

공시일	2020-05-12
기준일	2020-05-11

## 포커스농산물모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	4	0	4	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음



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

(단위:백만원)

105

공시일	2020-05-12
기준일	2020-05-11

## 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

995

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,166

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-12
기준일	2020-05-11

## 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

572
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

867
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-12
기준일	2020-05-11

## 유로인덱스모(주식-파생형)

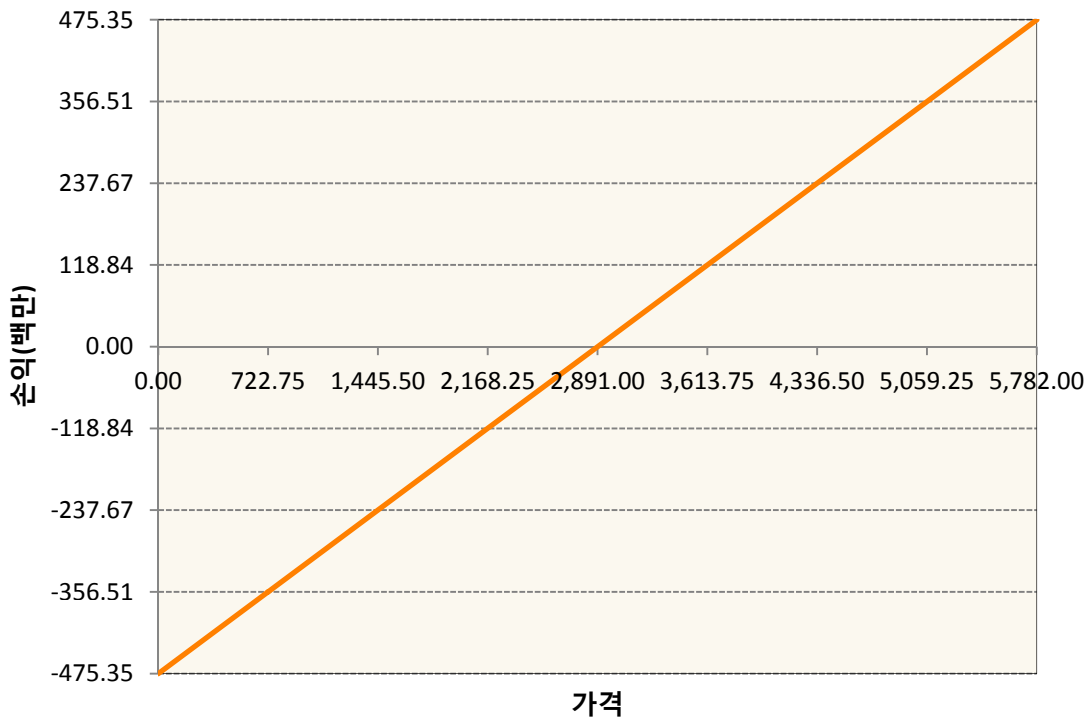
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	475	0	475	

### 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	2020-05-12
기준일	2020-05-11

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

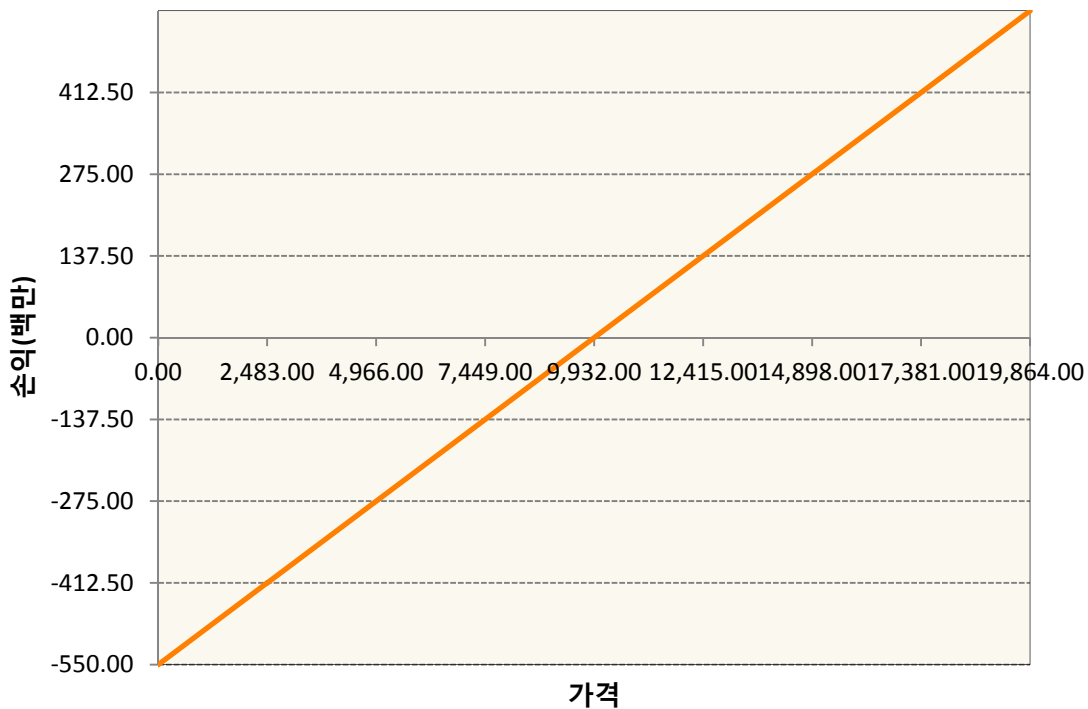
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	550	0	550	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)

48
----

공시일	2020-05-12
기준일	2020-05-11

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

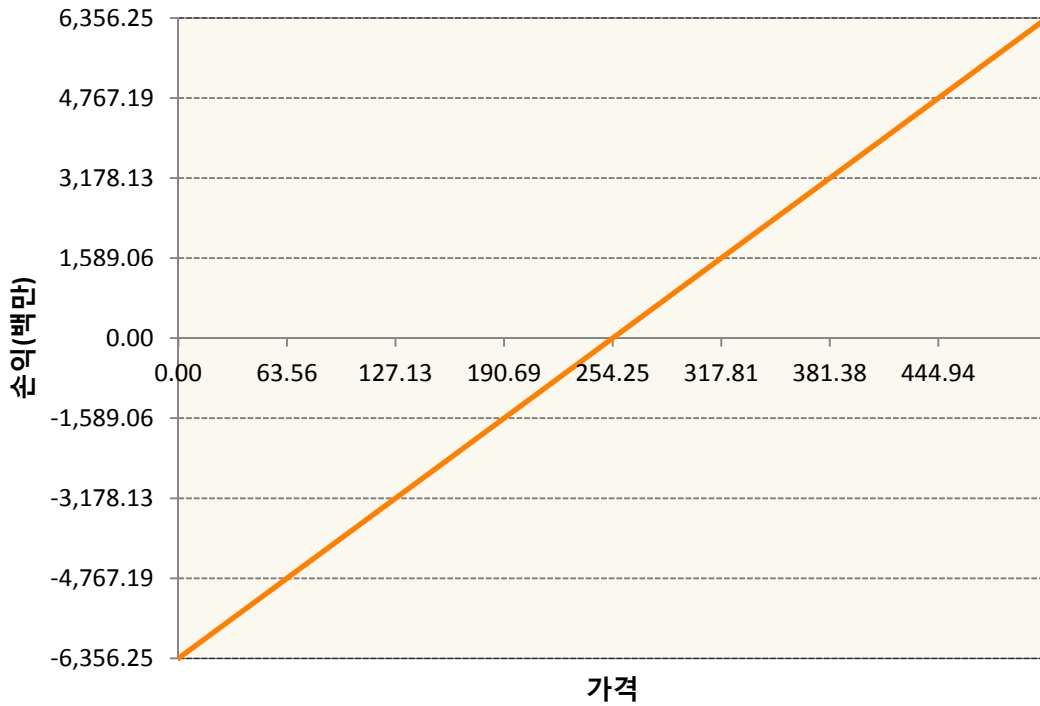
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

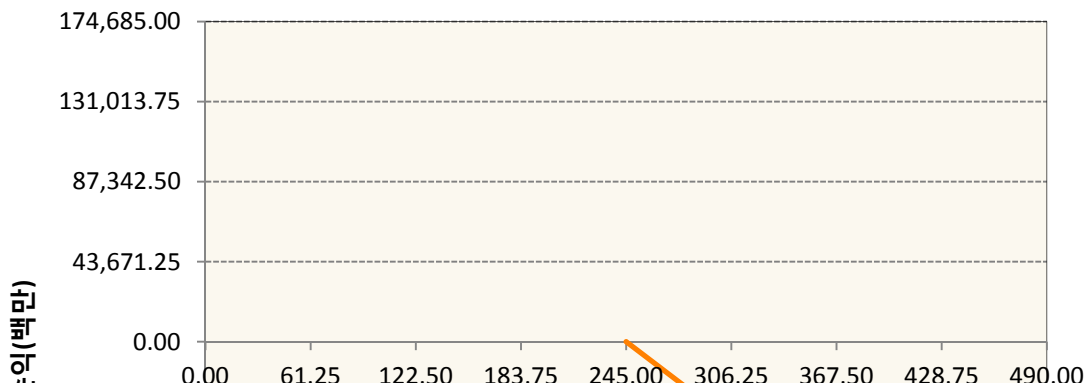
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,356	0	6,356	장내
누계	유가증권	옵션	0	351,608	-351,608	장내

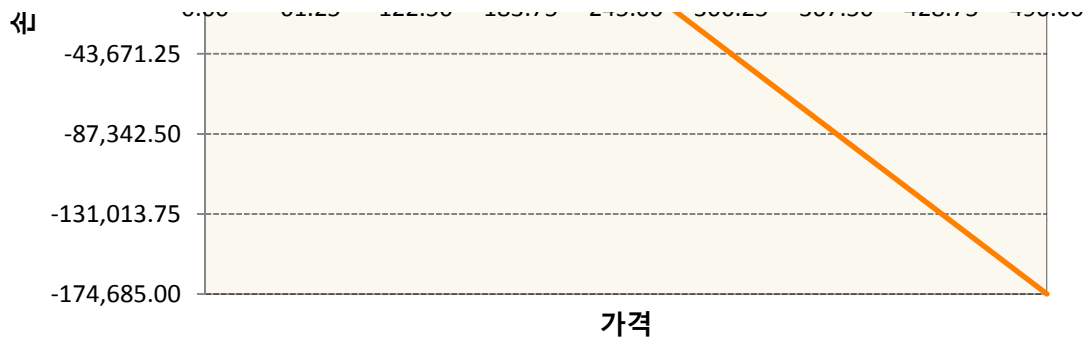
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

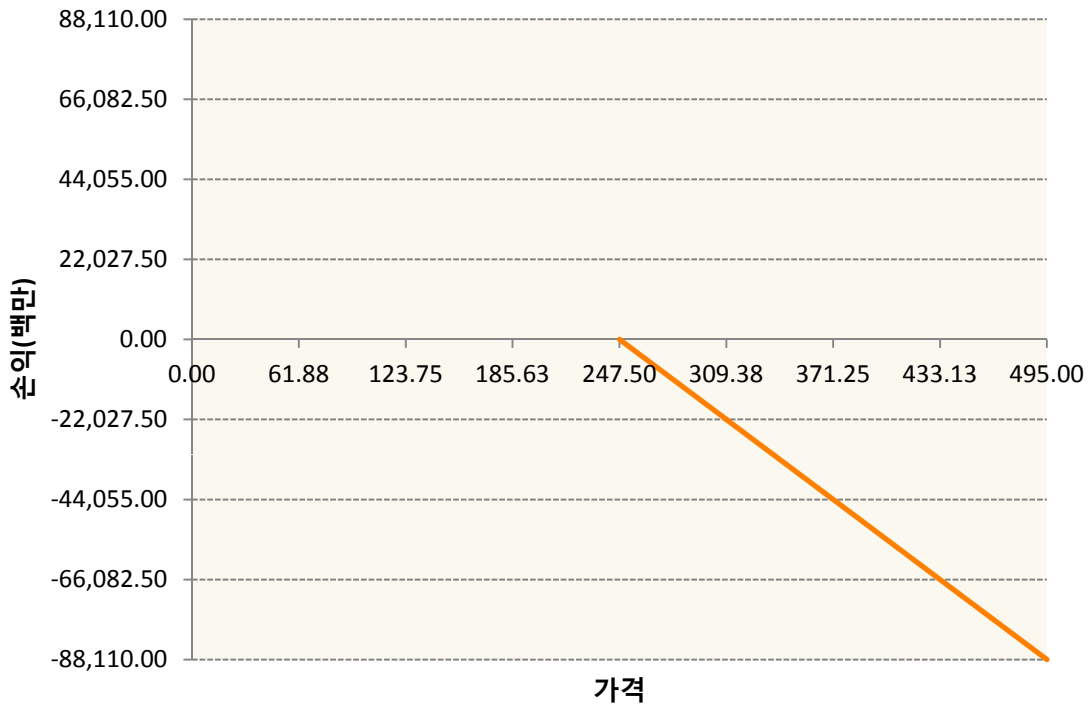


KR4201Q52452-2020-05 콜245

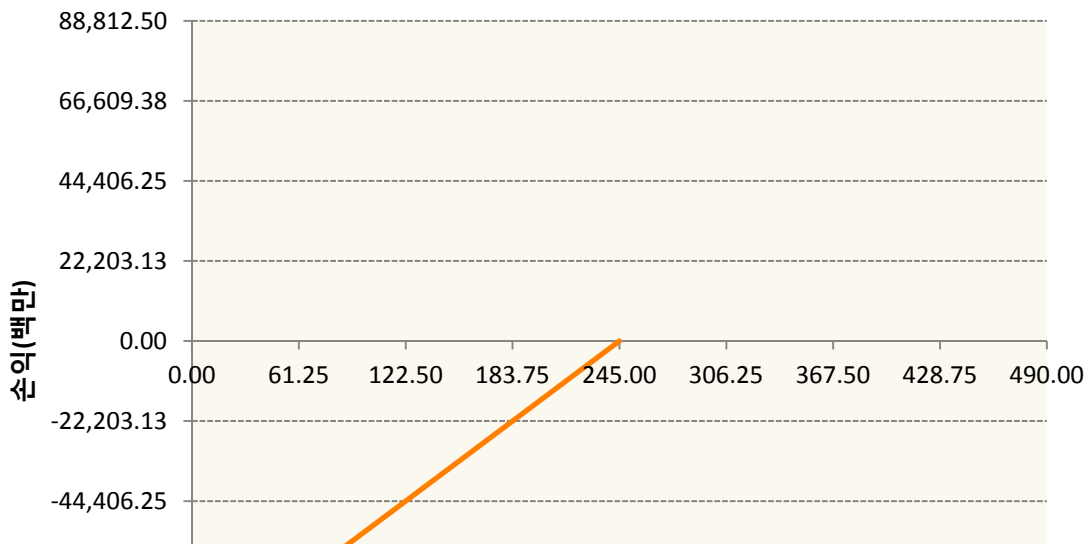


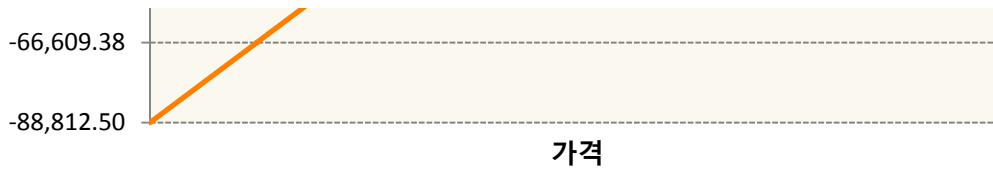


KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



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						13,928
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	7,532	7,438	7,327	7,202	7,064	6,915	6,757	
-5.33%	6,648	6,436	6,220	6,000	5,778	5,554	5,329	
-2.67%	4,268	4,046	3,821	3,593	3,364	3,133	2,901	
0%	393	278	146	0	-158	-326	-502	
2.67%	-4,230	-4,261	-4,306	-4,367	-4,441	-4,530	-4,632	
5.33%	-9,047	-9,051	-9,061	-9,078	-9,103	-9,138	-9,183	
8.00%	-13,891	-13,891	-13,893	-13,896	-13,902	-13,912	-13,928	
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5						6,785
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,104	3,074	3,036	2,990	2,938	2,878	2,814	
-5.33%	2,837	2,749	2,657	2,560	2,461	2,359	2,254	
-2.67%	1,950	1,830	1,710	1,590	1,470	1,350	1,230	
0%	260	179	92	0	-96	-195	-298	
2.67%	-1,951	-1,979	-2,016	-2,061	-2,114	-2,173	-2,239	
5.33%	-4,336	-4,341	-4,351	-4,366	-4,386	-4,412	-4,445	
8.00%	-6,752	-6,753	-6,755	-6,758	-6,764	-6,773	-6,785	
KR4301Q52450		2020-05 풋245						3,855
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,734	-3,743	-3,756	-3,775	-3,797	-3,824	-3,855	
-5.33%	-1,491	-1,551	-1,615	-1,681	-1,749	-1,818	-1,888	
-2.67%	-214	-281	-349	-420	-491	-564	-638	

