

공시일	2020-06-08
기준일	2020-06-05

## 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	2020-06-08
기준일	2020-06-05

## 스마트인덱스모

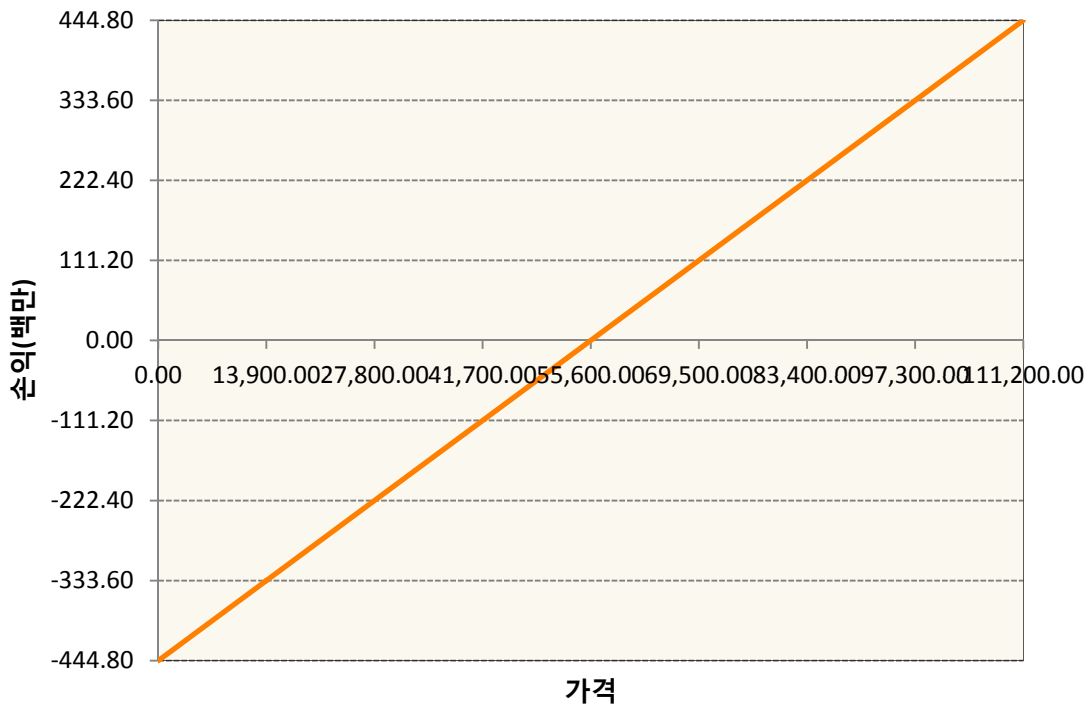
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	445	0	445	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4111Q60001-2020-06 삼성전자개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111Q60001		2020-06 삼성전자개별선물						36
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	
-5.33%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24	
-2.67%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	12	12	12	12	12	12	12	
5.33%	24	24	24	24	24	24	24	
8.00%	36	36	36	36	36	36	36	

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

(단위:백만원)

54

공시일	2020-06-08
기준일	2020-06-05

## 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

1,070

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,254

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-06-08
기준일	2020-06-05

## 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

584
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

866
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-06-08
기준일	2020-06-05

## 유로인덱스모(주식-파생형)

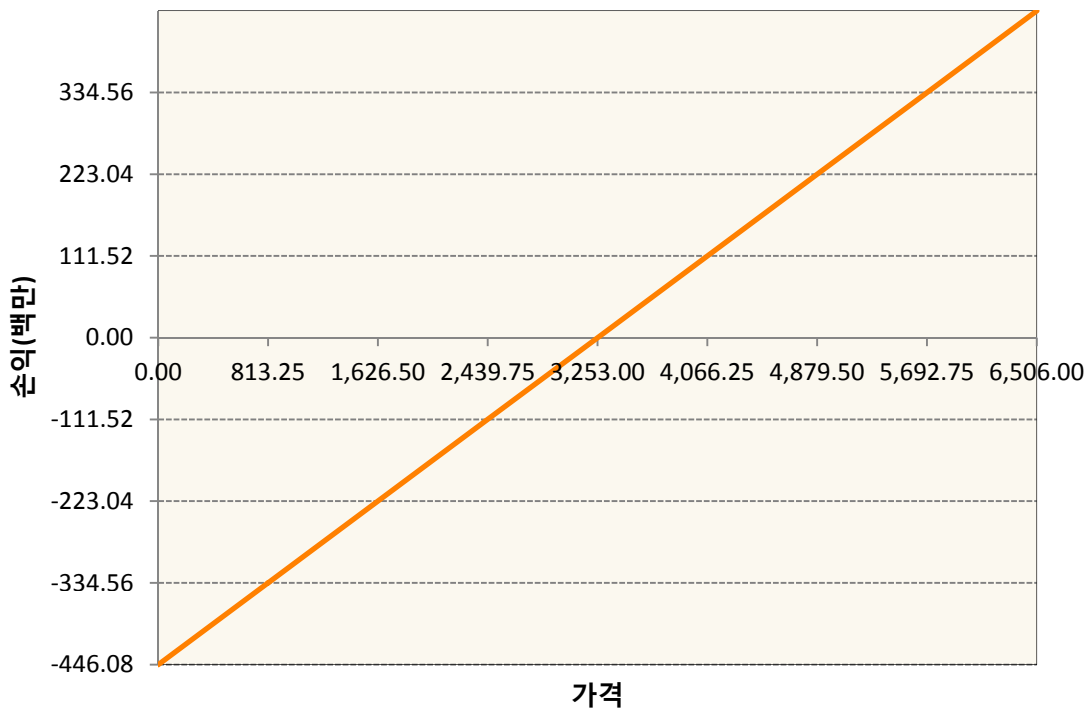
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

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

### 2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	36
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

47
----

공시일	2020-06-08
기준일	2020-06-05

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

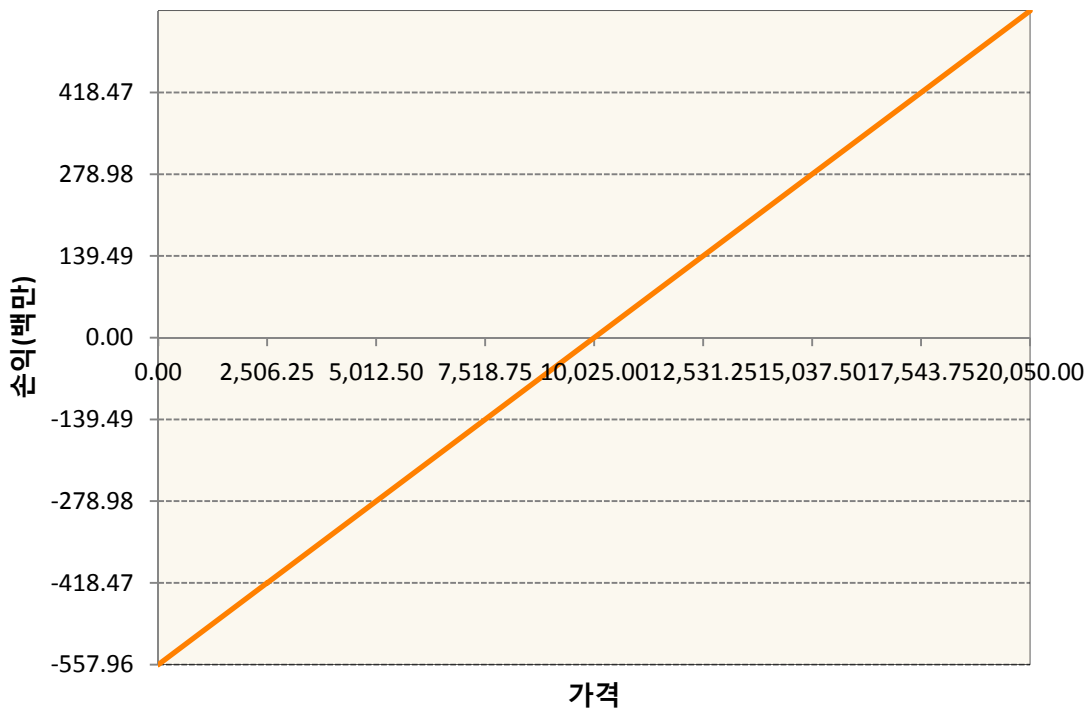
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	558	0	558	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HCM0-HSCEI Futures Jun20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM0	HSCEI Futures Jun20	45
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

48
----

공시일	2020-06-08
기준일	2020-06-05

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

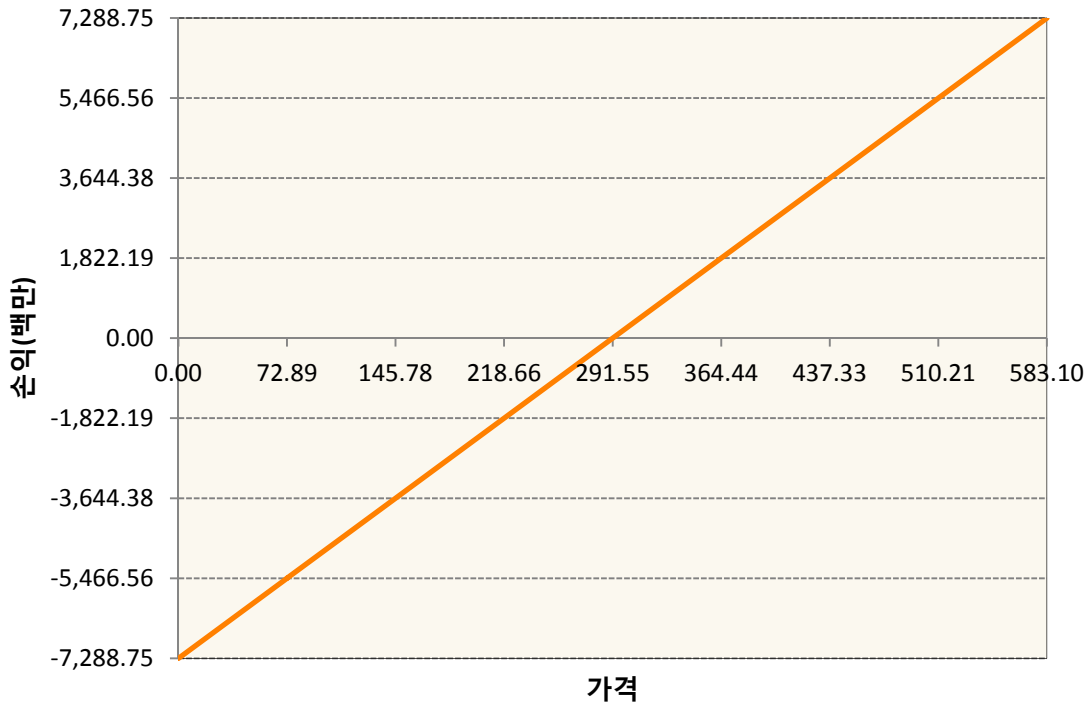
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

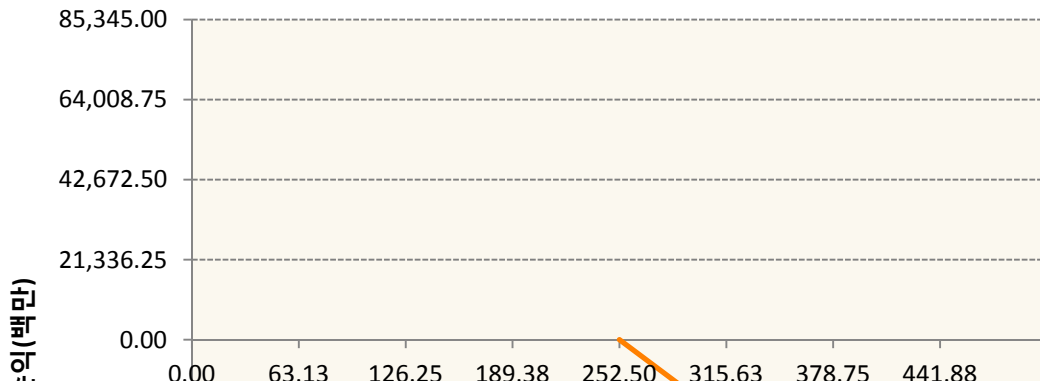
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,289	0	7,289	장내
누계	유가증권	옵션	0	332,463	-332,463	장내

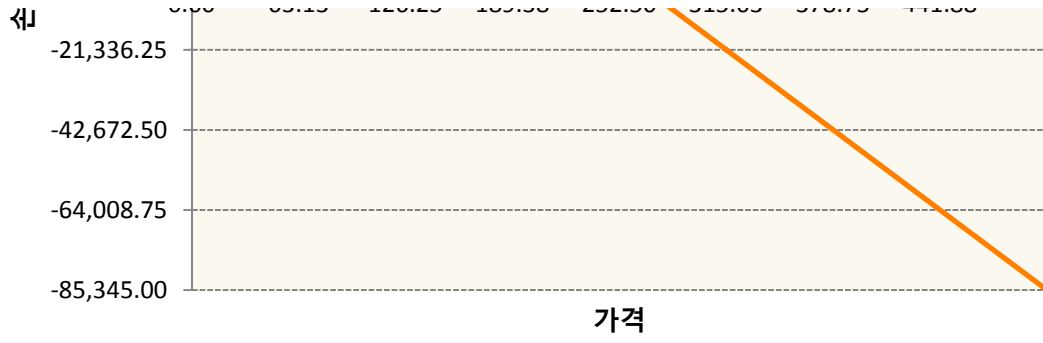
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

