

공시일	2020-05-21
기준일	2020-05-20

포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

48

공시일	2020-05-21
기준일	2020-05-20

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

994

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,168

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-21
기준일	2020-05-20

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

570

* 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	2020-05-21
기준일	2020-05-20

유로인덱스모(주식-파생형)

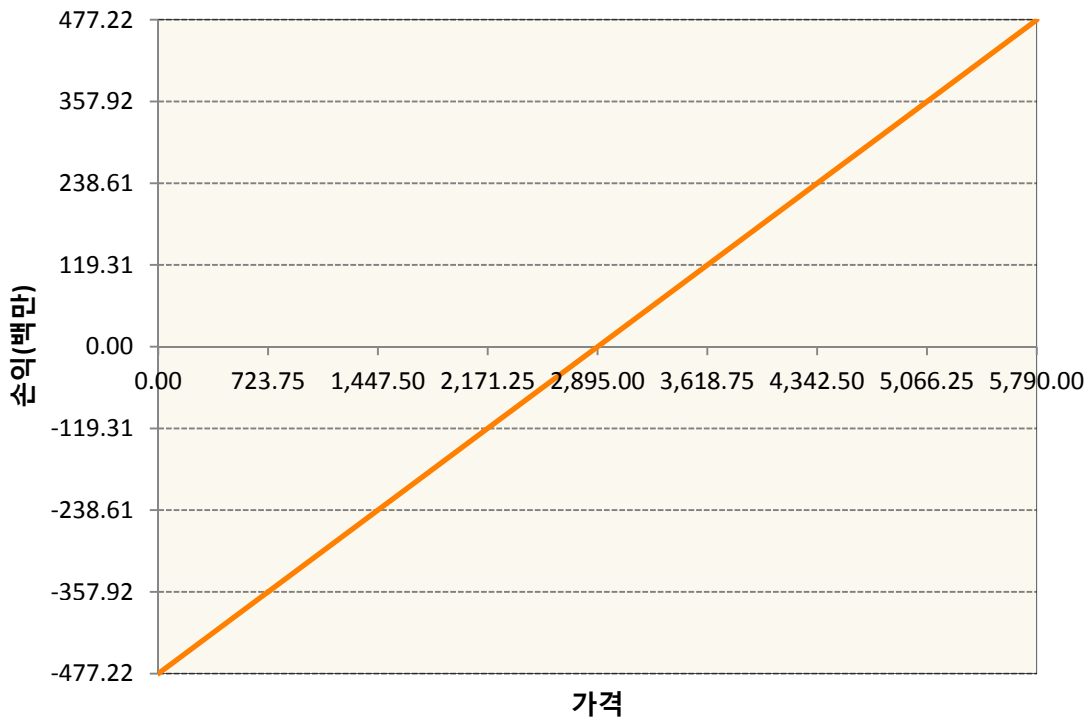
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	477	0	477	

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)

49

공시일	2020-05-21
기준일	2020-05-20

차이나인덱스모(주식-파생형)

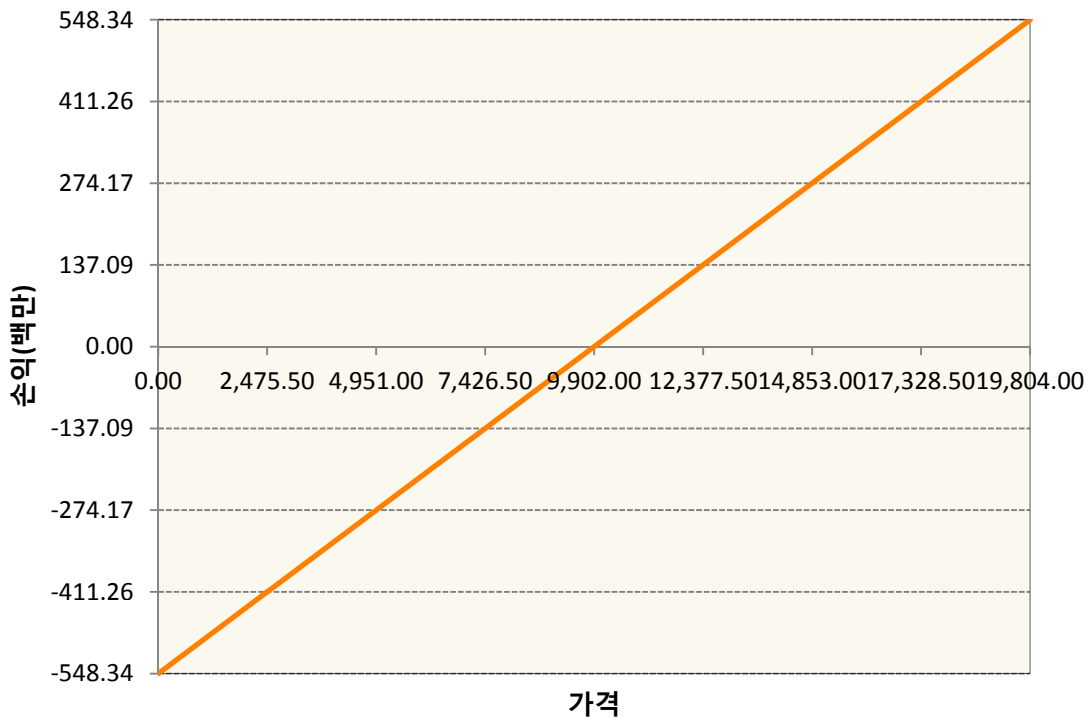
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	548	0	548	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCK0-HSCEI Futures May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK0	HSCEI Futures May20	44
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

47

공시일	2020-05-21
기준일	2020-05-20

커버드콜모(주식혼합-파생형)

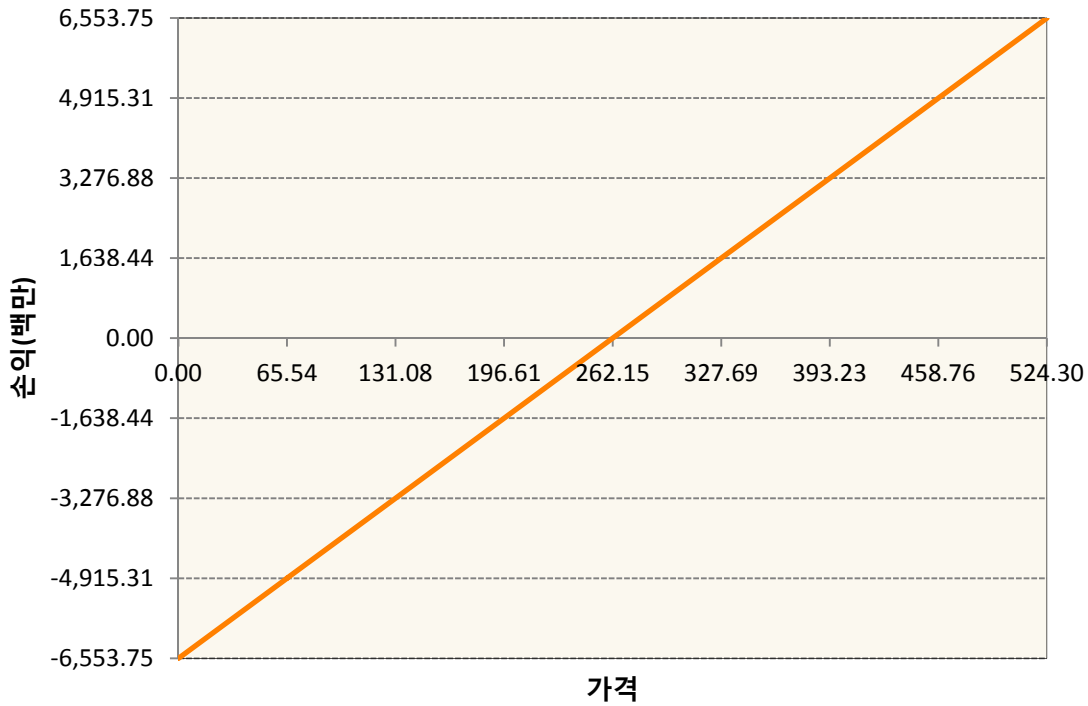
1. 계약금액

(단위:백만원)

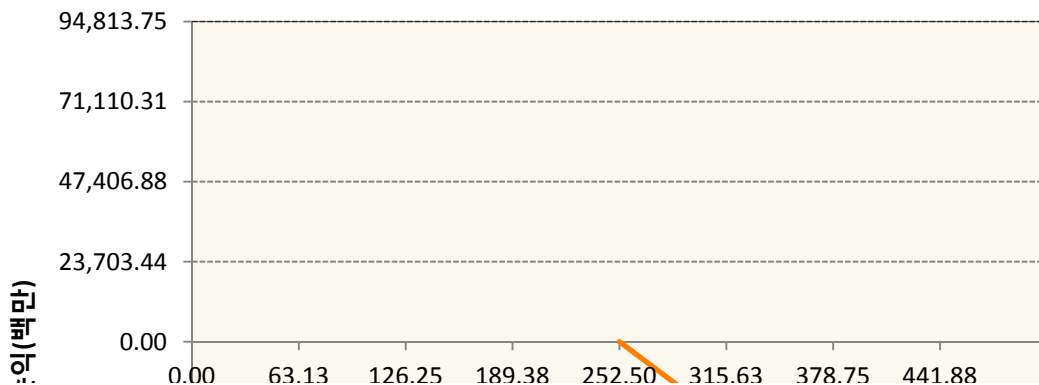
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,554	0	6,554	장내
누계	유가증권	옵션	0	364,213	-364,213	장내

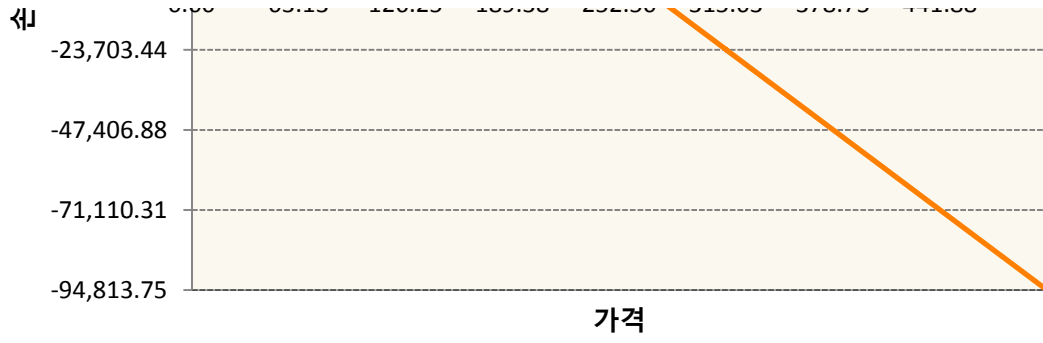
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

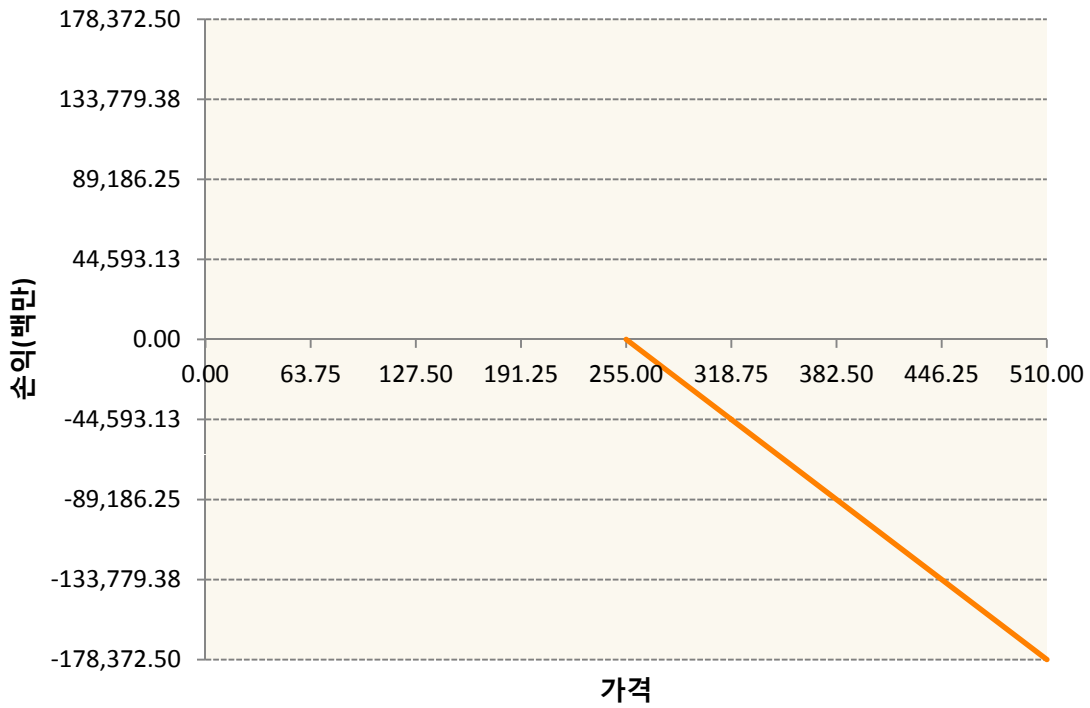


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

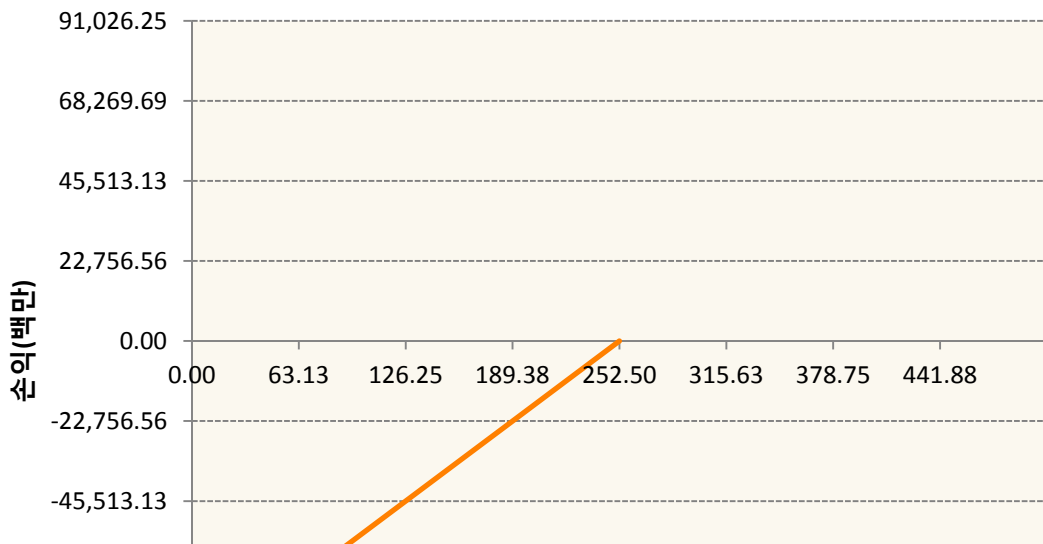


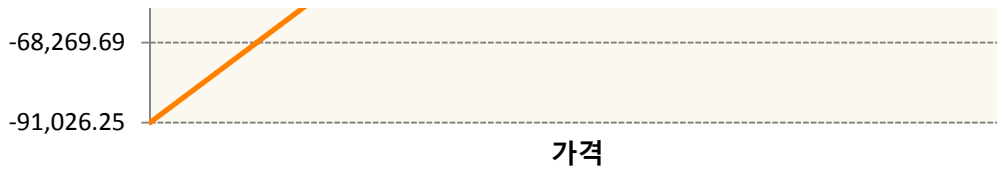


KR4201Q62550-2020-06 콜255



KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						525
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-525	-525	-525	-525	-525	-525	-525	
-5.33%	-350	-350	-350	-350	-350	-350	-350	
-2.67%	-175	-175	-175	-175	-175	-175	-175	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	175	175	175	175	175	175	175	
5.33%	350	350	350	350	350	350	350	
8.00%	525	525	525	525	525	525	525	
KR4201Q62527		2020-06 콜252.5						6,795
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4,921	4,632	4,337	4,035	3,730	3,421	3,109	
-5.33%	3,951	3,621	3,290	2,959	2,626	2,294	1,961	
-2.67%	2,624	2,287	1,949	1,610	1,272	933	594	
0%	950	639	322	0	-325	-653	-983	
2.67%	-1,025	-1,286	-1,562	-1,848	-2,144	-2,446	-2,754	
5.33%	-3,235	-3,436	-3,659	-3,900	-4,155	-4,422	-4,700	
8.00%	-5,614	-5,757	-5,925	-6,116	-6,327	-6,554	-6,795	
KR4201Q62550		2020-06 콜255						12,357
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	8,561	8,057	7,533	6,994	6,444	5,885	5,318	
-5.33%	6,974	6,374	5,769	5,160	4,549	3,935	3,319	
-2.67%	4,739	4,101	3,464	2,827	2,190	1,553	916	
0%	1,848	1,238	621	0	-625	-1,253	-1,882	
2.67%	-1,635	-2,166	-2,717	-3,285	-3,864	-4,454	-5,052	
5.33%	-5,601	-6,023	-6,482	-6,970	-7,481	-8,011	-8,557	
8.00%	-9,924	-10,234	-10,591	-10,987	-11,417	-11,875	-12,357	
KR4301Q62525		2020-06 풋252.5						4,256
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,411	-3,534	-3,666	-3,805	-3,951	-4,101	-4,256	
-5.33%	-1,568	-1,745	-1,924	-2,105	-2,286	-2,468	-2,651	
-2.67%	-283	-468	-654	-840	-1,027	-1,214	-1,401	

