

공시일	2020-05-22
기준일	2020-05-21

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	2020-05-22
기준일	2020-05-21

스마트인덱스모

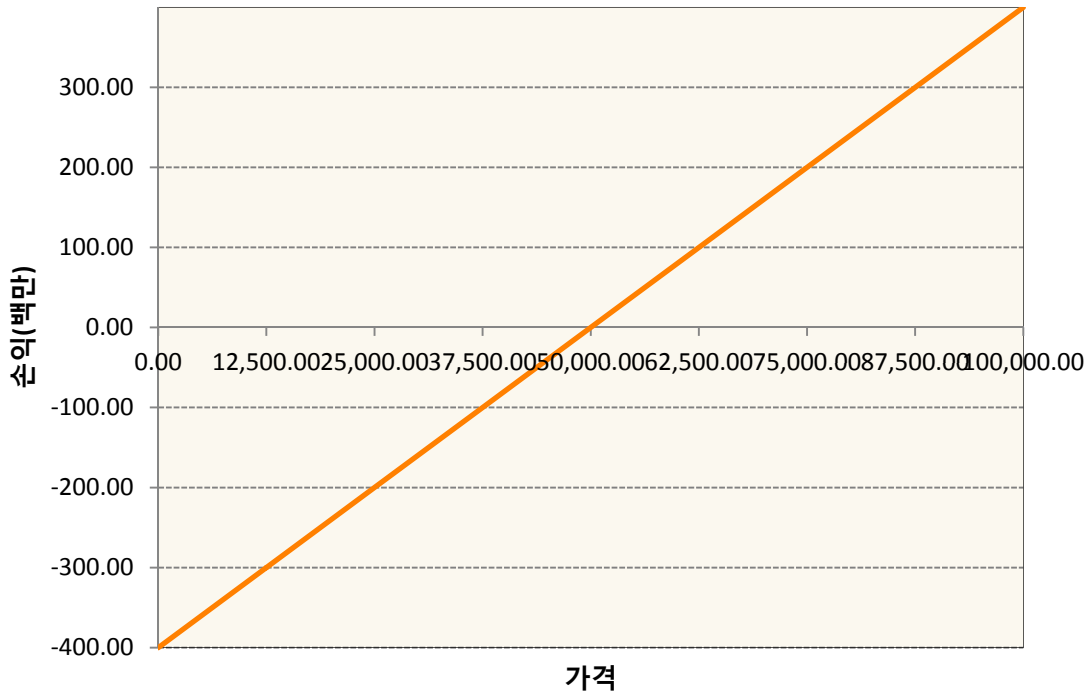
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	400	0	400	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111Q60001-2020-06 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111Q60001		2020-06 삼성전자개별선물						32
가격	기초자산의 변동성							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
-5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21	
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	11	11	11	11	11	11	11	
5.33%	21	21	21	21	21	21	21	
8.00%	32	32	32	32	32	32	32	

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

(단위:백만원)

48

공시일	2020-05-22
기준일	2020-05-21

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

1,009

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,185

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-22
기준일	2020-05-21

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

564

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

832

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-22
기준일	2020-05-21

유로인덱스모(주식-파생형)

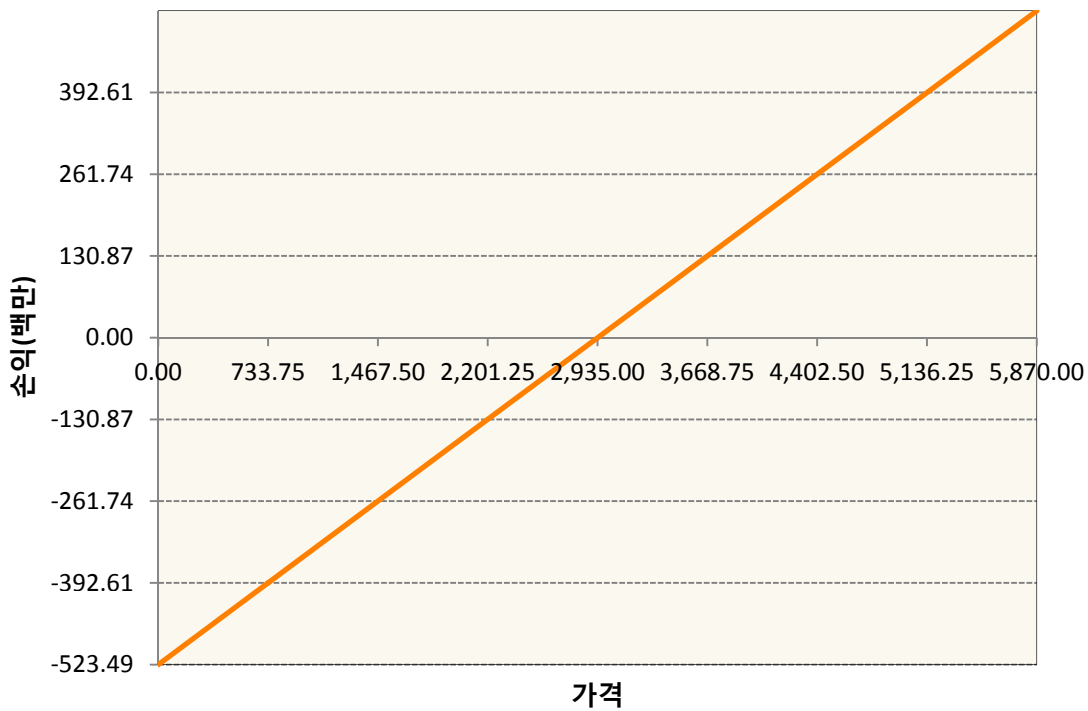
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	523	0	523	

2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	42
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

54

공시일	2020-05-22
기준일	2020-05-21

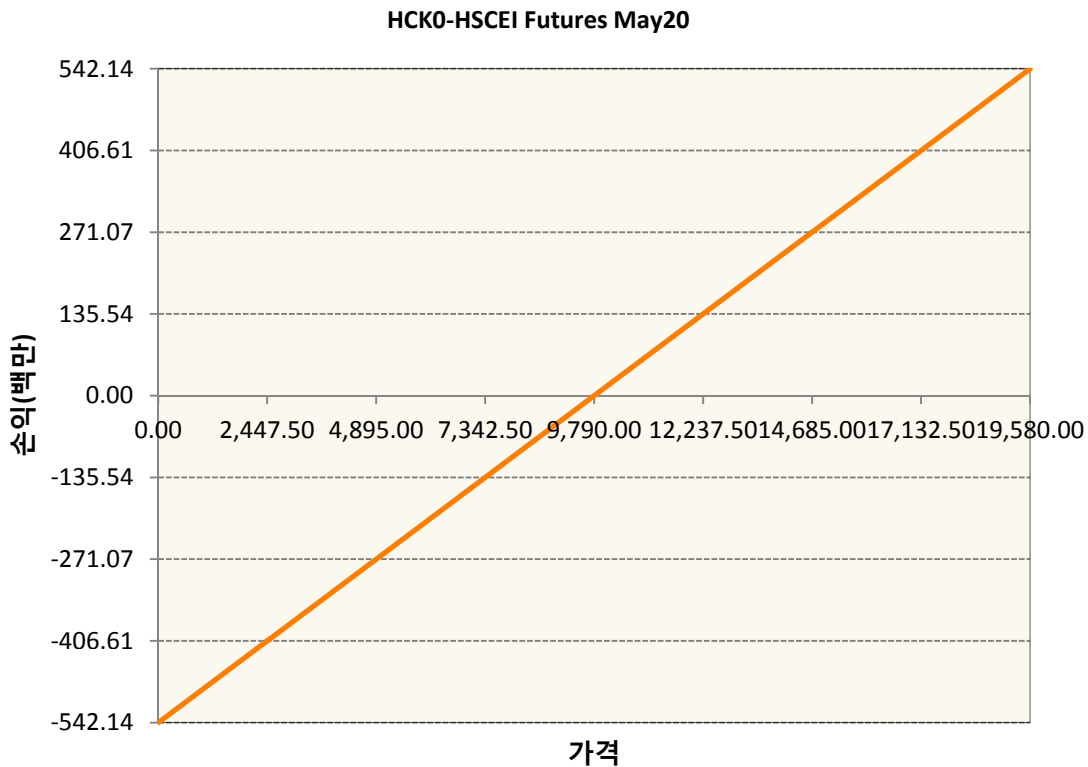
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

47

공시일	2020-05-22
기준일	2020-05-21

커버드콜모(주식혼합-파생형)

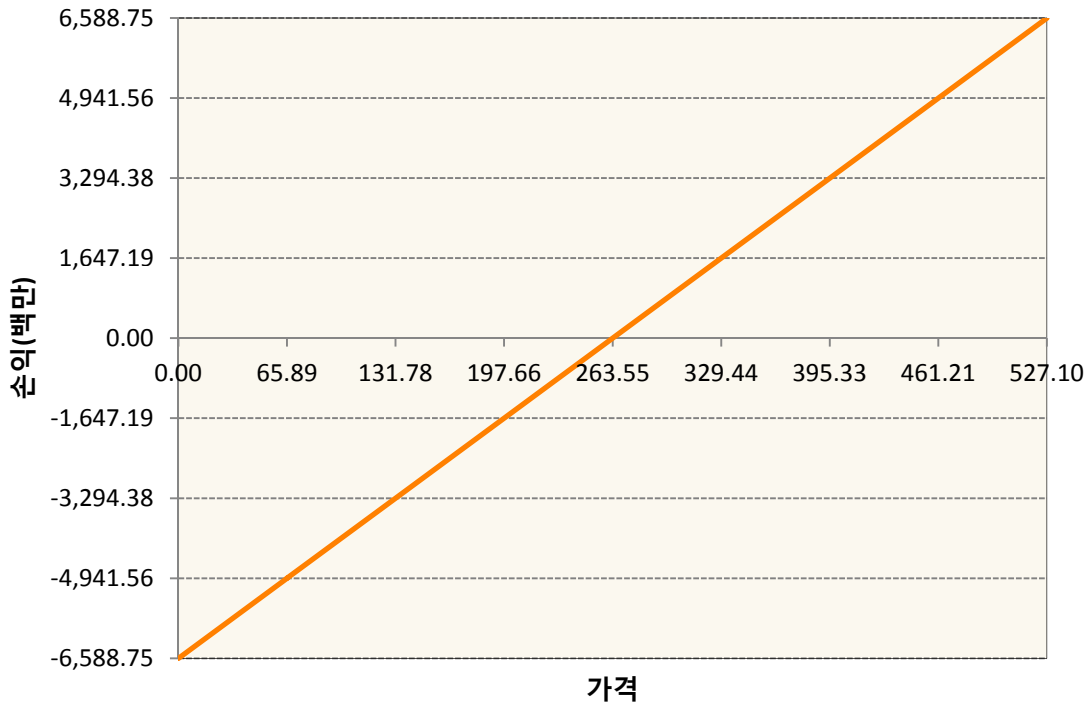
1. 계약금액

(단위:백만원)

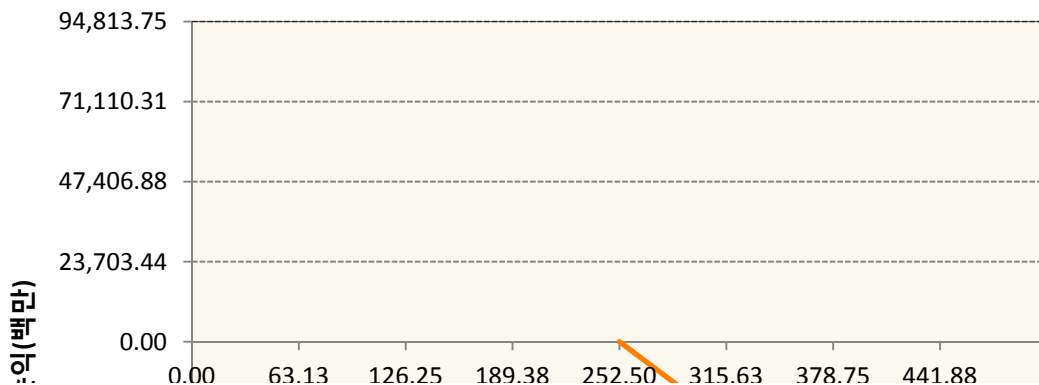
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,589	0	6,589	장내
누계	유가증권	옵션	0	364,213	-364,213	장내

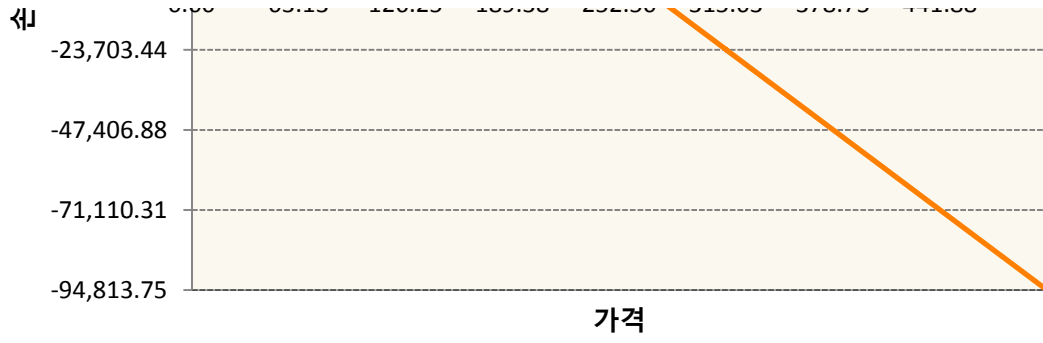
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

