

공시일	2020-06-17
기준일	2020-06-16

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	3	0	3	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	2020-06-17
기준일	2020-06-16

스마트인덱스모

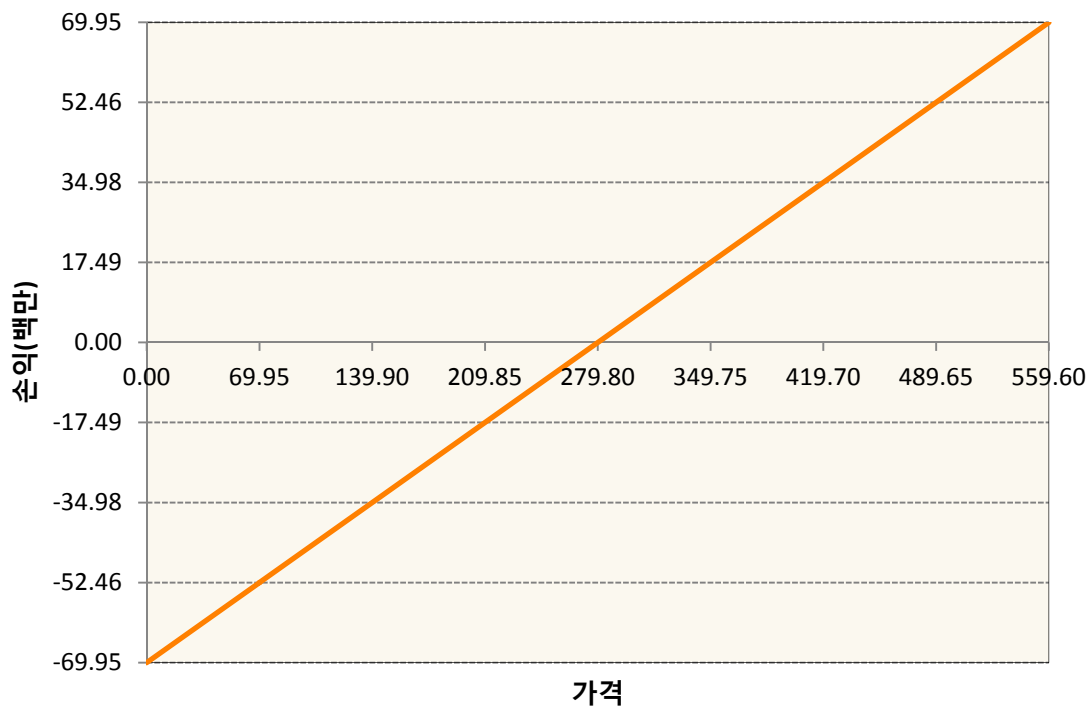
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	70	0	70	장내
누계	유가증권	선물	70	0	70	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009				2020-09 코스피200지수선물				6
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6	
-5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4	
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	2	2	2	2	2	2	2	
5.33%	4	4	4	4	4	4	4	
8.00%	6	6	6	6	6	6	6	

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

(단위:백만원)

9

공시일	2020-06-17
기준일	2020-06-16

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

1,048

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,251

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-06-17
기준일	2020-06-16

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

593

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

864

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-06-17
기준일	2020-06-16

유로인덱스모(주식-파생형)

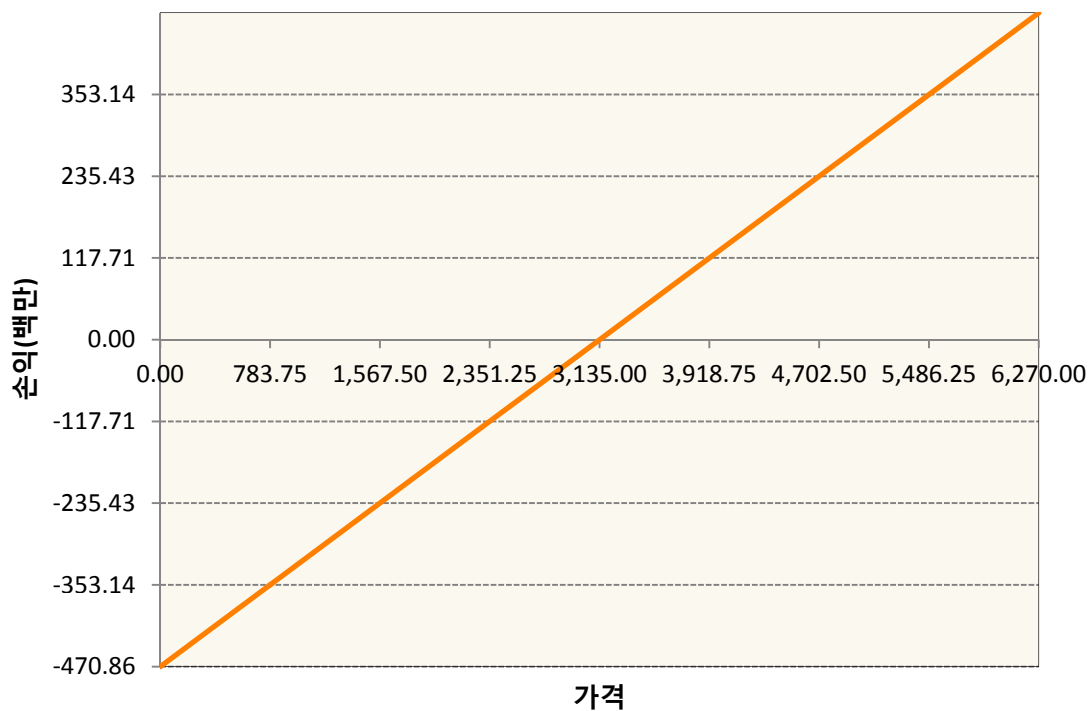
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	471	0	471	

2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	38
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

50

공시일	2020-06-17
기준일	2020-06-16

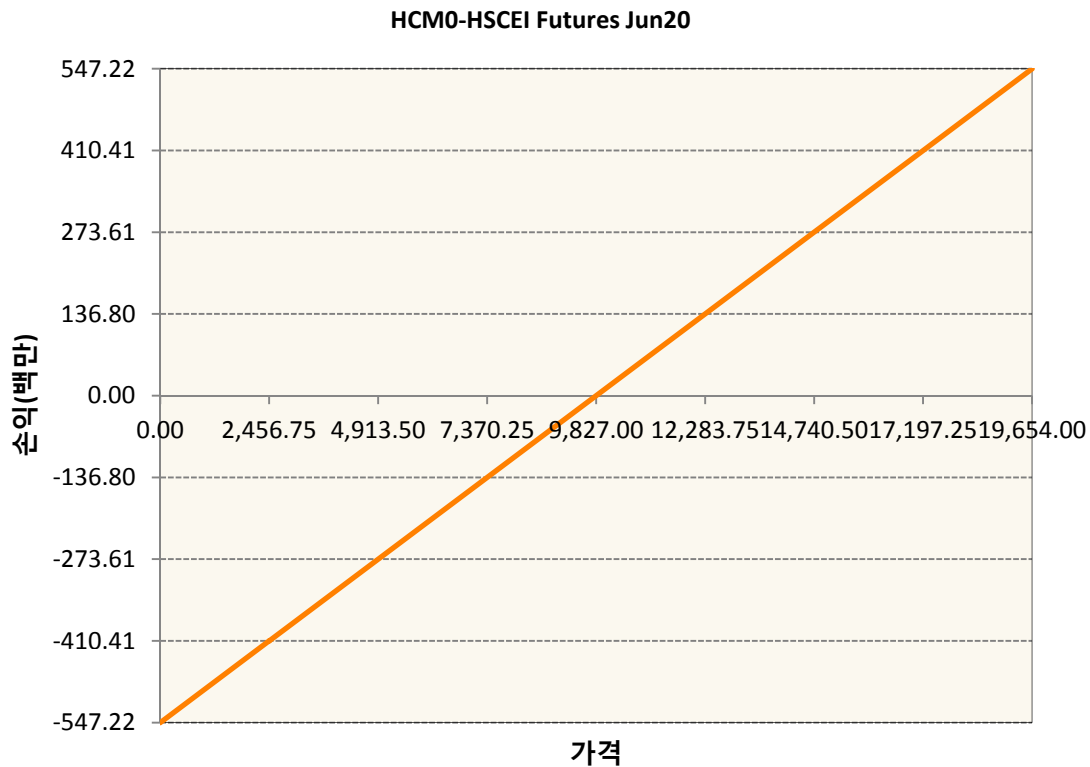
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	547	0	547	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

48

공시일	2020-06-17
기준일	2020-06-16

커버드콜모(주식혼합-파생형)

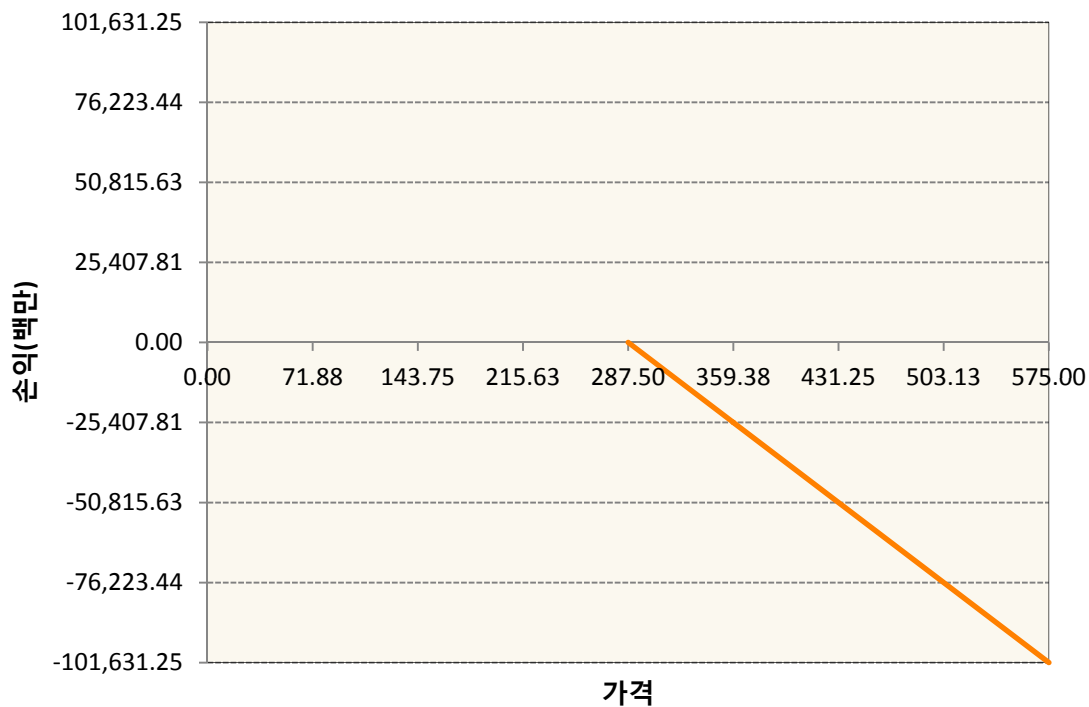
1. 계약금액

(단위:백만원)

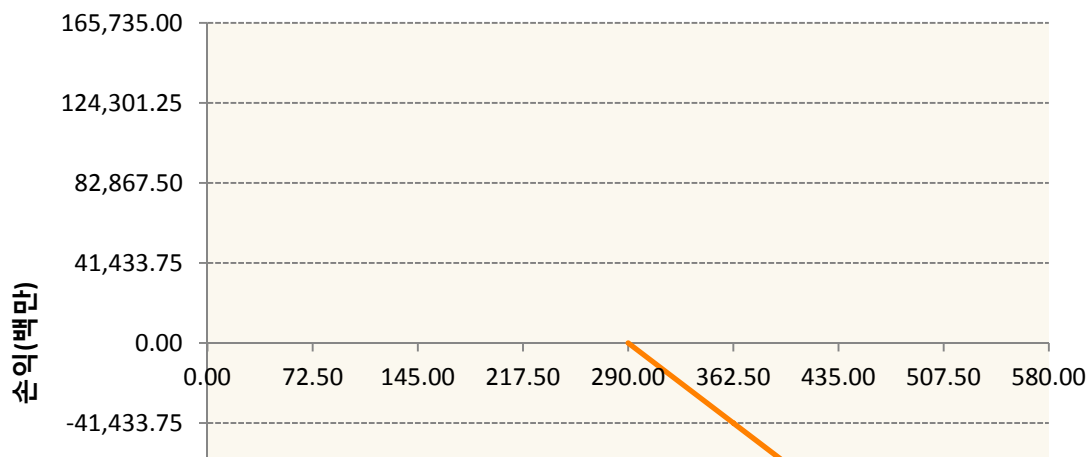
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	367,991	-367,991	장내

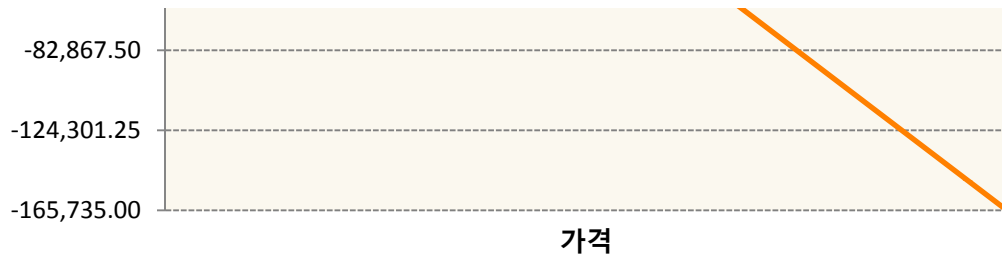
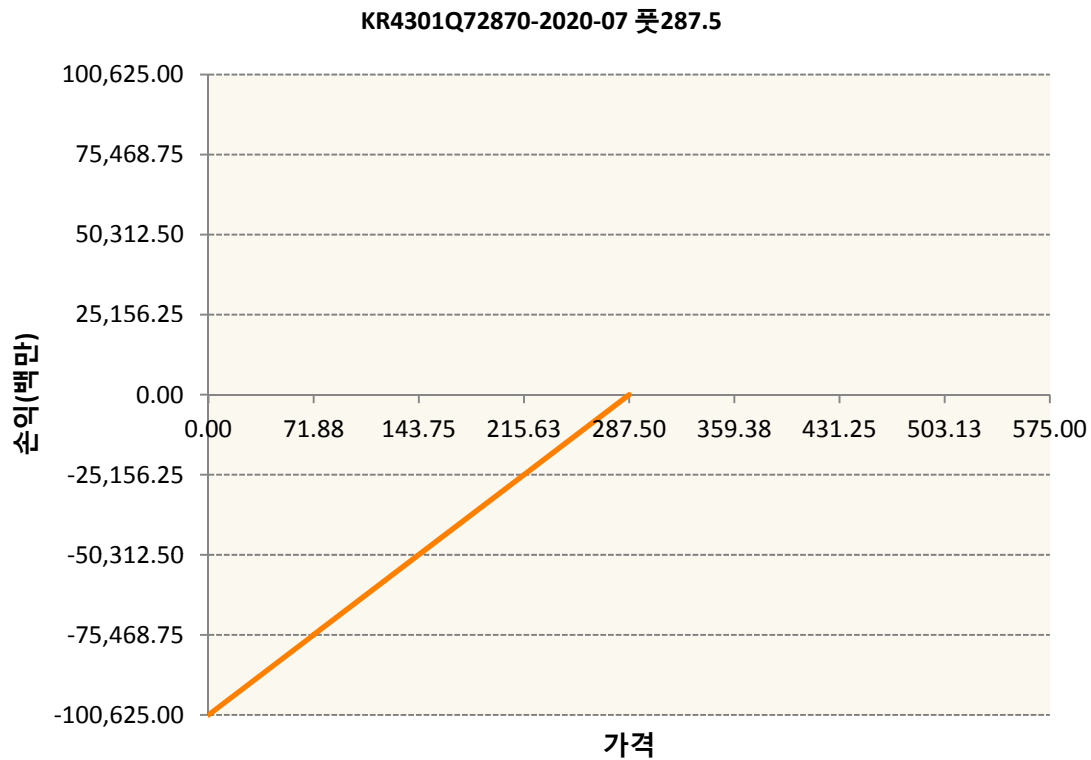
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q72872-2020-07 콜287.5