0%	447	306	156	0	-161	-326	-495
2.67%	780	698	602	494	376	249	115
5.33%	901	864	814	752	677	591	495
8.00%	936	923	902	871	830	778	716

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

(단위:백만원)

21,852

공시일	2020-05-21
기준일	2020-05-20

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

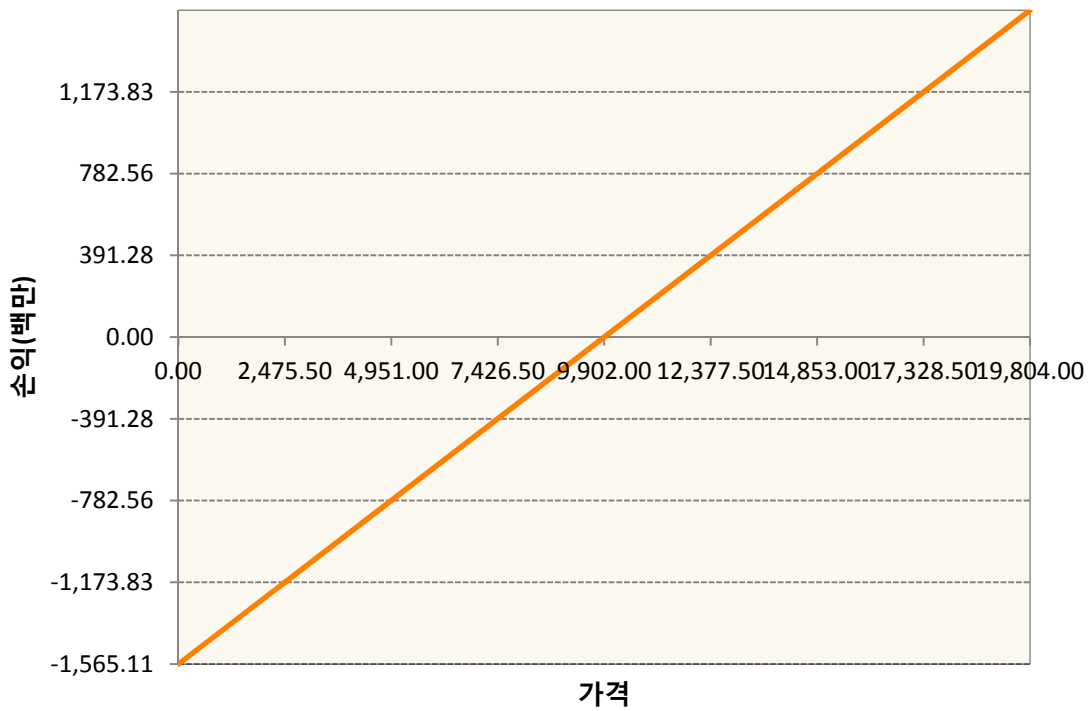
1. 계약금액

(단위:백만원)

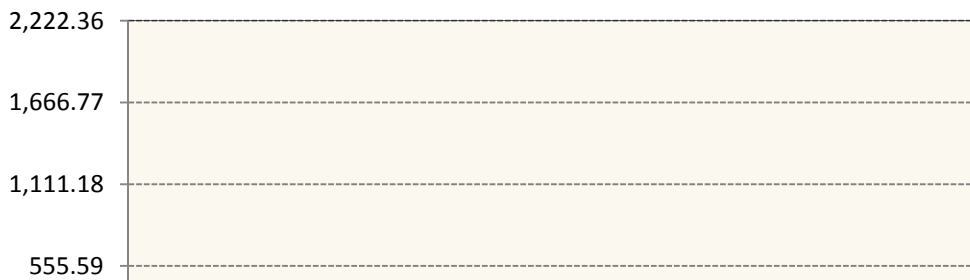
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,565	0	1,565	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,445	-4,445	장내
누계	통화	선도	698	3,772	-3,073	장외

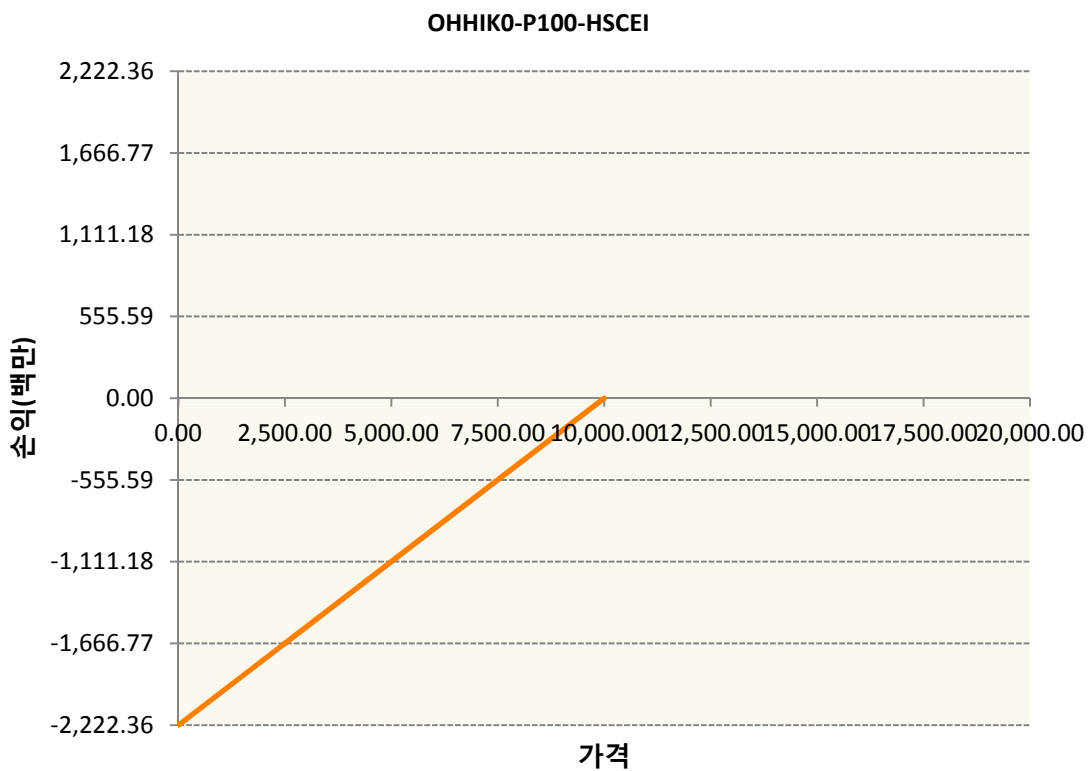
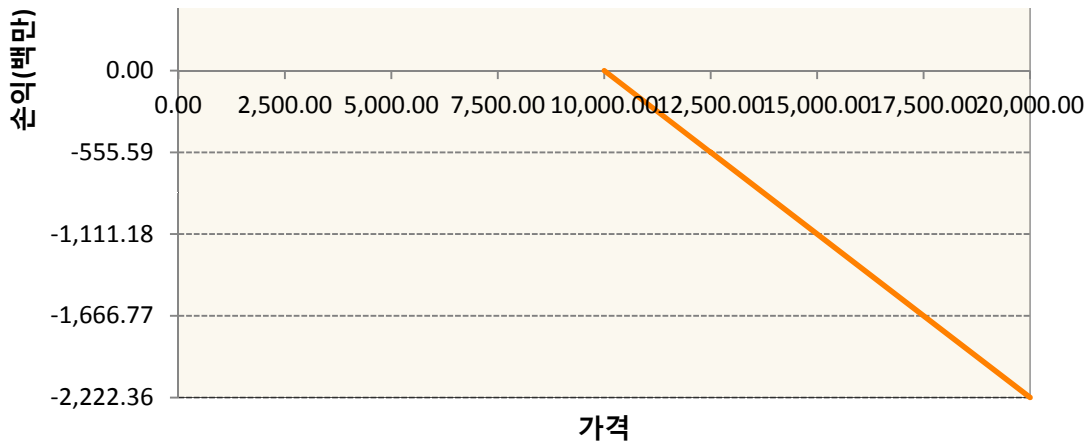
2. 만기시점의 손익구조

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
FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E		123
HCK0 HSCEI Futures May20		125
OHHIK0-C1C HSCEI		178
OHHIK0-P10 HSCEI		178

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

공시일	2020-05-21
기준일	2020-05-20

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

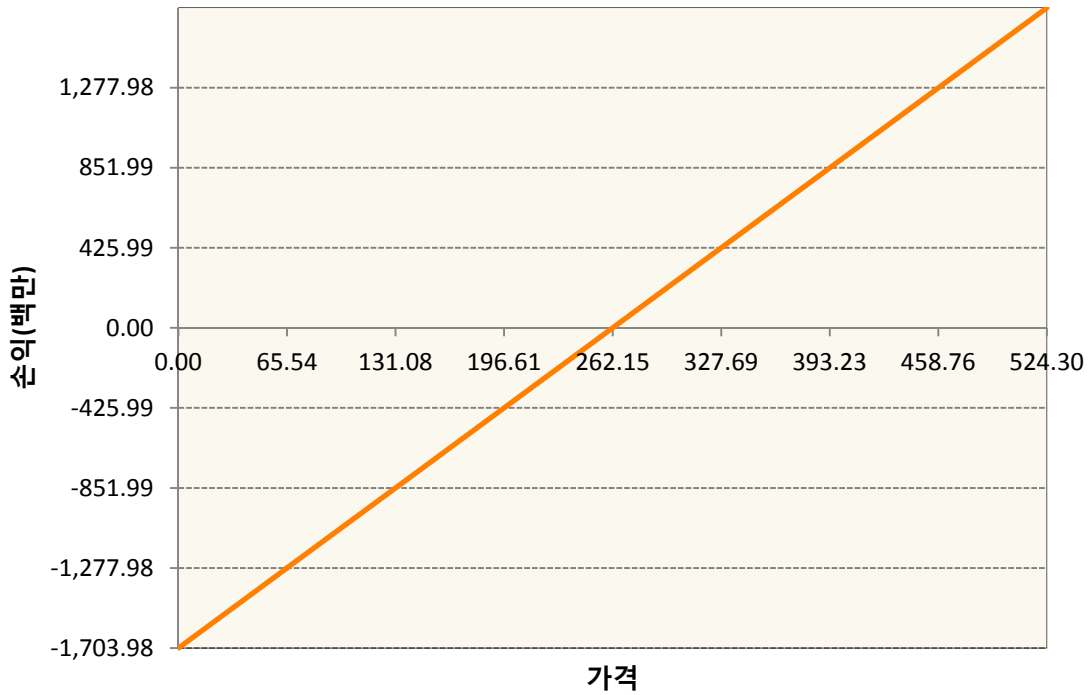
1. 계약금액

(단위:백만원)

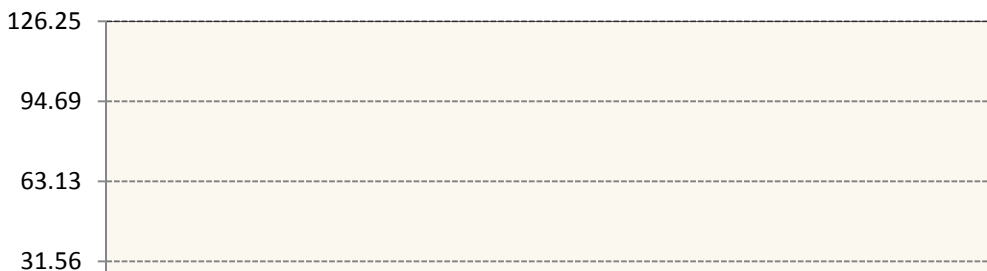
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,704	0	1,704	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,361	-3,361	장내

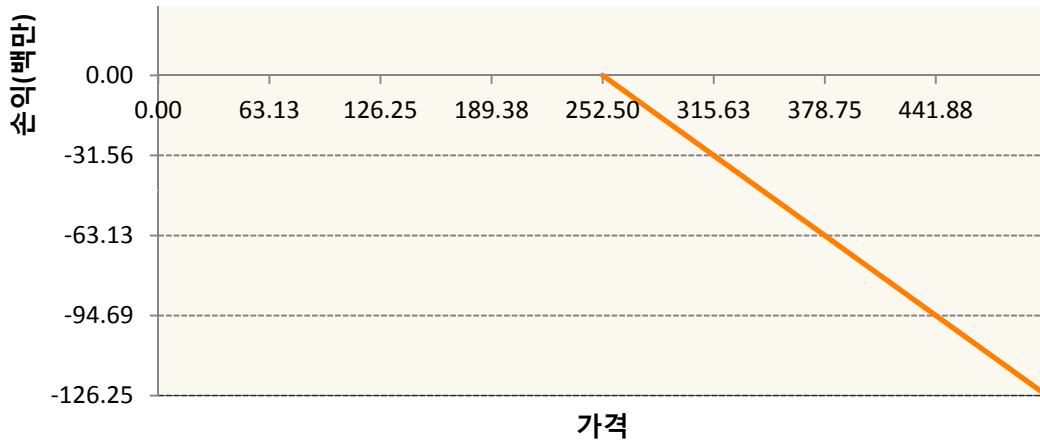
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

