

공시일	2020-05-26
기준일	2020-05-25

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	2020-05-26
기준일	2020-05-25

스마트인덱스모

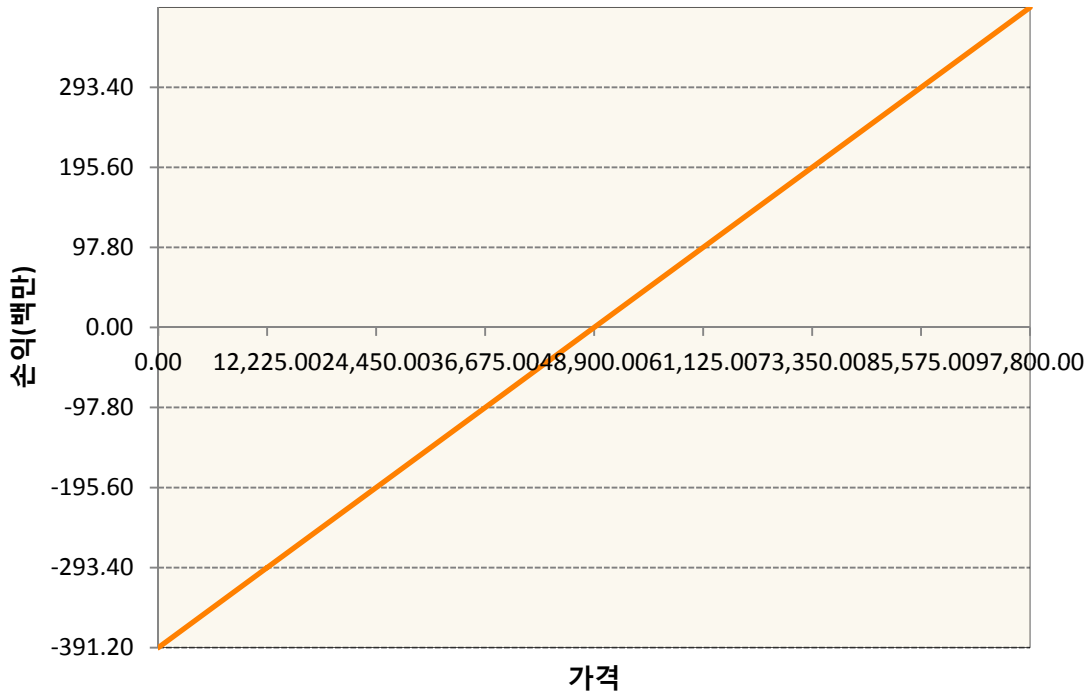
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	391	0	391	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111Q60001-2020-06 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111Q60001		2020-06 삼성전자개별선물						31
가격	기초자산의 변동성							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31	
-5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21	
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	10	10	10	10	10	10	10	
5.33%	21	21	21	21	21	21	21	
8.00%	31	31	31	31	31	31	31	

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

(단위:백만원)

47

공시일	2020-05-26
기준일	2020-05-25

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	12,516	0	12,516	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S200522

1,000

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,170

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-26
기준일	2020-05-25

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

551

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

814

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-26
기준일	2020-05-25

유로인덱스모(주식-파생형)

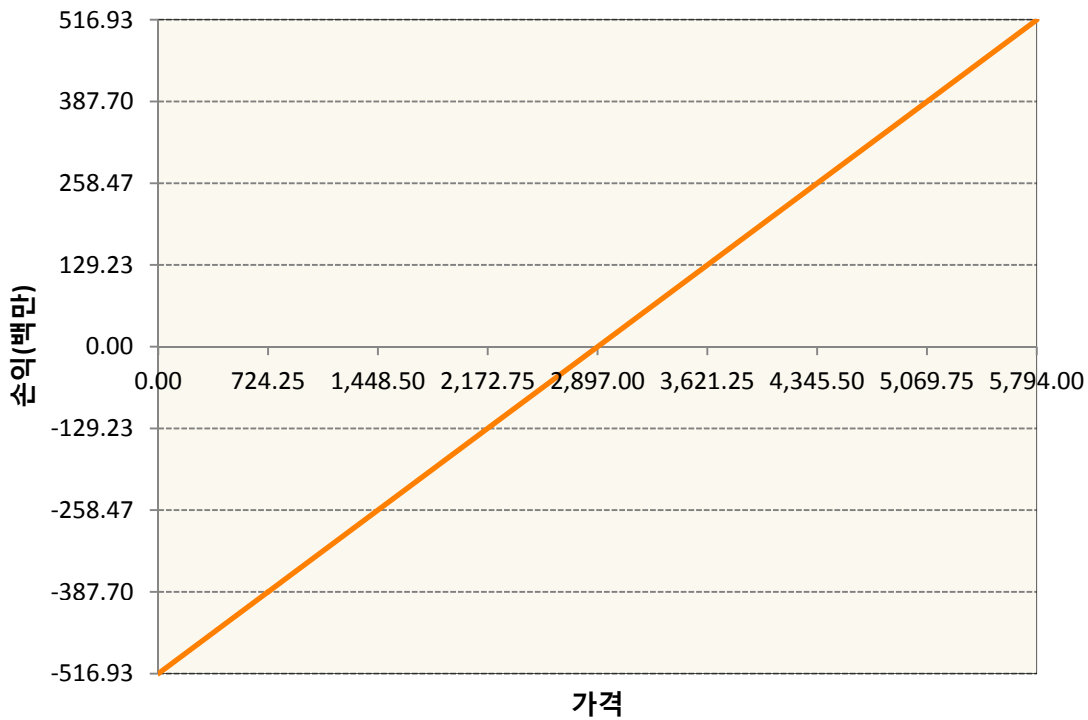
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	517	0	517	

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)

54

공시일	2020-05-26
기준일	2020-05-25

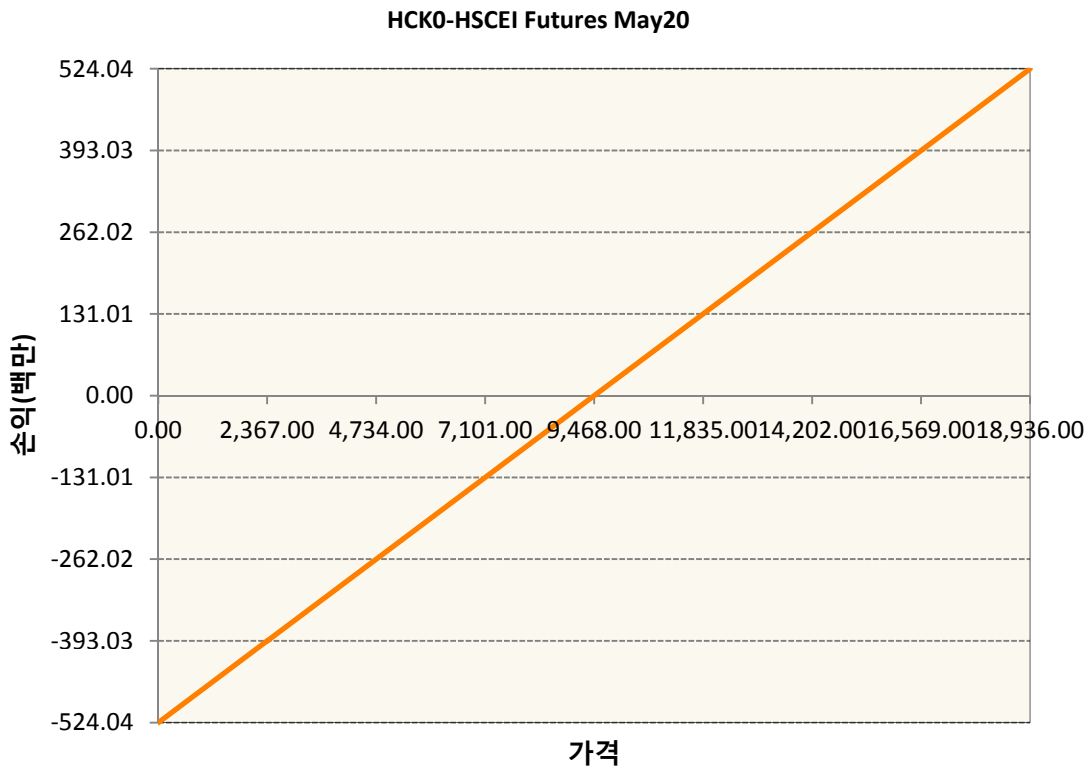
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	524	0	524	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

46

공시일	2020-05-26
기준일	2020-05-25

커버드콜모(주식혼합-파생형)

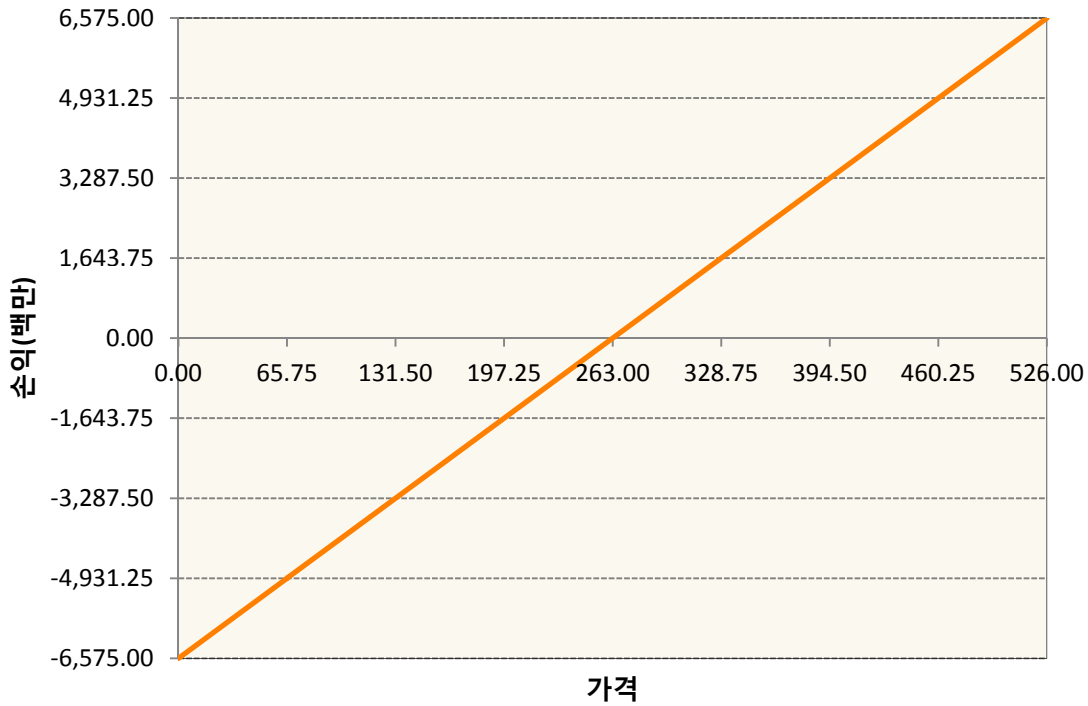
1. 계약금액

(단위:백만원)

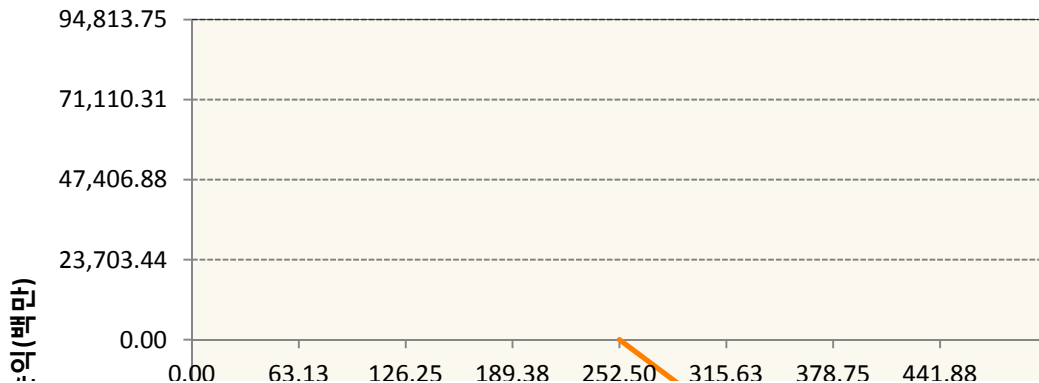
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,575	0	6,575	장내
누계	유가증권	옵션	0	364,213	-364,213	장내

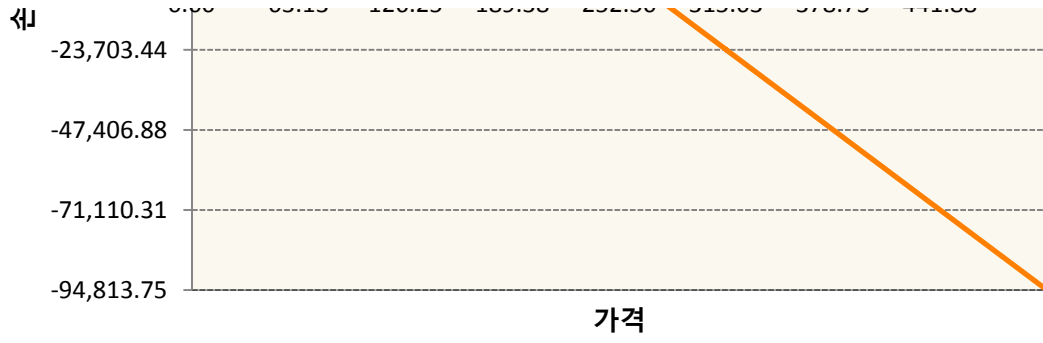
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

