

공시일	2020-05-11
기준일	2020-05-08

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	2020-05-11
기준일	2020-05-08

스마트인덱스모

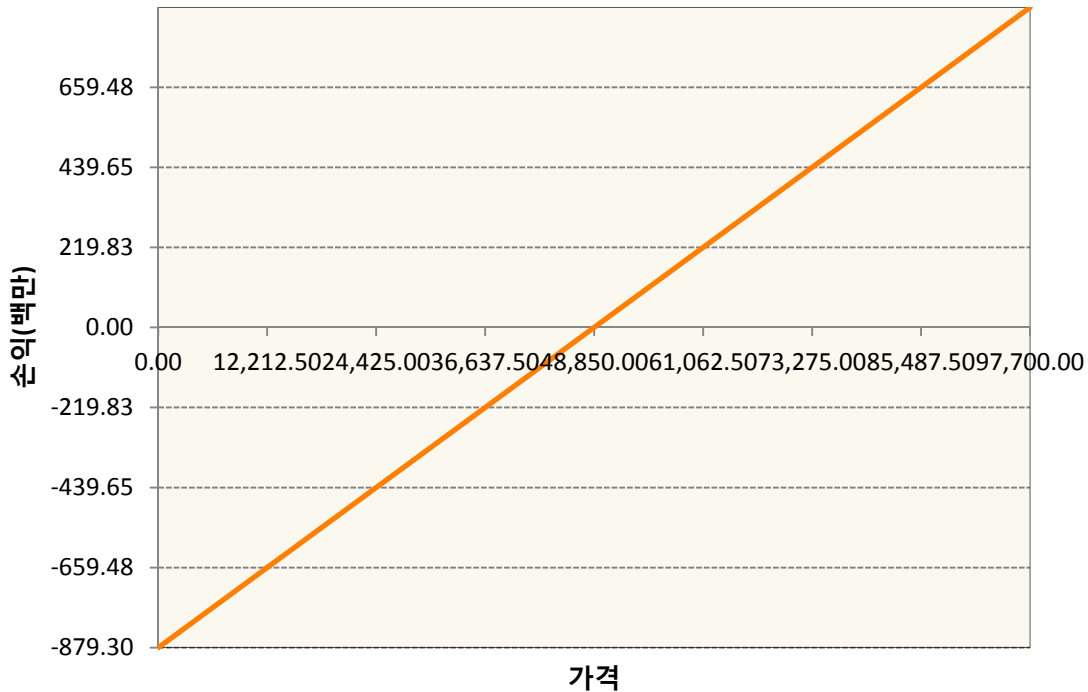
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	879	0	879	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	2020-05-11
기준일	2020-05-08

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

978

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,146

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-11
기준일	2020-05-08

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

573

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

898

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-11
기준일	2020-05-08

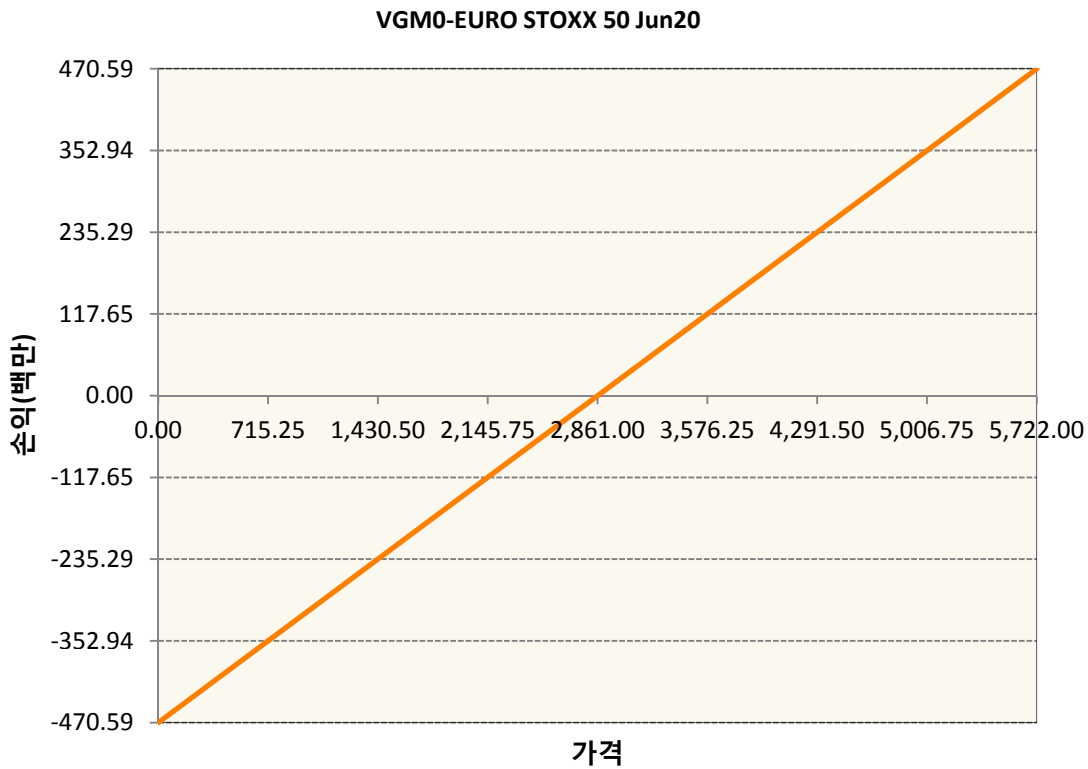
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	471	0	471	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

48

공시일	2020-05-11
기준일	2020-05-08

차이나인덱스모(주식-파생형)

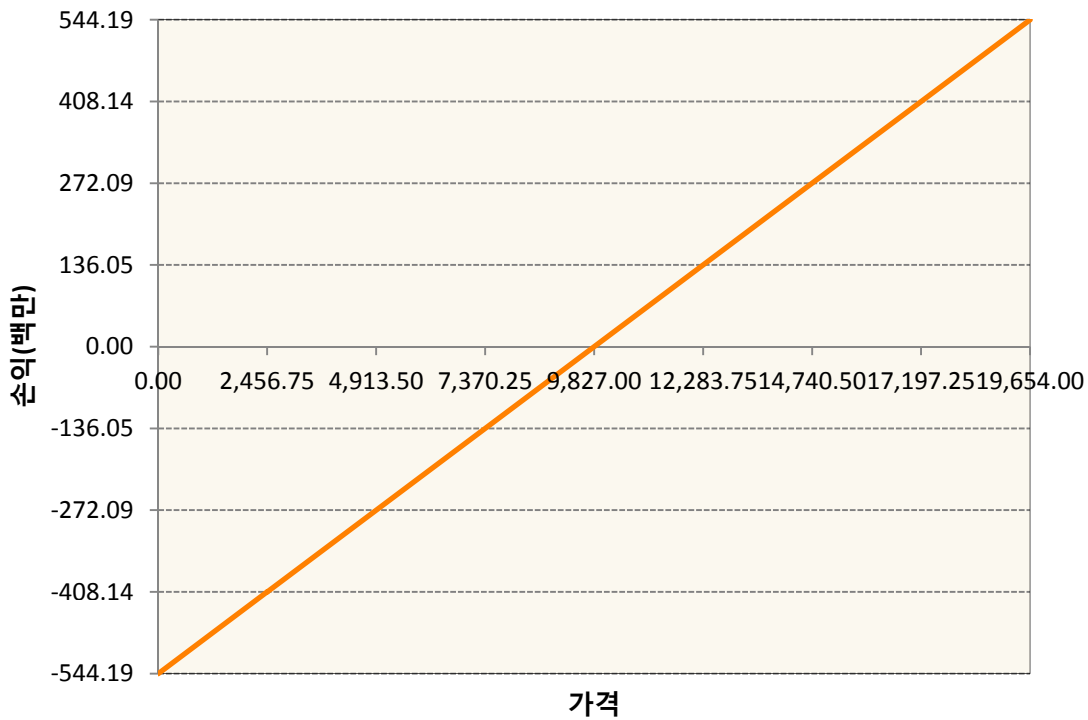
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	544	0	544	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	2020-05-11
기준일	2020-05-08

커버드콜모(주식혼합-파생형)

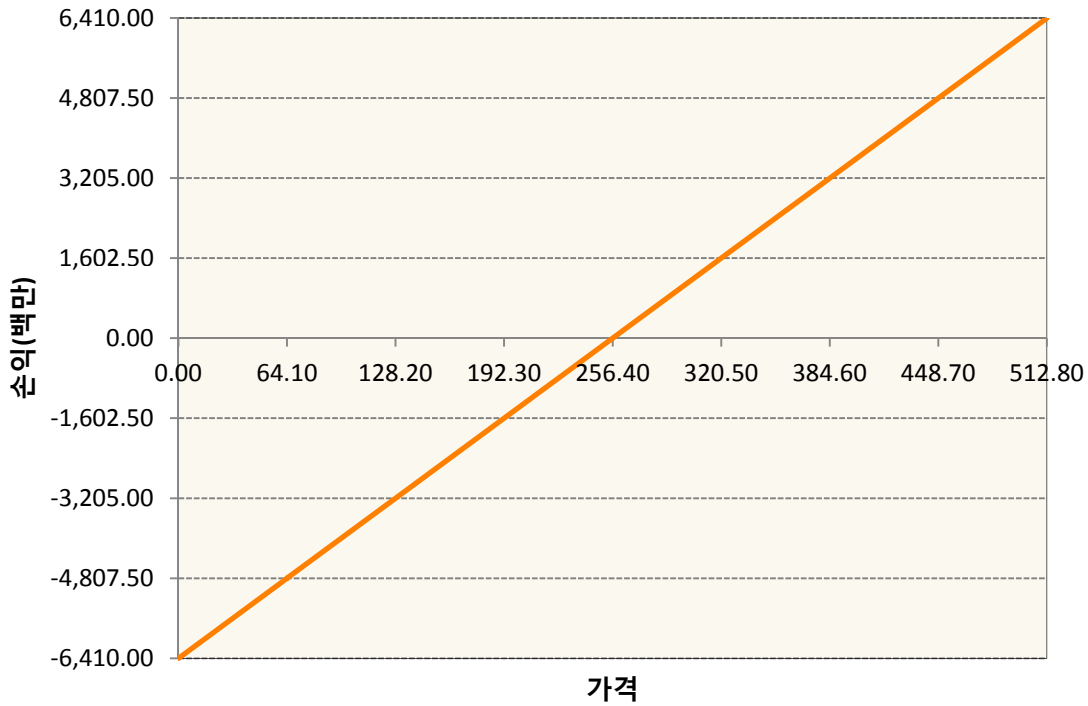
1. 계약금액

(단위:백만원)

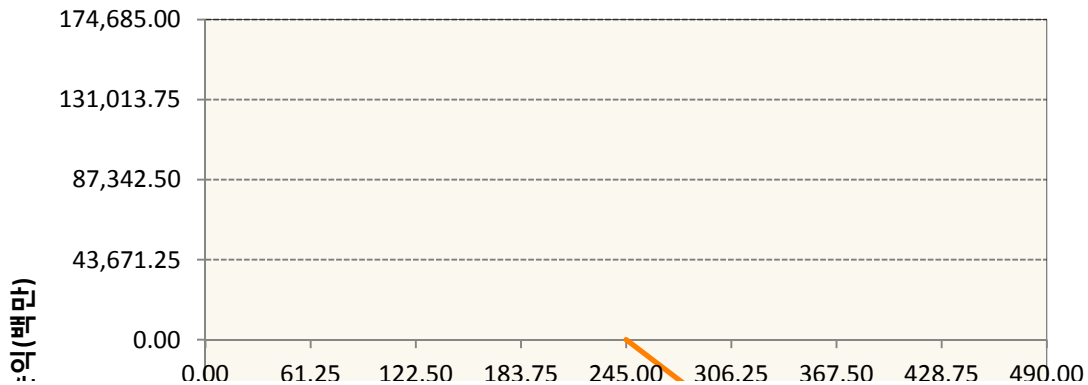
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,410	0	6,410	장내
누계	유가증권	옵션	0	351,608	-351,608	장내

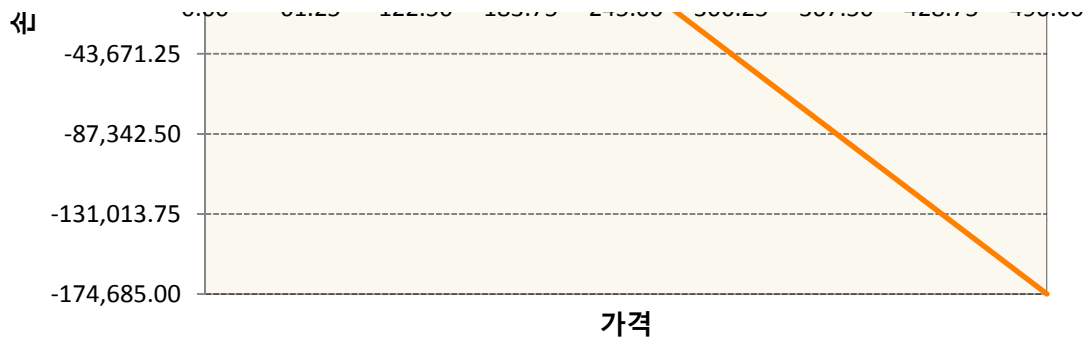
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

