

공시일	2020-05-29
기준일	2020-05-28

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)

49

공시일	2020-05-29
기준일	2020-05-28

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

1,032

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,208

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-29
기준일	2020-05-28

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

554

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

819

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-05-29
기준일	2020-05-28

유로인덱스모(주식-파생형)

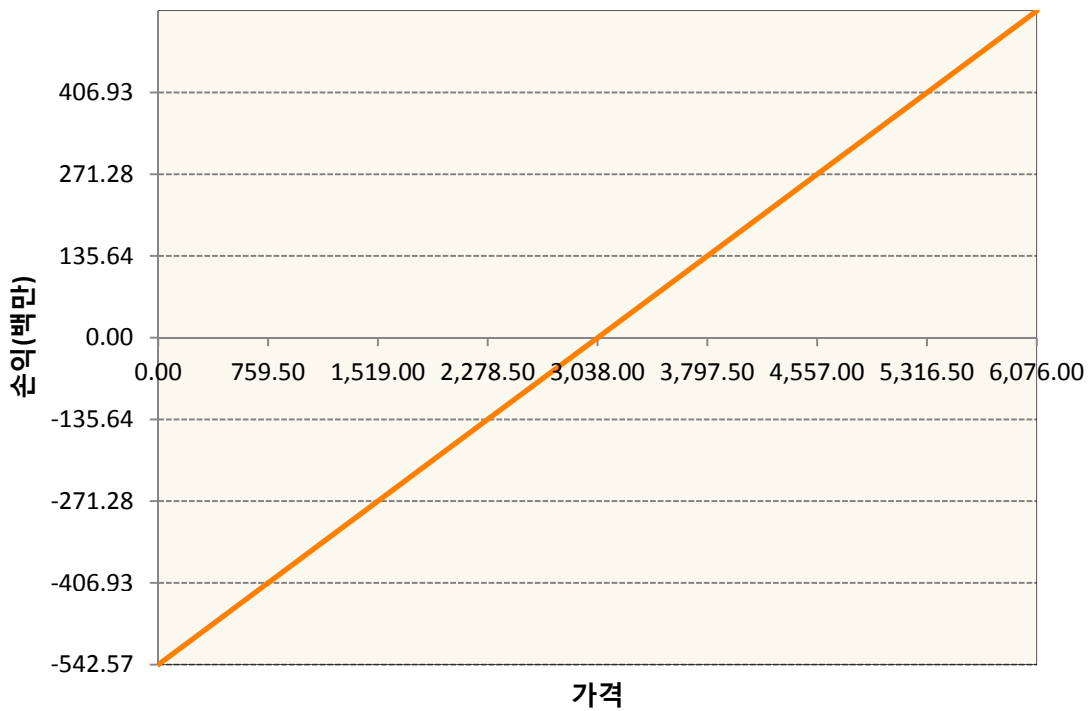
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	543	0	543	

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)

56

공시일	2020-05-29
기준일	2020-05-28

차이나인덱스모(주식-파생형)

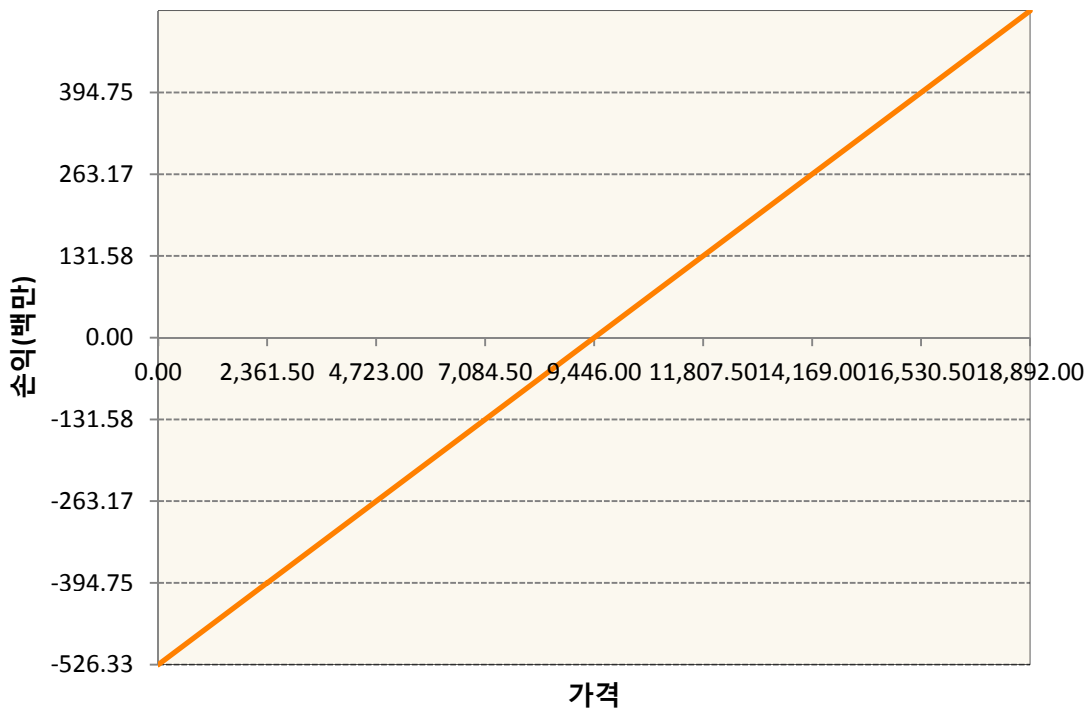
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	526	0	526	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	2020-05-29
기준일	2020-05-28

커버드콜모(주식혼합-파생형)

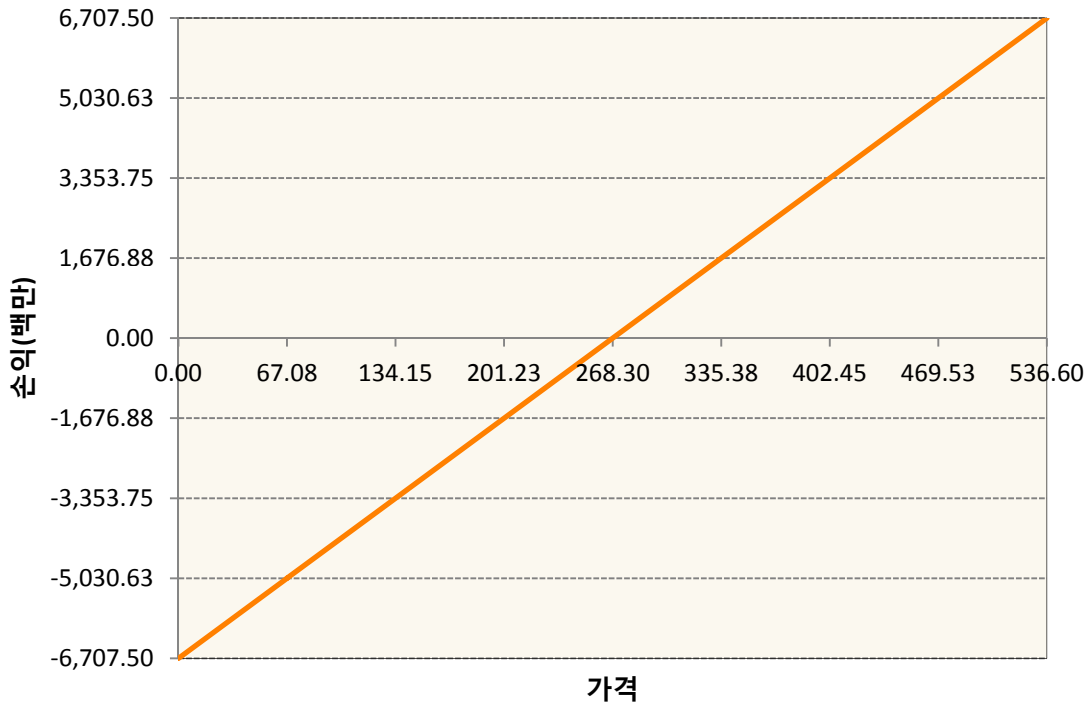
1. 계약금액

(단위:백만원)

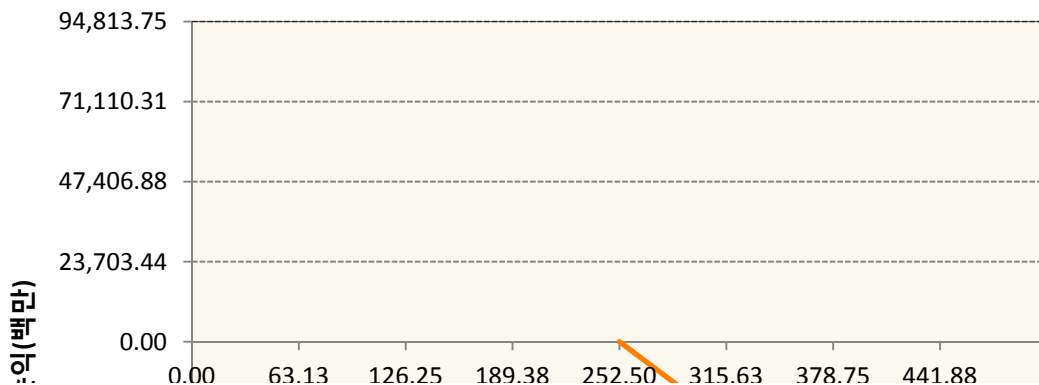
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	6,708	0	6,708	장내
누계	유가증권	옵션	0	364,213	-364,213	장내

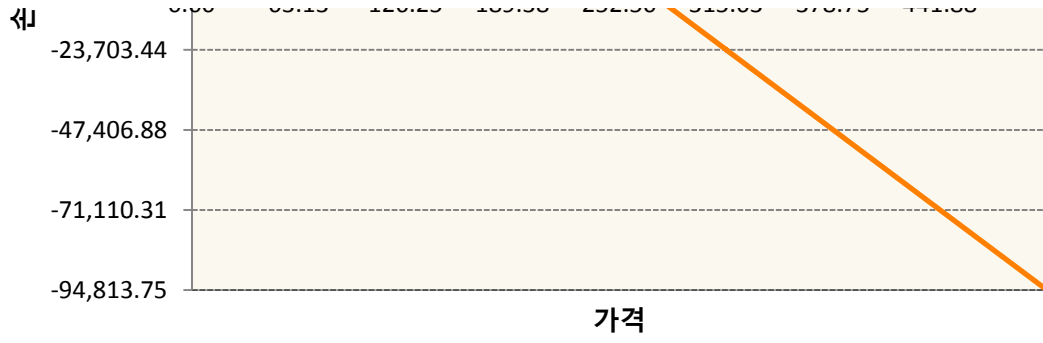
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

