

공시일	2020-05-27
기준일	2020-05-26

## 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	2020-05-27
기준일	2020-05-26

## 스마트인덱스모

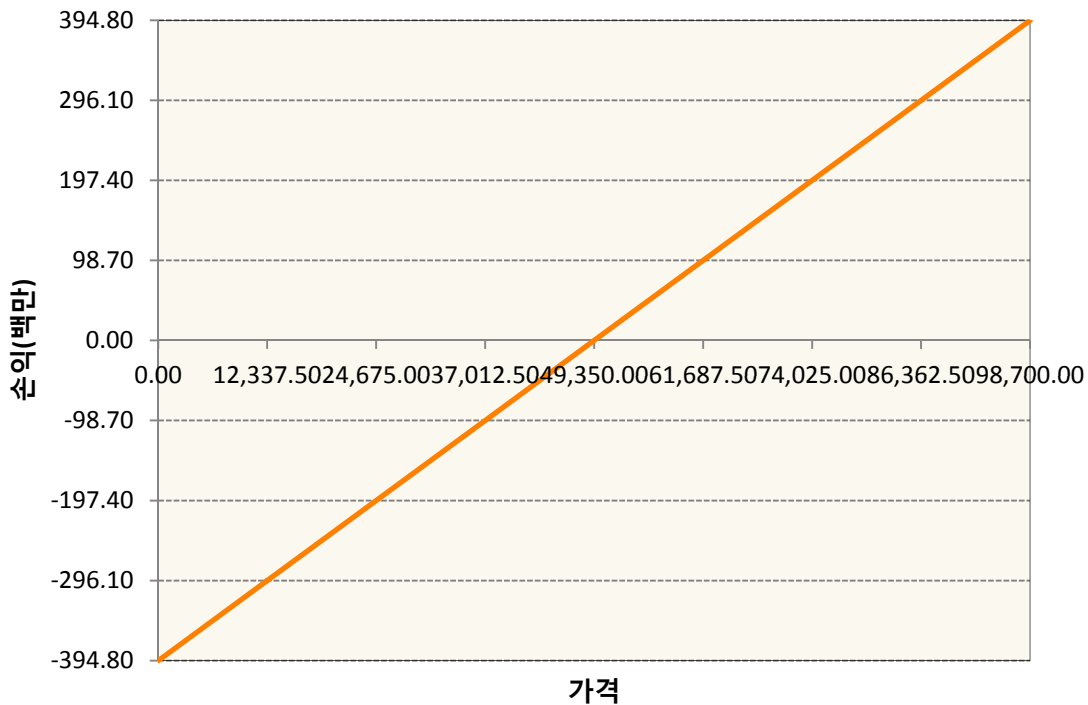
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	395	0	395	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4111Q60001-2020-06 삼성전자개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

48

공시일	2020-05-27
기준일	2020-05-26

## 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

1,005

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,175

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-27
기준일	2020-05-26

## 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

561

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

829

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-27
기준일	2020-05-26

## 유로인덱스모(주식-파생형)

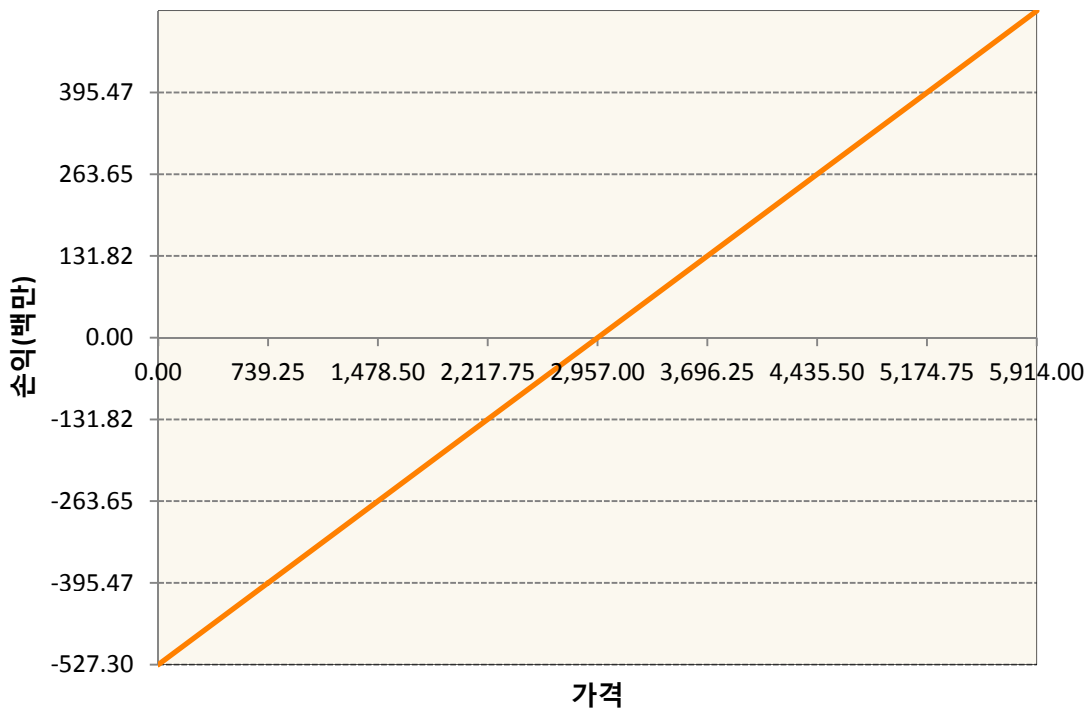
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	527	0	527	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

55
----

공시일	2020-05-27
기준일	2020-05-26

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

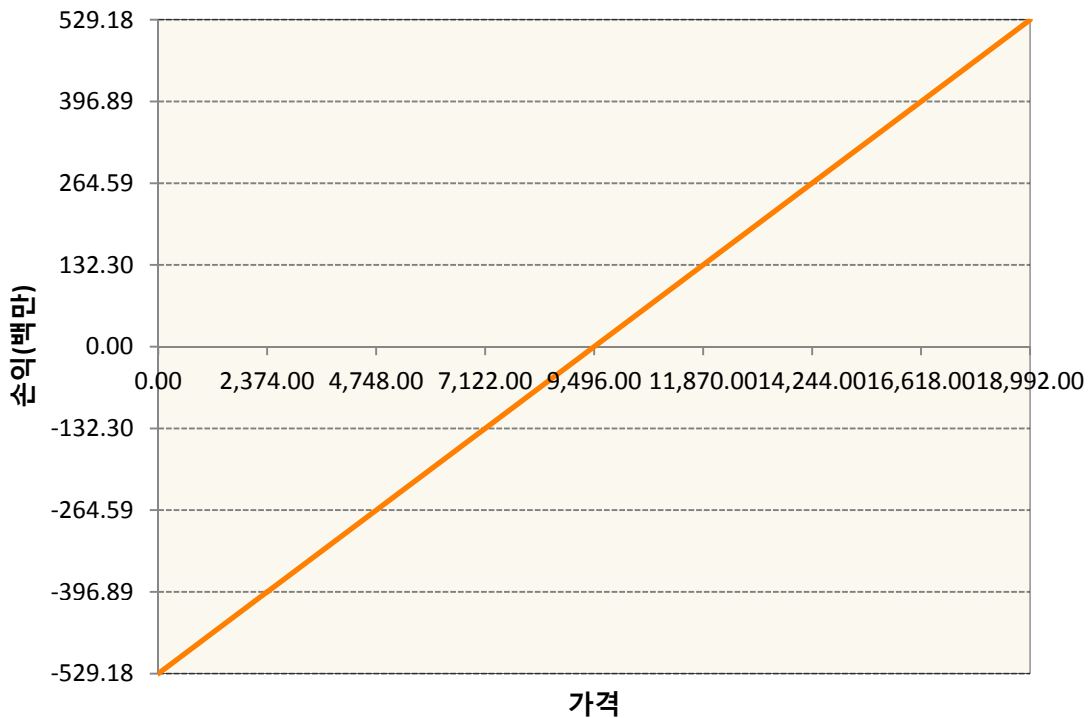
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	529	0	529	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCM0-HSCEI Futures Jun20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM0	HSCEI Futures Jun20	42
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

46
----

공시일	2020-05-27
기준일	2020-05-26

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

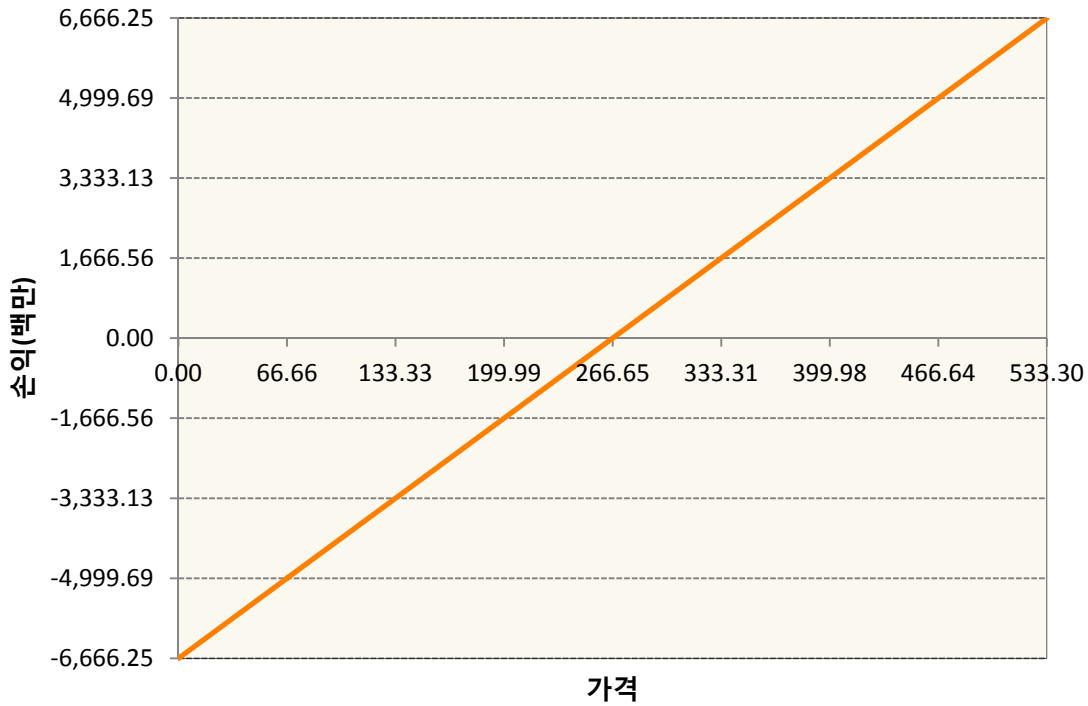
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

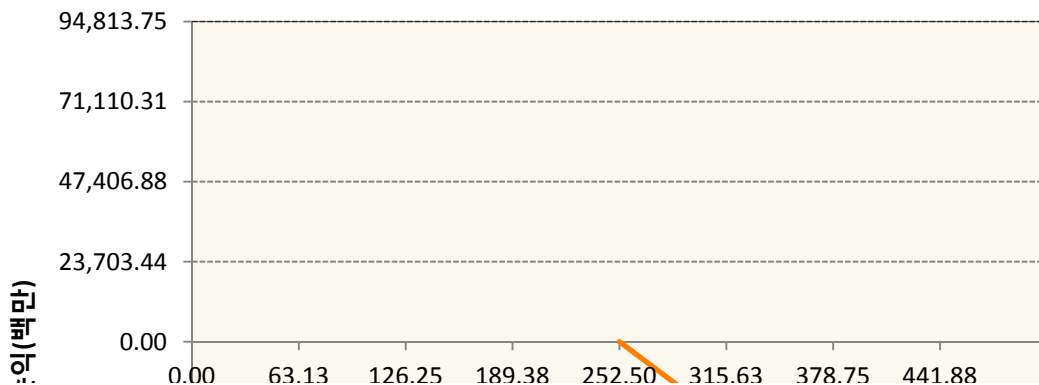
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,666	0	6,666	장내
누계	유가증권	옵션	0	364,213	-364,213	장내

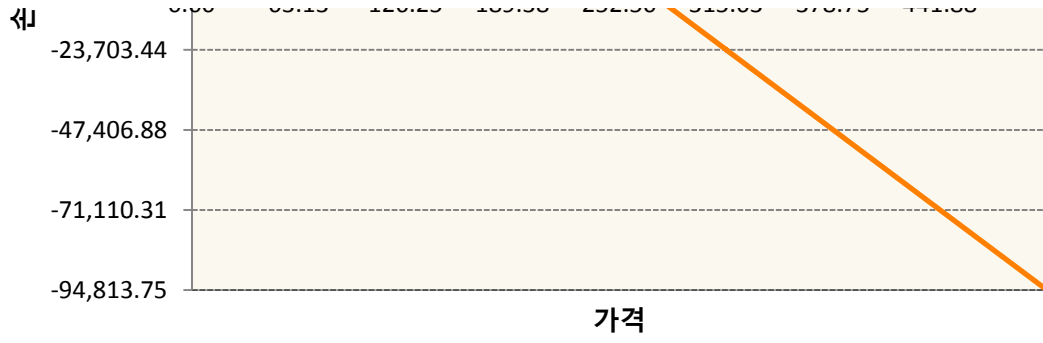
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

