

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-19 |
| 기준일 | 2020-05-18 |

## 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 | 2020-05-19 |
| 기준일 | 2020-05-18 |

## 스마트인덱스모

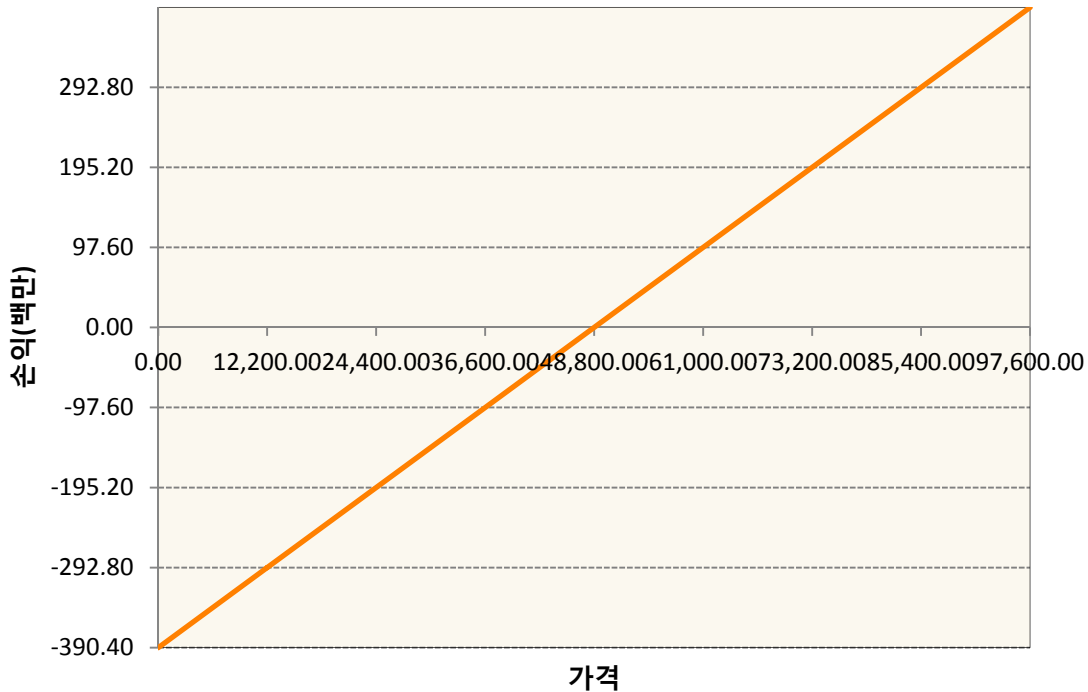
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 390   | 0     | 390       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4111Q60001-2020-06 삼성전자개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4111Q60001 |         | 2020-06 삼성전자개별선물 |        |     |       |        |        | 31 |
|--------------|---------|------------------|--------|-----|-------|--------|--------|----|
| 기초자산의 변동성    |         |                  |        |     |       |        |        |    |
| 가격           | -25.00% | -16.67%          | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |    |
| -8.00%       | -31     | -31              | -31    | -31 | -31   | -31    | -31    |    |
| -5.33%       | -21     | -21              | -21    | -21 | -21   | -21    | -21    |    |
| -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%        | 21      | 21               | 21     | 21  | 21    | 21     | 21     |    |
| 8.00%        | 31      | 31               | 31     | 31  | 31    | 31     | 31     |    |

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

(단위:백만원)

47

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-19 |
| 기준일 | 2020-05-18 |

## SMART합성-MSCI선진국증권상장

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0      | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 14,446 | 0     | 14,446    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0( 신한MXWO 미래S200224

967

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,130

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-19 |
| 기준일 | 2020-05-18 |

## 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

569

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

850

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-19 |
| 기준일 | 2020-05-18 |

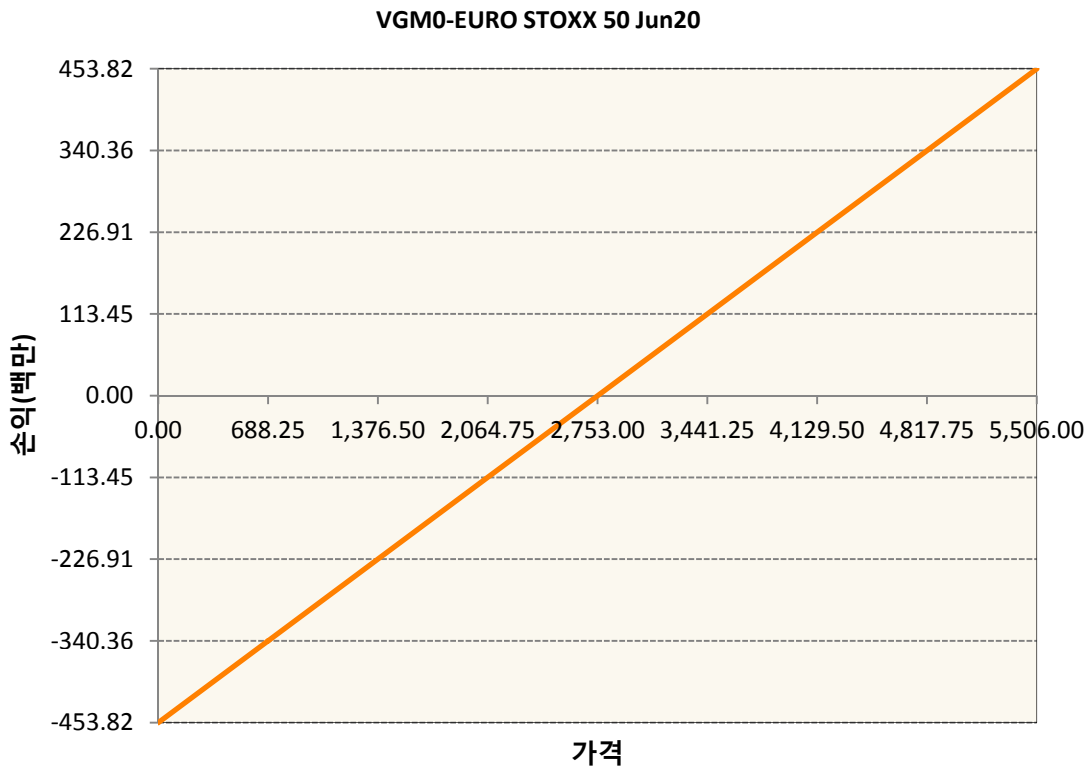
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 454   | 0     | 454       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 46 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-19 |
| 기준일 | 2020-05-18 |

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

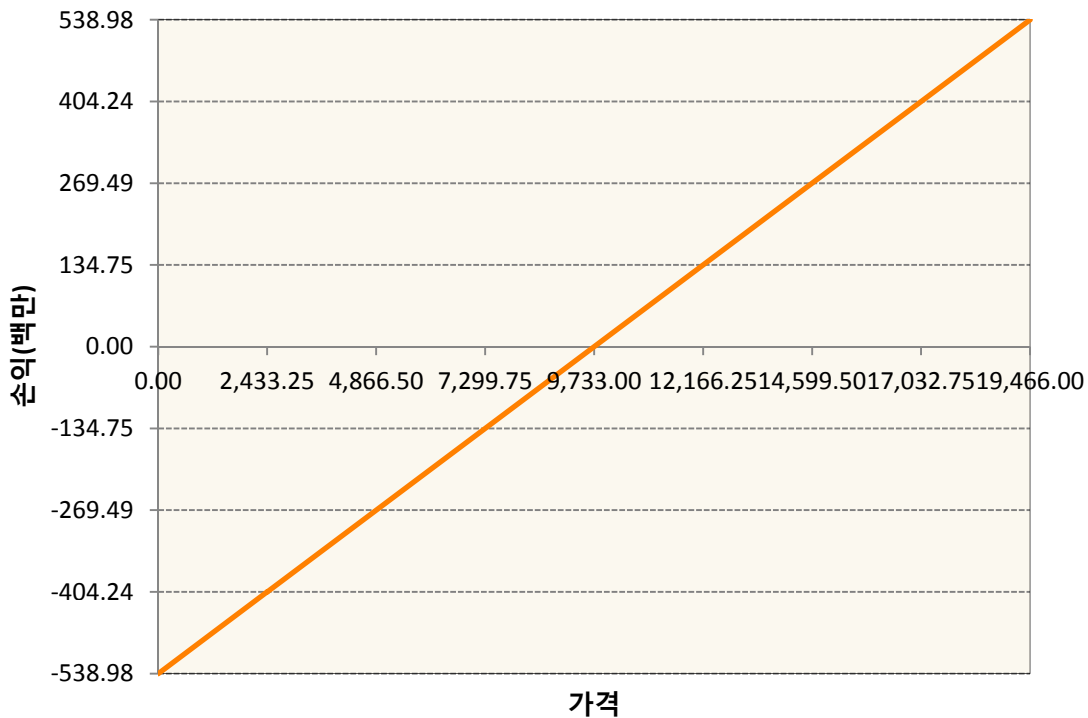
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 539   | 0     | 539       | 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)

|    |
|----|
| 47 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-19 |
| 기준일 | 2020-05-18 |

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

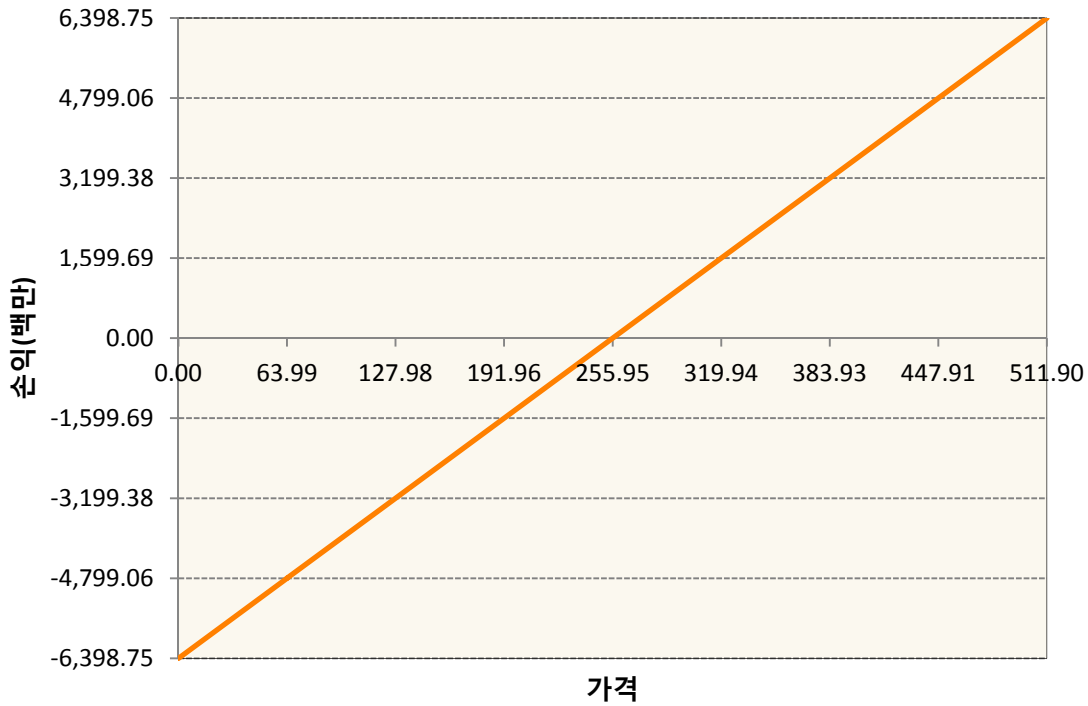
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

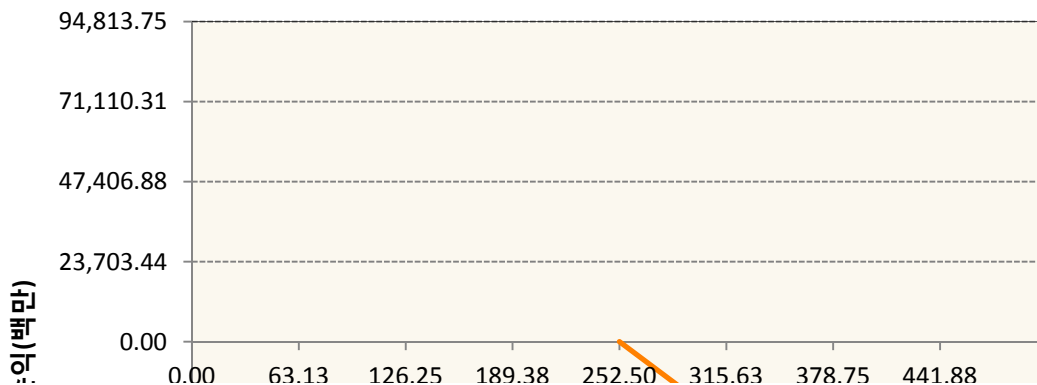
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)   | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0       | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 494   | 0       | 494       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 6,399 | 0       | 6,399     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 364,213 | -364,213  | 장내 |

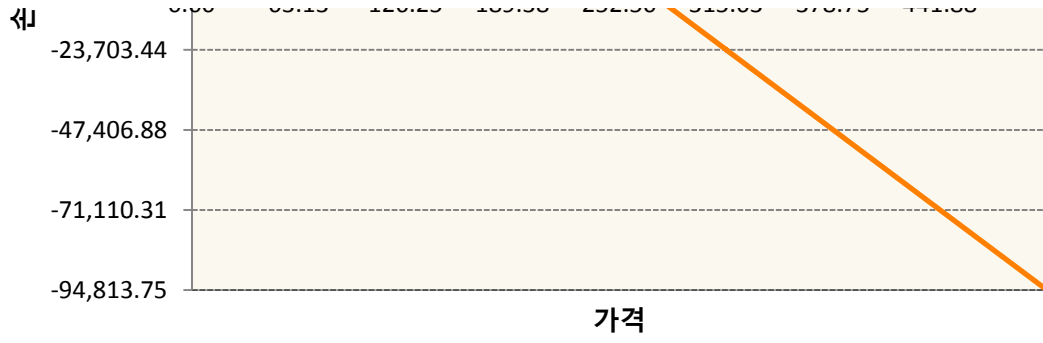
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

