

공시일	2020-07-02
기준일	2020-07-01

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	2020-07-02
기준일	2020-07-01

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

1,062

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,278

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-07-02
기준일	2020-07-01

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	7,304	0	7,304	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI500000 신한CSI500미래S200610

617

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

894

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-07-02
기준일	2020-07-01

유로인덱스모(주식-파생형)

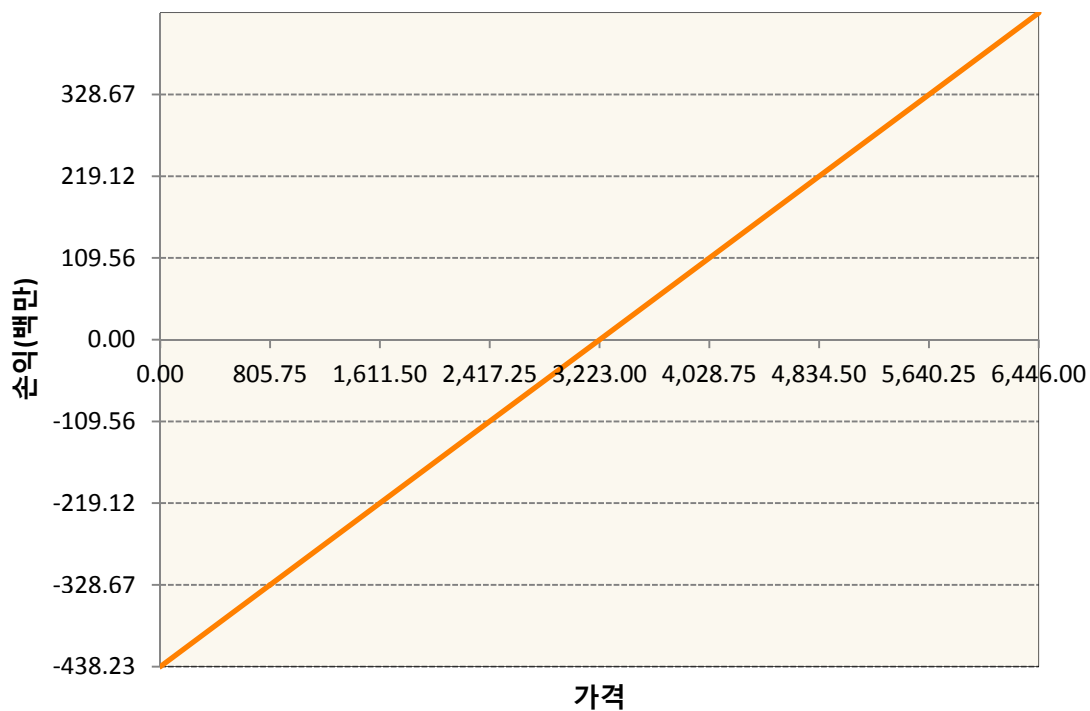
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	438	0	438	

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	2020-07-02
기준일	2020-07-01

차이나인덱스모(주식-파생형)

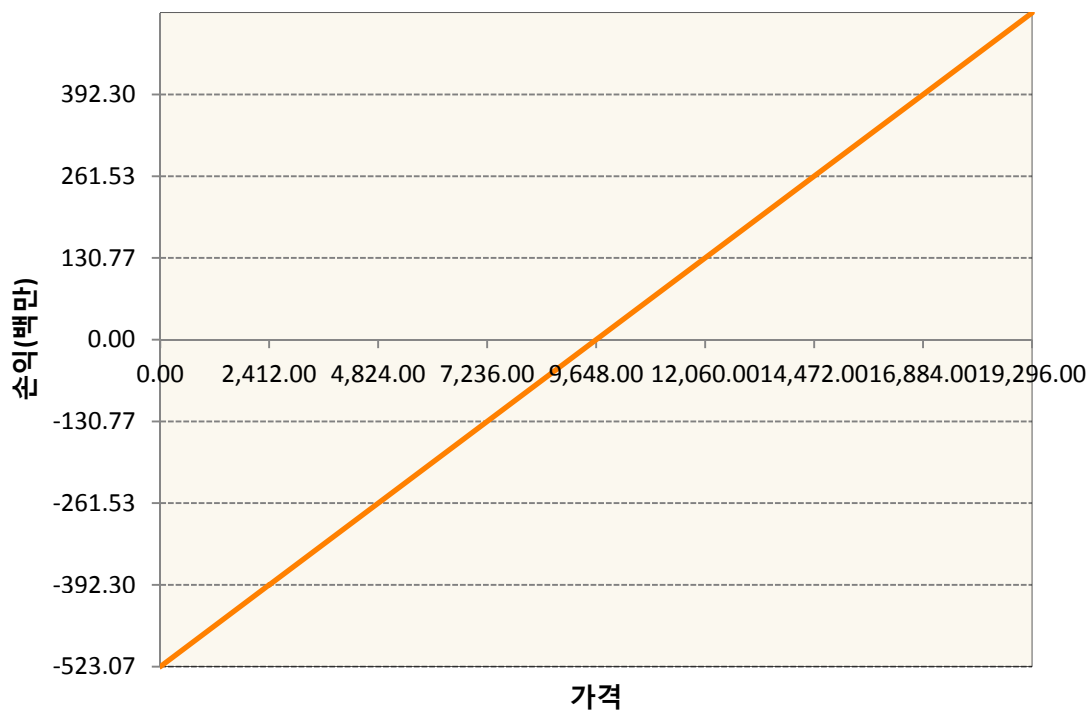
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	523	0	523	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCN0-HSCEI Futures Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

45

공시일	2020-07-02
기준일	2020-07-01

커버드콜모(주식혼합-파생형)

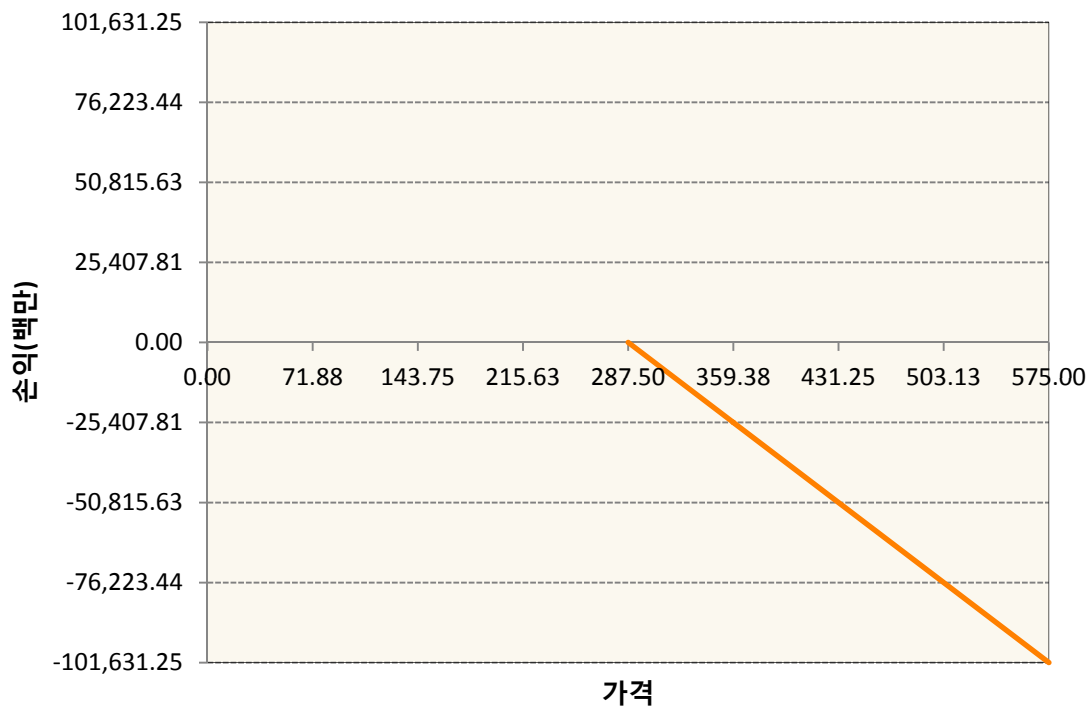
1. 계약금액

(단위:백만원)