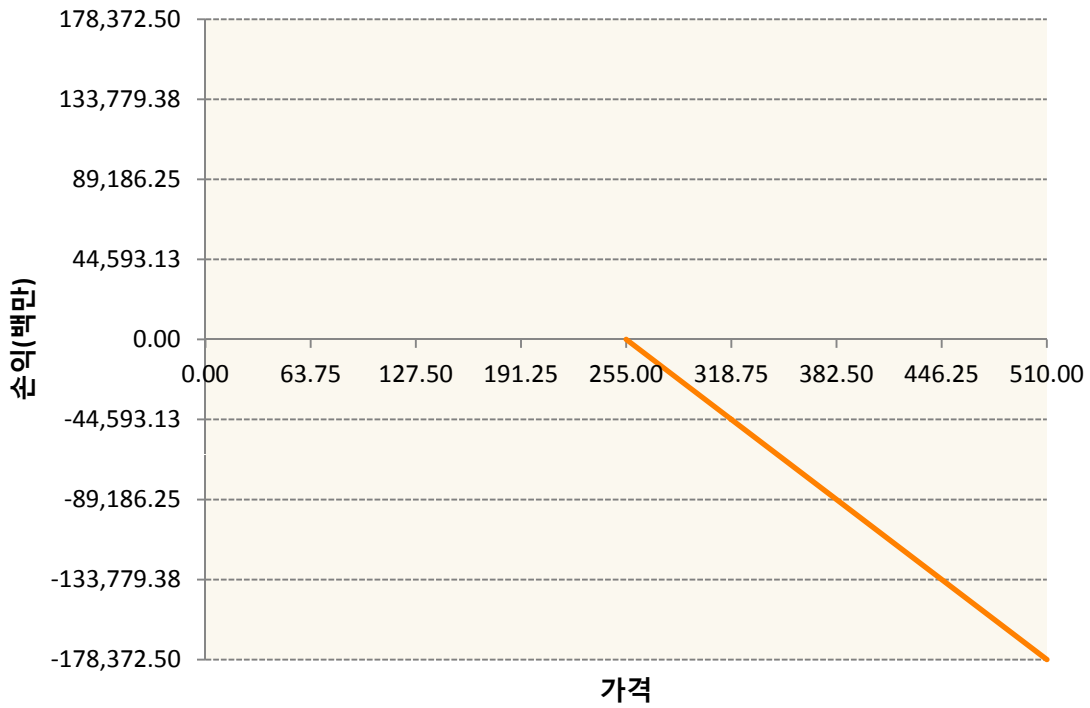


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

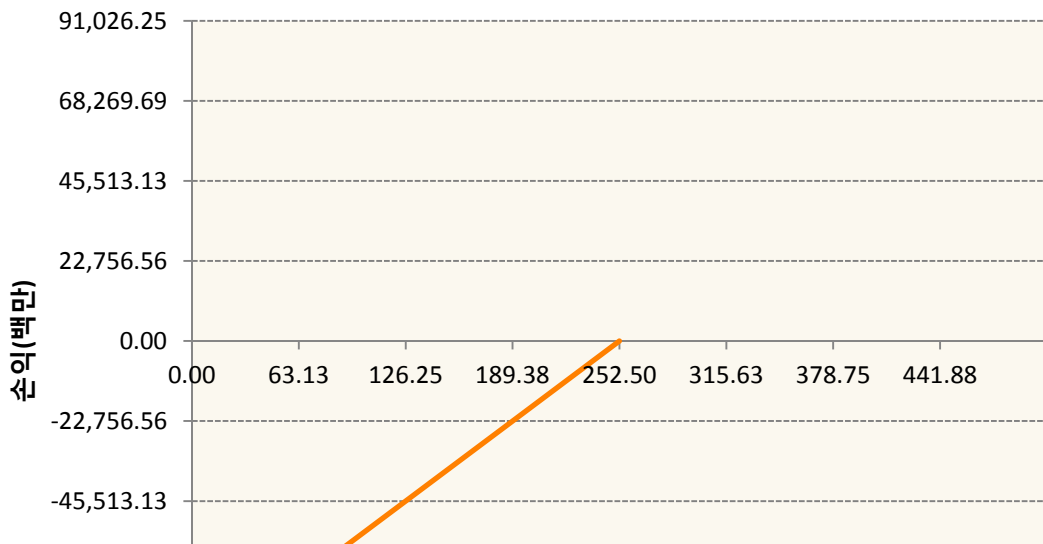


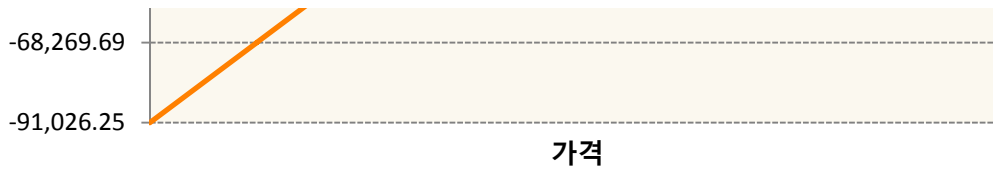


KR4201Q62550-2020-06 콜255



KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





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

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						535
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-535	-535	-535	-535	-535	-535	-535	
-5.33%	-356	-356	-356	-356	-356	-356	-356	
-2.67%	-178	-178	-178	-178	-178	-178	-178	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	178	178	178	178	178	178	178	
5.33%	356	356	356	356	356	356	356	
8.00%	535	535	535	535	535	535	535	
KR4201Q62527		2020-06 콜252.5						7,252
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5,464	5,199	4,931	4,661	4,388	4,114	3,838	
-5.33%	4,287	3,999	3,711	3,423	3,135	2,847	2,559	
-2.67%	2,679	2,410	2,136	1,860	1,582	1,301	1,019	
0%	691	472	241	0	-249	-503	-763	
2.67%	-1,585	-1,741	-1,917	-2,110	-2,315	-2,533	-2,759	
5.33%	-4,050	-4,149	-4,271	-4,412	-4,572	-4,746	-4,934	
8.00%	-6,624	-6,681	-6,758	-6,855	-6,970	-7,103	-7,252	
KR4201Q62550		2020-06 콜255						13,230
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	9,500	9,033	8,555	8,069	7,576	7,077	6,575	
-5.33%	7,584	7,048	6,511	5,974	5,437	4,900	4,362	
-2.67%	4,866	4,338	3,807	3,273	2,738	2,201	1,662	
0%	1,401	950	482	0	-492	-993	-1,500	
2.67%	-2,660	-2,999	-3,371	-3,769	-4,188	-4,625	-5,077	
5.33%	-7,138	-7,363	-7,630	-7,933	-8,267	-8,627	-9,009	
8.00%	-11,868	-12,003	-12,179	-12,392	-12,641	-12,922	-13,230	
KR4301Q62525		2020-06 풋252.5						3,406
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,593	-2,719	-2,850	-2,985	-3,123	-3,263	-3,406	
-5.33%	-1,008	-1,166	-1,325	-1,483	-1,641	-1,800	-1,958	
-2.67%	-127	-252	-383	-519	-658	-800	-944	

0%	228	163	87	0	-96	-199	-308
2.67%	330	307	274	232	179	118	47
5.33%	350	345	334	318	295	264	225
8.00%	353	352	350	345	336	323	304

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

(단위:백만원)

**23,109**

공시일	2020-05-27
기준일	2020-05-26

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

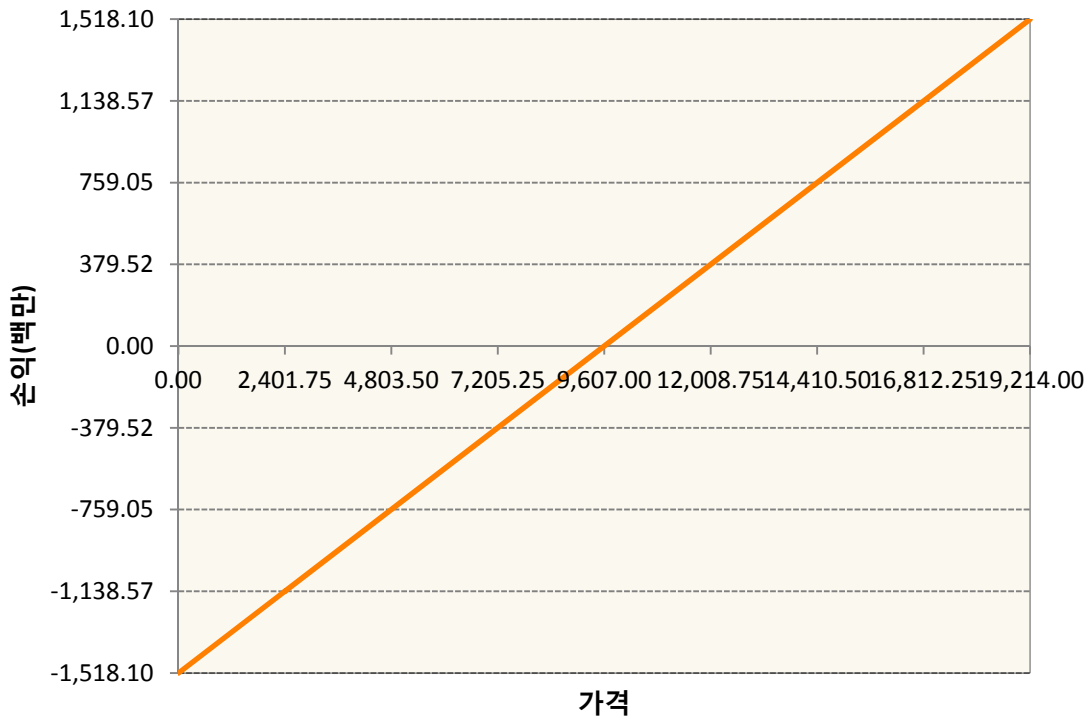
### 1. 계약금액

(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	1,518	0	1,518	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,458	-4,458	장내
누계	통화	선도	0	1,541	-1,541	장외

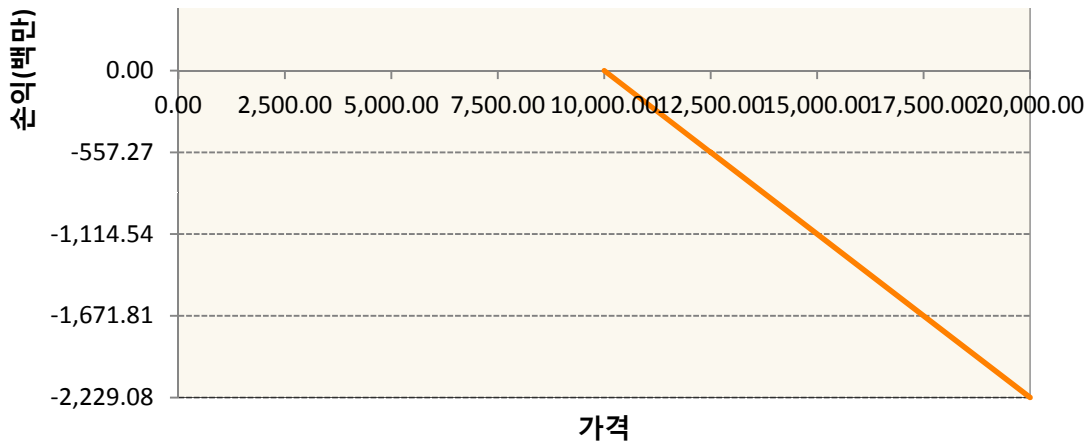
### 2. 만기시점의 손익구조

HCK0-HSCEI Futures May20

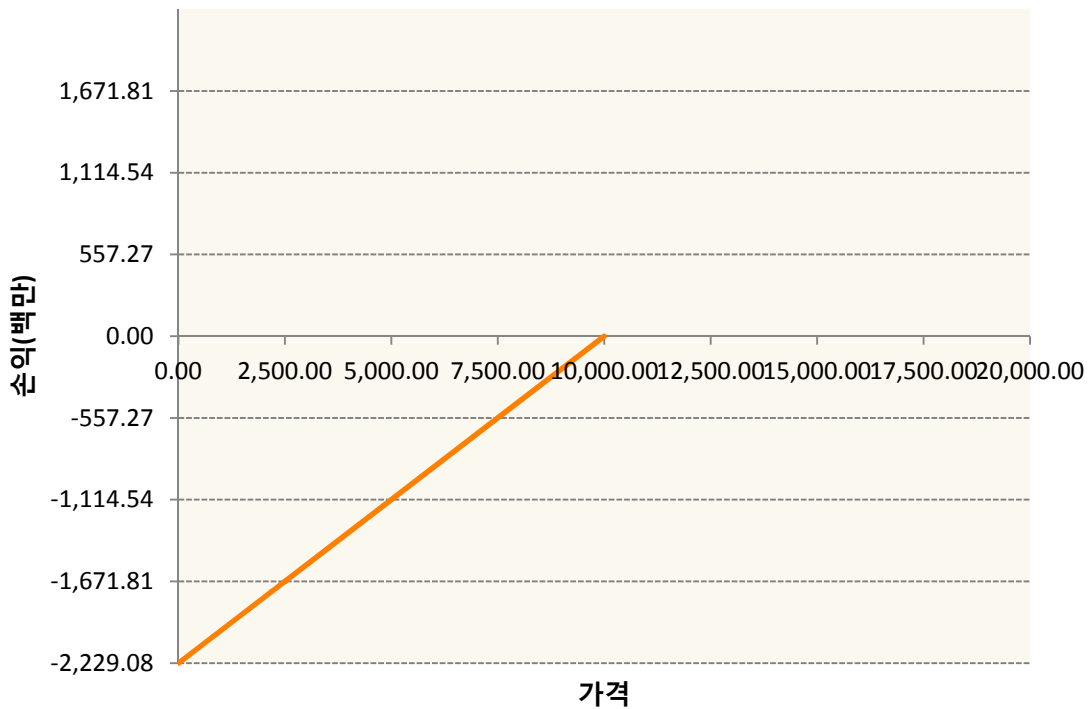


OHHIK0-C100-HSCEI





OHHIK0-P100-HSCEI



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E		123
HCK0 HSCEI Futures May20		121
OHHIK0-C1C HSCEI		178
OHHIK0-P10 HSCEI		178