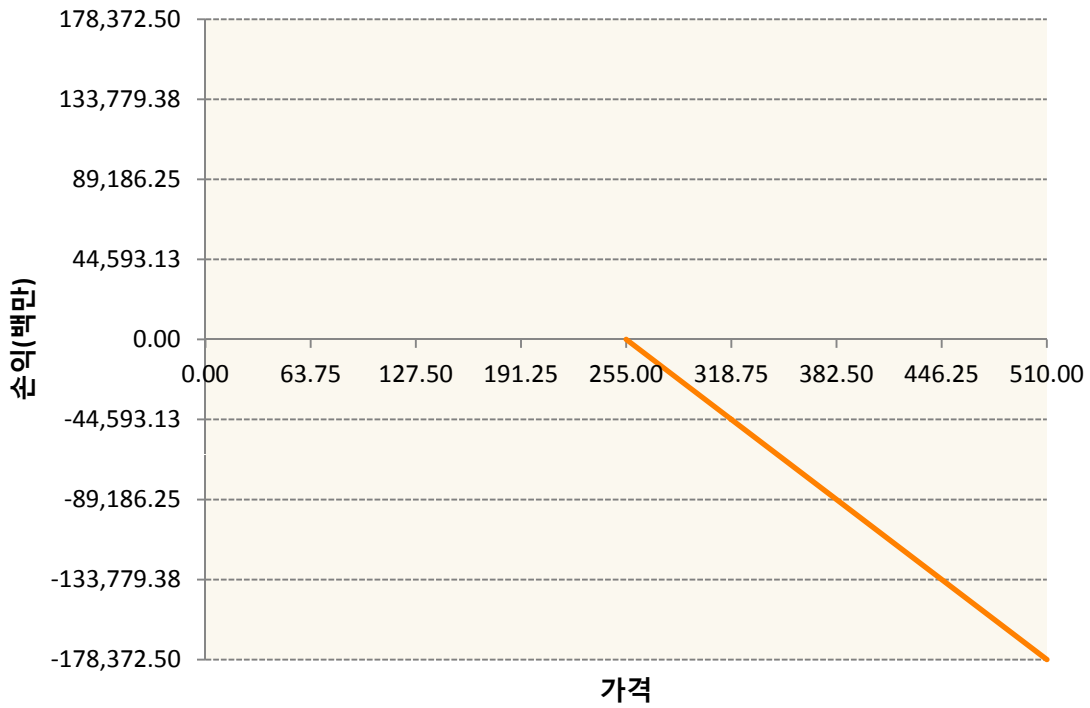


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

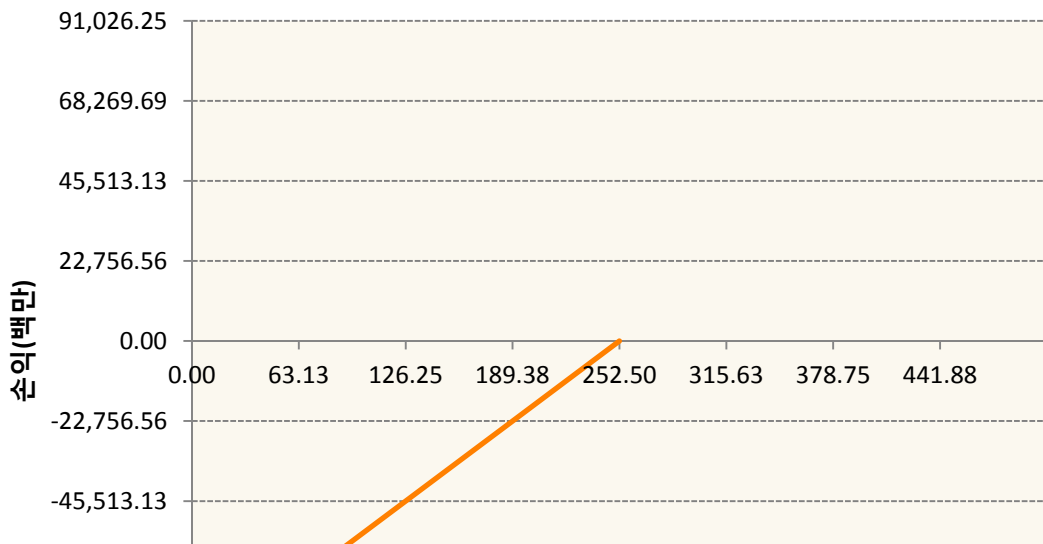


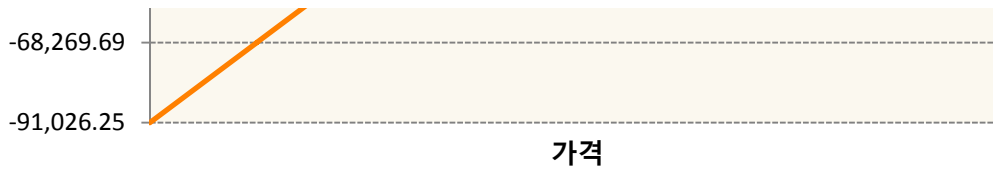


KR4201Q62550-2020-06 콜255



KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





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

| KR4101Q60002 |         | 2020-06 코스피200지수선물 |        |        |        |         |         | 511    |
|--------------|---------|--------------------|--------|--------|--------|---------|---------|--------|
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |        |        |         |         |        |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67%  | 25.00%  |        |
| -8.00%       | -511    | -511               | -511   | -511   | -511   | -511    | -511    |        |
| -5.33%       | -341    | -341               | -341   | -341   | -341   | -341    | -341    |        |
| -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%        | 341     | 341                | 341    | 341    | 341    | 341     | 341     |        |
| 8.00%        | 511     | 511                | 511    | 511    | 511    | 511     | 511     |        |
| KR4201Q62527 |         | 2020-06 콜252.5     |        |        |        |         |         | 6,139  |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |        |        |         |         |        |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67%  | 25.00%  |        |
| -8.00%       | 4,015   | 3,761              | 3,492  | 3,211  | 2,920  | 2,622   | 2,318   |        |
| -5.33%       | 3,341   | 3,026              | 2,704  | 2,377  | 2,046  | 1,712   | 1,375   |        |
| -2.67%       | 2,373   | 2,019              | 1,664  | 1,309  | 953    | 596     | 239     |        |
| 0%           | 1,088   | 725                | 363    | 0      | -363   | -726    | -1,089  |        |
| 2.67%        | -505    | -846               | -1,191 | -1,541 | -1,893 | -2,248  | -2,604  |        |
| 5.33%        | -2,371  | -2,667             | -2,976 | -3,295 | -3,622 | -3,955  | -4,293  |        |
| 8.00%        | -4,459  | -4,699             | -4,959 | -5,236 | -5,526 | -5,828  | -6,139  |        |
| KR4201Q62550 |         | 2020-06 콜255       |        |        |        |         |         | 11,093 |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |        |        |         |         |        |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67%  | 25.00%  |        |
| -8.00%       | 6,914   | 6,480              | 6,013  | 5,519  | 5,004  | 4,470   | 3,923   |        |
| -5.33%       | 5,829   | 5,272              | 4,698  | 4,110  | 3,510  | 2,903   | 2,288   |        |
| -2.67%       | 4,226   | 3,581              | 2,930  | 2,276  | 1,619  | 960     | 300     |        |
| 0%           | 2,047   | 1,365              | 682    | 0      | -682   | -1,364  | -2,046  |        |
| 2.67%        | -712    | -1,374             | -2,041 | -2,712 | -3,386 | -4,063  | -4,741  |        |
| 5.33%        | -4,003  | -4,597             | -5,208 | -5,833 | -6,469 | -7,114  | -7,766  |        |
| 8.00%        | -7,743  | -8,237             | -8,765 | -9,319 | -9,894 | -10,487 | -11,093 |        |
| KR4301Q62525 |         | 2020-06 풋252.5     |        |        |        |         |         | 5,153  |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |        |        |         |         |        |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67%  | 25.00%  |        |
| -8.00%       | -4,407  | -4,501             | -4,609 | -4,731 | -4,863 | -5,004  | -5,153  |        |
| -5.33%       | -2,321  | -2,480             | -2,647 | -2,822 | -3,002 | -3,186  | -3,374  |        |
| -2.67%       | -602    | -811               | -1,020 | -1,231 | -1,443 | -1,656  | -1,869  |        |

|       |       |       |       |       |       |       |       |
|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 0%    | 651   | 435   | 218   | 0     | -218  | -436  | -655  |
| 2.67% | 1,444 | 1,263 | 1,074 | 881   | 683   | 481   | 277   |
| 5.33% | 1,875 | 1,750 | 1,611 | 1,461 | 1,300 | 1,132 | 957   |
| 8.00% | 2,075 | 2,004 | 1,915 | 1,812 | 1,695 | 1,566 | 1,428 |

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

(단위:백만원)

**20,298**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-19 |
| 기준일 | 2020-05-18 |

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

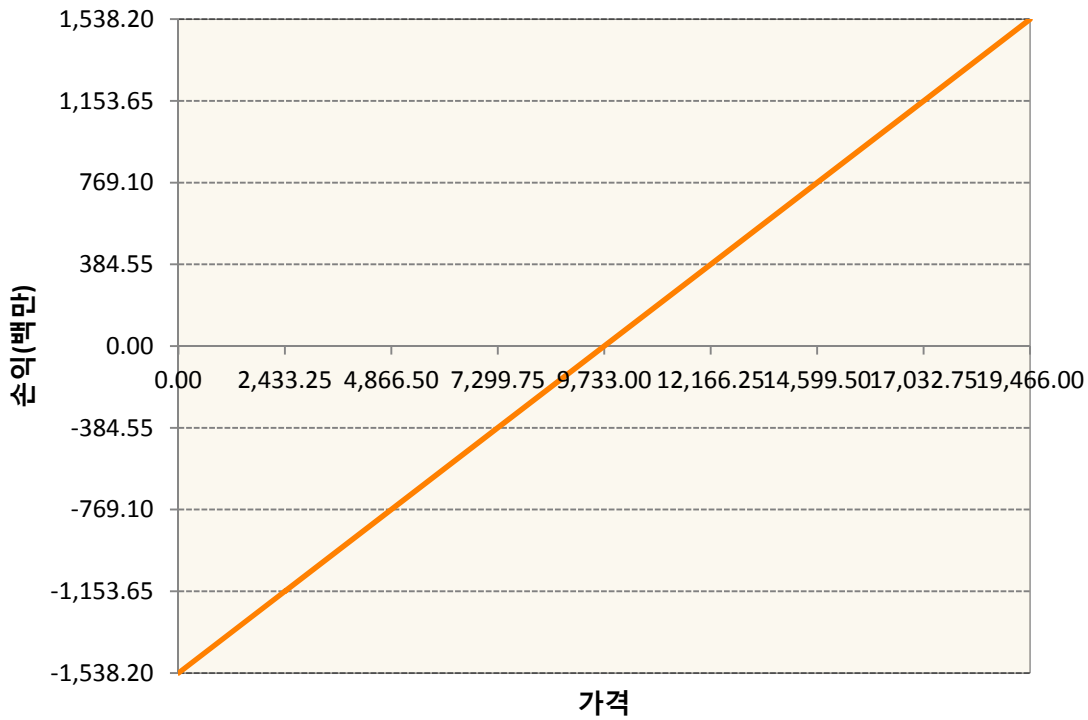
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

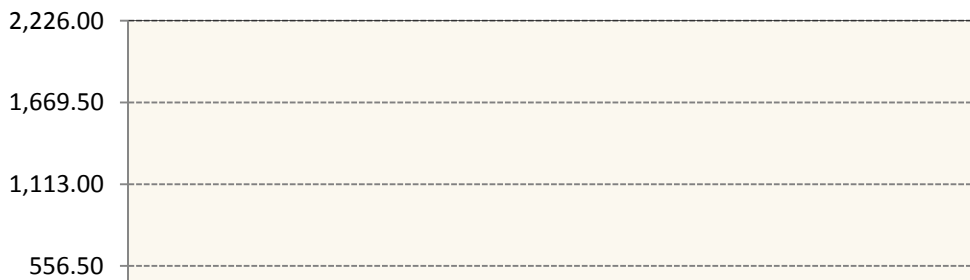
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,538 | 0     | 1,538     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 4,452 | -4,452    | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 700   | 2,239 | -1,539    | 장외 |

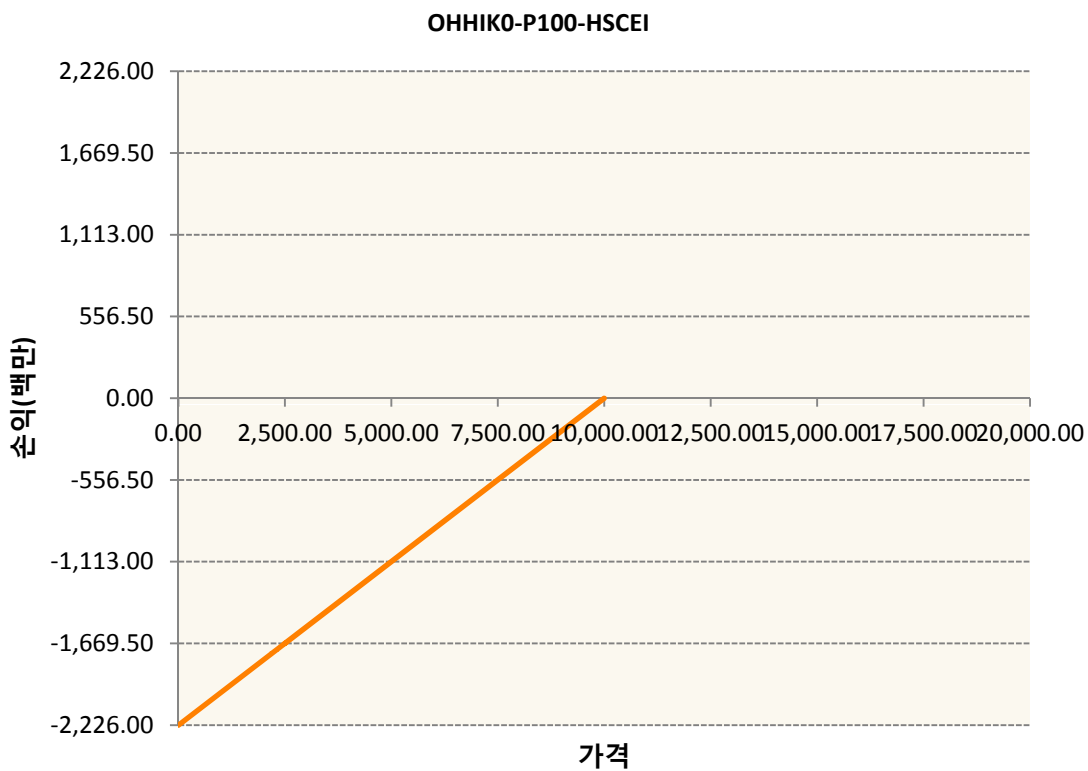
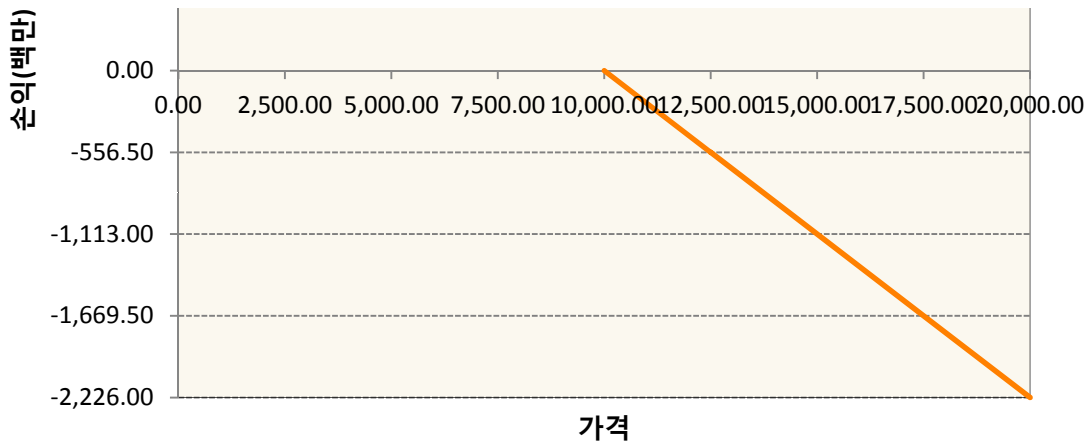
### 2. 만기시점의 손익구조

