

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-03 |
| 기준일 | 2020-06-02 |

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 | 2020-06-03 |
| 기준일 | 2020-06-02 |

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

1,044

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,223

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-03 |
| 기준일 | 2020-06-02 |

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

581

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

863

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-03 |
| 기준일 | 2020-06-02 |

유로인덱스모(주식-파생형)

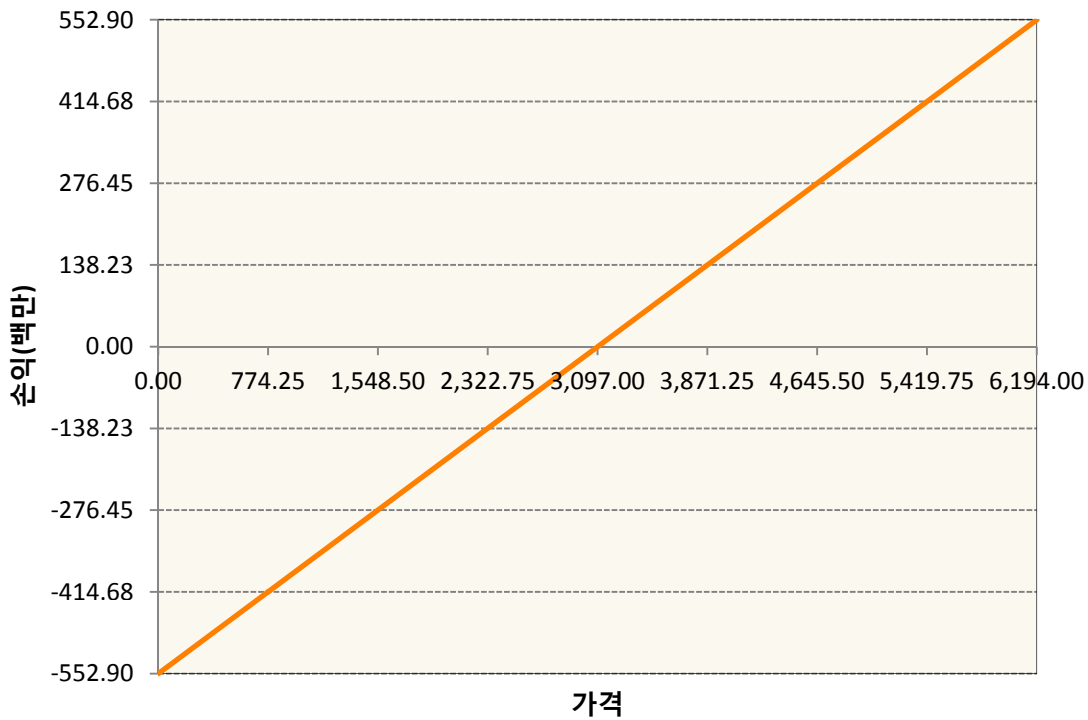
1. 계약금액

(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 | 2020-06-03 |
| 기준일 | 2020-06-02 |

차이나인덱스모(주식-파생형)

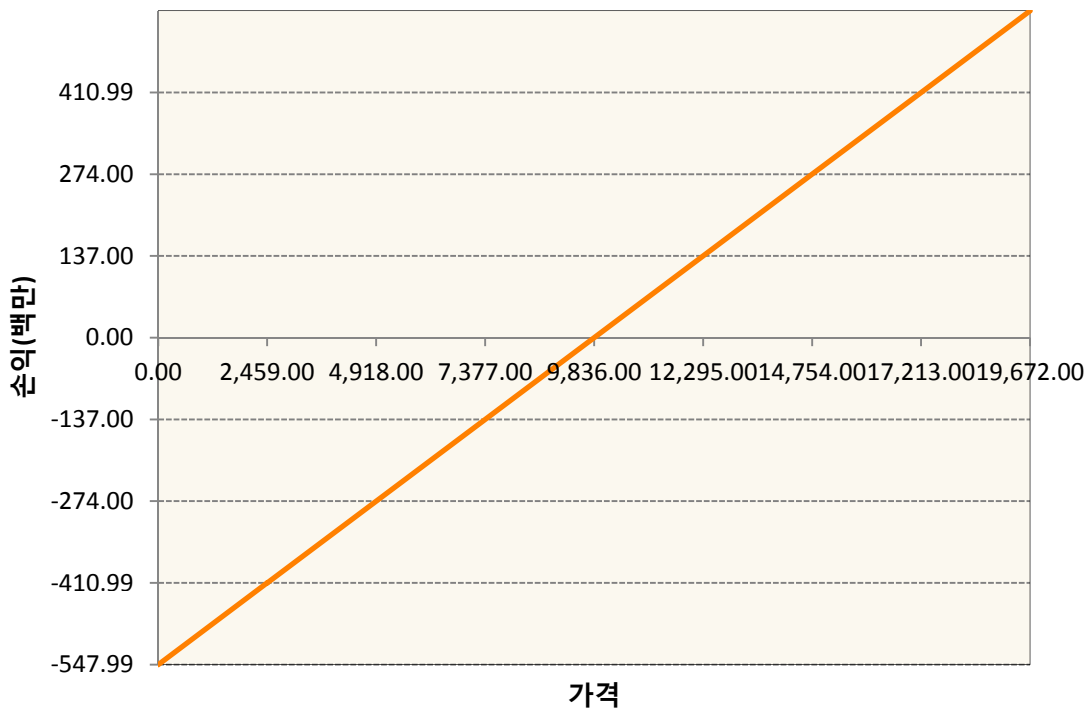
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 548 | 0 | 548 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

HCM0-HSCEI Futures Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------|---------------------|----|
| HCM0 | HSCEI Futures Jun20 | 44 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

| |
|----|
| 47 |
|----|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-03 |
| 기준일 | 2020-06-02 |

커버드콜모(주식혼합-파생형)

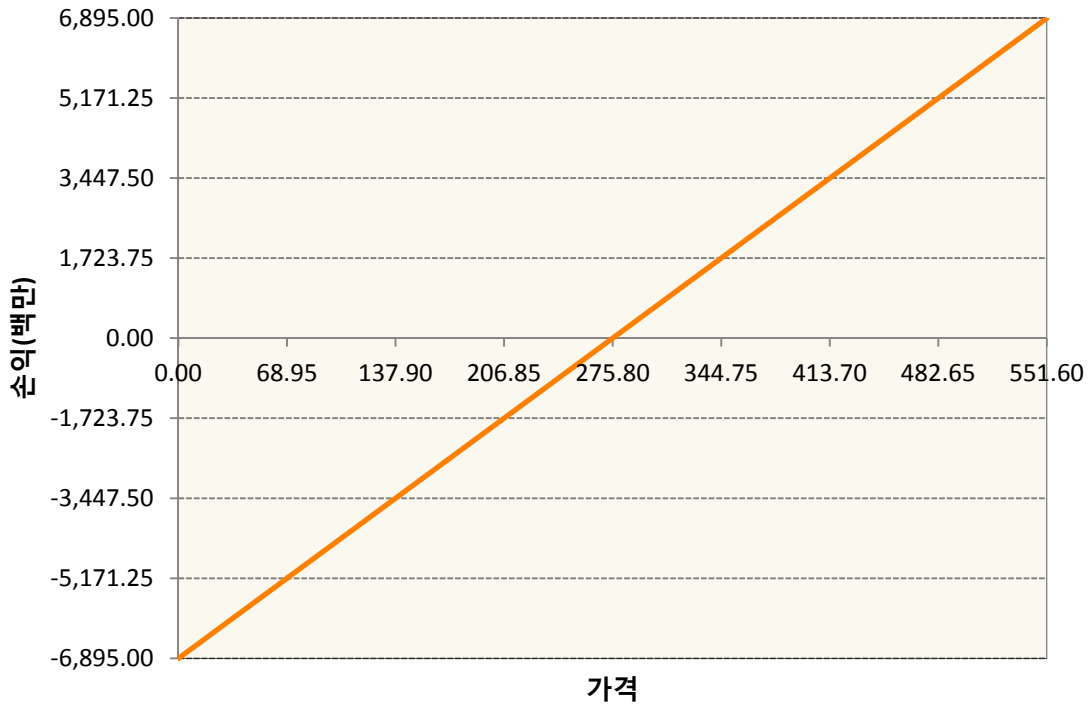
1. 계약금액

(단위:백만원)

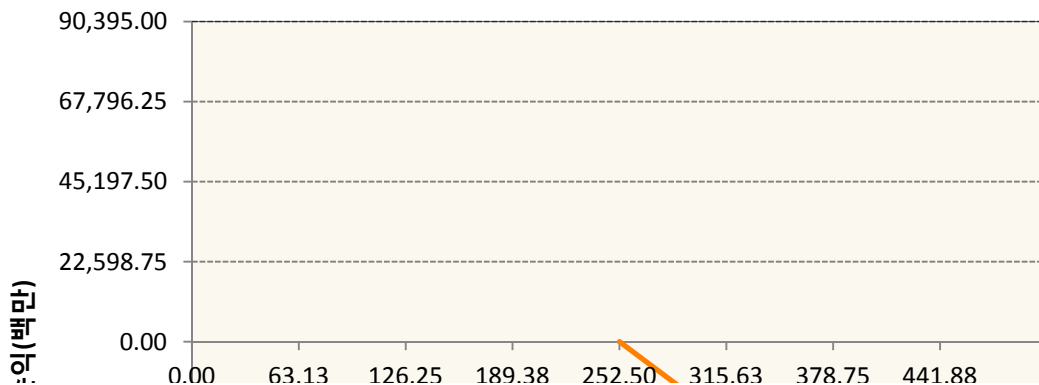
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 2,925 | 0 | 2,925 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 6,895 | 0 | 6,895 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 351,538 | -351,538 | 장내 |

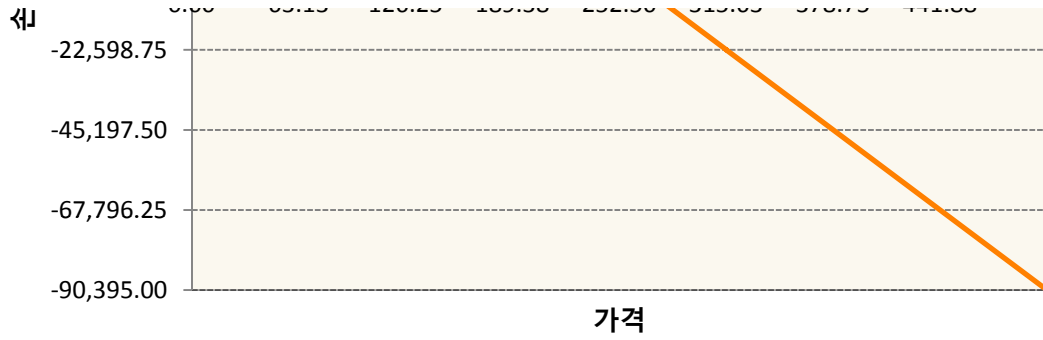
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

