

공시일	2020-05-28
기준일	2020-05-27

## 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)

48

공시일	2020-05-28
기준일	2020-05-27

## 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

1,021

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,194

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-28
기준일	2020-05-27

## 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

555

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

820

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-28
기준일	2020-05-27

## 유로인덱스모(주식-파생형)

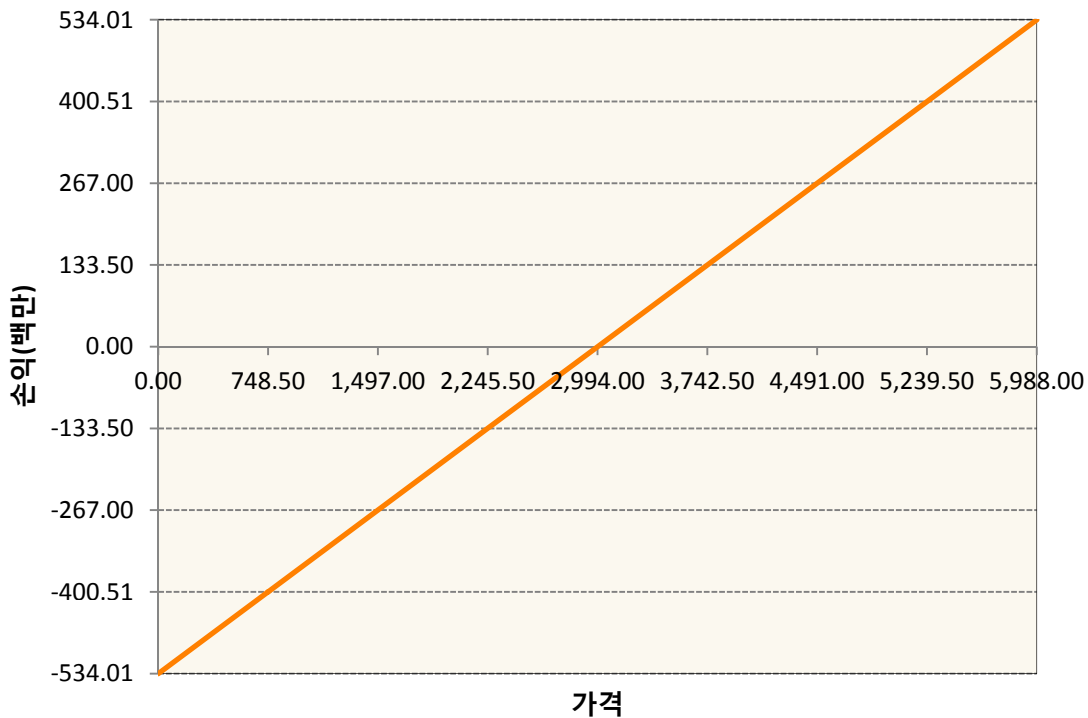
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	534	0	534	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	43
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

55
----

공시일	2020-05-28
기준일	2020-05-27

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

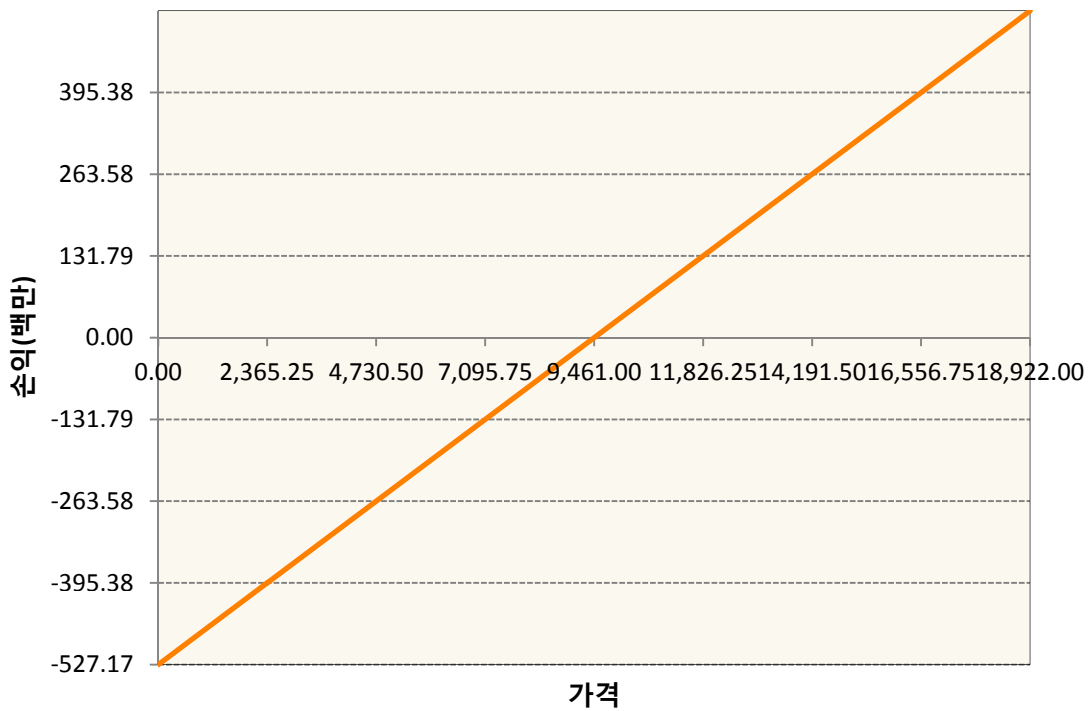
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	527	0	527	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	2020-05-28
기준일	2020-05-27

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

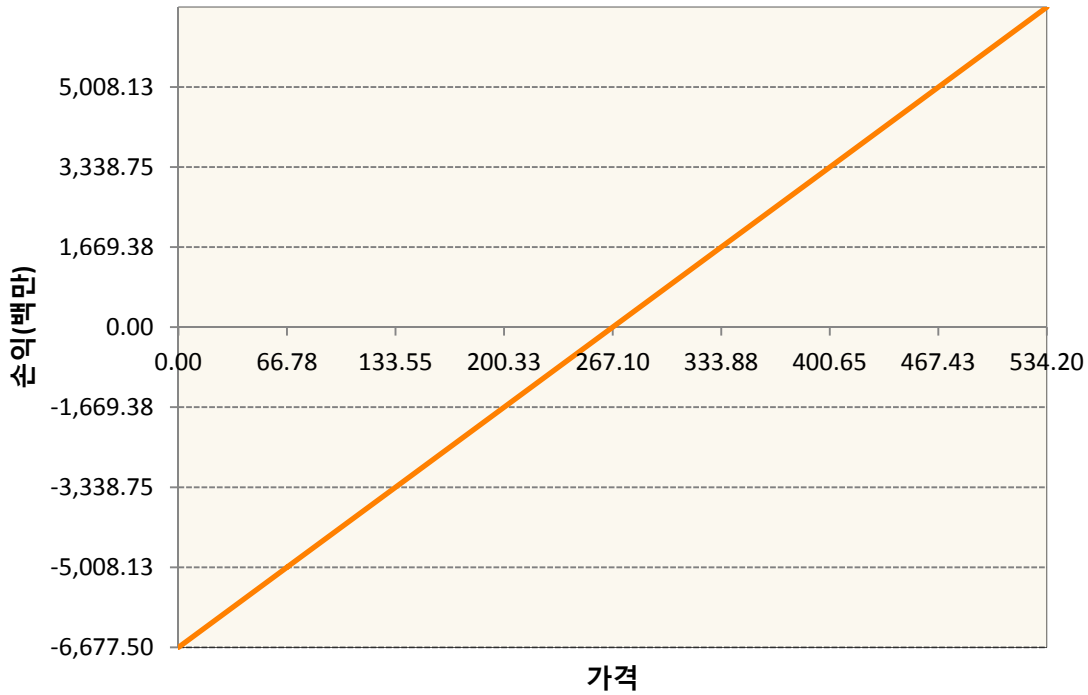
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

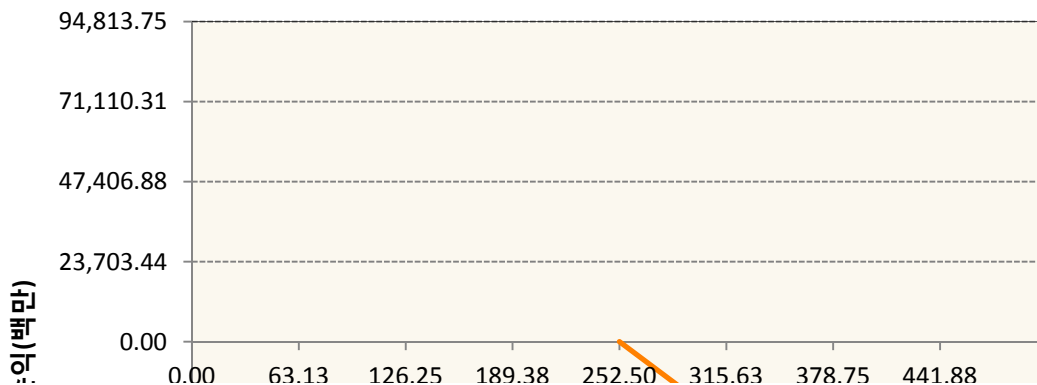
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,678	0	6,678	장내
누계	유가증권	옵션	0	364,213	-364,213	장내

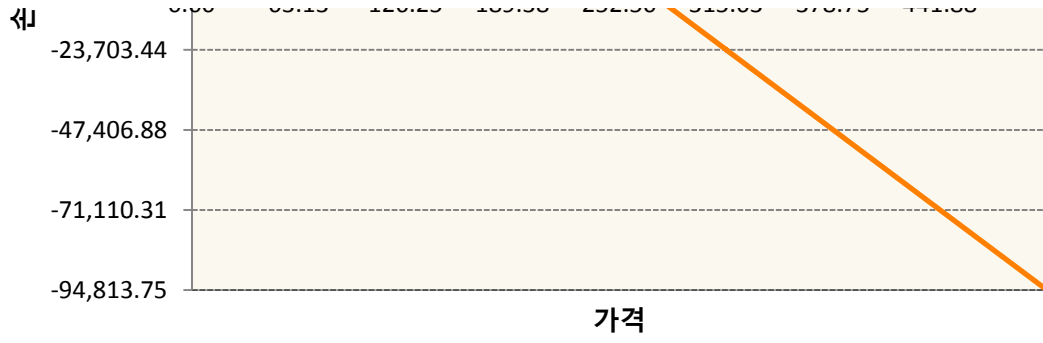
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

