

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-12 |
| 기준일 | 2020-06-11 |

## 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 | 2020-06-12 |
| 기준일 | 2020-06-11 |

## 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

1,092

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,283

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-12 |
| 기준일 | 2020-06-11 |

## 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   | 7,304 | 0     | 7,304     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI500000 신한CSI500미래S200610

582

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

858

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-12 |
| 기준일 | 2020-06-11 |

## 유로인덱스모(주식-파생형)

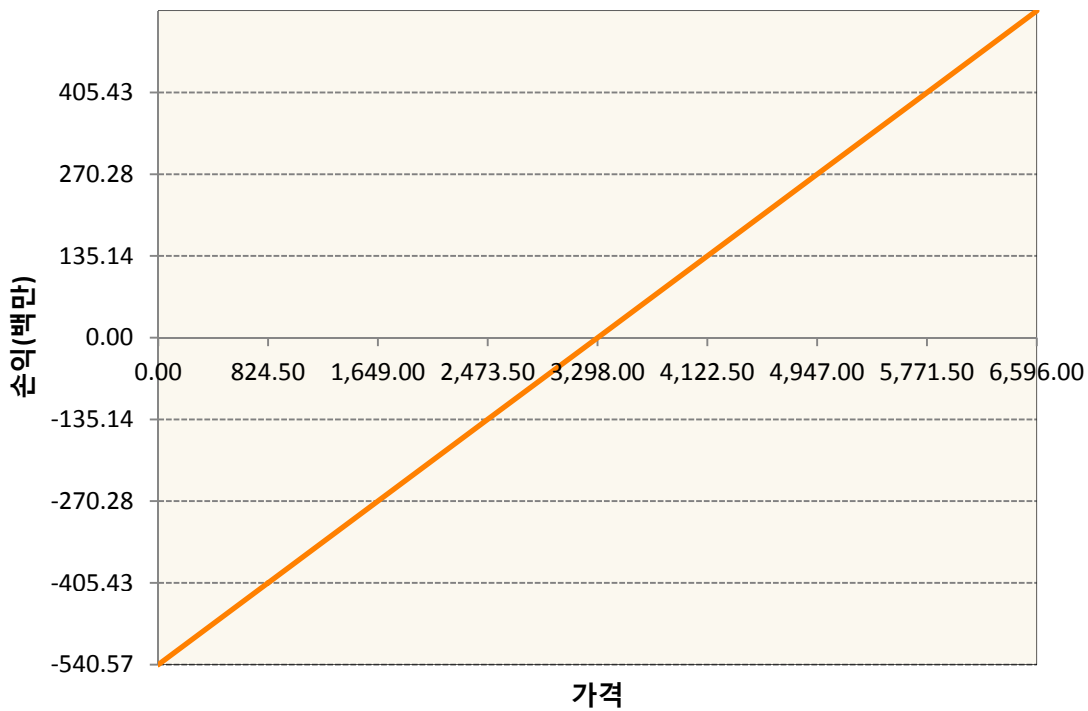
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 541   | 0     | 541       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGM0 | EURO STOXX 50 Jun20 | 43 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 57 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-12 |
| 기준일 | 2020-06-11 |

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

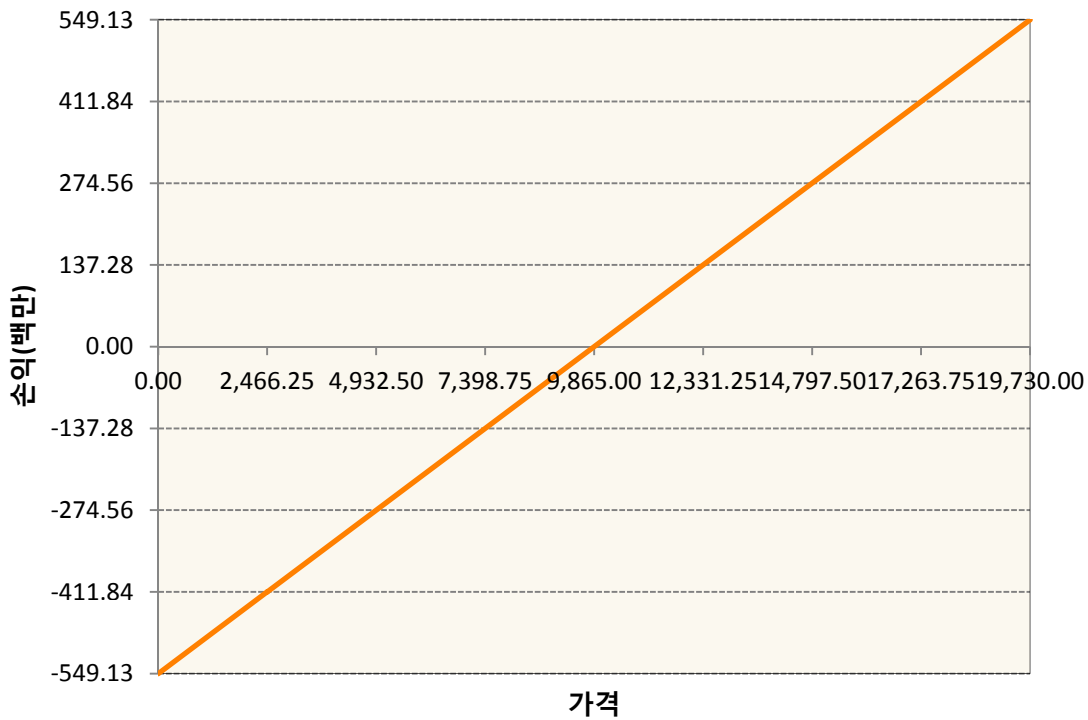
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 549   | 0     | 549       | 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 | 2020-06-12 |
| 기준일 | 2020-06-11 |

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

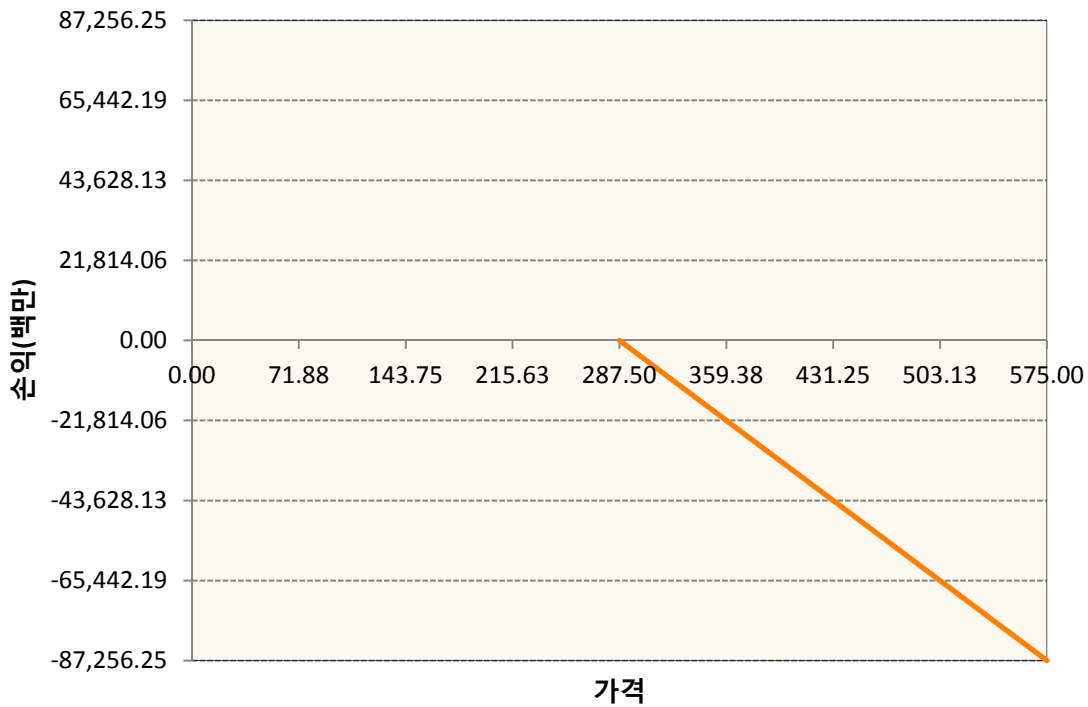
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

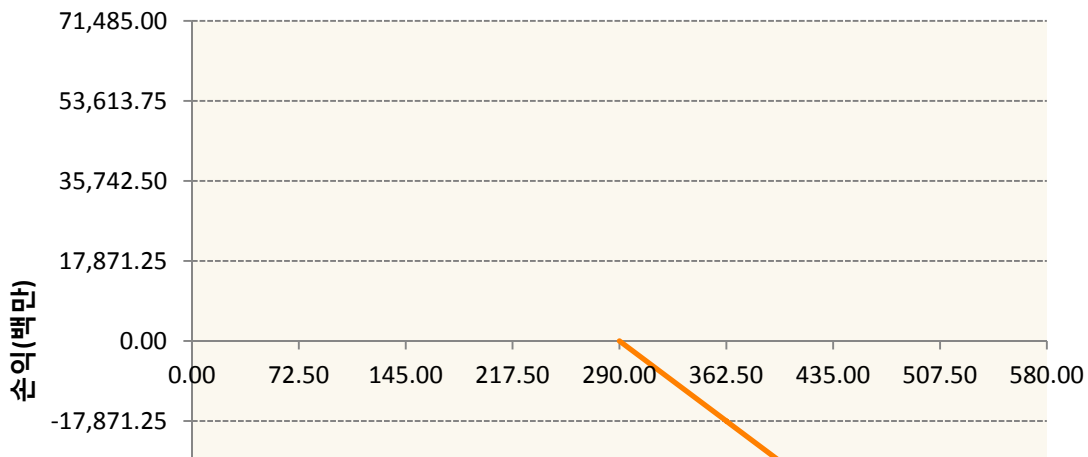
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)   | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 162,297 | -162,297  | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 158,741 | -158,741  | 장내 |

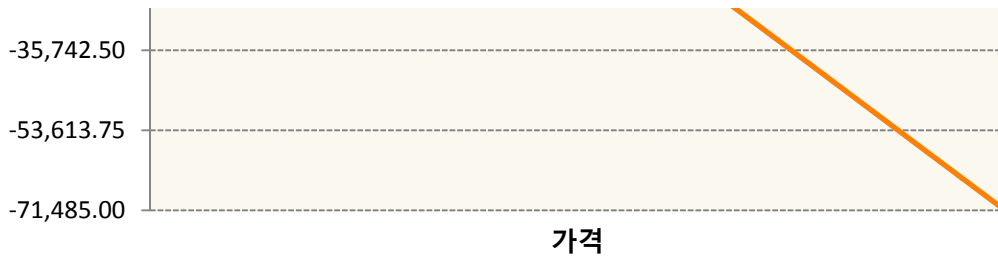
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q72872-2020-07 콜287.5



KR4201Q72906-2020-07 콜290





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

| KR4201Q72872 |         | 2020-07 콜287.5 |        |        |        |        |        | 5,501 |
|--------------|---------|----------------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|
| 기초자산의 변동성    |         |                |        |        |        |        |        |       |
| 가격           | -25.00% | -16.67%        | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |       |
| -8.00%       | 3,561   | 3,324          | 3,071  | 2,805  | 2,530  | 2,246  | 1,956  |       |
| -5.33%       | 2,982   | 2,687          | 2,383  | 2,073  | 1,758  | 1,440  | 1,119  |       |
| -2.67%       | 2,155   | 1,818          | 1,480  | 1,140  | 799    | 457    | 115    |       |
| 0%           | 1,056   | 704            | 352    | 0      | -352   | -704   | -1,056 |       |
| 2.67%        | -312    | -653           | -997   | -1,343 | -1,690 | -2,039 | -2,388 |       |
| 5.33%        | -1,927  | -2,234         | -2,551 | -2,875 | -3,204 | -3,537 | -3,874 |       |
| 8.00%        | -3,751  | -4,011         | -4,287 | -4,577 | -4,877 | -5,186 | -5,501 |       |
| KR4201Q72906 |         | 2020-07 콜290   |        |        |        |        |        | 4,349 |
| 기초자산의 변동성    |         |                |        |        |        |        |        |       |
| 가격           | -25.00% | -16.67%        | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |       |
| -8.00%       | 2,704   | 2,525          | 2,331  | 2,126  | 1,912  | 1,689  | 1,461  |       |
| -5.33%       | 2,288   | 2,059          | 1,822  | 1,578  | 1,329  | 1,077  | 820    |       |
| -2.67%       | 1,682   | 1,414          | 1,144  | 872    | 598    | 323    | 47     |       |
| 0%           | 861     | 574            | 287    | 0      | -287   | -574   | -860   |       |
| 2.67%        | -180    | -465           | -751   | -1,037 | -1,325 | -1,612 | -1,900 |       |
| 5.33%        | -1,427  | -1,690         | -1,959 | -2,232 | -2,507 | -2,786 | -3,066 |       |
| 8.00%        | -2,854  | -3,082         | -3,321 | -3,568 | -3,823 | -4,084 | -4,349 |       |

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

**8,259**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-12 |
| 기준일 | 2020-06-11 |

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

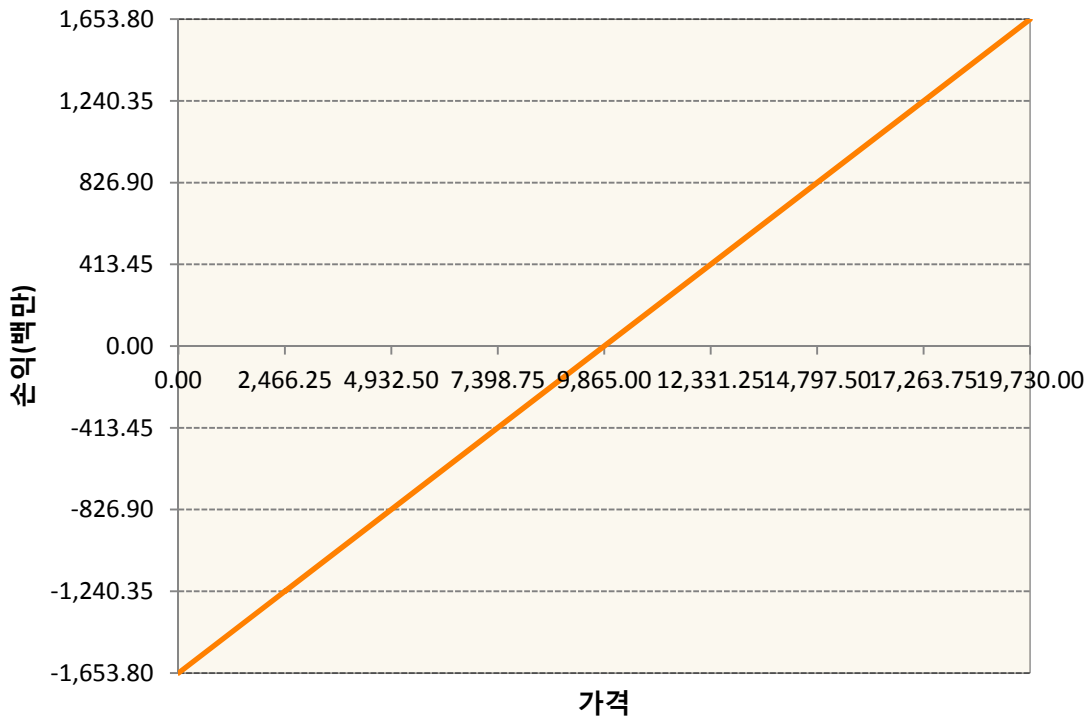
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

