

공시일	2020-06-01
기준일	2020-05-29

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	2020-06-01
기준일	2020-05-29

스마트인덱스모

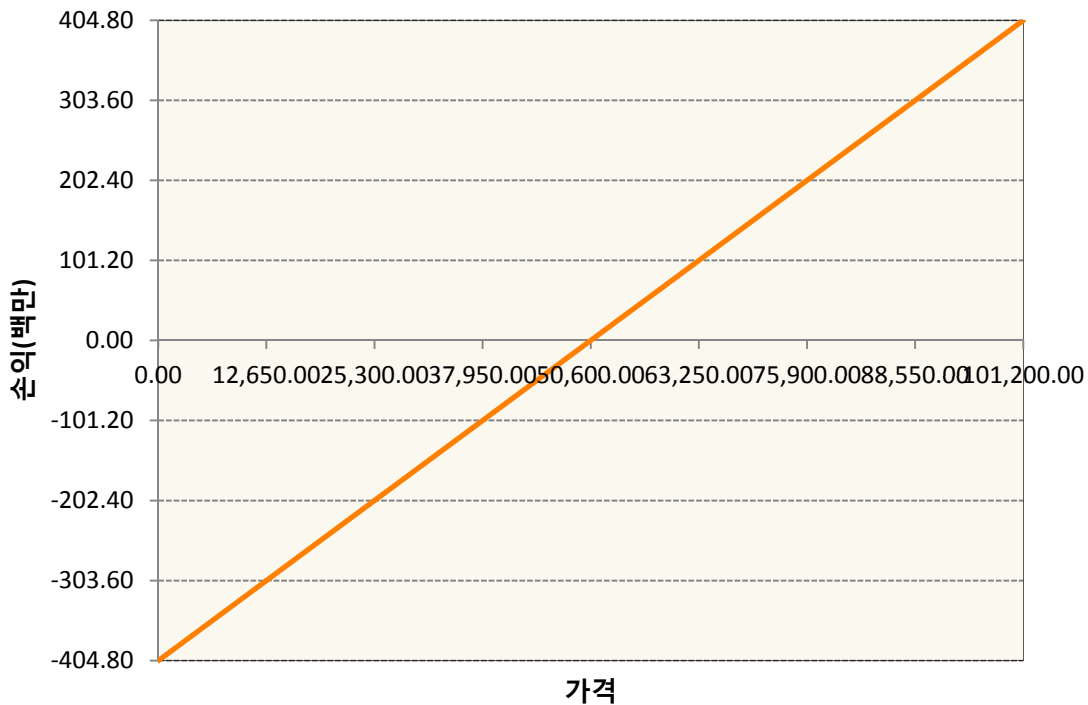
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

KR4111Q60001-2020-06 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111Q60001		2020-06 삼성전자개별선물						32
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%		-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
-5.33%		-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
-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%		22	22	22	22	22	22	22
8.00%		32	32	32	32	32	32	32

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

(단위:백만원)

49

공시일	2020-06-01
기준일	2020-05-29

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

1,037

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,215

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-06-01
기준일	2020-05-29

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

559

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

822

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-06-01
기준일	2020-05-29

유로인덱스모(주식-파생형)

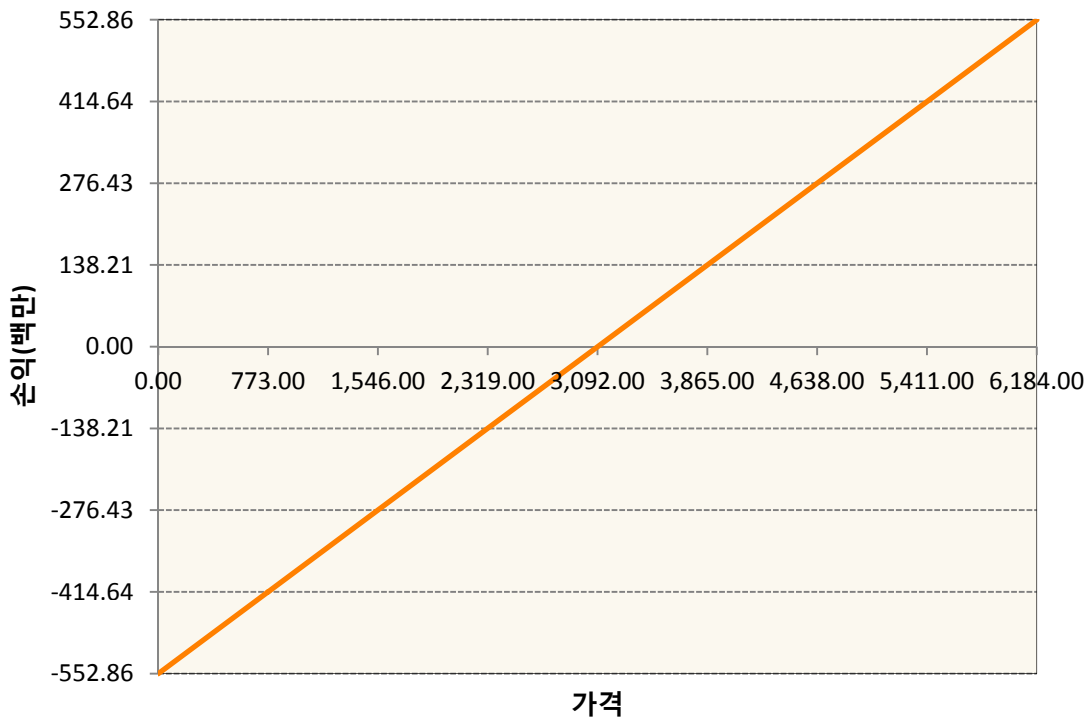
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	553	0	553	

2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	44
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

57

공시일	2020-06-01
기준일	2020-05-29

차이나인덱스모(주식-파생형)

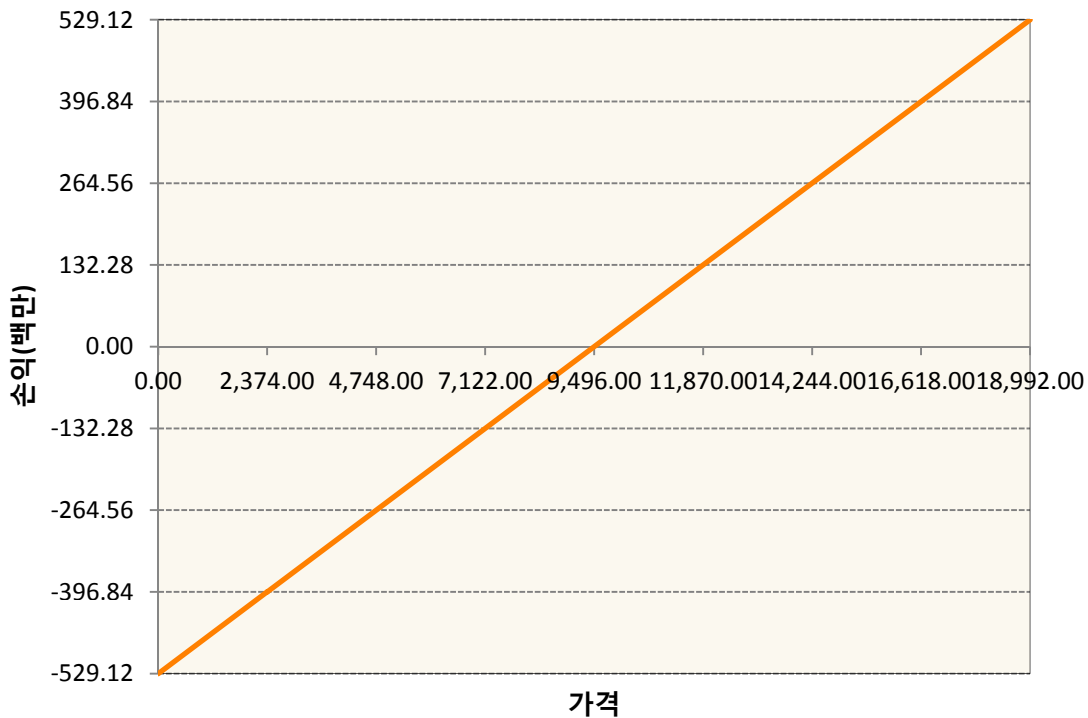
1. 계약금액

(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	2020-06-01
기준일	2020-05-29

커버드콜모(주식혼합-파생형)

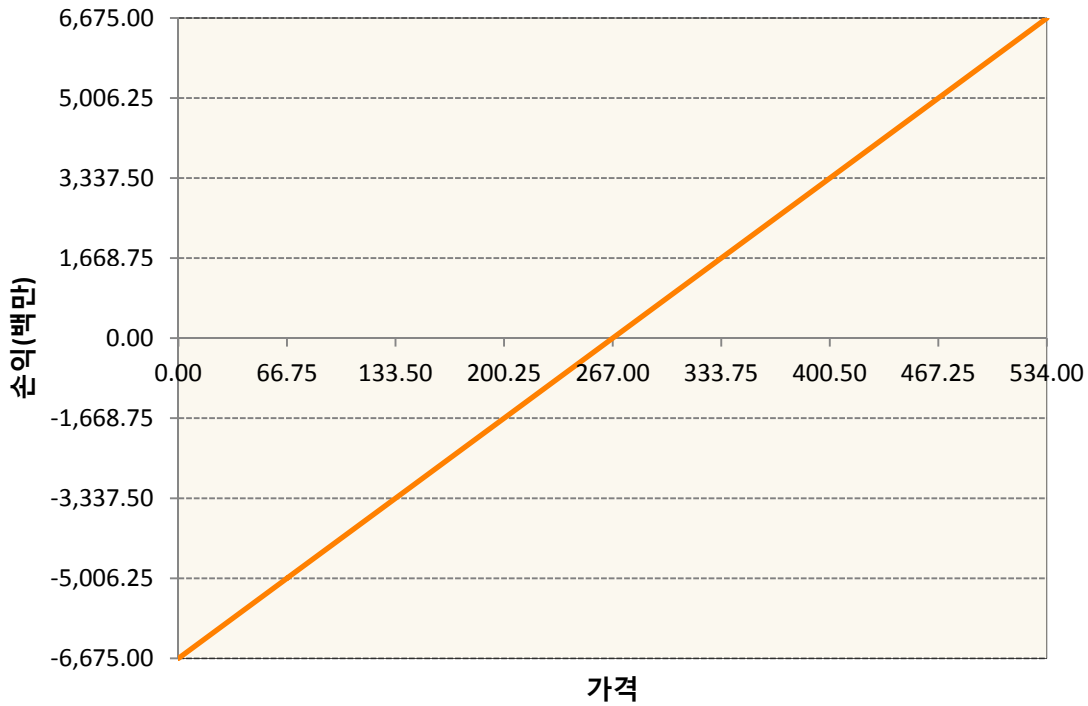
1. 계약금액

(단위:백만원)

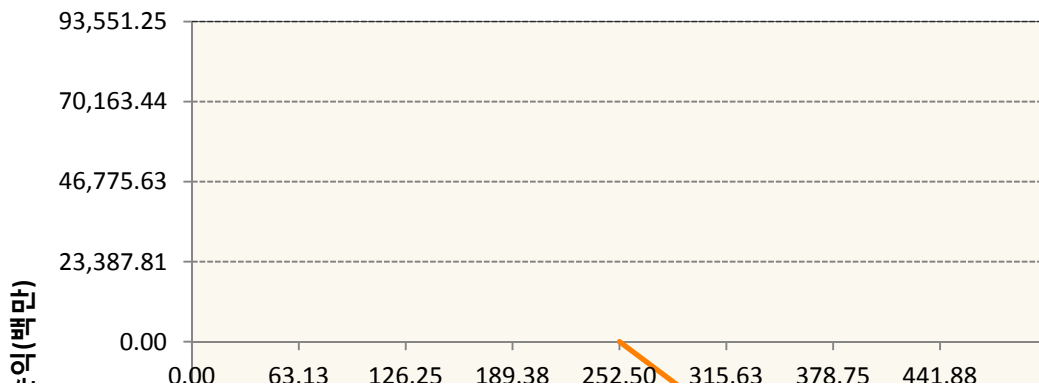
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	6,113	0	6,113	장내
누계	유가증권	선물	6,675	0	6,675	장내
누계	유가증권	옵션	0	357,881	-357,881	장내

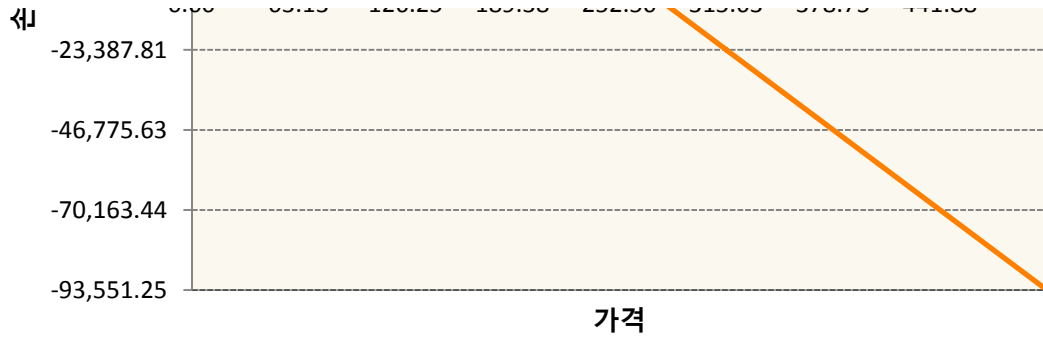
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