0%	57	44	24	0	-29	-63	-101
2.67%	74	73	71	68	63	56	46
5.33%	74	74	74	74	73	73	71
8.00%	74	74	74	74	74	74	74

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

(단위:백만원)

**26,092**

공시일	2020-05-12
기준일	2020-05-11

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

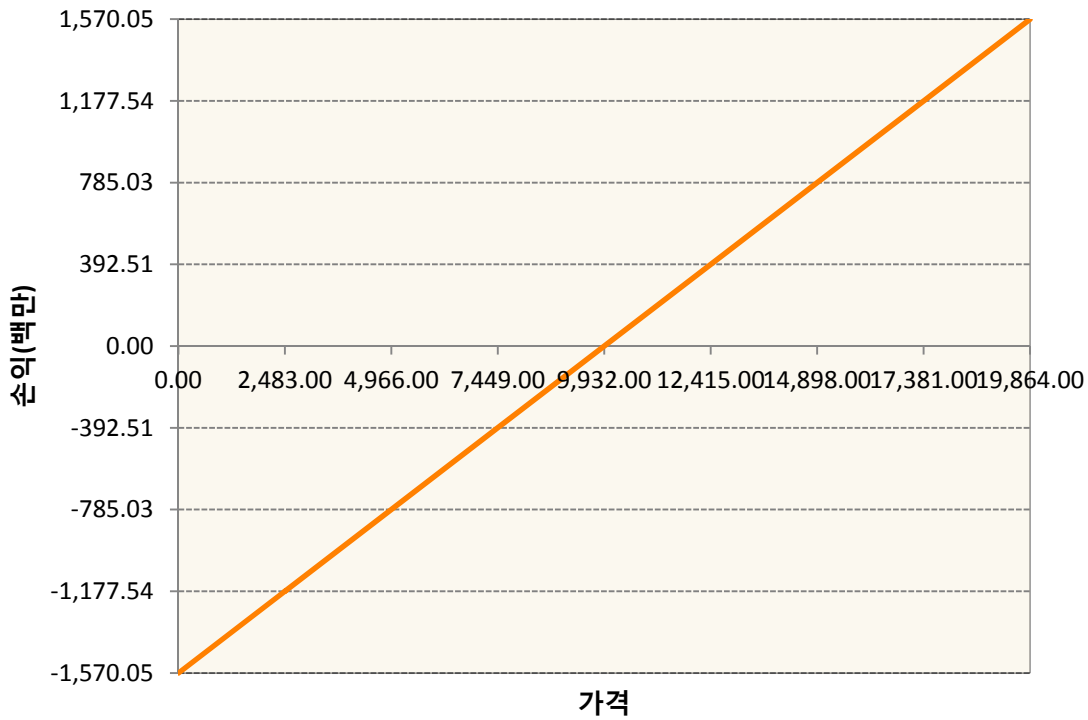
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

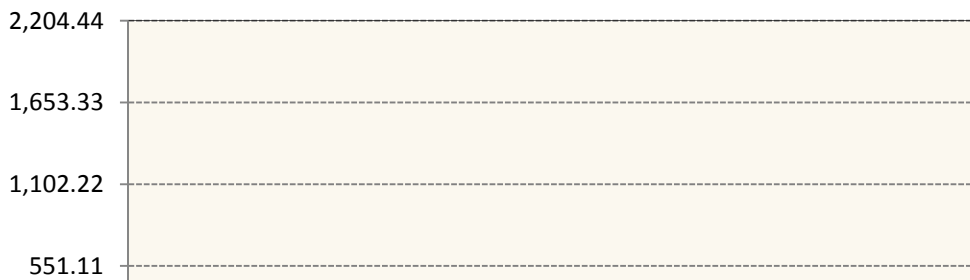
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,570	0	1,570	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,409	-4,409	장내
누계	통화	선도	693	2,217	-1,524	장외

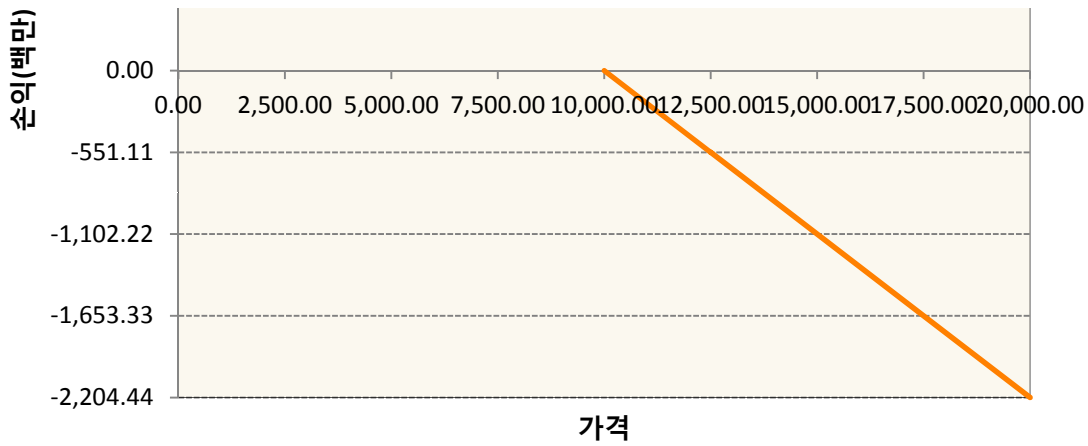
### 2. 만기시점의 손익구조

HCK0-HSCEI Futures May20

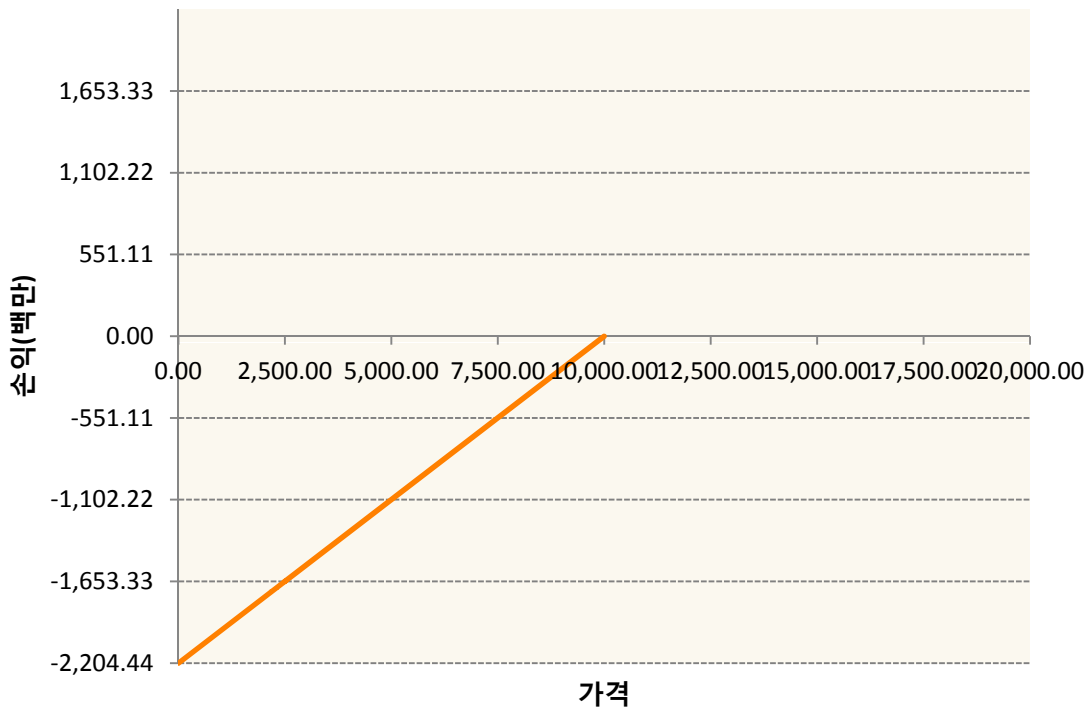


OHHIK0-C100-HSCEI





OHHIK0-P100-HSCEI



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

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	634

공시일	2020-05-12
기준일	2020-05-11

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

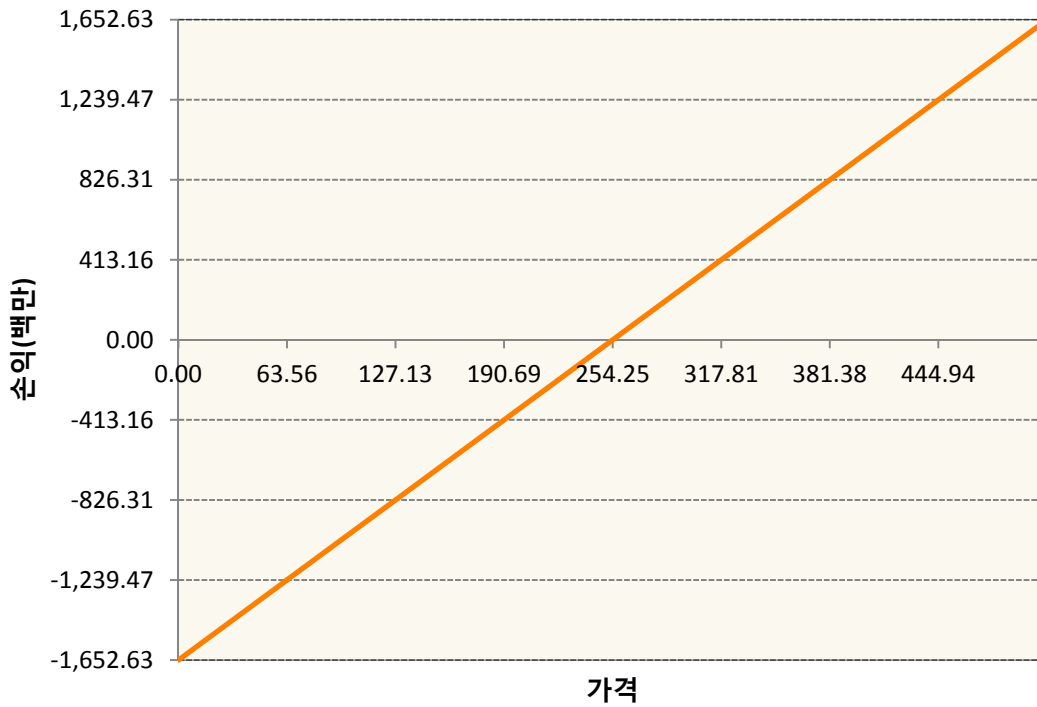
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

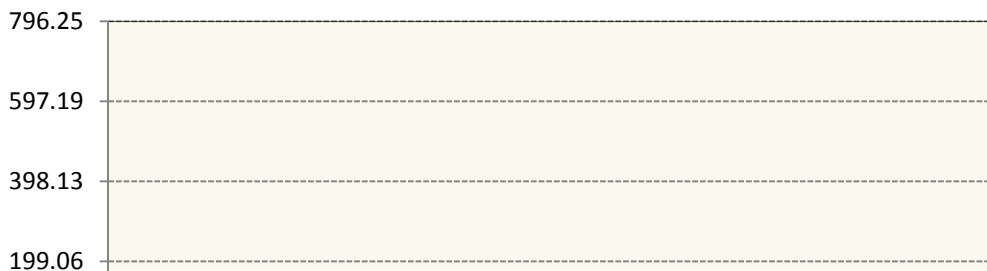
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,653	0	1,653	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,193	-3,193	장내

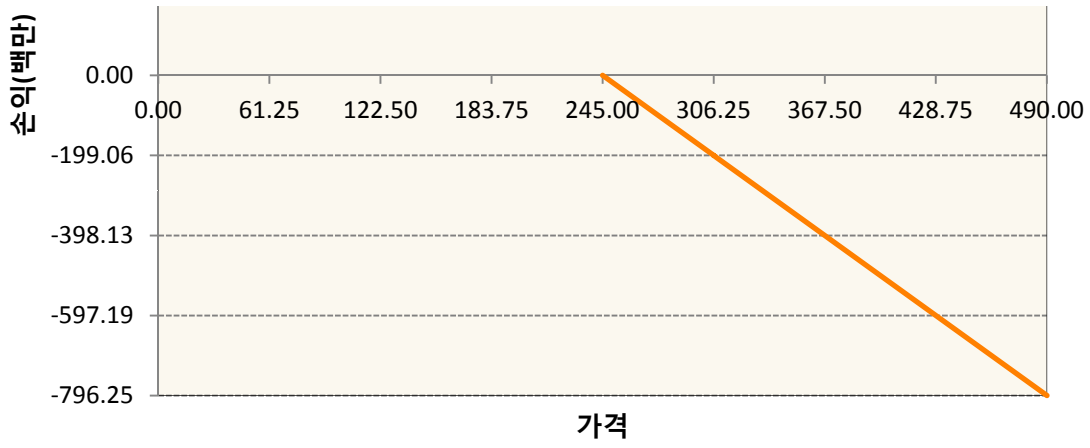
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