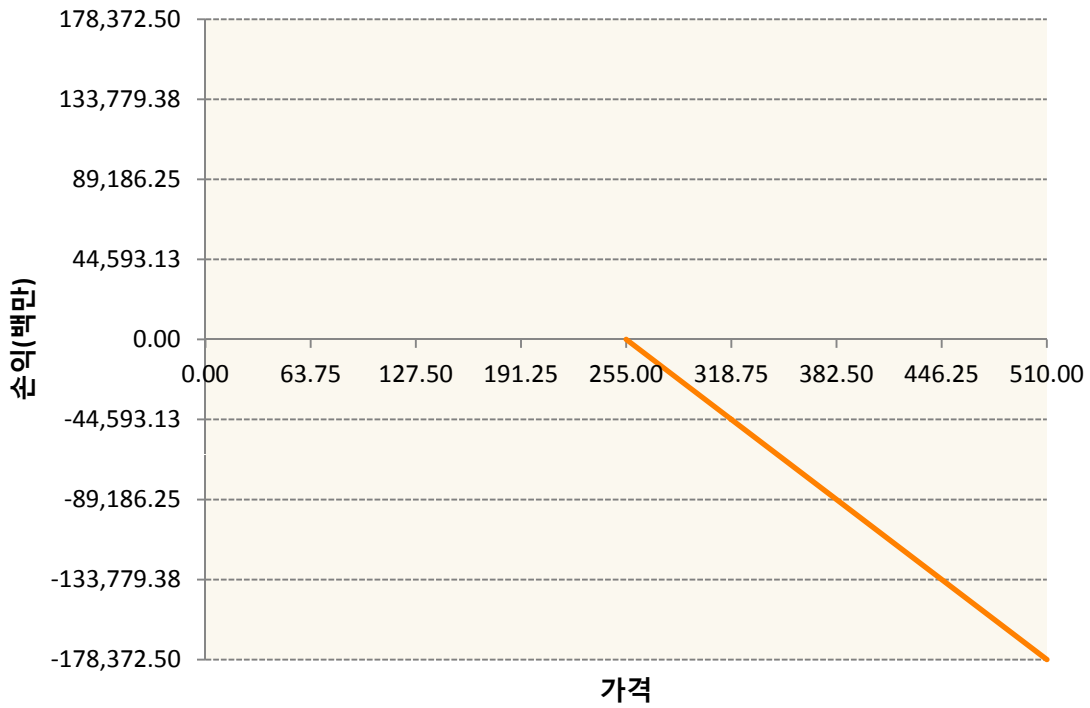


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

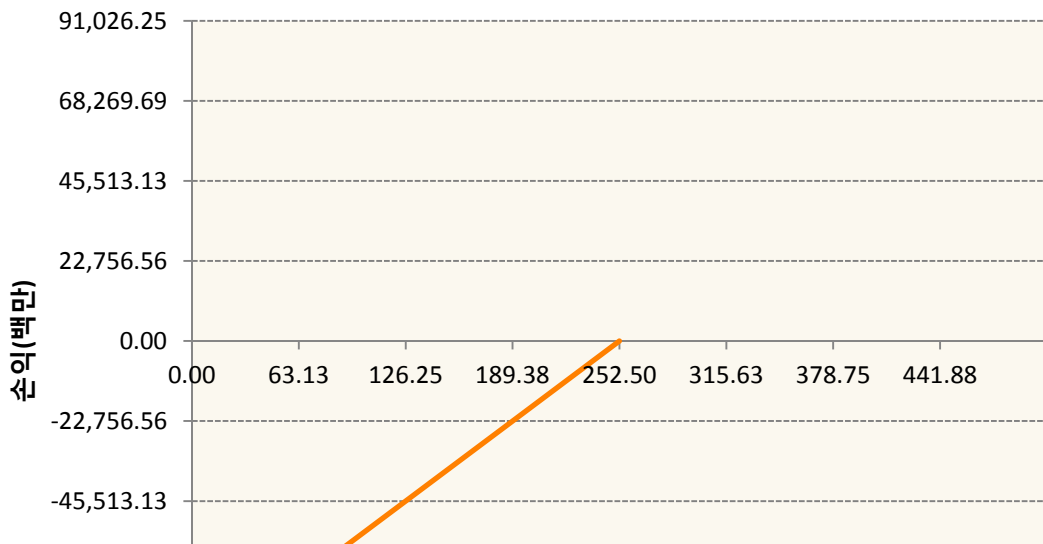


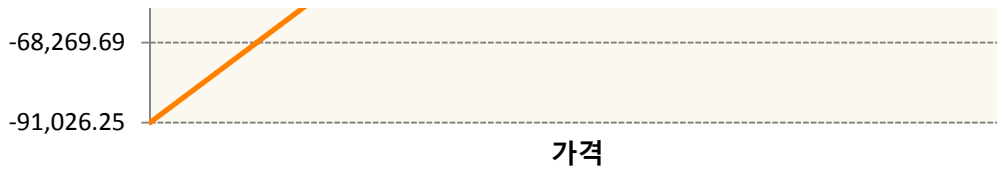


KR4201Q62550-2020-06 콜255



KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						526
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-526	-526	-526	-526	-526	-526	-526	
-5.33%	-350	-350	-350	-350	-350	-350	-350	
-2.67%	-175	-175	-175	-175	-175	-175	-175	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	175	175	175	175	175	175	175	
5.33%	350	350	350	350	350	350	350	
8.00%	526	526	526	526	526	526	526	
KR4201Q62527		2020-06 콜252.5						6,839
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4,786	4,538	4,283	4,022	3,756	3,486	3,213	
-5.33%	3,861	3,569	3,276	2,983	2,688	2,393	2,098	
-2.67%	2,536	2,238	1,938	1,639	1,339	1,038	738	
0%	823	554	280	0	-284	-570	-860	
2.67%	-1,219	-1,432	-1,661	-1,901	-2,151	-2,409	-2,674	
5.33%	-3,503	-3,655	-3,829	-4,021	-4,227	-4,447	-4,677	
8.00%	-5,947	-6,045	-6,166	-6,309	-6,470	-6,647	-6,839	
KR4201Q62550		2020-06 콜255						12,414
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	8,239	7,813	7,368	6,906	6,432	5,948	5,455	
-5.33%	6,758	6,231	5,698	5,161	4,622	4,079	3,535	
-2.67%	4,556	3,990	3,424	2,858	2,293	1,727	1,162	
0%	1,617	1,085	545	0	-549	-1,102	-1,657	
2.67%	-1,975	-2,419	-2,885	-3,368	-3,866	-4,374	-4,891	
5.33%	-6,077	-6,408	-6,775	-7,172	-7,594	-8,036	-8,495	
8.00%	-10,530	-10,752	-11,018	-11,322	-11,659	-12,024	-12,414	
KR4301Q62525		2020-06 풋252.5						4,203
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-3,467	-3,571	-3,685	-3,806	-3,933	-4,066	-4,203	
-5.33%	-1,580	-1,741	-1,904	-2,068	-2,233	-2,399	-2,566	
-2.67%	-298	-465	-634	-803	-973	-1,143	-1,314	

0%	386	266	136	0	-142	-288	-437
2.67%	665	603	527	440	343	237	124
5.33%	751	728	693	648	593	527	451
8.00%	772	765	752	733	706	670	626

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

(단위:백만원)

22,432

공시일	2020-05-26
기준일	2020-05-25

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

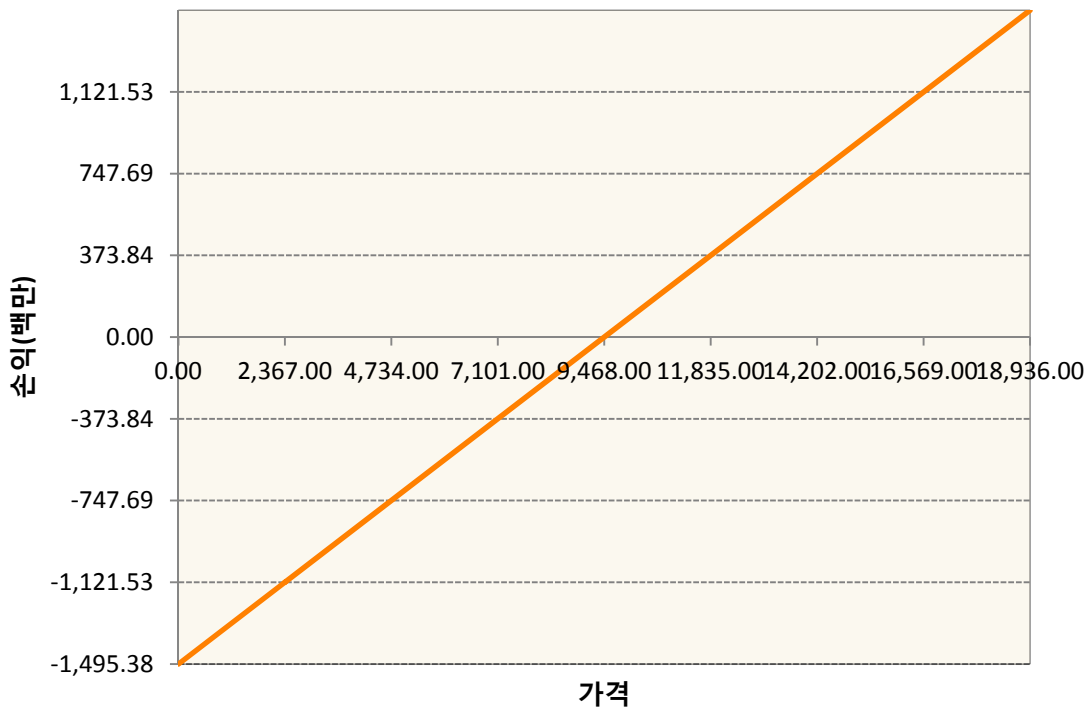
1. 계약금액

(단위:백만원)

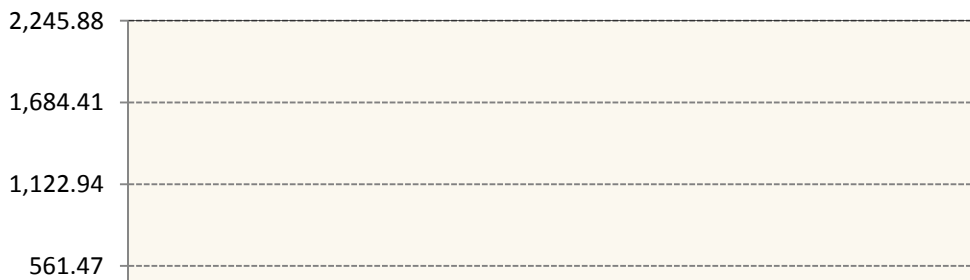
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,495	0	1,495	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,492	-4,492	장내
누계	통화	선도	0	1,553	-1,553	장외

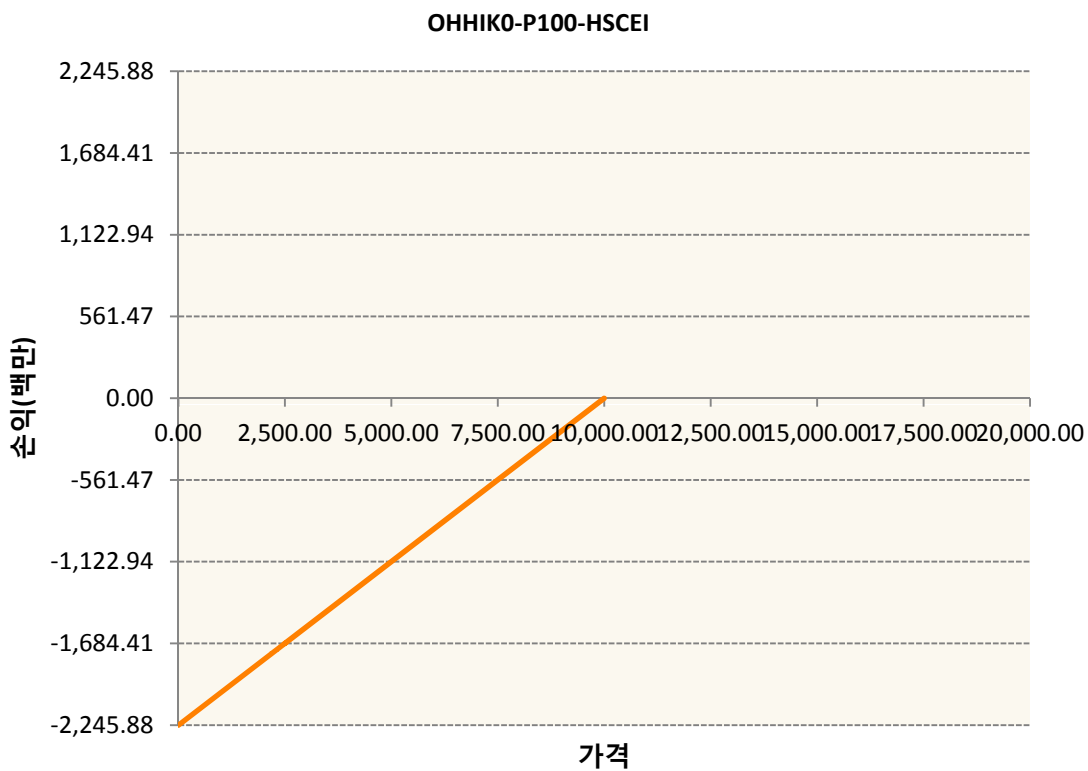
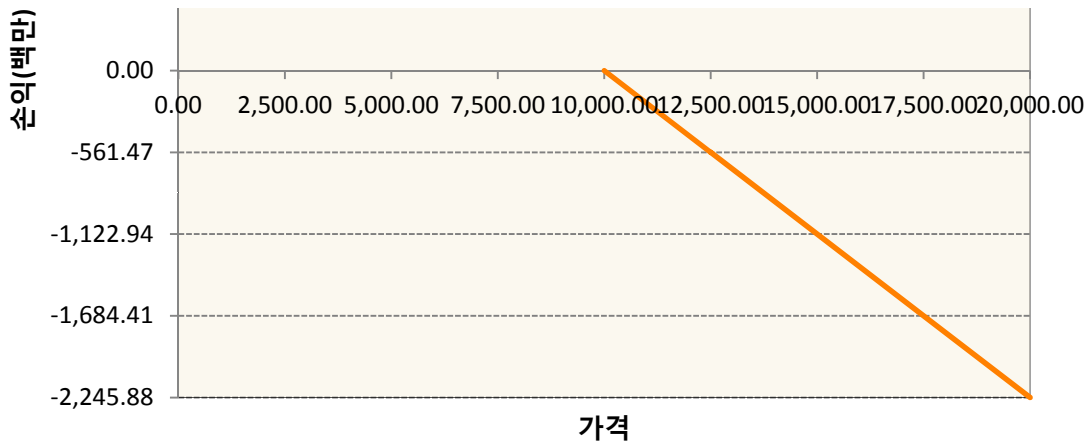
2. 만기시점의 손익구조

HCK0-HSCEI Futures May20



OHHIK0-C100-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E		124
HCK0 HSCEI Futures May20		120
OHHIK0-C1C HSCEI		180
OHHIK0-P10 HSCEI		180

