

공시일	2020-06-19
기준일	2020-06-18

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	2020-06-19
기준일	2020-06-18

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 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,280

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-06-19
기준일	2020-06-18

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

598

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

872

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-06-19
기준일	2020-06-18

유로인덱스모(주식-파생형)

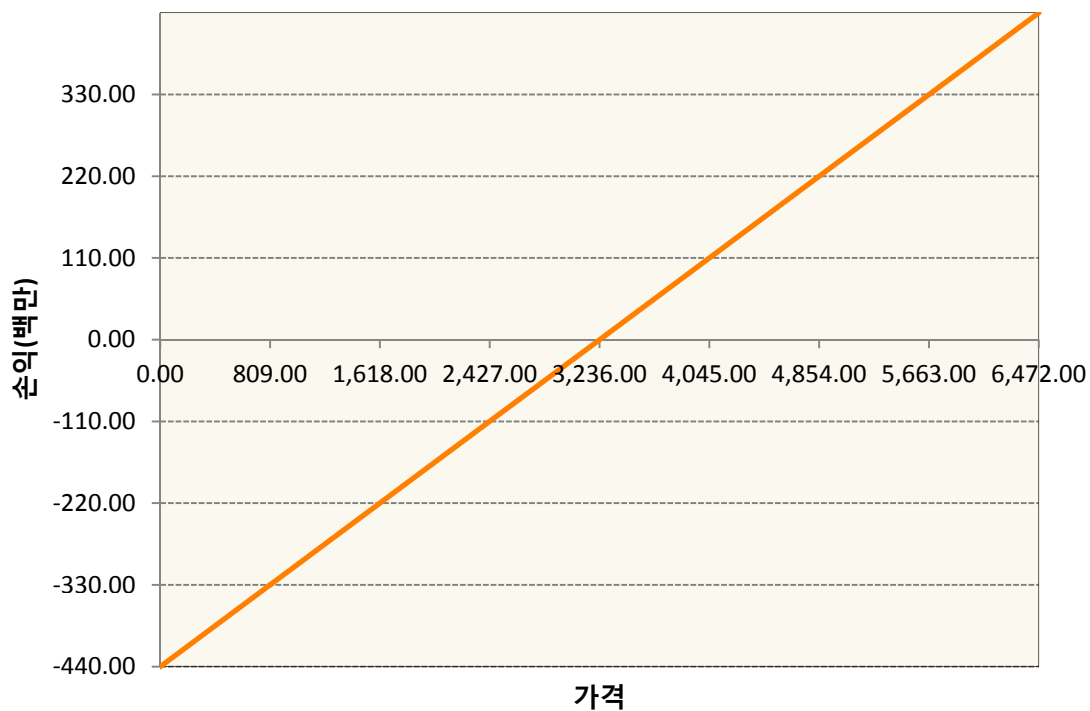
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	440	0	440	

2. 만기시점의 손익구조

VGU0-EURO STOXX 50 Sep20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU0 EURO STOXX 50 Sep20

35

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

(단위:백만원)

47

공시일	2020-06-19
기준일	2020-06-18

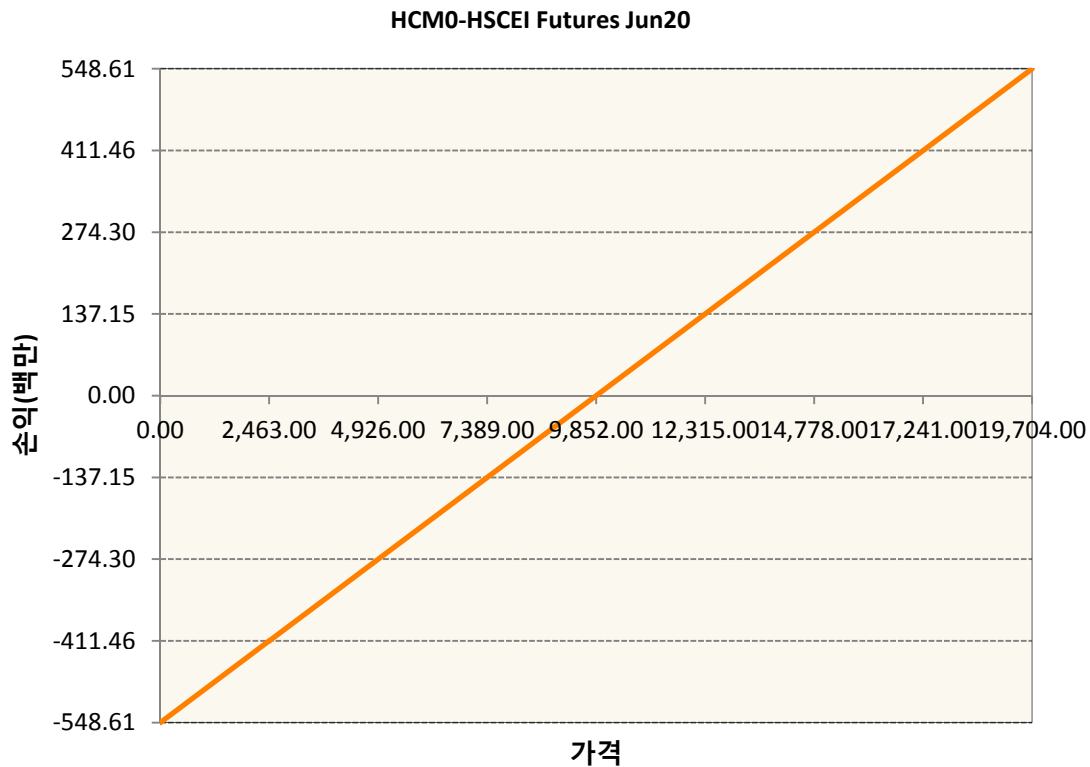
차이나인덱스모(주식-파생형)

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



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

48

공시일	2020-06-19
기준일	2020-06-18

커버드콜모(주식혼합-파생형)

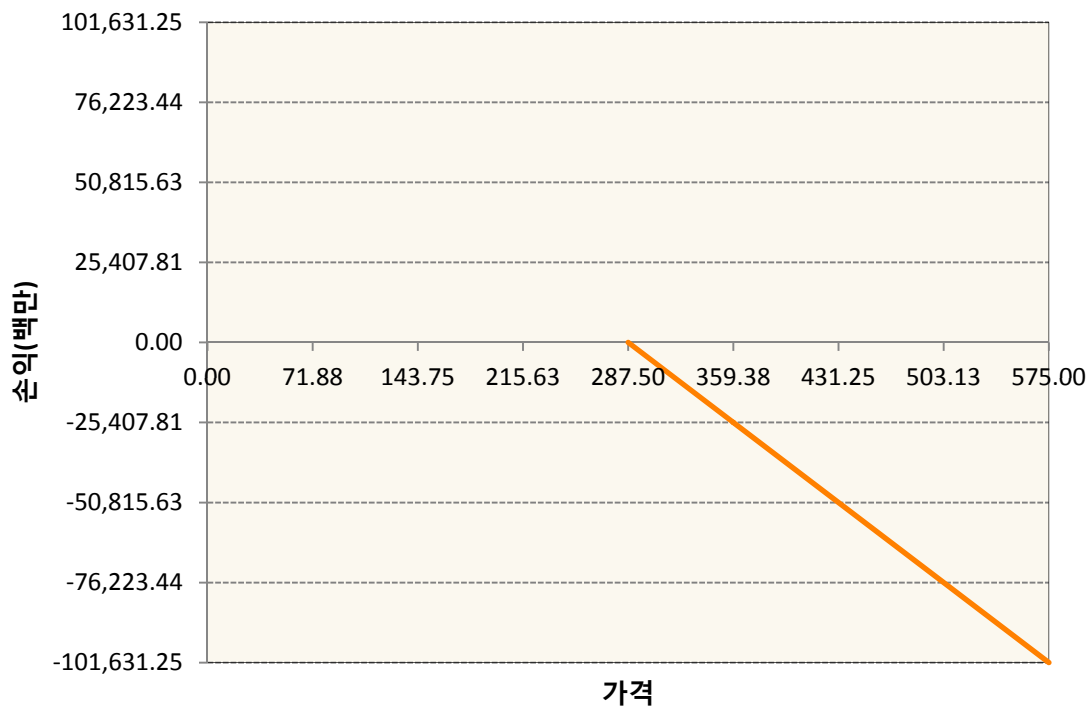
1. 계약금액

(단위:백만원)

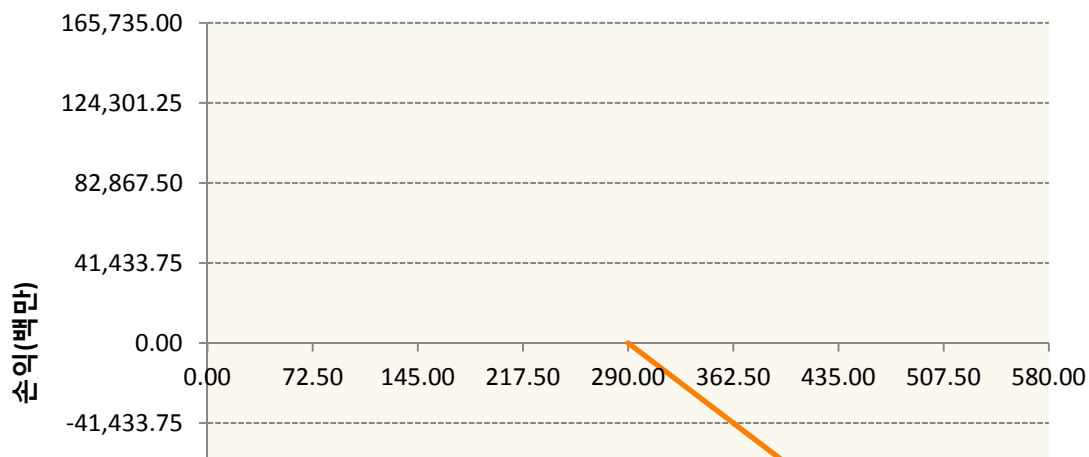
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	367,991	-367,991	장내

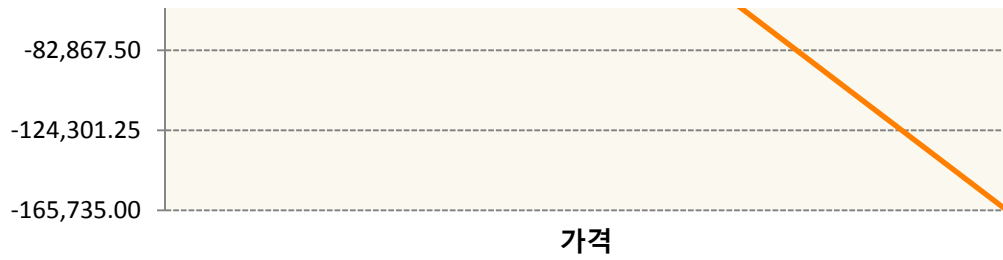
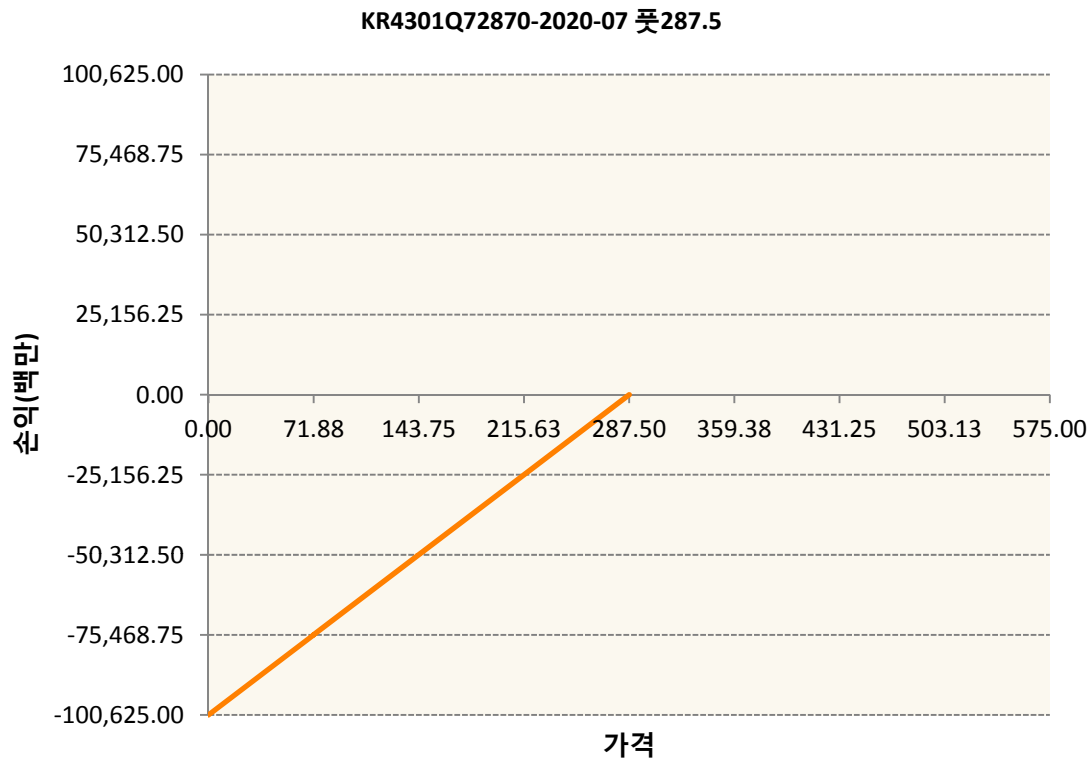
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q72872-2020-07 콜287.5



KR4201Q72906-2020-07 콜290





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q72872			2020-07 콜287.5				5,749
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,212	3,017	2,798	2,558	2,302	2,033	1,751
-5.33%	2,780	2,511	2,226	1,927	1,617	1,299	974
-2.67%	2,104	1,771	1,429	1,081	728	371	11
0%	1,137	759	380	0	-381	-763	-1,145
2.67%	-147	-539	-930	-1,321	-1,713	-2,104	-2,495
5.33%	-1,744	-2,118	-2,497	-2,878	-3,262	-3,647	-4,034
8.00%	-3,623	-3,955	-4,300	-4,653	-5,013	-5,379	-5,749
KR4201Q72906			2020-07 콜290				8,980
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,774	4,490	4,165	3,805	3,415	3,001	2,565

-5.33%	4,174	3,773	3,339	2,880	2,401	1,905	1,395
-2.67%	3,214	2,700	2,169	1,624	1,068	504	-67
0%	1,807	1,209	607	0	-610	-1,222	-1,836
2.67%	-100	-737	-1,373	-2,009	-2,645	-3,281	-3,917
5.33%	-2,515	-3,140	-3,769	-4,400	-5,033	-5,667	-6,303
8.00%	-5,402	-5,972	-6,557	-7,152	-7,755	-8,365	-8,980
KR4301Q72870 2020-07 풋287.5							6,290
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,483	-5,573	-5,684	-5,814	-5,959	-6,118	-6,290
-5.33%	-3,101	-3,257	-3,431	-3,620	-3,820	-4,031	-4,250
-2.67%	-961	-1,187	-1,423	-1,666	-1,916	-2,170	-2,429
0%	838	561	281	0	-283	-566	-850
2.67%	2,234	1,941	1,648	1,355	1,062	769	476
5.33%	3,224	2,955	2,681	2,404	2,124	1,841	1,557
8.00%	3,861	3,645	3,415	3,175	2,926	2,671	2,409

