

공시일	2020-05-15
기준일	2020-05-14

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)

46

공시일	2020-05-15
기준일	2020-05-14

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

963

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,125

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-15
기준일	2020-05-14

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)

SWCSI500000 신한CSI500미래S200310

571

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

856

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-15
기준일	2020-05-14

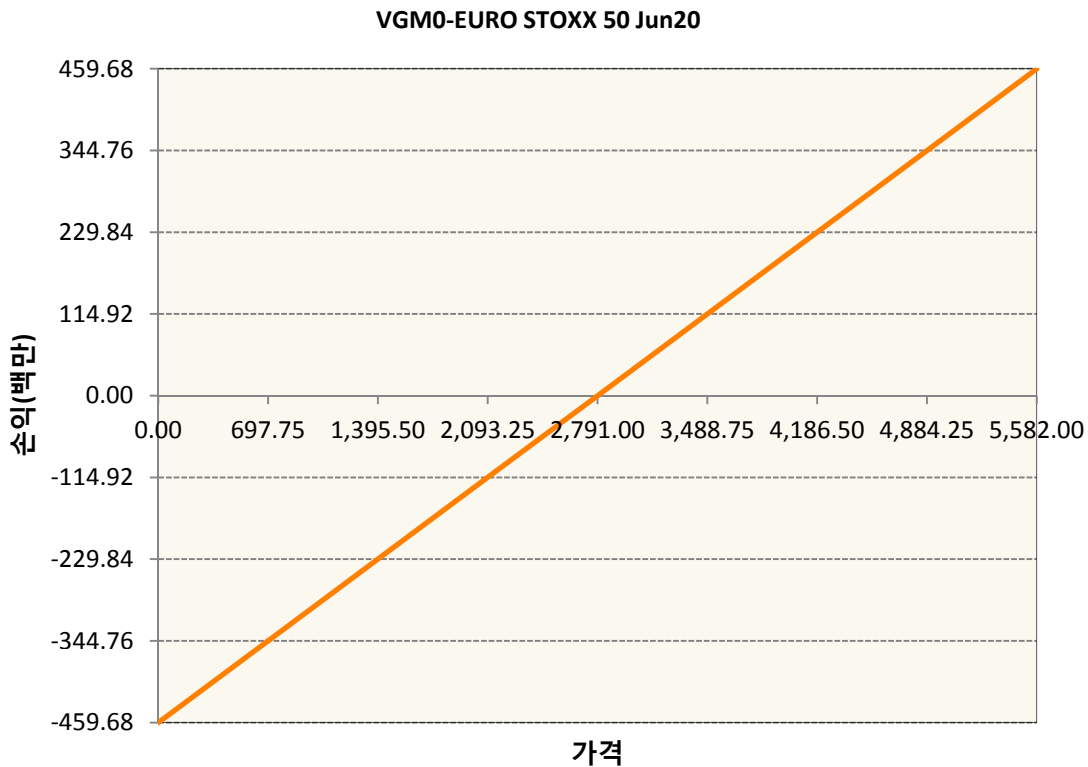
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	460	0	460	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	37
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

47

공시일	2020-05-15
기준일	2020-05-14

차이나인덱스모(주식-파생형)

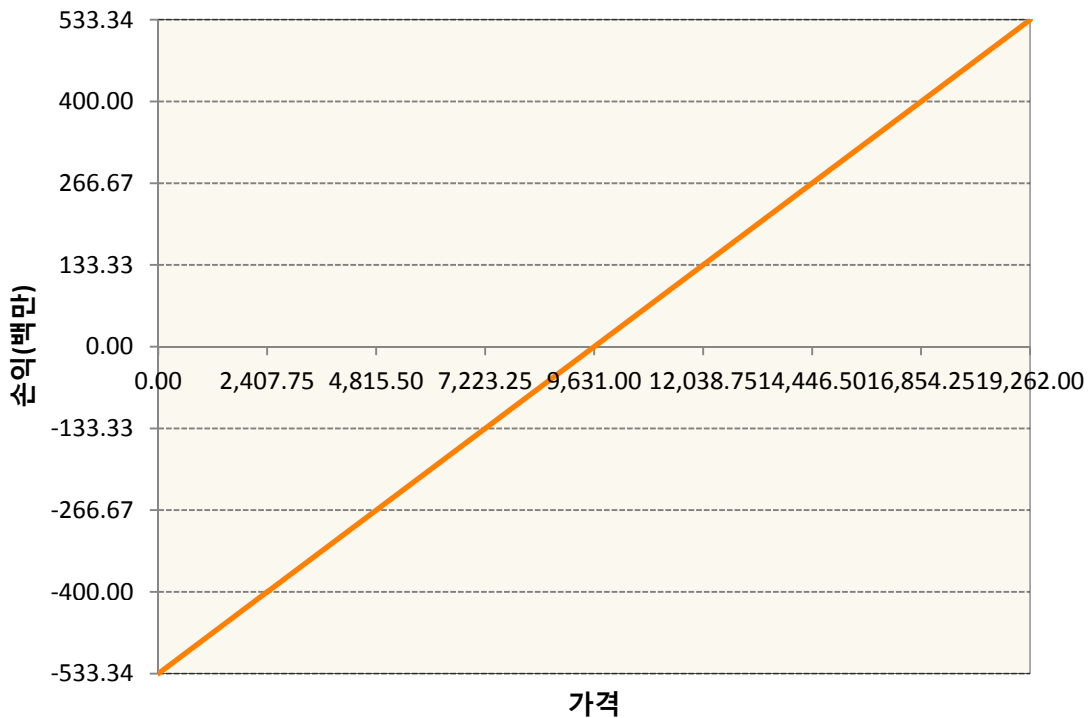
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	533	0	533	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCK0-HSCEI Futures May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

46

공시일	2020-05-15
기준일	2020-05-14

커버드콜모(주식혼합-파생형)

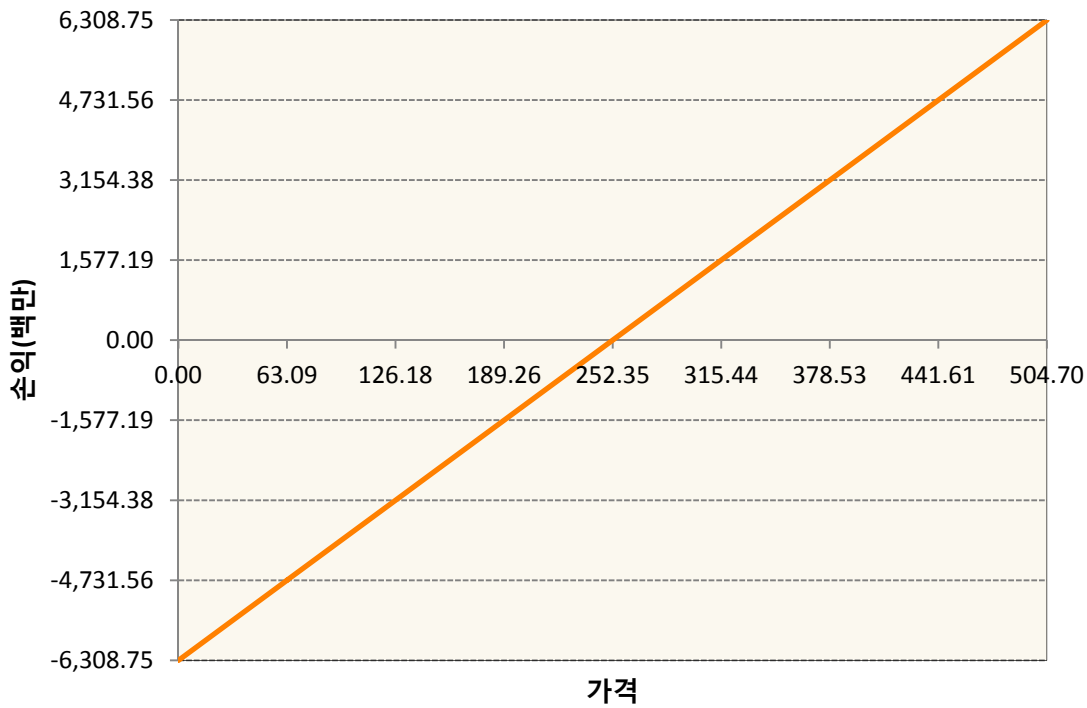
1. 계약금액

(단위:백만원)

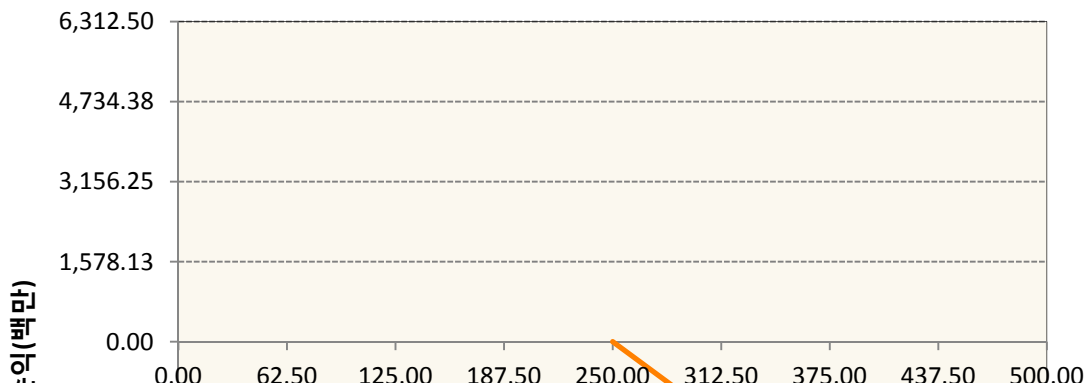
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	129,853	-129,853	장내
누계	유가증권	선물	6,309	0	6,309	장내
누계	유가증권	옵션	0	158,435	-158,435	장내

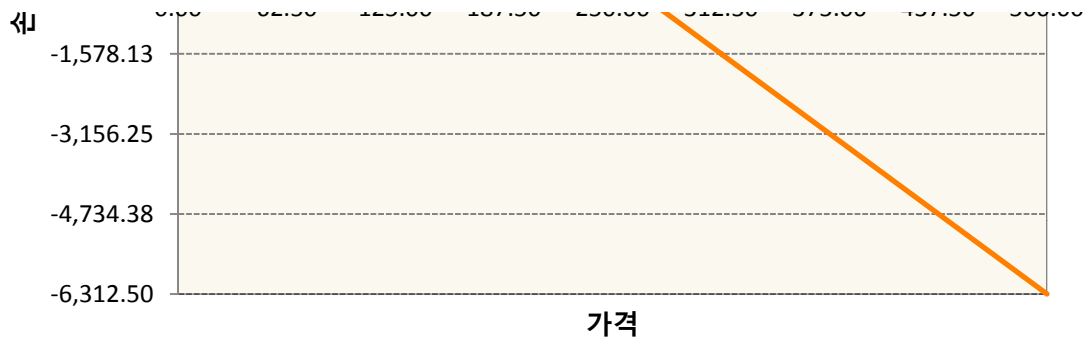
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