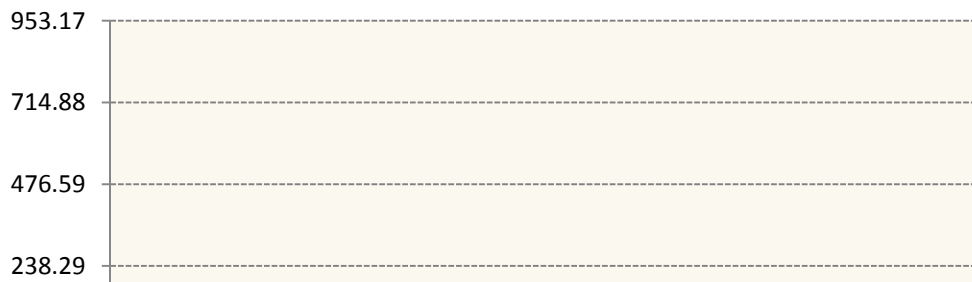
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,654 | 0     | 1,654     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 4,129 | -4,129    | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,494 | -1,494    | 장외 |

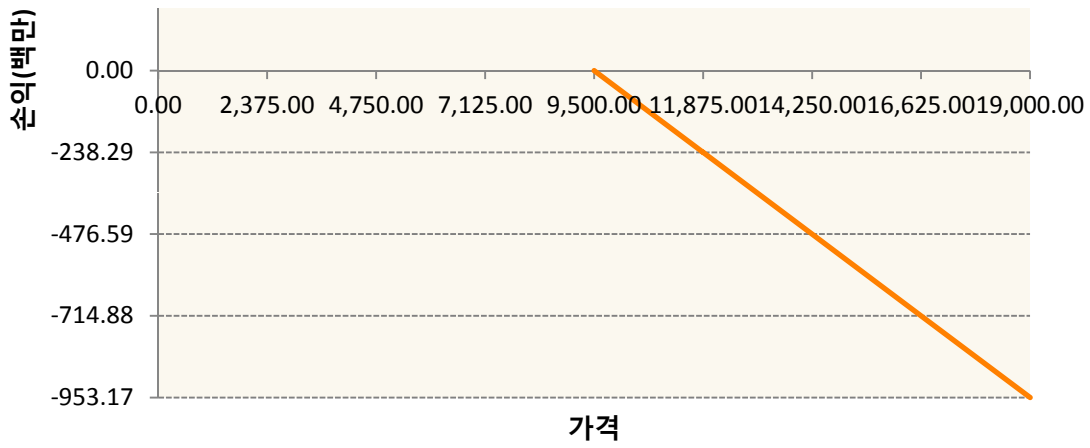
### 2. 만기시점의 손익구조

HCM0-HSCEI Futures Jun20

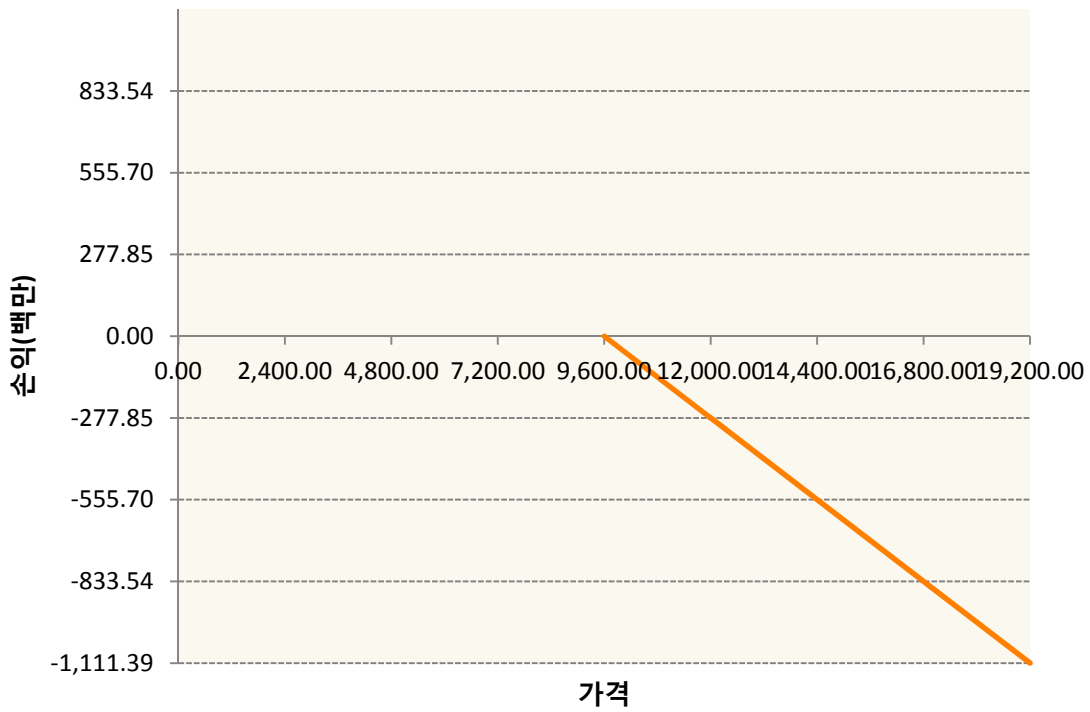


OHHIM0-C95-HSCEI

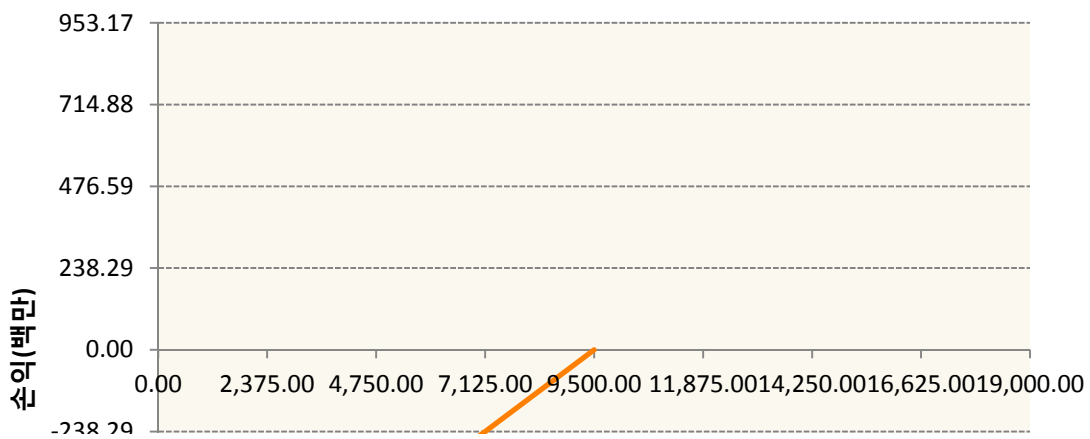


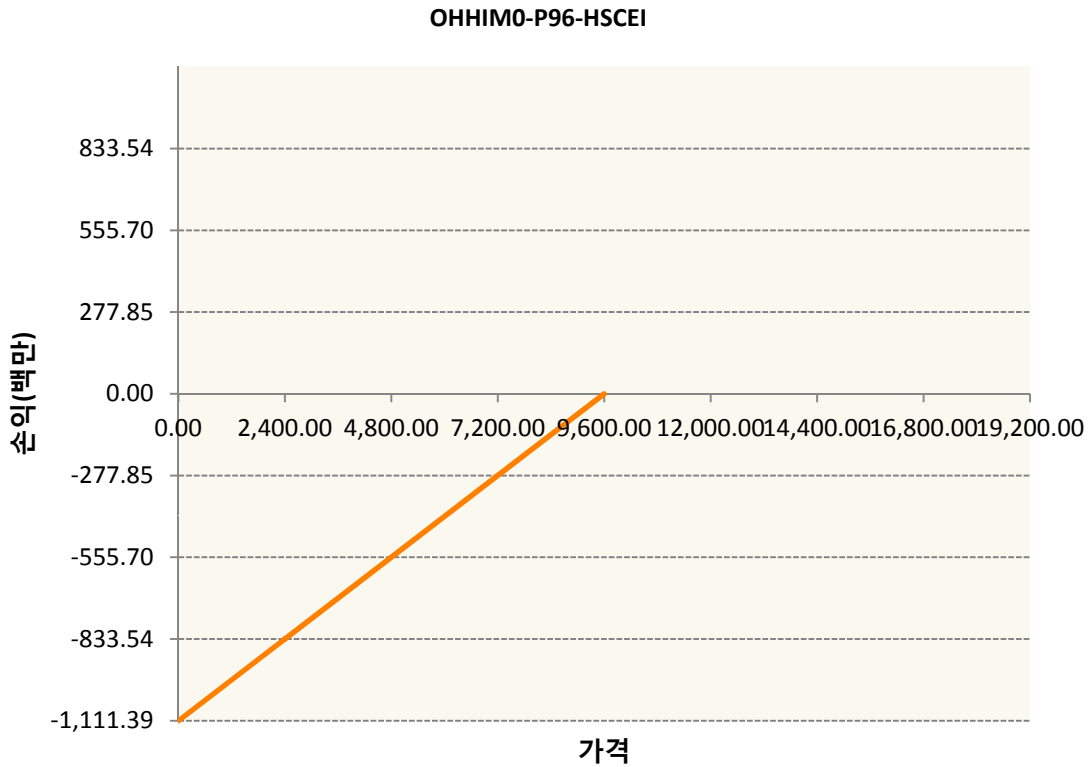


OHHIM0-C96-HSCEI



OHHIM0-P95-HSCEI





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

|                              |     |
|------------------------------|-----|
| FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E | 120 |
| HCM0 HSCEI Futures Jun20     | 132 |
| OHHIM0-C9 HSCEI              | 76  |
| OHHIM0-C9 HSCEI              | 89  |
| OHHIM0-P9 HSCEI              | 76  |
| OHHIM0-P9 HSCEI              | 89  |

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

**561**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-12 |
| 기준일 | 2020-06-11 |

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

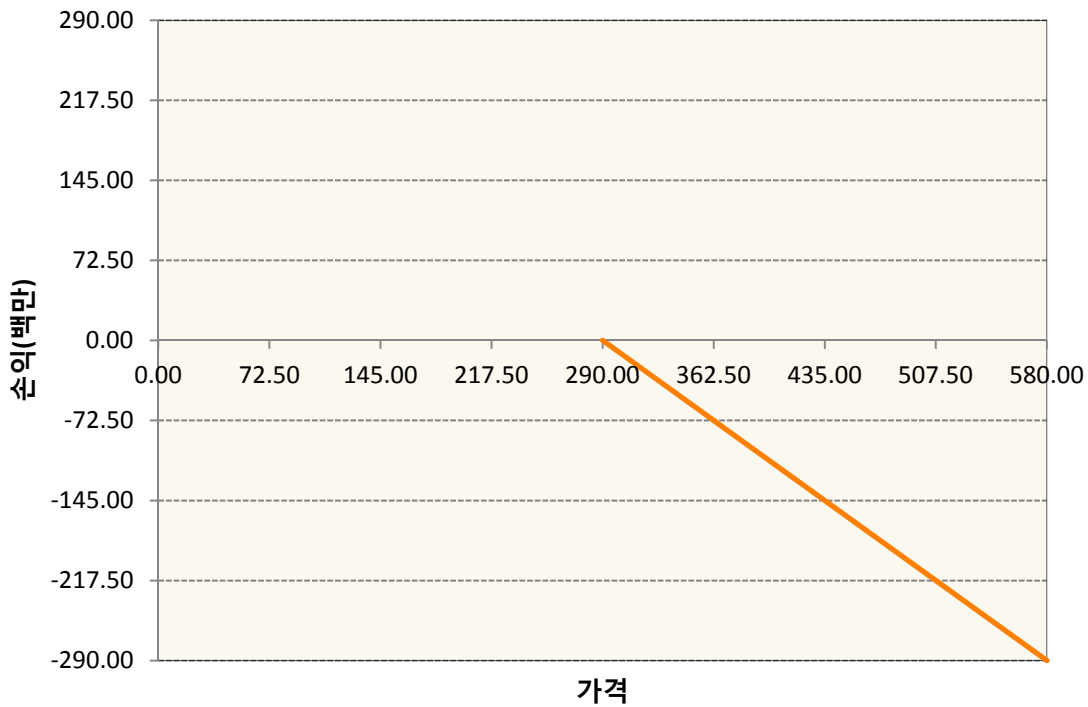
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

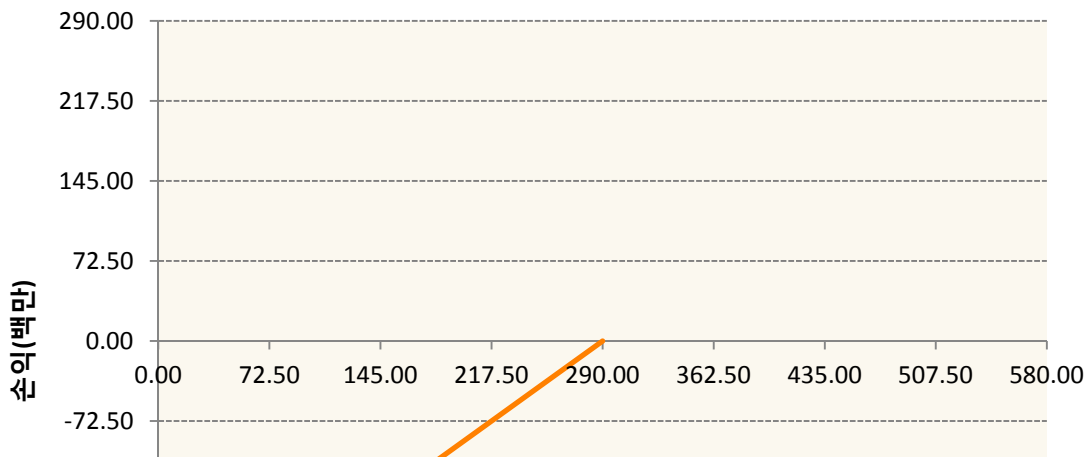
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 594   | -594      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 580   | -580      | 장내 |

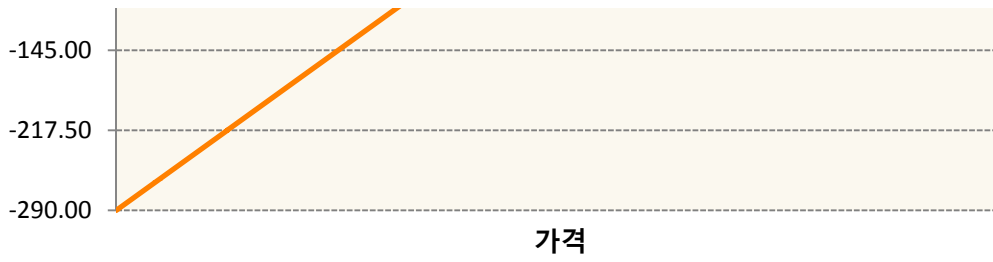
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q72906-2020-07 콜290