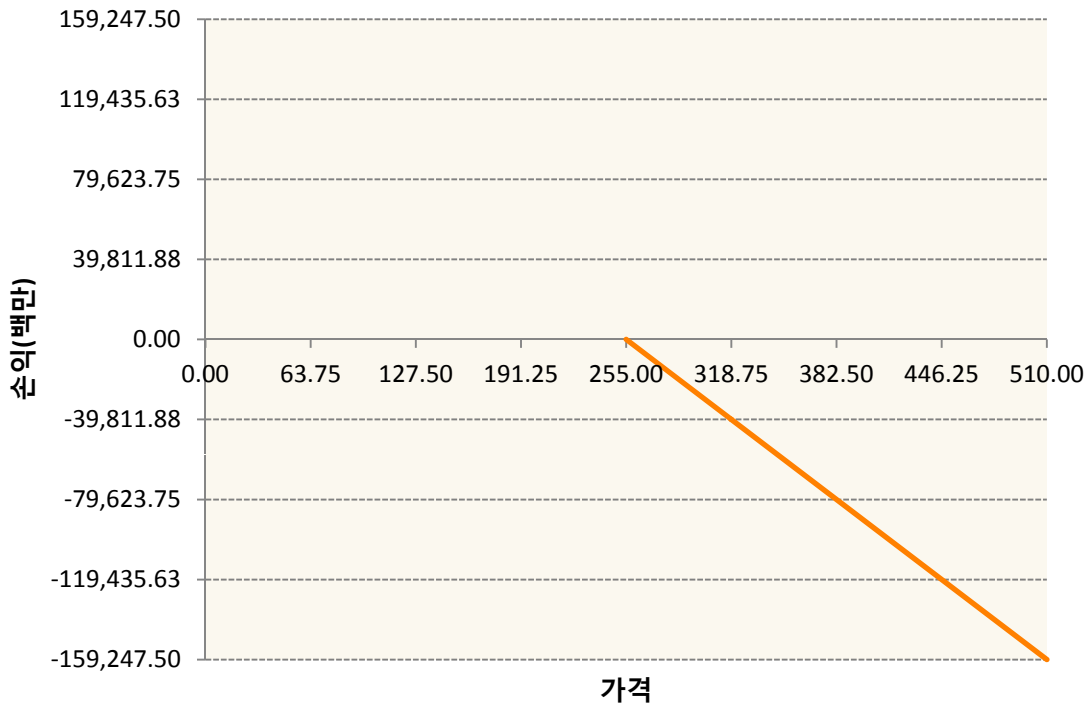


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

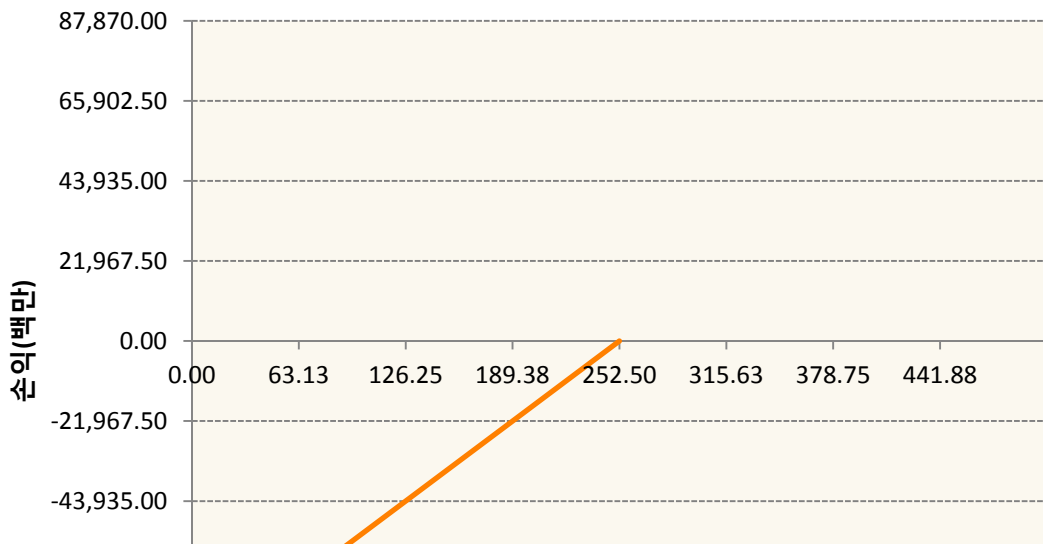


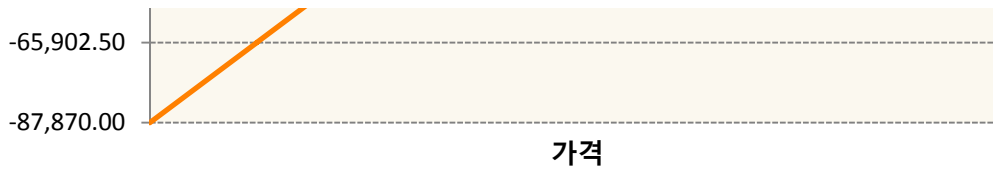


KR4201Q62550-2020-06 콜255



KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





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

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						581
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-581	-581	-581	-581	-581	-581	-581	
-5.33%	-387	-387	-387	-387	-387	-387	-387	
-2.67%	-194	-194	-194	-194	-194	-194	-194	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	194	194	194	194	194	194	194	
5.33%	387	387	387	387	387	387	387	
8.00%	581	581	581	581	581	581	581	
KR4201Q62527		2020-06 콜252.5						7,848
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	7,727	7,659	7,579	7,490	7,393	7,288	7,177	
-5.33%	5,220	5,197	5,163	5,120	5,067	5,005	4,934	
-2.67%	2,624	2,618	2,608	2,592	2,568	2,538	2,499	
0%	8	7	5	0	-8	-21	-39	
2.67%	-2,610	-2,610	-2,611	-2,612	-2,614	-2,619	-2,626	
5.33%	-5,229	-5,229	-5,229	-5,229	-5,229	-5,231	-5,233	
8.00%	-7,847	-7,847	-7,847	-7,847	-7,847	-7,848	-7,848	
KR4201Q62550		2020-06 콜255						14,491
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	14,120	13,954	13,771	13,571	13,360	13,137	12,906	
-5.33%	9,615	9,549	9,462	9,354	9,229	9,086	8,929	
-2.67%	4,852	4,834	4,804	4,759	4,700	4,625	4,534	
0%	26	22	14	0	-23	-56	-101	
2.67%	-4,811	-4,811	-4,813	-4,817	-4,824	-4,837	-4,856	
5.33%	-9,649	-9,649	-9,649	-9,650	-9,652	-9,656	-9,663	
8.00%	-14,487	-14,487	-14,487	-14,487	-14,488	-14,489	-14,491	
KR4301Q62525		2020-06 풋252.5						101
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-4	-10	-19	-32	-50	-73	-101	
-5.33%	0	0	-1	-2	-4	-8	-15	
-2.67%	0	0	0	0	0	-1	-1	

0%	0	0	0	0	0	0	0
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)

**23,393**

공시일	2020-06-08
기준일	2020-06-05

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

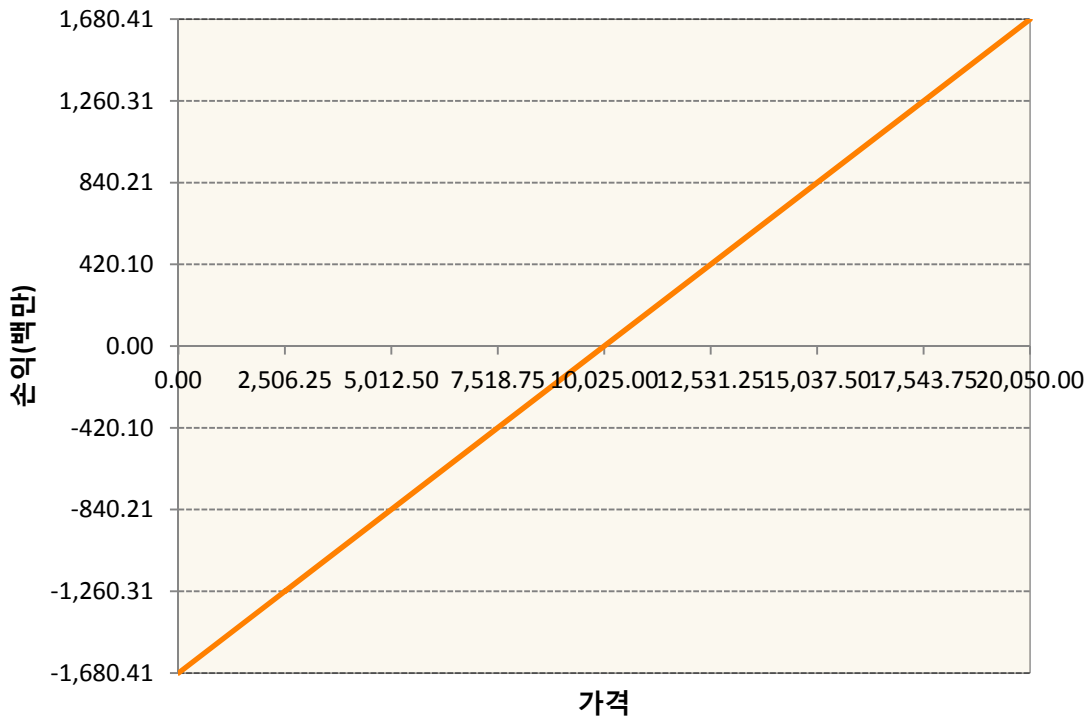
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

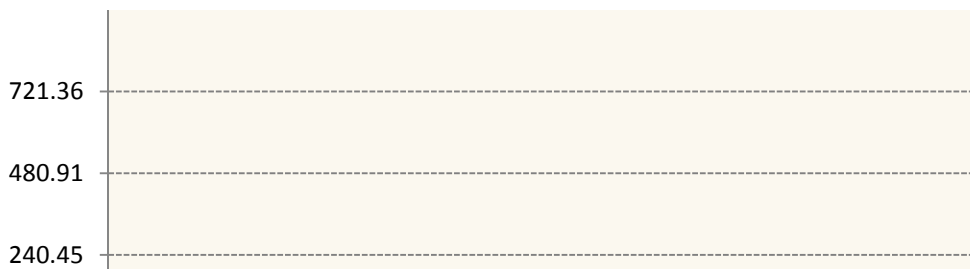
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,680	0	1,680	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,167	-4,167	장내
누계	통화	선도	0	1,508	-1,508	장외