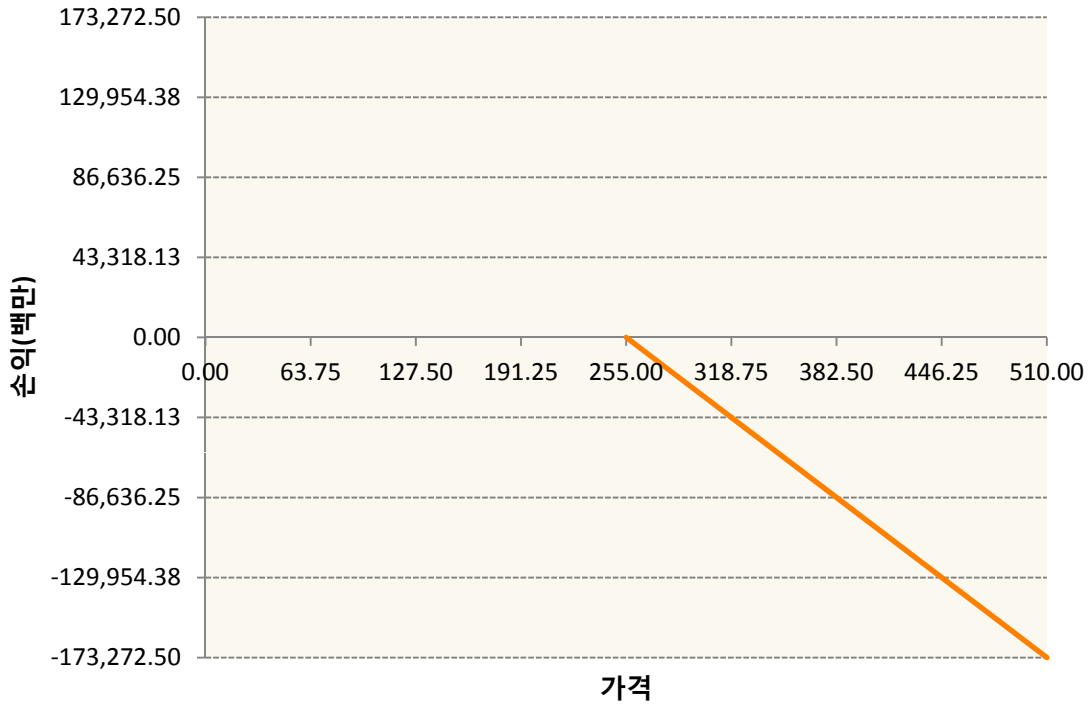


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

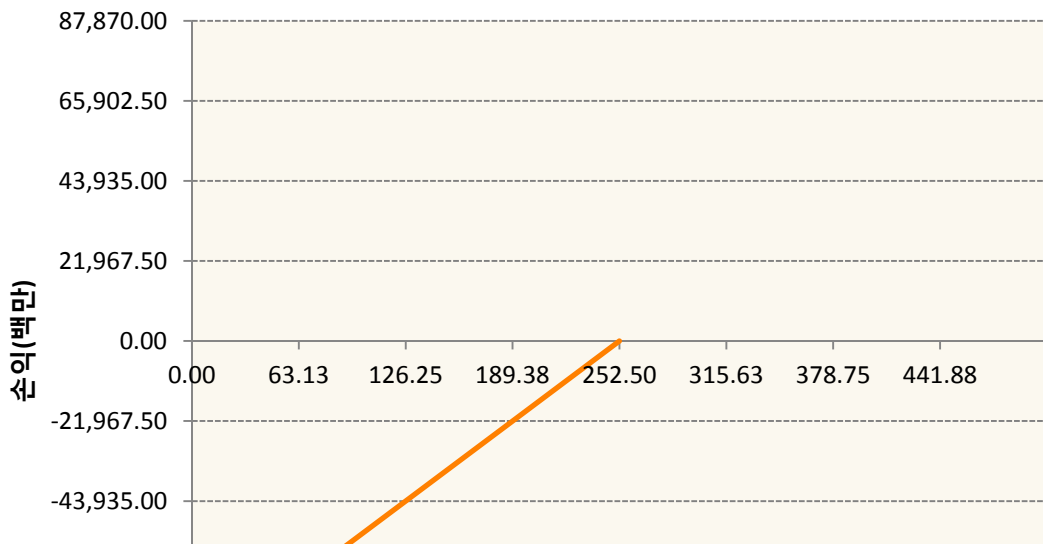


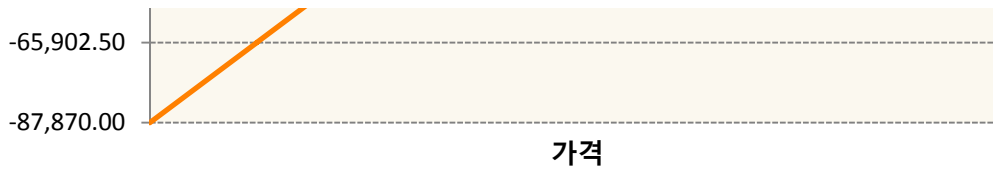


KR4201Q62550-2020-06 콜255



KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101Q60002 | | 2020-06 코스피200지수선물 | | | | | | 552 |
|--------------|---------|--------------------|---------|---------|---------|---------|---------|--------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -552 | -552 | -552 | -552 | -552 | -552 | -552 | |
| -5.33% | -368 | -368 | -368 | -368 | -368 | -368 | -368 | |
| -2.67% | -184 | -184 | -184 | -184 | -184 | -184 | -184 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 184 | 184 | 184 | 184 | 184 | 184 | 184 | |
| 5.33% | 368 | 368 | 368 | 368 | 368 | 368 | 368 | |
| 8.00% | 552 | 552 | 552 | 552 | 552 | 552 | 552 | |
| KR4201Q62527 | | 2020-06 콜252.5 | | | | | | 7,696 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 6,586 | 6,382 | 6,179 | 5,975 | 5,771 | 5,567 | 5,364 | |
| -5.33% | 4,850 | 4,680 | 4,504 | 4,324 | 4,139 | 3,951 | 3,761 | |
| -2.67% | 2,662 | 2,554 | 2,431 | 2,298 | 2,154 | 2,003 | 1,845 | |
| 0% | 208 | 153 | 84 | 0 | -97 | -205 | -323 | |
| 2.67% | -2,368 | -2,390 | -2,422 | -2,468 | -2,525 | -2,594 | -2,675 | |
| 5.33% | -4,986 | -4,993 | -5,007 | -5,028 | -5,058 | -5,098 | -5,148 | |
| 8.00% | -7,617 | -7,619 | -7,623 | -7,632 | -7,646 | -7,667 | -7,696 | |
| KR4201Q62550 | | 2020-06 콜255 | | | | | | 14,467 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 11,836 | 11,447 | 11,058 | 10,669 | 10,280 | 9,891 | 9,502 | |
| -5.33% | 8,903 | 8,546 | 8,182 | 7,813 | 7,440 | 7,064 | 6,685 | |
| -2.67% | 5,014 | 4,763 | 4,489 | 4,198 | 3,892 | 3,574 | 3,246 | |
| 0% | 500 | 362 | 194 | 0 | -218 | -455 | -711 | |
| 2.67% | -4,327 | -4,387 | -4,473 | -4,584 | -4,720 | -4,879 | -5,059 | |
| 5.33% | -9,276 | -9,298 | -9,334 | -9,389 | -9,465 | -9,560 | -9,677 | |
| 8.00% | -14,264 | -14,270 | -14,284 | -14,308 | -14,345 | -14,397 | -14,467 | |
| KR4301Q62525 | | 2020-06 풋252.5 | | | | | | 1,481 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -798 | -911 | -1,025 | -1,139 | -1,253 | -1,367 | -1,481 | |
| -5.33% | -147 | -211 | -283 | -360 | -443 | -529 | -620 | |
| -2.67% | -3 | -19 | -43 | -73 | -111 | -156 | -206 | |

| | | | | | | | |
|-------|----|----|----|----|-----|-----|-----|
| 0% | 14 | 12 | 7 | 0 | -11 | -27 | -48 |
| 2.67% | 15 | 15 | 14 | 13 | 11 | 7 | 0 |
| 5.33% | 15 | 15 | 15 | 15 | 14 | 14 | 12 |
| 8.00% | 15 | 15 | 15 | 15 | 15 | 15 | 14 |

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

(단위:백만원)

24,049

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-03 |
| 기준일 | 2020-06-02 |

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

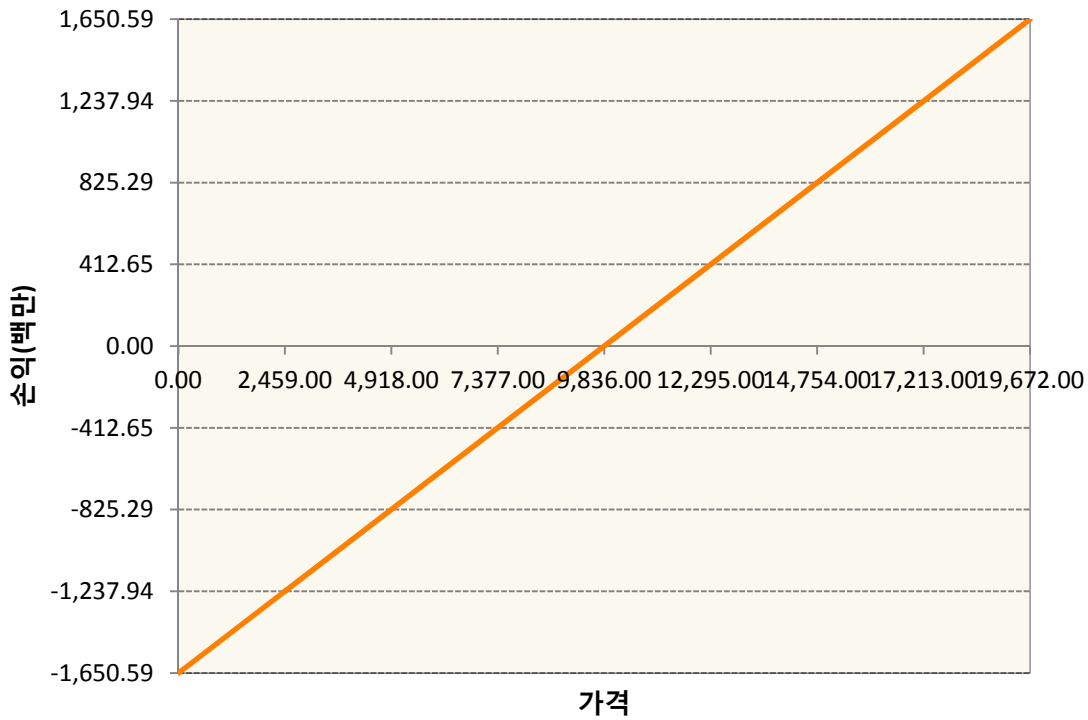
1. 계약금액

(단위:백만원)

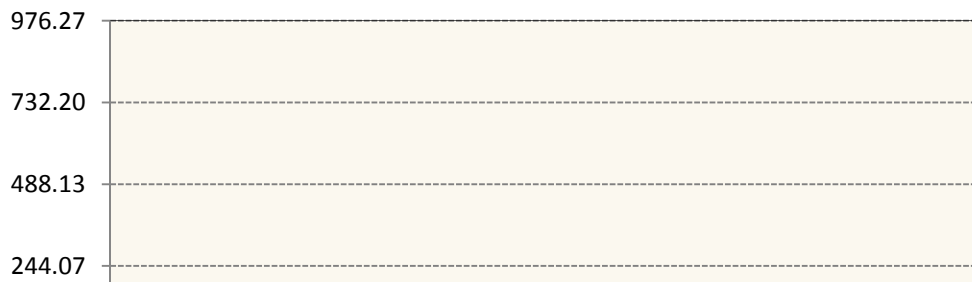
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,651 | 0 | 1,651 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 4,229 | -4,229 | 장내 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 1,530 | -1,530 | 장외 |

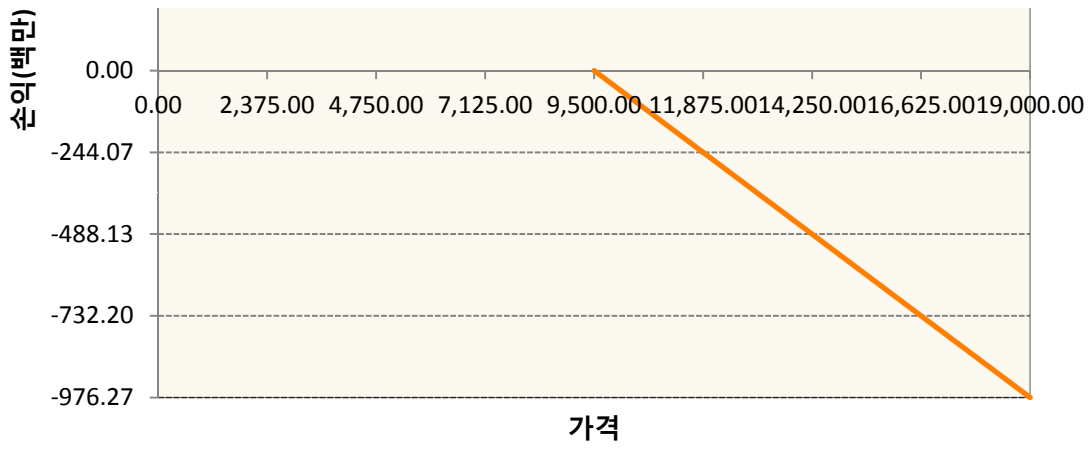
2. 만기시점의 손익구조

HCM0-HSCEI Futures Jun20

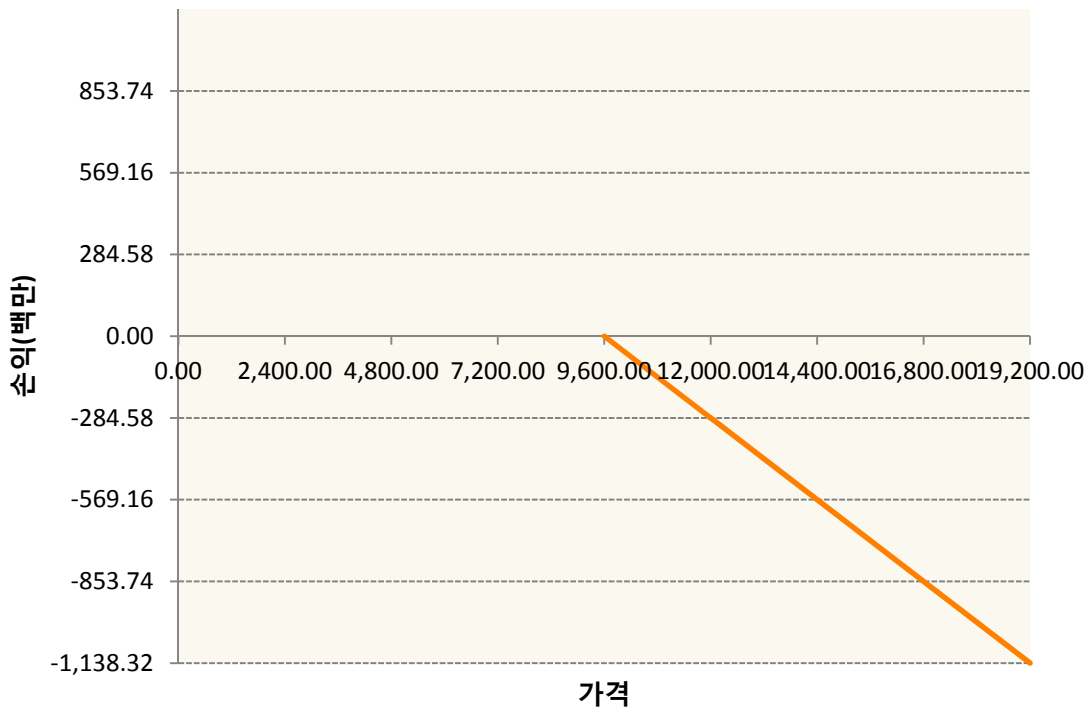


OHHIM0-C95-HSCEI

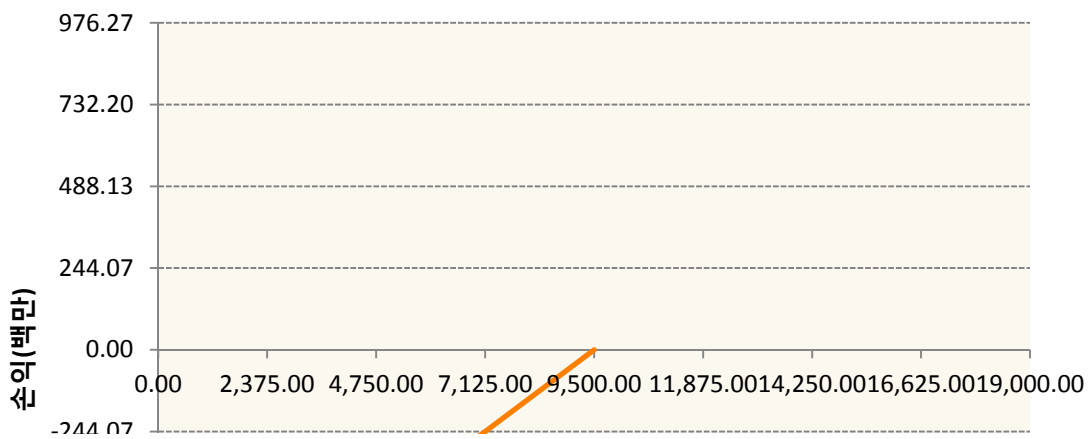


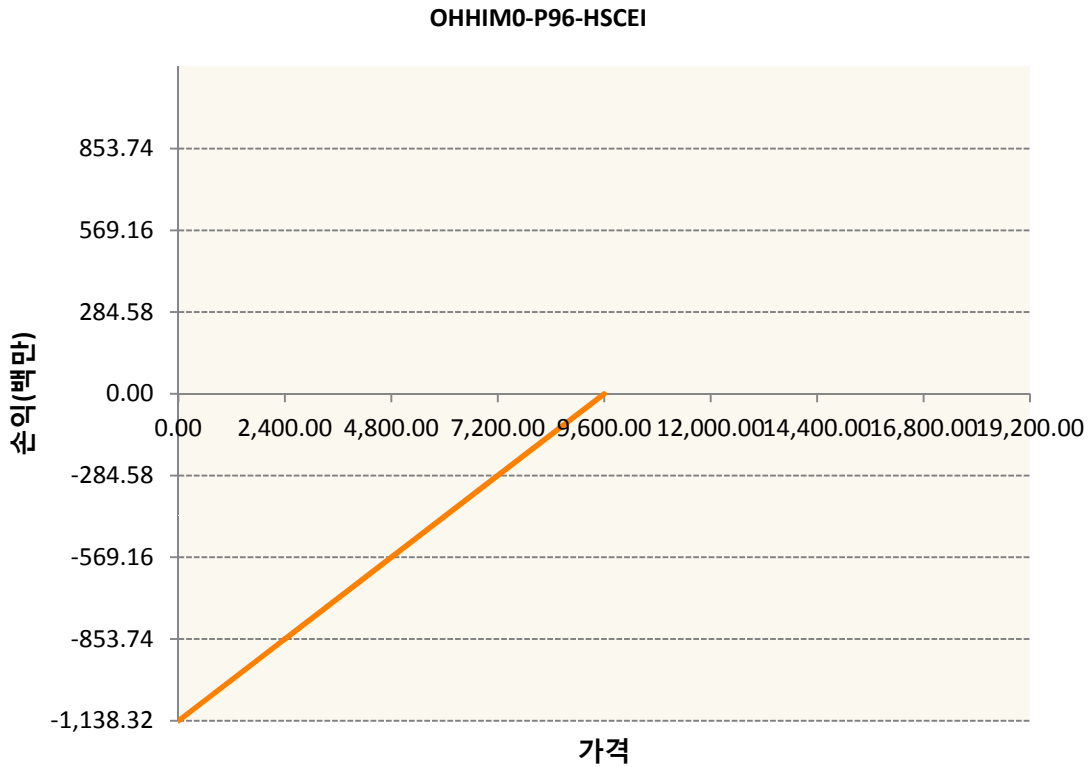
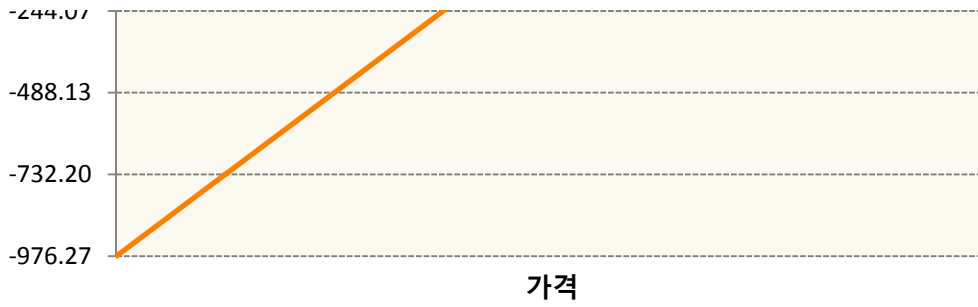


