공시일	2021-04-16
기준일	2021-04-15

포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	0	0	0	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	2021-04-16
기준일	2021-04-15

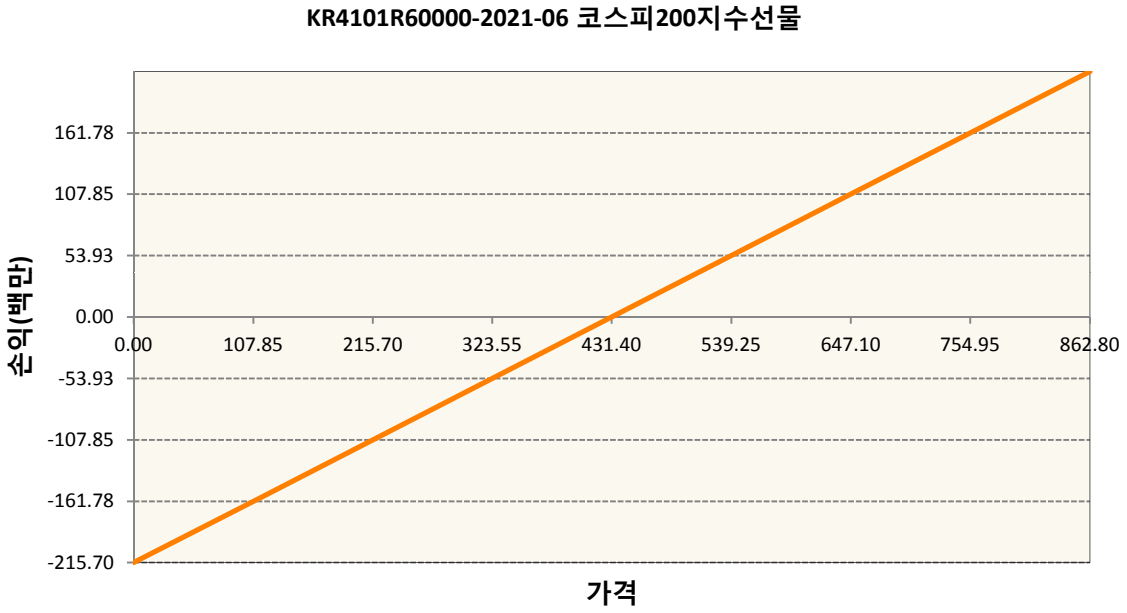
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101R60000	2021-06 코스피200지수선물						17
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
-5.33%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
-2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	6	6	6	6	6	6	6
5.33%	12	12	12	12	12	12	12
8.00%	17	17	17	17	17	17	17

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

(단위:백만원)

22

공시일	2021-04-16
기준일	2021-04-15

SMART합성-MSCI선진국증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	9,858	0	9,858	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0C 신한MSCI선진국미래20210225	826

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,031

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-04-16
기준일	2021-04-15

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	4,393	0	4,393	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래210311	362

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

471

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-04-16
기준일	2021-04-15

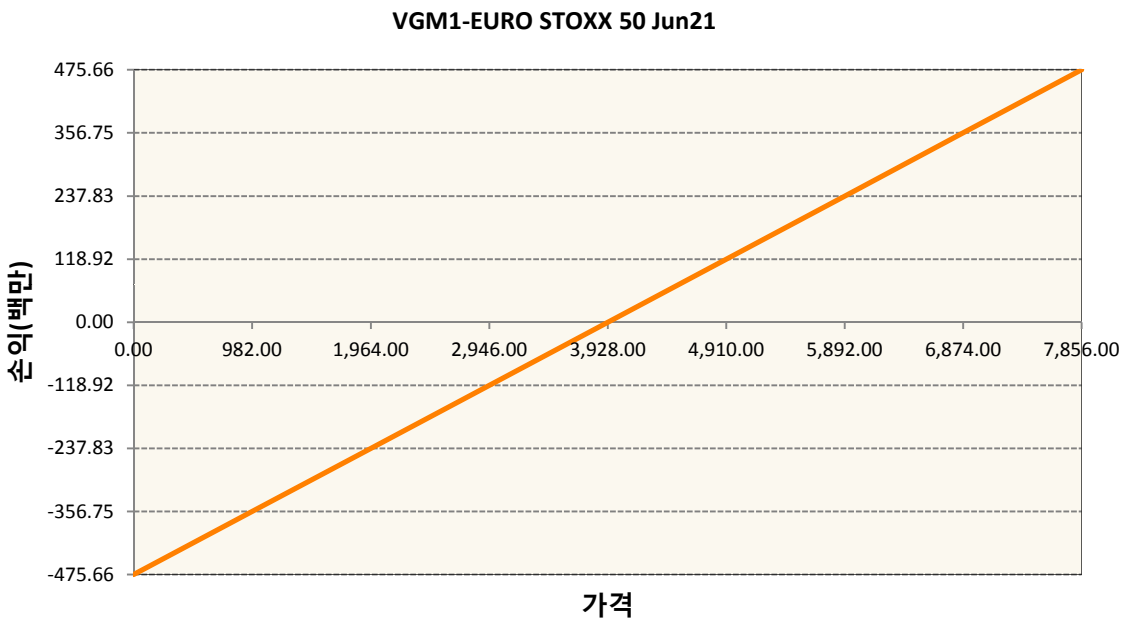
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	476	0	476	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM1	EURO STOXX 50 Jun21	38

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

(단위:백만원)

55

공시일	2021-04-16
기준일	2021-04-15

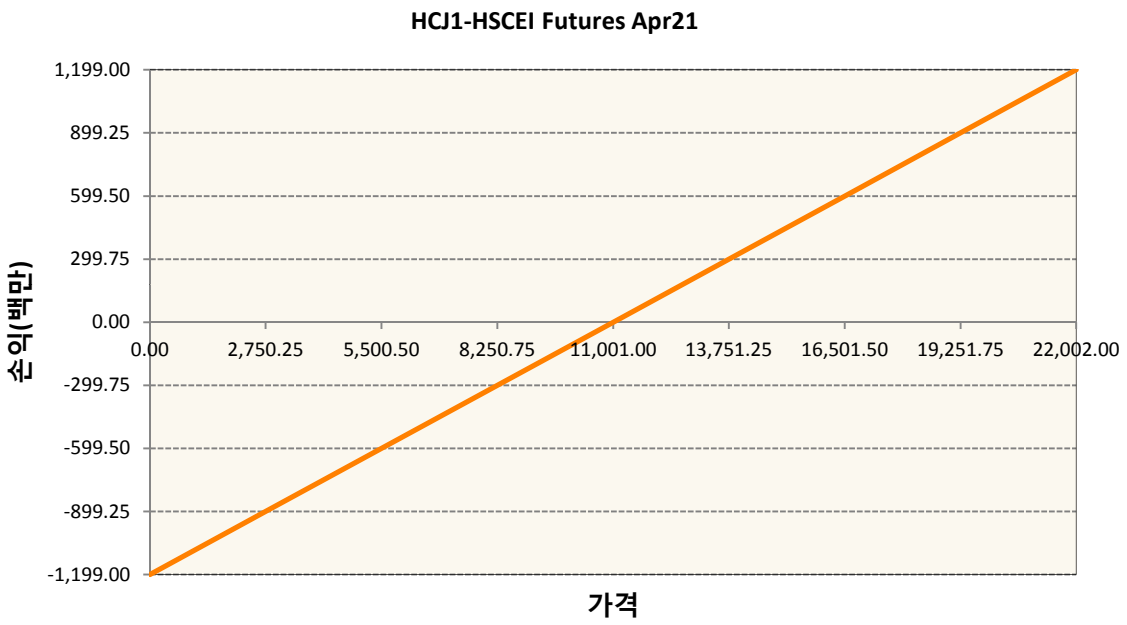
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,199	0	1,199	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ1	HSCEI Futures Apr21	96

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

(단위:백만원)

115

공시일	2021-04-16
기준일	2021-04-15

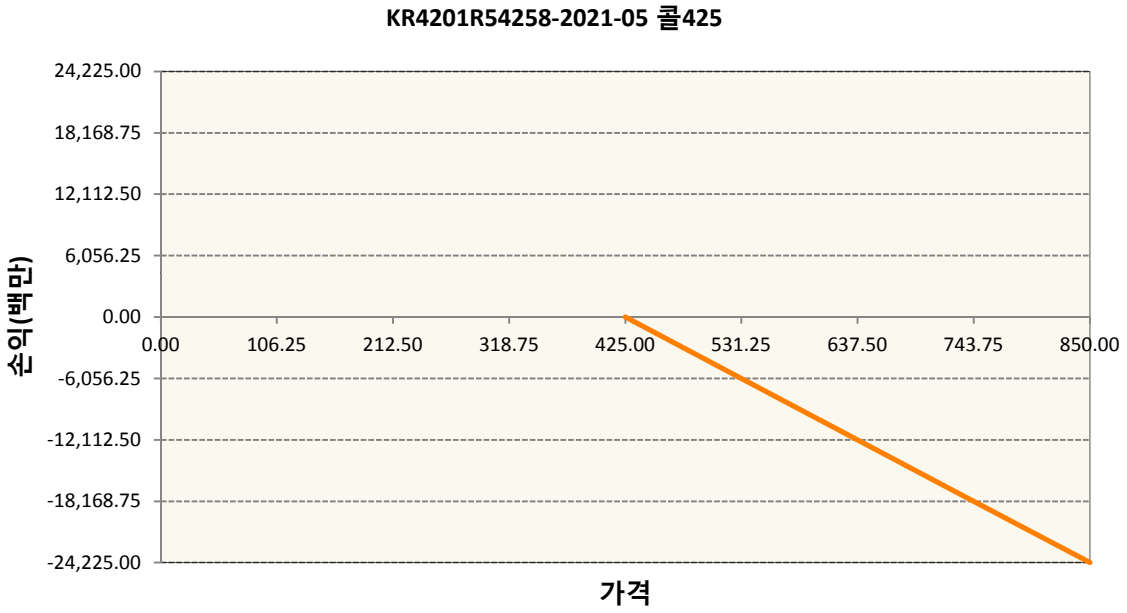
커버드콜모(주식혼합-파생형)

