

공시일	2020-05-25
기준일	2020-05-22

## 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)

47

공시일	2020-05-25
기준일	2020-05-22

## SMART합성-MSCI선진국증권상장

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	12,516	0	12,516	장외
누계	지수	스왑	12,516	0	12,516	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0( 신한MXWO 미래S200522

1,001

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,171

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-25
기준일	2020-05-22

## 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

552
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

815
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-25
기준일	2020-05-22

## 유로인덱스모(주식-파생형)

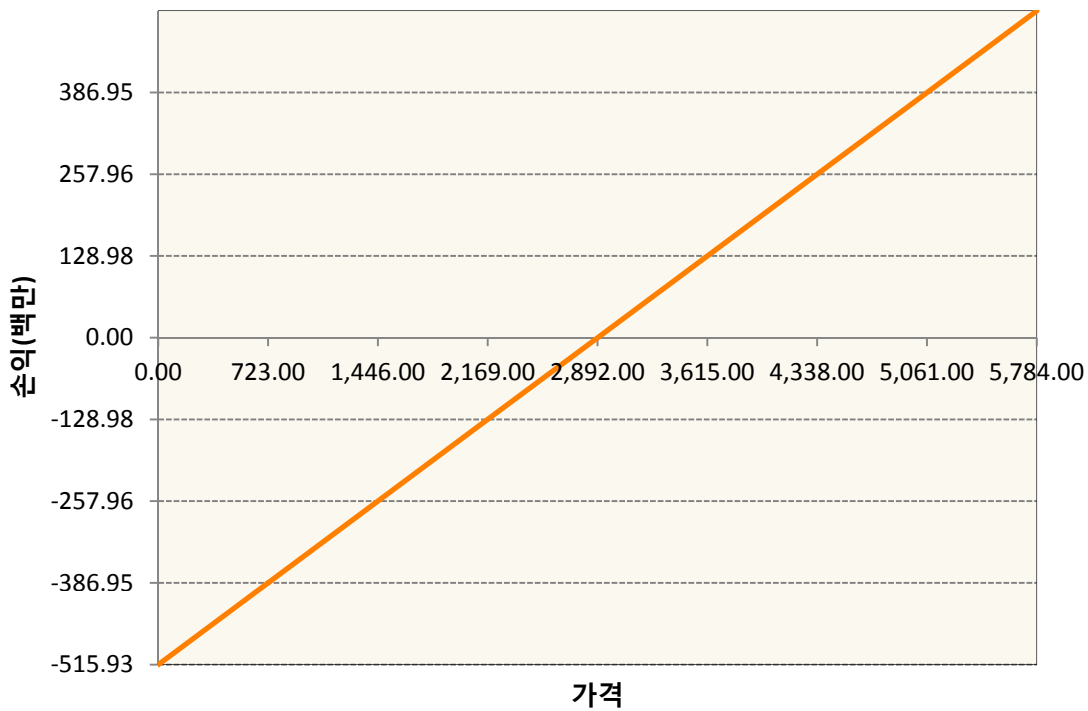
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	516	0	516	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	41
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

53
----

공시일	2020-05-25
기준일	2020-05-22

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

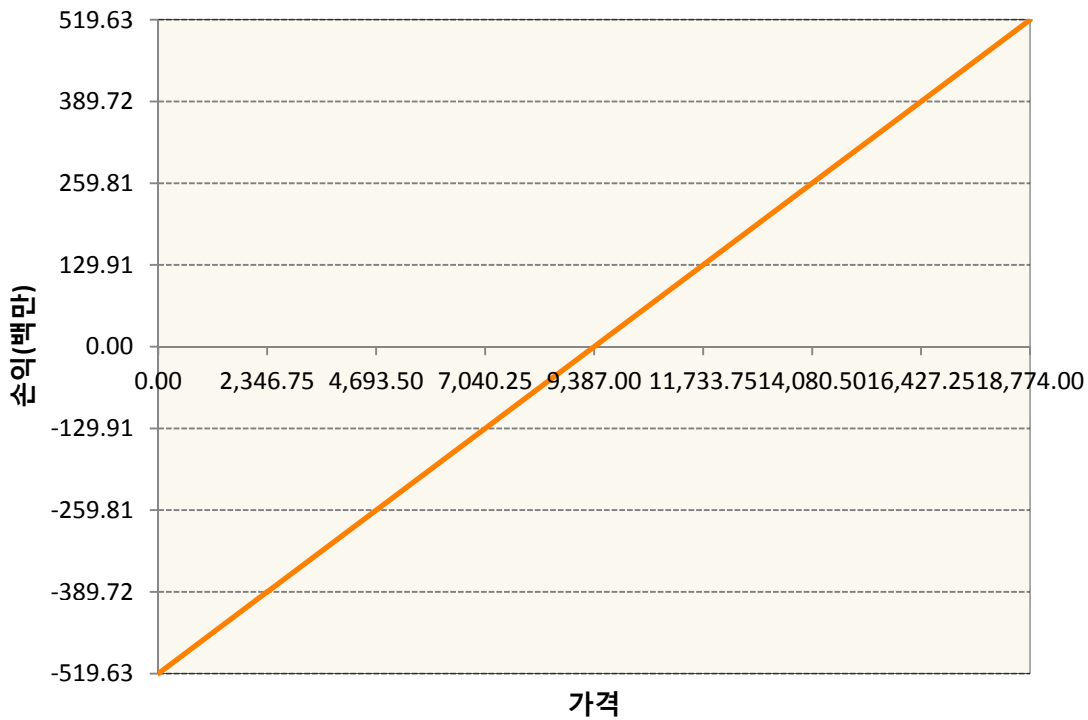
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	520	0	520	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCK0-HSCEI Futures May20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK0	HSCEI Futures May20	42
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

45
----

공시일	2020-05-25
기준일	2020-05-22

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

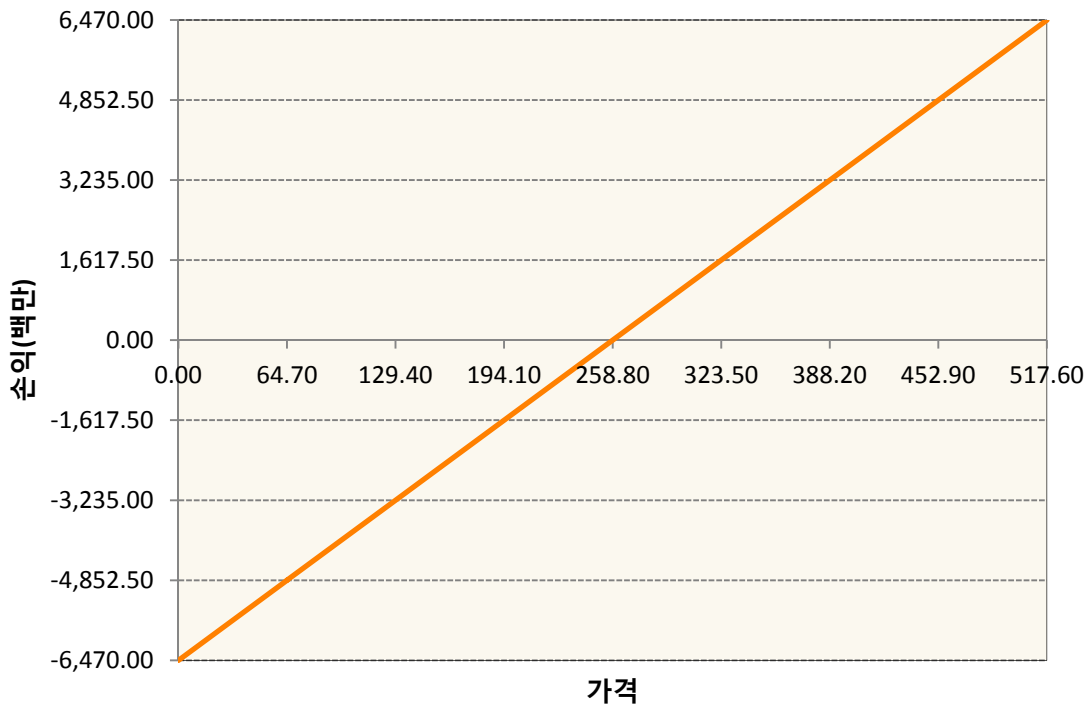
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

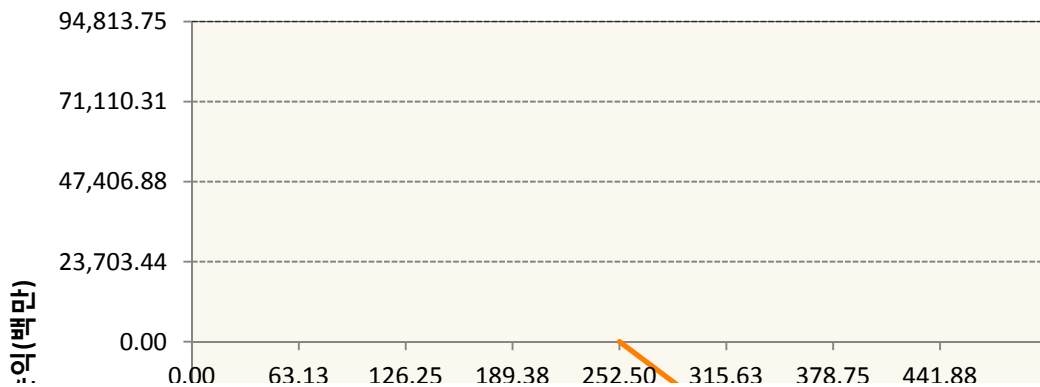
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,470	0	6,470	장내
누계	유가증권	옵션	0	364,213	-364,213	장내

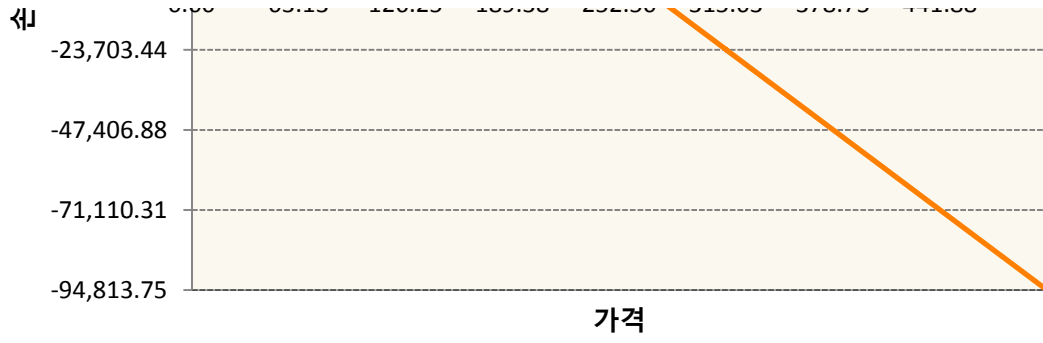
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

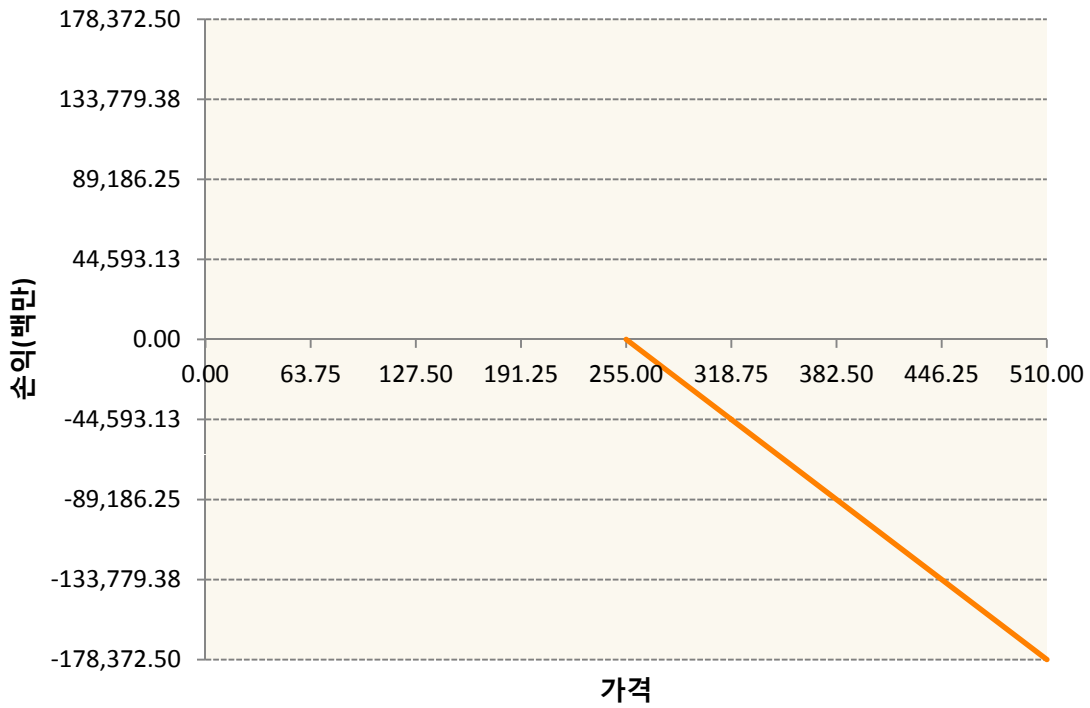


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

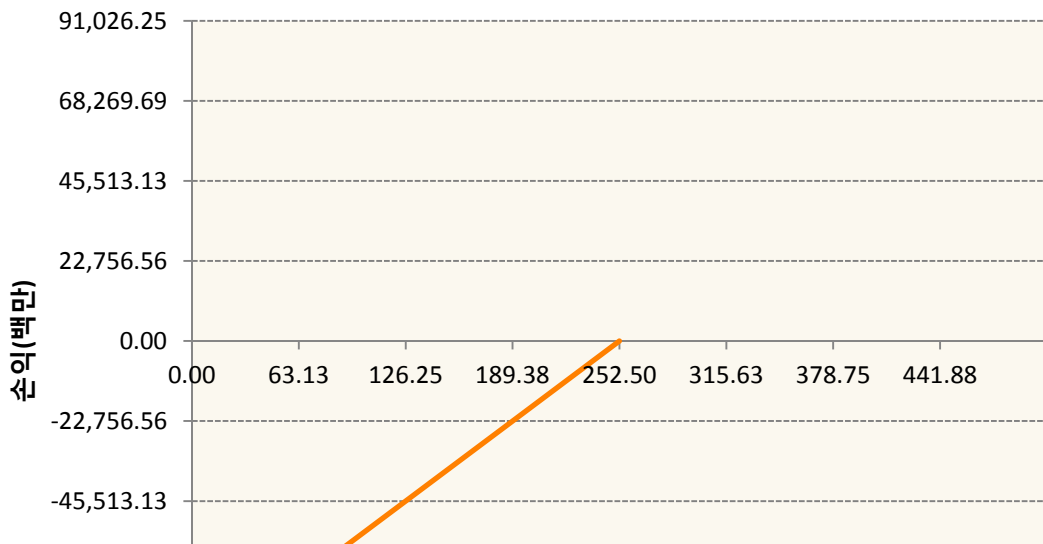


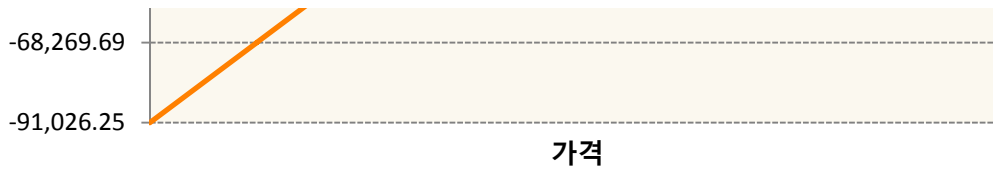


KR4201Q62550-2020-06 콜255



KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





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

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						519
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-519	-519	-519	-519	-519	-519	-519	
-5.33%	-346	-346	-346	-346	-346	-346	-346	
-2.67%	-173	-173	-173	-173	-173	-173	-173	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	173	173	173	173	173	173	173	
5.33%	346	346	346	346	346	346	346	
8.00%	519	519	519	519	519	519	519	
KR4201Q62527		2020-06 콜252.5						6,525
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4,415	4,166	3,905	3,635	3,359	3,077	2,791	
-5.33%	3,615	3,312	3,005	2,696	2,386	2,073	1,760	
-2.67%	2,462	2,136	1,810	1,484	1,158	832	507	
0%	948	635	319	0	-320	-642	-965	
2.67%	-894	-1,165	-1,447	-1,737	-2,034	-2,335	-2,641	
5.33%	-3,002	-3,215	-3,448	-3,695	-3,955	-4,224	-4,502	
8.00%	-5,304	-5,458	-5,636	-5,835	-6,051	-6,282	-6,525	
KR4201Q62550		2020-06 콜255						11,815
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	7,596	7,169	6,715	6,241	5,750	5,246	4,731	
-5.33%	6,313	5,772	5,220	4,660	4,095	3,524	2,949	
-2.67%	4,403	3,797	3,191	2,584	1,976	1,368	761	
0%	1,823	1,217	610	0	-611	-1,222	-1,835	
2.67%	-1,393	-1,938	-2,497	-3,067	-3,645	-4,229	-4,819	
5.33%	-5,145	-5,591	-6,066	-6,565	-7,082	-7,615	-8,160	
8.00%	-9,308	-9,641	-10,017	-10,427	-10,867	-11,331	-11,815	
KR4301Q62525		2020-06 풋252.5						4,679
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,974	-4,068	-4,173	-4,288	-4,412	-4,542	-4,679	
-5.33%	-1,959	-2,116	-2,277	-2,442	-2,610	-2,780	-2,952	
-2.67%	-443	-630	-817	-1,004	-1,191	-1,378	-1,565	