OHHIM0-C96-HSCEI



OHHIM0-P95-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | |
|------------------------------|-----|
| FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E | 122 |
| HCM0 HSCEI Futures Jun20 | 132 |
| 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)

571

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-03 |
| 기준일 | 2020-06-02 |

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

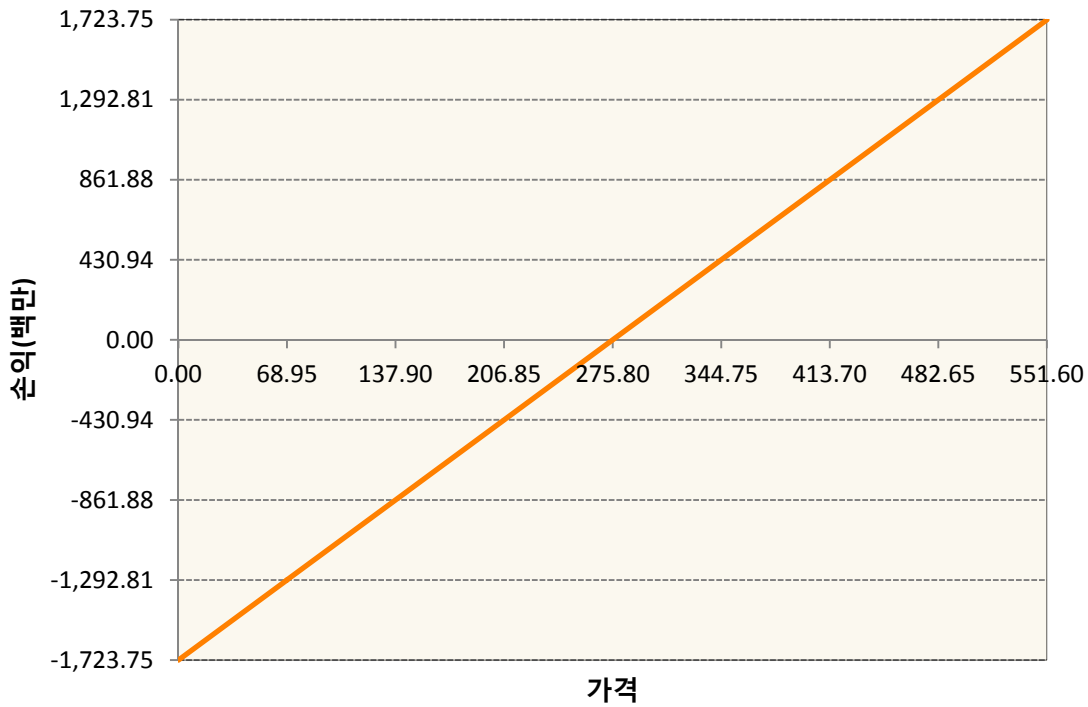
1. 계약금액

(단위:백만원)

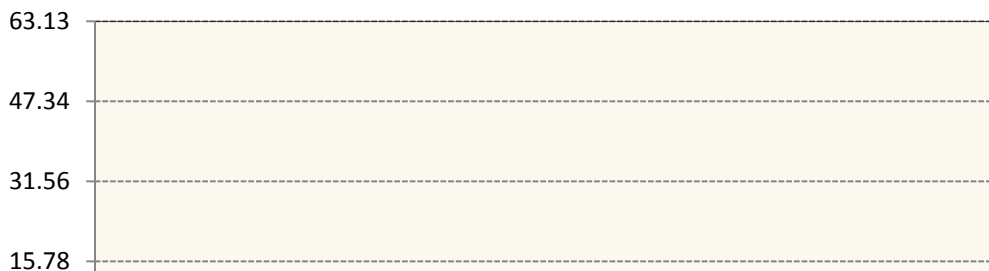
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 69 | -69 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 57 | 0 | 57 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,724 | 0 | 1,724 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 2,125 | 0 | 2,125 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 3,108 | -3,108 | 장내 |

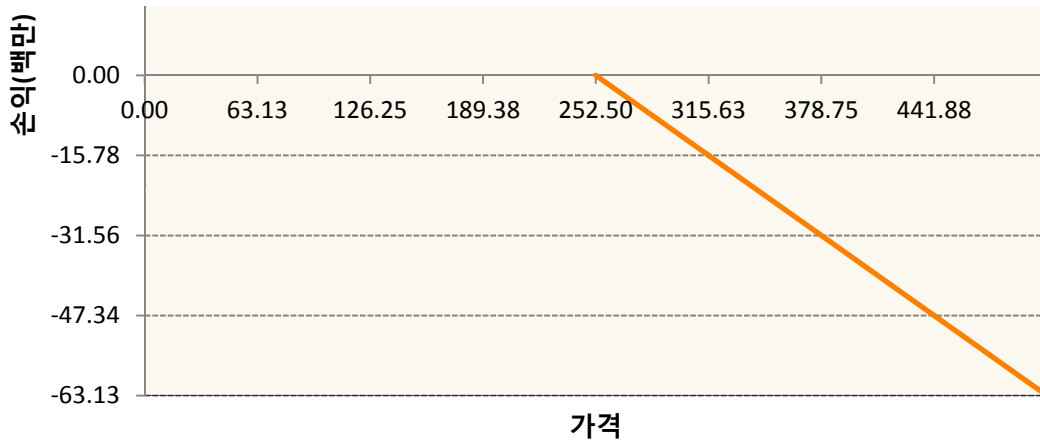
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

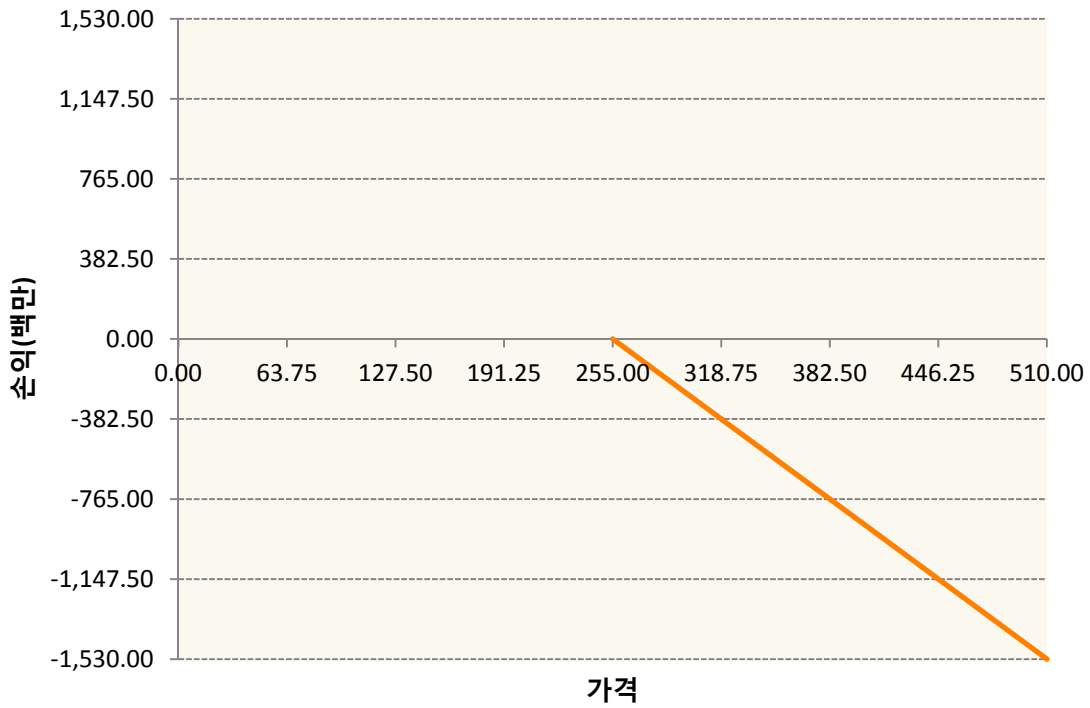


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

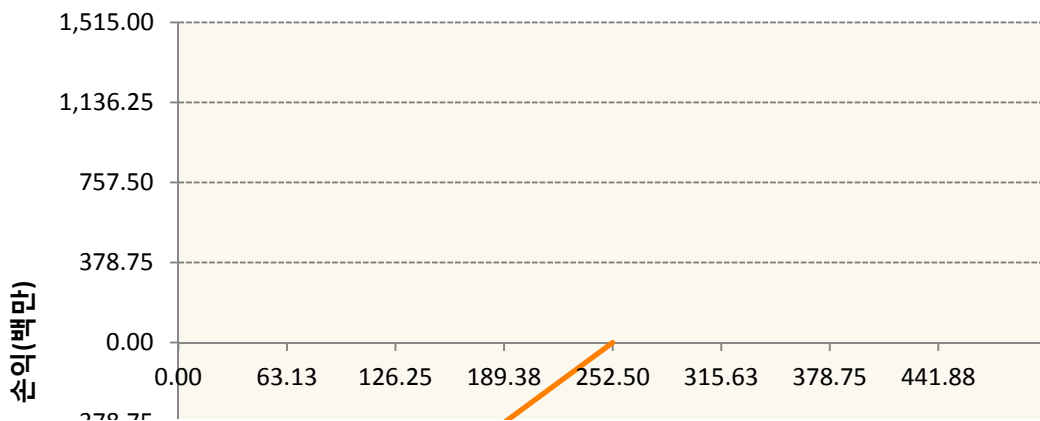




KR4201Q62550-2020-06 콜255



KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| 2.529E+11 | | UBCSFXC1 INDEX_16 | | | | | | 188 |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -188 | -188 | -188 | -188 | -188 | -188 | -188 | |
| -5.33% | -126 | -126 | -126 | -126 | -126 | -126 | -126 | |
| -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% | 126 | 126 | 126 | 126 | 126 | 126 | 126 | |
| 8.00% | 188 | 188 | 188 | 188 | 188 | 188 | 188 | |
| KR4101Q60002 | | 2020-06 코스피200지수선물 | | | | | | 138 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -138 | -138 | -138 | -138 | -138 | -138 | -138 | |
| -5.33% | -92 | -92 | -92 | -92 | -92 | -92 | -92 | |
| -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% | 92 | 92 | 92 | 92 | 92 | 92 | 92 | |
| 8.00% | 138 | 138 | 138 | 138 | 138 | 138 | 138 | |
| KR4201Q62527 | | 2020-06 콜252.5 | | | | | | 5 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 5 | 4 | 4 | 4 | 4 | 4 | 4 | |
| -5.33% | 3 | 3 | 3 | 3 | 3 | 3 | 3 | |
| -2.67% | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 | 1 | 1 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | -2 | -2 | -2 | -2 | -2 | -2 | -2 | |
| 5.33% | -3 | -3 | -3 | -4 | -4 | -4 | -4 | |
| 8.00% | -5 | -5 | -5 | -5 | -5 | -5 | -5 | |
| KR4201Q62550 | | 2020-06 콜255 | | | | | | 128 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |

| | | | | | | | |
|--|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| -8.00% | 105 | 101 | 98 | 94 | 91 | 87 | 84 |
| -5.33% | 79 | 75 | 72 | 69 | 66 | 62 | 59 |
| -2.67% | 44 | 42 | 40 | 37 | 34 | 32 | 29 |
| 0% | 4 | 3 | 2 | 0 | -2 | -4 | -6 |
| 2.67% | -38 | -39 | -39 | -40 | -42 | -43 | -45 |
| 5.33% | -82 | -82 | -82 | -83 | -84 | -84 | -85 |
| 8.00% | -126 | -126 | -126 | -126 | -127 | -127 | -128 |
| KR4301Q62525 2020-06 풋252.5 | | | | | | | 26 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -14 | -16 | -18 | -20 | -22 | -24 | -26 |
| -5.33% | -3 | -4 | -5 | -6 | -8 | -9 | -11 |
| -2.67% | 0 | 0 | -1 | -1 | -2 | -3 | -4 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | -1 |
| 2.67% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 5.33% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 8.00% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |

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

(단위:백만원)

539

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-03 |
| 기준일 | 2020-06-02 |

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

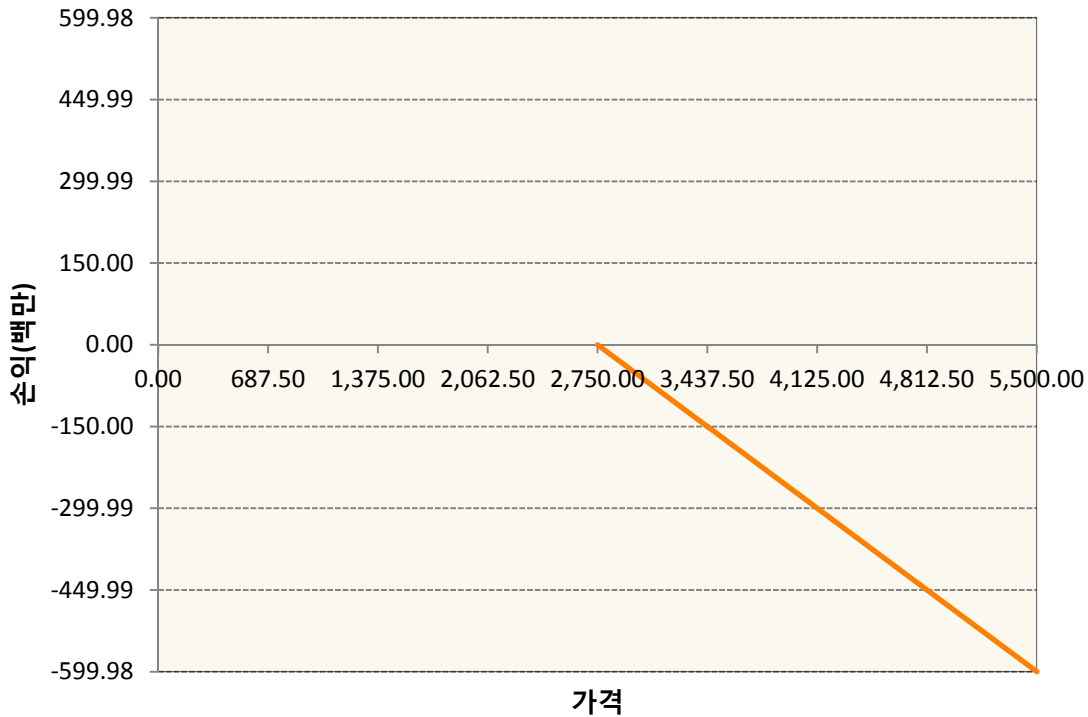
1. 계약금액

(단위:백만원)

