

공시일	2020-06-23
기준일	2020-06-22

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	2020-06-23
기준일	2020-06-22

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

1,066

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,275

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-06-23
기준일	2020-06-22

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)

SWCSI50000 신한CSI500미래S200610

604

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

880

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-06-23
기준일	2020-06-22

유로인덱스모(주식-파생형)

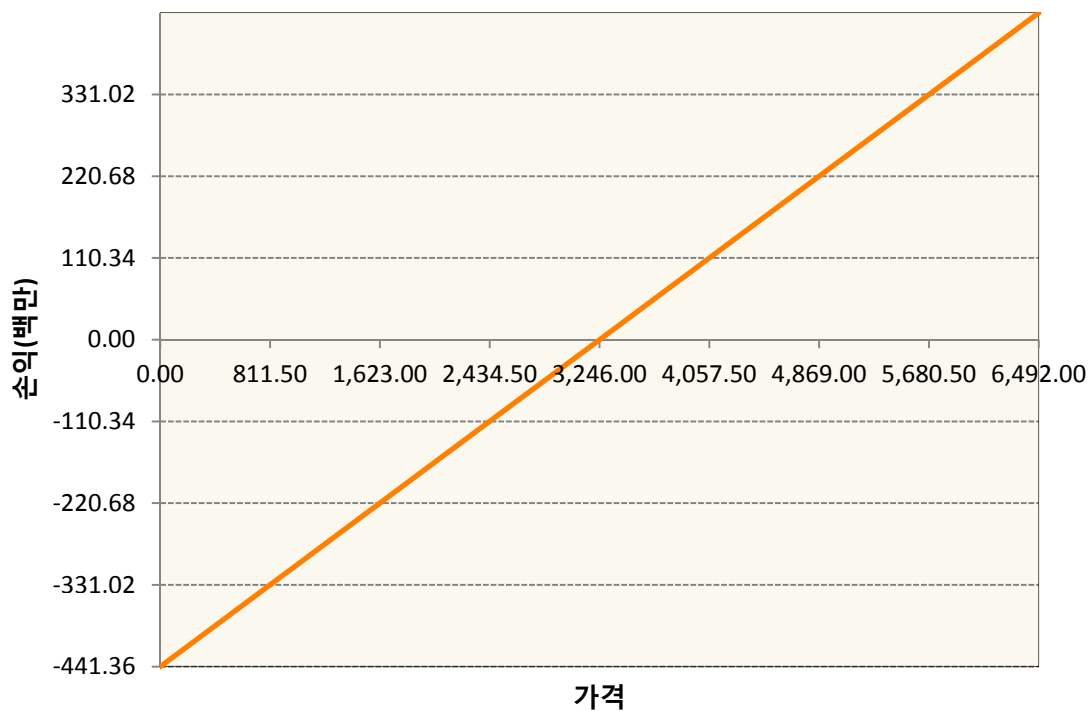
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	441	0	441	

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	2020-06-23
기준일	2020-06-22

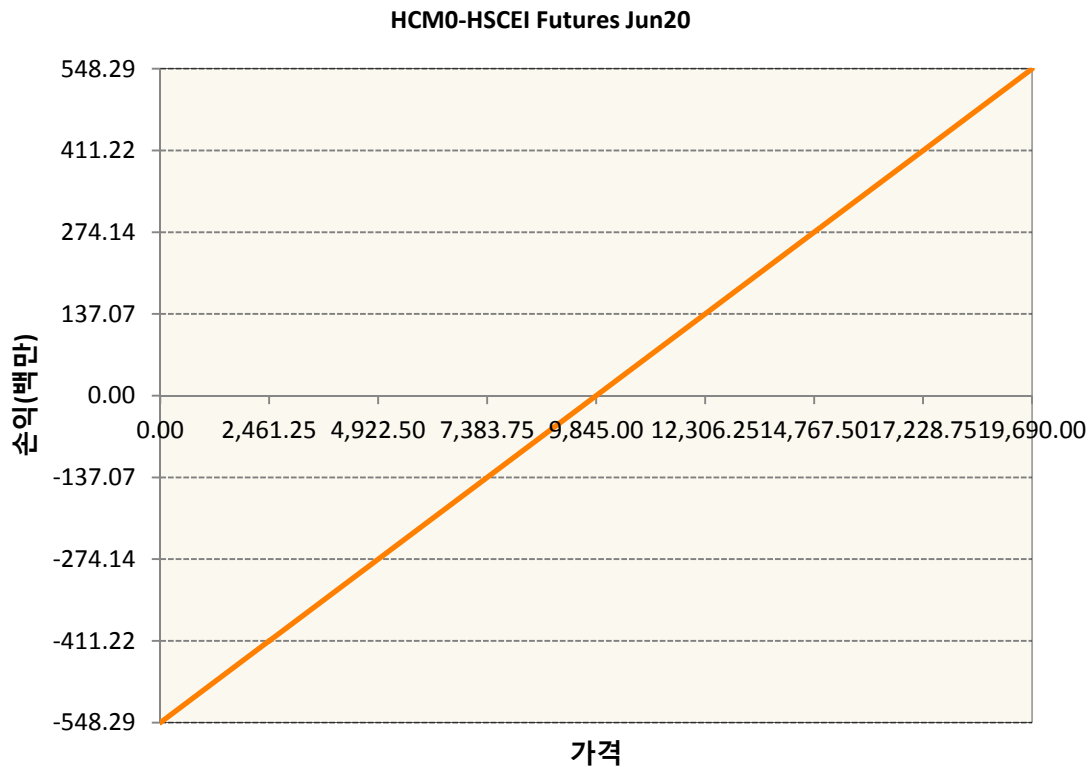
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

47

공시일	2020-06-23
기준일	2020-06-22

커버드콜모(주식혼합-파생형)

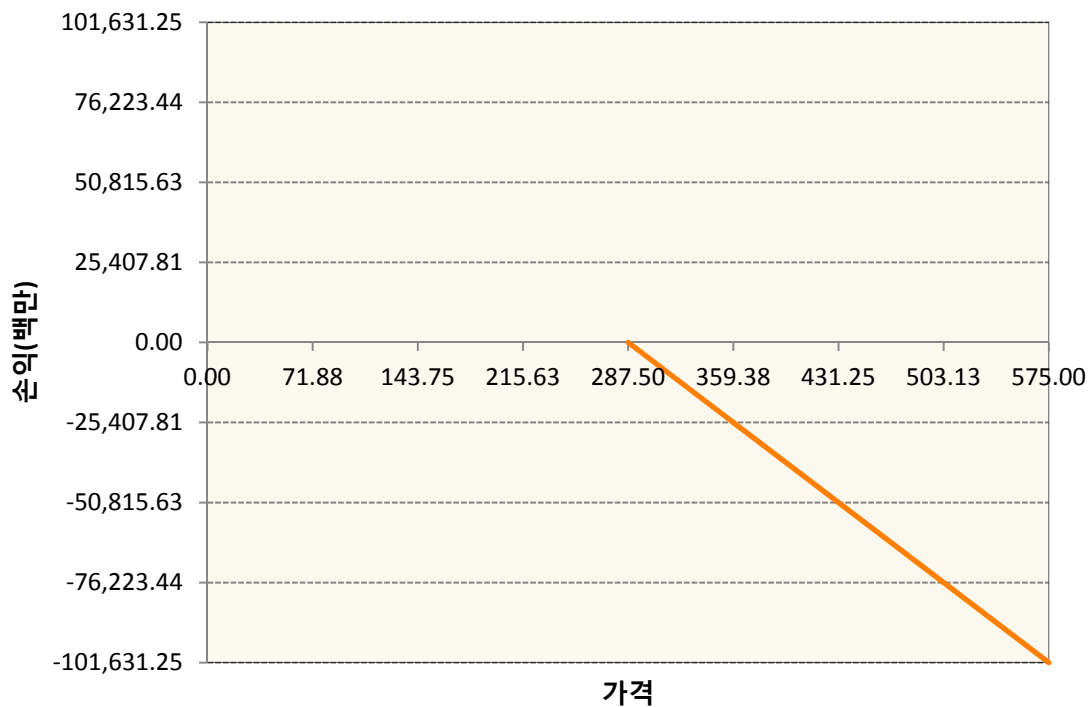
1. 계약금액

(단위:백만원)

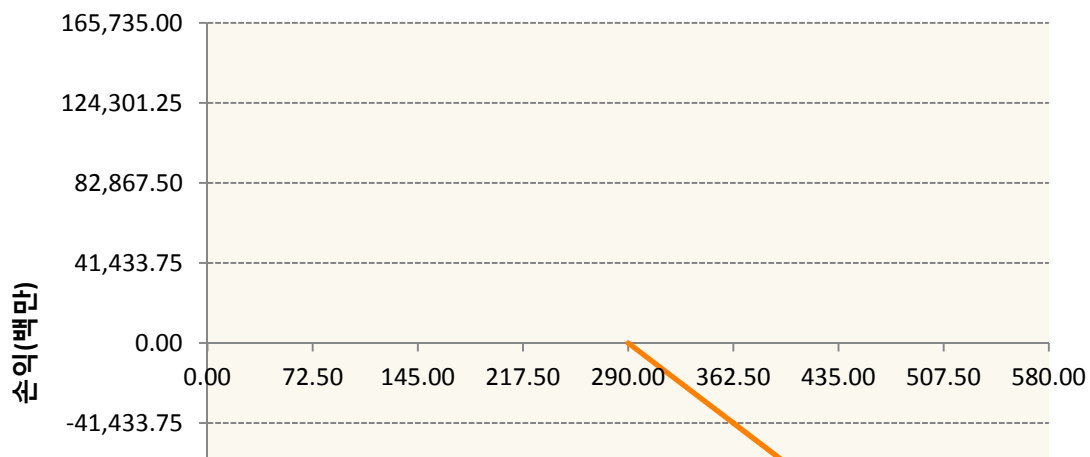
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	367,991	-367,991	장내

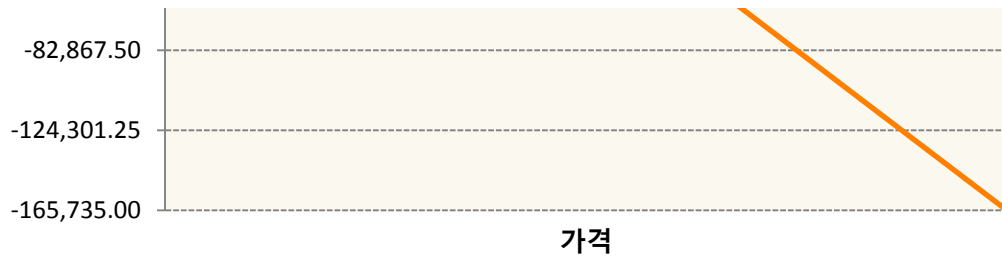
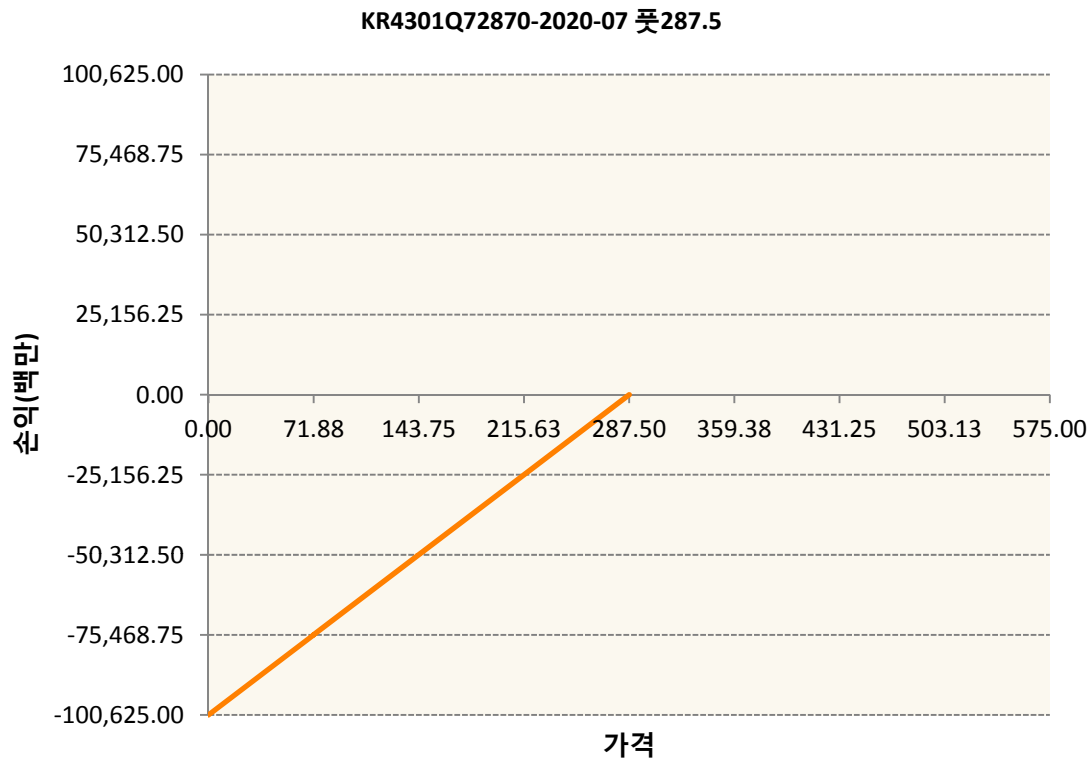
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q72872-2020-07 콜287.5



KR4201Q72906-2020-07 콜290





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q72872			2020-07 콜287.5				5,578
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,766	2,630	2,471	2,292	2,096	1,885	1,662
-5.33%	2,438	2,231	2,006	1,766	1,514	1,253	984
-2.67%	1,867	1,591	1,305	1,012	714	410	103
0%	981	656	329	0	-330	-661	-993
2.67%	-260	-602	-944	-1,285	-1,627	-1,969	-2,311
5.33%	-1,858	-2,182	-2,509	-2,840	-3,173	-3,507	-3,844
8.00%	-3,776	-4,054	-4,343	-4,642	-4,949	-5,261	-5,578
KR4201Q72906			2020-07 콜290				8,655
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,031	3,840	3,611	3,349	3,056	2,738	2,399