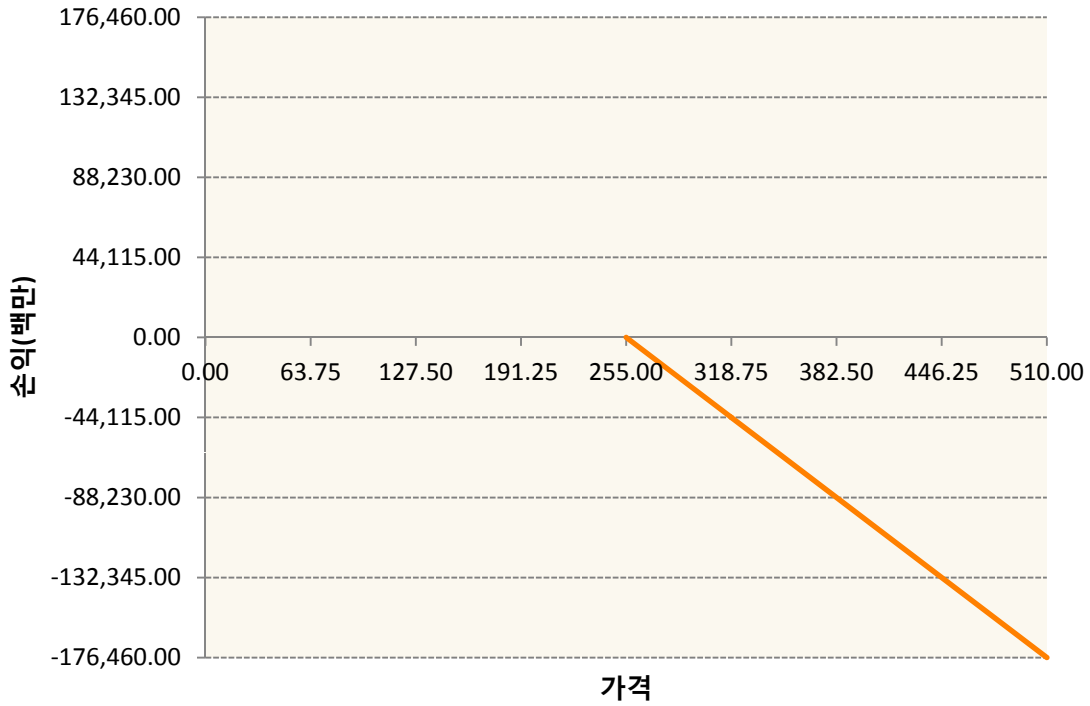


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

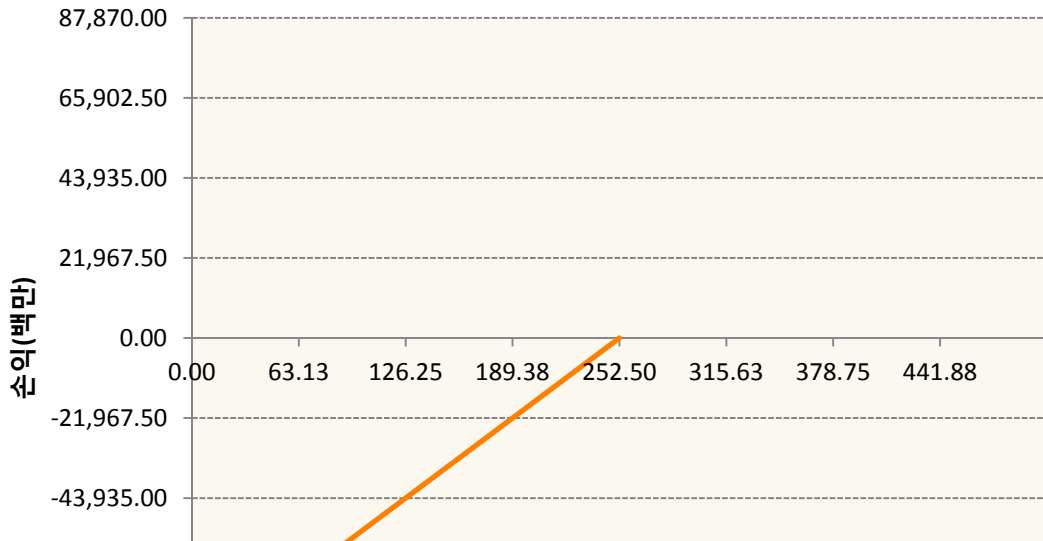


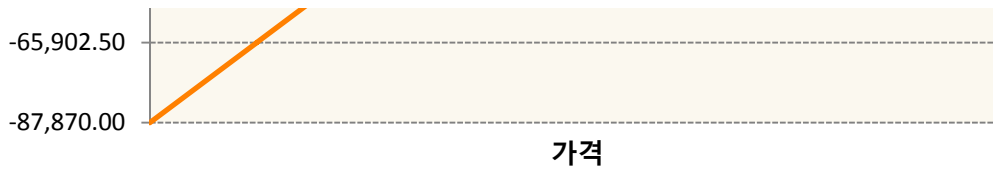


KR4201Q62550-2020-06 콜255



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						7,316
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5,508	5,273	5,036	4,797	4,557	4,315	4,072	
-5.33%	4,304	4,051	3,798	3,545	3,292	3,039	2,786	
-2.67%	2,623	2,398	2,167	1,932	1,694	1,454	1,211	
0%	544	376	194	0	-203	-412	-628	
2.67%	-1,811	-1,918	-2,045	-2,187	-2,344	-2,513	-2,693	
5.33%	-4,328	-4,387	-4,464	-4,559	-4,671	-4,797	-4,937	
8.00%	-6,924	-6,952	-6,995	-7,053	-7,126	-7,214	-7,316	
KR4201Q62550		2020-06 콜255						13,396
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	9,549	9,138	8,717	8,288	7,854	7,414	6,971	
-5.33%	7,610	7,135	6,660	6,185	5,710	5,234	4,759	
-2.67%	4,776	4,324	3,867	3,405	2,940	2,473	2,004	
0%	1,139	778	397	0	-410	-831	-1,259	
2.67%	-3,096	-3,340	-3,618	-3,924	-4,253	-4,602	-4,968	
5.33%	-7,703	-7,846	-8,025	-8,237	-8,480	-8,749	-9,041	
8.00%	-12,508	-12,580	-12,683	-12,818	-12,982	-13,176	-13,396	
KR4301Q62525		2020-06 풋252.5						3,067
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,297	-2,418	-2,543	-2,671	-2,801	-2,933	-3,067	
-5.33%	-843	-988	-1,132	-1,278	-1,423	-1,568	-1,714	
-2.67%	-94	-199	-310	-426	-547	-671	-798	

0%	173	126	68	0	-77	-161	-252
2.67%	238	224	203	173	135	89	34
5.33%	249	246	240	231	215	195	167
8.00%	250	250	249	246	241	233	222

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

(단위:백만원)

23,511

공시일	2020-06-01
기준일	2020-05-29

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

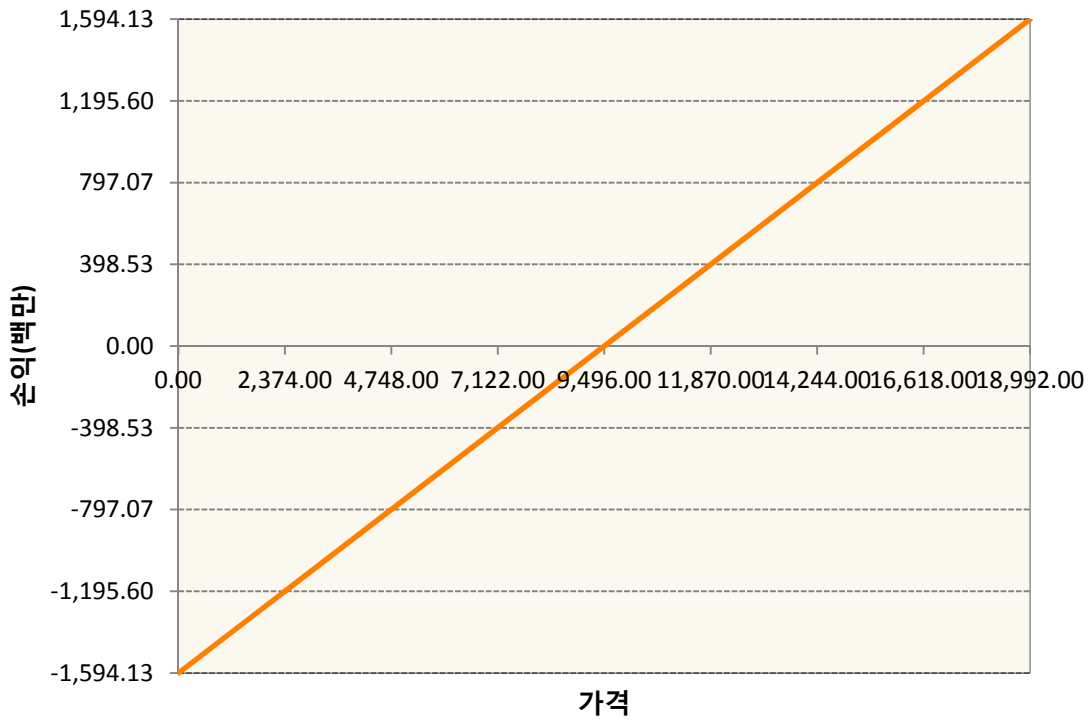
1. 계약금액

(단위:백만원)

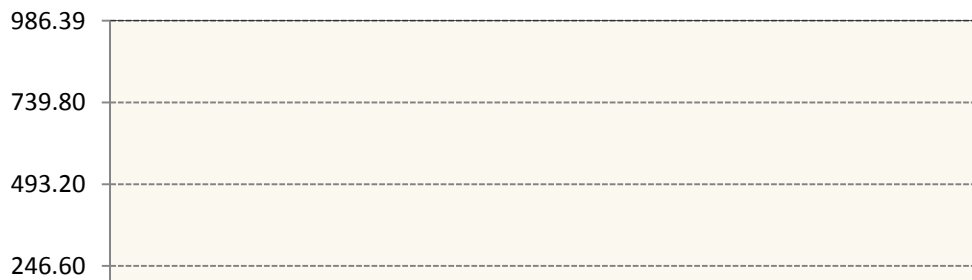
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,594	0	1,594	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,273	-4,273	장내
누계	통화	선도	0	1,546	-1,546	장외

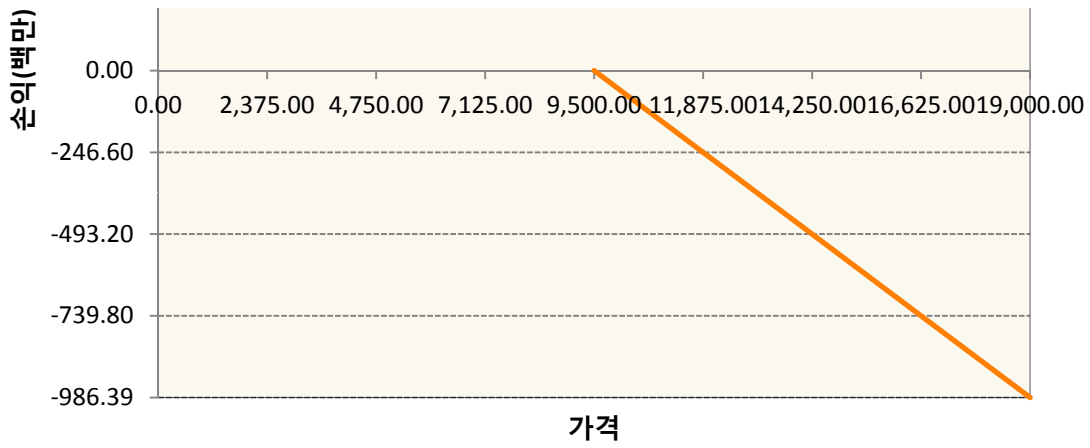
2. 만기시점의 손익구조

HCM0-HSCEI Futures Jun20

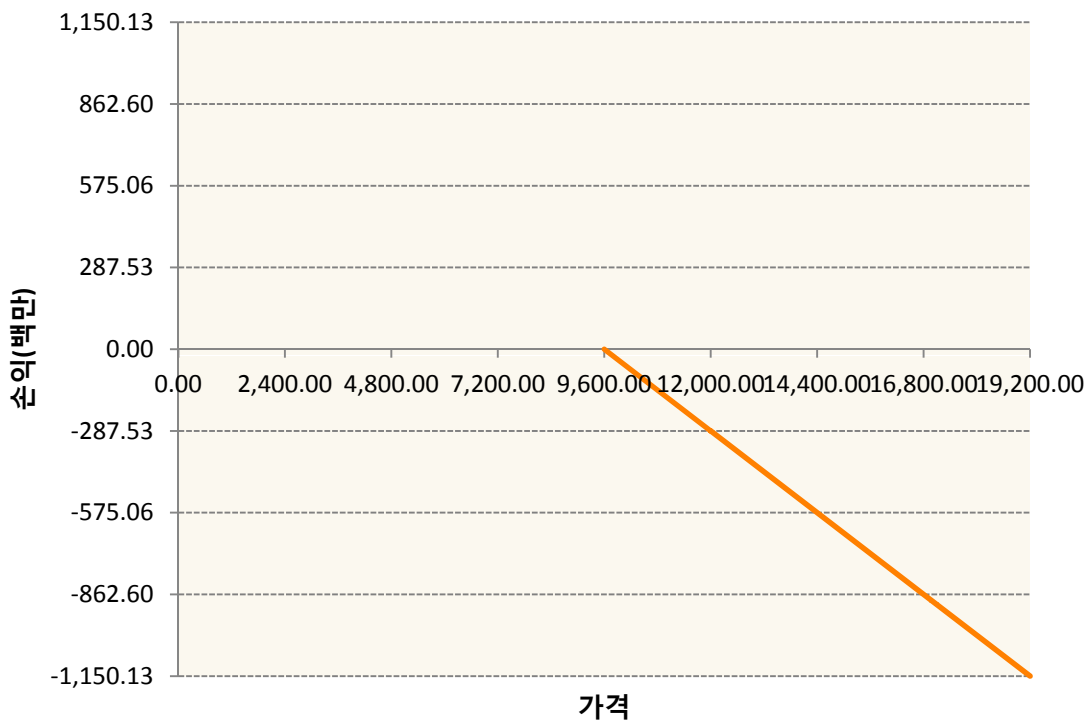


OHHIM0-C95-HSCEI

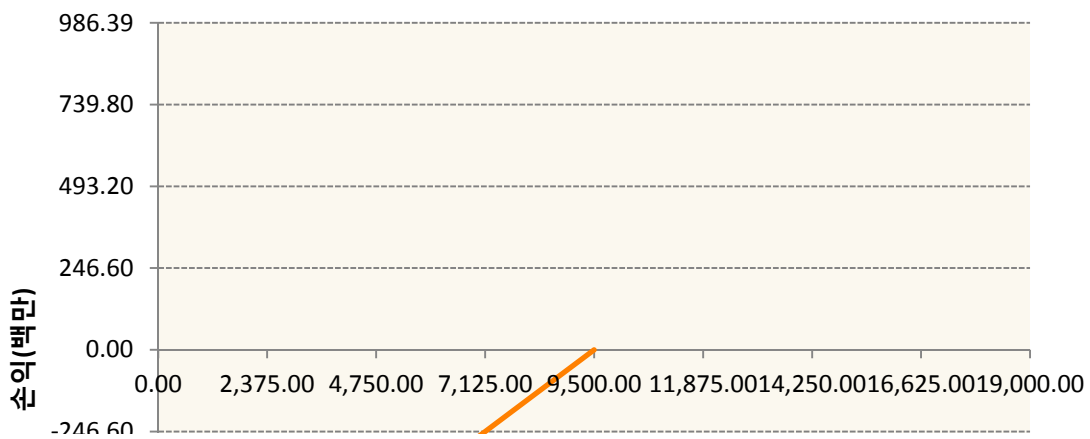


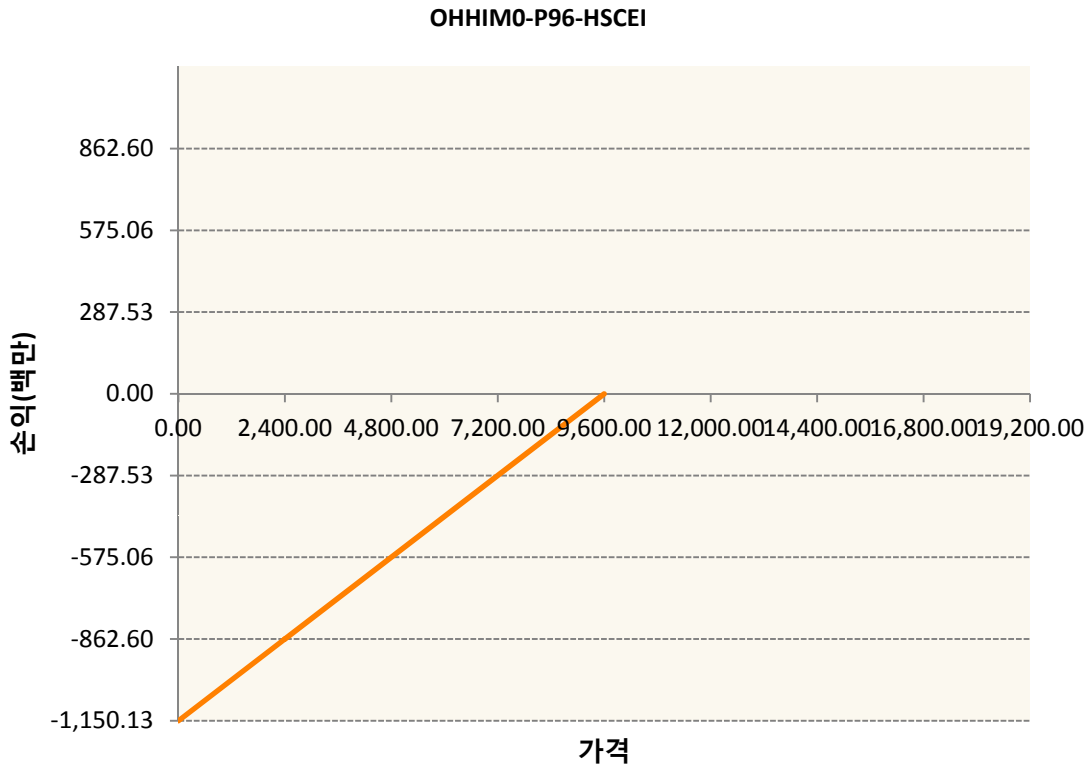


OHHIM0-C96-HSCEI



OHHIM0-P95-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E		124
HCM0 HSCEI Futures Jun20		128
OHHIM0-C9 HSCEI		79
OHHIM0-C9 HSCEI		92
OHHIM0-P9 HSCEI		79
OHHIM0-P9 HSCEI		92

