

공시일	2020-06-24
기준일	2020-06-23

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	2020-06-24
기준일	2020-06-23

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	2020-06-24
기준일	2020-06-23

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

607

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

879

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-06-24
기준일	2020-06-23

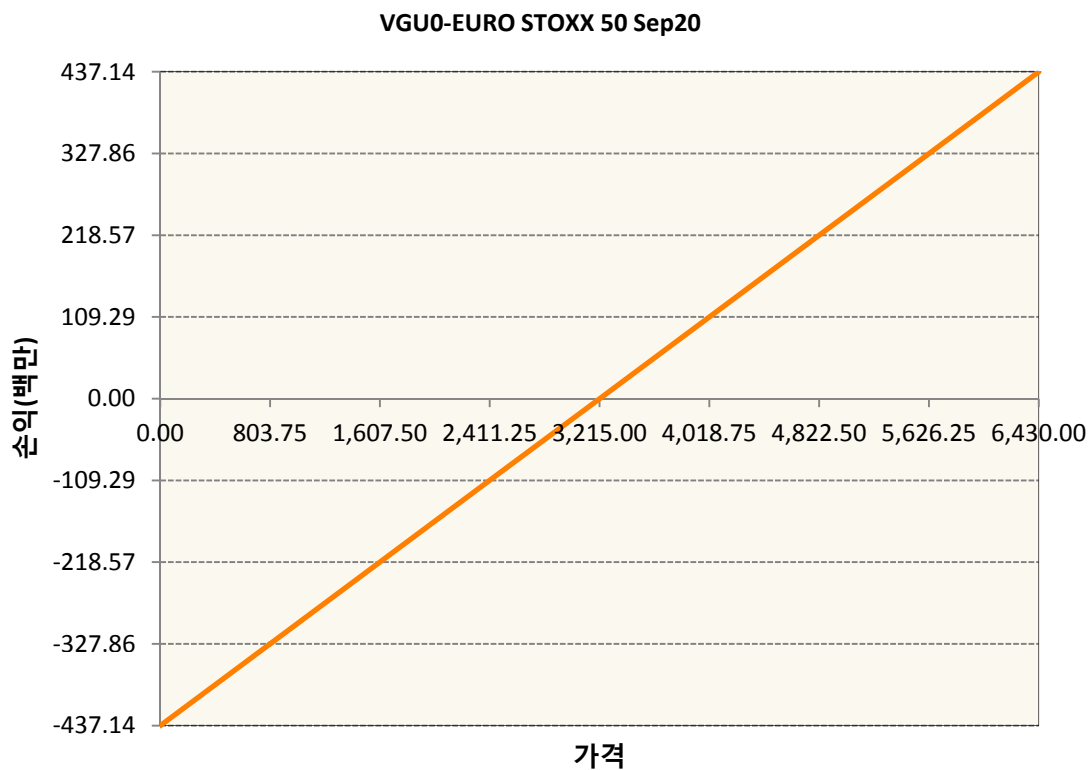
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	437	0	437	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU0	EURO STOXX 50 Sep20	35
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

47

공시일	2020-06-24
기준일	2020-06-23

차이나인덱스모(주식-파생형)

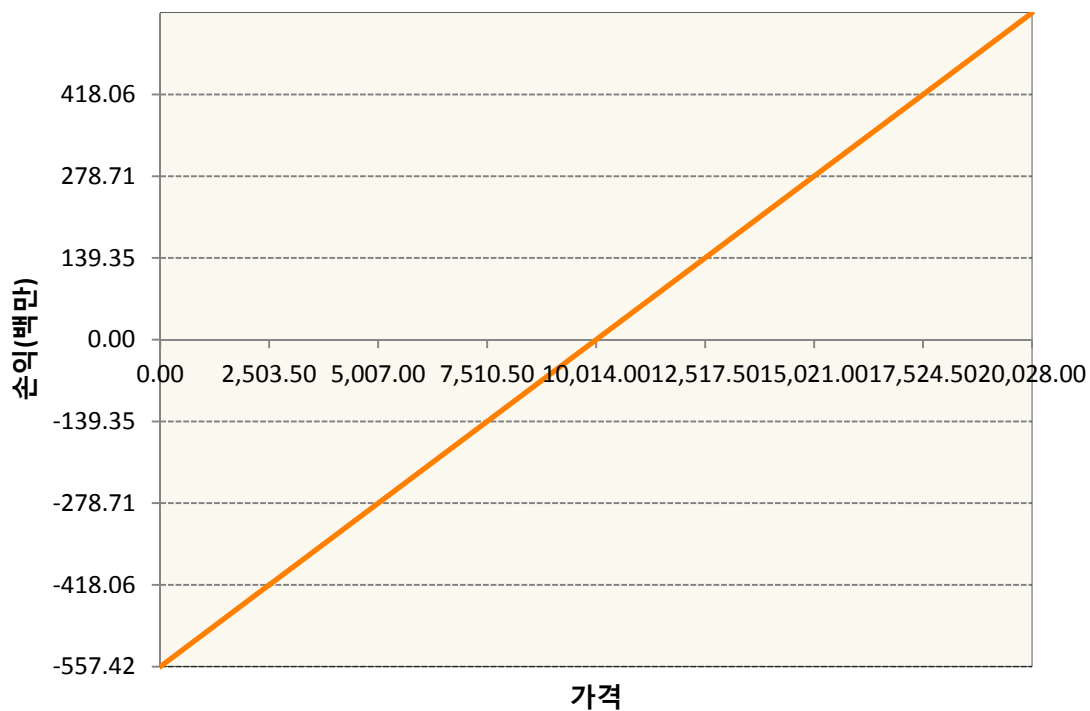
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	557	0	557	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCM0-HSCEI Futures Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

48

공시일	2020-06-24
기준일	2020-06-23

커버드콜모(주식혼합-파생형)

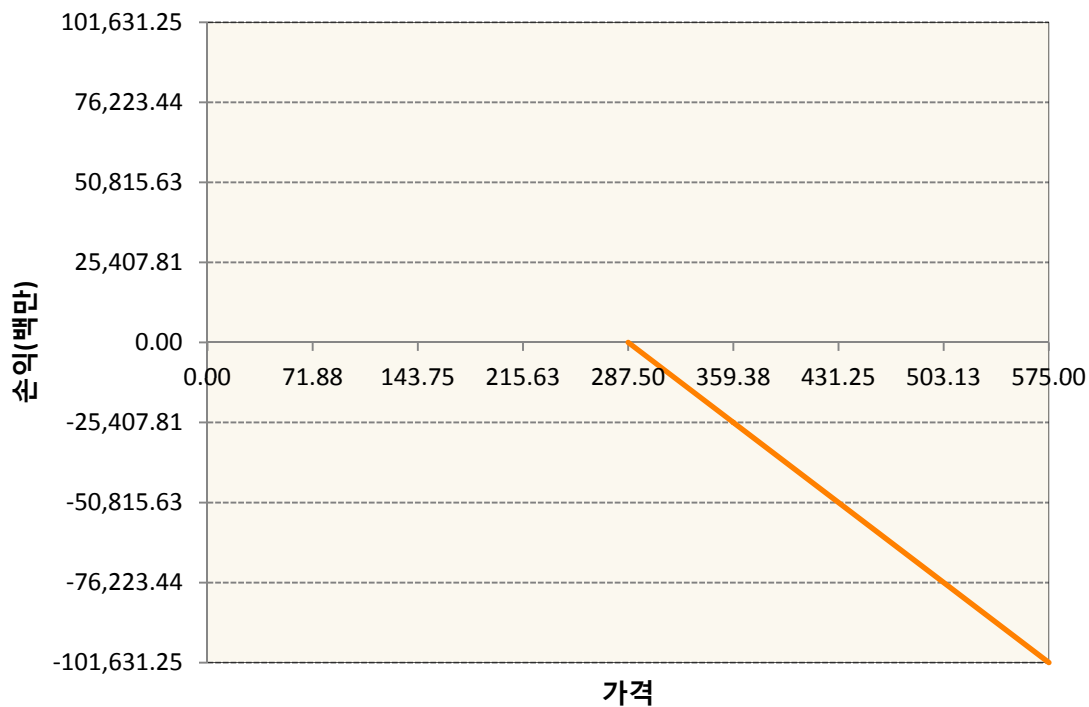
1. 계약금액

(단위:백만원)

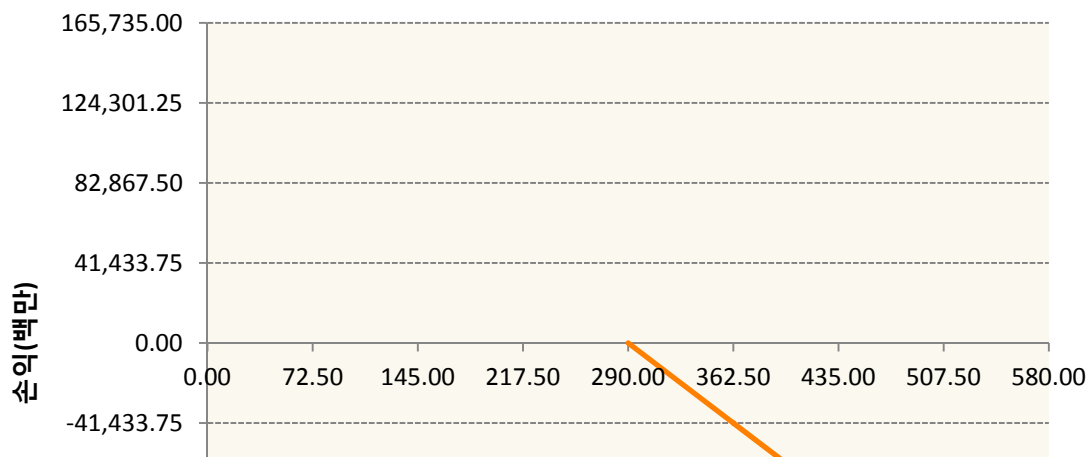
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	367,991	-367,991	장내

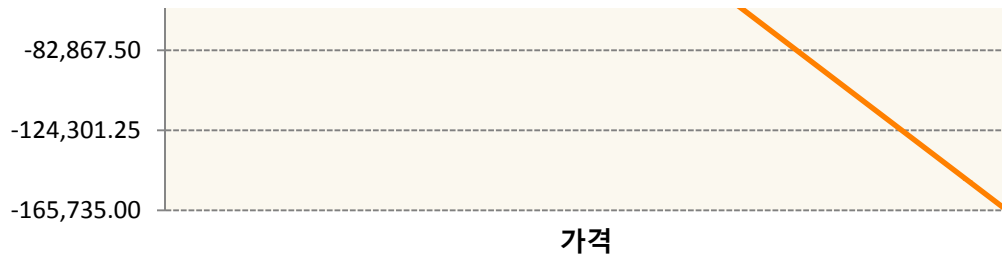
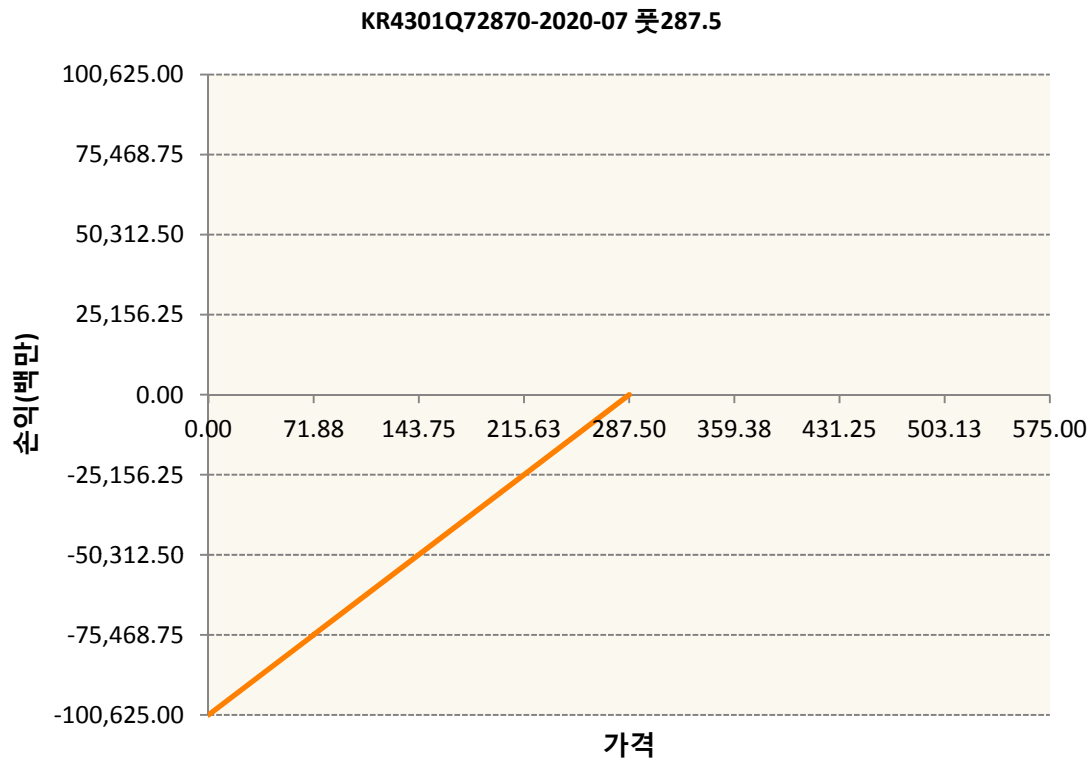
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q72872-2020-07 콜287.5



KR4201Q72906-2020-07 콜290





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q72872 2020-07 콜287.5							5,603
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,705	2,581	2,435	2,269	2,087	1,890	1,681
-5.33%	2,393	2,199	1,987	1,760	1,522	1,274	1,019
-2.67%	1,831	1,568	1,295	1,015	730	440	147
0%	942	629	315	0	-317	-634	-952
2.67%	-322	-649	-975	-1,302	-1,629	-1,955	-2,282
5.33%	-1,959	-2,263	-2,572	-2,885	-3,200	-3,518	-3,837
8.00%	-3,923	-4,178	-4,447	-4,725	-5,011	-5,304	-5,603
KR4201Q72906 2020-07 콜290							8,681
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,920	3,749	3,540	3,299	3,029	2,733	2,417