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	584

공시일	2020-05-26
기준일	2020-05-25

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

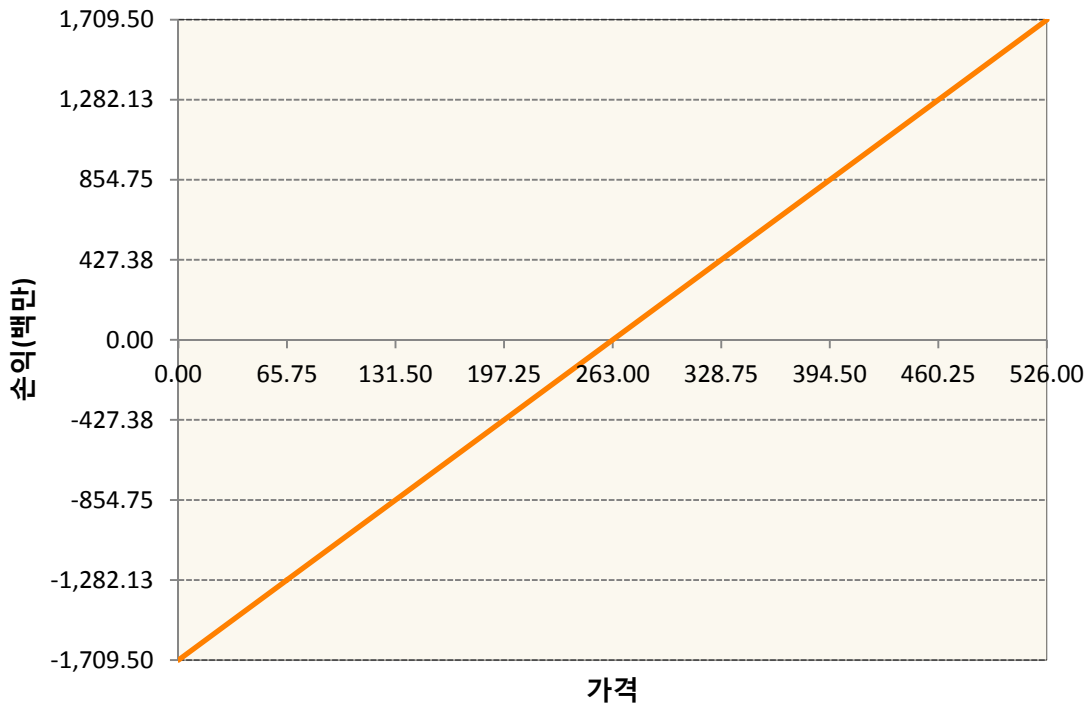
1. 계약금액

(단위:백만원)

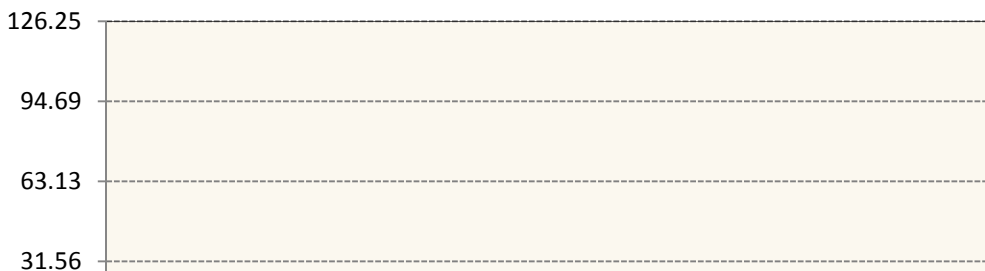
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,710	0	1,710	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,361	-3,361	장내

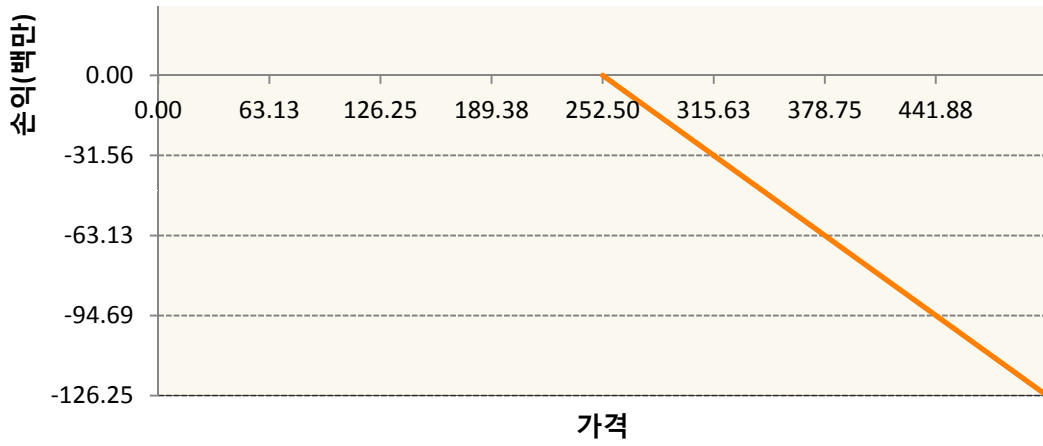
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

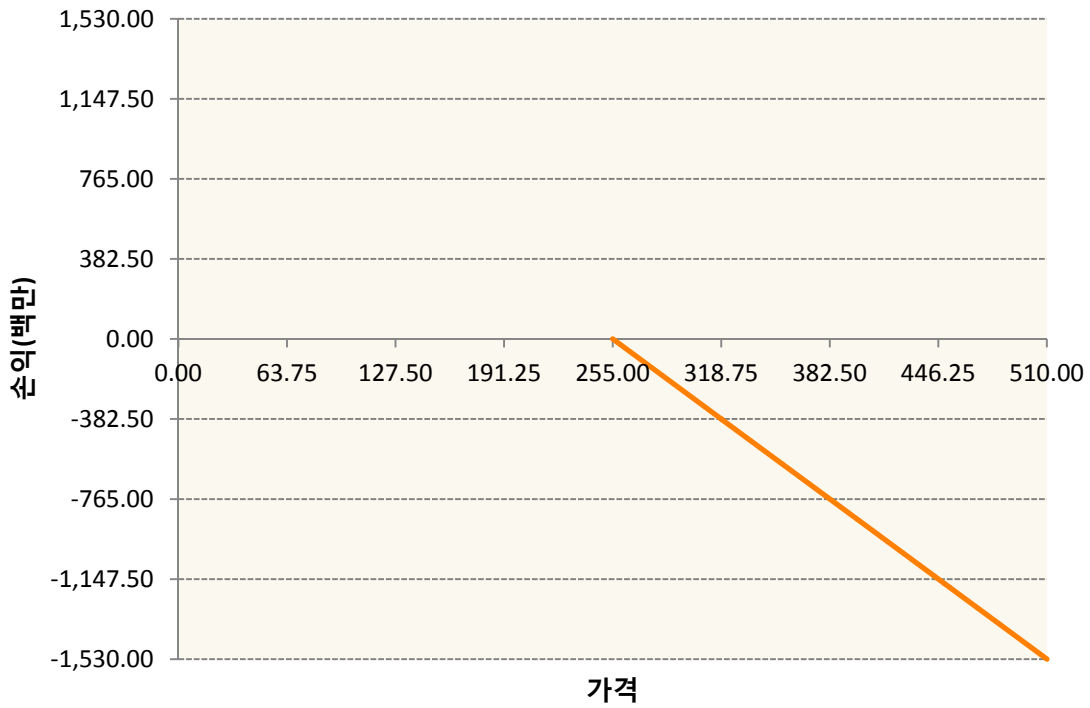


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

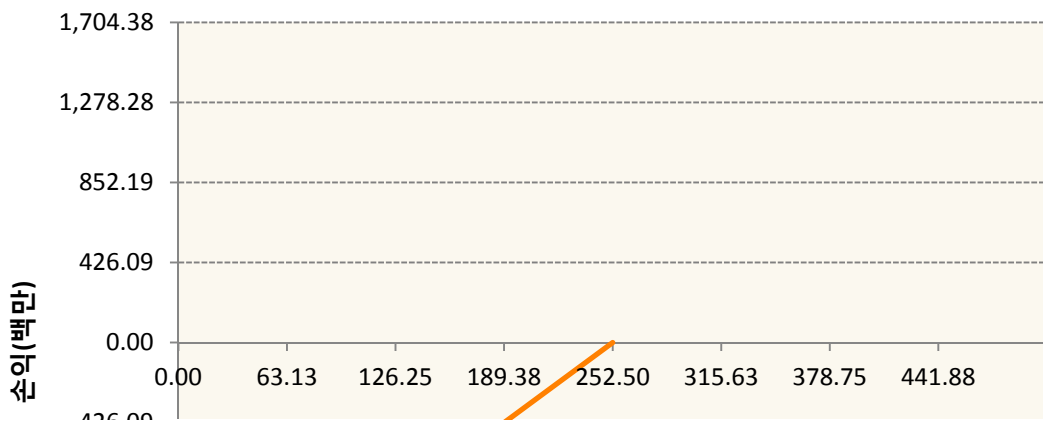




KR4201Q62550-2020-06 콜255



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						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%	6	6	6	5	5	5	4	
-5.33%	5	5	4	4	4	3	3	
-2.67%	3	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						106
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	71	67	63	59	55	51	47
-5.33%	58	53	49	44	40	35	30
-2.67%	39	34	29	25	20	15	10
0%	14	9	5	0	-5	-9	-14
2.67%	-17	-21	-25	-29	-33	-38	-42
5.33%	-52	-55	-58	-62	-65	-69	-73
8.00%	-90	-92	-95	-97	-100	-103	-106
KR4301Q62525 2020-06 풋252.5							79
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-65	-67	-69	-71	-74	-76	-79
-5.33%	-30	-33	-36	-39	-42	-45	-48
-2.67%	-6	-9	-12	-15	-18	-21	-25
0%	7	5	3	0	-3	-5	-8
2.67%	12	11	10	8	6	4	2
5.33%	14	14	13	12	11	10	8
8.00%	14	14	14	14	13	13	12

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

(단위:백만원)

568

공시일	2020-05-26
기준일	2020-05-25

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

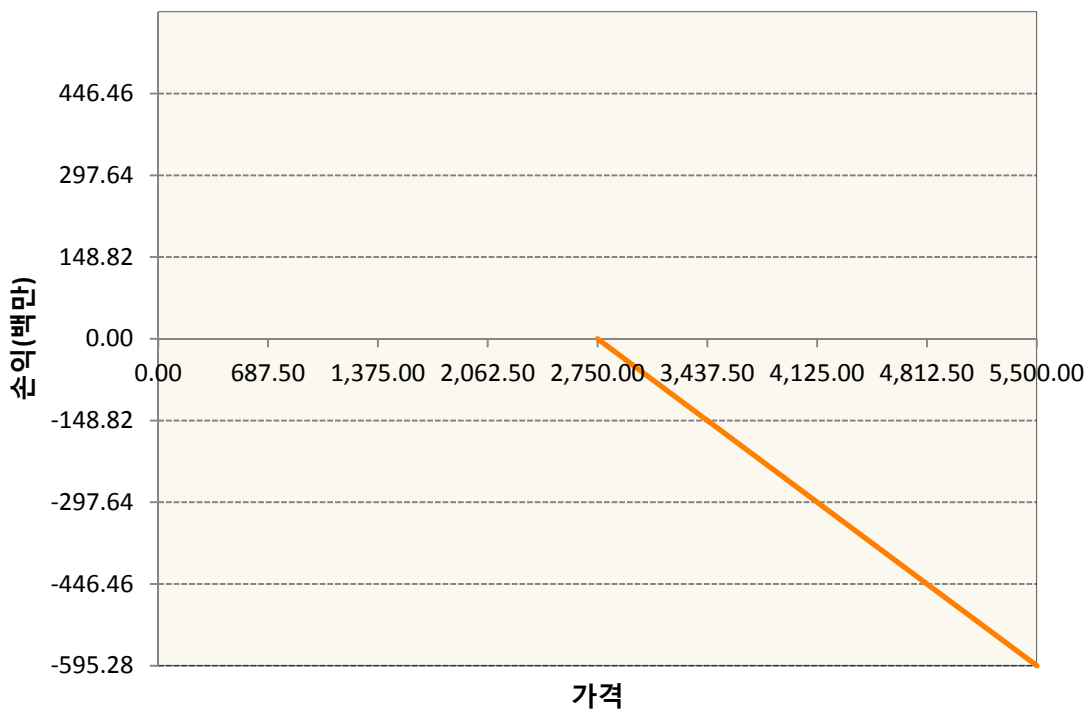
1. 계약금액

(단위:백만원)

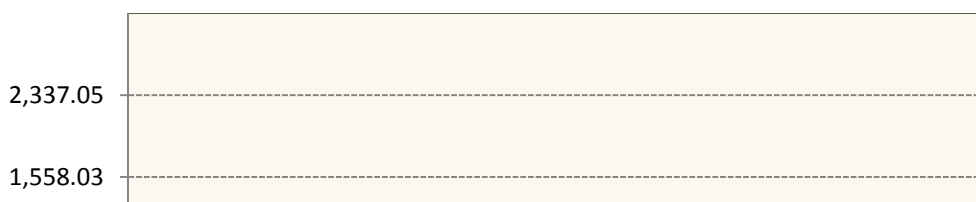
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,552	0	1,552	
누계	유가증권	스왑	8,069	0	8,069	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,423	-7,423	장내
누계	통화	선도	0	2,928	-2,928	장외