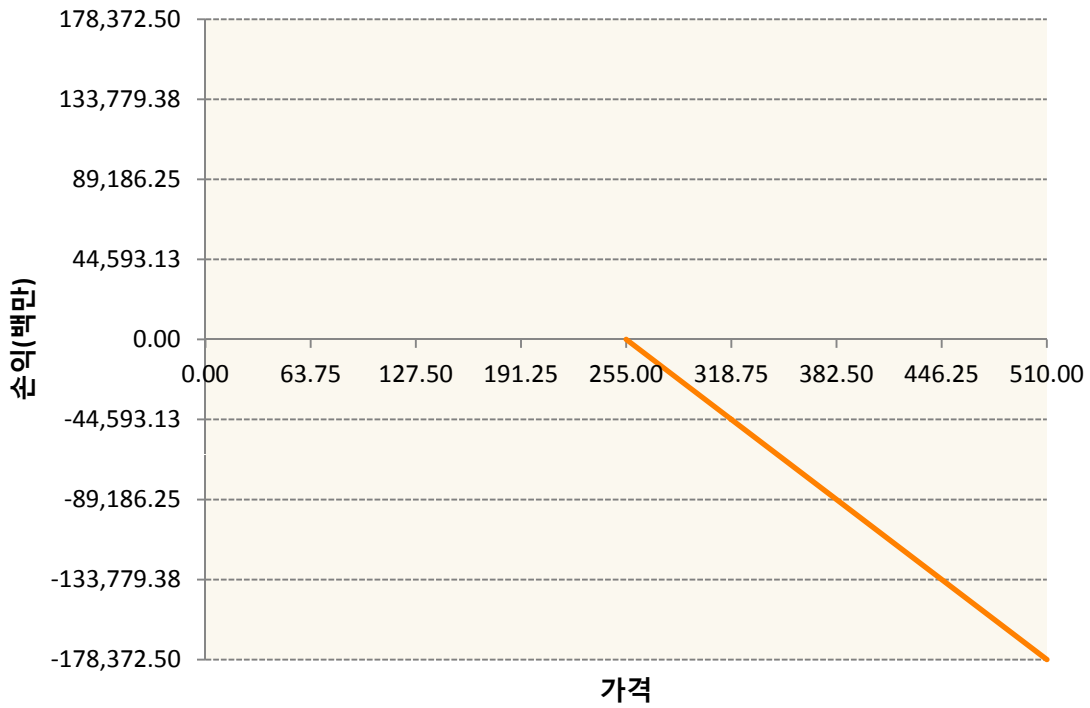


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

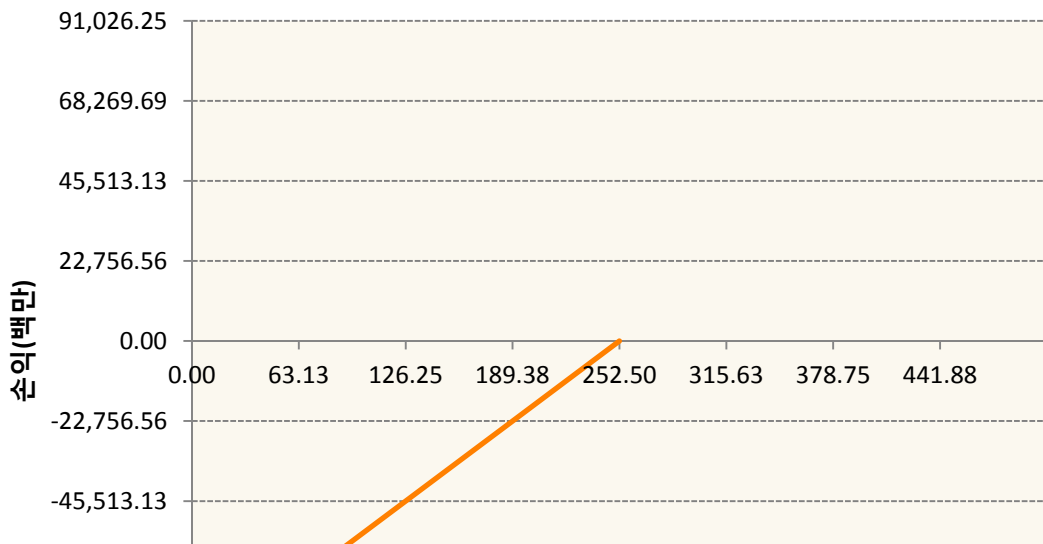


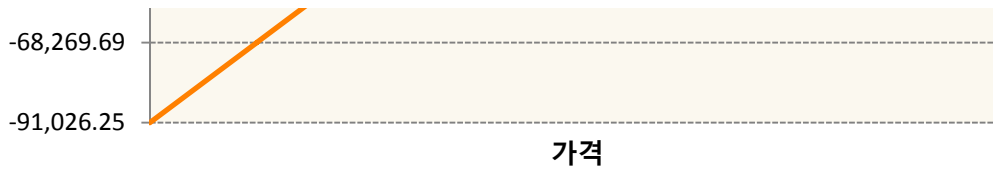


KR4201Q62550-2020-06 콜255



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%	-357	-357	-357	-357	-357	-357	-357	
-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%	357	357	357	357	357	357	357	
8.00%	535	535	535	535	535	535	535	
KR4201Q62527		2020-06 콜252.5						7,309
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5,494	5,241	4,985	4,726	4,465	4,203	3,939	
-5.33%	4,306	4,031	3,756	3,480	3,205	2,930	2,654	
-2.67%	2,667	2,414	2,156	1,894	1,630	1,364	1,096	
0%	637	437	224	0	-232	-470	-714	
2.67%	-1,680	-1,818	-1,975	-2,148	-2,336	-2,535	-2,744	
5.33%	-4,178	-4,261	-4,365	-4,489	-4,630	-4,786	-4,955	
8.00%	-6,776	-6,820	-6,883	-6,964	-7,063	-7,178	-7,309	
KR4201Q62550		2020-06 콜255						13,336
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	9,529	9,084	8,629	8,164	7,694	7,218	6,738	
-5.33%	7,606	7,093	6,579	6,065	5,551	5,037	4,523	
-2.67%	4,842	4,342	3,838	3,331	2,821	2,310	1,797	
0%	1,305	887	451	0	-462	-933	-1,411	
2.67%	-2,837	-3,140	-3,476	-3,839	-4,225	-4,629	-5,049	
5.33%	-7,383	-7,576	-7,808	-8,076	-8,374	-8,700	-9,048	
8.00%	-12,164	-12,273	-12,418	-12,600	-12,816	-13,062	-13,336	
KR4301Q62525		2020-06 풋252.5						3,337
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,524	-2,651	-2,782	-2,917	-3,055	-3,195	-3,337	
-5.33%	-965	-1,122	-1,278	-1,435	-1,591	-1,748	-1,905	
-2.67%	-117	-237	-364	-496	-631	-770	-911	

0%	214	154	82	0	-91	-190	-296
2.67%	305	285	255	216	168	110	43
5.33%	323	318	309	294	273	245	209
8.00%	325	324	322	318	310	299	282

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

(단위:백만원)

**23,397**

공시일	2020-05-28
기준일	2020-05-27

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

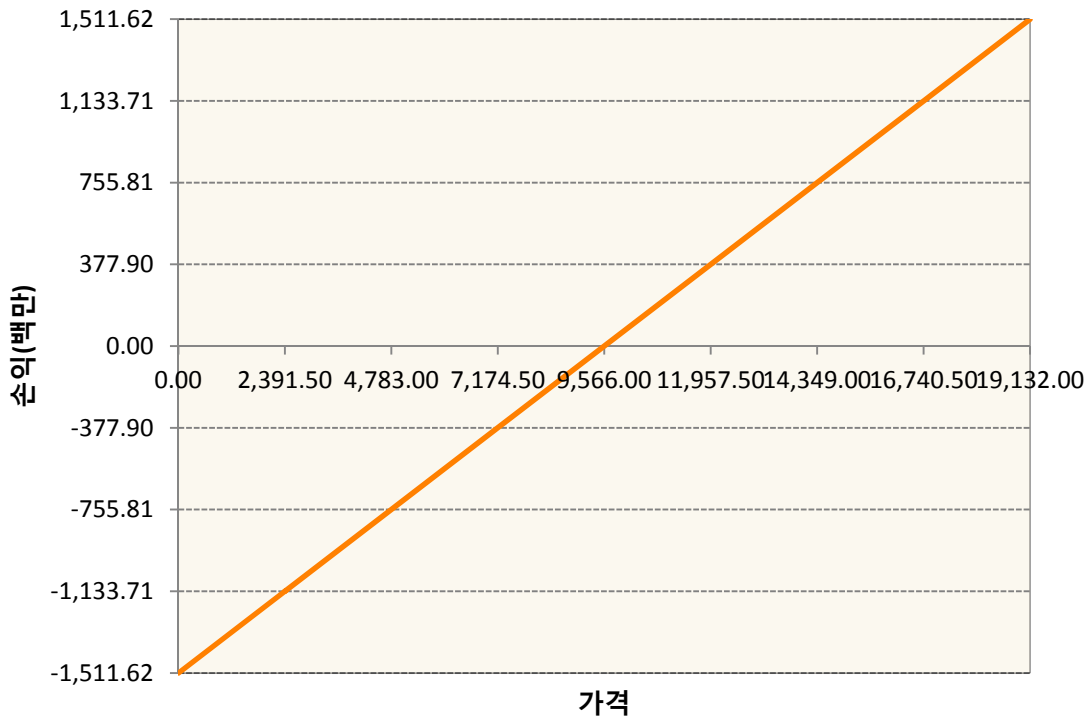
### 1. 계약금액

(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	1,512	0	1,512	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,458	-4,458	장내
누계	통화	선도	0	1,541	-1,541	장외

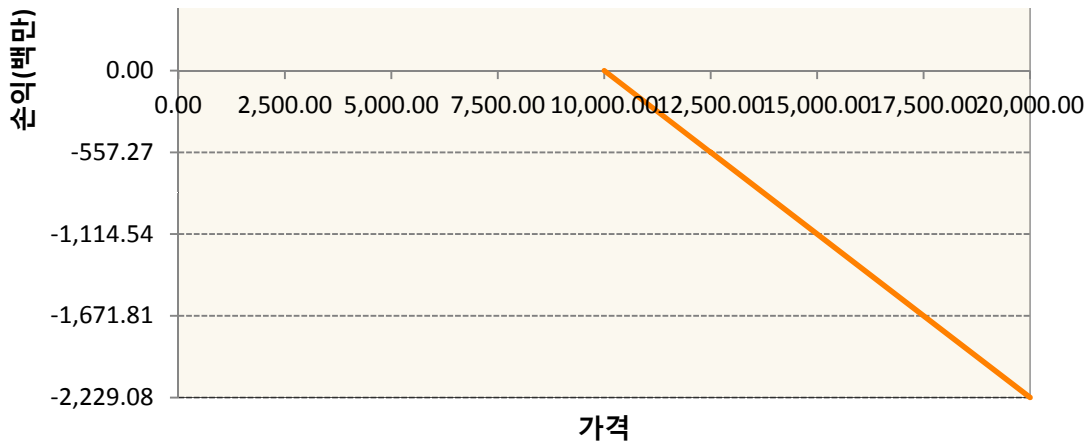
### 2. 만기시점의 손익구조

HCK0-HSCEI Futures May20

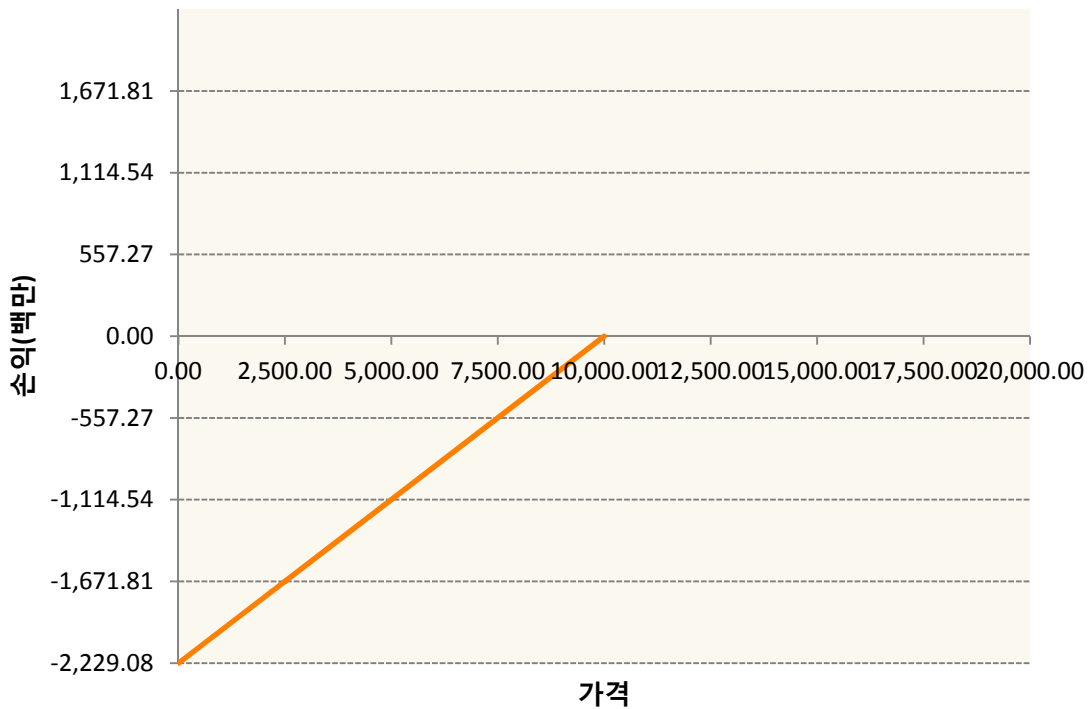


OHHIK0-C100-HSCEI





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)
	581

공시일	2020-05-28
기준일	2020-05-27

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

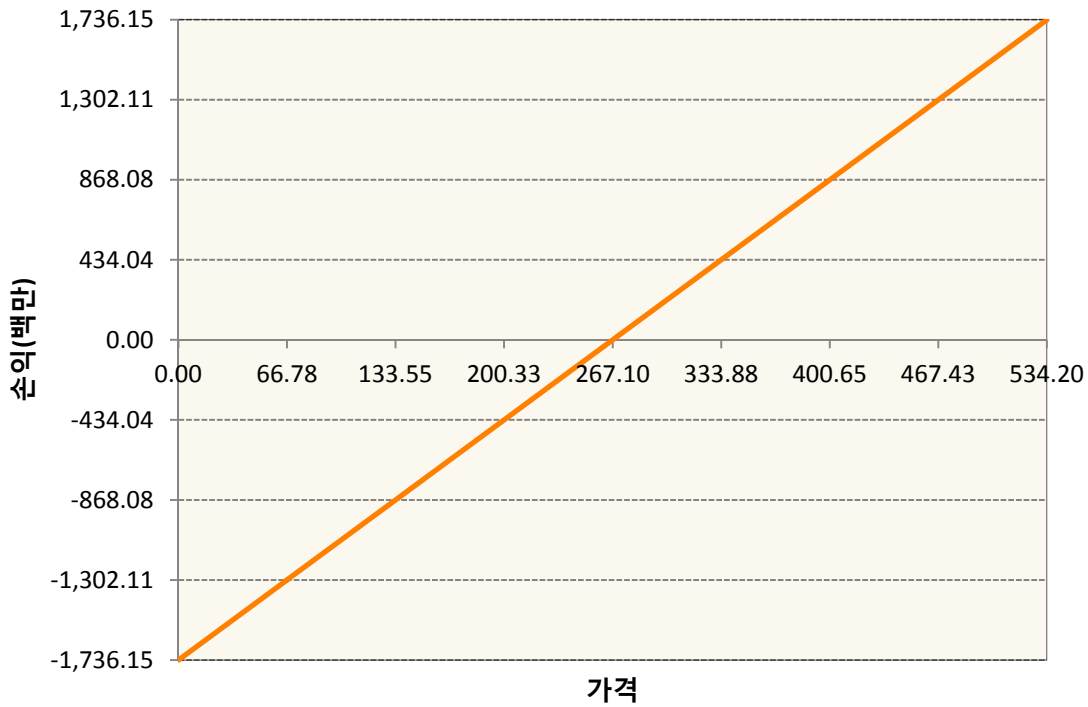
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

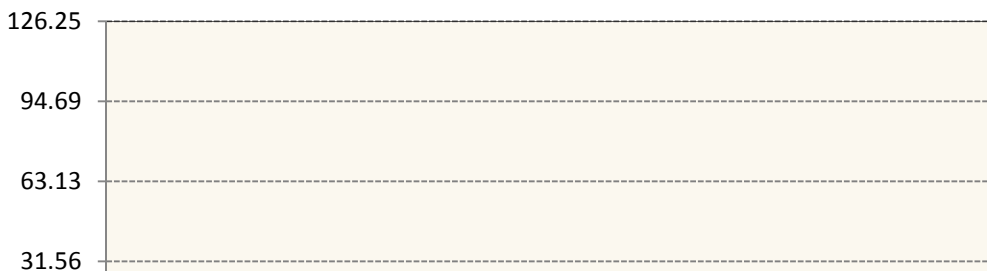
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,736	0	1,736	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,361	-3,361	장내

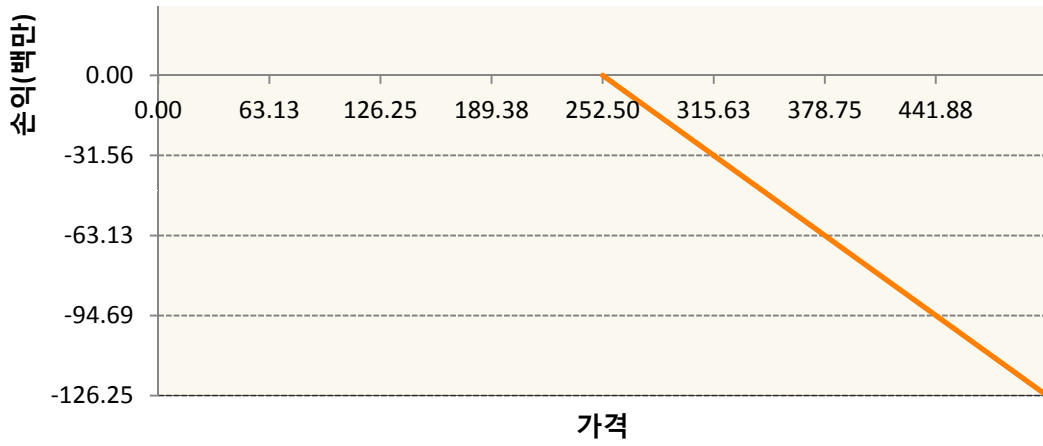
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

