

공시일	2020-05-06
기준일	2020-05-04

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	2020-05-06
기준일	2020-05-04

스마트인덱스모

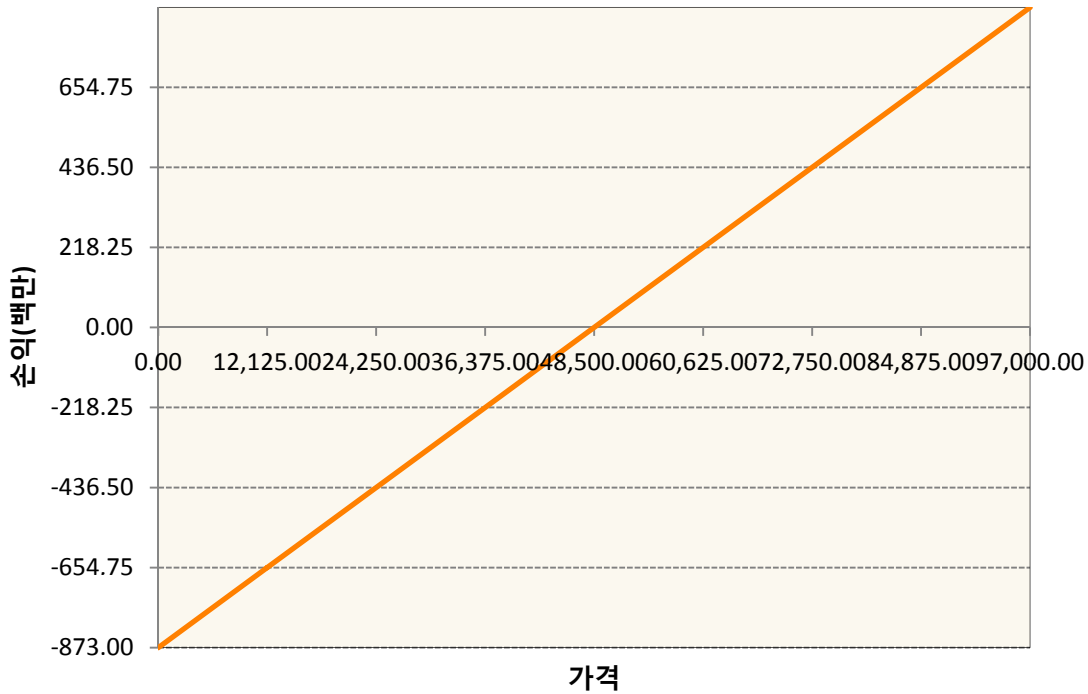
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	873	0	873	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111Q50002-2020-05 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111Q50002		2020-05 삼성전자개별선물						70
가격	기초자산의 변동성							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70	
-5.33%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47	
-2.67%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	23	23	23	23	23	23	23	
5.33%	47	47	47	47	47	47	47	
8.00%	70	70	70	70	70	70	70	

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

(단위:백만원)

105

공시일	2020-05-06
기준일	2020-05-04

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

965

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,134

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-06
기준일	2020-05-04

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

560

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

871

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-06
기준일	2020-05-04

유로인덱스모(주식-파생형)

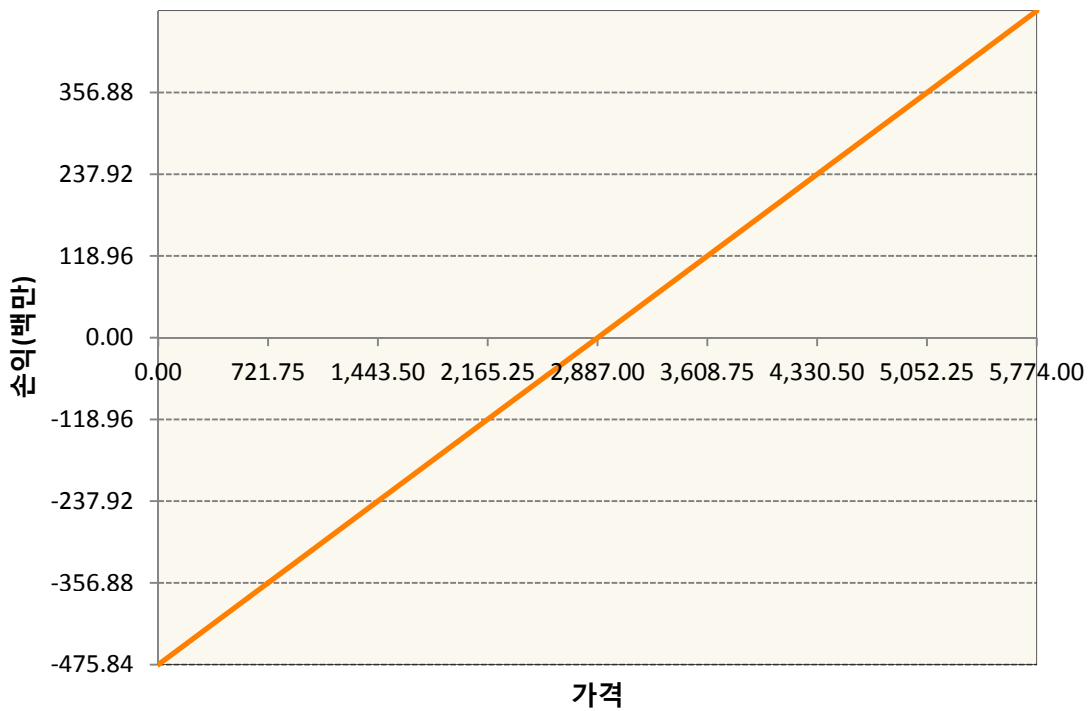
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	476	0	476	

2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	38
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

48

공시일	2020-05-06
기준일	2020-05-04

차이나인덱스모(주식-파생형)

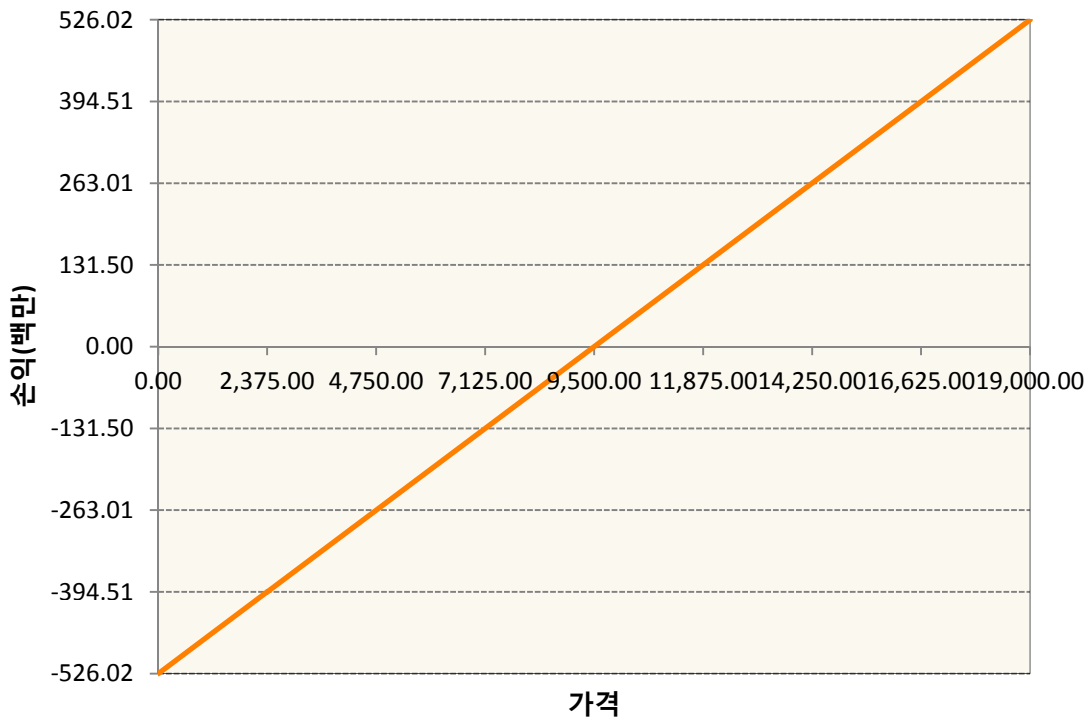
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	526	0	526	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCK0-HSCEI Futures May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK0	HSCEI Futures May20	42
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

45

공시일	2020-05-06
기준일	2020-05-04

커버드콜모(주식혼합-파생형)

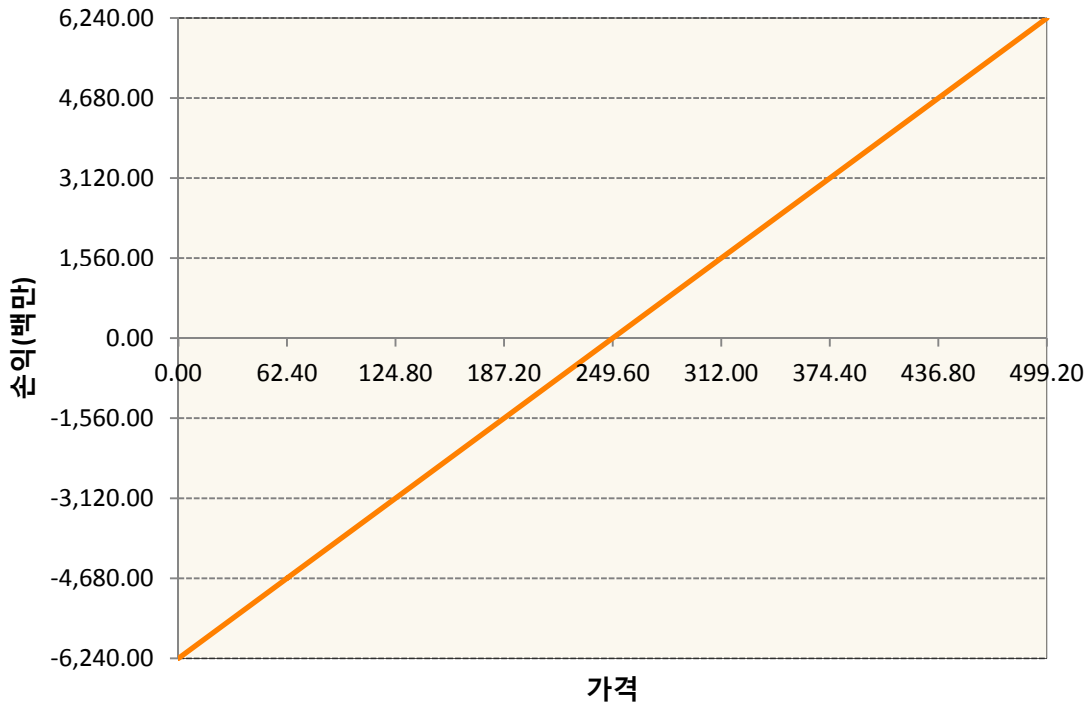
1. 계약금액

(단위:백만원)

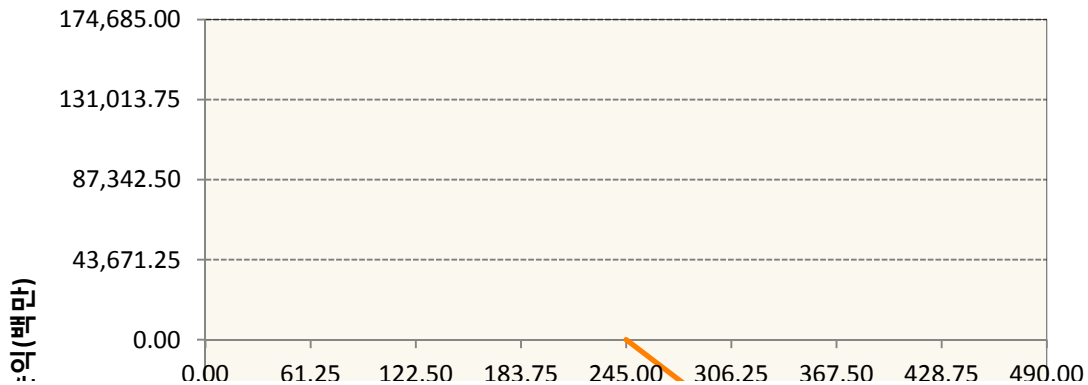
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,240	0	6,240	장내
누계	유가증권	옵션	0	351,608	-351,608	장내

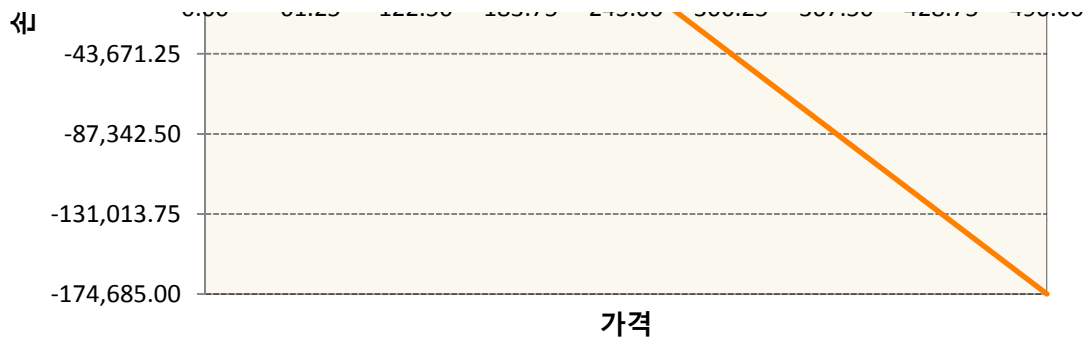
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