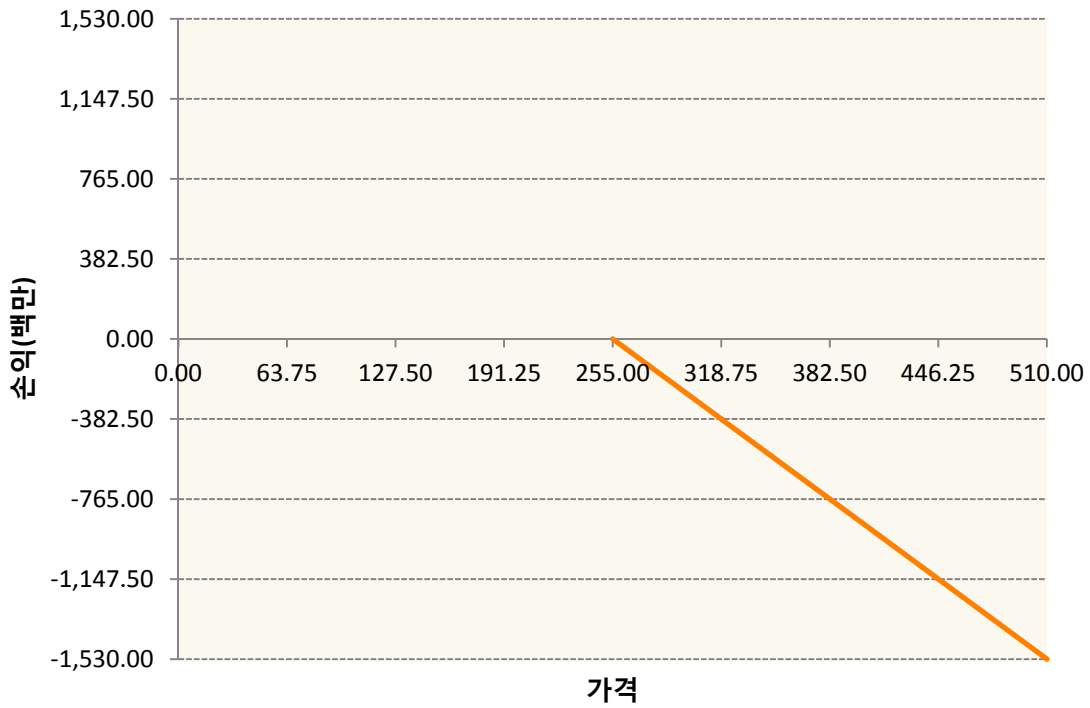


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

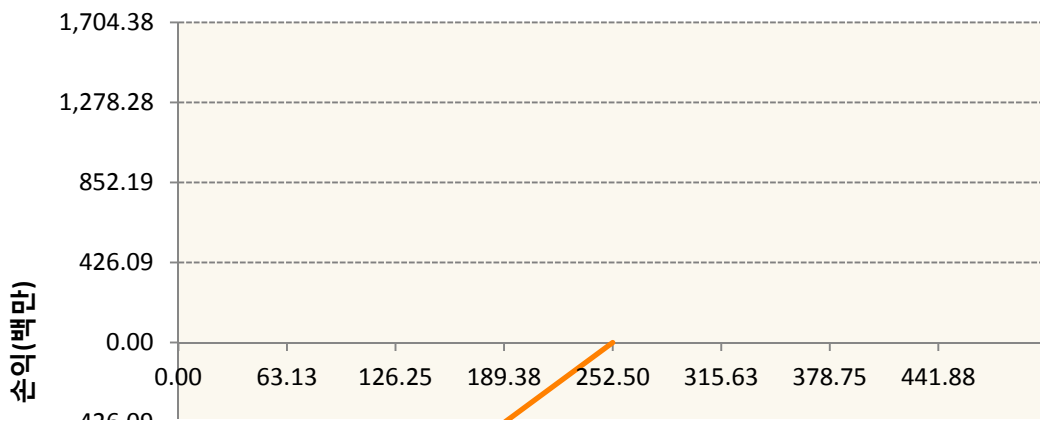




KR4201Q62550-2020-06 콜255



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						137
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-137	-137	-137	-137	-137	-137	-137	
-5.33%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91	
-2.67%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	46	46	46	46	46	46	46	
5.33%	91	91	91	91	91	91	91	
8.00%	137	137	137	137	137	137	137	
KR4201Q62527		2020-06 콜252.5						9
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	7	6	6	5	5	5	4	
-5.33%	5	5	4	4	3	3	3	
-2.67%	3	3	3	2	2	1	1	
0%	1	1	0	0	0	-1	-1	
2.67%	-1	-2	-2	-2	-3	-3	-4	
5.33%	-4	-5	-5	-5	-6	-6	-6	
8.00%	-7	-8	-8	-8	-8	-9	-9	
KR4201Q62550		2020-06 콜255						106
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	73	69	65	60	55	50	46
-5.33%	60	55	49	44	39	34	28
-2.67%	41	35	30	24	19	13	8
0%	16	11	5	0	-5	-11	-16
2.67%	-14	-19	-23	-28	-33	-38	-43
5.33%	-48	-52	-56	-60	-64	-69	-73
8.00%	-85	-88	-91	-94	-98	-102	-106
KR4301Q62525 2020-06 풋252.5							80
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-64	-66	-69	-71	-74	-77	-80
-5.33%	-29	-33	-36	-39	-43	-46	-50
-2.67%	-5	-9	-12	-16	-19	-23	-26
0%	8	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	15	13	11	9	7	5	2
5.33%	17	16	15	14	13	11	9
8.00%	18	17	17	16	16	15	13

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

(단위:백만원)

564

공시일	2020-05-21
기준일	2020-05-20

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

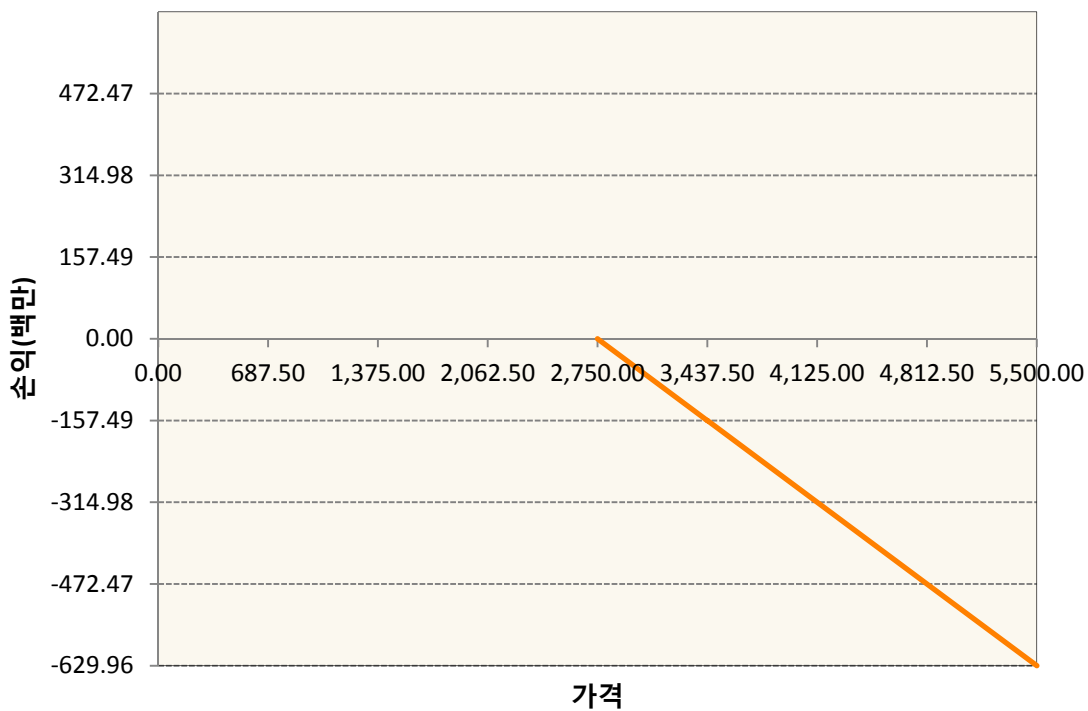
1. 계약금액

(단위:백만원)

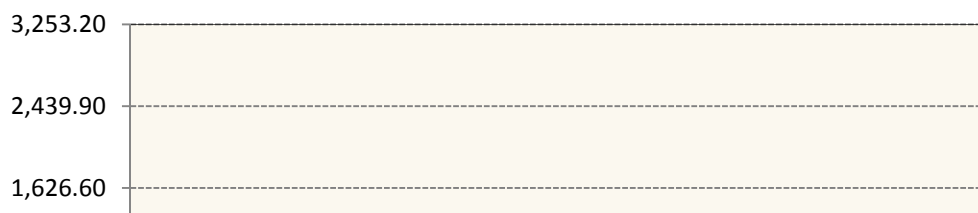
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,747	0	1,747	
누계	유가증권	스왑	8,037	0	8,037	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,766	-7,766	장내
누계	통화	선도	0	2,916	-2,916	장외