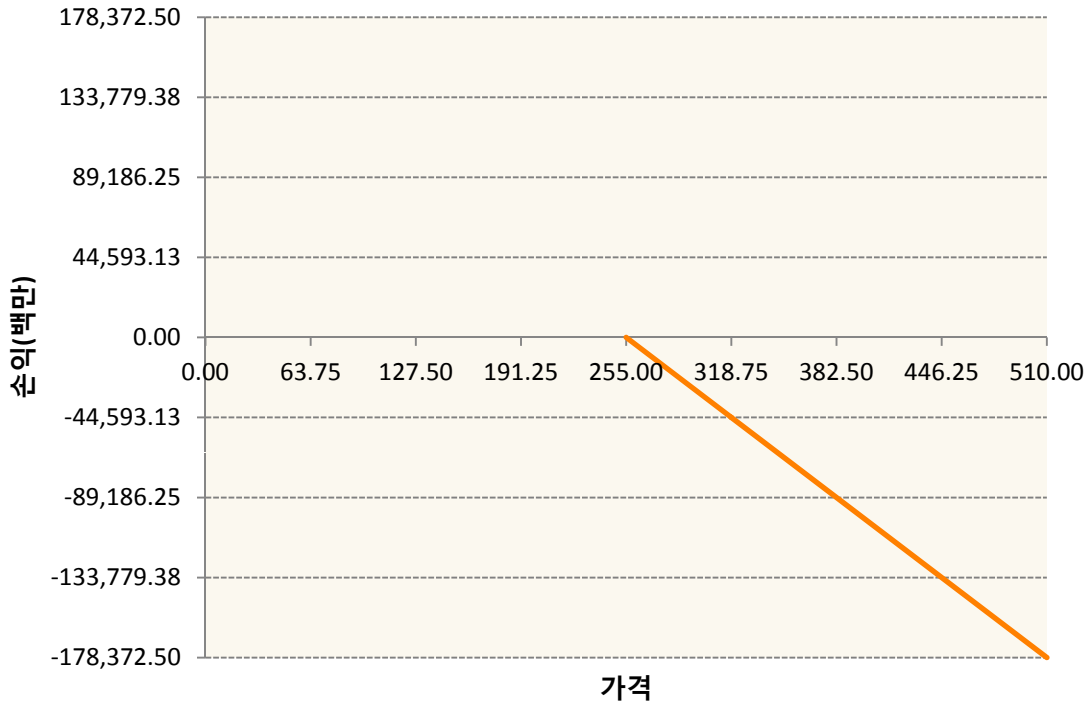


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

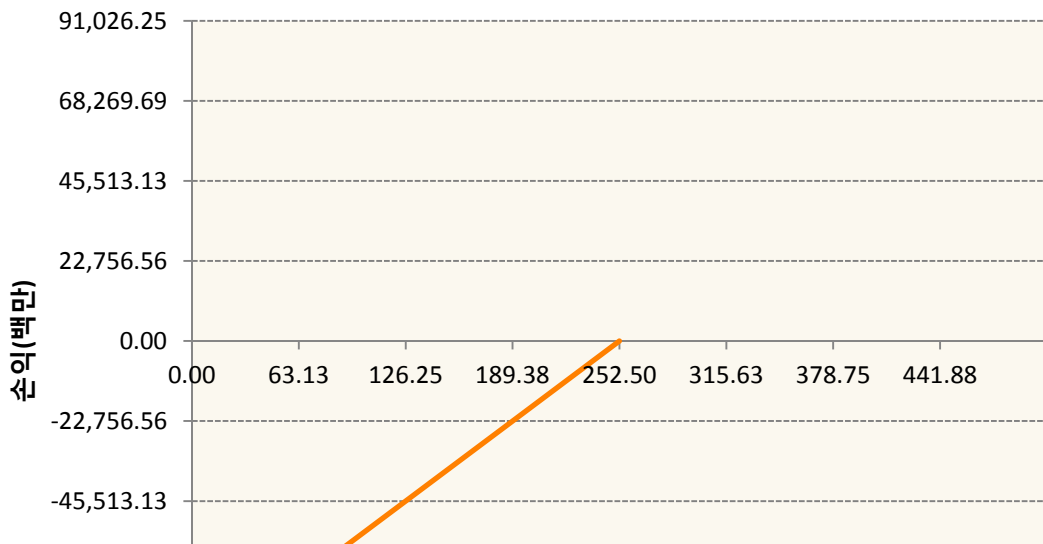


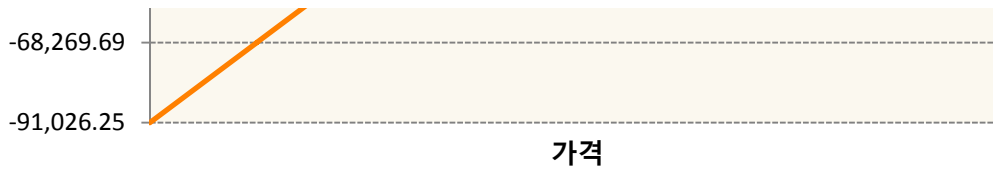


KR4201Q62550-2020-06 콜255



KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						527
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-527	-527	-527	-527	-527	-527	-527	
-5.33%	-352	-352	-352	-352	-352	-352	-352	
-2.67%	-176	-176	-176	-176	-176	-176	-176	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	176	176	176	176	176	176	176	
5.33%	352	352	352	352	352	352	352	
8.00%	527	527	527	527	527	527	527	
KR4201Q62527		2020-06 콜252.5						6,889
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5,039	4,752	4,459	4,160	3,859	3,554	3,247	
-5.33%	4,026	3,701	3,376	3,050	2,723	2,397	2,070	
-2.67%	2,643	2,316	1,988	1,659	1,329	999	669	
0%	908	612	309	0	-313	-629	-948	
2.67%	-1,128	-1,370	-1,628	-1,898	-2,179	-2,467	-2,762	
5.33%	-3,391	-3,573	-3,777	-3,999	-4,237	-4,489	-4,751	
8.00%	-5,813	-5,938	-6,088	-6,261	-6,454	-6,664	-6,889	
KR4201Q62550		2020-06 콜255						12,535
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	8,771	8,267	7,747	7,213	6,669	6,116	5,557	
-5.33%	7,112	6,519	5,922	5,321	4,719	4,116	3,511	
-2.67%	4,780	4,158	3,536	2,914	2,291	1,669	1,047	
0%	1,777	1,192	599	0	-604	-1,212	-1,822	
2.67%	-1,821	-2,318	-2,839	-3,378	-3,931	-4,495	-5,069	
5.33%	-5,892	-6,277	-6,701	-7,156	-7,636	-8,137	-8,656	
8.00%	-10,302	-10,577	-10,899	-11,261	-11,658	-12,084	-12,535	
KR4301Q62525		2020-06 풋252.5						4,091
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,248	-3,372	-3,504	-3,644	-3,789	-3,938	-4,091	
-5.33%	-1,451	-1,627	-1,803	-1,981	-2,159	-2,337	-2,516	
-2.67%	-246	-420	-596	-774	-952	-1,131	-1,311	

0%	402	277	142	0	-148	-301	-459
2.67%	676	609	528	435	332	219	98
5.33%	766	739	700	650	588	515	433
8.00%	789	780	765	742	711	669	619

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

(단위:백만원)

22,091

공시일	2020-05-22
기준일	2020-05-21

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

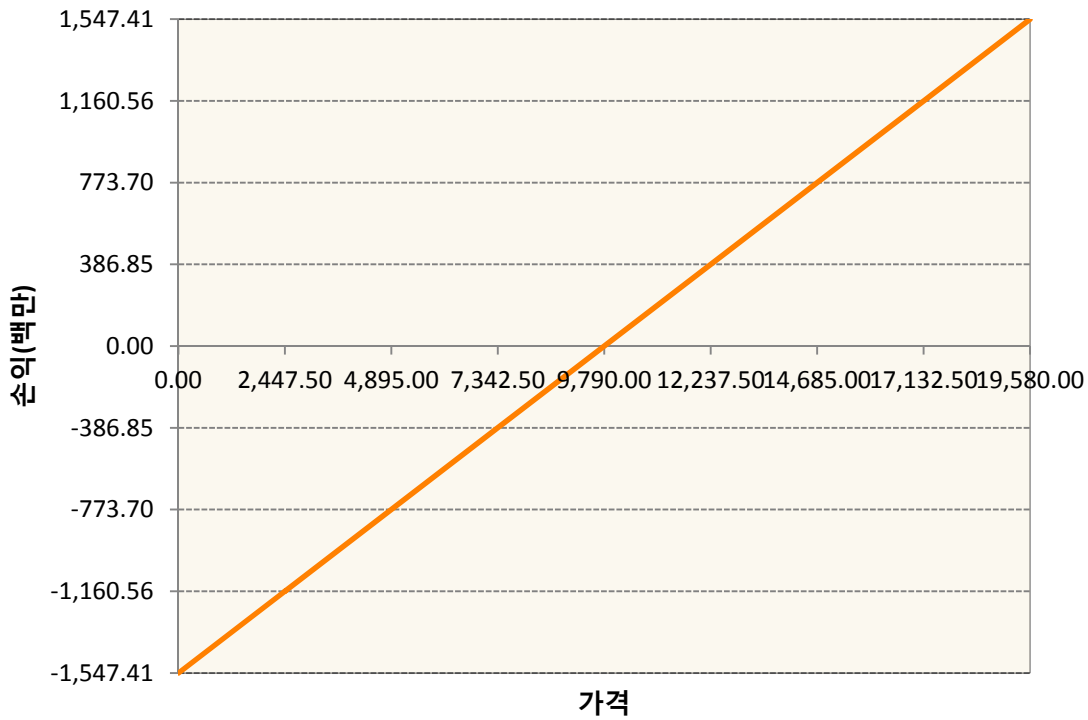
1. 계약금액

(단위:백만원)

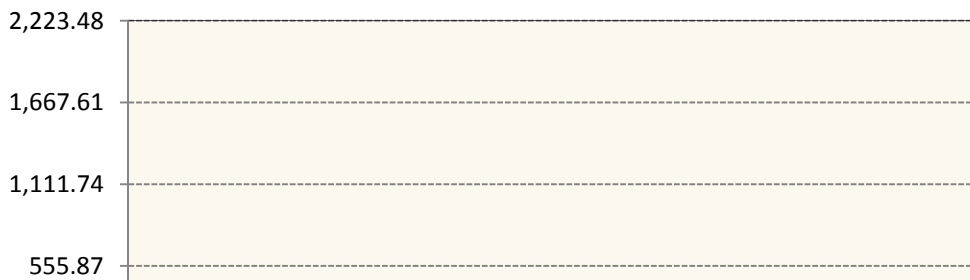
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,547	0	1,547	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,447	-4,447	장내
누계	통화	선도	699	3,774	-3,075	장외

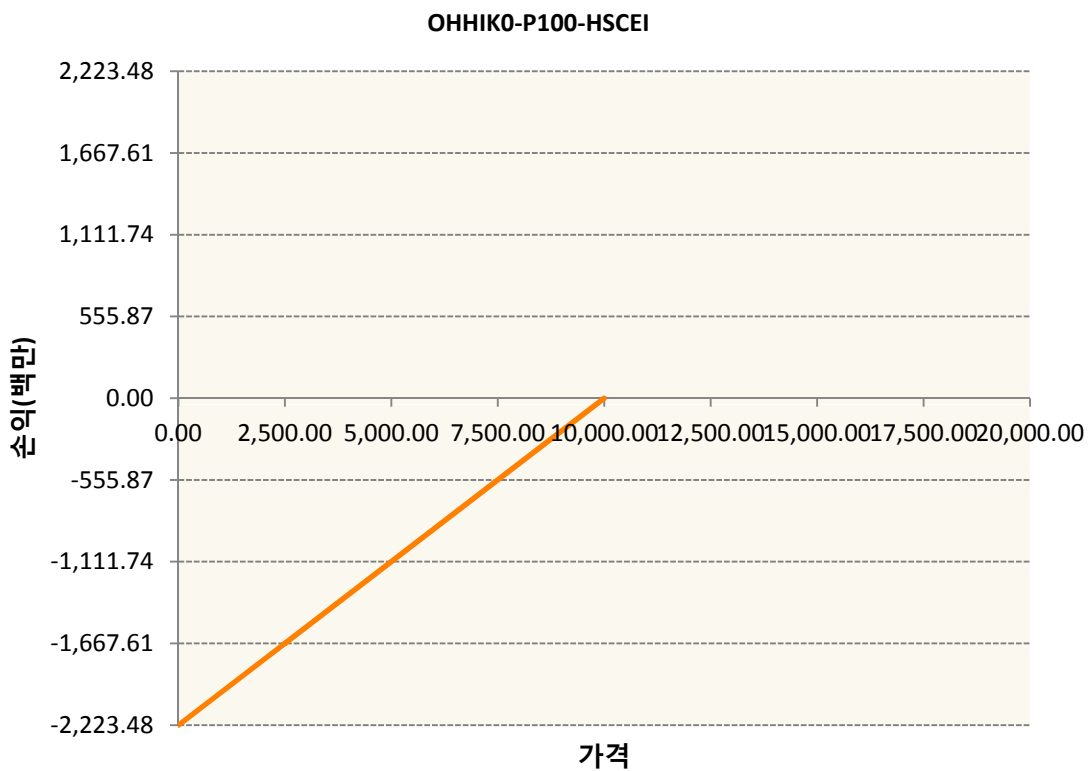
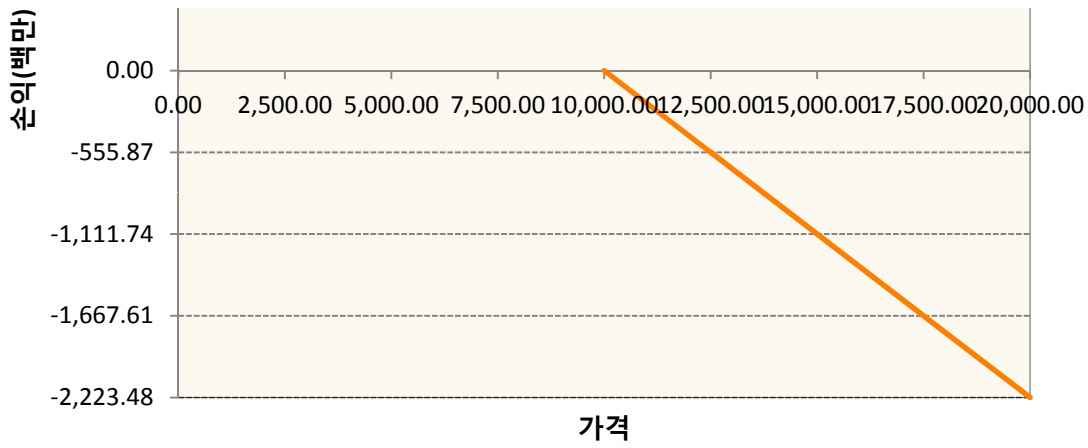
2. 만기시점의 손익구조

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		124
OHHIK0-C1C HSCEI		178
OHHIK0-P10 HSCEI		178

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

공시일	2020-05-22
기준일	2020-05-21

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

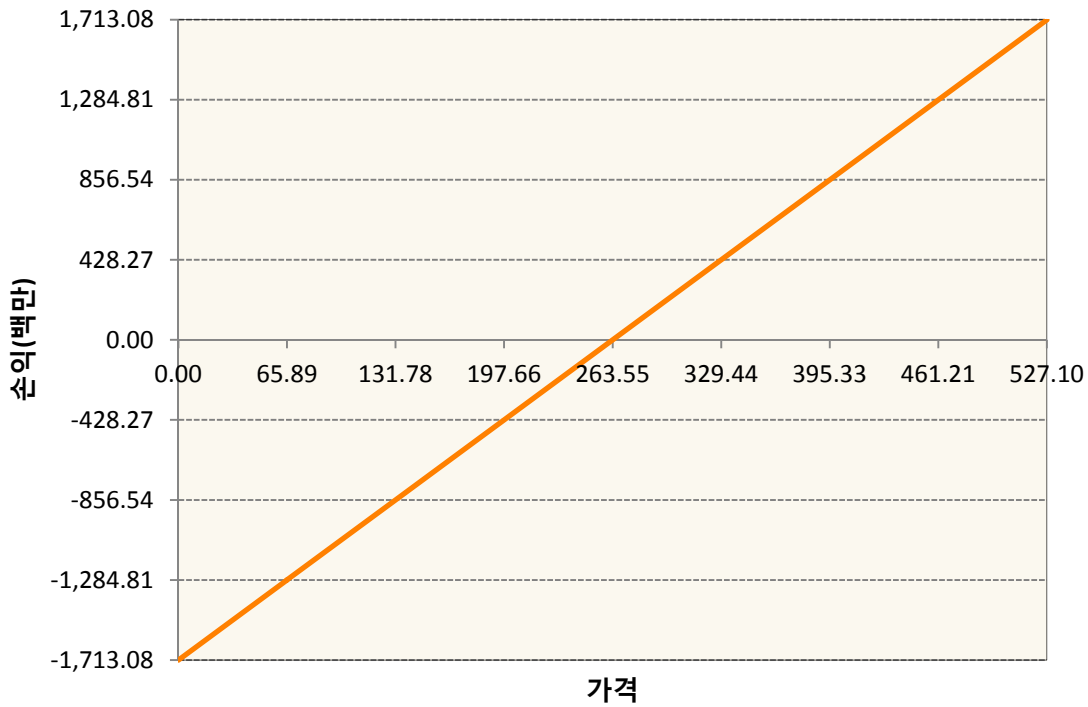
1. 계약금액

(단위:백만원)