0%	501	338	171	0	-174	-349	-527
2.67%	976	870	752	623	487	344	195
5.33%	1,167	1,114	1,047	966	874	772	661
8.00%	1,228	1,207	1,176	1,133	1,080	1,015	940

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

(단위:백만원)

**21,573**

공시일	2020-05-25
기준일	2020-05-22

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

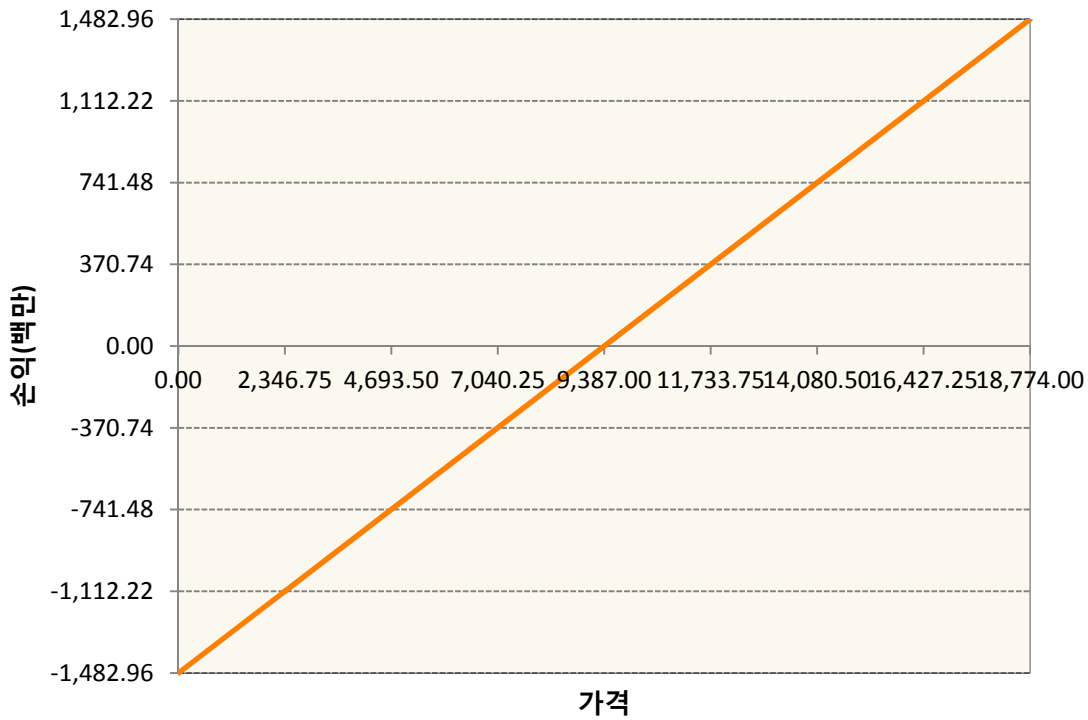
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

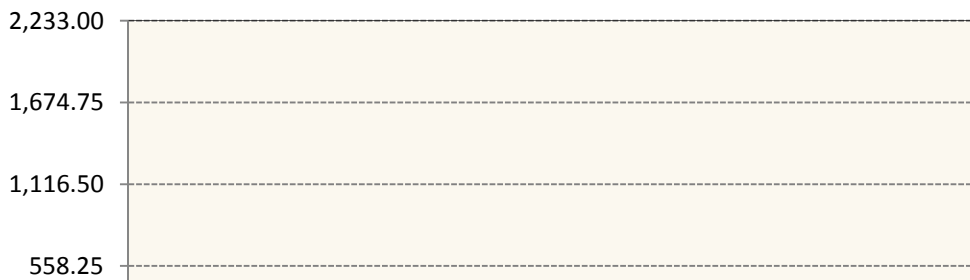
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,483	0	1,483	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,466	-4,466	장내
누계	통화	선도	0	1,544	-1,544	장외

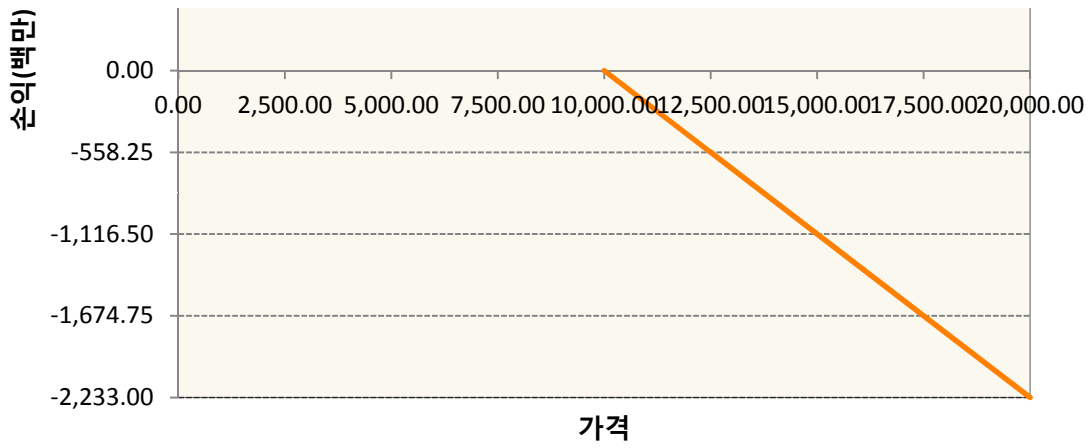
### 2. 만기시점의 손익구조

HCK0-HSCEI Futures May20

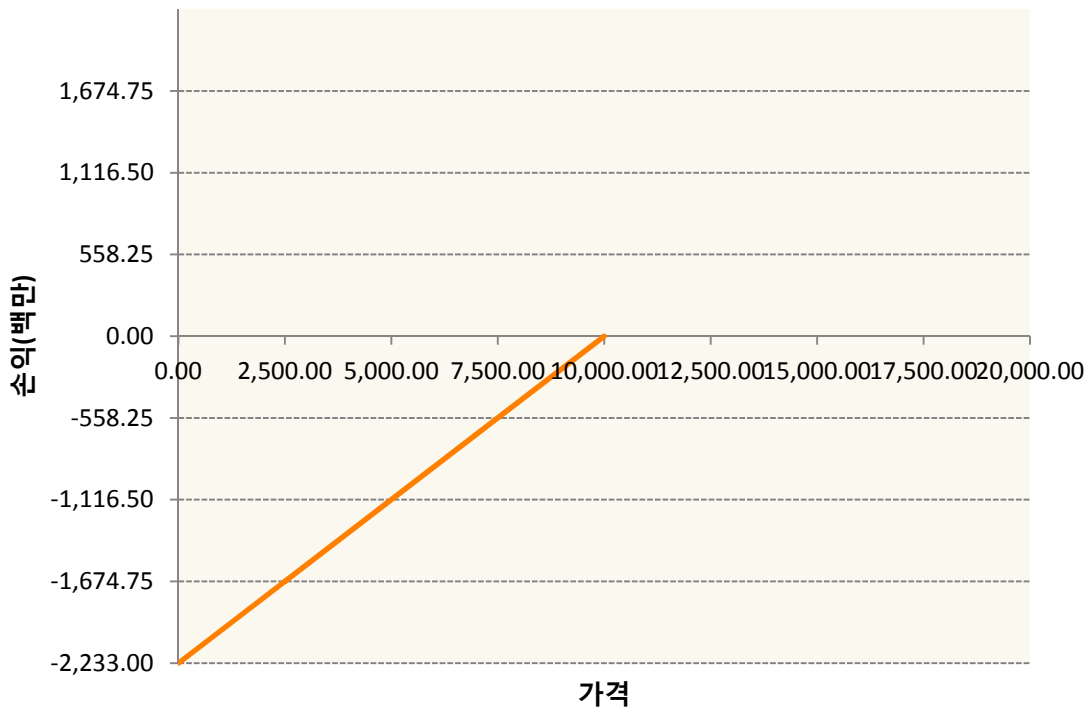


OHHIK0-C100-HSCEI





OHHIK0-P100-HSCEI



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020K02	KRW/HKD 21-08-20E	124
HCK0	HSCEI Futures May20	119
OHHIK0-C1C	HSCEI	179
OHHIK0-P10	HSCEI	179

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	574

공시일	2020-05-25
기준일	2020-05-22

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

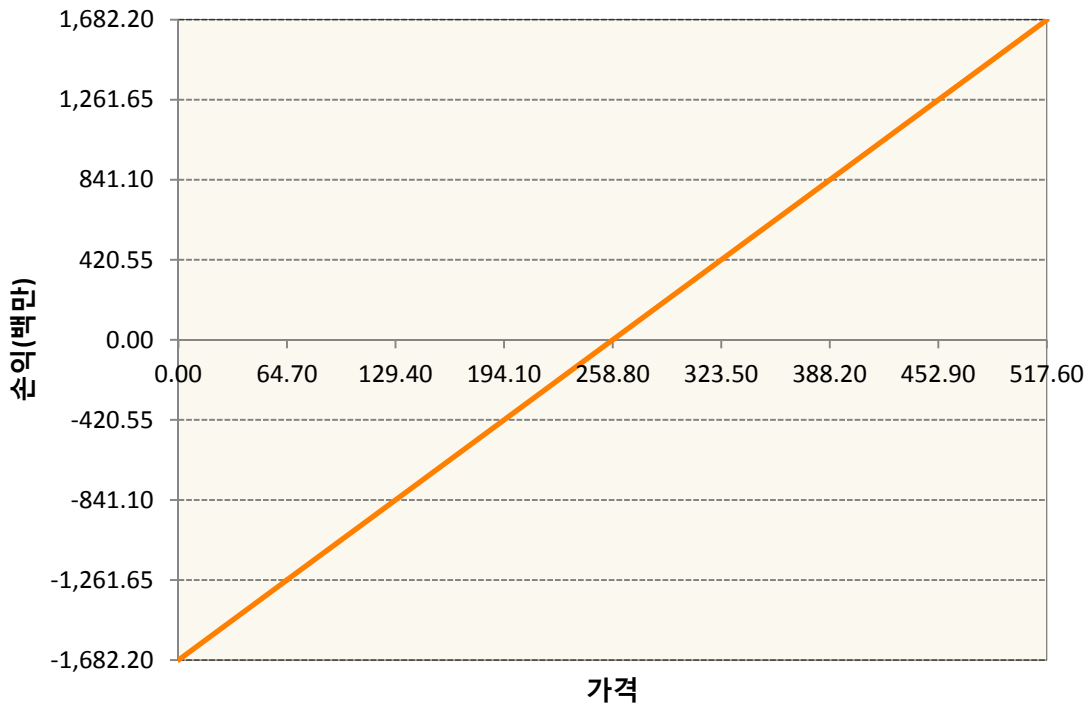
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

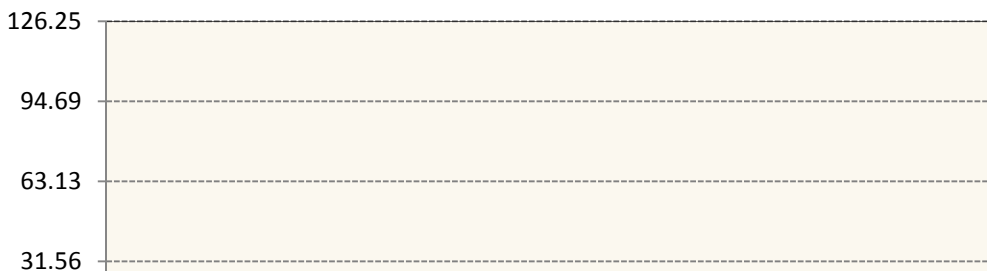
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,682	0	1,682	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,361	-3,361	장내

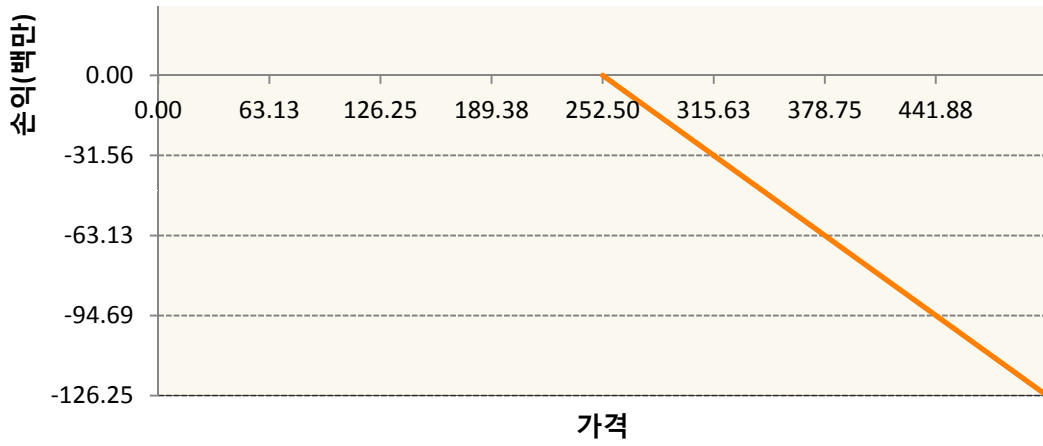
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