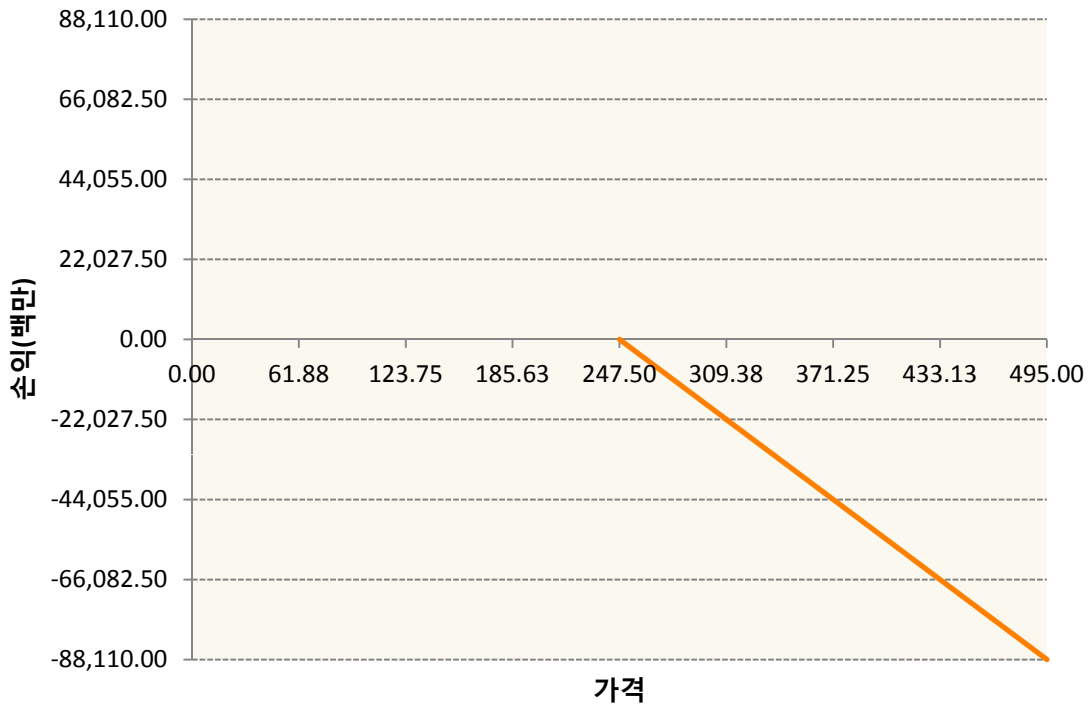


KR4201Q52452-2020-05 콜245

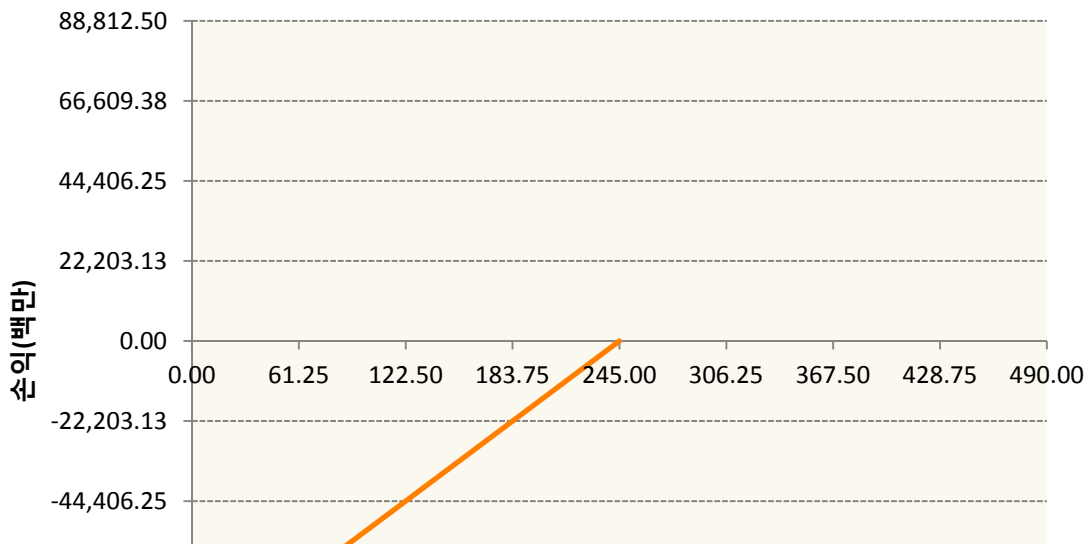


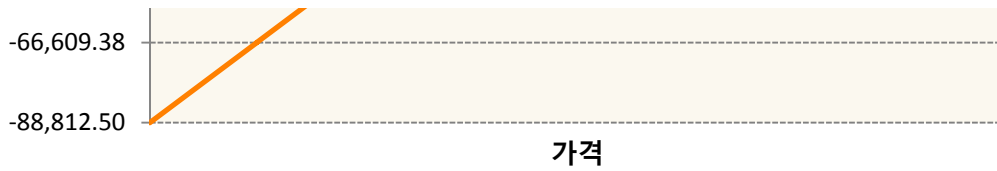


KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						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						11,931
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	7,029	6,740	6,426	6,092	5,741	5,378	5,003	
-5.33%	5,927	5,521	5,105	4,681	4,252	3,818	3,381	
-2.67%	4,063	3,595	3,127	2,659	2,190	1,722	1,254	
0%	1,358	910	457	0	-459	-921	-1,384	
2.67%	-2,109	-2,471	-2,853	-3,249	-3,658	-4,076	-4,502	
5.33%	-6,150	-6,401	-6,684	-6,993	-7,325	-7,676	-8,042	
8.00%	-10,559	-10,709	-10,895	-11,114	-11,362	-11,635	-11,931	
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5						5,742
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,122	2,998	2,861	2,711	2,551	2,382	2,207	
-5.33%	2,684	2,498	2,305	2,105	1,901	1,693	1,482	
-2.67%	1,900	1,671	1,441	1,210	978	746	513	
0%	706	471	236	0	-236	-473	-710	
2.67%	-888	-1,091	-1,300	-1,514	-1,732	-1,953	-2,177	
5.33%	-2,806	-2,955	-3,118	-3,293	-3,476	-3,668	-3,866	
8.00%	-4,945	-5,040	-5,153	-5,281	-5,424	-5,578	-5,742	
KR4301Q52450		2020-05 풋245						4,726
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-4,104	-4,182	-4,273	-4,374	-4,485	-4,602	-4,726	
-5.33%	-2,077	-2,218	-2,365	-2,517	-2,673	-2,831	-2,992	
-2.67%	-508	-687	-867	-1,046	-1,226	-1,405	-1,585	

0%	502	337	170	0	-172	-345	-519
2.67%	1,027	915	792	661	522	378	229
5.33%	1,244	1,186	1,114	1,030	935	830	717
8.00%	1,316	1,292	1,258	1,213	1,156	1,089	1,012

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

(단위:백만원)

22,022

공시일	2020-05-06
기준일	2020-05-04

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

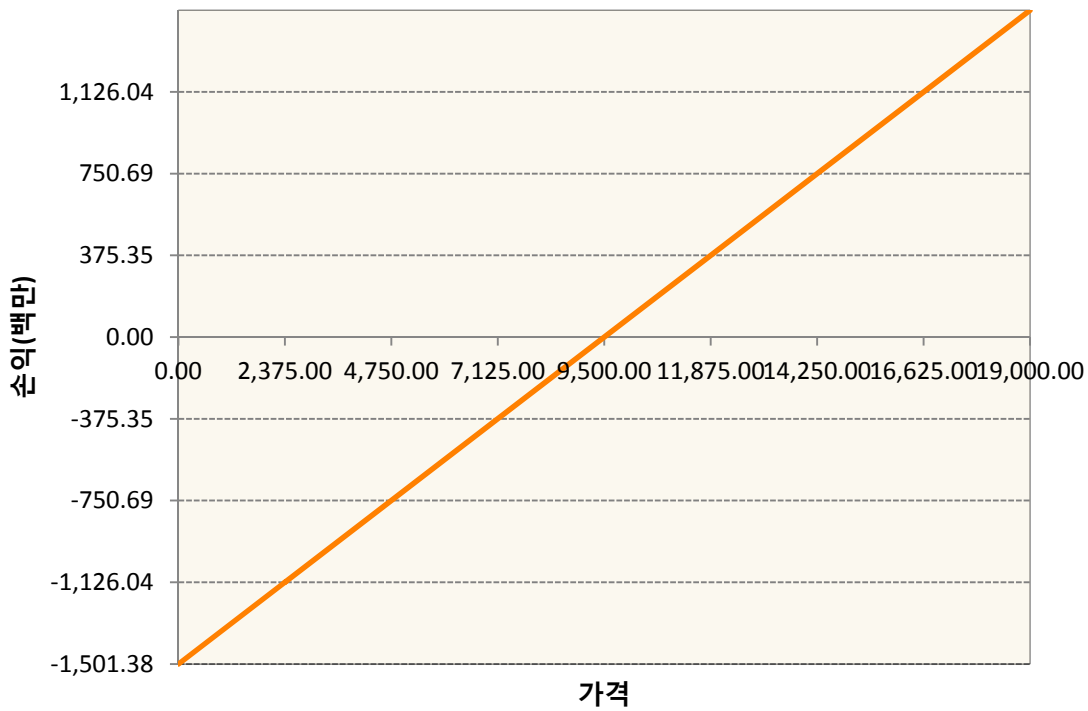
1. 계약금액

(단위:백만원)

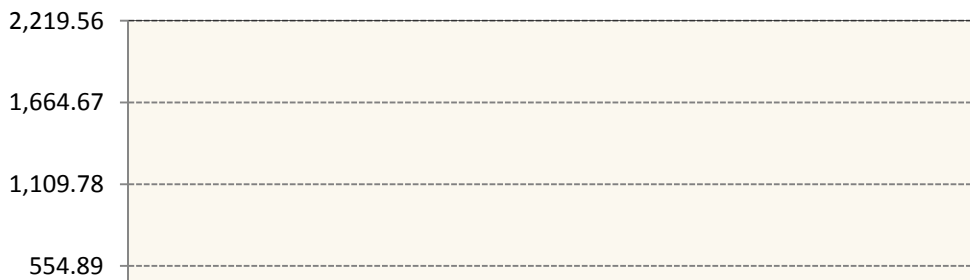
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,501	0	1,501	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,439	-4,439	장내
누계	통화	선도	698	2,232	-1,535	장외

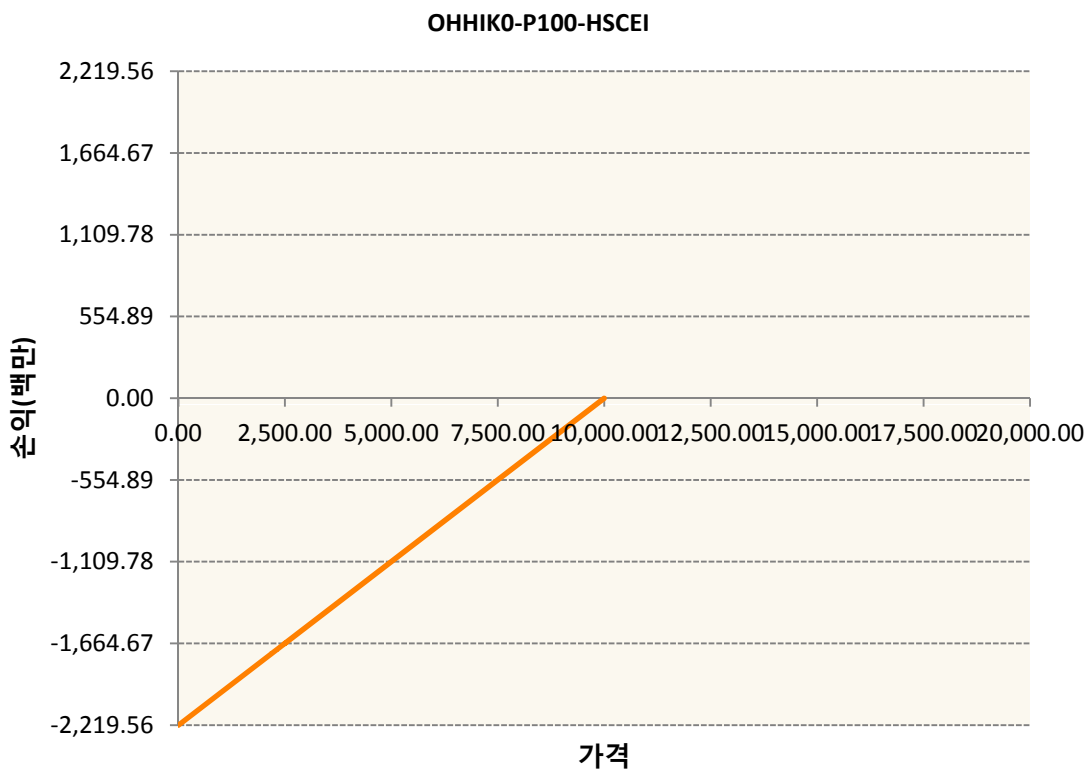
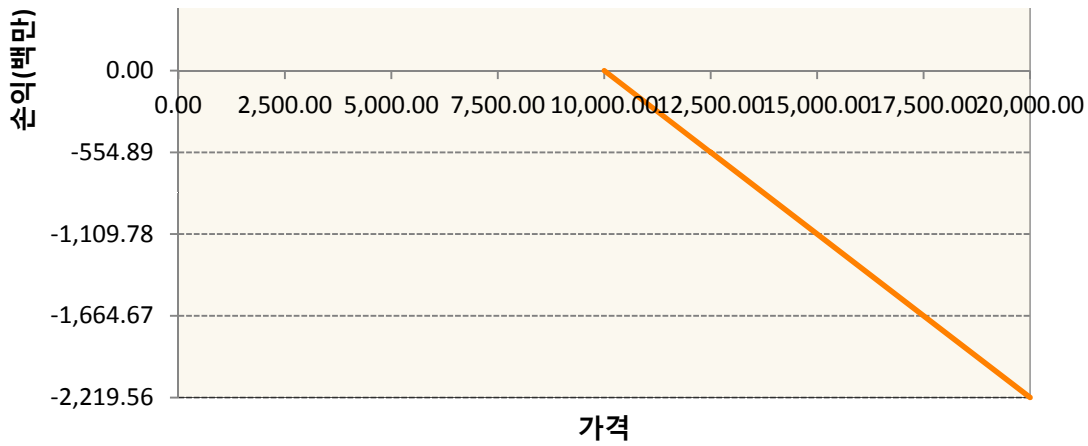
2. 만기시점의 손익구조

HCK0-HSCEI Futures May20



OHHIK0-C100-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E		179
FX21020H05 HKD/KRW 22-05-20E		56
HCK0 HSCEI Futures May20		120
OHHIK0-C1C HSCEI		178
OHHIK0-P10 HSCEI		178

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	621

공시일	2020-05-06
기준일	2020-05-04

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

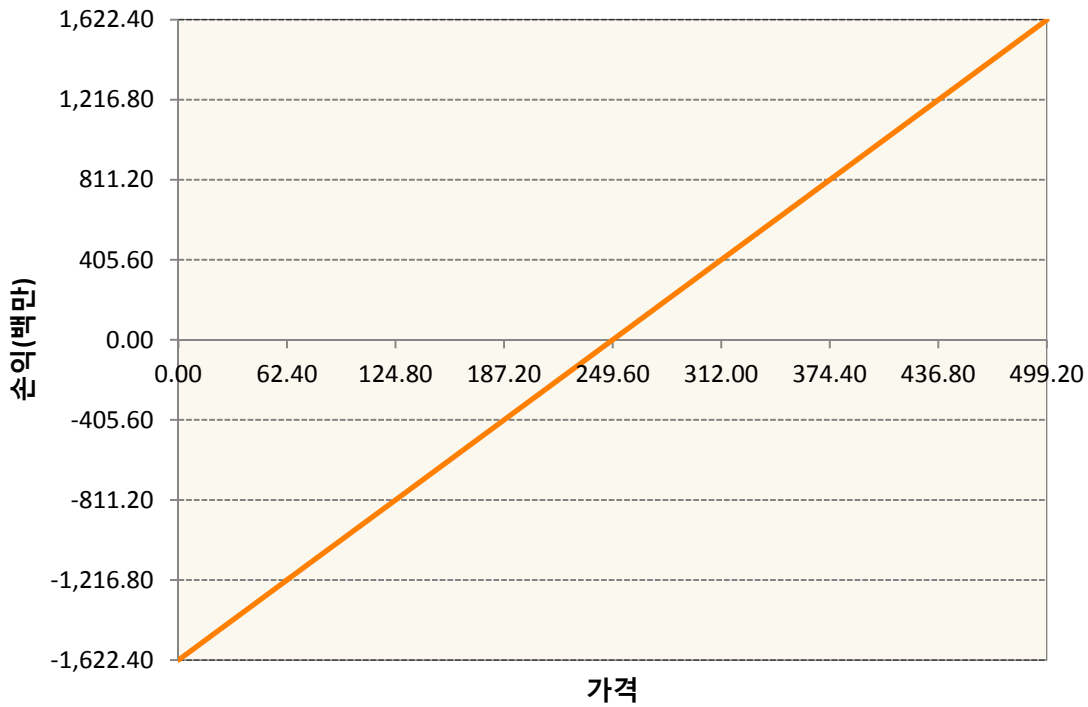
1. 계약금액

(단위:백만원)

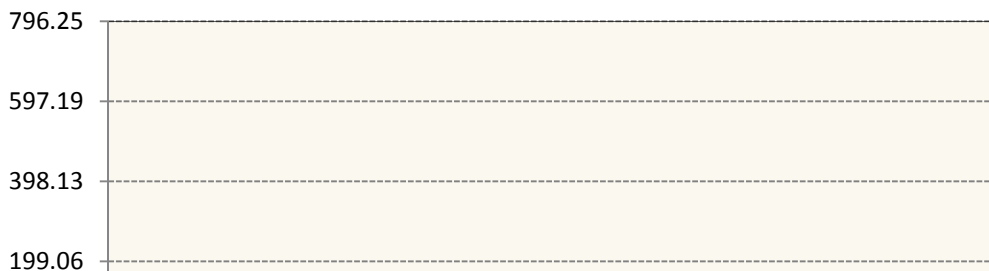
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,622	0	1,622	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,193	-3,193	장내

