

공시일	2020-06-02
기준일	2020-06-01

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	2020-06-02
기준일	2020-06-01

스마트인덱스모

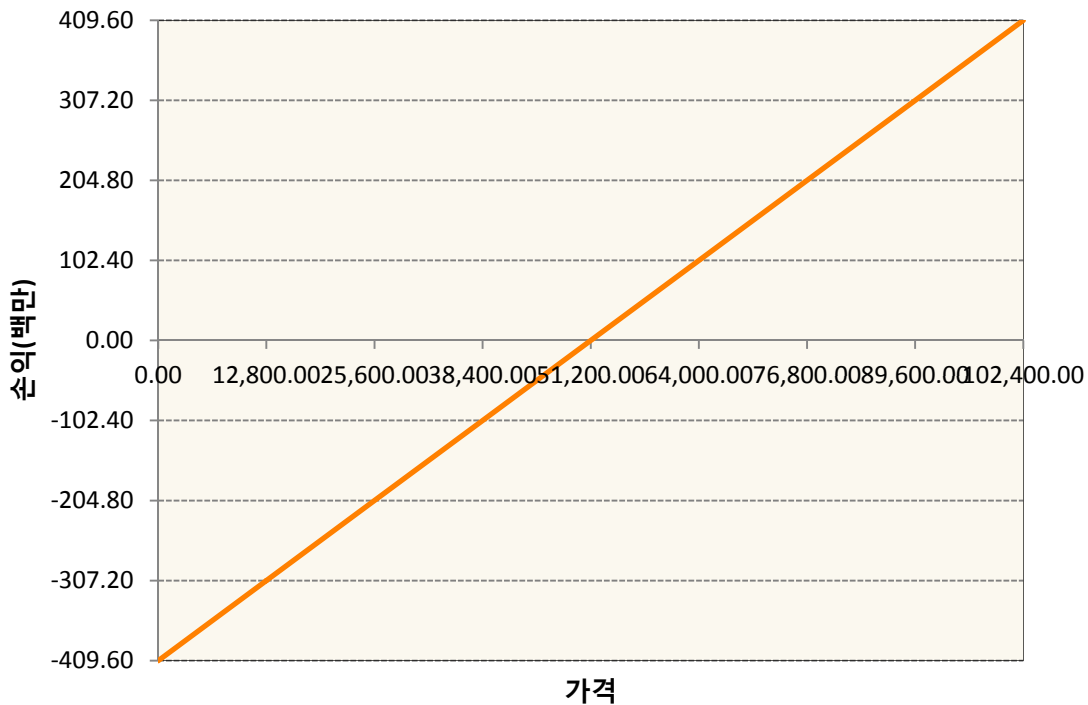
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

KR4111Q60001-2020-06 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111Q60001		2020-06 삼성전자개별선물						33
가격	기초자산의 변동성							
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
-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%	33	33	33	33	33	33	33	

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

(단위:백만원)

49

공시일	2020-06-02
기준일	2020-06-01

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)

1,214

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-06-02
기준일	2020-06-01

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

578

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

850

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-06-02
기준일	2020-06-01

유로인덱스모(주식-파생형)

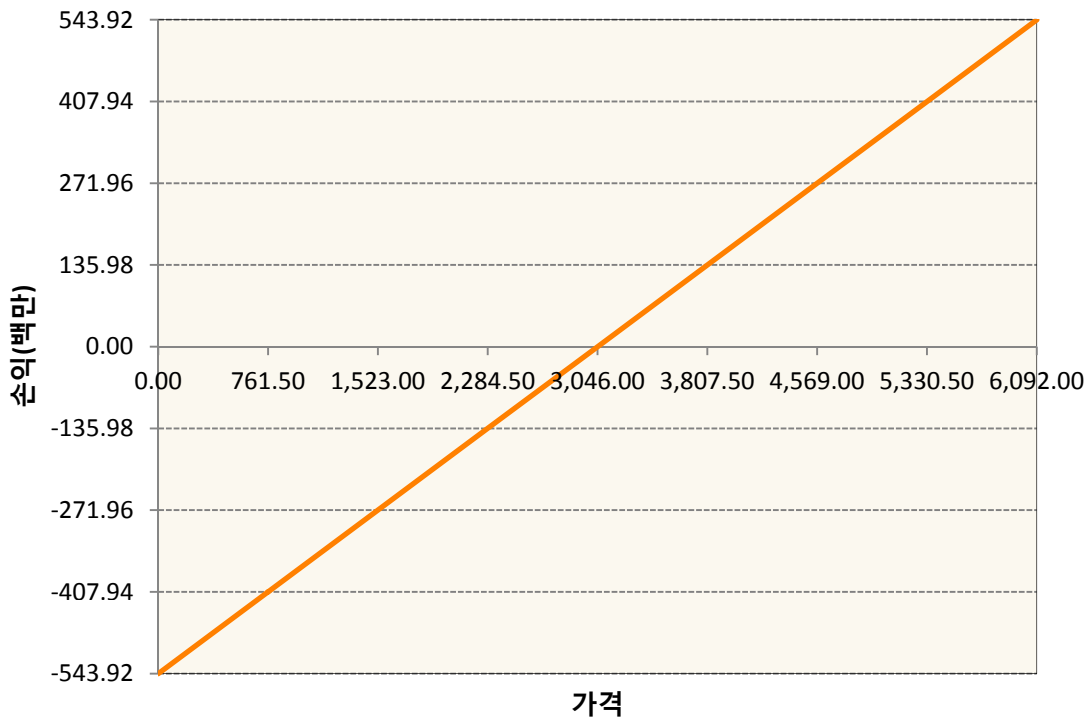
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	544	0	544	

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)

56

공시일	2020-06-02
기준일	2020-06-01

차이나인덱스모(주식-파생형)

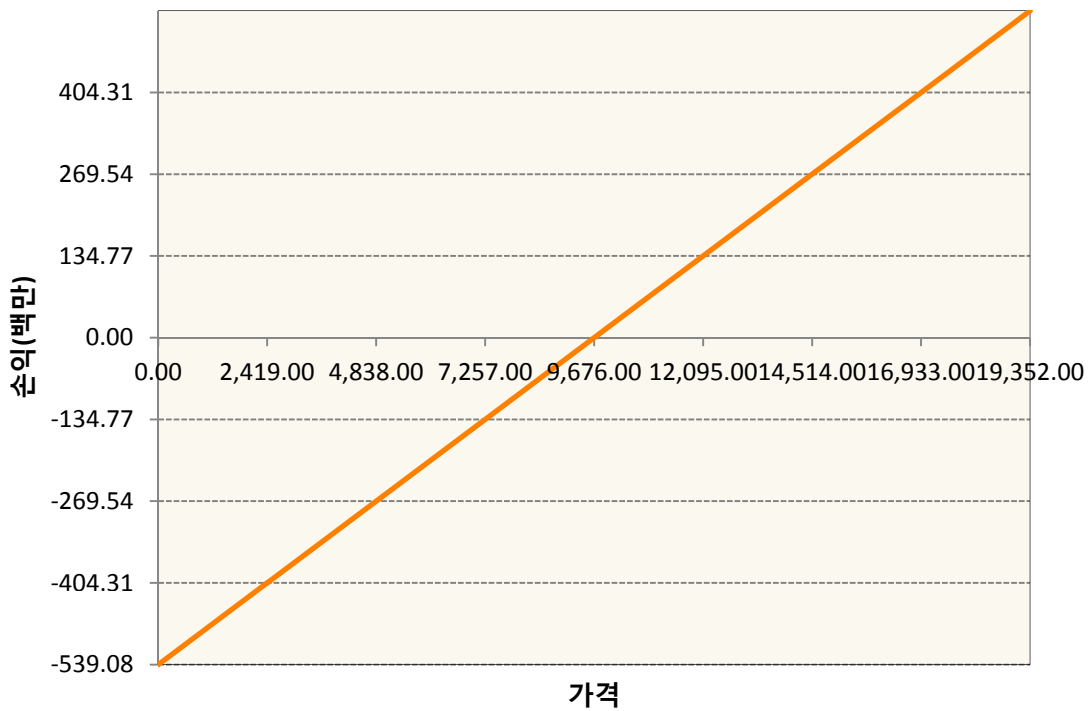
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	539	0	539	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCM0-HSCEI Futures Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM0	HSCEI Futures Jun20	43
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

47

공시일	2020-06-02
기준일	2020-06-01

커버드콜모(주식혼합-파생형)

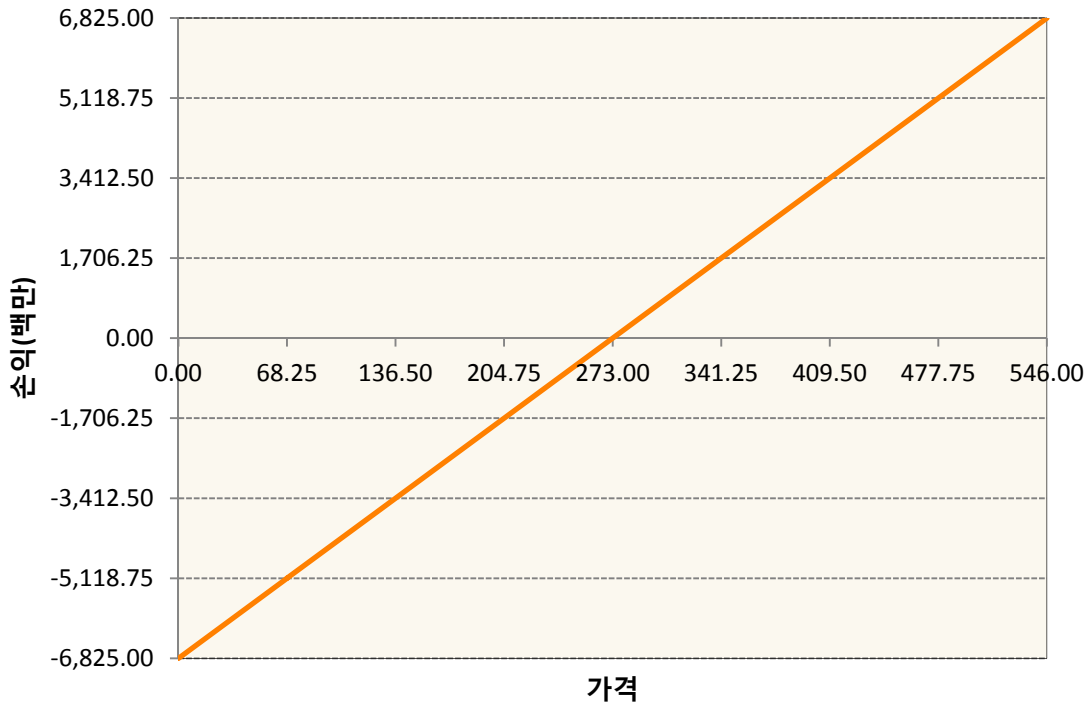
1. 계약금액

(단위:백만원)

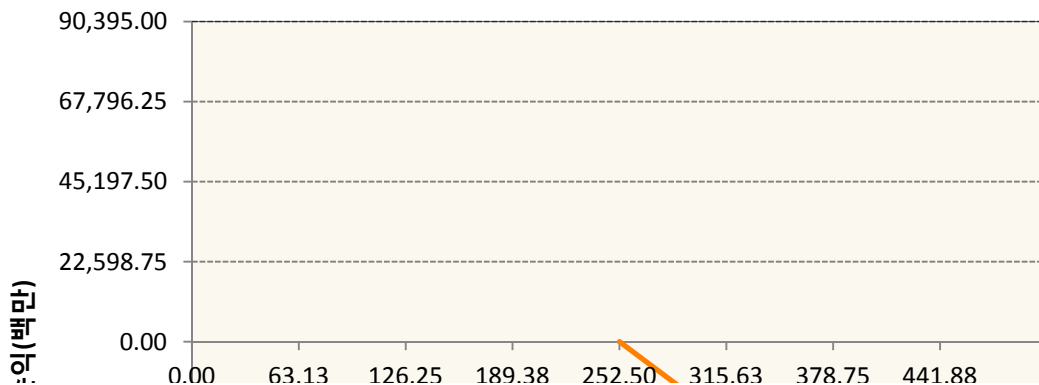
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	2,902	0	2,902	장내
누계	유가증권	선물	6,825	0	6,825	장내
누계	유가증권	옵션	0	354,725	-354,725	장내

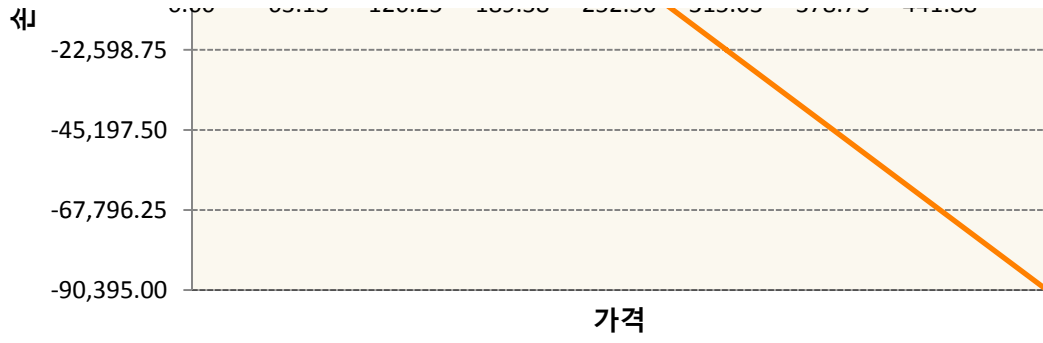
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