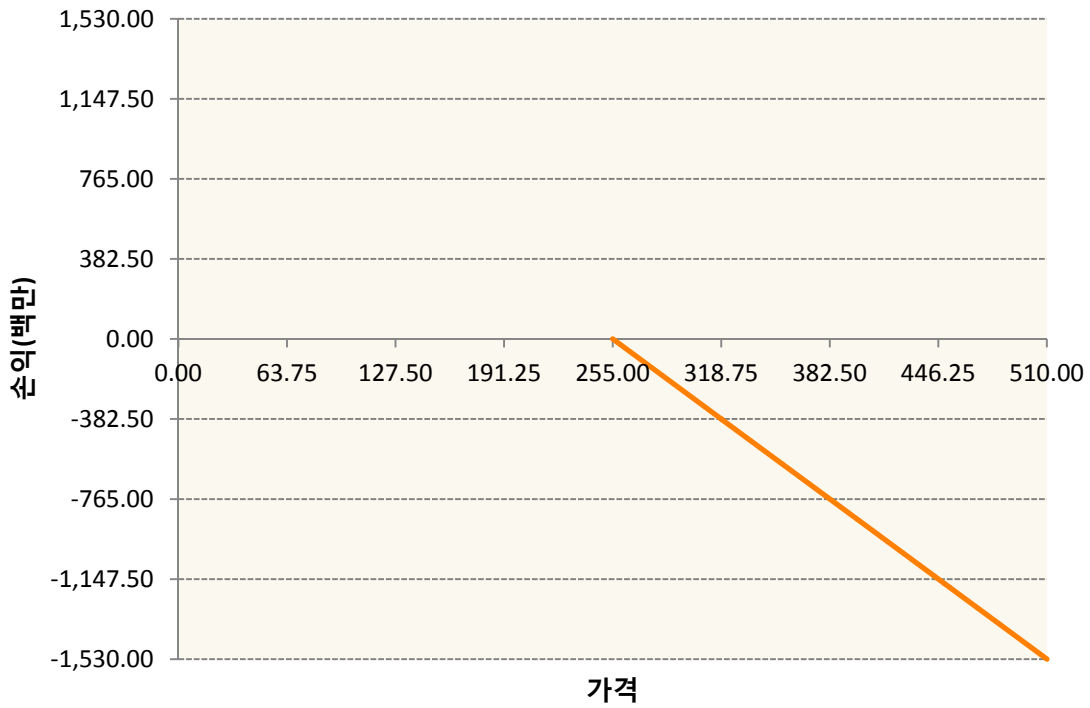


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

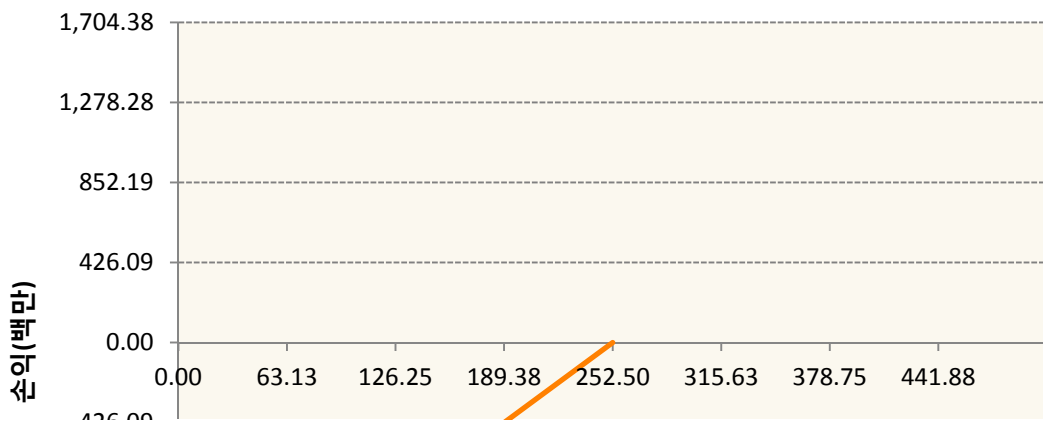




KR4201Q62550-2020-06 콜255



KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						190
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-190	-190	-190	-190	-190	-190	-190	
-5.33%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127	
-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%	127	127	127	127	127	127	127	
8.00%	190	190	190	190	190	190	190	
KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						135
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-135	-135	-135	-135	-135	-135	-135	
-5.33%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90	
-2.67%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	45	45	45	45	45	45	45	
5.33%	90	90	90	90	90	90	90	
8.00%	135	135	135	135	135	135	135	
KR4201Q62527		2020-06 콜252.5						9
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	6	6	5	5	4	4	4	
-5.33%	5	4	4	4	3	3	2	
-2.67%	3	3	2	2	2	1	1	
0%	1	1	0	0	0	-1	-1	
2.67%	-1	-2	-2	-2	-3	-3	-4	
5.33%	-4	-4	-5	-5	-5	-6	-6	
8.00%	-7	-7	-8	-8	-8	-8	-9	
KR4201Q62550		2020-06 콜255						101
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	65	61	58	54	49	45	41
-5.33%	54	50	45	40	35	30	25
-2.67%	38	33	27	22	17	12	7
0%	16	10	5	0	-5	-10	-16
2.67%	-12	-17	-21	-26	-31	-36	-41
5.33%	-44	-48	-52	-56	-61	-65	-70
8.00%	-80	-83	-86	-89	-93	-97	-101
KR4301Q62525                      2020-06 풋252.5							88
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-74	-76	-78	-80	-83	-85	-88
-5.33%	-37	-40	-43	-46	-49	-52	-55
-2.67%	-8	-12	-15	-19	-22	-26	-29
0%	9	6	3	0	-3	-7	-10
2.67%	18	16	14	12	9	6	4
5.33%	22	21	20	18	16	14	12
8.00%	23	23	22	21	20	19	18

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

(단위:백만원)

**568**

공시일	2020-05-25
기준일	2020-05-22

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

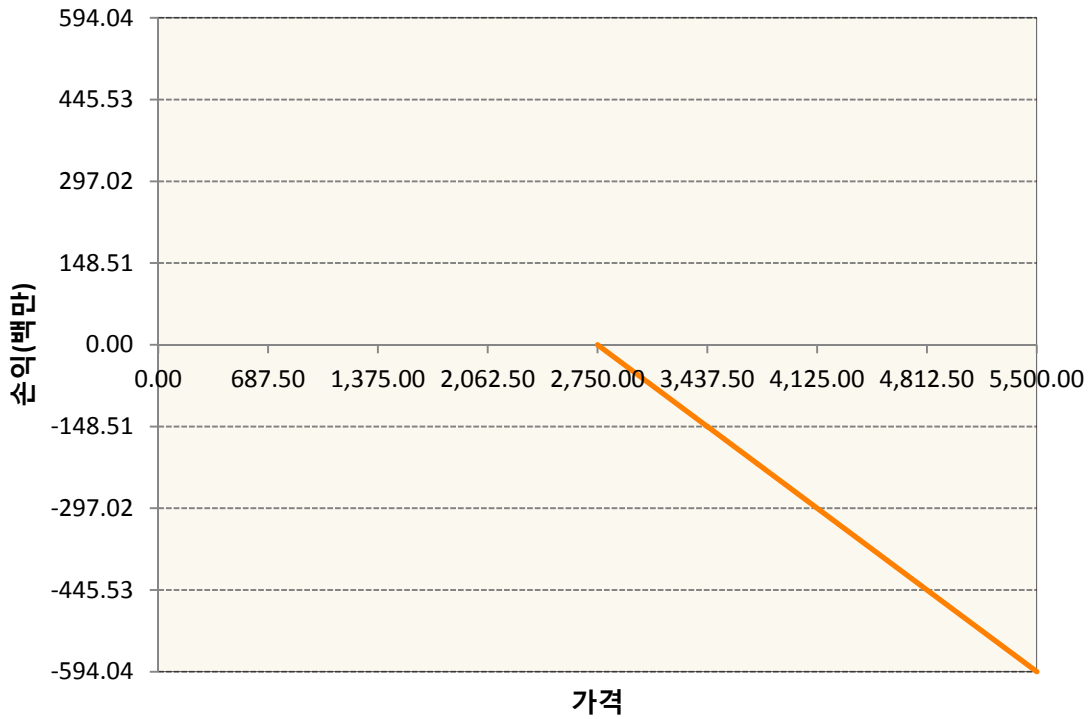
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

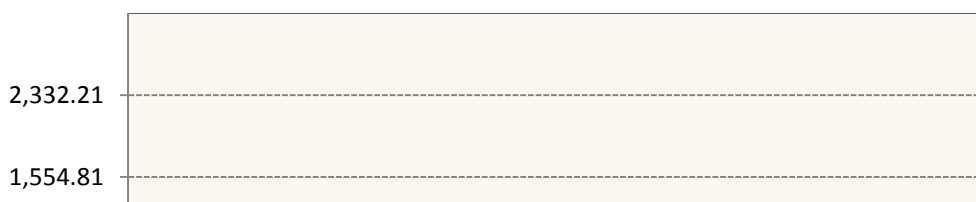
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,549	0	1,549	
누계	유가증권	스왑	8,052	0	8,052	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,407	-7,407	장내
누계	통화	선도	0	2,922	-2,922	장외

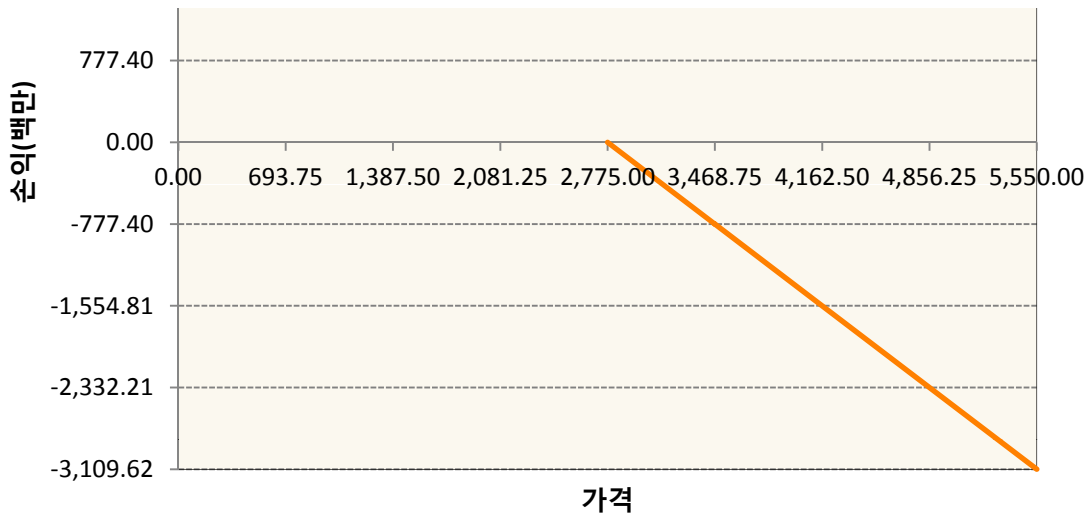
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXM0-C2750-EURO STOXX 50**

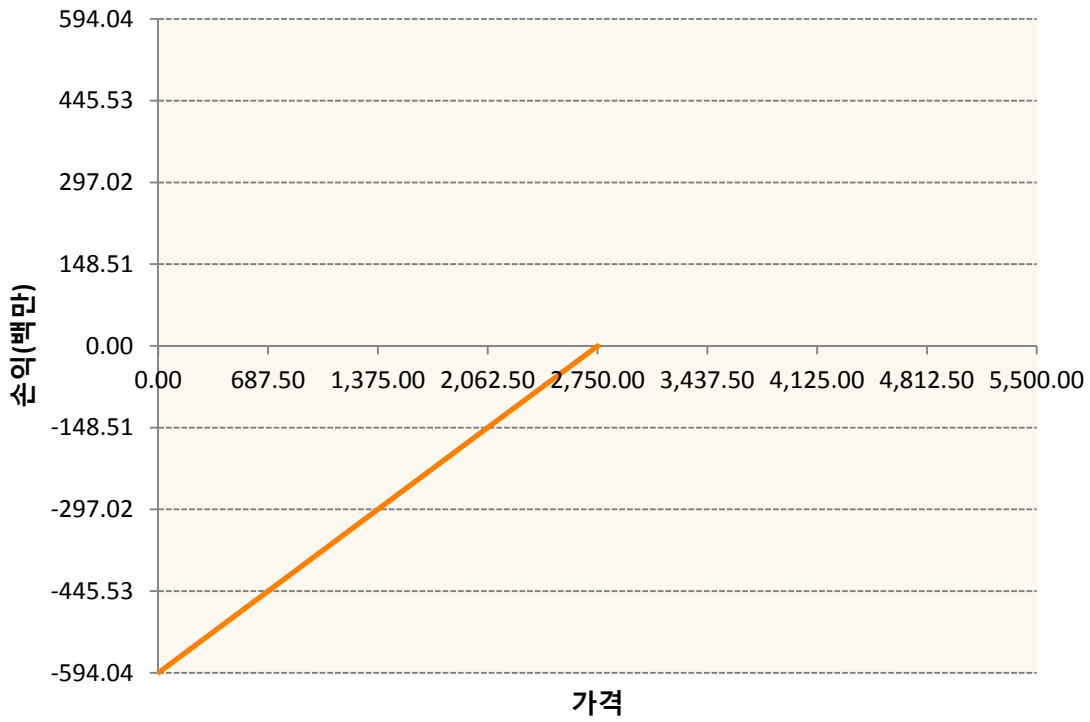


**OESXM0-C2775-EURO STOXX 50**

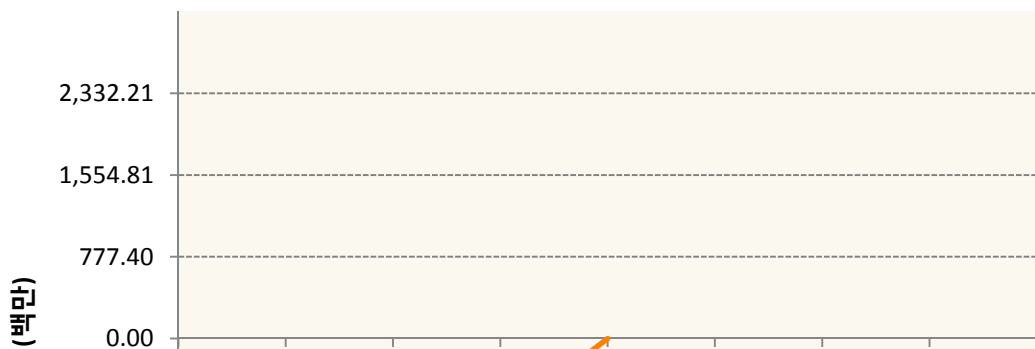


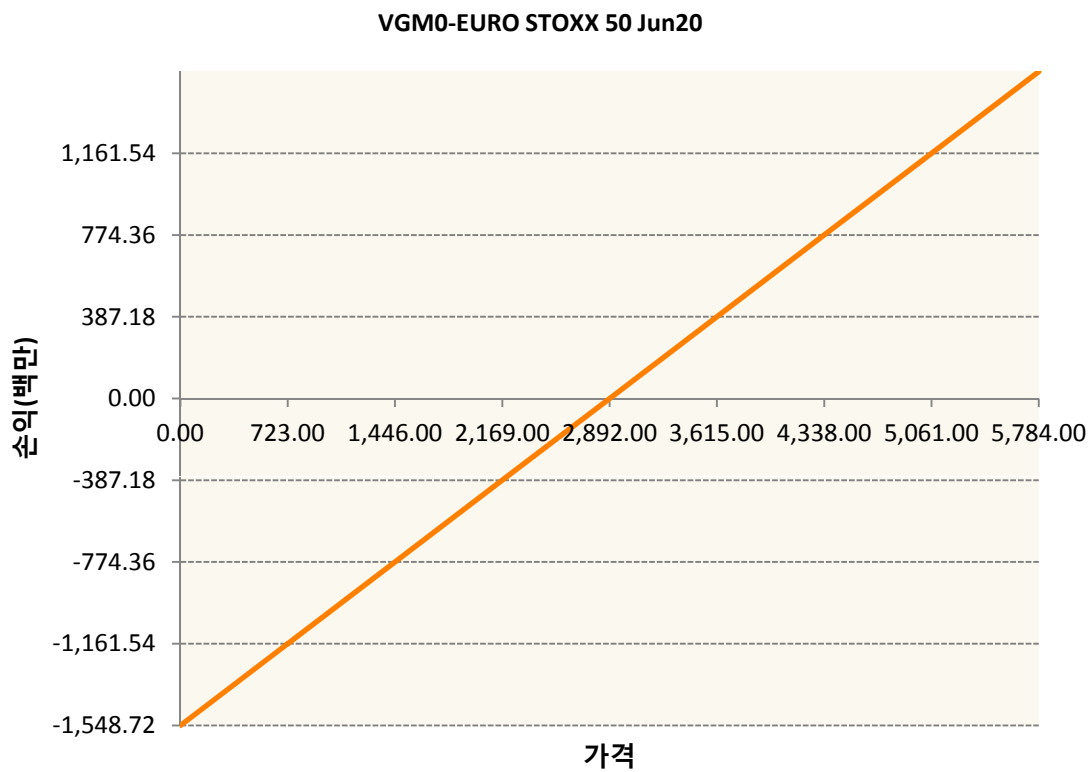
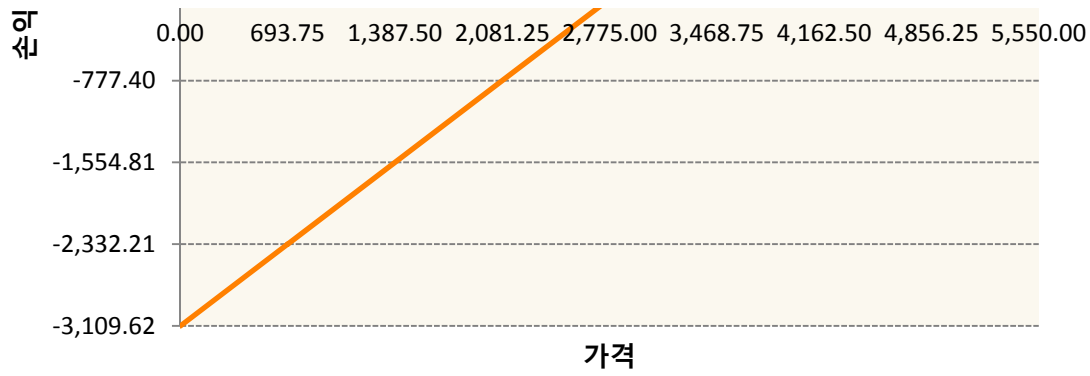


