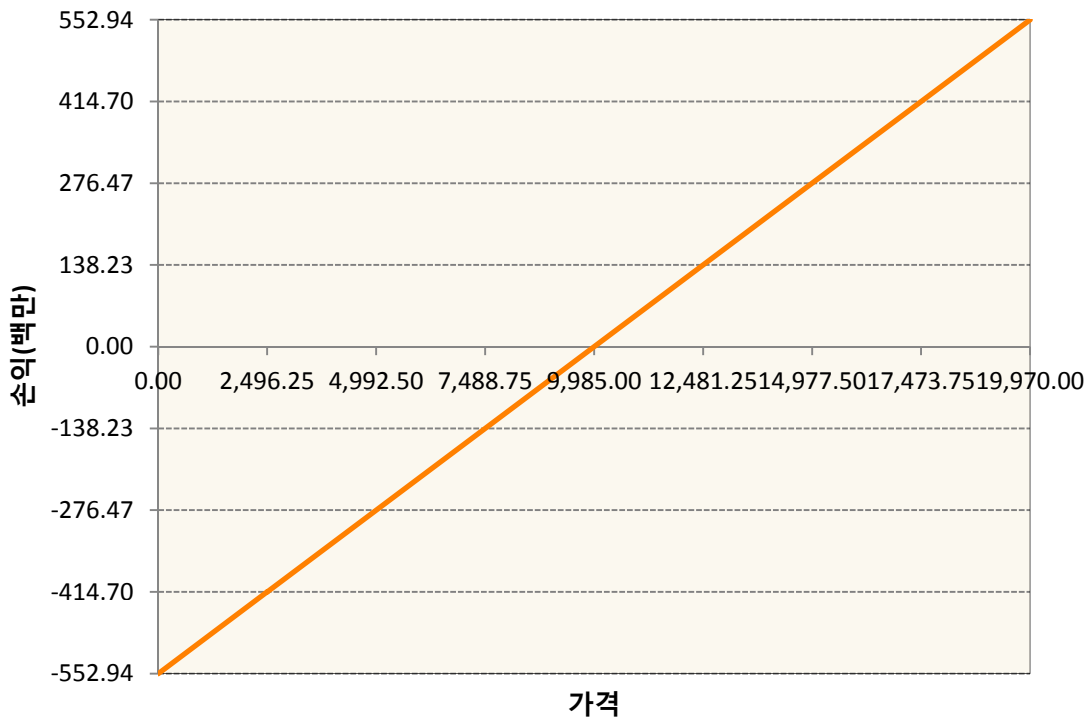
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	553	0	553	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)

47
----

공시일	2020-04-29
기준일	2020-04-28

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

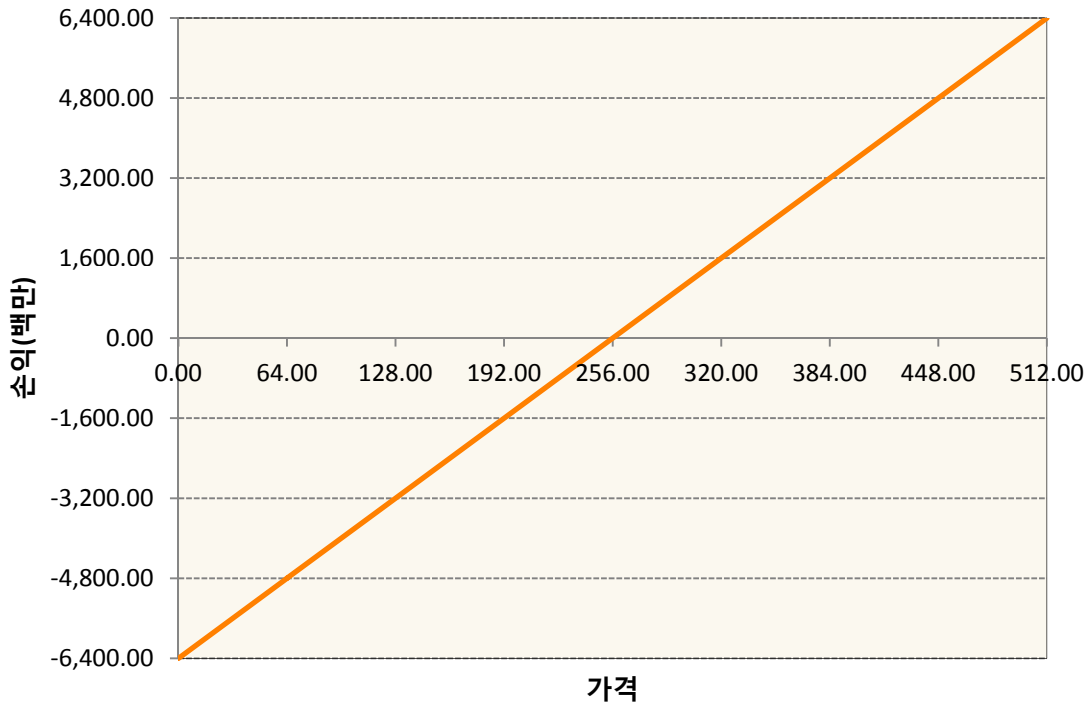
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

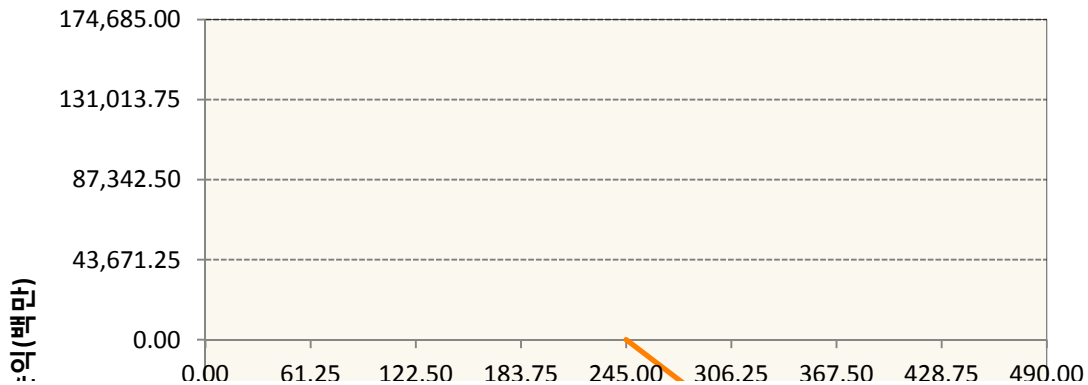
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	3,633	0	3,633	장내
누계	유가증권	선물	6,400	0	6,400	장내
누계	유가증권	옵션	0	354,670	-354,670	장내

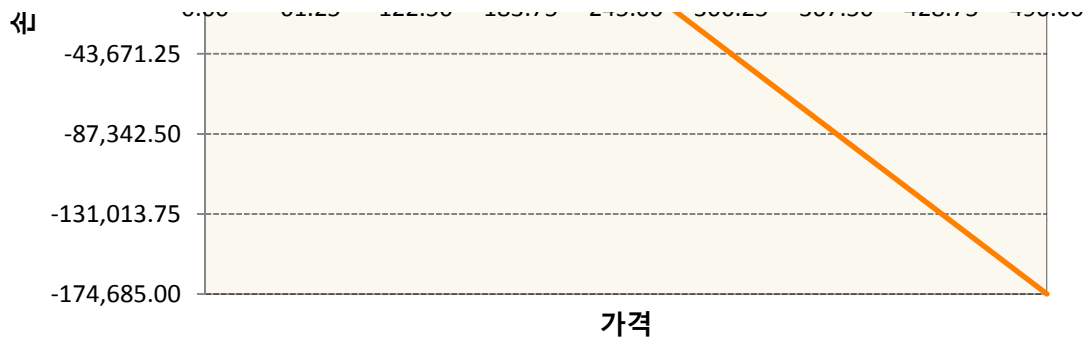
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

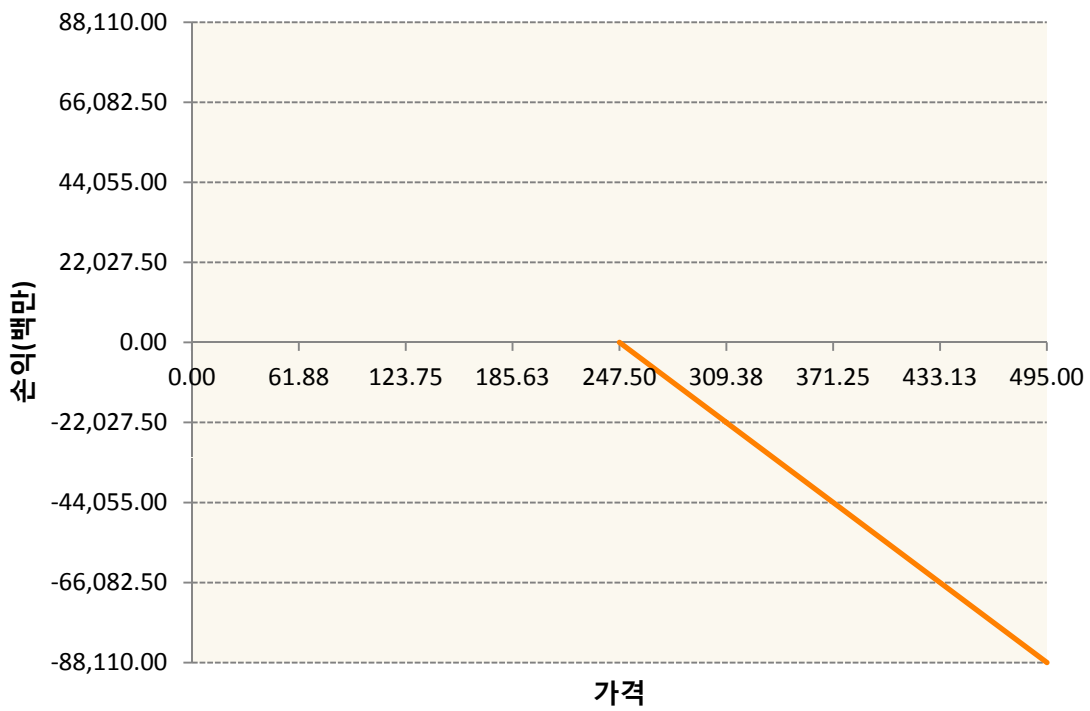


KR4201Q52452-2020-05 콜245

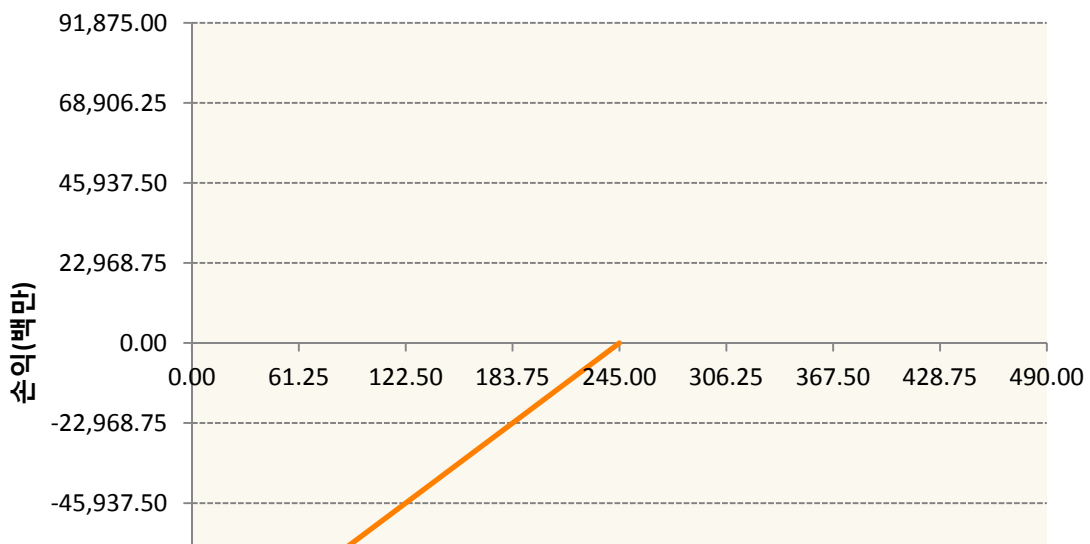


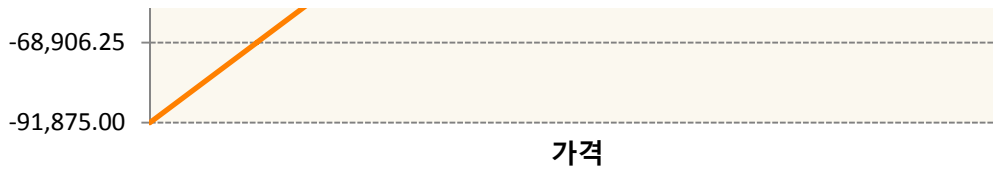


KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



KR4301Q52450-2020-05 풋245





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						513
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-513	-513	-513	-513	-513	-513	-513	
-5.33%	-342	-342	-342	-342	-342	-342	-342	
-2.67%	-171	-171	-171	-171	-171	-171	-171	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	171	171	171	171	171	171	171	
5.33%	342	342	342	342	342	342	342	
8.00%	513	513	513	513	513	513	513	
KR4201Q52452		2020-05 콜245						12,823
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	9,316	8,820	8,312	7,796	7,273	6,746	6,214	
-5.33%	7,435	6,870	6,305	5,739	5,172	4,606	4,039	
-2.67%	4,825	4,263	3,698	3,131	2,562	1,993	1,423	
0%	1,530	1,034	523	0	-532	-1,070	-1,615	
2.67%	-2,333	-2,724	-3,145	-3,592	-4,058	-4,540	-5,036	
5.33%	-6,610	-6,888	-7,208	-7,564	-7,948	-8,359	-8,790	
8.00%	-11,160	-11,340	-11,564	-11,829	-12,130	-12,463	-12,823	
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5						6,248
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4,320	4,088	3,848	3,602	3,351	3,095	2,836	
-5.33%	3,505	3,228	2,950	2,671	2,391	2,110	1,829	
-2.67%	2,334	2,046	1,757	1,468	1,180	891	602	
0%	811	545	274	0	-277	-557	-838	
2.67%	-1,017	-1,236	-1,468	-1,709	-1,959	-2,214	-2,475	
5.33%	-3,081	-3,243	-3,425	-3,623	-3,834	-4,056	-4,287	
8.00%	-5,305	-5,415	-5,547	-5,699	-5,868	-6,051	-6,248	
KR4301Q52450		2020-05 풋245						4,145
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,074	-3,238	-3,410	-3,588	-3,770	-3,956	-4,145	
-5.33%	-1,367	-1,576	-1,786	-1,996	-2,207	-2,418	-2,629	
-2.67%	-189	-394	-600	-809	-1,018	-1,228	-1,439	