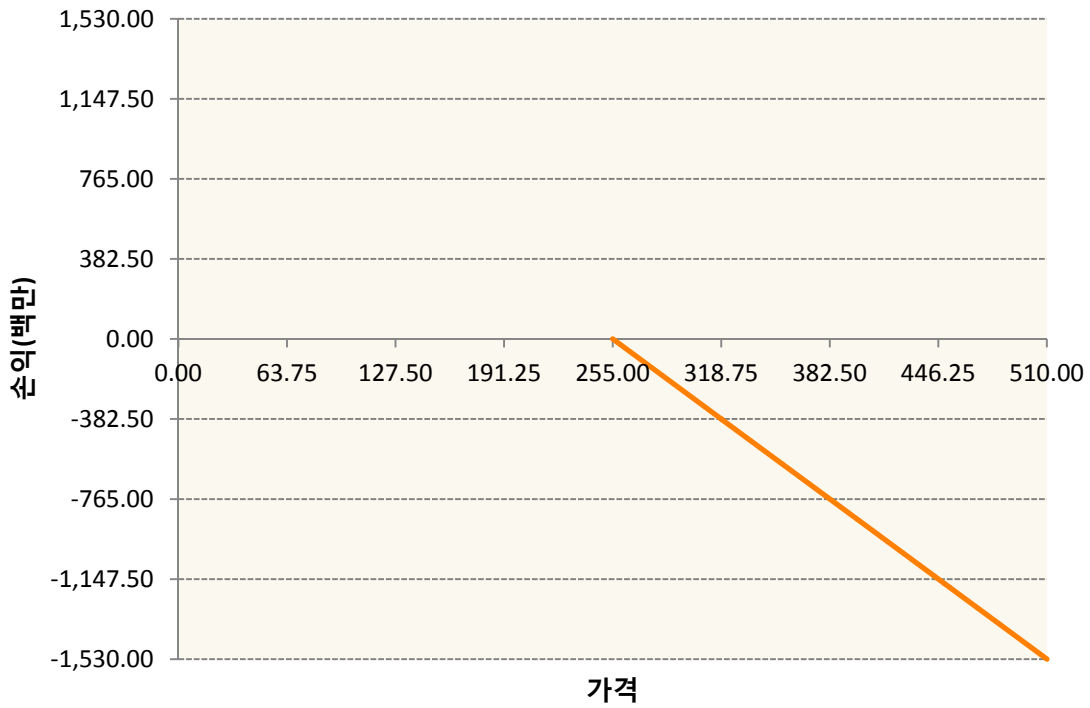


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

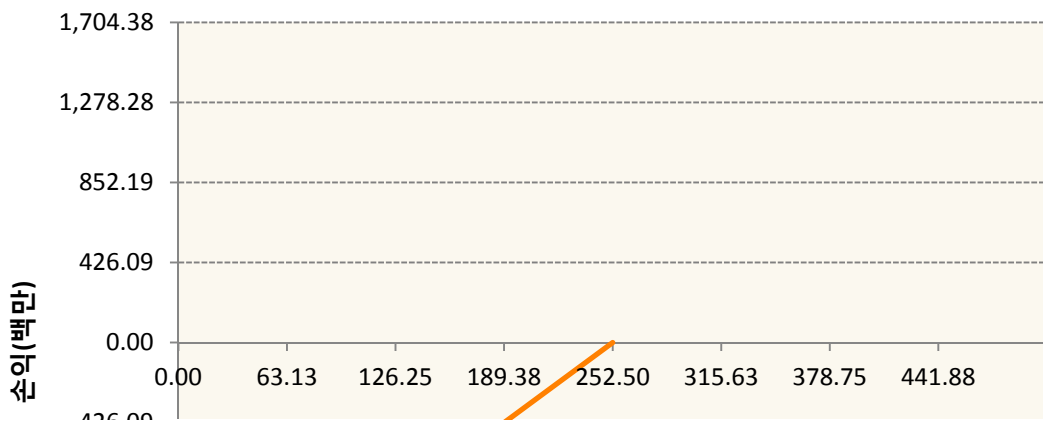




KR4201Q62550-2020-06 콜255



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	6	5	
-5.33%	6	5	5	5	4	4	4	
-2.67%	4	3	3	3	2	2	1	
0%	1	1	0	0	0	-1	-1	
2.67%	-2	-2	-3	-3	-3	-3	-4	
5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-7	
8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-10	-10	
KR4201Q62550		2020-06 콜255						114
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	82	78	74	70	66	62	58
-5.33%	65	61	56	52	48	43	39
-2.67%	42	37	33	29	24	20	15
0%	11	8	4	0	-4	-8	-12
2.67%	-24	-27	-30	-33	-36	-40	-43
5.33%	-63	-65	-67	-69	-72	-75	-78
8.00%	-104	-105	-107	-108	-110	-112	-114
KR4301Q62525                      2020-06 풋252.5							62
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-47	-50	-52	-55	-57	-60	-62
-5.33%	-18	-21	-24	-27	-30	-33	-36
-2.67%	-2	-4	-7	-9	-12	-14	-17
0%	4	3	2	0	-2	-4	-6
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

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

(단위:백만원)

**564**

공시일	2020-05-28
기준일	2020-05-27

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

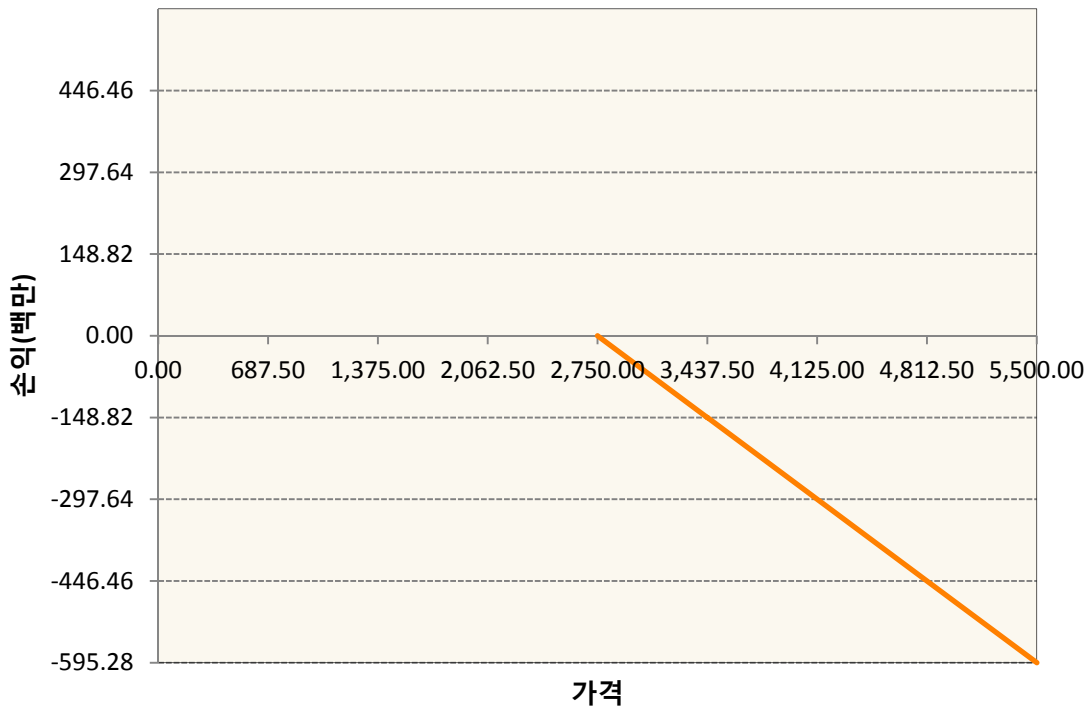
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

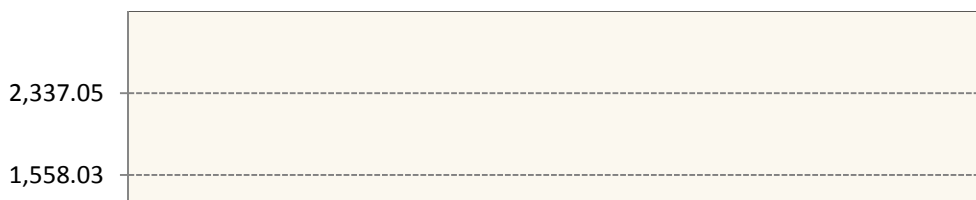
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,604	0	1,604	
누계	유가증권	스왑	8,069	0	8,069	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,423	-7,423	장내
누계	통화	선도	0	2,928	-2,928	장외

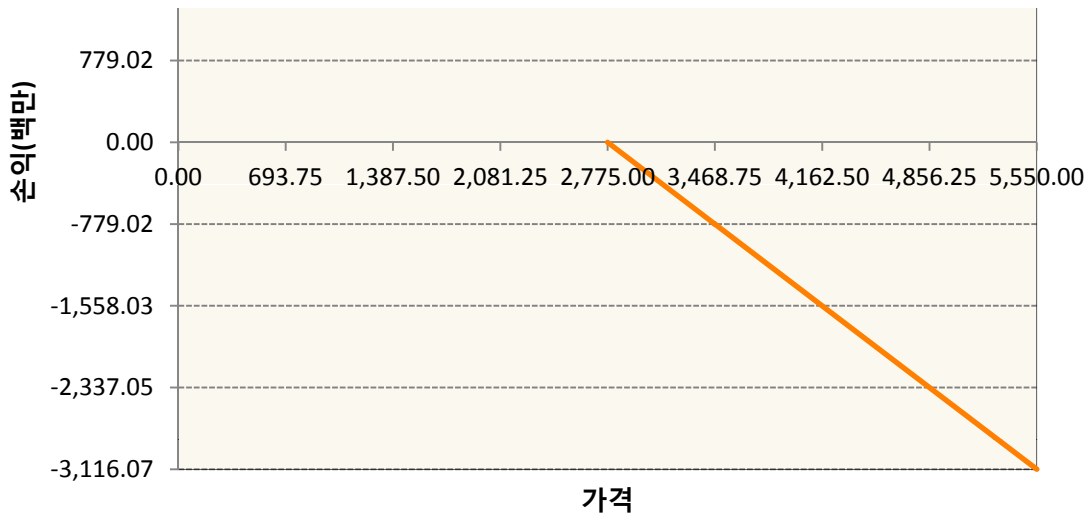
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXM0-C2750-EURO STOXX 50**