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	580

공시일	2020-05-27
기준일	2020-05-26

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

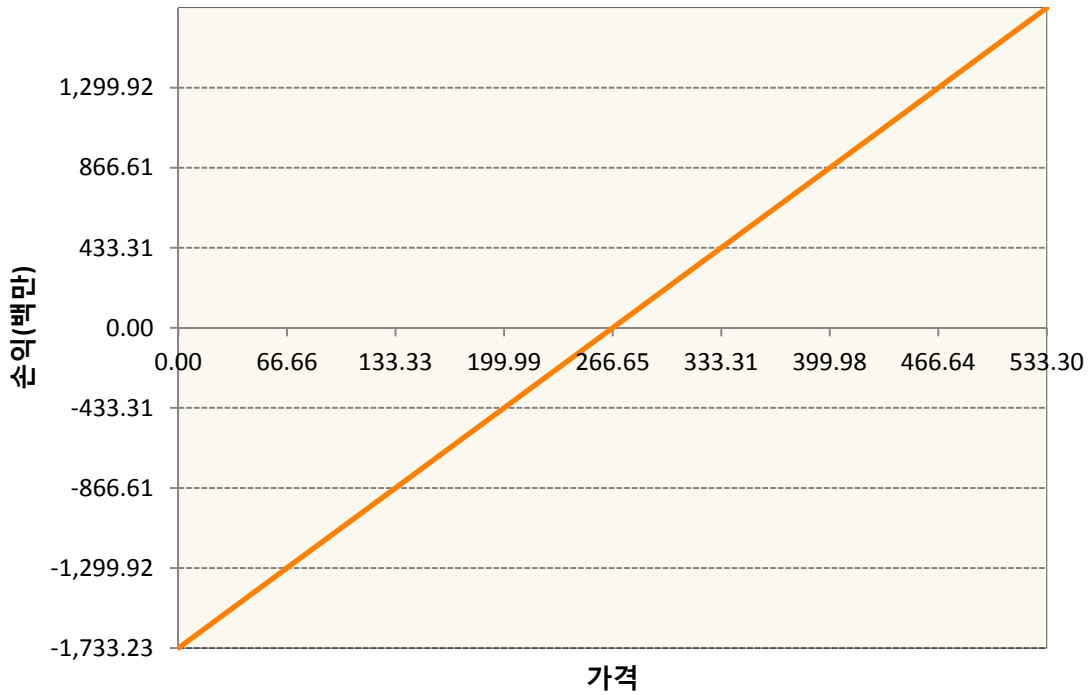
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

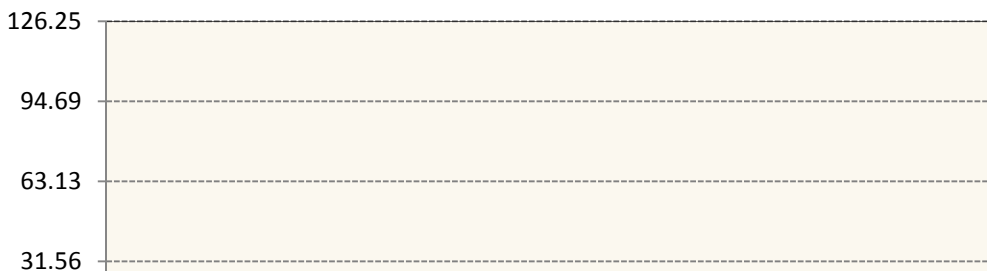
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,733	0	1,733	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,361	-3,361	장내

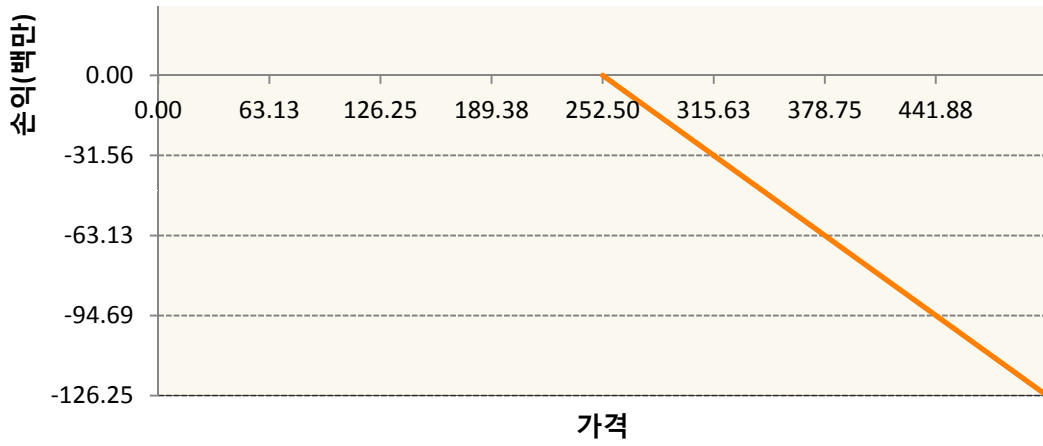
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

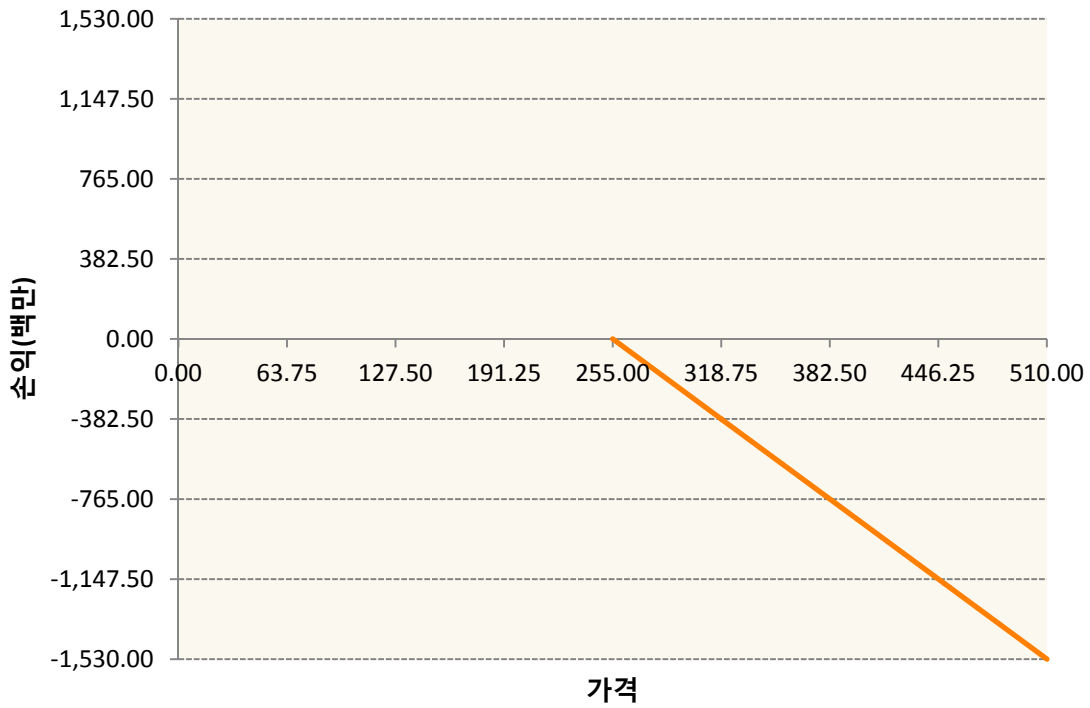


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

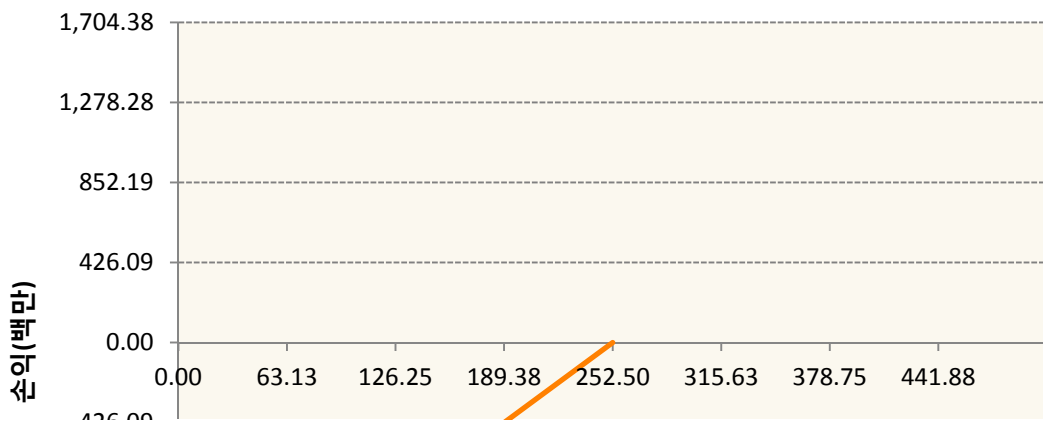




KR4201Q62550-2020-06 콜255



KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





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

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						191
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-191	-191	-191	-191	-191	-191	-191	
-5.33%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127	
-2.67%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	64	64	64	64	64	64	64	
5.33%	127	127	127	127	127	127	127	
8.00%	191	191	191	191	191	191	191	
KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						139
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-139	-139	-139	-139	-139	-139	-139	
-5.33%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93	
-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%	93	93	93	93	93	93	93	
8.00%	139	139	139	139	139	139	139	
KR4201Q62527		2020-06 콜252.5						10
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	7	7	7	6	6	5	5	
-5.33%	6	5	5	5	4	4	3	
-2.67%	4	3	3	2	2	2	1	
0%	1	1	0	0	0	-1	-1	
2.67%	-2	-2	-3	-3	-3	-3	-4	
5.33%	-5	-6	-6	-6	-6	-6	-7	
8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-10	
KR4201Q62550		2020-06 콜255						113
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	81	77	73	69	65	61	56
-5.33%	65	60	56	51	47	42	37
-2.67%	42	37	33	28	23	19	14
0%	12	8	4	0	-4	-9	-13
2.67%	-23	-26	-29	-32	-36	-40	-44
5.33%	-61	-63	-65	-68	-71	-74	-77
8.00%	-102	-103	-104	-106	-108	-111	-113
KR4301Q62525                      2020-06 풋252.5							64
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-49	-51	-53	-56	-58	-61	-64
-5.33%	-19	-22	-25	-28	-31	-34	-37
-2.67%	-2	-5	-7	-10	-12	-15	-18
0%	4	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	6	6	5	4	3	2	1
5.33%	7	6	6	6	6	5	4
8.00%	7	7	7	6	6	6	6

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

(단위:백만원)

**564**

공시일	2020-05-27
기준일	2020-05-26

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

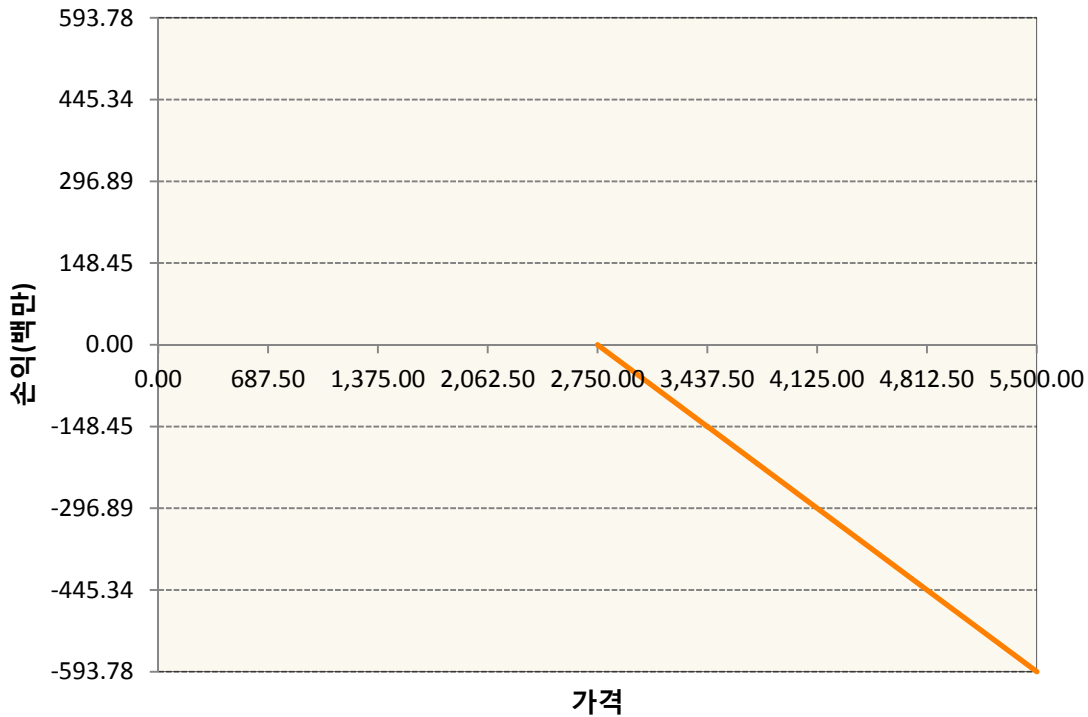
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

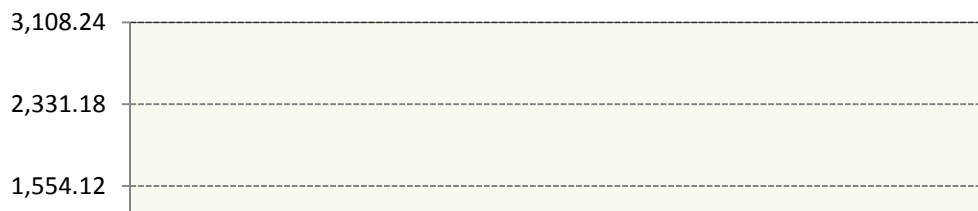
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,584	0	1,584	
누계	유가증권	스왑	8,048	0	8,048	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,404	-7,404	장내
누계	통화	선도	0	2,920	-2,920	장외