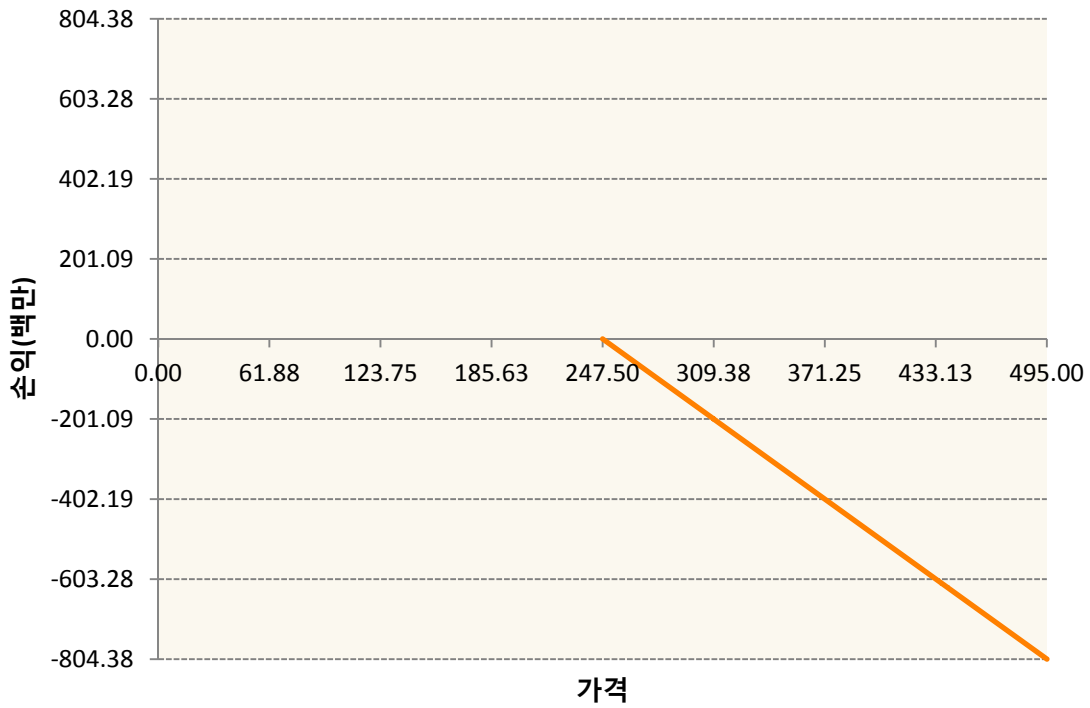


KR4201Q52452-2020-05 콜245

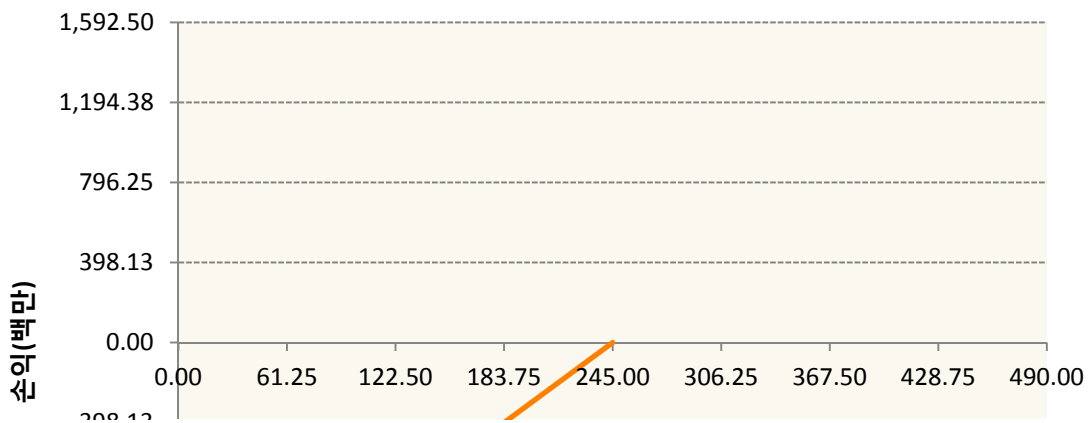




KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



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%	-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%	133	133	133	133	133	133	133	
KR4201Q52452		2020-05 콜245						63
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	34	34	33	33	32	32	31	
-5.33%	30	29	28	27	26	25	24	
-2.67%	19	18	17	16	15	14	13	
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2	
2.67%	-19	-19	-20	-20	-20	-21	-21	
5.33%	-41	-41	-41	-41	-41	-42	-42	
8.00%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63	
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5						62
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	28	28	28	27	27	26	26
-5.33%	26	25	24	23	22	22	21
-2.67%	18	17	16	15	13	12	11
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-18	-18	-18	-19	-19	-20	-20
5.33%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-41
8.00%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
KR4301Q52450                      2020-05 풋245							69
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-67	-67	-67	-68	-68	-69	-69
-5.33%	-27	-28	-29	-30	-31	-33	-34
-2.67%	-4	-5	-6	-8	-9	-10	-11
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

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

(단위:백만원)

**568**

공시일	2020-05-12
기준일	2020-05-11

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

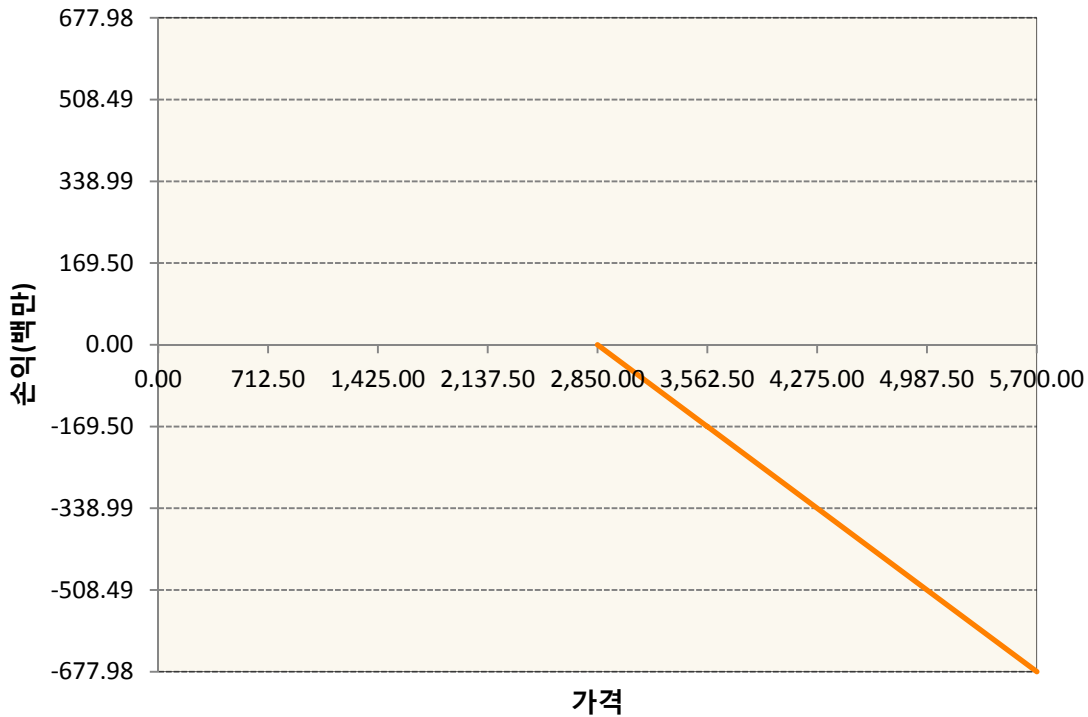
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

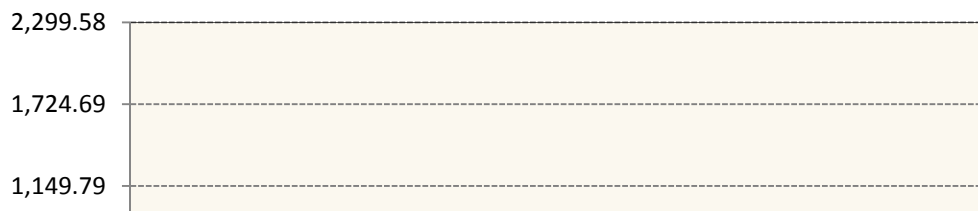
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	736	0	736	
누계	유가증권	스왑	7,882	0	7,882	장외
누계	유가증권	옵션	0	5,955	-5,955	장내
누계	통화	선도	0	2,675	-2,675	장외

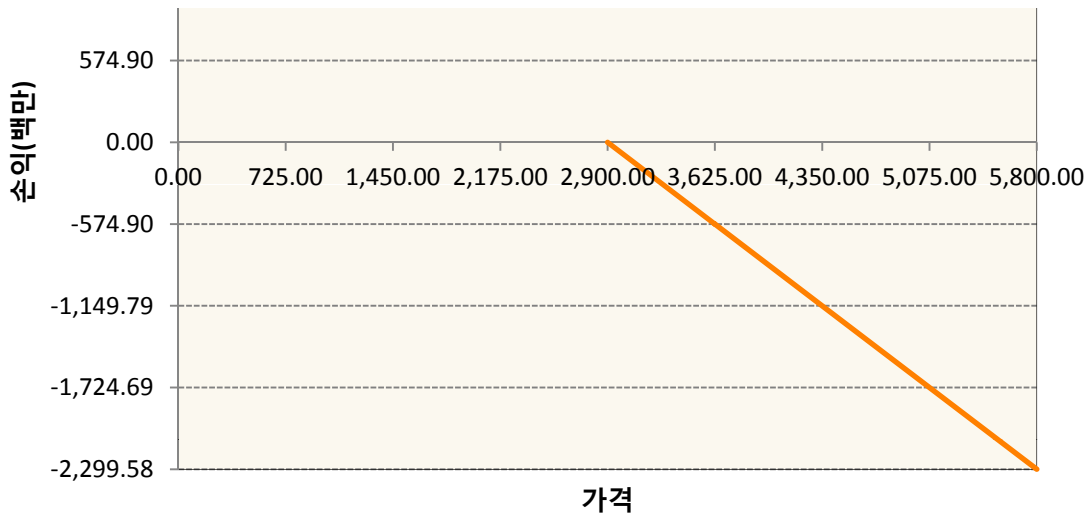
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXK0-C2850-EURO STOXX 50**