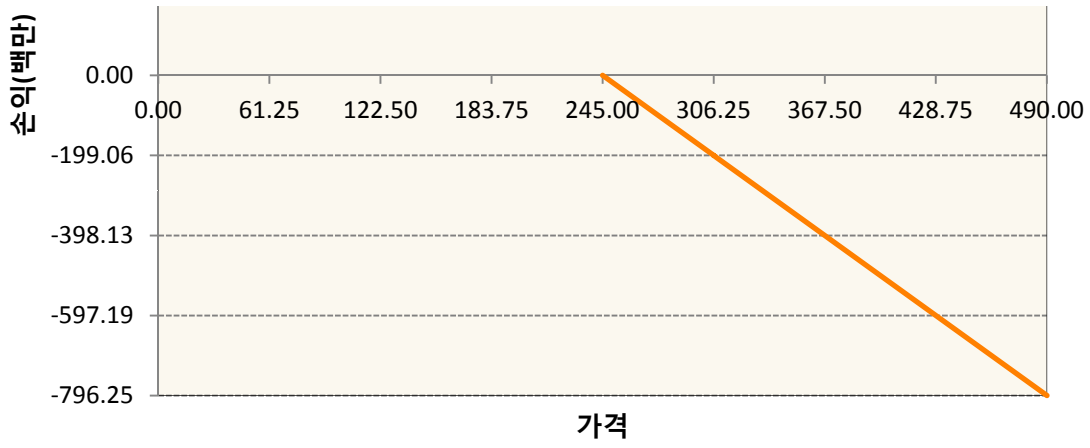
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

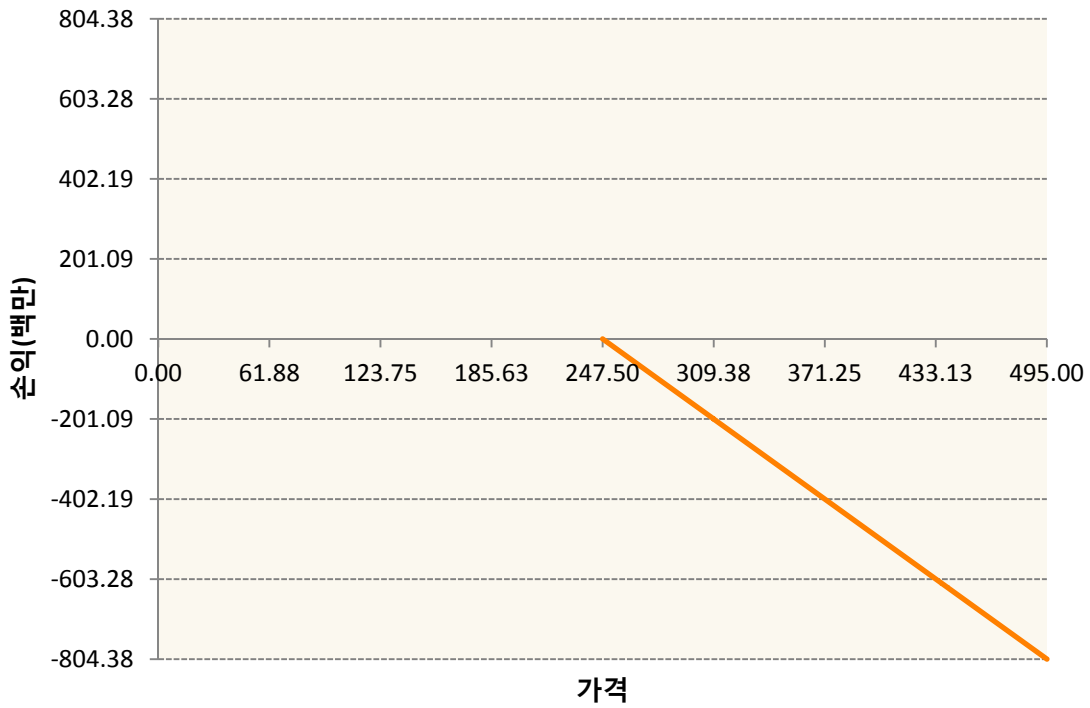


KR4201Q52452-2020-05 콜245

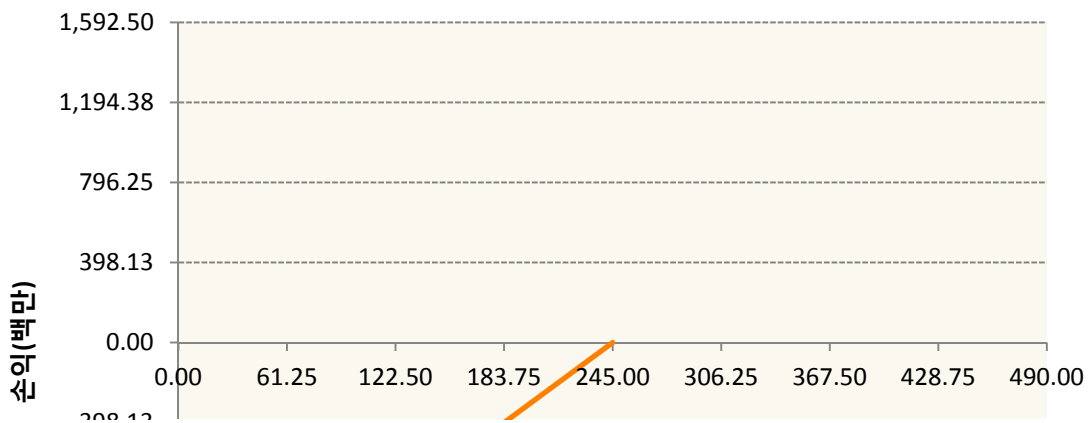




KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



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%	32	31	29	28	26	25	23	
-5.33%	27	25	23	21	19	17	15	
-2.67%	19	16	14	12	10	8	6	
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6	
2.67%	-10	-11	-13	-15	-17	-19	-21	
5.33%	-28	-29	-30	-32	-33	-35	-37	
8.00%	-48	-49	-50	-51	-52	-53	-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%	28	27	26	25	23	22	20
-5.33%	25	23	21	19	17	15	14
-2.67%	17	15	13	11	9	7	5
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	-8	-10	-12	-14	-16	-18	-20
5.33%	-26	-27	-28	-30	-32	-33	-35
8.00%	-45	-46	-47	-48	-50	-51	-52
KR4301Q52450 2020-05 풋245							85
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-74	-75	-77	-78	-80	-83	-85
-5.33%	-37	-40	-42	-45	-48	-51	-54
-2.67%	-9	-12	-16	-19	-22	-25	-28
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	18	16	14	12	9	7	4
5.33%	22	21	20	18	17	15	13
8.00%	24	23	23	22	21	20	18

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

(단위:백만원)

561

공시일	2020-05-06
기준일	2020-05-04

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

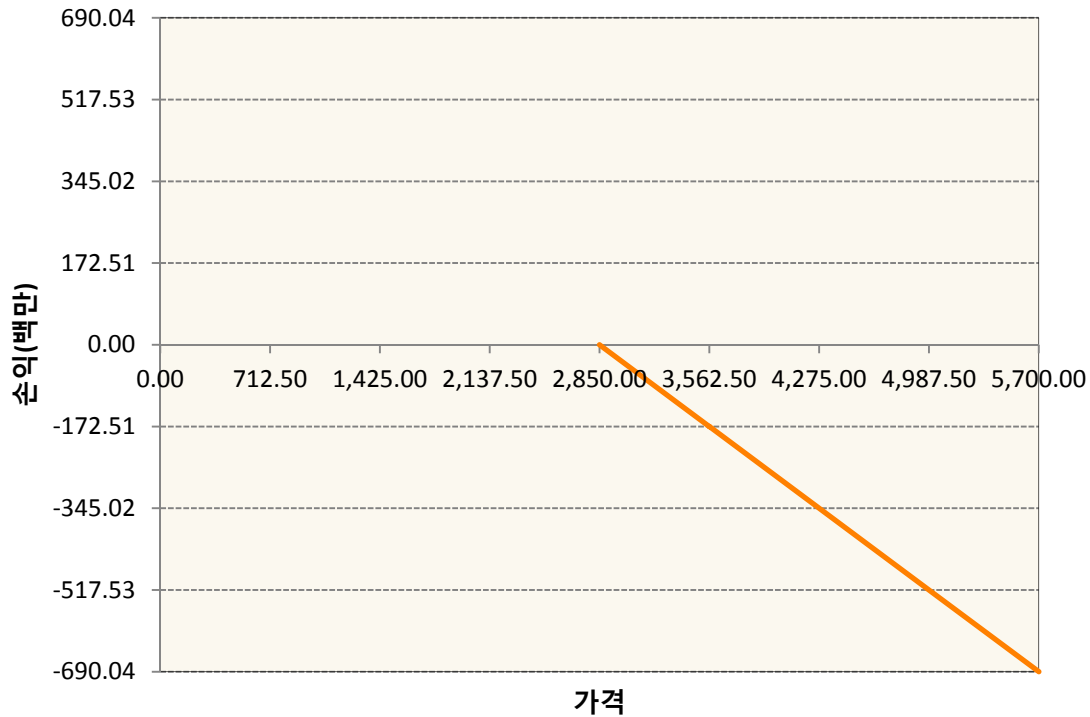
1. 계약금액

(단위:백만원)

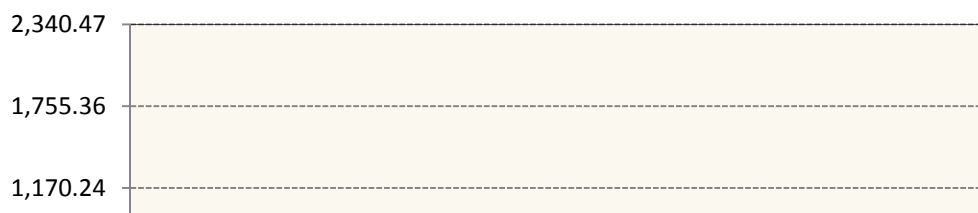
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	739	0	739	
누계	유가증권	스왑	8,022	0	8,022	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,061	-6,061	장내
누계	통화	선도	0	2,722	-2,722	장외