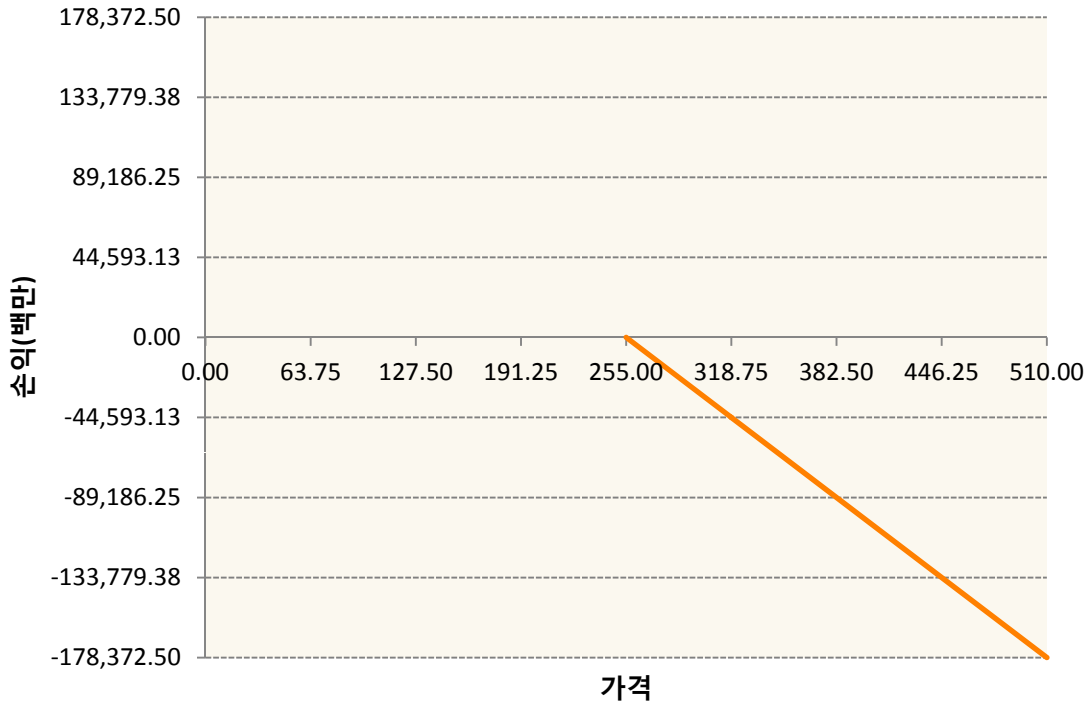


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

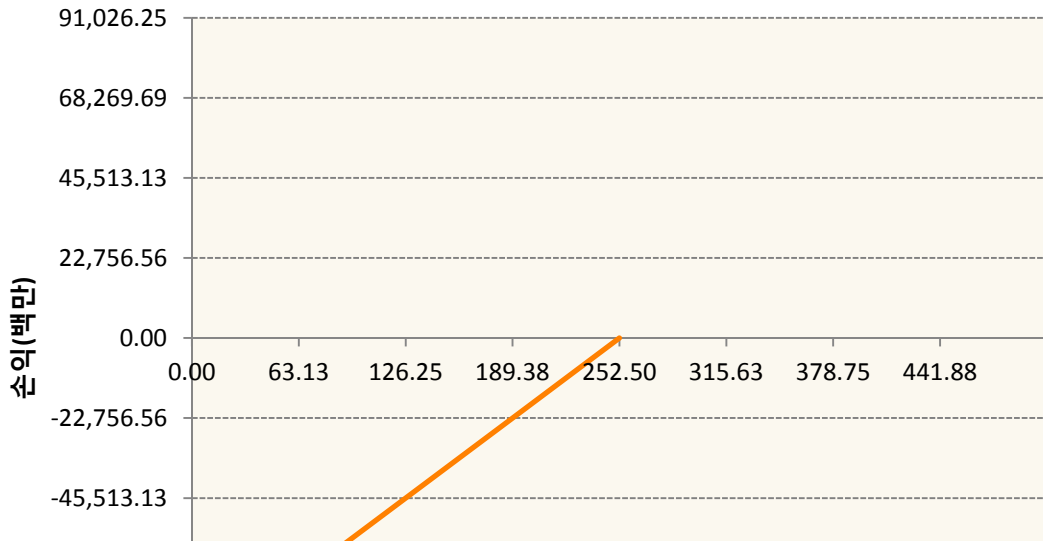


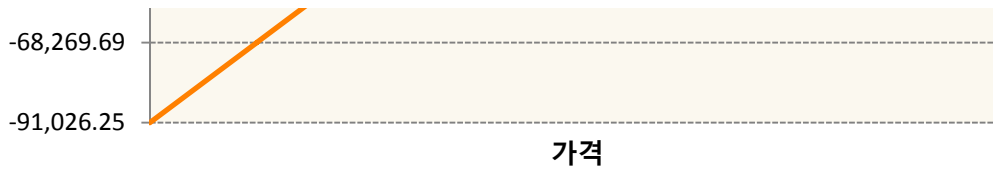


KR4201Q62550-2020-06 콜255



KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						537
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-537	-537	-537	-537	-537	-537	-537	
-5.33%	-358	-358	-358	-358	-358	-358	-358	
-2.67%	-179	-179	-179	-179	-179	-179	-179	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	179	179	179	179	179	179	179	
5.33%	358	358	358	358	358	358	358	
8.00%	537	537	537	537	537	537	537	
KR4201Q62527		2020-06 콜252.5						7,384
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5,587	5,340	5,090	4,838	4,584	4,329	4,073	
-5.33%	4,363	4,097	3,831	3,564	3,298	3,032	2,766	
-2.67%	2,673	2,433	2,188	1,939	1,687	1,433	1,176	
0%	589	405	208	0	-217	-442	-672	
2.67%	-1,775	-1,896	-2,036	-2,194	-2,365	-2,549	-2,743	
5.33%	-4,308	-4,377	-4,466	-4,575	-4,700	-4,840	-4,994	
8.00%	-6,928	-6,963	-7,015	-7,083	-7,168	-7,269	-7,384	
KR4201Q62550		2020-06 콜255						13,484
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	9,687	9,252	8,807	8,355	7,896	7,433	6,967	
-5.33%	7,708	7,210	6,711	6,213	5,714	5,215	4,717	
-2.67%	4,857	4,380	3,898	3,412	2,923	2,431	1,938	
0%	1,219	831	424	0	-436	-883	-1,337	
2.67%	-3,017	-3,287	-3,592	-3,924	-4,281	-4,657	-5,050	
5.33%	-7,636	-7,800	-8,003	-8,241	-8,509	-8,805	-9,124	
8.00%	-12,467	-12,555	-12,677	-12,832	-13,020	-13,238	-13,484	
KR4301Q62525		2020-06 풋252.5						3,200
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,390	-2,518	-2,649	-2,783	-2,920	-3,059	-3,200	
-5.33%	-883	-1,035	-1,187	-1,340	-1,492	-1,645	-1,798	
-2.67%	-99	-210	-328	-451	-579	-710	-844	

0%	187	136	73	0	-82	-173	-270
2.67%	259	243	220	187	145	95	36
5.33%	272	268	262	250	233	210	180
8.00%	273	273	271	268	263	253	240

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

(단위:백만원)

23,620

공시일	2020-05-29
기준일	2020-05-28

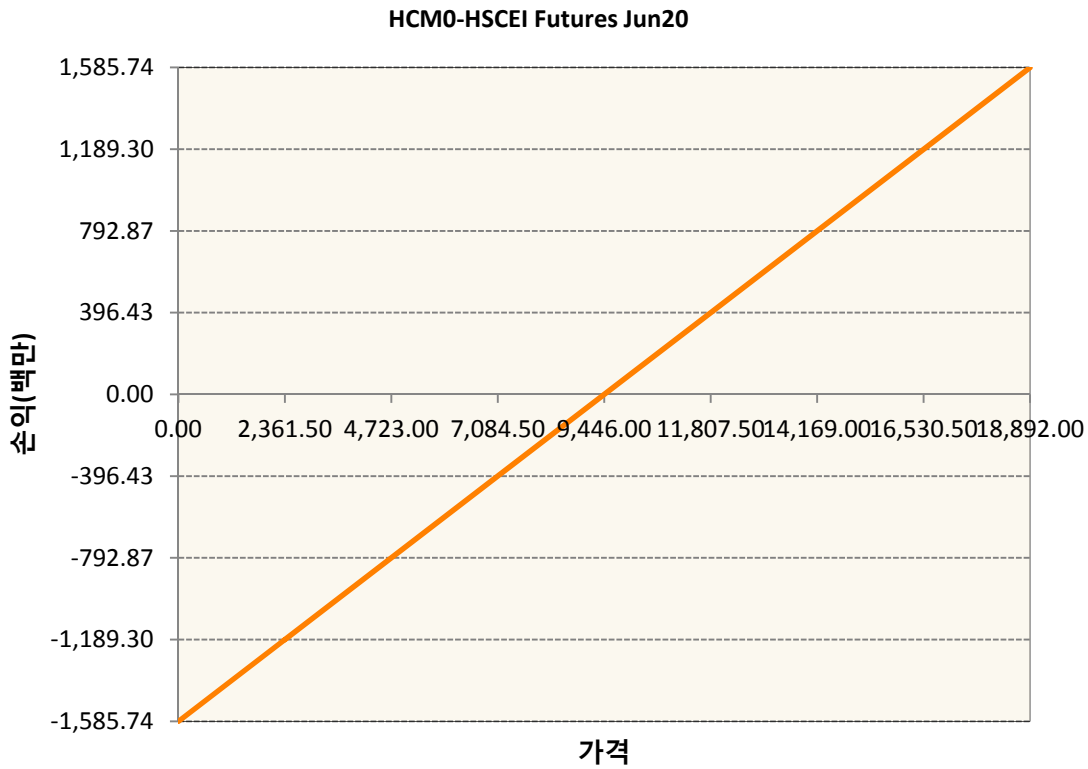
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,586	0	1,586	장내
누계	통화	선도	0	1,548	-1,548	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E	124
HCM0 HSCEI Futures Jun20	127

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

(단위:백만원)

200

공시일	2020-05-29
기준일	2020-05-28

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

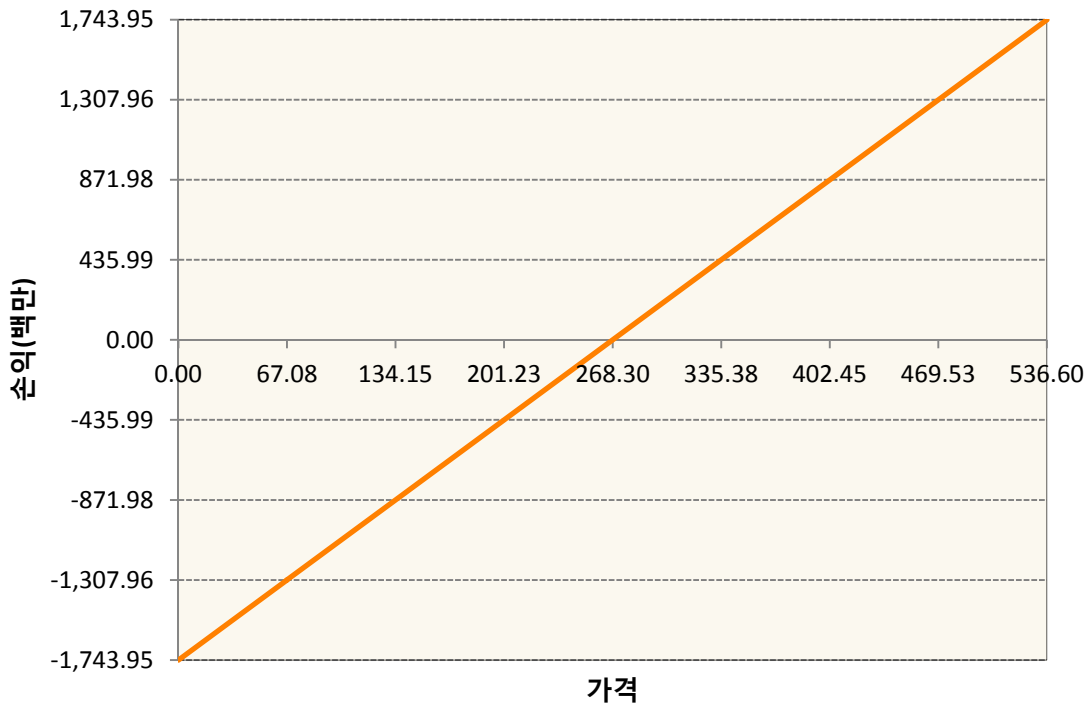
1. 계약금액

(단위:백만원)

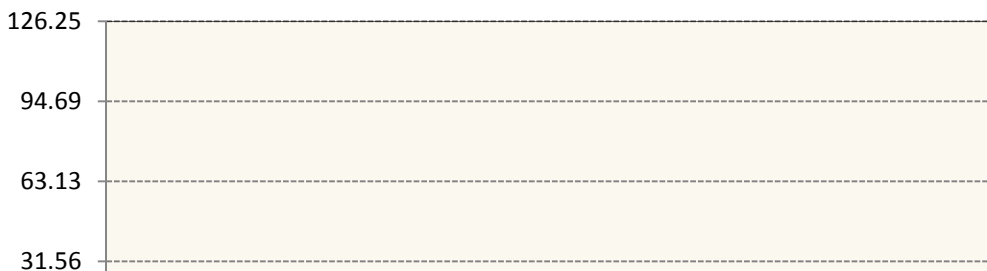
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,744	0	1,744	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,361	-3,361	장내

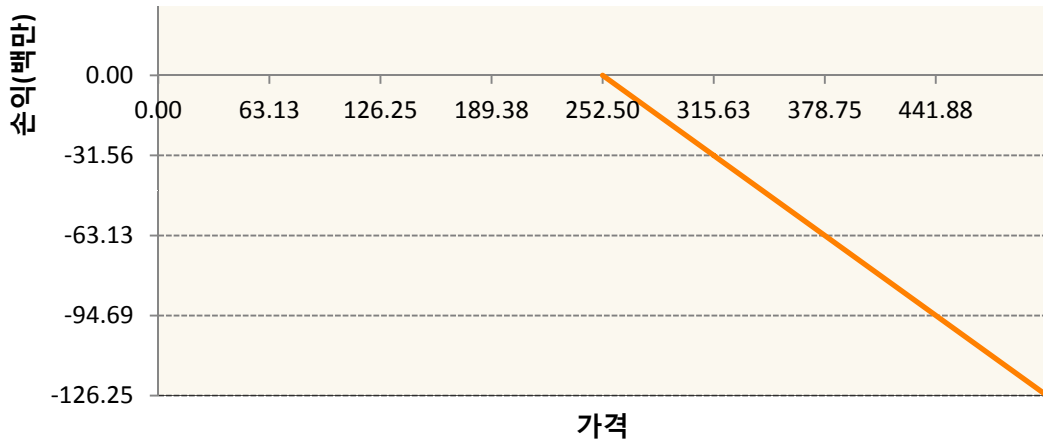
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