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		571

공시일	2020-06-01
기준일	2020-05-29

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

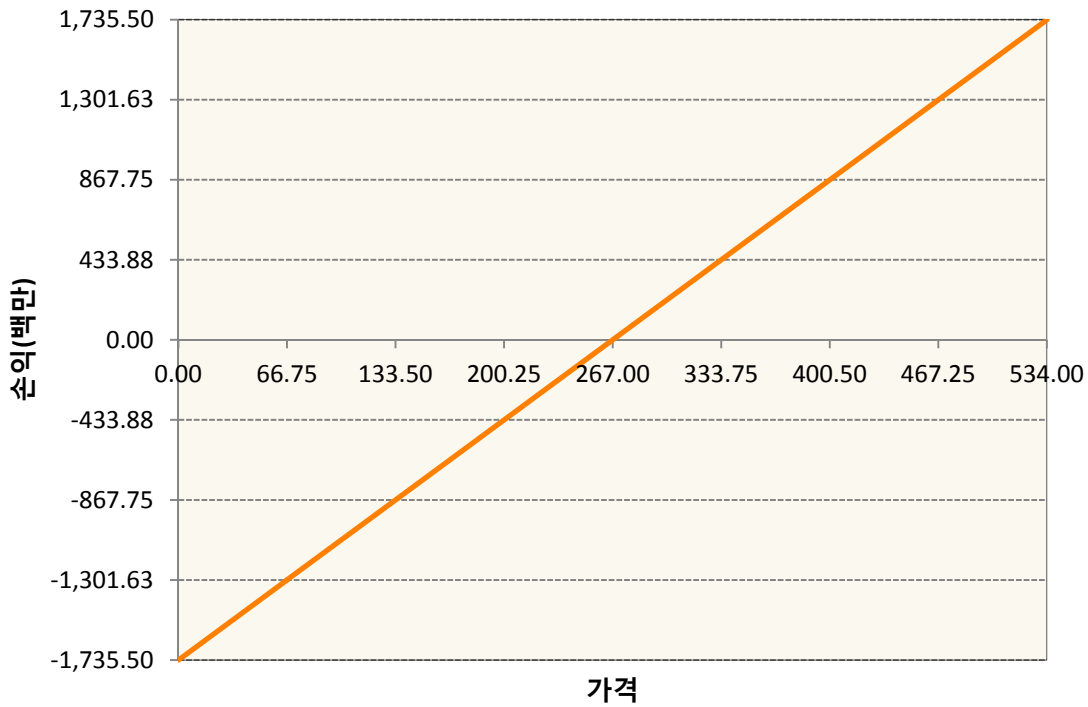
1. 계약금액

(단위:백만원)

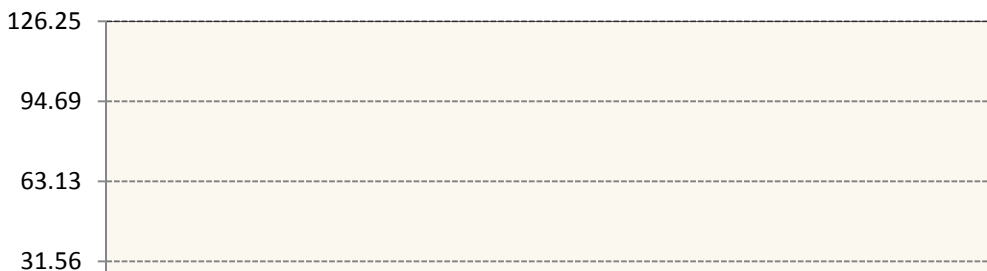
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	188	0	188	장내
누계	유가증권	선물	1,736	0	1,736	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,171	-3,171	장내

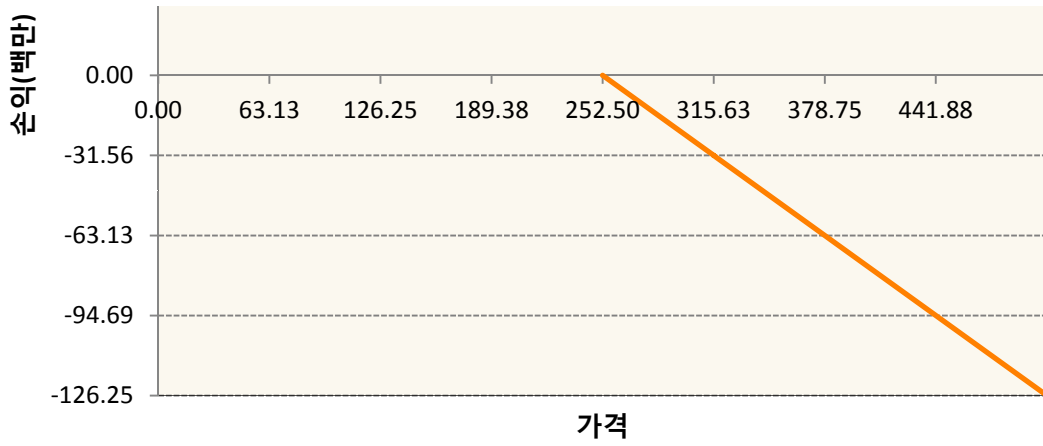
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

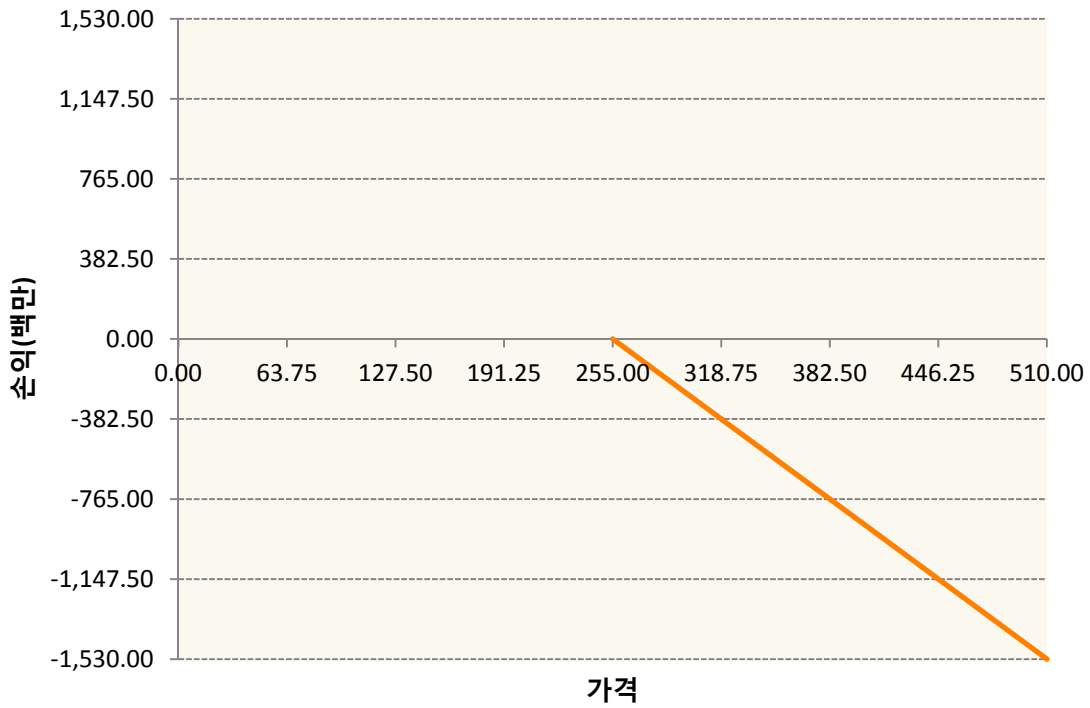


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

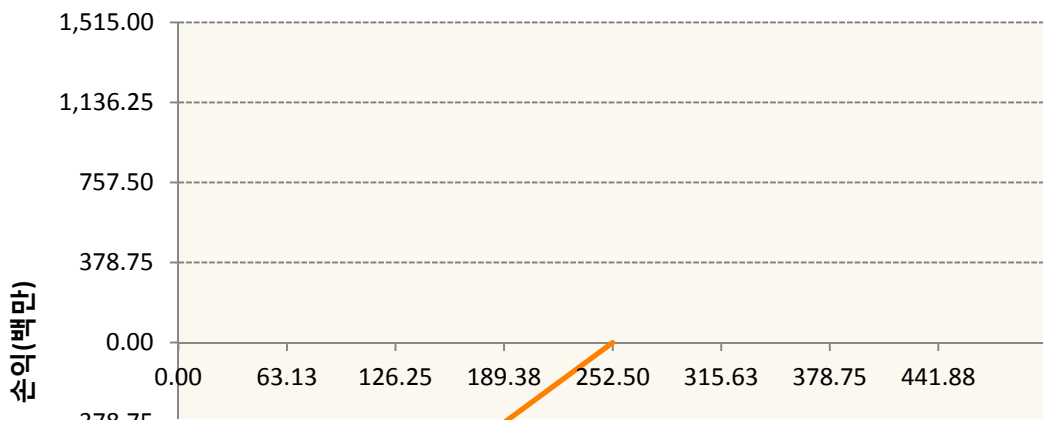




KR4201Q62550-2020-06 콜255



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	-10	-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	54	50	45	41
-2.67%	41	37	34	30	25	21	17
0%	10	7	3	0	-4	-7	-11
2.67%	-27	-29	-31	-34	-37	-40	-43
5.33%	-67	-68	-70	-71	-74	-76	-78
8.00%	-108	-109	-110	-111	-113	-114	-116
KR4301Q62525 2020-06 풋252.5							53
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-40	-42	-44	-46	-48	-51	-53
-5.33%	-15	-17	-20	-22	-25	-27	-30
-2.67%	-2	-3	-5	-7	-9	-12	-14
0%	3	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	4	4	3	3	2	2	1
5.33%	4	4	4	4	4	3	3
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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

(단위:백만원)

559

공시일	2020-06-01
기준일	2020-05-29

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

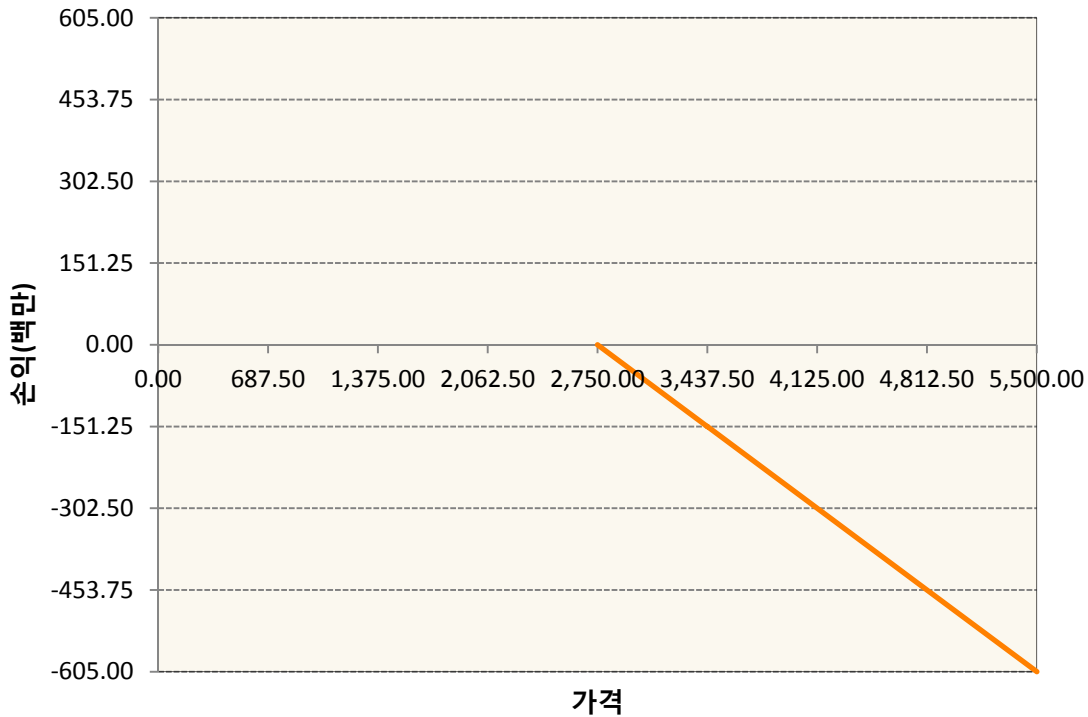
1. 계약금액

(단위:백만원)

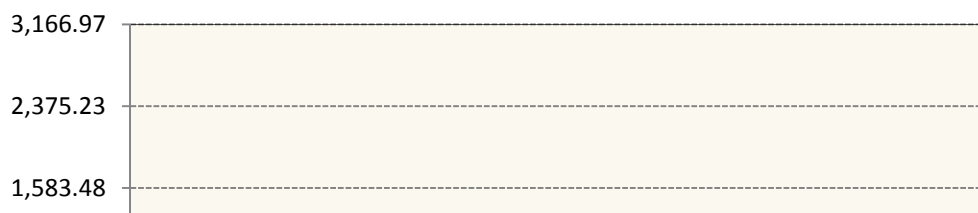
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,659	0	1,659	
누계	유가증권	스왑	8,201	0	8,201	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,544	-7,544	장내
누계	통화	선도	0	2,975	-2,975	장외