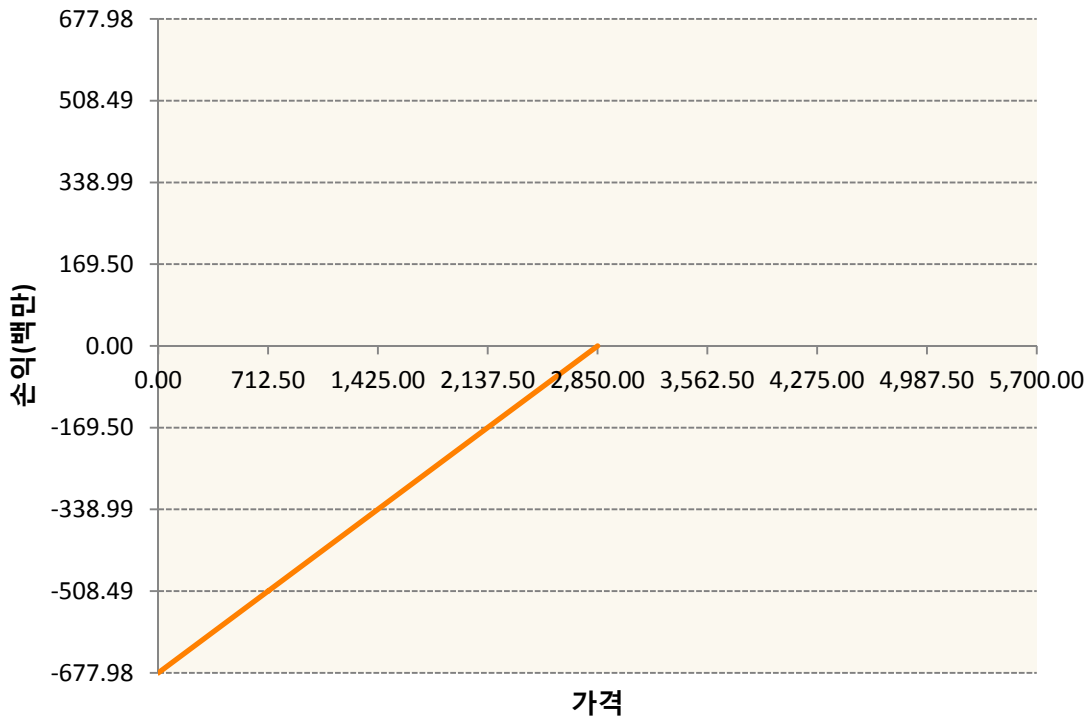


**OESXK0-C2900-EURO STOXX 50**

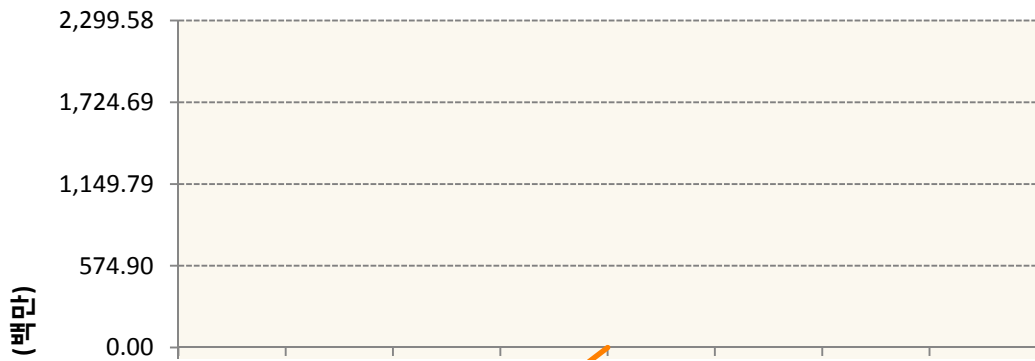


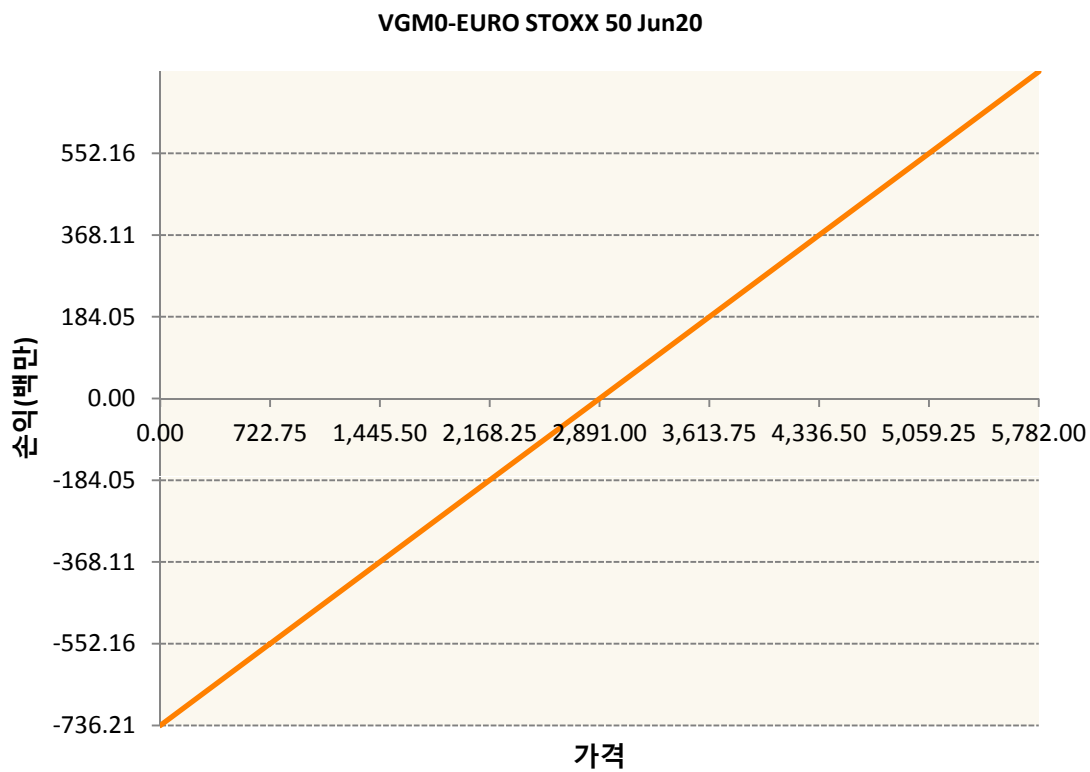
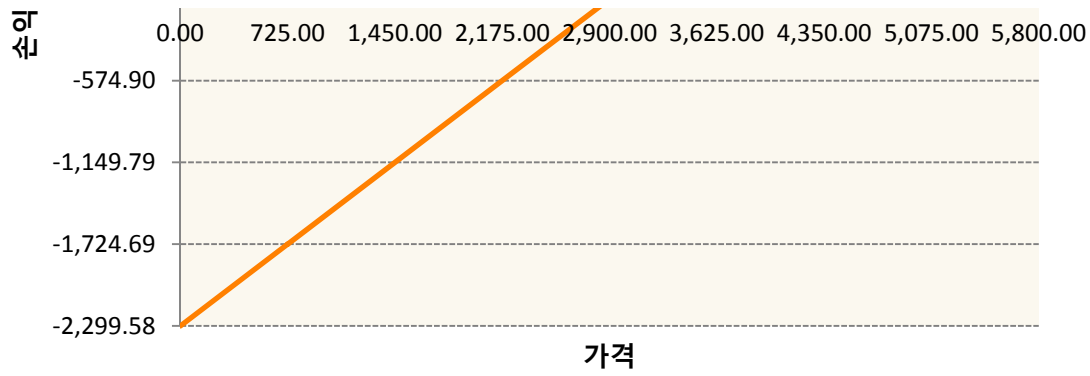


**OESXK0-P2850-EURO STOXX 50**



**OESXK0-P2900-EURO STOXX 50**





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

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	20
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E	214
OESXK0-C28 EURO STOXX 50	54
OESXK0-C29 EURO STOXX 50	184
OESXK0-P28 EURO STOXX 50	54
OESXK0-P29 EURO STOXX 50	184
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20	59

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





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

(단위:백만원)

1,142



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

(단위:백만원)

99

공시일	2020-05-12
기준일	2020-05-11

## ETF스마트레버리지목표전환형10호

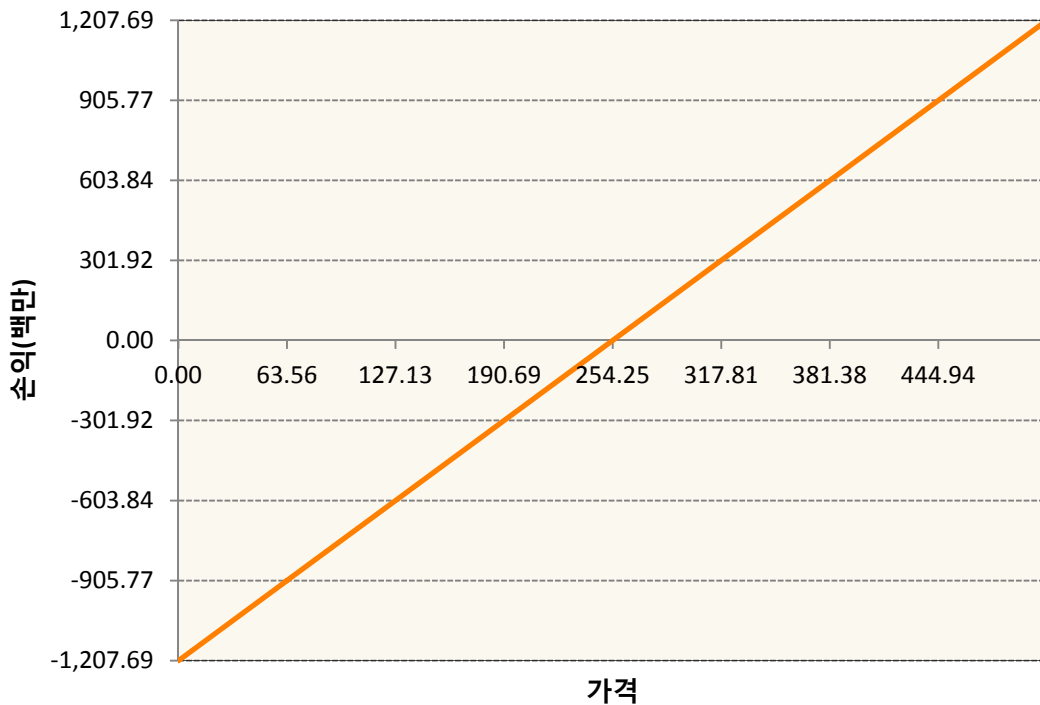
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,208	0	1,208	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	2020-05-12
기준일	2020-05-11

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

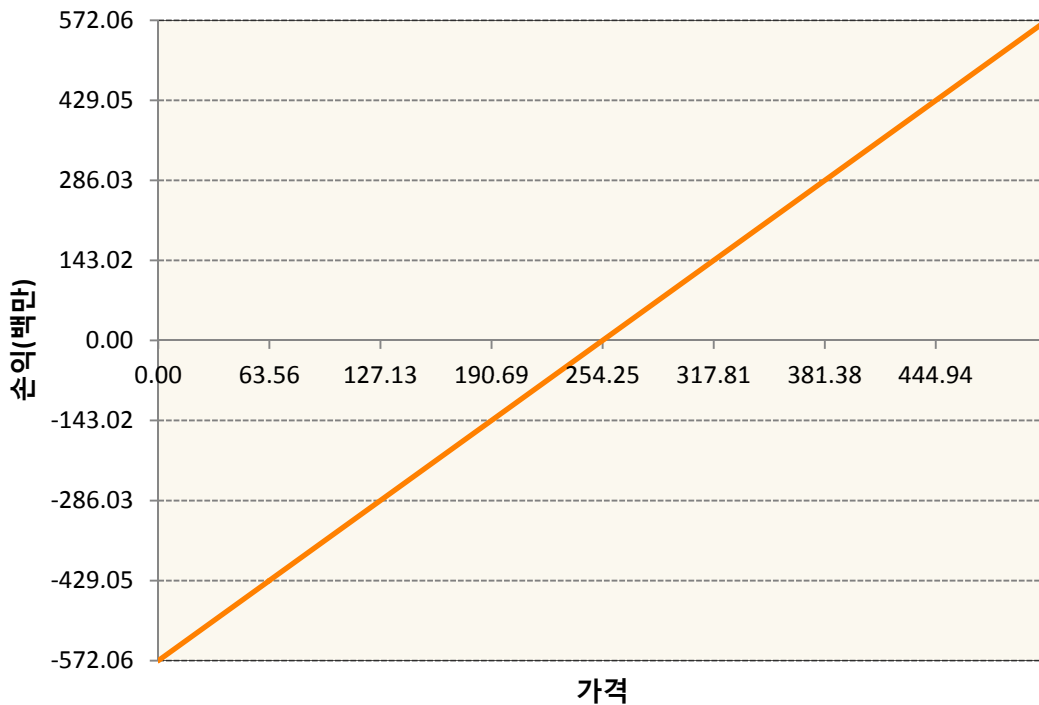
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	572	0	572	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	2020-05-12
기준일	2020-05-11

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

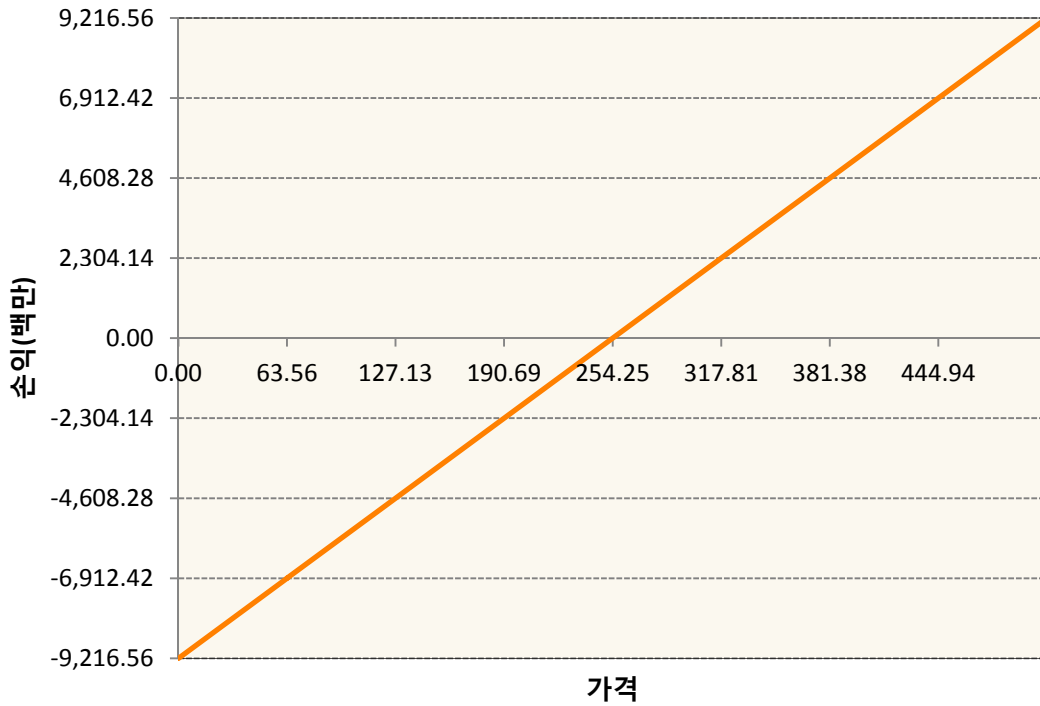
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

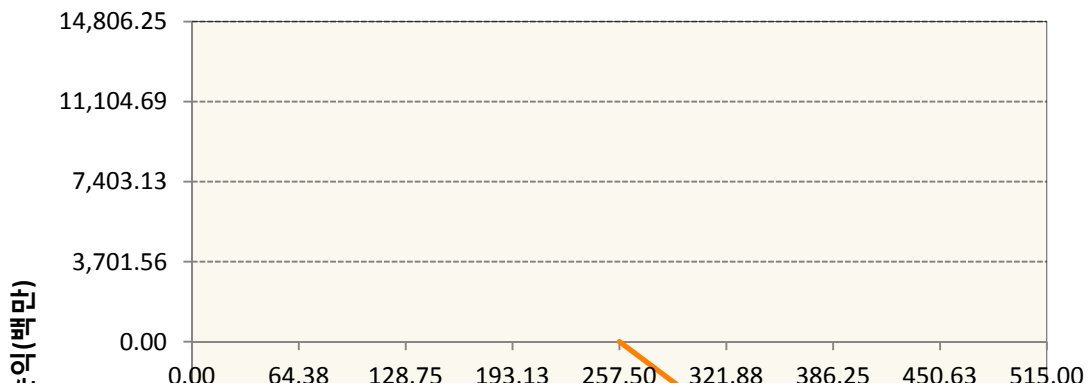
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,217	0	9,217	장내
누계	유가증권	옵션	6,201	17,536	-11,335	장내

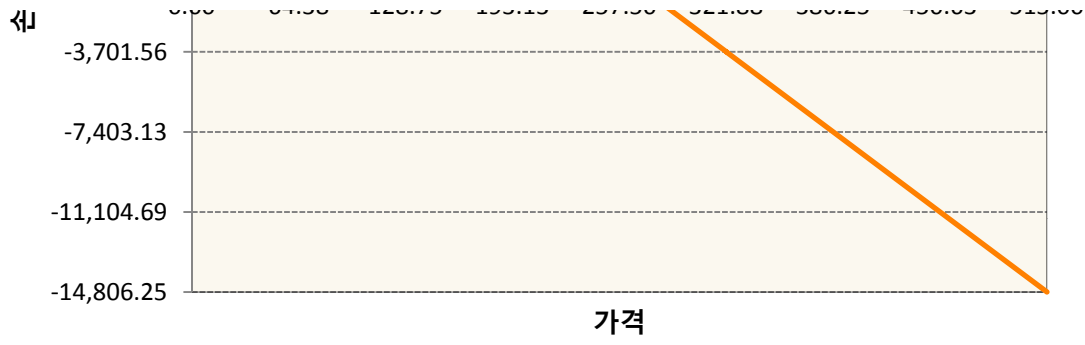
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