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

(단위:백만원)

17,831

공시일	2020-06-19
기준일	2020-06-18

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

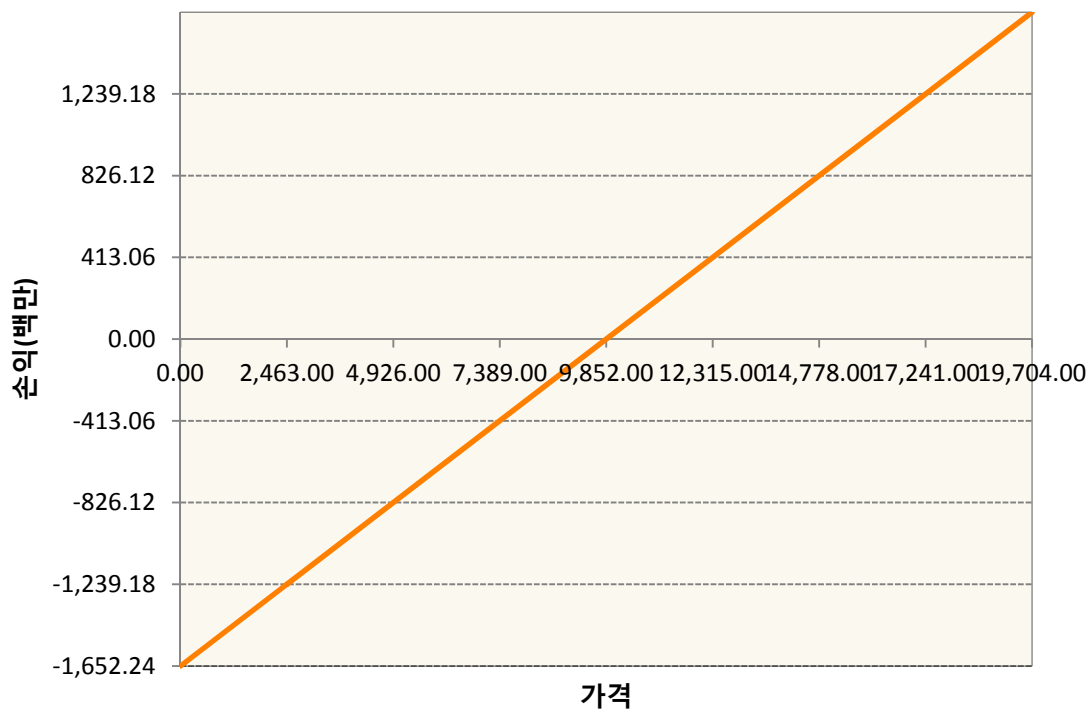
1. 계약금액

(단위:백만원)

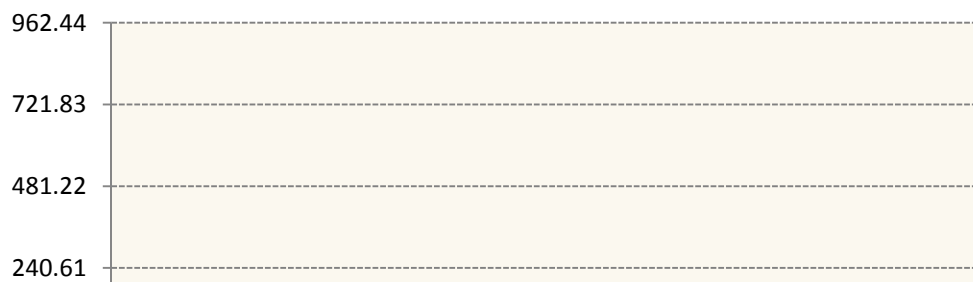
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,652	0	1,652	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,244	-4,244	장내
누계	통화	선도	0	1,509	-1,509	장외

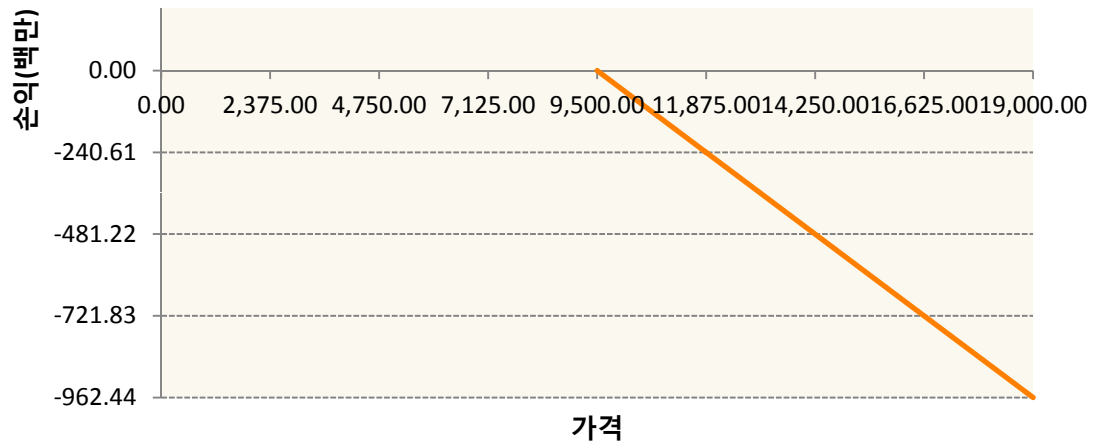
2. 만기시점의 손익구조

HCM0-HSCEI Futures Jun20

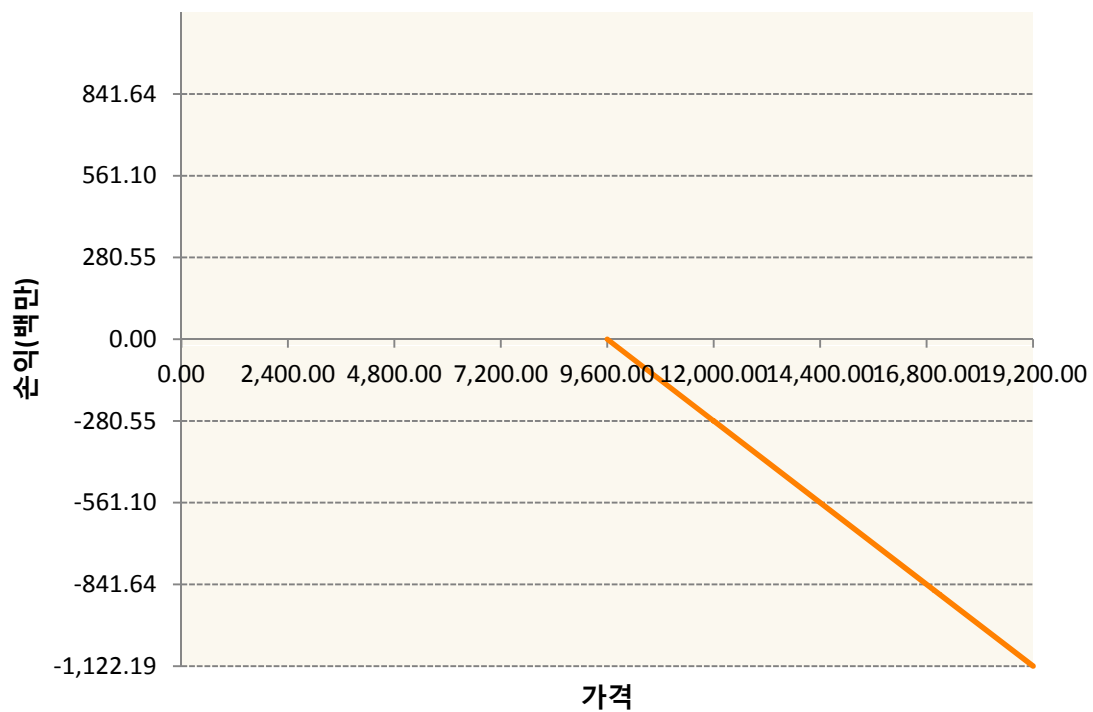


OHHIM0-C95-HSCEI

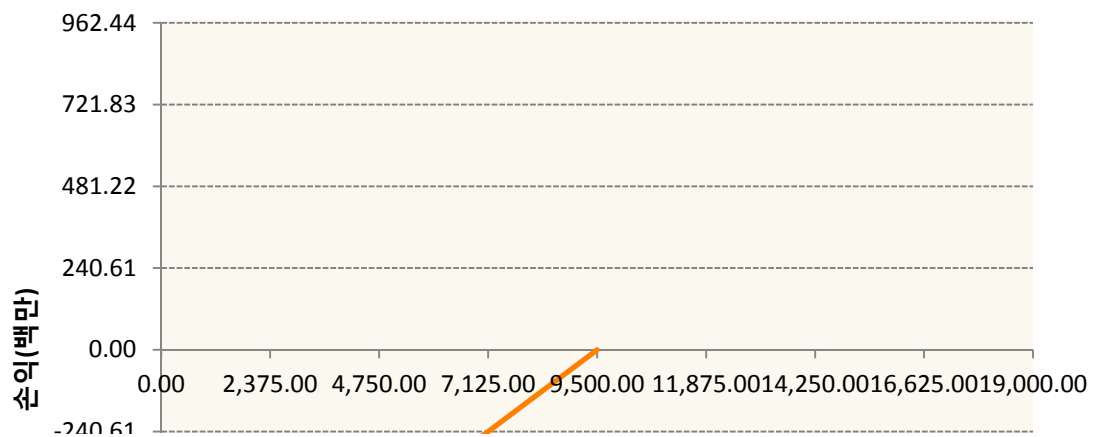


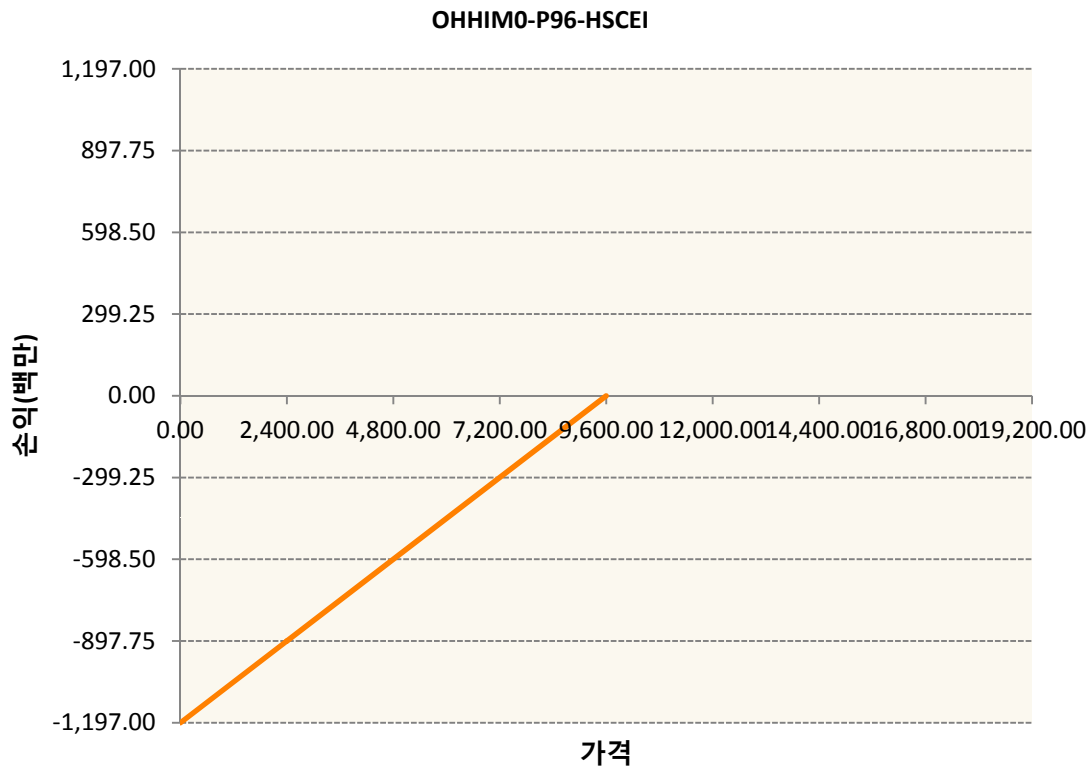


OHHIM0-C96-HSCEI



OHHIM0-P95-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E		121
HCM0 HSCEI Futures Jun20		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	2020-06-19
기준일	2020-06-18

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

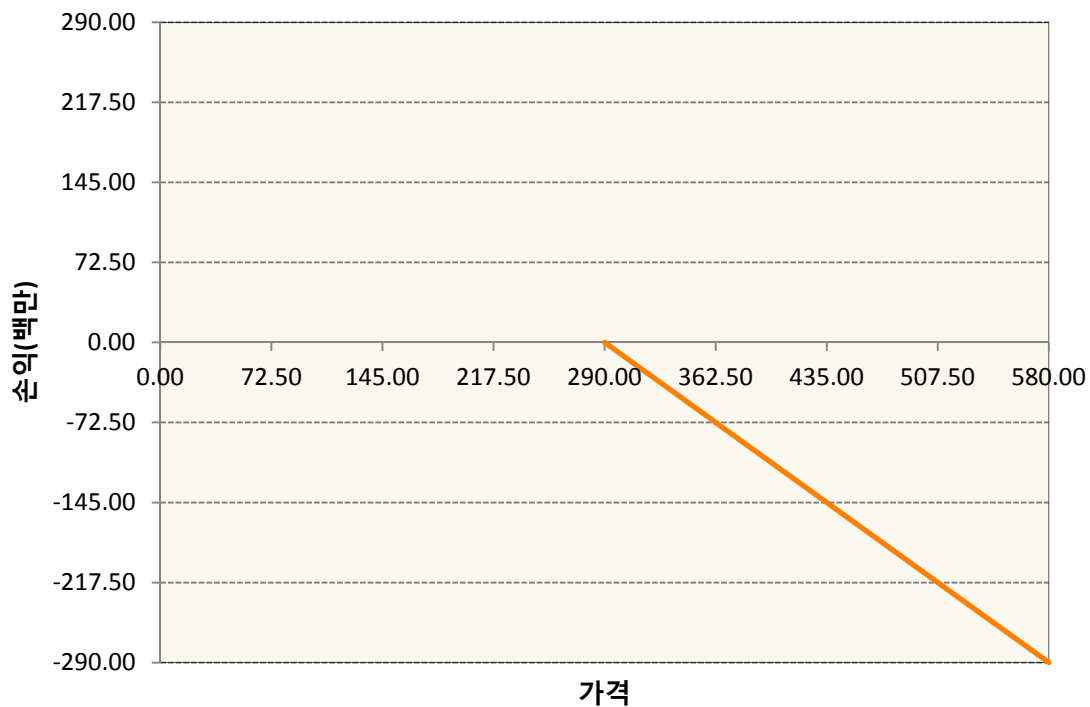
1. 계약금액

(단위:백만원)