KR4301Q72904-2020-07 풋290





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

| KR4201Q72906 |         | 2020-07 콜290 |        |     |       |        |        | 18 |
|--------------|---------|--------------|--------|-----|-------|--------|--------|----|
| 기초자산의 변동성    |         |              |        |     |       |        |        |    |
| 가격           | -25.00% | -16.67%      | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |    |
| -8.00%       | 11      | 10           | 9      | 9   | 8     | 7      | 6      |    |
| -5.33%       | 9       | 8            | 7      | 6   | 5     | 4      | 3      |    |
| -2.67%       | 7       | 6            | 5      | 4   | 2     | 1      | 0      |    |
| 0%           | 3       | 2            | 1      | 0   | -1    | -2     | -3     |    |
| 2.67%        | -1      | -2           | -3     | -4  | -5    | -7     | -8     |    |
| 5.33%        | -6      | -7           | -8     | -9  | -10   | -11    | -12    |    |
| 8.00%        | -12     | -13          | -13    | -14 | -16   | -17    | -18    |    |
| KR4301Q72904 |         | 2020-07 풋290 |        |     |       |        |        | 18 |
| 기초자산의 변동성    |         |              |        |     |       |        |        |    |
| 가격           | -25.00% | -16.67%      | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |    |
| -8.00%       | -16     | -16          | -16    | -17 | -17   | -17    | -18    |    |
| -5.33%       | -9      | -9           | -10    | -10 | -11   | -11    | -12    |    |
| -2.67%       | -3      | -3           | -4     | -5  | -5    | -6     | -6     |    |
| 0%           | 2       | 1            | 1      | 0   | -1    | -1     | -2     |    |
| 2.67%        | 5       | 5            | 4      | 3   | 3     | 2      | 1      |    |
| 5.33%        | 7       | 7            | 6      | 6   | 5     | 5      | 4      |    |
| 8.00%        | 8       | 8            | 8      | 7   | 7     | 6      | 6      |    |

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

32

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-12 |
| 기준일 | 2020-06-11 |

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

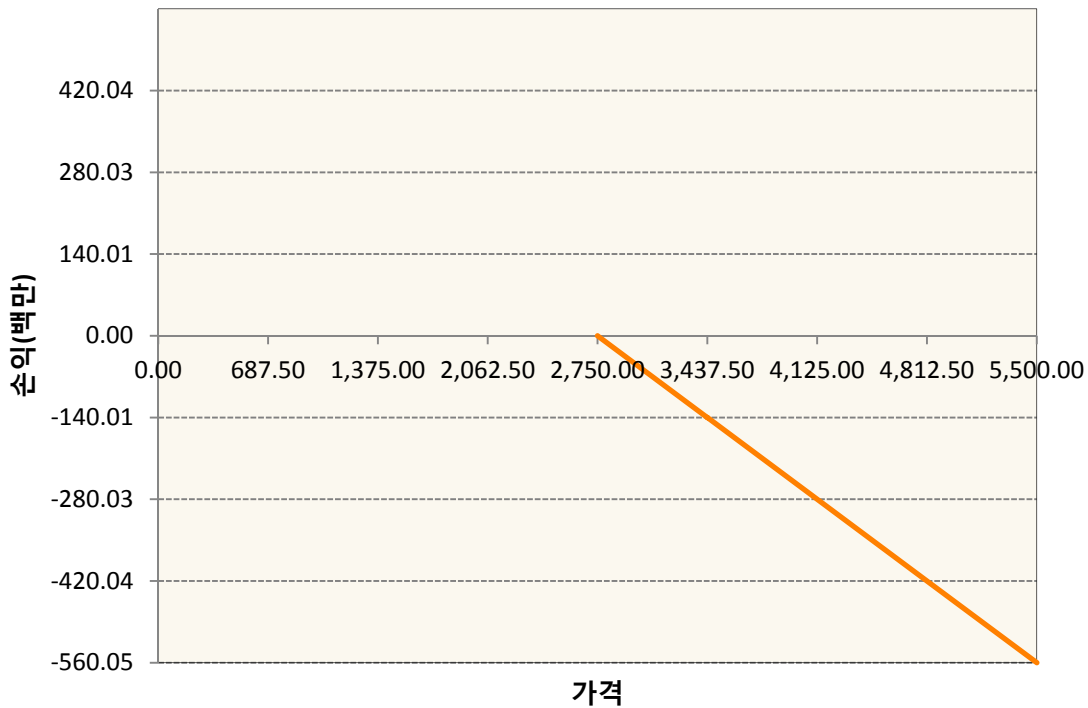
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

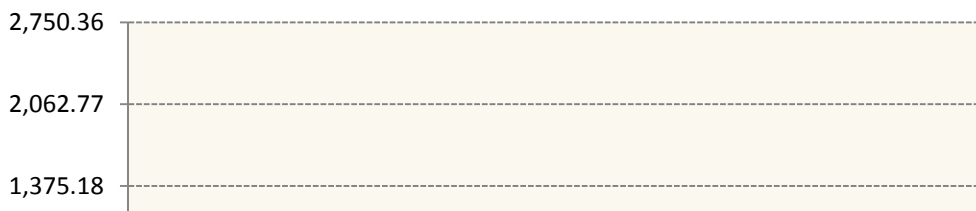
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,283 | 0     | 1,283     |    |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 8,097 | 0     | 8,097     | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 6,659 | -6,659    | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 2,938 | -2,938    | 장외 |

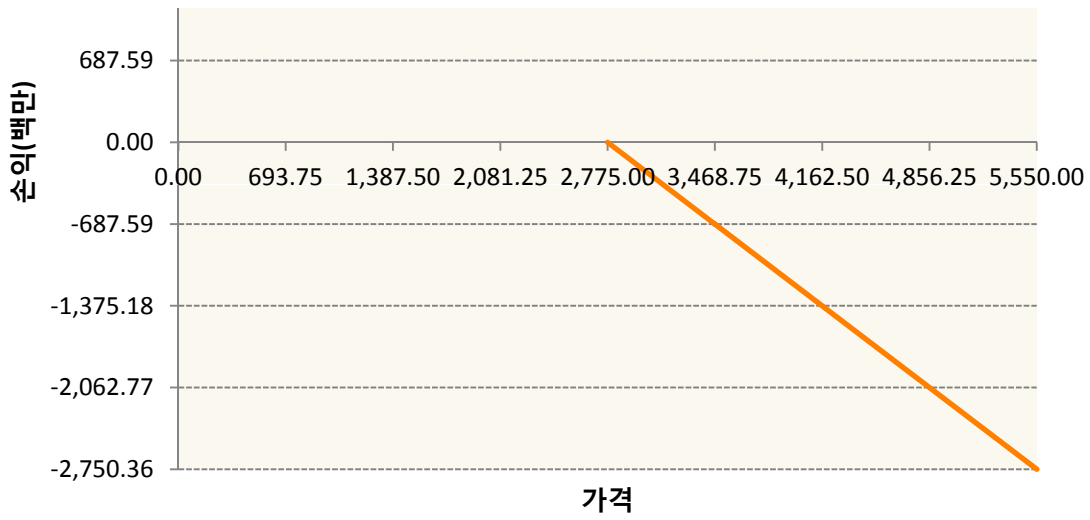
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXM0-C2750-EURO STOXX 50**

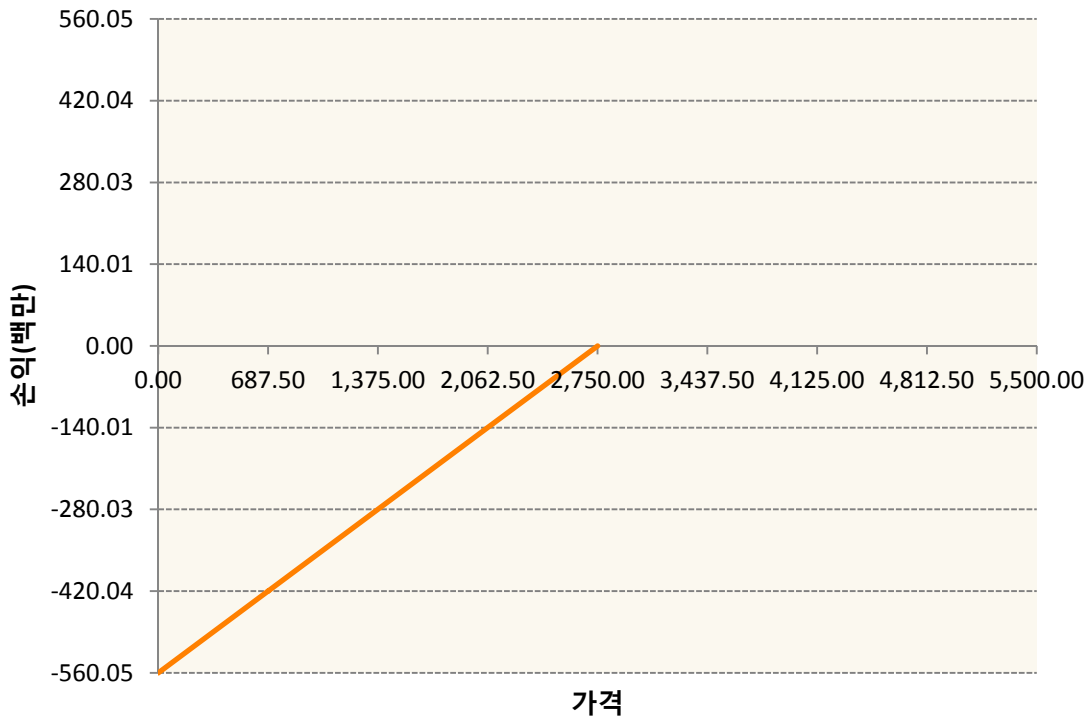


**OESXM0-C2775-EURO STOXX 50**

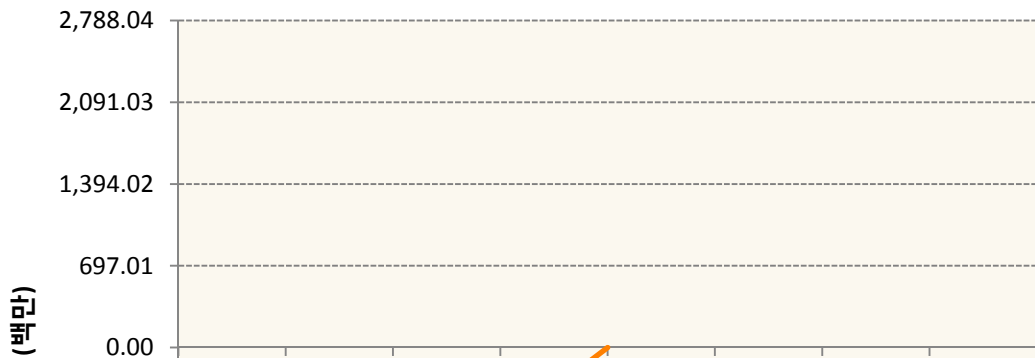


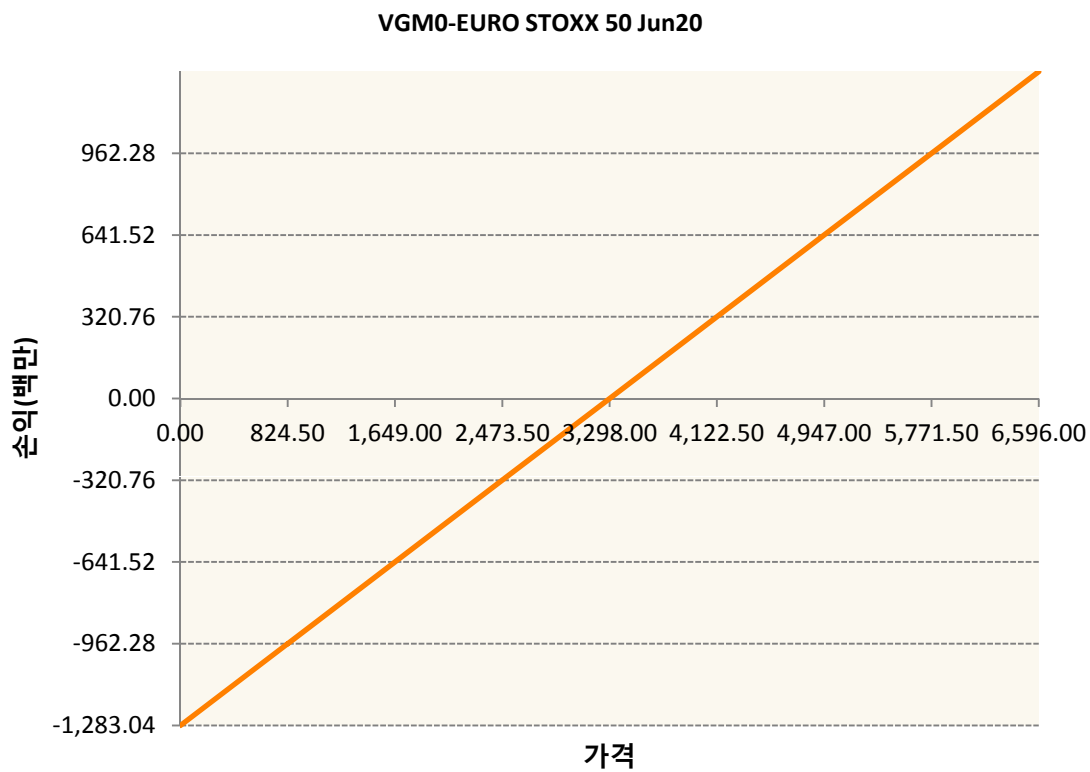
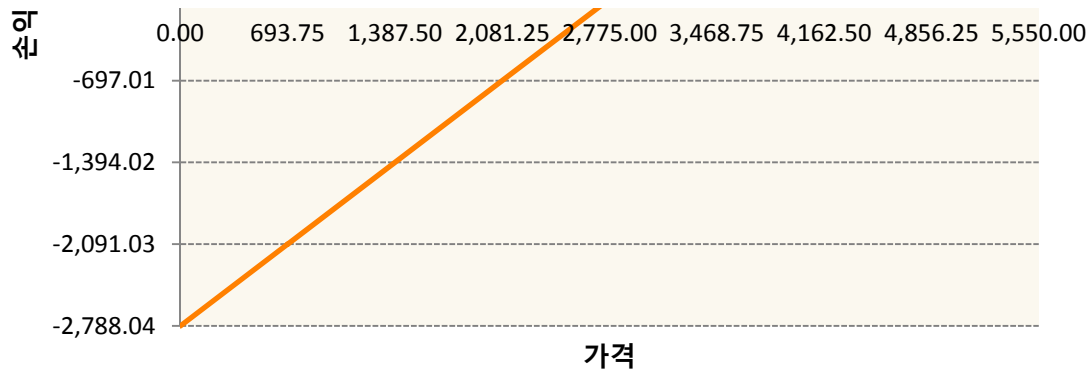


