

공시일	2020-05-08
기준일	2020-05-07

## 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	2020-05-08
기준일	2020-05-07

## 스마트인덱스모

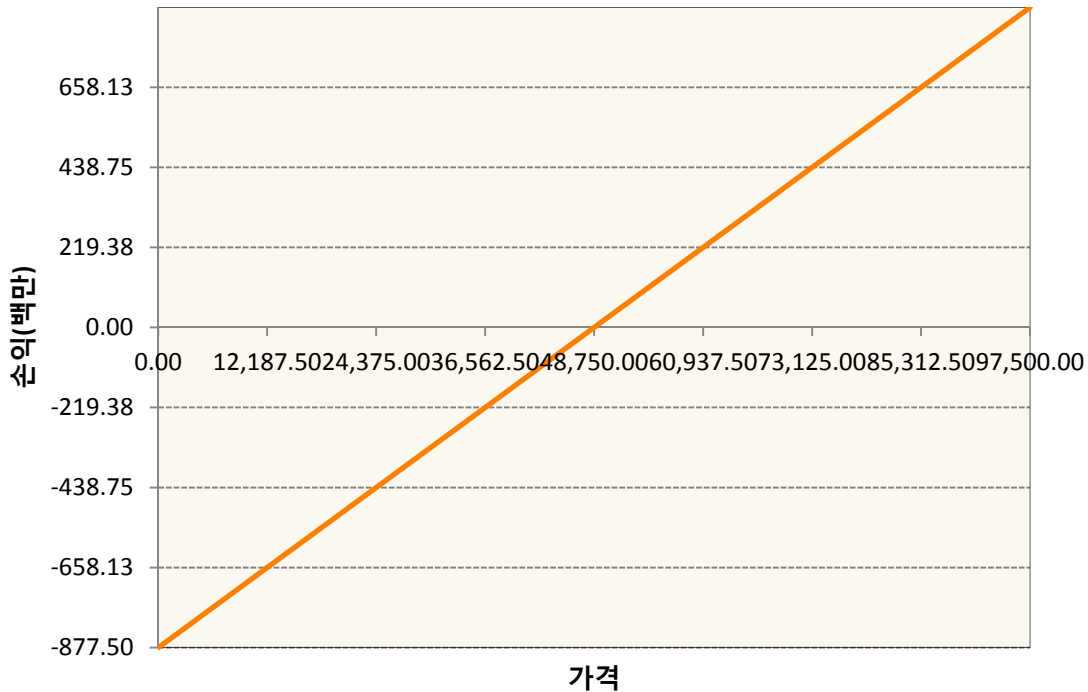
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	878	0	878	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)

106

공시일	2020-05-08
기준일	2020-05-07

## 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

967

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,135

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-08
기준일	2020-05-07

## 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

568

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

889

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-08
기준일	2020-05-07

## 유로인덱스모(주식-파생형)

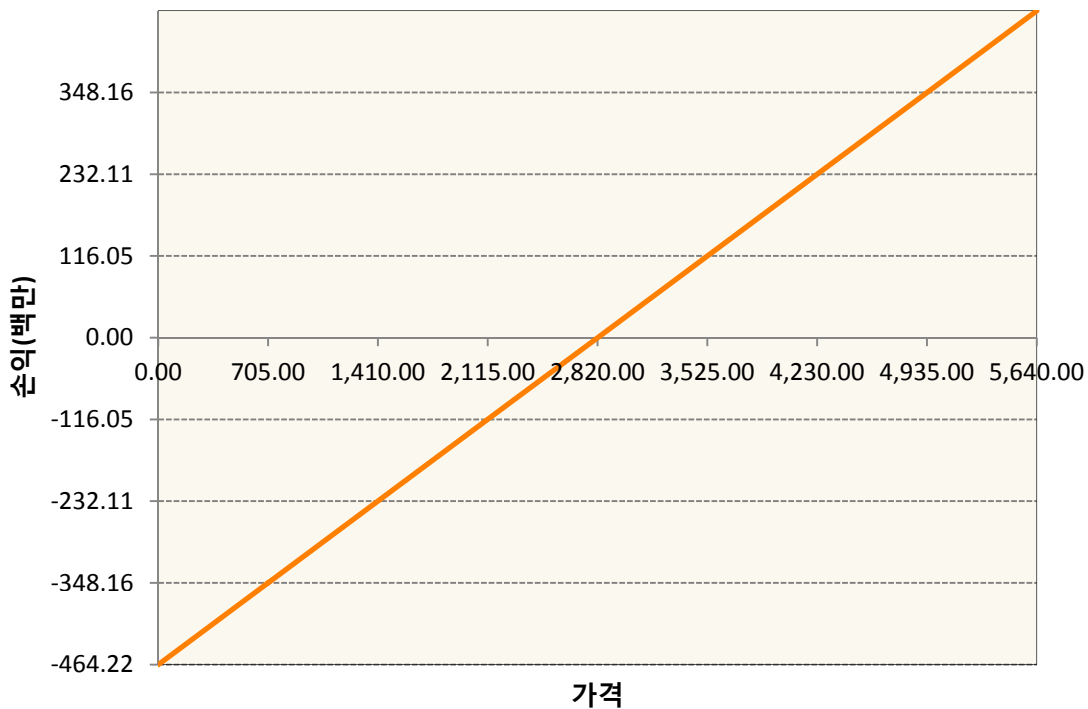
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	464	0	464	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	37
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

48
----

공시일	2020-05-08
기준일	2020-05-07

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

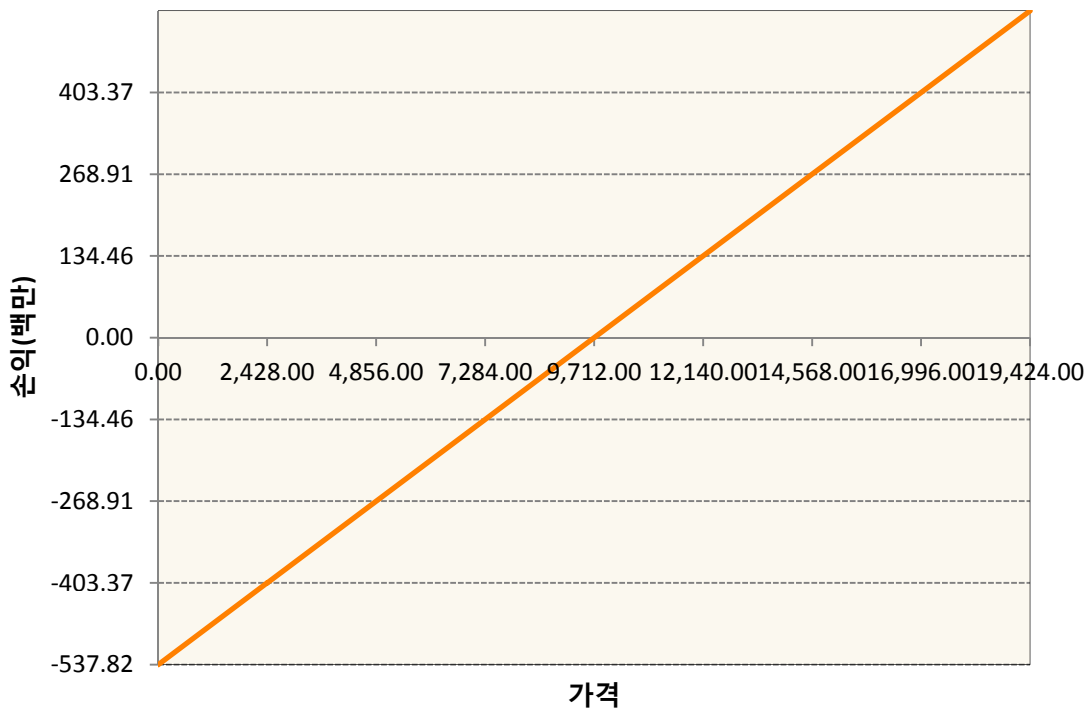
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	538	0	538	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)

46
----

공시일	2020-05-08
기준일	2020-05-07

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

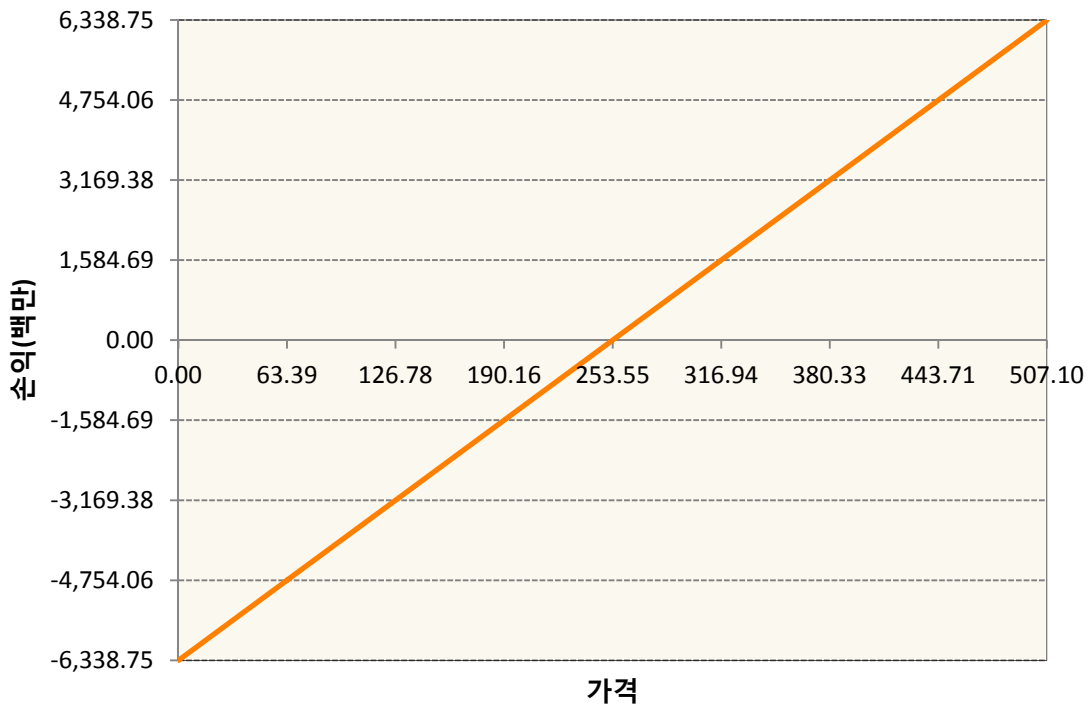
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

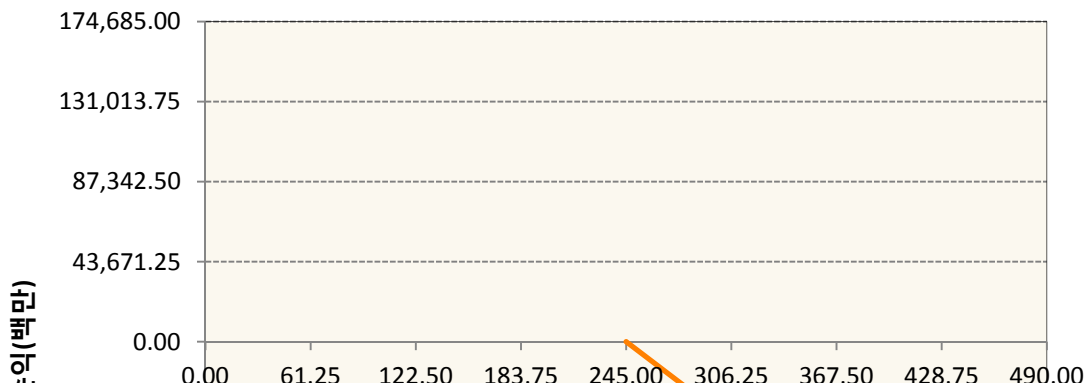
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,339	0	6,339	장내
누계	유가증권	옵션	0	351,608	-351,608	장내

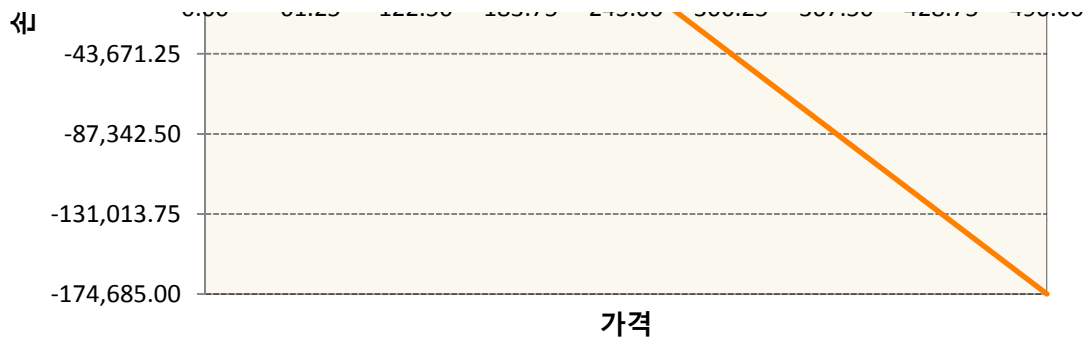
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

