

공시일	2020-05-04
기준일	2020-04-29

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

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

(단위:백만원)

108

공시일	2020-05-04
기준일	2020-04-29

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

976

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,141

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-04
기준일	2020-04-29

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)

850

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-04
기준일	2020-04-29

유로인덱스모(주식-파생형)

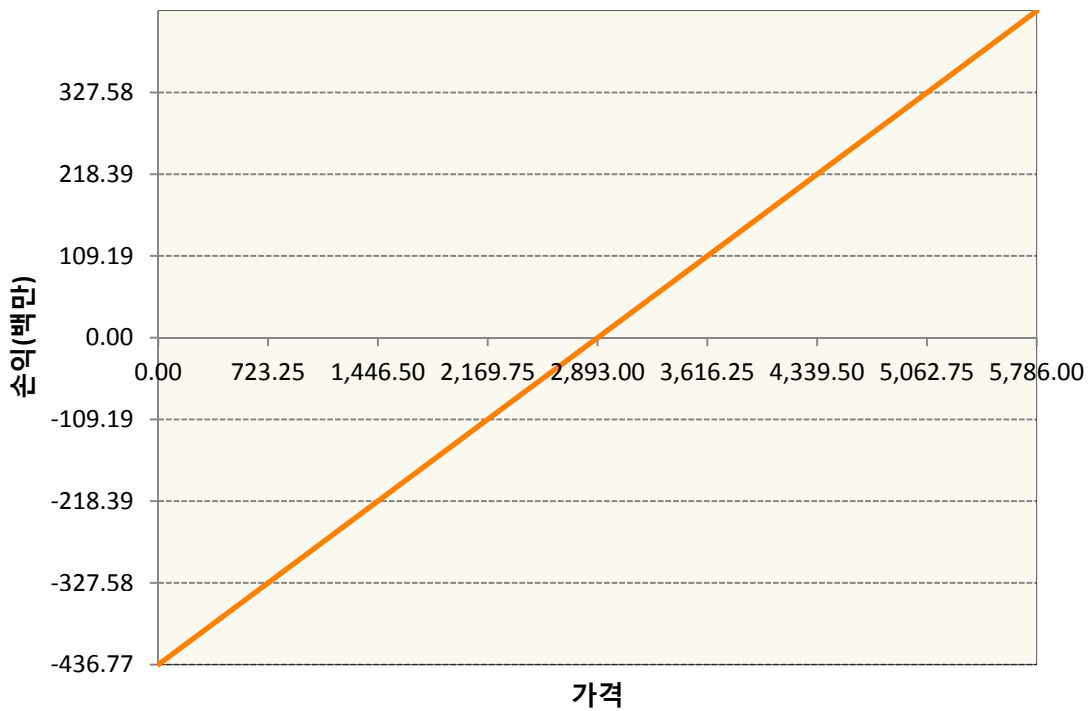
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	437	0	437	

2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	35
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

44

공시일	2020-05-04
기준일	2020-04-29

차이나인덱스모(주식-파생형)

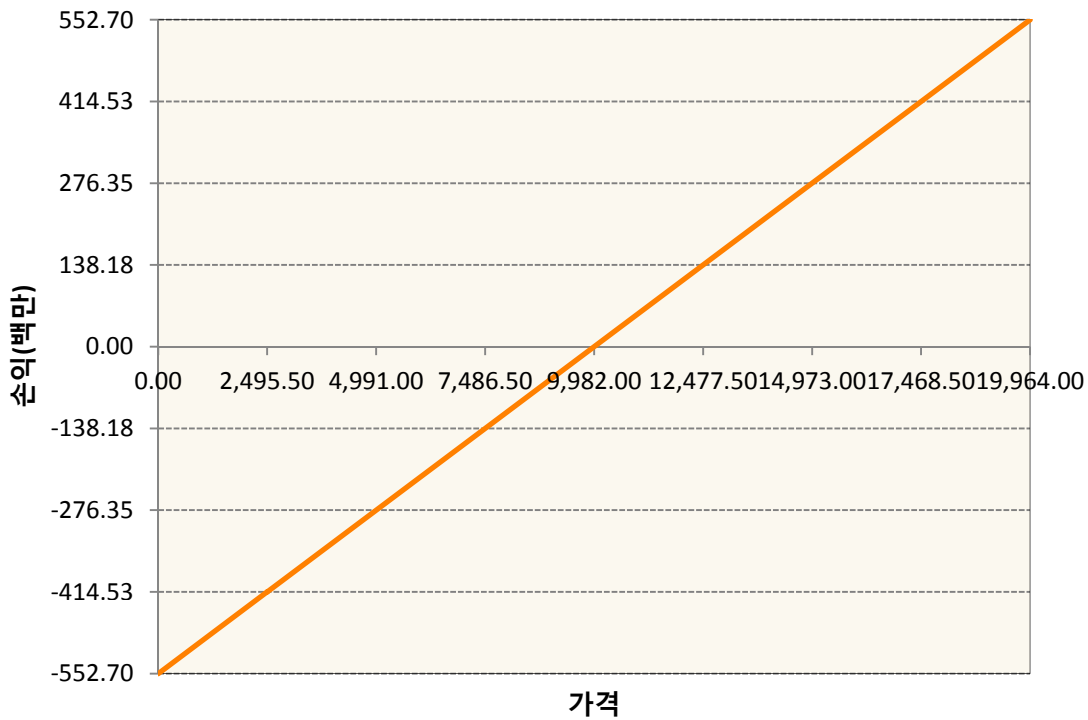
1. 계약금액

(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	2020-05-04
기준일	2020-04-29

커버드콜모(주식혼합-파생형)

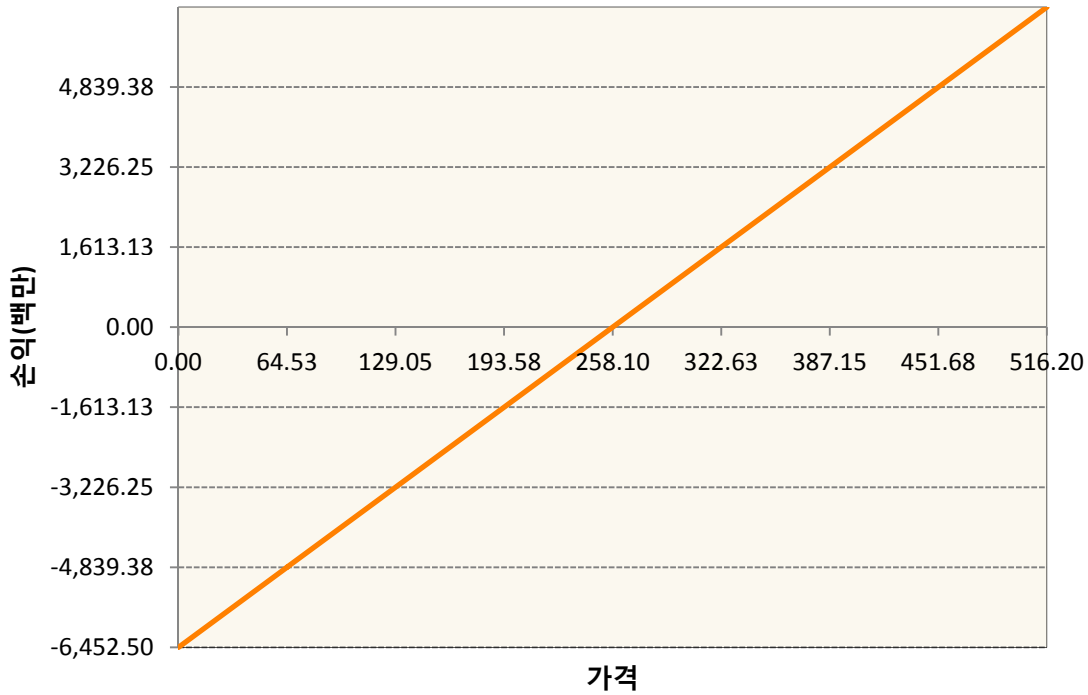
1. 계약금액

(단위:백만원)

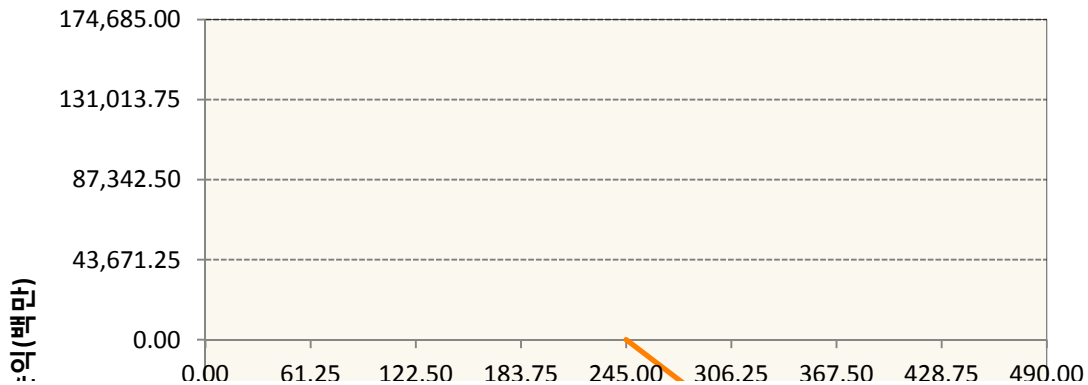
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	3,037	0	3,037	장내
누계	유가증권	선물	6,453	0	6,453	장내
누계	유가증권	옵션	0	351,608	-351,608	장내

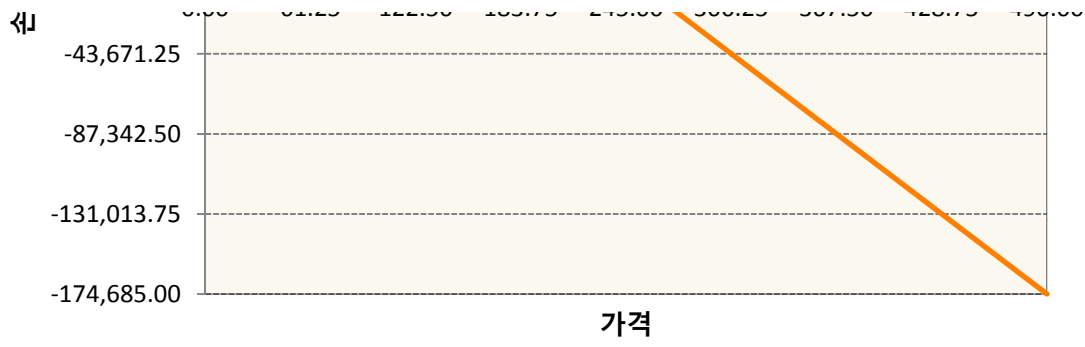
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