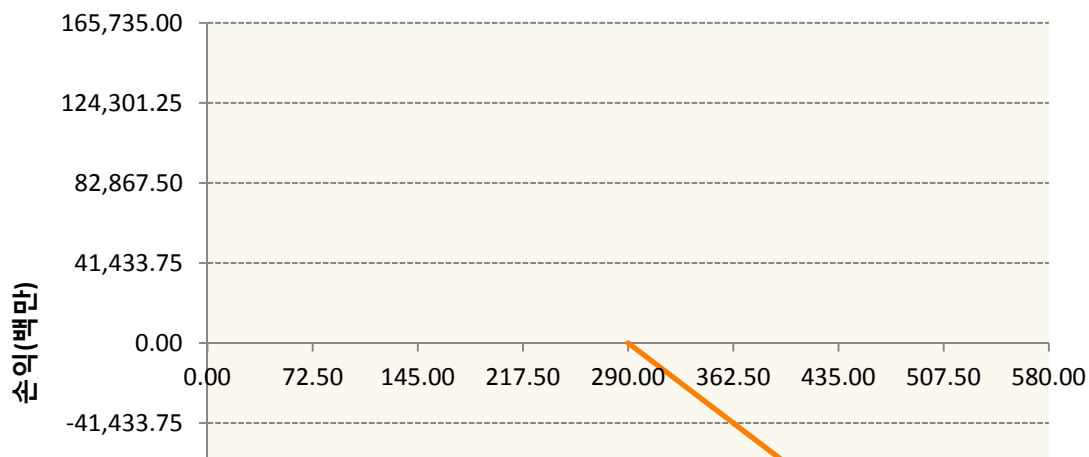
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	367,991	-367,991	장내

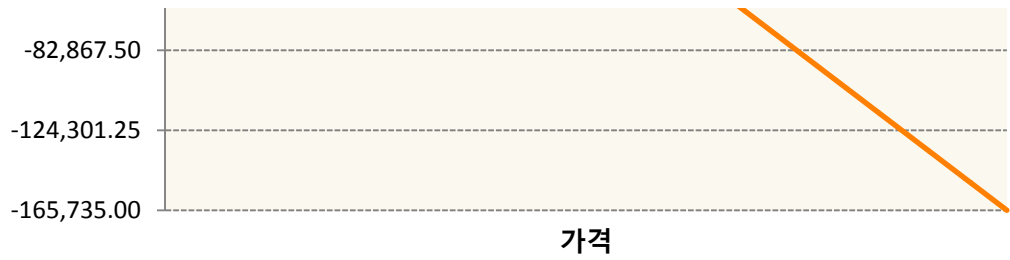
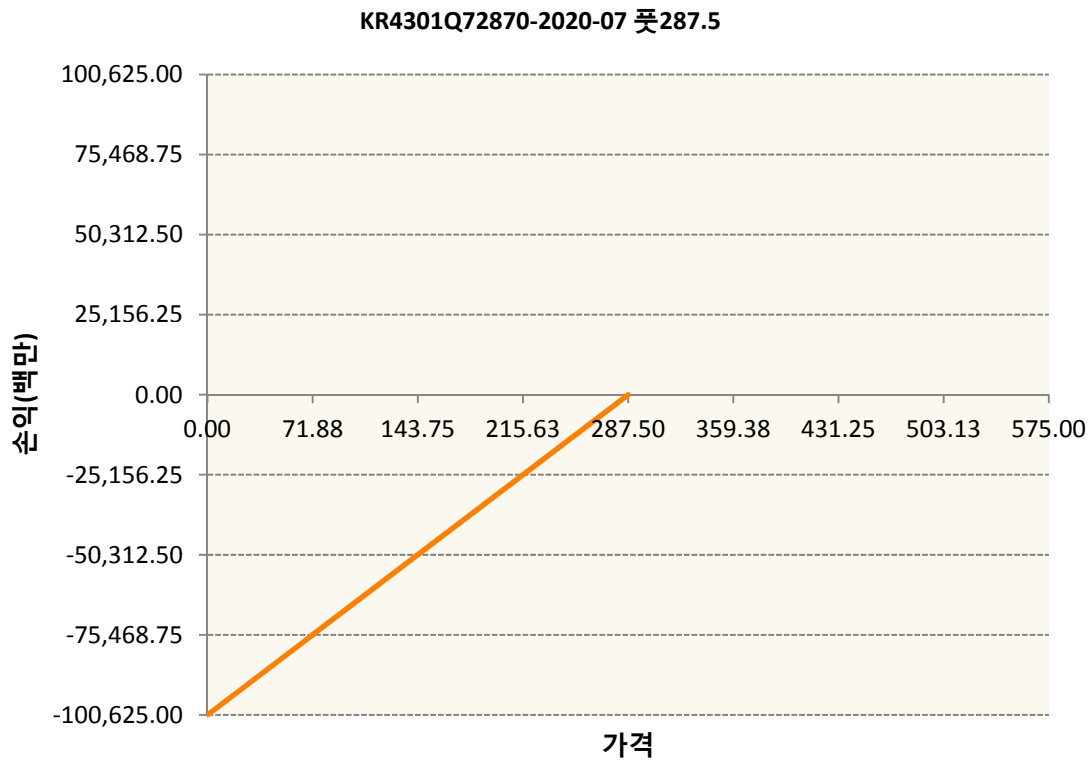
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q72872-2020-07 콜287.5



KR4201Q72906-2020-07 콜290





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q72872			2020-07 콜287.5				5,201
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,582	1,555	1,515	1,463	1,398	1,320	1,231
-5.33%	1,491	1,420	1,333	1,232	1,118	992	857
-2.67%	1,222	1,085	936	776	608	433	252
0%	615	414	209	0	-211	-424	-639
2.67%	-476	-704	-933	-1,162	-1,391	-1,619	-1,848
5.33%	-2,093	-2,299	-2,509	-2,723	-2,939	-3,157	-3,377
8.00%	-4,159	-4,307	-4,469	-4,641	-4,821	-5,008	-5,201
KR4201Q72906			2020-07 콜290				7,867
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,124	2,092	2,044	1,976	1,889	1,783	1,658