0%	499	342	175	0	-181	-367	-556
2.67%	836	739	626	500	363	215	60
5.33%	974	925	860	781	688	583	466
8.00%	1,021	1,000	969	925	869	800	719

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

(단위:백만원)

**22,144**

공시일	2020-04-29
기준일	2020-04-28

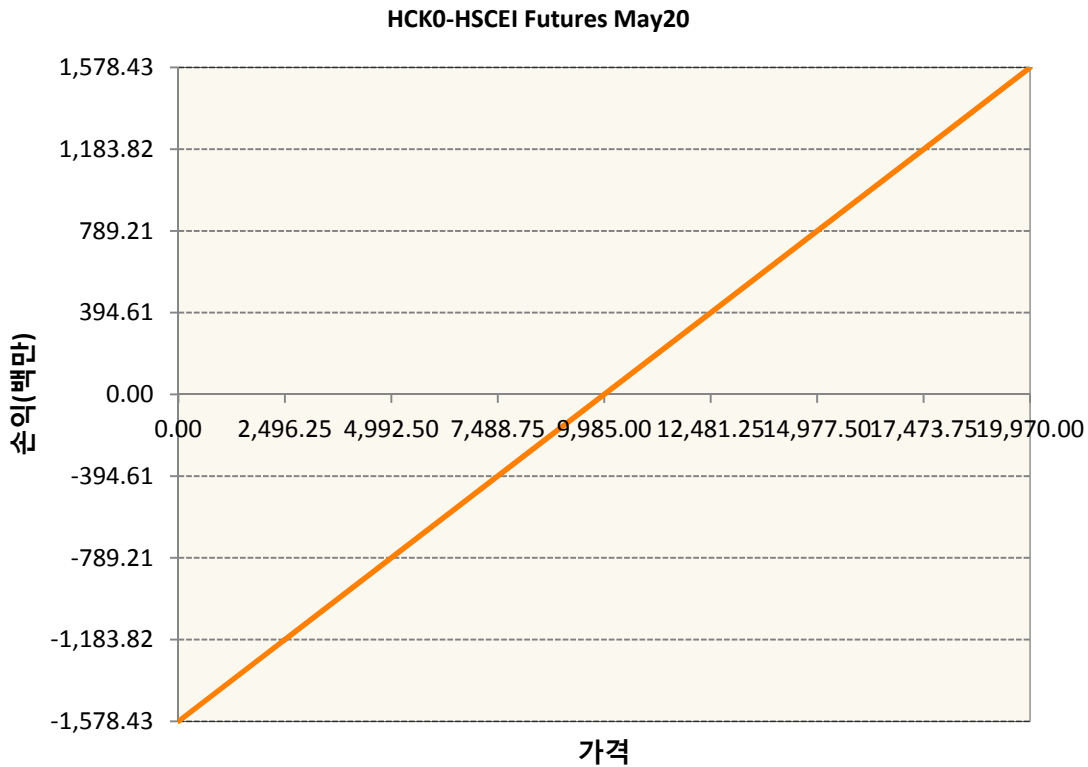
## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,578	0	1,578	장내
누계	통화	선도	696	2,226	-1,530	장외

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E	178
FX21020H05 HKD/KRW 22-05-20E	56
HCK0 HSCEI Futures May20	126

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

(단위:백만원)

<b>251</b>
------------

공시일	2020-04-29
기준일	2020-04-28

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

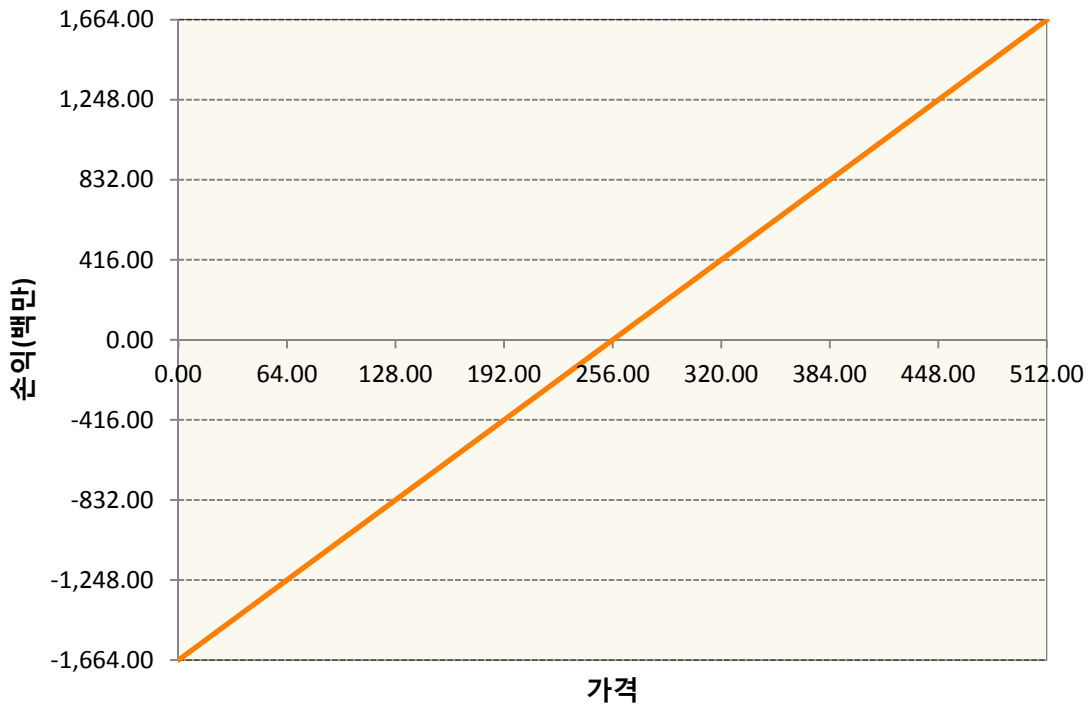
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

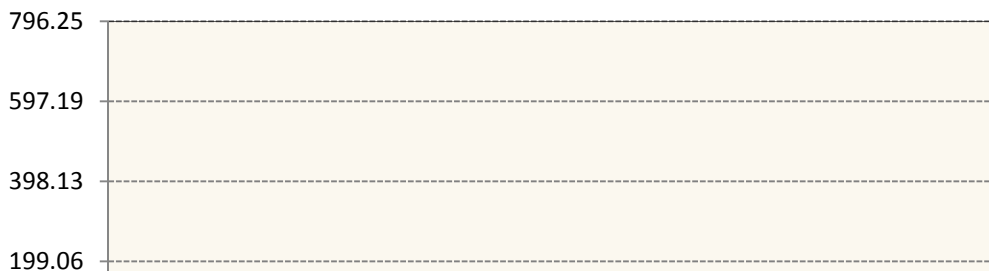
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,664	0	1,664	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,193	-3,193	장내

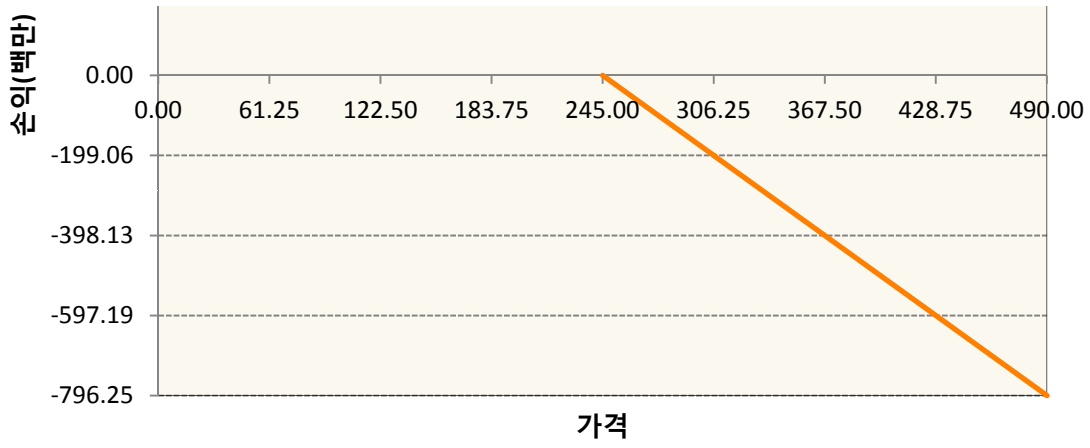
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

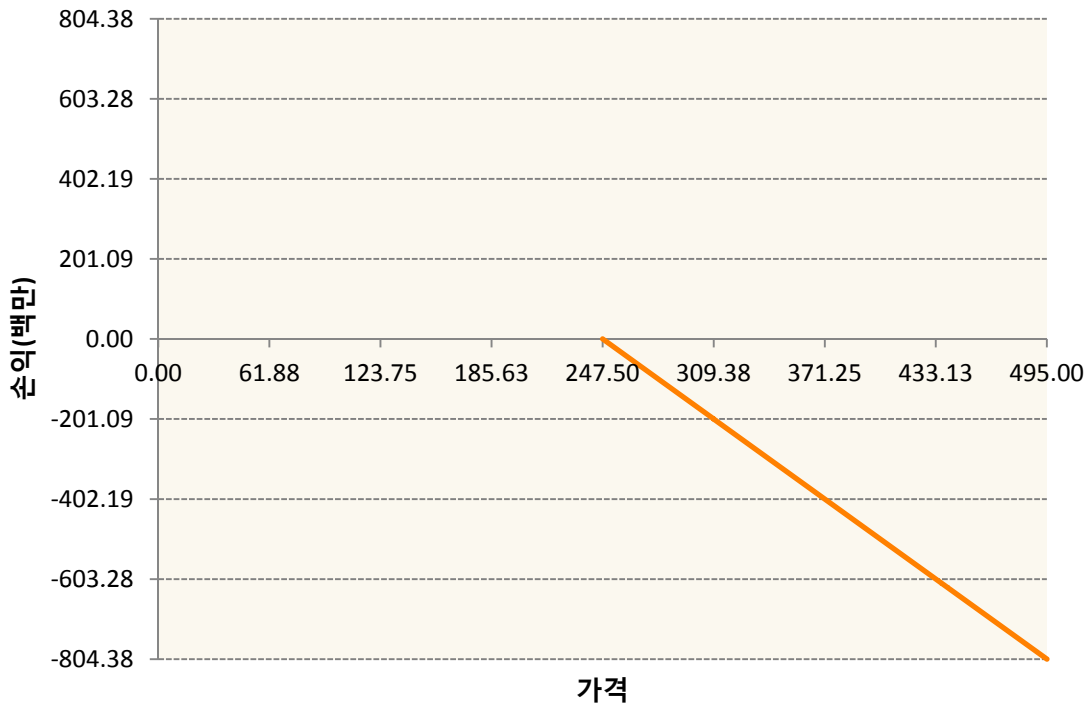


KR4201Q52452-2020-05 콜245

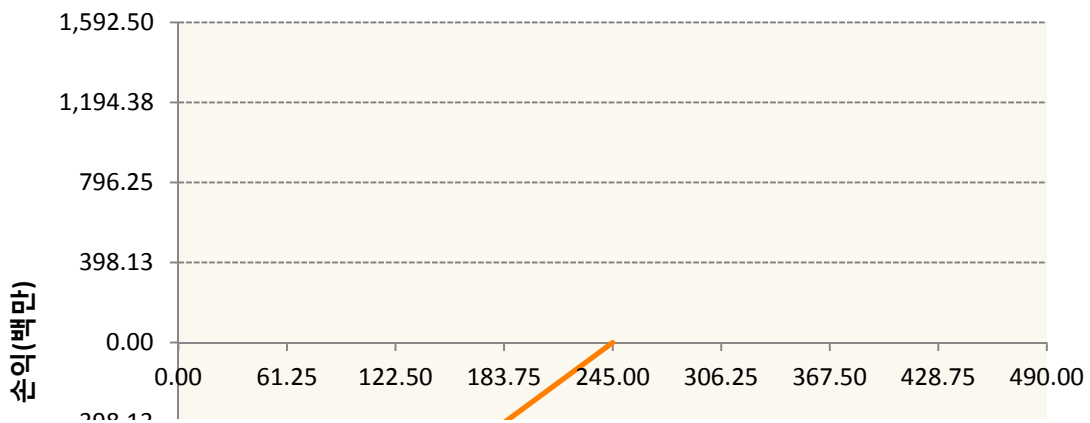




KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



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%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89	
-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%	89	89	89	89	89	89	89	
8.00%	133	133	133	133	133	133	133	
KR4201Q52452		2020-05 콜245						58
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	42	40	38	36	33	31	28	
-5.33%	34	31	29	26	24	21	18	
-2.67%	22	19	17	14	12	9	6	
0%	7	5	2	0	-2	-5	-7	
2.67%	-11	-12	-14	-16	-18	-21	-23	
5.33%	-30	-31	-33	-34	-36	-38	-40	
8.00%	-51	-52	-53	-54	-55	-57	-58	
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5						57
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	39	37	35	33	31	28	26
-5.33%	32	29	27	24	22	19	17
-2.67%	21	19	16	13	11	8	5
0%	7	5	3	0	-3	-5	-8
2.67%	-9	-11	-13	-16	-18	-20	-23
5.33%	-28	-30	-31	-33	-35	-37	-39
8.00%	-48	-49	-51	-52	-54	-55	-57
KR4301Q52450                      2020-05 풋245							72
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-53	-56	-59	-62	-65	-69	-72
-5.33%	-24	-27	-31	-35	-38	-42	-46
-2.67%	-3	-7	-10	-14	-18	-21	-25
0%	9	6	3	0	-3	-6	-10
2.67%	14	13	11	9	6	4	1
5.33%	17	16	15	14	12	10	8
8.00%	18	17	17	16	15	14	12

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

(단위:백만원)