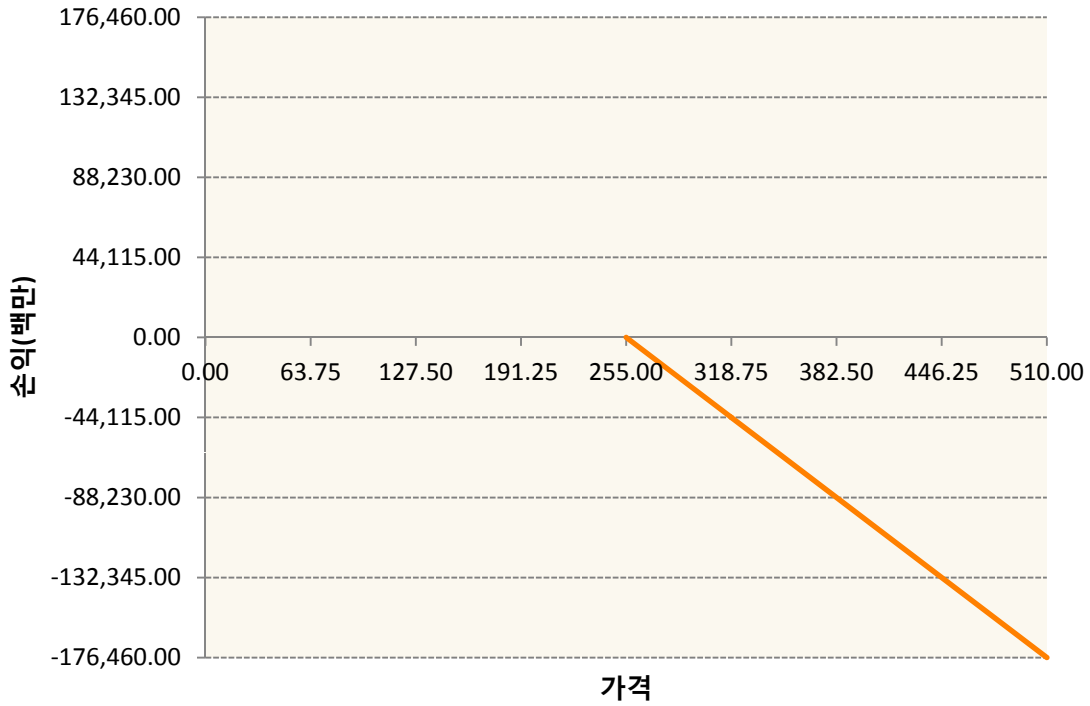


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

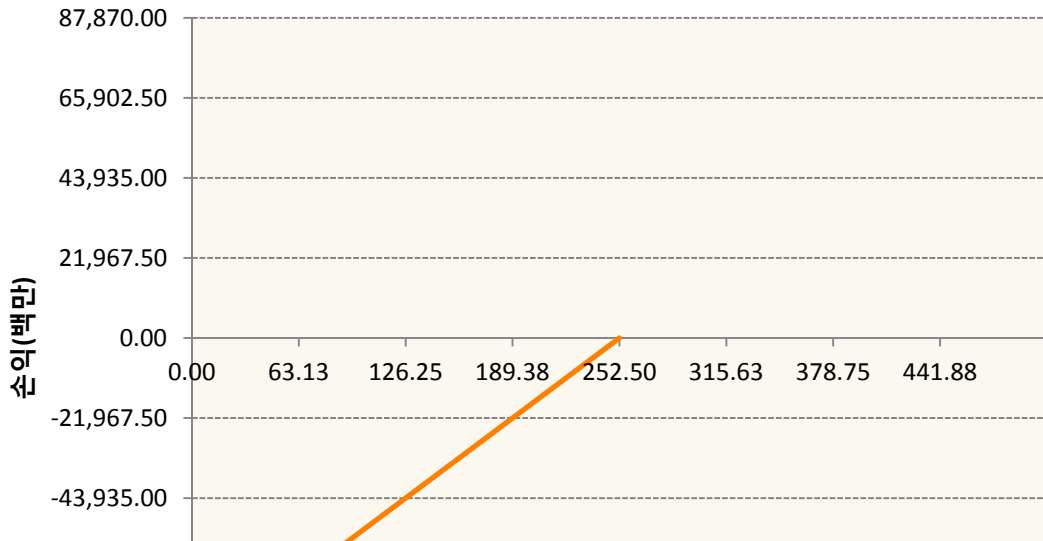


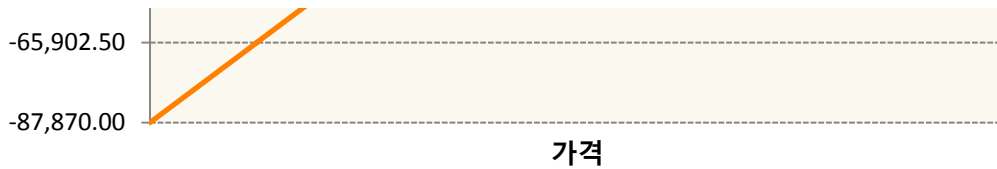


KR4201Q62550-2020-06 콜255



KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						546
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-546	-546	-546	-546	-546	-546	-546	
-5.33%	-364	-364	-364	-364	-364	-364	-364	
-2.67%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	182	182	182	182	182	182	182	
5.33%	364	364	364	364	364	364	364	
8.00%	546	546	546	546	546	546	546	
KR4201Q62527		2020-06 콜252.5						7,509
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	6,124	5,914	5,704	5,493	5,283	5,072	4,862	
-5.33%	4,616	4,420	4,221	4,019	3,816	3,611	3,405	
-2.67%	2,619	2,476	2,323	2,160	1,990	1,814	1,633	
0%	293	210	112	0	-125	-260	-404	
2.67%	-2,207	-2,246	-2,298	-2,366	-2,446	-2,540	-2,644	
5.33%	-4,780	-4,795	-4,819	-4,854	-4,901	-4,959	-5,029	
8.00%	-7,377	-7,382	-7,392	-7,408	-7,432	-7,466	-7,509	
KR4201Q62550		2020-06 콜255						14,327
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	11,098	10,702	10,304	9,904	9,503	9,100	8,697	
-5.33%	8,549	8,145	7,739	7,332	6,923	6,514	6,103	
-2.67%	4,992	4,672	4,335	3,986	3,626	3,259	2,884	
0%	688	486	256	0	-277	-571	-880	
2.67%	-4,049	-4,151	-4,284	-4,446	-4,634	-4,846	-5,079	
5.33%	-8,983	-9,026	-9,091	-9,181	-9,295	-9,433	-9,595	
8.00%	-13,992	-14,007	-14,034	-14,078	-14,141	-14,223	-14,327	
KR4301Q62525		2020-06 풋252.5						2,004
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,284	-1,403	-1,523	-1,643	-1,763	-1,883	-2,004	
-5.33%	-317	-413	-512	-615	-721	-829	-939	
-2.67%	-15	-52	-98	-152	-214	-282	-356	

0%	38	31	18	0	-25	-56	-93
2.67%	43	43	40	36	29	19	4
5.33%	44	44	43	43	41	39	34
8.00%	44	44	44	44	43	43	42

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

(단위:백만원)

24,059

공시일	2020-06-02
기준일	2020-06-01

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

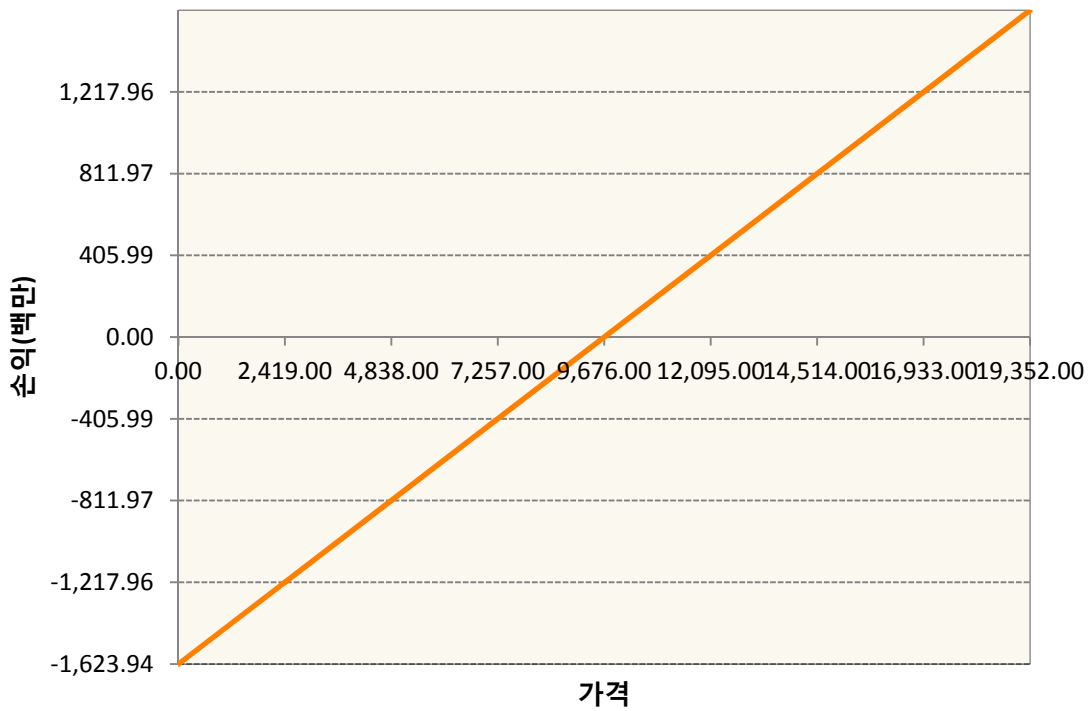
1. 계약금액

(단위:백만원)

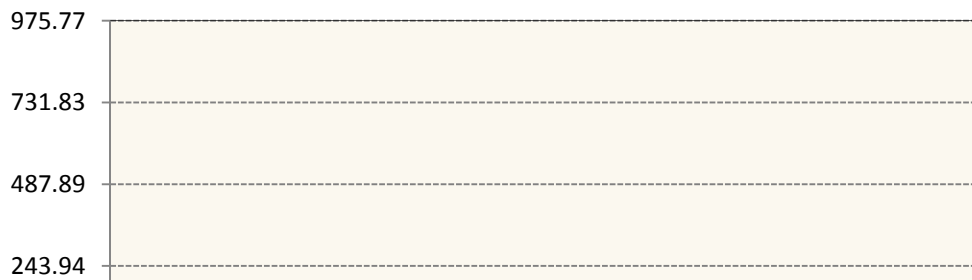
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,624	0	1,624	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,227	-4,227	장내
누계	통화	선도	0	1,530	-1,530	장외

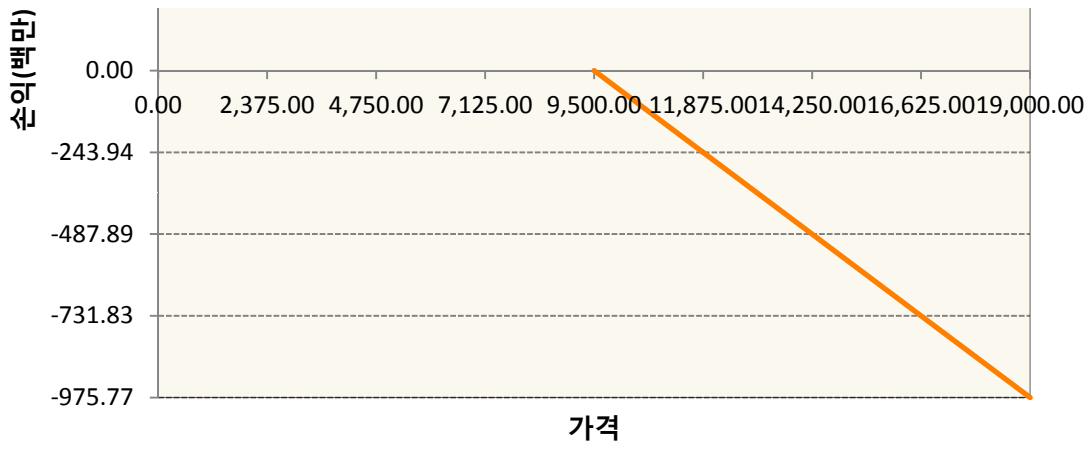
2. 만기시점의 손익구조

HCM0-HSCEI Futures Jun20

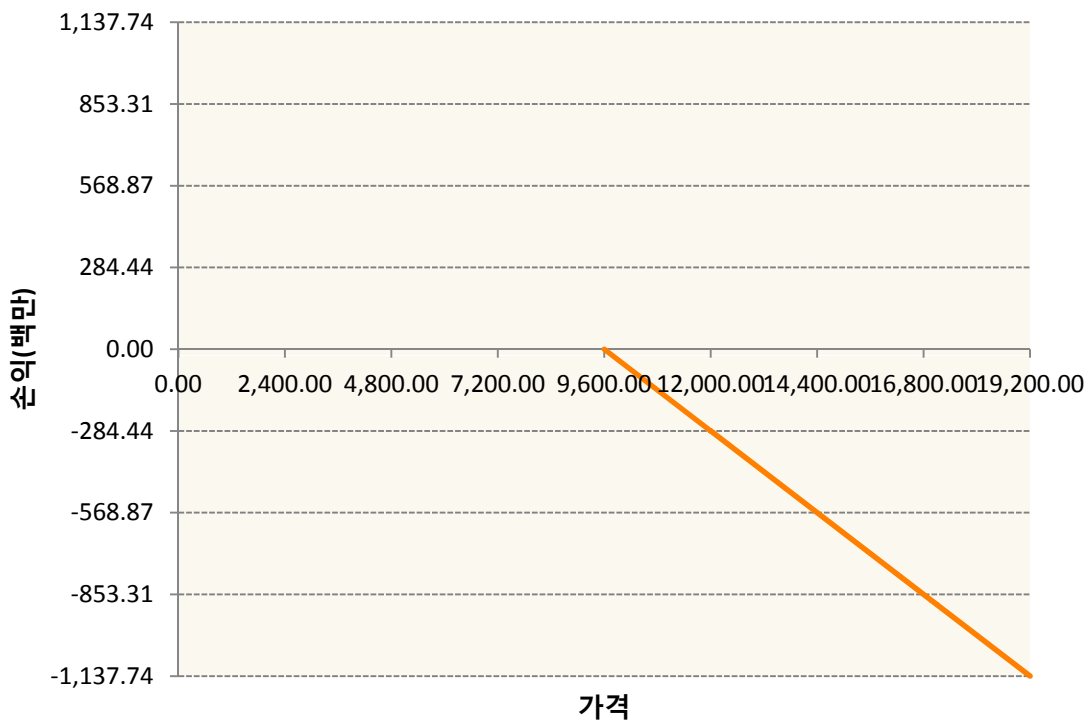


OHHIM0-C95-HSCEI

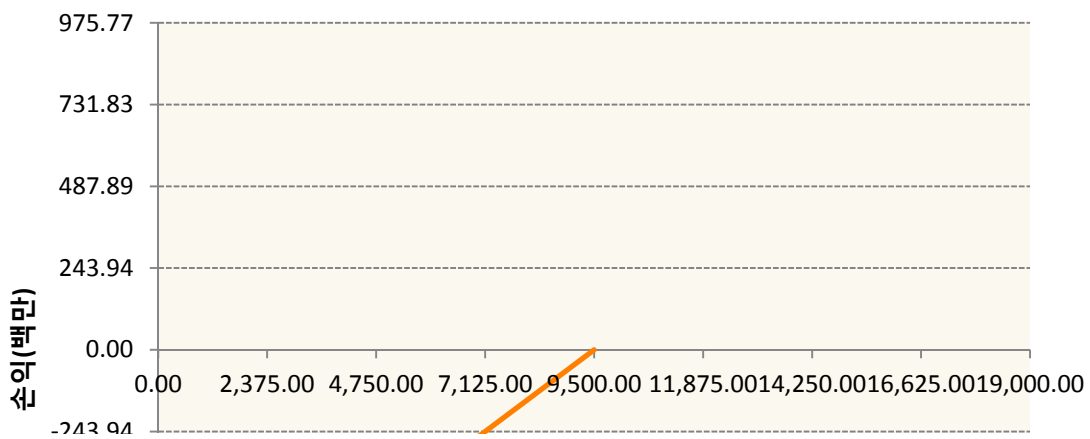


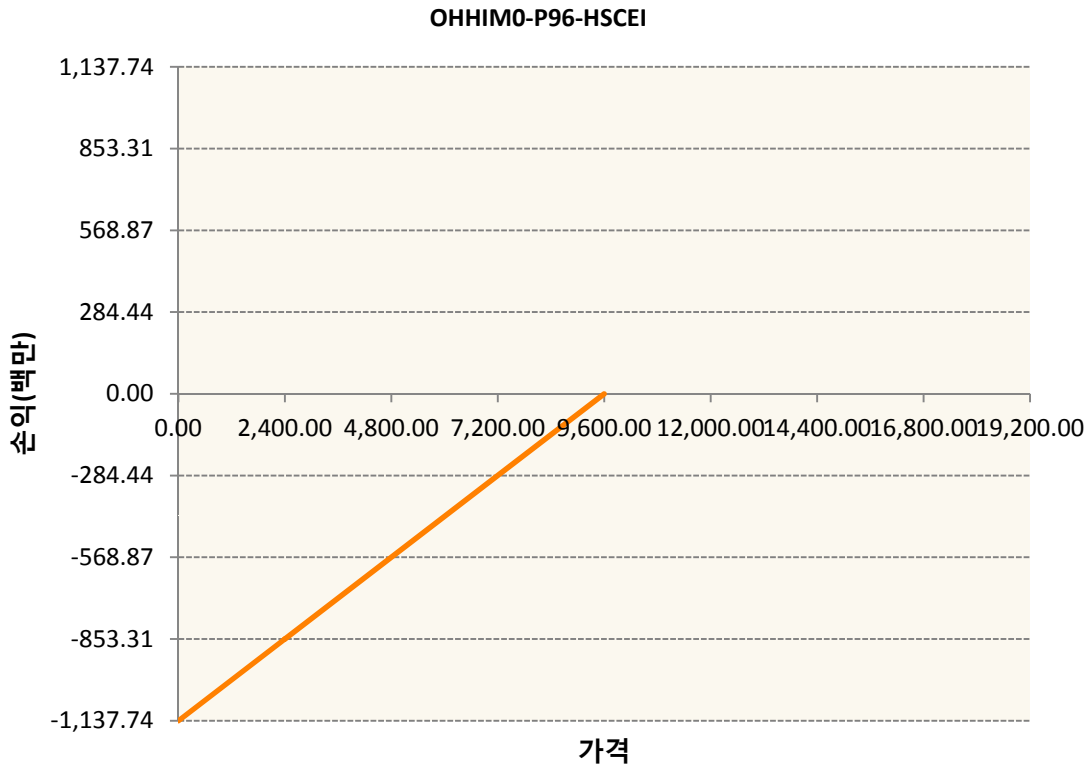
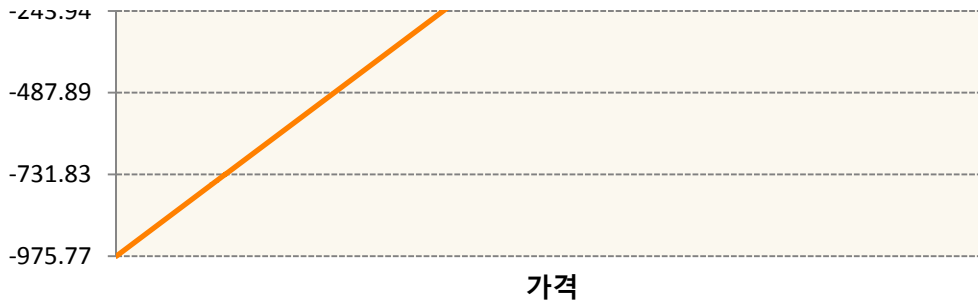