-5.33%	2,023	1,934	1,820	1,681	1,521	1,342	1,145
-2.67%	1,703	1,516	1,305	1,074	827	566	294
0%	926	628	318	0	-325	-656	-991
2.67%	-563	-931	-1,298	-1,667	-2,036	-2,405	-2,774
5.33%	-2,897	-3,254	-3,614	-3,977	-4,342	-4,708	-5,075
8.00%	-6,011	-6,289	-6,583	-6,891	-7,208	-7,534	-7,867
KR4301Q72870 2020-07 풋287.5							7,119
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,069	-7,070	-7,073	-7,078	-7,088	-7,101	-7,119
-5.33%	-4,462	-4,473	-4,490	-4,515	-4,547	-4,586	-4,633
-2.67%	-1,920	-1,967	-2,025	-2,093	-2,170	-2,253	-2,343
0%	354	241	123	0	-126	-256	-387
2.67%	2,020	1,870	1,721	1,571	1,422	1,273	1,123
5.33%	2,914	2,799	2,678	2,553	2,424	2,292	2,157
8.00%	3,244	3,190	3,125	3,050	2,966	2,875	2,777

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

(단위:백만원)

19,258

공시일	2020-07-02
기준일	2020-07-01

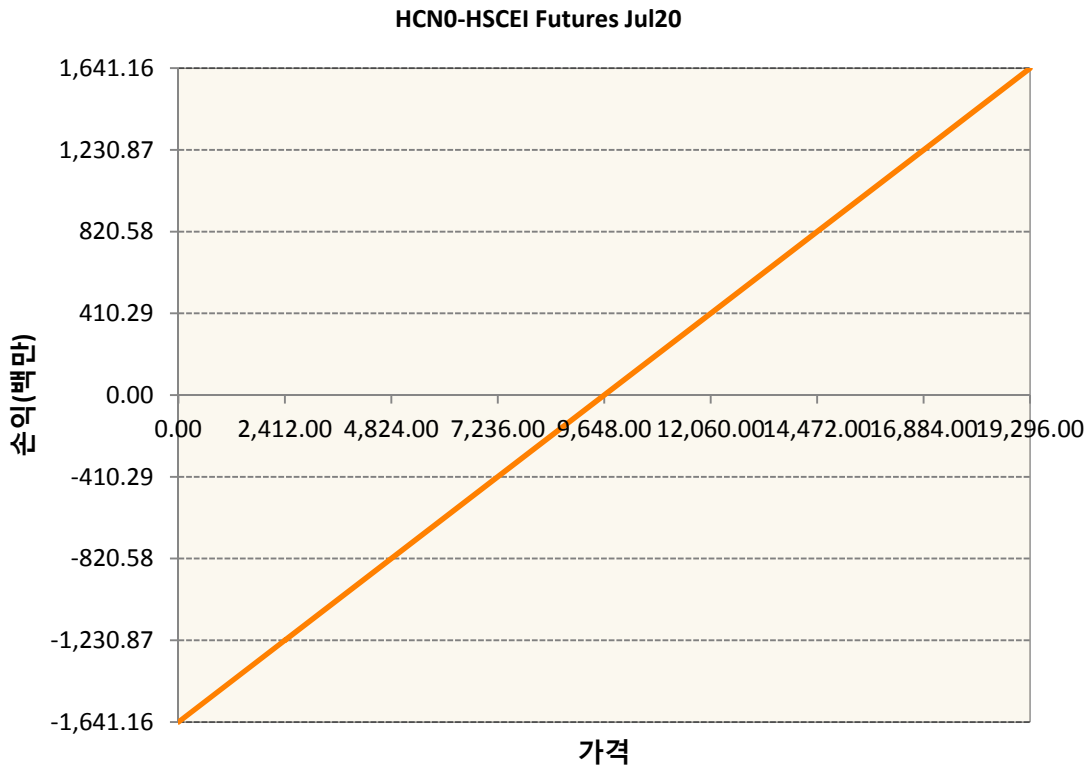
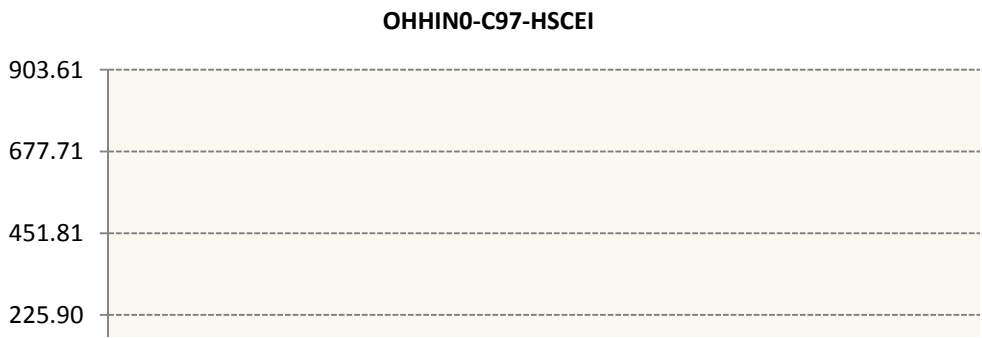
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

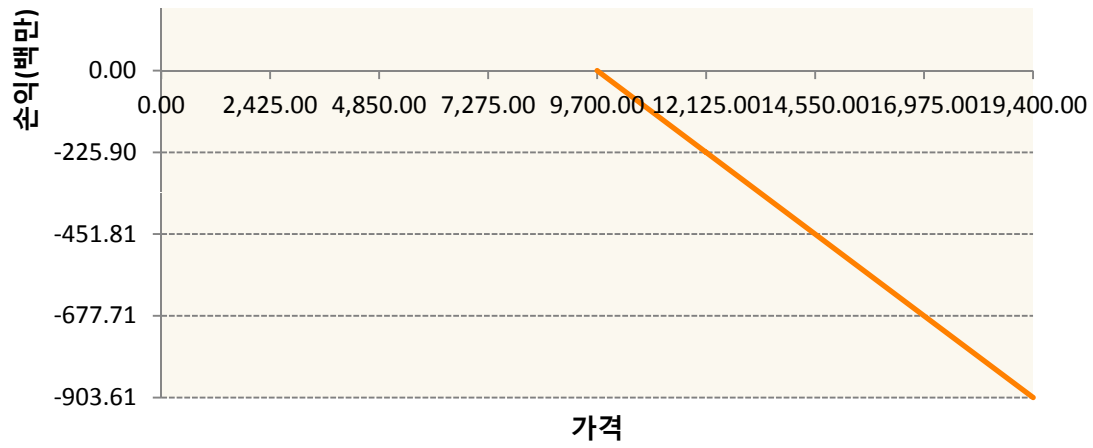
1. 계약금액

(단위:백만원)

