

공시일	2020-05-14
기준일	2020-05-13

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	2020-05-14
기준일	2020-05-13

스마트인덱스모

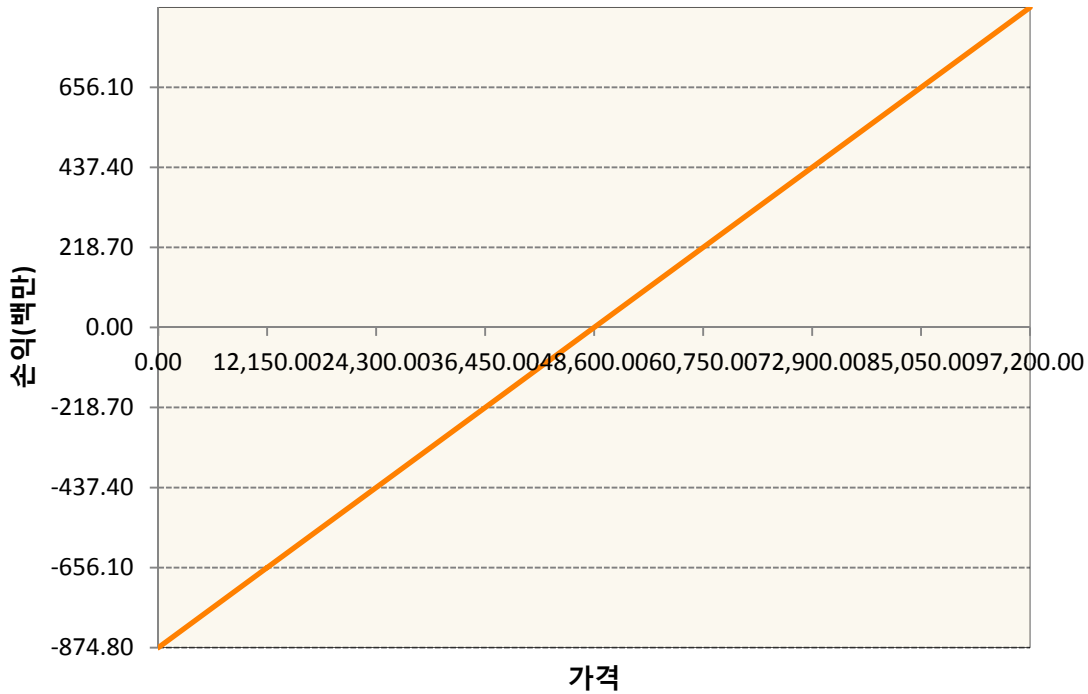
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	875	0	875	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111Q50002-2020-05 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

105

공시일	2020-05-14
기준일	2020-05-13

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

980

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,144

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-14
기준일	2020-05-13

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

576

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

870

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-14
기준일	2020-05-13

유로인덱스모(주식-파생형)

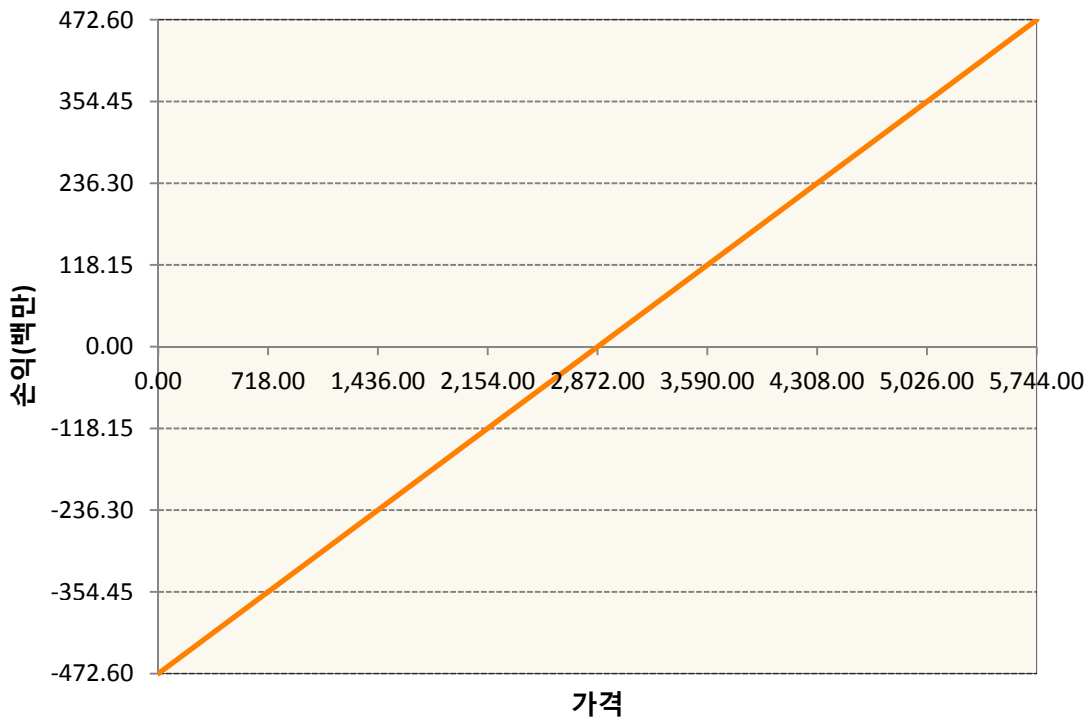
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	473	0	473	

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	2020-05-14
기준일	2020-05-13

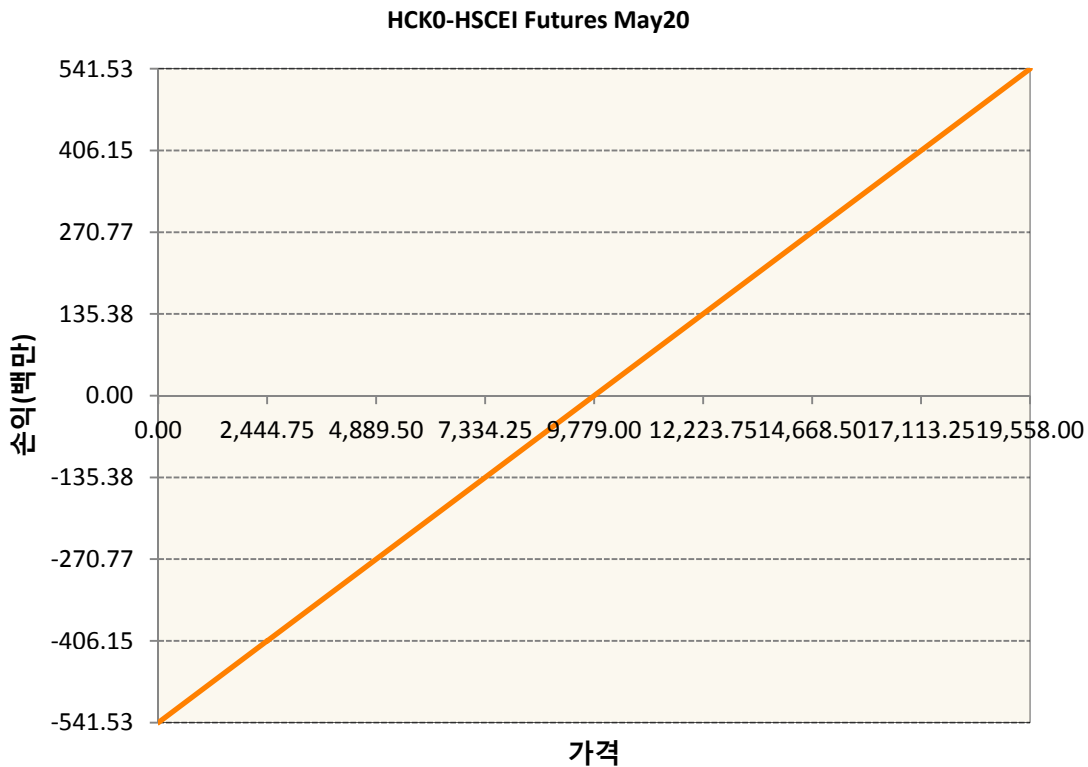
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	542	0	542	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

47

공시일	2020-05-14
기준일	2020-05-13

커버드콜모(주식혼합-파생형)

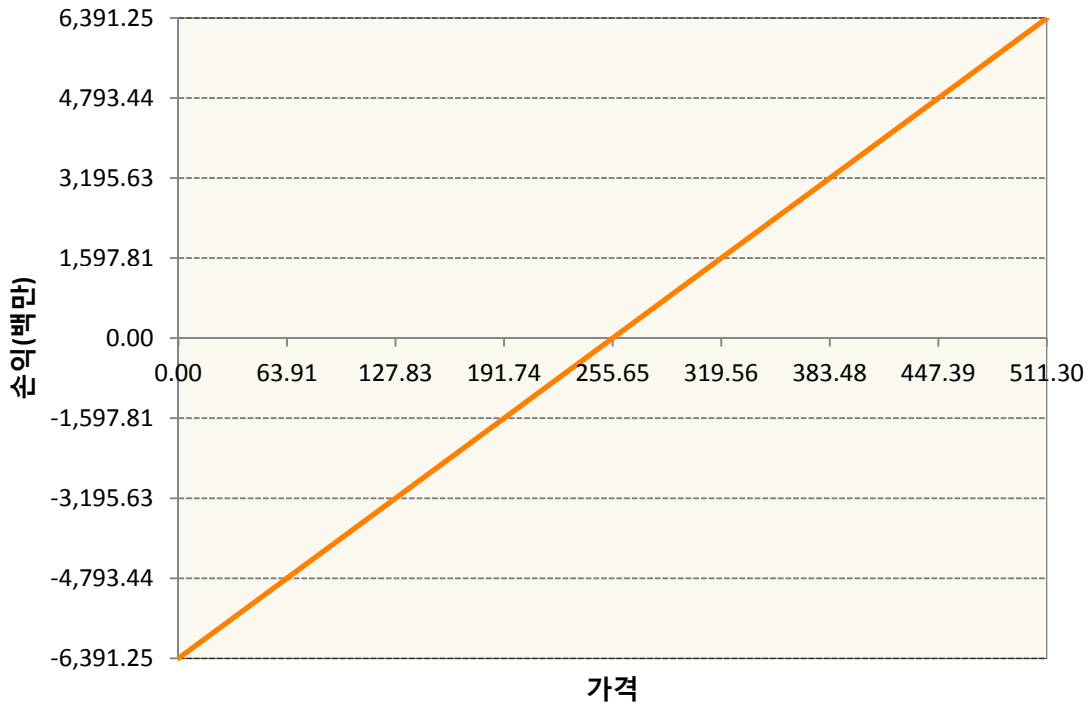
1. 계약금액

(단위:백만원)

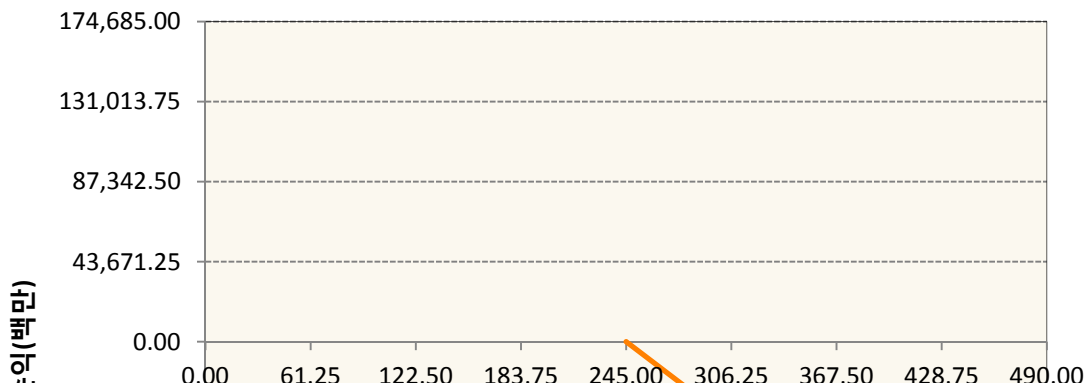
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	30,189	32,408	-2,219	장내
누계	유가증권	선물	6,391	0	6,391	장내
누계	유가증권	옵션	0	352,255	-352,255	장내

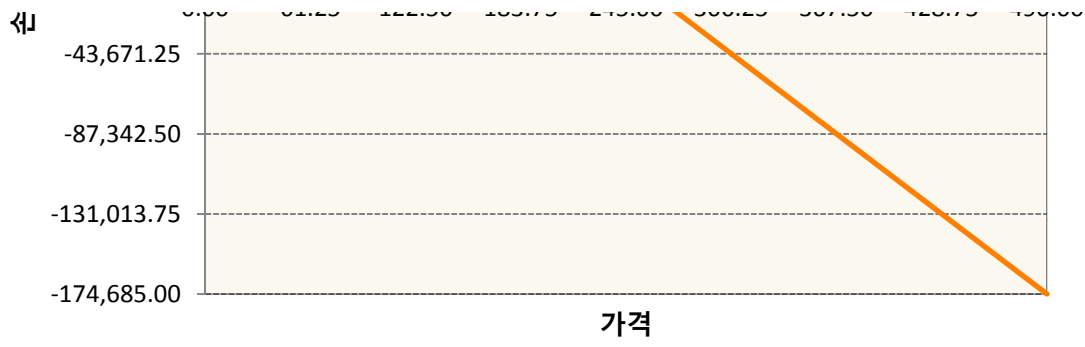
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