KR4201Q72906-2020-07 콜290





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q72872 2020-07 콜287.5							5,836
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,358	3,146	2,911	2,656	2,385	2,101	1,806
-5.33%	2,891	2,606	2,305	1,991	1,668	1,336	998
-2.67%	2,176	1,828	1,473	1,112	746	377	6
0%	1,171	781	391	0	-392	-784	-1,177
2.67%	-147	-547	-948	-1,348	-1,749	-2,149	-2,550
5.33%	-1,770	-2,151	-2,537	-2,926	-3,318	-3,711	-4,107
8.00%	-3,667	-4,006	-4,357	-4,717	-5,085	-5,458	-5,836
KR4201Q72906 2020-07 콜290							9,130
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,010	4,700	4,350	3,964	3,550	3,112	2,654

-5.33%	4,358	3,929	3,470	2,987	2,484	1,965	1,434
-2.67%	3,336	2,798	2,243	1,676	1,099	514	-76
0%	1,866	1,248	626	0	-628	-1,258	-1,890
2.67%	-98	-751	-1,403	-2,055	-2,706	-3,358	-4,009
5.33%	-2,560	-3,197	-3,839	-4,483	-5,130	-5,778	-6,428
8.00%	-5,482	-6,062	-6,657	-7,263	-7,879	-8,502	-9,130
KR4301Q72870 2020-07 풋287.5							6,262
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,462	-5,552	-5,662	-5,790	-5,934	-6,092	-6,262
-5.33%	-3,080	-3,236	-3,409	-3,597	-3,796	-4,005	-4,222
-2.67%	-948	-1,174	-1,409	-1,651	-1,898	-2,151	-2,407
0%	831	555	278	0	-279	-559	-840
2.67%	2,195	1,908	1,620	1,333	1,045	757	469
5.33%	3,147	2,888	2,623	2,354	2,081	1,806	1,528
8.00%	3,748	3,544	3,325	3,095	2,856	2,609	2,357

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

(단위:백만원)

17,994

공시일	2020-06-17
기준일	2020-06-16

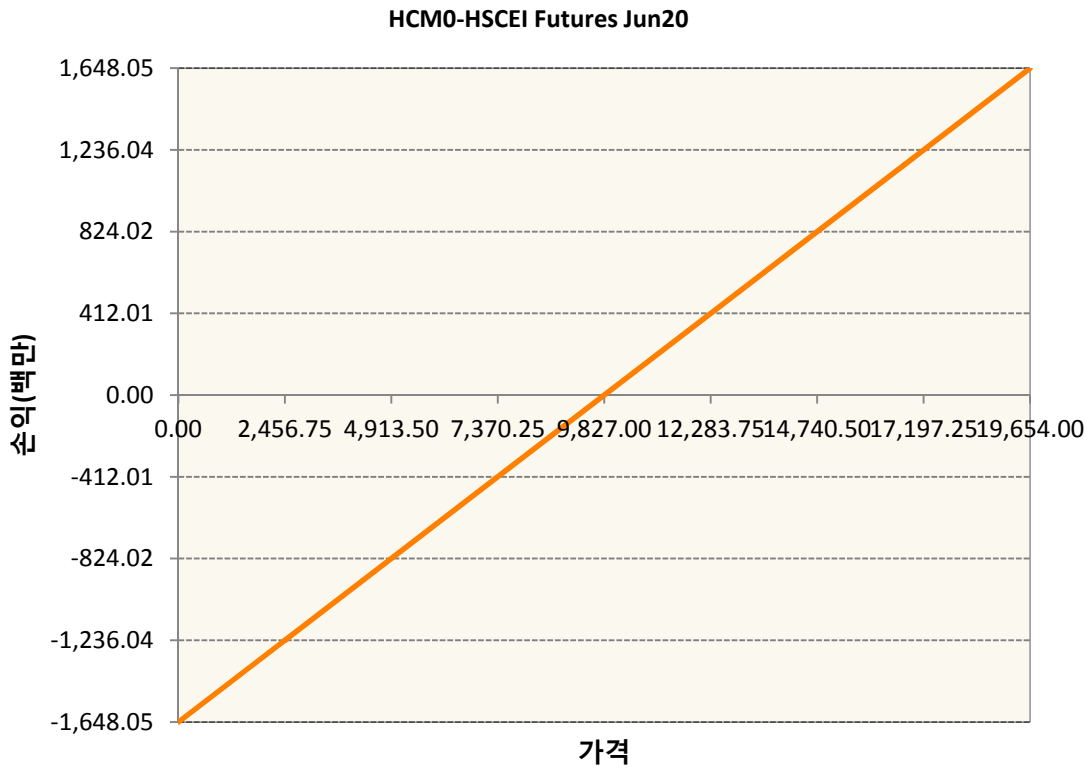
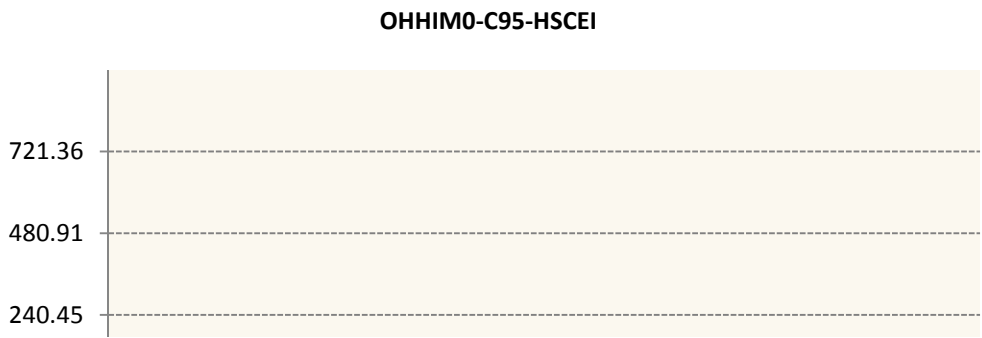
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

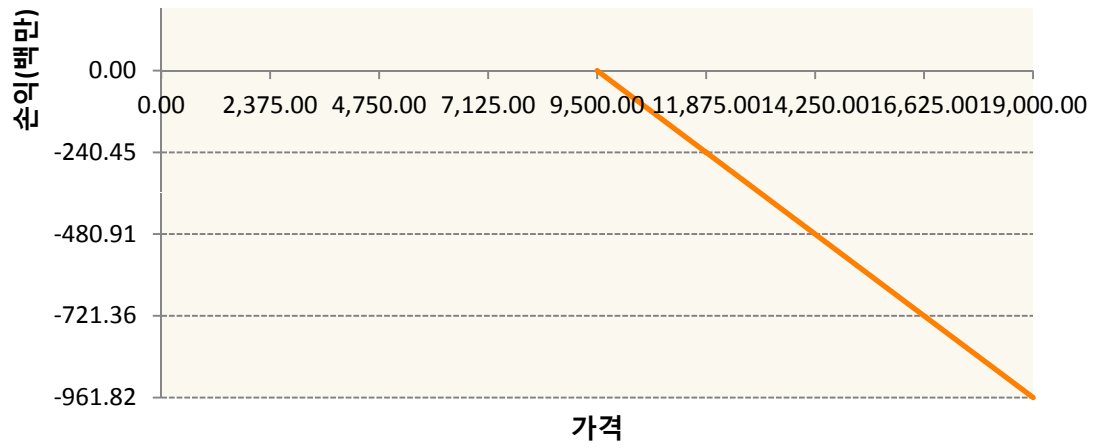
1. 계약금액

(단위:백만원)

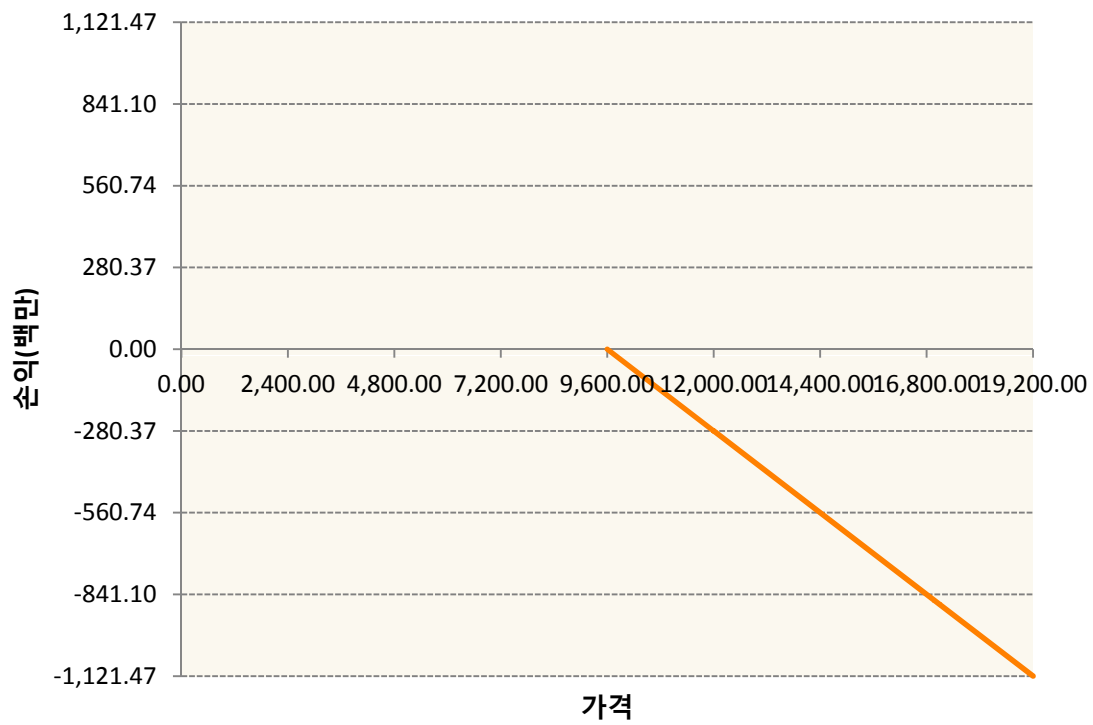
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,648	0	1,648	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,241	-4,241	장내
누계	통화	선도	0	1,508	-1,508	장외

2. 만기시점의 손익구조

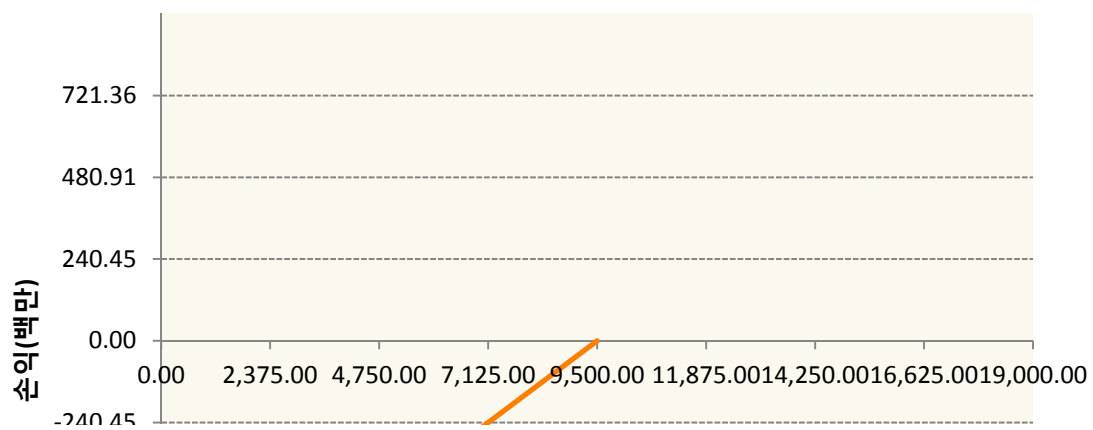


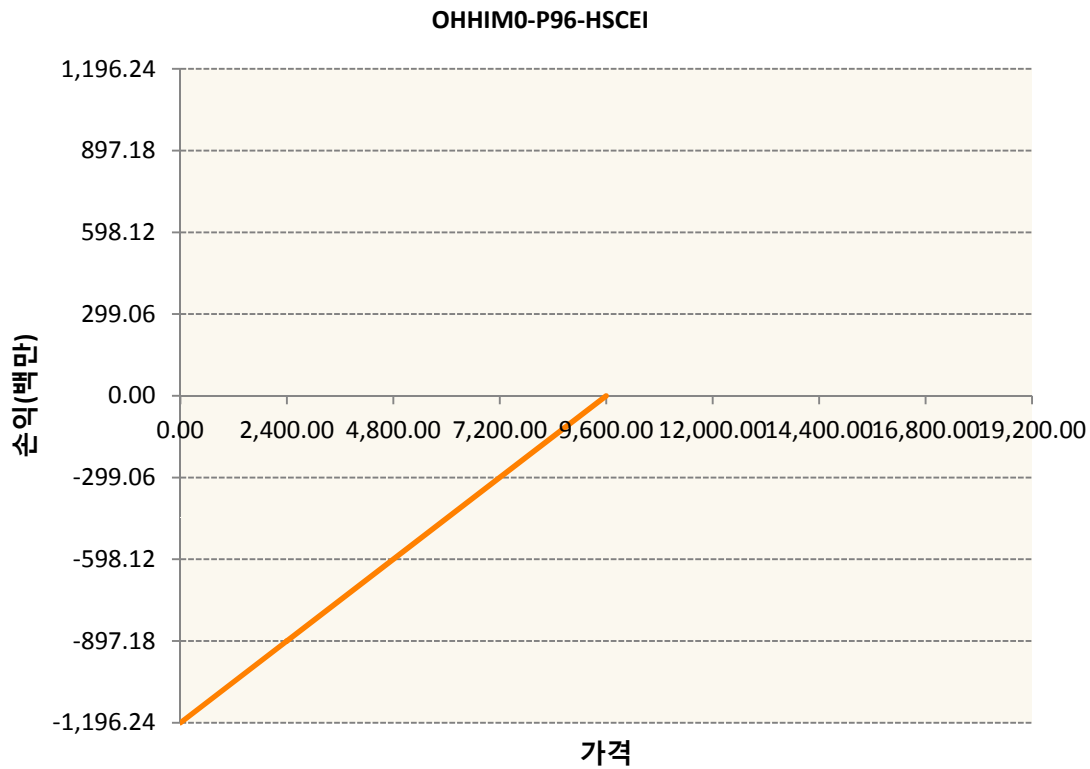


OHHIM0-C96-HSCEI



OHHIM0-P95-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E		121
HCM0 HSCEI Futures Jun20		132
OHHIM0-C9 HSCEI		77
OHHIM0-C9 HSCEI		90
OHHIM0-P9 HSCEI		77
OHHIM0-P9 HSCEI		96