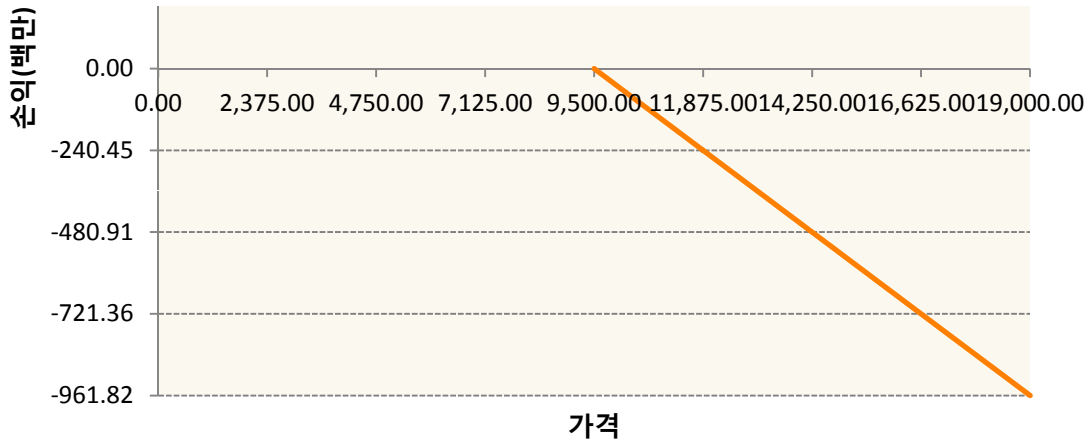
### 2. 만기시점의 손익구조

HCM0-HSCEI Futures Jun20

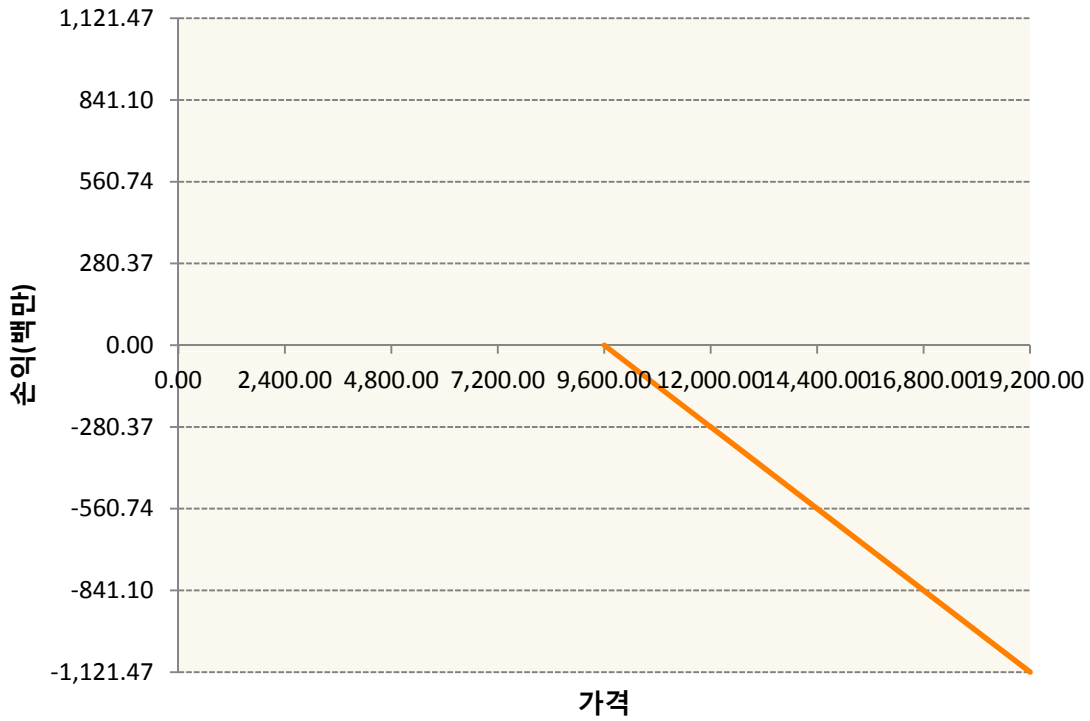


OHHIM0-C95-HSCEI

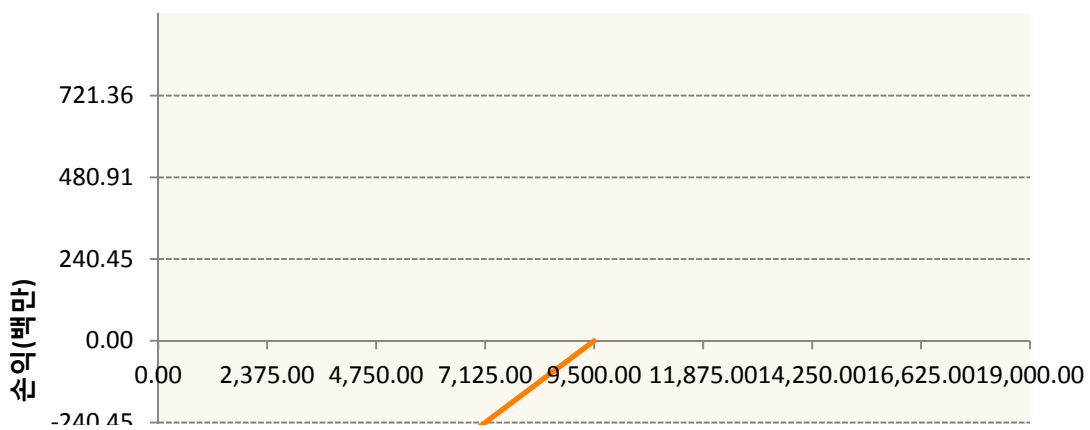


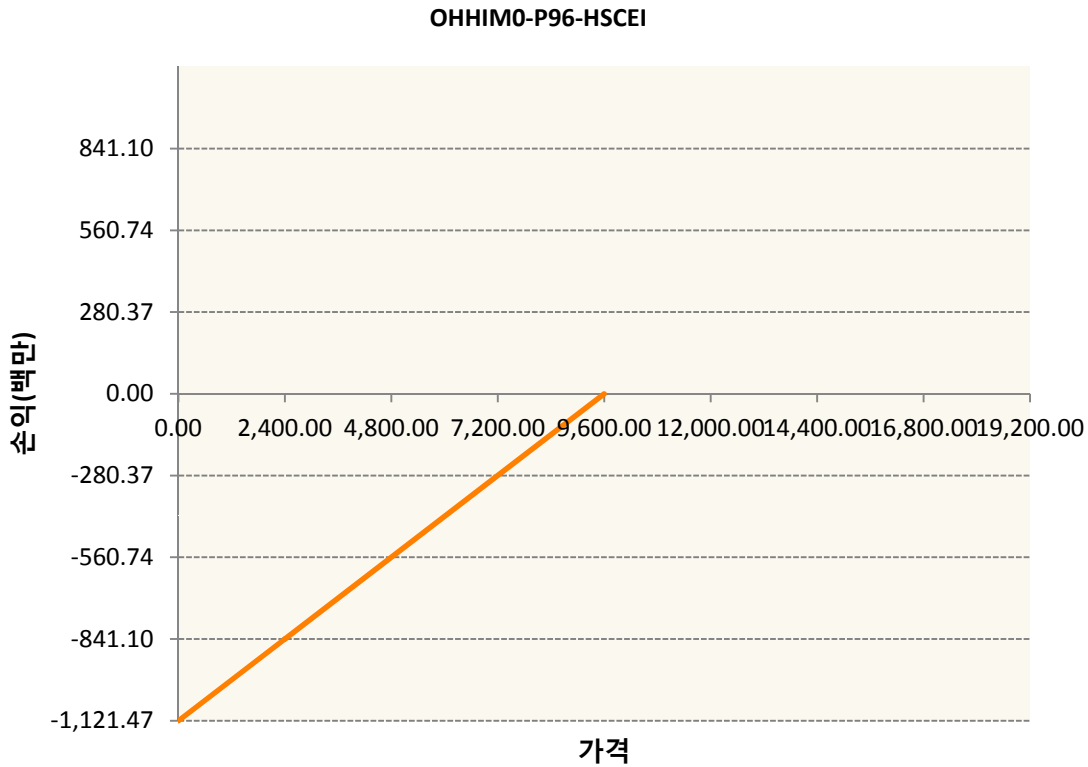


OHHIM0-C96-HSCEI



OHHIM0-P95-HSCEI





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

FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E	121
HCM0 HSCEI Futures Jun20	134
OHHIM0-C9 HSCEI	77
OHHIM0-C9 HSCEI	90
OHHIM0-P9 HSCEI	77
OHHIM0-P9 HSCEI	90

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

**567**

공시일	2020-06-08
기준일	2020-06-05

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

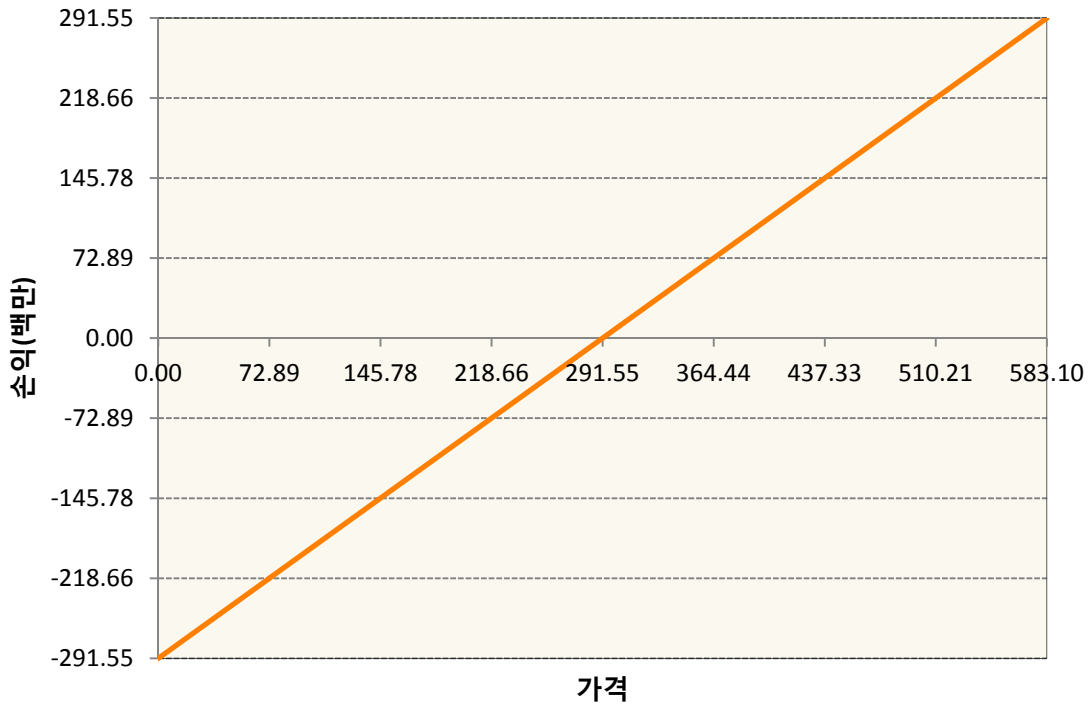
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

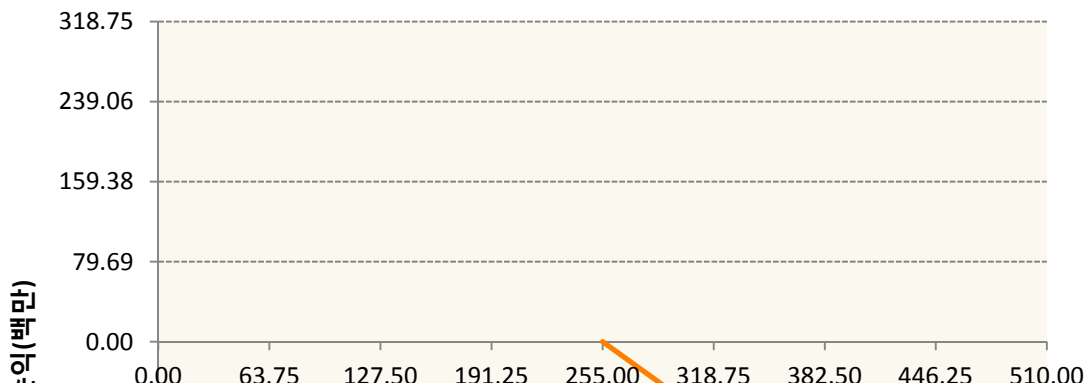
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	73	-73	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	292	0	292	장내
누계	유가증권	옵션	0	319	-319	장내

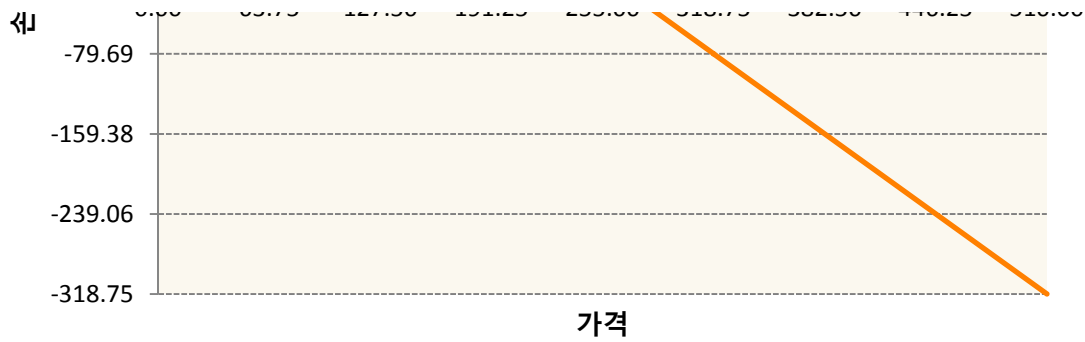
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



KR4201Q62550-2020-06 콜255





**3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						23
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23	
-5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	
-2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	8	8	8	8	8	8	8	
5.33%	15	15	15	15	15	15	15	
8.00%	23	23	23	23	23	23	23	
KR4201Q62550		2020-06 콜255						29
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	28	28	28	27	27	26	26	
-5.33%	19	19	19	19	18	18	18	
-2.67%	10	10	10	10	9	9	9	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10	
5.33%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
8.00%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29	

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

64

공시일	2020-06-08
기준일	2020-06-05

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

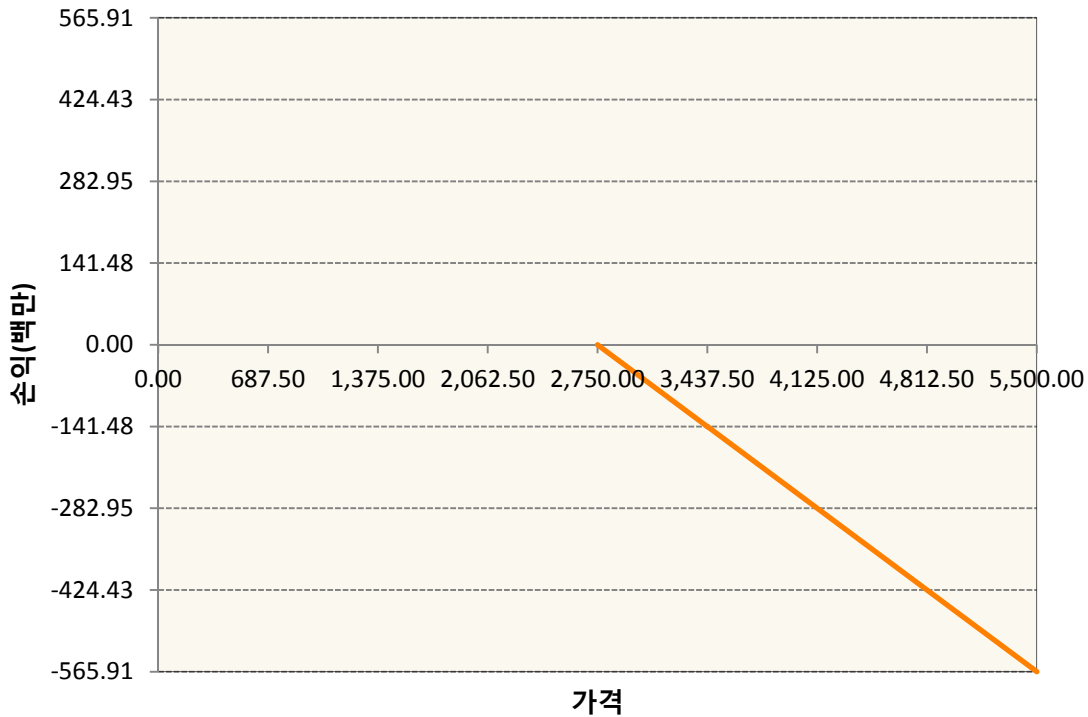
### 1. 계약금액

(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	1,355	0	1,355	
누계	유가증권	스왑	8,182	0	8,182	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,880	-6,880	장내
누계	통화	선도	0	2,969	-2,969	장외

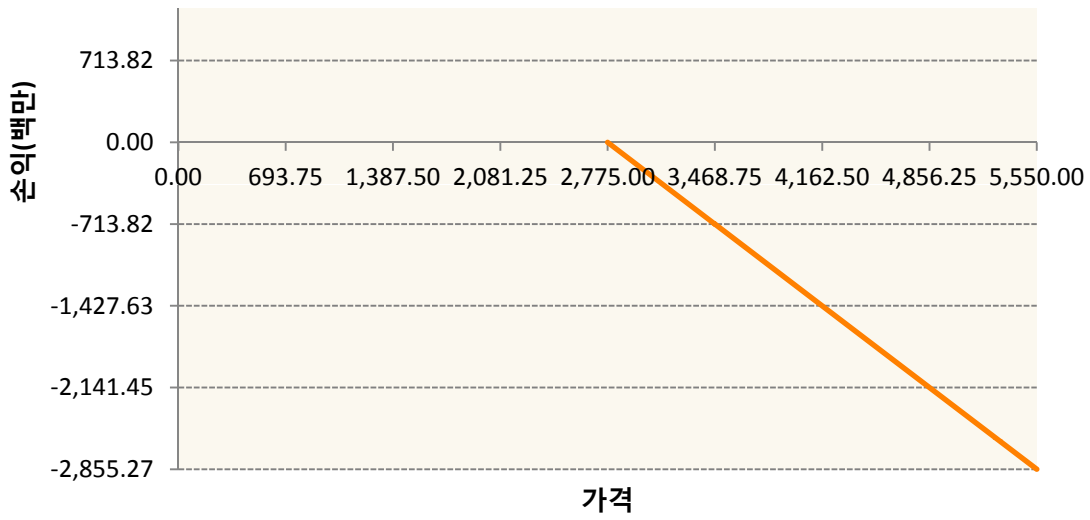
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXM0-C2750-EURO STOXX 50**