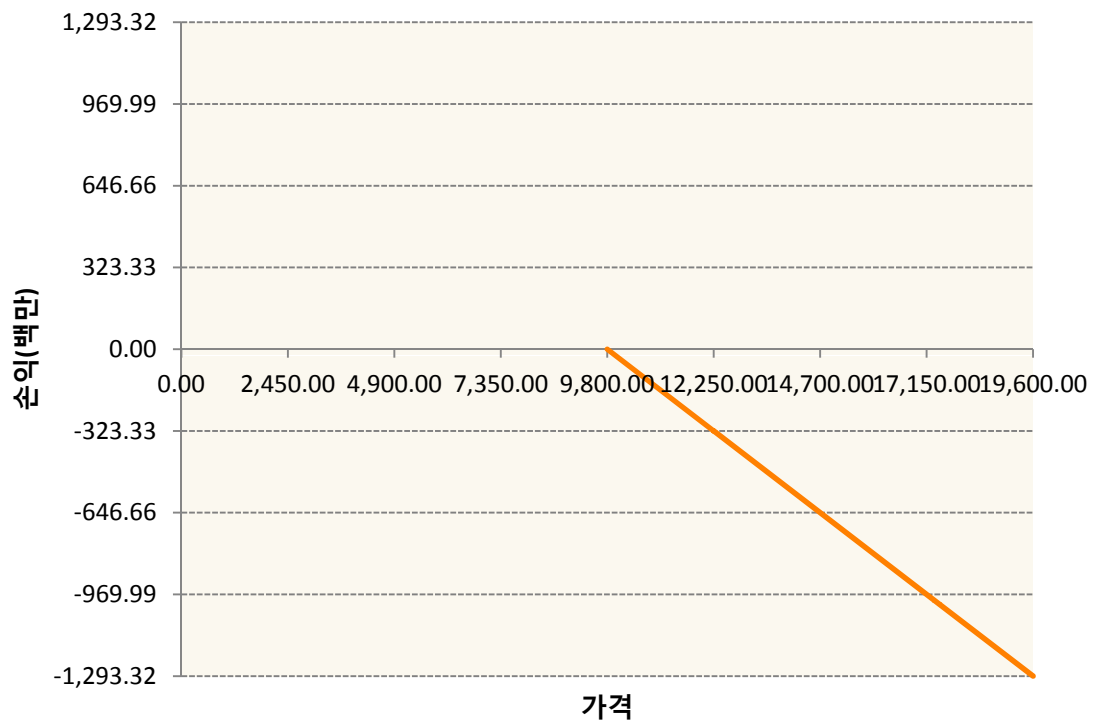
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,641	0	1,641	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,470	-4,470	장내
누계	통화	선도	0	1,503	-1,503	장외

2. 만기시점의 손익구조

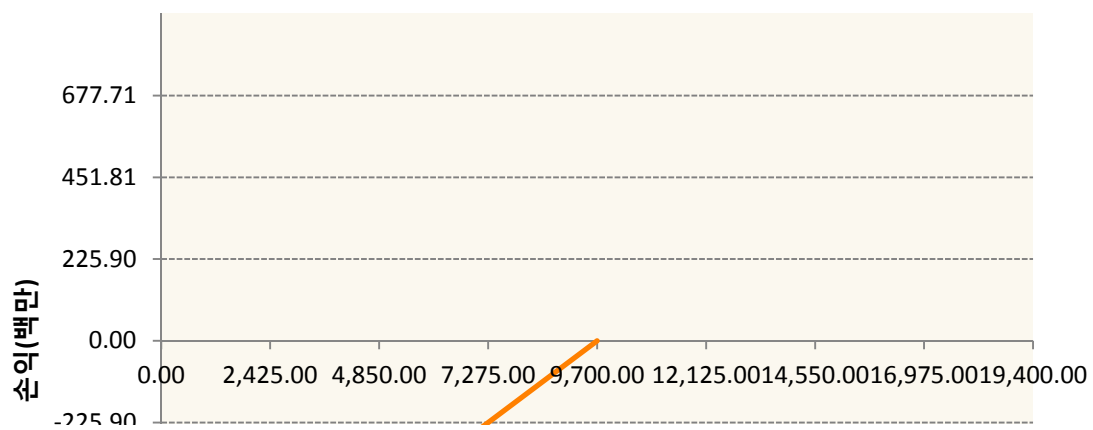


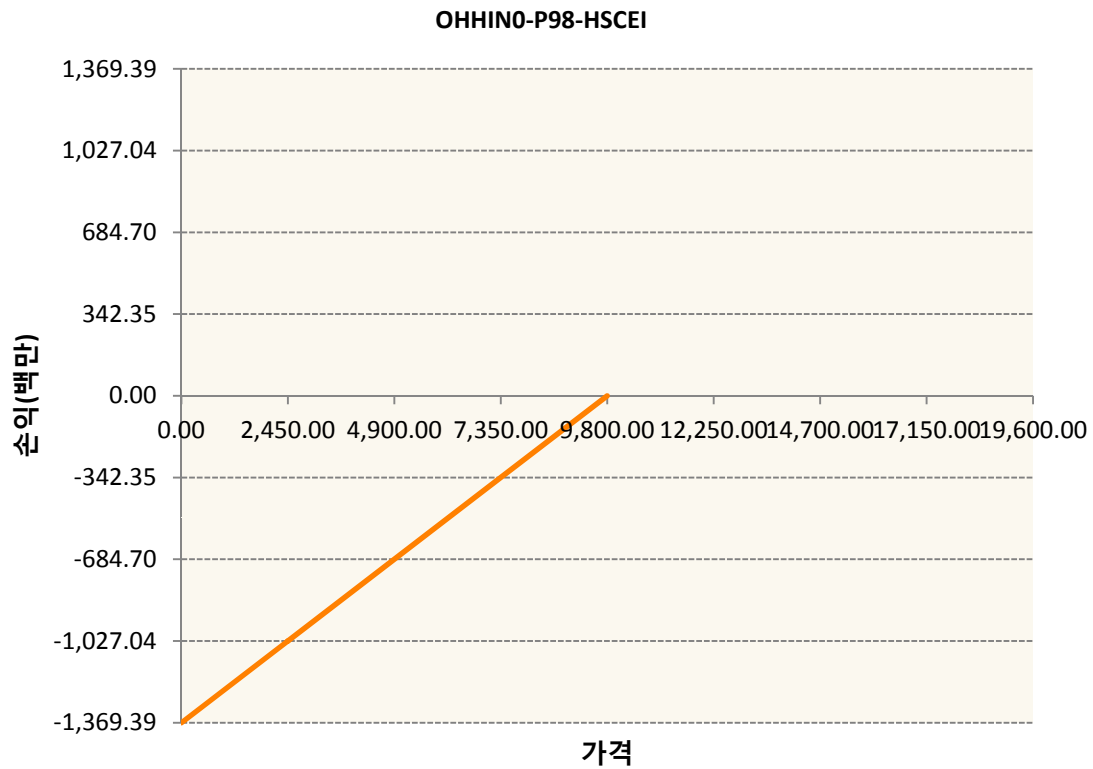


OHHIN0-C98-HSCEI



OHHIN0-P97-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E		120
HCN0 HSCEI Futures Jul20		131
OHHIN0-C9 HSCEI		72
OHHIN0-C9 HSCEI		103
OHHIN0-P9 HSCEI		72
OHHIN0-P9 HSCEI		110

