

공시일	2020-05-18
기준일	2020-05-15

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	2020-05-18
기준일	2020-05-15

스마트인덱스모

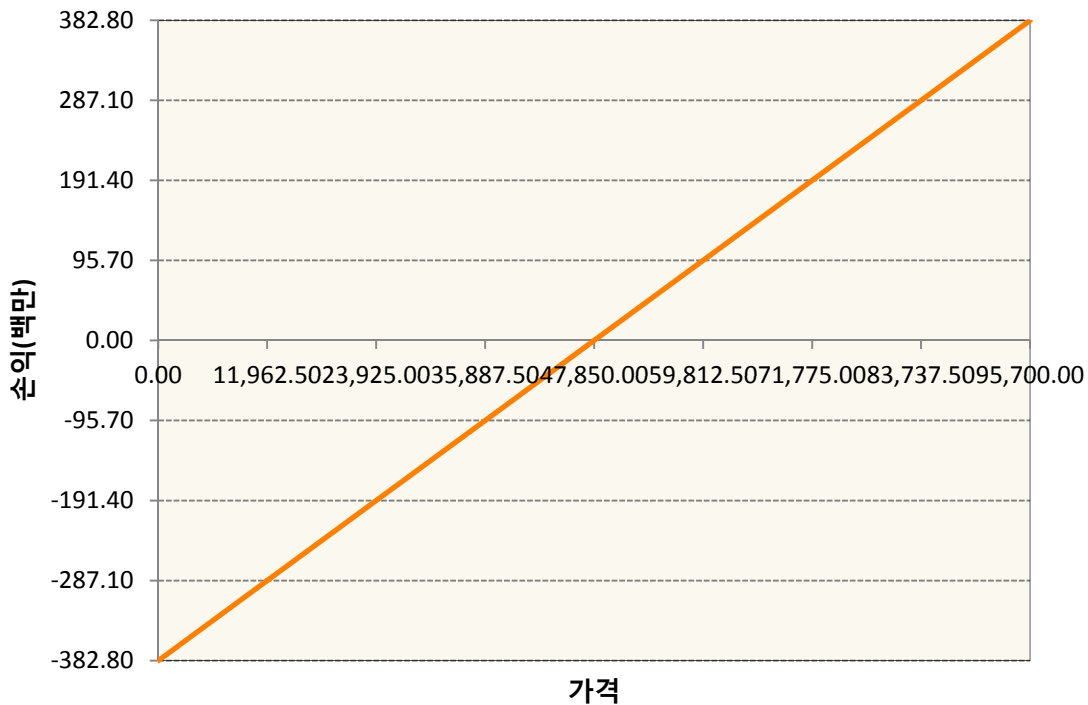
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	383	0	383	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111Q60001-2020-06 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111Q60001		2020-06 삼성전자개별선물						31
가격	기초자산의 변동성							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31	
-5.33%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20	
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	10	10	10	10	10	10	10	
5.33%	20	20	20	20	20	20	20	
8.00%	31	31	31	31	31	31	31	

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

(단위:백만원)

46

공시일	2020-05-18
기준일	2020-05-15

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

963

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,126

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-18
기준일	2020-05-15

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	7,308	0	7,308	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI500000 신한CSI500미래S200310

573

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

857

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-18
기준일	2020-05-15

유로인덱스모(주식-파생형)

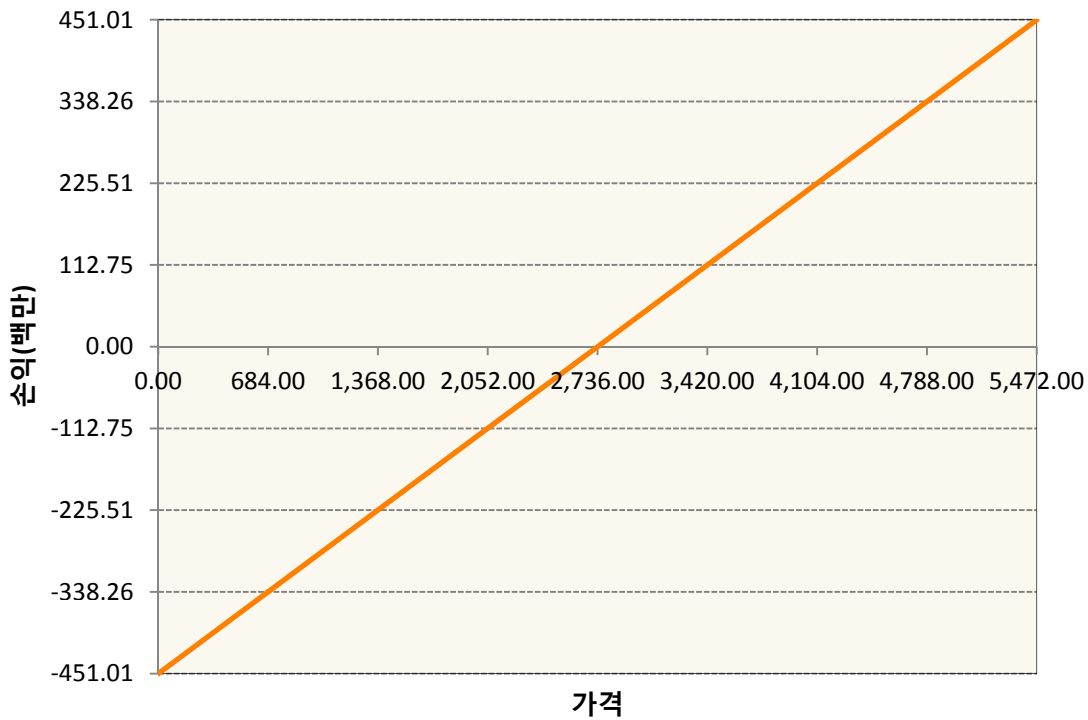
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	451	0	451	

2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	36
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

46

공시일	2020-05-18
기준일	2020-05-15

차이나인덱스모(주식-파생형)

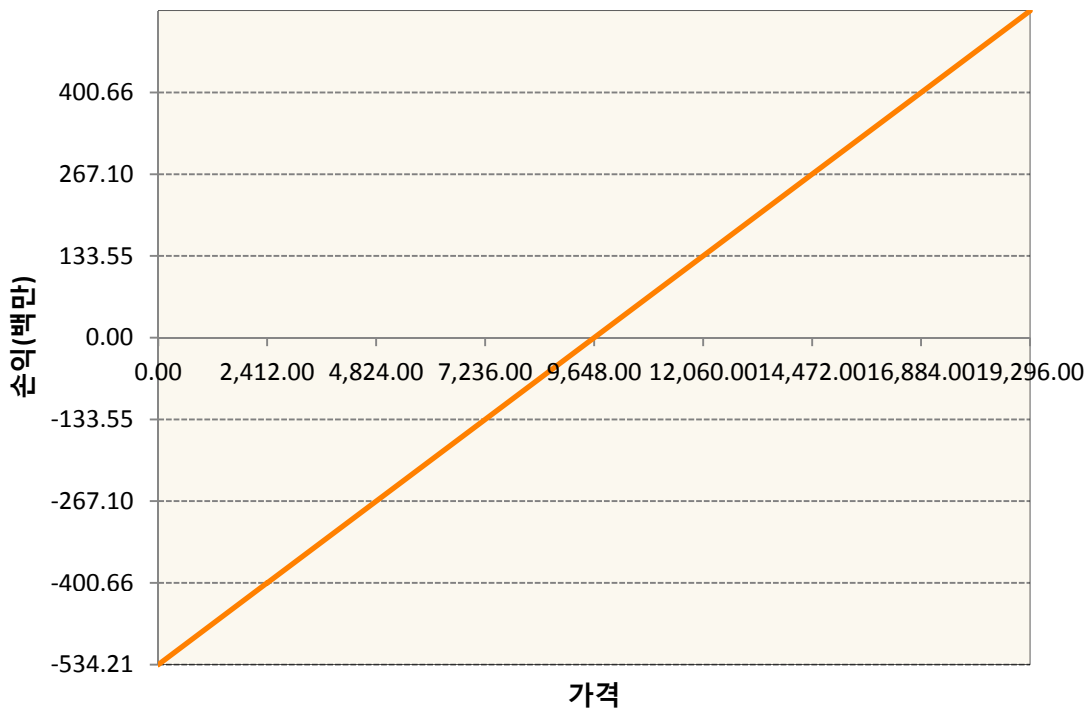
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	534	0	534	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	2020-05-18
기준일	2020-05-15

커버드콜모(주식혼합-파생형)

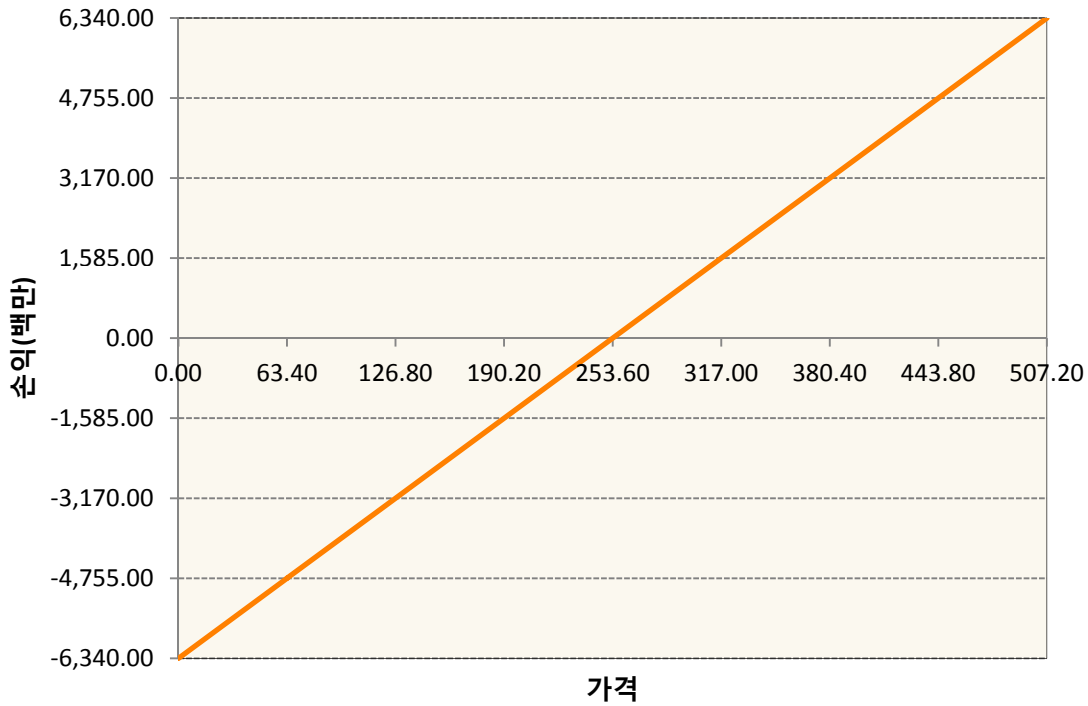
1. 계약금액

(단위:백만원)

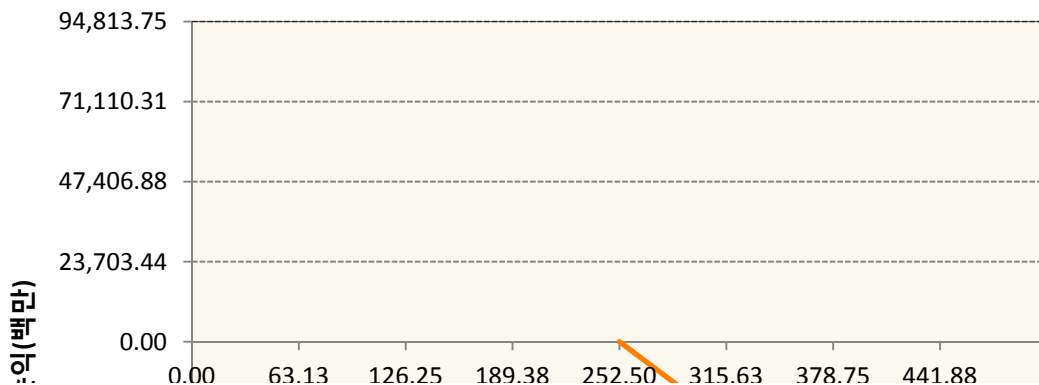
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	217,471	-217,471	장내
누계	유가증권	선물	6,340	0	6,340	장내
누계	유가증권	옵션	0	364,718	-364,718	장내

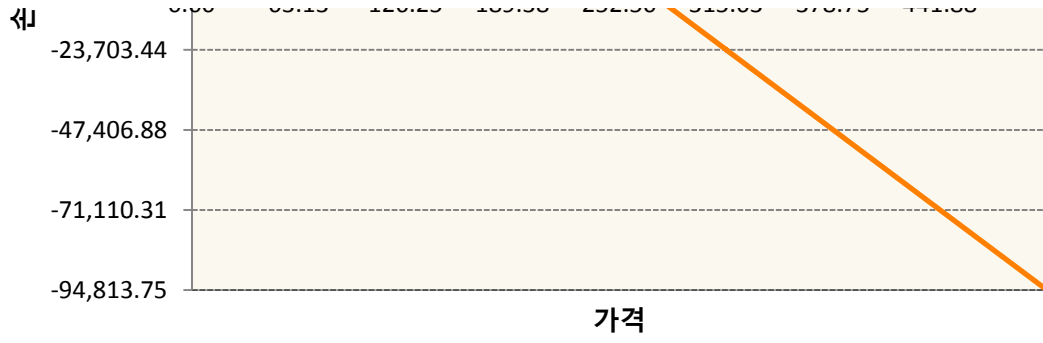
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