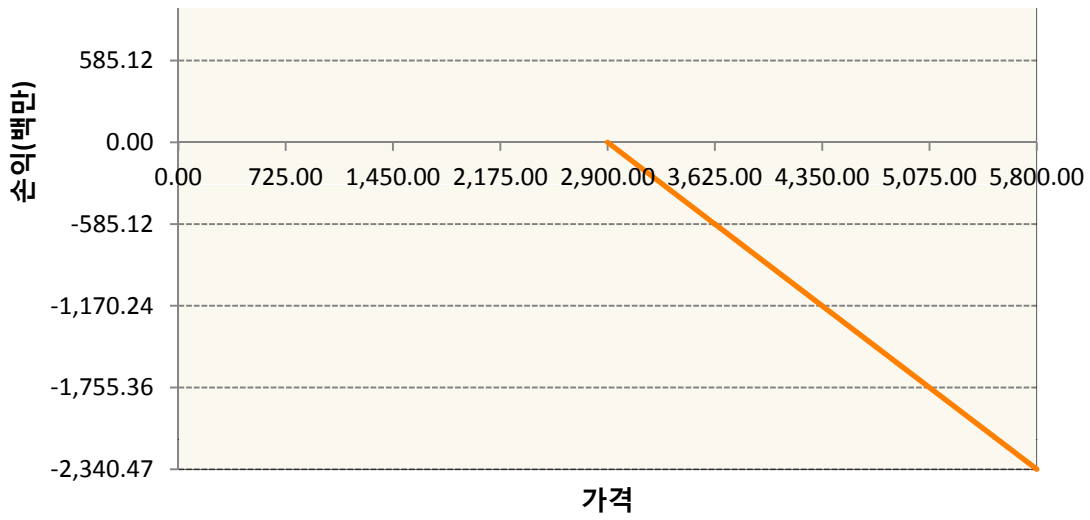
2. 만기시점의 손익구조

OESXK0-C2850-EURO STOXX 50

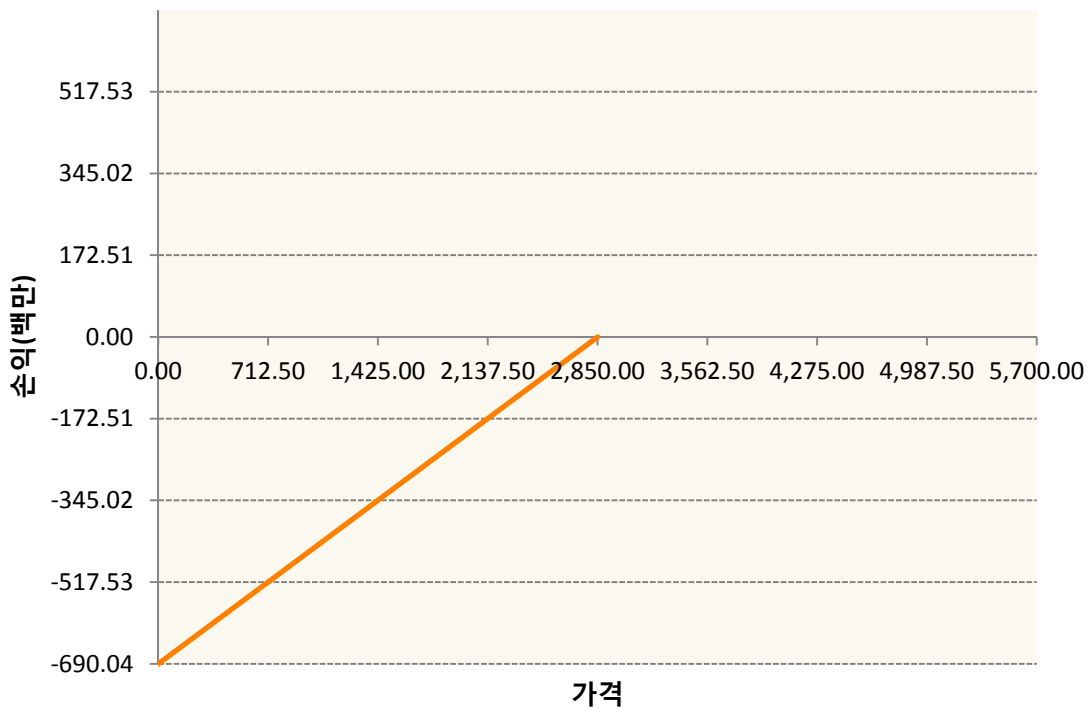


OESXK0-C2900-EURO STOXX 50

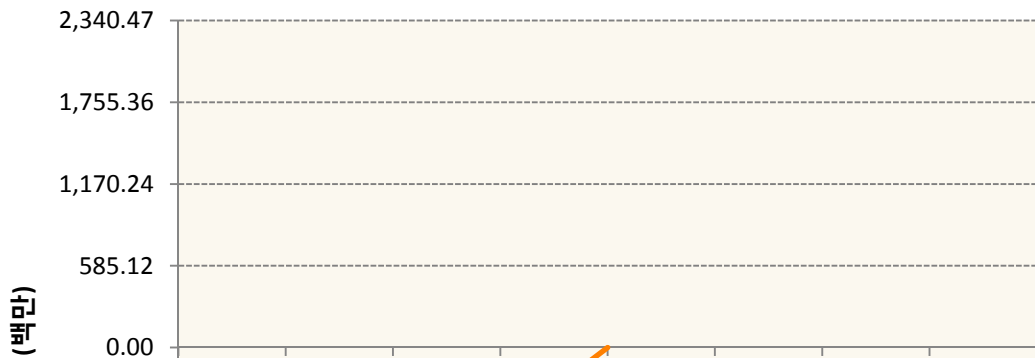


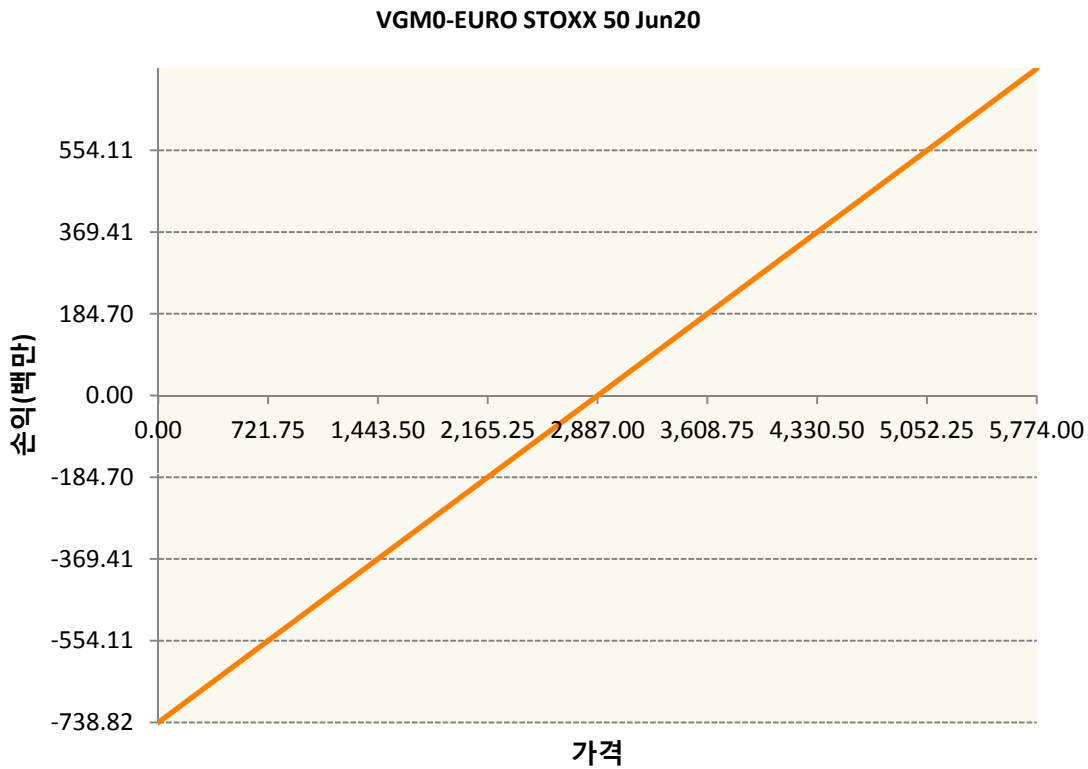
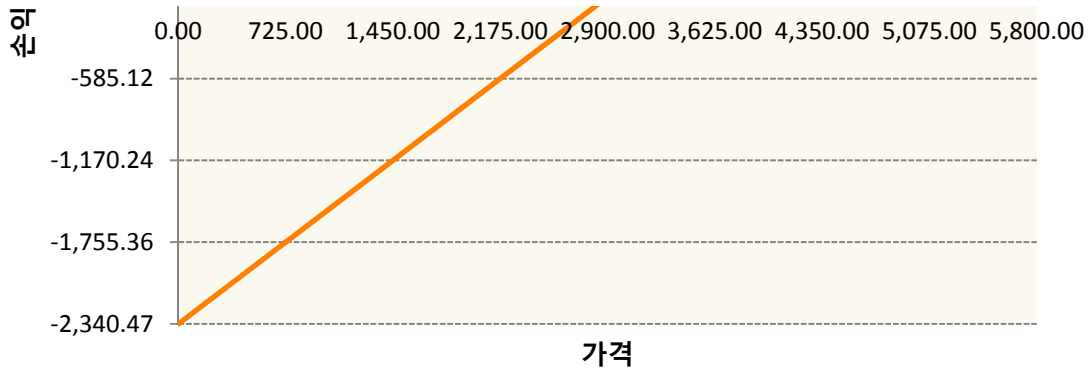


OESXK0-P2850-EURO STOXX 50



OESXK0-P2900-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	15
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E	218
OESXK0-C28 EURO STOXX 50	55
OESXK0-C29 EURO STOXX 50	187
OESXK0-P28 EURO STOXX 50	55
OESXK0-P29 EURO STOXX 50	187
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20	59

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

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

(단위:백만원)

1,120

공시일	2020-05-06
기준일	2020-05-04

ETF스마트레버리지목표전환형9호

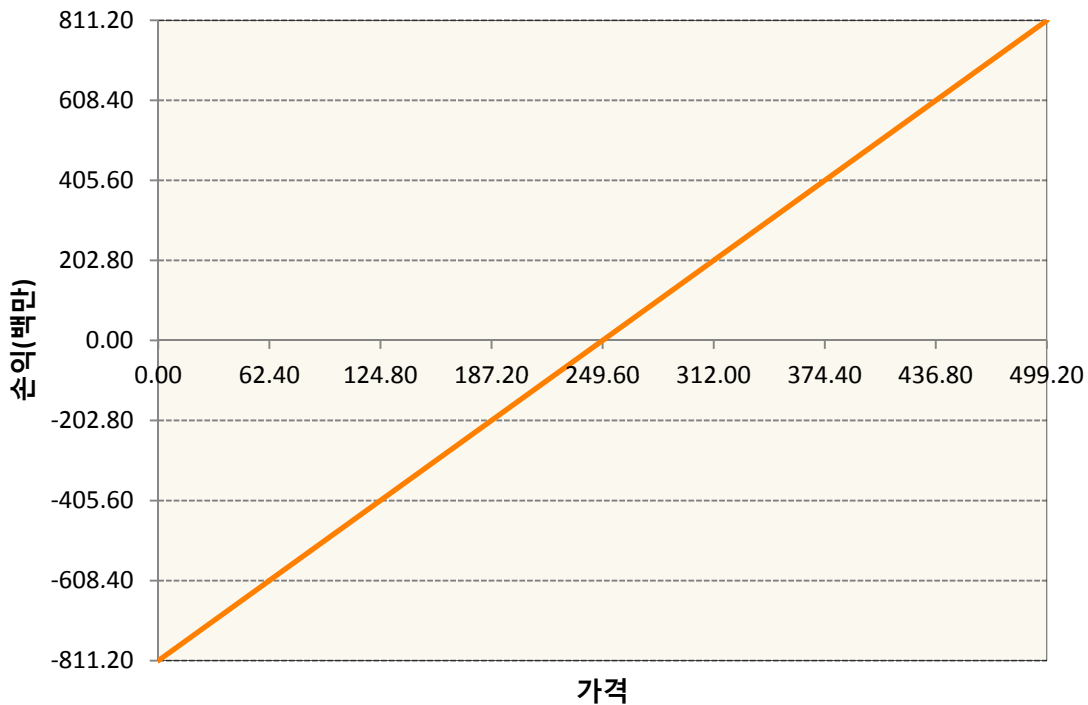
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	811	0	811	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						65
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65	
-5.33%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43	
-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%	43	43	43	43	43	43	43	
8.00%	65	65	65	65	65	65	65	

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

(단위:백만원)

97

공시일	2020-05-06
기준일	2020-05-04

ETF스마트레버리지목표전환형10호

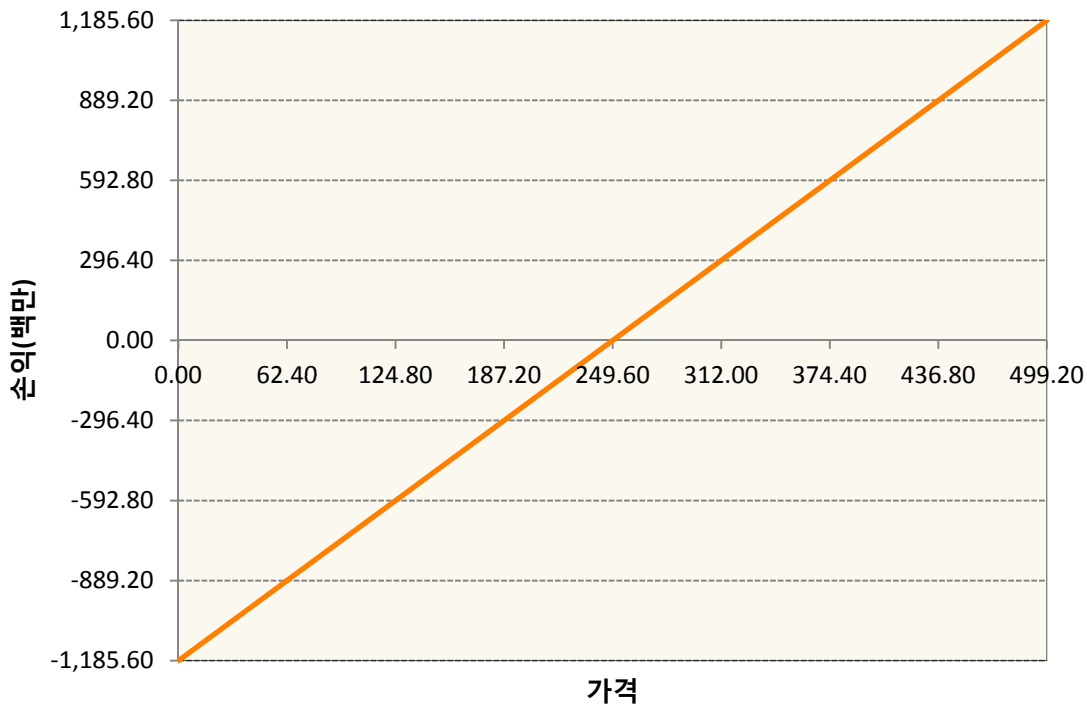
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						95
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-95	
-5.33%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63	
-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%	63	63	63	63	63	63	63	
8.00%	95	95	95	95	95	95	95	

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

(단위:백만원)

142

공시일	2020-05-06
기준일	2020-05-04

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

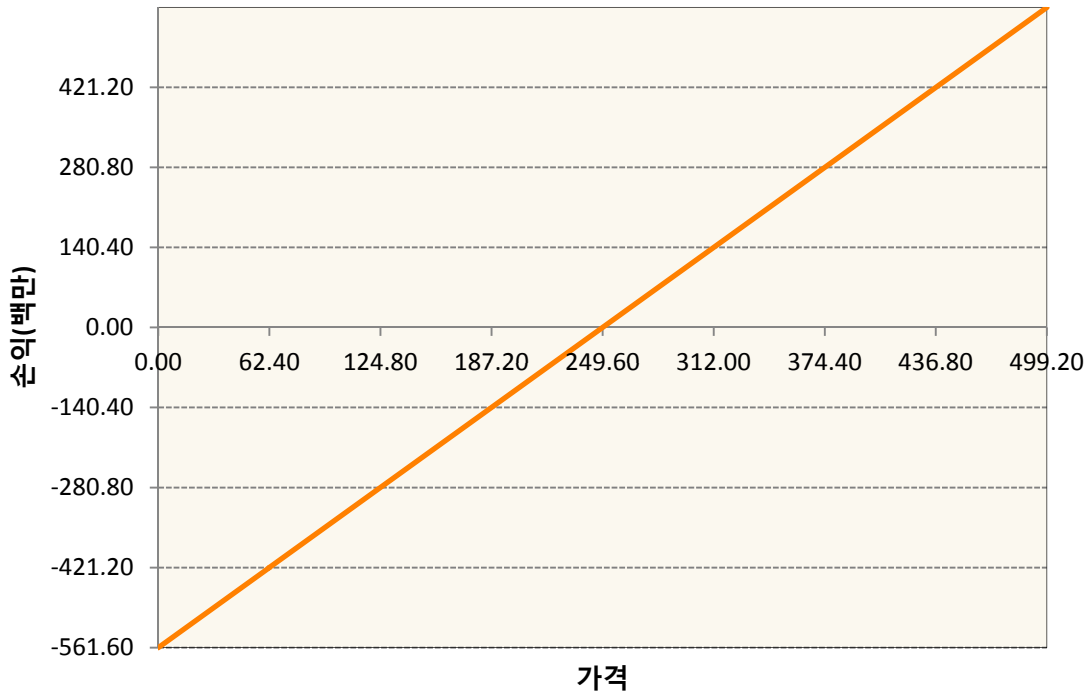
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	562	0	562	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	2020-05-06
기준일	2020-05-04

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

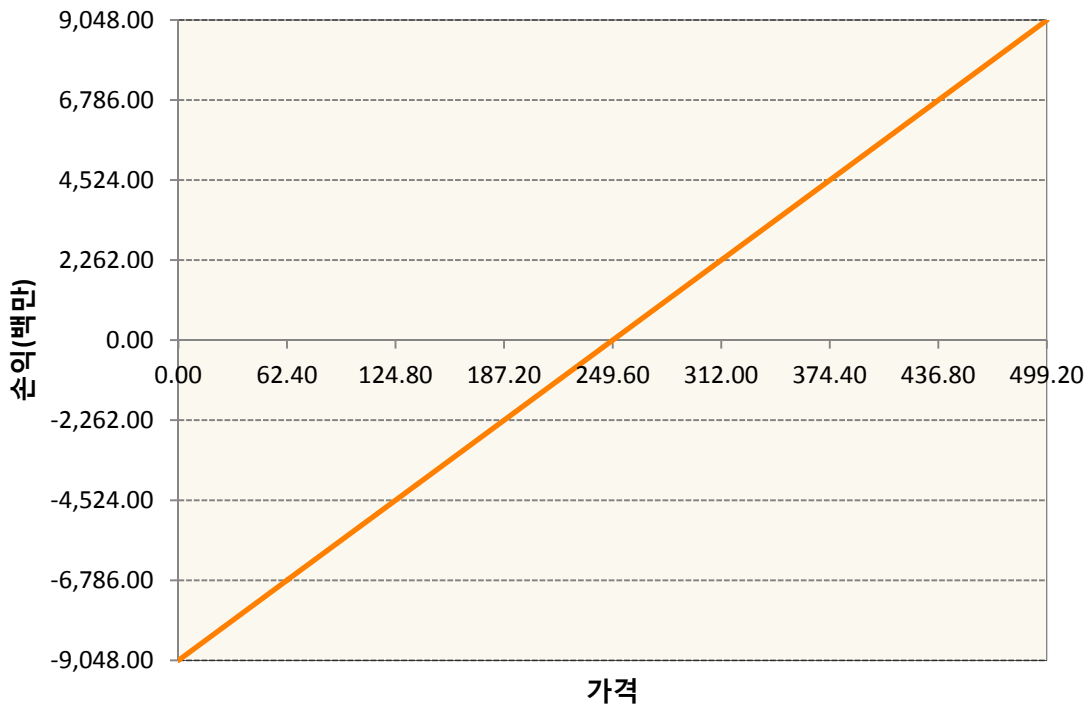
1. 계약금액

(단위:백만원)

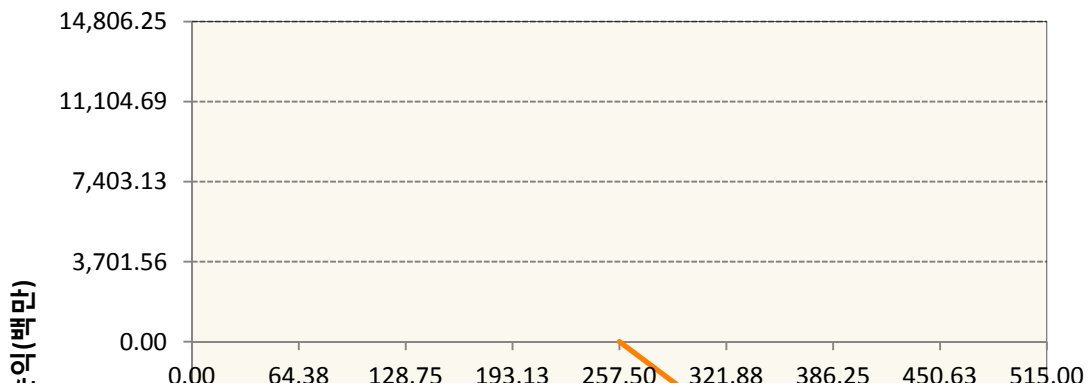
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,048	0	9,048	장내
누계	유가증권	옵션	6,201	17,536	-11,335	장내