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	590

공시일	2020-07-02
기준일	2020-07-01

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

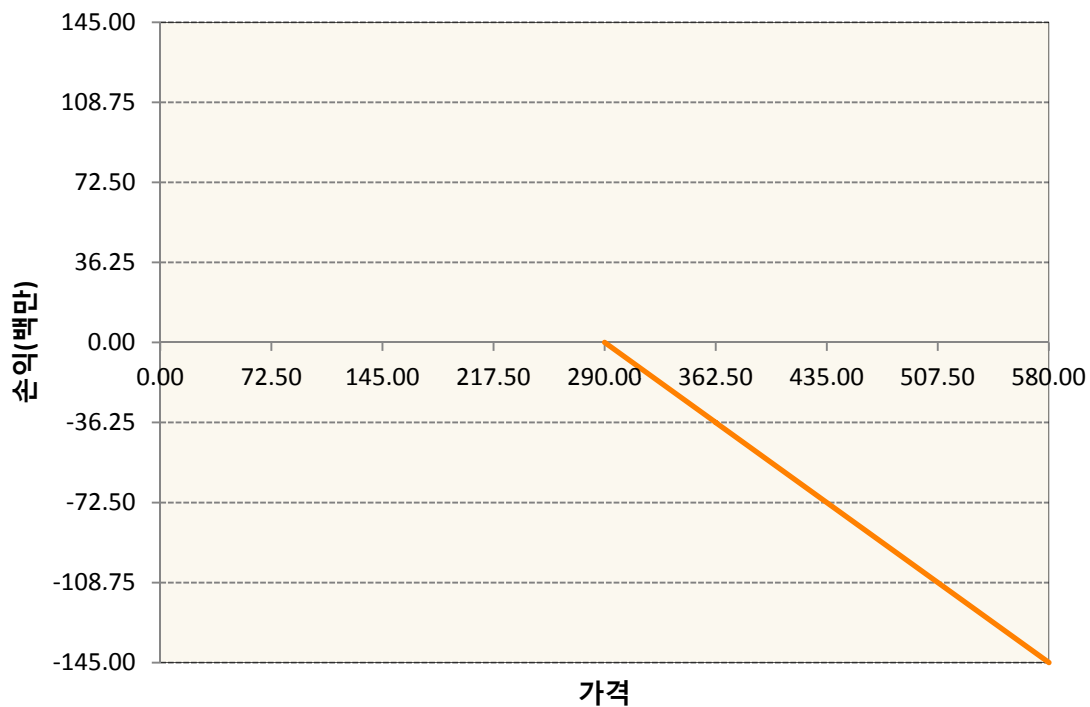
1. 계약금액

(단위:백만원)

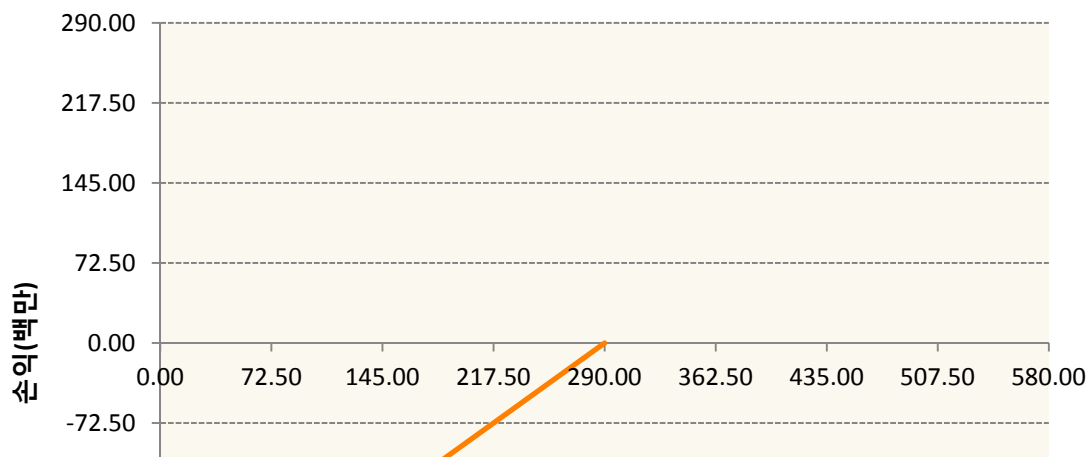
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	435	-435	장내

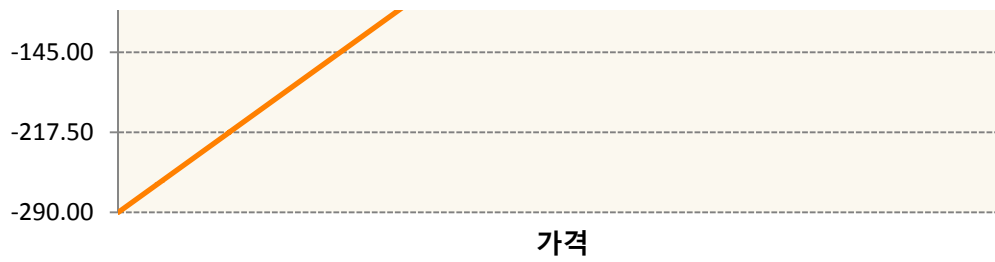
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q72906-2020-07 콜290



KR4301Q72904-2020-07 풋290





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q72906				2020-07 콜290			7
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2	2	2	2	2	2	1
-5.33%	2	2	2	1	1	1	1
-2.67%	1	1	1	1	1	0	0
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	0	-1	-1	-1	-2	-2	-2
5.33%	-3	-3	-3	-3	-4	-4	-4
8.00%	-5	-6	-6	-6	-6	-7	-7

KR4301Q72904				2020-07 풋290			21
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-5.33%	-13	-13	-13	-13	-14	-14	-14
-2.67%	-6	-6	-6	-6	-7	-7	-7
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	6	6	5	5	5	4	4
5.33%	10	9	9	8	8	8	7
8.00%	11	11	10	10	10	10	9

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

29

공시일 2020-07-02
기준일 2020-07-01

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

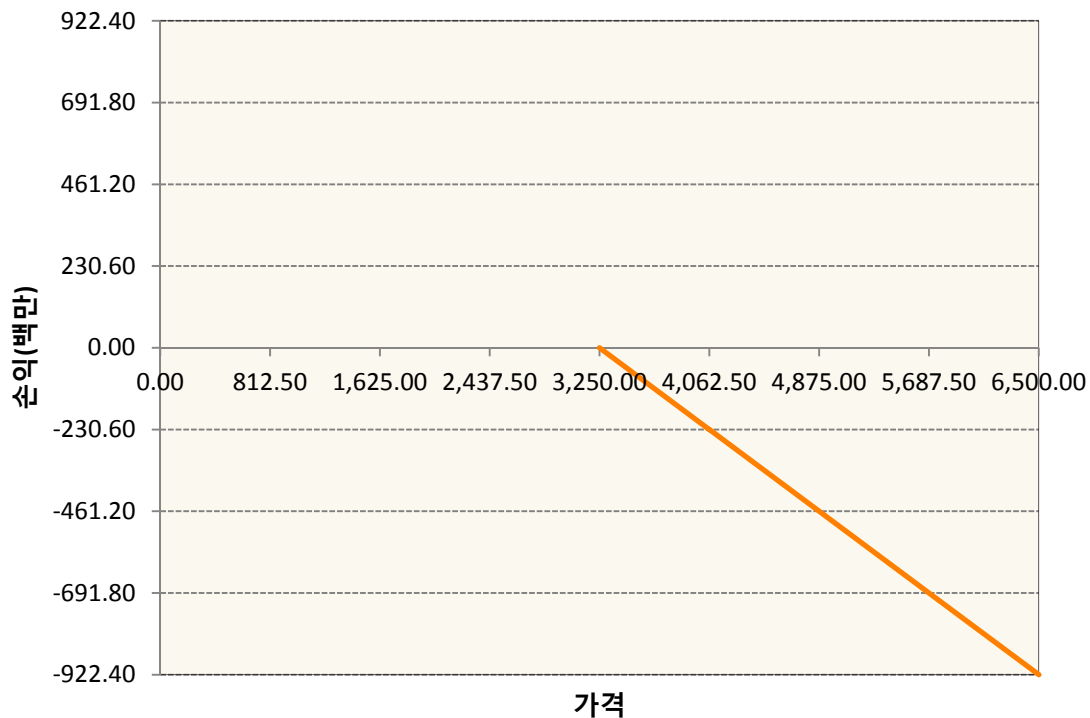
1. 계약금액

(단위:백만원)