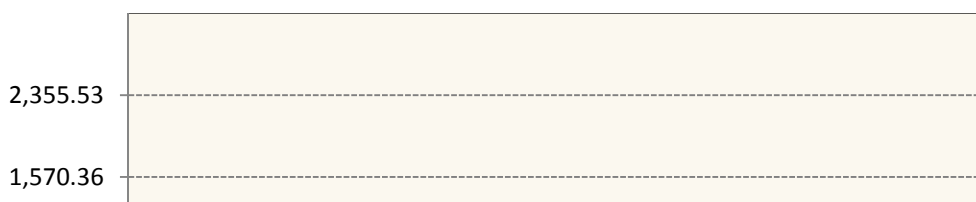
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,661 | 0 | 1,661 | |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 8,133 | 0 | 8,133 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 7,481 | -7,481 | 장내 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 2,951 | -2,951 | 장외 |

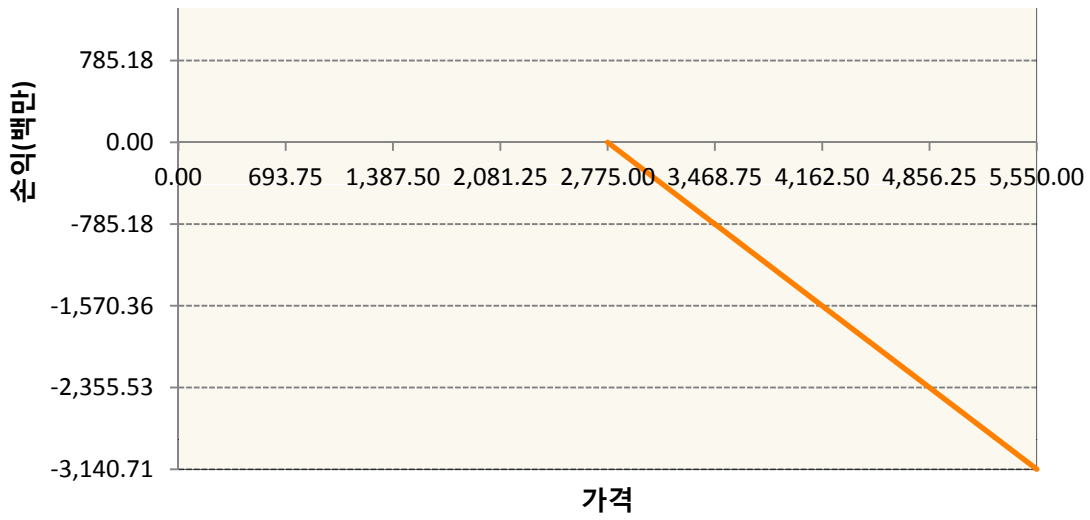
2. 만기시점의 손익구조

OESXM0-C2750-EURO STOXX 50

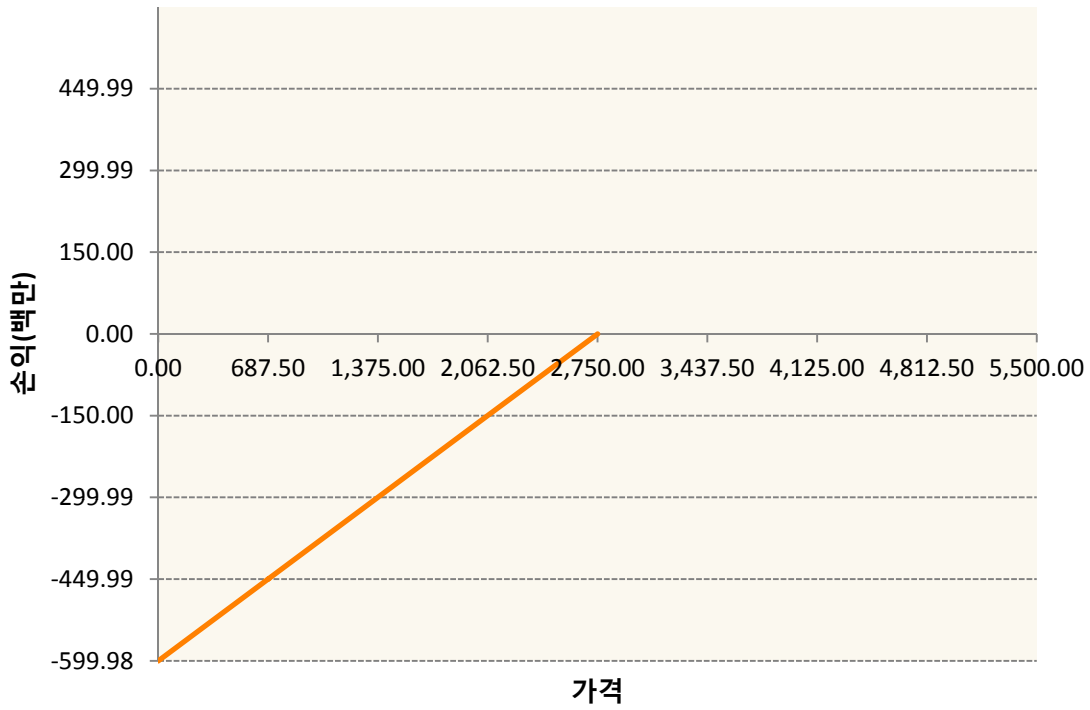


OESXM0-C2775-EURO STOXX 50

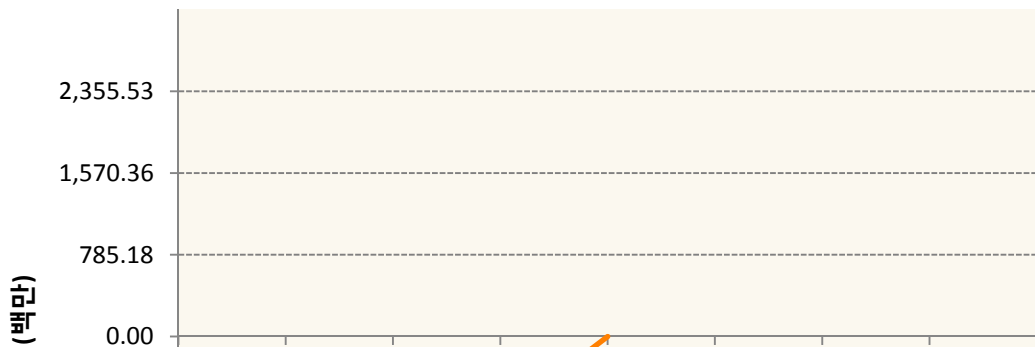


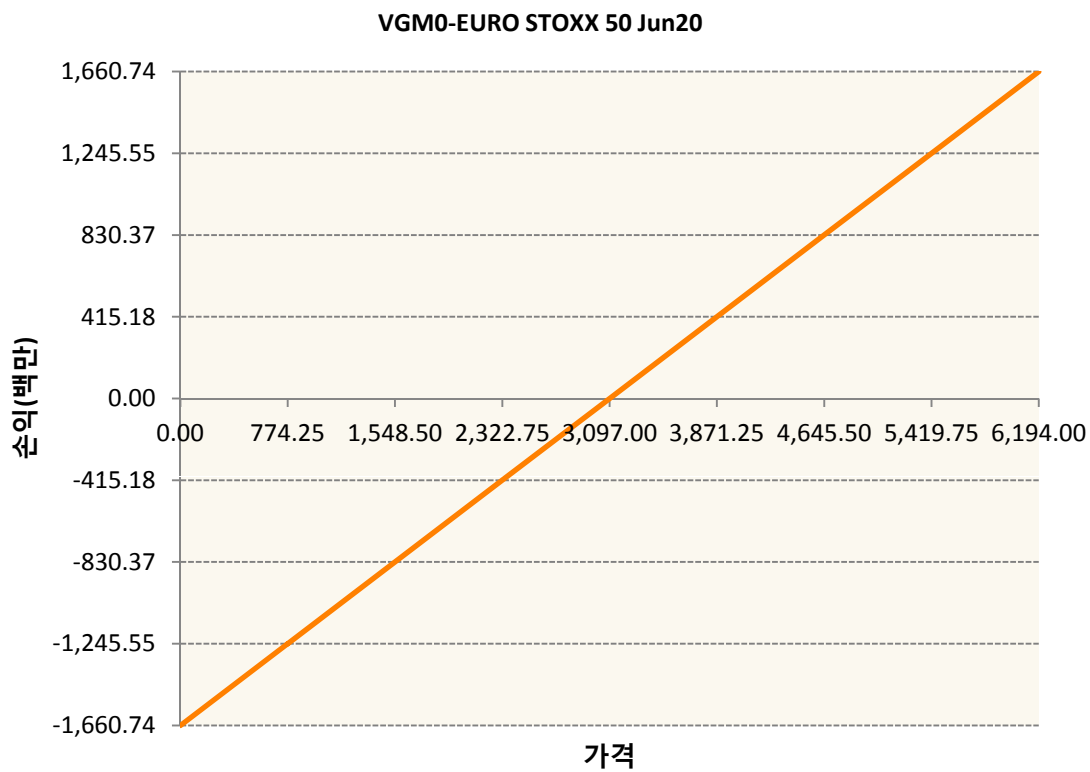
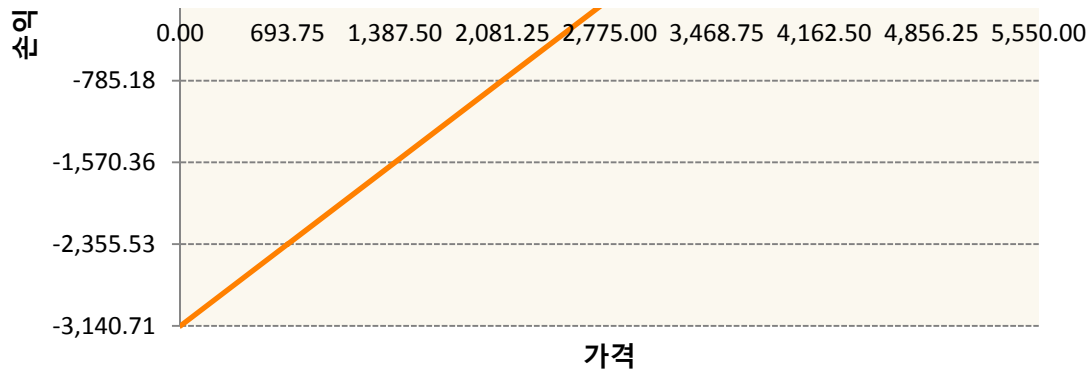


OESXM0-P2750-EURO STOXX 50



OESXM0-P2775-EURO STOXX 50





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|--|----------|
| 260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY | | 21 |
| FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E | | 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 | | 133 |

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

(단위:백만원)

1,135

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

(단위:백만원)

1,239

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-03 |
| 기준일 | 2020-06-02 |

ETF스마트레버리지목표전환형9호

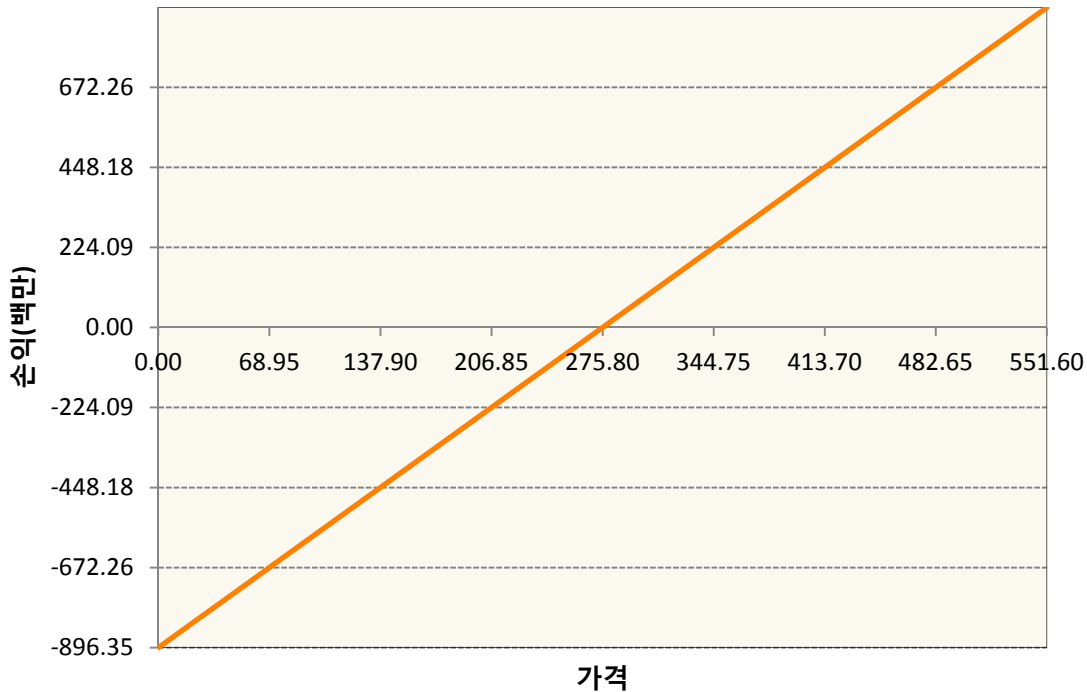
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 896 | 0 | 896 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101Q60002 | | 2020-06 코스피200지수선물 | | | | | | 72 |
|--------------|---------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|----|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -72 | -72 | -72 | -72 | -72 | -72 | -72 | |
| -5.33% | -48 | -48 | -48 | -48 | -48 | -48 | -48 | |
| -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% | 48 | 48 | 48 | 48 | 48 | 48 | 48 | |
| 8.00% | 72 | 72 | 72 | 72 | 72 | 72 | 72 | |

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

(단위:백만원)

107

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

(단위:백만원)

157

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

(단위:백만원)

74

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-03 |
| 기준일 | 2020-06-02 |

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

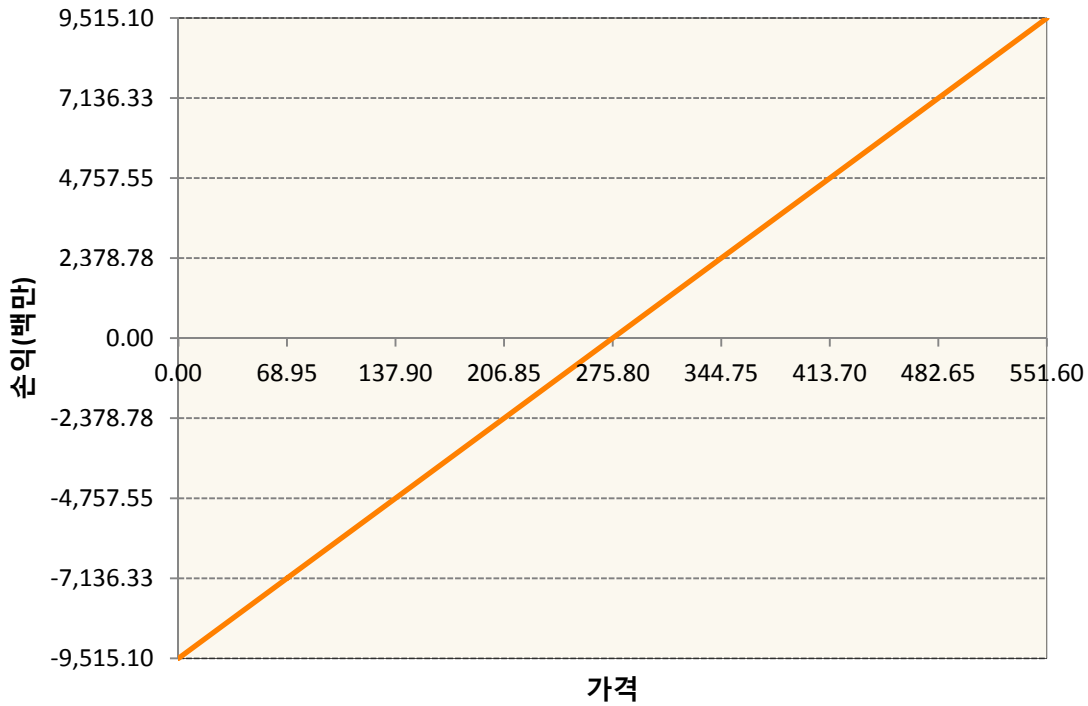
1. 계약금액

(단위:백만원)