OHHIM0-C96-HSCEI



OHHIM0-P95-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E	122
HCM0 HSCEI Futures Jun20	130
OHHIM0-C9 HSCEI	78
OHHIM0-C9 HSCEI	91
OHHIM0-P9 HSCEI	78
OHHIM0-P9 HSCEI	91

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

568

공시일	2020-06-02
기준일	2020-06-01

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

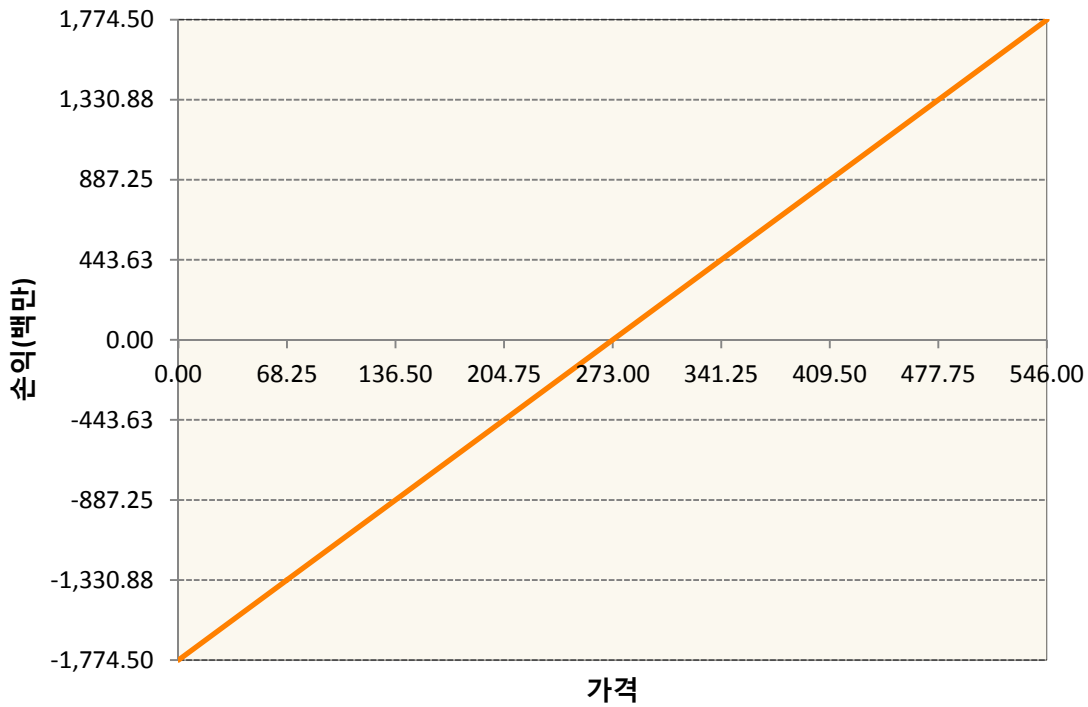
1. 계약금액

(단위:백만원)

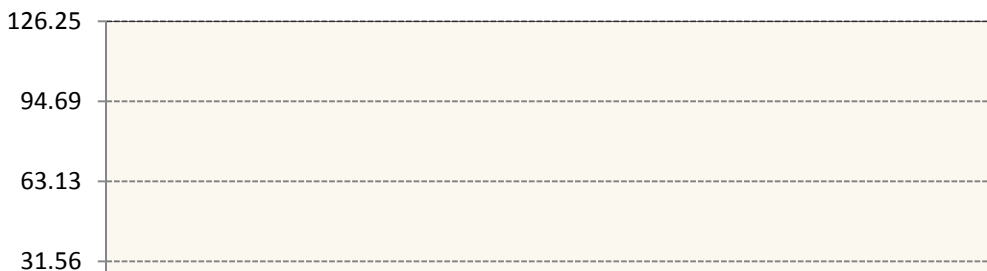
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,775	0	1,775	장내
누계	유가증권	스왑	2,125	0	2,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,171	-3,171	장내

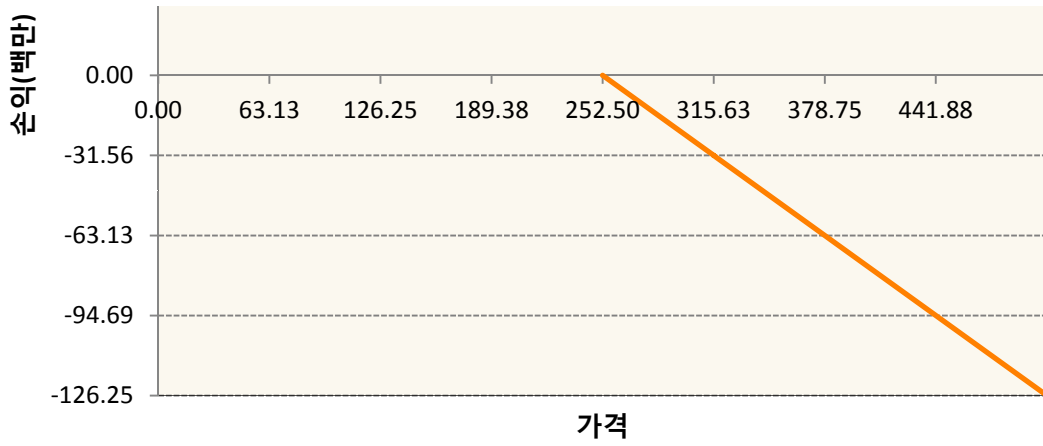
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

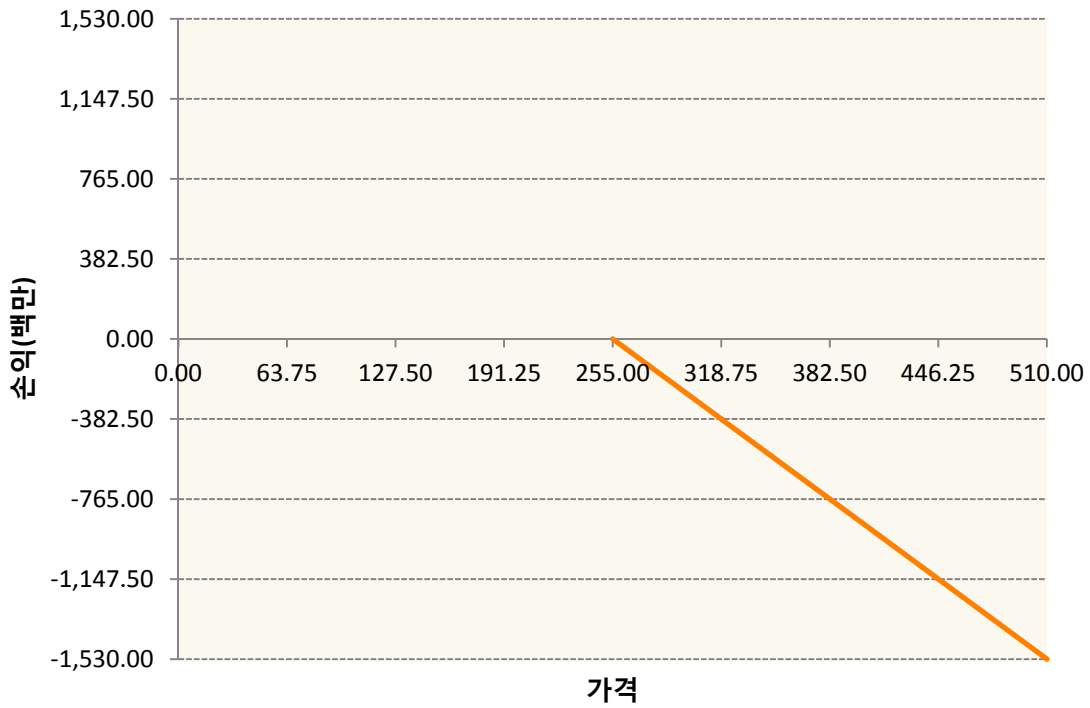


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

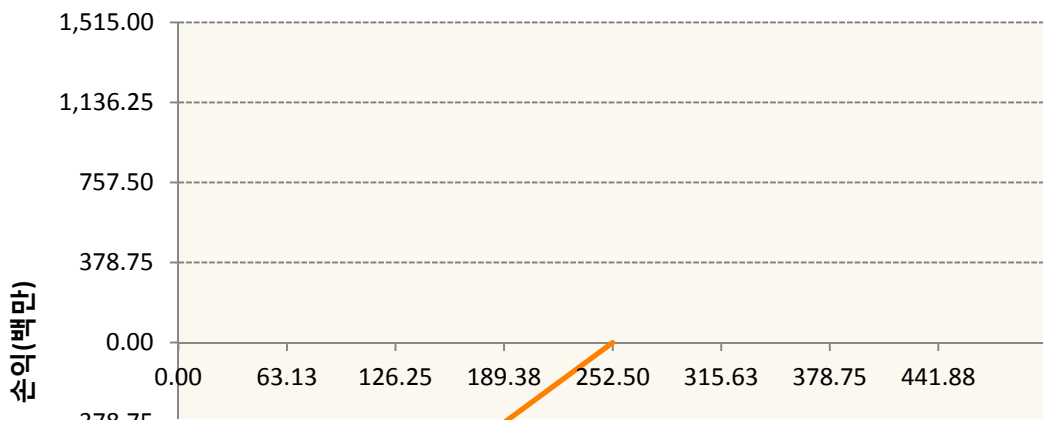




KR4201Q62550-2020-06 콜255



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						142
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-142	-142	-142	-142	-142	-142	-142	
-5.33%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-95	
-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%	95	95	95	95	95	95	95	
8.00%	142	142	142	142	142	142	142	
KR4201Q62527		2020-06 콜252.5						10
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	9	8	8	8	7	7	7	
-5.33%	6	6	6	6	5	5	5	
-2.67%	4	3	3	3	3	3	2	
0%	0	0	0	0	0	0	-1	
2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-4	-4	
5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7	
8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10	
KR4201Q62550		2020-06 콜255						124
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	96	93	89	86	82	79	75
-5.33%	74	71	67	64	60	56	53
-2.67%	43	41	38	35	31	28	25
0%	6	4	2	0	-2	-5	-8
2.67%	-35	-36	-37	-39	-40	-42	-44
5.33%	-78	-78	-79	-80	-81	-82	-83
8.00%	-121	-121	-122	-122	-123	-123	-124
KR4301Q62525 2020-06 풋252.5							35
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22	-24	-26	-28	-30	-32	-35
-5.33%	-5	-7	-9	-11	-12	-14	-16
-2.67%	0	-1	-2	-3	-4	-5	-6
0%	1	1	0	0	0	-1	-2
2.67%	1	1	1	1	1	0	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

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

(단위:백만원)

555

공시일	2020-06-02
기준일	2020-06-01

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

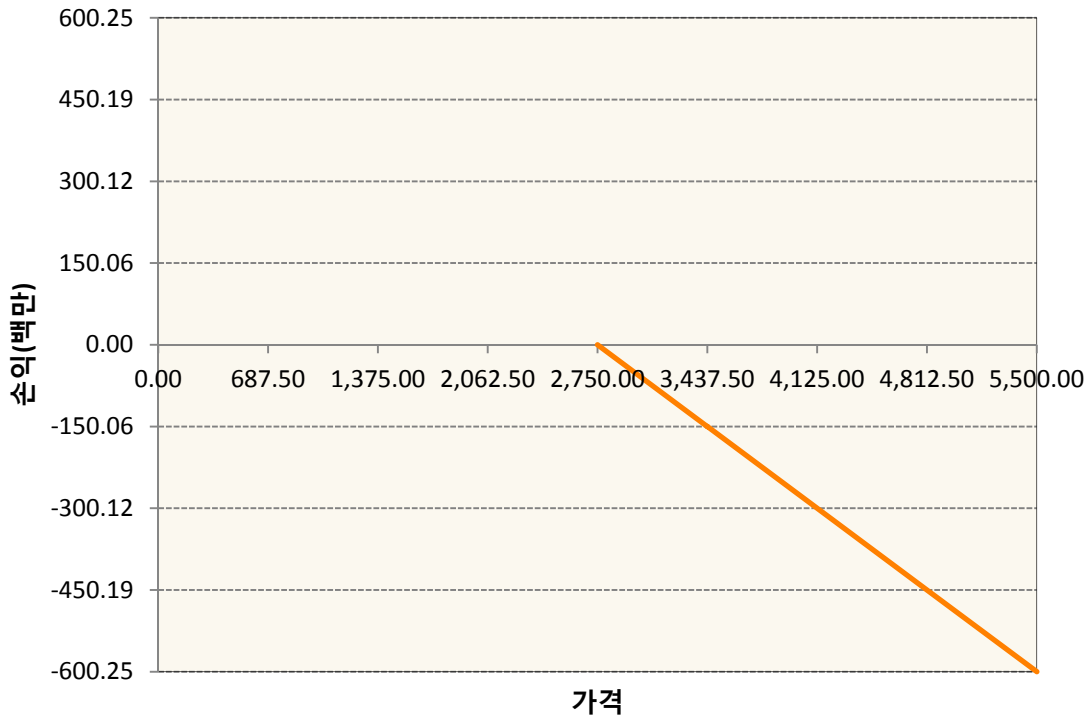
1. 계약금액

(단위:백만원)

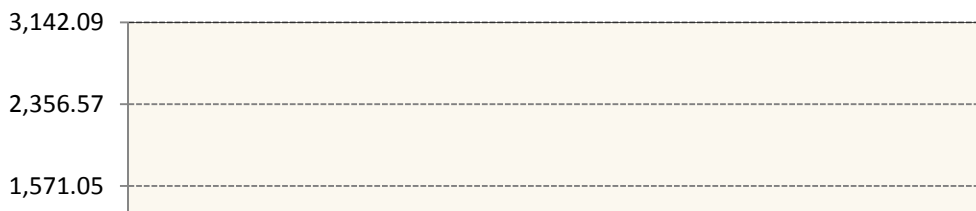
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,633	0	1,633	
누계	유가증권	스왑	8,136	0	8,136	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,485	-7,485	장내
누계	통화	선도	0	2,952	-2,952	장외