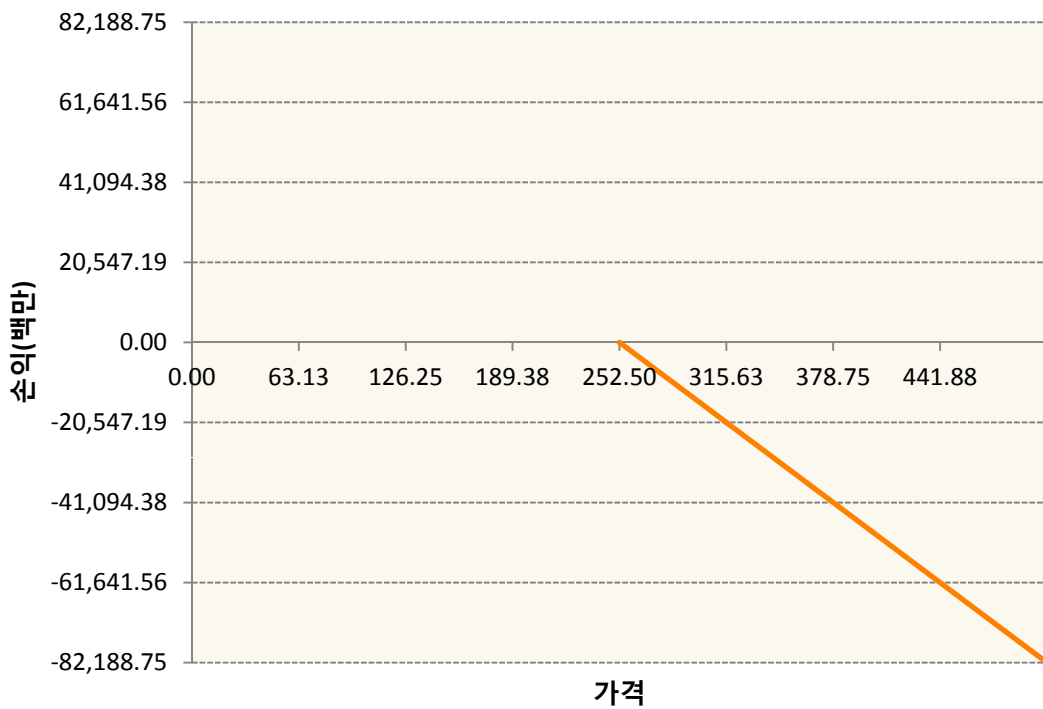


KR4201Q62501-2020-06 콜250

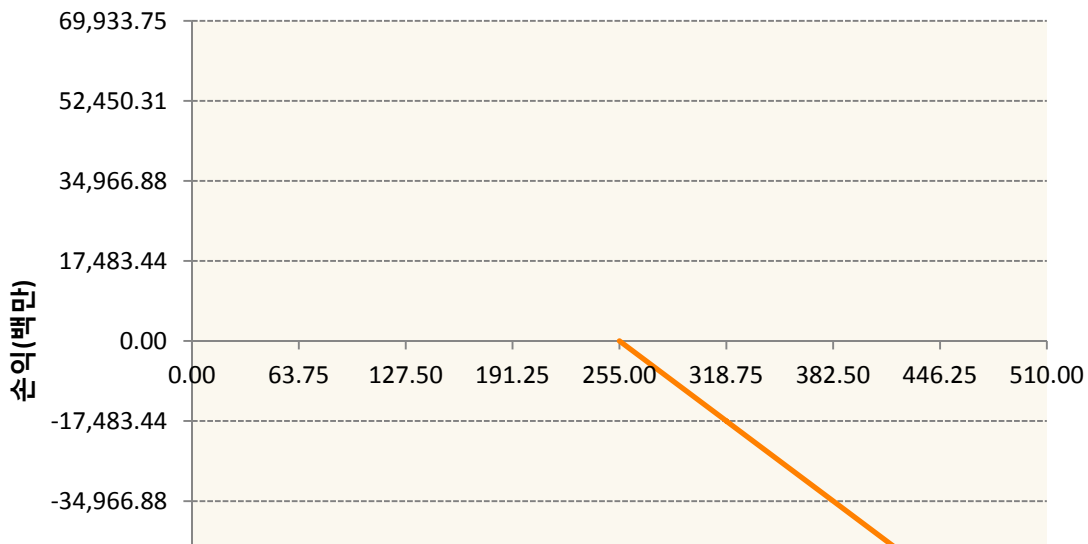


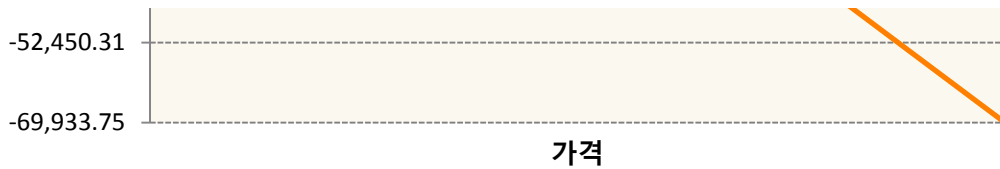


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5



KR4201Q62550-2020-06 콜255





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						507
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-507	-507	-507	-507	-507	-507	-507	
-5.33%	-338	-338	-338	-338	-338	-338	-338	
-2.67%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	169	169	169	169	169	169	169	
5.33%	338	338	338	338	338	338	338	
8.00%	507	507	507	507	507	507	507	
KR4201Q62501		2020-06 콜250						415
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	283	264	244	223	201	179	157	
-5.33%	234	211	187	163	139	115	91	
-2.67%	165	140	115	89	64	38	13	
0%	77	52	26	0	-26	-52	-77	
2.67%	-30	-54	-79	-104	-129	-154	-179	
5.33%	-154	-176	-198	-221	-244	-268	-292	
8.00%	-293	-310	-329	-349	-371	-392	-415	
KR4201Q62527		2020-06 콜252.5						5,199
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3,396	3,167	2,922	2,666	2,401	2,129	1,851	
-5.33%	2,840	2,555	2,264	1,967	1,665	1,360	1,053	
-2.67%	2,050	1,728	1,405	1,080	754	427	100	
0%	1,008	672	336	0	-336	-672	-1,007	
2.67%	-285	-610	-938	-1,268	-1,600	-1,932	-2,266	
5.33%	-1,807	-2,101	-2,403	-2,713	-3,027	-3,345	-3,667	
8.00%	-3,524	-3,773	-4,038	-4,315	-4,602	-4,897	-5,199	
KR4201Q62550		2020-06 콜255						4,250
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,654	2,476	2,283	2,079	1,866	1,645	1,418	
-5.33%	2,246	2,019	1,783	1,542	1,295	1,044	790	
-2.67%	1,652	1,388	1,120	851	580	307	34	

0%	852	568	284	0	-284	-568	-852
2.67%	-159	-442	-726	-1,010	-1,295	-1,580	-1,866
5.33%	-1,371	-1,633	-1,901	-2,172	-2,446	-2,723	-3,002
8.00%	-2,757	-2,985	-3,224	-3,472	-3,726	-3,986	-4,250

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

(단위:백만원)

9,001

공시일	2020-05-15
기준일	2020-05-14

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

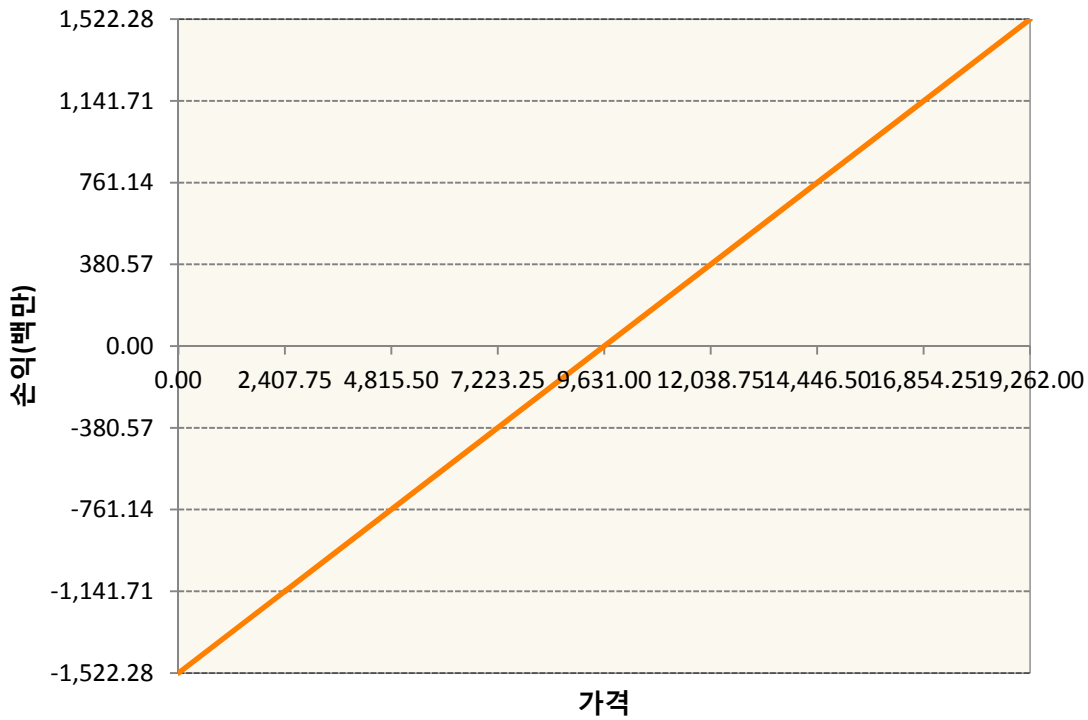
1. 계약금액

(단위:백만원)

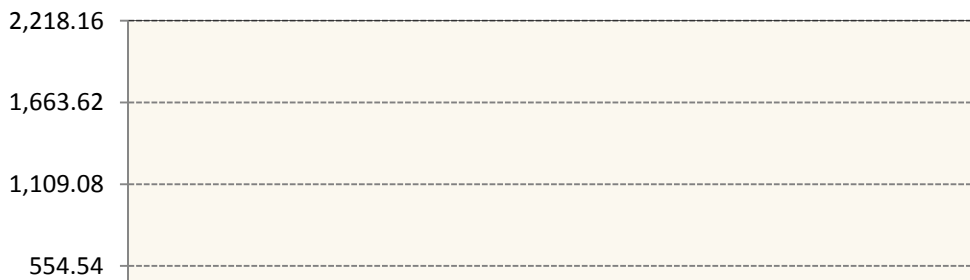
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,522	0	1,522	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,436	-4,436	장내
누계	통화	선도	697	2,231	-1,534	장외

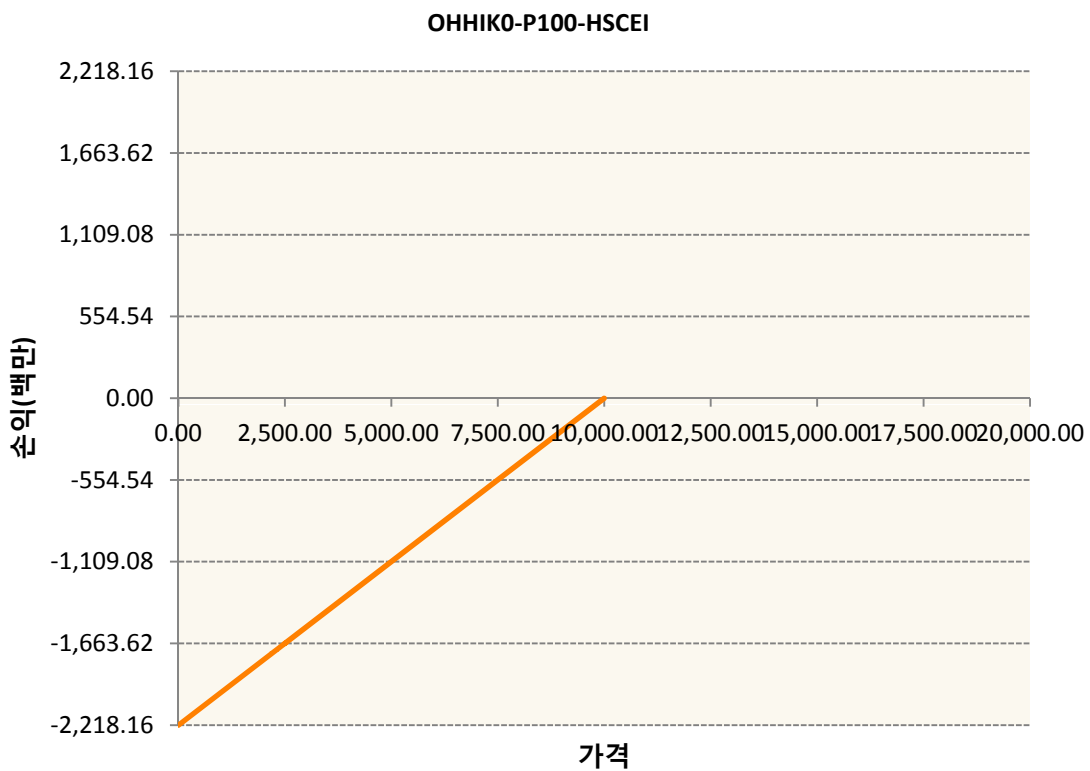
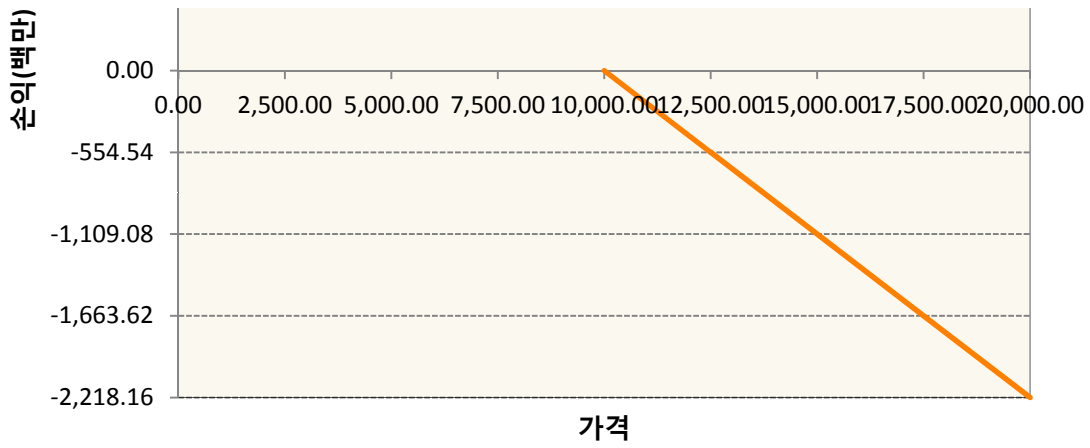
2. 만기시점의 손익구조

HCK0-HSCEI Futures May20



OHHIK0-C100-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E		178
FX21020H05 HKD/KRW 22-05-20E		56
HCK0 HSCEI Futures May20		122
OHHIK0-C1C HSCEI		177
OHHIK0-P10 HSCEI		177

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	633

공시일	2020-05-15
기준일	2020-05-14

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

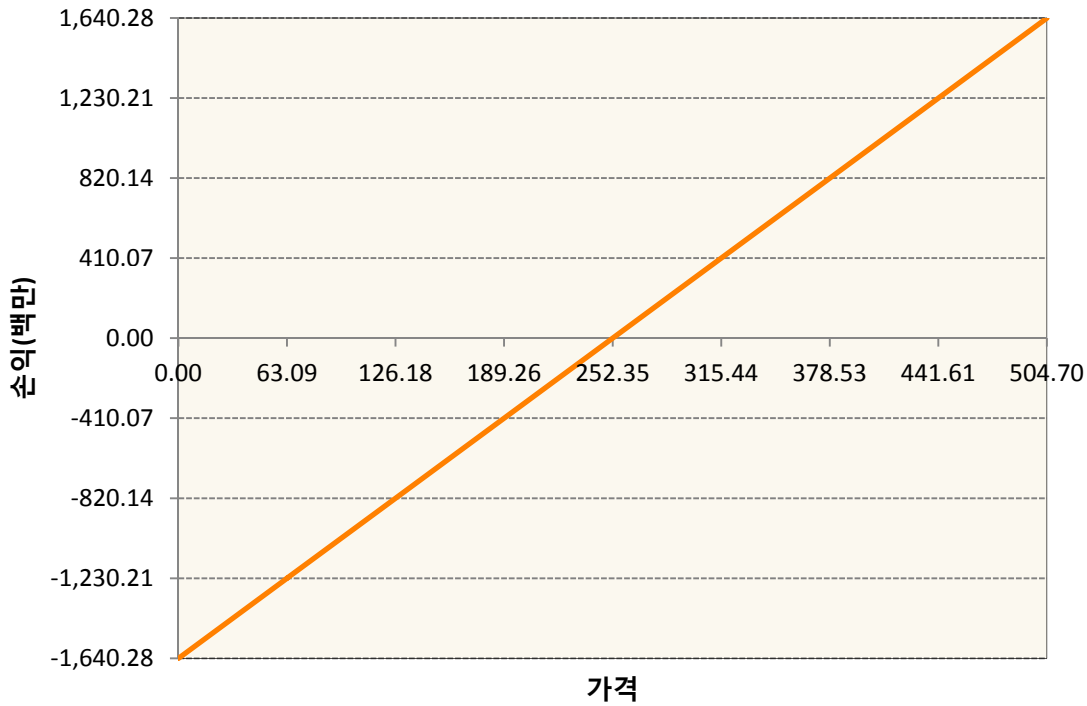
1. 계약금액

(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
누계	유가증권	선물	1,640	0	1,640	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



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							132
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	44	44	44	44	44	44	44
5.33%	88	88	88	88	88	88	88
8.00%	132	132	132	132	132	132	132

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

(단위:백만원)