-5.33%	3,509	3,228	2,915	2,576	2,215	1,835	1,441
-2.67%	2,741	2,345	1,929	1,498	1,054	601	140
0%	1,483	995	500	0	-503	-1,010	-1,518
2.67%	-358	-890	-1,421	-1,952	-2,484	-3,015	-3,546
5.33%	-2,806	-3,321	-3,840	-4,362	-4,886	-5,412	-5,940
8.00%	-5,811	-6,259	-6,723	-7,199	-7,686	-8,180	-8,681
KR4301Q72870 2020-07 풋287.5							6,544
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,182	-6,212	-6,253	-6,308	-6,375	-6,454	-6,544
-5.33%	-3,658	-3,733	-3,824	-3,929	-4,046	-4,174	-4,310
-2.67%	-1,334	-1,477	-1,631	-1,794	-1,964	-2,140	-2,320
0%	615	413	207	0	-209	-419	-631
2.67%	2,051	1,831	1,611	1,391	1,171	950	730
5.33%	2,954	2,768	2,575	2,378	2,176	1,972	1,765
8.00%	3,432	3,306	3,166	3,014	2,853	2,683	2,507

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

(단위:백만원)

18,594

공시일	2020-06-24
기준일	2020-06-23

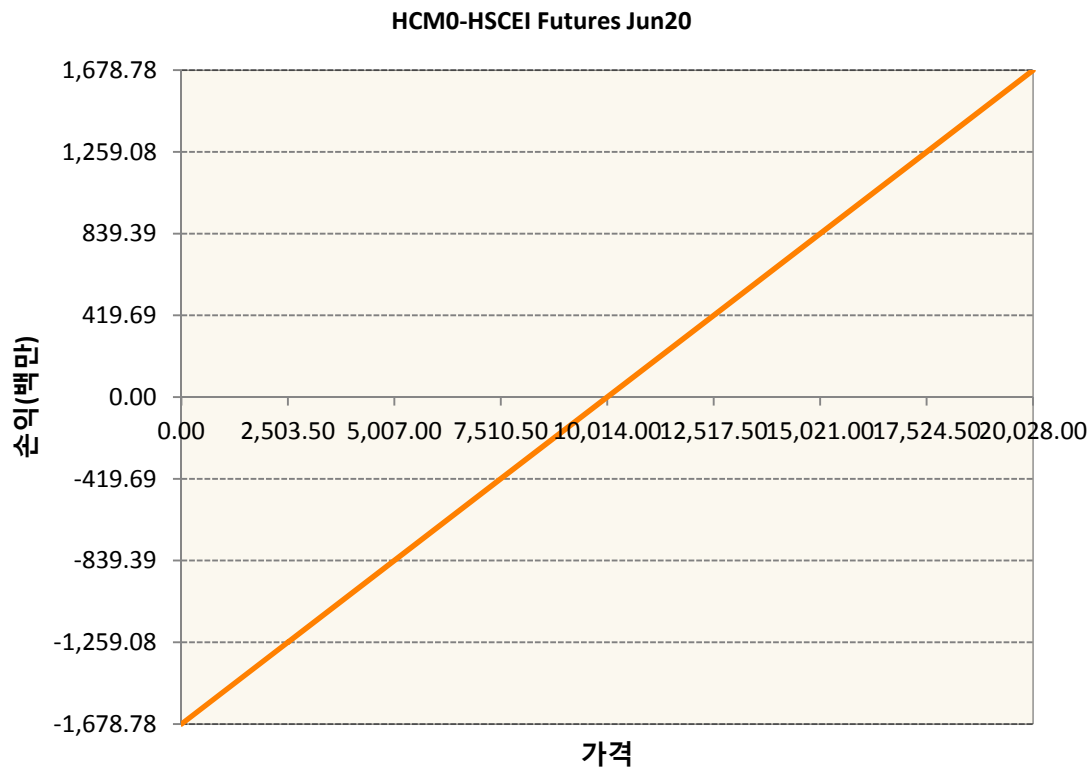
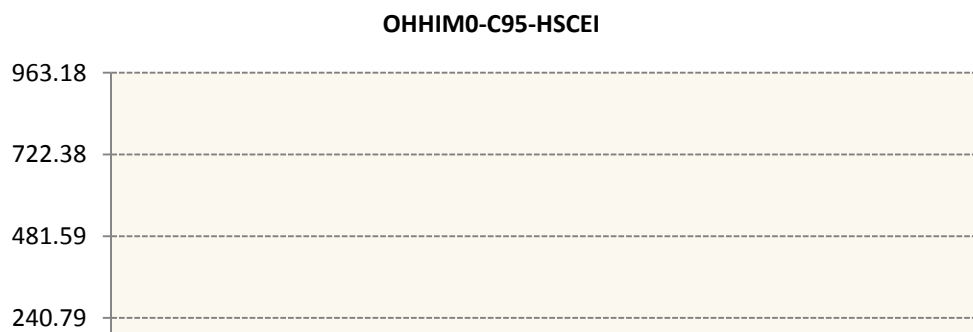
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

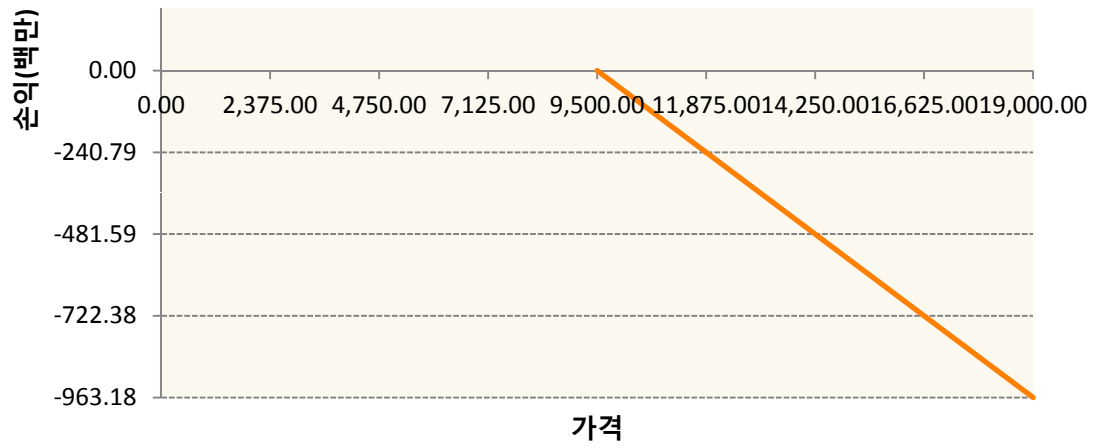
1. 계약금액

(단위:백만원)

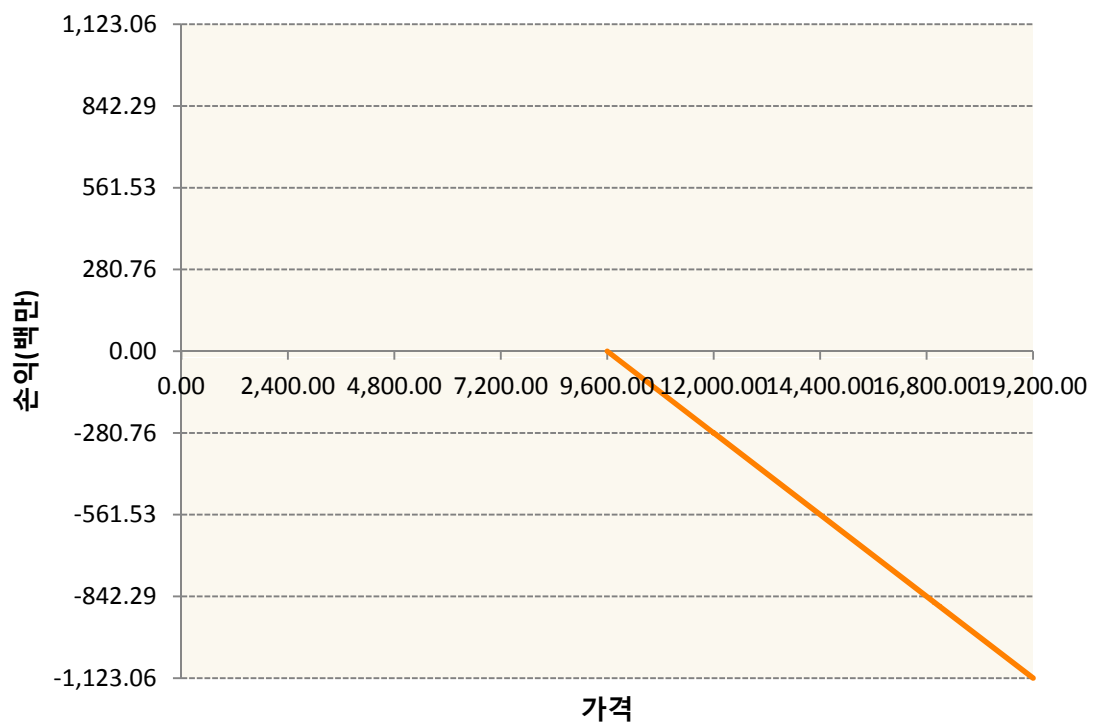
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,679	0	1,679	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,247	-4,247	장내
누계	통화	선도	0	1,510	-1,510	장외

2. 만기시점의 손익구조

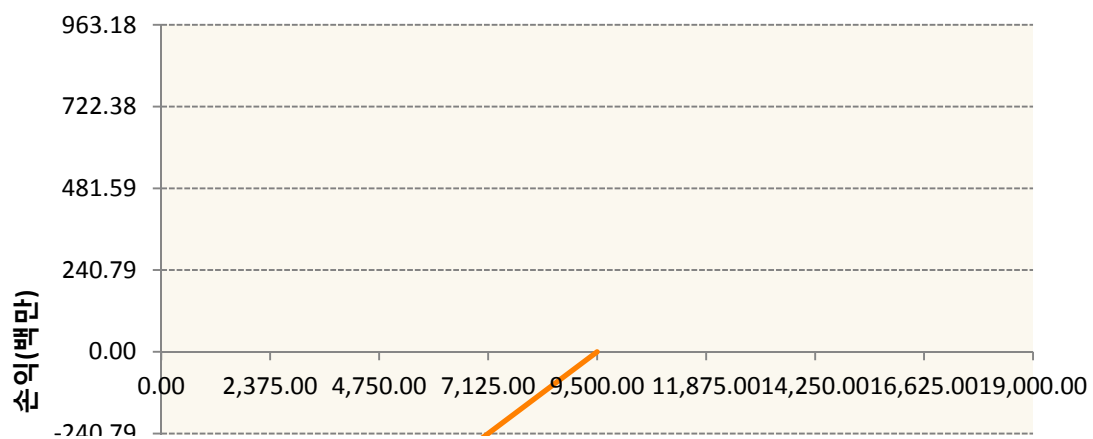


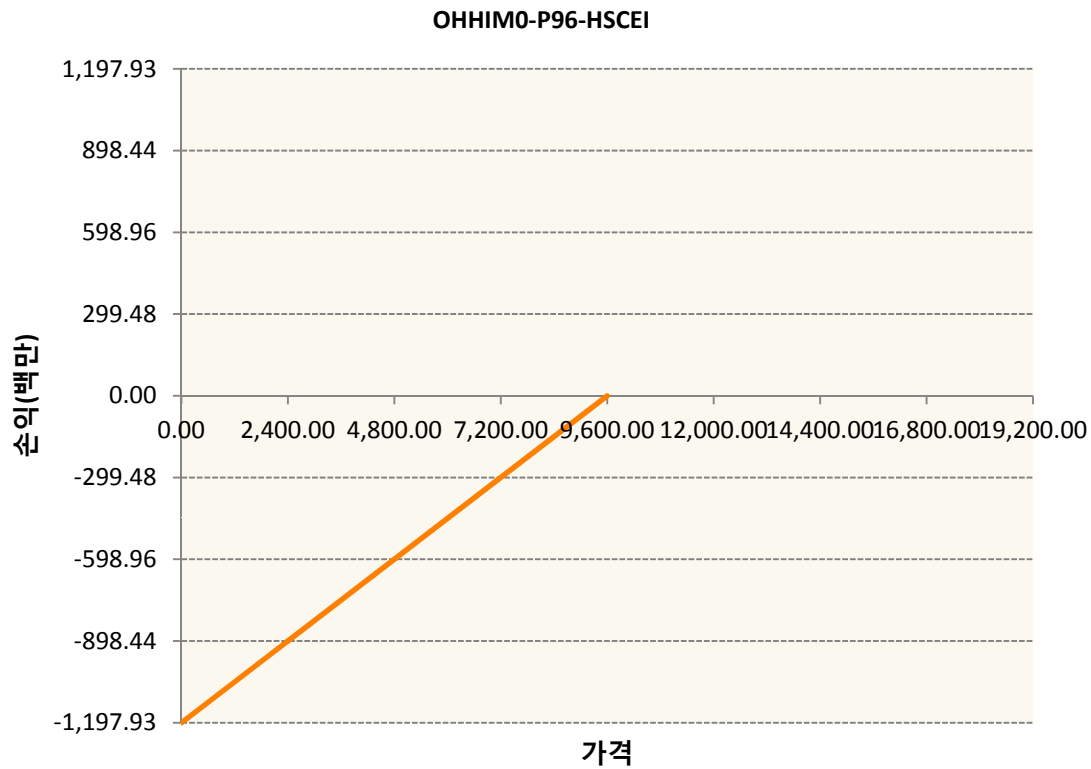


OHHIM0-C96-HSCEI



OHHIM0-P95-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E		121
HCM0 HSCEI Futures Jun20		134
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	2020-06-24
기준일	2020-06-23