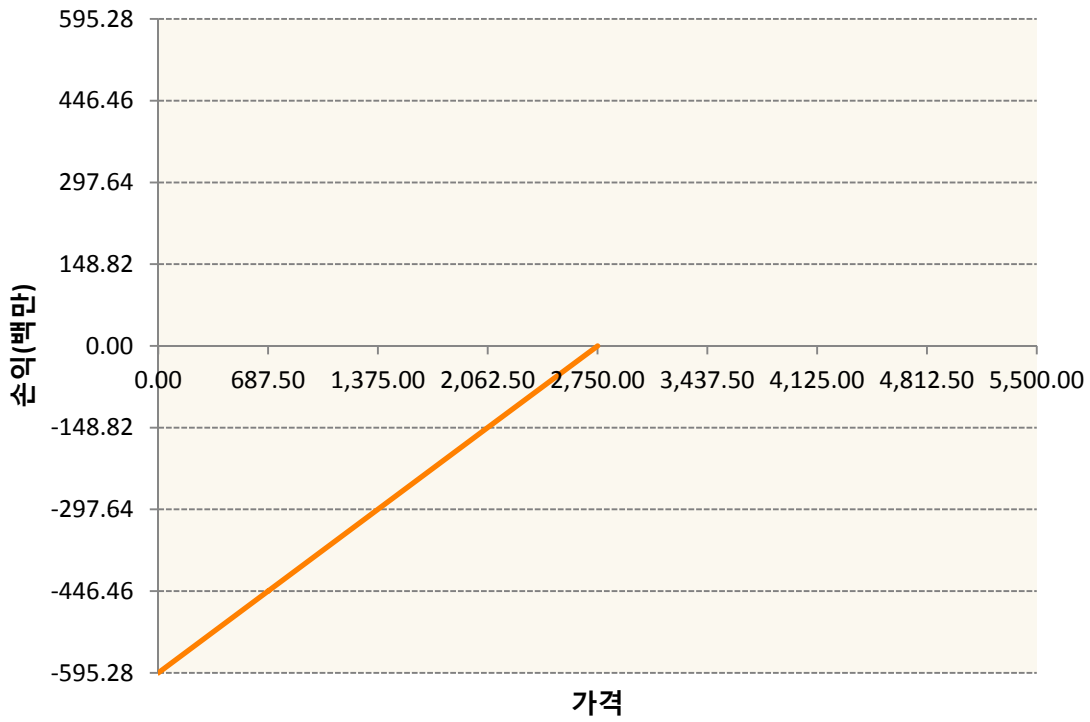


**OESXM0-C2775-EURO STOXX 50**

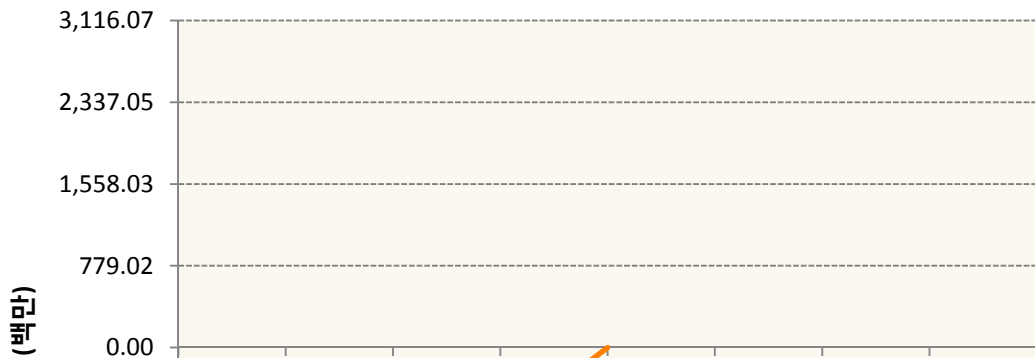


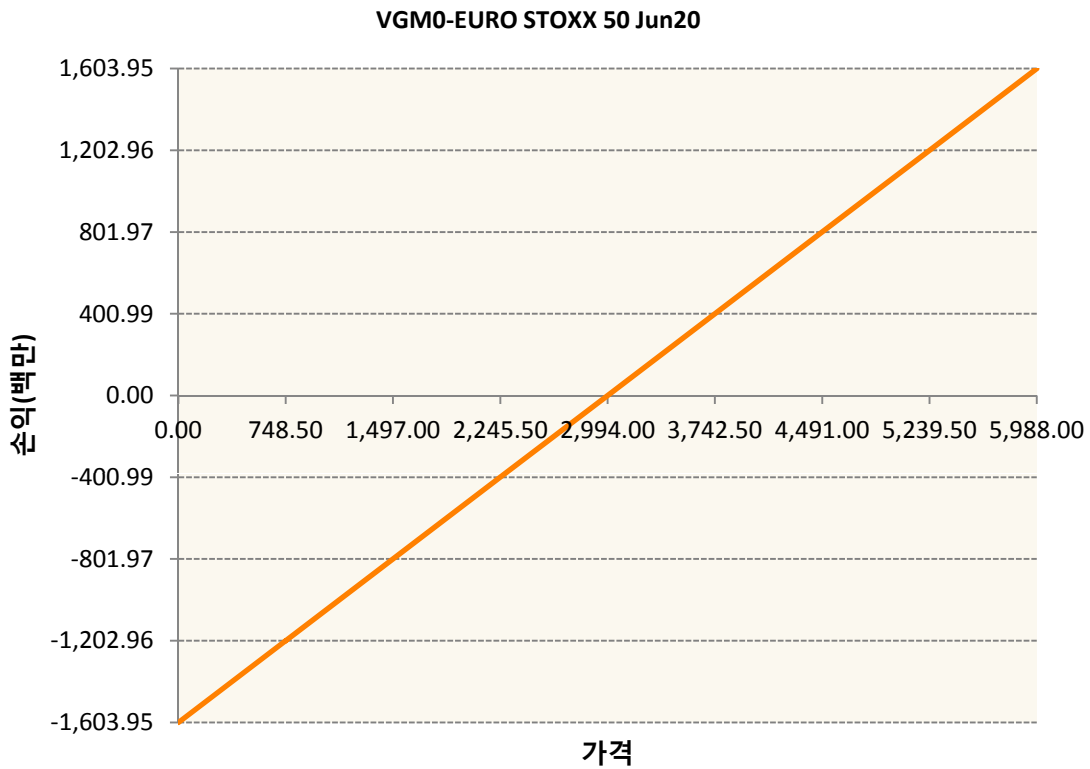
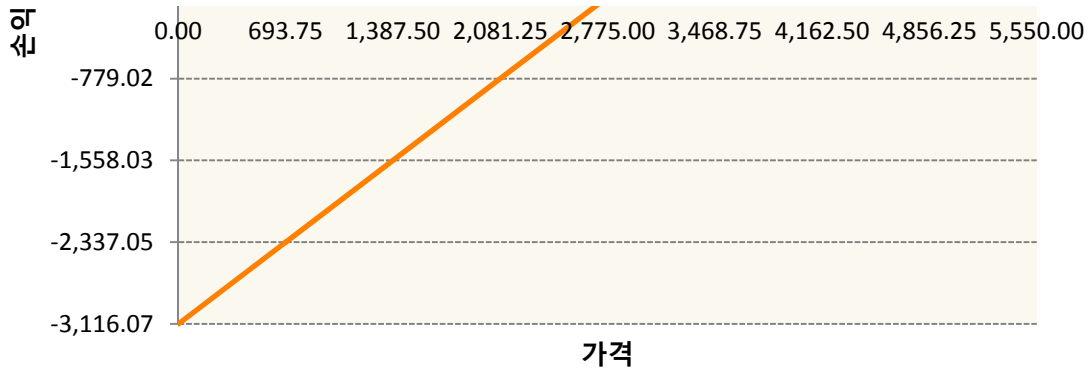


OESXM0-P2750-EURO STOXX 50



OESXM0-P2775-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		19
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		128

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

(단위:백만원)

1,115



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

(단위:백만원)

1,199

공시일	2020-05-28
기준일	2020-05-27

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

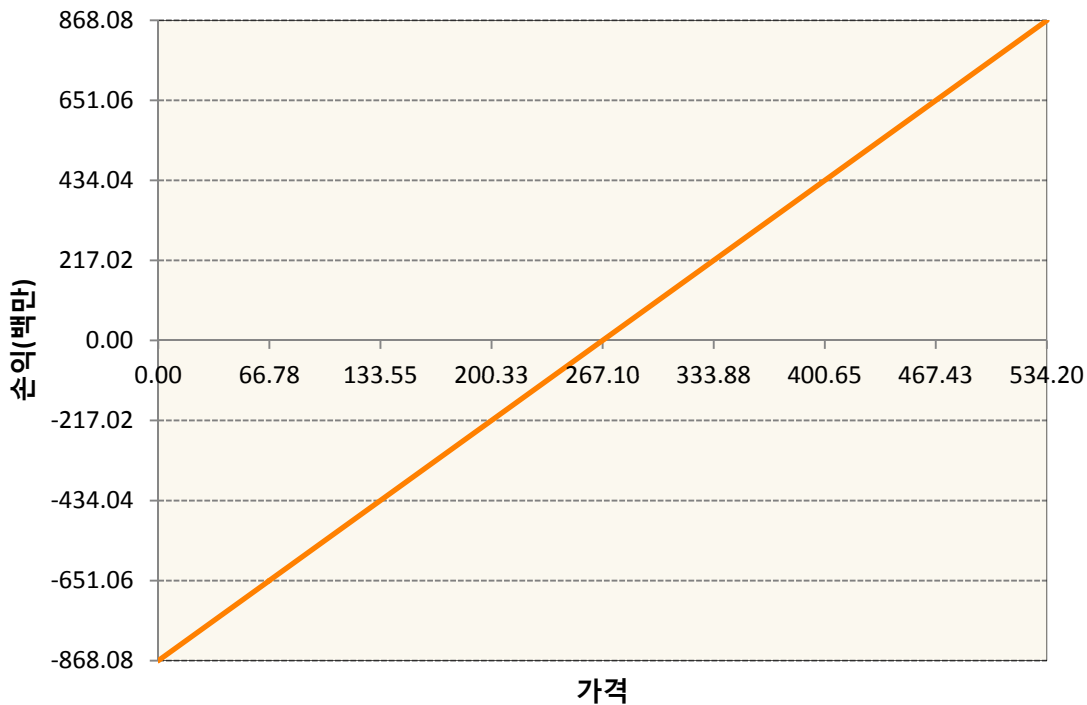
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	868	0	868	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						70
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70	
-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%	70	70	70	70	70	70	70	

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

(단위:백만원)

104



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

(단위:백만원)

152

공시일	2020-05-28
기준일	2020-05-27

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

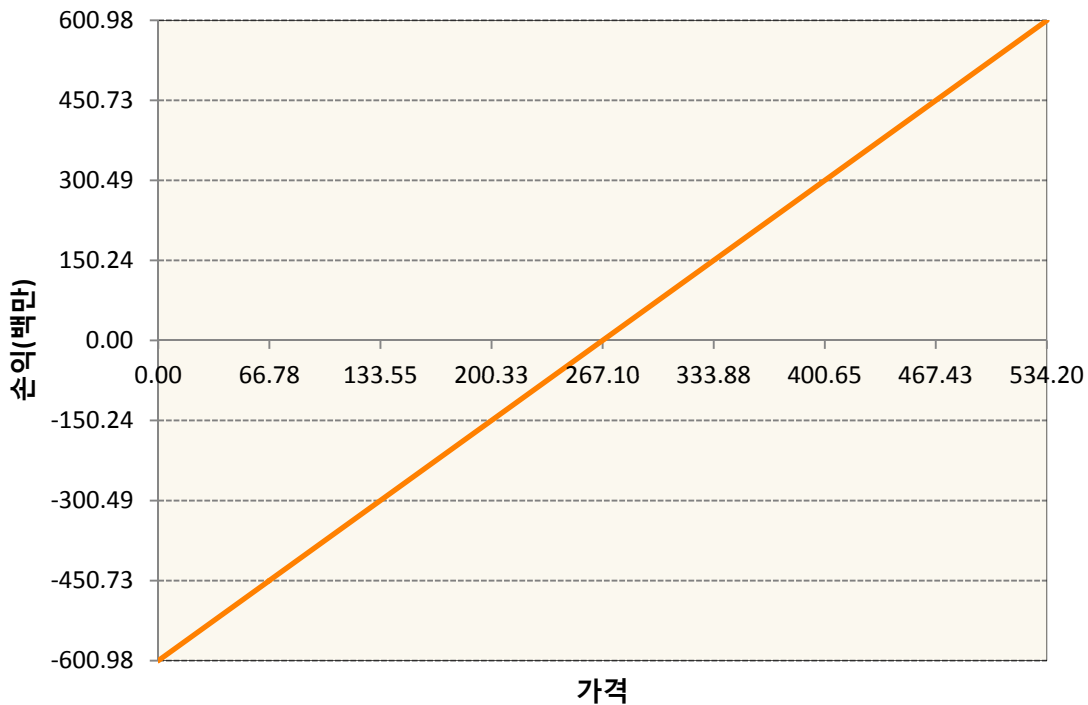
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	601	0	601	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						48
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48	
-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%	48	48	48	48	48	48	48	

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

(단위:백만원)

72

공시일	2020-05-28
기준일	2020-05-27

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

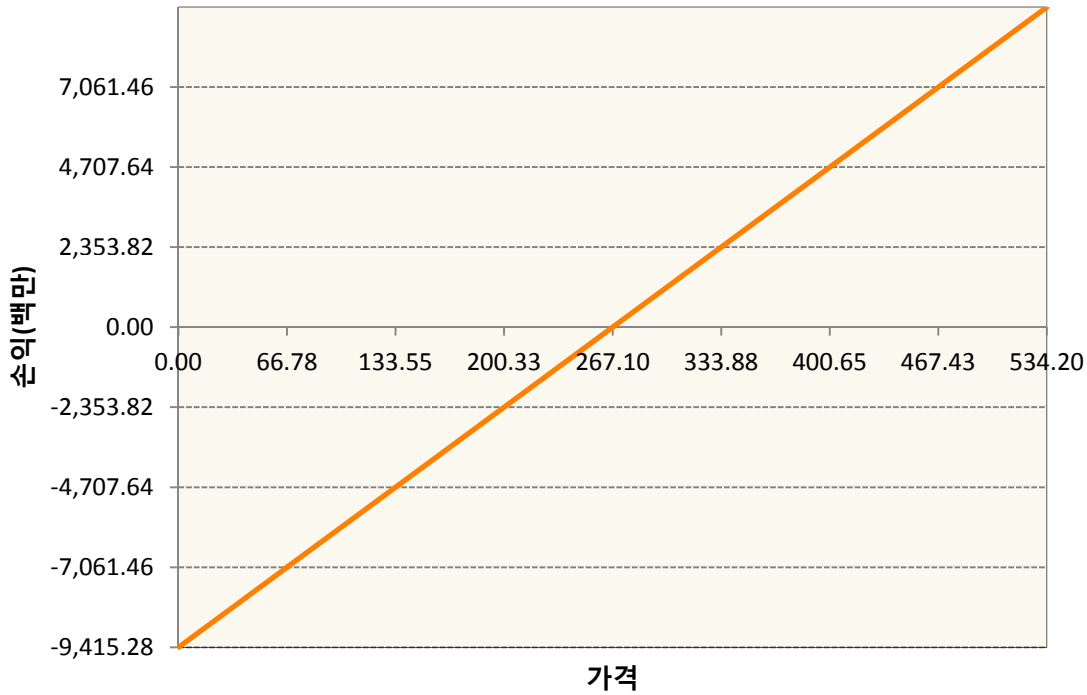
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

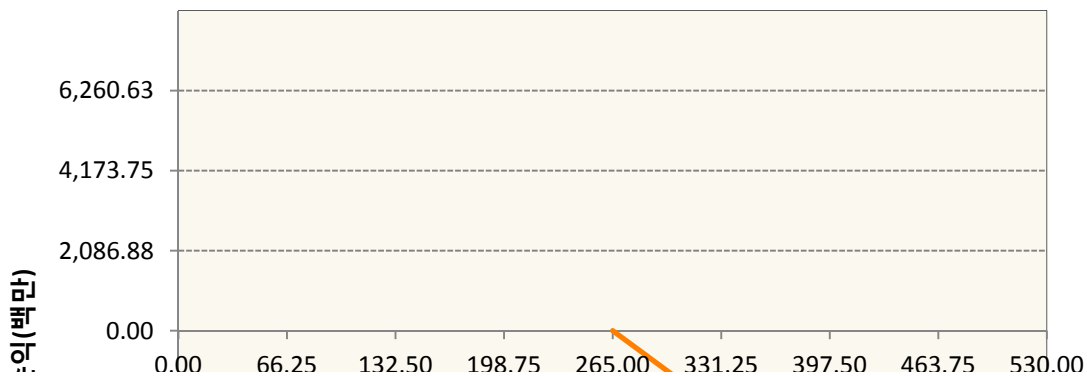
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,415	0	9,415	장내
누계	유가증권	옵션	2,917	17,911	-14,994	장내

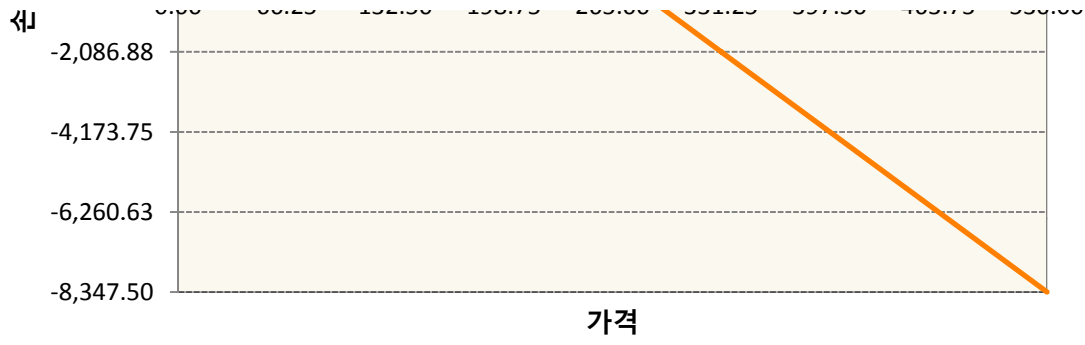
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