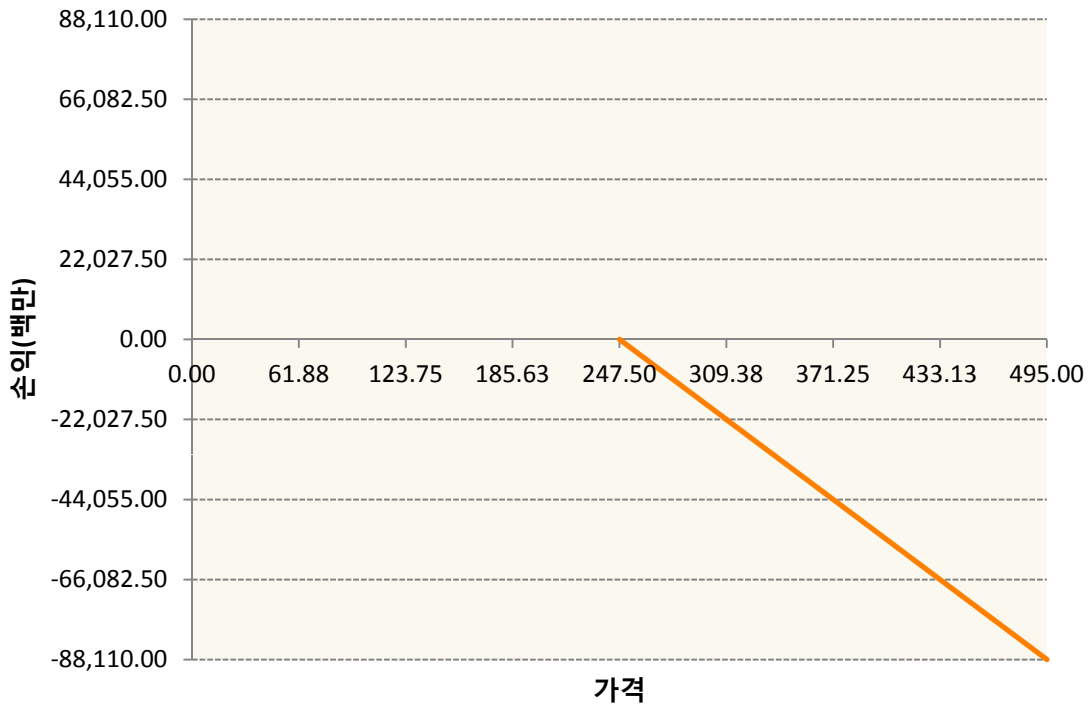


KR4201Q52452-2020-05 콜245

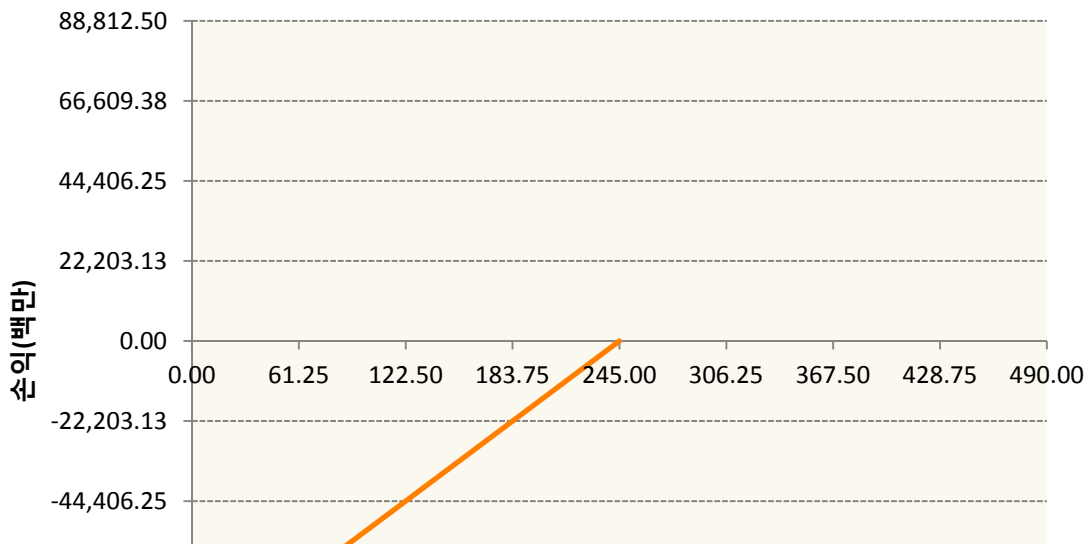


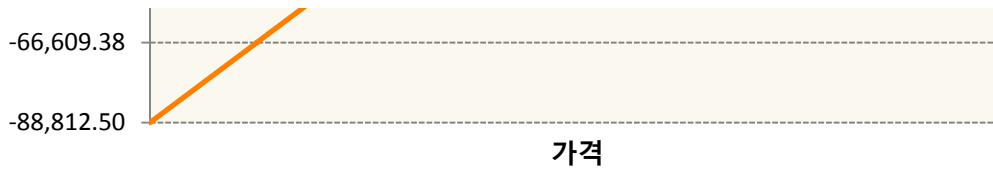


KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						513
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-513	-513	-513	-513	-513	-513	-513	
-5.33%	-342	-342	-342	-342	-342	-342	-342	
-2.67%	-171	-171	-171	-171	-171	-171	-171	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	171	171	171	171	171	171	171	
5.33%	342	342	342	342	342	342	342	
8.00%	513	513	513	513	513	513	513	
KR4201Q52452		2020-05 콜245						13,611
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	8,689	8,449	8,195	7,929	7,654	7,371	7,083	
-5.33%	7,174	6,843	6,511	6,178	5,844	5,510	5,176	
-2.67%	4,467	4,153	3,834	3,512	3,186	2,858	2,529	
0%	688	477	247	0	-260	-531	-810	
2.67%	-3,763	-3,866	-3,994	-4,146	-4,318	-4,509	-4,716	
5.33%	-8,513	-8,551	-8,607	-8,683	-8,780	-8,897	-9,032	
8.00%	-13,361	-13,372	-13,392	-13,424	-13,470	-13,532	-13,611	
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5						6,624
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,815	3,717	3,609	3,492	3,370	3,241	3,108	
-5.33%	3,243	3,087	2,929	2,769	2,608	2,446	2,283	
-2.67%	2,112	1,944	1,775	1,605	1,436	1,266	1,096	
0%	406	277	141	0	-146	-296	-448	
2.67%	-1,714	-1,785	-1,868	-1,963	-2,067	-2,180	-2,299	
5.33%	-4,043	-4,073	-4,113	-4,165	-4,228	-4,301	-4,383	
8.00%	-6,452	-6,461	-6,477	-6,500	-6,532	-6,573	-6,624	
KR4301Q52450		2020-05 풋245						3,579
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,173	-3,225	-3,285	-3,351	-3,423	-3,499	-3,579	
-5.33%	-1,253	-1,361	-1,470	-1,579	-1,689	-1,800	-1,910	
-2.67%	-198	-292	-389	-489	-591	-694	-799	

0%	134	98	53	0	-60	-125	-196
2.67%	190	183	171	155	132	103	69
5.33%	195	194	192	189	183	174	161
8.00%	195	195	195	194	193	191	188

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

(단위:백만원)

24,541

공시일	2020-05-11
기준일	2020-05-08

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

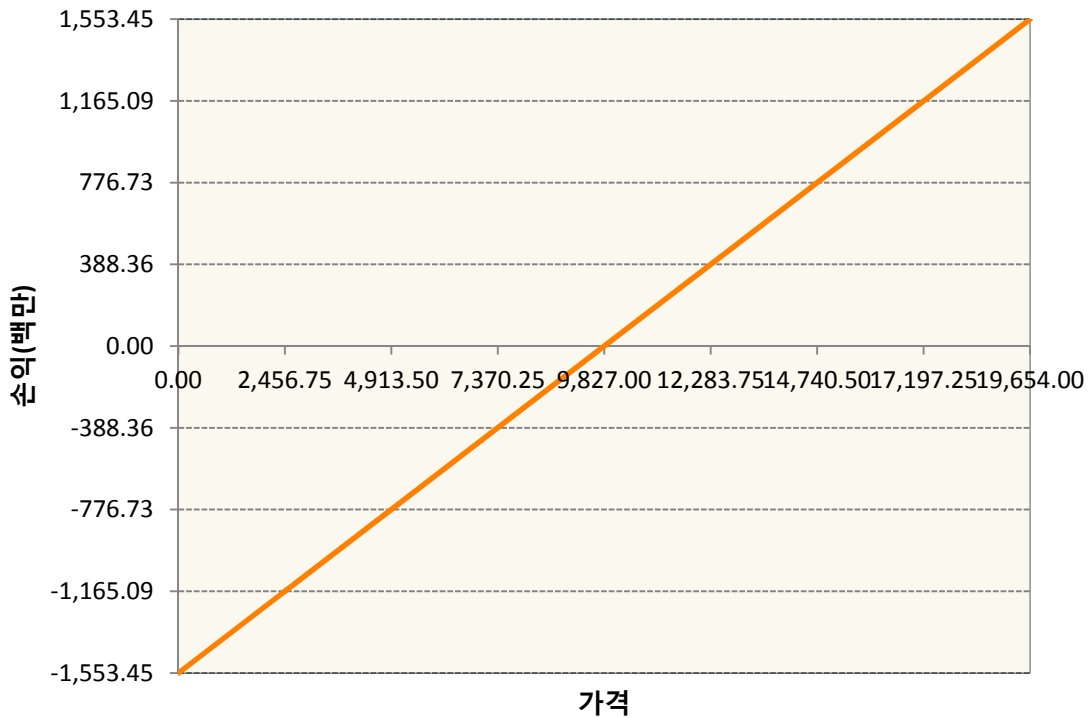
1. 계약금액

(단위:백만원)

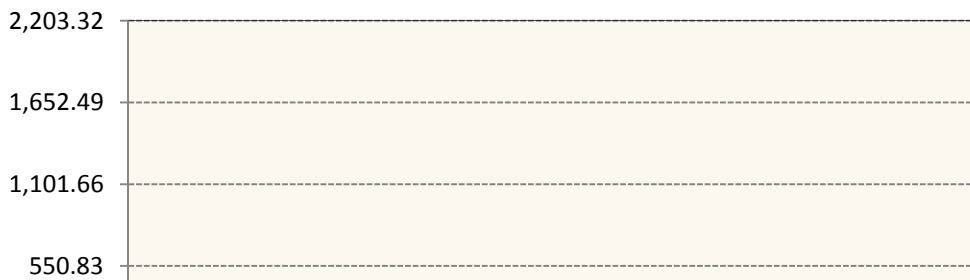
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,553	0	1,553	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,407	-4,407	장내
누계	통화	선도	693	2,216	-1,524	장외

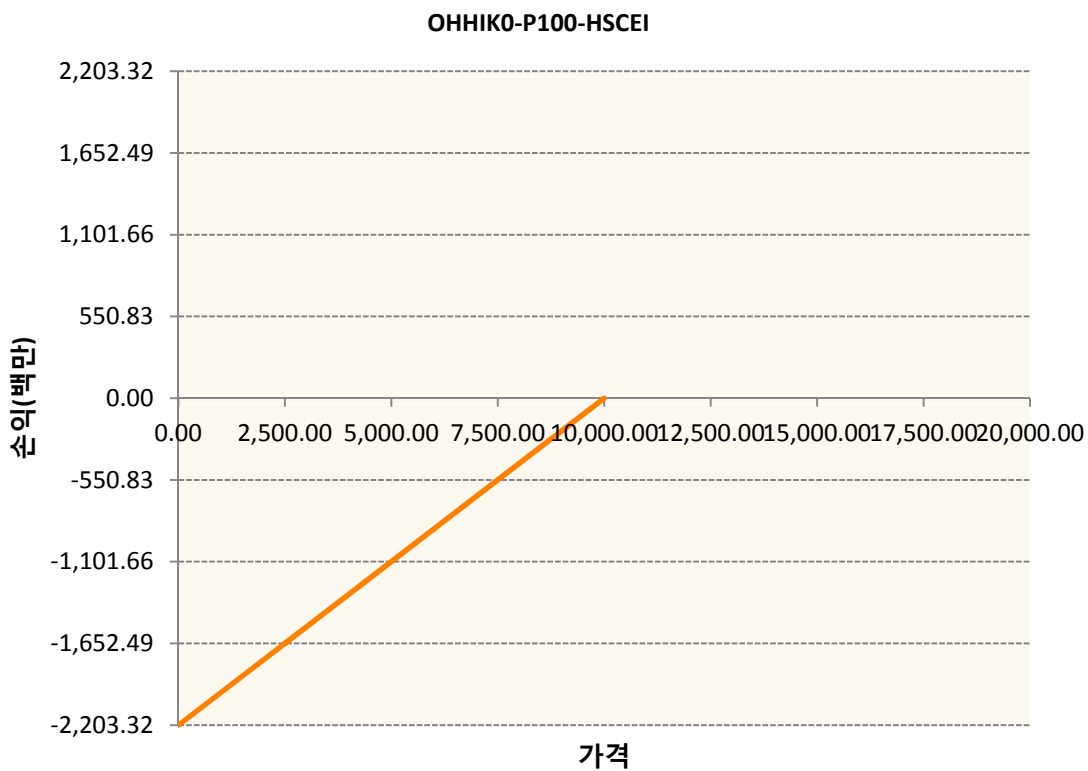
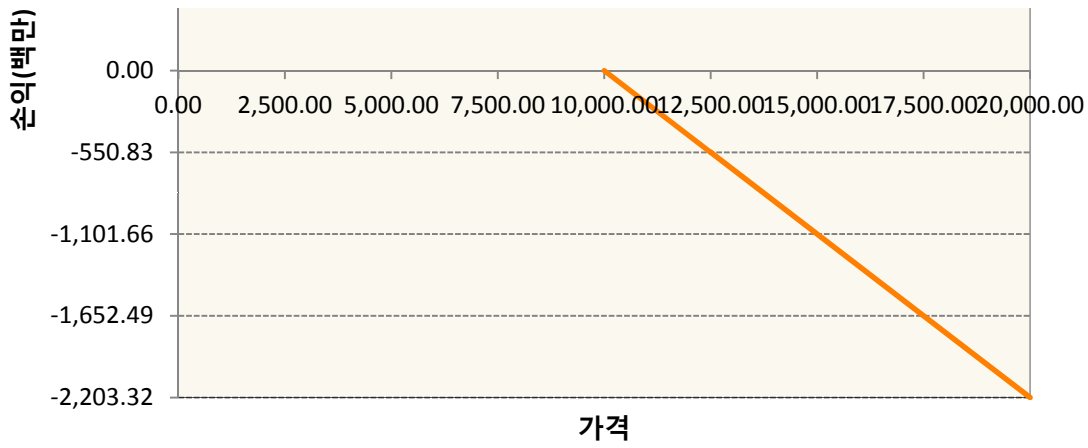
2. 만기시점의 손익구조

HCK0-HSCEI Futures May20



OHHIK0-C100-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		124
OHHIK0-C1C HSCEI		176
OHHIK0-P10 HSCEI		176

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

공시일	2020-05-11
기준일	2020-05-08

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

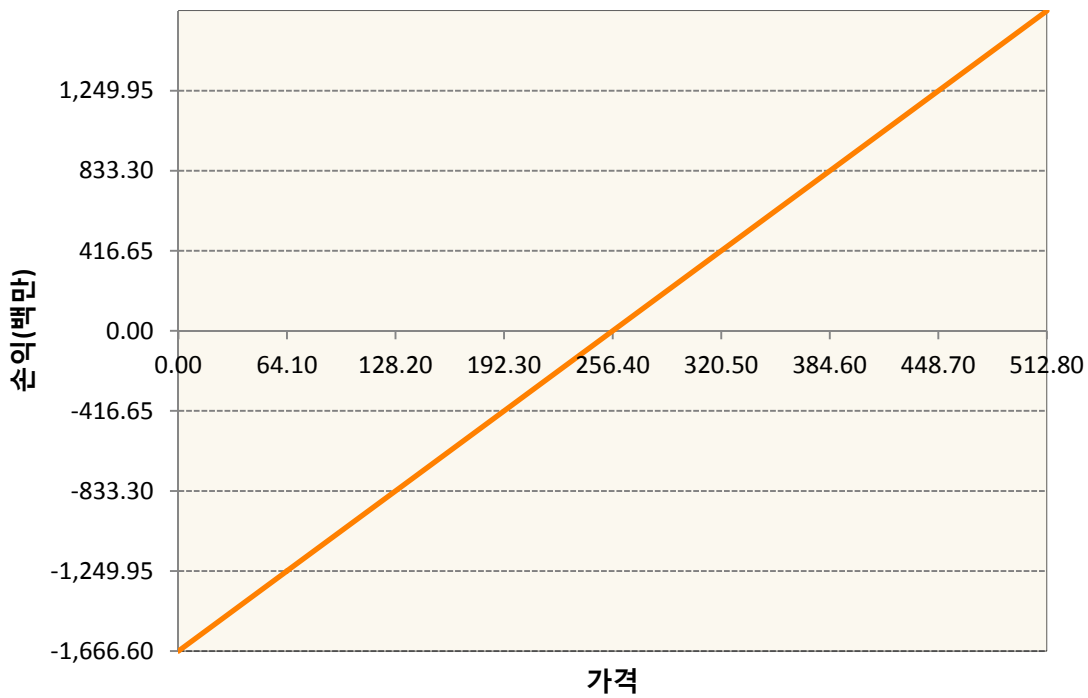
1. 계약금액

(단위:백만원)

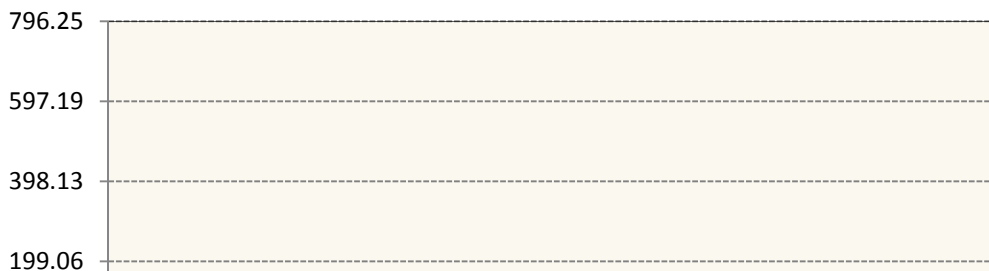
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,667	0	1,667	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,193	-3,193	장내