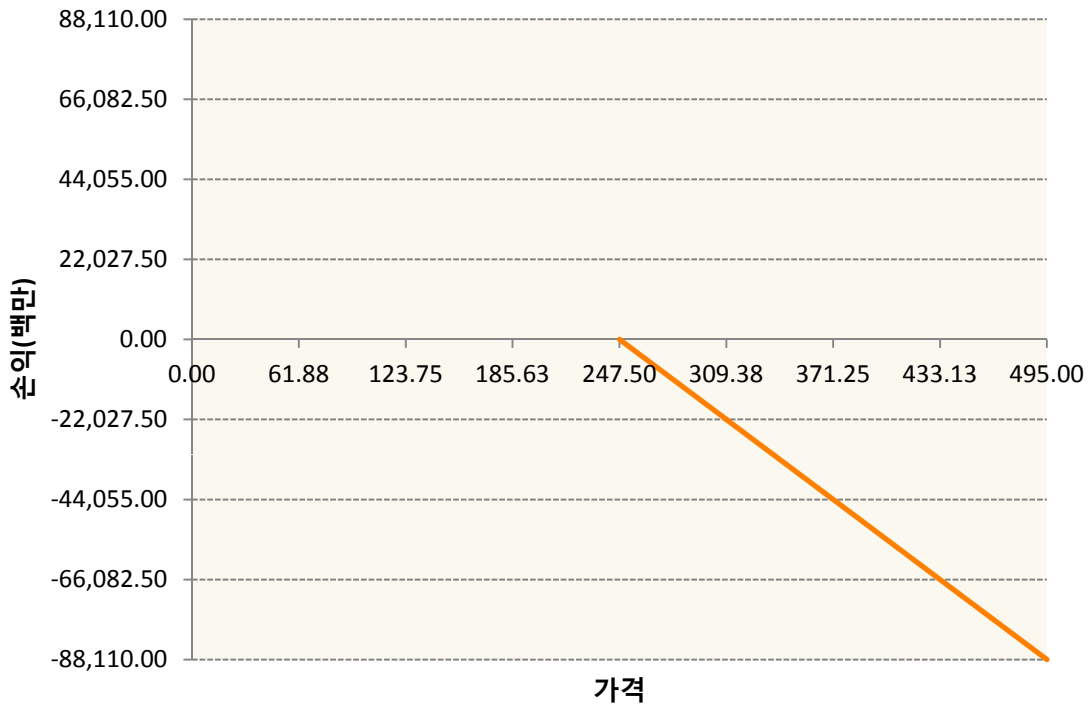


KR4201Q52452-2020-05 콜245

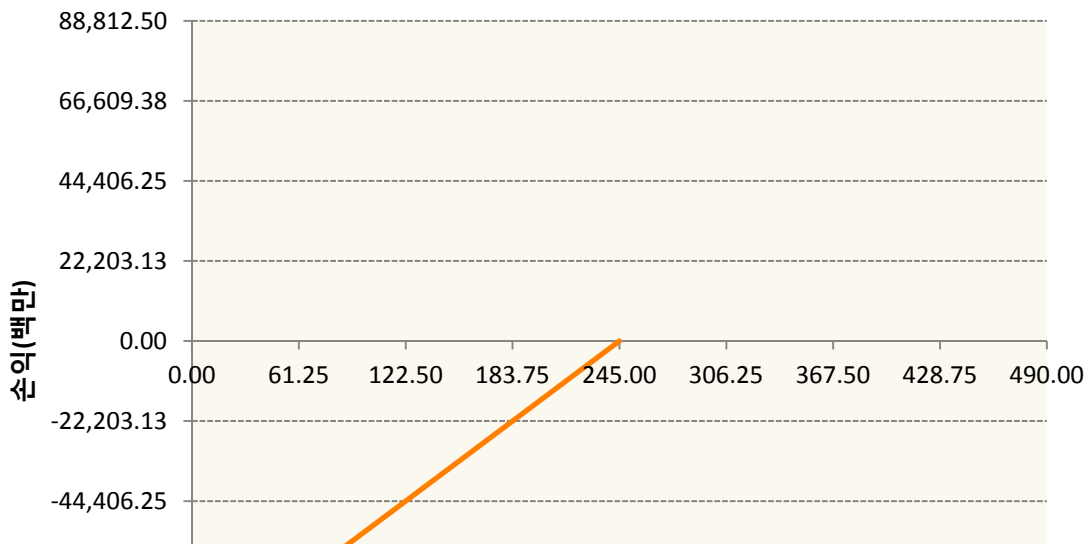


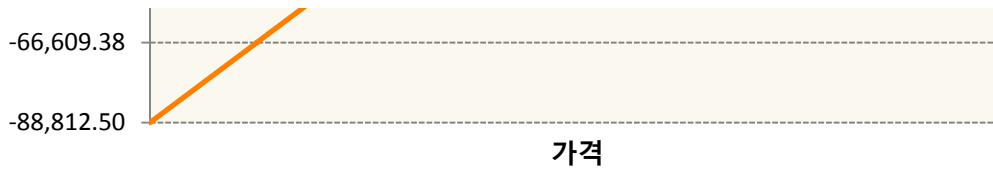


KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



KR4301Q52450-2020-05 풋245





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

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						509
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-509	-509	-509	-509	-509	-509	-509	
-5.33%	-339	-339	-339	-339	-339	-339	-339	
-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%	339	339	339	339	339	339	339	
8.00%	509	509	509	509	509	509	509	
KR4201Q52452		2020-05 콜245						13,034
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	7,920	7,675	7,411	7,132	6,842	6,541	6,233	
-5.33%	6,620	6,268	5,913	5,556	5,196	4,834	4,472	
-2.67%	4,285	3,916	3,545	3,174	2,801	2,428	2,055	
0%	916	624	318	0	-327	-661	-1,002	
2.67%	-3,219	-3,397	-3,601	-3,828	-4,075	-4,338	-4,615	
5.33%	-7,784	-7,869	-7,981	-8,119	-8,281	-8,465	-8,668	
8.00%	-12,535	-12,567	-12,619	-12,691	-12,784	-12,899	-13,034	
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5						6,308
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,475	3,374	3,261	3,139	3,009	2,872	2,730	
-5.33%	2,979	2,817	2,651	2,482	2,310	2,137	1,961	
-2.67%	2,010	1,821	1,631	1,442	1,253	1,064	875	
0%	511	344	174	0	-177	-355	-535	
2.67%	-1,428	-1,540	-1,663	-1,797	-1,938	-2,086	-2,239	
5.33%	-3,641	-3,700	-3,773	-3,860	-3,958	-4,067	-4,184	
8.00%	-5,986	-6,011	-6,047	-6,095	-6,155	-6,226	-6,308	
KR4301Q52450		2020-05 풋245						4,087
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,640	-3,696	-3,761	-3,833	-3,912	-3,997	-4,087	
-5.33%	-1,637	-1,753	-1,871	-1,992	-2,114	-2,237	-2,361	
-2.67%	-330	-456	-584	-713	-842	-971	-1,101	

0%	252	176	91	0	-97	-198	-304
2.67%	418	391	356	311	258	198	130
5.33%	448	442	432	417	395	367	332
8.00%	451	450	448	444	438	427	413

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

(단위:백만원)

**24,006**

공시일	2020-05-08
기준일	2020-05-07

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

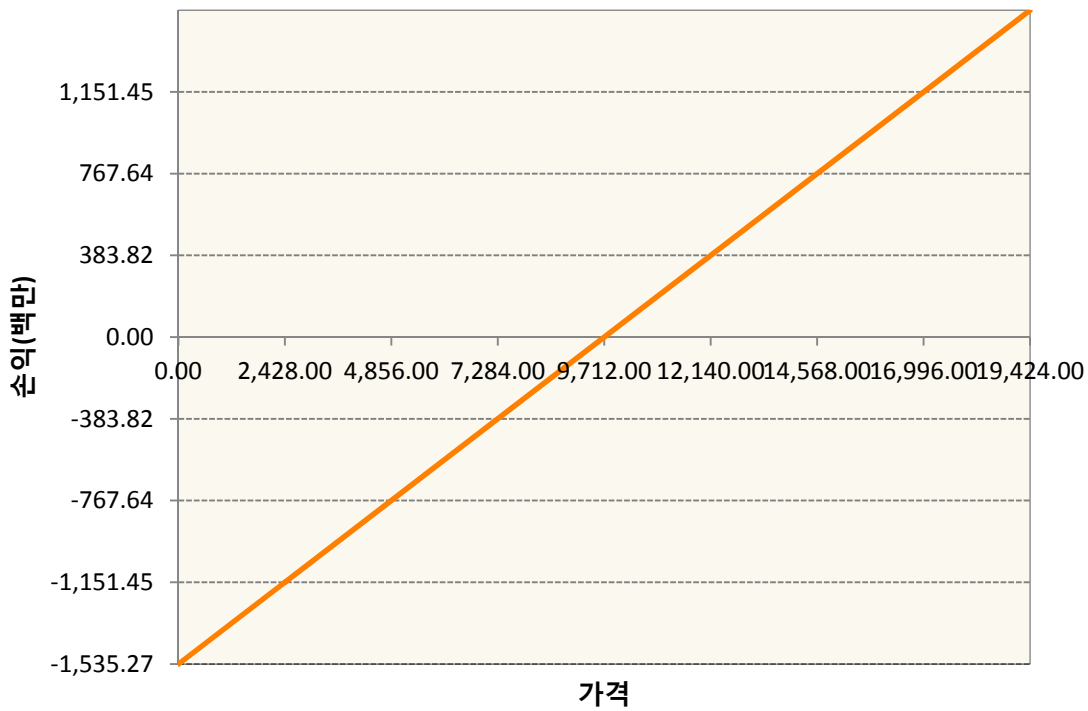
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

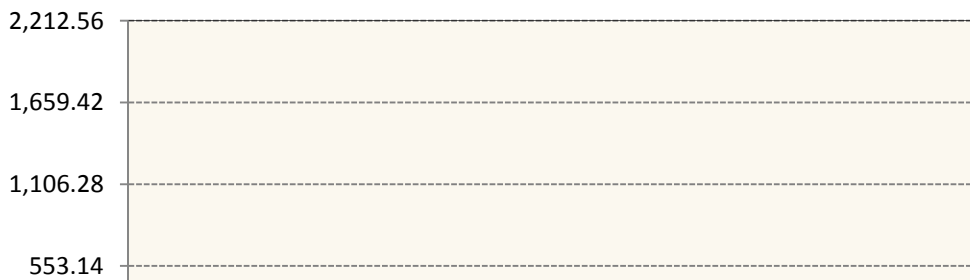
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,535	0	1,535	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,425	-4,425	장내
누계	통화	선도	695	2,225	-1,530	장외

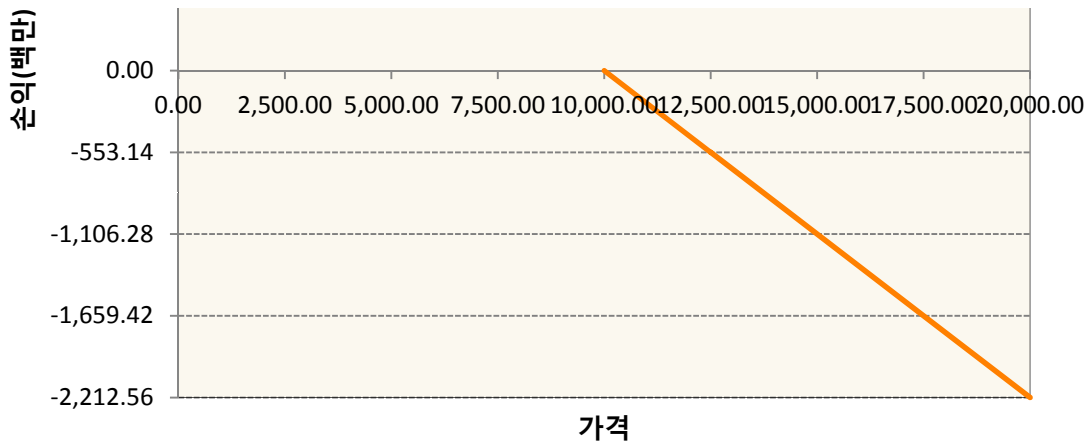
### 2. 만기시점의 손익구조

HCK0-HSCEI Futures May20

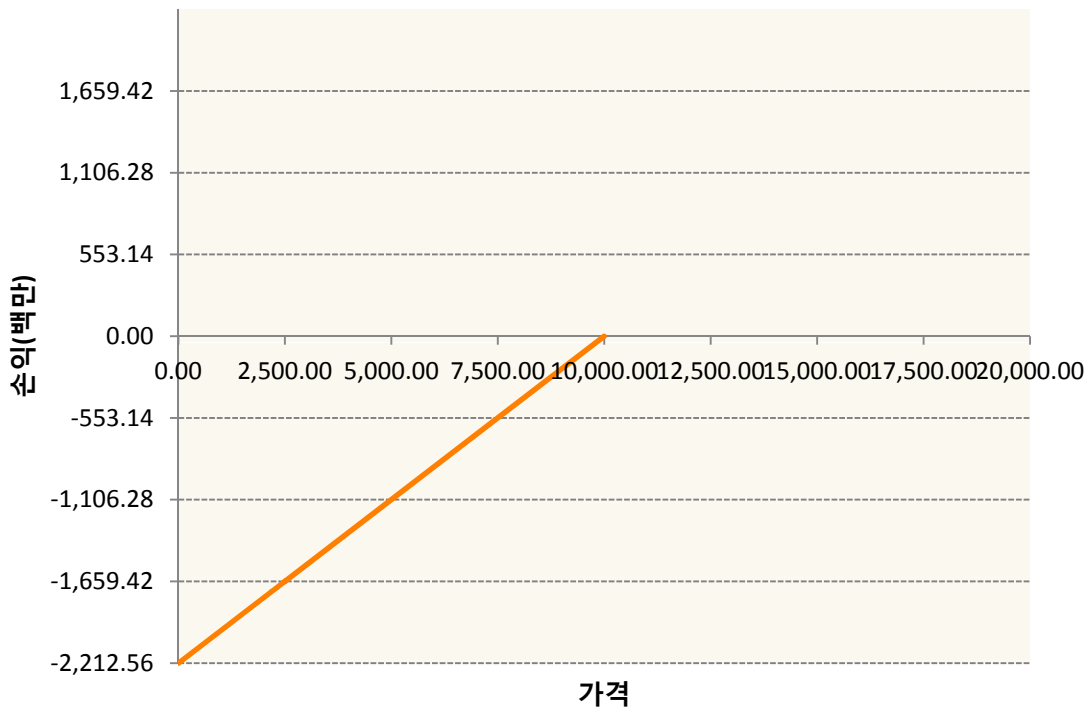


OHHIK0-C100-HSCEI





OHHIK0-P100-HSCEI



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E		178
FX21020H05 HKD/KRW 22-05-20E		56
HCK0 HSCEI Futures May20		123
OHHIK0-C1C HSCEI		177
OHHIK0-P10 HSCEI		177

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		632

공시일	2020-05-08
기준일	2020-05-07

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

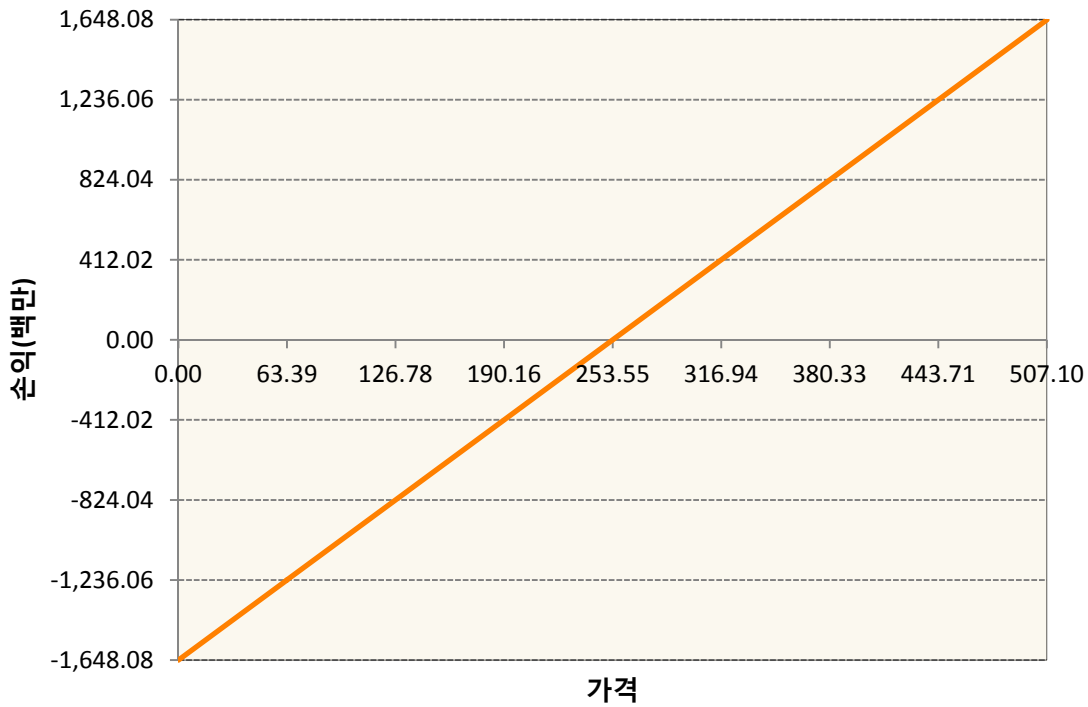
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

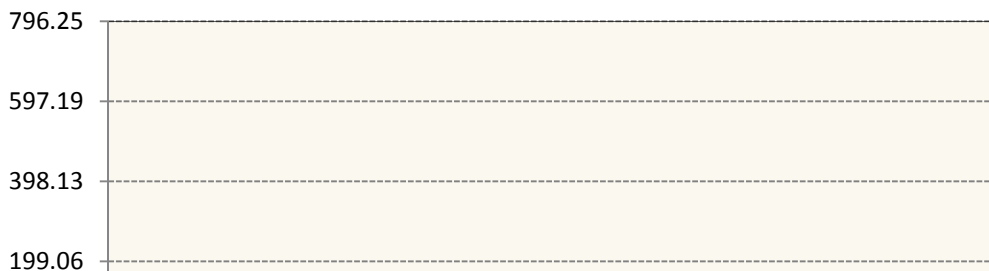
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,648	0	1,648	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,193	-3,193	장내