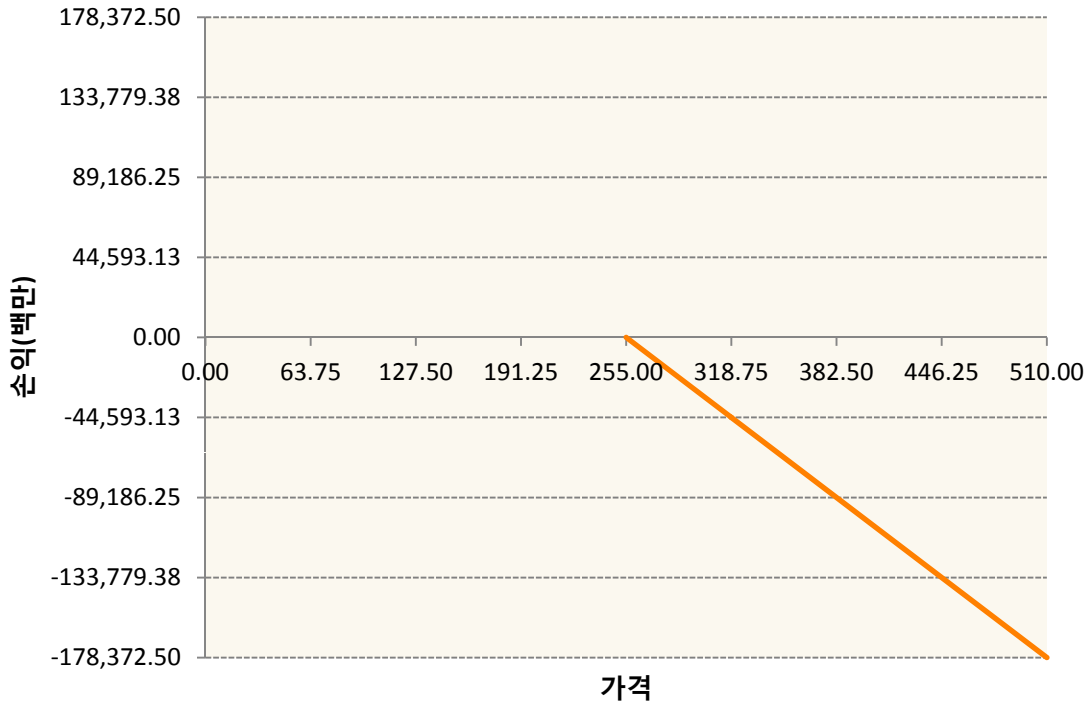


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

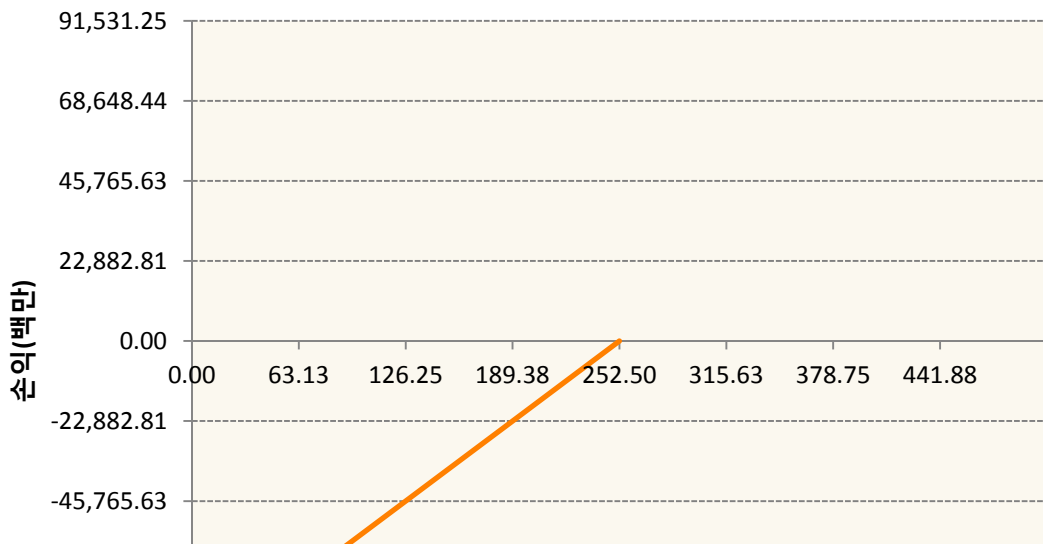


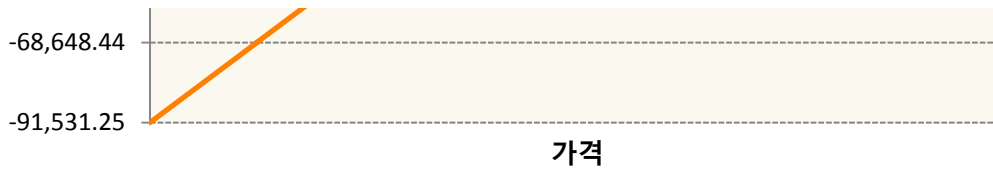


KR4201Q62550-2020-06 콜255



KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						508
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-508	-508	-508	-508	-508	-508	-508	
-5.33%	-338	-338	-338	-338	-338	-338	-338	
-2.67%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	169	169	169	169	169	169	169	
5.33%	338	338	338	338	338	338	338	
8.00%	508	508	508	508	508	508	508	
KR4201Q62527		2020-06 콜252.5						6,002
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,899	3,640	3,364	3,075	2,775	2,467	2,152	
-5.33%	3,261	2,939	2,609	2,272	1,930	1,584	1,235	
-2.67%	2,351	1,985	1,618	1,249	879	508	137	
0%	1,144	763	381	0	-381	-762	-1,143	
2.67%	-357	-725	-1,096	-1,470	-1,845	-2,222	-2,601	
5.33%	-2,126	-2,456	-2,797	-3,146	-3,501	-3,861	-4,225	
8.00%	-4,121	-4,399	-4,696	-5,007	-5,330	-5,662	-6,002	
KR4201Q62550		2020-06 콜255						10,844
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	6,726	6,282	5,803	5,294	4,762	4,210	3,643	
-5.33%	5,695	5,126	4,537	3,932	3,314	2,685	2,049	
-2.67%	4,185	3,521	2,850	2,174	1,493	809	123	
0%	2,140	1,427	713	0	-713	-1,426	-2,139	
2.67%	-456	-1,164	-1,874	-2,587	-3,301	-4,017	-4,733	
5.33%	-3,568	-4,222	-4,889	-5,567	-6,253	-6,945	-7,642	
8.00%	-7,131	-7,695	-8,288	-8,904	-9,537	-10,185	-10,844	
KR4301Q62525		2020-06 풋252.5						5,340
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-4,624	-4,711	-4,813	-4,929	-5,056	-5,194	-5,340	
-5.33%	-2,491	-2,642	-2,803	-2,973	-3,150	-3,332	-3,519	
-2.67%	-688	-894	-1,103	-1,315	-1,528	-1,742	-1,958	

0%	677	451	226	0	-226	-451	-677
2.67%	1,584	1,383	1,178	969	756	542	326
5.33%	2,108	1,960	1,800	1,629	1,451	1,265	1,074
8.00%	2,369	2,278	2,169	2,046	1,910	1,763	1,607

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

(단위:백만원)

19,841

공시일	2020-05-18
기준일	2020-05-15

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

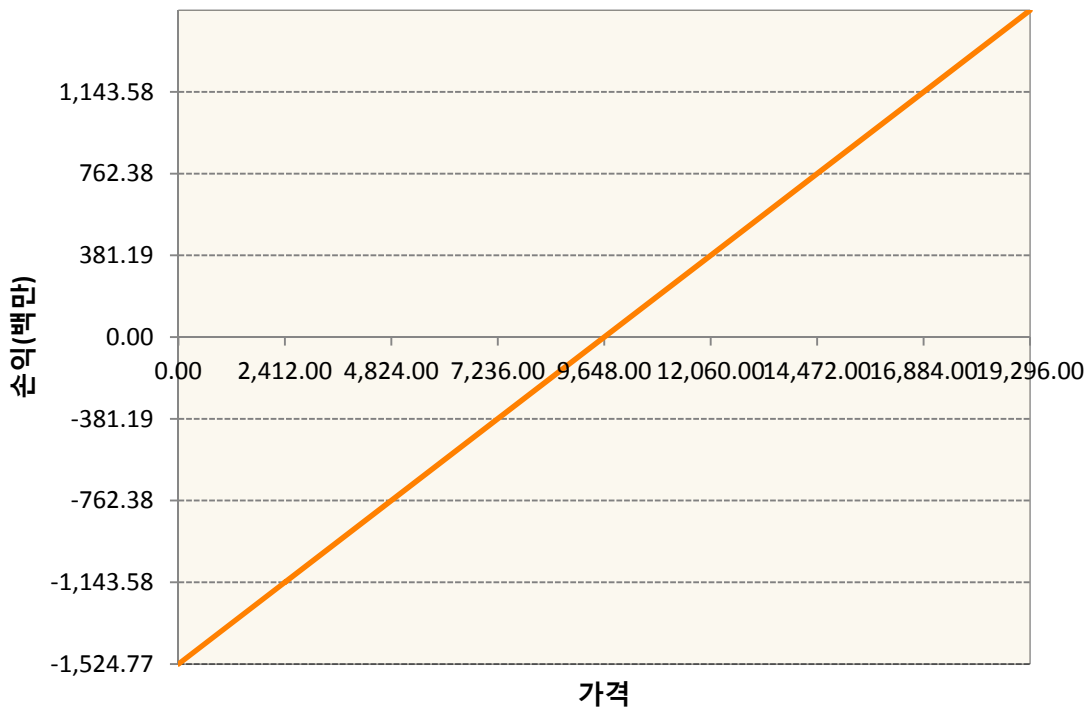
1. 계약금액

(단위:백만원)

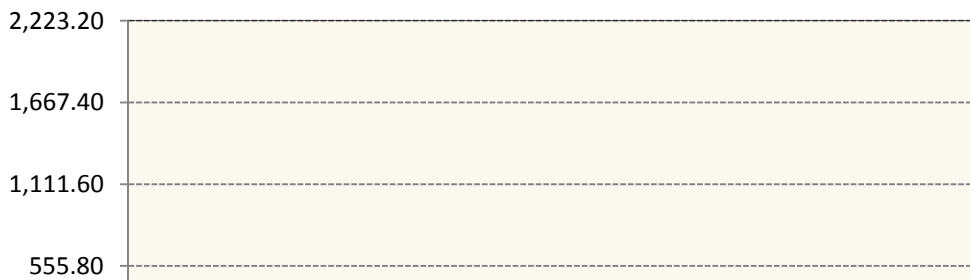
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,525	0	1,525	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,446	-4,446	장내
누계	통화	선도	699	2,236	-1,537	장외

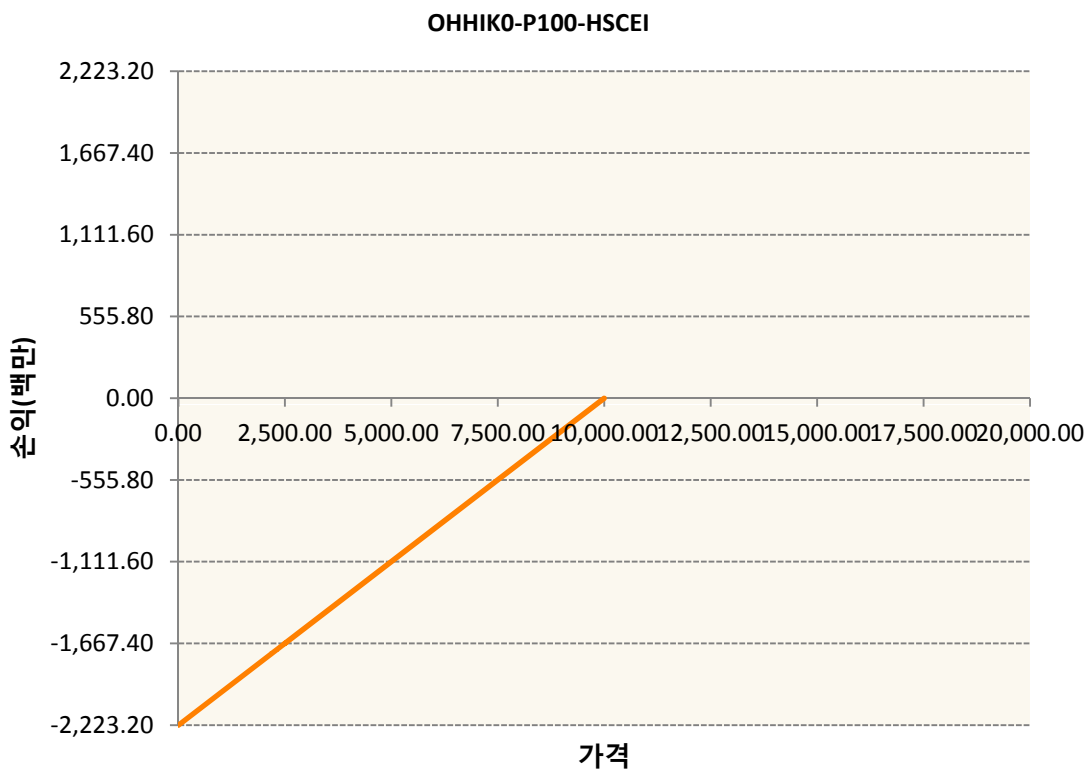
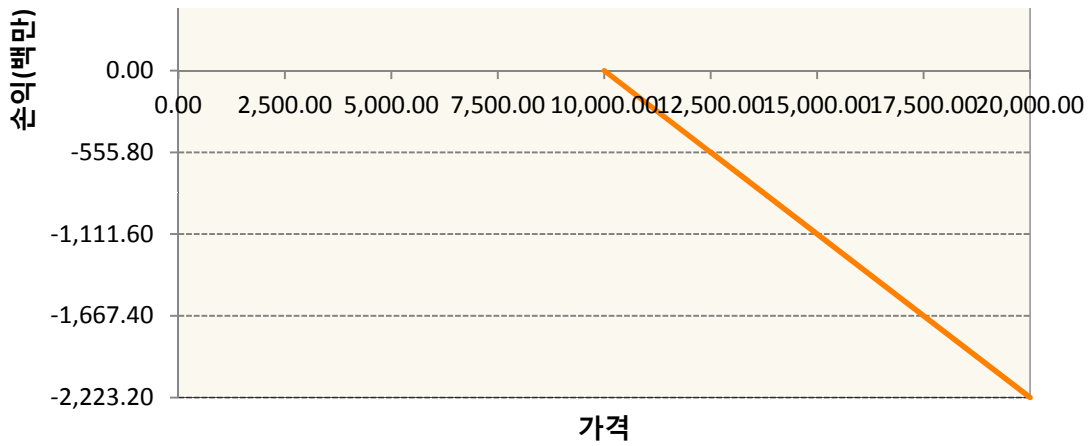
2. 만기시점의 손익구조

HCK0-HSCEI Futures May20



OHHIK0-C100-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E		179
FX21020H05 HKD/KRW 22-05-20E		56
HCK0 HSCEI Futures May20		122
OHHIK0-C1C HSCEI		178
OHHIK0-P10 HSCEI		178

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	635

공시일	2020-05-18
기준일	2020-05-15

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

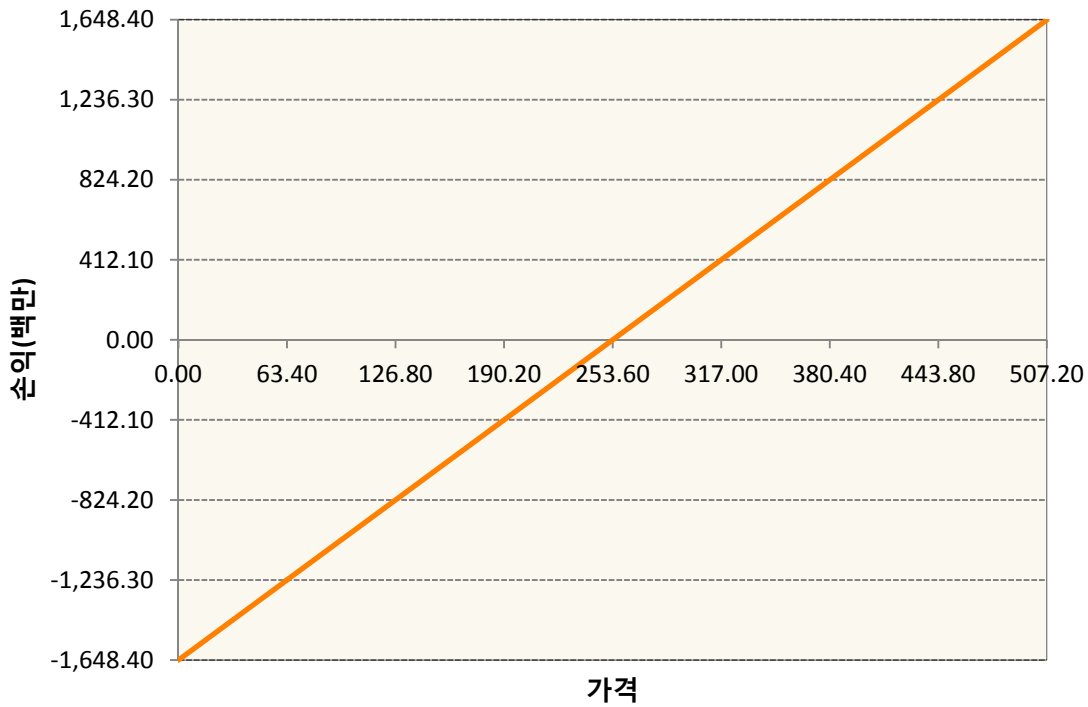
1. 계약금액

(단위:백만원)

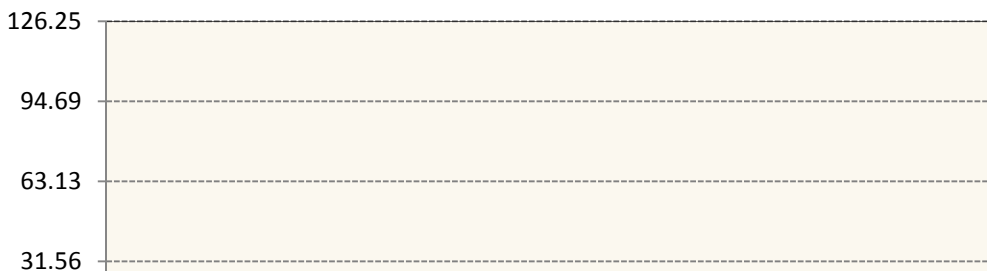
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	3,438	-3,438	장내
누계	유가증권	선물	1,648	0	1,648	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,361	-3,361	장내