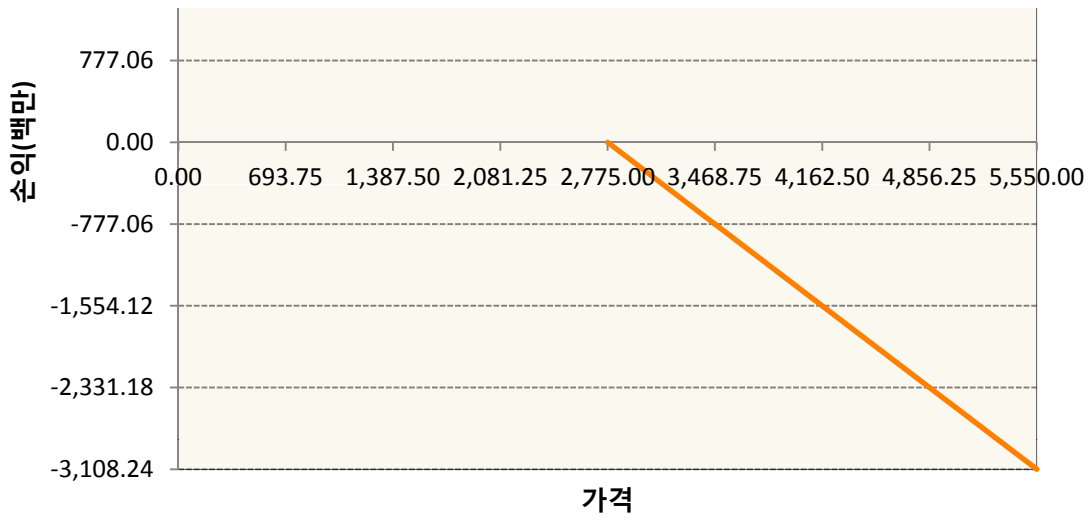
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXM0-C2750-EURO STOXX 50**

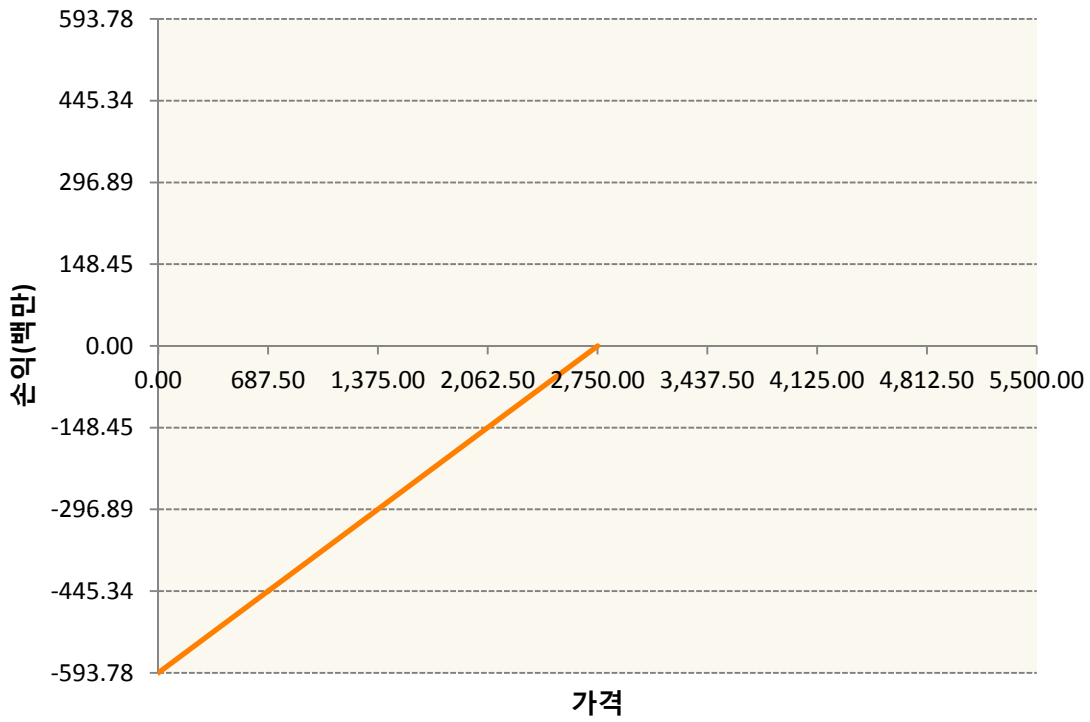


**OESXM0-C2775-EURO STOXX 50**

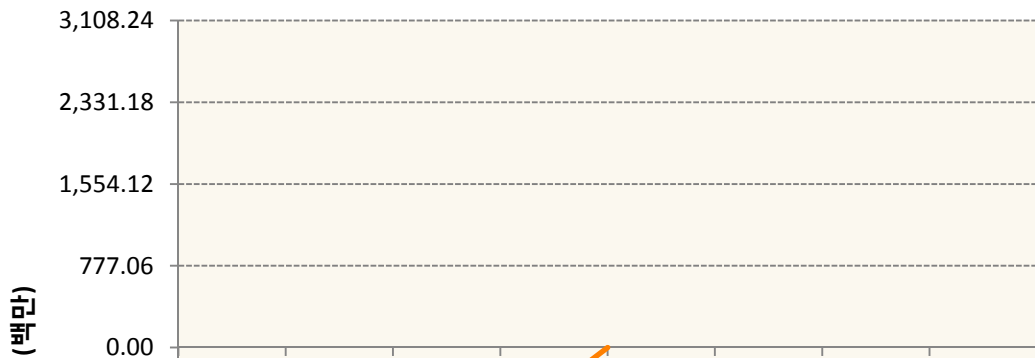


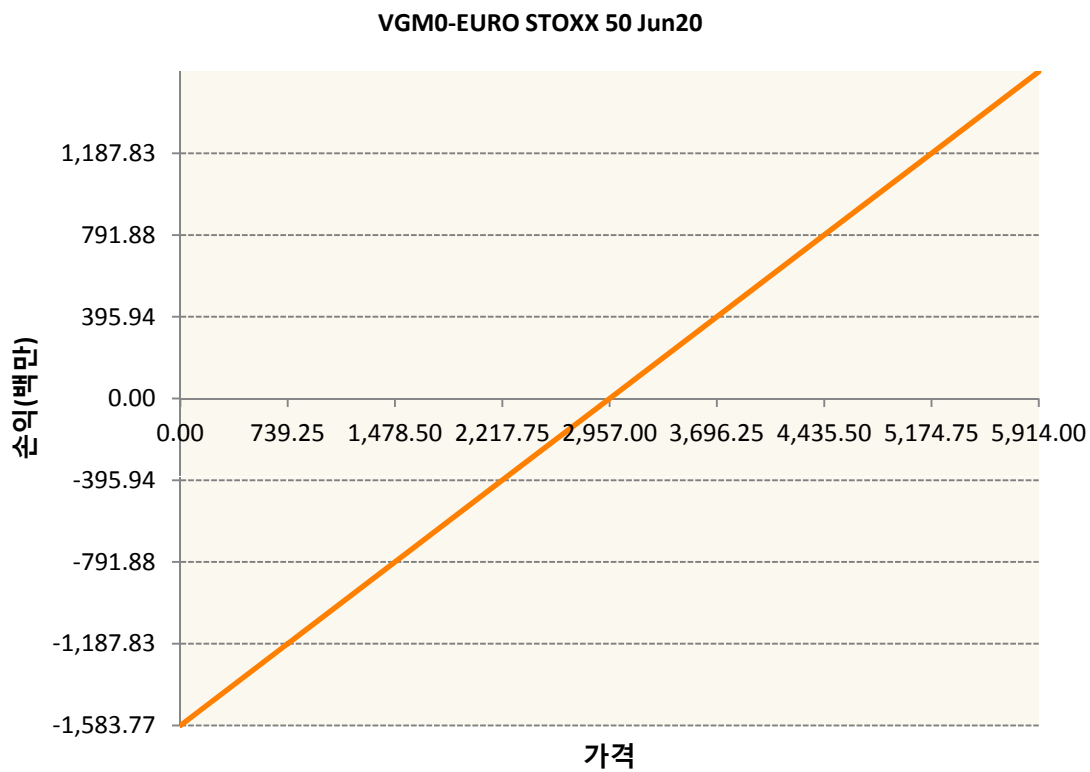
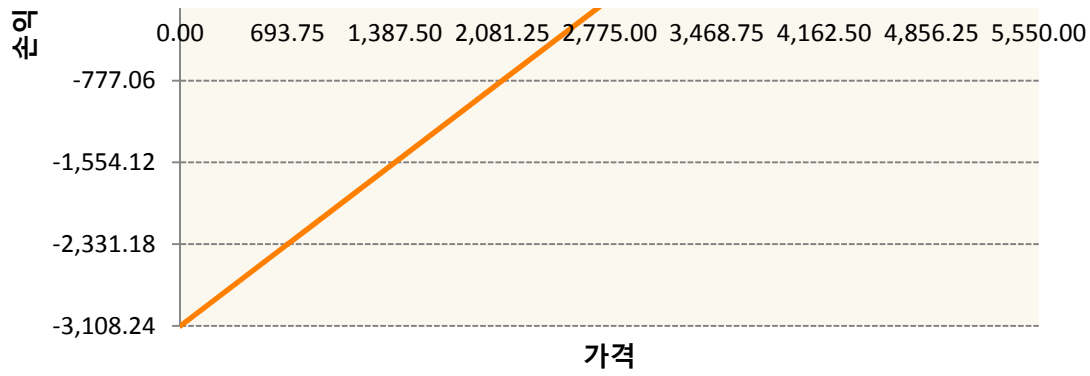


OESXM0-P2750-EURO STOXX 50



OESXM0-P2775-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		18
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		127

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

(단위:백만원)

1,107



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

(단위:백만원)

1,198



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

(단위:백만원)

104



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

(단위:백만원)

152



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

(단위:백만원)

72

공시일	2020-05-27
기준일	2020-05-26

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

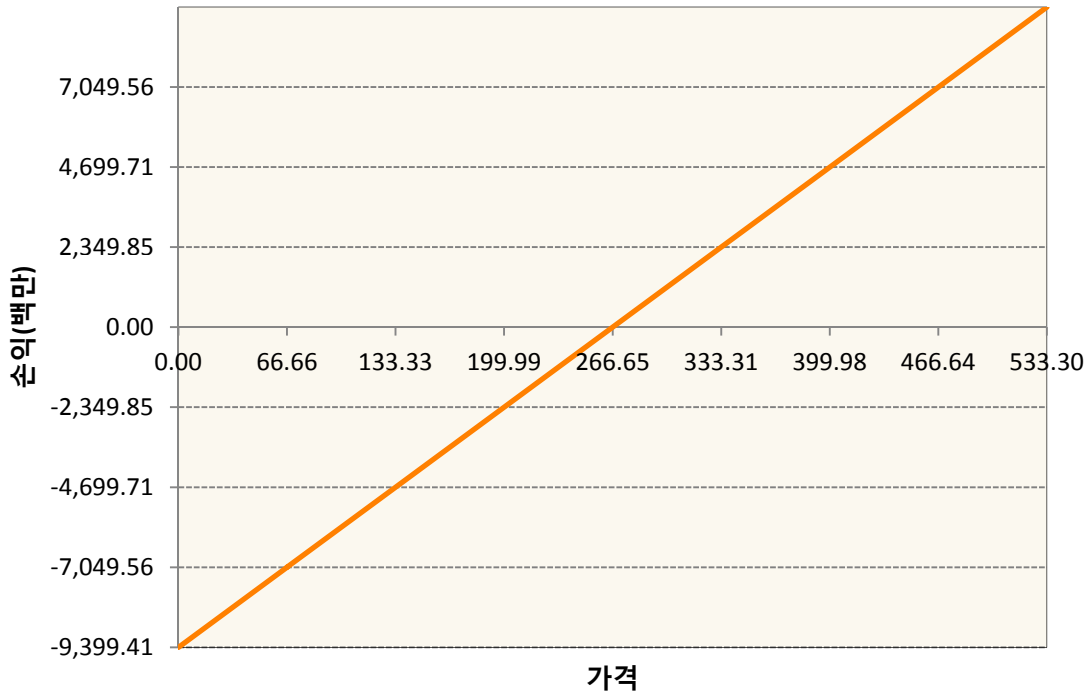
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

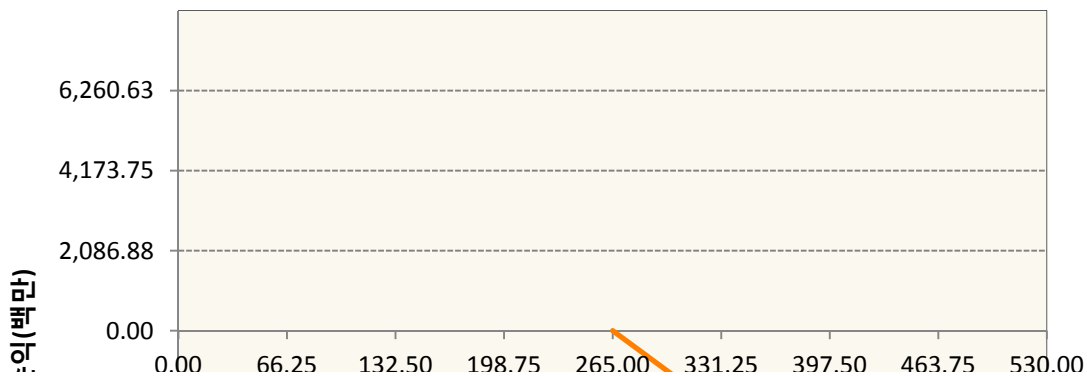
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,399	0	9,399	장내
누계	유가증권	옵션	2,917	17,911	-14,994	장내

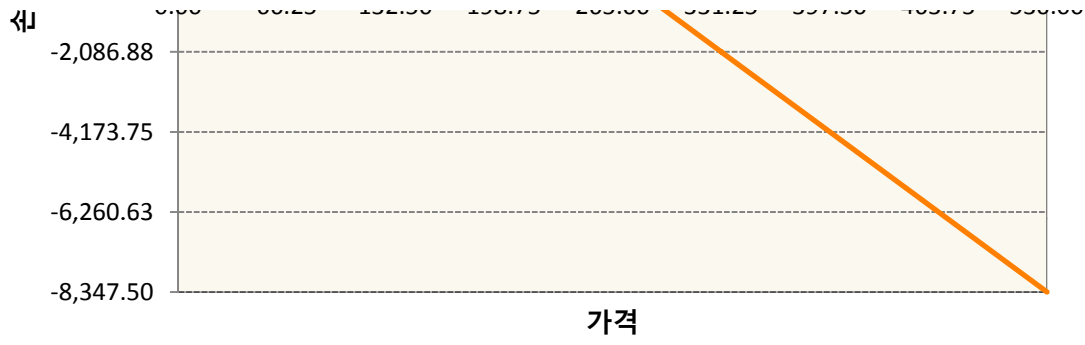
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