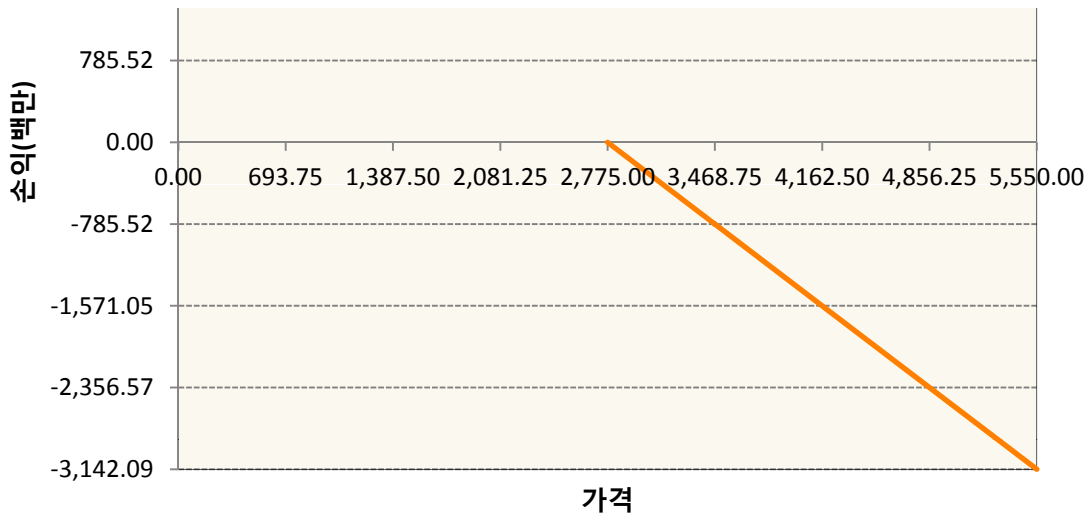
2. 만기시점의 손익구조

OESXM0-C2750-EURO STOXX 50

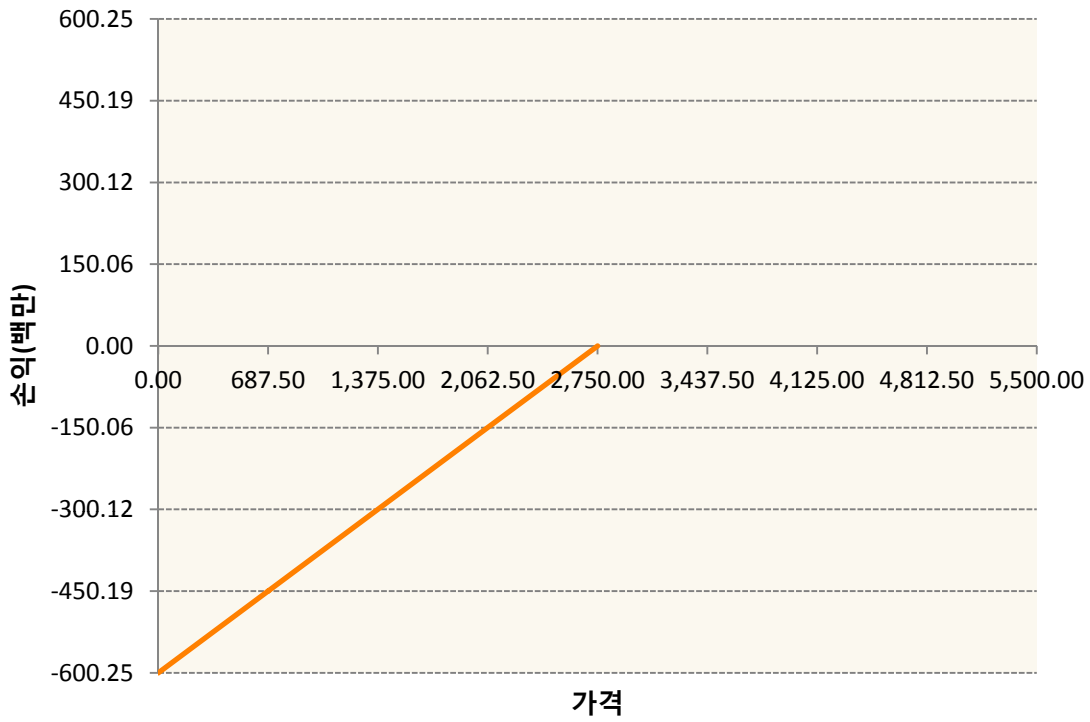


OESXM0-C2775-EURO STOXX 50

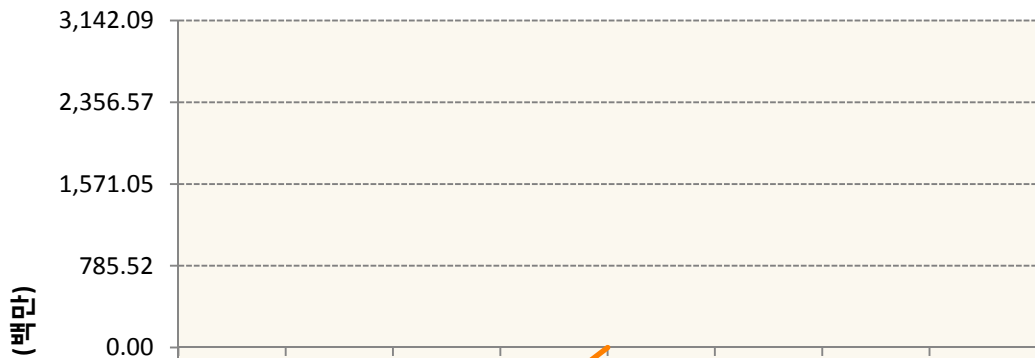


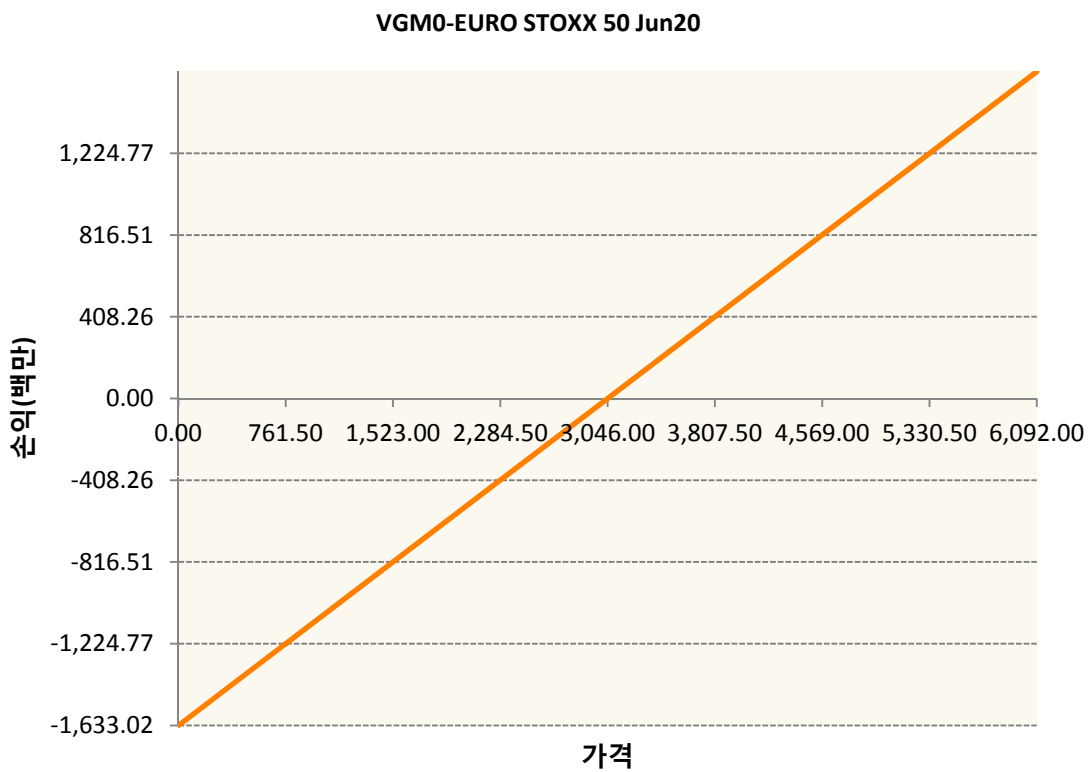
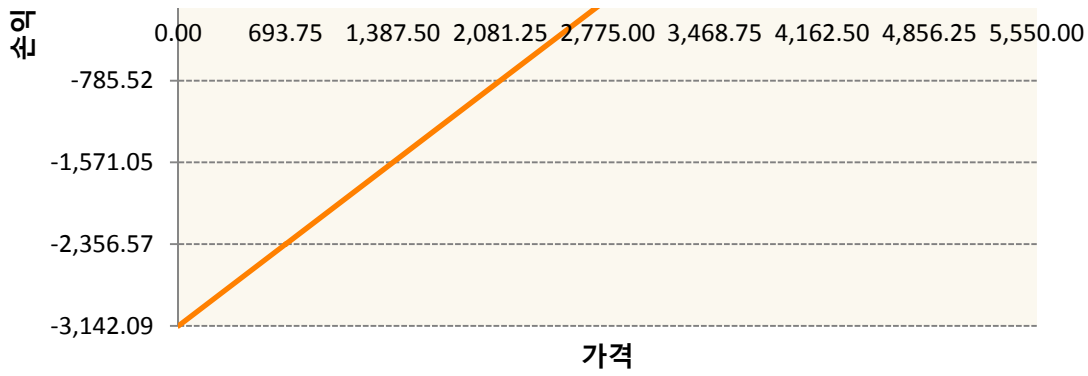


OESXM0-P2750-EURO STOXX 50



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	251
OESXM0-P2' EURO STOXX 50	48
OESXM0-P2' EURO STOXX 50	251
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20	131

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

(단위:백만원)

1,128

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

(단위:백만원)

1,226

공시일	2020-06-02
기준일	2020-06-01

ETF스마트레버리지목표전환형9호

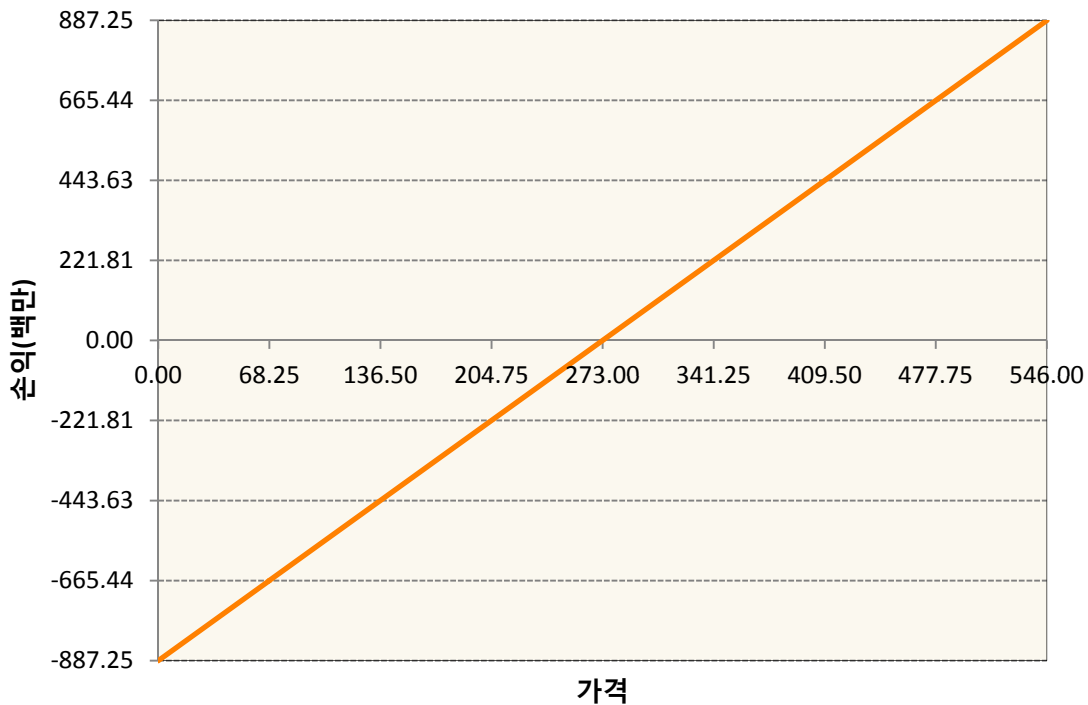
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	887	0	887	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						71
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71	
-5.33%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47	
-2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	24	24	24	24	24	24	24	
5.33%	47	47	47	47	47	47	47	
8.00%	71	71	71	71	71	71	71	

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

(단위:백만원)

106

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

(단위:백만원)

155

공시일	2020-06-02
기준일	2020-06-01

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

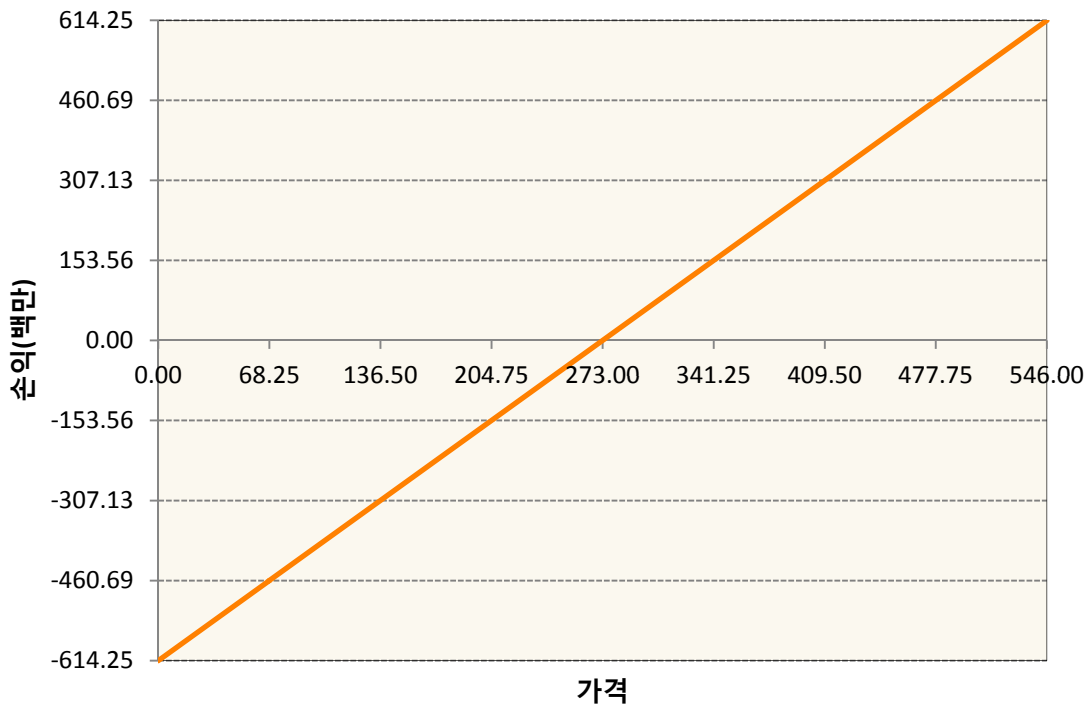
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	614	0	614	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						49
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
-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%	33	33	33	33	33	33	33	
8.00%	49	49	49	49	49	49	49	

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

(단위:백만원)

