

공시일	2020-05-07
기준일	2020-05-06

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	2020-05-07
기준일	2020-05-06

스마트인덱스모

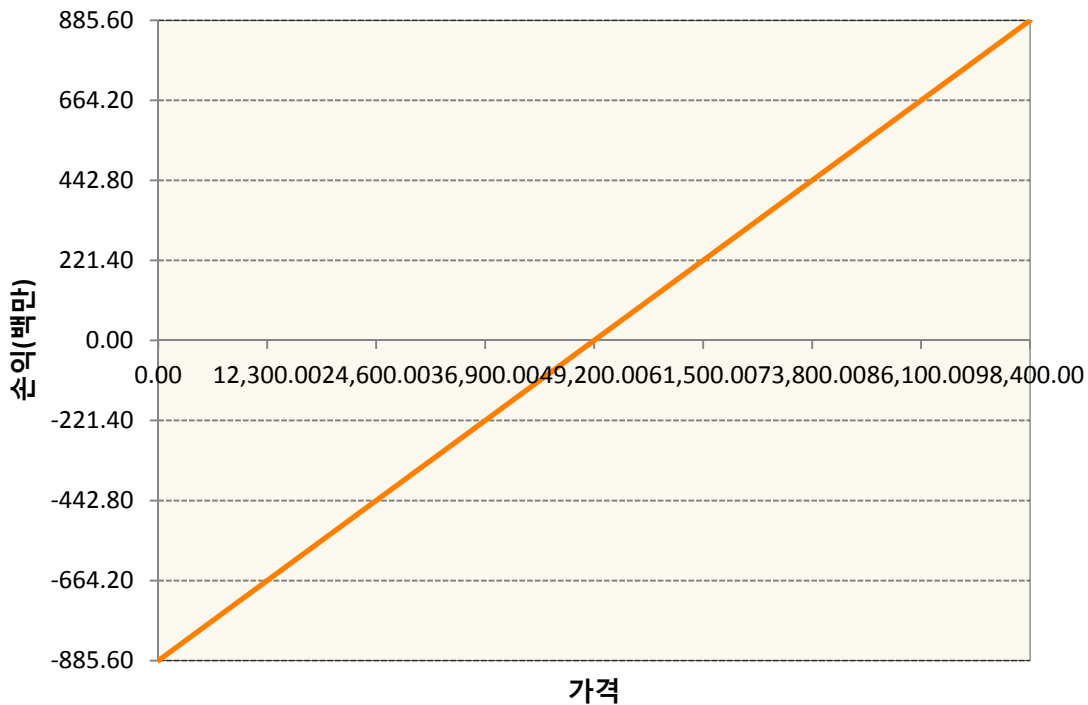
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	886	0	886	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111Q50002-2020-05 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111Q50002		2020-05 삼성전자개별선물						71
가격	기초자산의 변동성							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71	
-5.33%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47	
-2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	24	24	24	24	24	24	24	
5.33%	47	47	47	47	47	47	47	
8.00%	71	71	71	71	71	71	71	

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

(단위:백만원)

107

공시일	2020-05-07
기준일	2020-05-06

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

973

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,143

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-07
기준일	2020-05-06

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)

SWCSI500000 신한CSI500미래S200310

568

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

888

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-07
기준일	2020-05-06

유로인덱스모(주식-파생형)

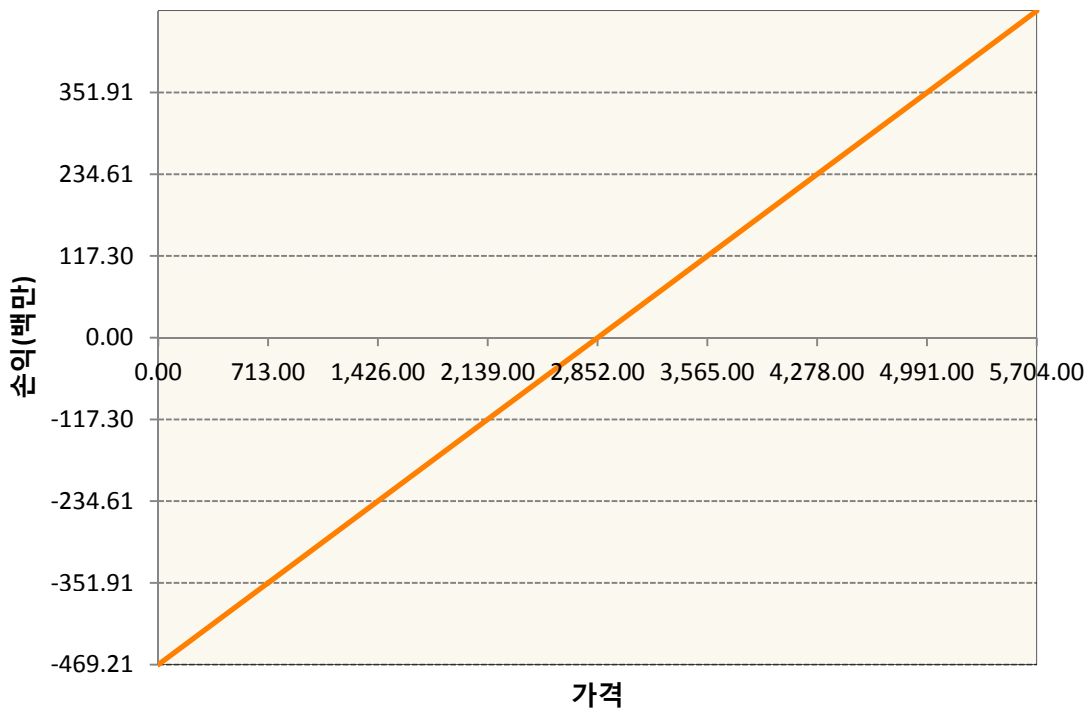
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	469	0	469	

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	2020-05-07
기준일	2020-05-06

차이나인덱스모(주식-파생형)

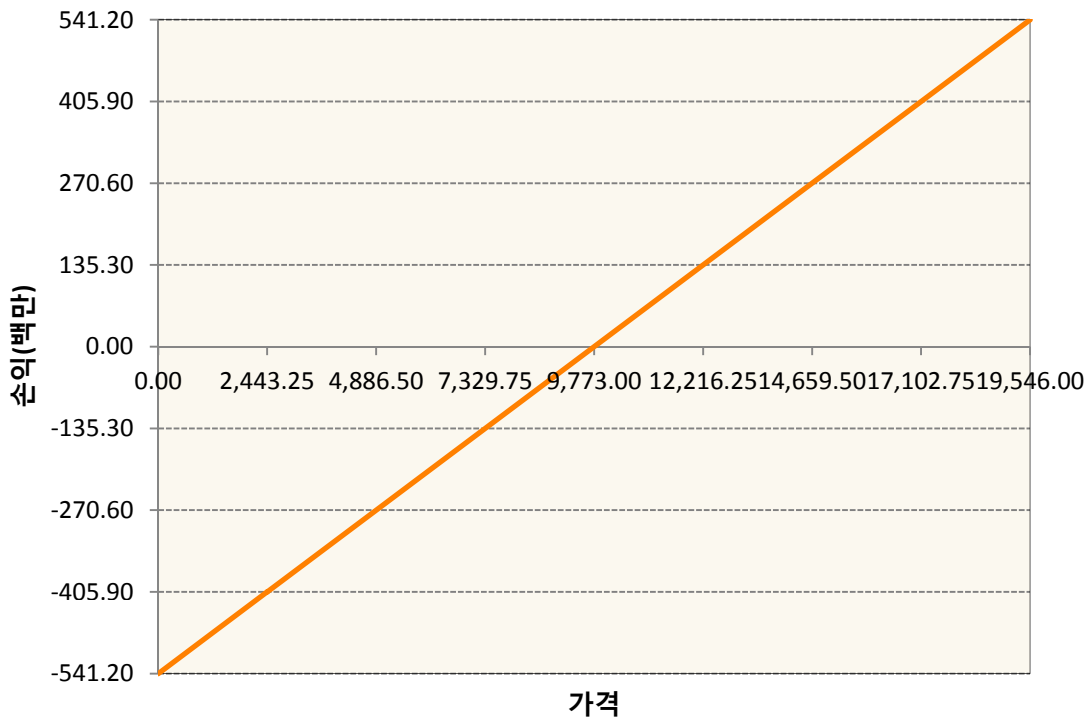
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	541	0	541	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCK0-HSCEI Futures May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK0	HSCEI Futures May20	43
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

47

공시일	2020-05-07
기준일	2020-05-06

커버드콜모(주식혼합-파생형)

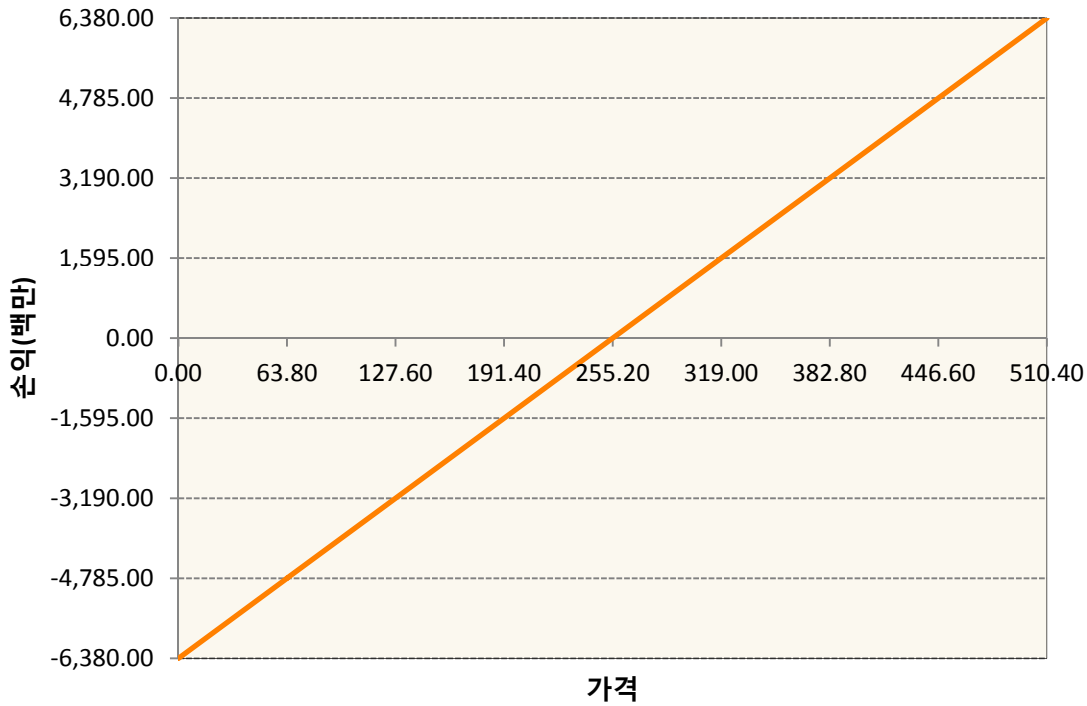
1. 계약금액

(단위:백만원)

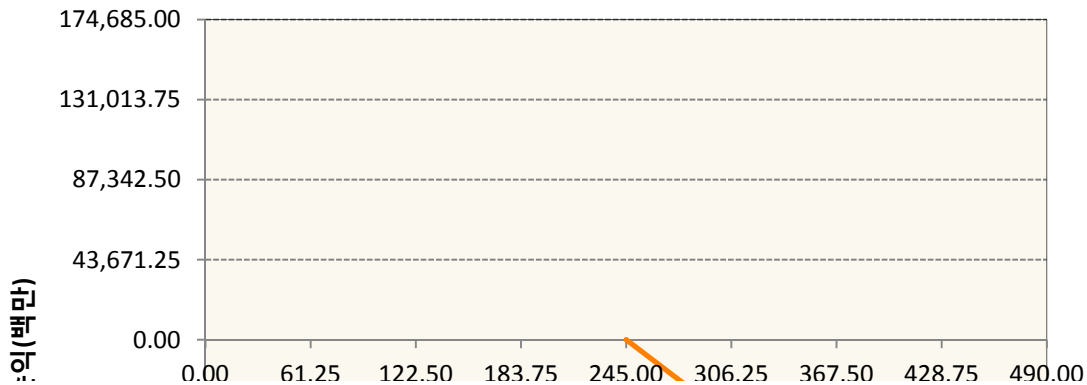
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,380	0	6,380	장내
누계	유가증권	옵션	0	351,608	-351,608	장내

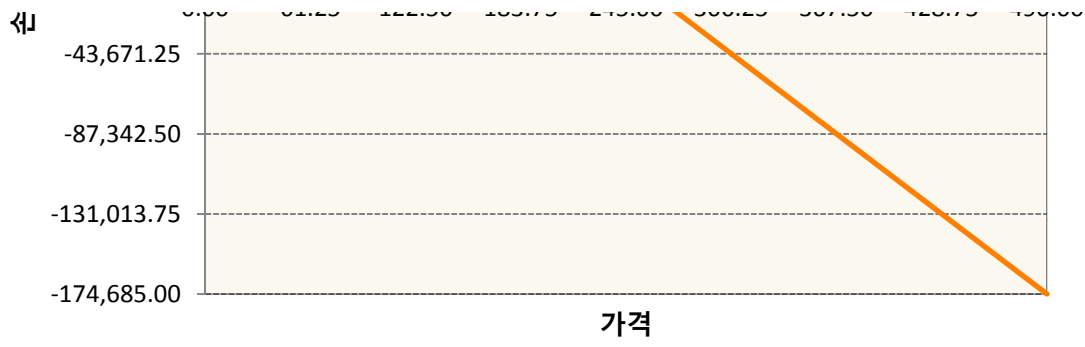
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