OESXM0-P2750-EURO STOXX 50



OESXM0-P2775-EURO STOXX 50





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)               |  | (단위:백만원) |
|---|--|----------|
| 260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY |  | 23       |
| FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E            |  | 220      |
| FX21020K02 KRW/EUR 26-06-20E            |  | 15       |
| OESXM0-C2' EURO STOXX 50                |  | 45       |
| OESXM0-C2' EURO STOXX 50                |  | 220      |
| OESXM0-P2' EURO STOXX 50                |  | 45       |
| OESXM0-P2' EURO STOXX 50                |  | 223      |
| VGM0 EURO STOXX 50 Jun20                |  | 103      |

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

(단위:백만원)

1,026



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

(단위:백만원)

1,288

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-12 |
| 기준일 | 2020-06-11 |

## ETF스마트레버리지목표전환형9호

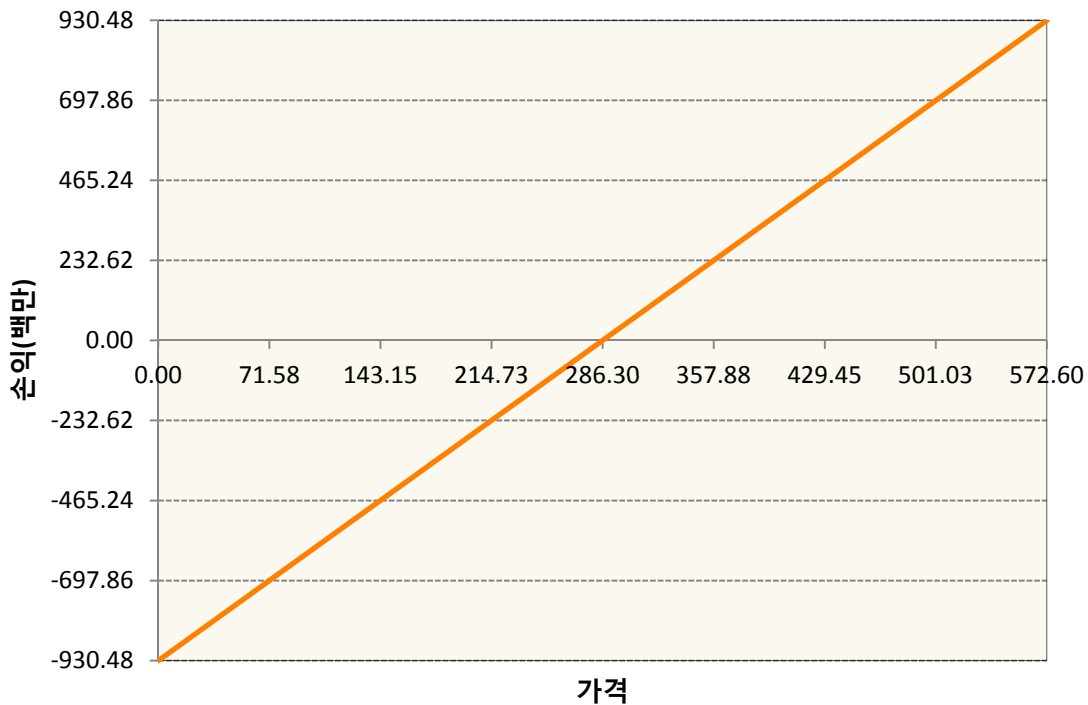
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 938   | 0     | 938       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 930   | 0     | 930       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101Q90009 |         | 2020-09 코스피200지수선물 |        |     |       |        |        | 75 |
|--------------|---------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|----|
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |     |       |        |        |    |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |    |
| -8.00%       | -75     | -75                | -75    | -75 | -75   | -75    | -75    |    |
| -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%        | 75      | 75                 | 75     | 75  | 75    | 75     | 75     |    |

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

(단위:백만원)

113



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

(단위:백만원)

165

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-12 |
| 기준일 | 2020-06-11 |

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

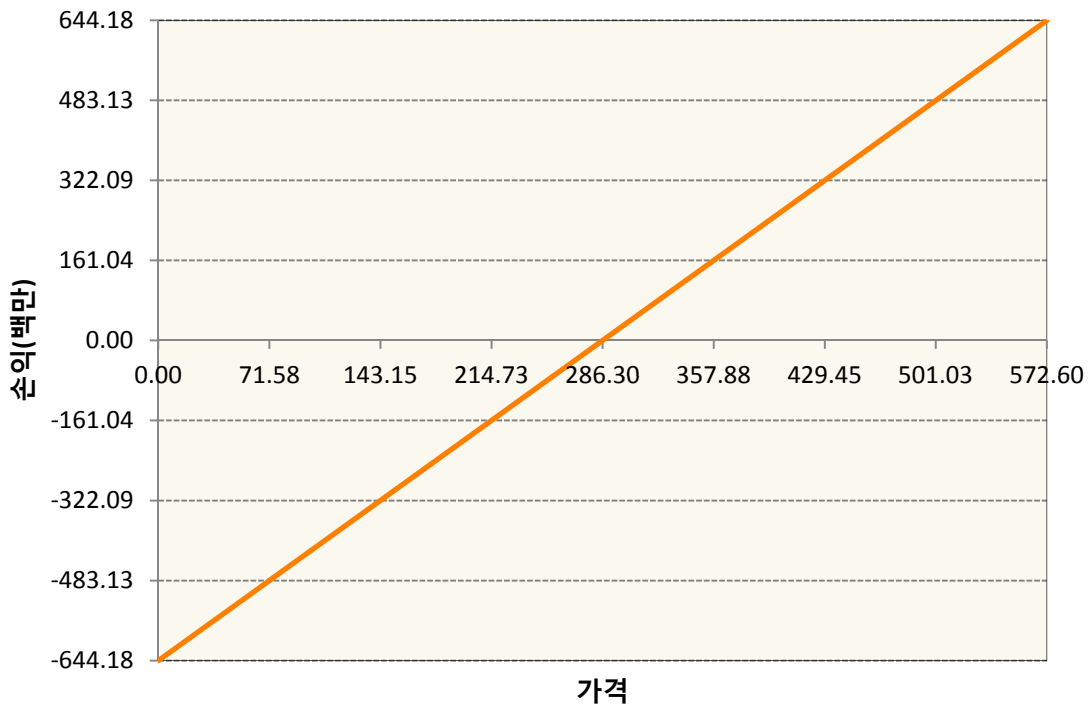
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 648   | 0     | 648       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 644   | 0     | 644       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101Q90009 |         | 2020-09 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)

78

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-12 |
| 기준일 | 2020-06-11 |

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

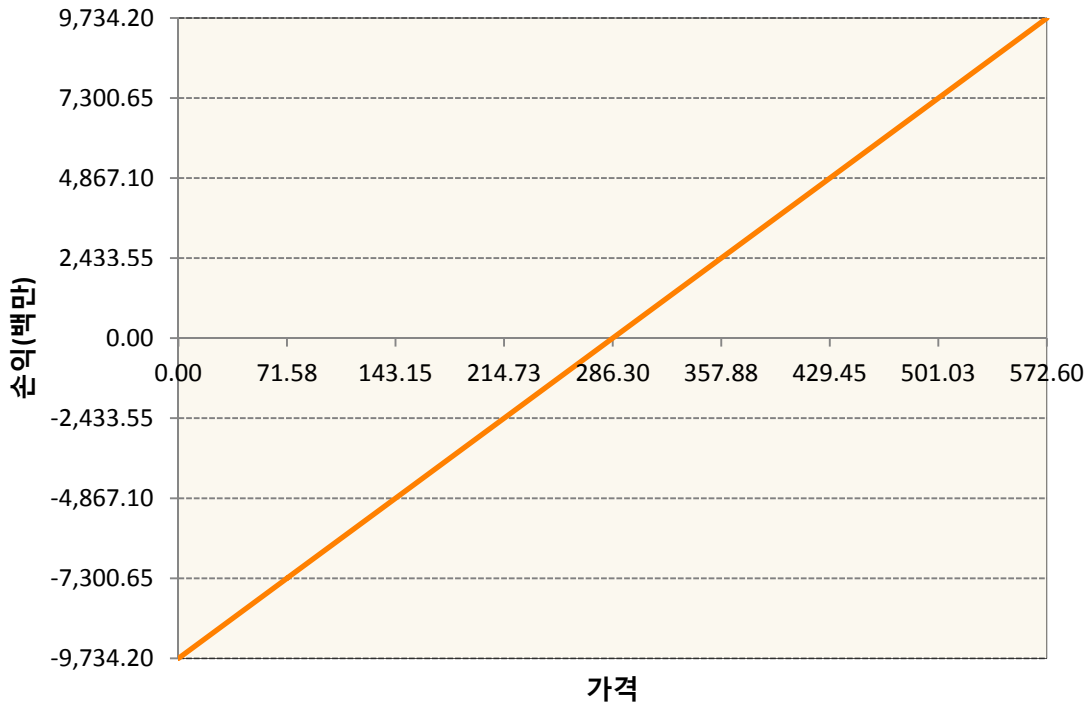
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

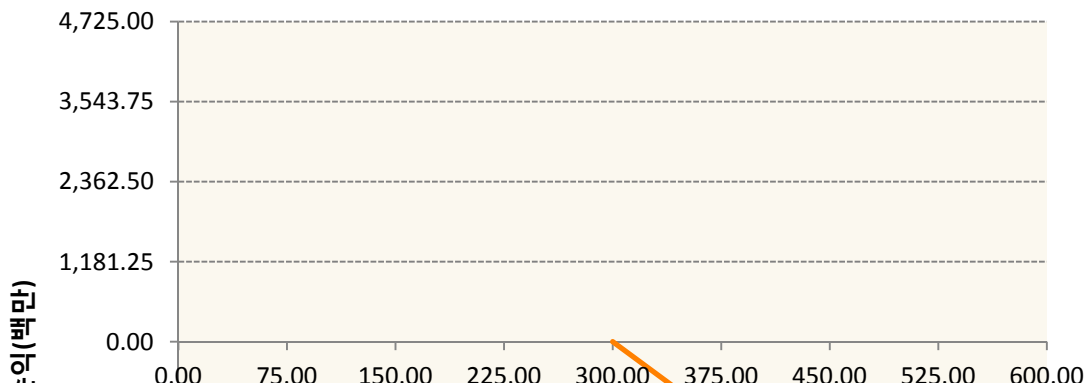
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 9,803 | 0      | 9,803     | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 3,972 | 18,887 | -14,914   | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 9,734 | 0      | 9,734     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 4,097 | 18,791 | -14,694   | 장내 |

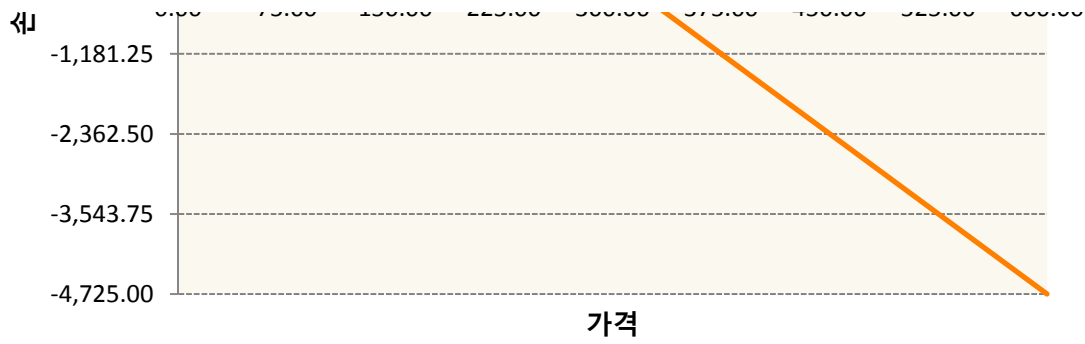
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물