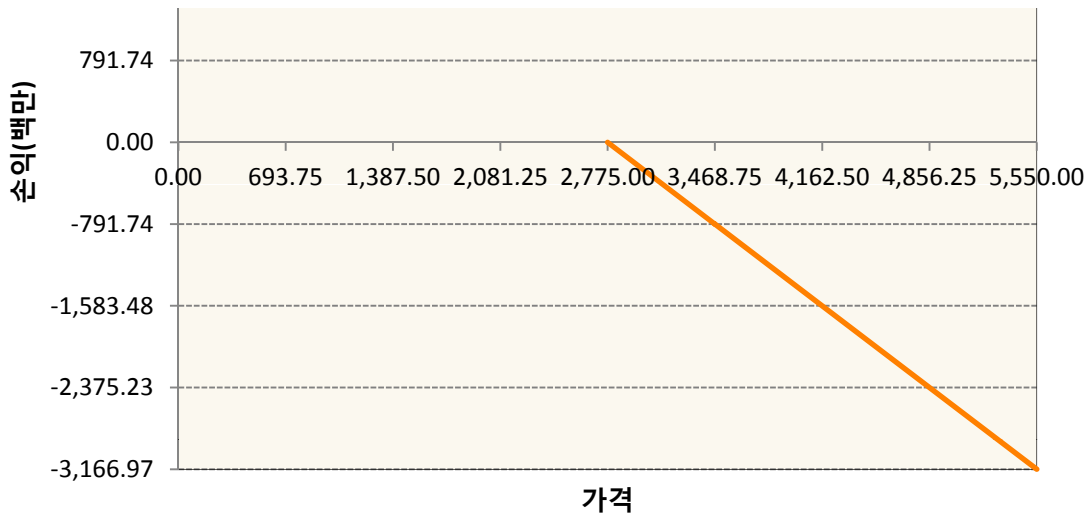
2. 만기시점의 손익구조

OESXM0-C2750-EURO STOXX 50

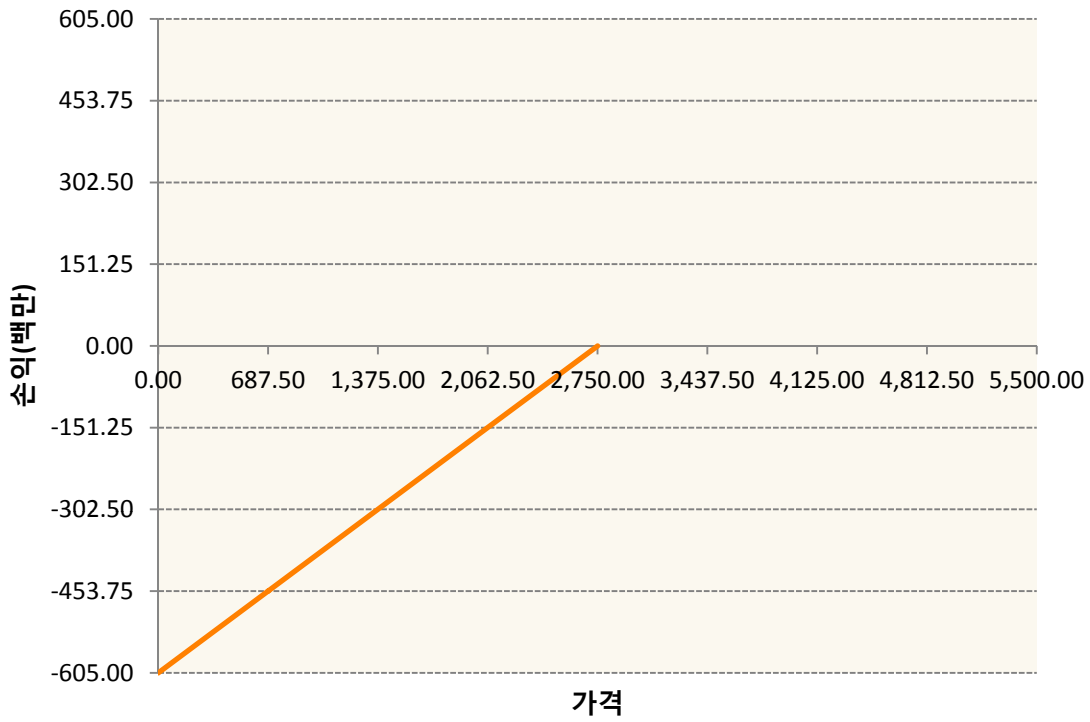


OESXM0-C2775-EURO STOXX 50

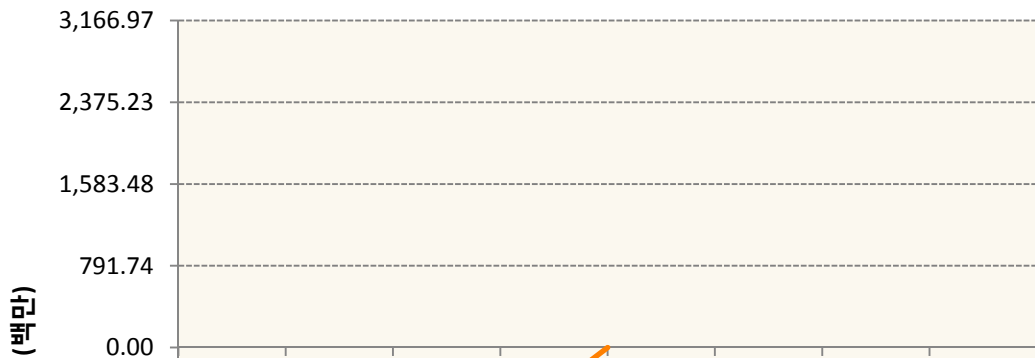


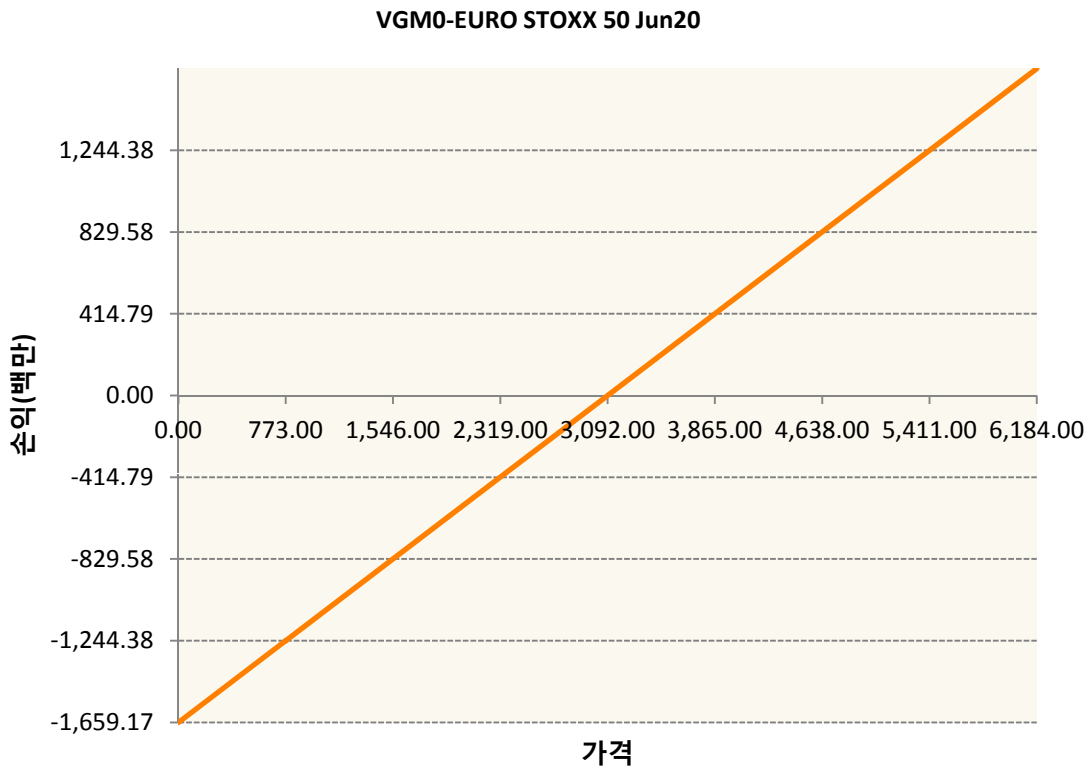
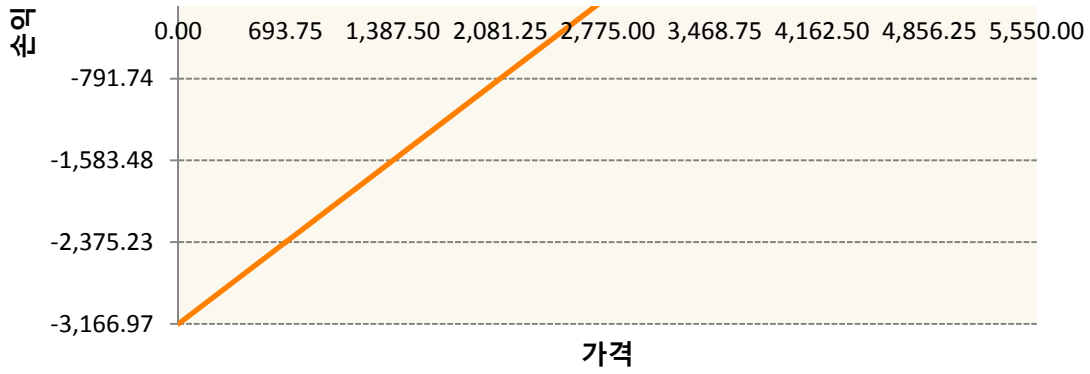


OESXM0-P2750-EURO STOXX 50



OESXM0-P2775-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP\SG EURO Covered CALL STRATEGY		21
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E		223
FX21020K02 KRW/EUR 26-06-20E		15
OESXM0-C2' EURO STOXX 50		48
OESXM0-C2' EURO STOXX 50		253
OESXM0-P2' EURO STOXX 50		48
OESXM0-P2' EURO STOXX 50		253
VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	133

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

(단위:백만원)

1,142

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

(단위:백만원)

1,202

공시일	2020-06-01
기준일	2020-05-29

ETF스마트레버리지목표전환형9호

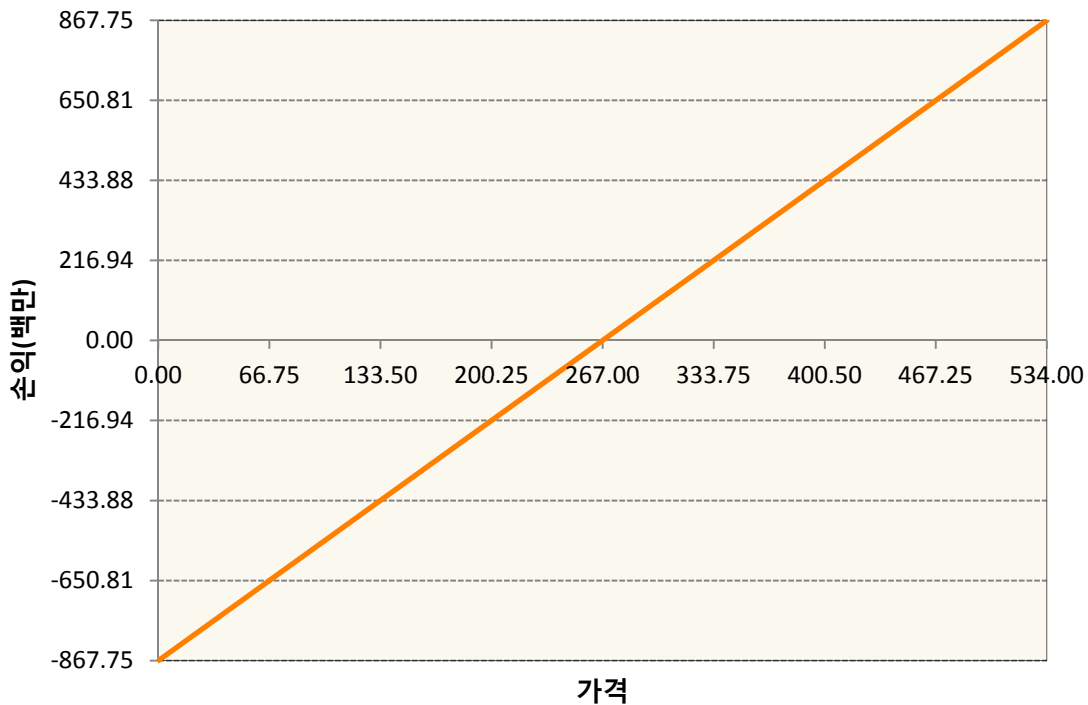
1. 계약금액

(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%	-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	2020-06-01
기준일	2020-05-29

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

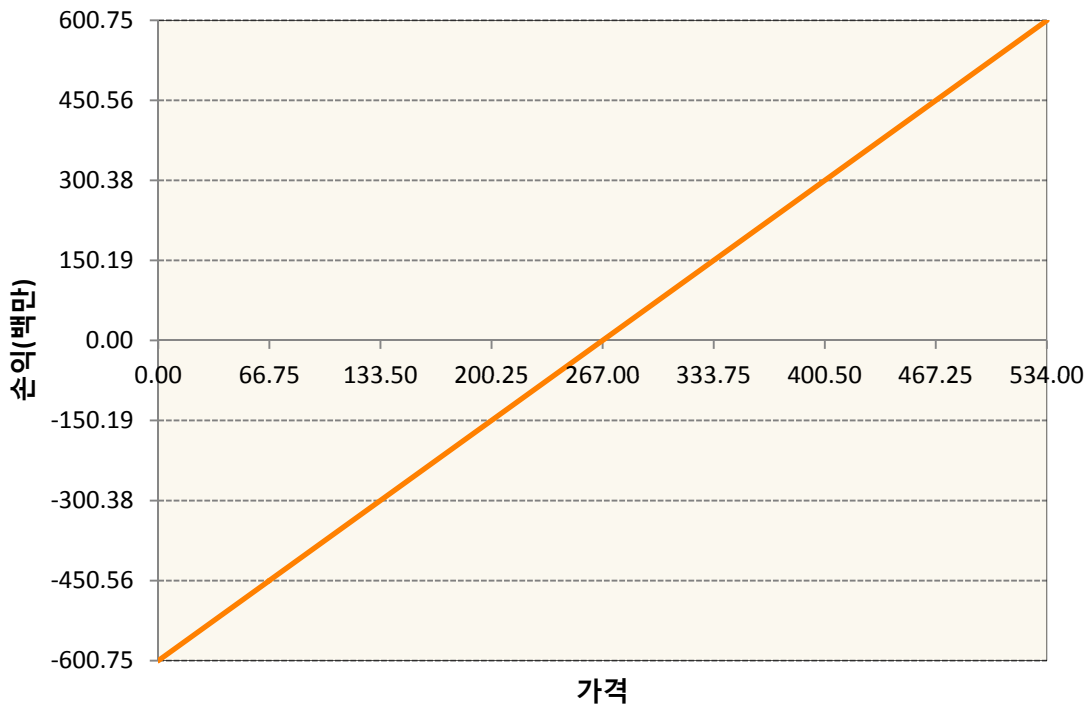
1. 계약금액

(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	2020-06-01
기준일	2020-05-29

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

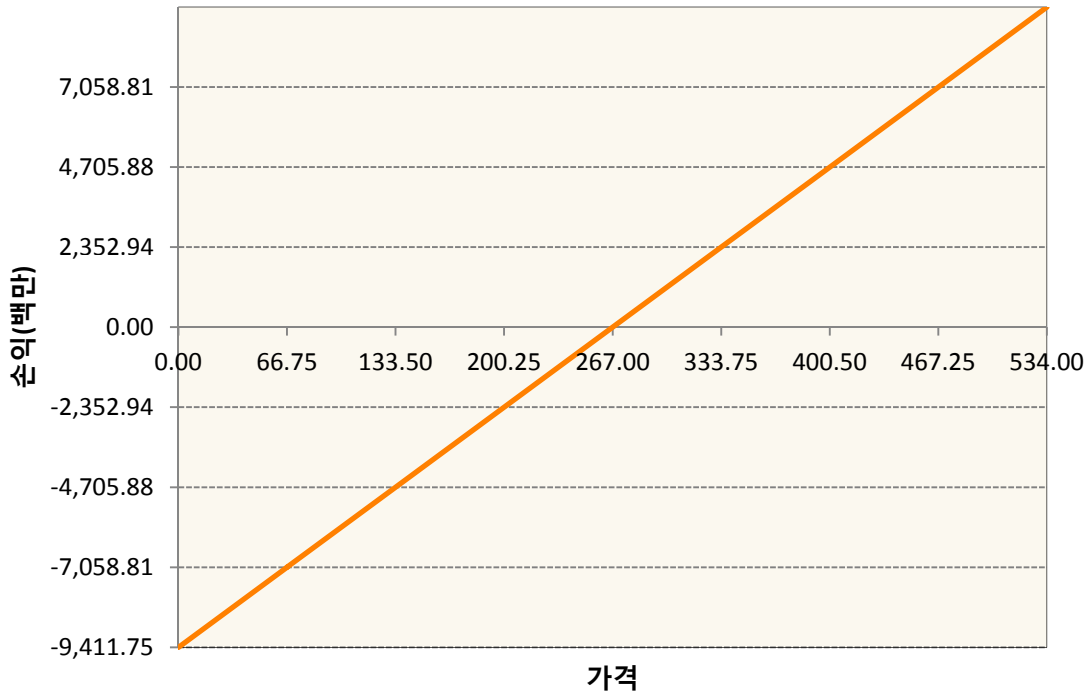
1. 계약금액

(단위:백만원)