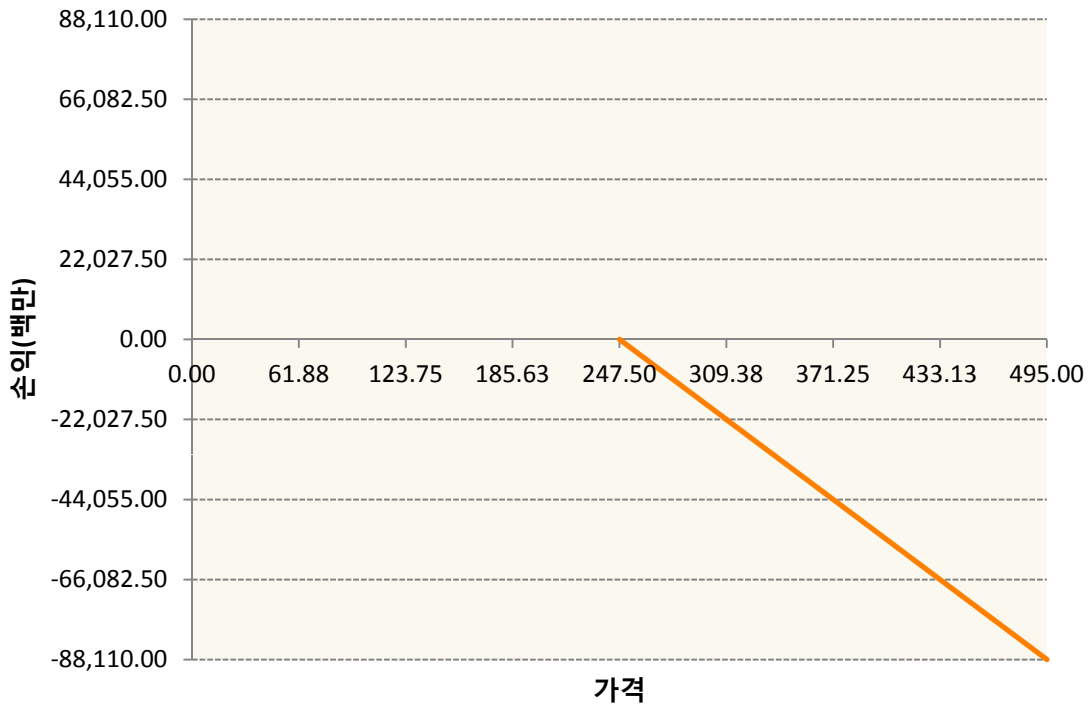


KR4201Q52452-2020-05 콜245

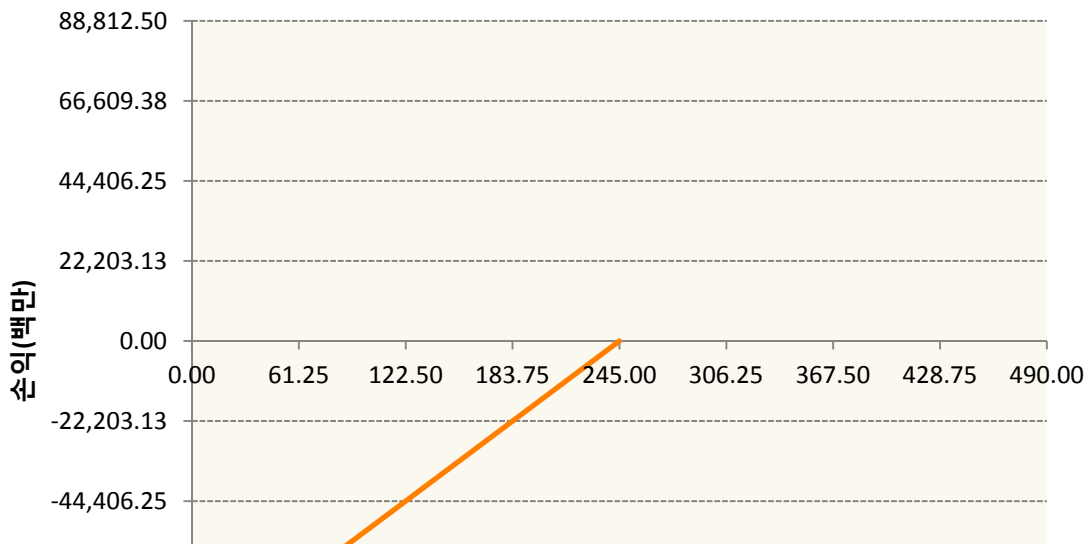


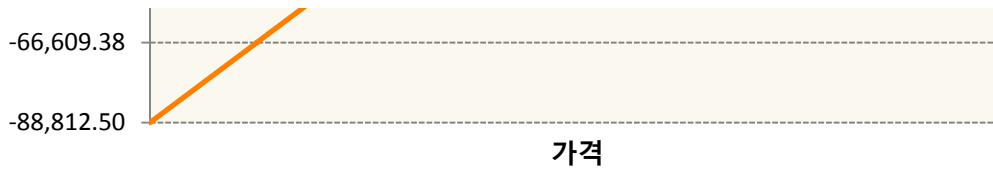


KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						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						13,012
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	8,257	7,969	7,663	7,344	7,015	6,676	6,331	
-5.33%	6,813	6,426	6,038	5,647	5,254	4,861	4,466	
-2.67%	4,385	3,988	3,590	3,191	2,790	2,388	1,986	
0%	998	679	346	0	-355	-718	-1,087	
2.67%	-3,111	-3,315	-3,547	-3,803	-4,080	-4,373	-4,680	
5.33%	-7,645	-7,751	-7,888	-8,053	-8,244	-8,457	-8,691	
8.00%	-12,381	-12,427	-12,495	-12,589	-12,706	-12,848	-13,012	
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5						6,306
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,670	3,547	3,413	3,270	3,119	2,963	2,801	
-5.33%	3,101	2,920	2,735	2,548	2,358	2,167	1,975	
-2.67%	2,073	1,869	1,665	1,461	1,257	1,053	849	
0%	551	372	188	0	-190	-383	-578	
2.67%	-1,380	-1,505	-1,643	-1,791	-1,947	-2,109	-2,278	
5.33%	-3,576	-3,648	-3,734	-3,835	-3,948	-4,072	-4,205	
8.00%	-5,910	-5,944	-5,991	-6,051	-6,124	-6,210	-6,306	
KR4301Q52450		2020-05 풋245						4,021
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,452	-3,529	-3,614	-3,708	-3,807	-3,912	-4,021	
-5.33%	-1,543	-1,678	-1,814	-1,951	-2,090	-2,230	-2,370	
-2.67%	-298	-437	-578	-720	-862	-1,005	-1,149	

0%	292	203	105	0	-111	-226	-346
2.67%	486	449	402	345	278	204	122
5.33%	530	520	503	480	448	409	362
8.00%	536	535	530	523	511	494	470

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

(단위:백만원)

23,660

공시일	2020-05-07
기준일	2020-05-06

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

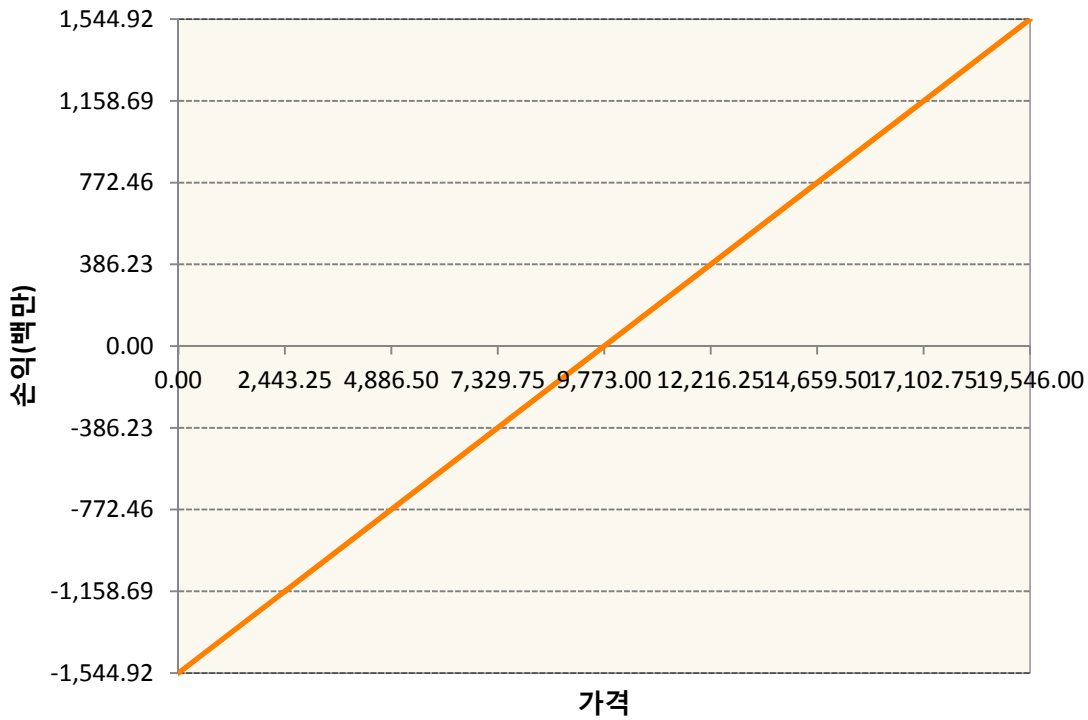
1. 계약금액

(단위:백만원)

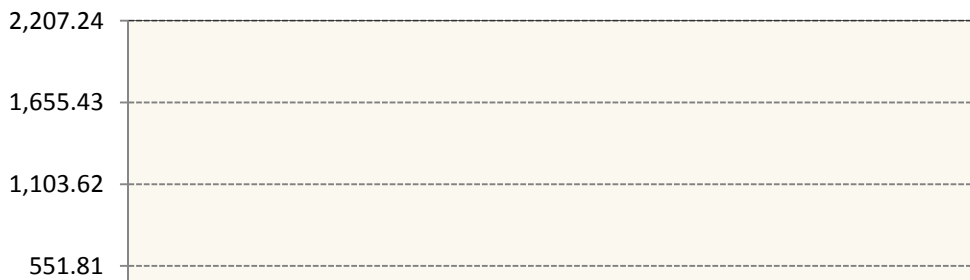
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,545	0	1,545	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,414	-4,414	장내
누계	통화	선도	694	2,220	-1,526	장외

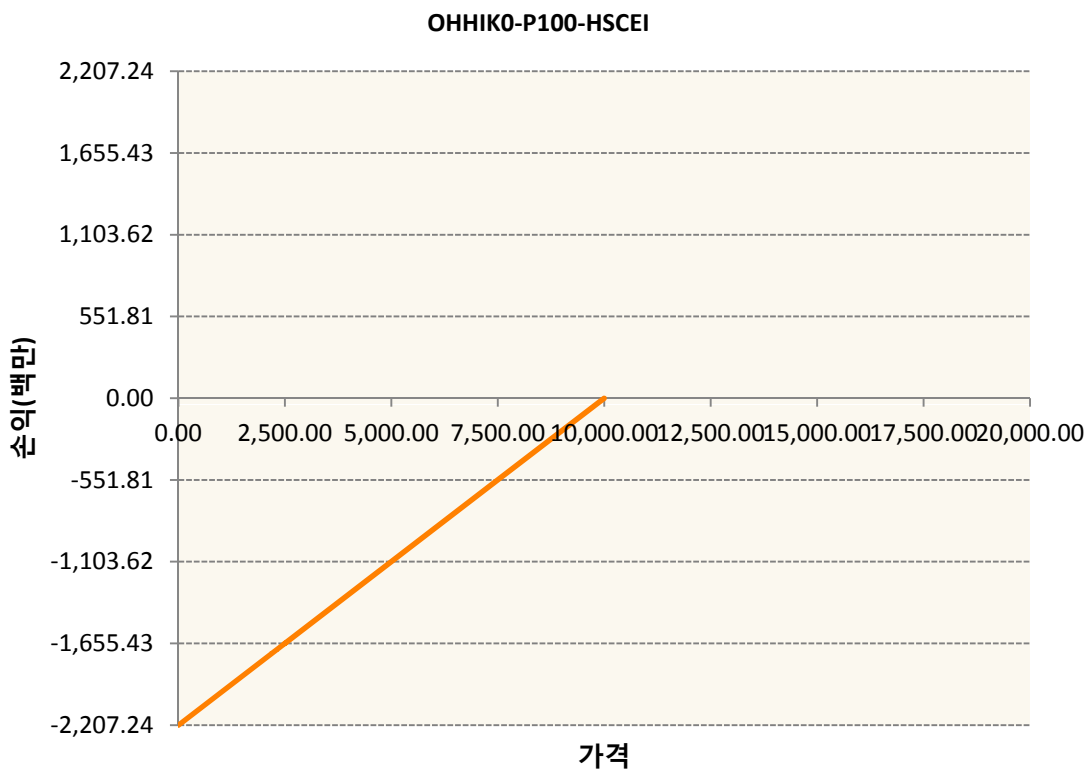
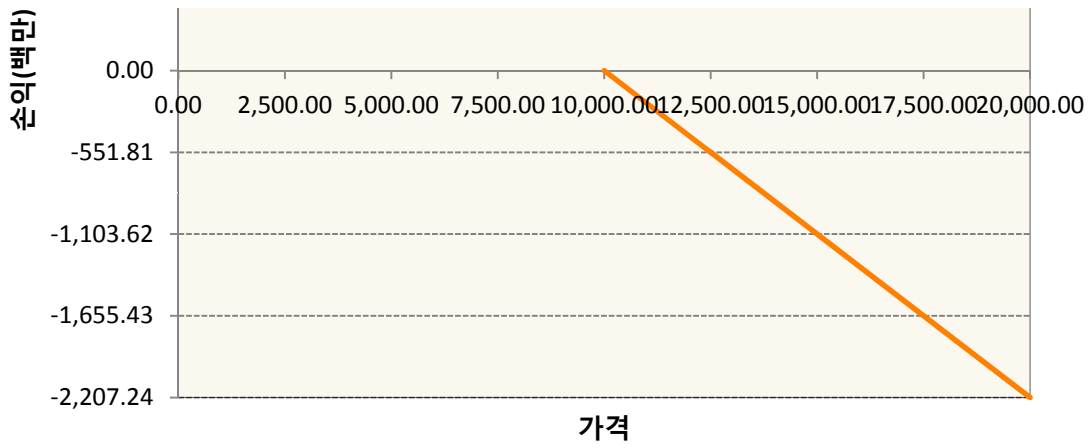
2. 만기시점의 손익구조

HCK0-HSCEI Futures May20



OHHIK0-C100-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E		178
FX21020H05 HKD/KRW 22-05-20E		55
HCK0 HSCEI Futures May20		124
OHHIK0-C1C HSCEI		177
OHHIK0-P10 HSCEI		177

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	631

공시일	2020-05-07
기준일	2020-05-06

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

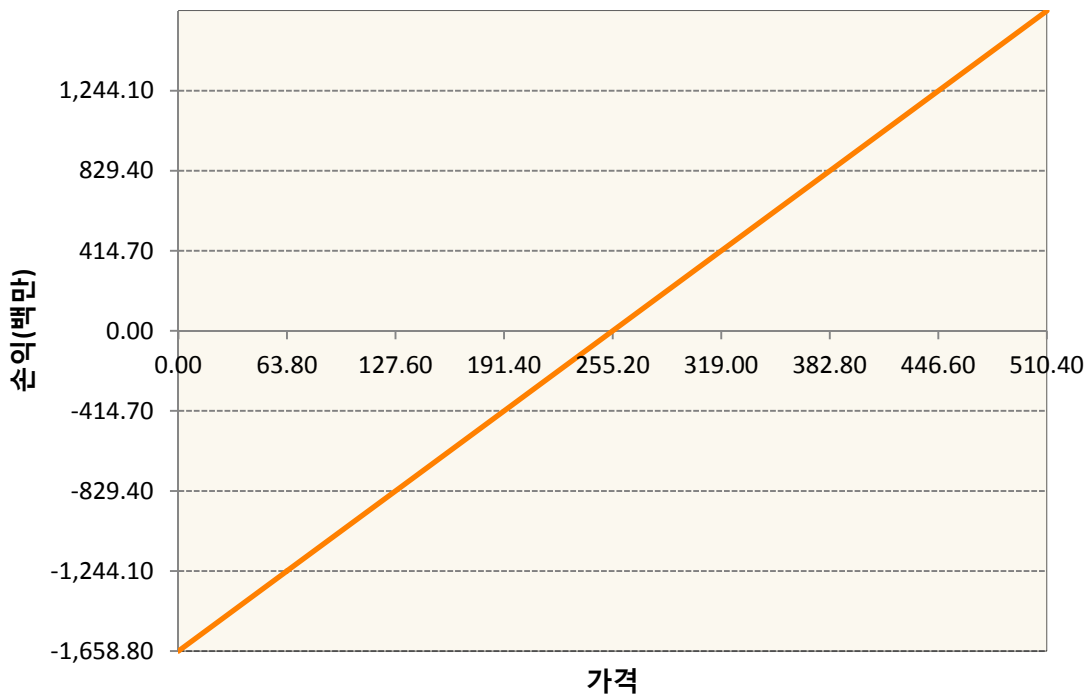
1. 계약금액

(단위:백만원)