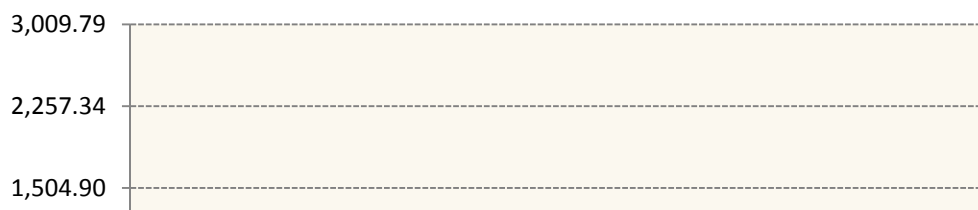
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,316	0	1,316	
누계	유가증권	스왑	8,060	0	8,060	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,864	-7,864	장내
누계	통화	선도	0	2,925	-2,925	장외

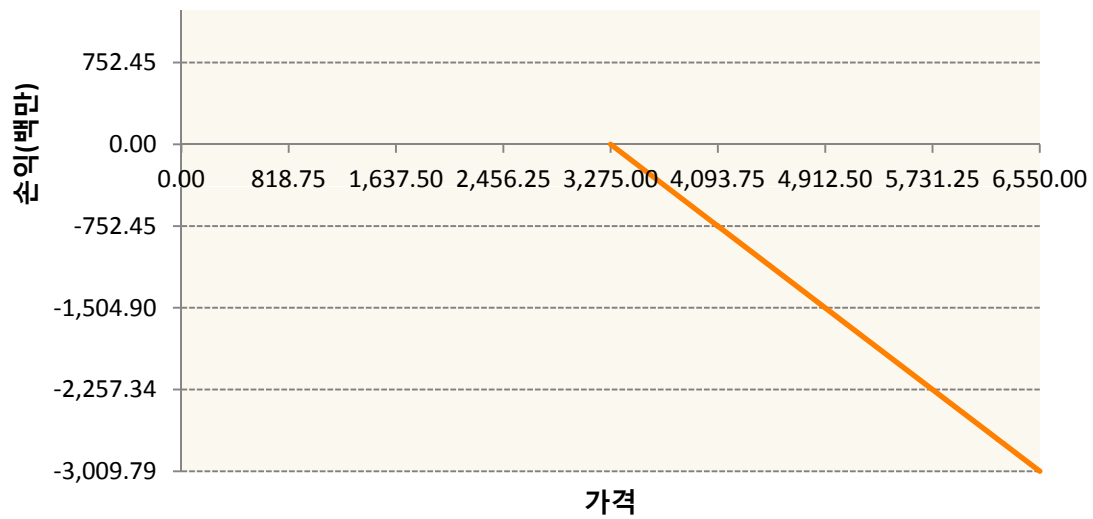
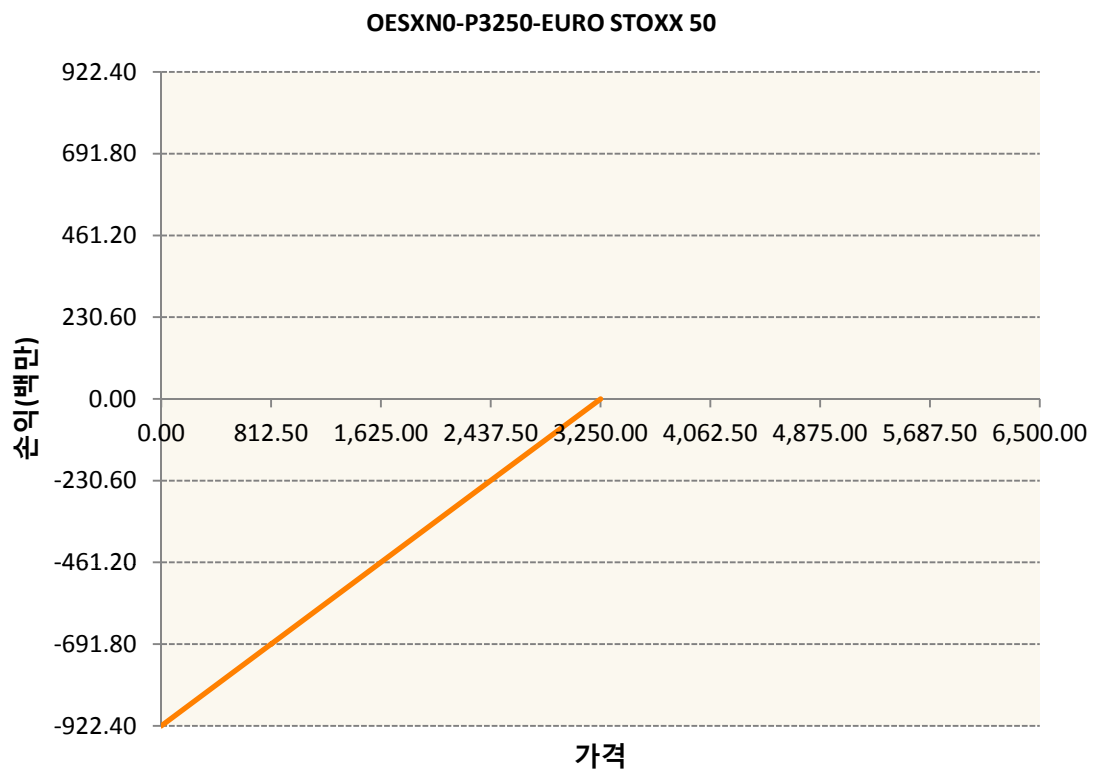
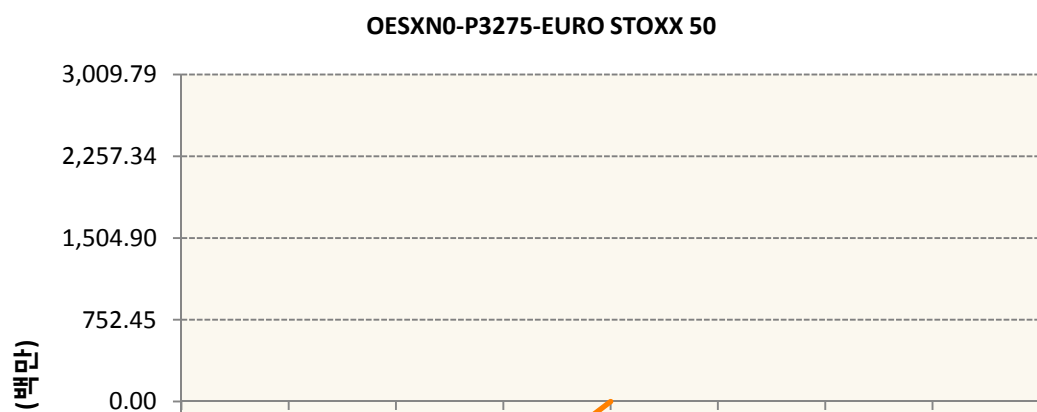
2. 만기시점의 손익구조