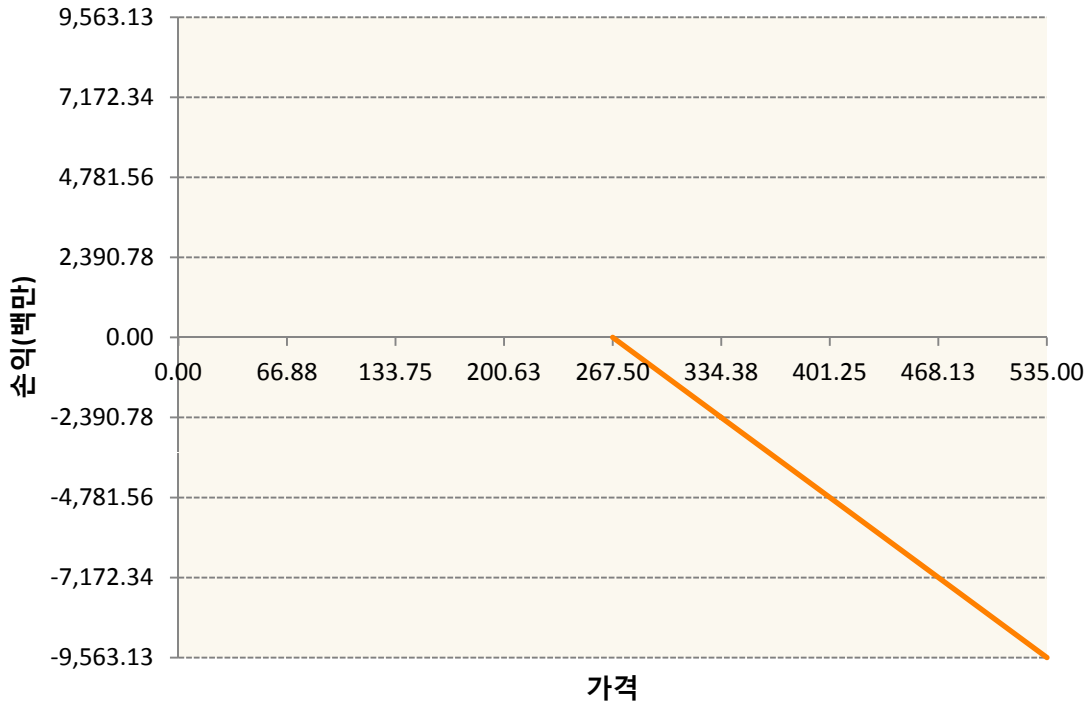


KR4201Q62659-2020-06 콜265

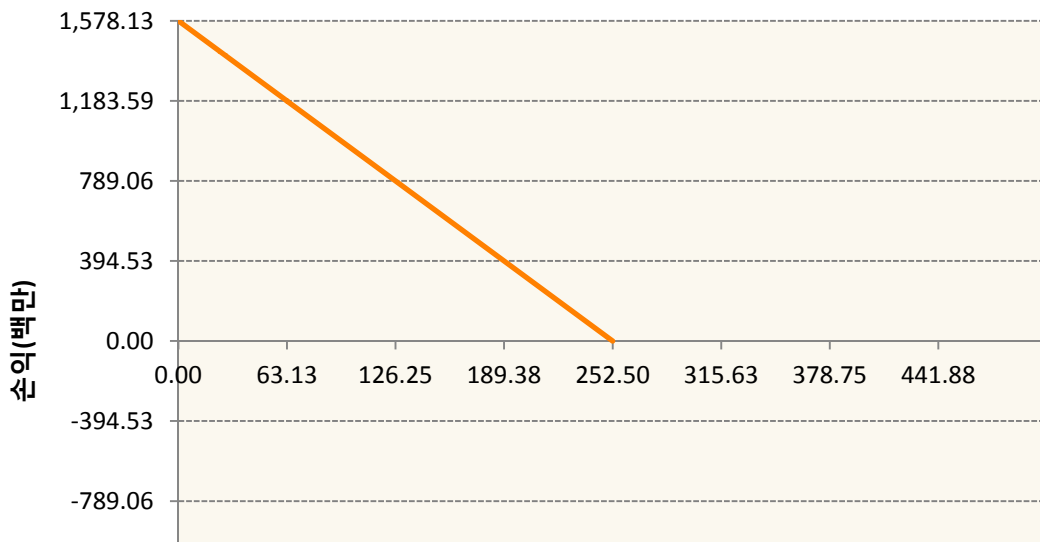


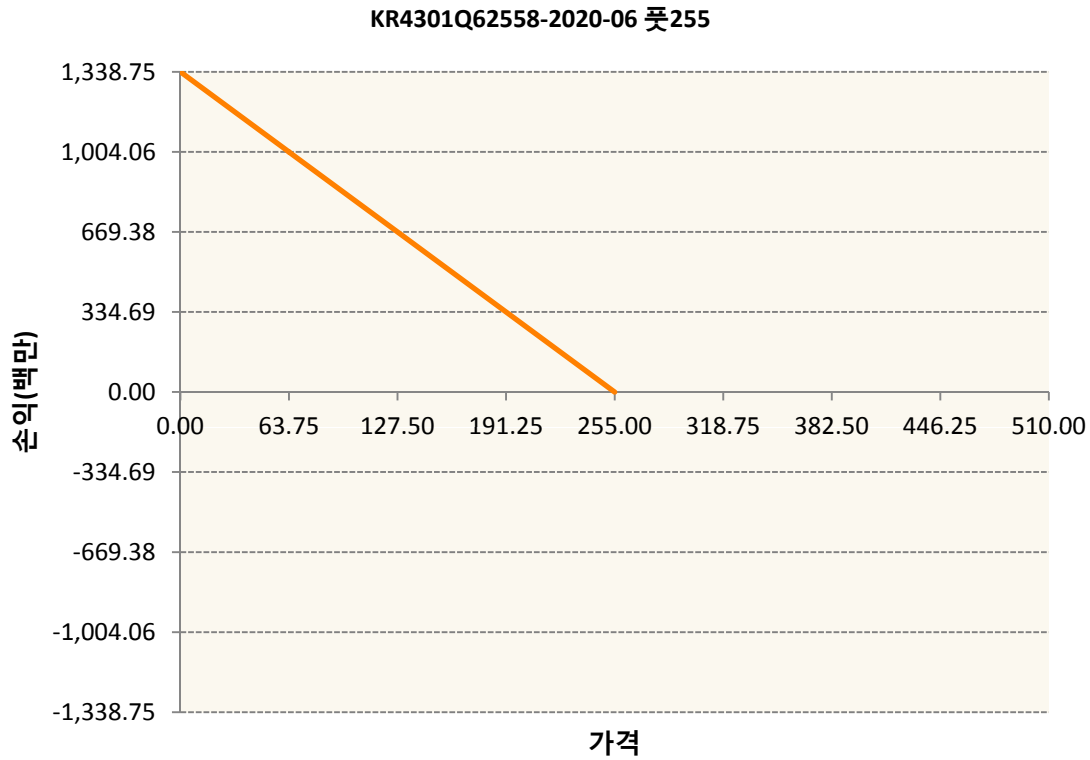
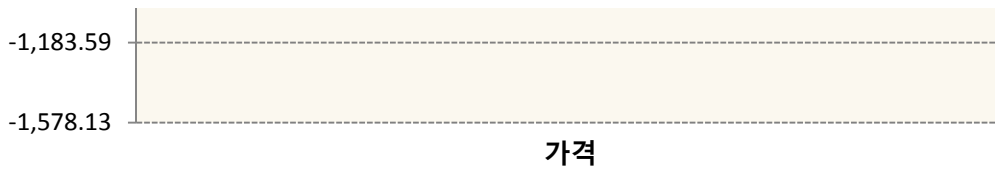


KR4201Q62675-2020-06 콜267.5



KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





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

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						755
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-755	-755	-755	-755	-755	-755	-755	
-5.33%	-503	-503	-503	-503	-503	-503	-503	
-2.67%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	252	252	252	252	252	252	252	
5.33%	503	503	503	503	503	503	503	
8.00%	755	755	755	755	755	755	755	
KR4201Q62659		2020-06 콜265						535
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	298	285	271	255	238	221	203	
-5.33%	256	236	217	196	175	154	133	
-2.67%	182	159	135	112	88	65	41	

0%	72	48	24	0	-24	-48	-73
2.67%	-72	-94	-116	-139	-162	-185	-208
5.33%	-247	-264	-282	-301	-321	-342	-363
8.00%	-444	-455	-469	-484	-500	-517	-535
KR4201Q62675                      2020-06 콜267.5							585
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	303	291	276	260	242	224	204
-5.33%	264	244	223	202	179	156	133
-2.67%	193	168	142	116	90	64	37
0%	83	55	28	0	-28	-55	-83
2.67%	-67	-94	-120	-147	-174	-201	-228
5.33%	-254	-276	-299	-322	-346	-371	-396
8.00%	-469	-485	-502	-521	-542	-563	-585
KR4301Q62525                      2020-06 풋252.5							58
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	44	46	48	51	53	55	58
-5.33%	17	19	22	25	28	30	33
-2.67%	2	4	6	9	11	13	16
0%	-4	-3	-1	0	2	3	5
2.67%	-5	-5	-4	-4	-3	-2	-1
5.33%	-6	-6	-5	-5	-5	-4	-4
8.00%	-6	-6	-6	-6	-5	-5	-5
KR4301Q62558                      2020-06 풋255							56
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	45	47	48	50	52	54	56
-5.33%	19	21	23	26	28	30	33
-2.67%	3	5	7	9	11	14	16
0%	-4	-3	-1	0	2	3	5
2.67%	-6	-6	-5	-4	-3	-2	-1
5.33%	-7	-7	-6	-6	-6	-5	-4
8.00%	-7	-7	-7	-7	-6	-6	-6

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

(단위:백만원)

2,197

공시일	2020-05-28
기준일	2020-05-27

## 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	153,405	0	153,405	

### 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	2020-05-28
기준일	2020-05-27

## 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	103,430	0	103,430	

### 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	2020-05-28
기준일	2020-05-27

## 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	456,949	0	456,949	
누계	통화	선도	0	437,718	-437,718	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	2,963
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	1,778
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	2,410
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	988
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)

**17,810**



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

(단위:백만원)

207

공시일	2020-05-28
기준일	2020-05-27

## 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	7,532	0	7,532	
누계	통화	선도	0	10,542	-10,542	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
FX21020K04 KRW/USD 27-07-20E	40
FX21020K04 KRW/USD 27-07-20E	99
FX21020K04 KRW/USD 30-06-20E	38
FX21020K04 KRW/USD 20-07-20E	79

IE00BD8RGM75

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

<b>429</b>
------------

공시일	2020-05-28
기준일	2020-05-27

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

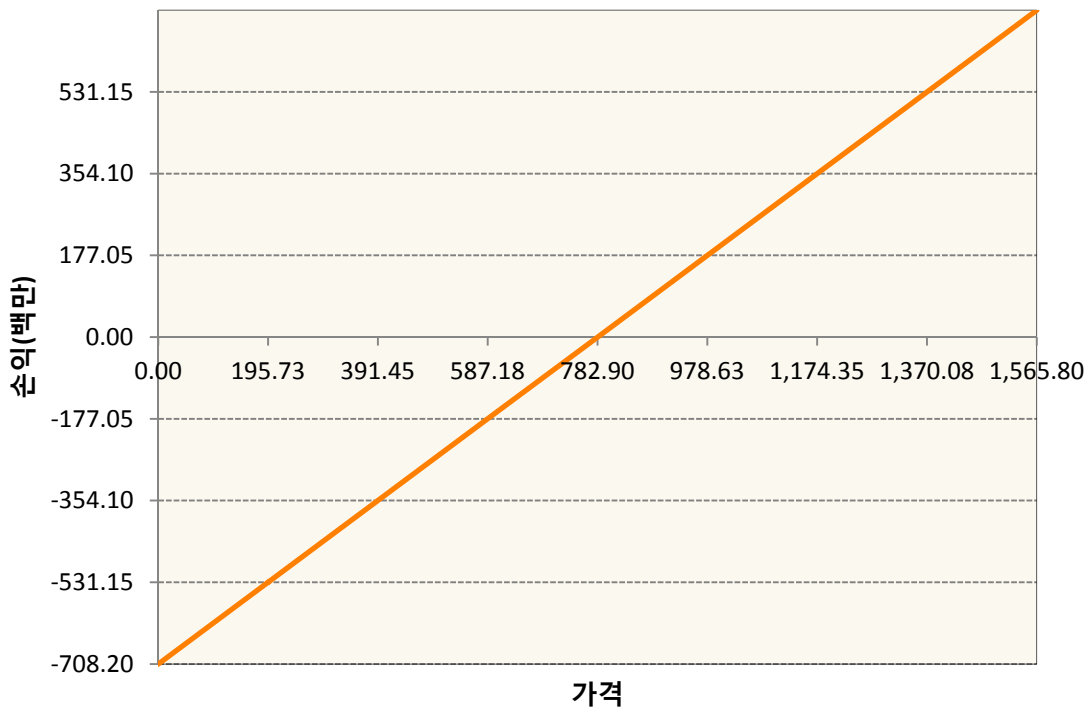
### 1. 계약금액

(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	708	0	708	
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	57

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

(단위:백만원)