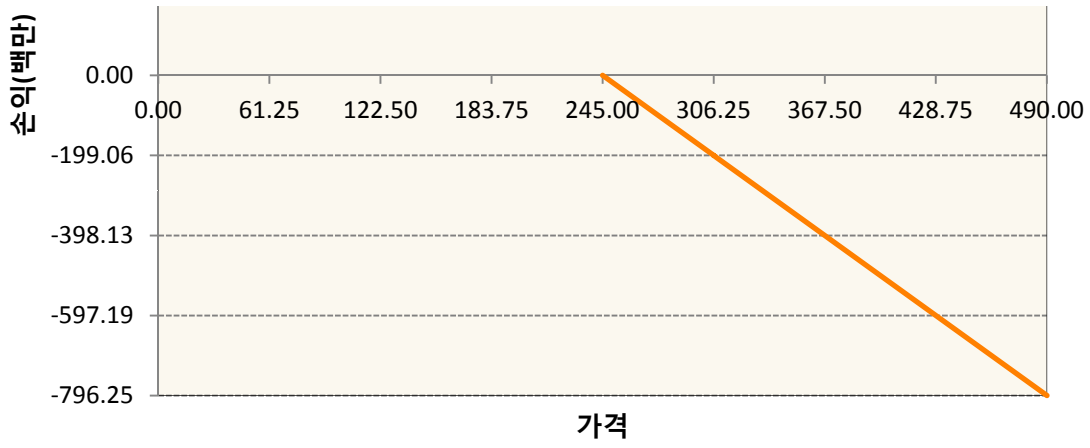
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

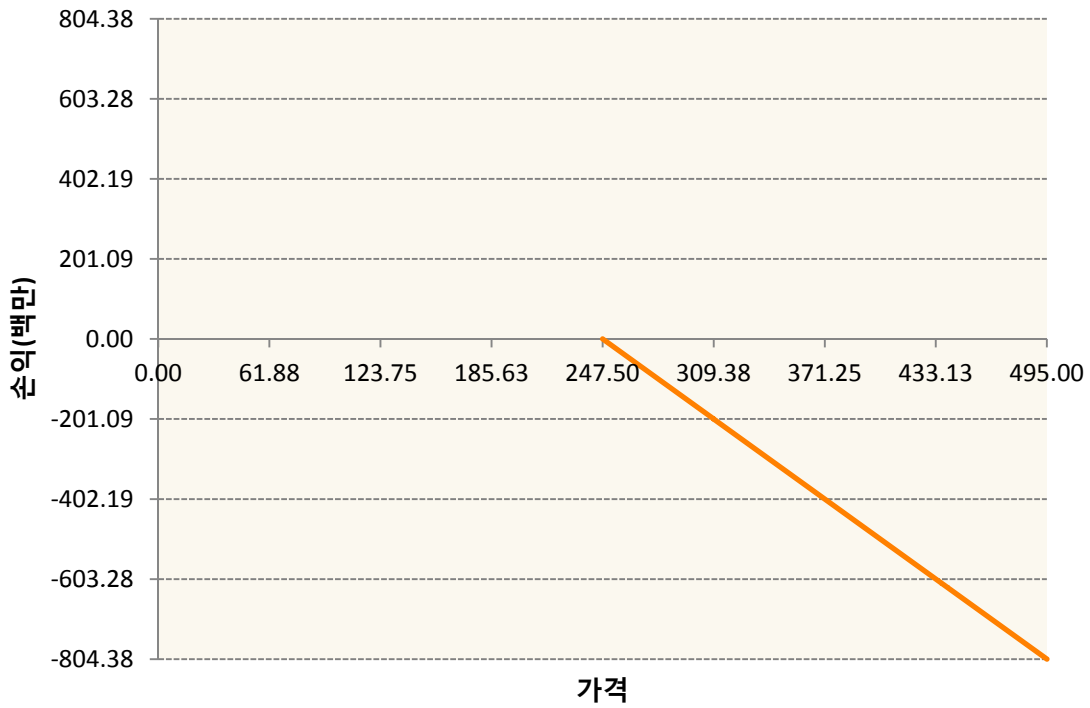


KR4201Q52452-2020-05 콜245

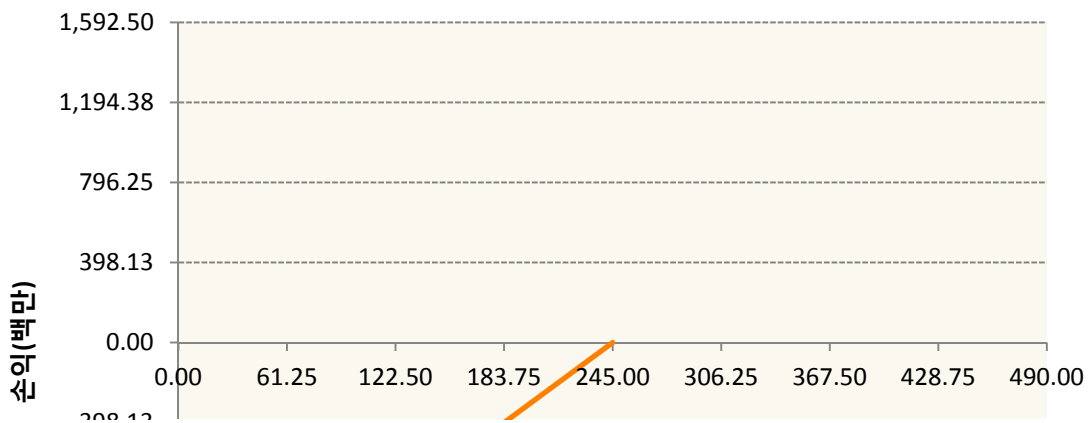




KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



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						132
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132	
-5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88	
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	44	44	44	44	44	44	44	
5.33%	88	88	88	88	88	88	88	
8.00%	132	132	132	132	132	132	132	
KR4201Q52452		2020-05 콜245						59
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	36	35	34	33	31	30	28	
-5.33%	30	29	27	25	24	22	20	
-2.67%	20	18	16	14	13	11	9	
0%	4	3	1	0	-1	-3	-5	
2.67%	-15	-15	-16	-17	-19	-20	-21	
5.33%	-35	-36	-36	-37	-38	-39	-40	
8.00%	-57	-57	-58	-58	-58	-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%	32	31	30	29	27	26	25
-5.33%	27	26	24	23	21	20	18
-2.67%	18	17	15	13	11	10	8
0%	5	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	-13	-14	-15	-16	-18	-19	-20
5.33%	-33	-34	-34	-35	-36	-37	-38
8.00%	-55	-55	-55	-56	-56	-57	-58
KR4301Q52450                      2020-05 풋245							73
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-65	-66	-67	-69	-70	-72	-73
-5.33%	-29	-31	-34	-36	-38	-40	-42
-2.67%	-6	-8	-10	-13	-15	-17	-20
0%	5	3	2	0	-2	-4	-5
2.67%	7	7	6	6	5	4	2
5.33%	8	8	8	7	7	7	6
8.00%	8	8	8	8	8	8	7

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

(단위:백만원)

**566**

공시일	2020-05-08
기준일	2020-05-07

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

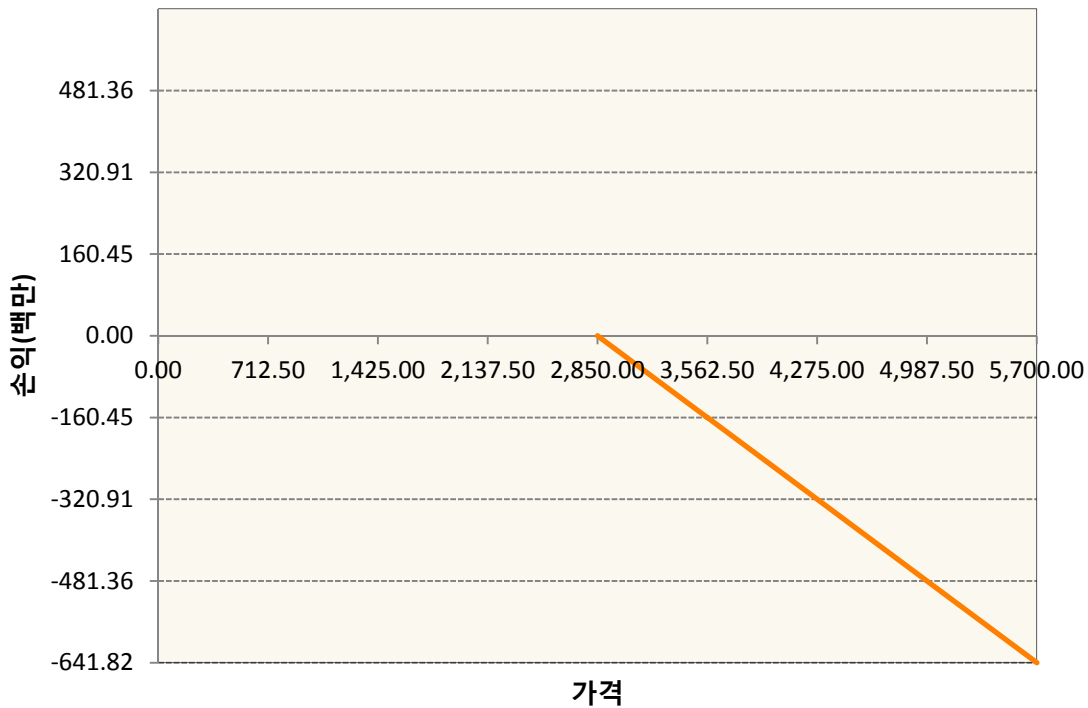
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

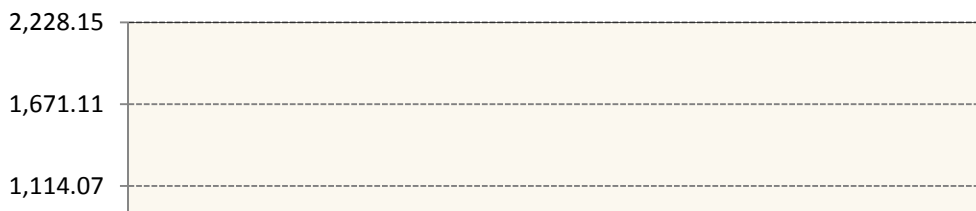
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	607	0	607	
누계	유가증권	스왑	7,901	0	7,901	장외
누계	유가증권	옵션	0	5,740	-5,740	장내
누계	통화	선도	0	2,681	-2,681	장외

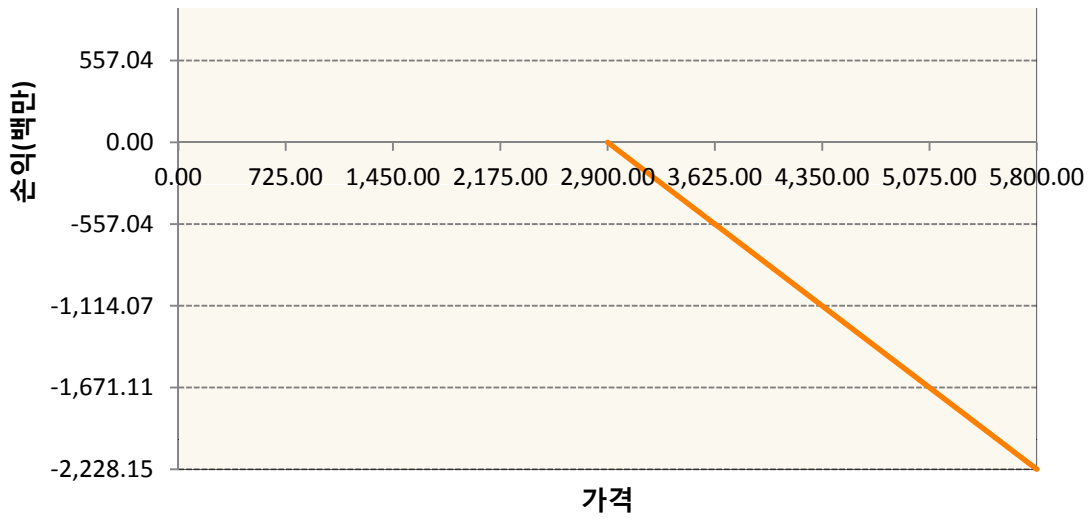
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXK0-C2850-EURO STOXX 50**