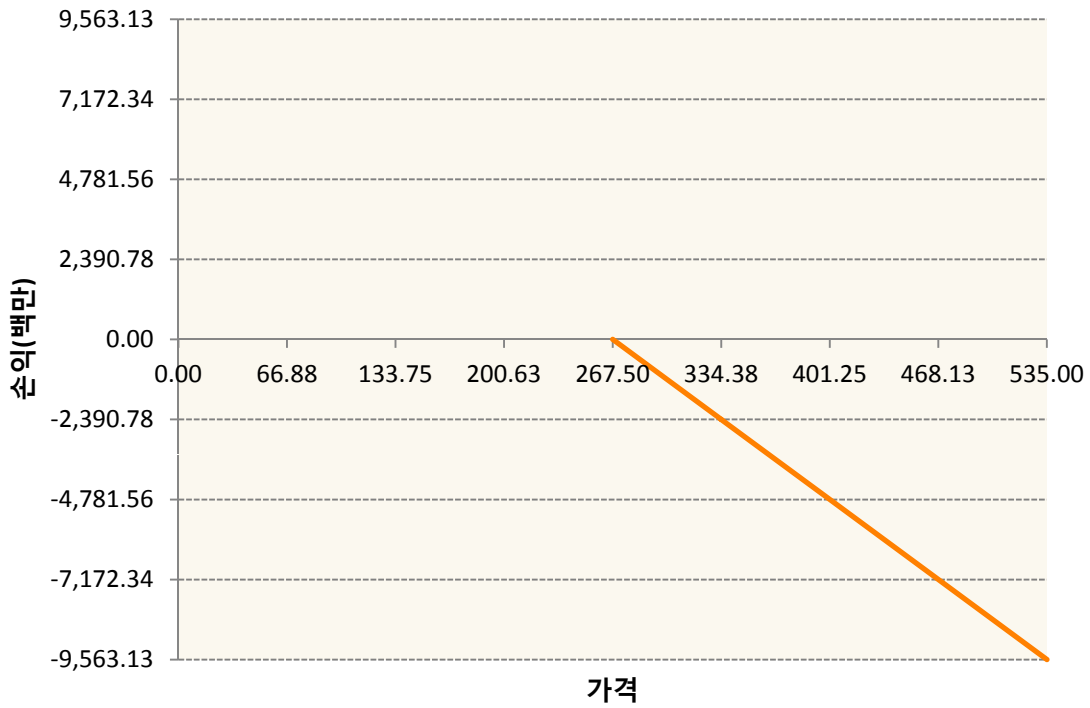


KR4201Q62659-2020-06 콜265

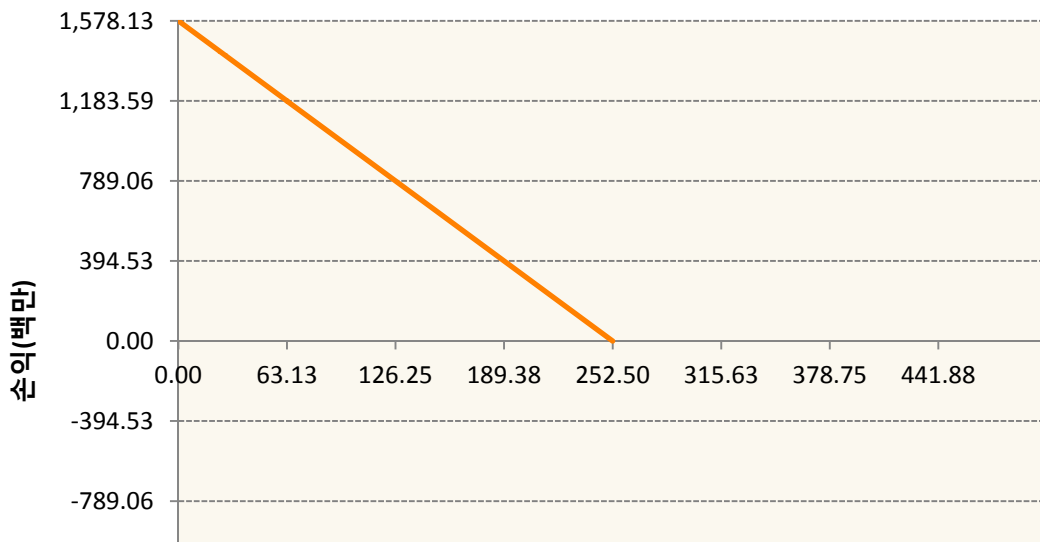


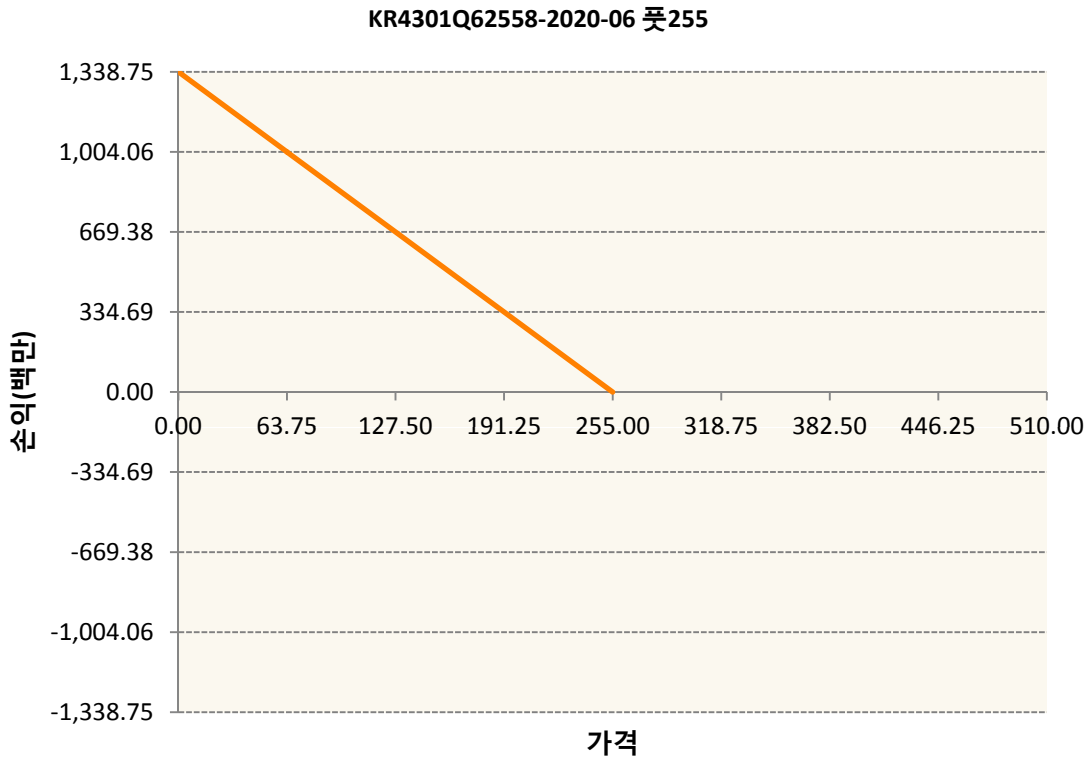
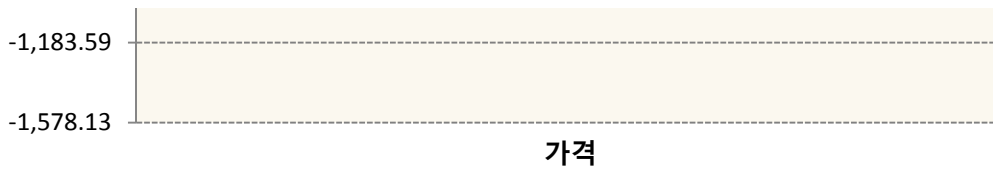


KR4201Q62675-2020-06 콜267.5



KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





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

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						754
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-754	-754	-754	-754	-754	-754	-754	
-5.33%	-503	-503	-503	-503	-503	-503	-503	
-2.67%	-251	-251	-251	-251	-251	-251	-251	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	251	251	251	251	251	251	251	
5.33%	503	503	503	503	503	503	503	
8.00%	754	754	754	754	754	754	754	
KR4201Q62659		2020-06 콜265						532
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	302	288	272	256	238	219	200	
-5.33%	258	238	217	195	174	151	129	
-2.67%	184	160	135	111	86	62	37	

0%	76	51	25	0	-25	-51	-76
2.67%	-66	-89	-113	-137	-161	-185	-210
5.33%	-237	-256	-276	-296	-318	-340	-362
8.00%	-430	-444	-459	-475	-493	-512	-532
KR4201Q62675                      2020-06 콜267.5							581
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	309	295	279	262	243	223	202
-5.33%	268	247	225	202	178	154	129
-2.67%	196	169	143	115	88	61	33
0%	87	58	29	0	-29	-58	-87
2.67%	-61	-89	-117	-145	-173	-202	-230
5.33%	-244	-267	-292	-317	-343	-369	-396
8.00%	-455	-472	-492	-513	-535	-558	-581
KR4301Q62525                      2020-06 풋252.5							59
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	45	47	49	52	54	57	59
-5.33%	17	20	23	26	28	31	34
-2.67%	2	4	7	9	11	14	16
0%	-4	-3	-2	0	2	3	5
2.67%	-6	-5	-5	-4	-3	-2	-1
5.33%	-6	-6	-6	-6	-5	-5	-4
8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-5
KR4301Q62558                      2020-06 풋255							57
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	46	48	49	51	53	55	57
-5.33%	20	22	24	26	29	31	33
-2.67%	3	5	7	10	12	14	16
0%	-4	-3	-2	0	2	3	5
2.67%	-7	-6	-5	-5	-4	-3	-1
5.33%	-7	-7	-7	-7	-6	-5	-5
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-6

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

(단위:백만원)

**2,178**

공시일	2020-05-27
기준일	2020-05-26

## 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	153,393	0	153,393	

### 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	2020-05-27
기준일	2020-05-26

## 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	103,421	0	103,421	

### 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	2020-05-27
기준일	2020-05-26

## 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	456,912	0	456,912	
누계	통화	선도	0	437,683	-437,683	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,456
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	7,011
FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E	2,962
FX21020J02€ KRW/USD 10-06-20E	1,343
FX21020J027 KRW/USD 22-06-20E	1,521
FX21020J028 KRW/USD 22-06-20E	1,975
FX21020J039 KRW/USD 24-07-20E	2,222
FX21020J043 KRW/USD 24-07-20E	1,777
FX21020J043 KRW/USD 24-07-20E	1,975
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	2,054
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	1,955
FX21020K01 KRW/USD 22-06-20E	691
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	2,409
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	987
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,037
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,639

IE00BD8RGM75

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

17,790



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

(단위:백만원)

207

공시일	2020-05-27
기준일	2020-05-26

## 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	7,531	0	7,531	
누계	통화	선도	0	7,356	-7,356	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J04(KRW/USD 29-05-20E	255
FX21020K01 KRW/USD 15-06-20E	323
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	2020-05-27
기준일	2020-05-26

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

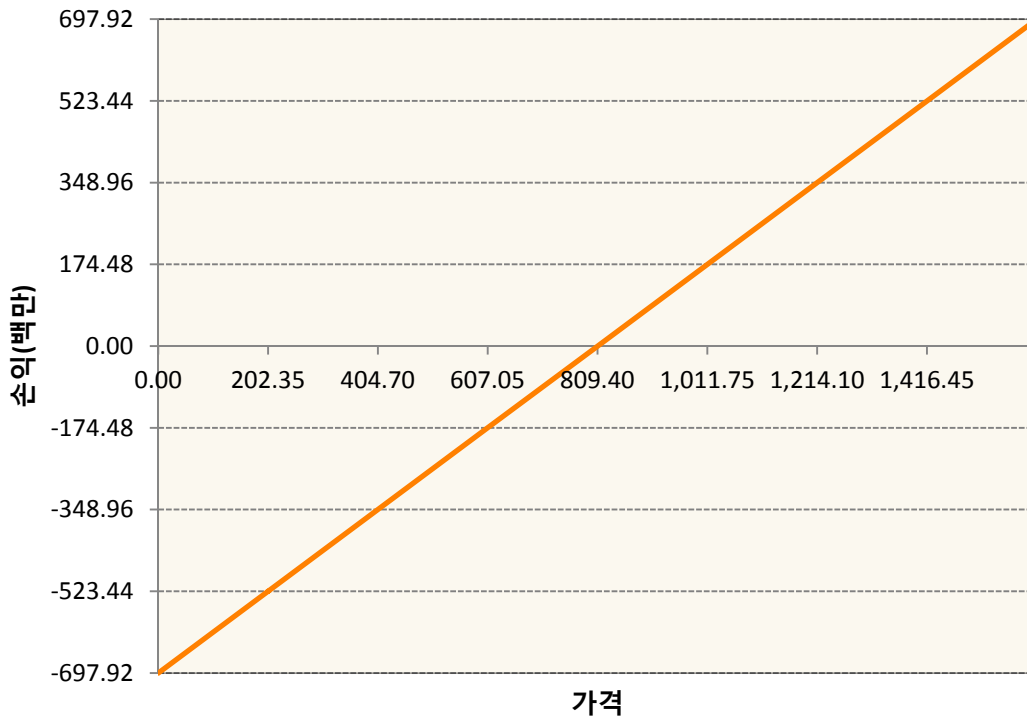
### 1. 계약금액

(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	698	0	698	
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	56

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

(단위:백만원)