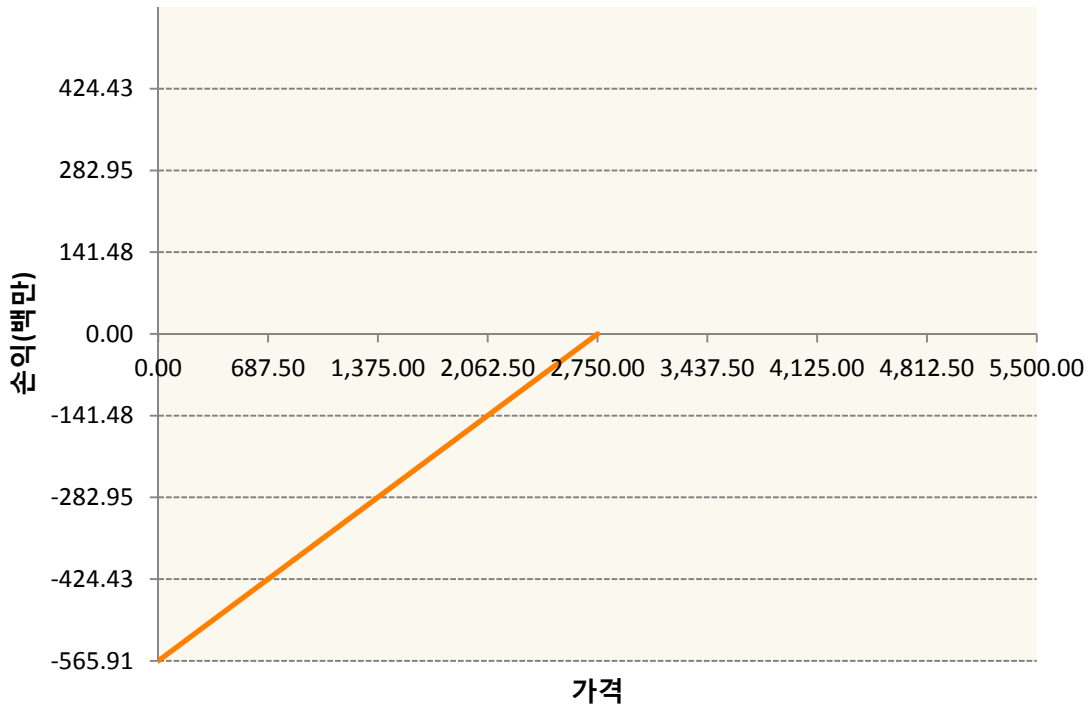


**OESXM0-C2775-EURO STOXX 50**

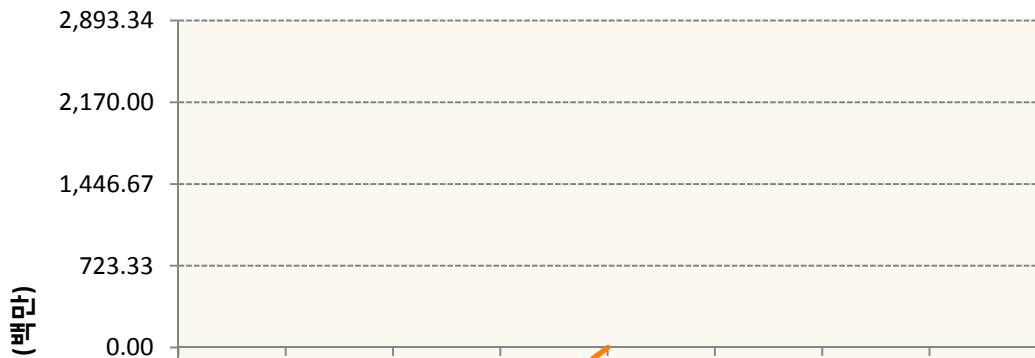


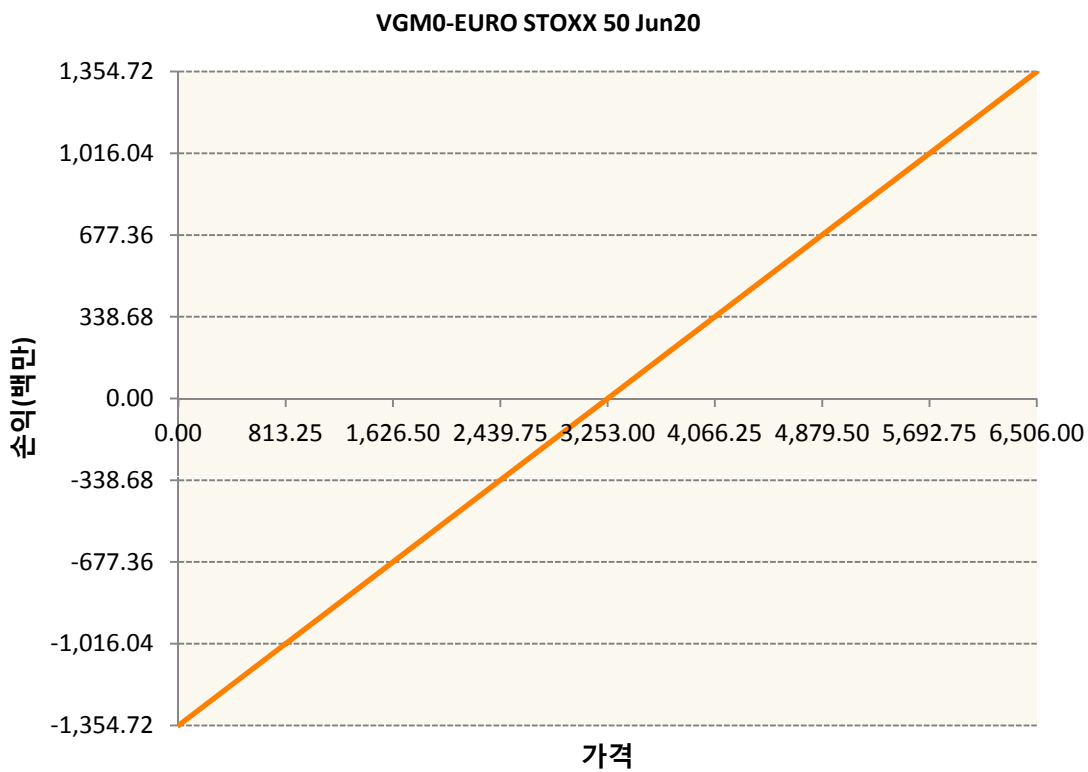
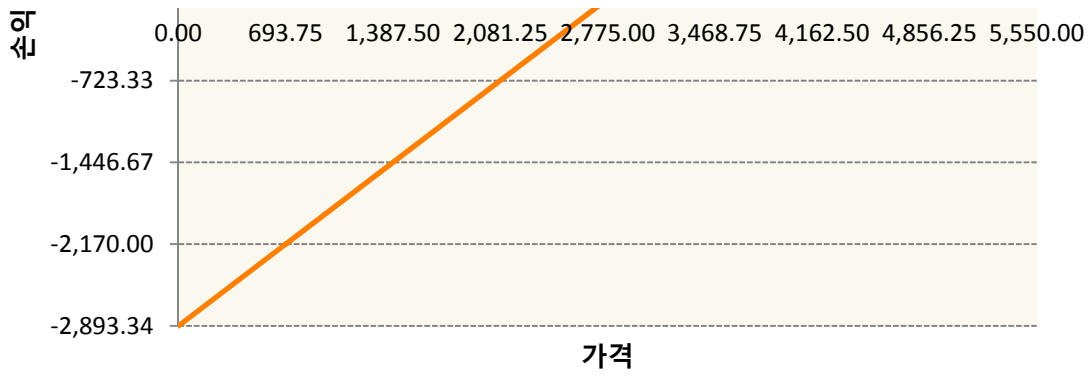


OESXM0-P2750-EURO STOXX 50



OESXM0-P2775-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		23
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E		222
FX21020K02 KRW/EUR 26-06-20E		15
OESXM0-C2' EURO STOXX 50		45
OESXM0-C2' EURO STOXX 50		228
OESXM0-P2' EURO STOXX 50		45
OESXM0-P2' EURO STOXX 50		231
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20		108

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

(단위:백만원)

1,051



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

(단위:백만원)

1,315

공시일	2020-06-08
기준일	2020-06-05

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

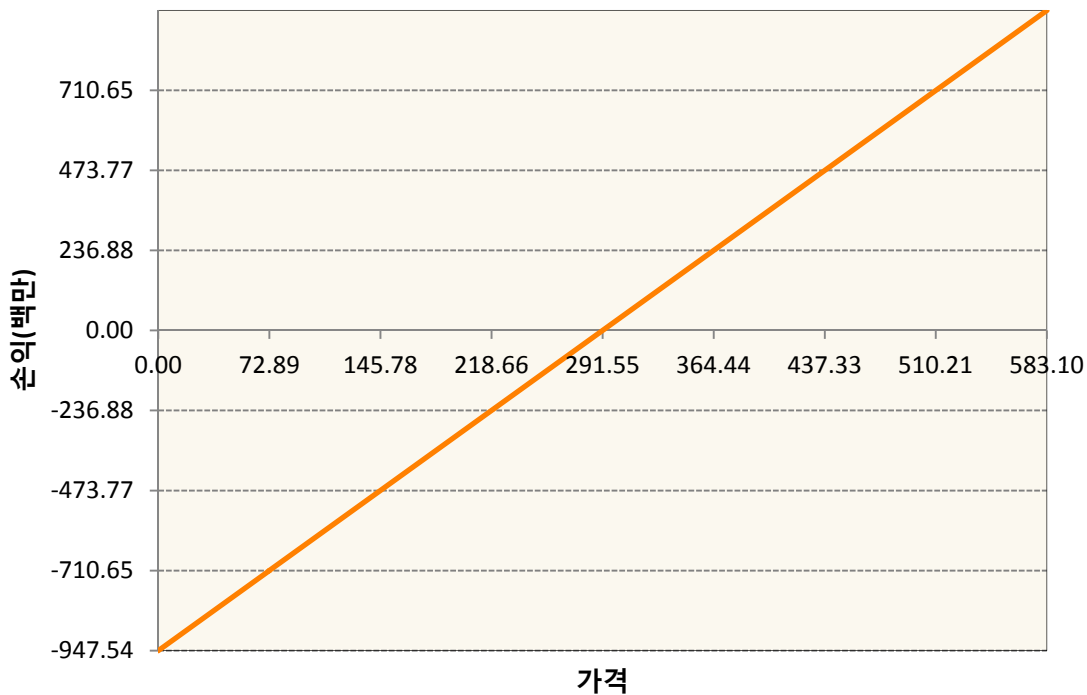
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	948	0	948	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						76
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76	
-5.33%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	25	25	25	25	25	25	25	
5.33%	50	50	50	50	50	50	50	
8.00%	76	76	76	76	76	76	76	

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

(단위:백만원)

114



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

(단위:백만원)

167

공시일	2020-06-08
기준일	2020-06-05

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

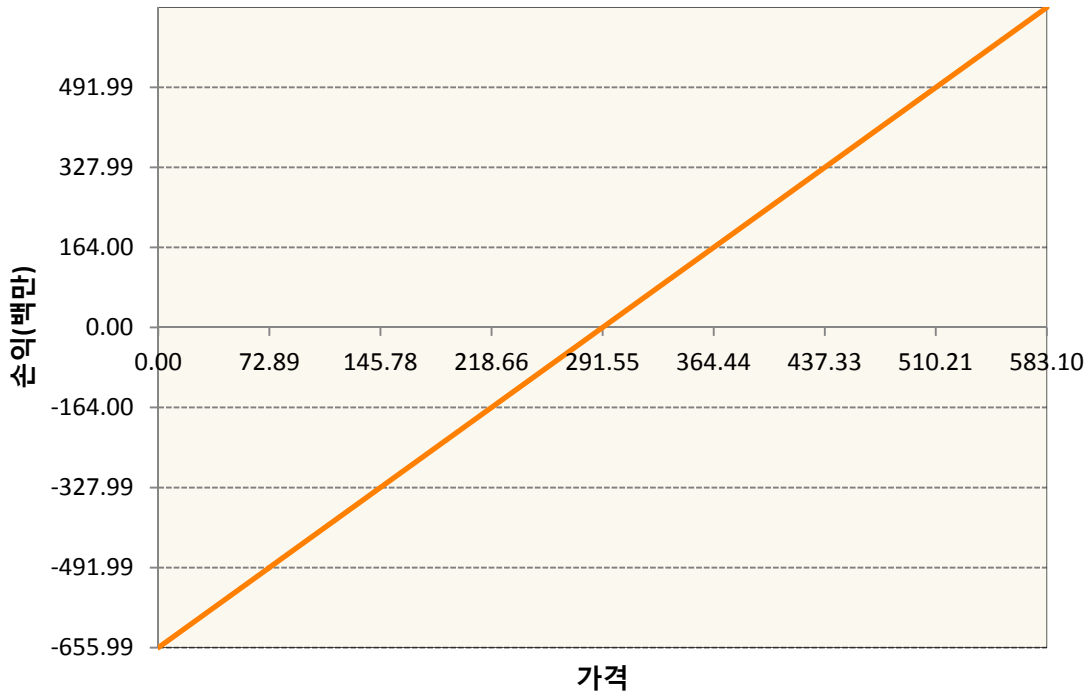
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	656	0	656	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						52
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52	
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	17	17	17	17	17	17	17	
5.33%	35	35	35	35	35	35	35	
8.00%	52	52	52	52	52	52	52	

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

(단위:백만원)

79

공시일	2020-06-08
기준일	2020-06-05

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

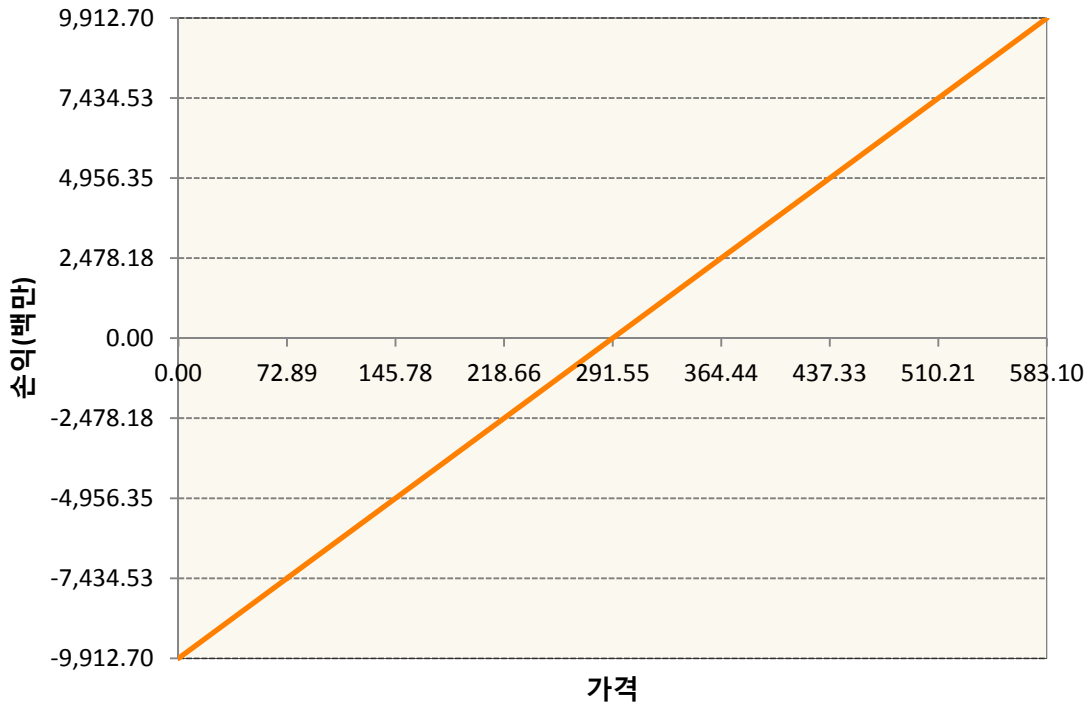
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

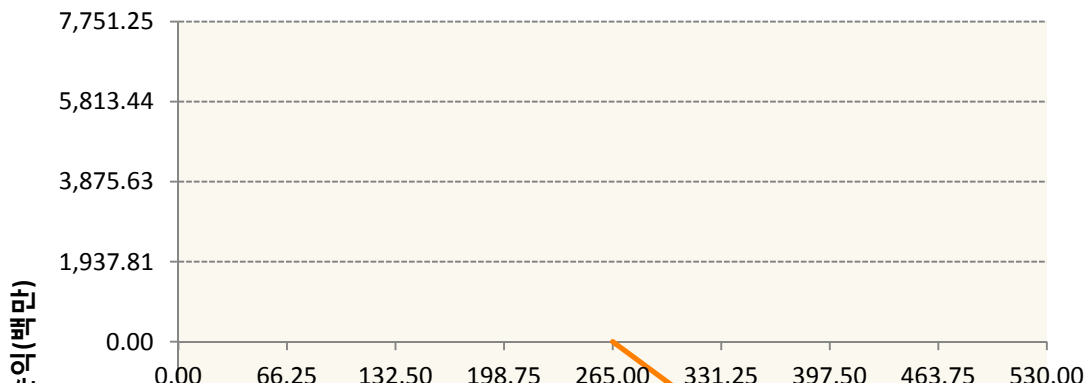
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	241	0	241	장내
누계	유가증권	선물	9,913	0	9,913	장내
누계	유가증권	옵션	2,917	16,646	-13,729	장내

