

공시일	2020-06-30
기준일	2020-06-29

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	2020-06-30
기준일	2020-06-29

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

1,041

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,251

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-06-30
기준일	2020-06-29

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)

873

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-06-30
기준일	2020-06-29

유로인덱스모(주식-파생형)

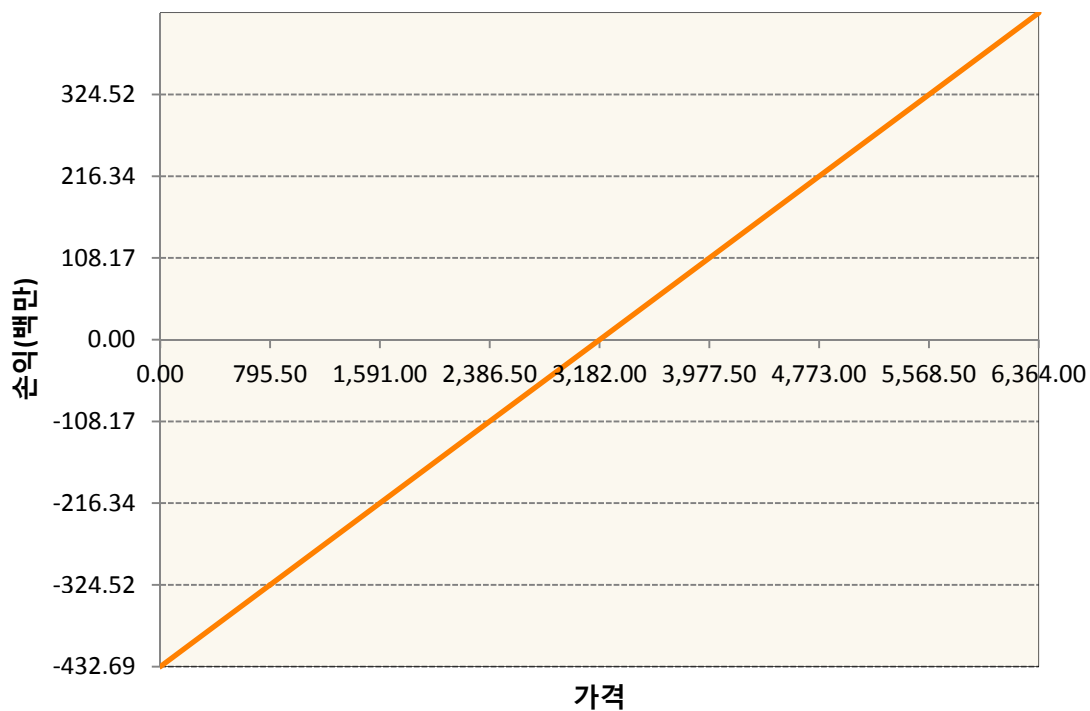
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	433	0	433	

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	2020-06-30
기준일	2020-06-29

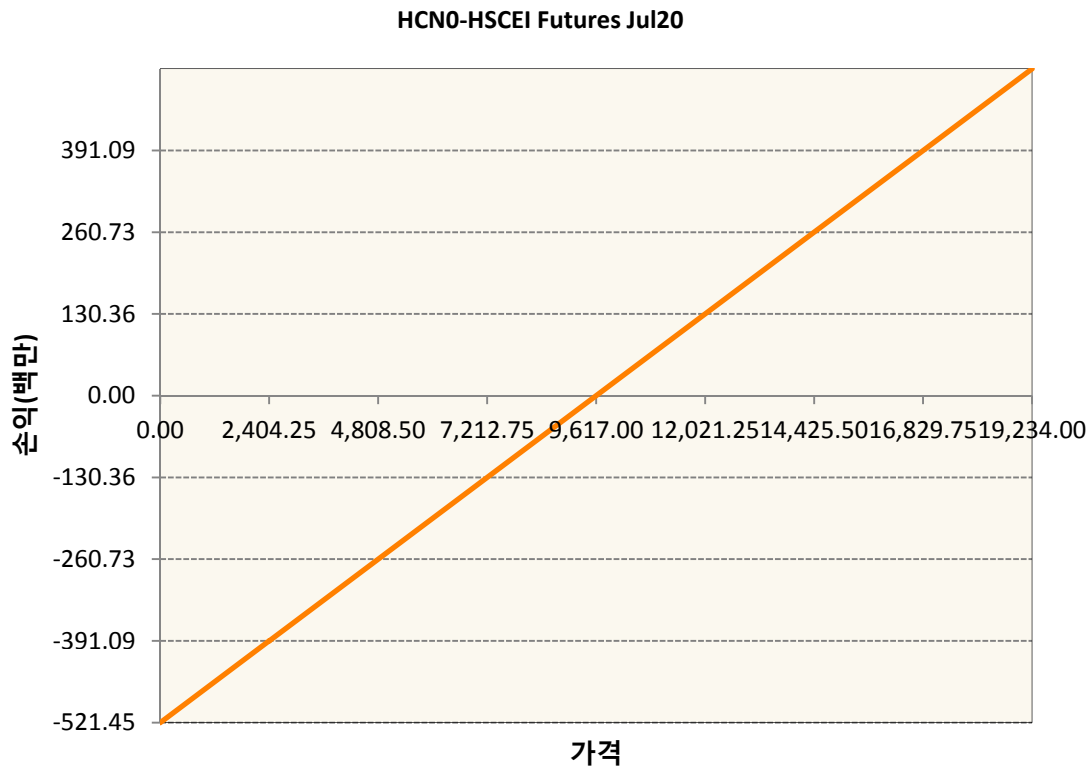
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	521	0	521	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN0	HSCEI Futures Jul20	42
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

45

공시일	2020-06-30
기준일	2020-06-29

커버드콜모(주식혼합-파생형)

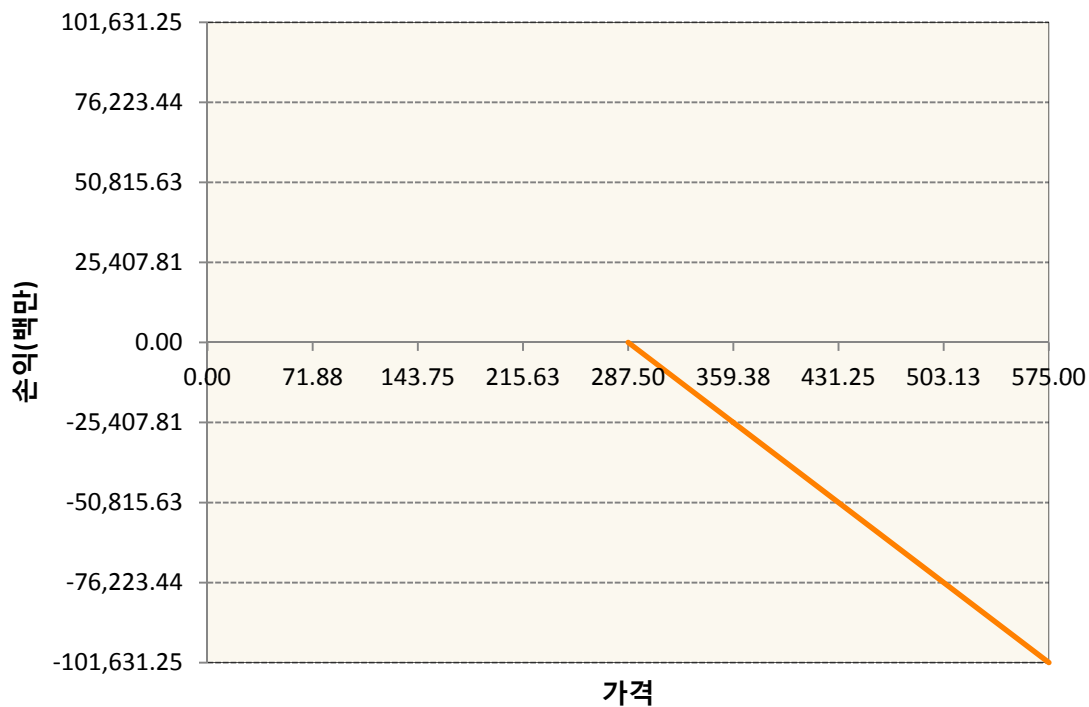
1. 계약금액

(단위:백만원)

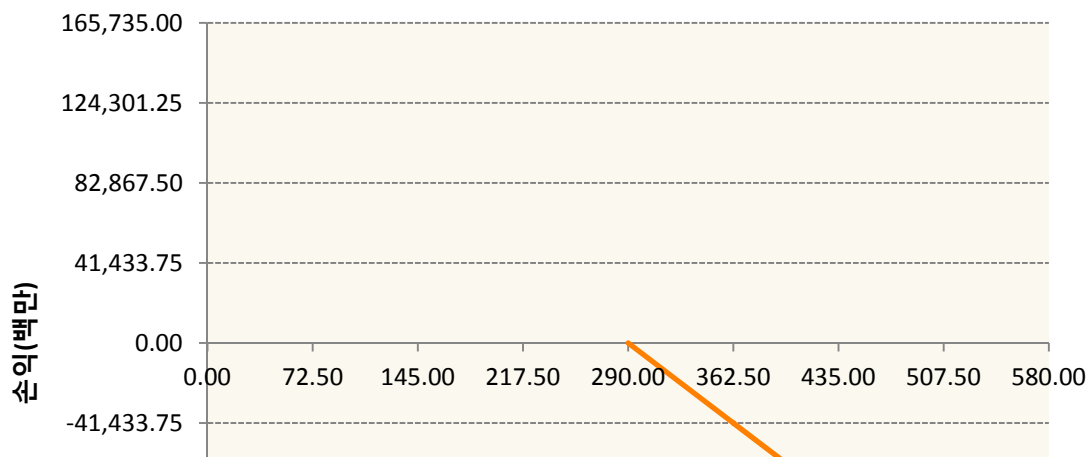
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	367,991	-367,991	장내

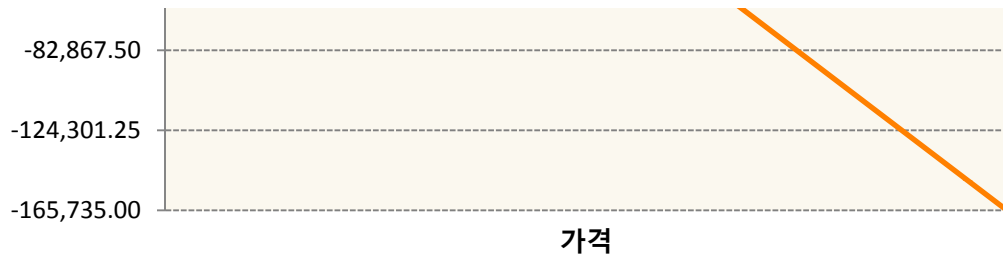
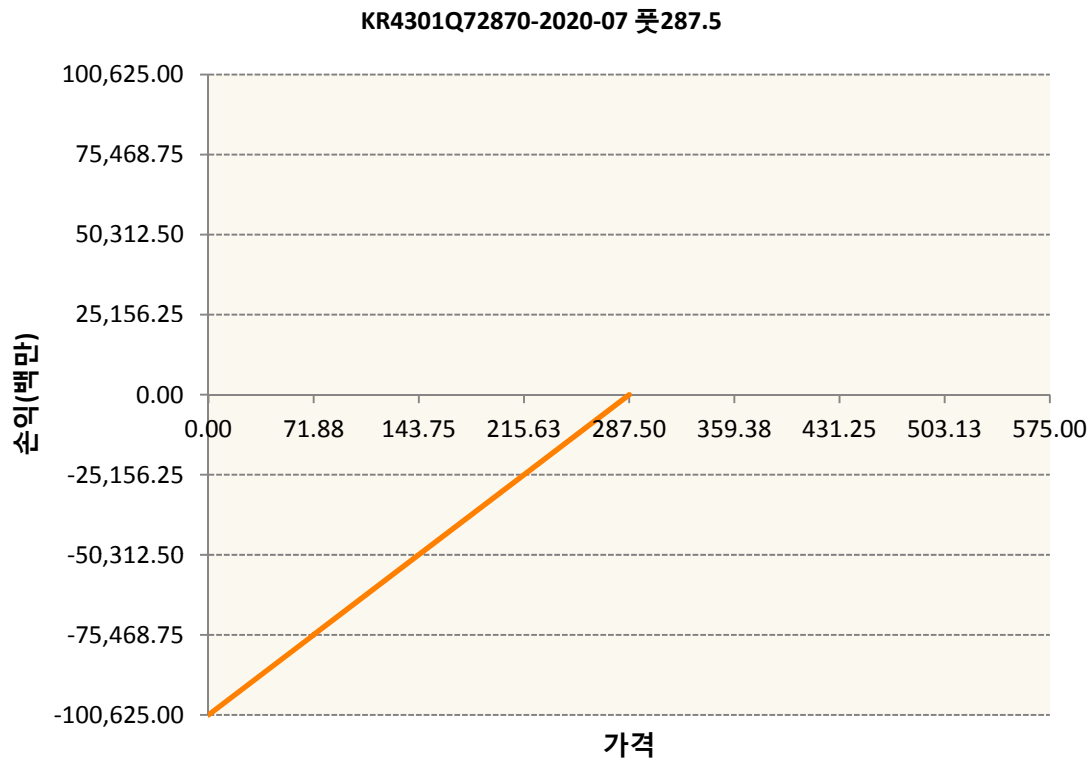
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q72872-2020-07 콜287.5



KR4201Q72906-2020-07 콜290





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q72872 2020-07 콜287.5							4,955
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,653	1,612	1,556	1,483	1,396	1,295	1,181
-5.33%	1,540	1,451	1,343	1,219	1,081	930	769
-2.67%	1,258	1,101	931	748	556	356	149
0%	684	461	233	0	-237	-477	-719
2.67%	-295	-555	-815	-1,076	-1,336	-1,597	-1,858
5.33%	-1,728	-1,982	-2,239	-2,496	-2,755	-3,015	-3,275
8.00%	-3,584	-3,794	-4,014	-4,242	-4,475	-4,713	-4,955
KR4201Q72906 2020-07 콜290							7,527
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,271	2,221	2,148	2,051	1,930	1,787	1,623