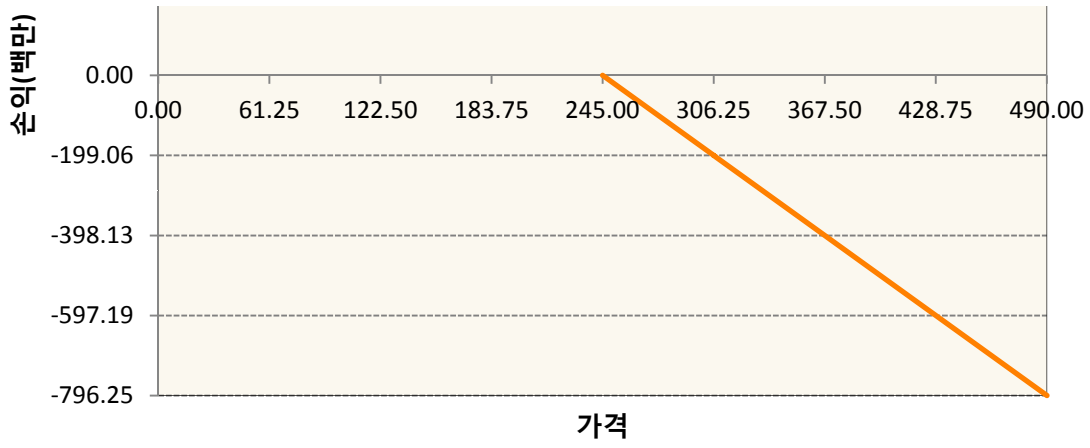
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

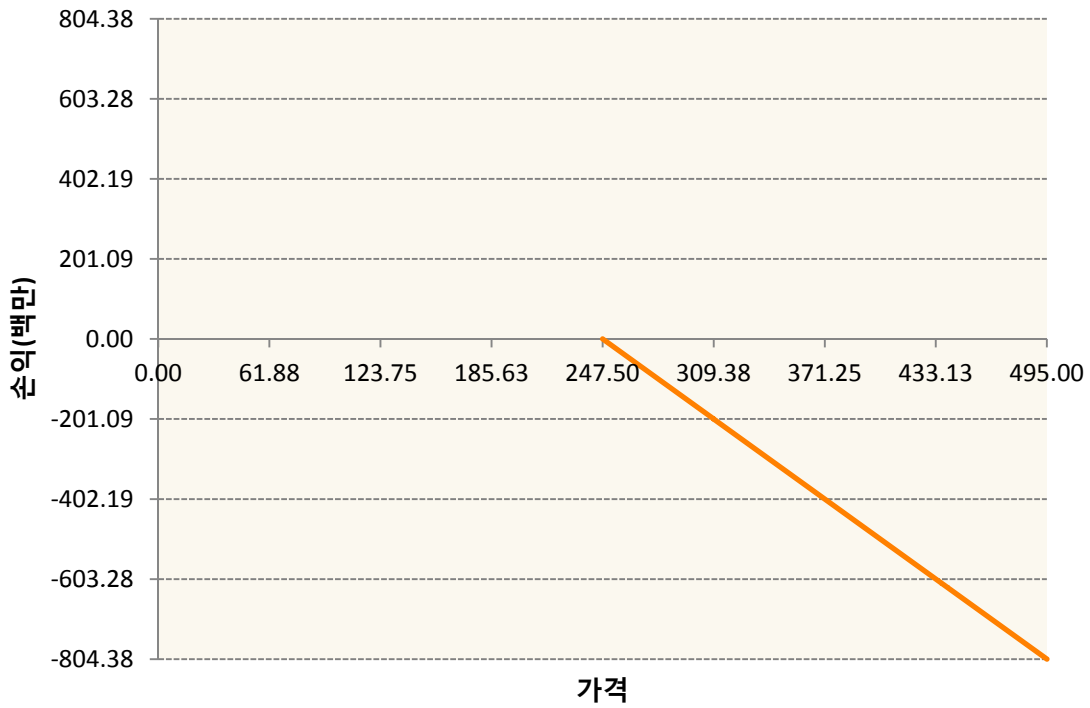


KR4201Q52452-2020-05 콜245

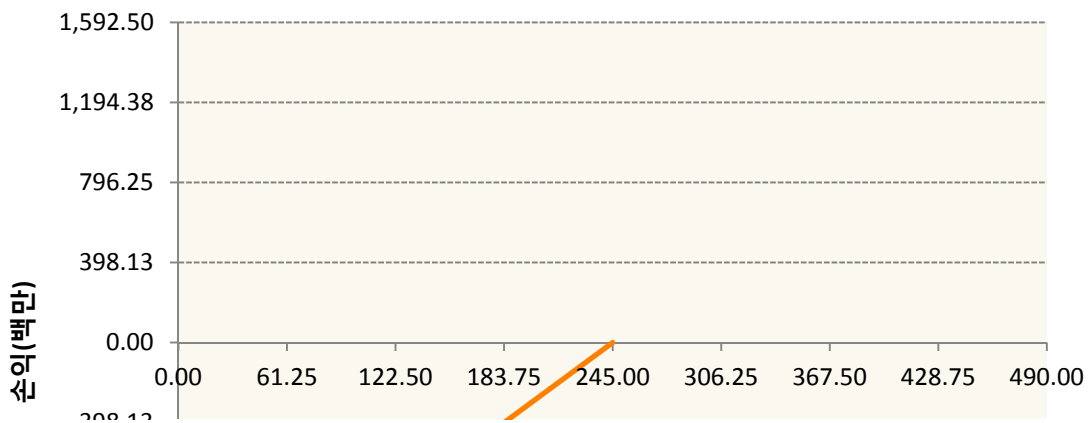




KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						188
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-188	-188	-188	-188	-188	-188	-188	
-5.33%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125	
-2.67%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	63	63	63	63	63	63	63	
5.33%	125	125	125	125	125	125	125	
8.00%	188	188	188	188	188	188	188	
KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						133
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133	
-5.33%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89	
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	44	44	44	44	44	44	44	
5.33%	89	89	89	89	89	89	89	
8.00%	133	133	133	133	133	133	133	
KR4201Q52452		2020-05 콜245						62
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	40	39	37	36	35	34	32	
-5.33%	33	31	30	28	27	25	24	
-2.67%	20	19	17	16	15	13	12	
0%	3	2	1	0	-1	-2	-4	
2.67%	-17	-18	-18	-19	-20	-21	-21	
5.33%	-39	-39	-39	-40	-40	-41	-41	
8.00%	-61	-61	-61	-61	-61	-62	-62	
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5						60
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	35	34	33	32	31	30	28
-5.33%	30	28	27	25	24	22	21
-2.67%	19	18	16	15	13	12	10
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4
2.67%	-16	-16	-17	-18	-19	-20	-21
5.33%	-37	-37	-38	-38	-39	-39	-40
8.00%	-59	-59	-59	-59	-60	-60	-60
KR4301Q52450 2020-05 풋245							64
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-57	-58	-59	-60	-61	-63	-64
-5.33%	-22	-24	-26	-28	-30	-32	-34
-2.67%	-4	-5	-7	-9	-11	-12	-14
0%	2	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	3	3	3	3	2	2	1
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

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

(단위:백만원)

561

공시일	2020-05-11
기준일	2020-05-08

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

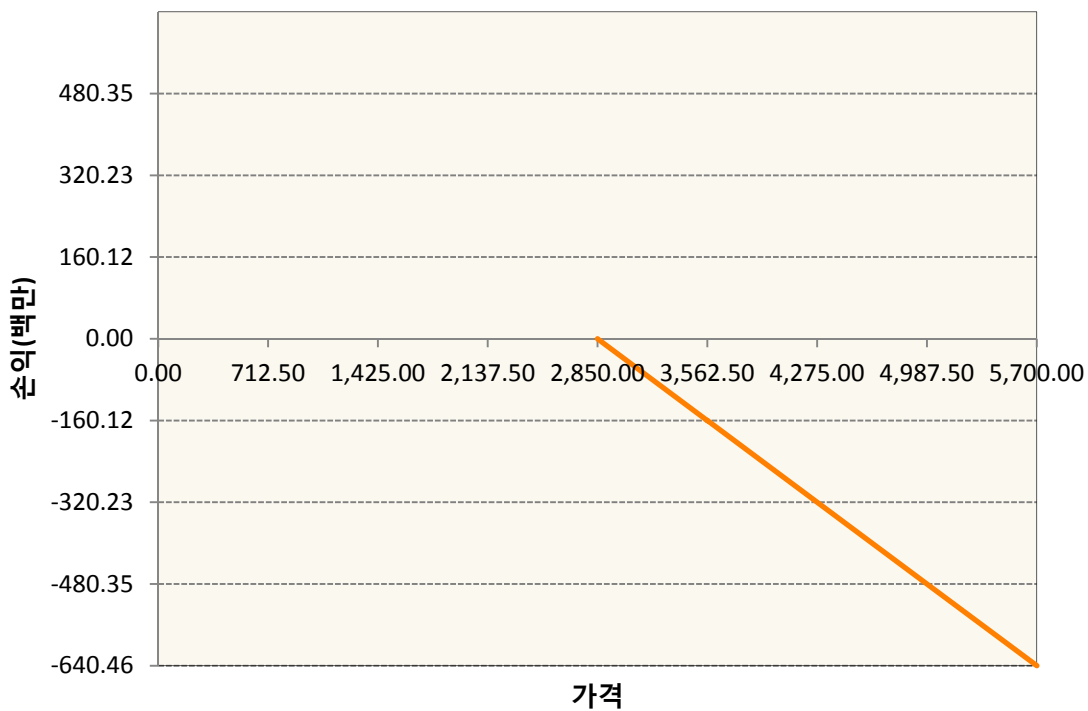
1. 계약금액

(단위:백만원)

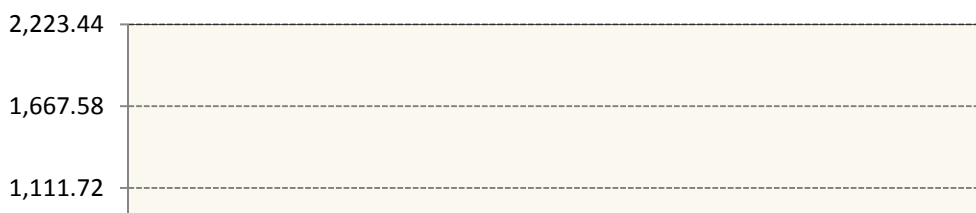
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	615	0	615	
누계	유가증권	스왑	7,884	0	7,884	장외
누계	유가증권	옵션	0	5,728	-5,728	장내
누계	통화	선도	0	2,675	-2,675	장외