-5.33%	3,593	3,292	2,958	2,597	2,213	1,811	1,394
-2.67%	2,806	2,389	1,952	1,499	1,034	559	76
0%	1,547	1,037	521	0	-525	-1,054	-1,584
2.67%	-268	-823	-1,378	-1,933	-2,488	-3,043	-3,598
5.33%	-2,662	-3,206	-3,753	-4,302	-4,853	-5,406	-5,960
8.00%	-5,594	-6,077	-6,574	-7,083	-7,600	-8,125	-8,655
KR4301Q72870 2020-07 풋287.5							6,486
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,019	-6,061	-6,118	-6,190	-6,276	-6,375	-6,486
-5.33%	-3,529	-3,624	-3,735	-3,860	-3,999	-4,147	-4,305
-2.67%	-1,249	-1,413	-1,587	-1,770	-1,961	-2,158	-2,359
0%	674	452	227	0	-229	-459	-691
2.67%	2,128	1,886	1,644	1,403	1,161	919	677
5.33%	3,092	2,878	2,658	2,435	2,208	1,978	1,747
8.00%	3,648	3,491	3,320	3,138	2,947	2,749	2,545

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

(단위:백만원)

18,213

공시일	2020-06-23
기준일	2020-06-22

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

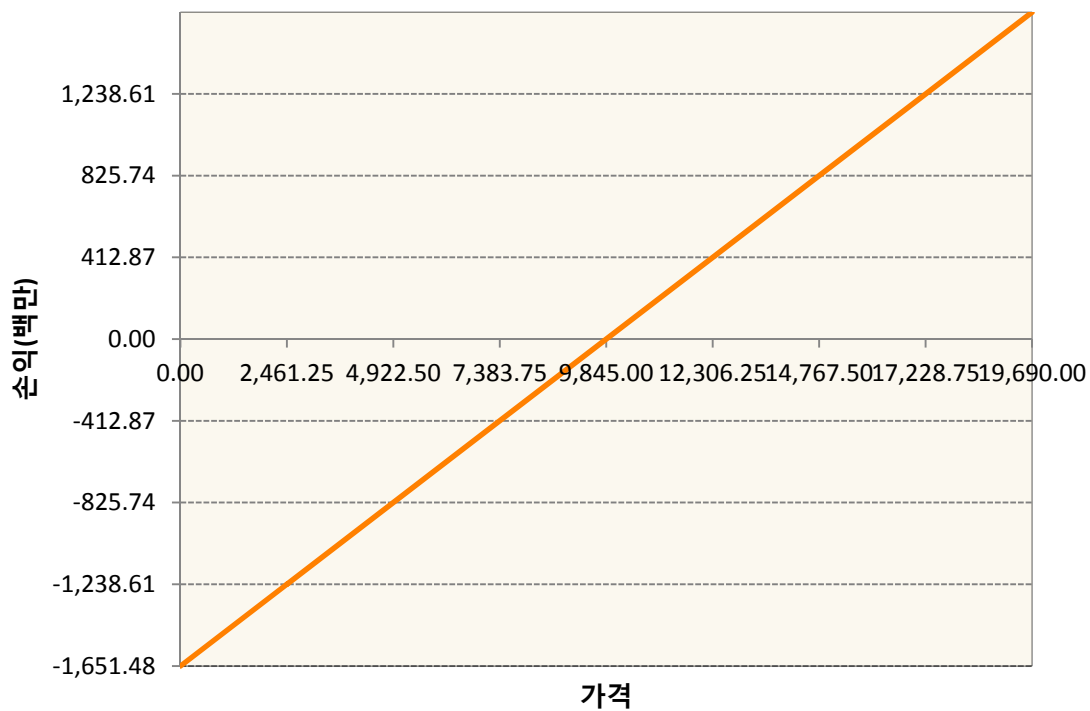
1. 계약금액

(단위:백만원)

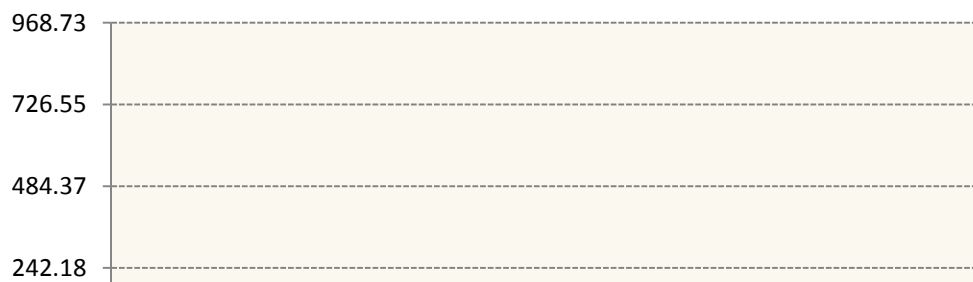
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,651	0	1,651	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,272	-4,272	장내
누계	통화	선도	0	1,519	-1,519	장외