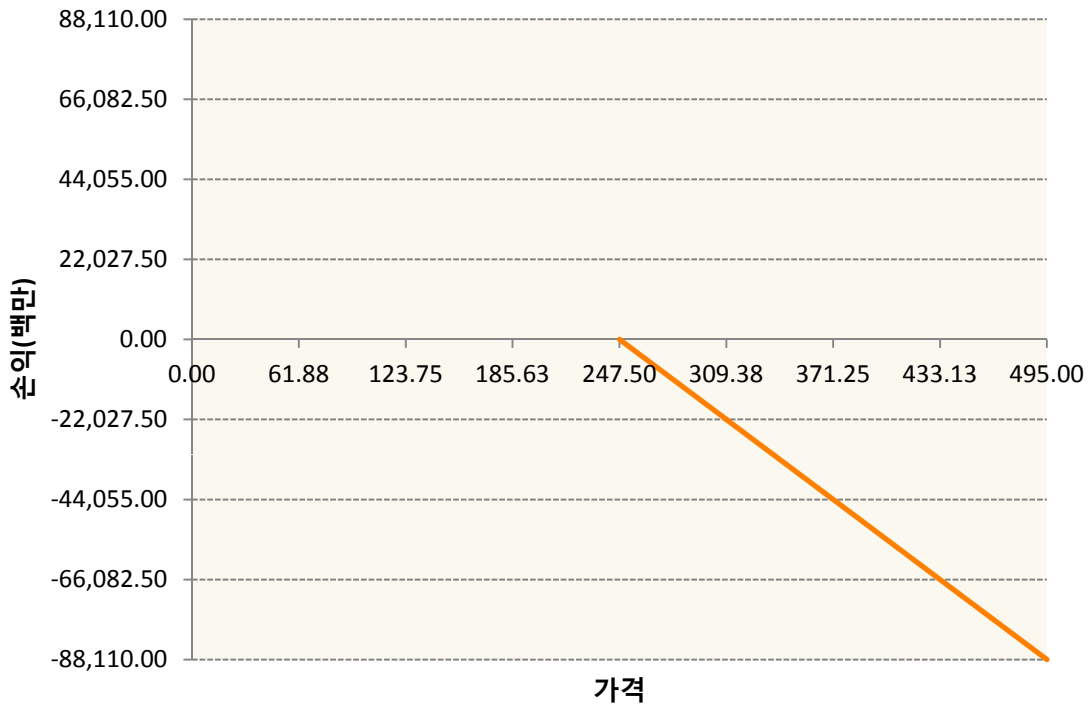


KR4201Q52452-2020-05 콜245

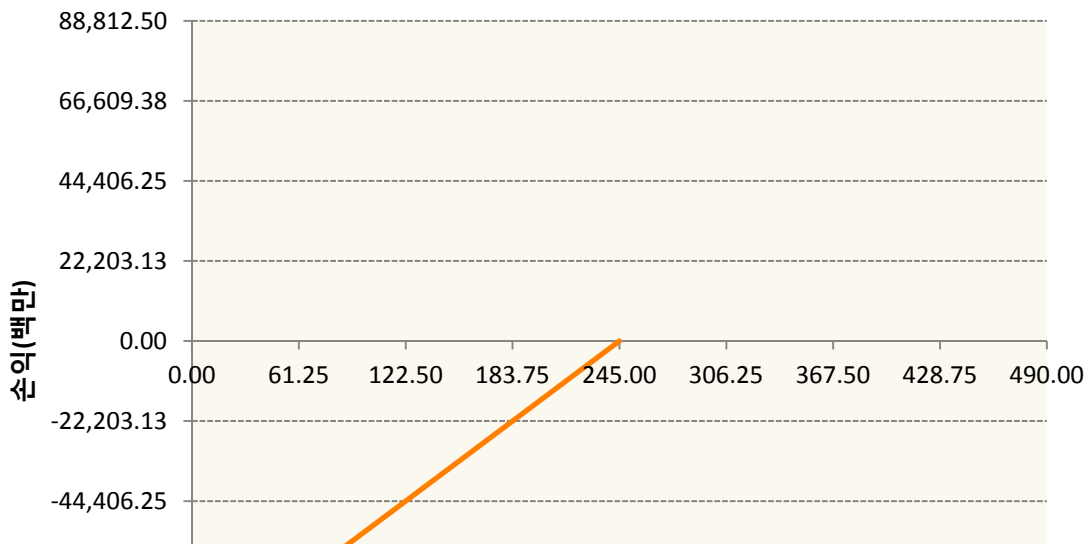


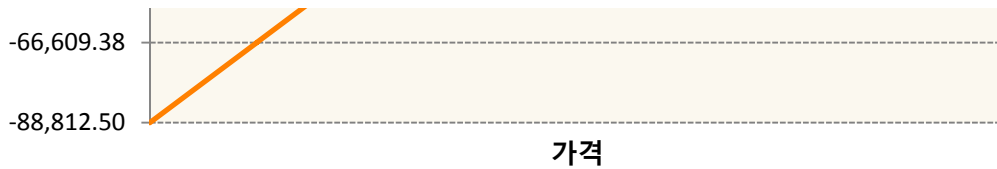


KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						516
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-516	-516	-516	-516	-516	-516	-516	
-5.33%	-344	-344	-344	-344	-344	-344	-344	
-2.67%	-172	-172	-172	-172	-172	-172	-172	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	172	172	172	172	172	172	172	
5.33%	344	344	344	344	344	344	344	
8.00%	516	516	516	516	516	516	516	
KR4201Q52452		2020-05 콜245						13,152
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	9,747	9,259	8,763	8,260	7,753	7,242	6,728	
-5.33%	7,703	7,161	6,619	6,077	5,535	4,992	4,450	
-2.67%	4,886	4,365	3,839	3,309	2,777	2,242	1,705	
0%	1,367	929	472	0	-484	-979	-1,481	
2.67%	-2,702	-3,027	-3,386	-3,773	-4,184	-4,613	-5,058	
5.33%	-7,149	-7,364	-7,622	-7,915	-8,241	-8,593	-8,969	
8.00%	-11,825	-11,954	-12,123	-12,330	-12,573	-12,848	-13,152	
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5						6,418
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4,524	4,295	4,059	3,819	3,574	3,326	3,075	
-5.33%	3,638	3,370	3,101	2,832	2,562	2,292	2,022	
-2.67%	2,370	2,099	1,828	1,555	1,282	1,009	735	
0%	737	498	251	0	-256	-514	-776	
2.67%	-1,200	-1,386	-1,588	-1,801	-2,023	-2,253	-2,490	
5.33%	-3,356	-3,485	-3,635	-3,802	-3,983	-4,177	-4,381	
8.00%	-5,652	-5,733	-5,835	-5,957	-6,096	-6,250	-6,418	
KR4301Q52450		2020-05 풋245						3,703
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,717	-2,871	-3,030	-3,194	-3,361	-3,531	-3,703	
-5.33%	-1,148	-1,337	-1,526	-1,716	-1,905	-2,095	-2,284	
-2.67%	-143	-314	-488	-666	-845	-1,027	-1,210	

0%	381	265	137	0	-145	-296	-452
2.67%	601	540	464	376	275	165	46
5.33%	675	650	613	564	504	432	350
8.00%	695	687	672	649	617	575	523

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

(단위:백만원)

22,504

공시일	2020-05-04
기준일	2020-04-29

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

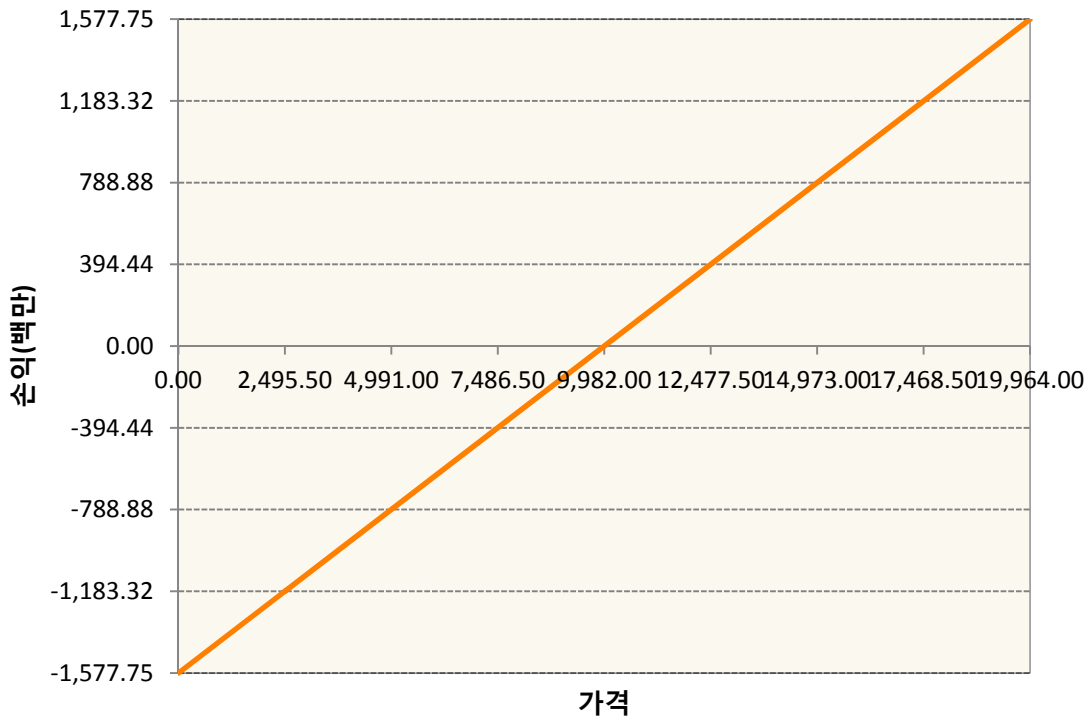
1. 계약금액

(단위:백만원)

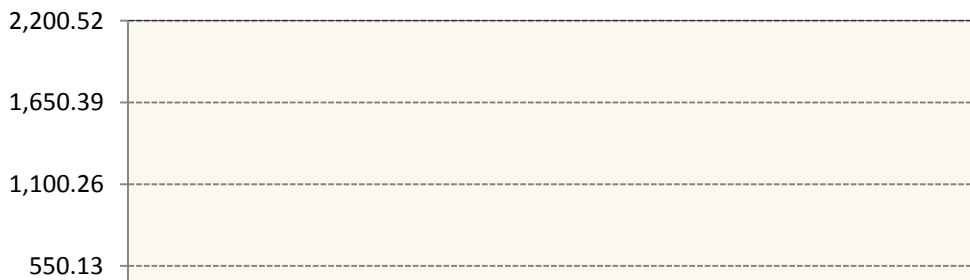
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,578	0	1,578	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,401	-4,401	장내
누계	통화	선도	692	2,213	-1,522	장외

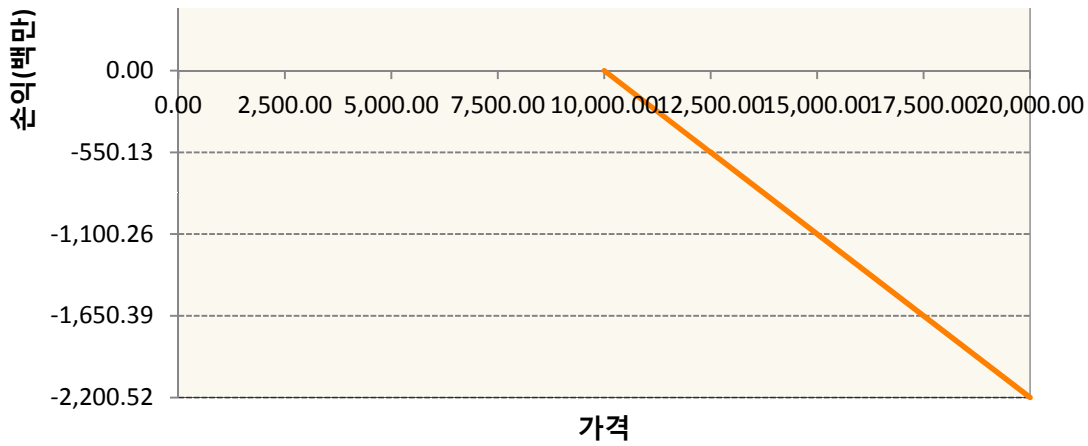
2. 만기시점의 손익구조

HCK0-HSCEI Futures May20

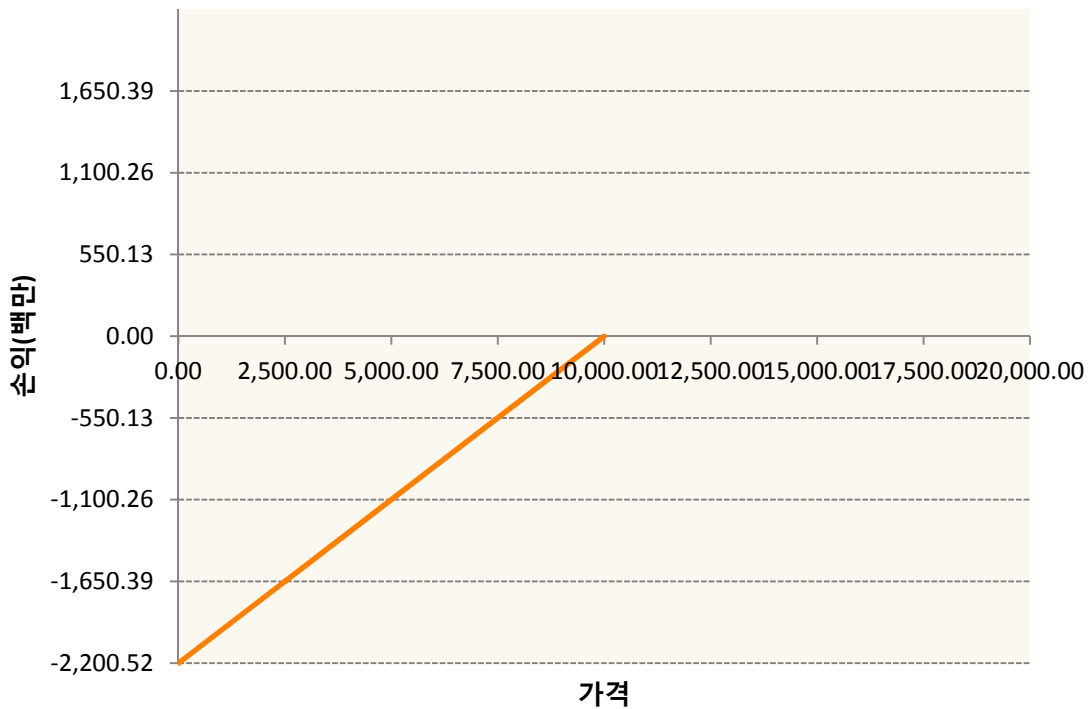


OHHIK0-C100-HSCEI





OHHIK0-P100-HSCEI



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E		177
FX21020H05 HKD/KRW 22-05-20E		55
HCK0 HSCEI Futures May20		126
OHHIK0-C1C HSCEI		176
OHHIK0-P10 HSCEI		176

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		623

공시일	2020-05-04
기준일	2020-04-29

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

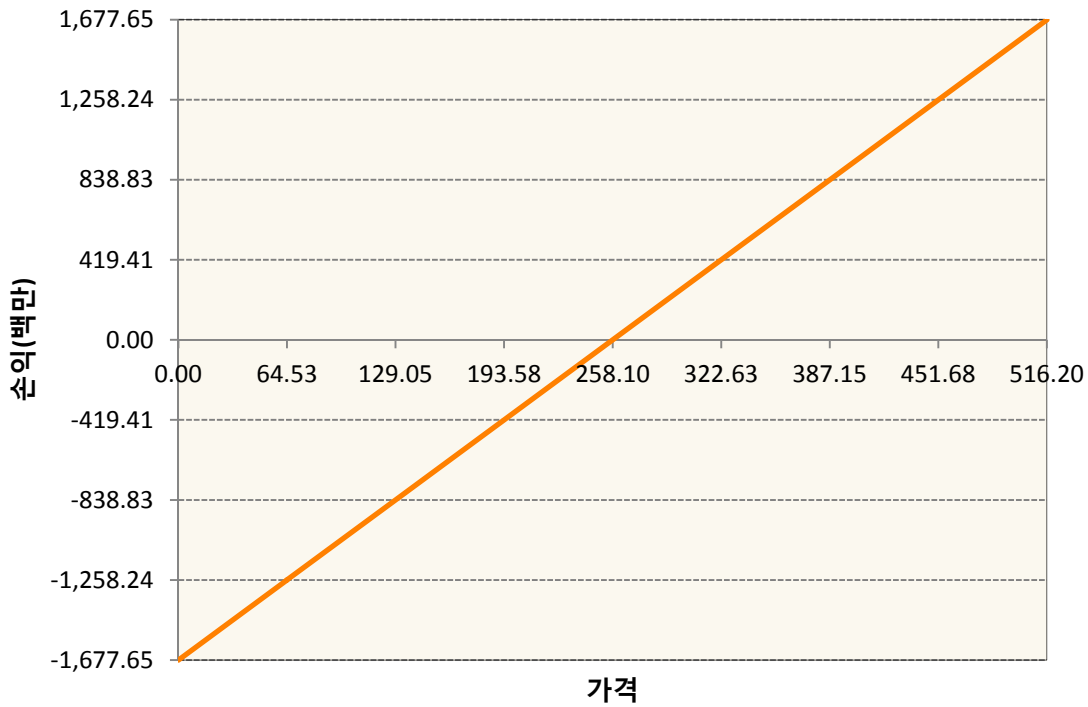
1. 계약금액

(단위:백만원)

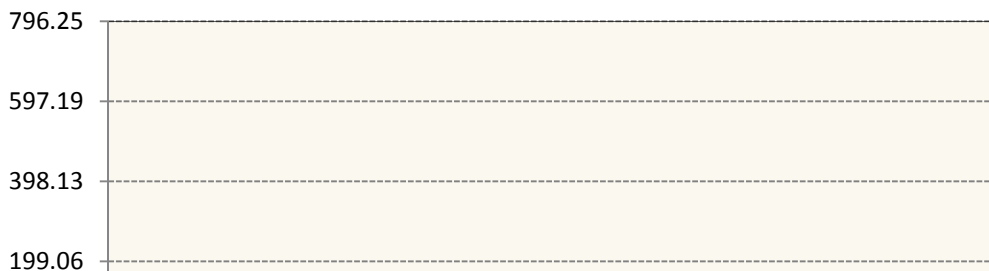
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,678	0	1,678	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,193	-3,193	장내

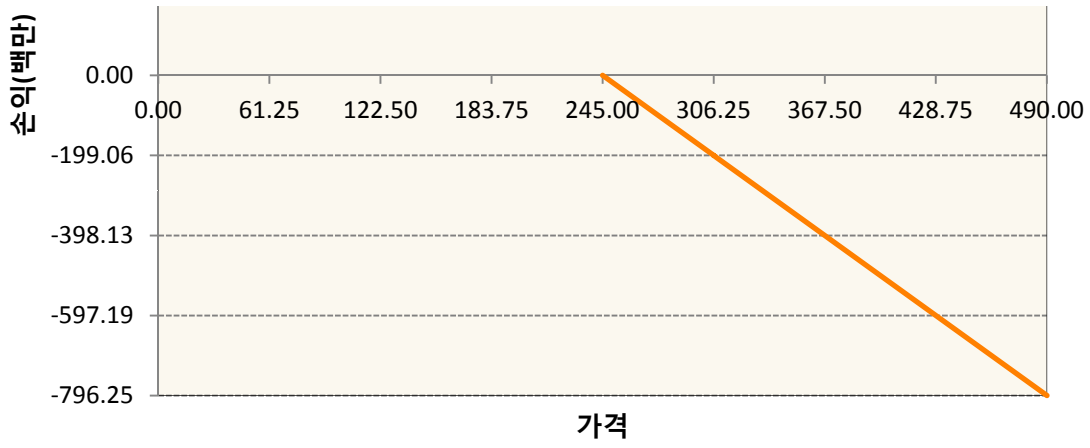
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