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

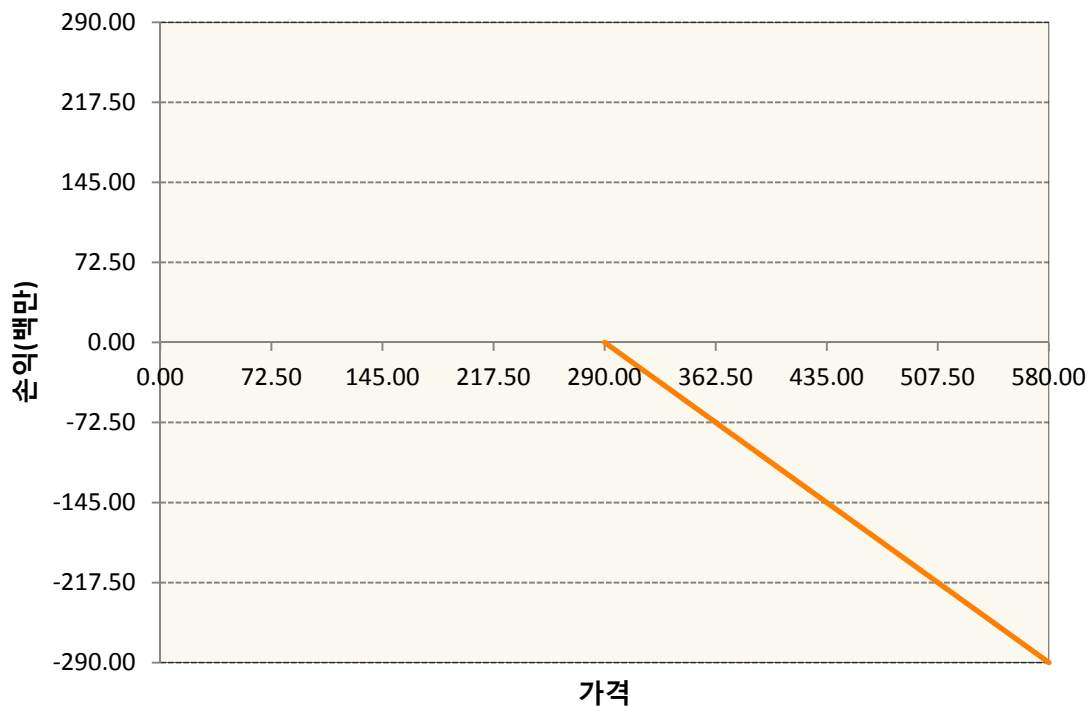
1. 계약금액

(단위:백만원)

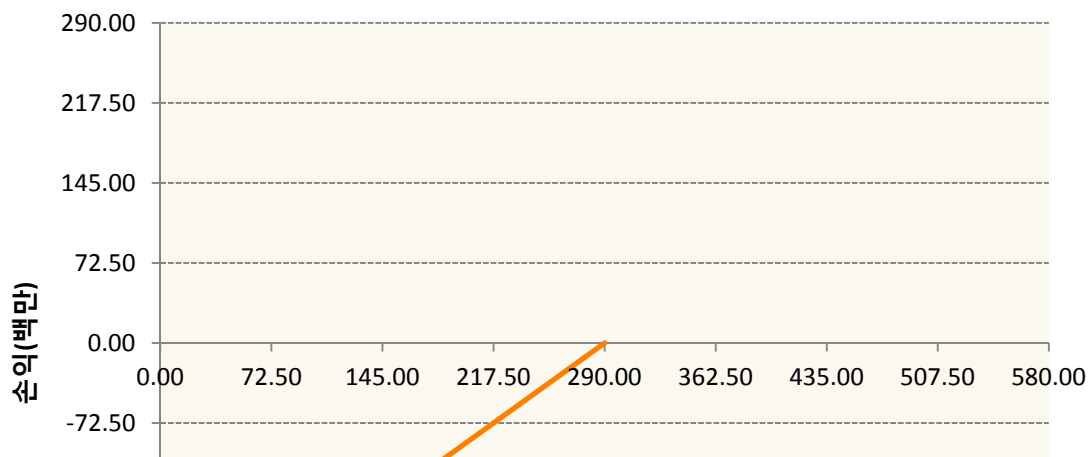
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	580	-580	장내

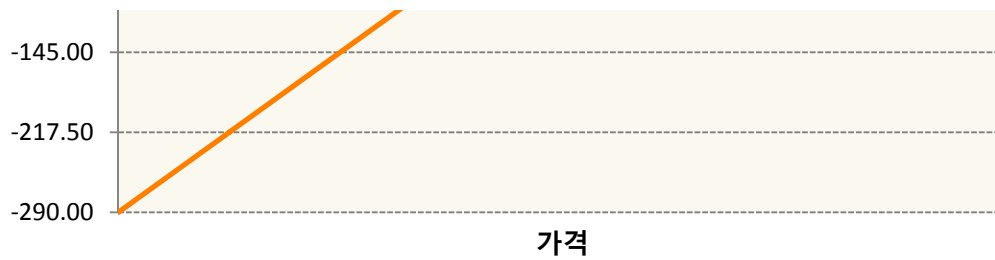
2. 만기시점의 손익구조

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	3	
-2.67%	5	4	3	3	2	1	0	
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3	
2.67%	-1	-2	-2	-3	-4	-5	-6	
5.33%	-5	-6	-7	-8	-9	-9	-10	
8.00%	-10	-11	-12	-13	-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	-19	-19	-19	-19	-19	-19	
-5.33%	-11	-11	-12	-12	-12	-12	-13	
-2.67%	-4	-5	-5	-5	-6	-6	-7	
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2	
2.67%	6	6	5	4	4	3	2	
5.33%	9	9	8	8	7	6	6	
8.00%	11	11	10	10	9	9	8	

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

32

공시일	2020-06-24
기준일	2020-06-23

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

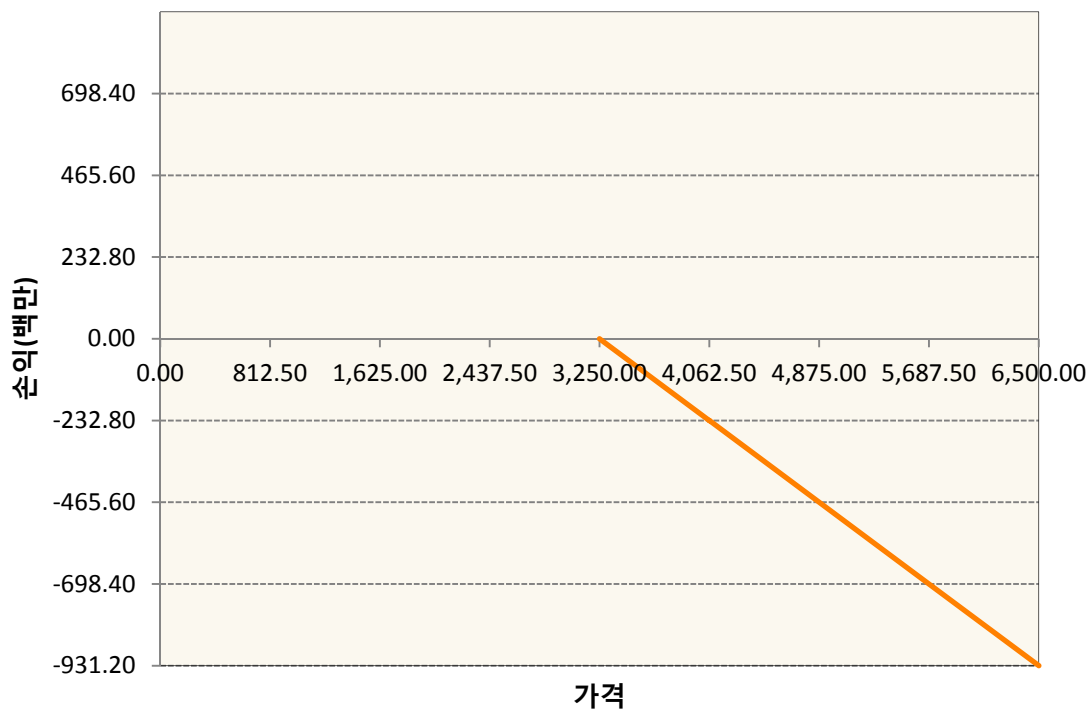
1. 계약금액

(단위:백만원)

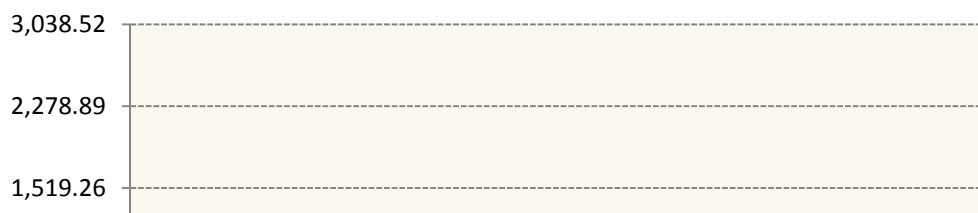
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,313	0	1,313	
누계	유가증권	스왑	8,137	0	8,137	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,939	-7,939	장내
누계	통화	선도	0	2,952	-2,952	장외