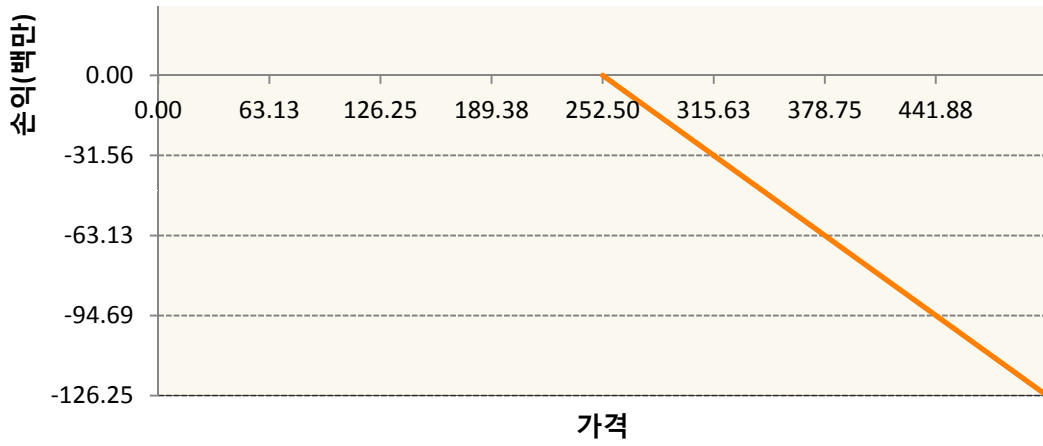
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

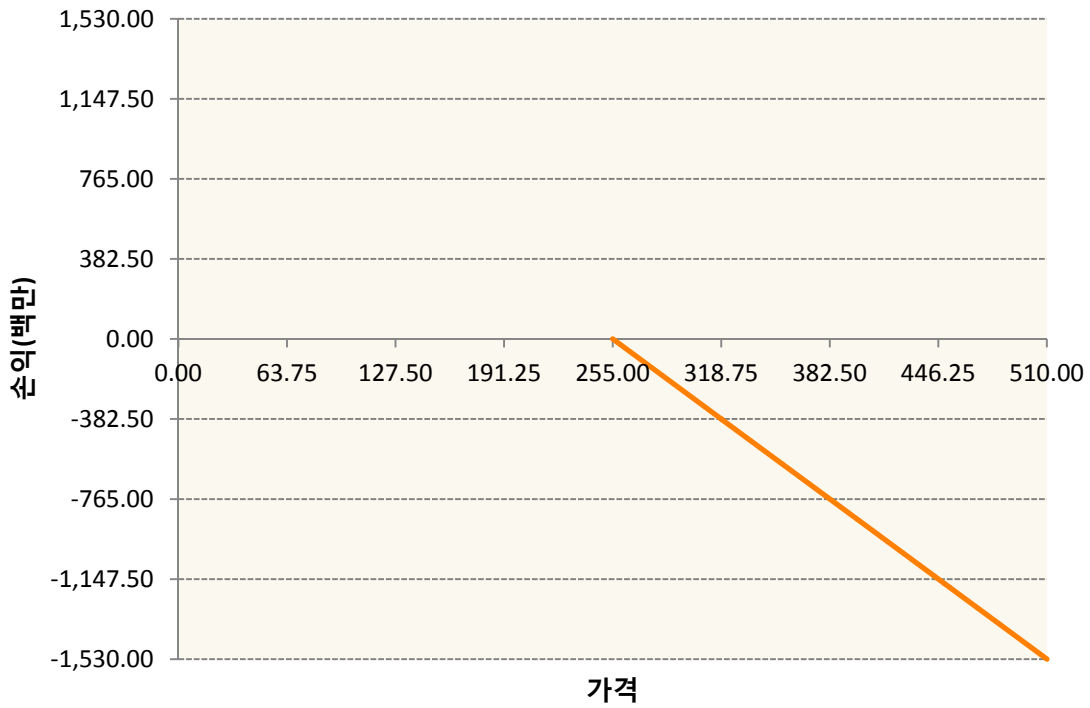


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

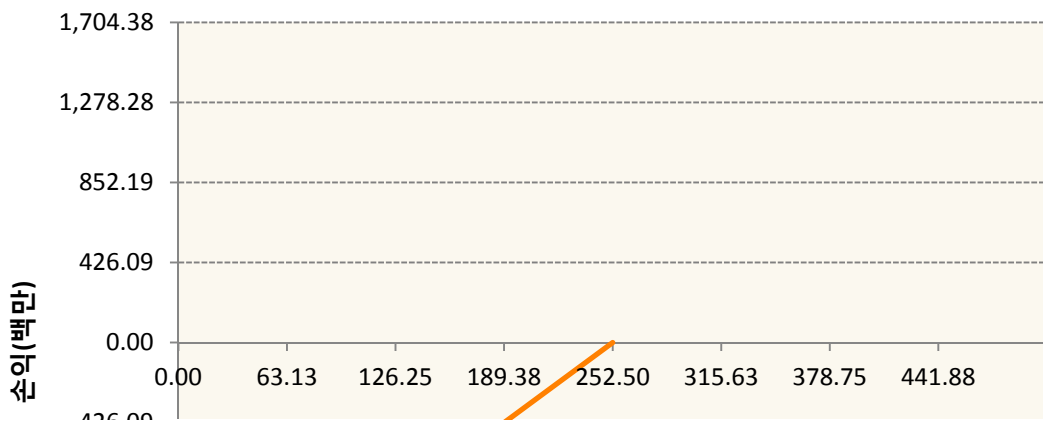




KR4201Q62550-2020-06 콜255



KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





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						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	
KR4201Q62527		2020-06 콜252.5						8
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5	5	4	4	4	3	3	
-5.33%	4	4	3	3	3	2	2	
-2.67%	3	3	2	2	1	1	0	
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2	
2.67%	0	-1	-1	-2	-2	-3	-3	
5.33%	-3	-3	-4	-4	-5	-5	-6	
8.00%	-5	-6	-6	-7	-7	-8	-8	
KR4201Q62550		2020-06 콜255						93
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	58	54	50	45	41	36	31
-5.33%	49	44	39	34	28	23	18
-2.67%	36	30	24	19	13	7	1
0%	18	12	6	0	-6	-12	-18
2.67%	-4	-10	-16	-22	-28	-34	-41
5.33%	-31	-36	-42	-48	-54	-60	-66
8.00%	-61	-66	-71	-76	-82	-87	-93
KR4301Q62525 2020-06 풋252.5							99
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-86	-88	-90	-92	-94	-97	-99
-5.33%	-46	-49	-52	-55	-59	-62	-66
-2.67%	-13	-17	-21	-24	-28	-32	-36
0%	13	8	4	0	-4	-8	-13
2.67%	29	26	22	18	14	10	6
5.33%	39	36	34	30	27	24	20
8.00%	44	42	40	38	36	33	30

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

(단위:백만원)

561

공시일	2020-05-18
기준일	2020-05-15

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

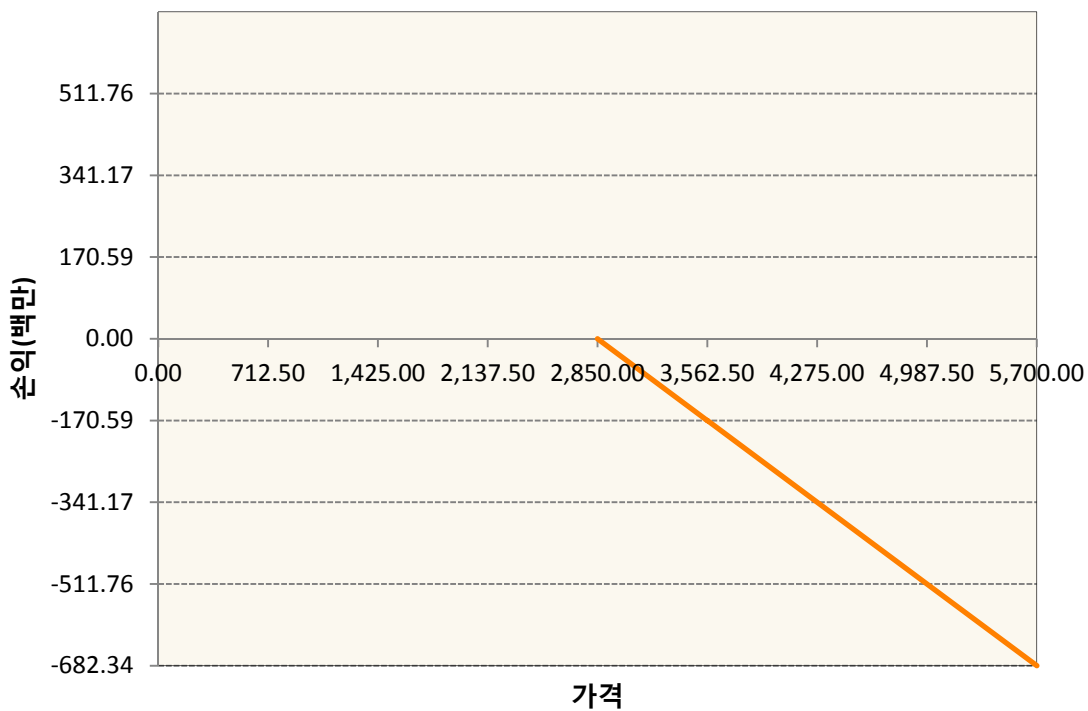
1. 계약금액

(단위:백만원)

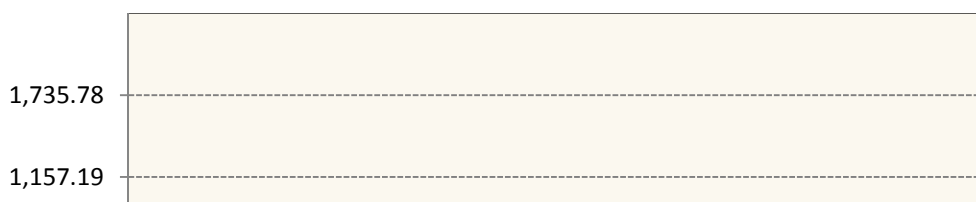
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	697	0	697	
누계	유가증권	스왑	7,933	0	7,933	장외
누계	유가증권	옵션	0	5,993	-5,993	장내
누계	통화	선도	0	2,692	-2,692	장외