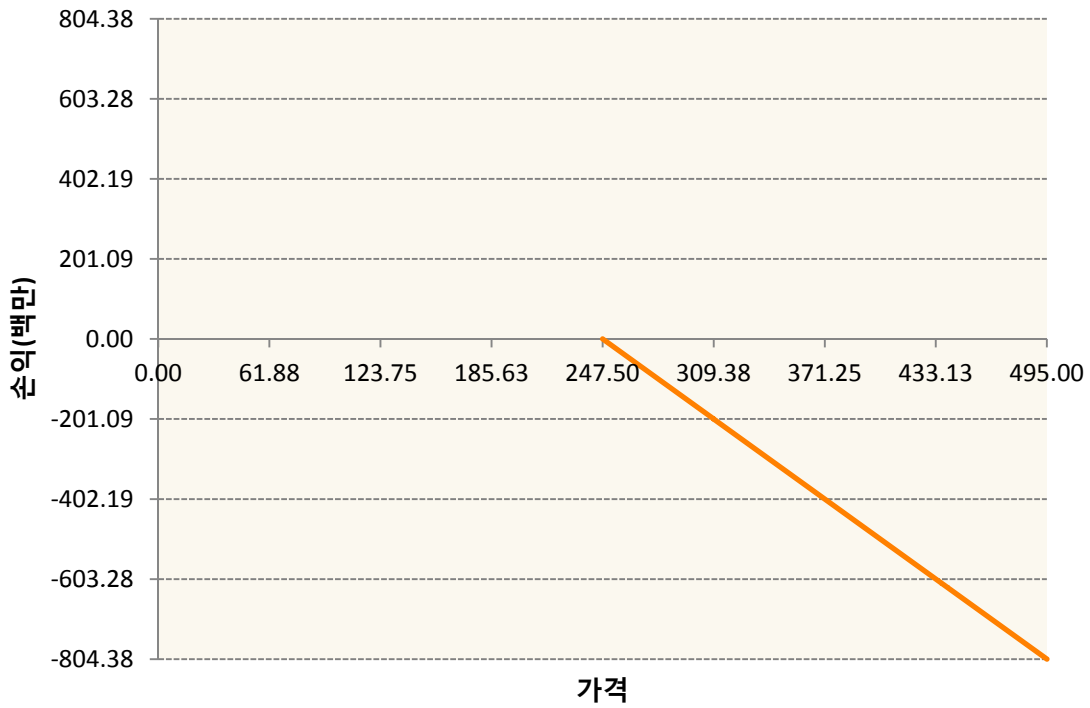


KR4201Q52452-2020-05 콜245

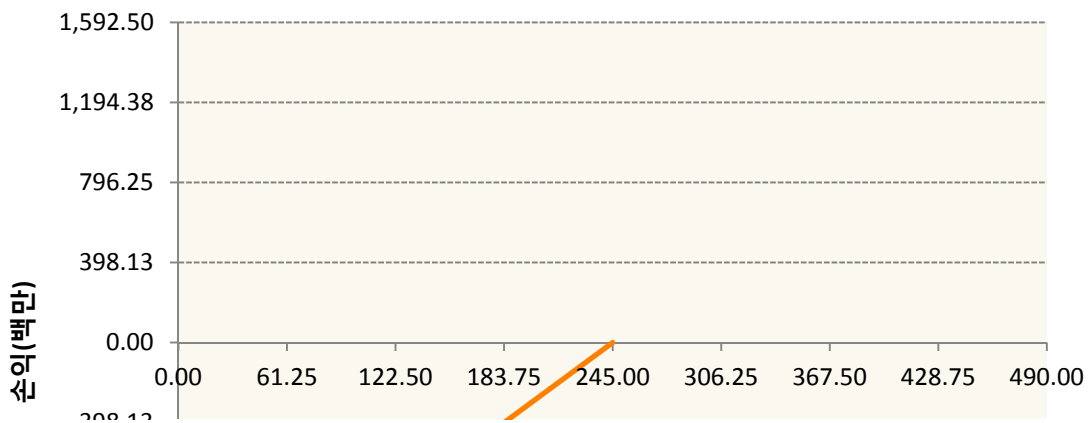




KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						187
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-187	-187	-187	-187	-187	-187	-187	
-5.33%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125	
-2.67%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	62	62	62	62	62	62	62	
5.33%	125	125	125	125	125	125	125	
8.00%	187	187	187	187	187	187	187	
KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						134
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-134	-134	-134	-134	-134	-134	-134	
-5.33%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89	
-2.67%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	45	45	45	45	45	45	45	
5.33%	89	89	89	89	89	89	89	
8.00%	134	134	134	134	134	134	134	
KR4201Q52452		2020-05 콜245						60
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	44	42	40	38	35	33	31	
-5.33%	35	33	30	28	25	23	20	
-2.67%	22	20	17	15	13	10	8	
0%	6	4	2	0	-2	-4	-7	
2.67%	-12	-14	-15	-17	-19	-21	-23	
5.33%	-33	-34	-35	-36	-38	-39	-41	
8.00%	-54	-54	-55	-56	-57	-59	-60	
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5						59
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	41	39	37	35	33	30	28
-5.33%	33	31	28	26	23	21	18
-2.67%	22	19	17	14	12	9	7
0%	7	5	2	0	-2	-5	-7
2.67%	-11	-13	-14	-16	-18	-21	-23
5.33%	-31	-32	-33	-35	-36	-38	-40
8.00%	-52	-52	-53	-54	-56	-57	-59
KR4301Q52450 2020-05 풋245							66
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-49	-51	-54	-57	-60	-63	-66
-5.33%	-21	-24	-27	-31	-34	-38	-41
-2.67%	-3	-6	-9	-12	-15	-18	-22
0%	7	5	2	0	-3	-5	-8
2.67%	11	10	8	7	5	3	1
5.33%	12	12	11	10	9	8	6
8.00%	12	12	12	12	11	10	9

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

(단위:백만원)

552

공시일	2020-05-04
기준일	2020-04-29

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

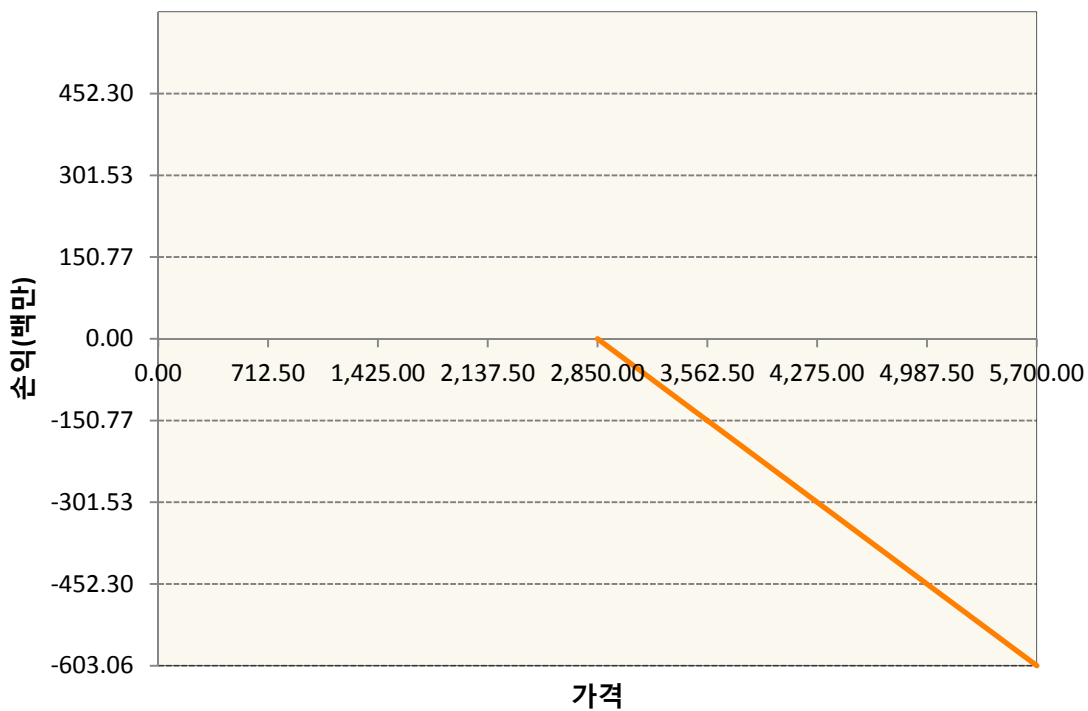
1. 계약금액

(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	468	0	468	
누계	유가증권	스왑	7,888	0	7,888	장외
누계	유가증권	옵션	0	5,425	-5,425	장내
누계	통화	선도	0	2,677	-2,677	장외