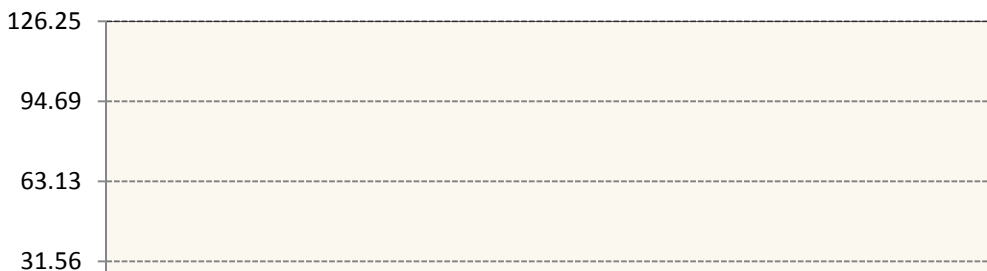
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,713	0	1,713	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,361	-3,361	장내

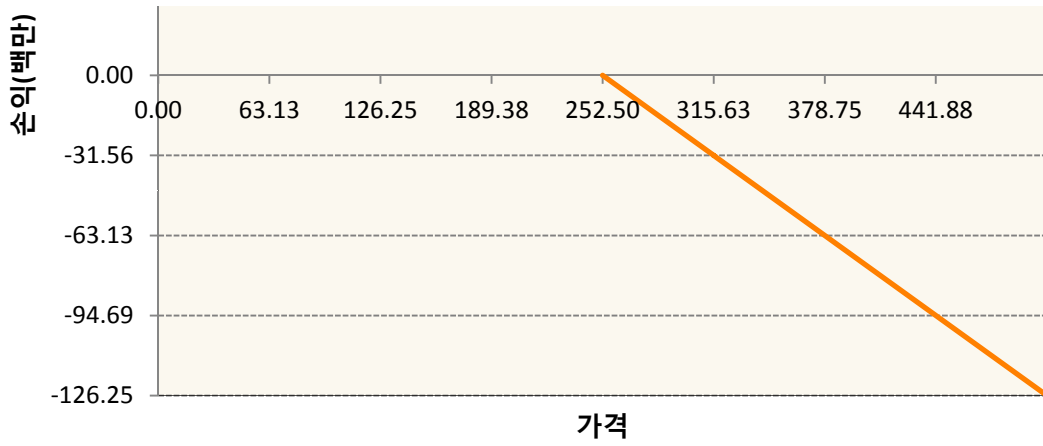
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

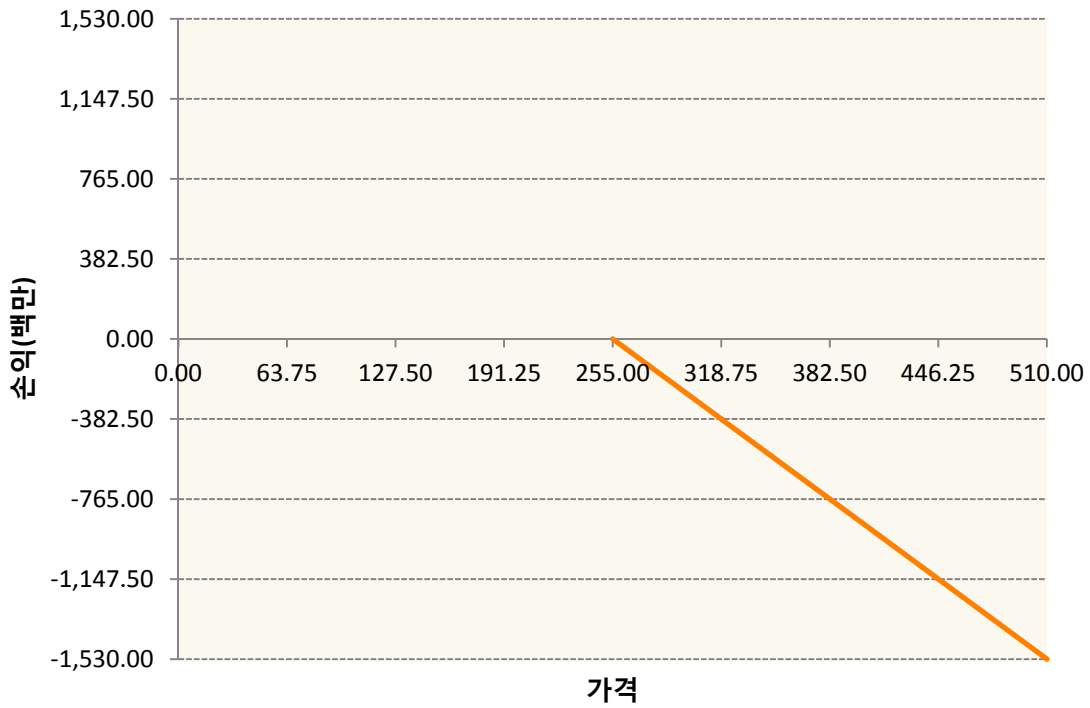


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

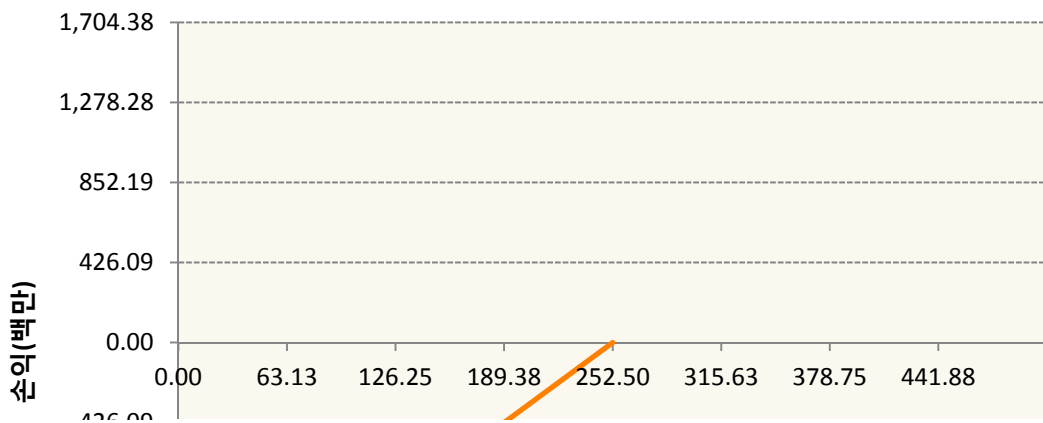




KR4201Q62550-2020-06 콜255



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	6	5	5	4	
-5.33%	5	5	4	4	4	3	3	
-2.67%	4	3	3	2	2	1	1	
0%	1	1	0	0	0	-1	-1	
2.67%	-2	-2	-2	-3	-3	-3	-4	
5.33%	-5	-5	-5	-5	-6	-6	-6	
8.00%	-8	-8	-8	-8	-9	-9	-9	
KR4201Q62550		2020-06 콜255						108
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	75	71	66	62	57	52	48
-5.33%	61	56	51	46	40	35	30
-2.67%	41	36	30	25	20	14	9
0%	15	10	5	0	-5	-10	-16
2.67%	-16	-20	-24	-29	-34	-39	-43
5.33%	-51	-54	-57	-61	-65	-70	-74
8.00%	-88	-91	-93	-97	-100	-104	-108
KR4301Q62525 2020-06 풋252.5							77
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-61	-63	-66	-68	-71	-74	-77
-5.33%	-27	-30	-34	-37	-40	-44	-47
-2.67%	-5	-8	-11	-14	-18	-21	-25
0%	8	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	13	11	10	8	6	4	2
5.33%	14	14	13	12	11	10	8
8.00%	15	15	14	14	13	13	12

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

(단위:백만원)

563

공시일	2020-05-22
기준일	2020-05-21

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

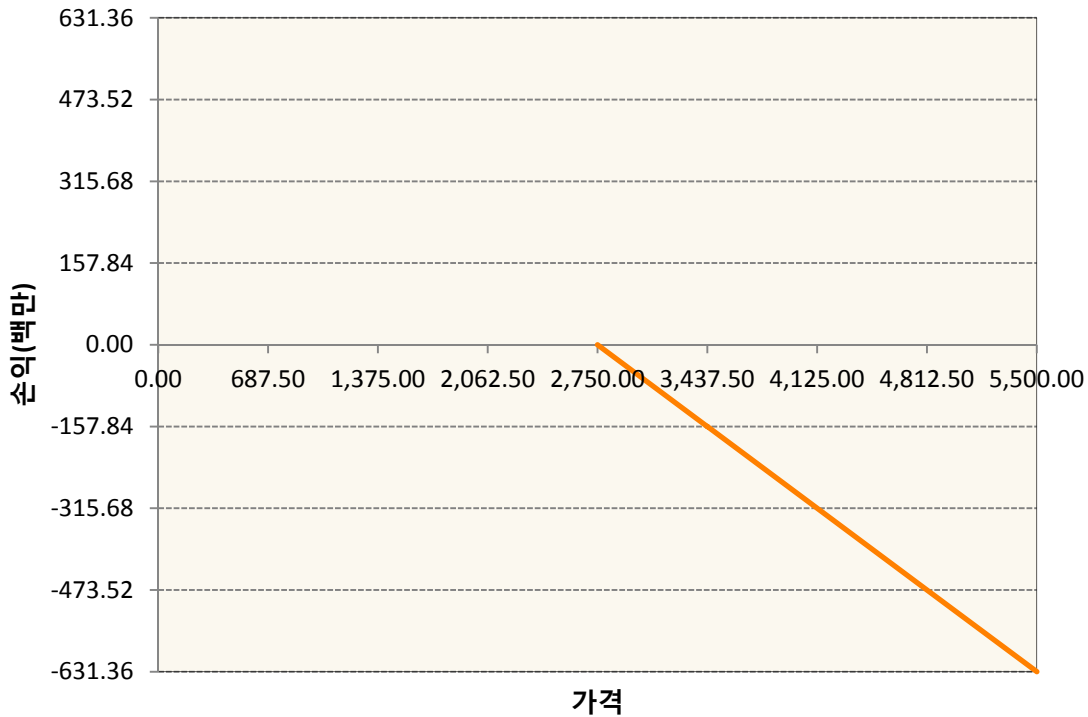
1. 계약금액

(단위:백만원)

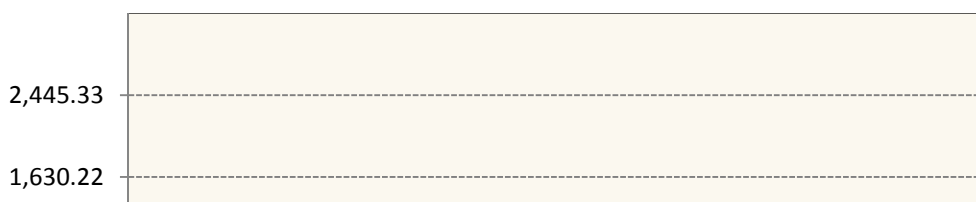
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,771	0	1,771	
누계	유가증권	스왑	8,055	0	8,055	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,784	-7,784	장내
누계	통화	선도	0	2,923	-2,923	장외