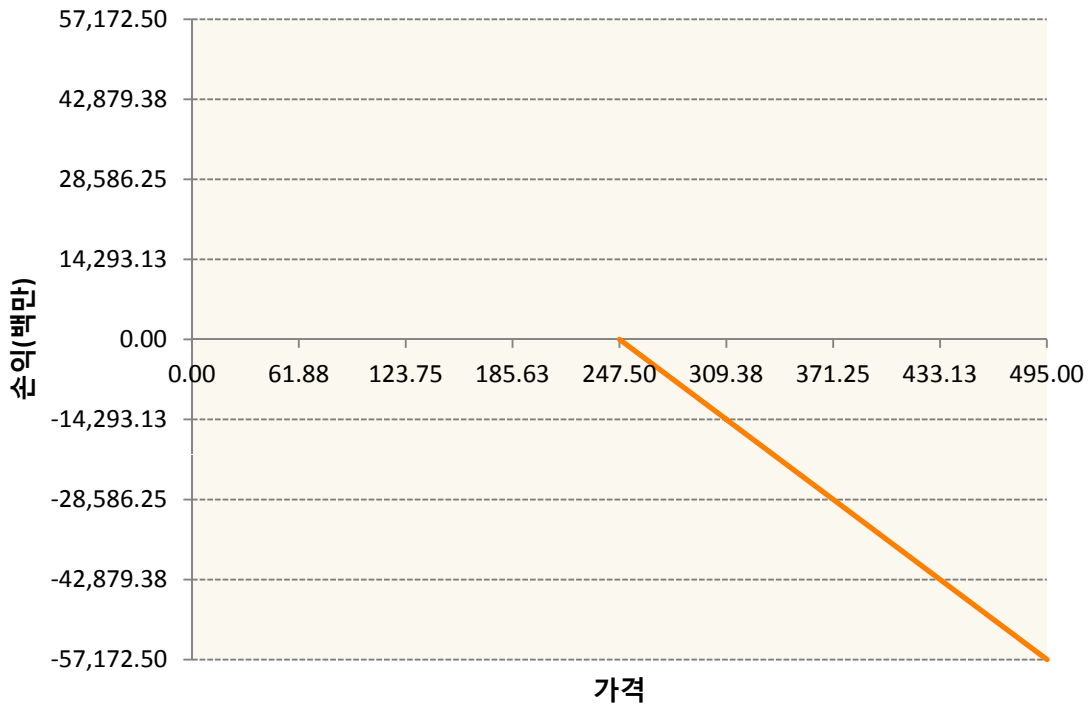


KR4201Q52452-2020-05 콜245

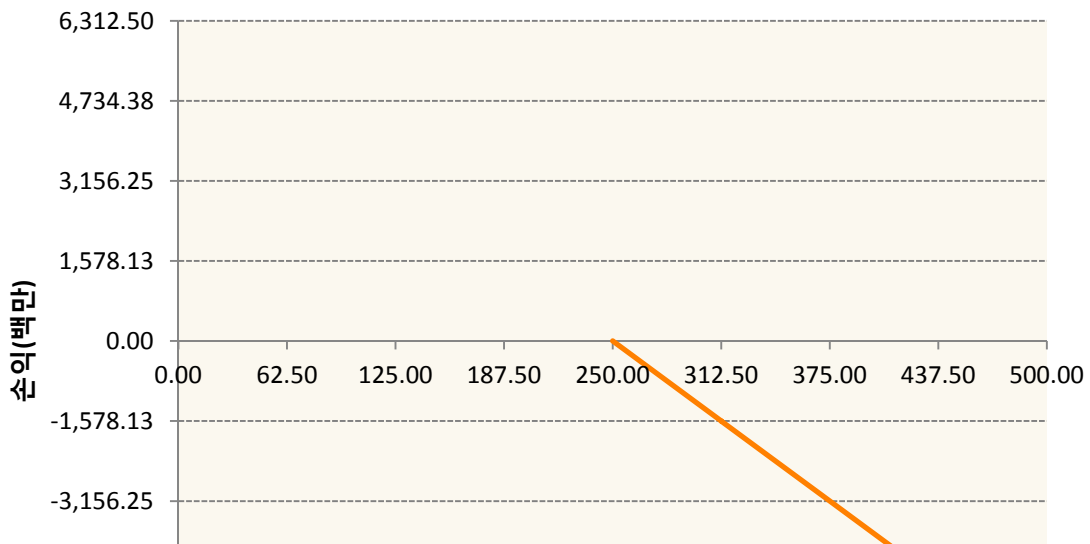


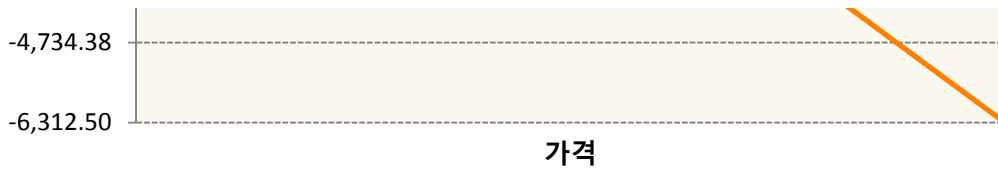


KR4201Q52478-2020-05 콜247.5

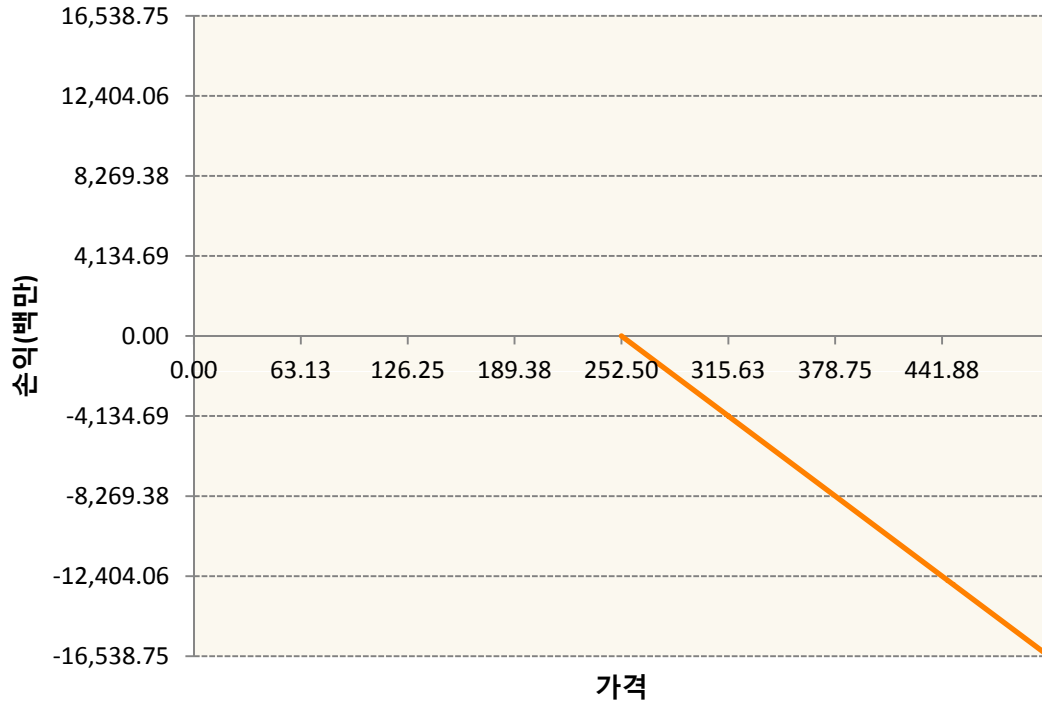


KR4201Q62501-2020-06 콜250

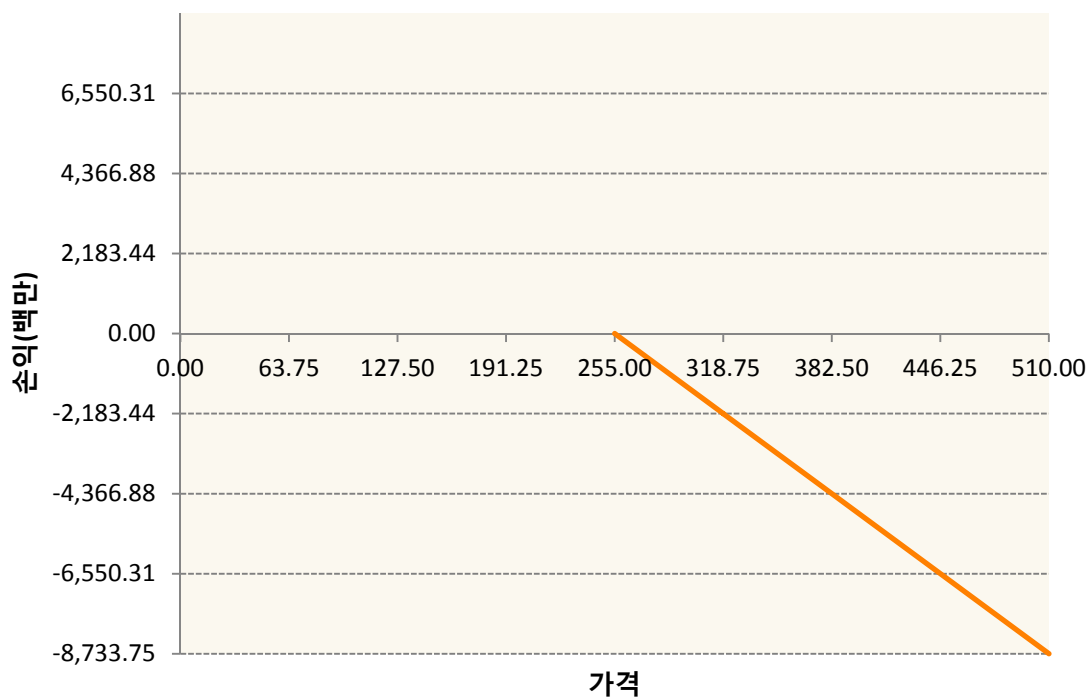




KR4201Q62527-2020-06 콜252.5



KR4201Q62550-2020-06 콜255



KR4201Q52478 2020-05 콜247.5 4,683

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,970	1,970	1,968	1,964	1,960	1,953	1,945
-5.33%	1,922	1,901	1,877	1,850	1,821	1,791	1,759
-2.67%	1,376	1,335	1,293	1,251	1,208	1,166	1,123
0%	34	26	14	0	-17	-37	-59
2.67%	-1,531	-1,531	-1,532	-1,533	-1,535	-1,538	-1,543
5.33%	-3,107	-3,107	-3,107	-3,107	-3,107	-3,107	-3,108
8.00%	-4,683	-4,683	-4,683	-4,683	-4,683	-4,683	-4,683

KR4201Q62501 2020-06 콜250 428

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	303	282	261	239	216	194	171
-5.33%	248	223	199	174	150	125	100
-2.67%	172	146	121	95	69	43	17
0%	77	52	26	0	-26	-52	-78
2.67%	-37	-60	-85	-109	-134	-159	-184
5.33%	-167	-187	-209	-231	-254	-277	-301
8.00%	-311	-327	-345	-364	-385	-406	-428

KR4201Q62527 2020-06 콜252.5 1,082

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	736	686	633	578	522	464	406
-5.33%	609	548	486	424	361	298	234
-2.67%	432	365	299	232	165	98	30
0%	204	136	68	0	-68	-136	-204
2.67%	-74	-138	-203	-269	-336	-402	-469
5.33%	-397	-453	-513	-573	-635	-699	-763
8.00%	-756	-803	-854	-908	-964	-1,022	-1,082

KR4201Q62550 2020-06 콜255 550

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	359	334	308	281	253	224	194
-5.33%	300	270	239	207	175	143	110
-2.67%	217	183	148	114	79	44	9
0%	108	72	36	0	-36	-72	-108
2.67%	-28	-63	-98	-134	-169	-205	-241
5.33%	-188	-220	-253	-286	-320	-354	-388
8.00%	-369	-396	-425	-455	-486	-518	-550

KR4301Q52450 2020-05 풋245 3,496

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,490	-3,490	-3,490	-3,491	-3,492	-3,493	-3,496

-5.33%	-1,081	-1,105	-1,131	-1,160	-1,190	-1,221	-1,254
-2.67%	-24	-38	-56	-76	-98	-122	-149
0%	0	0	0	0	-1	-1	-3
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)

24,411

공시일	2020-05-14
기준일	2020-05-13

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

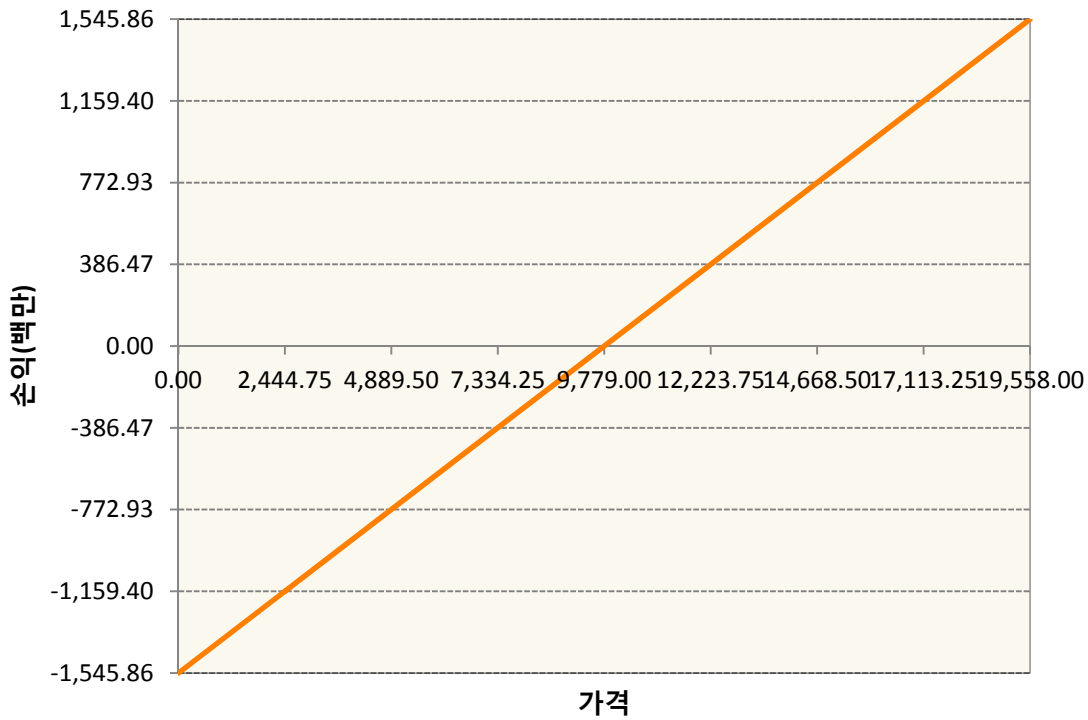
1. 계약금액

(단위:백만원)

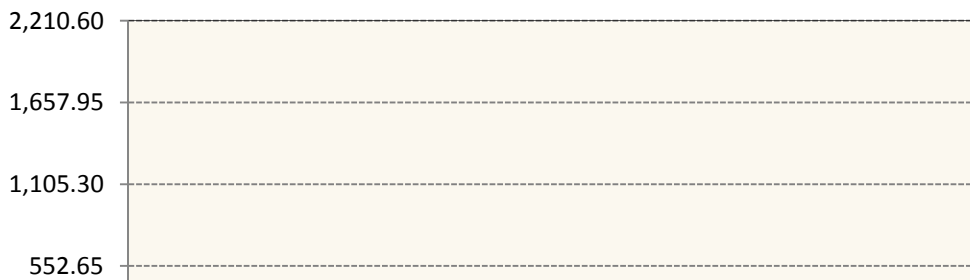
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,546	0	1,546	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,421	-4,421	장내
누계	통화	선도	695	2,223	-1,528	장외

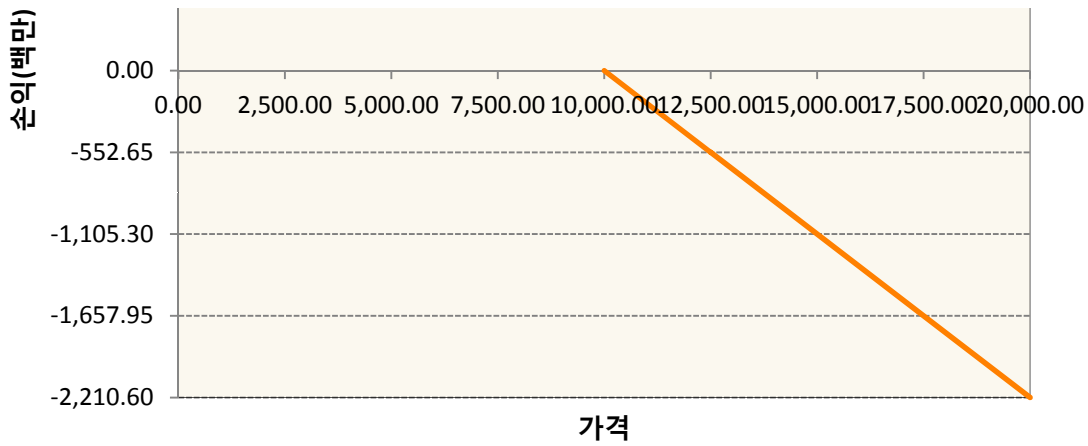
2. 만기시점의 손익구조

HCK0-HSCEI Futures May20

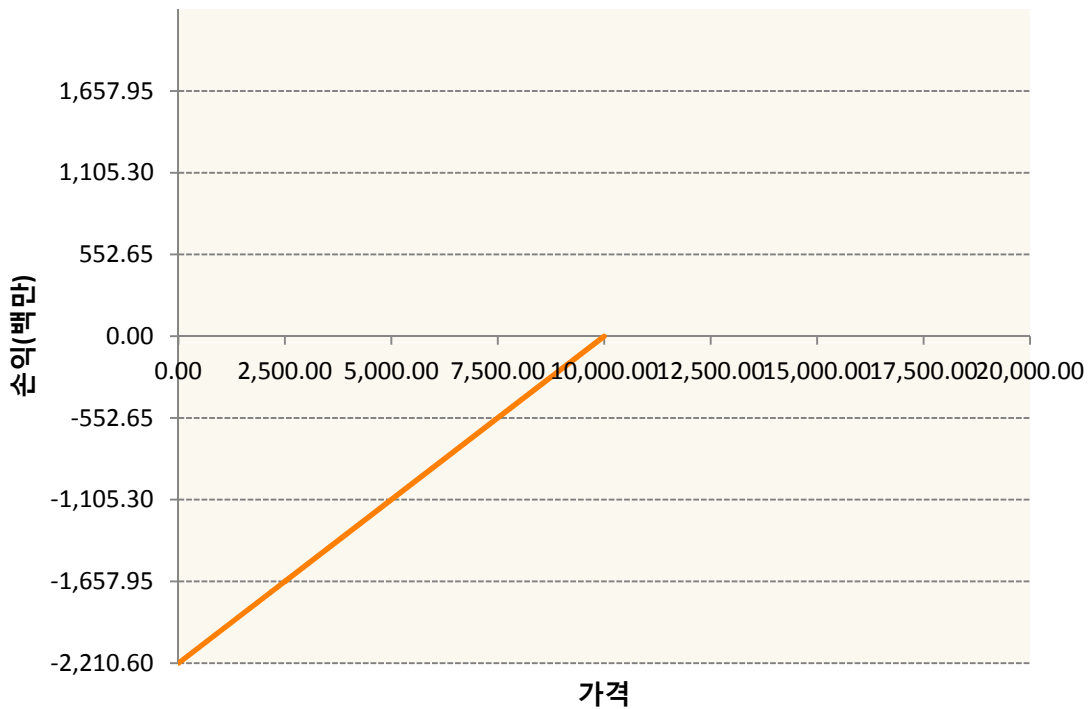


OHHIK0-C100-HSCEI





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	124
OHHIK0-C1C HSCEI	177
OHHIK0-P10 HSCEI	177