384

공시일	2020-05-15
기준일	2020-05-14

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

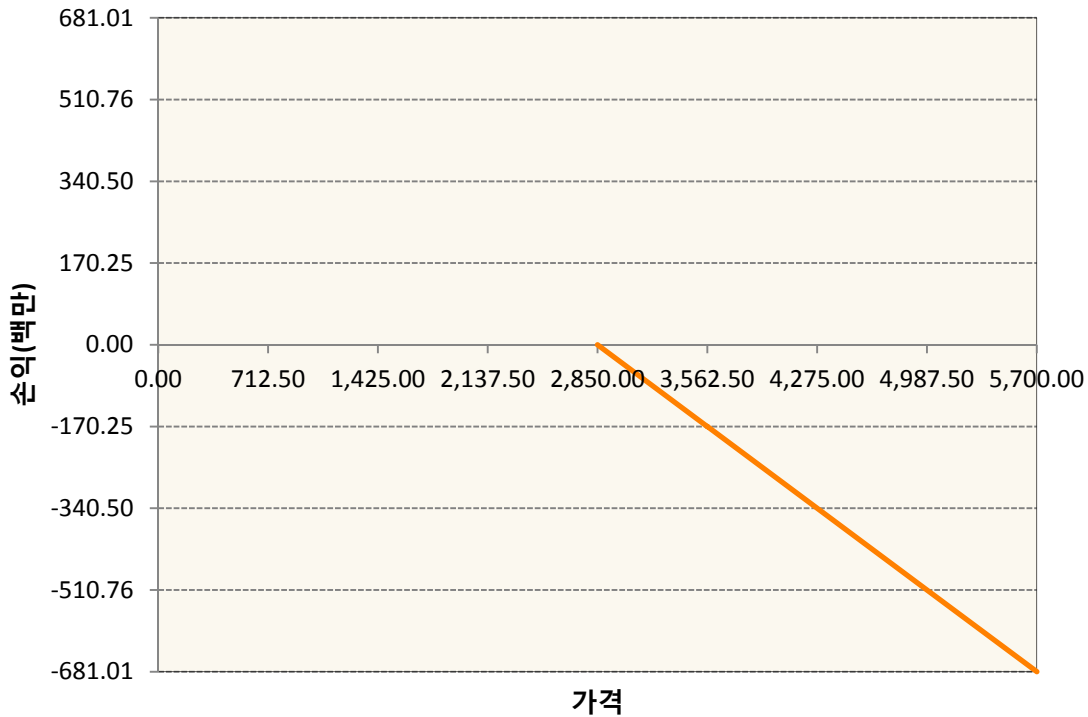
1. 계약금액

(단위:백만원)

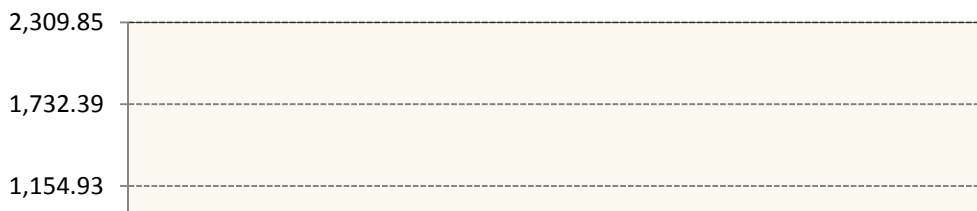
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	711	0	711	
누계	유가증권	스왑	7,917	0	7,917	장외
누계	유가증권	옵션	0	5,982	-5,982	장내
누계	통화	선도	0	2,687	-2,687	장외

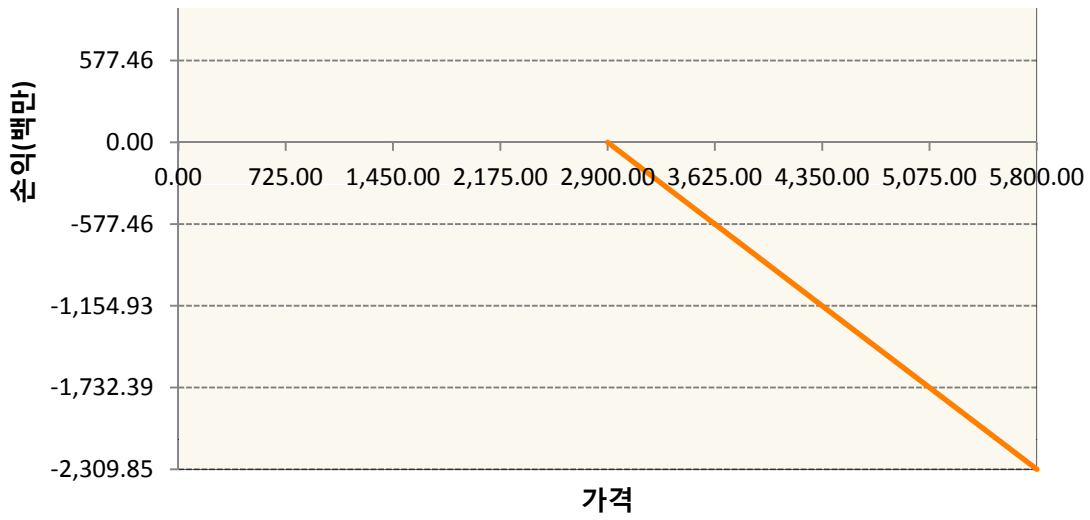
2. 만기시점의 손익구조

OESXK0-C2850-EURO STOXX 50

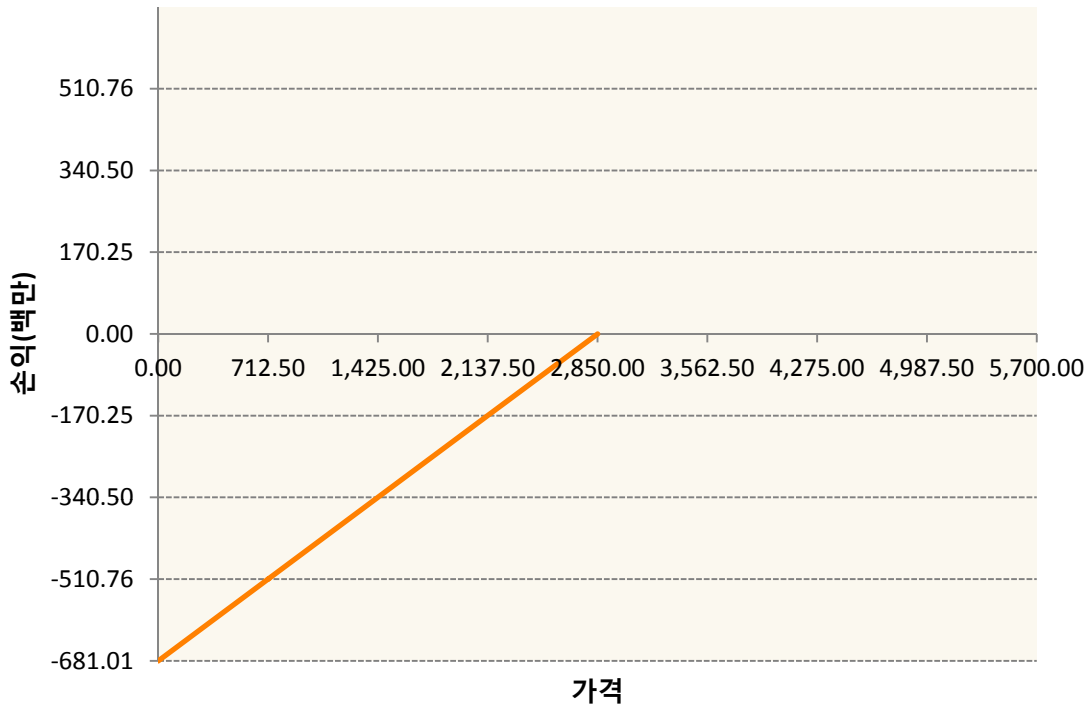


OESXK0-C2900-EURO STOXX 50

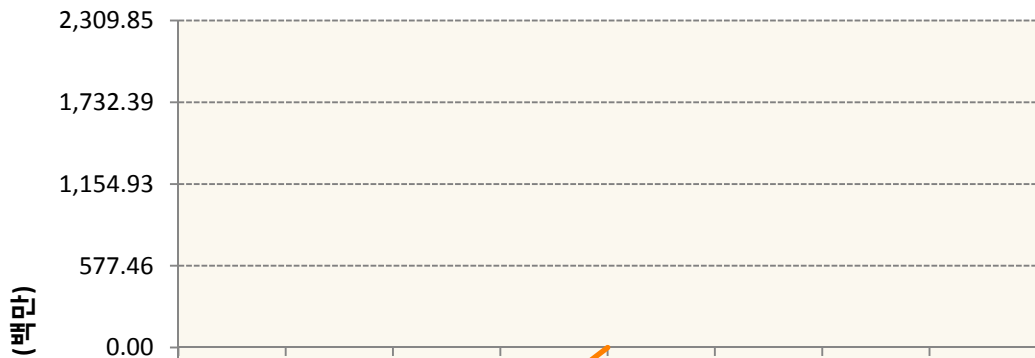


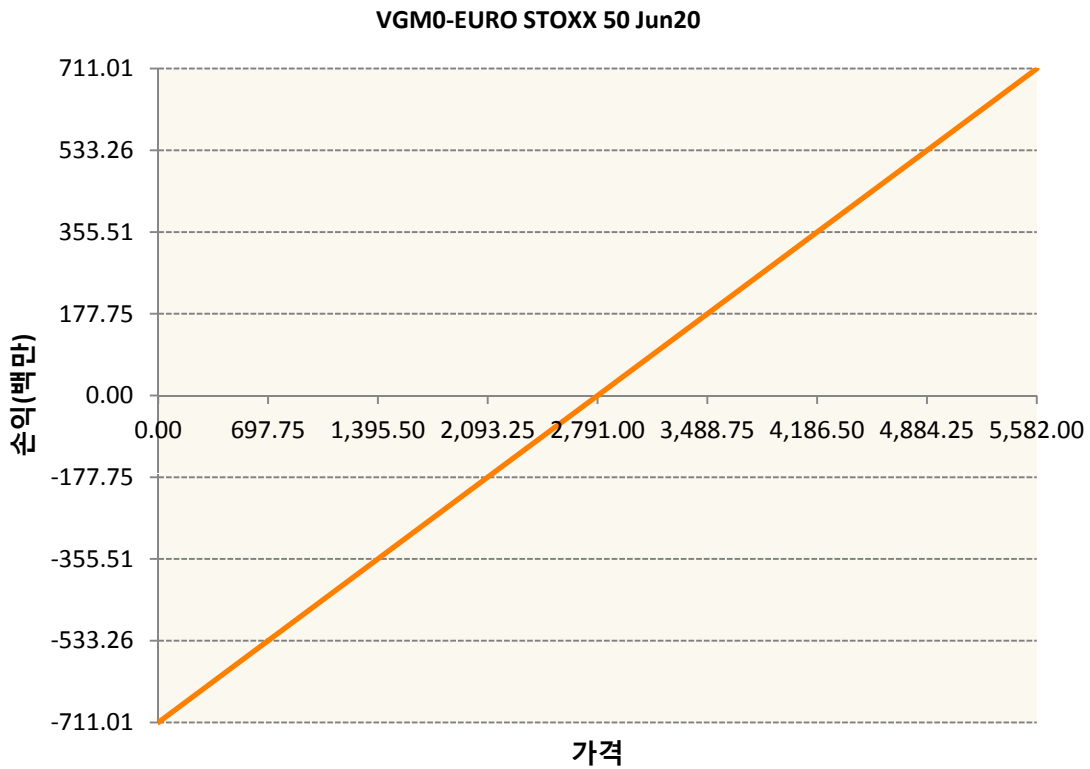
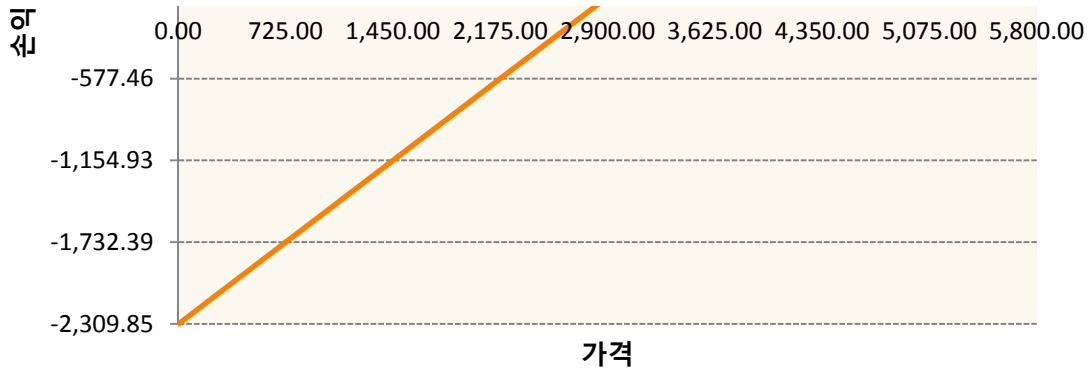


OESXK0-P2850-EURO STOXX 50



OESXK0-P2900-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		8
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E		215
OESXK0-C28 EURO STOXX 50		54
OESXK0-C29 EURO STOXX 50		185
OESXK0-P28 EURO STOXX 50		54
OESXK0-P29 EURO STOXX 50		185
VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	57

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

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

(단위:백만원)

1,128

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

(단위:백만원)

98

공시일	2020-05-15
기준일	2020-05-14

ETF스마트레버리지목표전환형10호

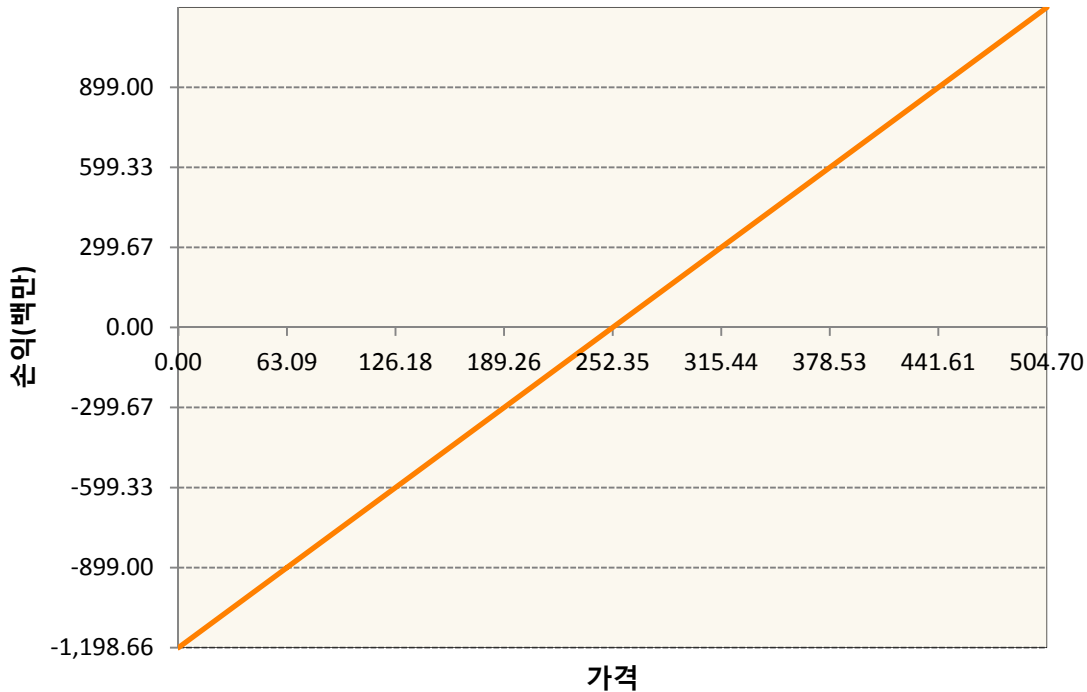
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						96
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96	
-5.33%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64	
-2.67%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	32	32	32	32	32	32	32	
5.33%	64	64	64	64	64	64	64	
8.00%	96	96	96	96	96	96	96	