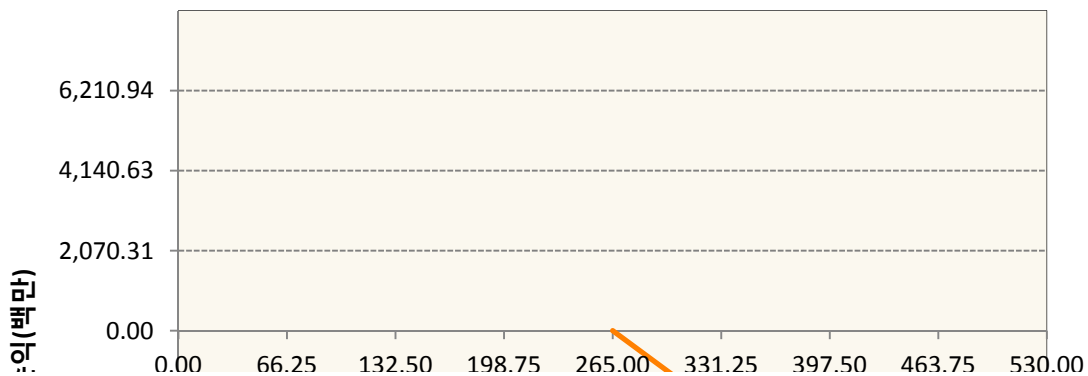
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 9,515 | 0 | 9,515 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 2,917 | 17,711 | -14,794 | 장내 |

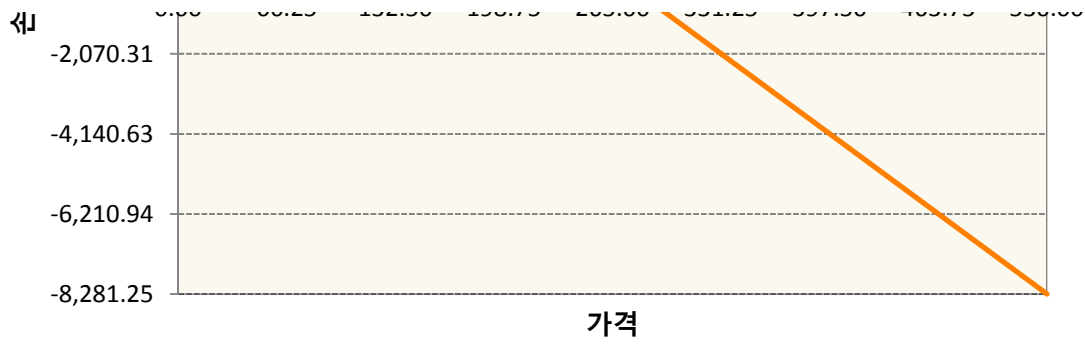
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

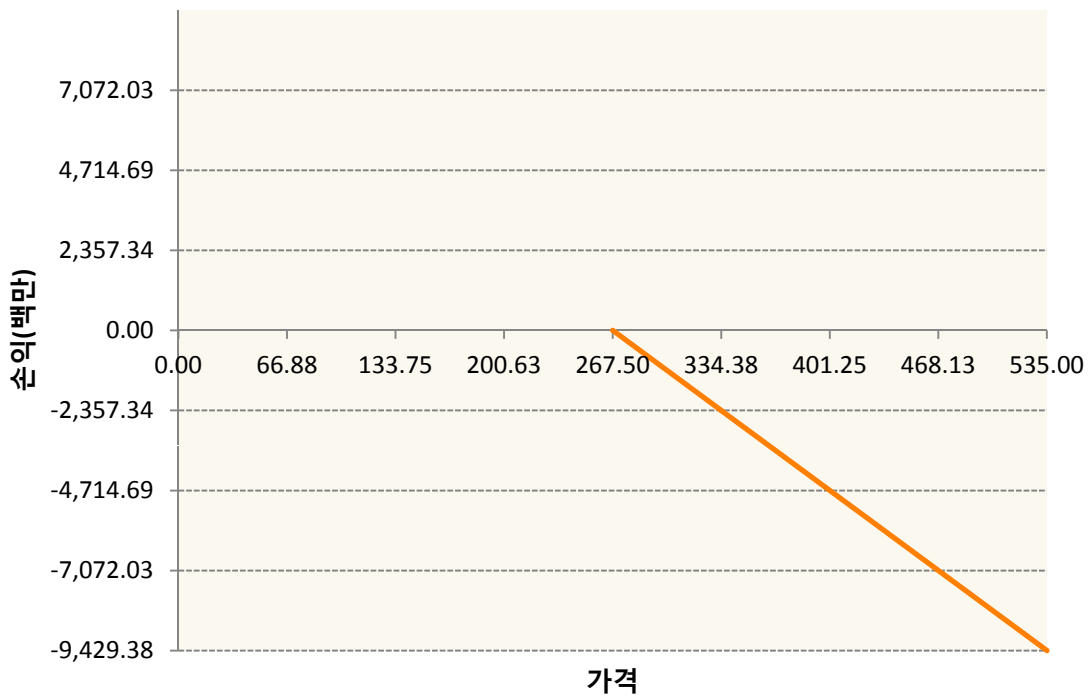


KR4201Q62659-2020-06 콜265

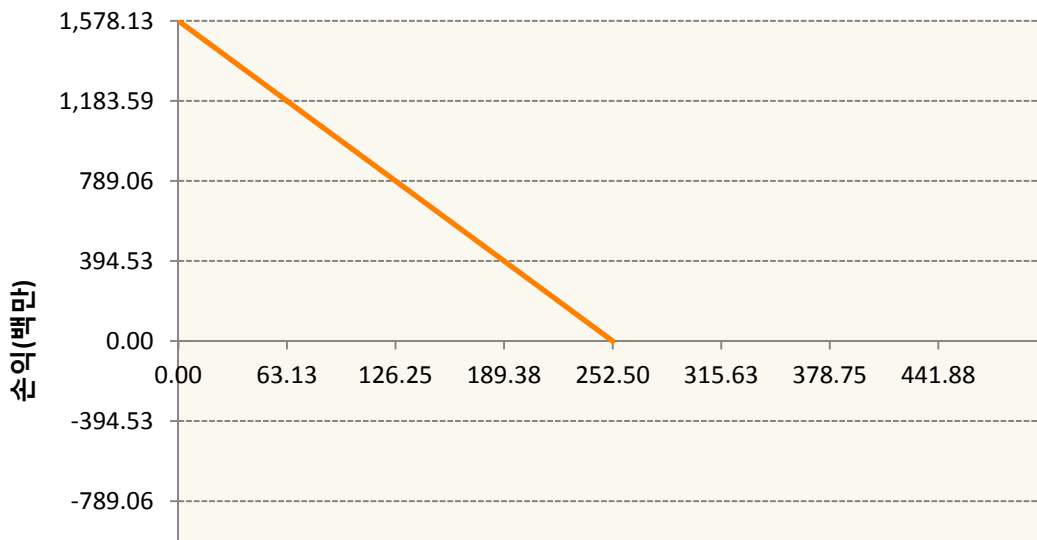


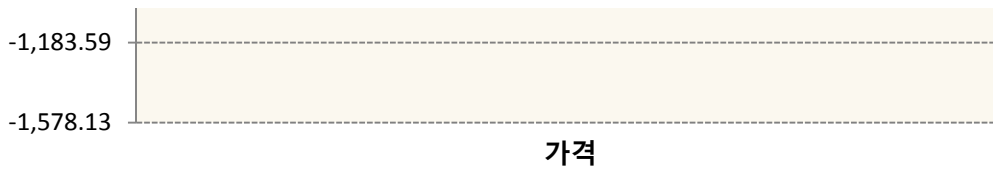


KR4201Q62675-2020-06 콜267.5

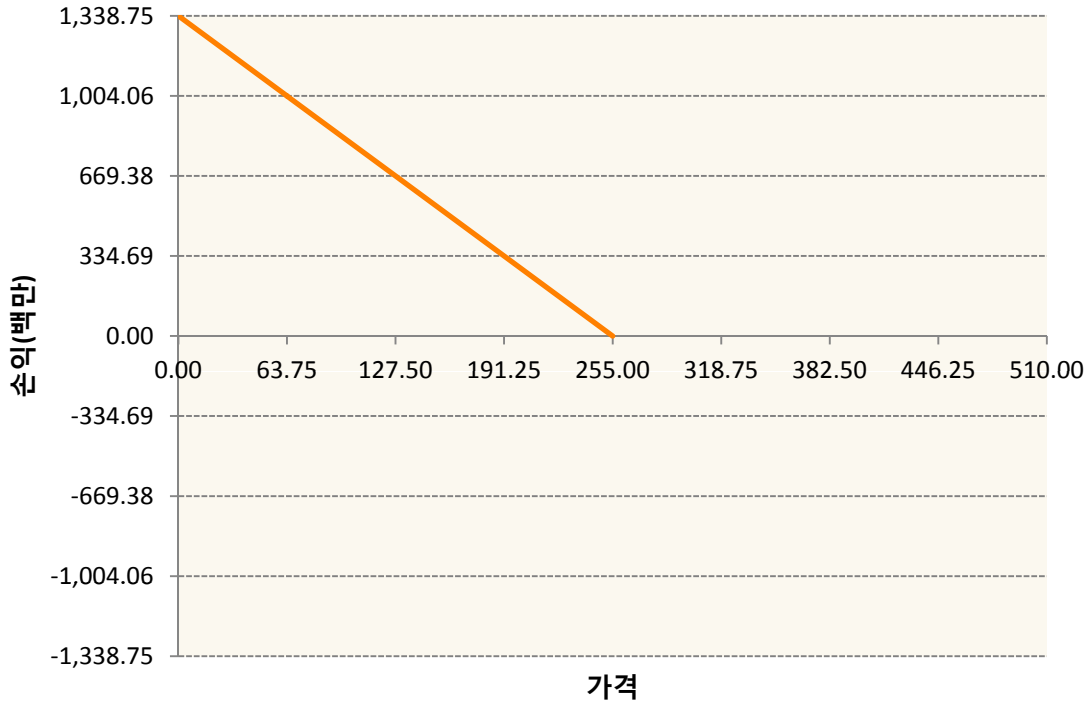


KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





KR4301Q62558-2020-06 풋255



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101Q60002 | | 2020-06 코스피200지수선물 | | | | | | 762 |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
| | | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -762 | -762 | -762 | -762 | -762 | -762 | -762 | |
| -5.33% | -508 | -508 | -508 | -508 | -508 | -508 | -508 | |
| -2.67% | -254 | -254 | -254 | -254 | -254 | -254 | -254 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 254 | 254 | 254 | 254 | 254 | 254 | 254 | |
| 5.33% | 508 | 508 | 508 | 508 | 508 | 508 | 508 | |
| 8.00% | 762 | 762 | 762 | 762 | 762 | 762 | 762 | |
| KR4201Q62659 | | 2020-06 콜265 | | | | | | 621 |
| | | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | 394 | 380 | 366 | 352 | 336 | 321 | 305 | |
| -5.33% | 325 | 307 | 289 | 271 | 253 | 234 | 216 | |
| -2.67% | 208 | 190 | 172 | 153 | 135 | 116 | 98 | |

| | | | | | | | |
|--|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 0% | 45 | 31 | 16 | 0 | -16 | -33 | -50 |
| 2.67% | -152 | -161 | -171 | -183 | -195 | -208 | -222 |
| 5.33% | -369 | -373 | -379 | -386 | -394 | -404 | -414 |
| 8.00% | -594 | -596 | -599 | -603 | -608 | -614 | -621 |
| KR4201Q62675 2020-06 콜267.5 | | | | | | | 682 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 398 | 385 | 371 | 356 | 340 | 324 | 307 |
| -5.33% | 336 | 317 | 298 | 278 | 258 | 238 | 218 |
| -2.67% | 223 | 202 | 181 | 160 | 138 | 117 | 96 |
| 0% | 56 | 38 | 19 | 0 | -20 | -39 | -60 |
| 2.67% | -154 | -167 | -180 | -195 | -211 | -227 | -245 |
| 5.33% | -393 | -399 | -408 | -417 | -428 | -441 | -454 |
| 8.00% | -644 | -647 | -651 | -657 | -664 | -672 | -682 |
| KR4301Q62525 2020-06 풋252.5 | | | | | | | 27 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 14 | 16 | 18 | 20 | 22 | 25 | 27 |
| -5.33% | 3 | 4 | 5 | 6 | 8 | 10 | 11 |
| -2.67% | 0 | 0 | 1 | 1 | 2 | 3 | 4 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1 |
| 2.67% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 5.33% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 8.00% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| KR4301Q62558 2020-06 풋255 | | | | | | | 29 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 18 | 20 | 22 | 24 | 25 | 27 | 29 |
| -5.33% | 4 | 5 | 7 | 8 | 10 | 11 | 13 |
| -2.67% | 0 | 1 | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1 | 1 |
| 2.67% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 5.33% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 8.00% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |

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

(단위:백만원)

2,473

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-03 |
| 기준일 | 2020-06-02 |

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 | 156,192 | 0 | 156,192 | |

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 | 2020-06-03 |
| 기준일 | 2020-06-02 |

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 | 105,312 | 0 | 105,312 | |

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 | 2020-06-03 |
| 기준일 | 2020-06-02 |

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 | 465,274 | 0 | 465,274 | |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 434,527 | -434,527 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|------------------------------|-------|
| FX21020J00(KRW/USD 10-06-20E | 2,941 |
| FX21020J02(KRW/USD 10-06-20E | 1,333 |
| FX21020J02(KRW/USD 22-06-20E | 1,510 |
| FX21020J02(KRW/USD 22-06-20E | 1,961 |
| FX21020J03(KRW/USD 24-07-20E | 2,206 |
| FX21020J04(KRW/USD 24-07-20E | 1,765 |
| FX21020J04(KRW/USD 24-07-20E | 1,961 |
| FX21020K00(KRW/USD 12-06-20E | 2,039 |
| FX21020K00(KRW/USD 12-06-20E | 1,941 |
| FX21020K01(KRW/USD 22-06-20E | 686 |
| FX21020K01(KRW/USD 18-08-20E | 2,392 |
| 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 | 3,431 |
| FX21020K05(KRW/USD 03-08-20E | 6,960 |

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

17,743

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

(단위:백만원)

215

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-03 |
| 기준일 | 2020-06-02 |

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 | 7,669 | 0 | 7,669 | |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 7,426 | -7,426 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|------------------------------|-----|
| FX21020K01 KRW/USD 15-06-20E | 321 |
| 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)

| |
|------------|
| 303 |
|------------|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-03 |
| 기준일 | 2020-06-02 |

