

공시일	2020-06-26
기준일	2020-06-25

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	2020-06-26
기준일	2020-06-25

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

1,052

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,263

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-06-26
기준일	2020-06-25

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)

878

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-06-26
기준일	2020-06-25

유로인덱스모(주식-파생형)

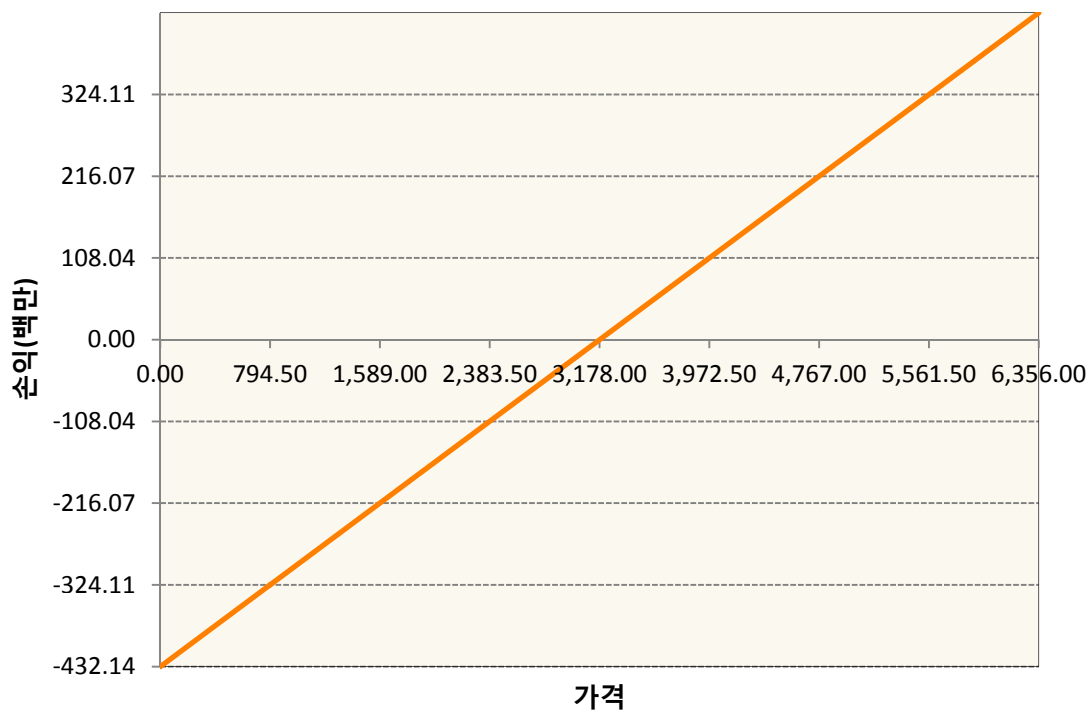
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	432	0	432	

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)

46

공시일	2020-06-26
기준일	2020-06-25

차이나인덱스모(주식-파생형)

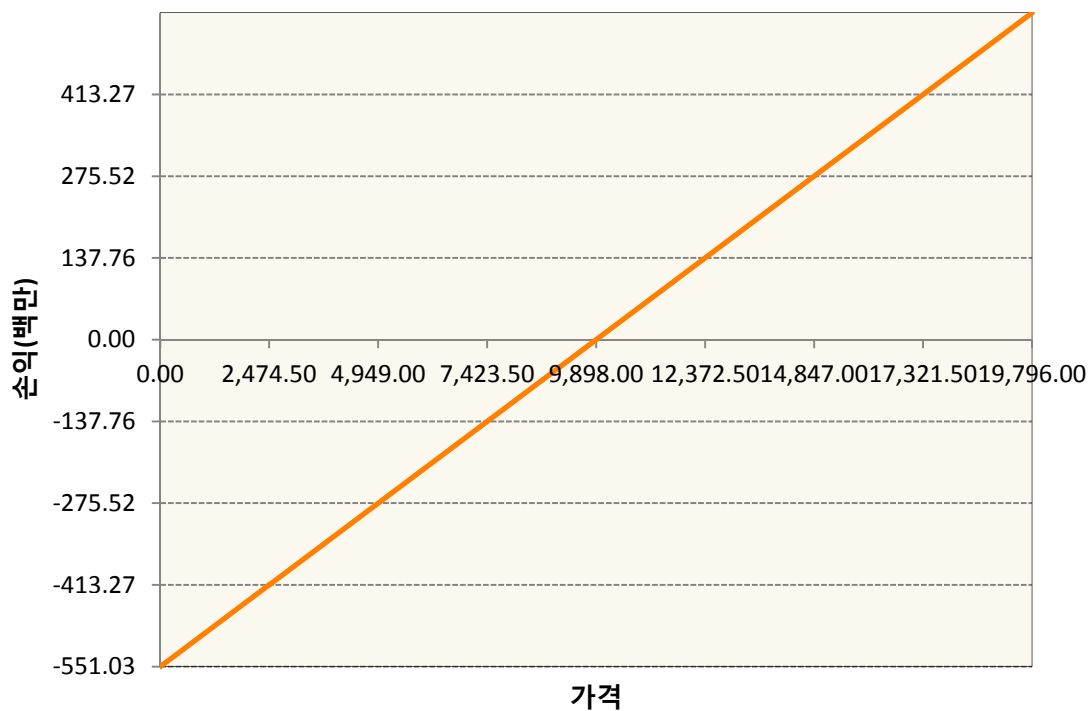
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	551	0	551	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCM0-HSCEI Futures Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

48

공시일	2020-06-26
기준일	2020-06-25

커버드콜모(주식혼합-파생형)

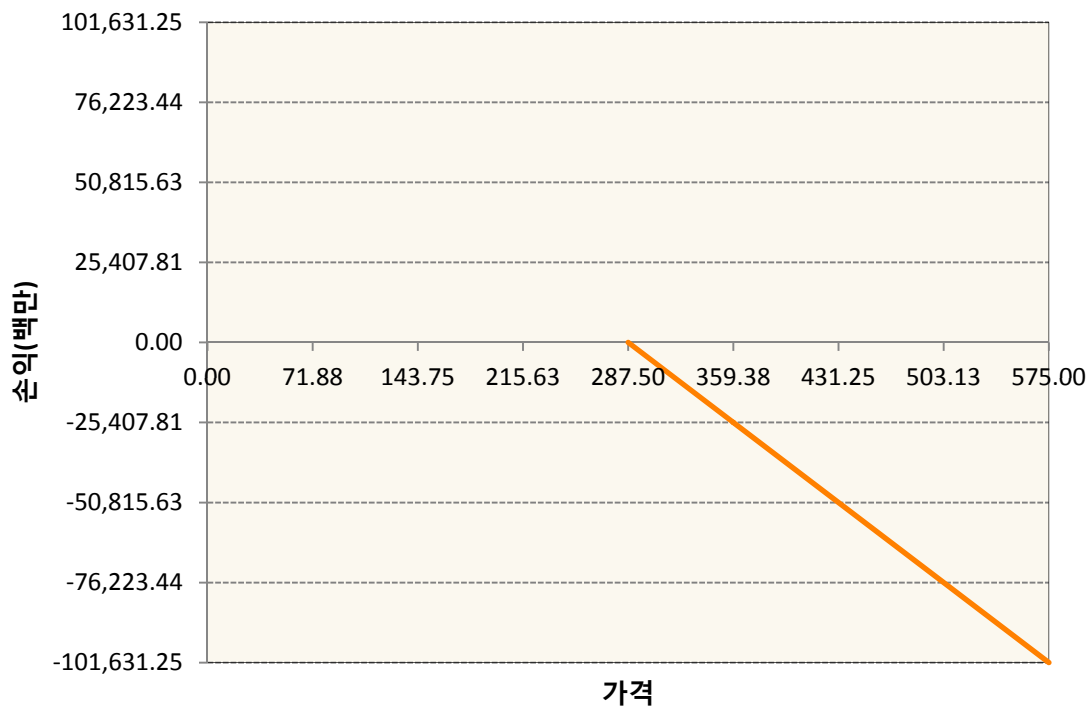
1. 계약금액

(단위:백만원)

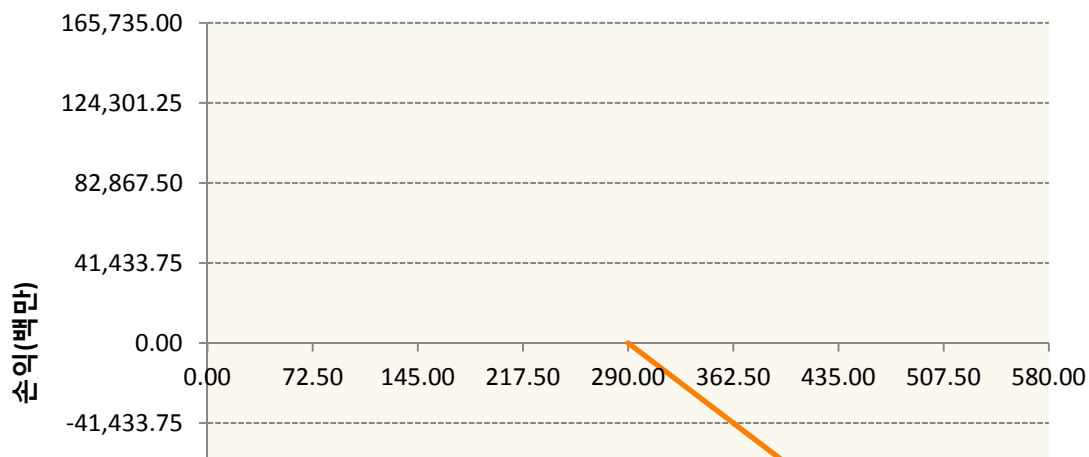
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	367,991	-367,991	장내

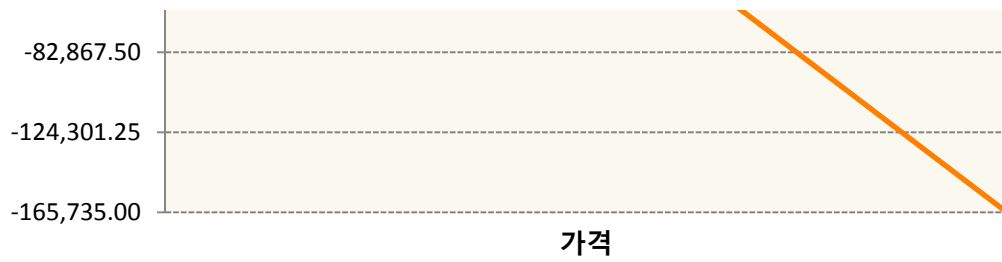
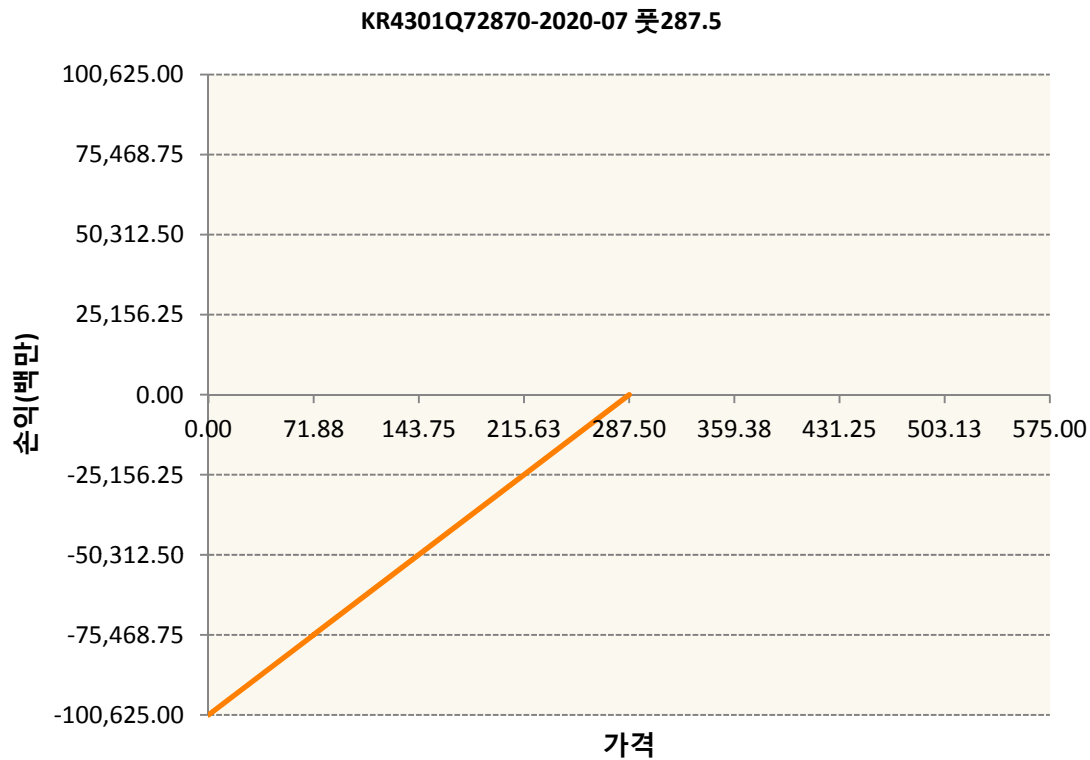
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q72872-2020-07 콜287.5



KR4201Q72906-2020-07 콜290





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q72872 2020-07 콜287.5							5,306
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,288	2,197	2,085	1,954	1,805	1,641	1,464
-5.33%	2,061	1,906	1,731	1,540	1,336	1,120	895
-2.67%	1,616	1,390	1,152	904	648	387	120
0%	862	578	291	0	-293	-587	-883
2.67%	-268	-577	-887	-1,197	-1,506	-1,816	-2,125
5.33%	-1,789	-2,086	-2,386	-2,689	-2,993	-3,298	-3,604
8.00%	-3,666	-3,919	-4,183	-4,455	-4,734	-5,018	-5,306
KR4201Q72906 2020-07 콜290							8,172
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,268	3,146	2,990	2,802	2,586	2,344	2,079

-5.33%	2,977	2,759	2,506	2,225	1,920	1,594	1,250
-2.67%	2,384	2,051	1,693	1,317	925	520	105
0%	1,339	902	455	0	-461	-927	-1,396
2.67%	-281	-779	-1,278	-1,777	-2,277	-2,777	-3,278
5.33%	-2,530	-3,028	-3,529	-4,031	-4,533	-5,037	-5,541
8.00%	-5,377	-5,820	-6,275	-6,739	-7,211	-7,689	-8,172
KR4301Q72870 2020-07 풋287.5							6,717
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,439	-6,458	-6,487	-6,528	-6,580	-6,643	-6,717
-5.33%	-3,897	-3,953	-4,024	-4,108	-4,206	-4,314	-4,432
-2.67%	-1,508	-1,625	-1,756	-1,898	-2,048	-2,206	-2,370
0%	564	381	192	0	-195	-393	-593
2.67%	2,154	1,938	1,722	1,507	1,291	1,075	859
5.33%	3,199	3,003	2,803	2,601	2,395	2,188	1,980
8.00%	3,776	3,636	3,484	3,322	3,152	2,976	2,794

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

(단위:백만원)