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

(단위:백만원)

143

공시일	2020-05-15
기준일	2020-05-14

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

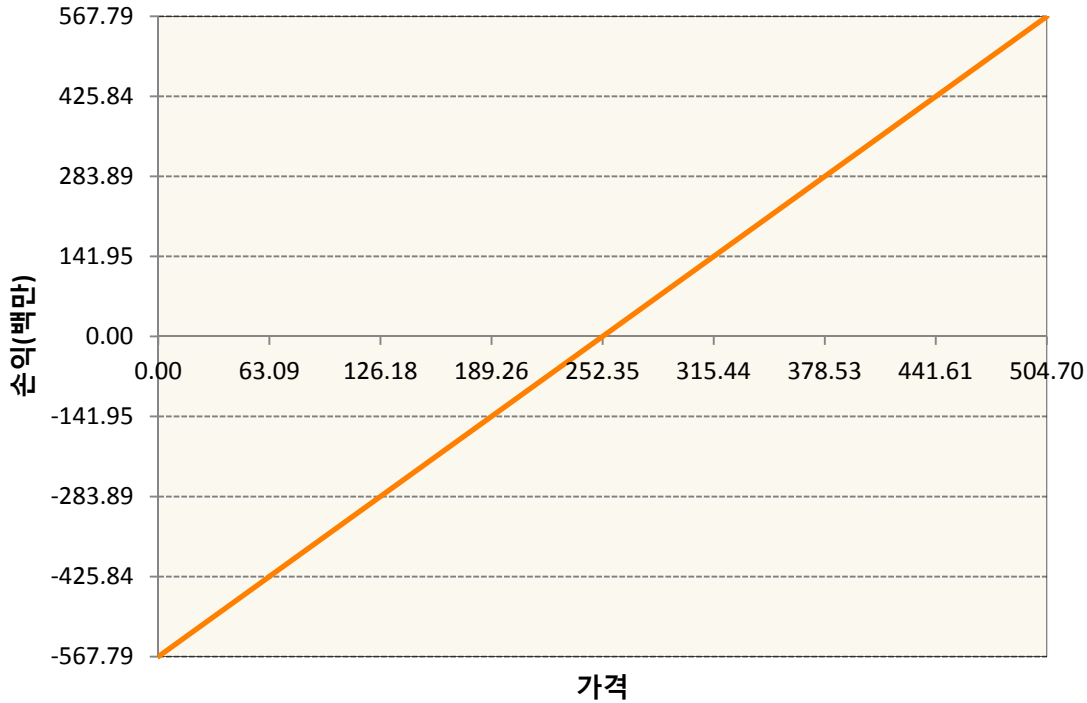
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	568	0	568	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						46
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46	
-5.33%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30	
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	15	15	15	15	15	15	15	
5.33%	30	30	30	30	30	30	30	
8.00%	46	46	46	46	46	46	46	

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

(단위:백만원)

68

공시일	2020-05-15
기준일	2020-05-14

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

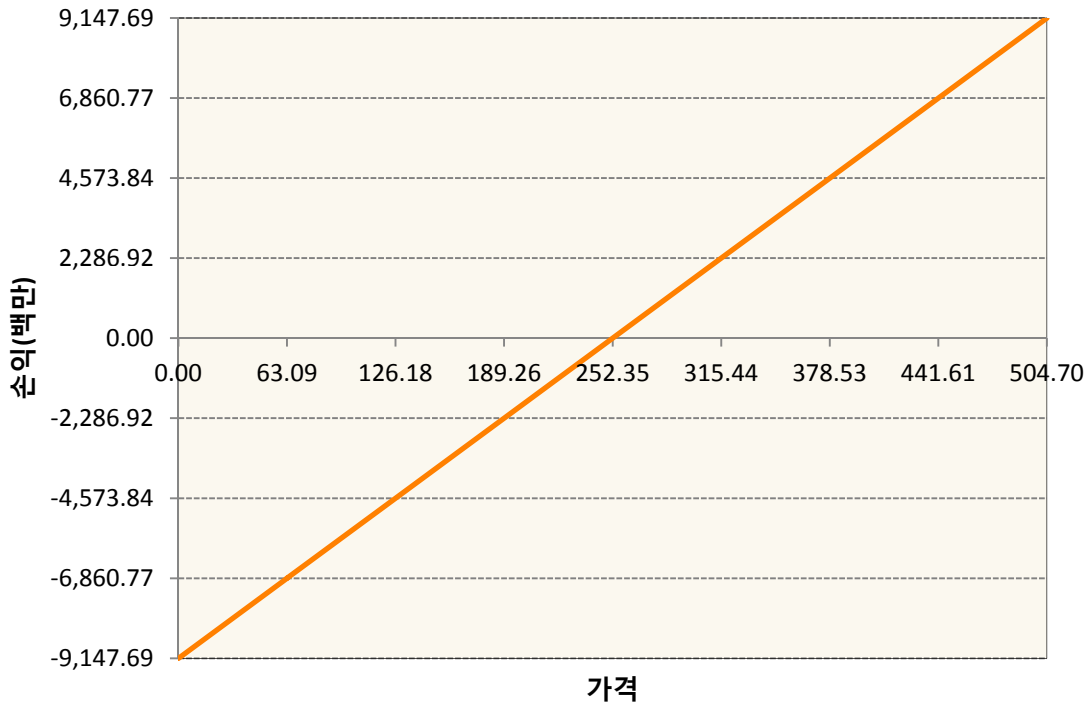
1. 계약금액

(단위:백만원)

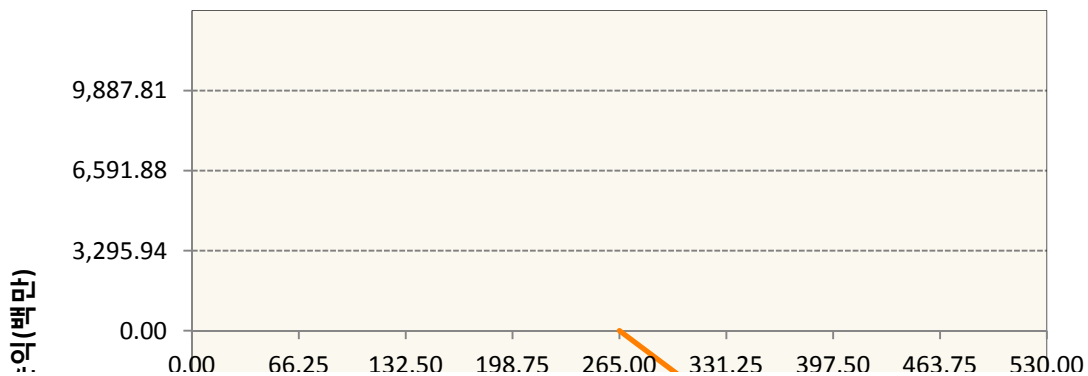
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	3,321	18,220	-14,900	장내
누계	유가증권	선물	9,148	0	9,148	장내
누계	유가증권	옵션	3,416	18,133	-14,717	장내

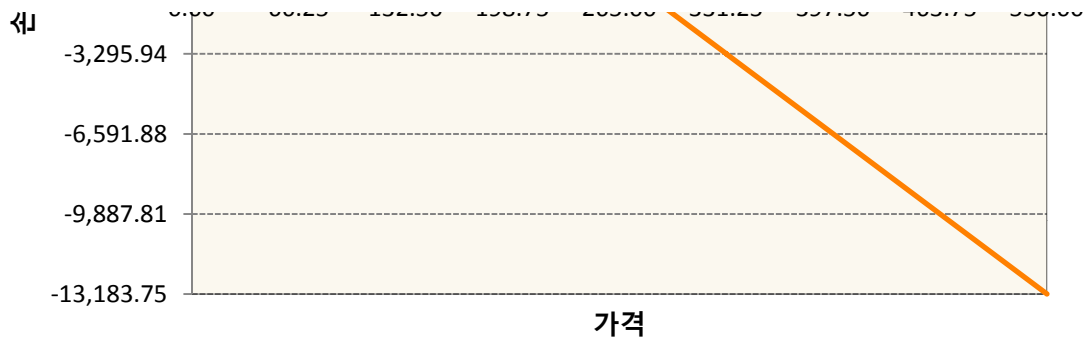
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