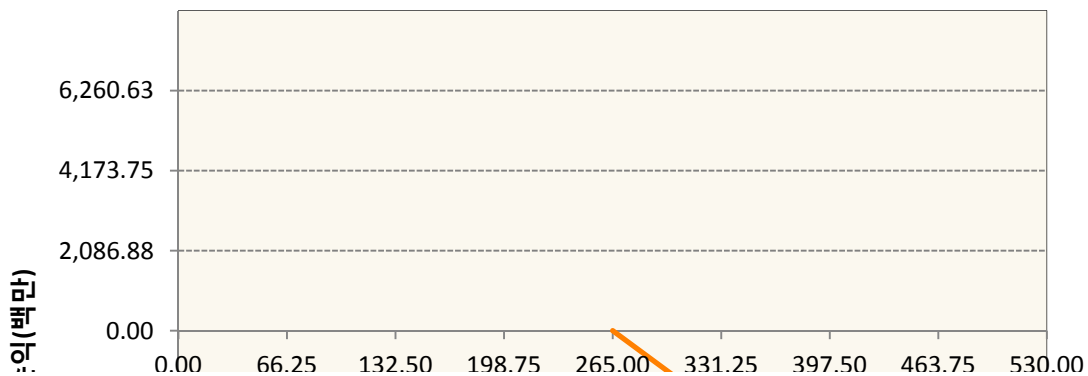
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,412	0	9,412	장내
누계	유가증권	옵션	2,917	17,911	-14,994	장내

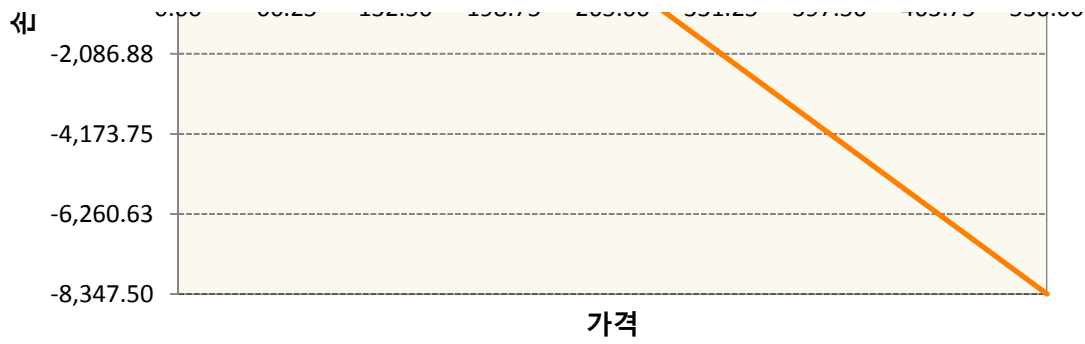
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

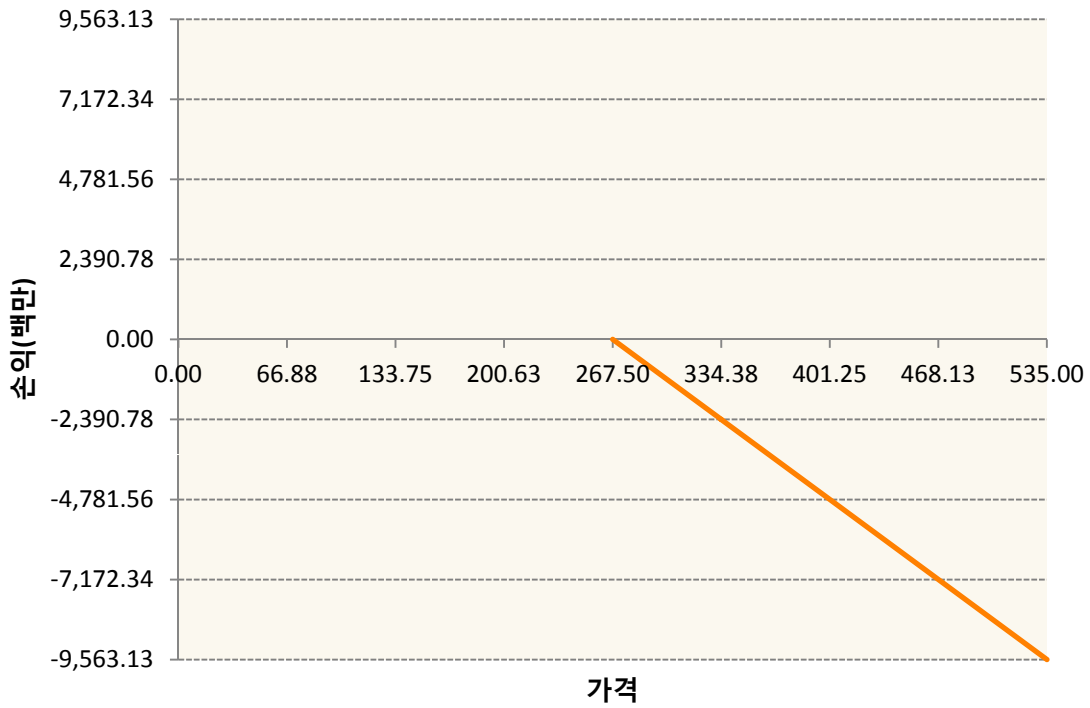


KR4201Q62659-2020-06 콜265

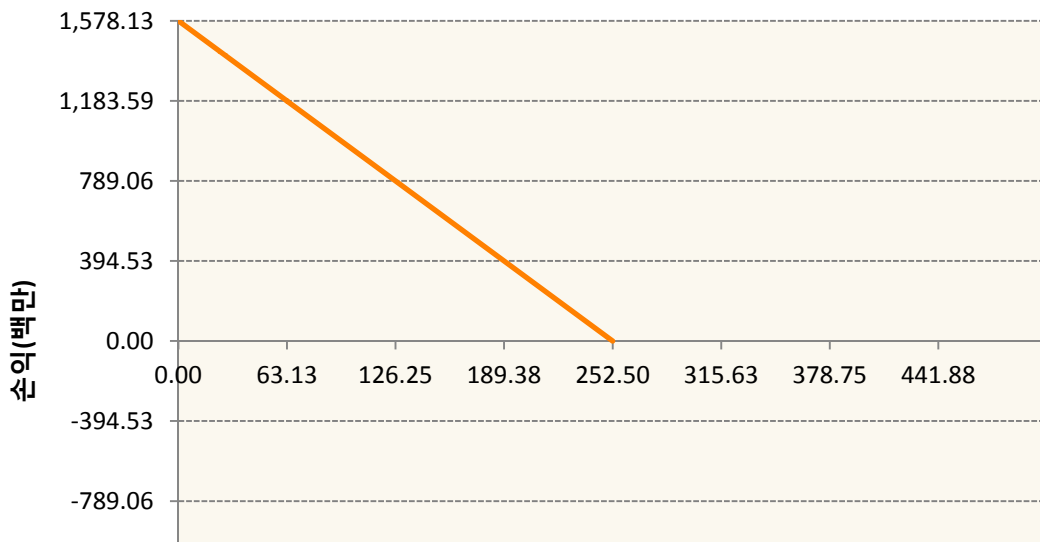


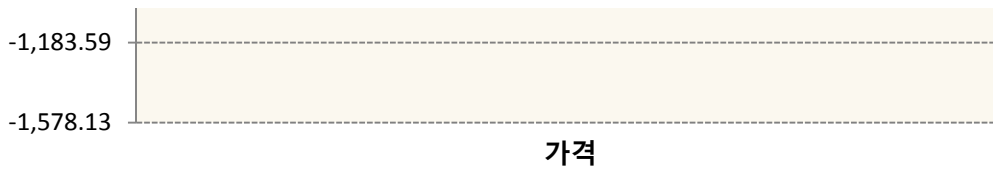


KR4201Q62675-2020-06 콜267.5

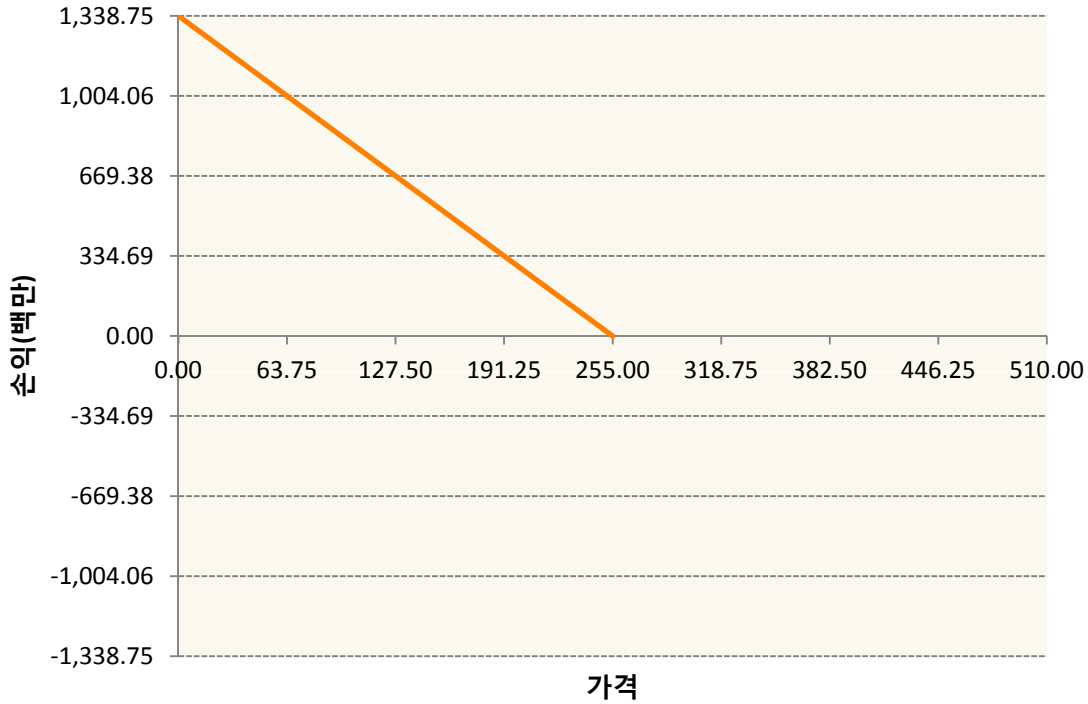


KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





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					543
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	296	284	271	257	241	225	209
-5.33%	254	237	218	199	180	160	140
-2.67%	180	158	136	114	92	70	48

0%	67	45	22	0	-22	-45	-68
2.67%	-84	-103	-123	-143	-164	-185	-206
5.33%	-265	-279	-295	-311	-329	-347	-366
8.00%	-467	-476	-487	-499	-513	-528	-543
KR4201Q62675 2020-06 콜267.5							593
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	298	287	274	260	244	227	209
-5.33%	261	243	224	203	183	161	139
-2.67%	190	167	142	118	94	69	44
0%	78	52	26	0	-26	-52	-78
2.67%	-79	-103	-127	-151	-176	-201	-226
5.33%	-273	-292	-312	-332	-354	-376	-399
8.00%	-495	-508	-522	-538	-555	-574	-593
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	43	46	48	50	53	55
-5.33%	15	18	20	23	26	28	31
-2.67%	2	4	6	8	10	12	14
0%	-3	-2	-1	0	1	3	5
2.67%	-4	-4	-4	-3	-2	-2	-1
5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-3	-3
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
KR4301Q62558 2020-06 풋255							53
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	43	45	46	48	50	52	53
-5.33%	17	20	22	24	26	28	31
-2.67%	3	5	6	8	10	13	15
0%	-3	-2	-1	0	1	3	5
2.67%	-5	-5	-4	-4	-3	-2	-1
5.33%	-6	-5	-5	-5	-5	-4	-4
8.00%	-6	-6	-6	-5	-5	-5	-5

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

(단위:백만원)

2,233

공시일	2020-06-01
기준일	2020-05-29

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	156,475	0	156,475	

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	2020-06-01
기준일	2020-05-29

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	105,500	0	105,500	

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	2020-06-01
기준일	2020-05-29

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	466,096	0	466,096	
누계	통화	선도	0	570,453	-570,453	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,468
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	7,035
FX21020J00 KRW/USD 10-06-20E	2,972
FX21020J02 KRW/USD 10-06-20E	1,347
FX21020J02 KRW/USD 22-06-20E	1,526
FX21020J02 KRW/USD 22-06-20E	1,982
FX21020J03 KRW/USD 24-07-20E	2,229
FX21020J04 KRW/USD 24-07-20E	1,783
FX21020J04 KRW/USD 24-07-20E	1,982
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	2,061
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	1,962
FX21020K01 KRW/USD 22-06-20E	694
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	2,418
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	991
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,040
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,645
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	3,468
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	7,035

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

23,237

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

(단위:백만원)

208

공시일	2020-06-01
기준일	2020-05-29

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	7,683	0	7,683	
누계	통화	선도	0	7,381	-7,381	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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)