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	574

공시일	2020-06-17
기준일	2020-06-16

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

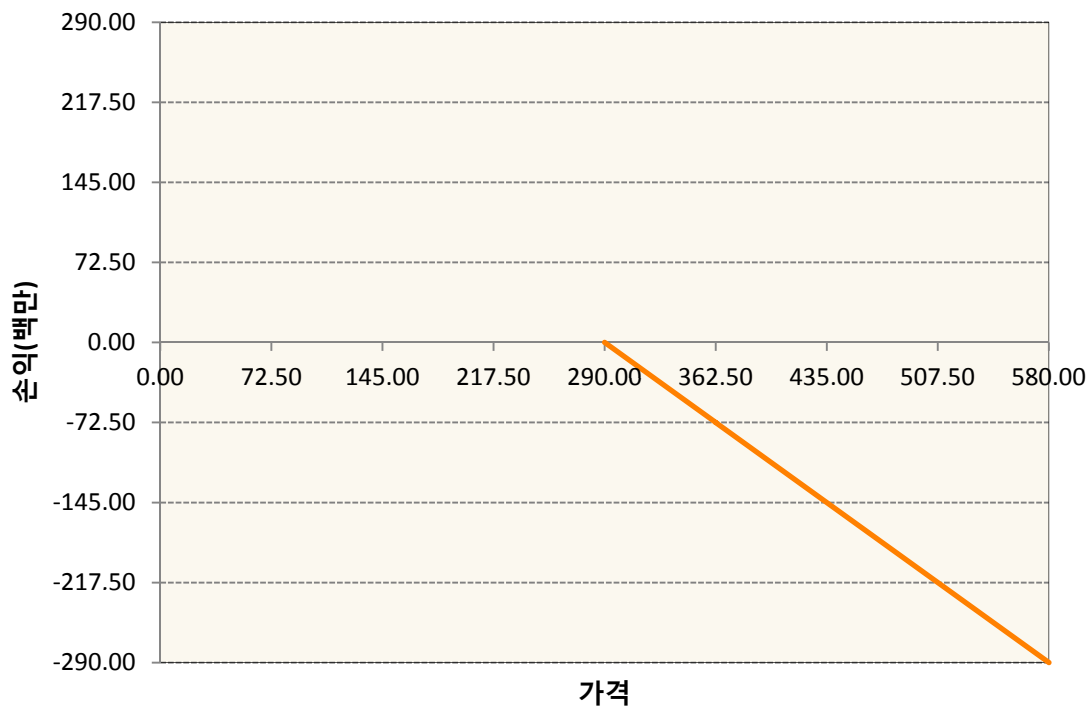
1. 계약금액

(단위:백만원)

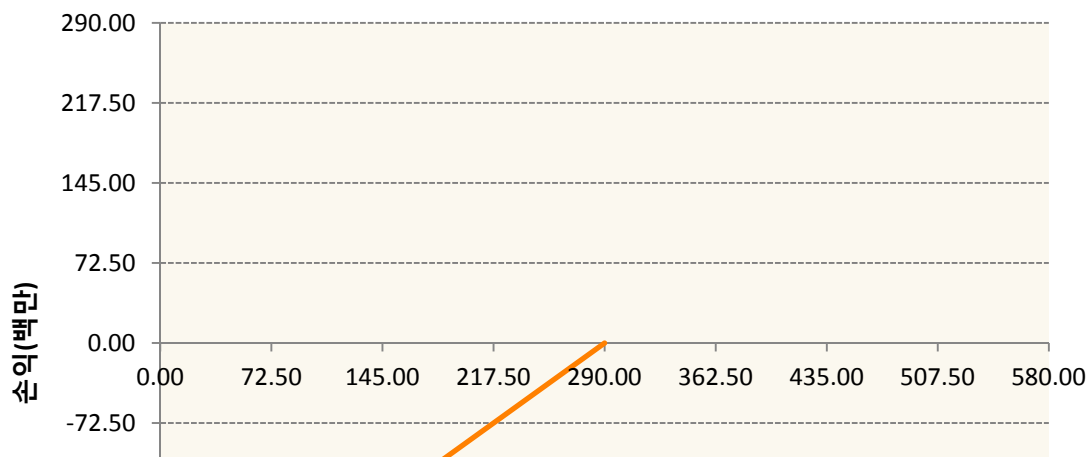
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	580	-580	장내

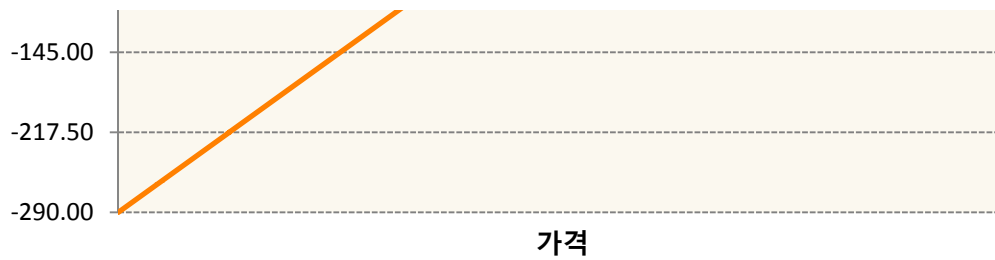
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q72906-2020-07 콜290



KR4301Q72904-2020-07 풋290





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q72906			2020-07 콜290				16
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9	8	8	7	6	5	5
-5.33%	8	7	6	5	4	3	3
-2.67%	6	5	4	3	2	1	0
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	0	-1	-2	-4	-5	-6	-7
5.33%	-4	-6	-7	-8	-9	-10	-11
8.00%	-10	-11	-12	-13	-14	-15	-16
KR4301Q72904			2020-07 풋290				18
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-16	-17	-17	-17	-18	-18	-18
-5.33%	-9	-10	-10	-11	-11	-12	-12
-2.67%	-3	-4	-4	-5	-6	-6	-7
0%	2	2	1	0	-1	-2	-2
2.67%	7	6	5	4	3	2	2
5.33%	10	9	8	7	7	6	5
8.00%	12	11	10	10	9	8	7

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

30

공시일	2020-06-17
기준일	2020-06-16

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

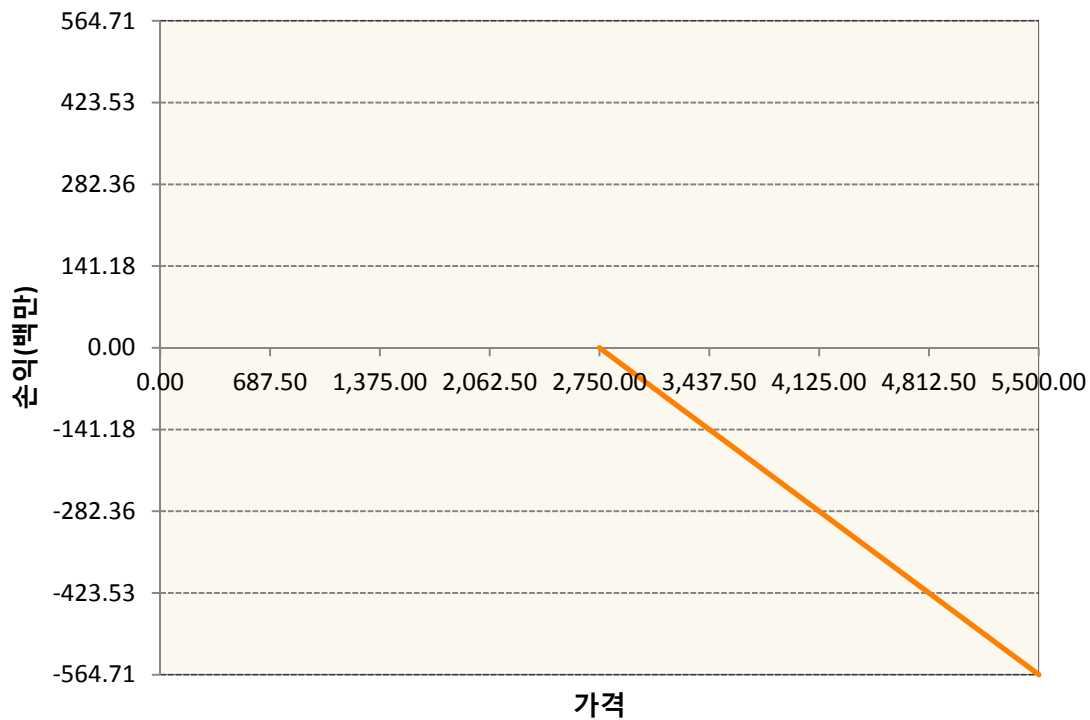
1. 계약금액

(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	1,220	0	1,220	
누계	유가증권	스왑	8,165	0	8,165	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,714	-6,714	장내
누계	통화	선도	0	2,962	-2,962	장외

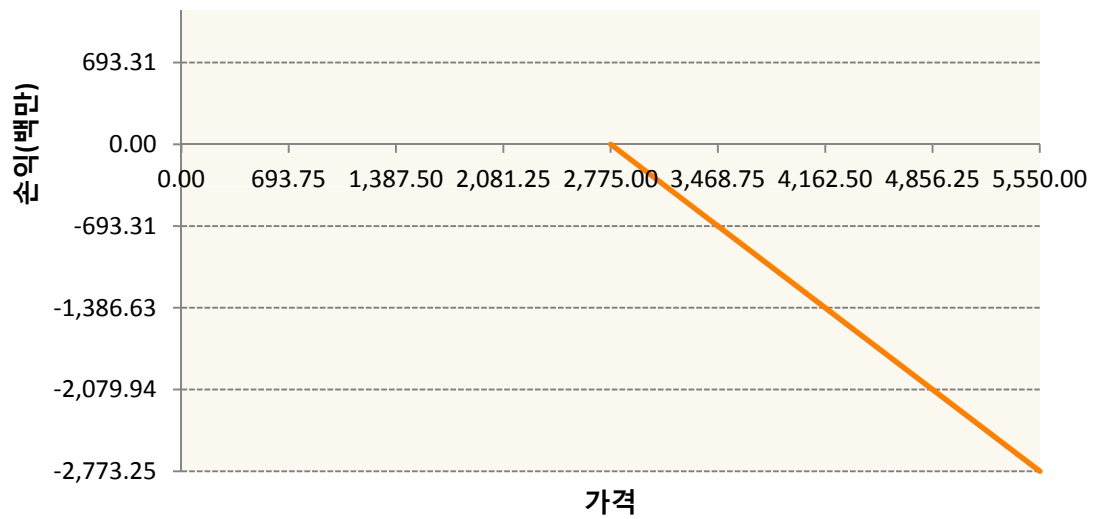
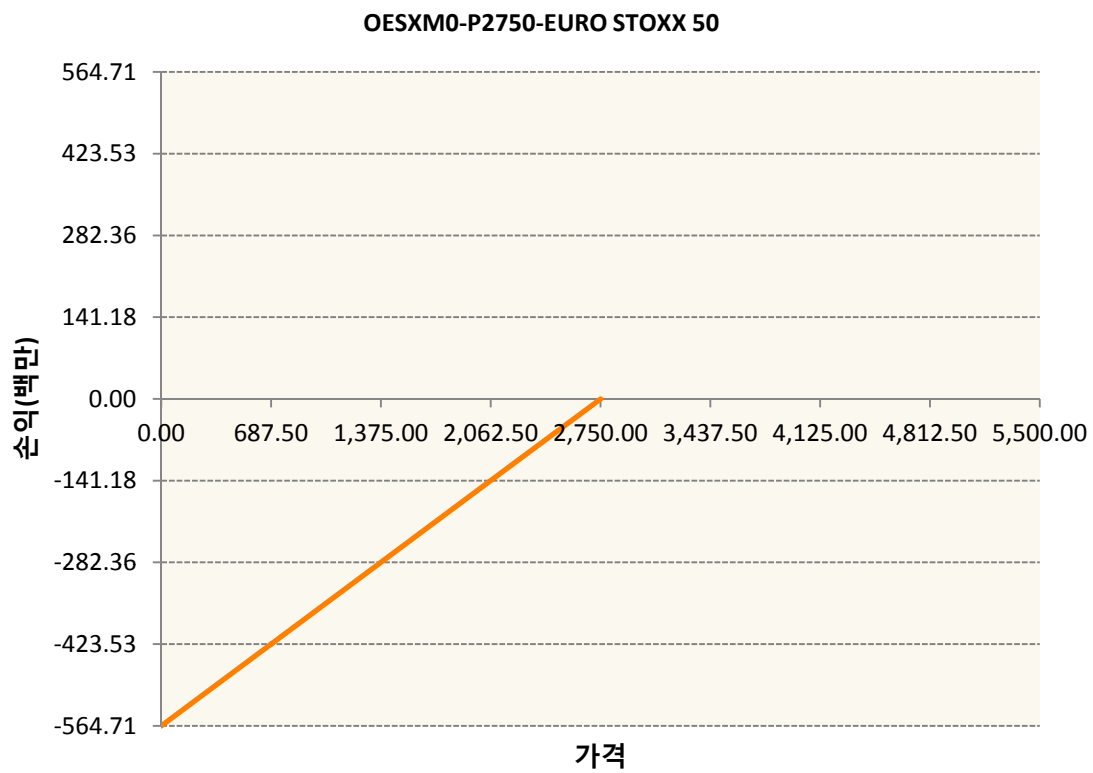
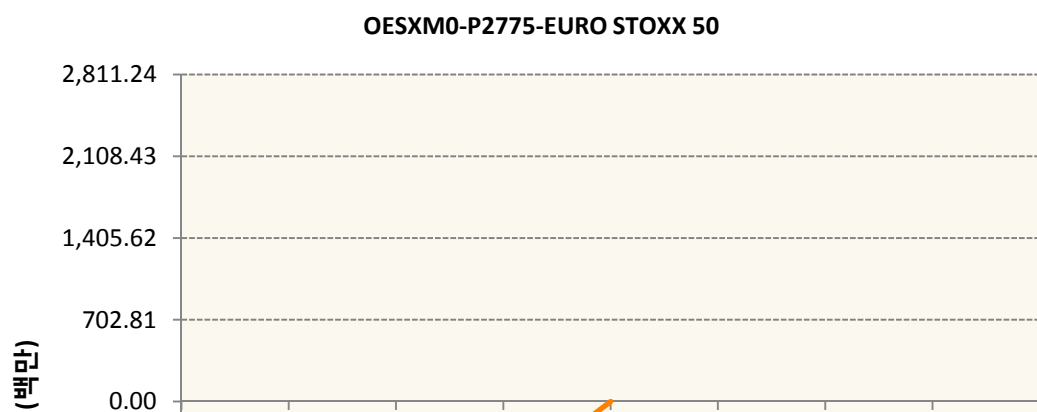
2. 만기시점의 손익구조