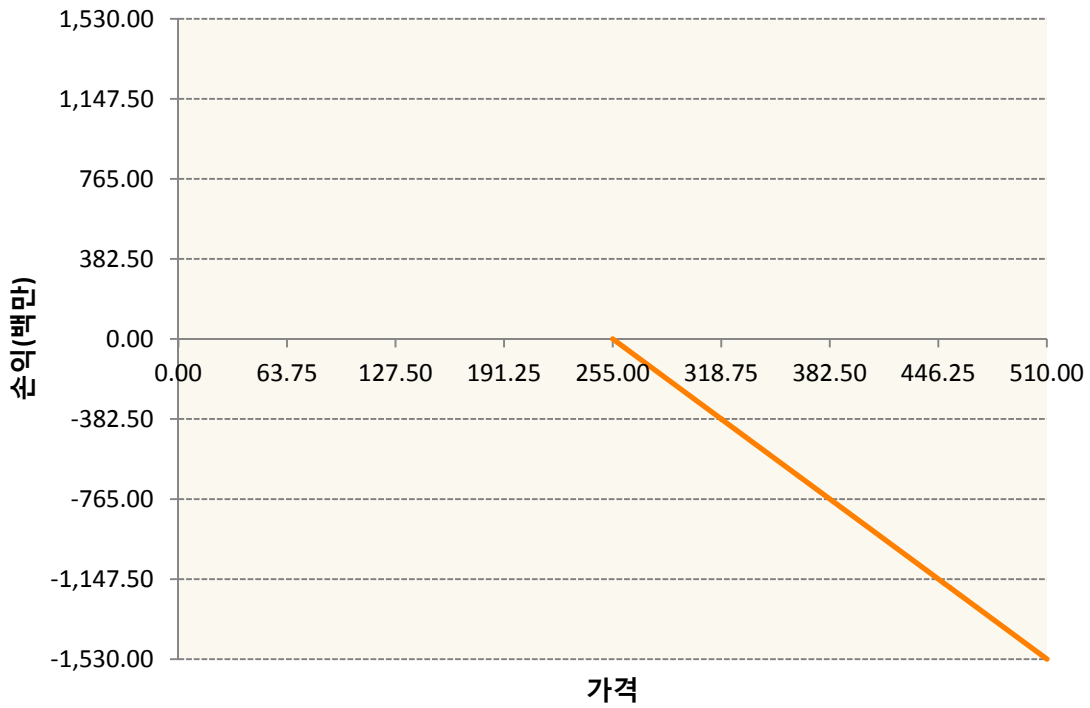


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

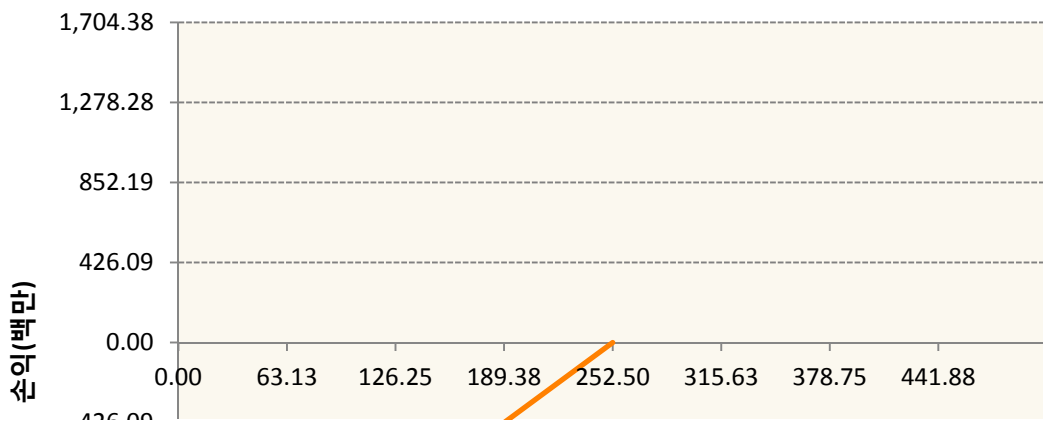


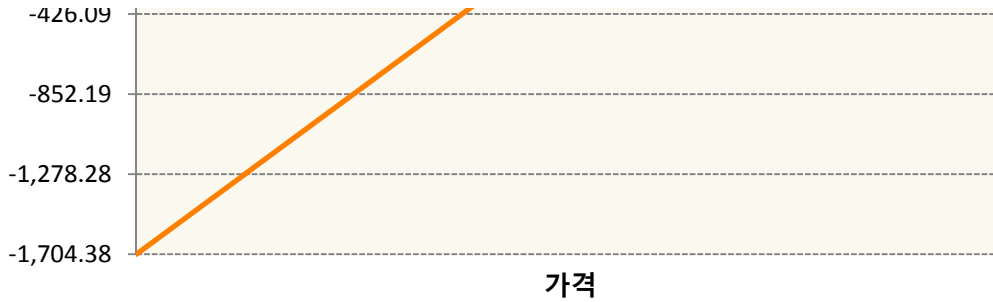


KR4201Q62550-2020-06 콜255



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						140
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-140	-140	-140	-140	-140	-140	-140	
-5.33%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93	
-2.67%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	47	47	47	47	47	47	47	
5.33%	93	93	93	93	93	93	93	
8.00%	140	140	140	140	140	140	140	
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	2	
0%	1	1	0	0	0	-1	-1	
2.67%	-2	-3	-3	-3	-3	-3	-4	
5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-7	
8.00%	-9	-9	-9	-9	-10	-10	-10	
KR4201Q62550		2020-06 콜255						116
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	83	79	76	72	68	64	60
-5.33%	66	62	58	53	49	45	40
-2.67%	42	38	33	29	25	21	17
0%	10	7	4	0	-4	-8	-11
2.67%	-26	-28	-31	-34	-37	-40	-43
5.33%	-65	-67	-69	-71	-73	-76	-78
8.00%	-107	-108	-109	-110	-112	-114	-116
KR4301Q62525 2020-06 풋252.5							60
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-45	-47	-50	-52	-55	-57	-60
-5.33%	-17	-19	-22	-25	-28	-31	-34
-2.67%	-2	-4	-6	-8	-11	-13	-16
0%	4	3	1	0	-2	-3	-5
2.67%	5	5	4	4	3	2	1
5.33%	5	5	5	5	4	4	3
8.00%	5	5	5	5	5	5	4

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

(단위:백만원)

563

공시일	2020-05-29
기준일	2020-05-28

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

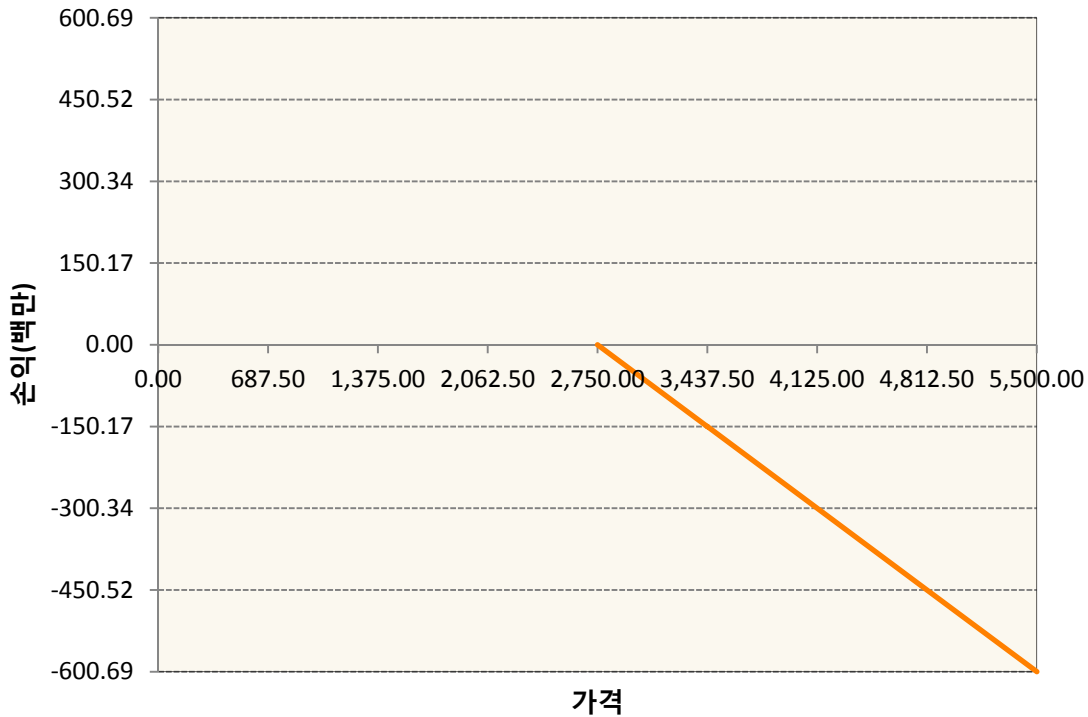
1. 계약금액

(단위:백만원)

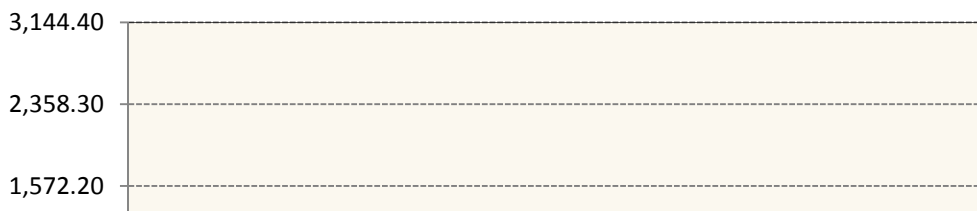
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,629	0	1,629	
누계	유가증권	스왑	8,142	0	8,142	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,490	-7,490	장내
누계	통화	선도	0	2,954	-2,954	장외