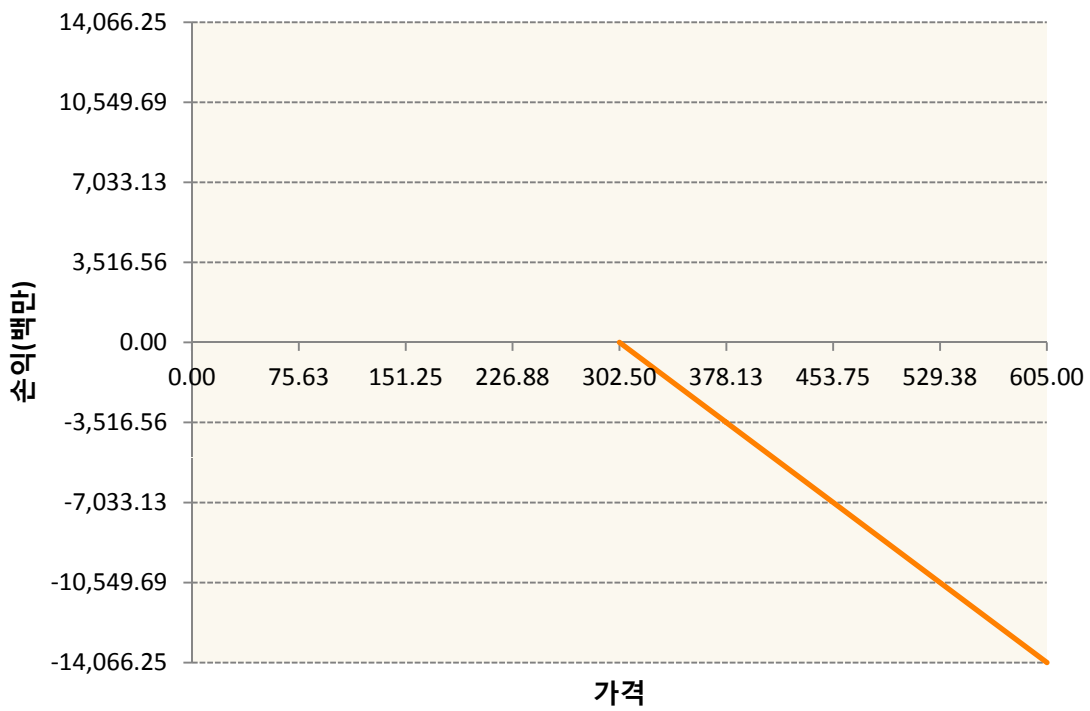


KR4201Q73003-2020-07 콜300

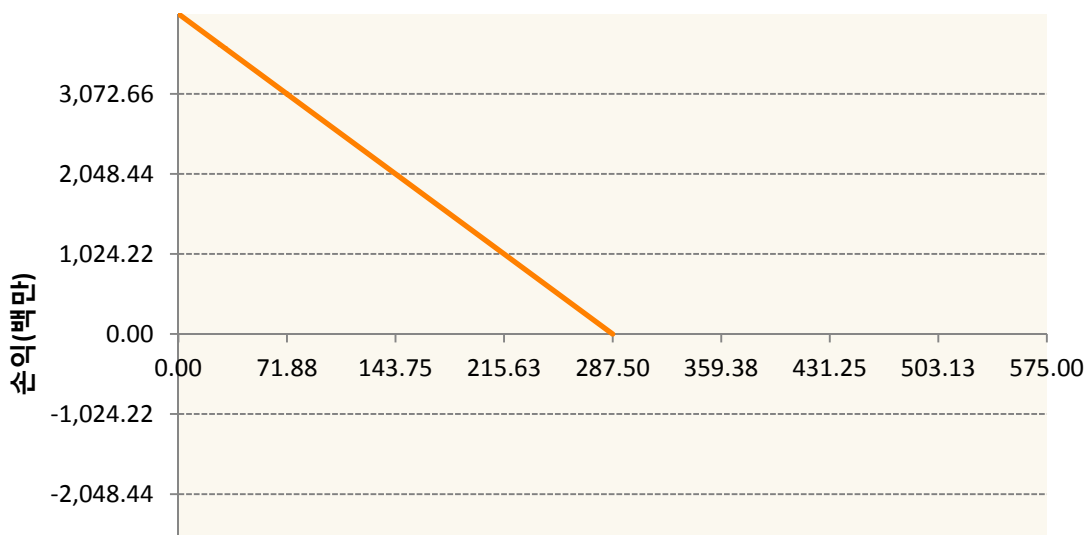


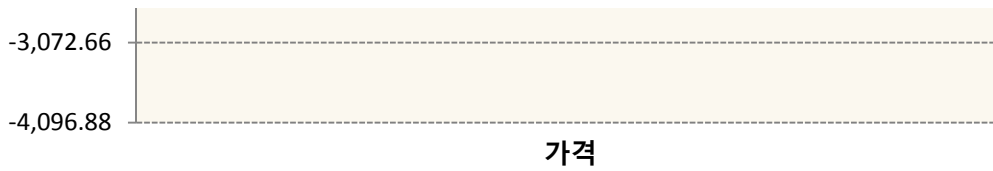


KR4201Q73029-2020-07 콜302.5



KR4301Q72870-2020-07 풋287.5





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

| KR4101Q90009 |         | 2020-09 코스피200지수선물 |        |      |       |        |        | 785 |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | -785    | -785               | -785   | -785 | -785  | -785   | -785   |     |
| -5.33%       | -523    | -523               | -523   | -523 | -523  | -523   | -523   |     |
| -2.67%       | -262    | -262               | -262   | -262 | -262  | -262   | -262   |     |
| 0%           | 0       | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |     |
| 2.67%        | 262     | 262                | 262    | 262  | 262   | 262    | 262    |     |
| 5.33%        | 523     | 523                | 523    | 523  | 523   | 523    | 523    |     |
| 8.00%        | 785     | 785                | 785    | 785  | 785   | 785    | 785    |     |
| KR4201Q73003 |         | 2020-07 콜300       |        |      |       |        |        | 245 |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | 127     | 120                | 110    | 100  | 89    | 77     | 65     |     |
| -5.33%       | 112     | 101                | 89     | 76   | 62    | 48     | 33     |     |
| -2.67%       | 88      | 73                 | 58     | 43   | 27    | 10     | -6     |     |
| 0%           | 52      | 35                 | 18     | 0    | -18   | -36    | -54    |     |
| 2.67%        | 3       | -15                | -34    | -53  | -72   | -90    | -109   |     |
| 5.33%        | -59     | -78                | -97    | -116 | -135  | -154   | -173   |     |
| 8.00%        | -134    | -152               | -171   | -189 | -208  | -226   | -245   |     |
| KR4201Q73029 |         | 2020-07 콜302.5     |        |      |       |        |        | 698 |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | 346     | 325                | 300    | 272  | 242   | 208    | 173    |     |
| -5.33%       | 307     | 277                | 243    | 207  | 168   | 128    | 86     |     |
| -2.67%       | 244     | 204                | 161    | 117  | 71    | 25     | -23    |     |
| 0%           | 150     | 101                | 51     | 0    | -51   | -103   | -156   |     |
| 2.67%        | 18      | -37                | -91    | -147 | -202  | -257   | -313   |     |
| 5.33%        | -153    | -210               | -267   | -323 | -380  | -437   | -494   |     |
| 8.00%        | -363    | -418               | -474   | -530 | -586  | -642   | -698   |     |
| KR4301Q72870 |         | 2020-07 풋287.5     |        |      |       |        |        | 241 |
| 기초자산의 변동성    |         |                    |        |      |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00% | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | 213     | 216                | 220    | 225  | 230   | 235    | 241    |     |
| -5.33%       | 116     | 122                | 129    | 136  | 143   | 150    | 158    |     |
| -2.67%       | 33      | 42                 | 51     | 60   | 69    | 78     | 87     |     |

|       |      |      |     |     |     |     |     |
|-------|------|------|-----|-----|-----|-----|-----|
| 0%    | -29  | -19  | -10 | 0   | 10  | 19  | 29  |
| 2.67% | -70  | -61  | -53 | -44 | -35 | -25 | -16 |
| 5.33% | -93  | -87  | -80 | -73 | -65 | -57 | -49 |
| 8.00% | -104 | -100 | -96 | -91 | -85 | -79 | -73 |

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

(단위:백만원)

**2,058**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-12 |
| 기준일 | 2020-06-11 |

## 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 | 156,425 | 0     | 156,425   |    |

### 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 | 2020-06-12 |
| 기준일 | 2020-06-11 |

## 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 | 103,621 | 0     | 103,621   |    |

### 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 | 2020-06-12 |
| 기준일 | 2020-06-11 |

## 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 | 465,936 | 0       | 465,936   |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0       | 492,917 | -492,917  | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                               |       |
|-------------------------------|-------|
| FX21020J027 KRW/USD 22-06-20E | 1,474 |
| FX21020J028 KRW/USD 22-06-20E | 1,914 |
| FX21020J039 KRW/USD 24-07-20E | 2,154 |
| FX21020J043 KRW/USD 24-07-20E | 1,723 |
| FX21020J043 KRW/USD 24-07-20E | 1,914 |
| FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E  | 1,991 |
| FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E  | 1,895 |
| FX21020K01 KRW/USD 22-06-20E  | 670   |
| FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E  | 2,335 |
| FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E  | 957   |
| FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E  | 1,005 |
| FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E  | 1,589 |
| FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E  | 3,350 |
| FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E  | 6,796 |
| FX21020M00 KRW/USD 26-08-20E  | 574   |
| FX21020M01 KRW/USD 26-08-20E  | 4,690 |
| FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E  | 1,991 |
| FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E  | 2,412 |

IE00BD8RGM75

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

20,220



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

(단위:백만원)

226

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-12 |
| 기준일 | 2020-06-11 |

## 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 | 7,680 | 0      | 7,680     |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 11,473 | -11,473   | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                              |     |
|------------------------------|-----|
| FX21020K01 KRW/USD 15-06-20E | 313 |
| FX21020K03 KRW/USD 15-06-20E | 11  |
| FX21020K04 KRW/USD 27-07-20E | 38  |
| FX21020K04 KRW/USD 27-07-20E | 96  |
| FX21020K04 KRW/USD 30-06-20E | 36  |
| FX21020K04 KRW/USD 20-07-20E | 77  |
| FX21020M00 KRW/USD 20-07-20E | 10  |
| FX21020M01 KRW/USD 20-07-20E | 14  |
| FX21020M02 KRW/USD 06-07-20E | 48  |
| FX21020M03 KRW/USD 15-07-20E | 220 |
| FX21020M04 KRW/USD 20-07-20E | 56  |

IE00BD8RGM75

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 471 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-12 |
| 기준일 | 2020-06-11 |

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

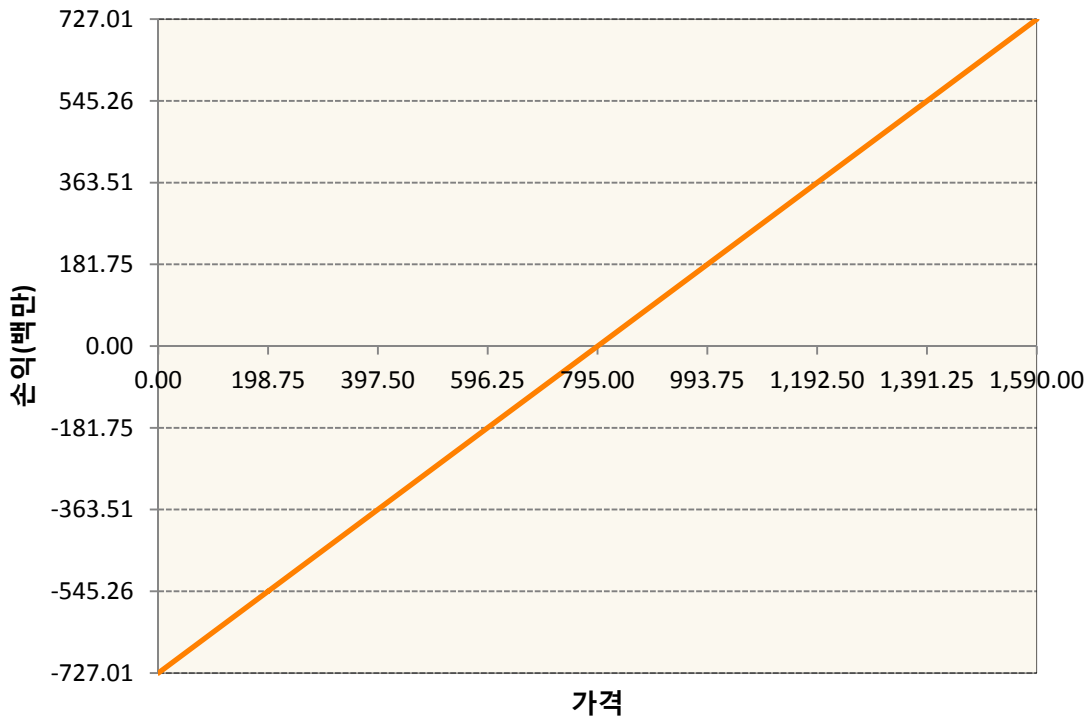
### 1. 계약금액

(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   | 727   | 0     | 727       |    |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 985   | 0     | 985       | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 209   | 888   | -679      | 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 | 58 |

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

(단위:백만원)

**175**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-12 |
| 기준일 | 2020-06-11 |

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

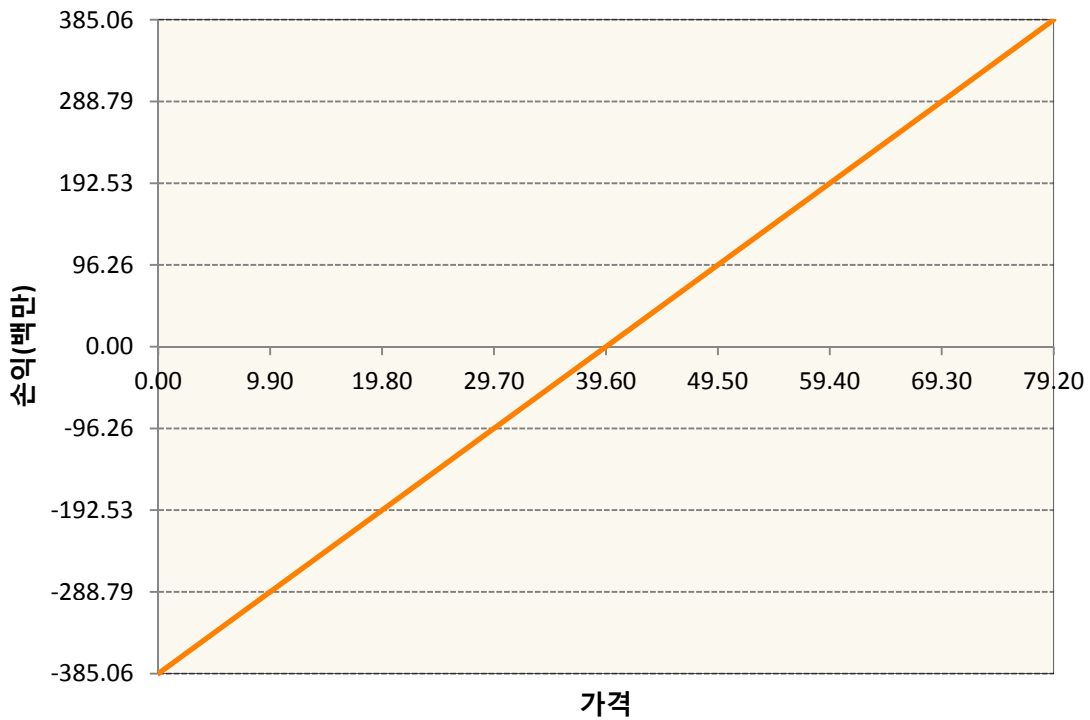
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

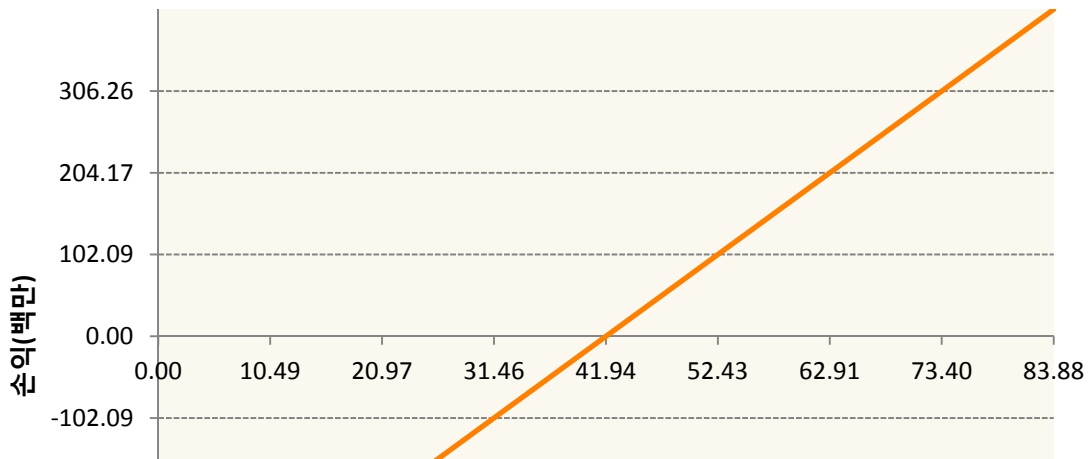
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,889 | 359   | 1,530     |    |