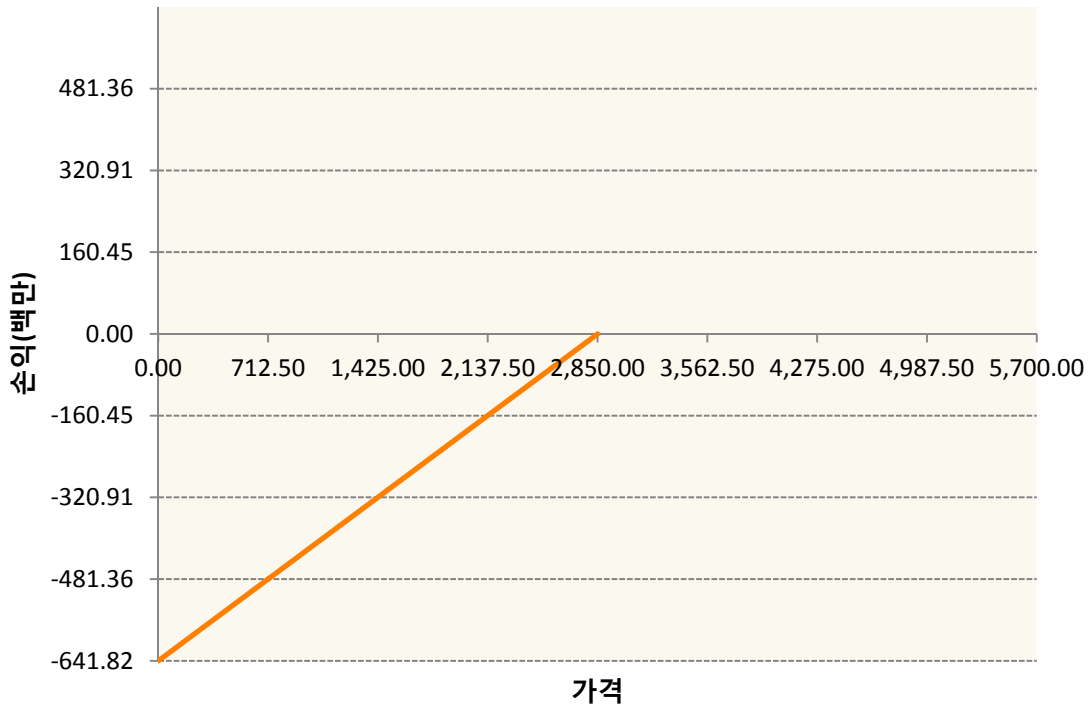


**OESXK0-C2900-EURO STOXX 50**

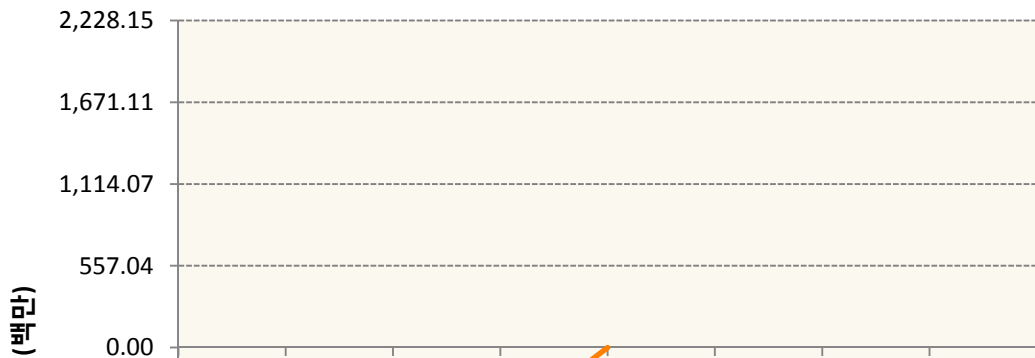


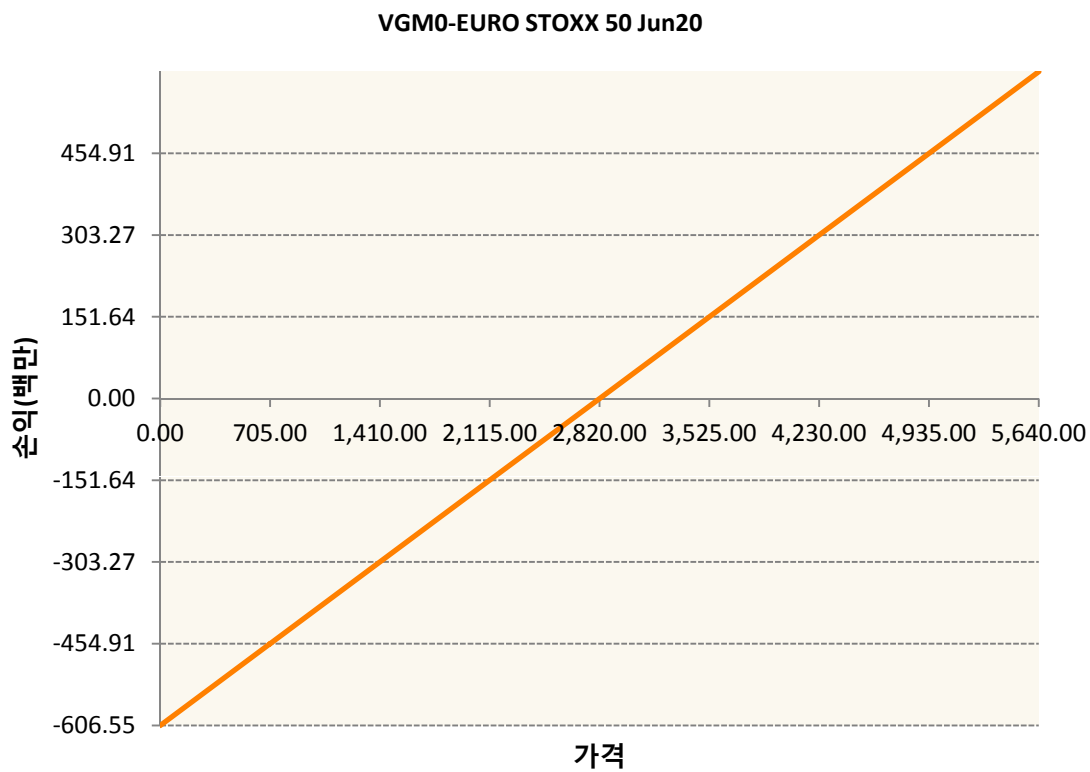
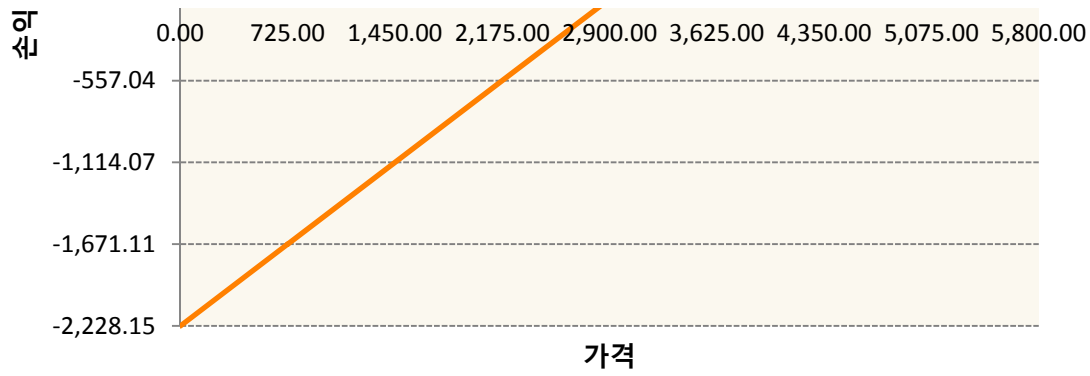


**OESXK0-P2850-EURO STOXX 50**



**OESXK0-P2900-EURO STOXX 50**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		9
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)

1,140

공시일	2020-05-08
기준일	2020-05-07

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

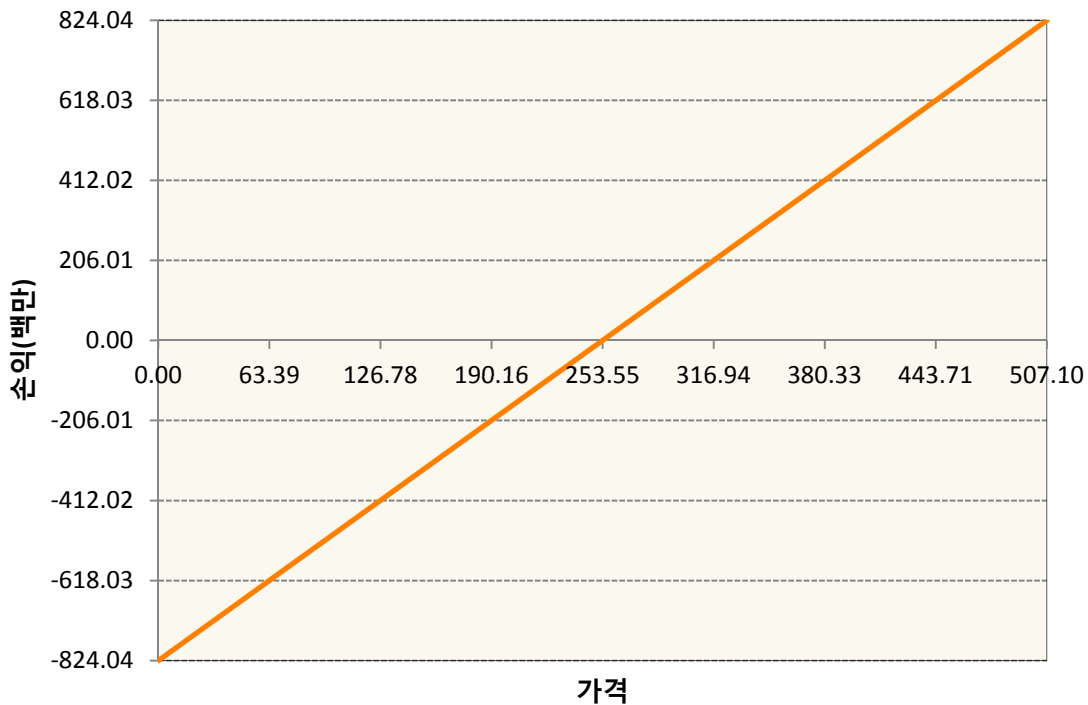
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	824	0	824	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

99

공시일	2020-05-08
기준일	2020-05-07

## ETF스마트레버리지목표전환형10호

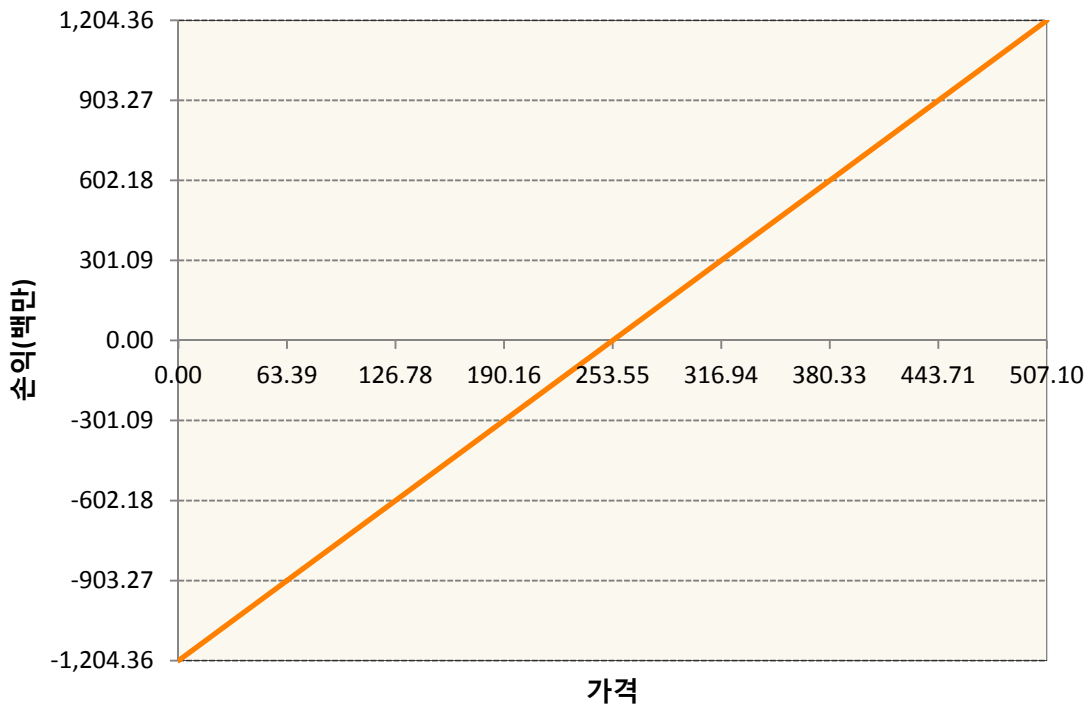
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,204	0	1,204	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%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64	
-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%	64	64	64	64	64	64	64	
8.00%	97	97	97	97	97	97	97	

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

(단위:백만원)

144

공시일	2020-05-08
기준일	2020-05-07

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

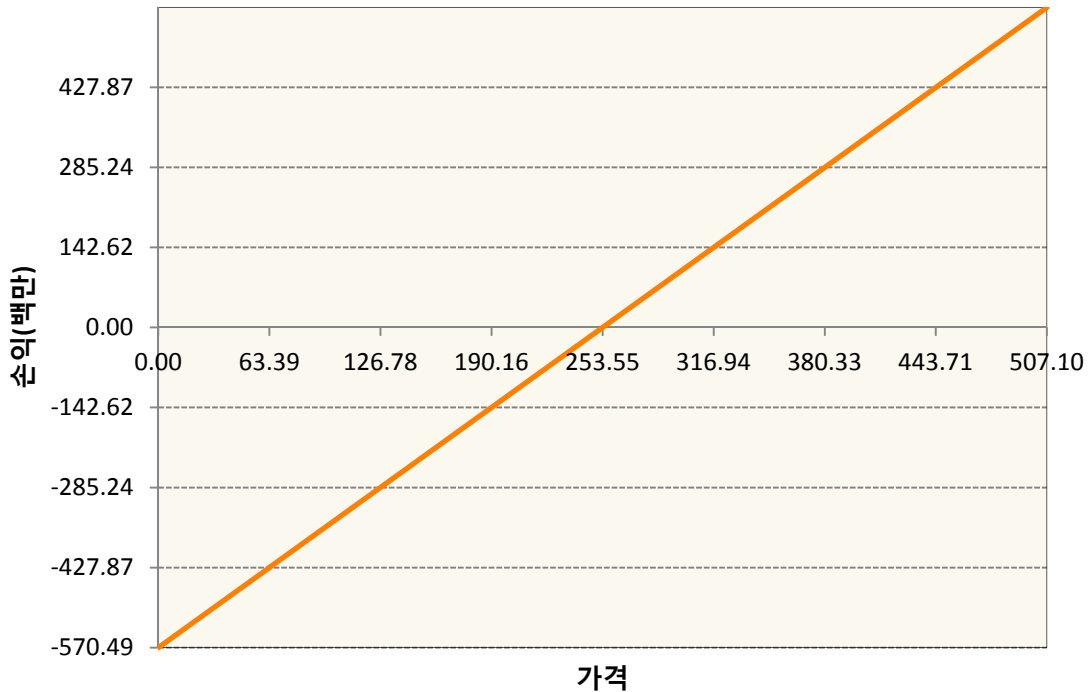
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	570	0	570	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002      2020-06 코스피200지수선물      46

가격	기초자산의 변동성						
	-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)

68

공시일	2020-05-08
기준일	2020-05-07

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

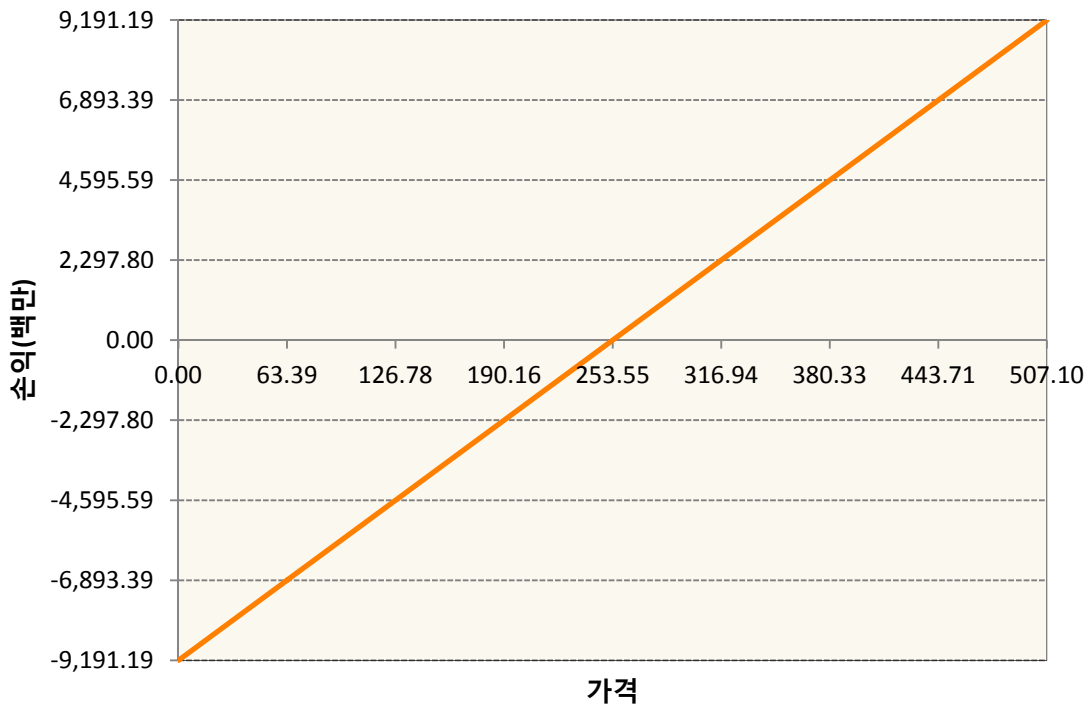
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

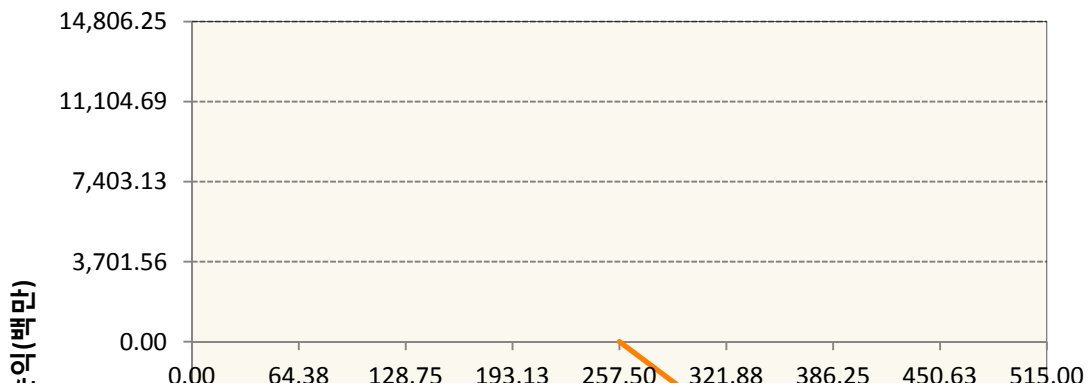
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,191	0	9,191	장내
누계	유가증권	옵션	6,201	17,536	-11,335	장내