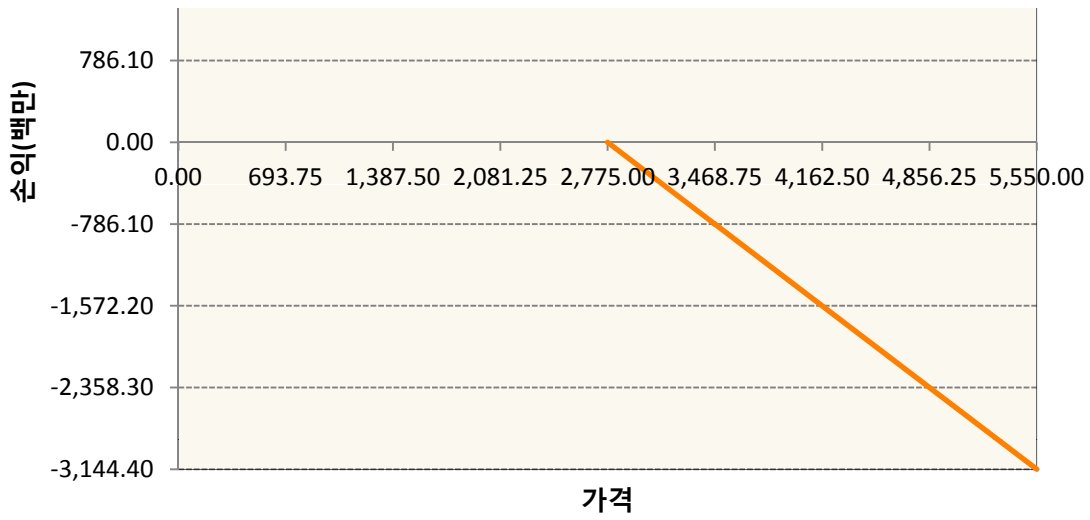
2. 만기시점의 손익구조

OESXM0-C2750-EURO STOXX 50

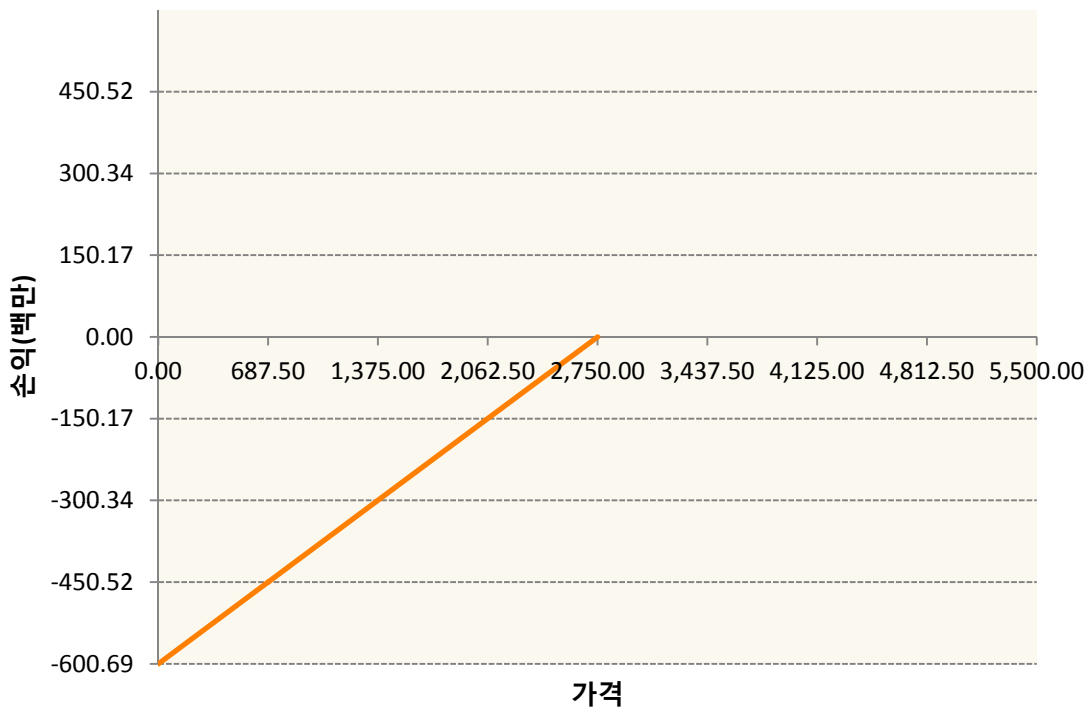


OESXM0-C2775-EURO STOXX 50

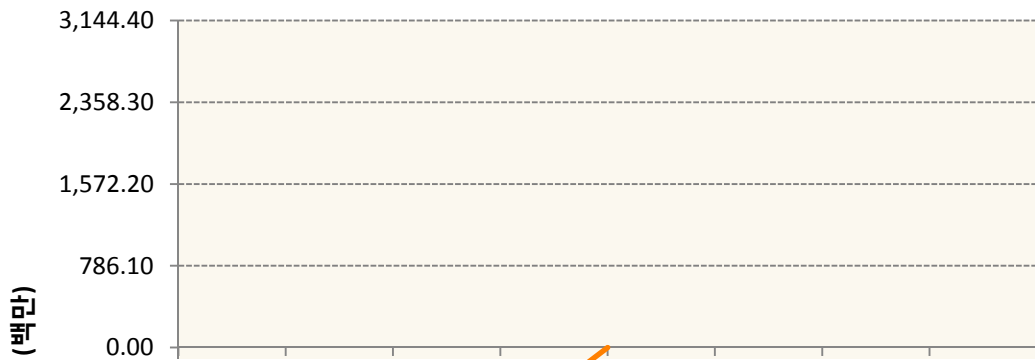


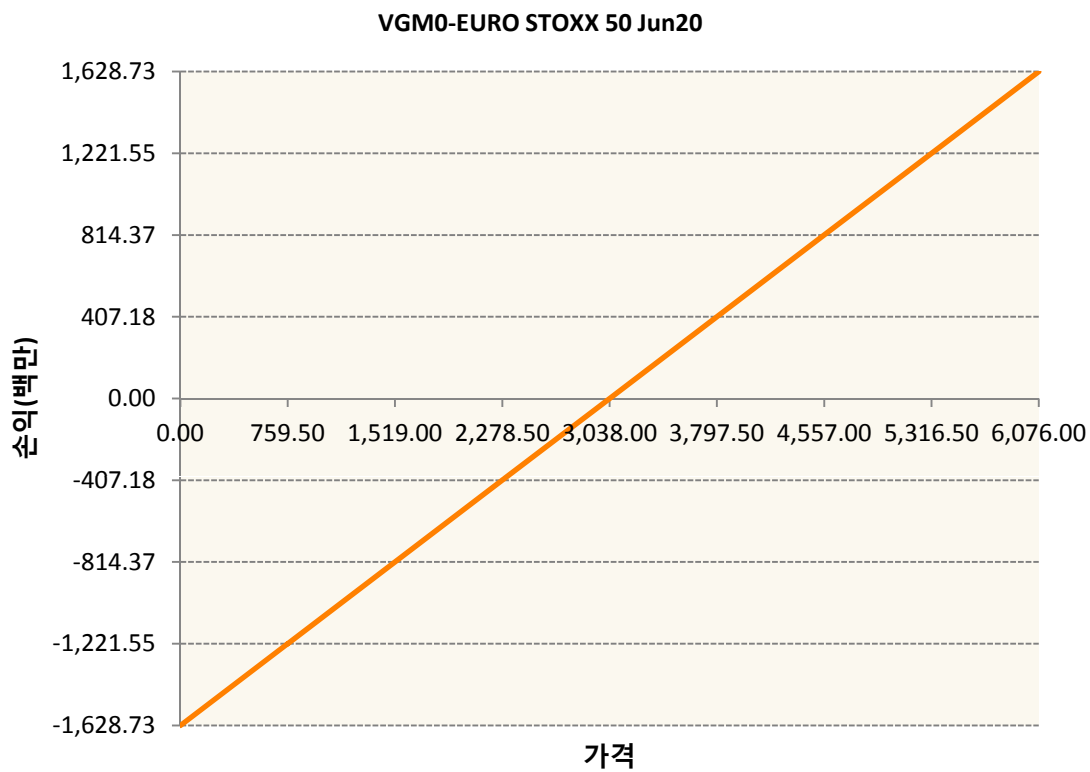
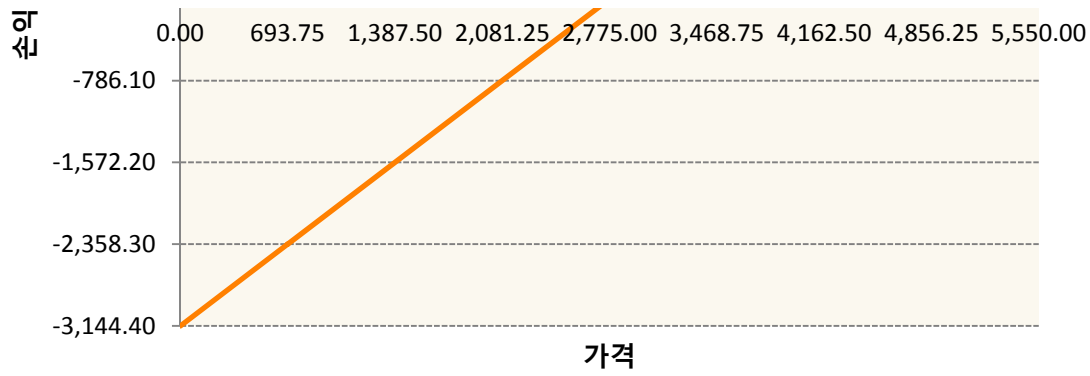


OESXM0-P2750-EURO STOXX 50



OESXM0-P2775-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		20
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E		221
FX21020K02 KRW/EUR 26-06-20E		15
OESXM0-C2' EURO STOXX 50		48
OESXM0-C2' EURO STOXX 50		252
OESXM0-P2' EURO STOXX 50		48
OESXM0-P2' EURO STOXX 50		252
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20		130

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

(단위:백만원)

1,128

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

(단위:백만원)

1,202

공시일	2020-05-29
기준일	2020-05-28

ETF스마트레버리지목표전환형9호

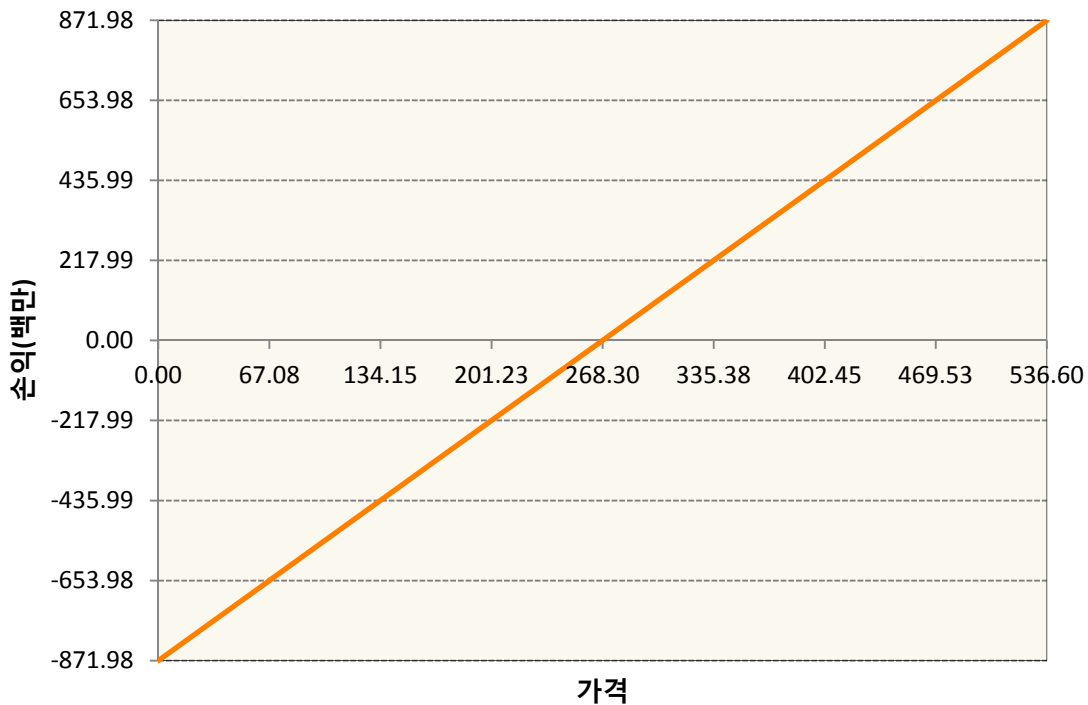
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	872	0	872	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%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47	
-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%	47	47	47	47	47	47	47	
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	2020-05-29
기준일	2020-05-28

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

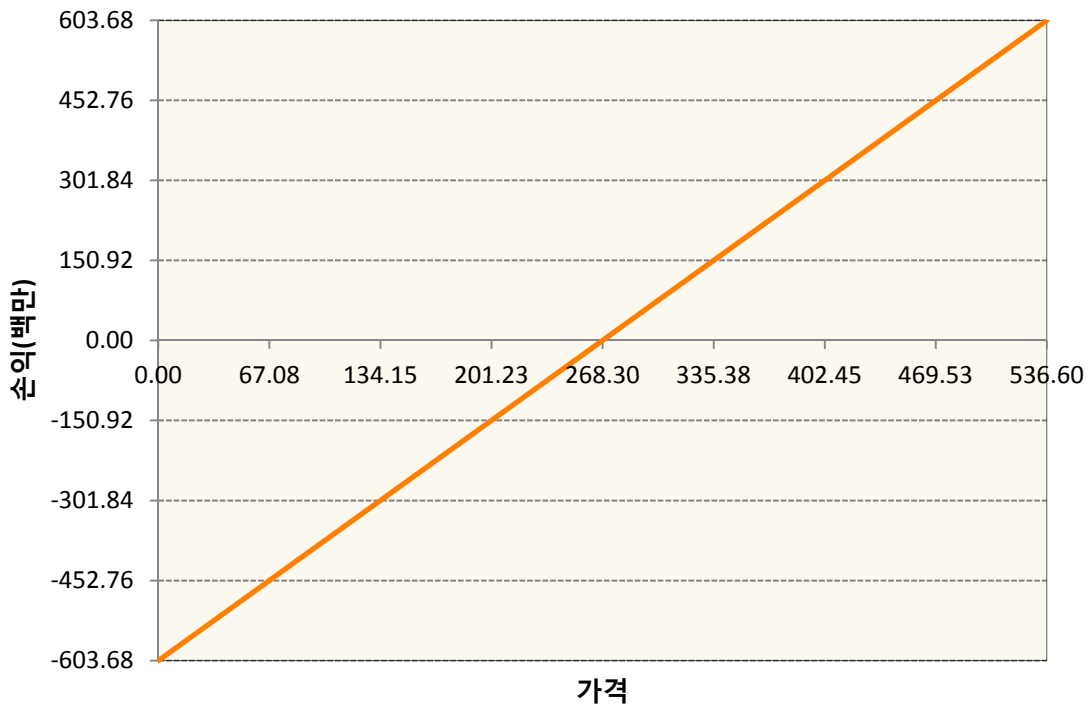
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	604	0	604	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	2020-05-29
기준일	2020-05-28

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

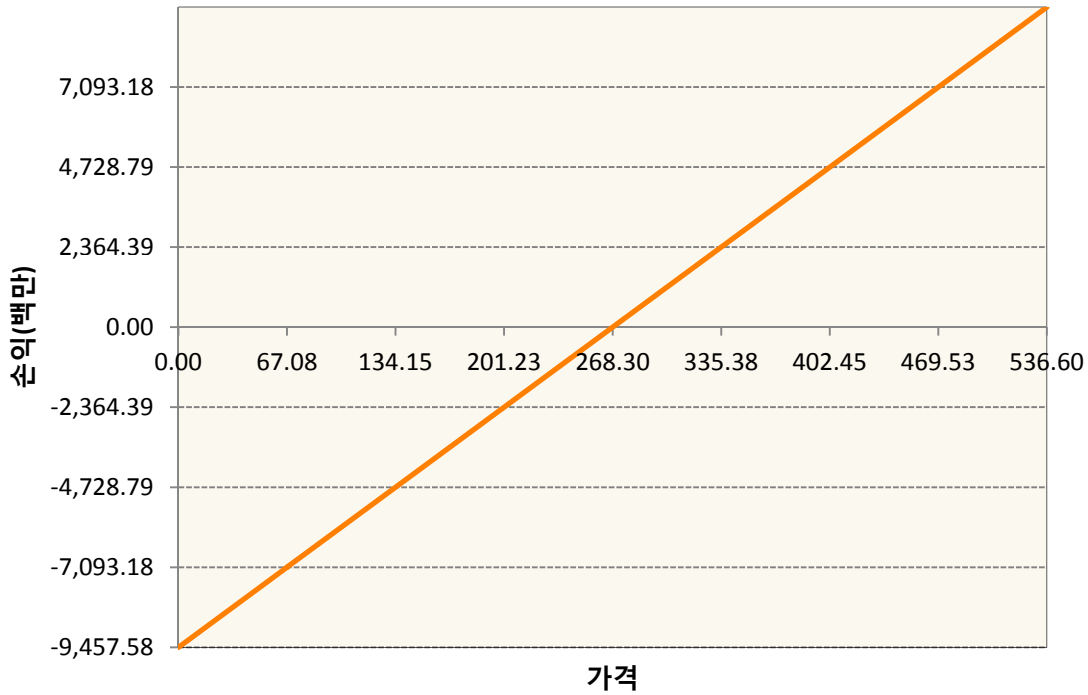
1. 계약금액

(단위:백만원)

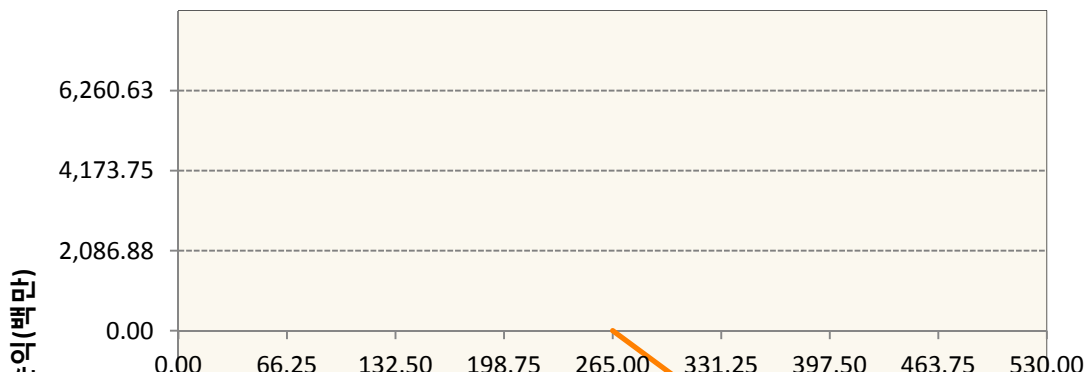
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,458	0	9,458	장내
누계	유가증권	옵션	2,917	17,911	-14,994	장내

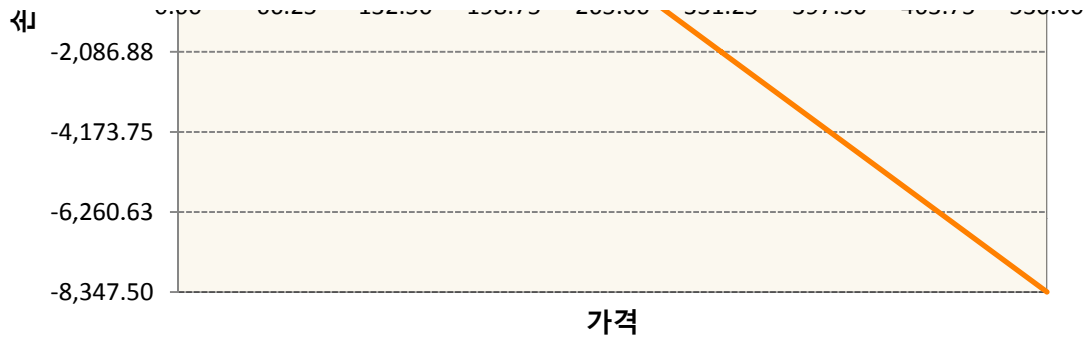
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