301

공시일	2020-06-01
기준일	2020-05-29

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

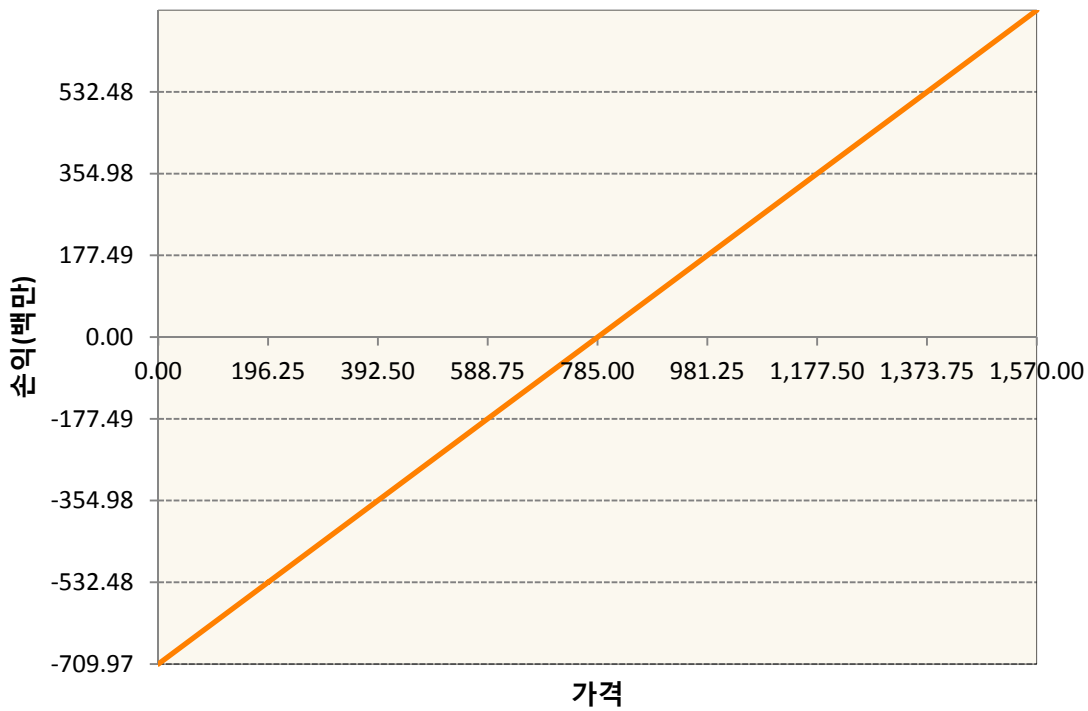
1. 계약금액

(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	710	0	710	
누계	유가증권	스왑	997	0	997	장외
누계	통화	선도	212	899	-687	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCM0-VN30 Index Future Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	80
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)

175

공시일	2020-06-01
기준일	2020-05-29

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

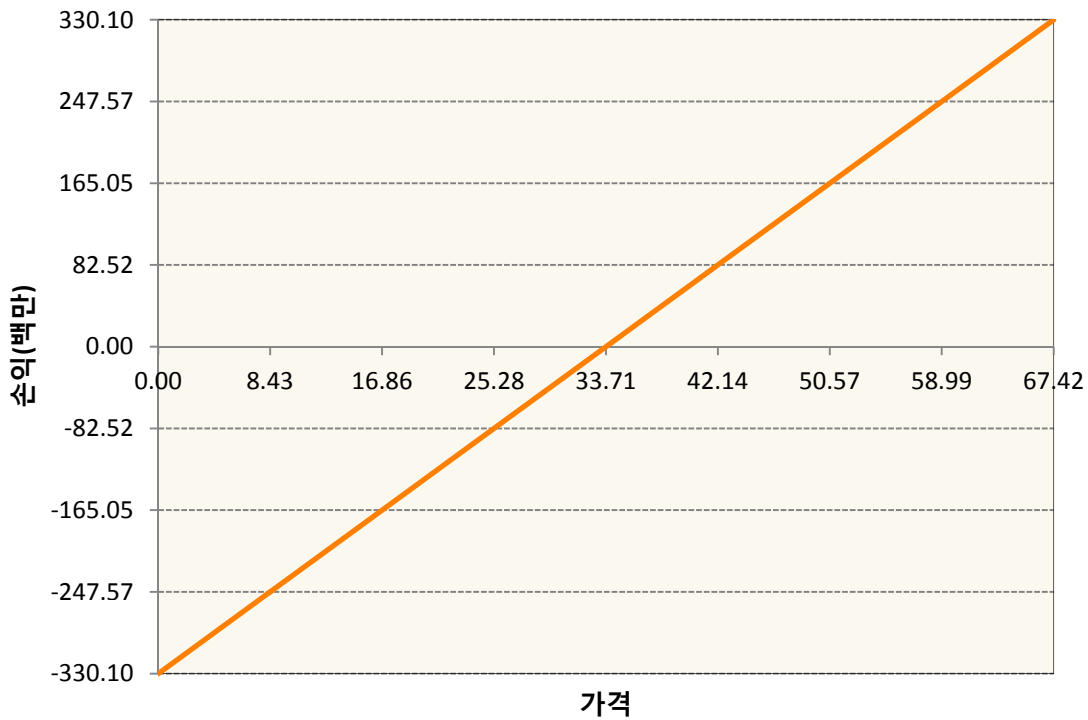
1. 계약금액

(단위:백만원)

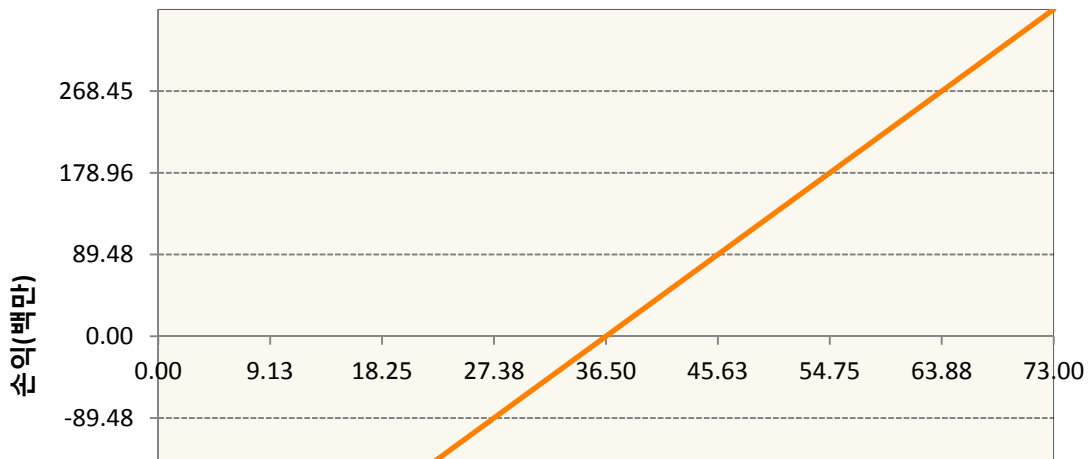
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,683	310	1,374	