18,064

공시일	2020-06-26
기준일	2020-06-25

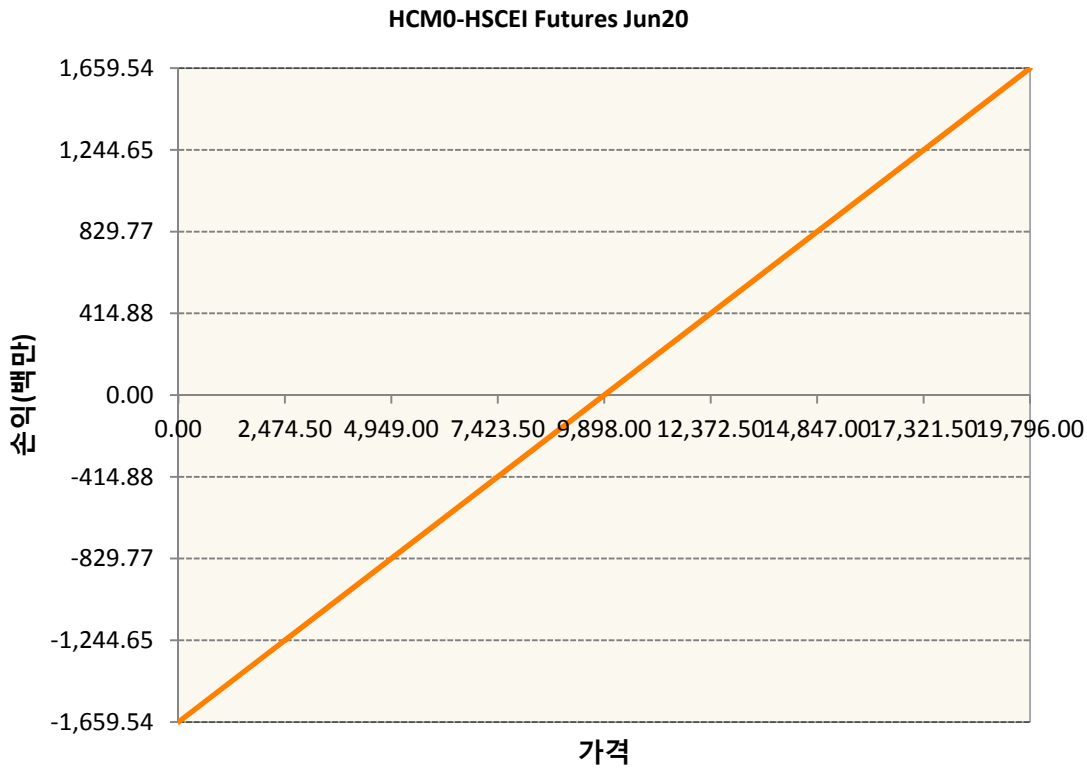
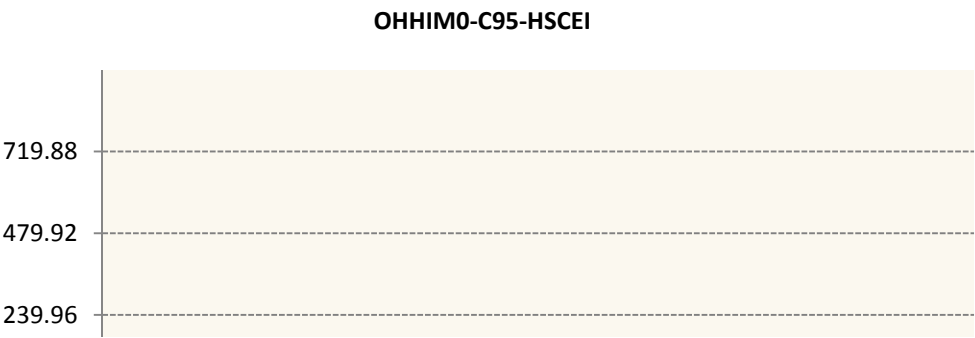
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

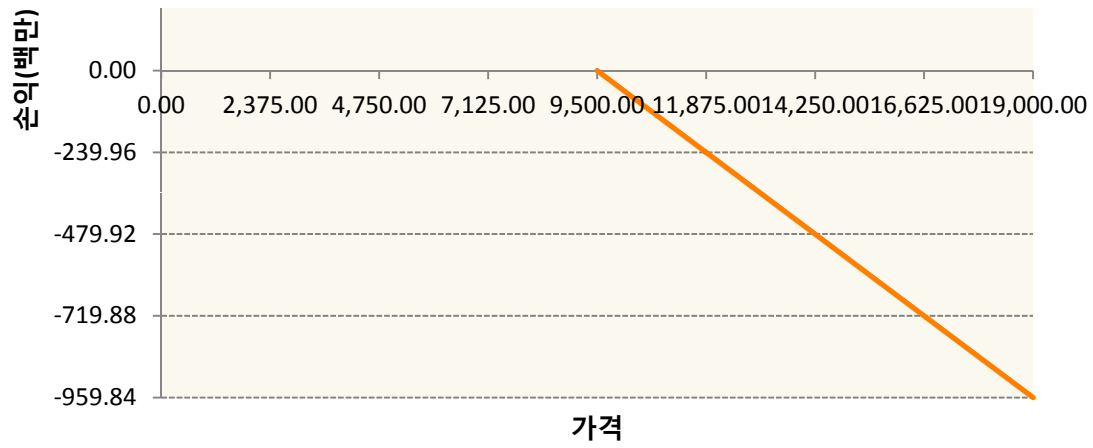
1. 계약금액

(단위:백만원)

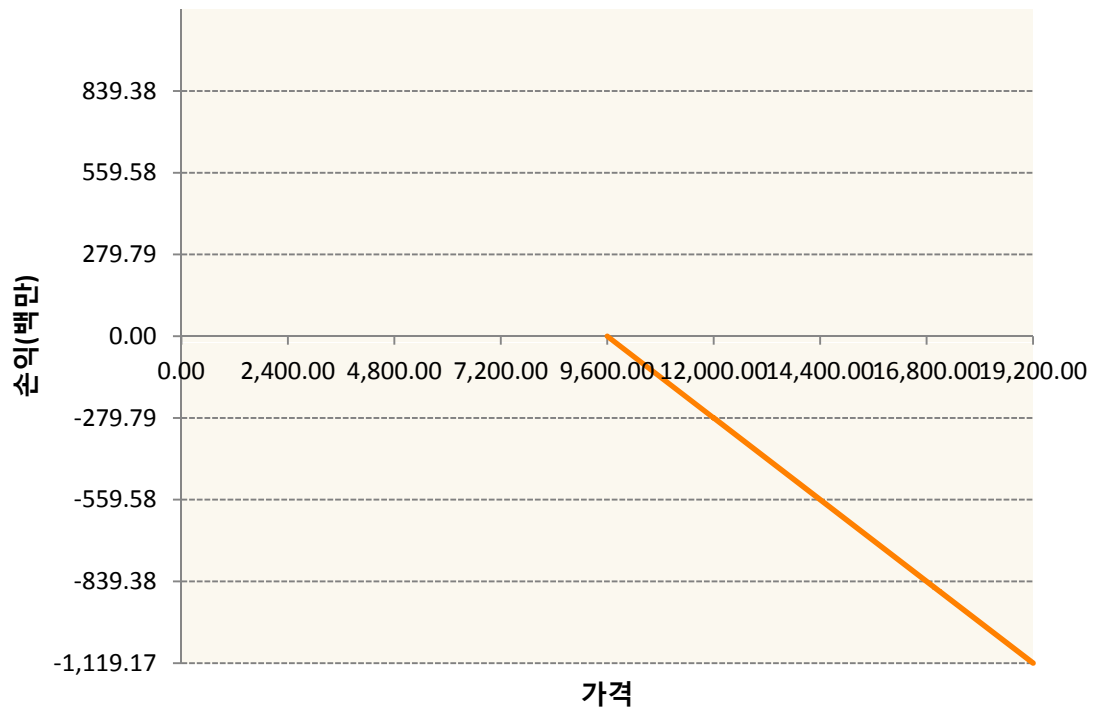
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,660	0	1,660	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,233	-4,233	장내
누계	통화	선도	0	1,505	-1,505	장외

2. 만기시점의 손익구조

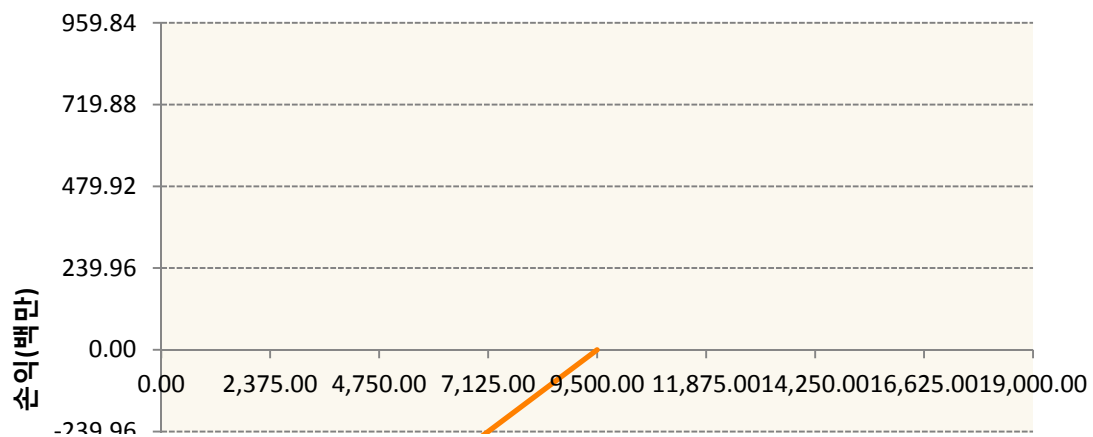


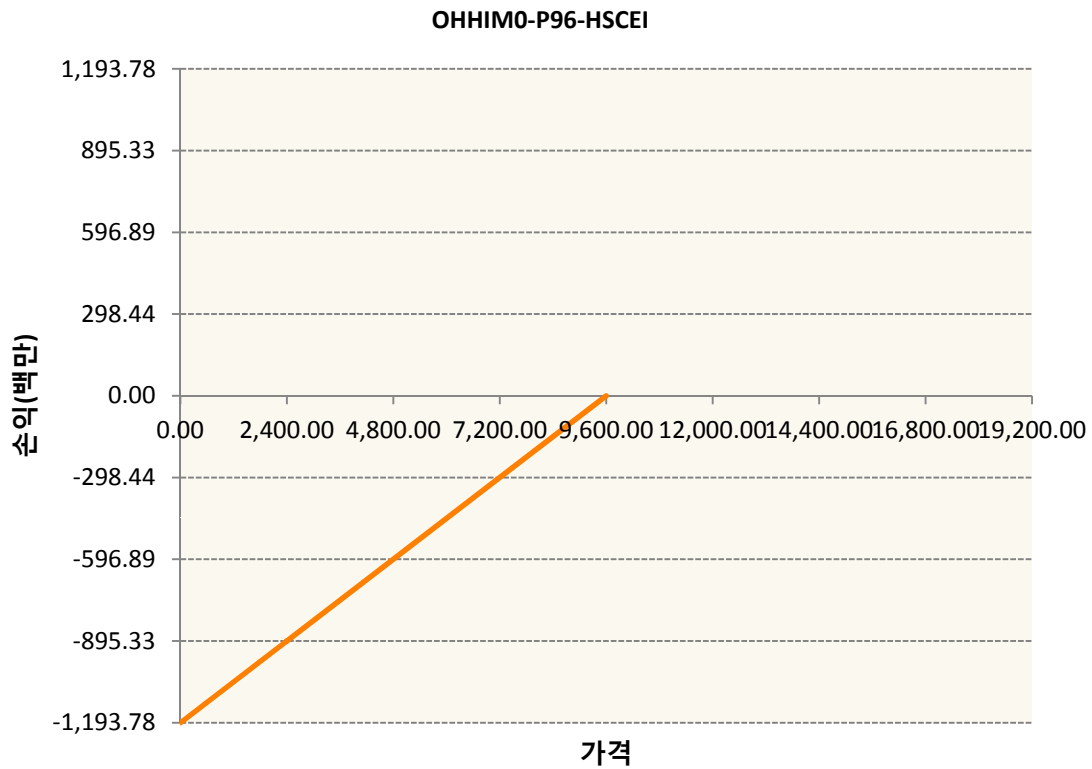


OHHIM0-C96-HSCEI



OHHIM0-P95-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E		120
HCM0 HSCEI Futures Jun20		133
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)
	572

공시일	2020-06-26
기준일	2020-06-25

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

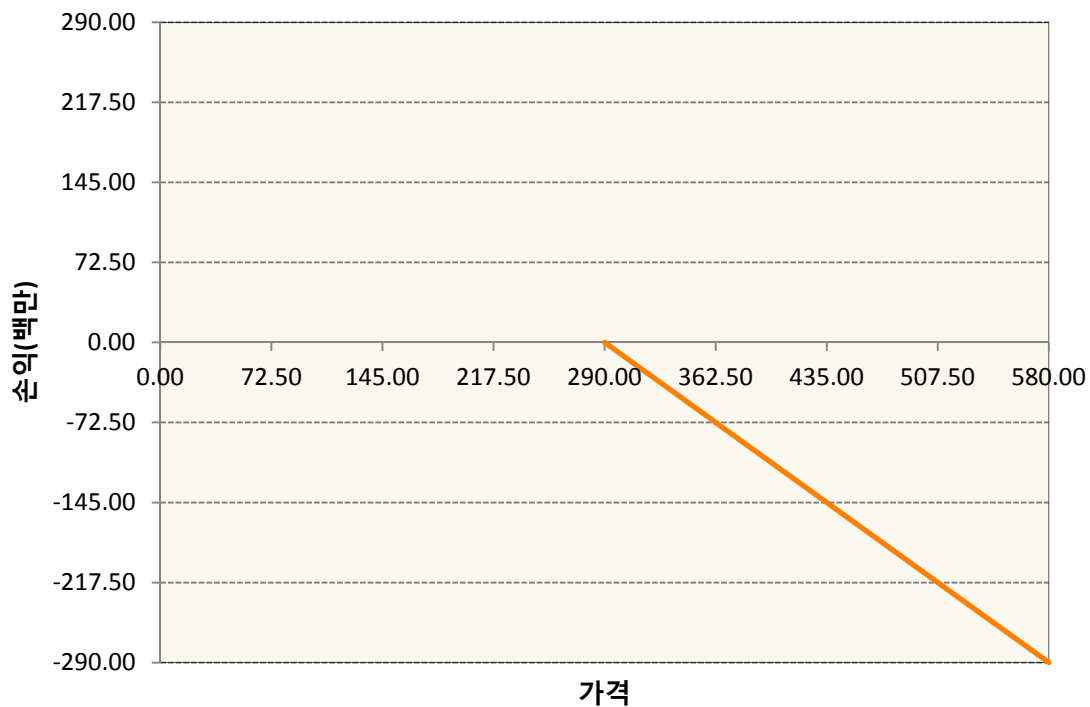
1. 계약금액

(단위:백만원)