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

(단위:백만원)

634

공시일	2020-05-14
기준일	2020-05-13

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

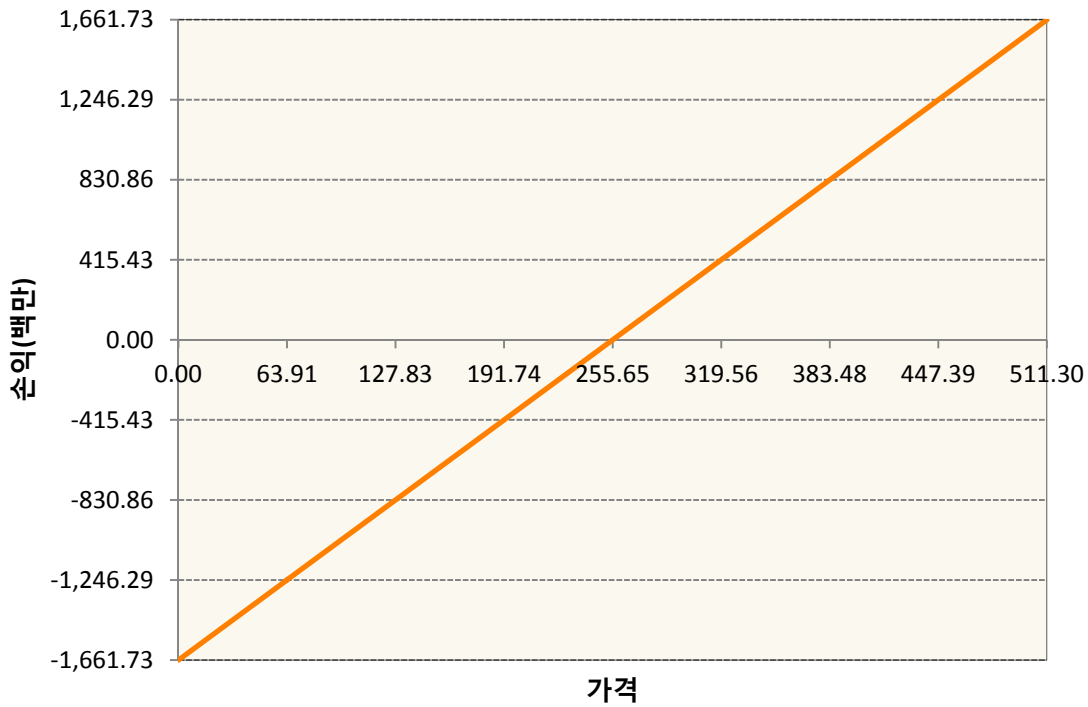
1. 계약금액

(단위:백만원)

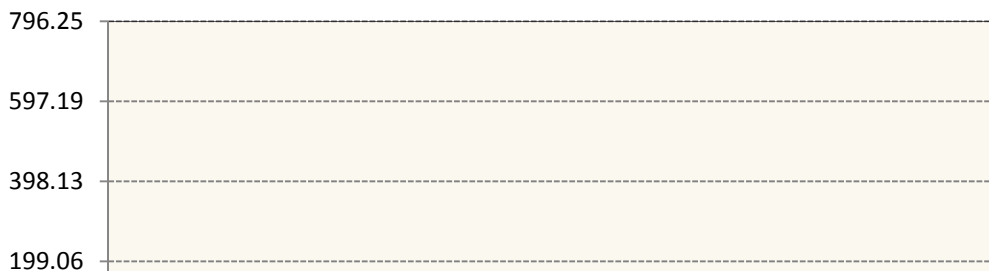
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,662	0	1,662	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,193	-3,193	장내

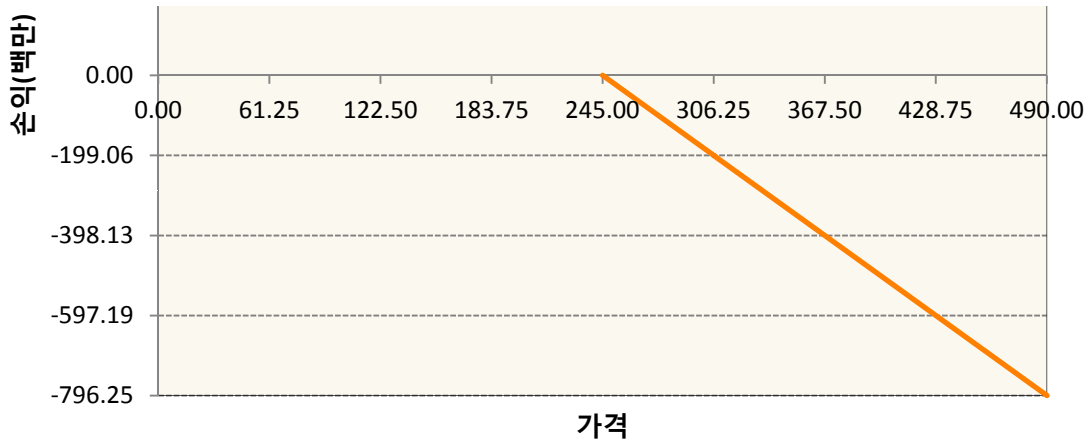
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

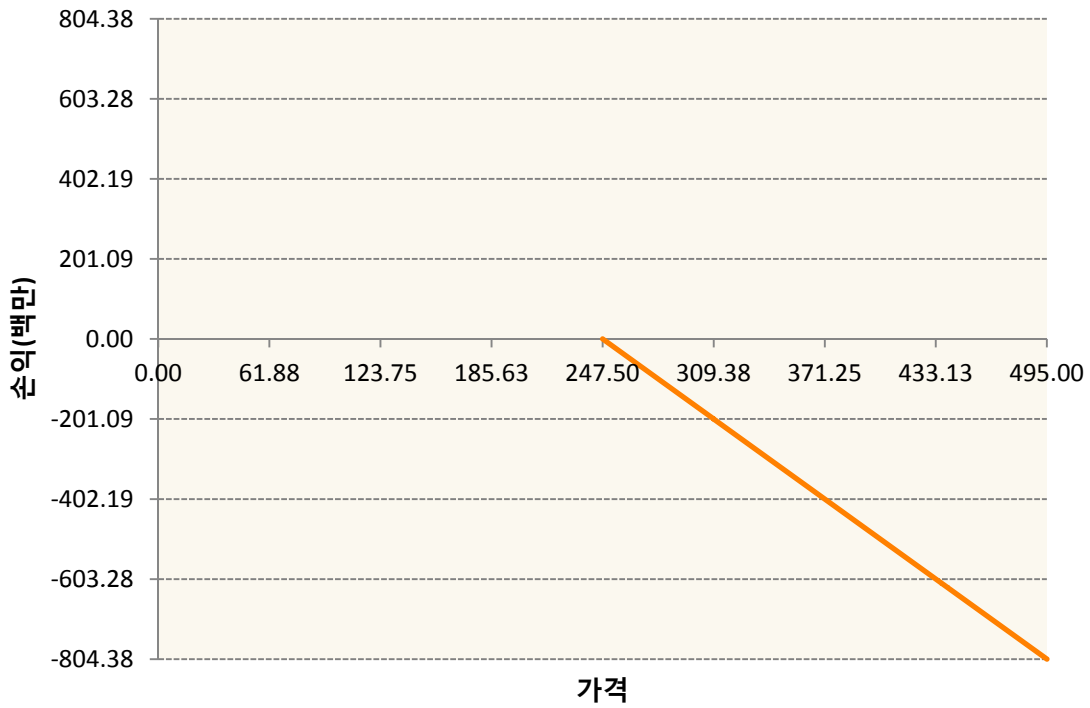


KR4201Q52452-2020-05 콜245

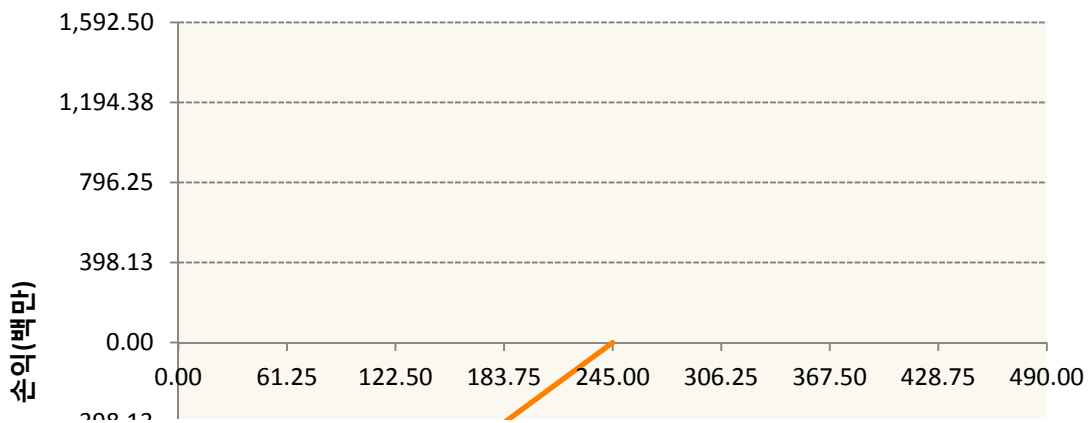




KR4201Q52478-2020-05 콜247.5



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						189
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-189	-189	-189	-189	-189	-189	-189	
-5.33%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126	
-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%	126	126	126	126	126	126	126	
8.00%	189	189	189	189	189	189	189	
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						66
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	35	35	35	35	35	35	35	
-5.33%	33	33	32	32	31	31	30	
-2.67%	21	21	20	20	19	19	18	
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	
KR4201Q52478		2020-05 콜247.5						66
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	28	28	28	28	28	27	27	
-5.33%	27	27	26	26	26	25	25	
-2.67%	19	19	18	18	17	16	16	
0%	0	0	0	0	0	-1	-1	
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	
KR4301Q52450 2020-05 풋245							63	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63	
-5.33%	-19	-20	-20	-21	-21	-22	-22	
-2.67%	0	-1	-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	

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

(단위:백만원)

545

공시일	2020-05-14
기준일	2020-05-13

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

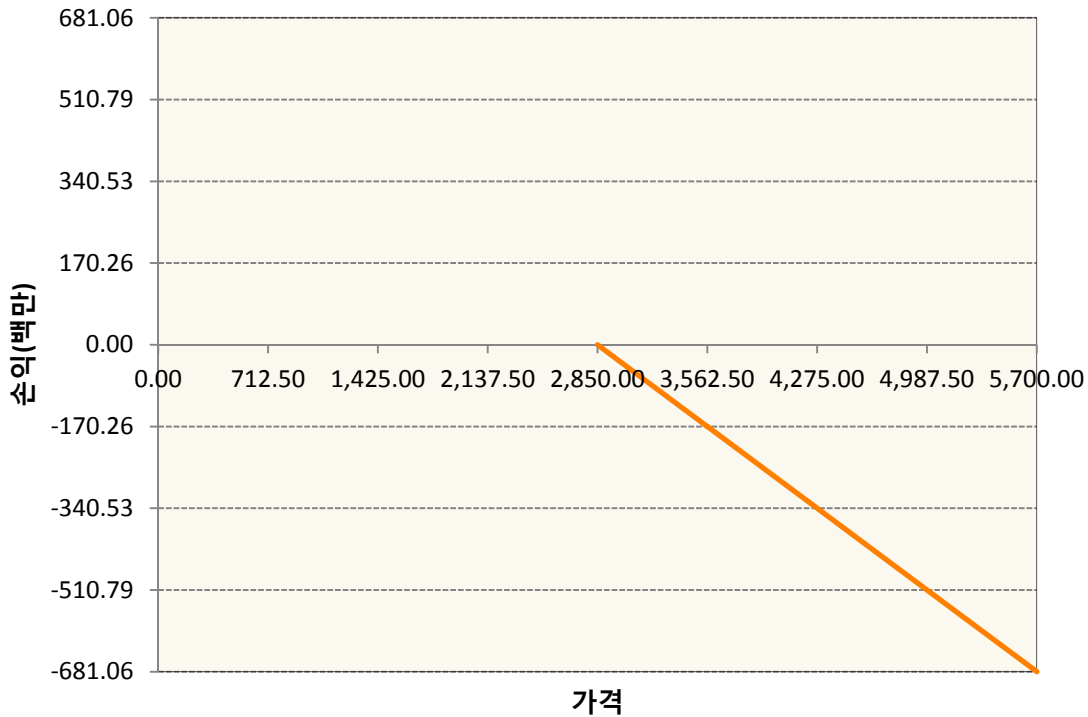
1. 계약금액

(단위:백만원)

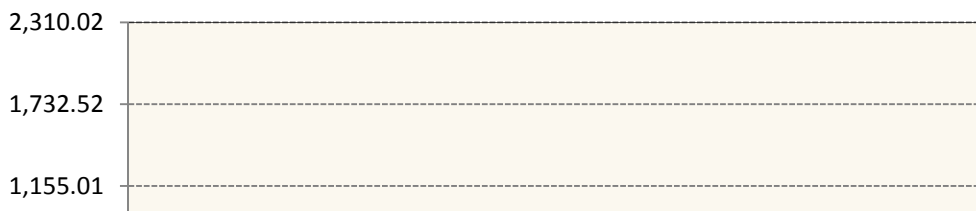
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	731	0	731	
누계	유가증권	스왑	7,918	0	7,918	장외
누계	유가증권	옵션	0	5,982	-5,982	장내
누계	통화	선도	0	2,687	-2,687	장외