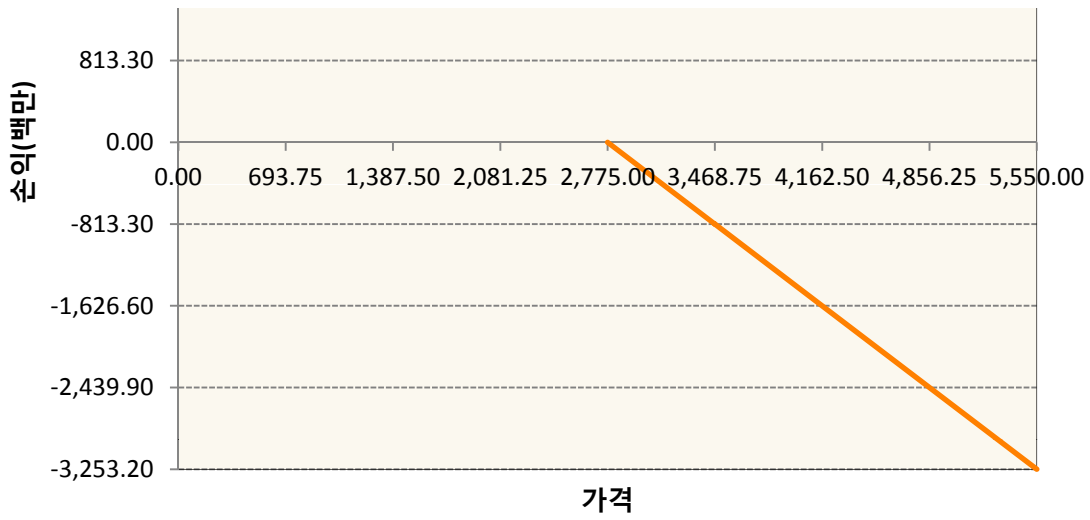
2. 만기시점의 손익구조

OESXM0-C2750-EURO STOXX 50

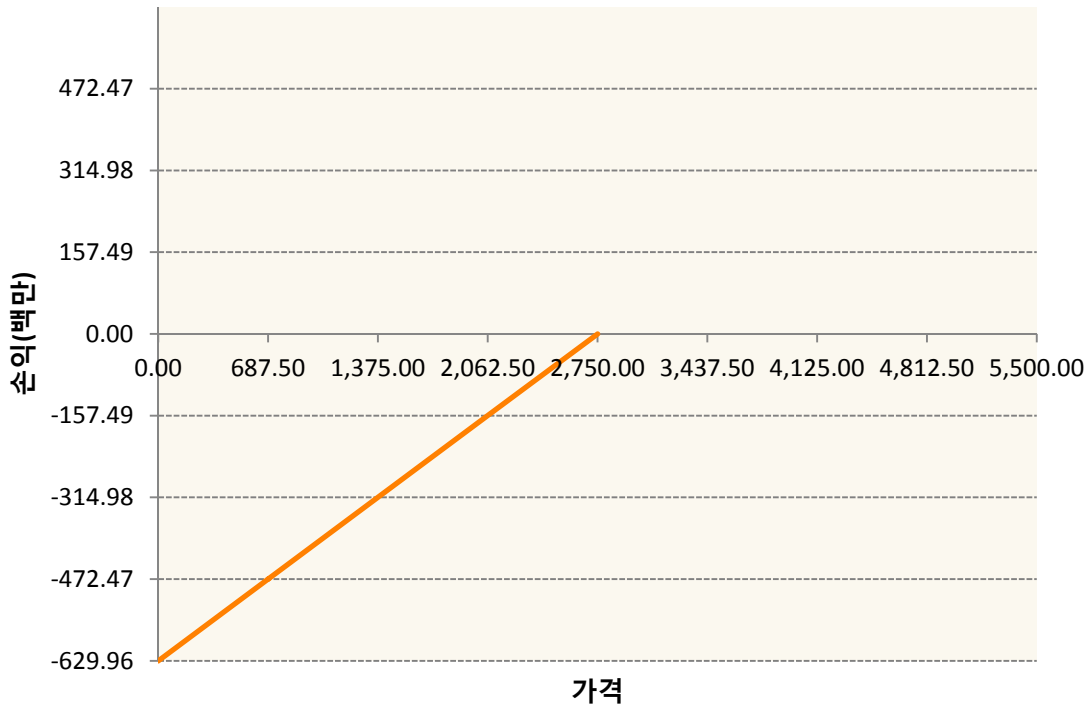


OESXM0-C2775-EURO STOXX 50

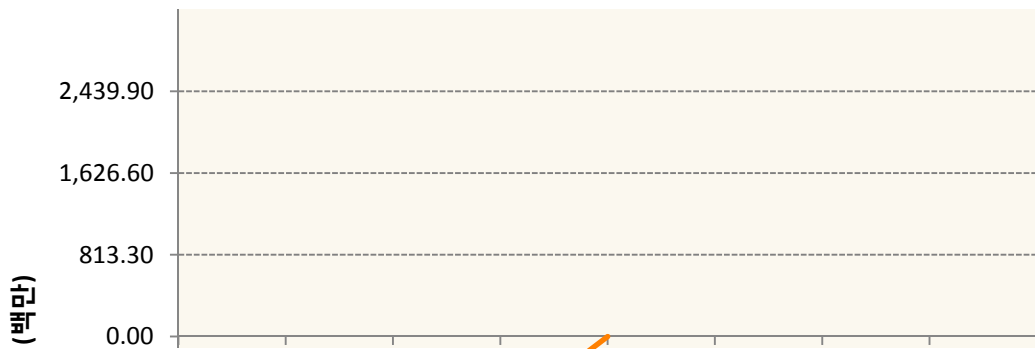


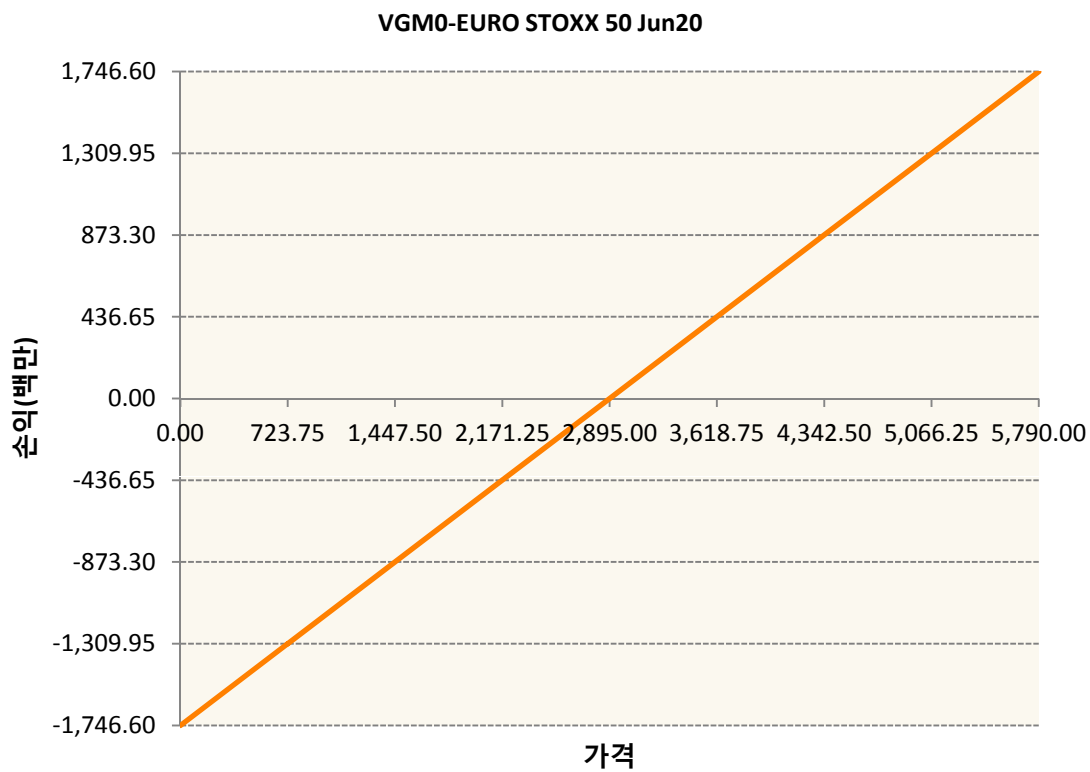
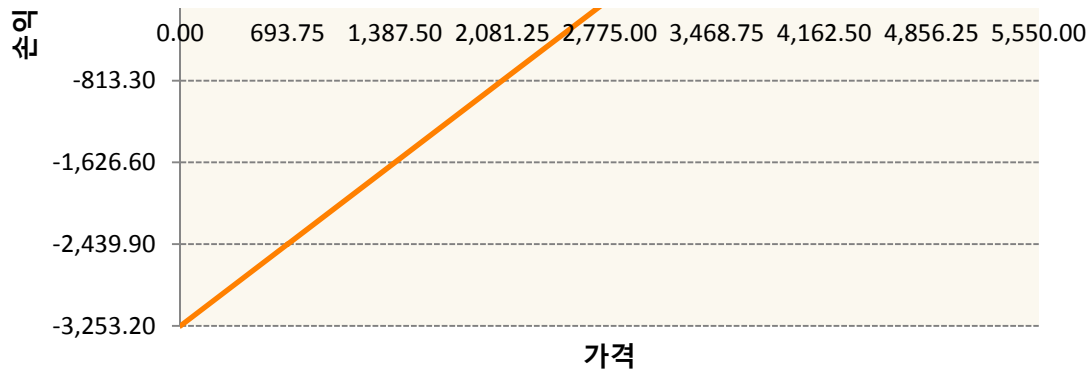


OESXM0-P2750-EURO STOXX 50



OESXM0-P2775-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		13
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E		218
FX21020K02 KRW/EUR 26-06-20E		15
OESXM0-C2' EURO STOXX 50		50
OESXM0-C2' EURO STOXX 50		260
OESXM0-P2' EURO STOXX 50		50
OESXM0-P2' EURO STOXX 50		260
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20		140

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

(단위:백만원)

1,147

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

(단위:백만원)

1,171

공시일	2020-05-21
기준일	2020-05-20

ETF스마트레버리지목표전환형9호

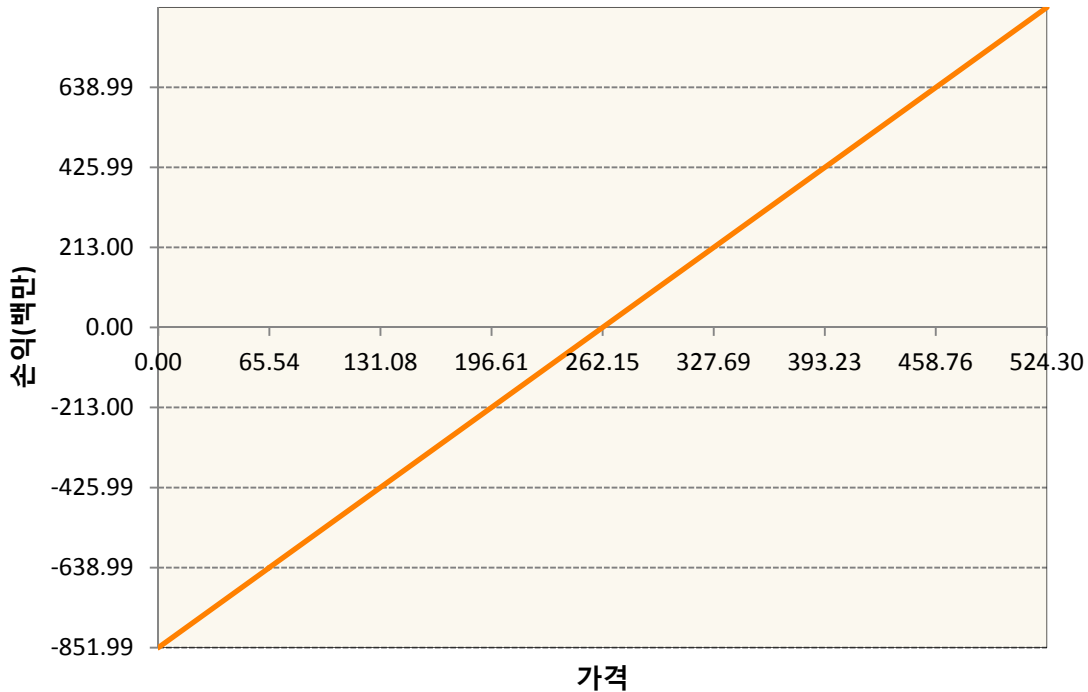
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	852	0	852	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002 2020-06 코스피200지수선물 68

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68
-5.33%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
-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%	46	46	46	46	46	46	46
8.00%	68	68	68	68	68	68	68

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

(단위:백만원)

102

공시일	2020-05-21
기준일	2020-05-20

ETF스마트레버리지목표전환형10호

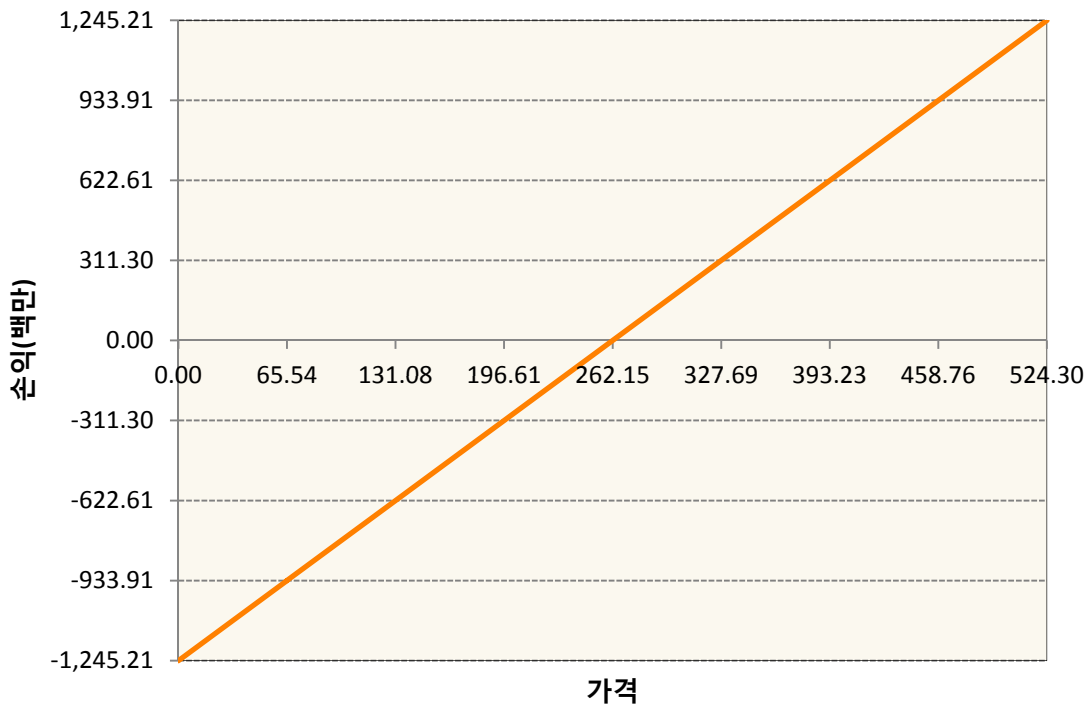
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



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

(단위:백만원)

148

공시일	2020-05-21
기준일	2020-05-20

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

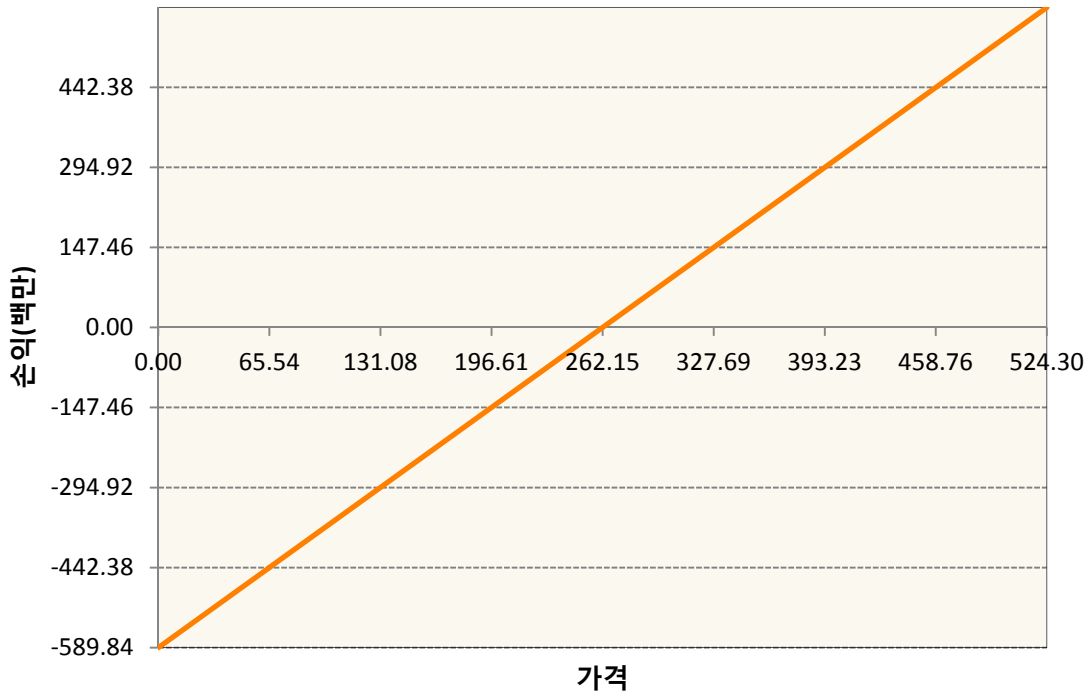
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	590	0	590	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002 2020-06 코스피200지수선물 47

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	16	16	16	16	16	16	16
5.33%	32	32	32	32	32	32	32
8.00%	47	47	47	47	47	47	47

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

(단위:백만원)

70

공시일	2020-05-21
기준일	2020-05-20

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

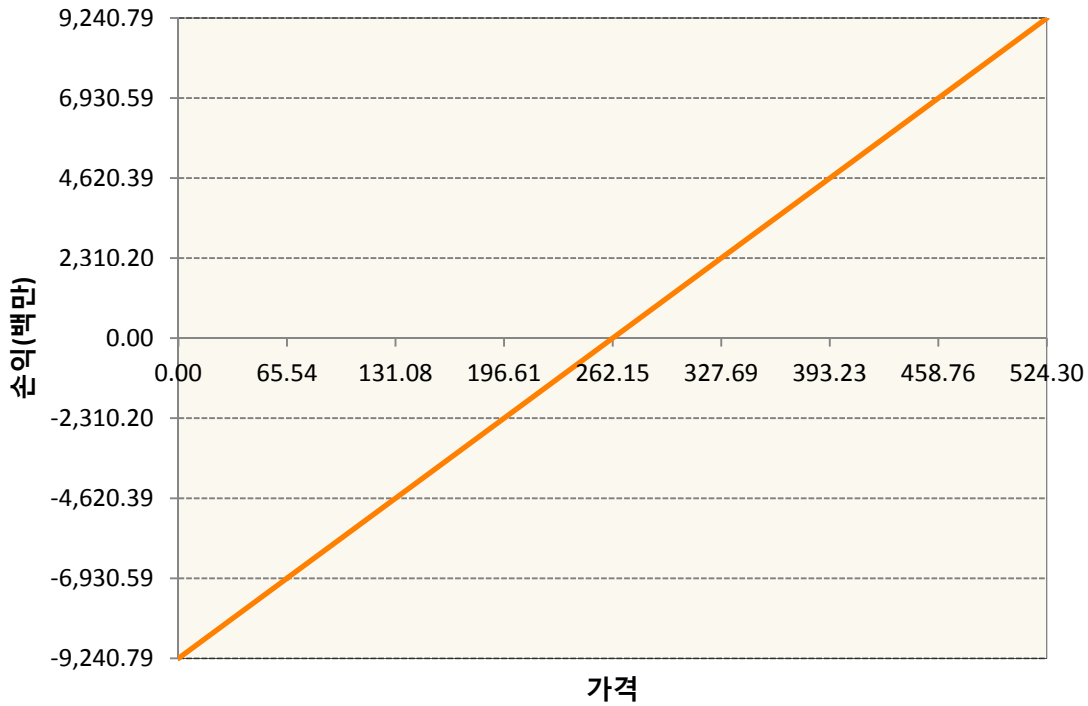
1. 계약금액

(단위:백만원)

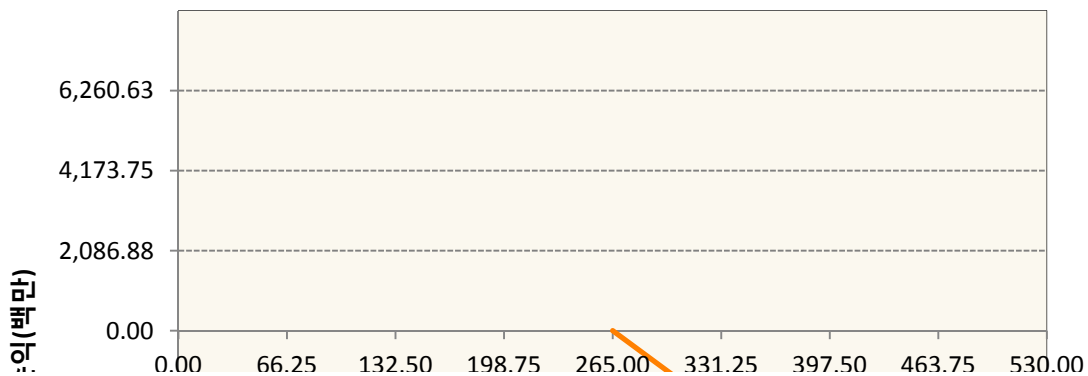
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,241	0	9,241	장내
누계	유가증권	옵션	2,917	17,911	-14,994	장내