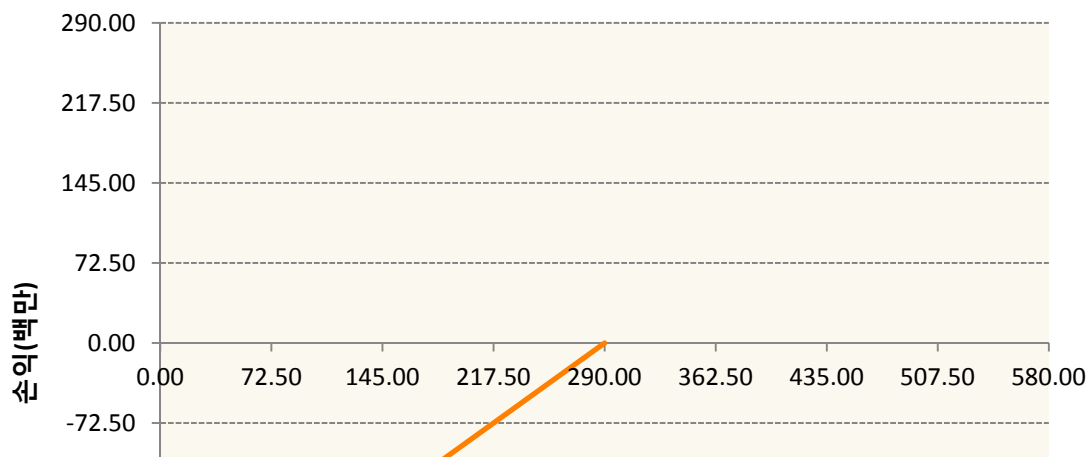
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	580	-580	장내

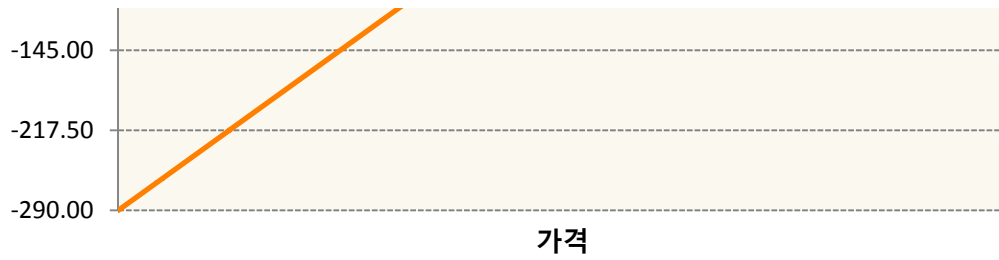
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q72906-2020-07 콜290



KR4301Q72904-2020-07 풋290





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q72906			2020-07 콜290				14
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6	6	5	5	5	4	4
-5.33%	5	5	4	4	3	3	2
-2.67%	4	4	3	2	2	1	0
0%	2	2	1	0	-1	-2	-2
2.67%	0	-1	-2	-3	-4	-5	-6
5.33%	-4	-5	-6	-7	-8	-9	-10
8.00%	-9	-10	-11	-12	-13	-13	-14
KR4301Q72904			2020-07 풋290				20
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19	-19	-19	-19	-19	-20	-20
-5.33%	-12	-12	-12	-12	-13	-13	-13
-2.67%	-5	-5	-5	-6	-6	-7	-7
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	7	6	5	5	4	3	3
5.33%	10	9	9	8	8	7	6
8.00%	12	12	11	11	10	10	9

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

32

공시일 2020-06-26
기준일 2020-06-25

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

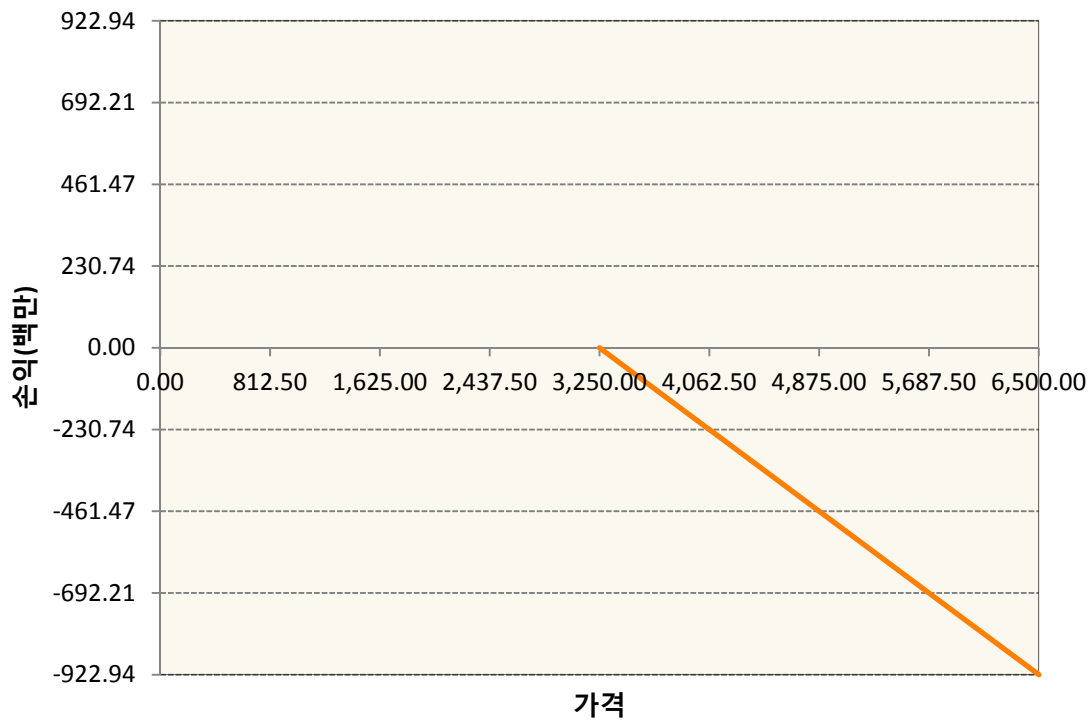
1. 계약금액

(단위:백만원)

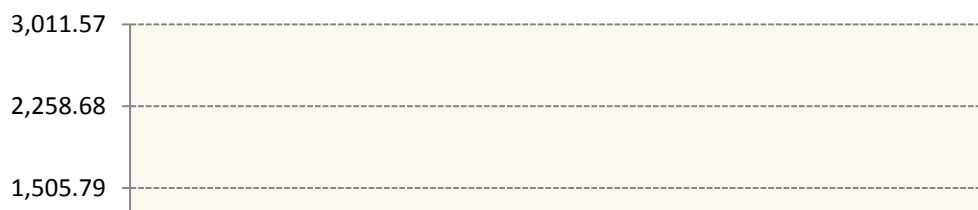
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,298	0	1,298	
누계	유가증권	스왑	8,065	0	8,065	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,869	-7,869	장내
누계	통화	선도	0	5,853	-5,853	장외

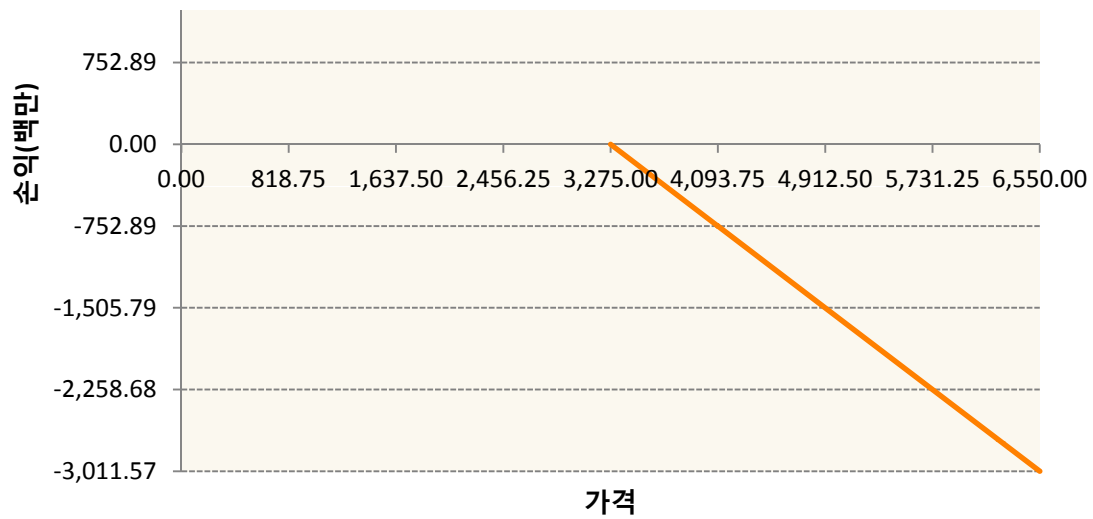
2. 만기시점의 손익구조

OESXN0-C3250-EURO STOXX 50

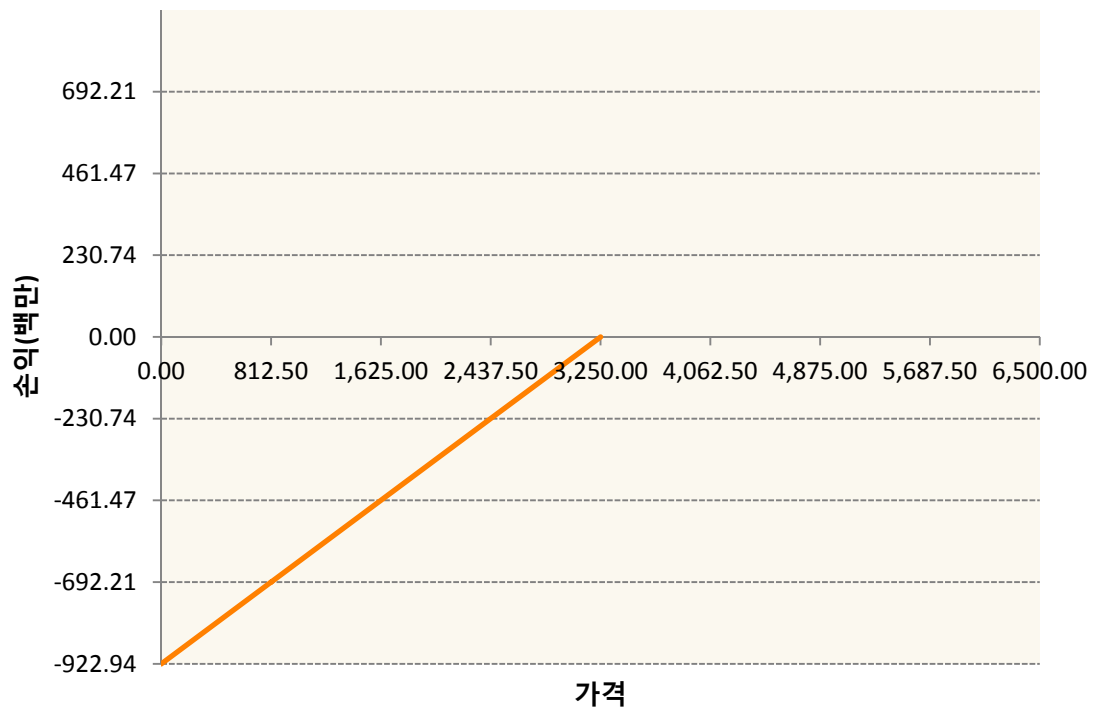


OESXN0-C3275-EURO STOXX 50



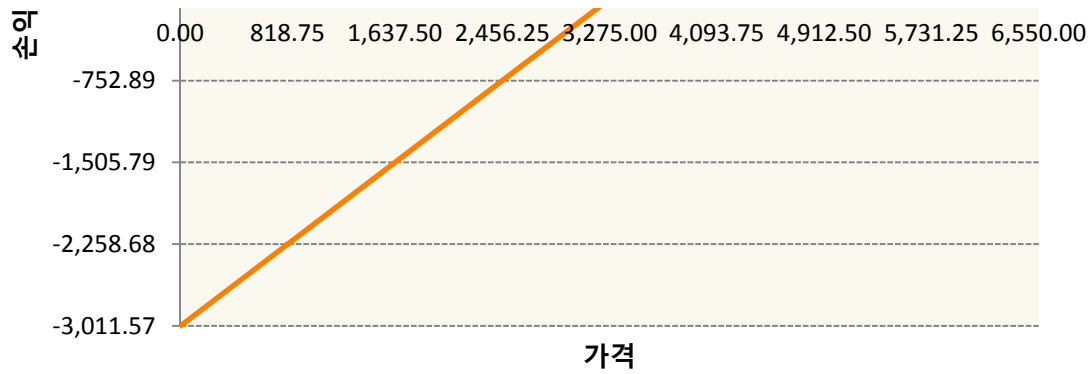
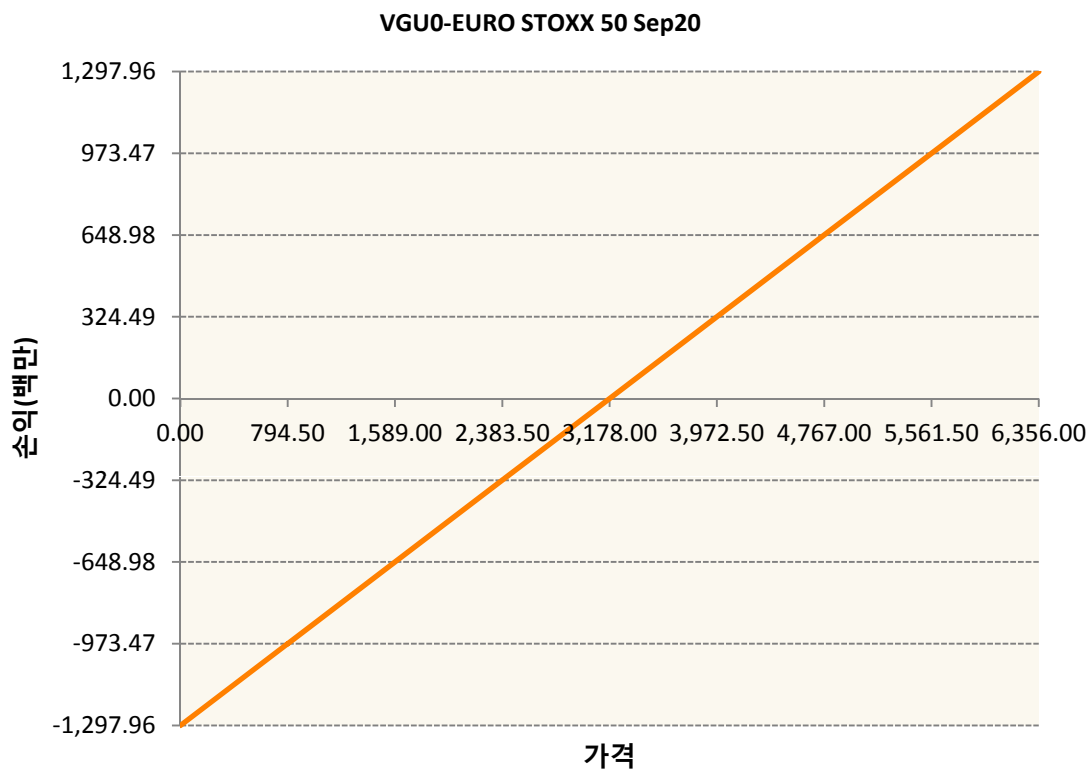