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

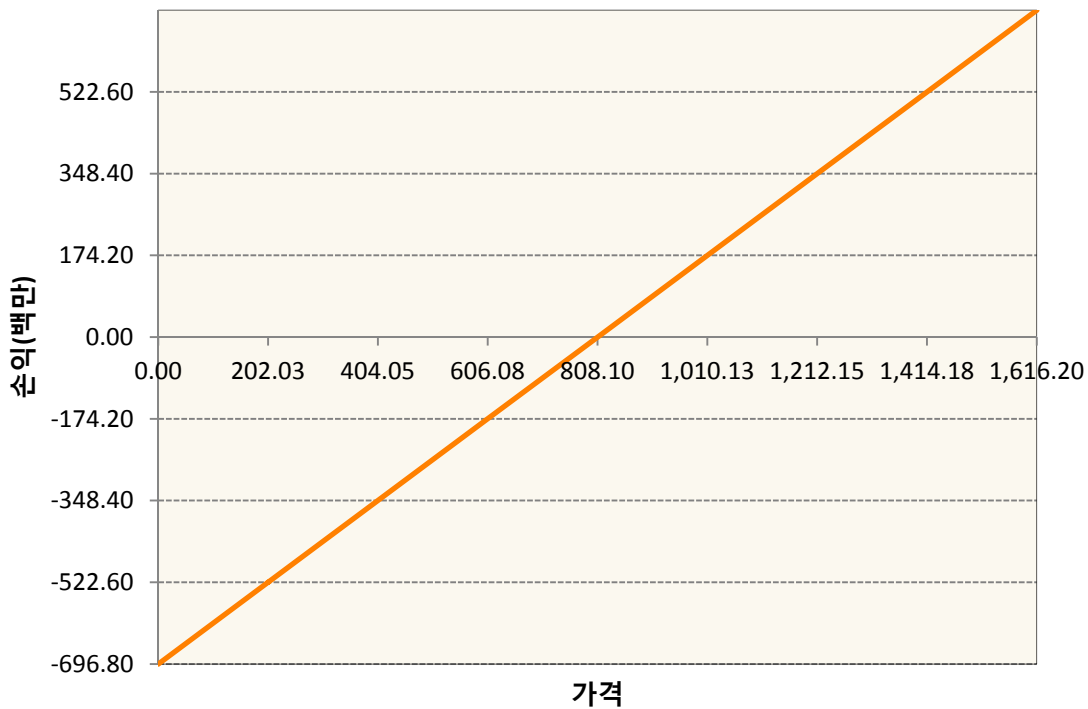
1. 계약금액

(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 | 697 | 0 | 697 | |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 989 | 0 | 989 | 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 | 2020-06-03 |
| 기준일 | 2020-06-02 |

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

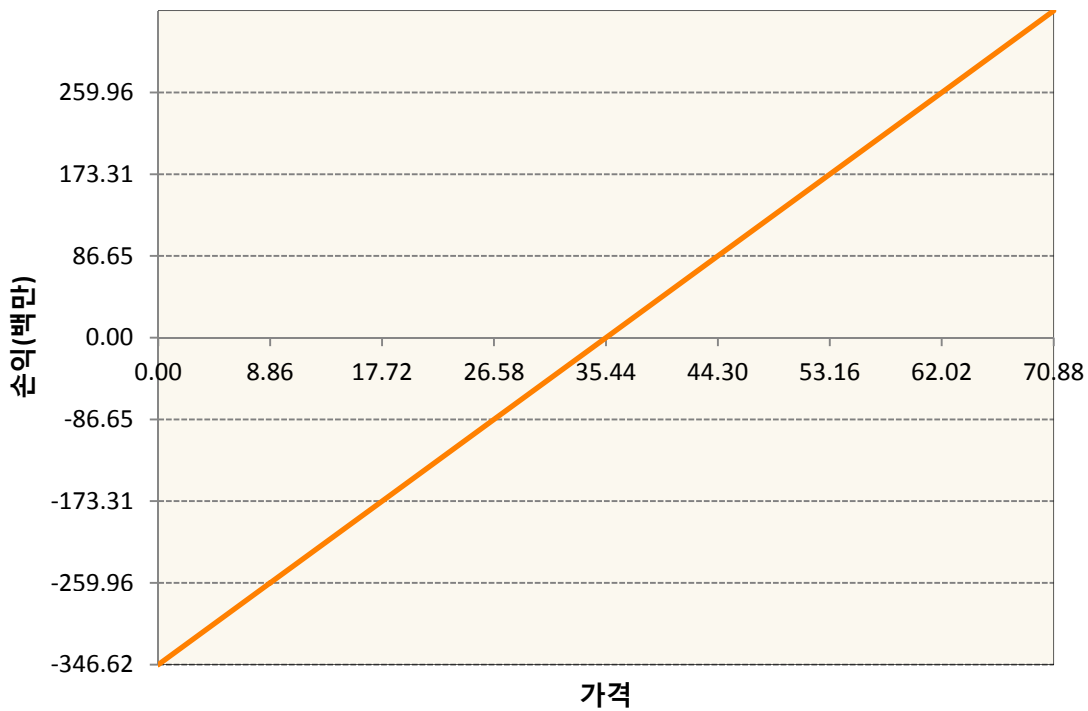
1. 계약금액

(단위:백만원)

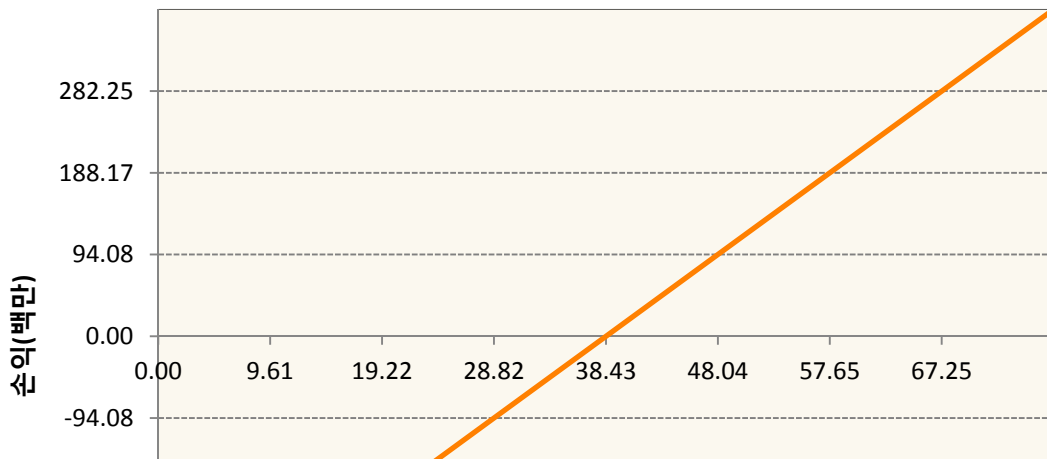
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,717 | 306 | 1,410 | |

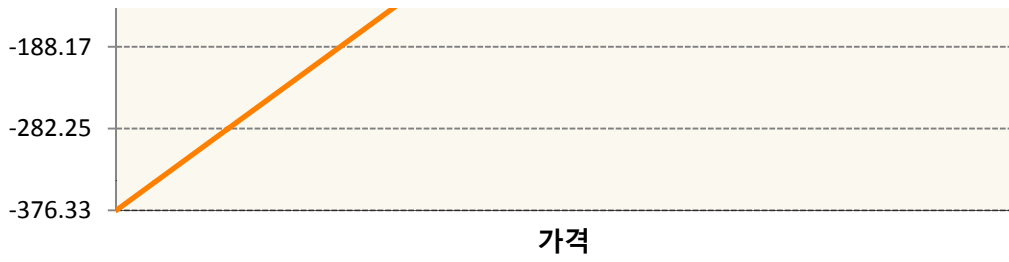
2. 만기시점의 손익구조

CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20

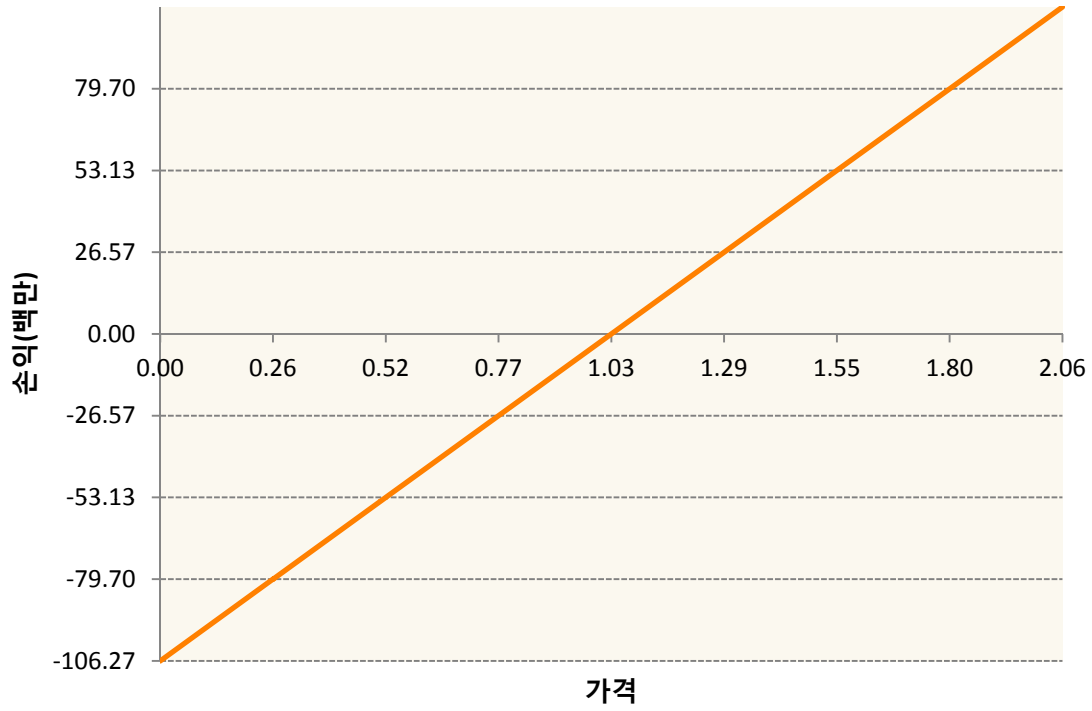


COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20

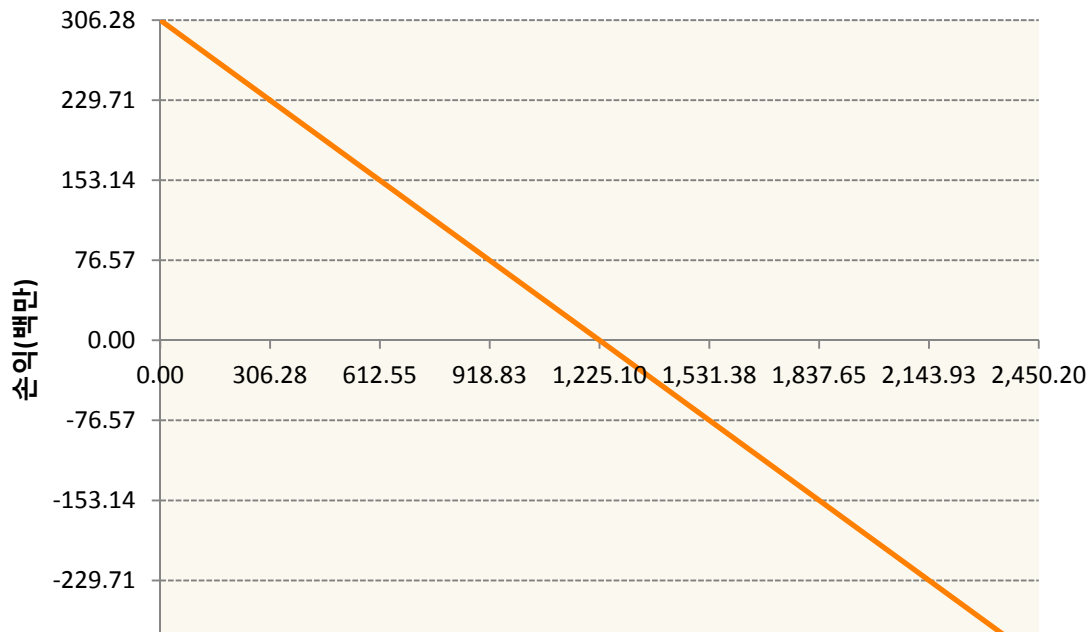


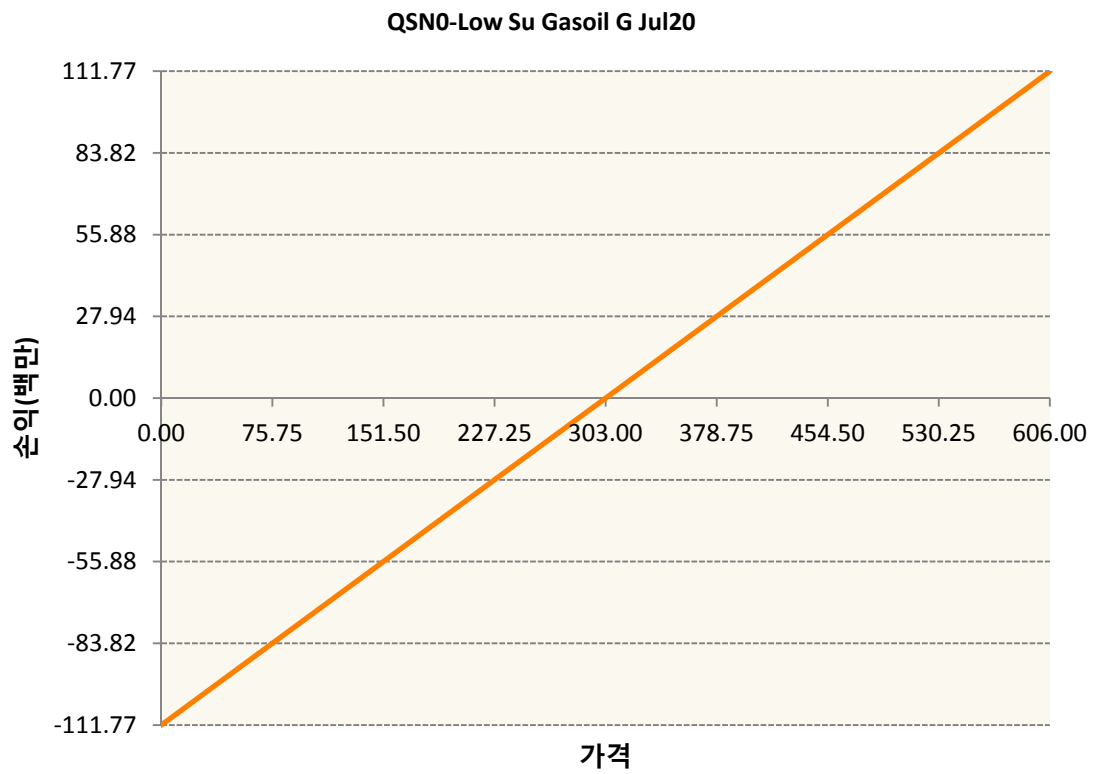
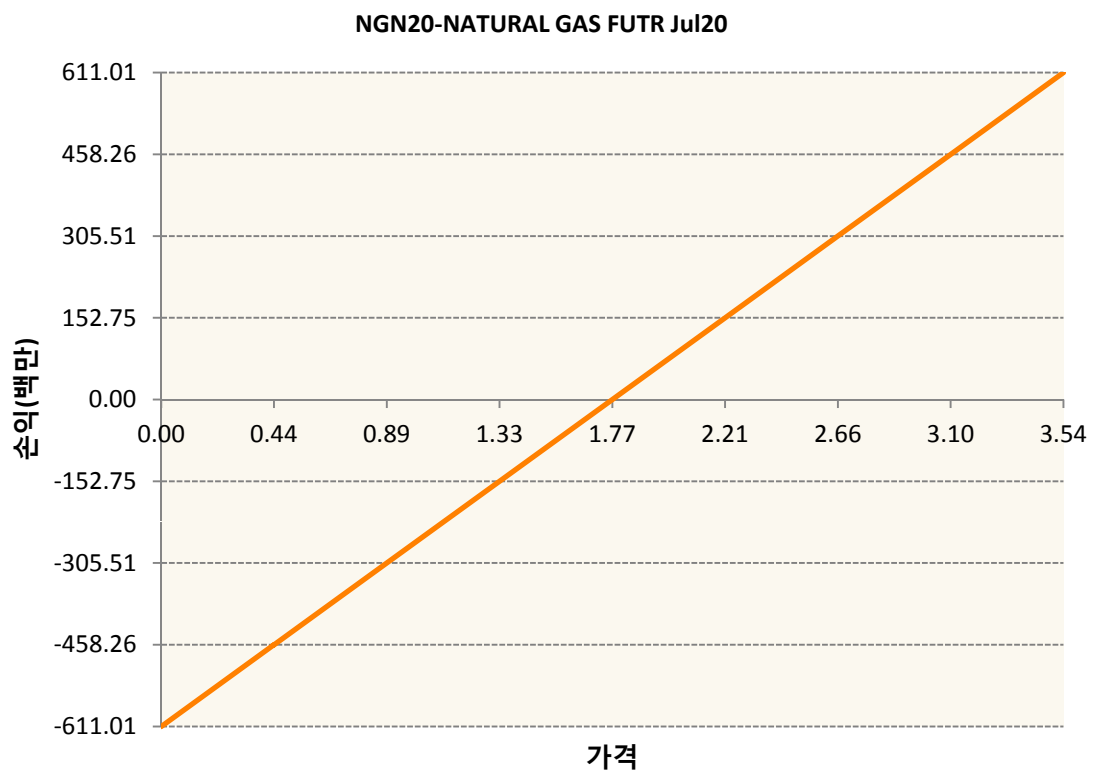
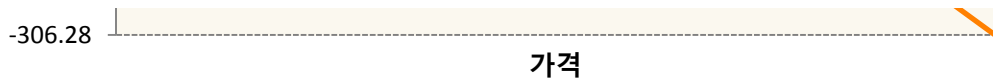