74

공시일	2020-06-02
기준일	2020-06-01

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

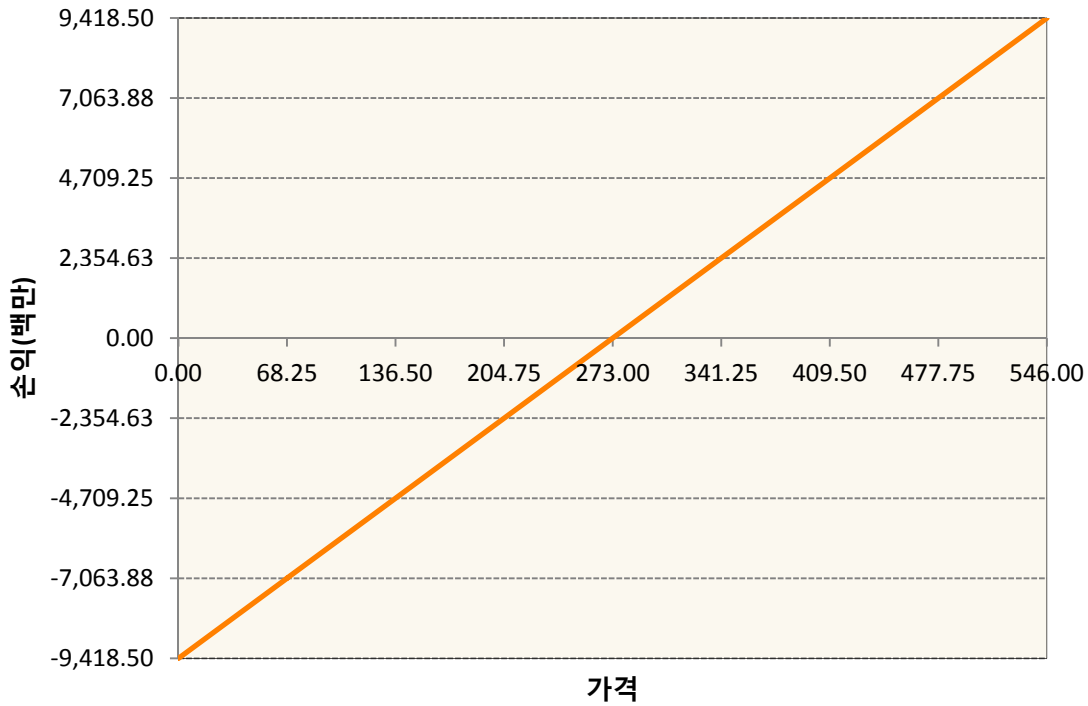
1. 계약금액

(단위:백만원)

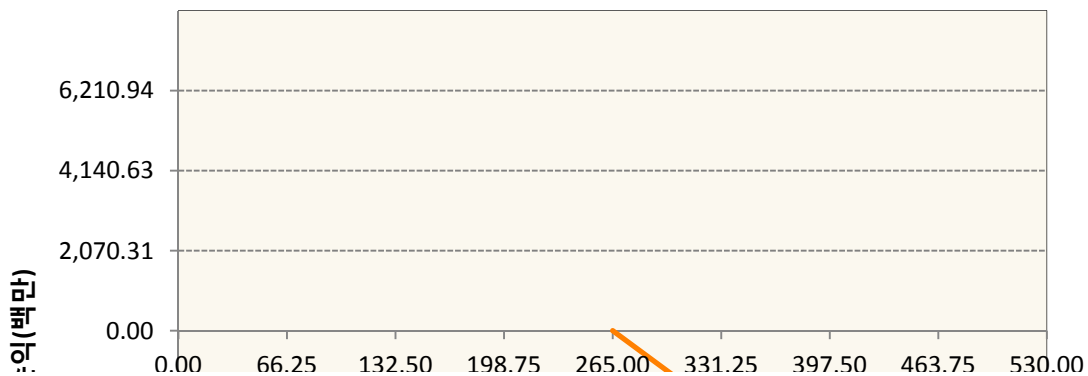
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	204	-204	장내
신규	유가증권	옵션	194	0	194	장내
누계	유가증권	선물	9,419	0	9,419	장내
누계	유가증권	옵션	2,917	17,711	-14,794	장내

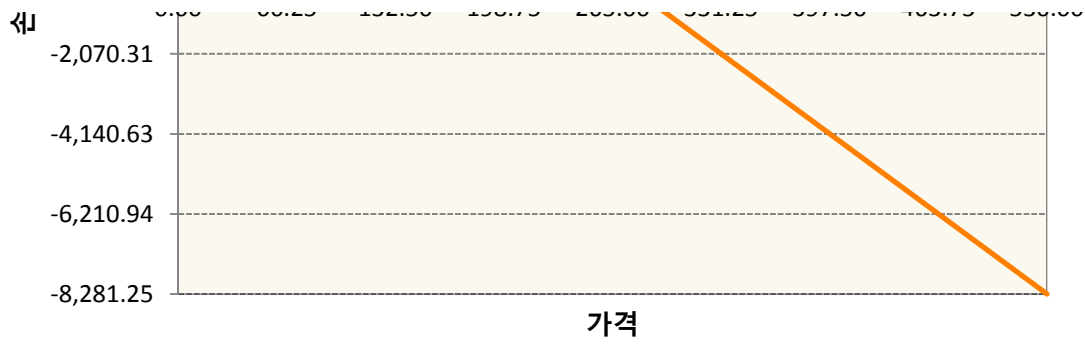
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

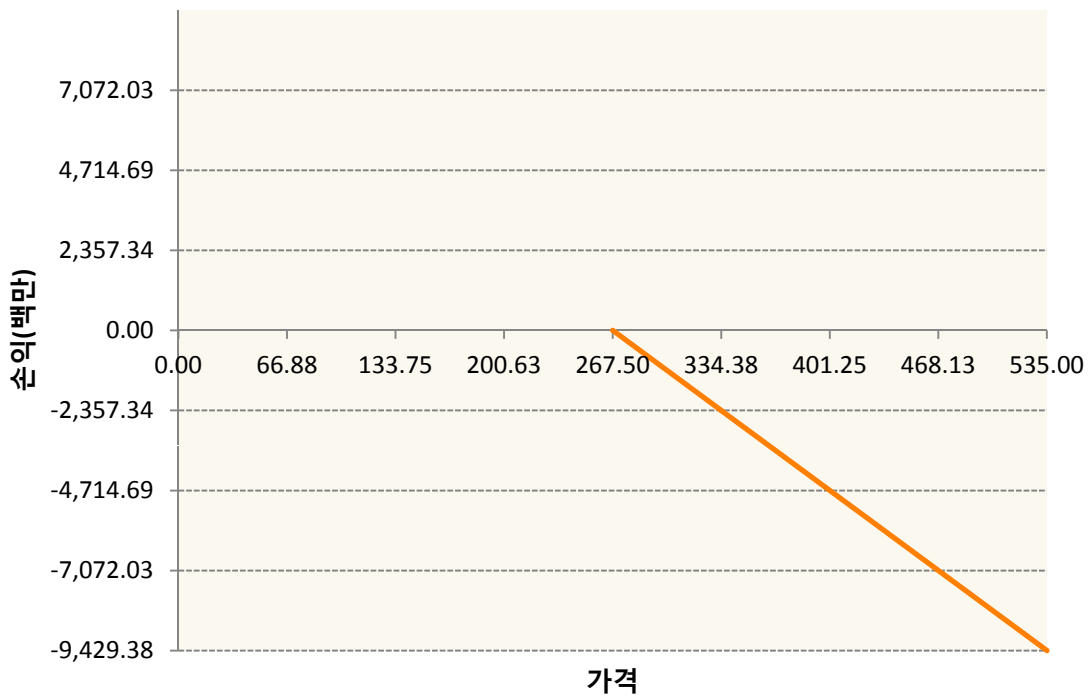


KR4201Q62659-2020-06 콜265

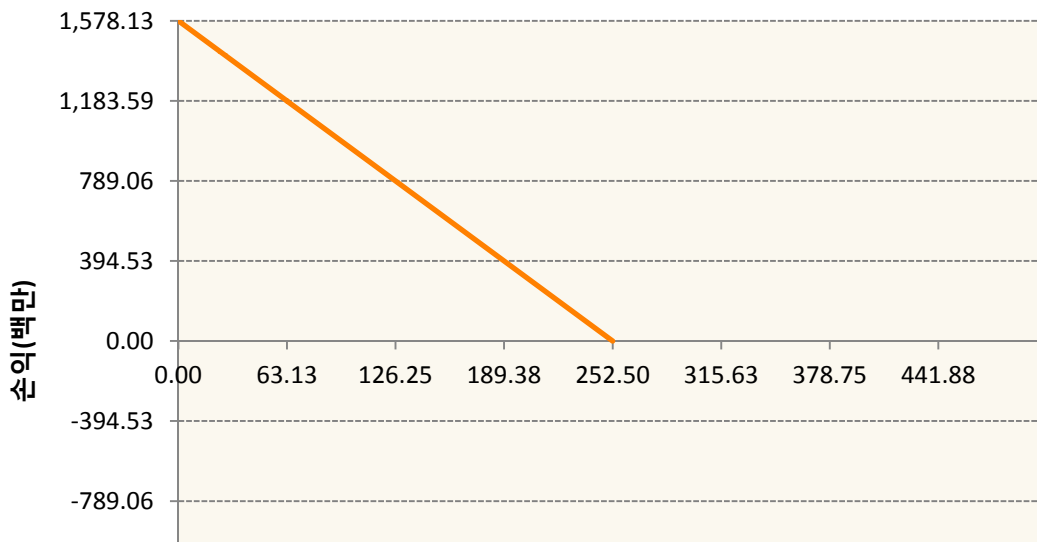


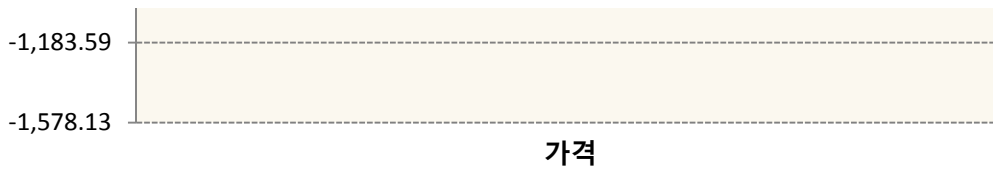


KR4201Q62675-2020-06 콜267.5

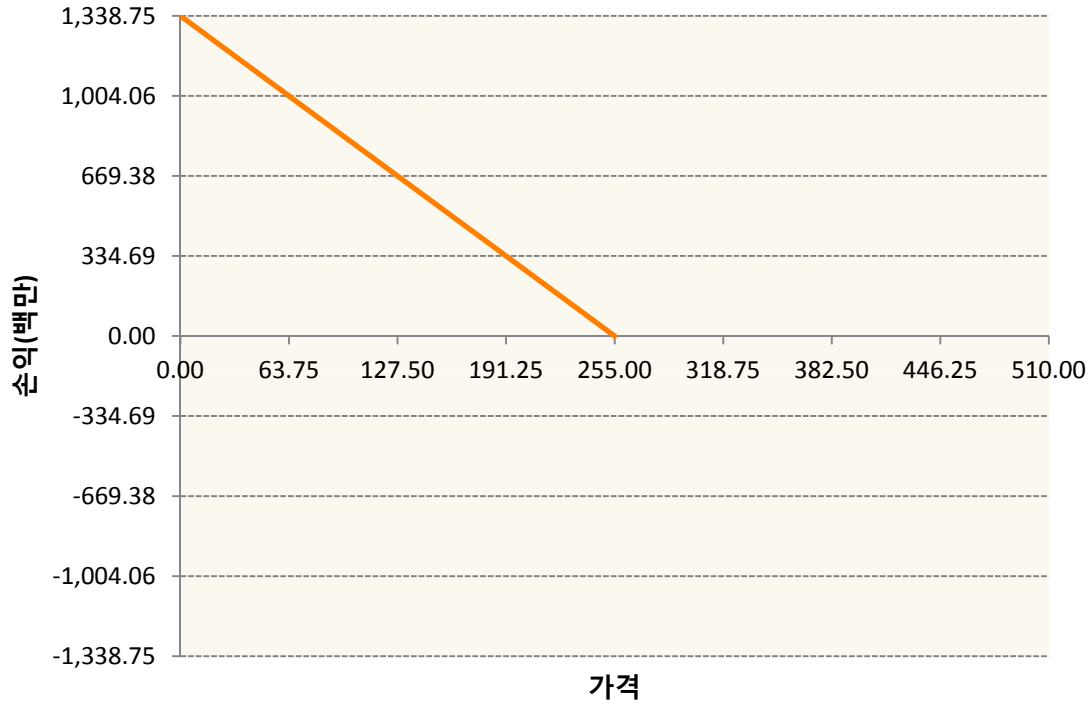


KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





KR4301Q62558-2020-06 풋255



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						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						593
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	348	336	324	310	295	280	265	
-5.33%	294	276	259	241	223	204	186	
-2.67%	196	177	157	138	118	99	80	

0%	52	35	18	0	-18	-36	-55
2.67%	-129	-141	-154	-168	-183	-199	-215
5.33%	-336	-342	-351	-360	-371	-383	-396
8.00%	-555	-558	-563	-569	-576	-584	-593

KR4201Q62675 2020-06 콜267.5 648

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	349	338	325	311	297	281	265
-5.33%	301	283	264	245	226	206	186
-2.67%	208	186	164	142	120	98	76
0%	63	42	21	0	-21	-43	-65
2.67%	-128	-144	-161	-179	-197	-216	-235
5.33%	-352	-362	-374	-386	-400	-416	-431
8.00%	-595	-601	-607	-615	-625	-636	-648

KR4301Q62525 2020-06 풋252.5 36

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	23	25	27	30	32	34	36
-5.33%	6	7	9	11	13	15	17
-2.67%	0	1	2	3	4	5	6
0%	-1	-1	0	0	0	1	2
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	0	0
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1

KR4301Q62558 2020-06 풋255 37

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	27	29	30	32	34	36	37
-5.33%	8	10	11	13	15	17	18
-2.67%	1	1	2	4	5	6	7
0%	-1	-1	0	0	1	1	2
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	0
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1

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

(단위:백만원)

2,382

공시일	2020-06-02
기준일	2020-06-01

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	156,141	0	156,141	

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	2020-06-02
기준일	2020-06-01

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	105,277	0	105,277	

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	2020-06-02
기준일	2020-06-01

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	465,122	0	465,122	
누계	통화	선도	0	564,235	-564,235	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	3,430
FX21020H11 KRW/USD 02-06-20E	6,958
FX21020J00€ KRW/USD 10-06-20E	2,940
FX21020J02€ KRW/USD 10-06-20E	1,333
FX21020J02£ KRW/USD 22-06-20E	1,509
FX21020J02¥ KRW/USD 22-06-20E	1,960
FX21020J03¥ KRW/USD 24-07-20E	2,205
FX21020J04£ KRW/USD 24-07-20E	1,764
FX21020J04¥ KRW/USD 24-07-20E	1,960
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	2,038
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	1,940
FX21020K01 KRW/USD 22-06-20E	686
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	2,391
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	980
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,029
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,627
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	3,430
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	6,958

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

22,953

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

(단위:백만원)

212

공시일	2020-06-02
기준일	2020-06-01

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	7,667	0	7,667	
누계	통화	선도	0	7,424	-7,424	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020K01 KRW/USD 15-06-20E	320
FX21020K03 KRW/USD 15-06-20E	11
FX21020K04 KRW/USD 27-07-20E	39
FX21020K04 KRW/USD 27-07-20E	98
FX21020K04 KRW/USD 30-06-20E	37
FX21020K04 KRW/USD 20-07-20E	78
FX21020M0(KRW/USD 20-07-20E	10
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