**553**

공시일	2020-04-29
기준일	2020-04-28

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

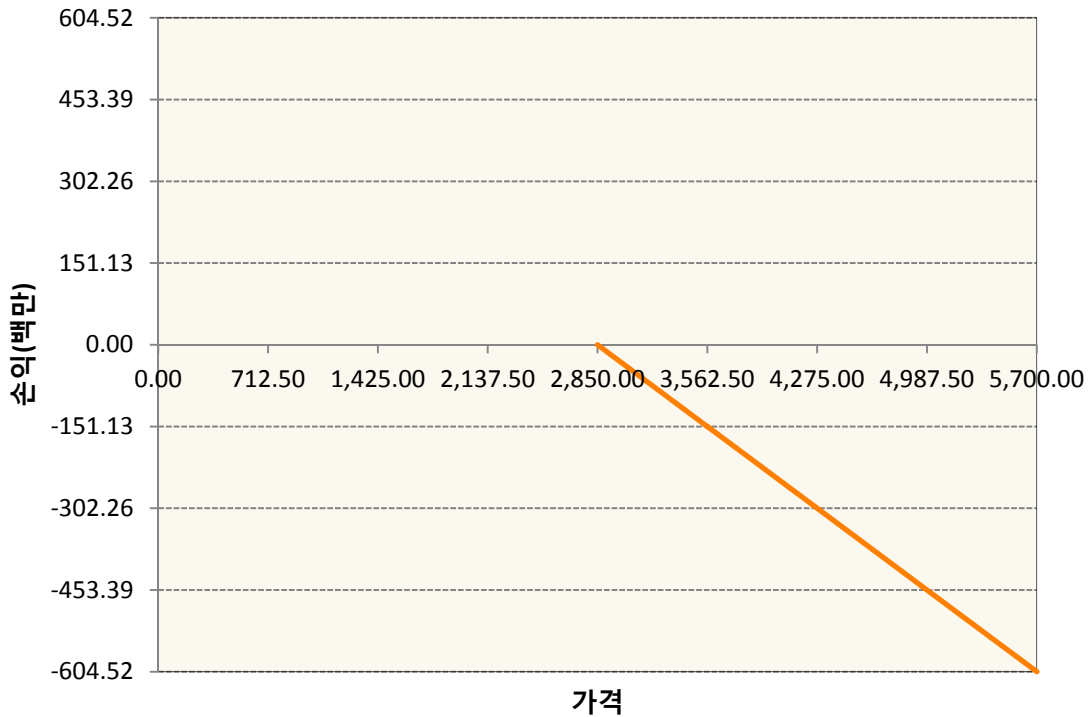
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

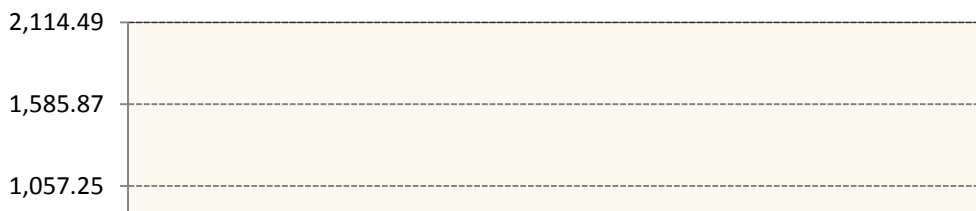
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	460	0	460	
누계	유가증권	스왑	7,906	0	7,906	장외
누계	유가증권	옵션	0	5,438	-5,438	장내
누계	통화	선도	0	2,683	-2,683	장외

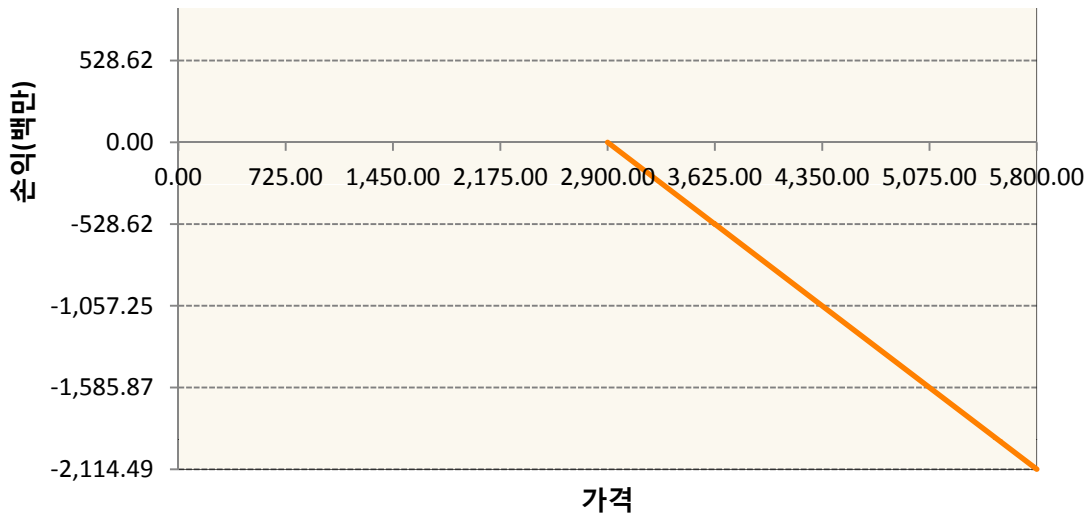
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXK0-C2850-EURO STOXX 50**

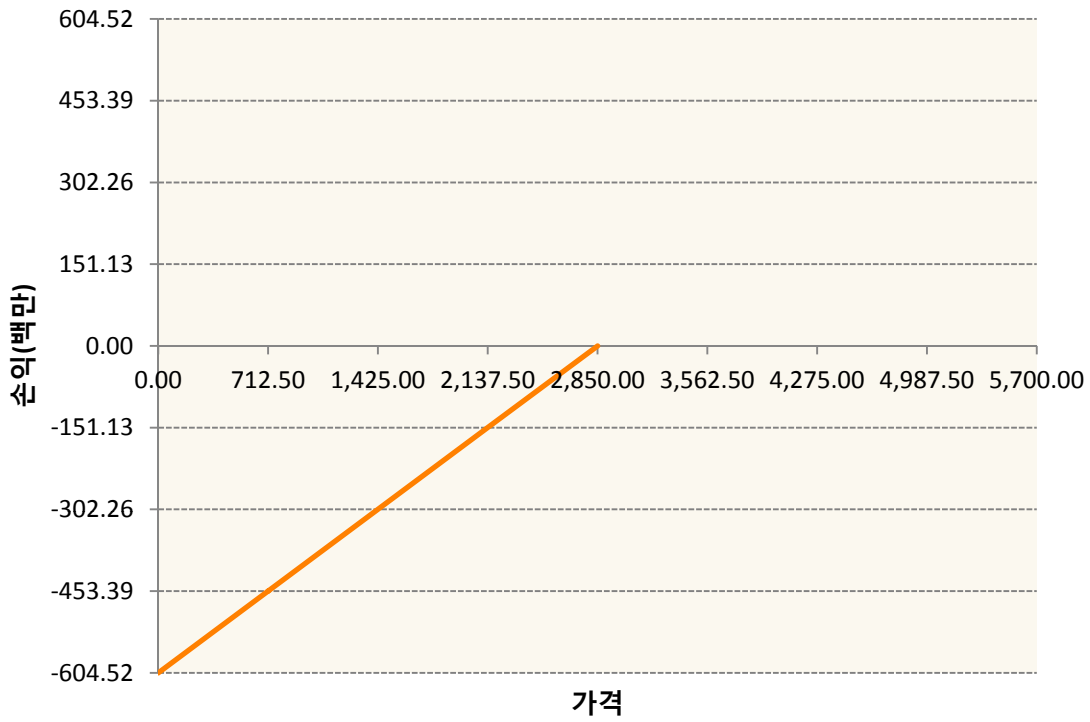


**OESXK0-C2900-EURO STOXX 50**

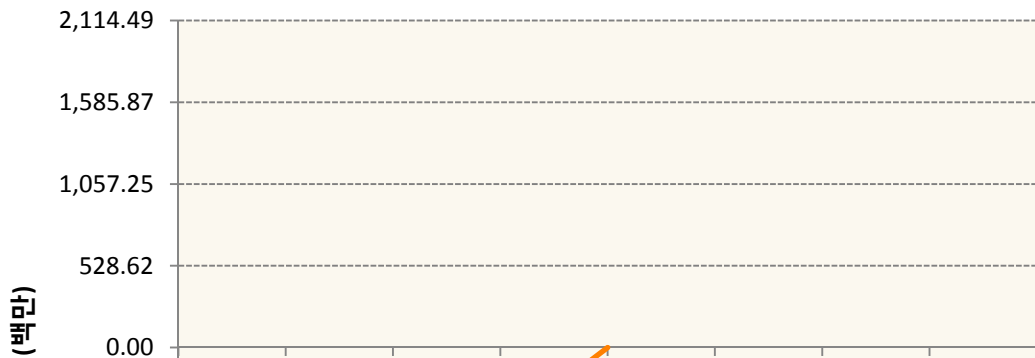


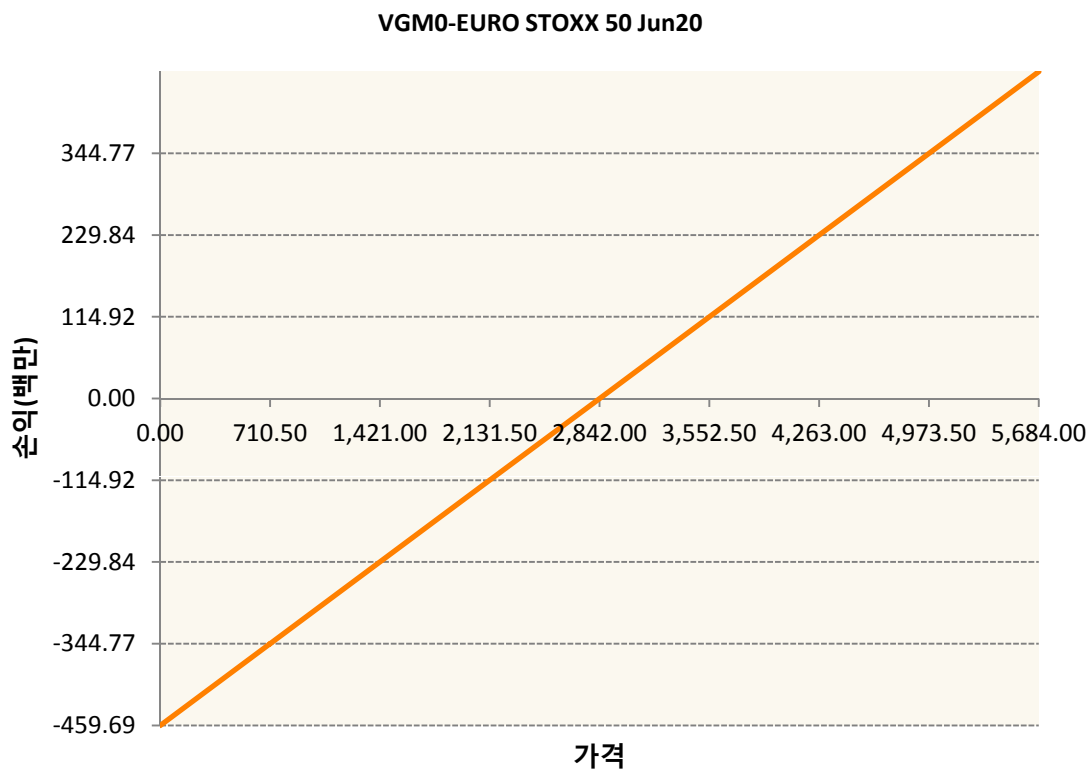
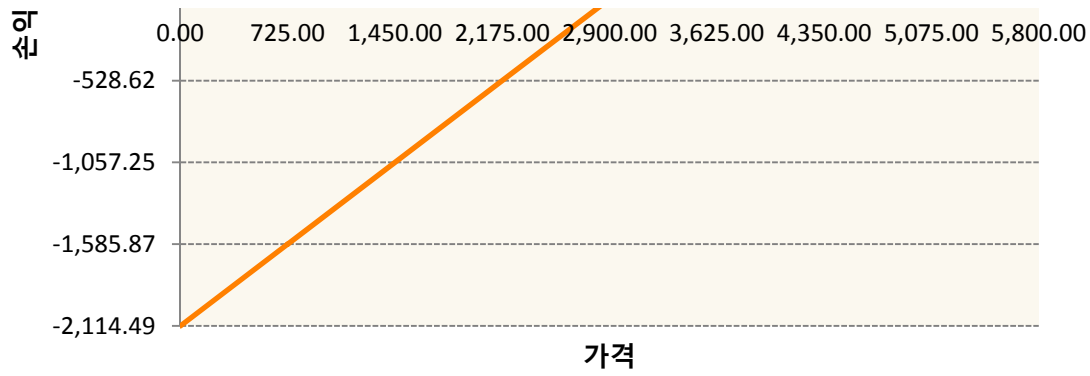


OESXK0-P2850-EURO STOXX 50



OESXK0-P2900-EURO STOXX 50





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	8
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)

1,142



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

(단위:백만원)

99

공시일	2020-04-29
기준일	2020-04-28

## ETF스마트레버리지목표전환형10호

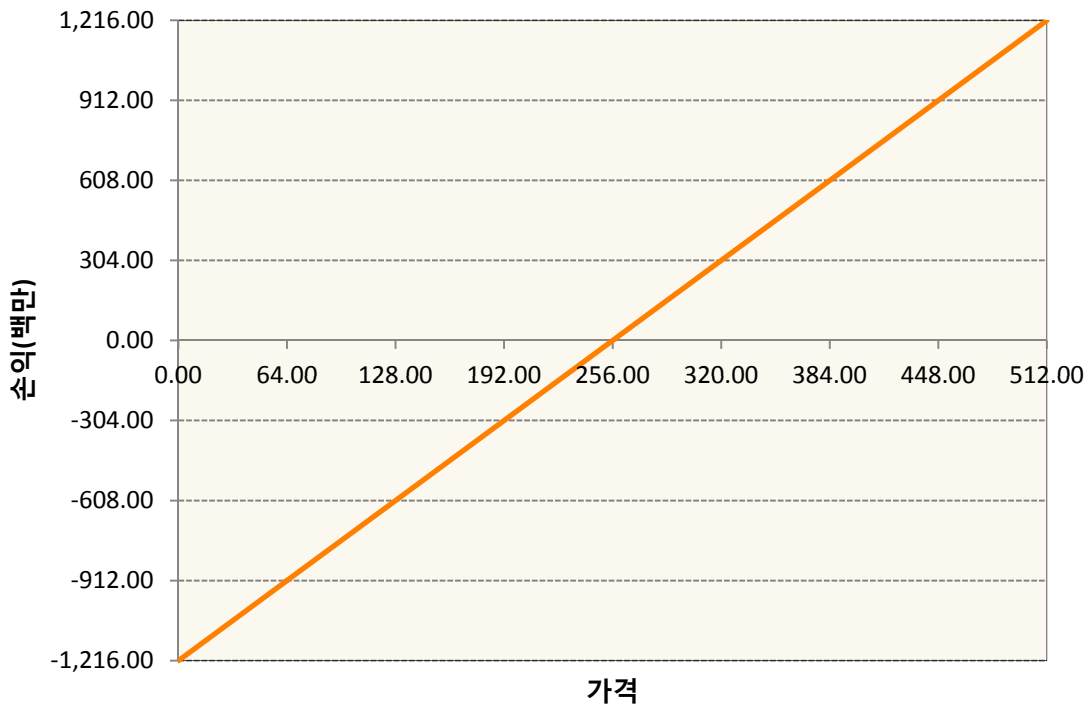
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,216	0	1,216	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						97
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97	
-5.33%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65	
-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%	65	65	65	65	65	65	65	
8.00%	97	97	97	97	97	97	97	