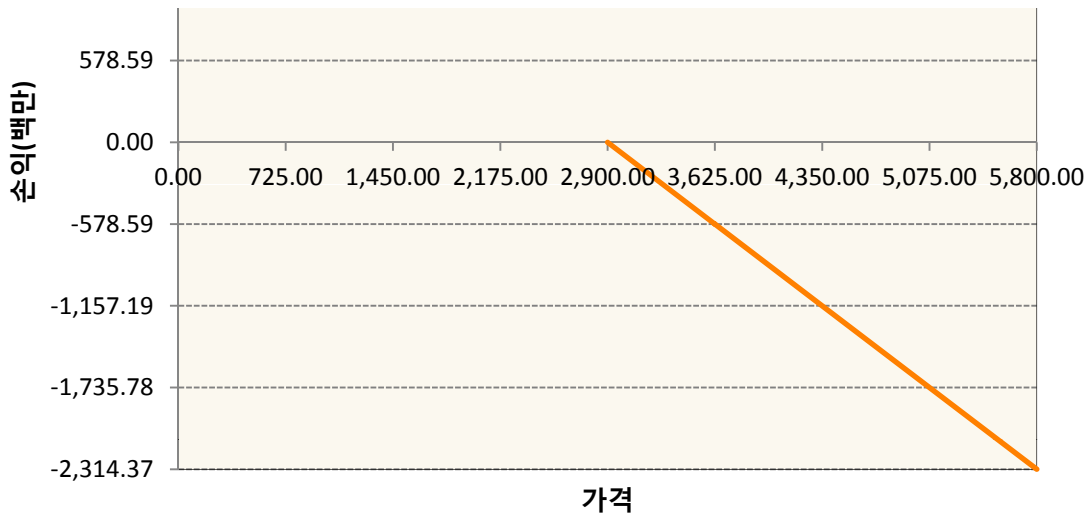
2. 만기시점의 손익구조

OESXK0-C2850-EURO STOXX 50

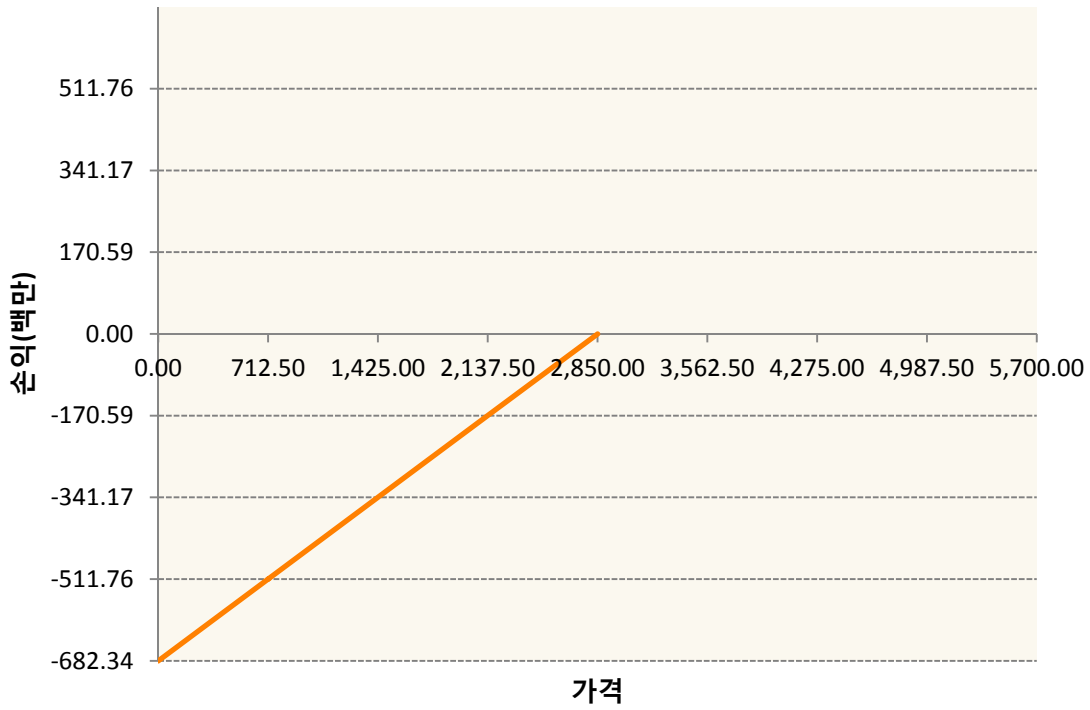


OESXK0-C2900-EURO STOXX 50

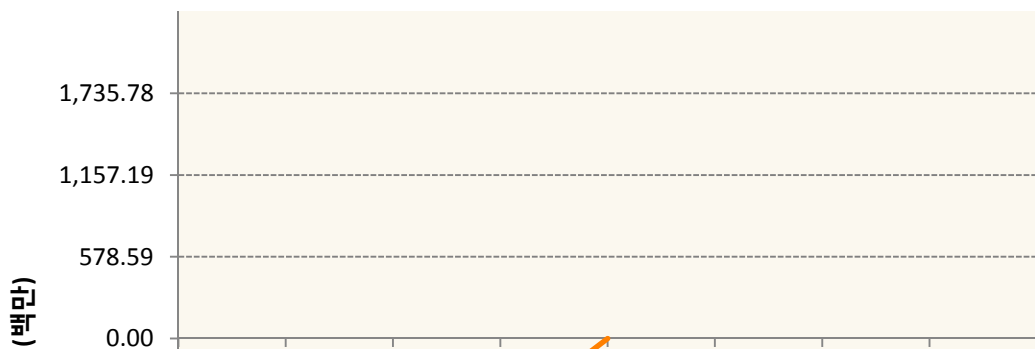


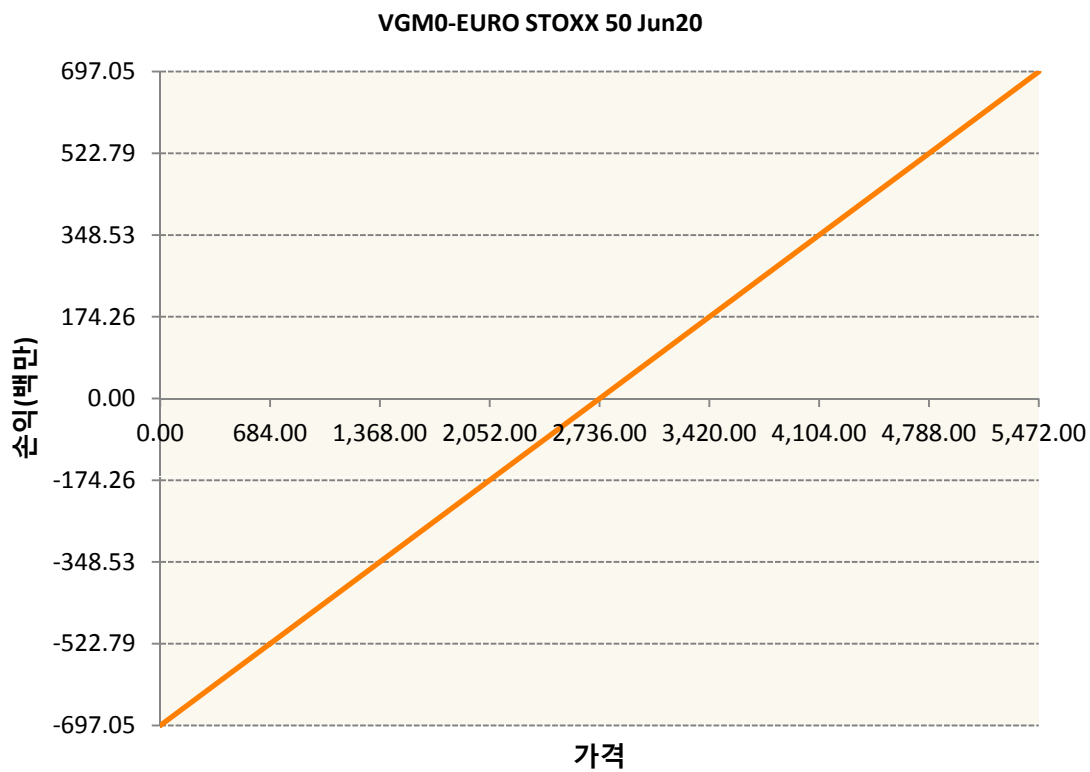
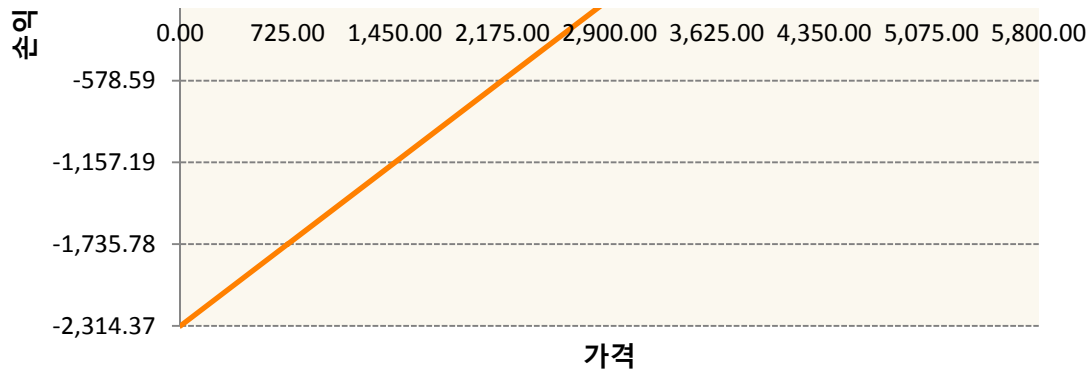


OESXK0-P2850-EURO STOXX 50



OESXK0-P2900-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	2
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E	215
OESXK0-C28 EURO STOXX 50	55
OESXK0-C29 EURO STOXX 50	185
OESXK0-P28 EURO STOXX 50	55
OESXK0-P29 EURO STOXX 50	185
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20	56

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

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

(단위:백만원)

1,127

공시일	2020-05-18
기준일	2020-05-15

ETF스마트레버리지목표전환형9호

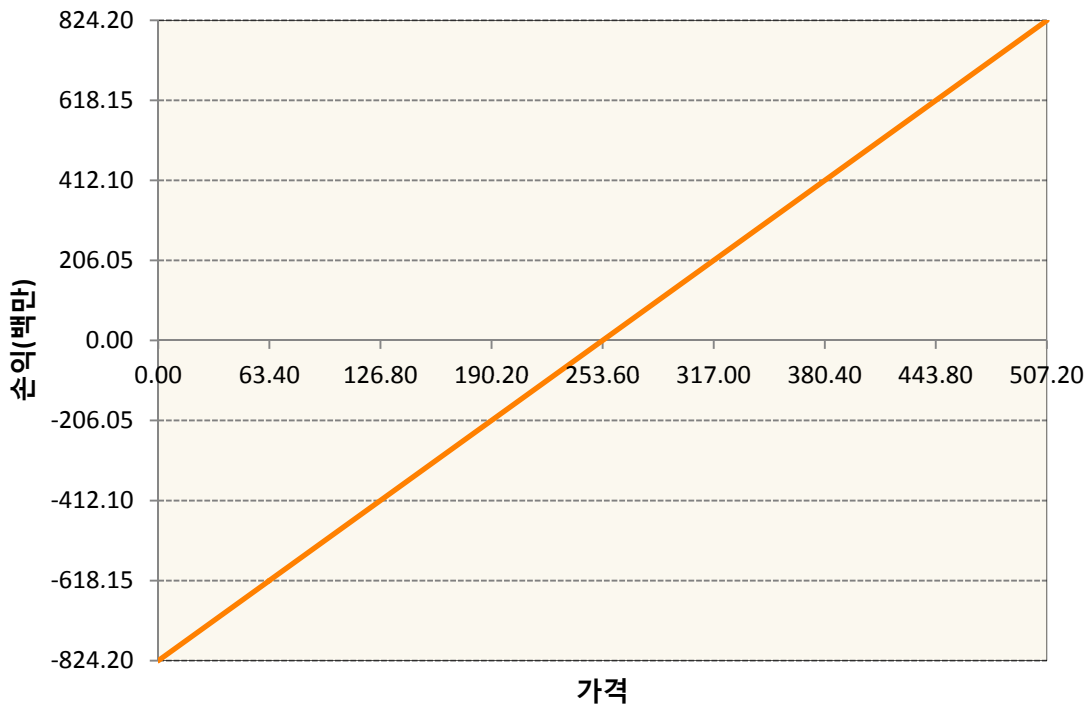
1. 계약금액

(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
가격	기초자산의 변동성							
	-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)

98

공시일	2020-05-18
기준일	2020-05-15

ETF스마트레버리지목표전환형10호

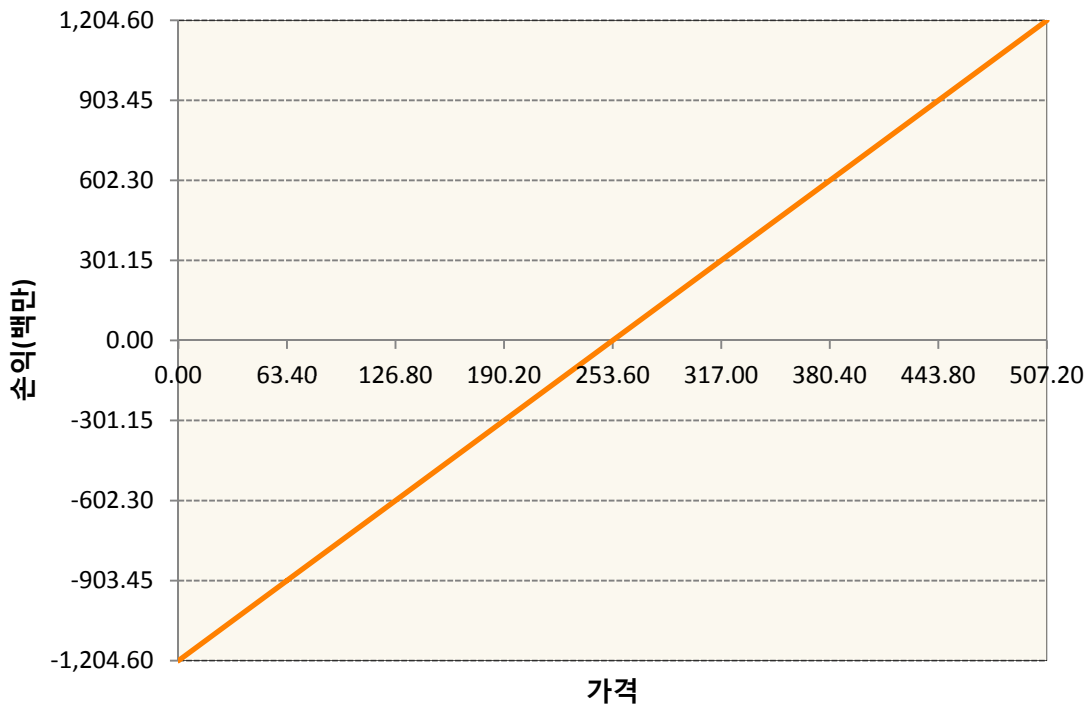
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,205	0	1,205	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						96
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96	
-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%	96	96	96	96	96	96	96	

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

(단위:백만원)

143

공시일	2020-05-18
기준일	2020-05-15

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

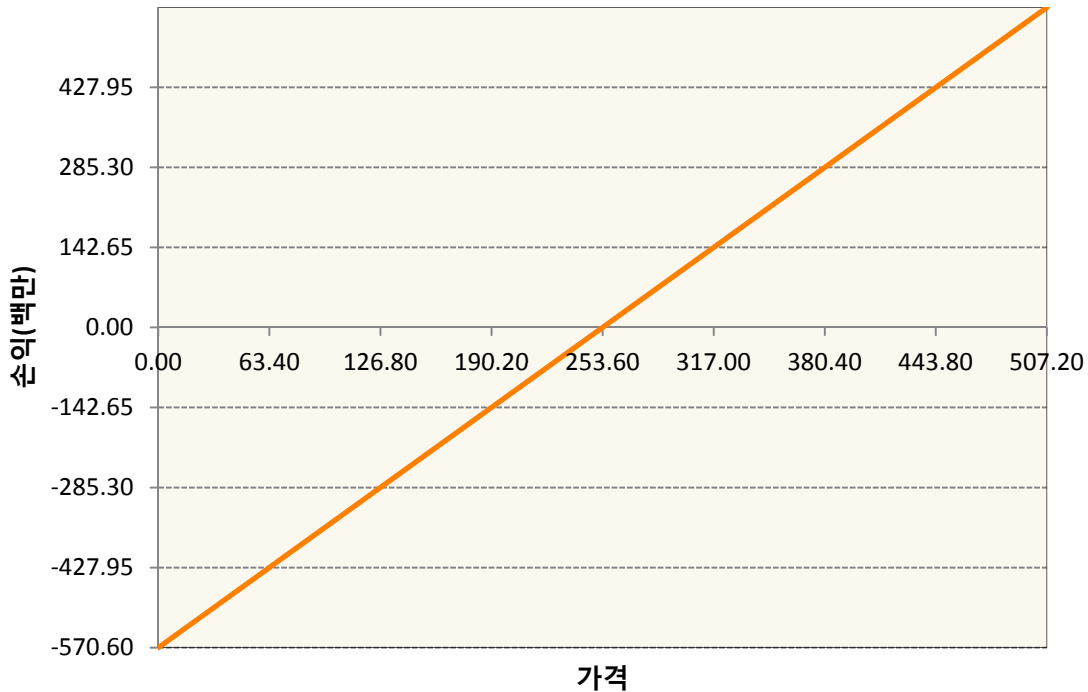
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	571	0	571	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%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-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%	30	30	30	30	30	30	30
8.00%	46	46	46	46	46	46	46

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

(단위:백만원)

68

공시일	2020-05-18
기준일	2020-05-15

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

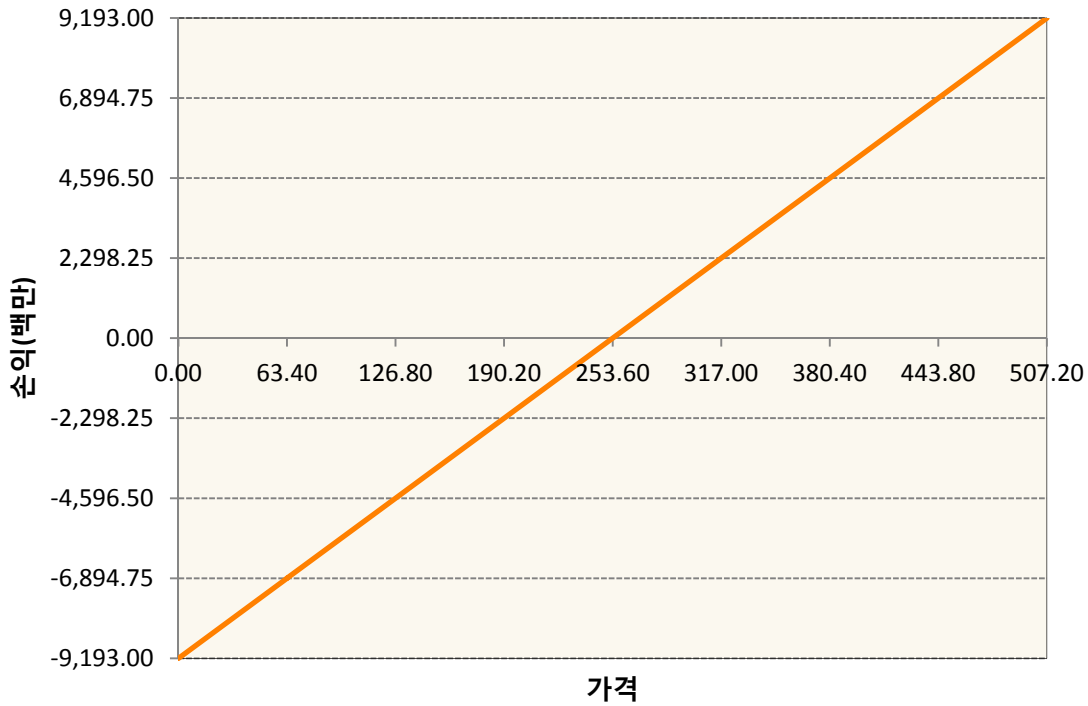
1. 계약금액

(단위:백만원)

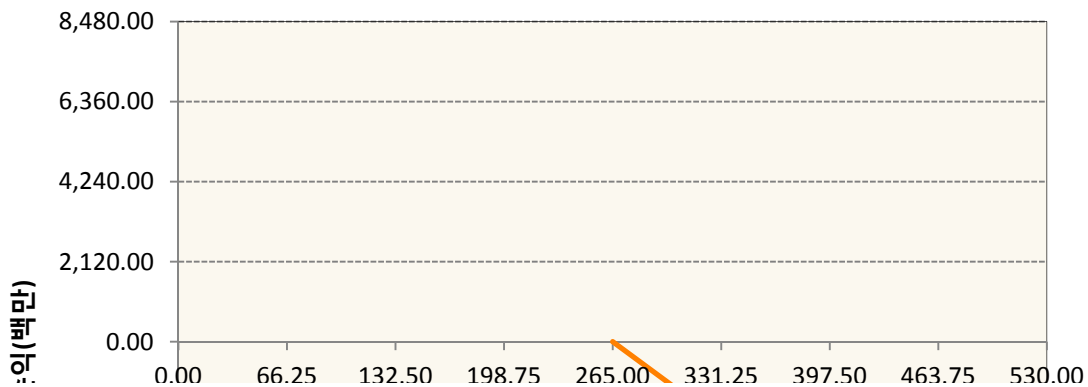
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	5,293	5,932	-639	장내
누계	유가증권	선물	9,193	0	9,193	장내
누계	유가증권	옵션	2,917	18,177	-15,260	장내

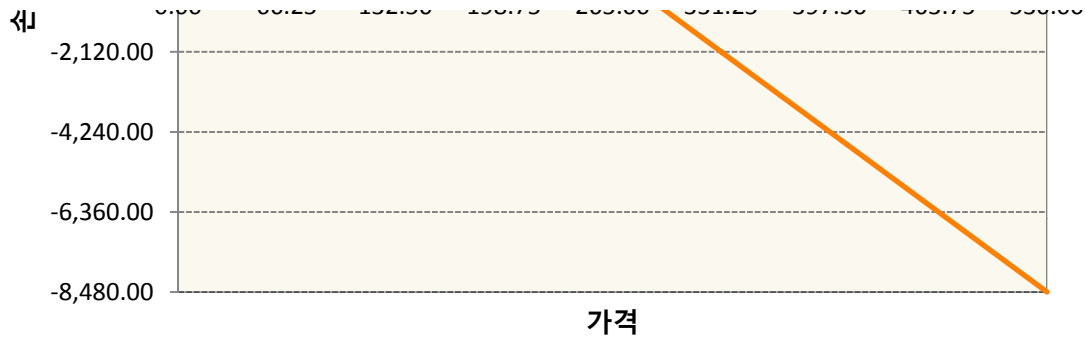
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