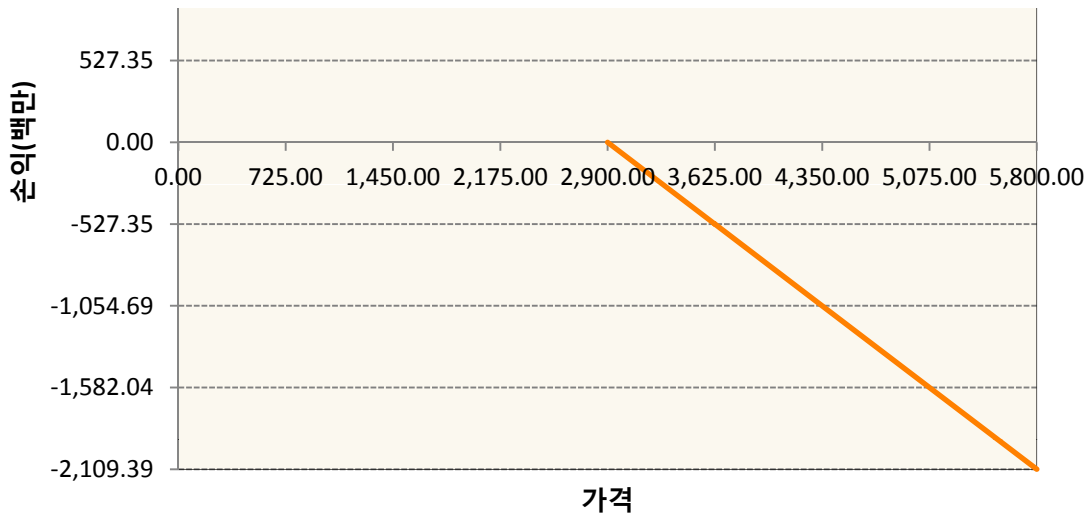
2. 만기시점의 손익구조

OESXK0-C2850-EURO STOXX 50

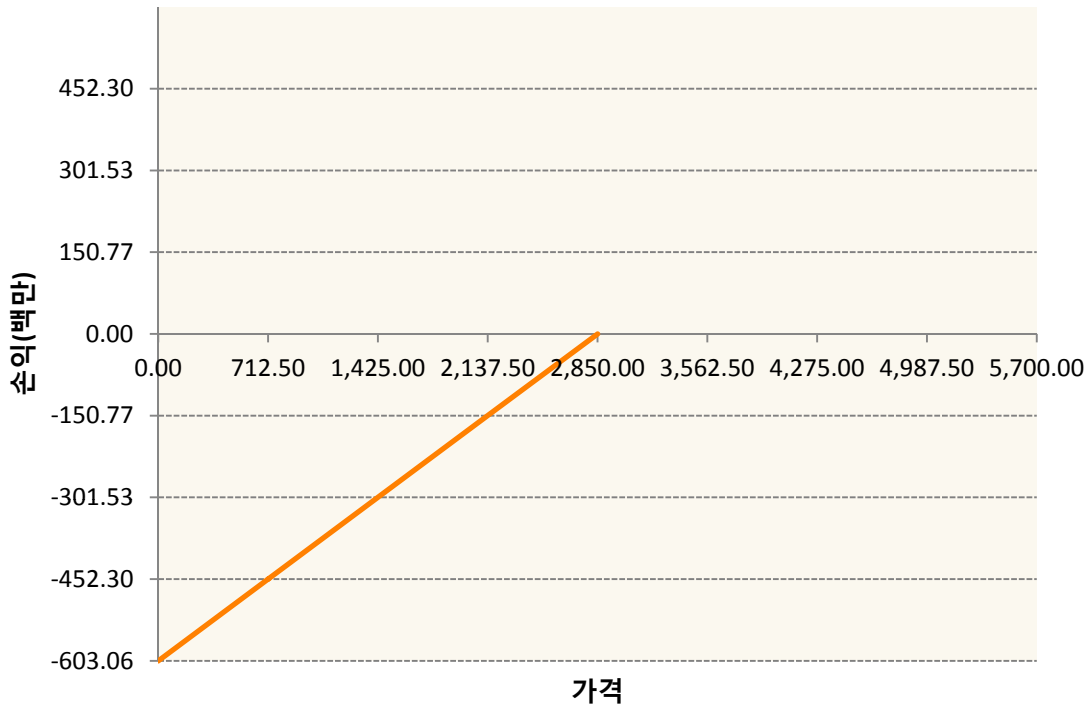


OESXK0-C2900-EURO STOXX 50

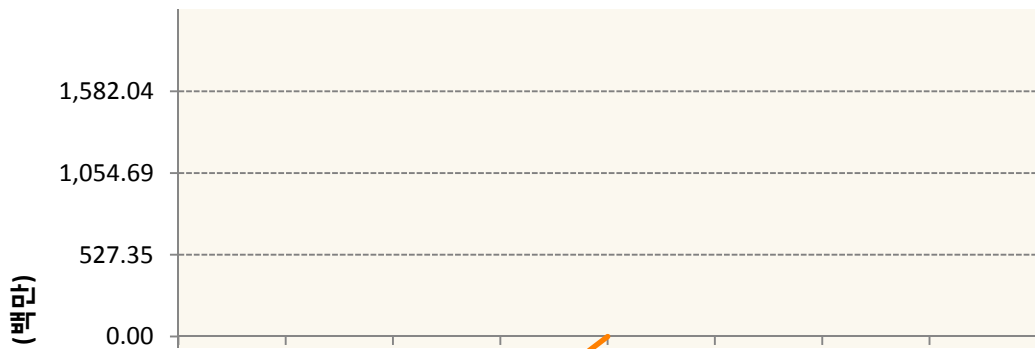


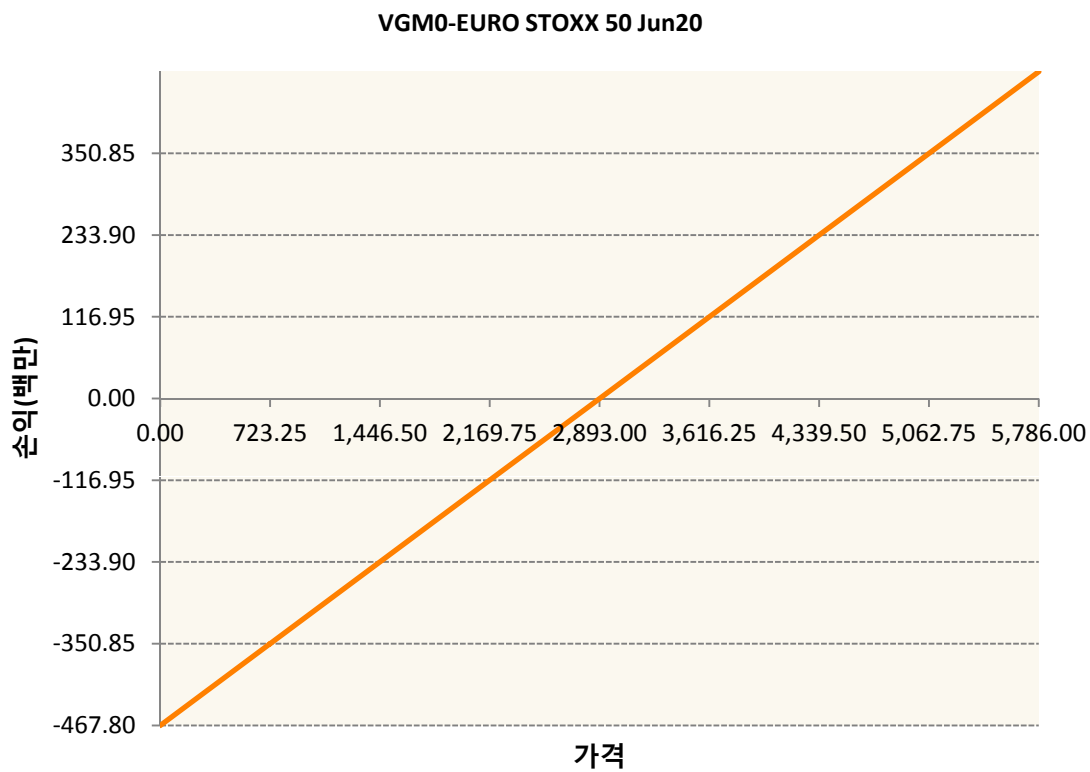
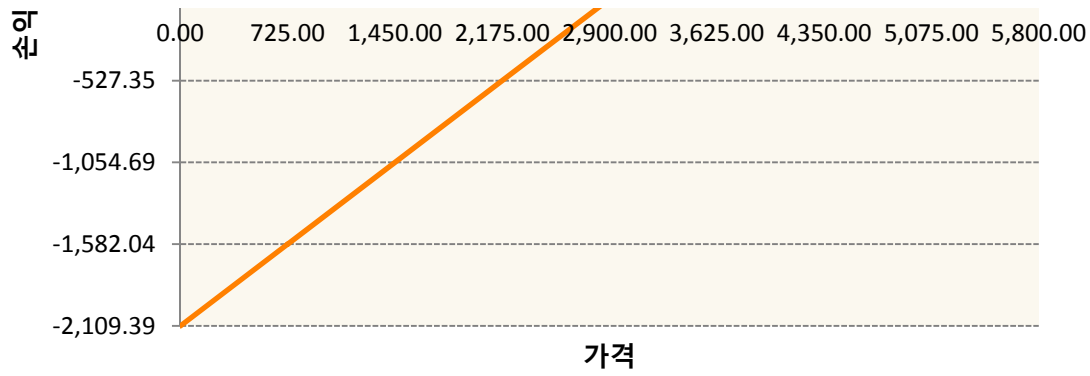


OESXK0-P2850-EURO STOXX 50



OESXK0-P2900-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		14
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E		214
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)

1,150

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

(단위:백만원)

100

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

(단위:백만원)

146

공시일	2020-05-04
기준일	2020-04-29

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

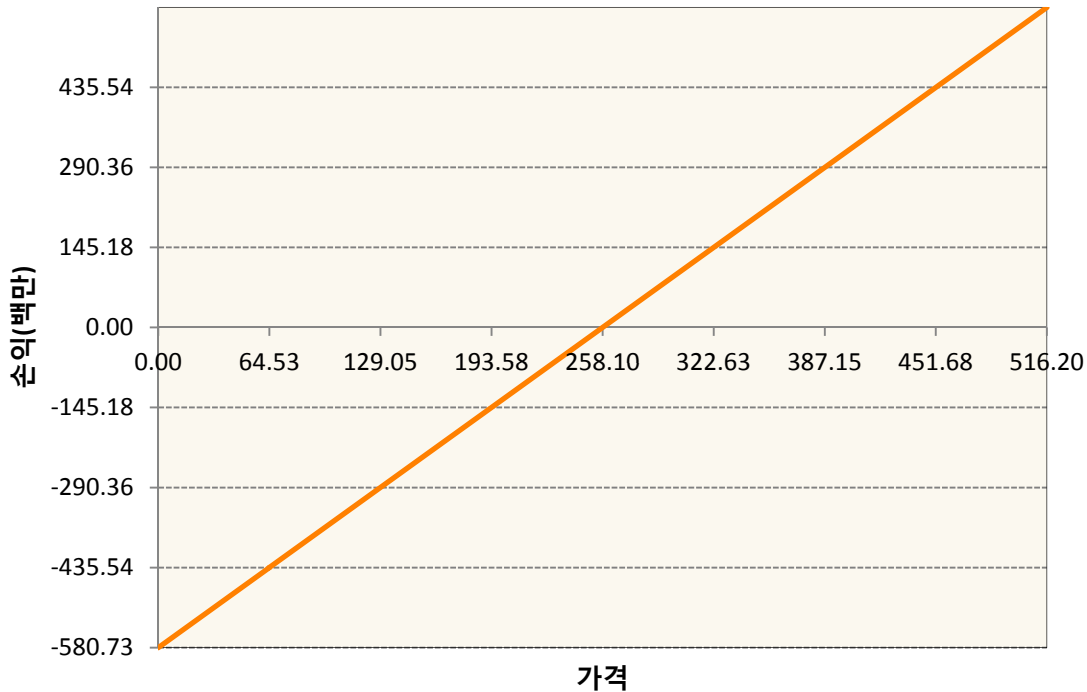
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	581	0	581	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	2020-05-04
기준일	2020-04-29

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

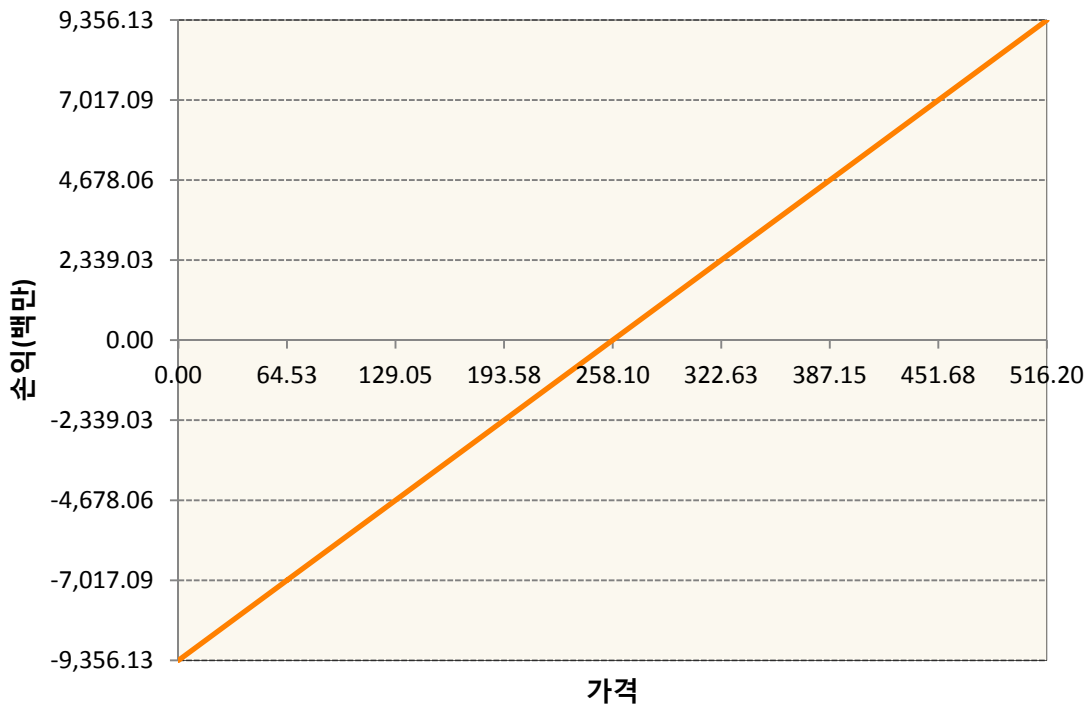
1. 계약금액

(단위:백만원)

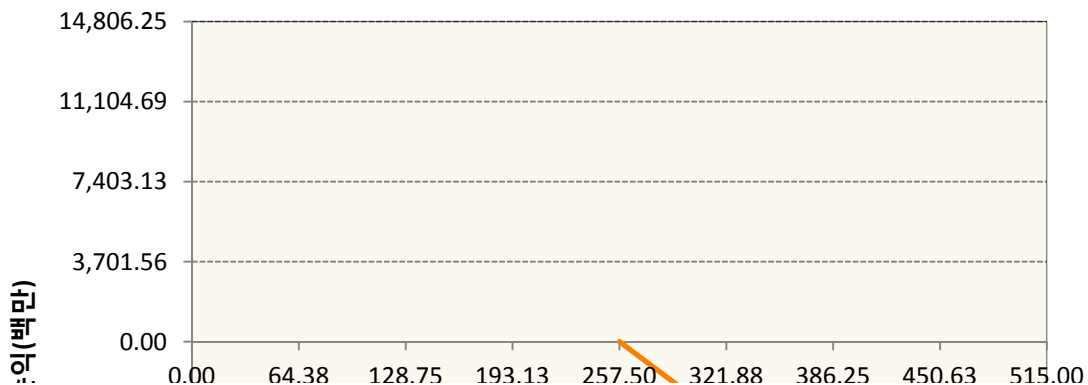
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,356	0	9,356	장내
누계	유가증권	옵션	6,201	17,536	-11,335	장내

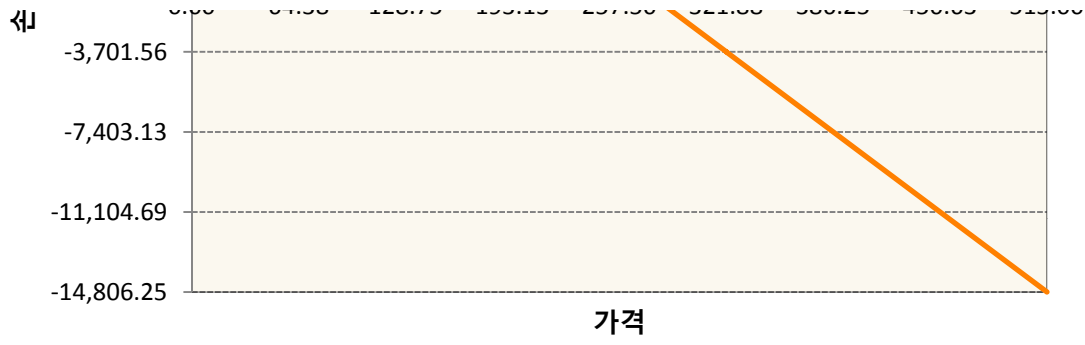
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