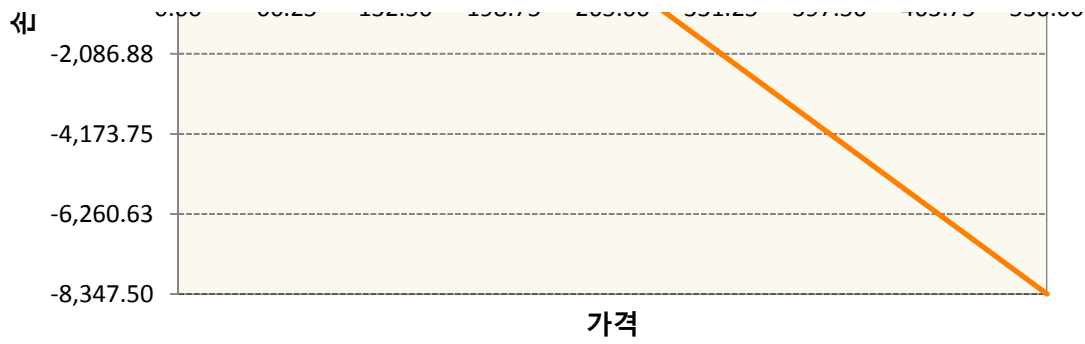
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

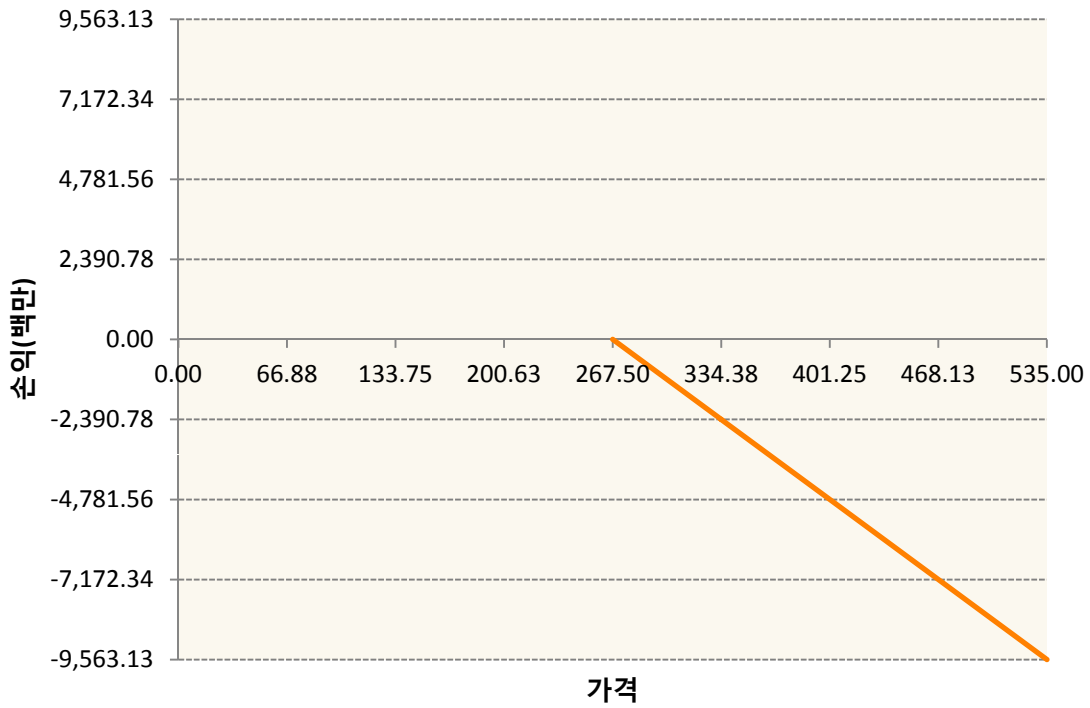


KR4201Q62659-2020-06 콜265

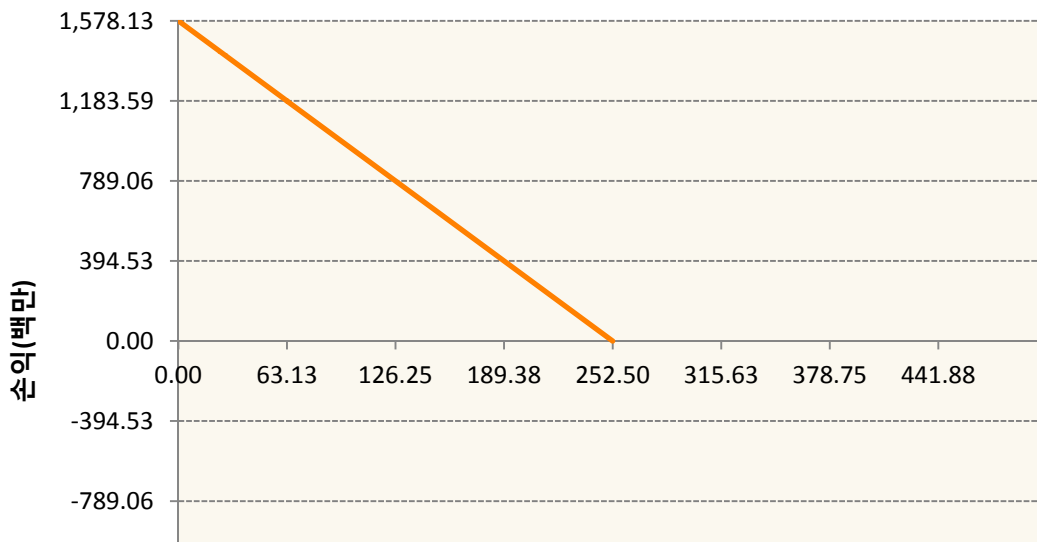


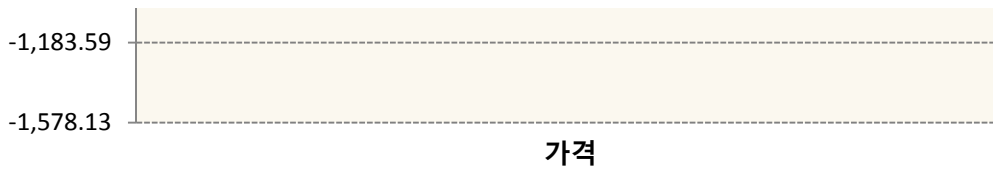


KR4201Q62675-2020-06 콜267.5

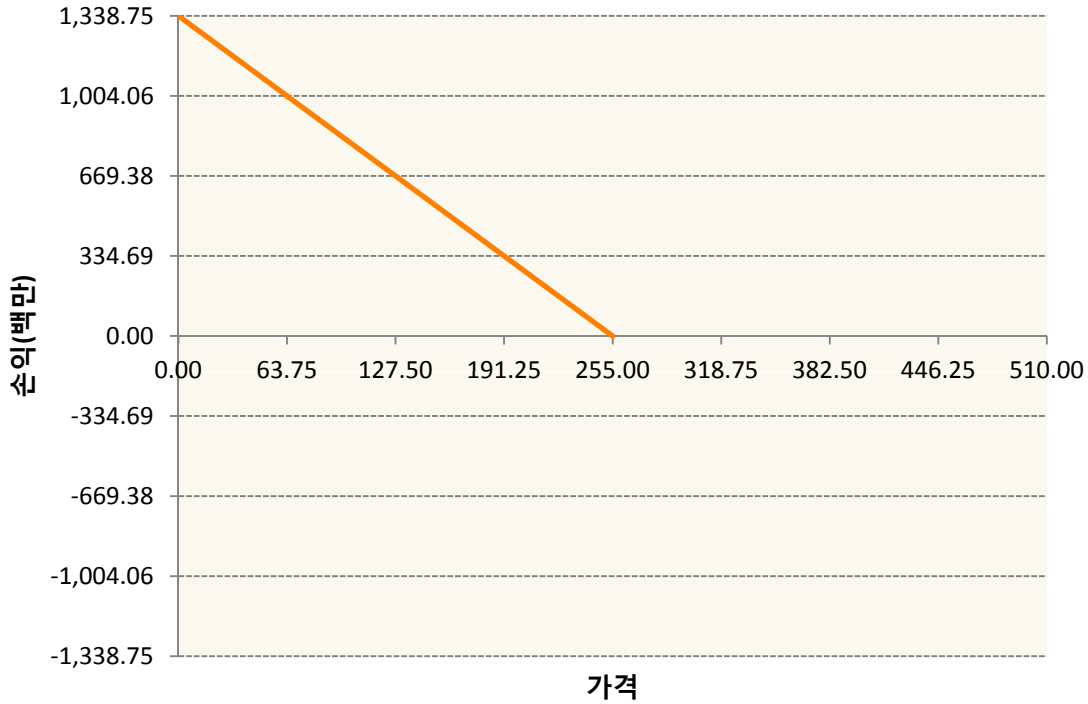


KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





KR4301Q62558-2020-06 풋255



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						741
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-741	-741	-741	-741	-741	-741	-741	
-5.33%	-494	-494	-494	-494	-494	-494	-494	
-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%	494	494	494	494	494	494	494	
8.00%	741	741	741	741	741	741	741	
KR4201Q62659		2020-06 콜265						492
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	278	262	245	226	206	185	163	
-5.33%	239	217	195	171	146	121	96	
-2.67%	177	151	124	96	68	40	12	

0%	89	59	30	0	-30	-59	-89
2.67%	-29	-59	-88	-118	-147	-177	-207
5.33%	-174	-201	-228	-256	-285	-313	-342
8.00%	-342	-365	-388	-413	-439	-465	-492
KR4201Q62675 2020-06 콜267.5							538
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	287	271	253	233	212	189	166
-5.33%	250	227	203	178	151	124	96
-2.67%	189	160	131	101	70	39	8
0%	99	66	33	0	-33	-67	-100
2.67%	-22	-57	-91	-125	-159	-193	-228
5.33%	-176	-208	-241	-274	-307	-340	-374
8.00%	-358	-385	-415	-445	-475	-507	-538
KR4301Q62525 2020-06 풋252.5							74
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	59	61	64	66	68	71	74
-5.33%	27	30	33	36	40	43	46
-2.67%	5	8	11	15	18	21	24
0%	-8	-5	-3	0	3	6	9
2.67%	-14	-12	-10	-9	-7	-4	-2
5.33%	-16	-15	-14	-13	-12	-10	-9
8.00%	-16	-16	-16	-15	-14	-13	-12
KR4301Q62558 2020-06 풋255							68
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	57	58	60	62	64	66	68
-5.33%	28	30	33	35	38	40	43
-2.67%	6	9	12	14	17	20	23
0%	-7	-5	-3	0	3	5	8
2.67%	-14	-12	-11	-9	-7	-5	-3
5.33%	-17	-16	-15	-14	-12	-11	-9
8.00%	-18	-17	-17	-16	-15	-14	-13

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

(단위:백만원)

2,039

공시일	2020-05-21
기준일	2020-05-20

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	150,683	0	150,683	

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	2020-05-21
기준일	2020-05-20

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	101,599	0	101,599	

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	2020-05-21
기준일	2020-05-20

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	448,877	0	448,877	
누계	통화	선도	0	428,883	-428,883	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	846
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	738
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	492
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,445
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,988
FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E	2,953
FX21020J02€ KRW/USD 10-06-20E	1,339
FX21020J02£ KRW/USD 22-06-20E	1,516
FX21020J02¥ KRW/USD 22-06-20E	1,968
FX21020J03¥ KRW/USD 24-07-20E	2,215
FX21020J04¥ KRW/USD 24-07-20E	1,772
FX21020J04£ KRW/USD 24-07-20E	1,968
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	2,047
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	1,949
FX21020K01 KRW/USD 22-06-20E	689
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	2,402
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	984

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

17,380

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

(단위:백만원)

203

공시일	2020-05-21
기준일	2020-05-20

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

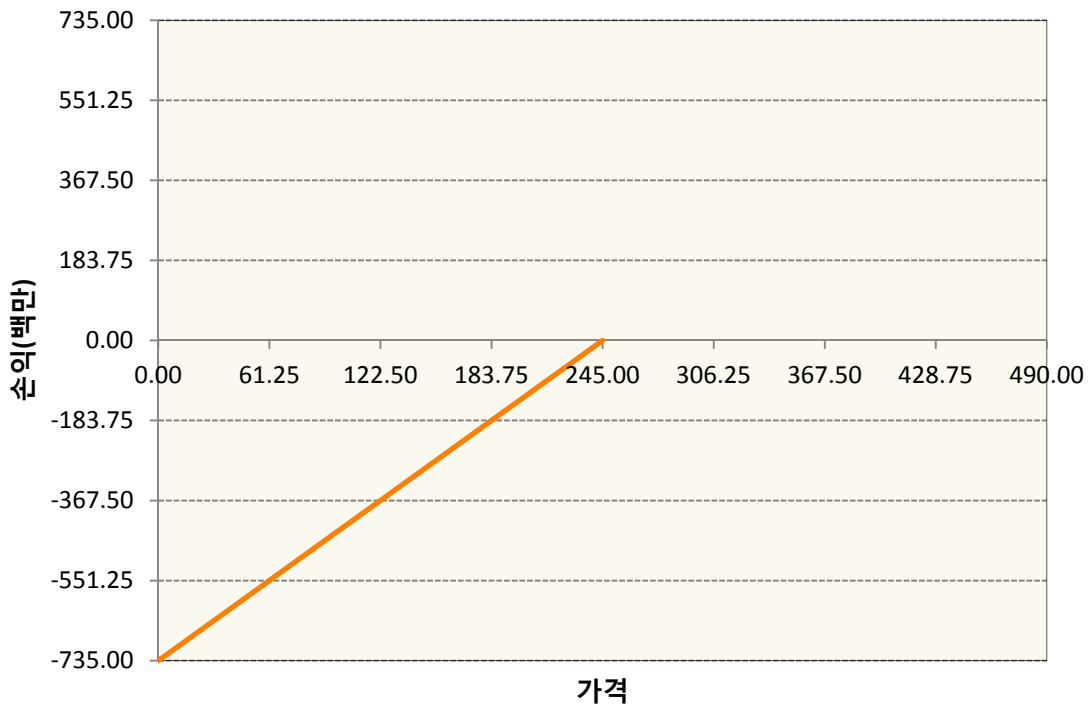
1. 계약금액

(단위:백만원)

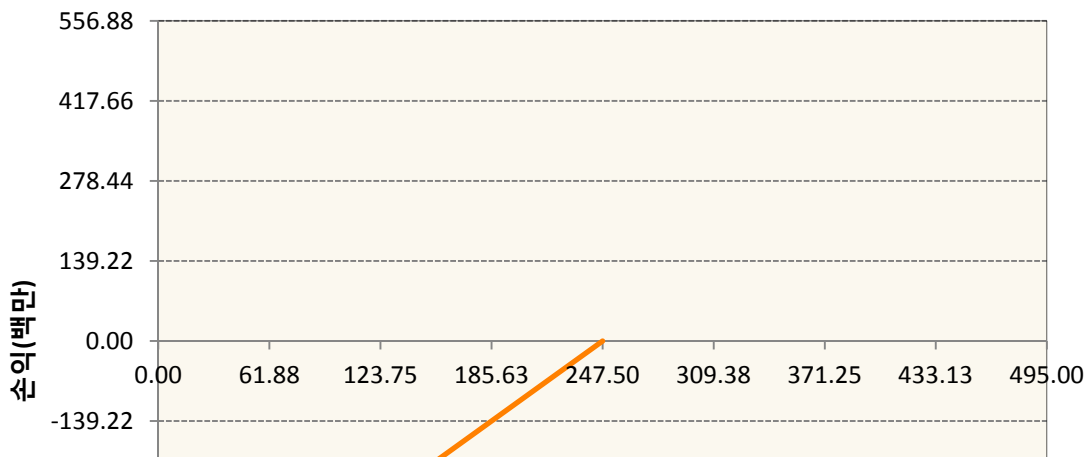
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	366	0	366	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,292	-1,292	장내