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     |  | 123      |
| OHHIK0-C1C HSCEI             |  | 178      |
| OHHIK0-P10 HSCEI             |  | 178      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|--|----------|
|  | 636      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-19 |
| 기준일 | 2020-05-18 |

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

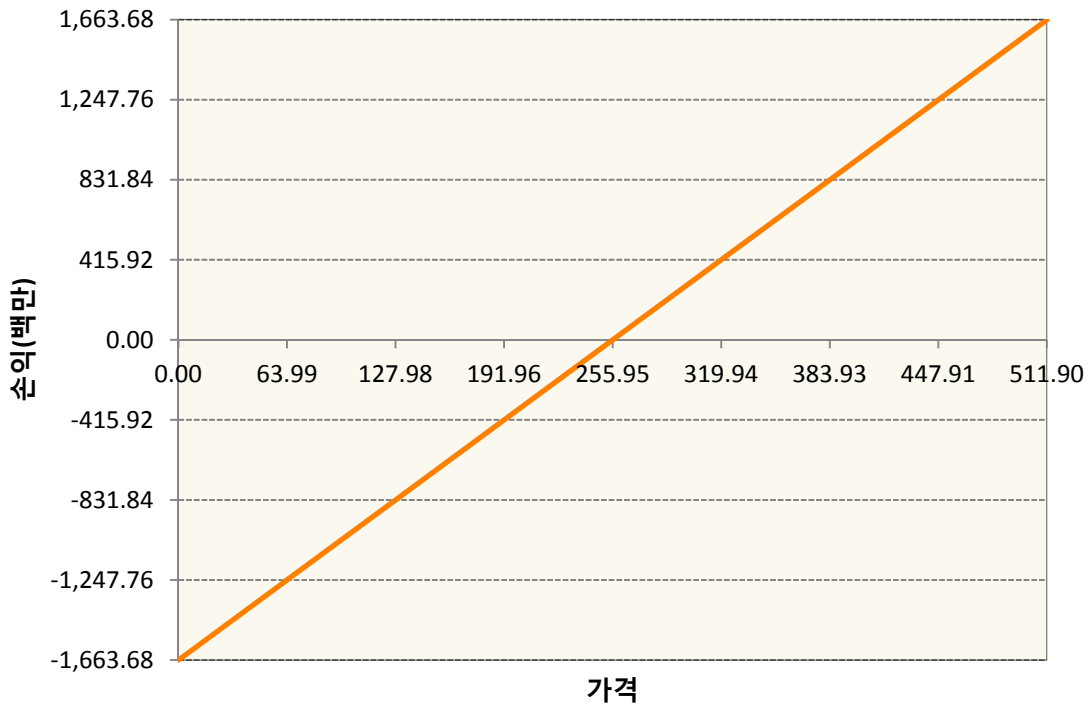
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

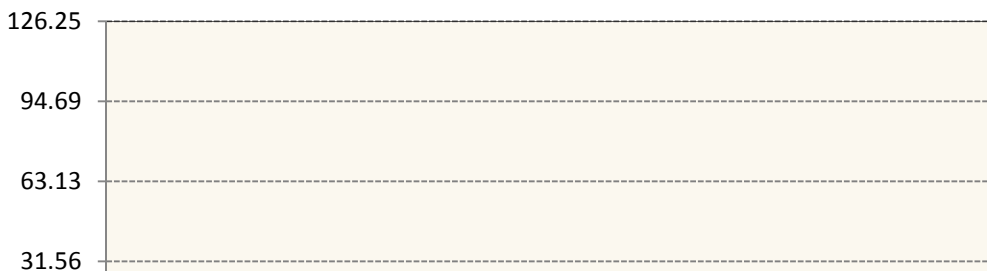
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,664 | 0     | 1,664     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 2,125 | 0     | 2,125     | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 3,361 | -3,361    | 장내 |

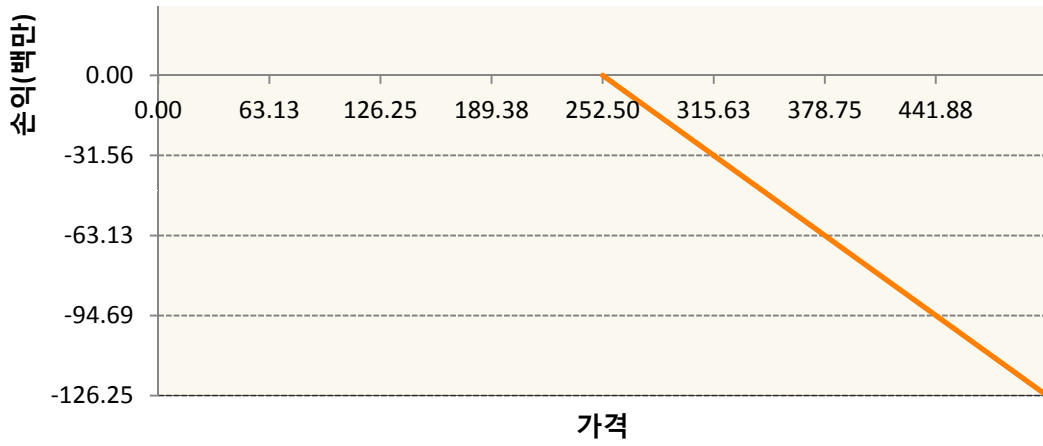
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

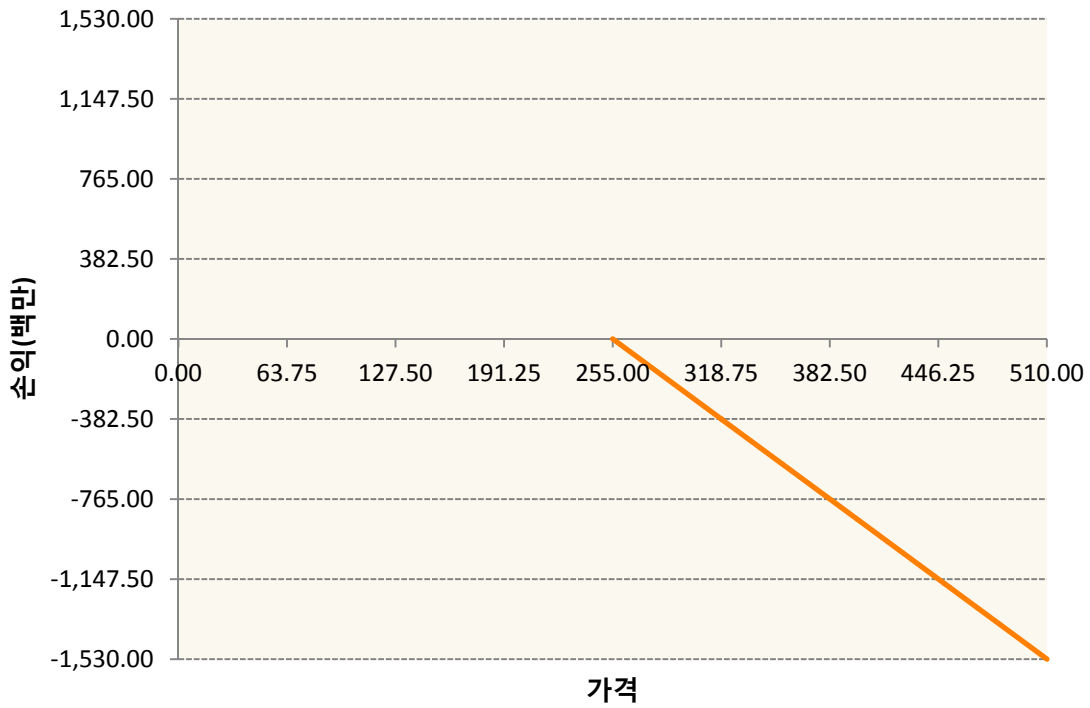


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

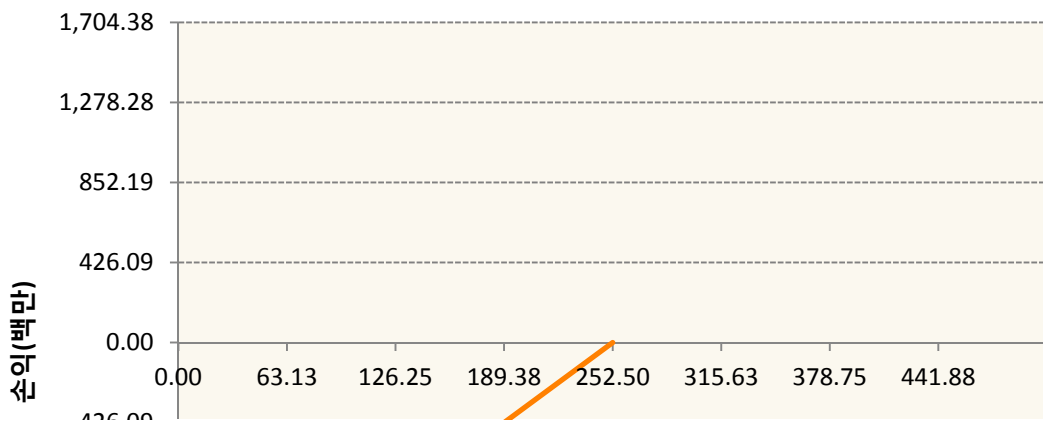




KR4201Q62550-2020-06 콜255



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 |        |      |       |        |        | 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    |     |
| 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                  | 5      | 4    | 4     | 3      | 3      |     |
| -5.33%       | 4         | 4                  | 4      | 3    | 3     | 2      | 2      |     |
| -2.67%       | 3         | 3                  | 2      | 2    | 1     | 1      | 0      |     |
| 0%           | 1         | 1                  | 0      | 0    | 0     | -1     | -1     |     |
| 2.67%        | -1        | -1                 | -2     | -2   | -3    | -3     | -3     |     |
| 5.33%        | -3        | -4                 | -4     | -4   | -5    | -5     | -6     |     |
| 8.00%        | -6        | -6                 | -7     | -7   | -7    | -8     | -8     |     |
| KR4201Q62550 |           | 2020-06 콜255       |        |      |       |        |        | 95  |
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |

|  |         |         |        |     |       |        |        |
|--|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| -8.00%   | 59      | 56      | 52     | 47  | 43    | 38     | 34     |
| -5.33%   | 50      | 45      | 40     | 35  | 30    | 25     | 20     |
| -2.67%   | 36      | 31      | 25     | 20  | 14    | 8      | 3      |
| 0%   | 18      | 12      | 6      | 0   | -6    | -12    | -18    |
| 2.67%  | -6      | -12     | -18    | -23 | -29   | -35    | -41    |
| 5.33%  | -34     | -39     | -45    | -50 | -55   | -61    | -67    |
| 8.00%  | -66     | -71     | -75    | -80 | -85   | -90    | -95    |
| KR4301Q62525                      2020-06 풋252.5 |         |         |        |     |       |        | 96     |
| 기초자산의 변동성  |         |         |        |     |       |        |        |
| 가격   | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%   | -83     | -84     | -86    | -89 | -91   | -94    | -96    |
| -5.33%   | -43     | -46     | -50    | -53 | -56   | -60    | -63    |
| -2.67%   | -11     | -15     | -19    | -23 | -27   | -31    | -35    |
| 0%   | 12      | 8       | 4      | 0   | -4    | -8     | -12    |
| 2.67%  | 27      | 24      | 20     | 16  | 13    | 9      | 5      |
| 5.33%  | 35      | 33      | 30     | 27  | 24    | 21     | 18     |
| 8.00%  | 39      | 38      | 36     | 34  | 32    | 29     | 27     |

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

(단위:백만원)

**563**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-19 |
| 기준일 | 2020-05-18 |

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

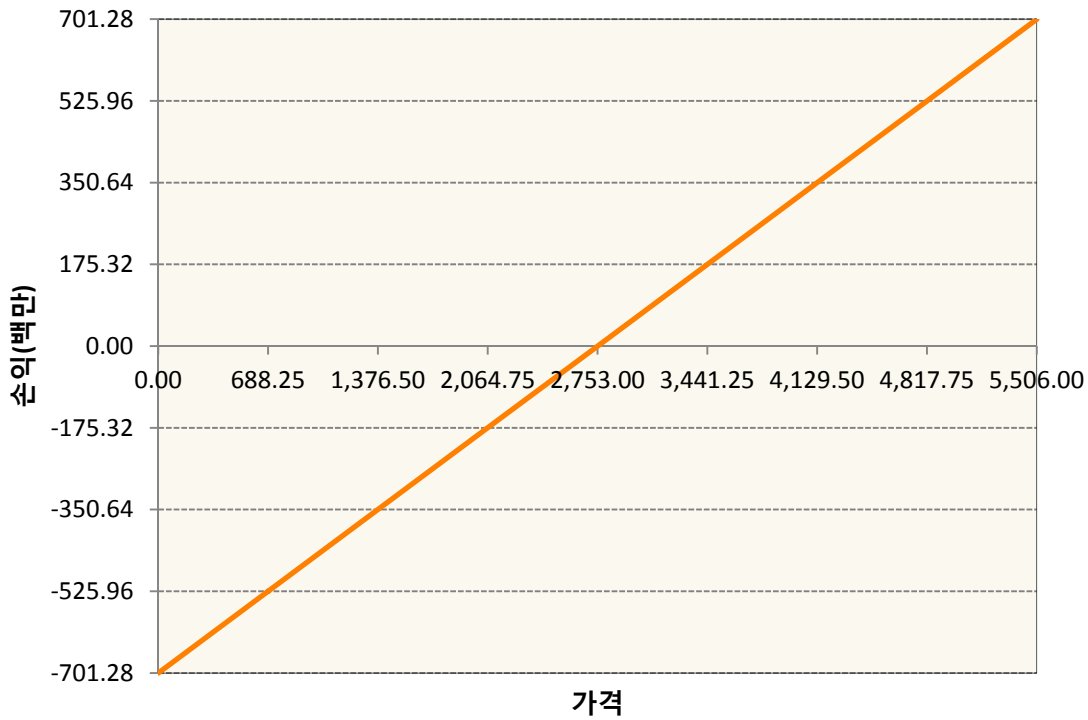
### 1. 계약금액

(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 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 701   | 0     | 701       |    |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 7,954 | 0     | 7,954     | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 2,886 | -2,886    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|   |     |
|---|-----|
| 260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY | 0.4 |
| FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E            | 216 |
| FX21020K02 KRW/EUR 26-06-20E            | 15  |
| VGM0 EURO STOXX 50 Jun20                | 56  |

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

(단위:백만원)

198



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

(단위:백만원)

1,135



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

(단위:백만원)