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

(단위:백만원)

145

공시일	2020-04-29
기준일	2020-04-28

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

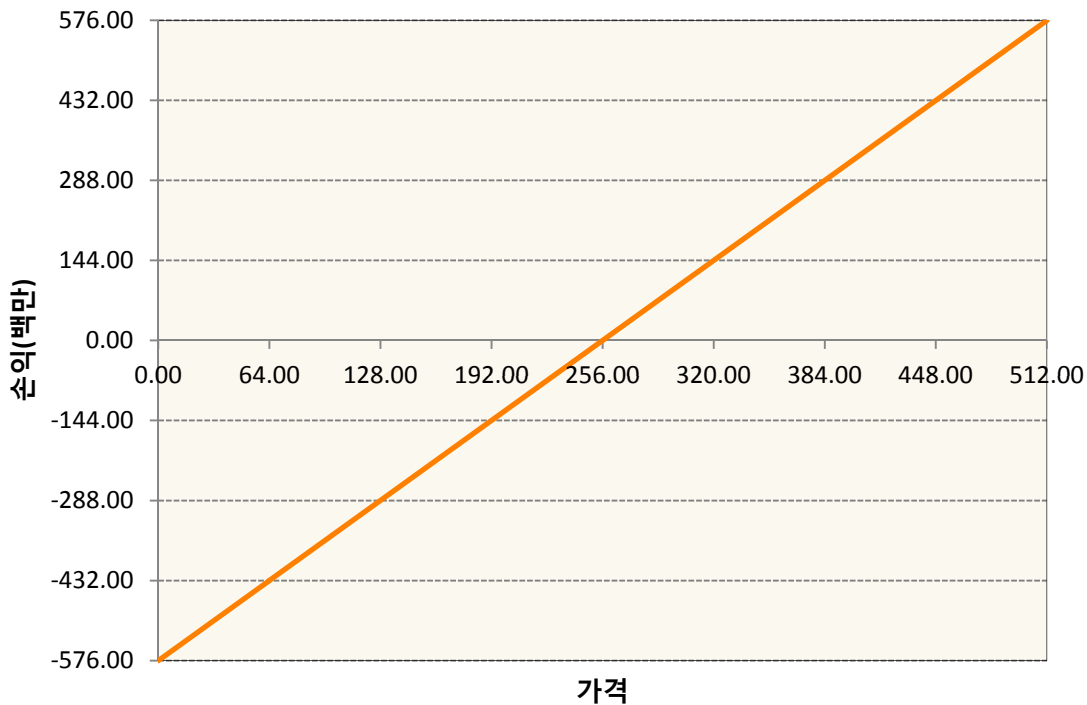
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	576	0	576	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%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31	
-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%	31	31	31	31	31	31	31	
8.00%	46	46	46	46	46	46	46	

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

(단위:백만원)

69

공시일	2020-04-29
기준일	2020-04-28

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

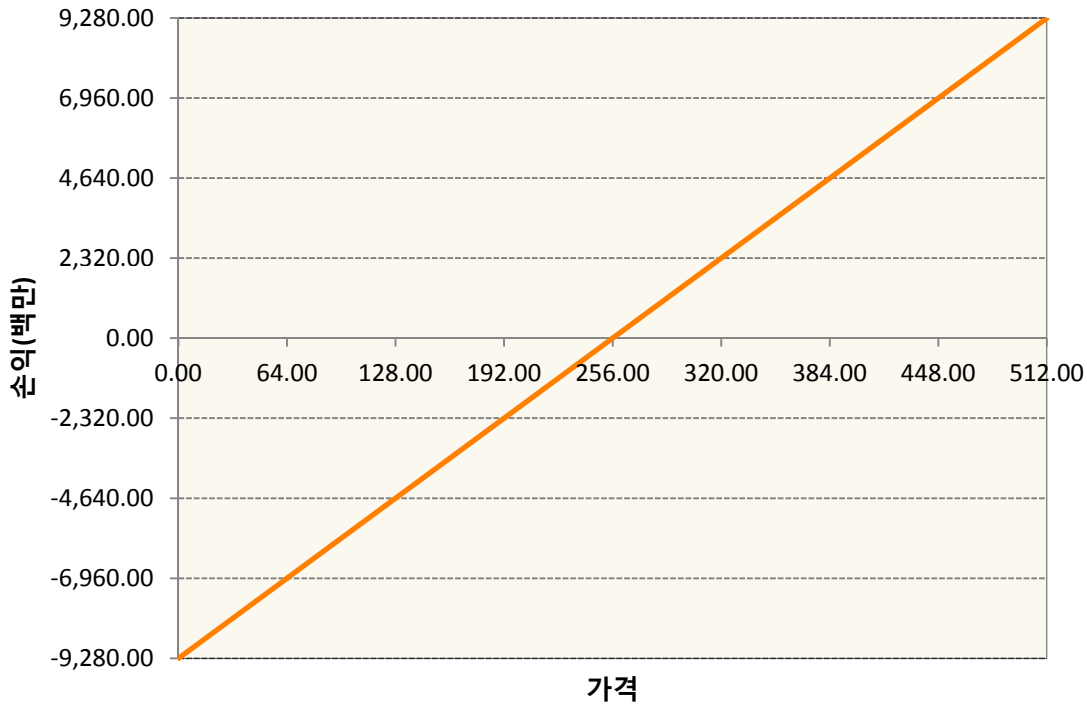
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

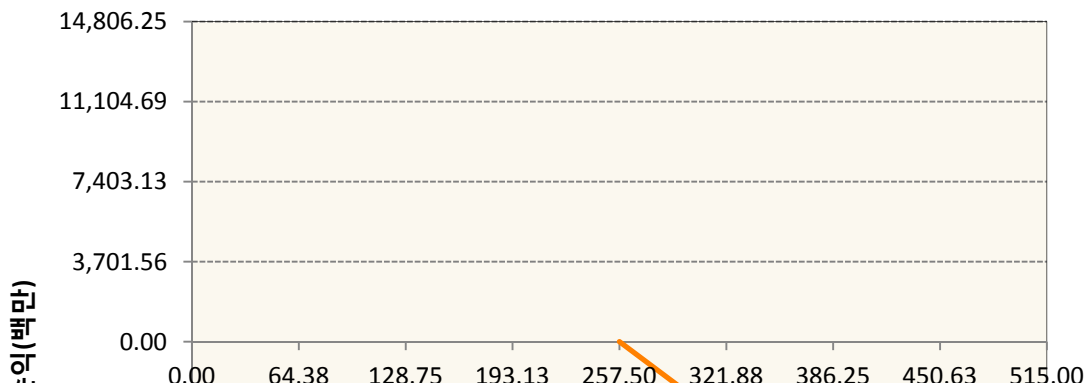
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,280	0	9,280	장내
누계	유가증권	옵션	6,201	17,536	-11,335	장내

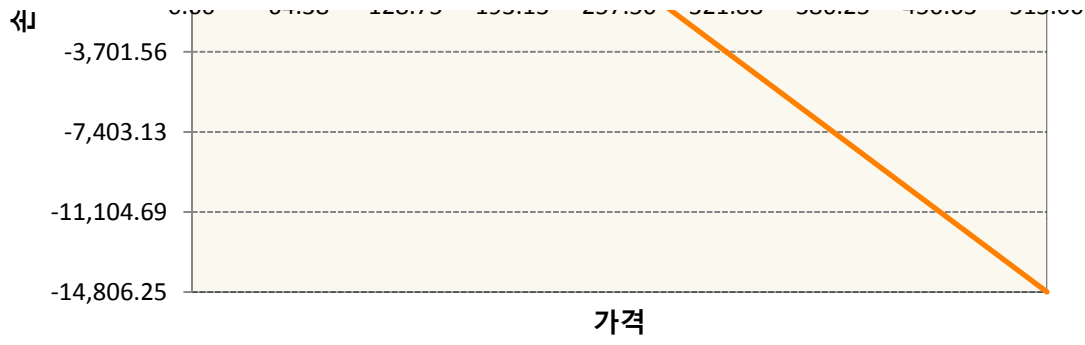
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

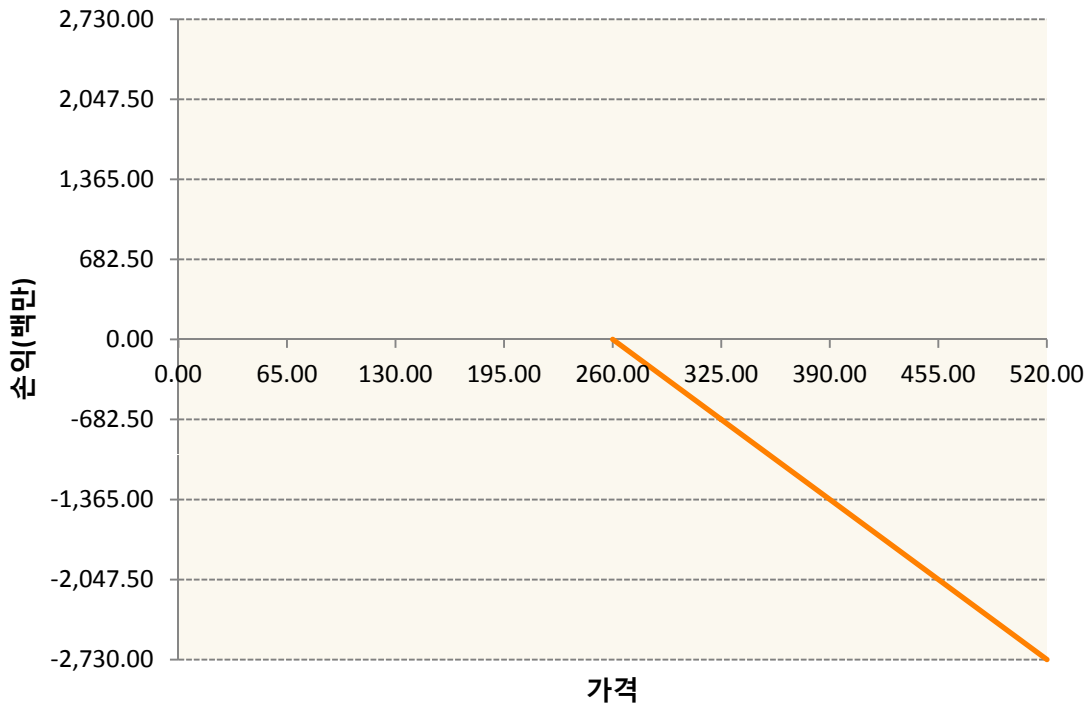


KR4201Q52577-2020-05 콜257.5

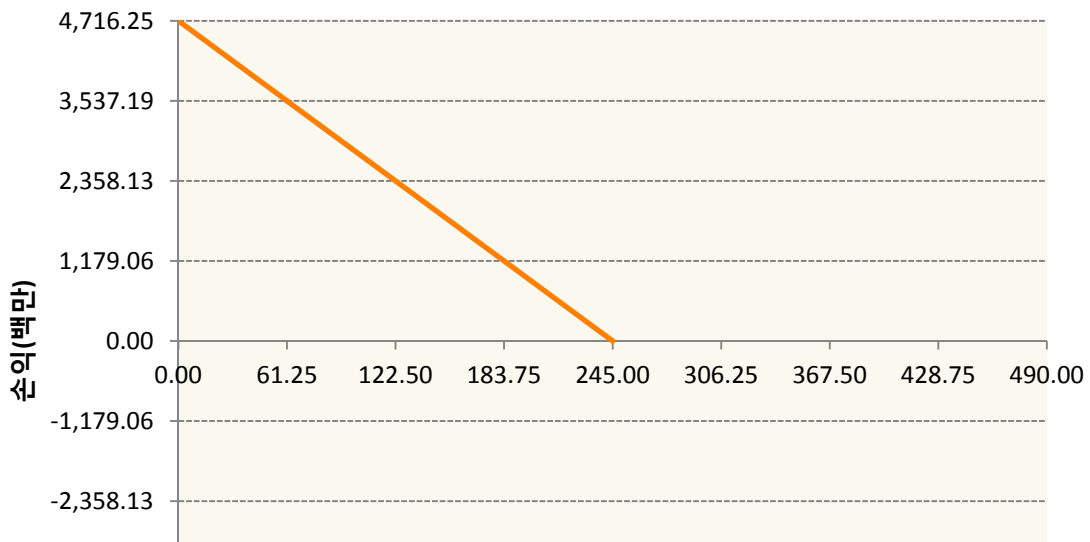


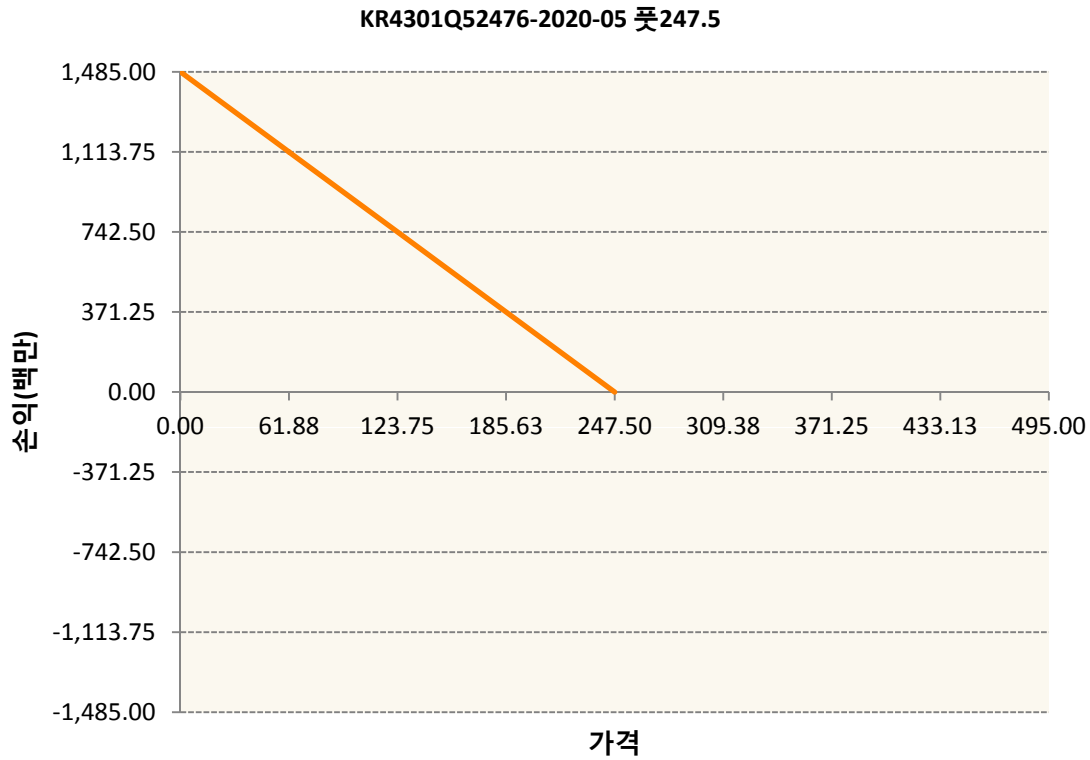
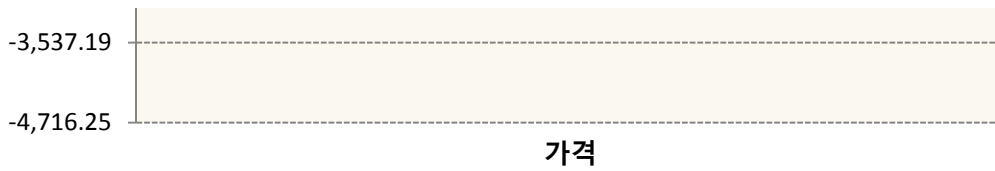