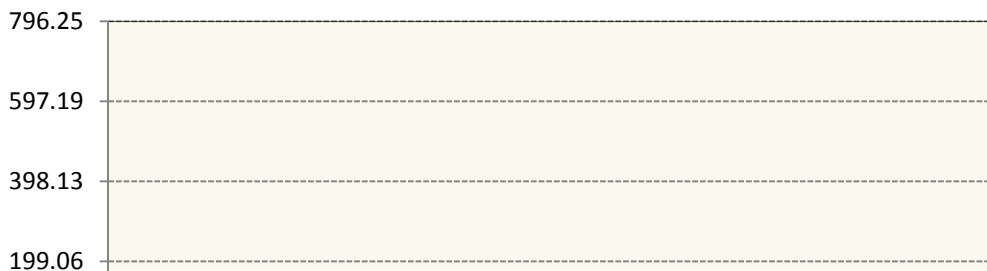
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,659	0	1,659	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,193	-3,193	장내

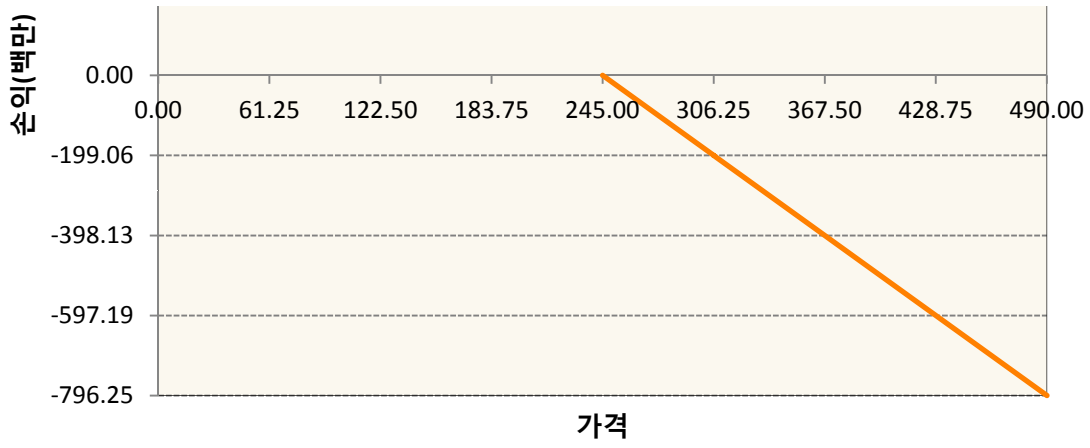
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

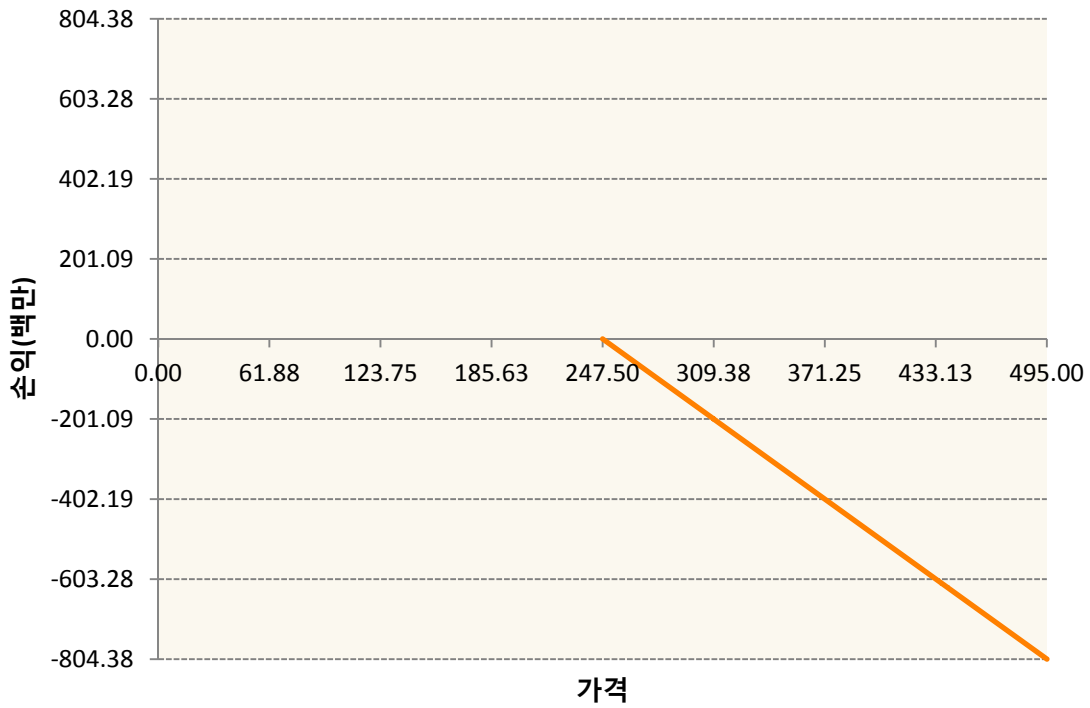


KR4201Q52452-2020-05 콜245

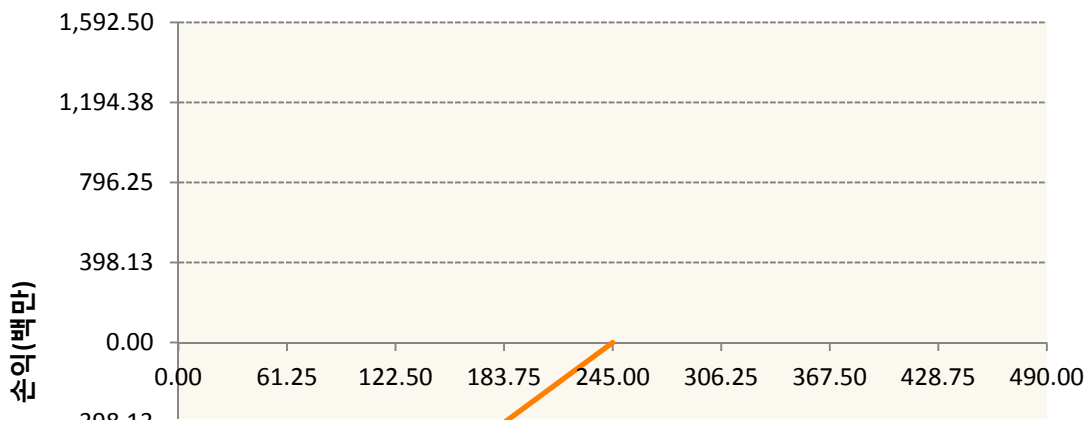




KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

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	-133	
-5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88	
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	44	44	44	44	44	44	44	44	
5.33%	88	88	88	88	88	88	88	88	
8.00%	133	133	133	133	133	133	133	133	
KR4201Q52452							2020-05 콜245		59
기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	38	36	35	33	32	30	29	29	
-5.33%	31	29	28	26	24	22	20	20	
-2.67%	20	18	16	15	13	11	9	9	
0%	5	3	2	0	-2	-3	-5	-5	
2.67%	-14	-15	-16	-17	-19	-20	-21	-21	
5.33%	-35	-35	-36	-37	-38	-39	-40	-40	
8.00%	-56	-57	-57	-57	-58	-59	-59	-59	
KR4201Q52478							2020-05 콜247.5		58
기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	34	32	31	30	28	27	26	26	
-5.33%	28	27	25	23	22	20	18	18	
-2.67%	19	17	15	13	11	10	8	8	
0%	5	3	2	0	-2	-3	-5	-5	
2.67%	-13	-14	-15	-16	-18	-19	-21	-21	
5.33%	-33	-33	-34	-35	-36	-37	-38	-38	
8.00%	-54	-54	-55	-55	-56	-57	-58	-58	
KR4301Q52450							2020-05 풋245		72
기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-62	-63	-65	-66	-68	-70	-72
-5.33%	-28	-30	-33	-35	-37	-40	-42
-2.67%	-5	-8	-10	-13	-15	-18	-21
0%	5	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	9	8	7	6	5	4	2
5.33%	9	9	9	9	8	7	6
8.00%	10	10	10	9	9	9	8

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

(단위:백만원)

564

공시일	2020-05-07
기준일	2020-05-06

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

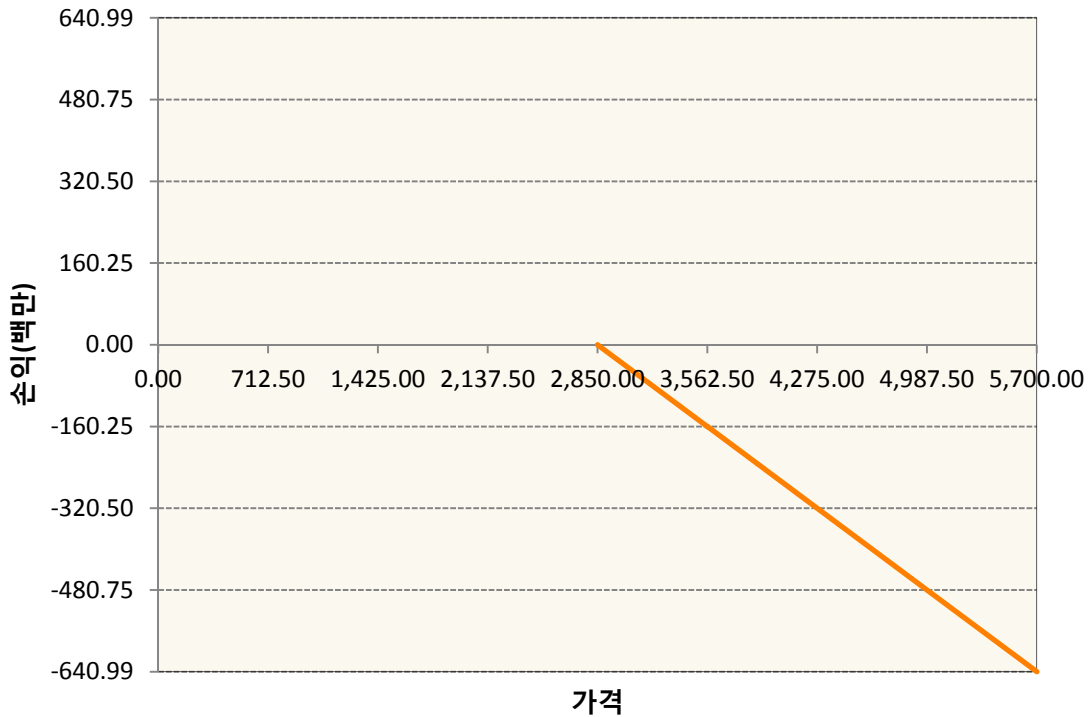
1. 계약금액

(단위:백만원)

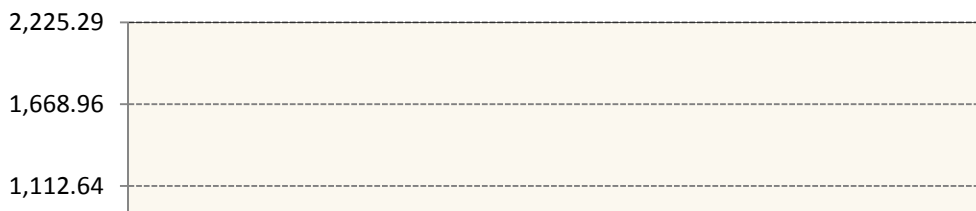
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	613	0	613	
누계	유가증권	스왑	7,891	0	7,891	장외
누계	유가증권	옵션	0	5,733	-5,733	장내
누계	통화	선도	0	2,678	-2,678	장외