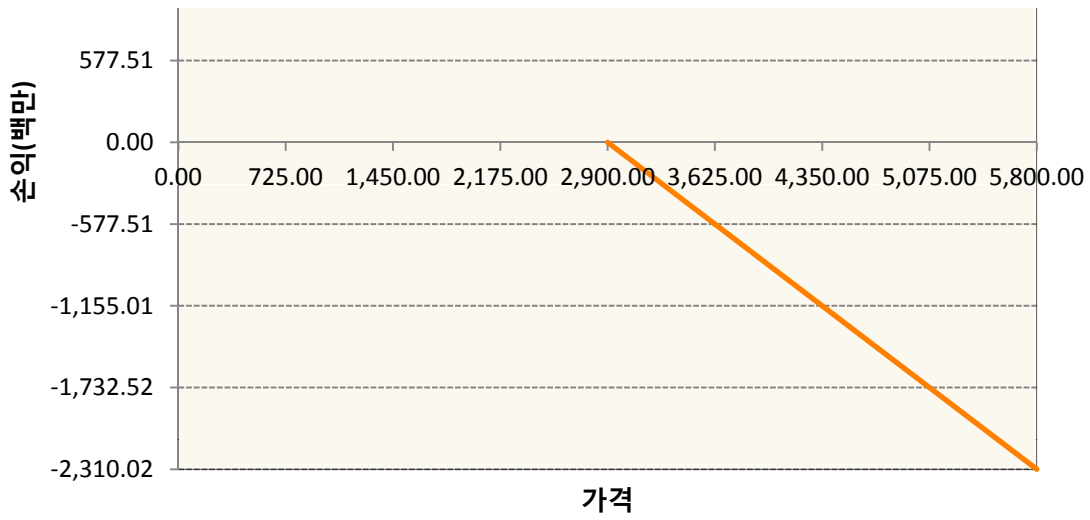
2. 만기시점의 손익구조

OESXK0-C2850-EURO STOXX 50

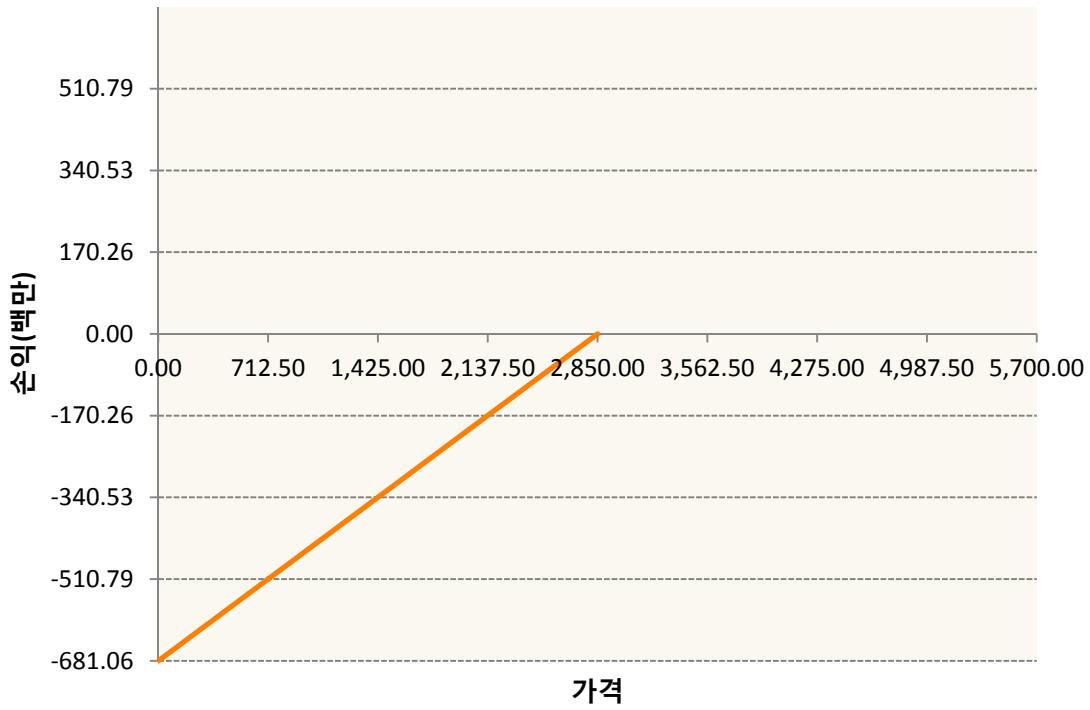


OESXK0-C2900-EURO STOXX 50

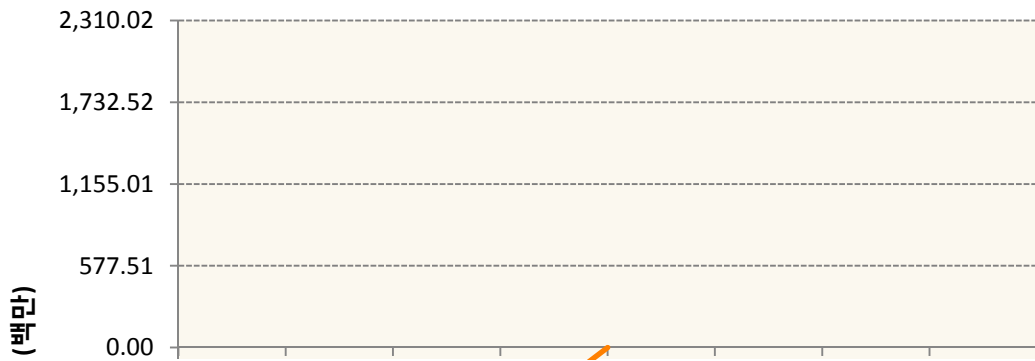


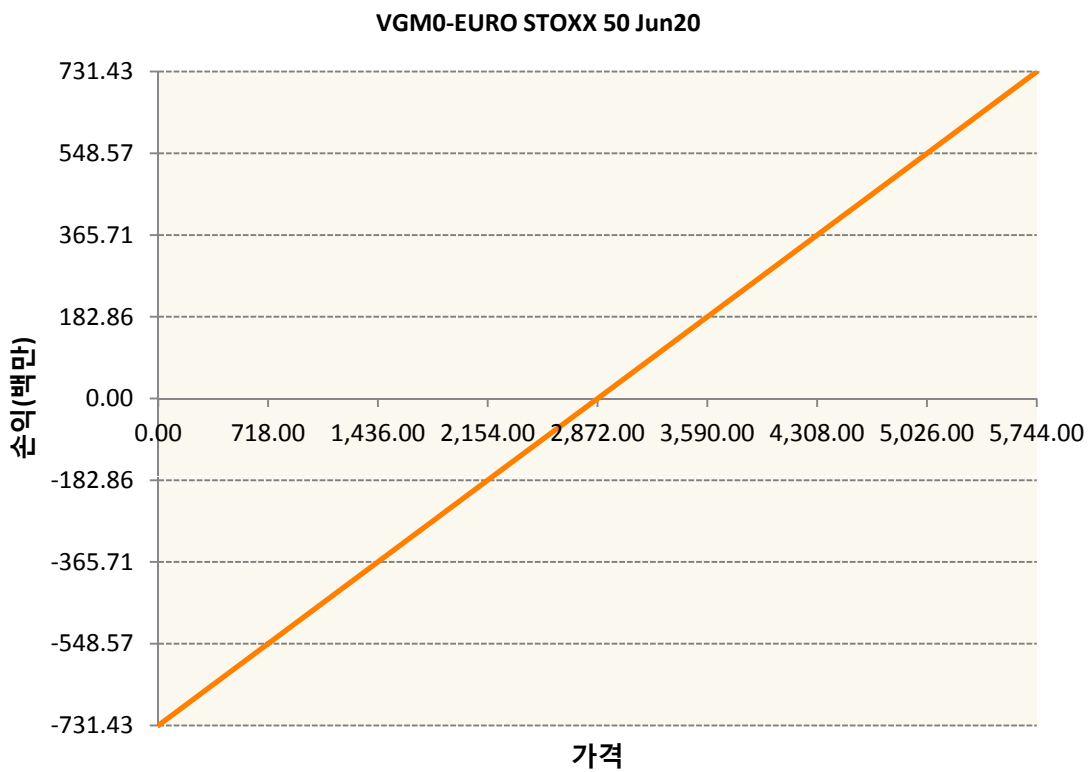
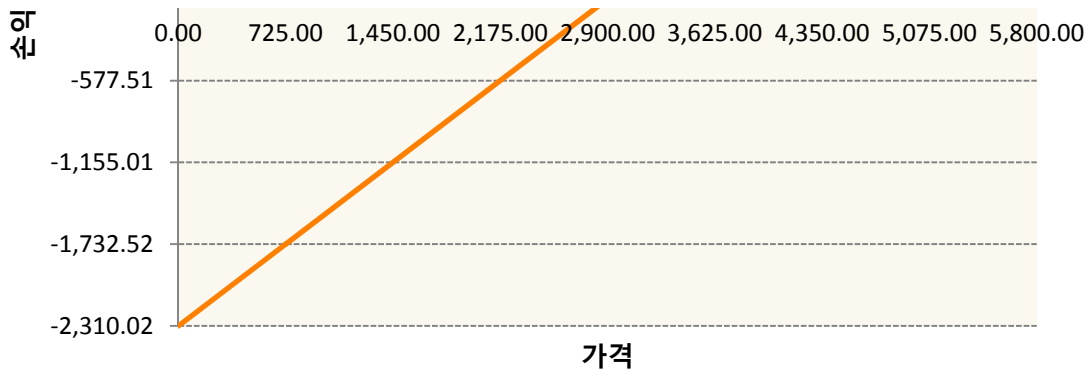


OESXK0-P2850-EURO STOXX 50



OESXK0-P2900-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	21
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E	215
OESXK0-C28 EURO STOXX 50	54
OESXK0-C29 EURO STOXX 50	185
OESXK0-P28 EURO STOXX 50	54
OESXK0-P29 EURO STOXX 50	185
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20	59

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

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

(단위:백만원)

1,137

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

(단위:백만원)

99

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

(단위:백만원)

144

공시일	2020-05-14
기준일	2020-05-13

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

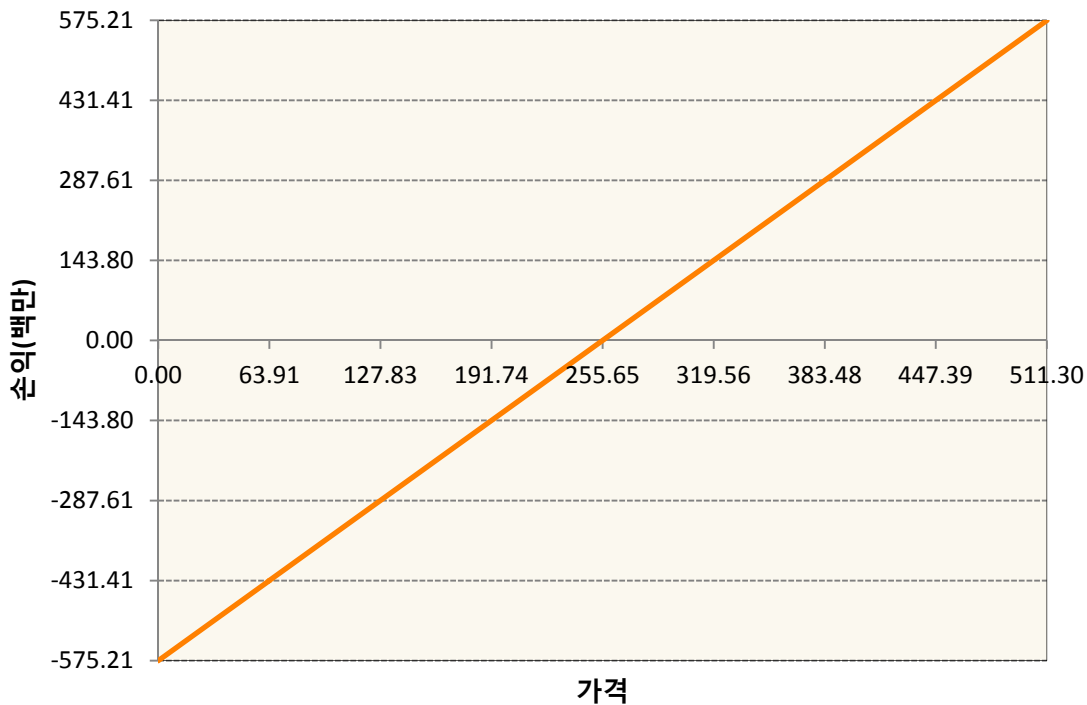
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	575	0	575	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)

68

공시일	2020-05-14
기준일	2020-05-13

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

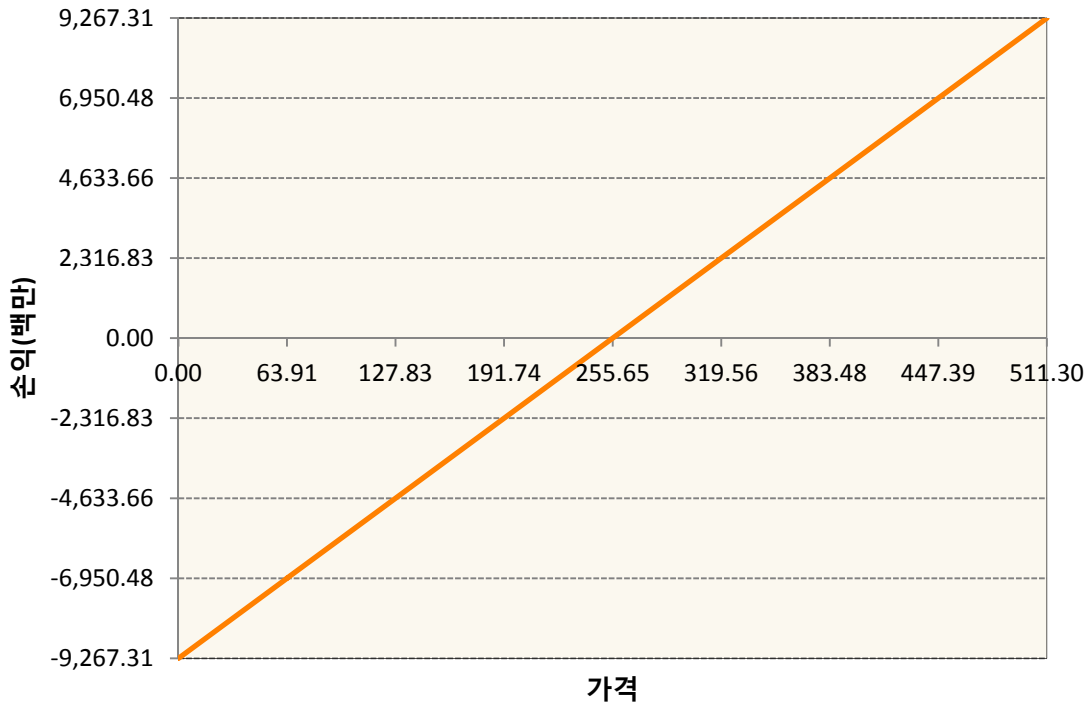
1. 계약금액

(단위:백만원)

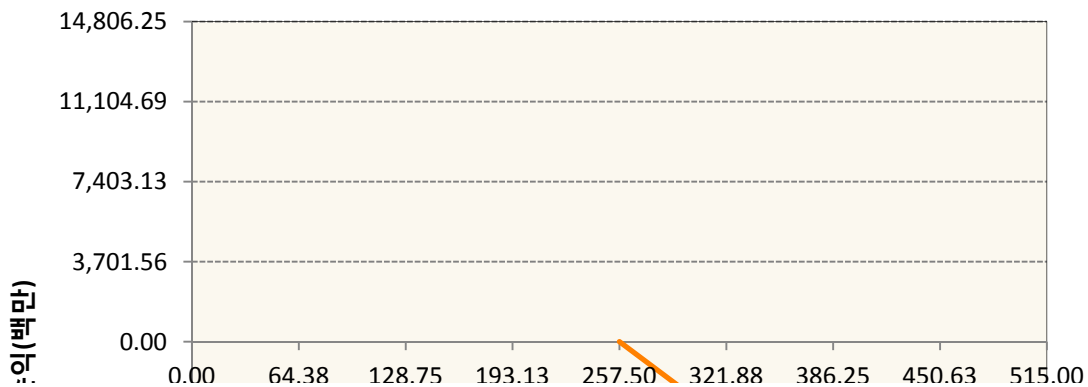
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,267	0	9,267	장내
누계	유가증권	옵션	6,201	17,536	-11,335	장내