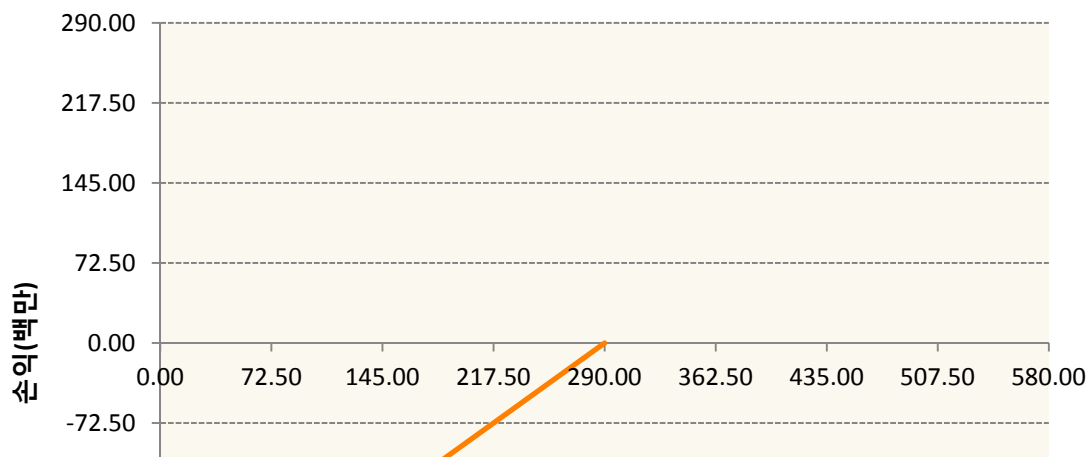
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	580	-580	장내

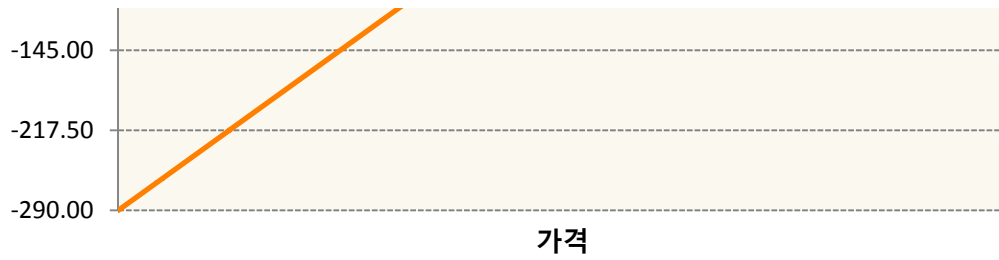
2. 만기시점의 손익구조

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%	8	8	7	7	6	5	4
-5.33%	7	7	6	5	4	3	2
-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	-5	-7	-8	-9	-10	-11
8.00%	-9	-10	-11	-13	-14	-15	-16
KR4301Q72904			2020-07 풋290				19
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-16	-17	-17	-17	-18	-18	-19
-5.33%	-10	-10	-10	-11	-11	-12	-13
-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	11	10	9	8	8

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

30

공시일	2020-06-19
기준일	2020-06-18

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

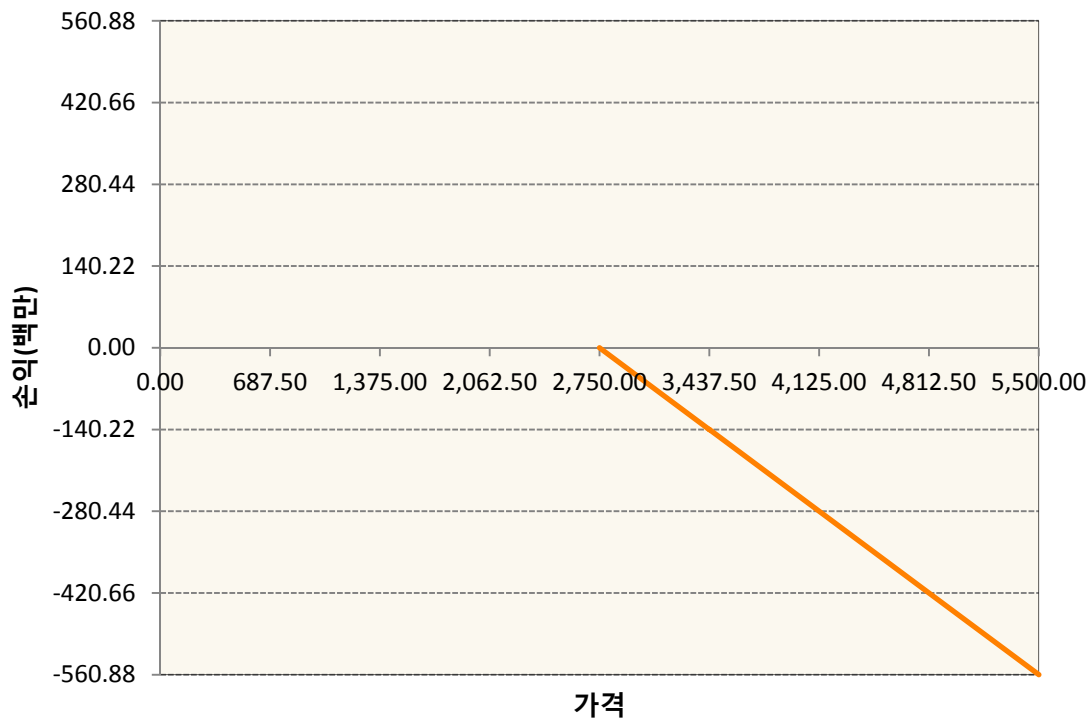
1. 계약금액

(단위:백만원)

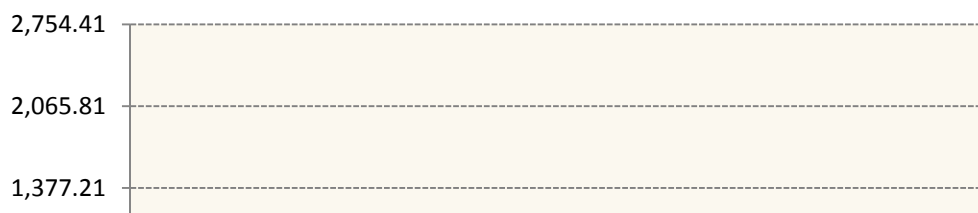
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,270	0	1,270	
누계	유가증권	스왑	8,110	0	8,110	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,668	-6,668	장내
누계	통화	선도	0	2,942	-2,942	장외

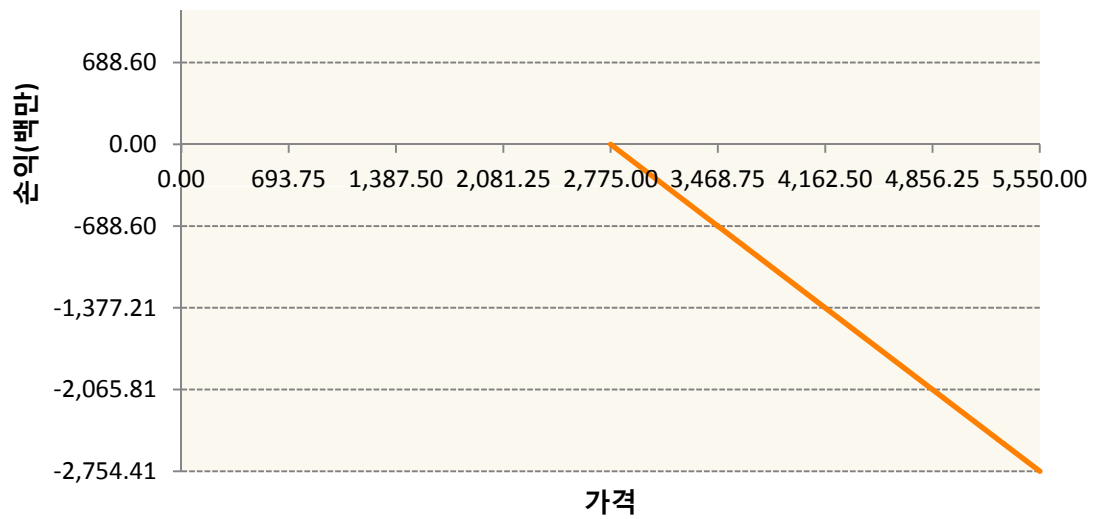
2. 만기시점의 손익구조

OESXM0-C2750-EURO STOXX 50

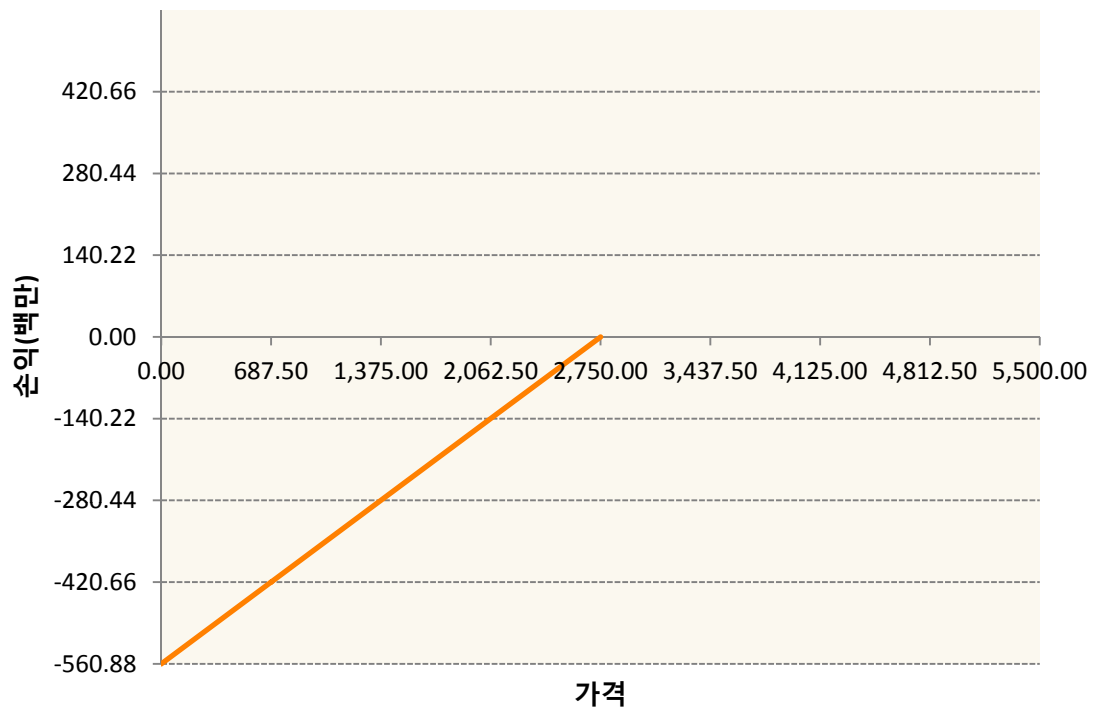


OESXM0-C2775-EURO STOXX 50

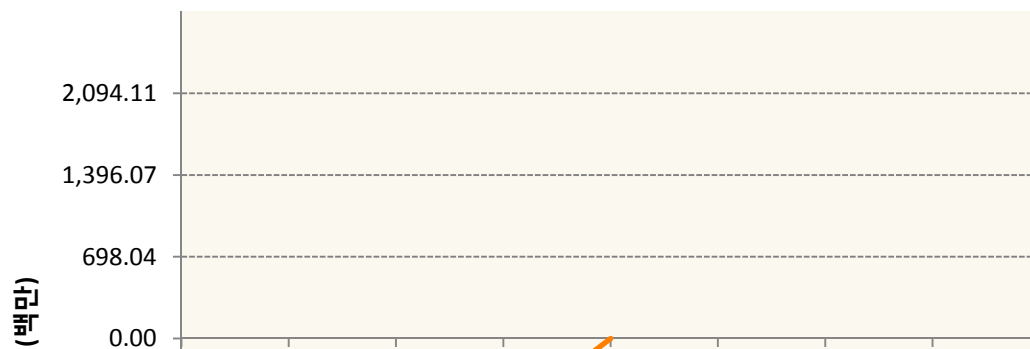


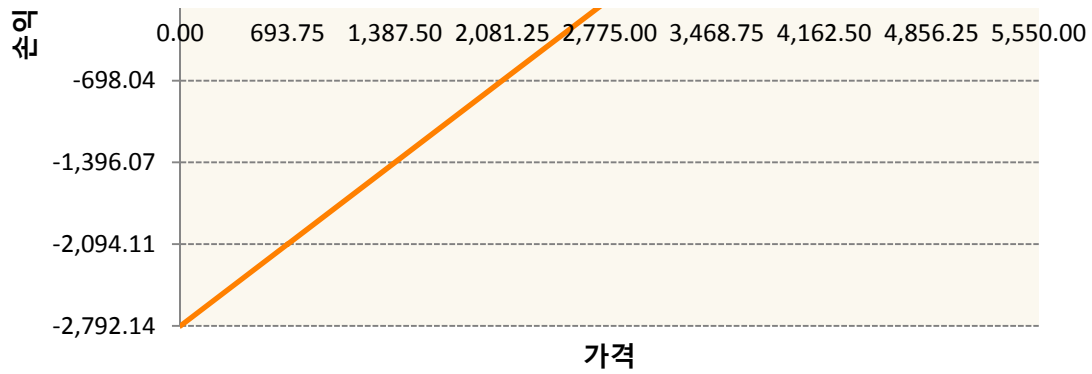
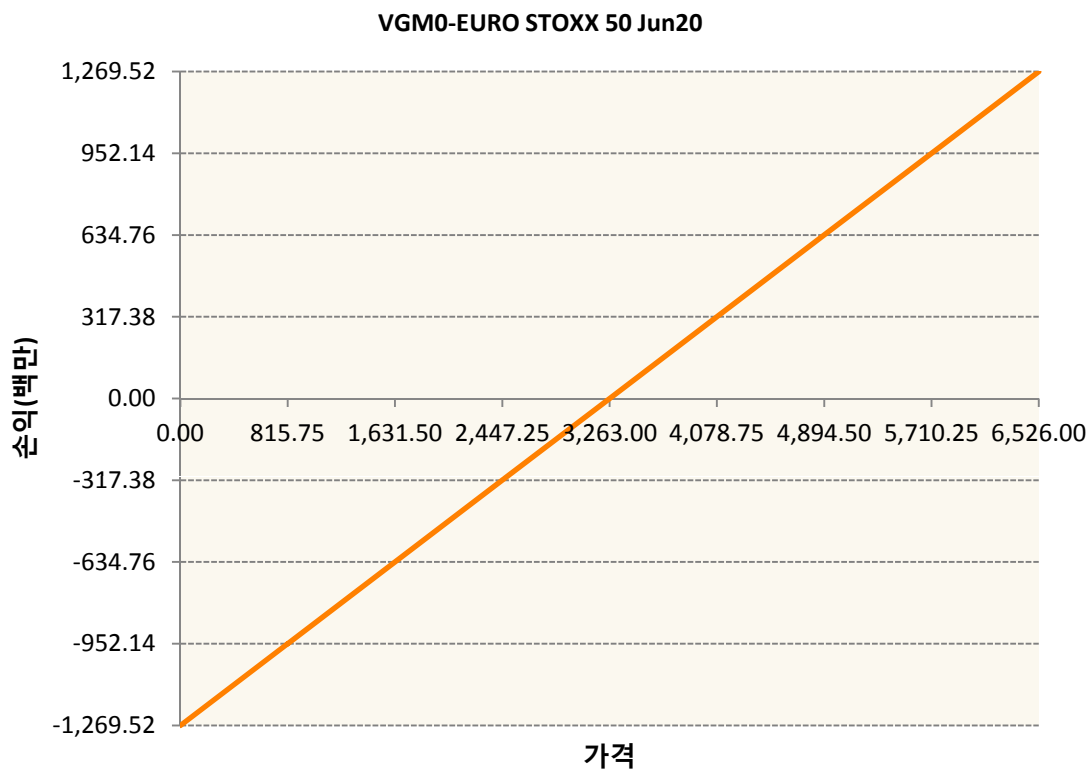