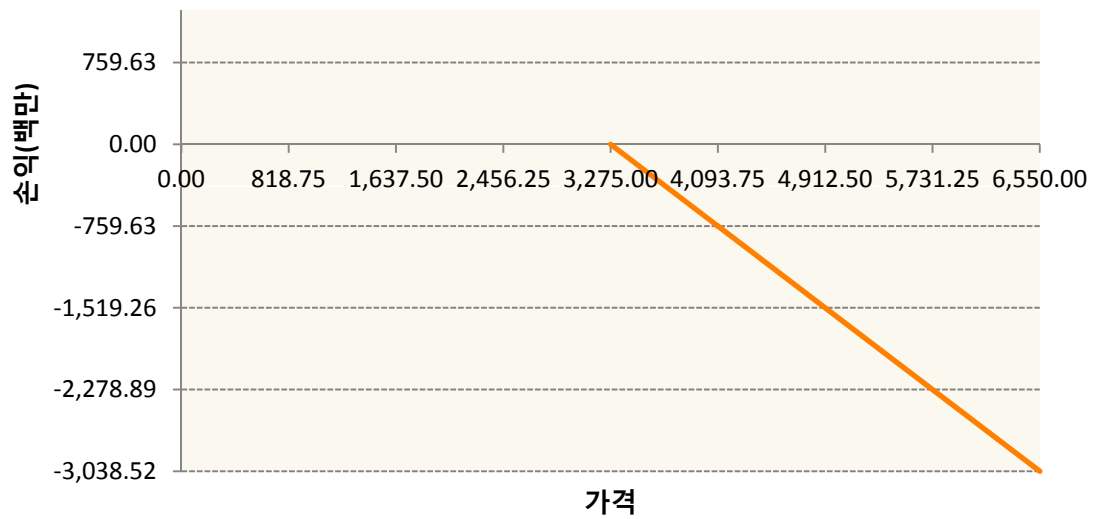
2. 만기시점의 손익구조

OESXN0-C3250-EURO STOXX 50

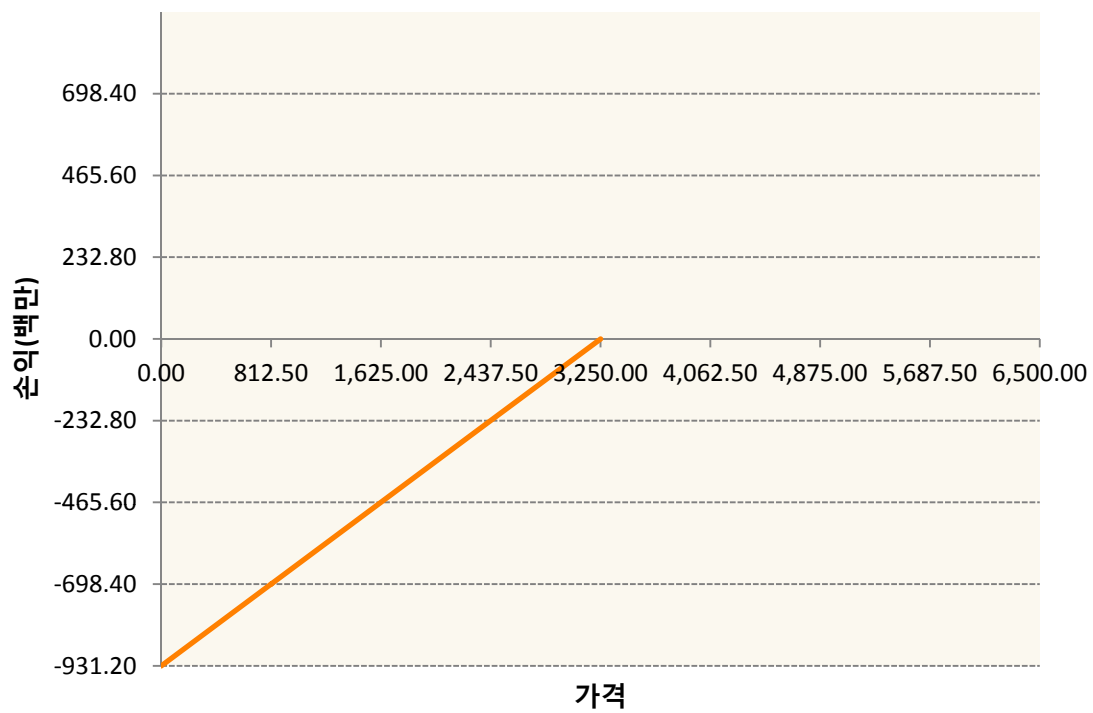


OESXN0-C3275-EURO STOXX 50



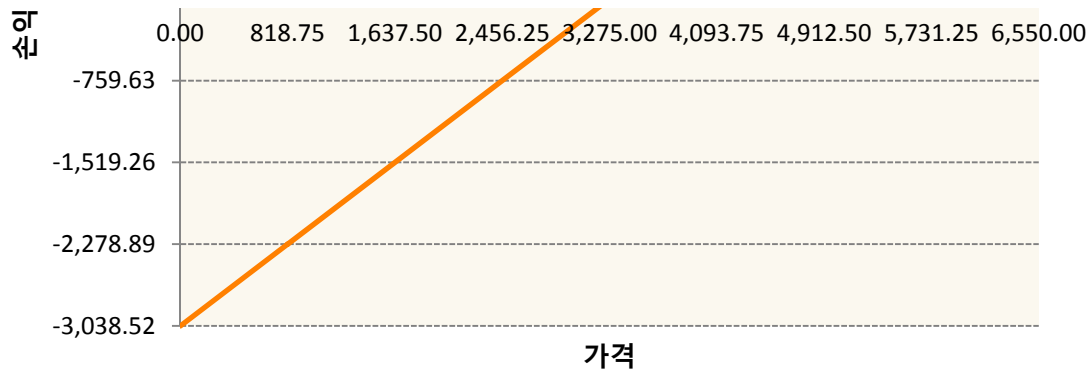
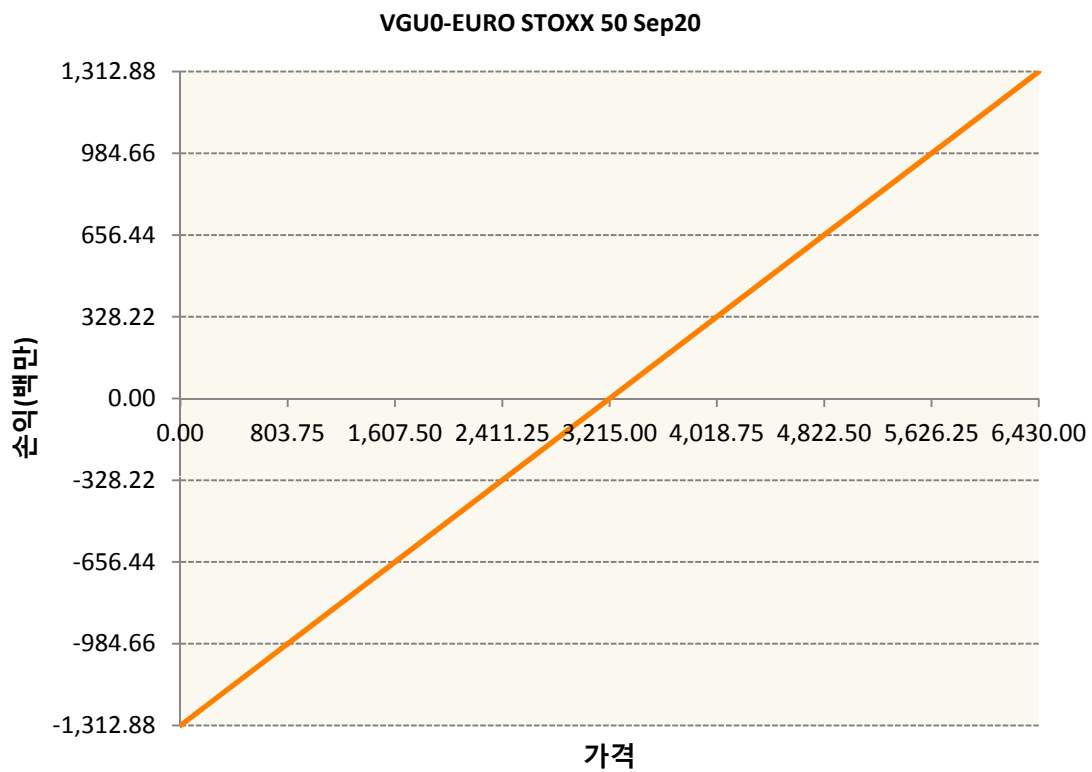


OESXN0-P3250-EURO STOXX 50



OESXN0-P3275-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	21
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E	221
FX21020K02 KRW/EUR 26-06-20E	15
OESXN0-C3½ EURO STOXX 50	74
OESXN0-C3½ EURO STOXX 50	243
OESXN0-P3½ EURO STOXX 50	74
OESXN0-P3½ EURO STOXX 50	243
VGU0 EURO STOXX 50 Sep20	105

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

(단위:백만원)

1,178

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

(단위:백만원)

1,311

공시일	2020-06-24
기준일	2020-06-23

ETF스마트레버리지목표전환형9호

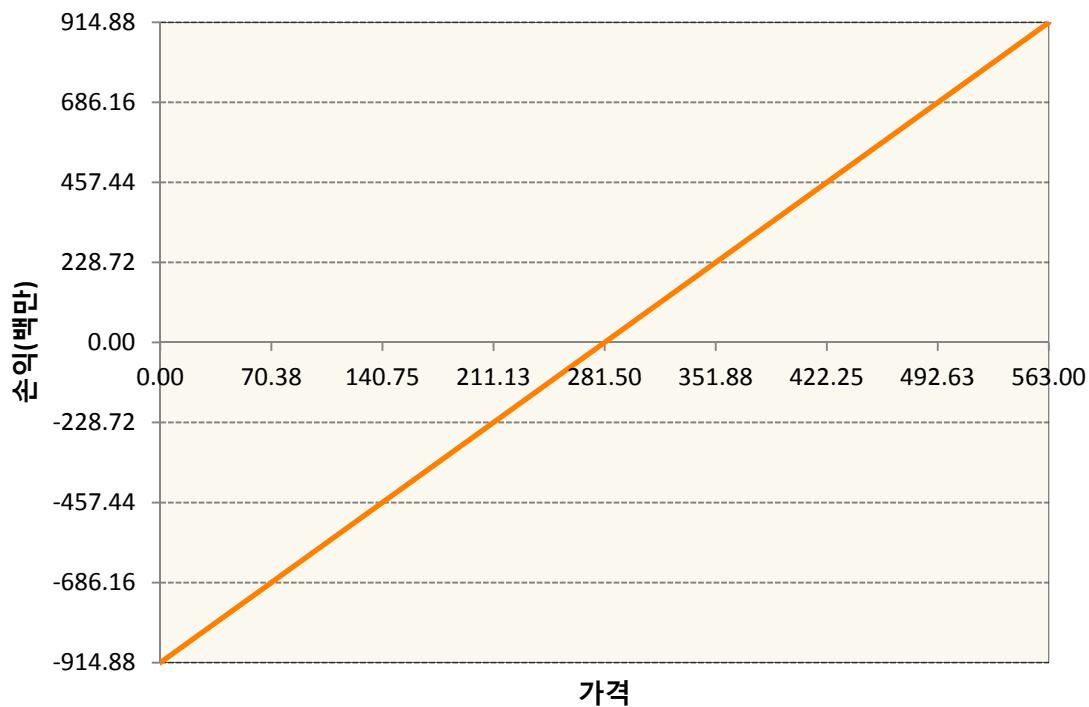
1. 계약금액

(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	
-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 a linear relationship between Price (가격) and Speed (속의) in millions. The x-axis (Price) ranges from 0.00 to 563.00, and the y-axis (Speed) ranges from -1,337.13 to 1,337.13. The line starts at the bottom-left corner and extends to the top-right corner, passing through the origin.

가격 (Price)	속의 (백만) (Speed in millions)
0.00	-1,337.13
70.38	-1,002.84
140.75	-668.56
211.13	-334.28
281.50	0.00
351.88	334.28
422.25	668.56
492.63	1,002.84
563.00	1,337.13

(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	2020-06-24
기준일	2020-06-23

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

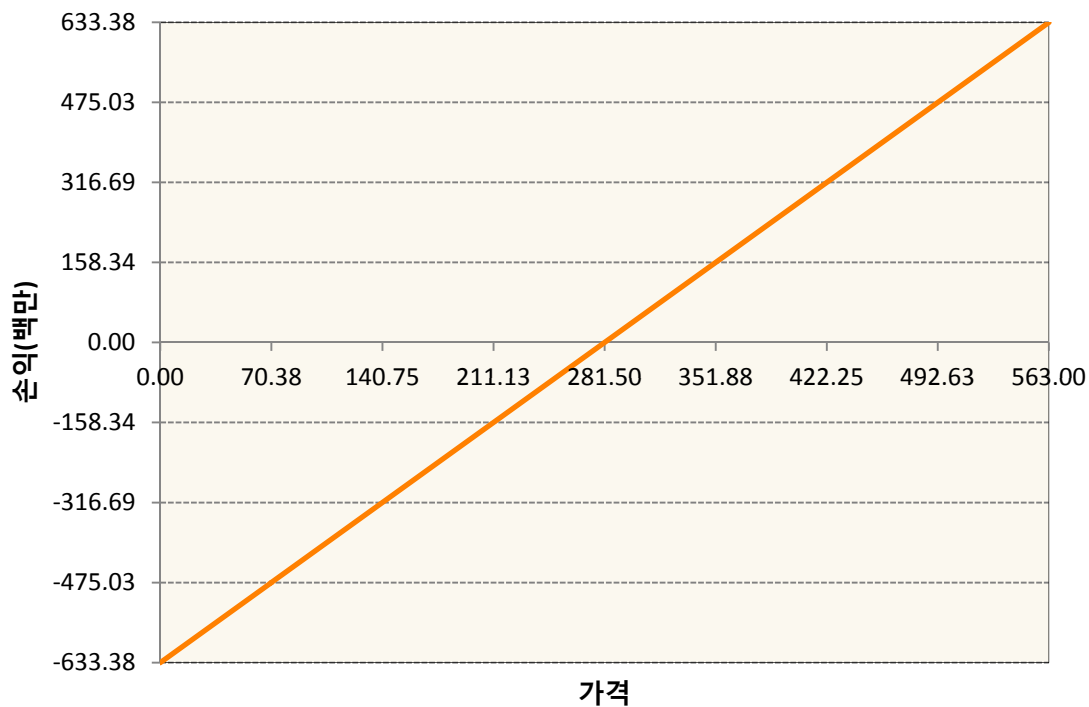
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	633	0	633	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
-5.33%		-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
-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%		34	34	34	34	34	34	34
8.00%		51	51	51	51	51	51	51

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

(단위:백만원)

80

공시일	2020-06-24
기준일	2020-06-23

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

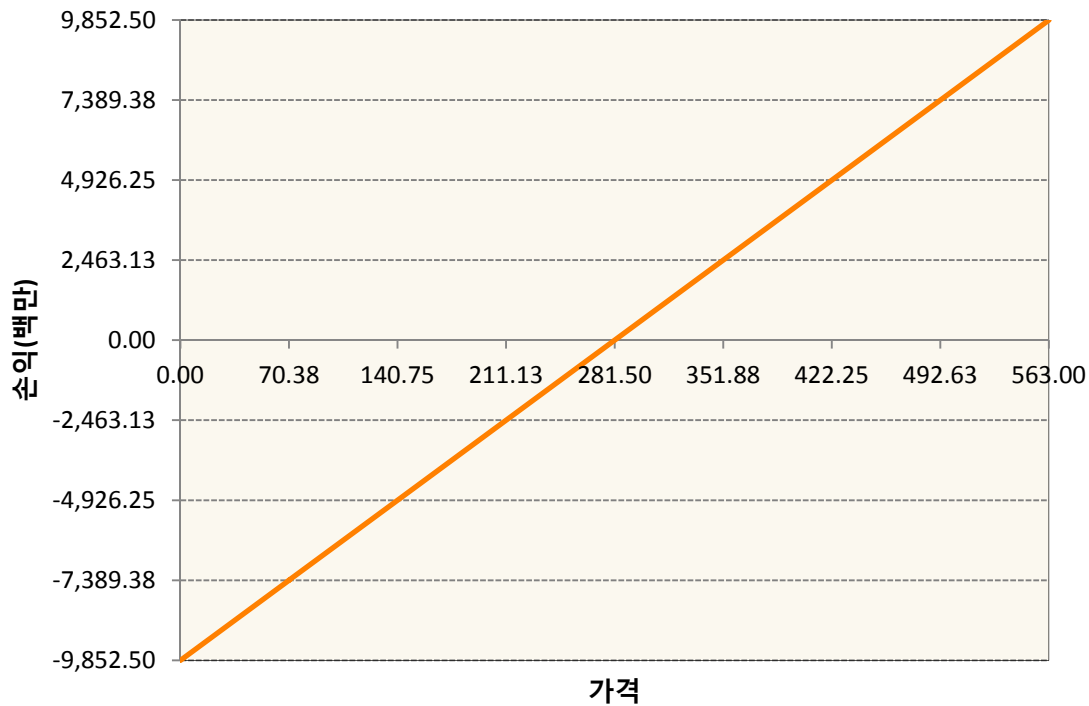
1. 계약금액

(단위:백만원)

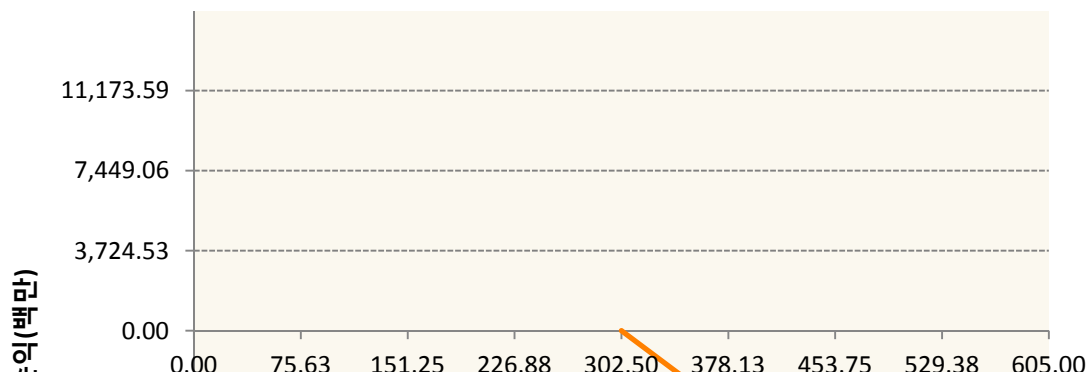
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,853	0	9,853	장내
누계	유가증권	옵션	3,247	19,092	-15,845	장내

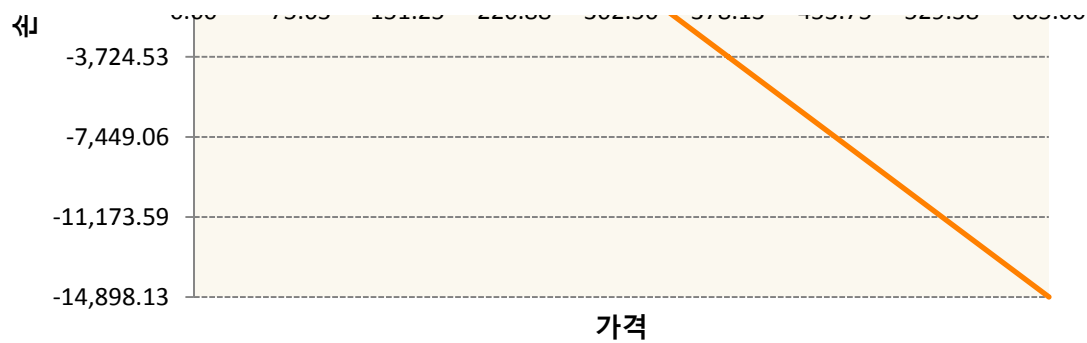
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물