**OESXM0-P2750-EURO STOXX 50**



**OESXM0-P2775-EURO STOXX 50**





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		13
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E		219
FX21020K02 KRW/EUR 26-06-20E		15
OESXM0-C2' EURO STOXX 50		48
OESXM0-C2' EURO STOXX 50		249
OESXM0-P2' EURO STOXX 50		48
OESXM0-P2' EURO STOXX 50		249
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20		124

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

(단위:백만원)

1,090



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

(단위:백만원)

1,159

공시일	2020-05-25
기준일	2020-05-22

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

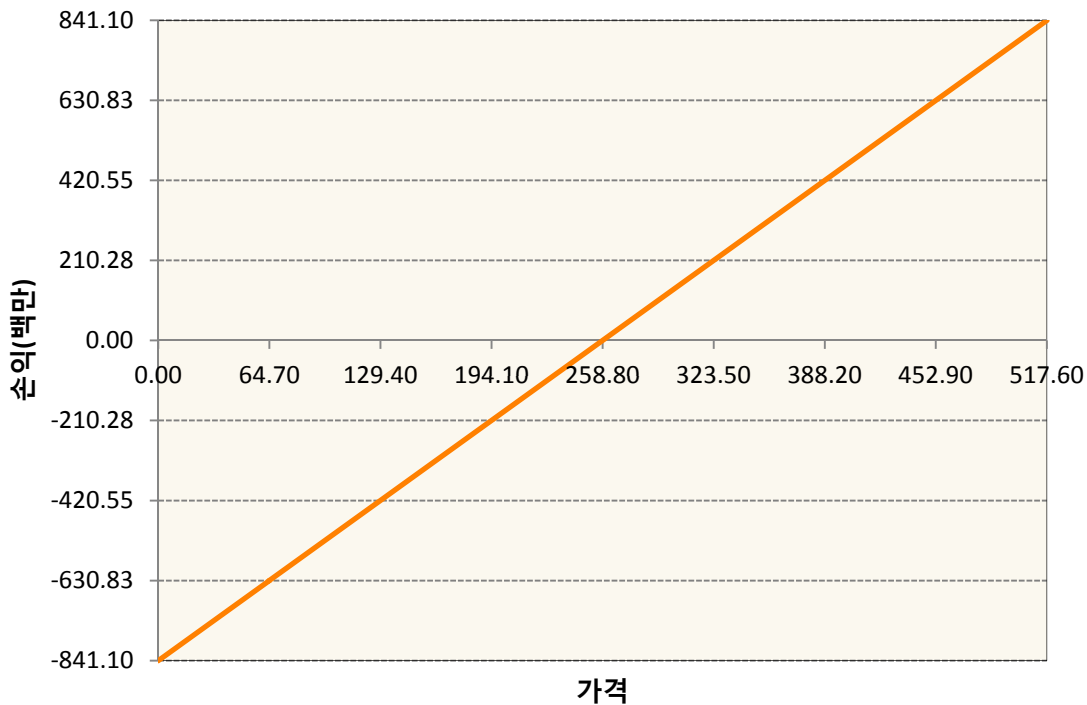
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	841	0	841	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						68
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68	
-5.33%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45	
-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%	45	45	45	45	45	45	45	
8.00%	68	68	68	68	68	68	68	

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

(단위:백만원)

100

공시일	2020-05-25
기준일	2020-05-22

## ETF스마트레버리지목표전환형10호

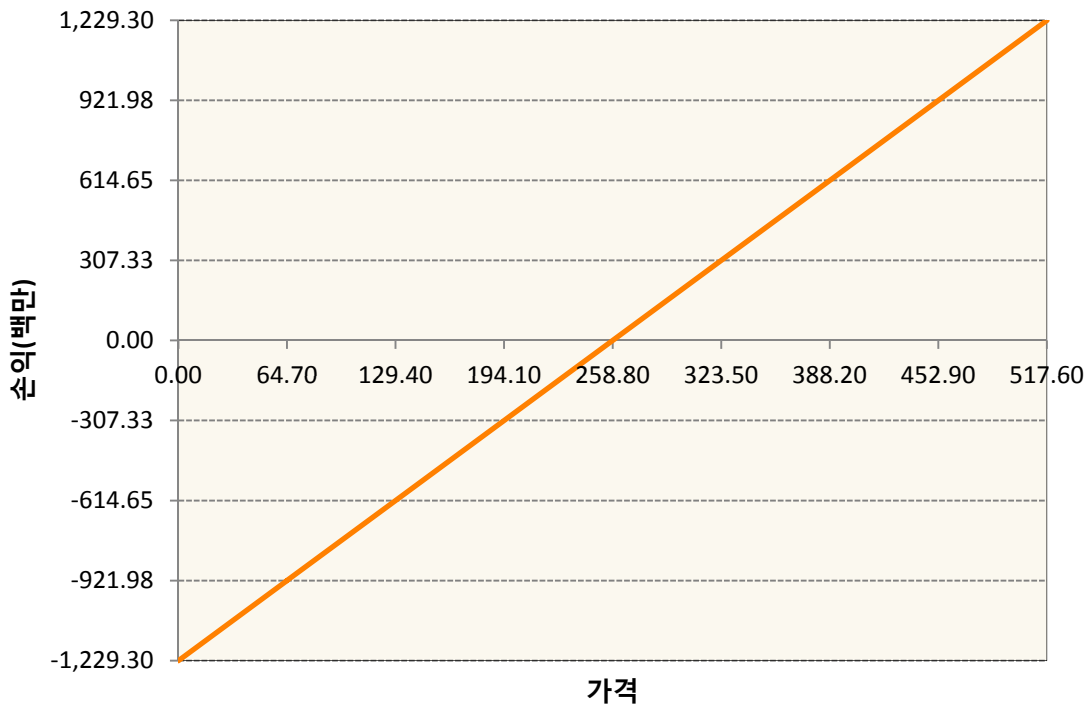
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,229	0	1,229	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002      2020-06 코스피200지수선물      99

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99
-5.33%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
-2.67%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	33	33	33	33	33	33	33
5.33%	66	66	66	66	66	66	66
8.00%	99	99	99	99	99	99	99

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

(단위:백만원)

147

공시일	2020-05-25
기준일	2020-05-22

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

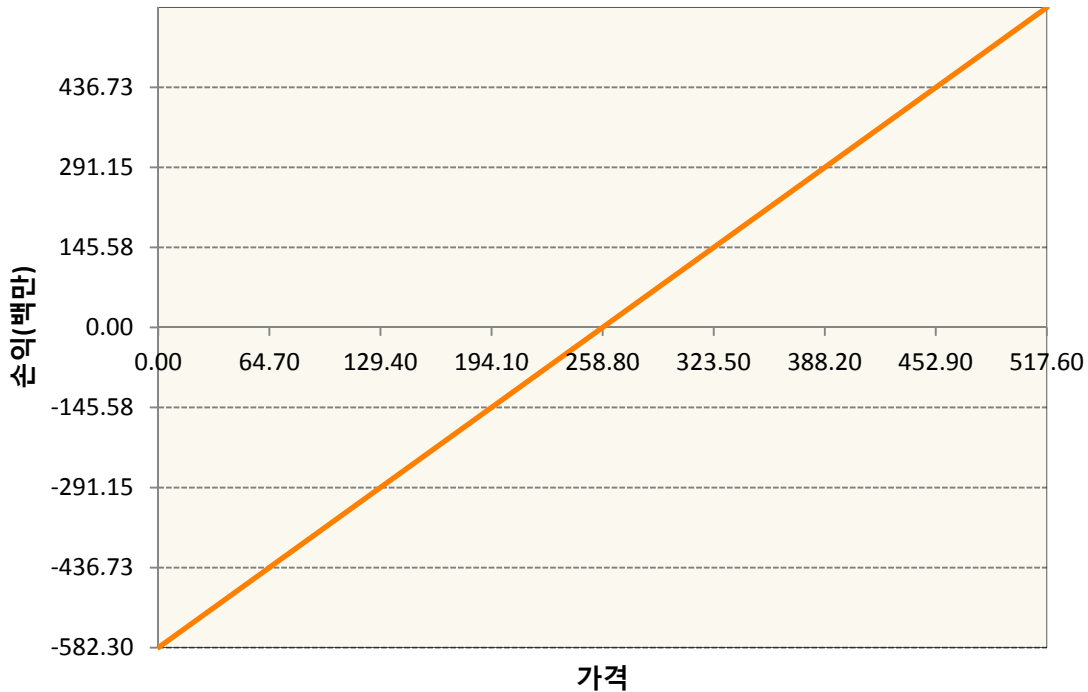
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	582	0	582	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%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31	
-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%	31	31	31	31	31	31	31	
8.00%	47	47	47	47	47	47	47	

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

(단위:백만원)

70

공시일	2020-05-25
기준일	2020-05-22

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

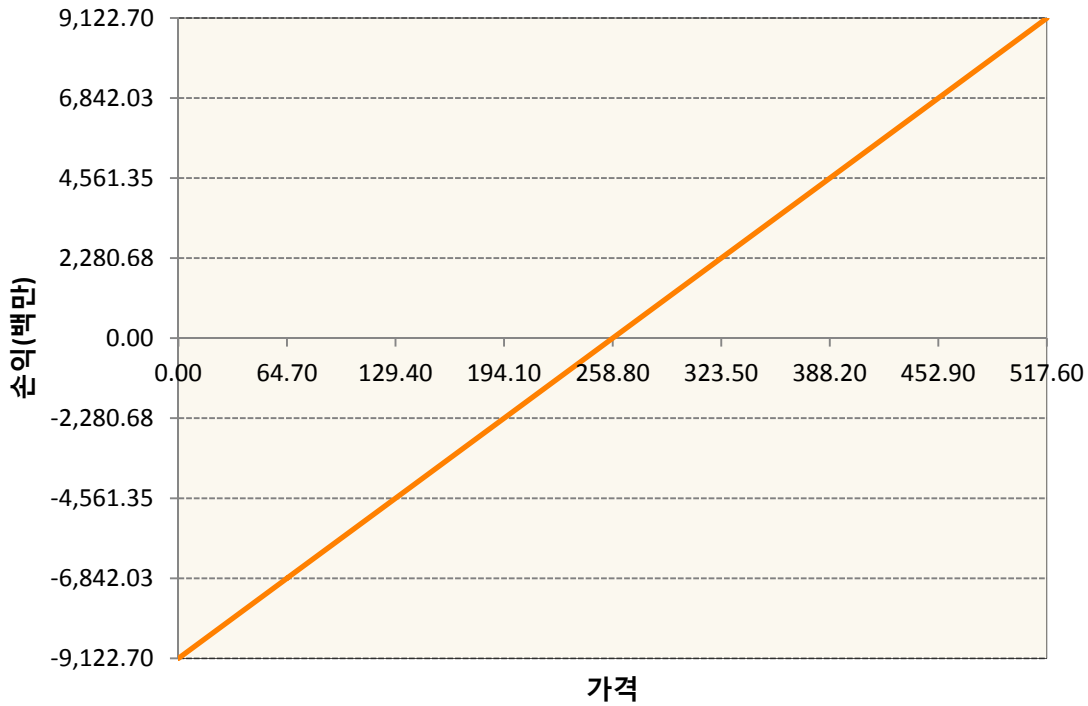
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

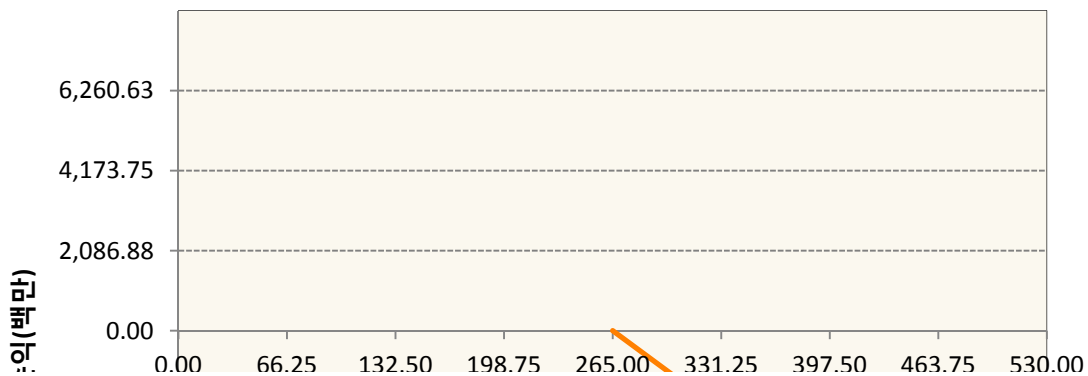
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,123	0	9,123	장내
누계	유가증권	옵션	2,917	17,911	-14,994	장내

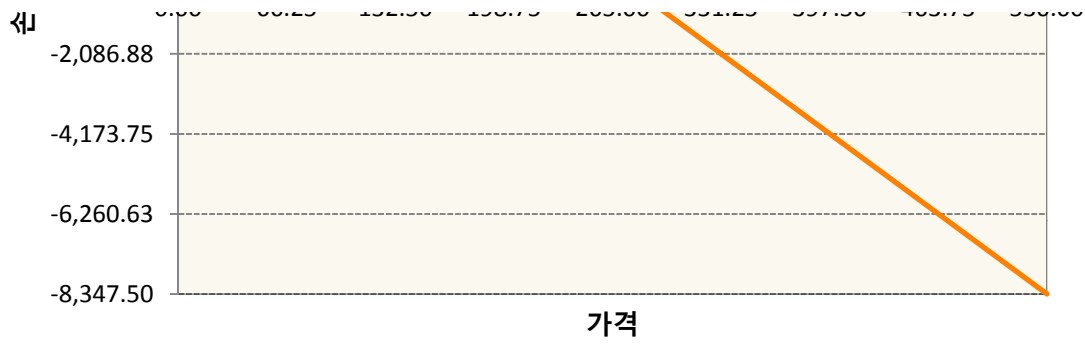
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