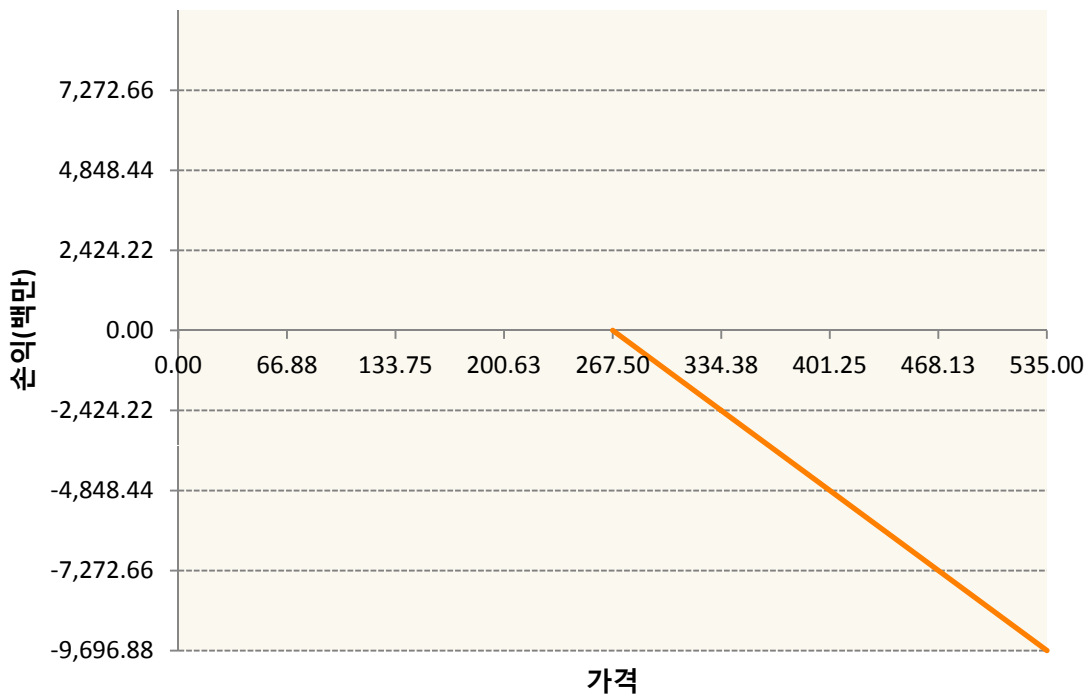


KR4201Q62659-2020-06 콜265

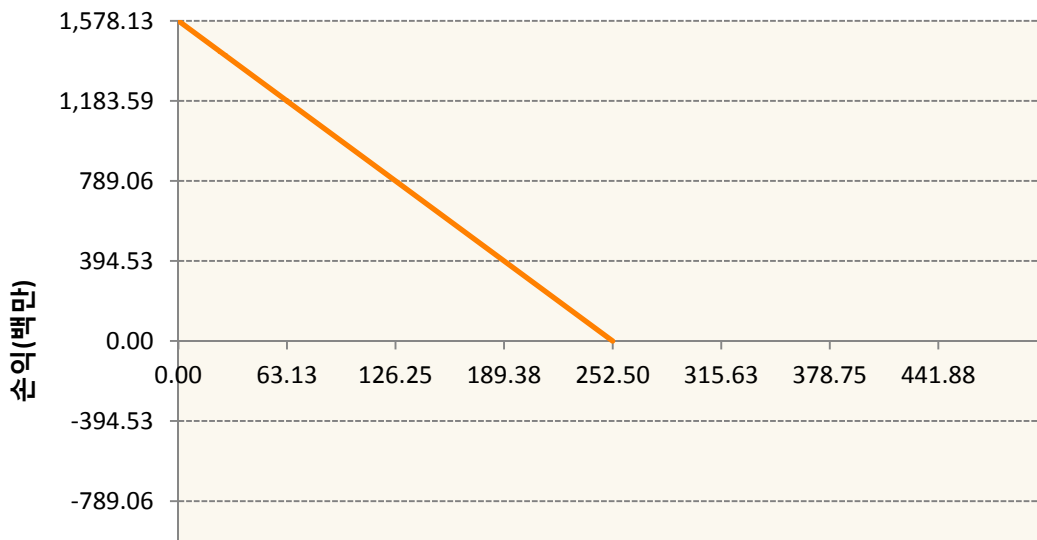


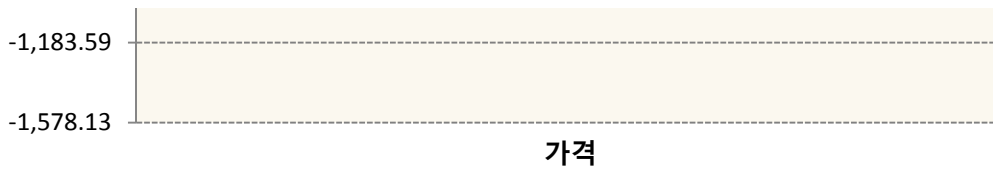


KR4201Q62675-2020-06 콜267.5

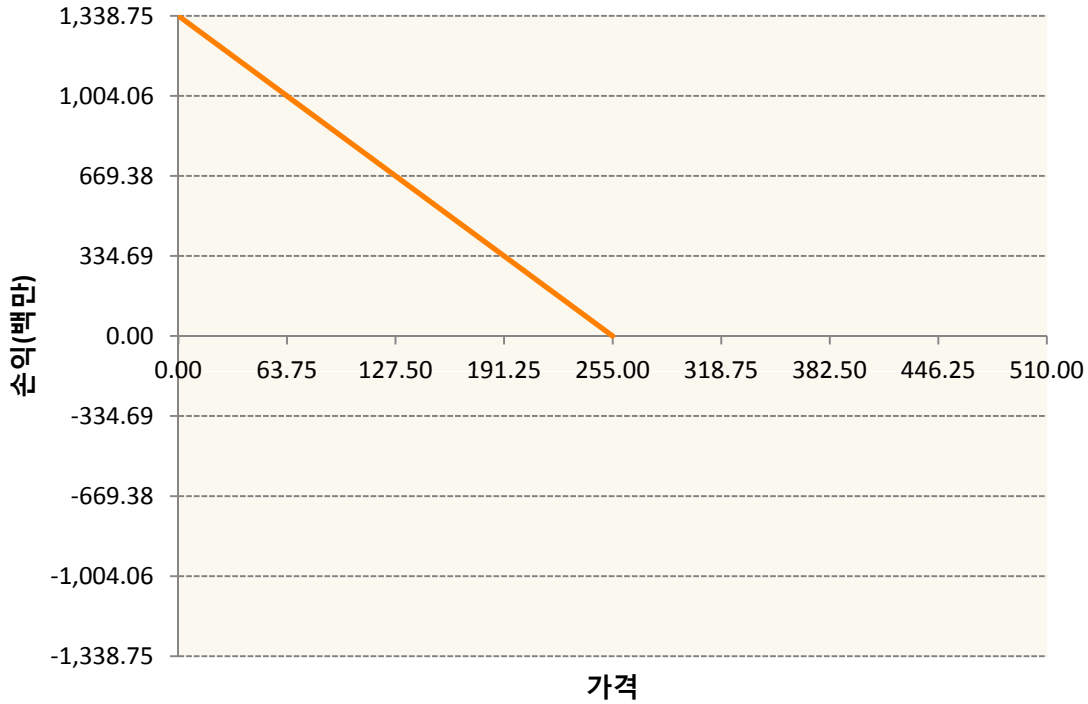


KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





KR4301Q62558-2020-06 풋255



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						736
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-736	-736	-736	-736	-736	-736	-736	
-5.33%	-491	-491	-491	-491	-491	-491	-491	
-2.67%	-245	-245	-245	-245	-245	-245	-245	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	245	245	245	245	245	245	245	
5.33%	491	491	491	491	491	491	491	
8.00%	736	736	736	736	736	736	736	
KR4201Q62659		2020-06 콜265						429
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	216	203	188	171	151	131	109	
-5.33%	192	173	152	129	106	81	55	
-2.67%	151	126	100	73	45	17	-13	

0%	91	61	31	0	-31	-63	-95
2.67%	9	-25	-58	-91	-125	-158	-191
5.33%	-98	-132	-167	-201	-235	-269	-303
8.00%	-229	-262	-295	-328	-361	-395	-429
KR4201Q62675 2020-06 콜267.5							466
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	222	209	193	175	155	133	110
-5.33%	199	179	157	134	108	81	54
-2.67%	159	133	105	76	46	14	-18
0%	100	67	34	0	-35	-70	-105
2.67%	15	-21	-59	-96	-133	-171	-209
5.33%	-96	-135	-173	-212	-251	-290	-329
8.00%	-234	-272	-311	-349	-388	-427	-466
KR4301Q62525 2020-06 풋252.5							92
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	80	81	83	85	87	90	92
-5.33%	43	46	48	51	54	57	61
-2.67%	12	15	19	23	26	30	34
0%	-12	-8	-4	0	4	8	12
2.67%	-27	-24	-20	-17	-13	-9	-6
5.33%	-36	-34	-31	-28	-25	-22	-19
8.00%	-41	-39	-37	-35	-33	-30	-28
KR4301Q62558 2020-06 풋255							81
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	72	73	75	76	78	79	81
-5.33%	40	42	44	47	49	51	54
-2.67%	12	15	18	21	24	27	30
0%	-10	-7	-3	0	3	7	10
2.67%	-25	-22	-19	-16	-13	-9	-6
5.33%	-35	-32	-30	-27	-24	-21	-18
8.00%	-40	-38	-36	-34	-32	-30	-27

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

(단위:백만원)

1,881

공시일	2020-05-18
기준일	2020-05-15

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	149,730	0	149,730	

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	2020-05-18
기준일	2020-05-15

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	100,956	0	100,956	

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	2020-05-18
기준일	2020-05-15

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	446,035	0	446,035	
누계	통화	선도	0	471,473	-471,473	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,403
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	985
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	847
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	739
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	492
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,447
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,992
FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E	2,954
FX21020J02€ KRW/USD 10-06-20E	1,339
FX21020J02£ KRW/USD 22-06-20E	1,517
FX21020J02¥ KRW/USD 22-06-20E	1,970
FX21020J03¥ KRW/USD 24-07-20E	2,216
FX21020J04¥ KRW/USD 24-07-20E	1,773
FX21020J04¥ KRW/USD 24-07-20E	1,970
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	2,048
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	1,950
FX21020K01 KRW/USD 22-06-20E	689
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	2,403
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	985

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

19,095

공시일	2020-05-18
기준일	2020-05-15

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

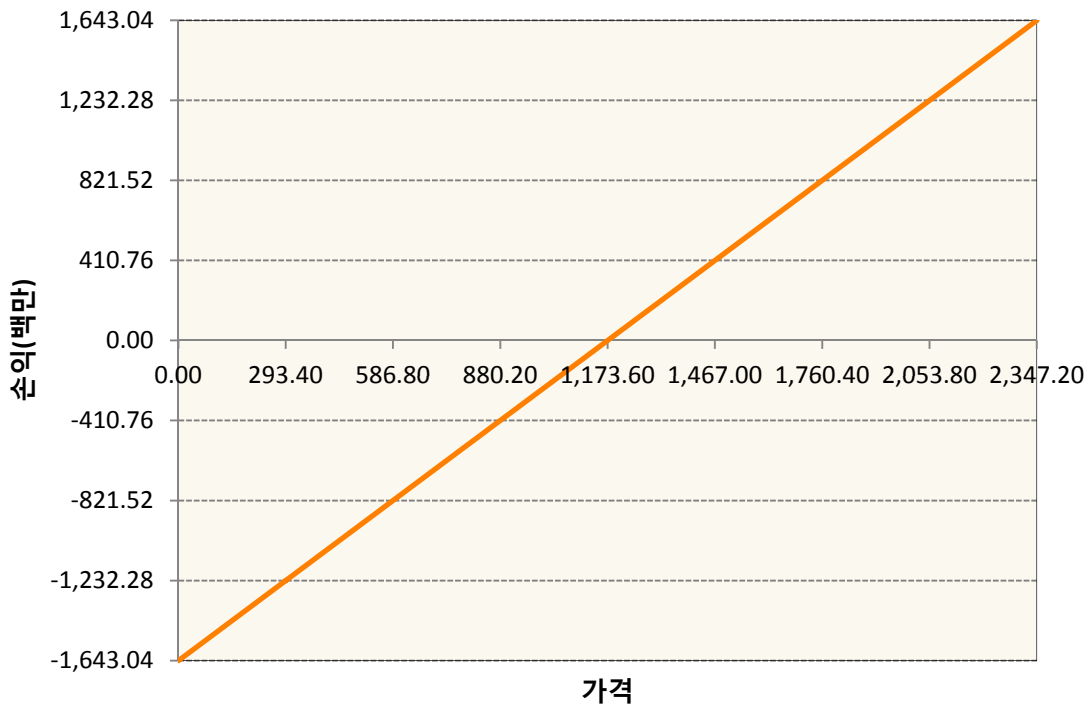
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,643	0	1,643	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4108Q60007-2020-06 KRX300 선물



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

(단위:백만원)

196

공시일	2020-05-18
기준일	2020-05-15

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

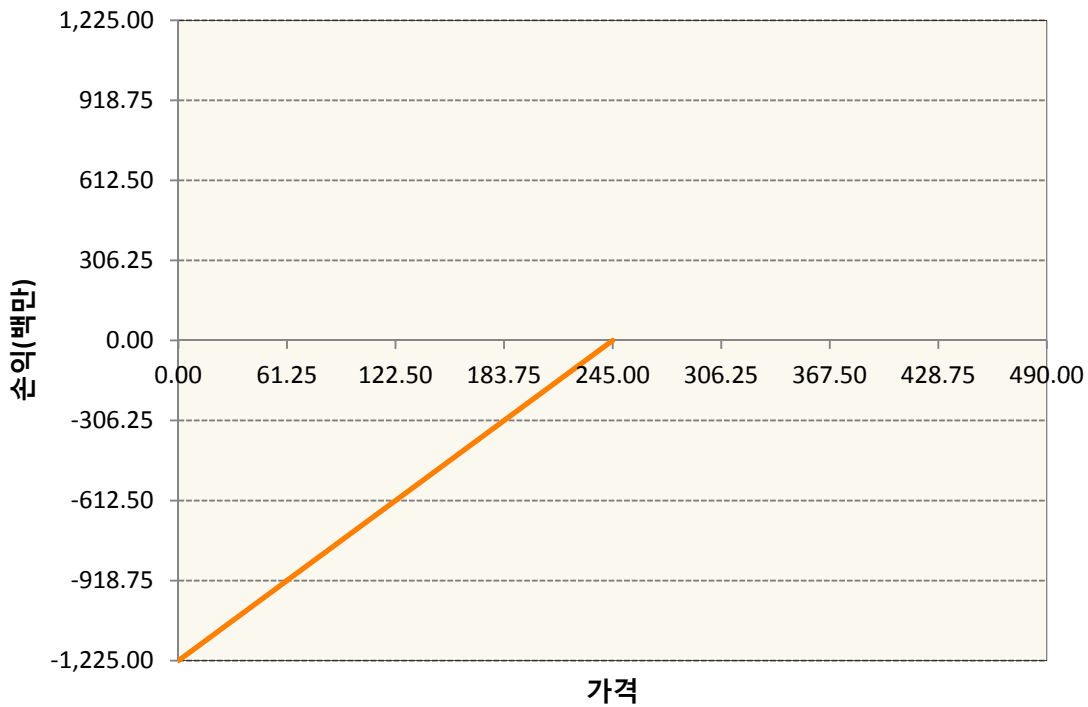
1. 계약금액

(단위:백만원)

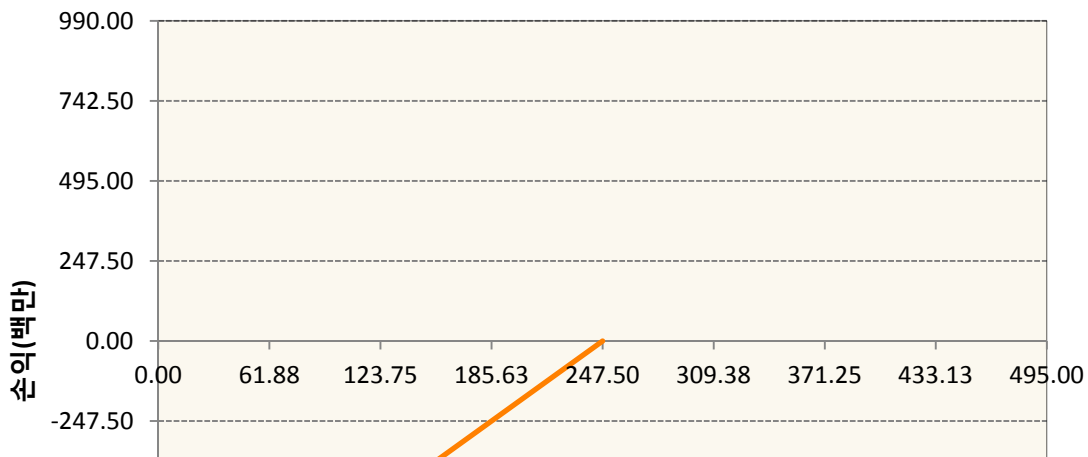
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	1,084	883	202	장내
누계	유가증권	옵션	0	2,215	-2,215	장내