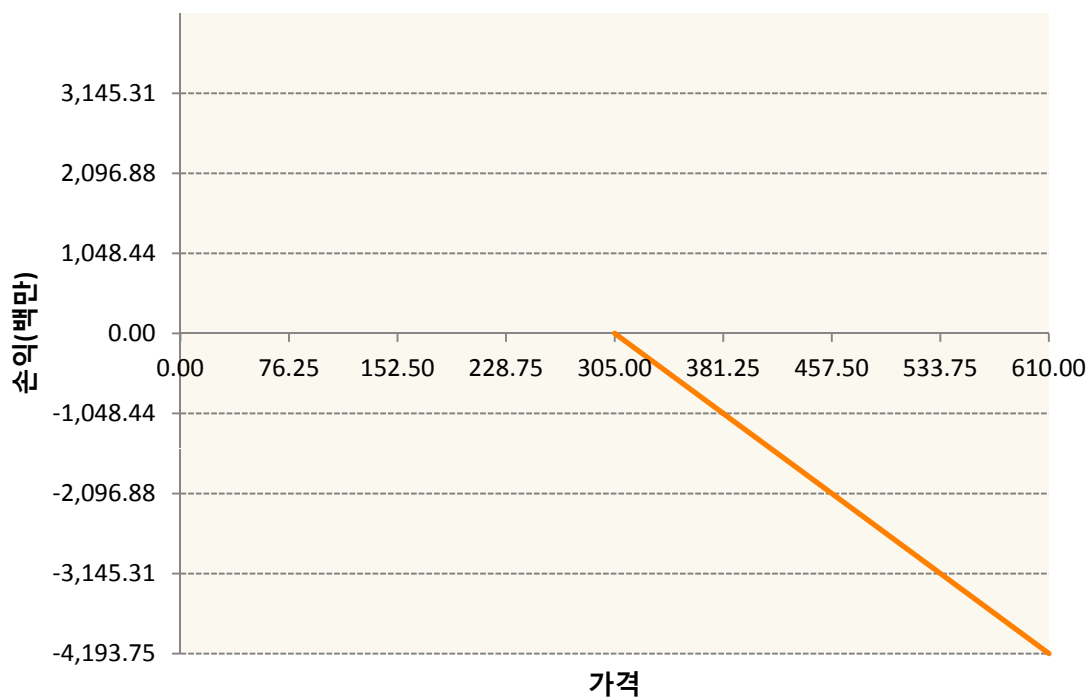


KR4201Q73029-2020-07 콜302.5

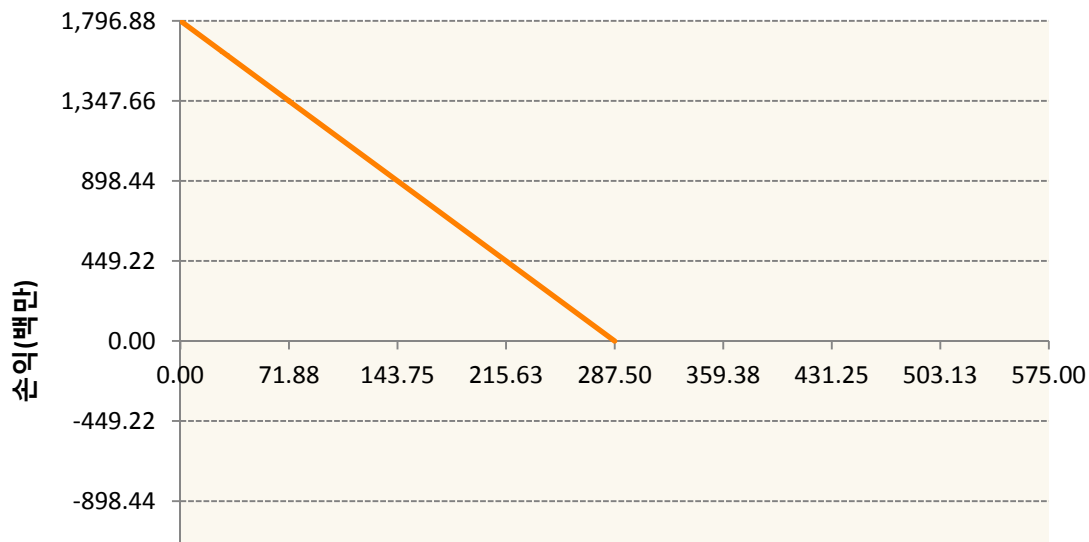


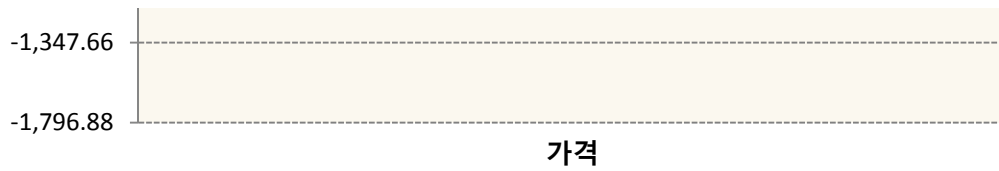
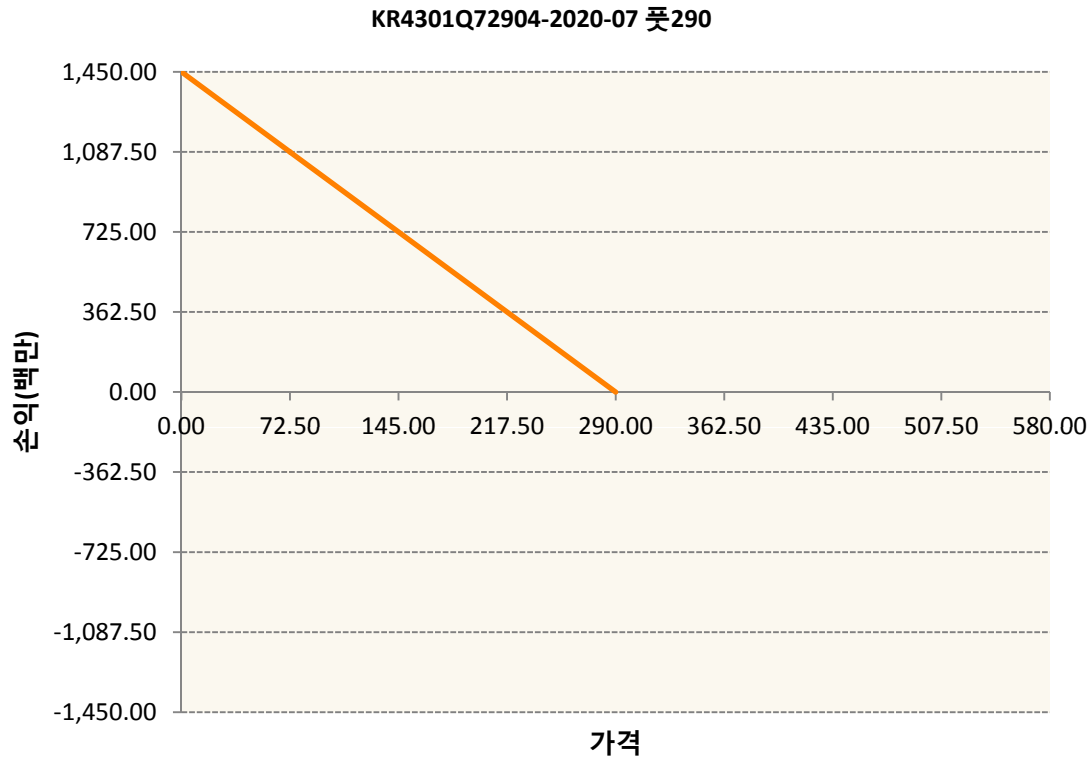


KR4201Q73052-2020-07 콜305



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				578
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	181	175	167	156	142	126	108
-5.33%	170	158	144	126	105	82	57
-2.67%	145	125	102	76	48	17	-15

0%	97	67	34	0	-36	-73	-112
2.67%	14	-26	-66	-108	-150	-193	-237
5.33%	-113	-159	-206	-252	-298	-345	-392
8.00%	-290	-338	-386	-434	-482	-530	-578
KR4201Q73052 2020-07 콜305							152
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	44	43	41	38	35	31	26
-5.33%	42	39	35	31	26	20	13
-2.67%	36	31	25	19	11	4	-5
0%	25	17	9	0	-9	-19	-30
2.67%	5	-5	-16	-27	-39	-50	-62
5.33%	-26	-39	-51	-64	-77	-90	-103
8.00%	-71	-85	-98	-111	-125	-138	-152
KR4301Q72870 2020-07 풋287.5							117
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	110	111	112	113	114	115	117
-5.33%	65	67	68	70	72	75	77
-2.67%	24	26	29	32	35	38	41
0%	-11	-7	-4	0	4	7	11
2.67%	-37	-33	-29	-25	-21	-17	-13
5.33%	-53	-49	-46	-42	-39	-35	-32
8.00%	-61	-59	-57	-54	-51	-48	-45
KR4301Q72904 2020-07 풋290							97
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	92	93	93	94	95	96	97
-5.33%	56	57	58	59	61	62	64
-2.67%	22	23	25	27	30	32	34
0%	-8	-6	-3	0	3	6	9
2.67%	-31	-28	-25	-22	-19	-15	-12
5.33%	-47	-44	-41	-38	-35	-32	-29
8.00%	-55	-53	-51	-48	-46	-43	-41

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

(단위:백만원)

1,927

공시일	2020-06-24
기준일	2020-06-23

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	141,602	0	141,602	

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	2020-06-24
기준일	2020-06-23

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	99,771	0	99,771	

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	2020-06-24
기준일	2020-06-23

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	464,842	0	464,842	
누계	통화	선도	0	442,904	-442,904	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J03: KRW/USD 24-07-20E	2,176
FX21020J04: KRW/USD 24-07-20E	1,741
FX21020J04: KRW/USD 24-07-20E	1,934
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	2,360
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	967
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,015
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,605
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	3,385
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	6,866
FX21020M0: KRW/USD 26-08-20E	580
FX21020M01 KRW/USD 26-08-20E	4,738
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	2,011
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	2,437
FX21020M05 KRW/USD 22-09-20E	1,006
FX21020M05 KRW/USD 22-09-20E	2,611

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

18,315

공시일	2020-06-24
기준일	2020-06-23

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

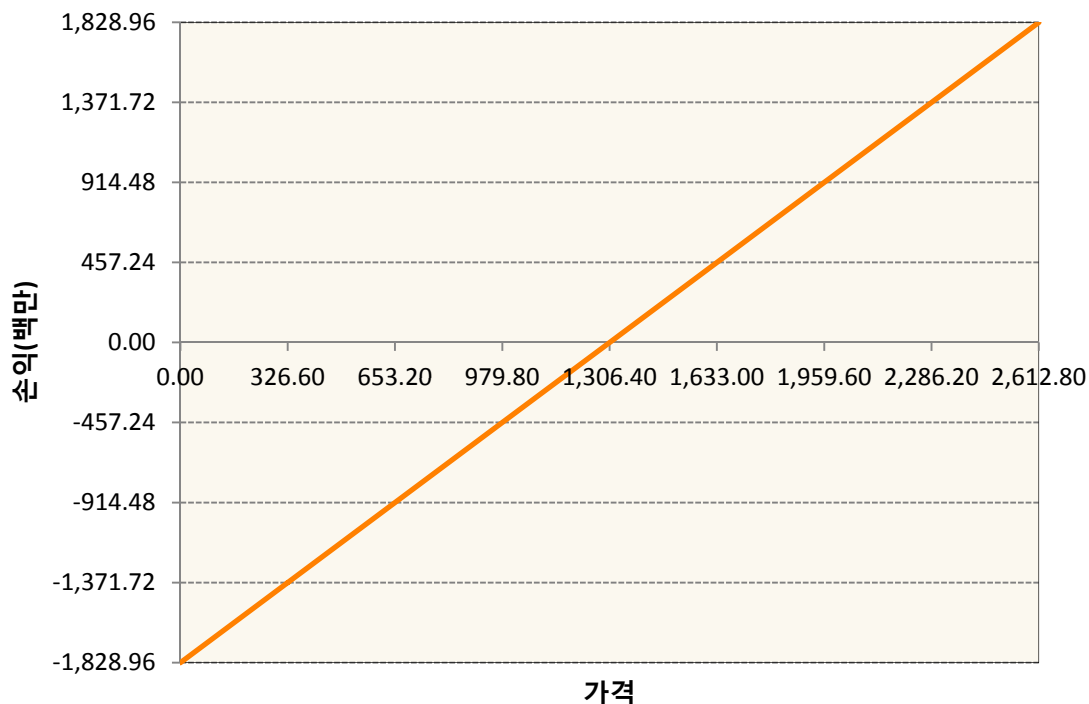
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,829	0	1,829	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	2020-06-24
기준일	2020-06-23

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	7,662	0	7,662	
누계	통화	선도	0	7,507	-7,507	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	15
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	2020-06-24
기준일	2020-06-23

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

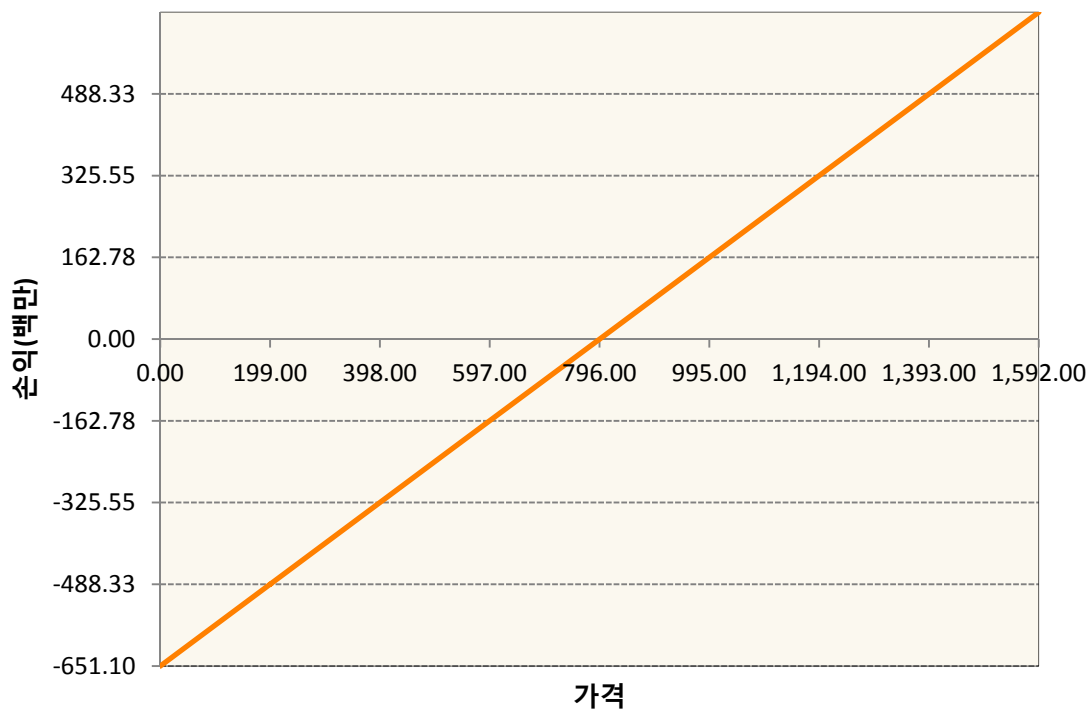
1. 계약금액

(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	651	0	651	
누계	유가증권	스왑	990	0	990	장외
누계	통화	선도	210	892	-682	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	52