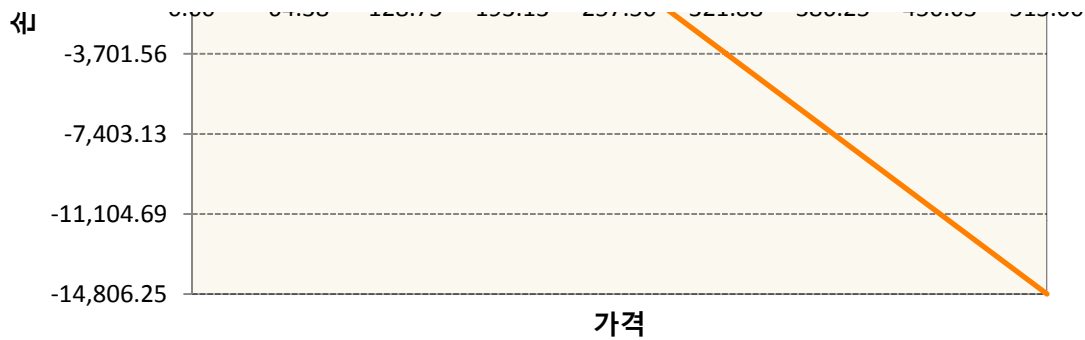
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

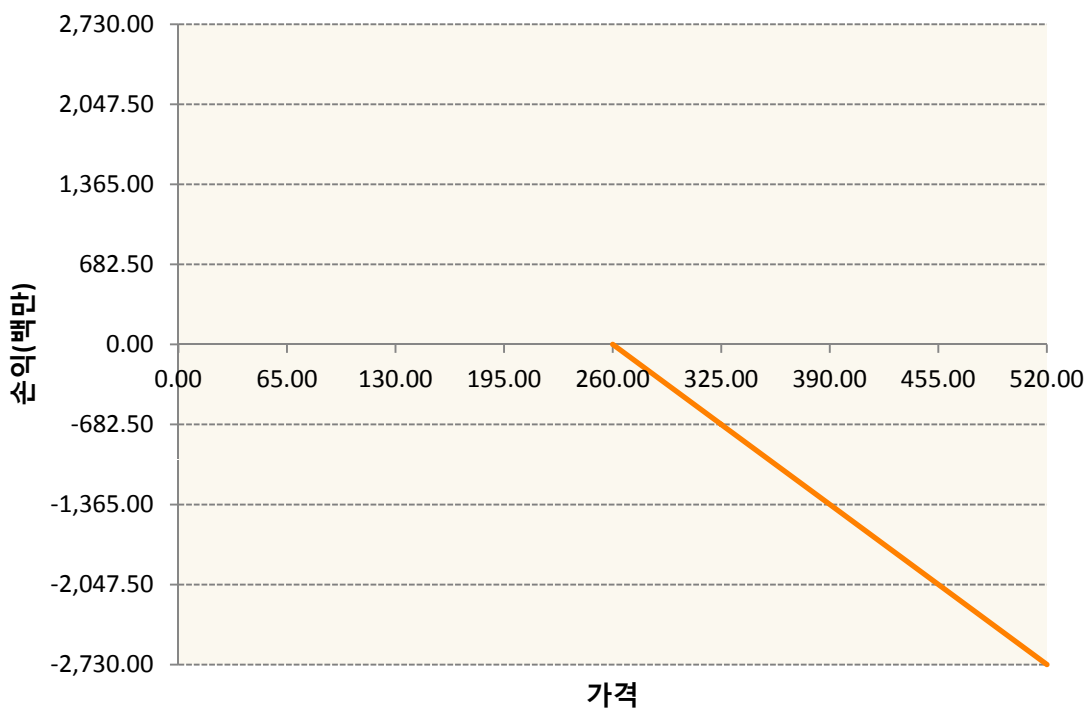


KR4201Q52577-2020-05 콜257.5

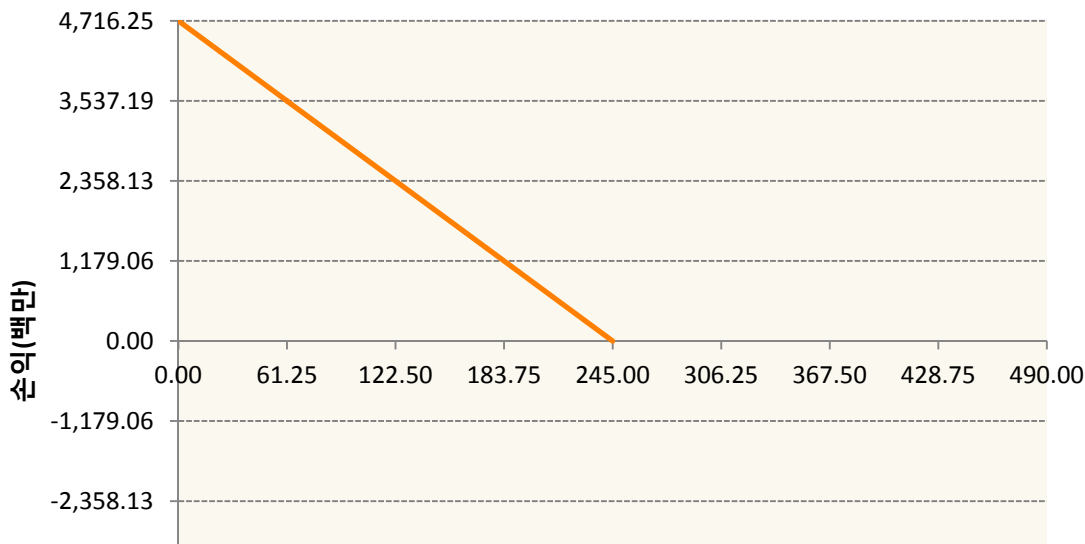


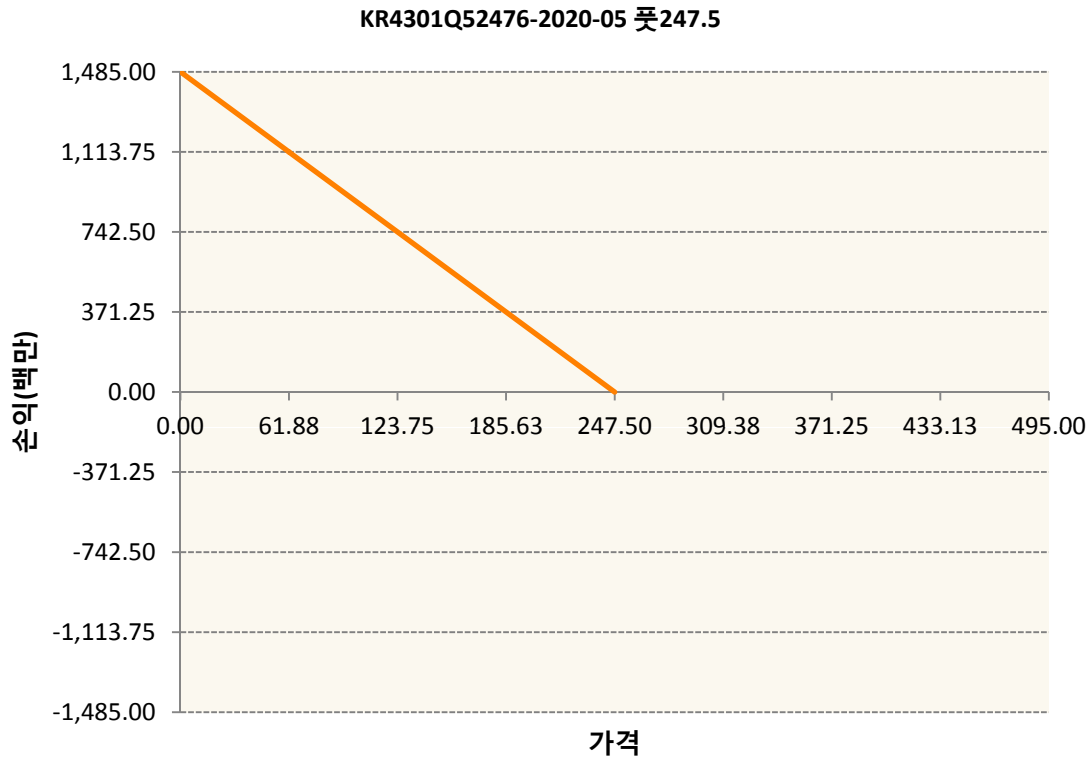
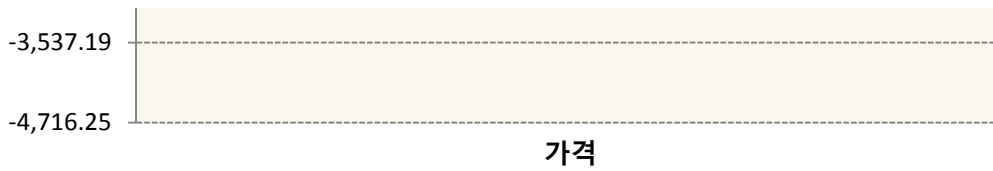


KR4201Q52601-2020-05 콜260



KR4301Q52450-2020-05 풋245





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

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						738
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-738	-738	-738	-738	-738	-738	-738	
-5.33%	-492	-492	-492	-492	-492	-492	-492	
-2.67%	-246	-246	-246	-246	-246	-246	-246	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	246	246	246	246	246	246	246	
5.33%	492	492	492	492	492	492	492	
8.00%	738	738	738	738	738	738	738	
KR4201Q52577		2020-05 콜257.5						842
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	290	285	277	268	257	244	230	
-5.33%	270	257	242	224	206	186	164	
-2.67%	213	190	165	140	114	87	59	

0%	93	62	31	0	-31	-62	-93
2.67%	-109	-140	-171	-202	-234	-265	-297
5.33%	-389	-413	-438	-465	-492	-520	-548
8.00%	-725	-740	-757	-776	-797	-819	-842
KR4201Q52601                      2020-05 콜260							144
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	43	43	42	40	39	37	35
-5.33%	41	39	37	34	31	28	25
-2.67%	33	30	26	22	17	13	8
0%	16	11	5	0	-5	-11	-17
2.67%	-15	-21	-27	-33	-39	-44	-50
5.33%	-61	-66	-71	-77	-82	-88	-93
8.00%	-119	-123	-126	-130	-135	-139	-144
KR4301Q52450                      2020-05 풋245							217
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	193	196	200	204	208	212	217
-5.33%	87	93	99	106	112	119	125
-2.67%	18	24	31	38	45	52	58
0%	-13	-9	-5	0	5	11	16
2.67%	-22	-21	-19	-17	-14	-10	-7
5.33%	-24	-23	-23	-22	-21	-19	-18
8.00%	-24	-24	-24	-24	-23	-23	-22
KR4301Q52476                      2020-05 풋247.5							76
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	71	71	72	73	74	75	76
-5.33%	35	36	38	40	42	44	45
-2.67%	8	11	13	15	17	19	22
0%	-5	-4	-2	0	2	4	6
2.67%	-10	-9	-8	-7	-6	-5	-3
5.33%	-11	-11	-10	-10	-10	-9	-8
8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-10	-10

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

(단위:백만원)

**2,145**

공시일	2020-05-08
기준일	2020-05-07

## 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	148,913	0	148,913	

### 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	2020-05-08
기준일	2020-05-07

## 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	100,405	0	100,405	

### 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	2020-05-08
기준일	2020-05-07

## 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	443,604	0	443,604	
누계	통화	선도	44,100	512,295	-468,195	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,450
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,038
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,038
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,391
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	3,430
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,958
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
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	2,038
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	1,940

IE00BD8RGM75

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)





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

(단위:백만원)

197

공시일	2020-05-08
기준일	2020-05-07

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

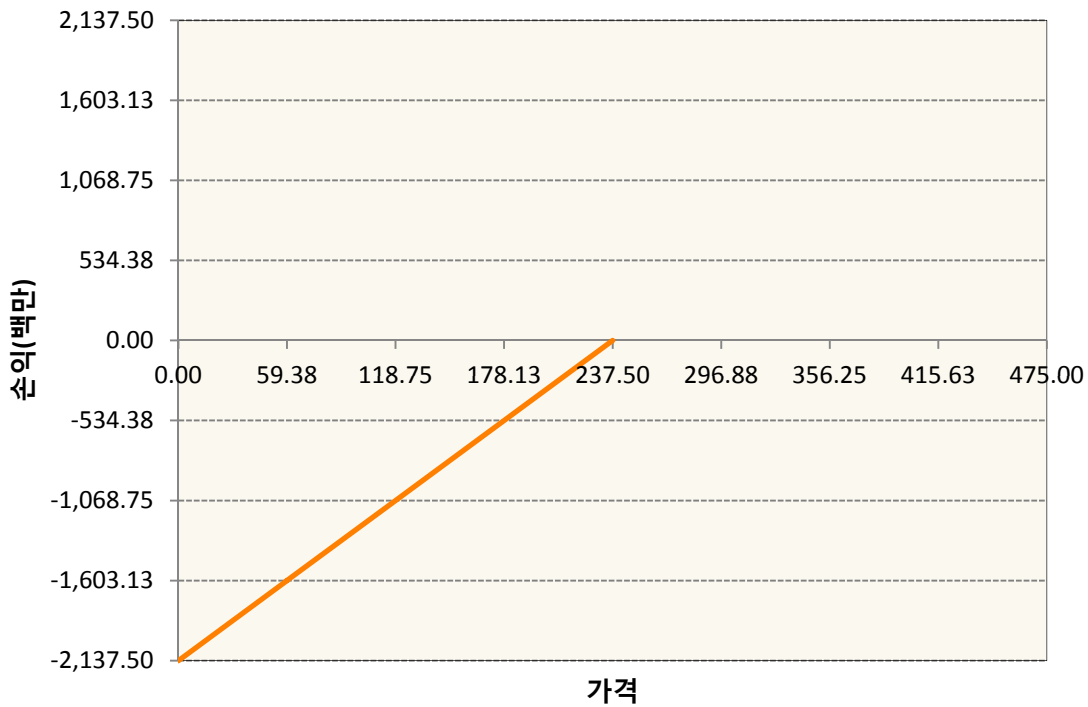
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

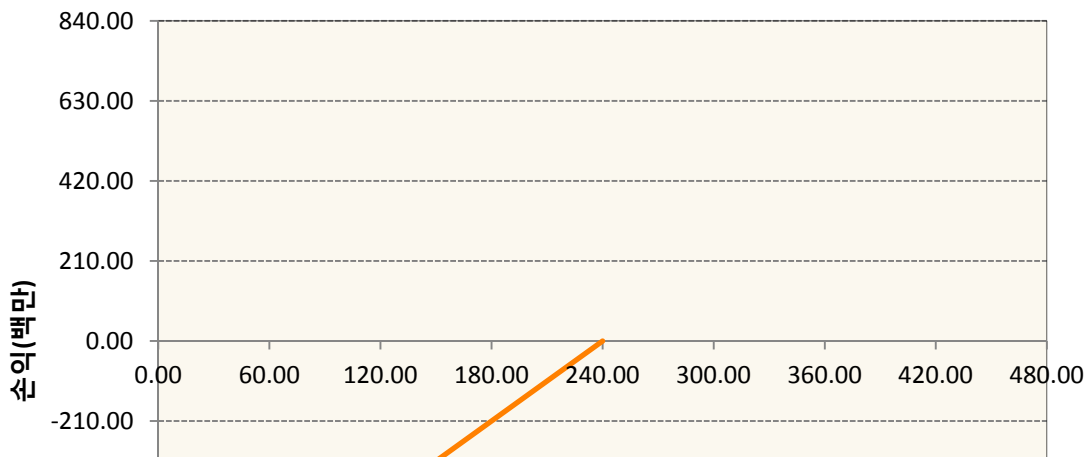
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	119	0	119	장내
누계	유가증권	옵션	0	2,978	-2,978	장내

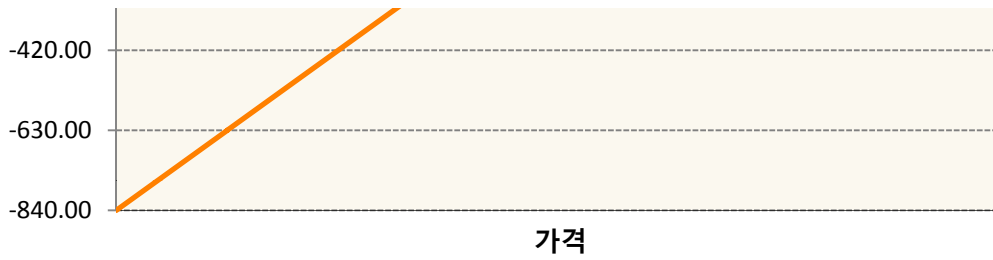
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q52377-2020-05 풋237.5