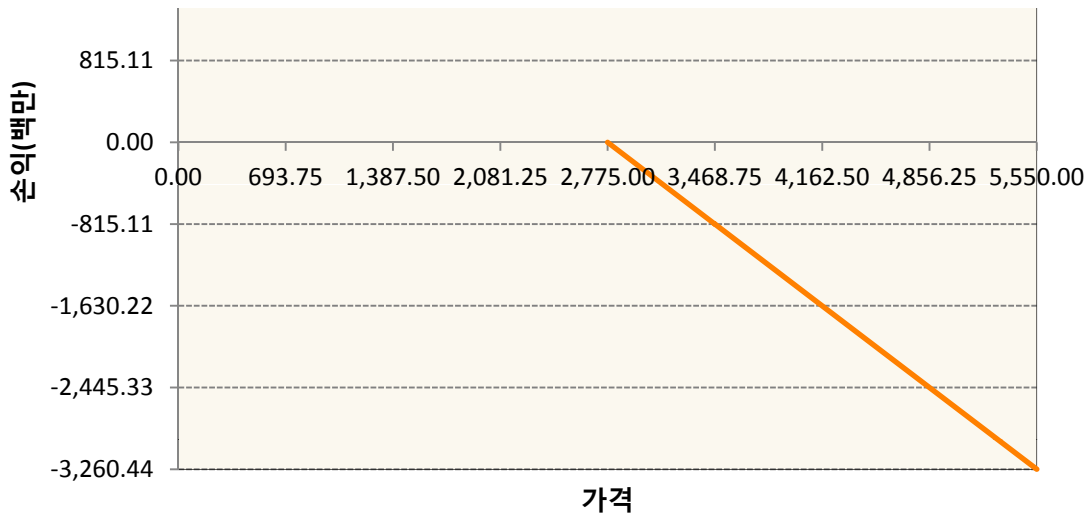
2. 만기시점의 손익구조

OESXM0-C2750-EURO STOXX 50

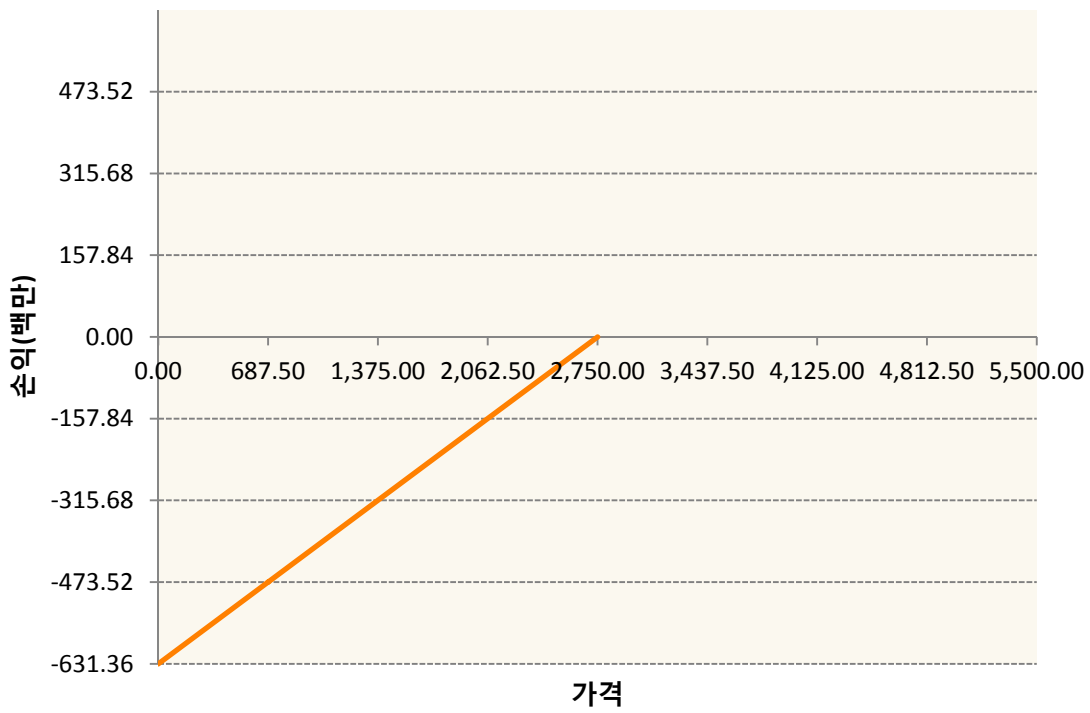


OESXM0-C2775-EURO STOXX 50

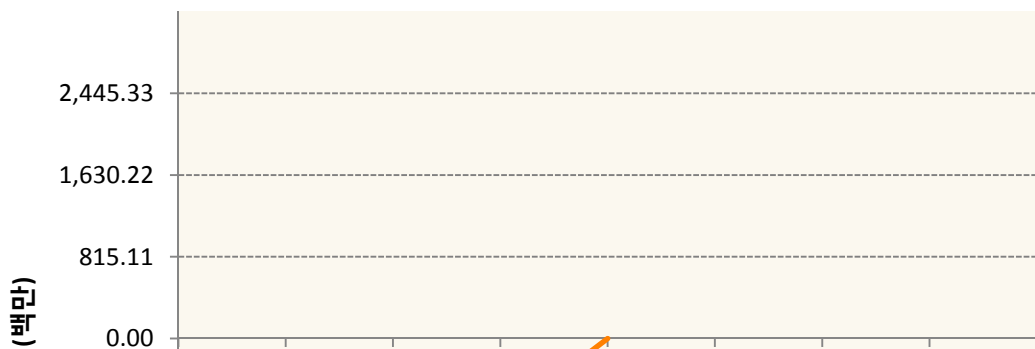


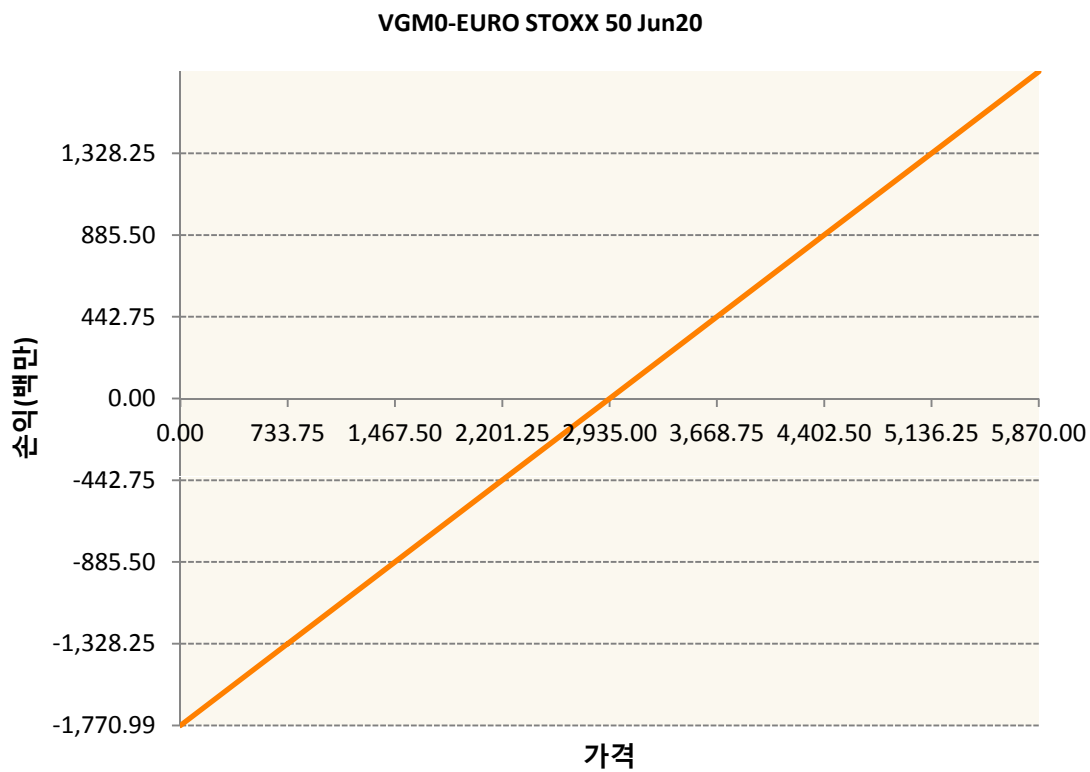
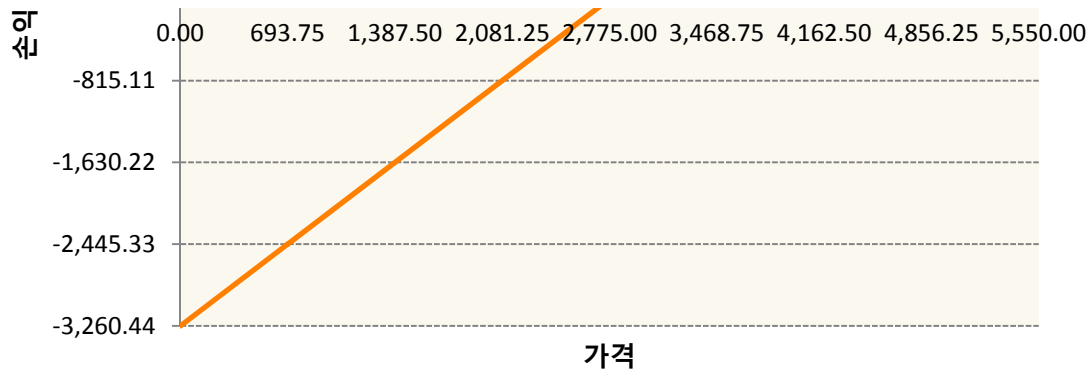


OESXM0-P2750-EURO STOXX 50



OESXM0-P2775-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		15
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E		219
FX21020K02 KRW/EUR 26-06-20E		15
OESXM0-C2' EURO STOXX 50		51
OESXM0-C2' EURO STOXX 50		261
OESXM0-P2' EURO STOXX 50		51
OESXM0-P2' EURO STOXX 50		261
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20		142

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

(단위:백만원)

1,159

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

(단위:백만원)

1,176

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

(단위:백만원)

102

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

(단위:백만원)

149

공시일	2020-05-22
기준일	2020-05-21

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

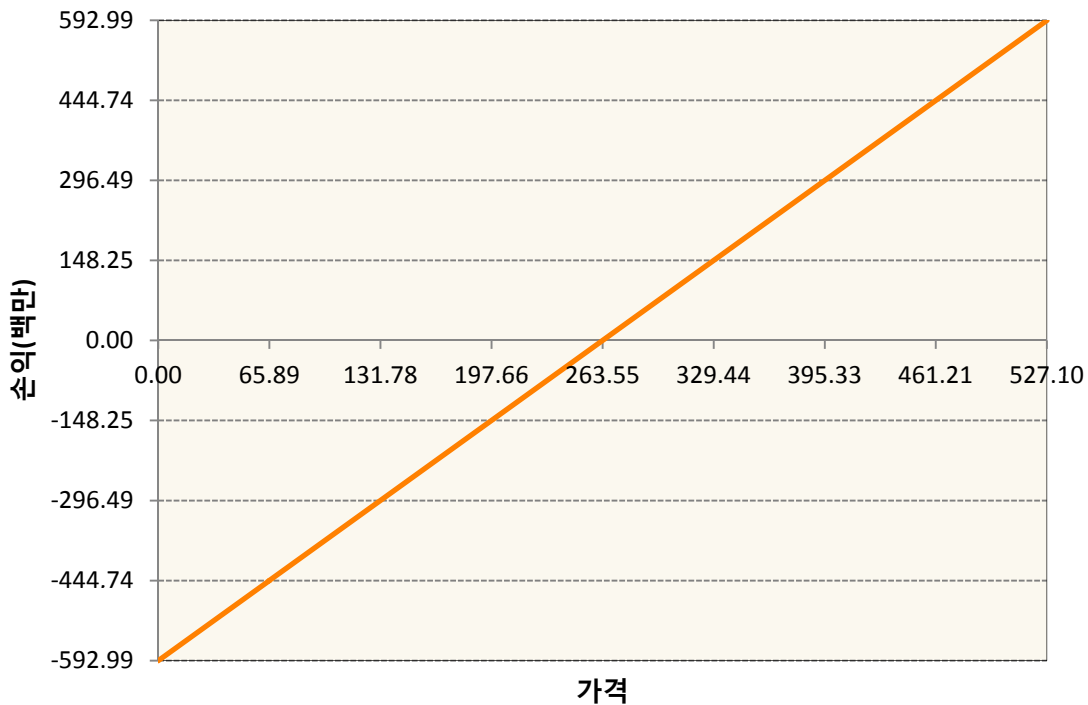
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						47
기초자산의 변동성								
가격	-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)

71

공시일	2020-05-22
기준일	2020-05-21

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

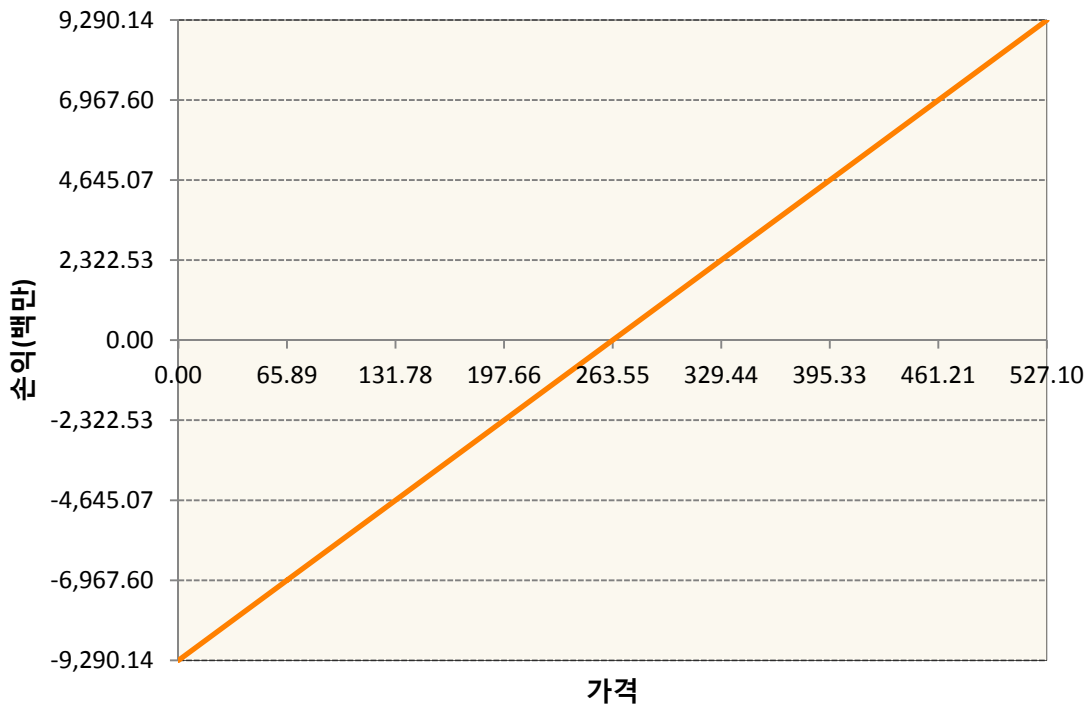
1. 계약금액

(단위:백만원)

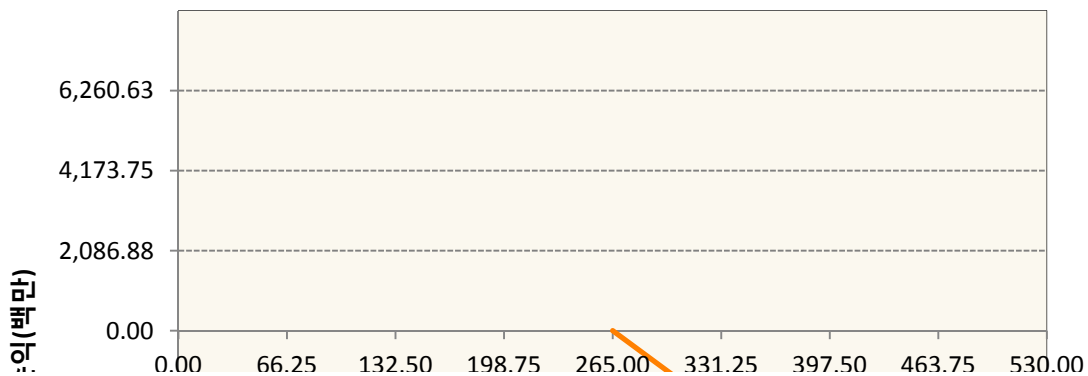
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,290	0	9,290	장내
누계	유가증권	옵션	2,917	17,911	-14,994	장내

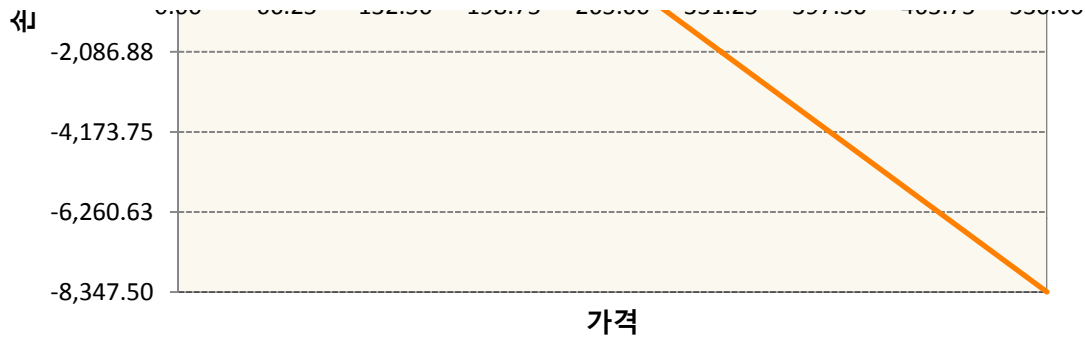
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