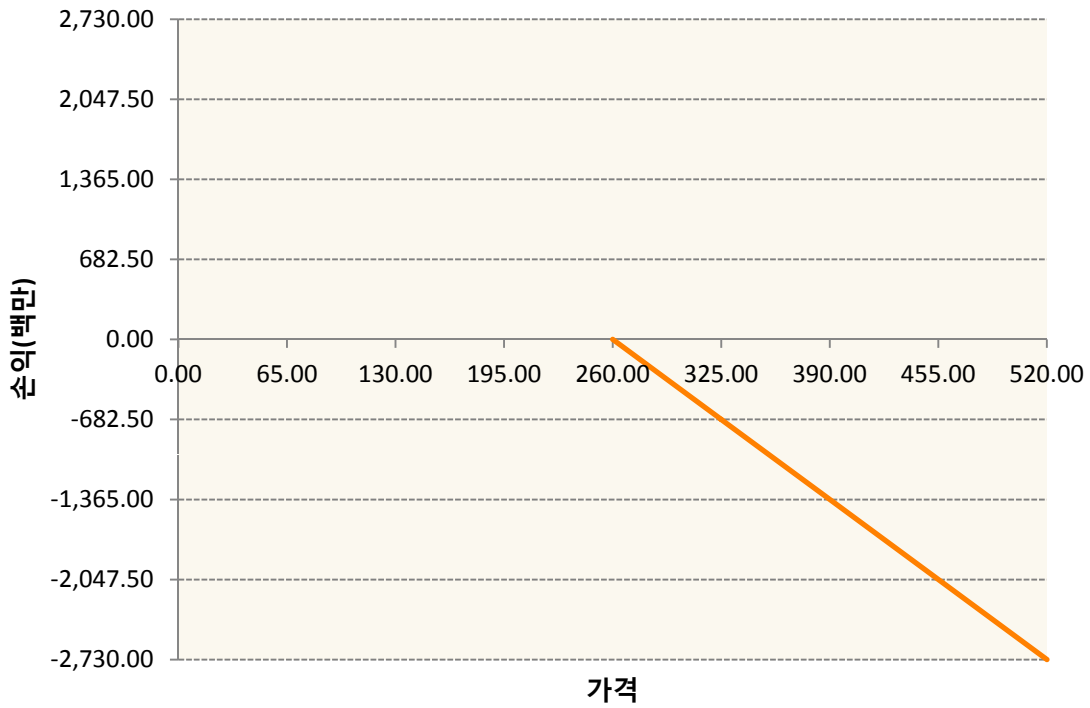


KR4201Q52577-2020-05 콜257.5

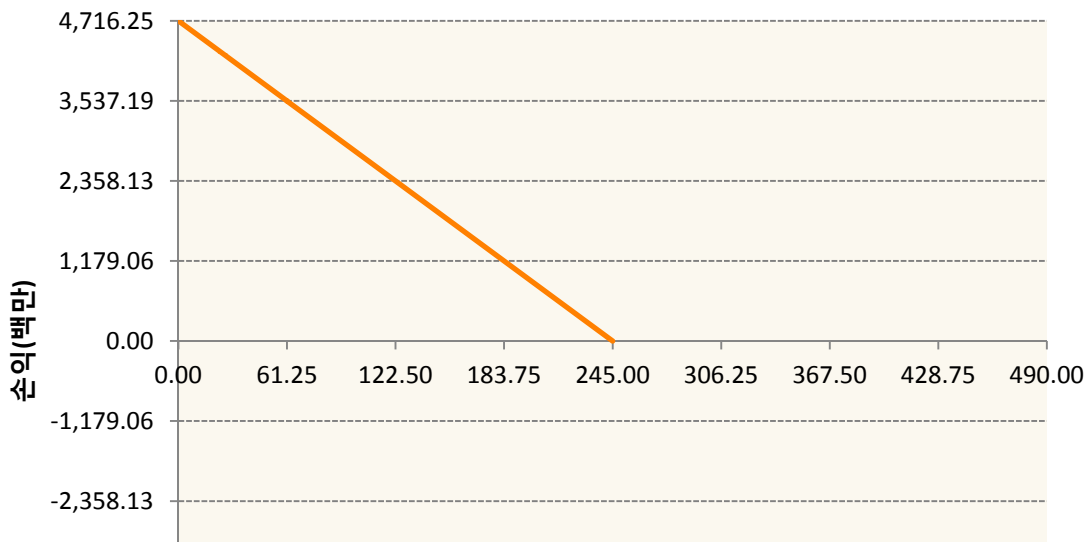


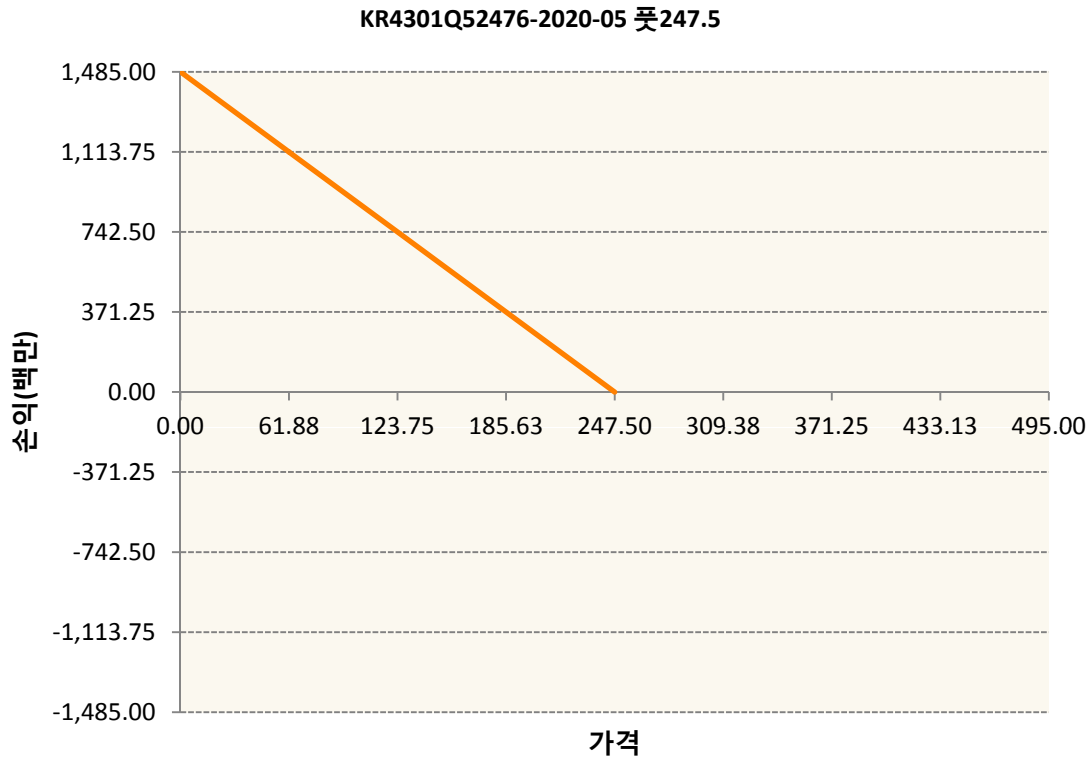
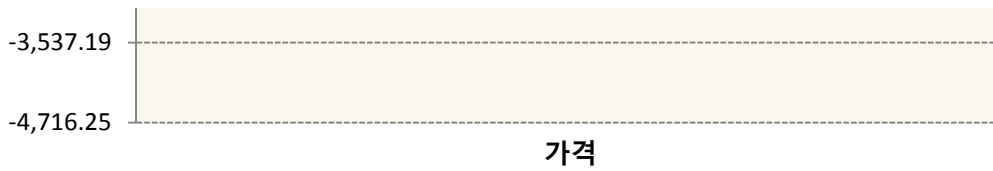


KR4201Q52601-2020-05 콜260



KR4301Q52450-2020-05 풋245





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

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						739
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-739	-739	-739	-739	-739	-739	-739	
-5.33%	-493	-493	-493	-493	-493	-493	-493	
-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%	493	493	493	493	493	493	493	
8.00%	739	739	739	739	739	739	739	
KR4201Q52577		2020-05 콜257.5						885
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	174	174	173	172	170	168	164	
-5.33%	171	169	165	160	154	146	138	
-2.67%	149	139	127	115	101	87	72	

0%	58	39	19	0	-20	-39	-59
2.67%	-155	-173	-192	-210	-229	-248	-268
5.33%	-478	-487	-497	-509	-521	-535	-550
8.00%	-852	-855	-858	-863	-870	-877	-885
KR4201Q52601                      2020-05 콜260							148
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	23	23	22	22	22	22	21
-5.33%	22	22	22	21	20	19	18
-2.67%	20	19	17	16	14	11	9
0%	9	6	3	0	-3	-7	-10
2.67%	-21	-24	-28	-32	-36	-39	-43
5.33%	-73	-76	-78	-81	-84	-87	-90
8.00%	-139	-140	-141	-142	-144	-146	-148
KR4301Q52450                      2020-05 풋245							205
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	198	199	199	200	202	203	205
-5.33%	79	82	86	89	93	97	100
-2.67%	11	15	19	22	26	30	34
0%	-3	-2	-1	0	2	3	5
2.67%	-4	-4	-4	-4	-3	-3	-2
5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
KR4301Q52476                      2020-05 풋247.5							76
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	75	75	75	75	76	76	76
-5.33%	36	36	37	38	39	40	41
-2.67%	7	9	10	11	13	14	15
0%	-2	-1	-1	0	1	2	2
2.67%	-3	-3	-3	-2	-2	-2	-2
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)

**2,227**

공시일	2020-05-12
기준일	2020-05-11

## 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	148,063	0	148,063	

### 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	2020-05-12
기준일	2020-05-11

## 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	99,833	0	99,833	

### 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	2020-05-12
기준일	2020-05-11

## 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	441,077	0	441,077	
누계	통화	선도	0	416,923	-416,923	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,382
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	976
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	840
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	732
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	488
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,417
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,932
FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E	2,929
FX21020J02€ KRW/USD 10-06-20E	1,328
FX21020J02£ KRW/USD 22-06-20E	1,504
FX21020J02¥ KRW/USD 22-06-20E	1,953
FX21020J03¥ KRW/USD 24-07-20E	2,197
FX21020J04¥ KRW/USD 24-07-20E	1,758
FX21020J04¥ KRW/USD 24-07-20E	1,953
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	2,031
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	1,933

IE00BD8RGM75

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

16,857



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

(단위:백만원)

198

공시일	2020-05-12
기준일	2020-05-11

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

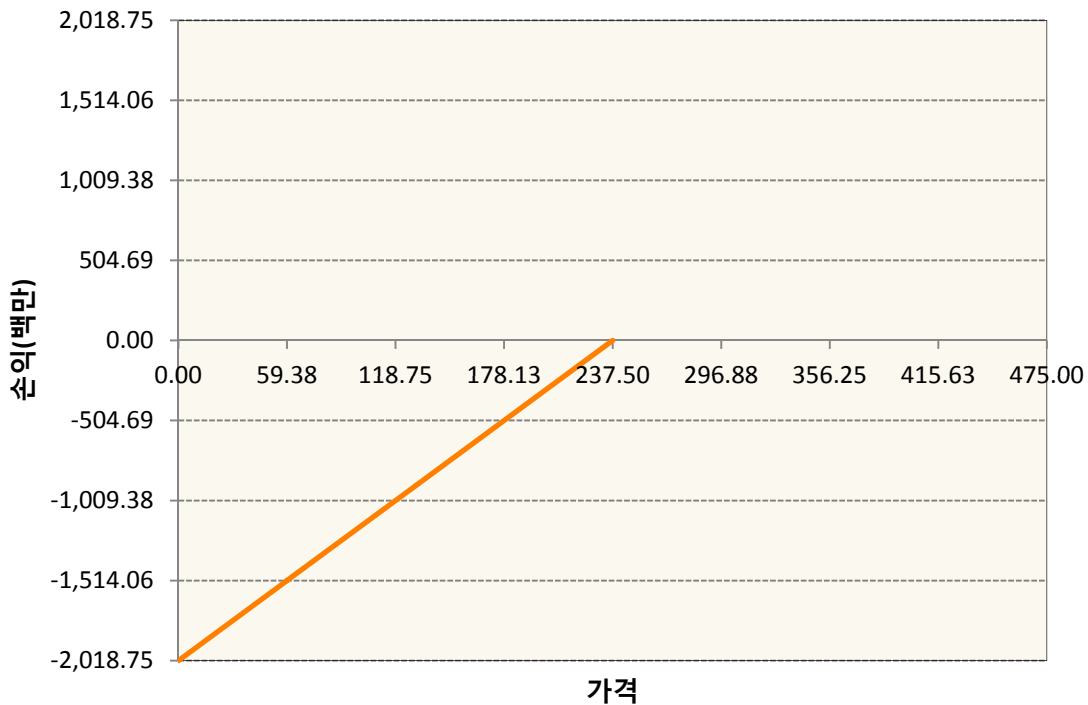
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

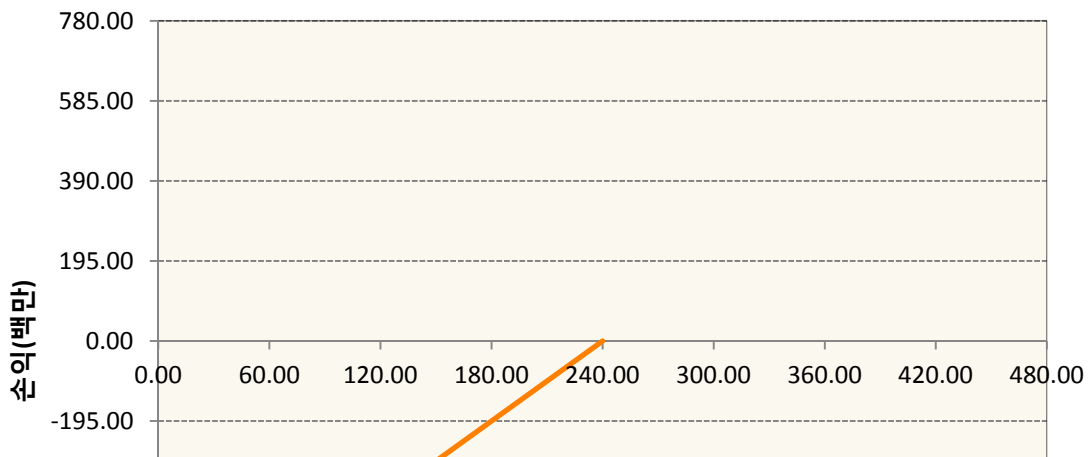
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	119	0	119	장내
누계	유가증권	옵션	0	2,799	-2,799	장내

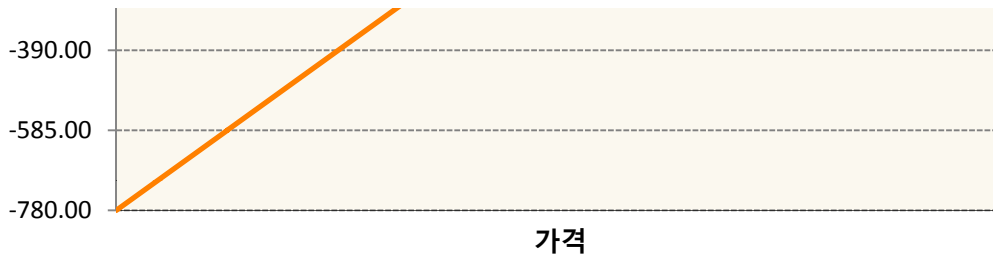
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q52377-2020-05 풋237.5



KR4301Q52401-2020-05 풋240





**3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4301Q52377      2020-05 풋237.5      41

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32	-33	-35	-36	-38	-40	-41
-5.33%	-5	-6	-8	-9	-11	-12	-14
-2.67%	0	0	-1	-1	-2	-2	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

KR4301Q52401      2020-05 풋240      21

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19	-19	-19	-20	-20	-21	-21
-5.33%	-4	-5	-6	-6	-7	-8	-8
-2.67%	0	0	-1	-1	-1	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

14

공시일	2020-05-12
기준일	2020-05-11

## 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	7,270	0	7,270	
누계	통화	선도	0	11,131	-11,131	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J01 KRW/USD 13-05-20E	319
FX21020J04 KRW/USD 29-05-20E	252
FX21020K01 KRW/USD 15-06-20E	319
IE00BD8RGM75	*