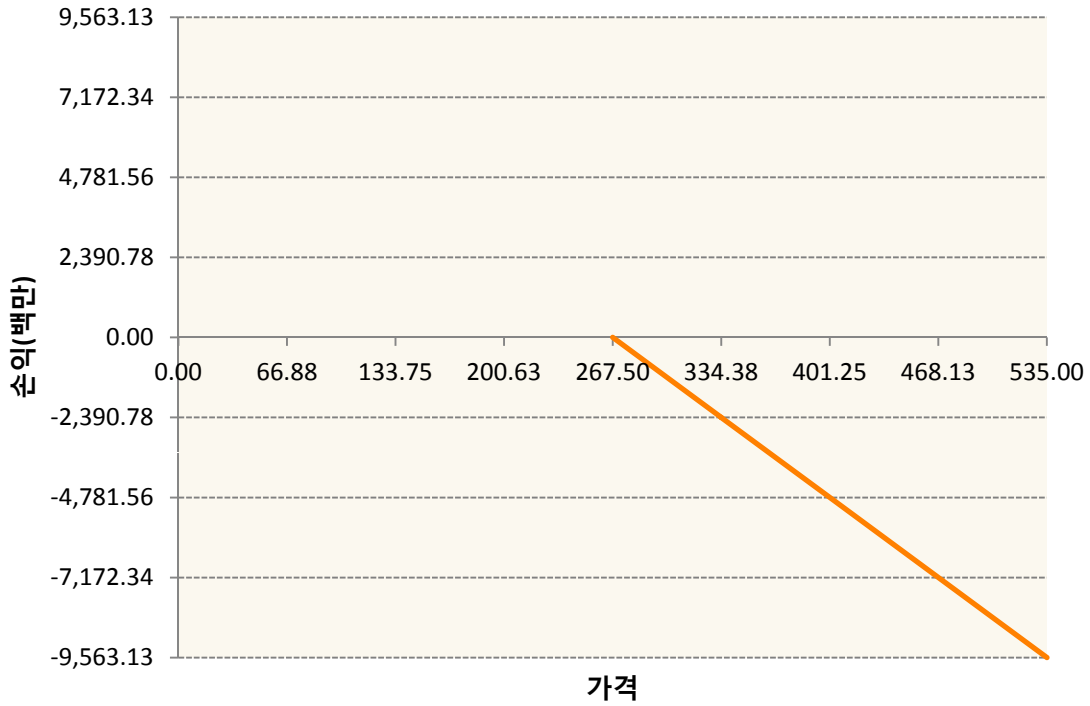


KR4201Q62659-2020-06 콜265

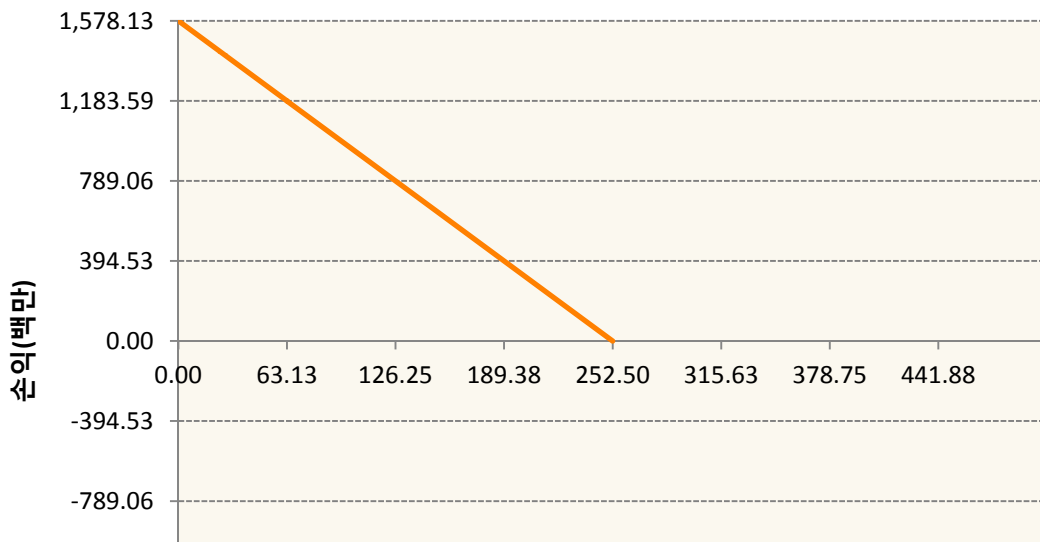


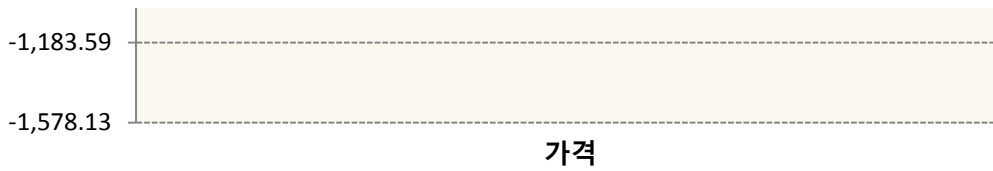


KR4201Q62675-2020-06 콜267.5

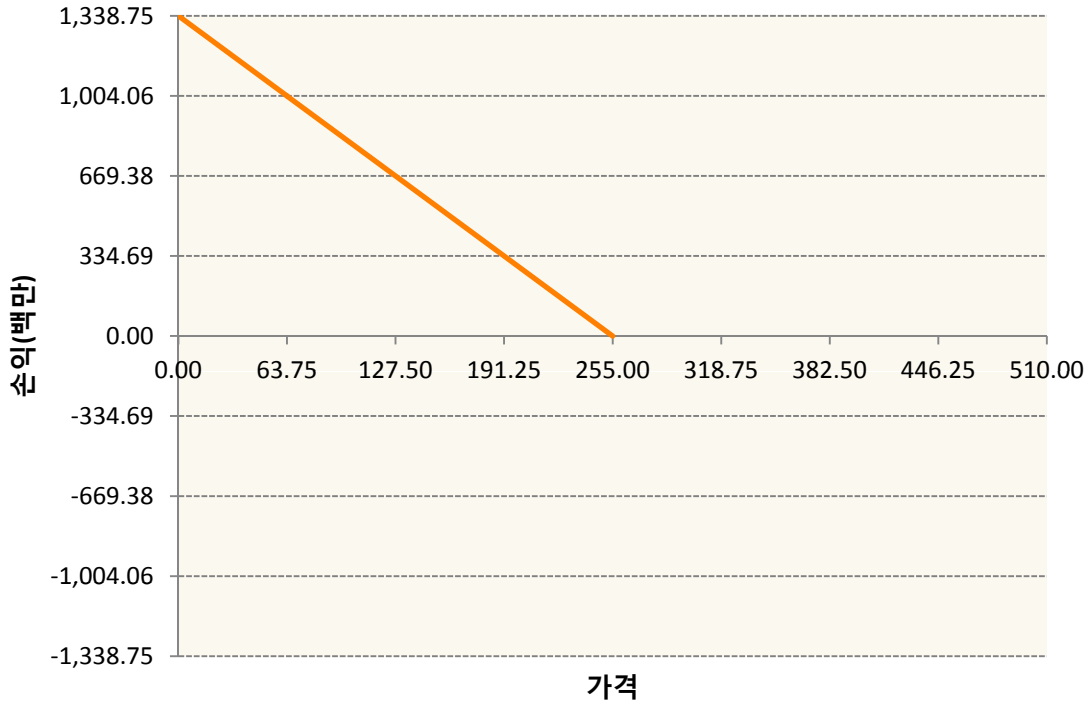


KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





KR4301Q62558-2020-06 풋255



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물					757
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-757	-757	-757	-757	-757	-757	-757
-5.33%	-504	-504	-504	-504	-504	-504	-504
-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%	504	504	504	504	504	504	504
8.00%	757	757	757	757	757	757	757
KR4201Q62659		2020-06 콜265					542
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	302	289	275	260	243	226	209
-5.33%	258	240	220	200	180	159	138
-2.67%	183	160	137	114	92	69	46

0%	70	47	23	0	-23	-47	-70
2.67%	-80	-100	-121	-142	-164	-186	-208
5.33%	-259	-274	-291	-309	-327	-347	-366
8.00%	-459	-469	-481	-495	-509	-525	-542
KR4201Q62675 2020-06 콜267.5							592
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	306	294	279	264	247	229	210
-5.33%	266	247	227	206	184	161	138
-2.67%	194	169	144	119	93	68	42
0%	81	54	27	0	-27	-54	-81
2.67%	-75	-100	-125	-150	-176	-202	-228
5.33%	-267	-287	-308	-330	-353	-376	-400
8.00%	-487	-501	-516	-534	-552	-572	-592
KR4301Q62525 2020-06 풋252.5							55
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	41	44	46	48	51	53	55
-5.33%	15	18	21	23	26	29	31
-2.67%	2	4	6	8	10	12	15
0%	-3	-2	-1	0	1	3	5
2.67%	-4	-4	-4	-3	-3	-2	-1
5.33%	-5	-5	-5	-4	-4	-4	-3
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-4	-4
KR4301Q62558 2020-06 풋255							54
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	43	45	46	48	50	52	54
-5.33%	18	20	22	24	27	29	31
-2.67%	3	5	7	9	11	13	15
0%	-4	-3	-1	0	1	3	5
2.67%	-5	-5	-5	-4	-3	-2	-1
5.33%	-6	-6	-6	-5	-5	-4	-4
8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-5	-5

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

(단위:백만원)

2,223

공시일	2020-05-29
기준일	2020-05-28

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	156,539	0	156,539	

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	2020-05-29
기준일	2020-05-28

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	105,543	0	105,543	

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	2020-05-29
기준일	2020-05-28

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	466,283	0	466,283	
누계	통화	선도	0	439,562	-439,562	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,471
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	7,041
FX21020J00 KRW/USD 10-06-20E	2,975
FX21020J02 KRW/USD 10-06-20E	1,349
FX21020J02 KRW/USD 22-06-20E	1,527
FX21020J02 KRW/USD 22-06-20E	1,983
FX21020J03 KRW/USD 24-07-20E	2,231
FX21020J04 KRW/USD 24-07-20E	1,785
FX21020J04 KRW/USD 24-07-20E	1,983
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	2,063
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	1,964
FX21020K01 KRW/USD 22-06-20E	694
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	2,420
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	992
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,041
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,646

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

17,885

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

(단위:백만원)

207

공시일	2020-05-29
기준일	2020-05-28

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	7,686	0	7,686	
누계	통화	선도	0	10,586	-10,586	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J04 KRW/USD 29-05-20E	256
FX21020K01 KRW/USD 15-06-20E	324
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)

431

공시일	2020-05-29
기준일	2020-05-28

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

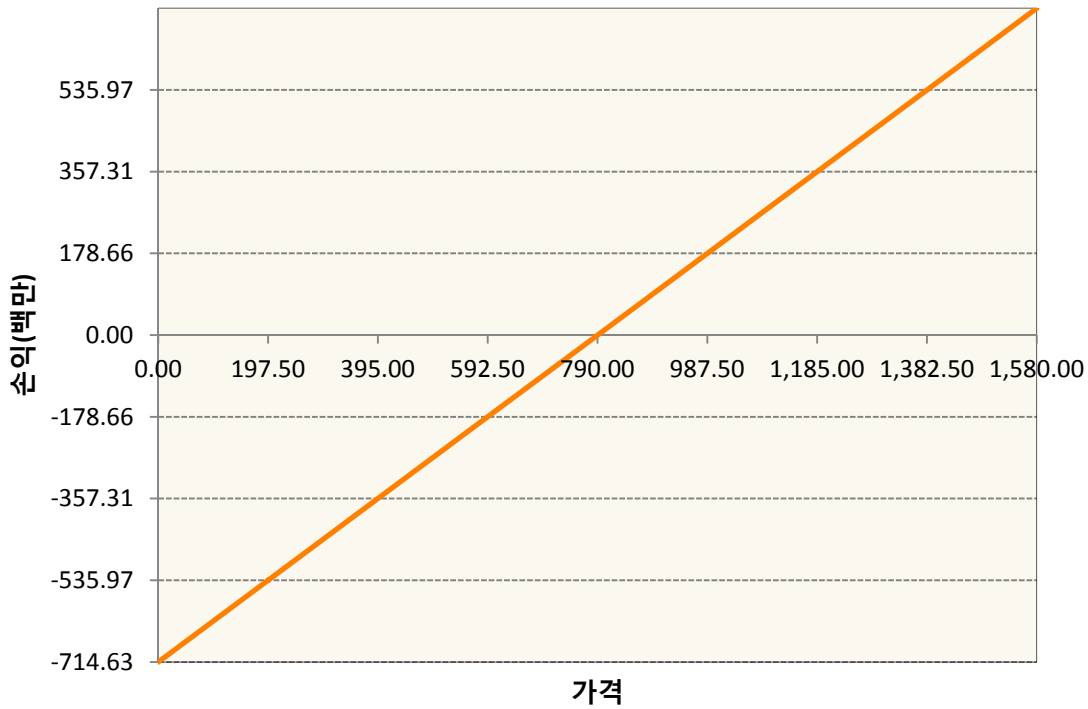
1. 계약금액

(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	715	0	715	
누계	유가증권	스왑	990	0	990	장외
누계	통화	선도	210	893	-683	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)

174

공시일	2020-05-29
기준일	2020-05-28

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

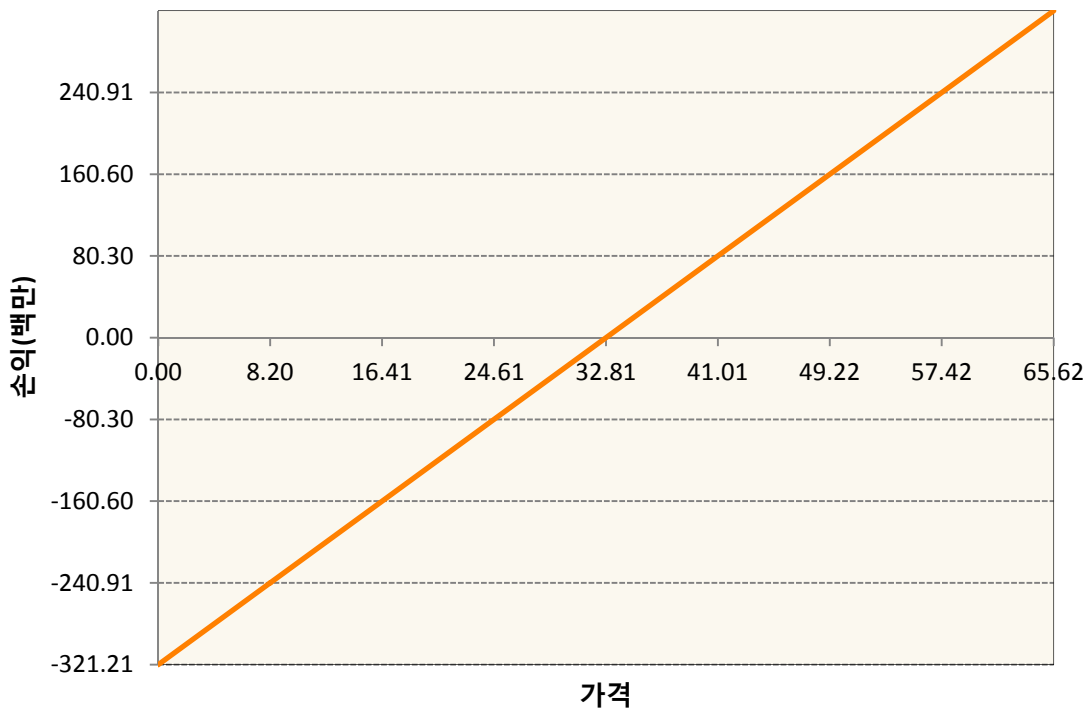
1. 계약금액

(단위:백만원)