OESXN0-P3250-EURO STOXX 50



OESXN0-P3275-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY	15
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E	219
FX21020K02 KRW/EUR 26-06-20E	15
FX21020M06 KRW/EUR 25-09-20E	234
OESXN0-C32 EURO STOXX 50	74
OESXN0-C32 EURO STOXX 50	241
OESXN0-P32 EURO STOXX 50	74
OESXN0-P32 EURO STOXX 50	241
VGU0 EURO STOXX 50 Sep20	104

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

(단위:백만원)

1,293

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

(단위:백만원)

1,308

공시일	2020-06-26
기준일	2020-06-25

ETF스마트레버리지목표전환형9호

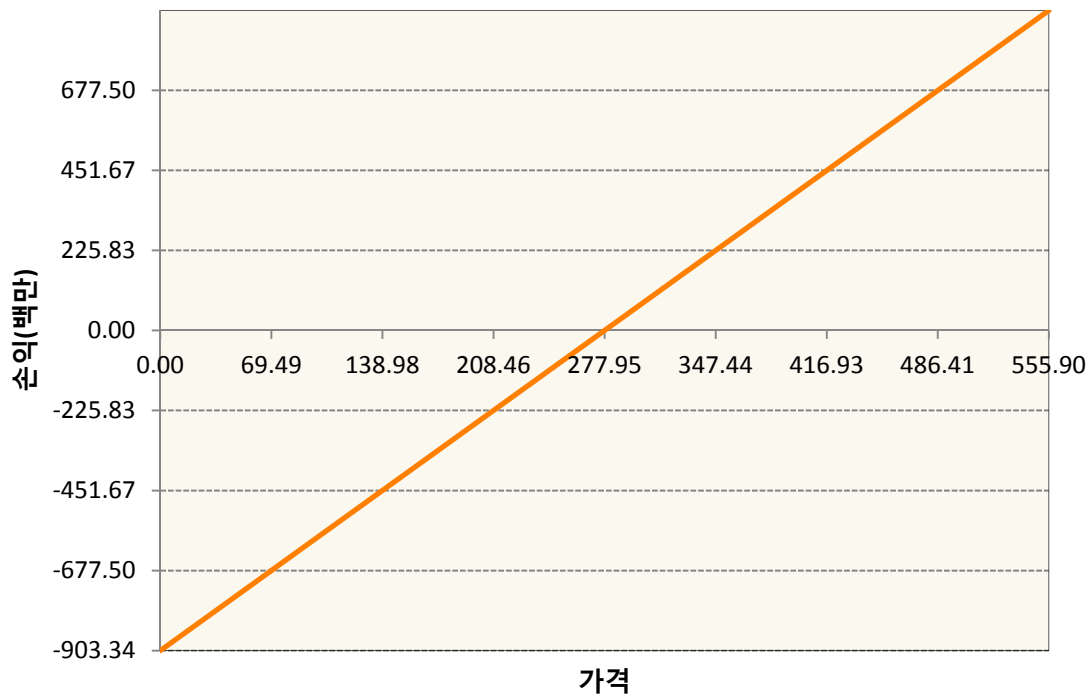
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	903	0	903	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%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
-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%	48	48	48	48	48	48	48	48
8.00%	73	73	73	73	73	73	73	73

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

(단위:백만원)

115

공시일	2020-06-26
기준일	2020-06-25

ETF스마트레버리지목표전환형10호

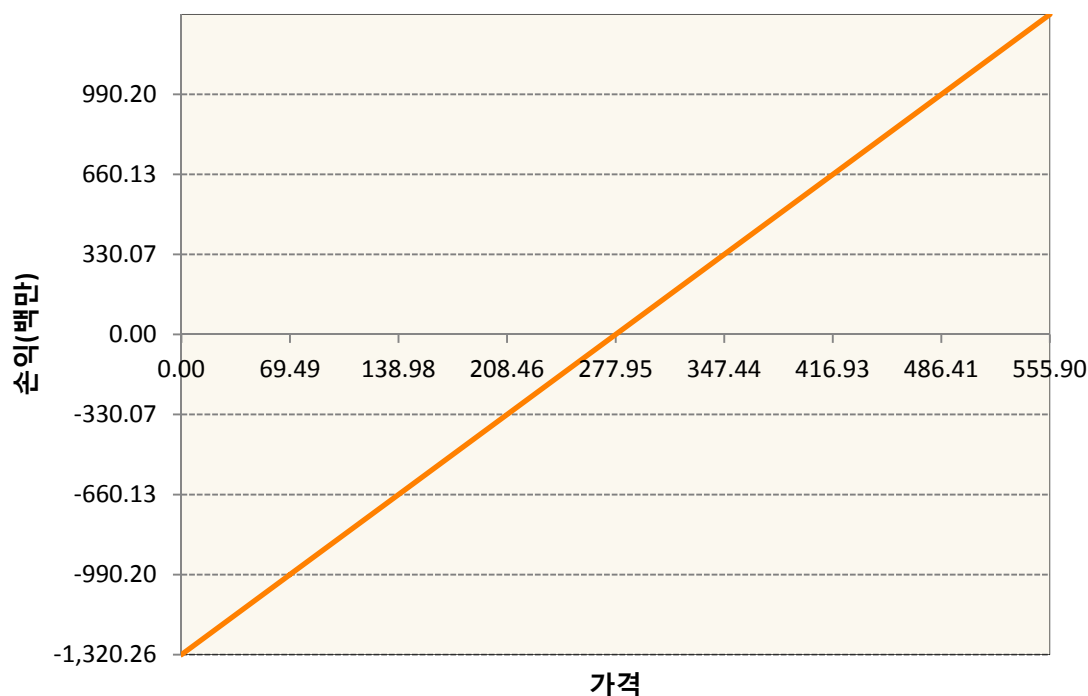
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,320	0	1,320	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피|200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009							2020-09 코스피200지수선물		106
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106	
-5.33%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71	
-2.67%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	35	35	35	35	35	35	35	35	
5.33%	71	71	71	71	71	71	71	71	
8.00%	106	106	106	106	106	106	106	106	

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

(단위:백만원)

168

공시일	2020-06-26
기준일	2020-06-25

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

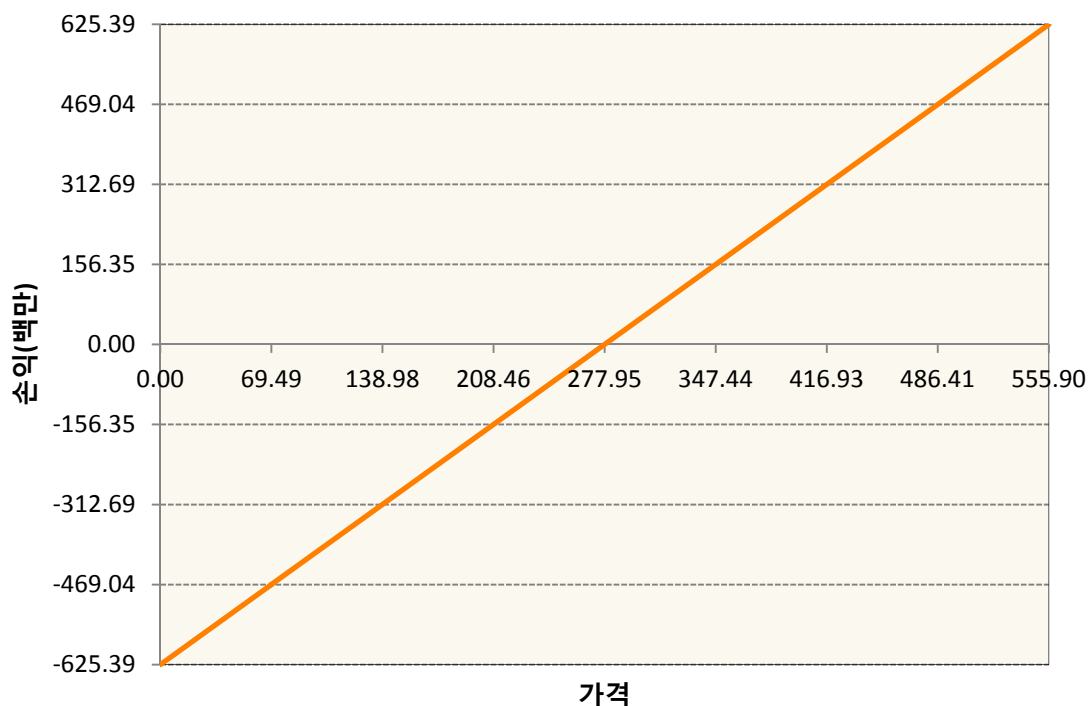
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	625	0	625	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009							2020-09 코스피200지수선물		50
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	
-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%	50	50	50	50	50	50	50	50	

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

(단위:백만원)

80

공시일	2020-06-26
기준일	2020-06-25

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

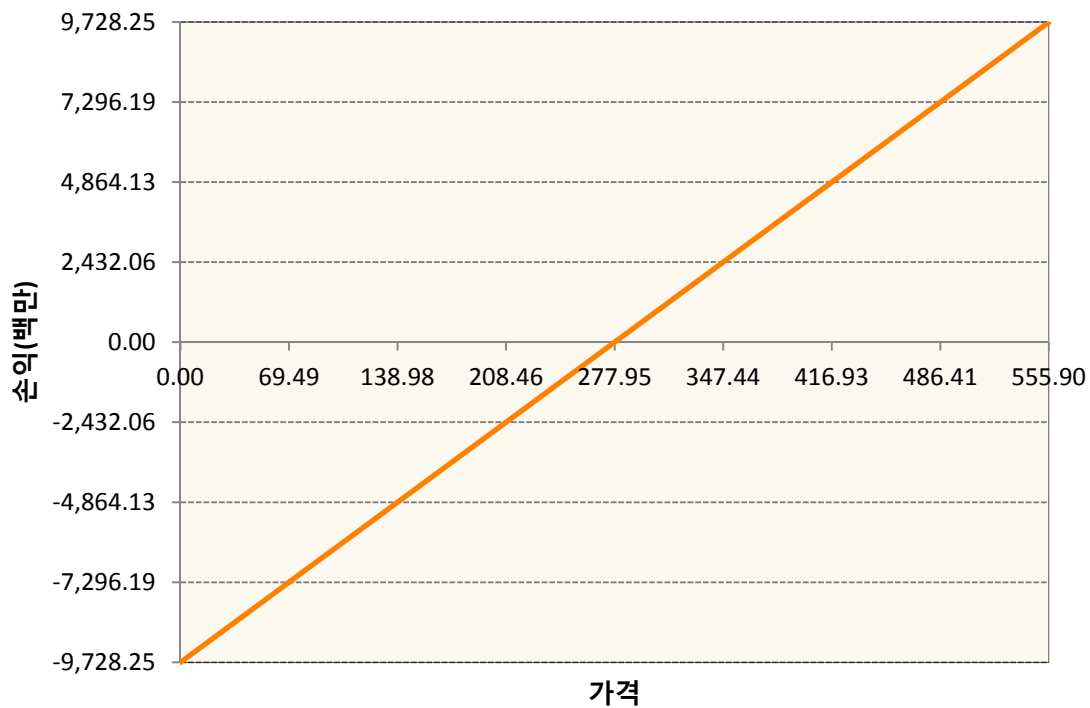
1. 계약금액

(단위:백만원)

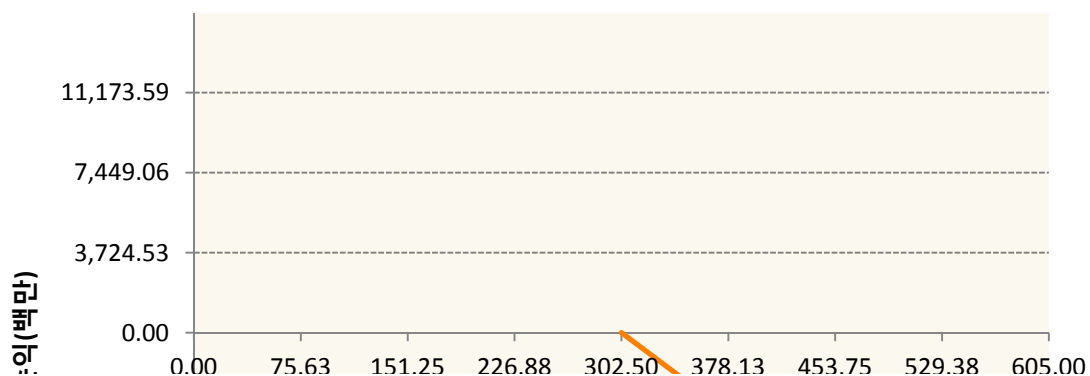
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,728	0	9,728	장내
누계	유가증권	옵션	3,247	19,092	-15,845	장내

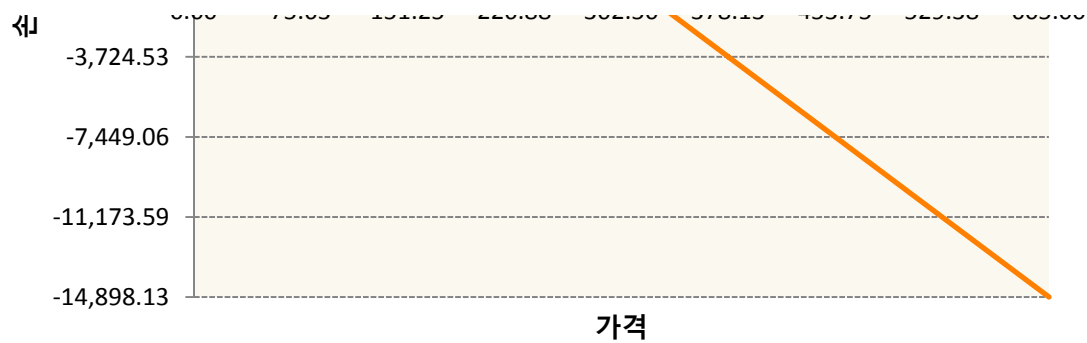
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물