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

450

공시일	2020-05-12
기준일	2020-05-11

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

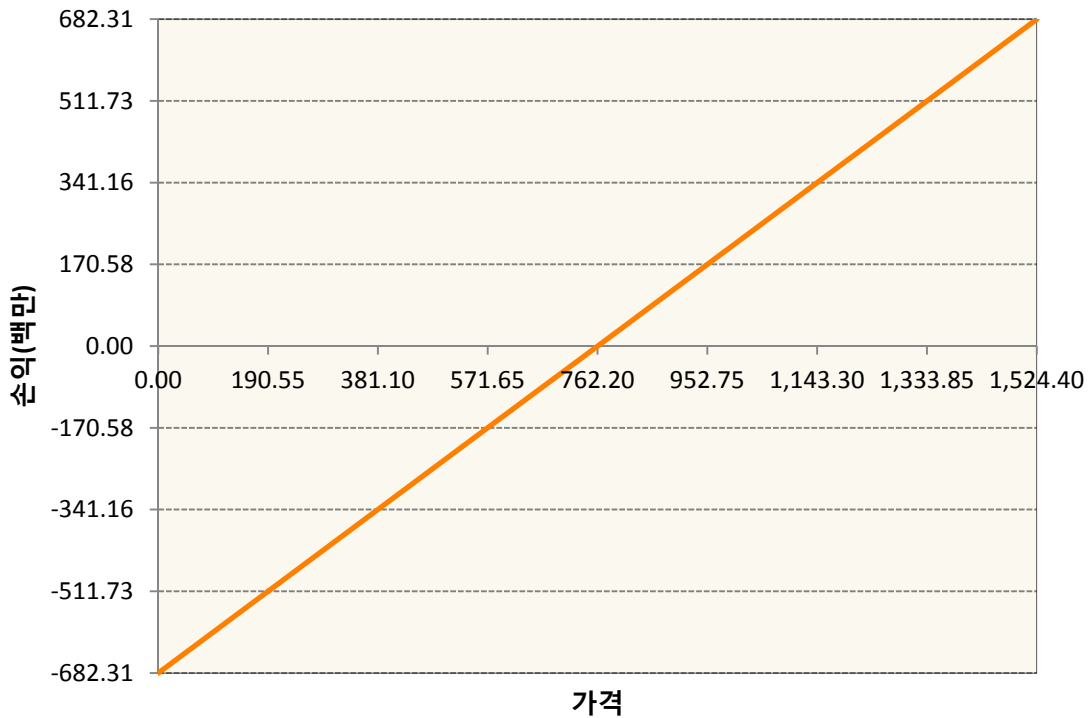
### 1. 계약금액

(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	682	0	682	
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	55

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

(단위:백만원)

**155**

공시일	2020-05-12
기준일	2020-05-11

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

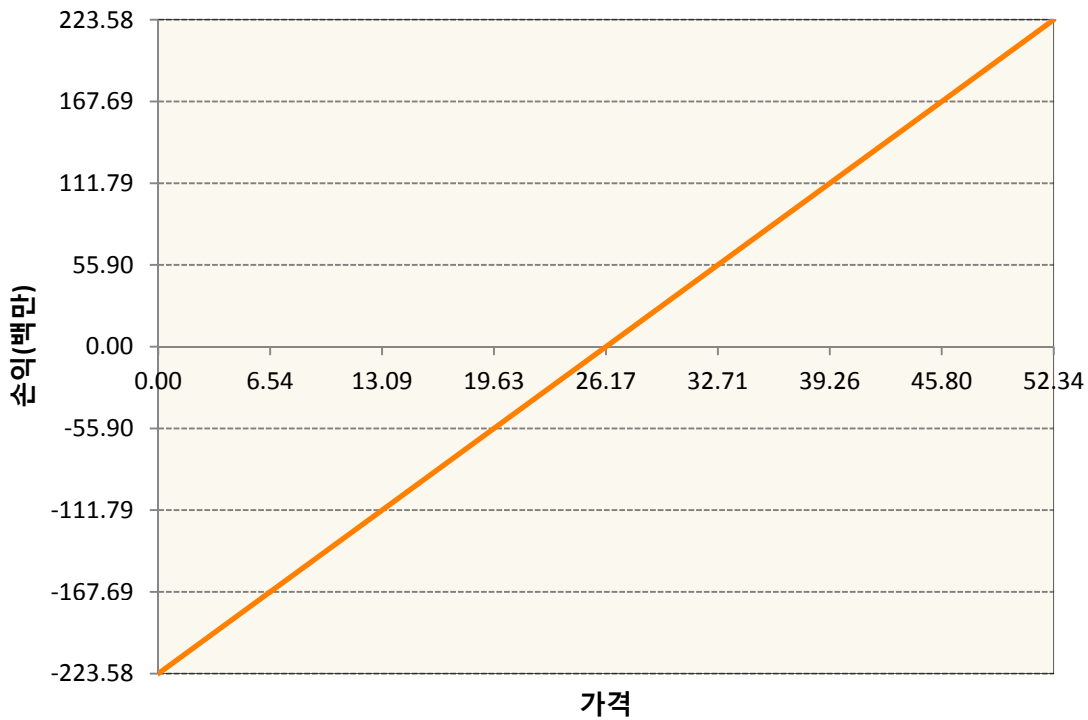
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

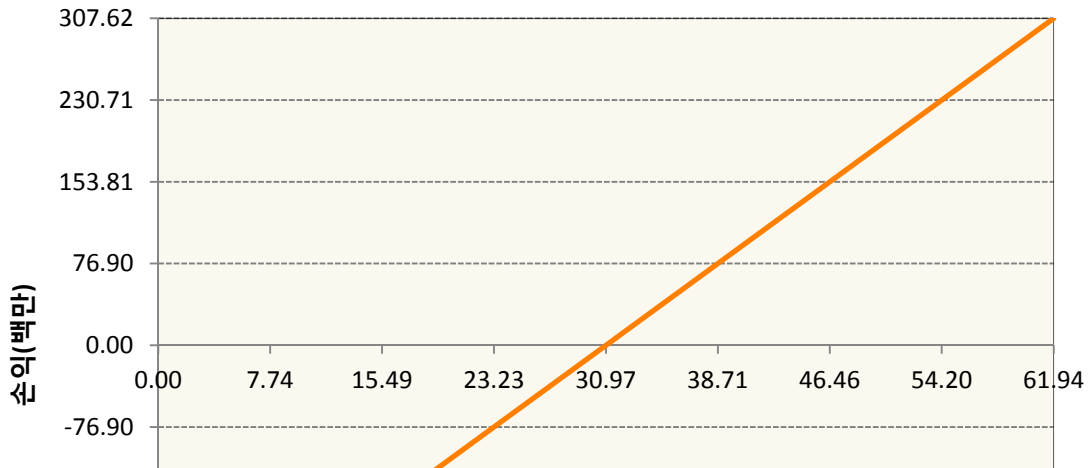
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,593	244	1,349	

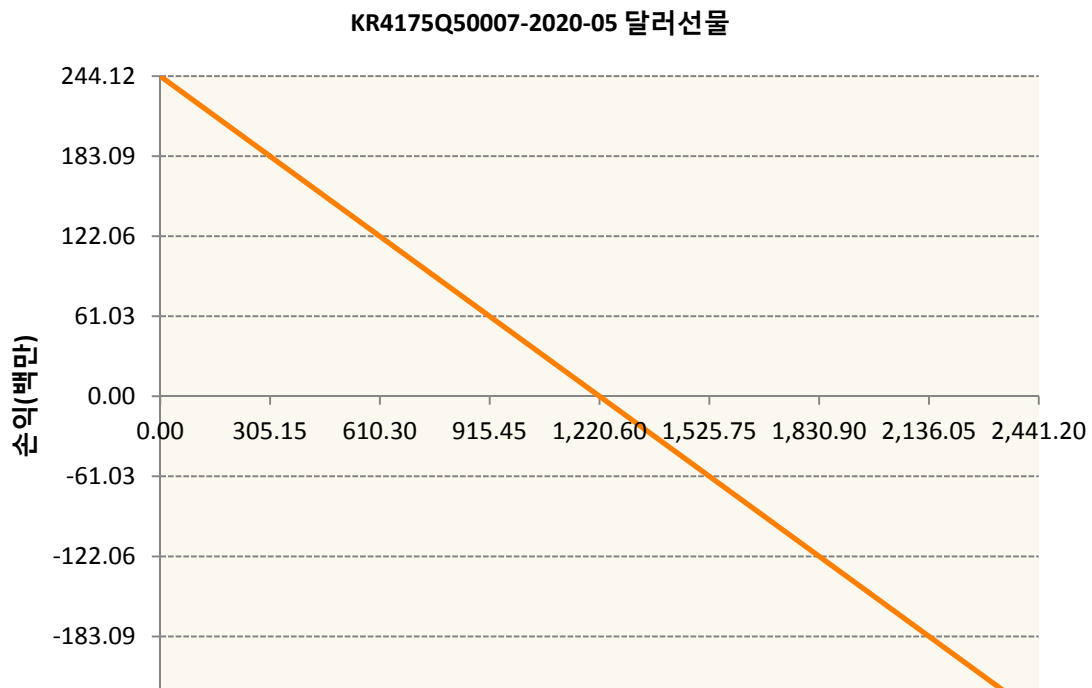
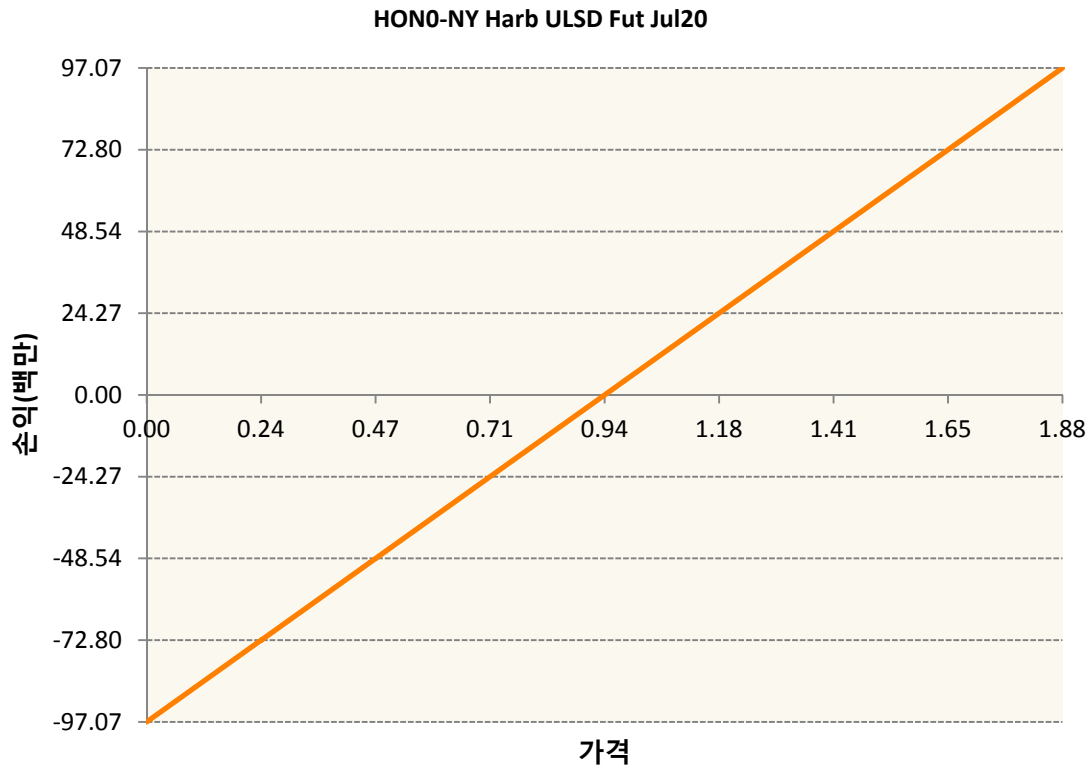
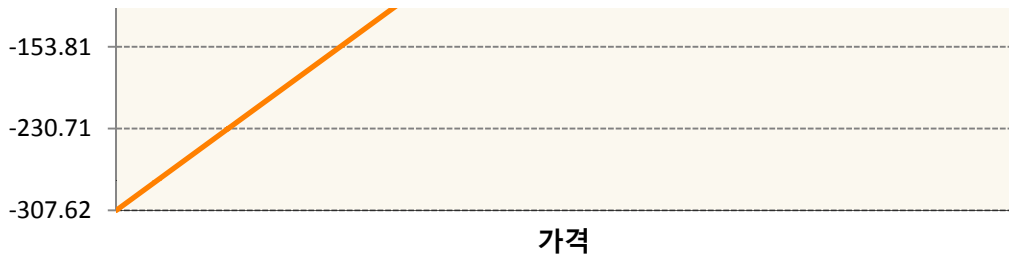
### 2. 만기시점의 손익구조

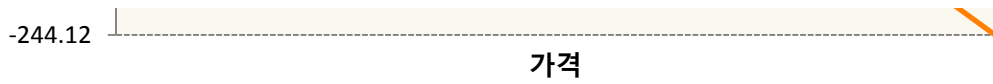
**CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20**