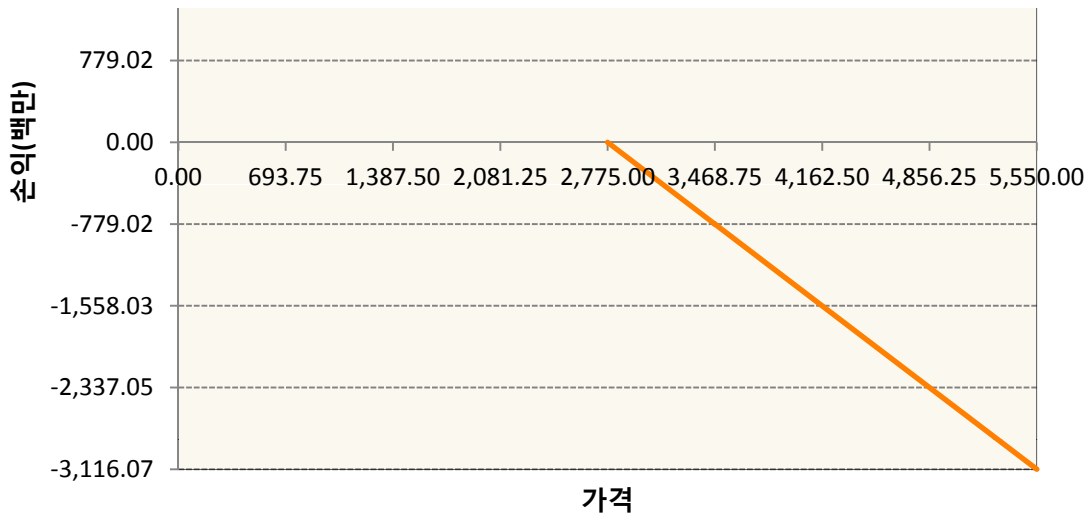
2. 만기시점의 손익구조

OESXM0-C2750-EURO STOXX 50

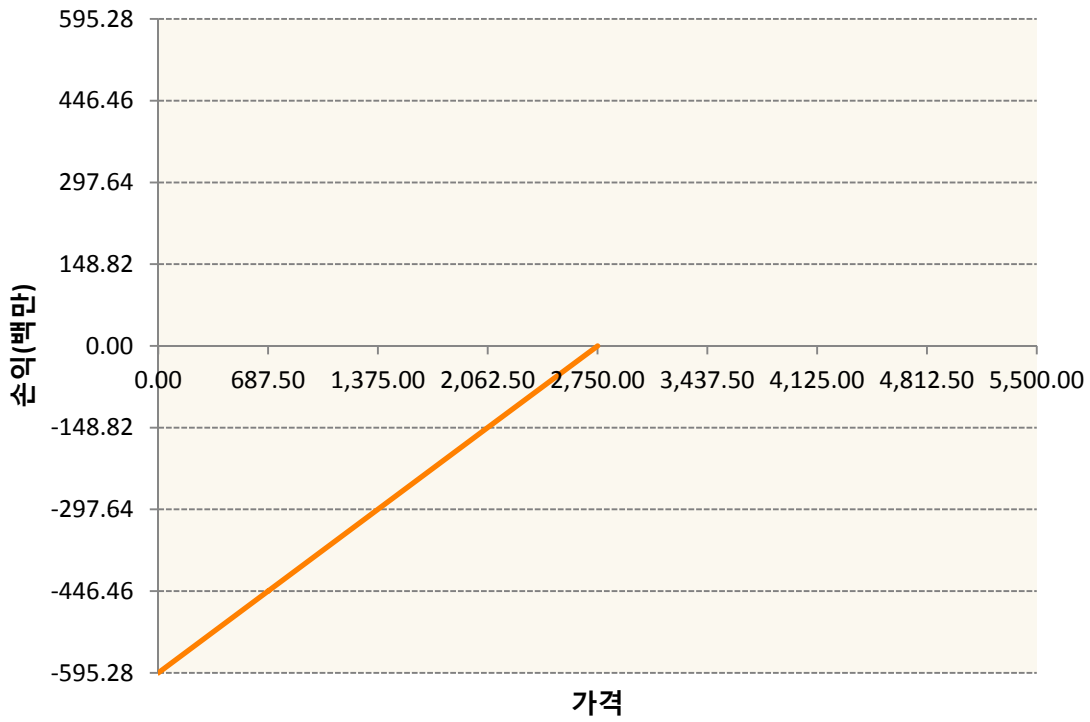


OESXM0-C2775-EURO STOXX 50

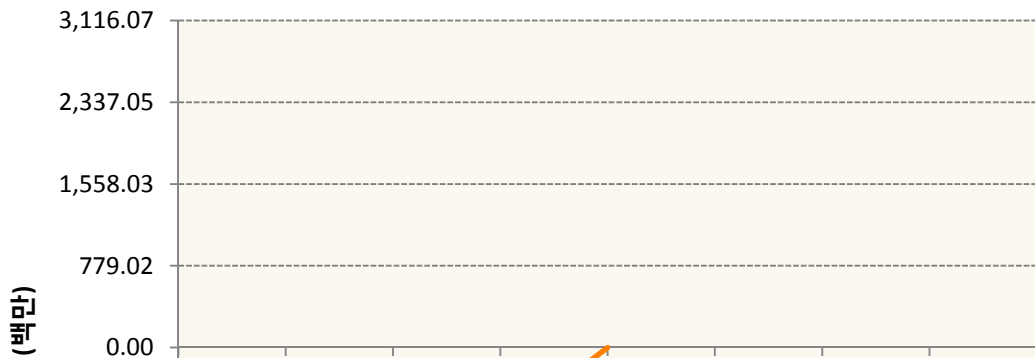


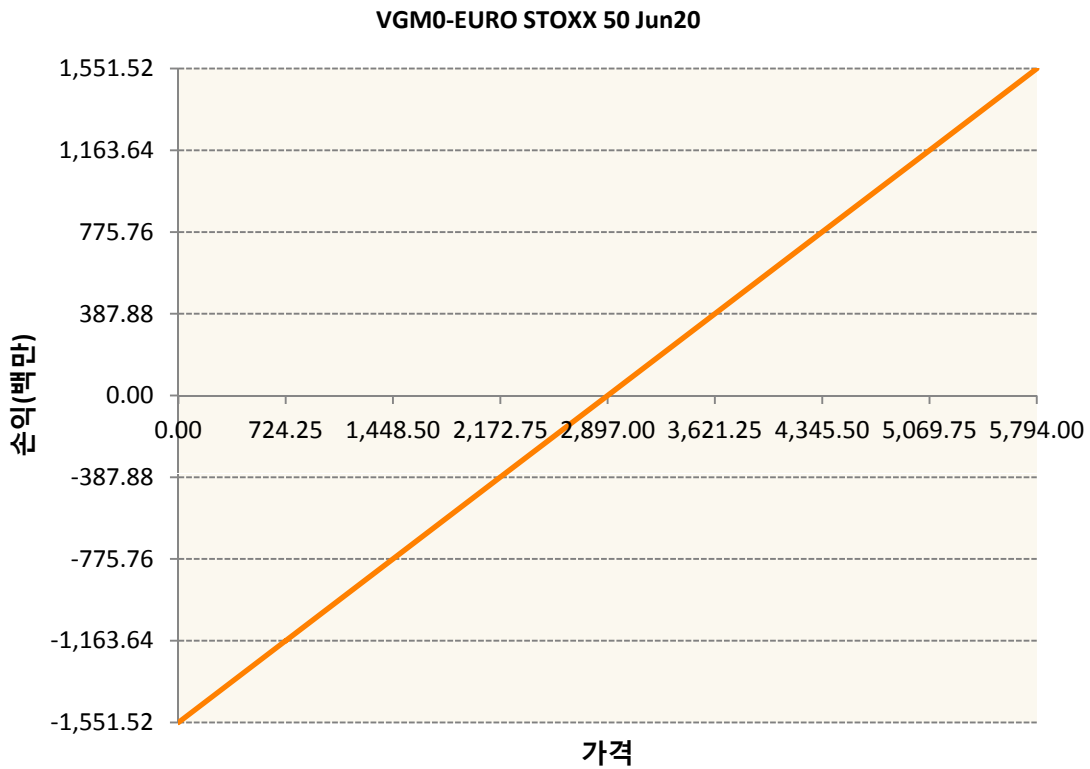
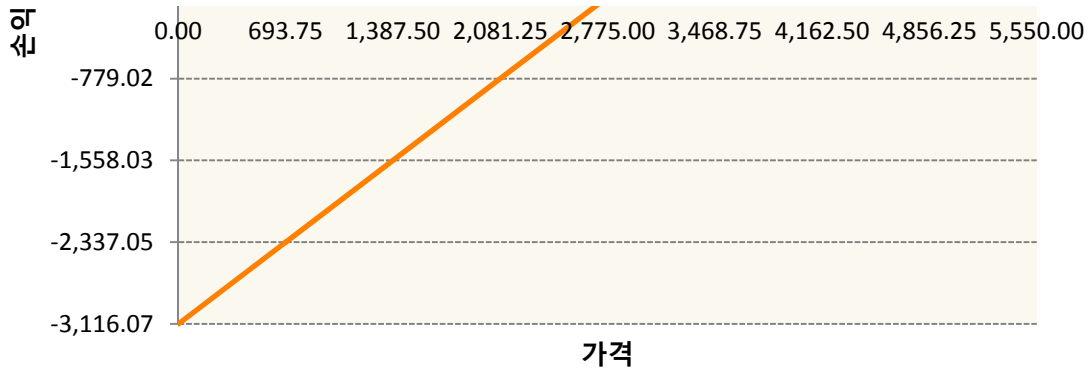


OESXM0-P2750-EURO STOXX 50



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)

1,092

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

(단위:백만원)

1,175

공시일	2020-05-26
기준일	2020-05-25

ETF스마트레버리지목표전환형9호

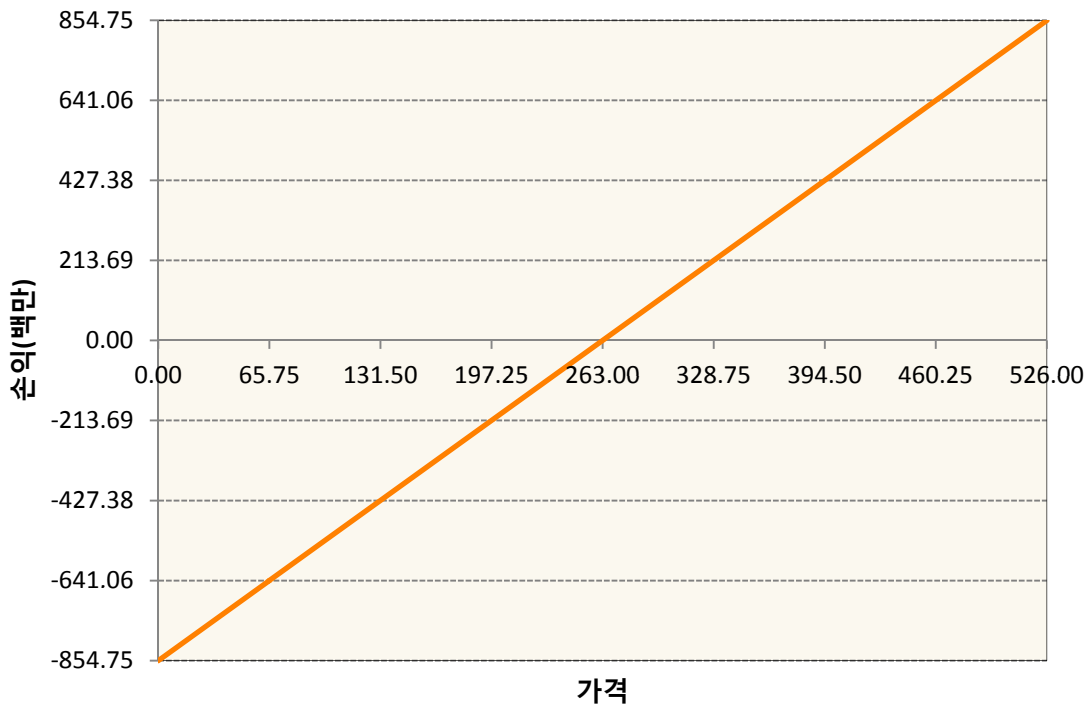
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	855	0	855	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%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46	
-2.67%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	23	23	23	23	23	23	23	
5.33%	46	46	46	46	46	46	46	
8.00%	68	68	68	68	68	68	68	

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

(단위:백만원)

102

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

(단위:백만원)

149

공시일	2020-05-26
기준일	2020-05-25

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

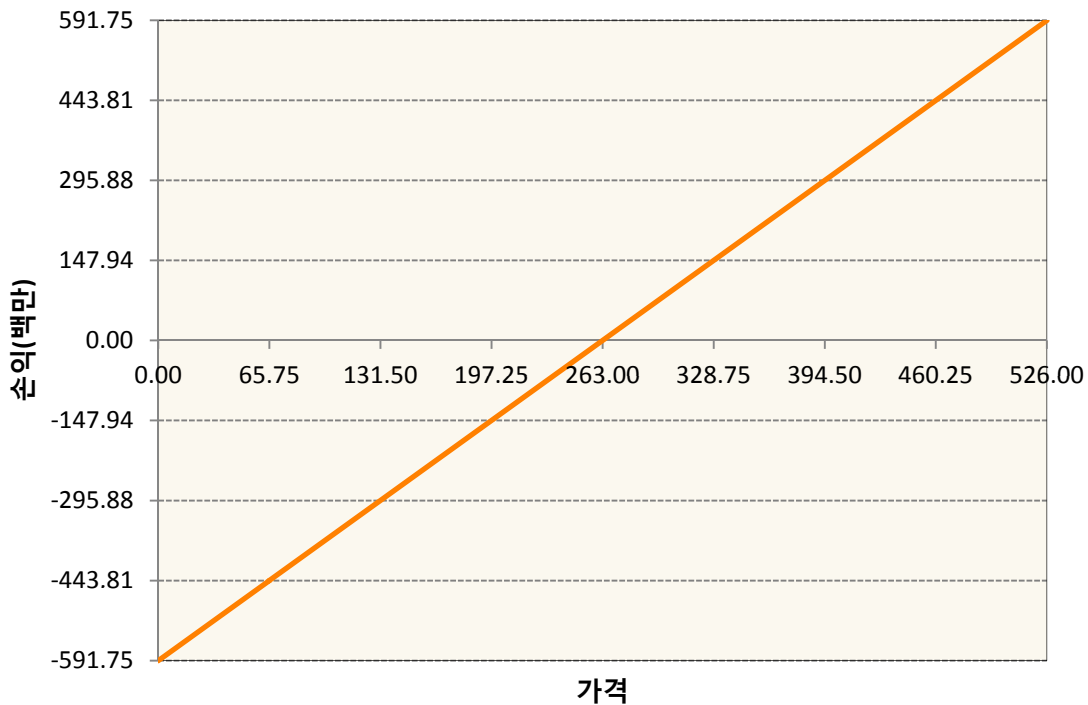
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	592	0	592	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)

70

공시일	2020-05-26
기준일	2020-05-25

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

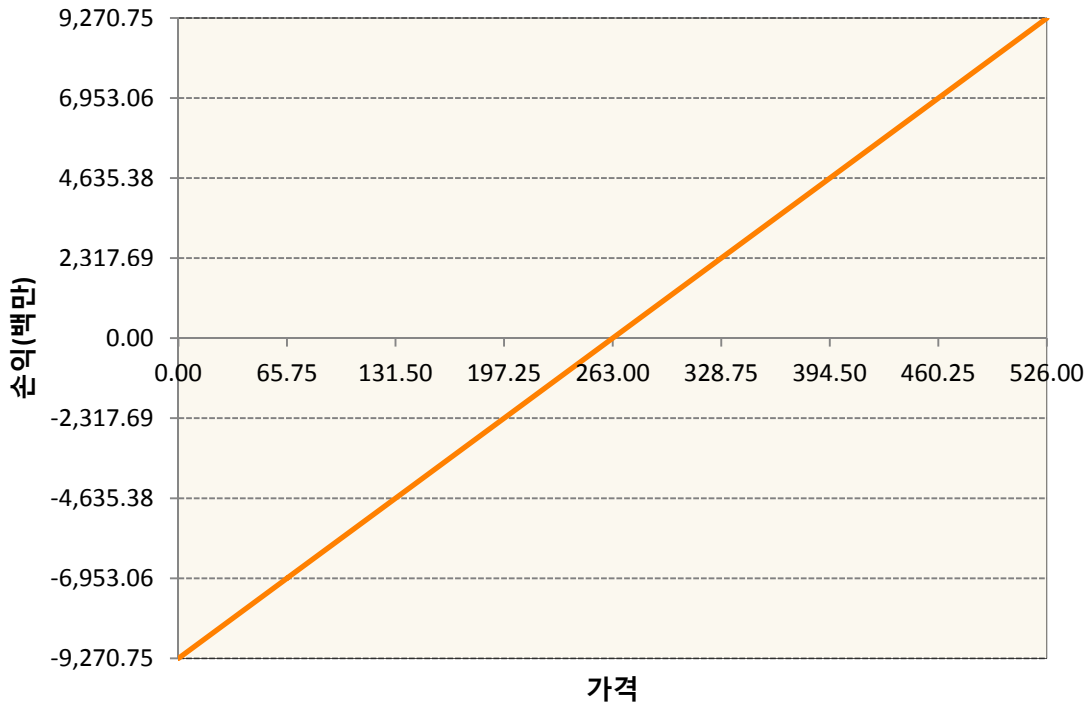
1. 계약금액

(단위:백만원)