-5.33%	2,138	2,021	1,874	1,700	1,501	1,281	1,043
-2.67%	1,788	1,569	1,323	1,055	769	467	152
0%	1,032	702	357	0	-366	-738	-1,117
2.67%	-320	-731	-1,144	-1,560	-1,976	-2,394	-2,813
5.33%	-2,389	-2,815	-3,242	-3,669	-4,097	-4,525	-4,954
8.00%	-5,168	-5,541	-5,925	-6,317	-6,716	-7,119	-7,527
KR4301Q72870 2020-07 풋287.5							6,997
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,879	-6,883	-6,893	-6,908	-6,930	-6,960	-6,997
-5.33%	-4,306	-4,329	-4,362	-4,405	-4,460	-4,524	-4,597
-2.67%	-1,817	-1,885	-1,966	-2,059	-2,161	-2,273	-2,391
0%	425	291	148	0	-153	-310	-470
2.67%	2,191	2,009	1,827	1,645	1,462	1,279	1,096
5.33%	3,338	3,166	2,992	2,816	2,638	2,459	2,279
8.00%	3,928	3,812	3,684	3,548	3,405	3,256	3,103

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

(단위:백만원)

17,829

공시일	2020-06-30
기준일	2020-06-29

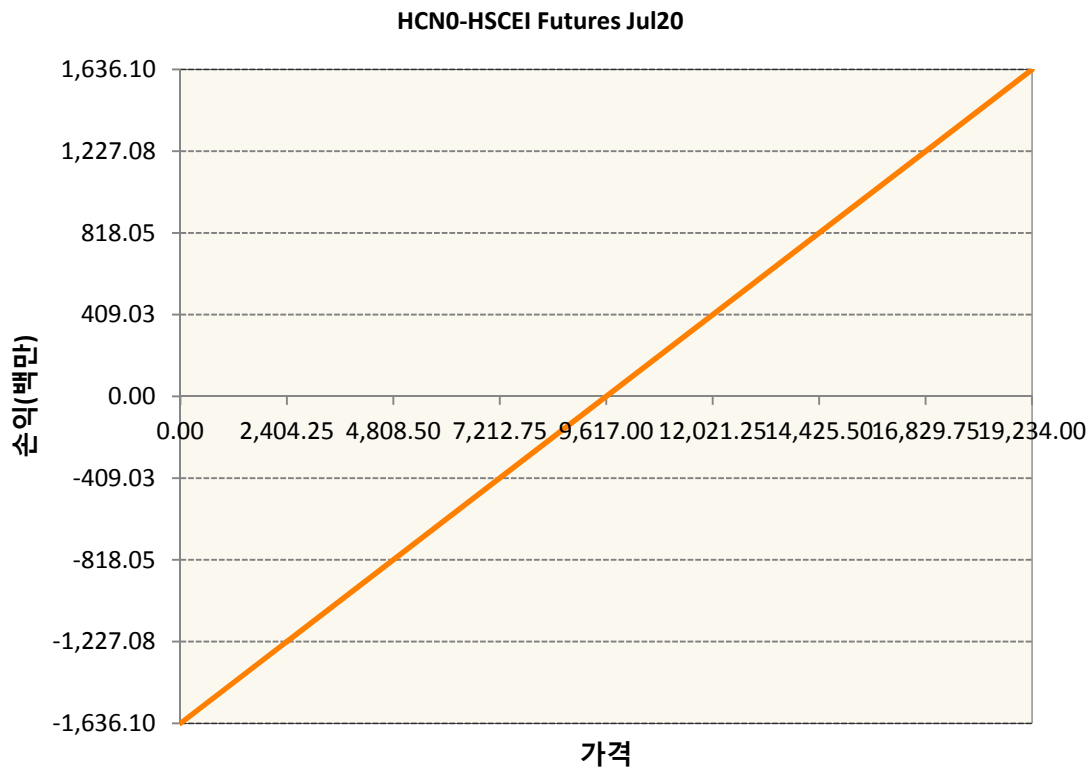
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,636	0	1,636	장내
누계	통화	선도	0	1,497	-1,497	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E

120

HCN0 HSCEI Futures Jul20

131

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

(단위:백만원)

203

공시일	2020-06-30
기준일	2020-06-29

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

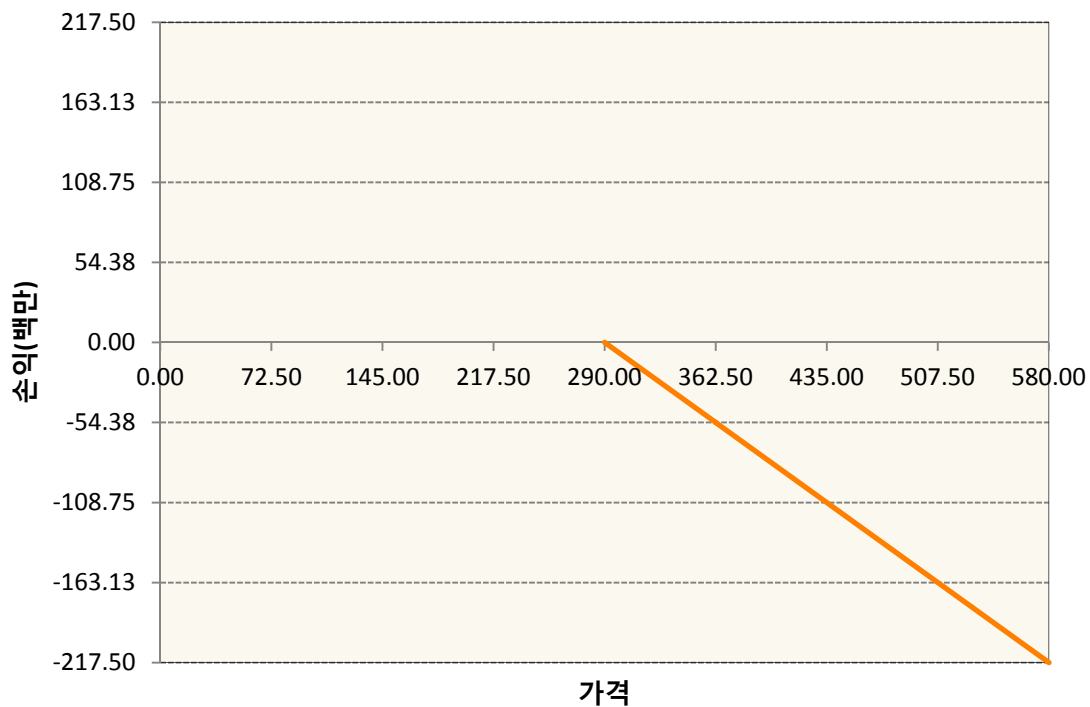
1. 계약금액

(단위:백만원)

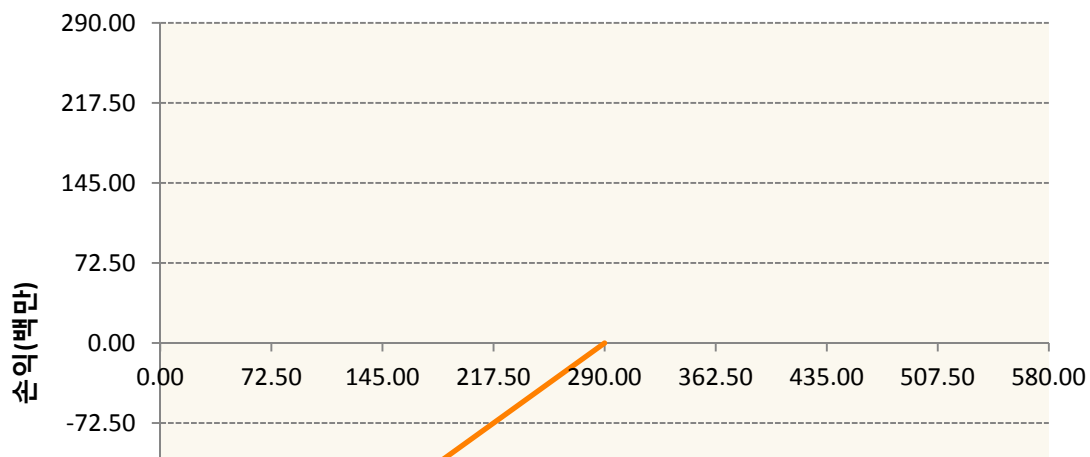
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	72	0	72	장내
누계	유가증권	옵션	0	508	-508	장내

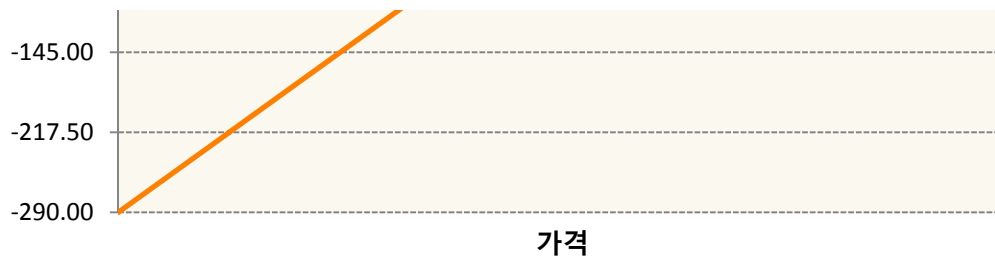
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q72906-2020-07 콜290



KR4301Q72904-2020-07 풋290





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

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

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

30

공시일	2020-06-30
기준일	2020-06-29

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

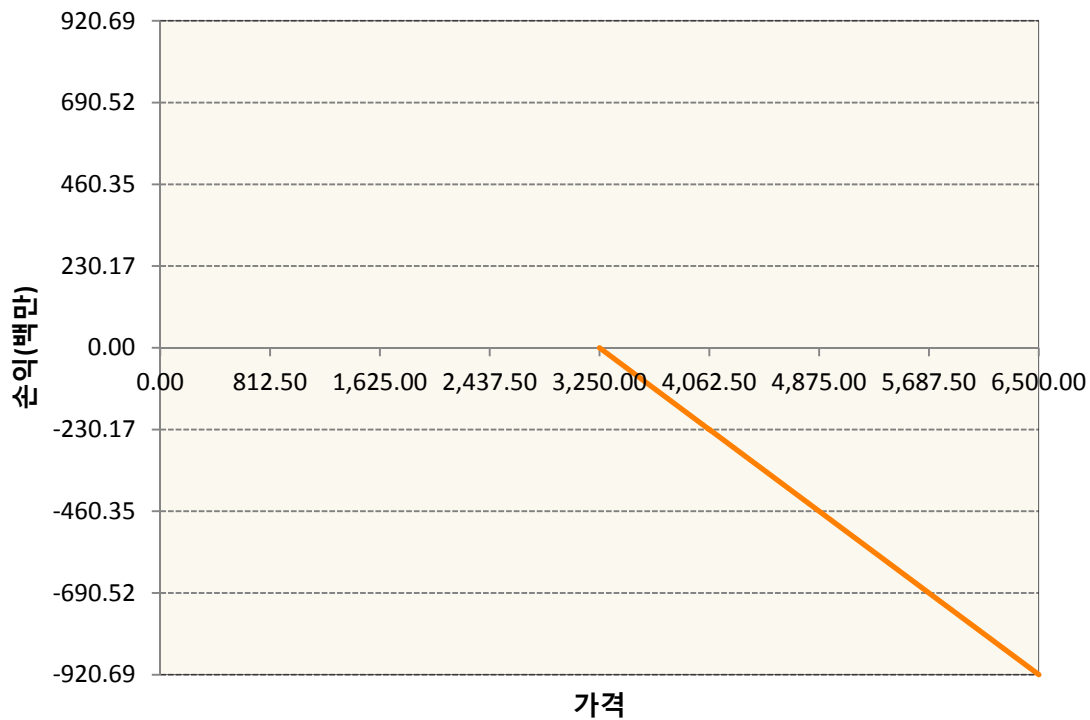
1. 계약금액

(단위:백만원)

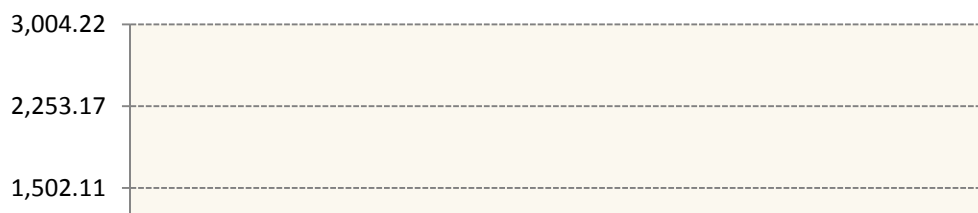
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,300	0	1,300	
누계	유가증권	스왑	8,046	0	8,046	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,850	-7,850	장내
누계	통화	선도	0	2,919	-2,919	장외