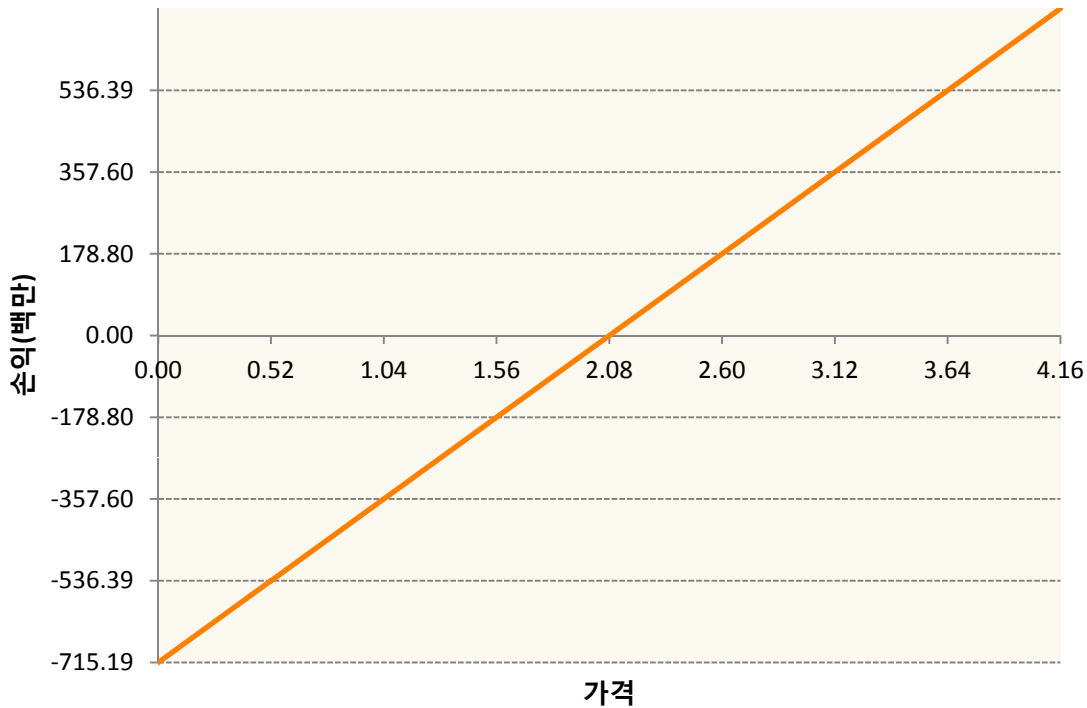
**CON0-BRENT CRUDE FUTR Jul20**



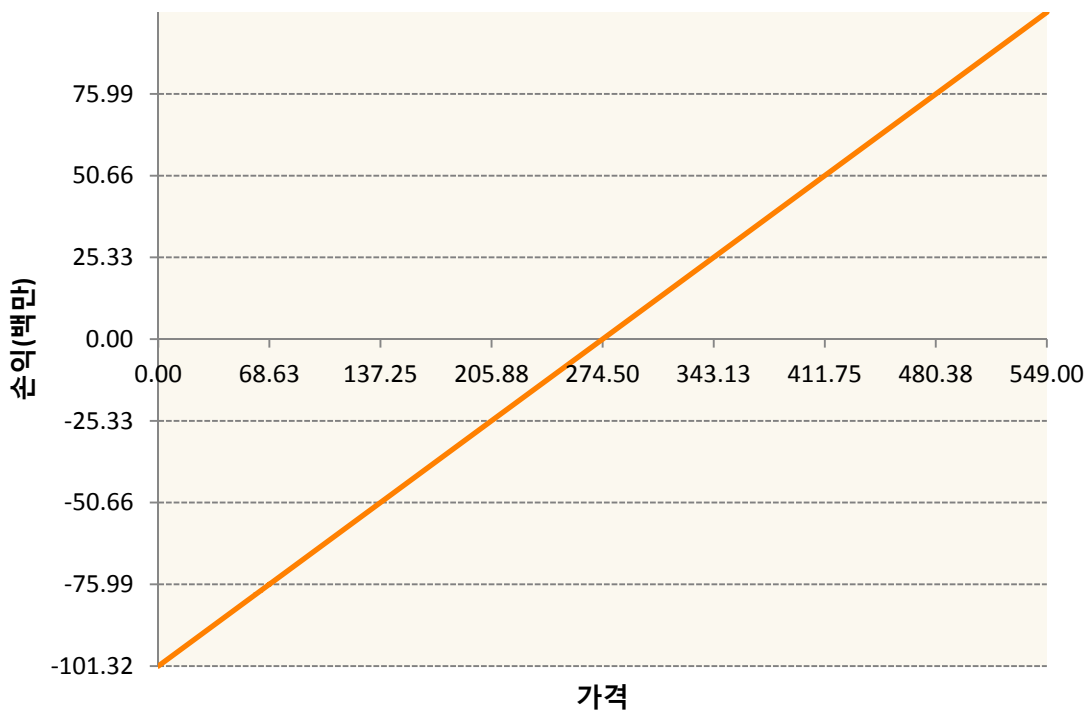




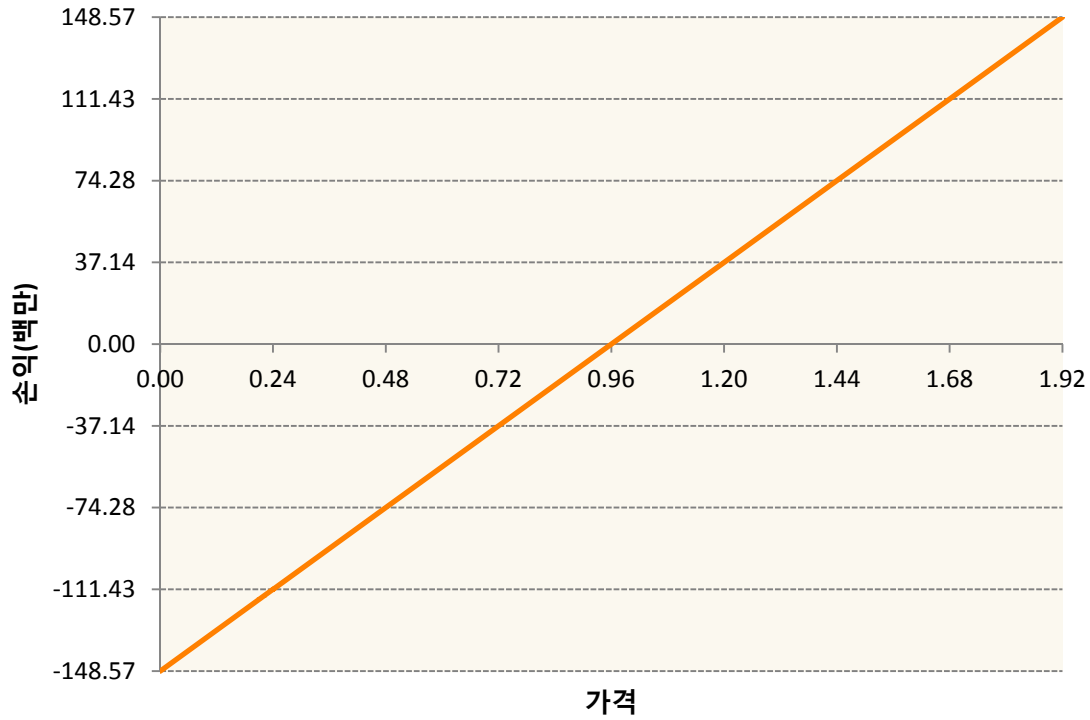
NGN20-NATURAL GAS FUTR Jul20



QSN0-Low Su Gasoil G Jul20



XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN0	WTI CRUDE FUTURE Jul20	18
CON0	BRENT CRUDE FUTR Jul20	25
HON0	NY Harb ULSD Fut Jul20	8
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)

648

공시일	2020-05-12
기준일	2020-05-11

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

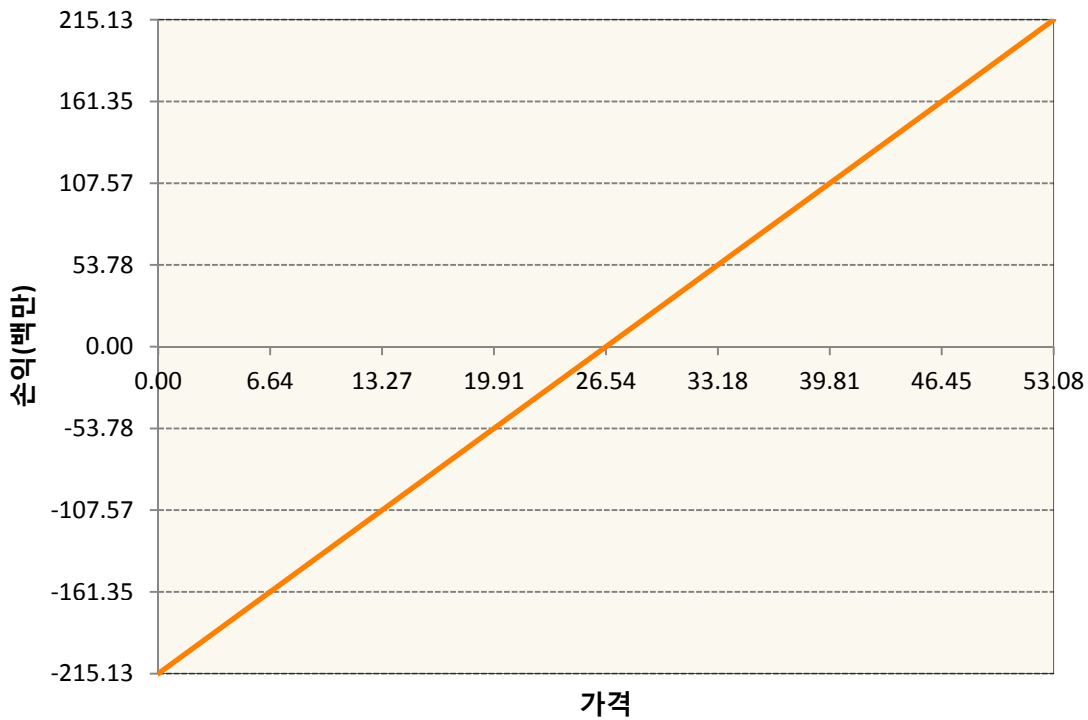
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

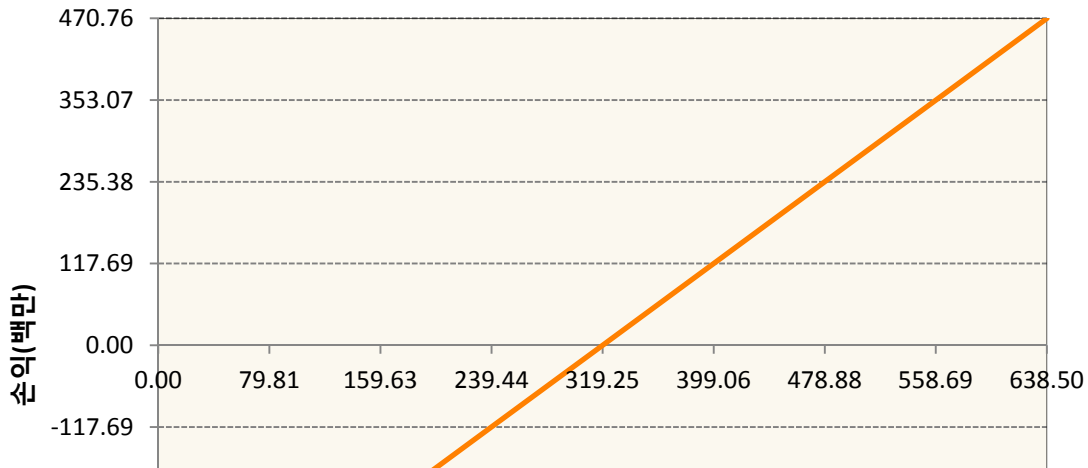
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,419	73	2,345	