**172**

공시일	2020-05-28
기준일	2020-05-27

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

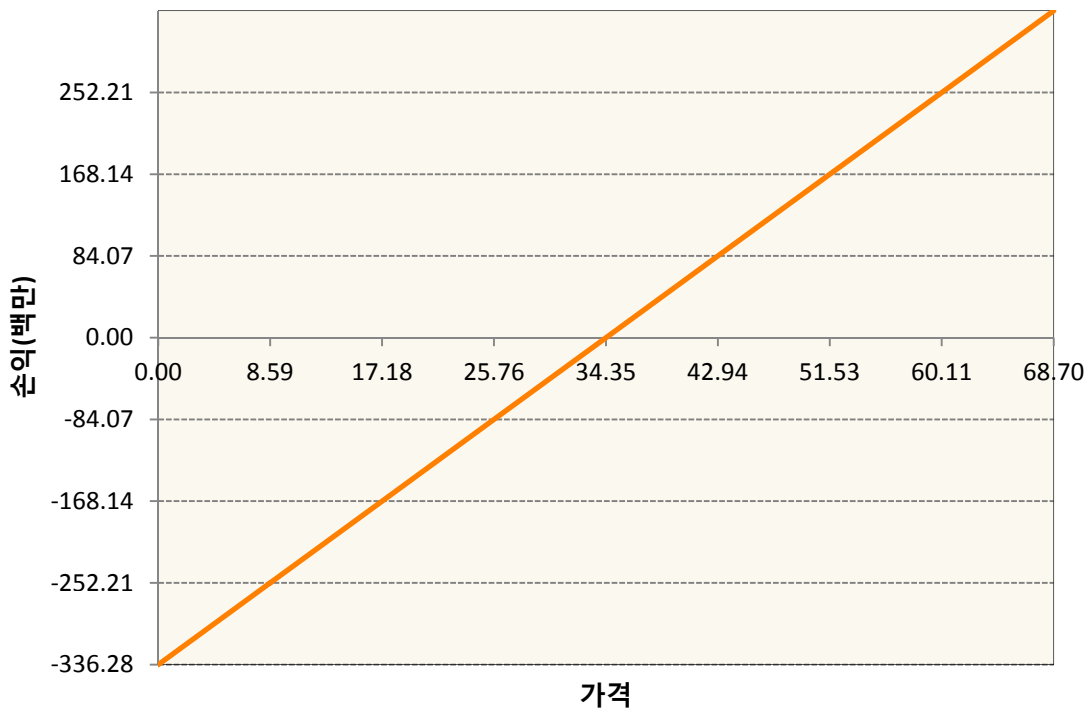
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

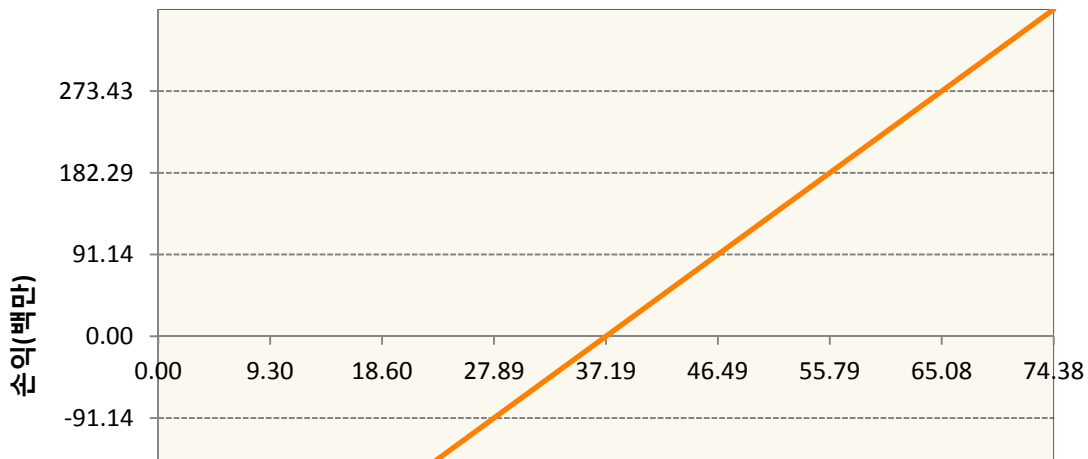
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,754	309	1,446	

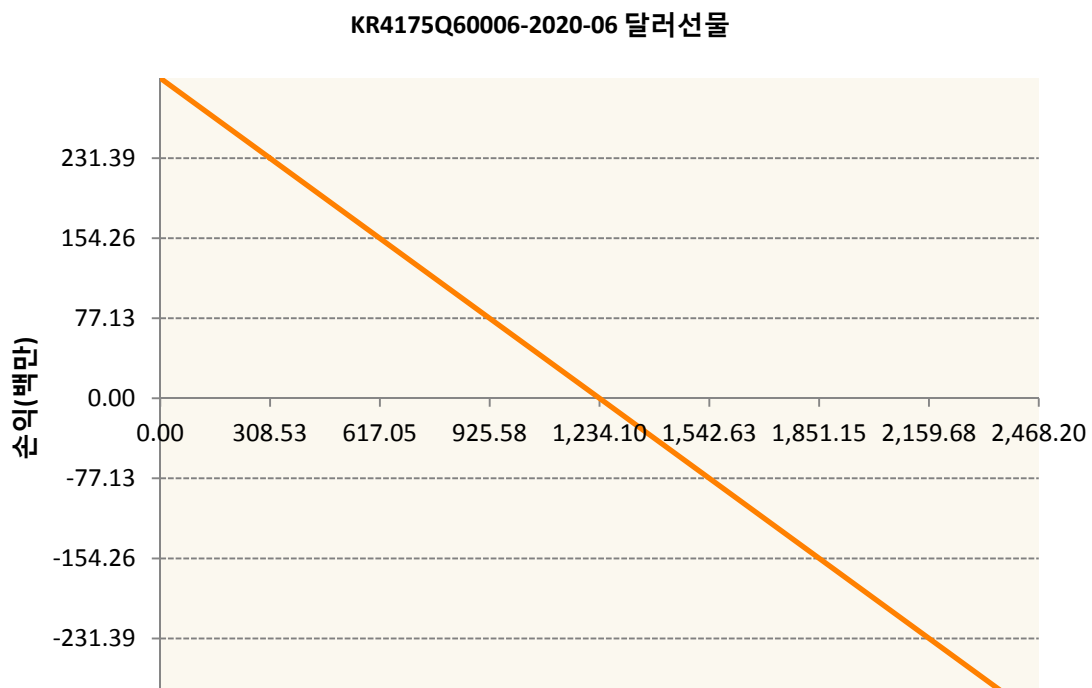
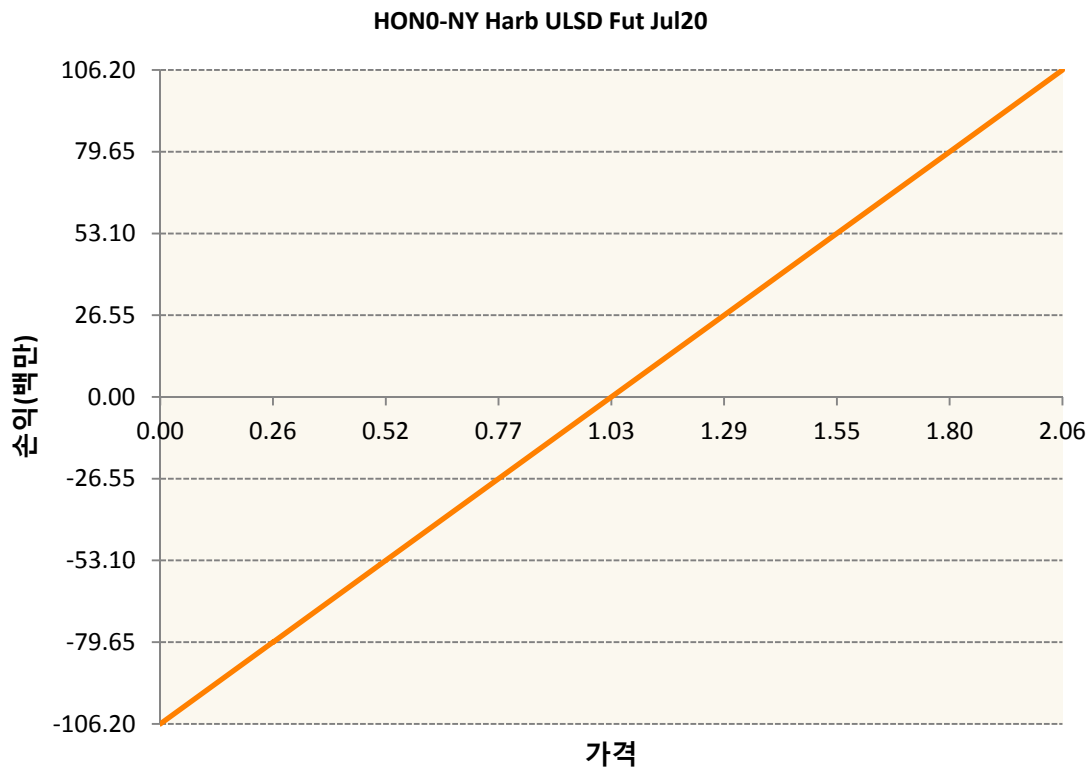
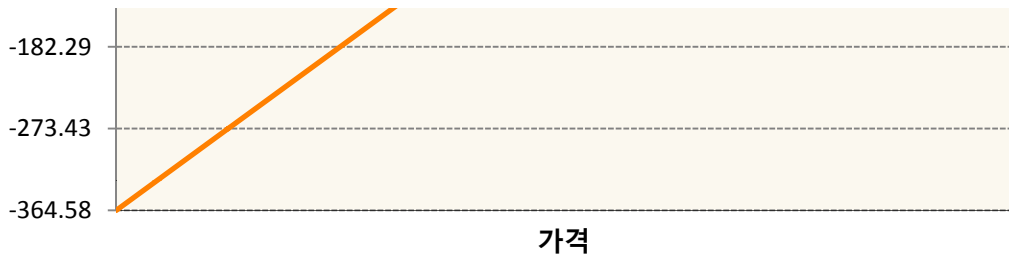
### 2. 만기시점의 손익구조

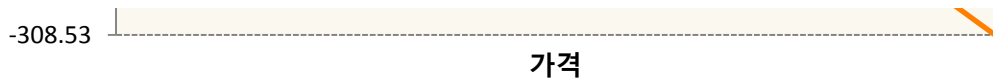
CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20



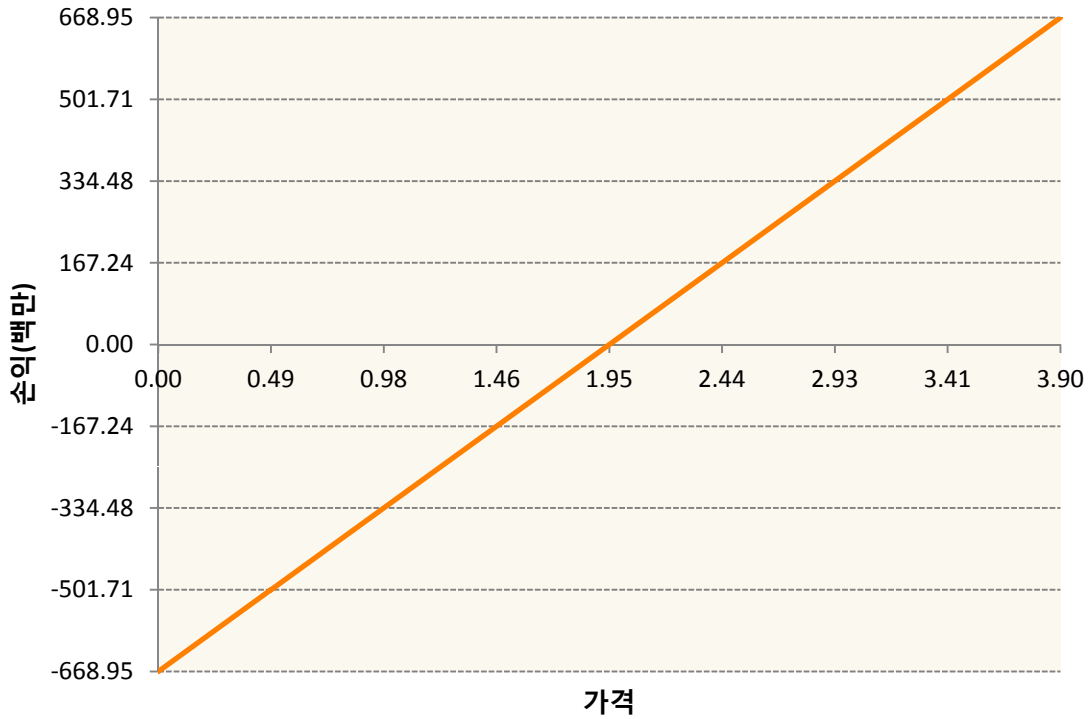
COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20