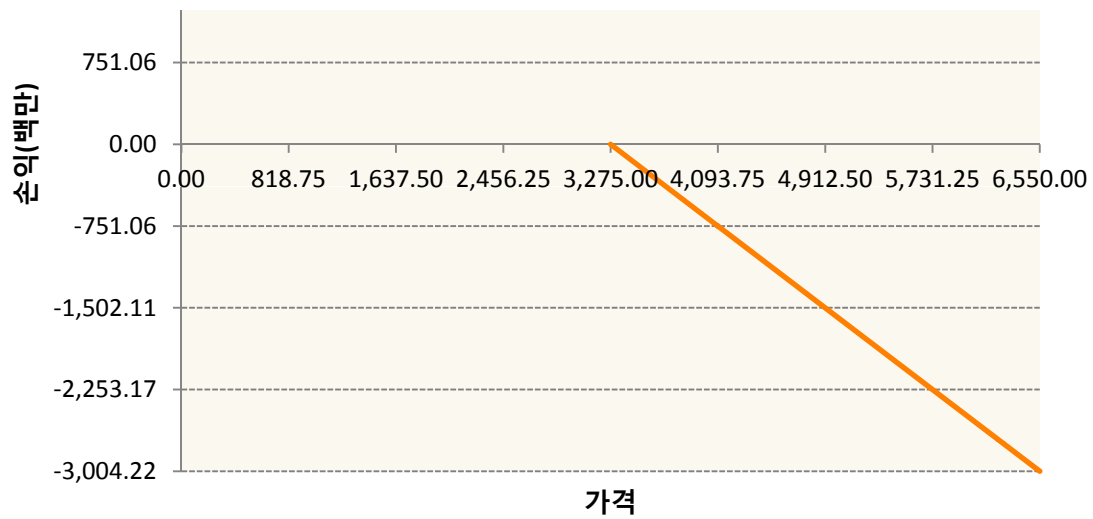
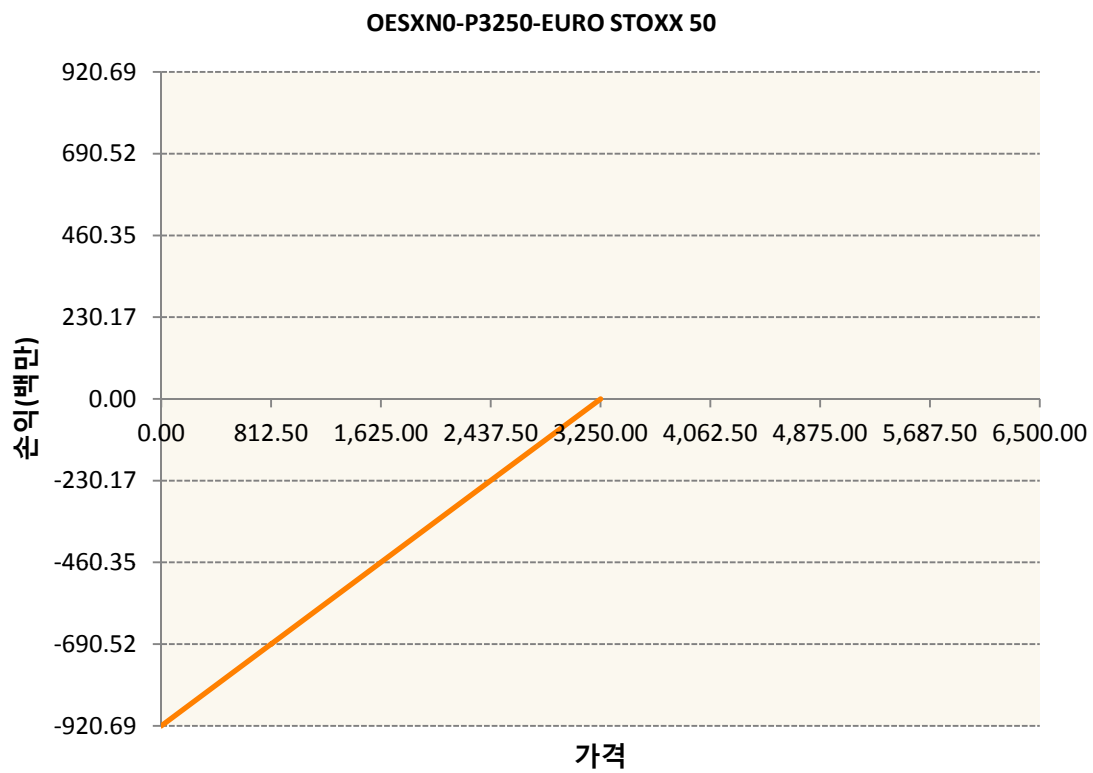
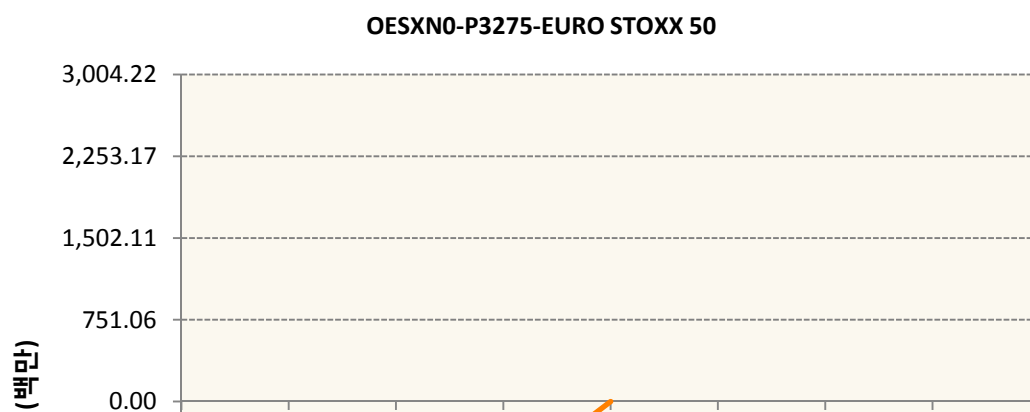
2. 만기시점의 손익구조

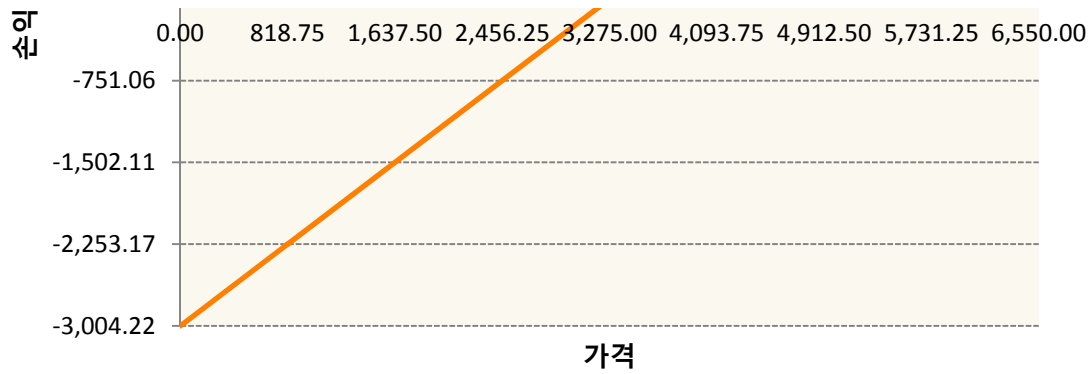
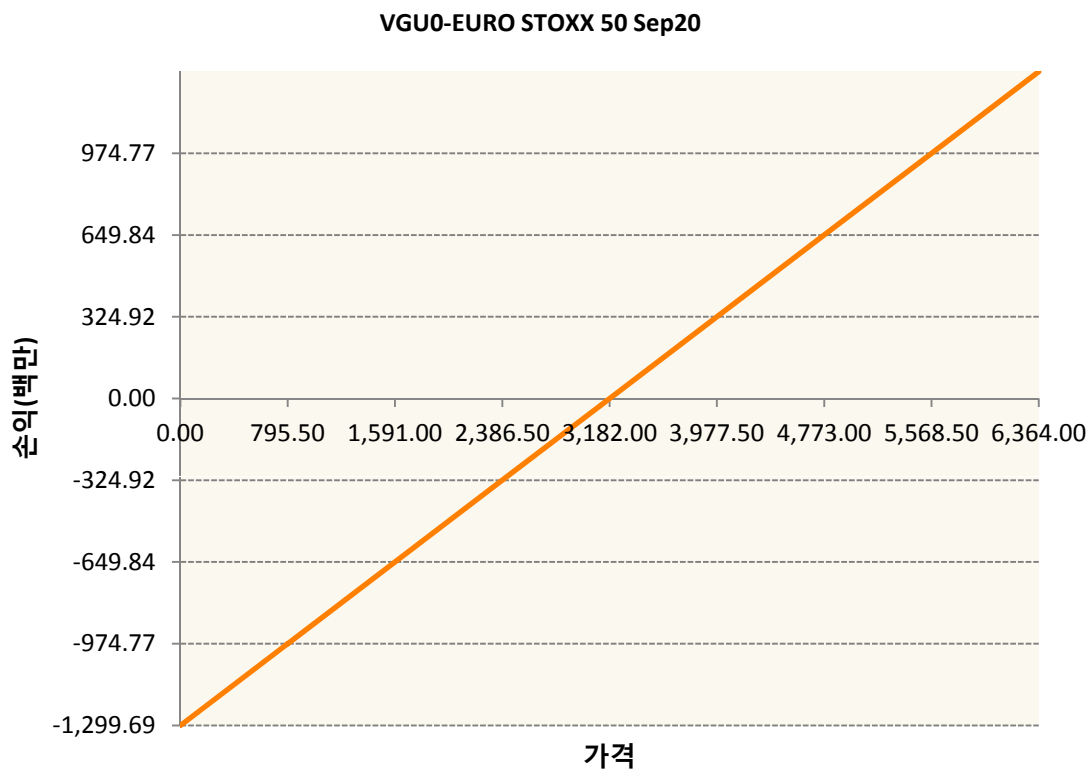
OESXN0-C3250-EURO STOXX 50



OESXN0-C3275-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY		17
FX21020M0₩/EUR 25-09-20E		234
OESXN0-C3₩ EURO STOXX 50		74
OESXN0-C3₩ EURO STOXX 50		240
OESXN0-P3₩ EURO STOXX 50		74
OESXN0-P3₩ EURO STOXX 50		240
VGU0 EURO STOXX 50 Sep20		104

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

ETF스마트레버리지목표전환형8호

(단위:백만원)

2. 만기시점의 손익구조

The graph illustrates a linear relationship between Price (가격) and Net Income (Dividend) (순이익(배당)). The x-axis represents Price, ranging from 0.00 to 556.30. The y-axis represents Net Income (Dividend), ranging from -10,291.55 to 7,718.66. The line starts at a negative value on the y-axis and crosses the x-axis at approximately 278.15, indicating a break-even point.

가격	순이익(배당)
0.00	-10,291.55
69.54	-7,718.66
139.08	-5,145.78
208.61	-2,572.89
278.15	0.00
347.69	2,572.89
417.23	5,145.78
486.76	7,718.66
556.30	10,291.55

(단위:백만원)

KR4101Q90009							2020-09 코스피200지수선물		823
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-823	-823	-823	-823	-823	-823	-823	-823	-823
-5.33%	-549	-549	-549	-549	-549	-549	-549	-549	-549
-2.67%	-274	-274	-274	-274	-274	-274	-274	-274	-274
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	274	274	274	274	274	274	274	274	274
5.33%	549	549	549	549	549	549	549	549	549
8.00%	823	823	823	823	823	823	823	823	823

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

(단위:백만원)

1,305

공시일	2020-06-30
기준일	2020-06-29

ETF스마트레버리지목표전환형9호

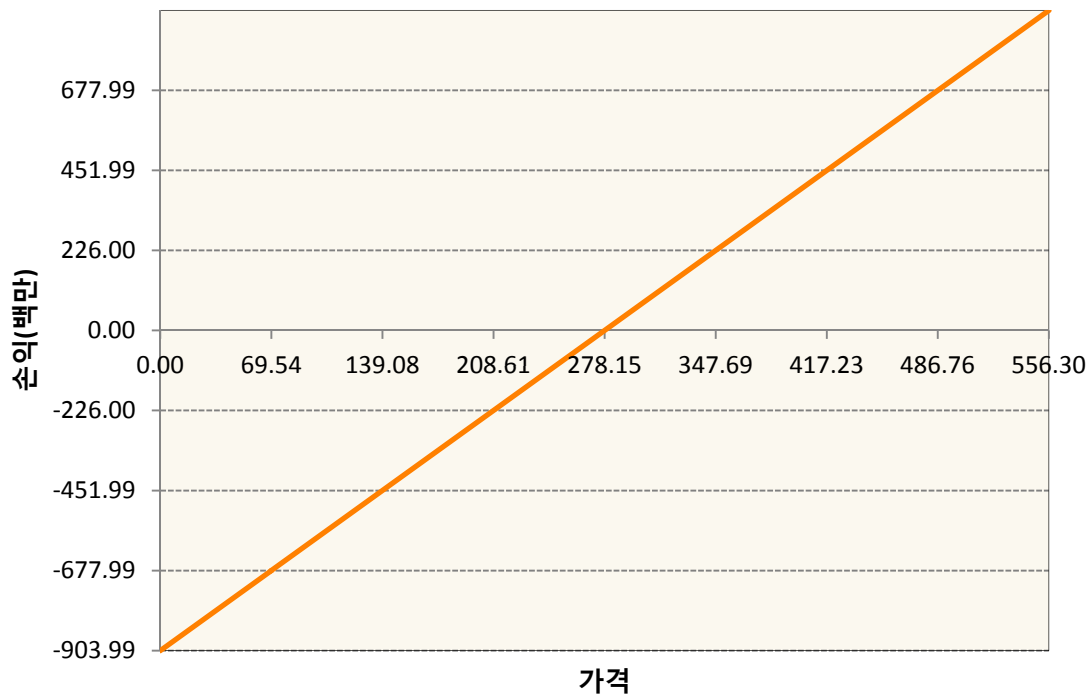
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	904	0	904	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009							2020-09 코스피200지수선물		72
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72	
-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%	72	72	72	72	72	72	72	72	

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

(단위:백만원)

115

ETF스마트레버리지목표전환형10호

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

(단위:백만원)