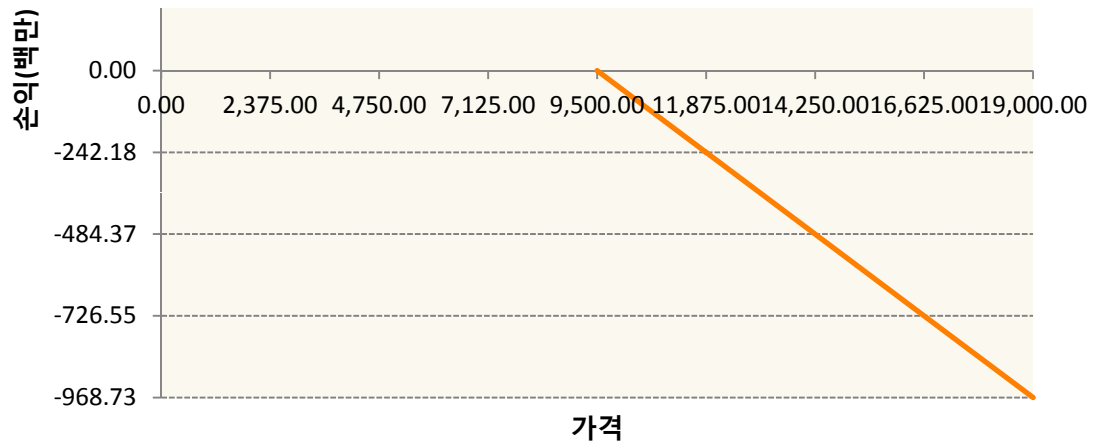
2. 만기시점의 손익구조

HCM0-HSCEI Futures Jun20

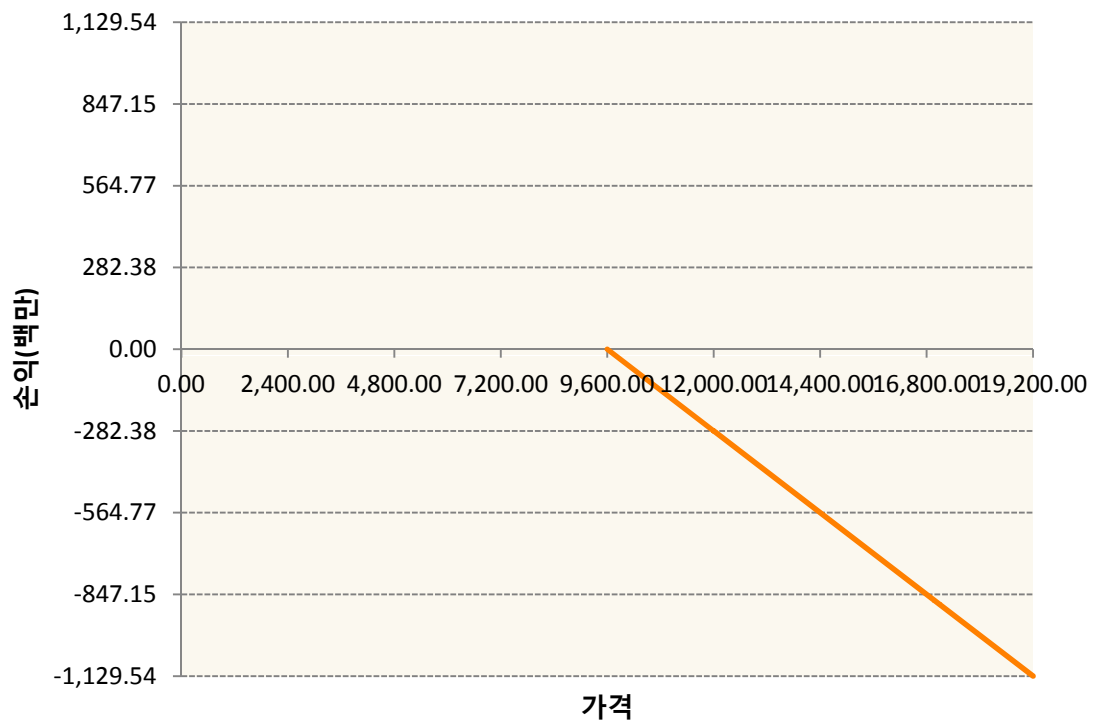


OHHIM0-C95-HSCEI

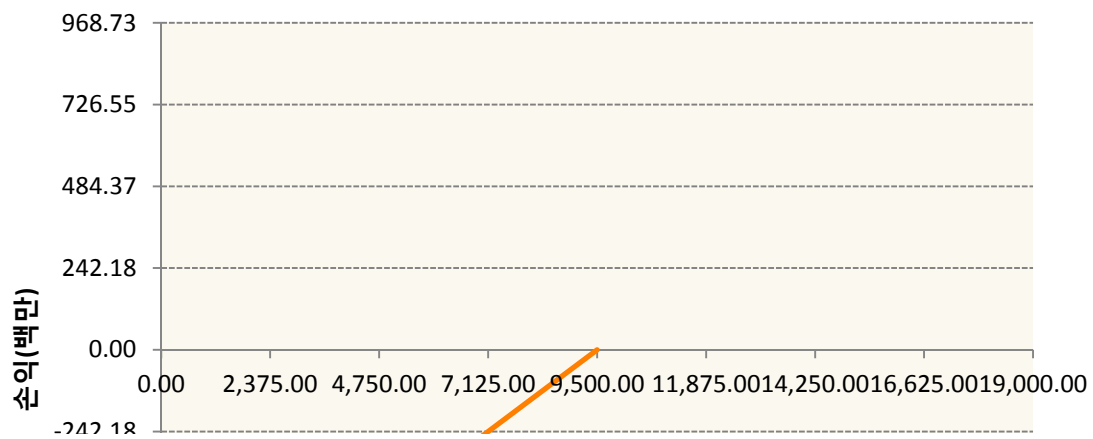


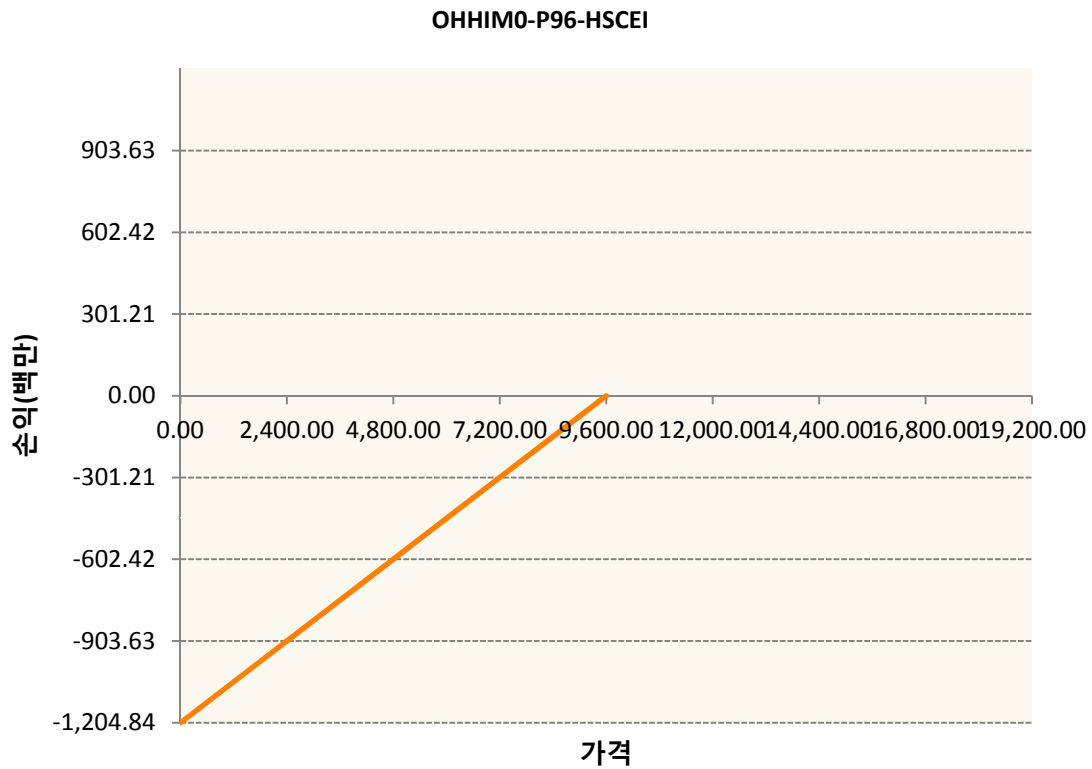


OHHIM0-C96-HSCEI



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)
	576

공시일	2020-06-23
기준일	2020-06-22

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

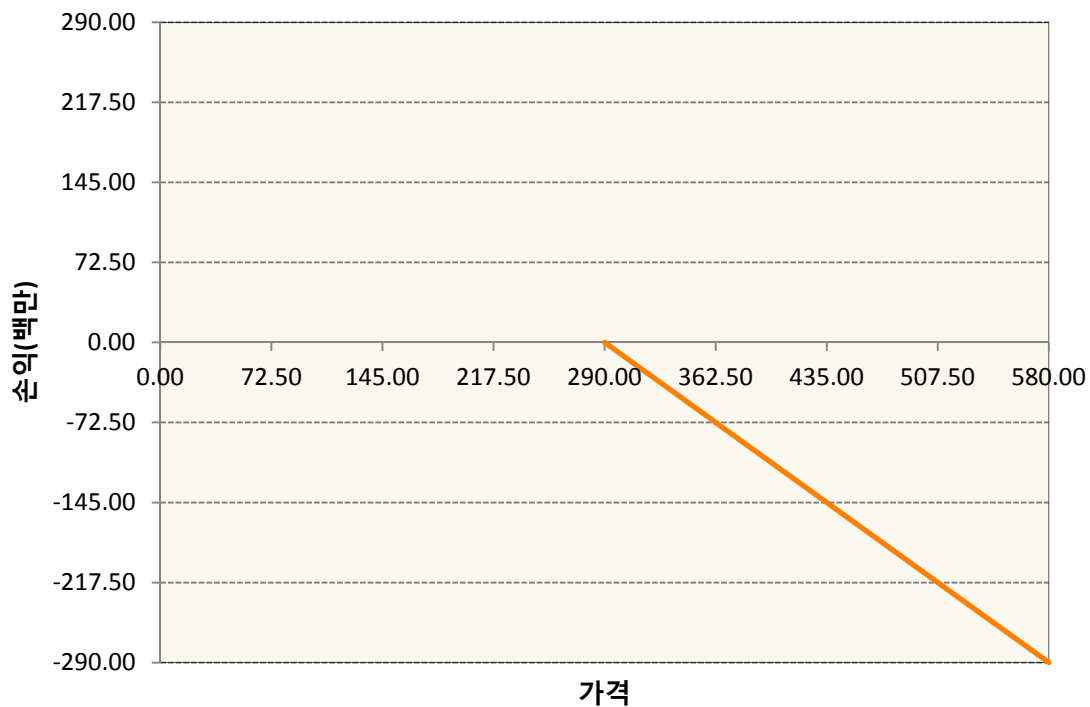
1. 계약금액

(단위:백만원)

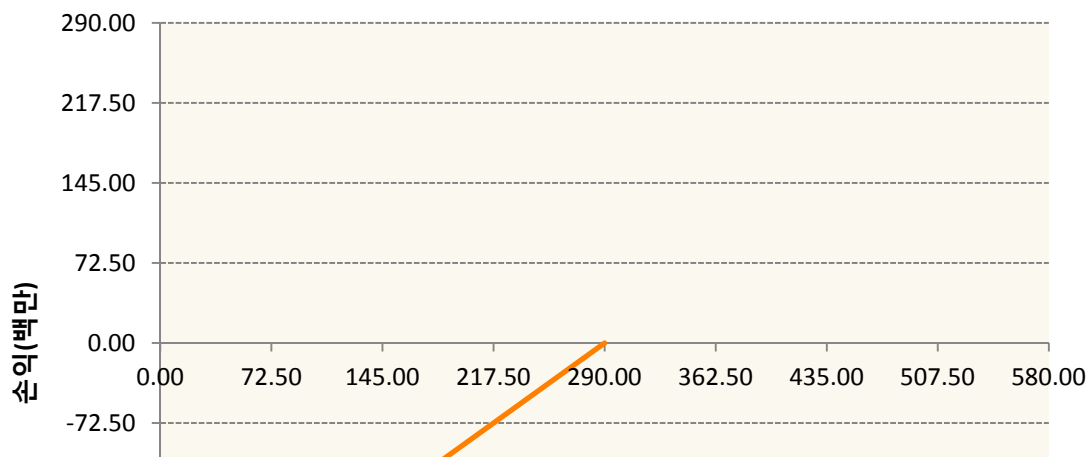
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	580	-580	장내

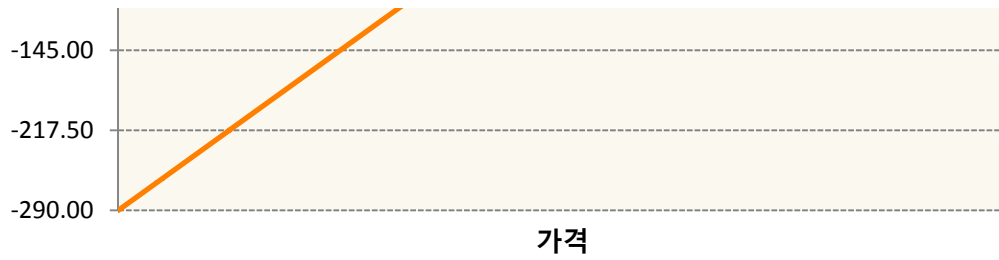
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q72906-2020-07 콜290



KR4301Q72904-2020-07 풋290





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q72906			2020-07 콜290				15
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7	7	6	6	5	5	4
-5.33%	6	6	5	5	4	3	2
-2.67%	5	4	3	3	2	1	0
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	0	-1	-2	-3	-4	-5	-6
5.33%	-5	-6	-7	-8	-8	-9	-10
8.00%	-10	-11	-12	-12	-13	-14	-15
KR4301Q72904			2020-07 풋290				19
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-18	-18	-18	-18	-19	-19	-19
-5.33%	-11	-11	-11	-12	-12	-12	-13
-2.67%	-4	-4	-5	-5	-6	-6	-7
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	6	6	5	4	4	3	2
5.33%	10	9	8	8	7	6	6
8.00%	12	11	11	10	9	9	8

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

32

공시일	2020-06-23
기준일	2020-06-22

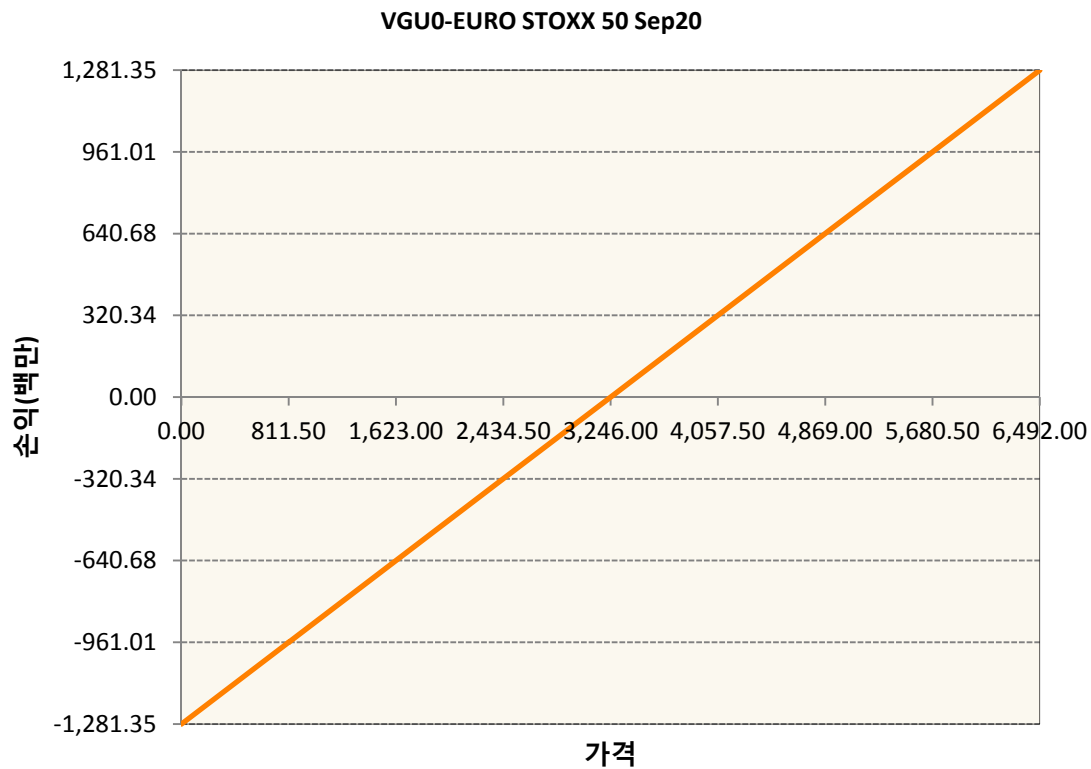
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

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	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,281	0	1,281	
누계	유가증권	스왑	8,118	0	8,118	장외
누계	통화	선도	0	2,946	-2,946	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPxSG EURO Covered CALL STRATEGY	23
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E	220
FX21020K02 KRW/EUR 26-06-20E	15
VGU0 EURO STOXX 50 Sep20	103

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

(단위:백만원)

330

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

(단위:백만원)

1,308

공시일	2020-06-23
기준일	2020-06-22

ETF스마트레버리지목표전환형9호

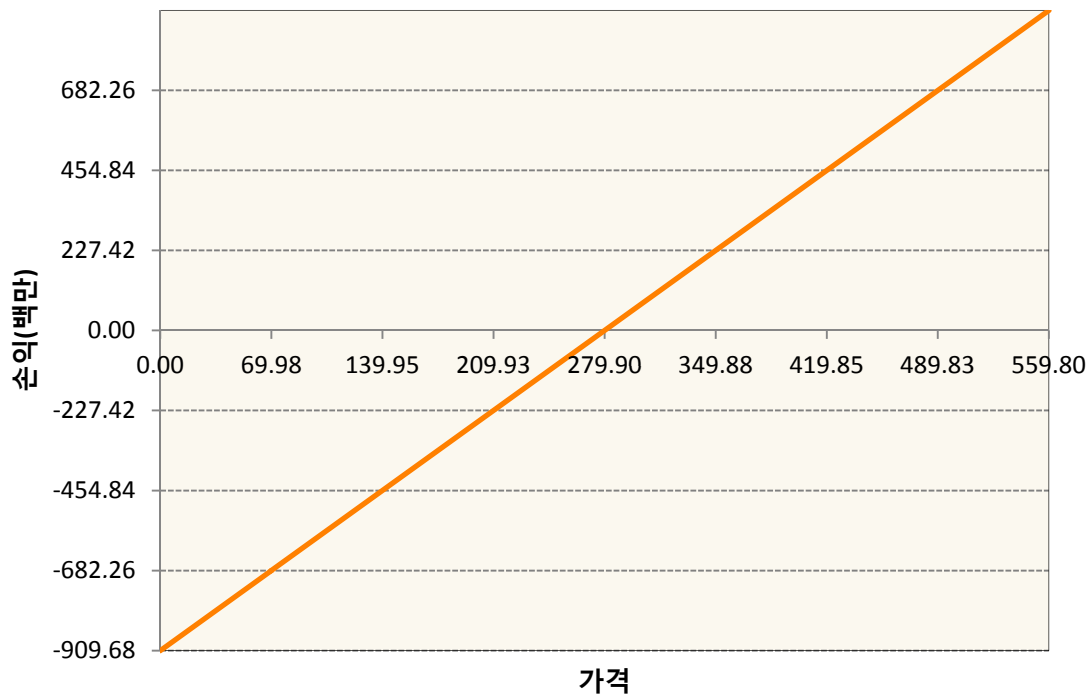
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	910	0	910	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)

115

ETF스마트레버리지목표전환형10호

(단위:백만원)

2. 만기시점의 손익구조

The graph illustrates the payoff of a call option. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 559.80. The y-axis, labeled '콜의(백만)' (Call Option Value in millions), ranges from -1,329.53 to 1,329.53. A solid orange line shows the payoff, which is zero for stock prices up to 279.90 and then increases linearly. Dashed horizontal lines are drawn at intervals of 332.38.