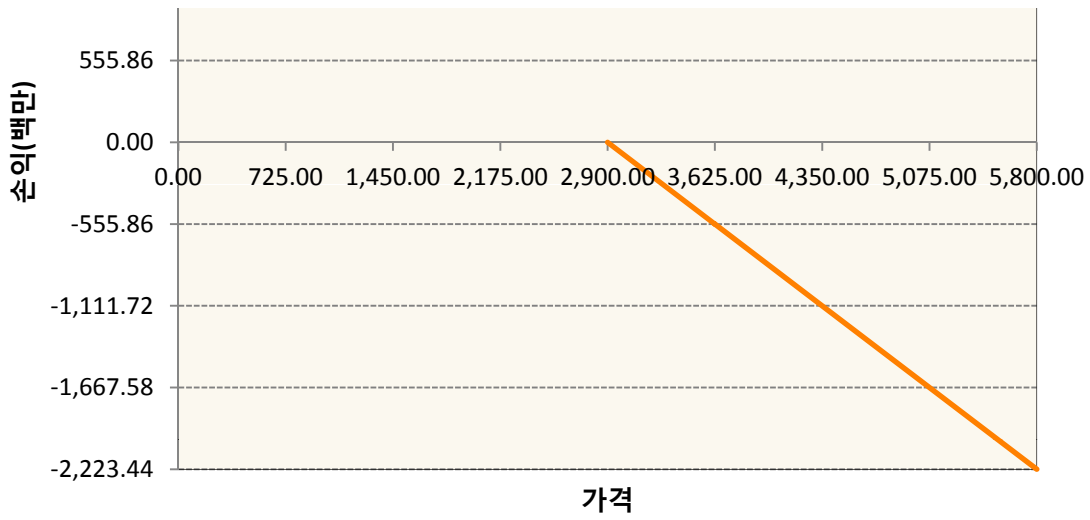
2. 만기시점의 손익구조

OESXK0-C2850-EURO STOXX 50

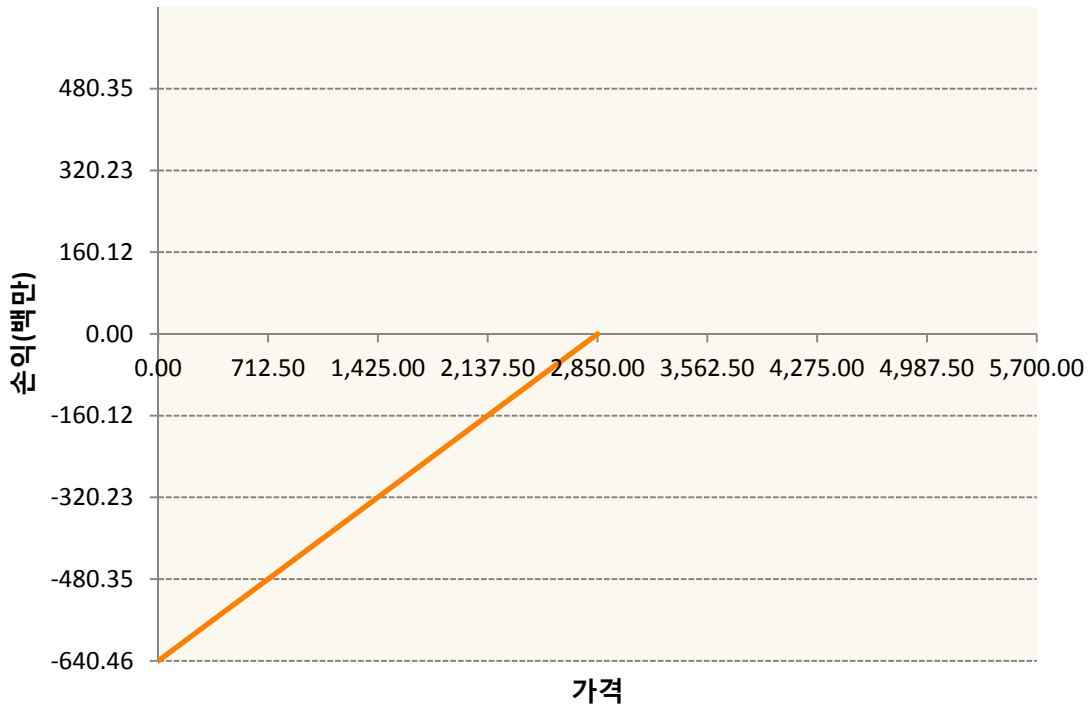


OESXK0-C2900-EURO STOXX 50

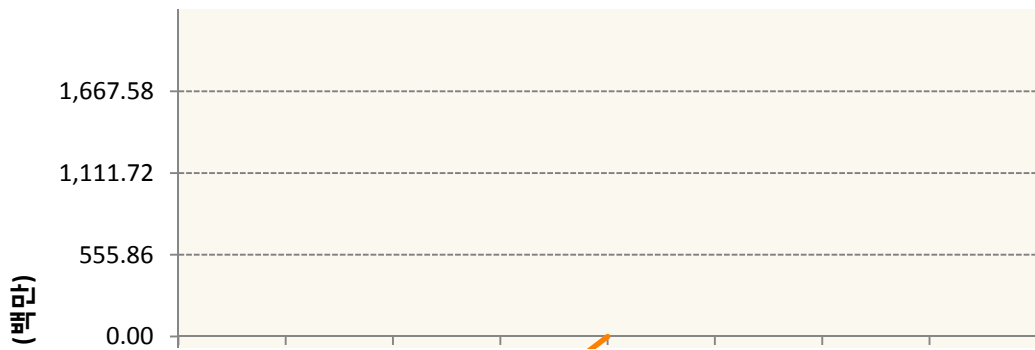


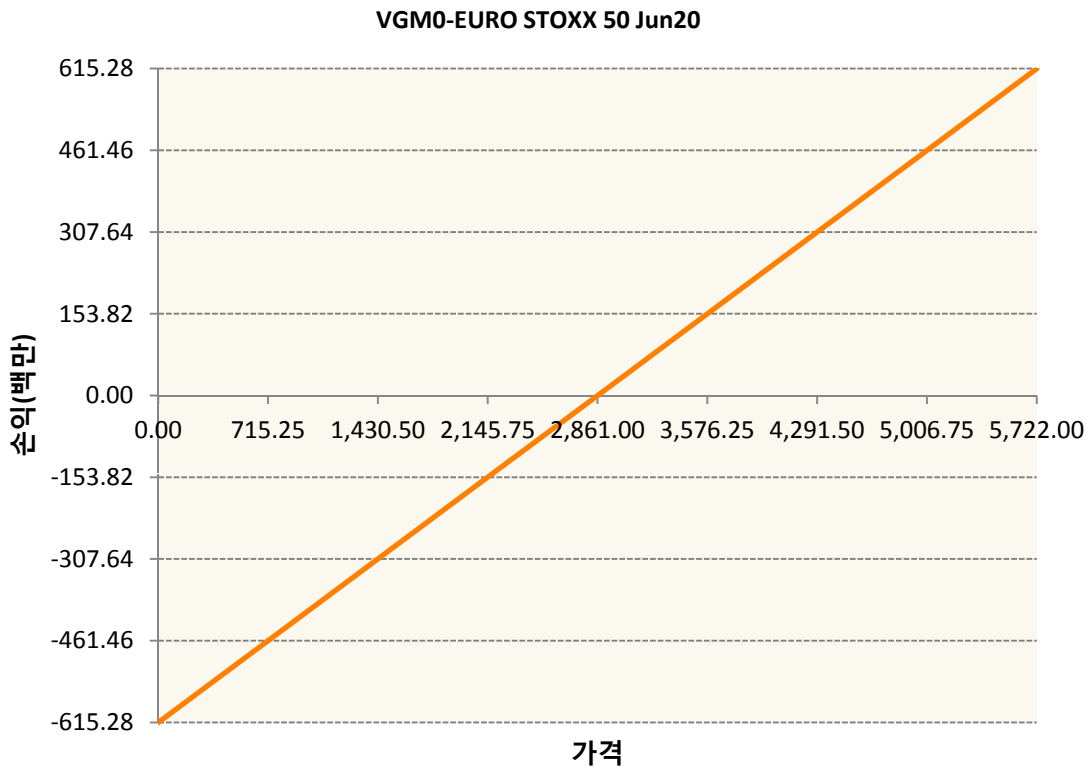
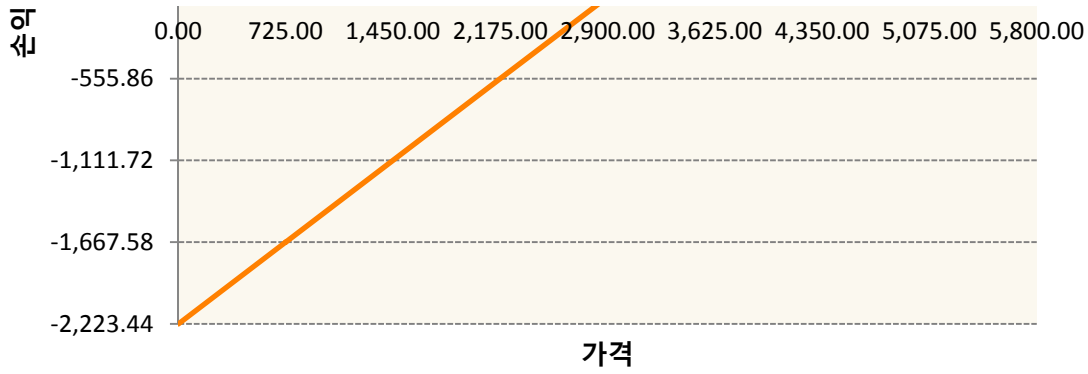


OESXK0-P2850-EURO STOXX 50



OESXK0-P2900-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	16
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)

1,150

공시일	2020-05-11
기준일	2020-05-08

ETF스마트레버리지목표전환형9호

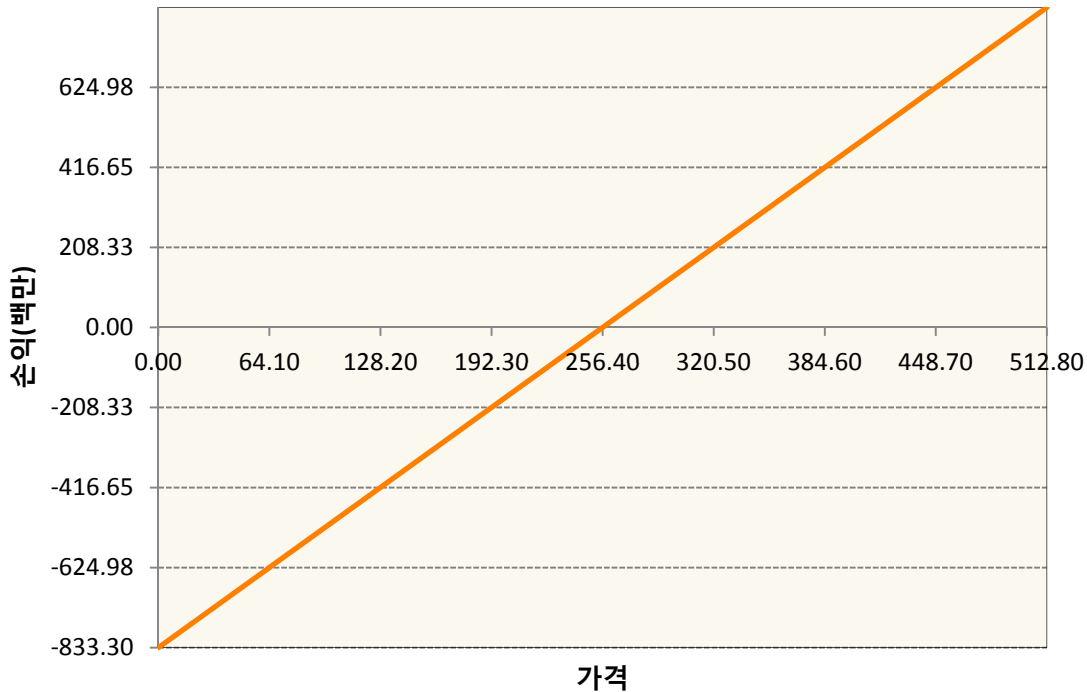
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	833	0	833	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						67
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67	
-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%	67	67	67	67	67	67	67	

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

(단위:백만원)

100

공시일	2020-05-11
기준일	2020-05-08

ETF스마트레버리지목표전환형10호

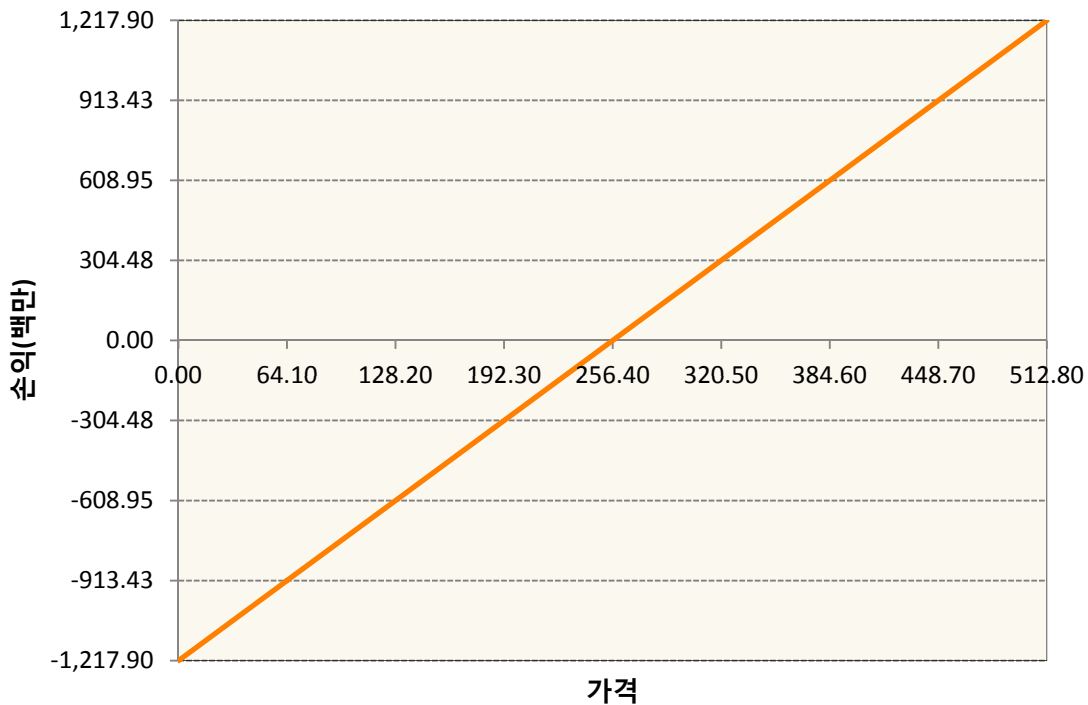
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,218	0	1,218	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						98
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98	
-5.33%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65	
-2.67%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	33	33	33	33	33	33	33	
5.33%	65	65	65	65	65	65	65	
8.00%	98	98	98	98	98	98	98	

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

(단위:백만원)

146

공시일	2020-05-11
기준일	2020-05-08

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

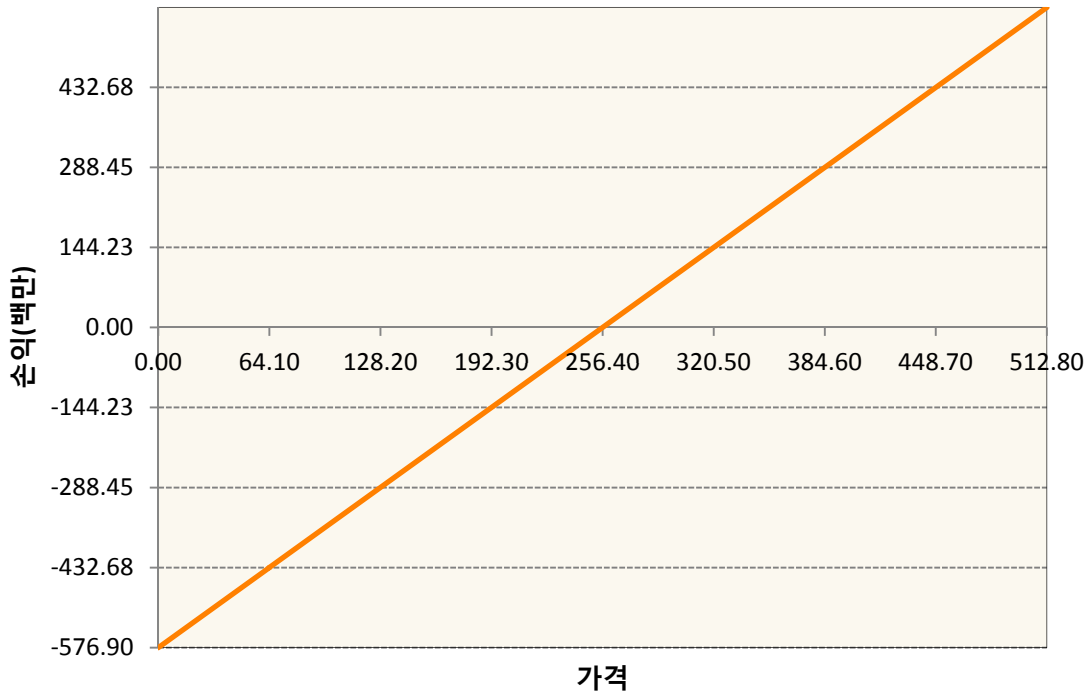
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	577	0	577	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	2020-05-11
기준일	2020-05-08

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

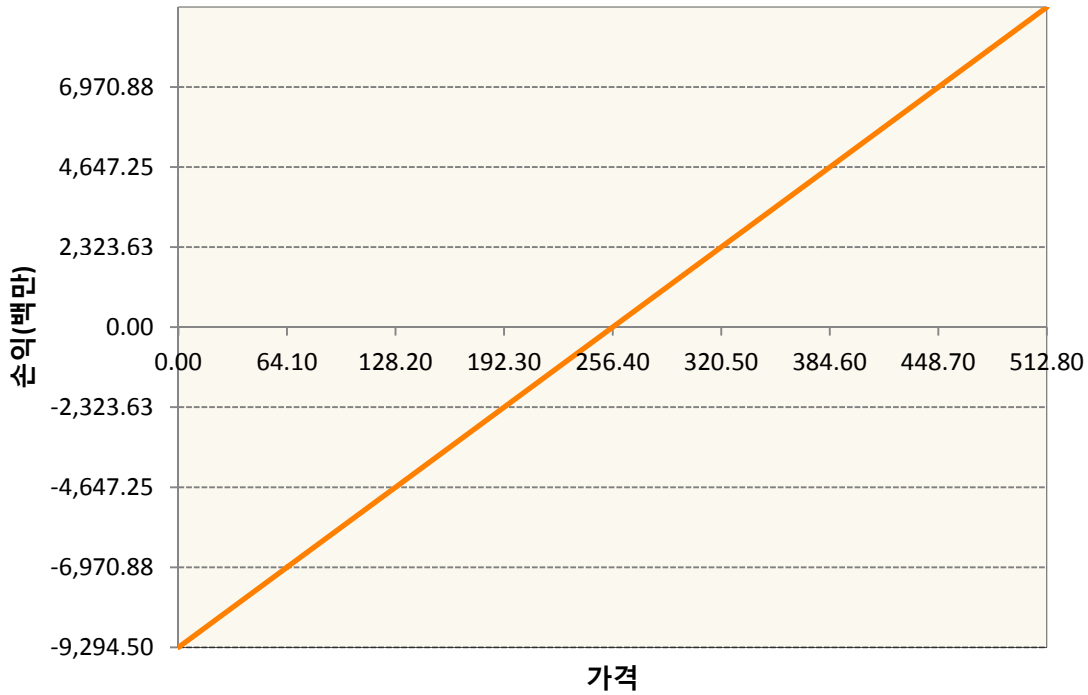
1. 계약금액

(단위:백만원)

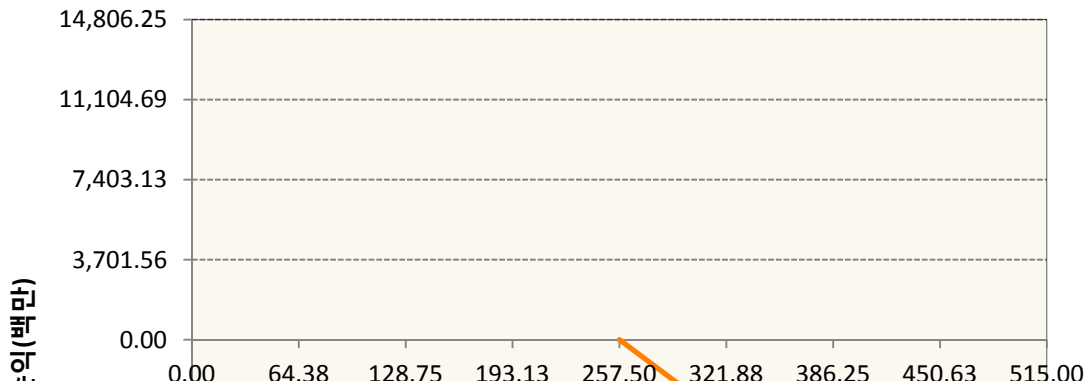
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,295	0	9,295	장내
누계	유가증권	옵션	6,201	17,536	-11,335	장내