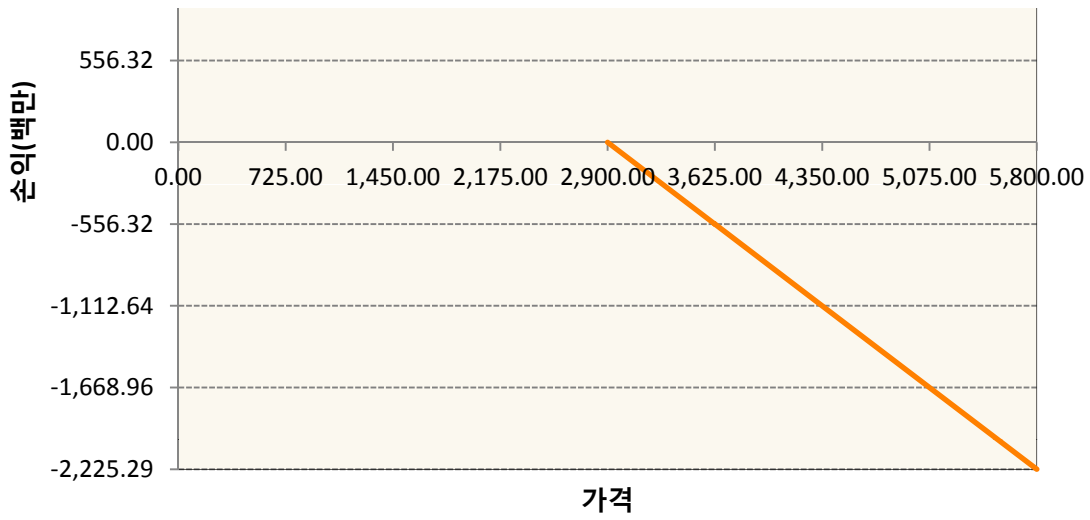
2. 만기시점의 손익구조

OESXK0-C2850-EURO STOXX 50

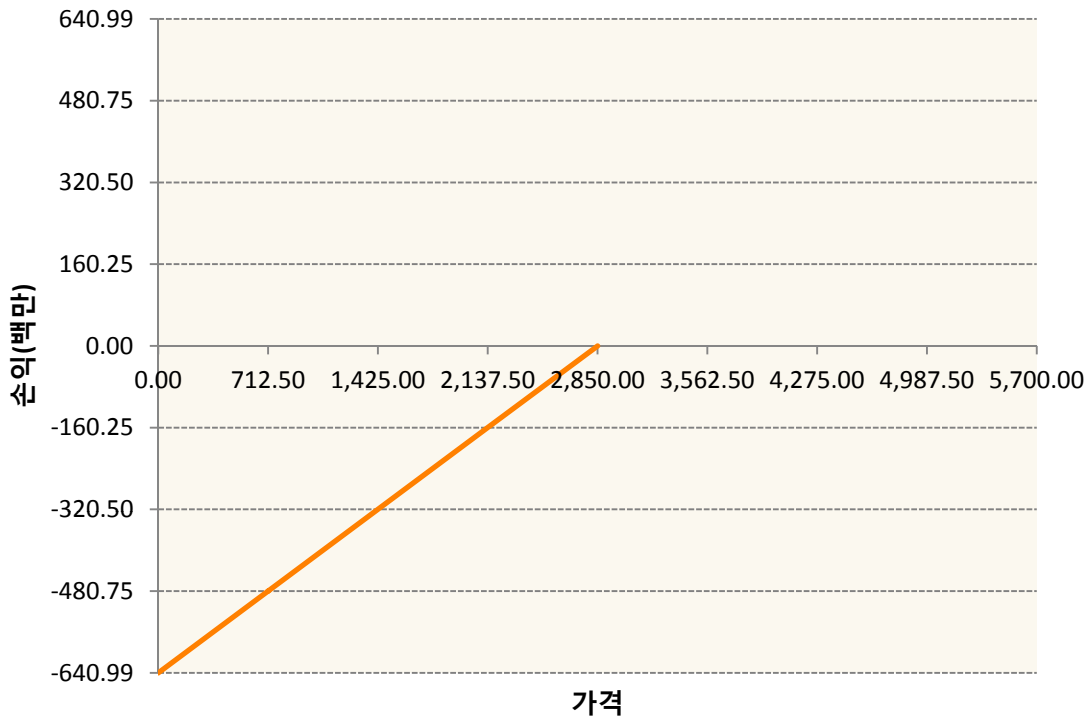


OESXK0-C2900-EURO STOXX 50



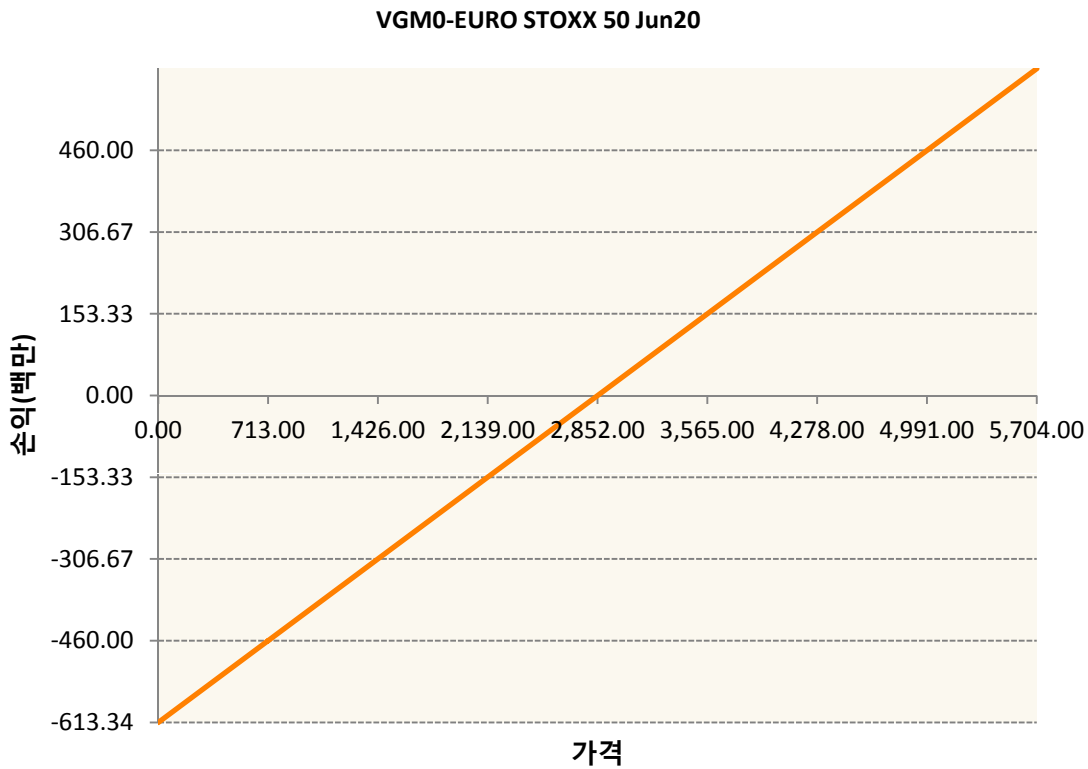
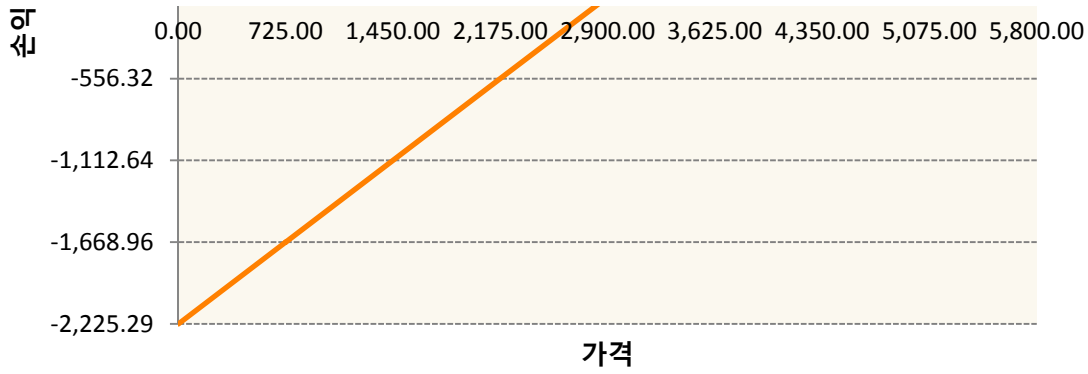


OESXK0-P2850-EURO STOXX 50



OESXK0-P2900-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	12
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E	214
OESXK0-C28 EURO STOXX 50	51
OESXK0-C29 EURO STOXX 50	178
OESXK0-P28 EURO STOXX 50	51
OESXK0-P29 EURO STOXX 50	178
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20	49

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	2020-05-07
기준일	2020-05-06

ETF스마트레버리지목표전환형10호

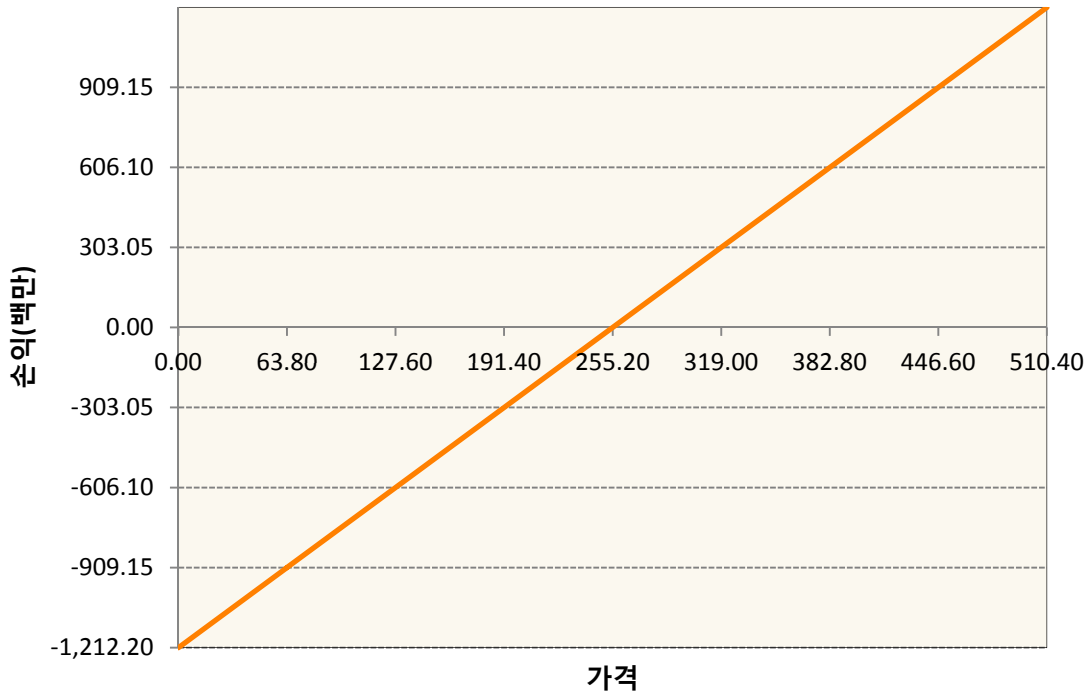
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,212	0	1,212	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	2020-05-07
기준일	2020-05-06

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

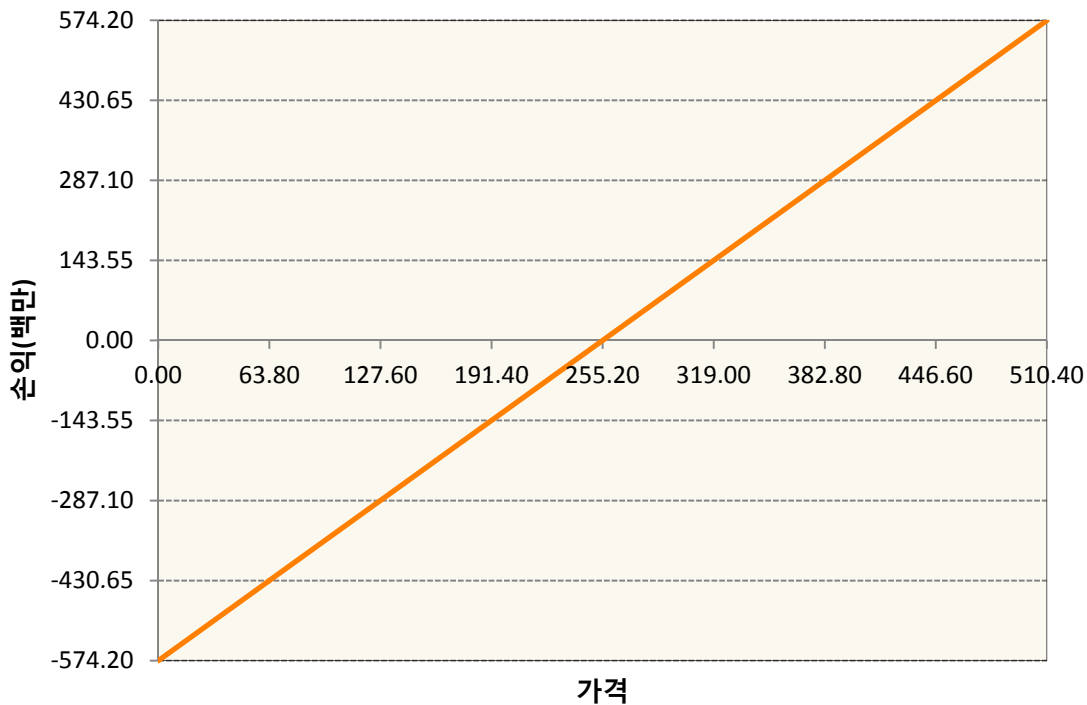
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	574	0	574	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	2020-05-07
기준일	2020-05-06

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

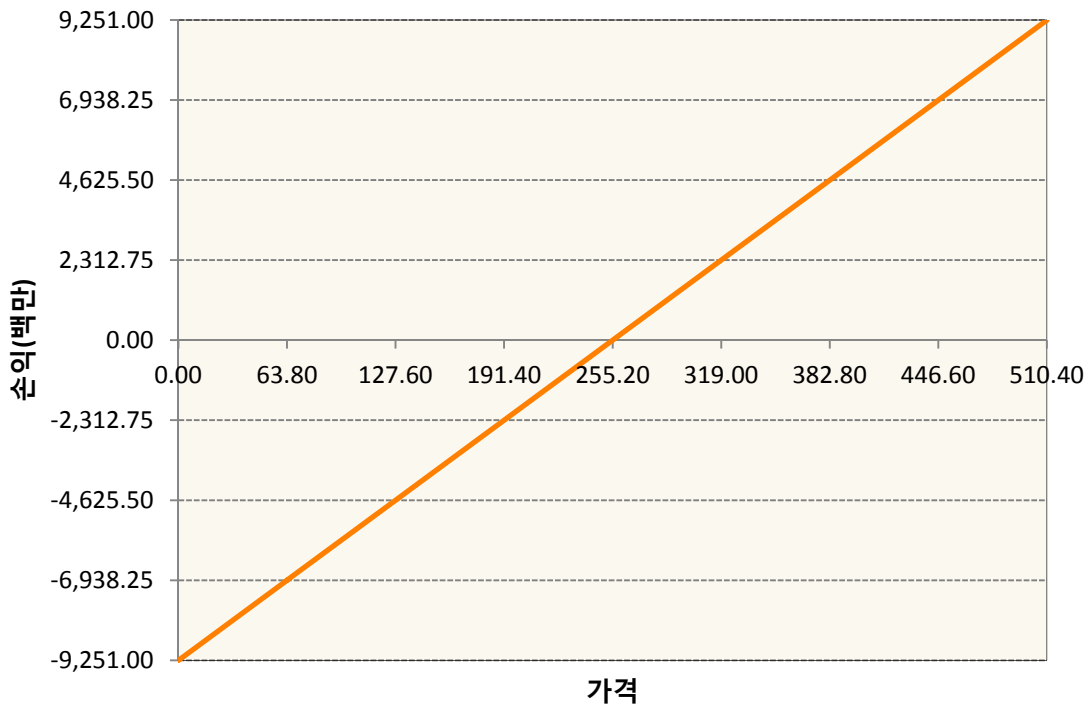
1. 계약금액

(단위:백만원)

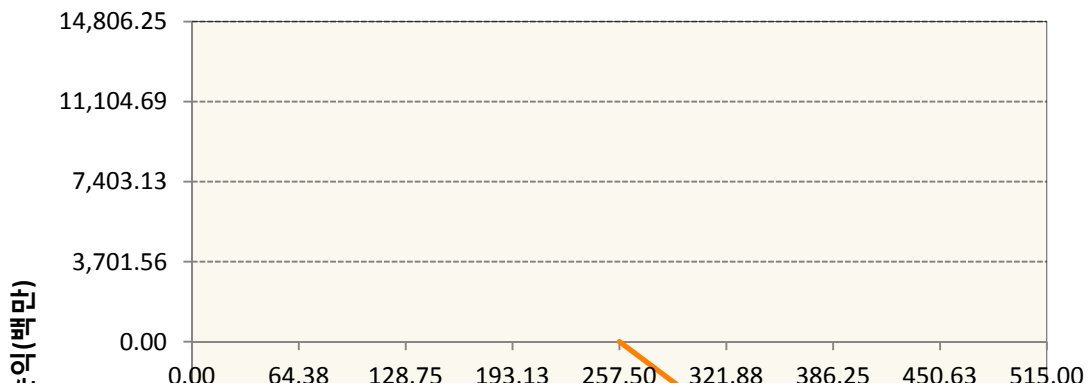
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,251	0	9,251	장내
누계	유가증권	옵션	6,201	17,536	-11,335	장내

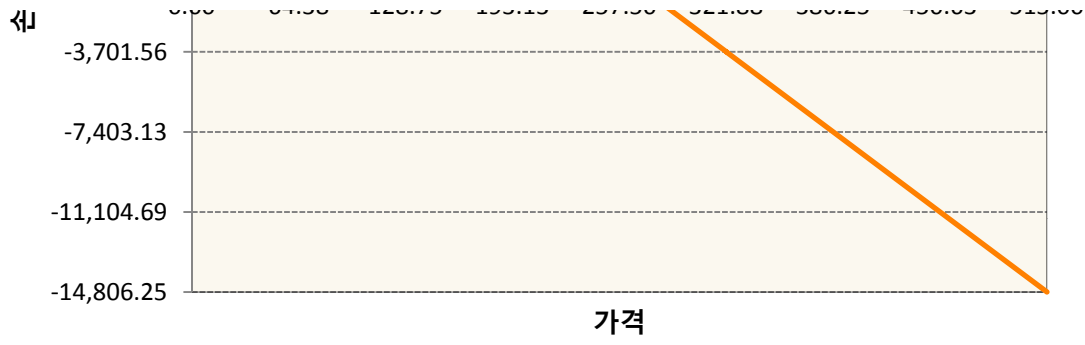
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