302

공시일	2020-06-02
기준일	2020-06-01

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

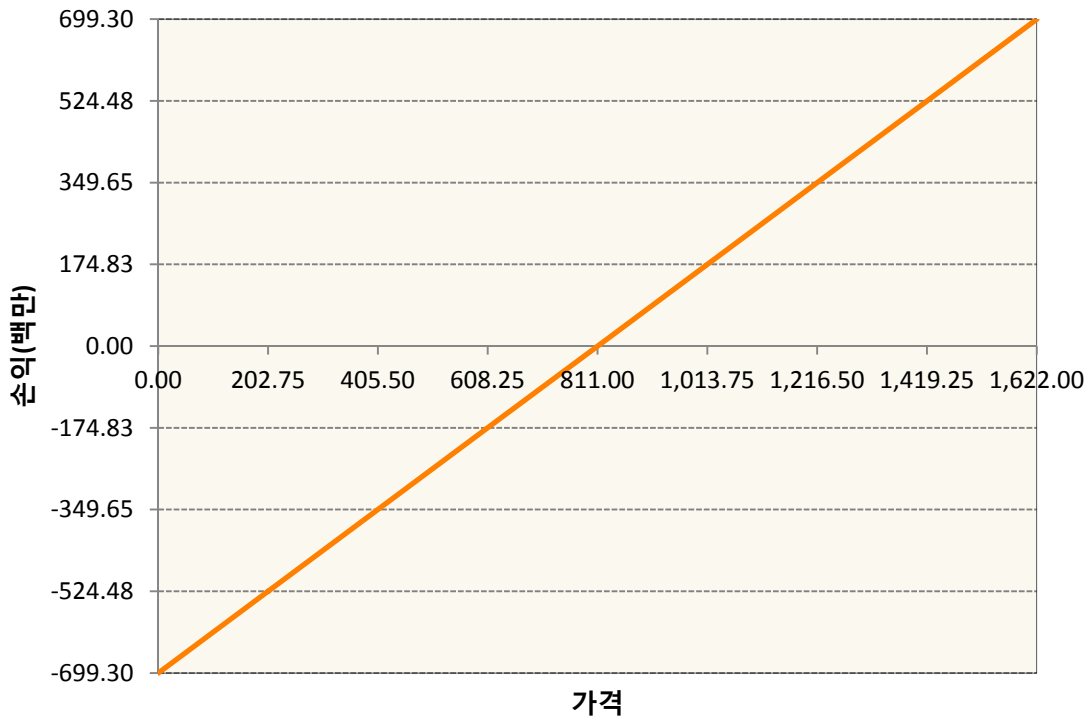
1. 계약금액

(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	699	0	699	
누계	유가증권	스왑	990	0	990	장외
누계	통화	선도	210	892	-682	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	56

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

(단위:백만원)

173

공시일	2020-06-02
기준일	2020-06-01

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

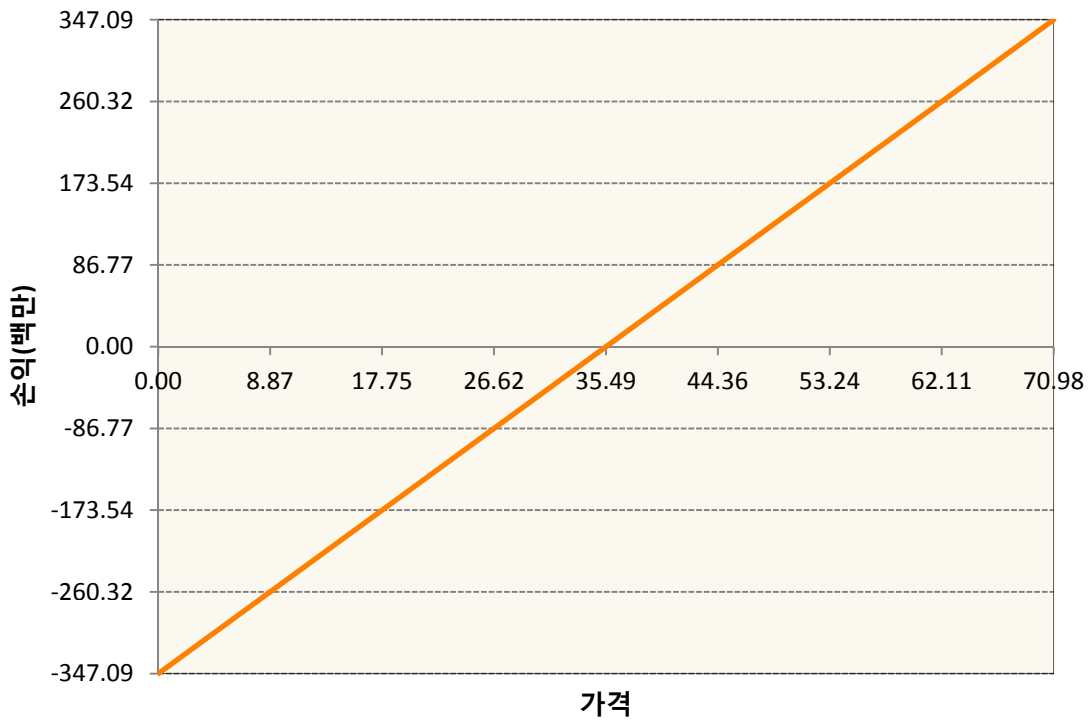
1. 계약금액

(단위:백만원)

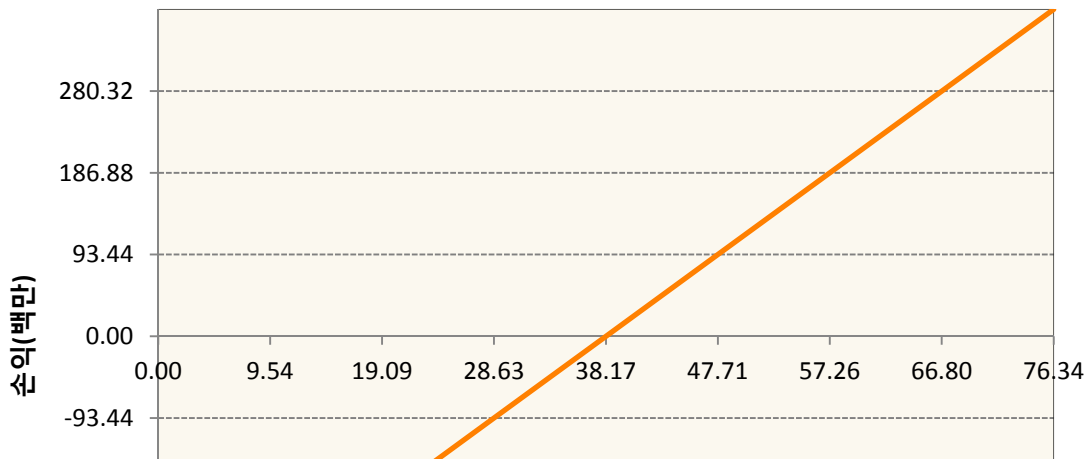
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,740	306	1,434	

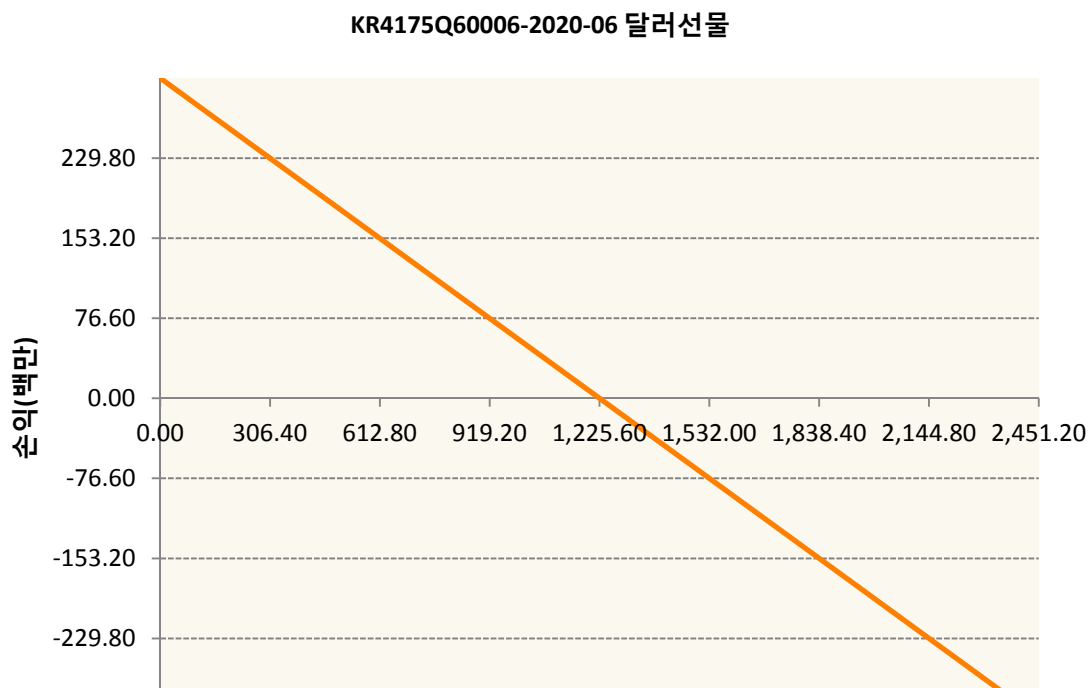
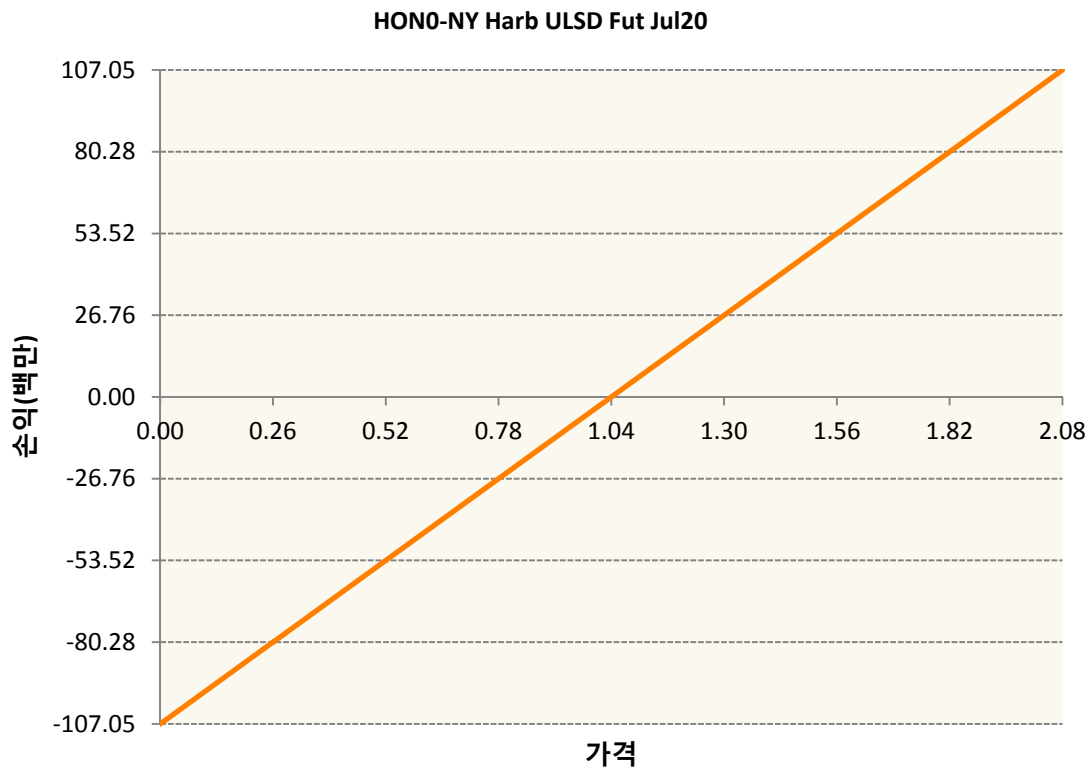
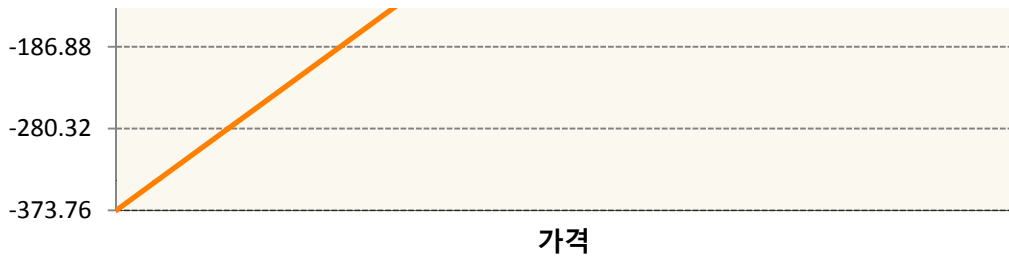
2. 만기시점의 손익구조

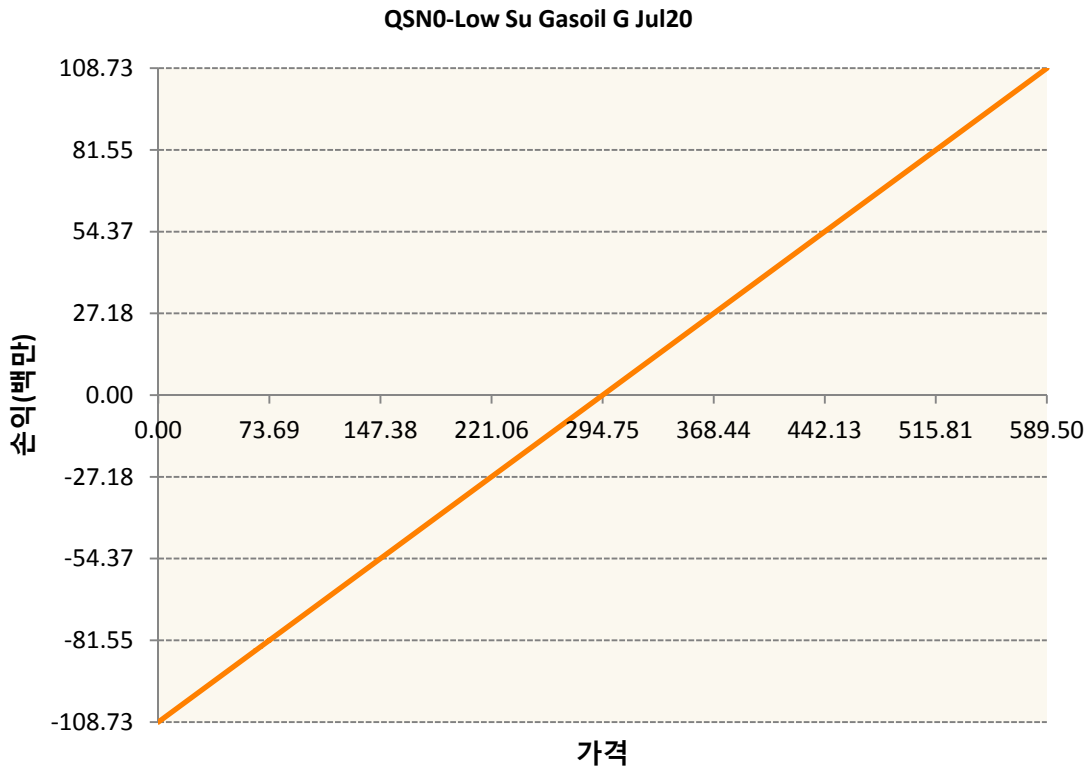
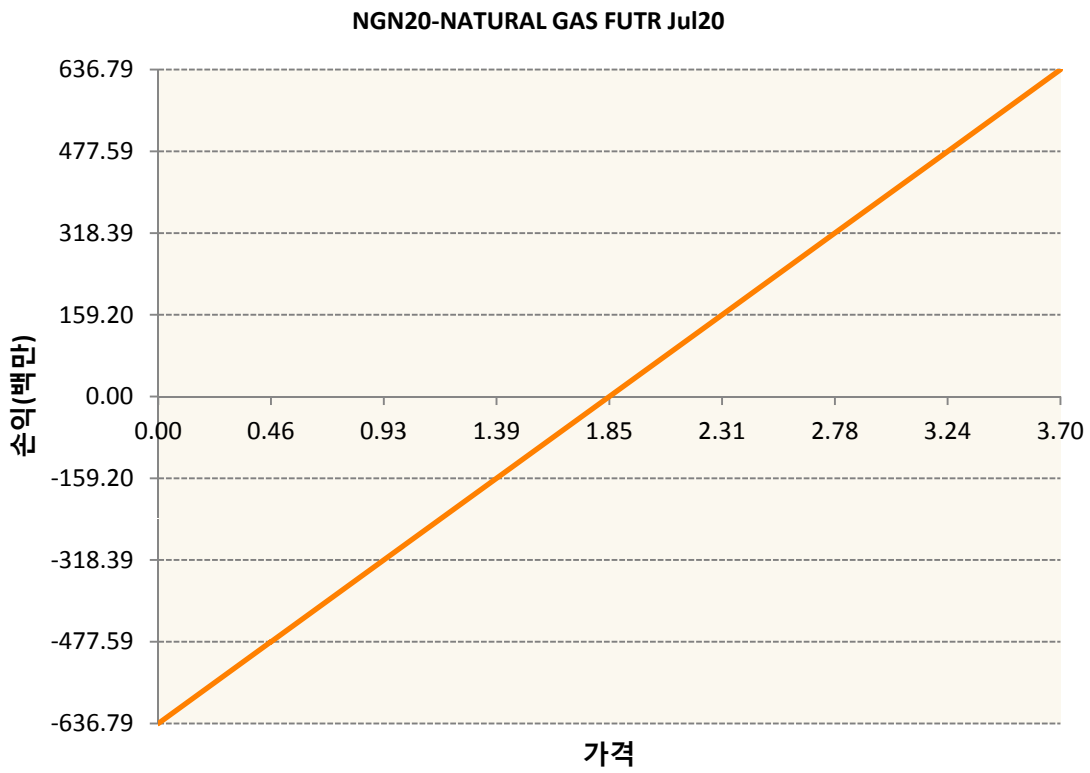
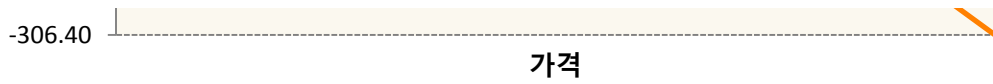
CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20