KR4201Q52601-2020-05 콜260



KR4301Q52450-2020-05 풋245





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						744
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-744	-744	-744	-744	-744	-744	-744	
-5.33%	-496	-496	-496	-496	-496	-496	-496	
-2.67%	-248	-248	-248	-248	-248	-248	-248	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	248	248	248	248	248	248	248	
5.33%	496	496	496	496	496	496	496	
8.00%	744	744	744	744	744	744	744	
KR4201Q52577		2020-05 콜257.5						887
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	485	461	434	404	372	338	303	
-5.33%	419	384	347	308	269	228	186	
-2.67%	308	265	220	175	130	84	38	

0%	145	97	48	0	-48	-97	-145
2.67%	-75	-122	-169	-217	-265	-313	-361
5.33%	-346	-387	-430	-474	-519	-564	-610
8.00%	-660	-692	-728	-766	-805	-845	-887
KR4201Q52601                      2020-05 콜260							156
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	80	76	71	66	61	55	49
-5.33%	70	64	58	51	44	37	30
-2.67%	53	45	37	29	21	13	5
0%	26	18	9	0	-9	-18	-26
2.67%	-10	-19	-28	-37	-46	-55	-64
5.33%	-56	-64	-73	-81	-90	-98	-107
8.00%	-111	-118	-125	-132	-140	-148	-156
KR4301Q52450                      2020-05 풋245							213
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	158	166	175	184	194	203	213
-5.33%	70	81	92	102	113	124	135
-2.67%	10	20	31	42	52	63	74
0%	-26	-18	-9	0	9	19	29
2.67%	-43	-38	-32	-26	-19	-11	-3
5.33%	-50	-47	-44	-40	-35	-30	-24
8.00%	-52	-51	-50	-47	-45	-41	-37
KR4301Q52476                      2020-05 풋247.5							72
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	57	59	62	64	67	70	72
-5.33%	27	30	33	36	40	43	46
-2.67%	5	8	12	15	19	22	25
0%	-9	-6	-3	0	3	6	10
2.67%	-16	-14	-12	-10	-7	-5	-2
5.33%	-19	-18	-17	-15	-14	-12	-10
8.00%	-21	-20	-19	-18	-17	-16	-14

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

(단위:백만원)

**2,155**

공시일	2020-04-29
기준일	2020-04-28

## 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	146,582	0	146,582	

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2020-04-29
기준일	2020-04-28

## 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	98,835	0	98,835	

### 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	2020-04-29
기준일	2020-04-28

## 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	436,672	0	436,672	
누계	통화	선도	44,107	462,636	-418,528	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,450
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,039
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,039
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,392
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	980
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	980
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,548
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	843
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	735
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	490
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,431
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,959
FX21020H11 KRW/USD 11-05-20E	980
FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E	2,940
FX21020J02€ KRW/USD 10-06-20E	1,333
FX21020J02£ KRW/USD 22-06-20E	1,509
FX21020J02¥ KRW/USD 22-06-20E	1,960
FX21020J03\$ KRW/USD 24-07-20E	2,205
FX21020J04₪ KRW/USD 24-07-20E	1,764
FX21020J04₹ KRW/USD 24-07-20E	1,960

IE00BD8RGM75

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

20,438



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

(단위:백만원)

197

공시일	2020-04-29
기준일	2020-04-28

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

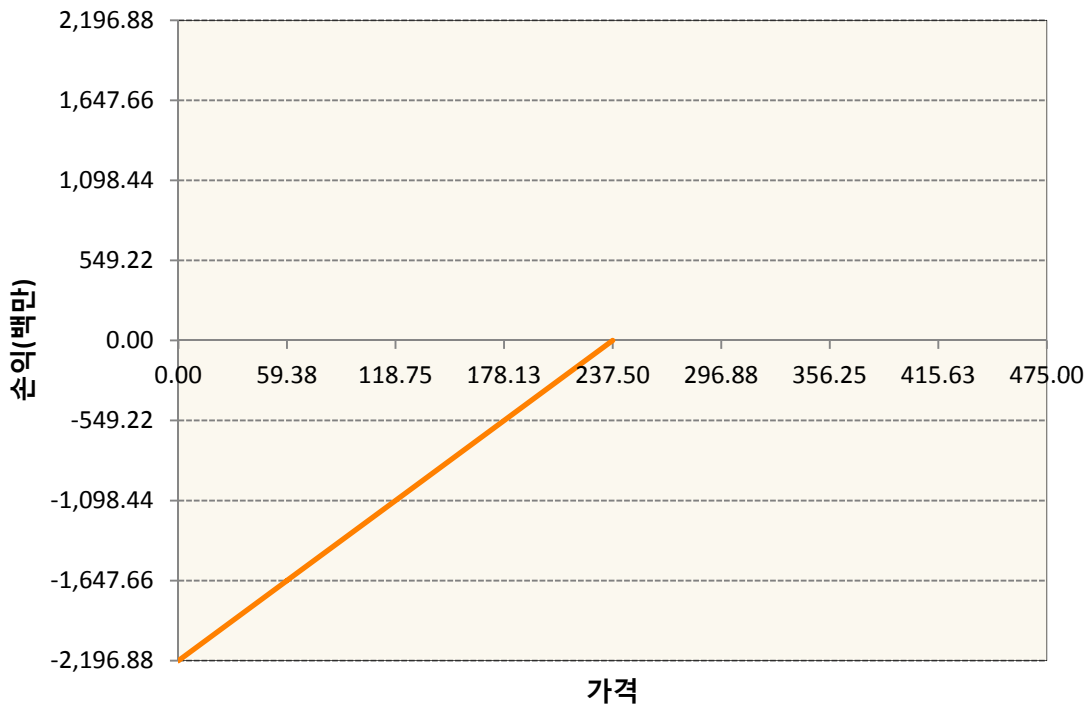
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

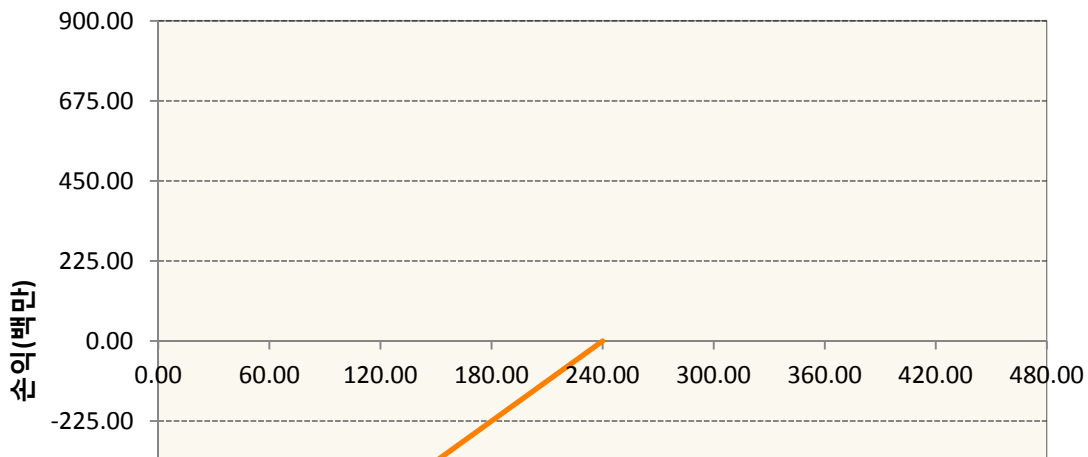
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,097	-3,097	장내

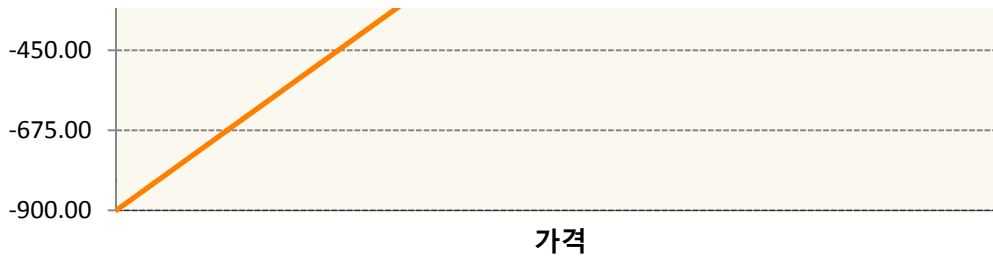
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q52377-2020-05 풋237.5



KR4301Q52401-2020-05 풋240





**3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4301Q52377      2020-05 풋237.5      74

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-43	-48	-53	-58	-63	-68	-74
-5.33%	-15	-20	-25	-30	-35	-40	-45
-2.67%	0	-3	-7	-11	-15	-20	-24
0%	7	5	3	0	-3	-6	-10
2.67%	10	9	8	6	4	2	-1
5.33%	11	11	10	9	8	6	5
8.00%	11	11	11	10	10	9	8

KR4301Q52401      2020-05 풋240      34

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22	-24	-26	-28	-30	-32	-34
-5.33%	-8	-10	-13	-15	-17	-19	-21
-2.67%	0	-2	-4	-6	-7	-9	-11
0%	4	3	1	0	-1	-3	-5
2.67%	5	5	4	3	2	1	0
5.33%	6	6	5	5	4	4	3
8.00%	6	6	6	6	5	5	4

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

74

공시일	2020-04-29
기준일	2020-04-28

## 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	7,198	0	7,198	
누계	통화	선도	0	10,328	-10,328	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H11 KRW/USD 29-04-20E	226
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	2020-04-29
기준일	2020-04-28

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

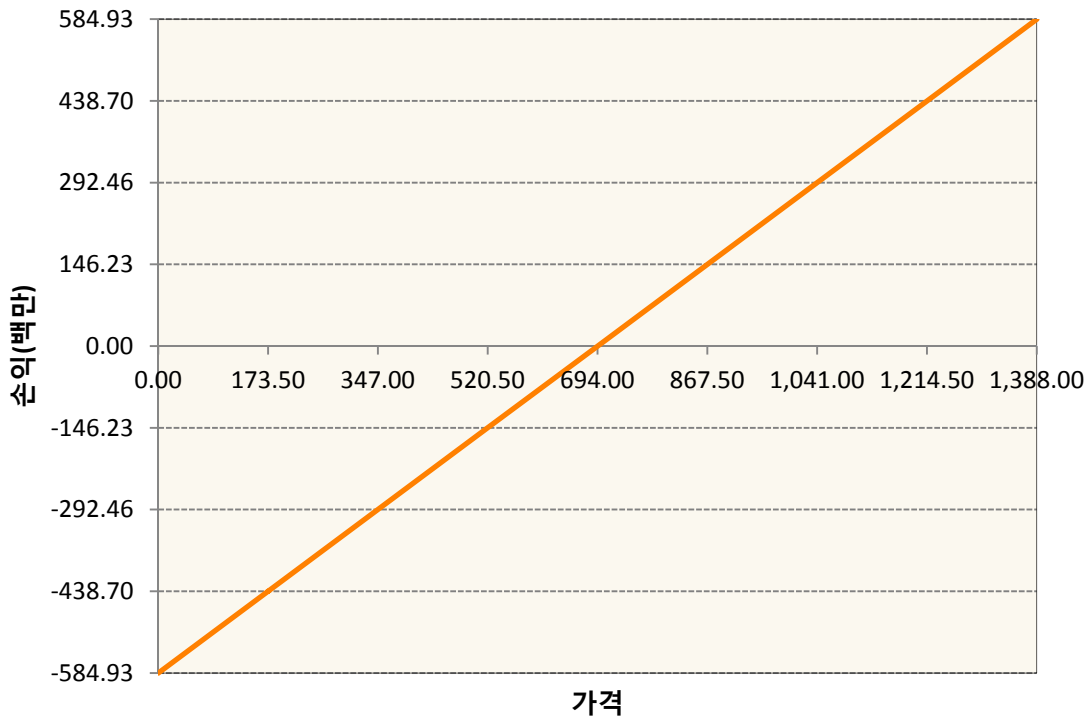
### 1. 계약금액

(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	585	0	585	
누계	유가증권	스왑	869	0	869	장외
누계	통화	선도	204	628	-424	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
FX21020J048 KRW/EUR 22-05-20E	11
VNCK0 VN30 Index Future May20	47

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

(단위:백만원)