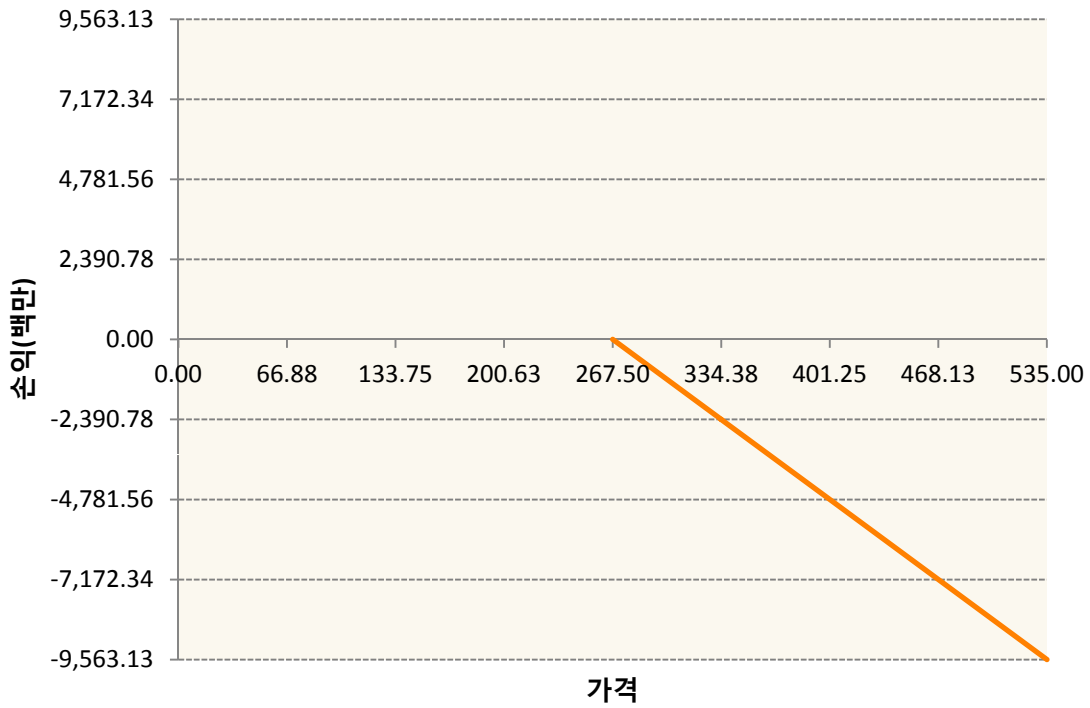


KR4201Q62659-2020-06 콜265

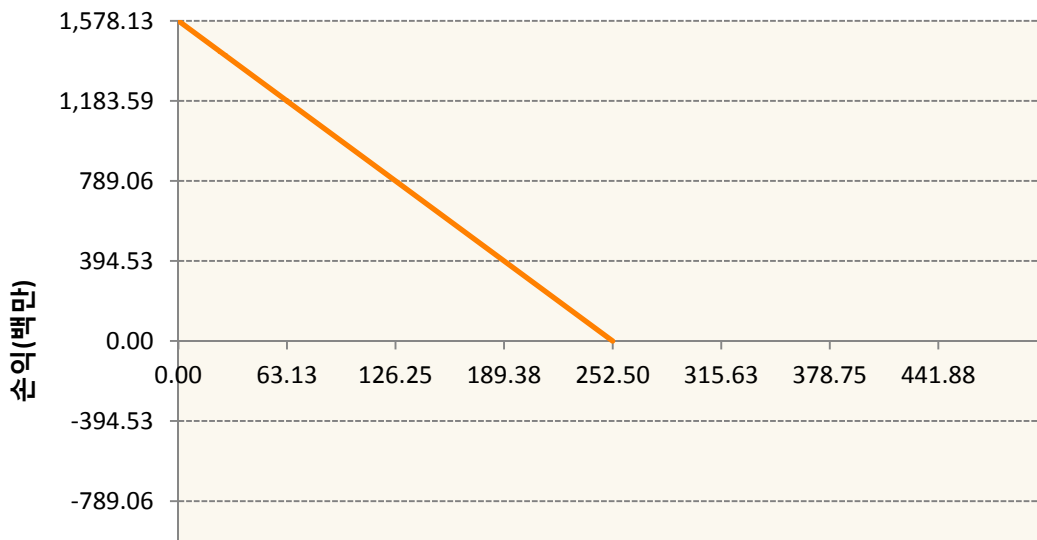


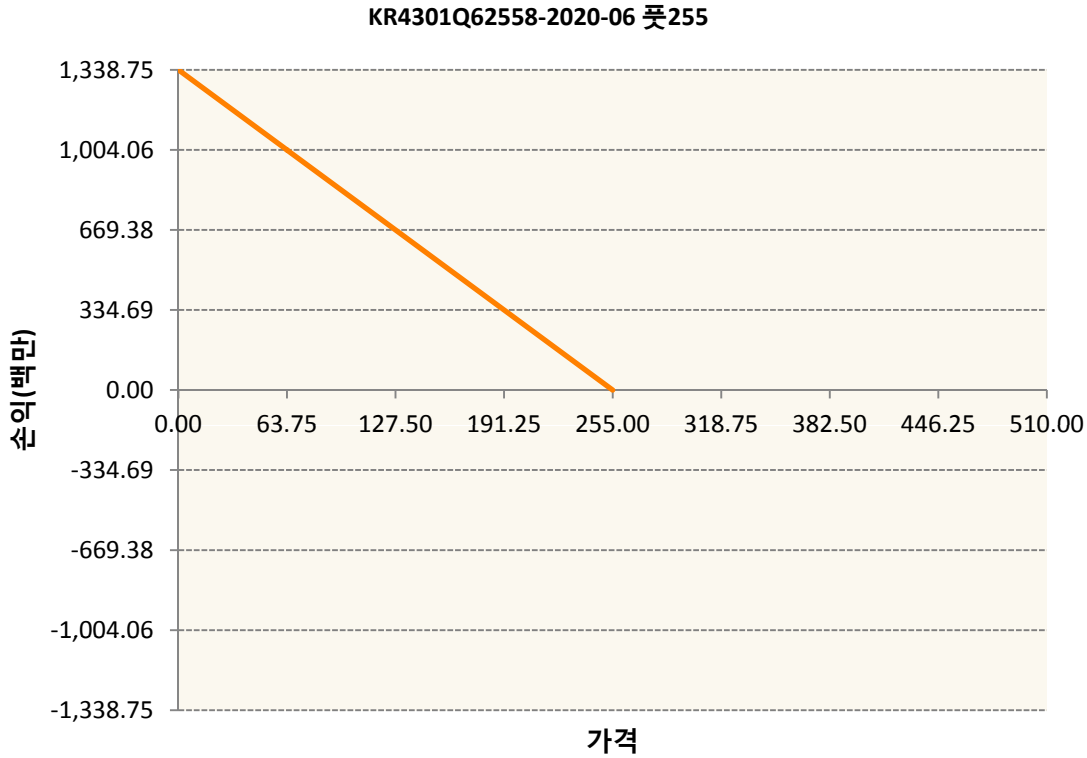
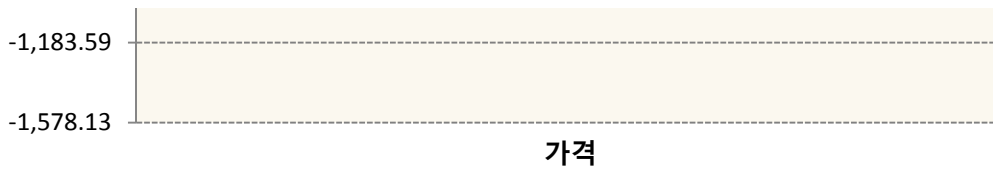


KR4201Q62675-2020-06 콜267.5



KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





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

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						732
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-732	-732	-732	-732	-732	-732	-732	
-5.33%	-488	-488	-488	-488	-488	-488	-488	
-2.67%	-244	-244	-244	-244	-244	-244	-244	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	244	244	244	244	244	244	244	
5.33%	488	488	488	488	488	488	488	
8.00%	732	732	732	732	732	732	732	
KR4201Q62659		2020-06 콜265						461
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	235	223	209	193	176	158	139	
-5.33%	206	188	169	148	127	104	81	
-2.67%	157	134	109	85	59	34	8	

0%	83	55	28	0	-28	-56	-84
2.67%	-20	-49	-78	-106	-135	-164	-193
5.33%	-152	-179	-207	-235	-263	-291	-319
8.00%	-309	-333	-357	-383	-408	-435	-461
KR4201Q62675                      2020-06 콜267.5							502
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	239	227	213	197	179	160	140
-5.33%	212	194	174	152	129	105	80
-2.67%	165	140	114	87	60	32	3
0%	92	61	31	0	-31	-62	-94
2.67%	-14	-46	-79	-112	-145	-178	-210
5.33%	-152	-184	-216	-249	-281	-314	-347
8.00%	-320	-349	-378	-408	-439	-470	-502
KR4301Q62525                      2020-06 풋252.5							81
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	69	71	72	74	76	79	81
-5.33%	34	37	39	42	45	48	51
-2.67%	8	11	14	17	21	24	27
0%	-9	-6	-3	0	3	6	9
2.67%	-17	-15	-13	-11	-8	-6	-3
5.33%	-20	-19	-18	-17	-15	-13	-11
8.00%	-21	-21	-20	-20	-19	-18	-16
KR4301Q62558                      2020-06 풋255							74
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	65	66	67	69	70	72	74
-5.33%	34	36	38	40	42	45	47
-2.67%	9	11	14	17	20	22	25
0%	-8	-5	-3	0	3	5	8
2.67%	-17	-15	-13	-11	-9	-6	-4
5.33%	-21	-20	-19	-17	-16	-14	-12
8.00%	-23	-22	-21	-21	-20	-18	-17

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

(단위:백만원)

1,971

공시일	2020-05-25
기준일	2020-05-22

## 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	153,469	0	153,469	

### 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	2020-05-25
기준일	2020-05-22

## 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	103,475	0	103,475	

### 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	2020-05-25
기준일	2020-05-22

## 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	457,161	0	457,161	
누계	통화	선도	0	464,741	-464,741	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	851
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	742
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	495
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,464
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	7,026
FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E	2,969
FX21020J02€ KRW/USD 10-06-20E	1,346
FX21020J02£ KRW/USD 22-06-20E	1,524
FX21020J02¥ KRW/USD 22-06-20E	1,979
FX21020J03¥ KRW/USD 24-07-20E	2,227
FX21020J04¥ KRW/USD 24-07-20E	1,781
FX21020J04£ KRW/USD 24-07-20E	1,979
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	2,058
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	1,959
FX21020K01 KRW/USD 22-06-20E	693
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	2,415
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	990
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,039
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,643

IE00BD8RGM75

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

**18,841**



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

(단위:백만원)

201

공시일	2020-05-25
기준일	2020-05-22

## 커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

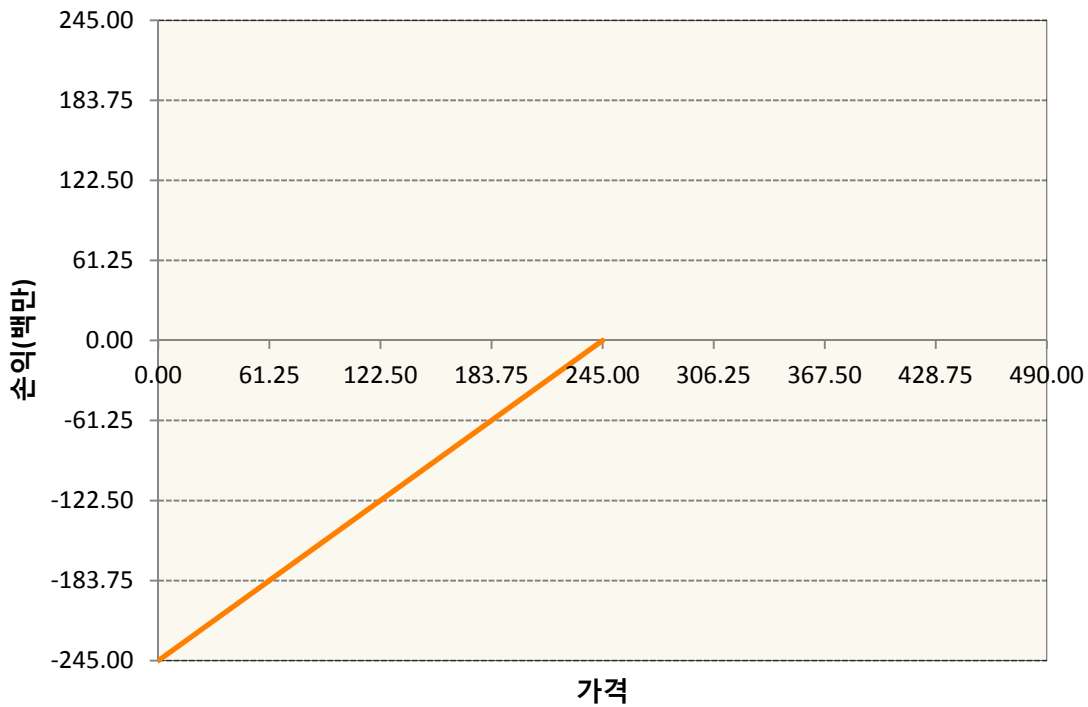
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

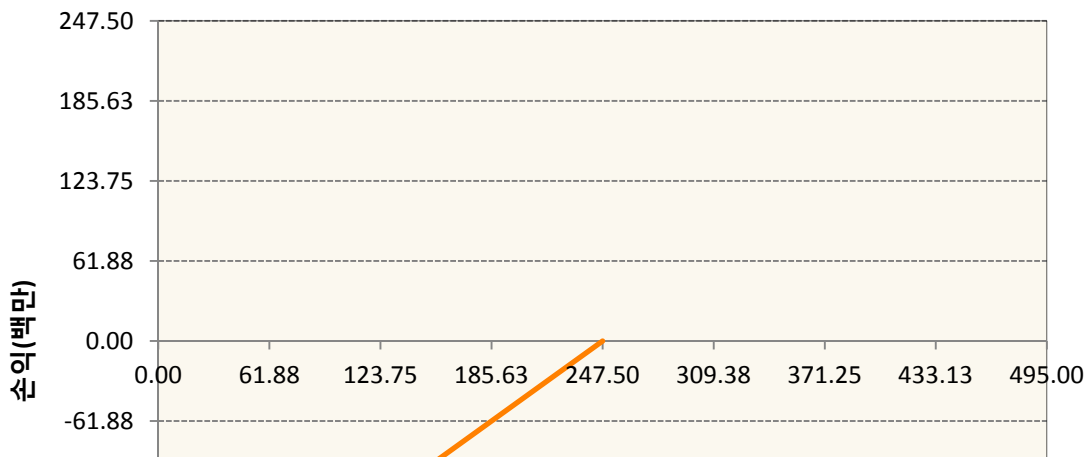
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	305	0	305	장내
누계	유가증권	옵션	0	493	-493	장내

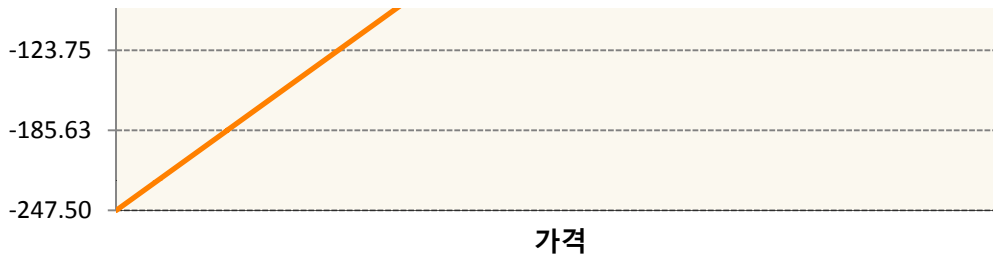
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q62459-2020-06 풋245