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

공시일	2020-06-24
기준일	2020-06-23

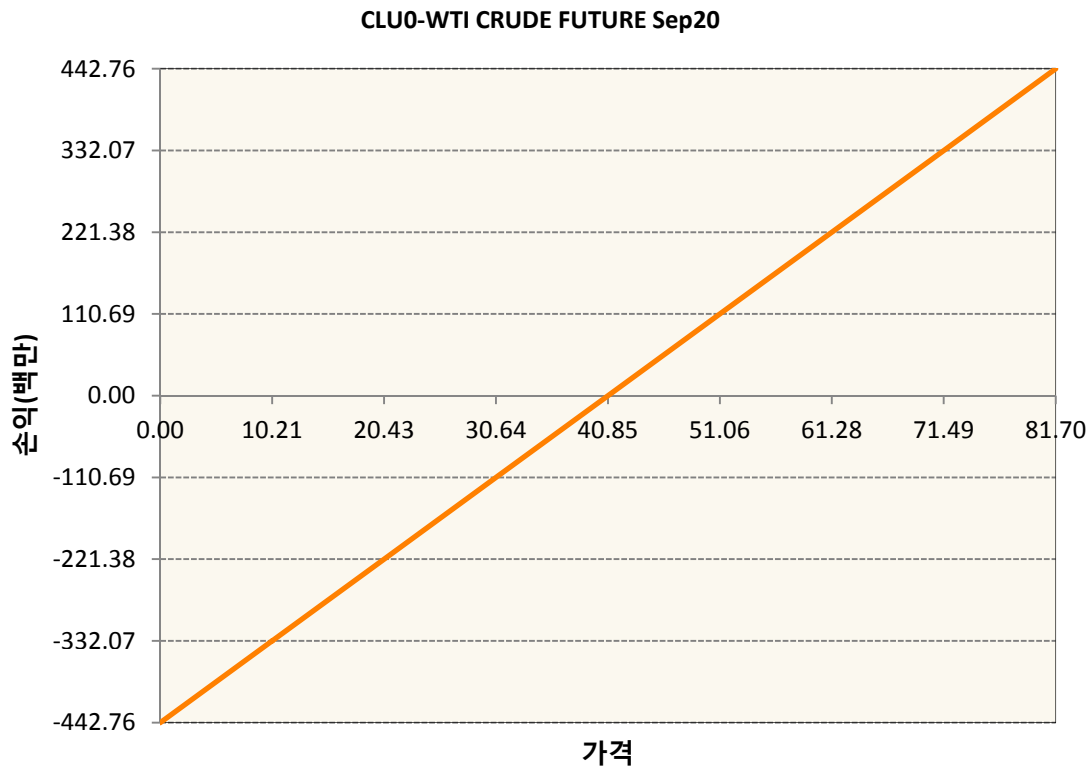
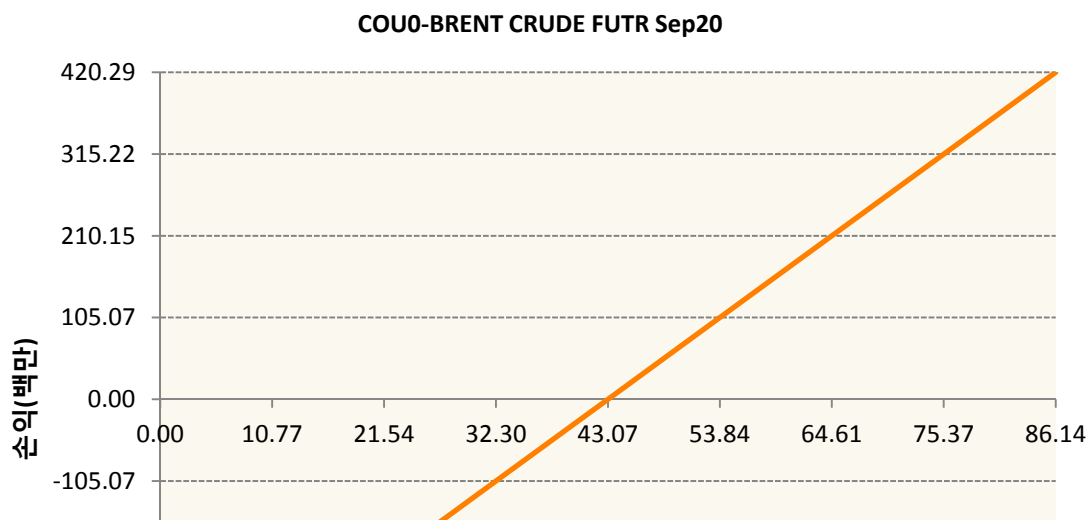
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

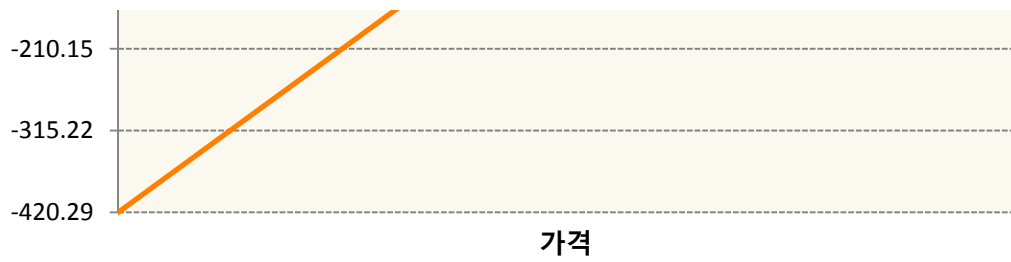
1. 계약금액

(단위:백만원)

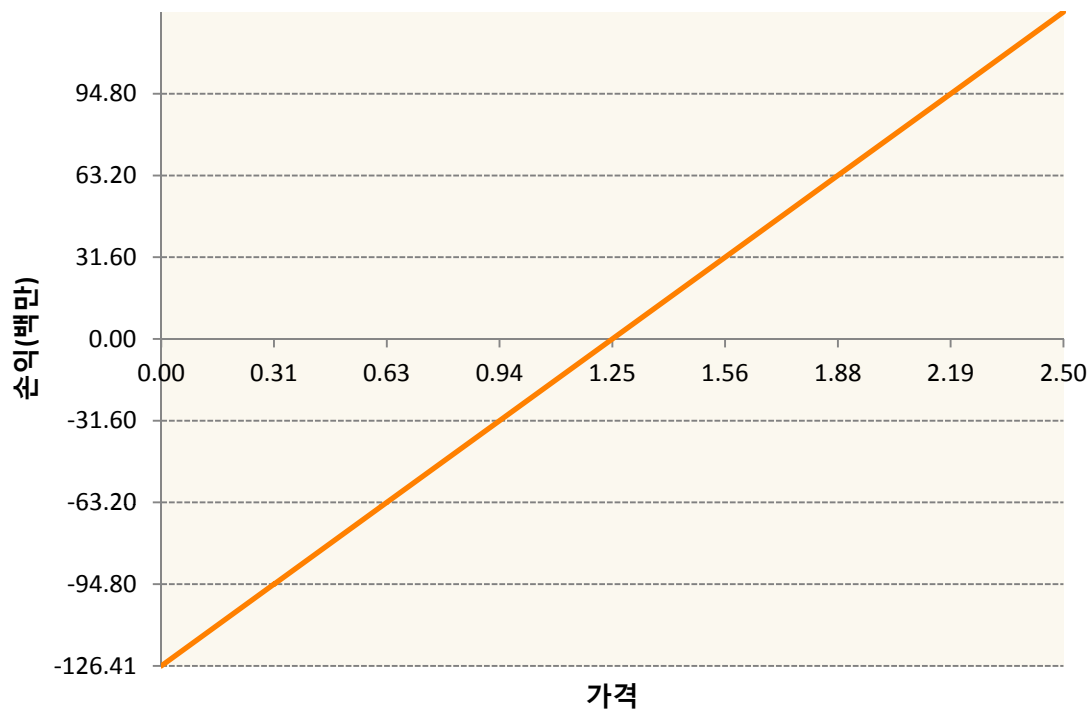
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,963	363	1,600	

2. 만기시점의 손익구조



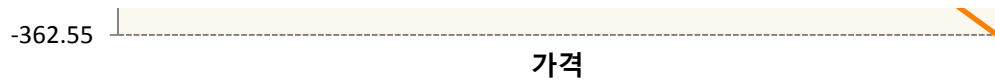
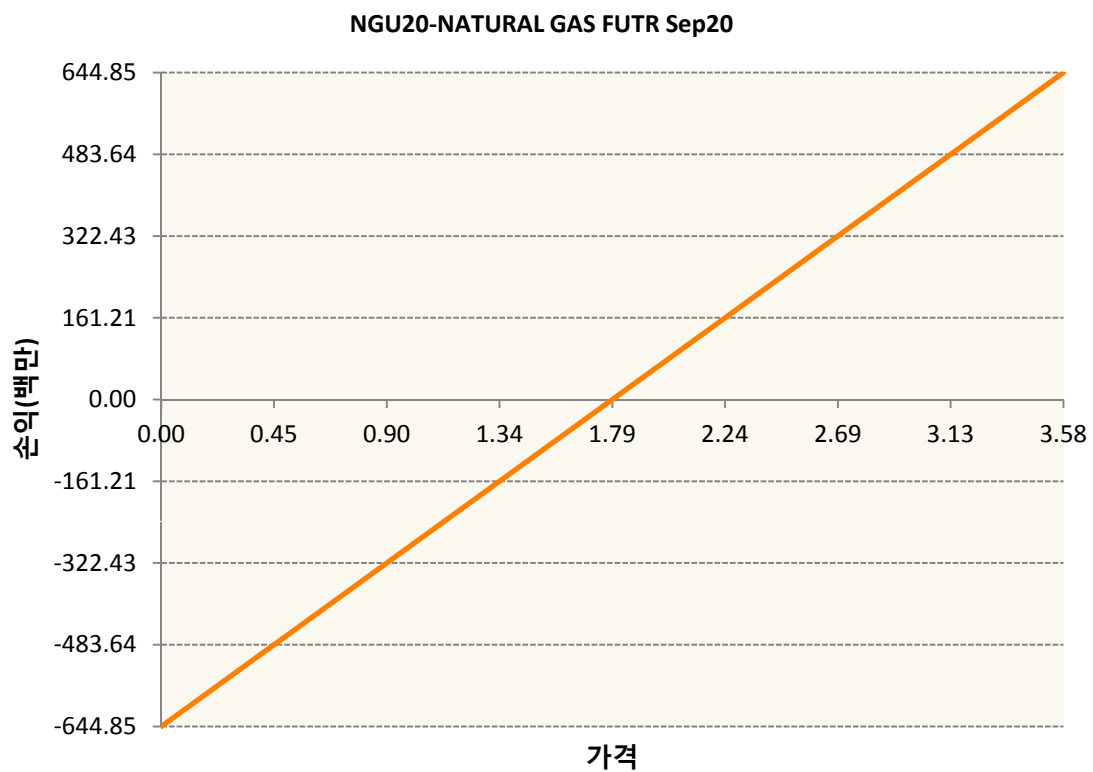
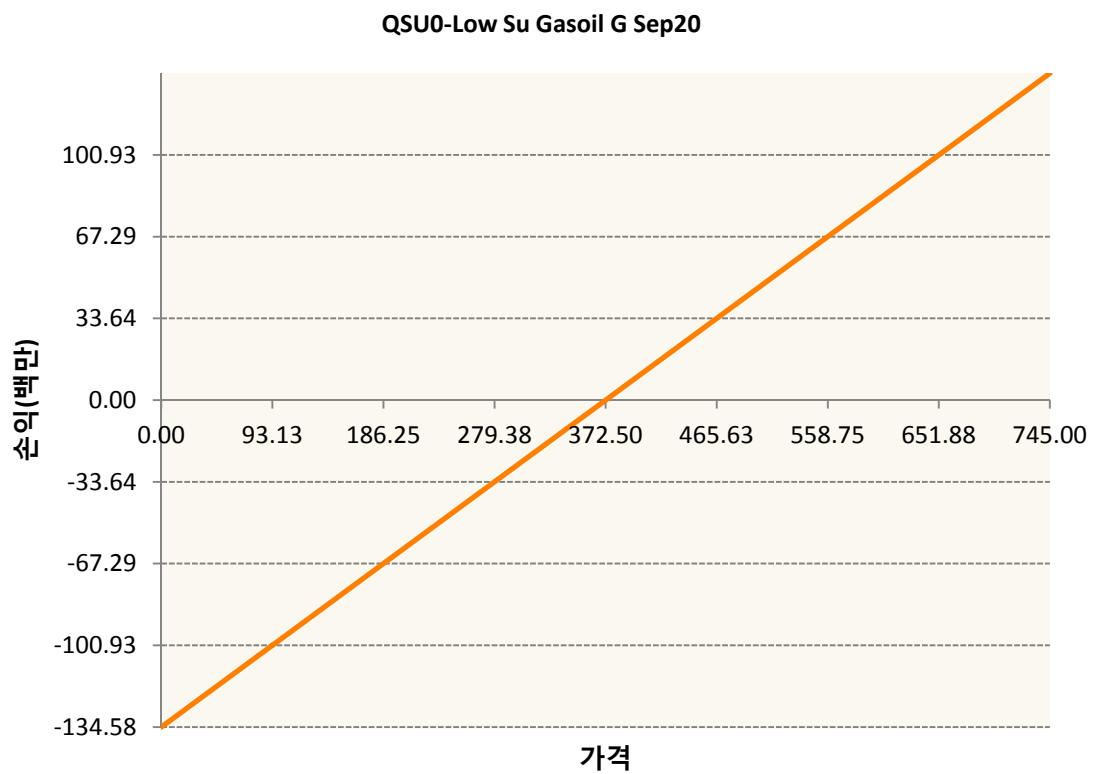