가격 (Price)	콜의(백만) (Call Option Value in millions)
0.00	-1,329.53
69.98	-997.14
139.95	-664.76
209.93	-332.38
279.90	0.00
349.88	332.38
419.85	664.76
489.83	997.14
559.80	1,329.53

(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	2020-06-23
기준일	2020-06-22

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

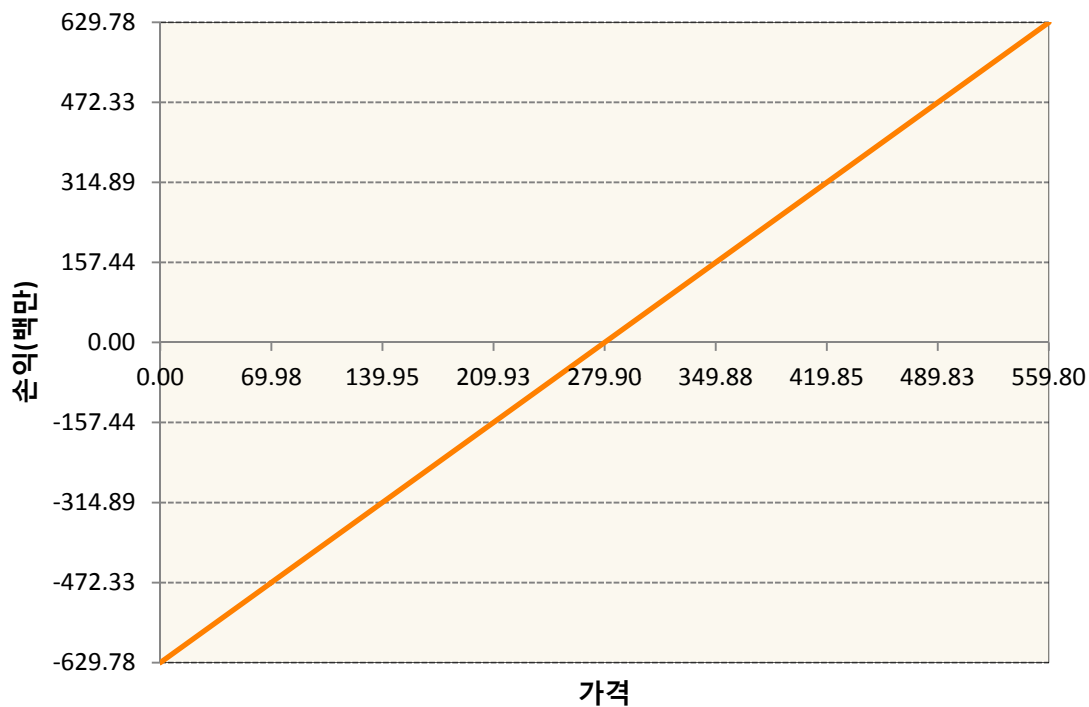
1. 계약금액

(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



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	2020-06-23
기준일	2020-06-22

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

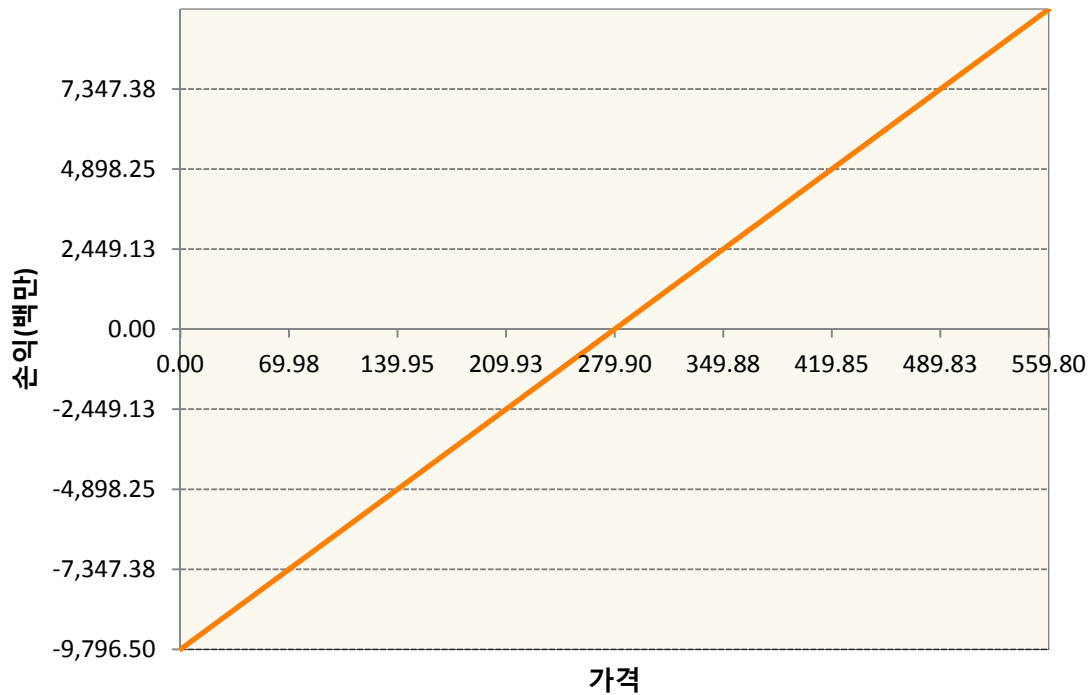
1. 계약금액

(단위:백만원)

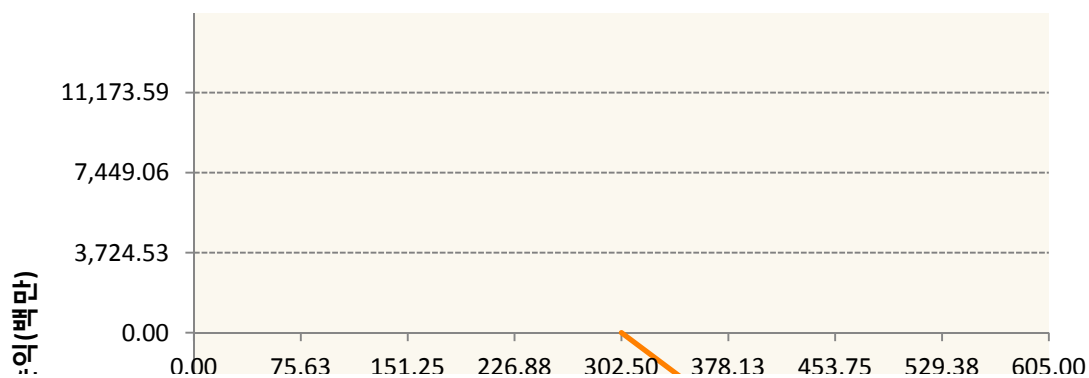
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,797	0	9,797	장내
누계	유가증권	옵션	3,247	19,092	-15,845	장내

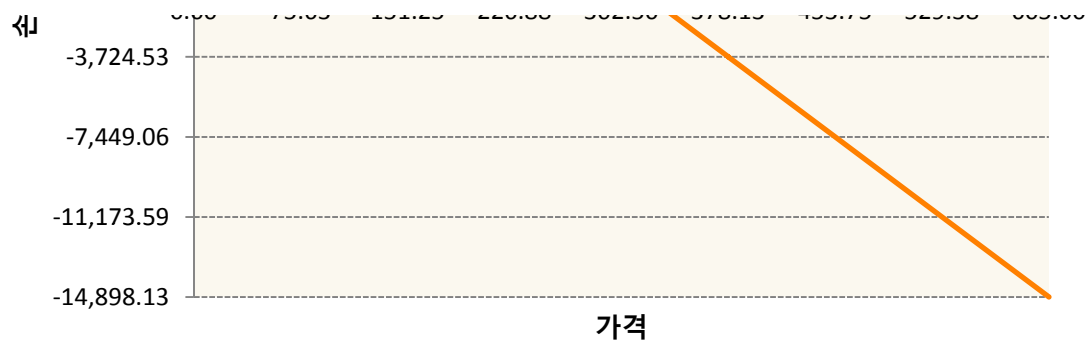
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물

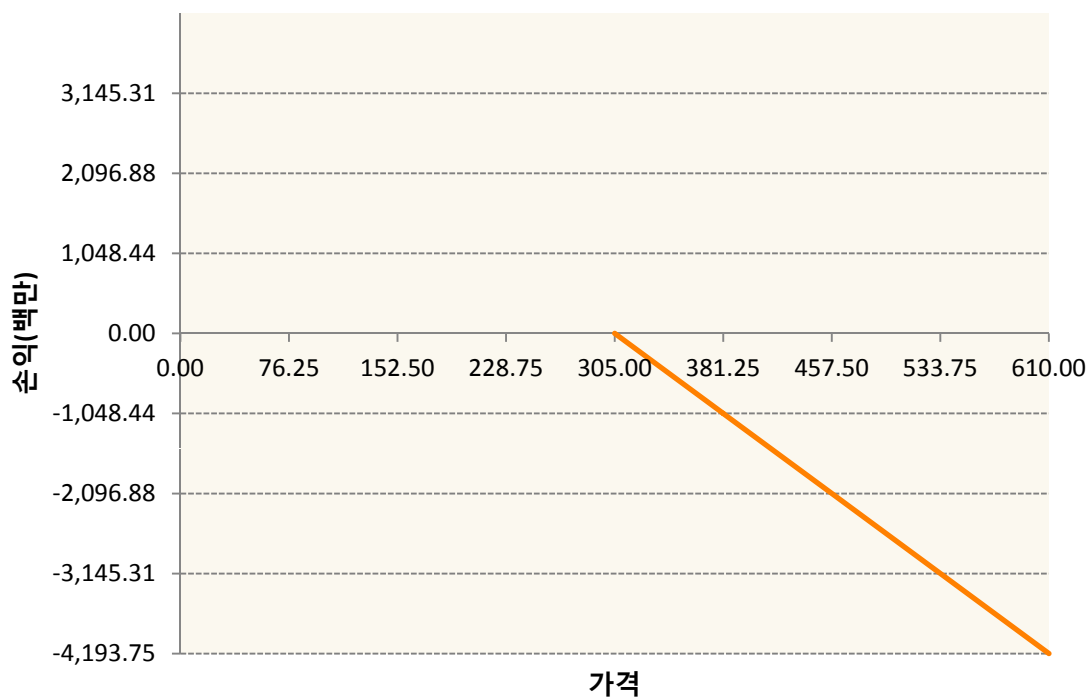


KR4201Q73029-2020-07 콜302.5

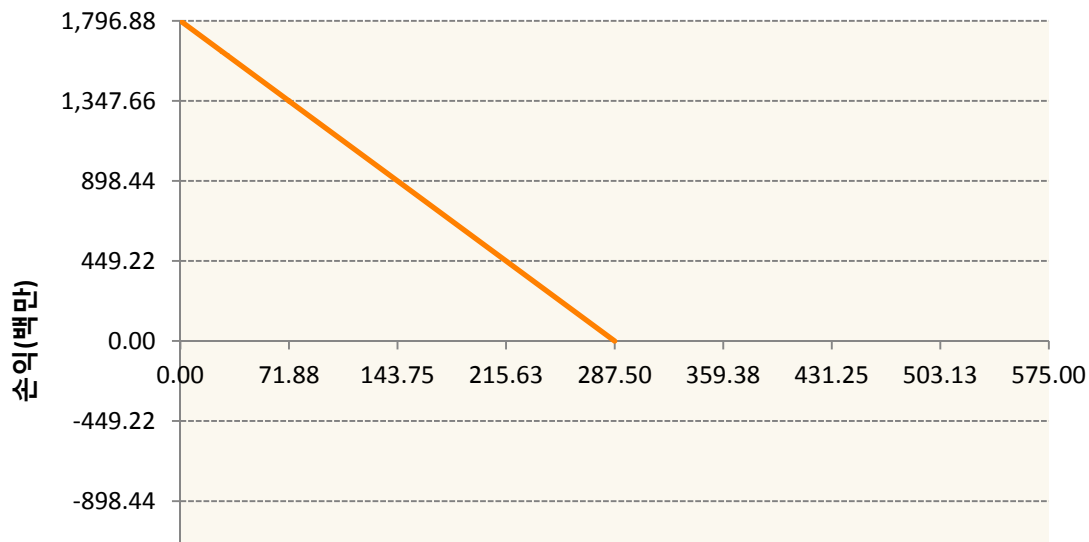


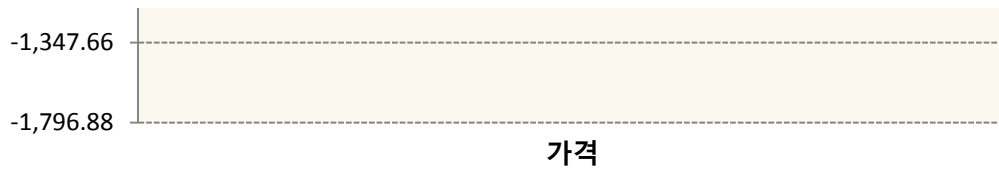
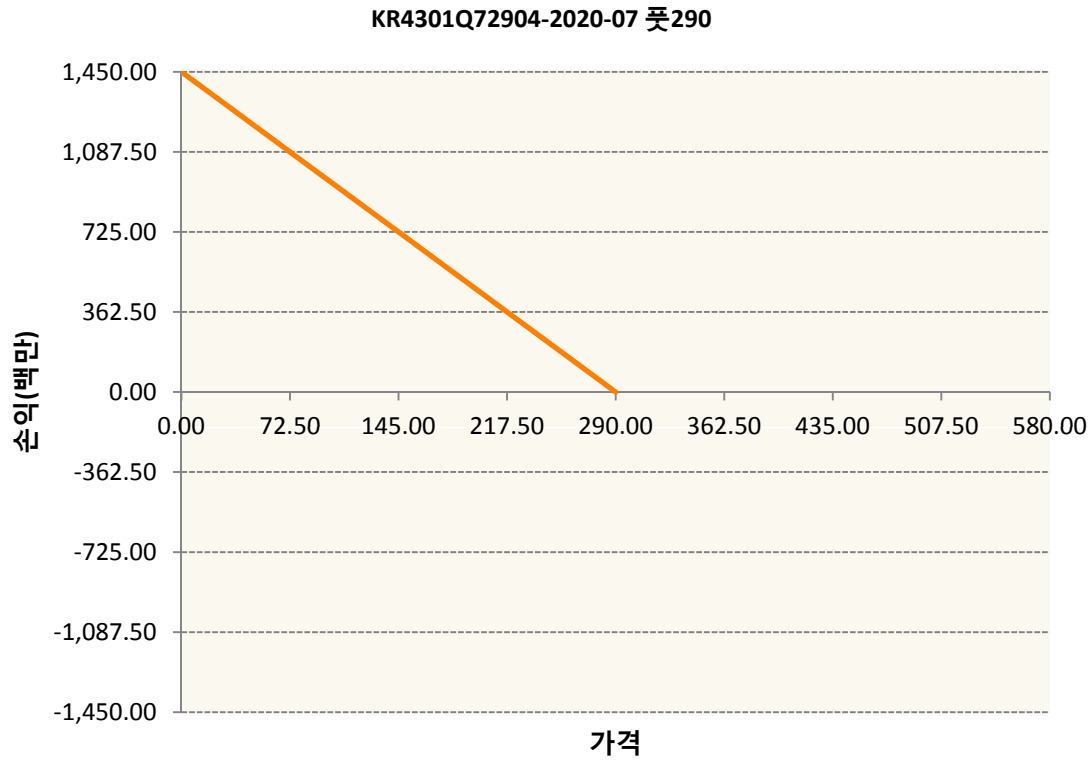