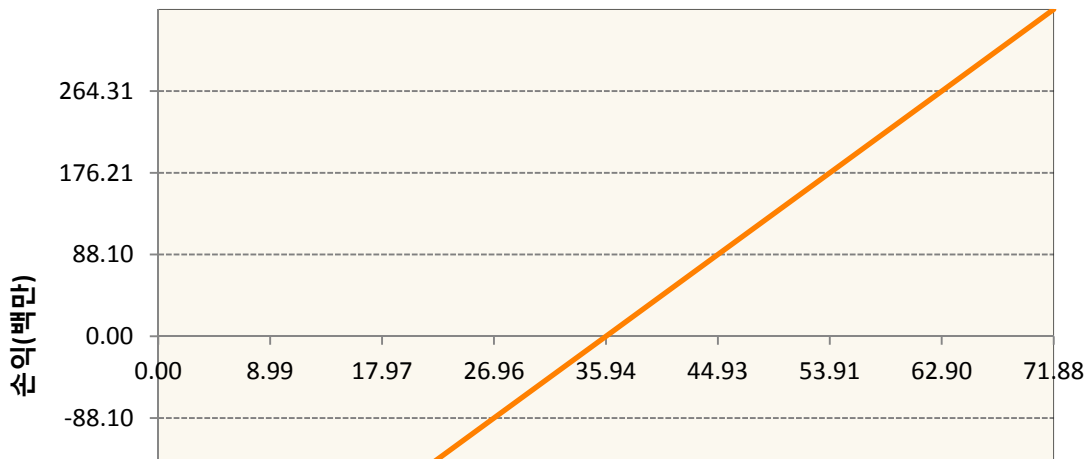
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,693	310	1,383	

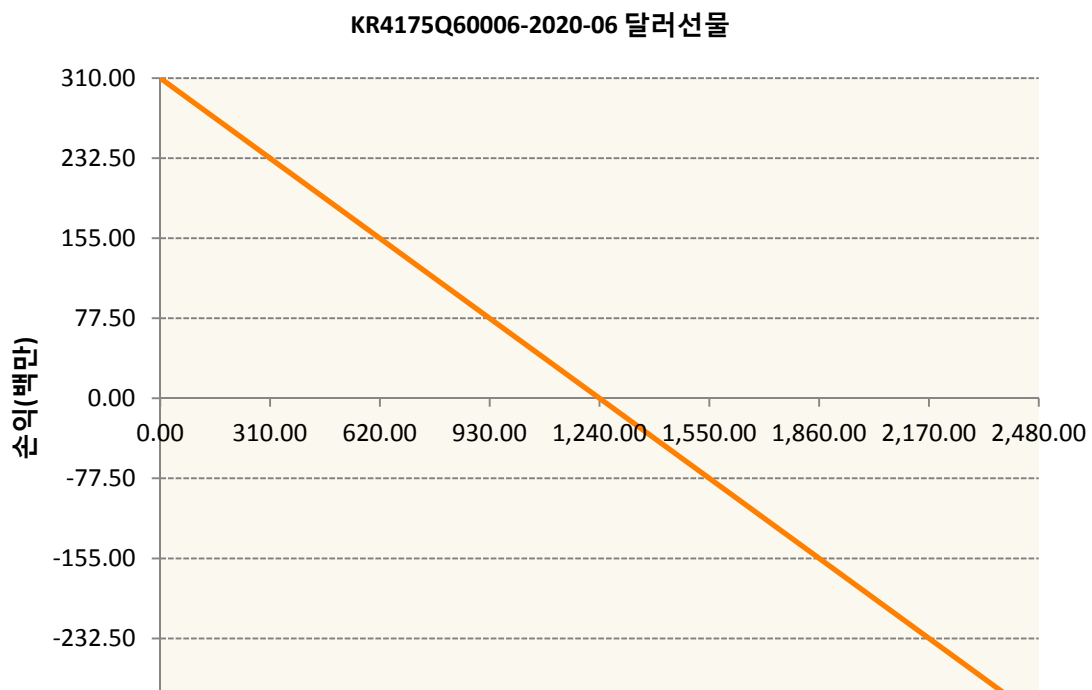
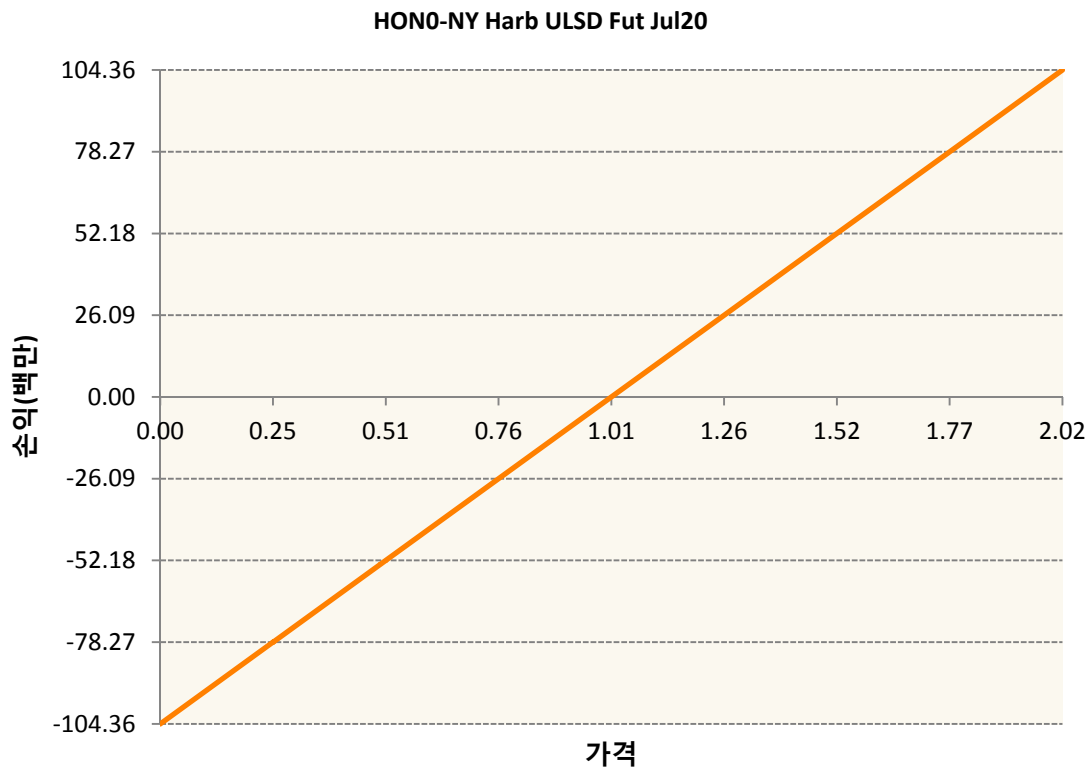
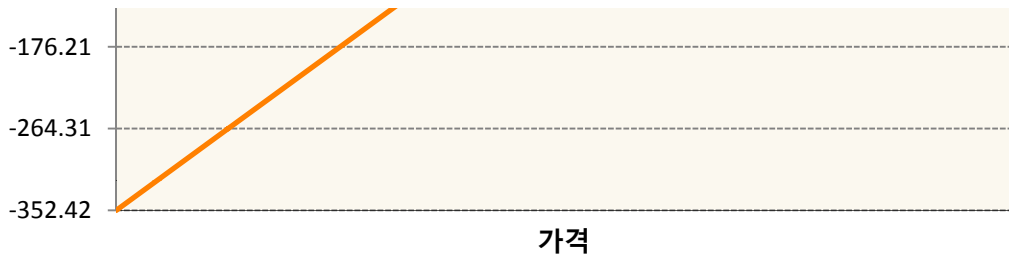
2. 만기시점의 손익구조

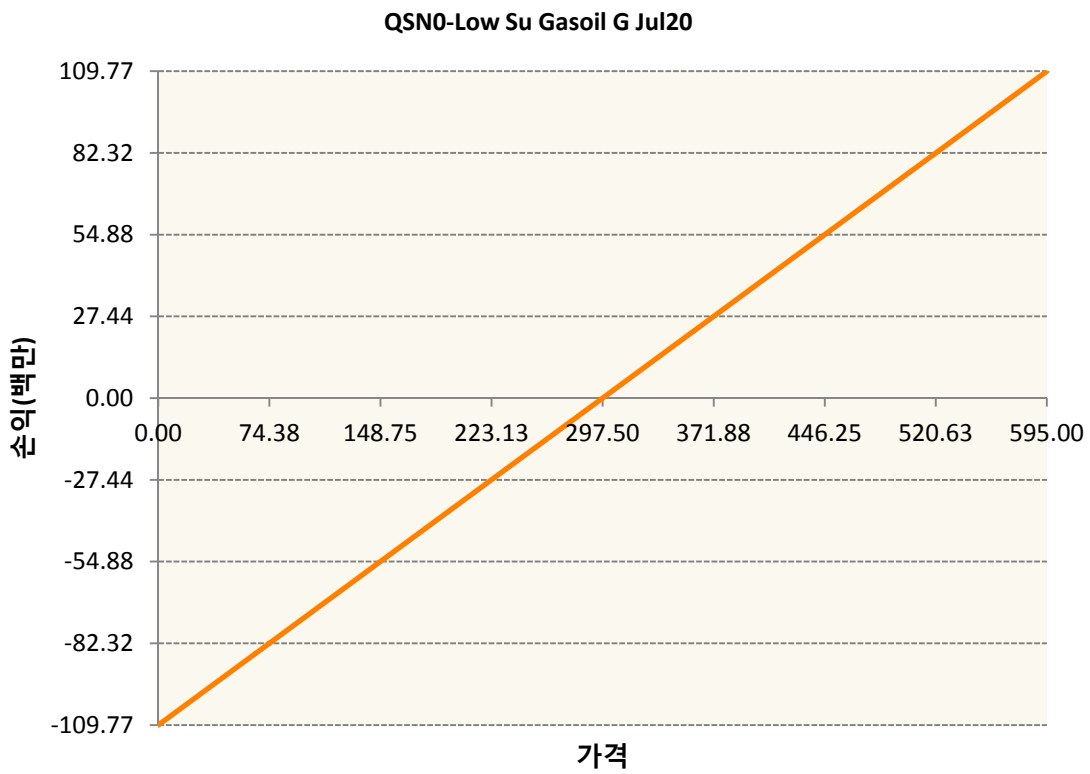
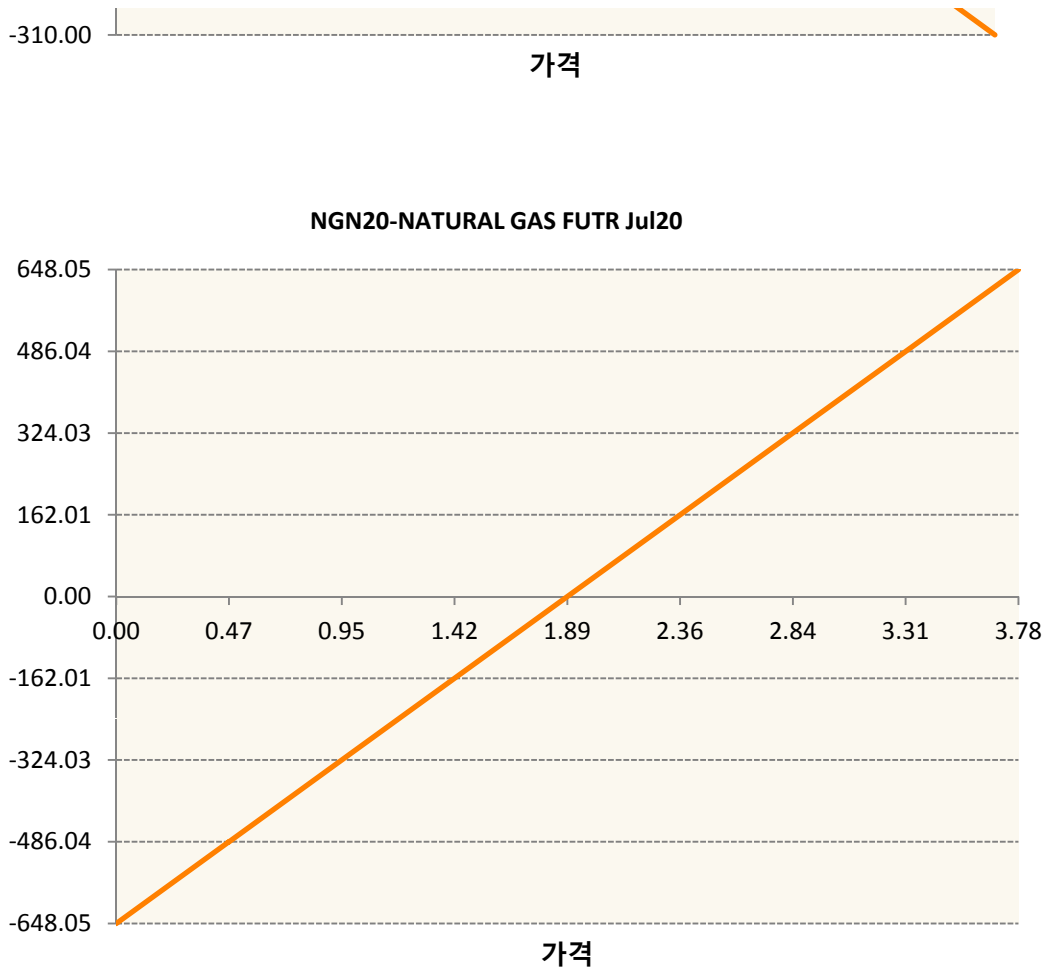
CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20