98

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-19 |
| 기준일 | 2020-05-18 |

## ETF스마트레버리지목표전환형10호

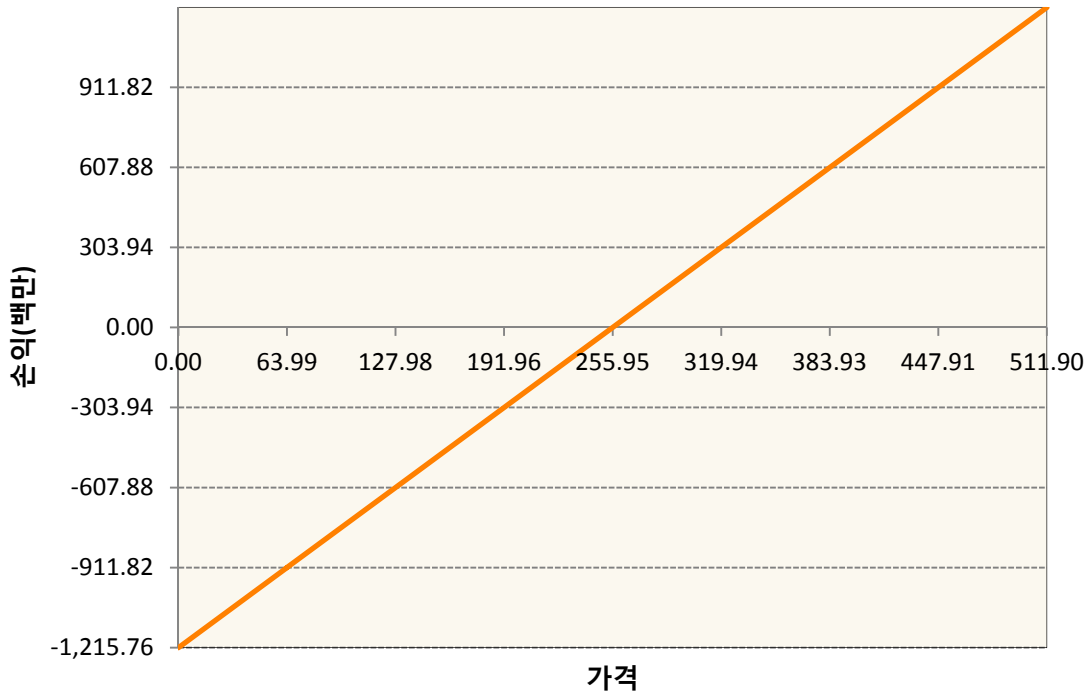
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,216 | 0     | 1,216     | 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)

144

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-19 |
| 기준일 | 2020-05-18 |

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

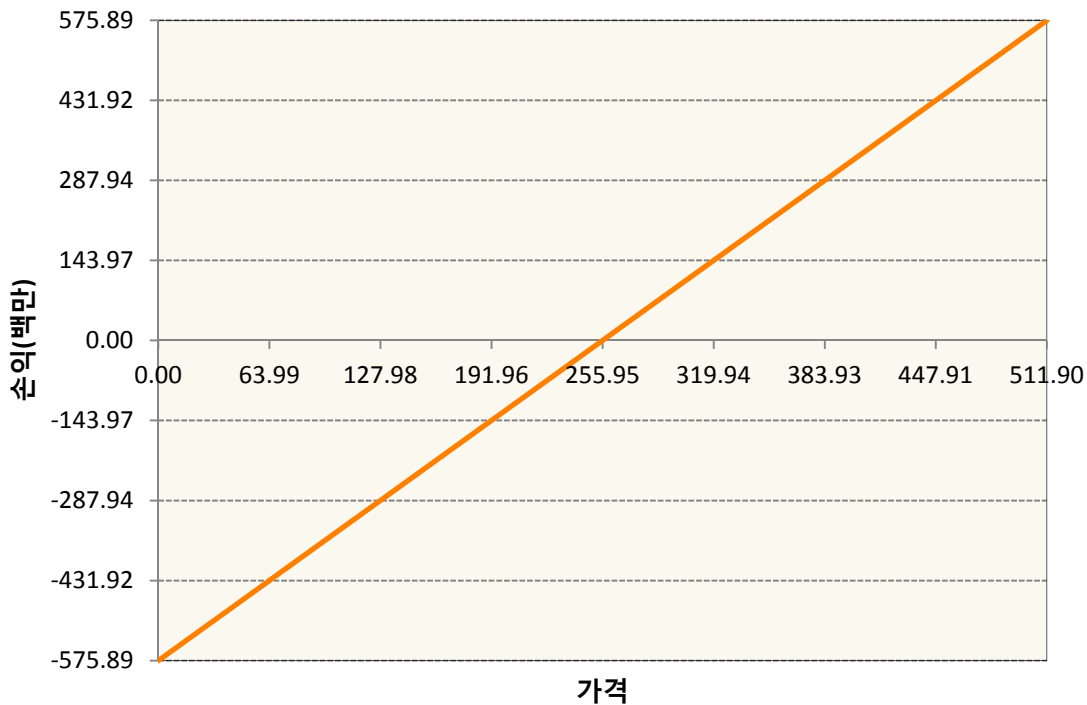
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 576   | 0     | 576       | 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 | 2020-05-19 |
| 기준일 | 2020-05-18 |

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

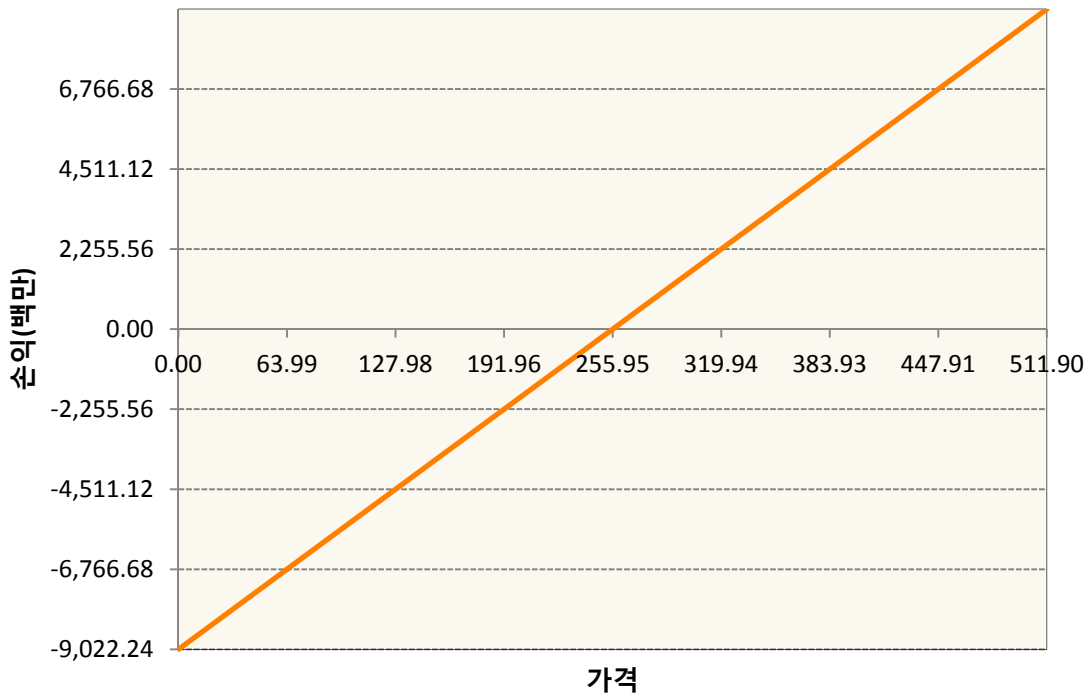
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

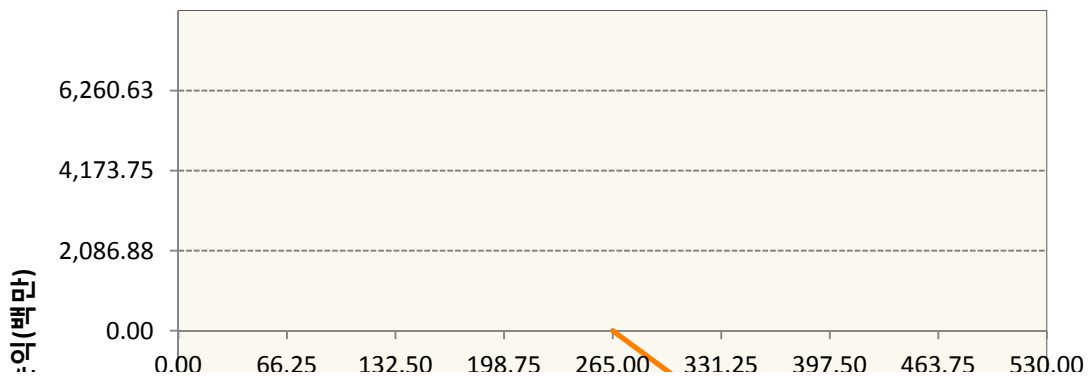
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 254    | -254      | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 265   | 0      | 265       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 9,022 | 0      | 9,022     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 2,917 | 17,911 | -14,994   | 장내 |

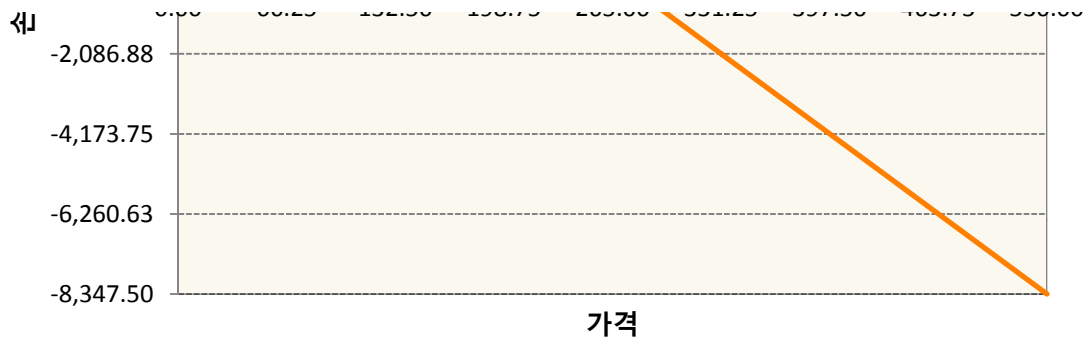
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