KR4301Q62475-2020-06 풋247.5





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

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

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

16

공시일	2020-05-25
기준일	2020-05-22

## 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	7,536	0	7,536	
누계	통화	선도	0	7,373	-7,373	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J04(KRW/USD 29-05-20E	255
FX21020K01 KRW/USD 15-06-20E	324
FX21020K03 KRW/USD 15-06-20E	11
IE00BD8RGM75	*

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

299

공시일	2020-05-25
기준일	2020-05-22

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

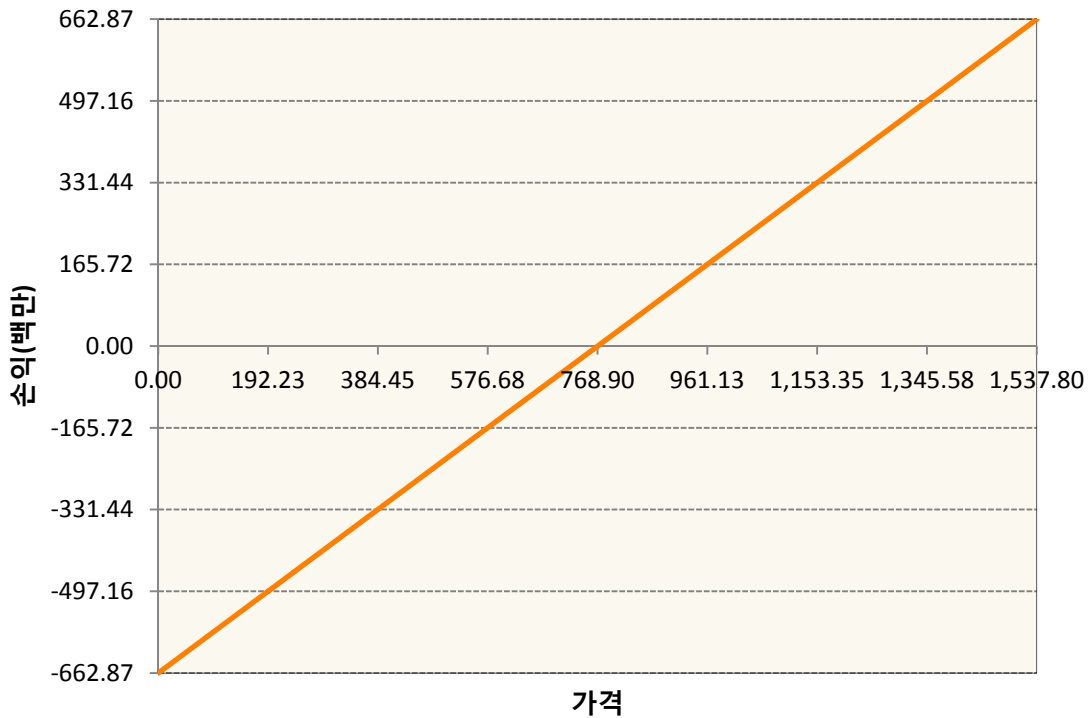
### 1. 계약금액

(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	663	0	663	
누계	유가증권	스왑	979	0	979	장외
누계	통화	선도	208	883	-675	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

VNCM0-VN30 Index Future Jun20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	78
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
FX21020J00¢ KRW/EUR 24-07-20E	5

FX21020J01	KRW/EUR 24-07-20E	3
FX21020J02	KRW/EUR 24-07-20E	5
FX21020J03	KRW/EUR 26-06-20E	5
FX21020J03	KRW/EUR 24-07-20E	1
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	53

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

(단위:백만원)

**169**

공시일	2020-05-25
기준일	2020-05-22

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

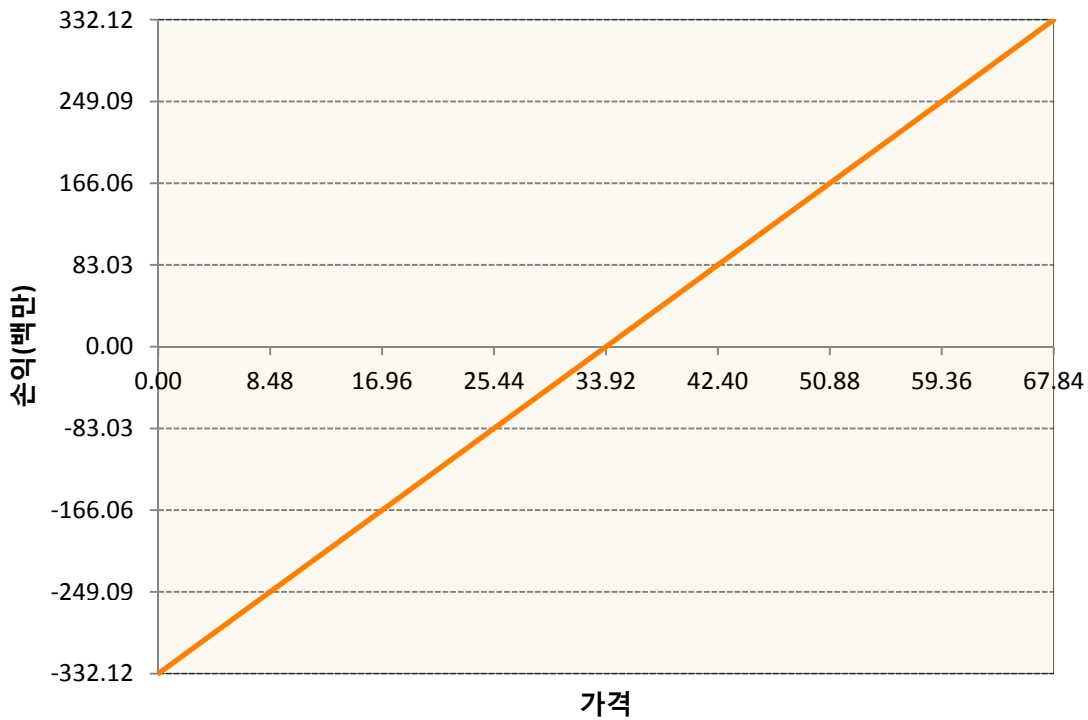
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

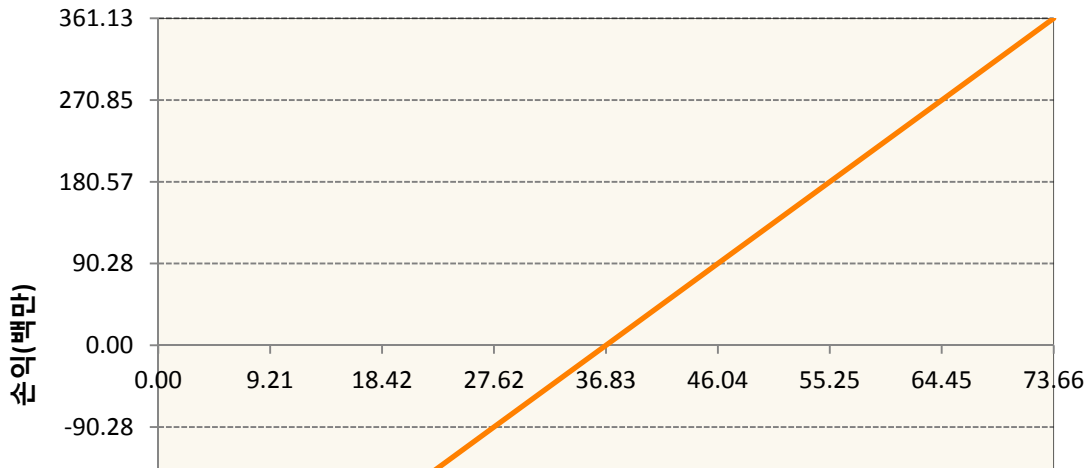
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,714	309	1,405	