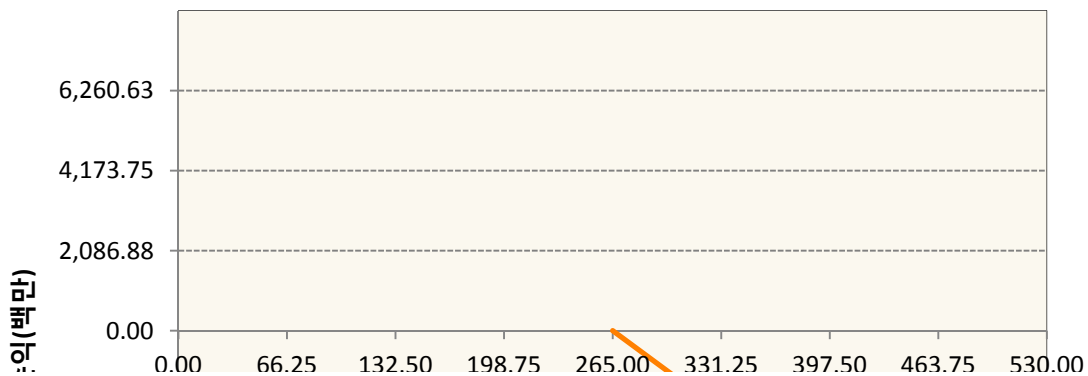
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,271	0	9,271	장내
누계	유가증권	옵션	2,917	17,911	-14,994	장내

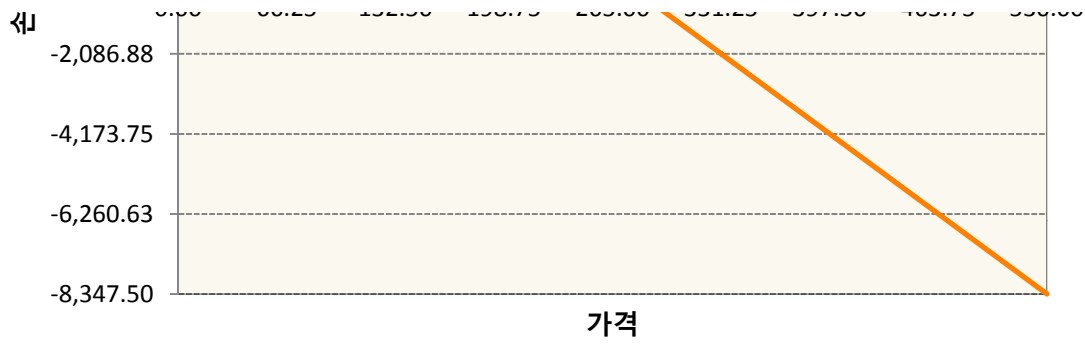
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

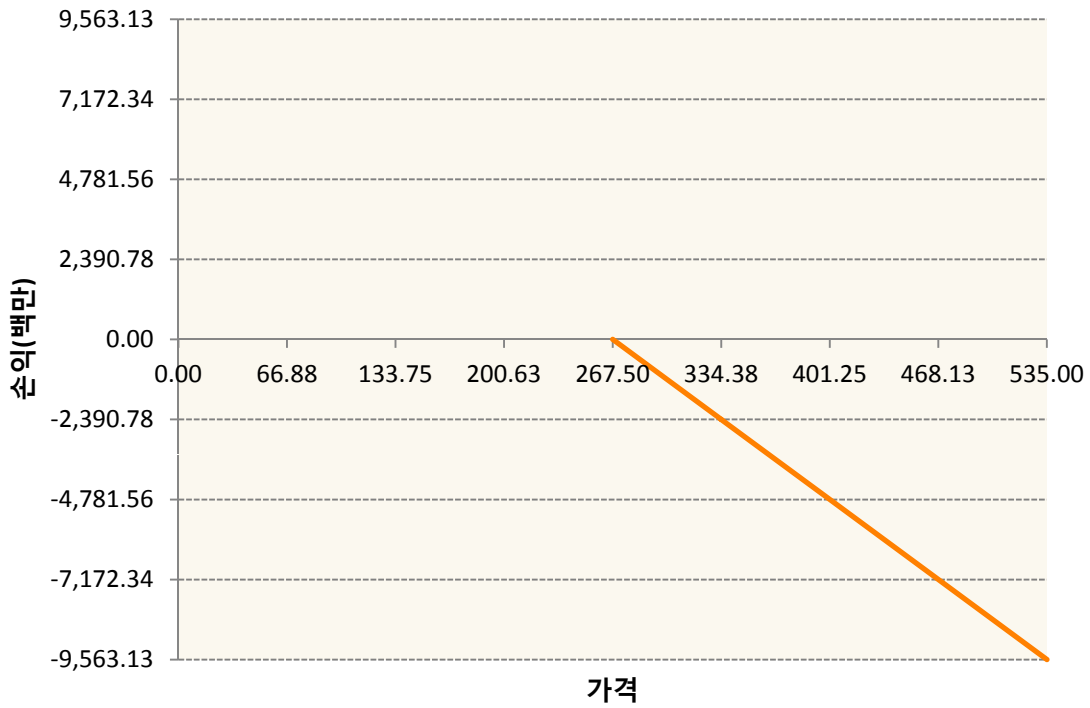


KR4201Q62659-2020-06 콜265

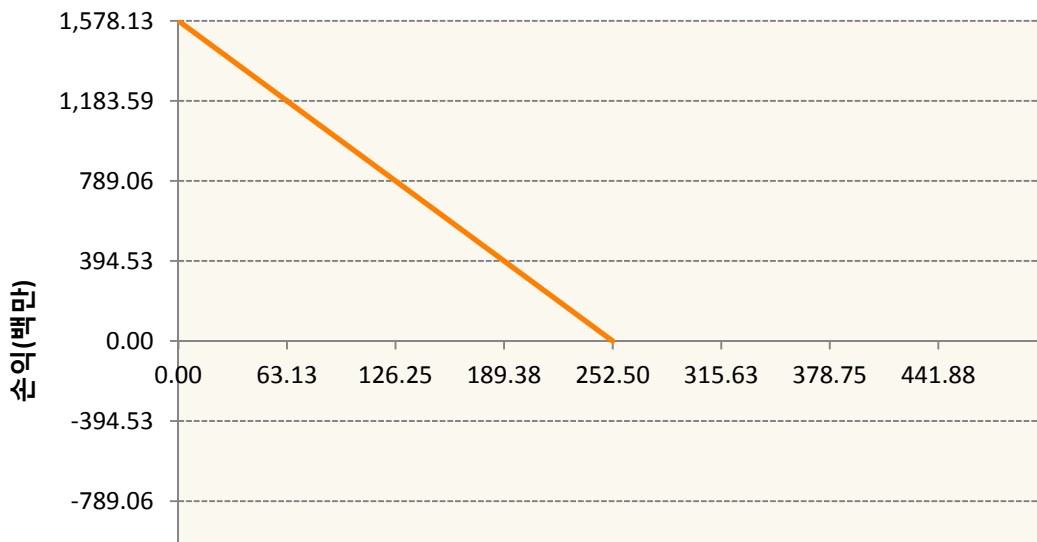


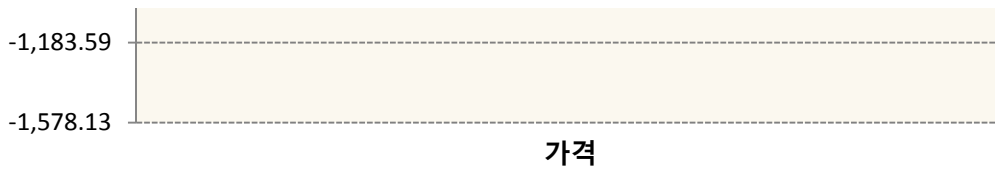


KR4201Q62675-2020-06 콜267.5

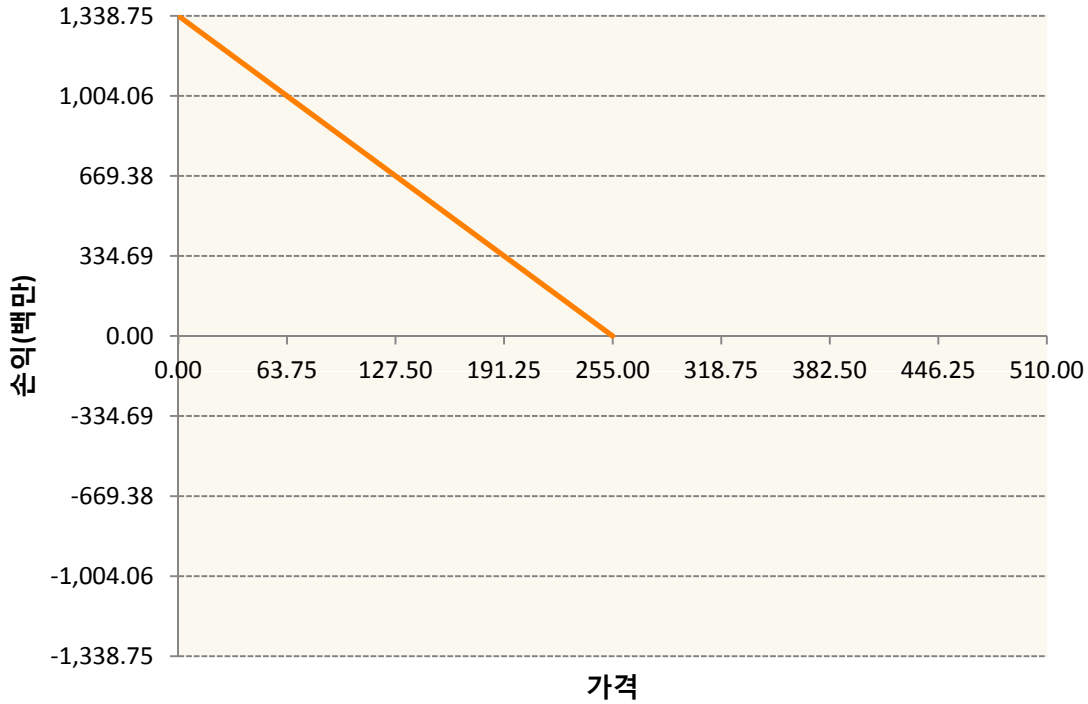


KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





KR4301Q62558-2020-06 풋255



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						741
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-741	-741	-741	-741	-741	-741	-741	
-5.33%	-494	-494	-494	-494	-494	-494	-494	
-2.67%	-247	-247	-247	-247	-247	-247	-247	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	247	247	247	247	247	247	247	
5.33%	494	494	494	494	494	494	494	
8.00%	741	741	741	741	741	741	741	
KR4201Q62659		2020-06 콜265						488
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	253	241	227	212	196	178	160	
-5.33%	221	203	184	164	143	121	99	
-2.67%	164	141	118	94	69	45	20	

0%	79	52	26	0	-26	-52	-79
2.67%	-40	-66	-92	-118	-144	-171	-197
5.33%	-188	-211	-235	-259	-284	-309	-334
8.00%	-362	-381	-400	-421	-443	-465	-488
KR4201Q62675 2020-06 콜267.5							531
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	256	245	231	216	199	181	161
-5.33%	227	209	189	168	145	122	98
-2.67%	173	148	123	97	70	43	16
0%	88	59	29	0	-29	-59	-89
2.67%	-33	-64	-94	-124	-154	-185	-215
5.33%	-190	-218	-246	-275	-304	-334	-363
8.00%	-377	-401	-425	-450	-477	-504	-531
KR4301Q62525 2020-06 풋252.5							73
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	60	62	64	66	68	70	73
-5.33%	27	30	33	36	39	42	44
-2.67%	5	8	11	14	17	20	23
0%	-7	-5	-2	0	2	5	8
2.67%	-12	-10	-9	-8	-6	-4	-2
5.33%	-13	-13	-12	-11	-10	-9	-8
8.00%	-13	-13	-13	-13	-12	-12	-11
KR4301Q62558 2020-06 풋255							68
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	58	59	61	62	64	66	68
-5.33%	28	30	33	35	37	40	42
-2.67%	6	9	11	14	17	19	22
0%	-6	-4	-2	0	2	5	7
2.67%	-12	-11	-10	-8	-6	-5	-3
5.33%	-14	-14	-13	-12	-11	-10	-9
8.00%	-15	-15	-14	-14	-14	-13	-12

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

(단위:백만원)

2,054

공시일	2020-05-26
기준일	2020-05-25

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	155,072	0	155,072	

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	2020-05-26
기준일	2020-05-25

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	104,557	0	104,557	

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	2020-05-26
기준일	2020-05-25

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	461,942	0	461,942	
누계	통화	선도	0	467,446	-467,446	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	856
FX21020H08 KRW/USD 26-05-20E	747
FX21020H09 KRW/USD 26-05-20E	498
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,484
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	7,067
FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E	2,986
FX21020J02€ KRW/USD 10-06-20E	1,354
FX21020J027 KRW/USD 22-06-20E	1,533
FX21020J028 KRW/USD 22-06-20E	1,991
FX21020J039 KRW/USD 24-07-20E	2,240
FX21020J041 KRW/USD 24-07-20E	1,792
FX21020J041 KRW/USD 24-07-20E	1,991
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	2,070
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	1,971
FX21020K01 KRW/USD 22-06-20E	697
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	2,429
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	995
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,045
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,652

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

18,974

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

(단위:백만원)

203

공시일	2020-05-26
기준일	2020-05-25

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	7,614	0	7,614	
누계	통화	선도	0	7,415	-7,415	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J04(KRW/USD 29-05-20E	257
FX21020K01(KRW/USD 15-06-20E	325
FX21020K03(KRW/USD 15-06-20E	11
IE00BD8RGM75	*

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

301

공시일	2020-05-26
기준일	2020-05-25

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

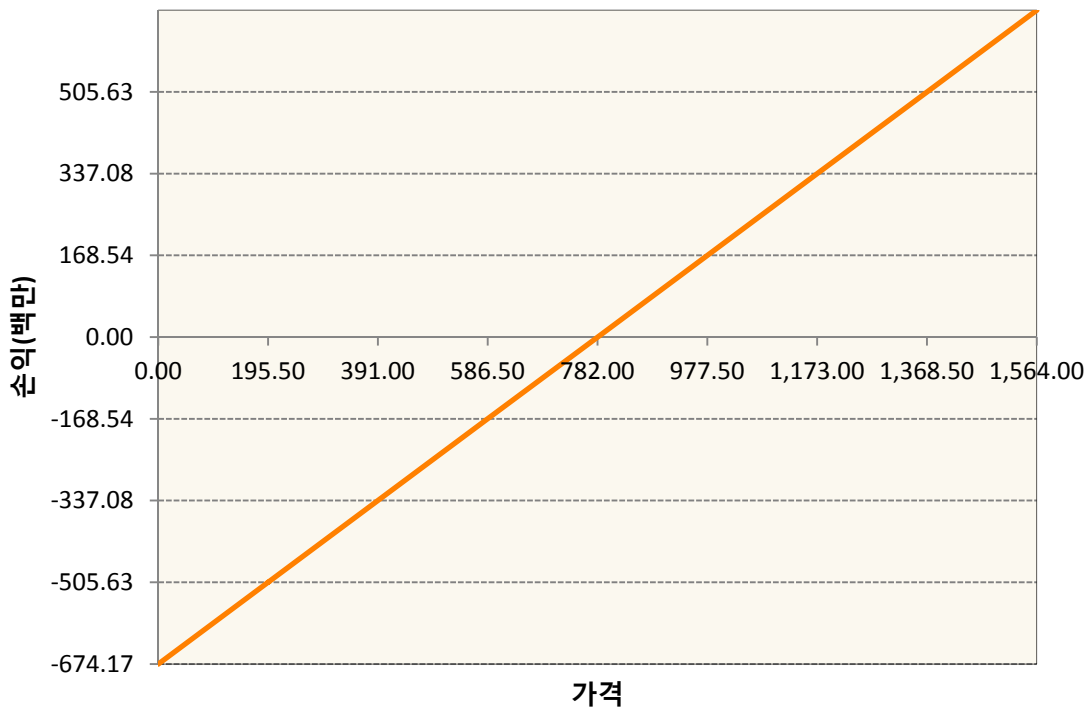
1. 계약금액

(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	674	0	674	
누계	유가증권	스왑	981	0	981	장외
누계	통화	선도	208	885	-676	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCM0-VN30 Index Future Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	79
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	54