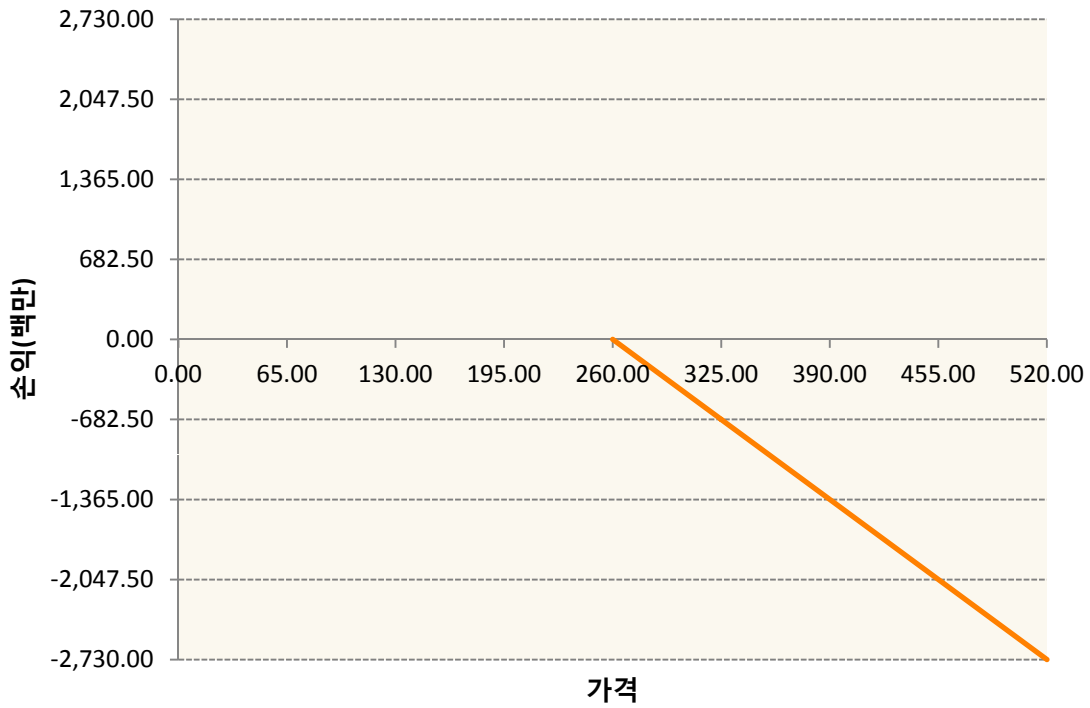


KR4201Q52577-2020-05 콜257.5

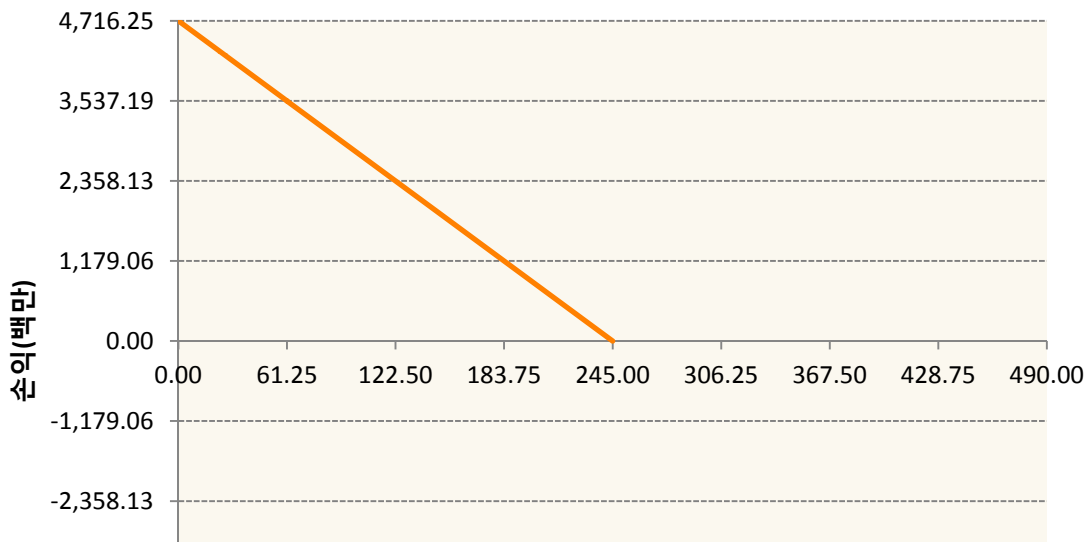


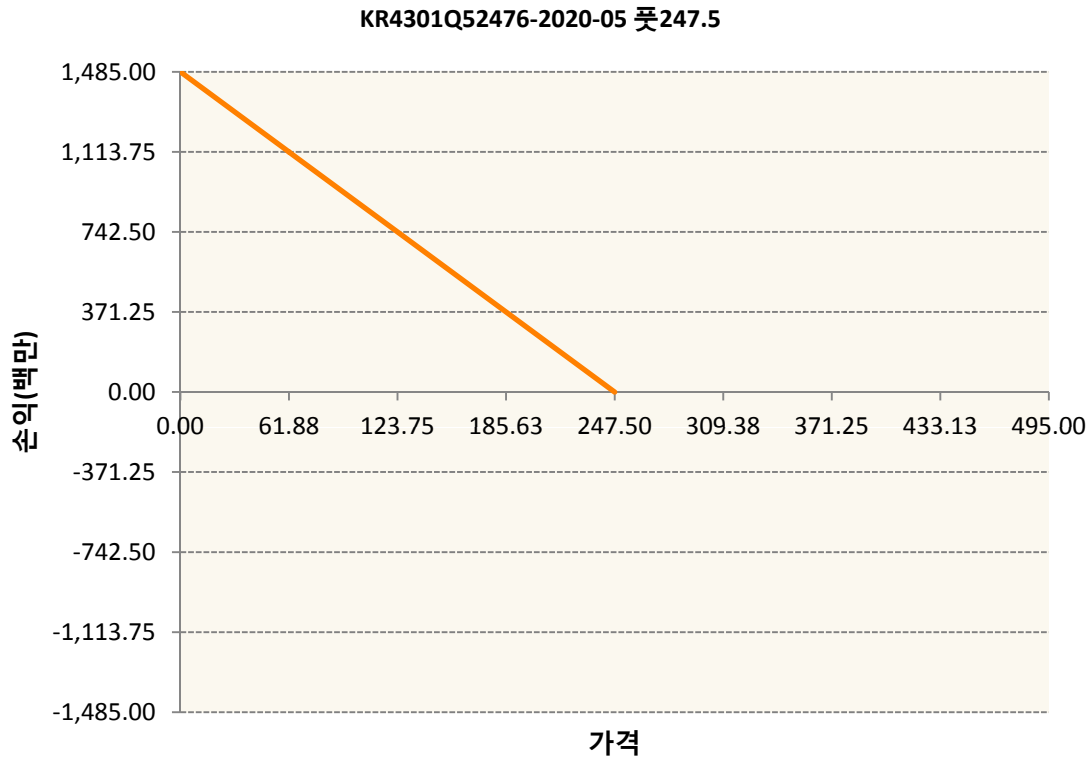
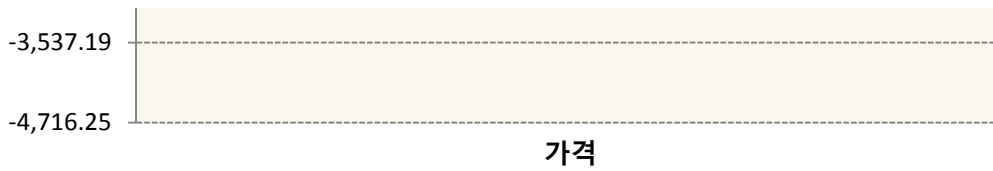


KR4201Q52601-2020-05 콜260



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						749
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-749	-749	-749	-749	-749	-749	-749	
-5.33%	-499	-499	-499	-499	-499	-499	-499	
-2.67%	-250	-250	-250	-250	-250	-250	-250	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	250	250	250	250	250	250	250	
5.33%	499	499	499	499	499	499	499	
8.00%	749	749	749	749	749	749	749	
KR4201Q52577		2020-05 콜257.5						916
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	507	483	456	427	396	363	329	
-5.33%	436	401	365	327	288	249	208	
-2.67%	316	273	230	186	142	98	53	

0%	138	92	46	0	-46	-92	-138
2.67%	-98	-142	-186	-230	-275	-320	-365
5.33%	-388	-424	-462	-502	-542	-584	-626
8.00%	-718	-745	-775	-808	-842	-879	-916
KR4201Q52601 2020-05 콜260							161
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	83	79	75	70	65	59	53
-5.33%	72	67	60	54	47	40	33
-2.67%	54	46	39	31	23	15	7
0%	25	17	8	0	-8	-17	-25
2.67%	-14	-22	-31	-39	-48	-56	-64
5.33%	-64	-71	-78	-86	-94	-102	-110
8.00%	-121	-127	-133	-140	-146	-153	-161
KR4301Q52450 2020-05 풋245							197
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	144	152	161	170	178	188	197
-5.33%	61	71	81	91	101	111	121
-2.67%	8	17	26	35	45	55	64
0%	-20	-14	-7	0	8	16	24
2.67%	-32	-29	-25	-20	-15	-9	-2
5.33%	-36	-35	-33	-30	-27	-23	-19
8.00%	-37	-36	-36	-34	-33	-31	-28
KR4301Q52476 2020-05 풋247.5							68
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	53	55	58	60	63	65	68
-5.33%	24	27	30	33	36	39	42
-2.67%	4	7	10	13	16	20	23
0%	-7	-5	-3	0	3	5	8
2.67%	-13	-11	-10	-8	-6	-4	-2
5.33%	-15	-14	-13	-12	-11	-9	-8
8.00%	-15	-15	-14	-14	-13	-12	-11

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

(단위:백만원)

2,194

공시일	2020-05-04
기준일	2020-04-29

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	146,851	0	146,851	

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	2020-05-04
기준일	2020-04-29

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	99,013	0	99,013	

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	2020-05-04
기준일	2020-04-29

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	437,441	0	437,441	
누계	통화	선도	43,855	459,992	-416,137	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,436
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,027
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,027
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,378
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	975
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	975
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,534
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	838
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	731
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	487
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,411
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,919
FX21020H11 KRW/USD 11-05-20E	975
FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E	2,924
FX21020J02€ KRW/USD 10-06-20E	1,325
FX21020J02₯ KRW/USD 22-06-20E	1,501
FX21020J02₮ KRW/USD 22-06-20E	1,949
FX21020J03₯ KRW/USD 24-07-20E	2,193
FX21020J04₯ KRW/USD 24-07-20E	1,754
FX21020J04₯ KRW/USD 24-07-20E	1,949

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

20,212

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

(단위:백만원)

198

공시일	2020-05-04
기준일	2020-04-29

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

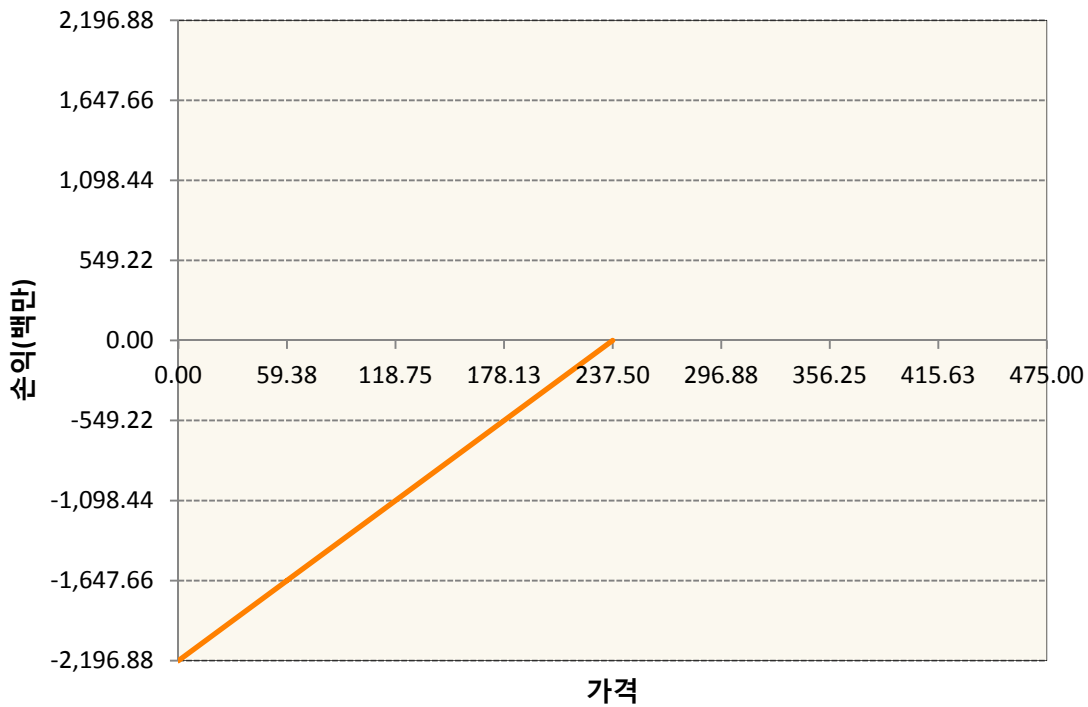
1. 계약금액

(단위:백만원)

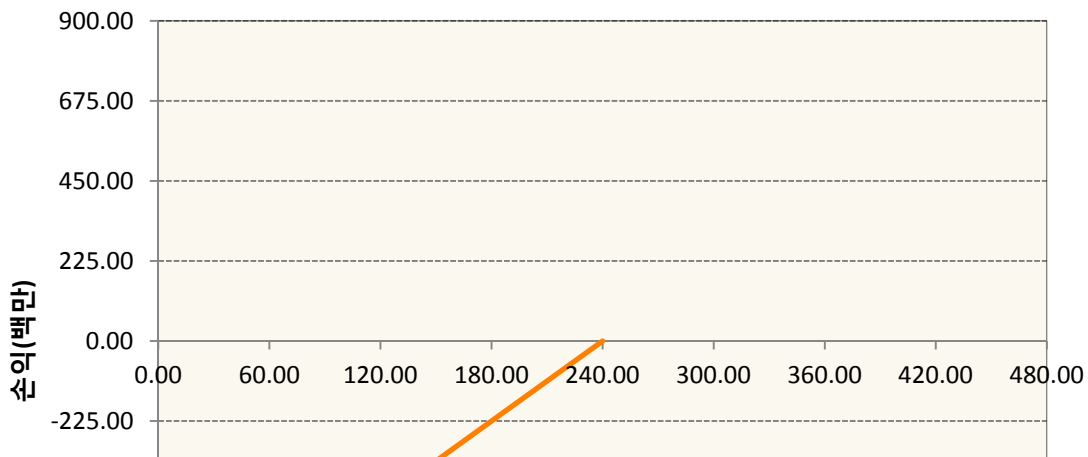
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,097	-3,097	장내

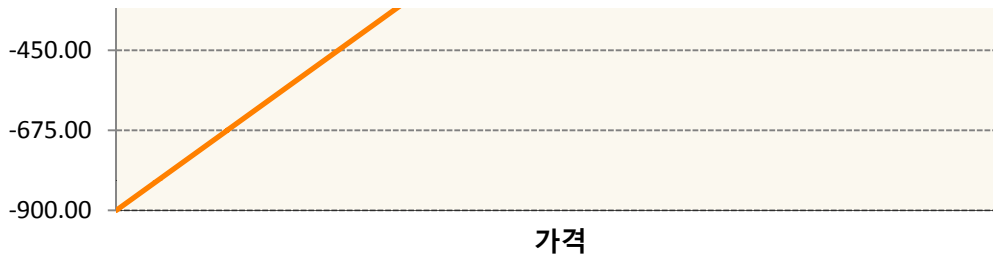
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q52377-2020-05 풋237.5



KR4301Q52401-2020-05 풋240





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q52377		2020-05 풋237.5						64
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-36	-41	-45	-50	-55	-60	-64	
-5.33%	-12	-16	-20	-24	-29	-33	-38	
-2.67%	0	-2	-5	-9	-12	-16	-19	
0%	5	4	2	0	-2	-5	-8	
2.67%	6	6	5	4	3	1	-1	
5.33%	7	7	6	6	5	4	3	
8.00%	7	7	7	7	6	6	5	
KR4301Q52401		2020-05 풋240						30
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-19	-21	-22	-24	-26	-28	-30	
-5.33%	-7	-9	-10	-12	-14	-16	-18	
-2.67%	0	-2	-3	-4	-6	-8	-9	
0%	3	2	1	0	-1	-2	-4	
2.67%	4	3	3	2	2	1	0	
5.33%	4	4	4	3	3	2	2	
8.00%	4	4	4	4	4	3	3	

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

60

공시일	2020-05-04
기준일	2020-04-29

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	7,210	0	7,210	
누계	통화	선도	0	7,126	-7,126	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J01! KRW/USD 13-05-20E	319
FX21020J04! KRW/USD 29-05-20E	251
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

286

공시일	2020-05-04
기준일	2020-04-29

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

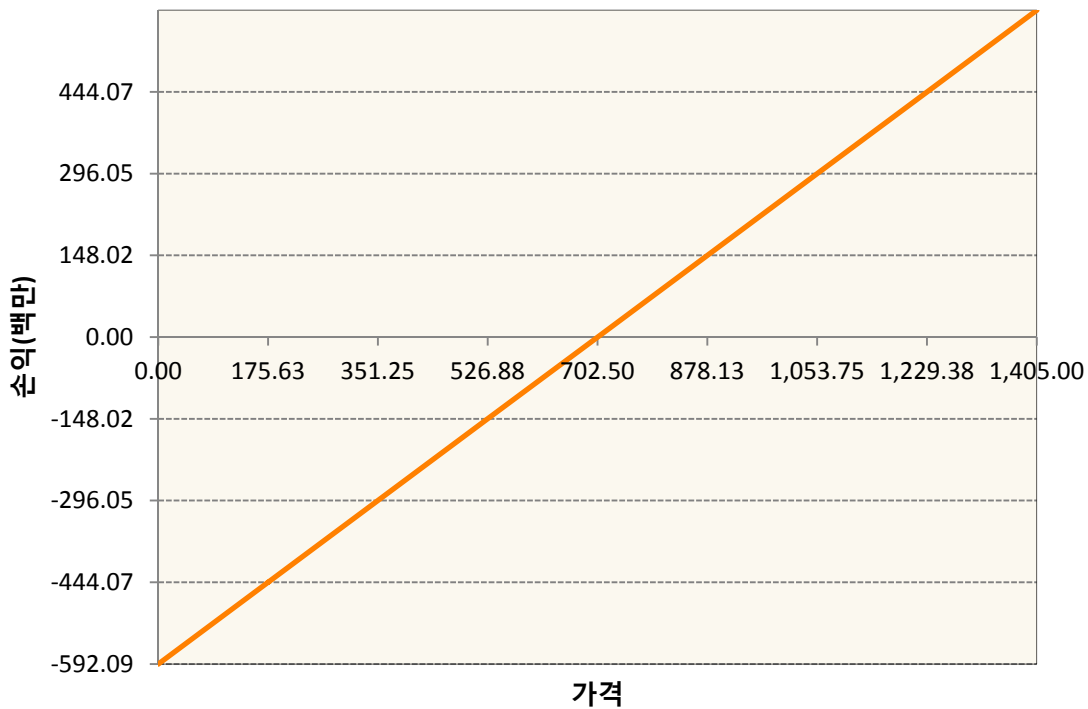
1. 계약금액

(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	592	0	592	
누계	유가증권	스왑	867	0	867	장외
누계	통화	선도	204	627	-423	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	2020-05-04
기준일	2020-04-29