**141**

공시일	2020-04-29
기준일	2020-04-28

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

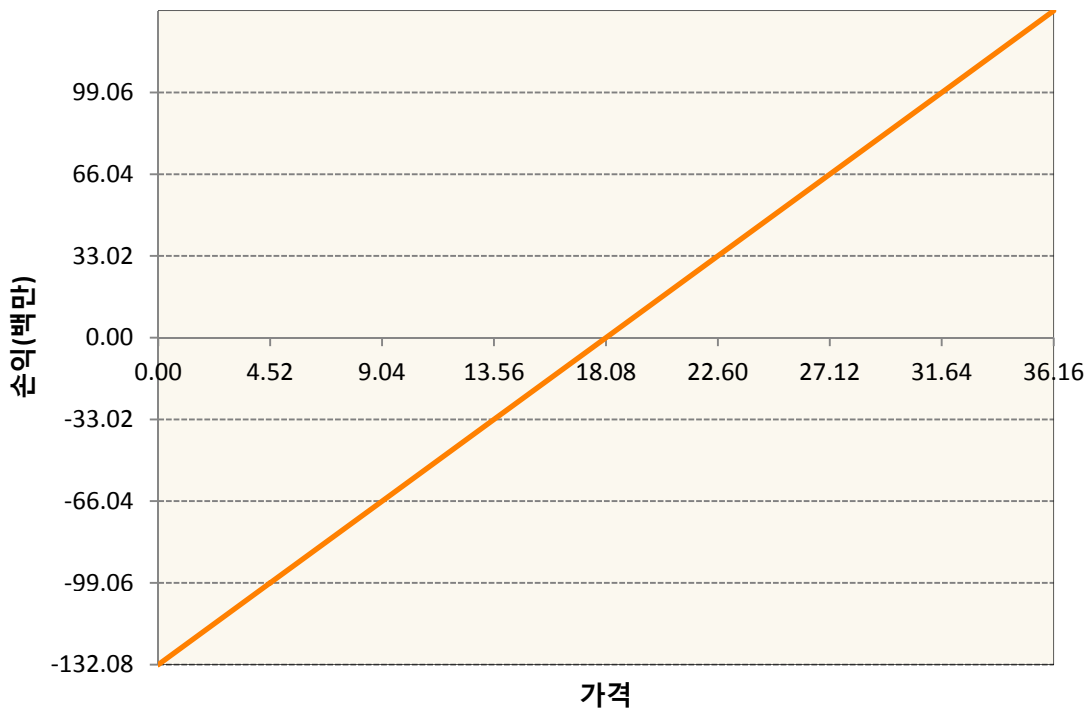
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

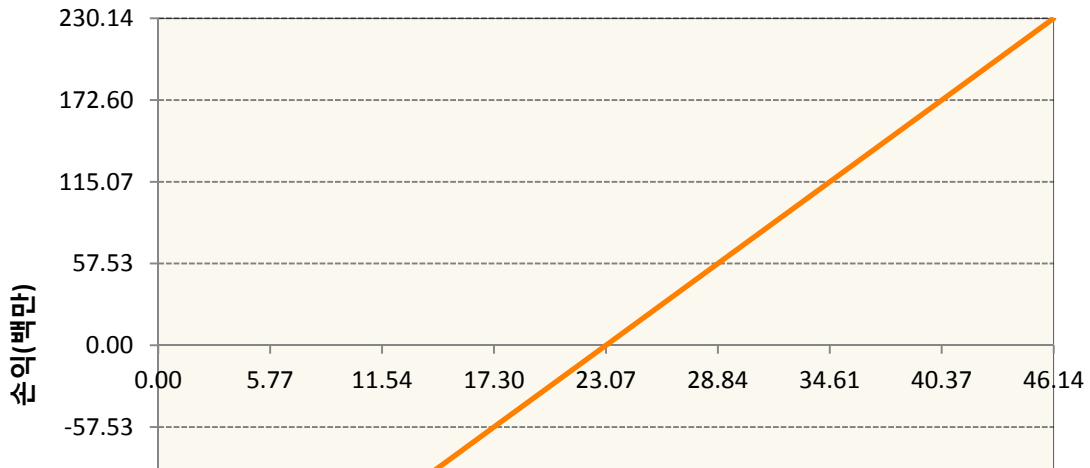
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,328	184	1,144	

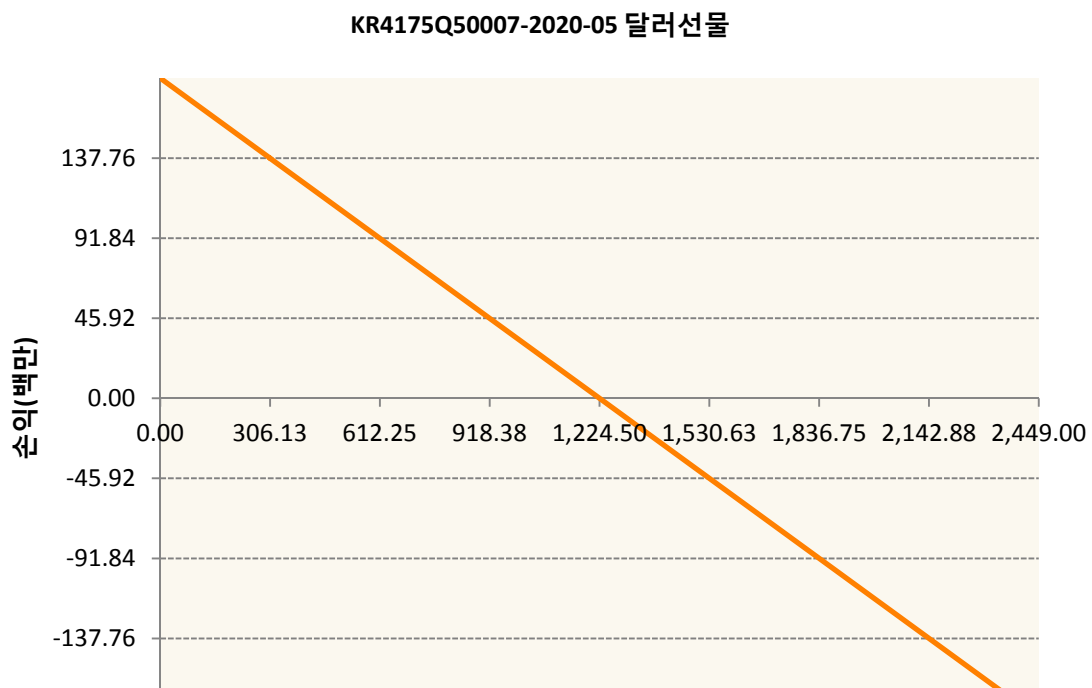
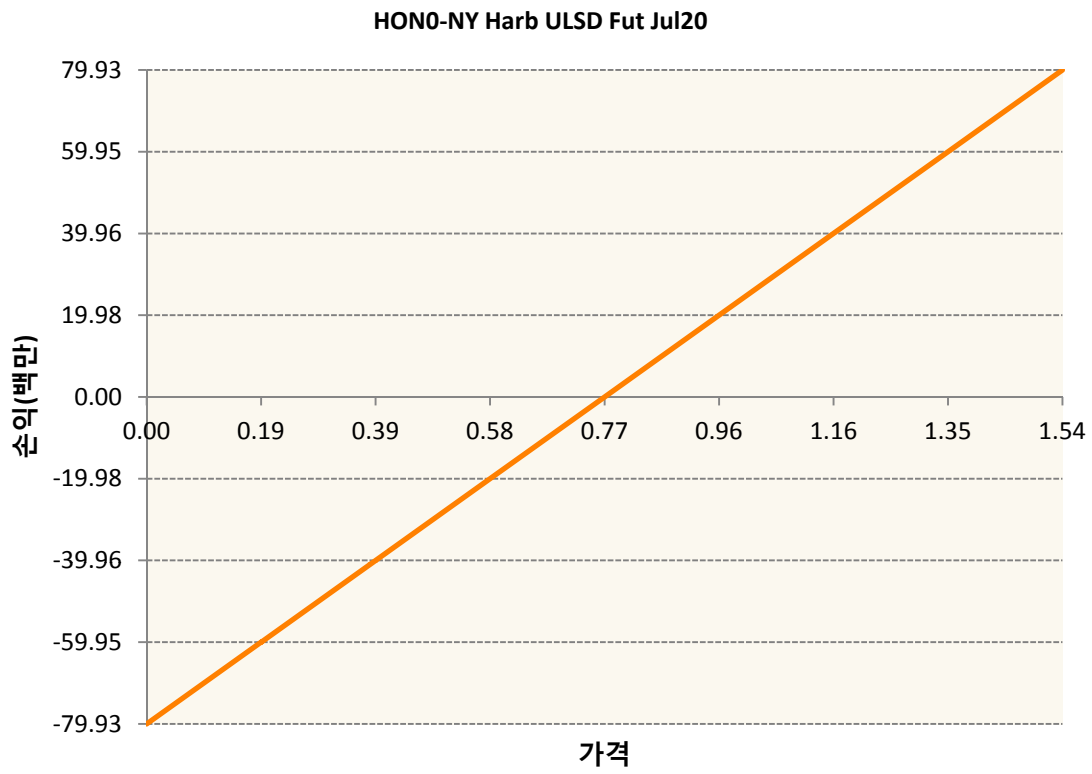
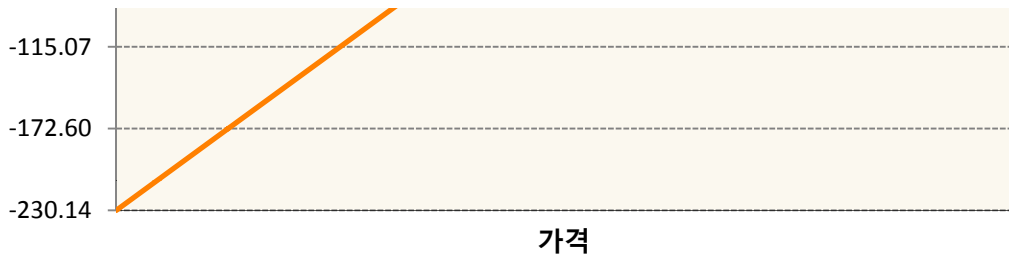
### 2. 만기시점의 손익구조

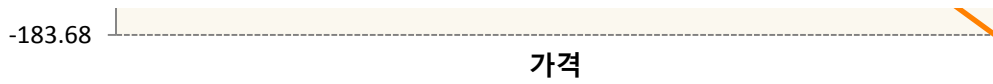
**CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20**



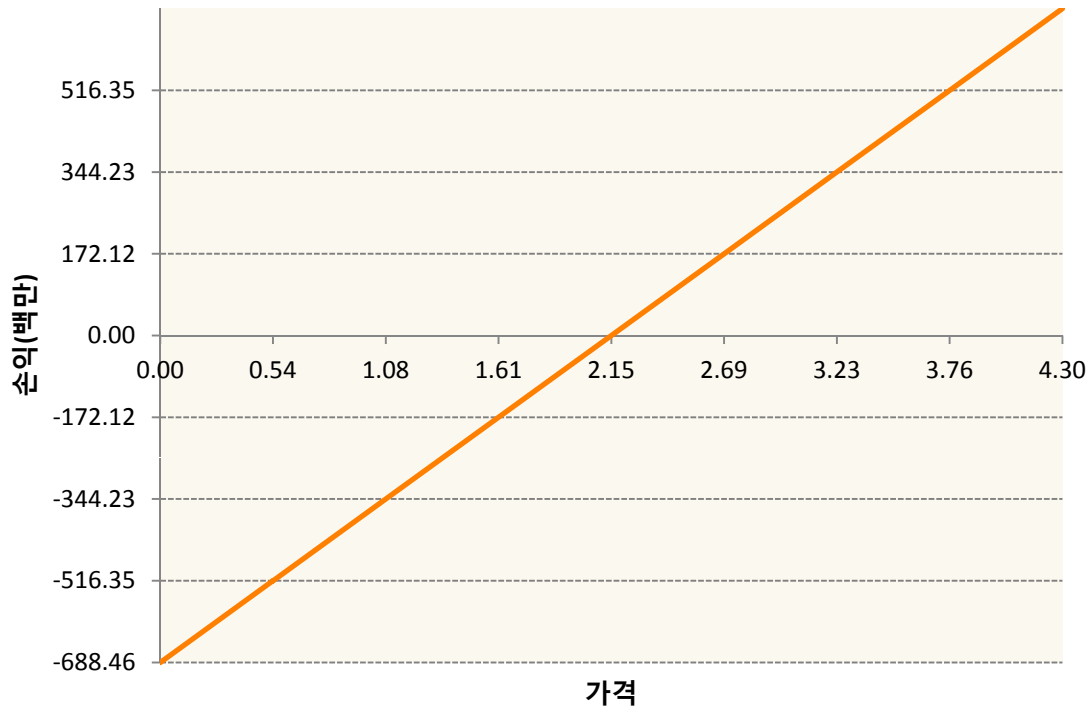
**CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20**