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

(단위:백만원)

170

공시일	2020-05-26
기준일	2020-05-25

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

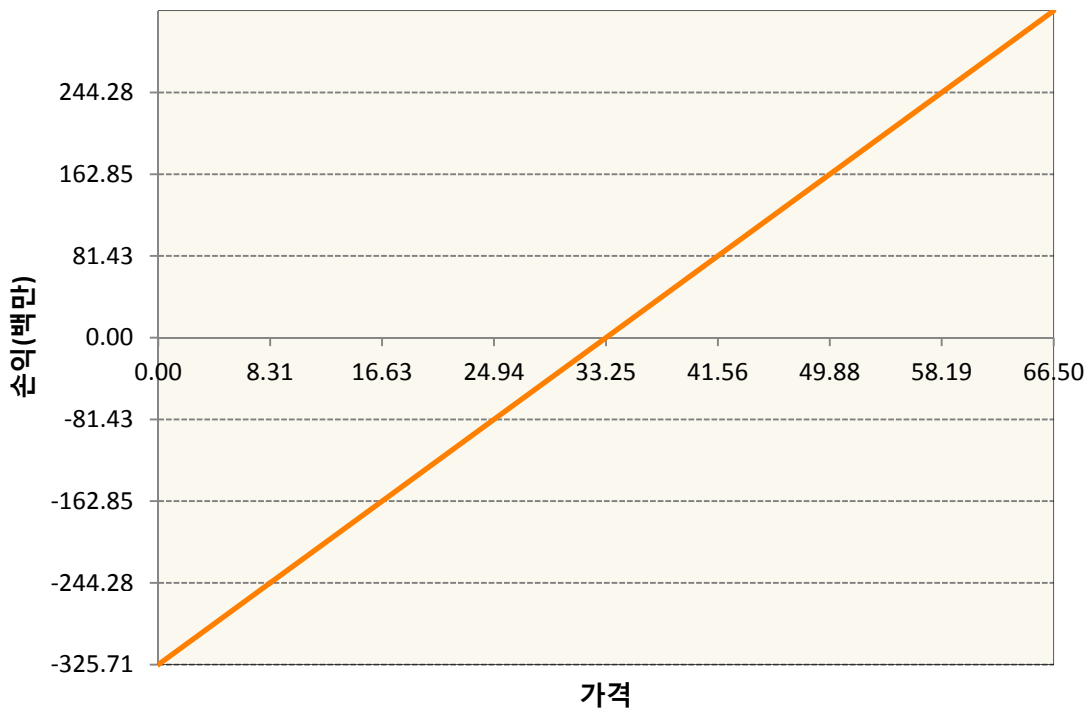
1. 계약금액

(단위:백만원)

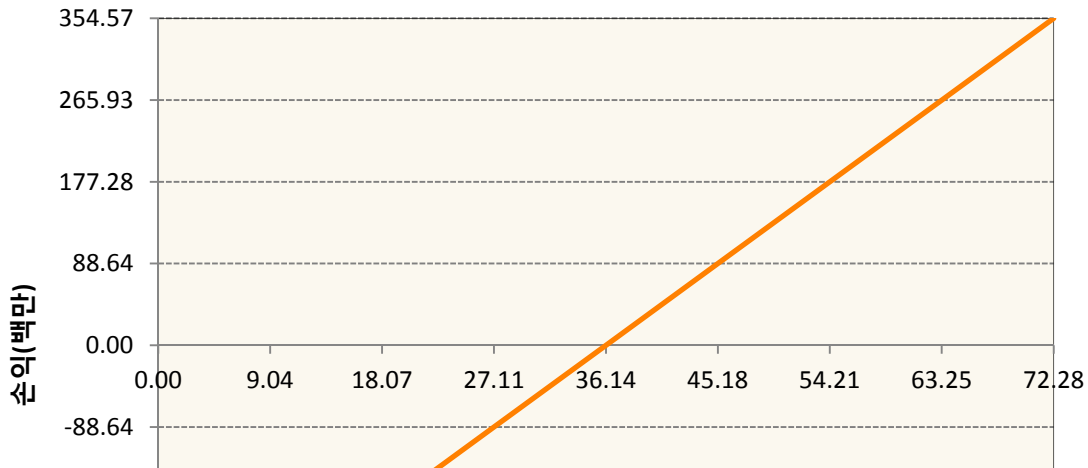
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,705	311	1,394	

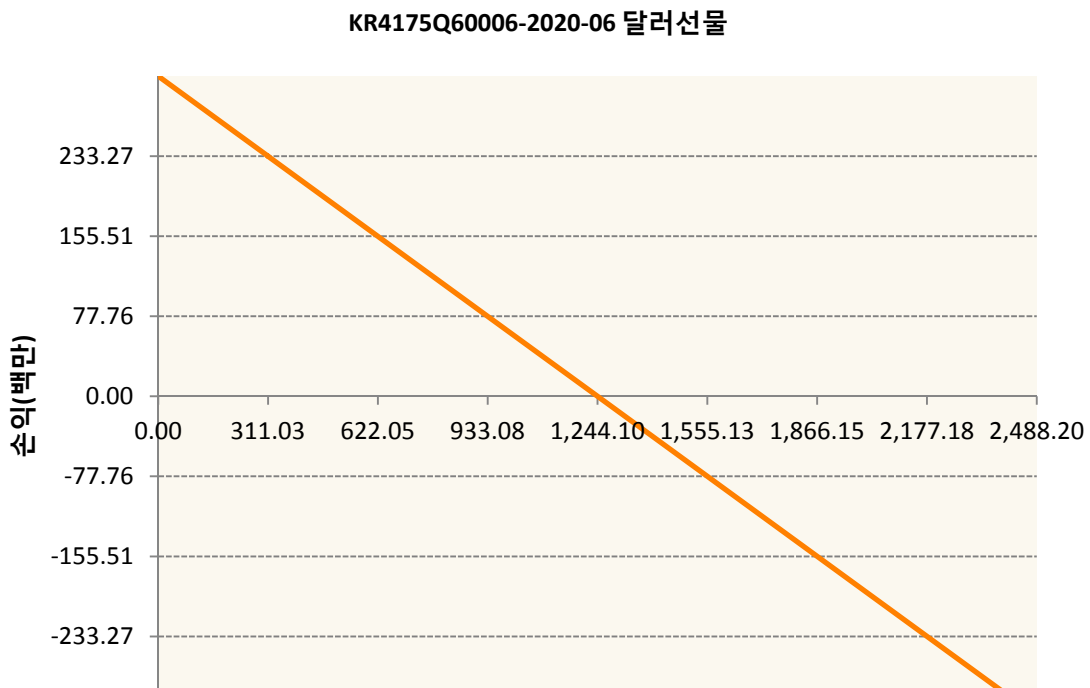
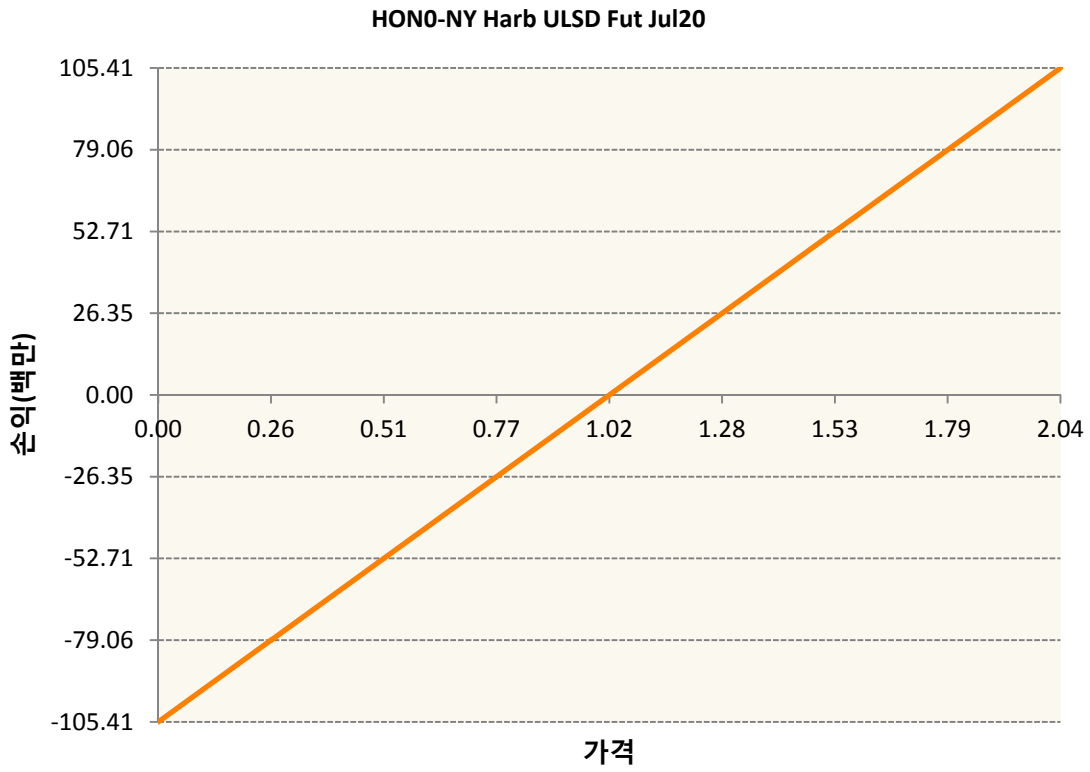
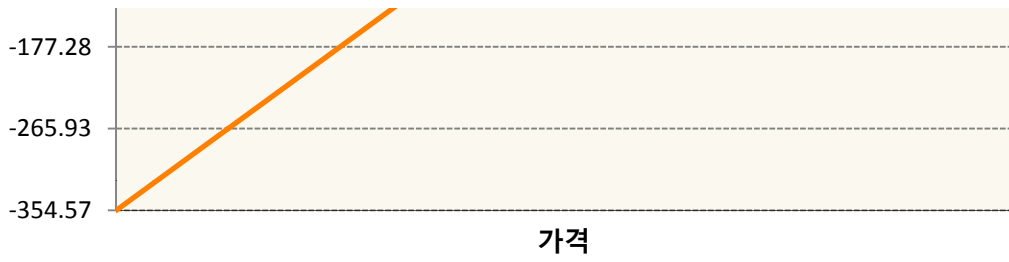
2. 만기시점의 손익구조

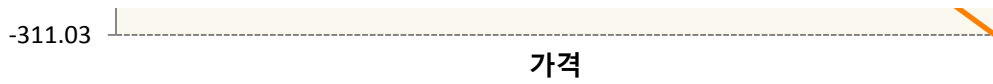
CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20



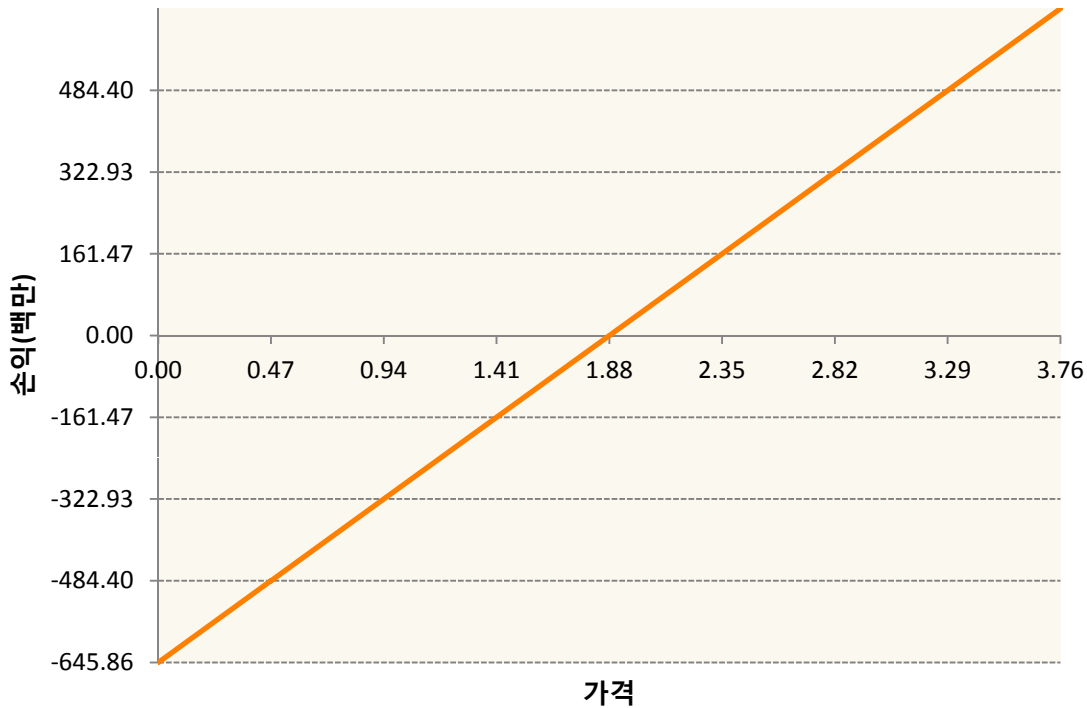
COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20