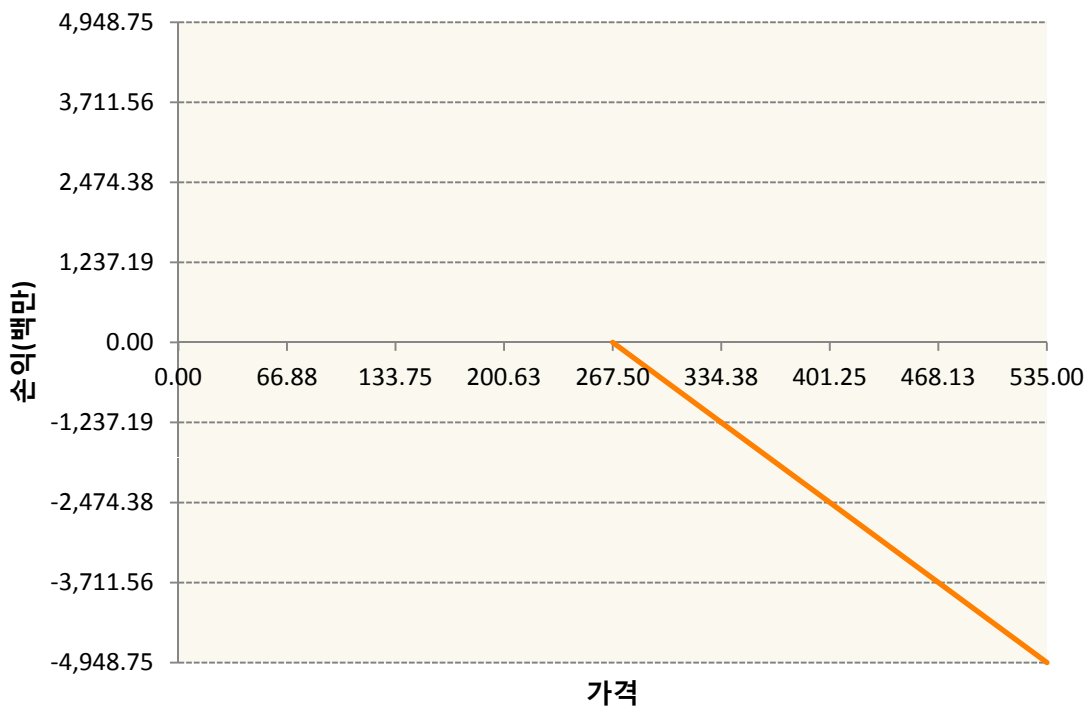


KR4201Q62659-2020-06 콜265

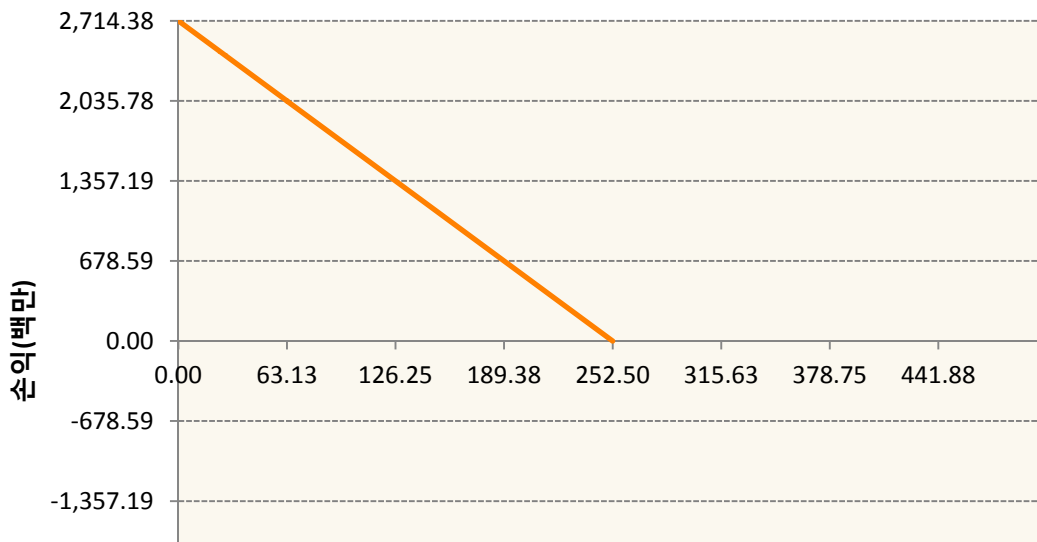


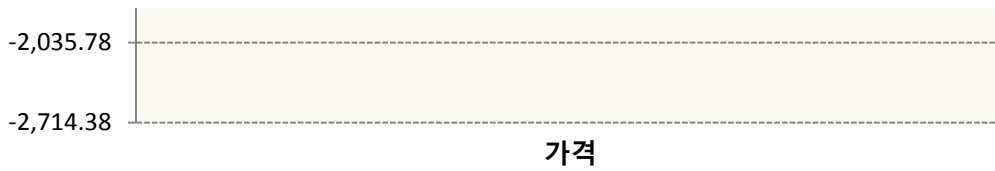


KR4201Q62675-2020-06 콜267.5

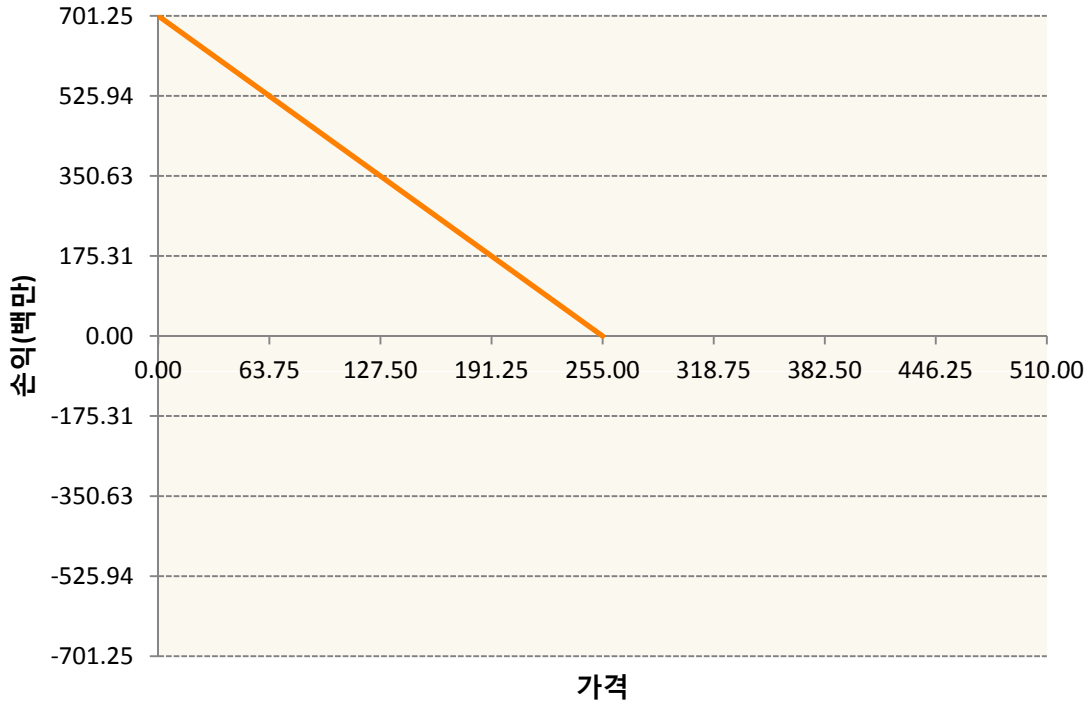


KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





KR4301Q62558-2020-06 풋255



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						736
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-736	-736	-736	-736	-736	-736	-736	
-5.33%	-490	-490	-490	-490	-490	-490	-490	
-2.67%	-245	-245	-245	-245	-245	-245	-245	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	245	245	245	245	245	245	245	
5.33%	490	490	490	490	490	490	490	
8.00%	736	736	736	736	736	736	736	
KR4201Q62659		2020-06 콜265						668
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	341	320	295	267	237	204	169	
-5.33%	302	271	238	202	164	125	84	
-2.67%	238	199	157	114	70	24	-22	

0%	144	97	49	0	-49	-99	-150
2.67%	16	-36	-89	-142	-194	-247	-300
5.33%	-150	-204	-257	-311	-365	-419	-473
8.00%	-351	-403	-456	-508	-561	-615	-668
KR4201Q62675 2020-06 콜267.5							238
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	115	108	100	90	80	68	56
-5.33%	103	93	81	69	55	41	27
-2.67%	82	69	54	39	23	7	-10
0%	52	35	18	0	-18	-36	-55
2.67%	9	-10	-30	-49	-68	-88	-107
5.33%	-48	-68	-88	-108	-128	-149	-169
8.00%	-118	-138	-158	-178	-198	-218	-238
KR4301Q62525 2020-06 풋252.5							158
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	136	139	142	145	149	154	158
-5.33%	73	78	83	88	93	99	105
-2.67%	20	26	33	39	46	52	59
0%	-21	-14	-7	0	7	14	21
2.67%	-48	-42	-36	-29	-23	-16	-9
5.33%	-64	-60	-55	-49	-44	-38	-32
8.00%	-73	-70	-66	-62	-58	-53	-48
KR4301Q62558 2020-06 풋255							43
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	38	38	39	40	41	42	43
-5.33%	21	22	23	24	26	27	28
-2.67%	6	8	9	11	13	14	16
0%	-5	-4	-2	0	2	4	5
2.67%	-14	-12	-10	-8	-7	-5	-3
5.33%	-19	-17	-16	-14	-13	-11	-10
8.00%	-22	-21	-20	-18	-17	-16	-14

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

(단위:백만원)

1,909

공시일	2020-05-15
기준일	2020-05-14

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	149,757	0	149,757	

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	2020-05-15
기준일	2020-05-14

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	100,973	0	100,973	

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	2020-05-15
기준일	2020-05-14

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	446,108	0	446,108	
누계	통화	선도	0	470,324	-470,324	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	2,397
FX21020H05 KRW/USD 18-05-20E	982
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	845
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	737
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	491
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,438
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,975
FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E	2,947
FX21020J02€ KRW/USD 10-06-20E	1,336
FX21020J02£ KRW/USD 22-06-20E	1,513
FX21020J02¥ KRW/USD 22-06-20E	1,965
FX21020J03¥ KRW/USD 24-07-20E	2,210
FX21020J04¥ KRW/USD 24-07-20E	1,768
FX21020J04¥ KRW/USD 24-07-20E	1,965
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	2,043
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	1,945
FX21020K01 KRW/USD 22-06-20E	688
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	2,397
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	982

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

19,051

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

(단위:백만원)

196

공시일	2020-05-15
기준일	2020-05-14

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

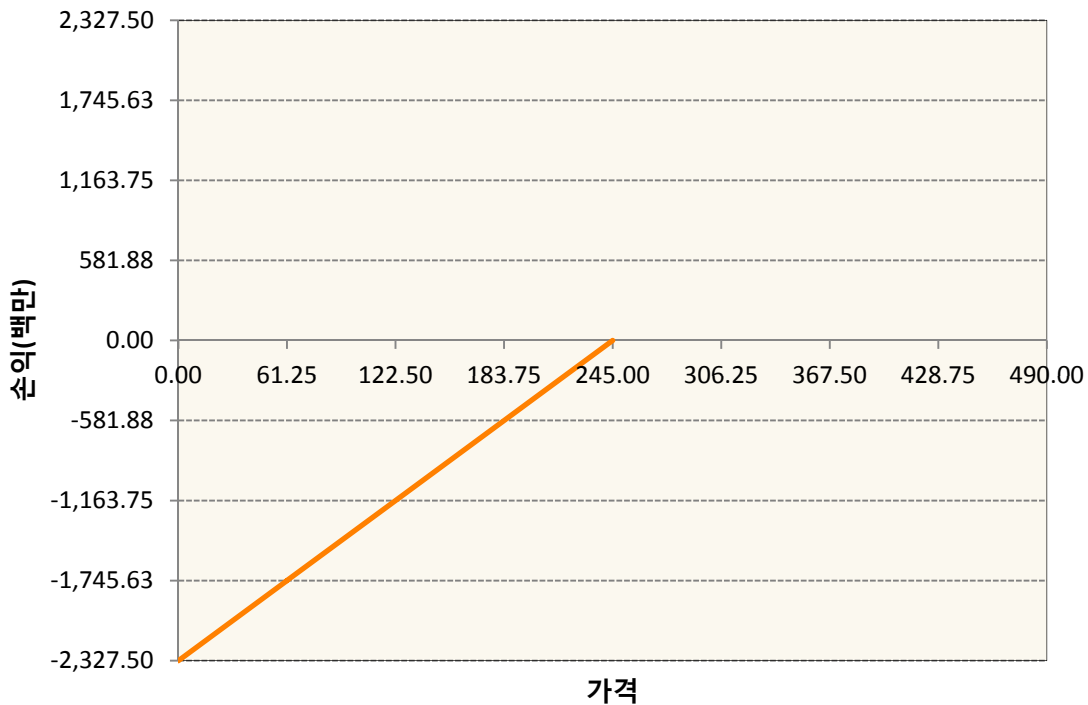
1. 계약금액

(단위:백만원)

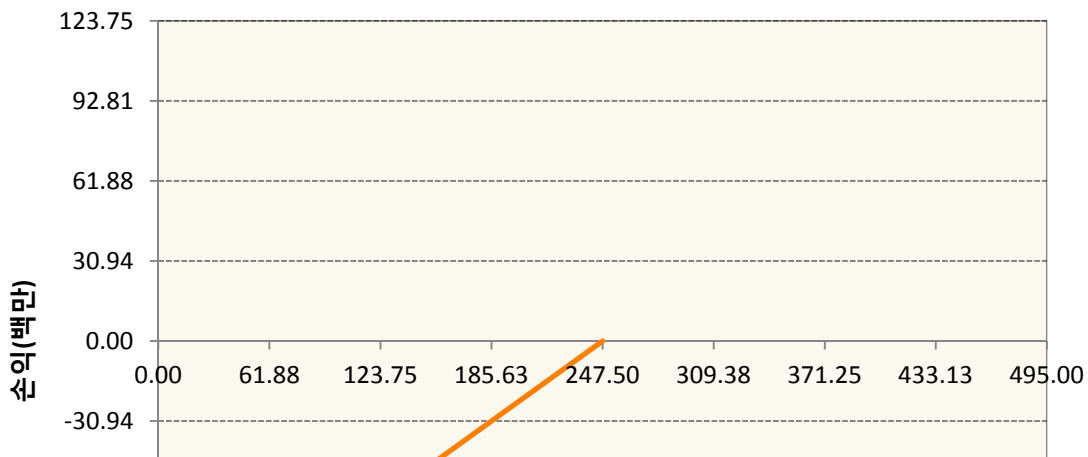
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	2,495	-2,495	장내
누계	유가증권	옵션	0	2,451	-2,451	장내

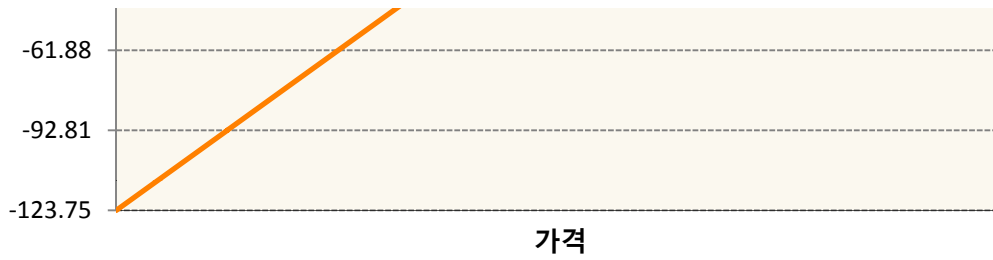
2. 만기시점의 손익구조

KR4301Q62459-2020-06 풋245



KR4301Q62475-2020-06 풋247.5





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4301Q62459		2020-06 풋245						115
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-88	-92	-96	-101	-106	-110	-115	
-5.33%	-41	-47	-53	-58	-64	-70	-75	
-2.67%	-7	-13	-19	-25	-31	-36	-42	
0%	16	11	5	0	-6	-11	-17	
2.67%	29	25	21	17	12	7	2	
5.33%	35	33	30	27	24	20	16	
8.00%	38	37	35	33	31	28	25	
KR4301Q62475		2020-06 풋247.5						7
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-5	-5	-6	-6	-6	-6	-7	
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-4	-4	-4	
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-2	-2	-2	
0%	1	1	0	0	0	-1	-1	
2.67%	2	2	1	1	1	0	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)

104

공시일	2020-05-15
기준일	2020-05-14

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	7,353	0	7,353	
누계	통화	선도	0	7,184	-7,184	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J04(KRW/USD 29-05-20E	253
FX21020K01(KRW/USD 15-06-20E	321
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

291

공시일	2020-05-15
기준일	2020-05-14

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

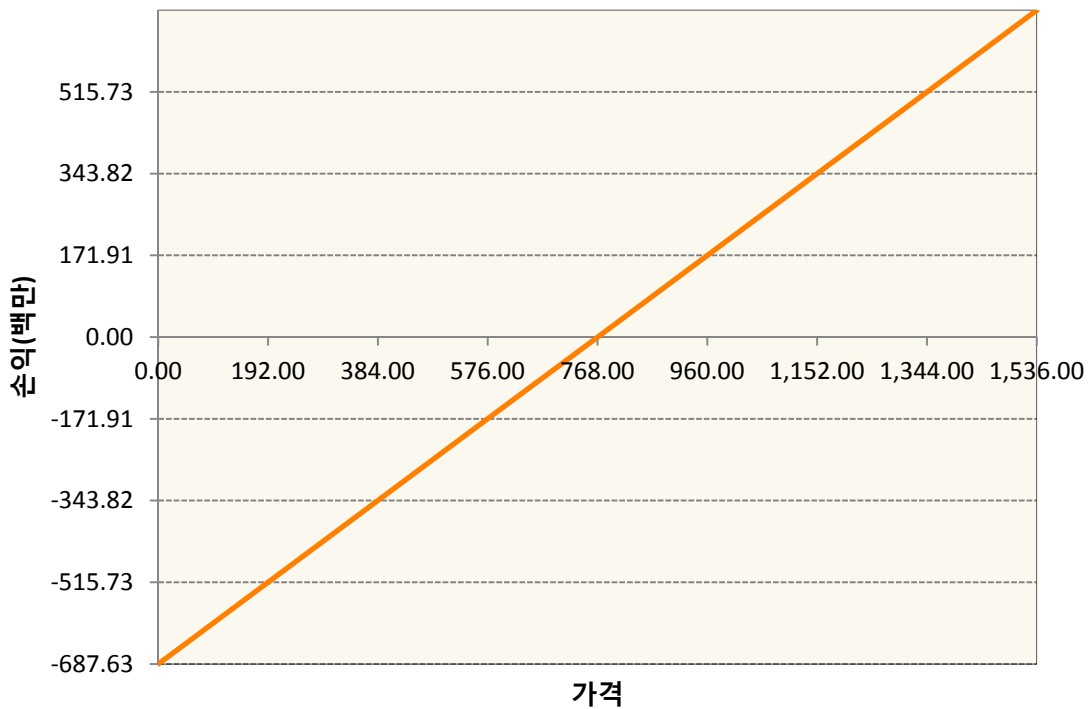
1. 계약금액

(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	688	0	688	
누계	유가증권	스왑	870	0	870	장외
누계	통화	선도	204	868	-664	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCK0-VN30 Index Future May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	70
FX21020G01 KRW/EUR 22-05-20E	5
FX21020G05 KRW/EUR 26-06-20E	12
FX21020H09 EUR/KRW 26-06-20E	8
FX21020H11 EUR/KRW 26-06-20E	8
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	8
VNCK0 VN30 Index Future May20	55

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

(단위:백만원)