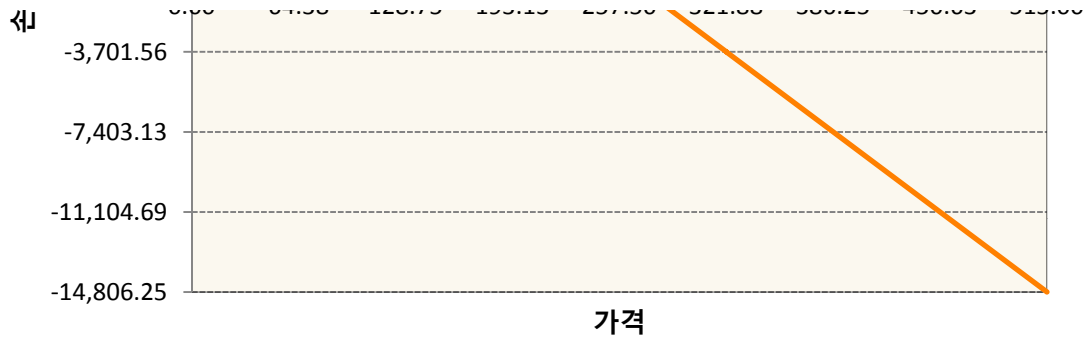
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

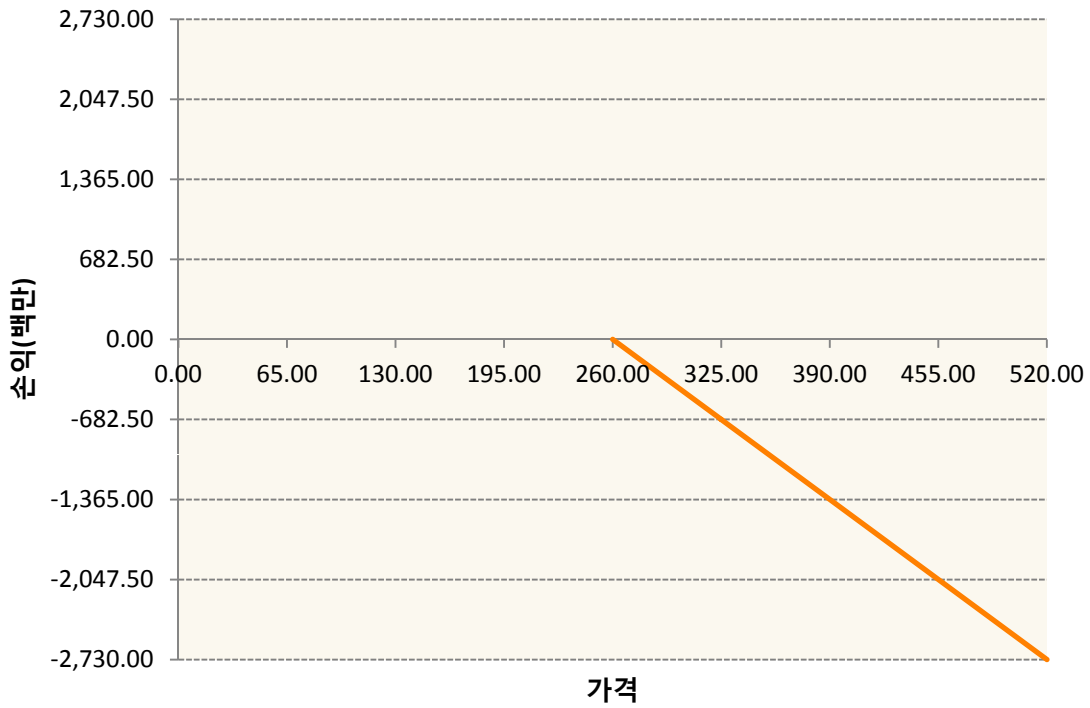


KR4201Q52577-2020-05 콜257.5

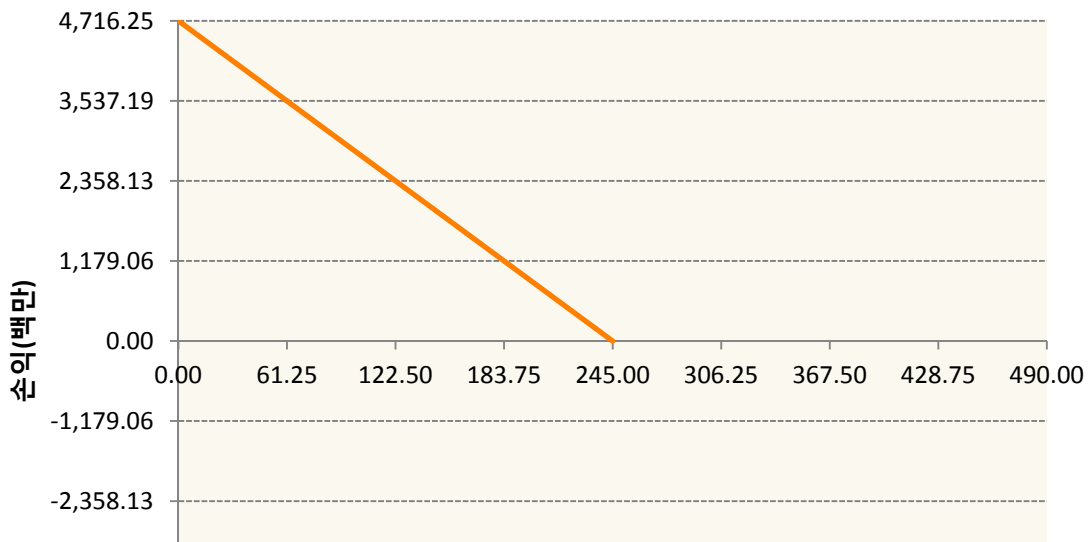


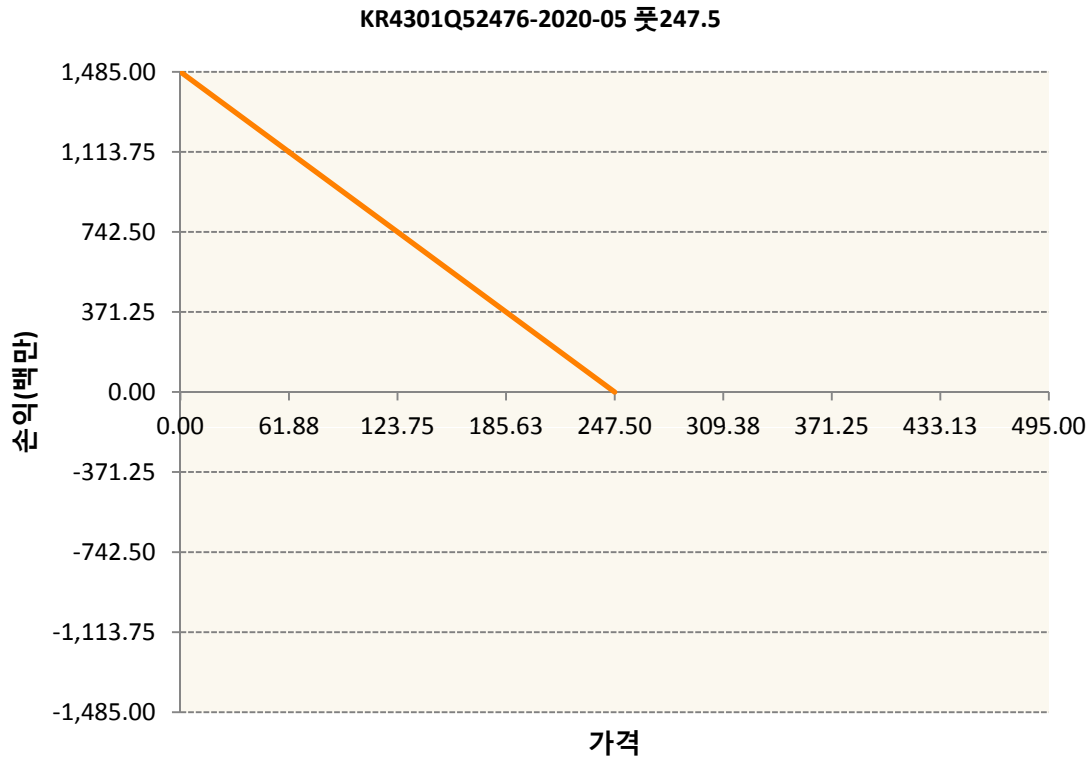
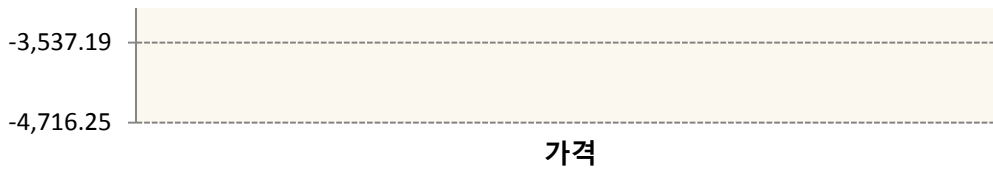


KR4201Q52601-2020-05 콜260



KR4301Q52450-2020-05 풋245





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						742
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-742	-742	-742	-742	-742	-742	-742	
-5.33%	-495	-495	-495	-495	-495	-495	-495	
-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%	495	495	495	495	495	495	495	
8.00%	742	742	742	742	742	742	742	
KR4201Q52577		2020-05 콜257.5						989
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	93	93	93	93	93	93	93	
-5.33%	93	93	93	93	92	92	91	
-2.67%	91	89	86	82	78	73	68	

0%	32	22	11	0	-11	-22	-33
2.67%	-220	-226	-233	-241	-249	-257	-266
5.33%	-596	-597	-598	-599	-601	-603	-606
8.00%	-988	-988	-988	-988	-988	-989	-989
KR4201Q52601 2020-05 콜260							163
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9	9	9	9	9	9	9
-5.33%	9	9	9	9	9	9	9
-2.67%	9	9	8	8	8	7	7
0%	4	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	-27	-29	-31	-33	-35	-37	-39
5.33%	-91	-91	-92	-92	-93	-94	-95
8.00%	-162	-162	-162	-162	-162	-163	-163
KR4301Q52450 2020-05 풋245							186
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	185	185	185	185	185	186	186
-5.33%	57	59	60	62	63	65	67
-2.67%	1	2	3	4	5	7	8
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
KR4301Q52476 2020-05 풋247.5							73
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	73	73	73	73	73	73	73
-5.33%	32	32	32	32	33	33	33
-2.67%	3	3	4	4	5	6	6
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)

2,474

공시일	2020-05-14
기준일	2020-05-13

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	149,218	0	149,218	

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	2020-05-14
기준일	2020-05-13

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	100,612	0	100,612	

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	2020-05-14
기준일	2020-05-13

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	444,516	0	444,516	
누계	통화	선도	0	426,617	-426,617	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,389
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	979
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	842
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	734
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	490
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,427
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,951
FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E	2,937
FX21020J02€ KRW/USD 10-06-20E	1,331
FX21020J02£ KRW/USD 22-06-20E	1,508
FX21020J02¥ KRW/USD 22-06-20E	1,958
FX21020J03¥ KRW/USD 24-07-20E	2,203
FX21020J04¥ KRW/USD 24-07-20E	1,762
FX21020J04¥ KRW/USD 24-07-20E	1,958
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	2,036
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	1,938
FX21020K01 KRW/USD 22-06-20E	685

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

17,307

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

(단위:백만원)

197

공시일	2020-05-14
기준일	2020-05-13

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

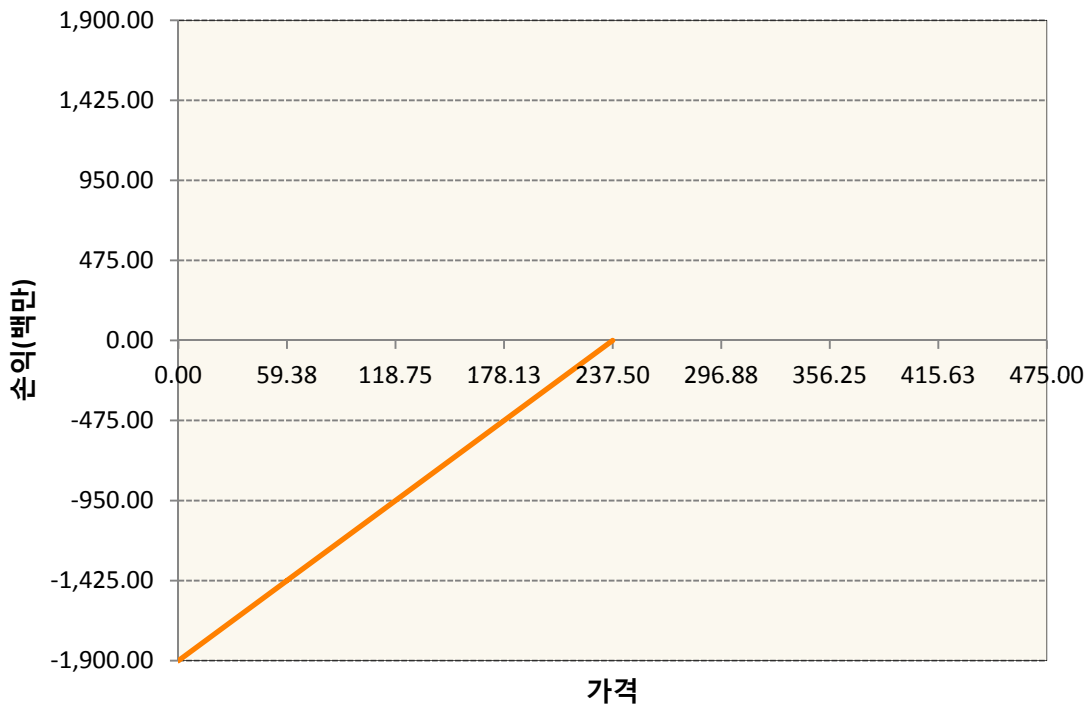
1. 계약금액

(단위:백만원)

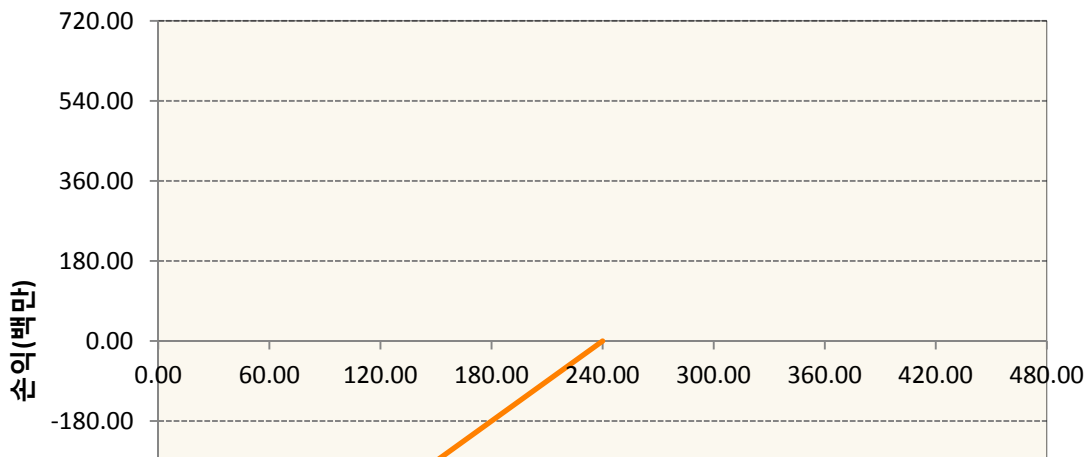
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	119	0	119	장내
누계	유가증권	옵션	0	2,620	-2,620	장내

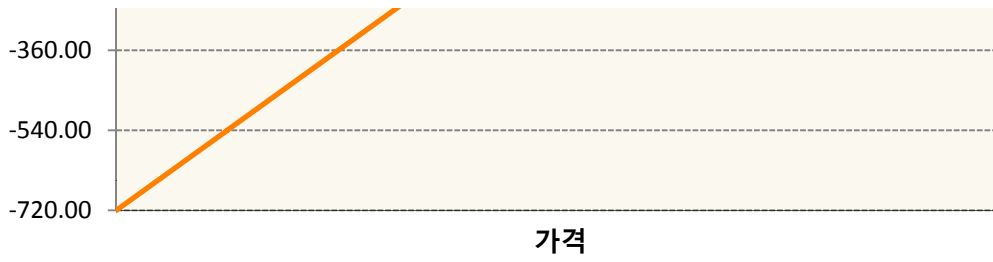
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q52377-2020-05 풋237.5