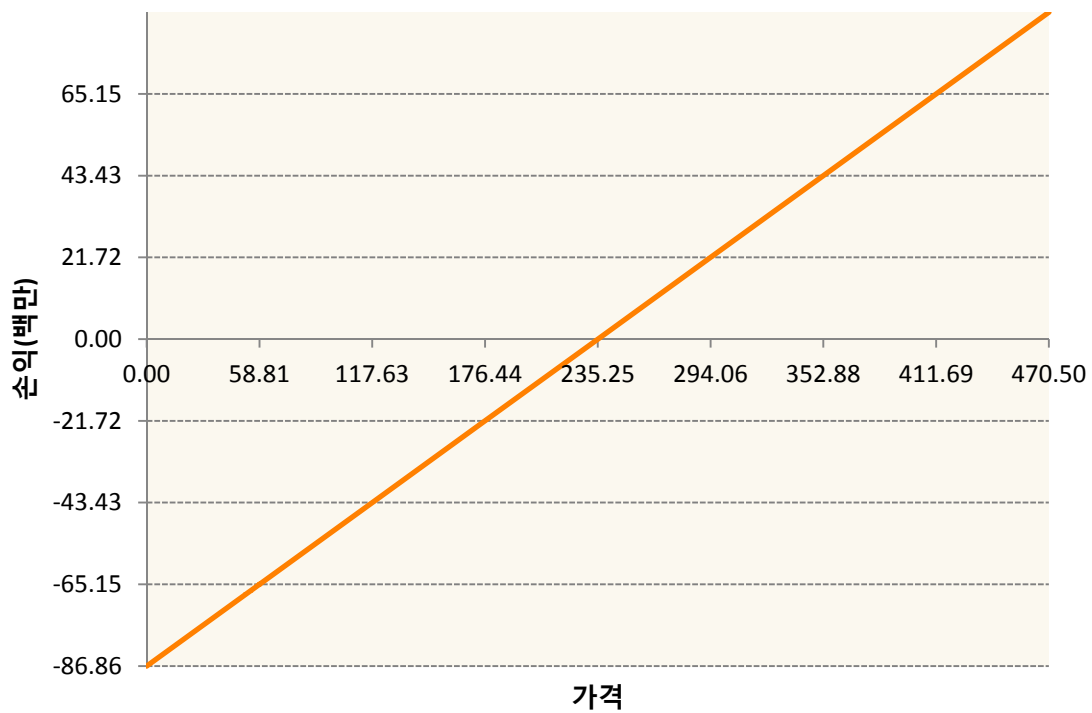




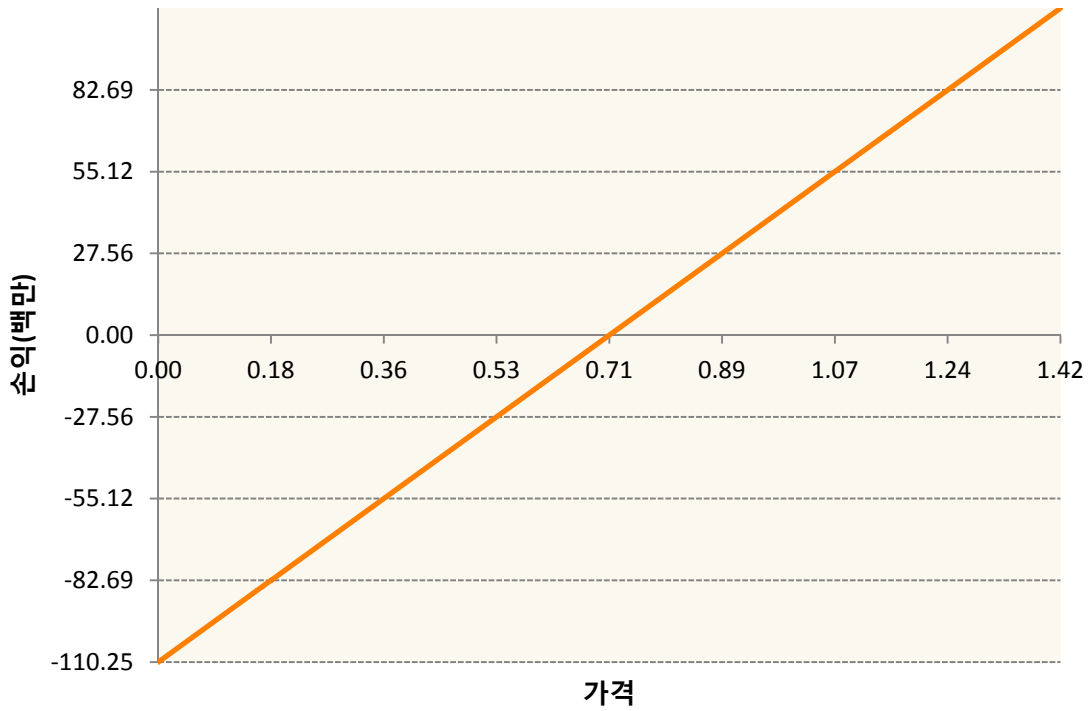
NGN20-NATURAL GAS FUTR Jul20



QSN0-Low Su Gasoil G Jul20



XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN0	WTI CRUDE FUTURE Jul20	11
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	18
HON0	NY Harb ULSD Fut Jul20	6
KR4175Q50C	2020-05 달러선물	15
NGN20	NATURAL GAS FUTR Jul20	55
QSN0	Low Su Gasoil G Jul20	7
XBN0	GASOLINE RBOB FUT Jul20	9

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

(단위:백만원)

459

공시일	2020-04-29
기준일	2020-04-28

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

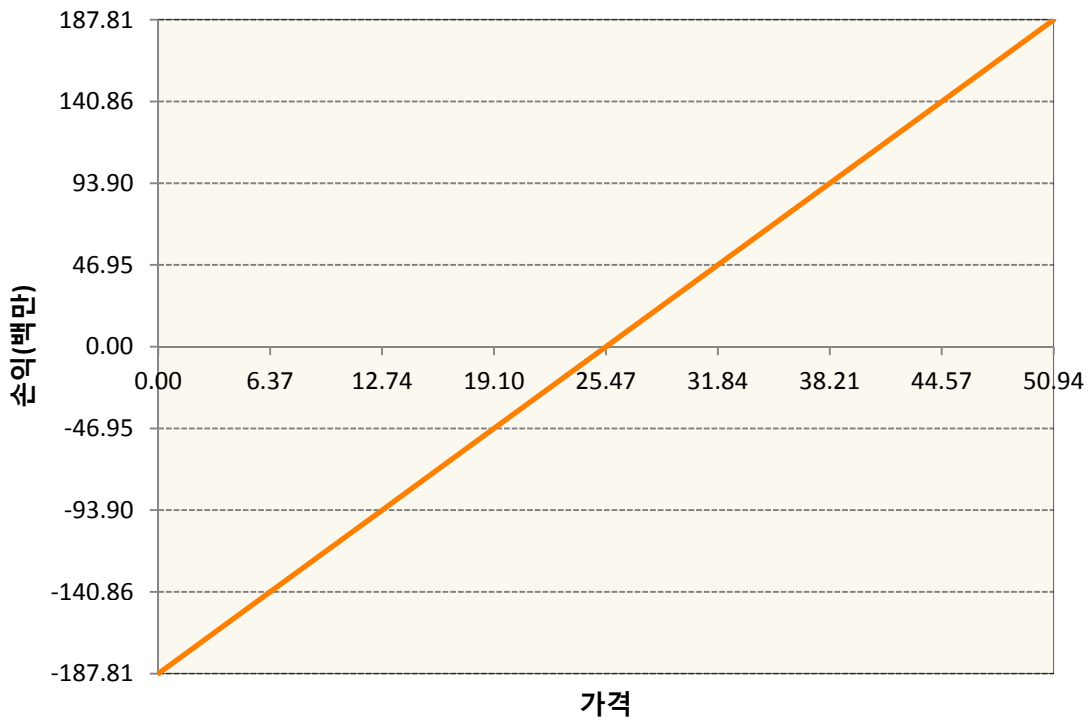
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

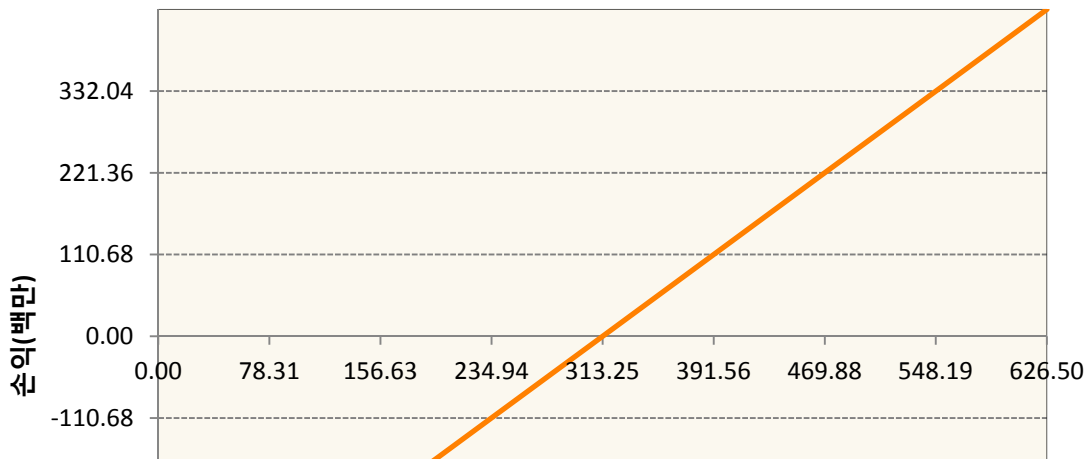
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,324	73	2,250	