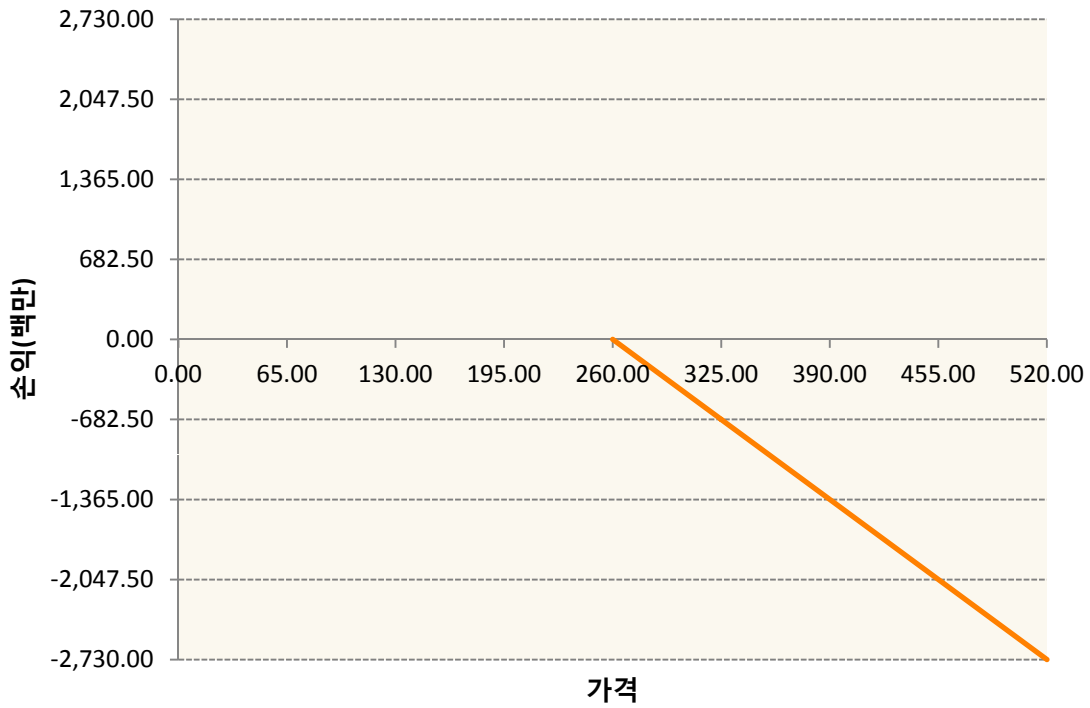


KR4201Q52577-2020-05 콜257.5

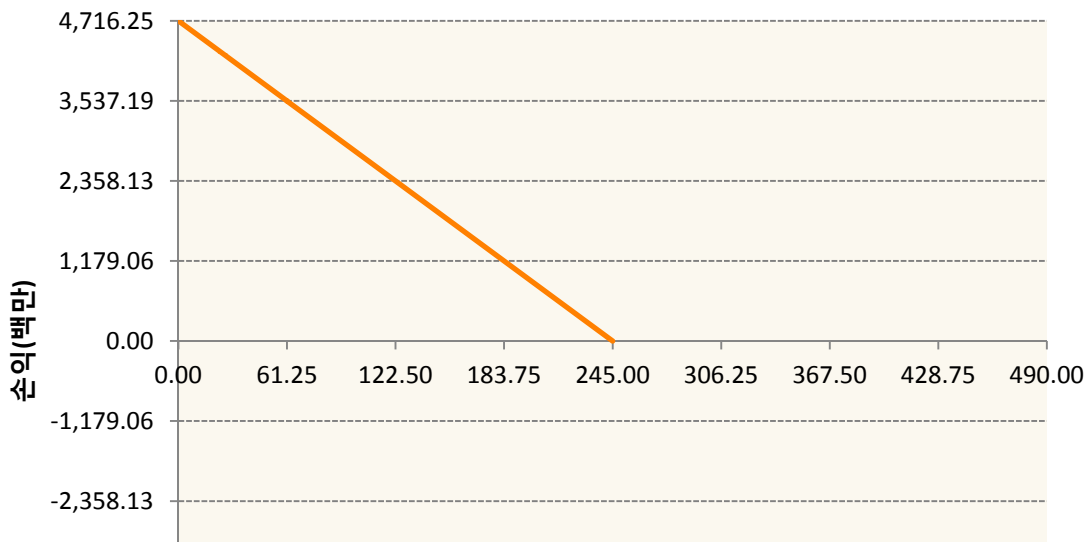


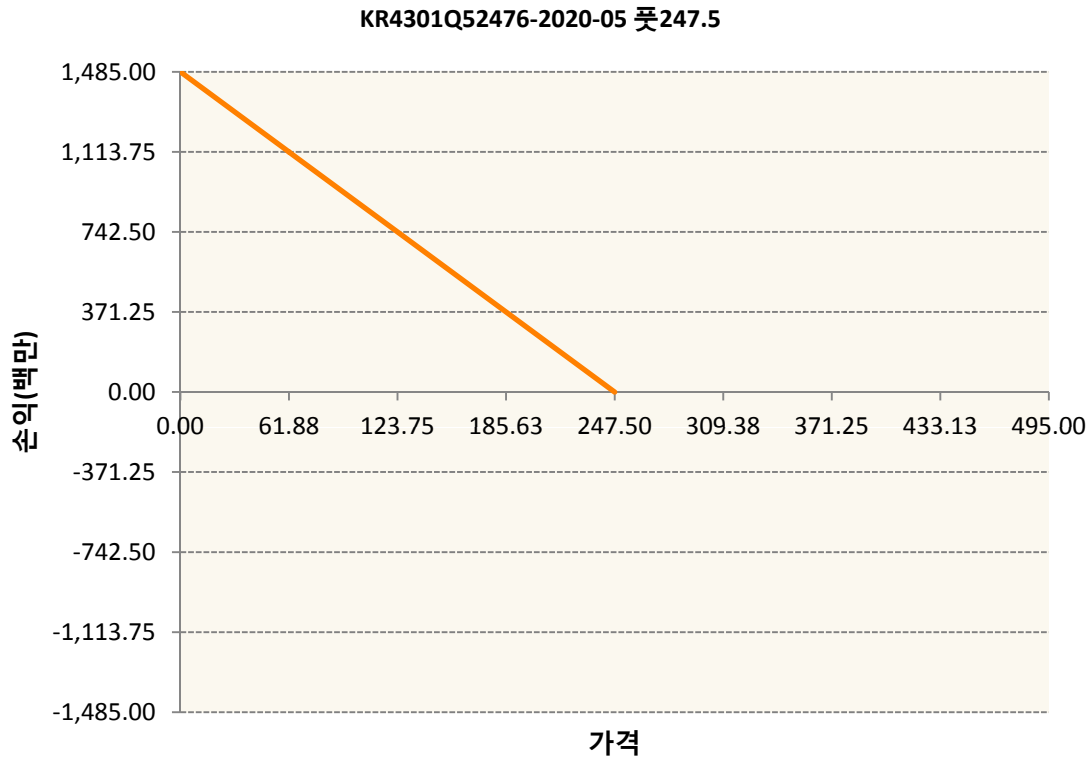
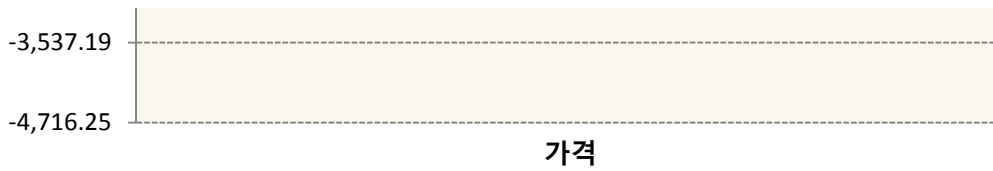


KR4201Q52601-2020-05 콜260



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						740
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-740	-740	-740	-740	-740	-740	-740	
-5.33%	-493	-493	-493	-493	-493	-493	-493	
-2.67%	-247	-247	-247	-247	-247	-247	-247	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	247	247	247	247	247	247	247	
5.33%	493	493	493	493	493	493	493	
8.00%	740	740	740	740	740	740	740	
KR4201Q52577		2020-05 콜257.5						854
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	328	320	310	298	284	268	250	
-5.33%	301	284	265	245	222	199	174	
-2.67%	233	206	178	149	120	90	59	

0%	101	67	34	0	-34	-68	-101
2.67%	-108	-141	-174	-208	-241	-275	-309
5.33%	-388	-414	-442	-471	-500	-531	-562
8.00%	-722	-739	-759	-780	-803	-828	-854
KR4201Q52601 2020-05 콜260							147
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	50	49	48	46	44	41	38
-5.33%	47	44	41	38	34	31	26
-2.67%	37	33	28	24	19	13	8
0%	18	12	6	0	-6	-12	-18
2.67%	-15	-21	-28	-34	-40	-47	-53
5.33%	-62	-67	-73	-78	-84	-90	-96
8.00%	-119	-123	-127	-132	-137	-142	-147
KR4301Q52450 2020-05 풋245							214
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	183	187	192	197	202	208	214
-5.33%	82	89	96	104	111	118	126
-2.67%	16	23	31	38	46	53	61
0%	-16	-11	-6	0	6	12	18
2.67%	-26	-24	-21	-18	-15	-11	-6
5.33%	-28	-28	-27	-25	-24	-22	-19
8.00%	-28	-28	-28	-28	-27	-26	-25
KR4301Q52476 2020-05 풋247.5							75
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	67	68	69	70	72	73	75
-5.33%	32	34	36	39	41	43	45
-2.67%	8	10	12	15	17	20	22
0%	-6	-4	-2	0	2	4	6
2.67%	-11	-10	-9	-8	-6	-5	-3
5.33%	-12	-12	-12	-11	-10	-9	-8
8.00%	-13	-13	-12	-12	-12	-11	-11

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

(단위:백만원)

2,157

공시일	2020-05-07
기준일	2020-05-06

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	147,966	0	147,966	

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	2020-05-07
기준일	2020-05-06

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	99,768	0	99,768	

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	2020-05-07
기준일	2020-05-06

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	440,790	0	440,790	
누계	통화	선도	43,996	461,465	-417,469	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,444
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,034
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,034
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,386
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	978
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	978
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,542
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	841
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	733
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	489
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,422
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,942
FX21020H11 KRW/USD 11-05-20E	978
FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E	2,933
FX21020J02€ KRW/USD 10-06-20E	1,330
FX21020J02₯ KRW/USD 22-06-20E	1,506
FX21020J02₮ KRW/USD 22-06-20E	1,955
FX21020J03₯ KRW/USD 24-07-20E	2,200
FX21020J04₯ KRW/USD 24-07-20E	1,760
FX21020J04₯ KRW/USD 24-07-20E	1,955

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

20,392

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

(단위:백만원)

197

공시일	2020-05-07
기준일	2020-05-06

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

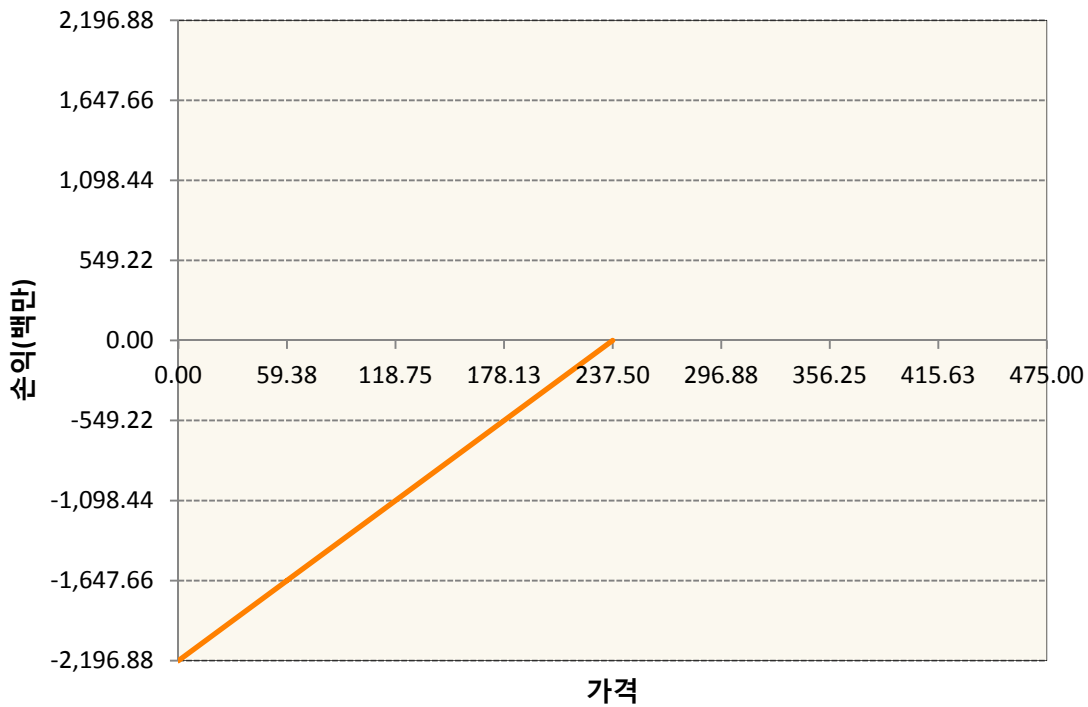
1. 계약금액

(단위:백만원)

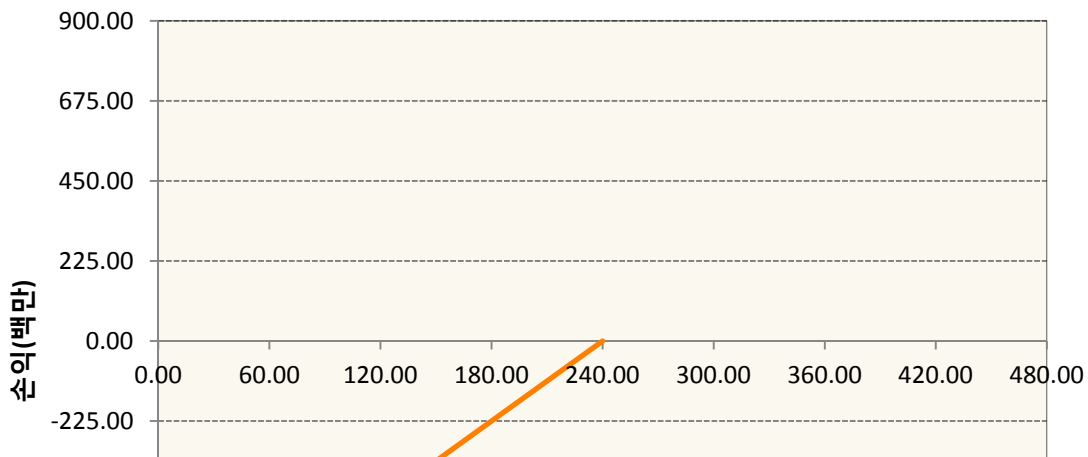
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,097	-3,097	장내

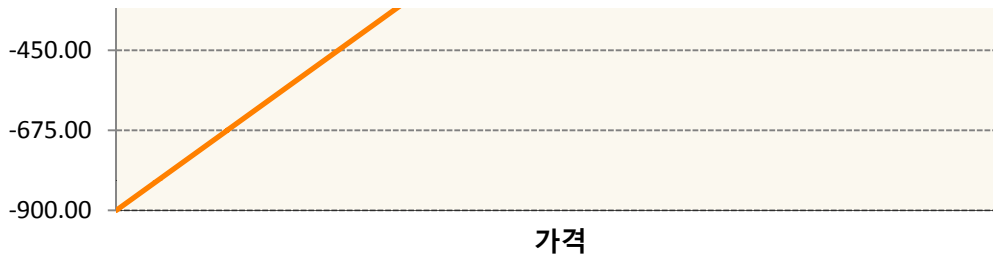
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q52377-2020-05 풋237.5



KR4301Q52401-2020-05 풋240





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q52377		2020-05 풋237.5						65
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-44	-48	-51	-54	-58	-61	-65	
-5.33%	-14	-18	-21	-24	-28	-31	-35	
-2.67%	-1	-3	-5	-8	-10	-13	-16	
0%	3	2	1	0	-1	-3	-5	
2.67%	4	4	3	3	2	1	0	
5.33%	4	4	4	4	3	3	3	
8.00%	4	4	4	4	4	4	3	
KR4301Q52401		2020-05 풋240						31
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-23	-25	-26	-27	-29	-30	-31	
-5.33%	-9	-10	-12	-13	-14	-16	-17	
-2.67%	-1	-2	-3	-4	-6	-7	-8	
0%	2	1	1	0	-1	-2	-3	
2.67%	2	2	2	2	1	1	0	
5.33%	2	2	2	2	2	2	2	
8.00%	2	2	2	2	2	2	2	