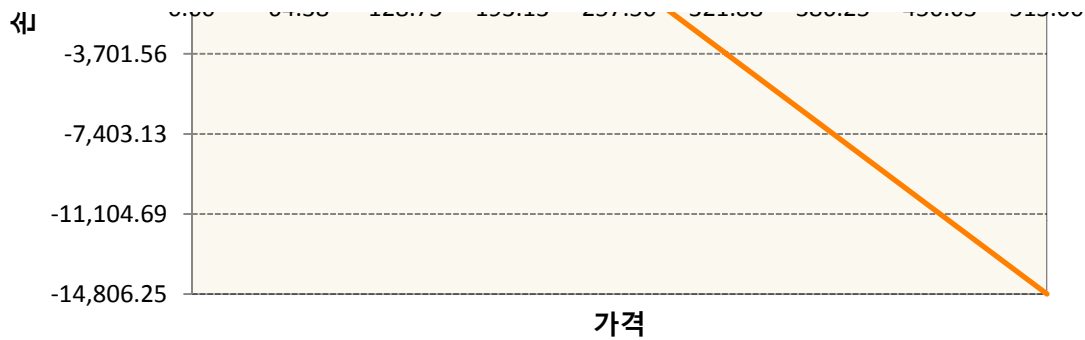
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

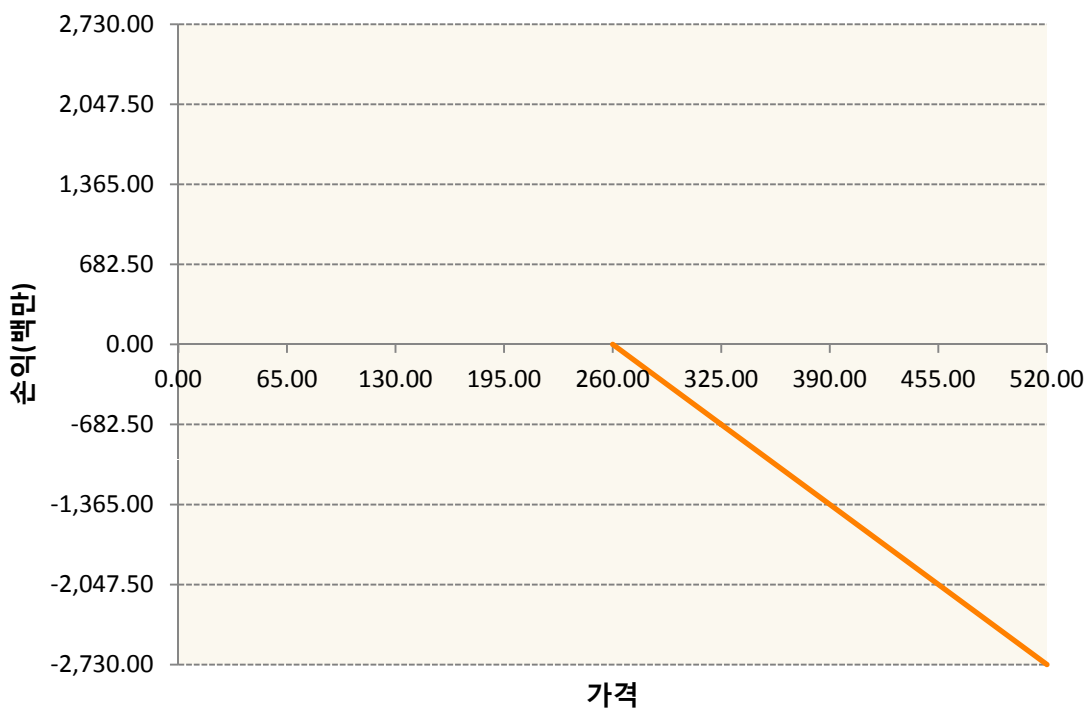


KR4201Q52577-2020-05 콜257.5

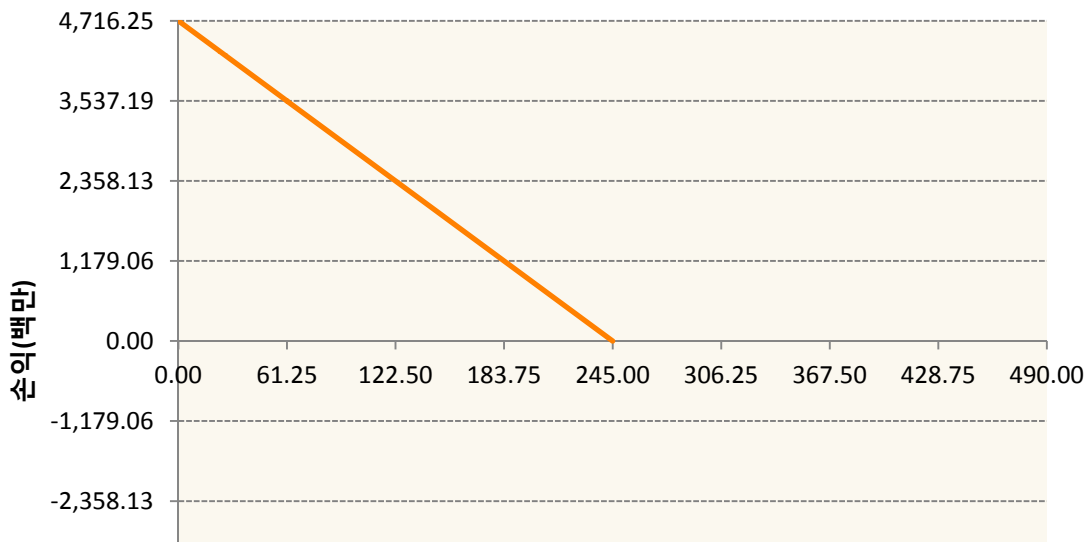


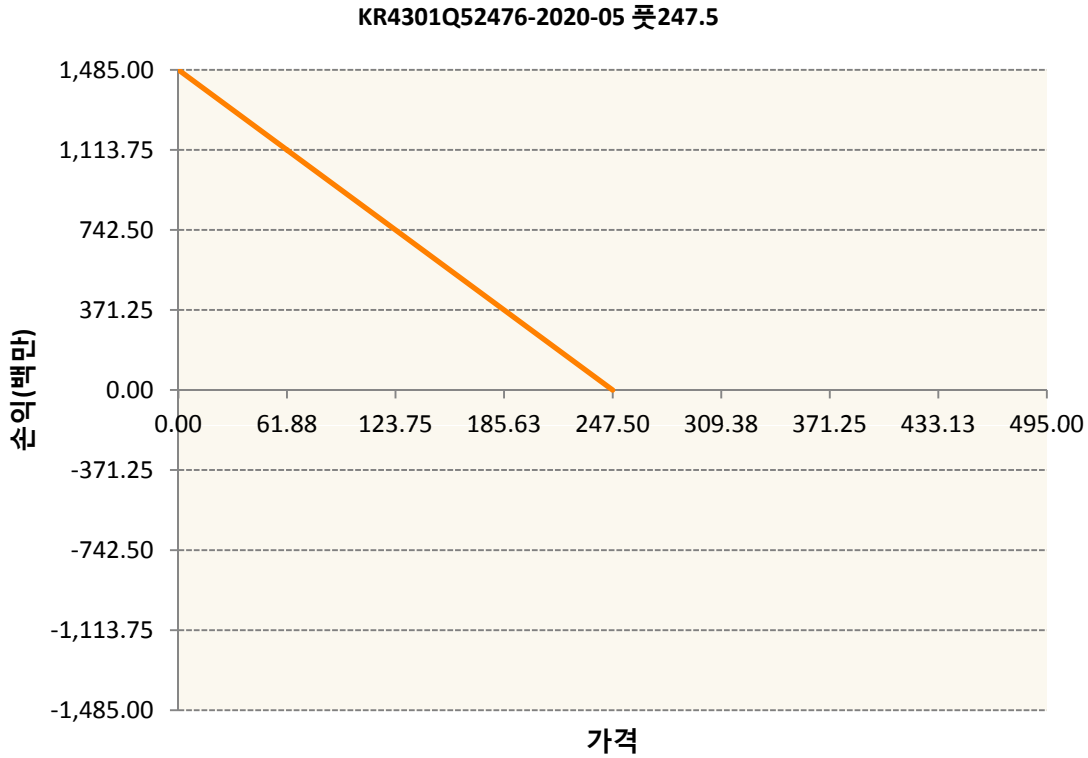
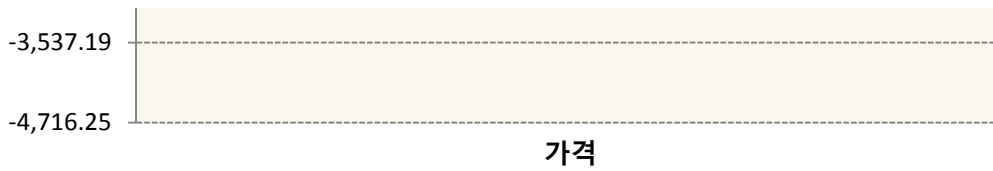


KR4201Q52601-2020-05 콜260



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						744
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-744	-744	-744	-744	-744	-744	-744	
-5.33%	-496	-496	-496	-496	-496	-496	-496	
-2.67%	-248	-248	-248	-248	-248	-248	-248	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	248	248	248	248	248	248	248	
5.33%	496	496	496	496	496	496	496	
8.00%	744	744	744	744	744	744	744	
KR4201Q52577		2020-05 콜257.5						901
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	312	307	301	293	283	271	259	
-5.33%	291	278	264	248	230	211	192	
-2.67%	226	204	180	156	131	106	80	

0%	86	57	29	0	-29	-57	-86
2.67%	-148	-173	-200	-226	-253	-281	-308
5.33%	-460	-477	-496	-516	-537	-560	-583
8.00%	-821	-830	-840	-853	-867	-883	-901

KR4201Q52601 2020-05 콜260 154

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	46	46	45	44	42	40	38
-5.33%	44	42	40	37	35	32	29
-2.67%	35	32	28	24	20	16	11
0%	15	10	5	0	-5	-10	-15
2.67%	-21	-26	-31	-37	-42	-47	-52
5.33%	-73	-77	-81	-86	-90	-94	-99
8.00%	-137	-139	-141	-144	-147	-151	-154

KR4301Q52450 2020-05 풋245 190

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	168	171	174	178	182	186	190
-5.33%	67	72	78	84	90	96	101
-2.67%	11	15	21	26	31	37	42
0%	-7	-5	-3	0	3	7	10
2.67%	-10	-10	-9	-8	-7	-5	-4
5.33%	-10	-10	-10	-10	-10	-9	-9
8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10

KR4301Q52476 2020-05 풋247.5 69

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	64	65	65	66	67	68	69
-5.33%	29	30	32	34	35	37	39
-2.67%	6	8	10	11	13	15	17
0%	-3	-2	-1	0	1	3	4
2.67%	-5	-5	-5	-4	-4	-3	-2
5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-4
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5

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

(단위:백만원)

2,226

공시일	2020-05-11
기준일	2020-05-08

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	147,199	0	147,199	

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	2020-05-11
기준일	2020-05-08

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	99,246	0	99,246	

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	2020-05-11
기준일	2020-05-08

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	438,469	0	438,469	
누계	통화	선도	43,916	510,162	-466,246	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,440
FX21020H02 KRW/USD 11-05-20E	2,030
FX21020H03 KRW/USD 11-05-20E	2,030
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,381
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	976
FX21020H07 USD/KRW 11-05-20E	976
FX21020H08 USD/KRW 11-05-20E	2,537
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	839
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	732
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	488
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,416
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,929
FX21020H11 KRW/USD 11-05-20E	976
FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E	2,928
FX21020J02€ KRW/USD 10-06-20E	1,327
FX21020J027 KRW/USD 22-06-20E	1,503
FX21020J028 KRW/USD 22-06-20E	1,952
FX21020J039 KRW/USD 24-07-20E	2,196
FX21020J043 KRW/USD 24-07-20E	1,757
FX21020J043 KRW/USD 24-07-20E	1,952
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	2,030
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	1,932
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)

199

공시일	2020-05-11
기준일	2020-05-08

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

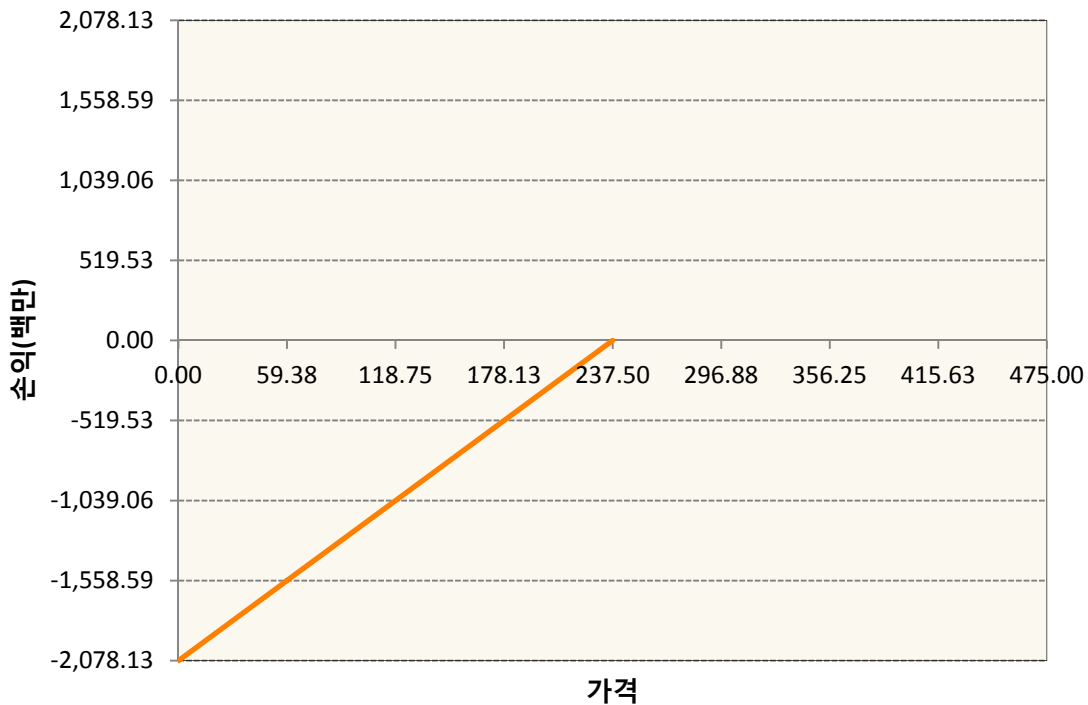
1. 계약금액

(단위:백만원)

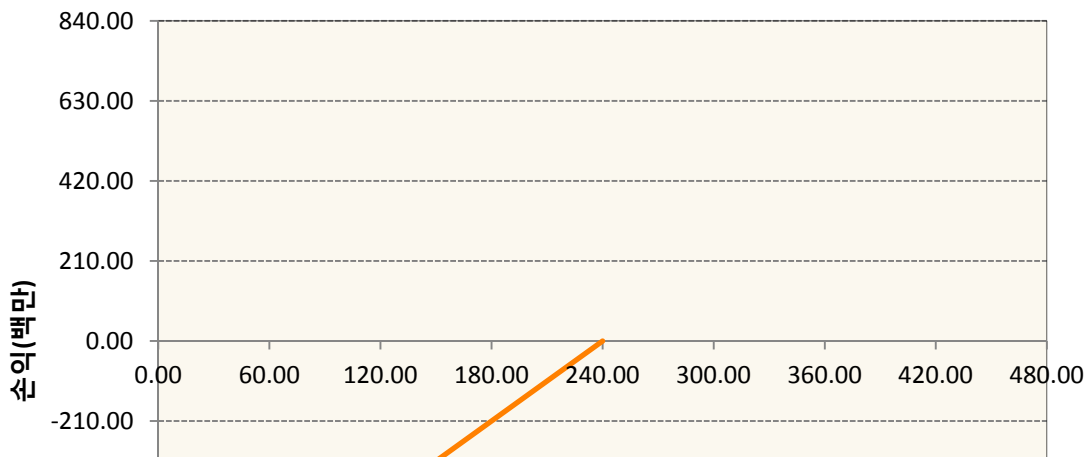
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	59	0	59	장내
누계	유가증권	옵션	0	2,918	-2,918	장내