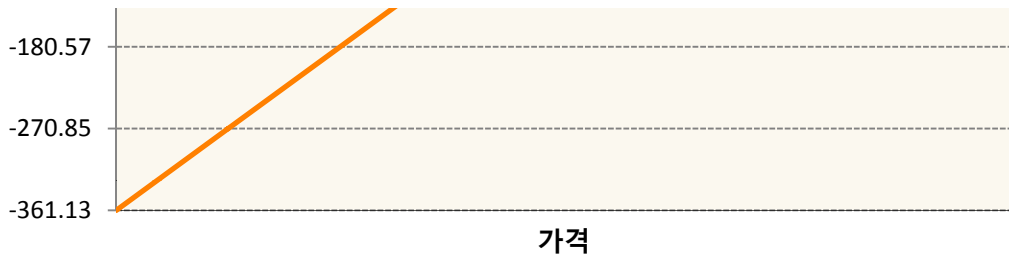
### 2. 만기시점의 손익구조

**CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20**

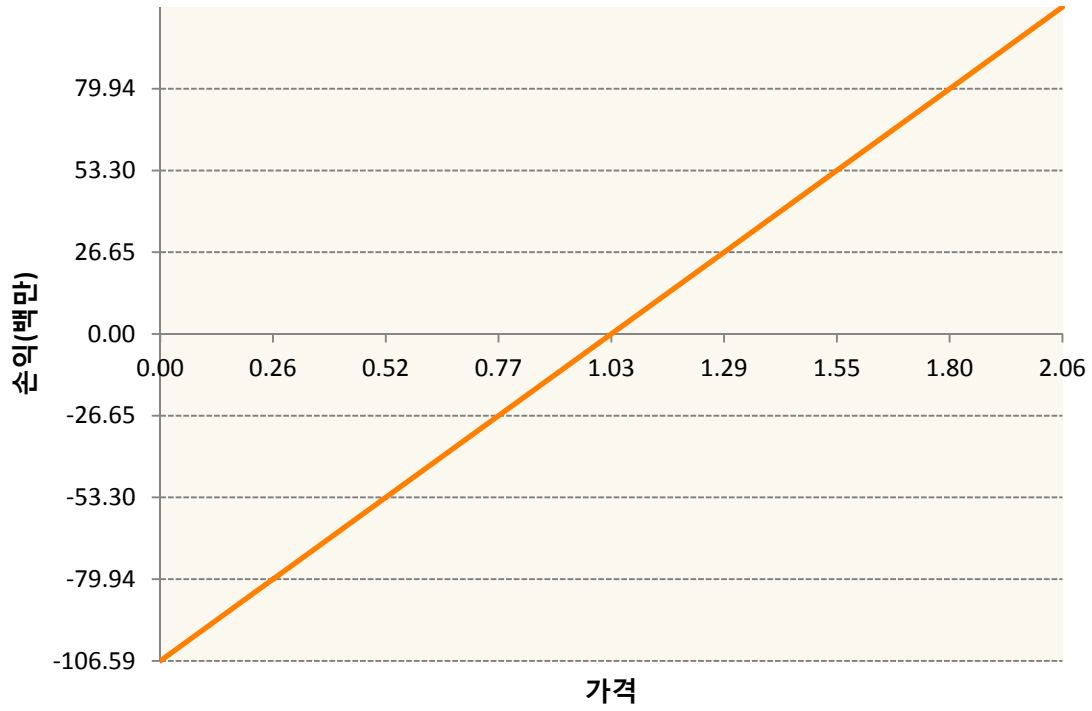


**COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20**

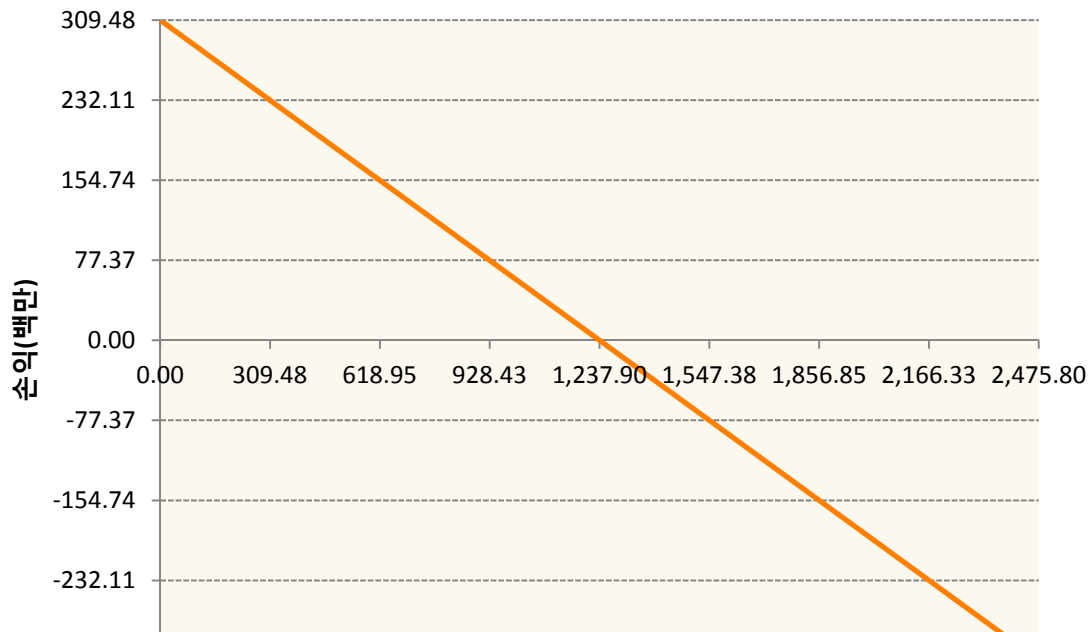


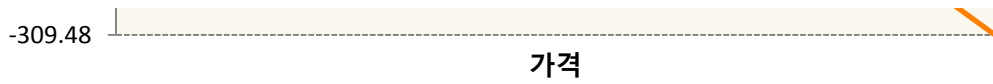


HON0-NY Harb ULSD Fut Jul20

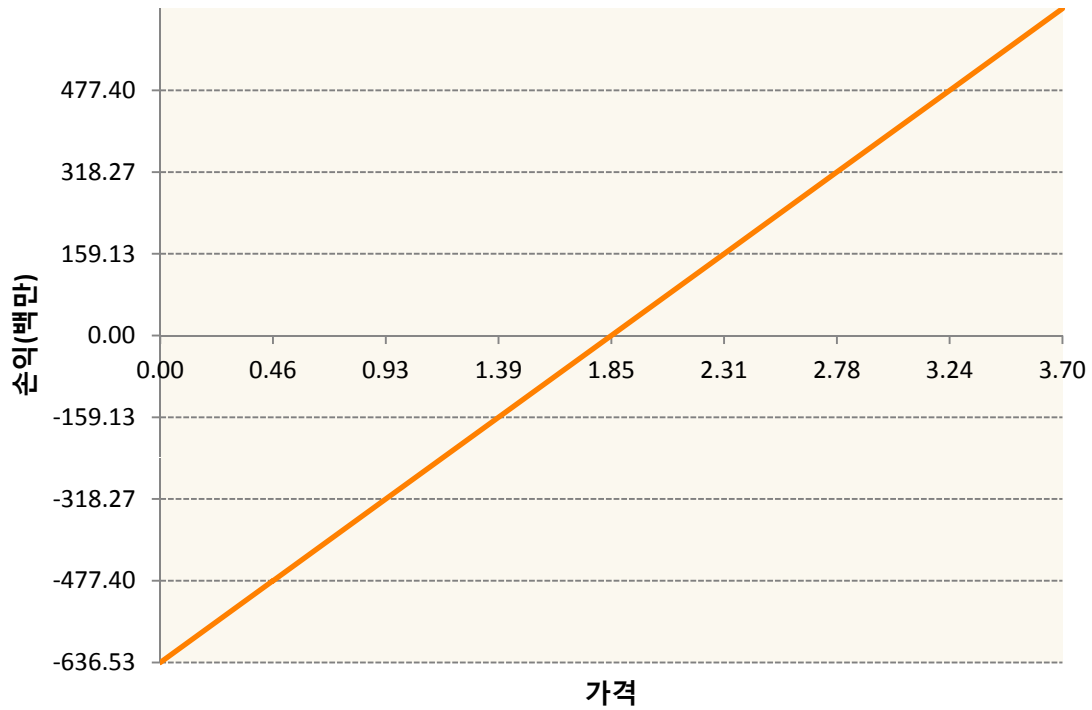


KR4175Q60006-2020-06 달러선물

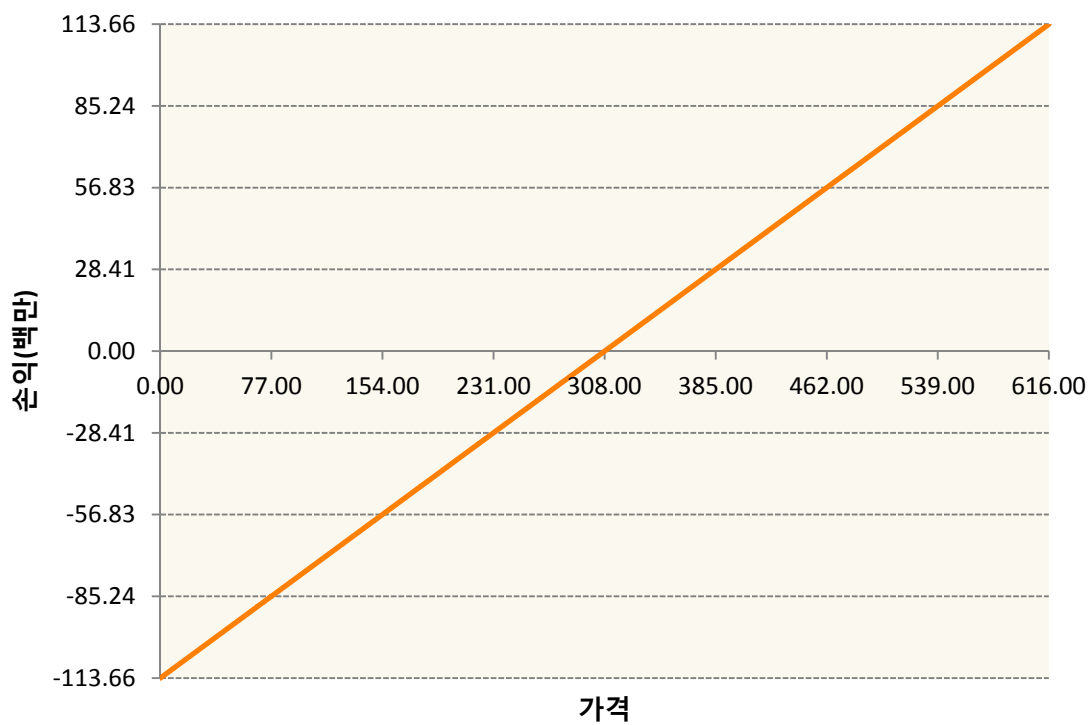




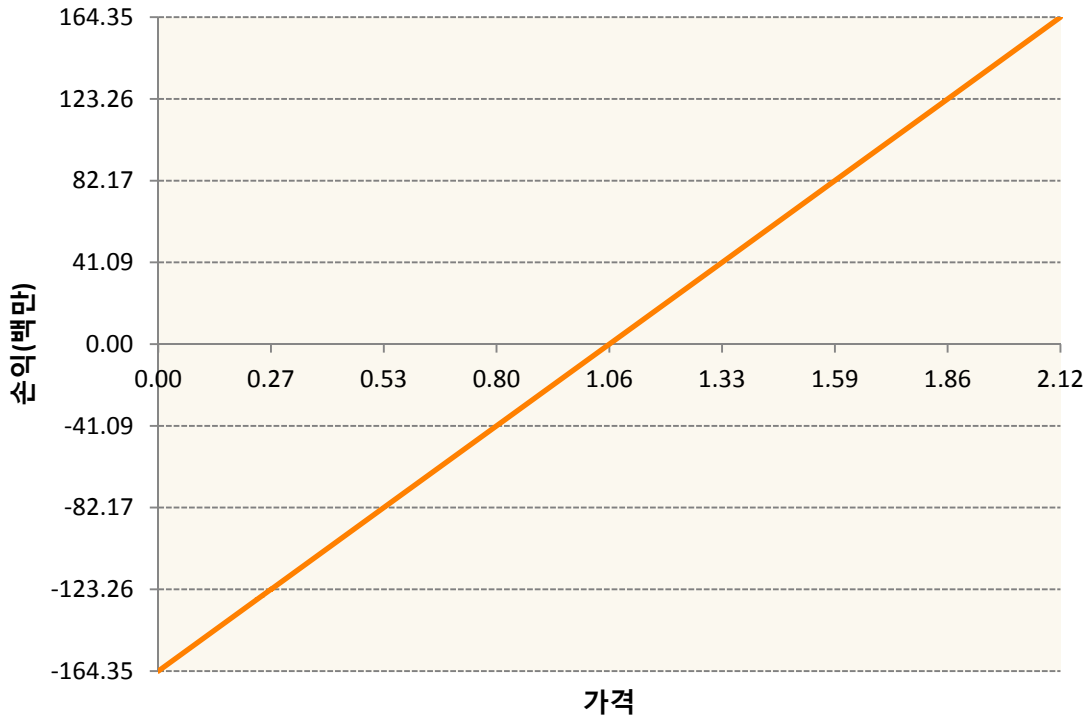
NGN20-NATURAL GAS FUTR Jul20



QSN0-Low Su Gasoil G Jul20



XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN0	WTI CRUDE FUTURE Jul20	27
COU0	BRENT CRUDE FUTR Sep20	29
HON0	NY Harb ULSD Fut Jul20	9
KR4175Q60C	2020-06 달러선물	25
NGN20	NATURAL GAS FUTR Jul20	51
QSN0	Low Su Gasoil G Jul20	9
XBN0	GASOLINE RBOB FUT Jul20	13

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

819

공시일	2020-05-25
기준일	2020-05-22

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

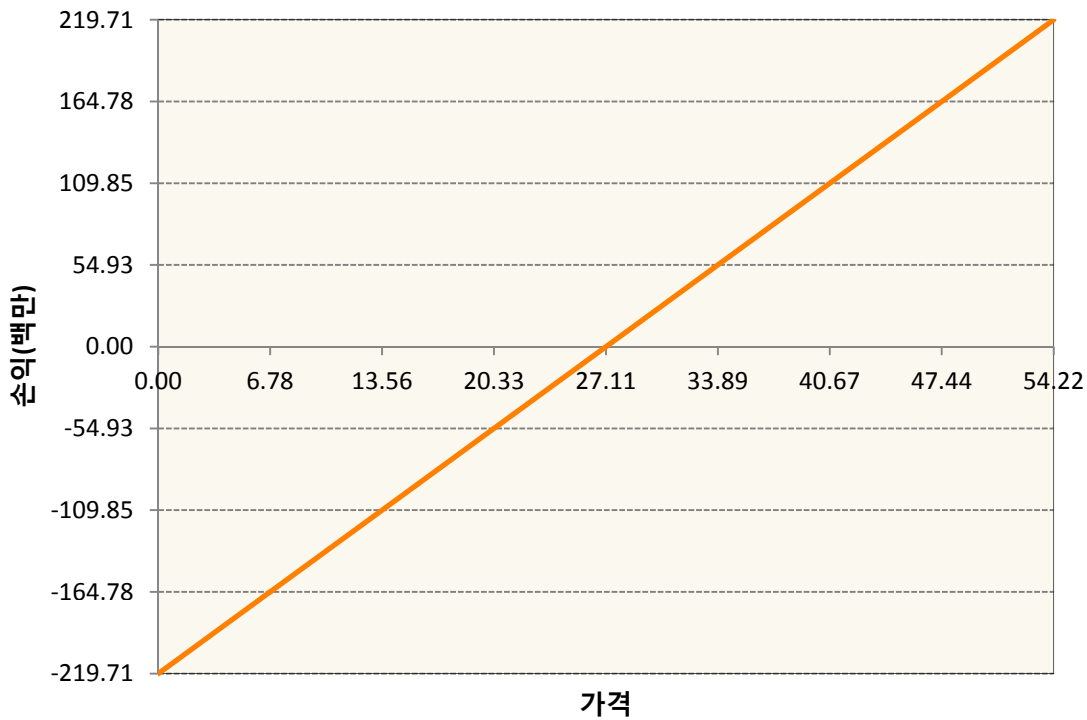
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

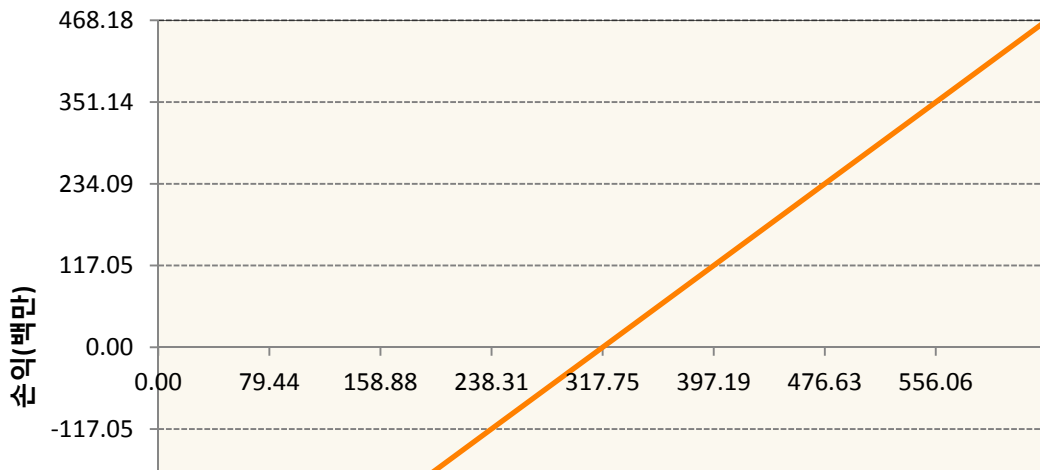
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,426	74	2,351	

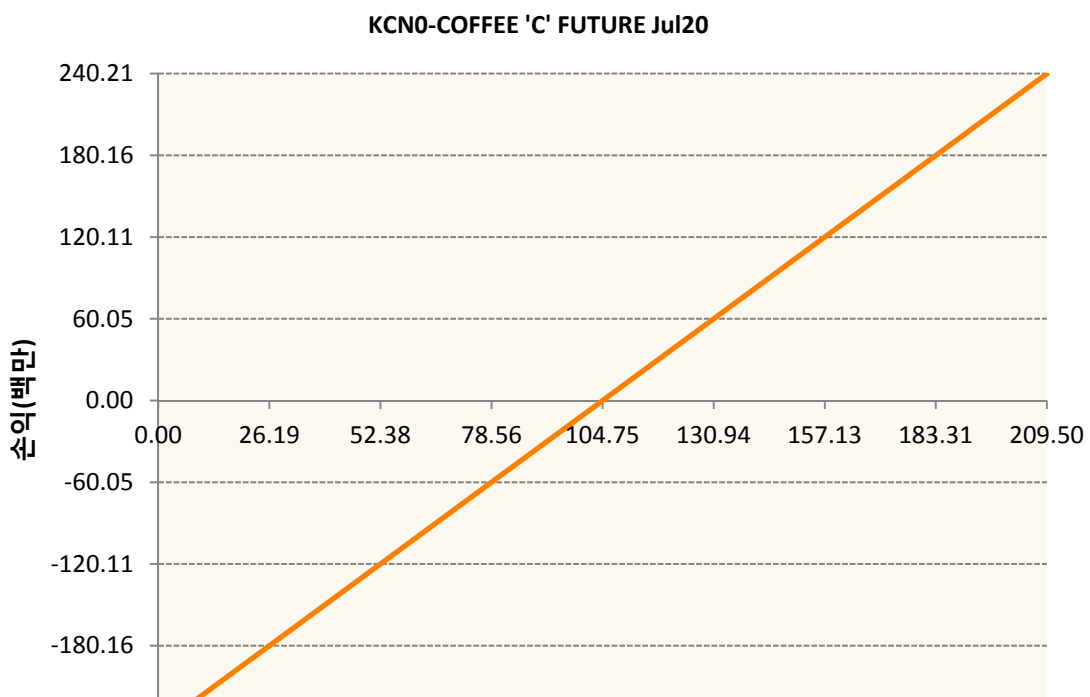
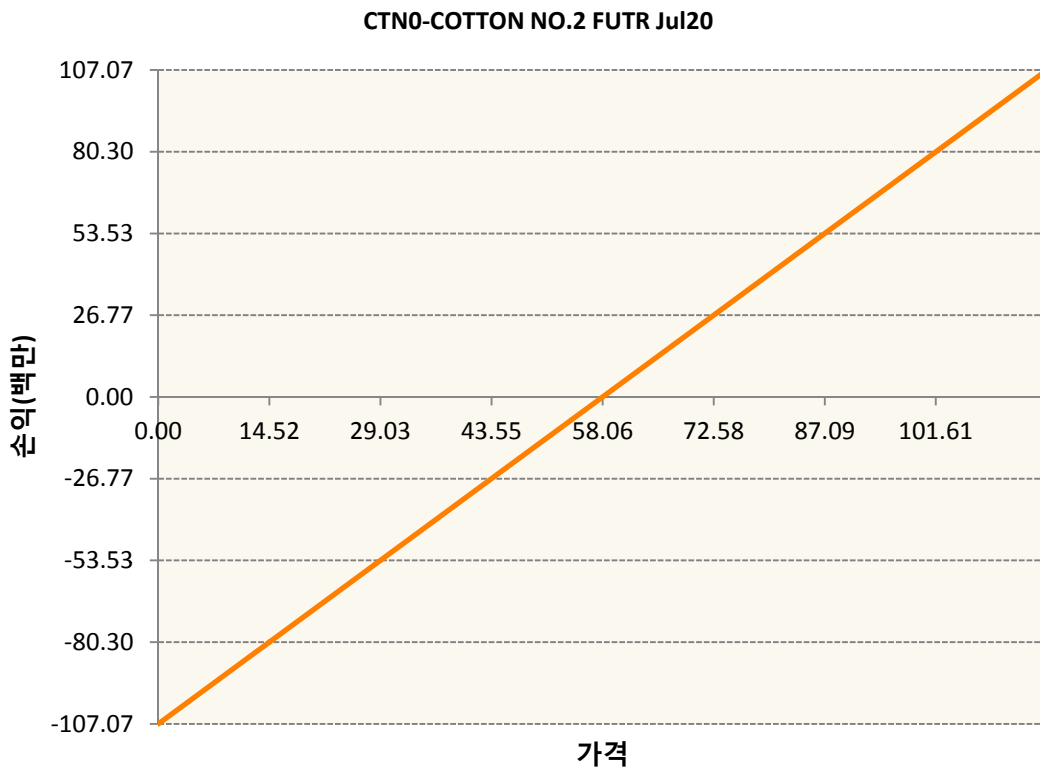
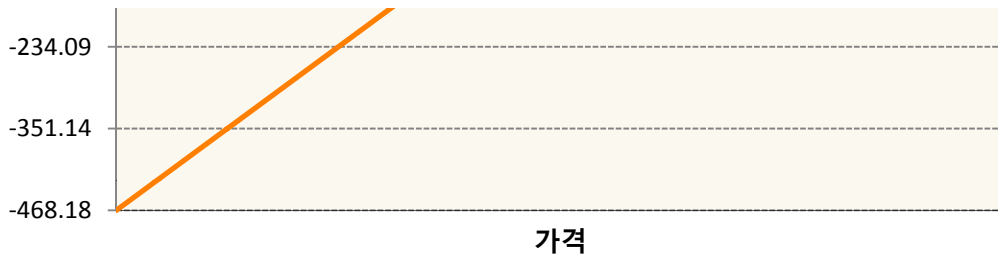
### 2. 만기시점의 손익구조