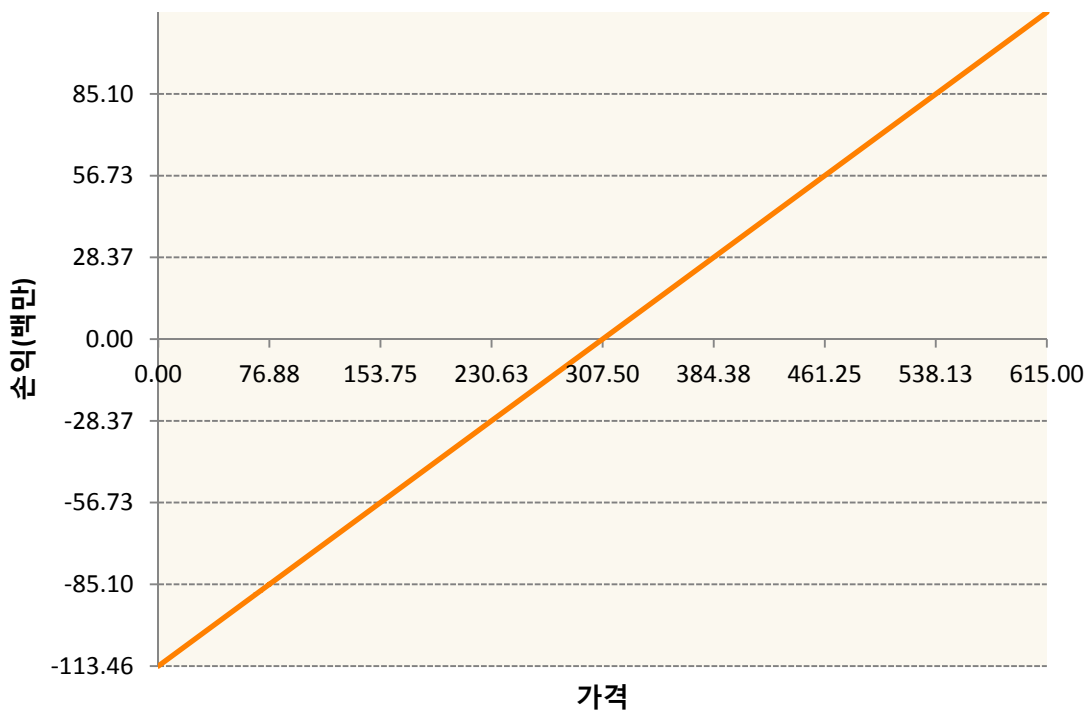




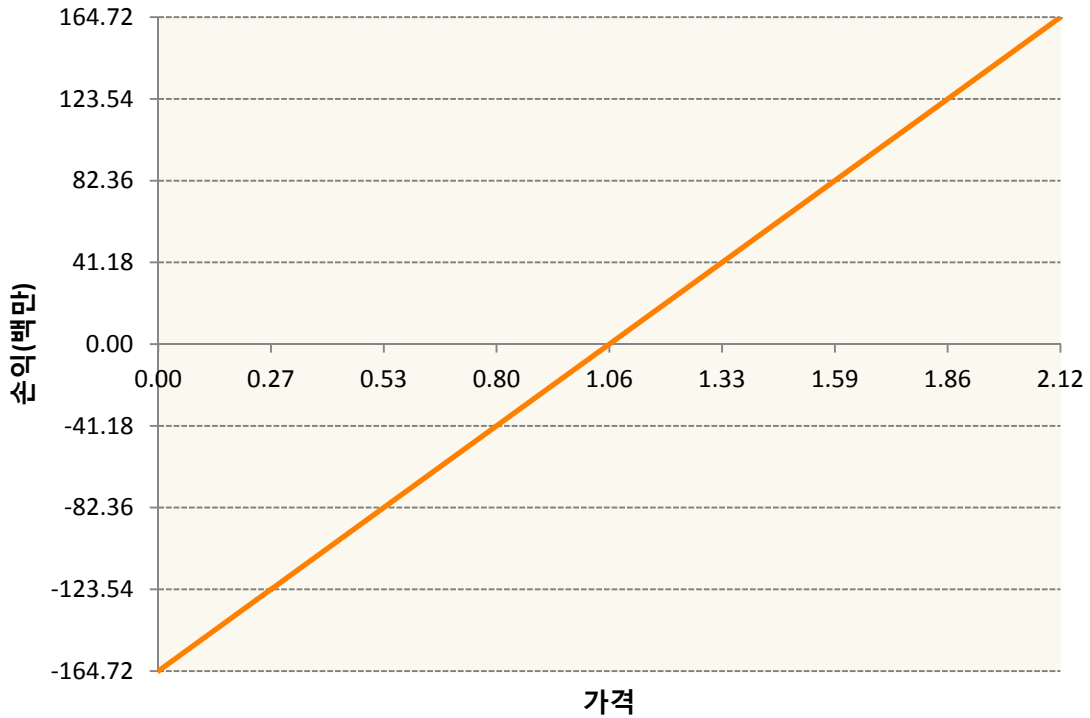
NGN20-NATURAL GAS FUTR Jul20



QSN0-Low Su Gasoil G Jul20



XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN0	WTI CRUDE FUTURE Jul20	27
COU0	BRENT CRUDE FUTR Sep20	29
HON0	NY Harb ULSD Fut Jul20	8
KR4175Q60C	2020-06 달러선물	25
NGN20	NATURAL GAS FUTR Jul20	54
QSN0	Low Su Gasoil G Jul20	9
XBN0	GASOLINE RBOB FUT Jul20	13

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

831

공시일	2020-05-28
기준일	2020-05-27

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

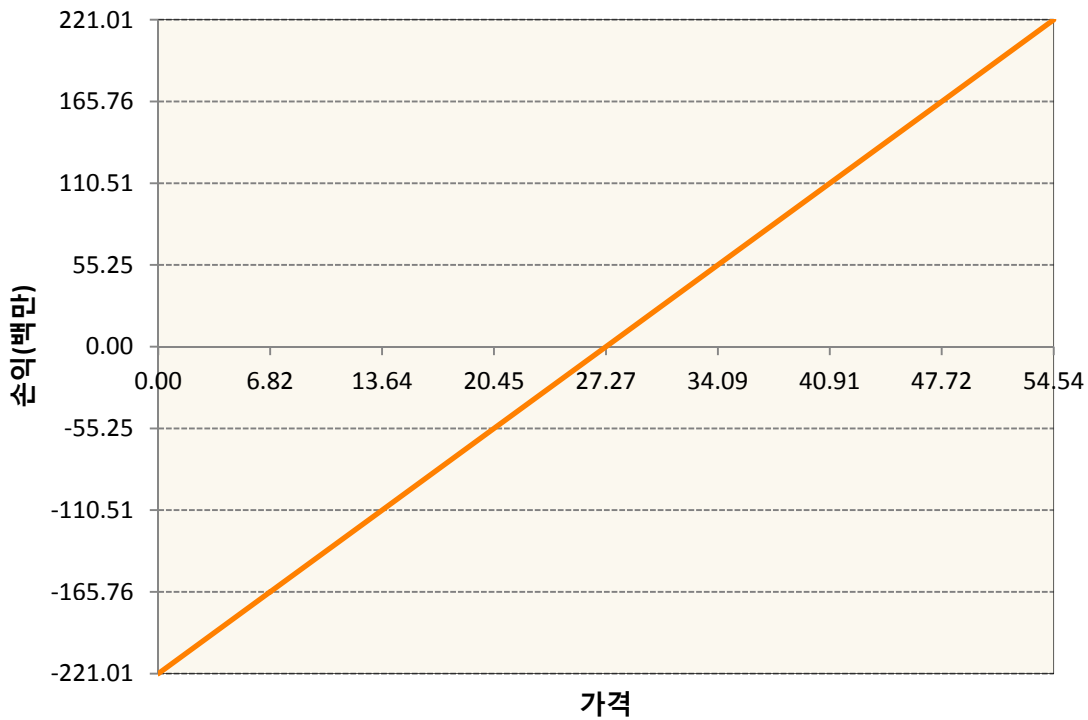
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

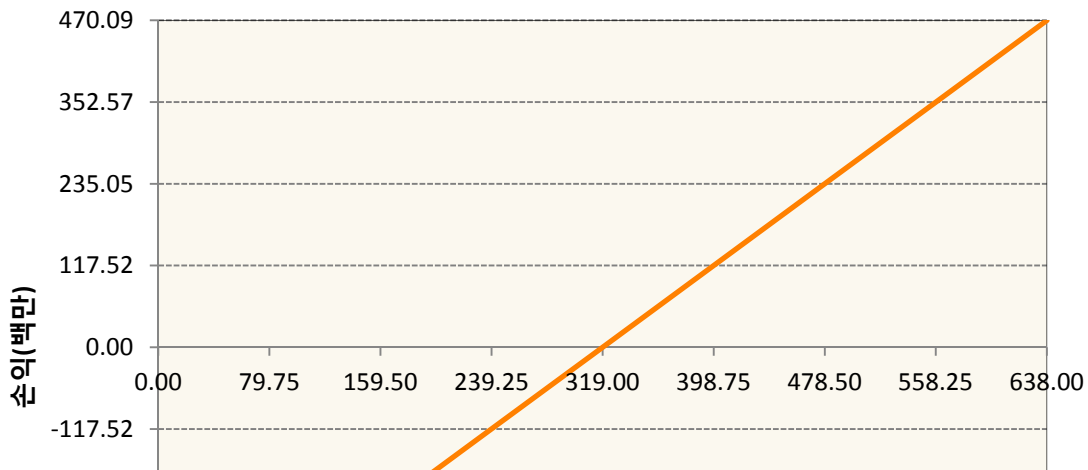
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,432	74	2,358	

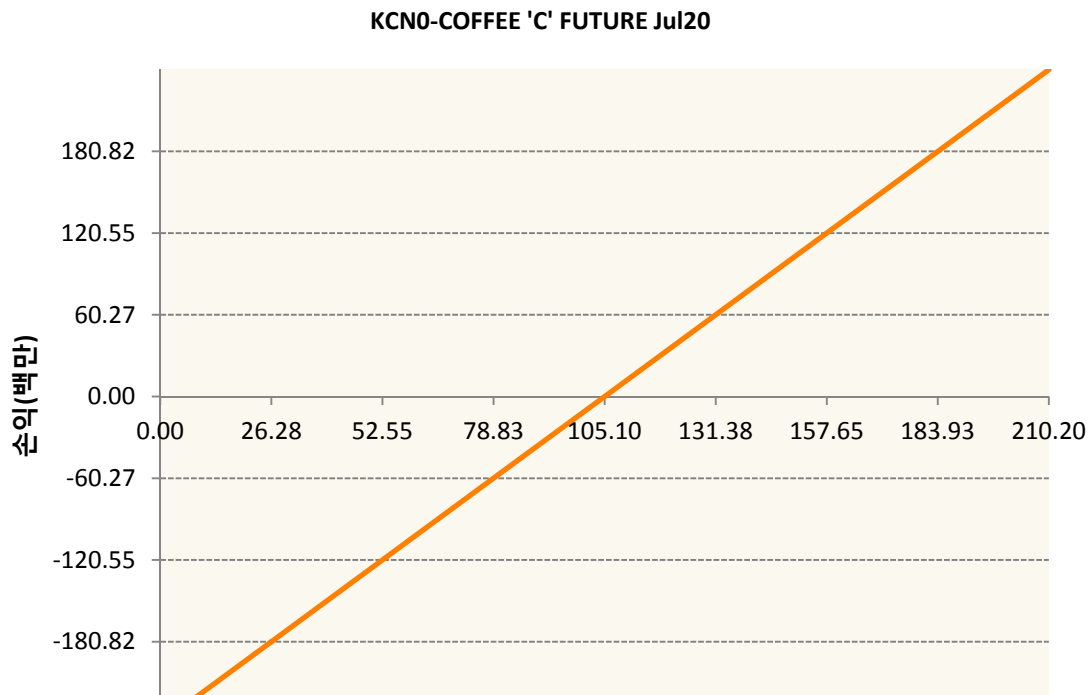
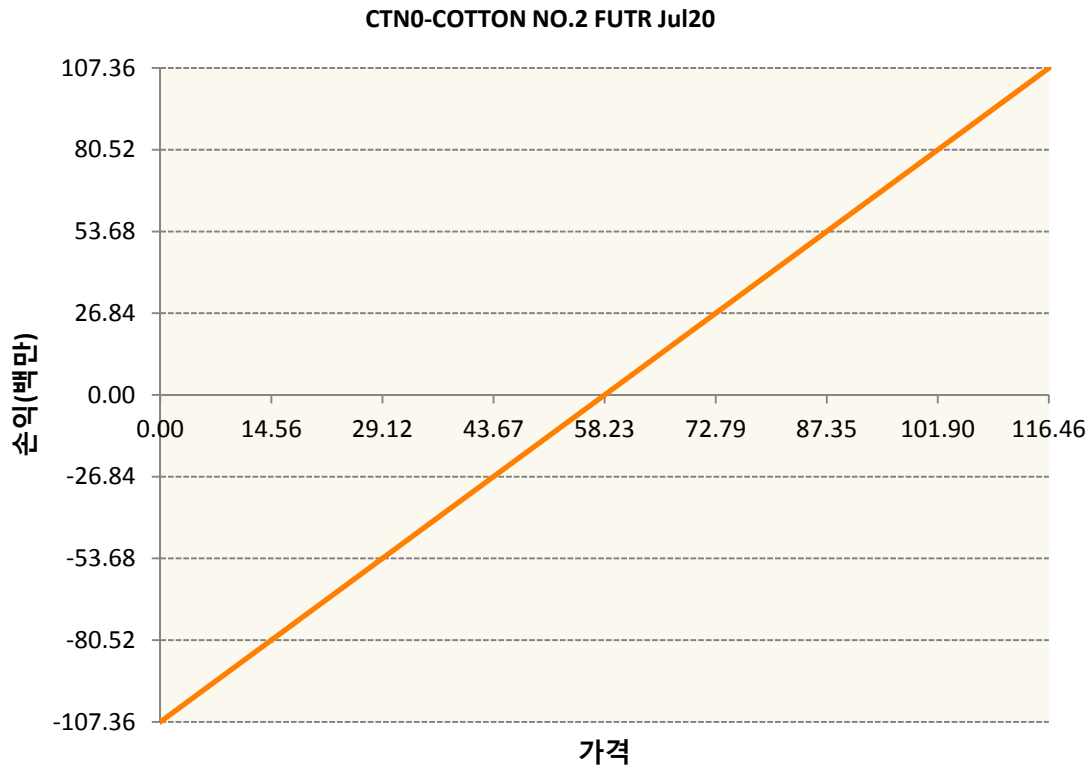
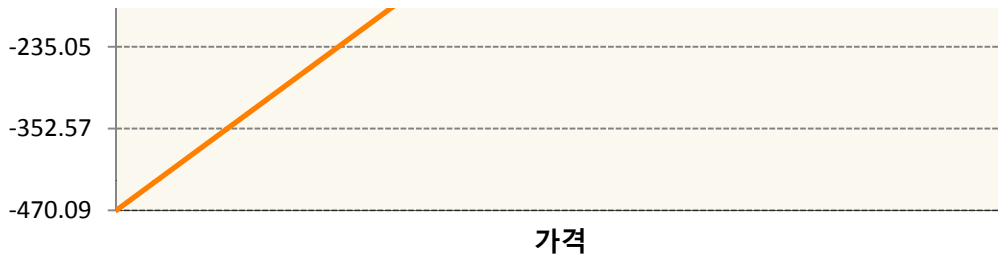
### 2. 만기시점의 손익구조

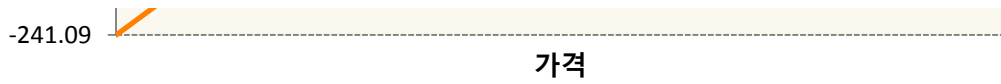
**BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20**