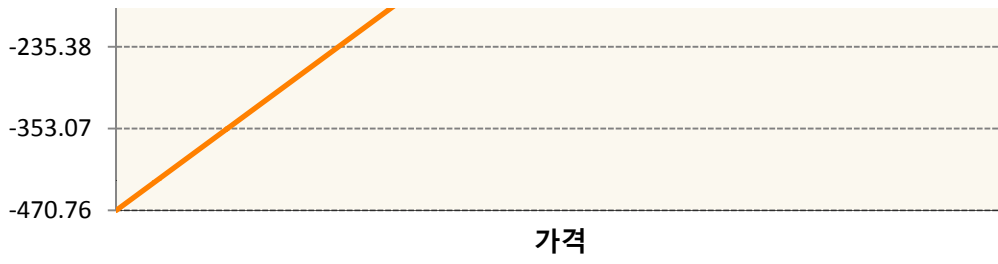
### 2. 만기시점의 손익구조

**BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20**

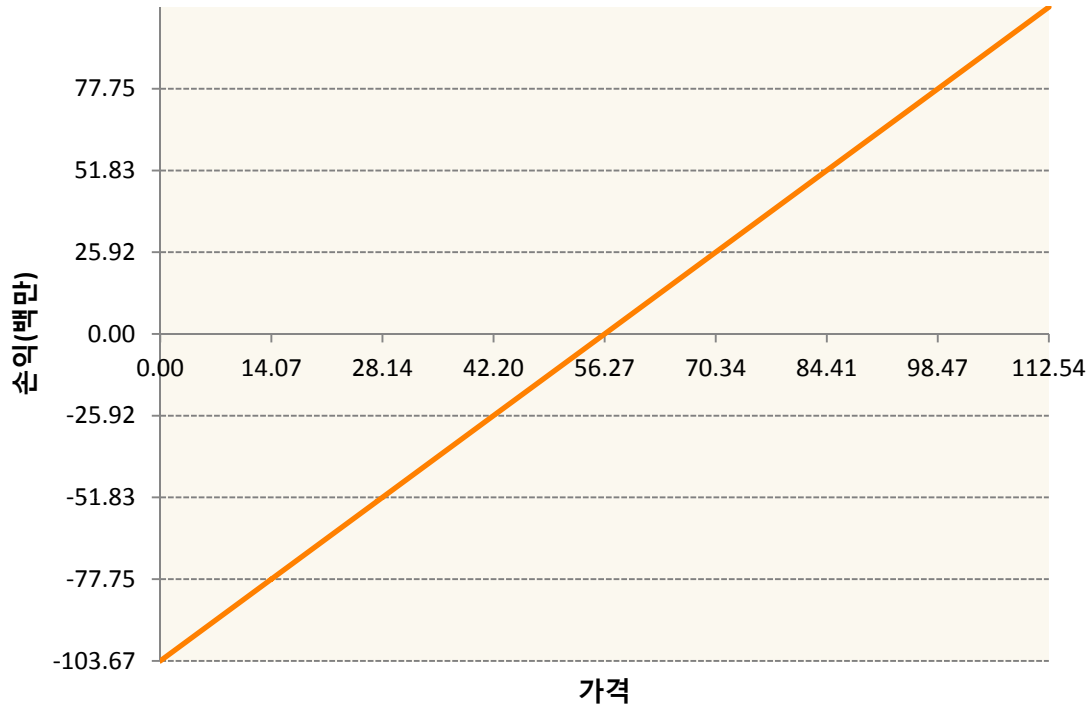


**CNO-CORN FUTURE Jul20**

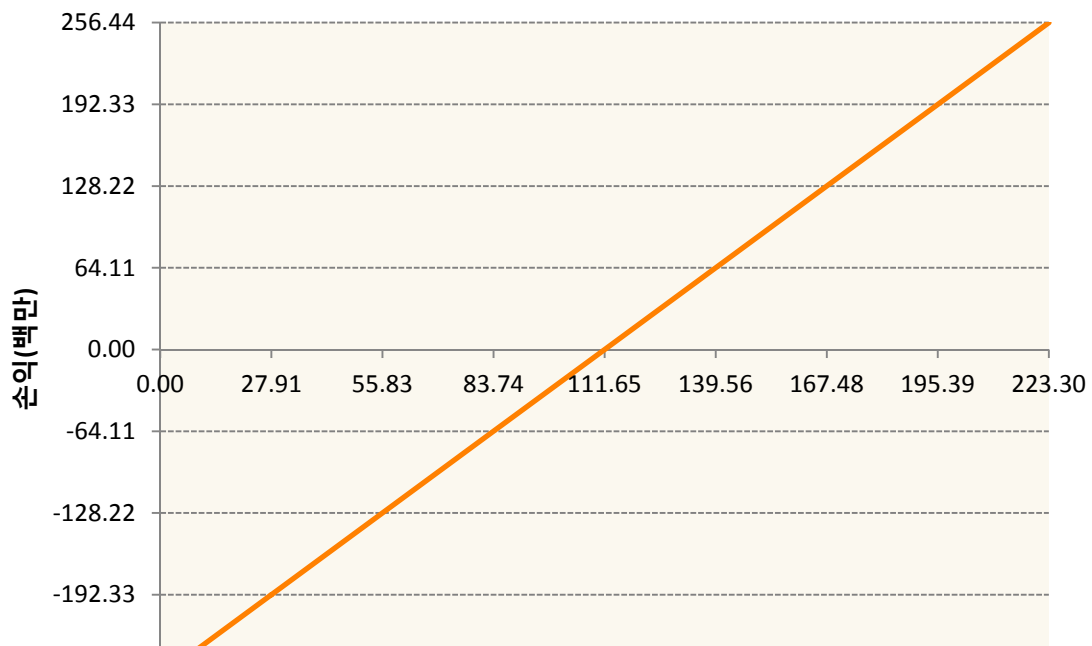


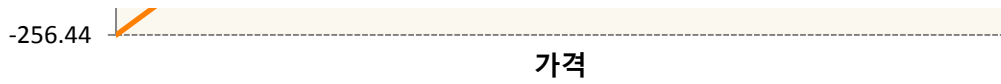


CTN0-COTTON NO.2 FUTR Jul20

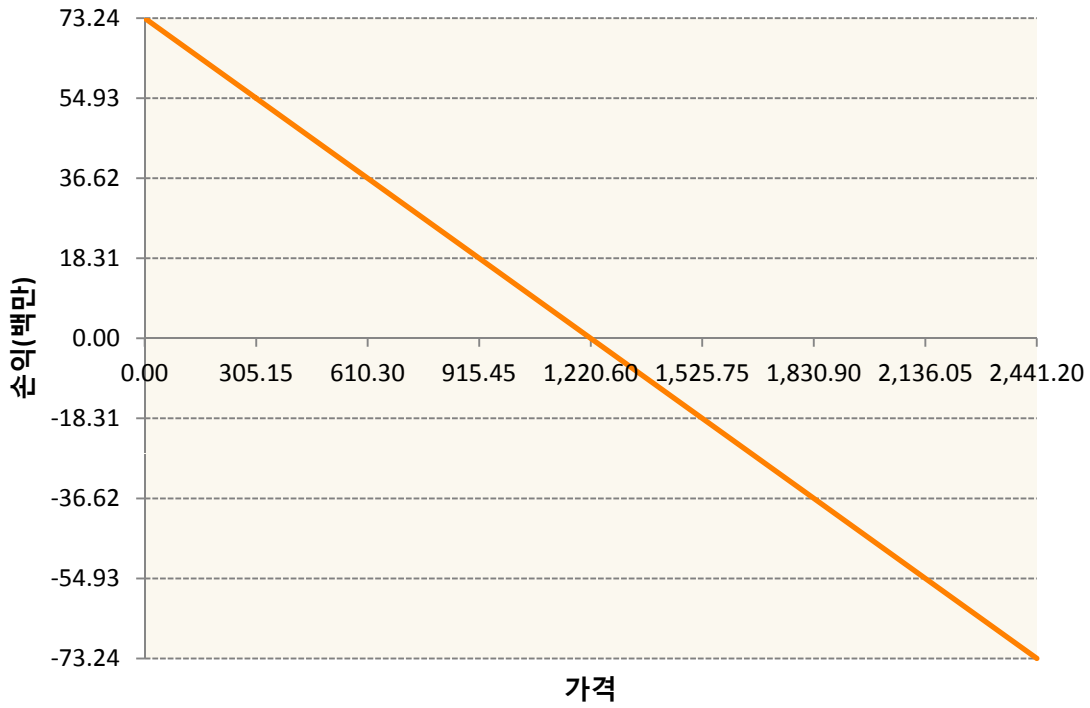


KCN0-COFFEE 'C' FUTURE Jul20

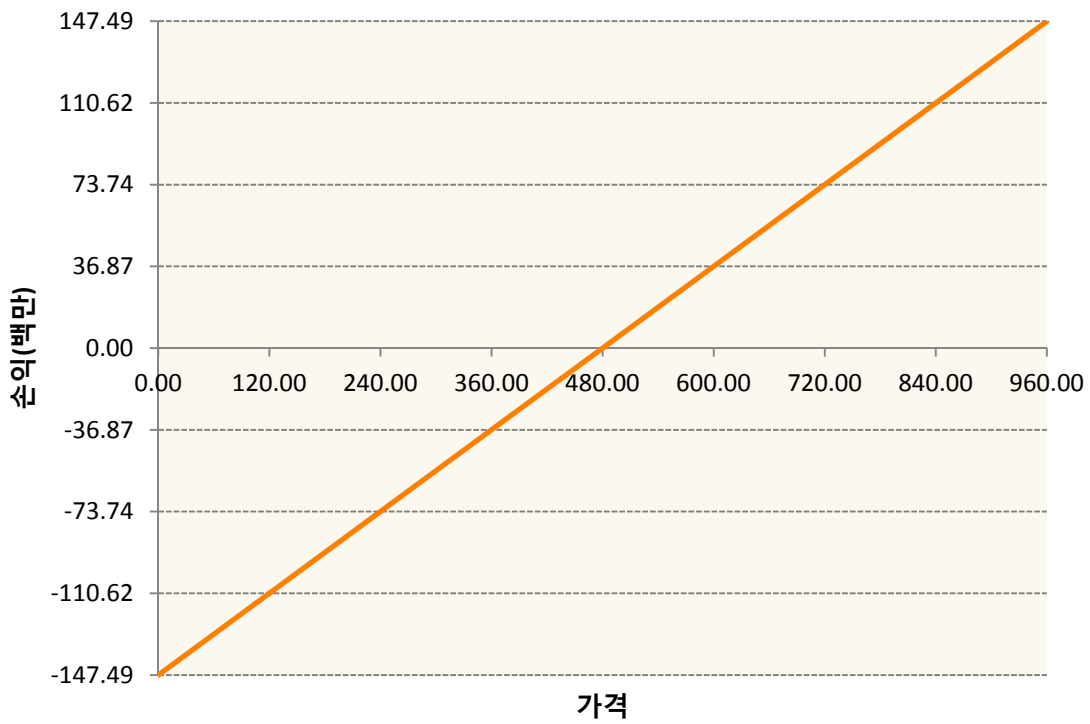




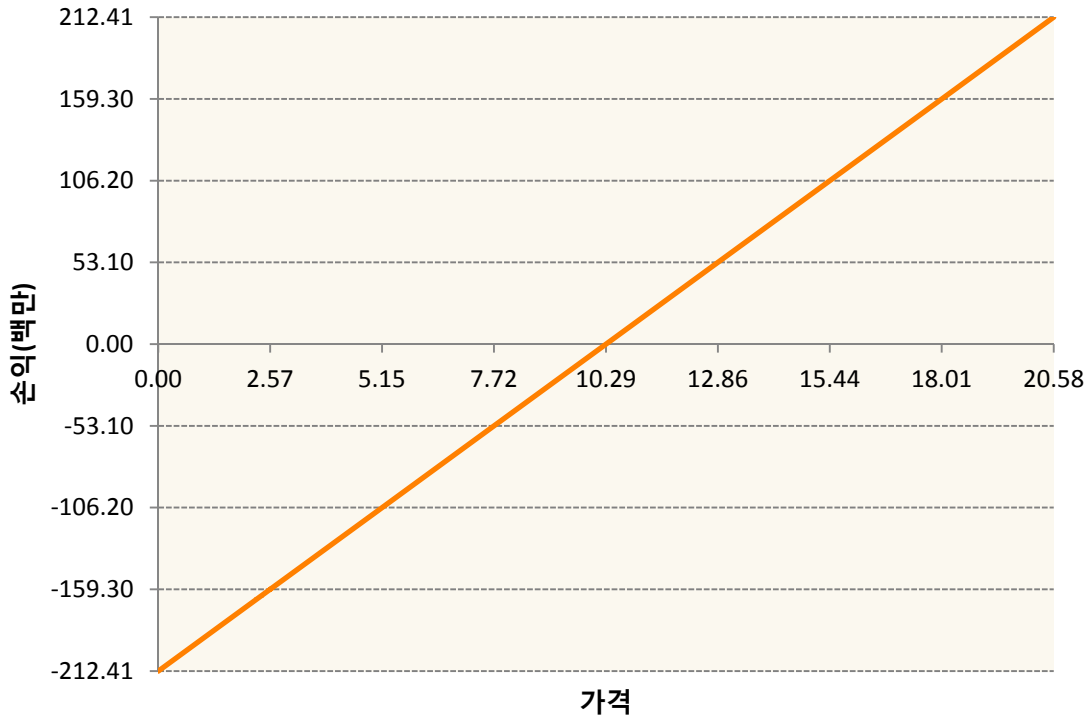
KR4175Q50007-2020-05 달러선물



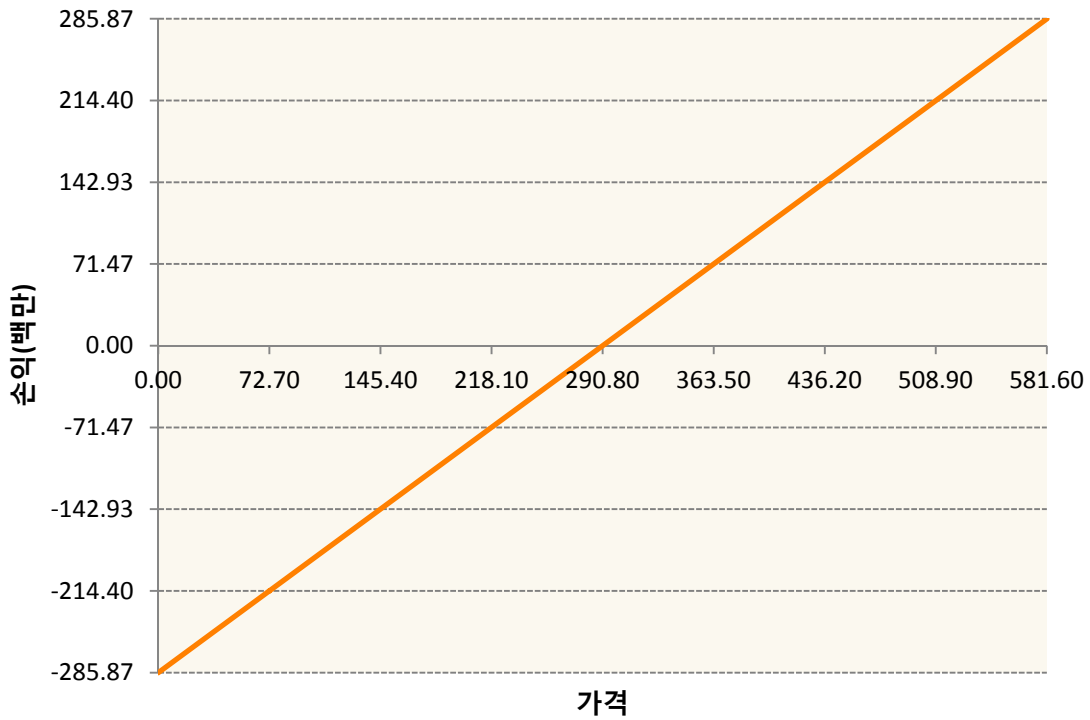
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



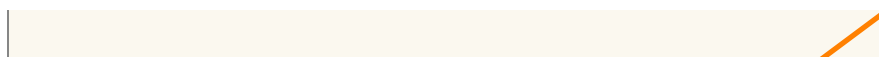
SBN0-Sugar Jul20

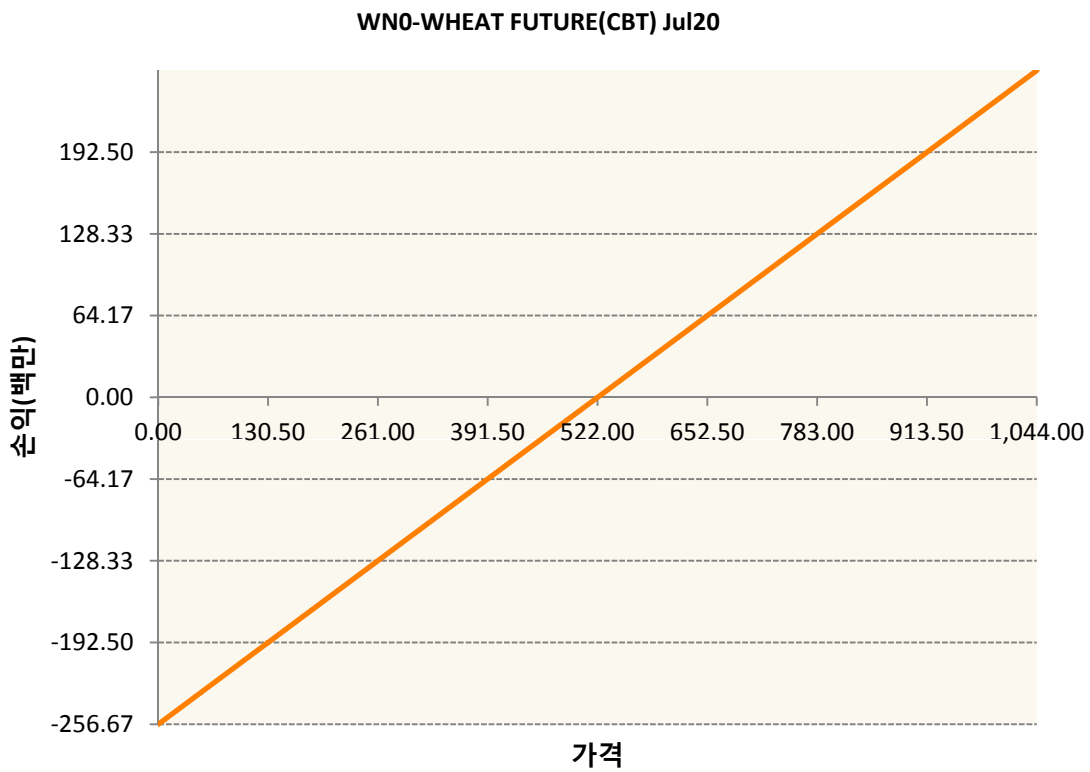
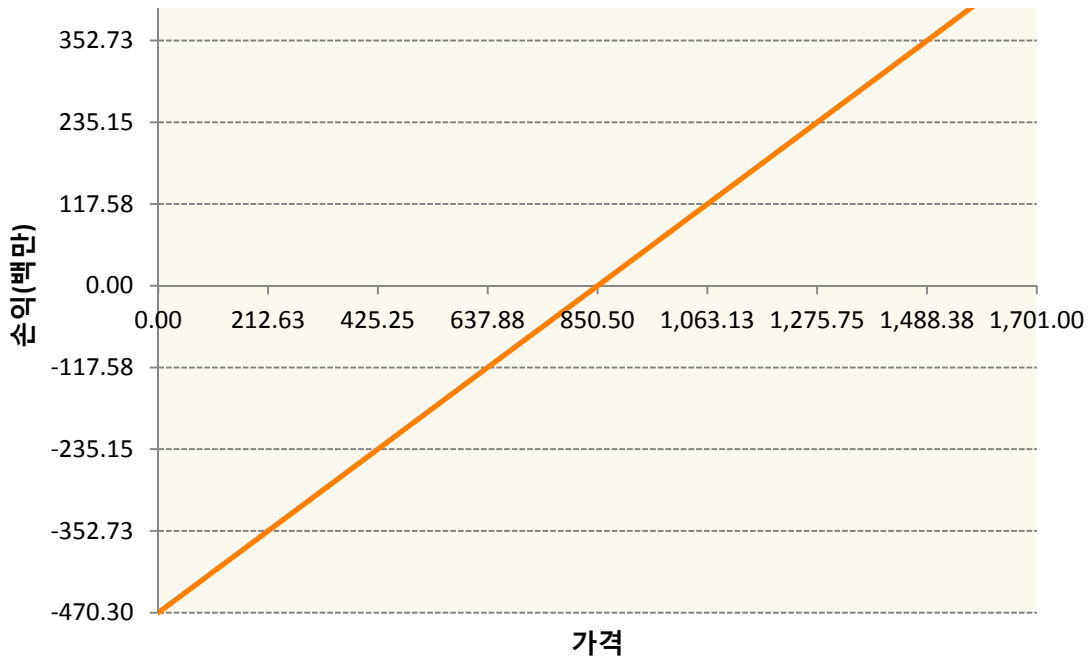


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20



SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BON0	SOYBEAN OIL FUTR Jul20	17
CN0	CORN FUTURE Jul20	38
CTN0	COTTON NO.2 FUTR Jul20	8
KCN0	COFFEE 'C' FUTURE Jul20	21
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	38
WN0	WHEAT FUTURE(CBT) Jul20	21

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

(단위:백만원)

**230**