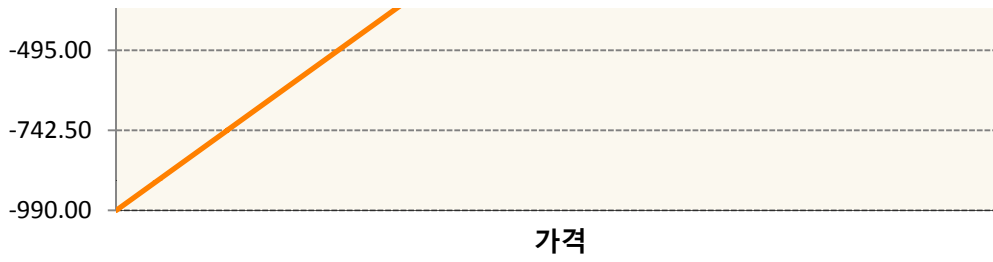
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q62459-2020-06 풋245



KR4301Q62475-2020-06 풋247.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q62459		2020-06 풋245						60
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-46	-48	-51	-53	-55	-58	-60	
-5.33%	-22	-25	-28	-30	-33	-36	-39	
-2.67%	-4	-7	-10	-13	-16	-19	-22	
0%	8	5	3	0	-3	-6	-8	
2.67%	15	13	11	9	6	4	1	
5.33%	18	17	15	14	12	10	8	
8.00%	19	18	18	17	16	14	13	
KR4301Q62475		2020-06 풋247.5						52
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-42	-43	-45	-47	-48	-50	-52	
-5.33%	-21	-23	-25	-27	-29	-32	-34	
-2.67%	-4	-7	-9	-12	-14	-16	-19	
0%	7	5	2	0	-2	-5	-7	
2.67%	14	12	10	8	6	4	2	
5.33%	17	16	15	13	12	10	8	
8.00%	18	18	17	16	15	14	12	

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

97

공시일	2020-05-18
기준일	2020-05-15

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	7,352	0	7,352	
누계	통화	선도	0	7,201	-7,201	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J04(KRW/USD 29-05-20E	254
FX21020K01(KRW/USD 15-06-20E	322
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

292

공시일	2020-05-18
기준일	2020-05-15

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

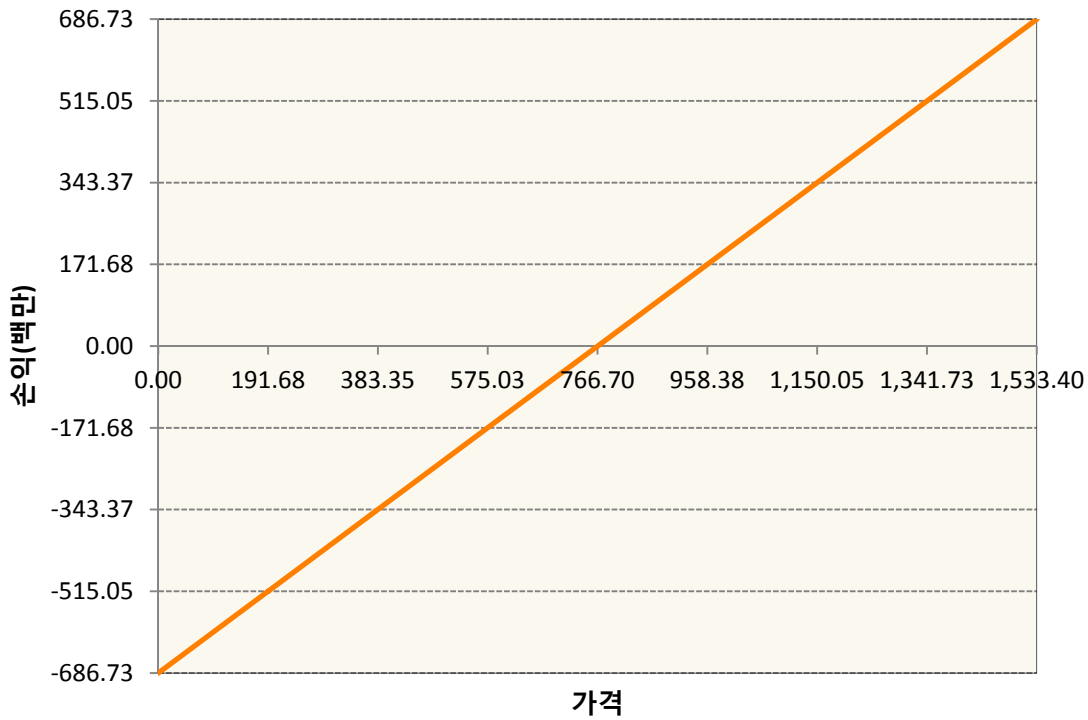
1. 계약금액

(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	687	0	687	
누계	유가증권	스왑	872	0	872	장외
누계	통화	선도	205	870	-665	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	9
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	9
VNCK0 VN30 Index Future May20	55

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

(단위:백만원)

161

공시일	2020-05-18
기준일	2020-05-15

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

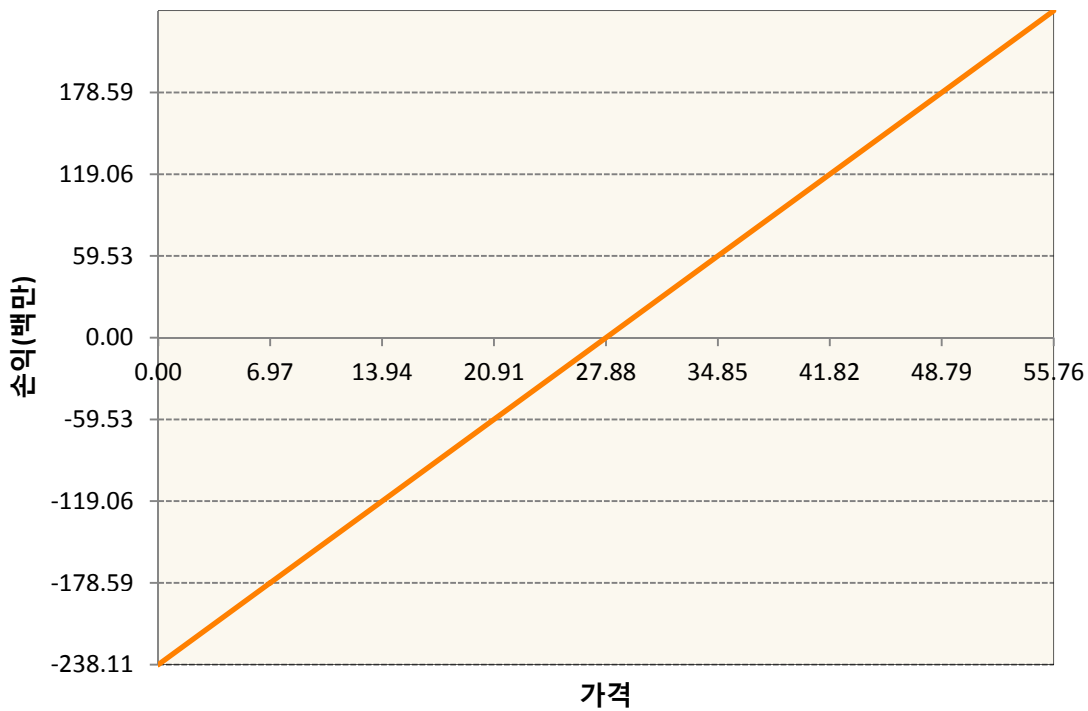
1. 계약금액

(단위:백만원)

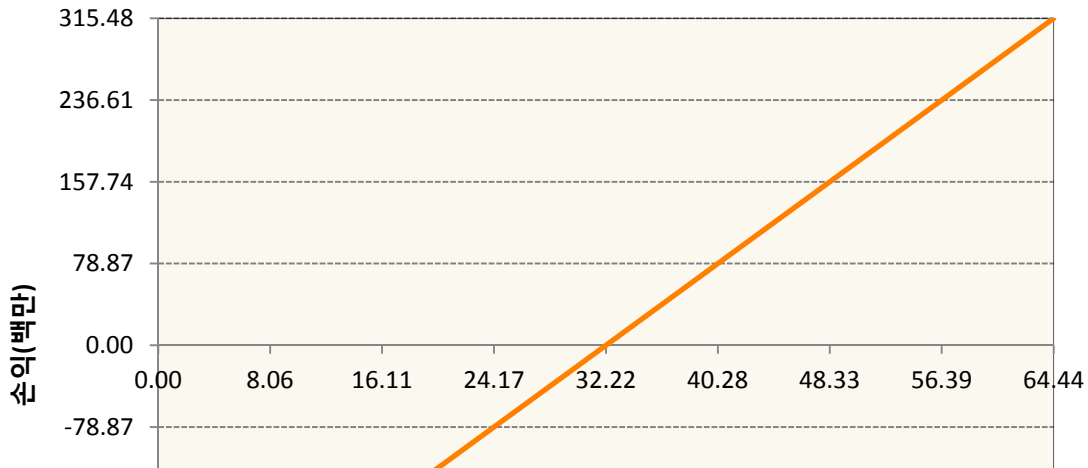
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,542	185	1,358	