**171**

공시일	2020-05-27
기준일	2020-05-26

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

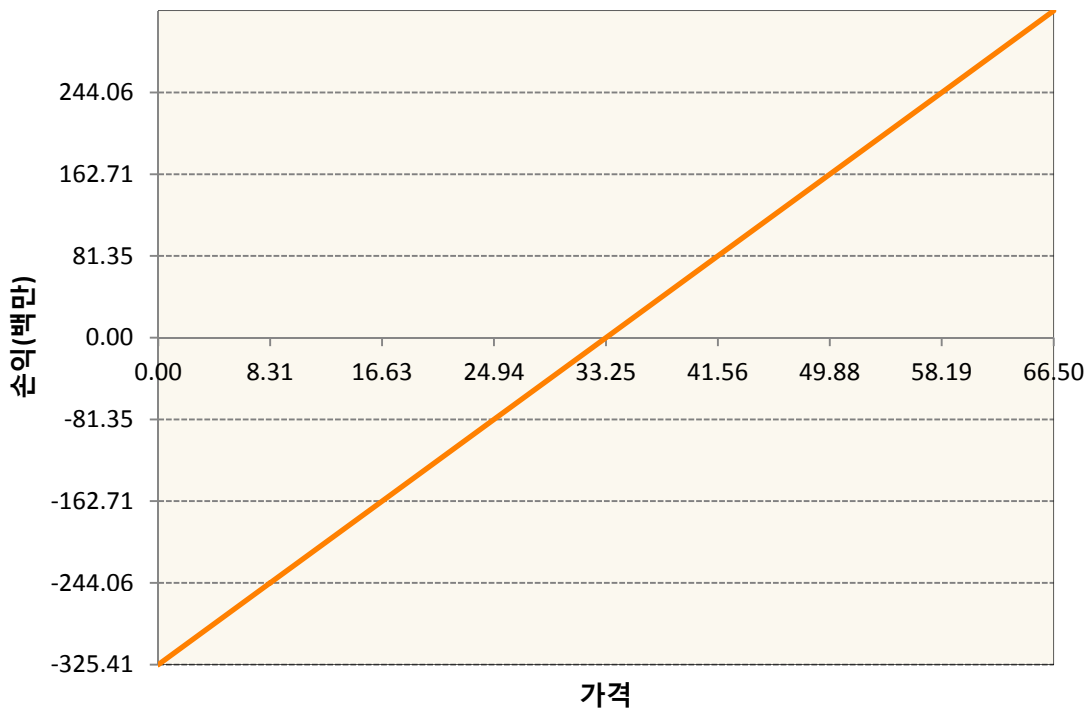
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

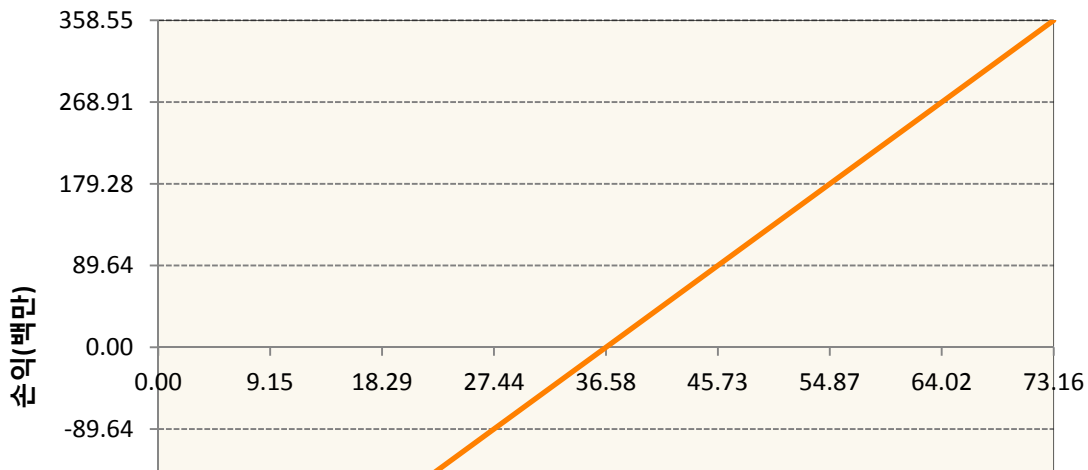
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,713	308	1,405	