OESXM0-P2750-EURO STOXX 50



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	102

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

(단위:백만원)

1,040

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

(단위:백만원)

1,312

공시일	2020-06-19
기준일	2020-06-18

ETF스마트레버리지목표전환형9호

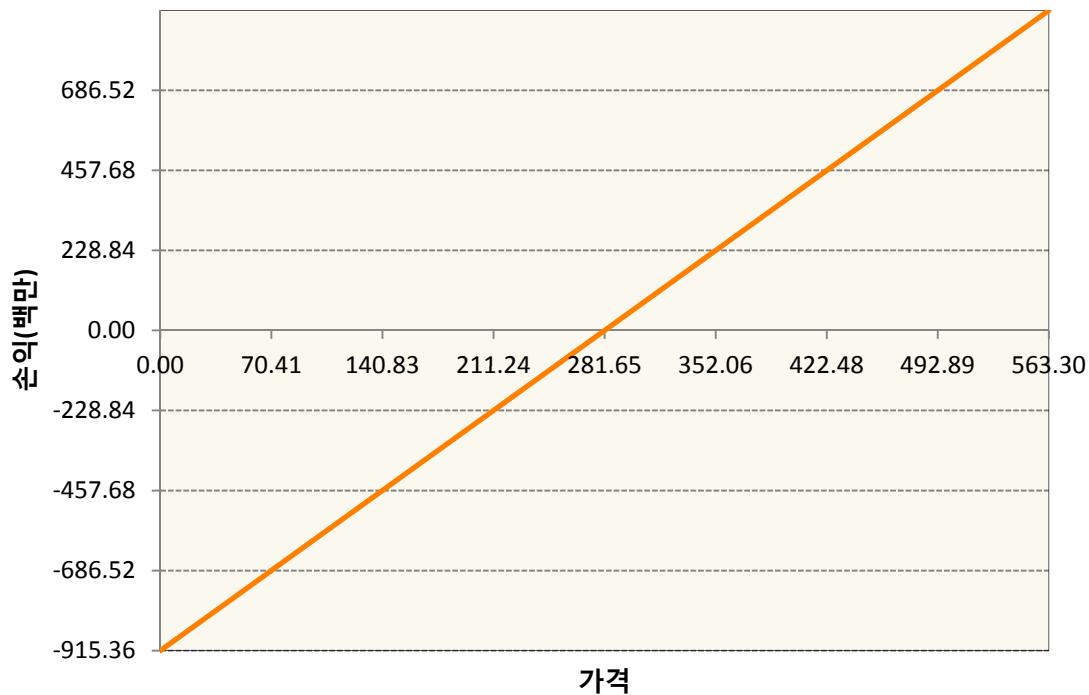
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	915	0	915	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	-73
-5.33%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	24	24	24	24	24	24	24	24	24
5.33%	49	49	49	49	49	49	49	49	49
8.00%	73	73	73	73	73	73	73	73	73

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

(단위:백만원)

115

ETF스마트레버리지목표전환형10호

(단위:백만원)

2. 만기시점의 손익구조

The graph illustrates a linear relationship between Price (가격) and Speed (속이) in millions. The x-axis represents Price, ranging from 0.00 to 563.30 with major ticks every 70.41 units. The y-axis represents Speed, ranging from -1,337.84 to 1,337.84 with major ticks every 668.92 units. A solid orange line represents the linear function, passing through the origin (0,0) and the point (563.30, 1337.84).

가격 (Price)	속이 (백만) (Speed in millions)
0.00	-1,337.84
70.41	-1,003.38
140.83	-668.92
211.24	-334.46
281.65	0.00
352.06	334.46
422.48	668.92
492.89	1,003.38
563.30	1,337.84

(단위:백만원)

KR4101Q90009 2020-09 코스피200지수선물							107
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107
-5.33%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
-2.67%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	36	36	36	36	36	36	36
5.33%	71	71	71	71	71	71	71
8.00%	107	107	107	107	107	107	107

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

(단위:백만원)

168

공시일	2020-06-19
기준일	2020-06-18

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

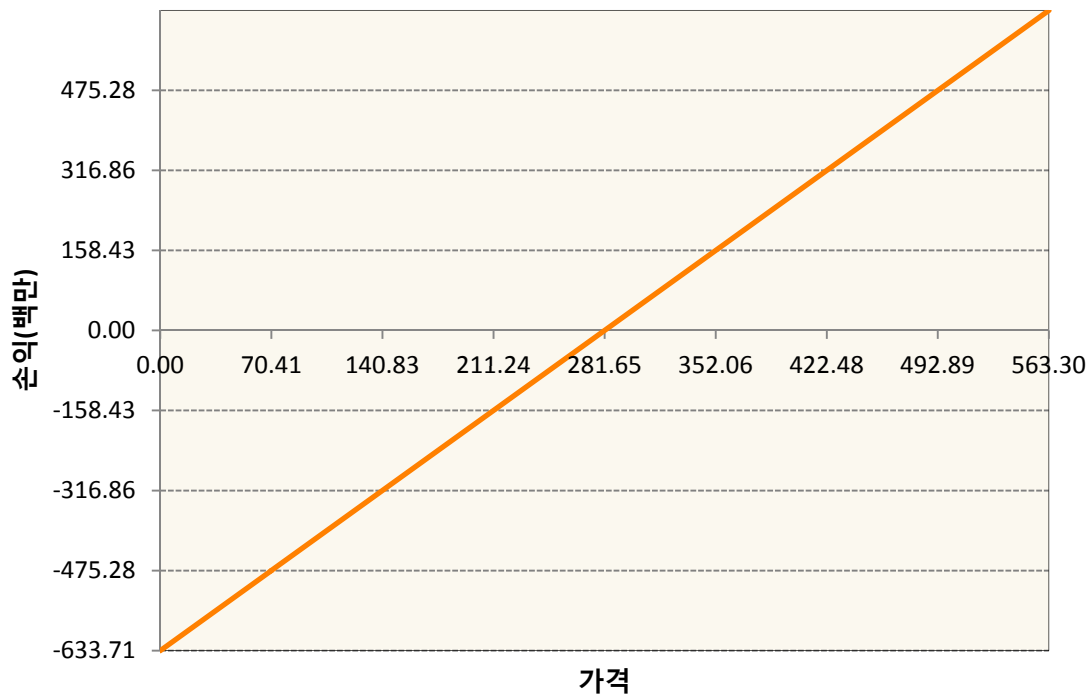
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	634	0	634	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009							2020-09 코스피200지수선물		51
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51	
-5.33%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	17	17	17	17	17	17	17	17	
5.33%	34	34	34	34	34	34	34	34	
8.00%	51	51	51	51	51	51	51	51	

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

(단위:백만원)

80

공시일	2020-06-19
기준일	2020-06-18

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

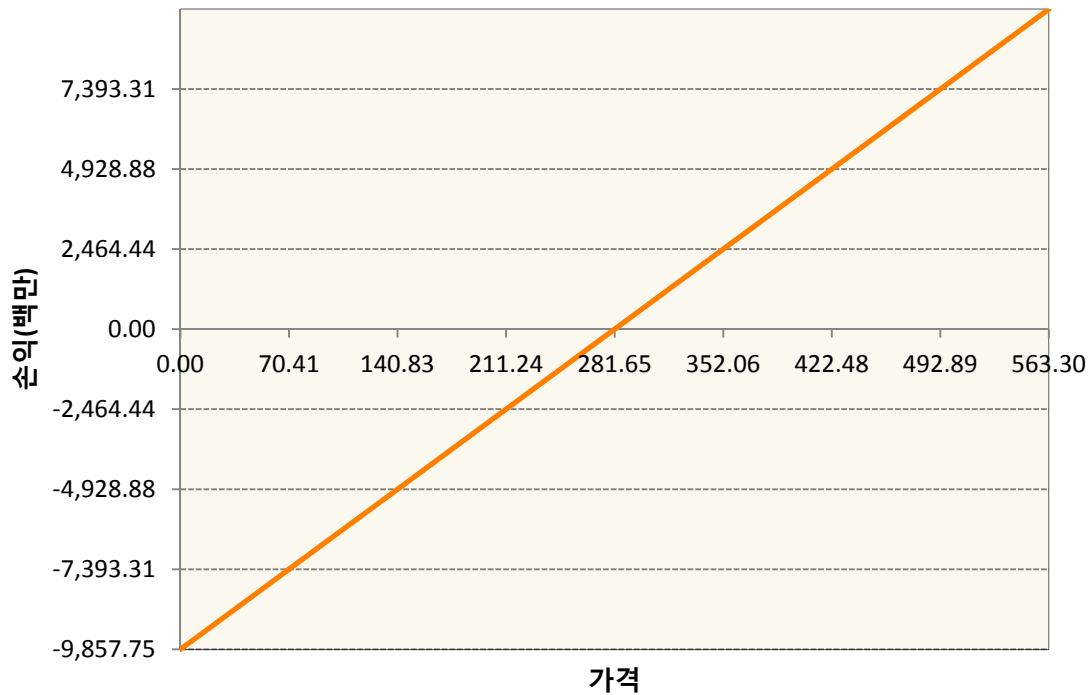
1. 계약금액

(단위:백만원)

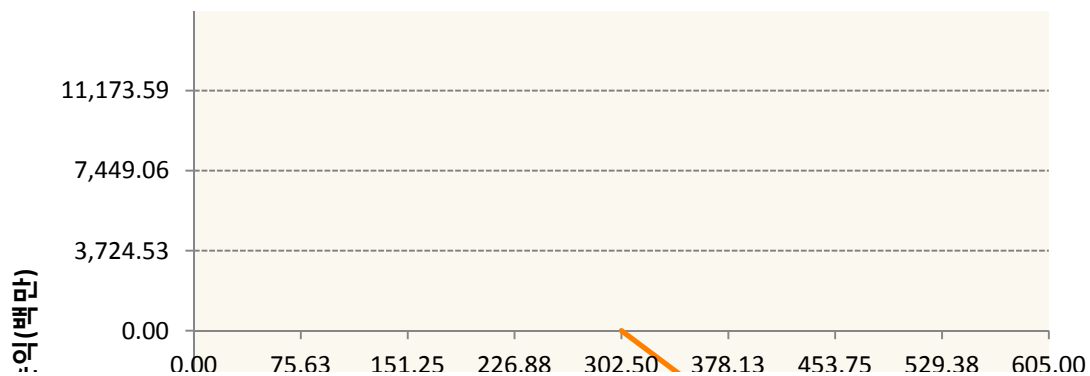
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,858	0	9,858	장내
누계	유가증권	옵션	3,247	19,092	-15,845	장내

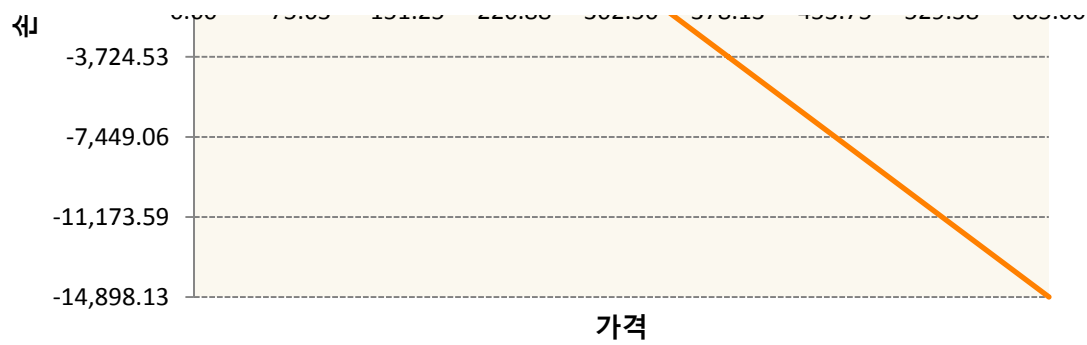
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물