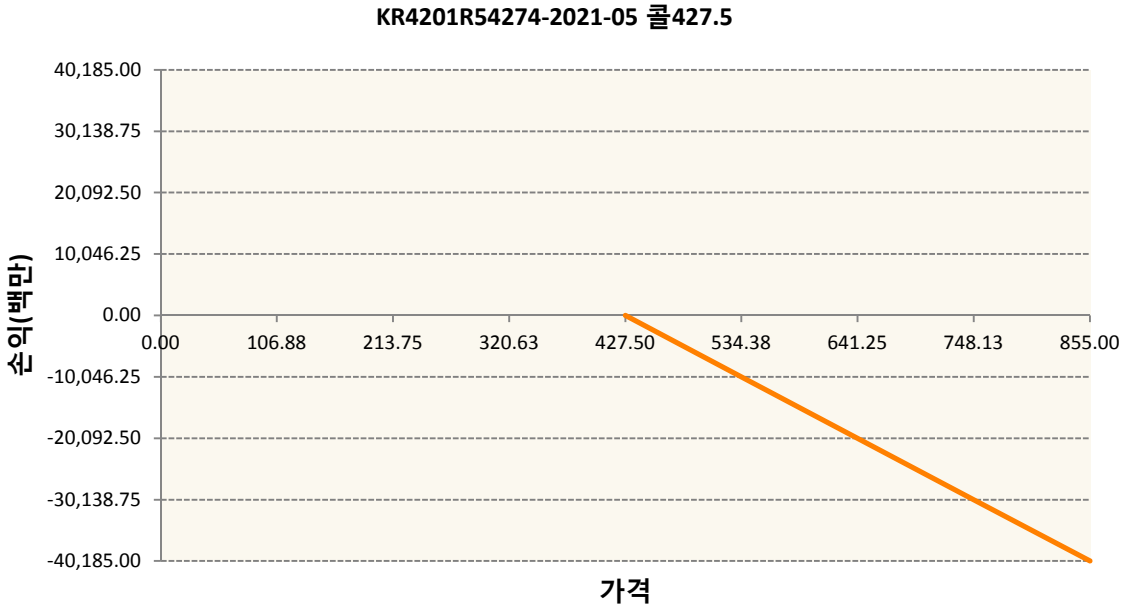
1. 계약금액

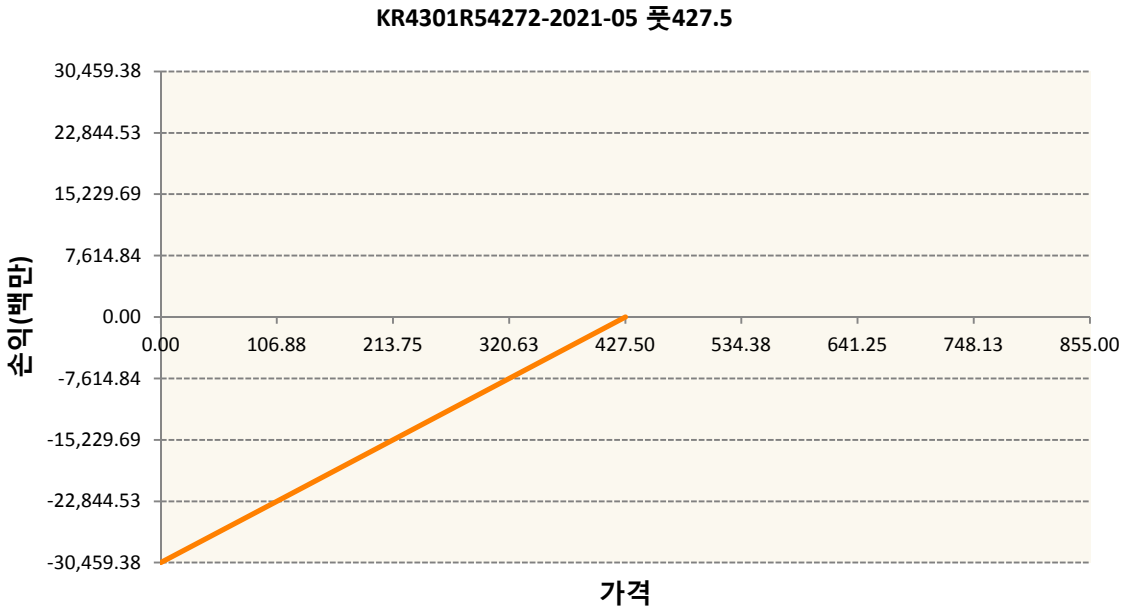
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	94,869	-94,869	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201R54258	2021-05 콜425						1,605
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	986	936	883	827	769	708	647
-5.33%	826	760	693	625	556	486	416
-2.67%	575	500	425	350	275	200	125
0%	225	150	75	0	-75	-151	-227
2.67%	-220	-285	-353	-422	-492	-564	-636
5.33%	-742	-793	-849	-907	-969	-1,032	-1,098
8.00%	-1,320	-1,357	-1,398	-1,445	-1,495	-1,549	-1,605
KR4201R54274	2021-05 콜427.5						2,595
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,535	1,459	1,376	1,288	1,196	1,099	1,000
-5.33%	1,299	1,195	1,088	978	867	754	639
-2.67%	919	796	674	551	428	304	181
0%	376	251	126	0	-126	-252	-377
2.67%	-324	-437	-553	-671	-790	-910	-1,032
5.33%	-1,159	-1,250	-1,347	-1,449	-1,554	-1,663	-1,775
8.00%	-2,095	-2,160	-2,235	-2,316	-2,404	-2,498	-2,595
KR4301R54272	2021-05 풋427.5						1,780
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,679	-1,688	-1,701	-1,716	-1,735	-1,756	-1,780
-5.33%	-914	-941	-971	-1,003	-1,038	-1,075	-1,113
-2.67%	-277	-323	-370	-418	-466	-514	-562
0%	148	99	49	0	-50	-100	-149

2.67%	358	325	290	252	212	171	128
5.33%	433	418	400	378	353	325	295
8.00%	452	447	440	430	418	402	384

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

5,607

공시일	2021-04-16
기준일	2021-04-15

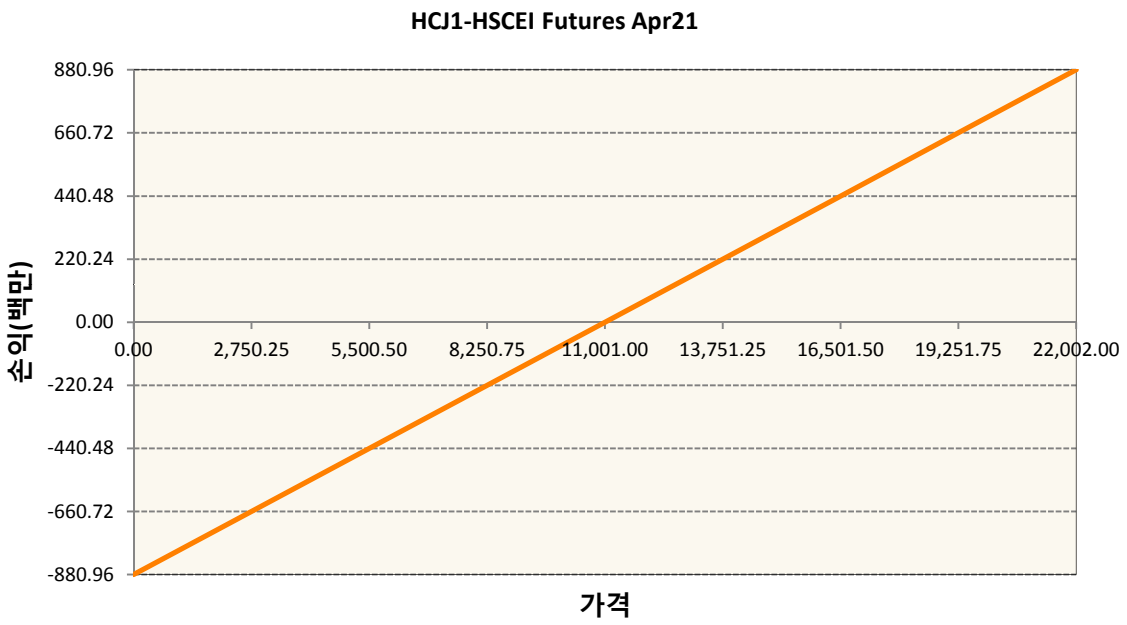
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

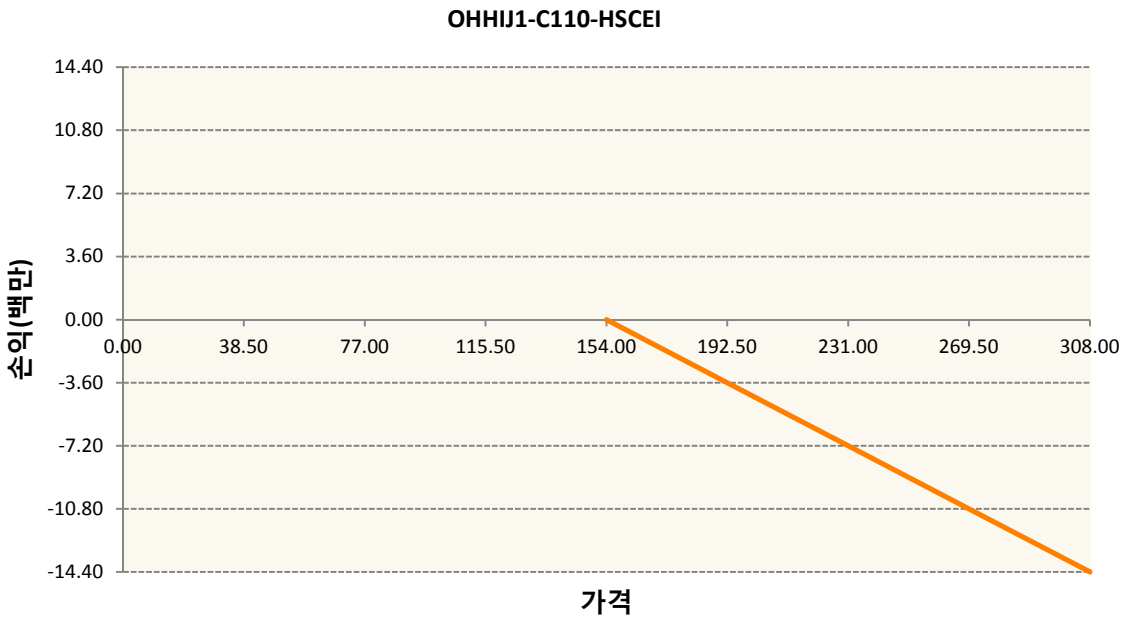
1. 계약금액

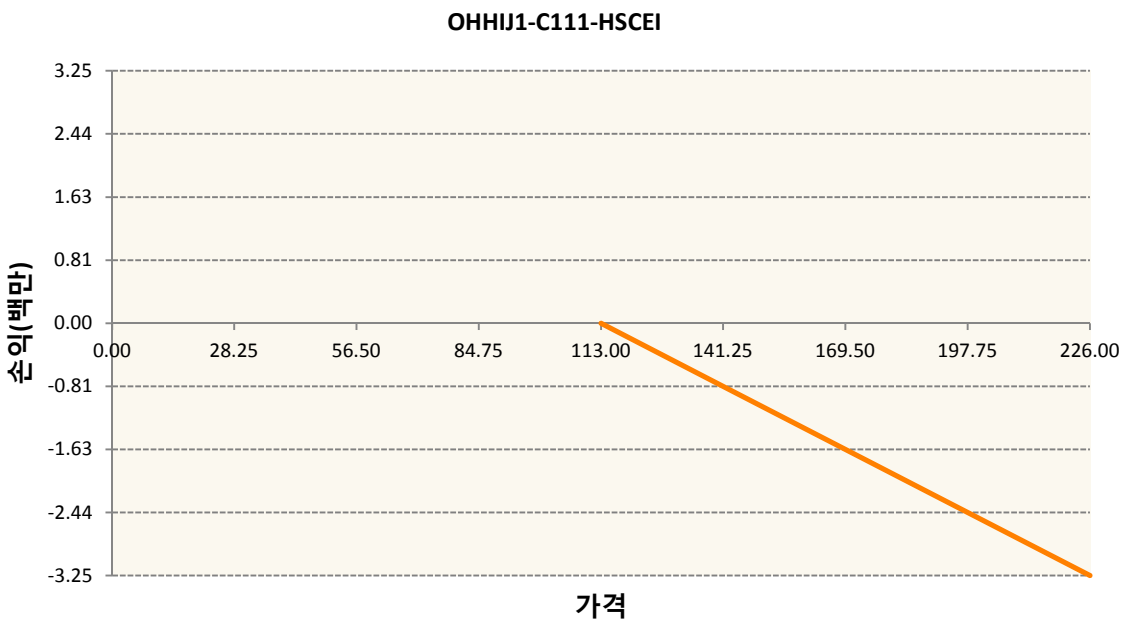
(단위:백만원)

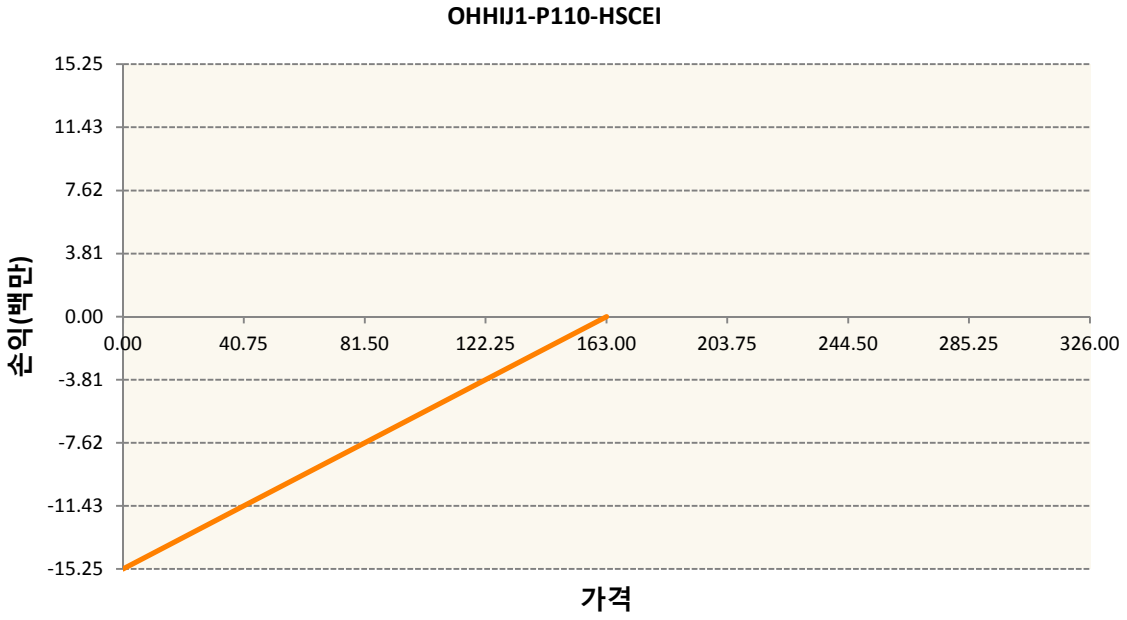
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	881	0	881	장내
누계	유가증권	옵션	0	39	-39	장내