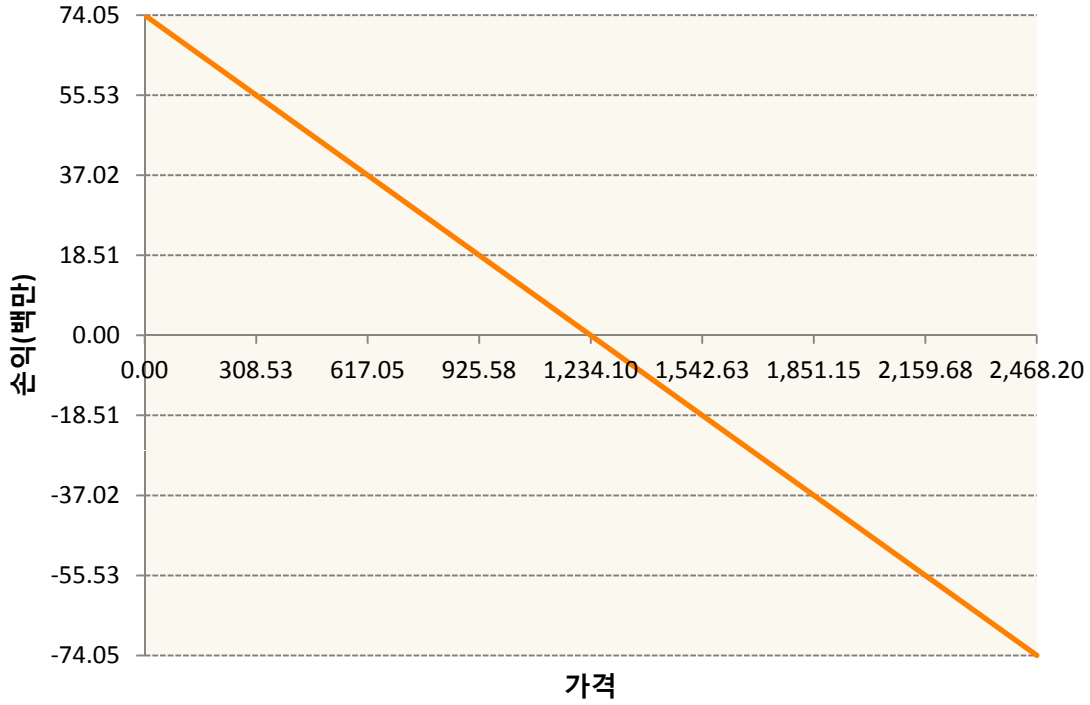
**CN0-CORN FUTURE Jul20**



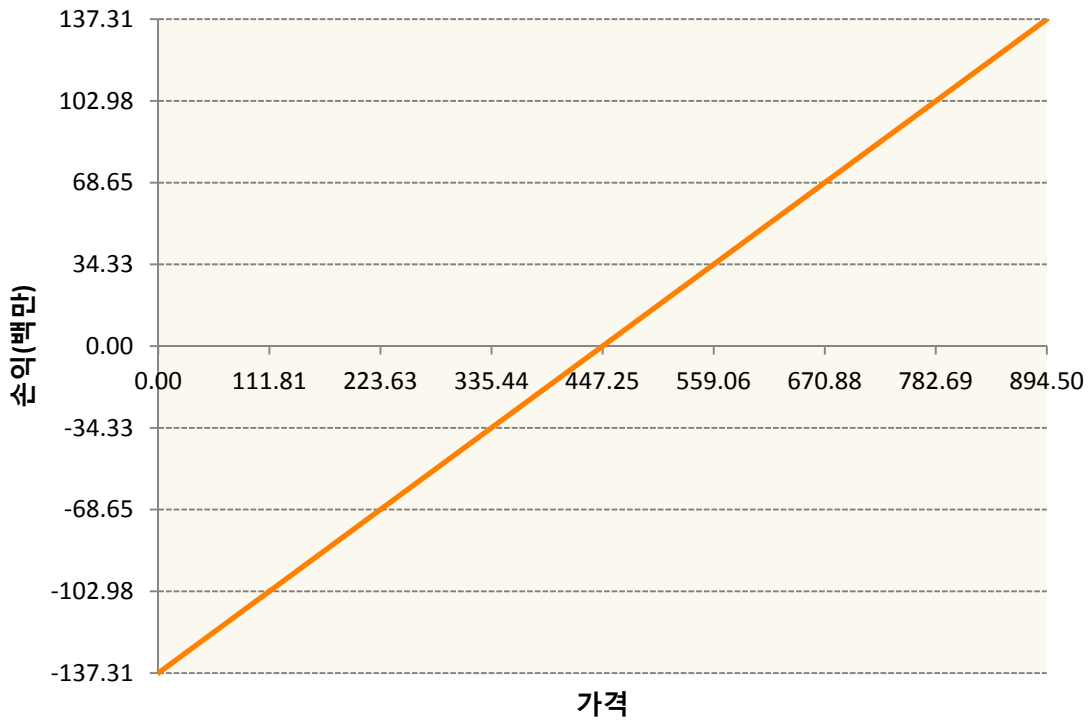




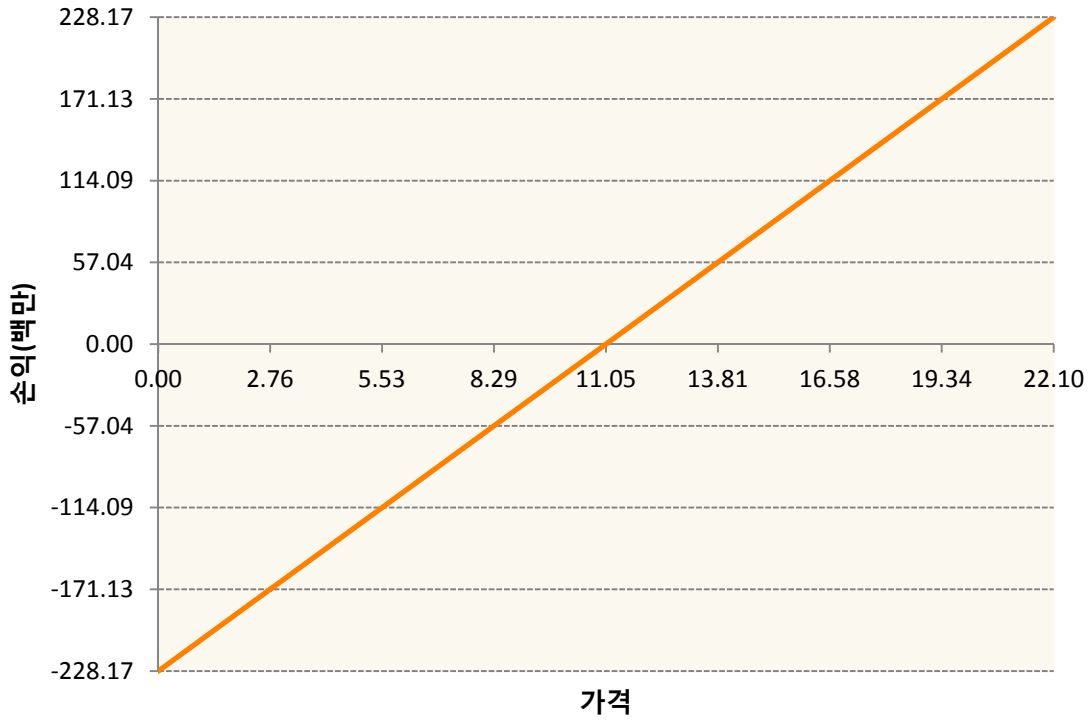
KR4175Q60006-2020-06 달러선물



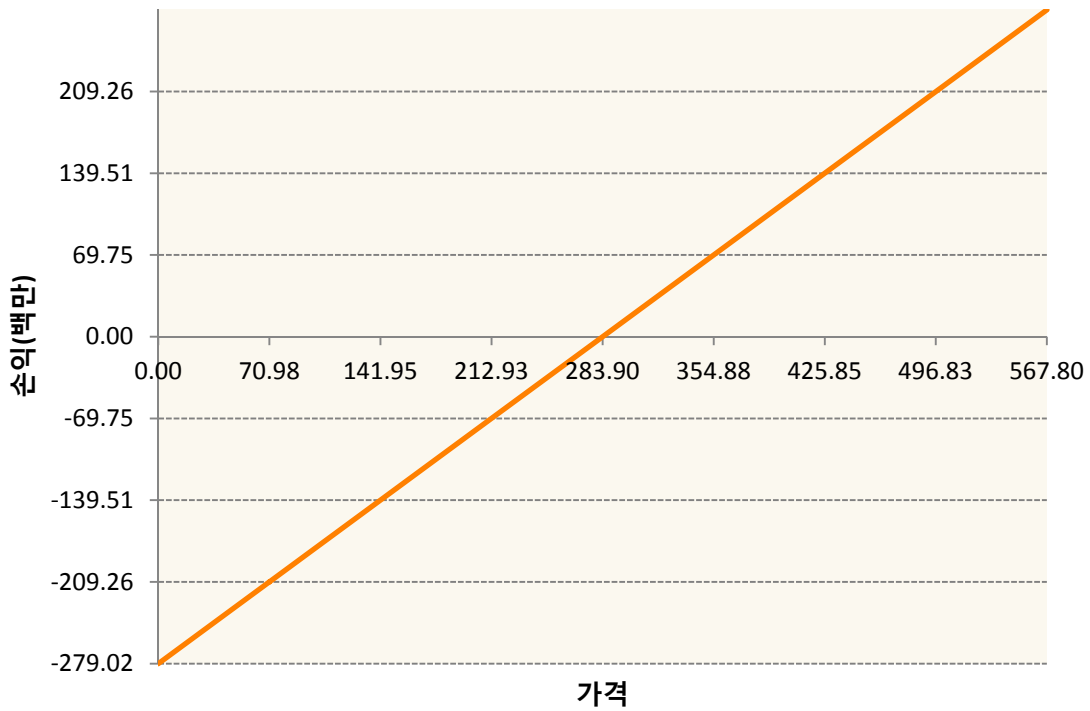
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



SBN0-Sugar Jul20

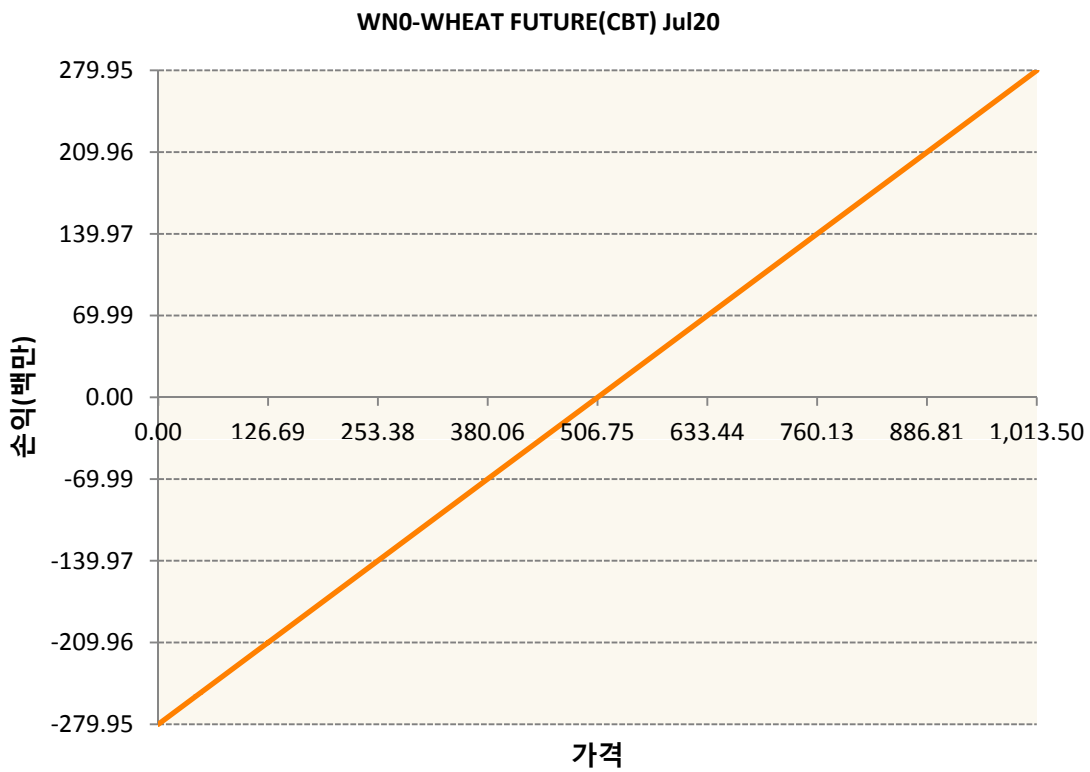
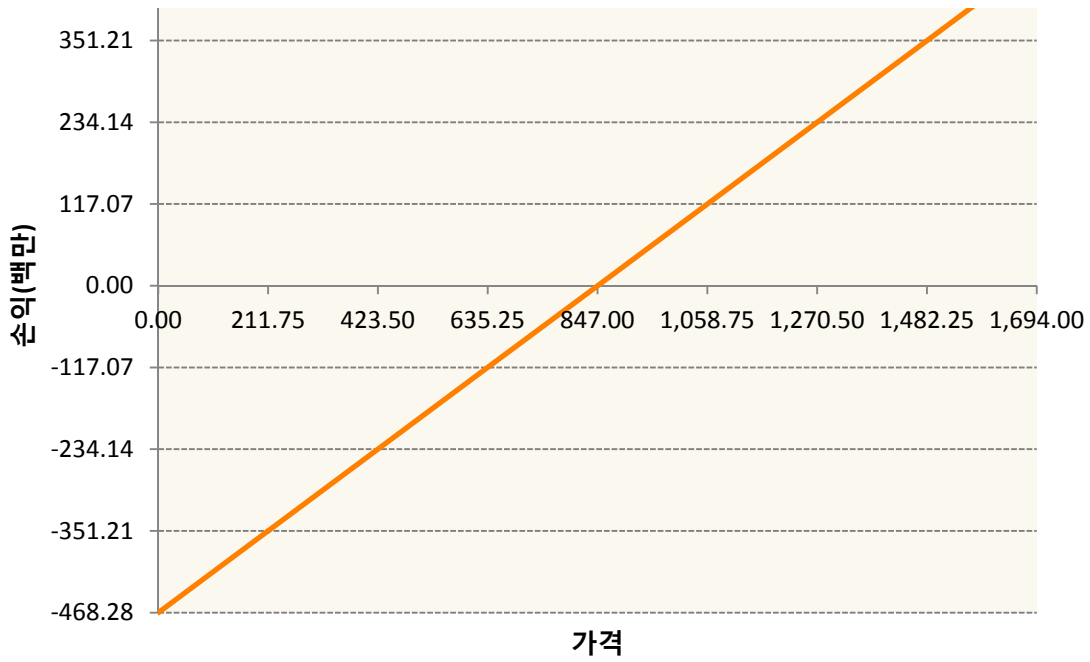


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20



SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BON0	SOYBEAN OIL FUTR Jul20	18
CN0	CORN FUTURE Jul20	38
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)

**230**