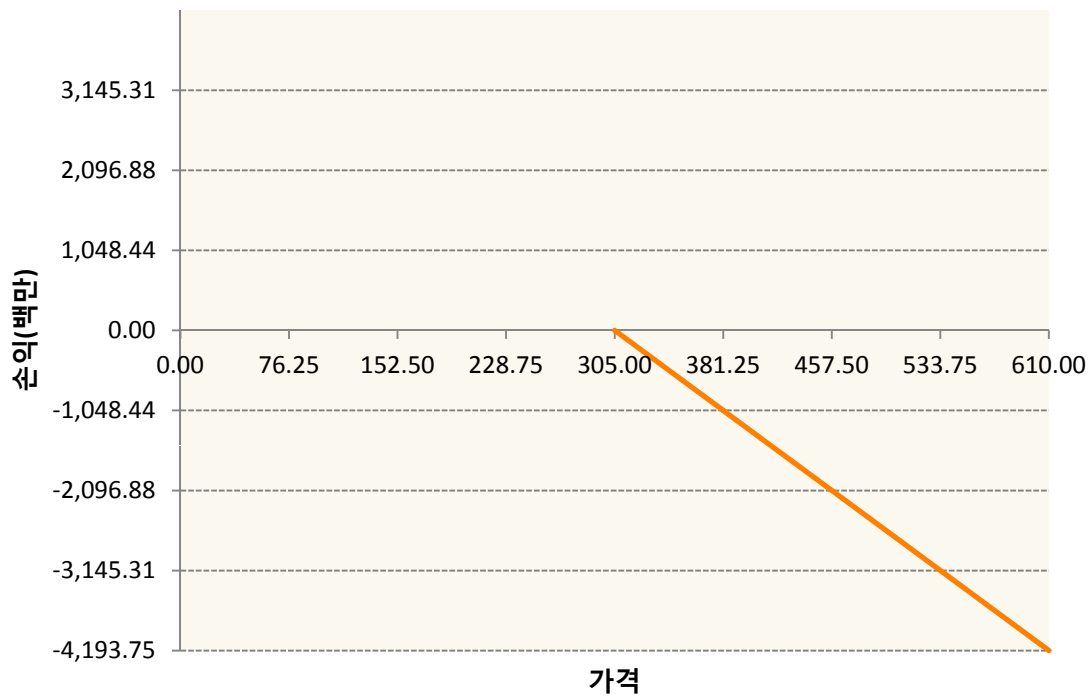


KR4201Q73029-2020-07 콜302.5

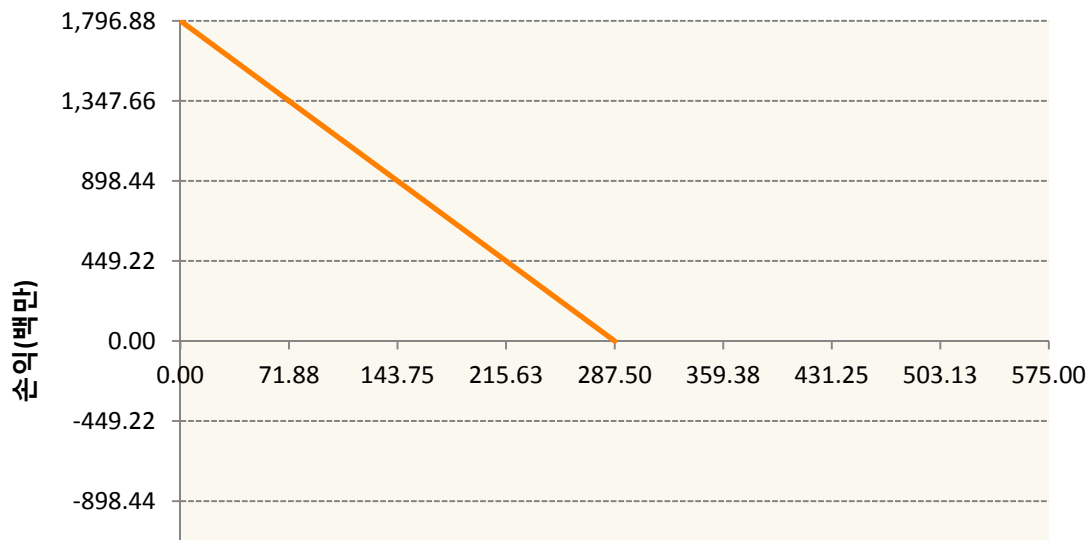


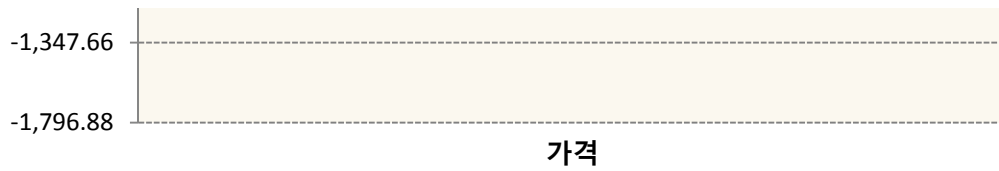
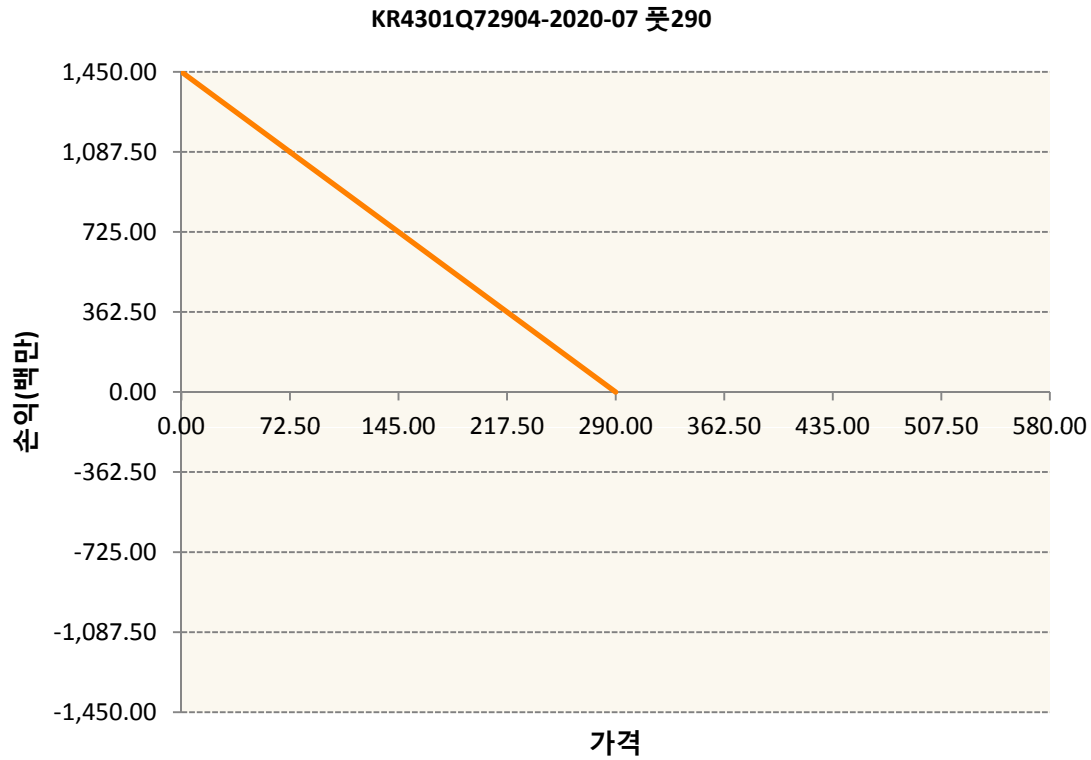


KR4201Q73052-2020-07 콜305



KR4301Q72870-2020-07 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q90009			2020-09 코스피200지수선물				789
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-789	-789	-789	-789	-789	-789	-789
-5.33%	-526	-526	-526	-526	-526	-526	-526
-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%	526	526	526	526	526	526	526
8.00%	789	789	789	789	789	789	789
KR4201Q73029			2020-07 콜302.5				631
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	255	243	226	206	183	157	128
-5.33%	234	213	188	160	129	95	59
-2.67%	194	163	129	93	54	13	-30

0%	129	88	45	0	-46	-94	-142
2.67%	30	-19	-70	-122	-174	-227	-280
5.33%	-107	-163	-218	-274	-330	-386	-443
8.00%	-287	-344	-402	-459	-516	-574	-631
KR4201Q73052 2020-07 콜305							168
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	64	61	57	52	46	39	32
-5.33%	59	54	48	40	32	24	14
-2.67%	50	42	33	24	13	2	-9
0%	34	23	12	0	-12	-25	-38
2.67%	10	-4	-17	-31	-46	-60	-75
5.33%	-25	-40	-56	-71	-87	-102	-118
8.00%	-71	-88	-104	-120	-136	-152	-168
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	100	102	104	106	109	112
-5.33%	55	58	61	65	68	72	76
-2.67%	17	21	25	30	34	39	43
0%	-15	-10	-5	0	5	10	15
2.67%	-40	-35	-29	-24	-19	-14	-9
5.33%	-58	-53	-48	-43	-38	-33	-28
8.00%	-69	-65	-61	-57	-52	-48	-43
KR4301Q72904 2020-07 풋290							93
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	82	83	85	86	88	90	93
-5.33%	48	50	52	54	57	60	63
-2.67%	16	19	22	25	29	32	36
0%	-12	-8	-4	0	4	8	12
2.67%	-33	-29	-25	-21	-17	-12	-8
5.33%	-49	-45	-41	-37	-33	-29	-25
8.00%	-60	-57	-53	-50	-46	-42	-38

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

(단위:백만원)

1,962

공시일	2020-06-19
기준일	2020-06-18

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	6,063	-6,063	
누계	유가증권	수익증권	141,329	0	141,329	

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	2020-06-19
기준일	2020-06-18

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	1,213	-1,213	
누계	유가증권	수익증권	99,581	0	99,581	

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	2020-06-19
기준일	2020-06-18

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	463,961	0	463,961	
누계	통화	선도	0	493,830	-493,830	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J027 KRW/USD 22-06-20E	1,488
FX21020J028 KRW/USD 22-06-20E	1,933
FX21020J039 KRW/USD 24-07-20E	2,174
FX21020J043 KRW/USD 24-07-20E	1,740
FX21020J043 KRW/USD 24-07-20E	1,933
FX21020K01 KRW/USD 22-06-20E	676
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	2,358
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	966
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,015
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,604
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	3,382
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	6,861
FX21020M00 KRW/USD 26-08-20E	580
FX21020M01 KRW/USD 26-08-20E	4,735
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	2,010
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	2,435
FX21020M05 KRW/USD 22-09-20E	1,005
FX21020M05 KRW/USD 22-09-20E	2,609

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

20,484

공시일	2020-06-19
기준일	2020-06-18

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

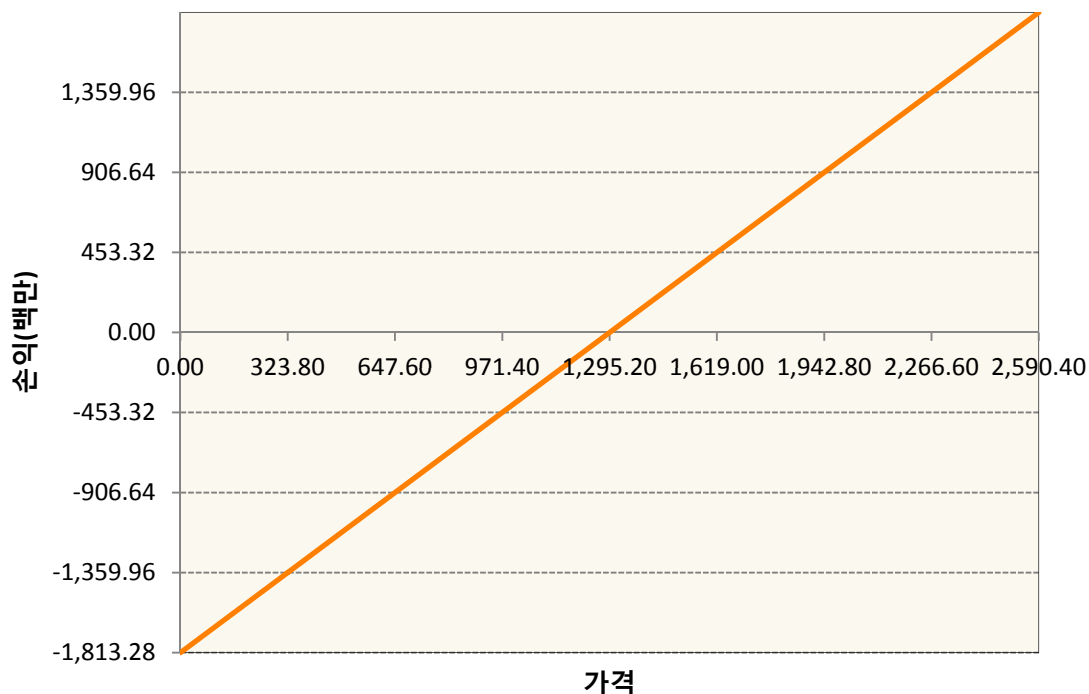
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,813	0	1,813	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	-146	
-5.33%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97	
-2.67%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	49	49	49	49	49	49	49	49	
5.33%	97	97	97	97	97	97	97	97	
8.00%	146	146	146	146	146	146	146	146	

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

(단위:백만원)

230

공시일	2020-06-19
기준일	2020-06-18

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	7,648	0	7,648	
누계	통화	선도	0	7,502	-7,502	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)

311

공시일	2020-06-19
기준일	2020-06-18

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

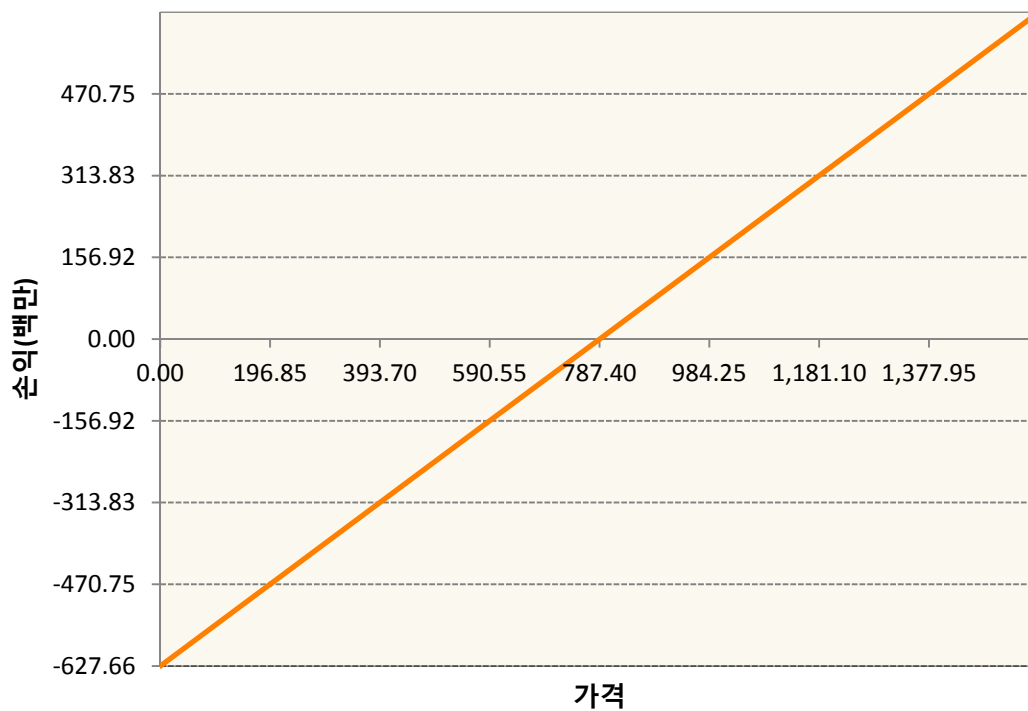
1. 계약금액

(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	628	0	628	
누계	유가증권	스왑	986	0	986	장외
누계	통화	선도	209	889	-680	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCN0-VN30 Index Future Jul20



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
VNCN0 VN30 Index Future Jul20	50