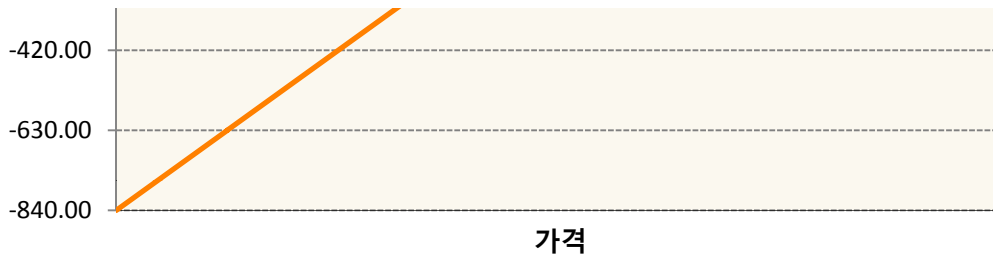
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q52377-2020-05 풋237.5



KR4301Q52401-2020-05 풋240





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q52377 2020-05 풋237.5 46

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-30	-33	-35	-38	-40	-43	-46
-5.33%	-7	-9	-11	-13	-16	-18	-20
-2.67%	0	-1	-2	-3	-4	-6	-7
0%	1	1	0	0	0	-1	-2
2.67%	1	1	1	1	0	0	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

KR4301Q52401 2020-05 풋240 23

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-18	-18	-19	-20	-21	-22	-23
-5.33%	-5	-6	-7	-8	-9	-10	-11
-2.67%	0	-1	-1	-2	-3	-3	-4
0%	0	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	1	1	1	0	0	0	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	0
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

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

28

공시일	2020-05-11
기준일	2020-05-08

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	7,227	0	7,227	
누계	통화	선도	0	7,136	-7,136	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J01! KRW/USD 13-05-20E	319
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	2020-05-11
기준일	2020-05-08

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

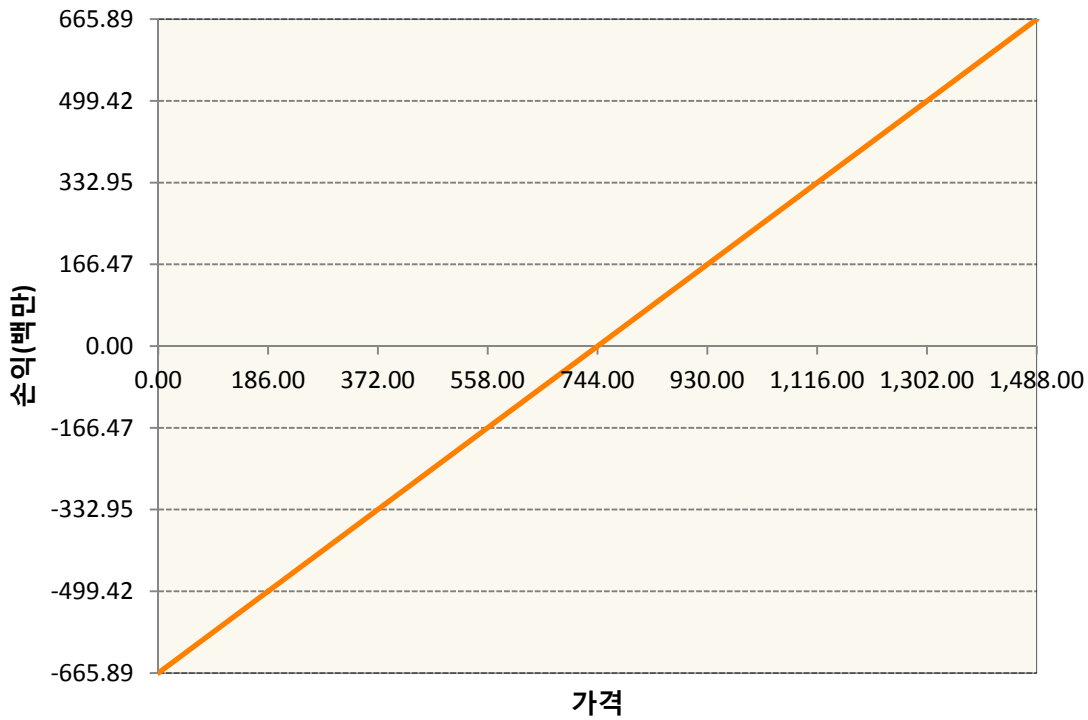
1. 계약금액

(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	666	0	666	
누계	유가증권	스왑	866	0	866	장외
누계	통화	선도	204	759	-555	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	2020-05-11
기준일	2020-05-08

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

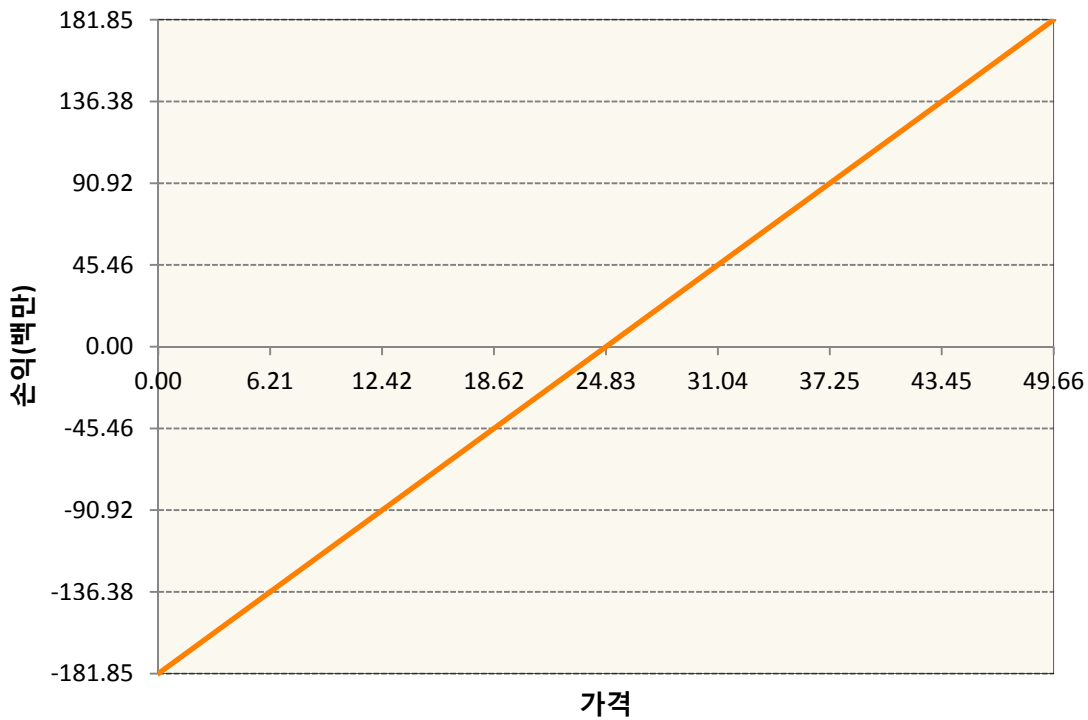
1. 계약금액

(단위:백만원)

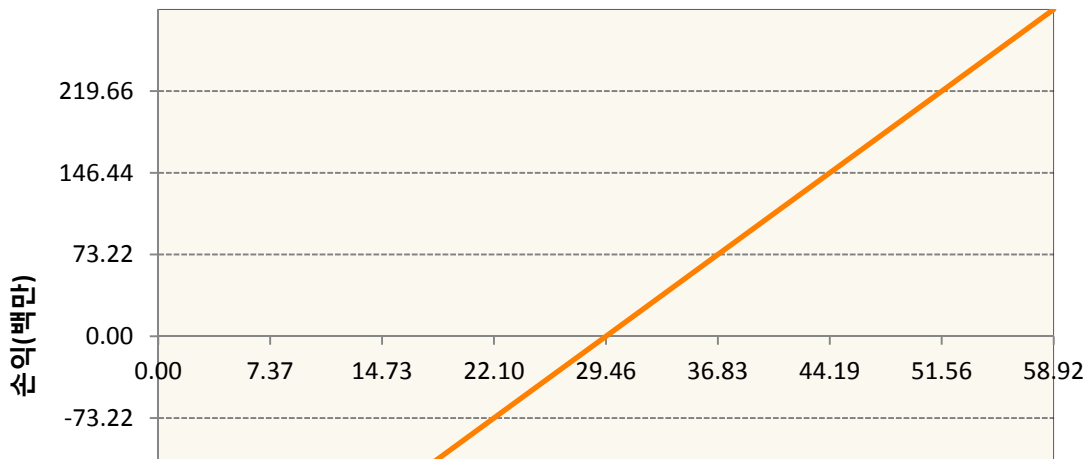
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,516	244	1,272	

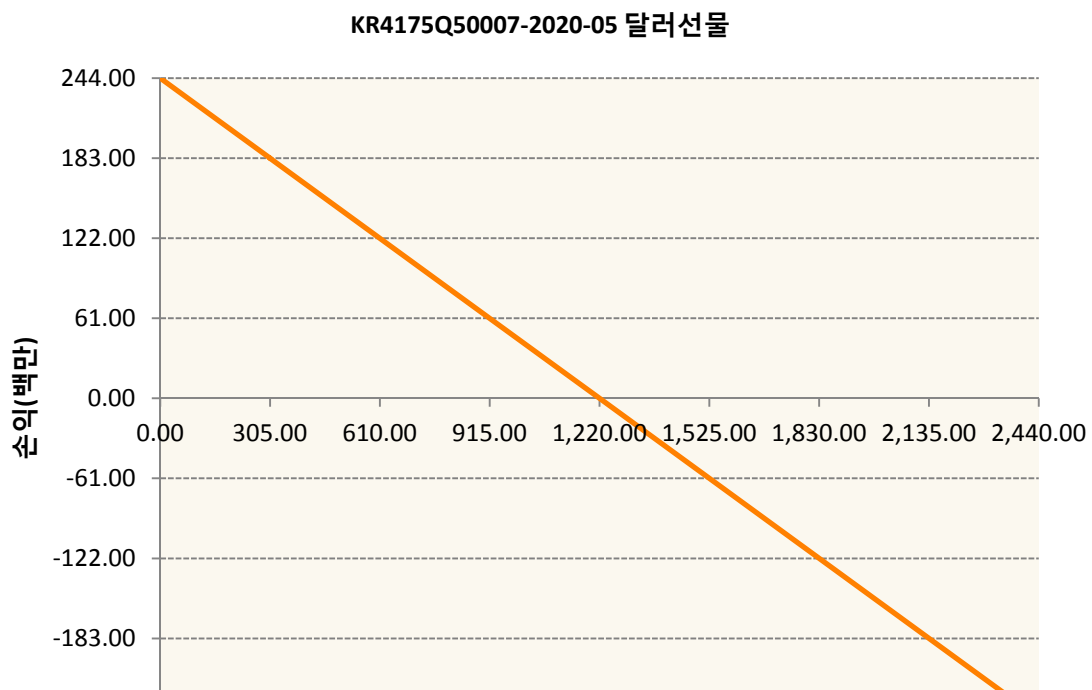
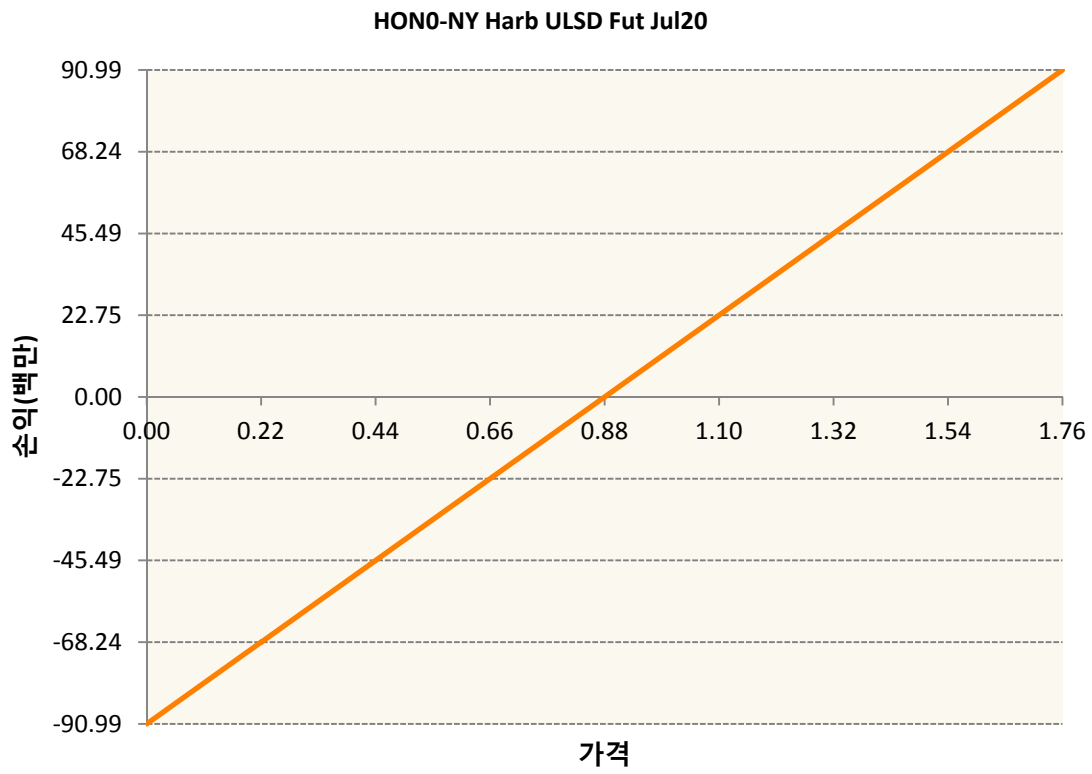
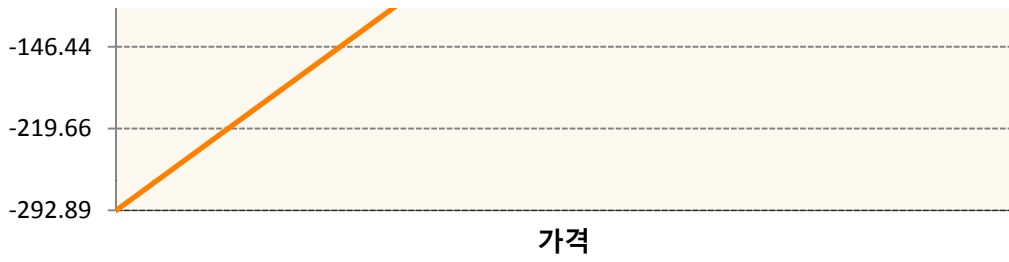
2. 만기시점의 손익구조

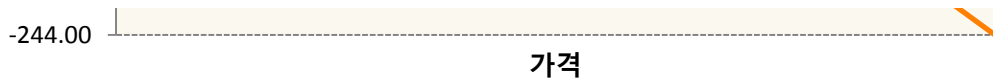
CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20