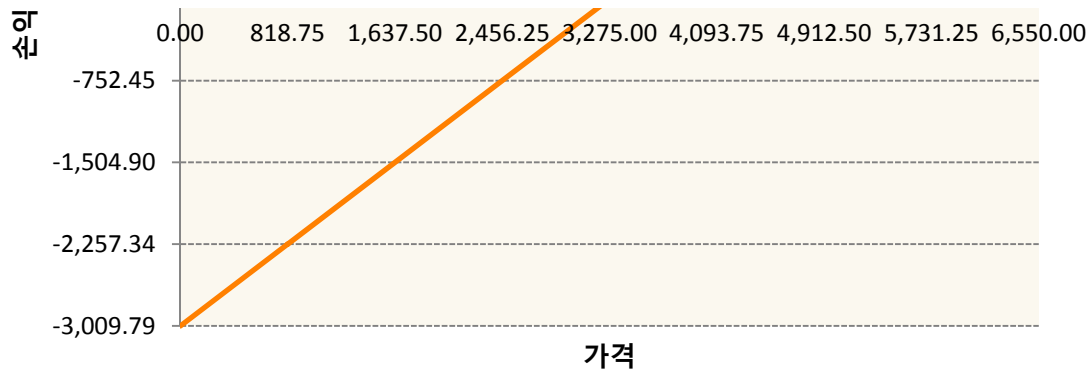
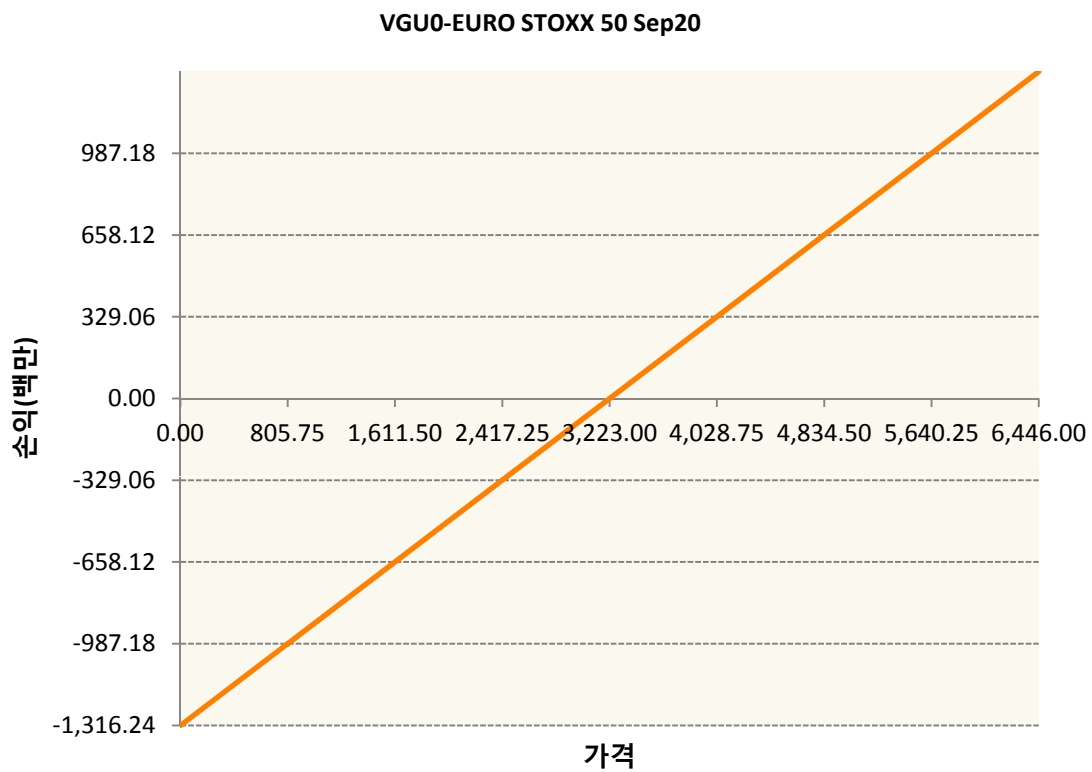
OESXN0-C3250-EURO STOXX 50



OESXN0-C3275-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY		22
FX21020M0₩/EUR 25-09-20E		234
OESXN0-C3₩ EURO STOXX 50		74
OESXN0-C3₩ EURO STOXX 50		241
OESXN0-P3₩ EURO STOXX 50		74
OESXN0-P3₩ EURO STOXX 50		241
VGU0 EURO STOXX 50 Sep20		105

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 (순이익(백만)). The x-axis represents Price, ranging from 0.00 to 559.70. The y-axis represents Net Income, ranging from -10,354.45 to 10,354.45. The line starts at a negative net income of -10,354.45 when the price is 0.00 and increases linearly to a positive net income of 10,354.45 at a price of 559.70.

가격	순이익(백만)
0.00	-10,354.45
69.96	-7,765.84
139.93	-5,177.23
209.89	-2,588.61
279.85	0.00
349.81	2,588.61
419.78	5,177.23
489.74	7,765.84
559.70	10,354.45

(단위:백만원)

KR4101Q90009							2020-09 코스피200지수선물		830
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-830	-830	-830	-830	-830	-830	-830		
-5.33%	-553	-553	-553	-553	-553	-553	-553		
-2.67%	-277	-277	-277	-277	-277	-277	-277		
0%	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	277	277	277	277	277	277	277		
5.33%	553	553	553	553	553	553	553		
8.00%	830	830	830	830	830	830	830		

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

(단위:백만원)

1,315

공시일	2020-07-02
기준일	2020-07-01

ETF스마트레버리지목표전환형9호

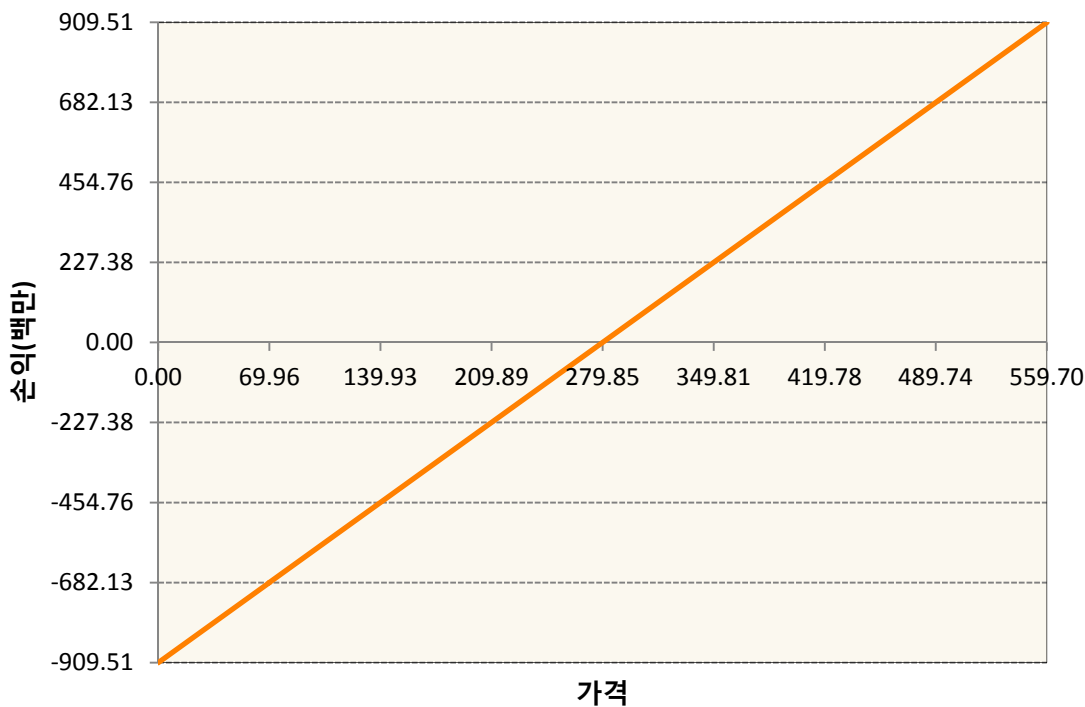
1. 계약금액

(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)

116

ETF스마트레버리지목표전환형10호

(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 559.70. The y-axis represents Net Income (Dividend), ranging from -1,329.29 to 996.97. A solid orange line shows the relationship, starting at (0, -1,329.29) and ending at (559.70, 996.97).