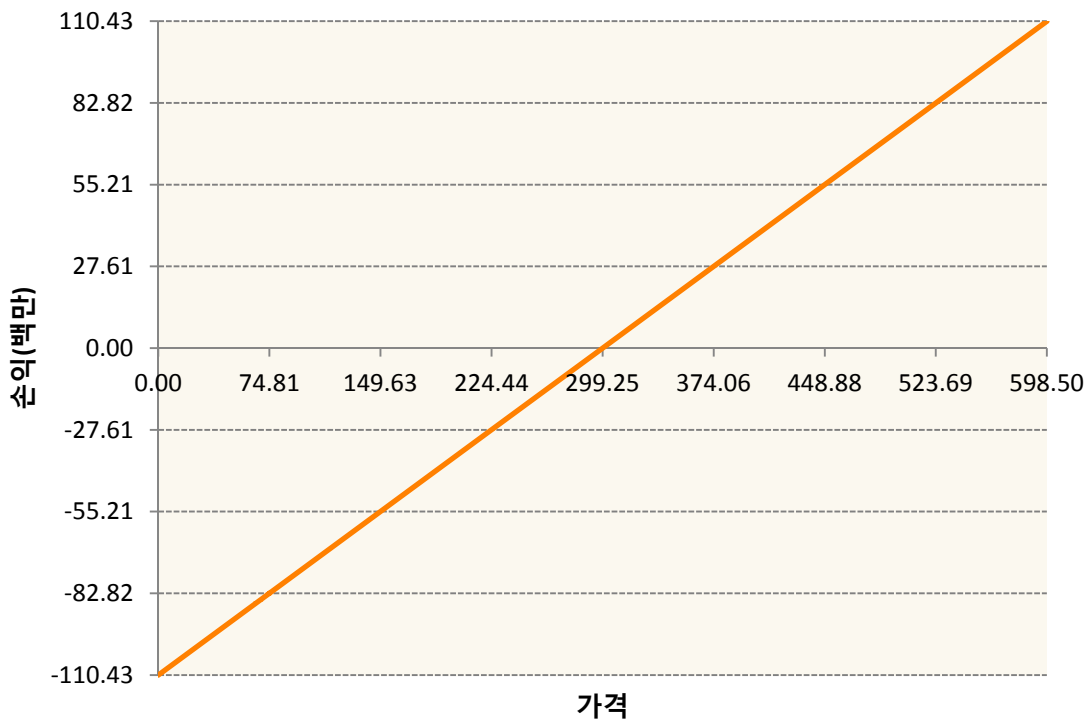




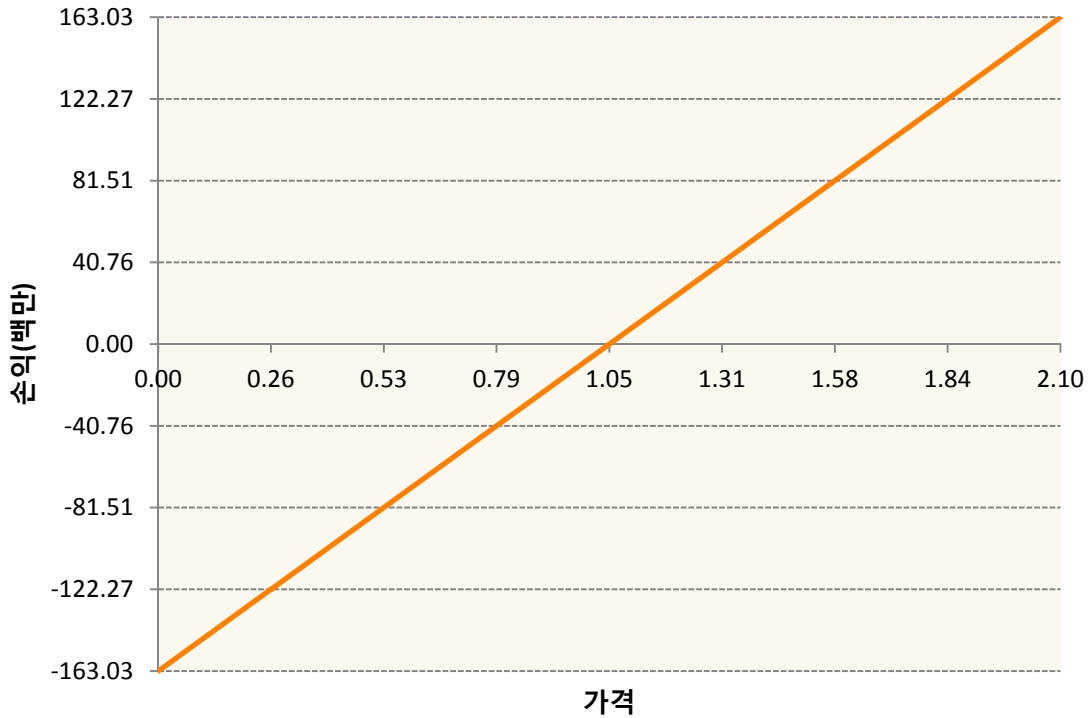
NGN20-NATURAL GAS FUTR Jul20



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	28
HON0	NY Harb ULSD Fut Jul20	8
KR4175Q60C	2020-06 달러선물	25
NGN20	NATURAL GAS FUTR Jul20	52
QSN0	Low Su Gasoil G Jul20	9
XBN0	GASOLINE RBOB FUT Jul20	13

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

807

공시일	2020-05-26
기준일	2020-05-25

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

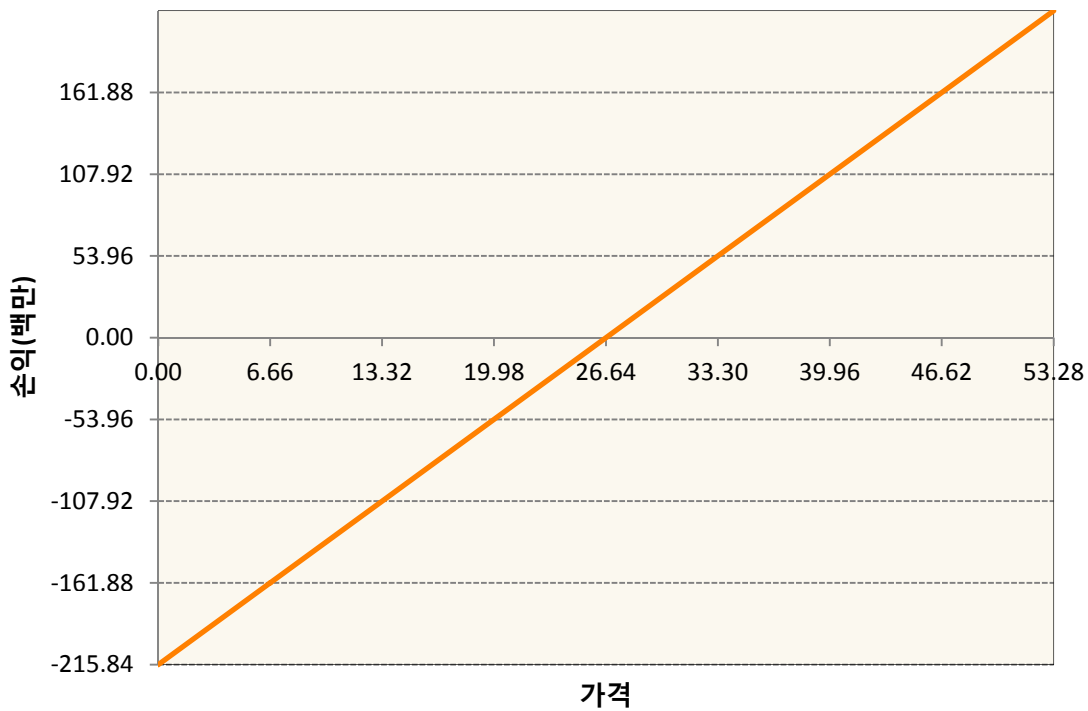
1. 계약금액

(단위:백만원)

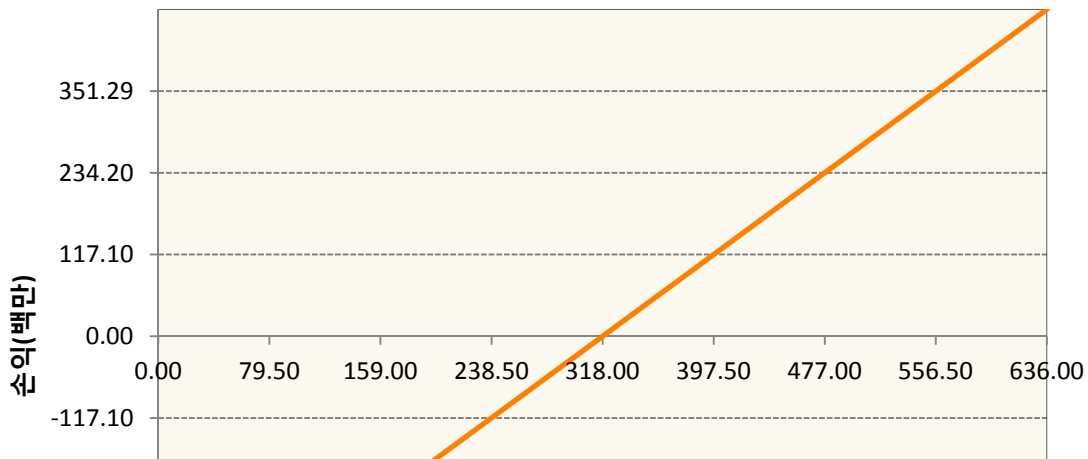
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,410	75	2,336	