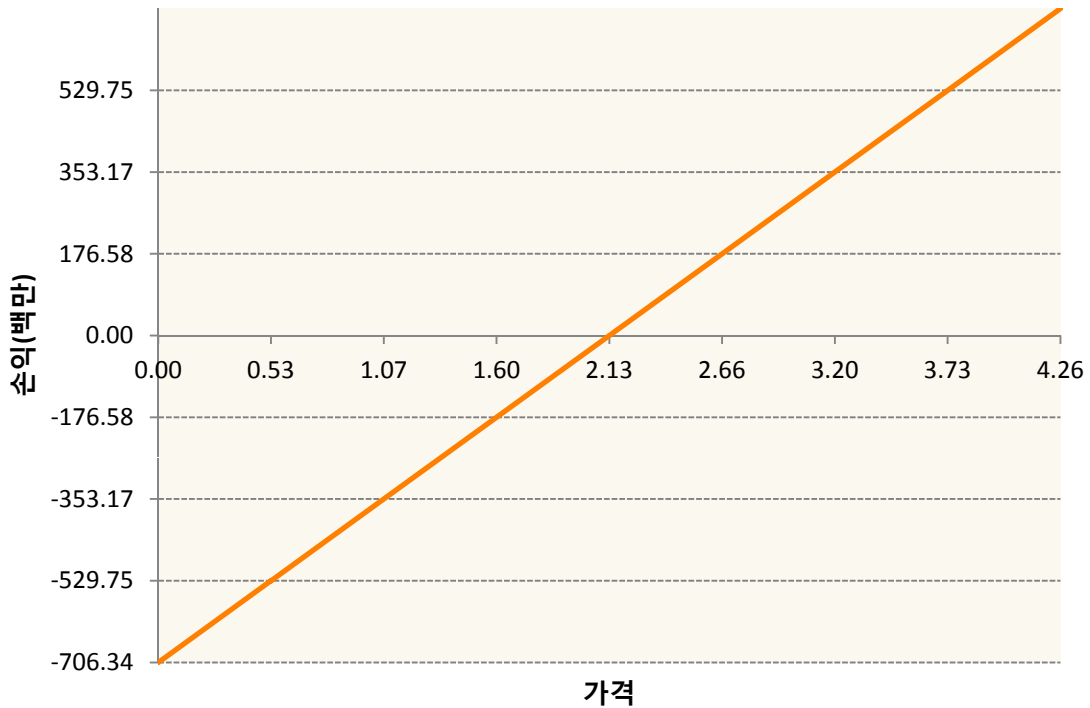
CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20



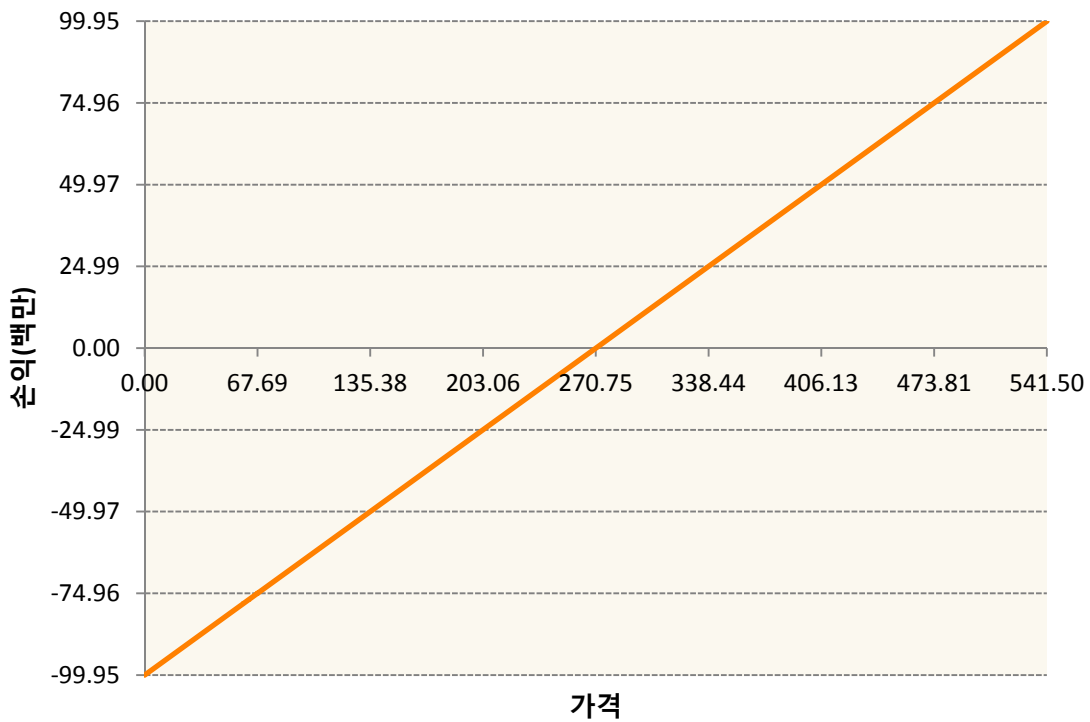




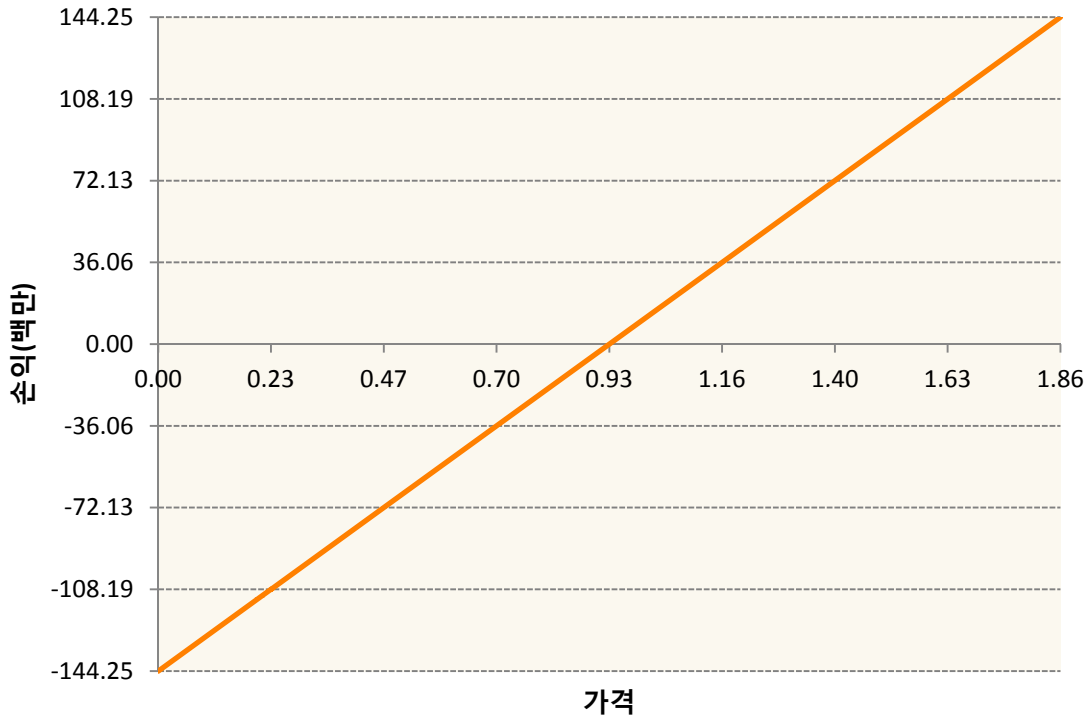
NGN20-NATURAL GAS FUTR Jul20



QSN0-Low Su Gasoil G Jul20



XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN0	WTI CRUDE FUTURE Jul20	15
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	23
HON0	NY Harb ULSD Fut Jul20	7
KR4175Q50C	2020-05 달러선물	20
NGN20	NATURAL GAS FUTR Jul20	57
QSN0	Low Su Gasoil G Jul20	8
XBN0	GASOLINE RBOB FUT Jul20	12

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

(단위:백만원)

579

공시일	2020-05-11
기준일	2020-05-08

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

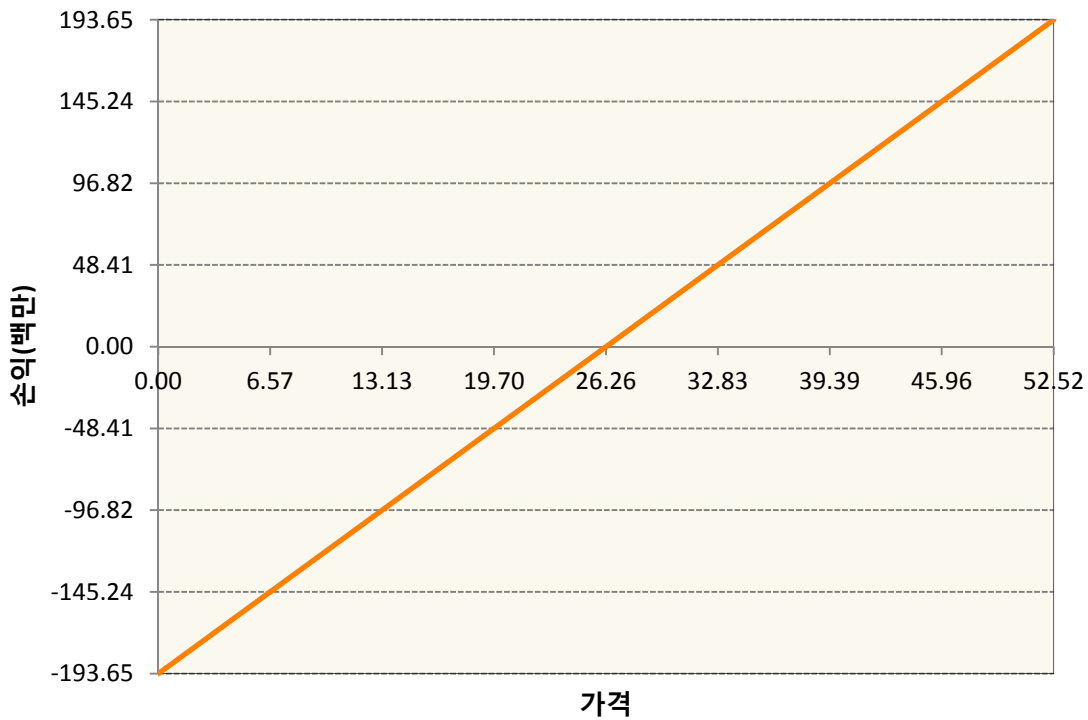
1. 계약금액

(단위:백만원)

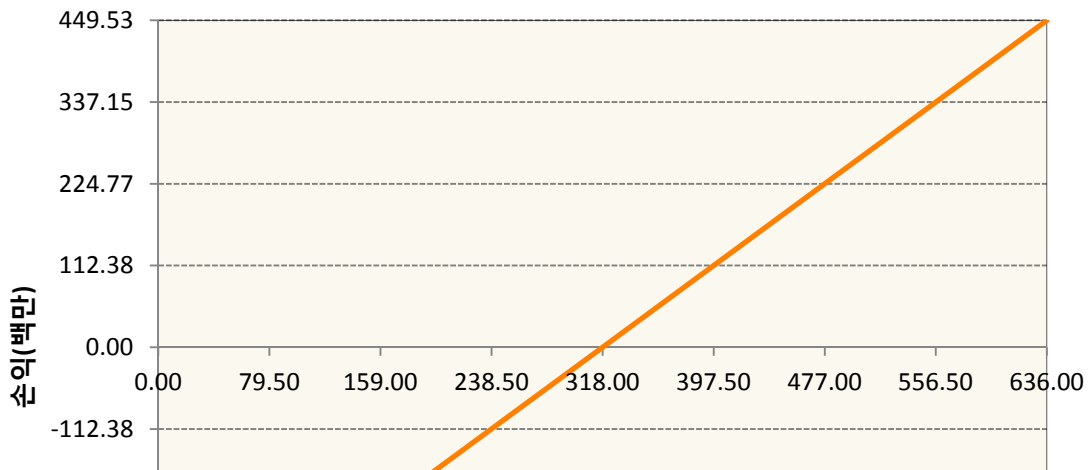
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,363	73	2,290	

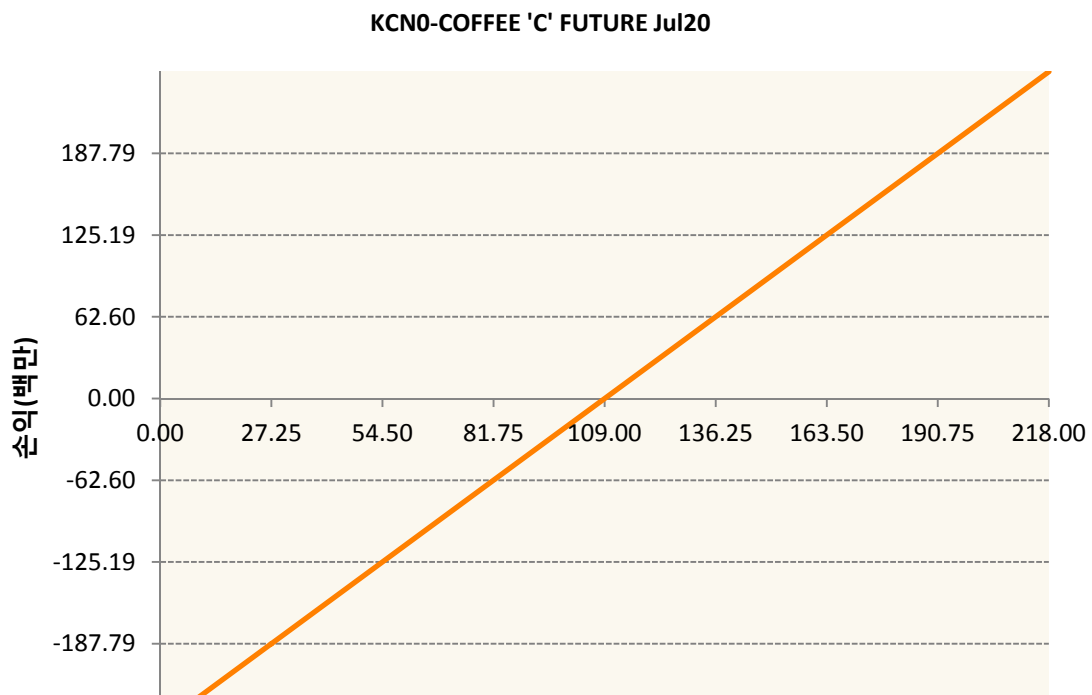
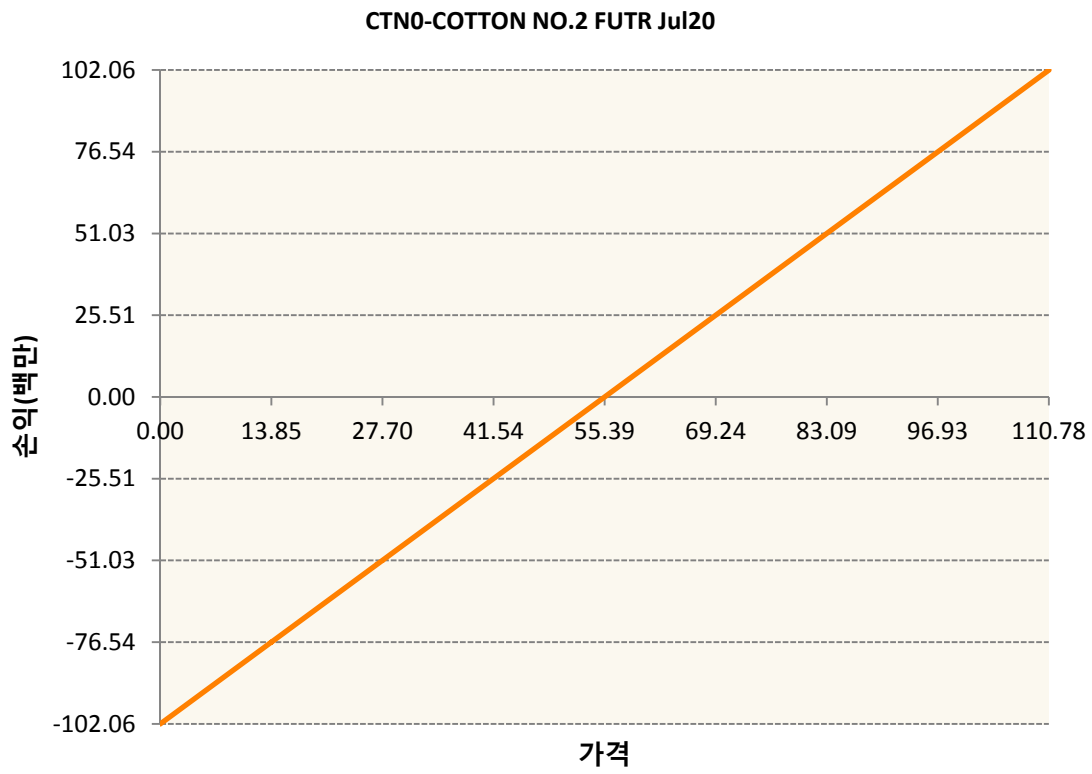
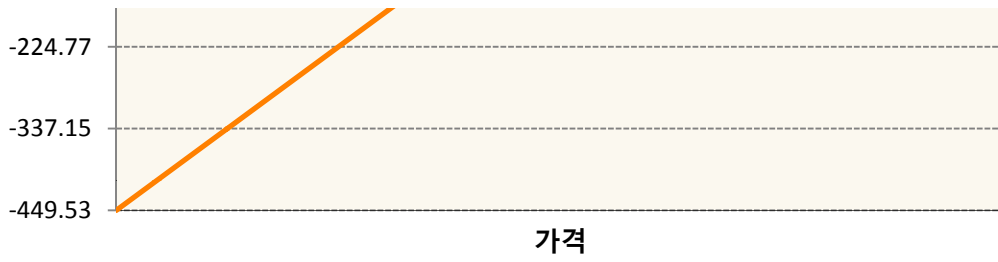
2. 만기시점의 손익구조