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

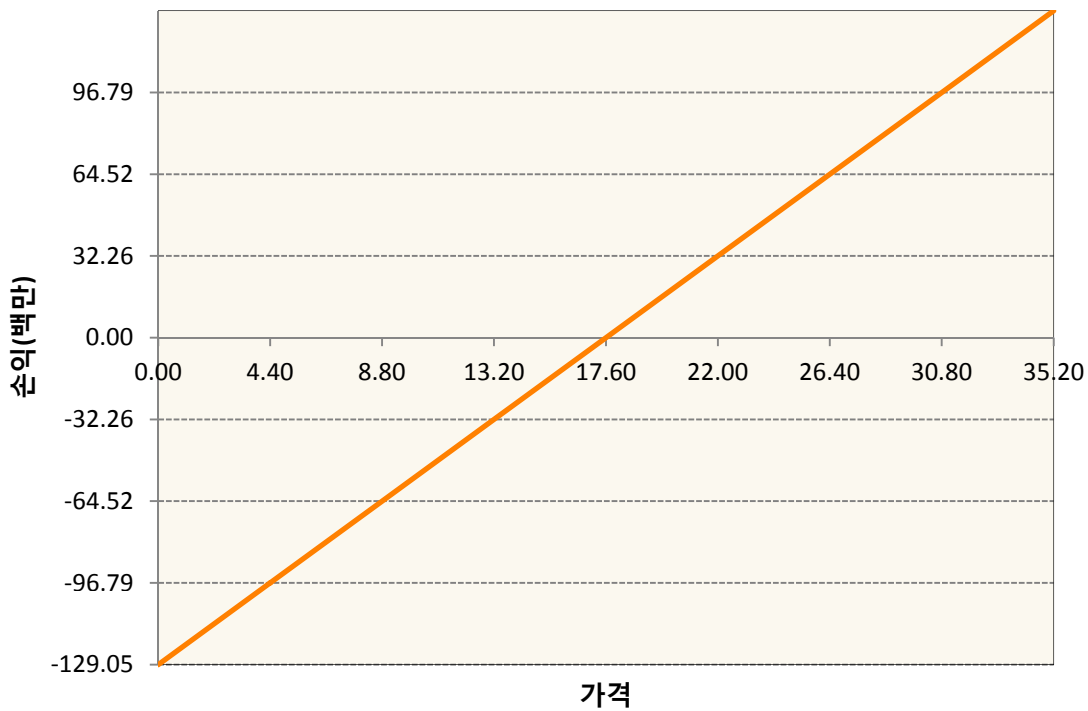
1. 계약금액

(단위:백만원)

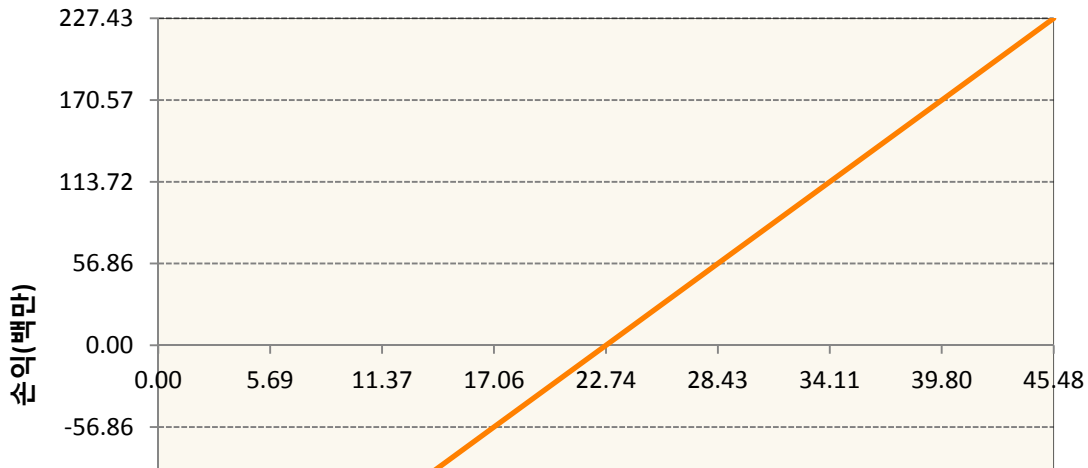
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,332	183	1,149	

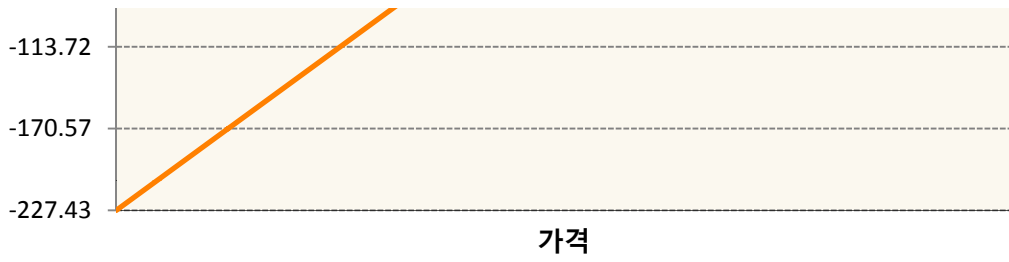
2. 만기시점의 손익구조

CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20

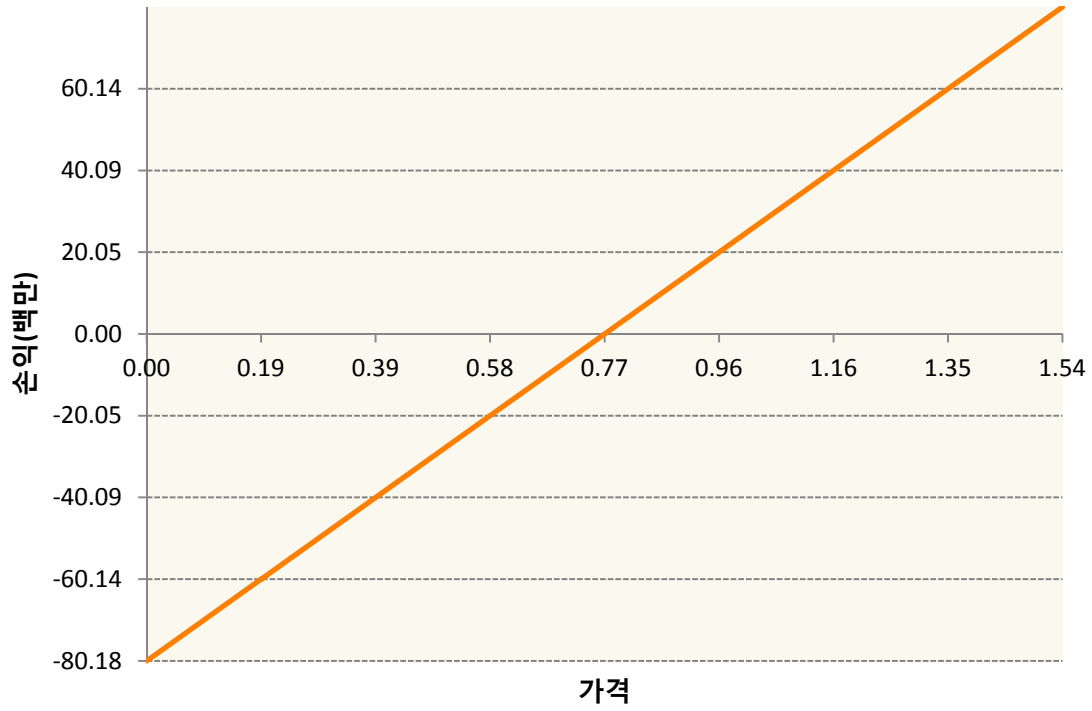


CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20

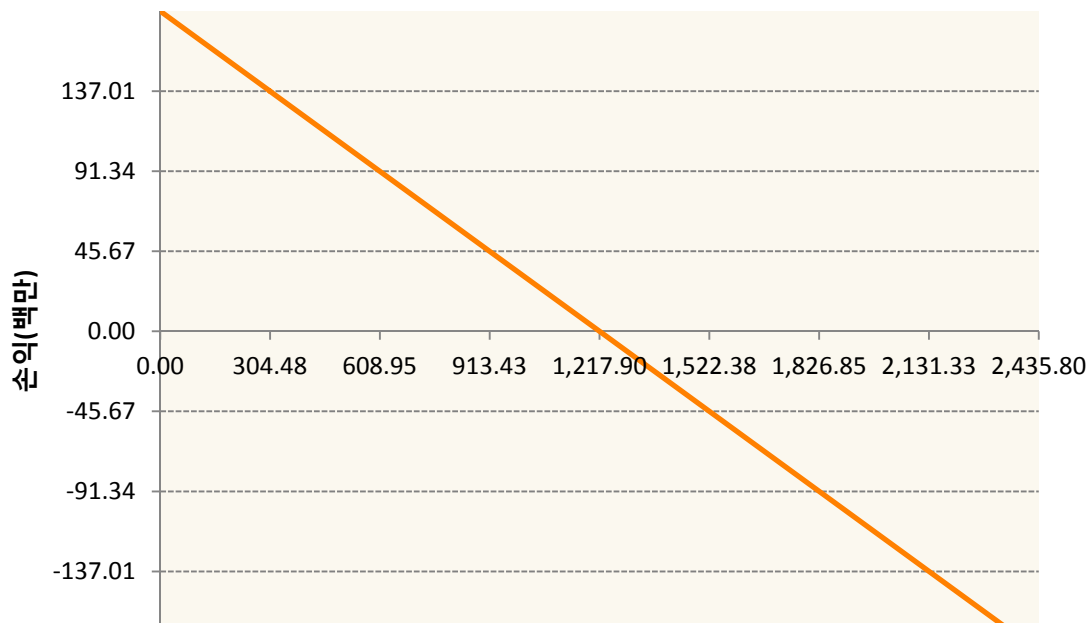


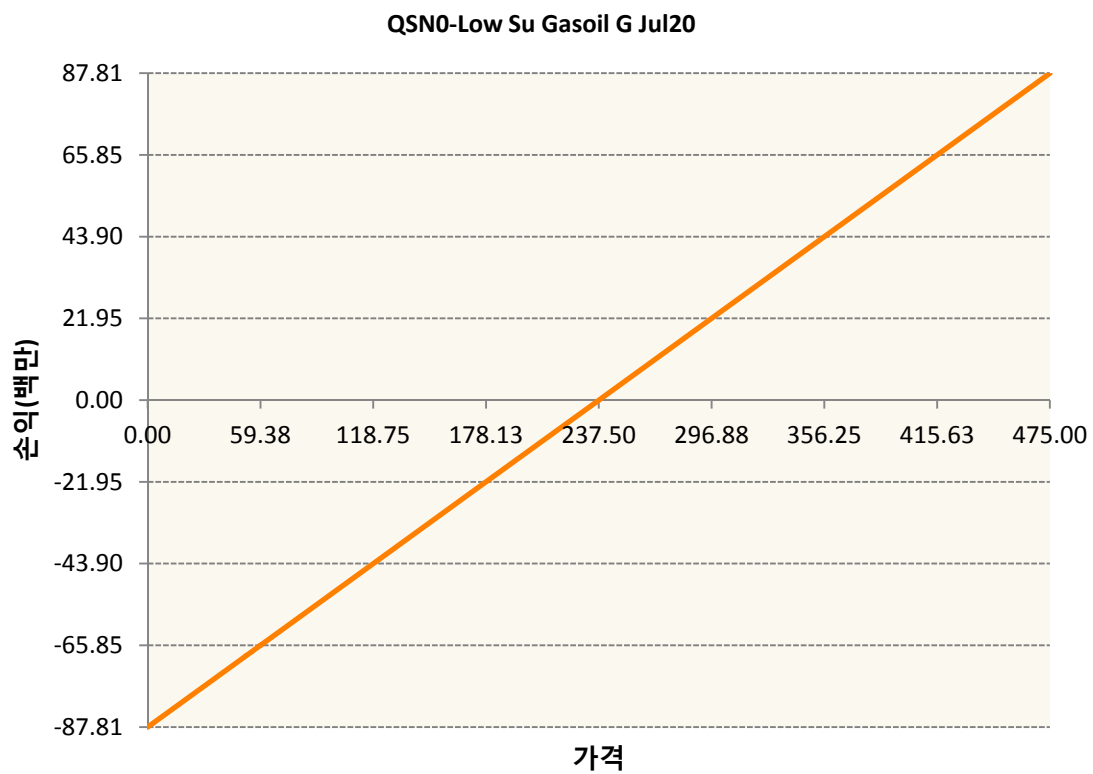
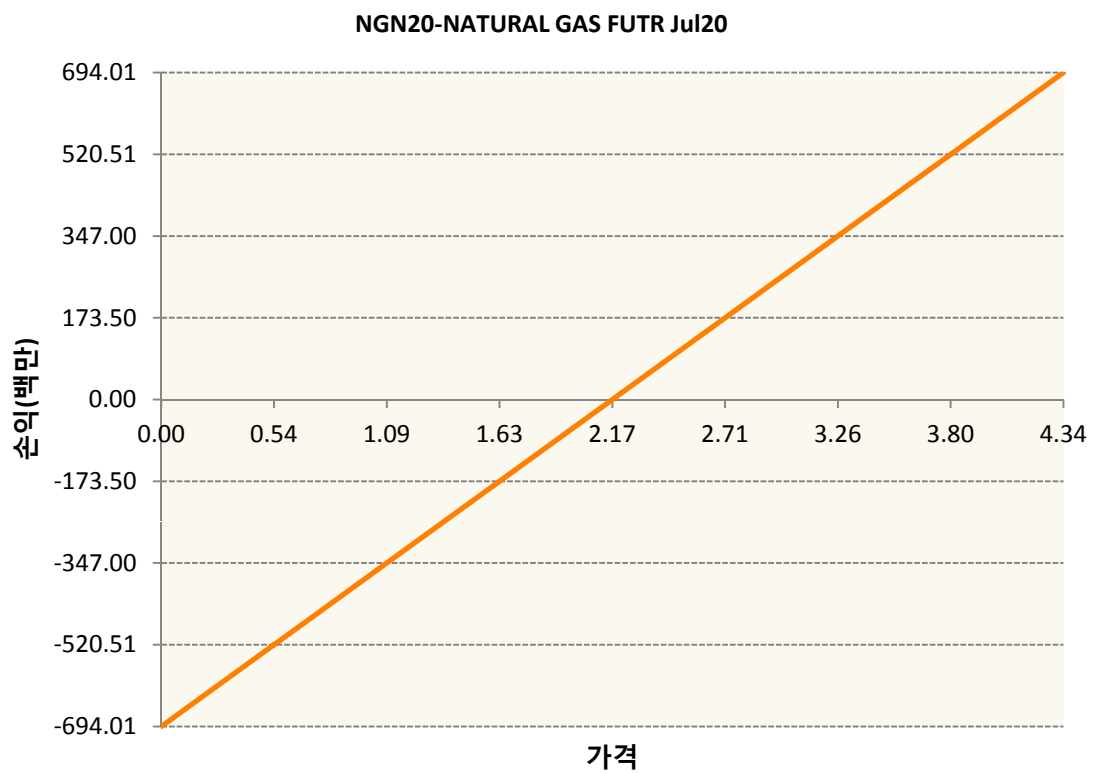
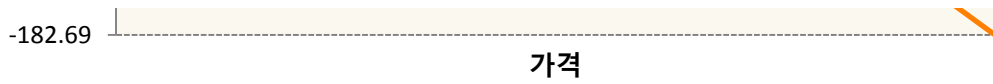