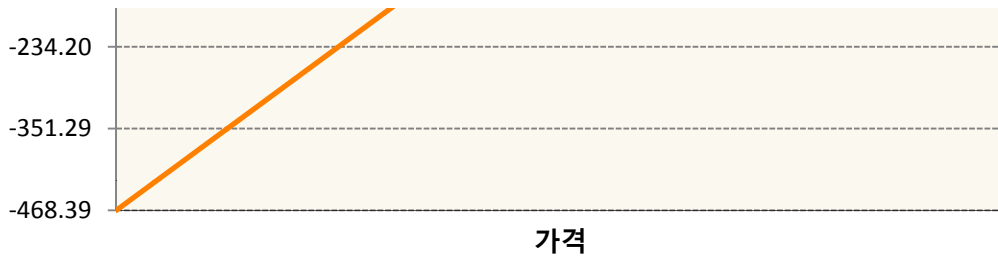
2. 만기시점의 손익구조

BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20

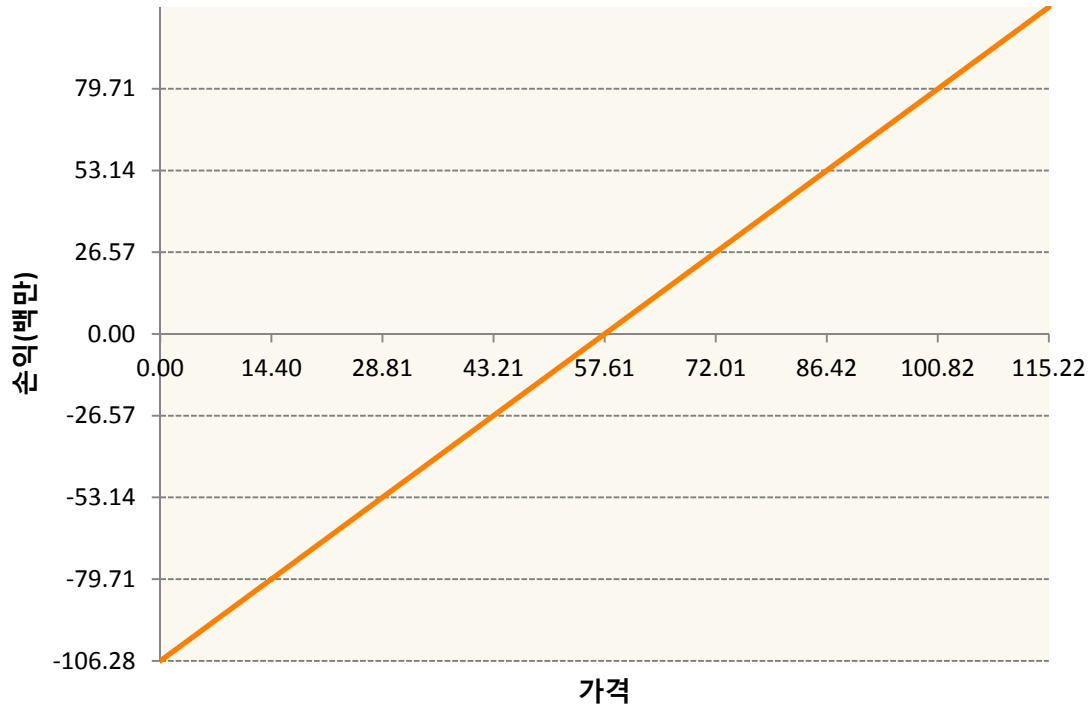


CNO-CORN FUTURE Jul20

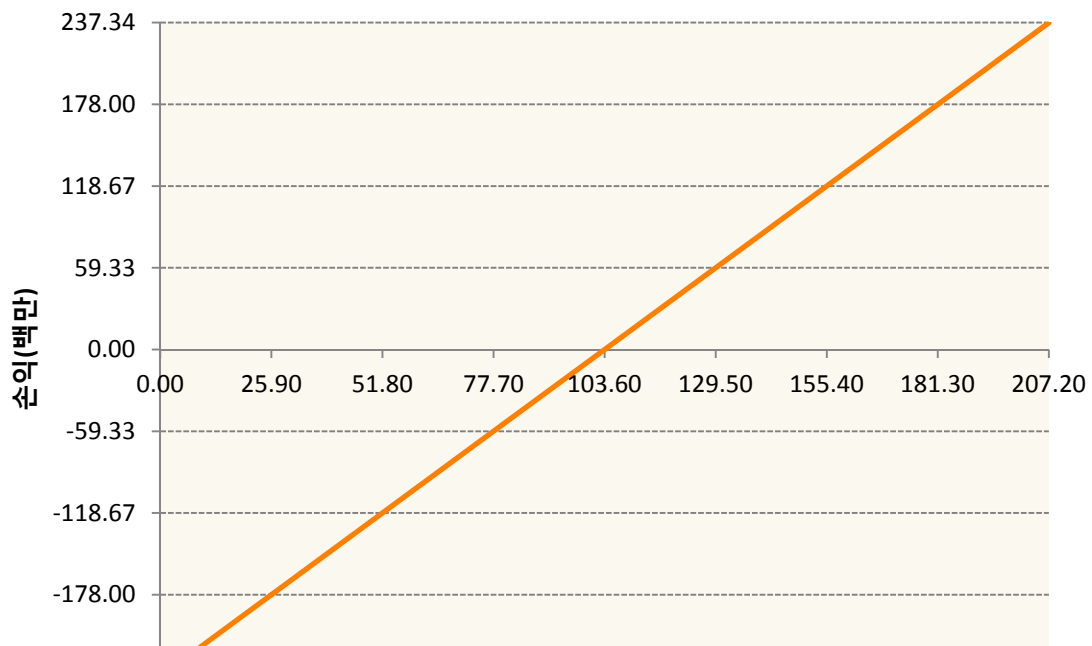


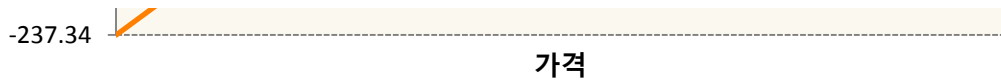


CTN0-COTTON NO.2 FUTR Jul20

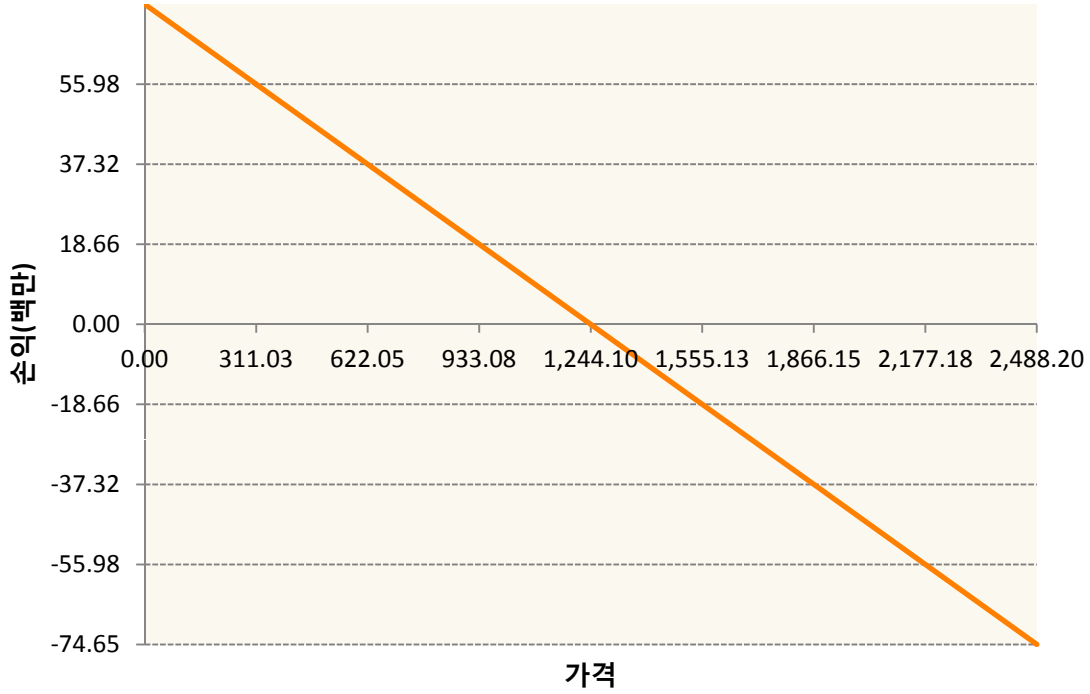


KCN0-COFFEE 'C' FUTURE Jul20

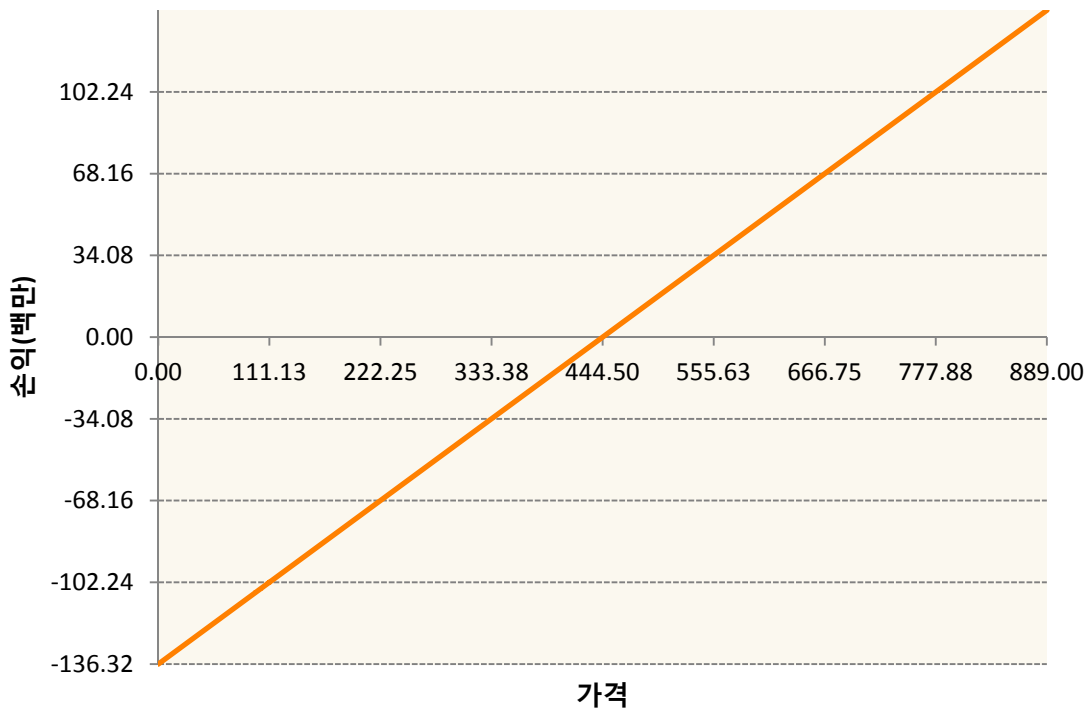




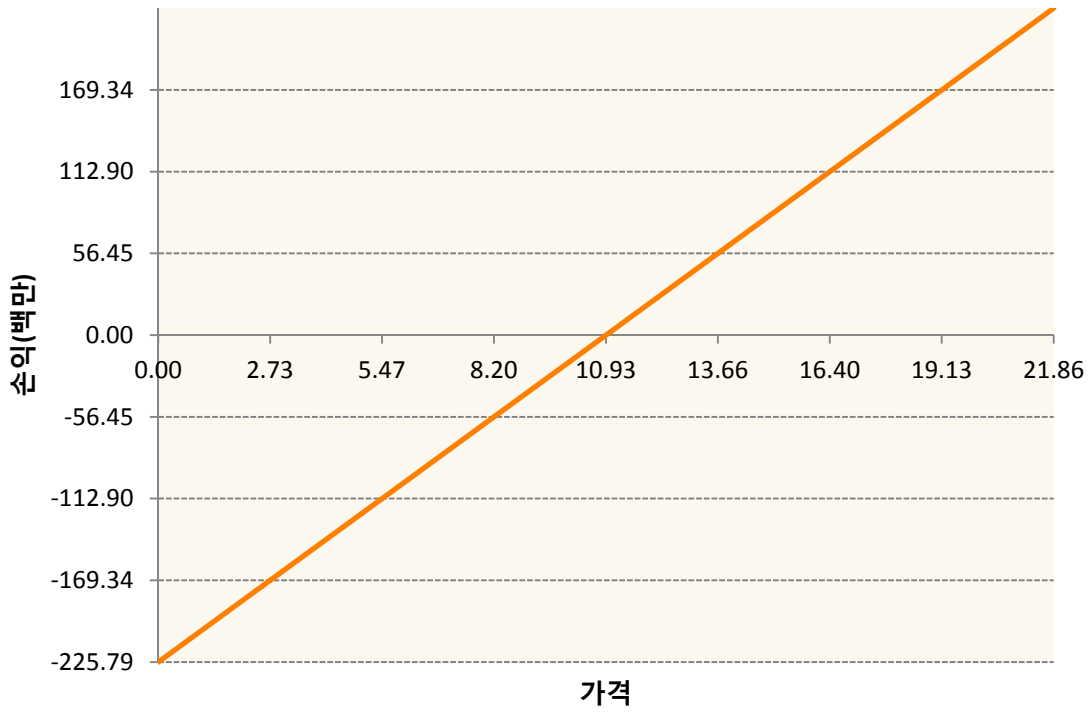
KR4175Q60006-2020-06 달러선물



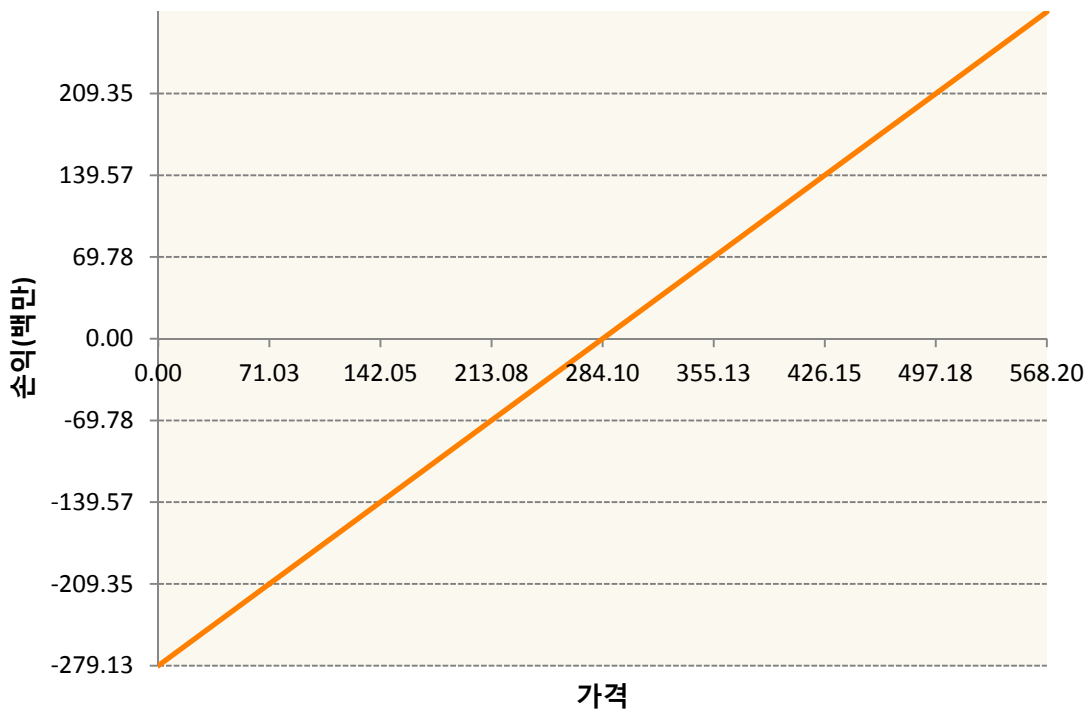
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



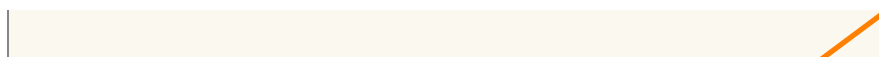
SBN0-Sugar Jul20

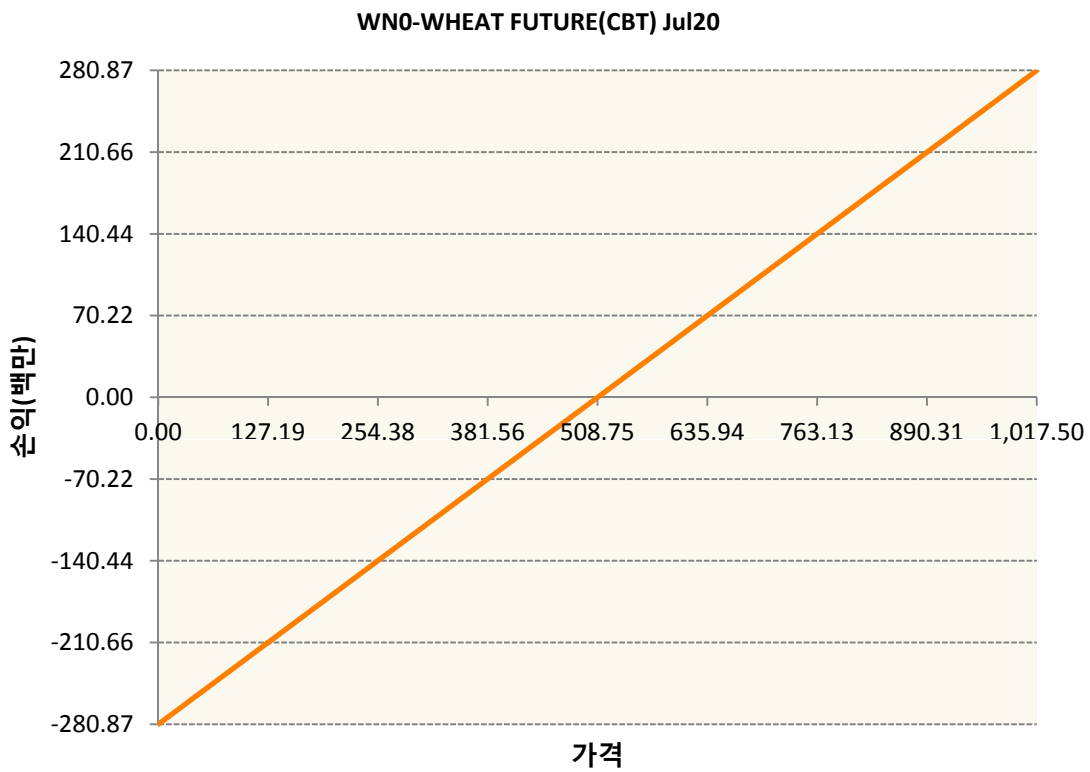
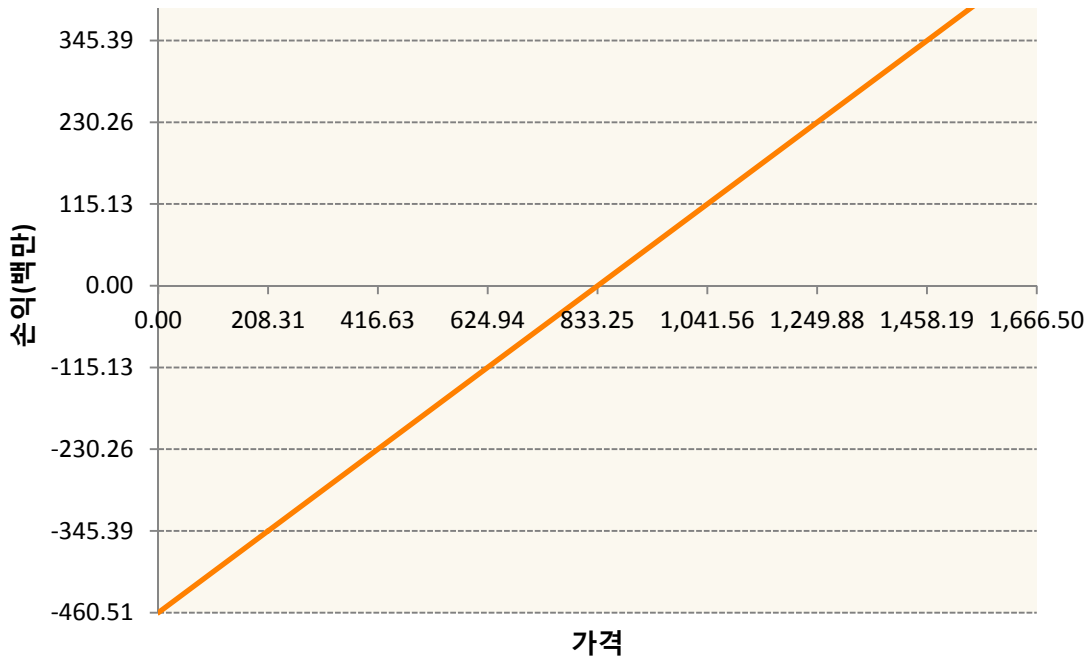


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20



SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON0	SOYBEAN OIL FUTR Jul20	17
CN0	CORN FUTURE Jul20	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
WNO	WHEAT FUTURE(CBT) Jul20	22

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

(단위:백만원)

229