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	172

공시일	2020-06-19
기준일	2020-06-18

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

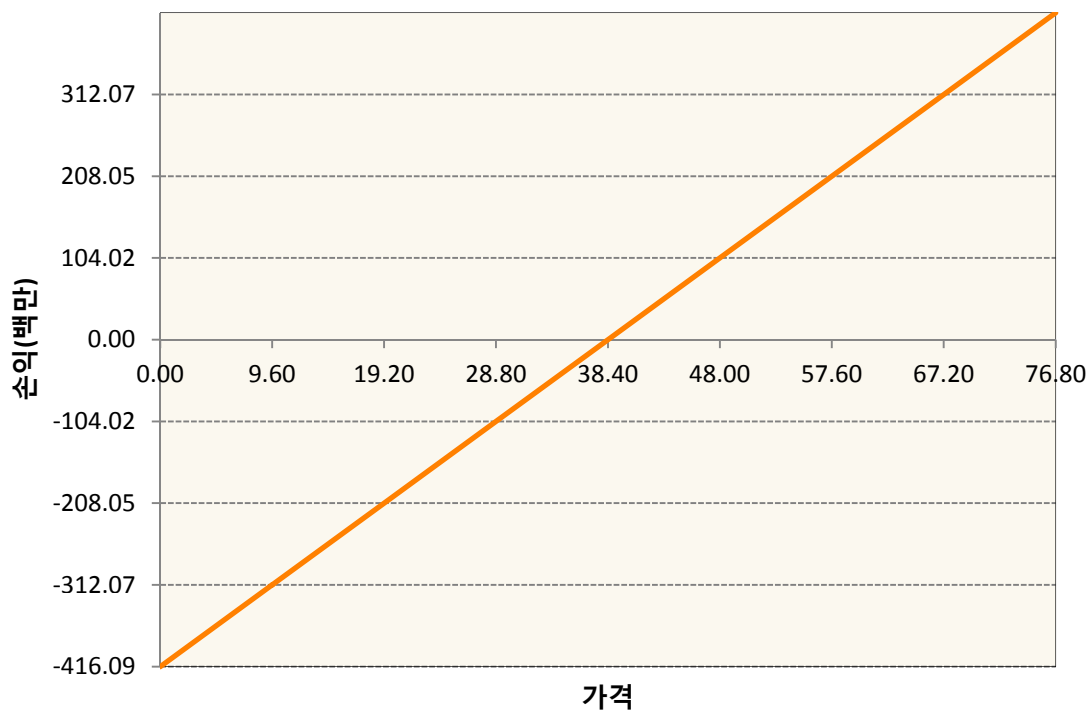
1. 계약금액

(단위:백만원)

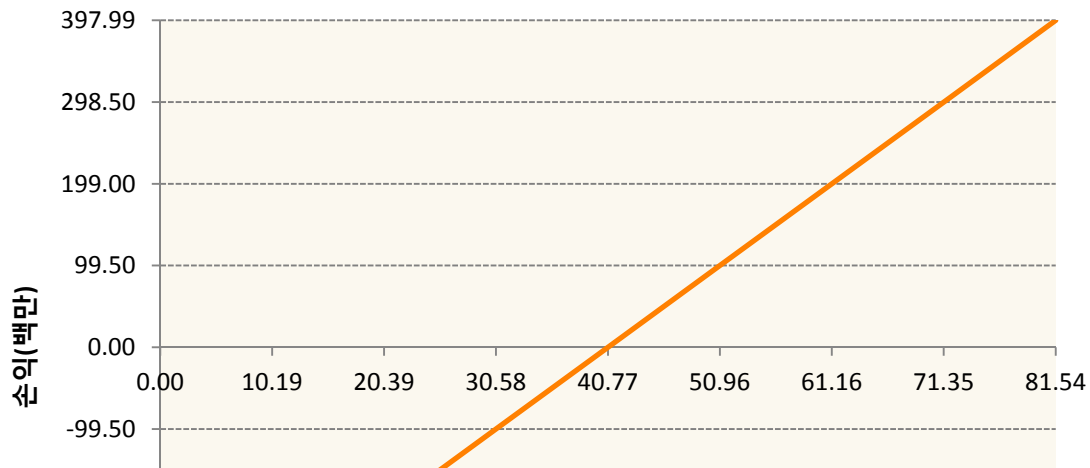
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,894	362	1,532	

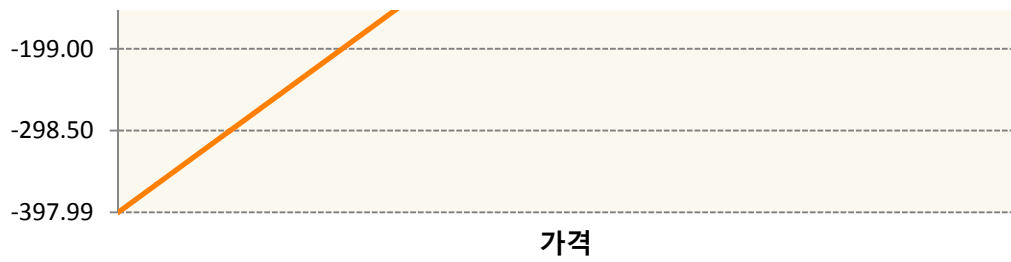
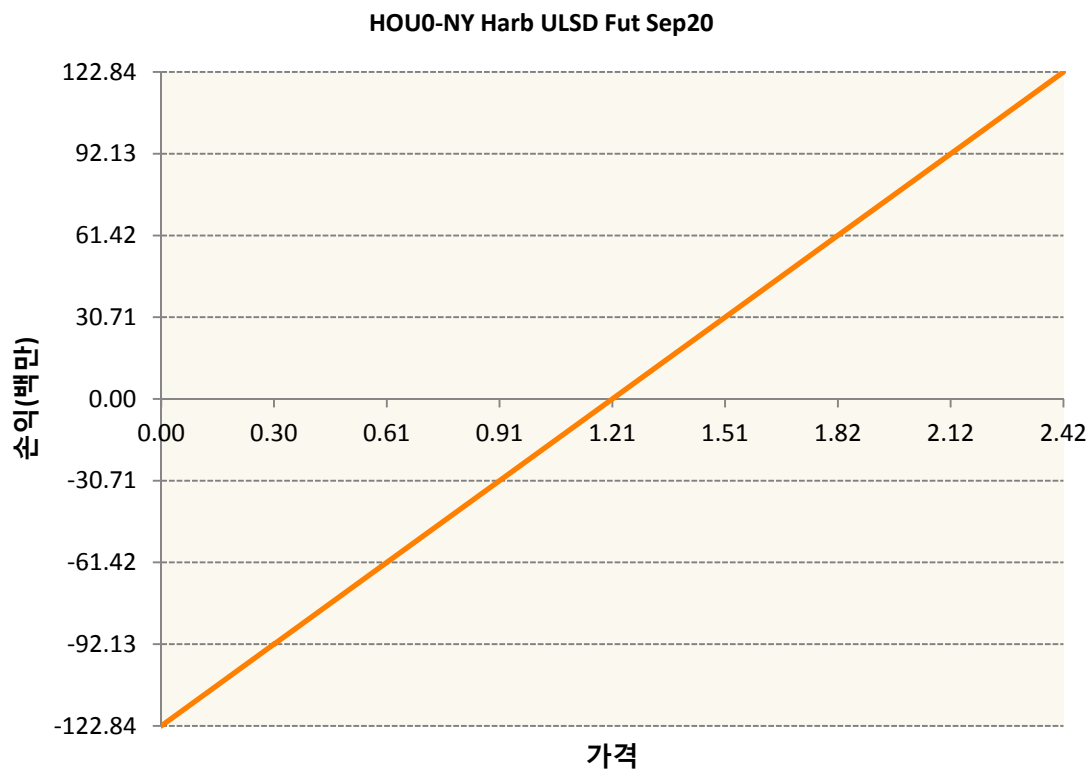
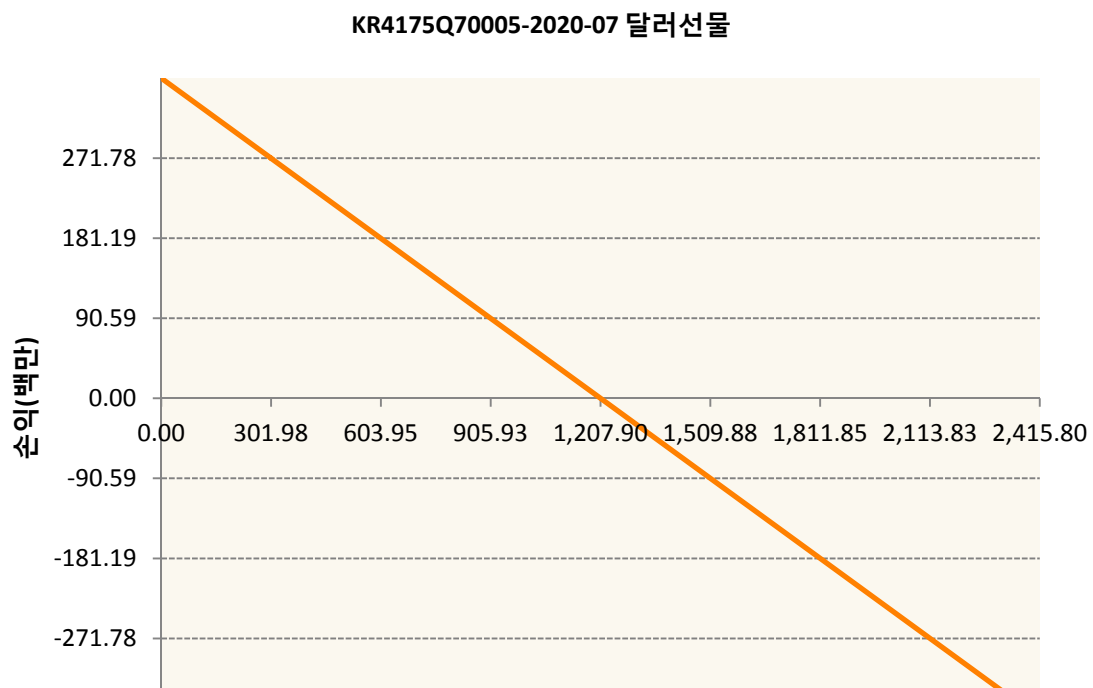
2. 만기시점의 손익구조

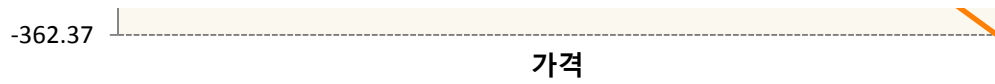
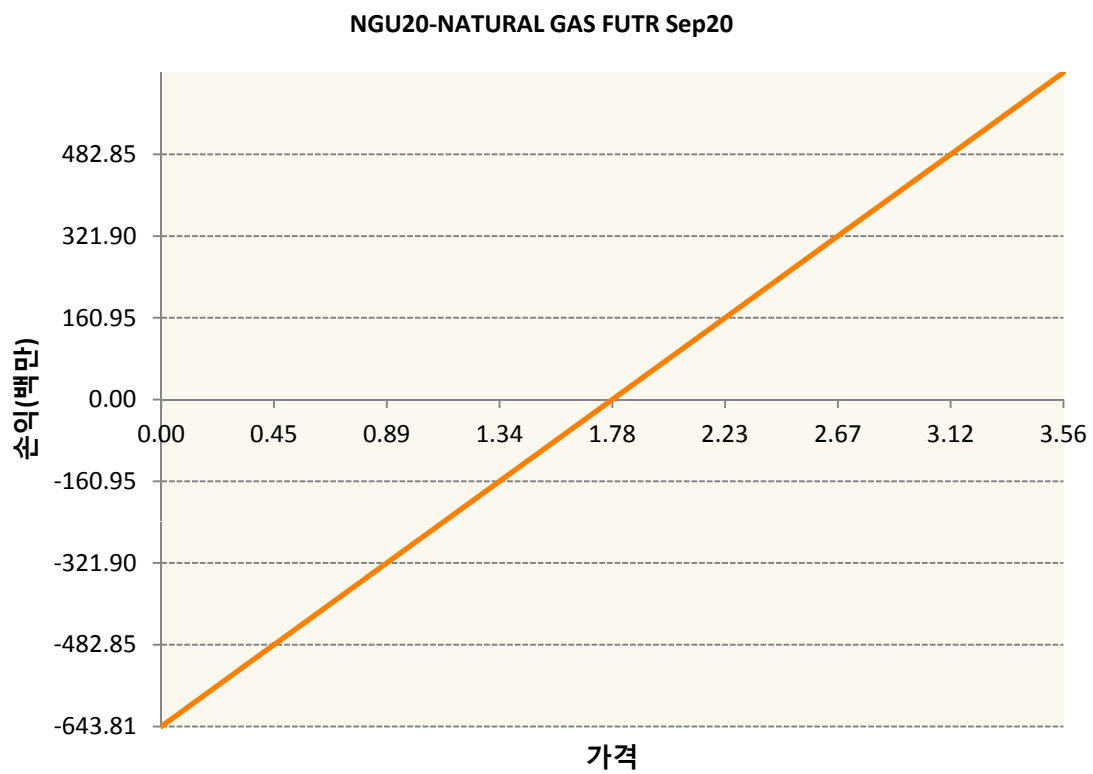
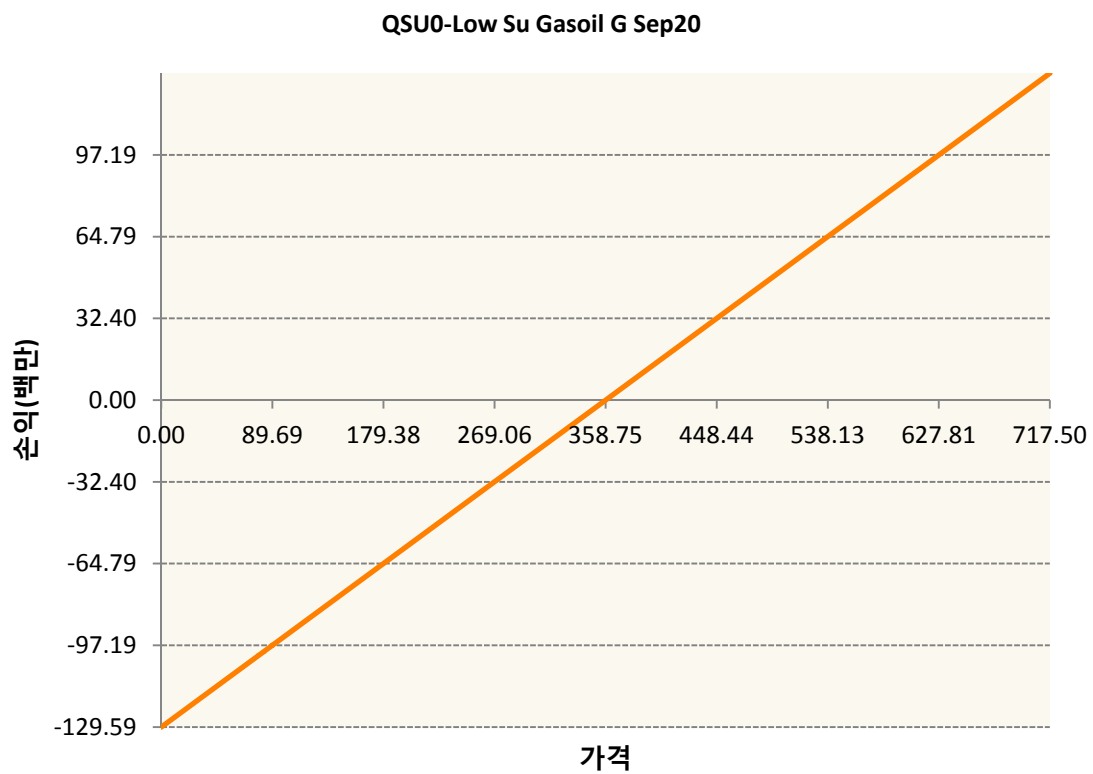
CLU0-WTI CRUDE FUTURE Sep20