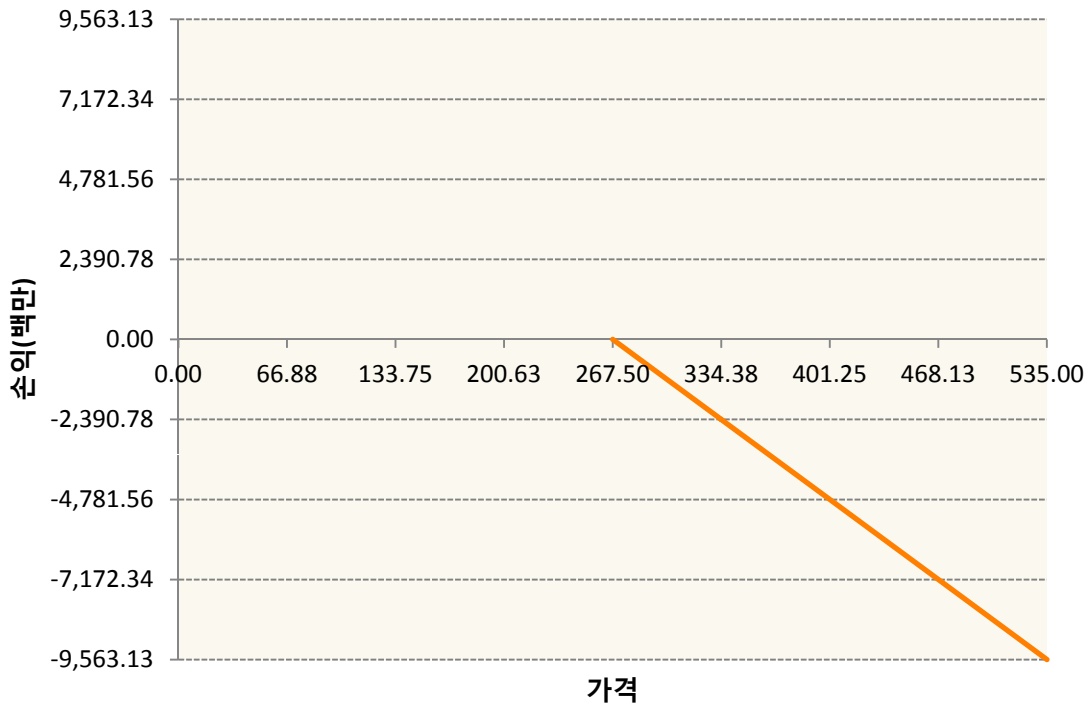


KR4201Q62659-2020-06 콜265

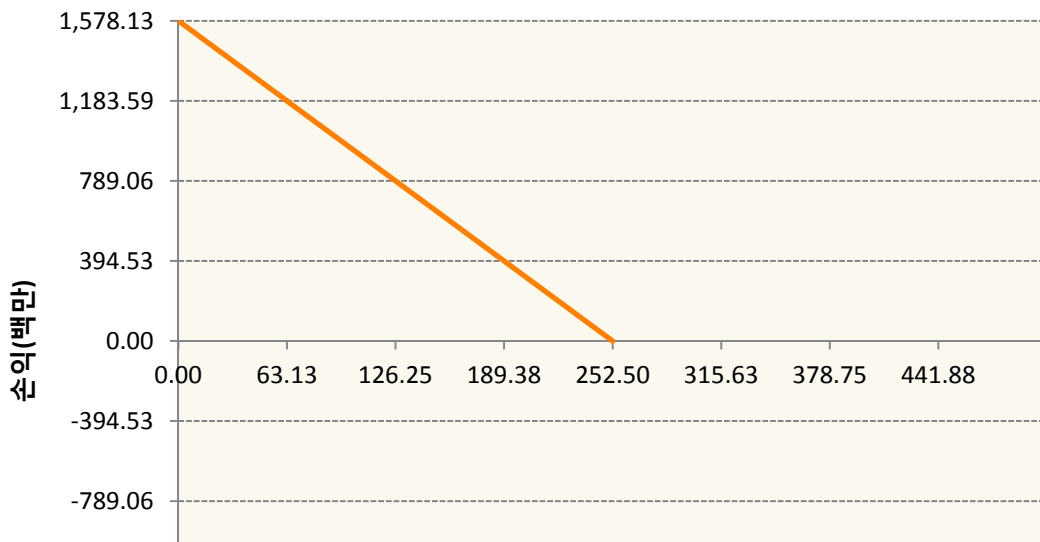


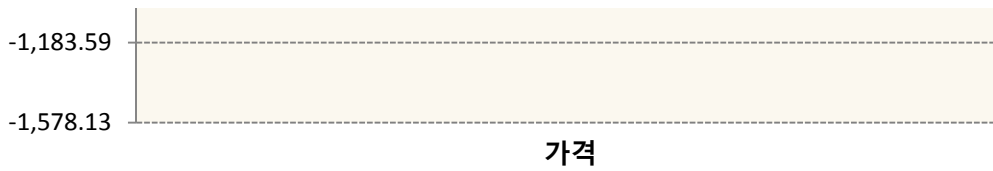


KR4201Q62675-2020-06 콜267.5

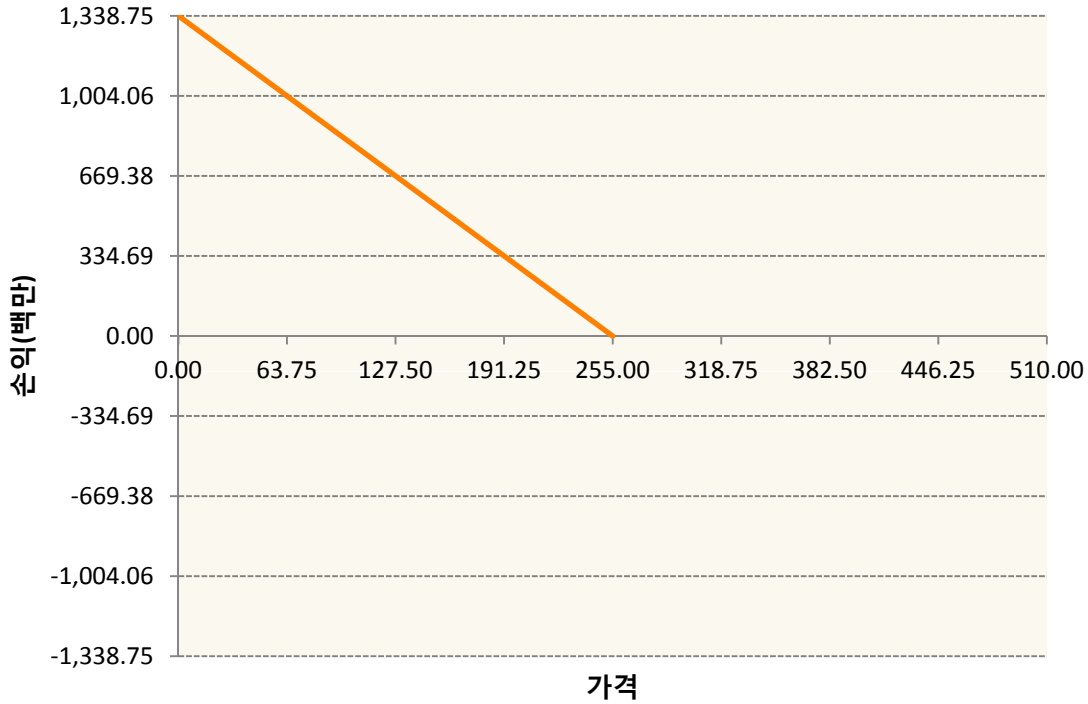


KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





KR4301Q62558-2020-06 풋255



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101Q60002 |         | 2020-06 코스피200지수선물 |        |      |       |        |        | 720 |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
|              |         | 기초자산의 변동성          |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | -720    | -720               | -720   | -720 | -720  | -720   | -720   |     |
| -5.33%       | -480    | -480               | -480   | -480 | -480  | -480   | -480   |     |
| -2.67%       | -240    | -240               | -240   | -240 | -240  | -240   | -240   |     |
| 0%           | 0       | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |     |
| 2.67%        | 240     | 240                | 240    | 240  | 240   | 240    | 240    |     |
| 5.33%        | 480     | 480                | 480    | 480  | 480   | 480    | 480    |     |
| 8.00%        | 720     | 720                | 720    | 720  | 720   | 720    | 720    |     |
| KR4201Q62659 |         | 2020-06 콜265       |        |      |       |        |        | 431 |
|              |         | 기초자산의 변동성          |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | 217     | 204                | 190    | 173  | 155   | 136    | 115    |     |
| -5.33%       | 191     | 173                | 153    | 132  | 109   | 86     | 61     |     |
| -2.67%       | 150     | 126                | 101    | 75   | 48    | 21     | -7     |     |

|       |      |      |      |      |      |      |      |
|-------|------|------|------|------|------|------|------|
| 0%    | 87   | 59   | 30   | 0    | -30  | -60  | -90  |
| 2.67% | 1    | -31  | -62  | -94  | -125 | -157 | -189 |
| 5.33% | -111 | -143 | -175 | -207 | -239 | -271 | -303 |
| 8.00% | -248 | -277 | -308 | -338 | -369 | -400 | -431 |

KR4201Q62675                      2020-06 콜267.5                      469

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |      |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | 222     | 210     | 195    | 178  | 159   | 138    | 116    |
| -5.33%    | 198     | 180     | 159    | 136  | 112   | 87     | 60     |
| -2.67%    | 158     | 133     | 106    | 78   | 49    | 19     | -12    |
| 0%        | 96      | 65      | 33     | 0    | -33   | -66    | -100   |
| 2.67%     | 7       | -28     | -63    | -99  | -134  | -170   | -206   |
| 5.33%     | -109    | -146    | -182   | -219 | -256  | -292   | -329   |
| 8.00%     | -254    | -289    | -325   | -361 | -397  | -433   | -469   |

KR4301Q62525                      2020-06 풋252.5                      89

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |     |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | 76      | 78      | 80     | 82  | 84    | 87     | 89     |
| -5.33%    | 40      | 43      | 46     | 49  | 52    | 55     | 59     |
| -2.67%    | 10      | 14      | 18     | 21  | 25    | 29     | 32     |
| 0%        | -11     | -8      | -4     | 0   | 4     | 8      | 11     |
| 2.67%     | -25     | -22     | -19    | -15 | -12   | -8     | -5     |
| 5.33%     | -33     | -30     | -28    | -25 | -23   | -20    | -17    |
| 8.00%     | -36     | -35     | -33    | -31 | -29   | -27    | -25    |

KR4301Q62558                      2020-06 풋255                      79

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |     |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | 70      | 71      | 72     | 74  | 76    | 77     | 79     |
| -5.33%    | 38      | 40      | 42     | 45  | 47    | 50     | 52     |
| -2.67%    | 11      | 14      | 17     | 20  | 23    | 26     | 29     |
| 0%        | -10     | -6      | -3     | 0   | 3     | 6      | 10     |
| 2.67%     | -24     | -21     | -18    | -15 | -12   | -9     | -5     |
| 5.33%     | -32     | -29     | -27    | -25 | -22   | -19    | -17    |
| 8.00%     | -36     | -34     | -33    | -31 | -29   | -27    | -25    |

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

(단위:백만원)

**1,874**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-19 |
| 기준일 | 2020-05-18 |

## 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 | 149,546 | 0     | 149,546   |    |

### 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 | 2020-05-19 |
| 기준일 | 2020-05-18 |

## 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 | 100,831 | 0     | 100,831   |    |

### 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 | 2020-05-19 |
| 기준일 | 2020-05-18 |

## 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 | 445,478 | 0       | 445,478   |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0       | 429,615 | -429,615  | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                               |       |
|-------------------------------|-------|
| FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E  | 848   |
| FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E  | 739   |
| FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E  | 493   |
| FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E  | 3,451 |
| FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E  | 7,000 |
| FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E | 2,958 |
| FX21020J02€ KRW/USD 10-06-20E | 1,341 |
| FX21020J02£ KRW/USD 22-06-20E | 1,518 |
| FX21020J02¥ KRW/USD 22-06-20E | 1,972 |
| FX21020J03¥ KRW/USD 24-07-20E | 2,218 |
| FX21020J04¥ KRW/USD 24-07-20E | 1,775 |
| FX21020J04£ KRW/USD 24-07-20E | 1,972 |
| FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E  | 2,051 |
| FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E  | 1,952 |
| FX21020K01 KRW/USD 22-06-20E  | 690   |
| FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E  | 2,406 |
| FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E  | 986   |

IE00BD8RGM75

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

**17,382**



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

(단위:백만원)

197

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-19 |
| 기준일 | 2020-05-18 |

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

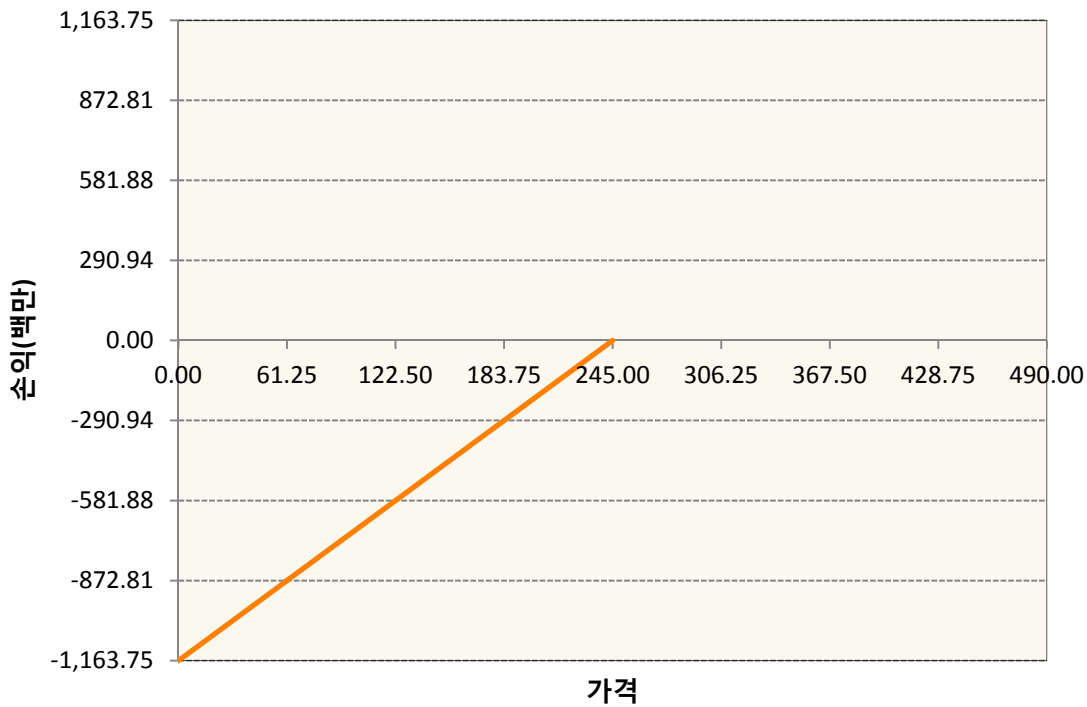
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

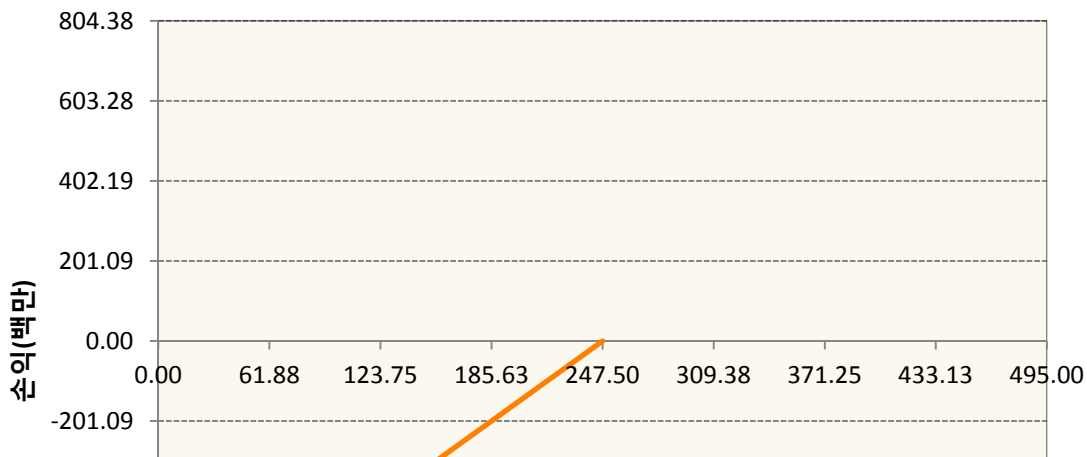
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 243   | 0     | 243       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 1,968 | -1,968    | 장내 |

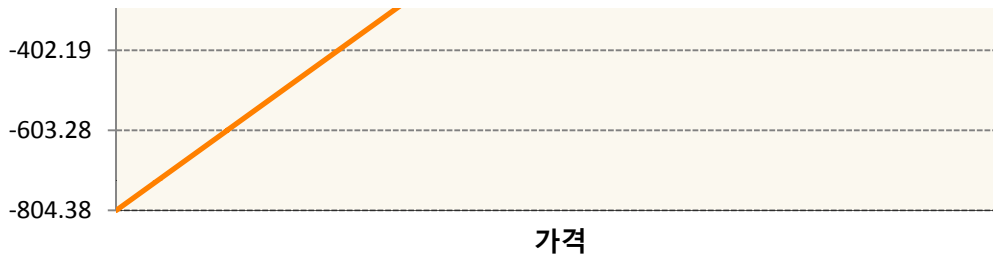
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q62459-2020-06 풋245



KR4301Q62475-2020-06 풋247.5





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

|              |         |                |        |     |       |        |        |    |
|--------------|---------|----------------|--------|-----|-------|--------|--------|----|
| KR4301Q62459 |         | 2020-06 풋245   |        |     |       |        |        | 55 |
| 기초자산의 변동성    |         |                |        |     |       |        |        |    |
| 가격           | -25.00% | -16.67%        | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |    |
| -8.00%       | -41     | -43            | -45    | -47 | -50   | -52    | -55    |    |
| -5.33%       | -19     | -21            | -24    | -27 | -29   | -32    | -35    |    |
| -2.67%       | -3      | -6             | -8     | -11 | -14   | -17    | -19    |    |
| 0%           | 7       | 5              | 2      | 0   | -2    | -5     | -8     |    |
| 2.67%        | 12      | 11             | 9      | 7   | 5     | 3      | 1      |    |
| 5.33%        | 14      | 13             | 12     | 11  | 10    | 8      | 7      |    |
| 8.00%        | 15      | 15             | 14     | 13  | 13    | 12     | 10     |    |
| KR4301Q62475 |         | 2020-06 풋247.5 |        |     |       |        |        | 40 |
| 기초자산의 변동성    |         |                |        |     |       |        |        |    |
| 가격           | -25.00% | -16.67%        | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |    |
| -8.00%       | -32     | -33            | -35    | -36 | -37   | -39    | -40    |    |
| -5.33%       | -15     | -17            | -19    | -21 | -23   | -24    | -26    |    |
| -2.67%       | -3      | -5             | -7     | -9  | -11   | -13    | -15    |    |
| 0%           | 5       | 4              | 2      | 0   | -2    | -4     | -5     |    |
| 2.67%        | 10      | 9              | 7      | 6   | 4     | 3      | 1      |    |
| 5.33%        | 12      | 11             | 10     | 9   | 8     | 7      | 6      |    |
| 8.00%        | 13      | 12             | 12     | 11  | 11    | 10     | 9      |    |

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

80

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-19 |
| 기준일 | 2020-05-18 |

## 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 | 7,343 | 0     | 7,343     |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 7,210 | -7,210    | 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 | 2020-05-19 |
| 기준일 | 2020-05-18 |