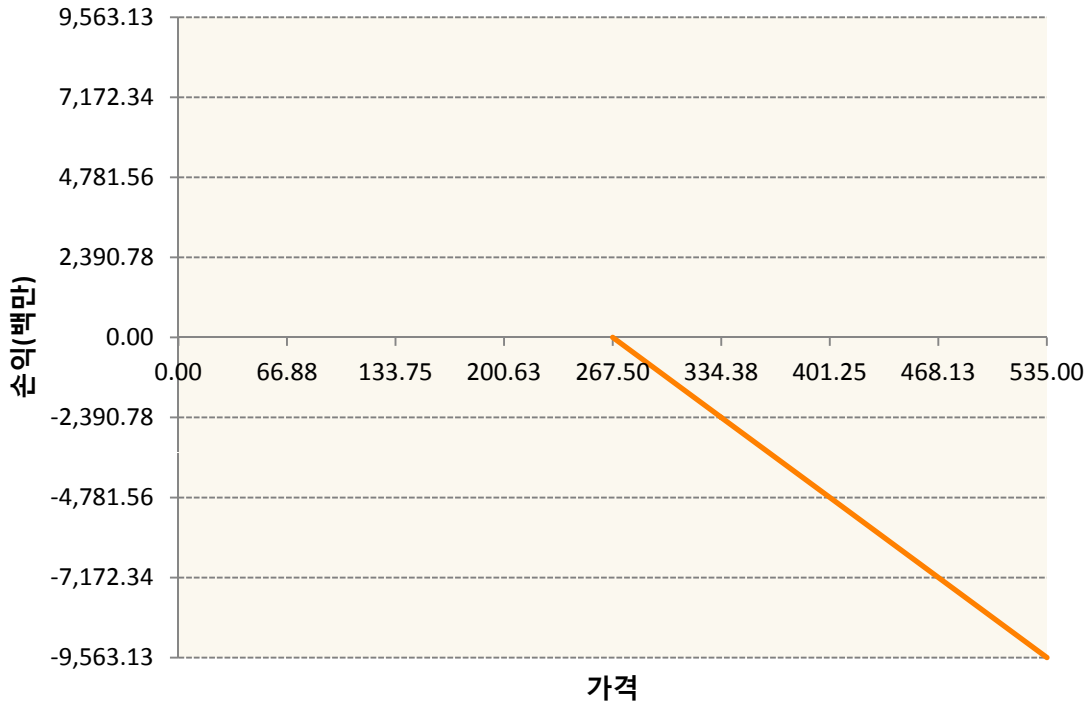


KR4201Q62659-2020-06 콜265

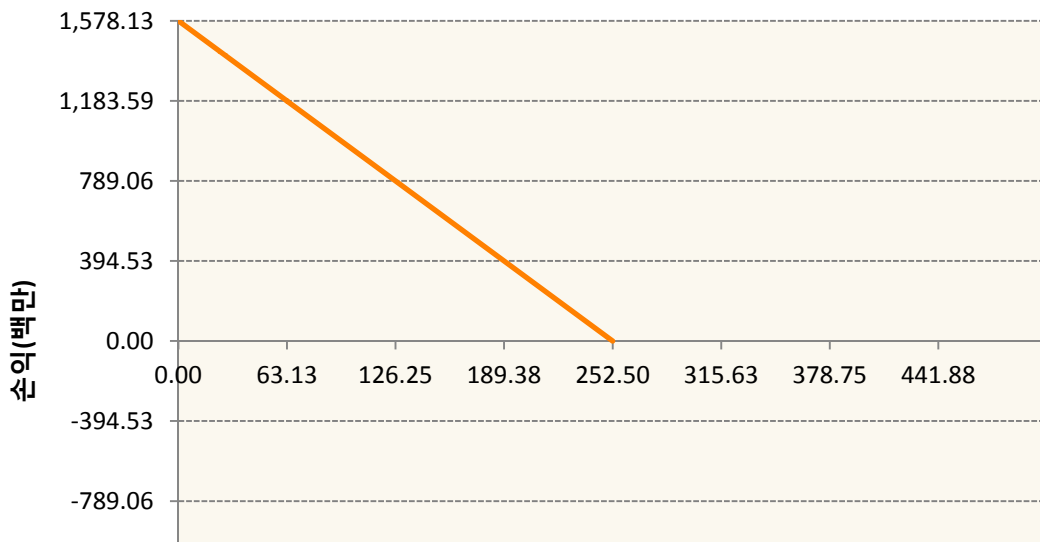


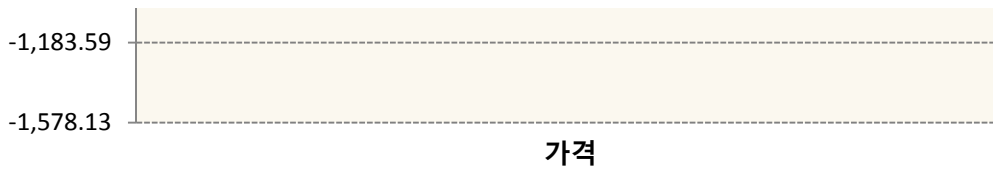


KR4201Q62675-2020-06 콜267.5

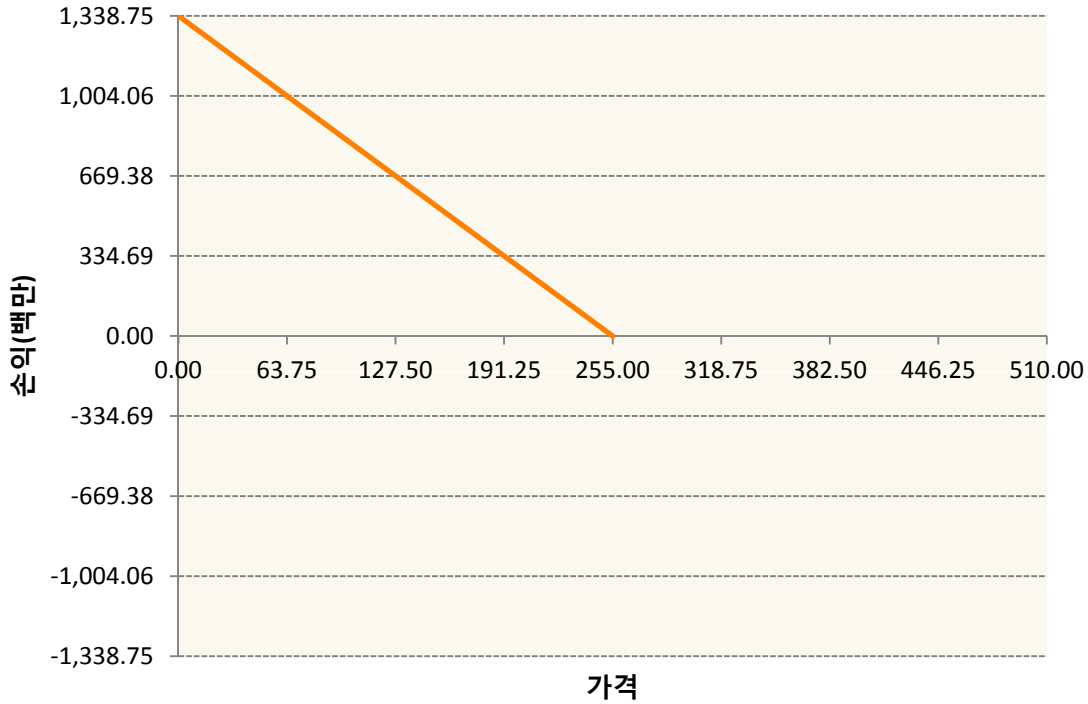


KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





KR4301Q62558-2020-06 풋255



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						744
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-744	-744	-744	-744	-744	-744	-744	
-5.33%	-496	-496	-496	-496	-496	-496	-496	
-2.67%	-248	-248	-248	-248	-248	-248	-248	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	248	248	248	248	248	248	248	
5.33%	496	496	496	496	496	496	496	
8.00%	744	744	744	744	744	744	744	
KR4201Q62659		2020-06 콜265						501
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	285	269	252	233	213	192	170	
-5.33%	244	222	200	176	152	127	102	
-2.67%	180	153	126	99	72	44	17	

0%	87	58	29	0	-29	-58	-87
2.67%	-36	-64	-93	-121	-150	-179	-208
5.33%	-186	-211	-237	-264	-291	-319	-347
8.00%	-359	-380	-402	-425	-450	-475	-501
KR4201Q62675 2020-06 콜267.5							548
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	293	278	260	240	219	197	173
-5.33%	255	232	208	183	157	130	102
-2.67%	192	163	134	104	73	43	12
0%	98	65	33	0	-33	-66	-98
2.67%	-29	-62	-96	-129	-162	-196	-229
5.33%	-188	-219	-251	-282	-314	-347	-379
8.00%	-376	-402	-429	-458	-487	-517	-548
KR4301Q62525 2020-06 풋252.5							71
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	56	58	61	63	66	68	71
-5.33%	25	28	31	34	37	41	44
-2.67%	4	7	10	13	17	20	23
0%	-7	-5	-2	0	3	5	8
2.67%	-12	-11	-9	-8	-6	-4	-2
5.33%	-13	-13	-12	-11	-10	-9	-7
8.00%	-14	-14	-13	-13	-12	-12	-11
KR4301Q62558 2020-06 풋255							66
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	55	56	58	60	62	64	66
-5.33%	26	28	31	33	36	38	41
-2.67%	5	8	11	13	16	19	21
0%	-7	-5	-2	0	2	5	7
2.67%	-12	-11	-10	-8	-6	-4	-2
5.33%	-14	-14	-13	-12	-11	-10	-8
8.00%	-15	-15	-15	-14	-13	-13	-12

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

(단위:백만원)

2,065

공시일	2020-05-22
기준일	2020-05-21

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	151,948	0	151,948	

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	2020-05-22
기준일	2020-05-21

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	102,449	0	102,449	

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	2020-05-22
기준일	2020-05-21

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	452,619	0	452,619	
누계	통화	선도	0	429,092	-429,092	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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	1,516
FX21020J02¥ KRW/USD 22-06-20E	1,969
FX21020J03¥ KRW/USD 24-07-20E	2,216
FX21020J04¥ KRW/USD 24-07-20E	1,772
FX21020J04£ KRW/USD 24-07-20E	1,969
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)

17,396

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

(단위:백만원)

204

공시일	2020-05-22
기준일	2020-05-21

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

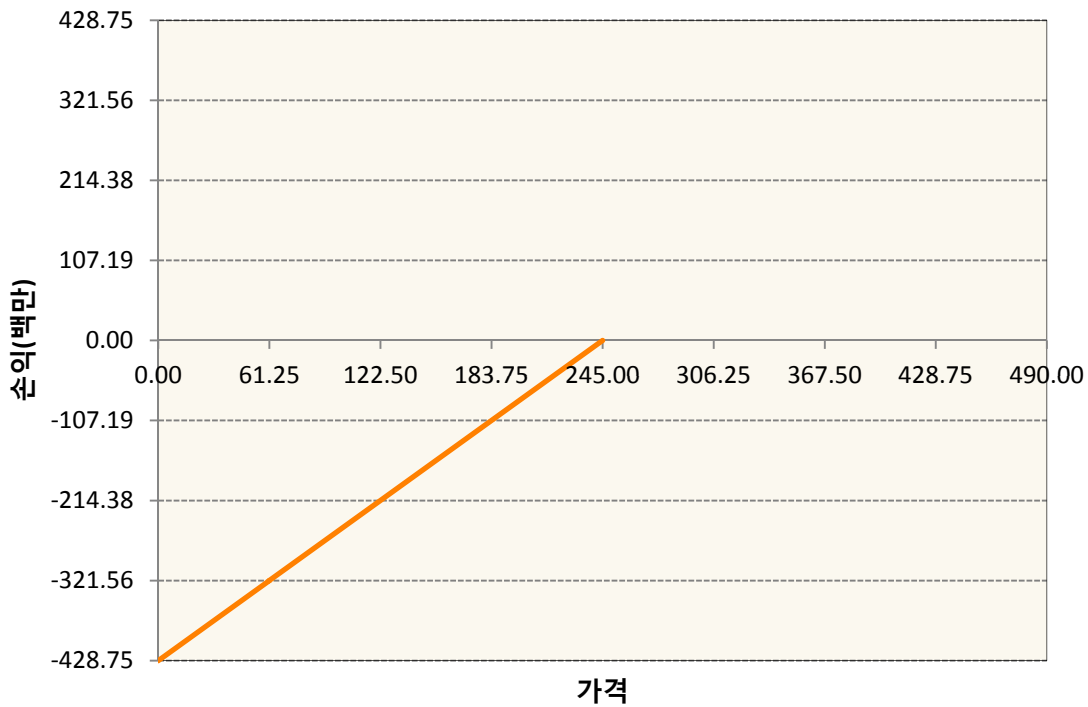
1. 계약금액

(단위:백만원)

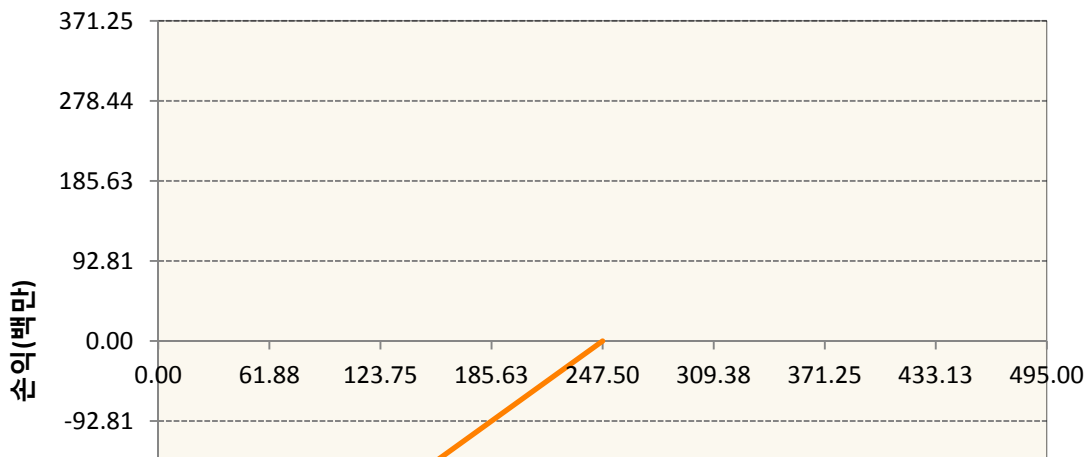
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	489	0	489	장내
누계	유가증권	옵션	0	800	-800	장내

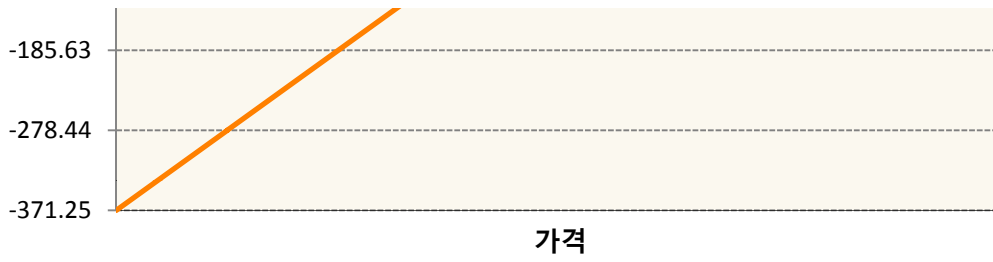
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q62459-2020-06 풋245



KR4301Q62475-2020-06 풋247.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q62459		2020-06 풋245						14
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-9	-10	-10	-11	-12	-13	-14	
-5.33%	-3	-4	-5	-6	-6	-7	-8	
-2.67%	0	-1	-1	-2	-3	-3	-4	
0%	1	1	0	0	0	-1	-2	
2.67%	1	1	1	1	1	0	0	
5.33%	1	1	1	1	1	1	1	
8.00%	1	1	1	1	1	1	1	
KR4301Q62475		2020-06 풋247.5						13
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-9	-10	-11	-11	-12	-13	-13	
-5.33%	-4	-4	-5	-6	-7	-7	-8	
-2.67%	0	-1	-1	-2	-3	-3	-4	
0%	1	1	0	0	0	-1	-2	
2.67%	2	1	1	1	1	0	0	
5.33%	2	2	2	2	1	1	1	
8.00%	2	2	2	2	2	2	1	

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

19

공시일	2020-05-22
기준일	2020-05-21

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	7,461	0	7,461	
누계	통화	선도	0	7,336	-7,336	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J04(KRW/USD 29-05-20E	254
FX21020K01 KRW/USD 15-06-20E	322
FX21020K03 KRW/USD 15-06-20E	11
IE00BD8RGM75	*