KR4301Q52401-2020-05 풋240





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q52377 2020-05 풋237.5 23

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19	-20	-20	-21	-22	-23	-23
-5.33%	0	0	-1	-1	-1	-2	-2
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
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 15

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14	-14	-14	-14	-14	-15	-15
-5.33%	-1	-1	-1	-2	-2	-2	-2
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
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)

0

공시일	2020-05-14
기준일	2020-05-13

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	7,327	0	7,327	
누계	통화	선도	0	7,159	-7,159	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J04(KRW/USD 29-05-20E)	253
FX21020K01(KRW/USD 15-06-20E)	320
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

290

공시일	2020-05-14
기준일	2020-05-13

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

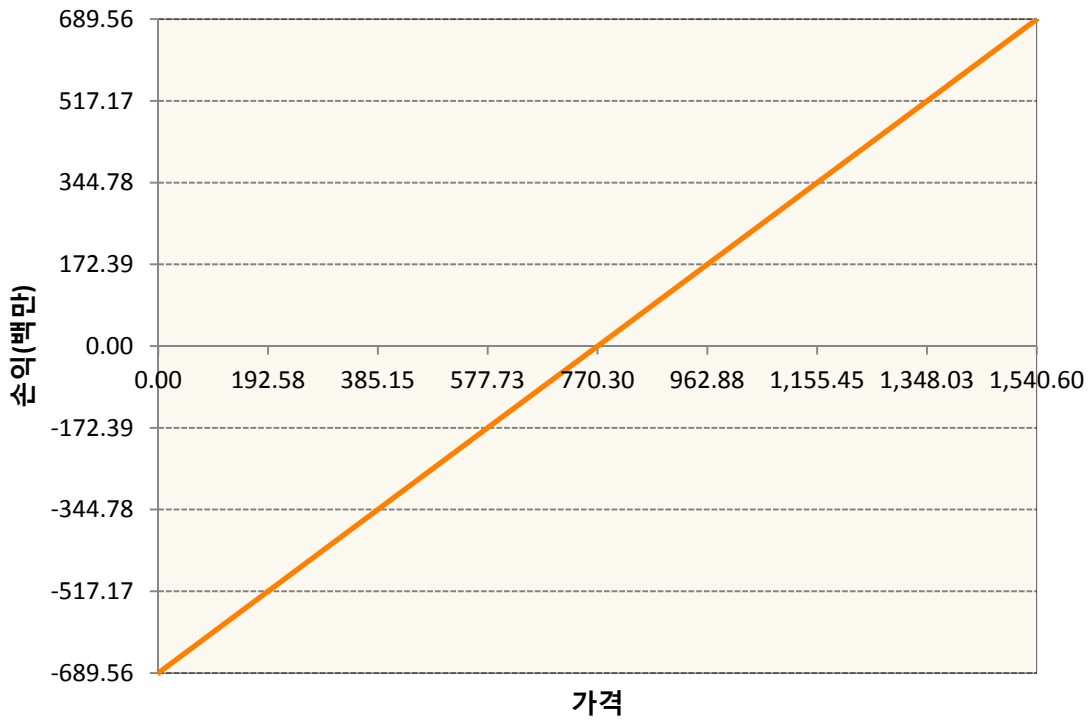
1. 계약금액

(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	690	0	690	
누계	유가증권	스왑	870	0	870	장외
누계	통화	선도	204	868	-664	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCK0-VN30 Index Future May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	70
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
FX21020K01 KRW/EUR 24-07-20E	8
VNCK0 VN30 Index Future May20	55

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

(단위:백만원)

161

공시일	2020-05-14
기준일	2020-05-13

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

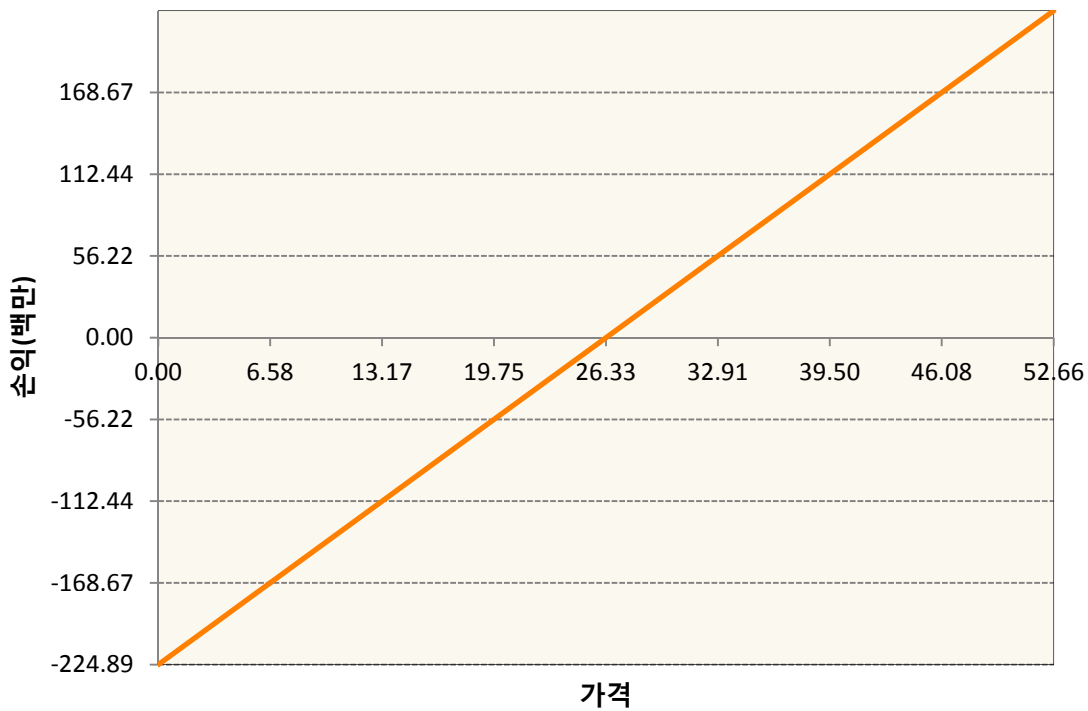
1. 계약금액

(단위:백만원)

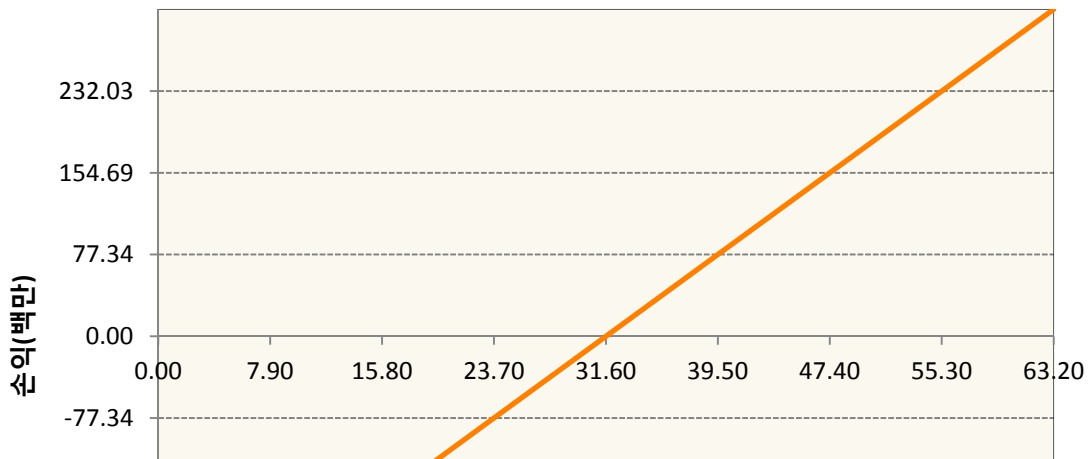
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,544	245	1,299	