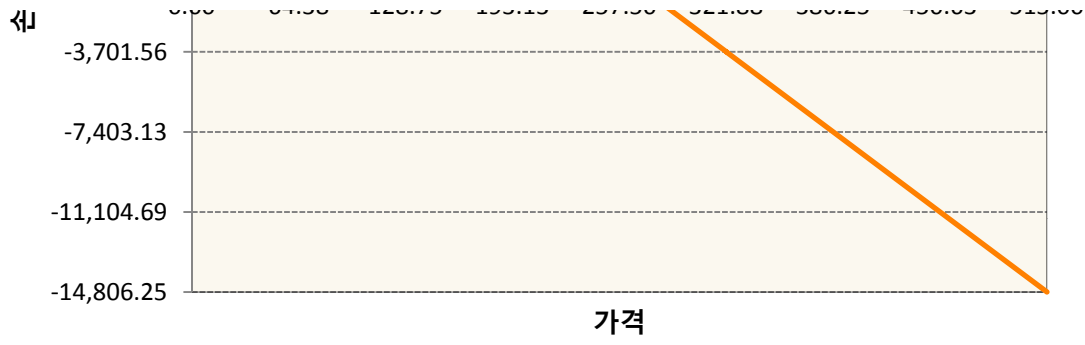
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

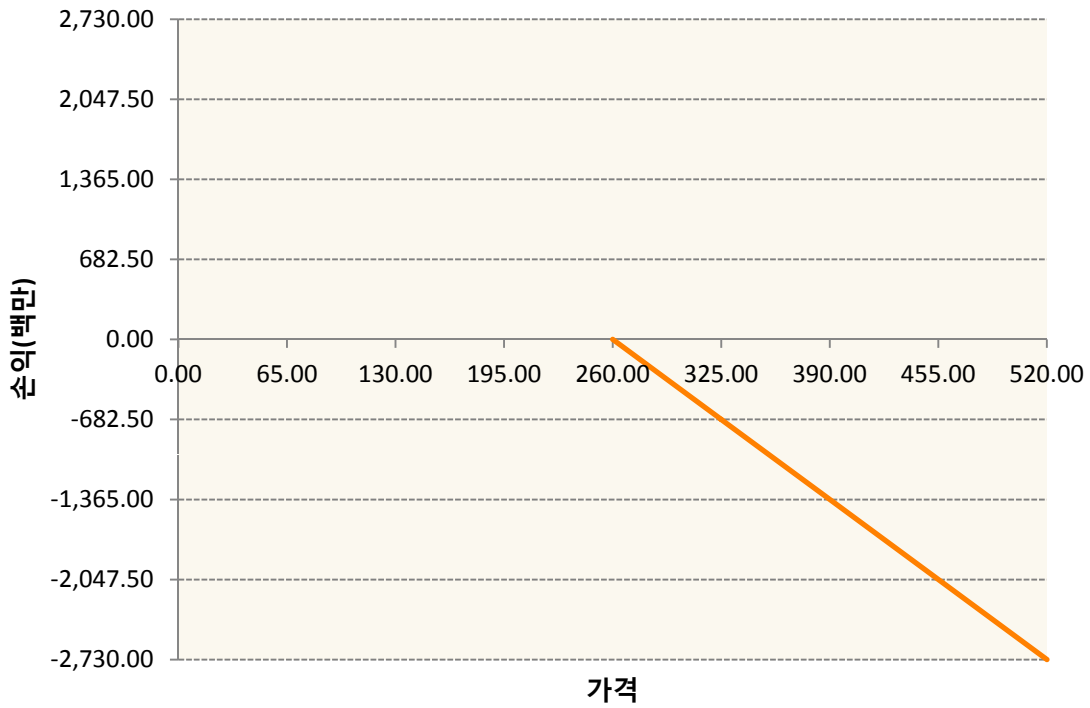


KR4201Q52577-2020-05 콜257.5

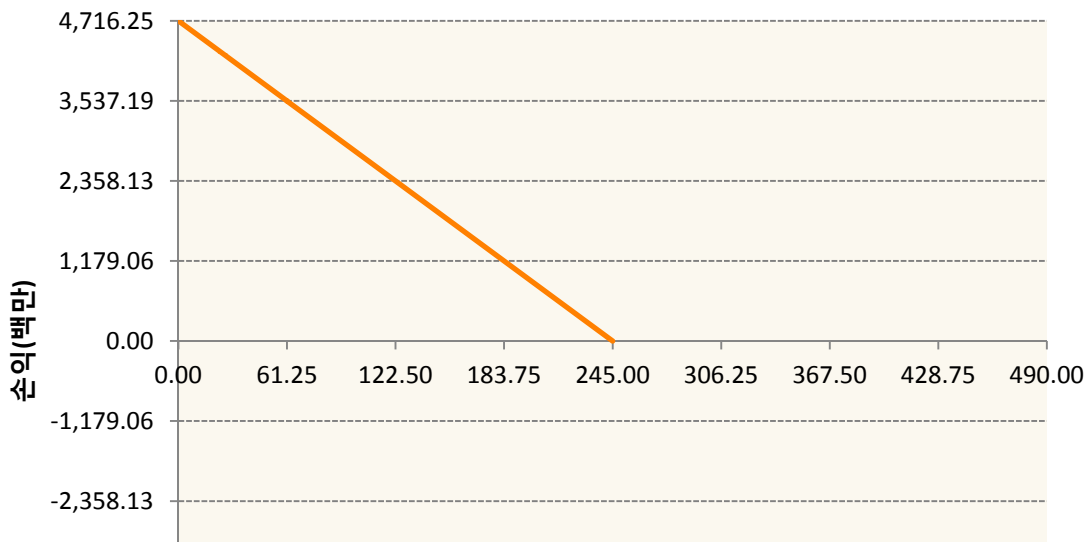


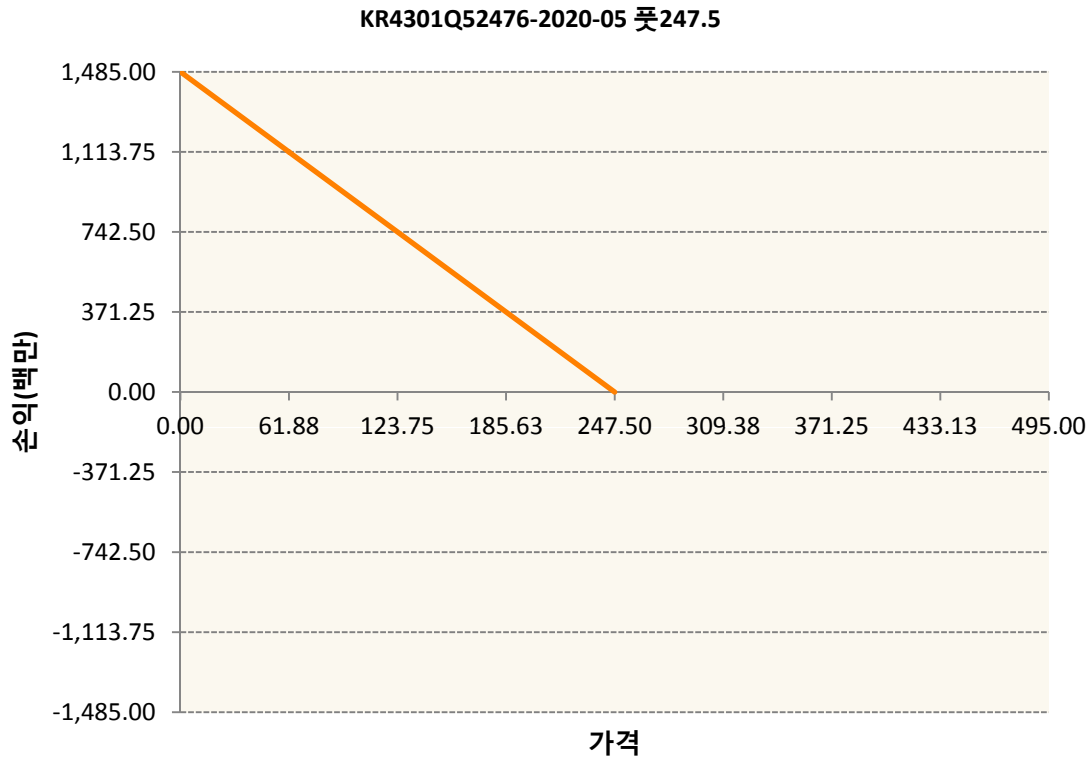
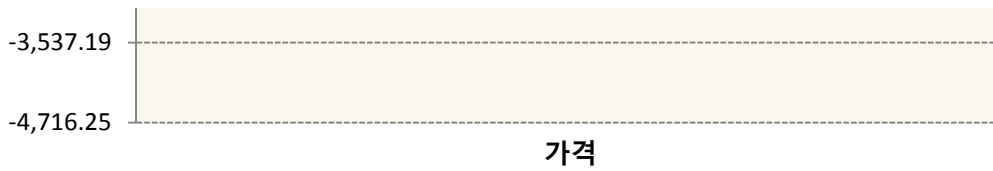


KR4201Q52601-2020-05 콜260



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						727
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-727	-727	-727	-727	-727	-727	-727	
-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%	727	727	727	727	727	727	727	
KR4201Q52577		2020-05 콜257.5						761
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	286	278	267	253	237	219	199	
-5.33%	263	246	226	205	181	156	129	
-2.67%	209	182	154	123	92	60	26	

0%	109	73	37	0	-37	-75	-113
2.67%	-52	-91	-131	-171	-211	-251	-291
5.33%	-277	-314	-352	-391	-430	-469	-508
8.00%	-560	-590	-622	-656	-690	-725	-761
KR4201Q52601 2020-05 콜260							131
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	44	43	41	39	37	34	31
-5.33%	41	39	36	32	28	24	20
-2.67%	34	29	25	20	14	9	3
0%	19	13	6	0	-7	-13	-20
2.67%	-6	-14	-21	-28	-35	-42	-50
5.33%	-43	-50	-58	-65	-72	-79	-87
8.00%	-91	-97	-104	-110	-117	-124	-131
KR4301Q52450 2020-05 풋245							251
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	218	222	227	232	238	244	251
-5.33%	110	118	126	134	142	150	159
-2.67%	27	37	46	56	65	75	84
0%	-27	-18	-9	0	9	18	28
2.67%	-55	-49	-42	-35	-28	-20	-12
5.33%	-66	-63	-59	-55	-50	-44	-38
8.00%	-70	-69	-67	-64	-61	-58	-54
KR4301Q52476 2020-05 풋247.5							84
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	76	77	78	79	81	83	84
-5.33%	40	42	44	47	49	52	54
-2.67%	11	14	17	20	23	26	29
0%	-9	-6	-3	0	3	6	9
2.67%	-20	-18	-16	-13	-11	-8	-5
5.33%	-26	-24	-23	-21	-19	-17	-15
8.00%	-27	-27	-26	-25	-24	-23	-21

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

(단위:백만원)

2,036

공시일	2020-05-06
기준일	2020-05-04

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	150,714	0	150,714	

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	2020-05-06
기준일	2020-05-04

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	101,622	0	101,622	

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	2020-05-06
기준일	2020-05-04

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	448,984	0	448,984	
누계	통화	선도	44,248	464,108	-419,861	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,458
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,045
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,045
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,399
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	983
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	983
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,557
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	846
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	737
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	492
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,441
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,981
FX21020H11 KRW/USD 11-05-20E	983
FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E	2,950
FX21020J02€ KRW/USD 10-06-20E	1,337
FX21020J02₯ KRW/USD 22-06-20E	1,514
FX21020J02₮ KRW/USD 22-06-20E	1,967
FX21020J03₯ KRW/USD 24-07-20E	2,212
FX21020J04₯ KRW/USD 24-07-20E	1,770
FX21020J04₯ KRW/USD 24-07-20E	1,967

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

20,437

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

(단위:백만원)

193

공시일	2020-05-06
기준일	2020-05-04

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

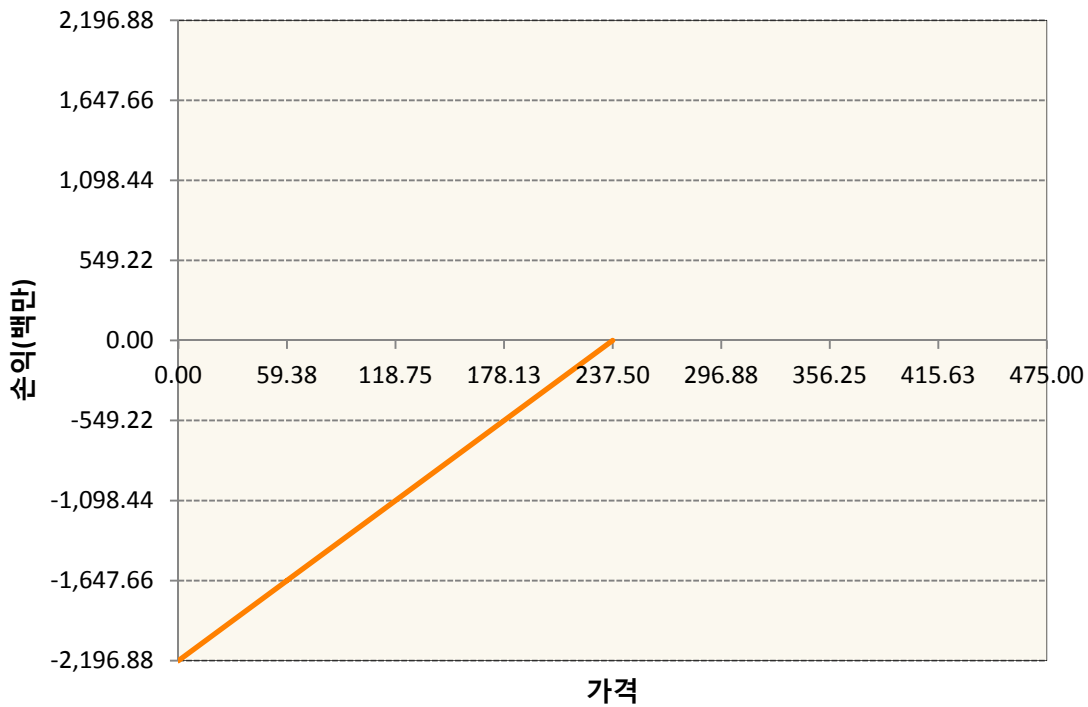
1. 계약금액

(단위:백만원)

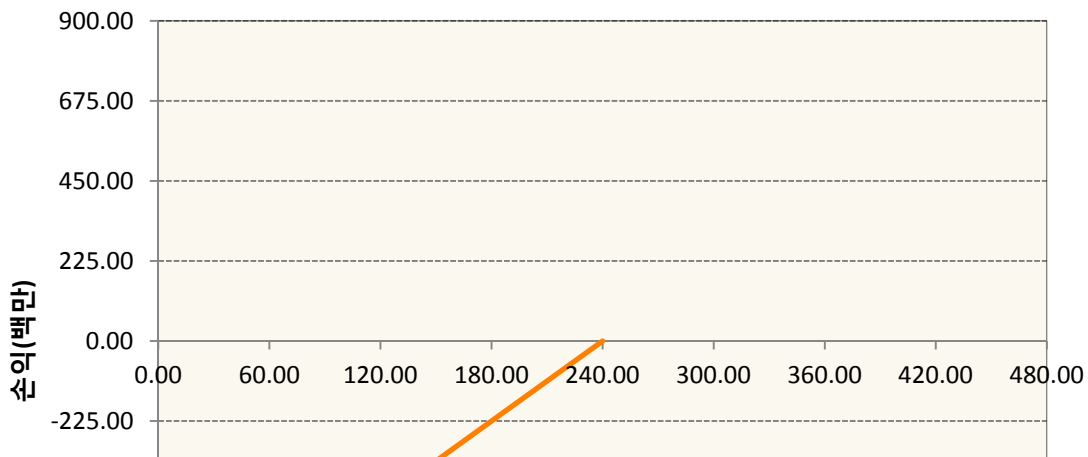
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,097	-3,097	장내

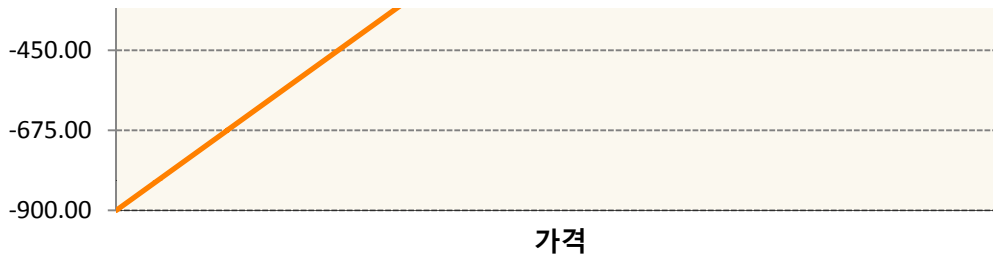
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q52377-2020-05 풋237.5