KR4301Q52401-2020-05 풋240





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

KR4301Q52377      2020-05 풋237.5      62

기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-44	-47	-50	-53	-56	-59	-62	
-5.33%	-14	-17	-20	-23	-26	-29	-32	
-2.67%	-1	-3	-5	-7	-9	-11	-13	
0%	2	2	1	0	-1	-2	-4	
2.67%	3	3	2	2	2	1	0	
5.33%	3	3	3	3	2	2	2	
8.00%	3	3	3	3	3	3	2	

KR4301Q52401      2020-05 풋240      29

기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-23	-24	-25	-26	-27	-28	-29	
-5.33%	-8	-9	-11	-12	-13	-14	-16	
-2.67%	-1	-2	-3	-4	-5	-6	-7	
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2	
2.67%	2	2	1	1	1	1	0	
5.33%	2	2	2	2	2	1	1	
8.00%	2	2	2	2	2	2	2	

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

53

공시일	2020-05-08
기준일	2020-05-07

## 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	7,312	0	7,312	
누계	통화	선도	0	7,166	-7,166	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J01! KRW/USD 13-05-20E	320
FX21020J04! KRW/USD 29-05-20E	253
IE00BD8RGM75	

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

289
-----

공시일	2020-05-08
기준일	2020-05-07

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

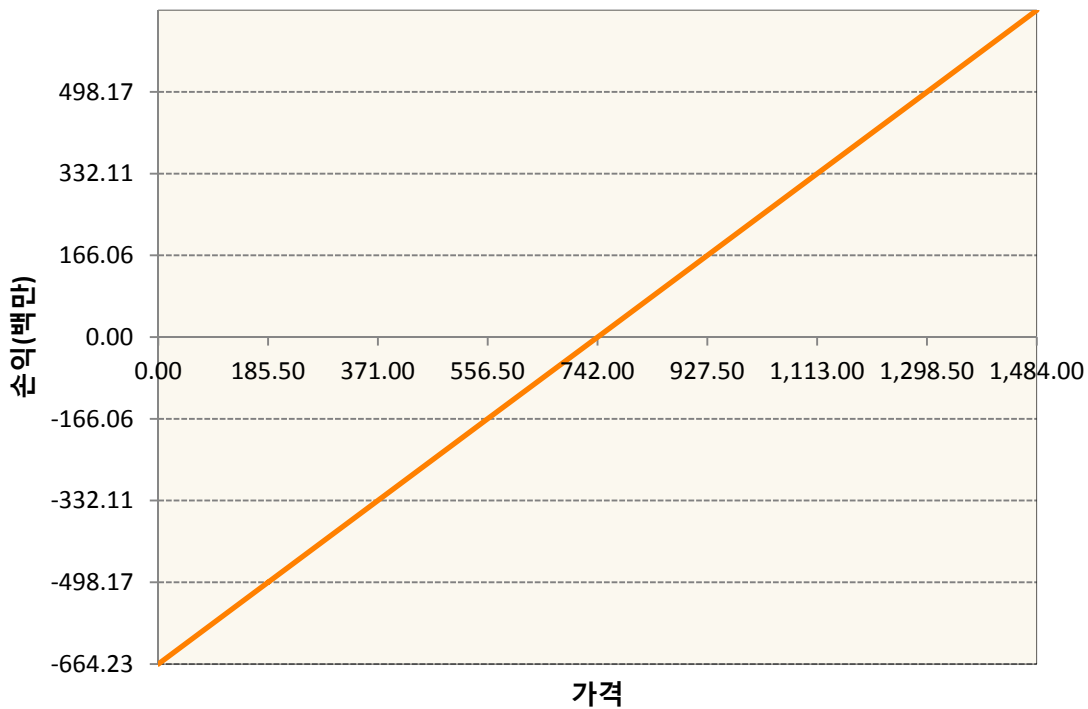
### 1. 계약금액

(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	664	0	664	
누계	유가증권	스왑	868	0	868	장외
누계	통화	선도	204	760	-556	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
FX21020K00 KRW/EUR 24-07-20E	5
VNCK0 VN30 Index Future May20	53

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

(단위:백만원)

**153**

공시일	2020-05-08
기준일	2020-05-07

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

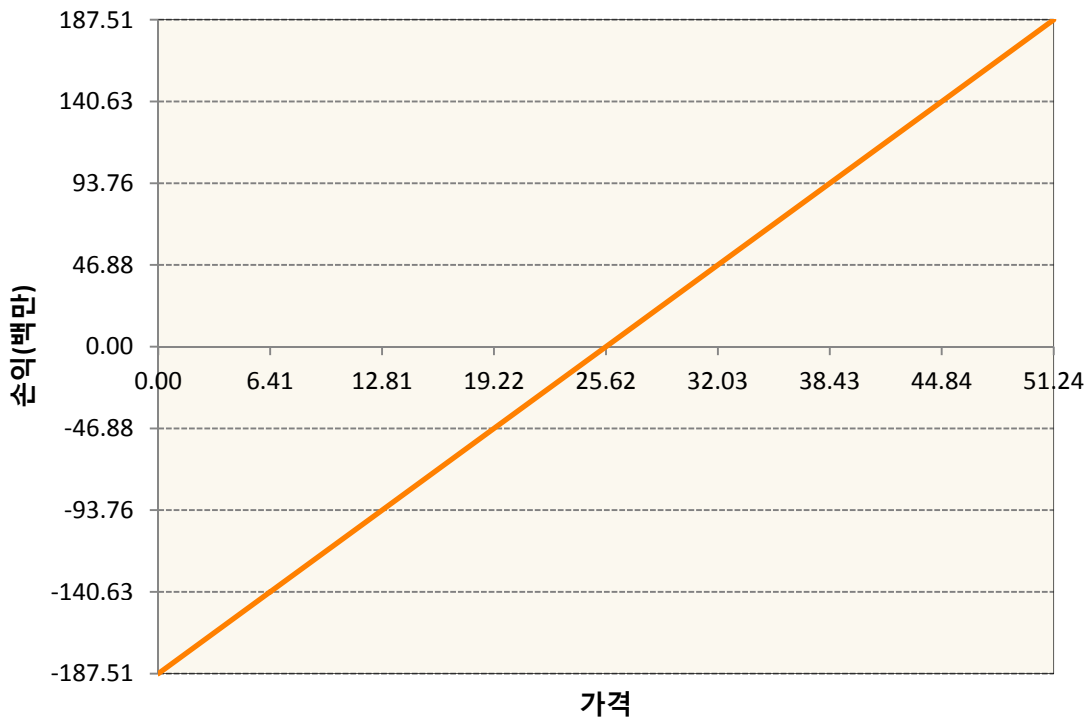
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

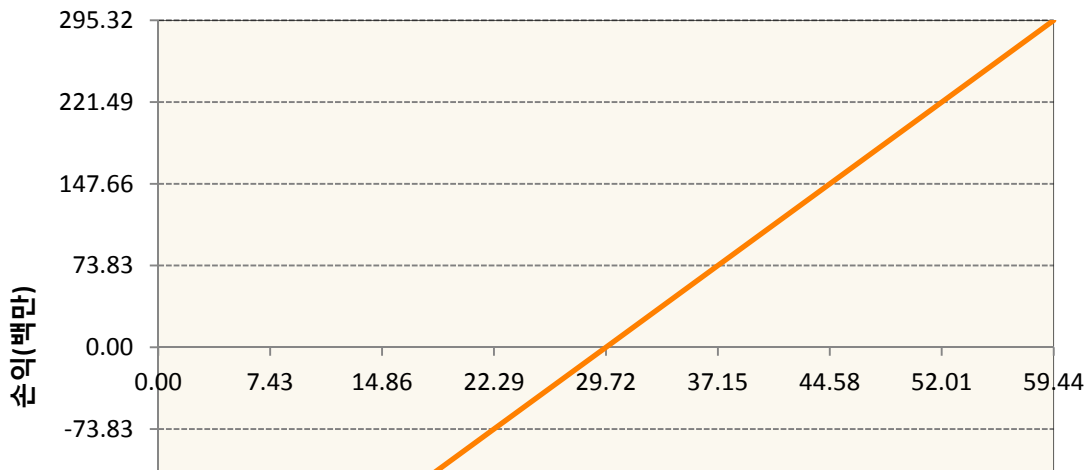
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,527	184	1,343	