HON0-NY Harb ULSD Fut Jul20

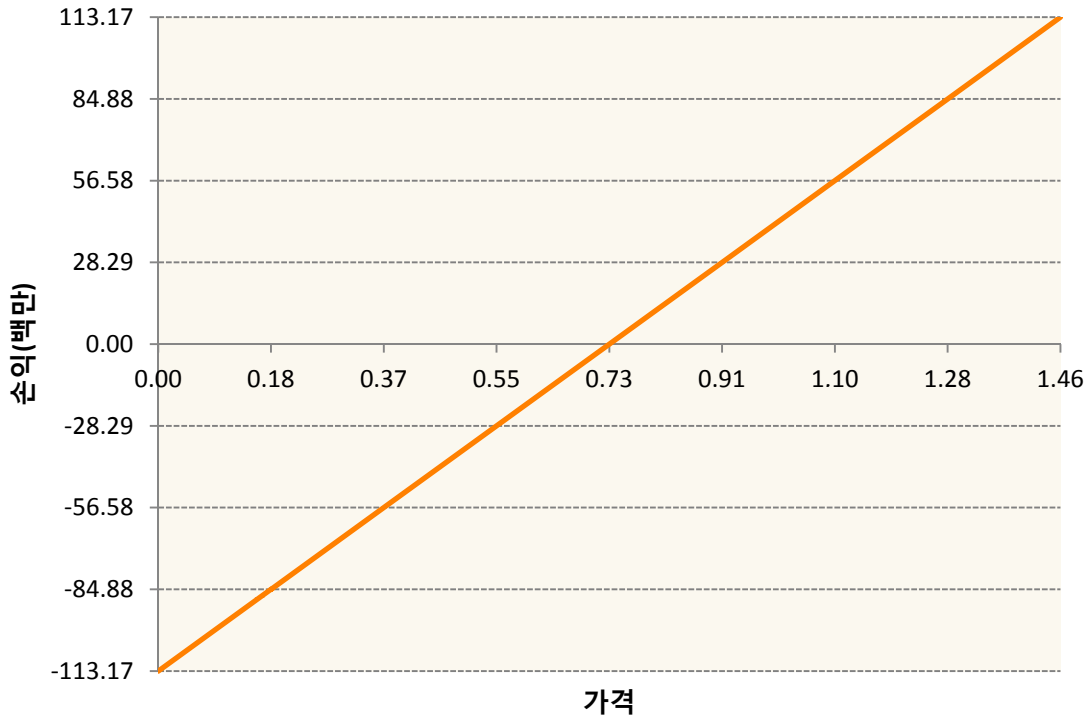


KR4175Q50007-2020-05 달러선물





XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN0	WTI CRUDE FUTURE Jul20	10
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	18
HON0	NY Harb ULSD Fut Jul20	6
KR4175Q50C	2020-05 달러선물	15
NGN20	NATURAL GAS FUTR Jul20	56
QSN0	Low Su Gasoil G Jul20	7
XBN0	GASOLINE RBOB FUT Jul20	9

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

(단위:백만원)

456

공시일	2020-05-04
기준일	2020-04-29

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

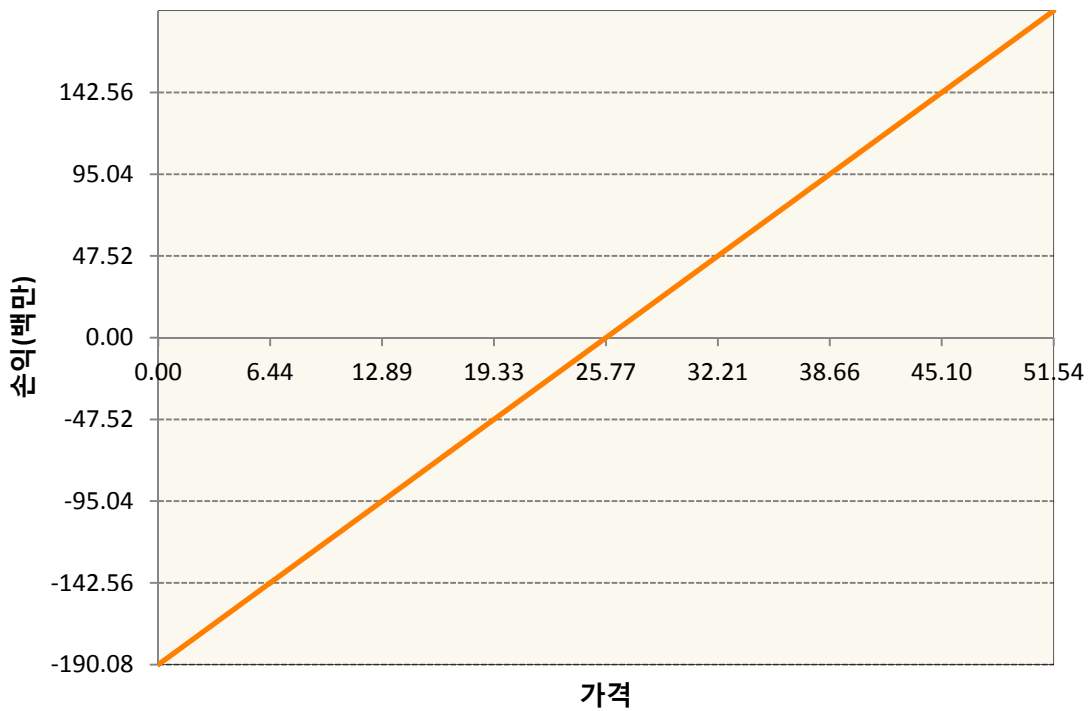
1. 계약금액

(단위:백만원)

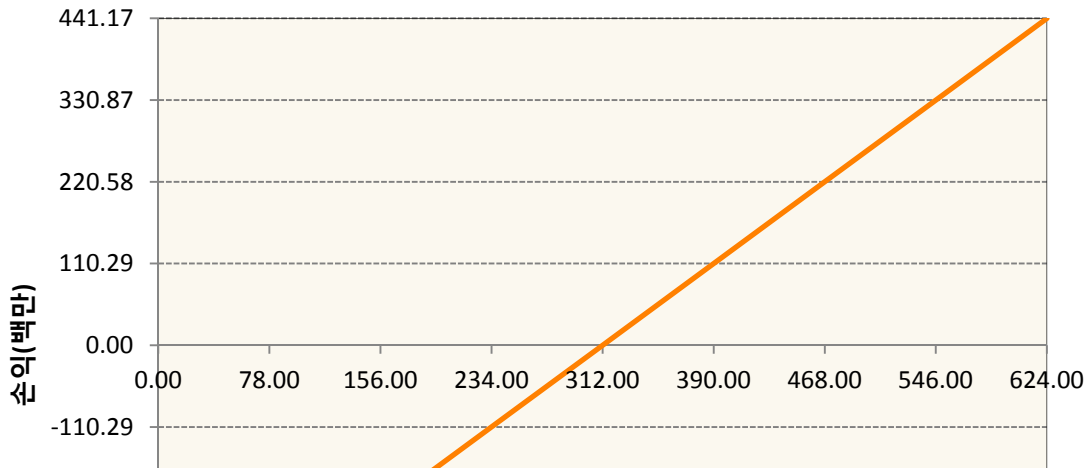
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,329	73	2,256	

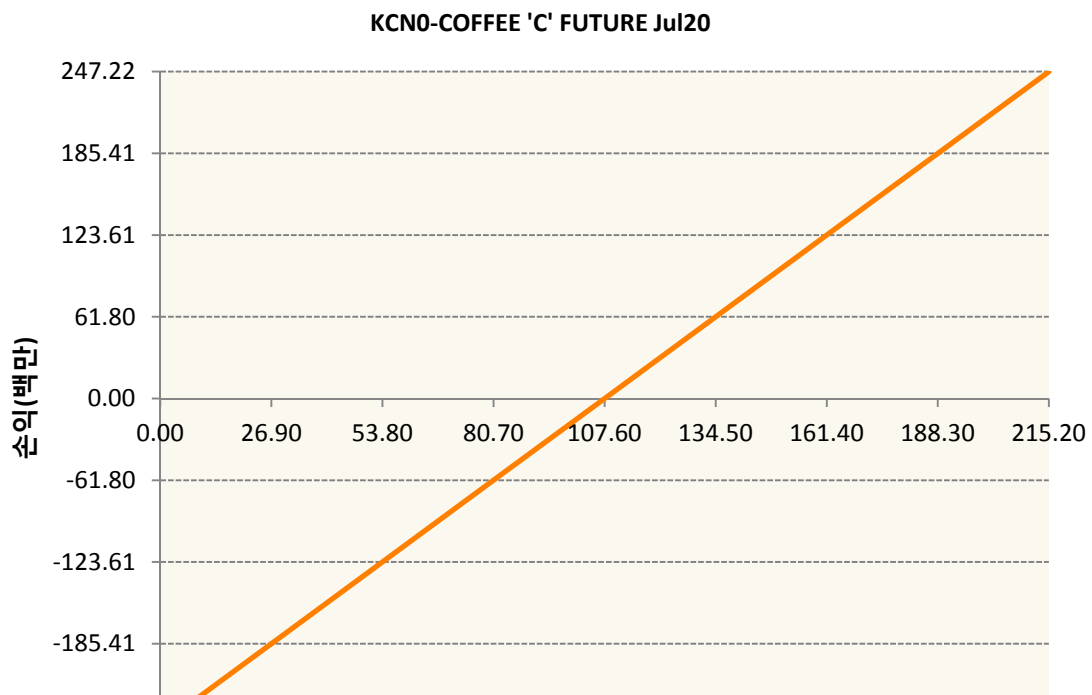
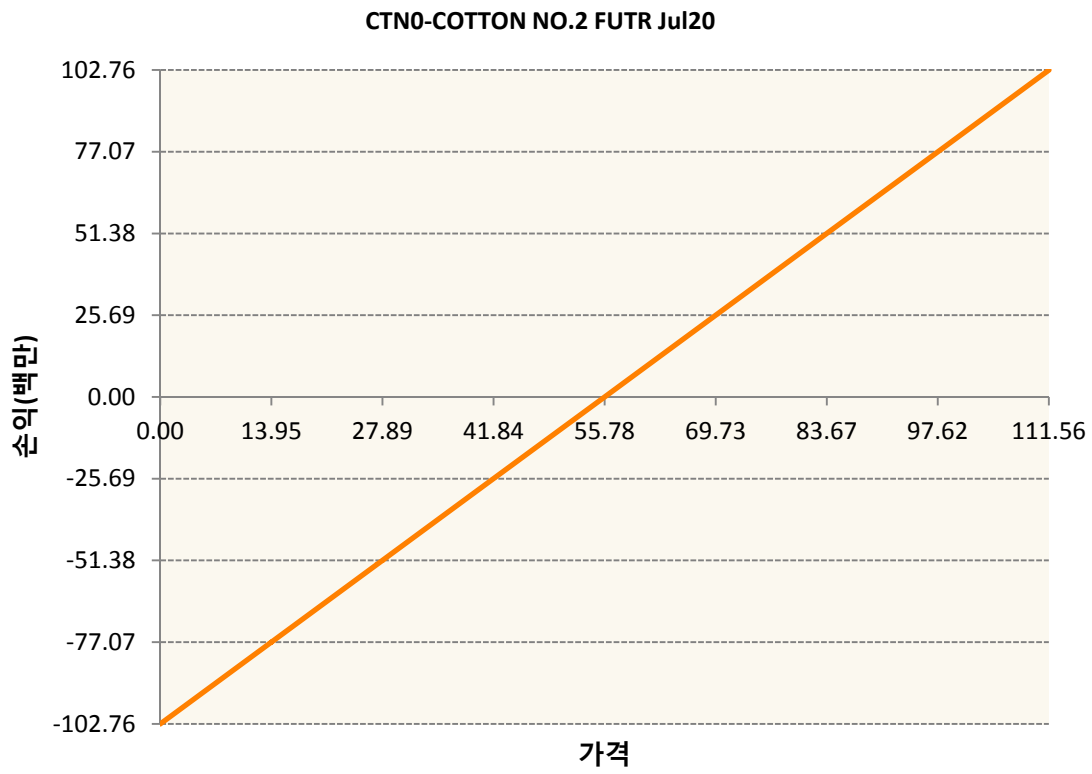
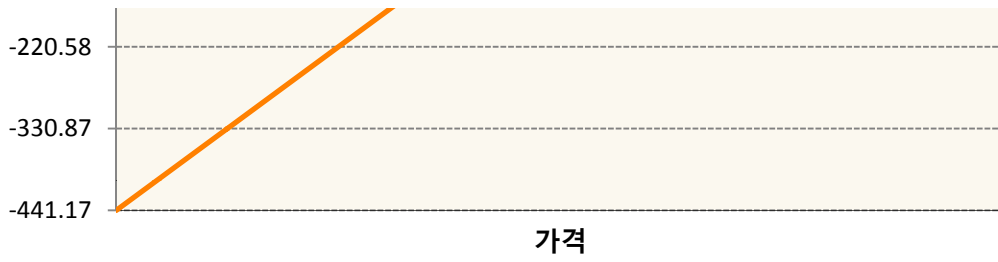
2. 만기시점의 손익구조

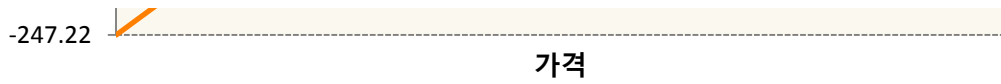
BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20