KR4301Q52401-2020-05 풋240





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q52377		2020-05 풋237.5						89
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-66	-69	-73	-77	-81	-85	-89	
-5.33%	-27	-32	-36	-41	-45	-50	-54	
-2.67%	-3	-7	-11	-15	-20	-24	-28	
0%	8	6	3	0	-3	-7	-10	
2.67%	13	12	10	8	6	4	1	
5.33%	14	14	13	12	11	9	8	
8.00%	15	14	14	14	13	12	11	
KR4301Q52401		2020-05 풋240						40
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-32	-33	-35	-36	-37	-39	-40	
-5.33%	-14	-16	-18	-20	-21	-23	-25	
-2.67%	-2	-4	-6	-8	-9	-11	-13	
0%	4	3	1	0	-1	-3	-5	
2.67%	7	6	5	4	3	2	1	
5.33%	8	7	7	7	6	5	4	
8.00%	8	8	8	7	7	7	6	

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

101

공시일	2020-05-06
기준일	2020-05-04

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	7,401	0	7,401	
누계	통화	선도	0	7,190	-7,190	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J01! KRW/USD 13-05-20E	322
FX21020J04! KRW/USD 29-05-20E	254
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

289

공시일	2020-05-06
기준일	2020-05-04

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

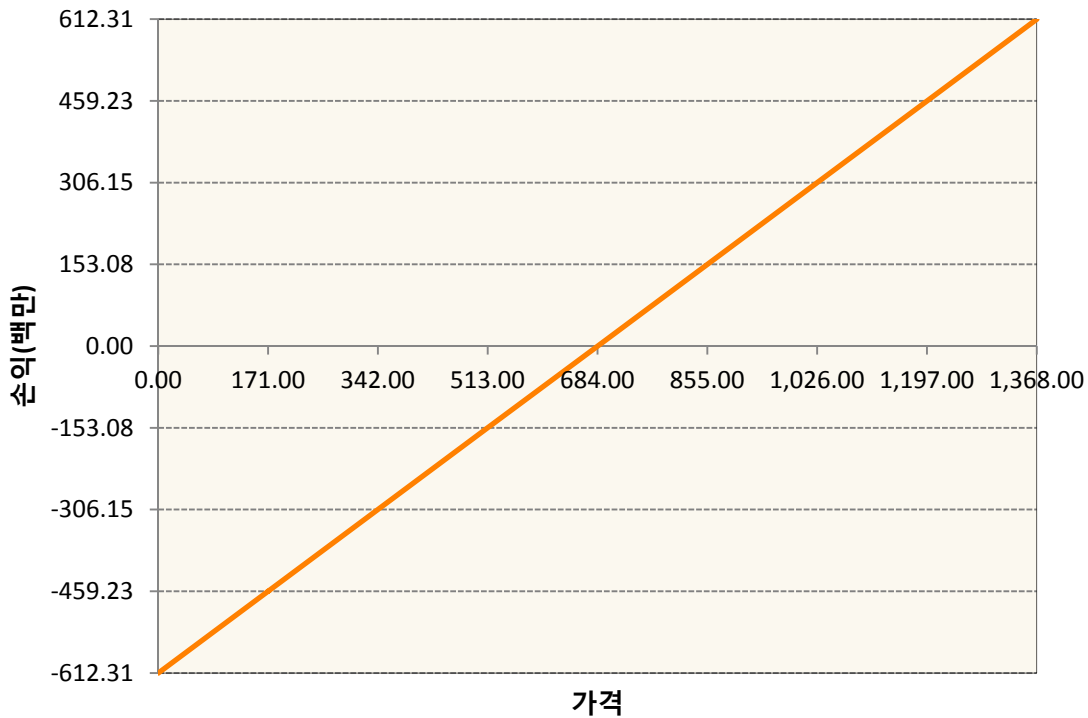
1. 계약금액

(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	612	0	612	
누계	유가증권	스왑	881	0	881	장외
누계	통화	선도	207	705	-498	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCK0-VN30 Index Future May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	71
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
FX21020K00 KRW/EUR 22-05-20E	5
VNCK0 VN30 Index Future May20	49

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

(단위:백만원)

147

공시일	2020-05-06
기준일	2020-05-04

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

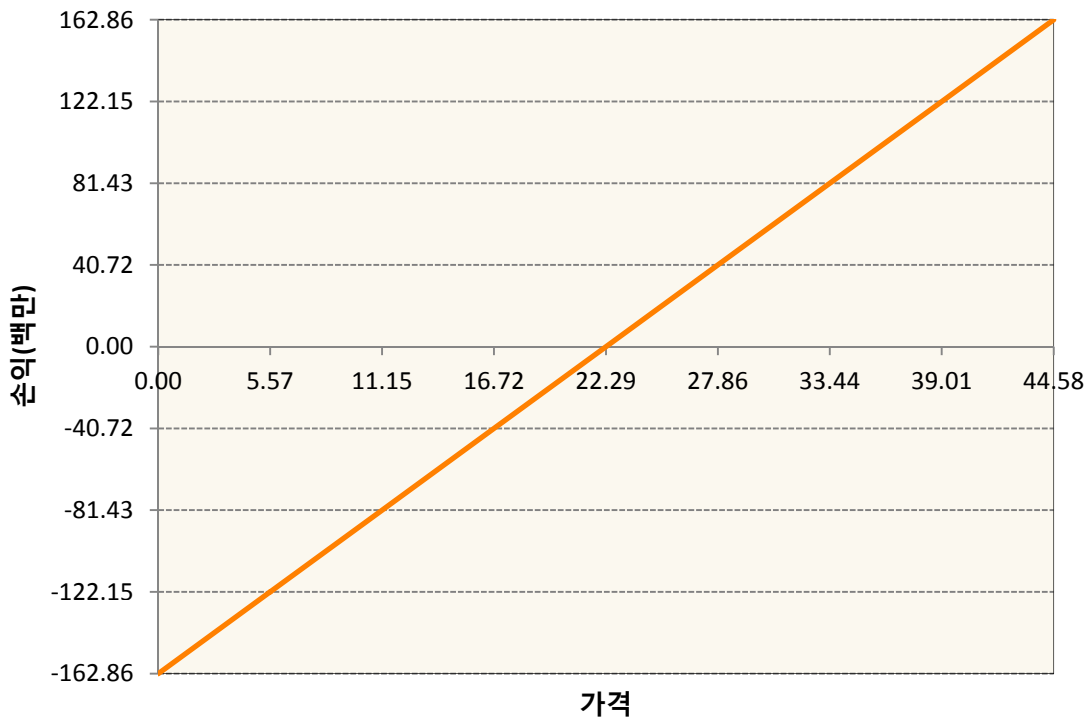
1. 계약금액

(단위:백만원)

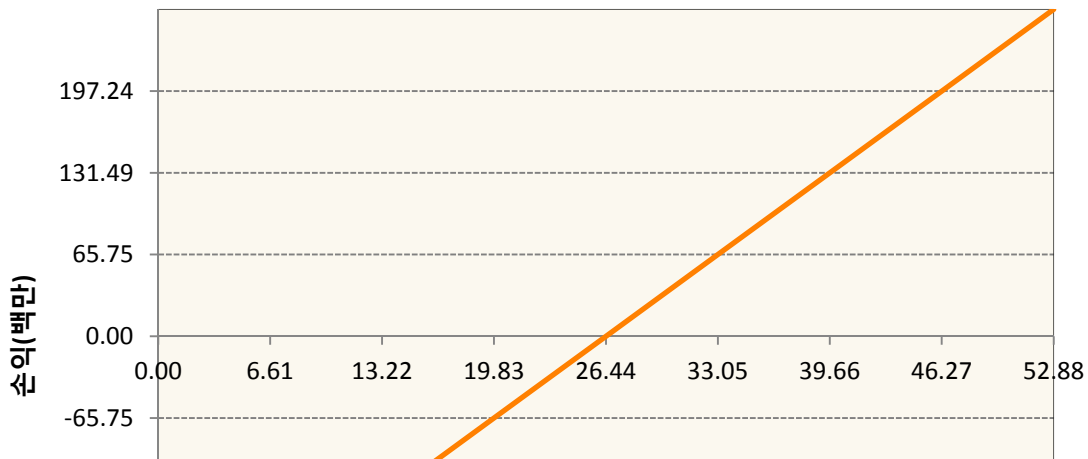
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,412	184	1,228	

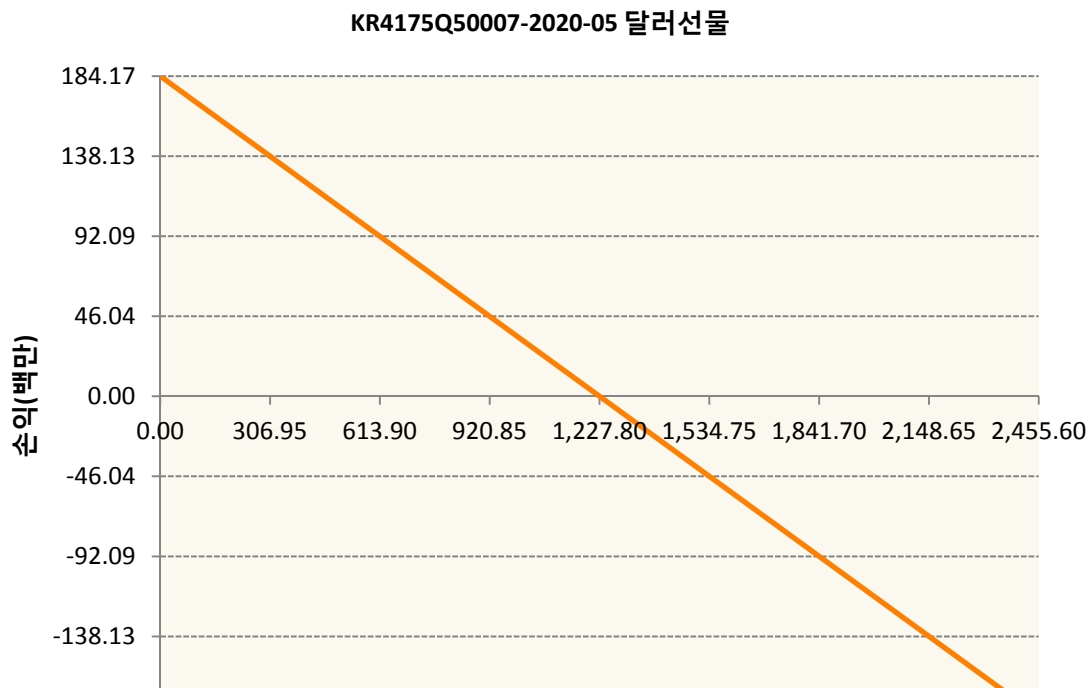
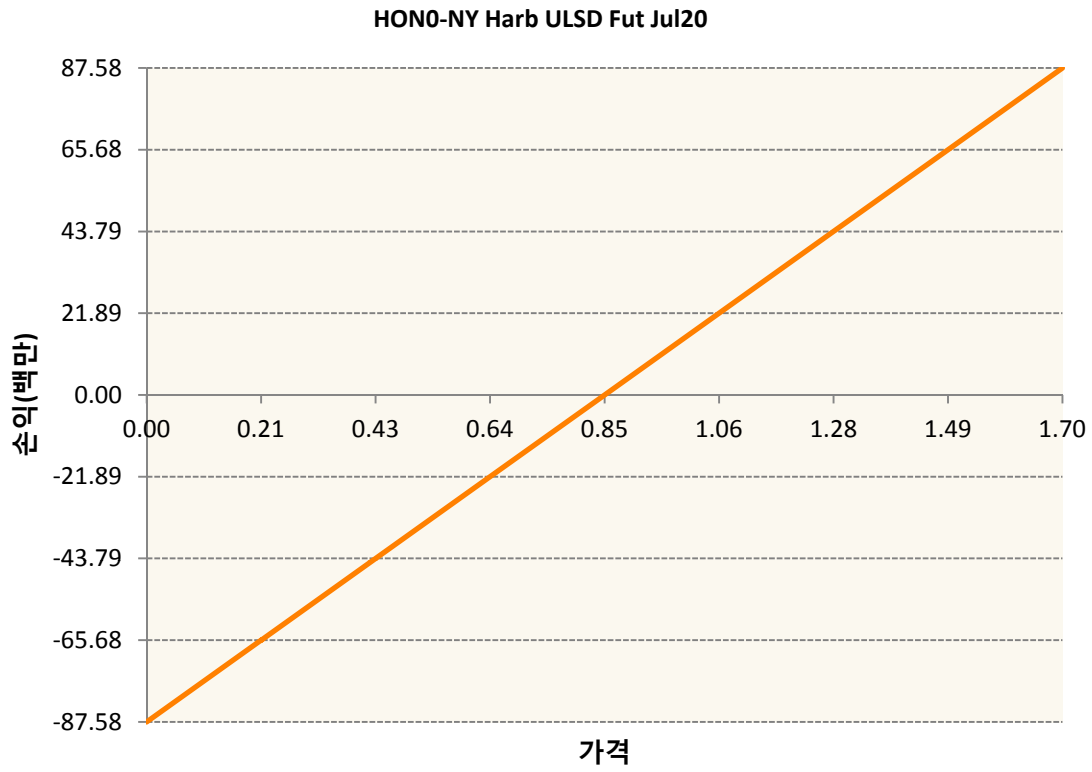
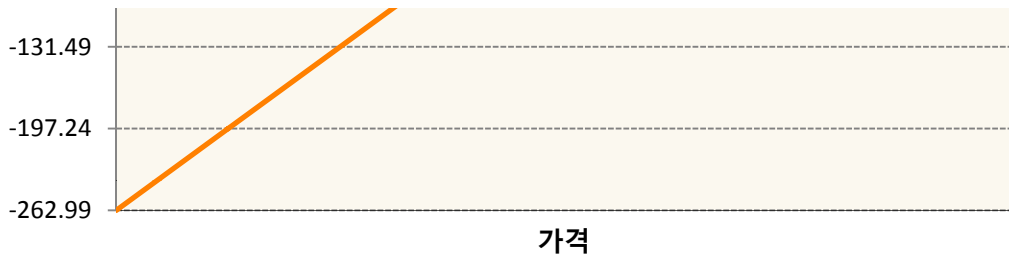
2. 만기시점의 손익구조

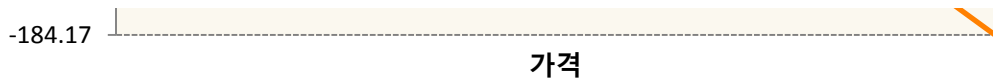
CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20



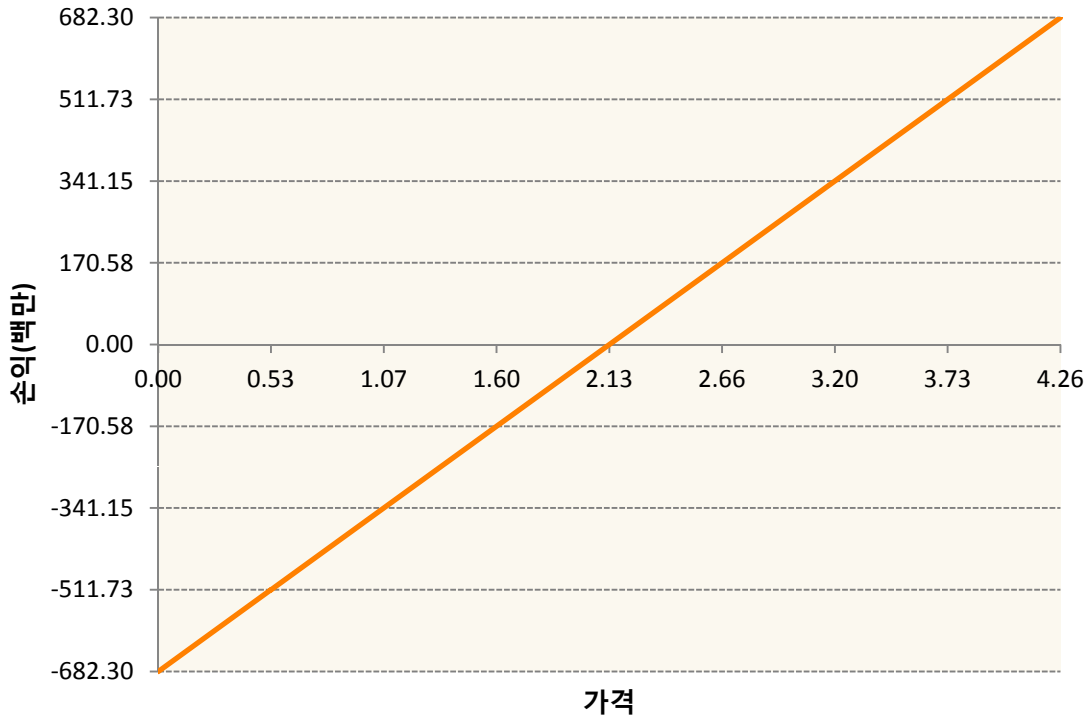
CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20