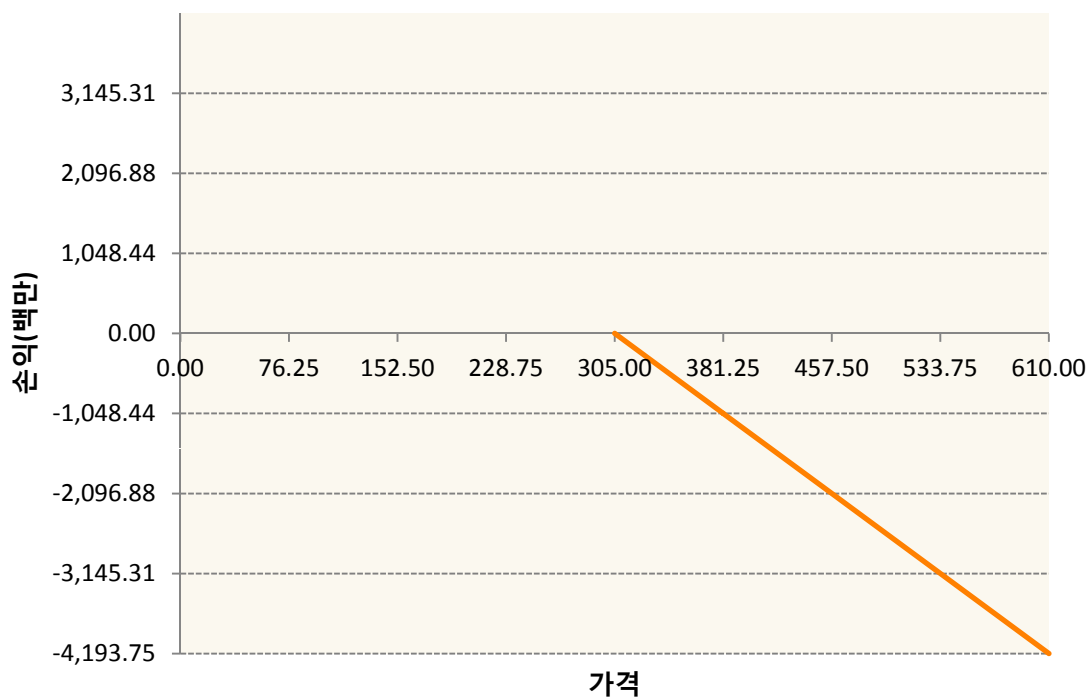


KR4201Q73029-2020-07 콜302.5

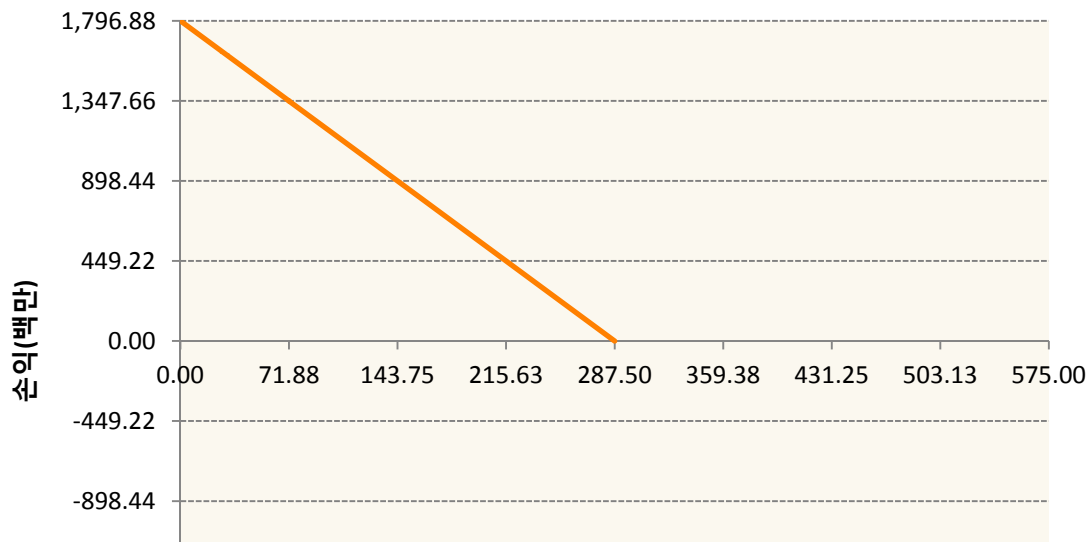


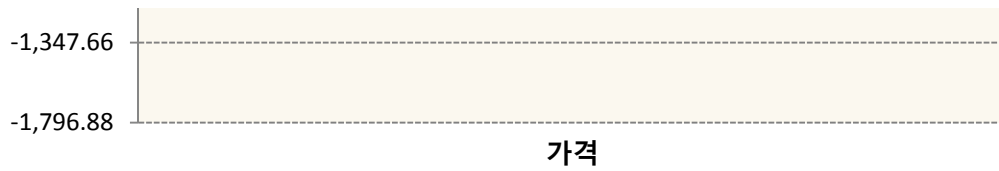
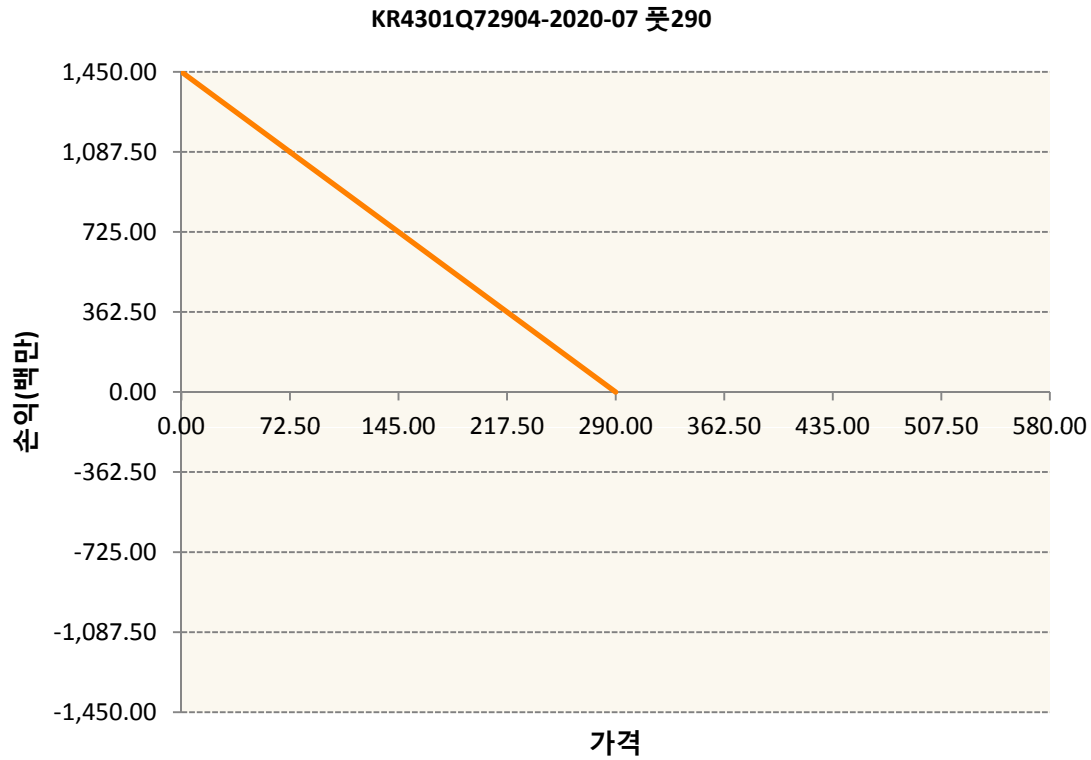


KR4201Q73052-2020-07 콜305



KR4301Q72870-2020-07 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q90009 2020-09 코스피200지수선물 783							
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-783	-783	-783	-783	-783	-783	-783
-5.33%	-522	-522	-522	-522	-522	-522	-522
-2.67%	-261	-261	-261	-261	-261	-261	-261
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	261	261	261	261	261	261	261
5.33%	522	522	522	522	522	522	522
8.00%	783	783	783	783	783	783	783
KR4201Q73029 2020-07 콜302.5 525							
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	139	136	130	123	113	101	86
-5.33%	133	125	114	101	85	66	46
-2.67%	116	101	83	62	39	13	-14

0%	80	56	29	0	-31	-64	-98
2.67%	14	-20	-56	-93	-131	-170	-209
5.33%	-94	-136	-178	-221	-264	-308	-351
8.00%	-252	-298	-343	-389	-434	-479	-525
KR4201Q73052 2020-07 콜305							137
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	33	33	31	29	27	24	20
-5.33%	32	30	28	24	20	16	11
-2.67%	28	25	20	15	9	3	-4
0%	20	14	7	0	-8	-17	-26
2.67%	5	-4	-13	-23	-33	-44	-54
5.33%	-21	-33	-44	-56	-67	-79	-91
8.00%	-61	-73	-86	-99	-111	-124	-137
KR4301Q72870 2020-07 풋287.5							120
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	115	115	116	117	117	119	120
-5.33%	70	71	72	73	75	77	79
-2.67%	27	29	31	34	37	39	42
0%	-10	-7	-3	0	3	7	11
2.67%	-38	-35	-31	-27	-23	-19	-15
5.33%	-57	-54	-50	-46	-43	-39	-35
8.00%	-67	-65	-62	-59	-56	-53	-50
KR4301Q72904 2020-07 풋290							99
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	96	96	96	97	97	98	99
-5.33%	59	60	60	61	63	64	65
-2.67%	24	25	27	29	31	33	35
0%	-7	-5	-3	0	3	5	8
2.67%	-33	-30	-26	-23	-20	-17	-14
5.33%	-50	-47	-44	-41	-38	-35	-32
8.00%	-60	-58	-56	-53	-50	-48	-45

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

(단위:백만원)

1,871

공시일	2020-06-26
기준일	2020-06-25

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	137,705	0	137,705	

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	2020-06-26
기준일	2020-06-25

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	99,569	0	99,569	

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	2020-06-26
기준일	2020-06-25

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	463,898	0	463,898	
누계	통화	선도	0	441,402	-441,402	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J03 KRW/USD 24-07-20E	2,168
FX21020J04 KRW/USD 24-07-20E	1,735
FX21020J04 KRW/USD 24-07-20E	1,928
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	2,352
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	964
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,012
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,600
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	3,373
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	6,843
FX21020M0 KRW/USD 26-08-20E	578
FX21020M01 KRW/USD 26-08-20E	4,722
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	2,005
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	2,429
FX21020M05 KRW/USD 22-09-20E	1,002
FX21020M05 KRW/USD 22-09-20E	2,602

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

18,200

공시일	2020-06-26
기준일	2020-06-25

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

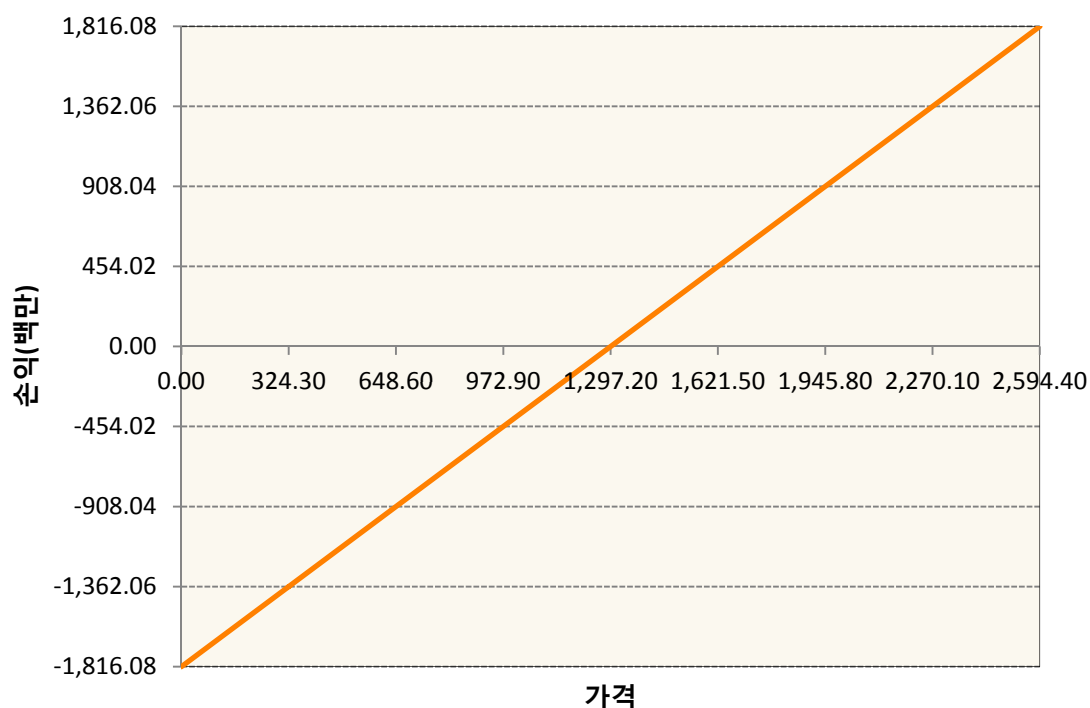
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,816	0	1,816	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4108Q90004-2020-09 KRX300 선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4108Q90004							2020-09 KRX300 선물		145
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-145	-145	-145	-145	-145	-145	-145	-145	
-5.33%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97	
-2.67%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	48	48	48	48	48	48	48	48	
5.33%	97	97	97	97	97	97	97	97	
8.00%	145	145	145	145	145	145	145	145	

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

(단위:백만원)

230

공시일	2020-06-26
기준일	2020-06-25

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	7,646	0	7,646	
누계	통화	선도	0	7,481	-7,481	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020K04 KRW/USD 27-07-20E	39
FX21020K04 KRW/USD 27-07-20E	96
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)

308

공시일	2020-06-26
기준일	2020-06-25

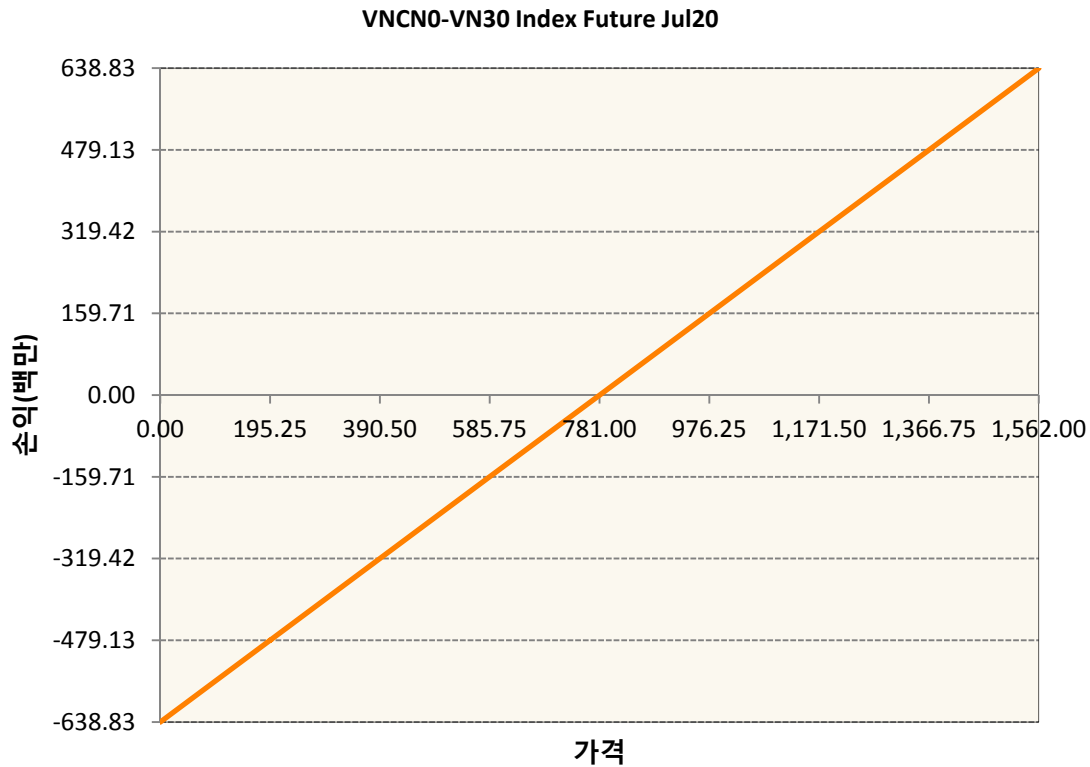
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	639	0	639	
누계	유가증권	스왑	981	0	981	장외
누계	통화	선도	208	884	-676	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	78
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	2020-06-26
기준일	2020-06-25