161

공시일	2020-05-15
기준일	2020-05-14

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

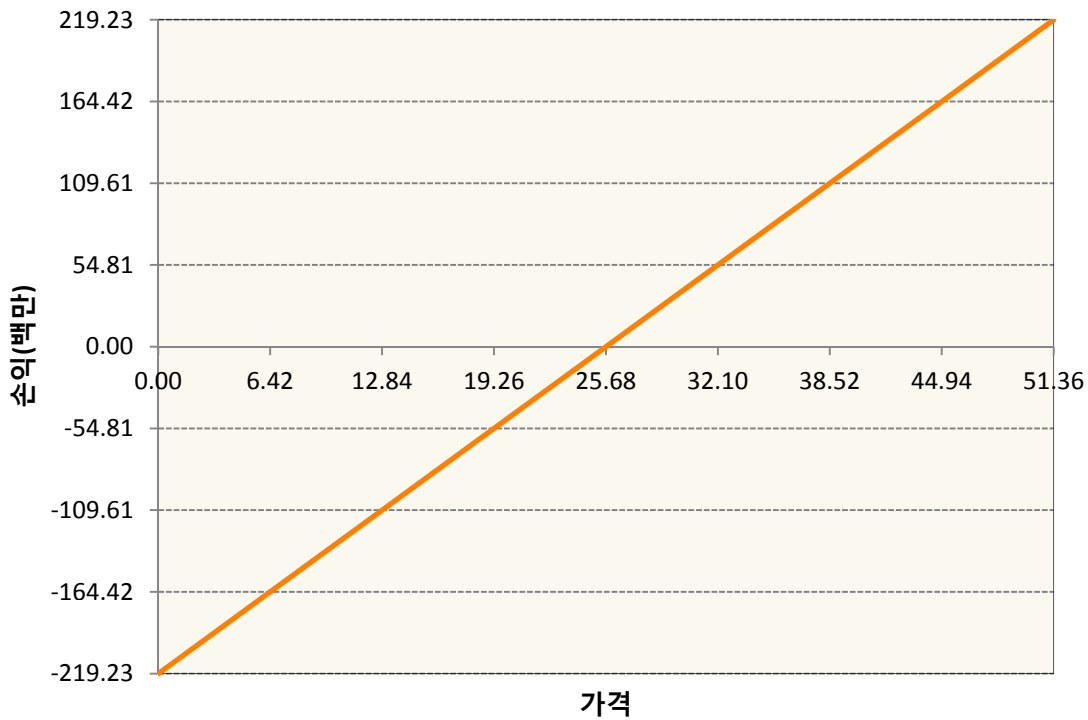
1. 계약금액

(단위:백만원)

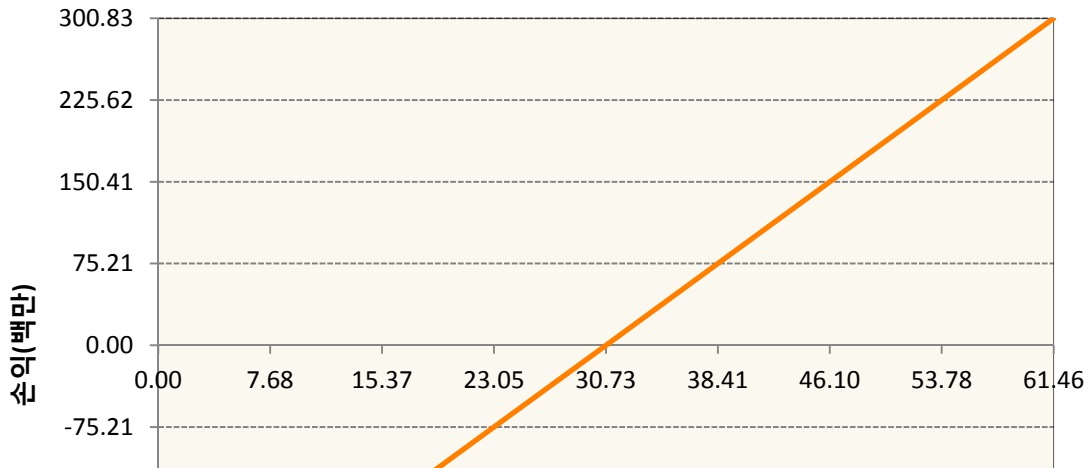
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,482	184	1,297	

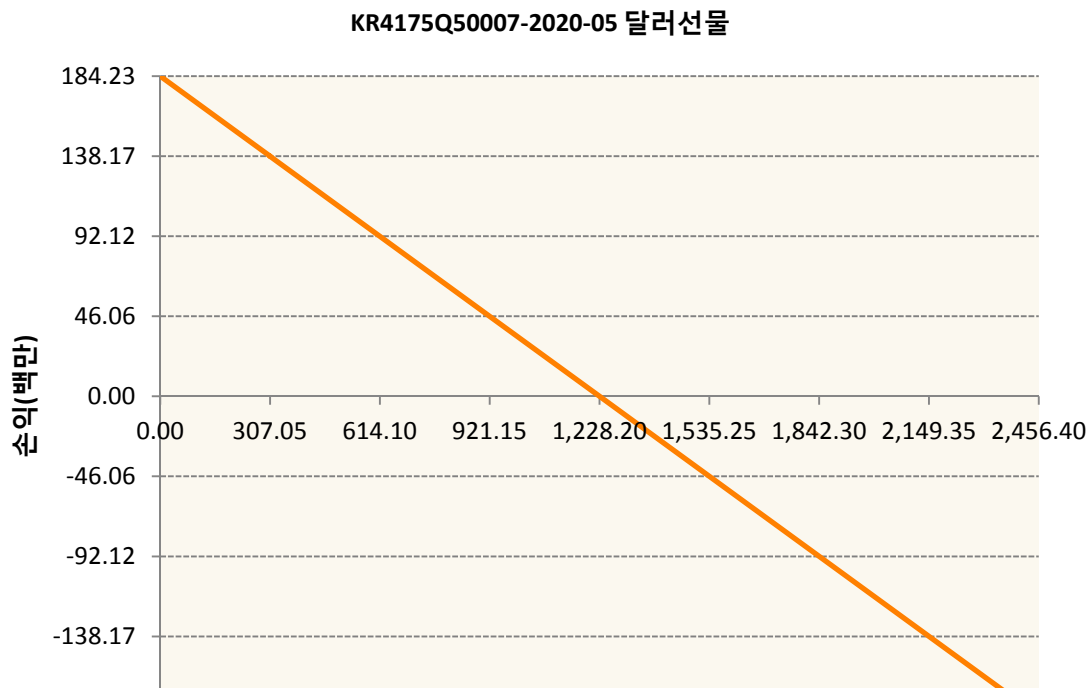
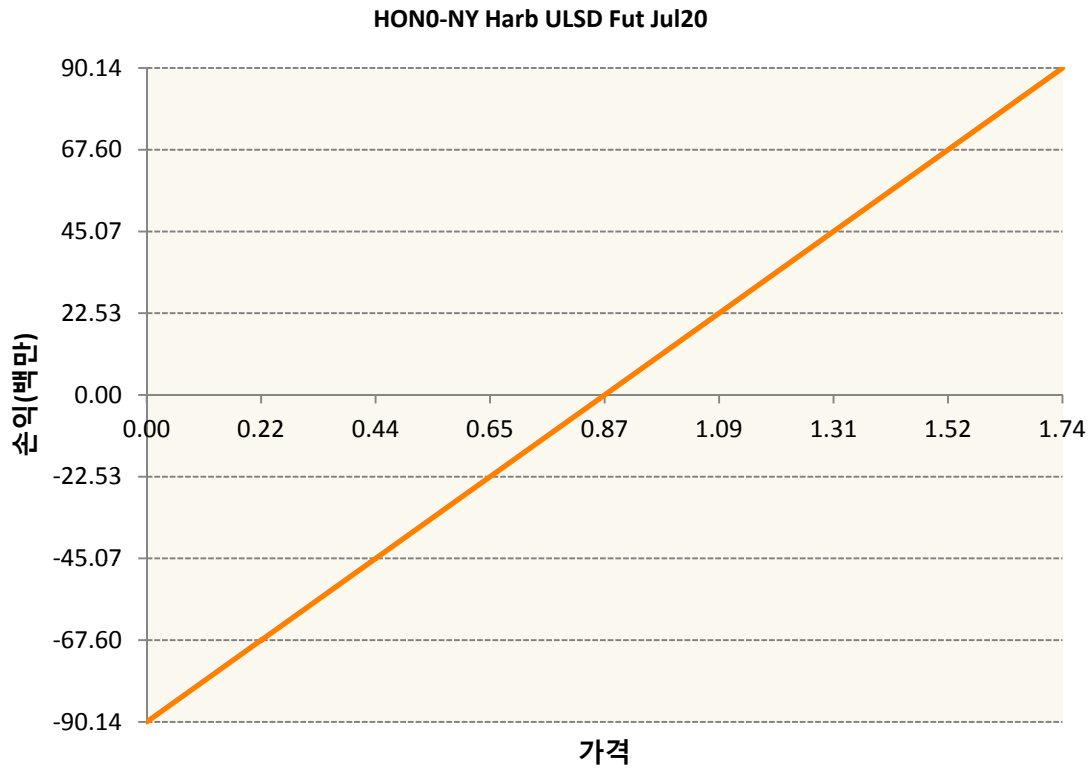
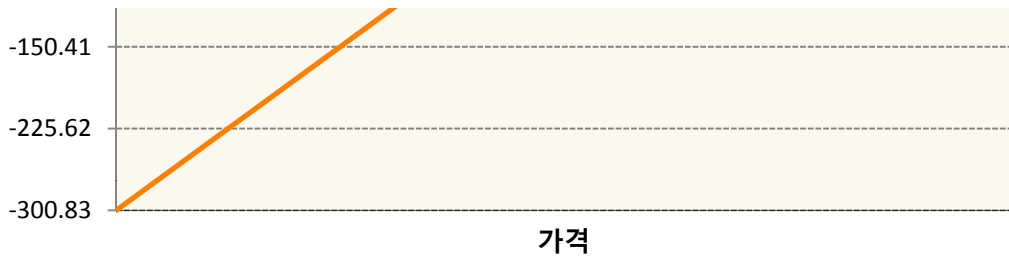
2. 만기시점의 손익구조

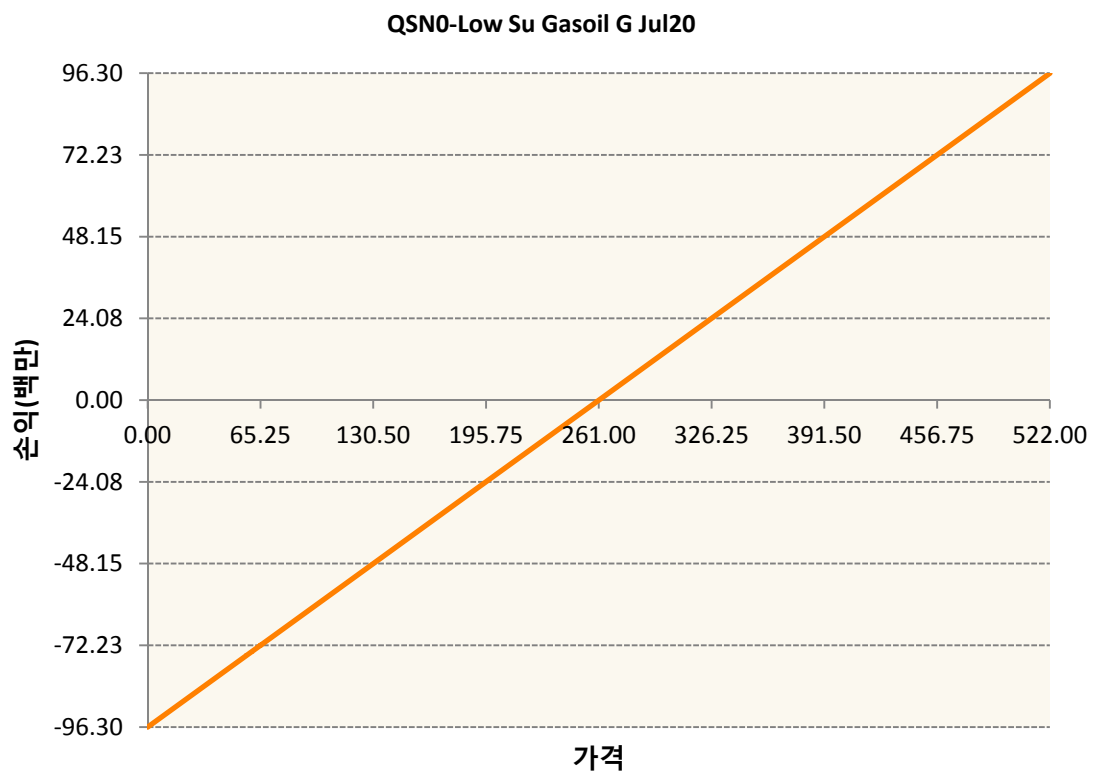
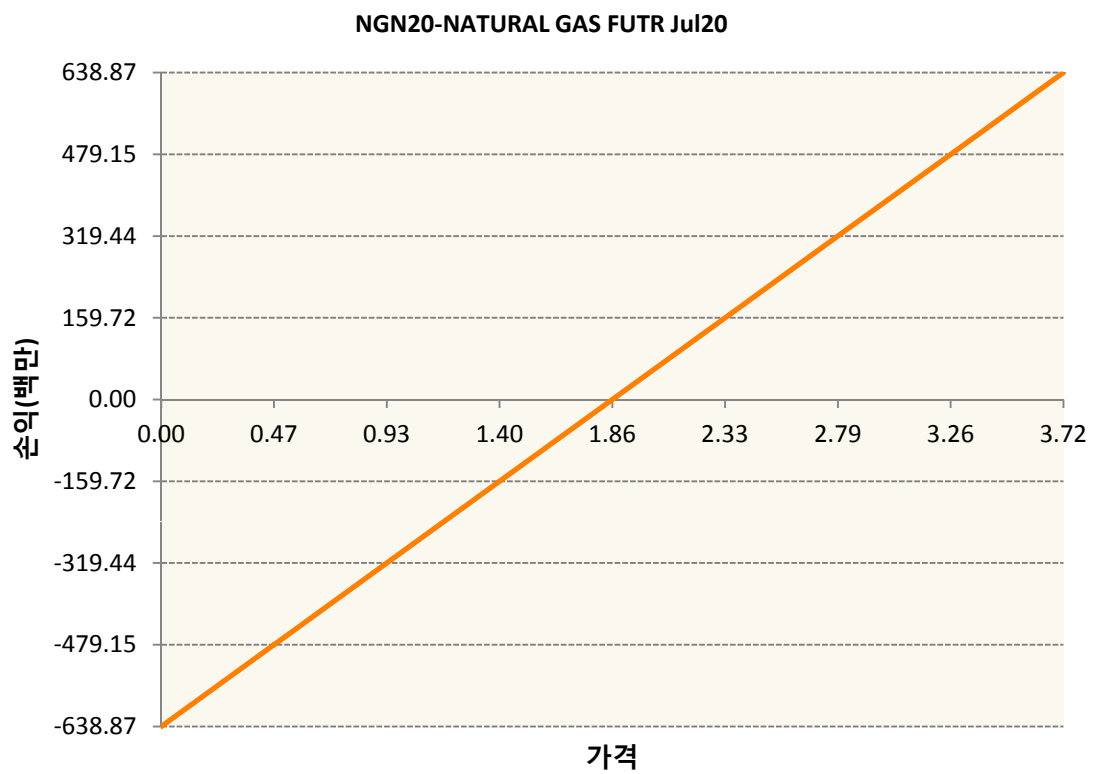
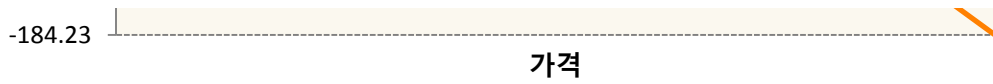
CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20