KR4201Q73052-2020-07 콜305



KR4301Q72870-2020-07 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q90009			2020-09 코스피200지수선물				788
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-788	-788	-788	-788	-788	-788	-788
-5.33%	-525	-525	-525	-525	-525	-525	-525
-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%	525	525	525	525	525	525	525
8.00%	788	788	788	788	788	788	788
KR4201Q73029			2020-07 콜302.5				582
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	193	186	176	163	148	130	110
-5.33%	180	167	150	131	108	83	56
-2.67%	153	131	106	78	48	15	-19

0%	103	71	36	0	-38	-77	-118
2.67%	18	-23	-65	-109	-153	-198	-244
5.33%	-108	-156	-204	-252	-301	-350	-398
8.00%	-282	-332	-382	-432	-482	-532	-582
KR4201Q73052 2020-07 콜305							153
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	47	46	43	40	36	32	27
-5.33%	44	41	37	32	27	20	13
-2.67%	38	33	27	19	12	3	-6
0%	26	18	10	0	-10	-21	-31
2.67%	6	-5	-16	-28	-40	-52	-64
5.33%	-25	-38	-51	-65	-78	-91	-105
8.00%	-69	-83	-97	-111	-125	-139	-153
KR4301Q72870 2020-07 풋287.5							116
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	107	108	109	111	112	114	116
-5.33%	63	65	67	69	71	74	77
-2.67%	22	25	28	32	35	39	42
0%	-12	-8	-4	0	4	8	12
2.67%	-38	-34	-29	-25	-21	-16	-12
5.33%	-55	-51	-47	-43	-39	-35	-31
8.00%	-65	-62	-59	-56	-53	-49	-45
KR4301Q72904 2020-07 풋290							96
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	90	90	91	92	93	94	96
-5.33%	54	55	56	58	60	62	64
-2.67%	20	22	24	27	29	32	35
0%	-9	-6	-3	0	3	6	10
2.67%	-32	-29	-25	-22	-18	-15	-11
5.33%	-48	-45	-42	-38	-35	-31	-28
8.00%	-58	-55	-53	-50	-47	-44	-41

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

(단위:백만원)

1,924

공시일	2020-06-23
기준일	2020-06-22

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	141,964	0	141,964	

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	2020-06-23
기준일	2020-06-22

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	100,027	0	100,027	

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	2020-06-23
기준일	2020-06-22

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	466,035	0	466,035	
누계	통화	선도	0	445,469	-445,469	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J03\$ KRW/USD 24-07-20E	2,188
FX21020J04\$ KRW/USD 24-07-20E	1,751
FX21020J04\$ KRW/USD 24-07-20E	1,945
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	2,373
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	973
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,021
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,615
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	3,404
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	6,906
FX21020M0\$ KRW/USD 26-08-20E	584
FX21020M0\$ KRW/USD 26-08-20E	4,766
FX21020M0\$ KRW/USD 14-09-20E	2,023
FX21020M0\$ KRW/USD 14-09-20E	2,451
FX21020M0\$ KRW/USD 22-09-20E	1,012
FX21020M0\$ KRW/USD 22-09-20E	2,626

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

18,475

공시일	2020-06-23
기준일	2020-06-22

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

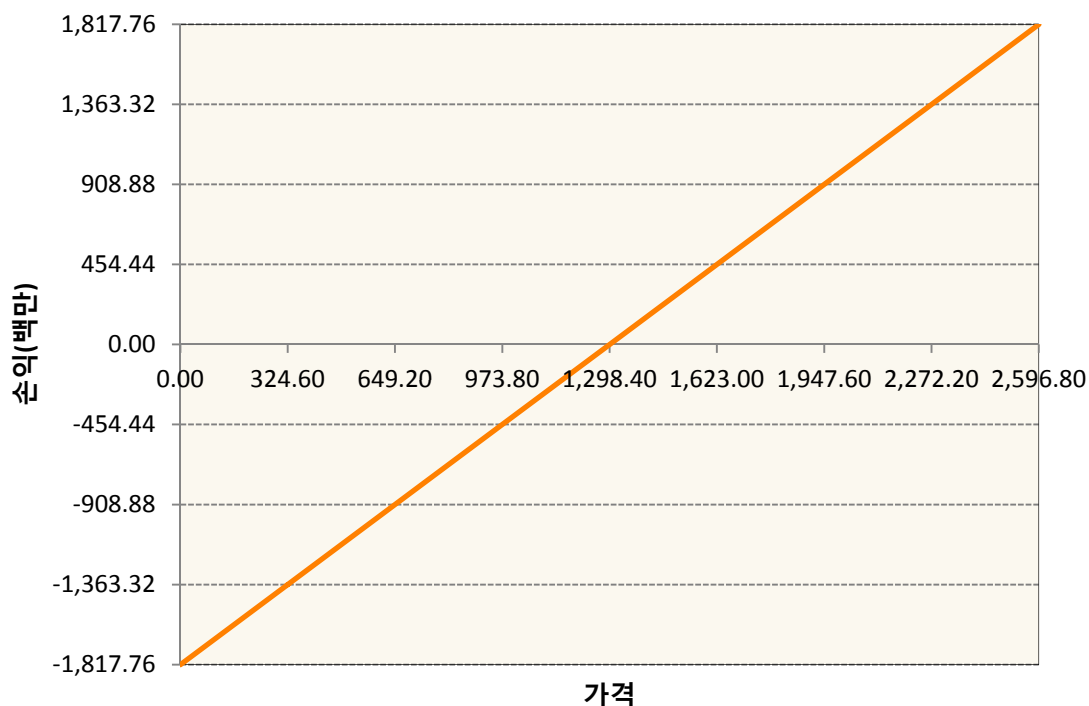
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,818	0	1,818	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%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97
-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%	97	97	97	97	97	97	97
8.00%	146	146	146	146	146	146	146

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

(단위:백만원)

230

공시일	2020-06-23
기준일	2020-06-22

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	7,682	0	7,682	
누계	통화	선도	0	7,550	-7,550	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	78
FX21020M00 KRW/USD 20-07-20E	10
FX21020M02 KRW/USD 20-07-20E	15
FX21020M03 KRW/USD 06-07-20E	49
FX21020M03 KRW/USD 15-07-20E	224
FX21020M03 KRW/USD 20-07-20E	56

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

313

공시일	2020-06-23
기준일	2020-06-22

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

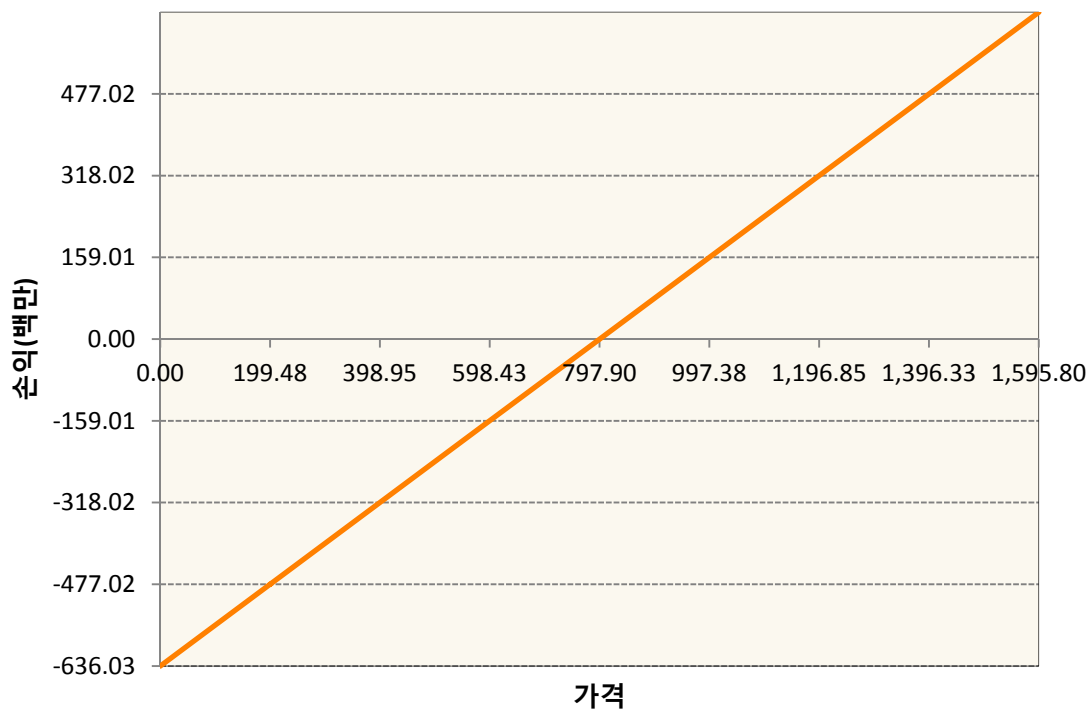
1. 계약금액

(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	636	0	636	
누계	유가증권	스왑	987	0	987	장외
누계	통화	선도	210	890	-681	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	51

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	173

공시일	2020-06-23
기준일	2020-06-22

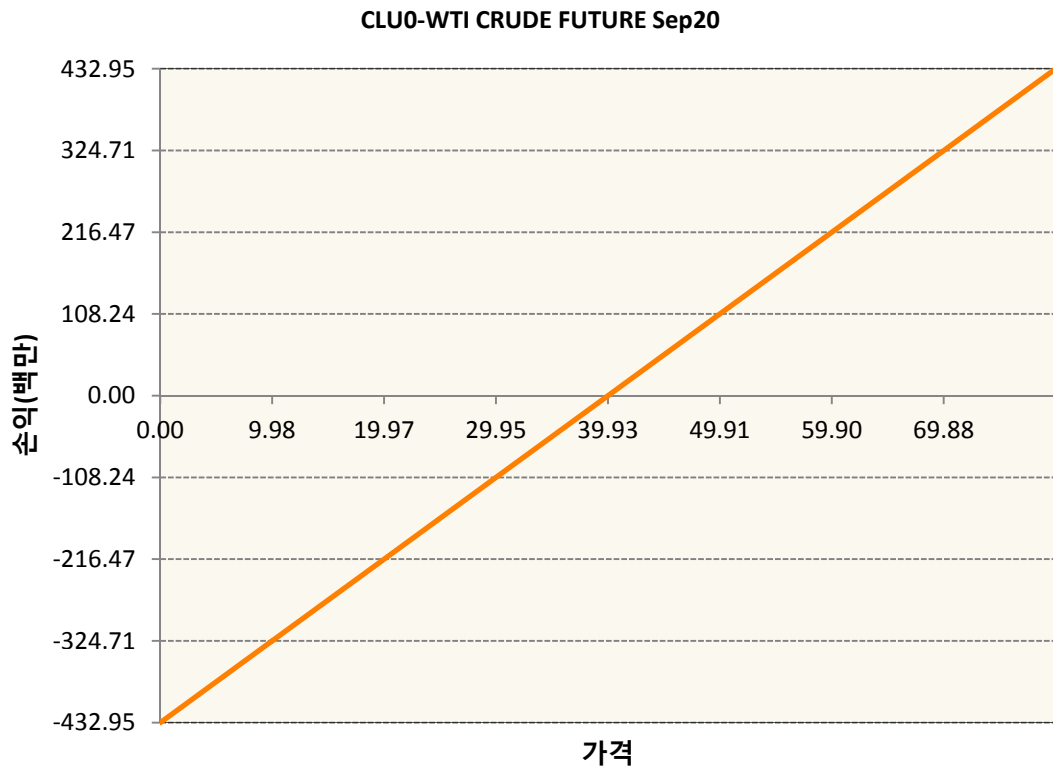
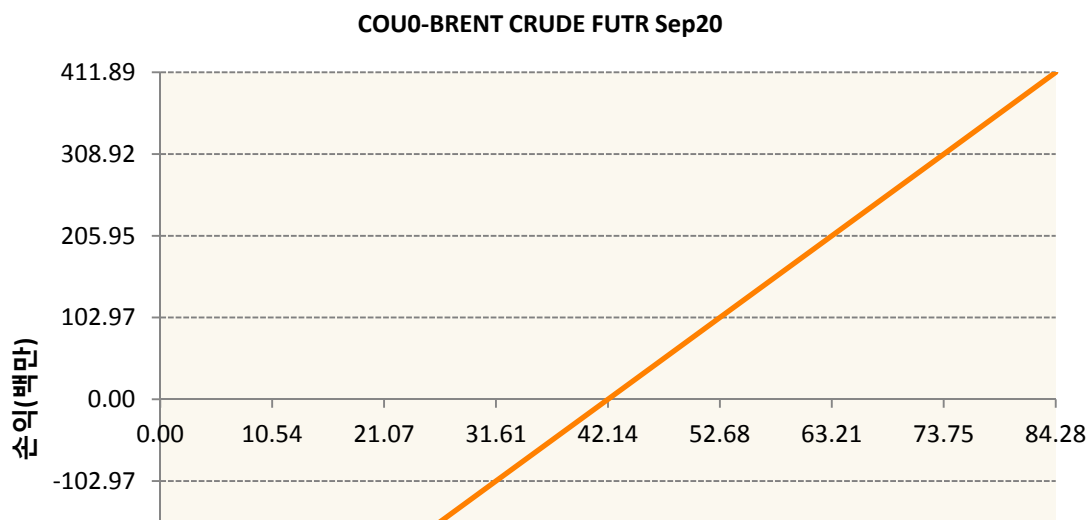
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