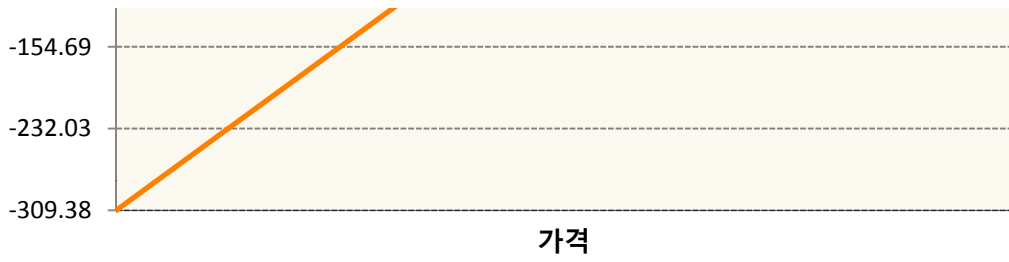
2. 만기시점의 손익구조

CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20

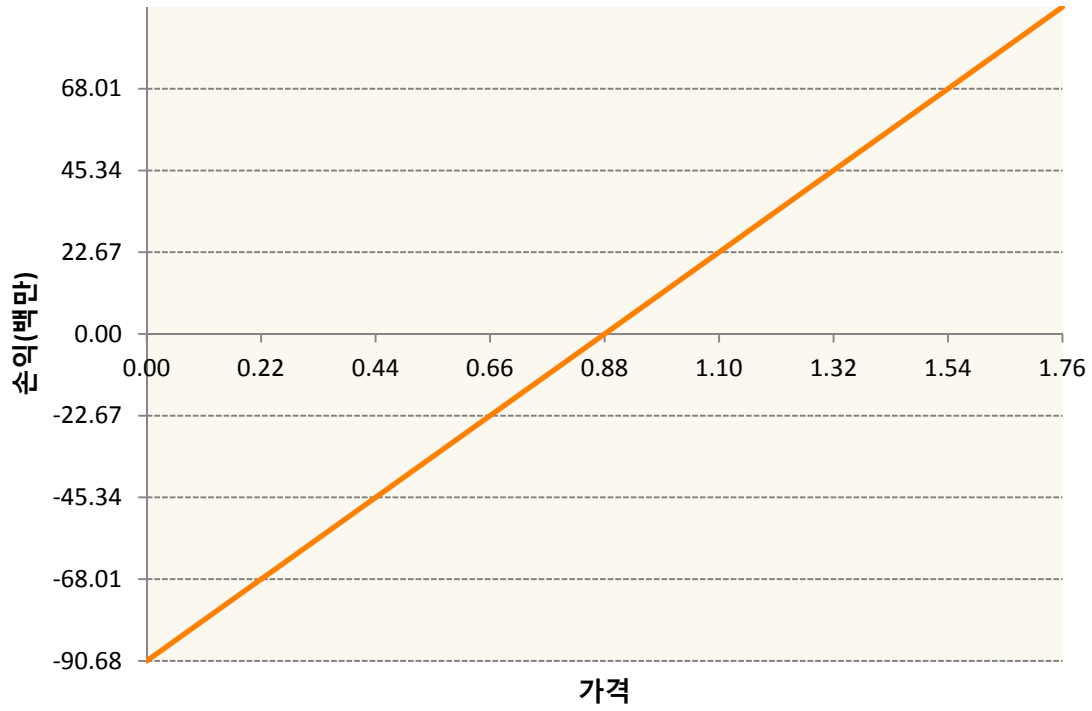


COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20

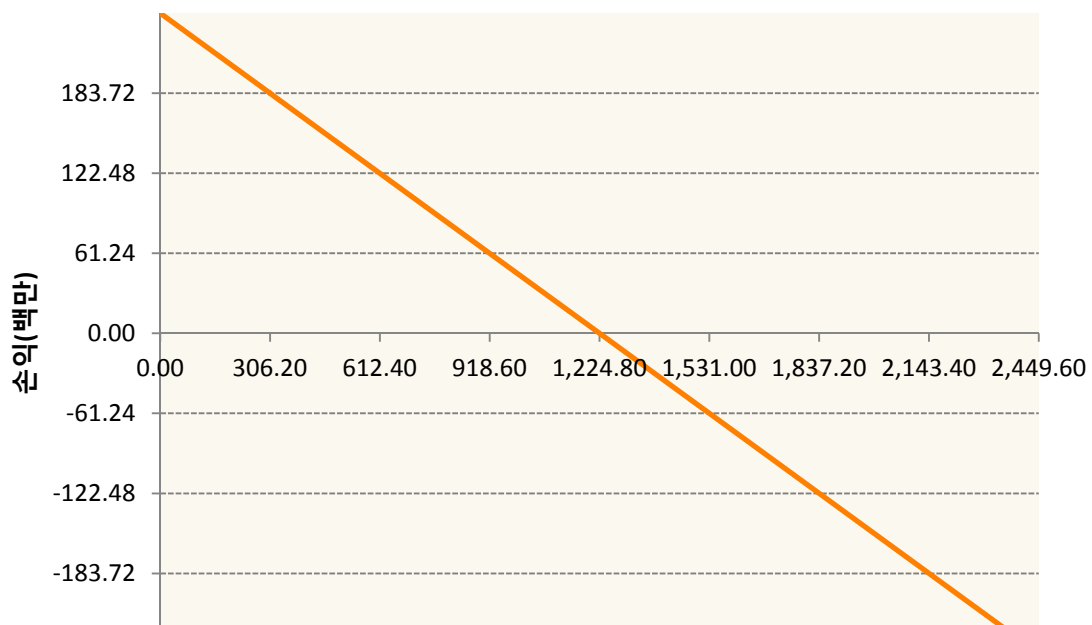


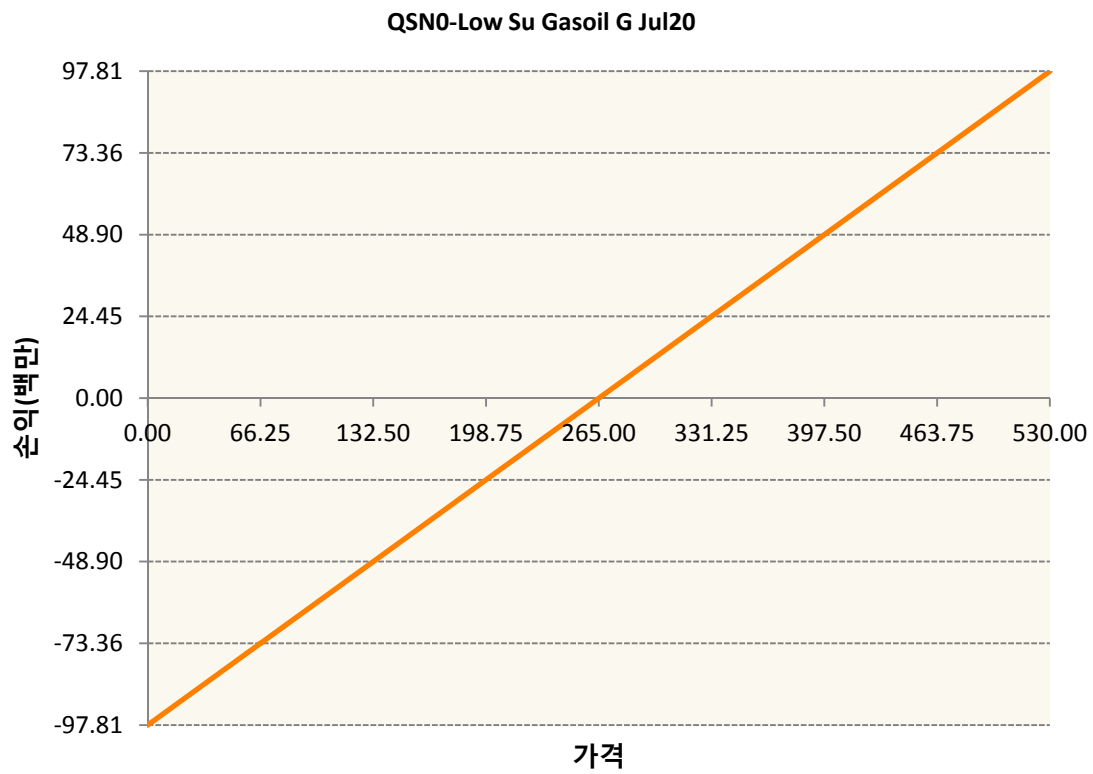
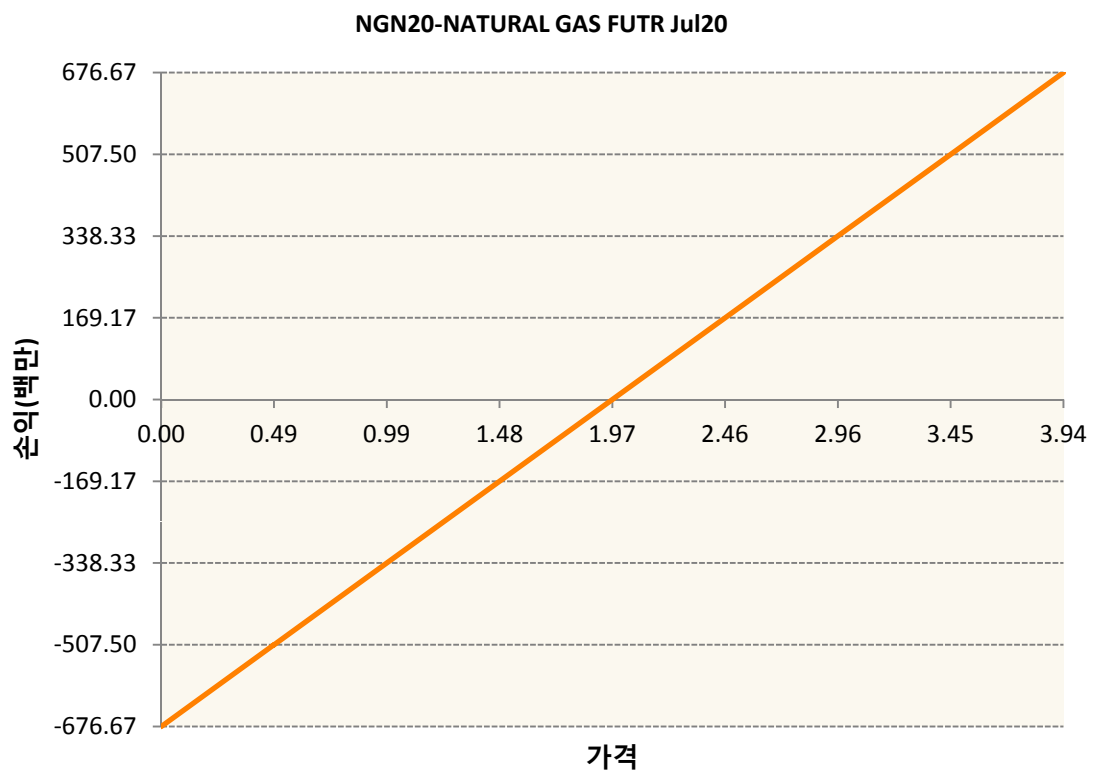
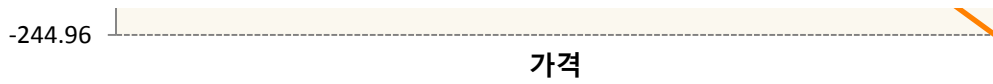


HON0-NY Harb ULSD Fut Jul20

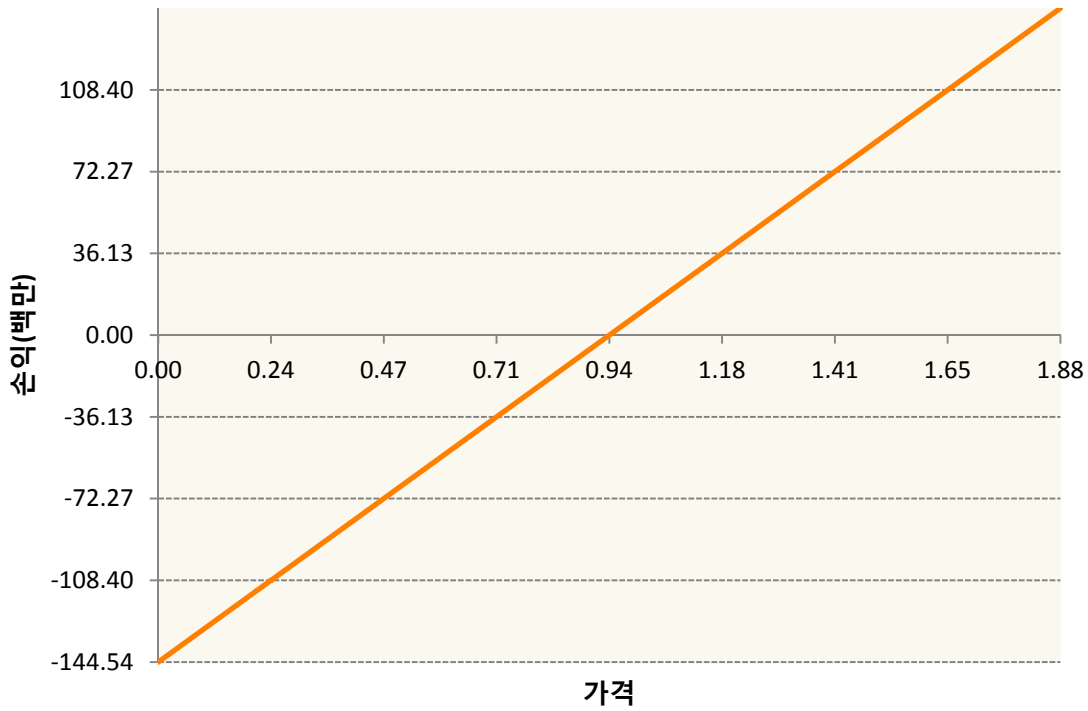


KR4175Q50007-2020-05 달러선물





XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN0	WTI CRUDE FUTURE Jul20	18
COU0	BRENT CRUDE FUTR Sep20	25
HON0	NY Harb ULSD Fut Jul20	7
KR4175Q50C	2020-05 달러선물	20
NGN20	NATURAL GAS FUTR Jul20	54
QSN0	Low Su Gasoil G Jul20	8
XBN0	GASOLINE RBOB FUT Jul20	12

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

(단위:백만원)

641

공시일	2020-05-14
기준일	2020-05-13

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

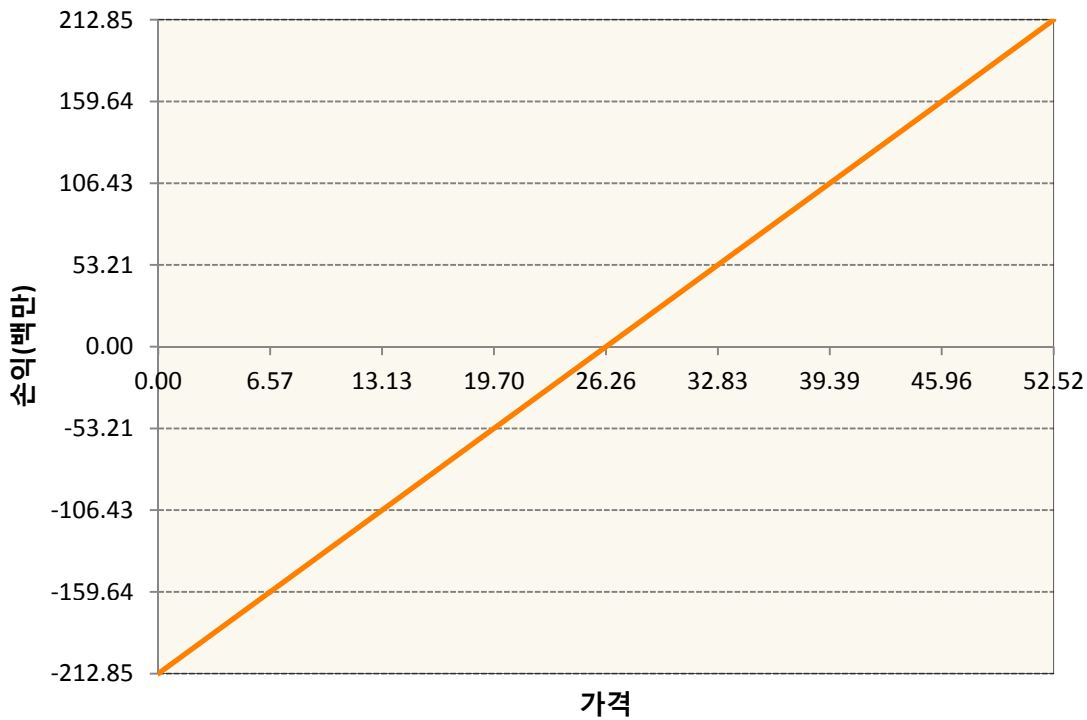
1. 계약금액

(단위:백만원)

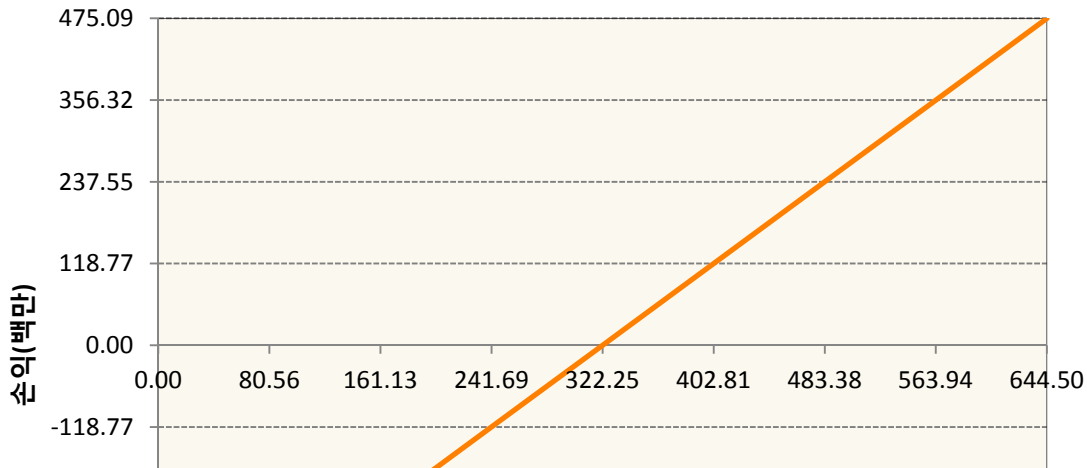
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,440	73	2,367	