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

59

공시일	2020-05-07
기준일	2020-05-06

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	7,266	0	7,266	
누계	통화	선도	0	7,149	-7,149	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J01! KRW/USD 13-05-20E	320
FX21020J04! KRW/USD 29-05-20E	252
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

288

공시일	2020-05-07
기준일	2020-05-06

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

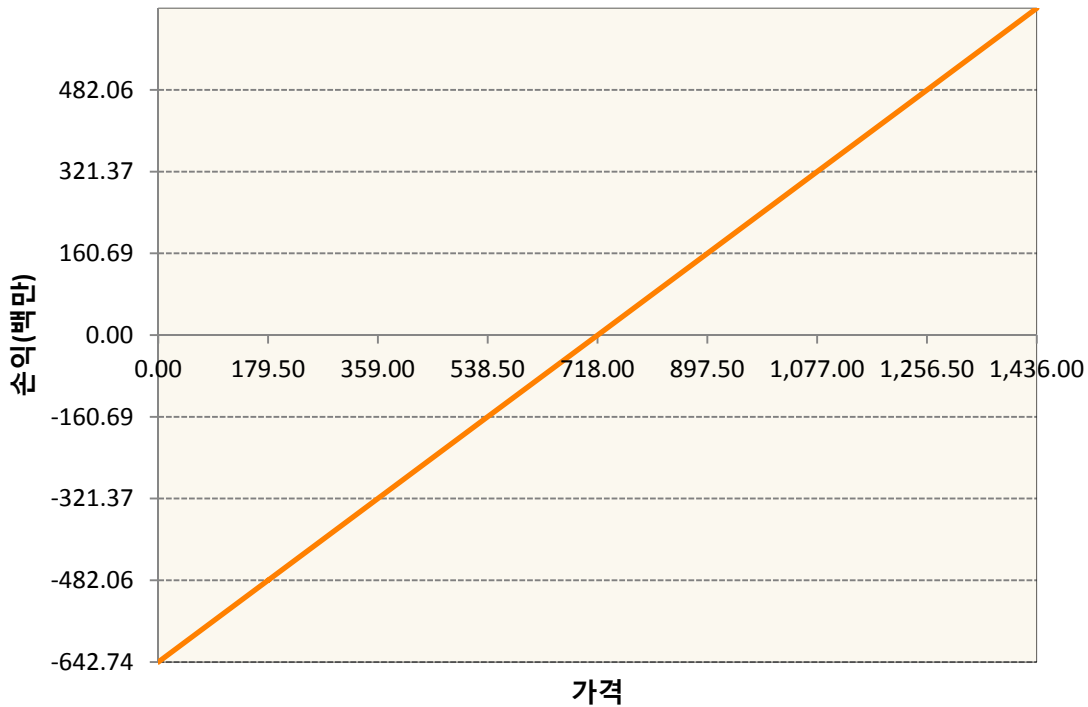
1. 계약금액

(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	643	0	643	
누계	유가증권	스왑	867	0	867	장외
누계	통화	선도	204	693	-490	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
FX21020K00 KRW/EUR 22-05-20E	5
VNCK0 VN30 Index Future May20	51

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

(단위:백만원)

147

공시일	2020-05-07
기준일	2020-05-06

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

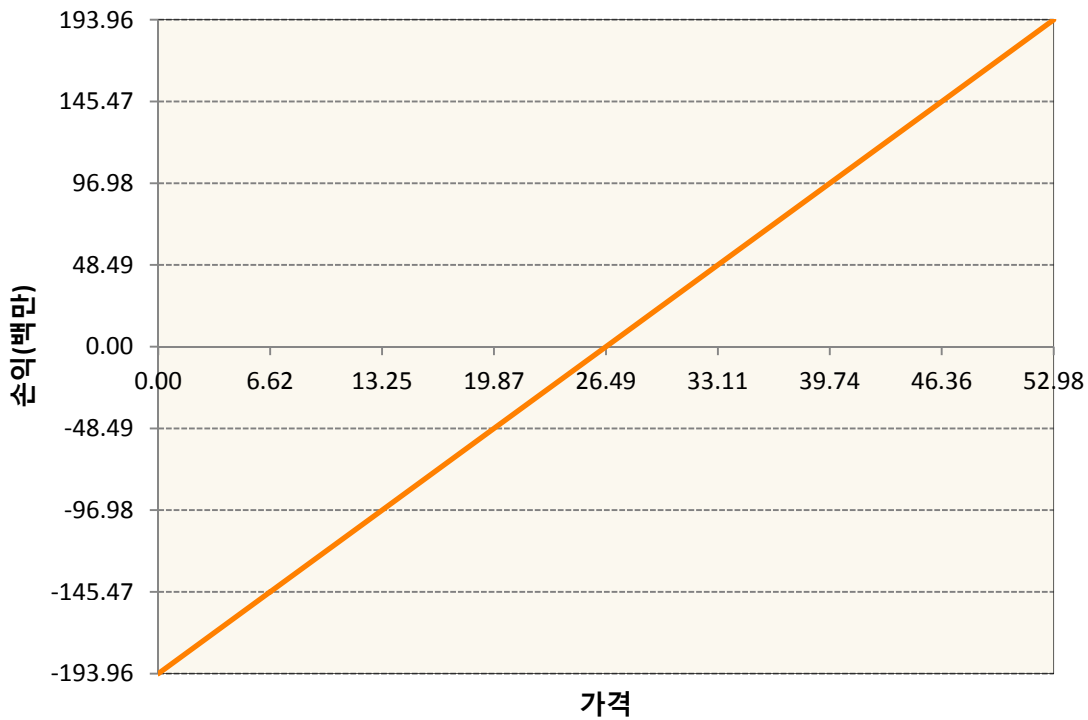
1. 계약금액

(단위:백만원)

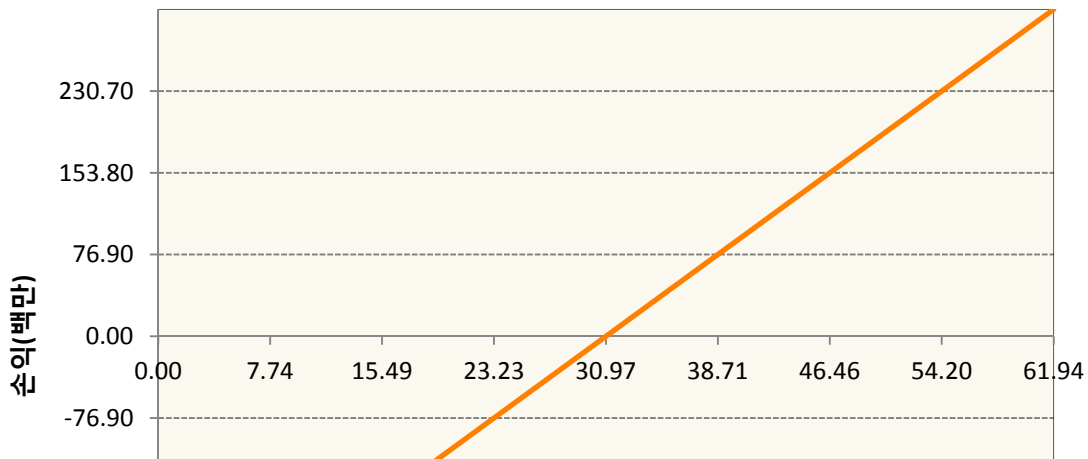
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,608	183	1,424	