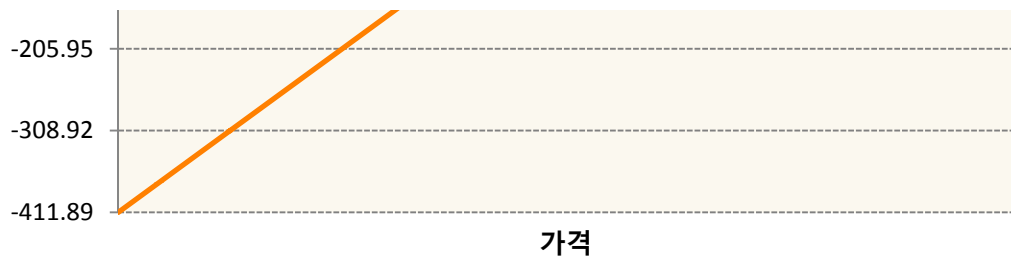
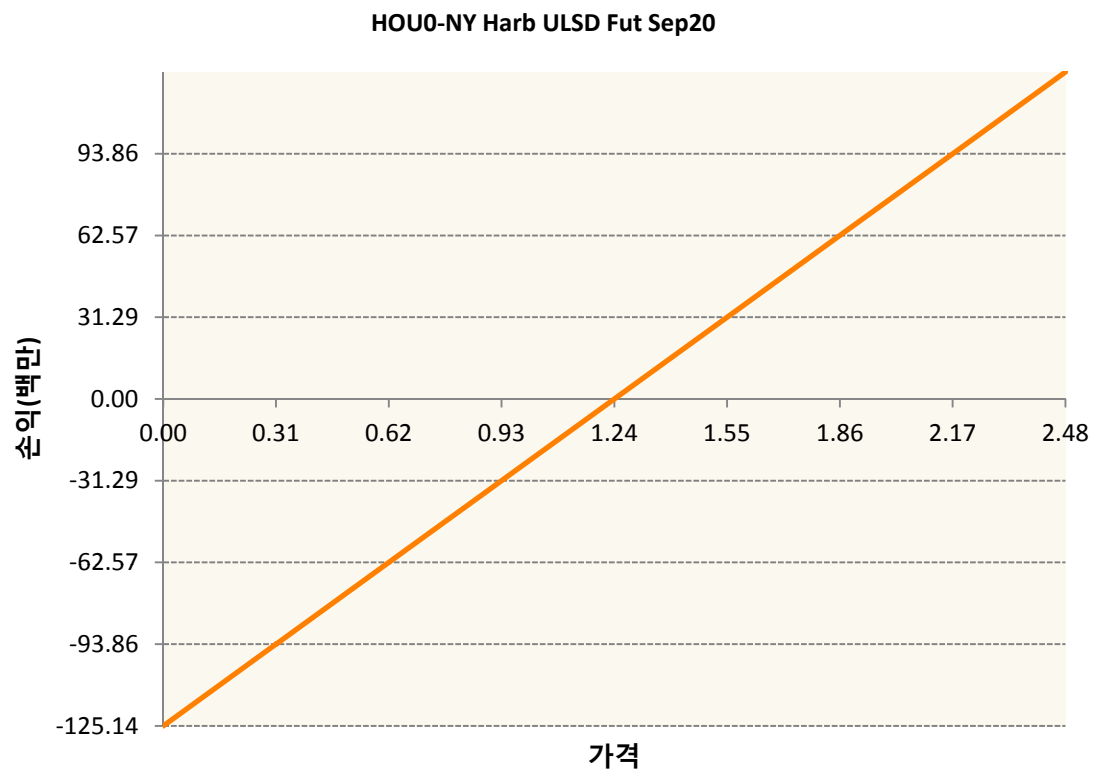
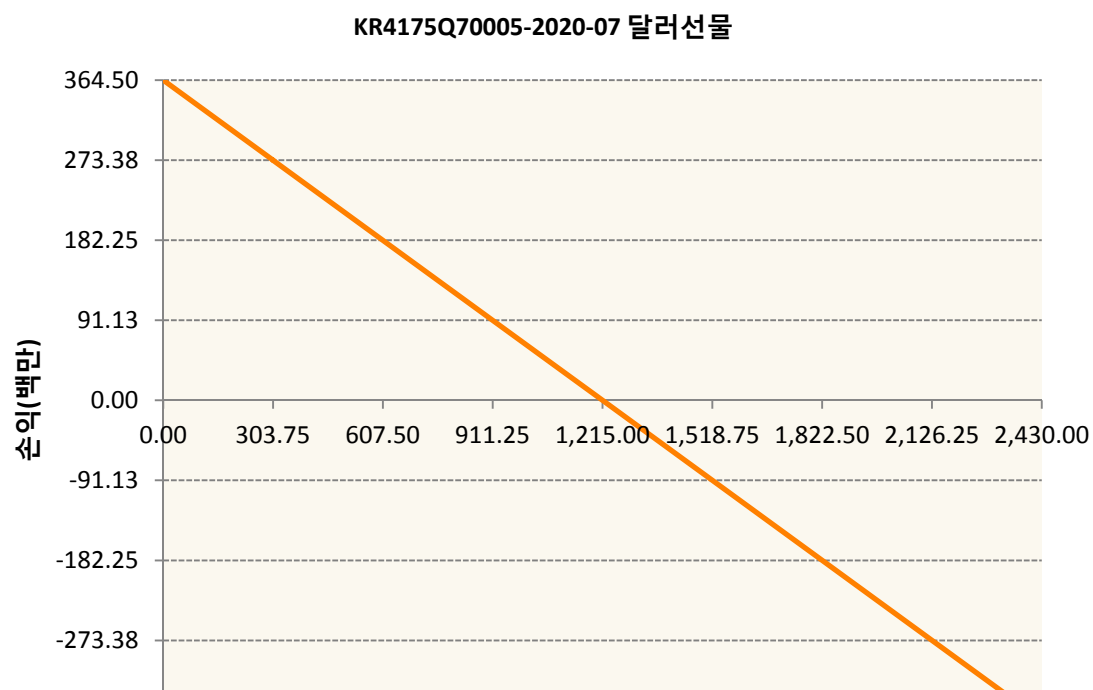
1. 계약금액

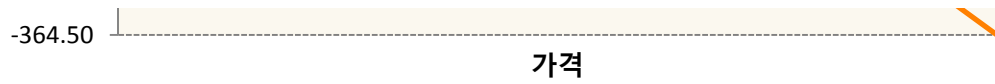
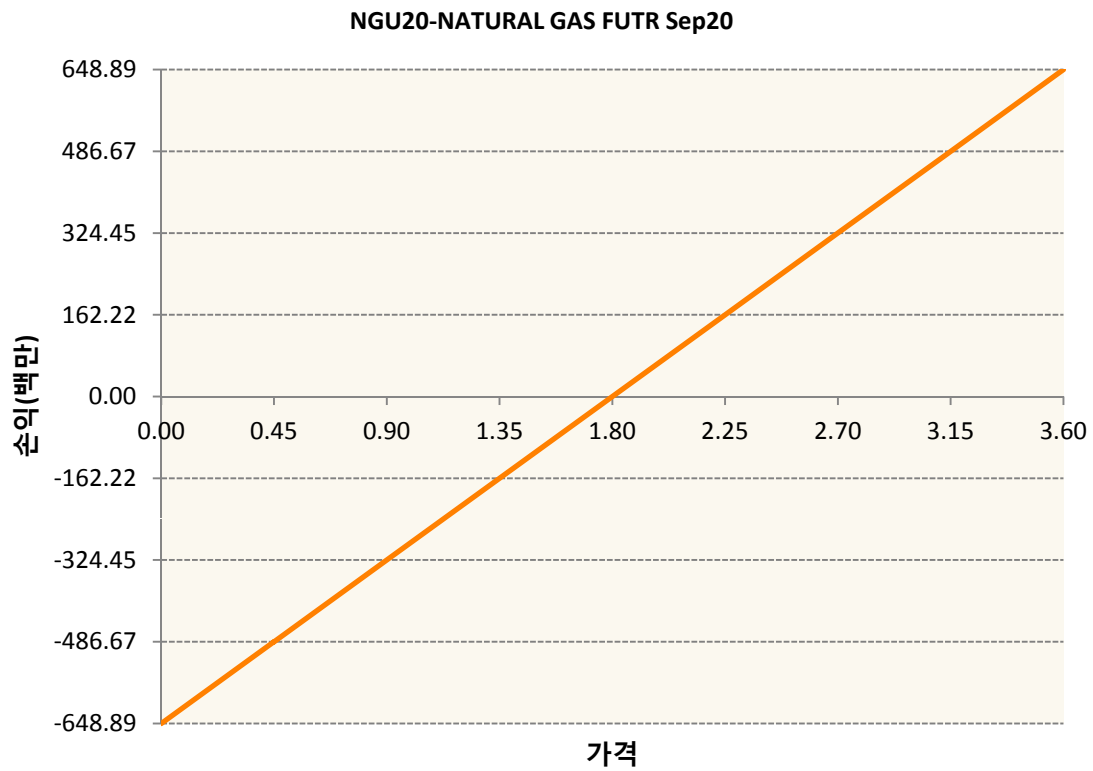
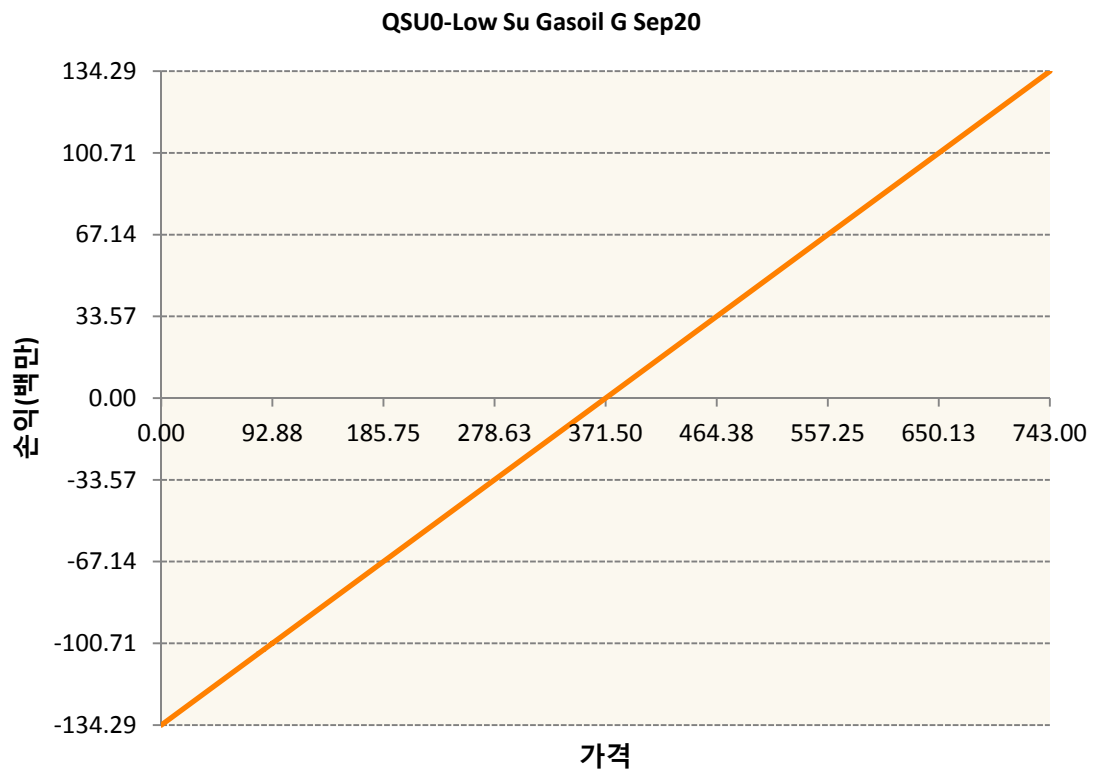
(단위:백만원)

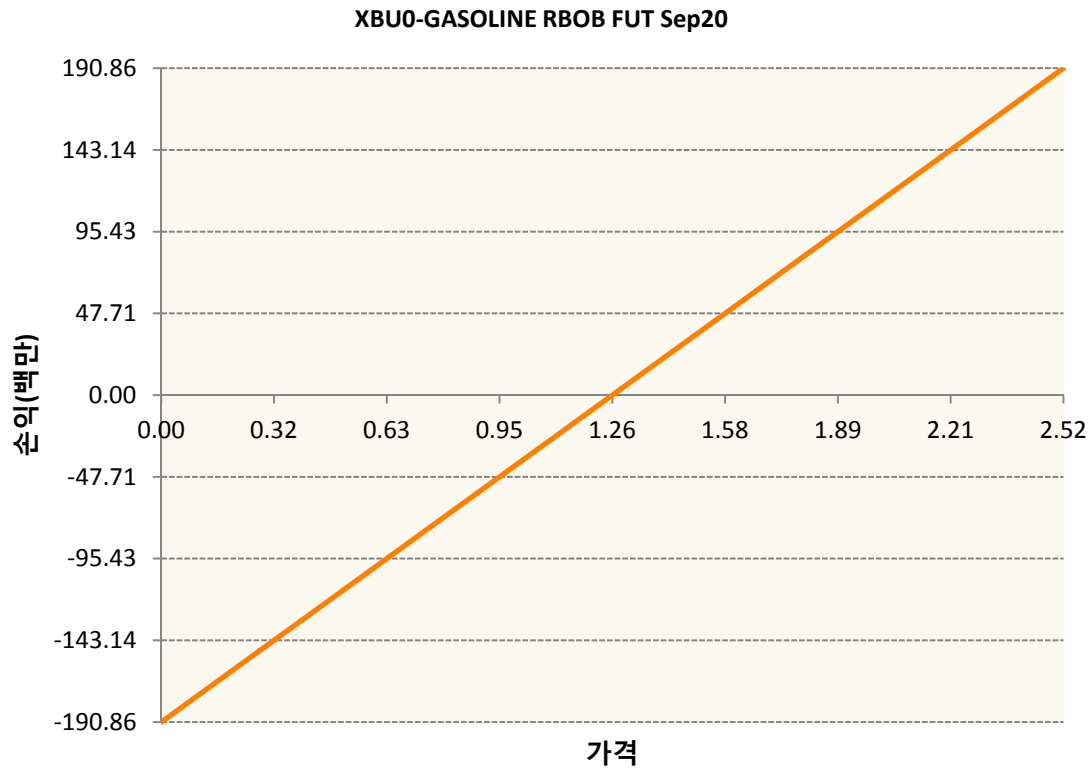
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,944	365	1,580	