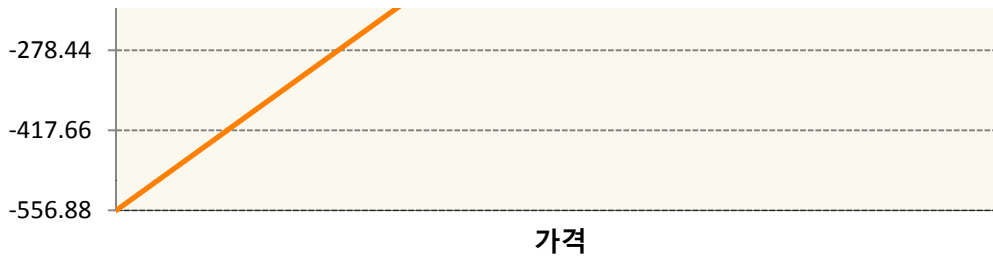
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q62459-2020-06 풋245



KR4301Q62475-2020-06 풋247.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q62459		2020-06 풋245						25
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-16	-18	-19	-21	-22	-24	-25	
-5.33%	-6	-7	-9	-10	-12	-13	-15	
-2.67%	0	-1	-3	-4	-5	-6	-8	
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3	
2.67%	3	3	2	2	1	1	0	
5.33%	3	3	3	3	2	2	2	
8.00%	3	3	3	3	3	3	3	
KR4301Q62475		2020-06 풋247.5						21
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-15	-16	-17	-18	-19	-20	-21	
-5.33%	-6	-7	-8	-9	-11	-12	-13	
-2.67%	-1	-2	-3	-4	-5	-6	-7	
0%	2	1	1	0	-1	-2	-3	
2.67%	3	3	2	2	1	1	0	
5.33%	3	3	3	3	2	2	2	
8.00%	3	3	3	3	3	3	3	

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

33

공시일	2020-05-21
기준일	2020-05-20

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	7,399	0	7,399	
누계	통화	선도	0	7,197	-7,197	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	2020-05-21
기준일	2020-05-20

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

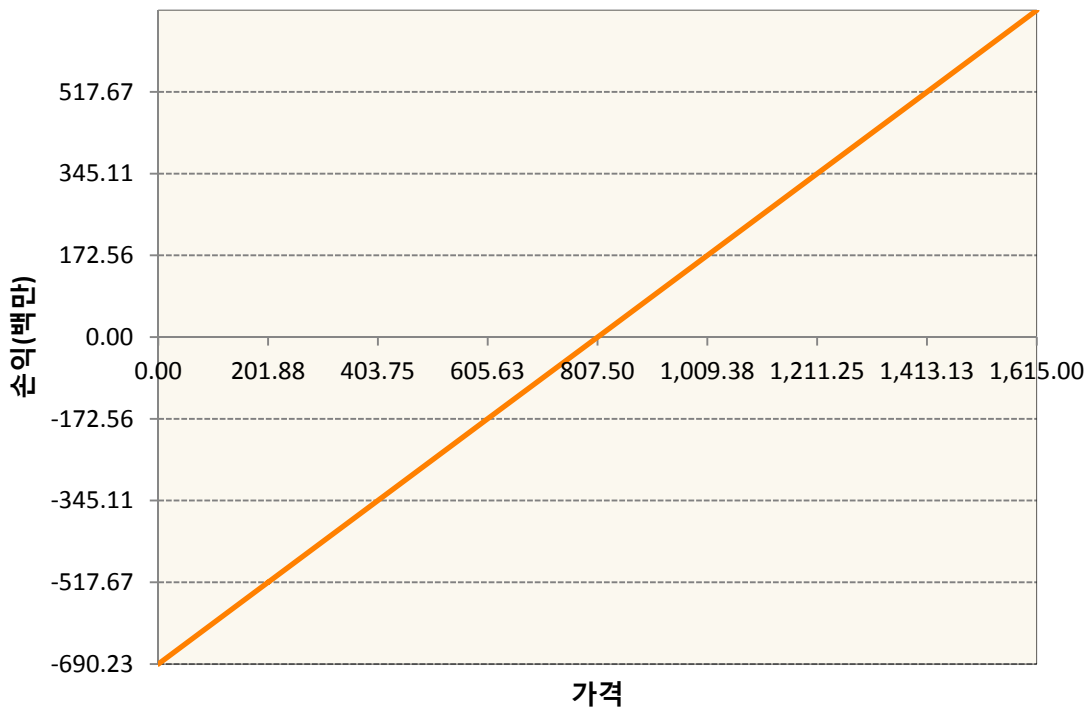
1. 계약금액

(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	977	0	977	장외
누계	통화	선도	208	881	-674	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCK0-VN30 Index Future May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	78
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)

170

공시일	2020-05-21
기준일	2020-05-20

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

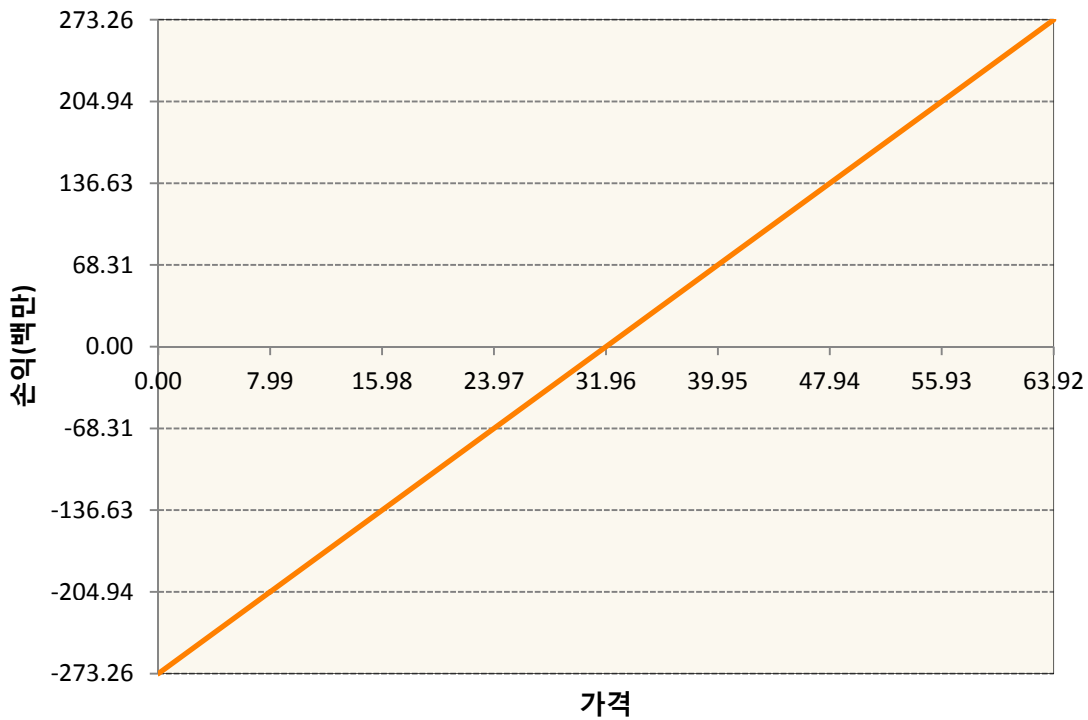
1. 계약금액

(단위:백만원)

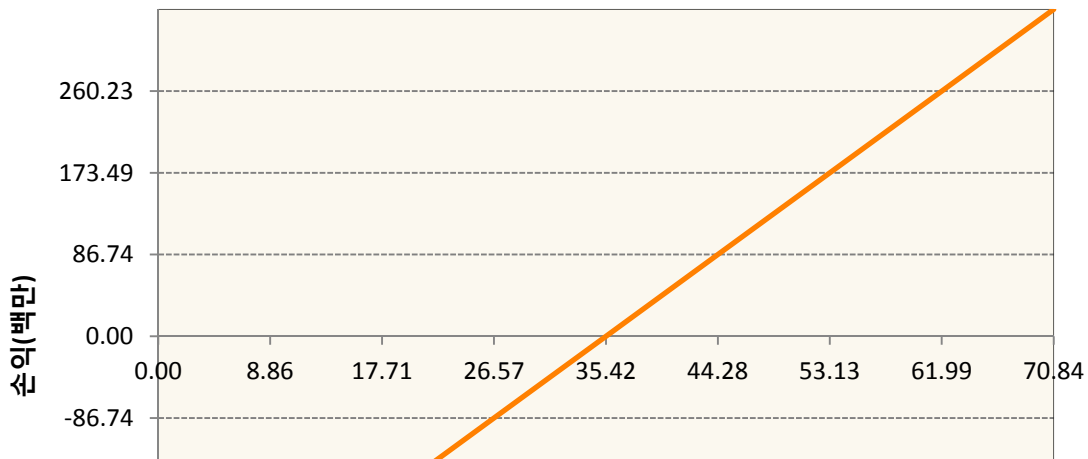
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,683	246	1,437	

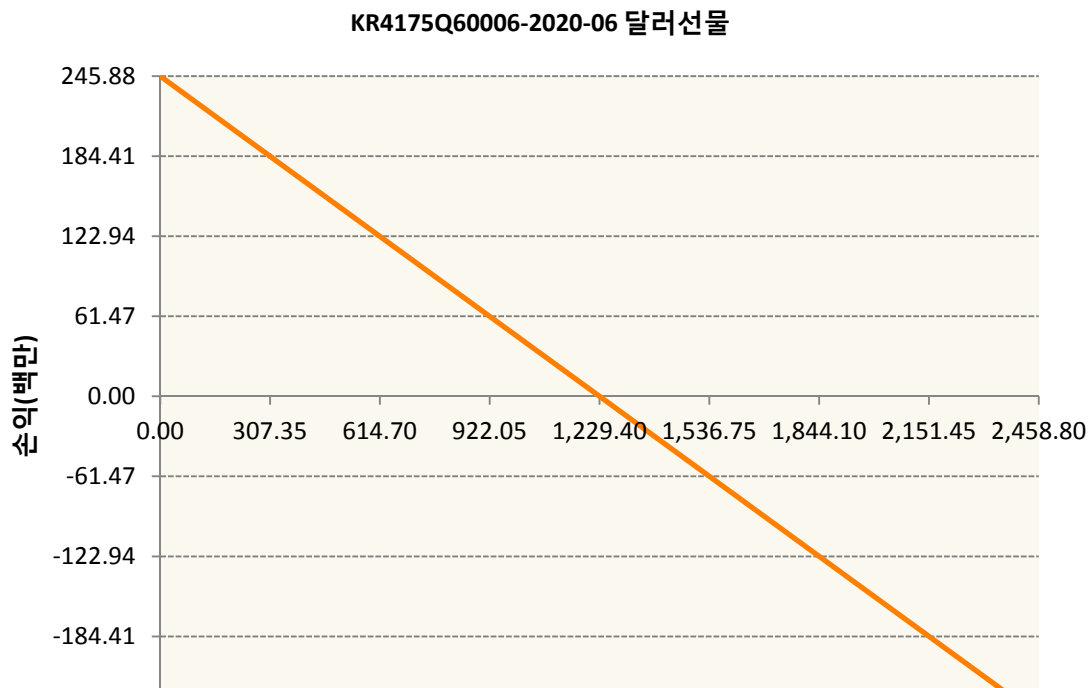
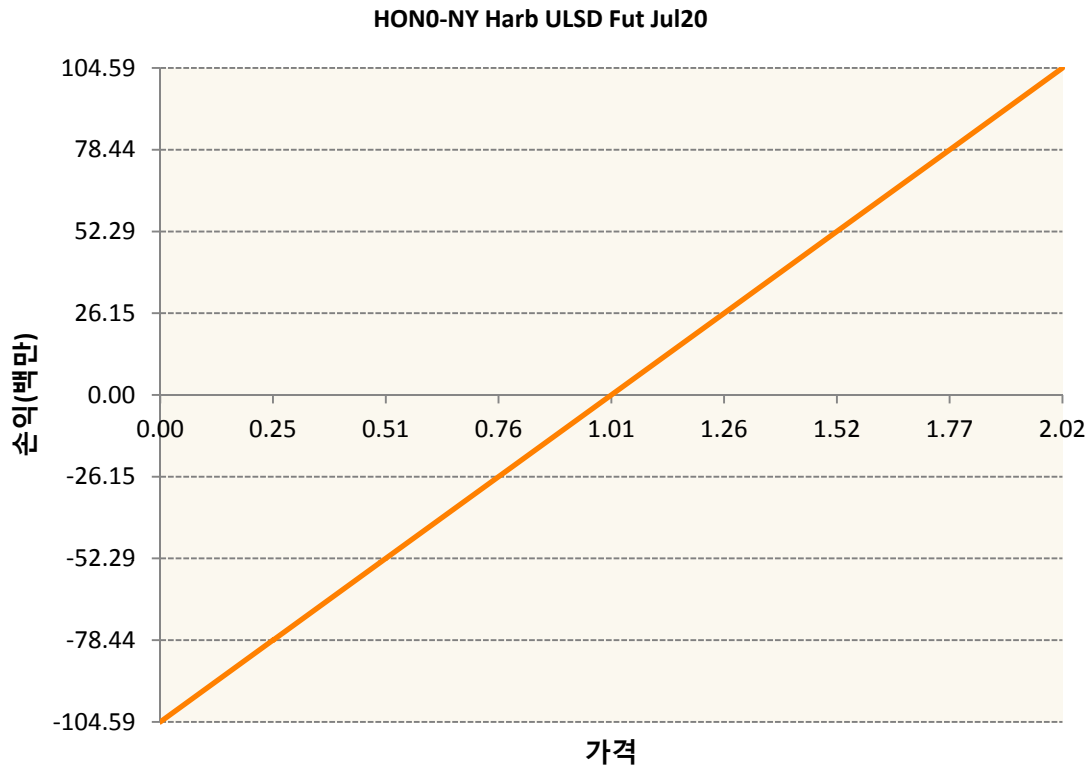
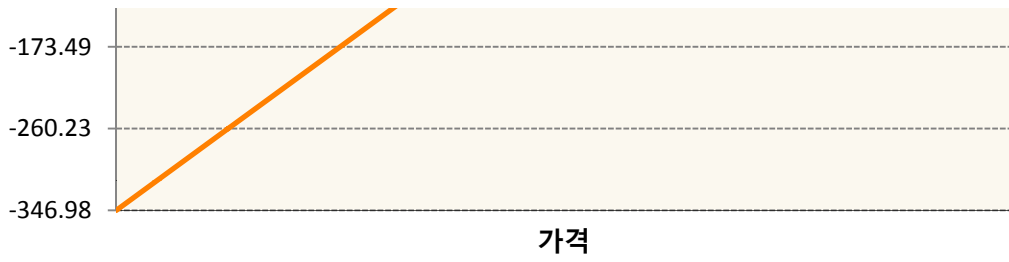
2. 만기시점의 손익구조

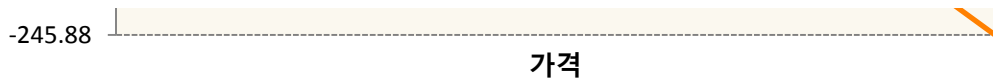
CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20