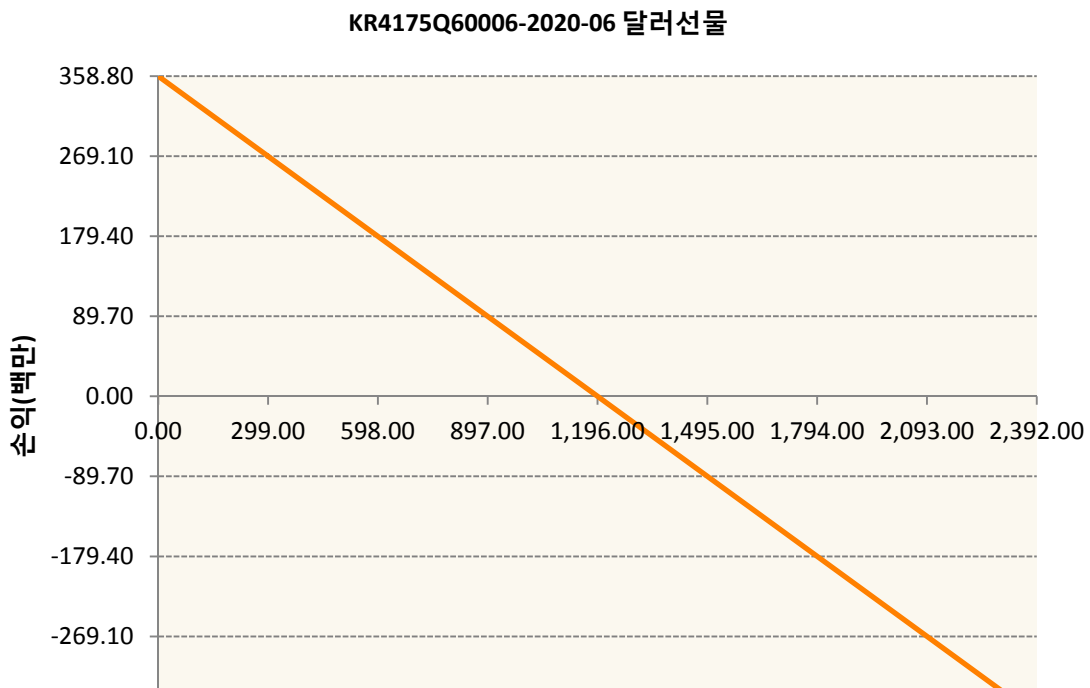
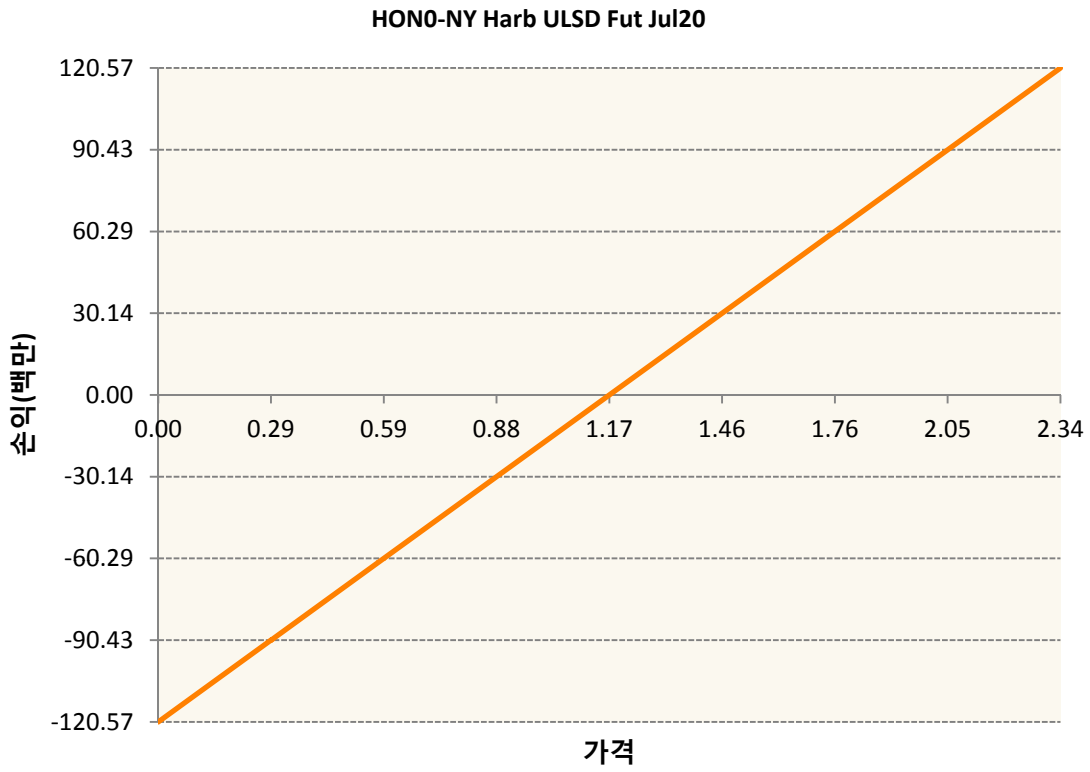
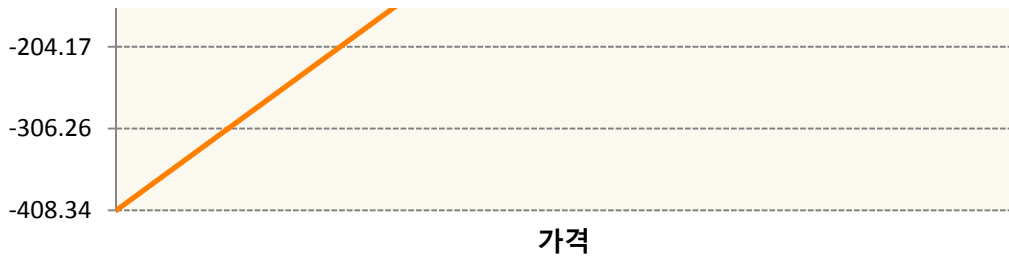
### 2. 만기시점의 손익구조

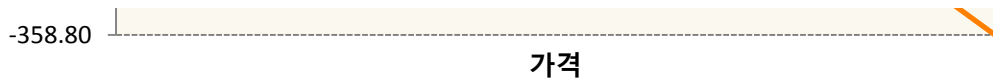
**CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20**



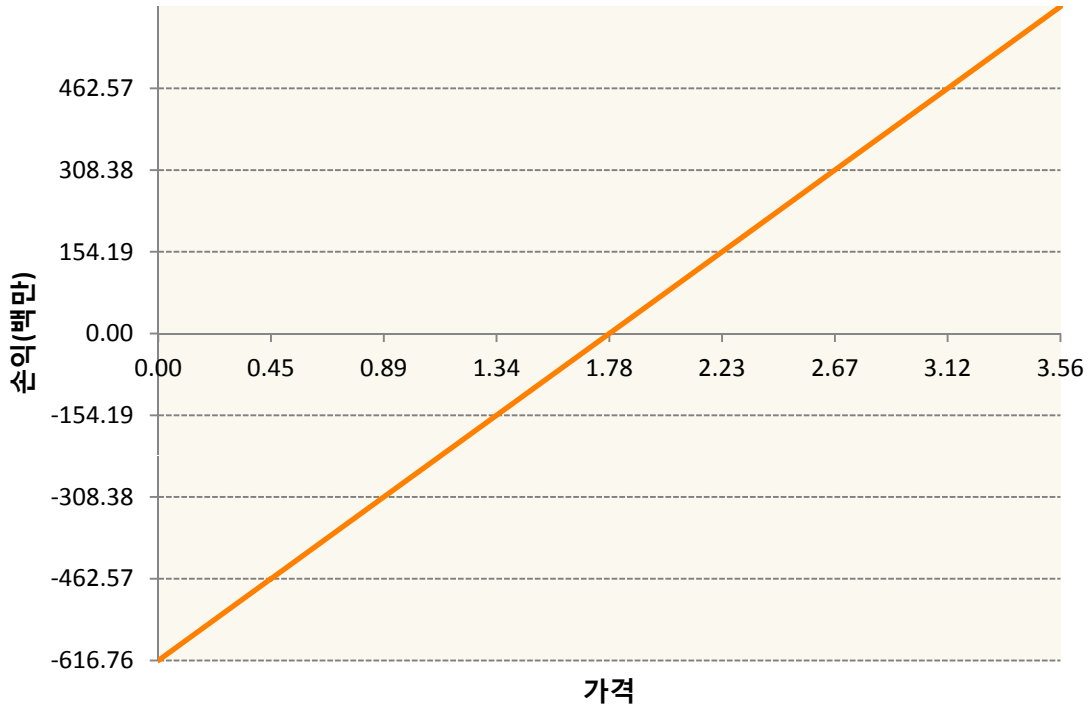
**COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20**



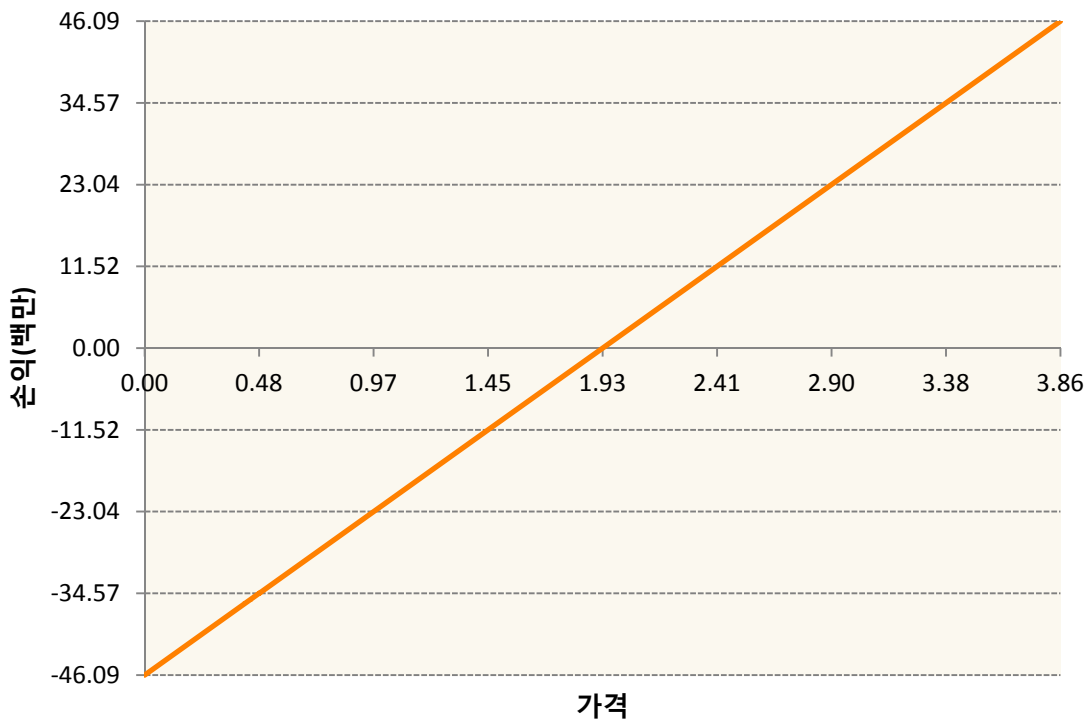




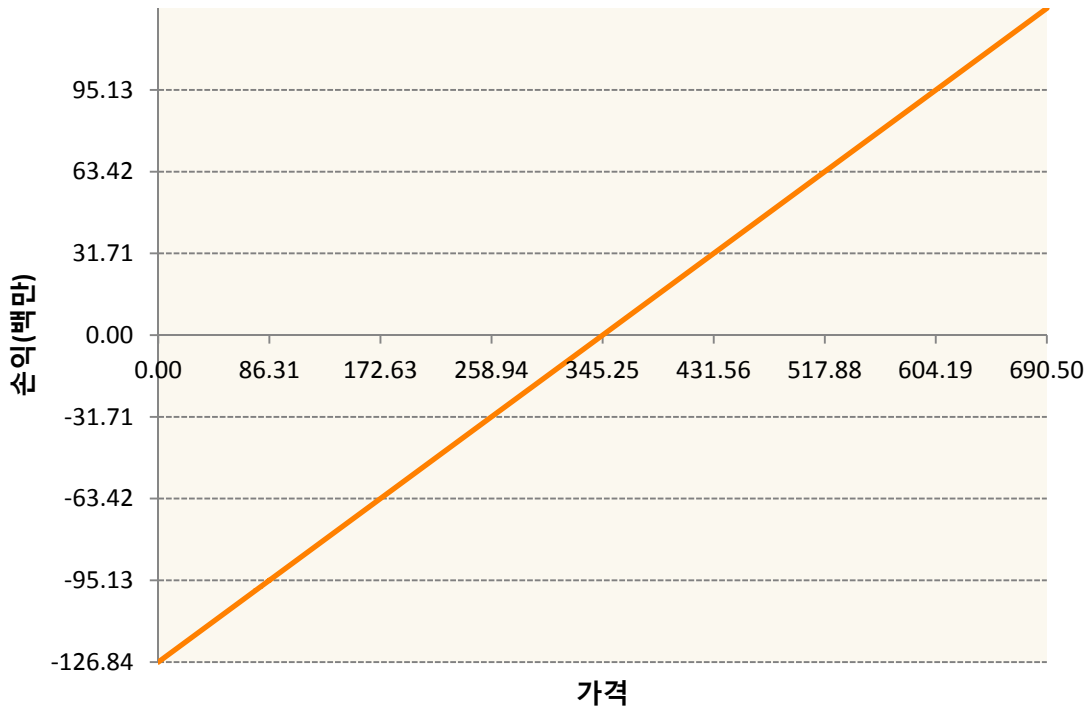
NGN20-NATURAL GAS FUTR Jul20



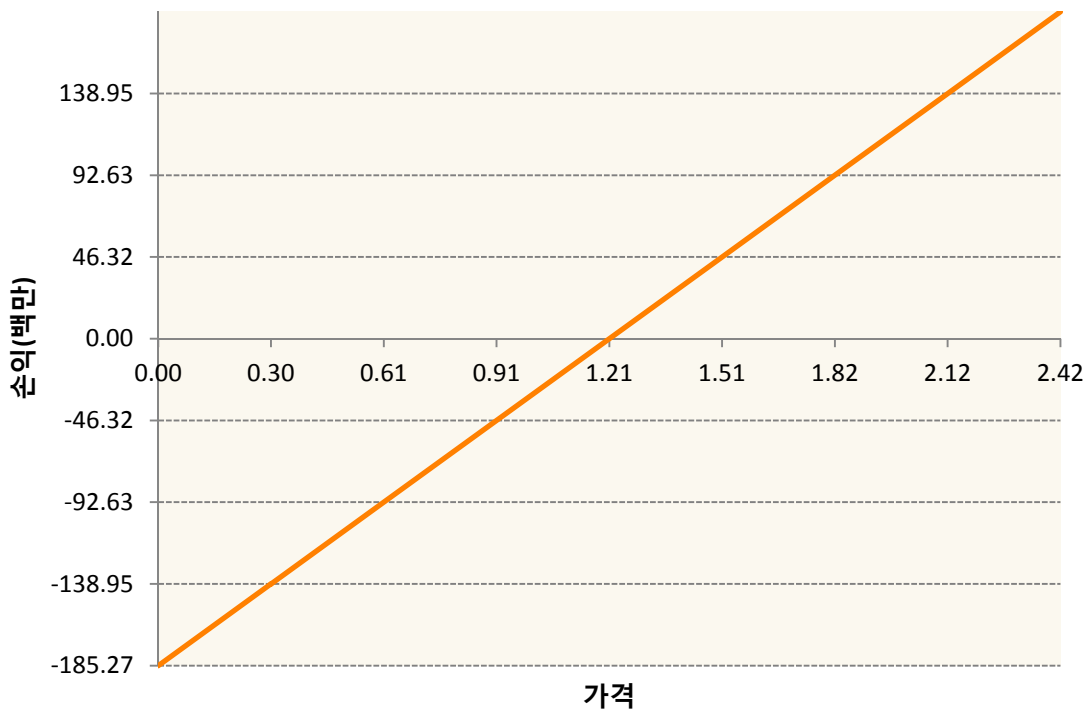
NGU20-NATURAL GAS FUTR Sep20



QSN0-Low Su Gasoil G Jul20



XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN0 WTI CRUDE FUTURE Jul20

31

|            |                         |    |
|------------|-------------------------|----|
| COU0       | BRENT CRUDE FUTR Sep20  | 33 |
| HON0       | NY Harb ULSD Fut Jul20  | 10 |
| KR4175Q60C | 2020-06 달러선물            | 29 |
| NGN20      | NATURAL GAS FUTR Jul20  | 49 |
| NGU20      | NATURAL GAS FUTR Sep20  | 4  |
| QSN0       | Low Su Gasoil G Jul20   | 10 |
| XBN0       | GASOLINE RBOB FUT Jul20 | 15 |