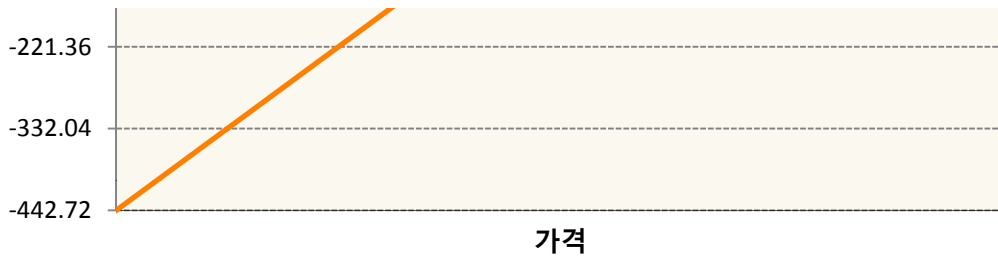
### 2. 만기시점의 손익구조

**BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20**

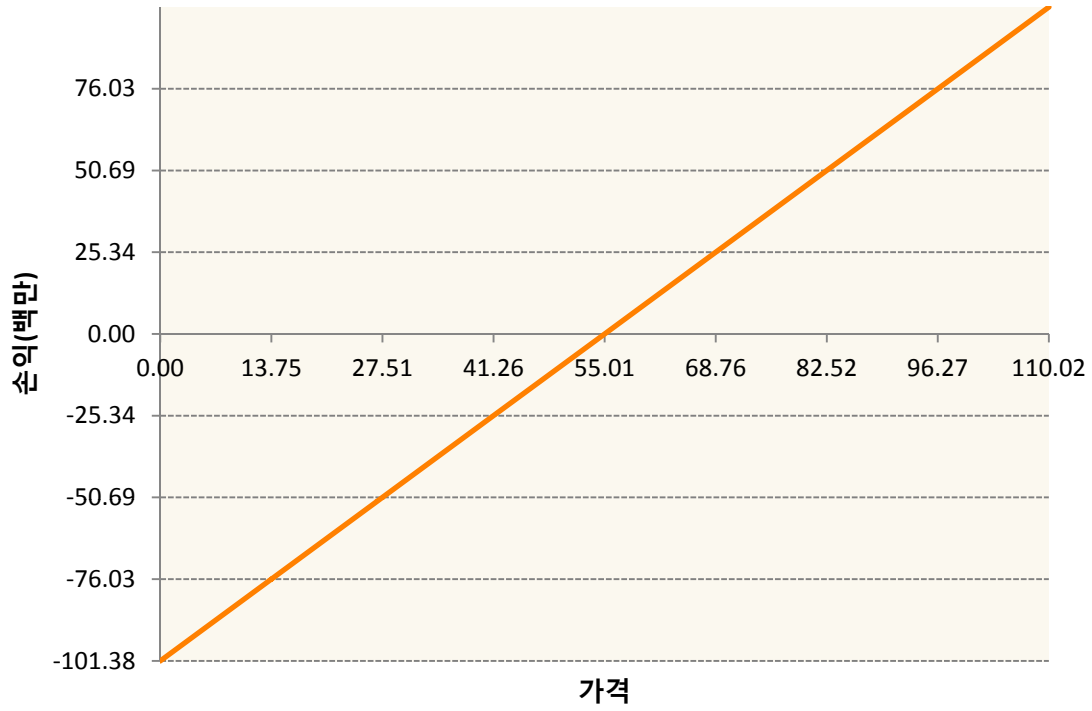


**CNO-CORN FUTURE Jul20**

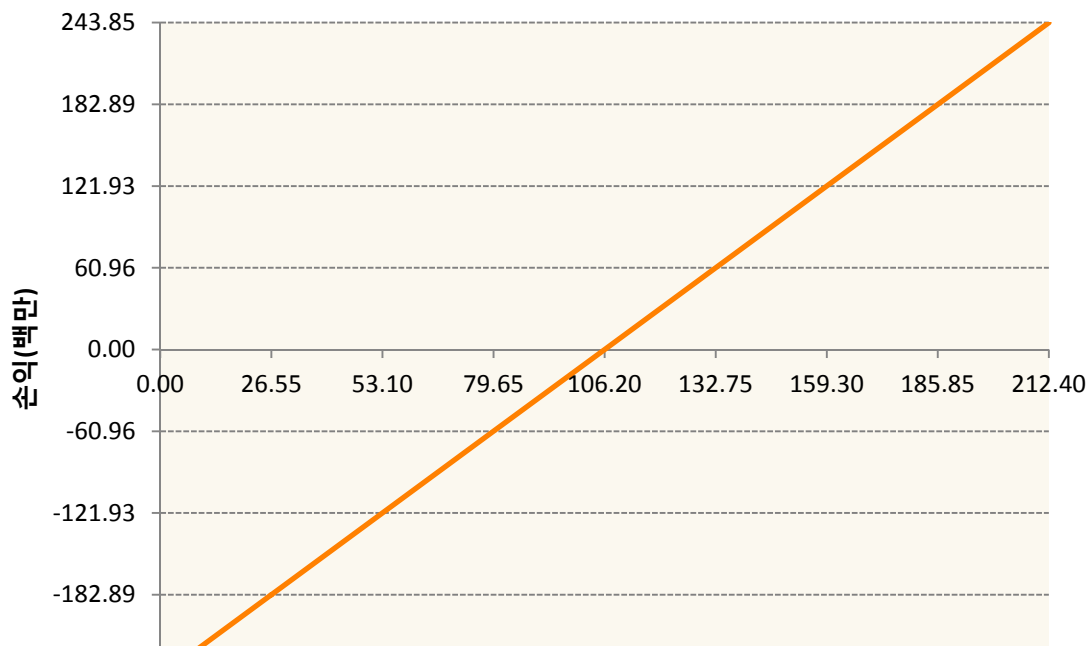


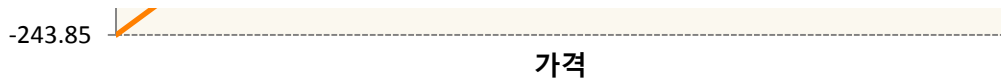


CTN0-COTTON NO.2 FUTR Jul20

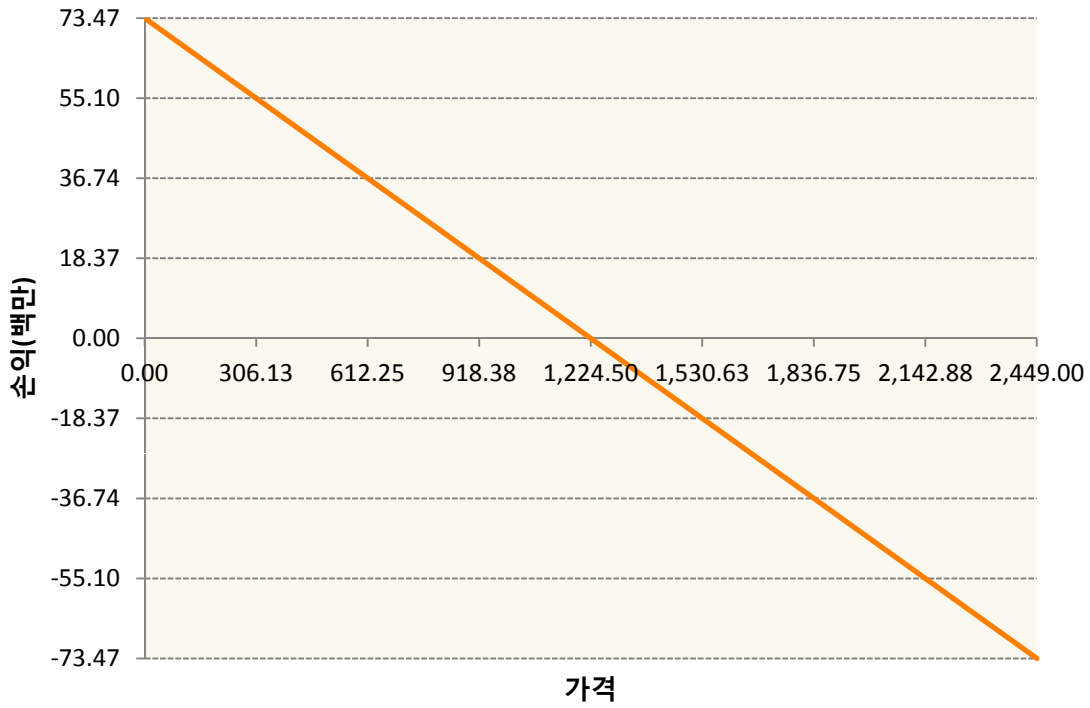


KCN0-COFFEE 'C' FUTURE Jul20

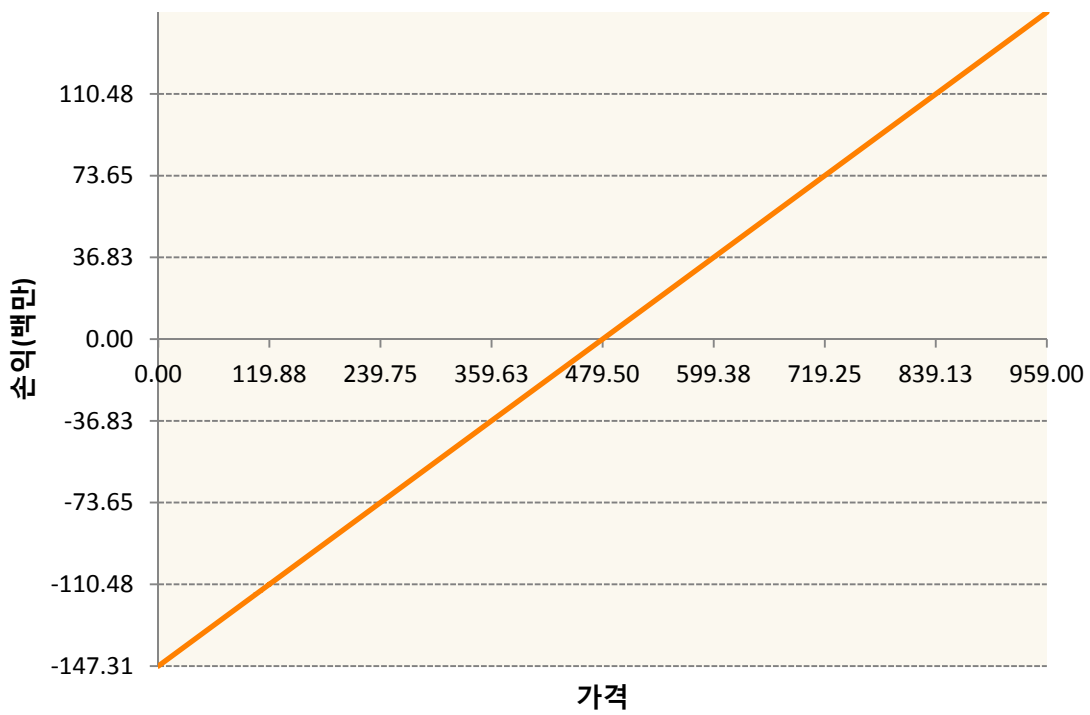




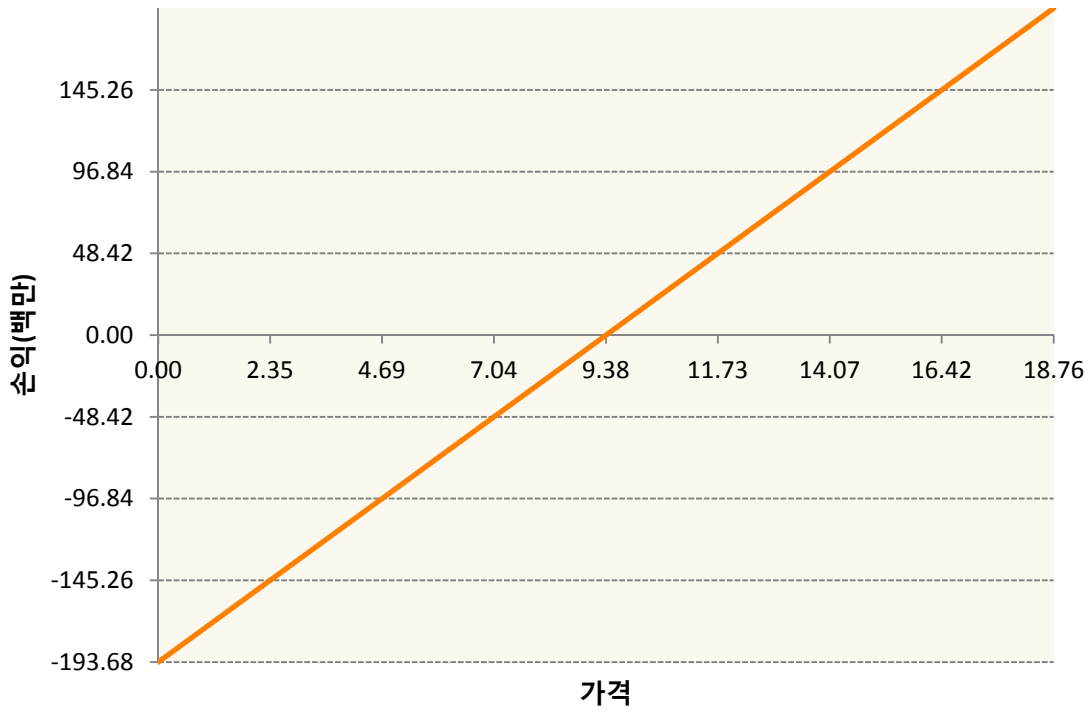
KR4175Q50007-2020-05 달러선물



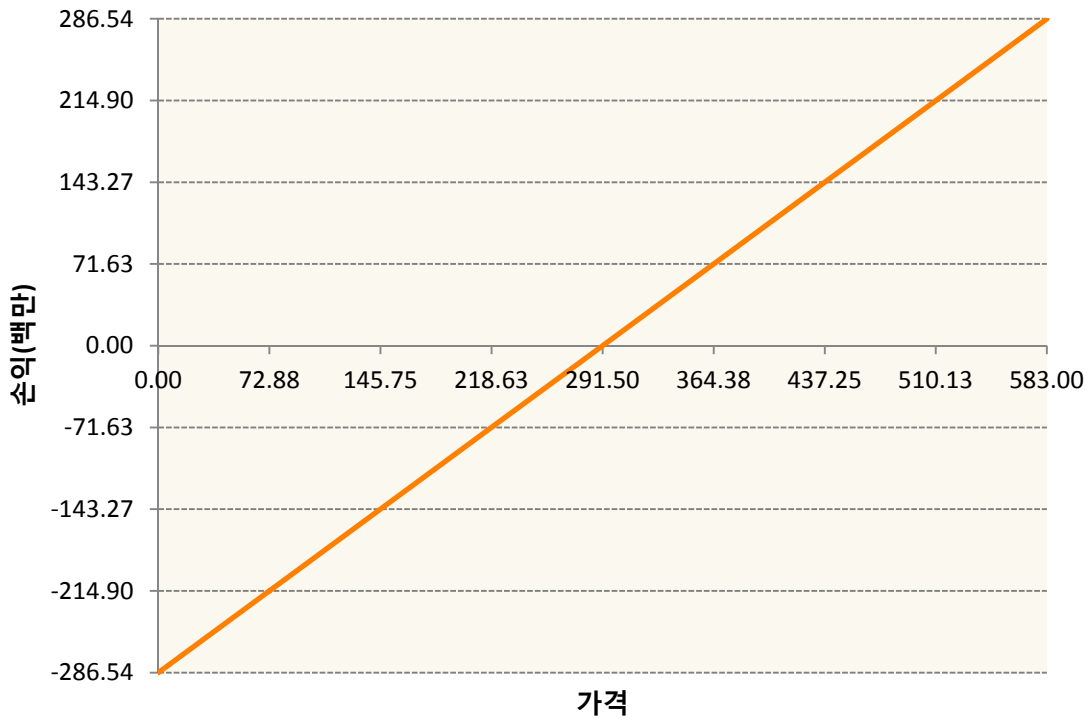
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



SBN0-Sugar Jul20

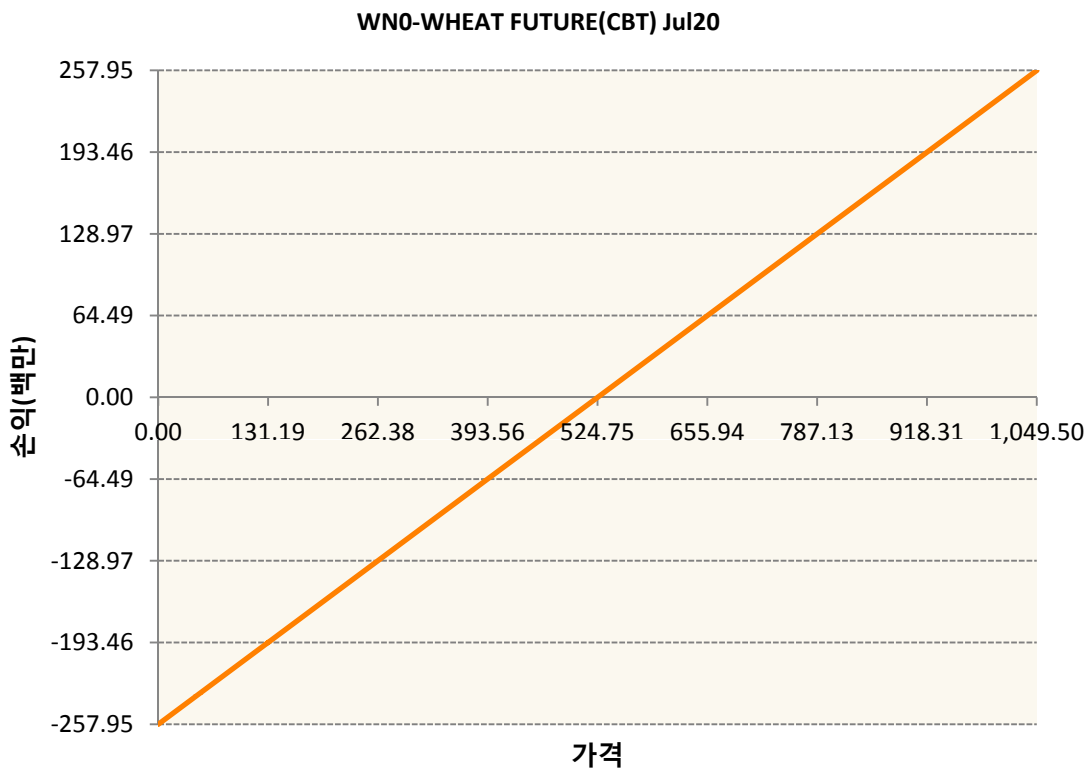
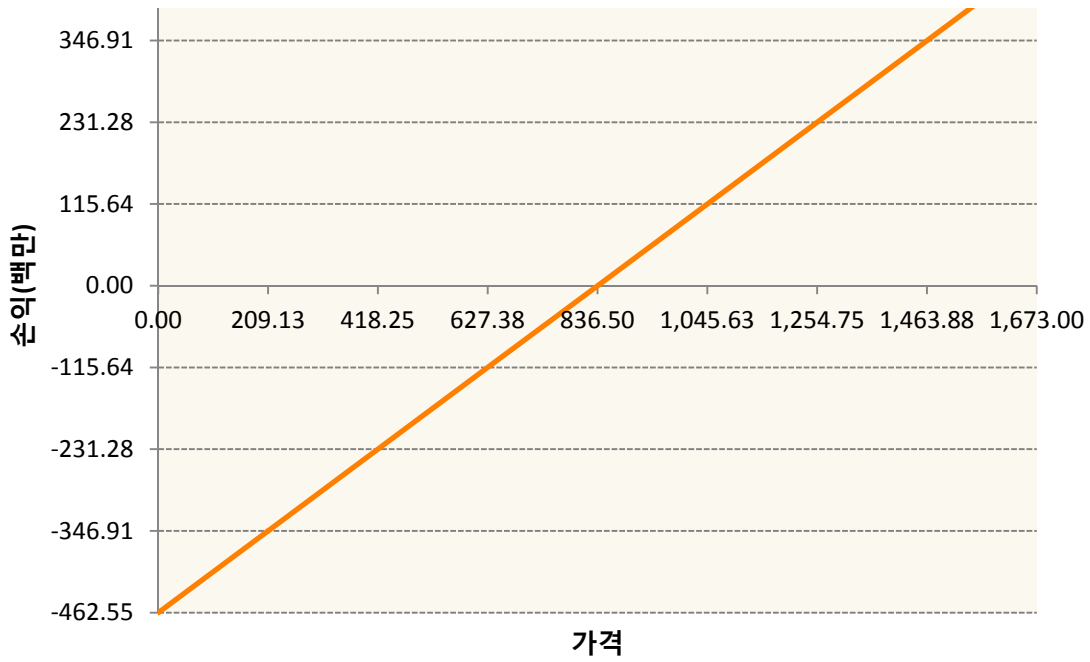


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20



SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON0	SOYBEAN OIL FUTR Jul20	15
CN0	CORN FUTURE Jul20	35
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	15
SMN0	SOYBEAN MEAL FUTR Jul20	23
SN0	SOYBEAN FUTURE Jul20	37
WN0	WHEAT FUTURE(CBT) Jul20	21

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

(단위:백만원)

**219**