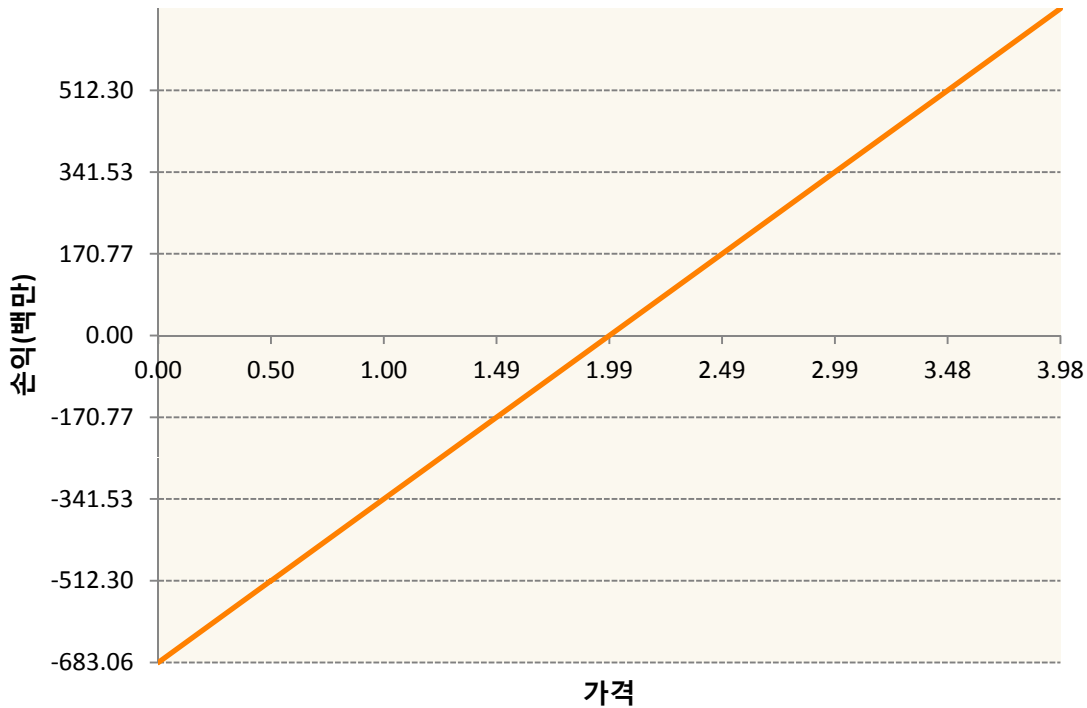
COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20



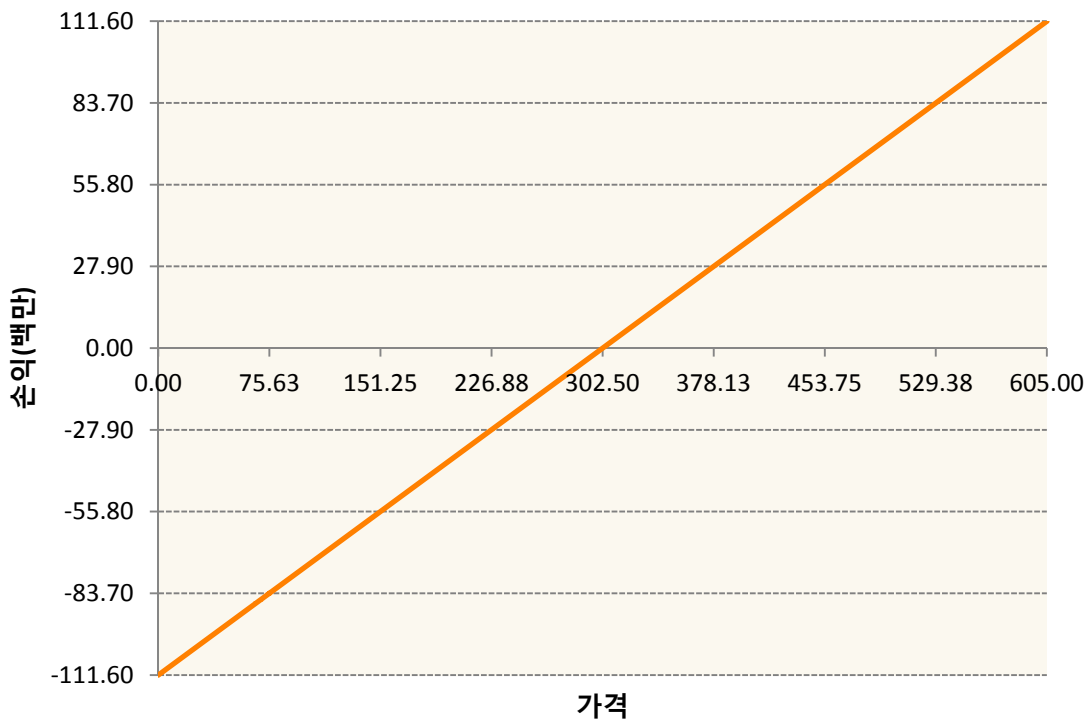




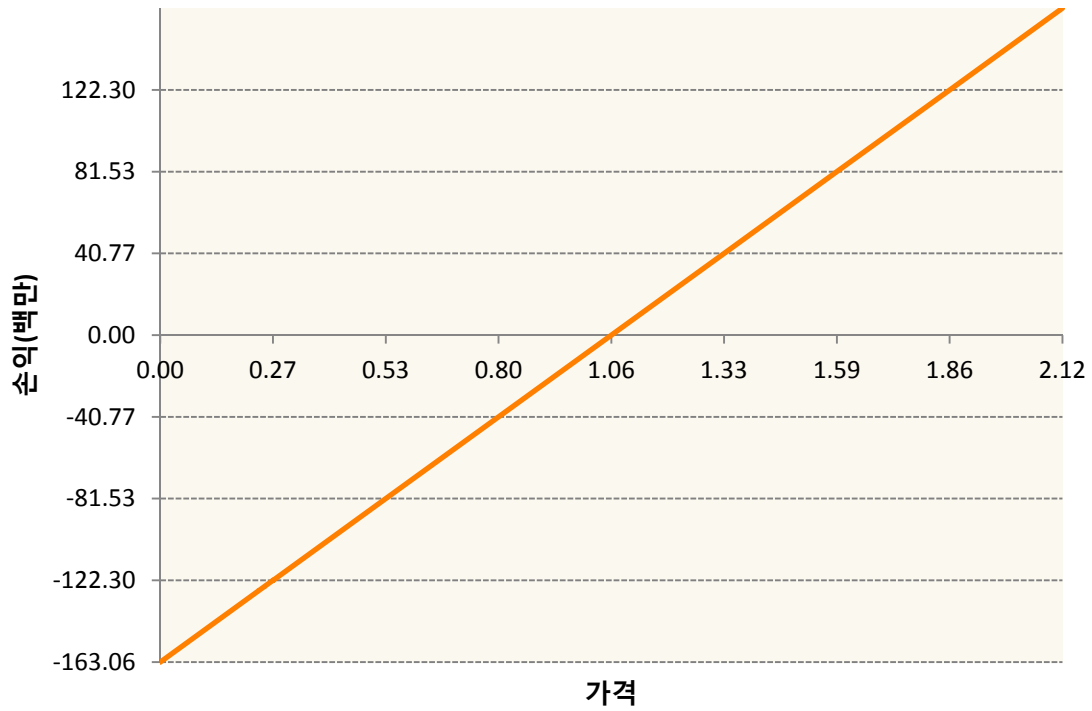
NGN20-NATURAL GAS FUTR Jul20



QSN0-Low Su Gasoil G Jul20



XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN0	WTI CRUDE FUTURE Jul20	22
COU0	BRENT CRUDE FUTR Sep20	28
HON0	NY Harb ULSD Fut Jul20	8
KR4175Q60C	2020-06 달러선물	20
NGN20	NATURAL GAS FUTR Jul20	55
QSN0	Low Su Gasoil G Jul20	9
XBN0	GASOLINE RBOB FUT Jul20	13

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

(단위:백만원)

738

공시일	2020-05-21
기준일	2020-05-20

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

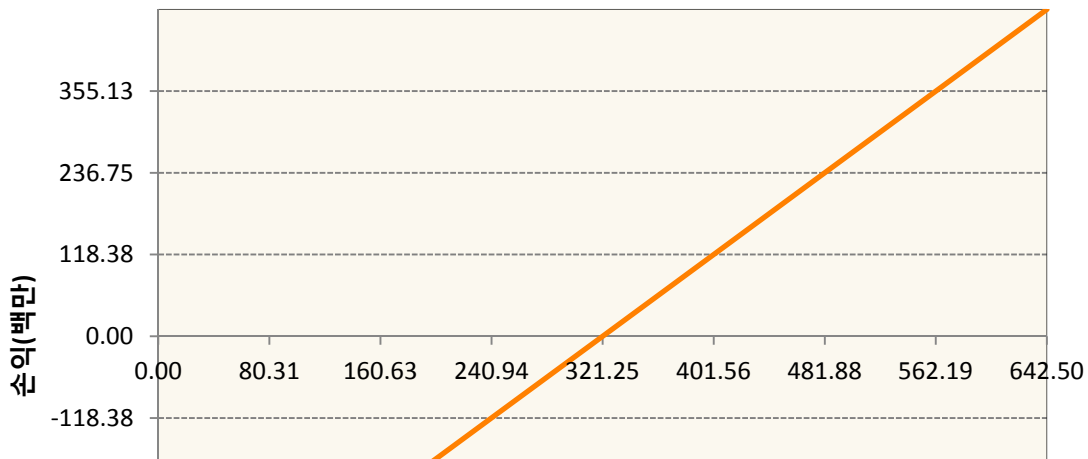
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,429	74	2,355	

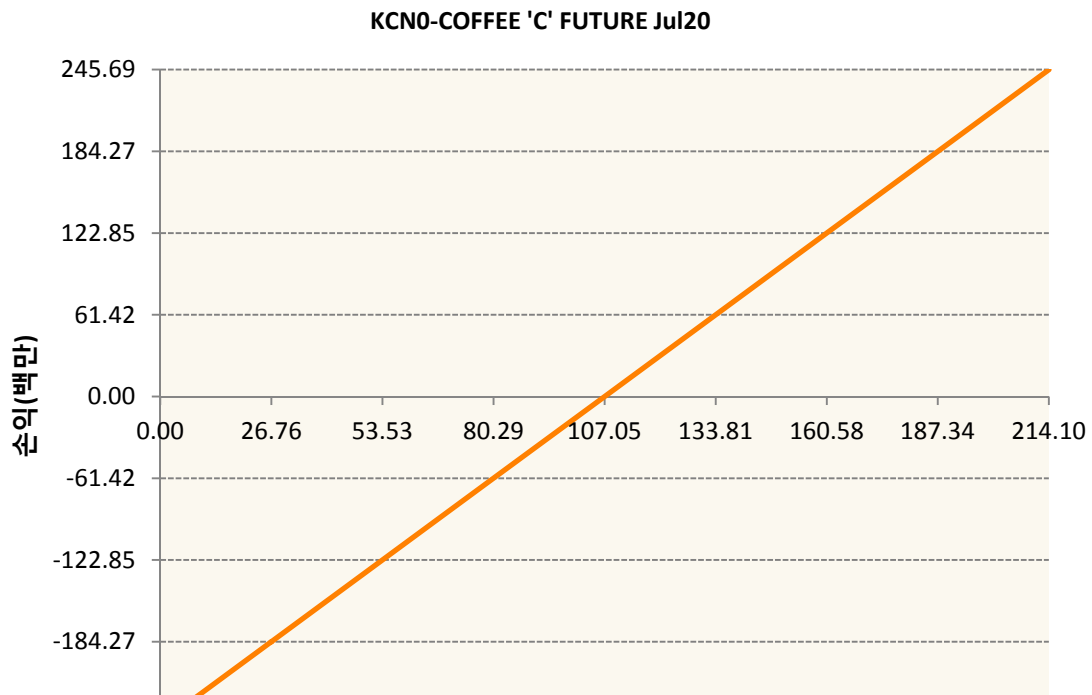
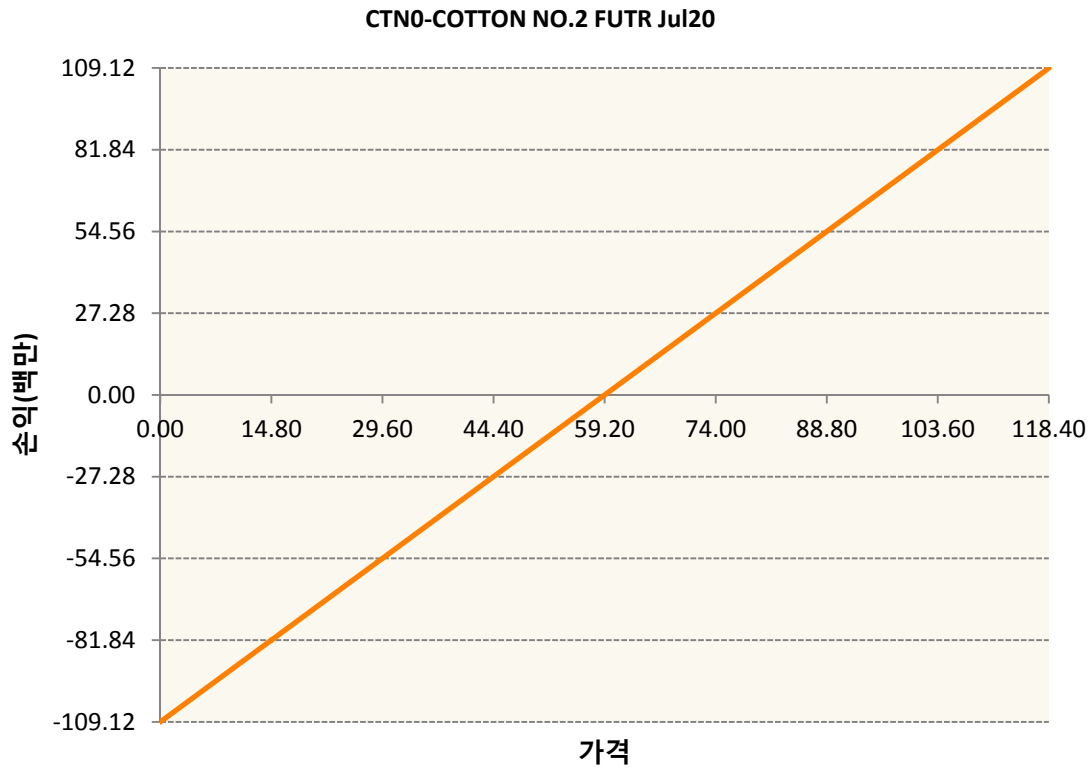
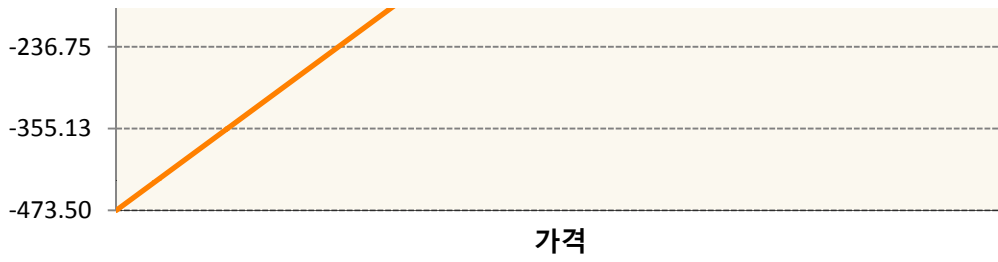
2. 만기시점의 손익구조

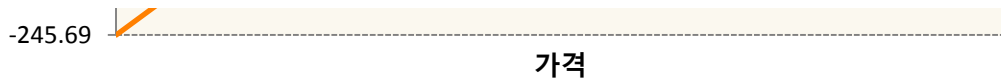
BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20