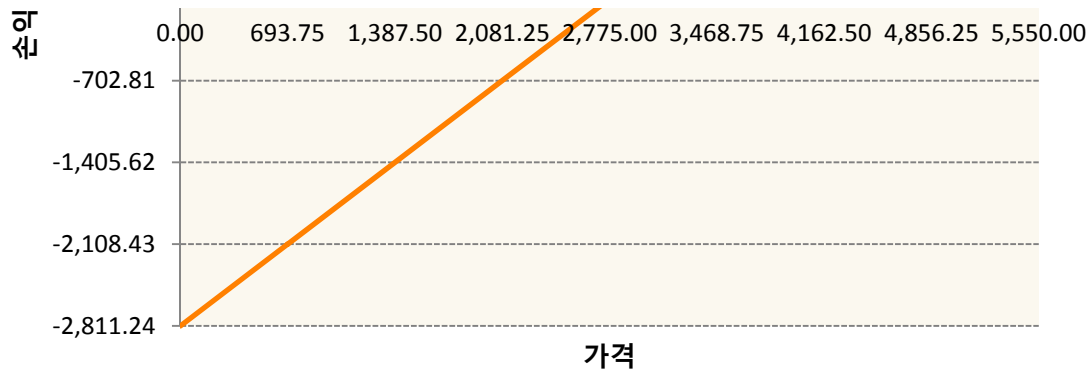
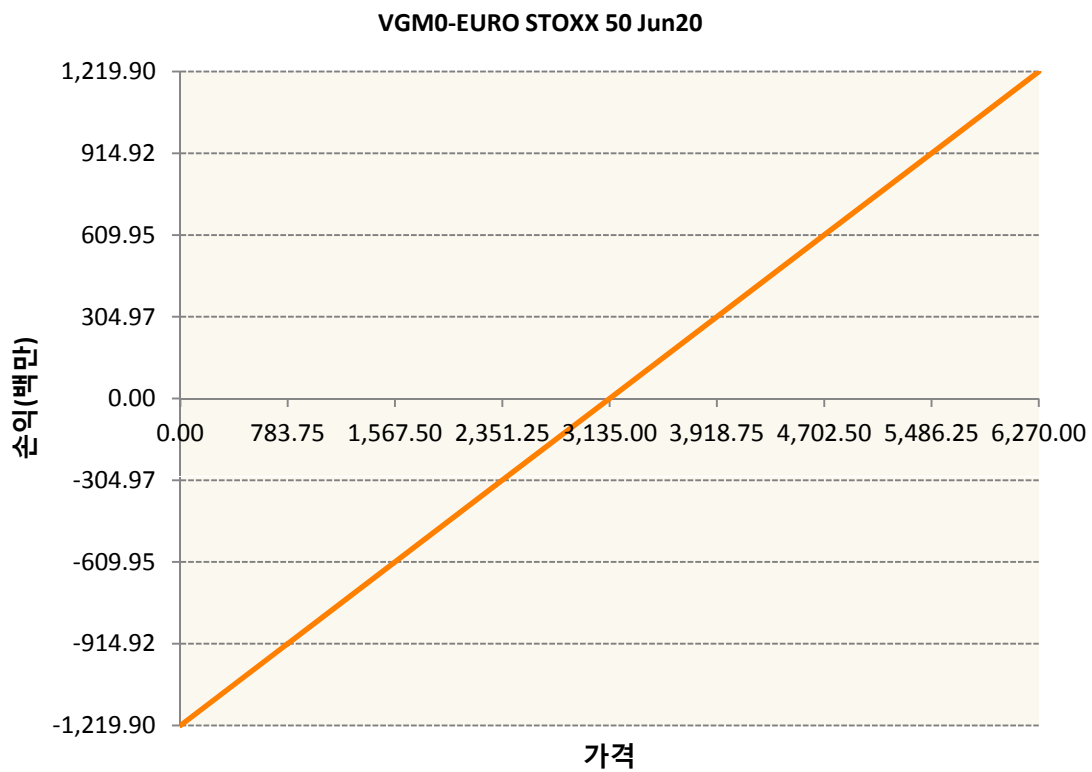
OESXM0-C2750-EURO STOXX 50



OESXM0-C2775-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		222
OESXM0-P2' EURO STOXX 50		45
OESXM0-P2' EURO STOXX 50		225
VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	98

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

(단위:백만원)

1,037

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

(단위:백만원)

1,315

공시일	2020-06-17
기준일	2020-06-16

ETF스마트레버리지목표전환형9호

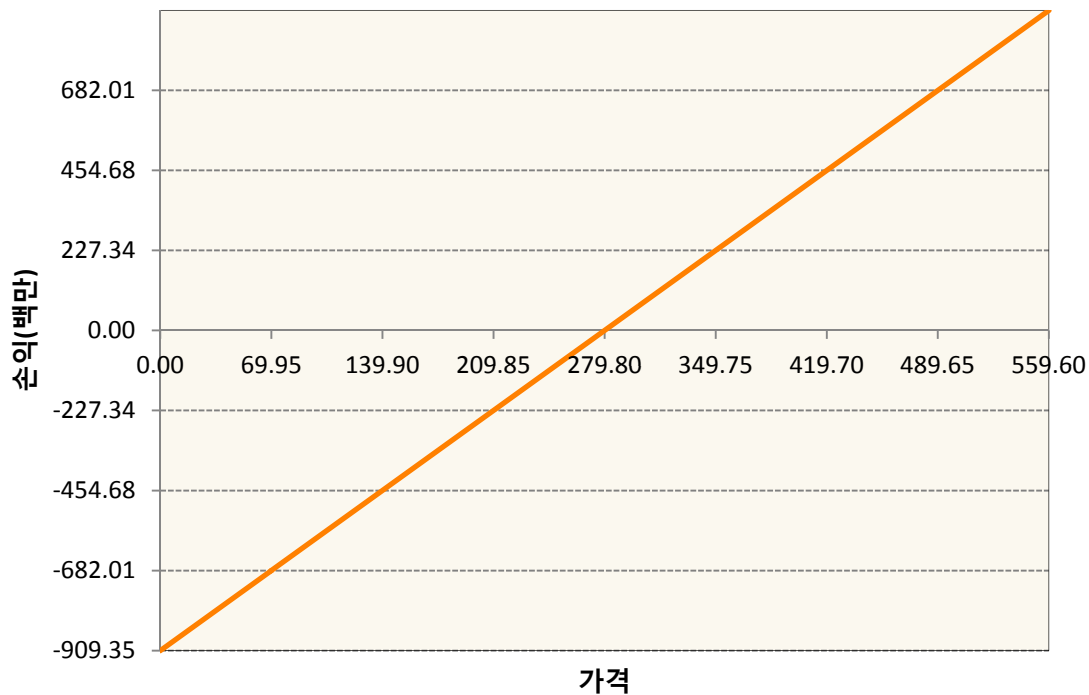
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	909	0	909	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009							2020-09 코스피200지수선물		73
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73	
-5.33%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
-2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	24	24	24	24	24	24	24	24	
5.33%	49	49	49	49	49	49	49	49	
8.00%	73	73	73	73	73	73	73	73	

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

(단위:백만원)

116

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

(단위:백만원)

169

공시일	2020-06-17
기준일	2020-06-16

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

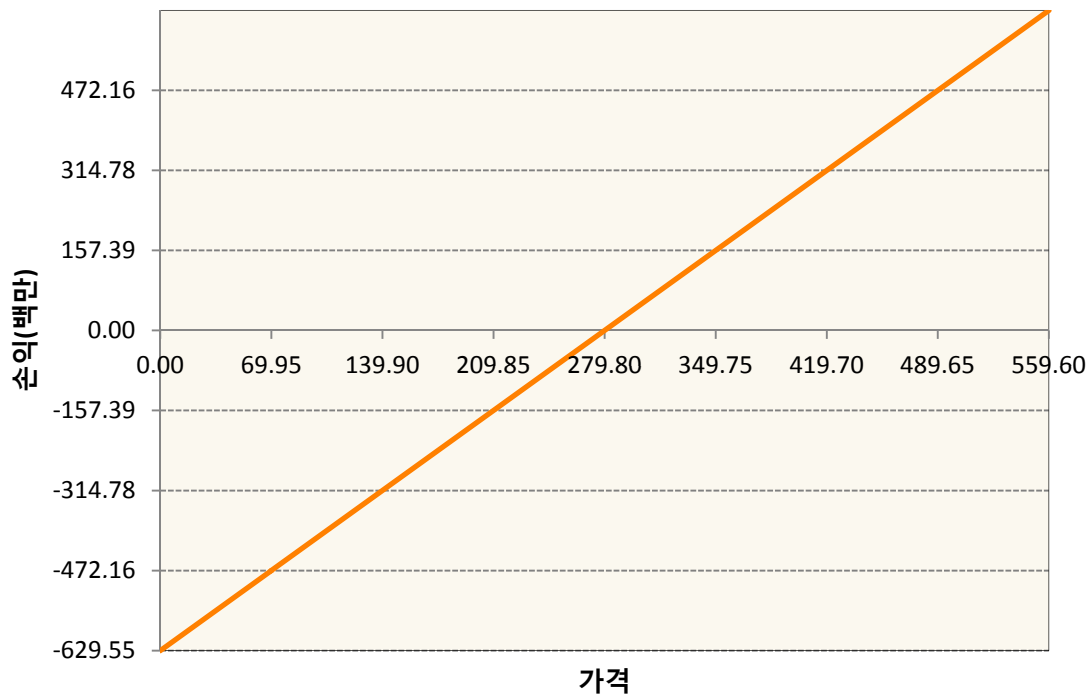
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	630	0	630	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물



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

(단위:백만원)

80

공시일	2020-06-17
기준일	2020-06-16

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

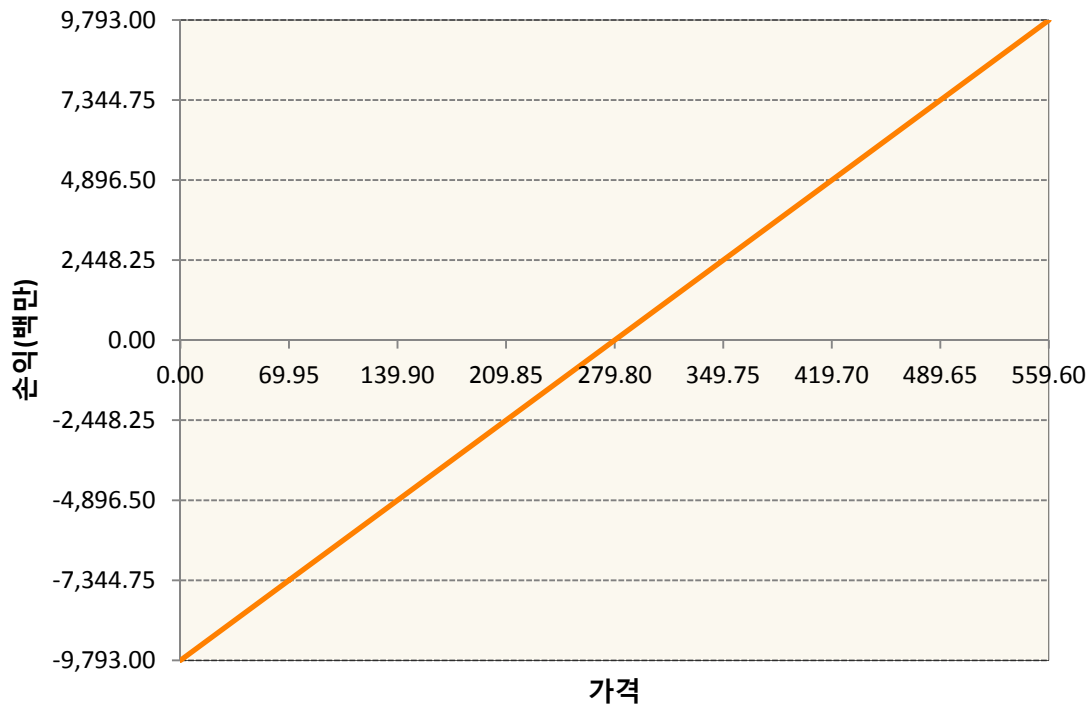
1. 계약금액

(단위:백만원)

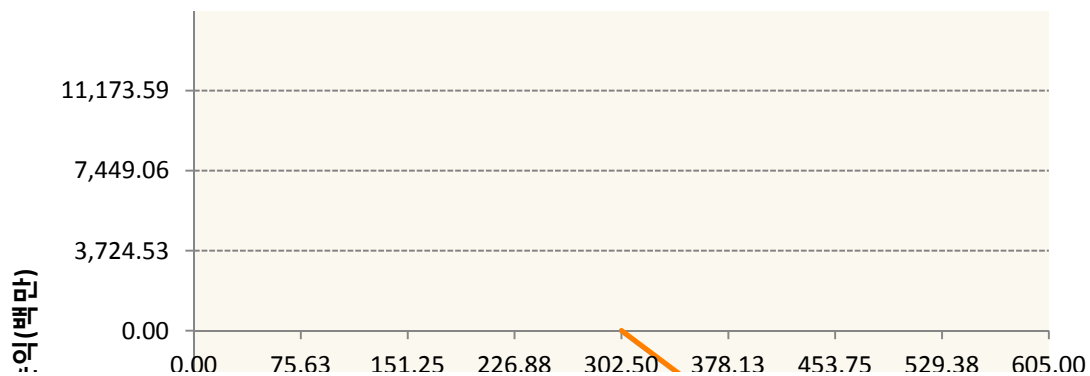
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	211	0	211	장내
신규	유가증권	옵션	0	304	-304	장내
누계	유가증권	선물	9,793	0	9,793	장내
누계	유가증권	옵션	3,247	19,092	-15,845	장내

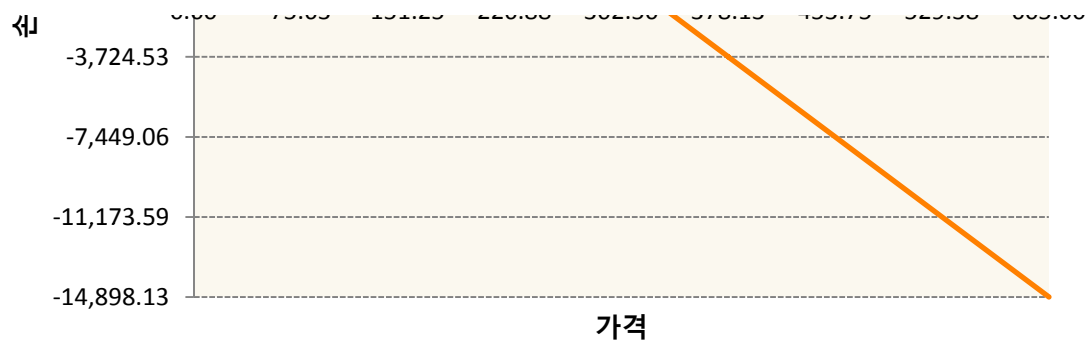
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물