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

297

공시일	2020-05-22
기준일	2020-05-21

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

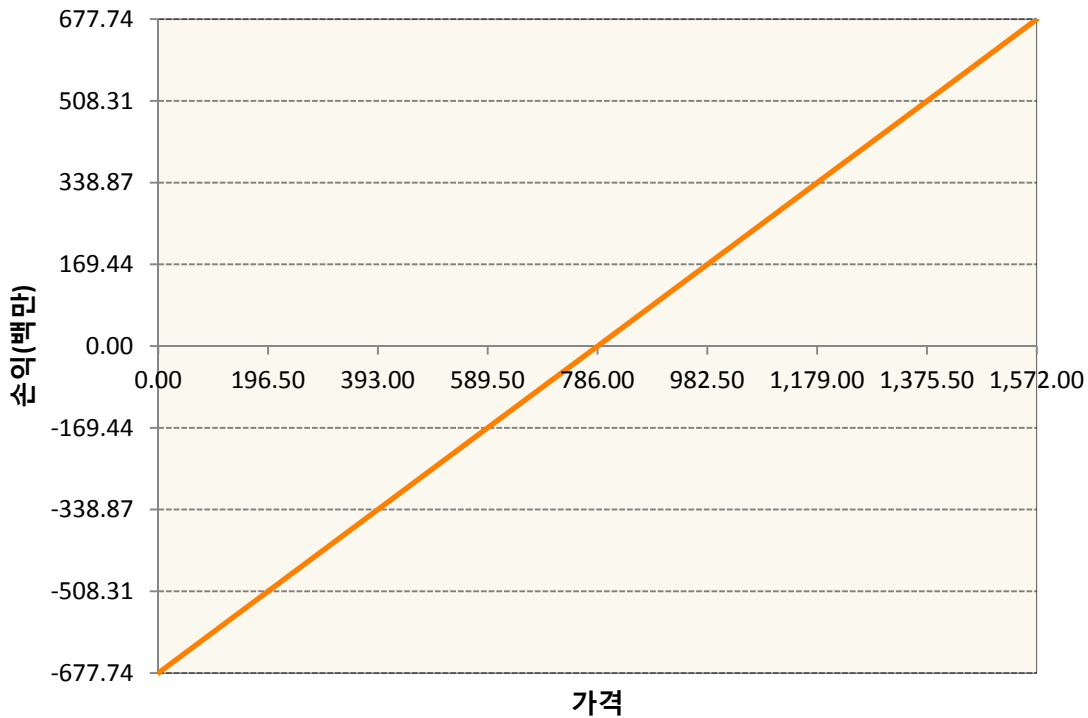
1. 계약금액

(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	678	0	678	
누계	유가증권	스왑	980	0	980	장외
누계	통화	선도	208	1,153	-945	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCM0-VN30 Index Future Jun20



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
FX21020K03 KRW/EUR 28-08-20E	22
VNCM0 VN30 Index Future Jun20	54

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

(단위:백만원)

181

공시일	2020-05-22
기준일	2020-05-21

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

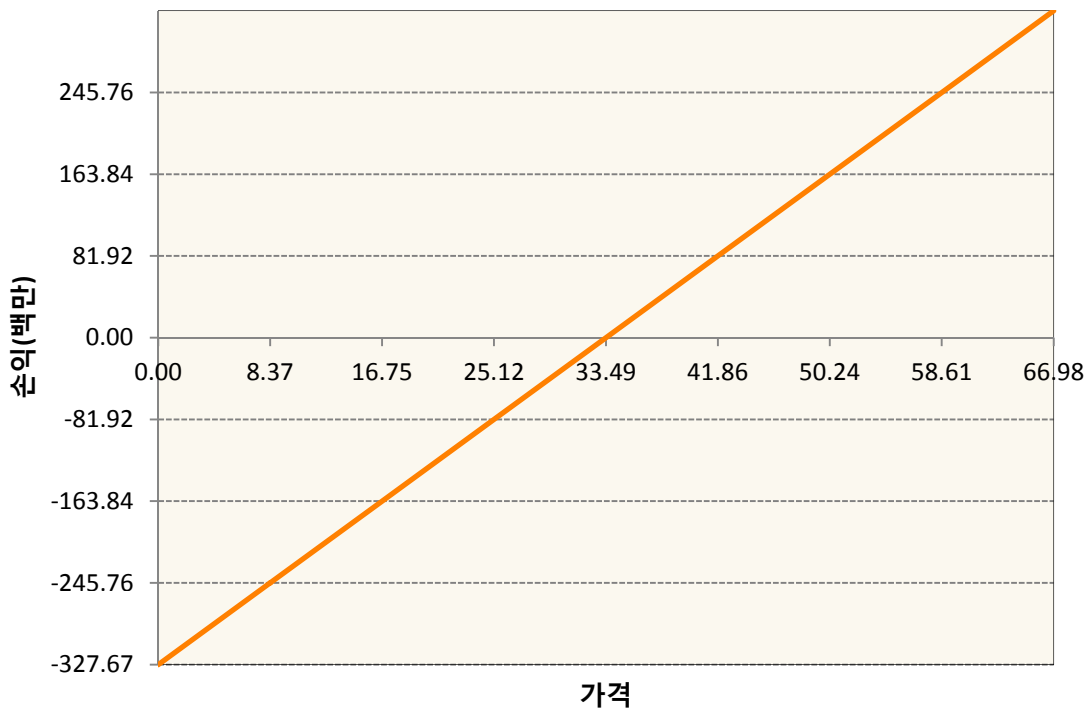
1. 계약금액

(단위:백만원)

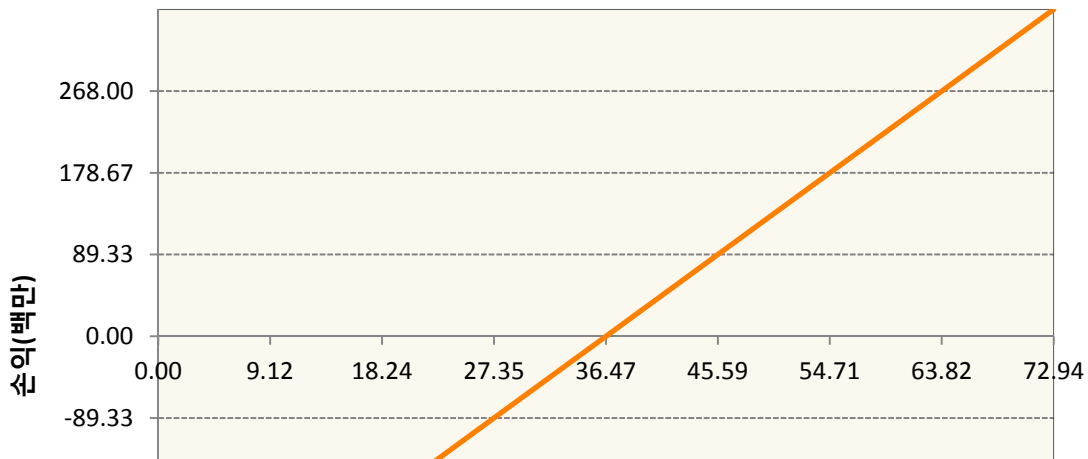
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,727	307	1,420	

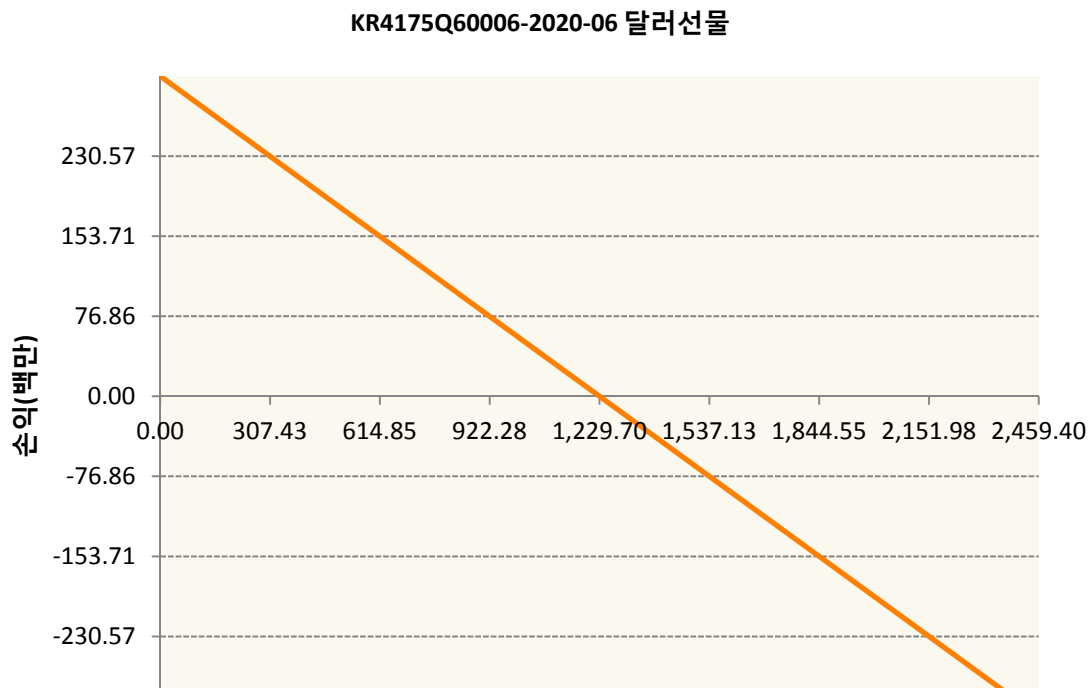
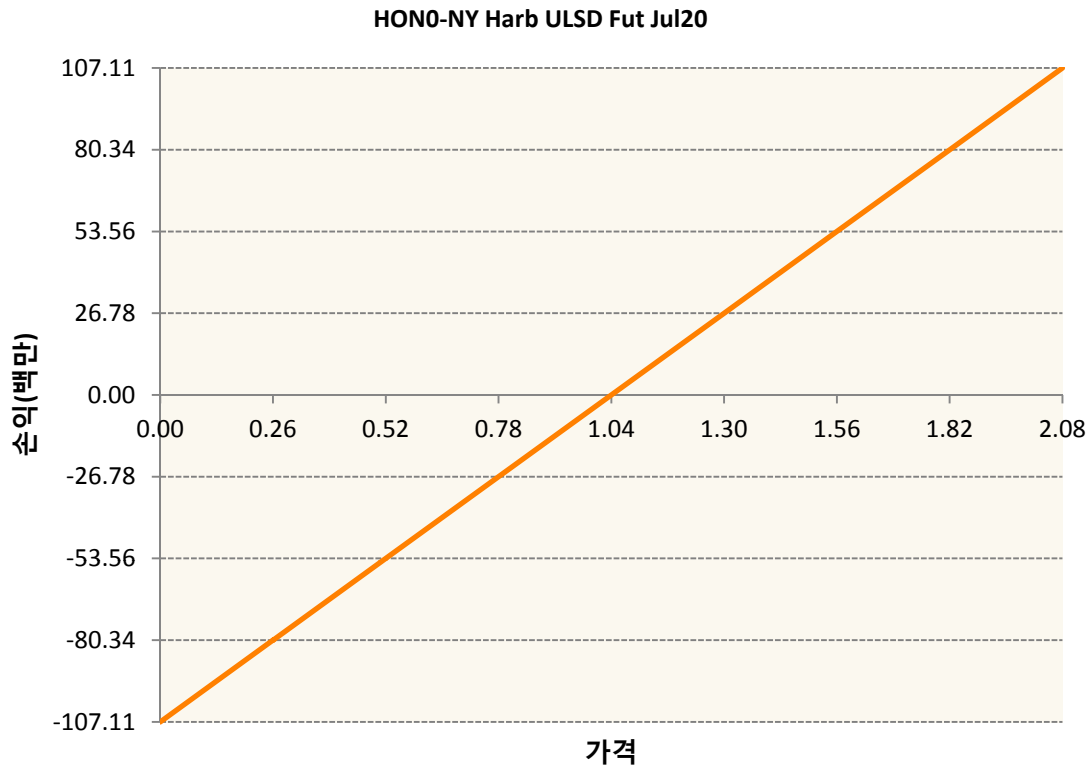
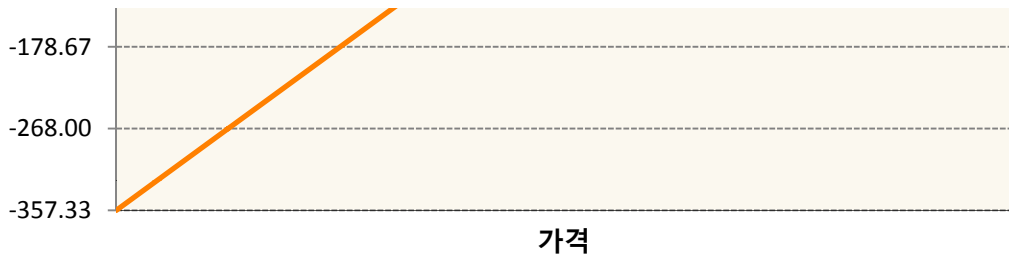
2. 만기시점의 손익구조

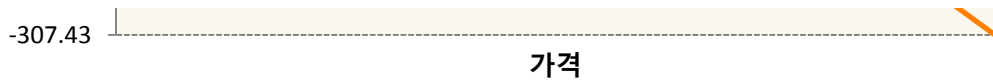
CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20



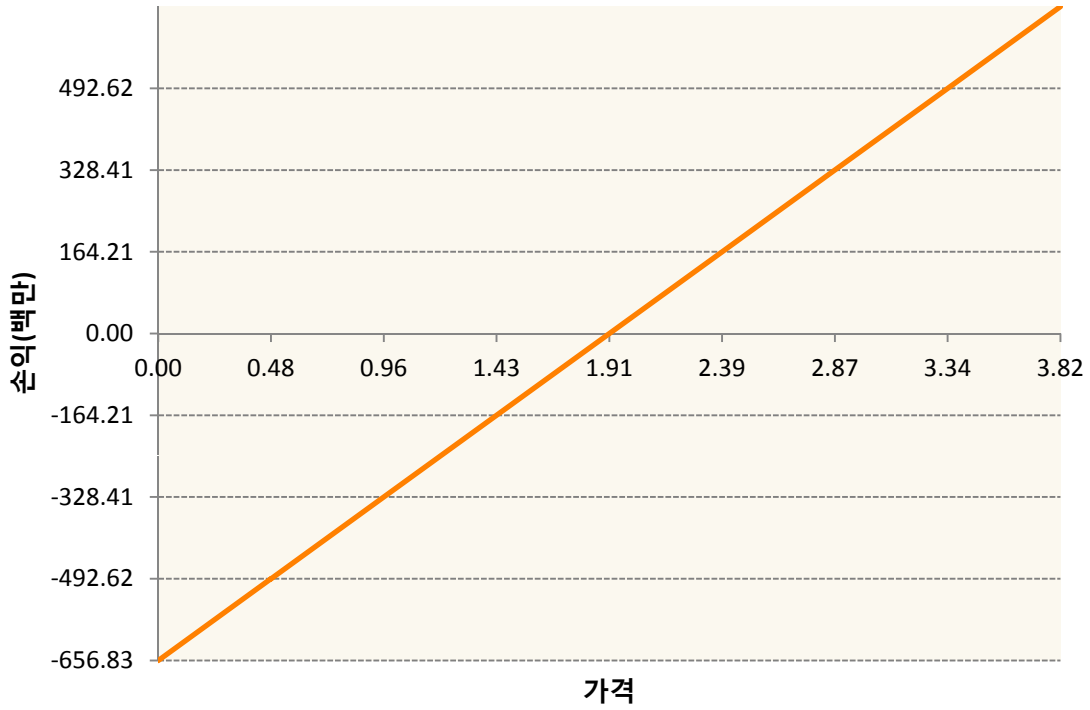
COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20