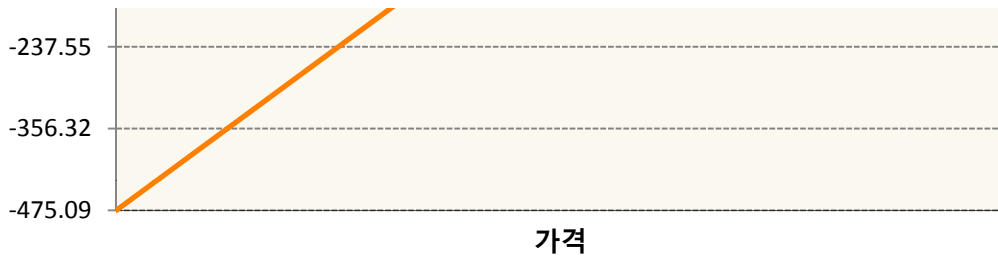
2. 만기시점의 손익구조

BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20

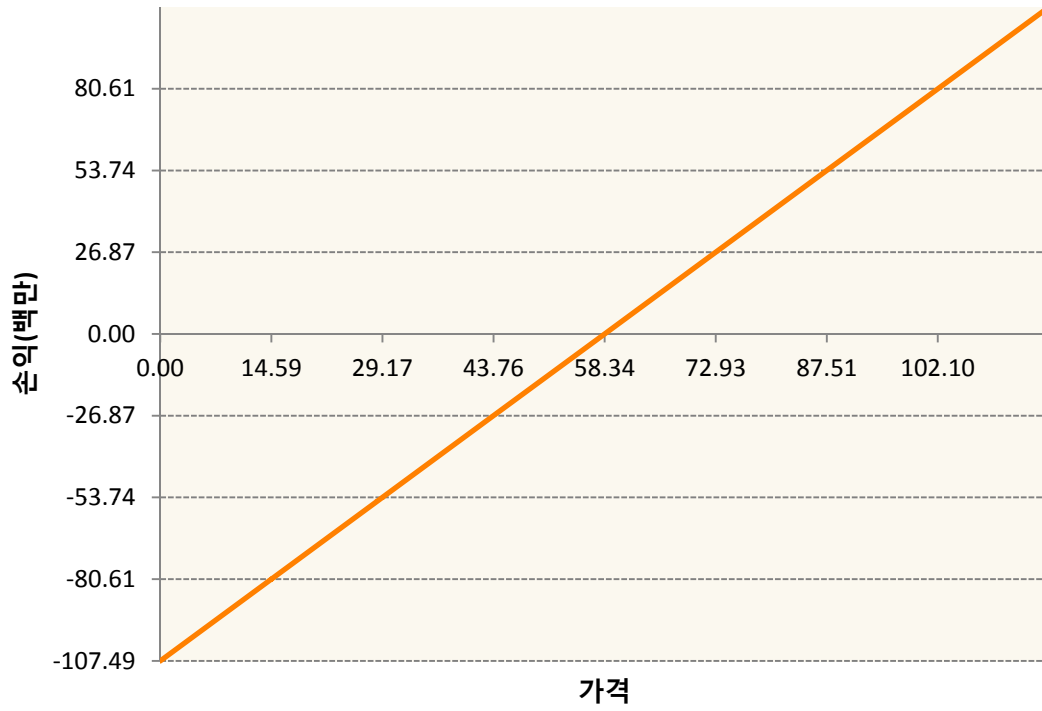


CNO-CORN FUTURE Jul20

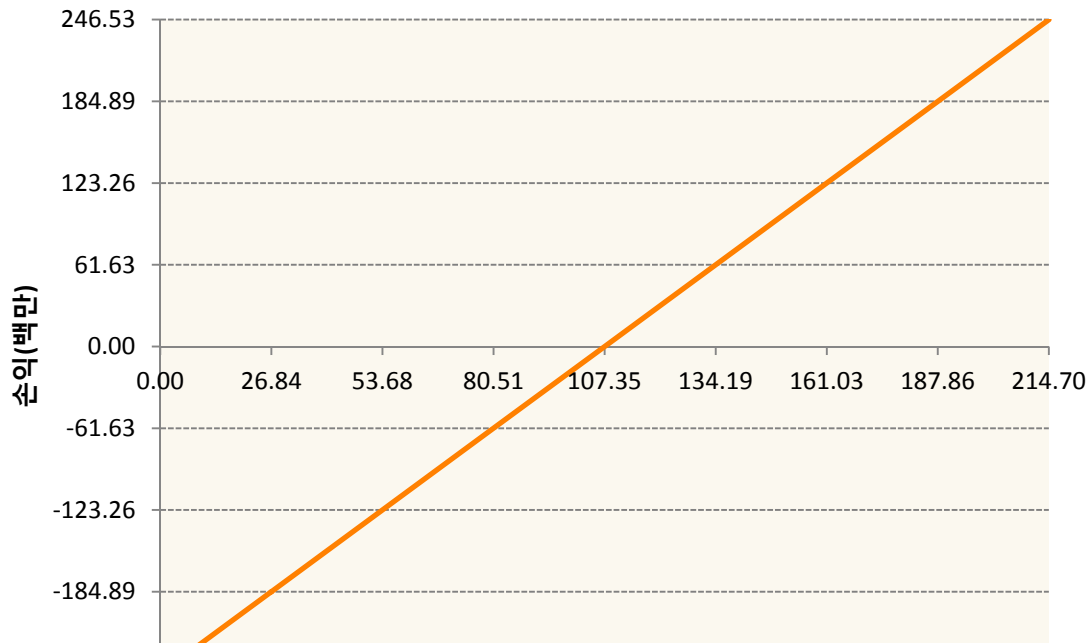


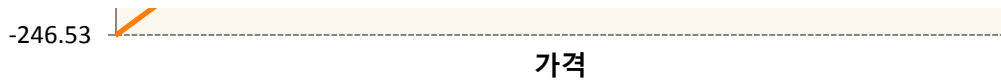


CTN0-COTTON NO.2 FUTR Jul20

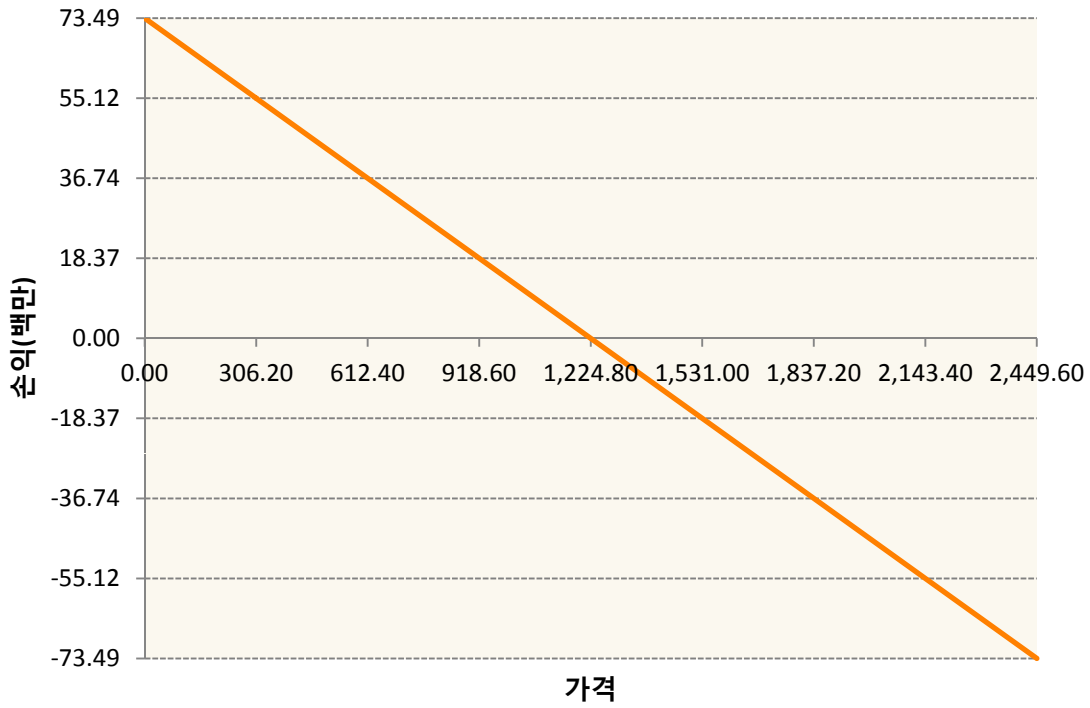


KCN0-COFFEE 'C' FUTURE Jul20

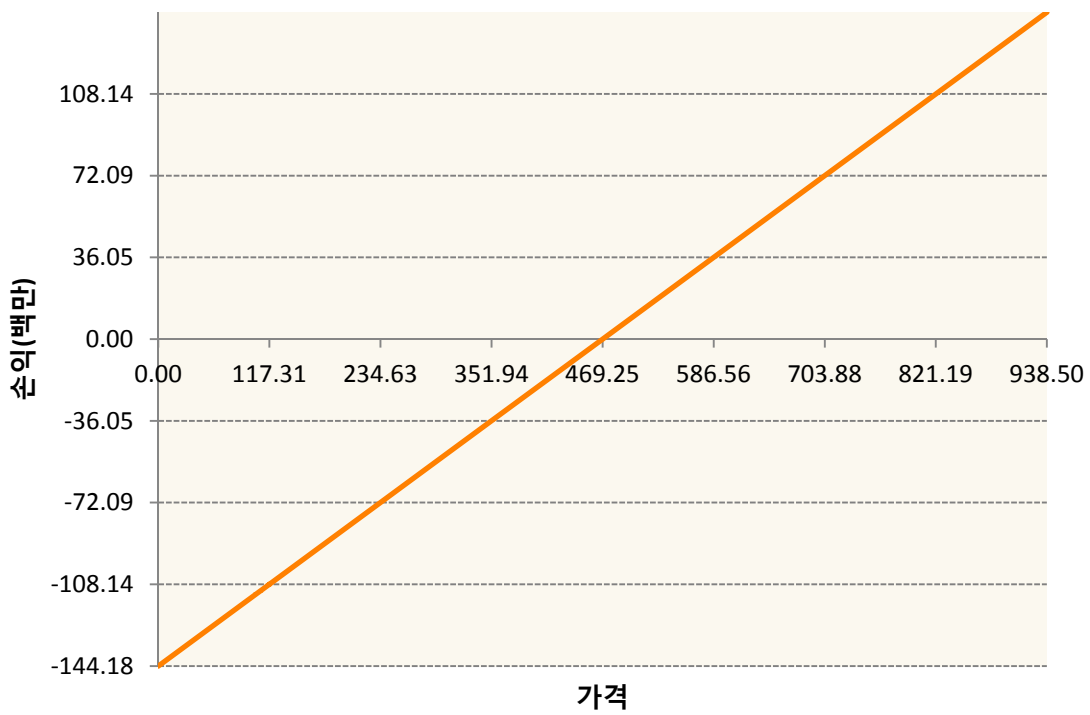




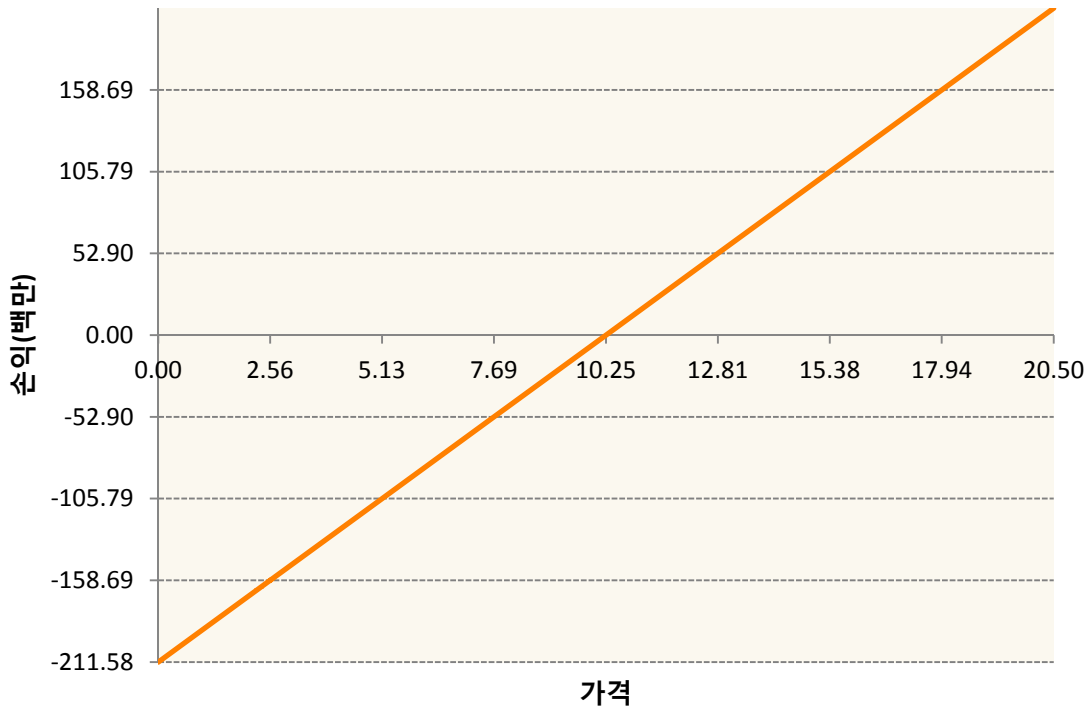
KR4175Q50007-2020-05 달러선물



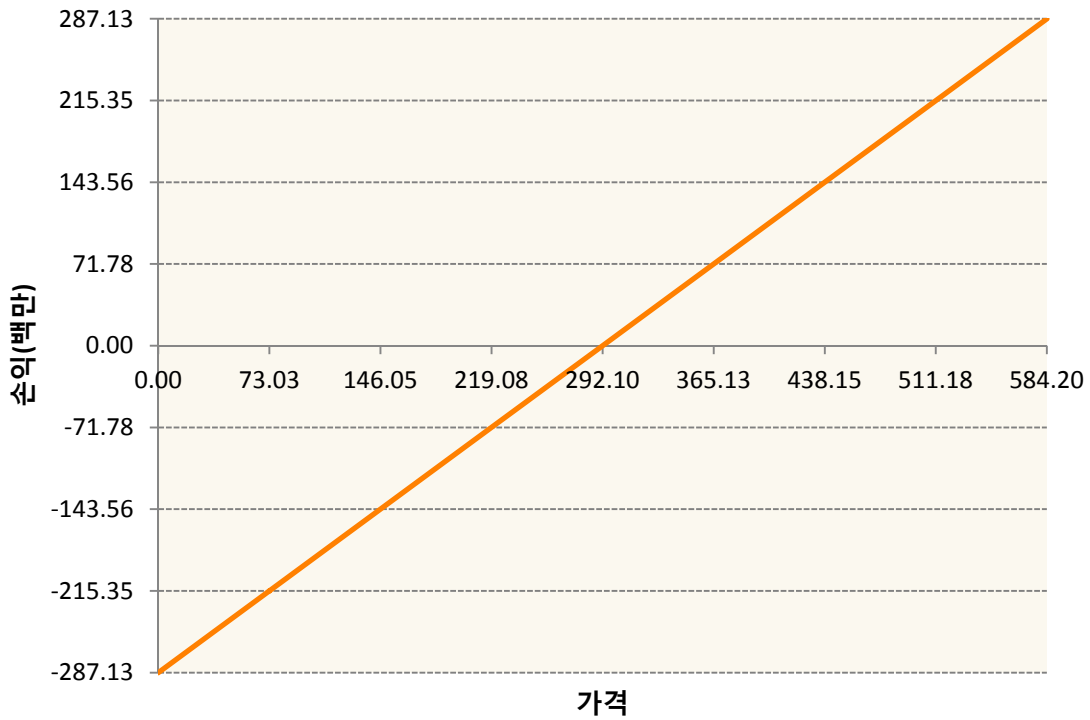
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



SBN0-Sugar Jul20

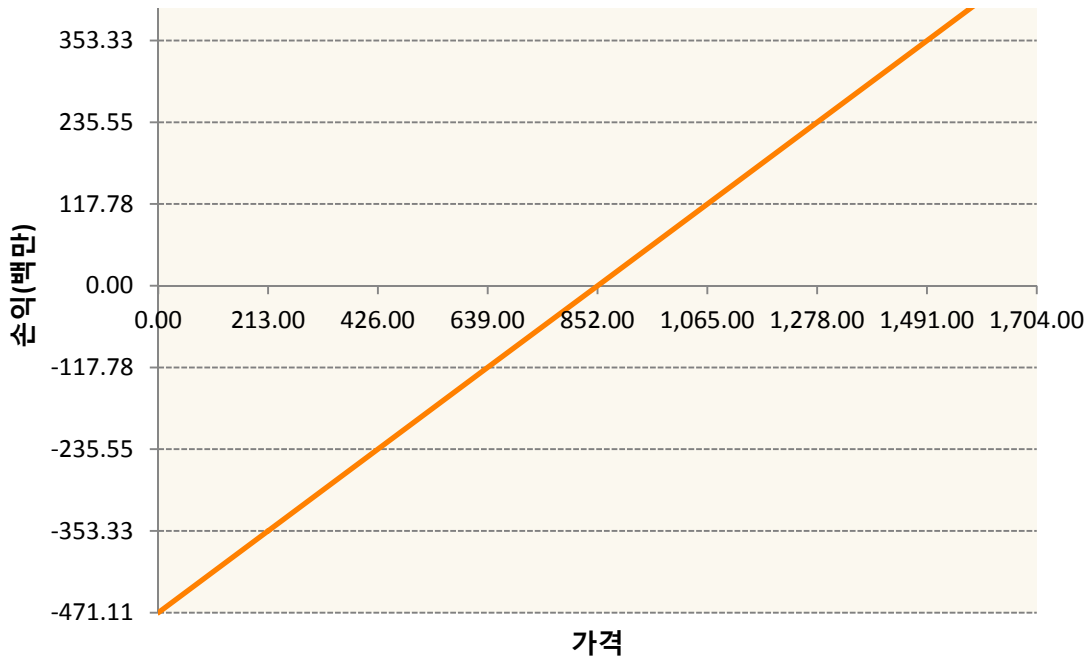


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20

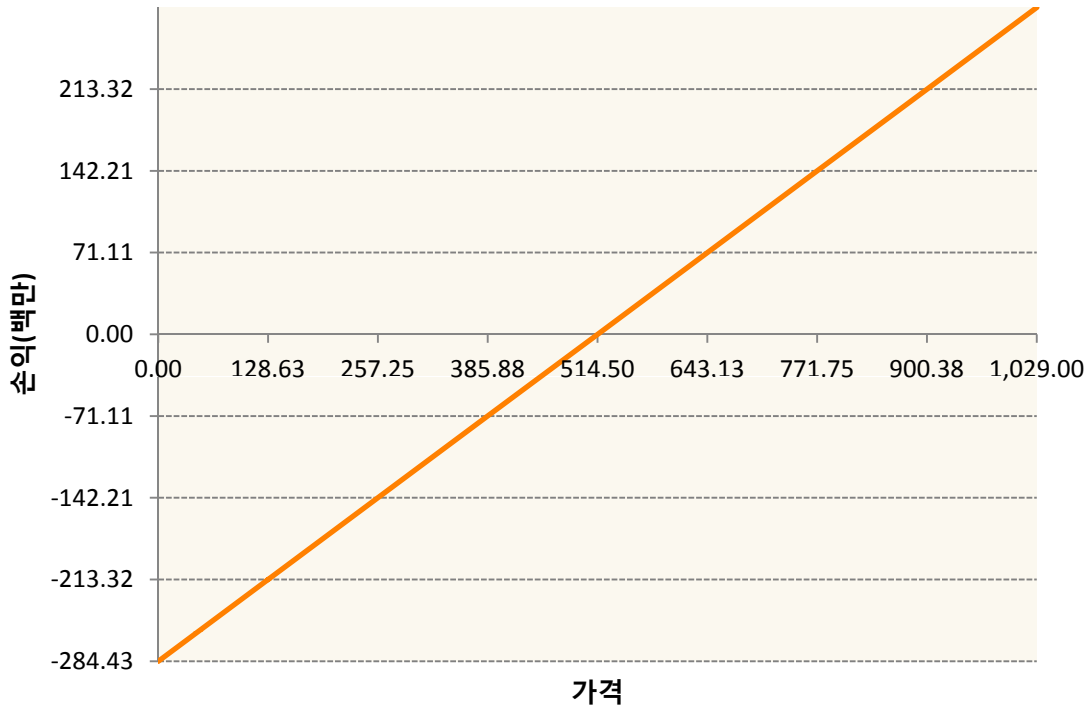


SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





WN0-WHEAT FUTURE(CBT) Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON0	SOYBEAN OIL FUTR Jul20	17
CN0	CORN FUTURE Jul20	38
CTN0	COTTON NO.2 FUTR Jul20	9
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	38
WN0	WHEAT FUTURE(CBT) Jul20	23

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

(단위:백만원)

231