168

공시일	2020-06-30
기준일	2020-06-29

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

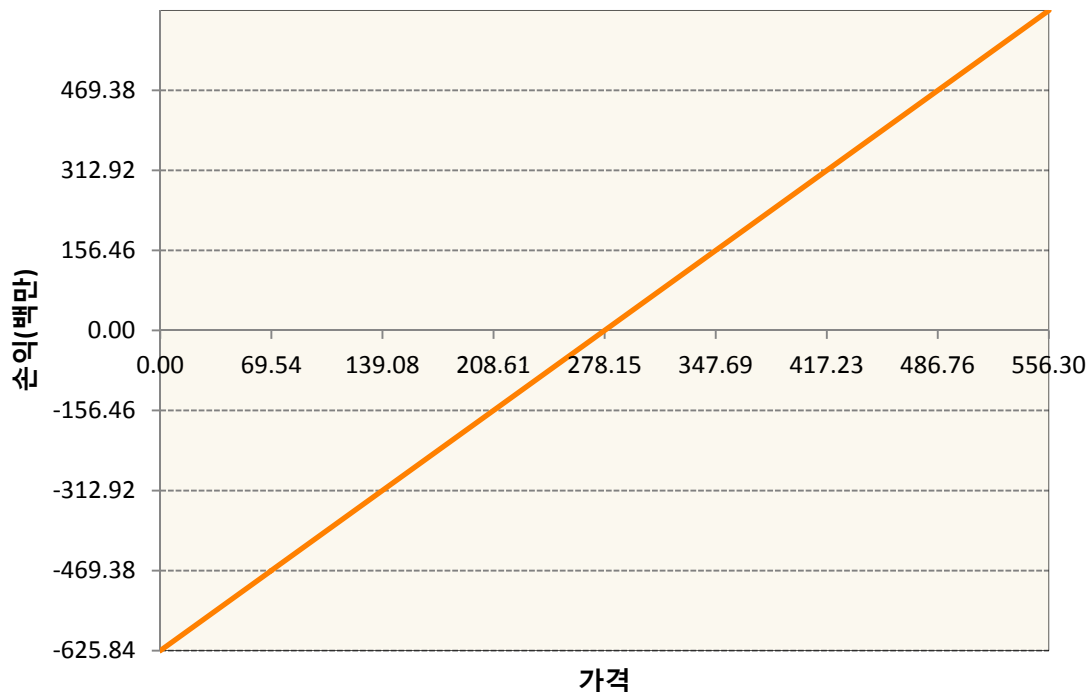
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	626	0	626	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%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
-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%	33	33	33	33	33	33	33	33	
8.00%	50	50	50	50	50	50	50	50	

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

(단위:백만원)

79

공시일	2020-06-30
기준일	2020-06-29

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

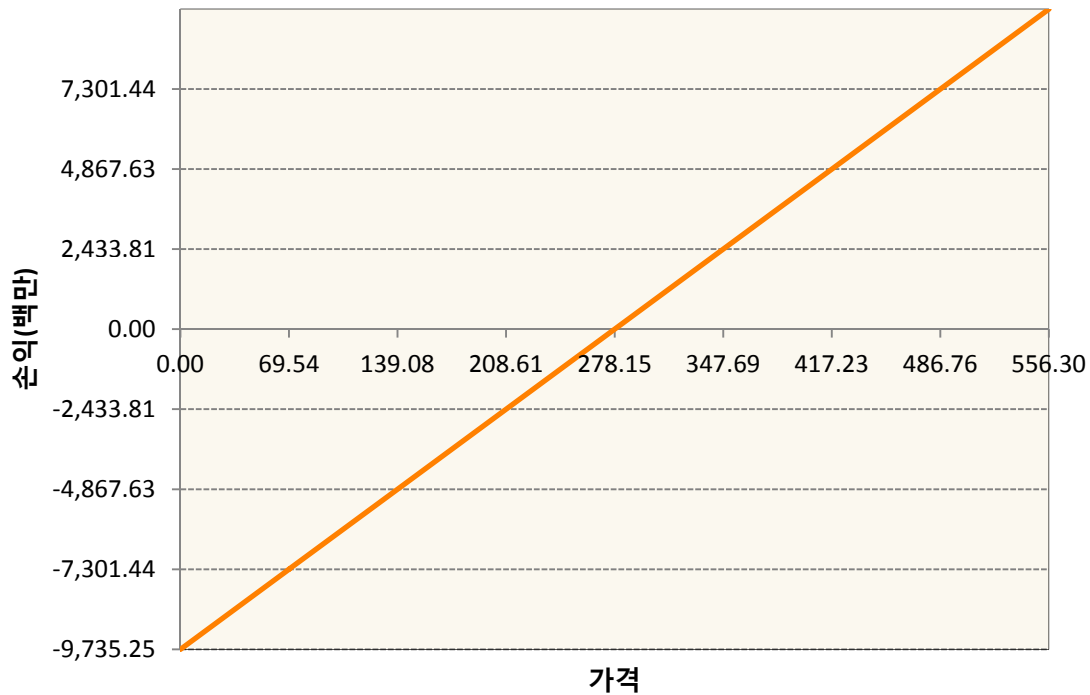
1. 계약금액

(단위:백만원)

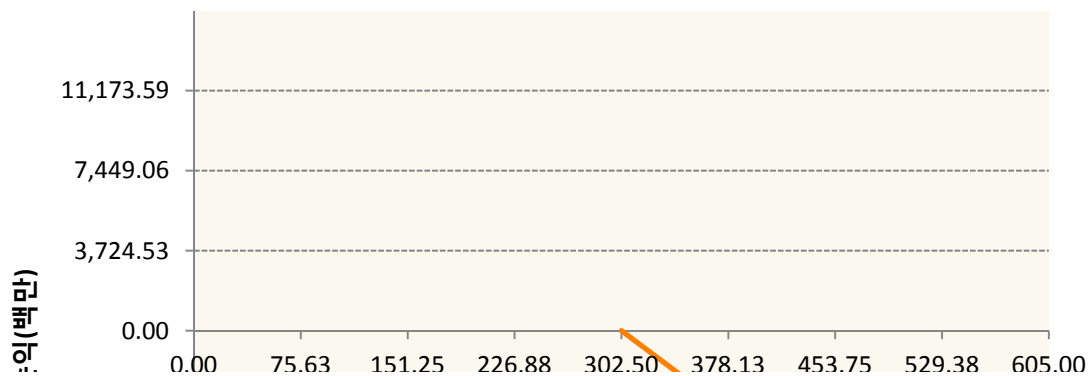
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,735	0	9,735	장내
누계	유가증권	옵션	3,247	19,092	-15,845	장내

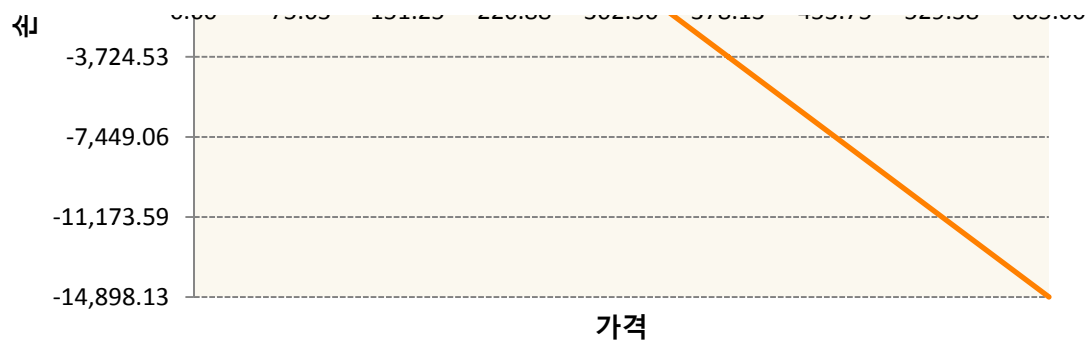
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물

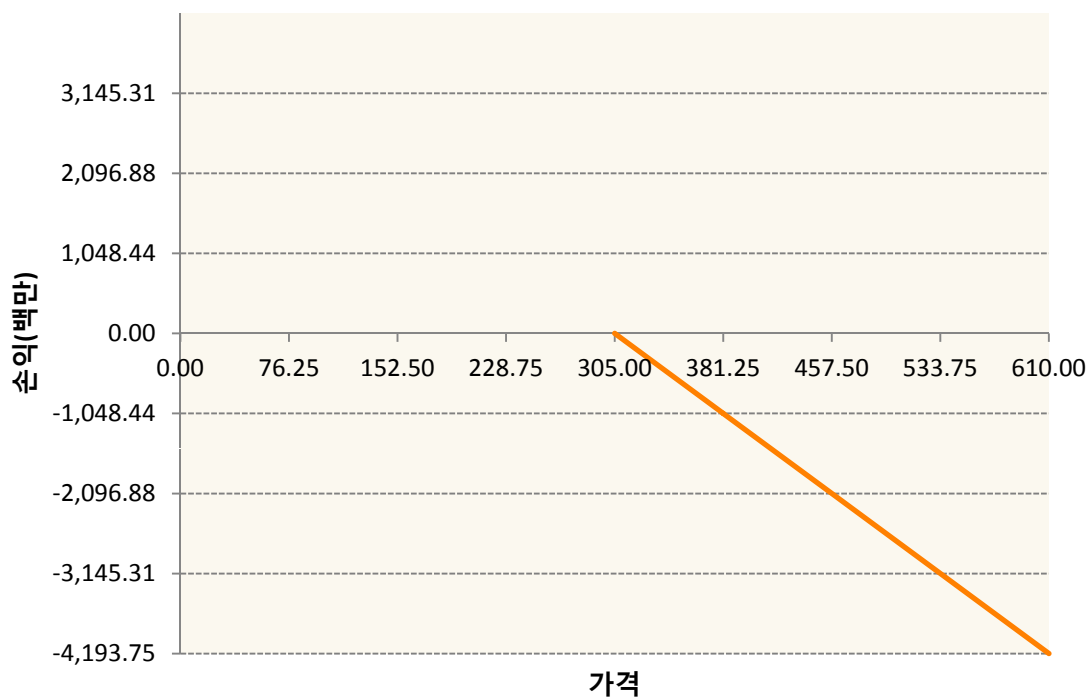


KR4201Q73029-2020-07 콜302.5

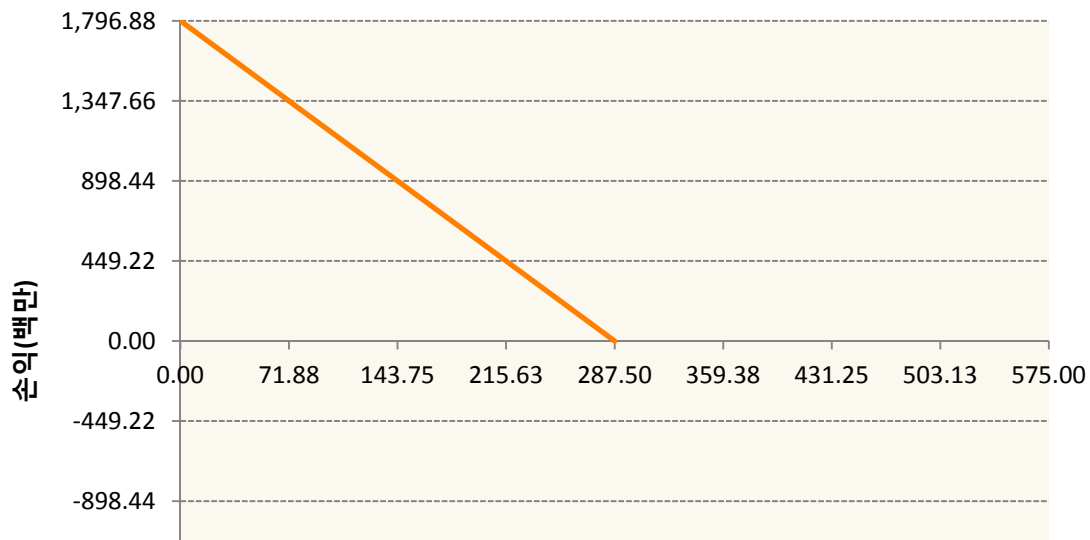


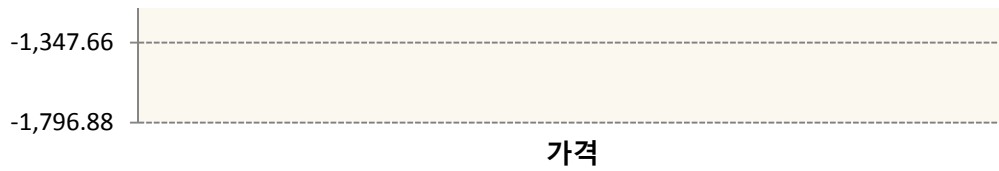
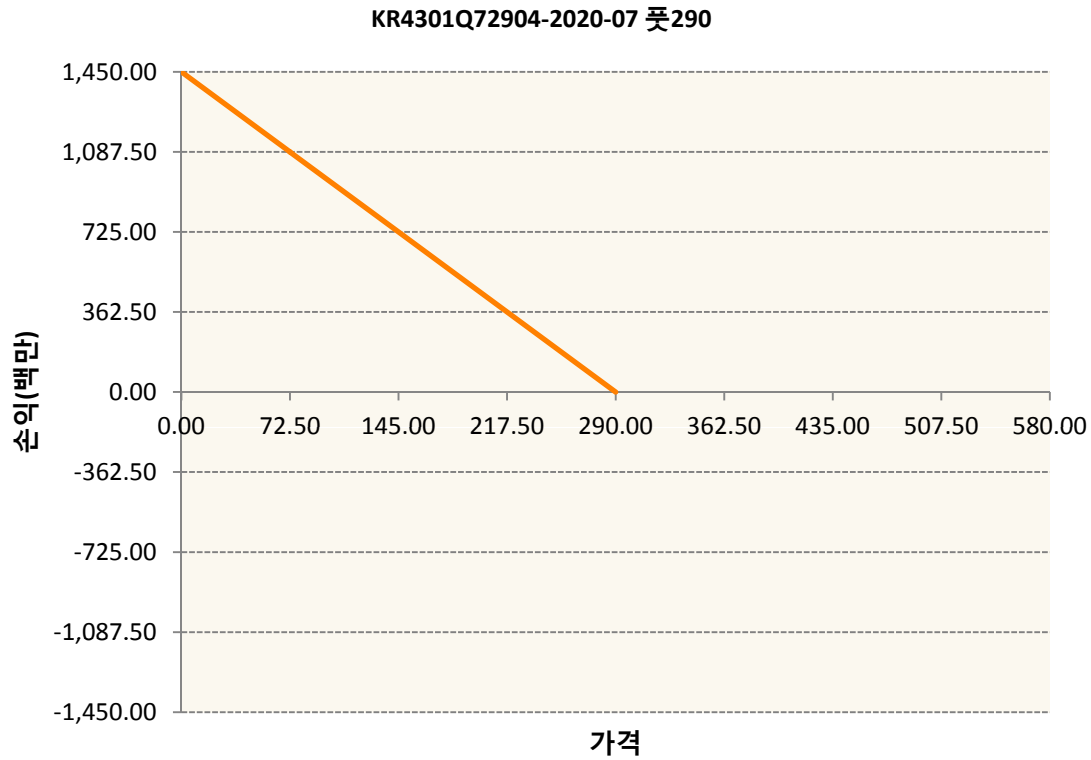