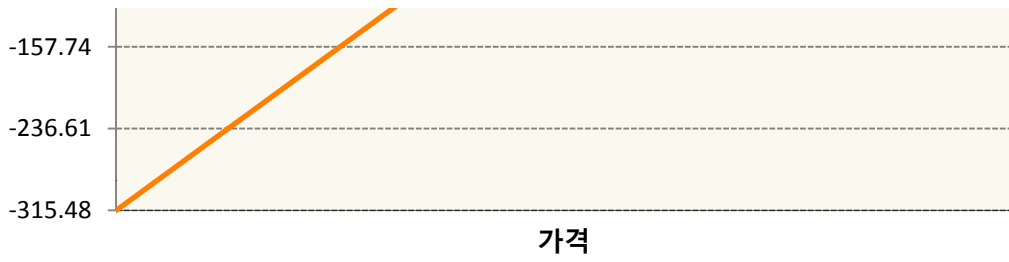
2. 만기시점의 손익구조

CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20

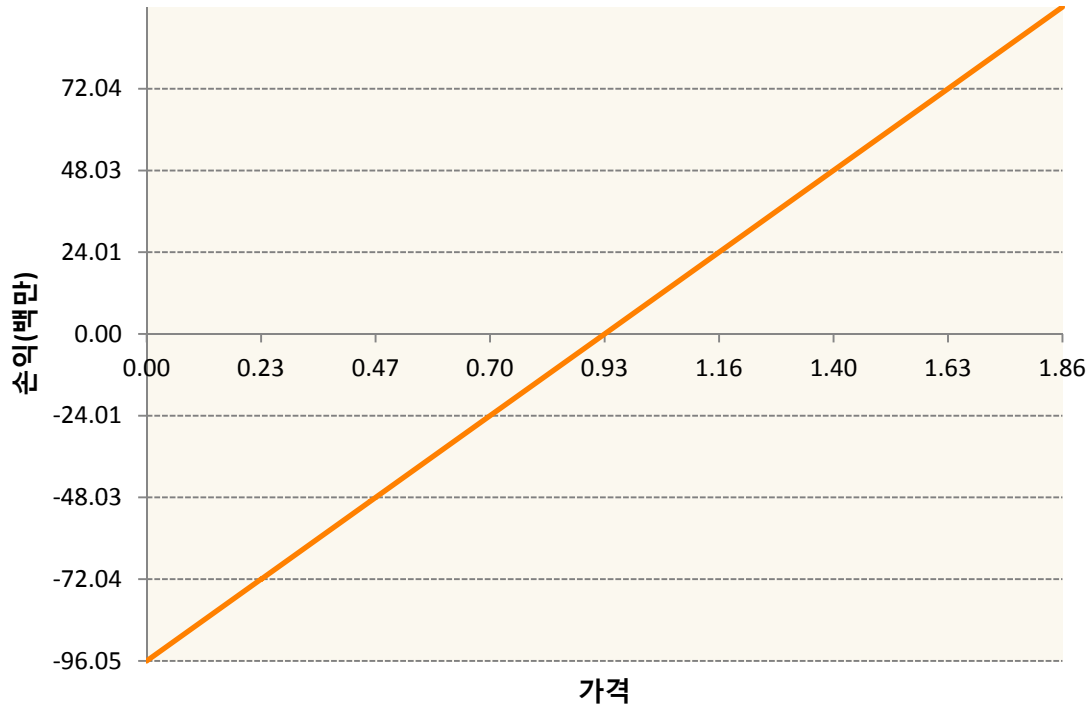


COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20

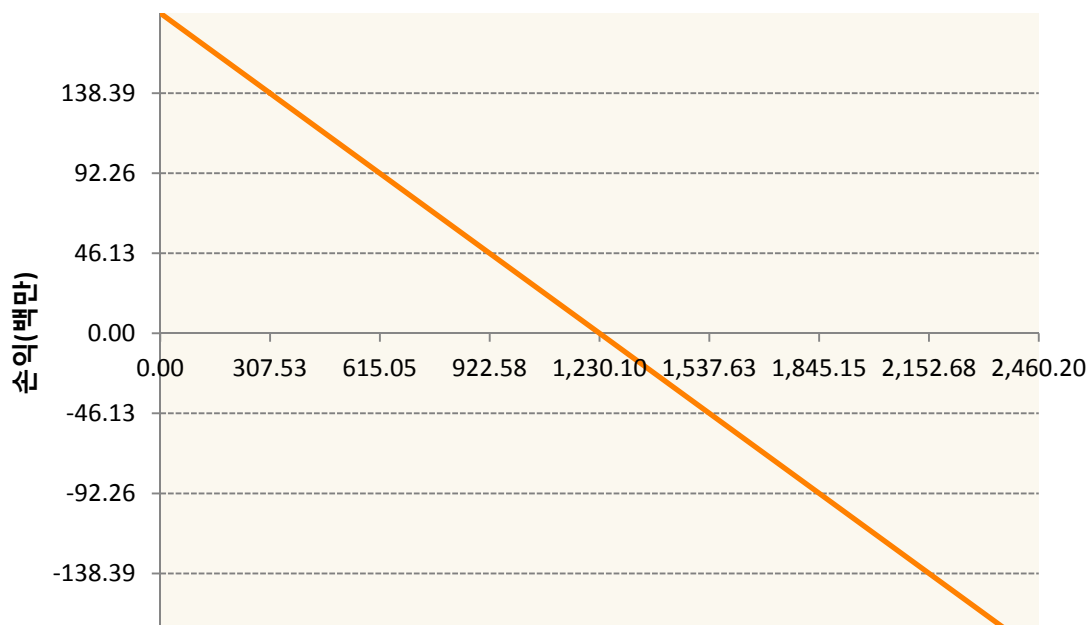


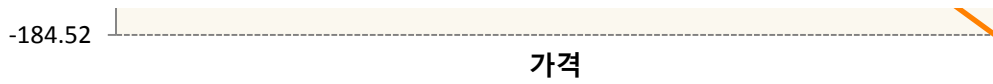


HON0-NY Harb ULSD Fut Jul20

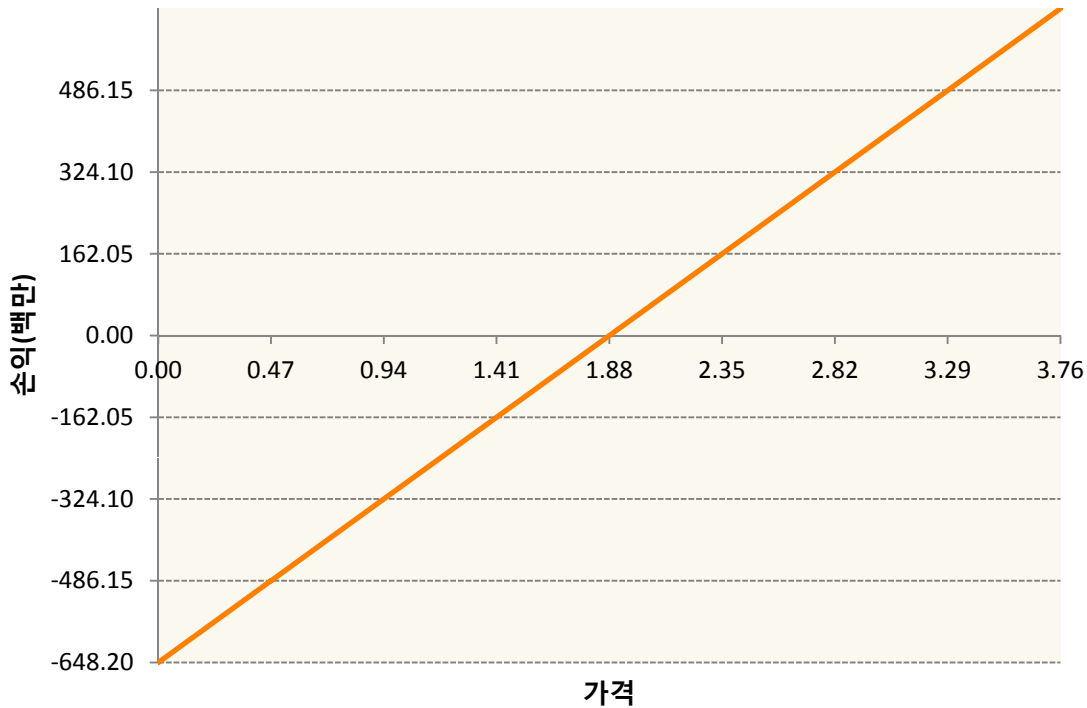


KR4175Q60006-2020-06 달러선물

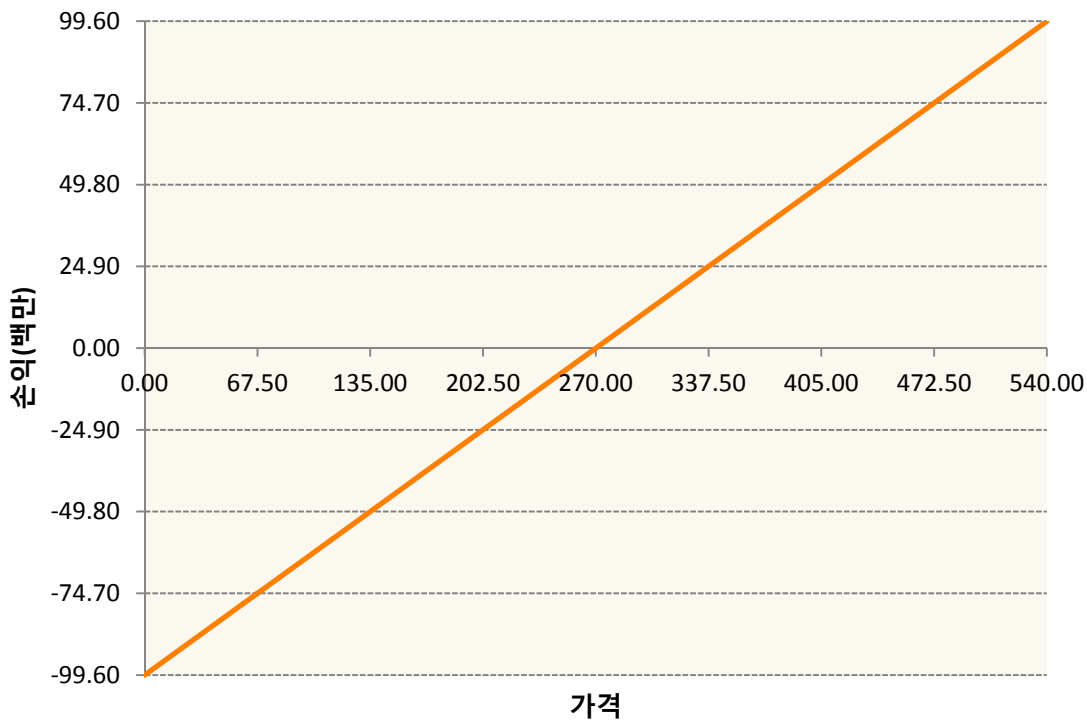




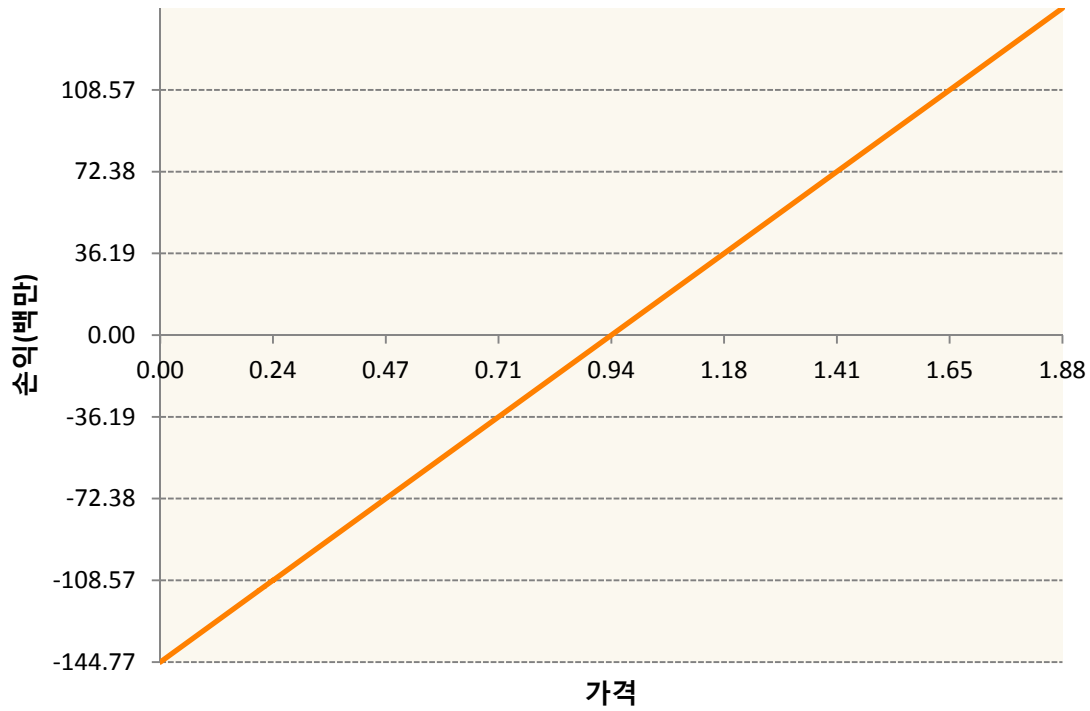
NGN20-NATURAL GAS FUTR Jul20



QSN0-Low Su Gasoil G Jul20



XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN0	WTI CRUDE FUTURE Jul20	19
COU0	BRENT CRUDE FUTR Sep20	25
HON0	NY Harb ULSD Fut Jul20	8
KR4175Q60C	2020-06 달러선물	15
NGN20	NATURAL GAS FUTR Jul20	52
QSN0	Low Su Gasoil G Jul20	8
XBN0	GASOLINE RBOB FUT Jul20	12

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

(단위:백만원)

657

공시일	2020-05-18
기준일	2020-05-15

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

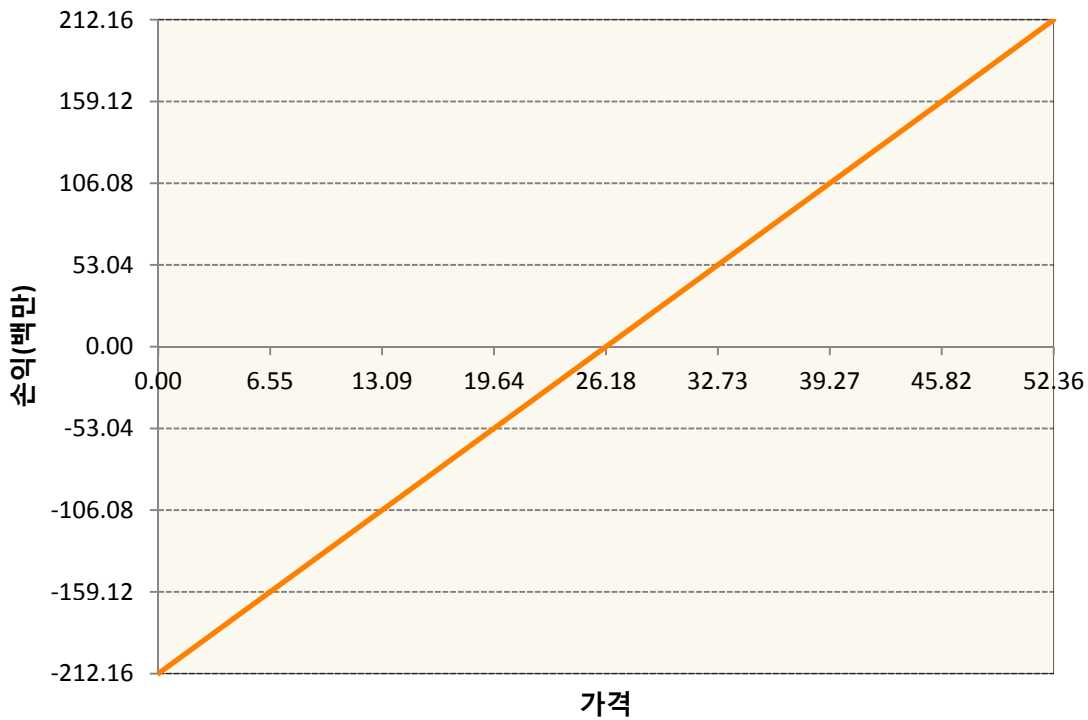
1. 계약금액

(단위:백만원)

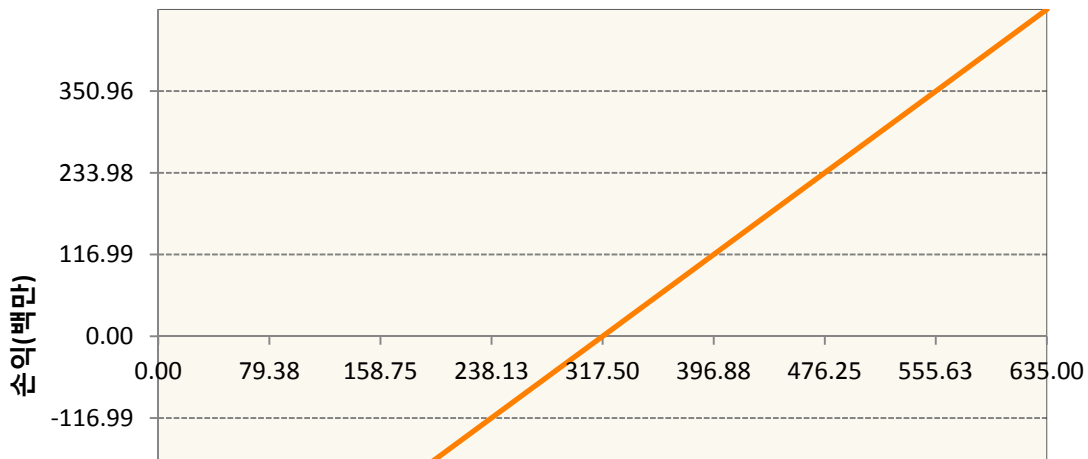
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,410	74	2,336	