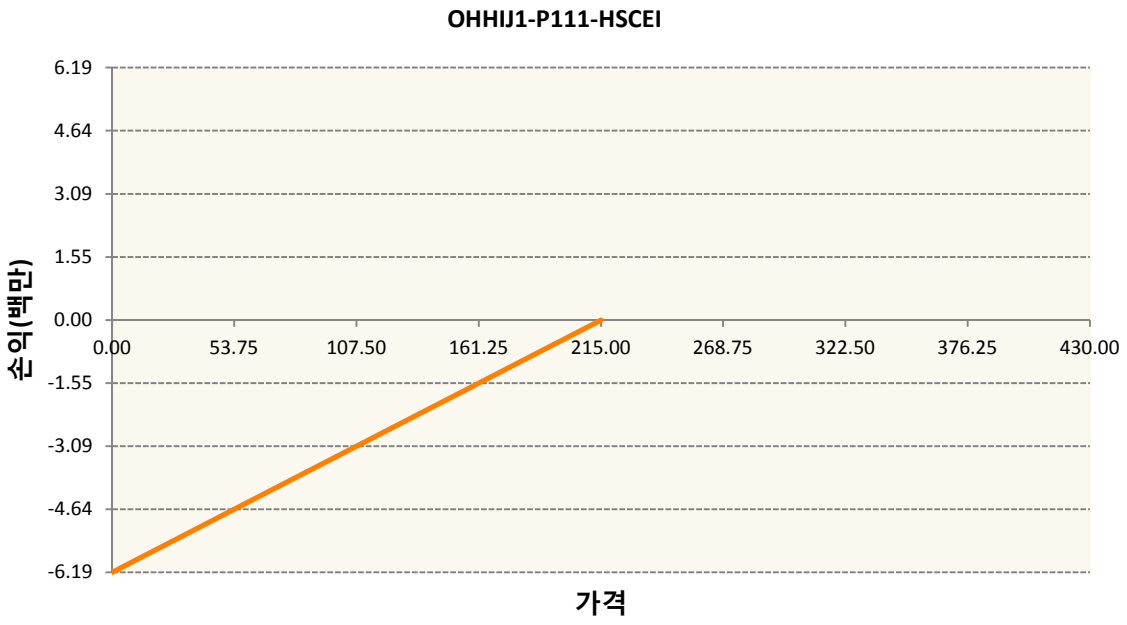
2. 만기시점의 손익구조






OHHIJ1-C111-HSCEI
3.25
2.44
1.63
0.81
0.00
-0.81
-1.63
-2.44
-3.25
0.00
28.25
56.50
84.75
113.00
141.25
169.50
197.75
226.00
손익(백만)
가격


OHHIJ1-P110-HSCEI
15.25
11.43
7.62
3.81
0.00
-3.81
-7.62
-11.43
-15.25
0.00
40.75
81.50
122.25
163.00
203.75
244.50
285.25
326.00
손익(백만)
가격


OHHIJ1-P111-HSCEI
6.19
4.64
3.09
1.55
0.00
-1.55
-3.09
-4.64
-6.19
0.00
53.75
107.50
161.25
215.00
268.75
322.50
376.25
430.00
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ1	HSCEI Futures Apr21	70
OHHIJ1-C11(	HSCEI	1
OHHIJ1-C11:	HSCEI	0.26
OHHIJ1-P11(	HSCEI	1
OHHIJ1-P11:	HSCEI	0.5

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

(단위:백만원)

88

공시일	2021-04-16
기준일	2021-04-15

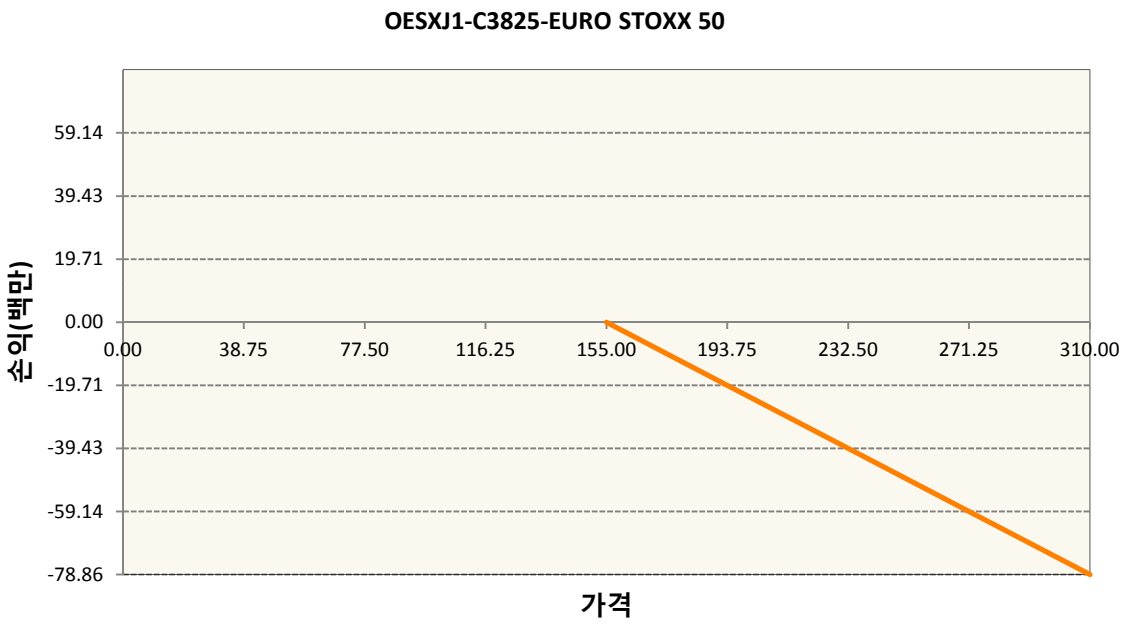
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

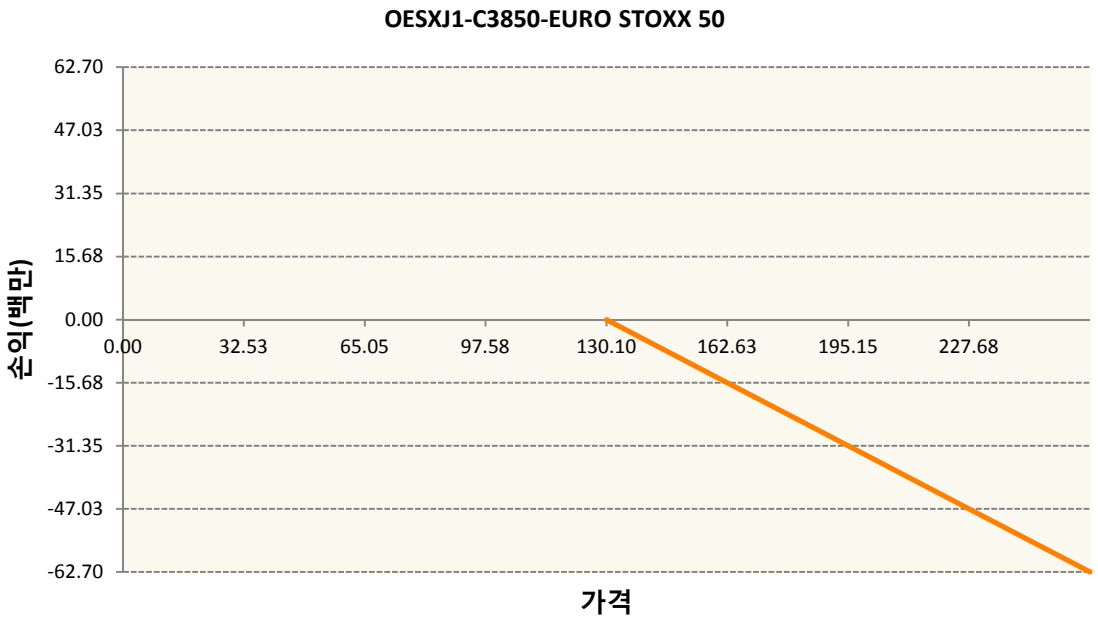
1. 계약금액

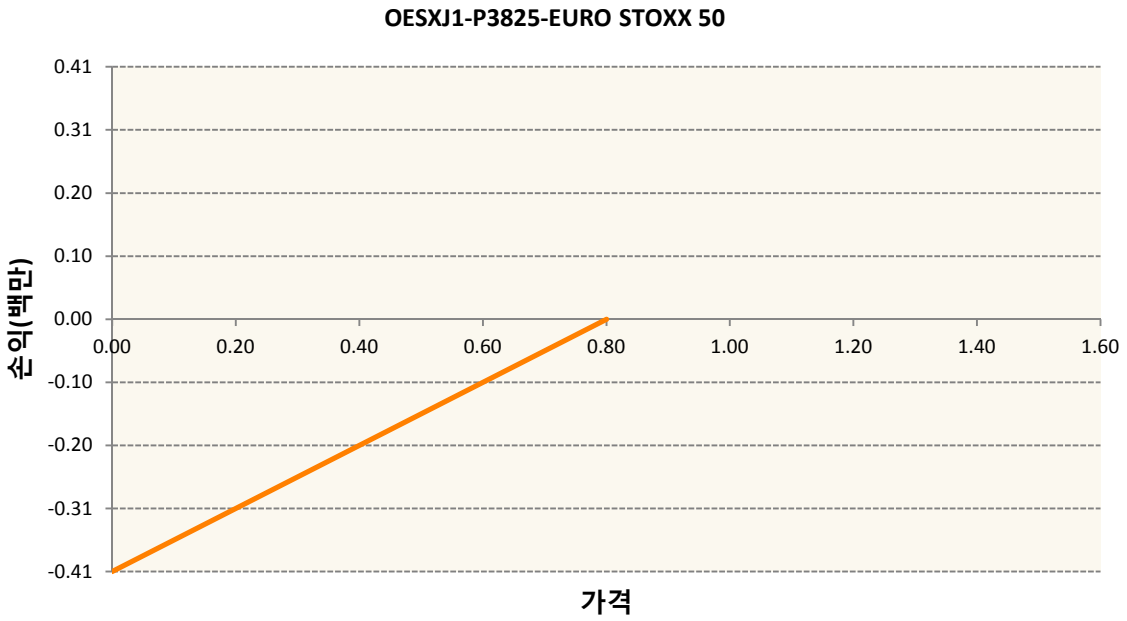
(단위:백만원)

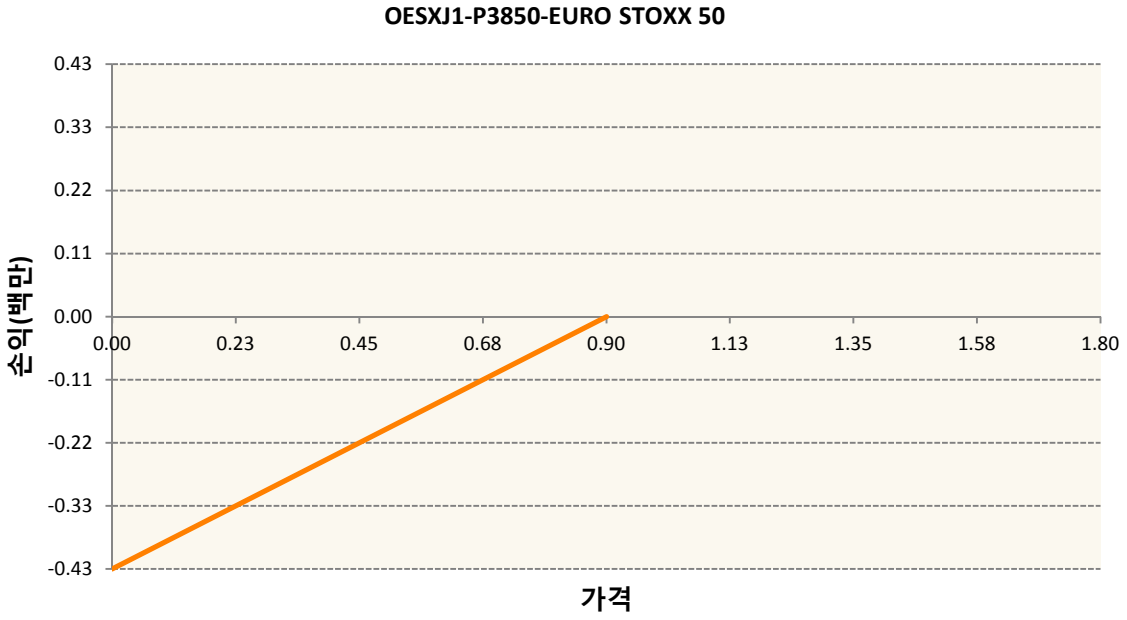
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	10	0	10	장외
누계	유가증권	옵션	0	142	-142	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	41
OESXJ1-C38 EURO STOXX 50	6
OESXJ1-C38 EURO STOXX 50	5
OESXJ1-P38 EURO STOXX 50	0.03
OESXJ1-P38 EURO STOXX 50	0.03