KR4201Q73052-2020-07 콜305



KR4301Q72870-2020-07 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q90009 2020-09 코스피200지수선물								779
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-779	-779	-779	-779	-779	-779	-779	-779
-5.33%	-519	-519	-519	-519	-519	-519	-519	-519
-2.67%	-260	-260	-260	-260	-260	-260	-260	-260
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	260	260	260	260	260	260	260	260
5.33%	519	519	519	519	519	519	519	519
8.00%	779	779	779	779	779	779	779	779
KR4201Q73029 2020-07 콜302.5								442
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	78	77	75	72	68	62	55	
-5.33%	76	73	69	62	54	44	32	
-2.67%	69	62	53	41	27	11	-7	

0%	51	36	19	0	-21	-45	-69
2.67%	8	-16	-42	-70	-98	-128	-159
5.33%	-76	-108	-142	-177	-212	-247	-282
8.00%	-213	-251	-289	-327	-365	-404	-442
KR4201Q73052 2020-07 콜305							113
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	18	17	17	16	16	14	13
-5.33%	17	17	16	14	12	10	7
-2.67%	16	14	12	9	6	2	-2
0%	12	9	5	0	-5	-11	-18
2.67%	3	-3	-10	-17	-24	-32	-40
5.33%	-16	-25	-34	-43	-52	-62	-71
8.00%	-49	-60	-70	-81	-91	-102	-113
KR4301Q72870 2020-07 풋287.5							125
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	123	123	123	123	124	124	125
-5.33%	77	77	78	79	80	81	82
-2.67%	32	34	35	37	39	41	43
0%	-8	-5	-3	0	3	6	8
2.67%	-39	-36	-33	-29	-26	-23	-20
5.33%	-60	-57	-53	-50	-47	-44	-41
8.00%	-70	-68	-66	-63	-61	-58	-55
KR4301Q72904 2020-07 풋290							102
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	101	101	101	101	102	102	102
-5.33%	64	65	65	65	66	67	68
-2.67%	28	29	30	31	32	34	35
0%	-5	-4	-2	0	2	4	6
2.67%	-33	-31	-28	-26	-23	-20	-18
5.33%	-52	-50	-47	-45	-42	-39	-37
8.00%	-63	-61	-59	-57	-55	-52	-50

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

(단위:백만원)

1,787

공시일	2020-06-30
기준일	2020-06-29

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	1,191	-1,191	
누계	유가증권	수익증권	134,532	0	134,532	

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	2020-06-30
기준일	2020-06-29

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	98,135	0	98,135	

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	2020-06-30
기준일	2020-06-29

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	457,214	0	457,214	
누계	통화	선도	0	439,167	-439,167	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J03\$ KRW/USD 24-07-20E	2,157
FX21020J04\$ KRW/USD 24-07-20E	1,726
FX21020J04\$ KRW/USD 24-07-20E	1,918
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	2,340
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	959
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,007
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,592
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	3,356
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	6,808
FX21020M00 KRW/USD 26-08-20E	575
FX21020M01 KRW/USD 26-08-20E	4,699
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	1,994
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	2,416
FX21020M05 KRW/USD 22-09-20E	997
FX21020M05 KRW/USD 22-09-20E	2,589

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

18,122

공시일	2020-06-30
기준일	2020-06-29

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

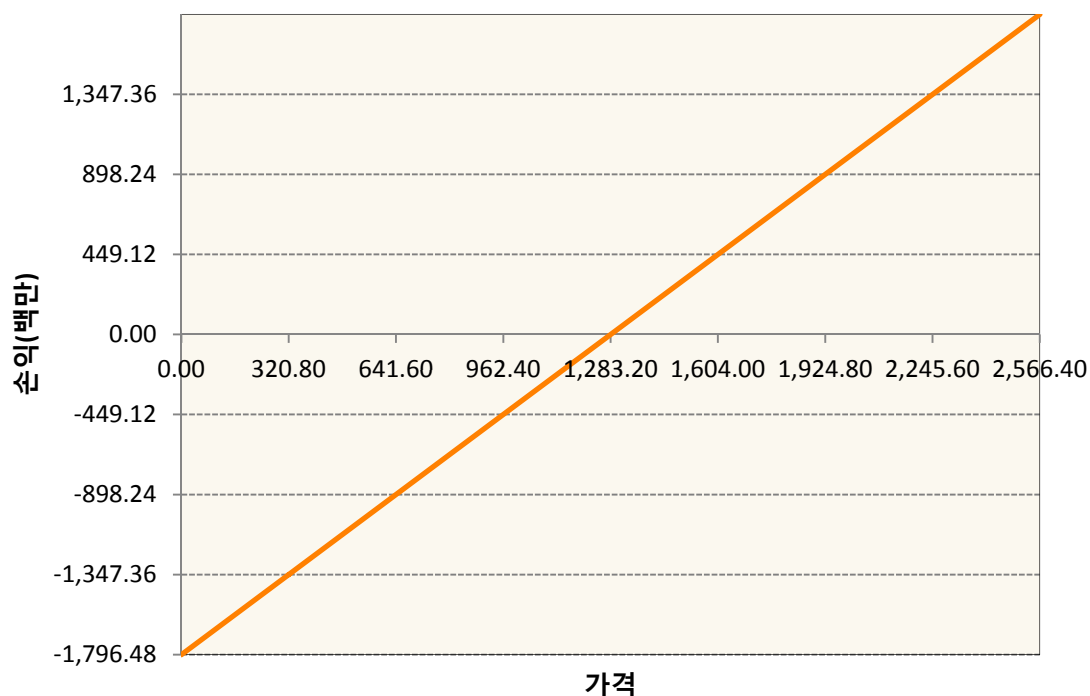
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,796	0	1,796	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4108Q90004-2020-09 KRX300 선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4108Q90004							2020-09 KRX300 선물		144
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-144	-144	-144	-144	-144	-144	-144	-144	
-5.33%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96	
-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%	96	96	96	96	96	96	96	96	
8.00%	144	144	144	144	144	144	144	144	

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

(단위:백만원)

229

공시일	2020-06-30
기준일	2020-06-29

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	7,536	0	7,536	
누계	통화	선도	0	7,899	-7,899	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020K04 KRW/USD 27-07-20E	38
FX21020K04 KRW/USD 27-07-20E	96
FX21020K04 KRW/USD 30-06-20E	36
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	221
FX21020M03 KRW/USD 20-07-20E	56
FX21020M07 KRW/USD 27-07-20E	36

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

326

공시일	2020-06-30
기준일	2020-06-29

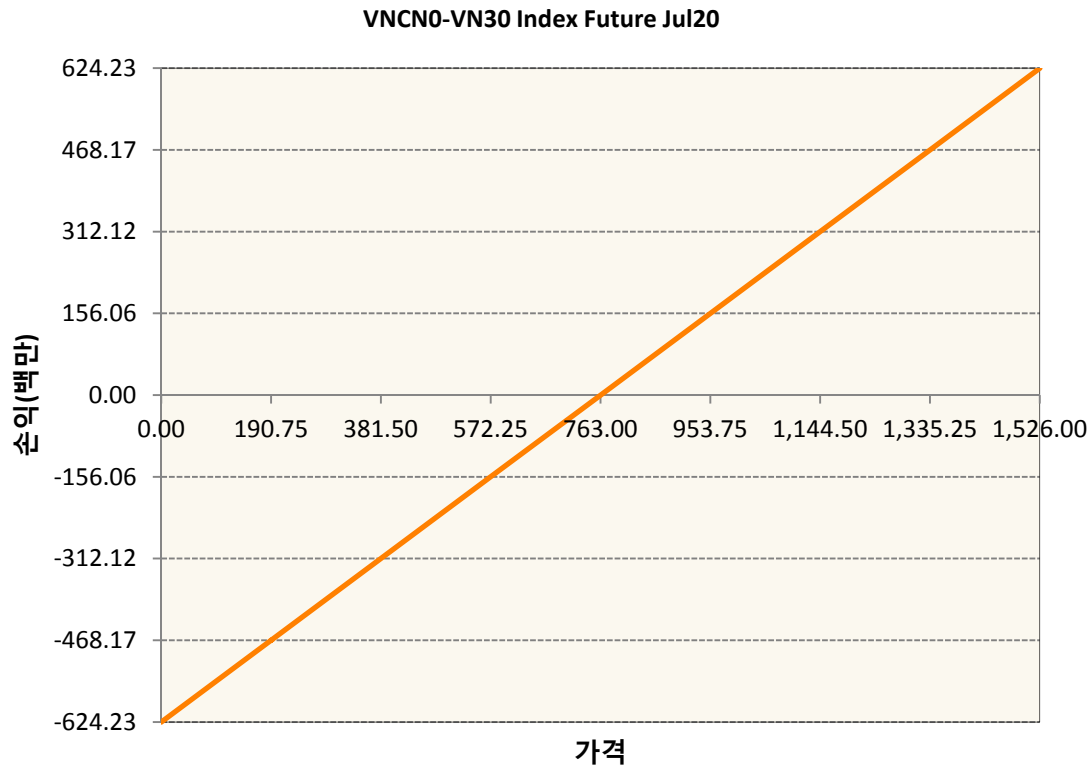
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	624	0	624	
누계	유가증권	스왑	979	0	979	장외
누계	통화	선도	0	675	-675	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	78
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 24-07-20E	1

FX21020K00 KRW/EUR 24-07-20E
FX21020K01 KRW/EUR 24-07-20E
FX21020K03 KRW/EUR 28-08-20E
VNCN0 VN30 Index Future Jul20

5
9
22
50

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

(단위:백만원)

152

공시일	2020-06-30
기준일	2020-06-29

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

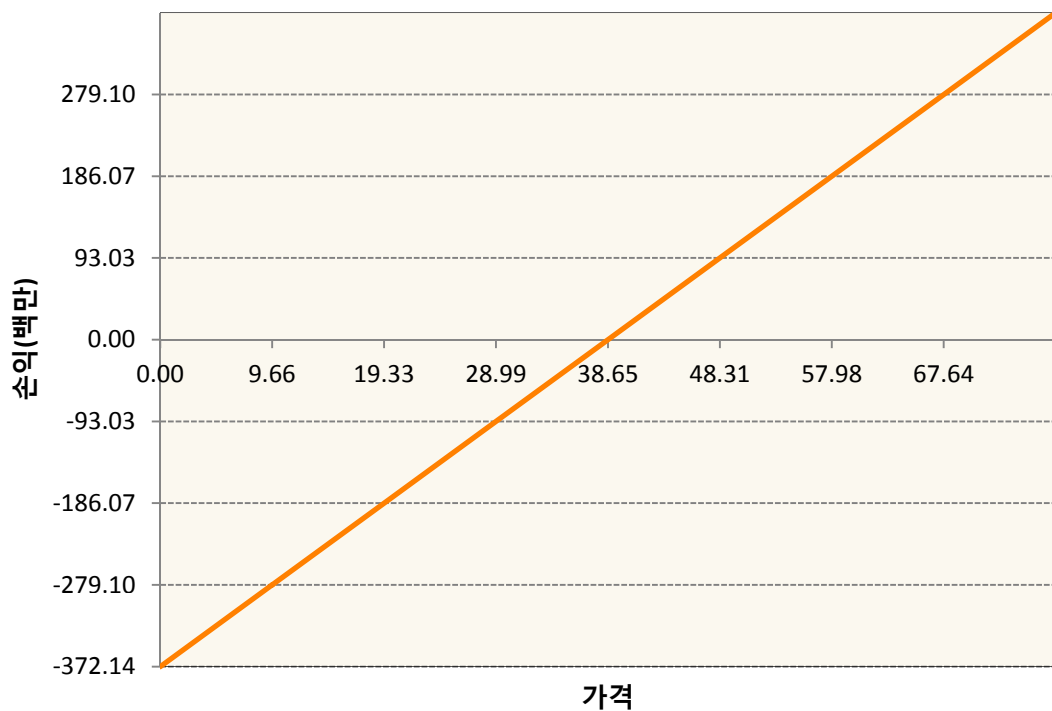
1. 계약금액

(단위:백만원)

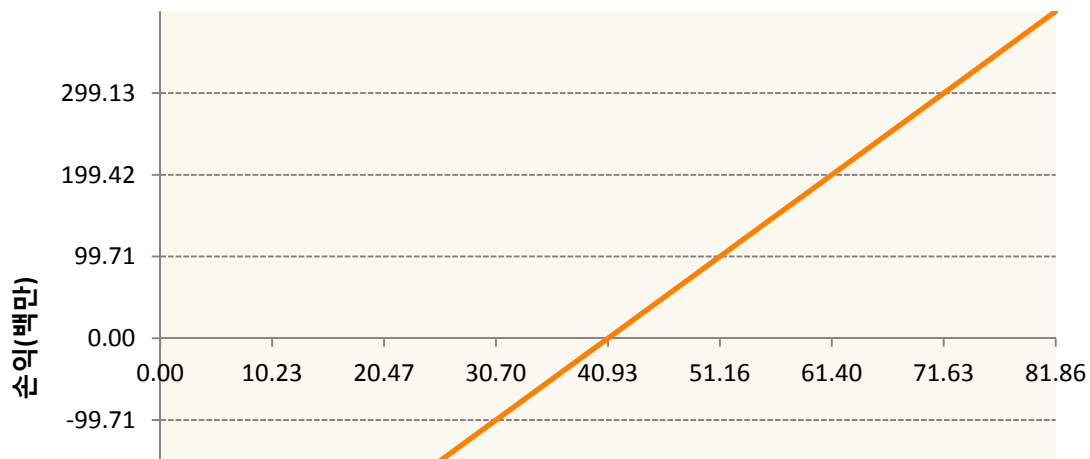
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,770	360	1,410	