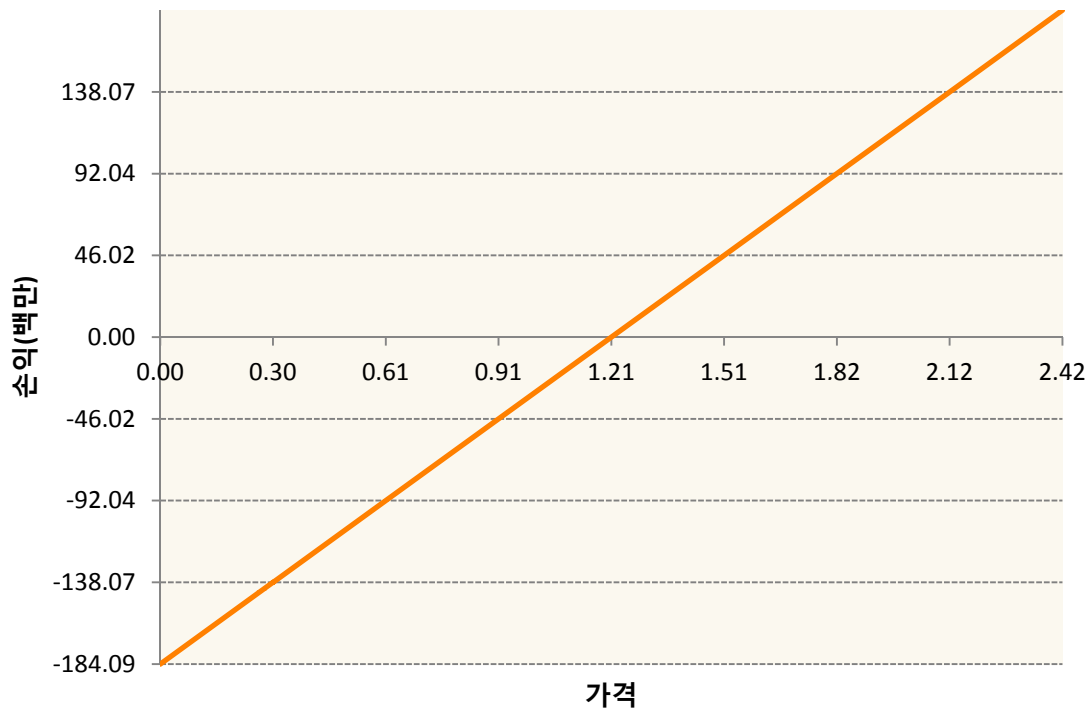
COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20







XBU0-GASOLINE RBOB FUT Sep20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLU0	WTI CRUDE FUTURE Sep20	33
COU0	BRENT CRUDE FUTR Sep20	32
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	15

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

(단위:백만원)

958

공시일	2020-06-19
기준일	2020-06-18

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

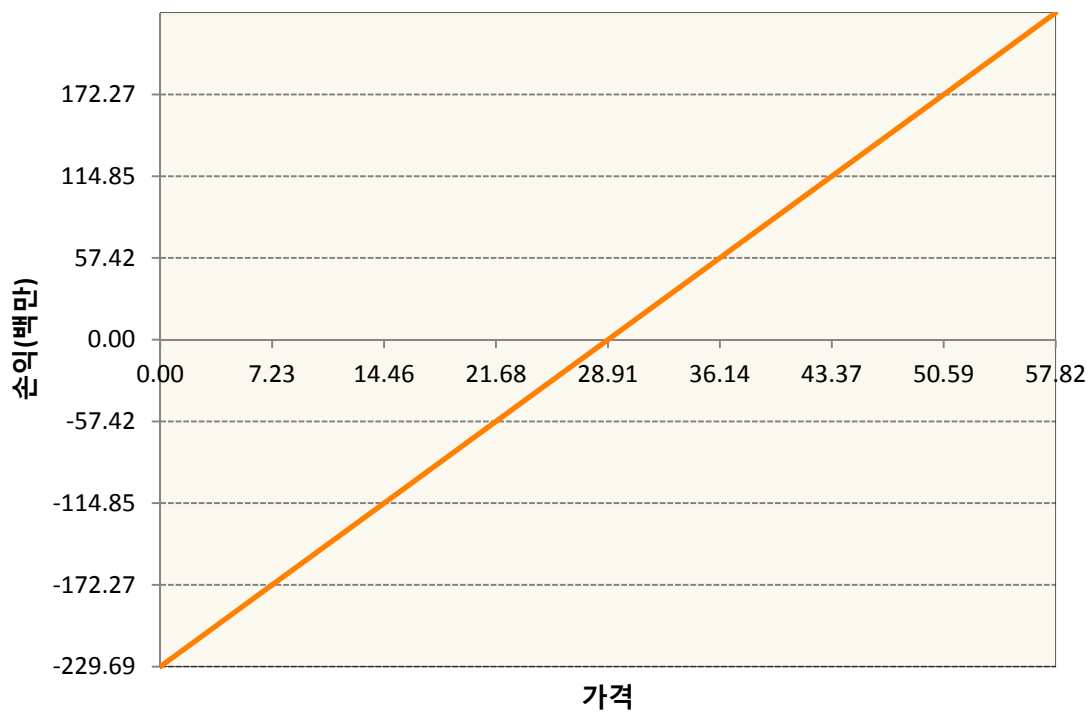
1. 계약금액

(단위:백만원)

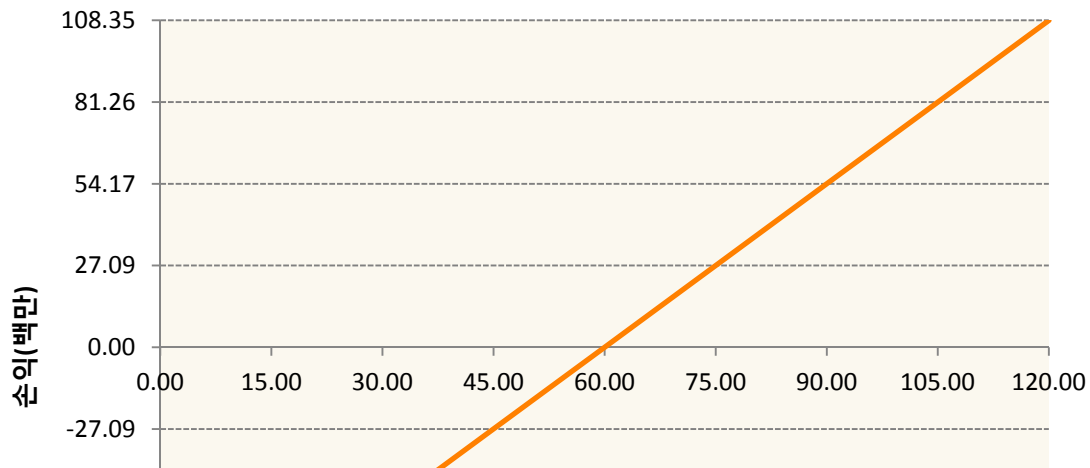
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,575	72	2,503	

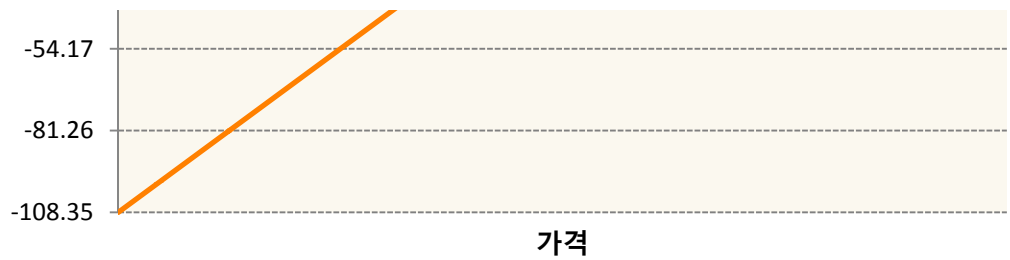
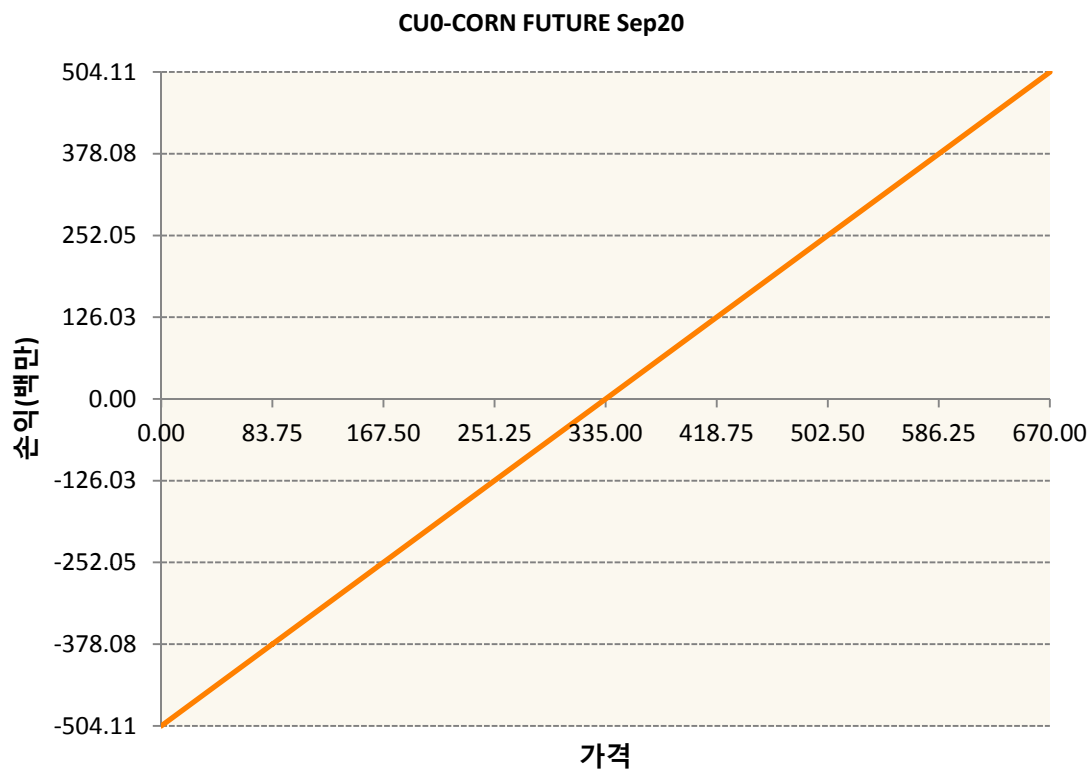
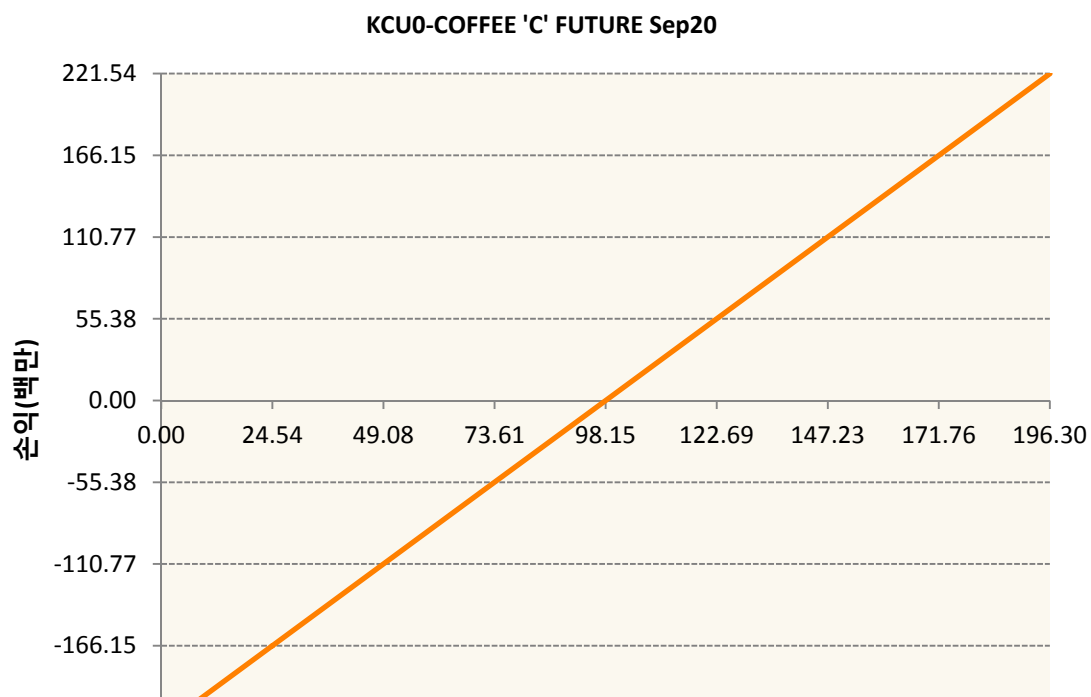
2. 만기시점의 손익구조