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	72

공시일	2021-04-16
기준일	2021-04-15

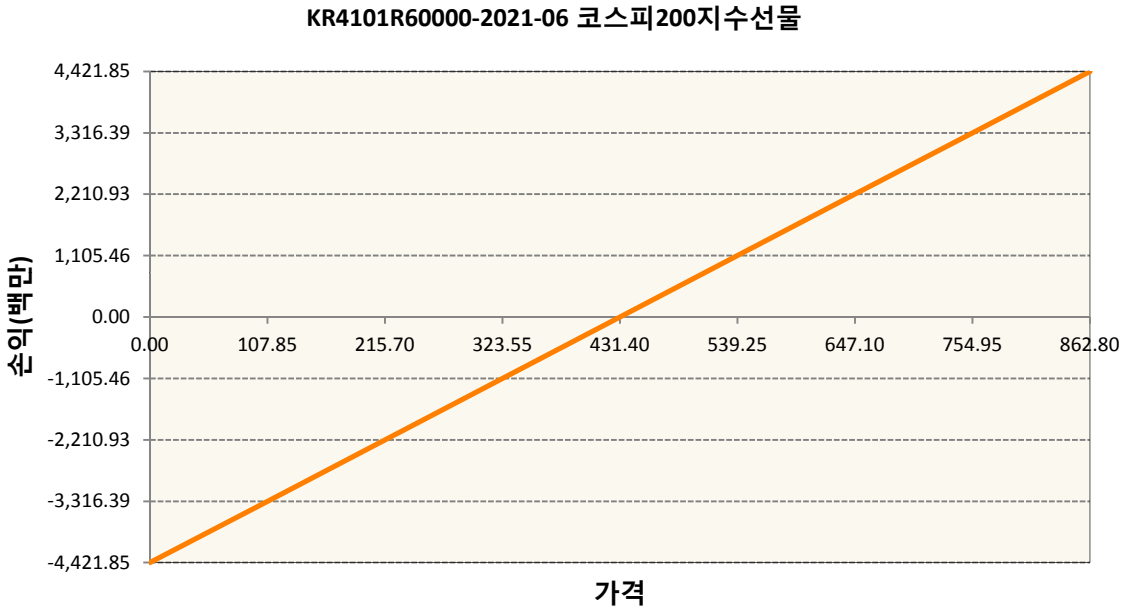
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

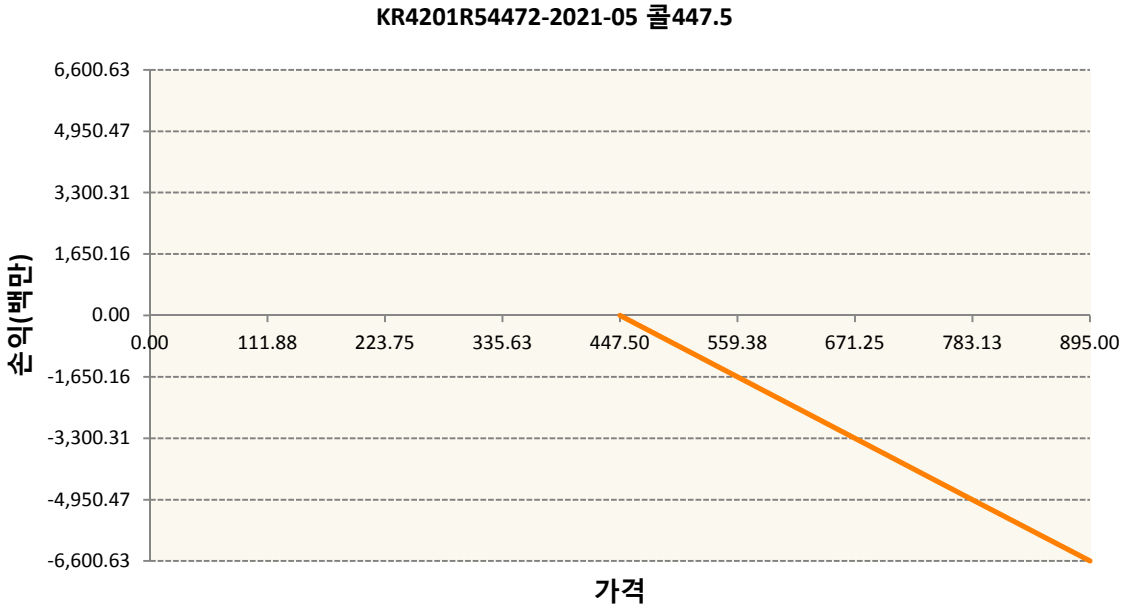
1. 계약금액

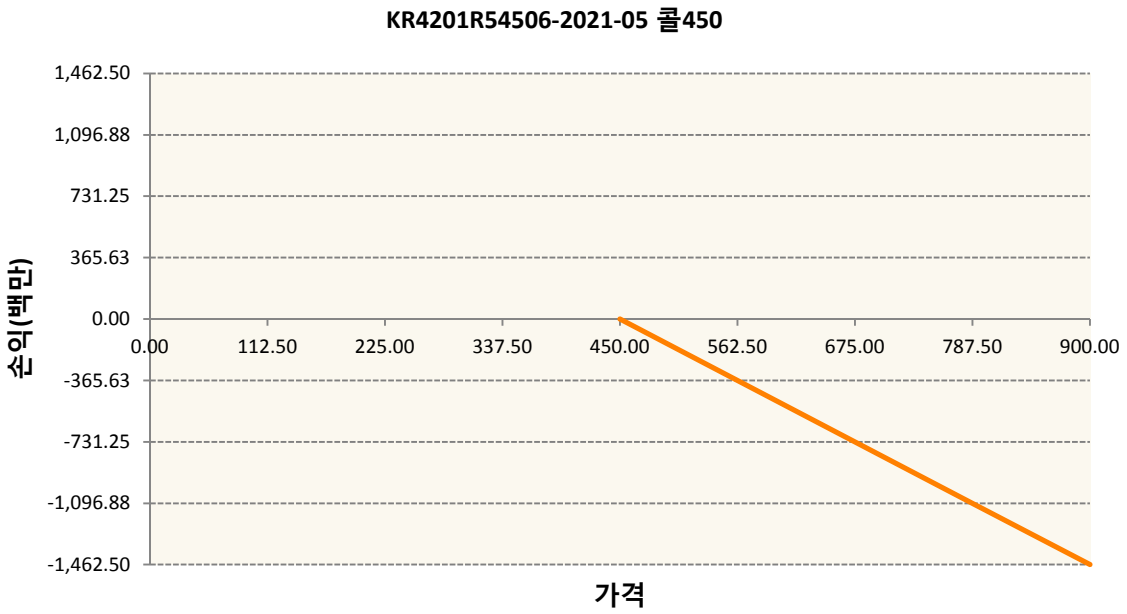
(단위:백만원)

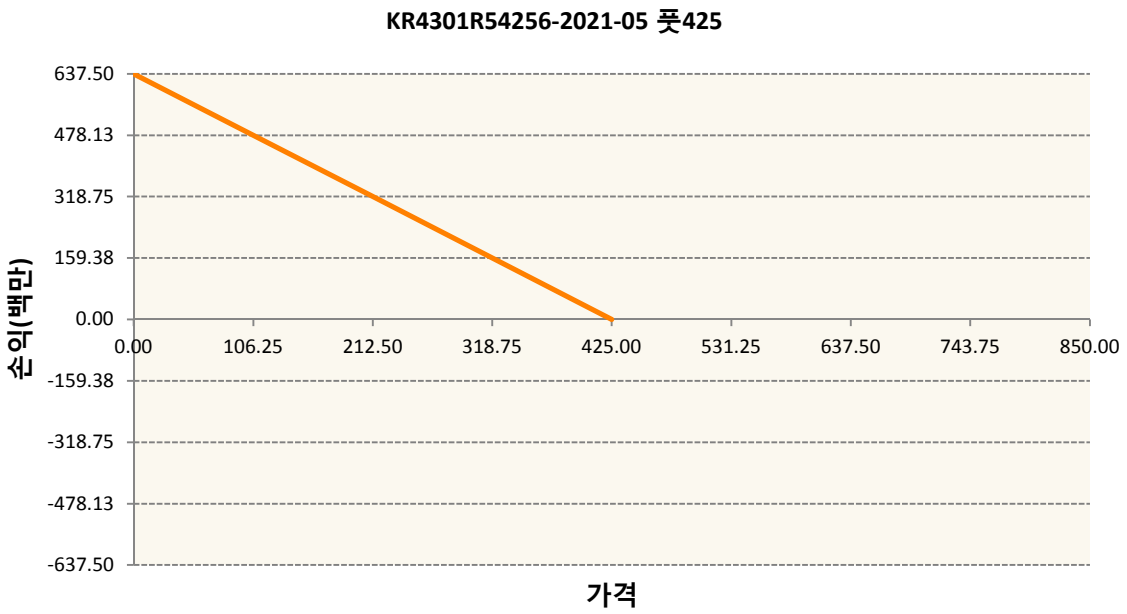
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	216	-216	장내
신규	유가증권	옵션	335	0	335	장내
누계	유가증권	선물	4,422	0	4,422	장내
누계	유가증권	옵션	1,706	8,063	-6,357	장내

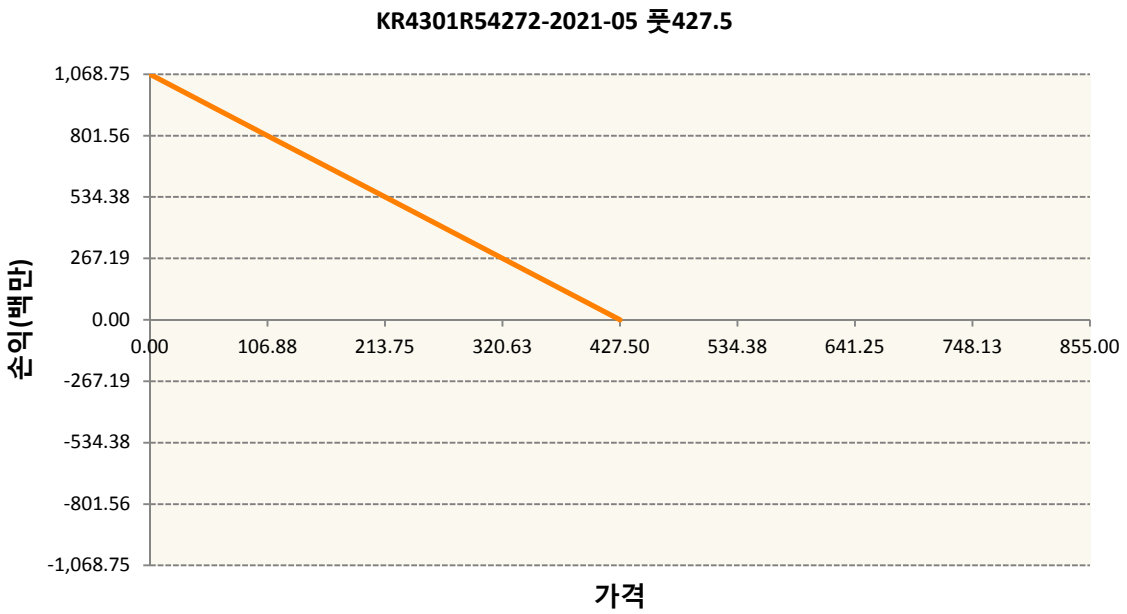
2. 만기시점의 손익구조






KR4201R54506-2021-05 콜450
1,462.50
1,096.88
731.25
365.63
0.00
-365.63
-731.25
-1,096.88
-1,462.50
0.00
112.50
225.00
337.50
450.00
562.50
675.00
787.50
900.00
손익(백만)
가격


KR4301R54256-2021-05 풋425
637.50
478.13
318.75
159.38
0.00
-159.38
-318.75
-478.13
-637.50
0.00
106.25
212.50
318.75
425.00
531.25
637.50
743.75
850.00
손익(백만)
가격


KR4301R54272-2021-05 풋427.5
1,068.75
801.56
534.38
267.19
0.00
-267.19
-534.38
-801.56
-1,068.75
0.00
106.88
213.75
320.63
427.50
534.38
641.25
748.13
855.00
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