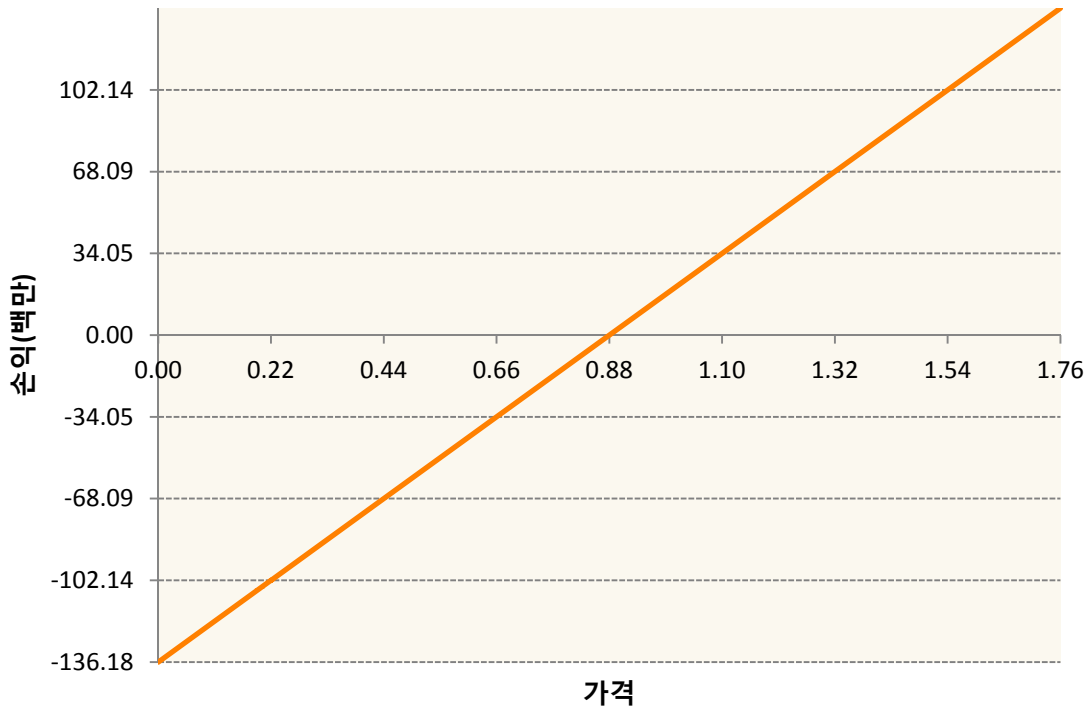
COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20







XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN0	WTI CRUDE FUTURE Jul20	18
COU0	BRENT CRUDE FUTR Sep20	24
HON0	NY Harb ULSD Fut Jul20	7
KR4175Q50C	2020-05 달러선물	15
NGN20	NATURAL GAS FUTR Jul20	51
QSN0	Low Su Gasoil G Jul20	8
XBN0	GASOLINE RBOB FUT Jul20	11

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

(단위:백만원)

618

공시일	2020-05-15
기준일	2020-05-14

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

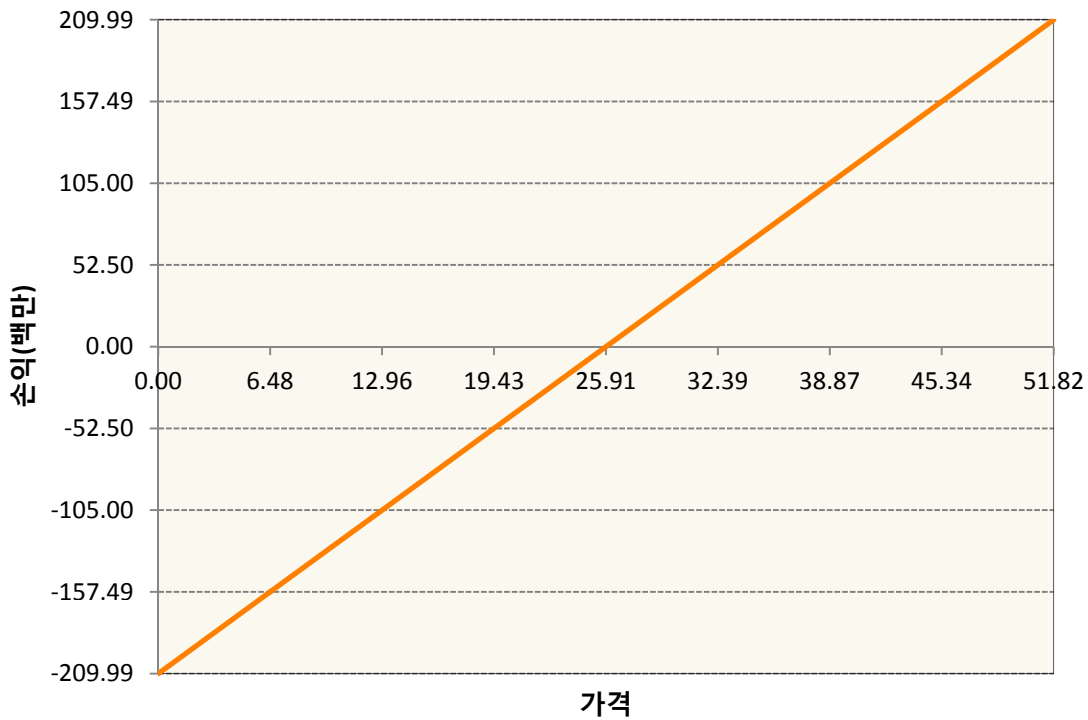
1. 계약금액

(단위:백만원)

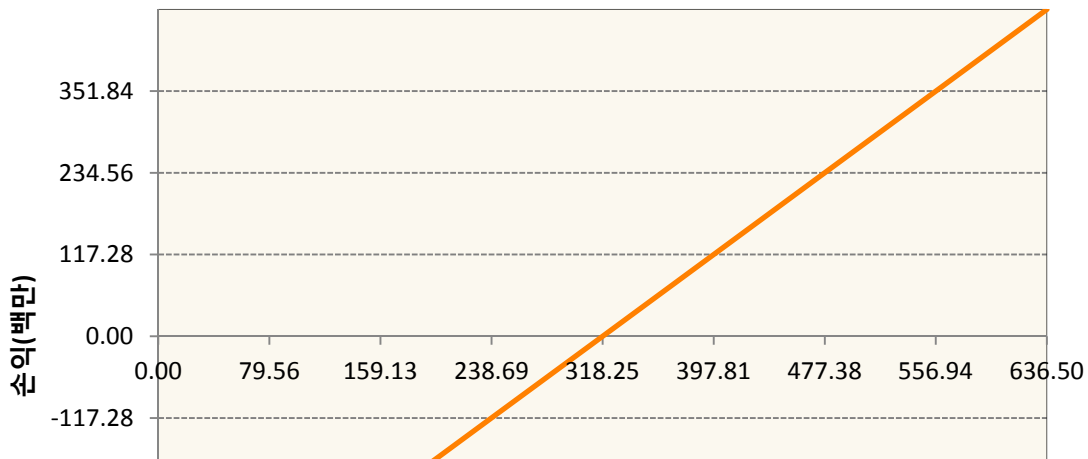
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,405	74	2,331	

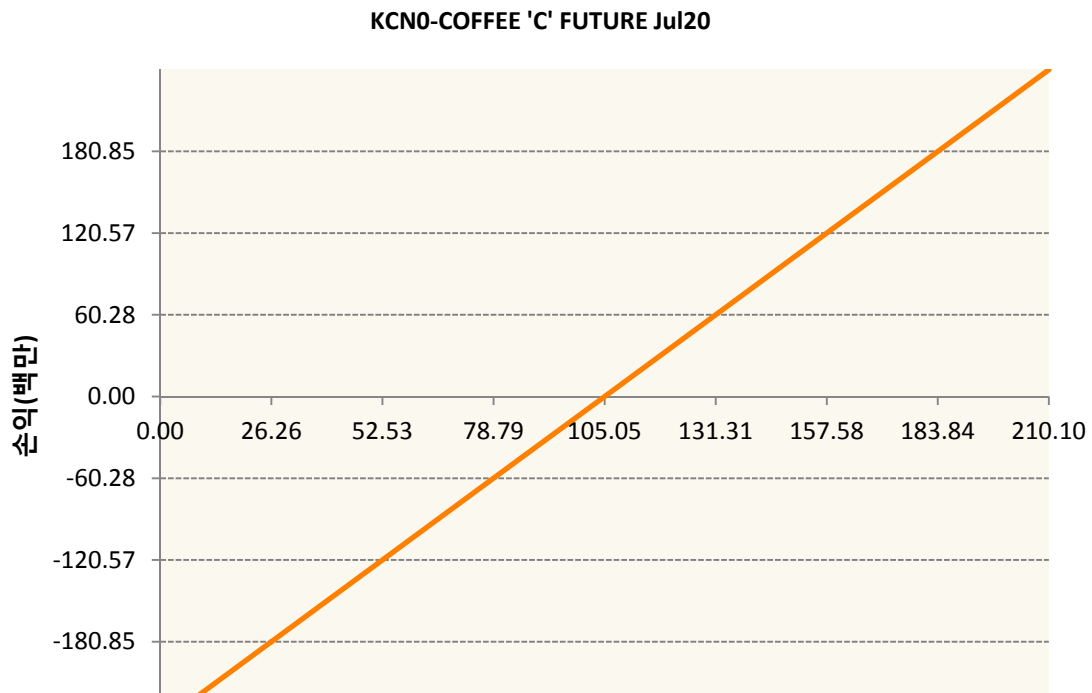
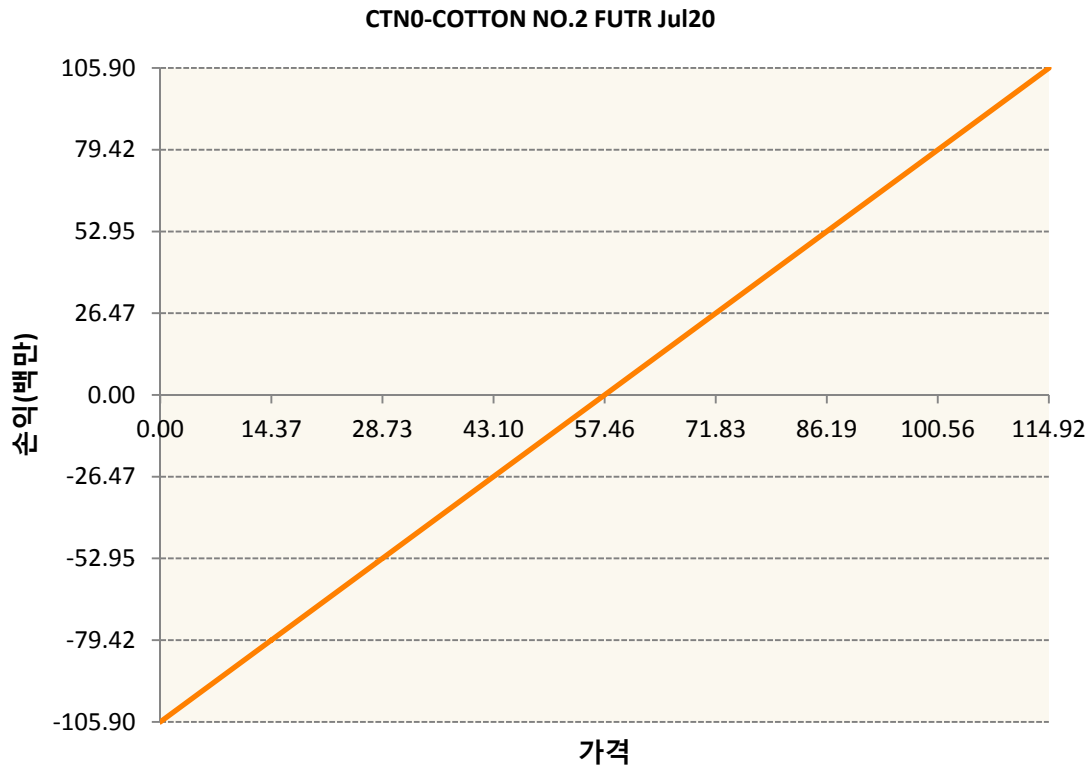
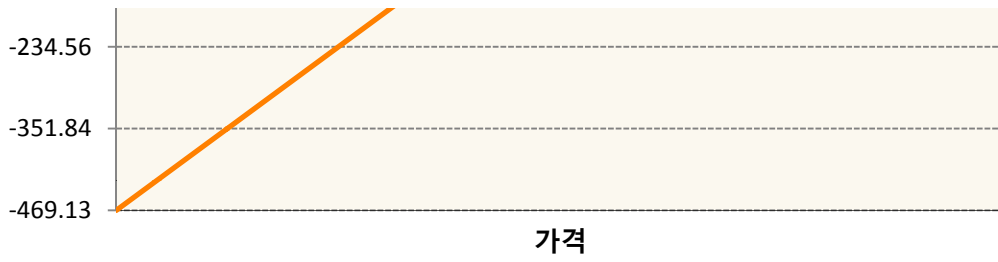
2. 만기시점의 손익구조

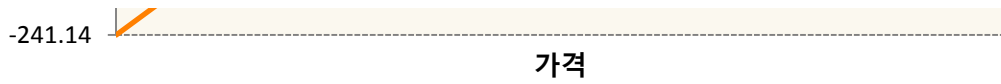
BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20