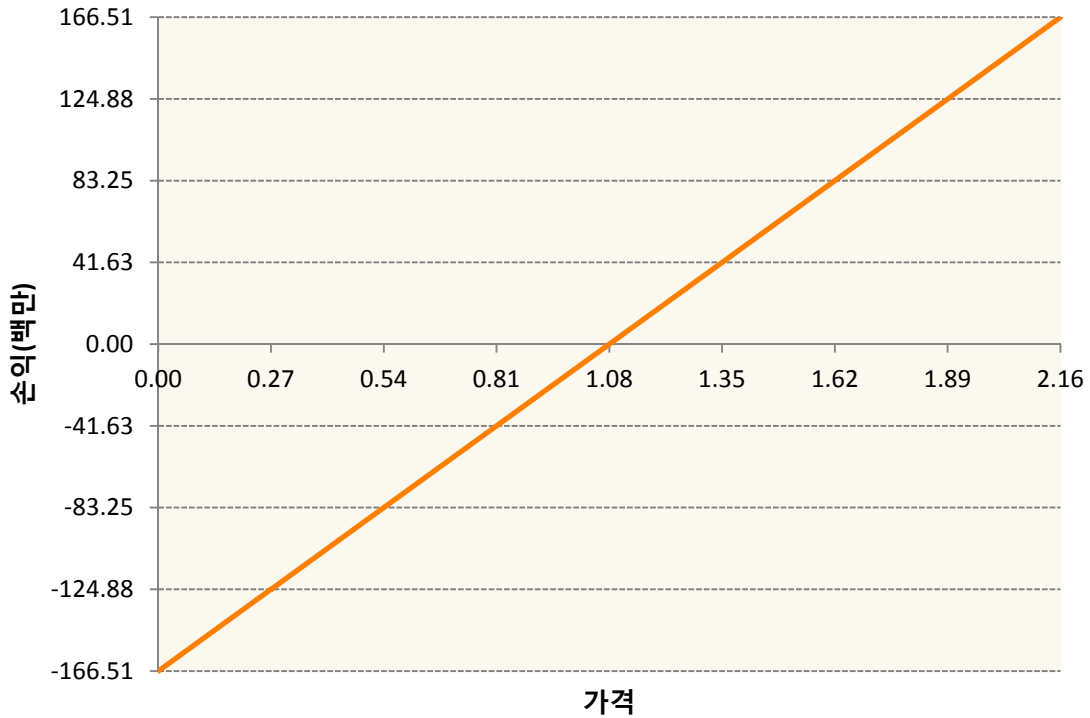
COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20







XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN0	WTI CRUDE FUTURE Jul20	28
COU0	BRENT CRUDE FUTR Sep20	30
HON0	NY Harb ULSD Fut Jul20	9
KR4175Q60C	2020-06 달러선물	25
NGN20	NATURAL GAS FUTR Jul20	51
QSN0	Low Su Gasoil G Jul20	9
XBN0	GASOLINE RBOB FUT Jul20	13

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

841

공시일	2020-06-02
기준일	2020-06-01

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

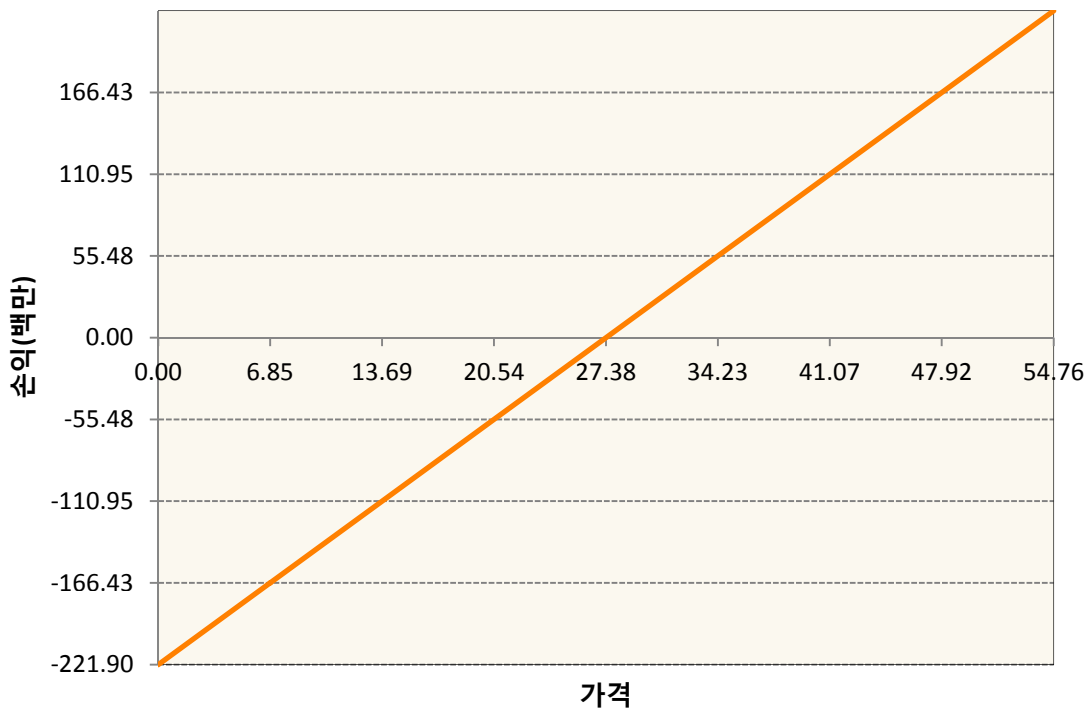
1. 계약금액

(단위:백만원)

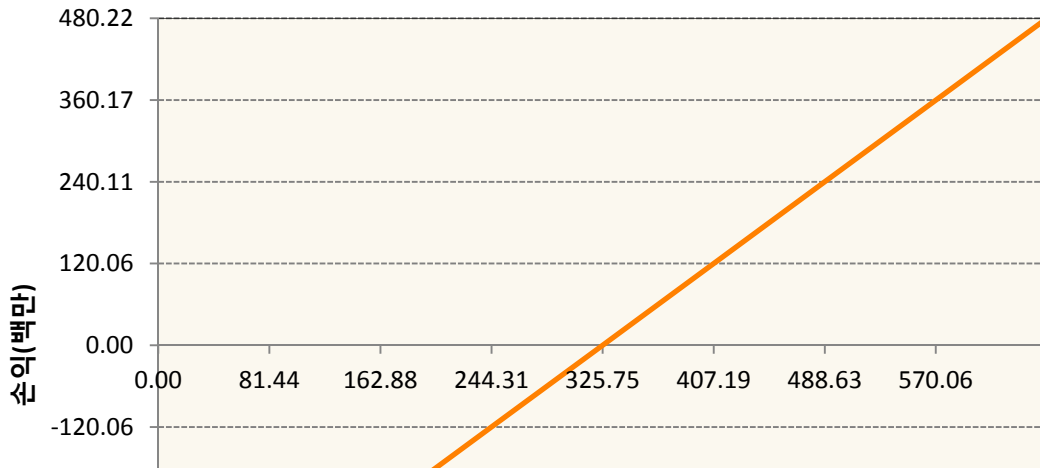
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,430	74	2,357	

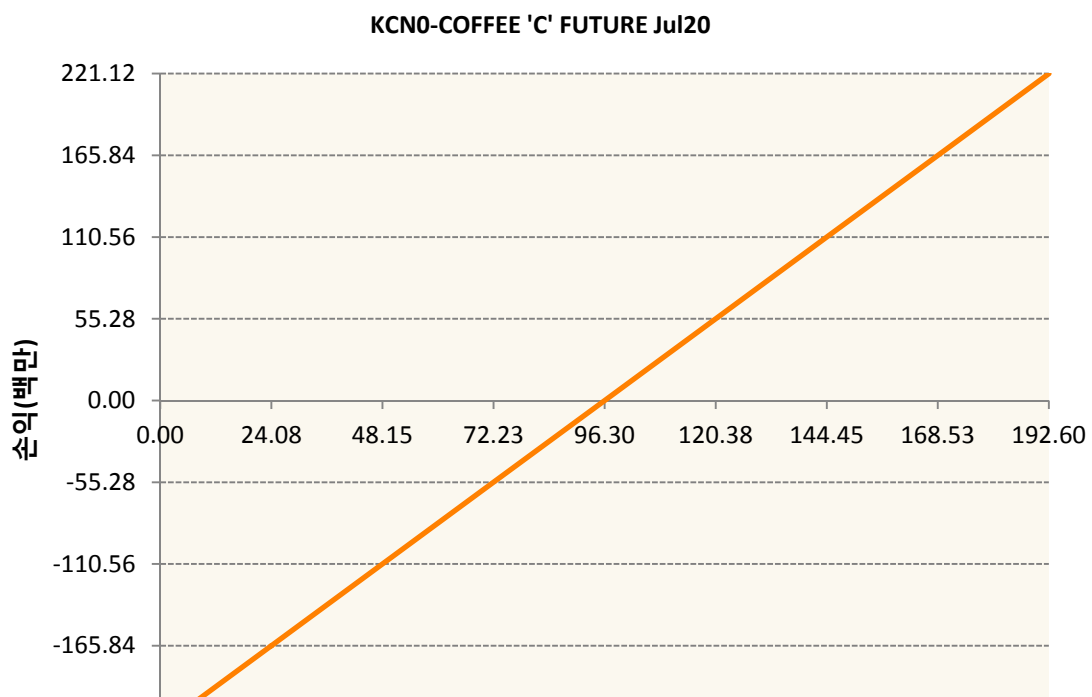
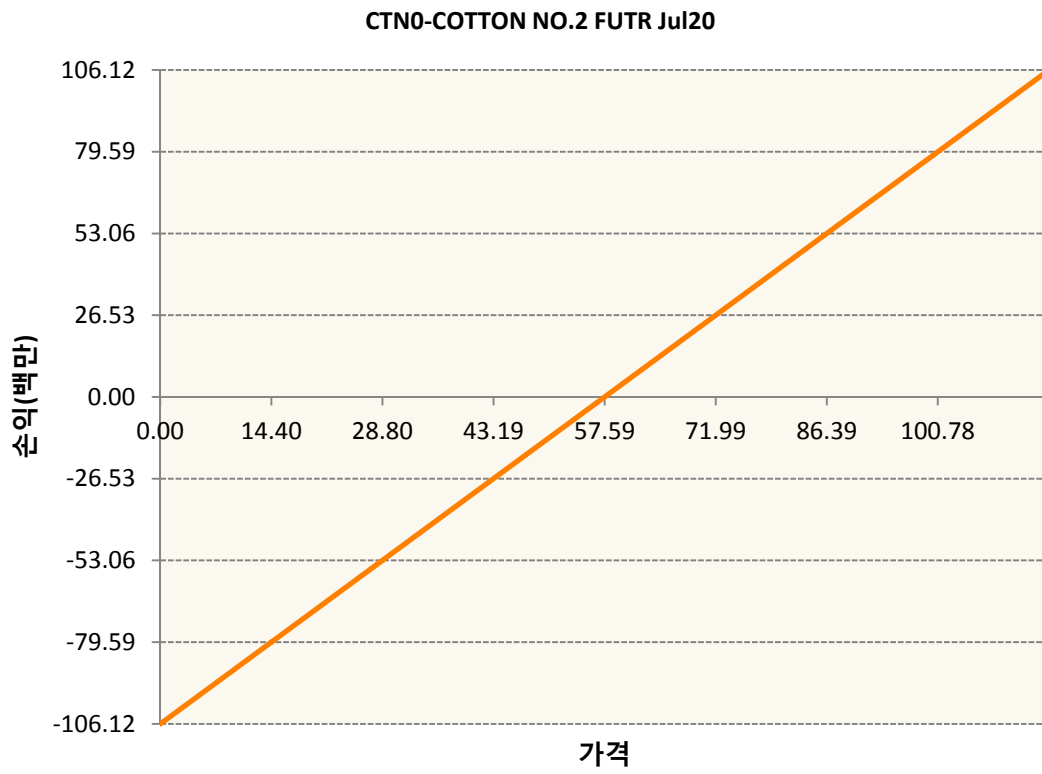
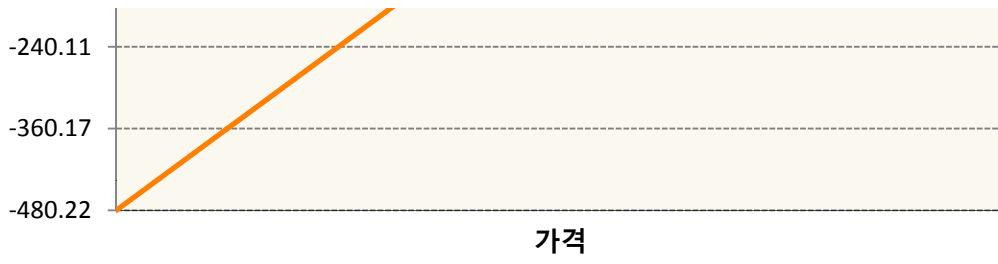
2. 만기시점의 손익구조