	KR4101R60000		2021-06 코스피200지수선물				355
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-355	-355	-355	-355	-355	-355	-355
-5.33%	-237	-237	-237	-237	-237	-237	-237
-2.67%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	118	118	118	118	118	118	118
5.33%	237	237	237	237	237	237	237
8.00%	355	355	355	355	355	355	355
	KR4201R54472		2021-05 콜447.5				332
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	139	134	127	118	109	98	87
-5.33%	126	116	105	93	80	66	52
-2.67%	100	86	71	55	38	21	4
0%	56	37	19	0	-19	-38	-58
2.67%	-11	-32	-52	-73	-93	-114	-134
5.33%	-103	-123	-144	-164	-185	-205	-226
8.00%	-218	-236	-254	-273	-293	-312	-332
	KR4201R54506		2021-05 콜450				71
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	28	27	26	24	22	20	18
-5.33%	26	24	22	19	16	13	10
-2.67%	21	18	15	11	8	4	0
0%	12	8	4	0	-4	-8	-13
2.67%	-2	-6	-11	-15	-20	-24	-29
5.33%	-21	-25	-30	-34	-39	-44	-48
8.00%	-45	-49	-53	-58	-62	-66	-71
	KR4301R54256		2021-05 풋425				36
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	33	33	34	34	35	35	36
-5.33%	17	18	19	20	20	21	22
-2.67%	5	6	7	8	9	10	11
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-7	-6	-5	-5	-4	-3	-2
5.33%	-8	-8	-7	-7	-6	-6	-5
8.00%	-8	-8	-8	-8	-7	-7	-7
	KR4301R54272		2021-05 풋427.5				62
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	59	59	60	60	61	62	62
-5.33%	32	33	34	35	36	38	39
-2.67%	10	11	13	15	16	18	20
0%	-5	-3	-2	0	2	3	5
2.67%	-13	-11	-10	-9	-7	-6	-4
5.33%	-15	-15	-14	-13	-12	-11	-10
8.00%	-16	-16	-15	-15	-15	-14	-13

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

830

공시일	2021-04-16
기준일	2021-04-15

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	25,159	0	25,159	

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	2021-04-16
기준일	2021-04-15

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	16,810	0	16,810	

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	2021-04-16
기준일	2021-04-15

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	71,047	0	71,047	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

0

공시일	2021-04-16
기준일	2021-04-15

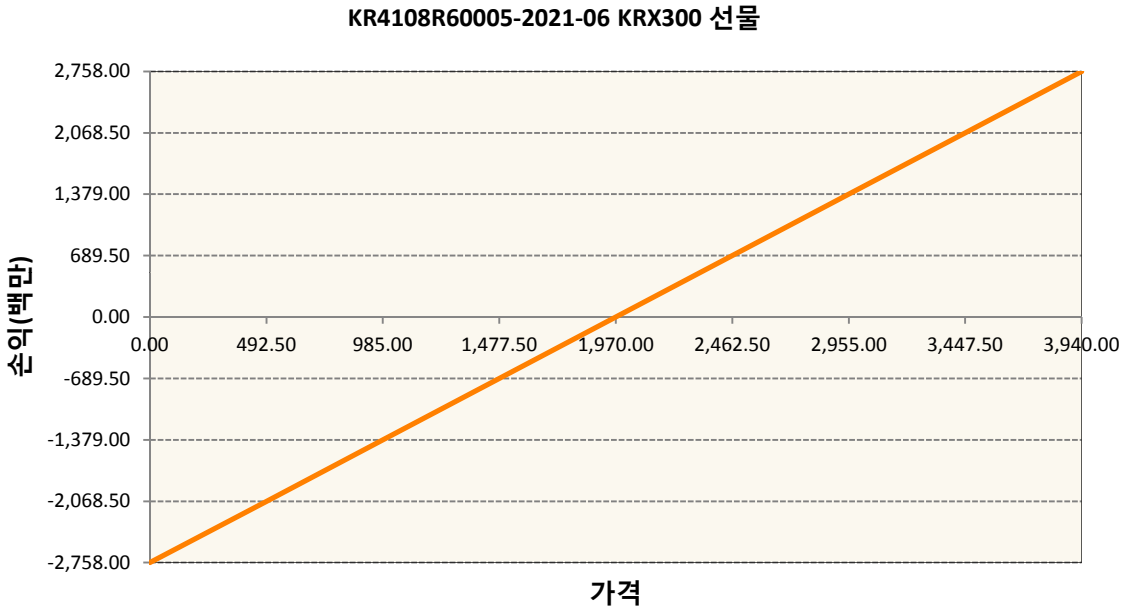
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,758	0	2,758	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4108R60005	2021-06 KRX300 선물						220
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-220	-220	-220	-220	-220	-220	-220
-5.33%	-147	-147	-147	-147	-147	-147	-147
-2.67%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	73	73	73	73	73	73	73
5.33%	147	147	147	147	147	147	147
8.00%	220	220	220	220	220	220	220

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

273

공시일	2021-04-16
기준일	2021-04-15

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	1,662	0	1,662	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

0

공시일	2021-04-16
기준일	2021-04-15

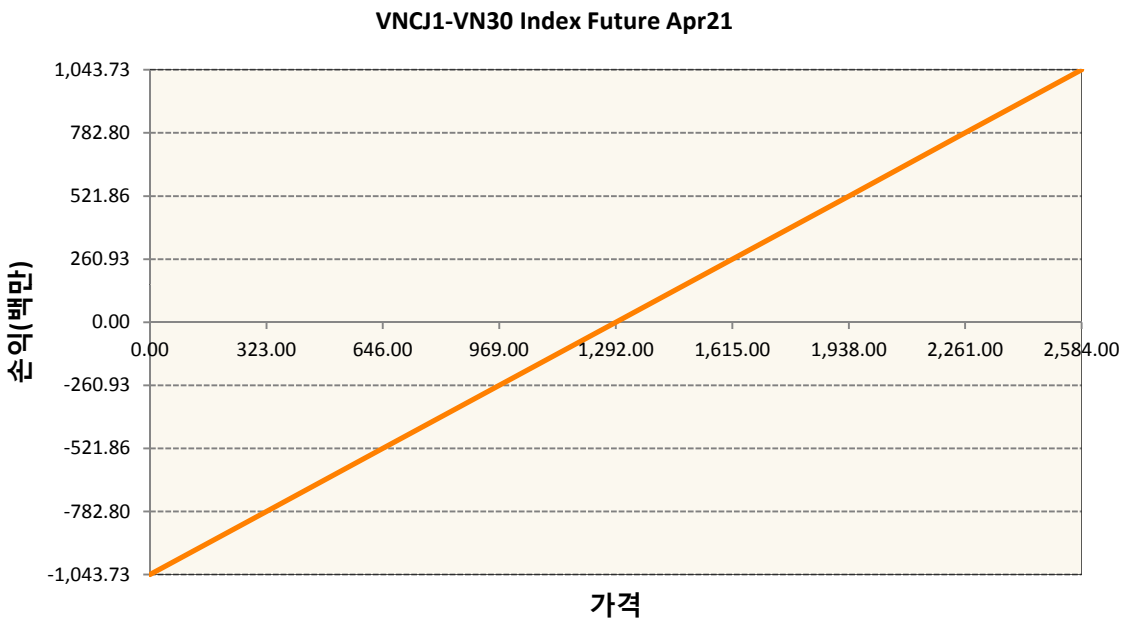
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,044	0	1,044	
누계	유가증권	스왑	1,472	0	1,472	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11	VN30TR Index(EUR)	118
VNCJ1	VN30 Index Future Apr21	83

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

(단위:백만원)

244

공시일	2021-04-16
기준일	2021-04-15

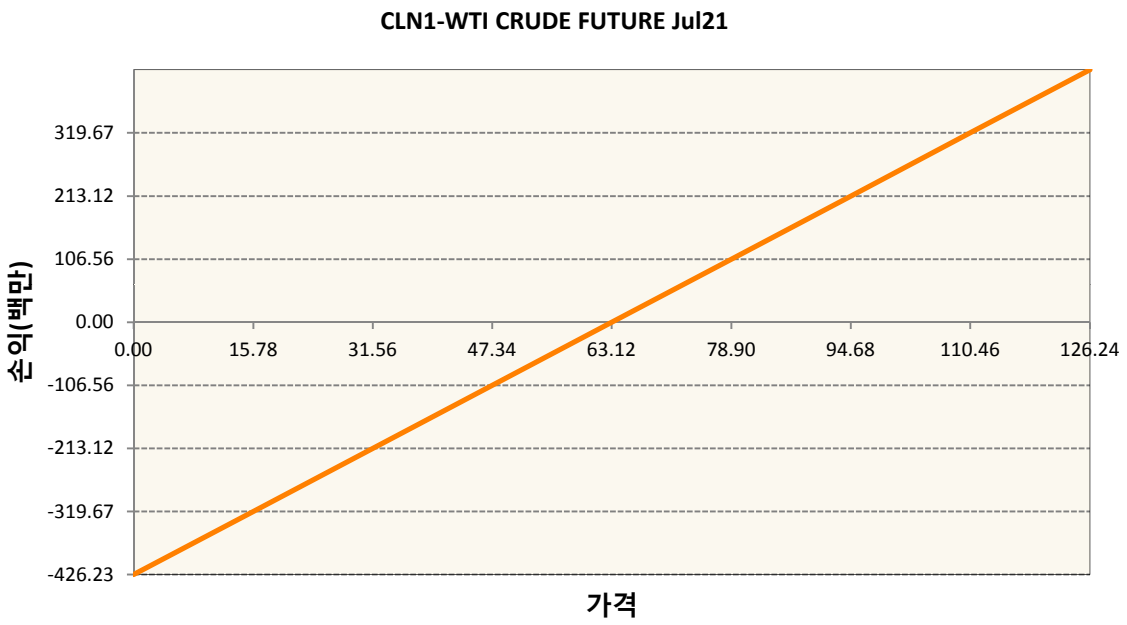
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