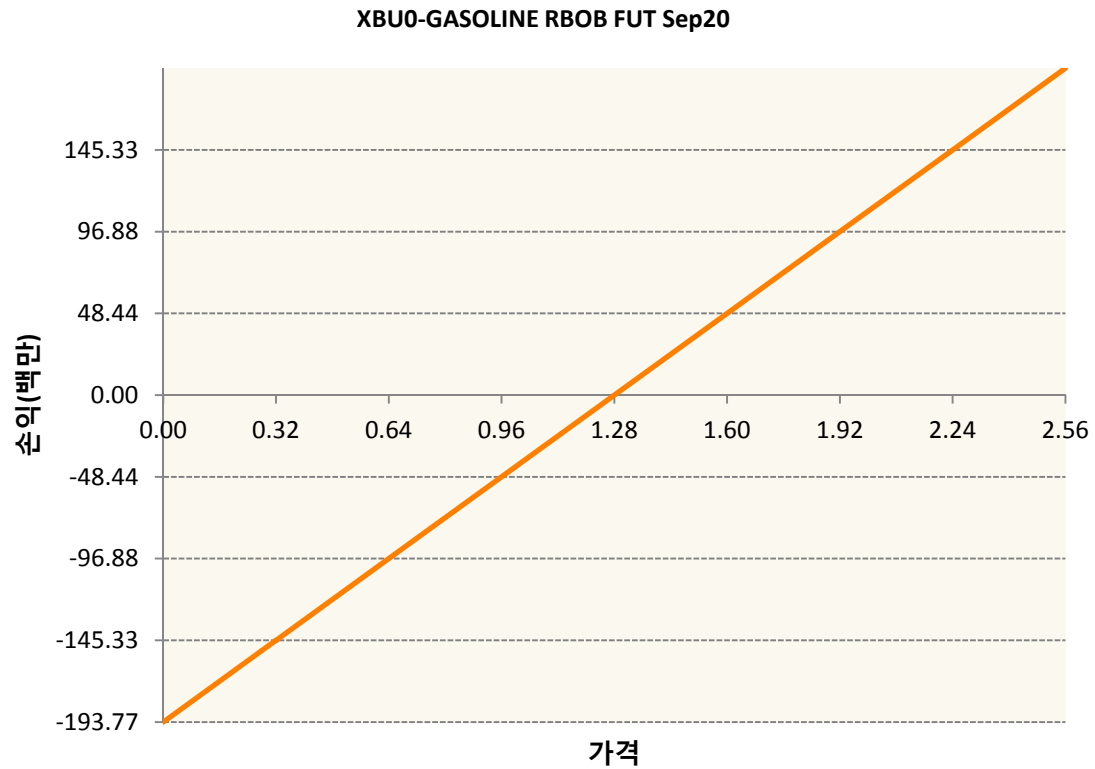
HOU0-NY Harb ULSD Fut Sep20



KR4175Q70005-2020-07 달러선물







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLU0	WTI CRUDE FUTURE Sep20		35
COU0	BRENT CRUDE FUTR Sep20		34
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		16

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,008

공시일	2020-06-24
기준일	2020-06-23

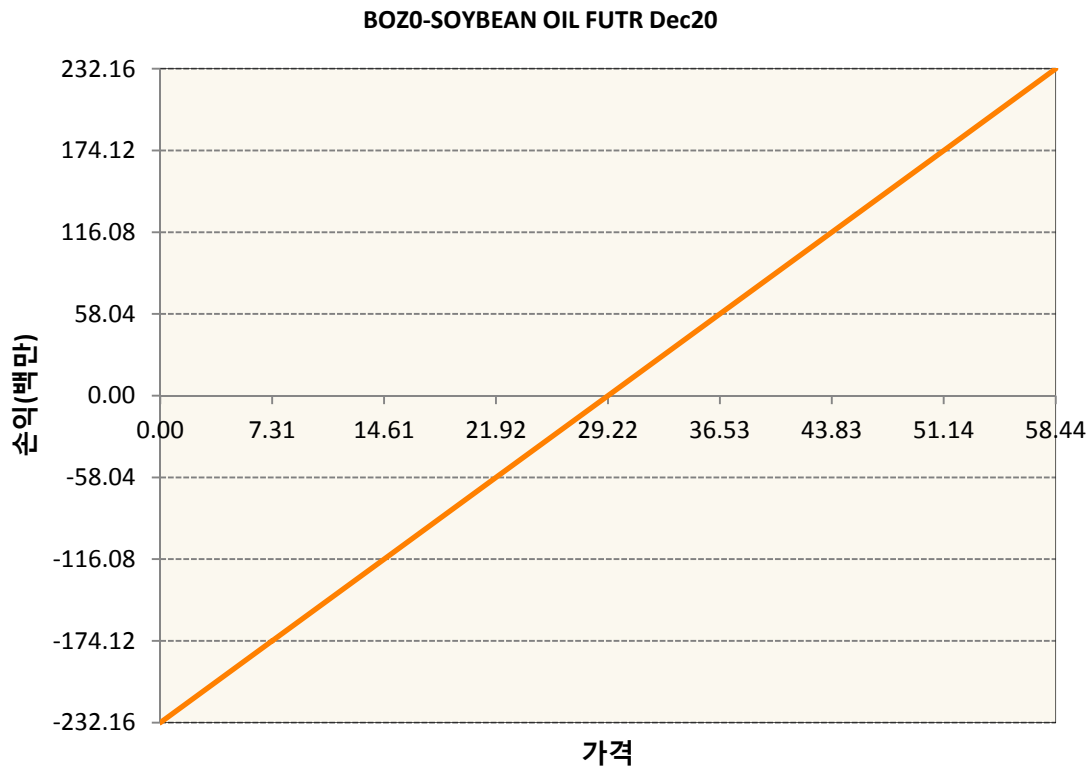
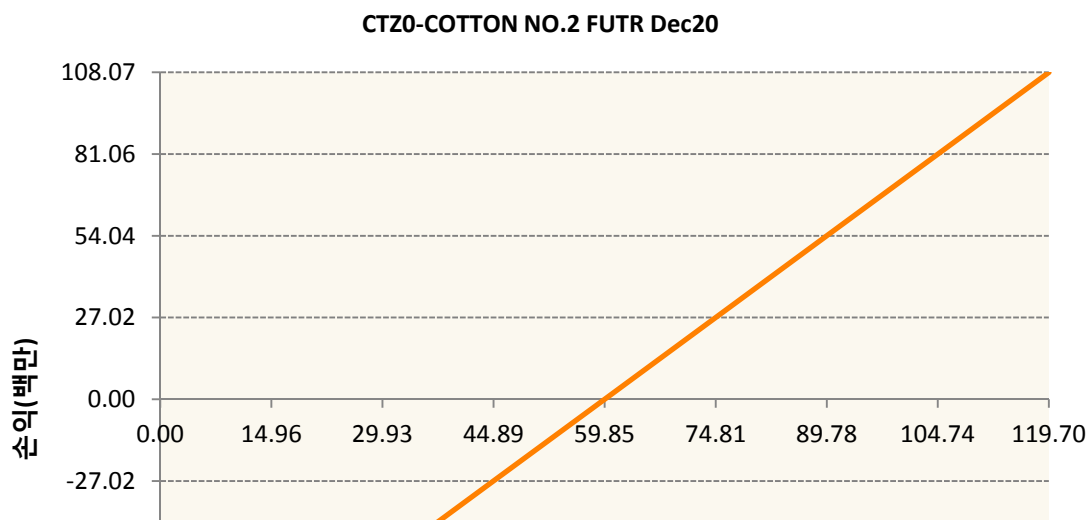
애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

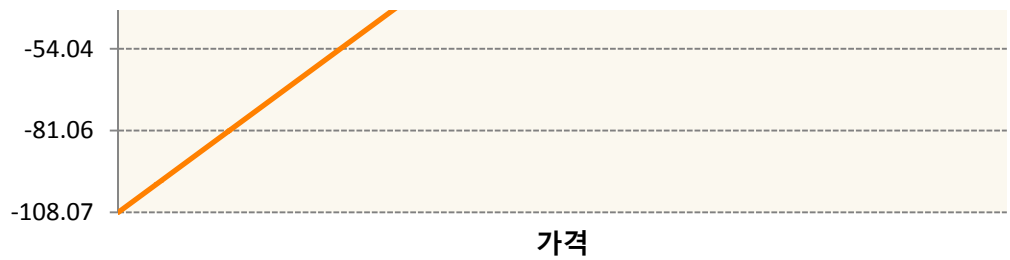
1. 계약금액

(단위:백만원)

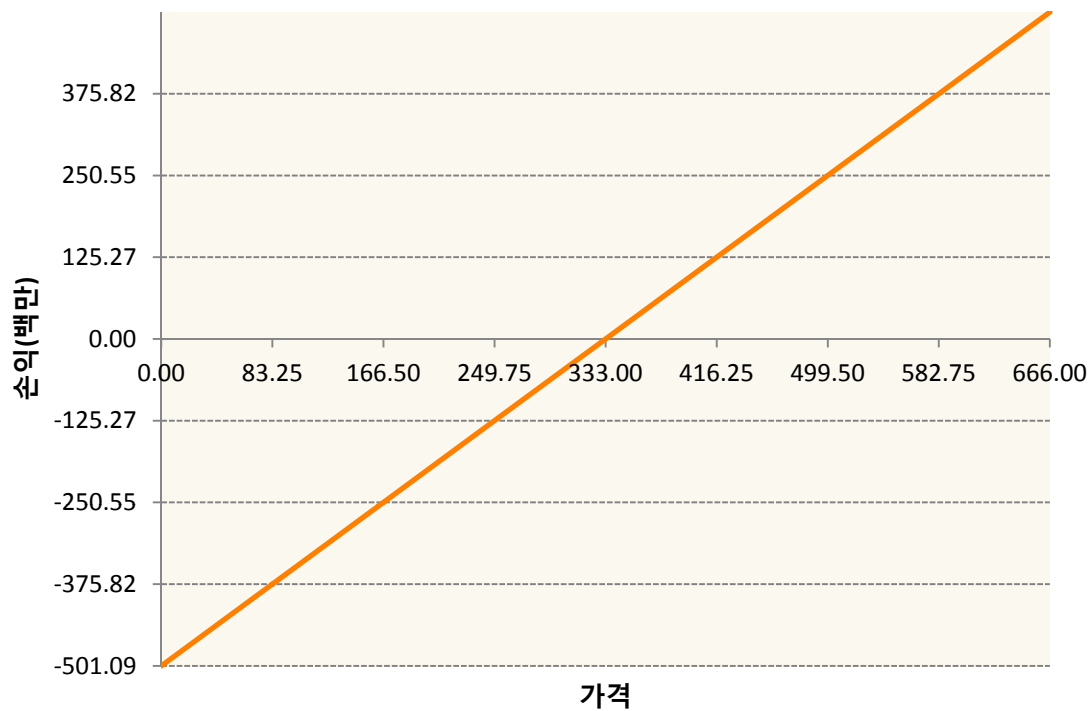
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,567	73	2,494	