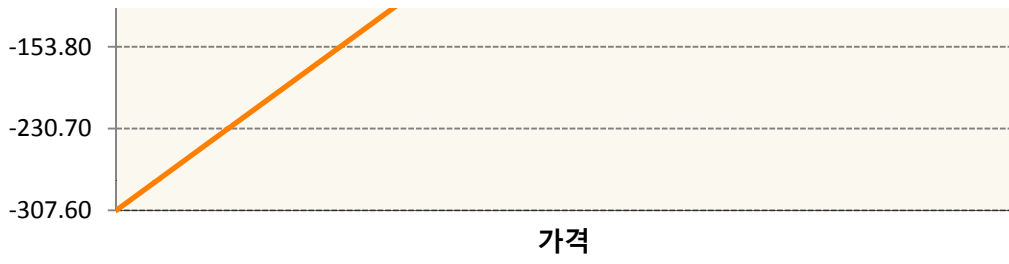
2. 만기시점의 손익구조

CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20

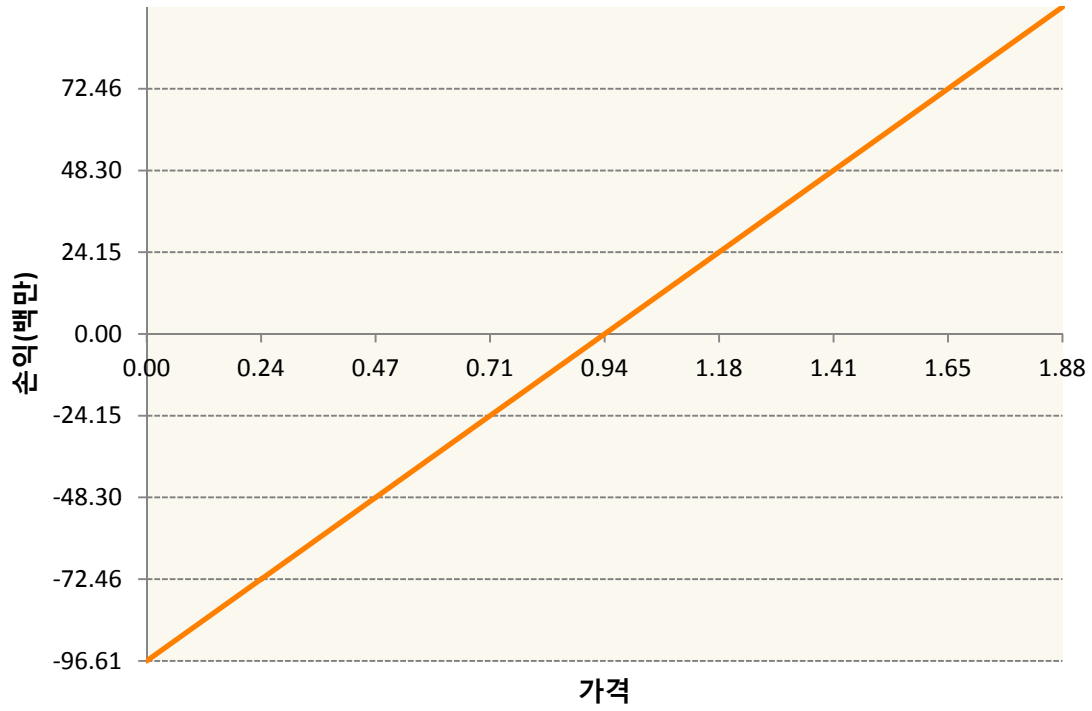


CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20

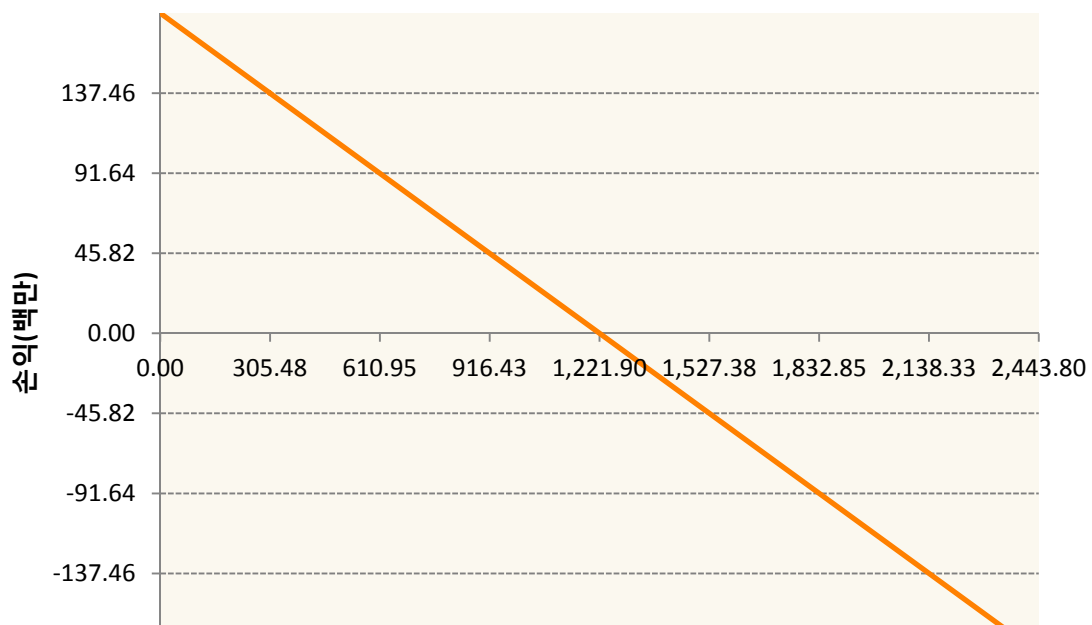


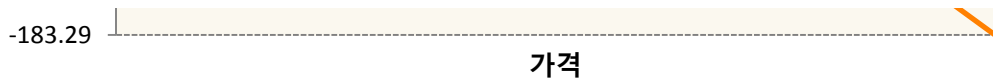


HON0-NY Harb ULSD Fut Jul20

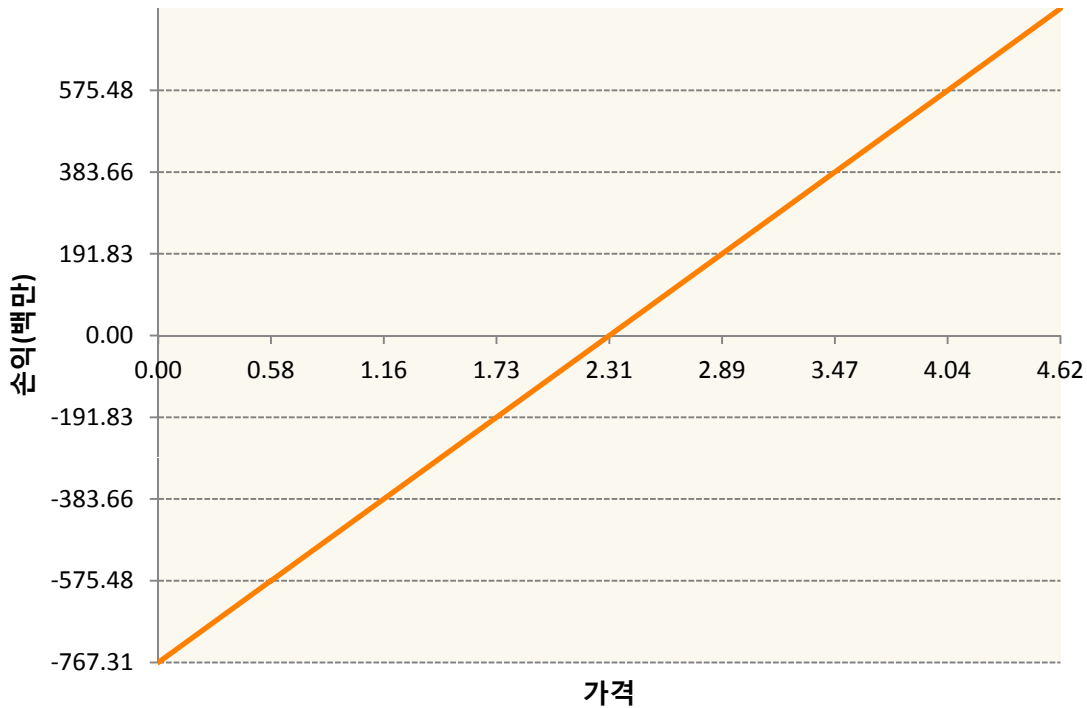


KR4175Q50007-2020-05 달러선물

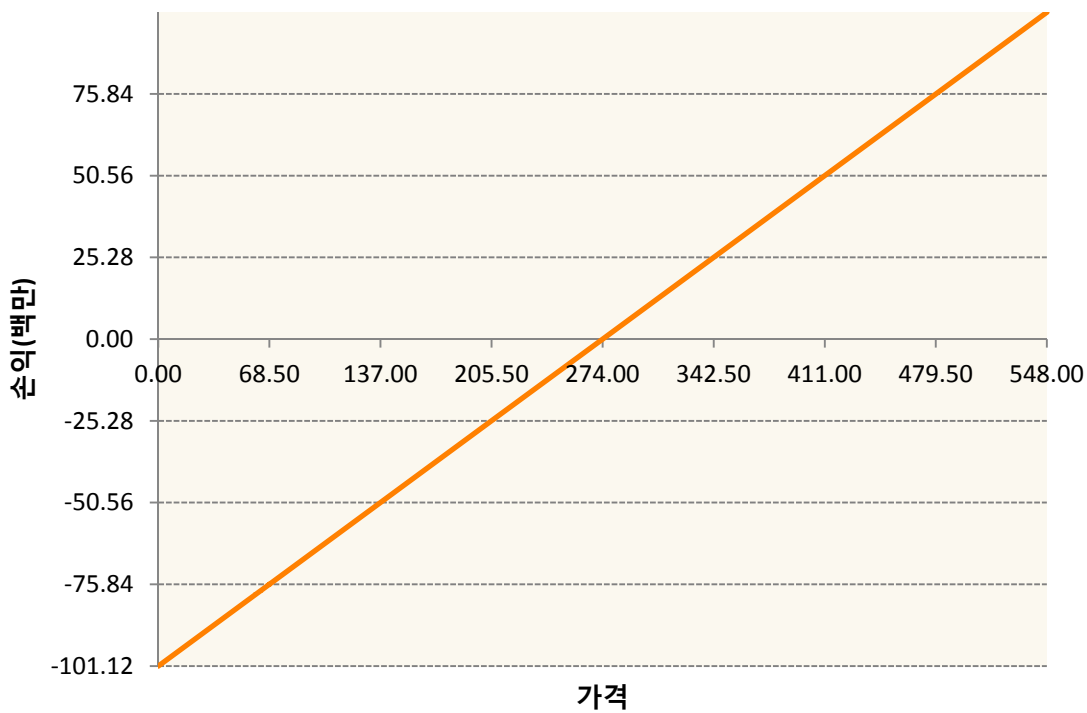




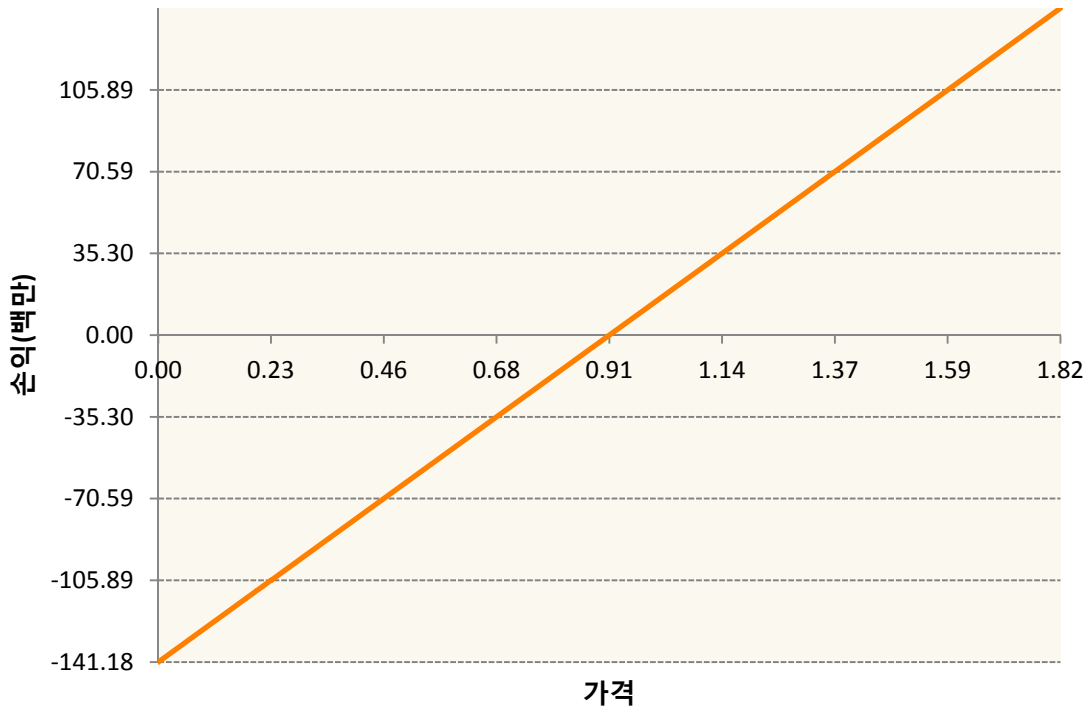
NGN20-NATURAL GAS FUTR Jul20



QSN0-Low Su Gasoil G Jul20



XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN0	WTI CRUDE FUTURE Jul20	16
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	25
HON0	NY Harb ULSD Fut Jul20	8
KR4175Q50C	2020-05 달러선물	15
NGN20	NATURAL GAS FUTR Jul20	61
QSN0	Low Su Gasoil G Jul20	8
XBN0	GASOLINE RBOB FUT Jul20	11

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

(단위:백만원)

609

공시일	2020-05-07
기준일	2020-05-06

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

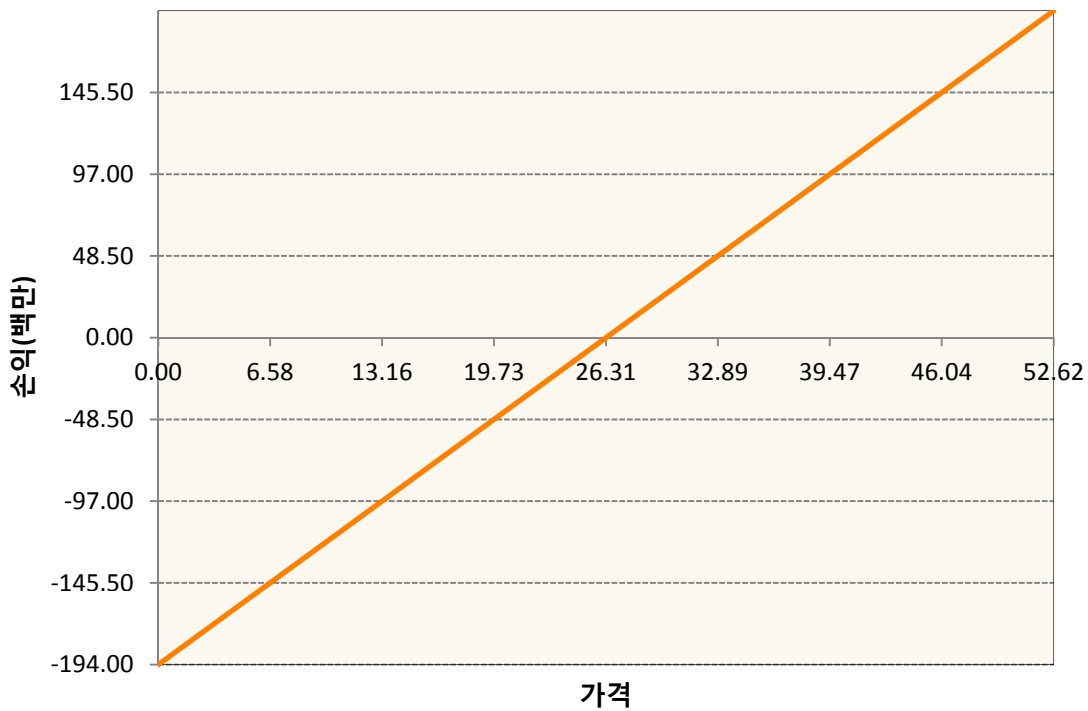
1. 계약금액

(단위:백만원)

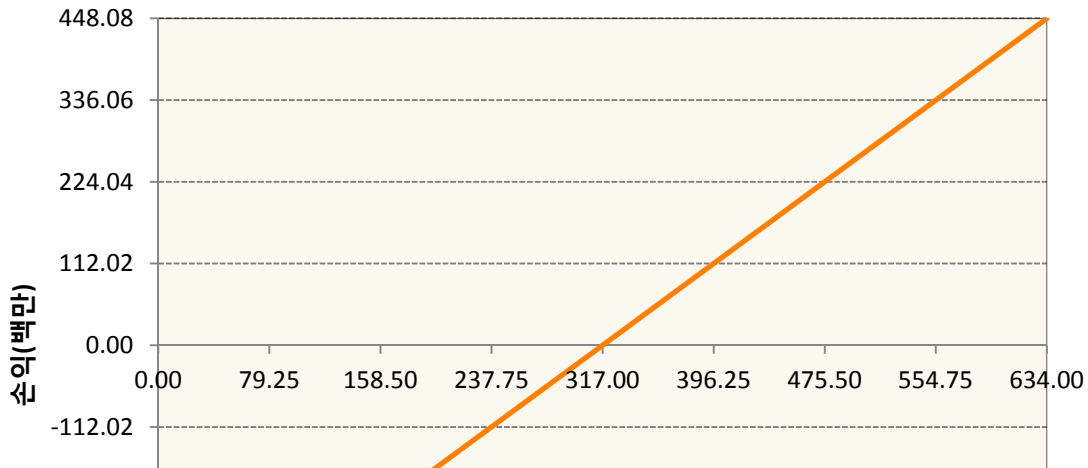
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,371	73	2,298	