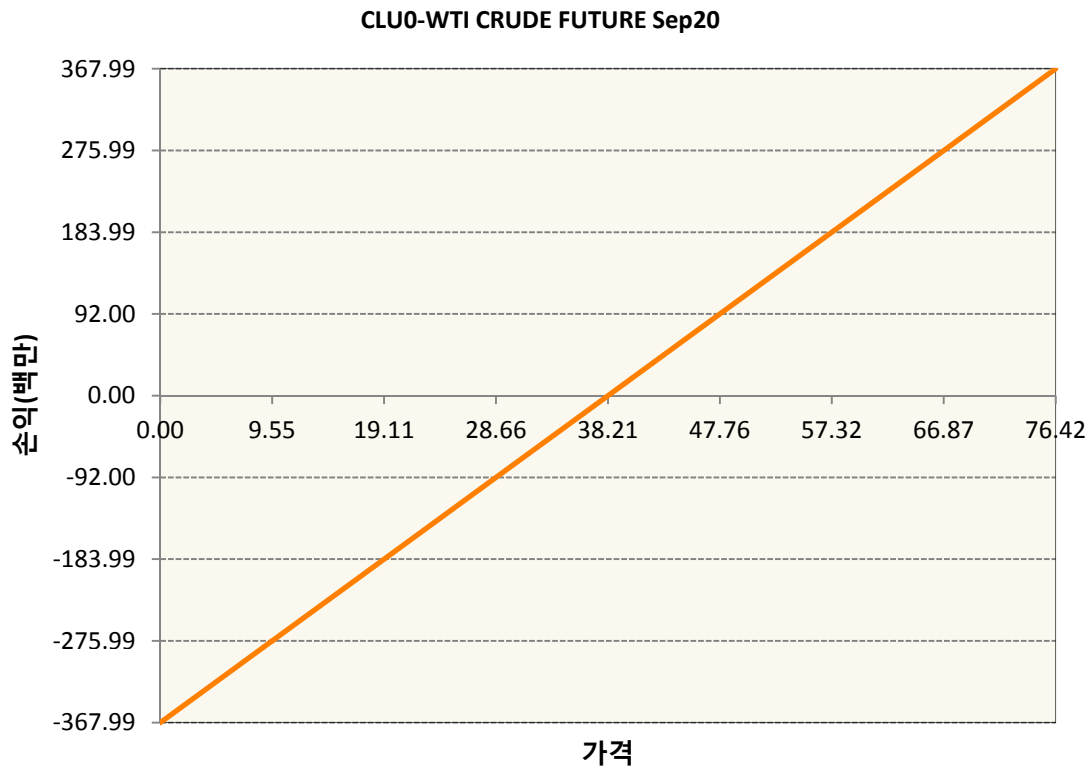
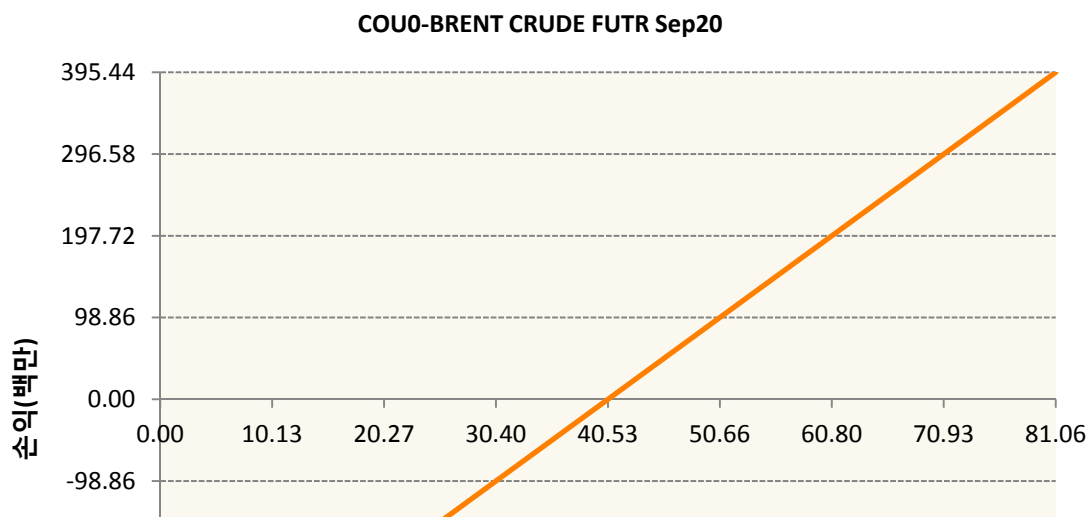
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

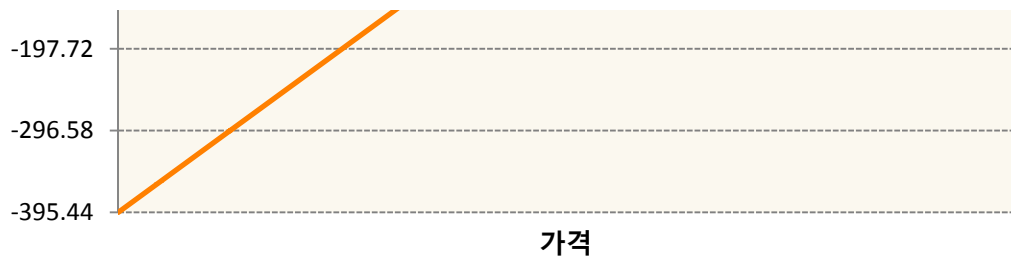
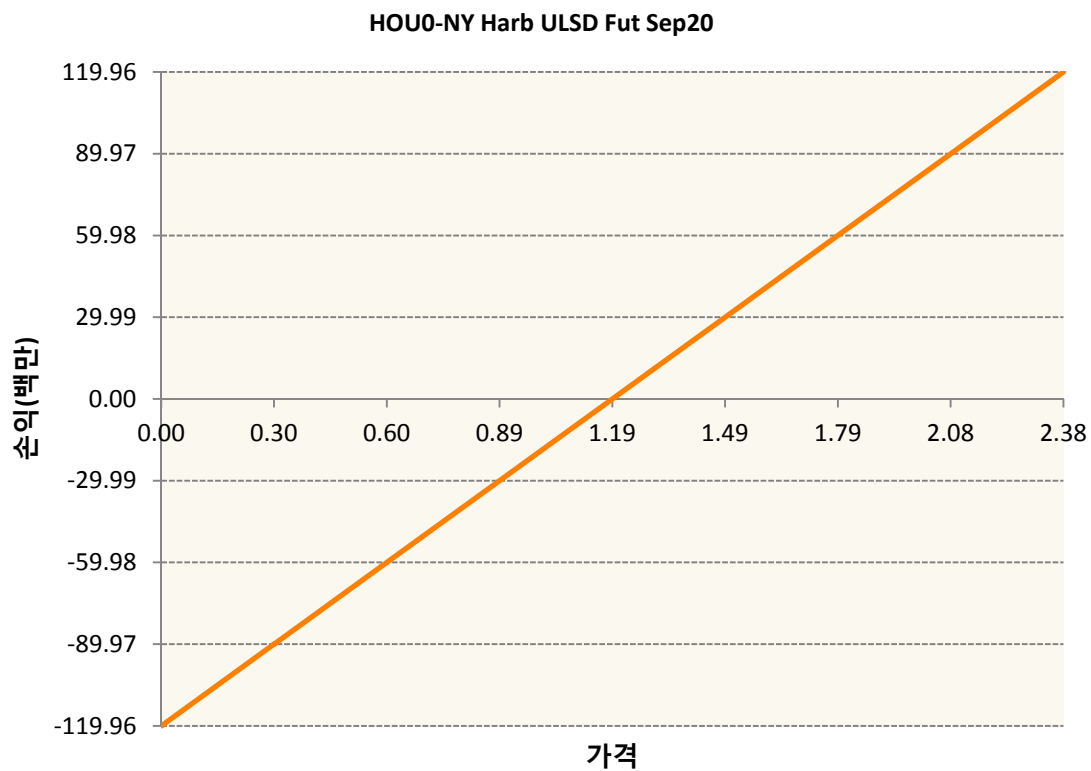
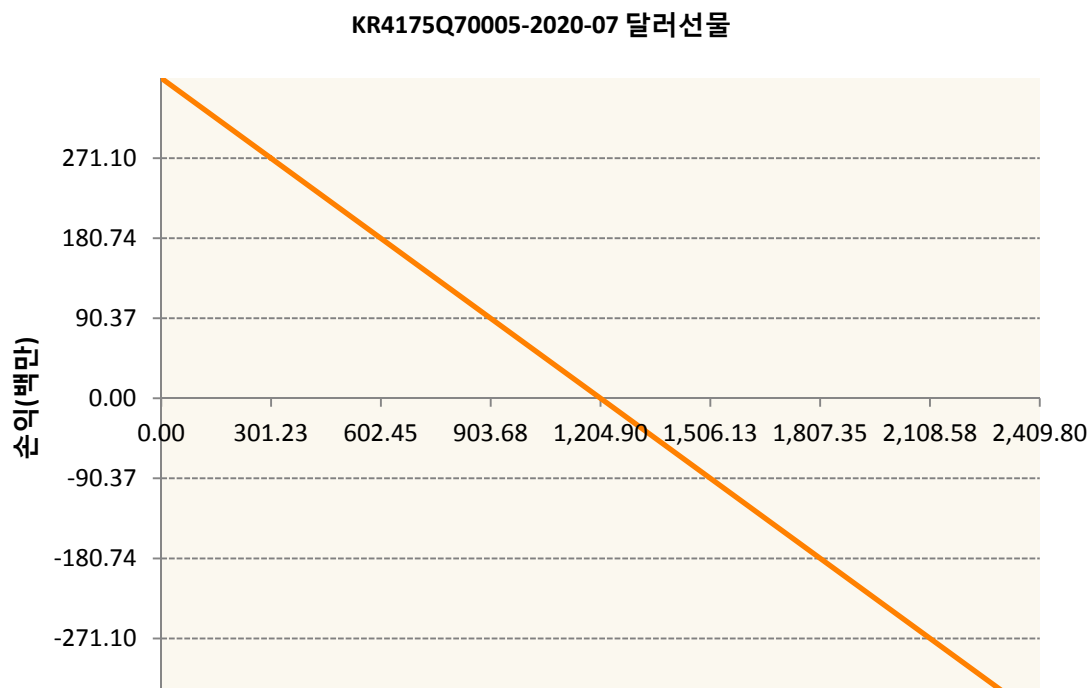
1. 계약금액

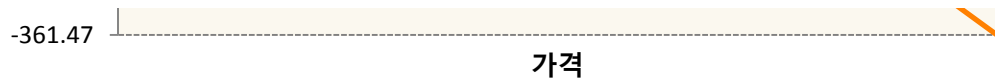
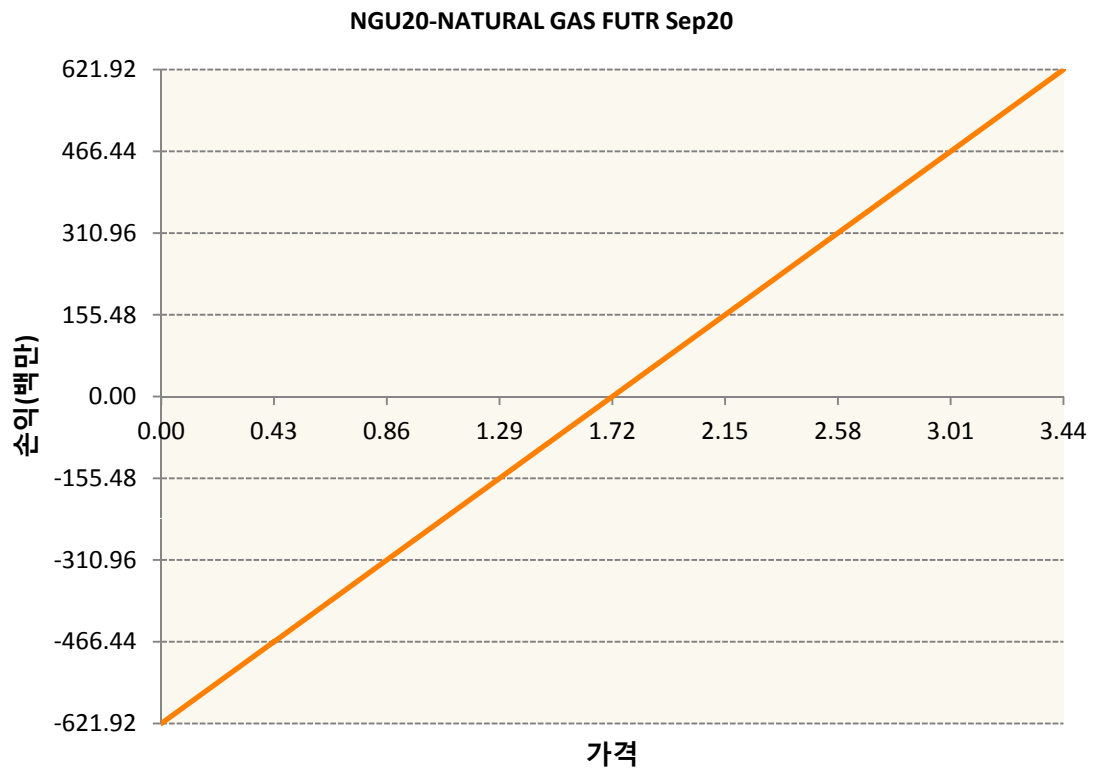
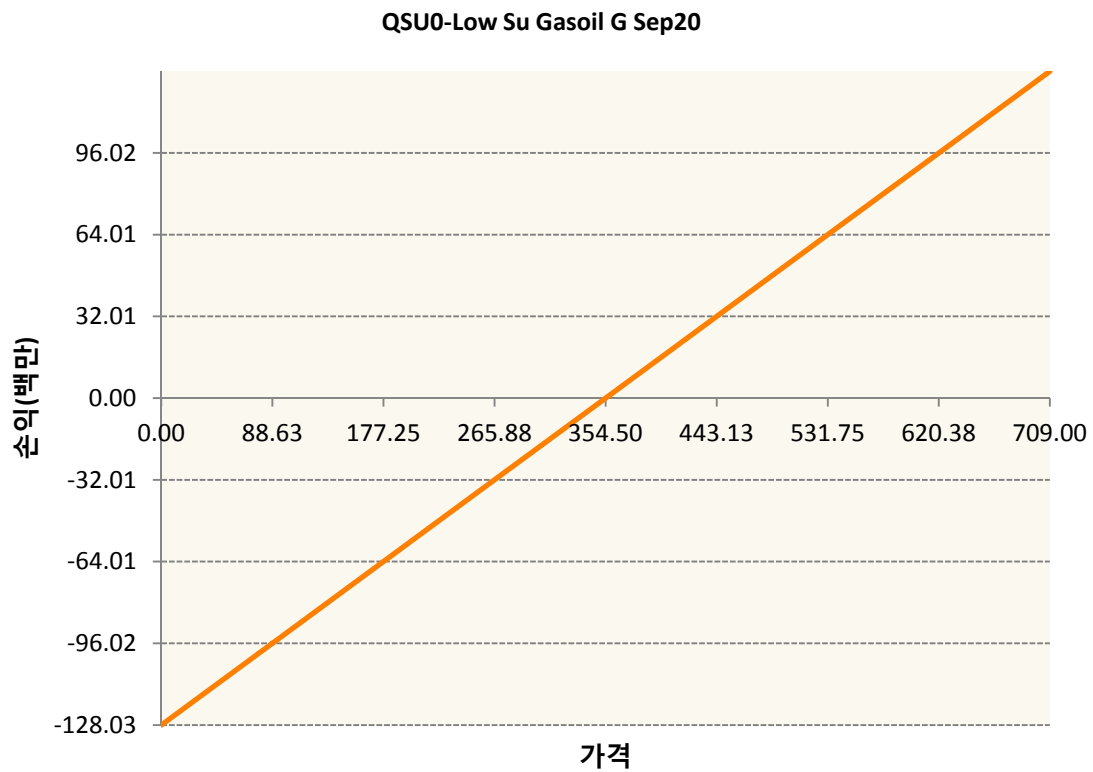
(단위:백만원)