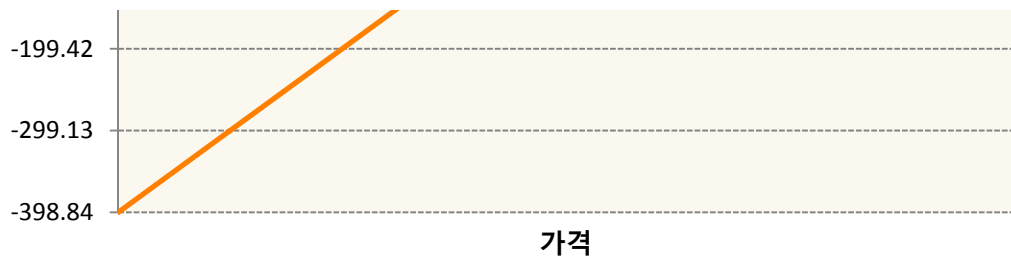
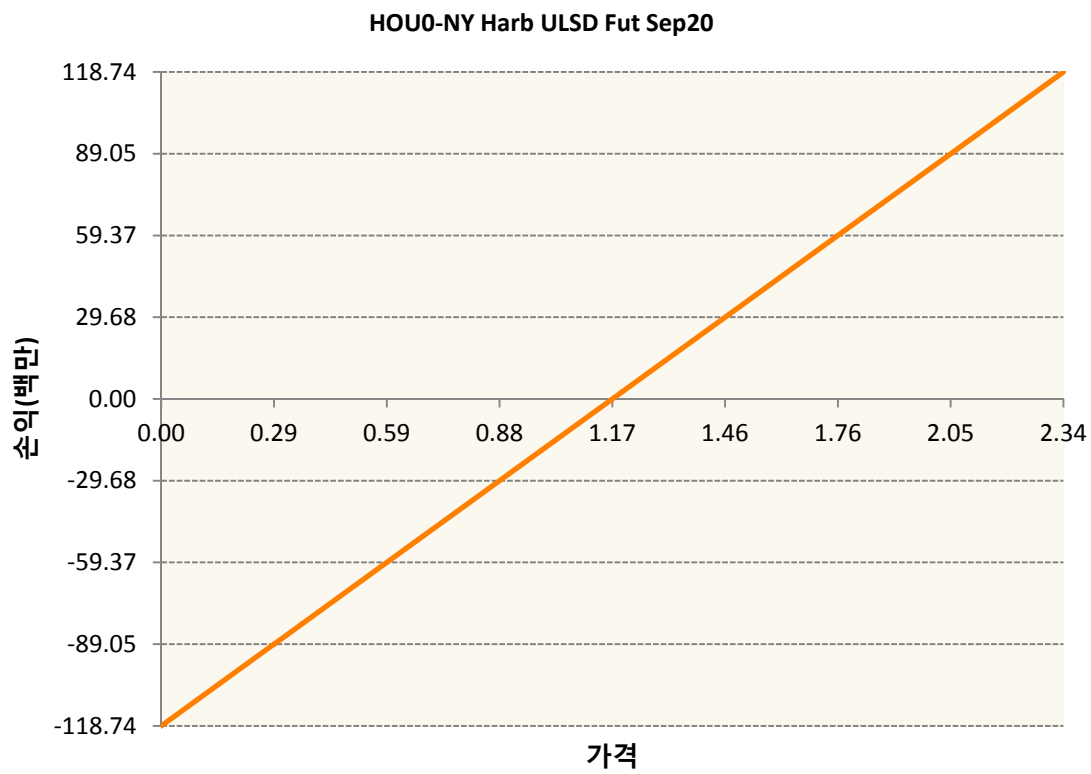
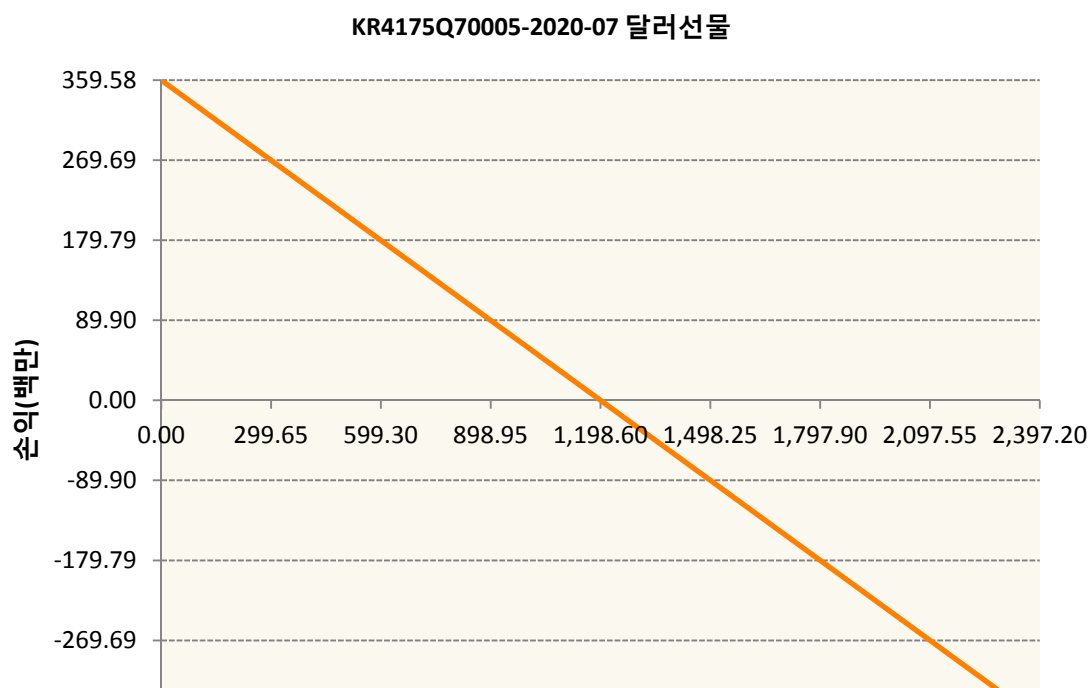
2. 만기시점의 손익구조

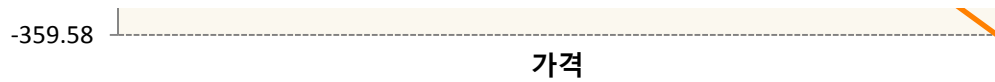
CLU0-WTI CRUDE FUTURE Sep20



COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20

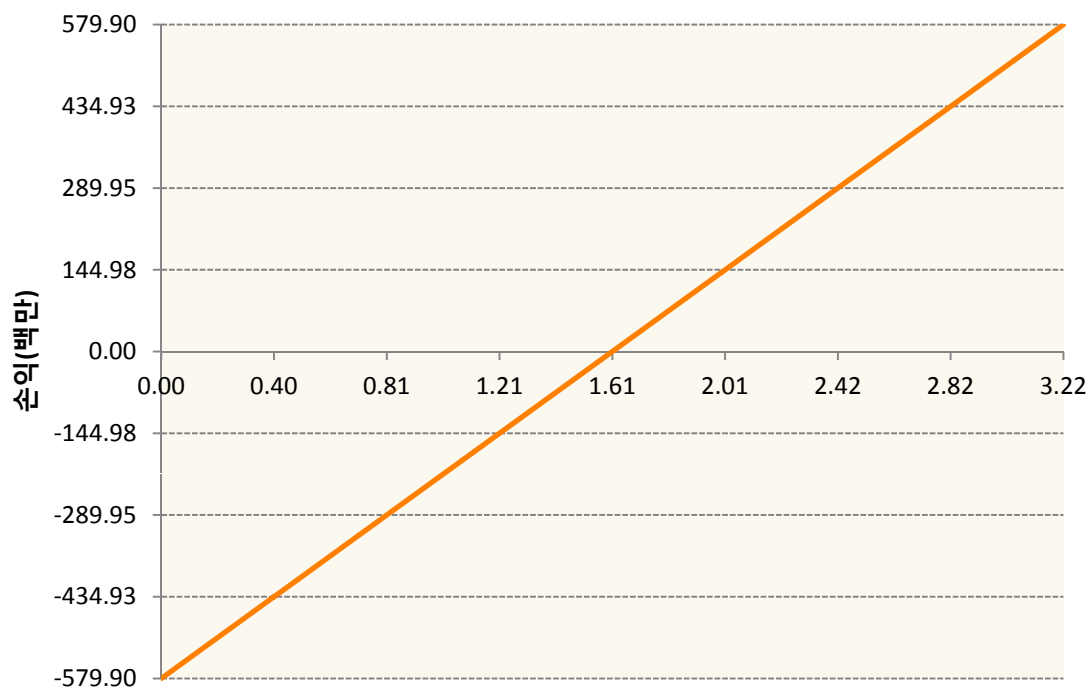






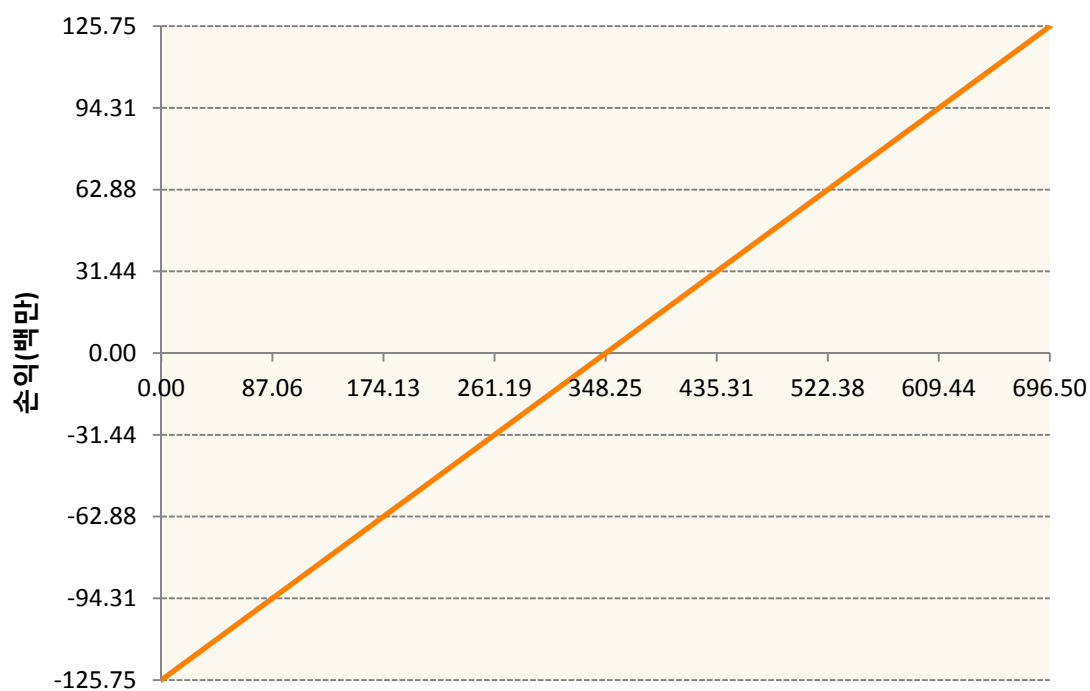
가격

NGU20-NATURAL GAS FUTR Sep20

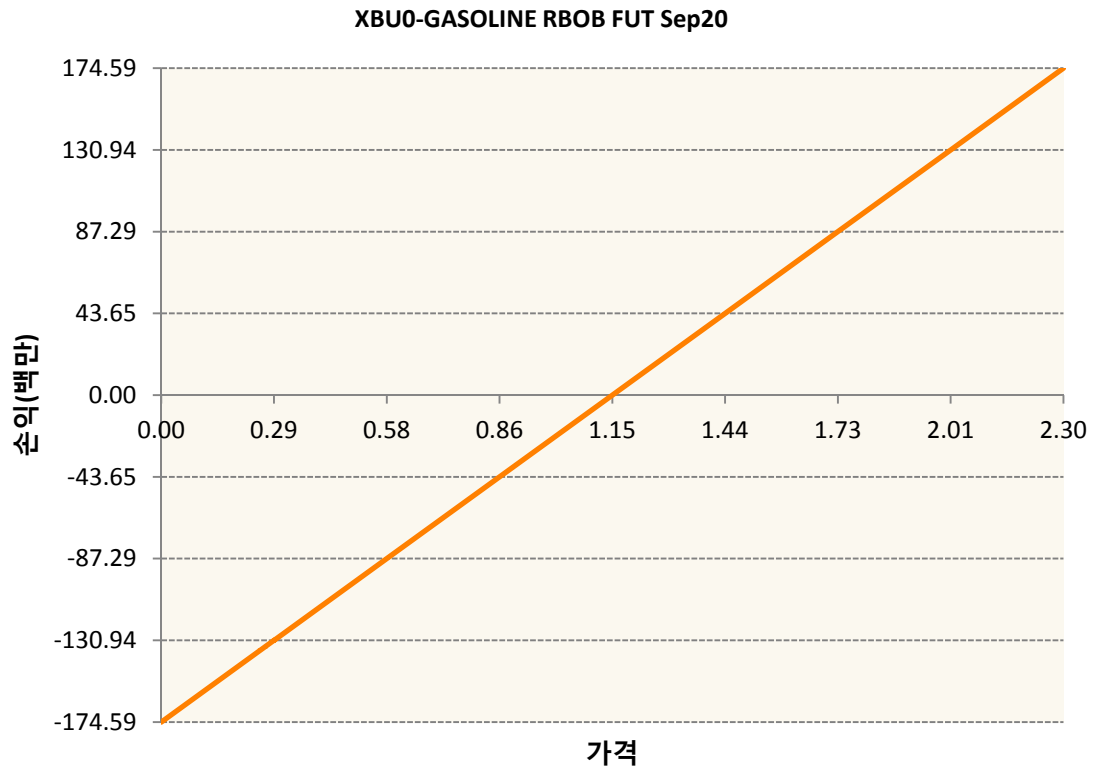


가격

QSU0-Low Su Gasoil G Sep20



가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU0	WTI CRUDE FUTURE Sep20	30
COU0	BRENT CRUDE FUTR Sep20	32
HOU0	NY Harb ULSD Fut Sep20	9
KR4175Q70C 2020-07 달러선물		29
NGU20	NATURAL GAS FUTR Sep20	46
QSU0	Low Su Gasoil G Sep20	10
XBU0	GASOLINE RBOB FUT Sep20	14