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

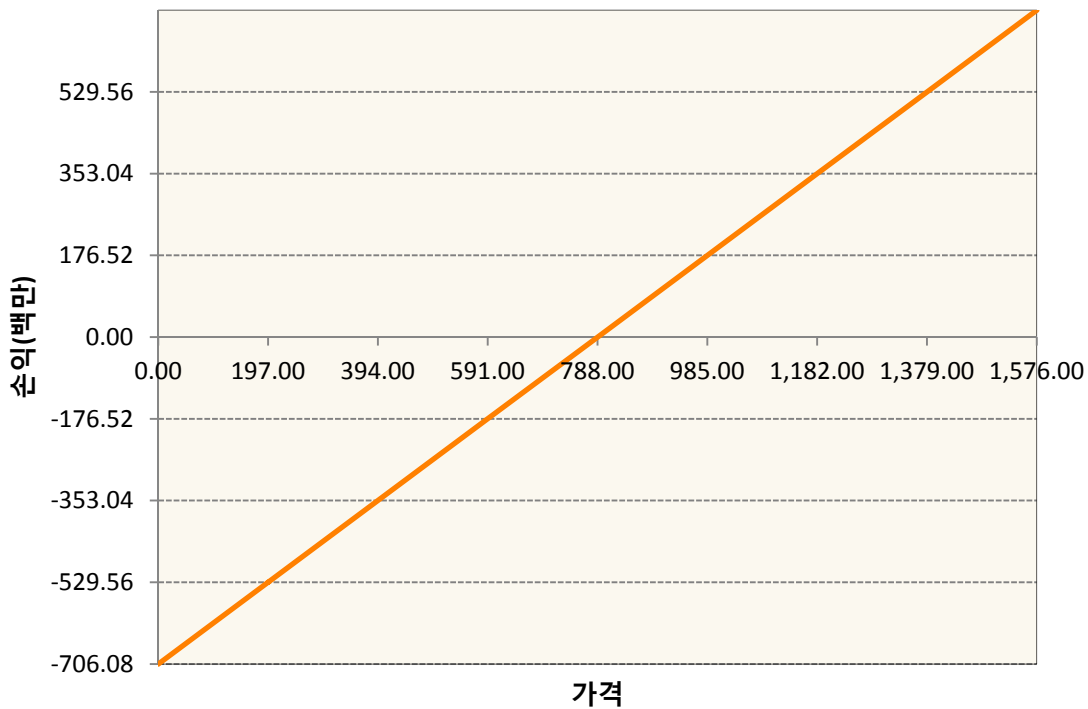
### 1. 계약금액

(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   | 706   | 0     | 706       |    |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 874   | 0     | 874       | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 205   | 872   | -667      | 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 | 56 |

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

(단위:백만원)

**163**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-19 |
| 기준일 | 2020-05-18 |

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

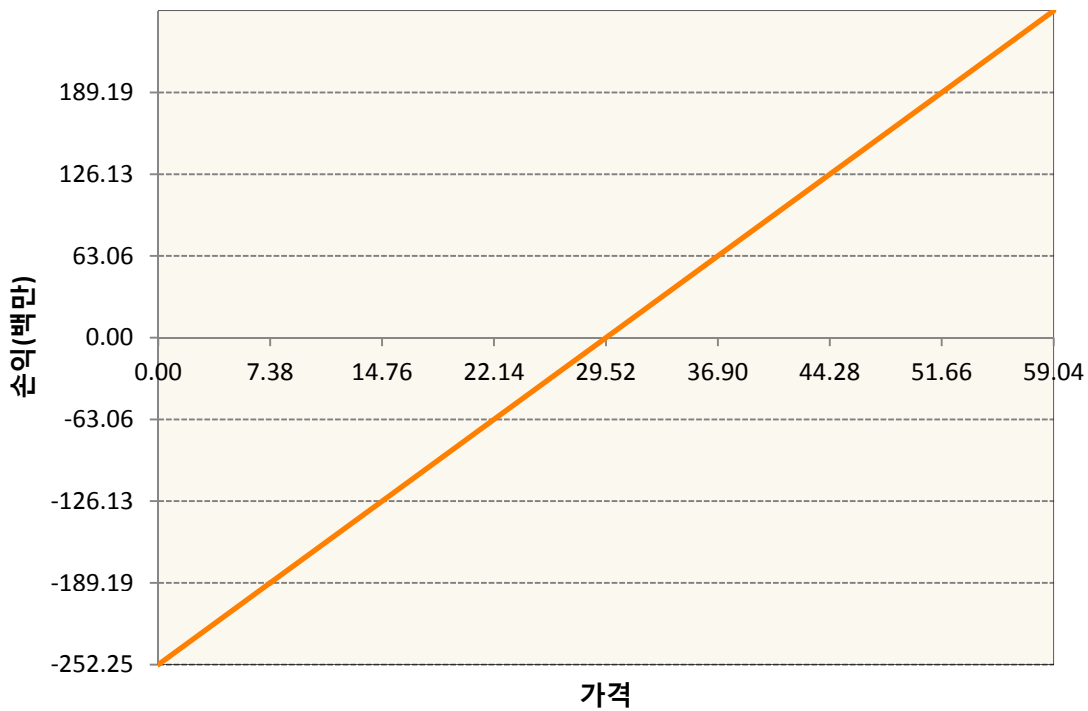
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

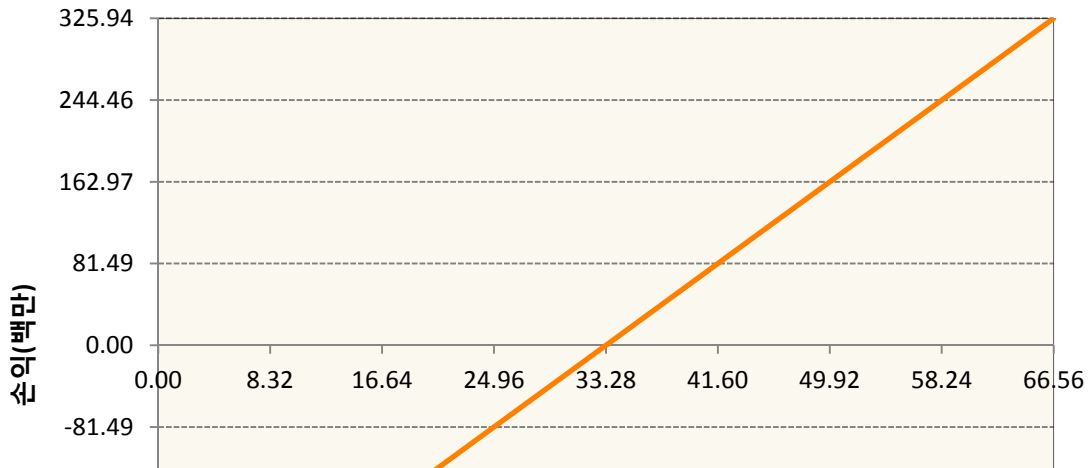
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,563 | 185   | 1,379     |    |