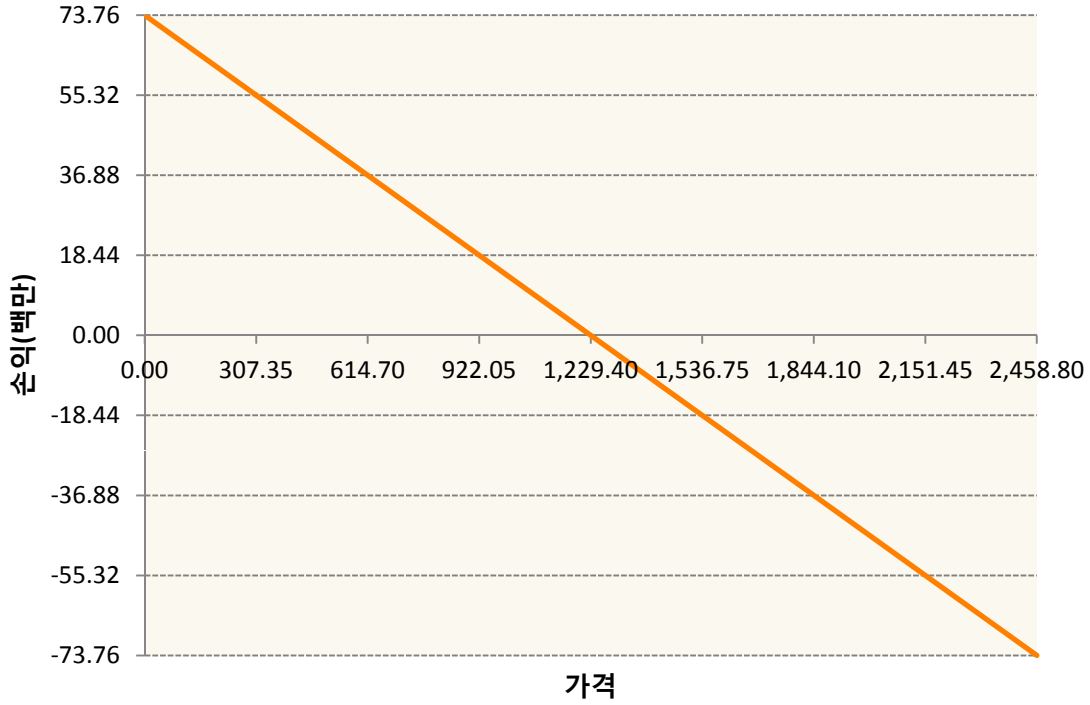
CNO-CORN FUTURE Jul20



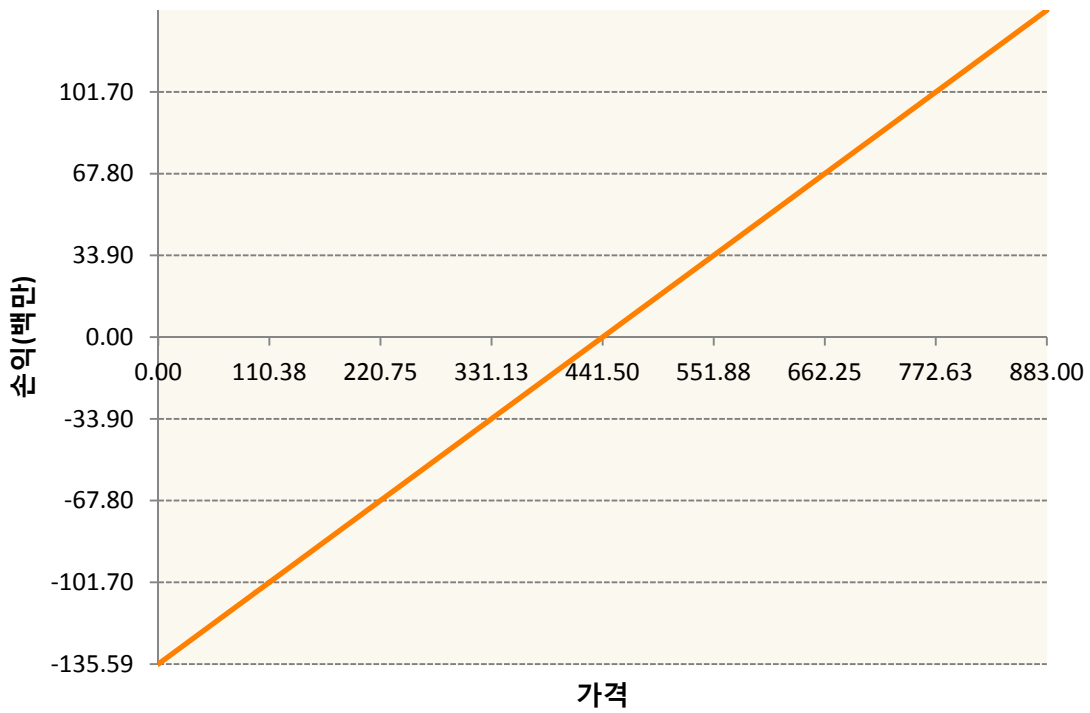




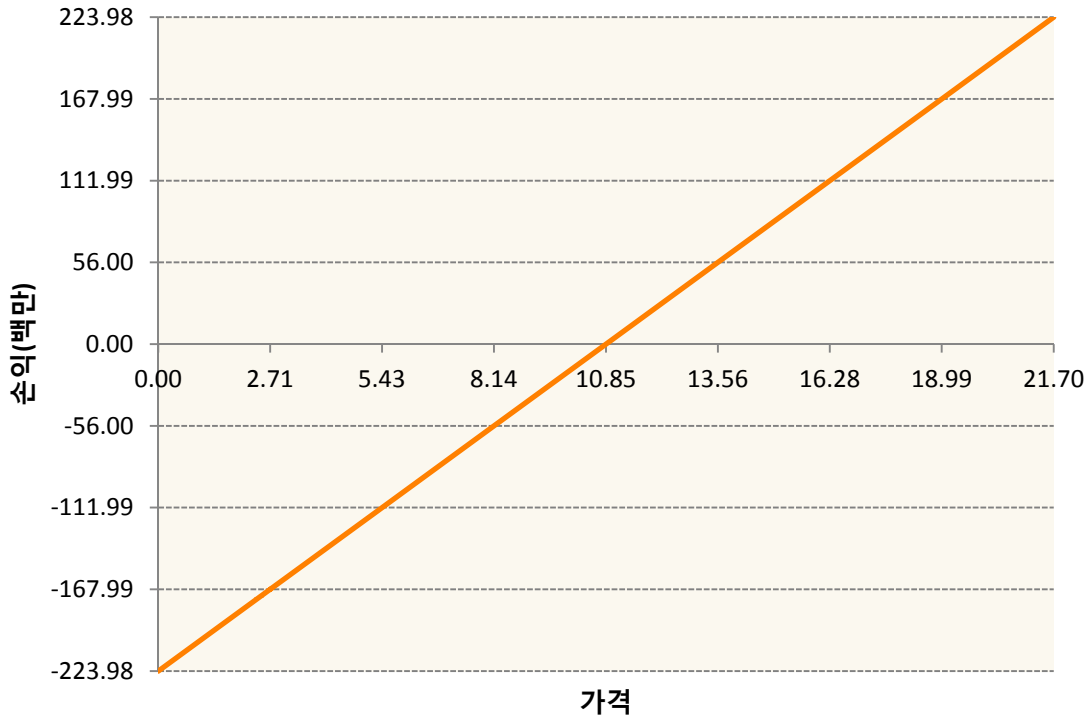
KR4175Q60006-2020-06 달러선물



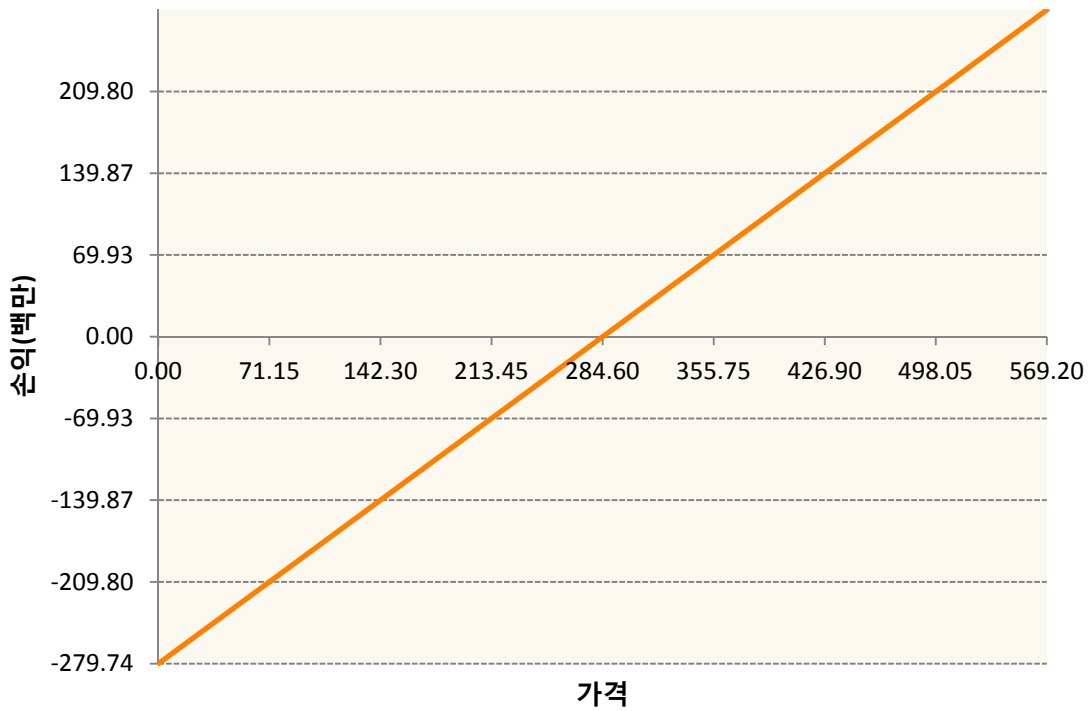
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



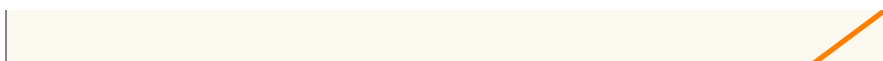
SBN0-Sugar Jul20

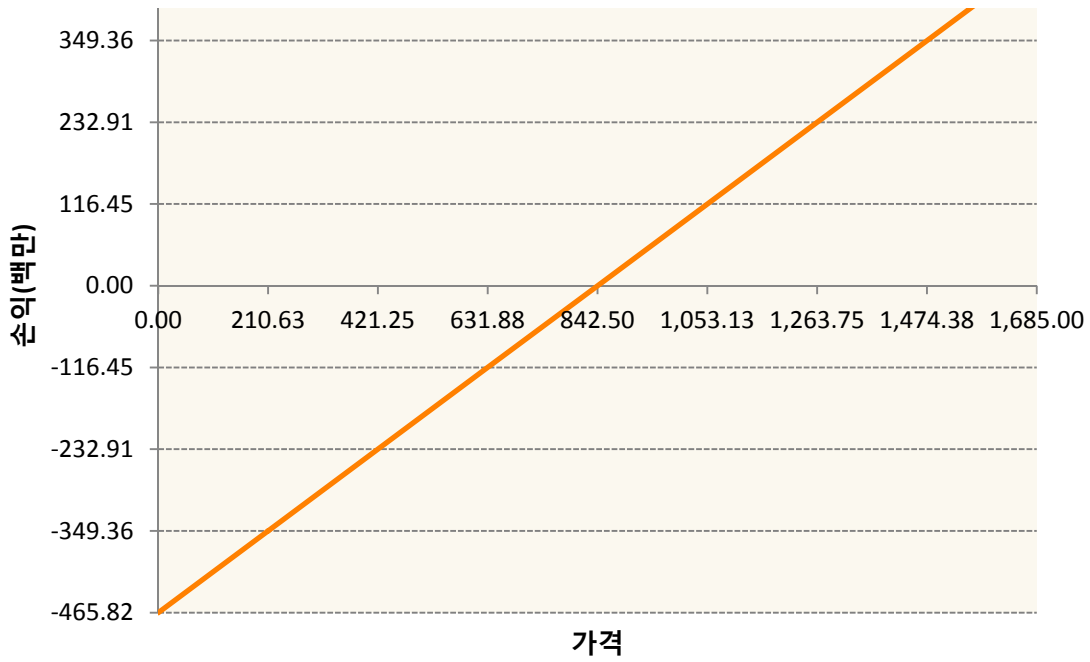


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20

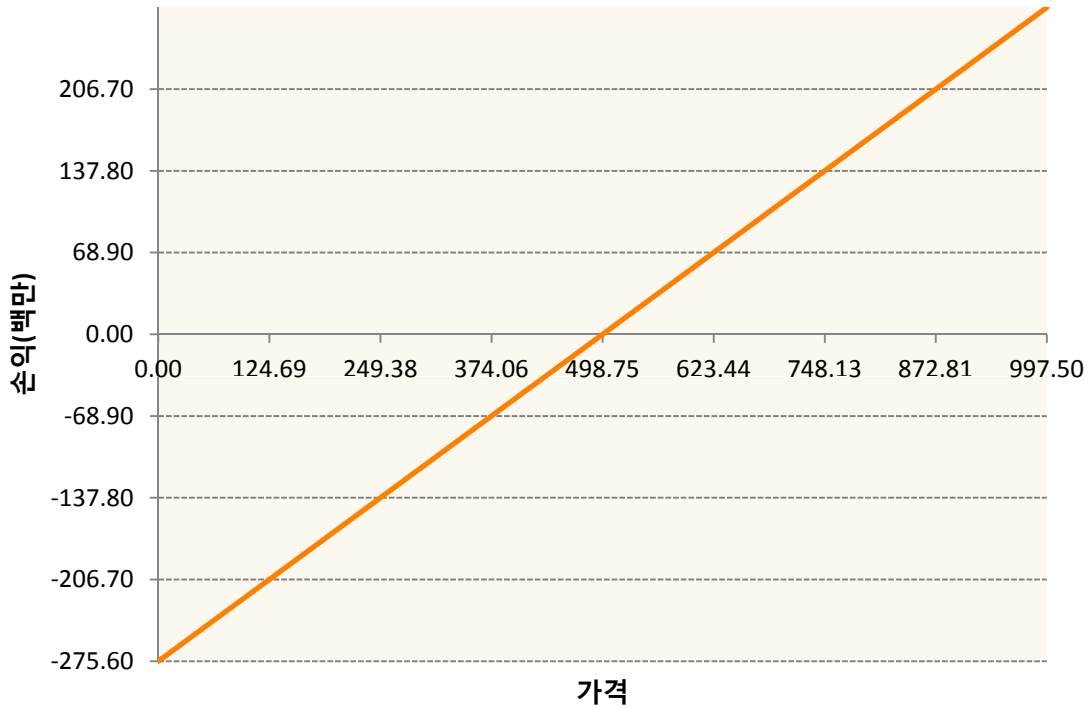


SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





WN0-WHEAT FUTURE(CBT) Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON0	SOYBEAN OIL FUTR Jul20	18
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	18
SMN0	SOYBEAN MEAL FUTR Jul20	22
SN0	SOYBEAN FUTURE Jul20	37
WNO	WHEAT FUTURE(CBT) Jul20	22

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

(단위:백만원)

231