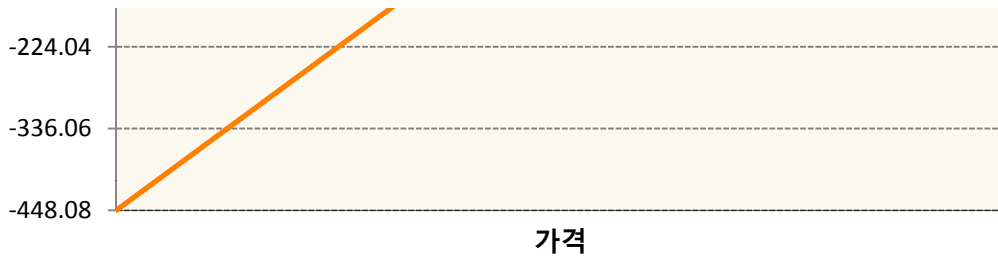
2. 만기시점의 손익구조

BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20

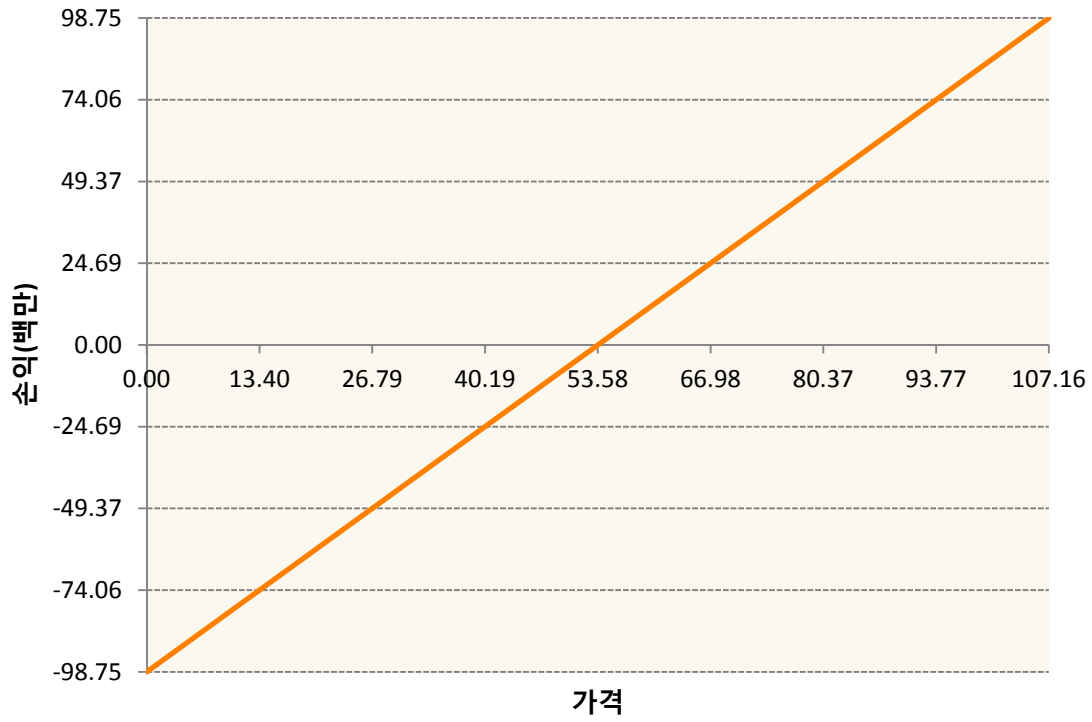


CN0-CORN FUTURE Jul20

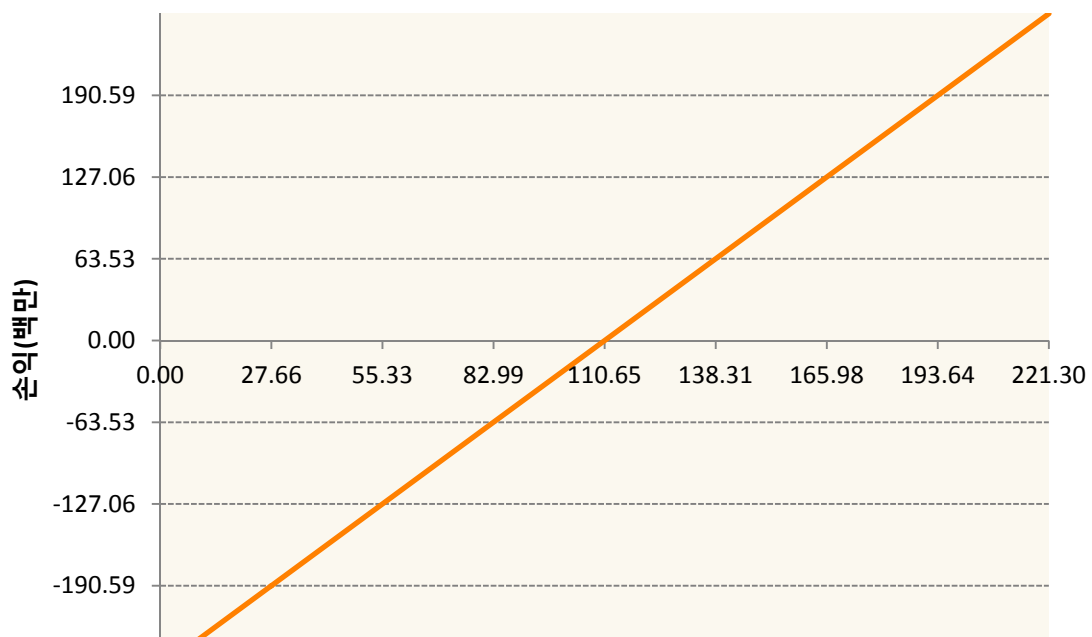


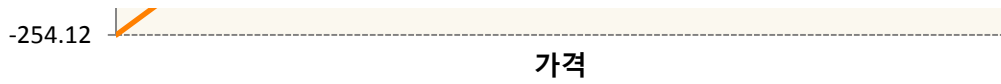


CTN0-COTTON NO.2 FUTR Jul20

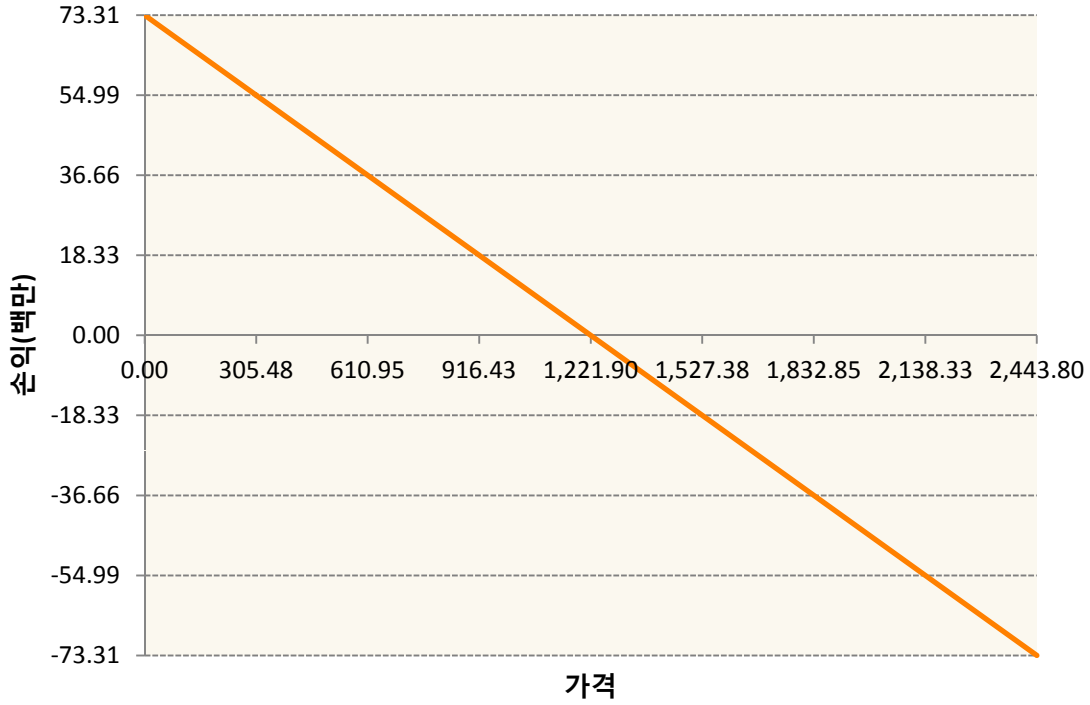


KCN0-COFFEE 'C' FUTURE Jul20

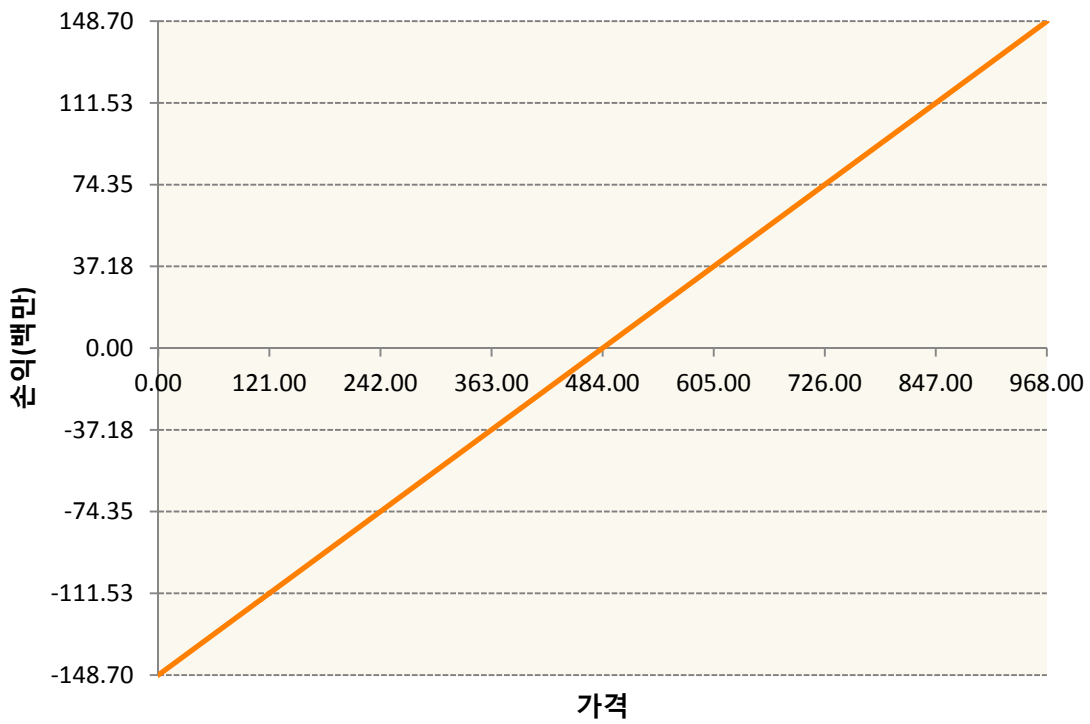




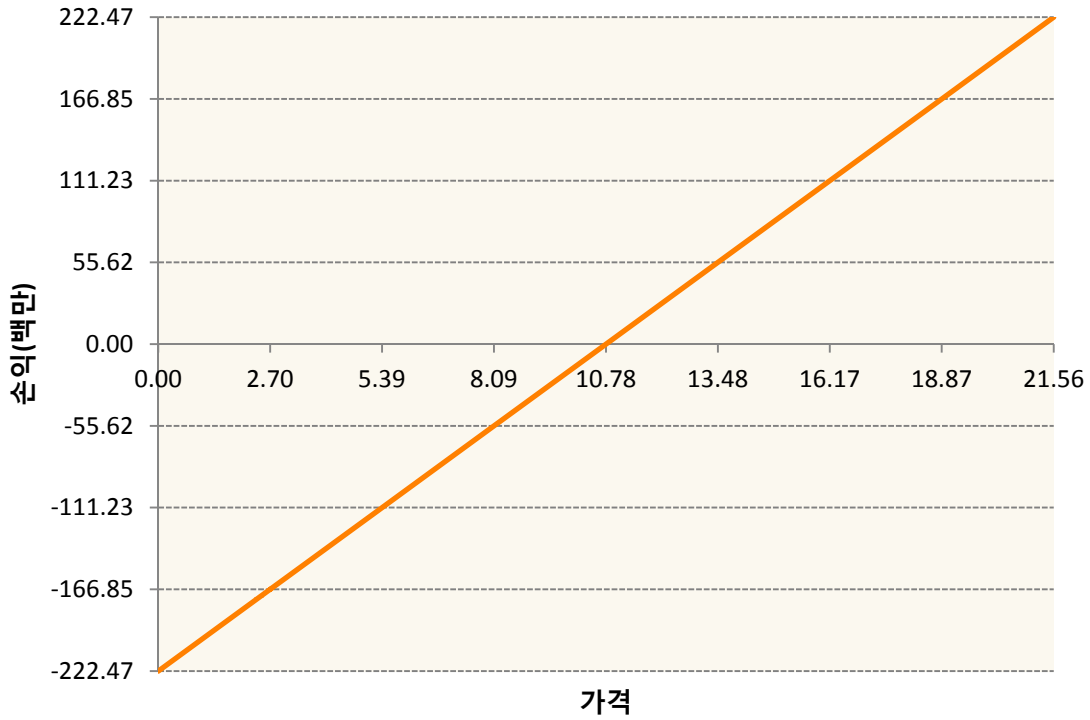
KR4175Q50007-2020-05 달러선물



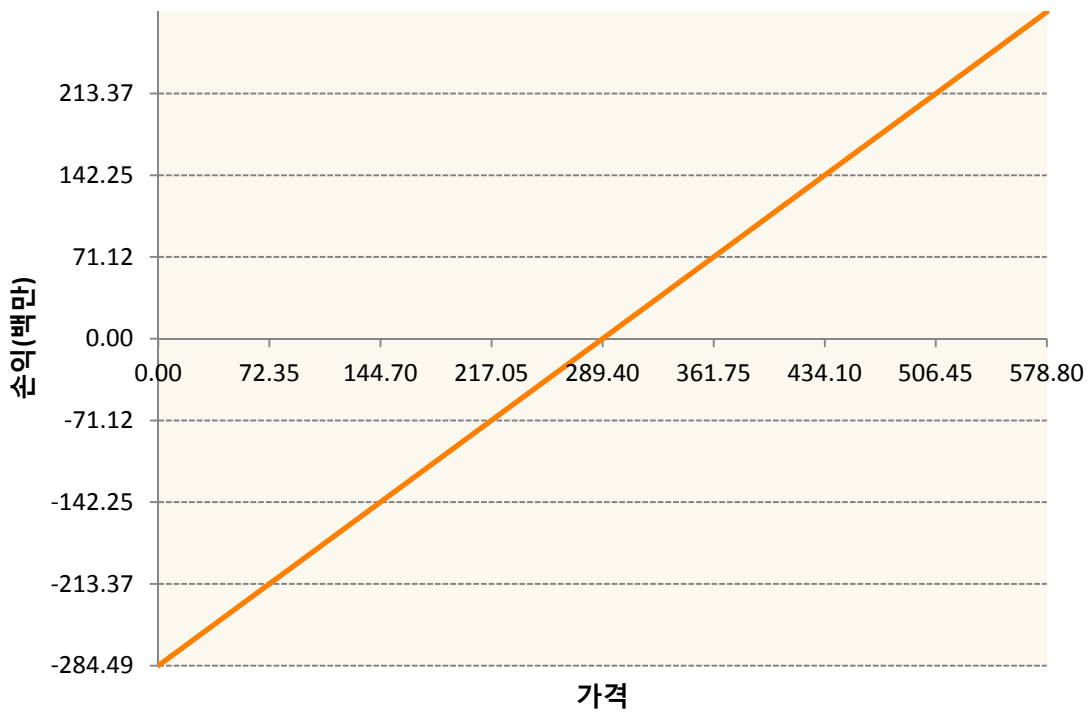
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



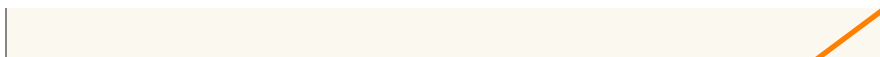
SBN0-Sugar Jul20

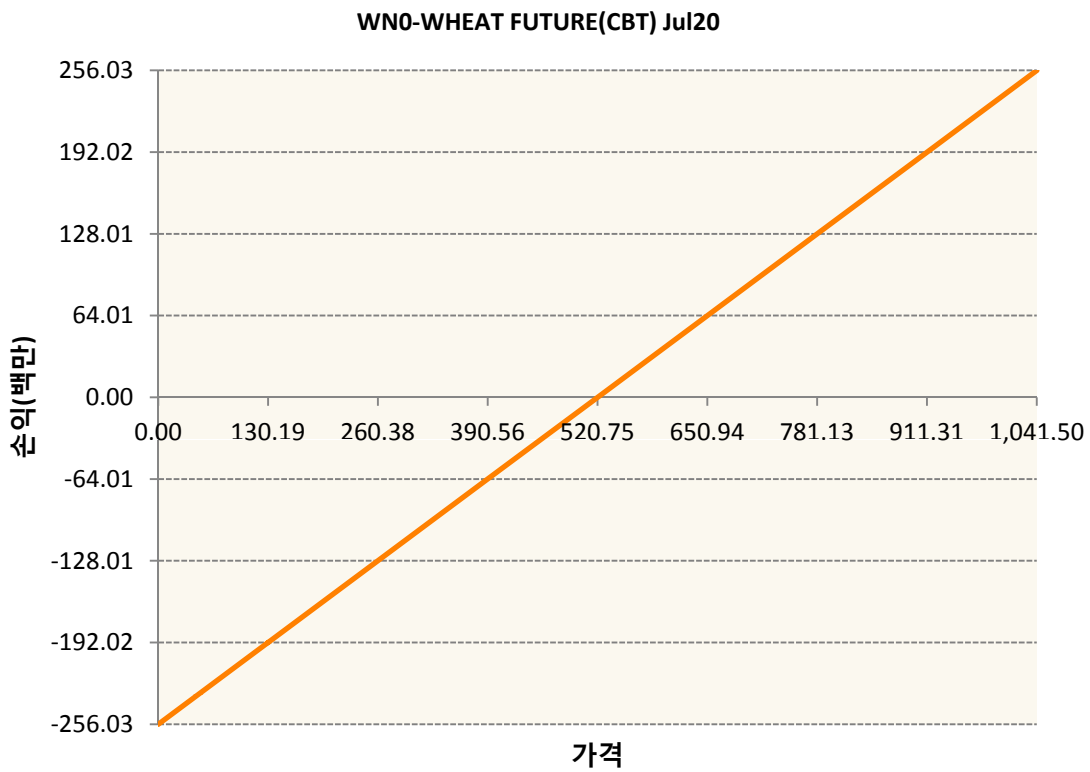
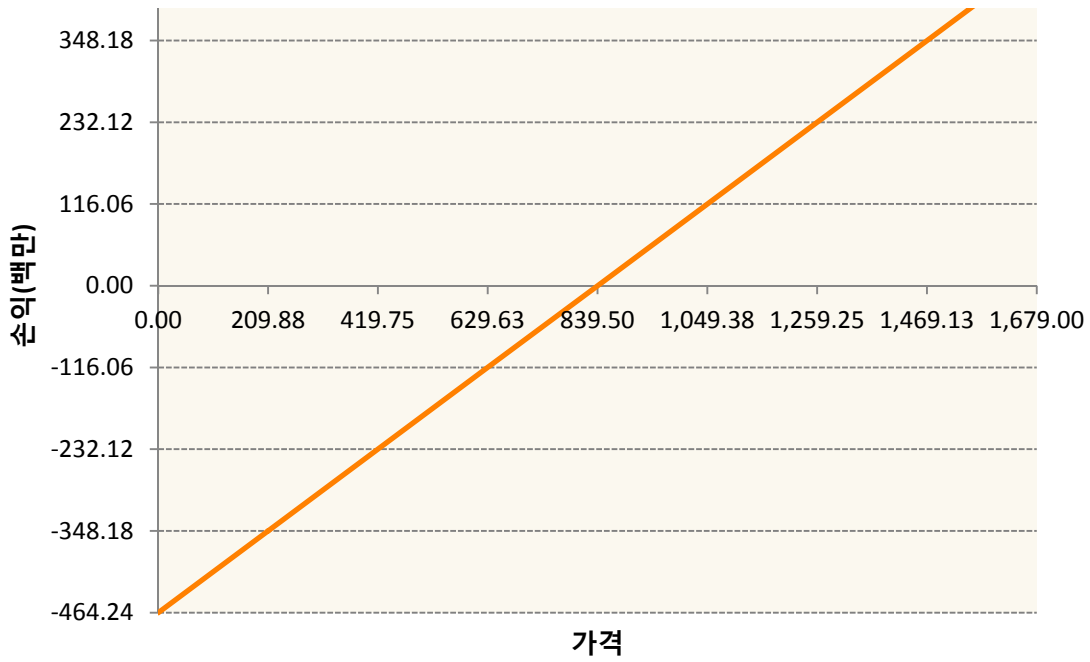


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20



SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON0	SOYBEAN OIL FUTR Jul20	16
CN0	CORN FUTURE Jul20	36
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	18
SMN0	SOYBEAN MEAL FUTR Jul20	23
SN0	SOYBEAN FUTURE Jul20	37
WNO	WHEAT FUTURE(CBT) Jul20	20

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

(단위:백만원)

226