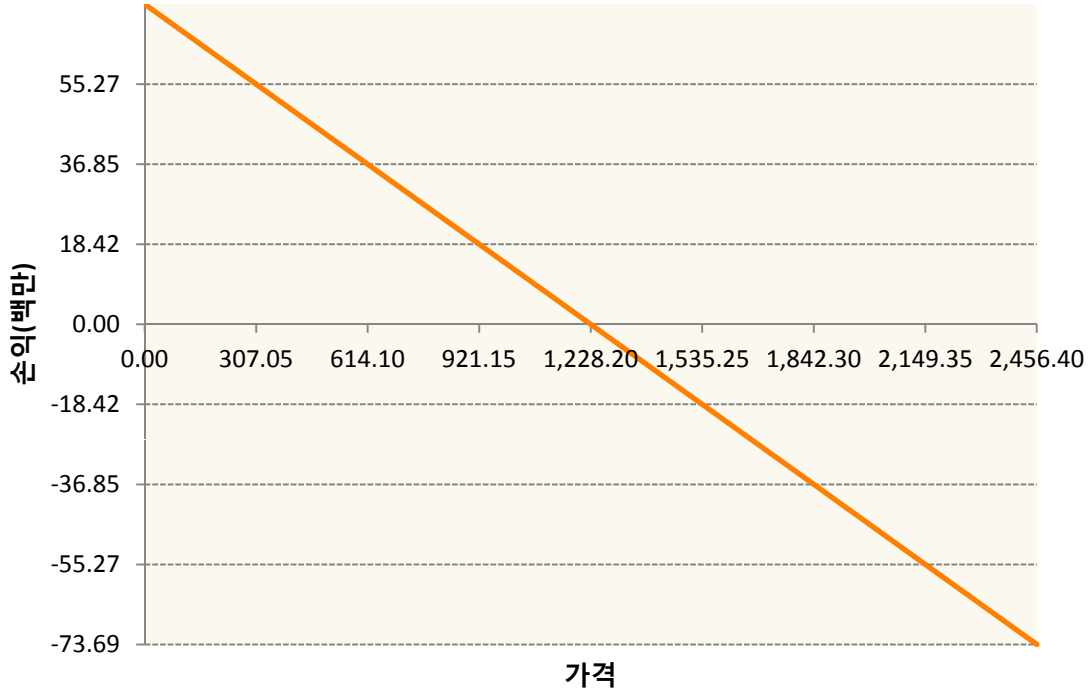
CNO-CORN FUTURE Jul20



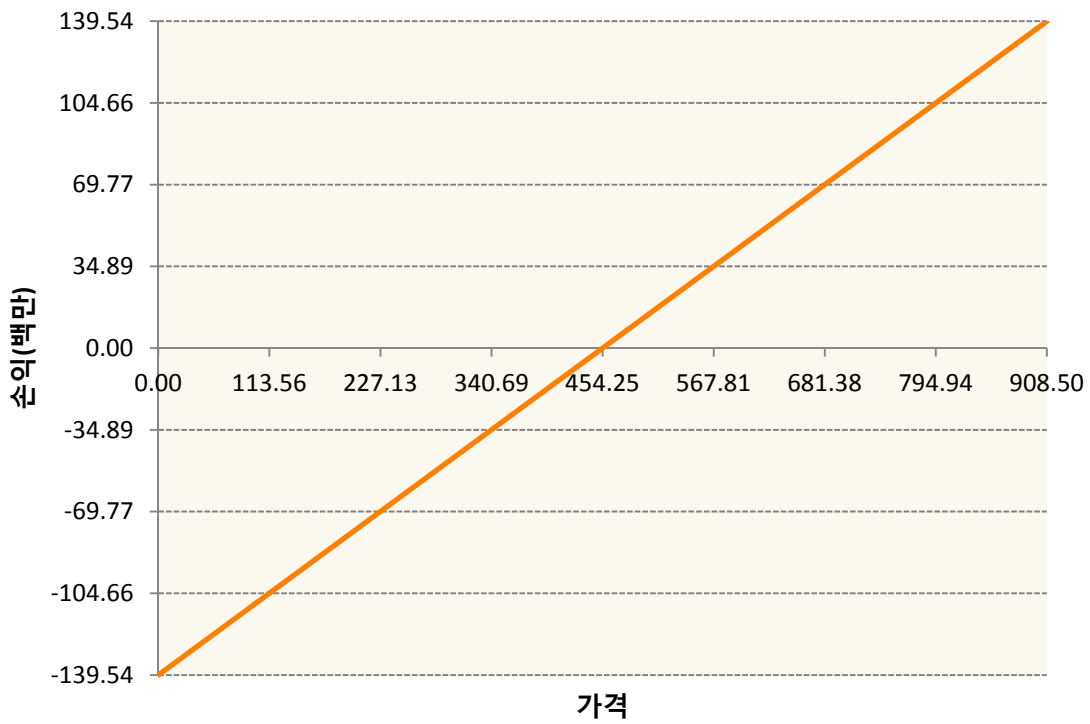




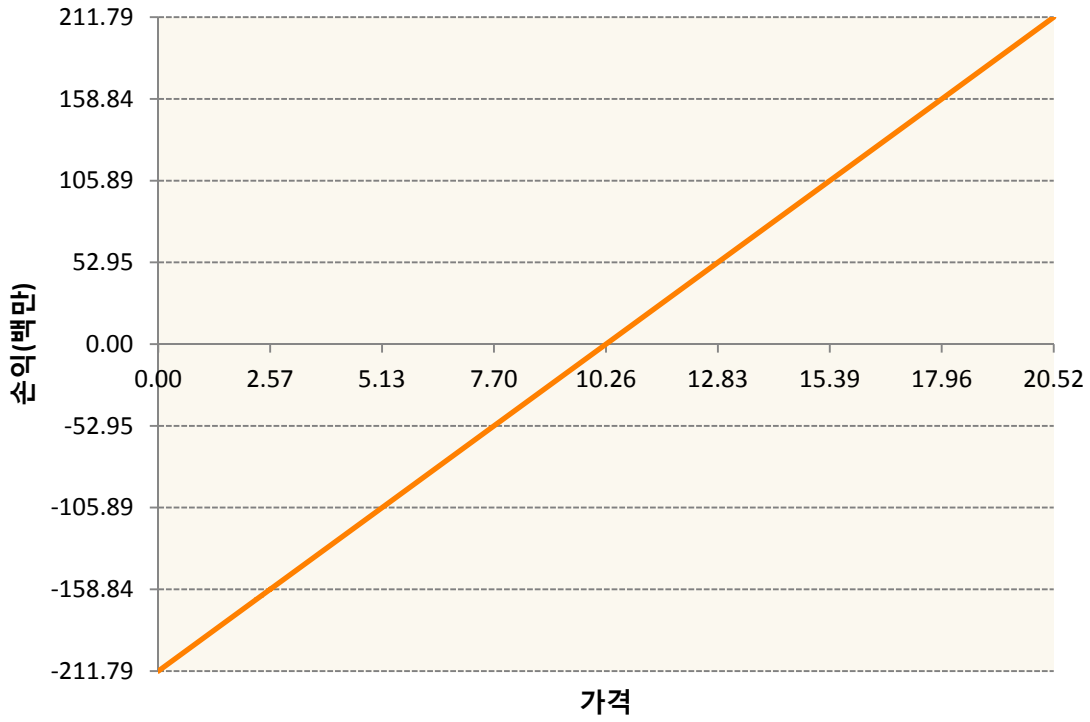
KR4175Q50007-2020-05 달러선물



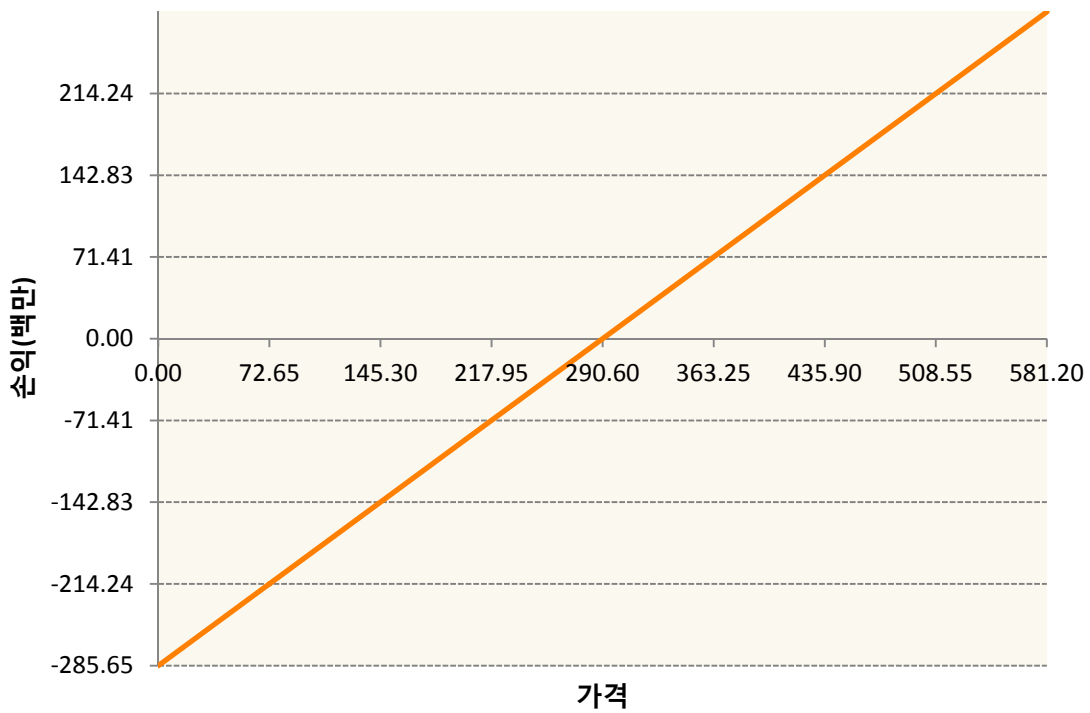
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



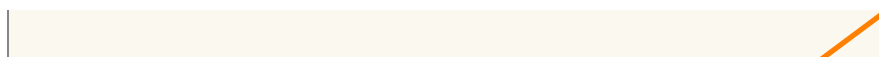
SBN0-Sugar Jul20

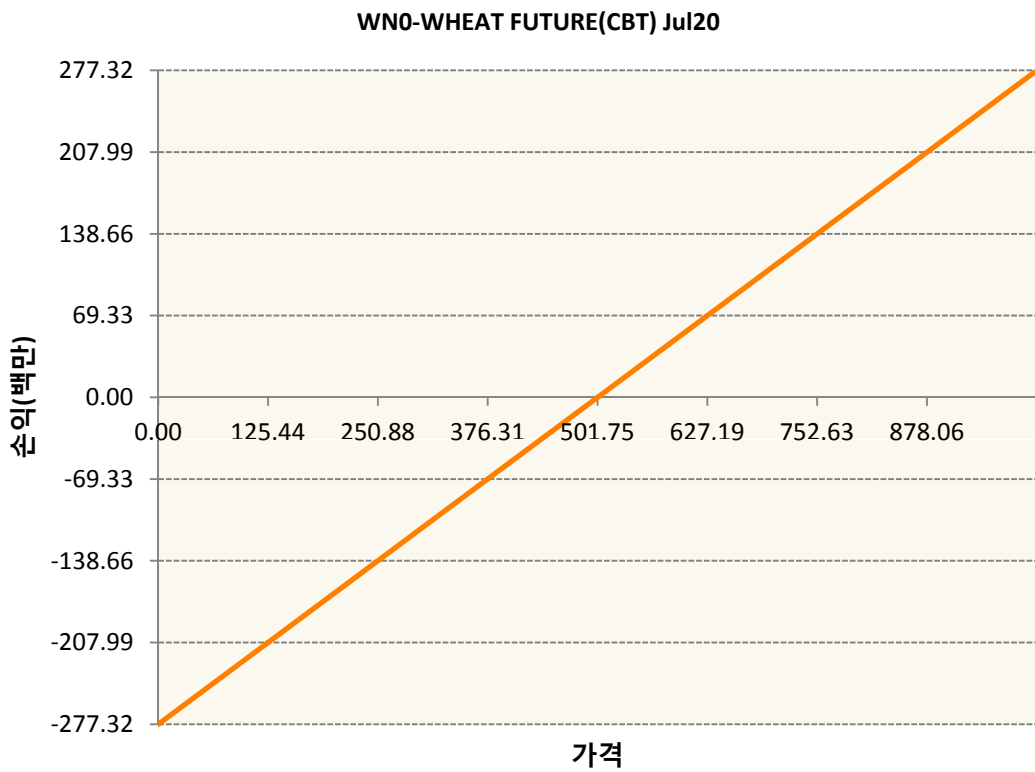
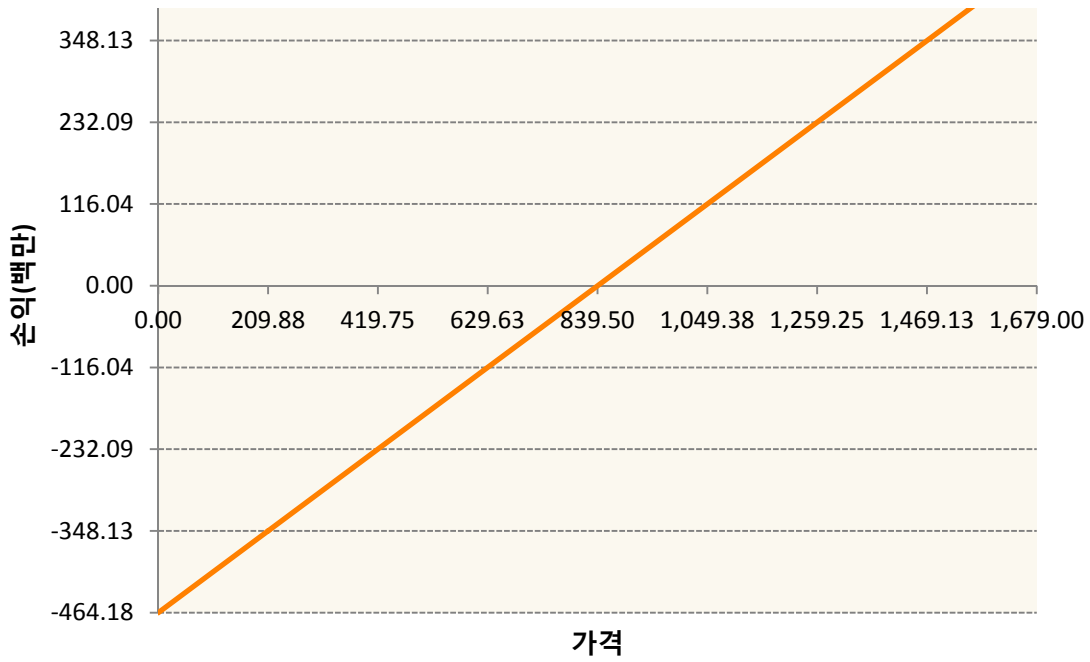


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20



SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BON0	SOYBEAN OIL FUTR Jul20	17
CN0	CORN FUTURE Jul20	38
CTN0	COTTON NO.2 FUTR Jul20	8
KCN0	COFFEE 'C' FUTURE Jul20	19
KR4175Q50C	2020-05 달러선물	6

KWN0	KC HRW WHEAT FUT Jul20	11
SBN0	Sugar Jul20	17
SMN0	SOYBEAN MEAL FUTR Jul20	23
SN0	SOYBEAN FUTURE Jul20	37
WNO	WHEAT FUTURE(CBT) Jul20	22

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

(단위:백만원)

228