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

(단위:백만원)

**922**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2020-06-12 |
| 기준일 | 2020-06-11 |

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

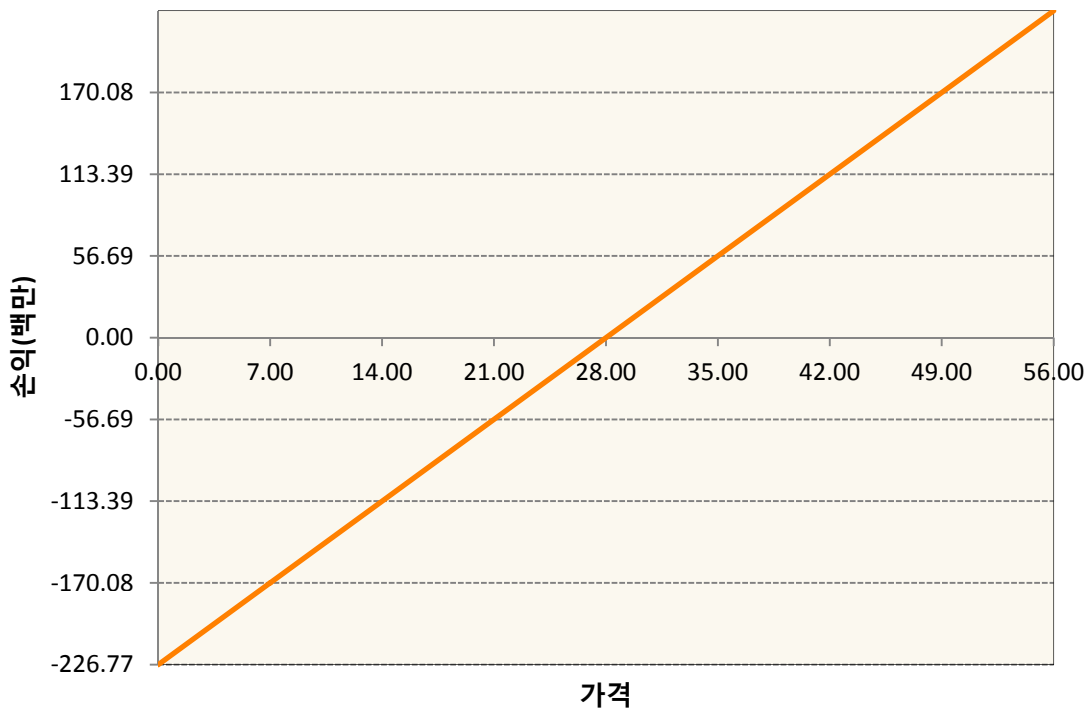
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

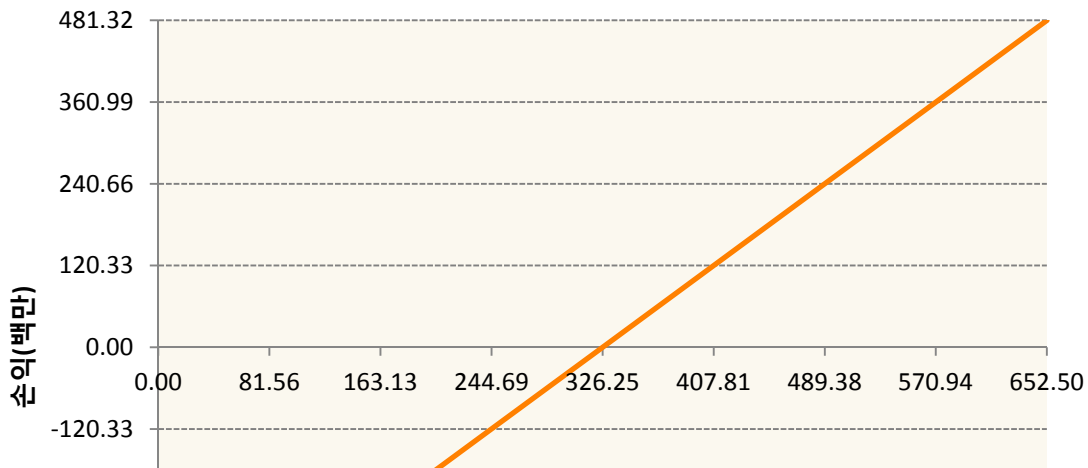
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,513 | 72    | 2,442     |    |

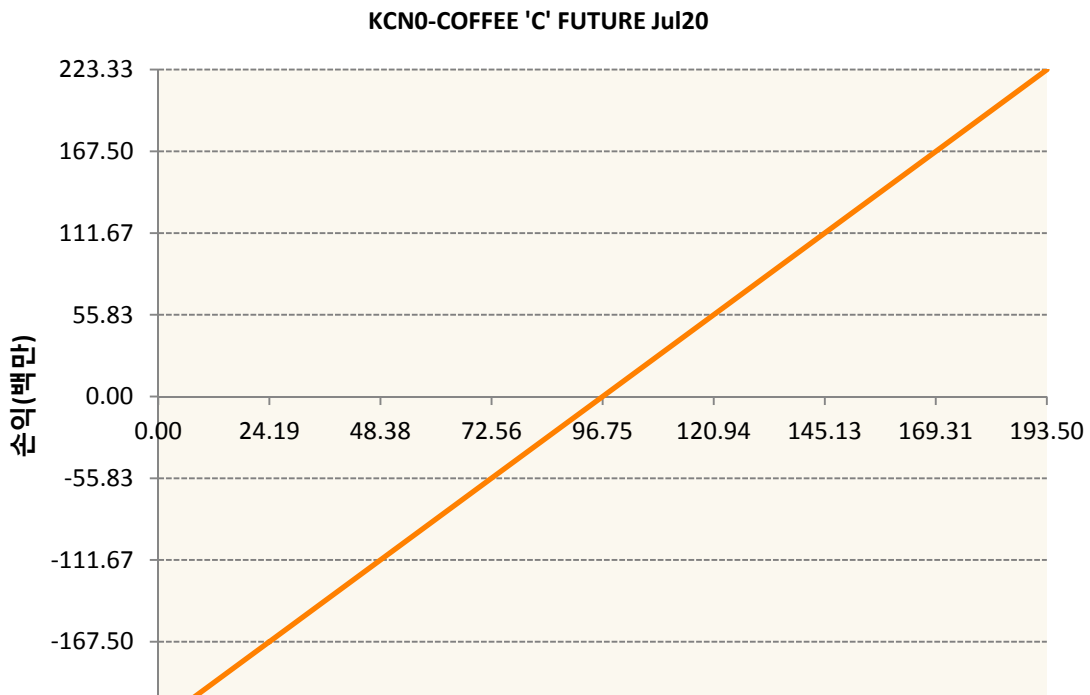
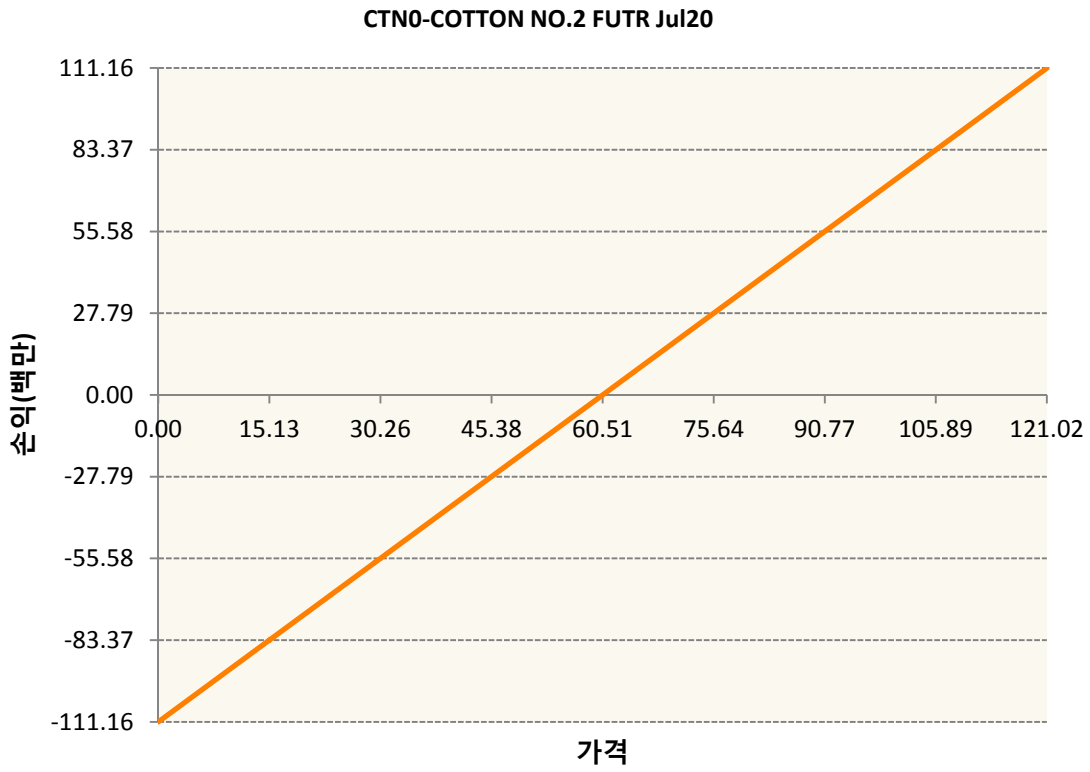
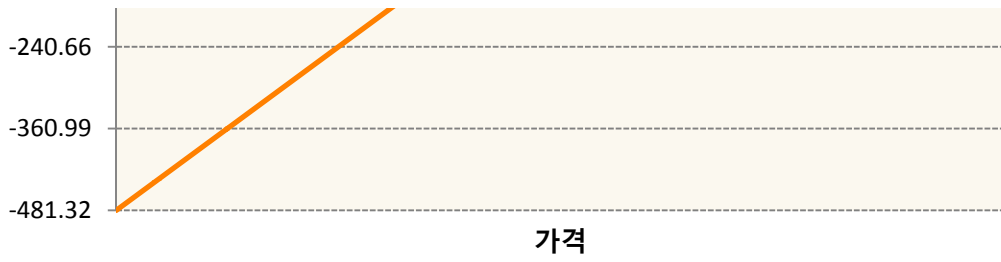
### 2. 만기시점의 손익구조

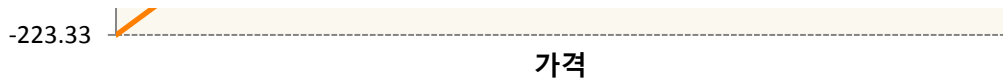
**BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20**