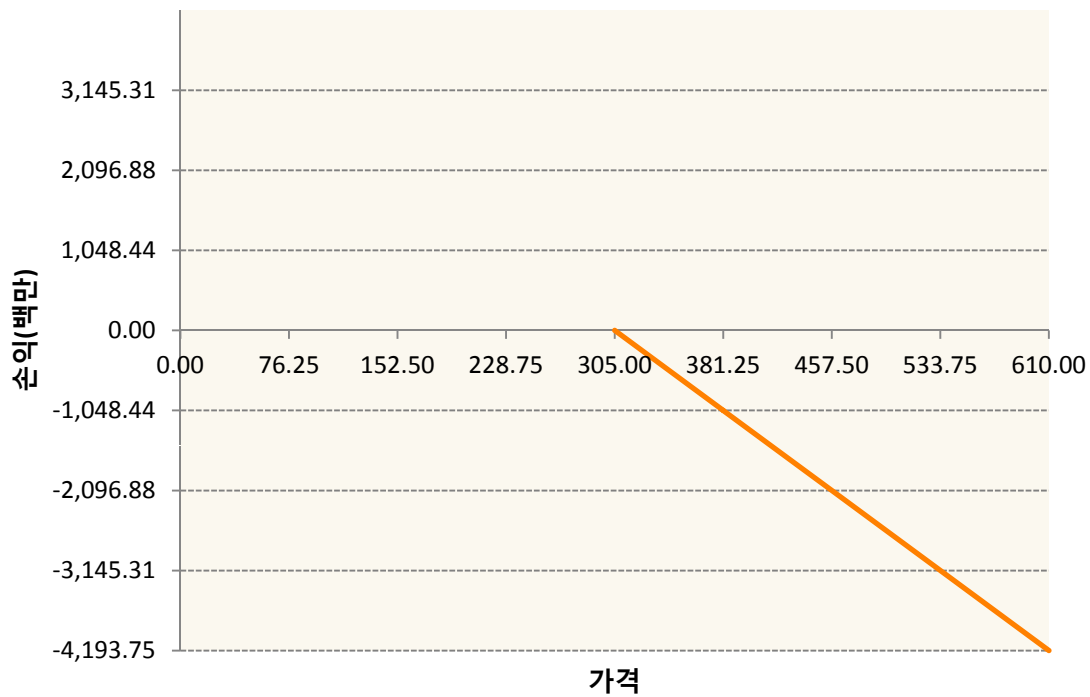


KR4201Q73029-2020-07 콜302.5

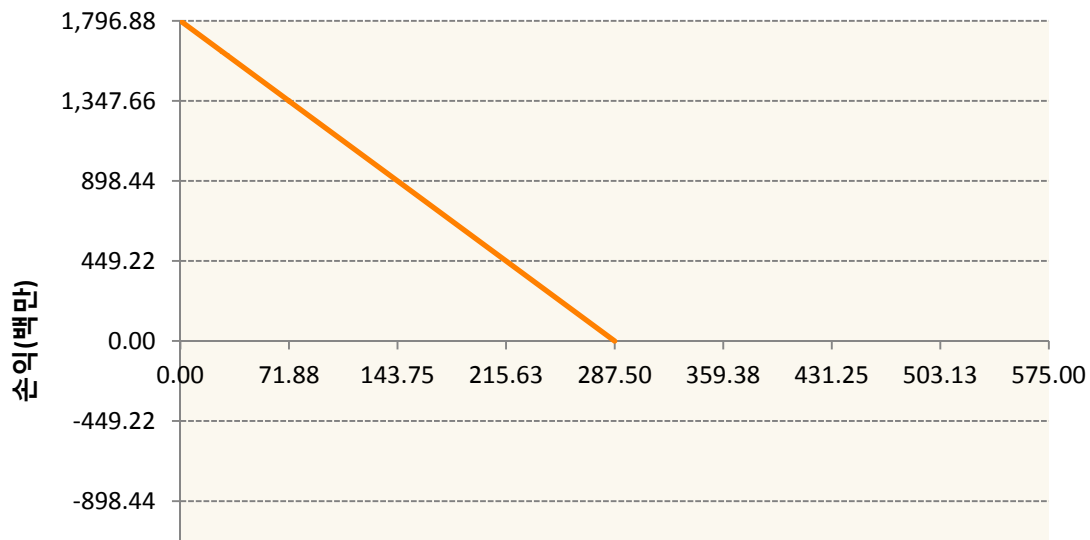


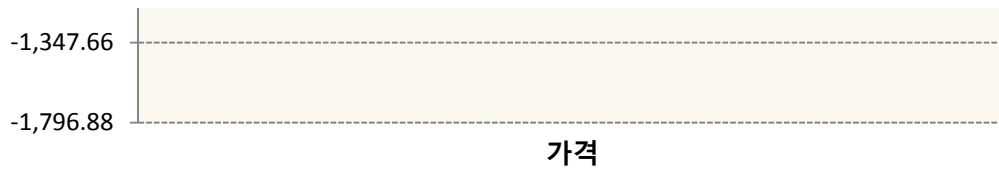
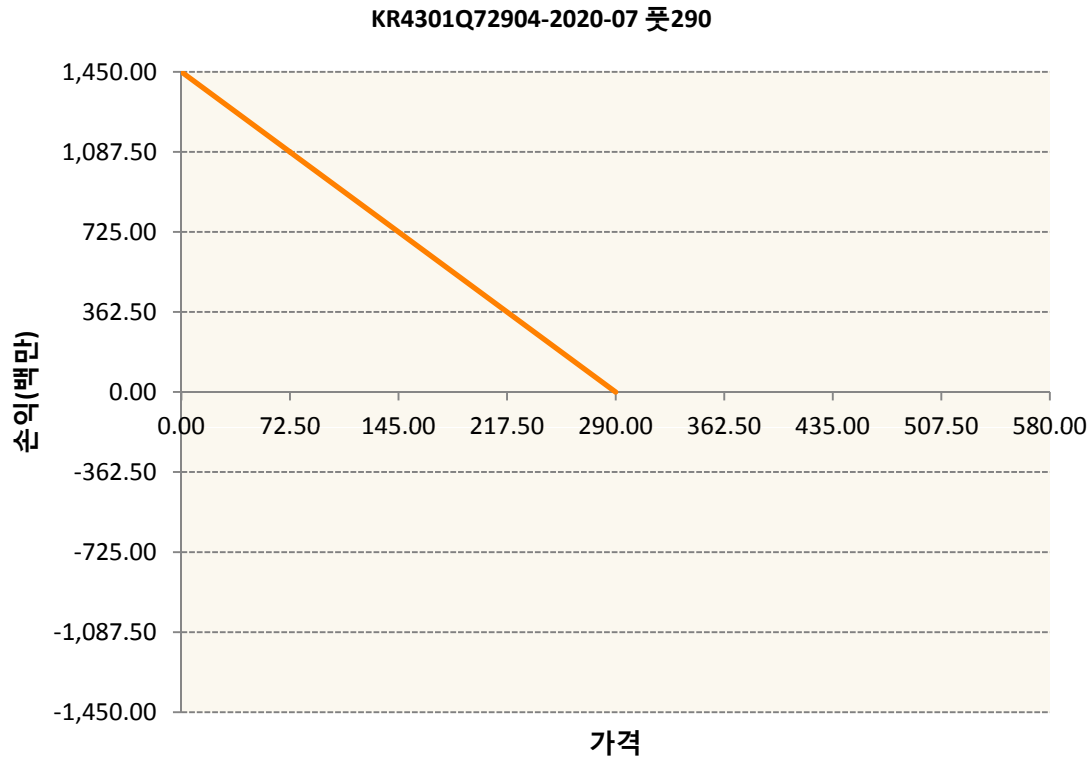


KR4201Q73052-2020-07 콜305



KR4301Q72870-2020-07 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q90009			2020-09 코스피200지수선물				791
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-791	-791	-791	-791	-791	-791	-791
-5.33%	-528	-528	-528	-528	-528	-528	-528
-2.67%	-264	-264	-264	-264	-264	-264	-264
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	264	264	264	264	264	264	264
5.33%	528	528	528	528	528	528	528
8.00%	791	791	791	791	791	791	791
KR4201Q73029			2020-07 콜302.5				648
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	274	260	241	219	194	165	135
-5.33%	249	226	199	169	136	100	62
-2.67%	206	173	136	97	56	13	-32

0%	136	92	47	0	-48	-98	-148
2.67%	32	-20	-73	-126	-180	-235	-290
5.33%	-111	-168	-226	-283	-341	-398	-456
8.00%	-296	-354	-413	-472	-530	-589	-648
KR4201Q73052 2020-07 콜305							173
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	69	66	61	55	49	42	33
-5.33%	63	58	51	43	34	25	15
-2.67%	53	45	35	25	14	2	-10
0%	36	25	13	0	-13	-26	-40
2.67%	10	-4	-18	-33	-47	-62	-77
5.33%	-26	-42	-58	-74	-90	-106	-122
8.00%	-74	-90	-107	-123	-140	-156	-173
KR4301Q72870 2020-07 풋287.5							112
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	98	99	101	103	106	109	112
-5.33%	55	58	61	64	68	72	75
-2.67%	17	21	25	29	34	38	43
0%	-15	-10	-5	0	5	10	15
2.67%	-39	-34	-29	-24	-19	-14	-8
5.33%	-56	-52	-47	-42	-37	-32	-27
8.00%	-67	-63	-59	-55	-51	-47	-42
KR4301Q72904 2020-07 풋290							92
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	82	83	85	86	88	90	92
-5.33%	47	49	52	54	57	59	62
-2.67%	16	19	22	25	28	32	35
0%	-12	-8	-4	0	4	8	12
2.67%	-33	-29	-25	-21	-16	-12	-8
5.33%	-48	-45	-41	-37	-33	-28	-24
8.00%	-59	-55	-52	-48	-45	-41	-37

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

(단위:백만원)

1,981

공시일	2020-06-17
기준일	2020-06-16

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	2,370	-2,370	
누계	유가증권	수익증권	152,557	0	152,557	

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	2020-06-17
기준일	2020-06-16

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	1,185	-1,185	
누계	유가증권	수익증권	101,443	0	101,443	

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	2020-06-17
기준일	2020-06-16

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	461,471	0	461,471	
누계	통화	선도	0	448,354	-448,354	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J027 KRW/USD 22-06-20E	1,487
FX21020J028 KRW/USD 22-06-20E	1,932
FX21020J039 KRW/USD 24-07-20E	2,173
FX21020J043 KRW/USD 24-07-20E	1,738
FX21020J043 KRW/USD 24-07-20E	1,932
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	6,857
FX21020M00 KRW/USD 26-08-20E	579
FX21020M01 KRW/USD 26-08-20E	4,732
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	2,009
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	2,434

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

18,542

공시일	2020-06-17
기준일	2020-06-16

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

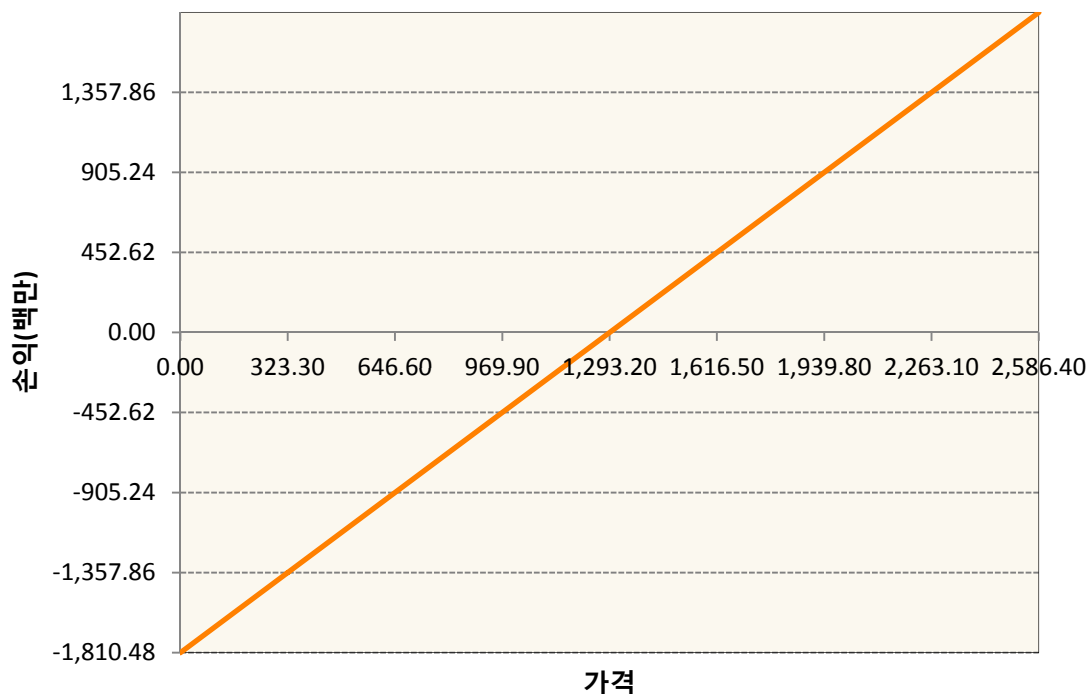
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,810	0	1,810	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4108Q90004-2020-09 KRX300 선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4108Q90004 2020-09 KRX300 선물							146
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-146	-146	-146	-146	-146	-146	-146
-5.33%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98
-2.67%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	49	49	49	49	49	49	49
5.33%	98	98	98	98	98	98	98
8.00%	146	146	146	146	146	146	146

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

(단위:백만원)

231

공시일	2020-06-17
기준일	2020-06-16

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	7,606	0	7,606	
누계	통화	선도	0	7,497	-7,497	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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
FX21020M00 KRW/USD 20-07-20E	10
FX21020M02 KRW/USD 20-07-20E	14
FX21020M03 KRW/USD 06-07-20E	48
FX21020M03 KRW/USD 15-07-20E	222
FX21020M03 KRW/USD 20-07-20E	56
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

310

공시일	2020-06-17
기준일	2020-06-16

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

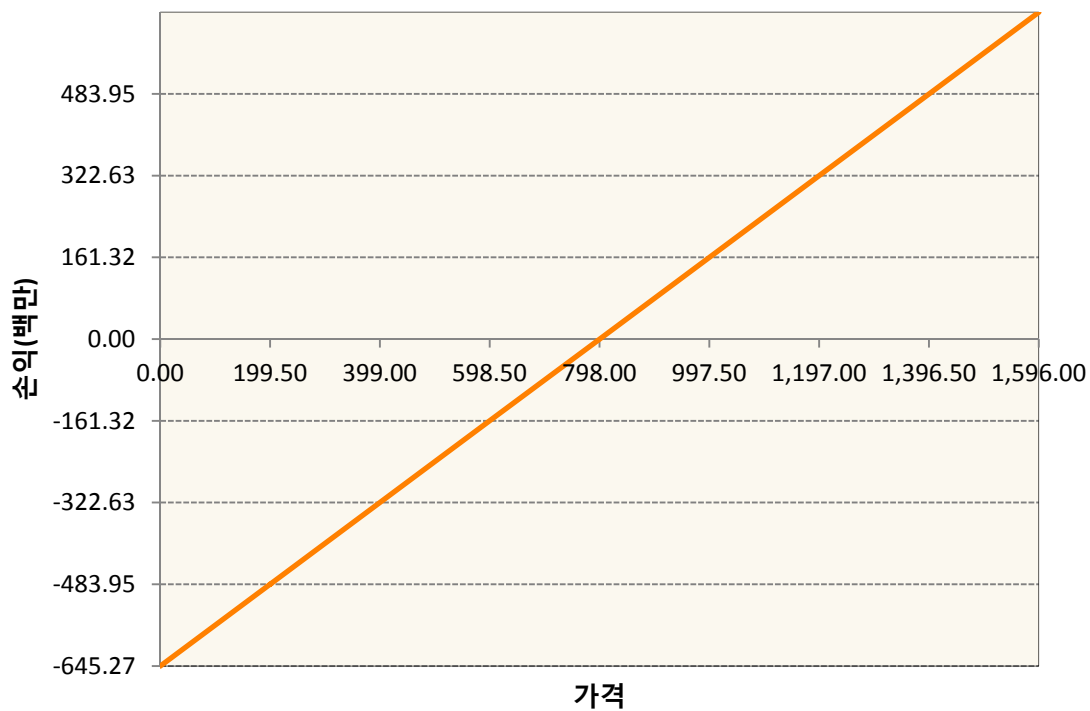
1. 계약금액

(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	645	0	645	
누계	유가증권	스왑	993	0	993	장외
누계	통화	선도	211	895	-684	장외