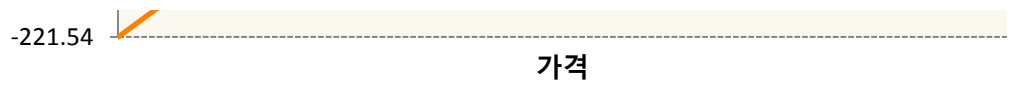
BOZ0-SOYBEAN OIL FUTR Dec20



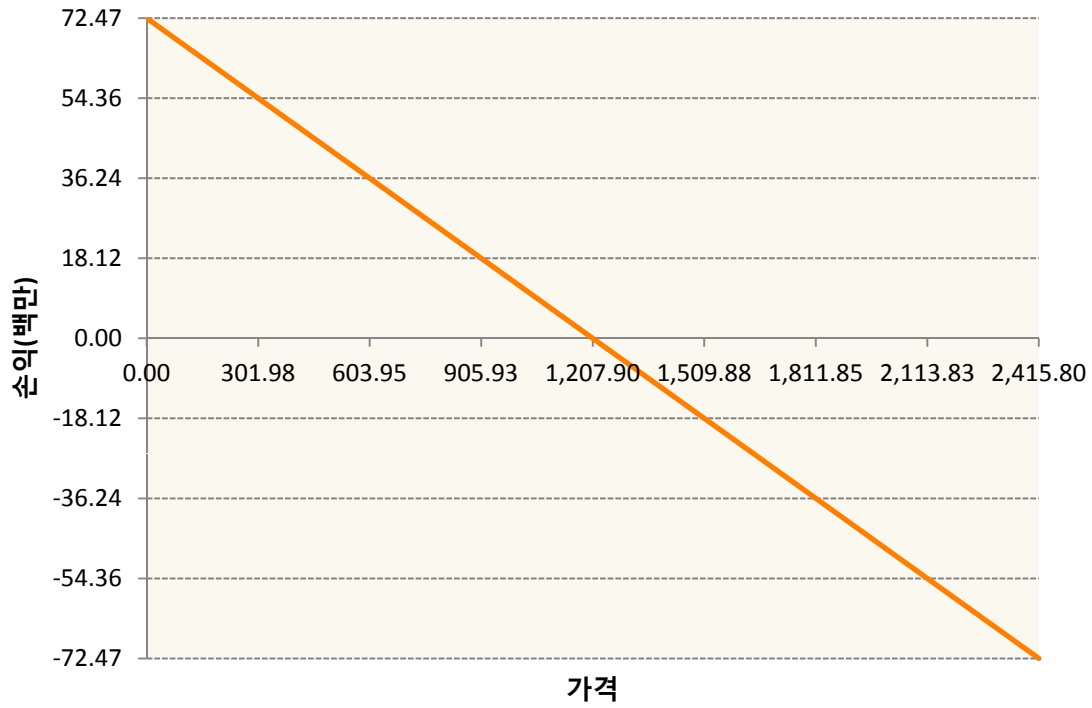
CTZ0-COTTON NO.2 FUTR Dec20



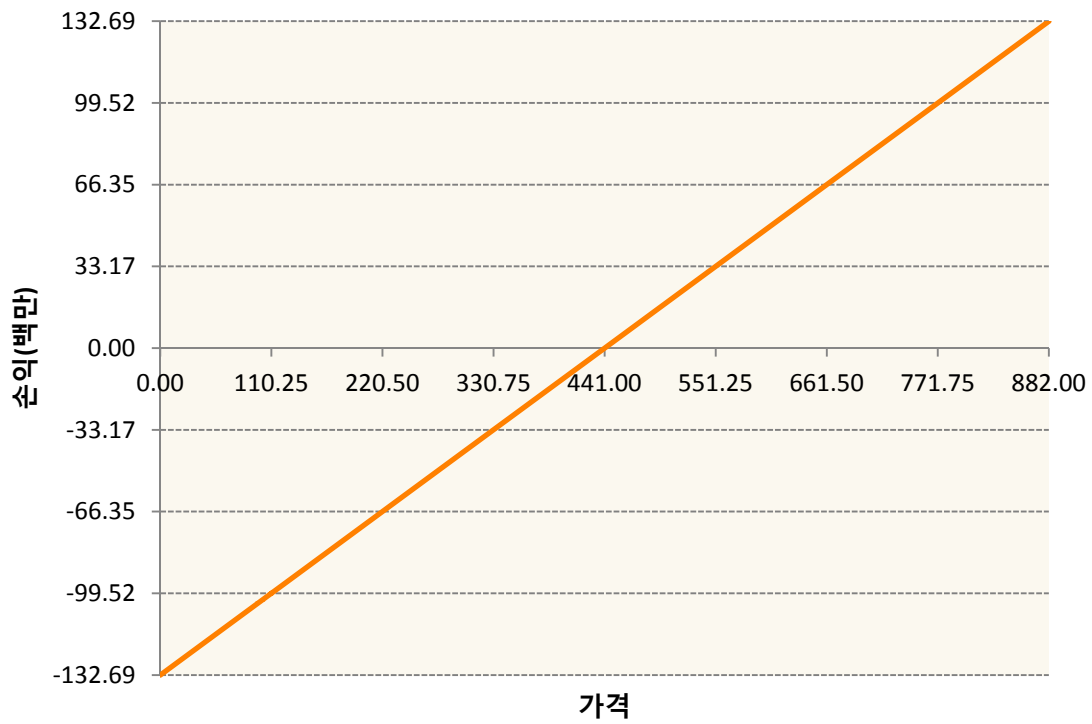




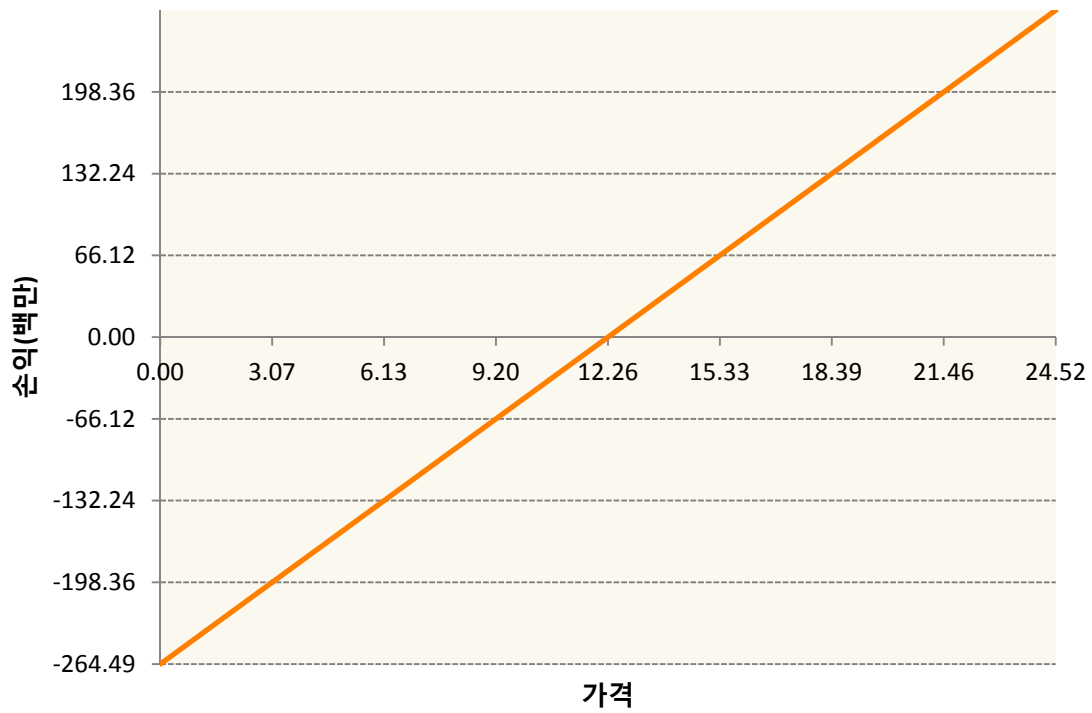
KR4175Q70005-2020-07 달러선물



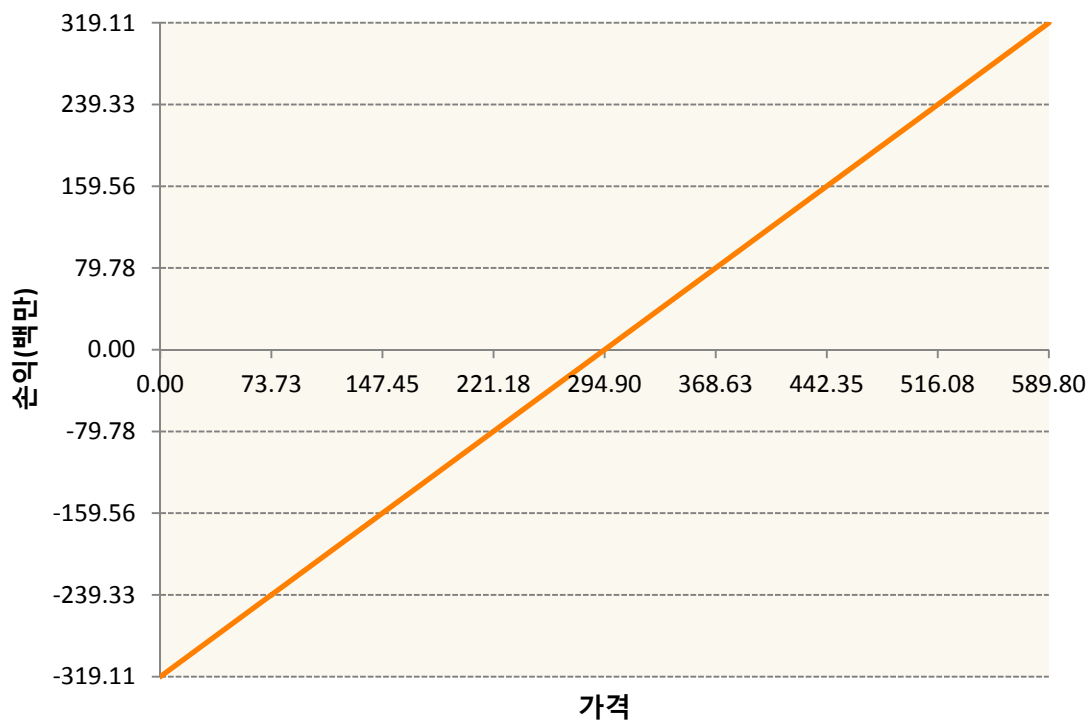
KWU0-KC HRW WHEAT FUT Sep20



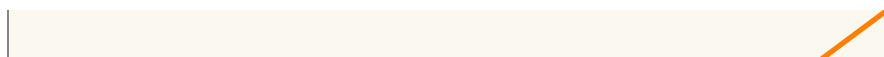
SBV0-Sugar Oct20

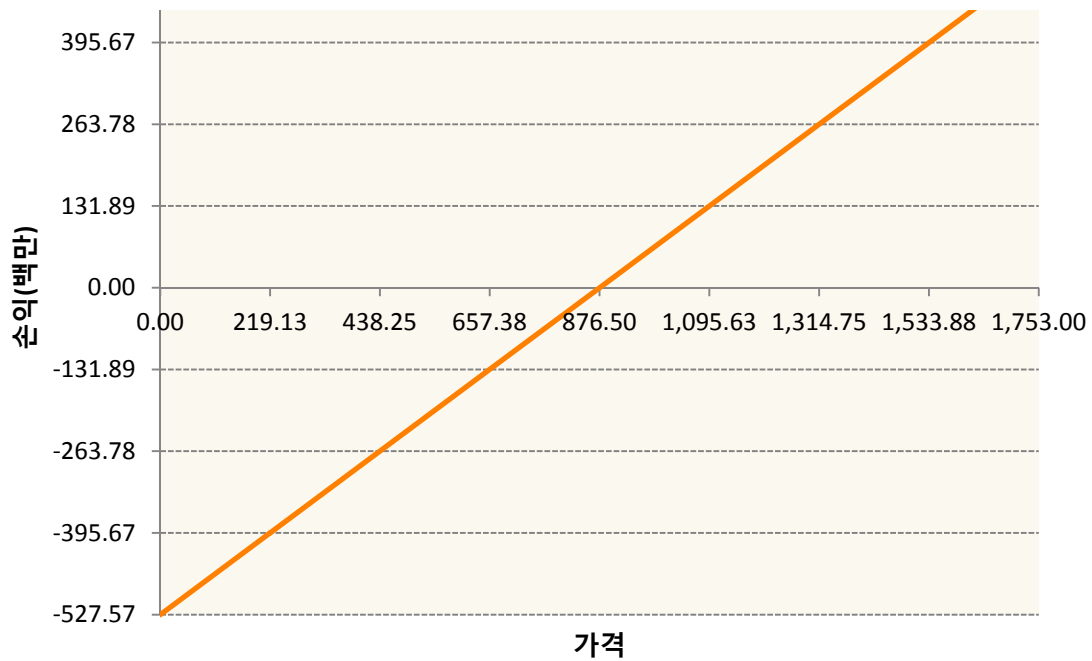
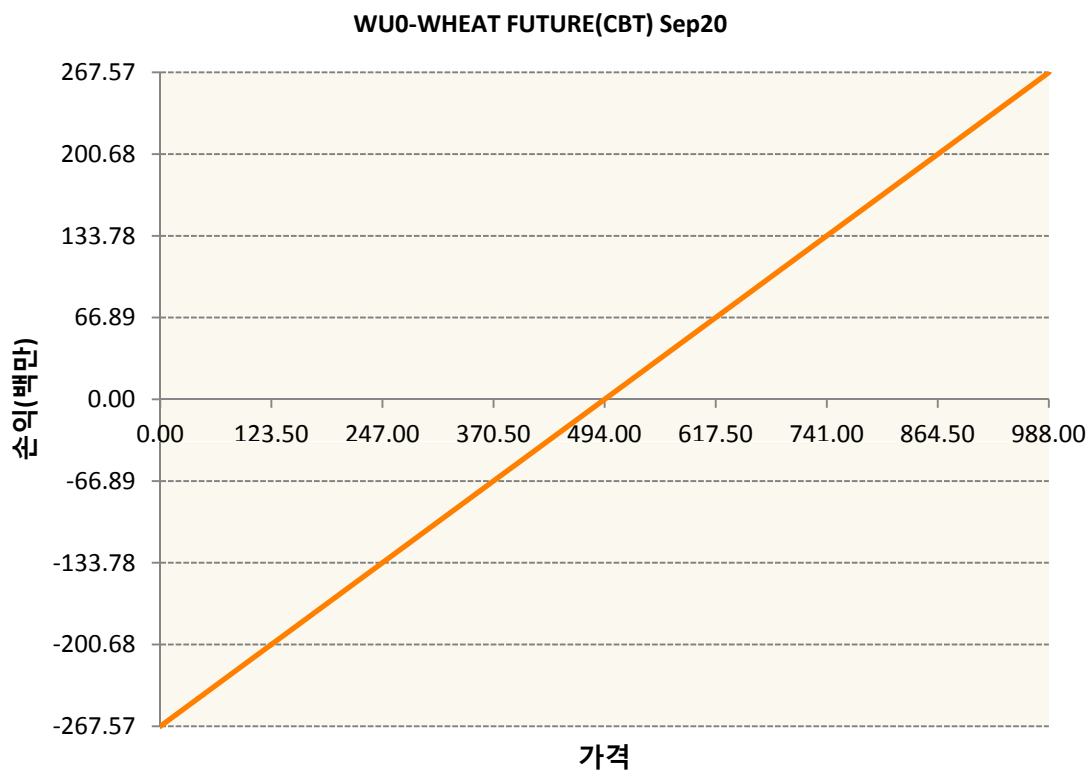


SMZ0-SOYBEAN MEAL FUTR Dec20



SX0-SOYBEAN FUTURE Nov20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ0	SOYBEAN OIL FUTR Dec20	18
CTZ0	COTTON NO.2 FUTR Dec20	9
CU0	CORN FUTURE Sep20	40
KCU0	COFFEE 'C' FUTURE Sep20	18
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	21

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

(단위:백만원)

241