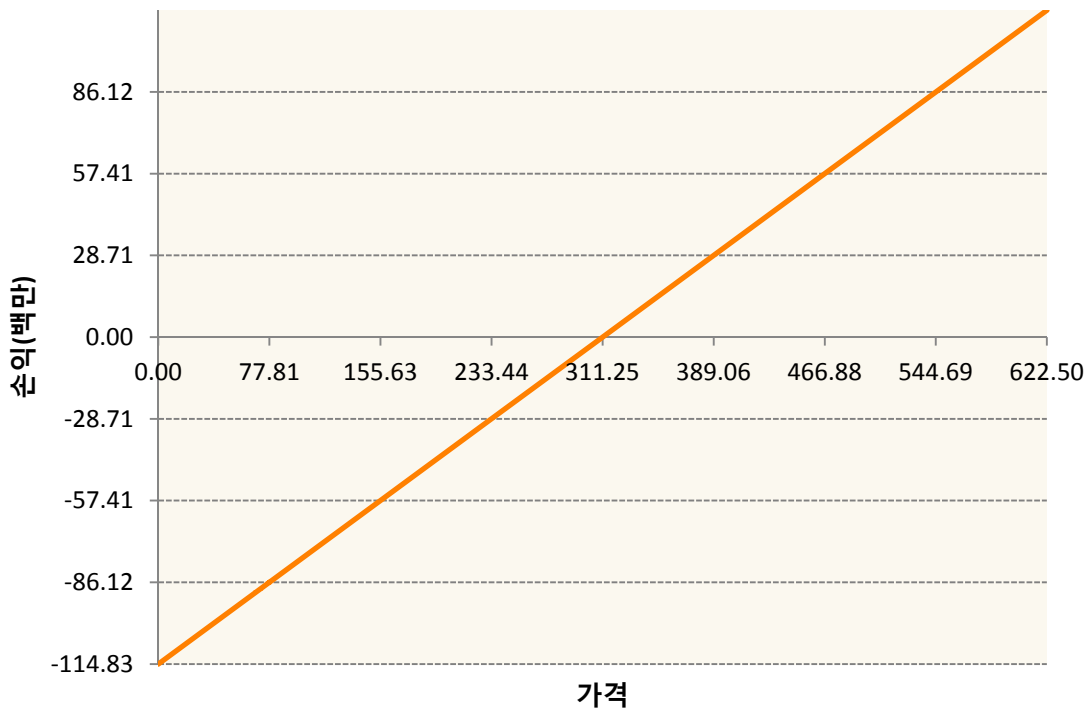




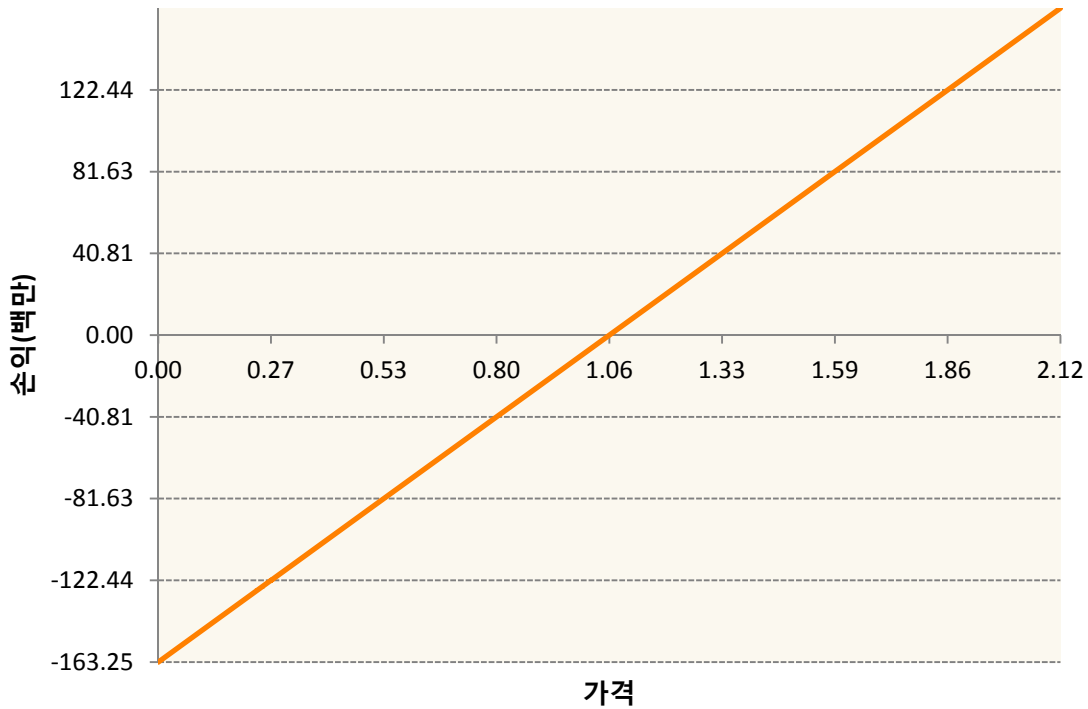
NGN20-NATURAL GAS FUTR Jul20



QSN0-Low Su Gasoil G Jul20



XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN0	WTI CRUDE FUTURE Jul20	26
COU0	BRENT CRUDE FUTR Sep20	29
HON0	NY Harb ULSD Fut Jul20	9
KR4175Q60C	2020-06 달러선물	25
NGN20	NATURAL GAS FUTR Jul20	53
QSN0	Low Su Gasoil G Jul20	9
XBN0	GASOLINE RBOB FUT Jul20	13

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

816

공시일	2020-05-22
기준일	2020-05-21

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

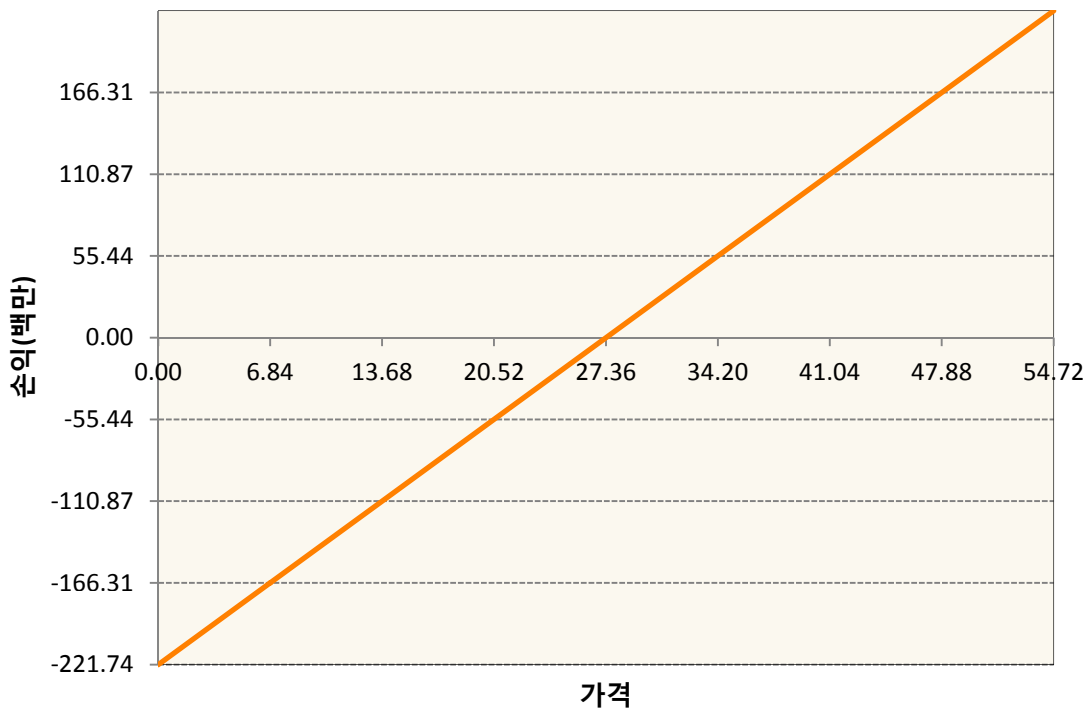
1. 계약금액

(단위:백만원)

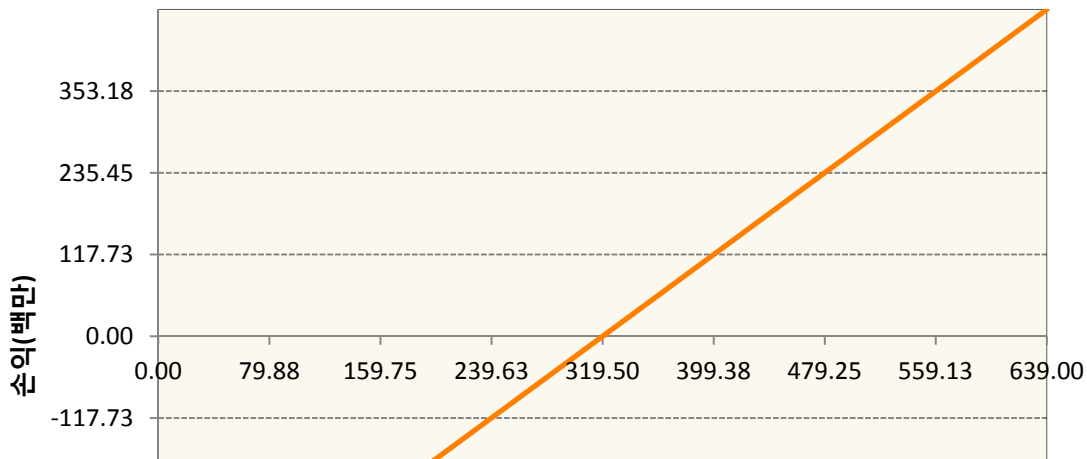
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,445	74	2,372	

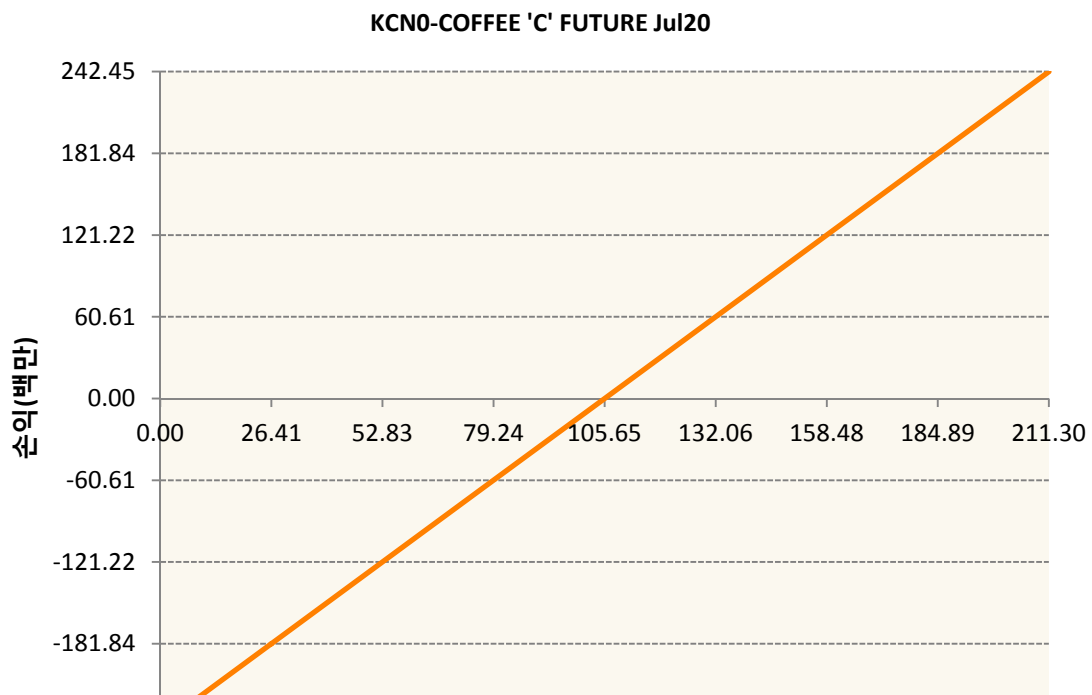
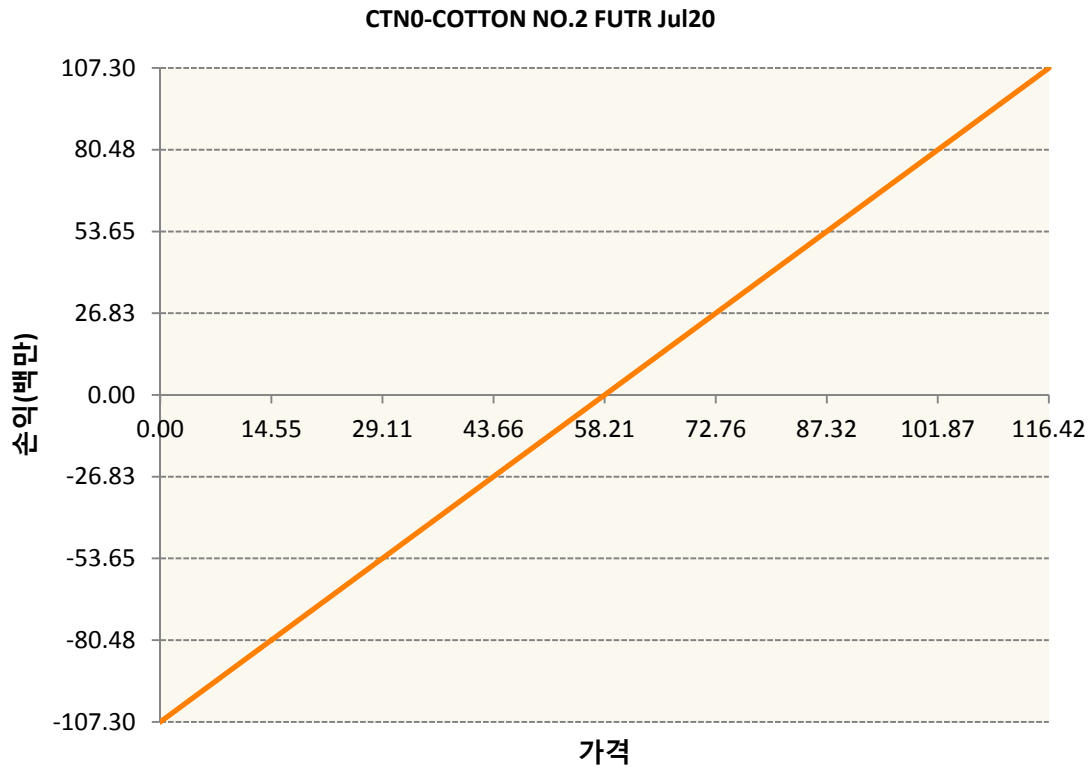
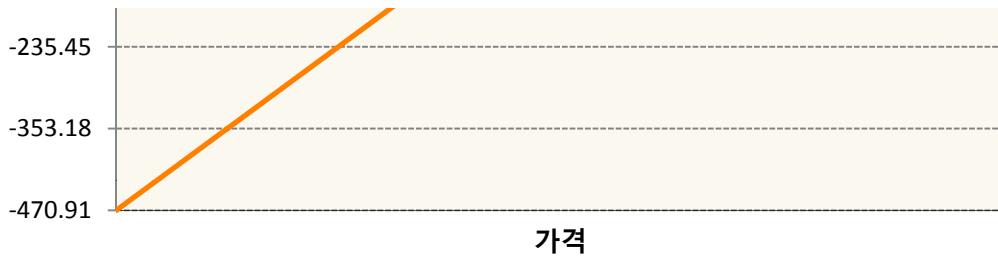
2. 만기시점의 손익구조