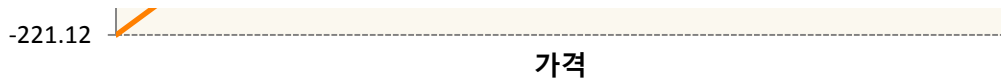
BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20



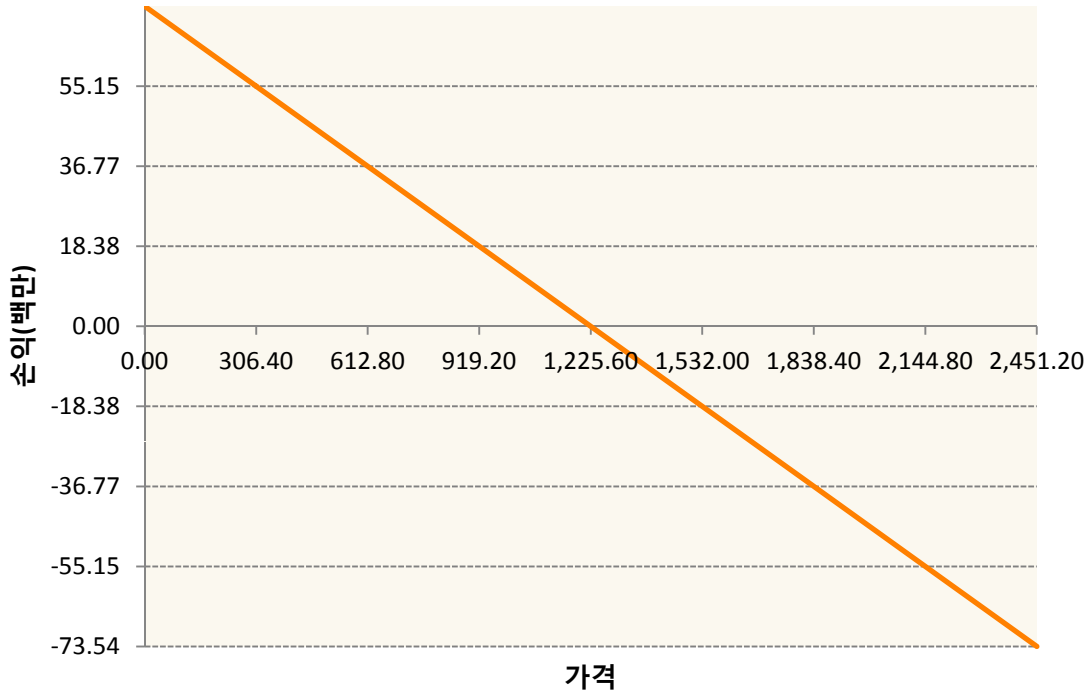
CNO-CORN FUTURE Jul20



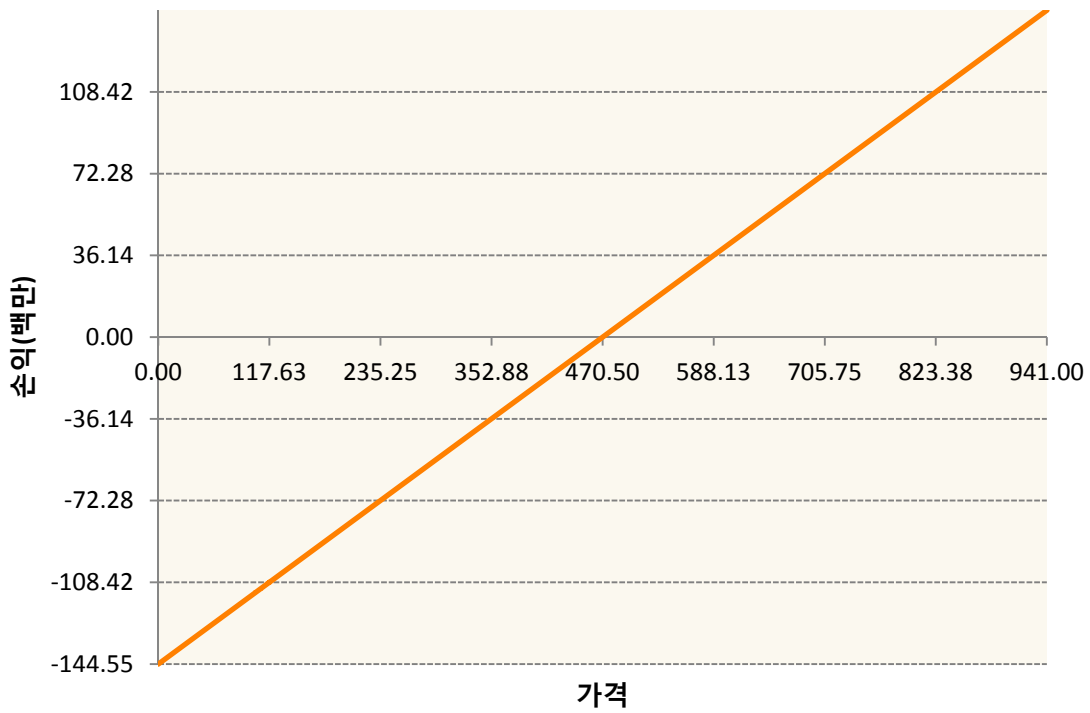




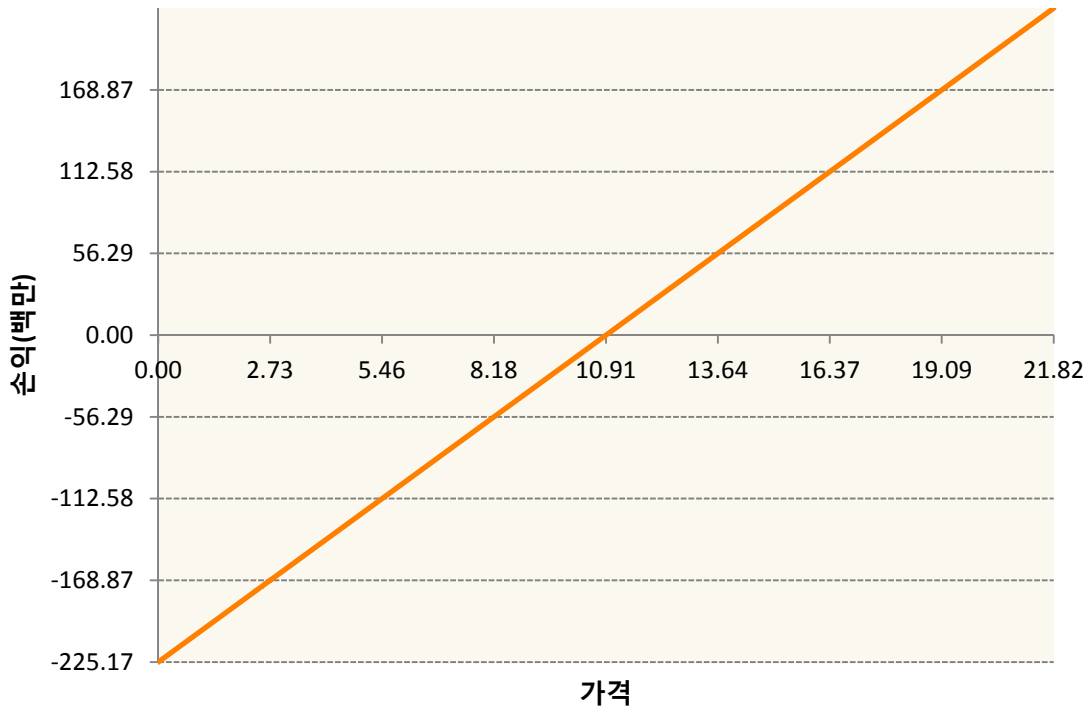
KR4175Q60006-2020-06 달러선물



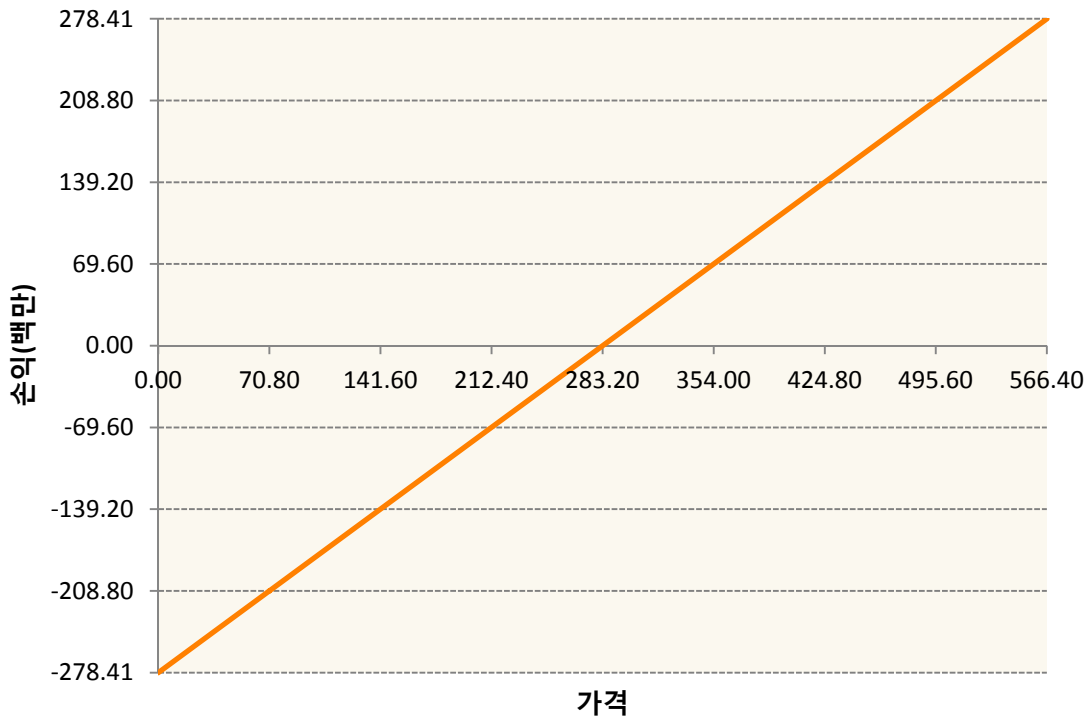
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



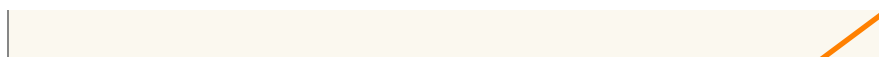
SBN0-Sugar Jul20

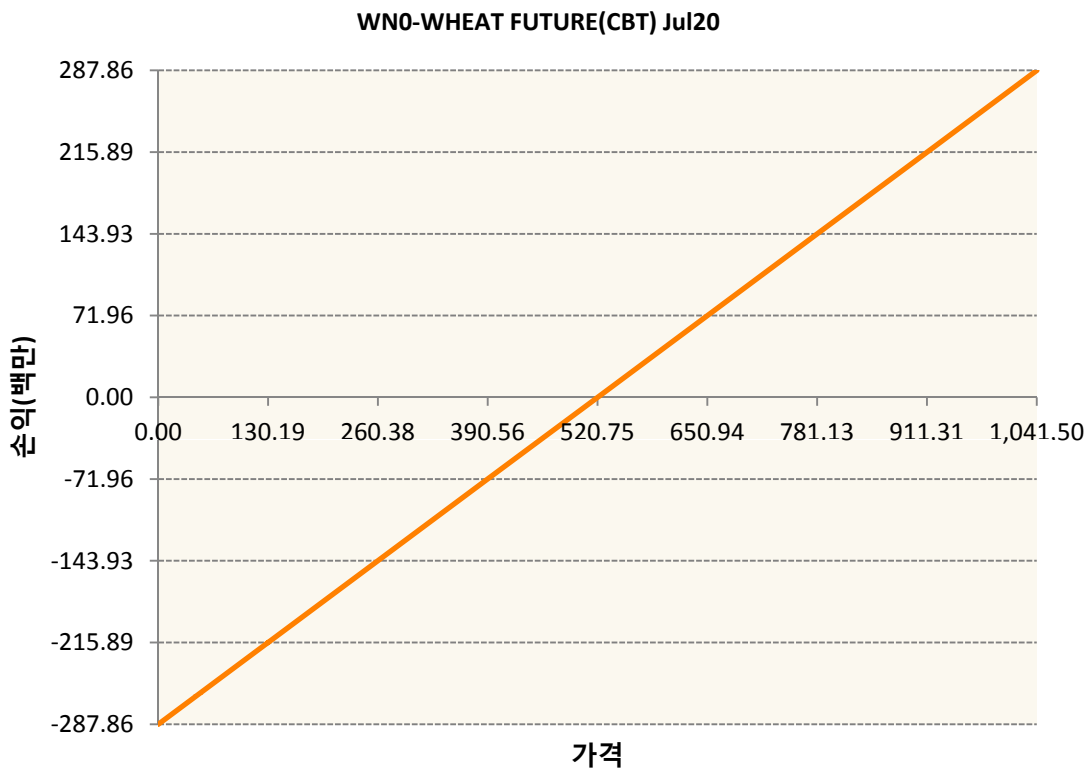
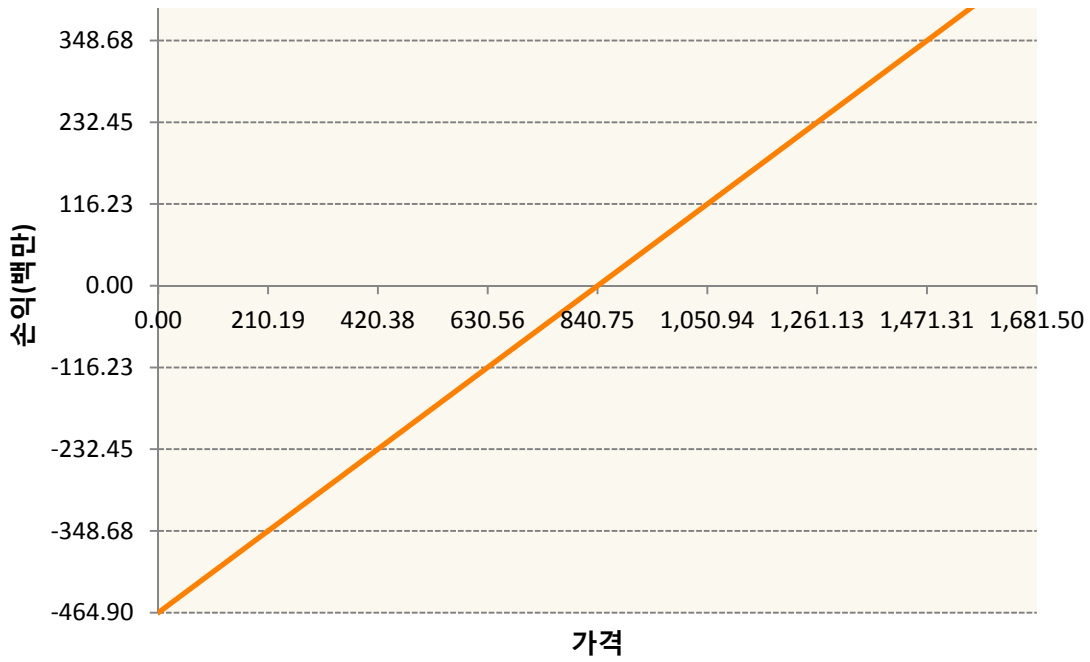


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20



SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BON0	SOYBEAN OIL FUTR Jul20	18
CN0	CORN FUTURE Jul20	38
CTN0	COTTON NO.2 FUTR Jul20	8
KCN0	COFFEE 'C' FUTURE Jul20	18
KR4175Q60C	2020-06 달러선물	6

KWN0	KC HRW WHEAT FUT Jul20	12
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