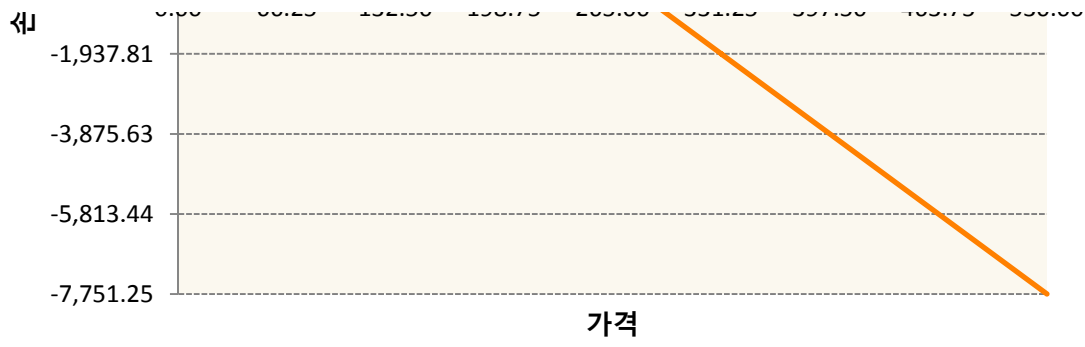
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

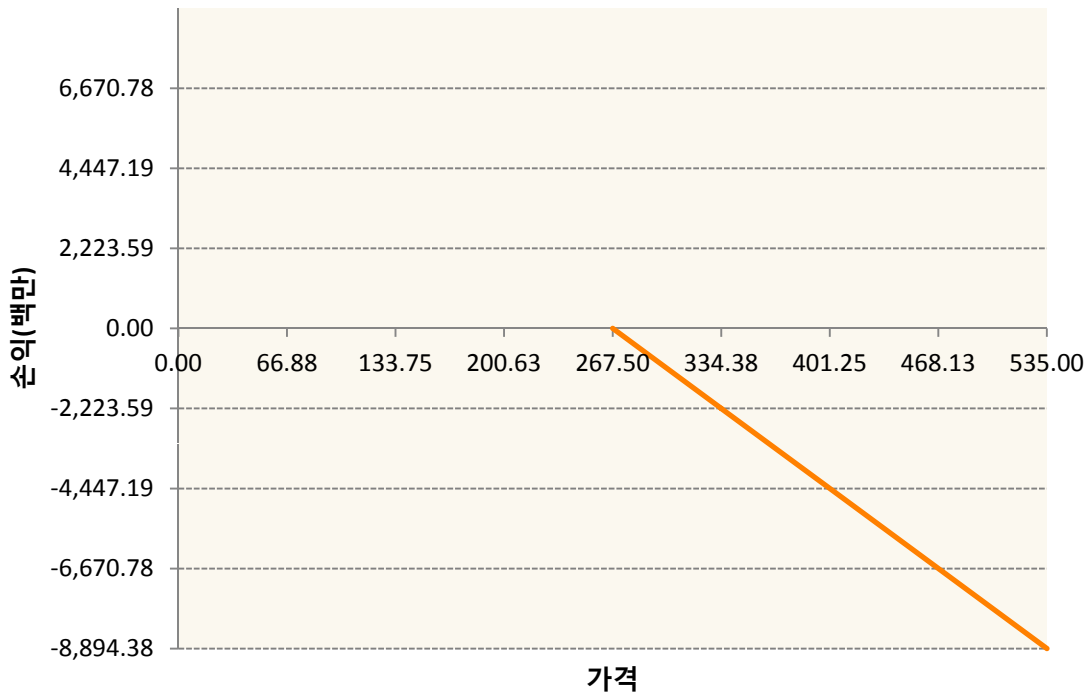


KR4201Q62659-2020-06 콜265

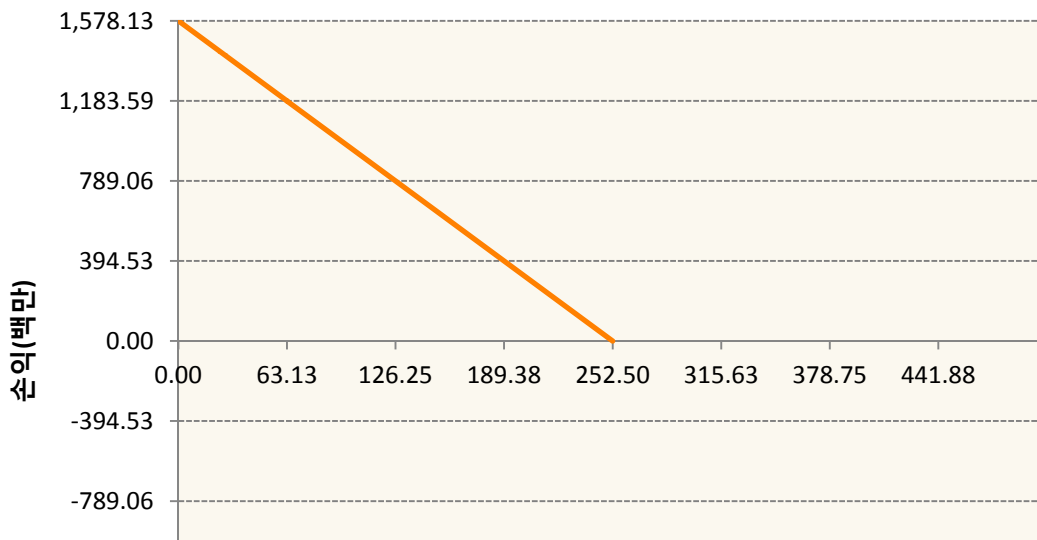


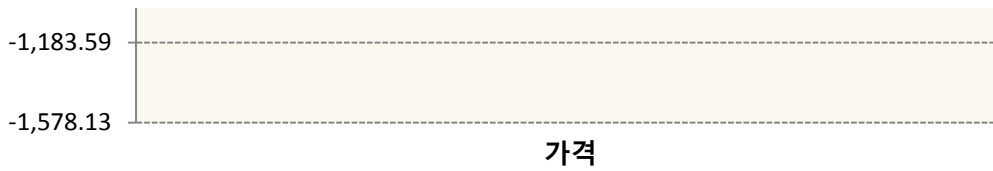


KR4201Q62675-2020-06 콜267.5

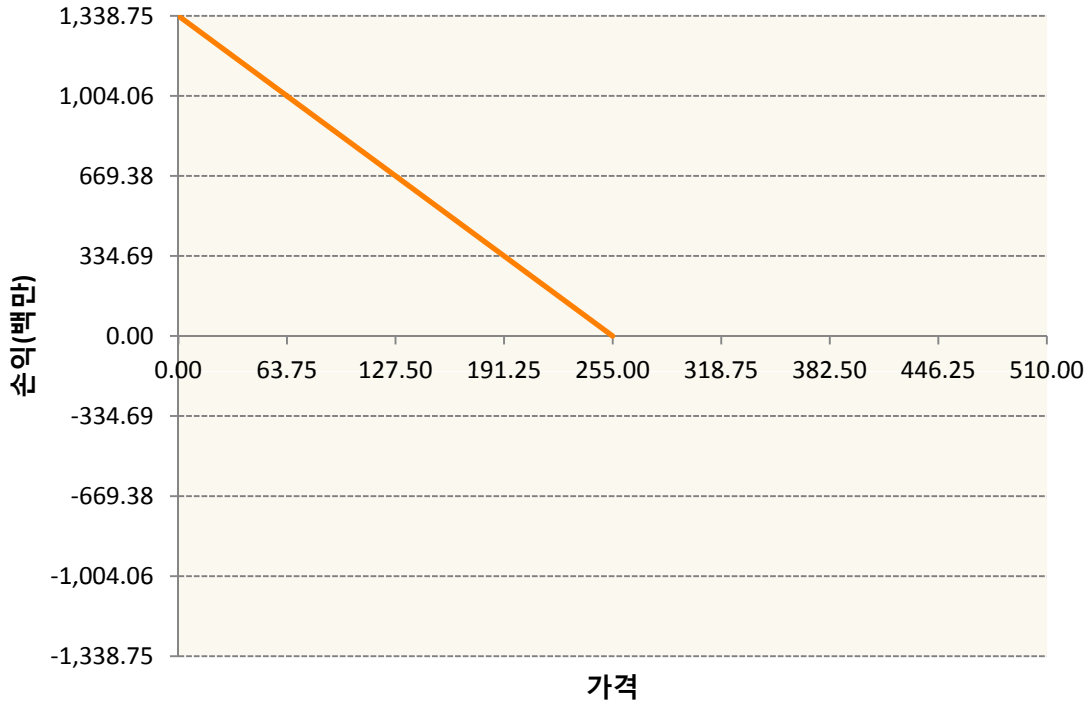


KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





KR4301Q62558-2020-06 풋255



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						790
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-790	-790	-790	-790	-790	-790	-790	
-5.33%	-527	-527	-527	-527	-527	-527	-527	
-2.67%	-263	-263	-263	-263	-263	-263	-263	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	263	263	263	263	263	263	263	
5.33%	527	527	527	527	527	527	527	
8.00%	790	790	790	790	790	790	790	
KR4201Q62659		2020-06 콜265						672
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	591	577	564	550	535	521	507	
-5.33%	429	419	409	398	386	374	362	
-2.67%	227	222	217	210	202	194	185	

0%	7	6	3	0	-4	-9	-15
2.67%	-218	-219	-219	-220	-222	-225	-228
5.33%	-445	-445	-445	-445	-446	-447	-448
8.00%	-671	-671	-671	-671	-672	-672	-672

KR4201Q62675                      2020-06 콜267.5                      760

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	638	622	606	589	573	557	541
-5.33%	475	461	447	433	418	404	389
-2.67%	257	250	241	232	221	210	198
0%	12	9	5	0	-6	-13	-21
2.67%	-243	-244	-245	-247	-250	-254	-258
5.33%	-501	-501	-501	-502	-503	-504	-507
8.00%	-758	-758	-758	-758	-759	-759	-760

KR4301Q62525                      2020-06 풋252.5                      2

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	1	1	1	2
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
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                      3

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	1	1	2	2	3
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
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)

**2,674**

공시일	2020-06-08
기준일	2020-06-05

## 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	156,288	0	156,288	

### 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	2020-06-08
기준일	2020-06-05

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	1,842	-1,842	
누계	유가증권	수익증권	103,529	0	103,529	

### 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	2020-06-08
기준일	2020-06-05

## 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	465,517	0	465,517	
누계	통화	선도	0	435,280	-435,280	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J00(KRW/USD 10-06-20E	2,897
FX21020J02(KRW/USD 10-06-20E	1,313
FX21020J02(KRW/USD 22-06-20E	1,487
FX21020J02(KRW/USD 22-06-20E	1,931
FX21020J03(KRW/USD 24-07-20E	2,173
FX21020J04(KRW/USD 24-07-20E	1,738
FX21020J04(KRW/USD 24-07-20E	1,931
FX21020K00(KRW/USD 12-06-20E	2,009
FX21020K00(KRW/USD 12-06-20E	1,912
FX21020K01(KRW/USD 22-06-20E	676
FX21020K01(KRW/USD 18-08-20E	2,356
FX21020K01(KRW/USD 18-08-20E	966
FX21020K03(KRW/USD 26-08-20E	1,014
FX21020K03(KRW/USD 26-08-20E	1,603
FX21020K05(KRW/USD 03-08-20E	3,380
FX21020K05(KRW/USD 03-08-20E	6,856
FX21020M0(KRW/USD 26-08-20E	579

IE00BD8RGM75

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

**17,794**



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

(단위:백만원)

227

공시일	2020-06-08
기준일	2020-06-05

## 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	7,673	0	7,673	
누계	통화	선도	0	7,315	-7,315	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020K01 KRW/USD 15-06-20E	316
FX21020K03 KRW/USD 15-06-20E	11
FX21020K04 KRW/USD 27-07-20E	39
FX21020K04 KRW/USD 27-07-20E	97
FX21020K04 KRW/USD 30-06-20E	37
FX21020K04 KRW/USD 20-07-20E	77
FX21020M0( KRW/USD 20-07-20E	10
IE00BD8RGM75	

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

<b>299</b>
------------

공시일	2020-06-08
기준일	2020-06-05

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

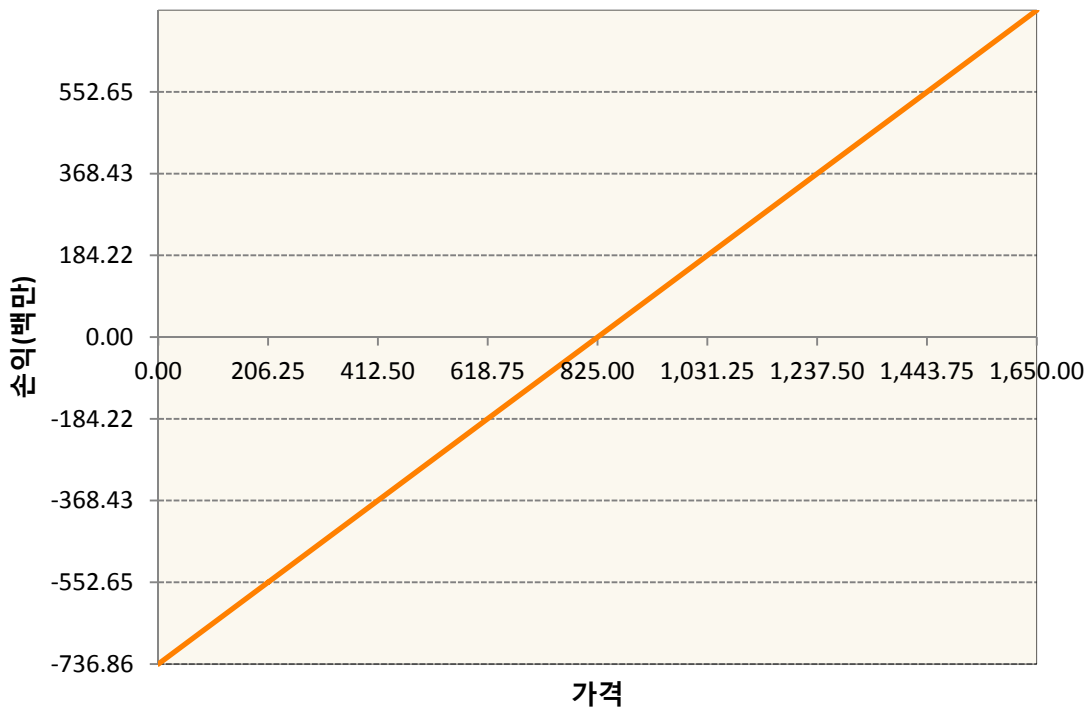
### 1. 계약금액

(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	737	0	737	
누계	유가증권	스왑	995	0	995	장외
누계	통화	선도	211	897	-686	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	59