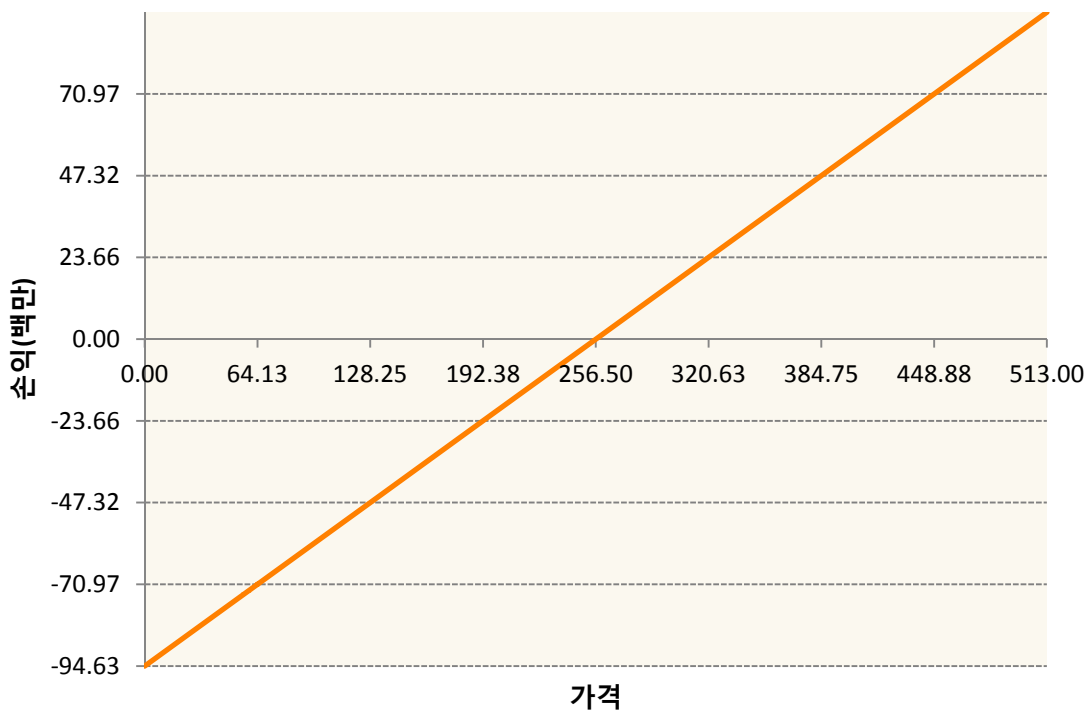




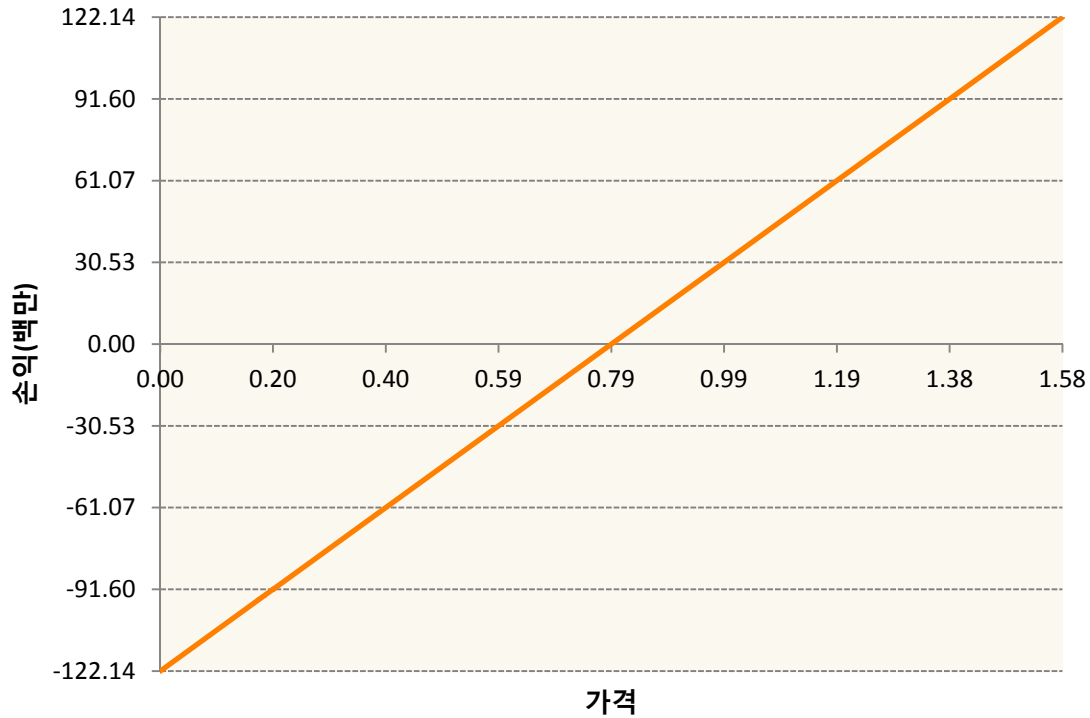
NGN20-NATURAL GAS FUTR Jul20



QSN0-Low Su Gasoil G Jul20



XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN0	WTI CRUDE FUTURE Jul20	13
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	21
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	10

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

520

공시일	2020-05-06
기준일	2020-05-04

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

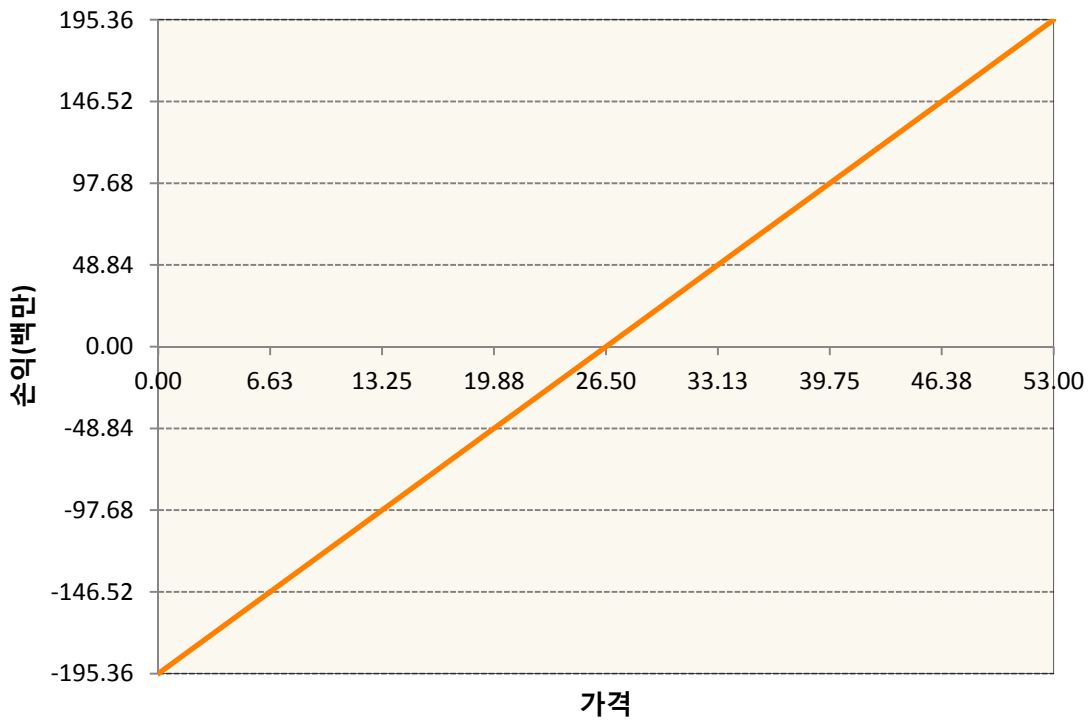
1. 계약금액

(단위:백만원)

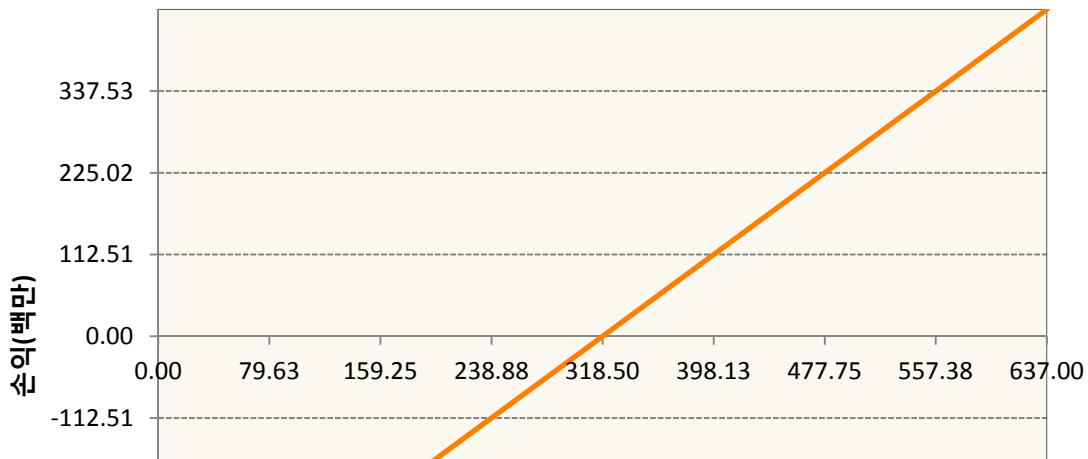
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,378	74	2,304	

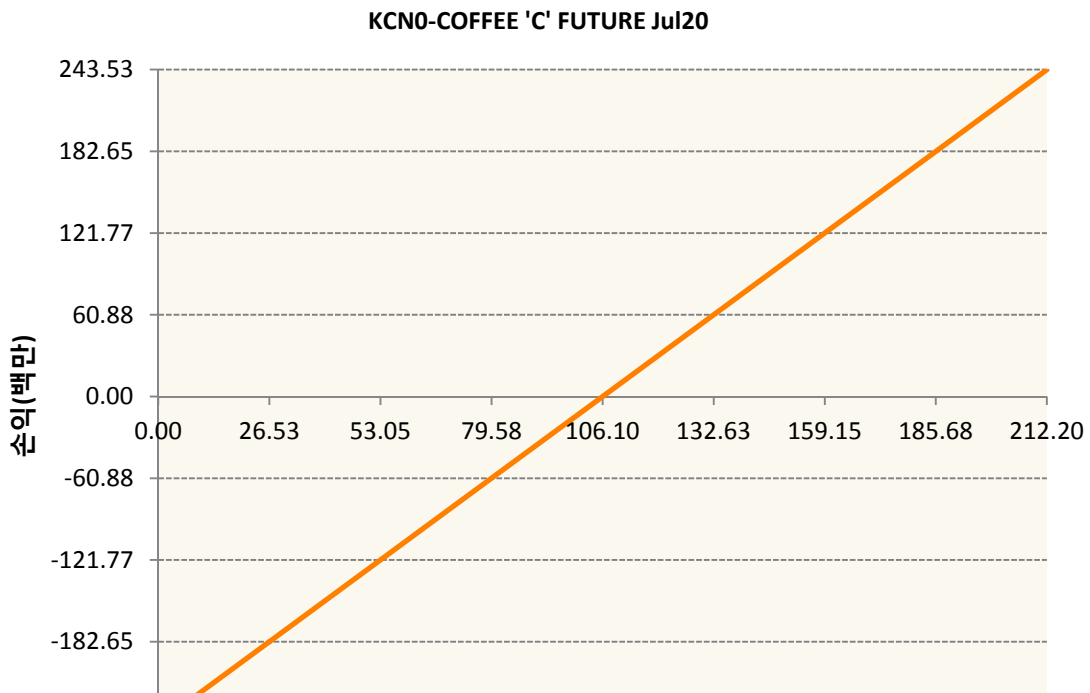
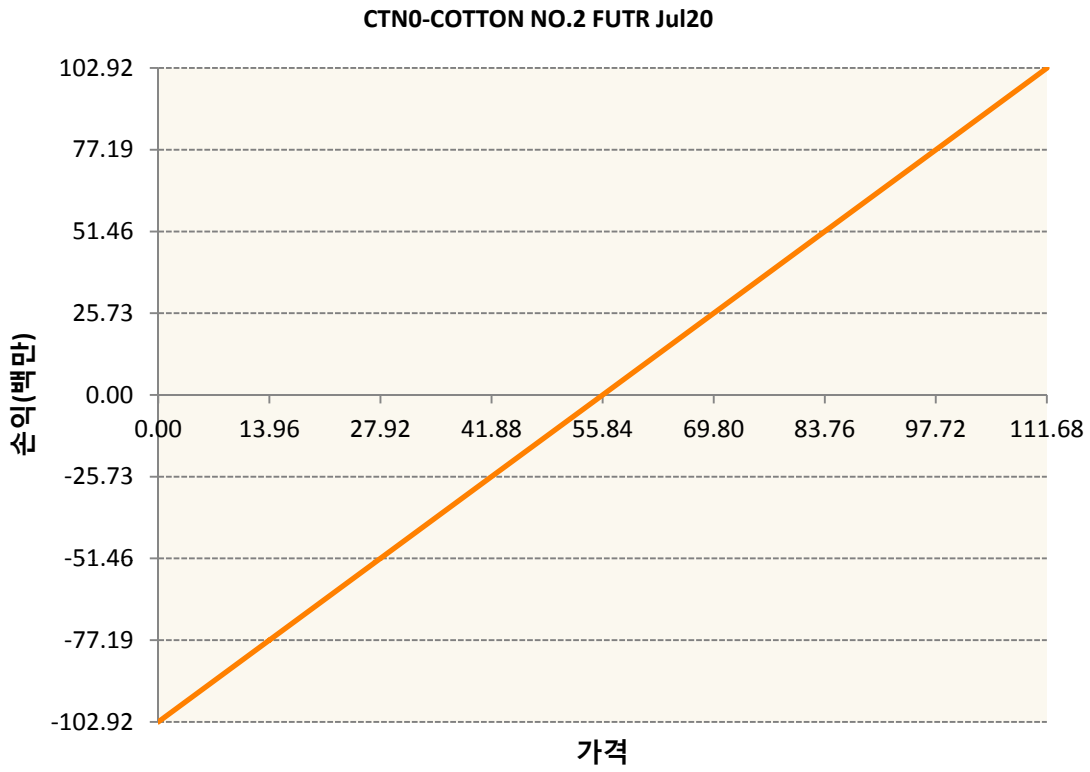
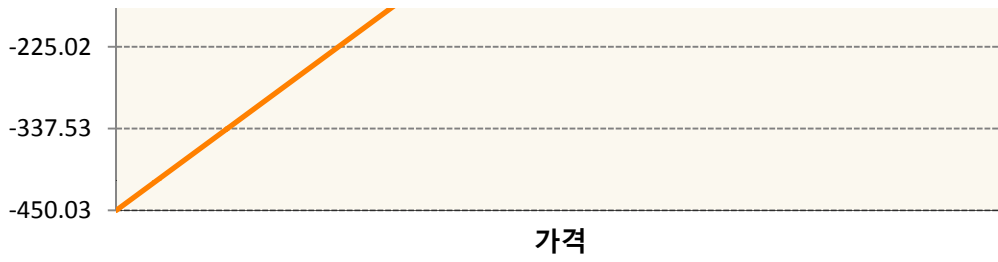
2. 만기시점의 손익구조