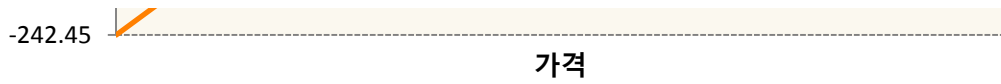
BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20



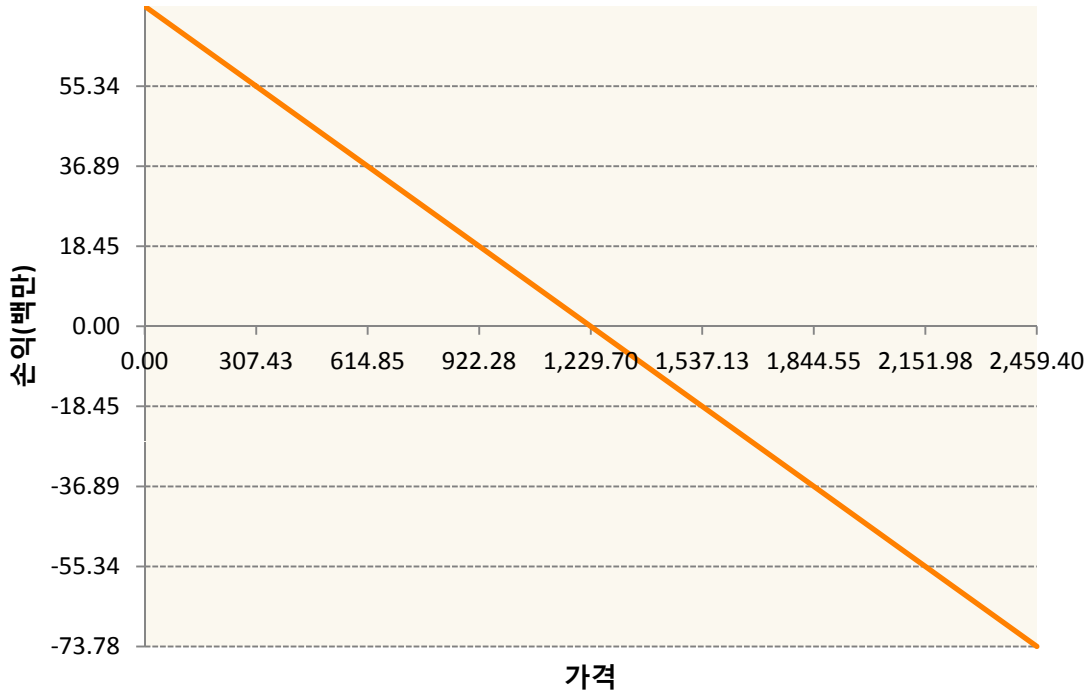
CNO-CORN FUTURE Jul20



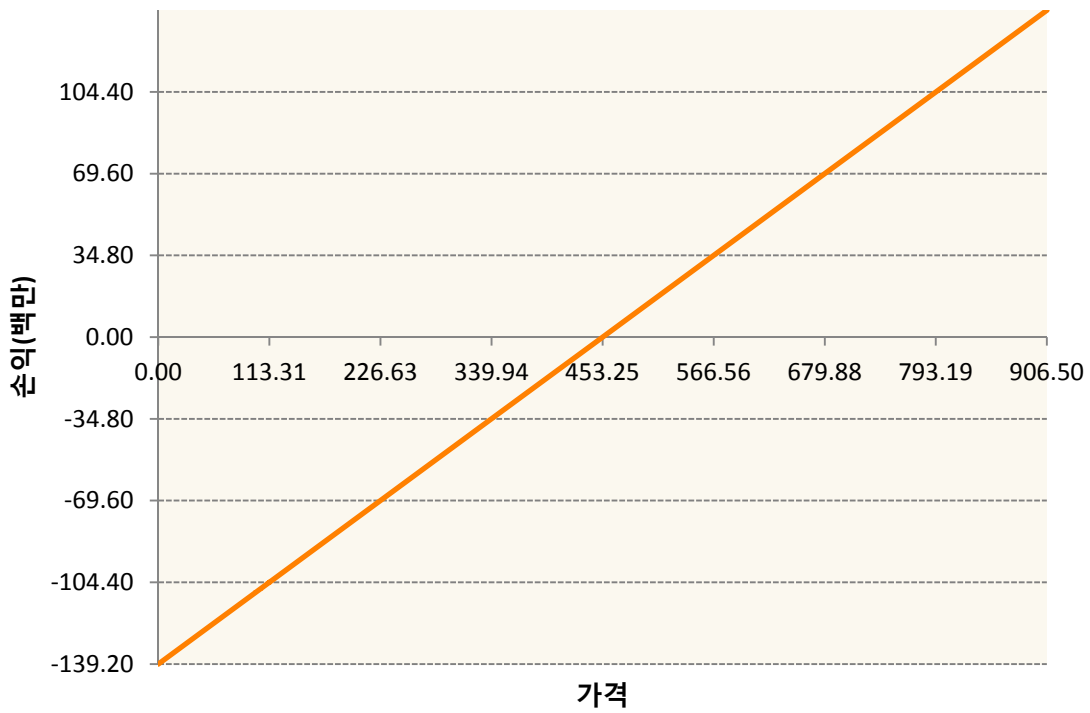




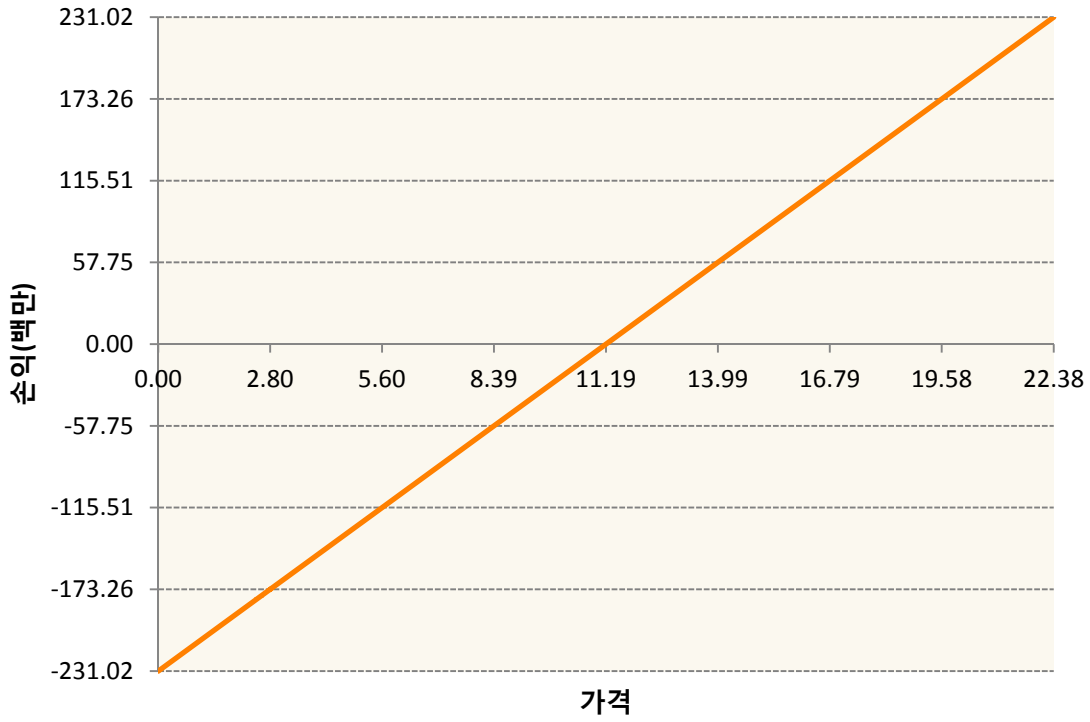
KR4175Q60006-2020-06 달러선물



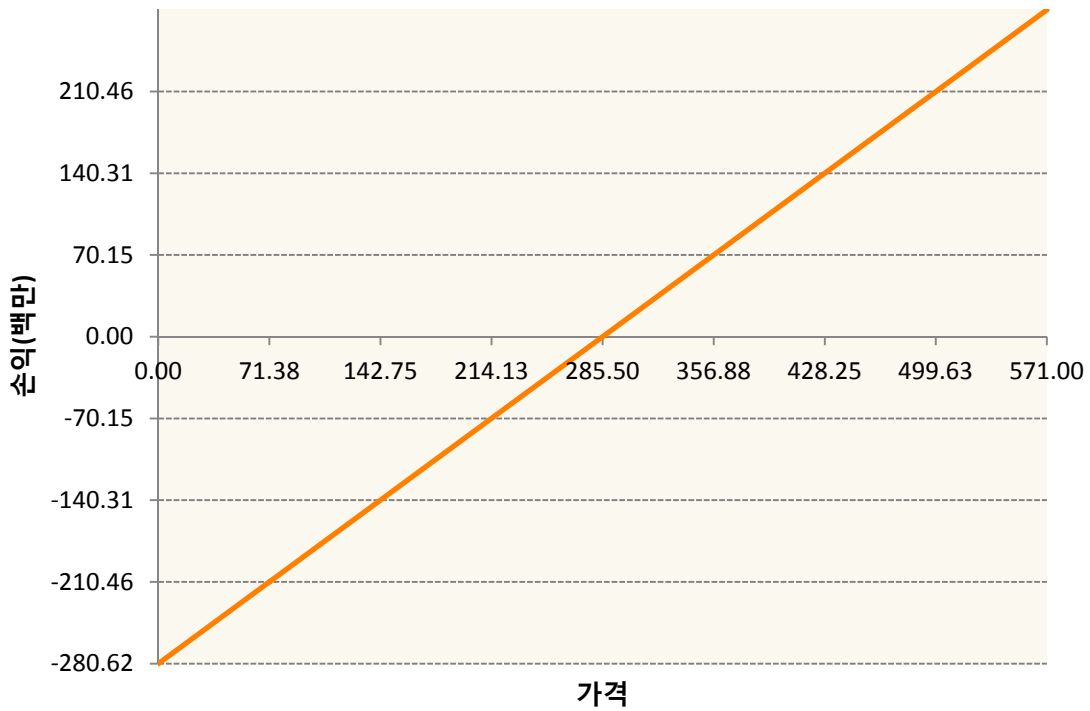
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



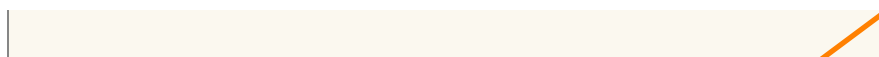
SBN0-Sugar Jul20

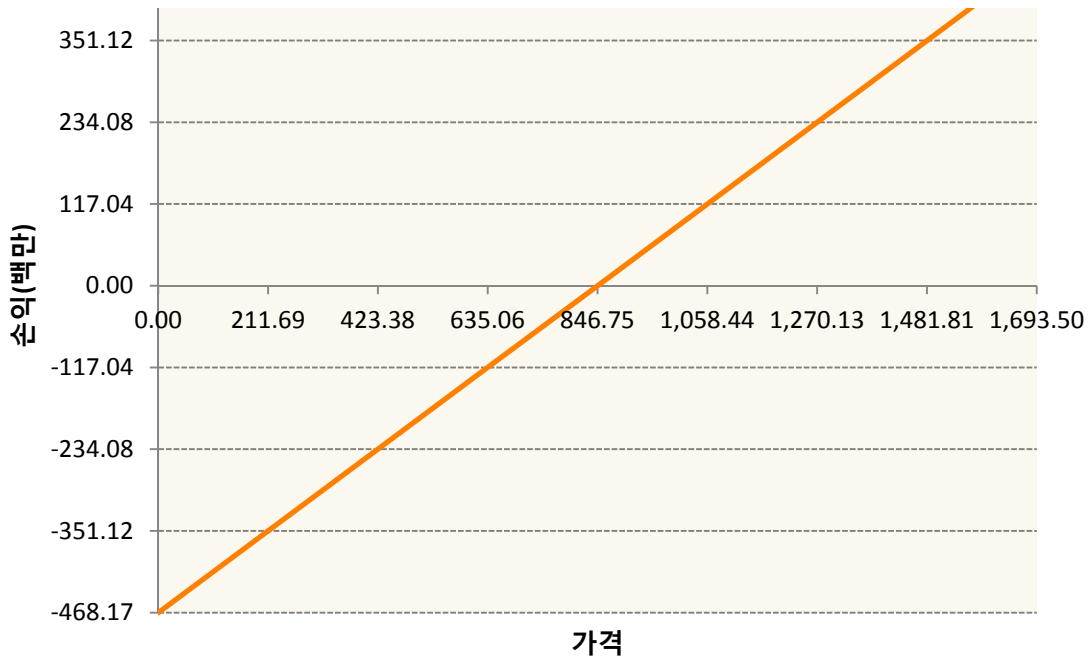


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20

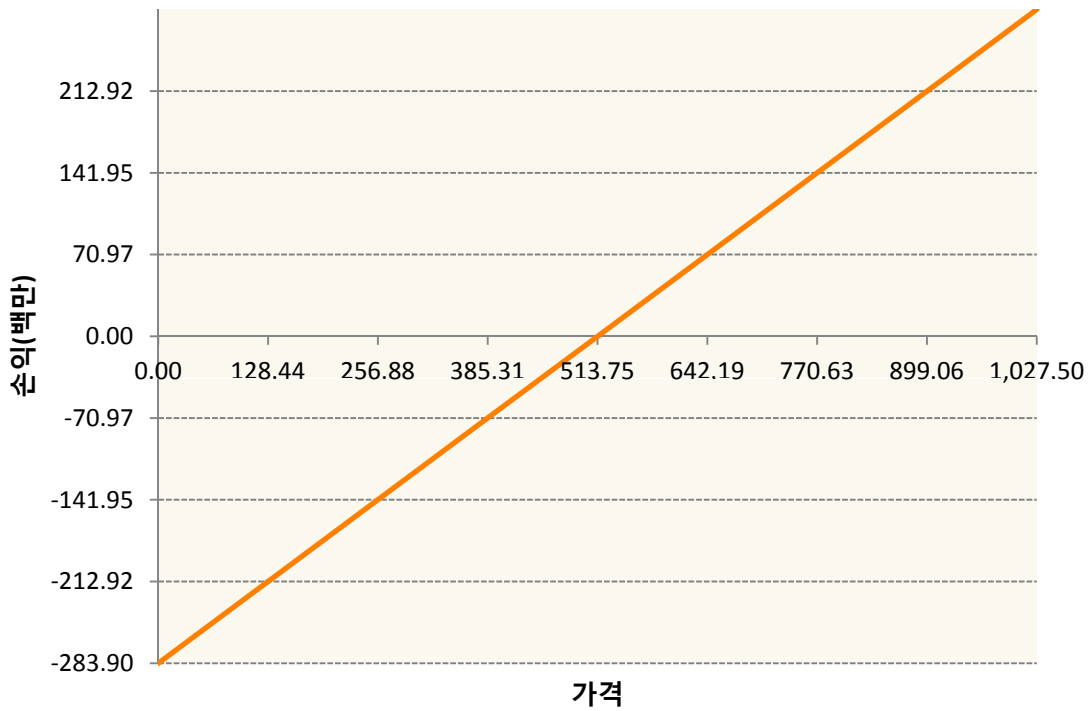


SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





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	19
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
WN0	WHEAT FUTURE(CBT) Jul20	23

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

(단위:백만원)

232