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

(단위:백만원)

**177**

공시일	2020-06-08
기준일	2020-06-05

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

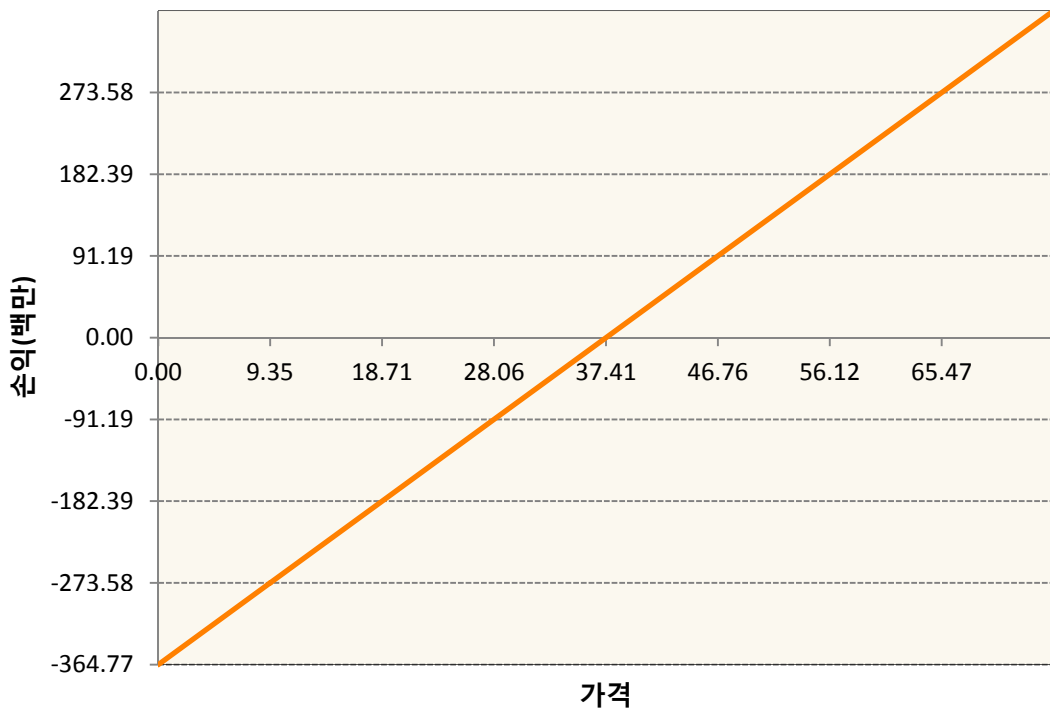
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

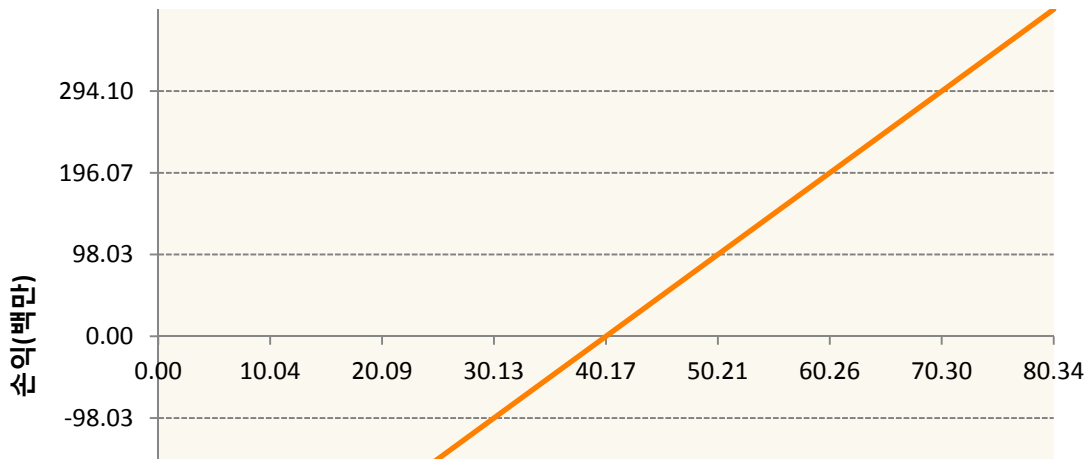
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,789	362	1,427	

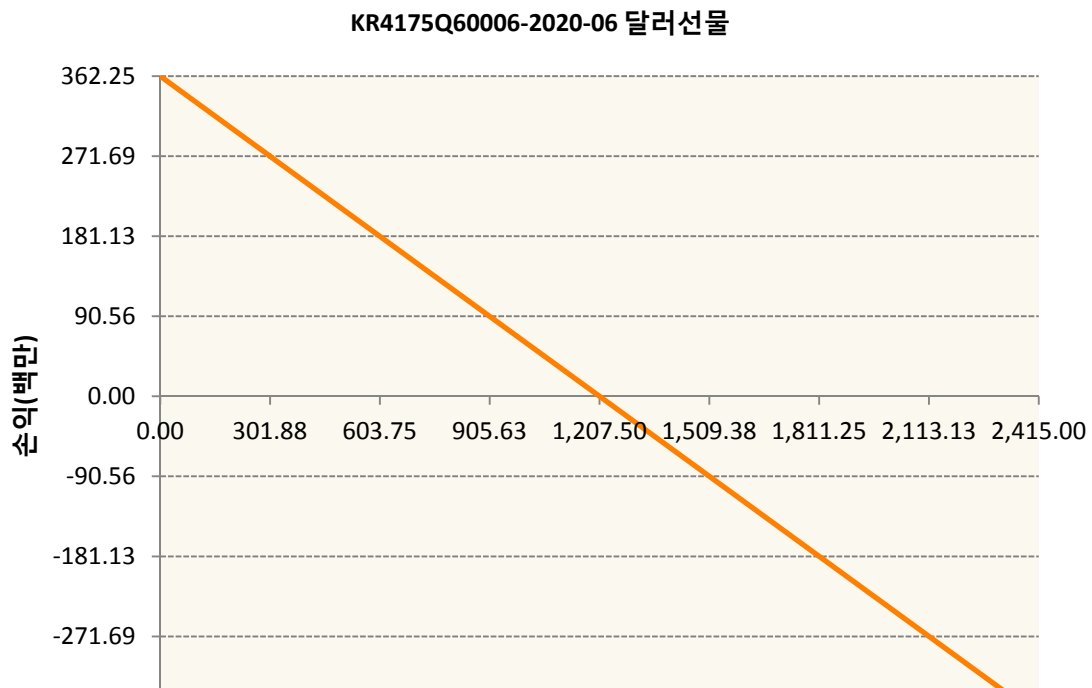
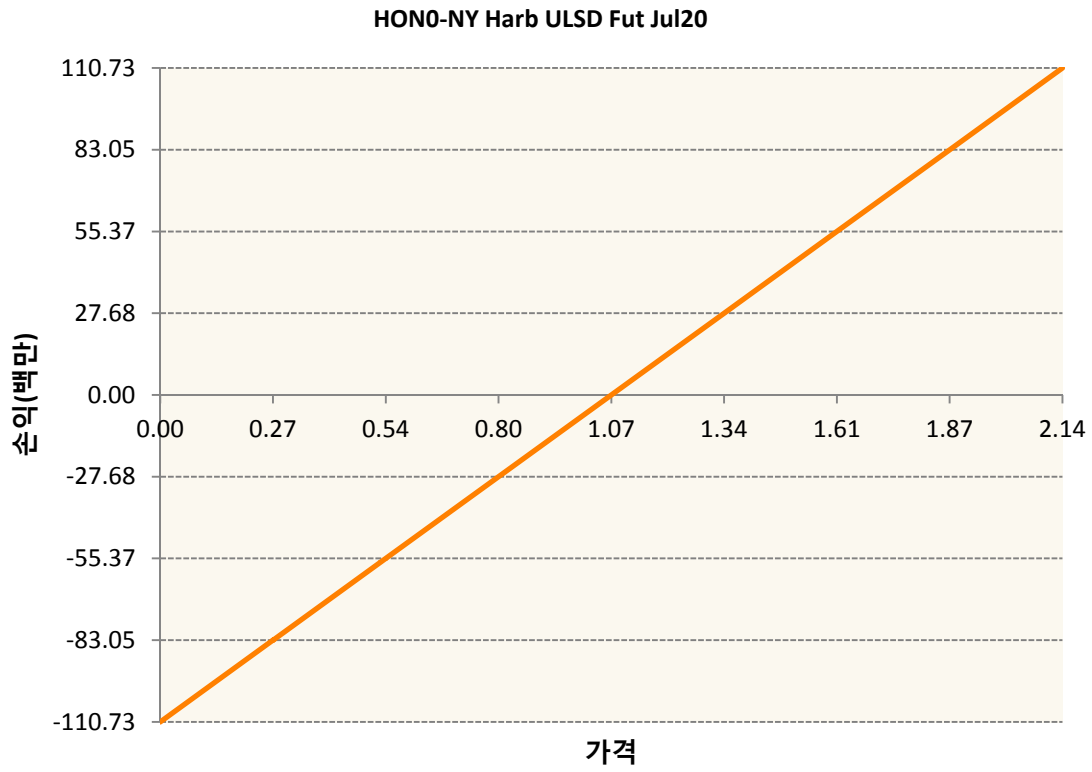
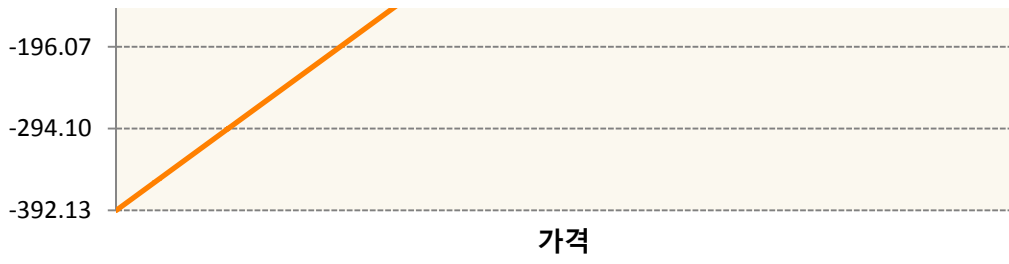
### 2. 만기시점의 손익구조

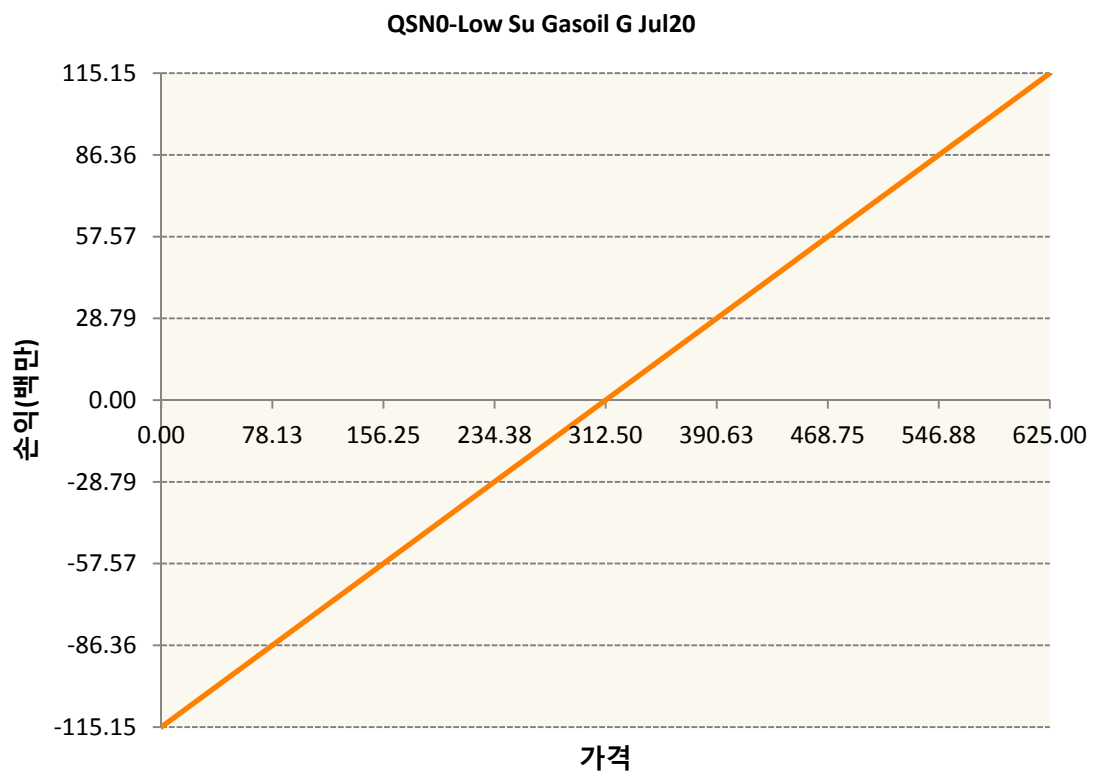
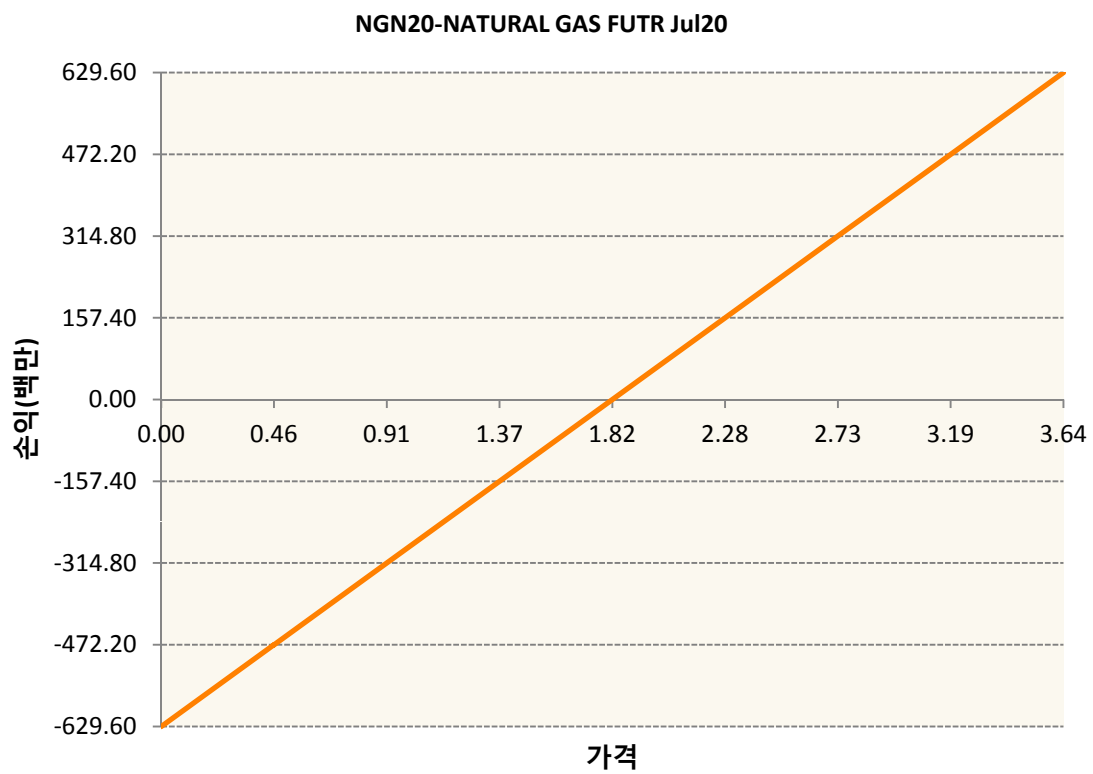
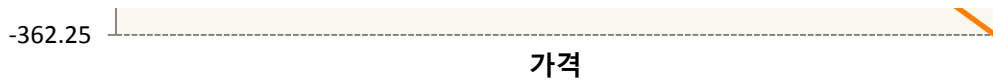
CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20