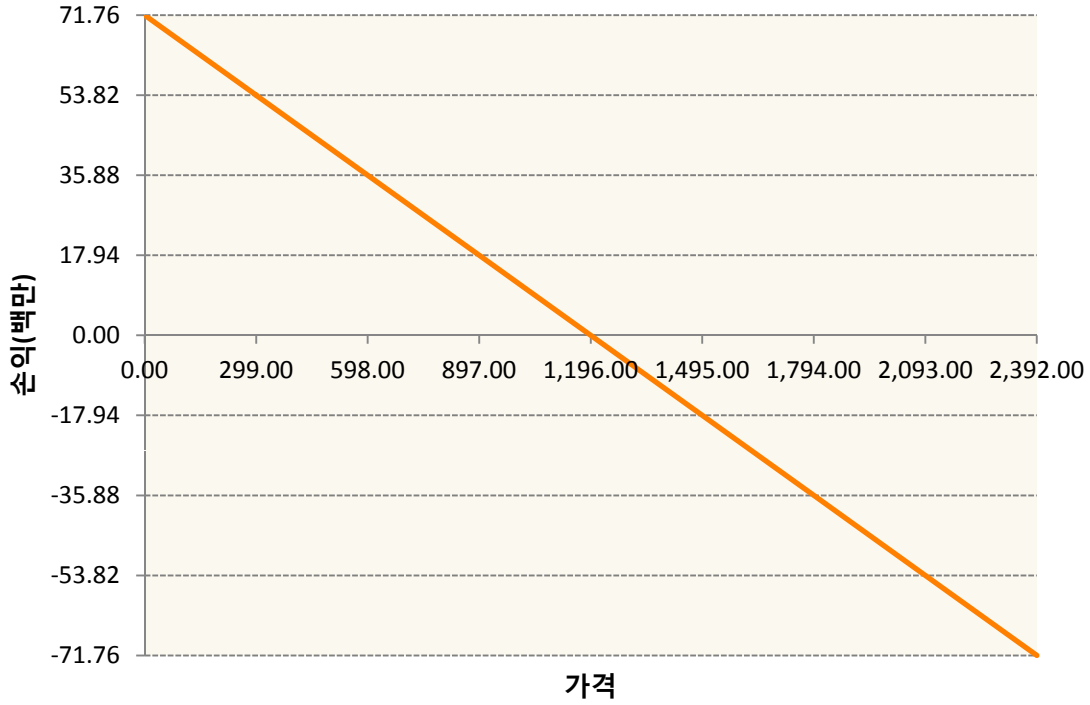
**CNO-CORN FUTURE Jul20**



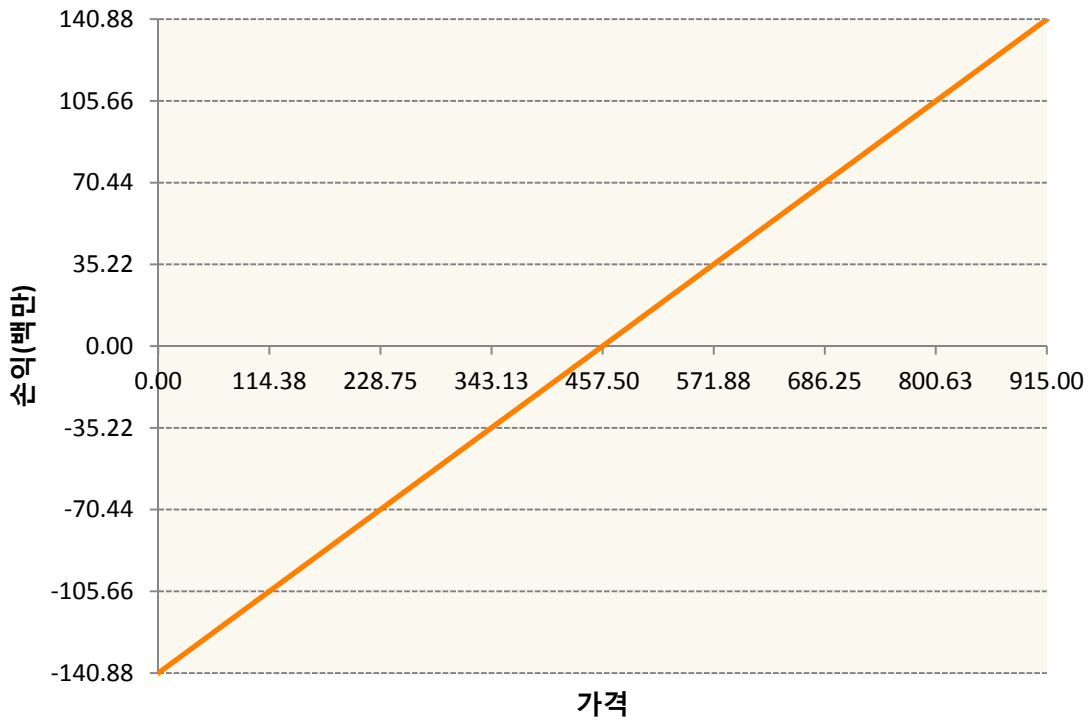




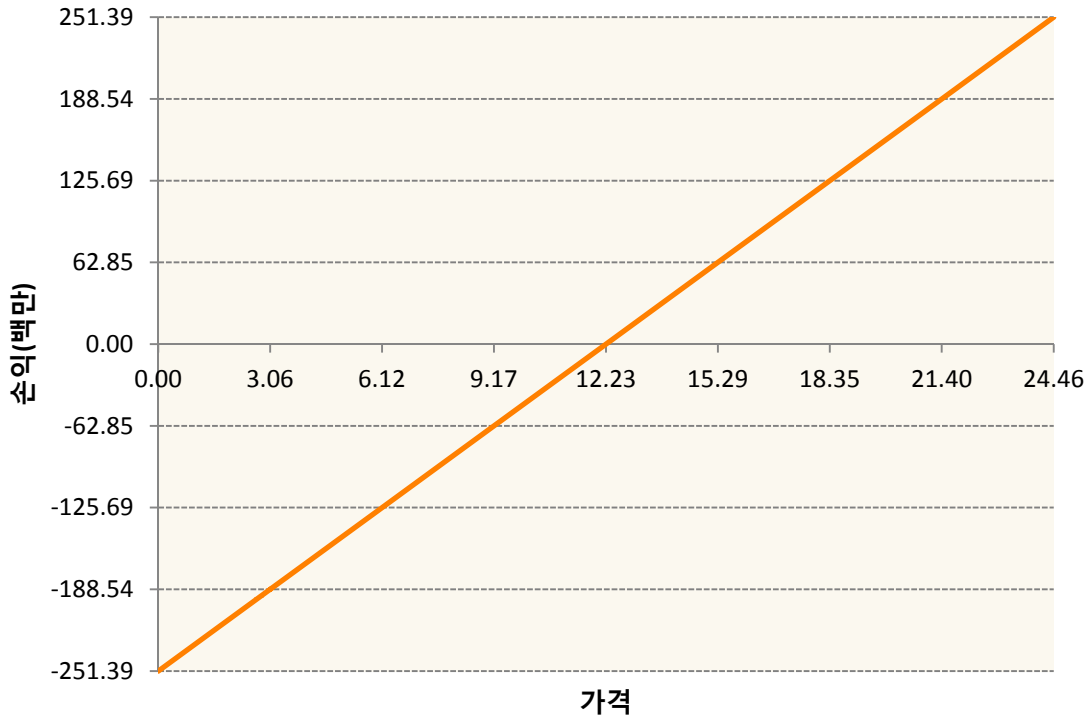
KR4175Q60006-2020-06 달러선물



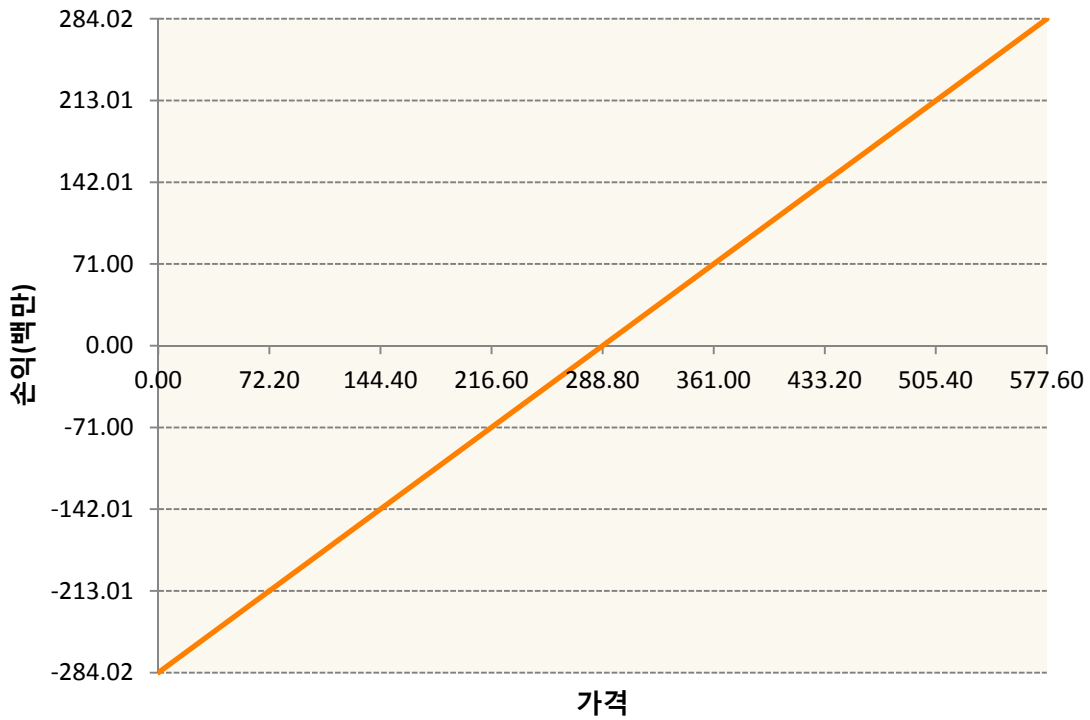
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



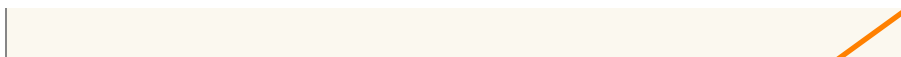
SBN0-Sugar Jul20

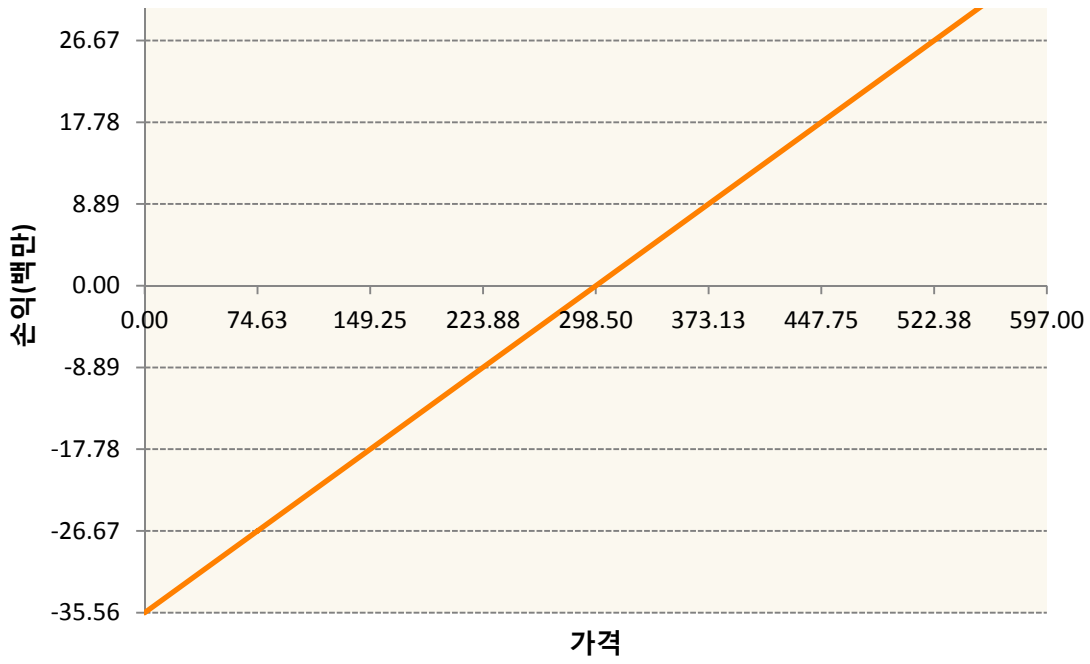


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20

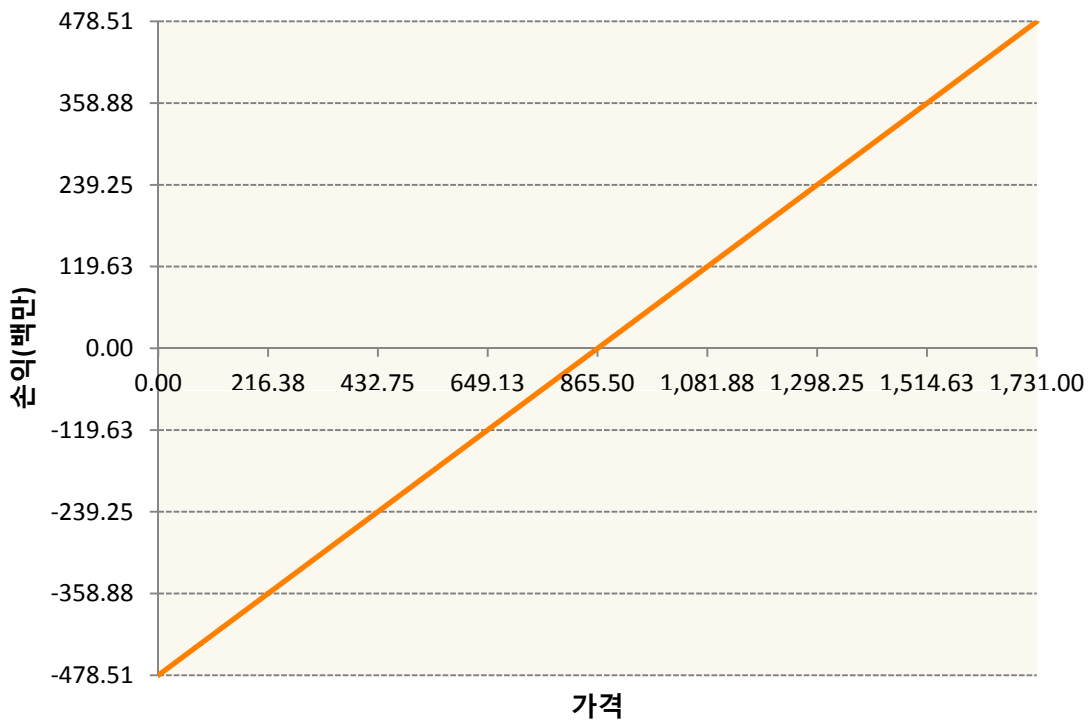


SMZ0-SOYBEAN MEAL FUTR Dec20

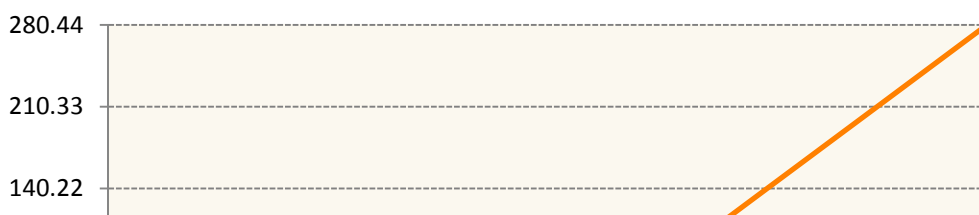


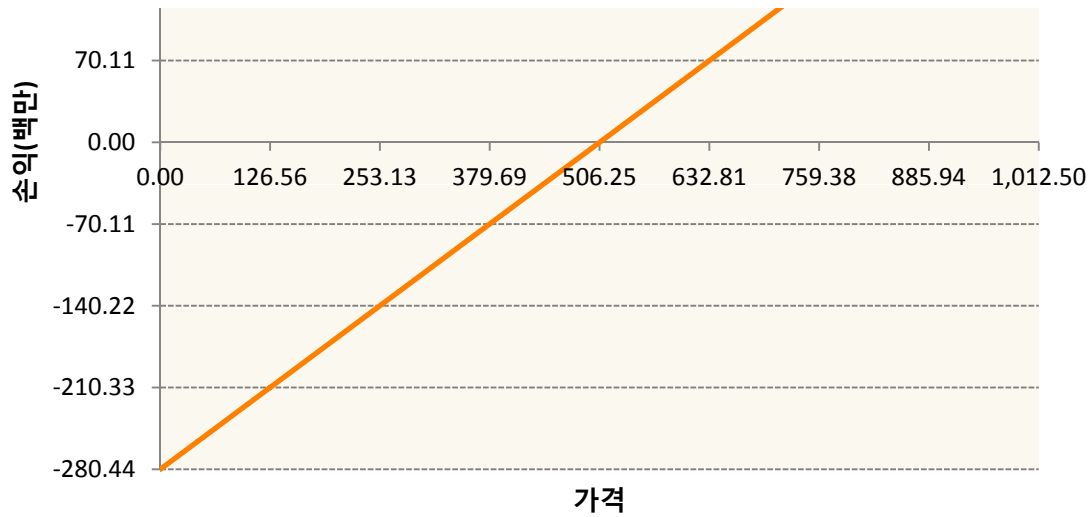


**SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20**



**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  | 9  |
| KCN0       | COFFEE 'C' FUTURE Jul20 | 18 |
| KR4175Q60C | 2020-06 달러선물            | 6  |
| KWN0       | KC HRW WHEAT FUT Jul20  | 11 |
| SBN0       | Sugar Jul20             | 20 |
| SMN0       | SOYBEAN MEAL FUTR Jul20 | 23 |
| SMZ0       | SOYBEAN MEAL FUTR Dec20 | 3  |
| SN0        | SOYBEAN FUTURE Jul20    | 38 |
| WN0        | WHEAT FUTURE(CBT) Jul20 | 22 |

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

237