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLU0	WTI CRUDE FUTURE Sep20		35
COU0	BRENT CRUDE FUTR Sep20		33
HOU0	NY Harb ULSD Fut Sep20		10
KR4175Q70C 2020-07 달러선물			29
NGU20	NATURAL GAS FUTR Sep20		52
QSU0	Low Su Gasoil G Sep20		11
XBU0	GASOLINE RBOB FUT Sep20		15

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	991

공시일	2020-06-23
기준일	2020-06-22

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

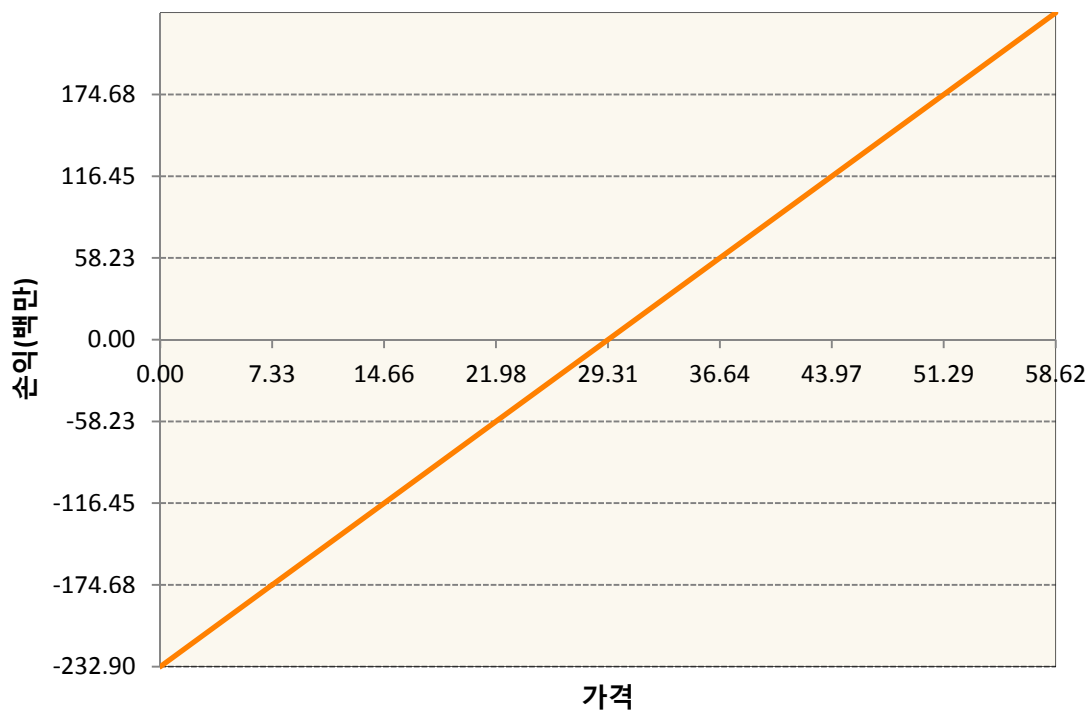
1. 계약금액

(단위:백만원)

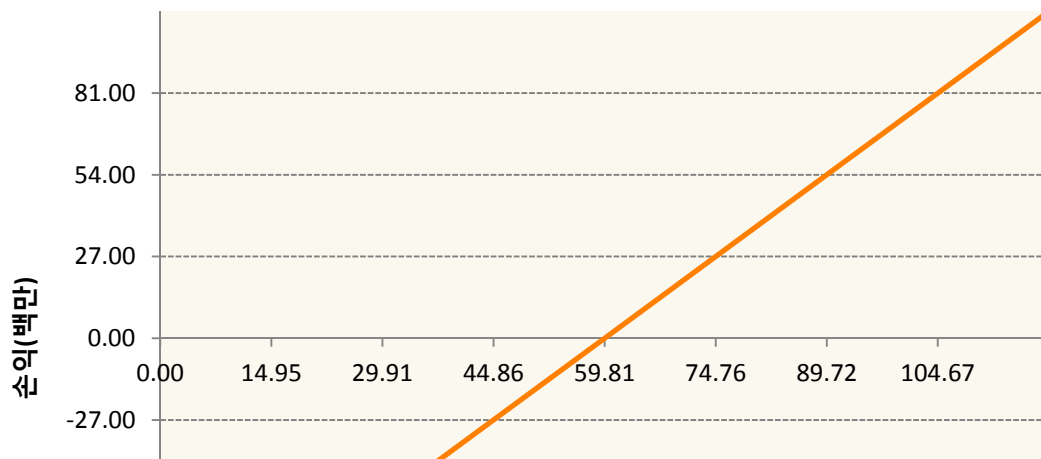
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,570	73	2,497	

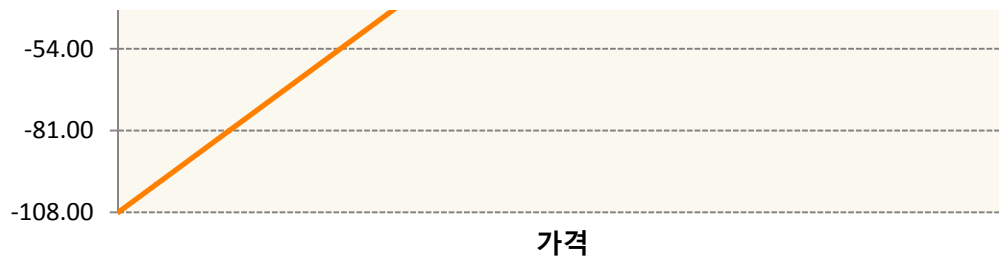
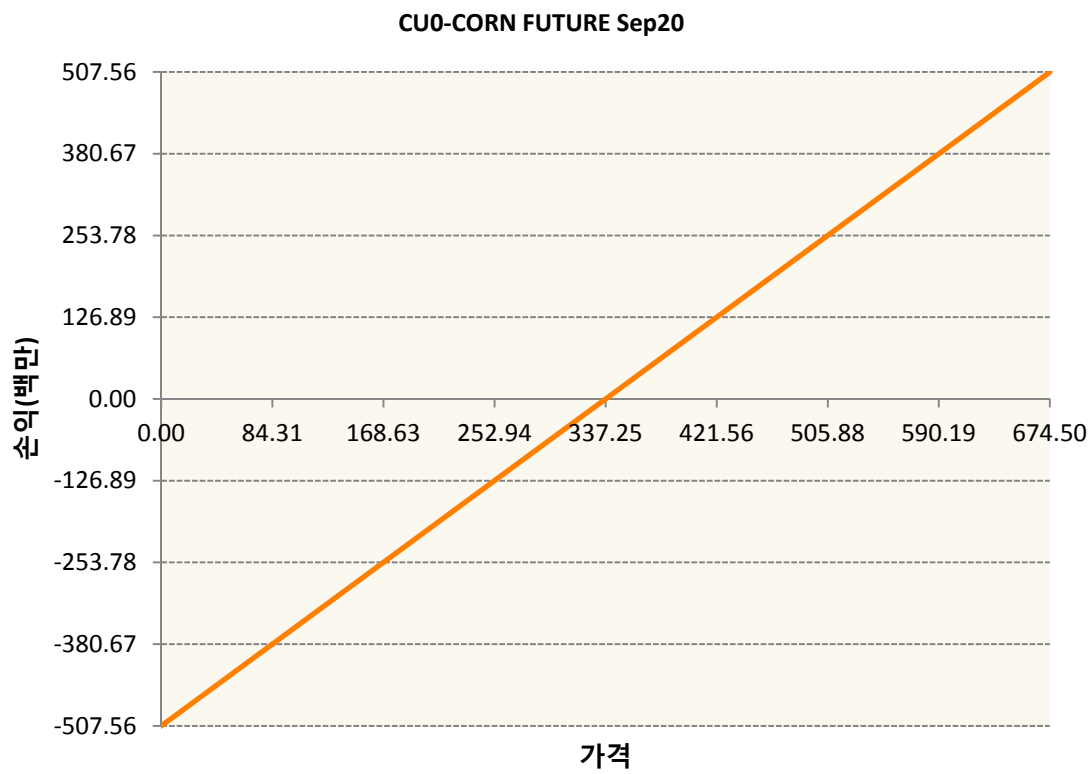
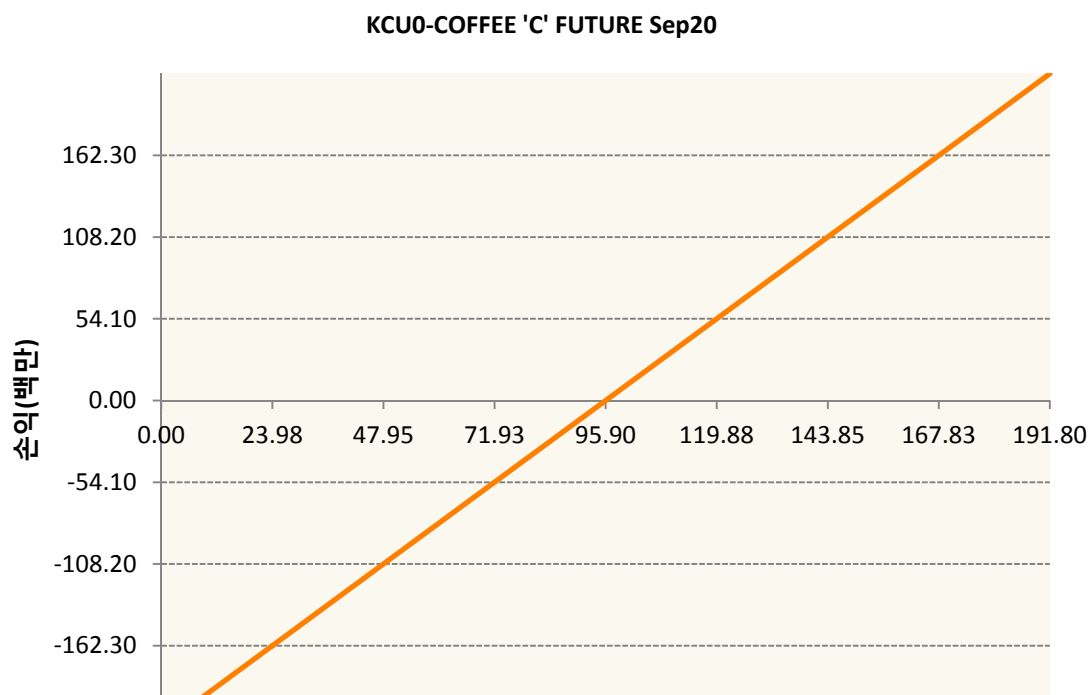
2. 만기시점의 손익구조

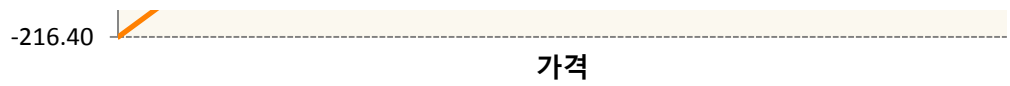
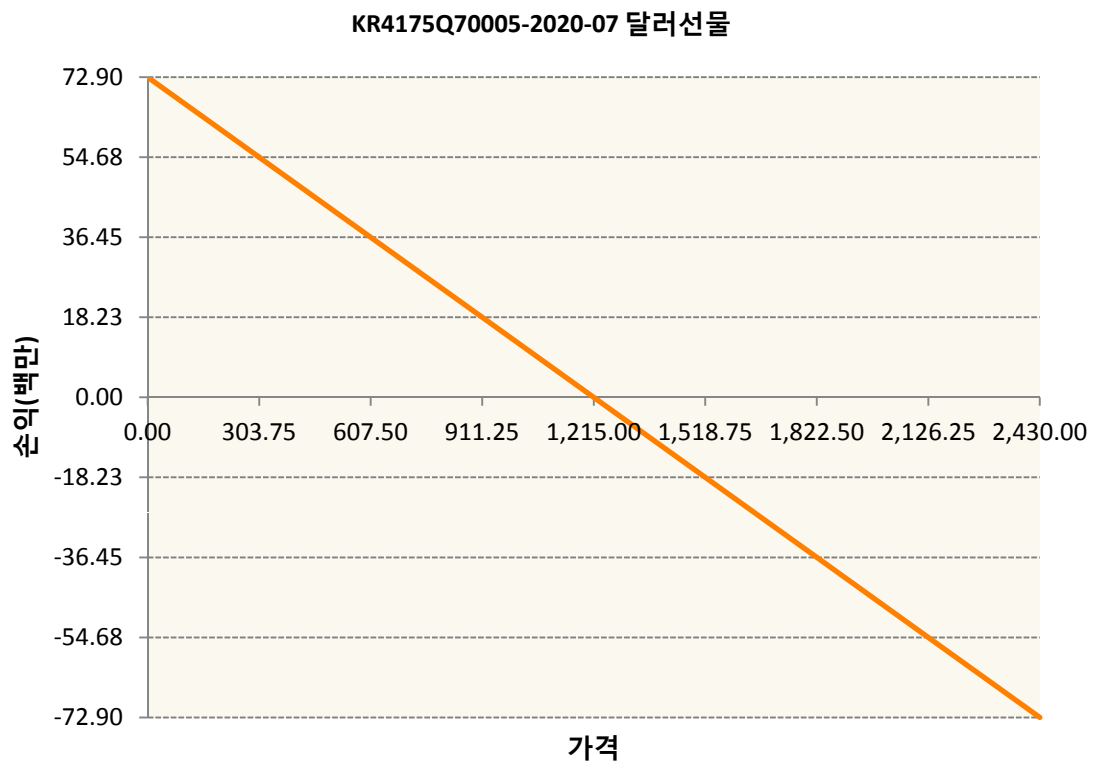
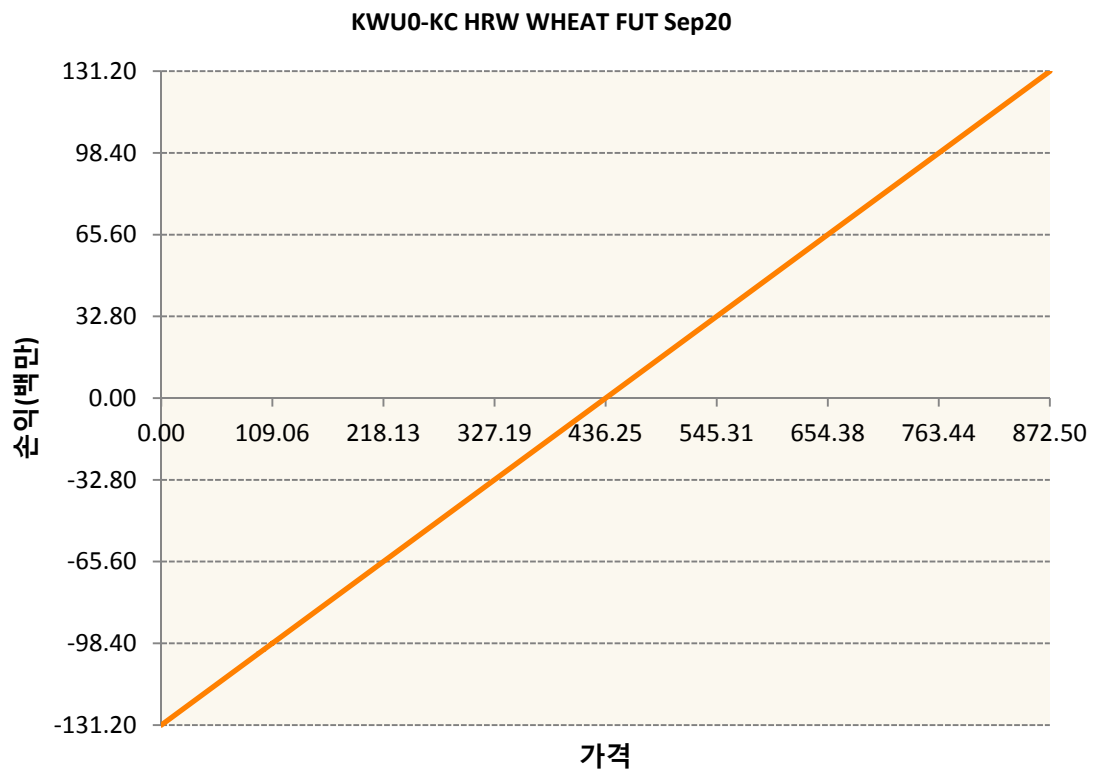
BOZ0-SOYBEAN OIL FUTR Dec20