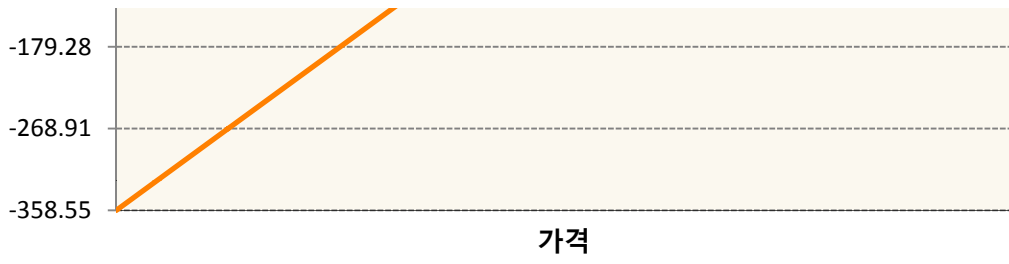
### 2. 만기시점의 손익구조

CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20

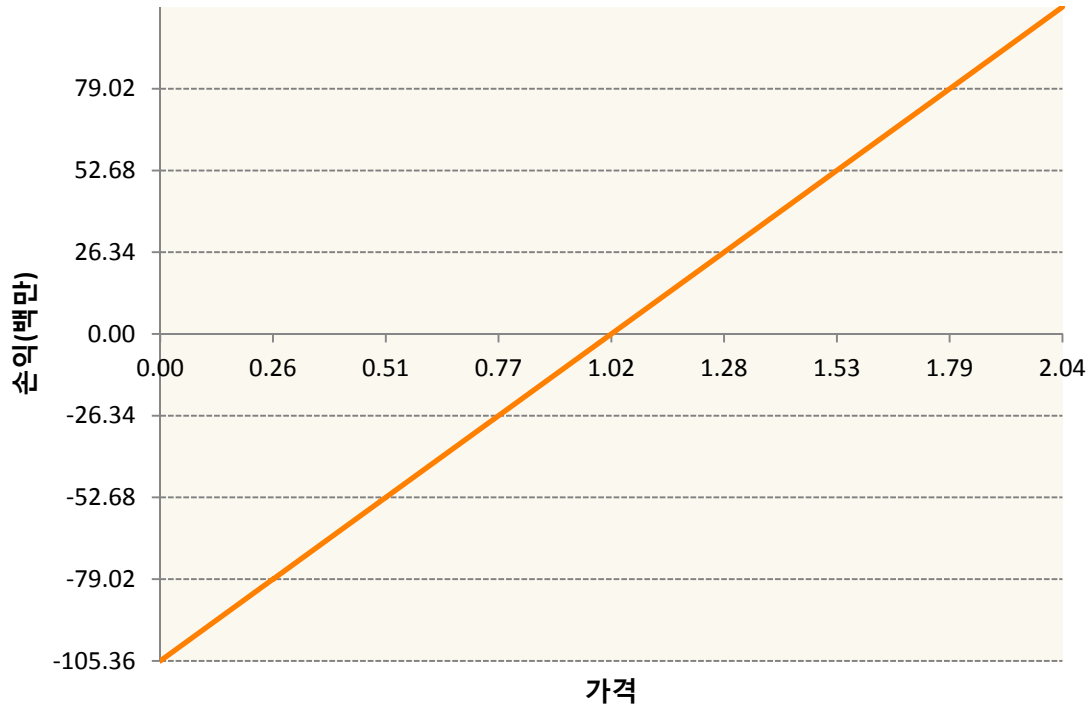


COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20

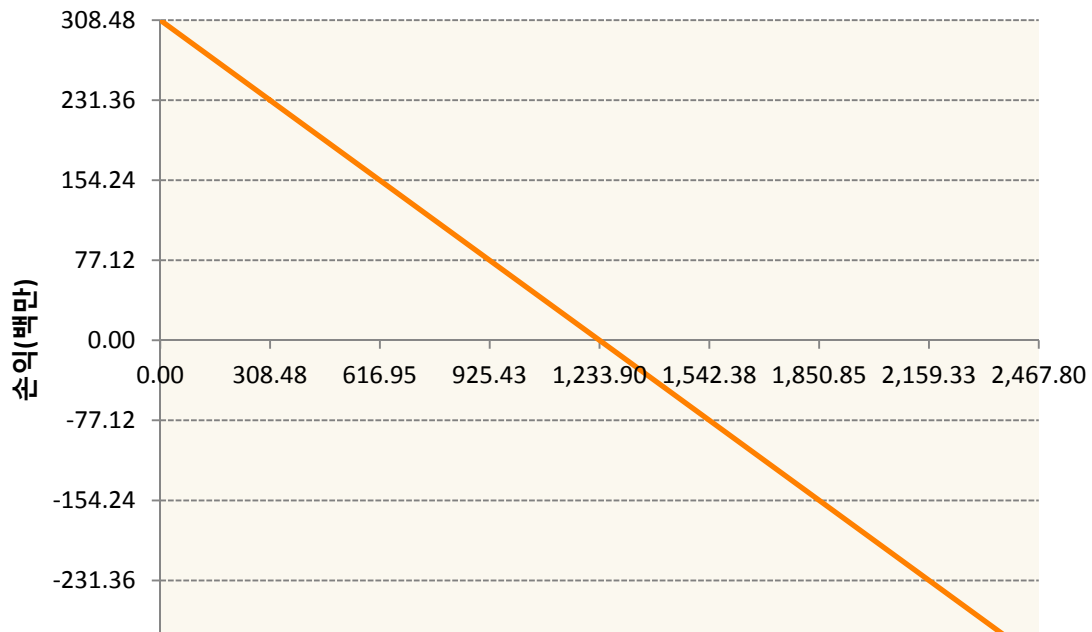


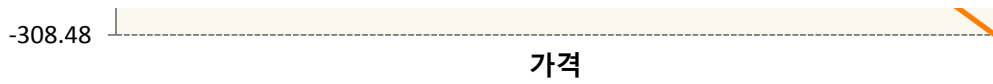


HON0-NY Harb ULSD Fut Jul20

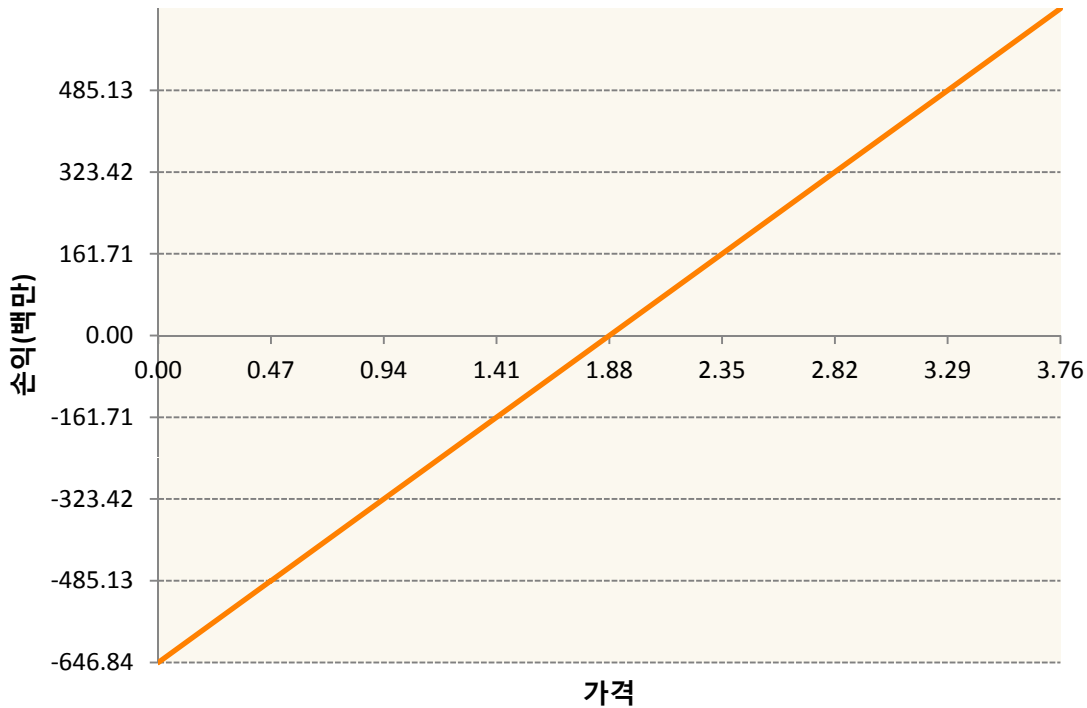


KR4175Q60006-2020-06 달러선물

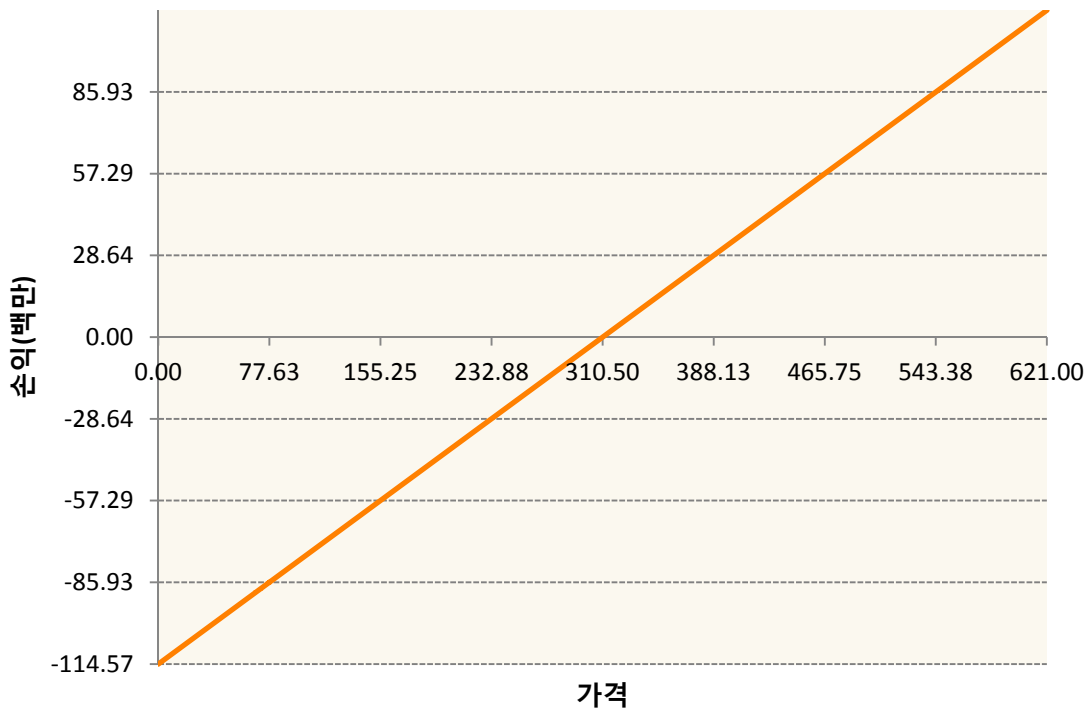




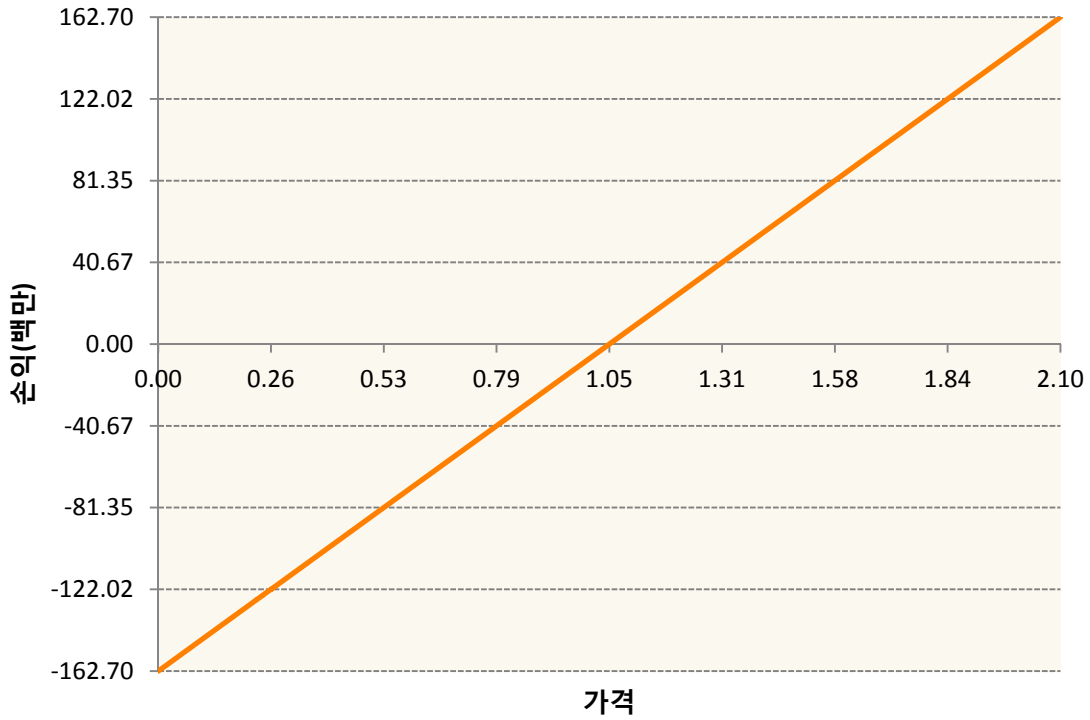
NGN20-NATURAL GAS FUTR Jul20



QSN0-Low Su Gasoil G Jul20



XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN0	WTI CRUDE FUTURE Jul20	26
COU0	BRENT CRUDE FUTR Sep20	29
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)

808

공시일	2020-05-27
기준일	2020-05-26

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

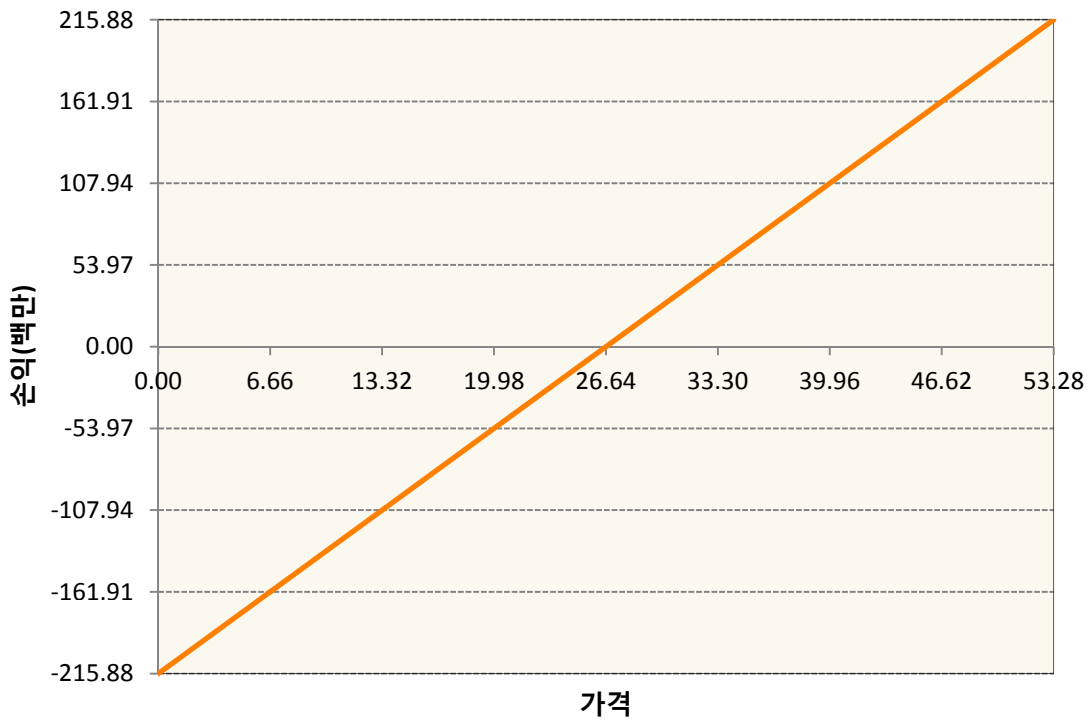
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

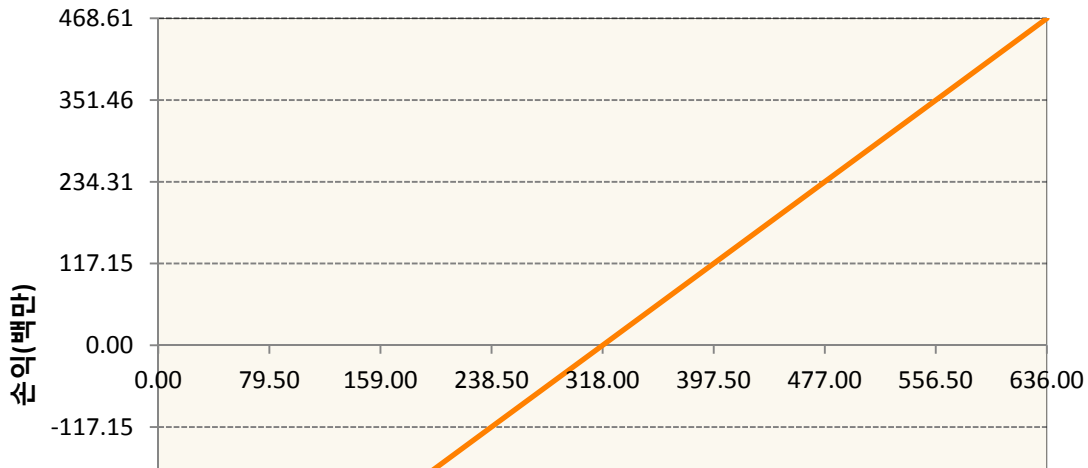
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,411	74	2,337	