HON0-NY Harb ULSD Fut Jul20

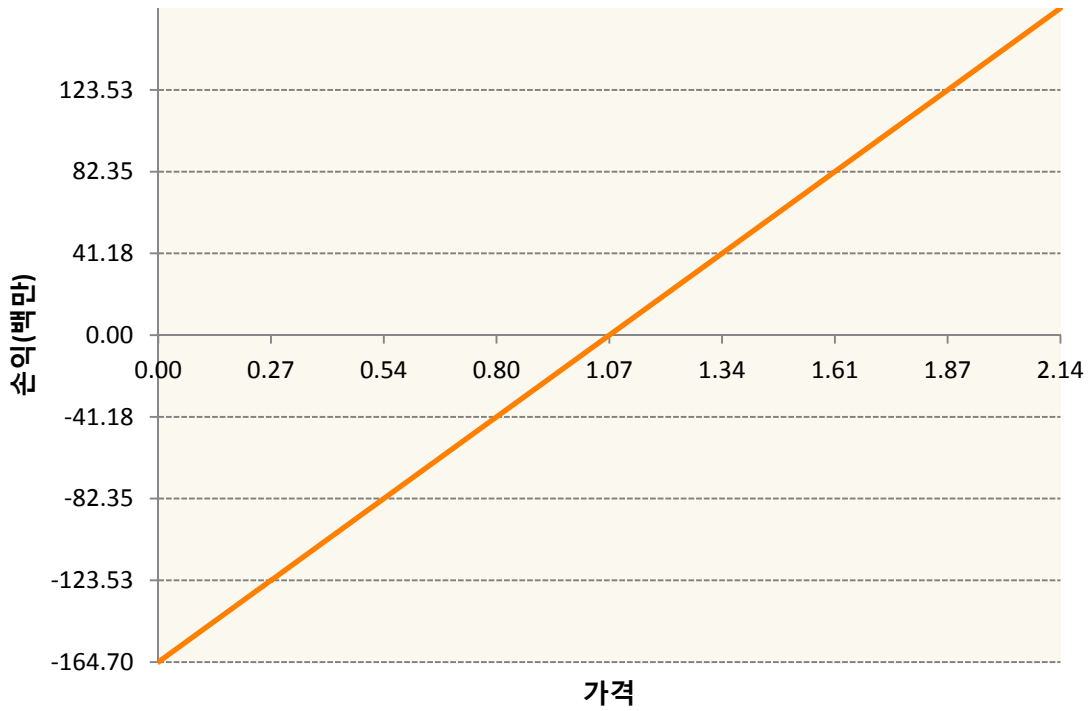


KR4175Q60006-2020-06 달러선물





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 | 49 |
| QSN0 | Low Su Gasoil G Jul20 | 9 |
| XBN0 | GASOLINE RBOB FUT Jul20 | 13 |

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

837

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-03 |
| 기준일 | 2020-06-02 |

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

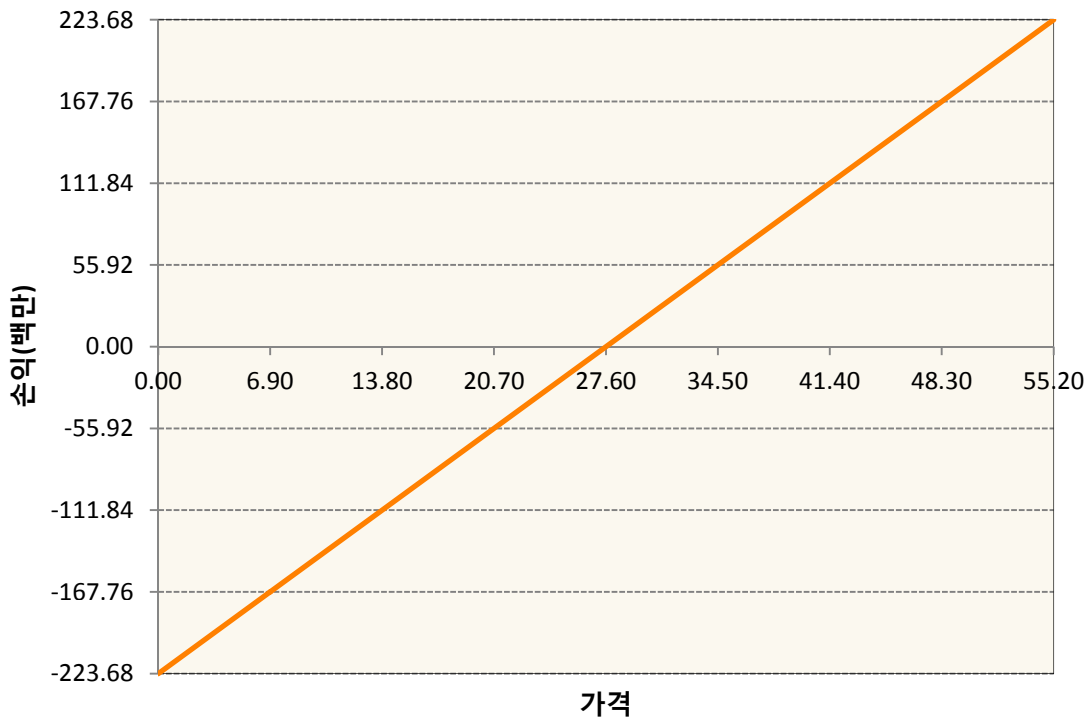
1. 계약금액

(단위:백만원)

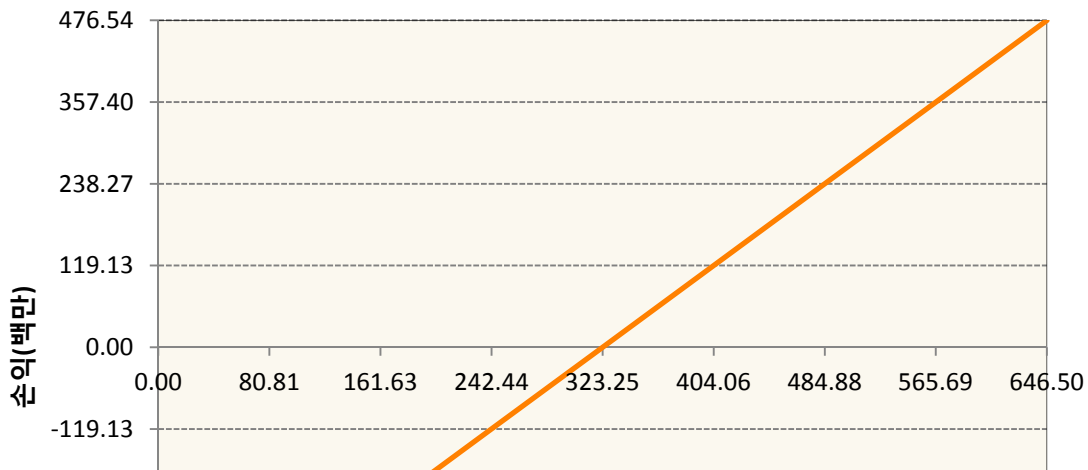
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,434 | 74 | 2,360 | |

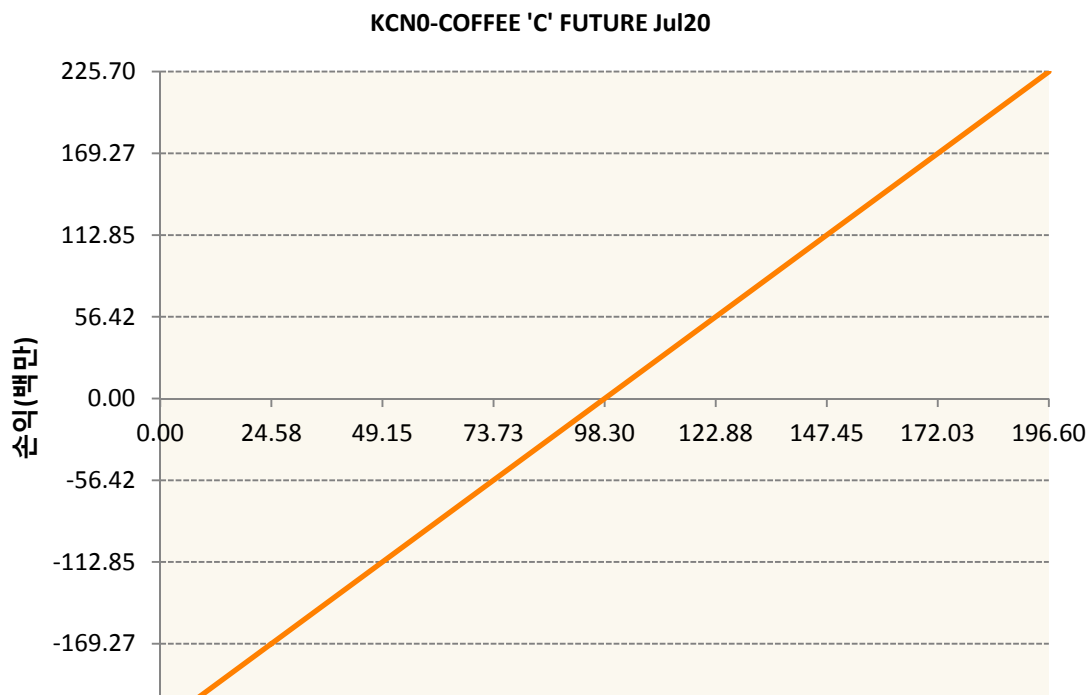
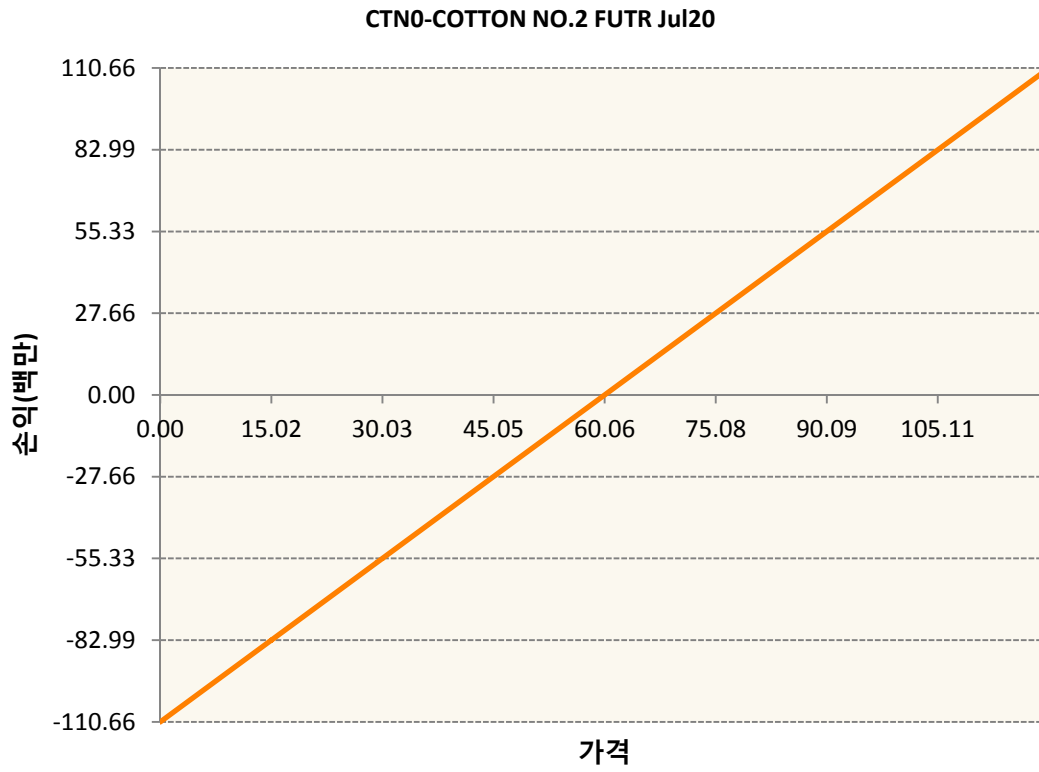
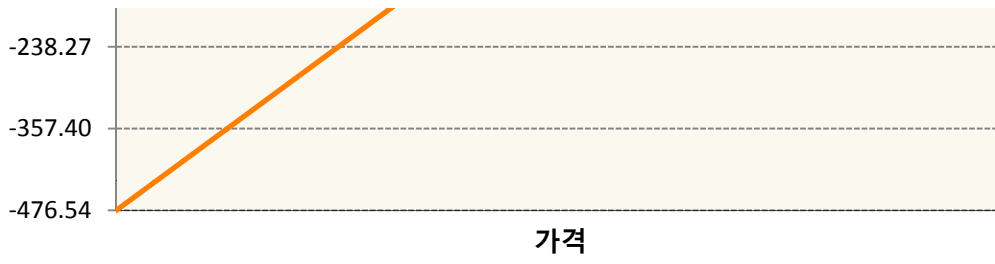
2. 만기시점의 손익구조