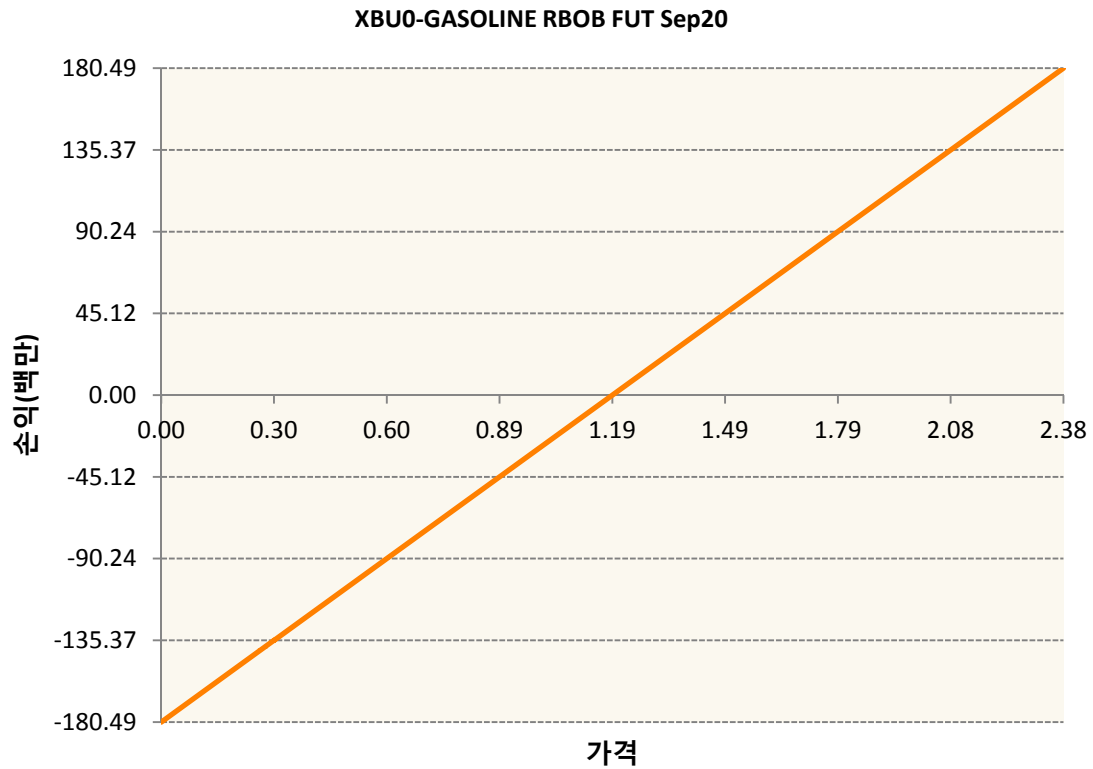
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,814	361	1,452	

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLU0	WTI CRUDE FUTURE Sep20		29
COU0	BRENT CRUDE FUTR Sep20		32
HOU0	NY Harb ULSD Fut Sep20		10
KR4175Q70C 2020-07 달러선물			29
NGU20	NATURAL GAS FUTR Sep20		50
QSU0	Low Su Gasoil G Sep20		10
XBU0	GASOLINE RBOB FUT Sep20		14

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	880

공시일	2020-06-26
기준일	2020-06-25

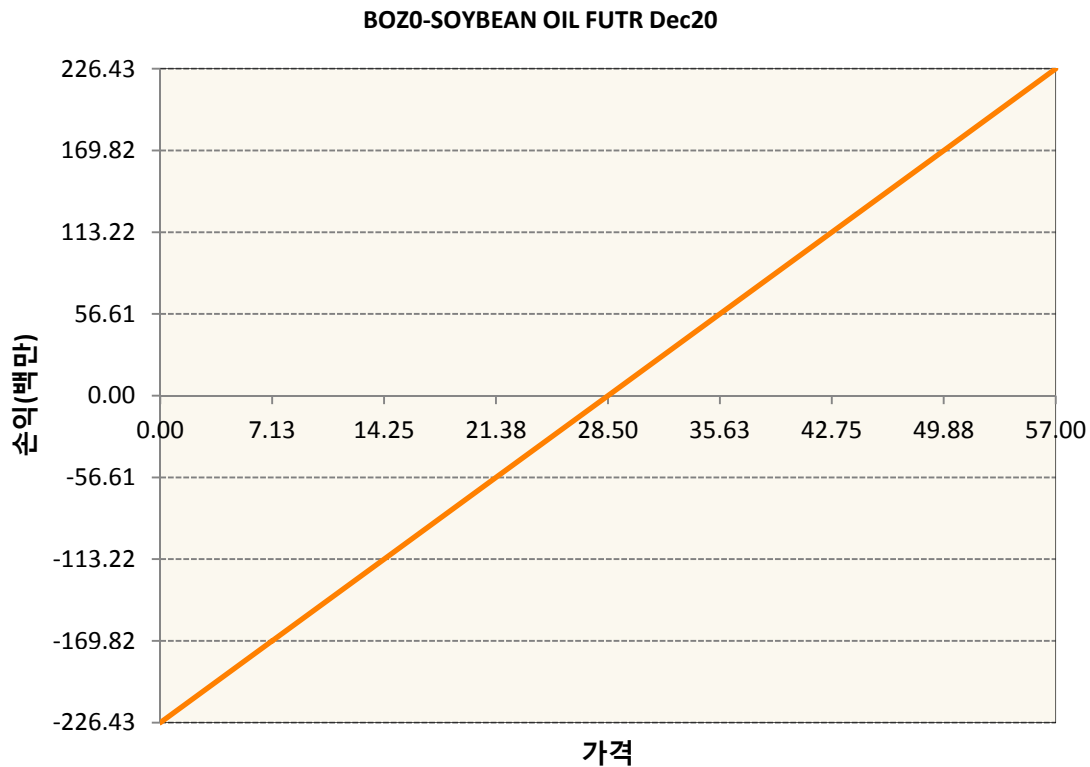
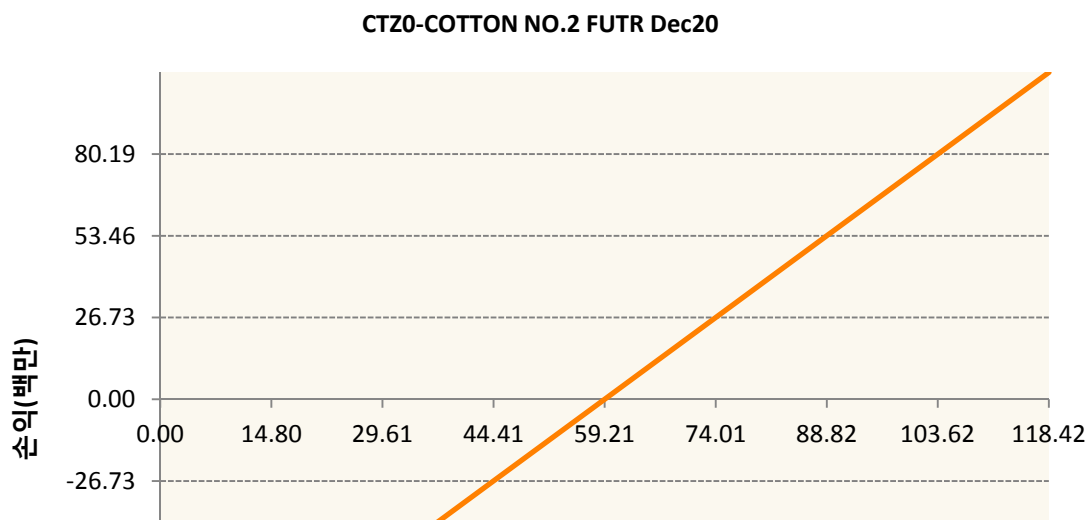
애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

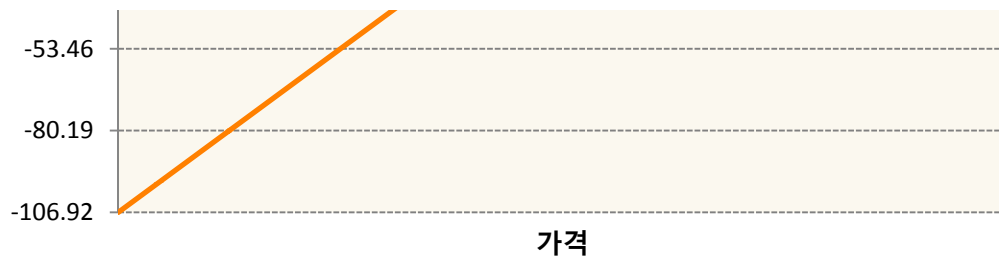
1. 계약금액

(단위:백만원)

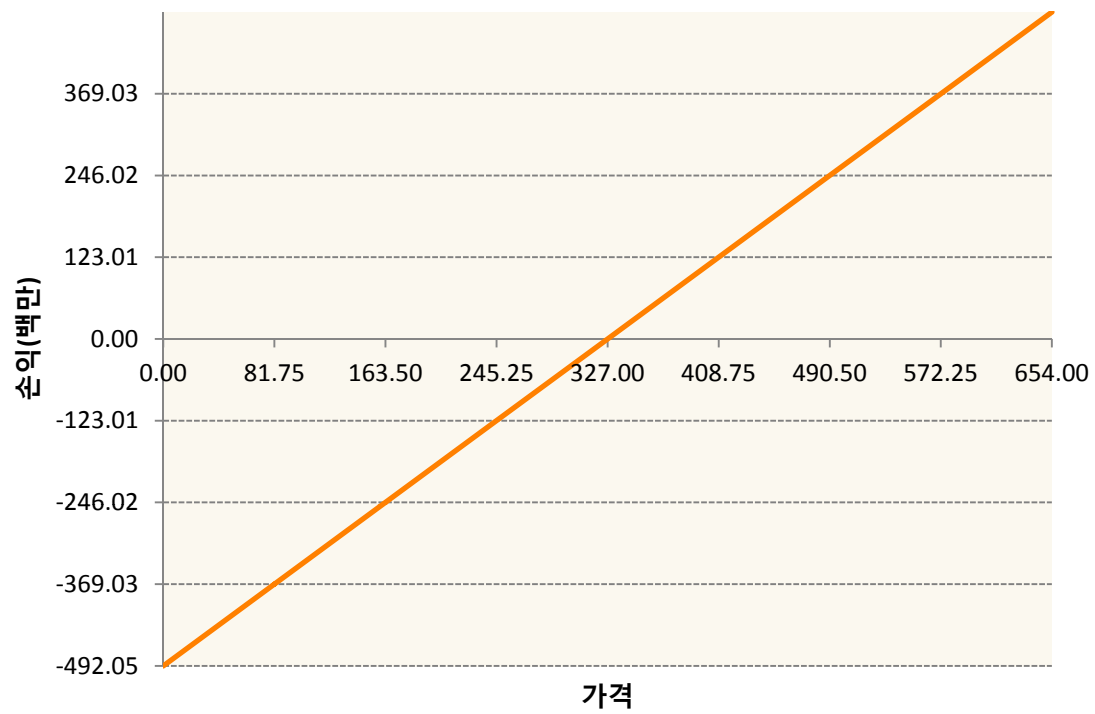
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,538	72	2,466	