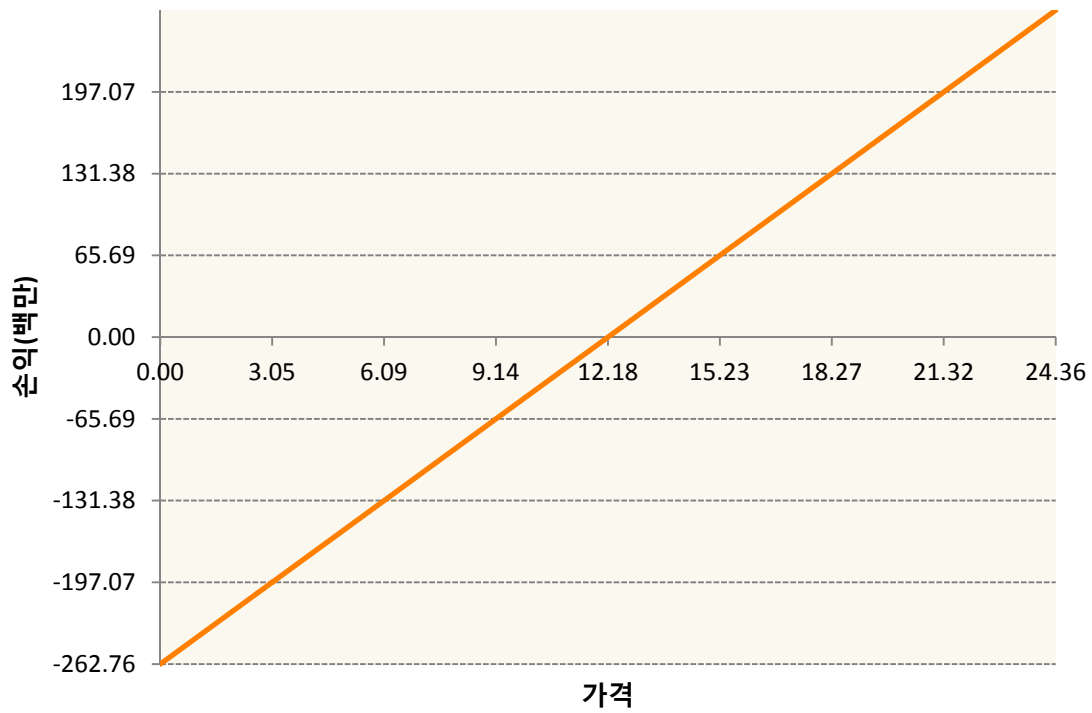
CTZ0-COTTON NO.2 FUTR Dec20



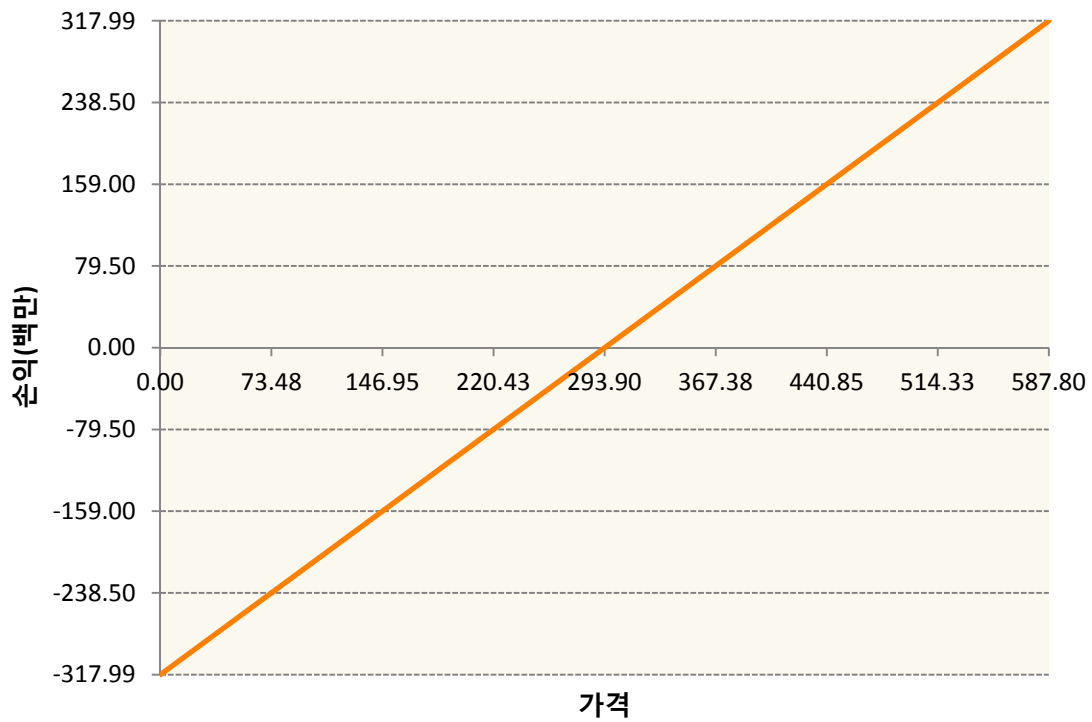




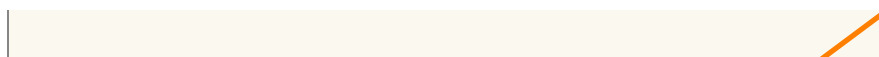
SBV0-Sugar Oct20

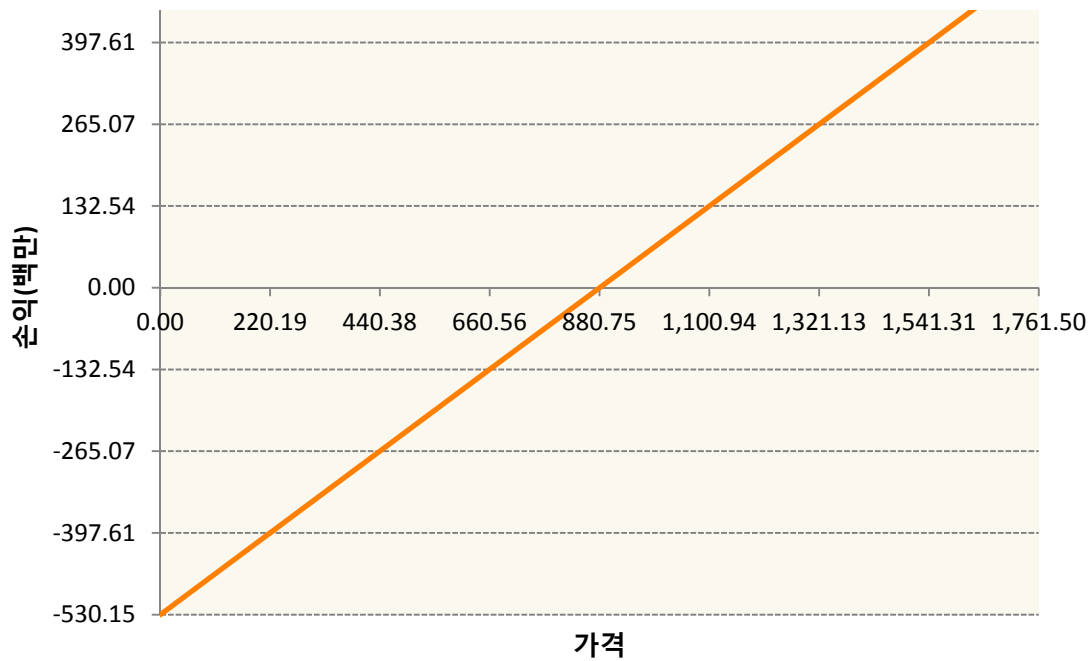
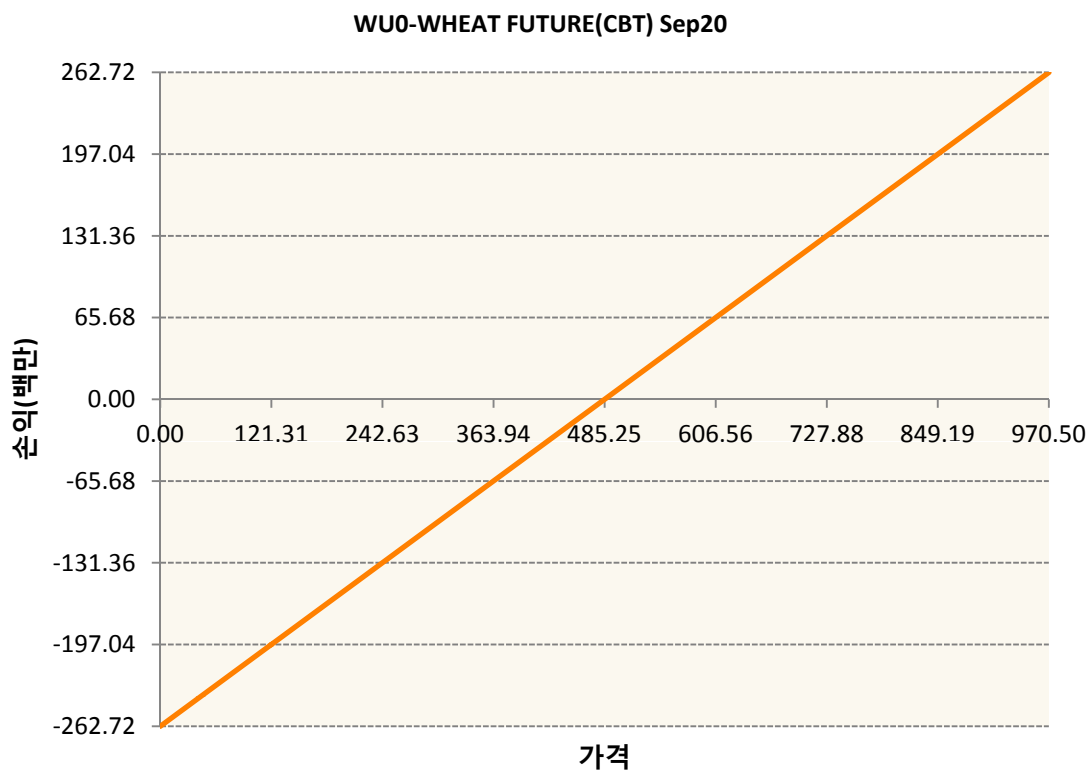


SMZ0-SOYBEAN MEAL FUTR Dec20



SX0-SOYBEAN FUTURE Nov20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ0	SOYBEAN OIL FUTR Dec20	19
CTZ0	COTTON NO.2 FUTR Dec20	9
CU0	CORN FUTURE Sep20	41
KCU0	COFFEE 'C' FUTURE Sep20	17
KR4175Q70C 2020-07 달러선물		6

KWU0	KC HRW WHEAT FUT Sep20	10
SBV0	Sugar Oct20	21
SMZ0	SOYBEAN MEAL FUTR Dec20	25
SX0	SOYBEAN FUTURE Nov20	42
WU0	WHEAT FUTURE(CBT) Sep20	21

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

(단위:백만원)

240