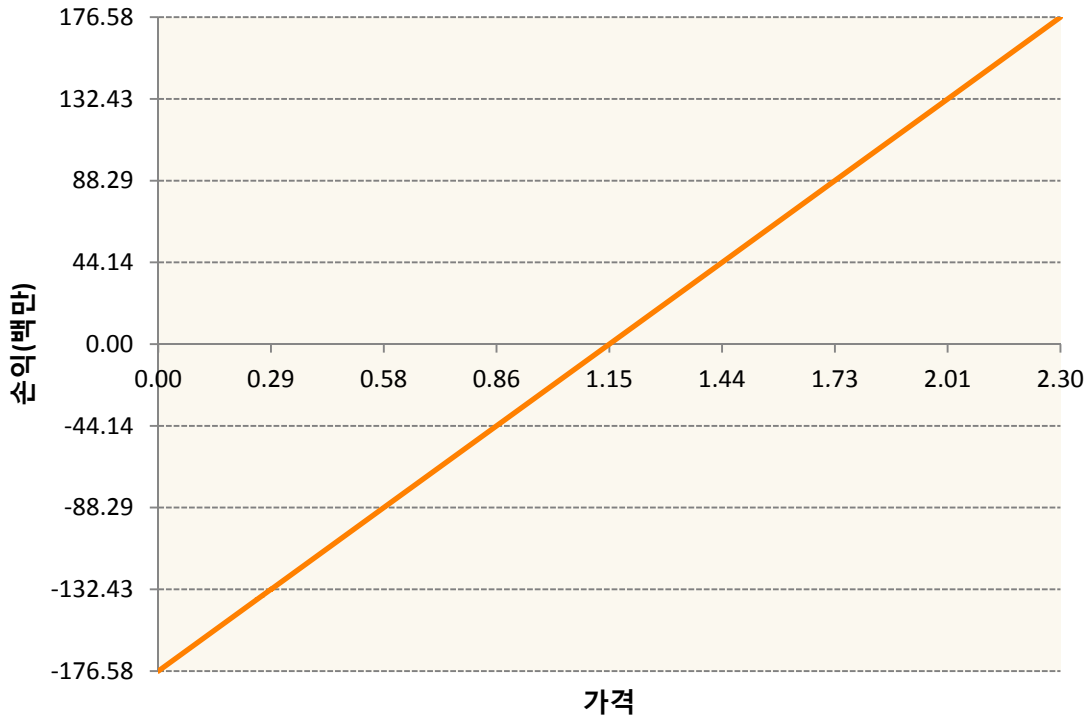
COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20







XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN0	WTI CRUDE FUTURE Jul20	29
COU0	BRENT CRUDE FUTR Sep20	31
HON0	NY Harb ULSD Fut Jul20	9
KR4175Q60C	2020-06 달러선물	29
NGN20	NATURAL GAS FUTR Jul20	50
QSN0	Low Su Gasoil G Jul20	9
XBN0	GASOLINE RBOB FUT Jul20	14

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

(단위:백만원)

875

공시일	2020-06-08
기준일	2020-06-05

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

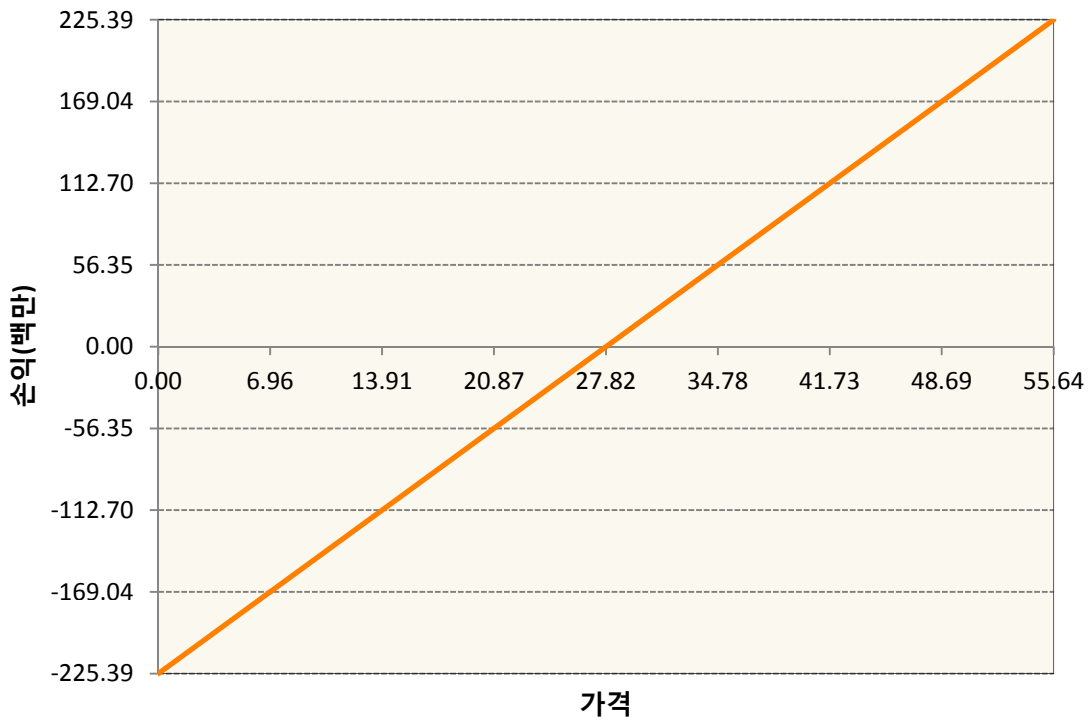
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

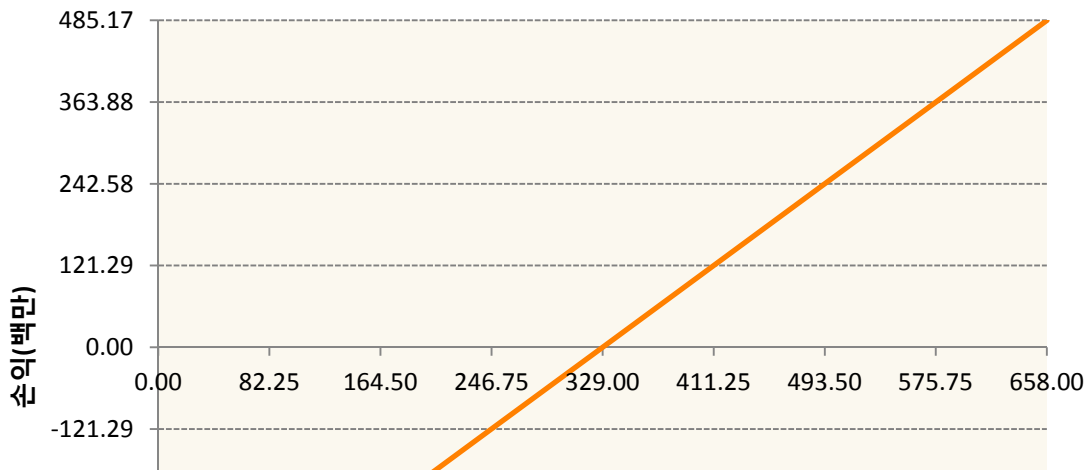
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,488	72	2,416	