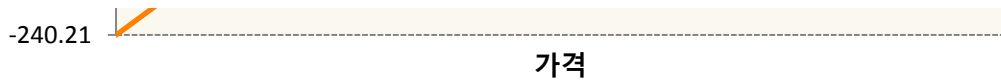
**BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20**



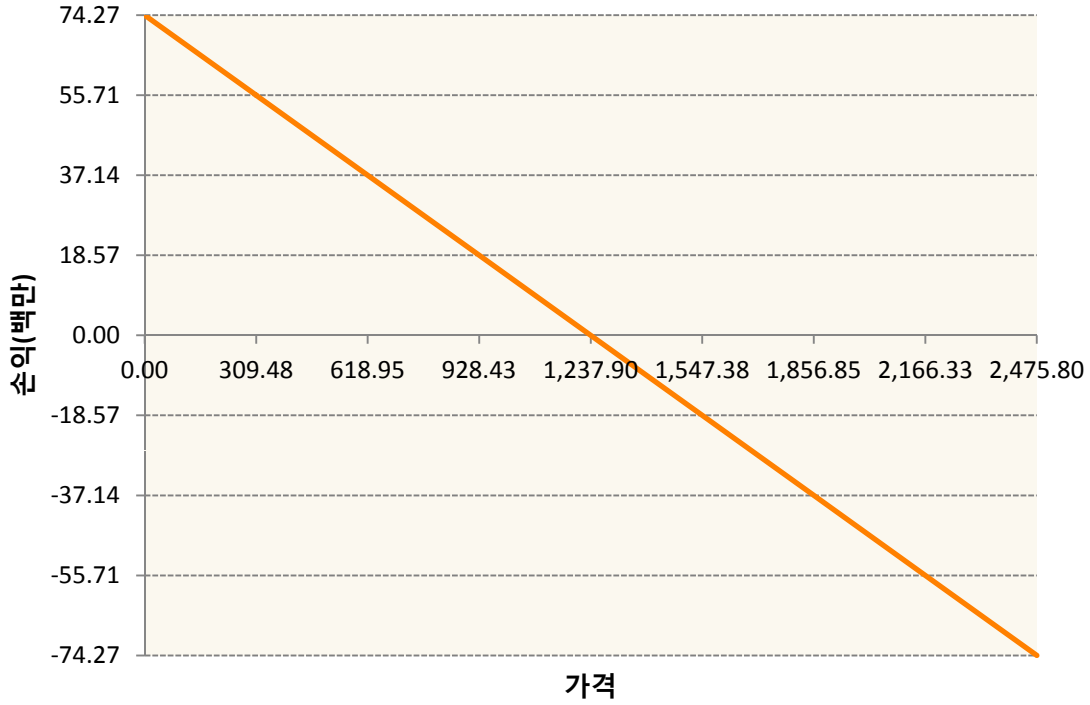
**CN0-CORN FUTURE Jul20**



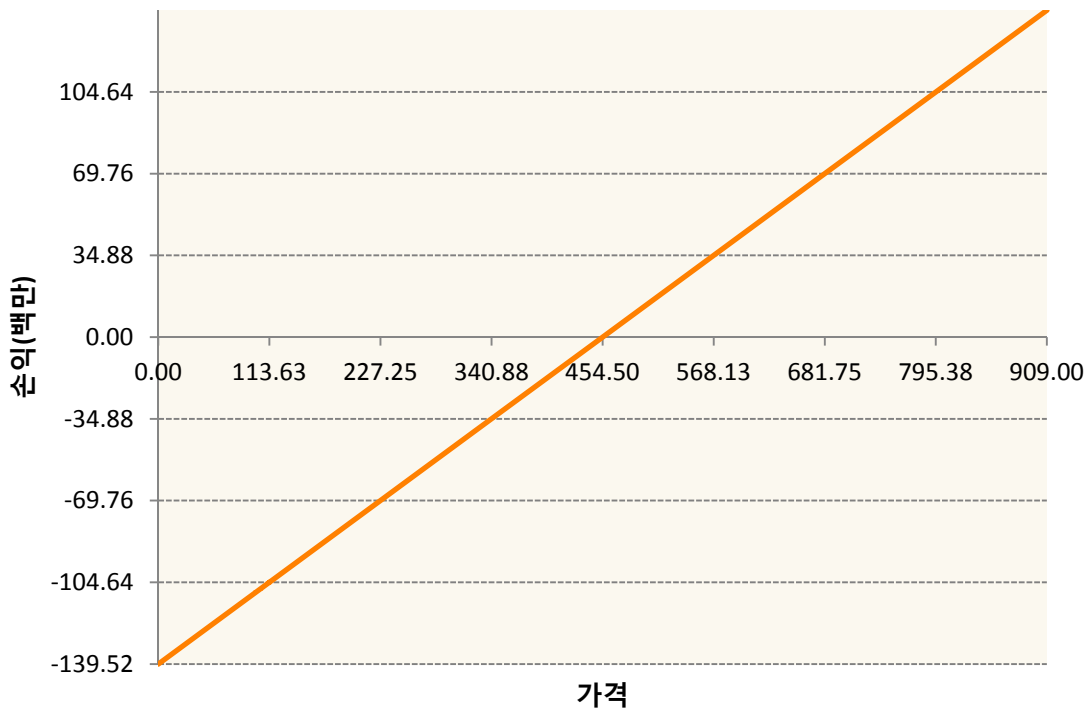




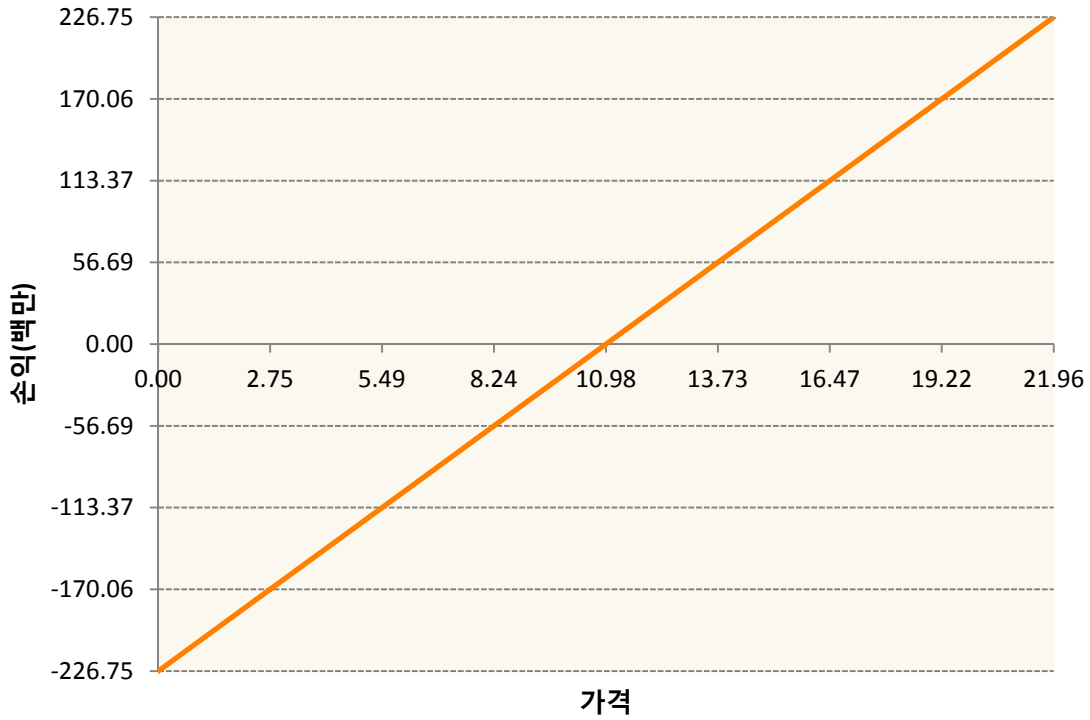
KR4175Q60006-2020-06 달러선물



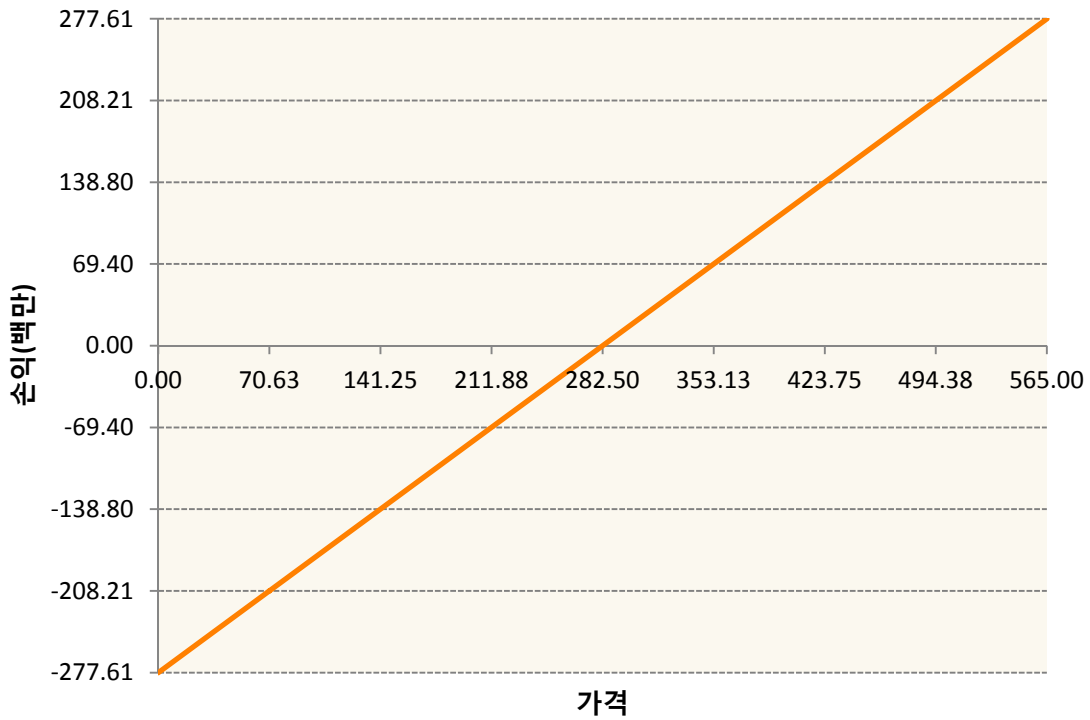
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



SBN0-Sugar Jul20

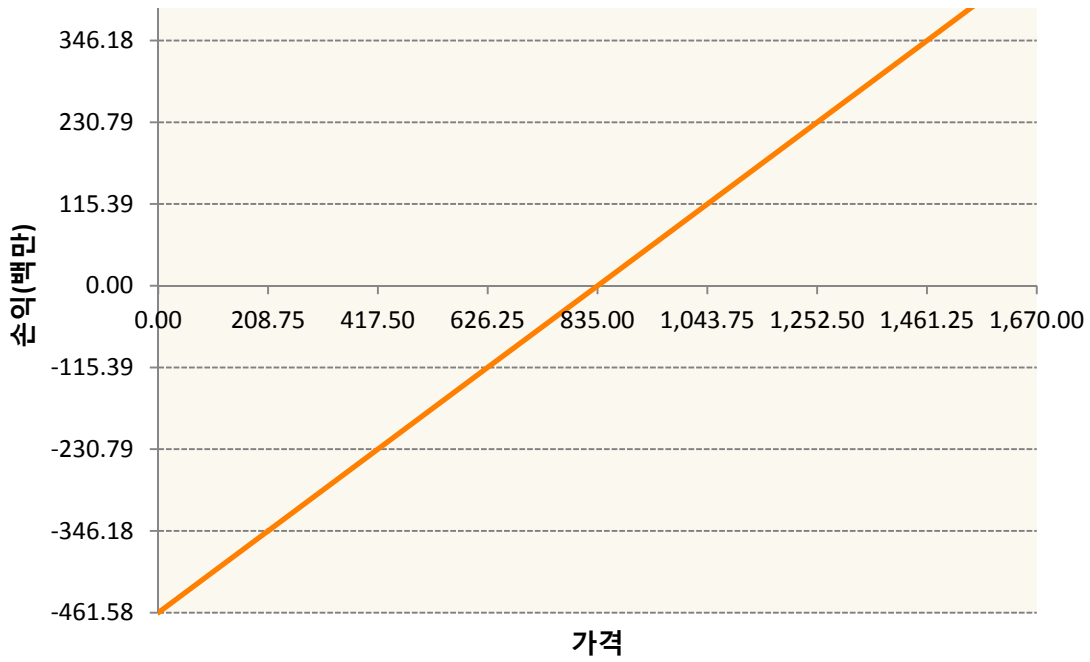


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20

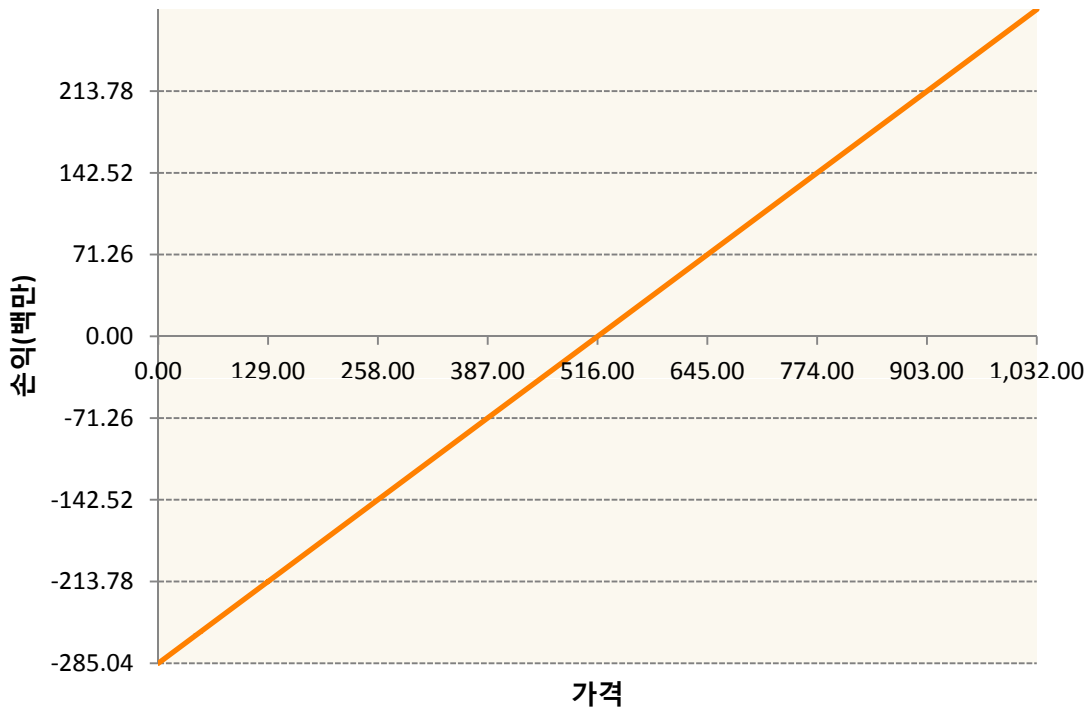


SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





WN0-WHEAT FUTURE(CBT) Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON0	SOYBEAN OIL FUTR Jul20	18
CN0	CORN FUTURE Jul20	37
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)

**230**