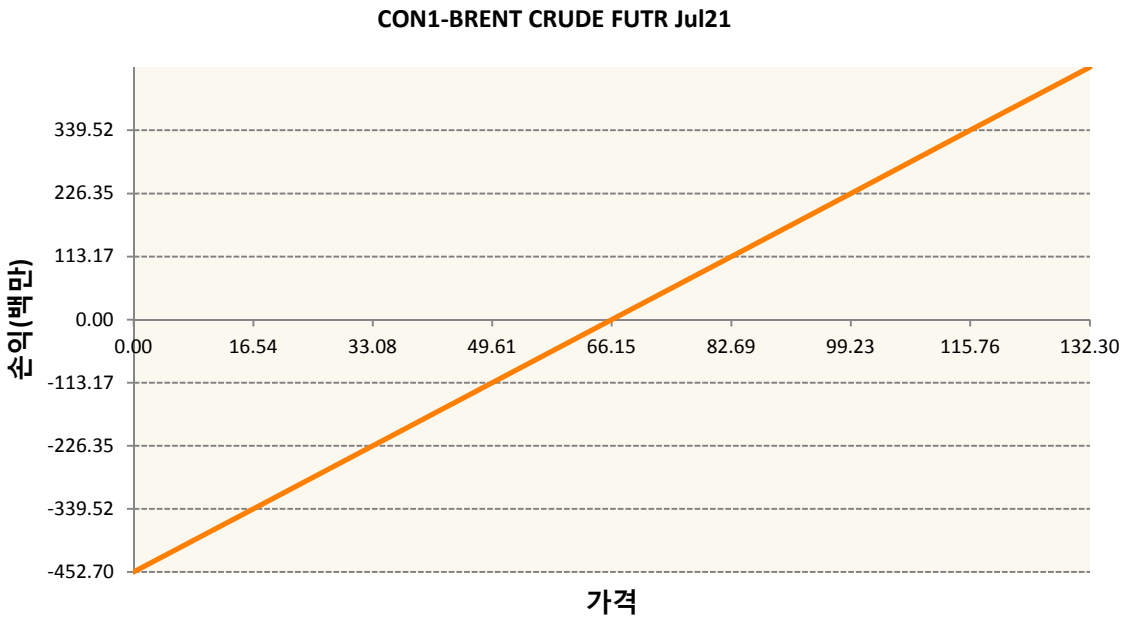
1. 계약금액

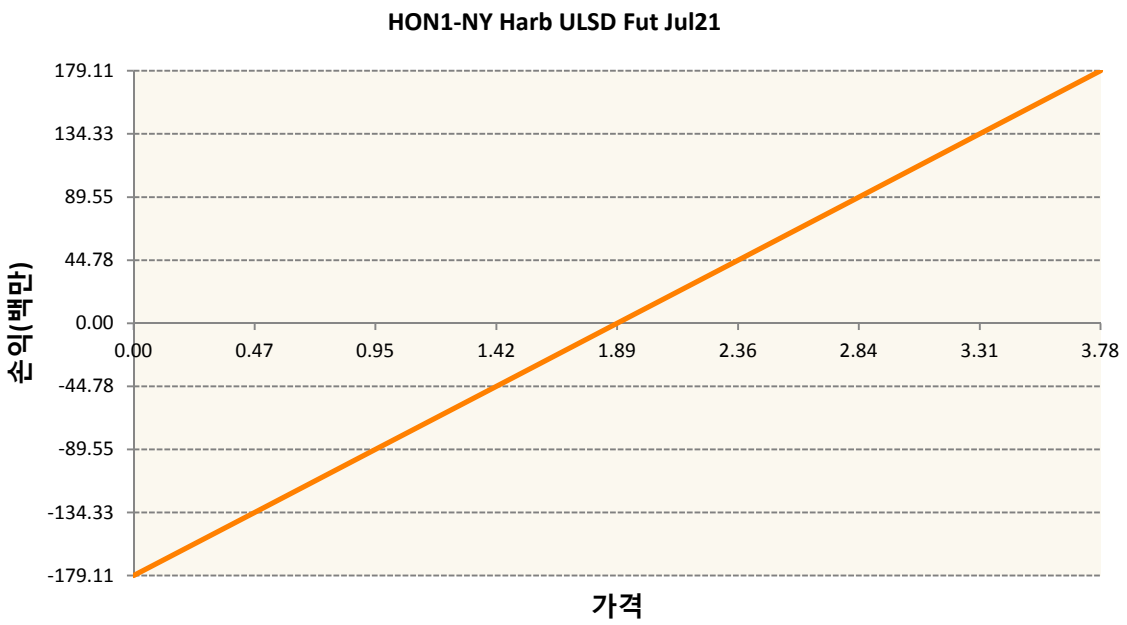
(단위:백만원)

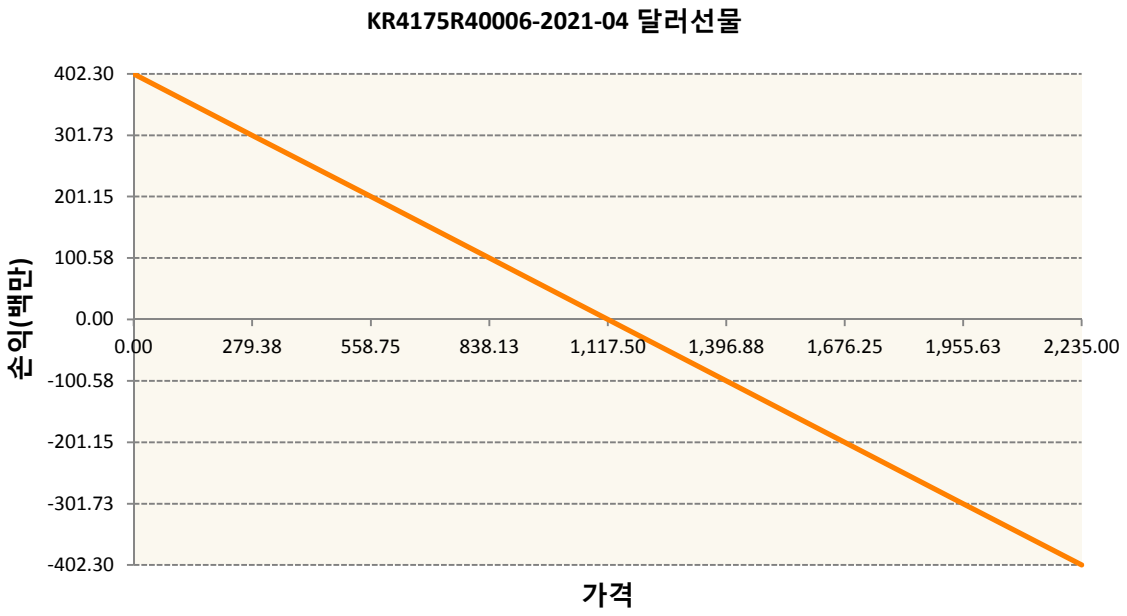
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,899	402	1,496	

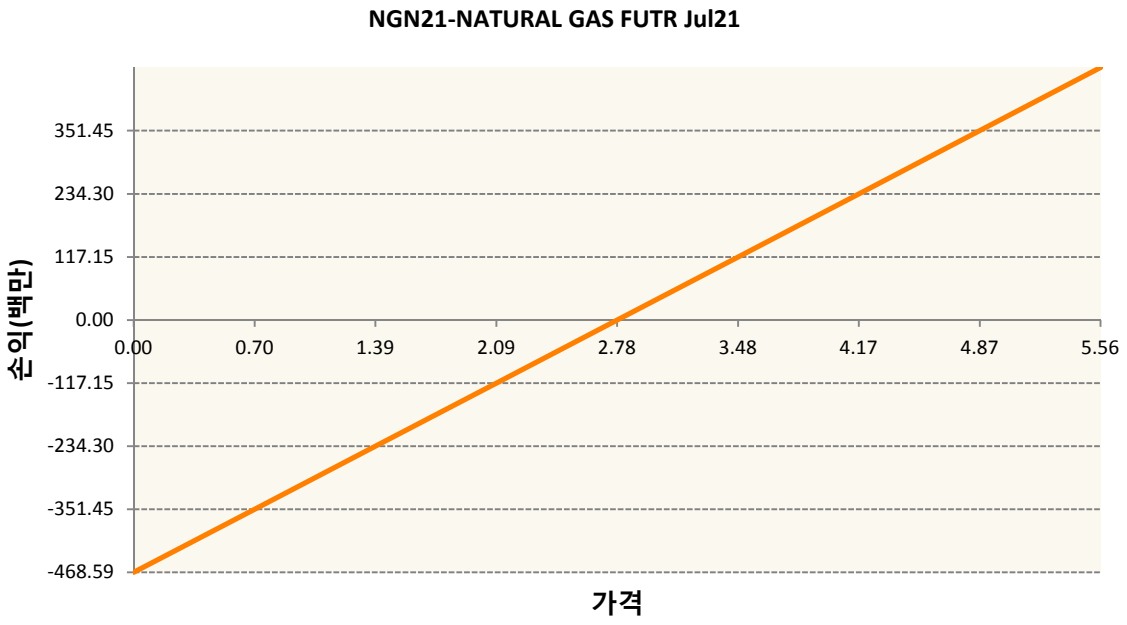
2. 만기시점의 손익구조

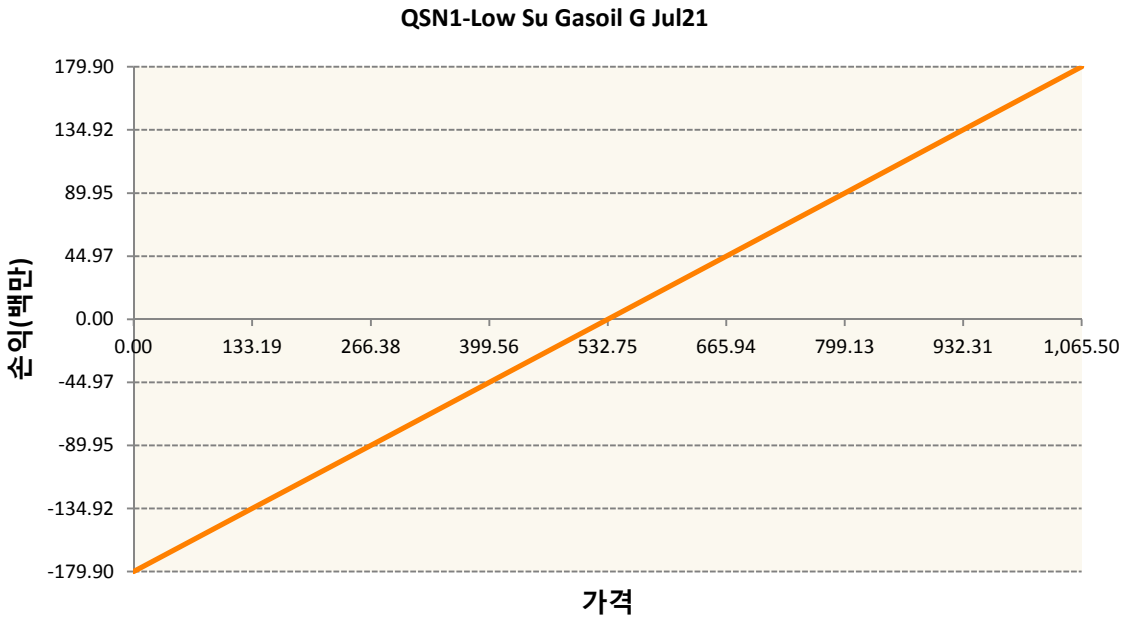


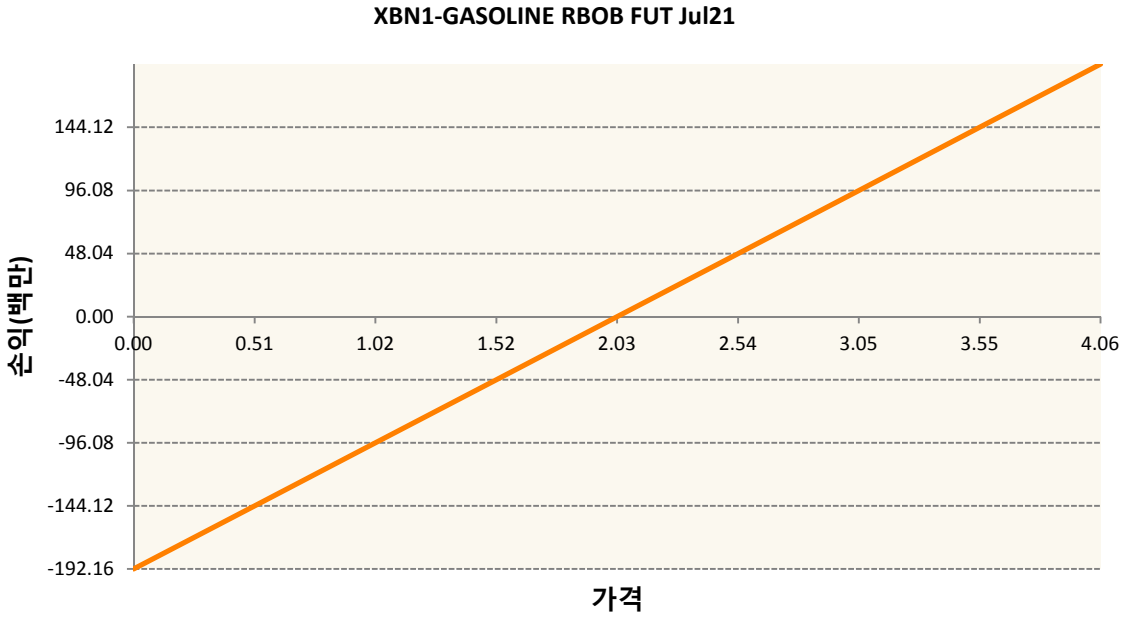



HON1-NY Harb ULSD Fut Jul21
179.11
134.33
89.55
44.78
0.00
-44.78
-89.55
-134.33
-179.11
0.00
0.47
0.95
1.42
1.89
2.36
2.84
3.31
3.78
손익(백만)
가격


KR4175R40006-2021-04 달러선물
402.30
301.73
201.15
100.58
0.00
-100.58
-201.15
-301.73
-402.30
0.00
279.38
558.75
838.13
1,117.50
1,396.88
1,676.25
1,955.63
2,235.00
손익(백만)
가격


NGN21-NATURAL GAS FUTR Jul21
351.45
234.30
117.15
0.00
-117.15
-234.30
-351.45
-468.59
0.00
0.70
1.39
2.09
2.78
3.48
4.17
4.87
5.56
손익(백만)
가격





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLN1	WTI CRUDE FUTURE Jul21	34
CON1	BRENT CRUDE FUTR Jul21	36
HON1	NY Harb ULSD Fut Jul21	14
KR4175R400	2021-04 달러선물	32
NGN21	NATURAL GAS FUTR Jul21	37
QSN1	Low Su Gasoil G Jul21	14
XBN1	GASOLINE RBOB FUT Jul21	15