2. 만기시점의 손익구조

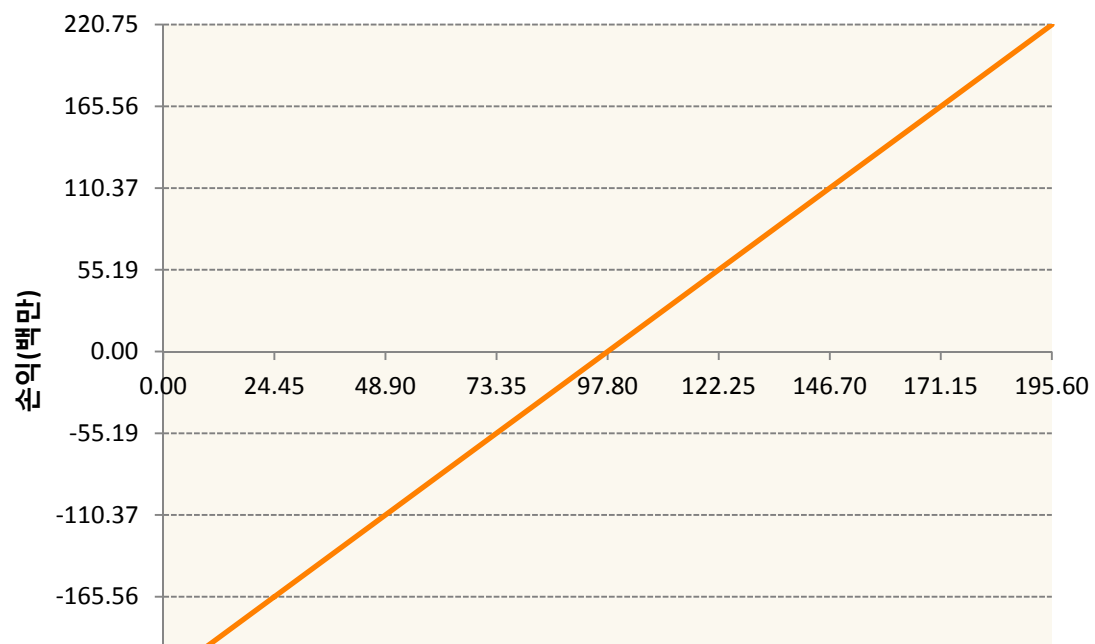


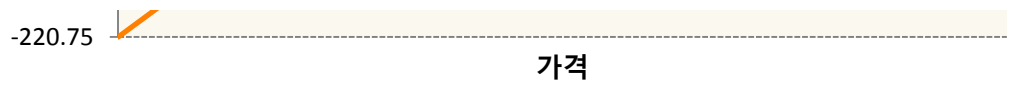
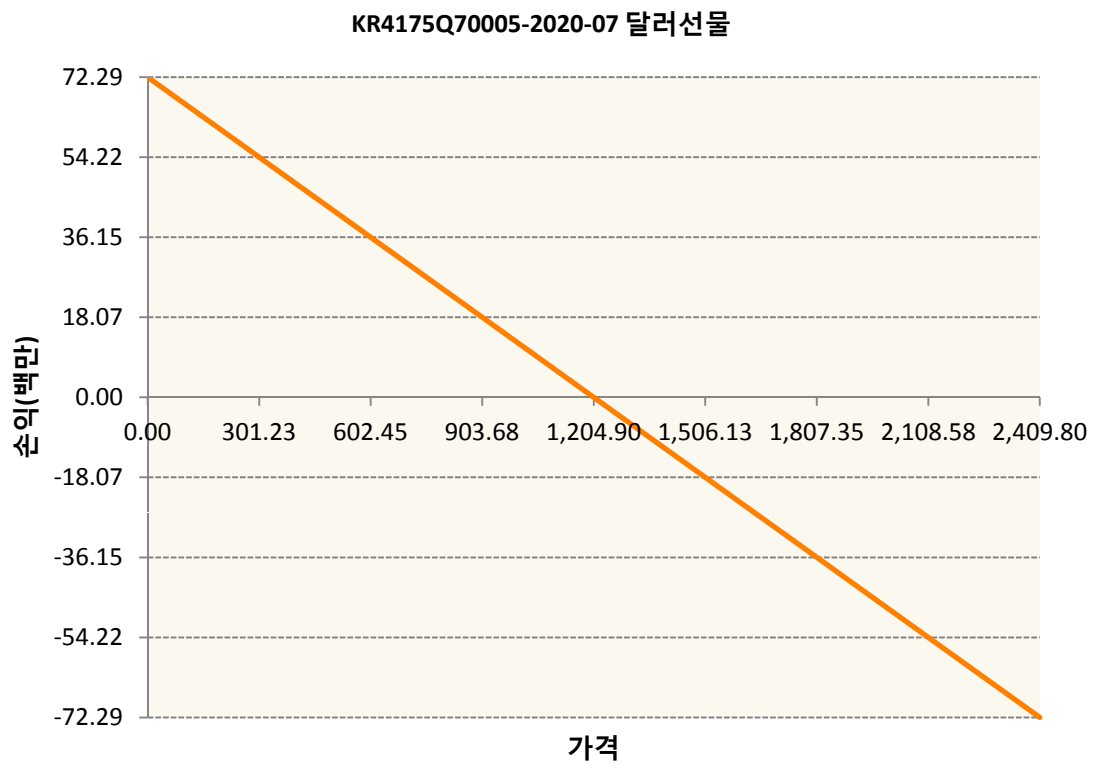
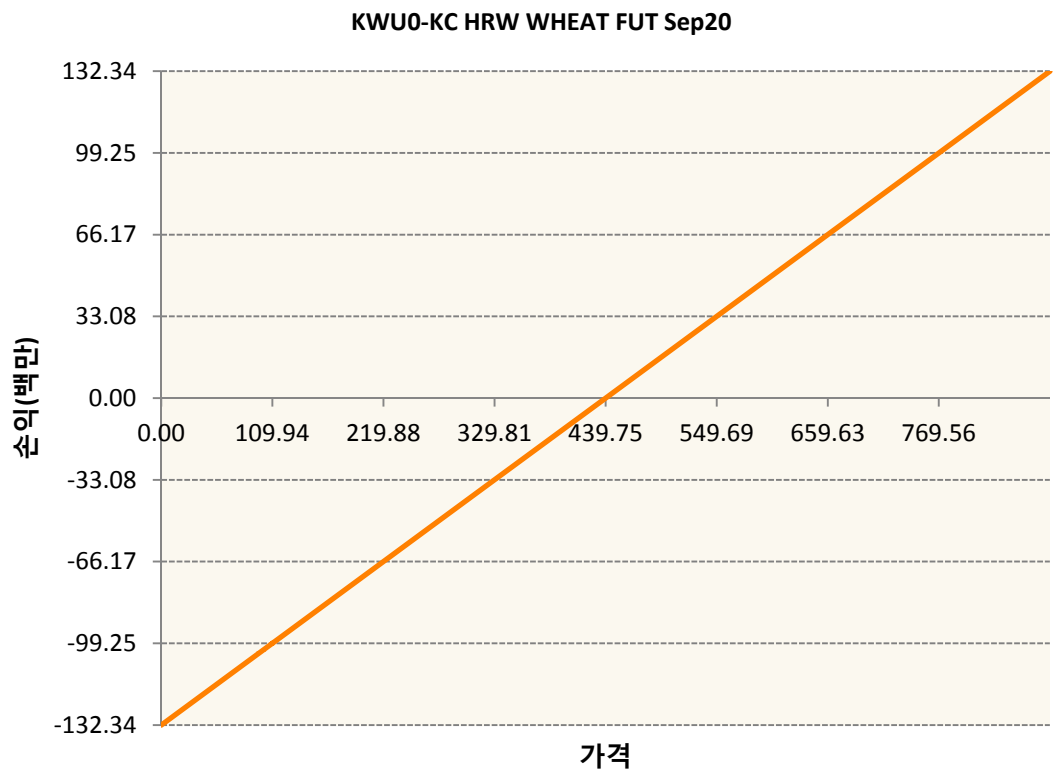


CU0-CORN FUTURE Sep20

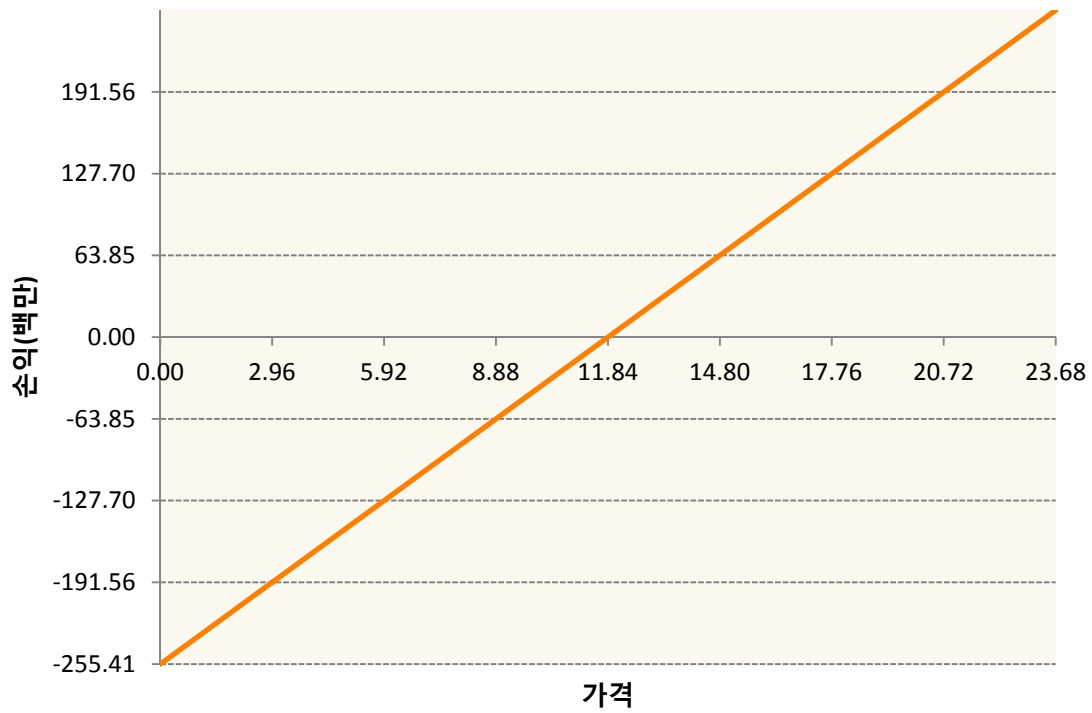


KCU0-COFFEE 'C' FUTURE Sep20

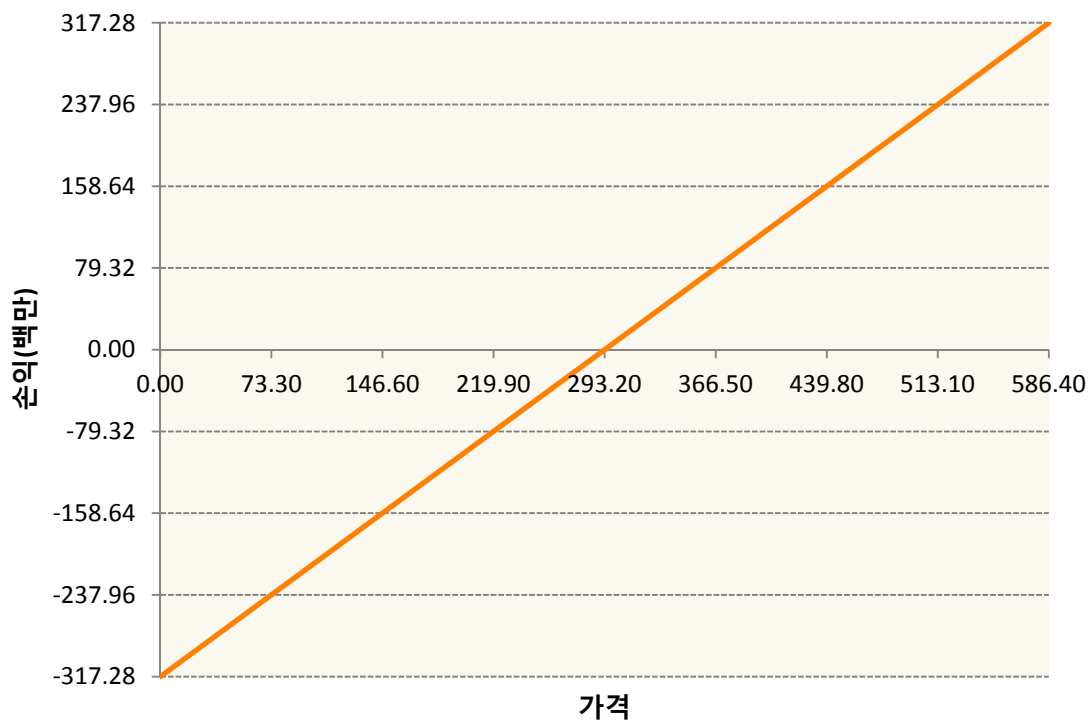




SBV0-Sugar Oct20

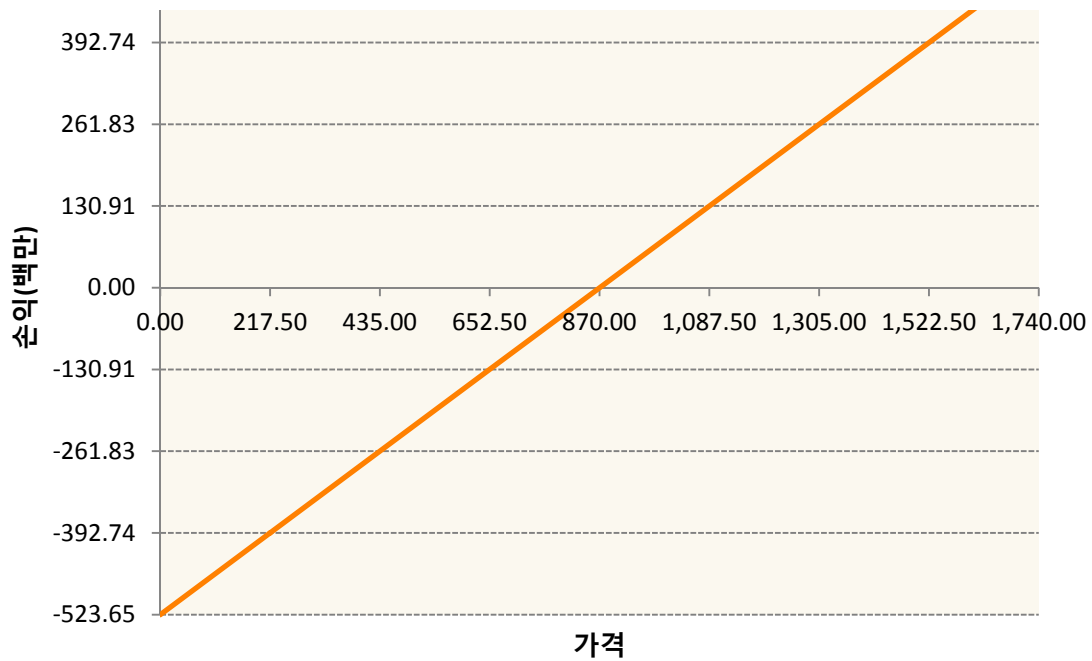
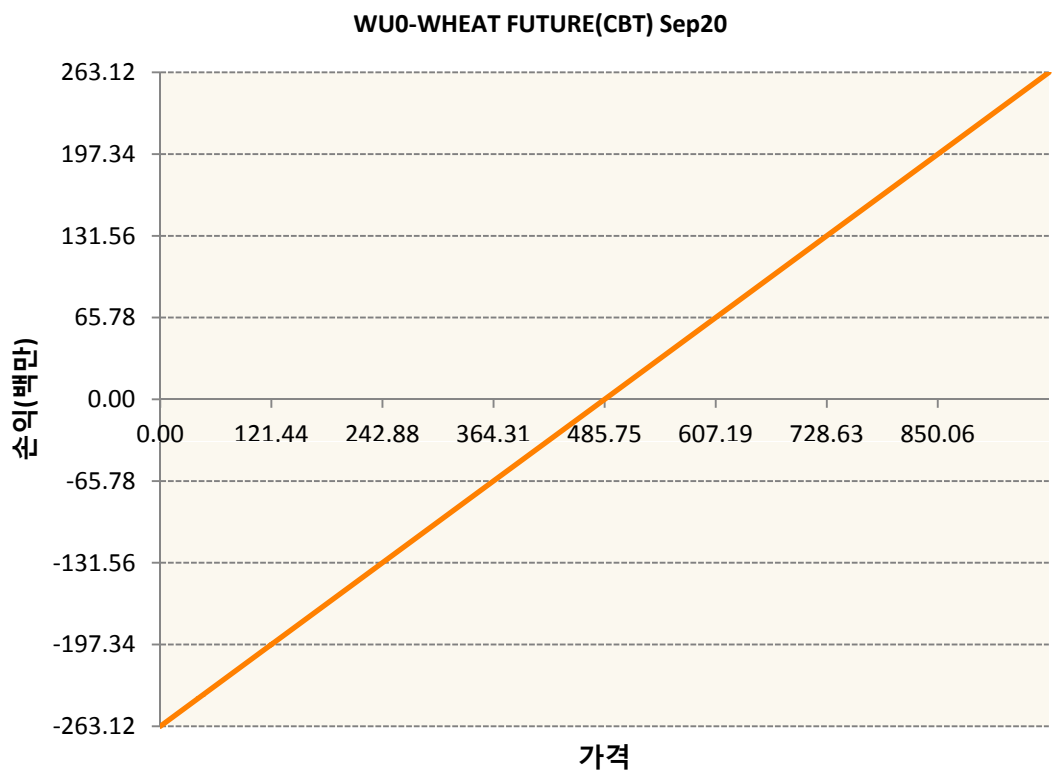


SMZ0-SOYBEAN MEAL FUTR Dec20



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	39
KCU0	COFFEE 'C' FUTURE Sep20	18
KR4175Q70C 2020-07 달러선물		6

KWU0	KC HRW WHEAT FUT Sep20	11
SBV0	Sugar Oct20	20
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)

237