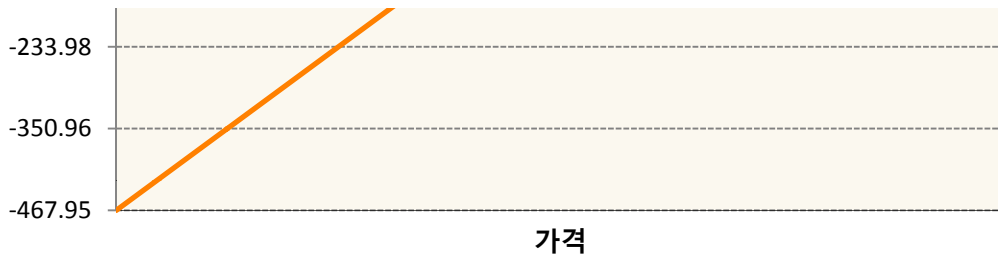
2. 만기시점의 손익구조

BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20

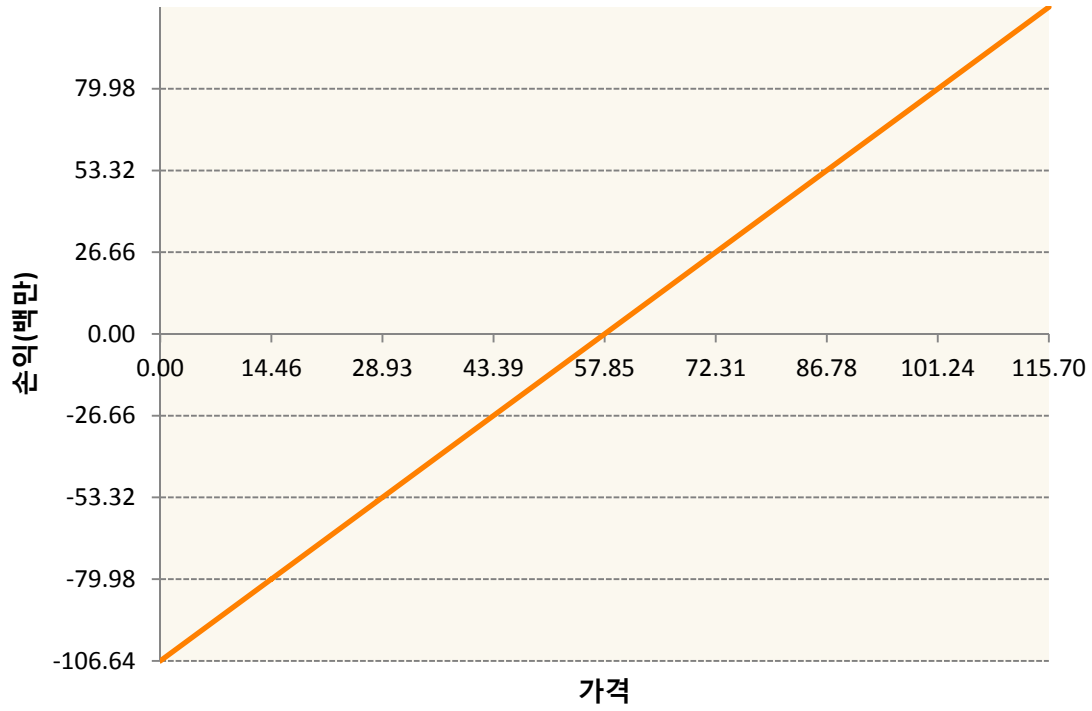


CNO-CORN FUTURE Jul20

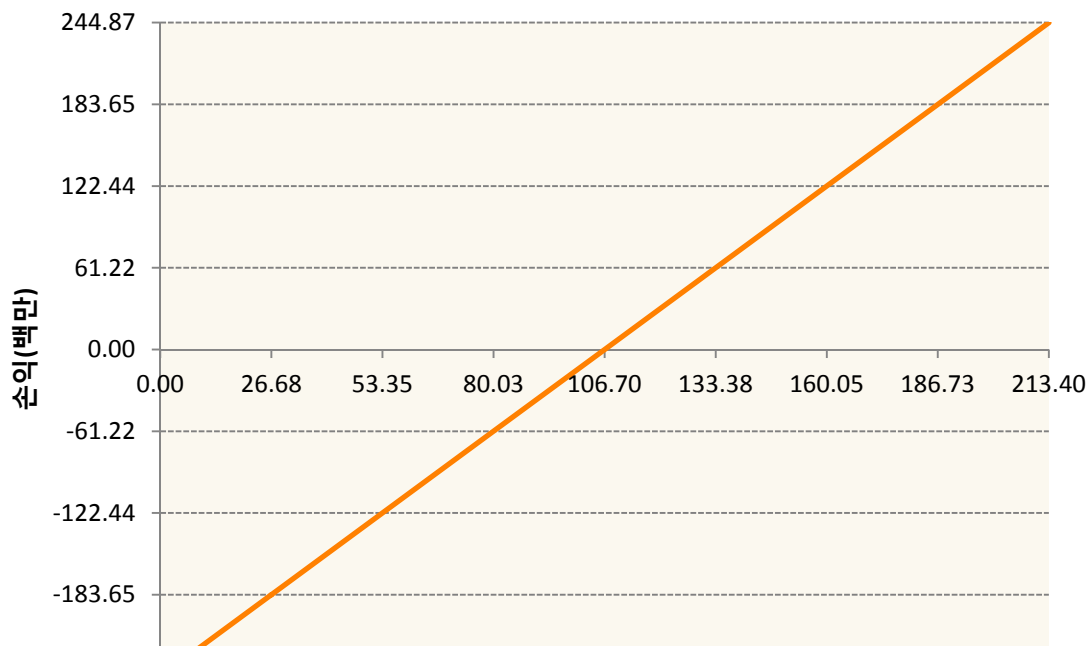


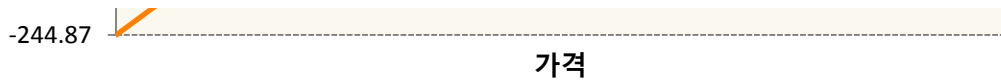


CTN0-COTTON NO.2 FUTR Jul20

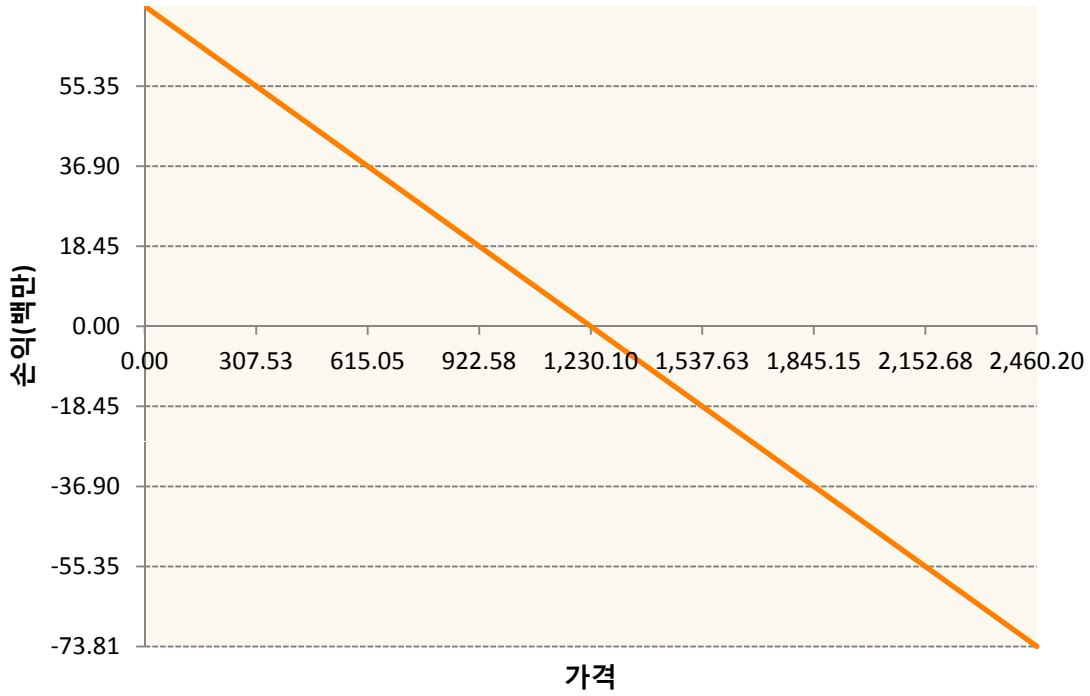


KCN0-COFFEE 'C' FUTURE Jul20

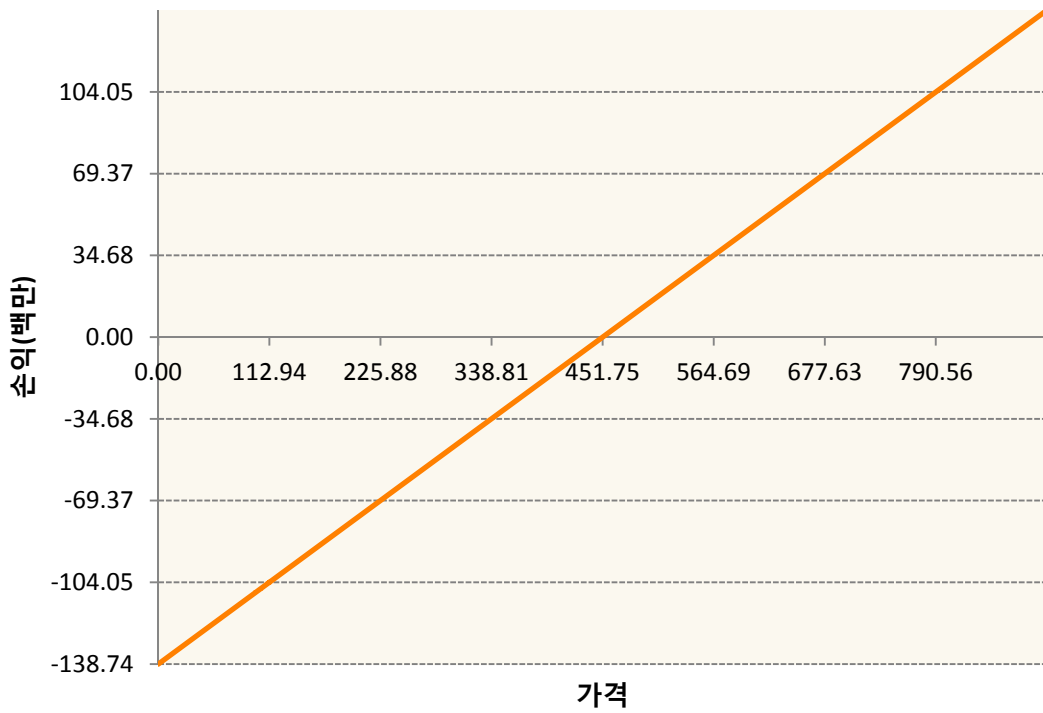




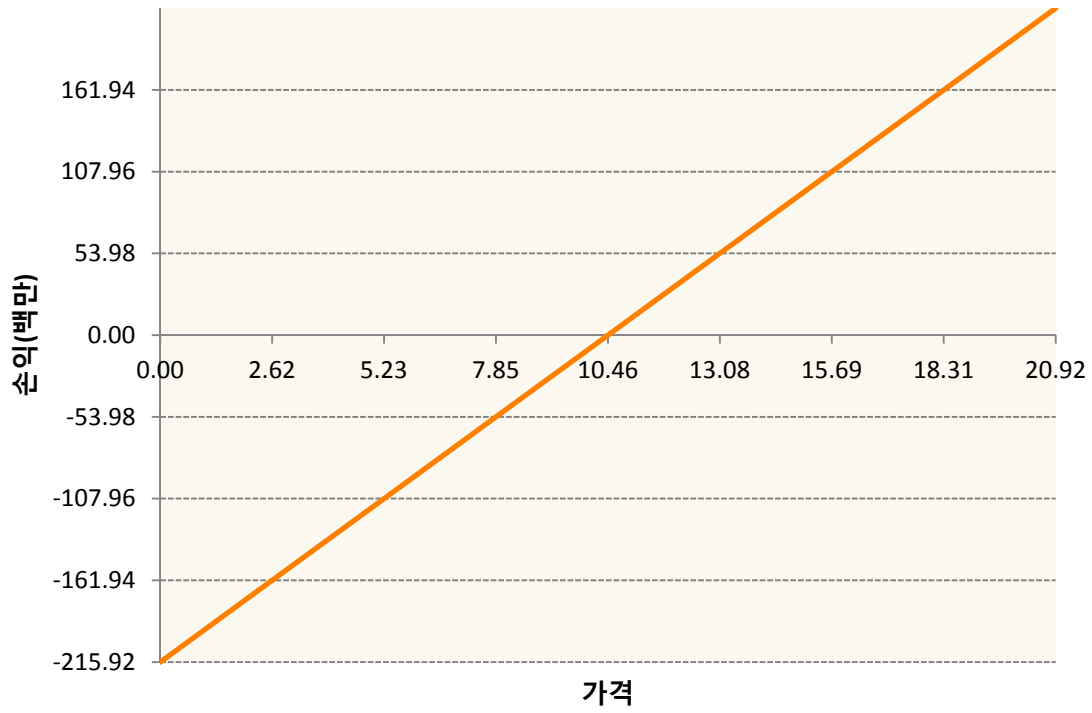
KR4175Q60006-2020-06 달러선물



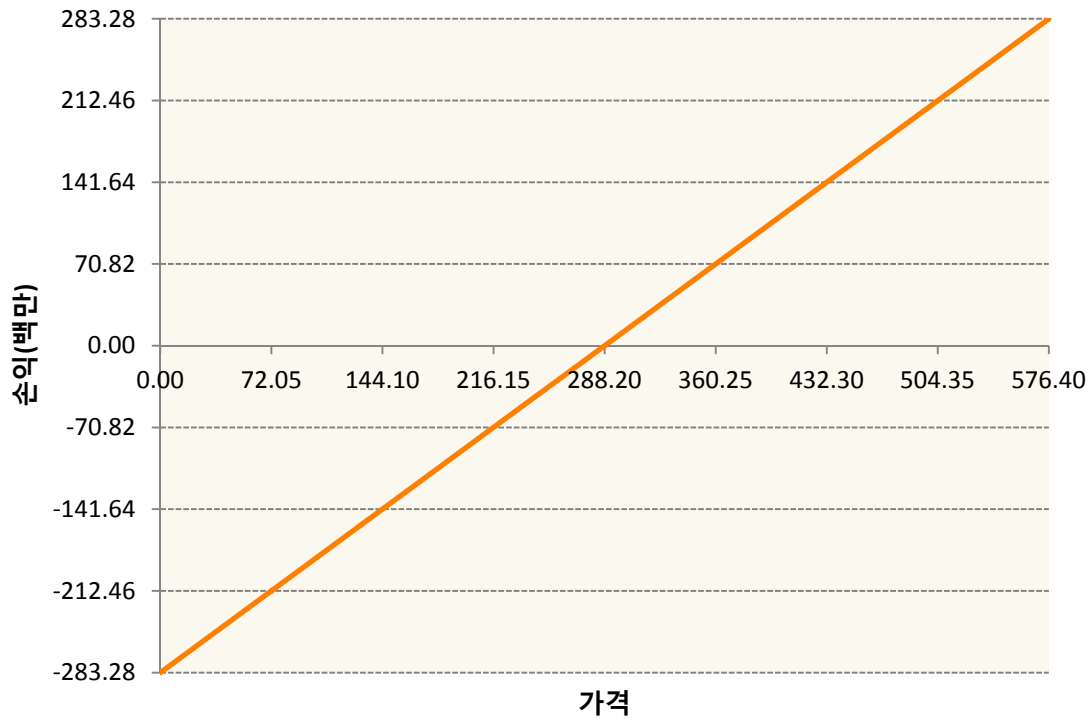
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



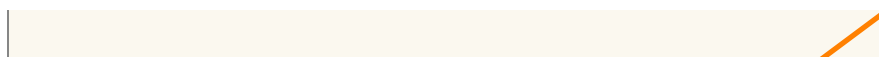
SBN0-Sugar Jul20

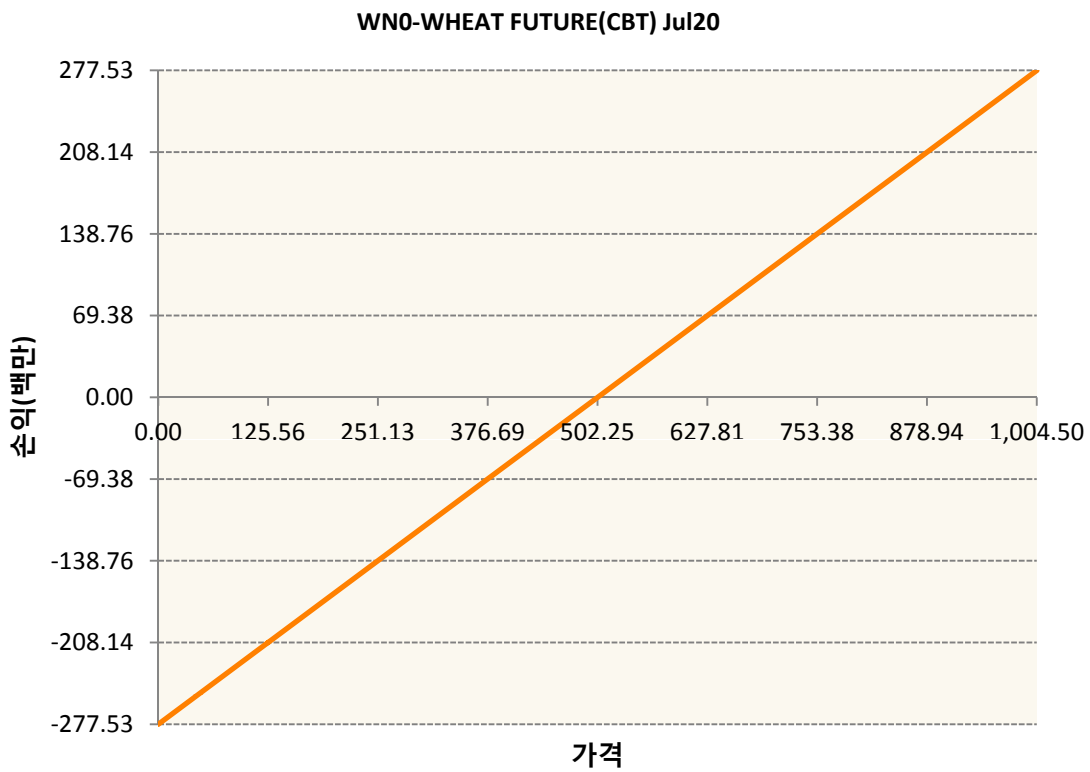
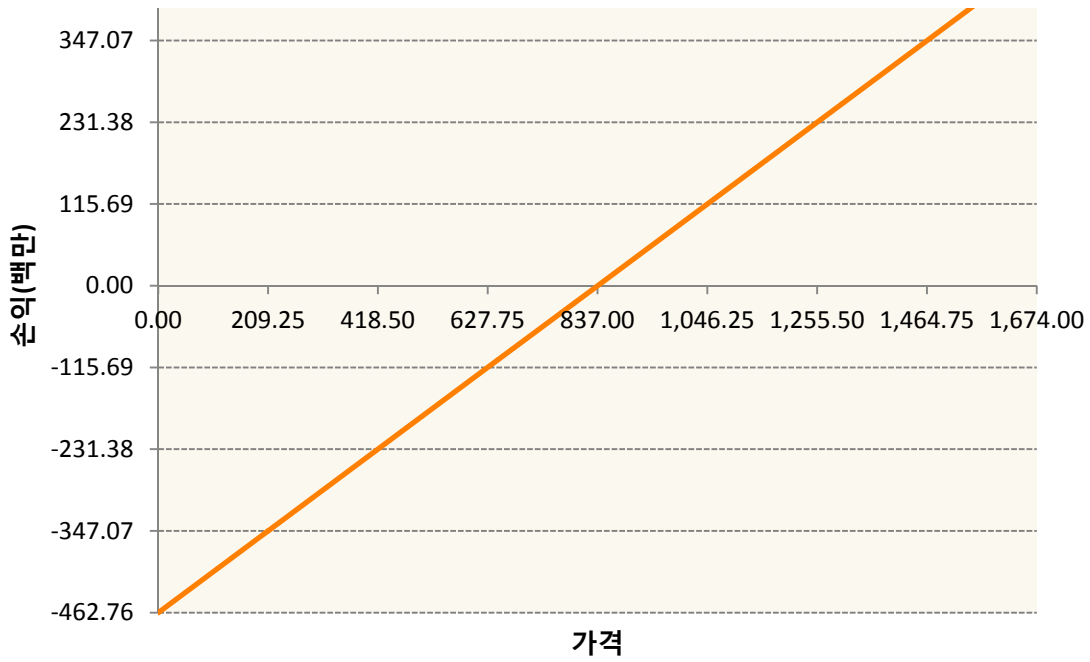


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20



SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON0	SOYBEAN OIL FUTR Jul20	17
CN0	CORN FUTURE Jul20	37
CTN0	COTTON NO.2 FUTR Jul20	9
KCN0	COFFEE 'C' FUTURE Jul20	20
KR4175Q60C	2020-06 달러선물	6

KWN0	KC HRW WHEAT FUT Jul20	11
SBN0	Sugar Jul20	17
SMN0	SOYBEAN MEAL FUTR Jul20	23
SN0	SOYBEAN FUTURE Jul20	37
WNO	WHEAT FUTURE(CBT) Jul20	22

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

(단위:백만원)

229