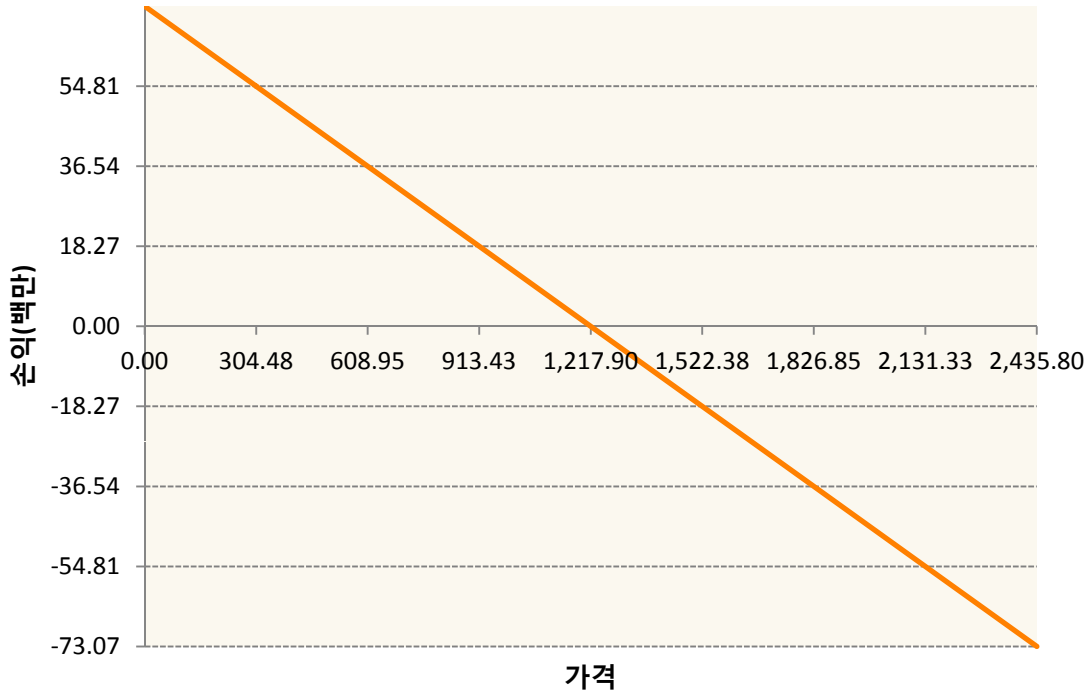
CN0-CORN FUTURE Jul20



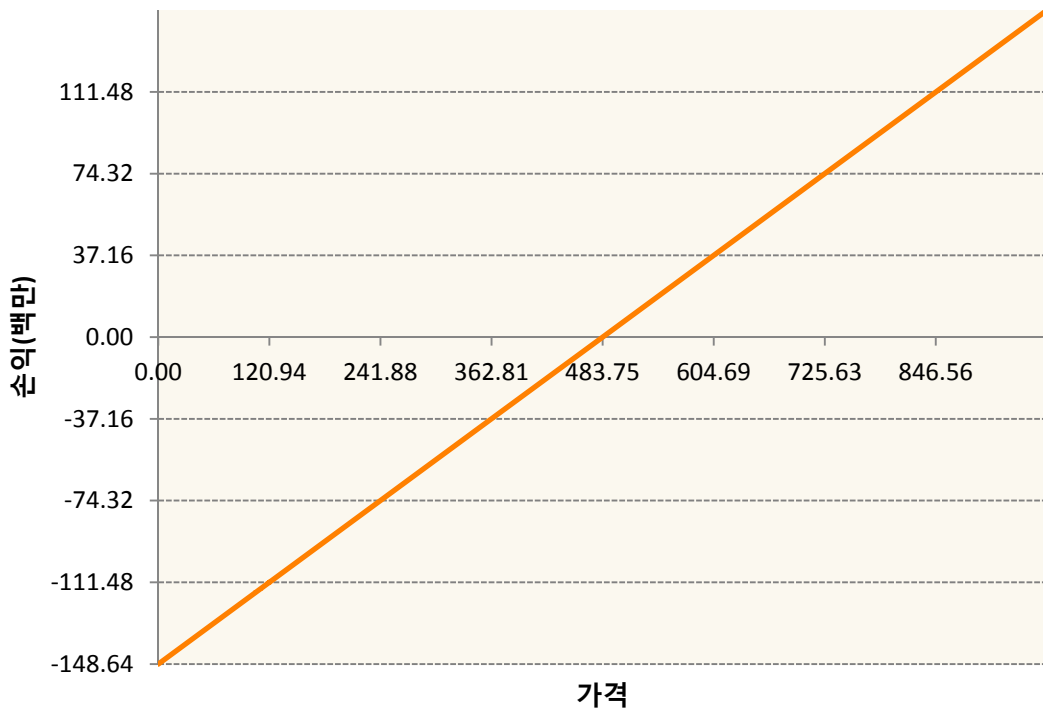




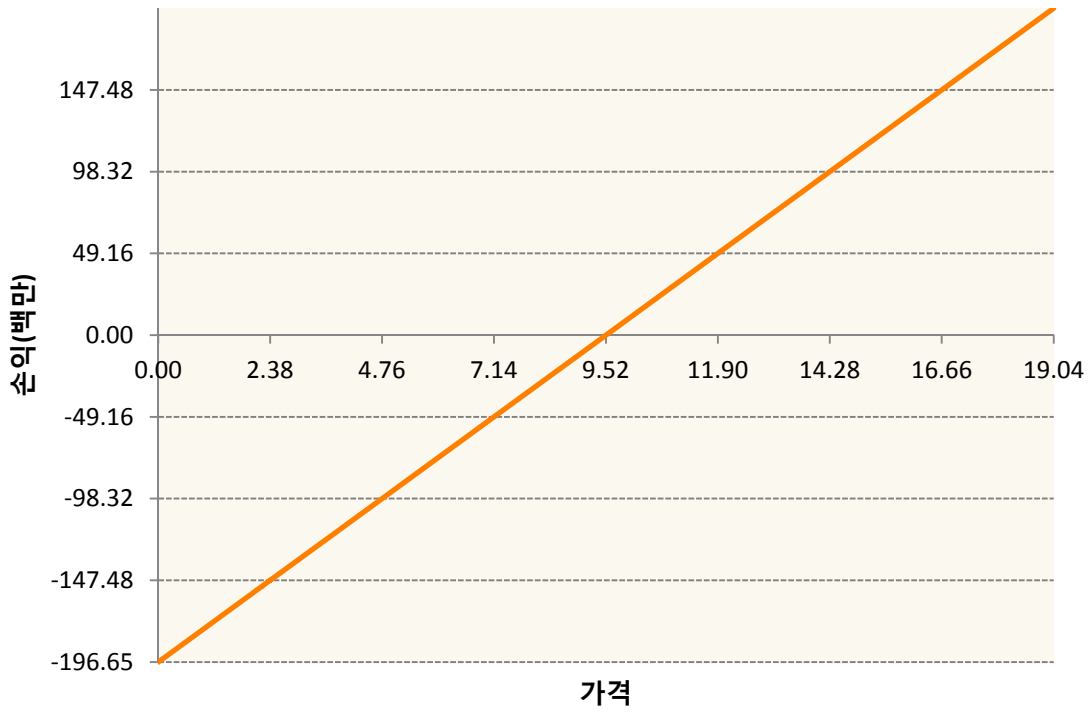
KR4175Q50007-2020-05 달러선물



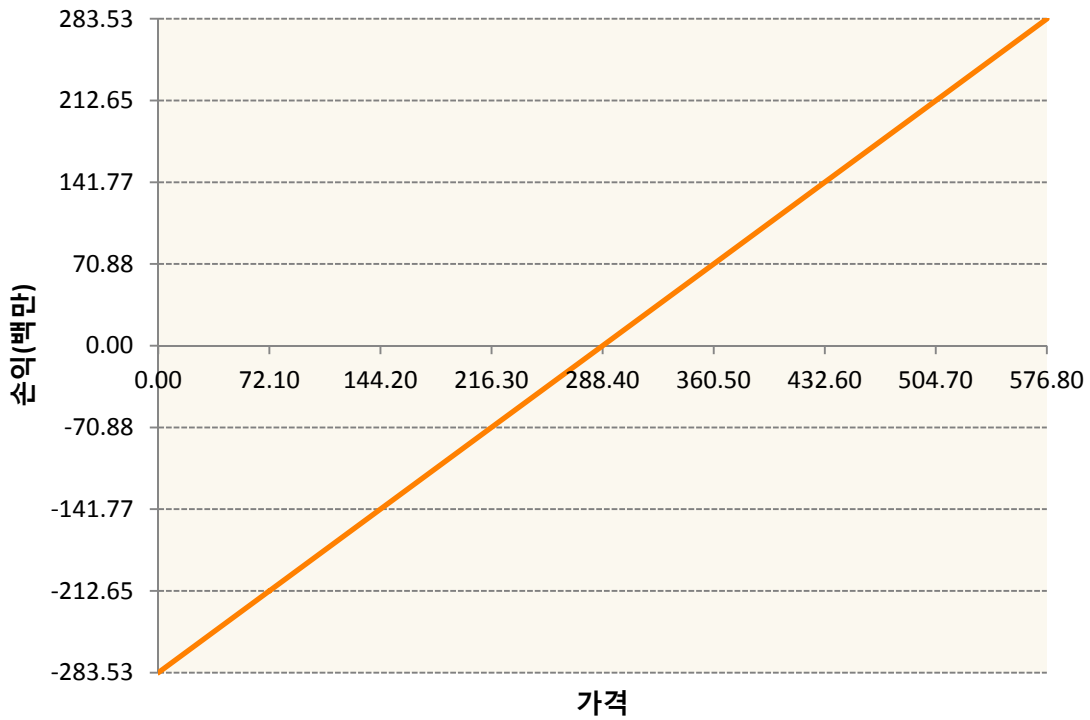
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



SBN0-Sugar Jul20

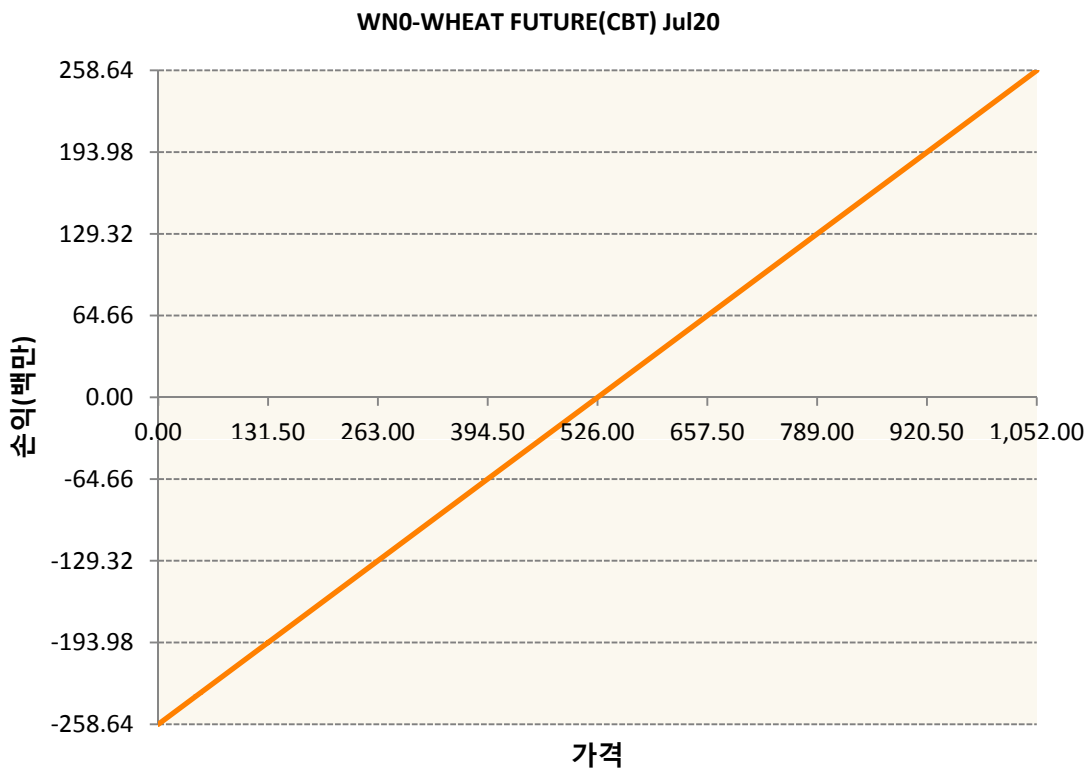
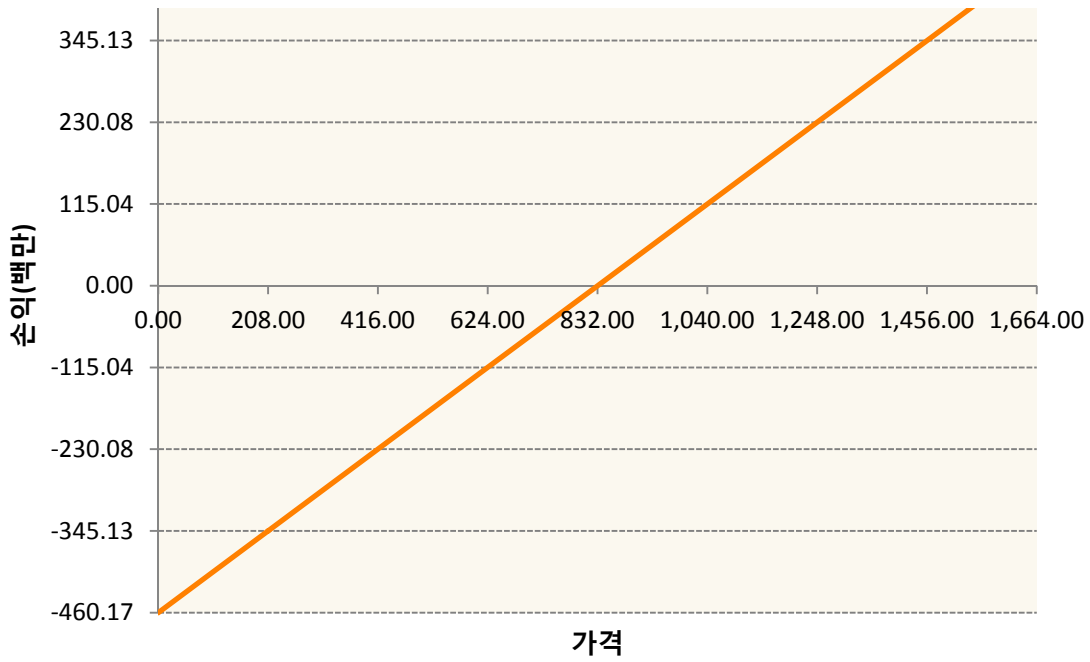


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20



SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON0	SOYBEAN OIL FUTR Jul20	15
CN0	CORN FUTURE Jul20	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	16
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)

220