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	517

공시일	2021-04-16
기준일	2021-04-15

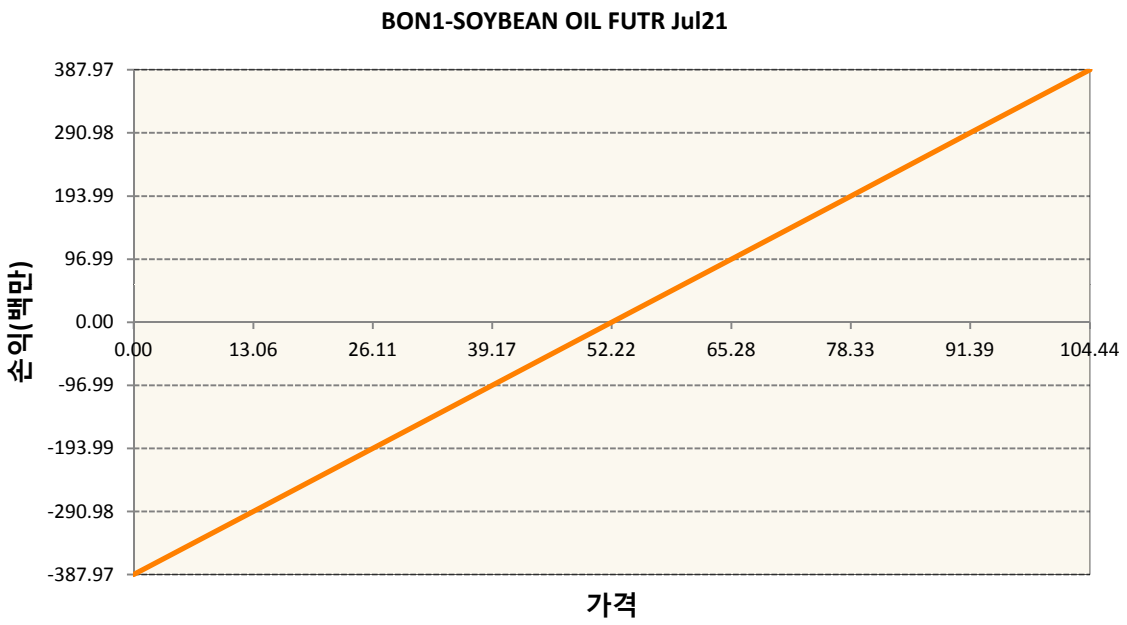
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

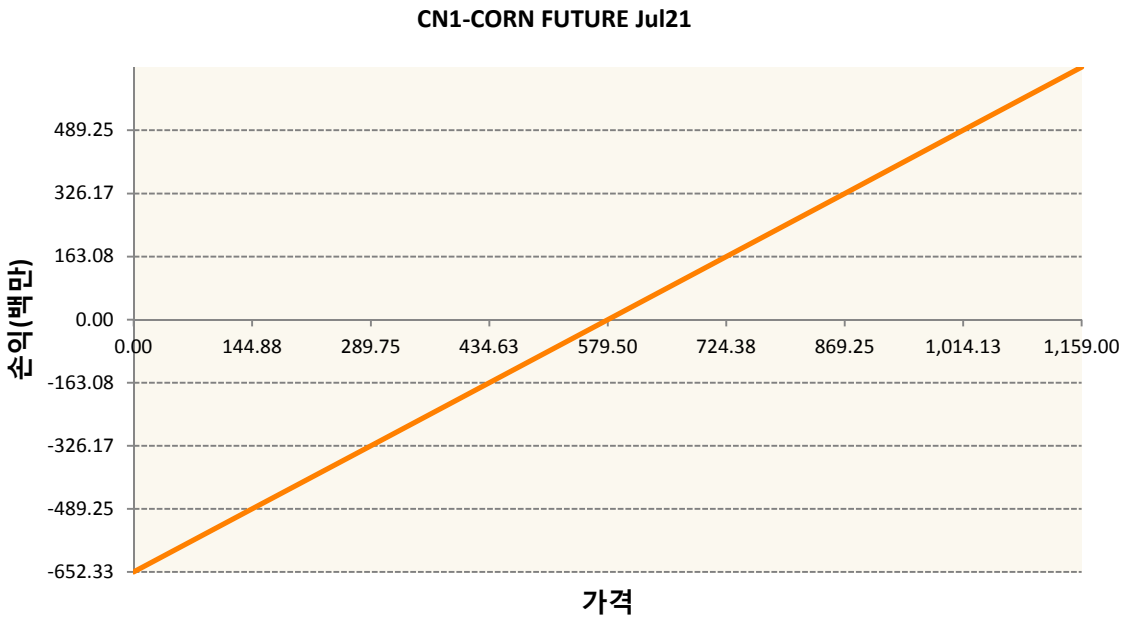
1. 계약금액

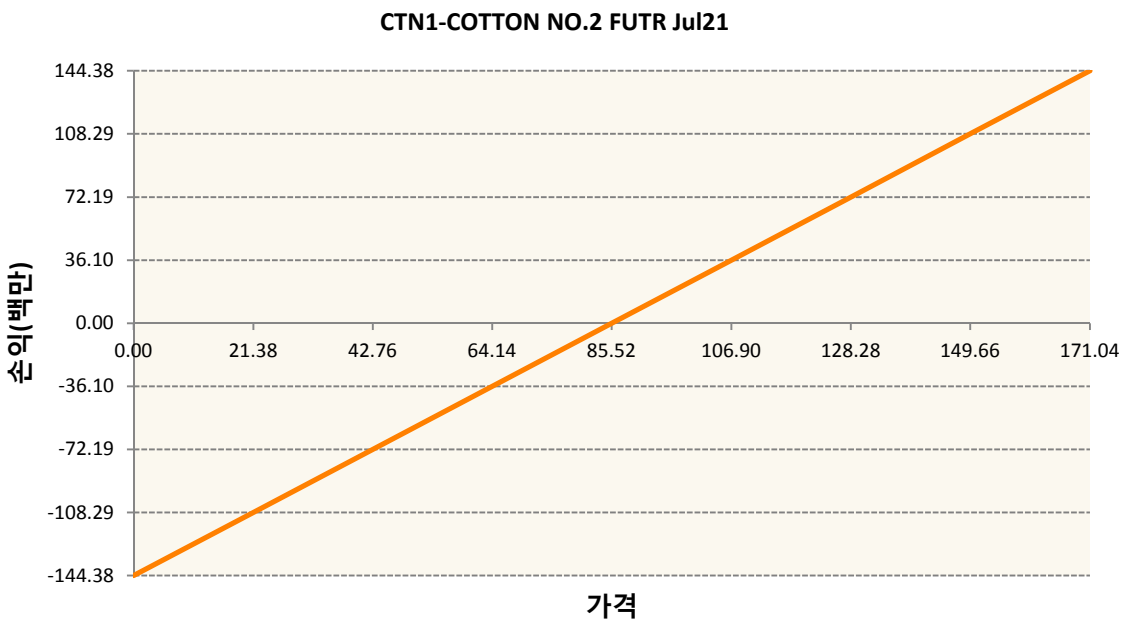
(단위:백만원)

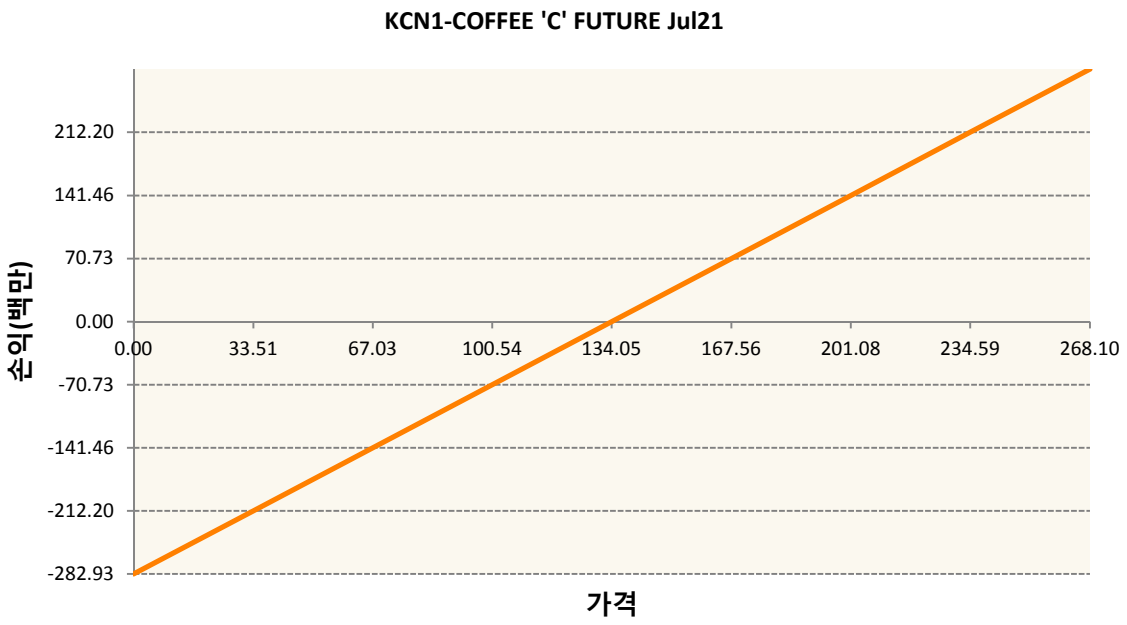
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,069	738	2,331	