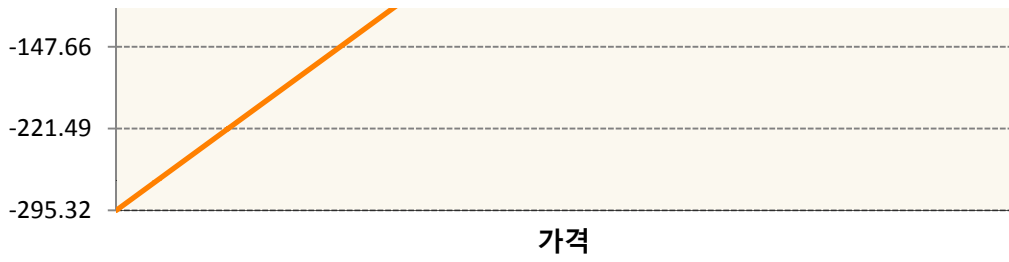
### 2. 만기시점의 손익구조

**CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20**

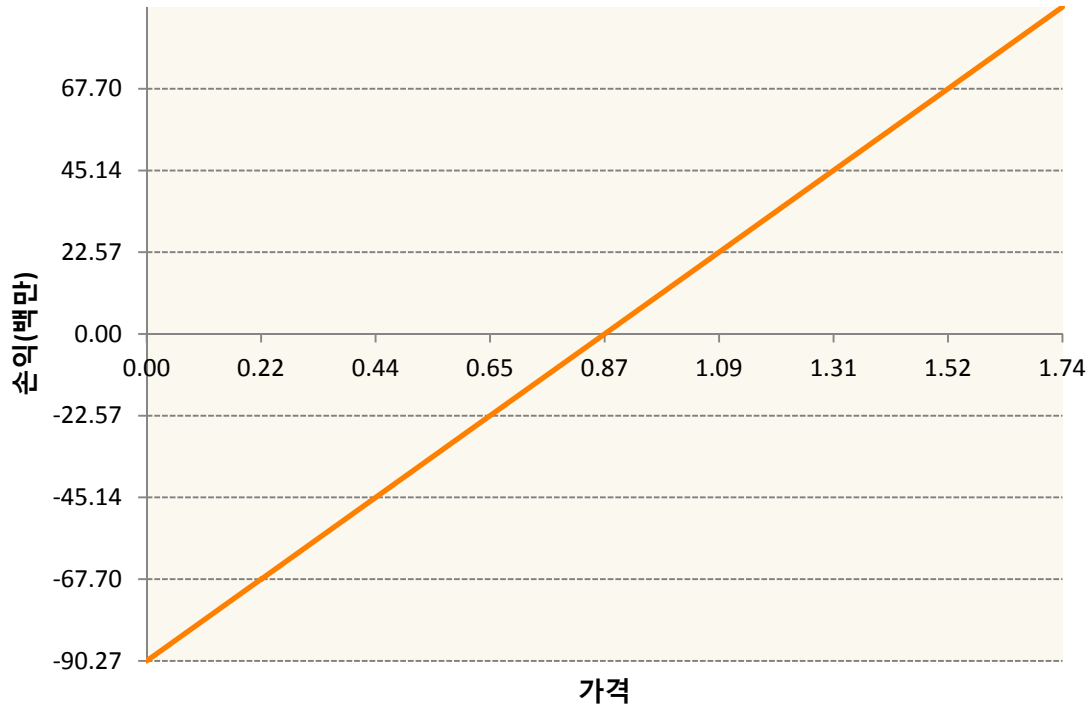


**CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20**

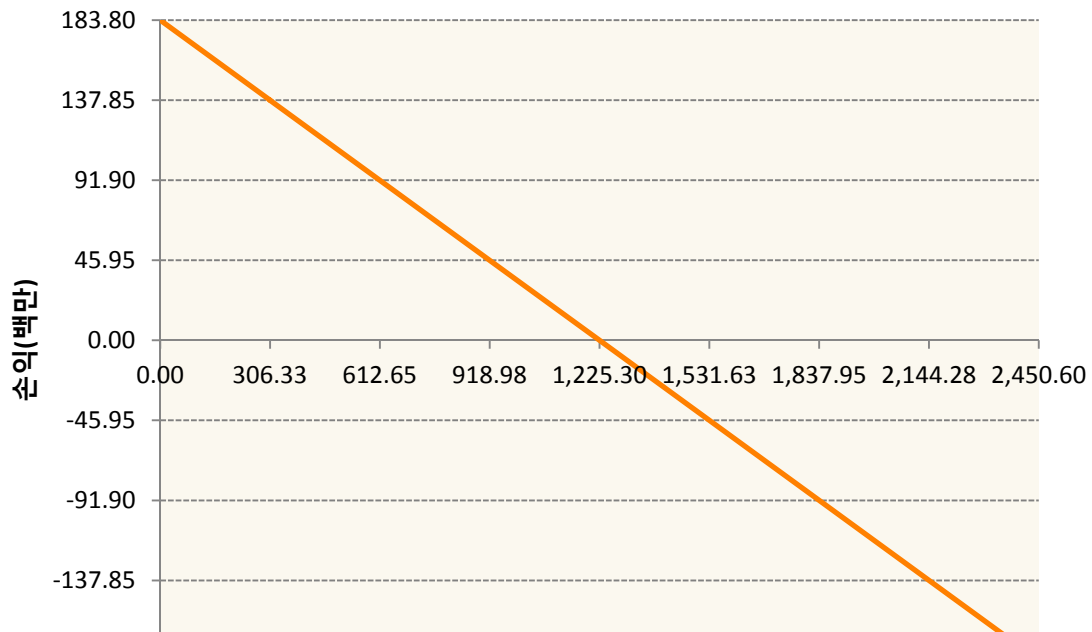


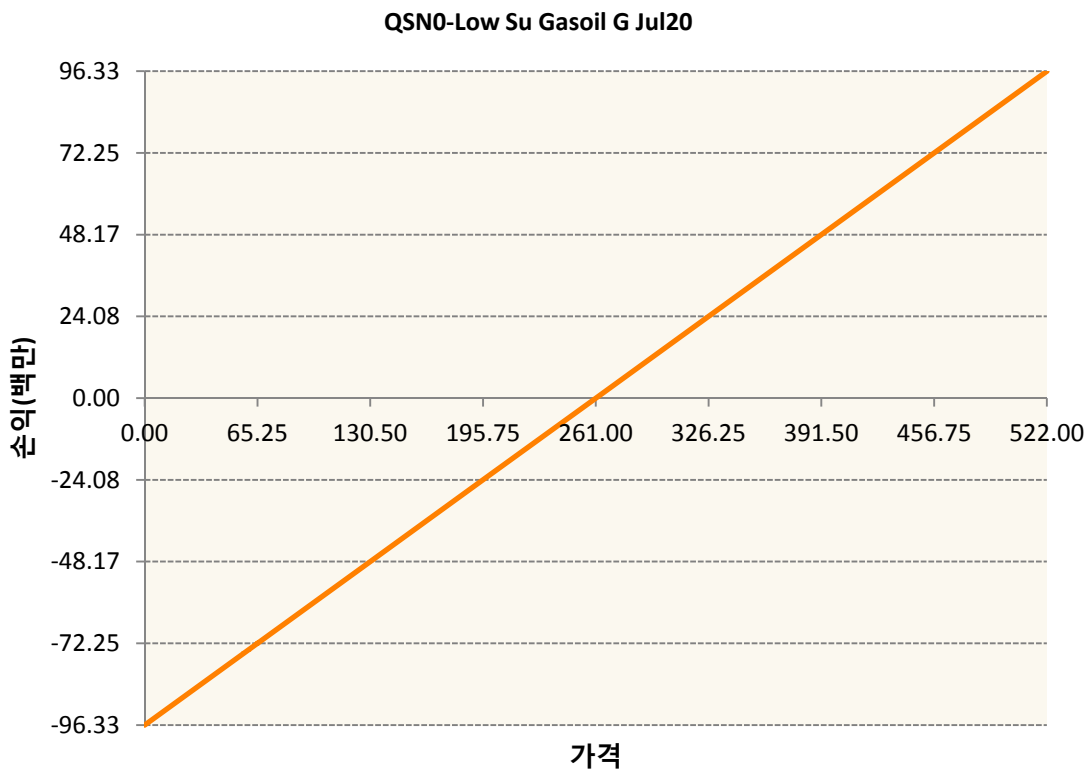
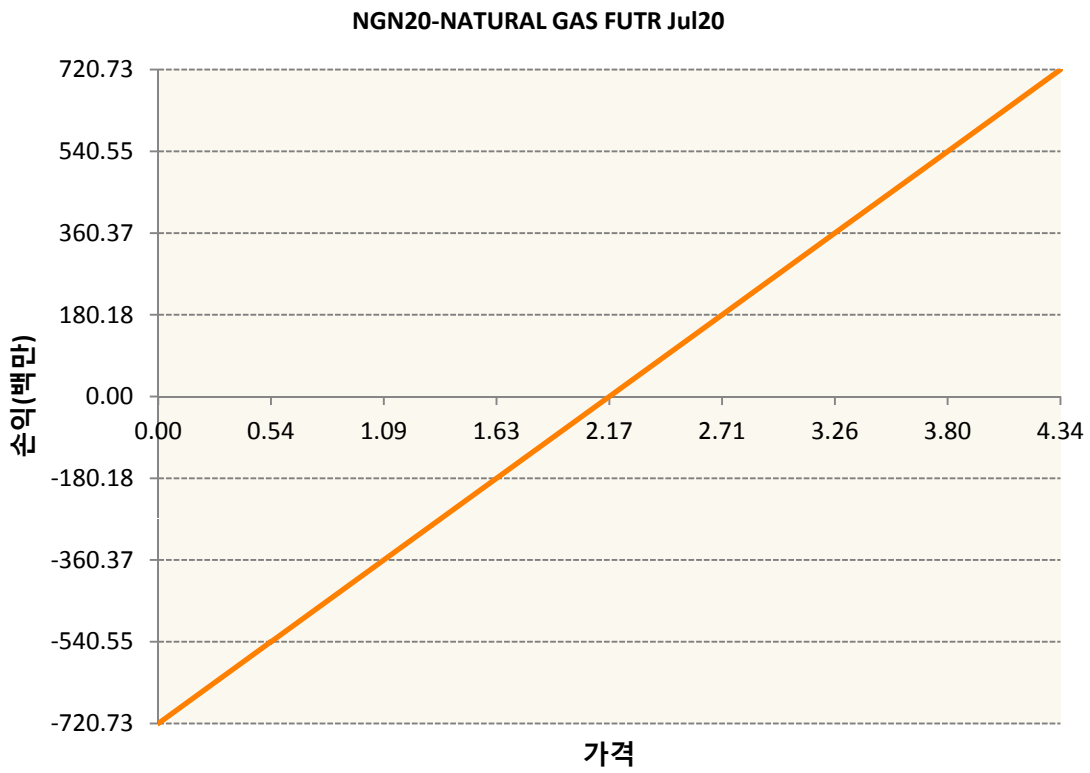
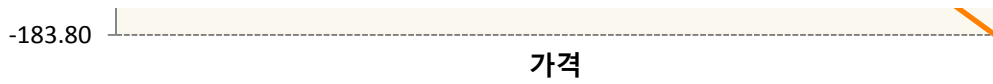


HON0-NY Harb ULSD Fut Jul20

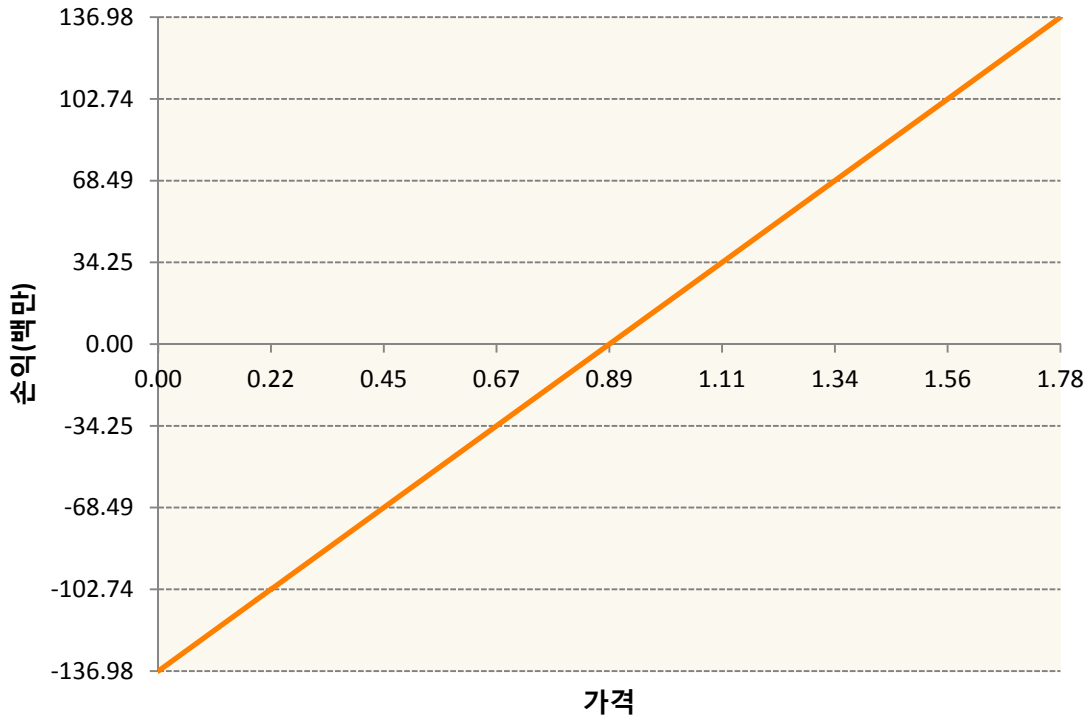


KR4175Q50007-2020-05 달러선물





XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN0	WTI CRUDE FUTURE Jul20	15
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	24
HON0	NY Harb ULSD Fut Jul20	7
KR4175Q50C	2020-05 달러선물	15
NGN20	NATURAL GAS FUTR Jul20	58
QSN0	Low Su Gasoil G Jul20	8
XBN0	GASOLINE RBOB FUT Jul20	11

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

(단위:백만원)

587

공시일	2020-05-08
기준일	2020-05-07

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

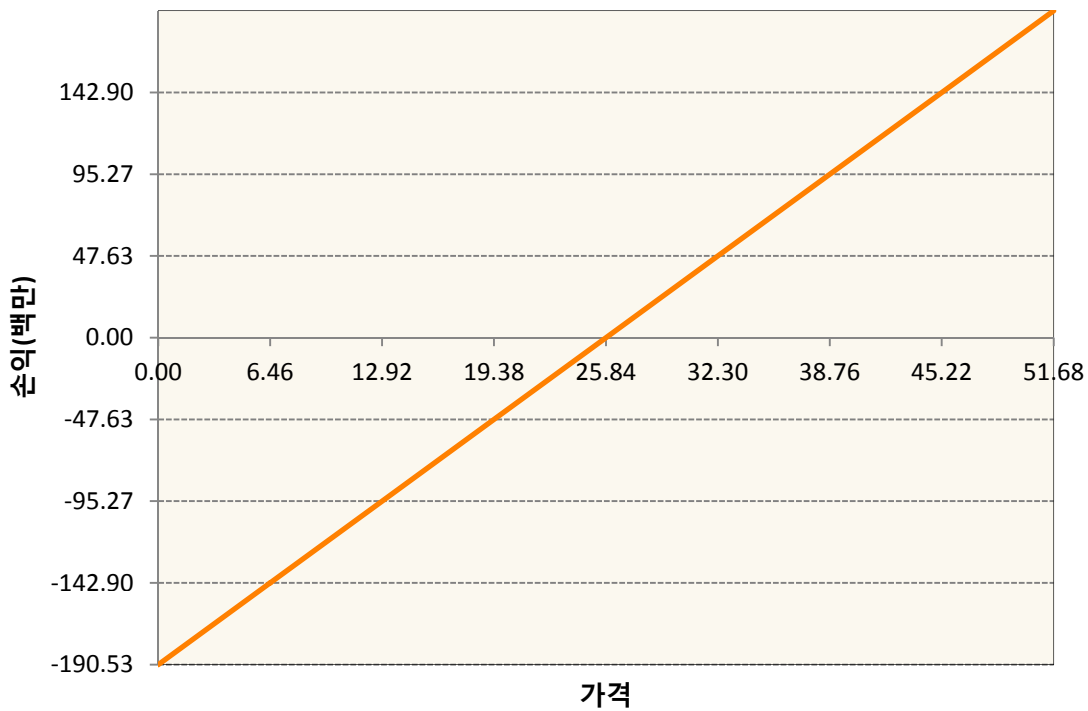
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

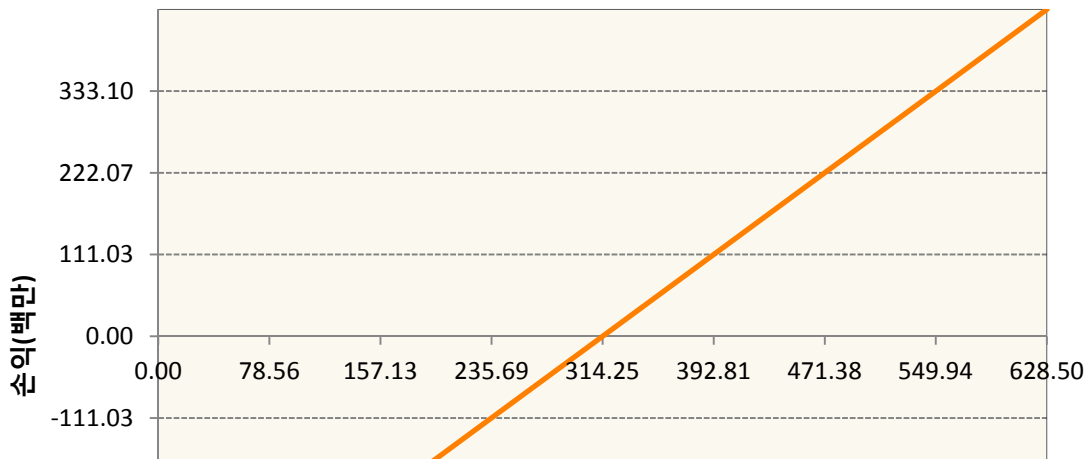
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,346	74	2,272	