2. 만기시점의 손익구조

VN30-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	52

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	174

공시일	2020-06-17
기준일	2020-06-16

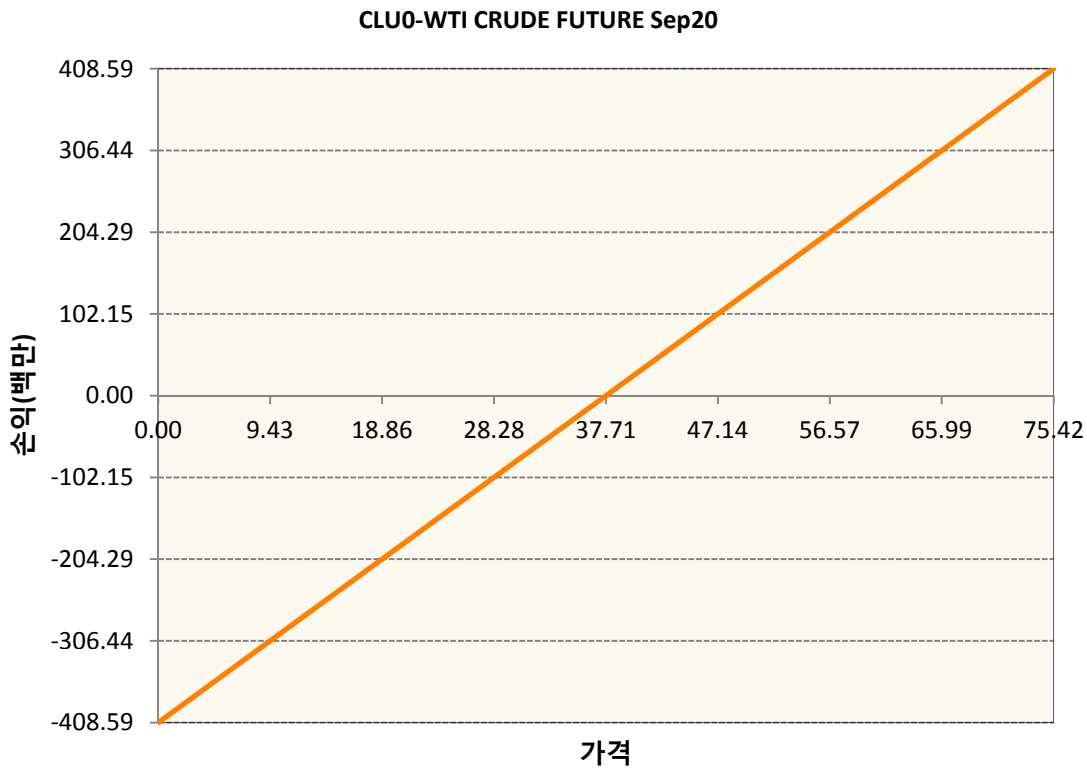
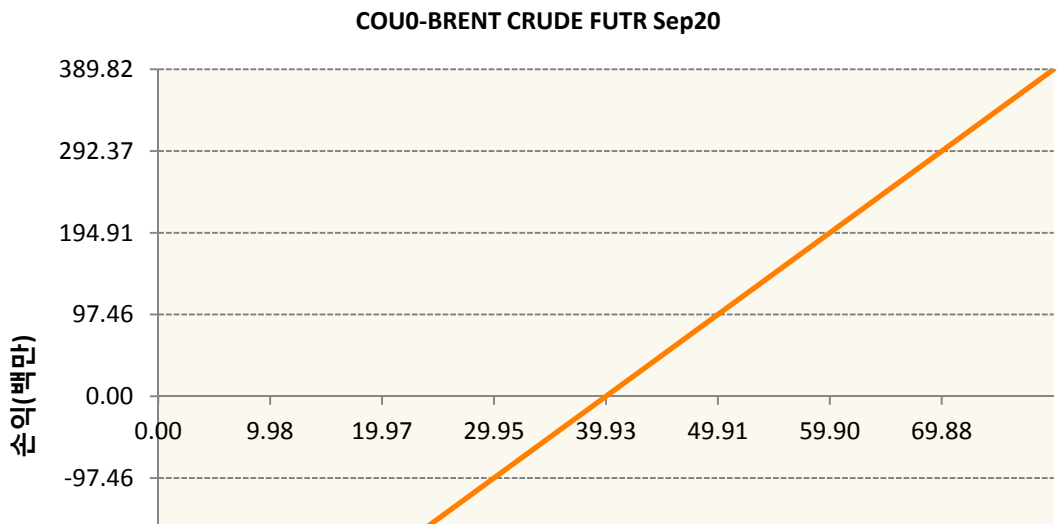
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

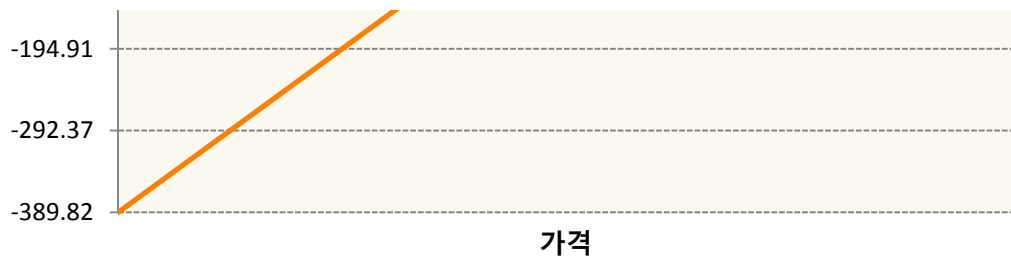
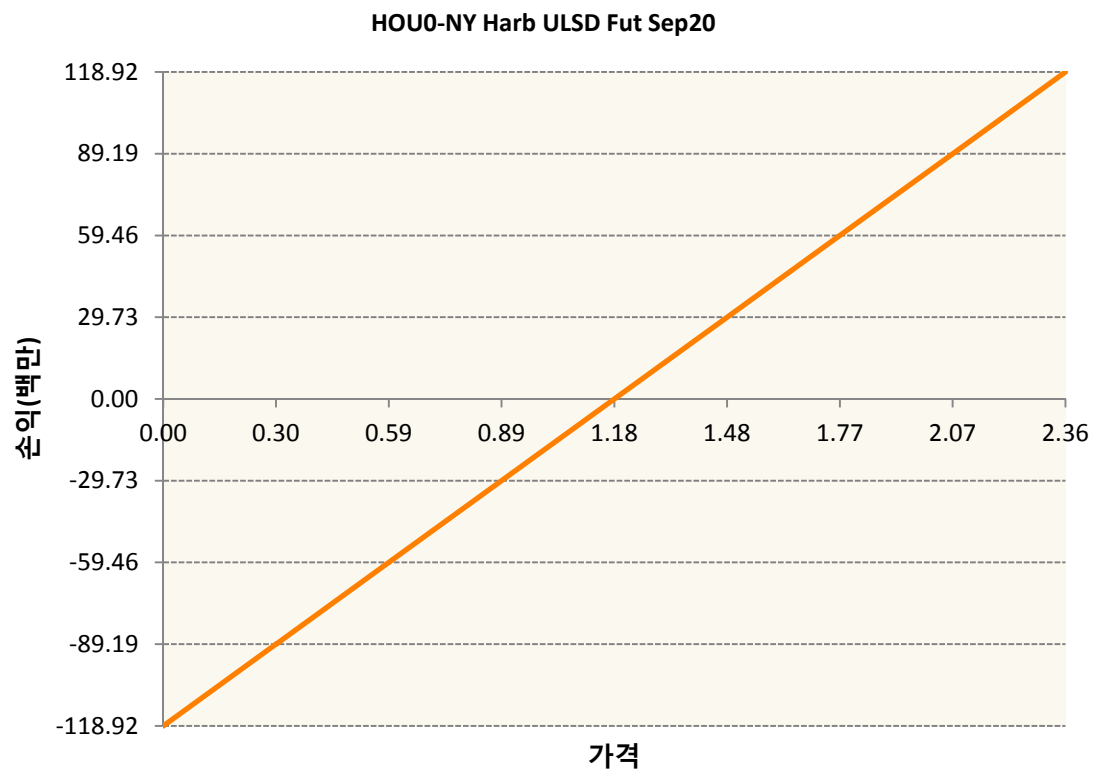
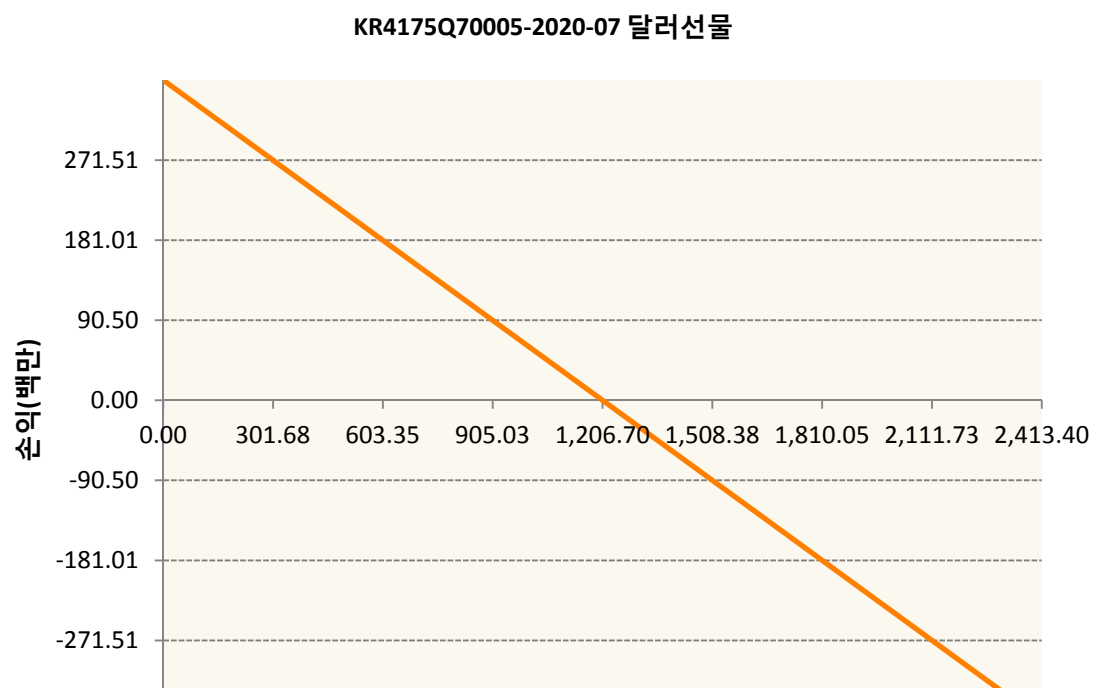
1. 계약금액

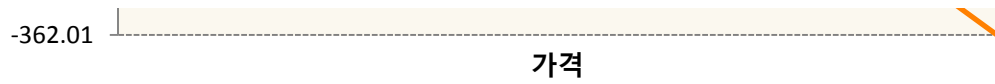
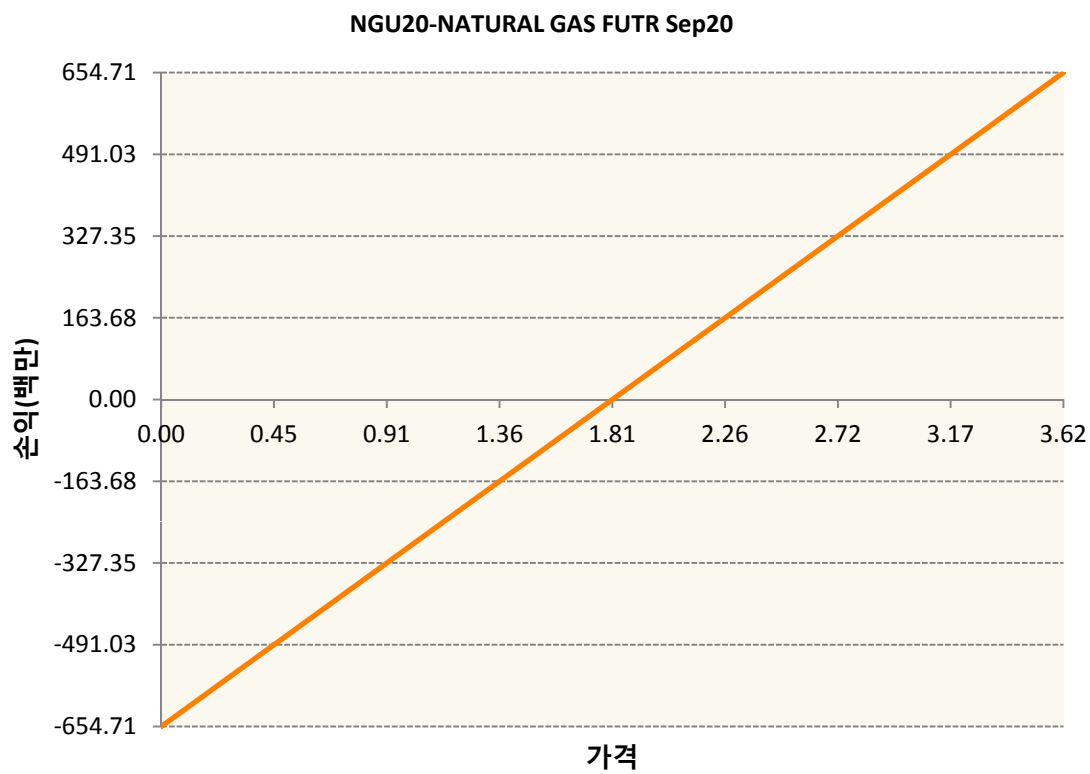
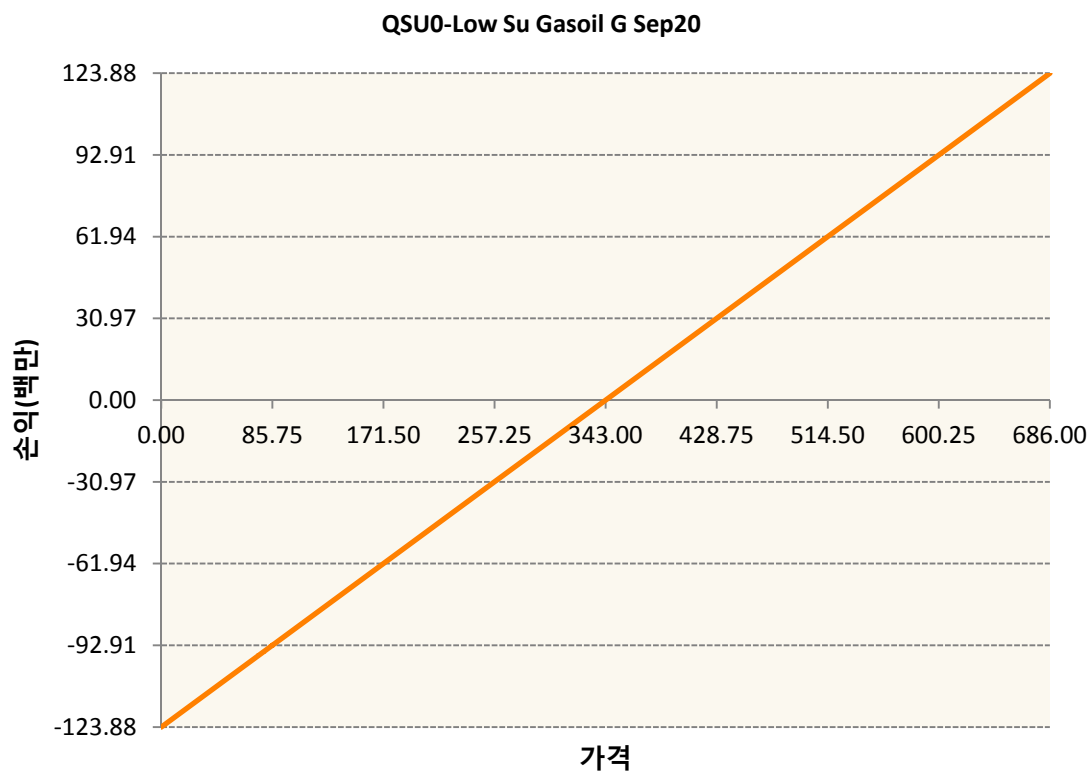
(단위:백만원)