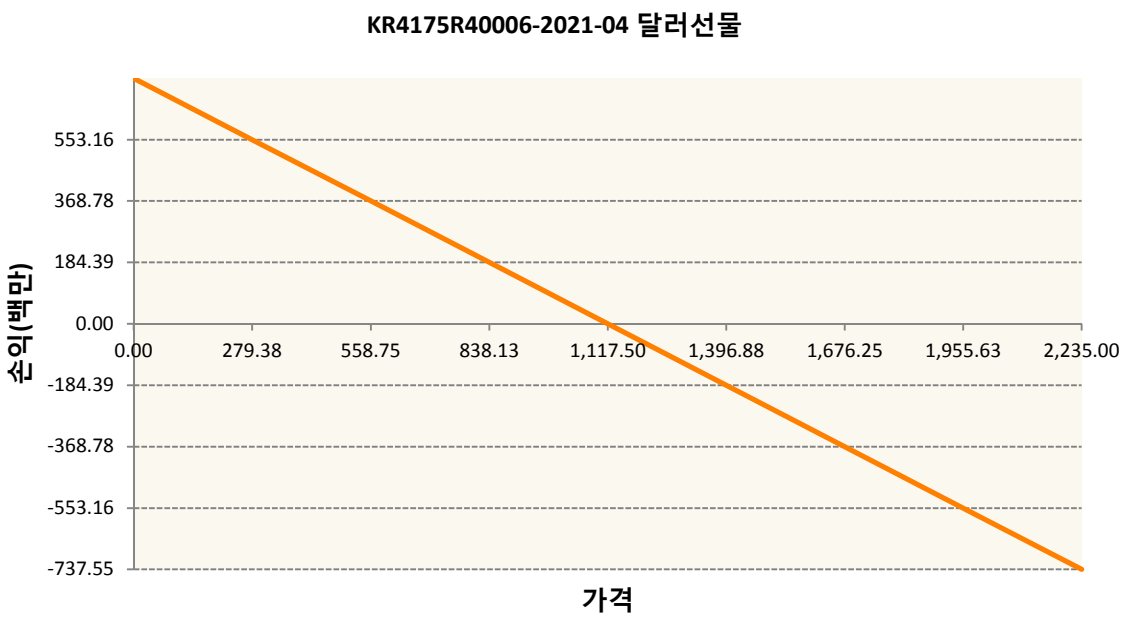
2. 만기시점의 손익구조

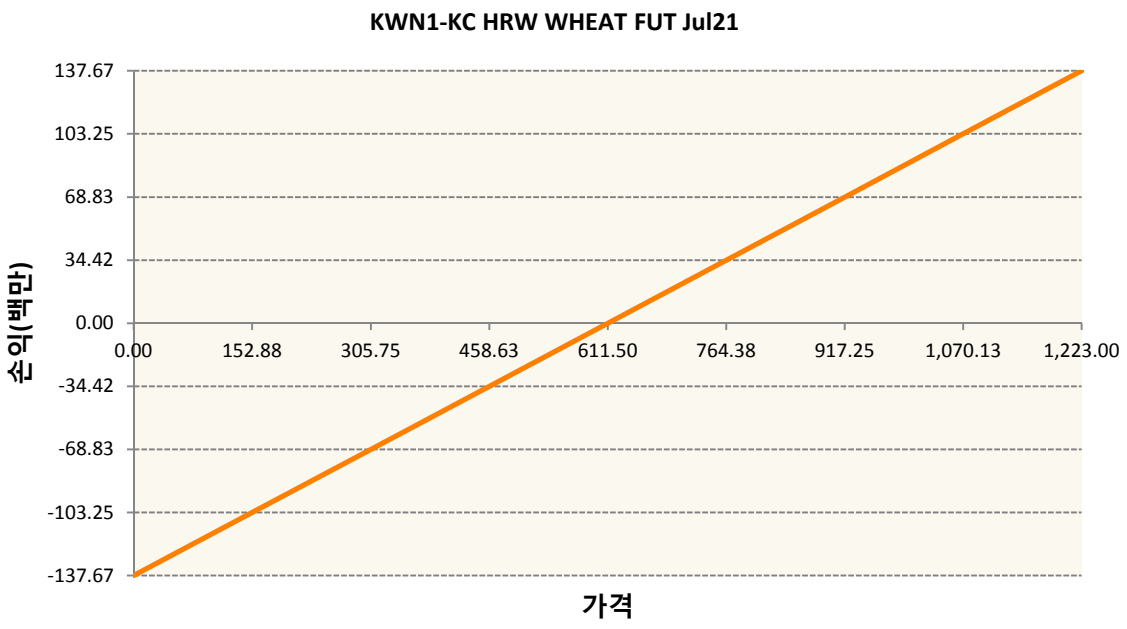


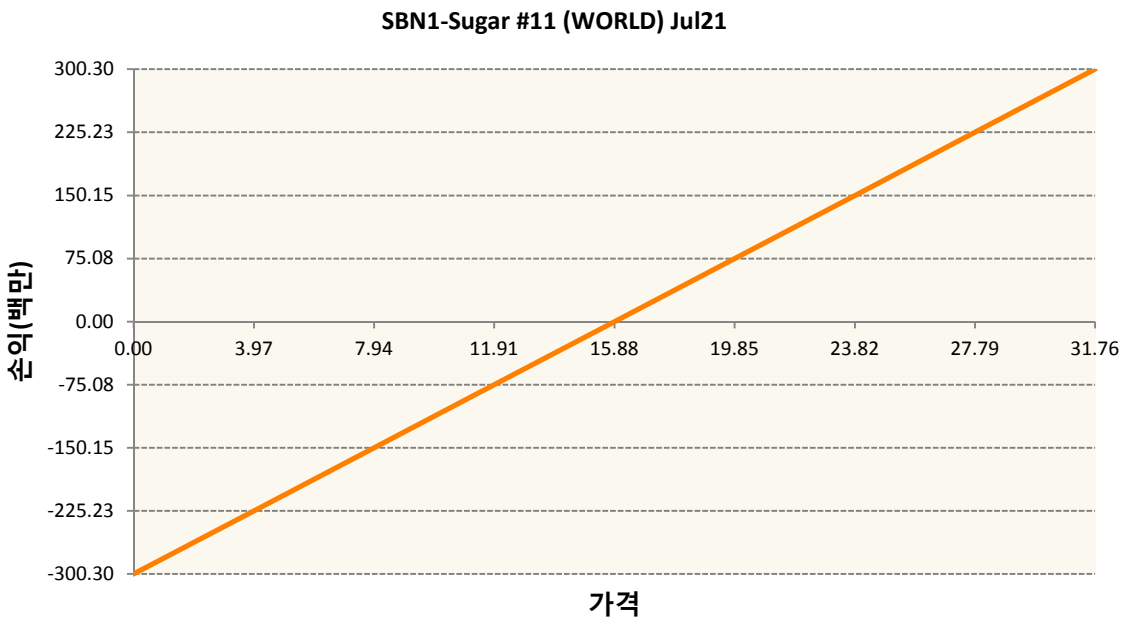


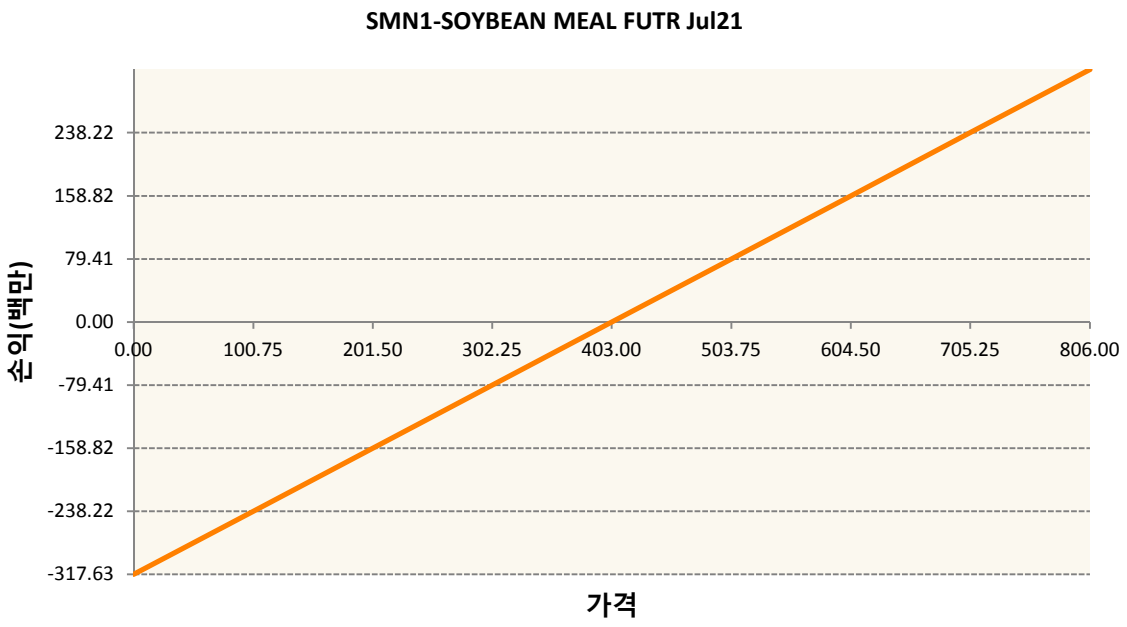

CTN1-COTTON NO.2 FUTR Jul21
144.38
108.29
72.19
36.10
0.00
-36.10
-72.19
-108.29
-144.38
0.00
21.38
42.76
64.14
85.52
106.90
128.28
149.66
171.04
손익(백만)
가격

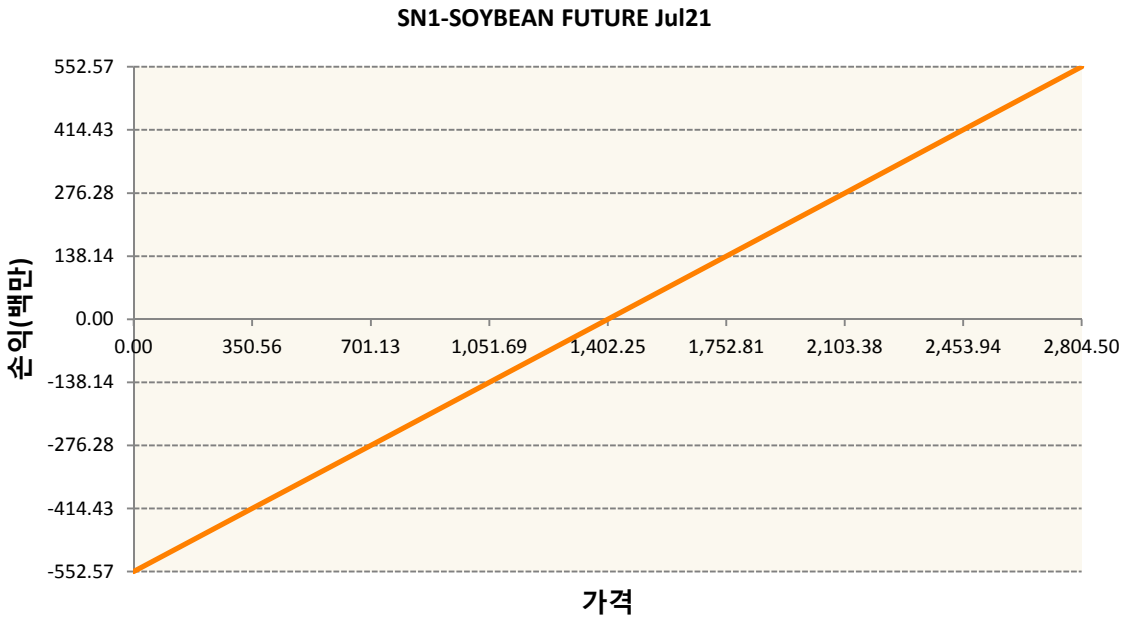

KCN1-COFFEE 'C' FUTURE Jul21
212.20
141.46
70.73
0.00
-70.73
-141.46
-212.20
-282.93
0.00
33.51
67.03
100.54
134.05
167.56
201.08
234.59
268.10
손익(백만)
가격

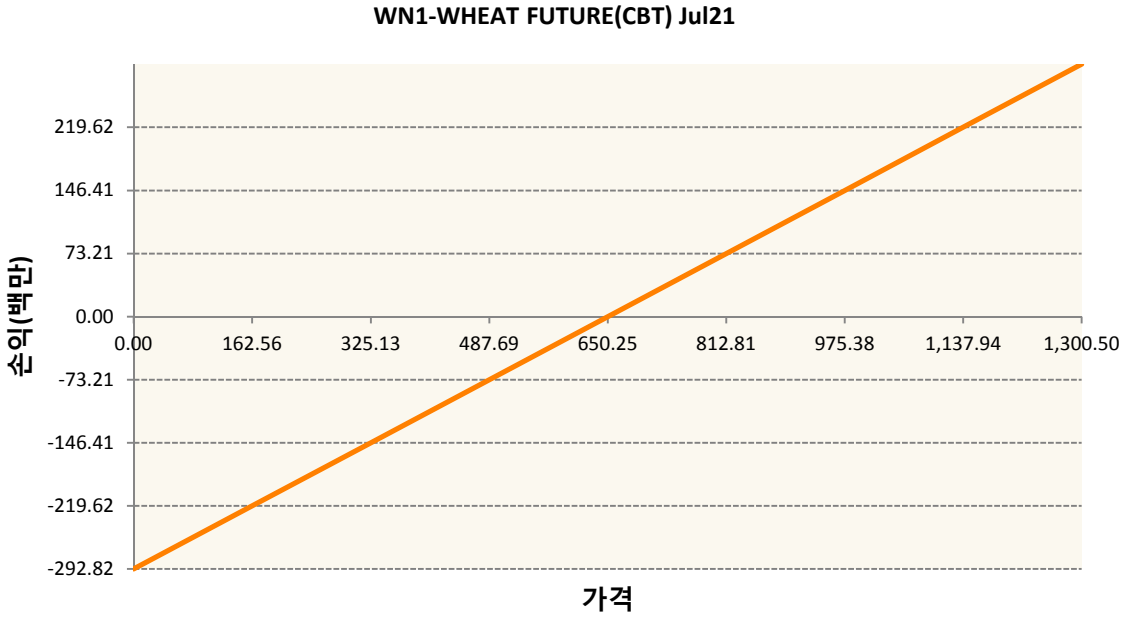

KR4175R40006-2021-04 달러선물
553.16
368.78
184.39
0.00
-184.39
-368.78
-553.16
-737.55
0.00
279.38
558.75
838.13
1,117.50
1,396.88
1,676.25
1,955.63
2,235.00
손익(백만)
가격


KWN1-KC HRW WHEAT FUT Jul21
137.67
103.25
68.83
34.42
0.00
-34.42
-68.83
-103.25
-137.67
0.00
152.88
305.75
458.63
611.50
764.38
917.25
1,070.13
1,223.00
손익(백만)
가격


SBN1-Sugar #11 (WORLD) Jul21
300.30
225.23
150.15
75.08
0.00
-75.08
-150.15
-225.23
-300.30
0.00
3.97
7.94
11.91
15.88
19.85
23.82
27.79
31.76
손익(백만)
가격


SMN1-SOYBEAN MEAL FUTR Jul21
238.22
158.82
79.41
0.00
-79.41
-158.82
-238.22
-317.63
0.00
100.75
201.50
302.25
403.00
503.75
604.50
705.25
806.00
손익(백만)
가격





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON1	SOYBEAN OIL FUTR Jul21	31
CN1	CORN FUTURE Jul21	52
CTN1	COTTON NO.2 FUTR Jul21	12
KCN1	COFFEE 'C' FUTURE Jul21	23
KR4175R400	2021-04 달러선물	59
KWN1	KC HRW WHEAT FUT Jul21	11
SBN1	Sugar #11 (WORLD) Jul21	24
SMN1	SOYBEAN MEAL FUTR Jul21	25
SN1	SOYBEAN FUTURE Jul21	44
WN1	WHEAT FUTURE(CBT) Jul21	23

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

340