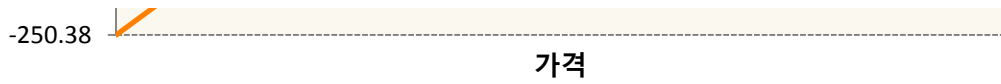
BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20



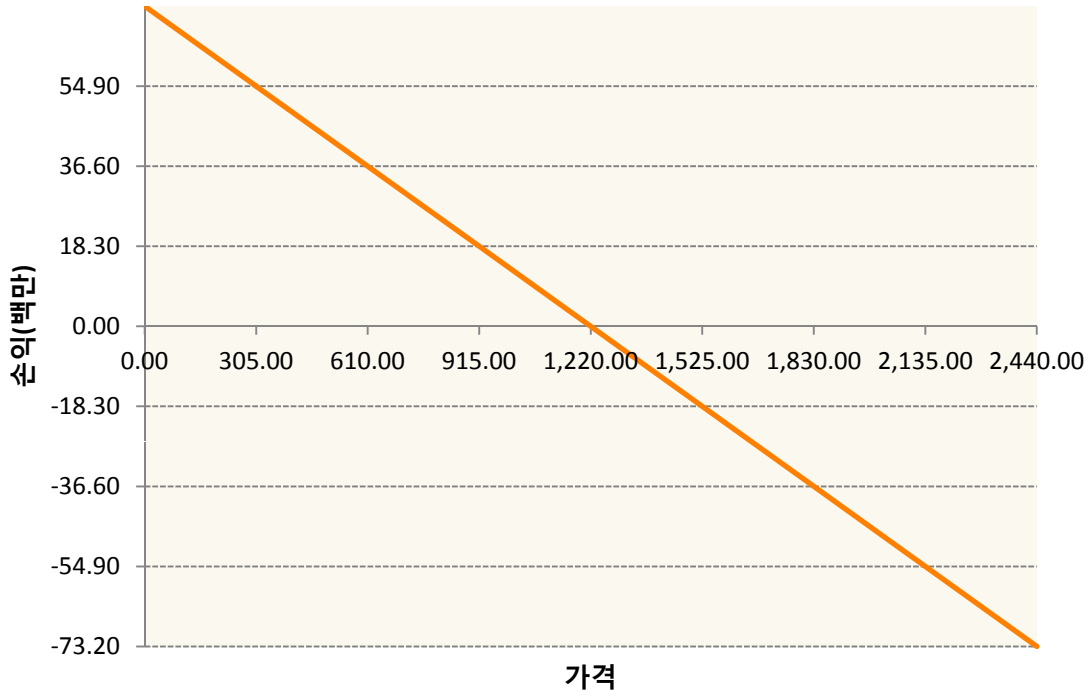
CNO-CORN FUTURE Jul20



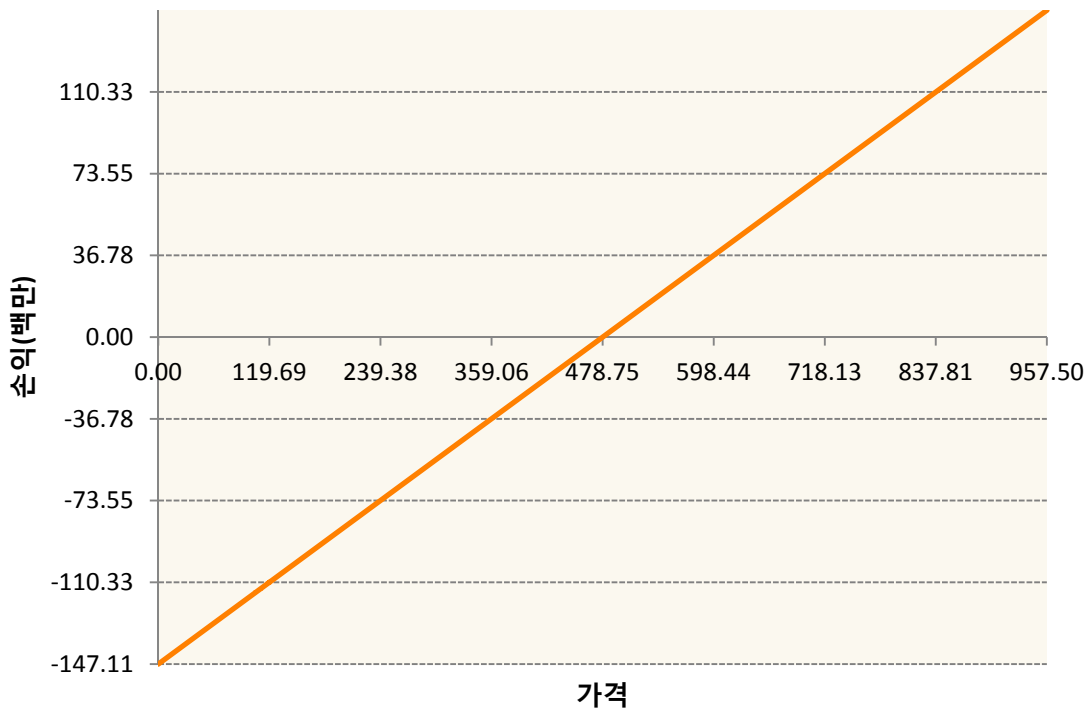




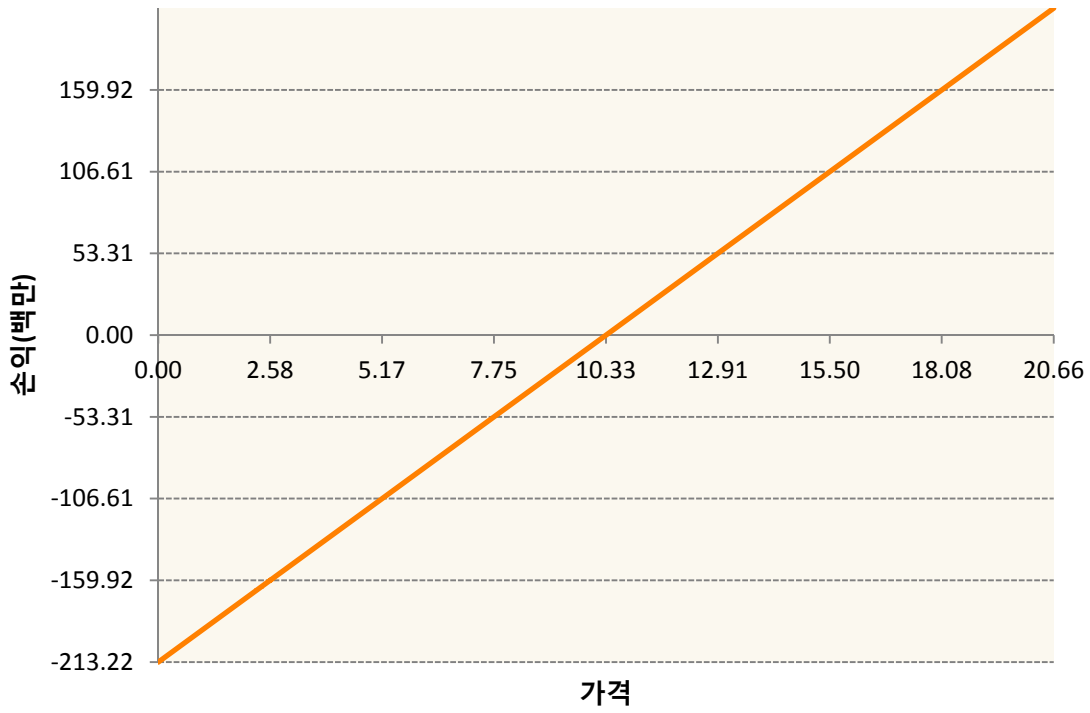
KR4175Q50007-2020-05 달러선물



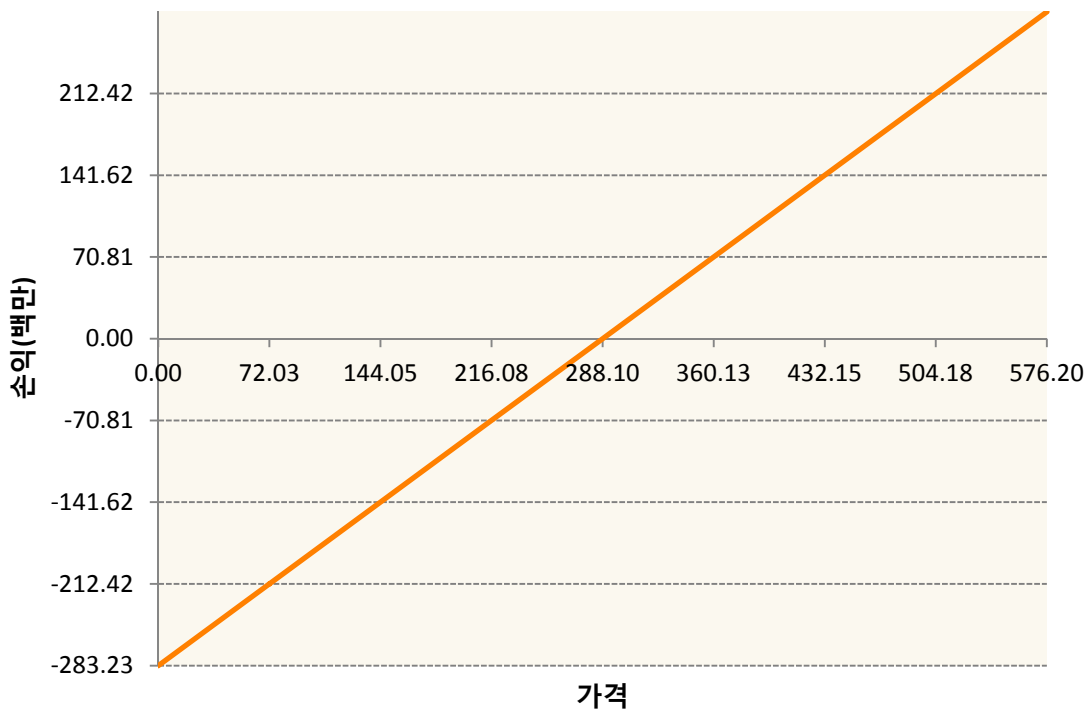
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



SBN0-Sugar Jul20

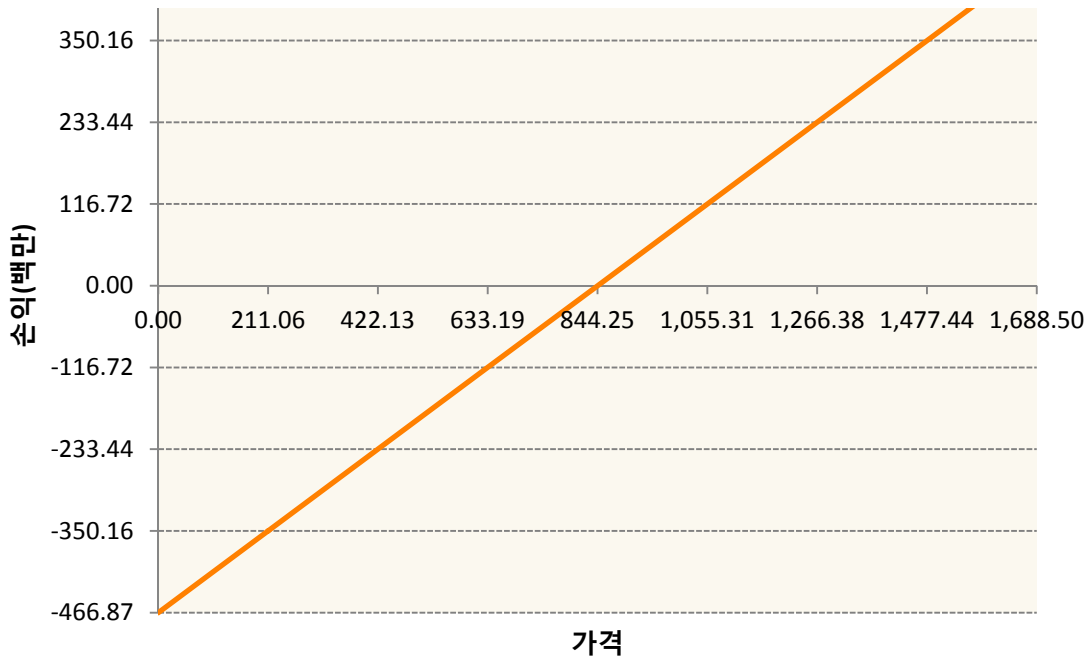


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20

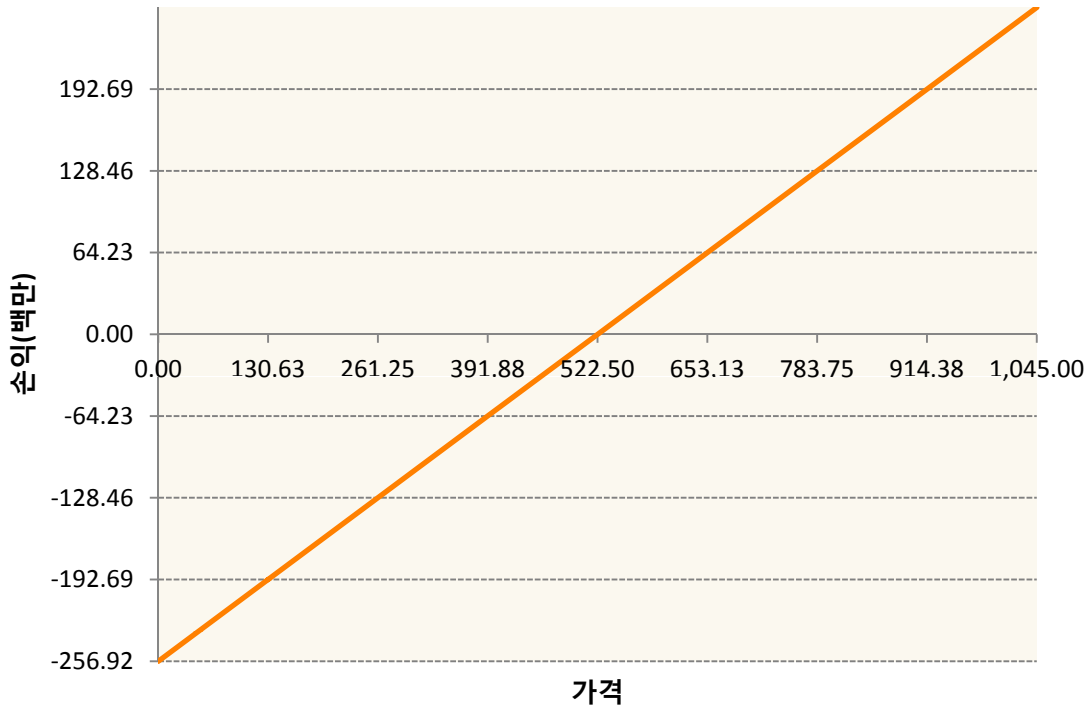


SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





WN0-WHEAT FUTURE(CBT) Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON0	SOYBEAN OIL FUTR Jul20	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	21

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

(단위:백만원)

224