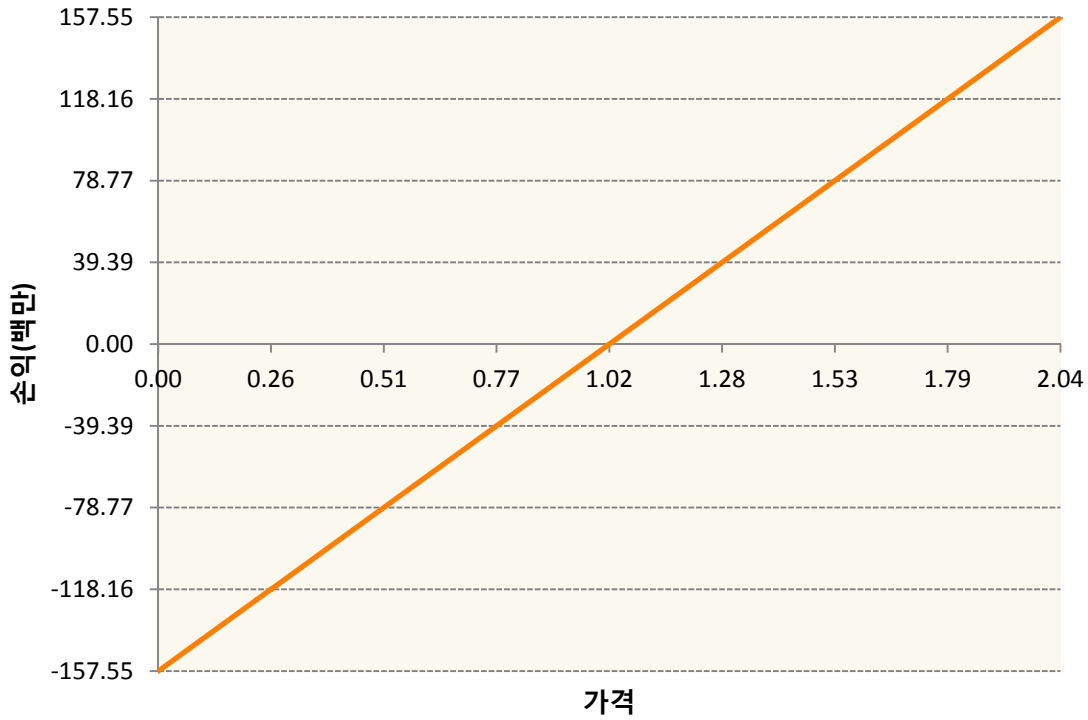
COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20







XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN0	WTI CRUDE FUTURE Jul20	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)

798

공시일	2020-05-29
기준일	2020-05-28

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

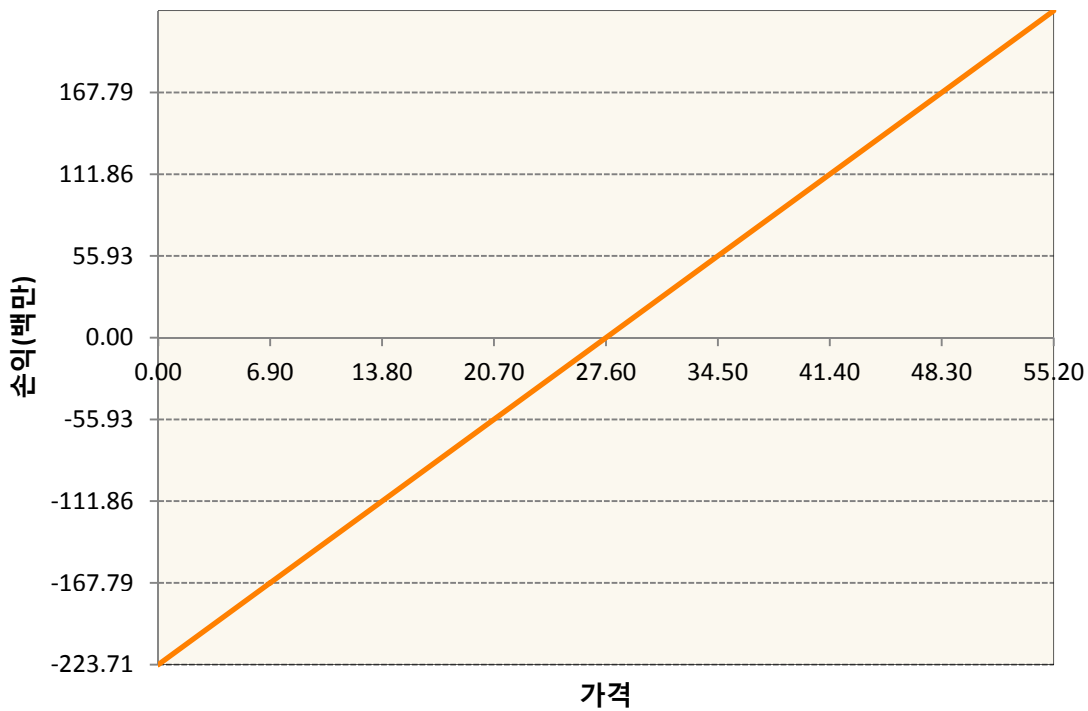
1. 계약금액

(단위:백만원)

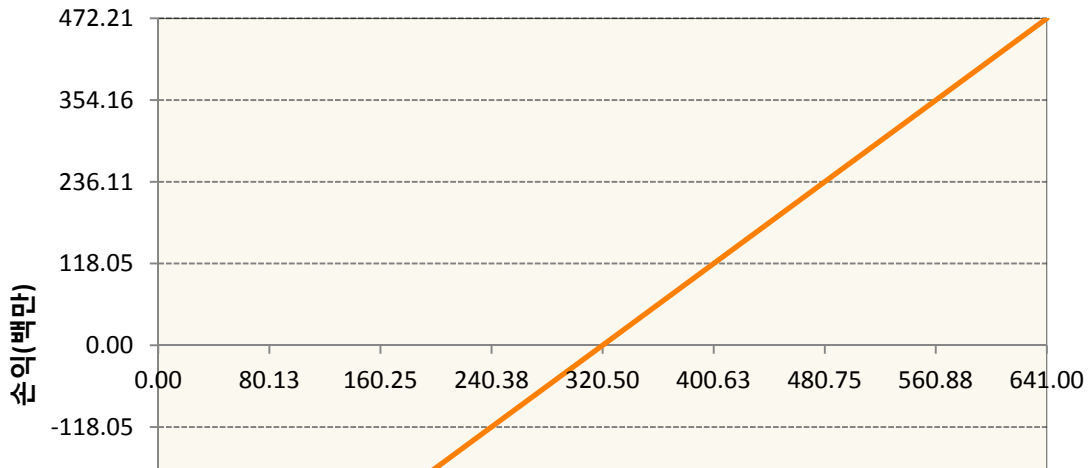
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,425	74	2,350	

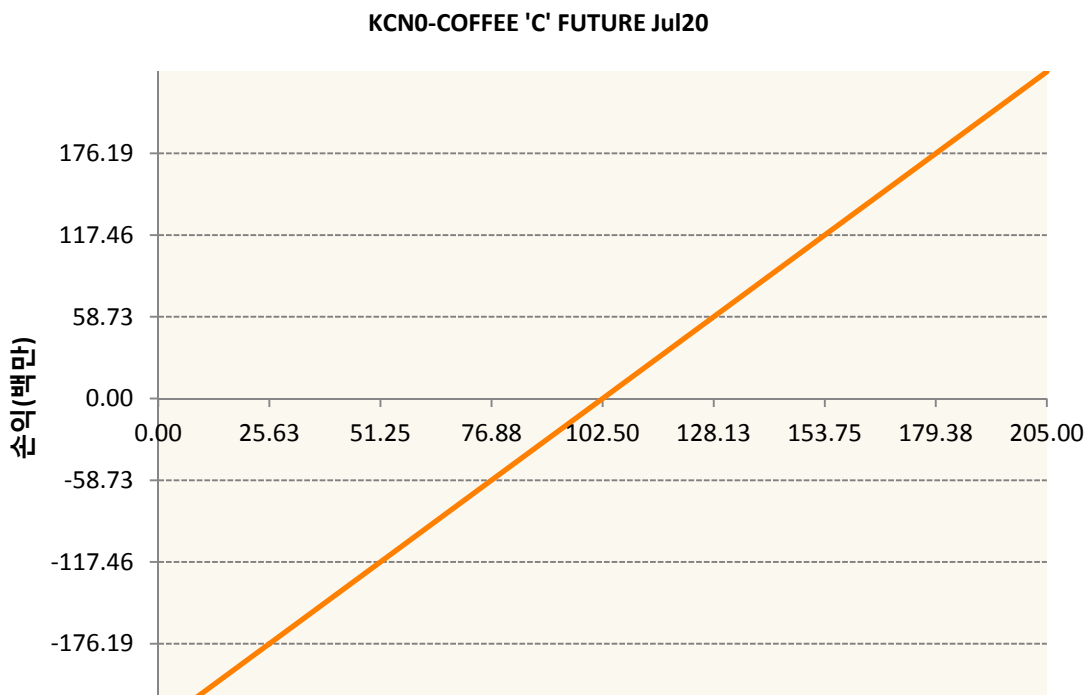
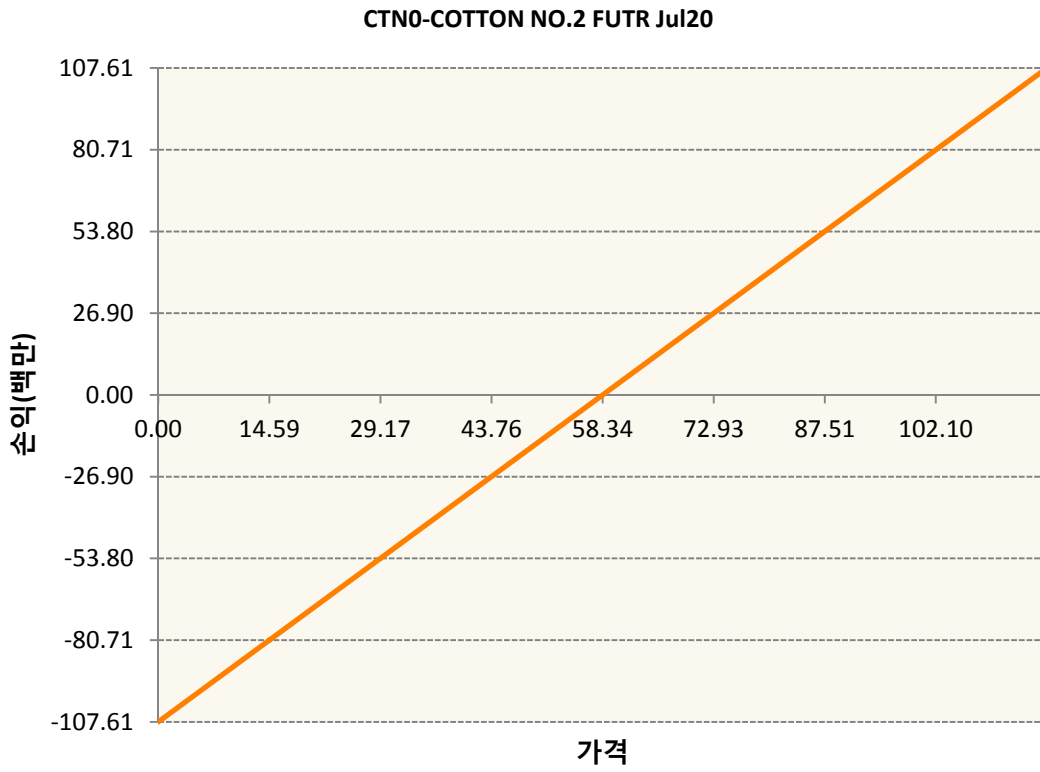
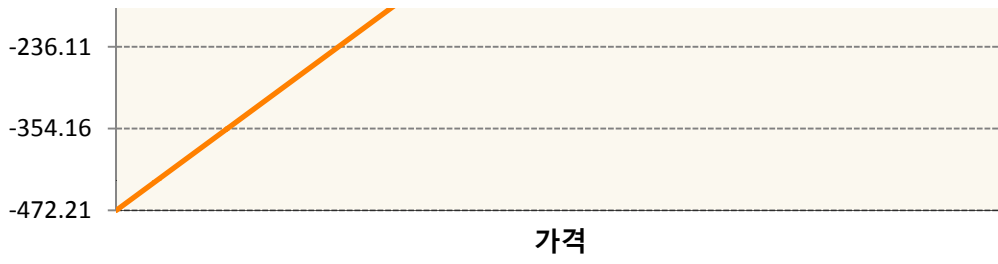
2. 만기시점의 손익구조

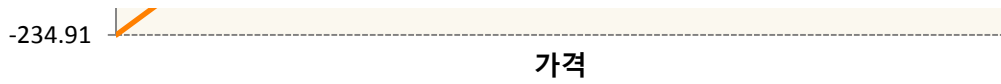
BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20