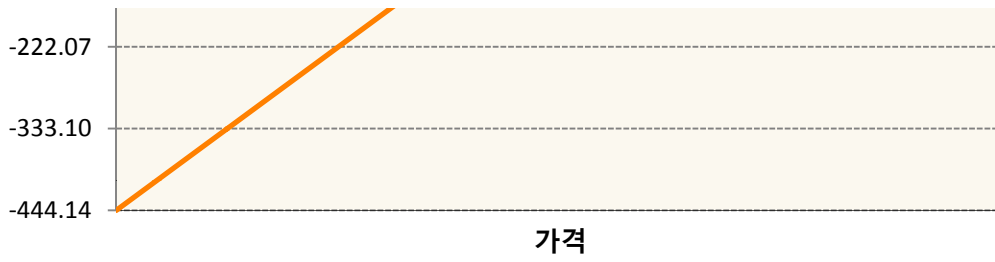
### 2. 만기시점의 손익구조

**BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20**

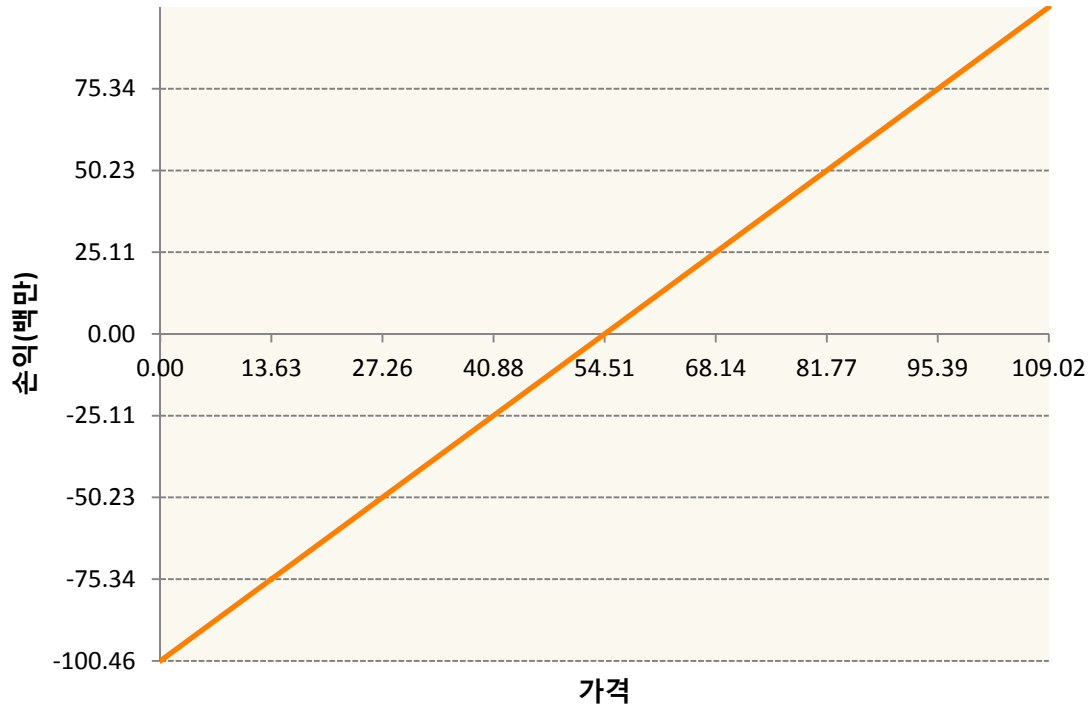


**CNO-CORN FUTURE Jul20**

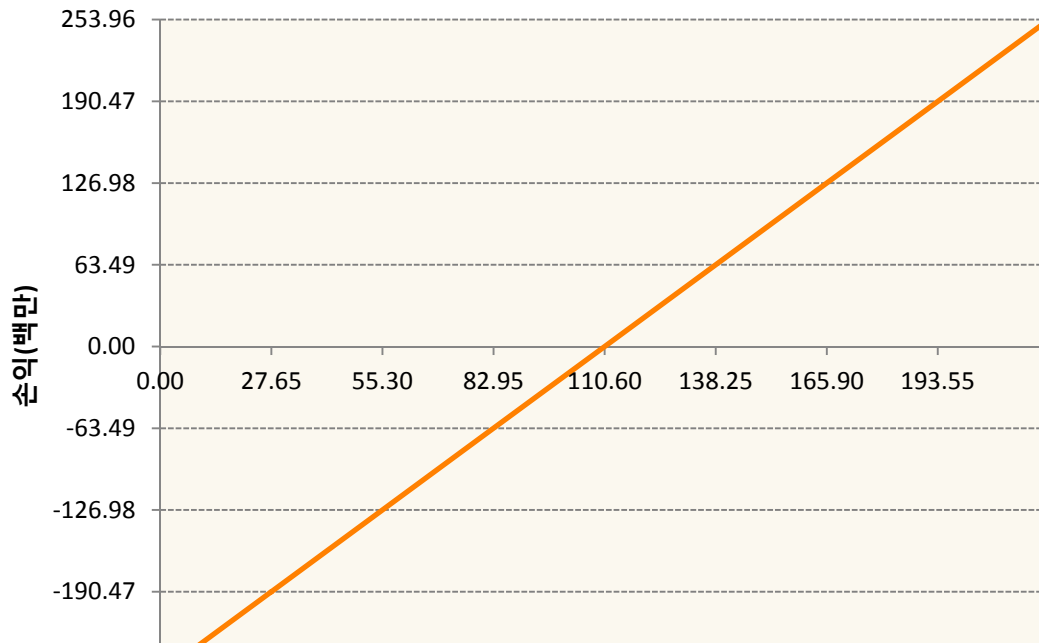


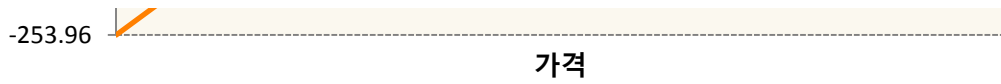


CTN0-COTTON NO.2 FUTR Jul20

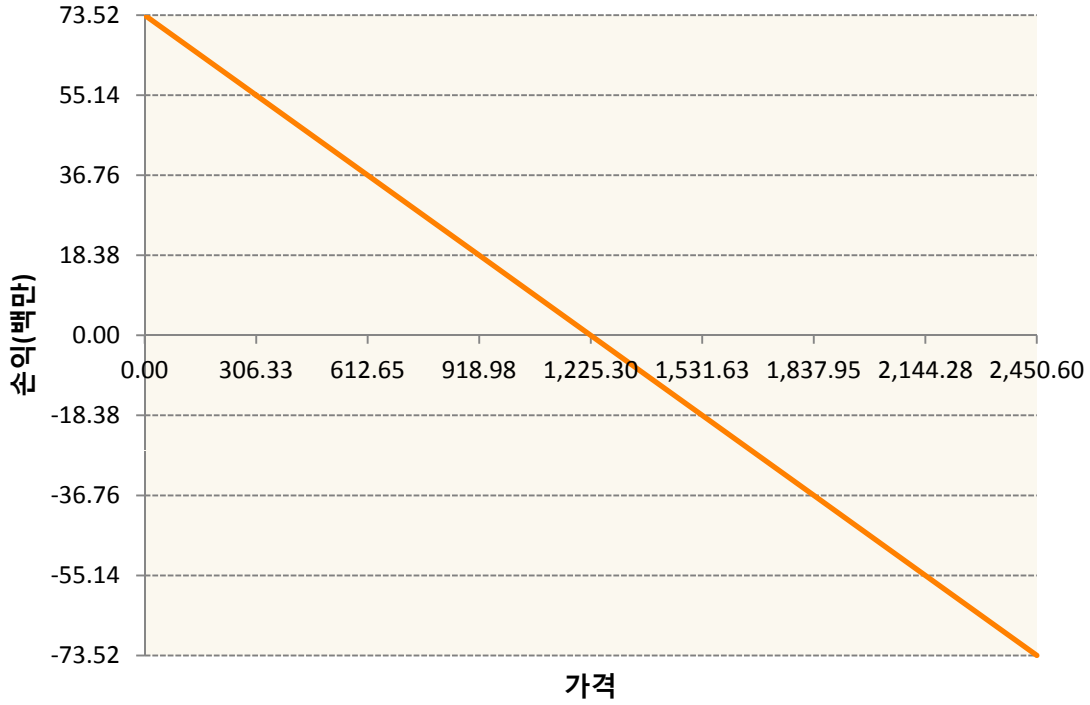


KCN0-COFFEE 'C' FUTURE Jul20

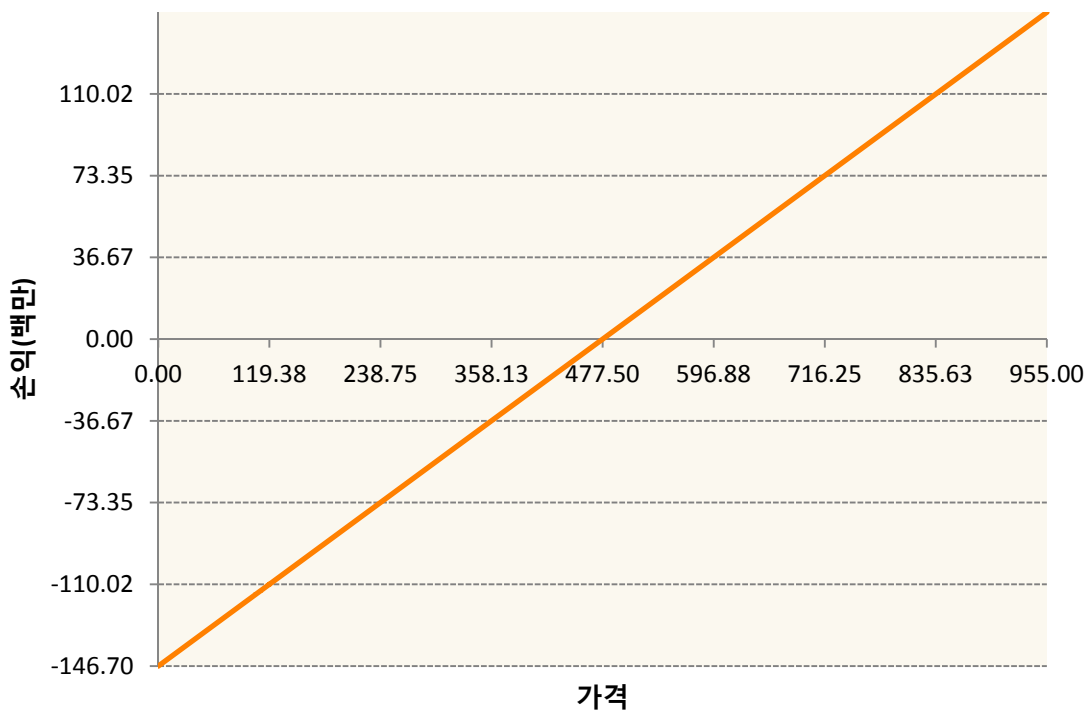




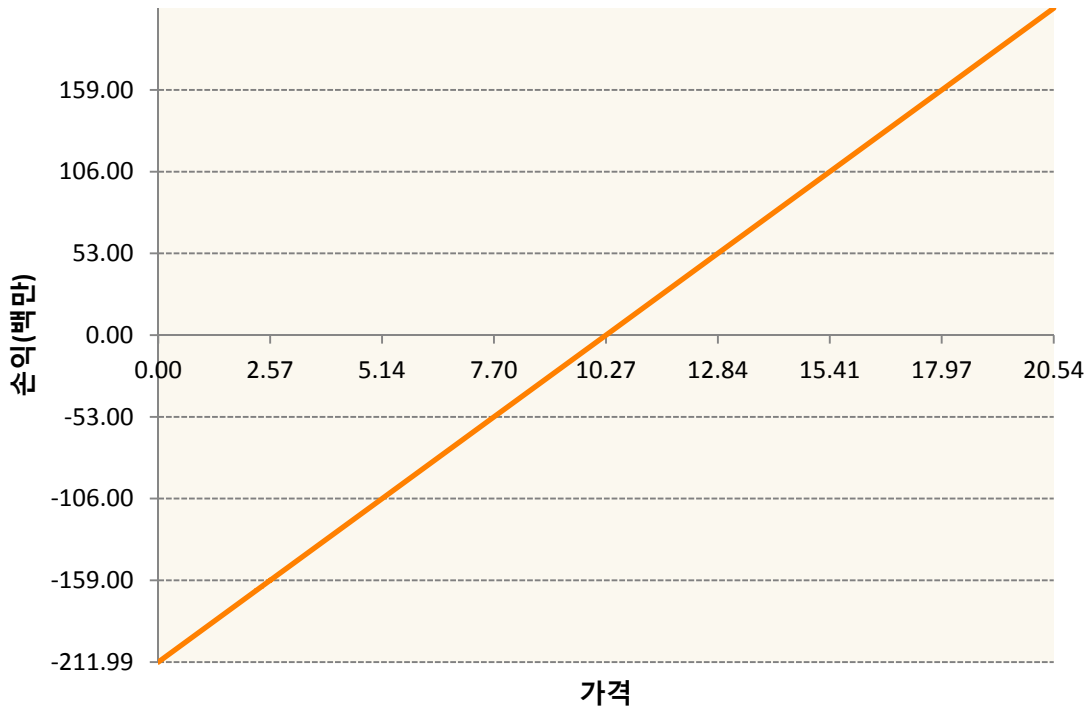
KR4175Q50007-2020-05 달러선물



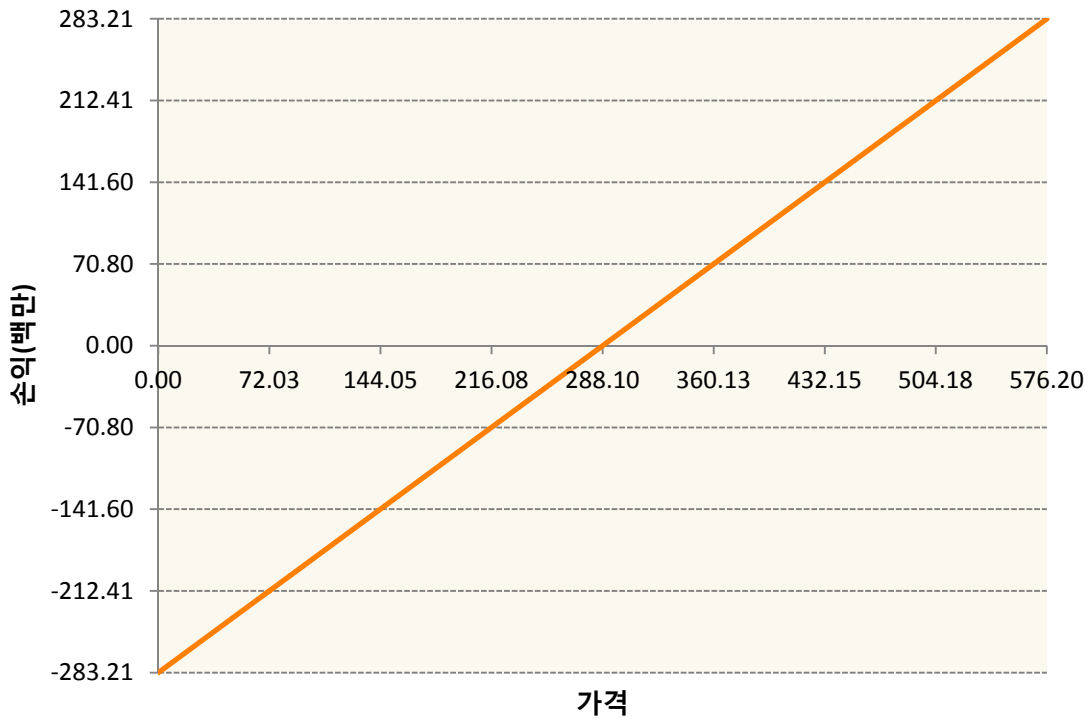
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



SBN0-Sugar Jul20

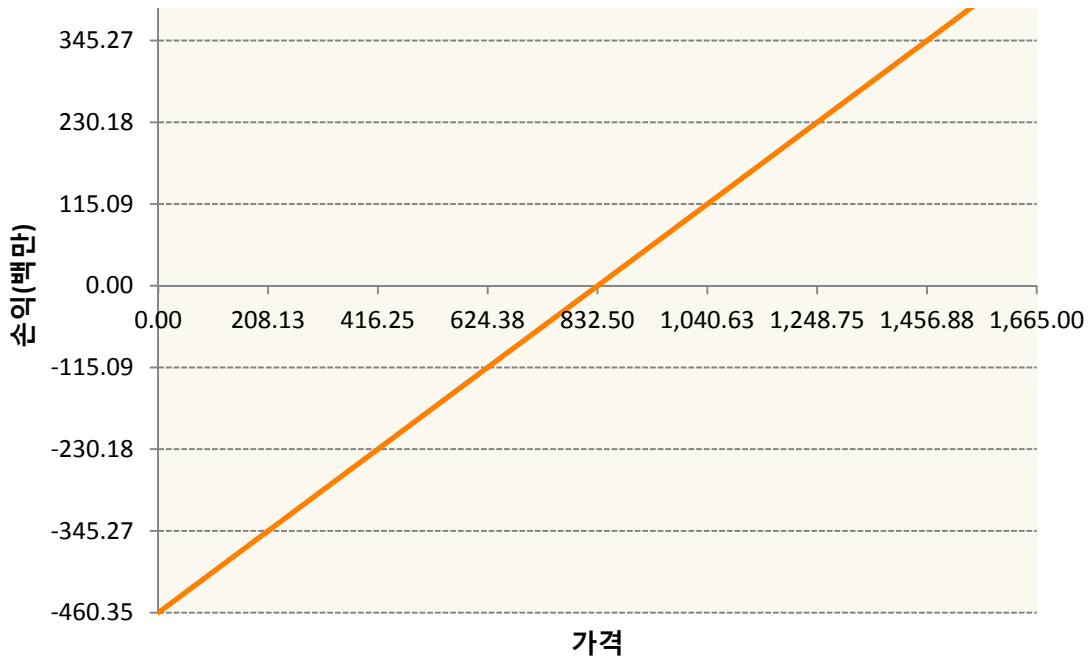


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20

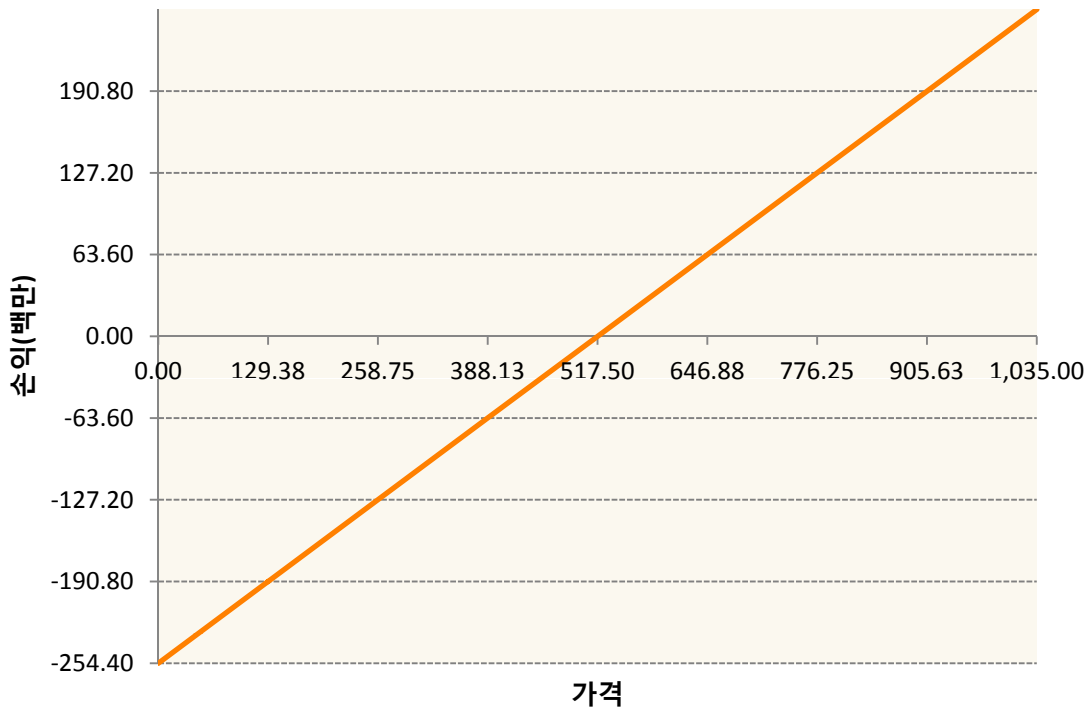


SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





WN0-WHEAT FUTURE(CBT) Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON0	SOYBEAN OIL FUTR Jul20	15
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	17
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)

**223**