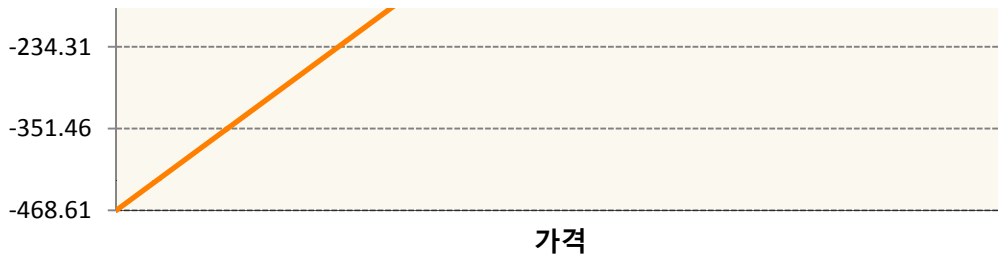
### 2. 만기시점의 손익구조

**BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20**

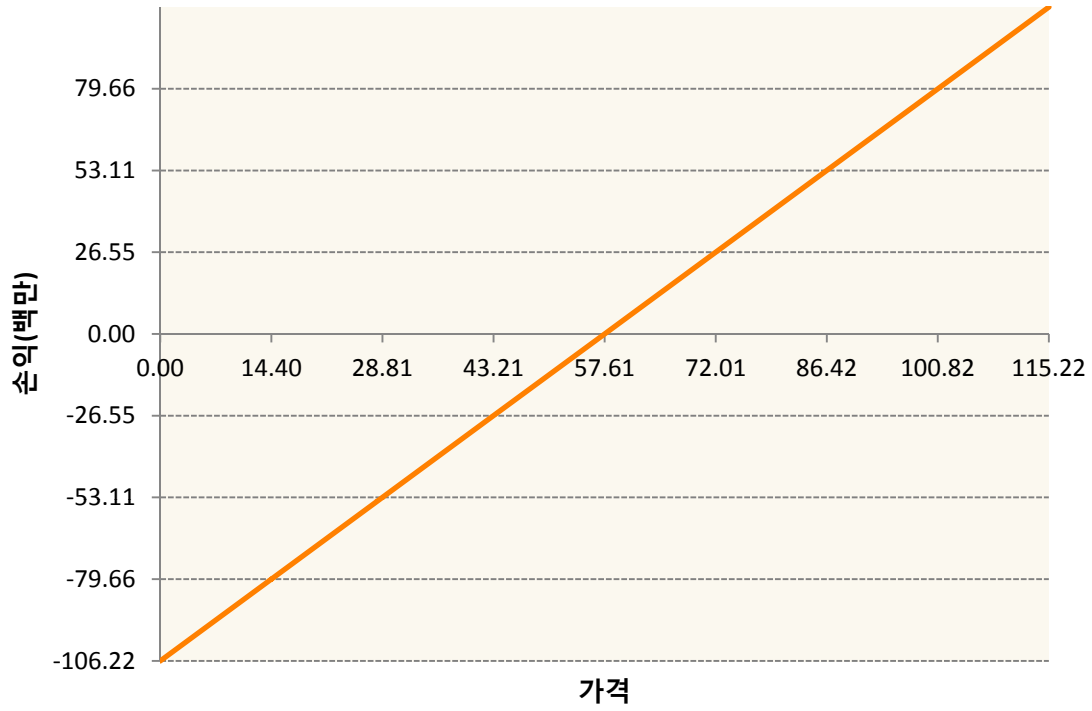


**CNO-CORN FUTURE Jul20**

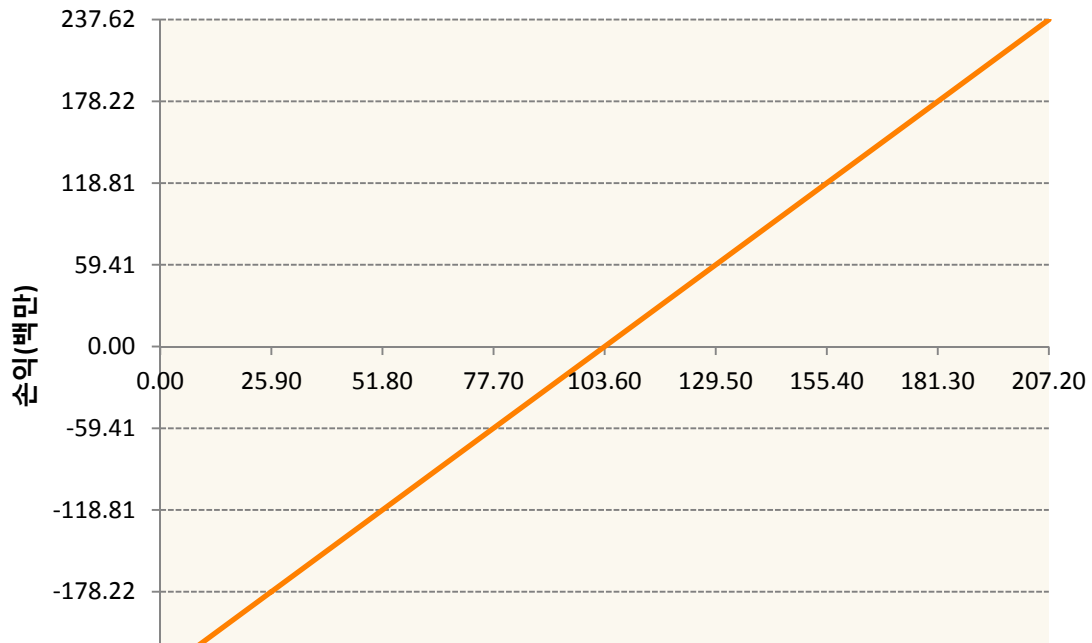


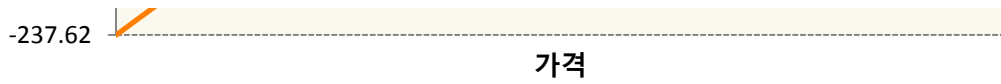


CTN0-COTTON NO.2 FUTR Jul20

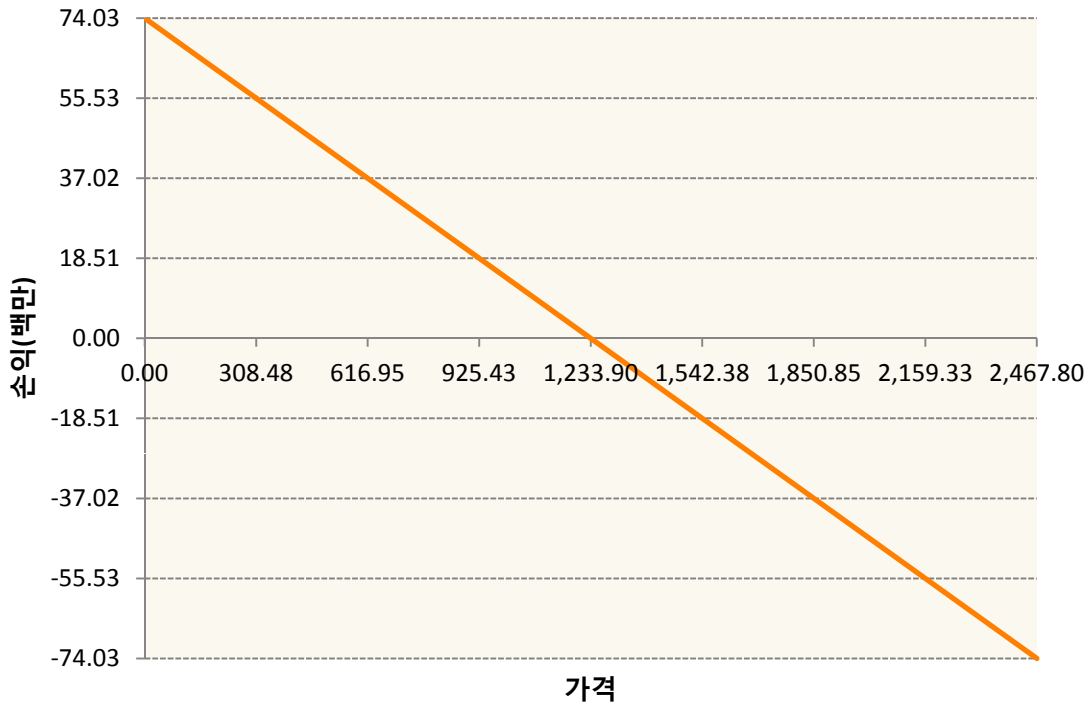


KCN0-COFFEE 'C' FUTURE Jul20

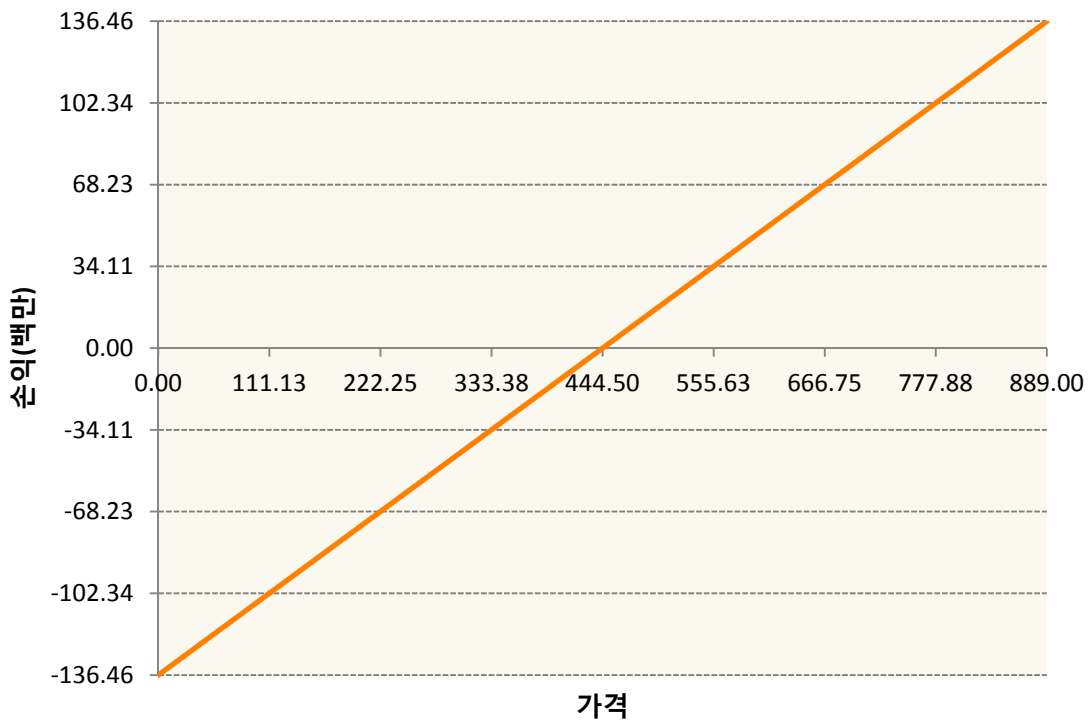




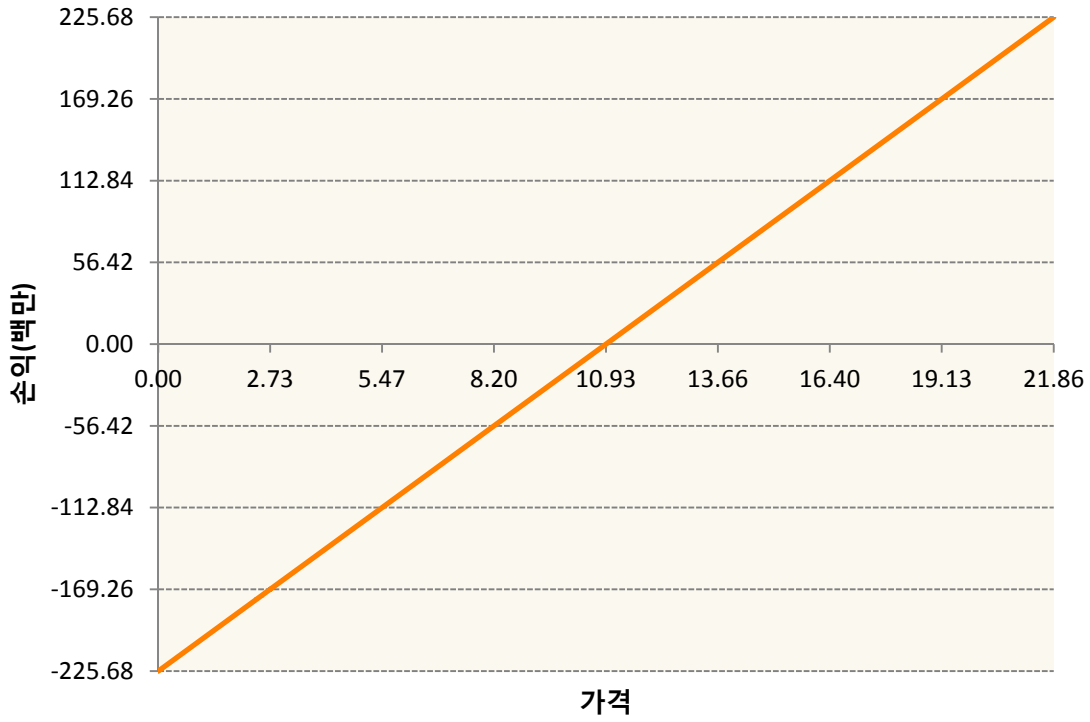
KR4175Q60006-2020-06 달러선물



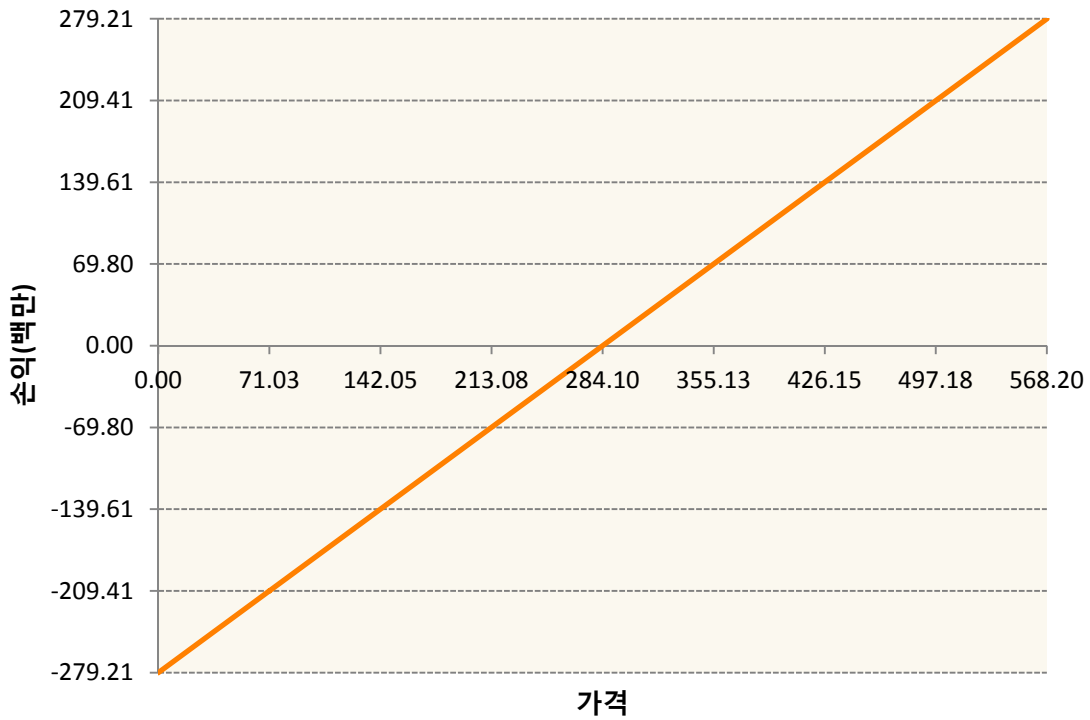
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



SBN0-Sugar Jul20

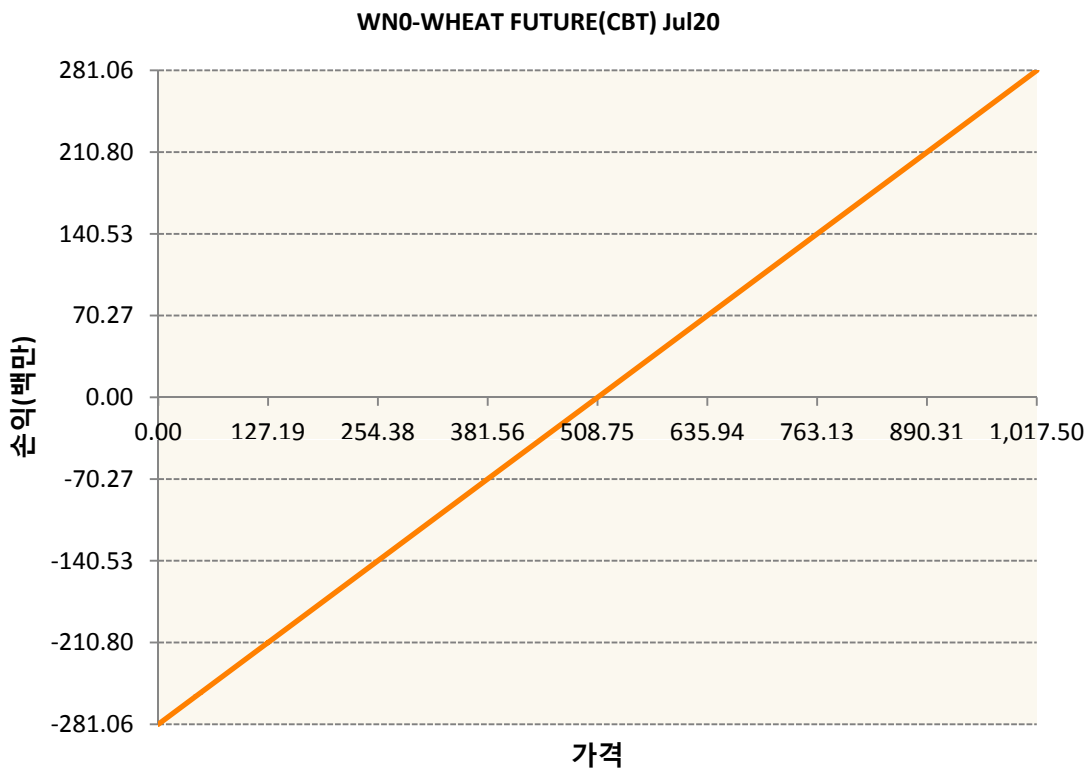
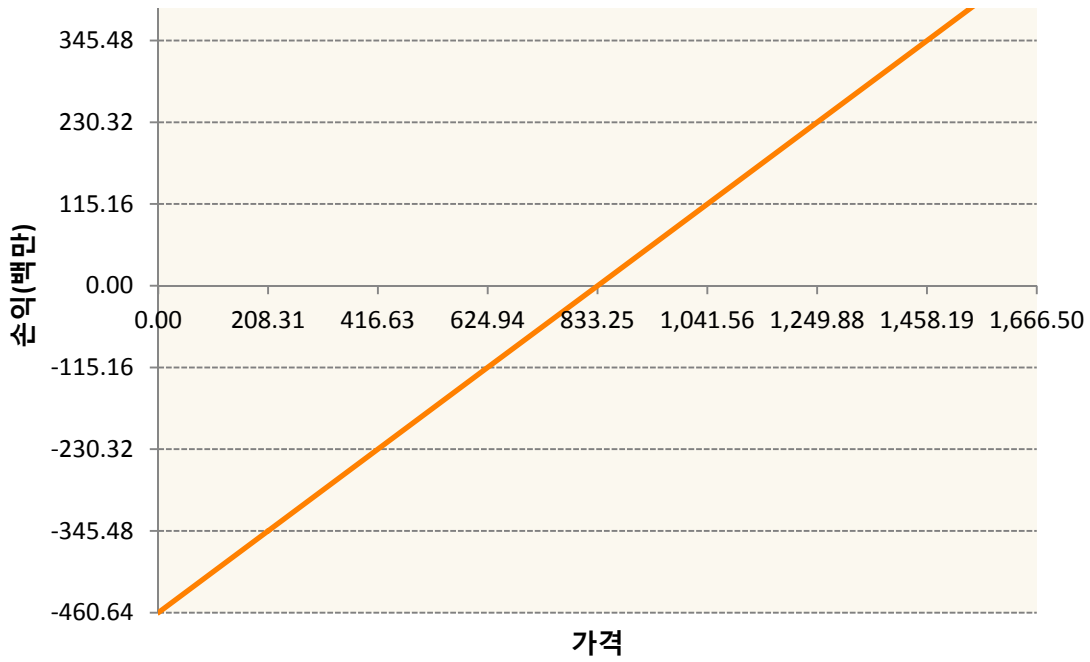


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20



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	8
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**