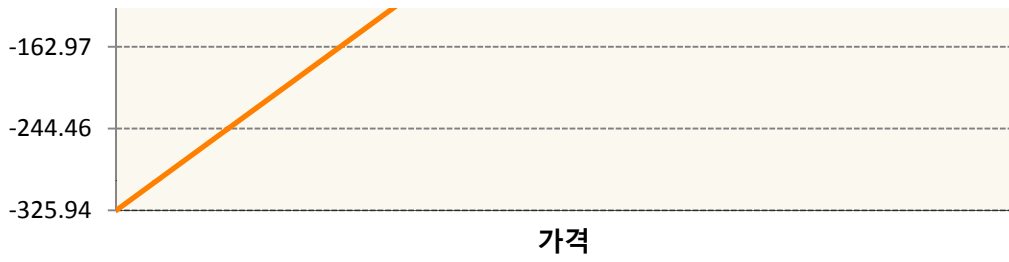
### 2. 만기시점의 손익구조

CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20

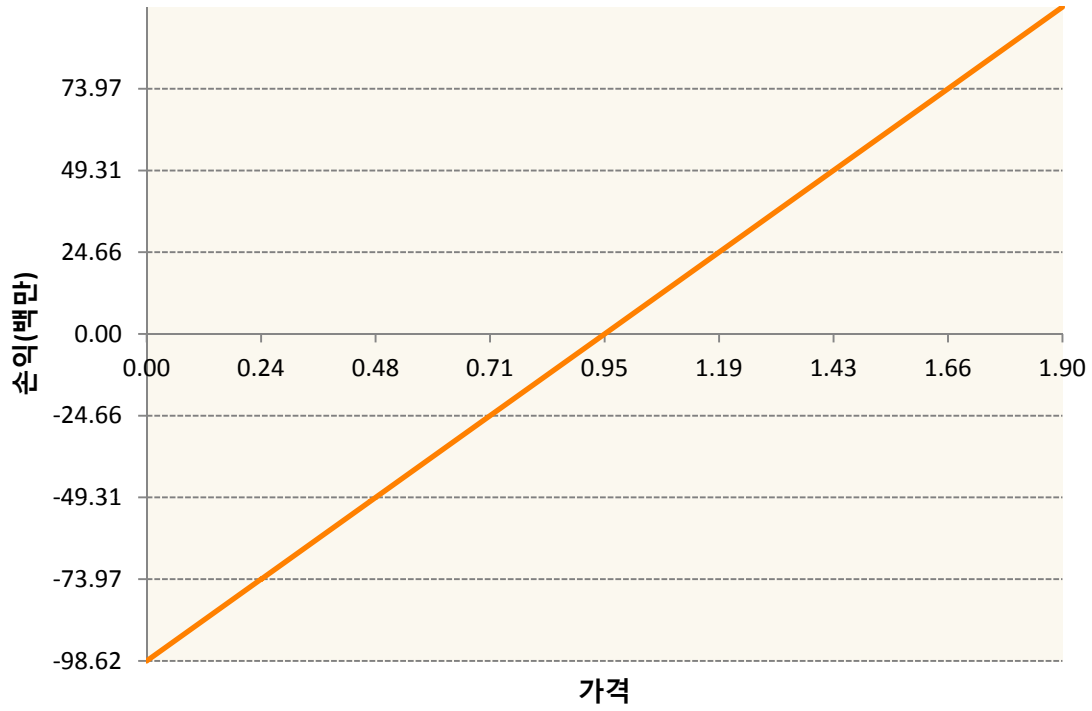


COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20

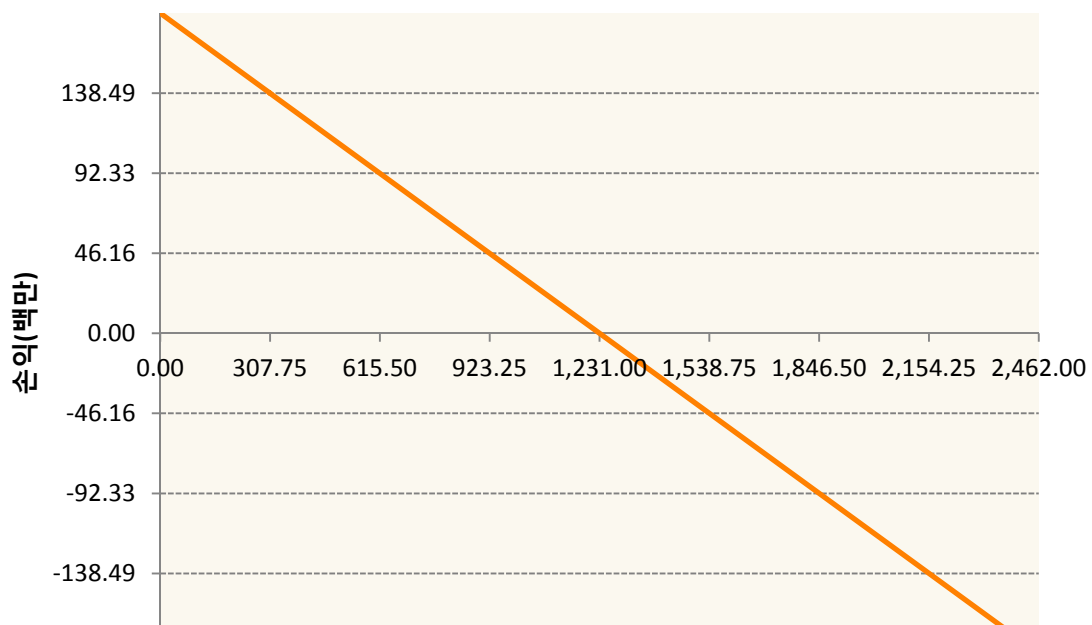


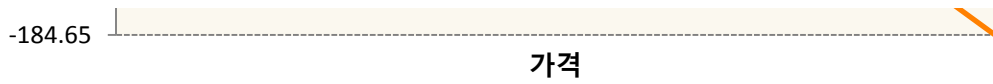


HON0-NY Harb ULSD Fut Jul20

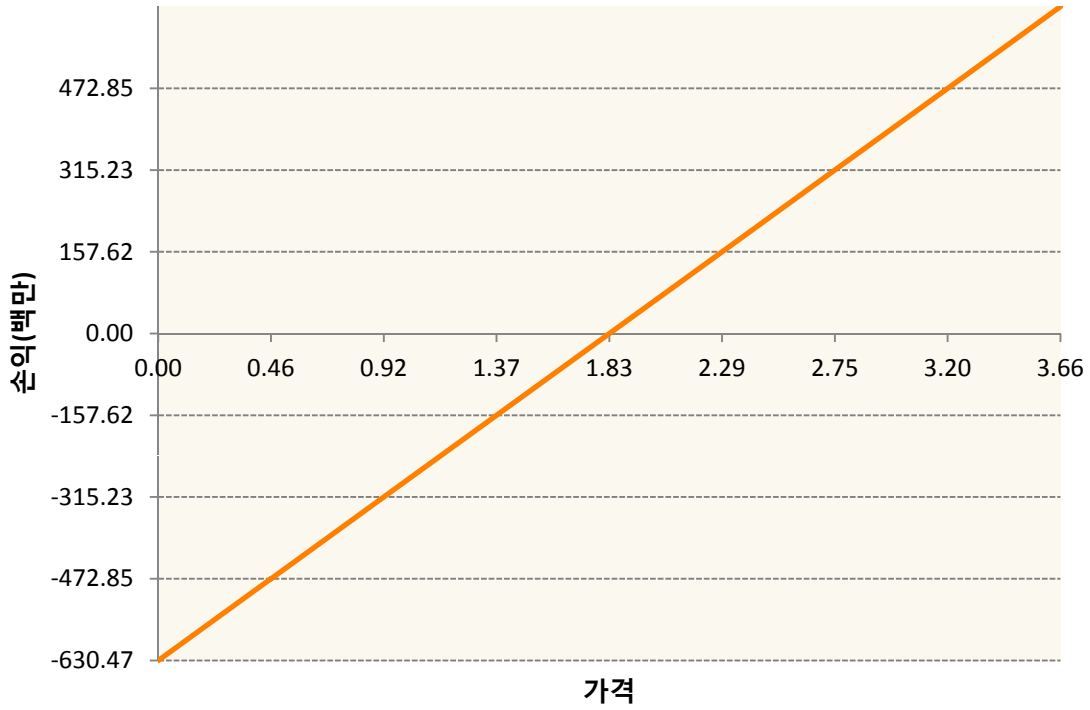


KR4175Q60006-2020-06 달러선물

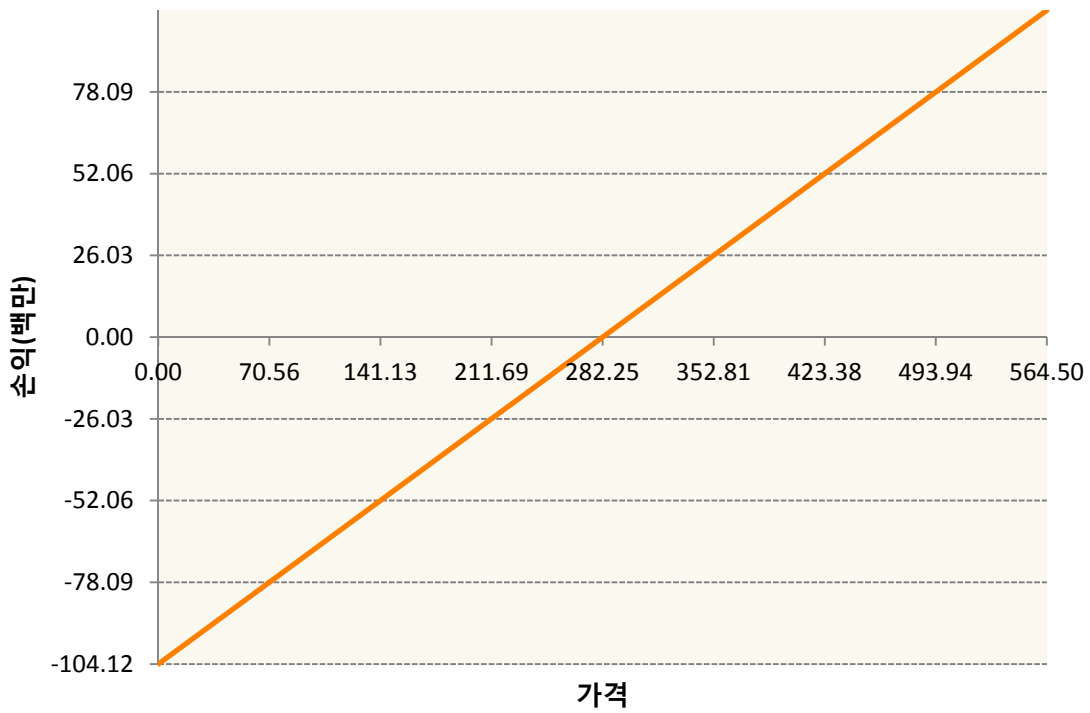




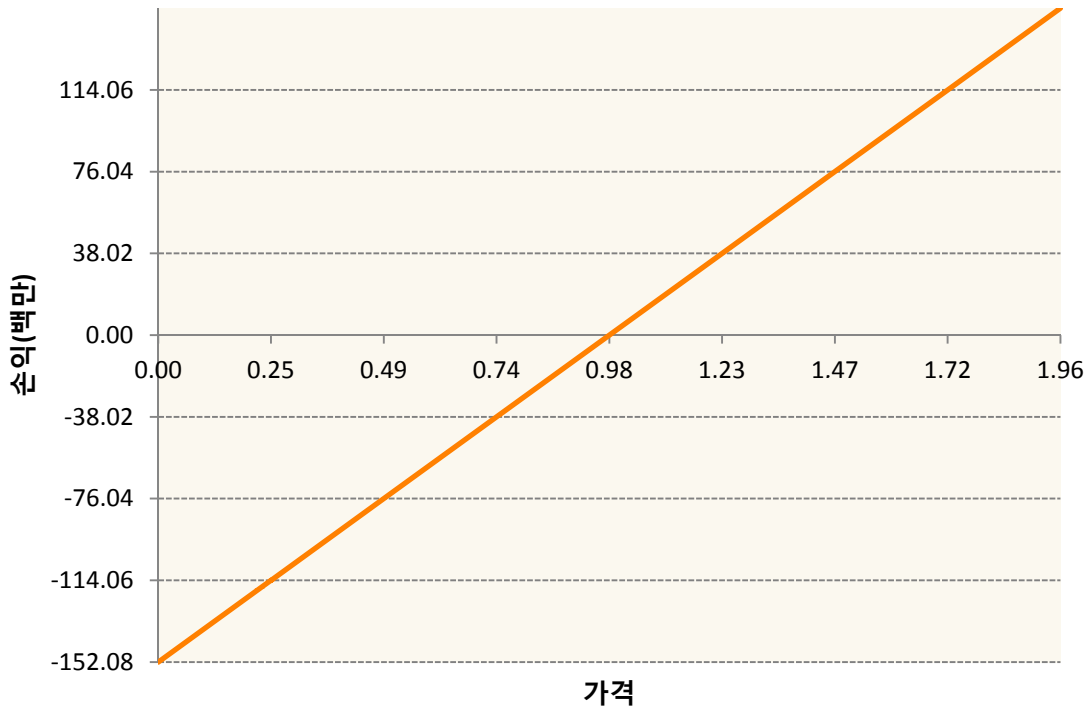
NGN20-NATURAL GAS FUTR Jul20



QSN0-Low Su Gasoil G Jul20



XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|            |                         |    |
|------------|-------------------------|----|
| CLN0       | WTI CRUDE FUTURE Jul20  | 20 |
| COU0       | BRENT CRUDE FUTR Sep20  | 26 |
| HON0       | NY Harb ULSD Fut Jul20  | 8  |
| KR4175Q60C | 2020-06 달러선물            | 15 |
| NGN20      | NATURAL GAS FUTR Jul20  | 50 |
| QSN0       | Low Su Gasoil G Jul20   | 8  |
| XBN0       | GASOLINE RBOB FUT Jul20 | 12 |

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

(단위:백만원)

681

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-05-19 |
| 기준일 | 2020-05-18 |

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

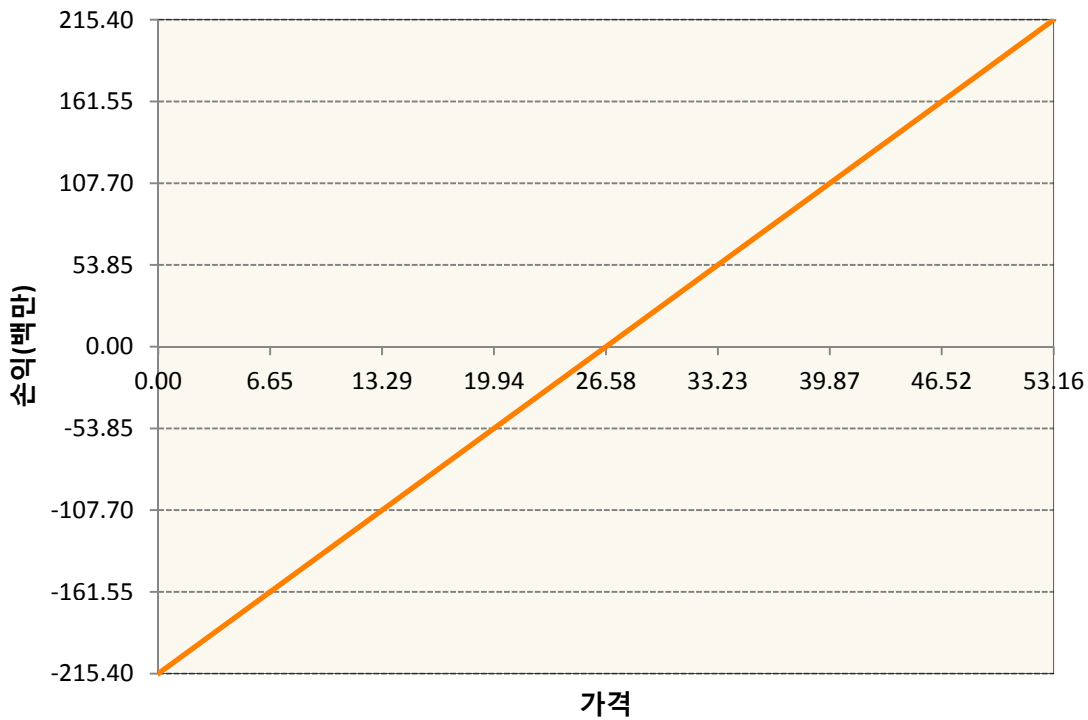
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

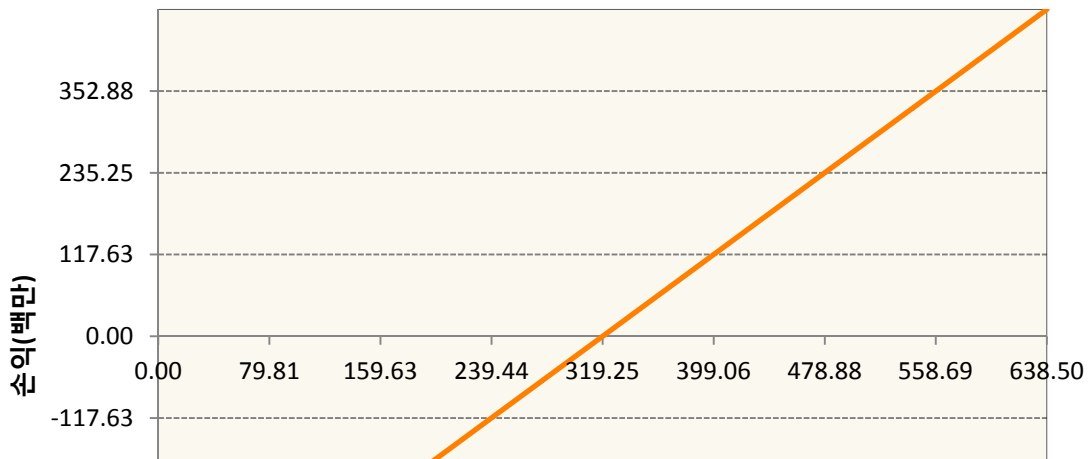
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,414 | 74    | 2,340     |    |

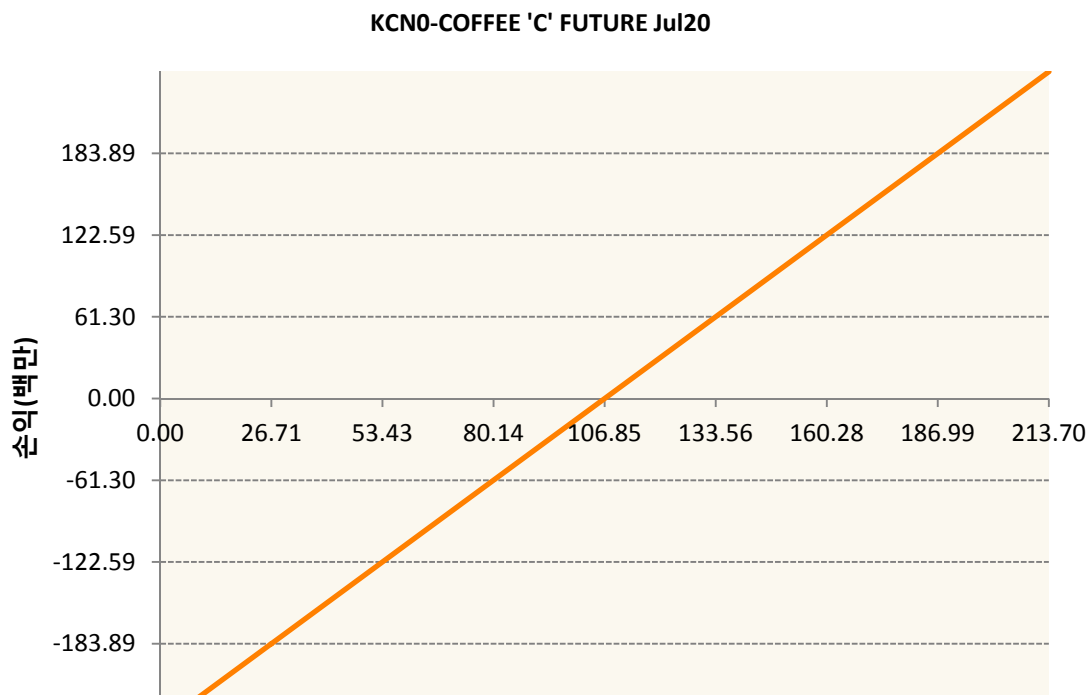
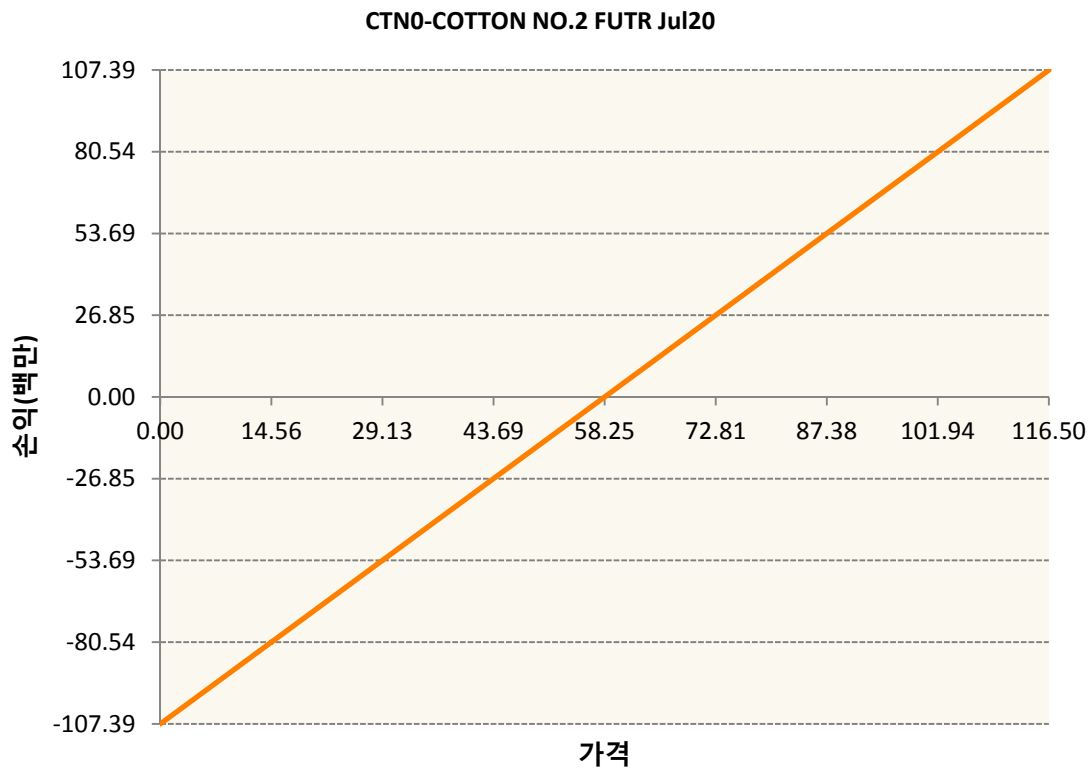
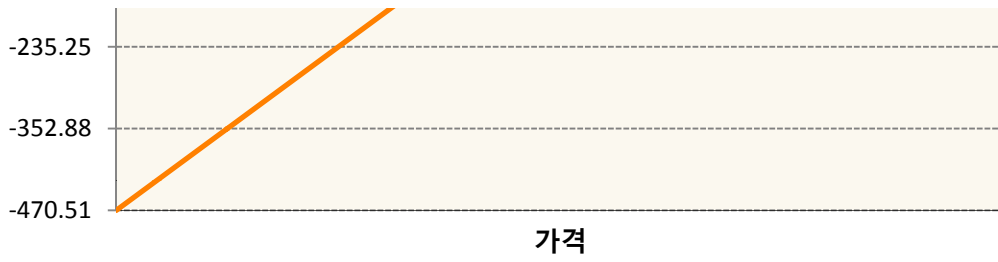
### 2. 만기시점의 손익구조

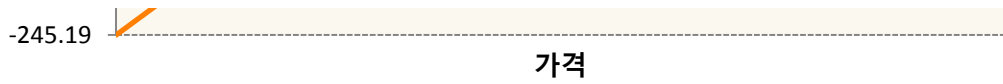
**BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20**