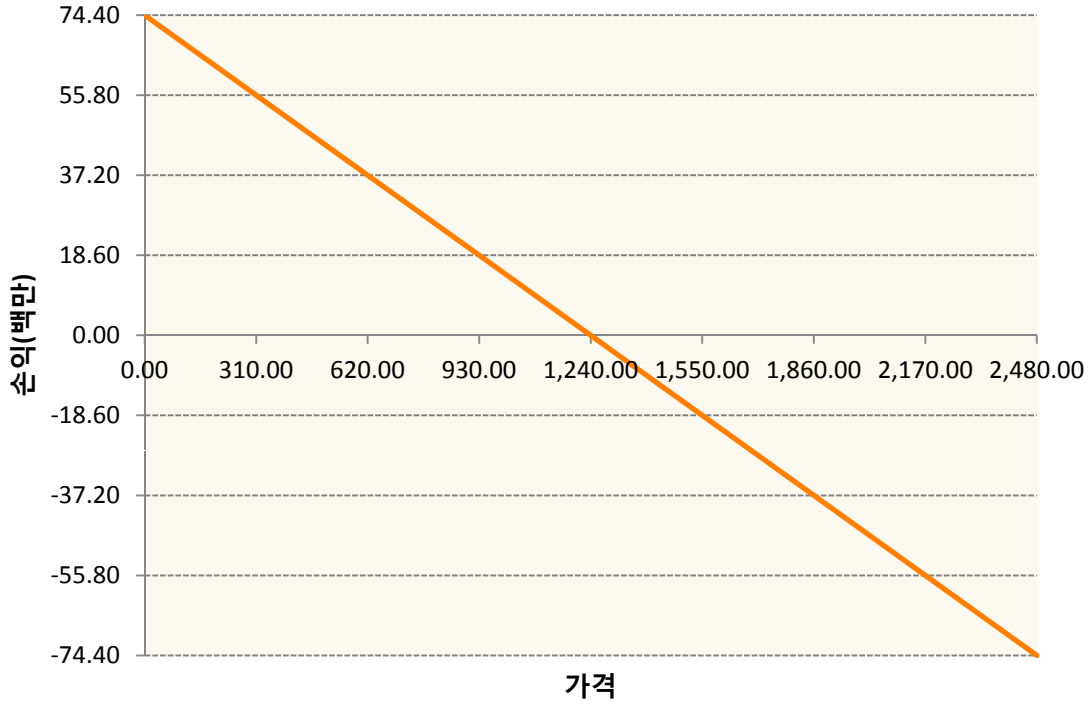
CNO-CORN FUTURE Jul20



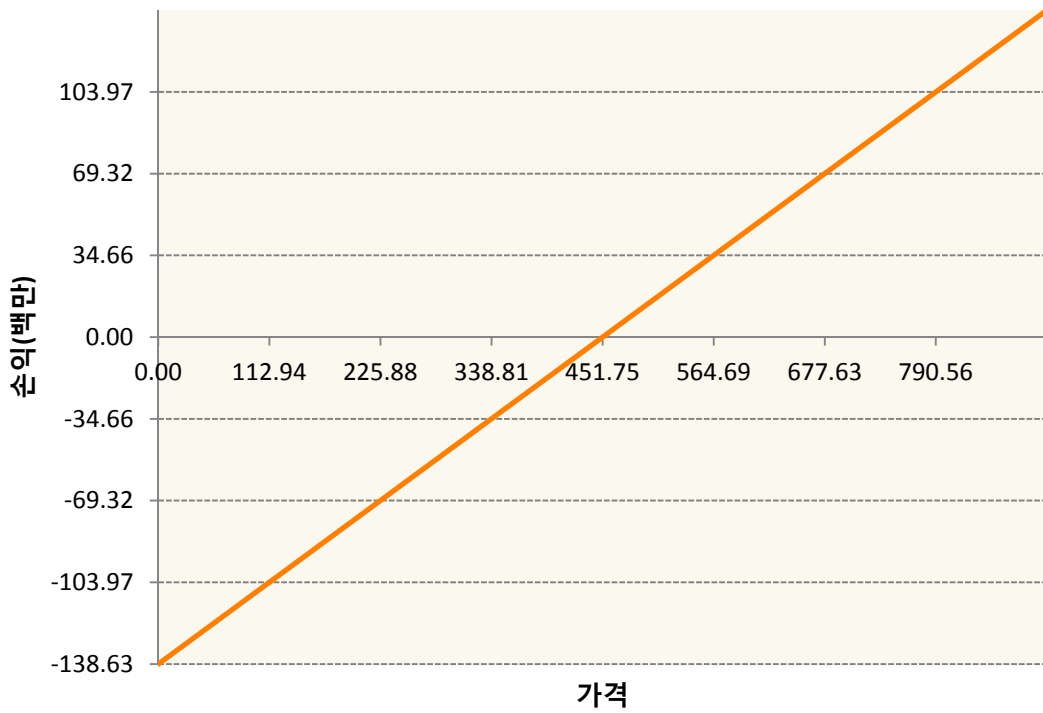




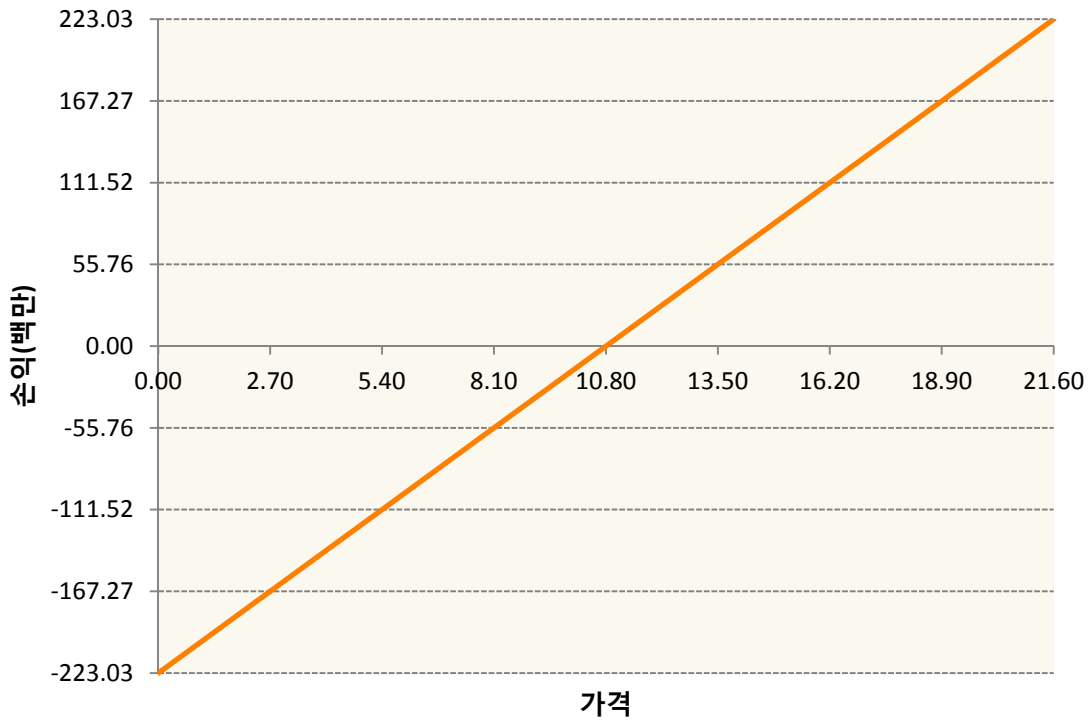
KR4175Q60006-2020-06 달러선물



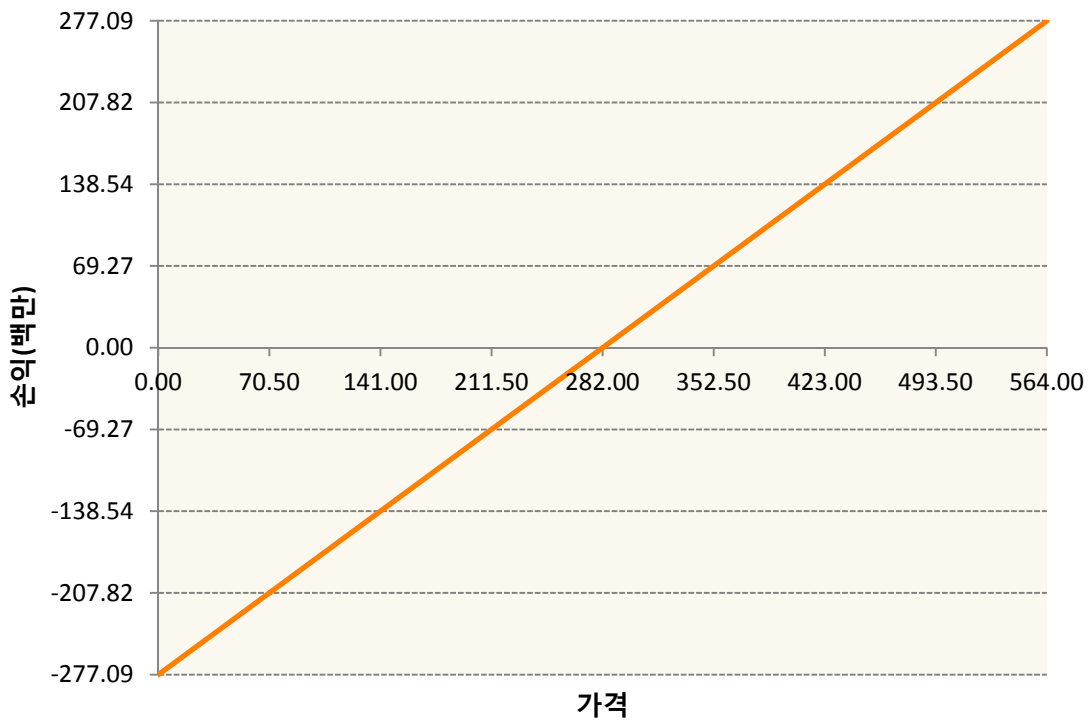
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



SBN0-Sugar Jul20

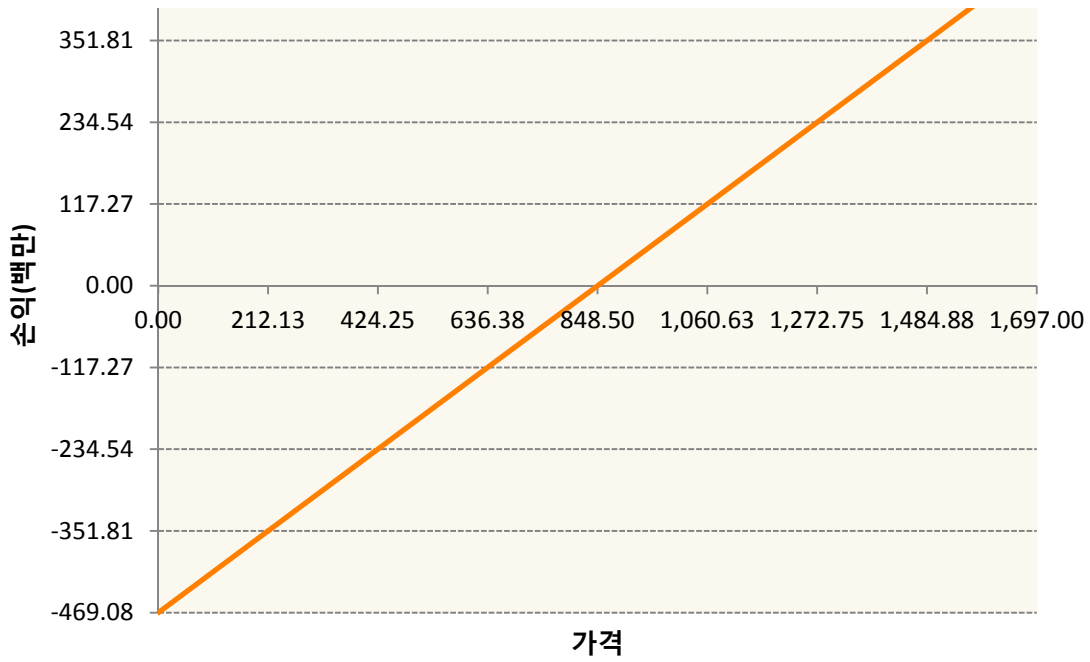


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20

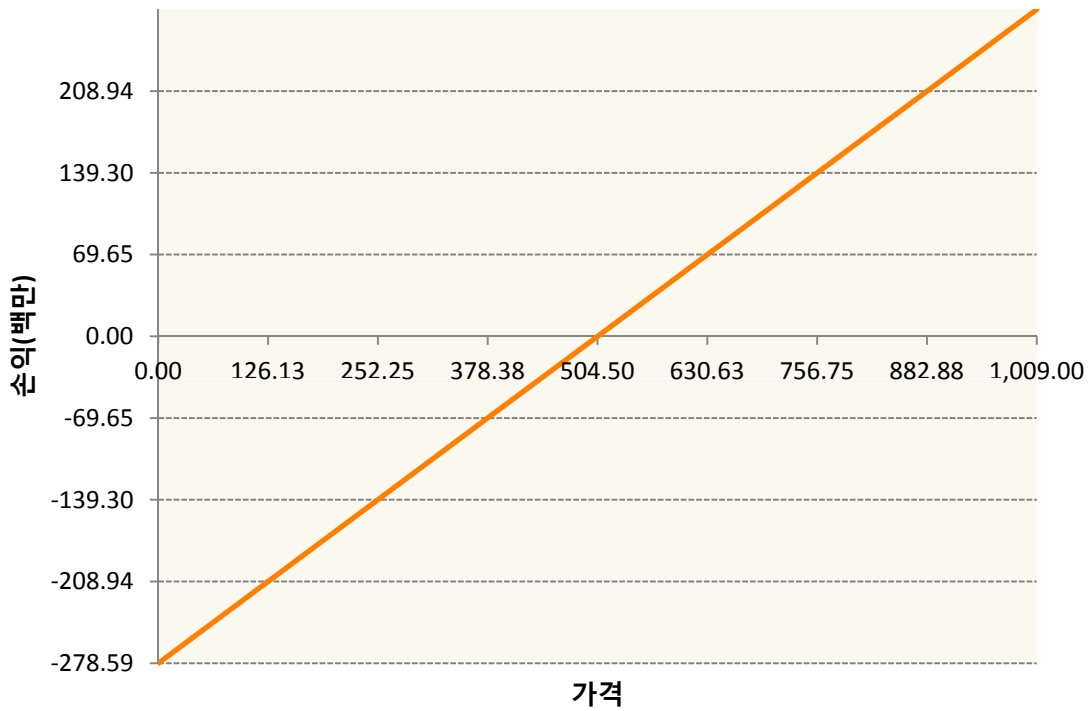


SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





WN0-WHEAT FUTURE(CBT) 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	38
WNO	WHEAT FUTURE(CBT) Jul20	22

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

(단위:백만원)

229