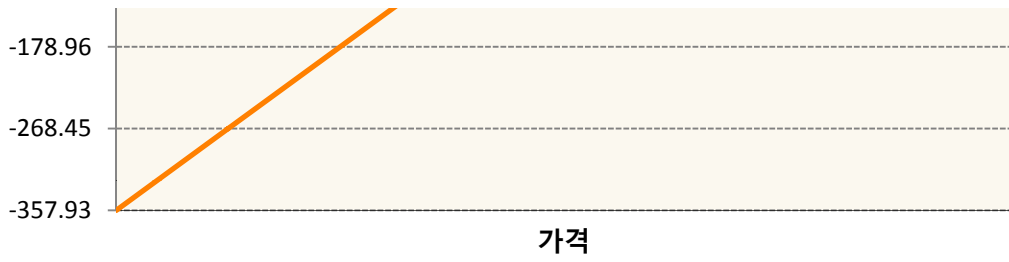
2. 만기시점의 손익구조

CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20

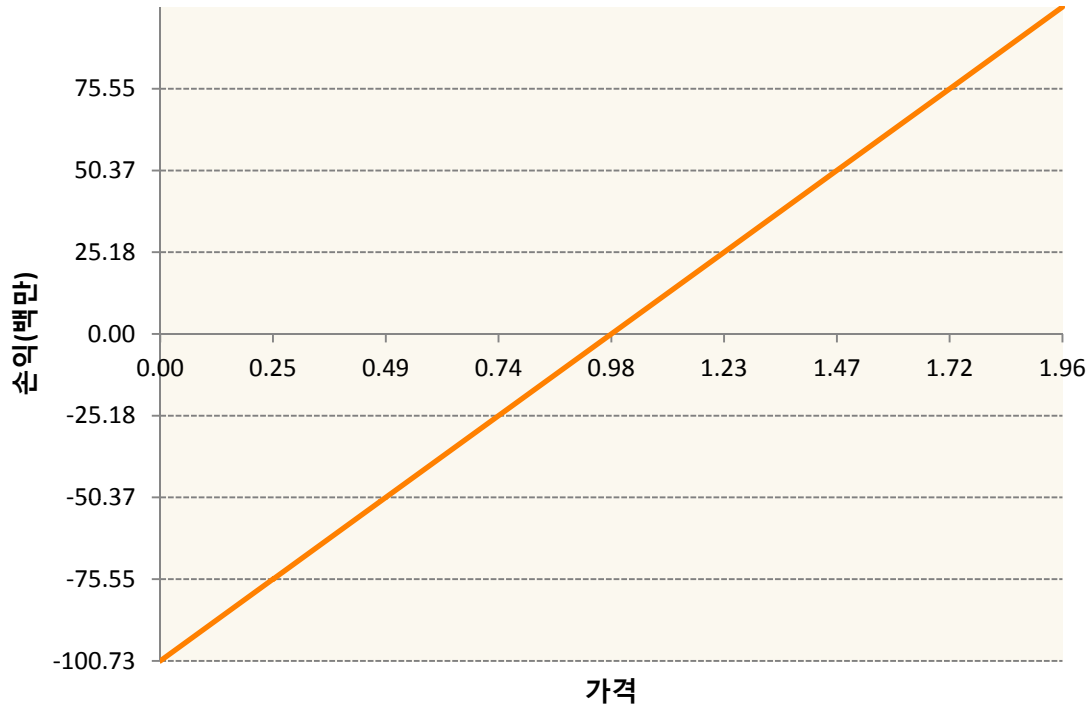


COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20

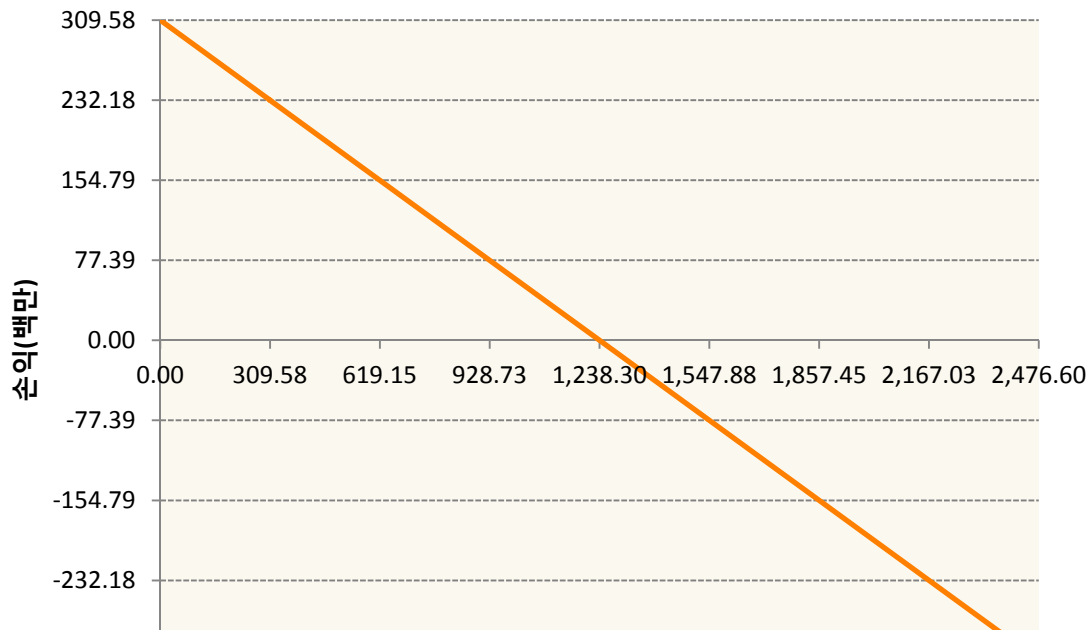


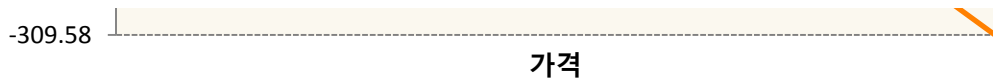


HON0-NY Harb ULSD Fut Jul20

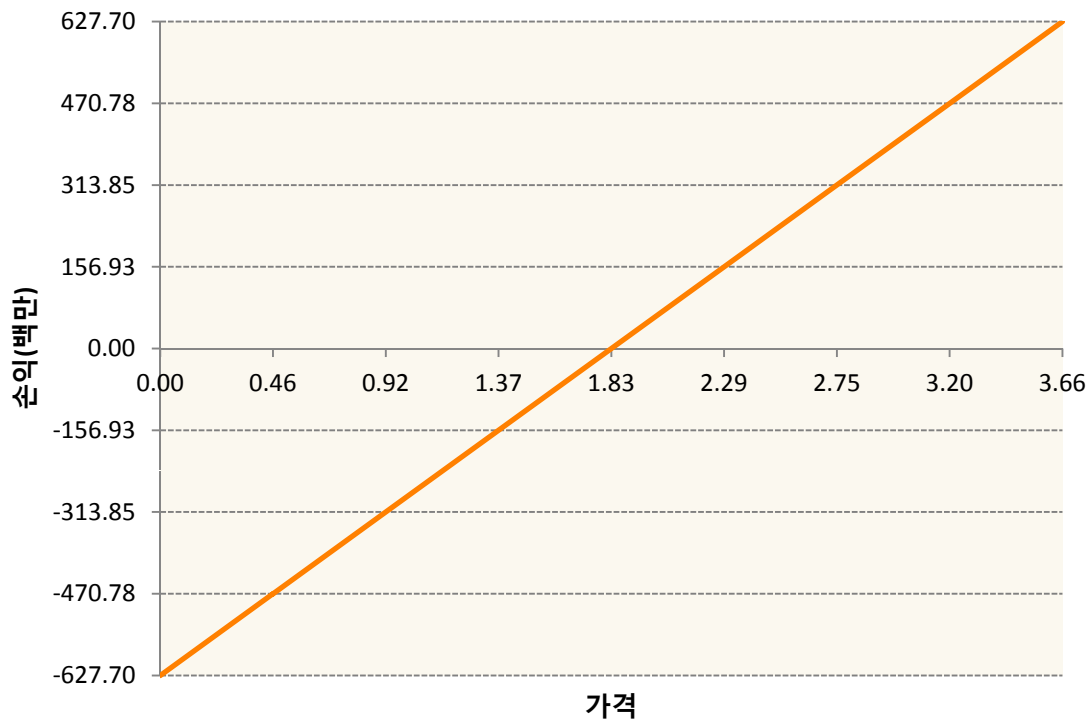


KR4175Q60006-2020-06 달러선물

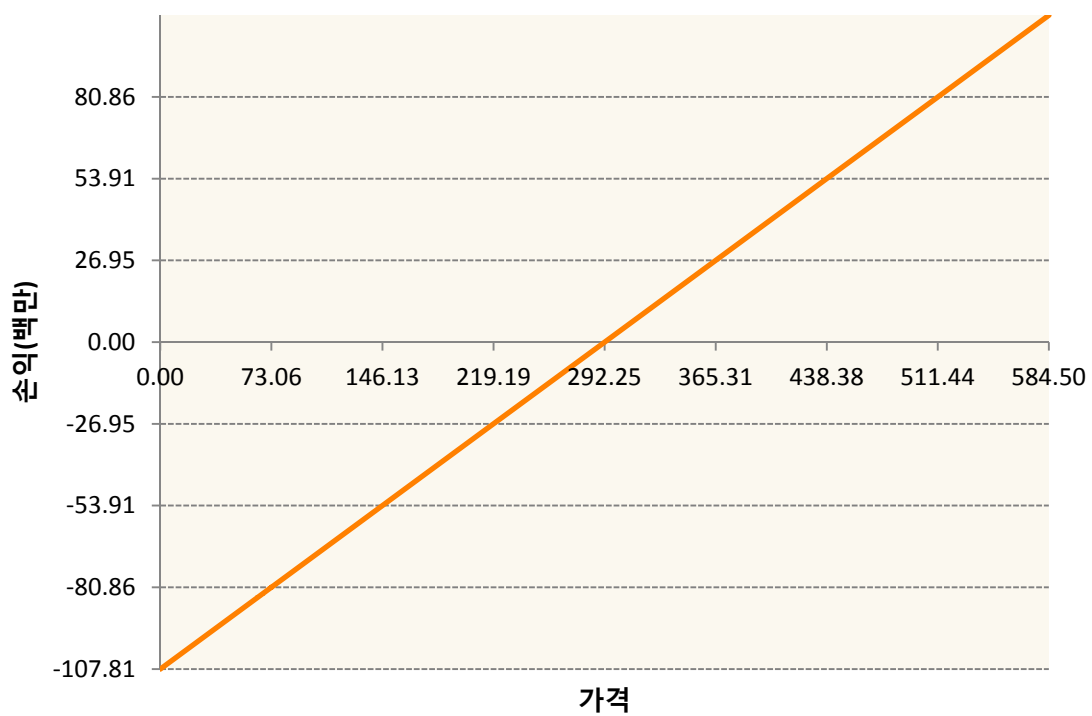




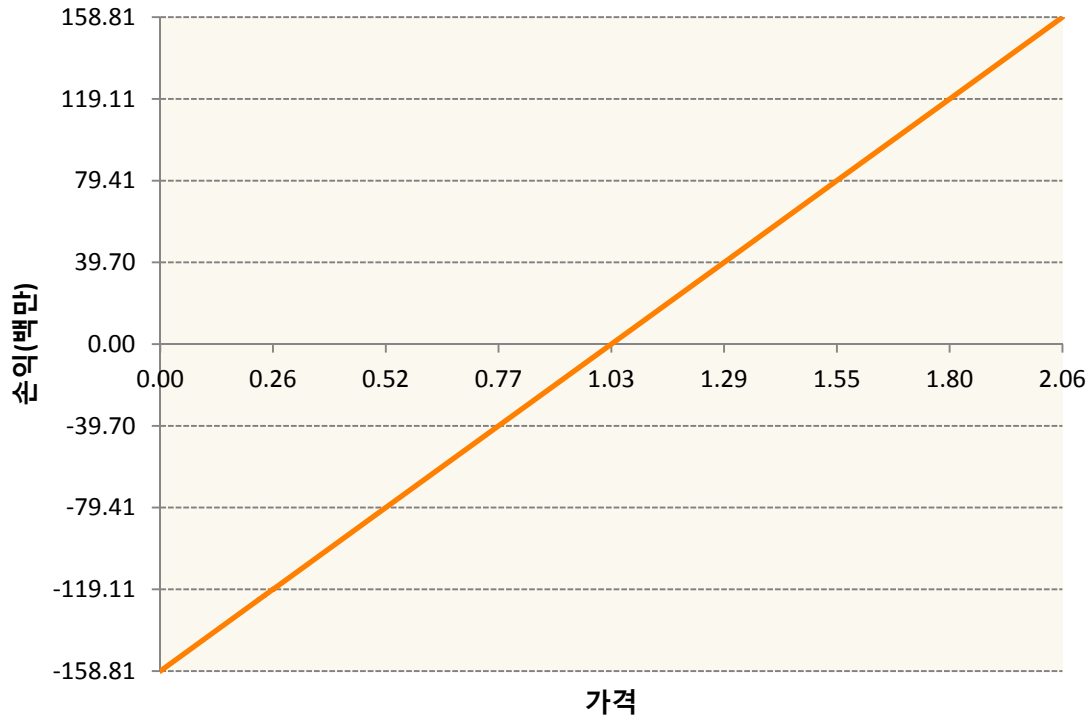
NGN20-NATURAL GAS FUTR Jul20



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	50
QSN0	Low Su Gasoil G Jul20	9
XBN0	GASOLINE RBOB FUT Jul20	13

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

(단위:백만원)

808

공시일	2020-06-01
기준일	2020-05-29

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

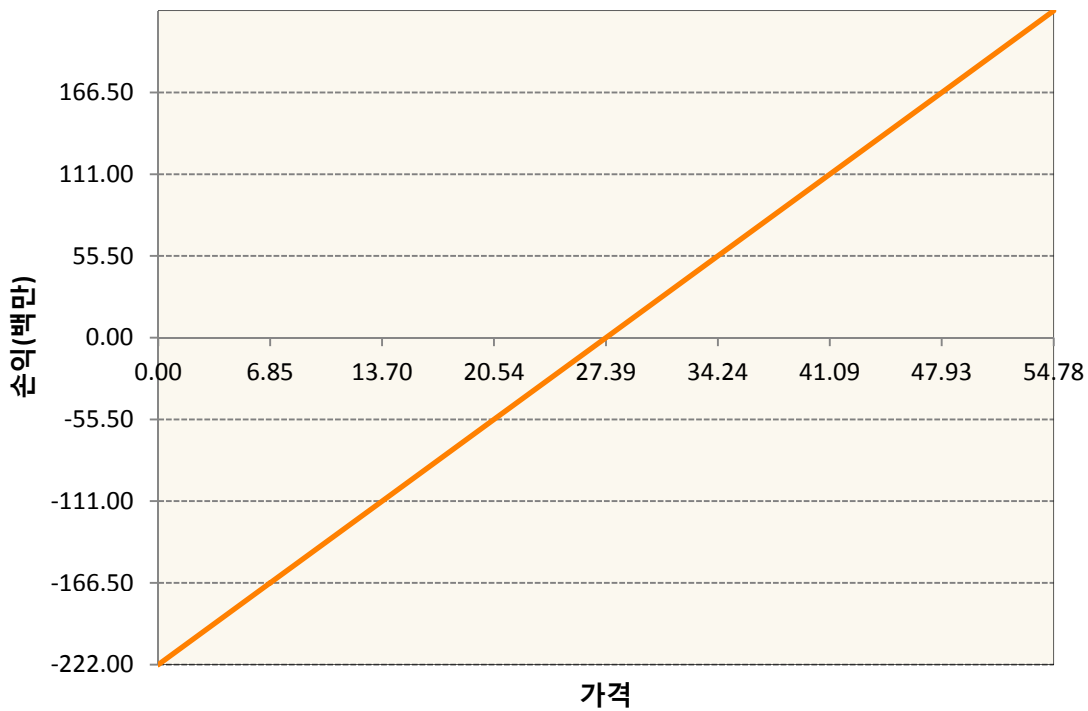
1. 계약금액

(단위:백만원)

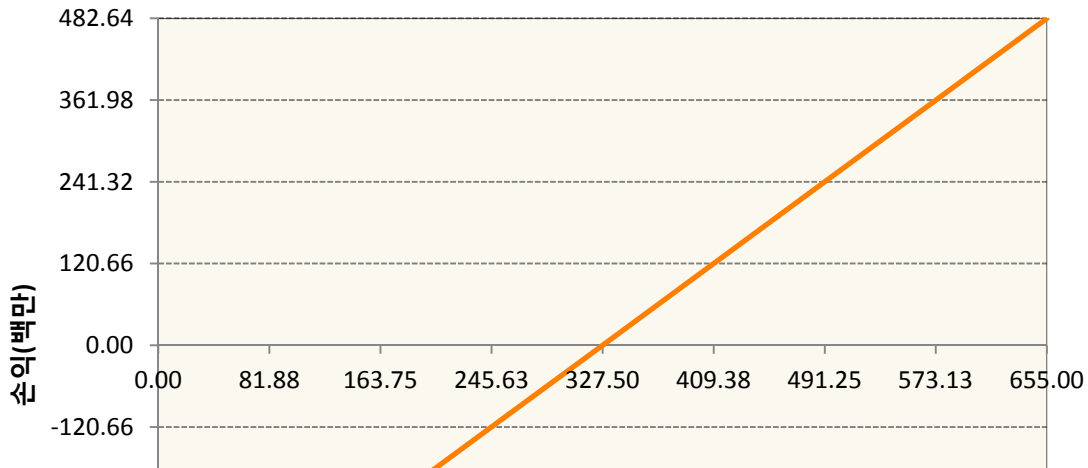
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,435	74	2,361	

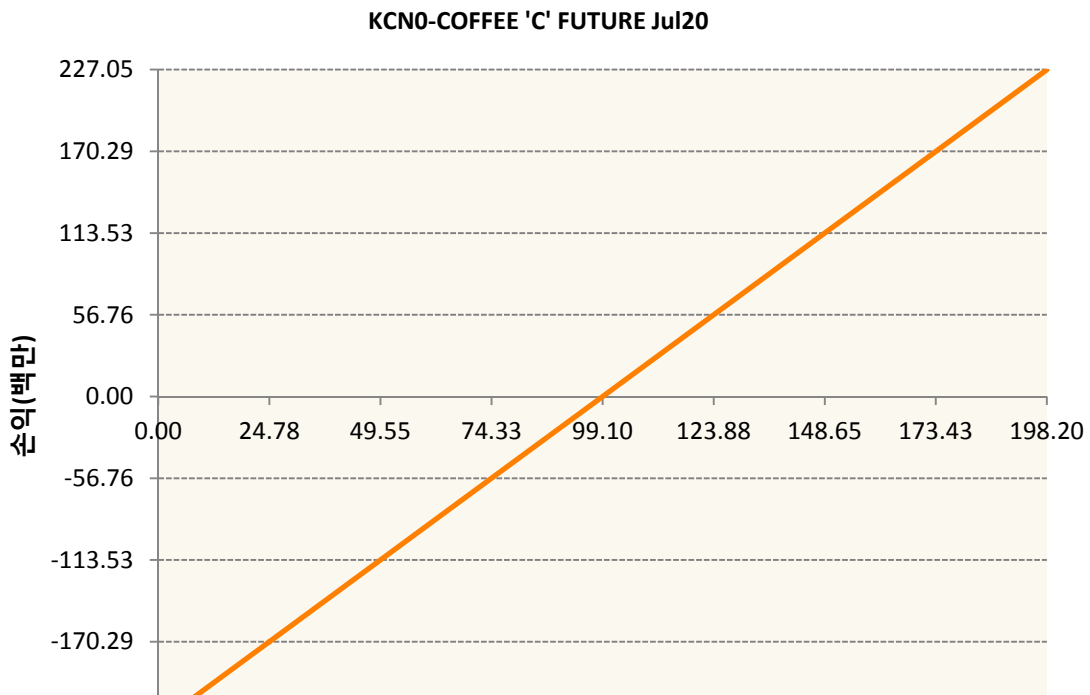
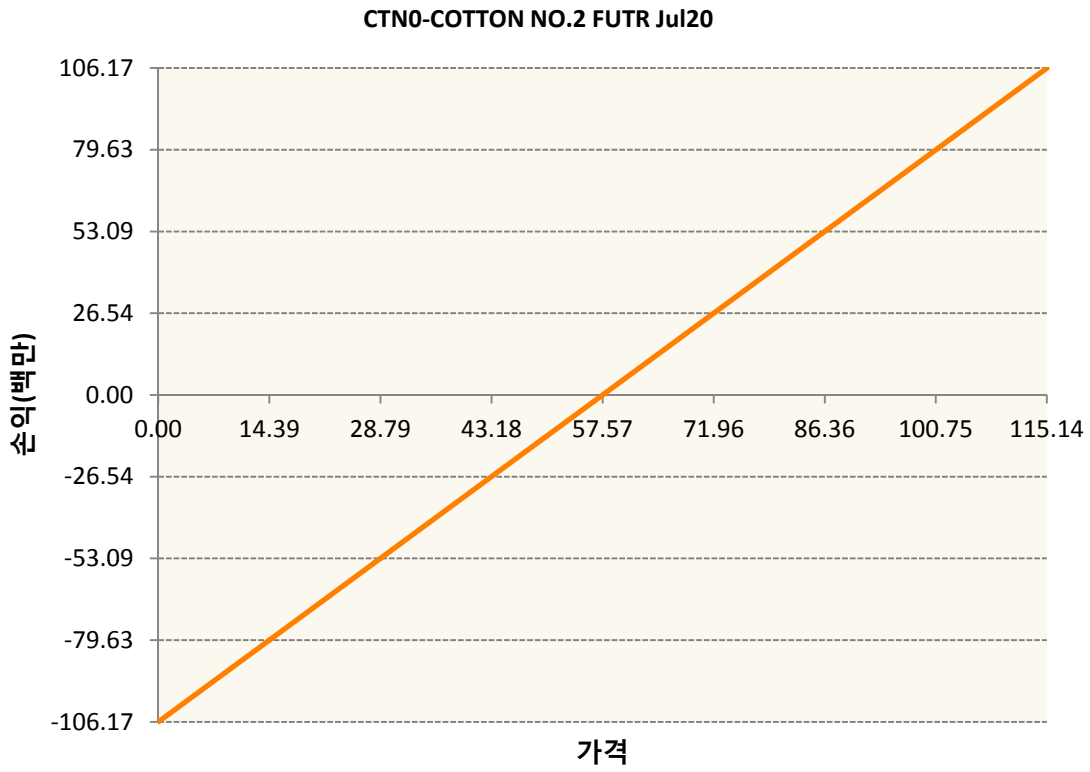
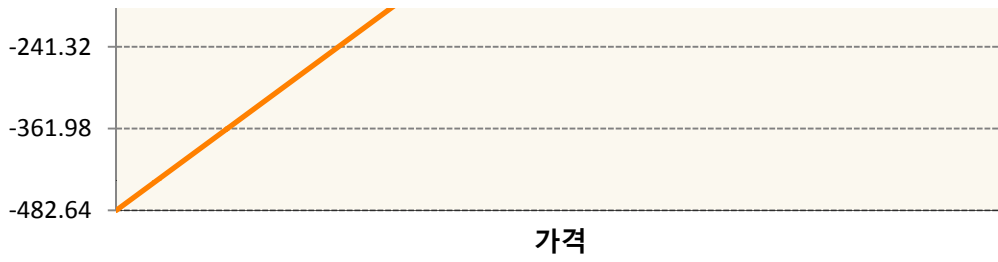
2. 만기시점의 손익구조

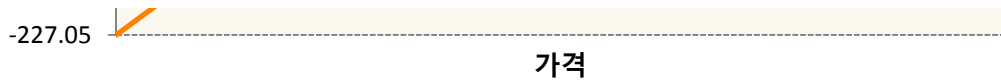
BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20