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

877

공시일	2020-06-30
기준일	2020-06-29

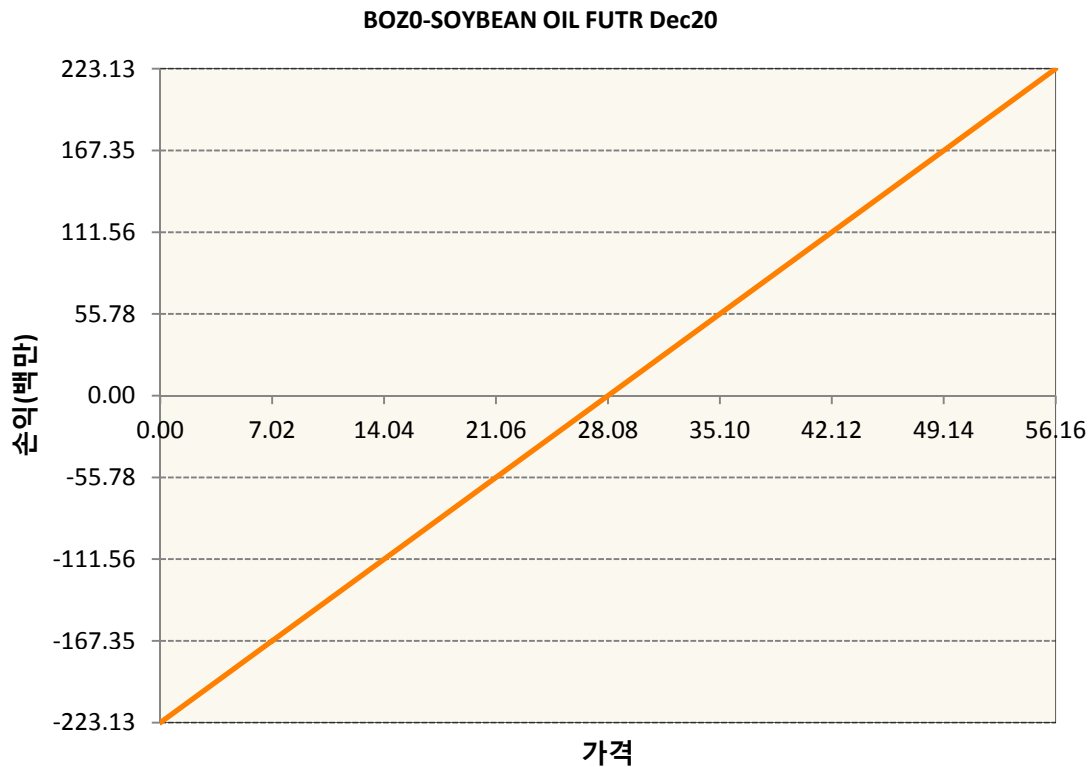
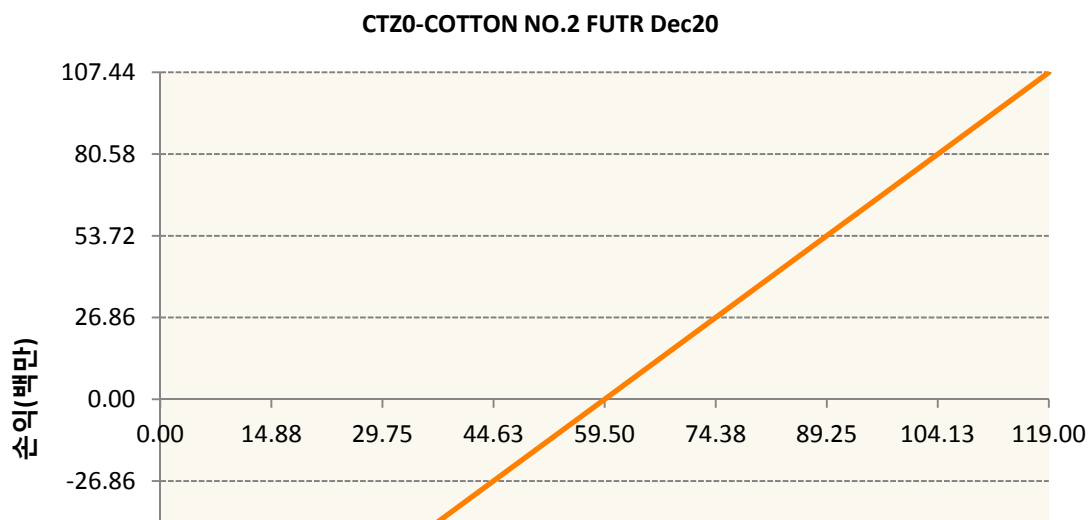
애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

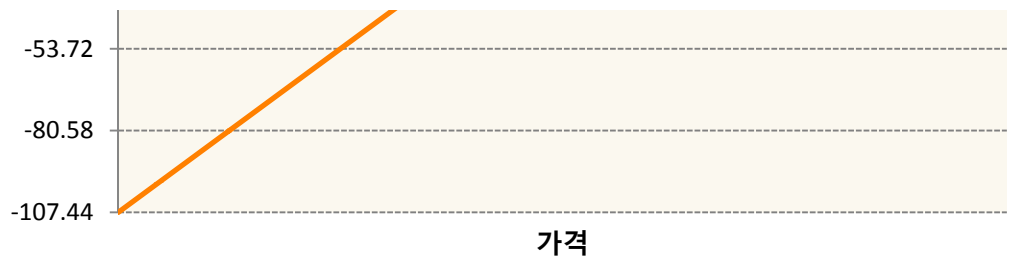
1. 계약금액

(단위:백만원)

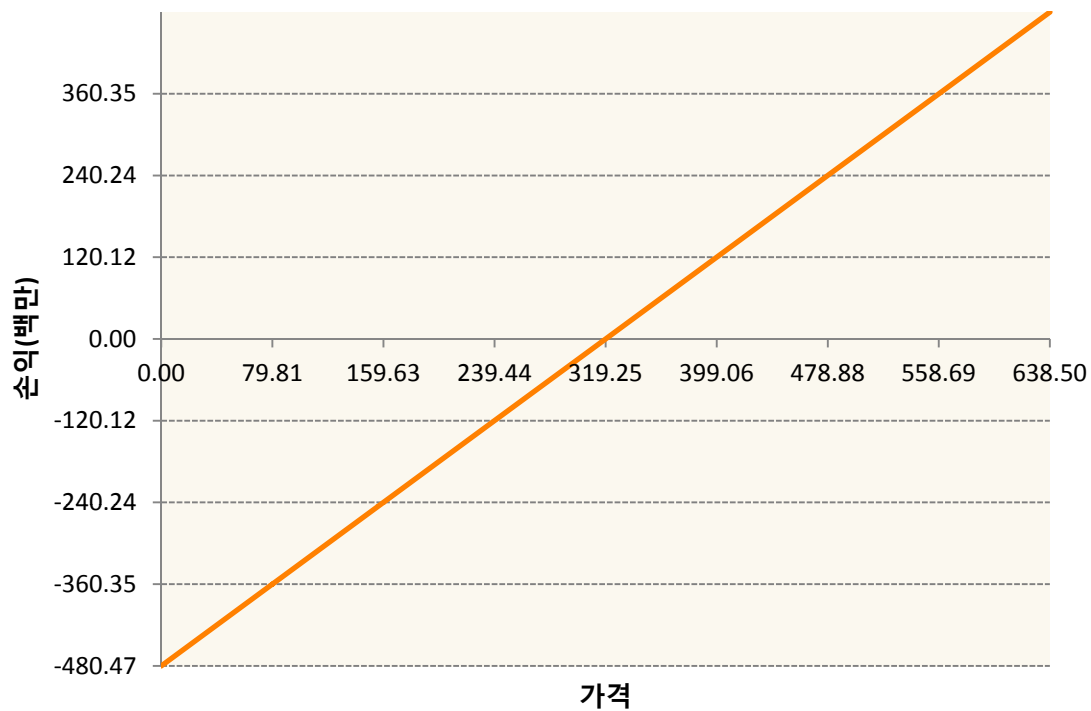
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,499	72	2,428	