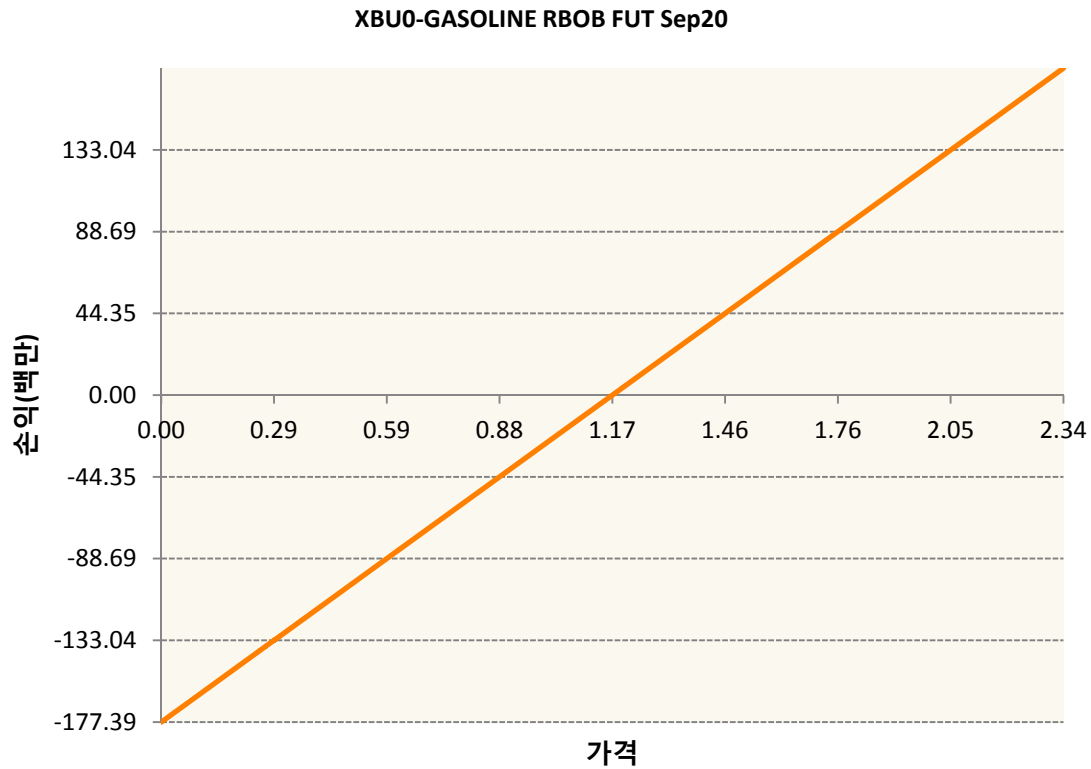
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,873	362	1,511	

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLU0	WTI CRUDE FUTURE Sep20		33
COU0	BRENT CRUDE FUTR Sep20		31
HOU0	NY Harb ULSD Fut Sep20		10
KR4175Q70C 2020-07 달러선물			29
NGU20	NATURAL GAS FUTR Sep20		52
QSU0	Low Su Gasoil G Sep20		10
XBU0	GASOLINE RBOB FUT Sep20		14

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	947

공시일	2020-06-17
기준일	2020-06-16

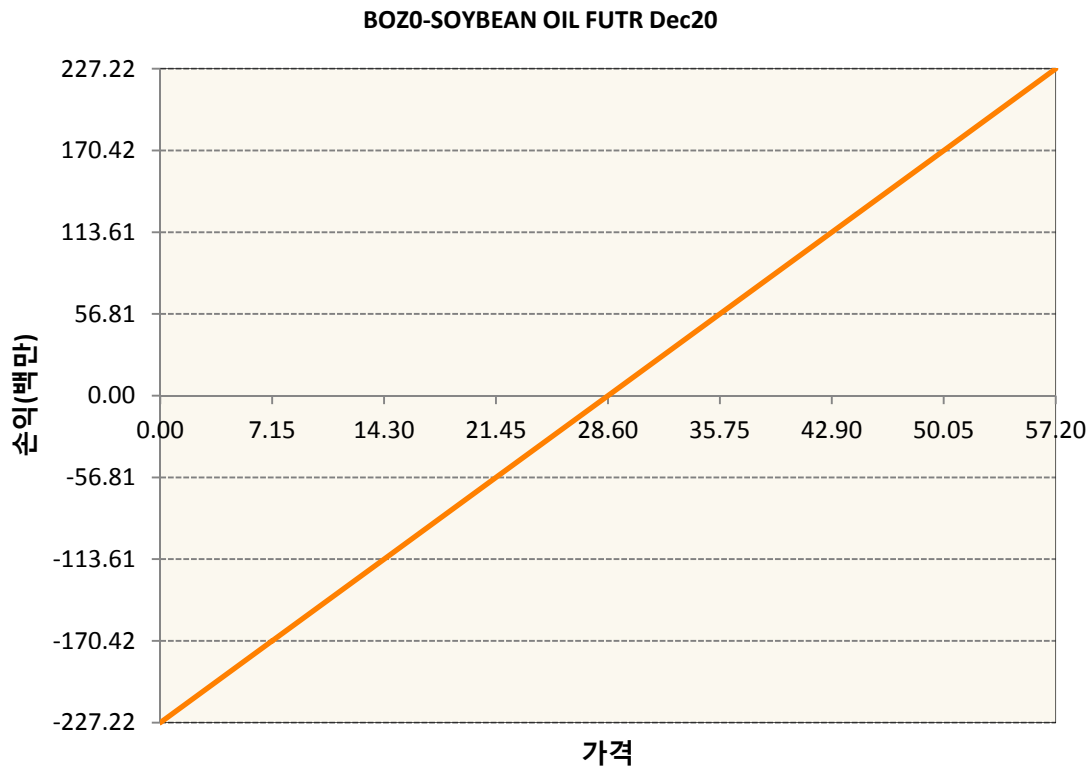
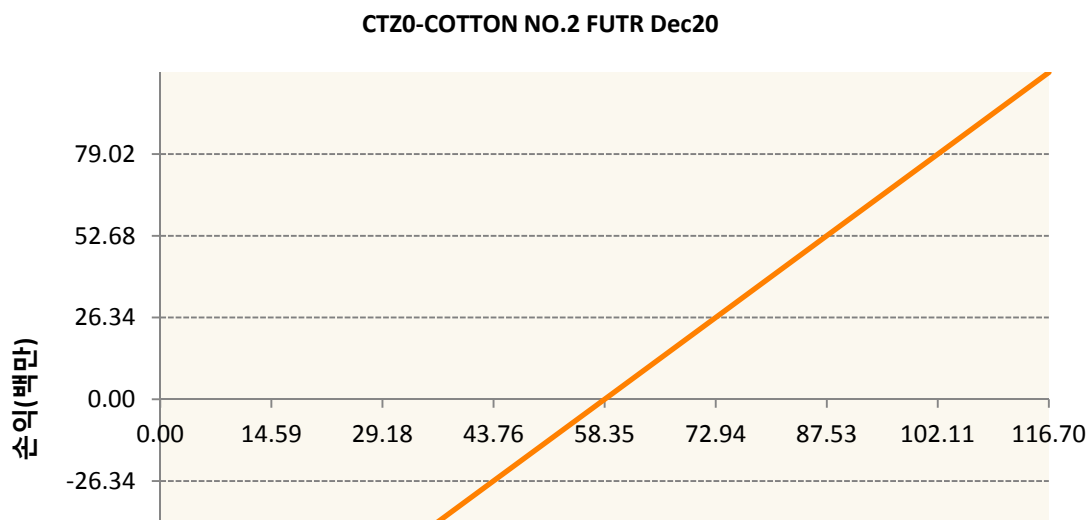
애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

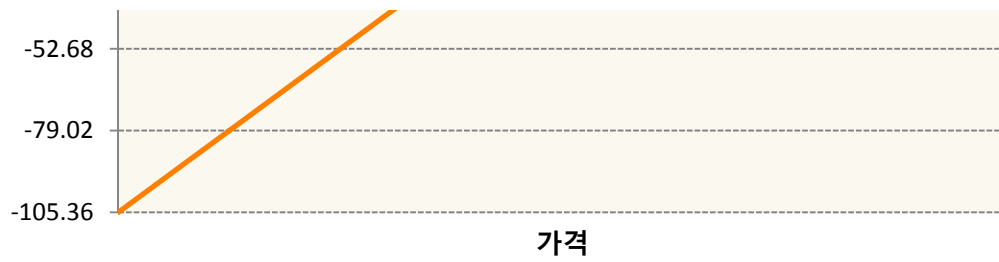
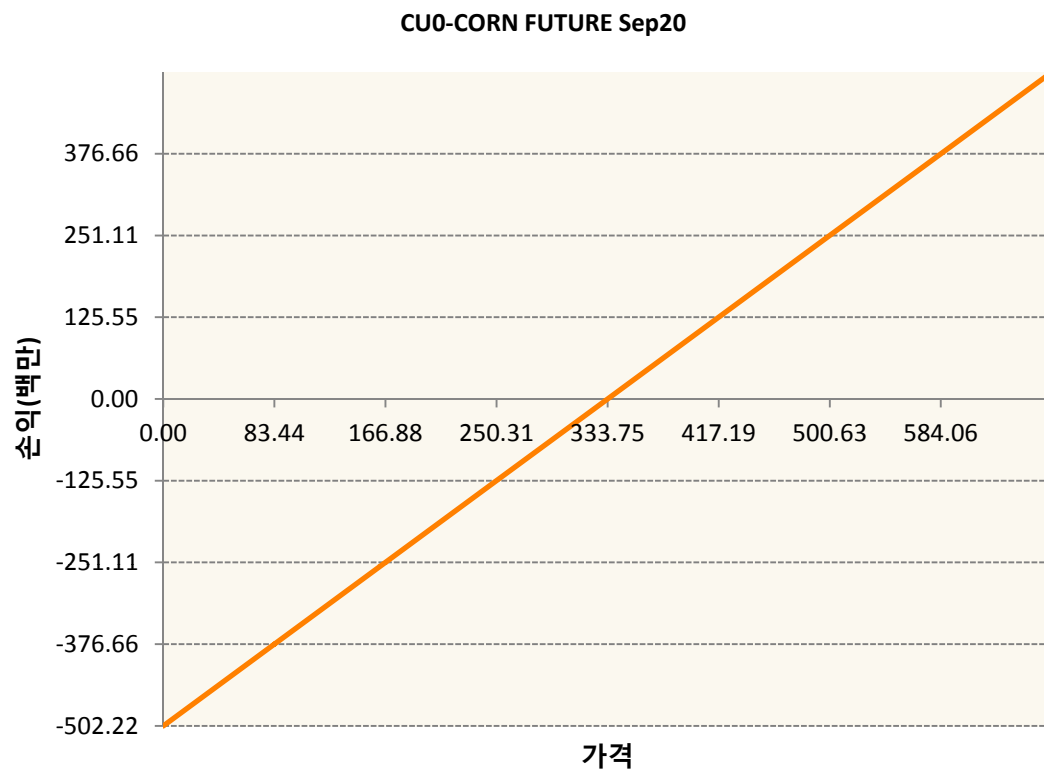
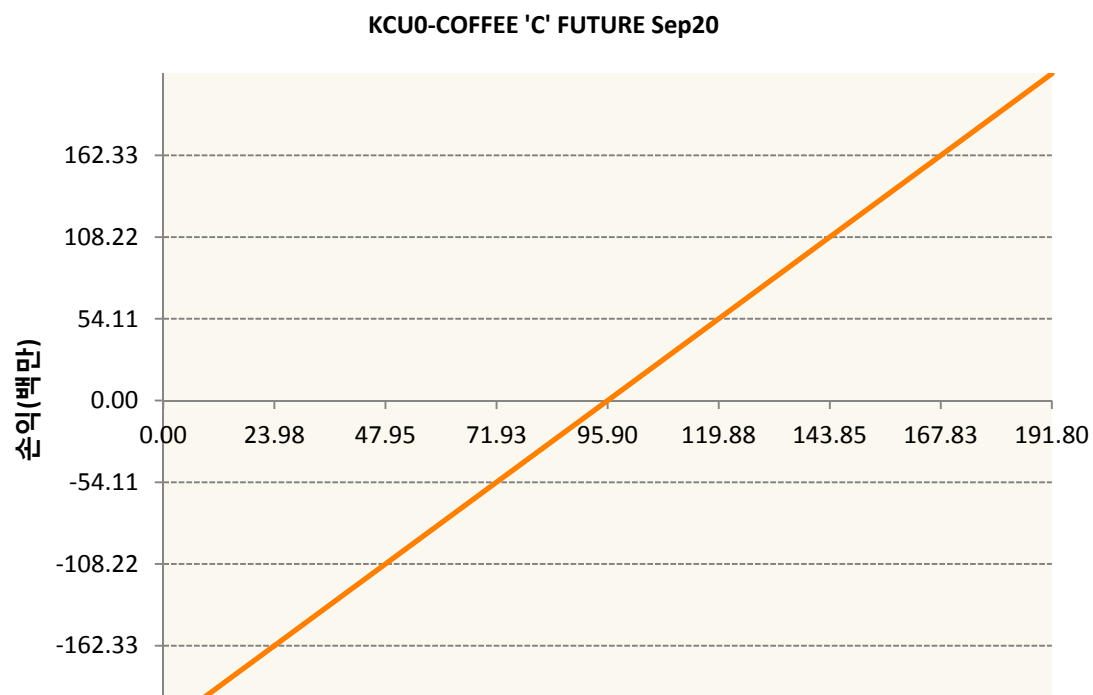
1. 계약금액