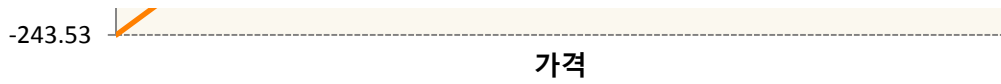
BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20



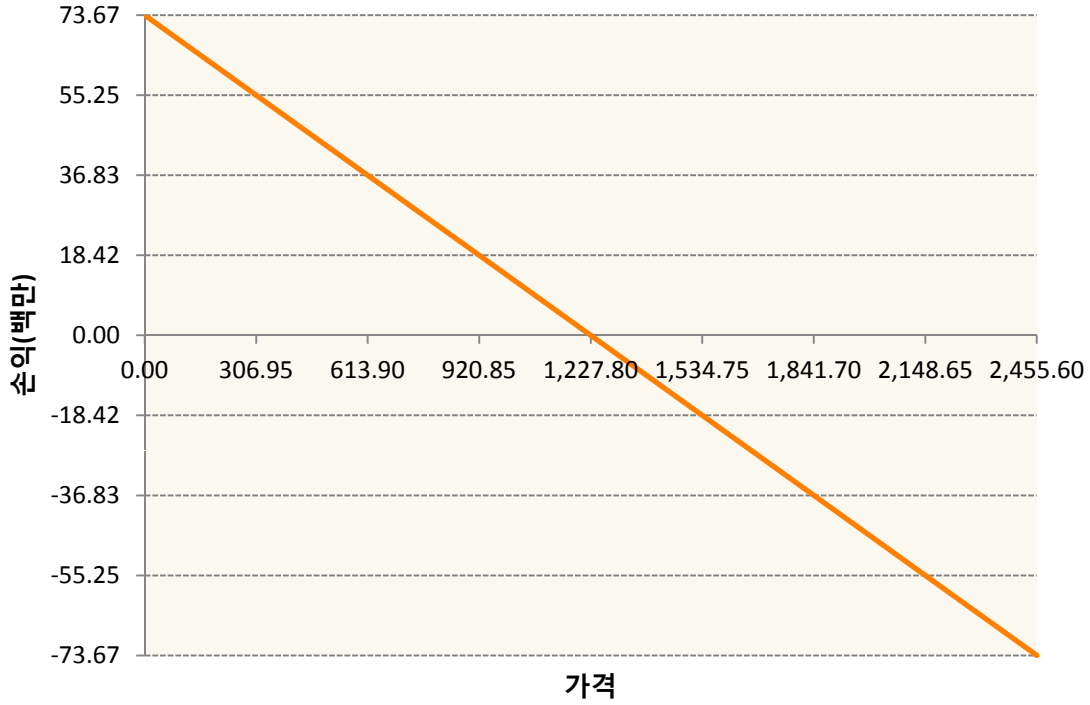
CNO-CORN FUTURE Jul20



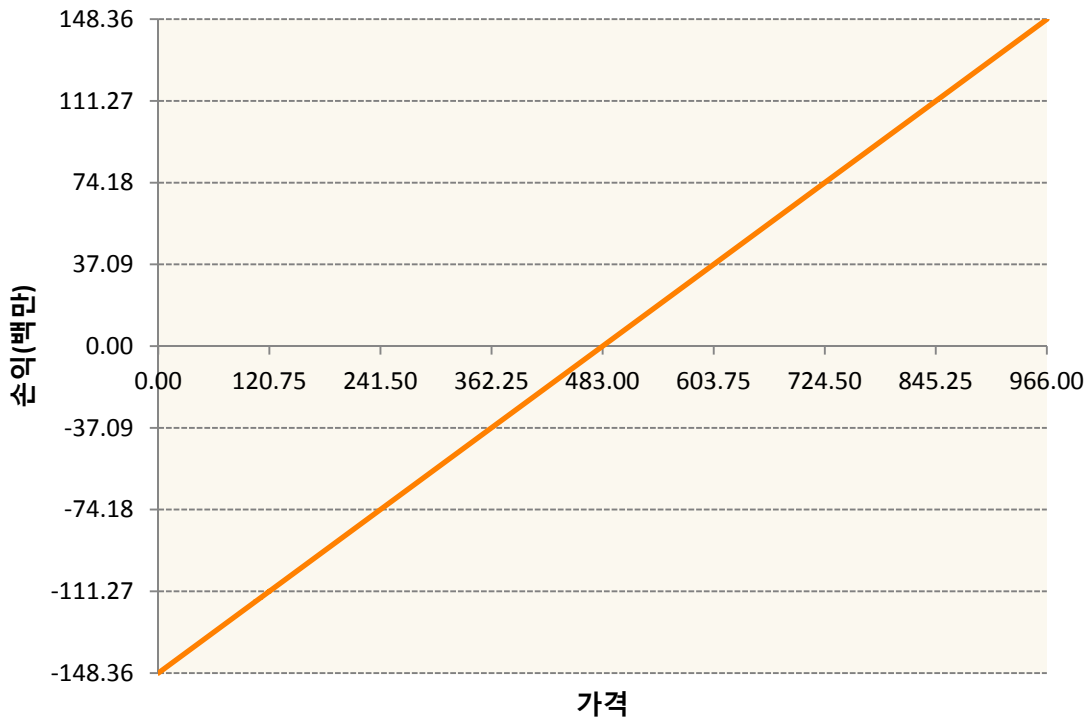




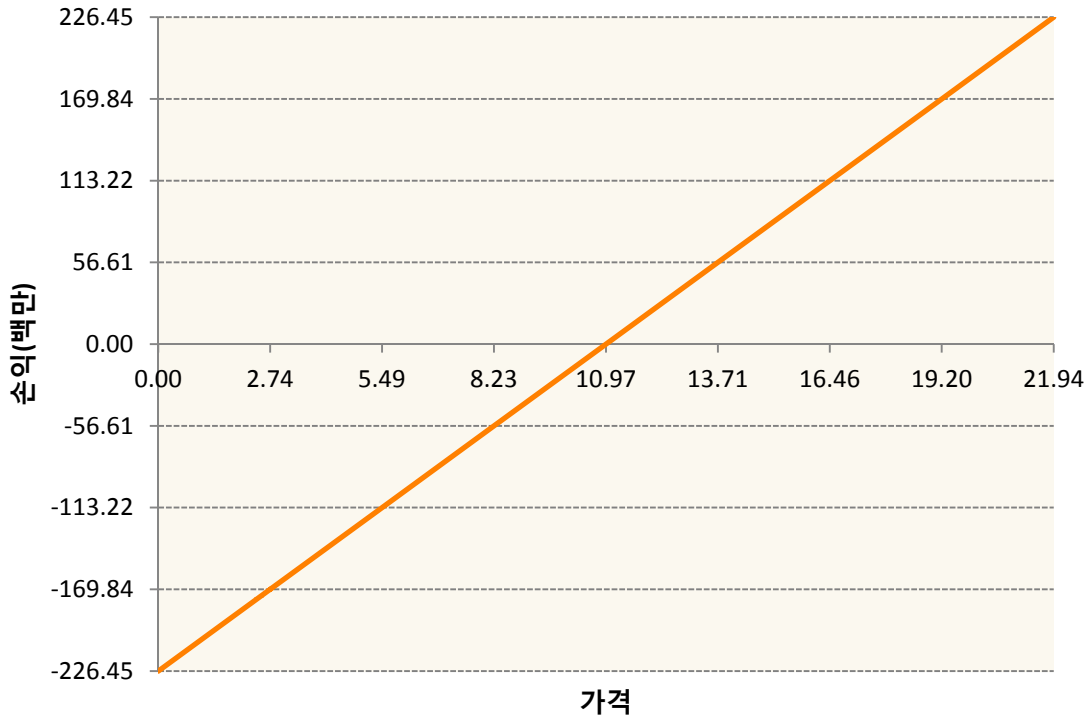
KR4175Q50007-2020-05 달러선물



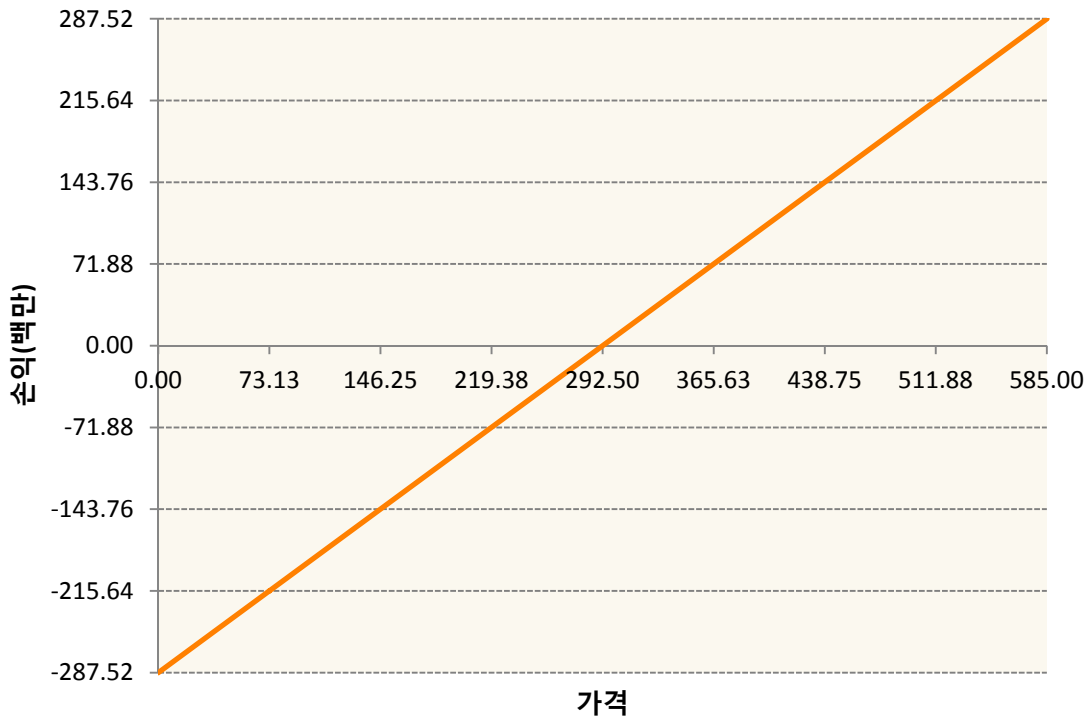
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



SBN0-Sugar Jul20

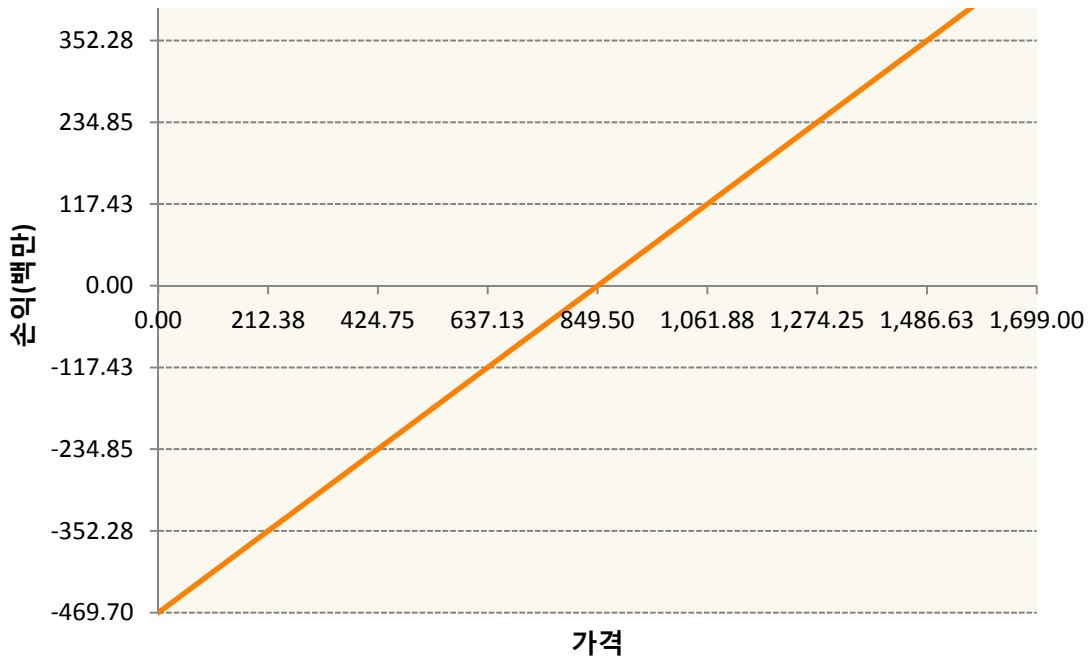


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20

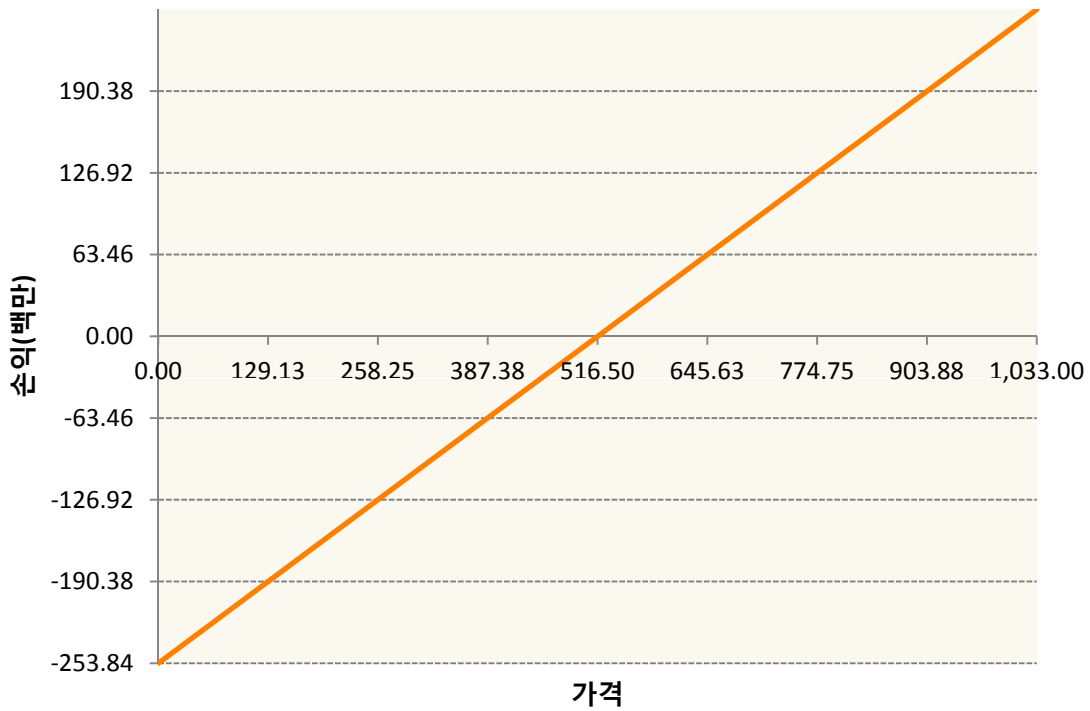


SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





WN0-WHEAT FUTURE(CBT) Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON0	SOYBEAN OIL FUTR Jul20	16
CN0	CORN FUTURE Jul20	36
CTN0	COTTON NO.2 FUTR Jul20	8
KCN0	COFFEE 'C' FUTURE Jul20	19
KR4175Q50C	2020-05 달러선물	6

KWN0	KC HRW WHEAT FUT Jul20	12
SBN0	Sugar Jul20	18
SMN0	SOYBEAN MEAL FUTR Jul20	23
SN0	SOYBEAN FUTURE Jul20	38
WNO	WHEAT FUTURE(CBT) Jul20	20

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

(단위:백만원)

225