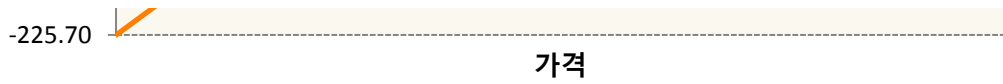
BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20



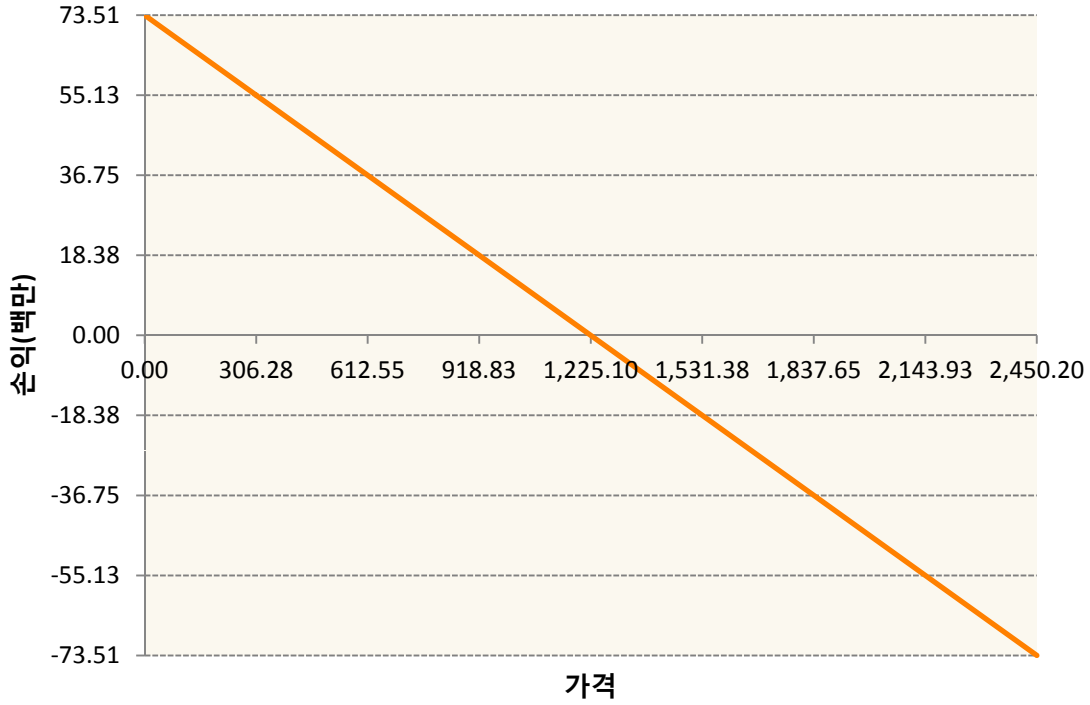
CNO-CORN FUTURE Jul20



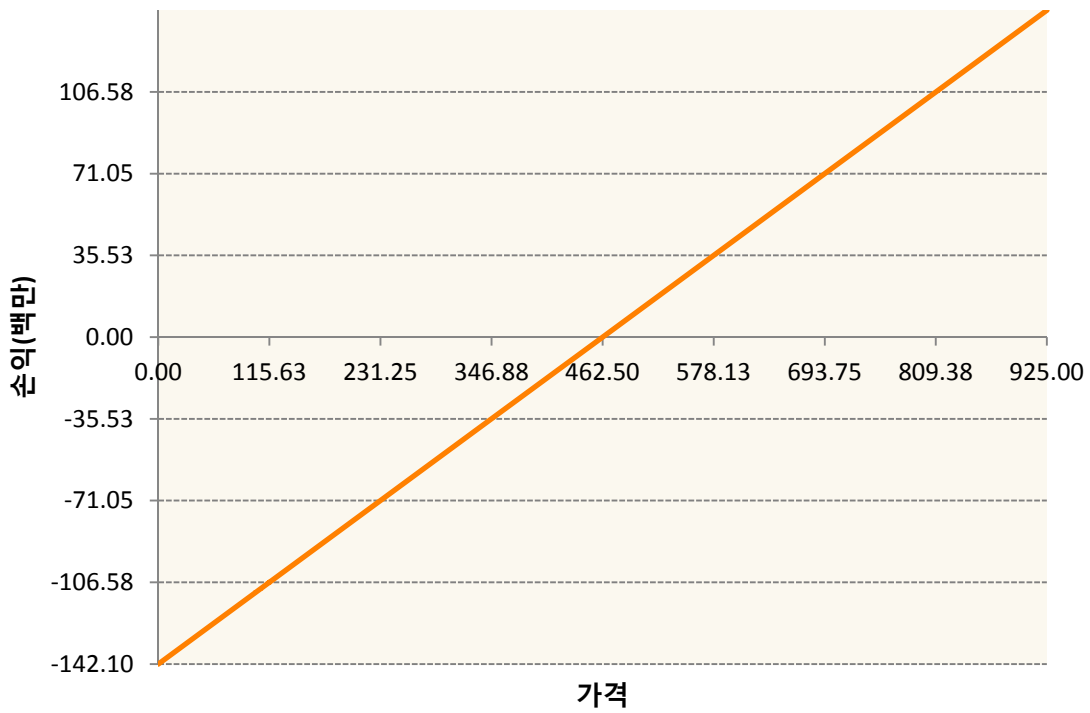




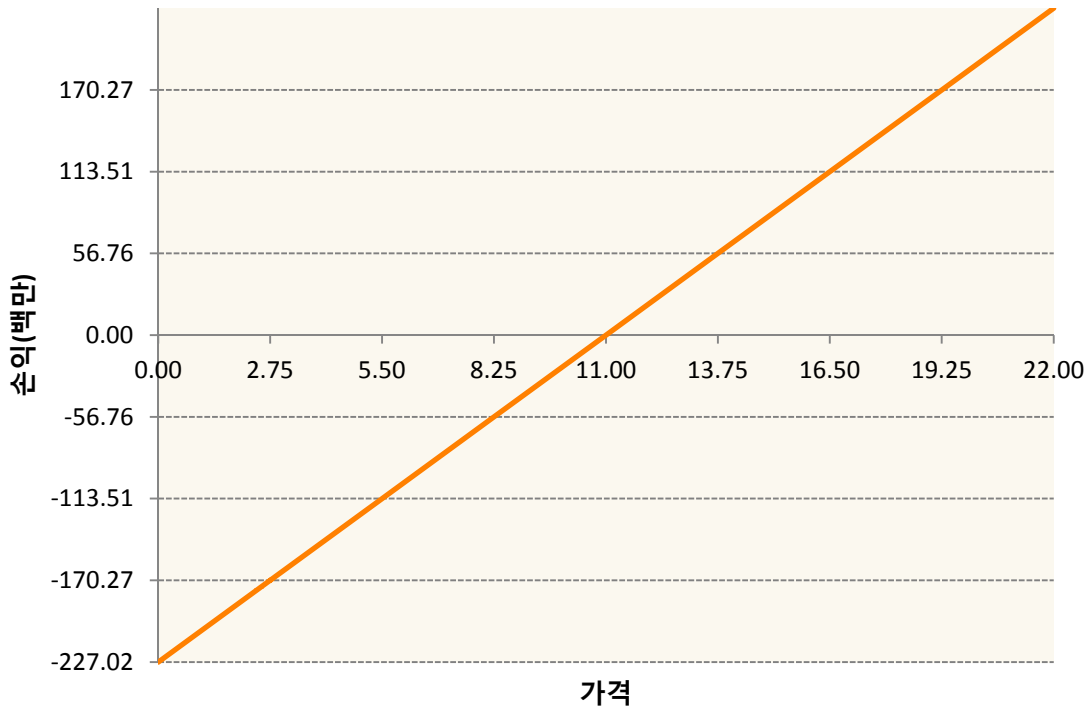
KR4175Q60006-2020-06 달러선물



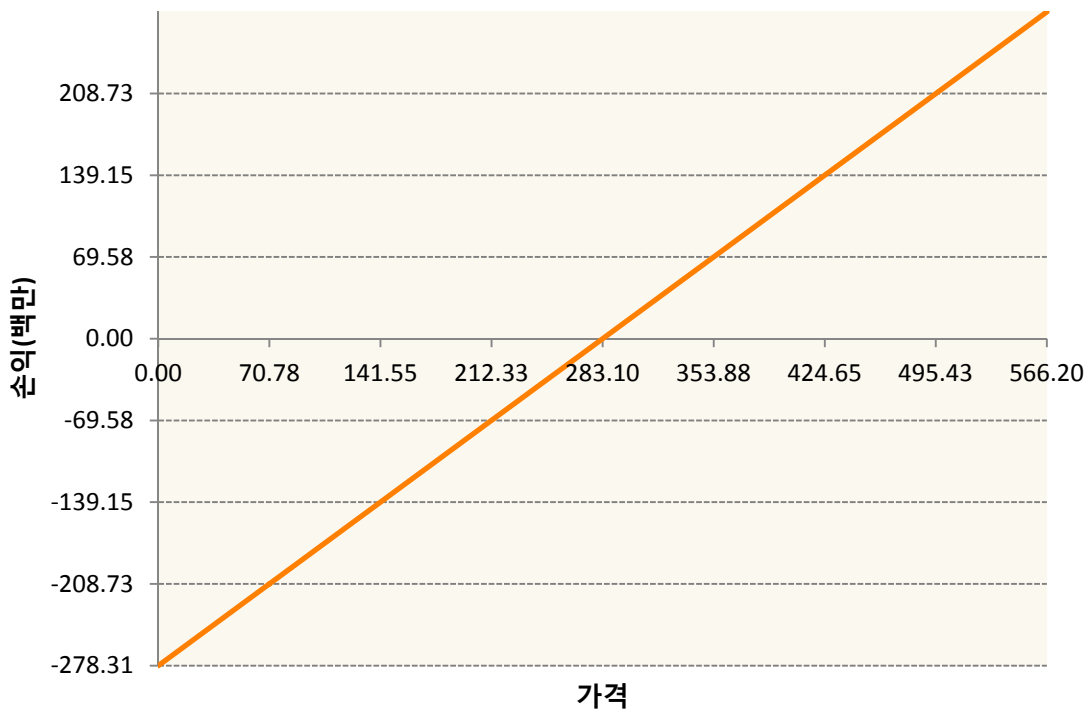
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



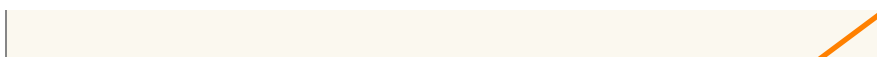
SBN0-Sugar Jul20

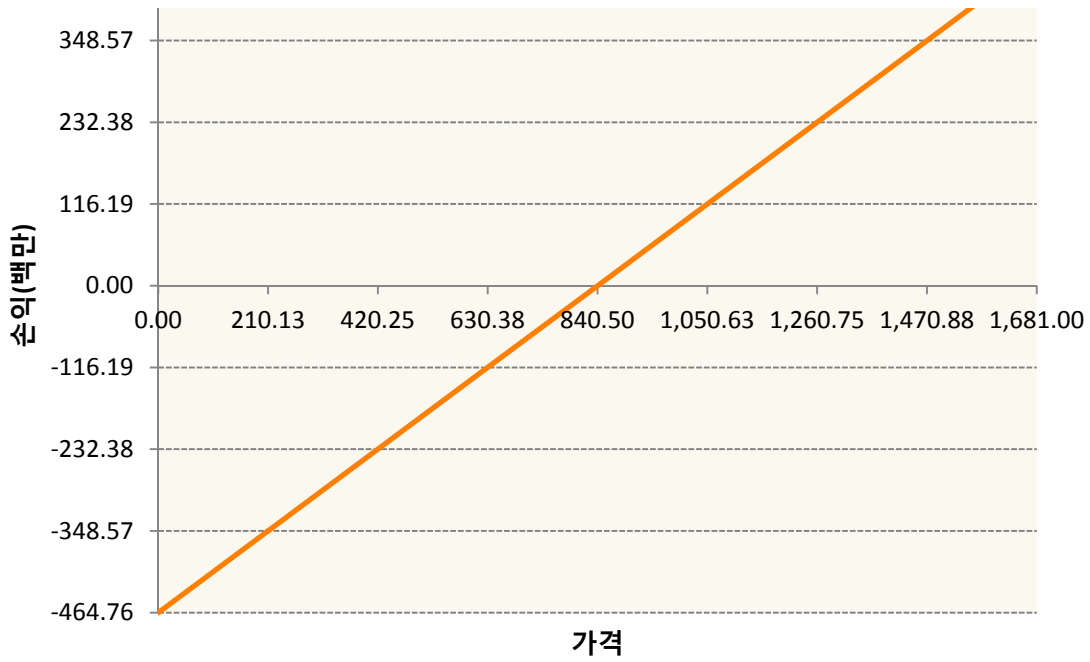


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20

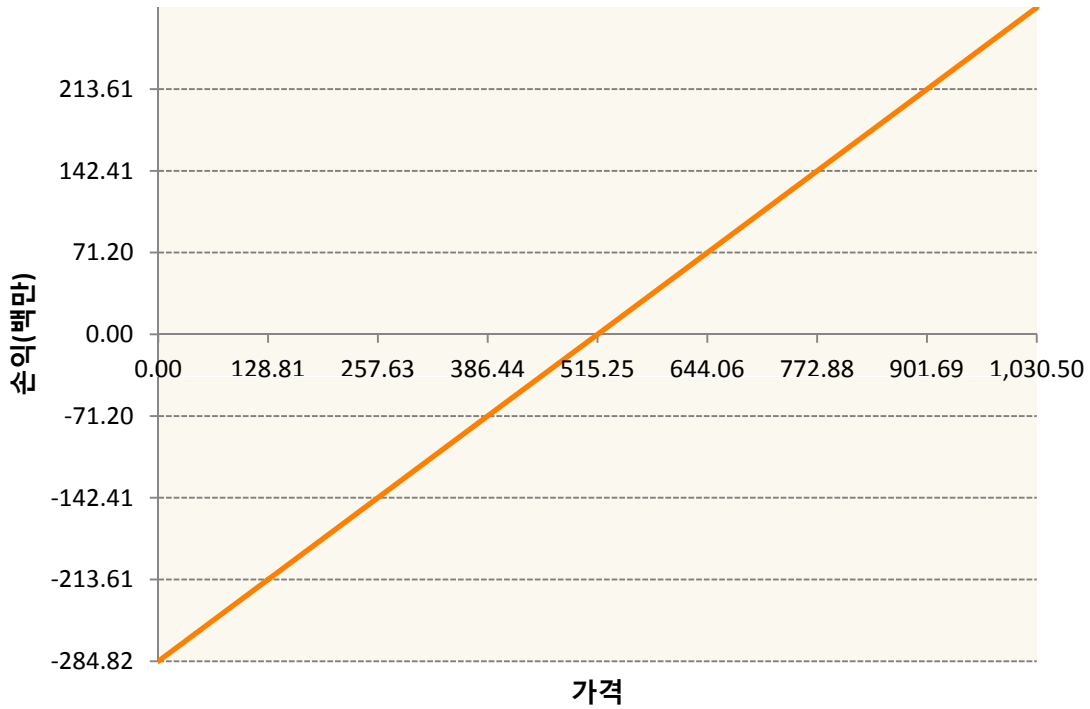


SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





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 | 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