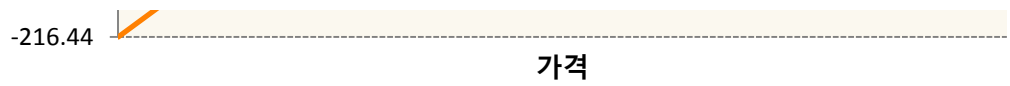
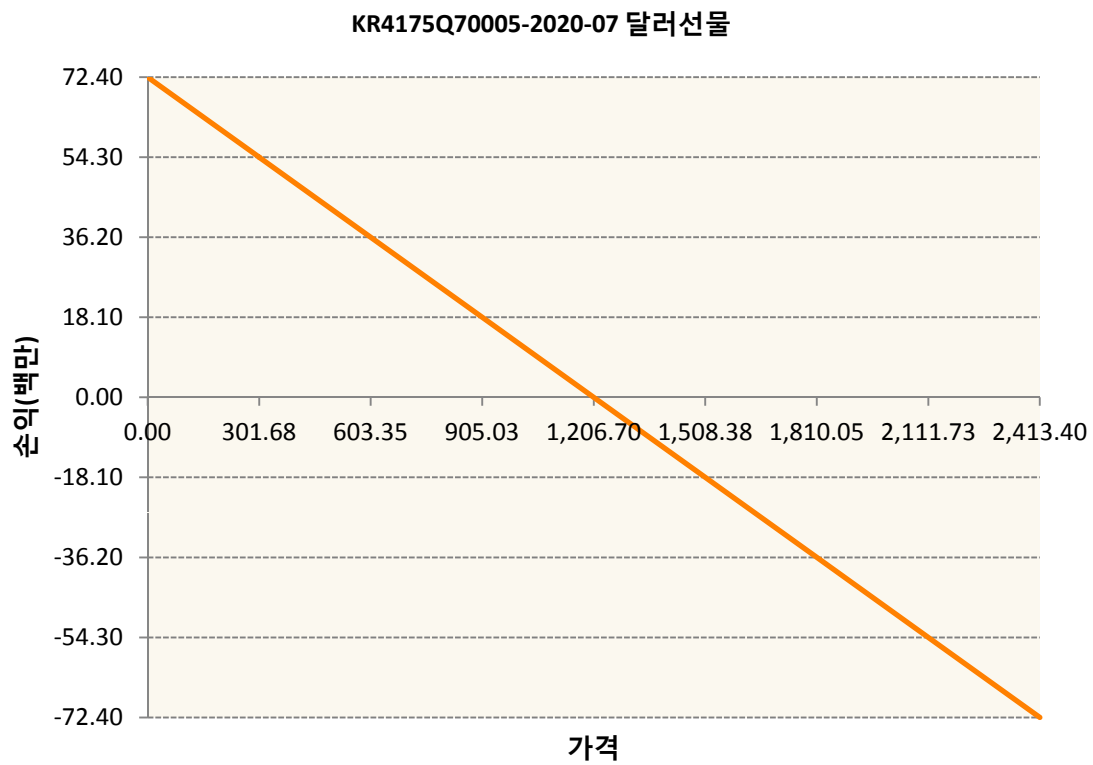
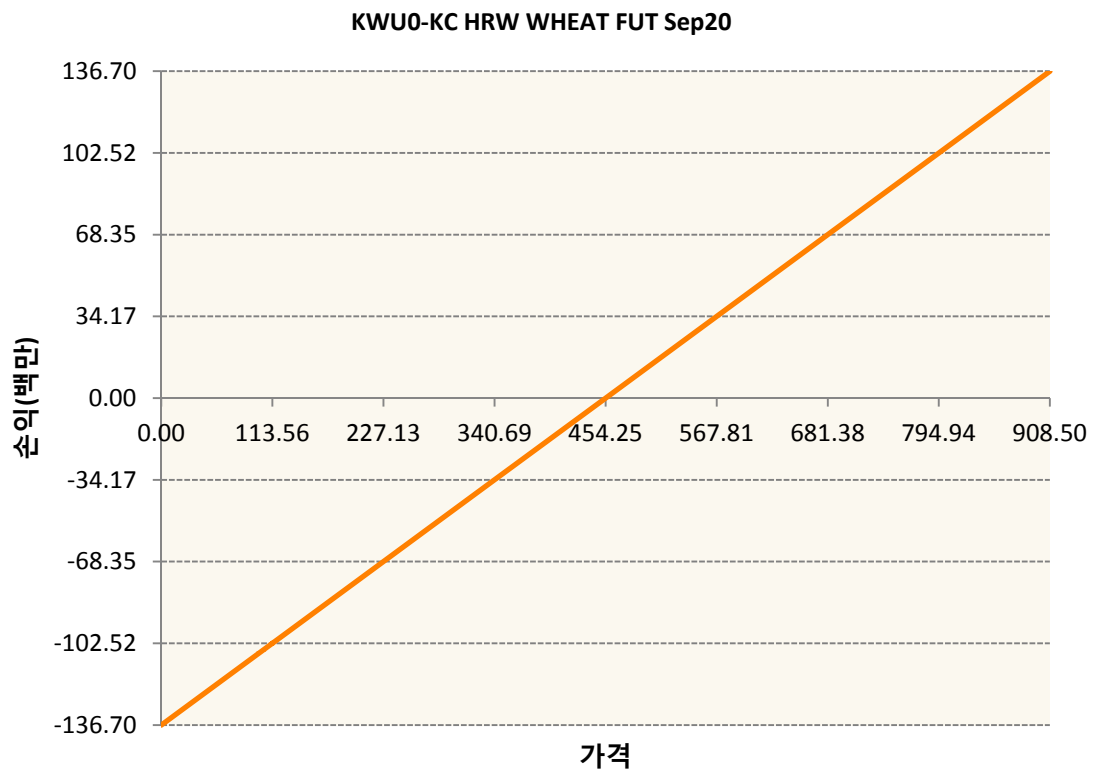
(단위:백만원)

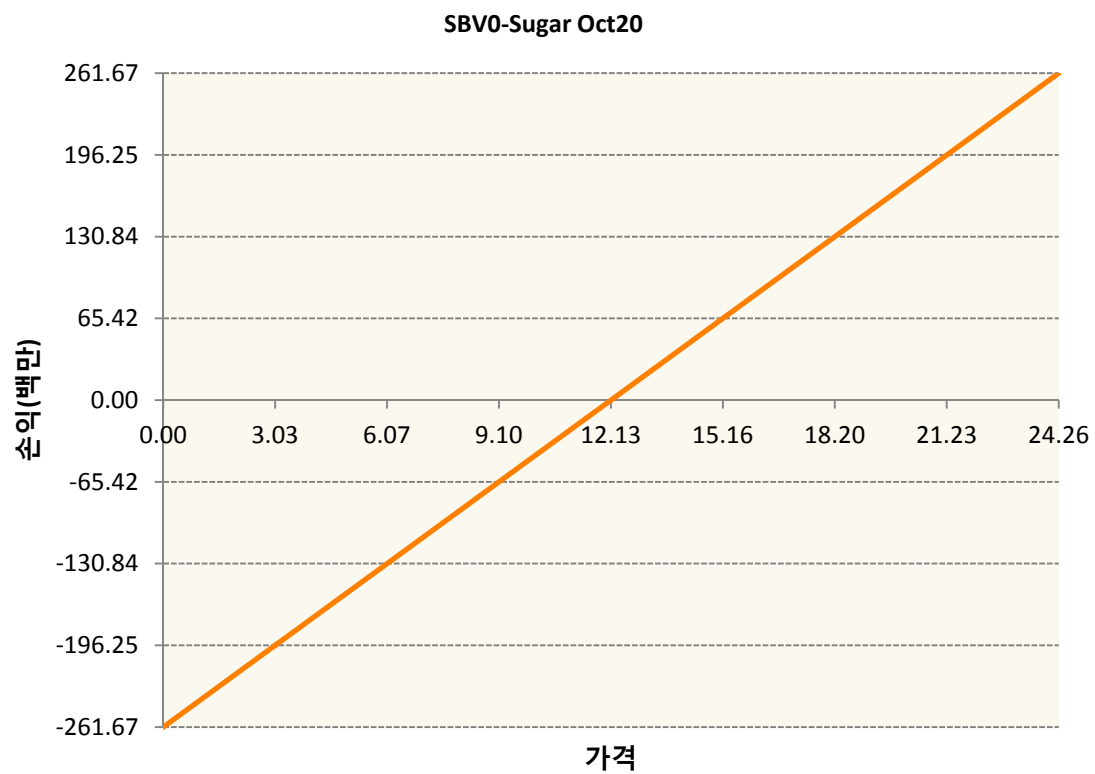
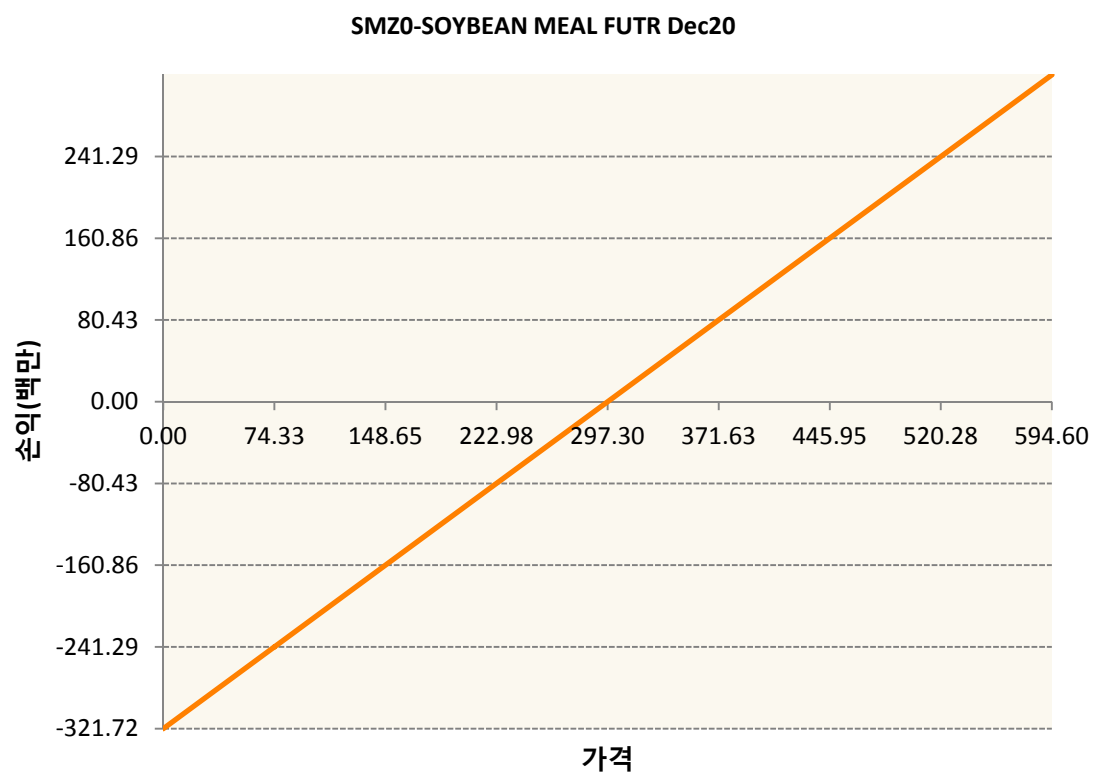
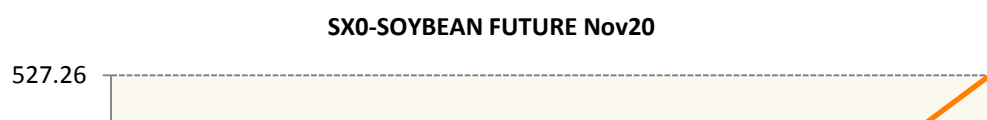
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,575	72	2,502	

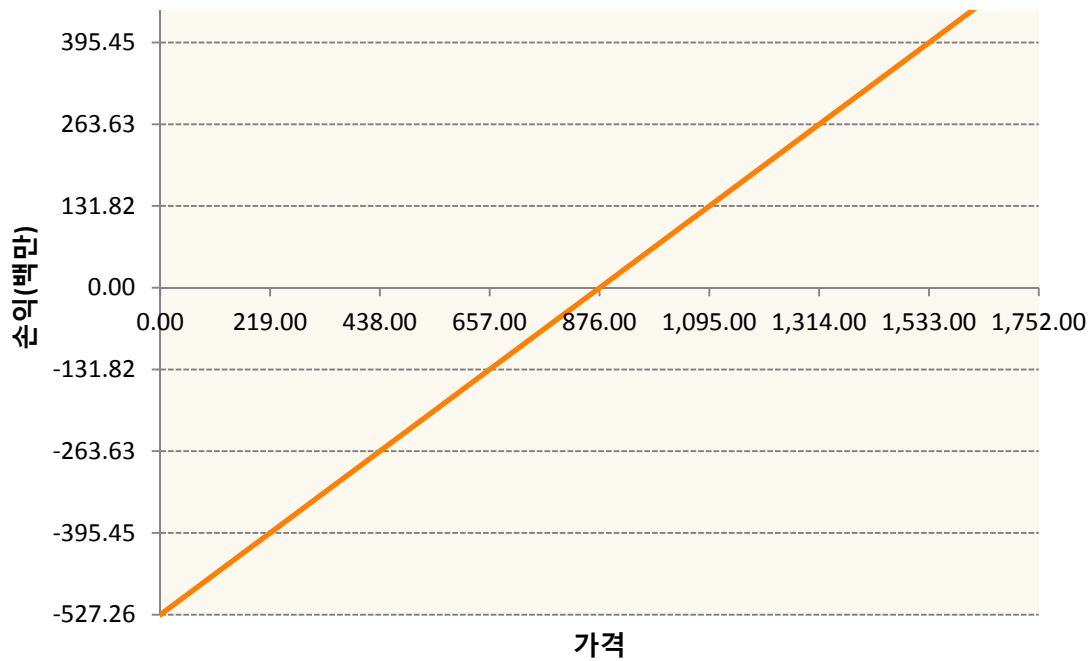
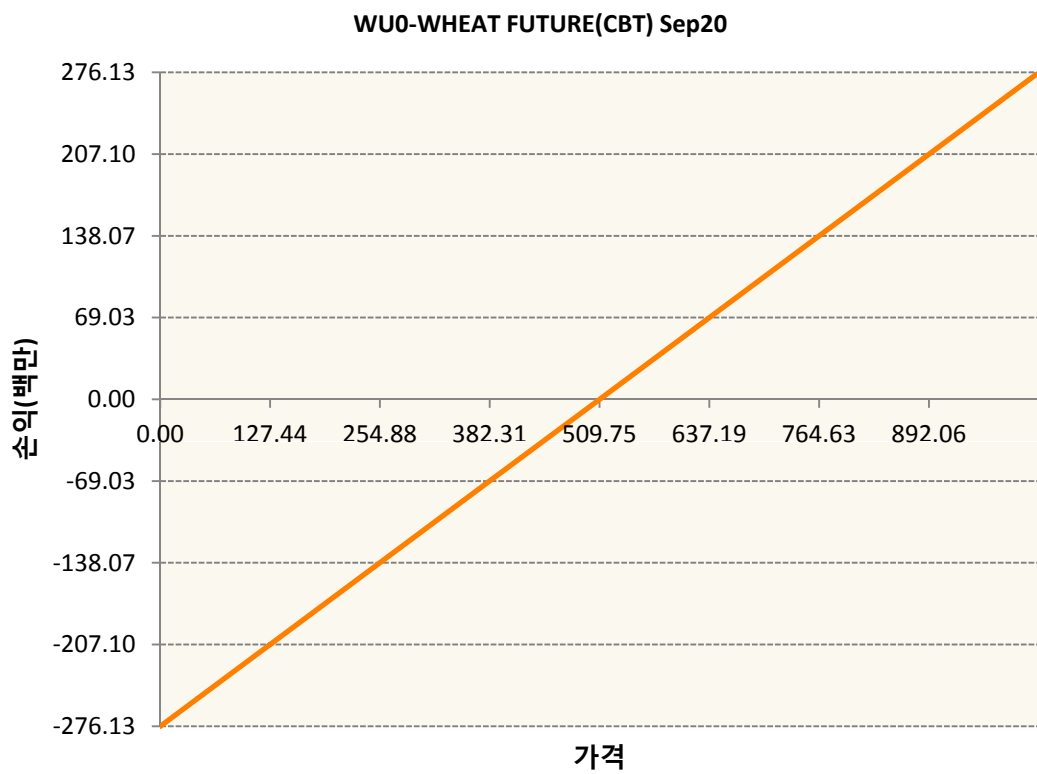
2. 만기시점의 손익구조











3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ0	SOYBEAN OIL FUTR Dec20	18
CTZ0	COTTON NO.2 FUTR Dec20	8
CU0	CORN FUTURE Sep20	40
KCU0	COFFEE 'C' FUTURE Sep20	17
KR4175Q70C 2020-07 달러선물		6

KWU0	KC HRW WHEAT FUT Sep20	11
SBV0	Sugar Oct20	21
SMZ0	SOYBEAN MEAL FUTR Dec20	26
SX0	SOYBEAN FUTURE Nov20	42
WU0	WHEAT FUTURE(CBT) Sep20	22

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

(단위:백만원)

241