2. 만기시점의 손익구조

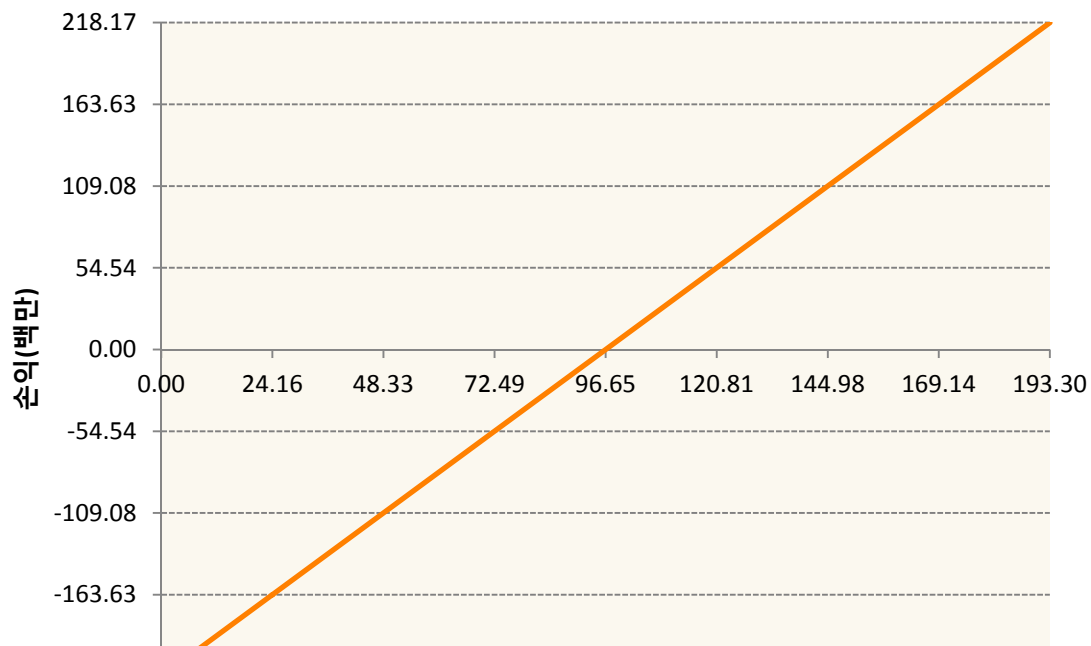


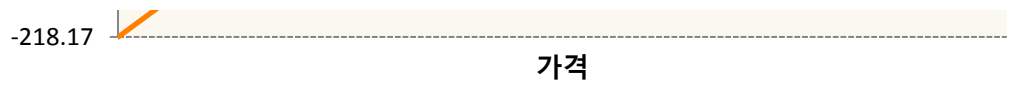
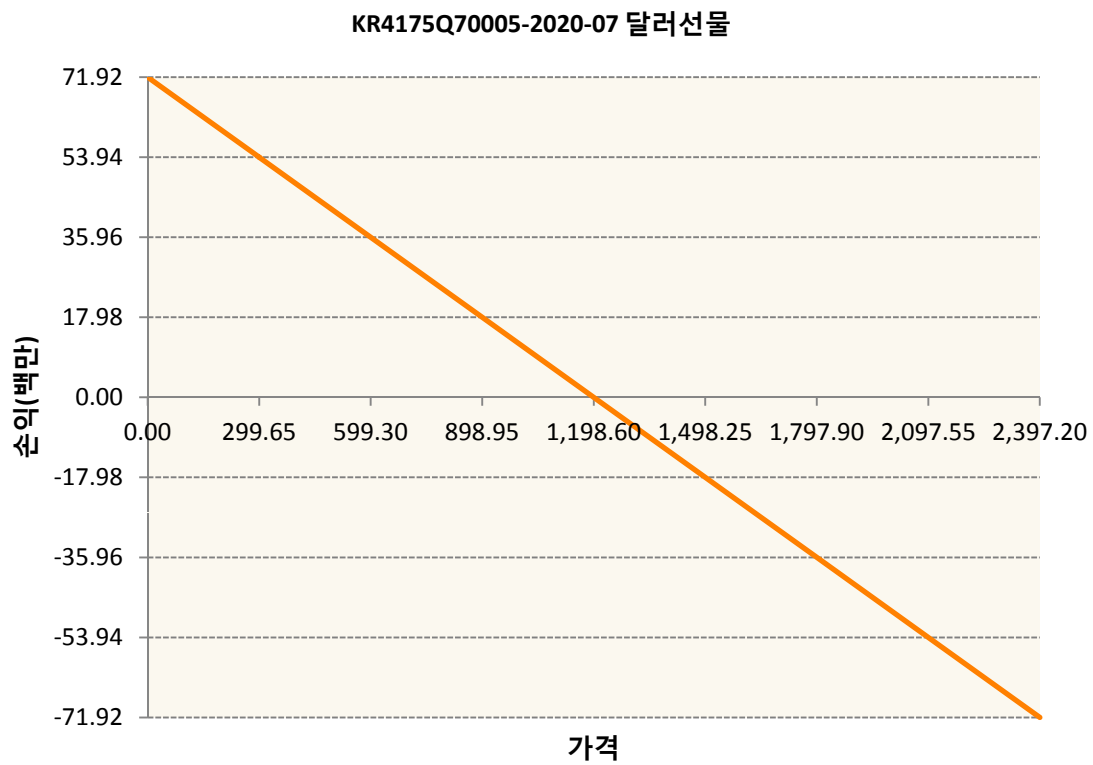
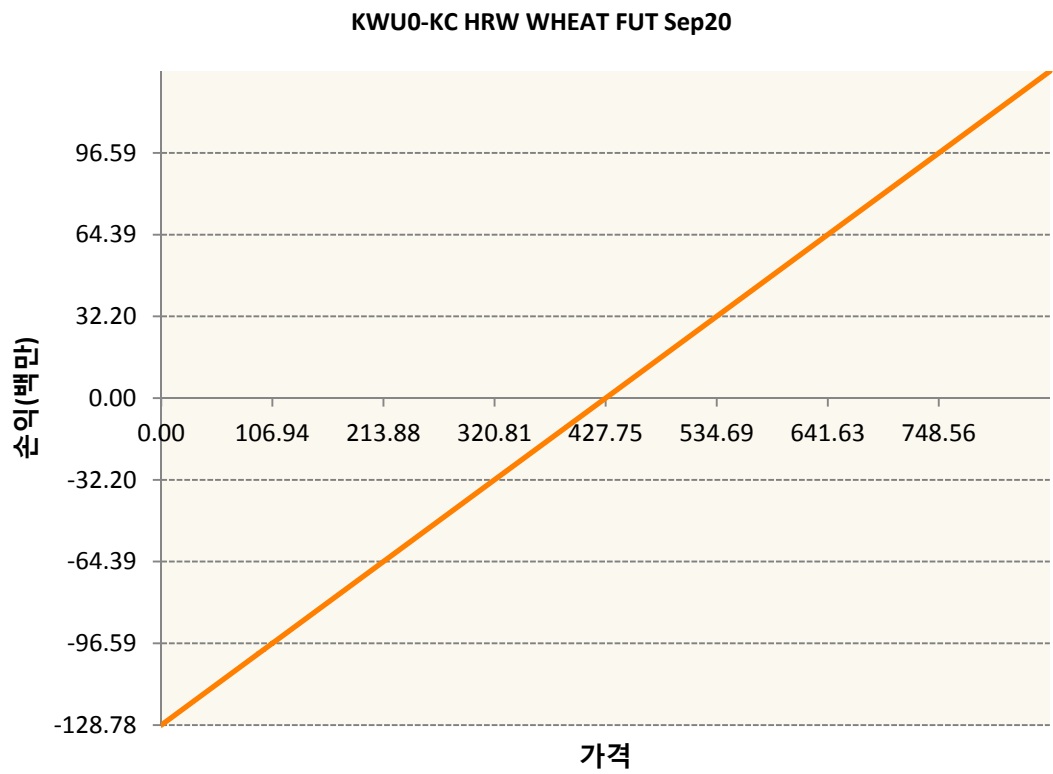


CU0-CORN FUTURE Sep20

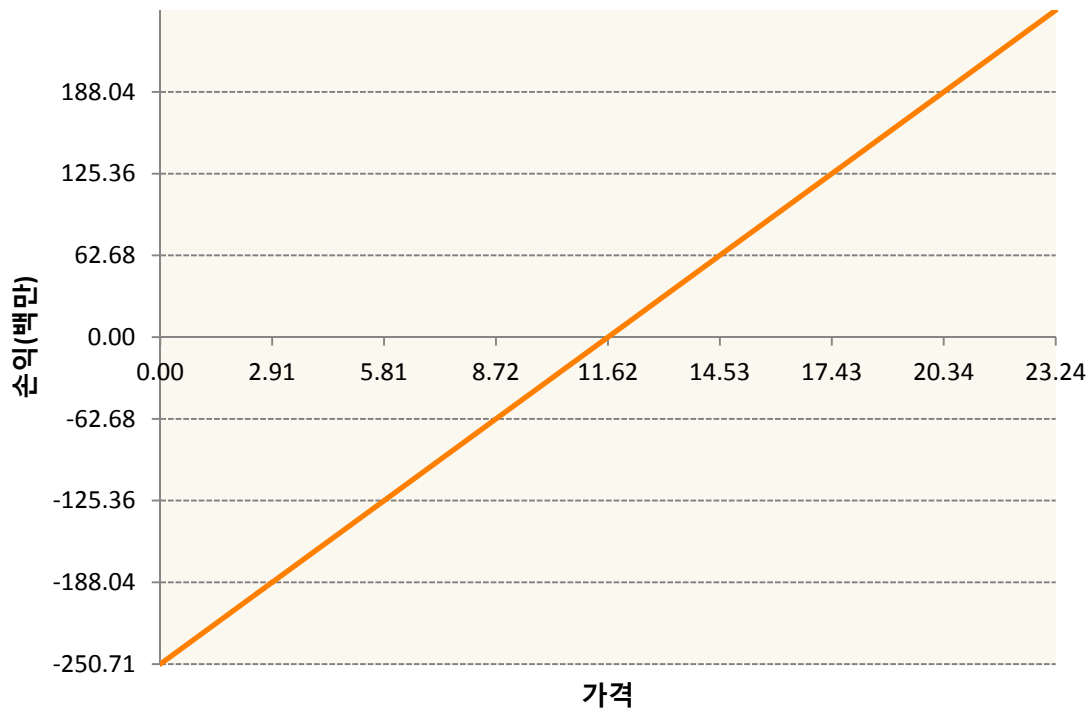


KCU0-COFFEE 'C' FUTURE Sep20

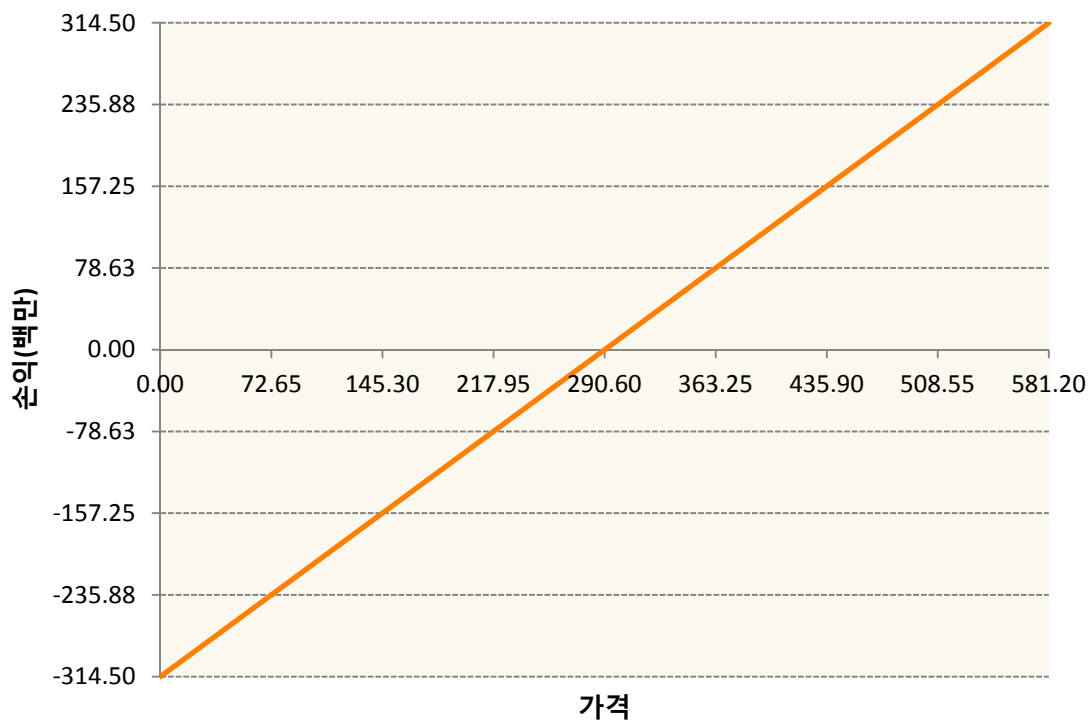




SBV0-Sugar Oct20

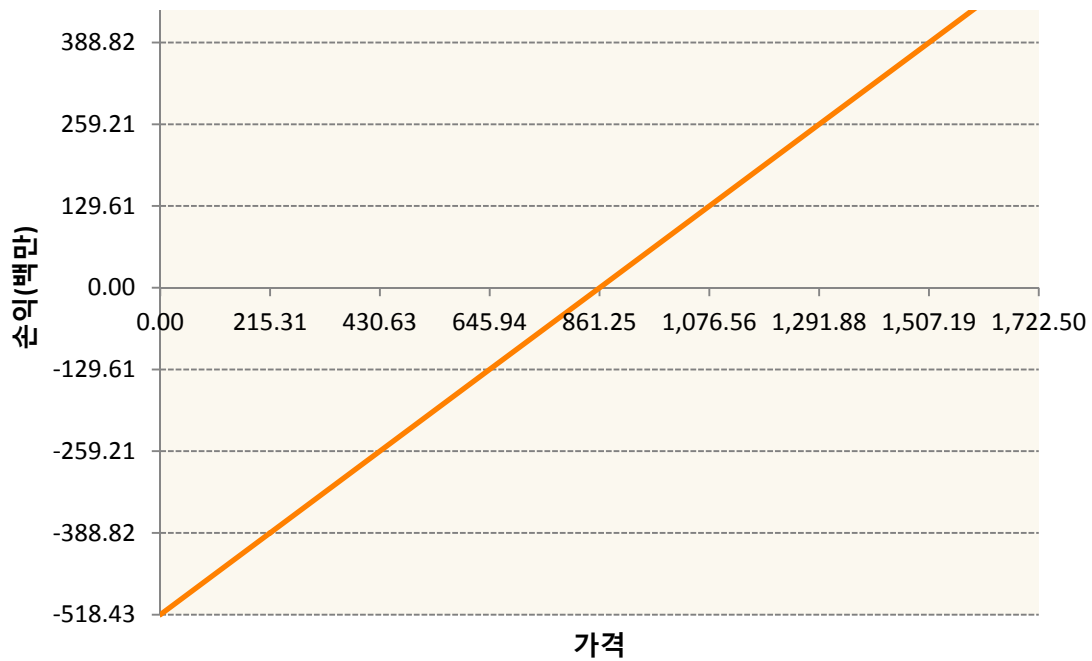


SMZ0-SOYBEAN MEAL FUTR Dec20

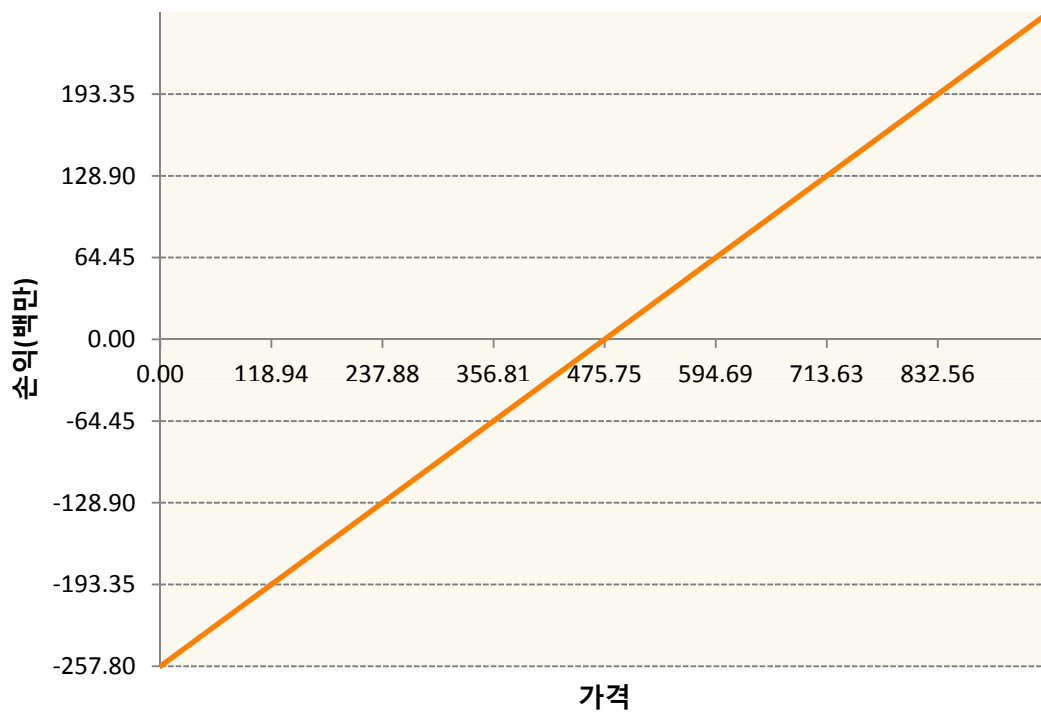


SX0-SOYBEAN FUTURE Nov20





WU0-WHEAT FUTURE(CBT) Sep20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ0	SOYBEAN OIL FUTR Dec20	18
CTZ0	COTTON NO.2 FUTR Dec20	9
CU0	CORN FUTURE Sep20	38
KCU0	COFFEE 'C' FUTURE Sep20	17
KR4175Q70C 2020-07 달러선물		6

KWU0	KC HRW WHEAT FUT Sep20	10
SBV0	Sugar Oct20	20
SMZ0	SOYBEAN MEAL FUTR Dec20	25
SX0	SOYBEAN FUTURE Nov20	41
WU0	WHEAT FUTURE(CBT) Sep20	21

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

(단위:백만원)

234