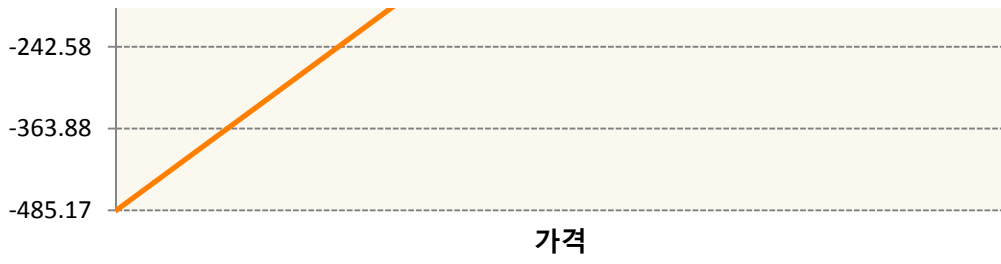
### 2. 만기시점의 손익구조

**BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20**

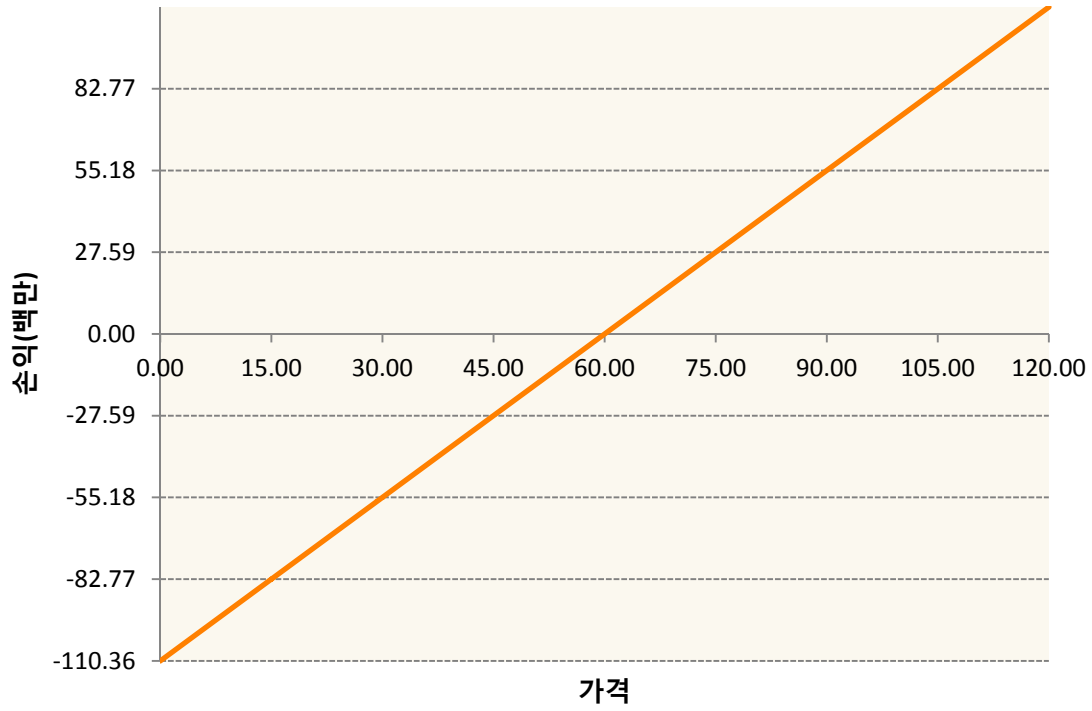


**CNO-CORN FUTURE Jul20**

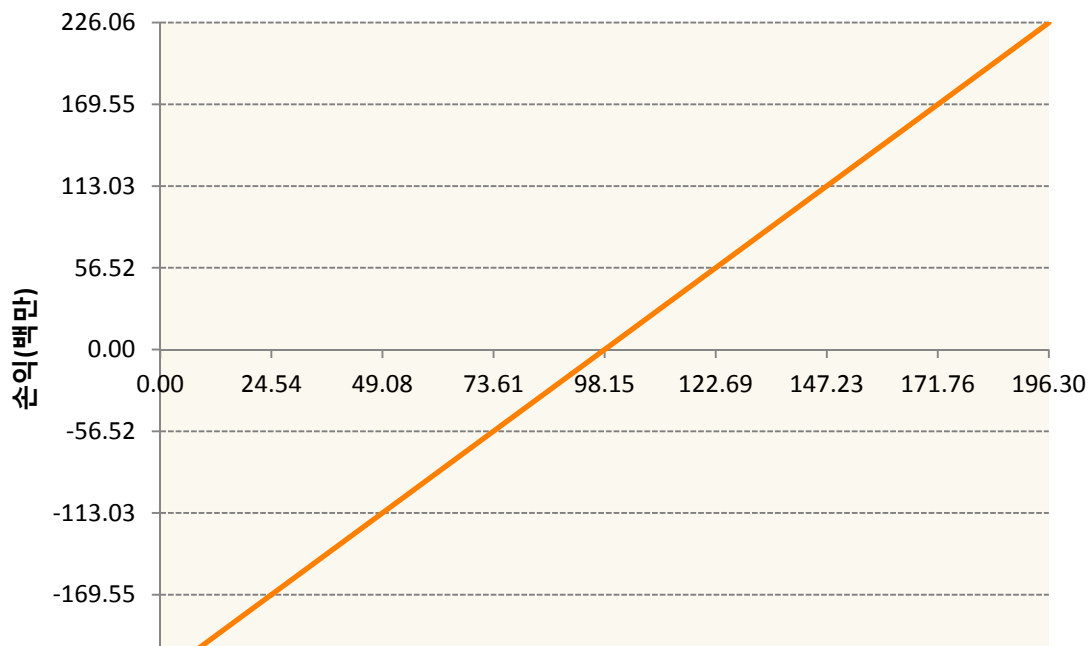


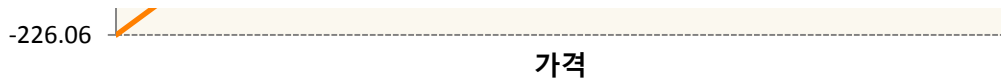


CTN0-COTTON NO.2 FUTR Jul20

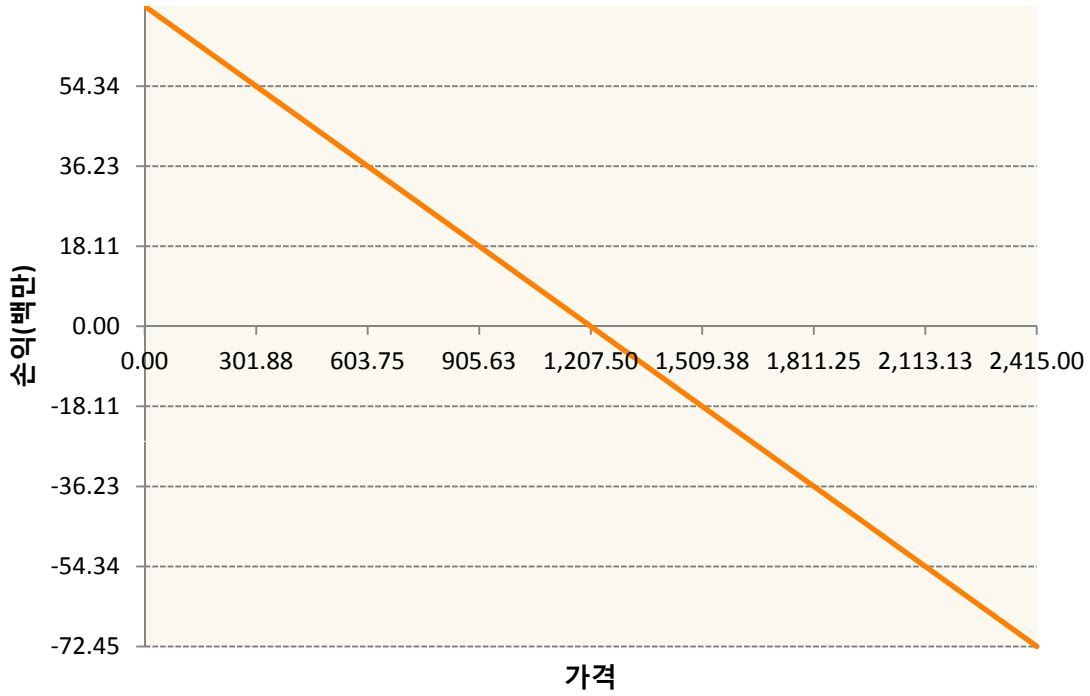


KCN0-COFFEE 'C' FUTURE Jul20

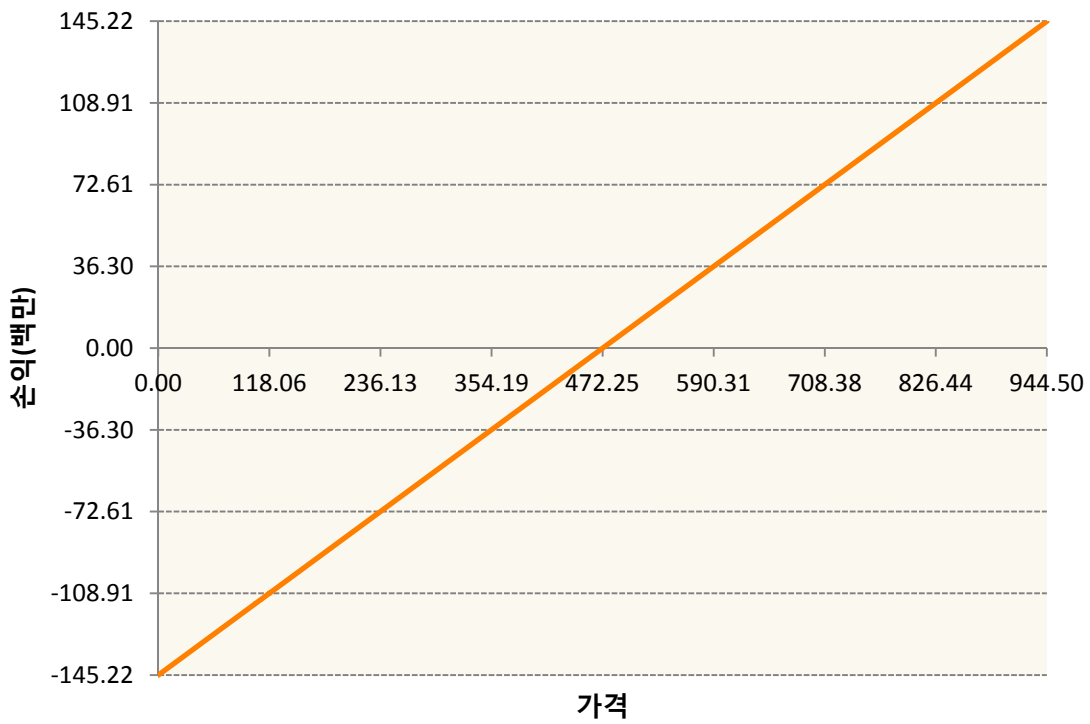




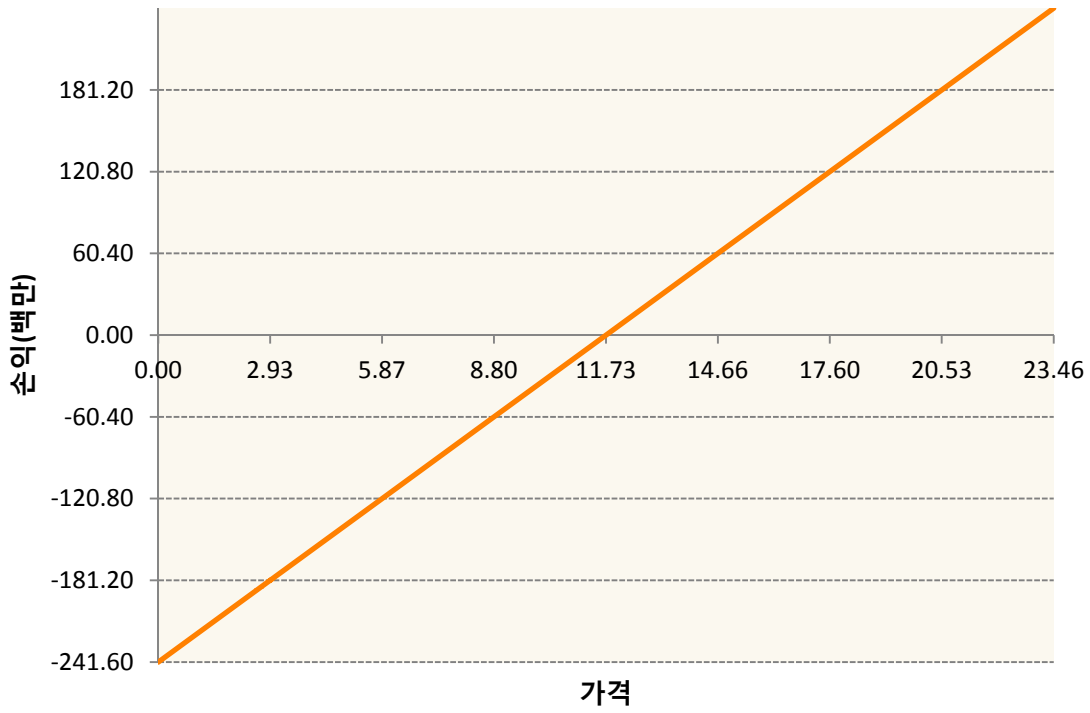
KR4175Q60006-2020-06 달러선물



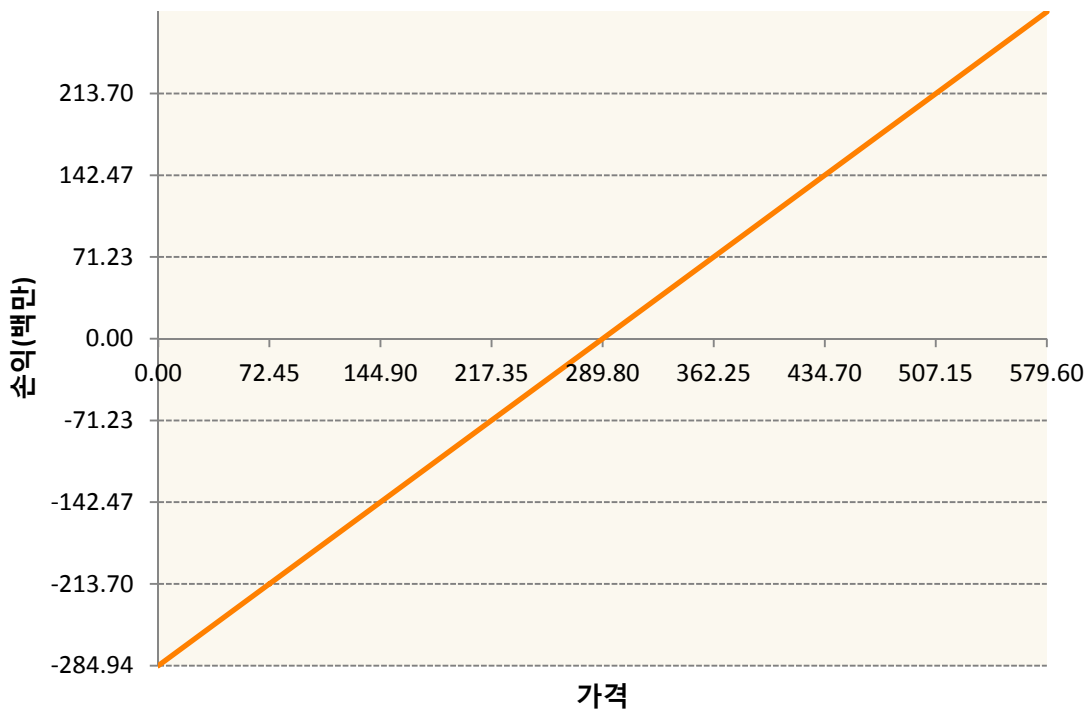
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



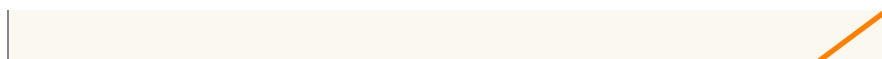
SBN0-Sugar Jul20

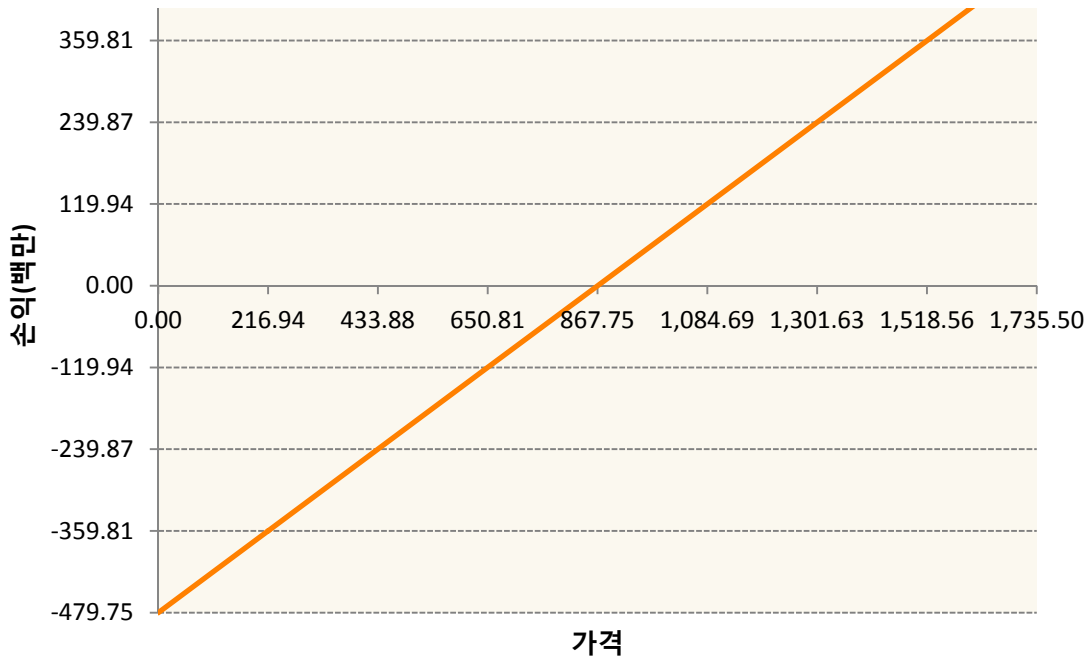


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20

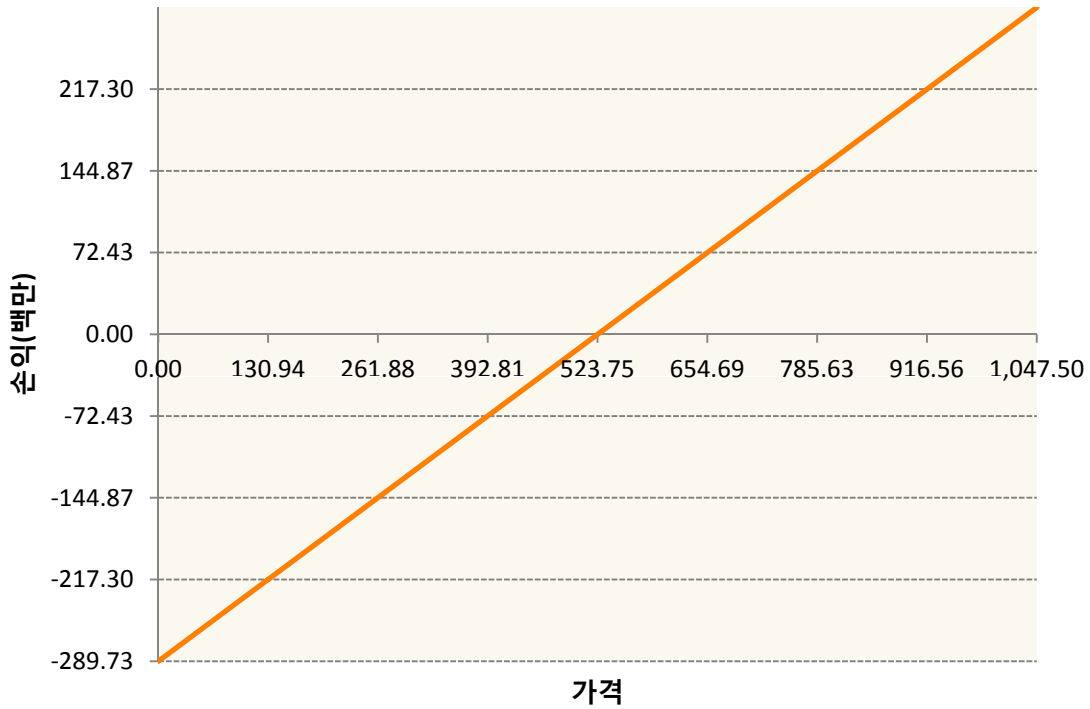


SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





WNO-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	9
KCN0	COFFEE 'C' FUTURE Jul20	18
KR4175Q60C	2020-06 달러선물	6

KWN0	KC HRW WHEAT FUT Jul20	12
SBN0	Sugar Jul20	19
SMN0	SOYBEAN MEAL FUTR Jul20	23
SN0	SOYBEAN FUTURE Jul20	38
WN0	WHEAT FUTURE(CBT) Jul20	23

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

(단위:백만원)

**235**