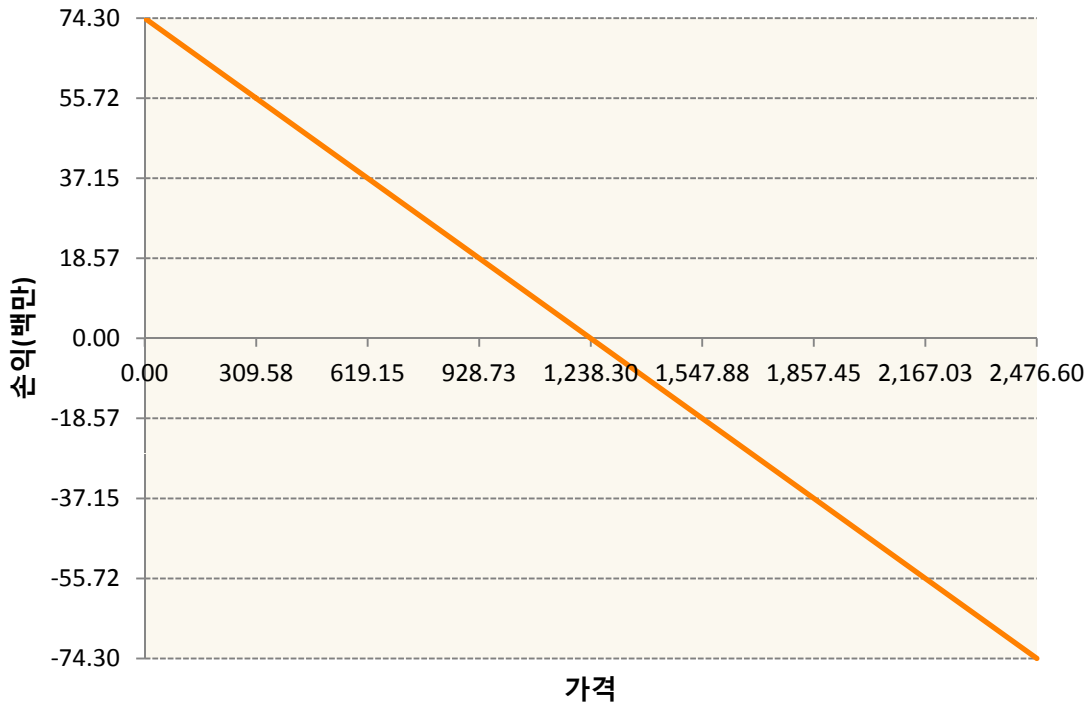
CNO-CORN FUTURE Jul20



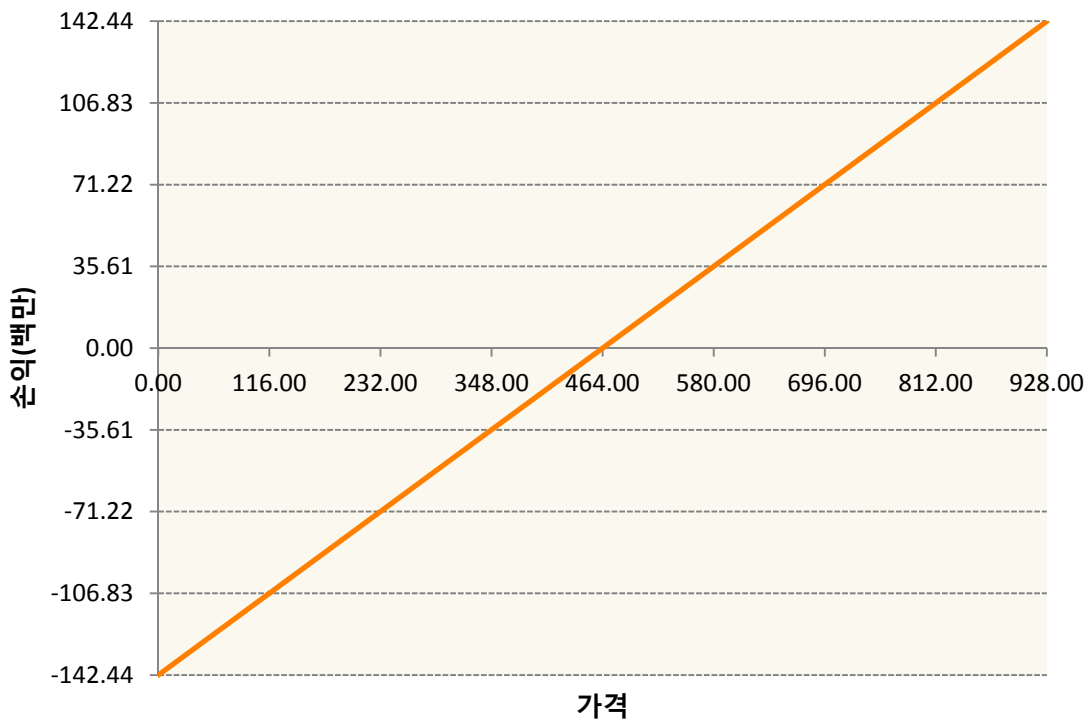




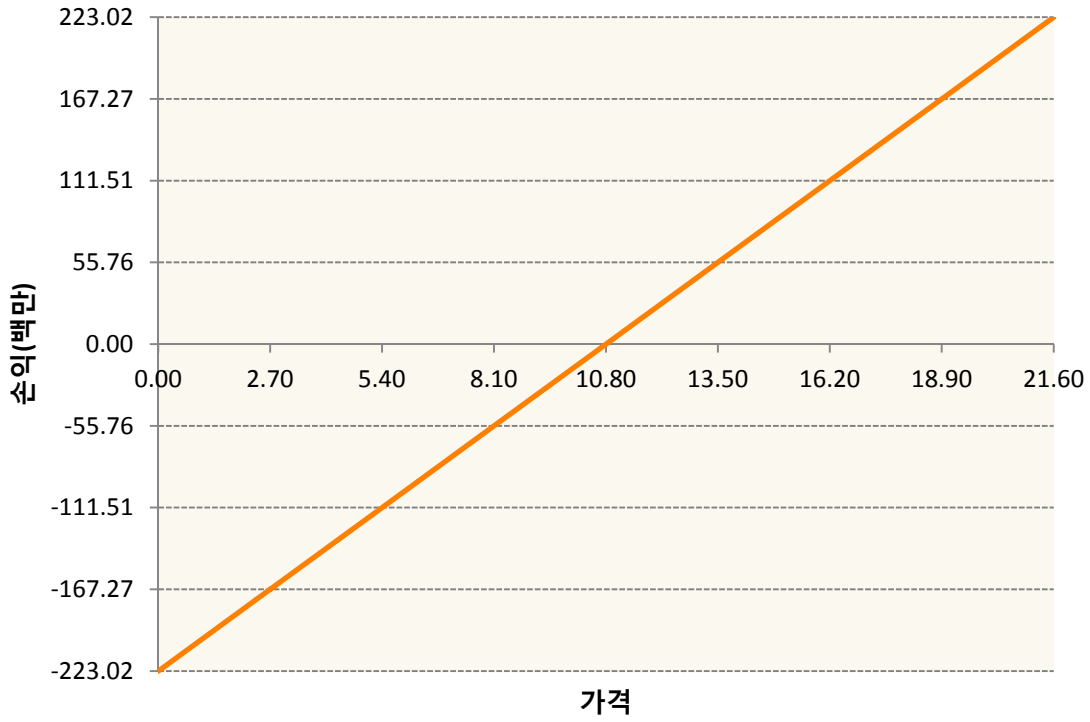
KR4175Q60006-2020-06 달러선물



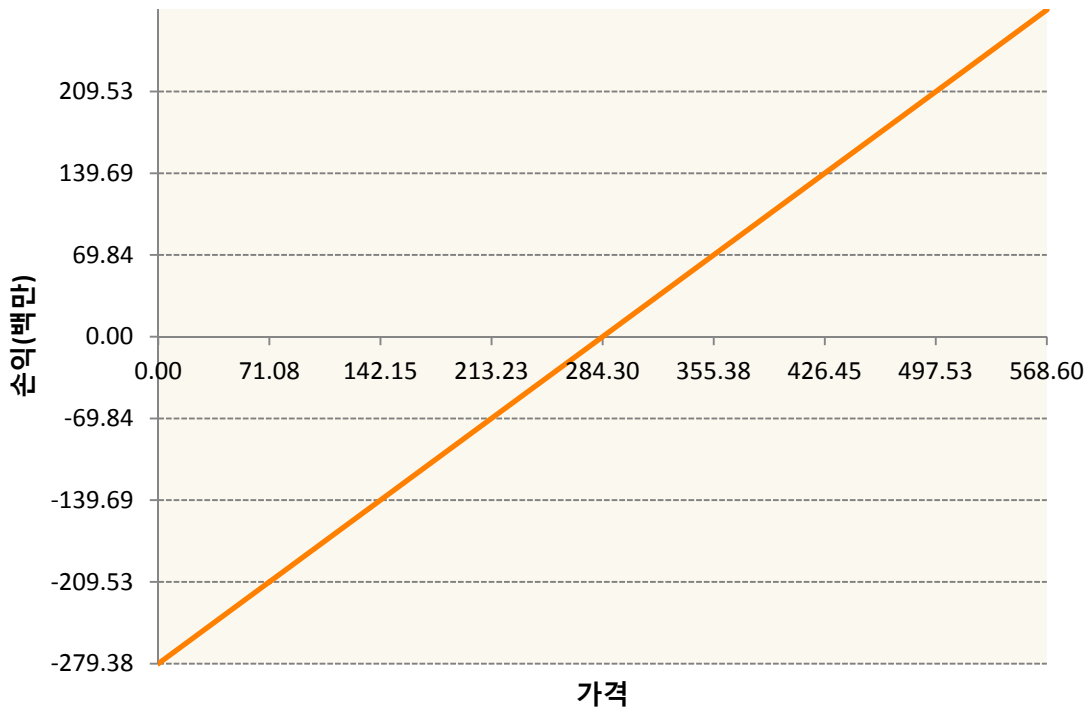
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



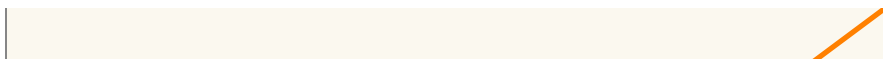
SBN0-Sugar Jul20

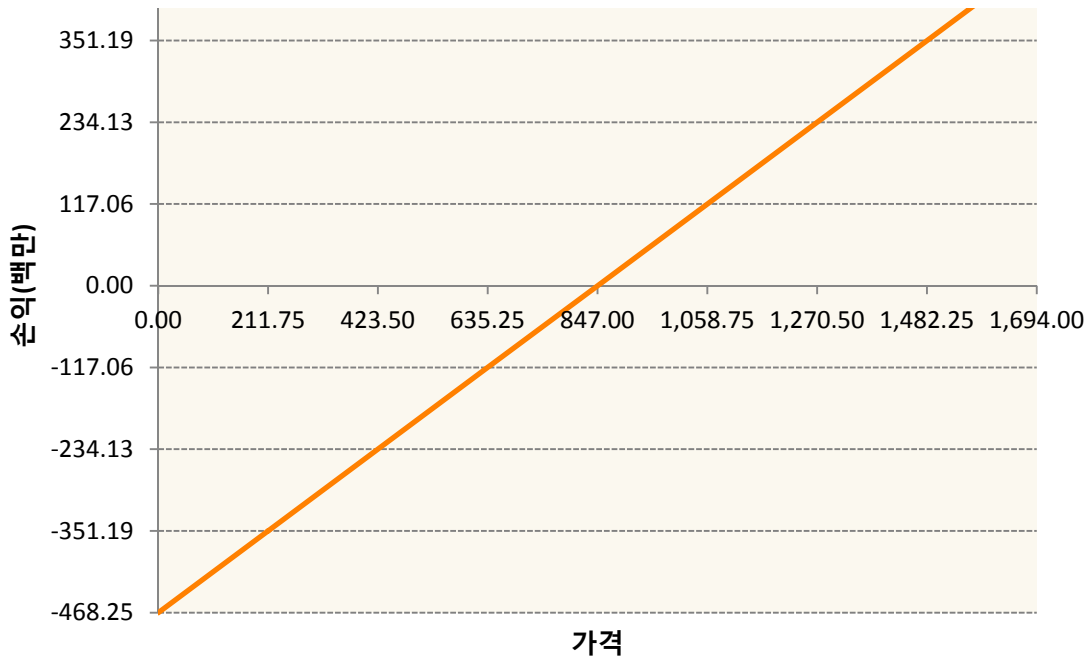


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20

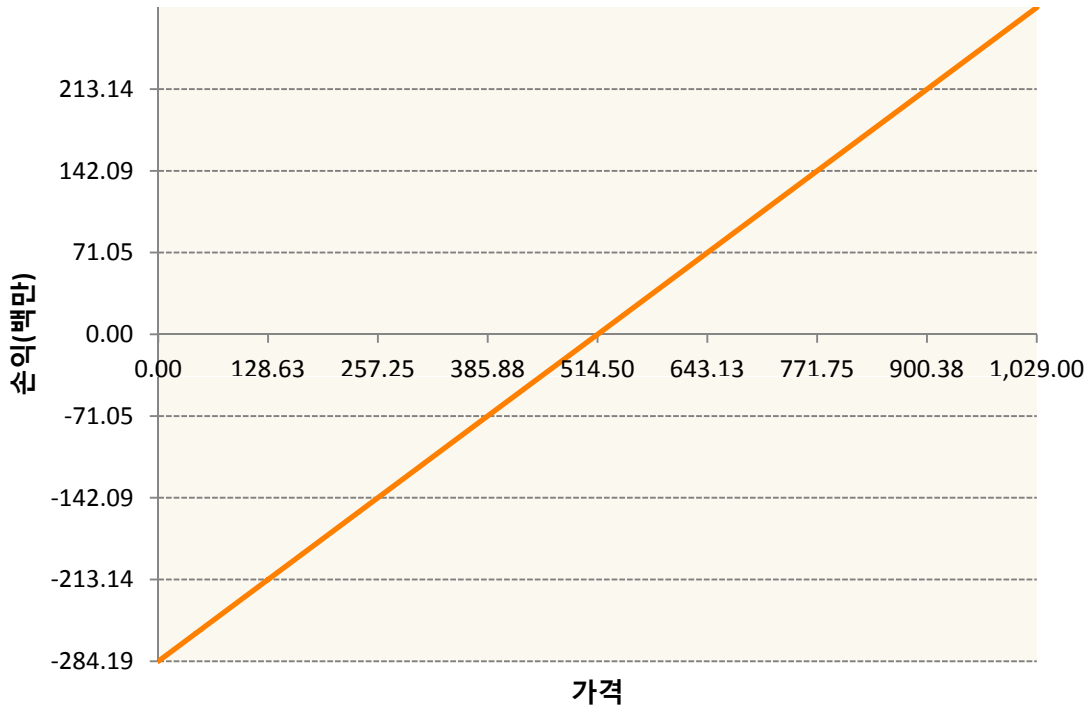


SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





WN0-WHEAT FUTURE(CBT) Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON0	SOYBEAN OIL FUTR Jul20	18
CN0	CORN FUTURE Jul20	39
CTN0	COTTON NO.2 FUTR Jul20	8
KCN0	COFFEE 'C' FUTURE Jul20	18
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
WN0	WHEAT FUTURE(CBT) Jul20	23

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

(단위:백만원)

230