2. 만기시점의 손익구조

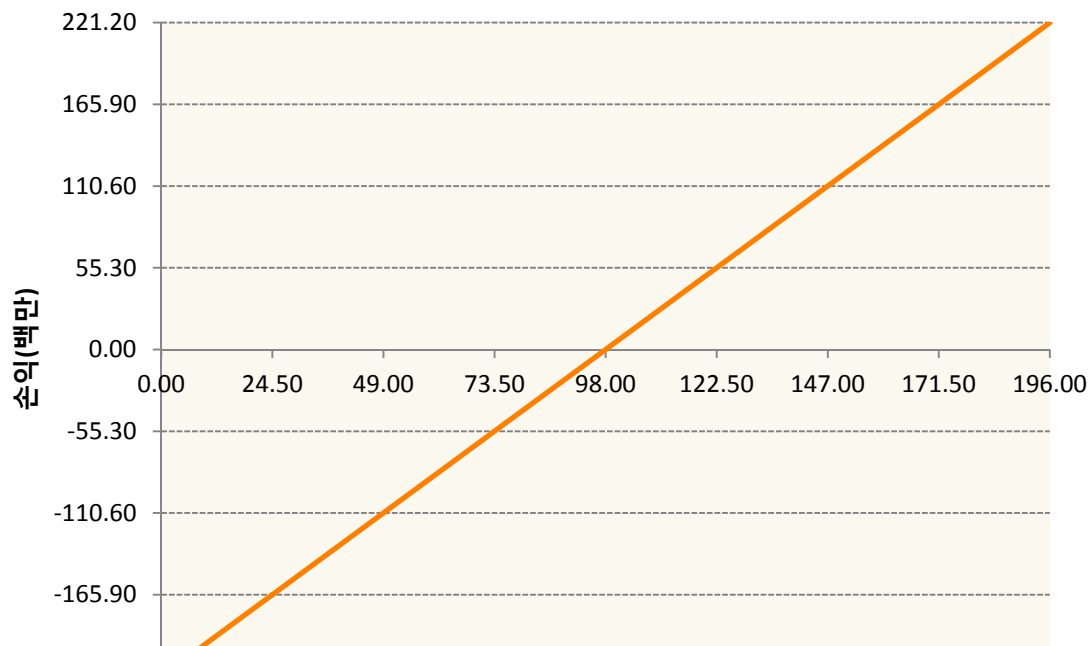


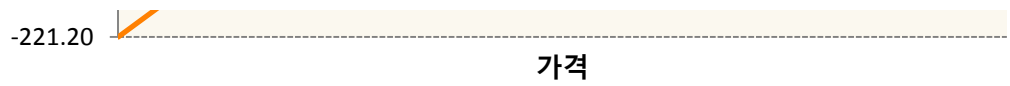


CU0-CORN FUTURE Sep20

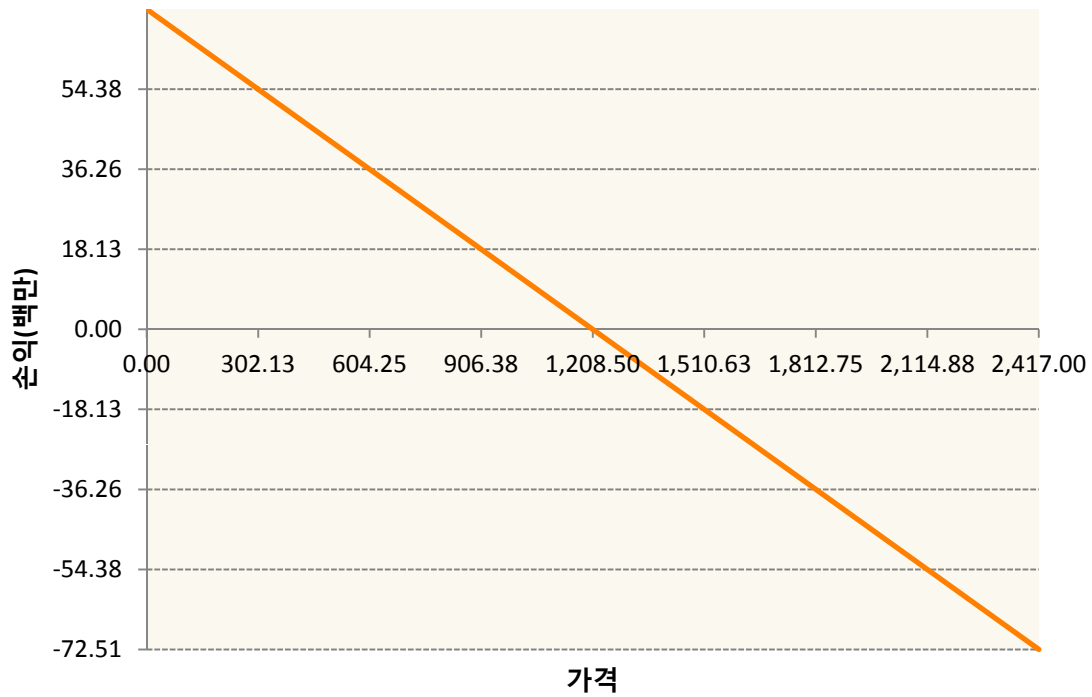


KCU0-COFFEE 'C' FUTURE Sep20

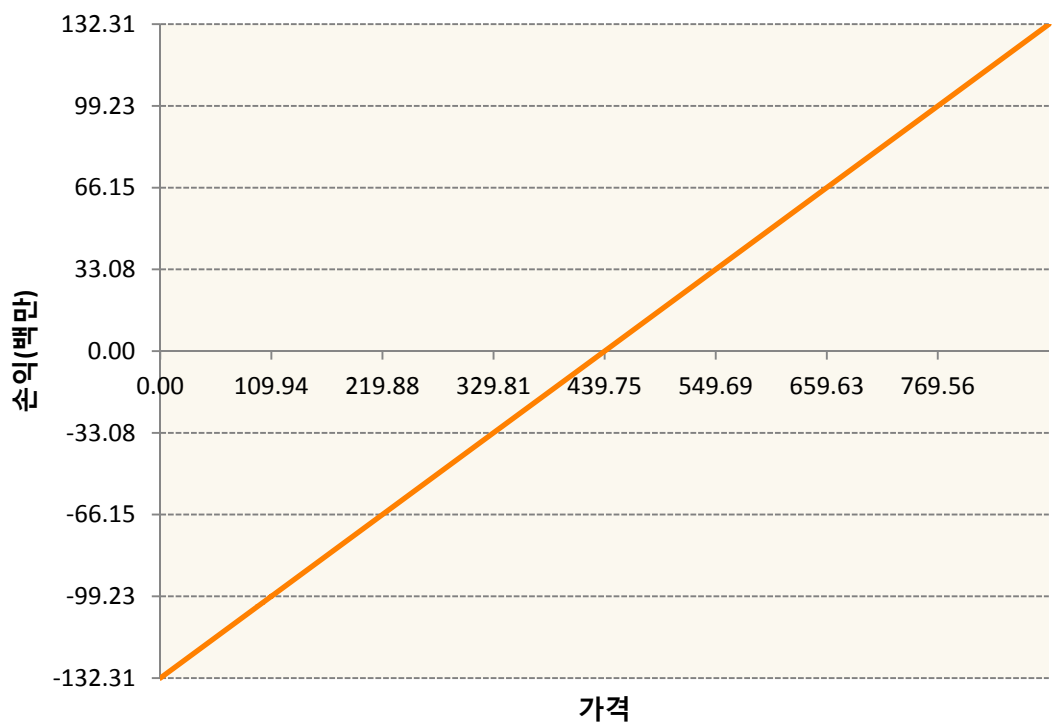




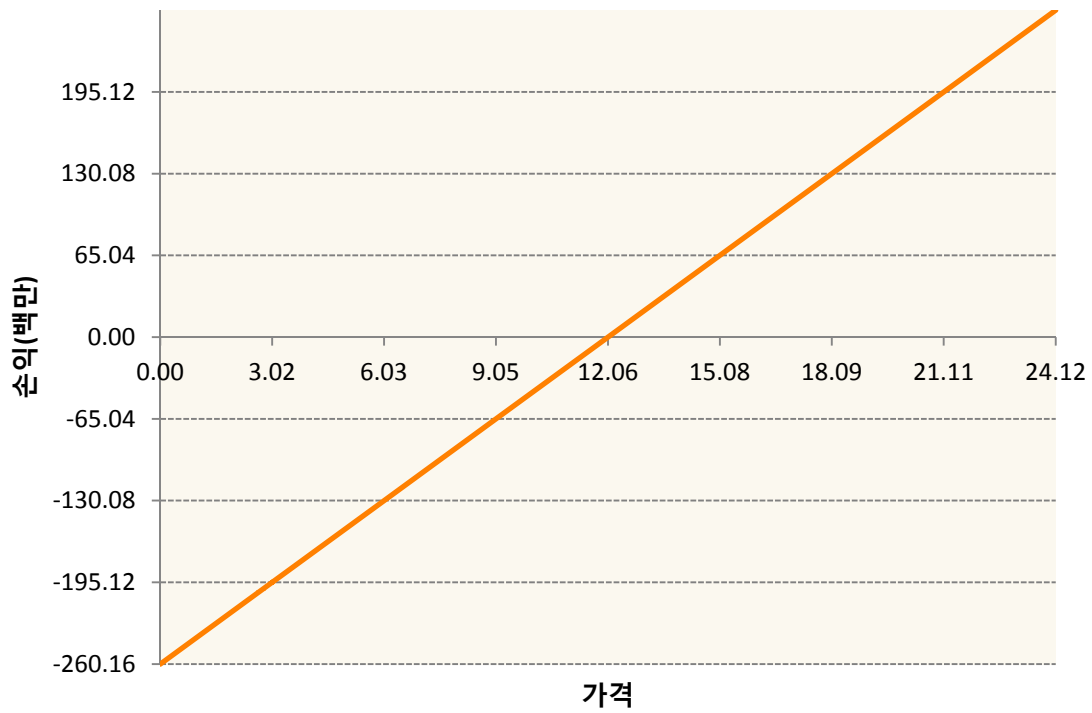
KR4175Q70005-2020-07 달러선물



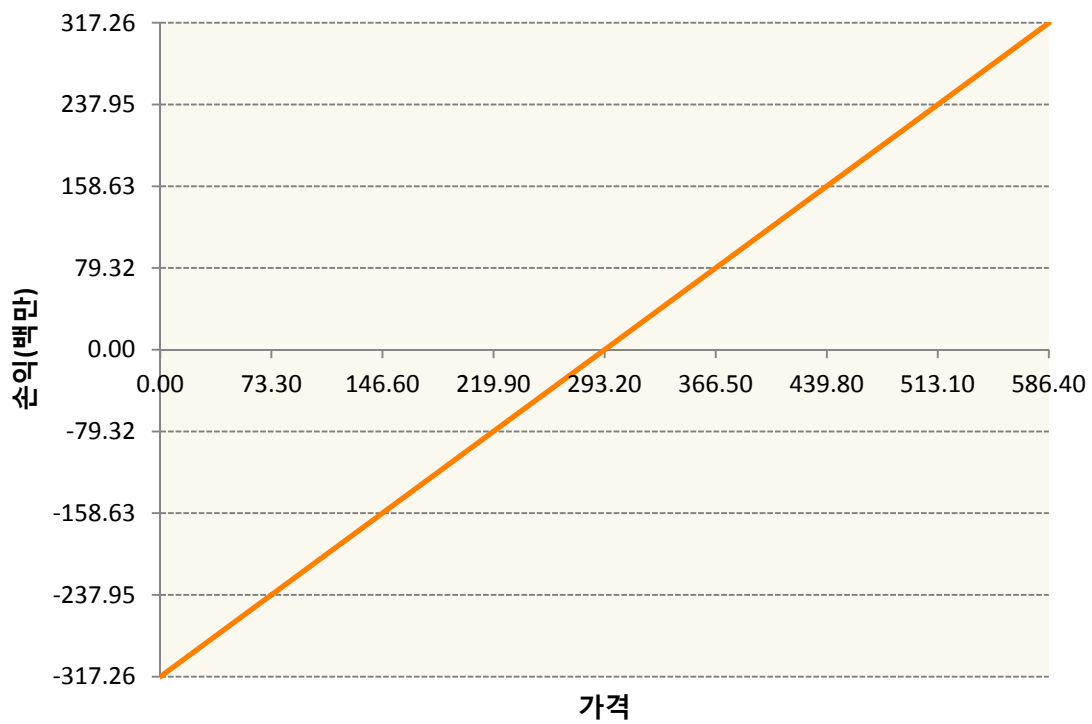
KWU0-KC HRW WHEAT FUT Sep20



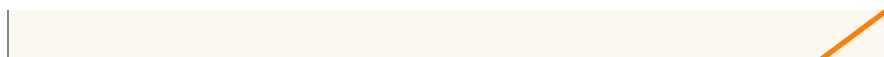
SBV0-Sugar Oct20

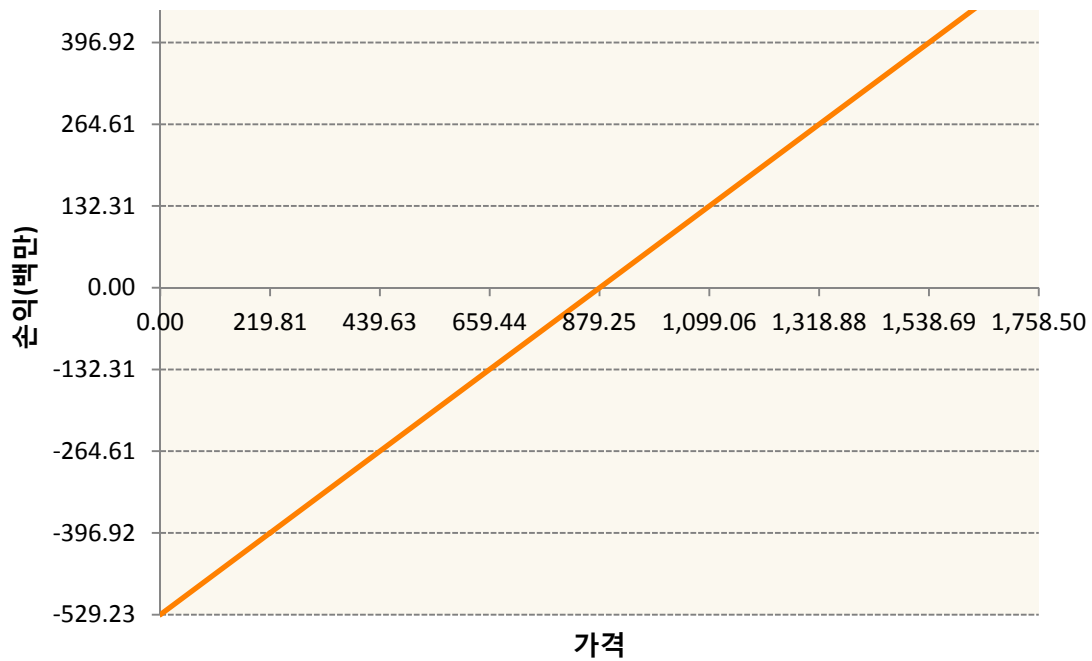


SMZ0-SOYBEAN MEAL FUTR Dec20

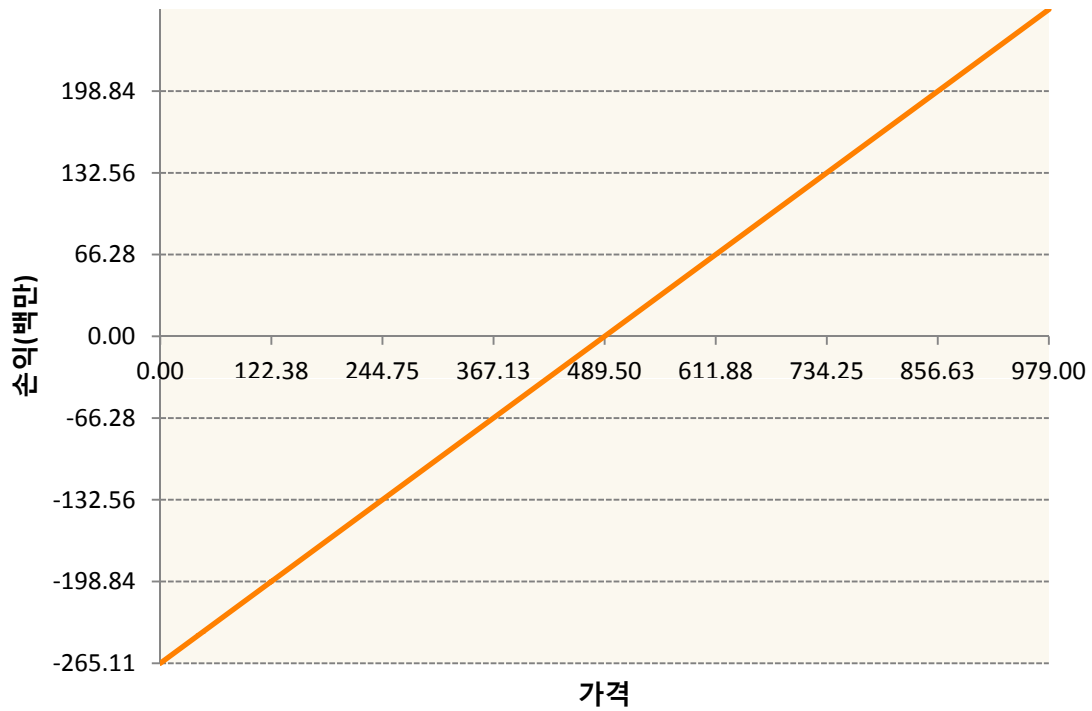


SX0-SOYBEAN FUTURE Nov20





WU0-WHEAT FUTURE(CBT) Sep20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ0	SOYBEAN OIL FUTR Dec20	19
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	25
SX0	SOYBEAN FUTURE Nov20	42
WU0	WHEAT FUTURE(CBT) Sep20	21

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

(단위:백만원)

240