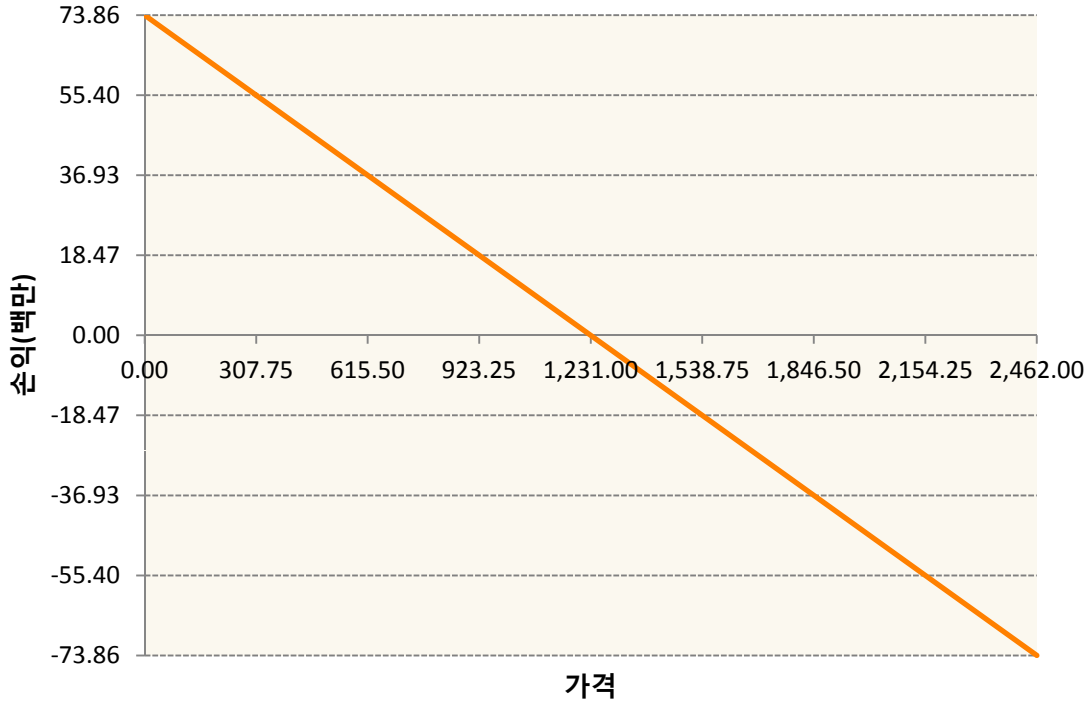
**CNO-CORN FUTURE Jul20**



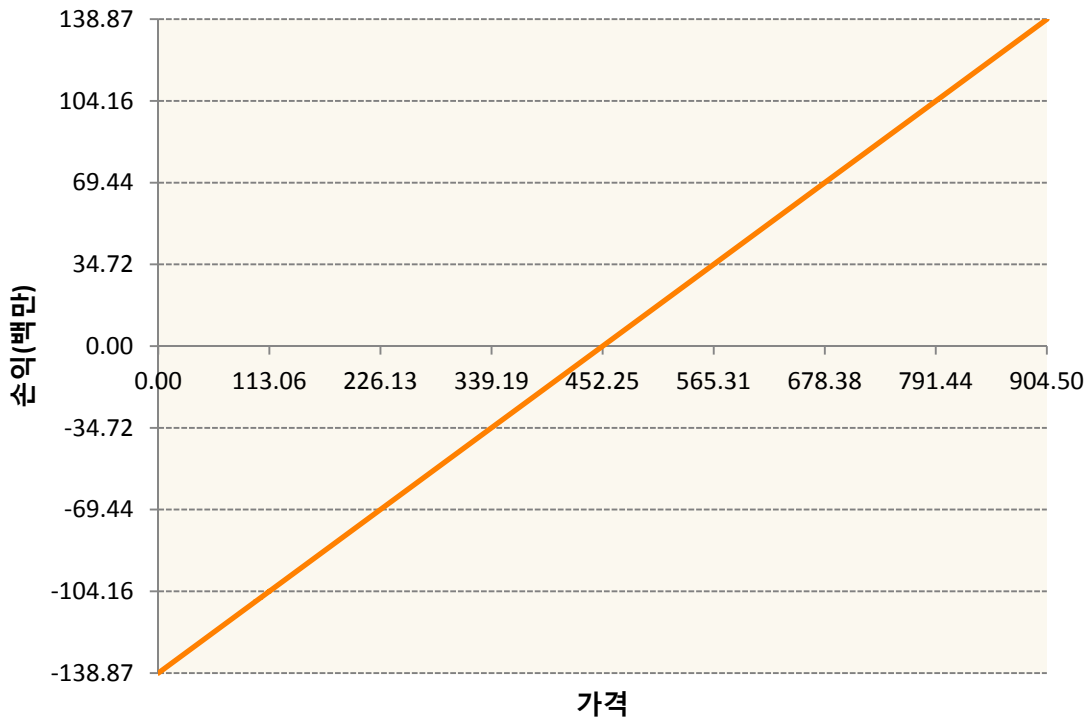




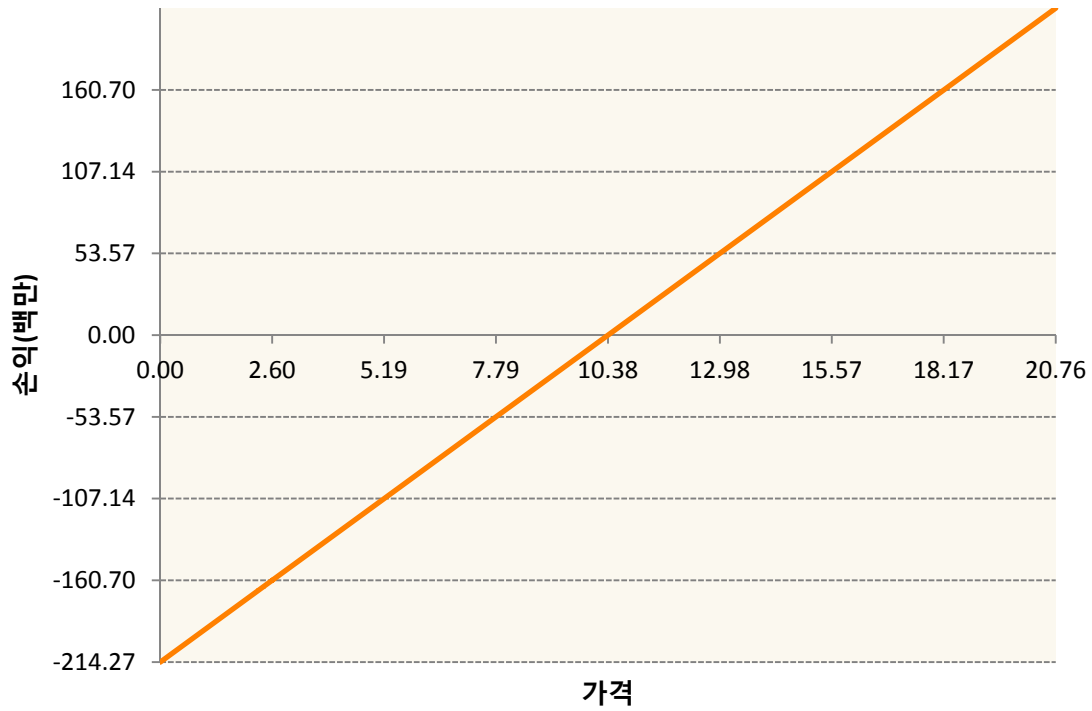
KR4175Q60006-2020-06 달러선물



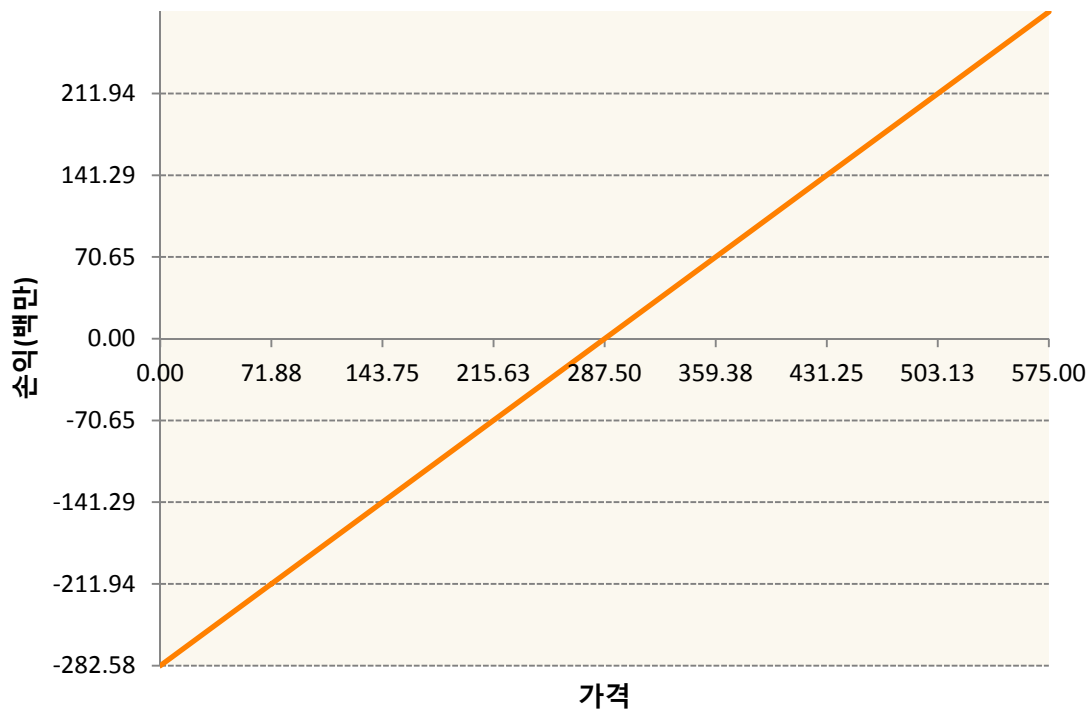
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



SBN0-Sugar Jul20

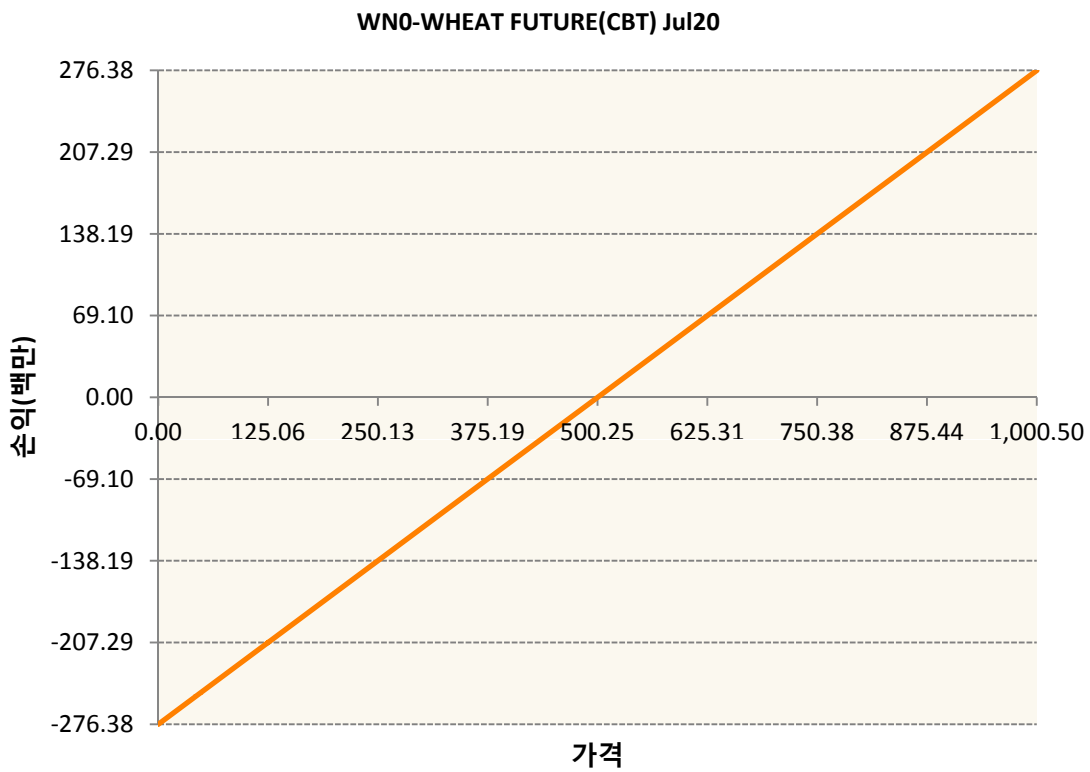
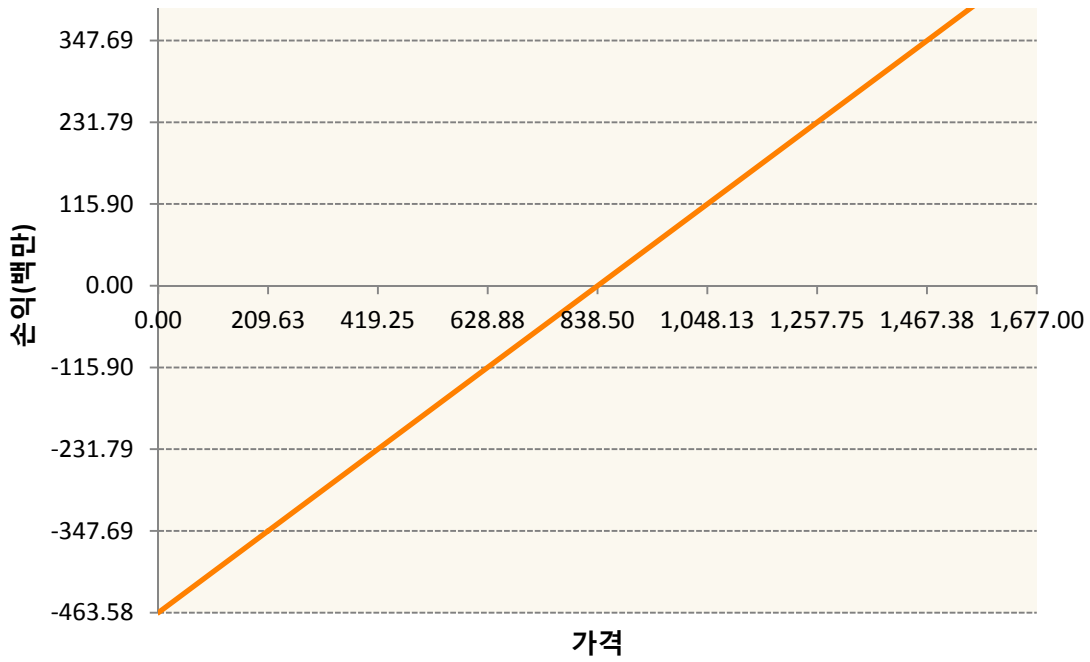


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20



SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

|            |                         |    |
|------------|-------------------------|----|
| BON0       | SOYBEAN OIL FUTR Jul20  | 17 |
| CN0        | CORN FUTURE Jul20       | 38 |
| 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 |
| WN0  | WHEAT FUTURE(CBT) Jul20 | 22 |

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

(단위:백만원)

**229**