가격 (Price)	순이익(배당) (Net Income (Dividend))
0.00	-1,329.29
69.96	-996.97
139.93	-664.64
209.89	-332.32
279.85	0.00
349.81	332.32
419.78	664.64
489.74	996.97
559.70	1,329.29

(단위:백만원)

[illegible]

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

(단위:백만원)

169

공시일	2020-07-02
기준일	2020-07-01

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

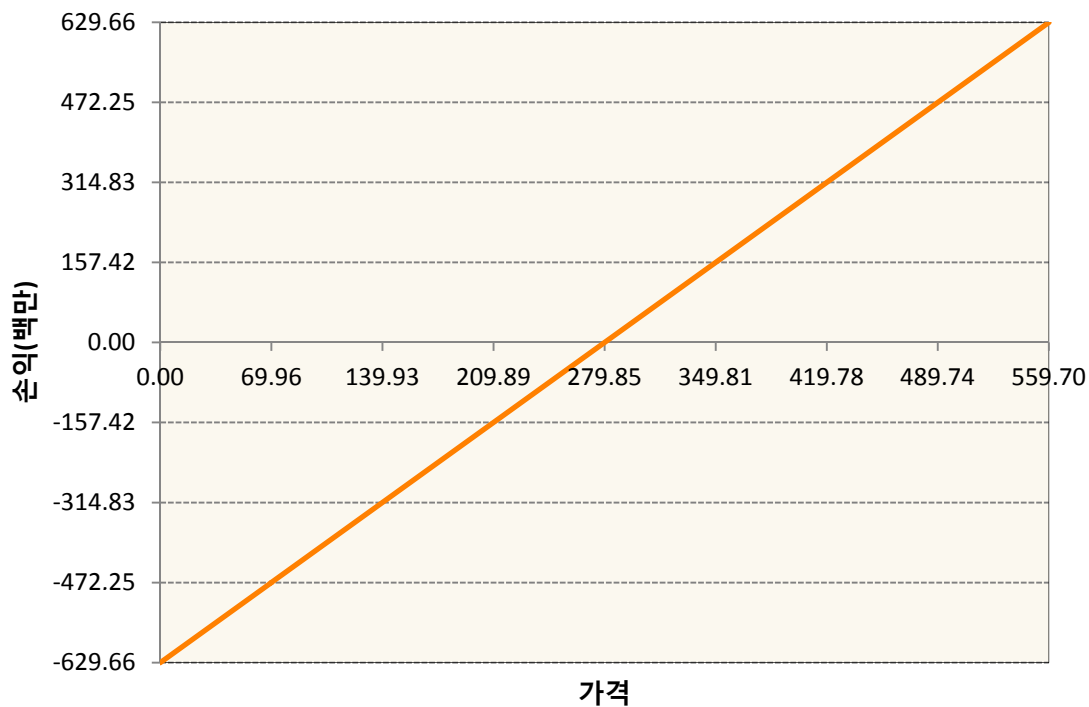
1. 계약금액

(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		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	2020-07-02
기준일	2020-07-01

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

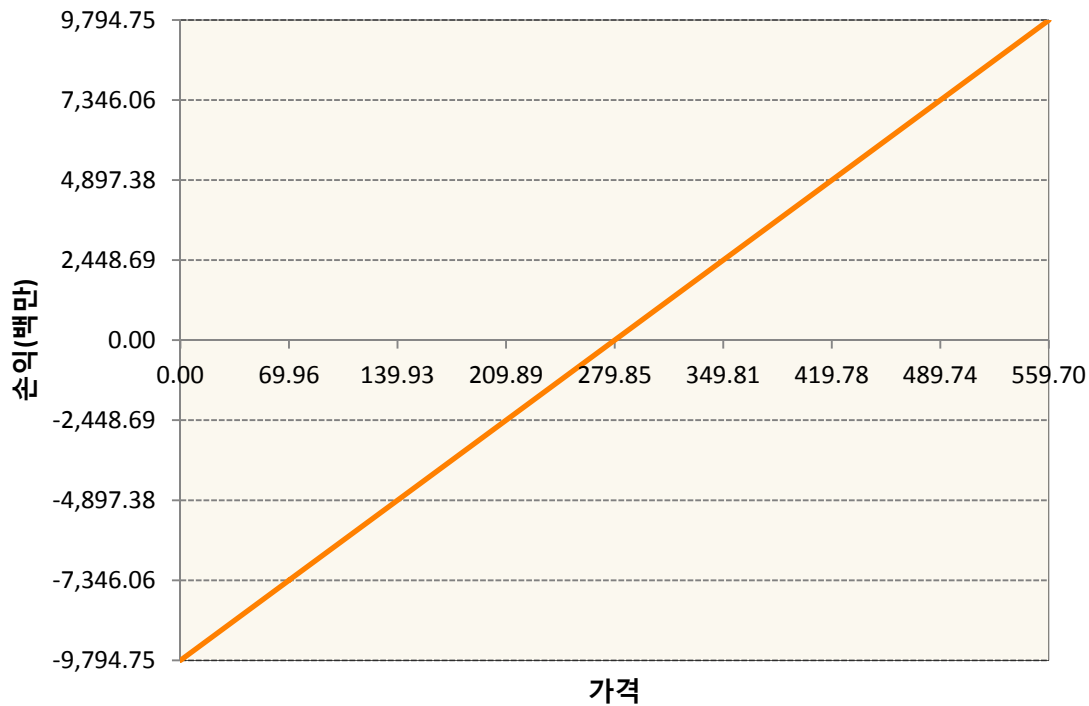
1. 계약금액

(단위:백만원)

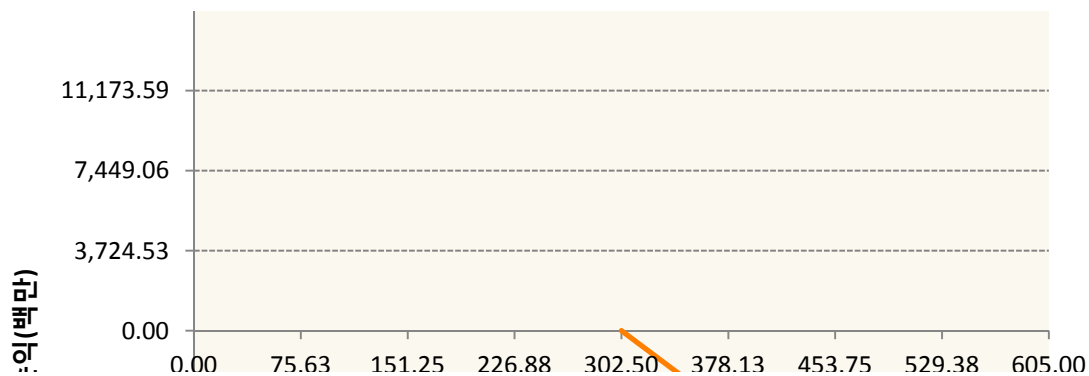
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,795	0	9,795	장내
누계	유가증권	옵션	3,247	19,092	-15,845	장내

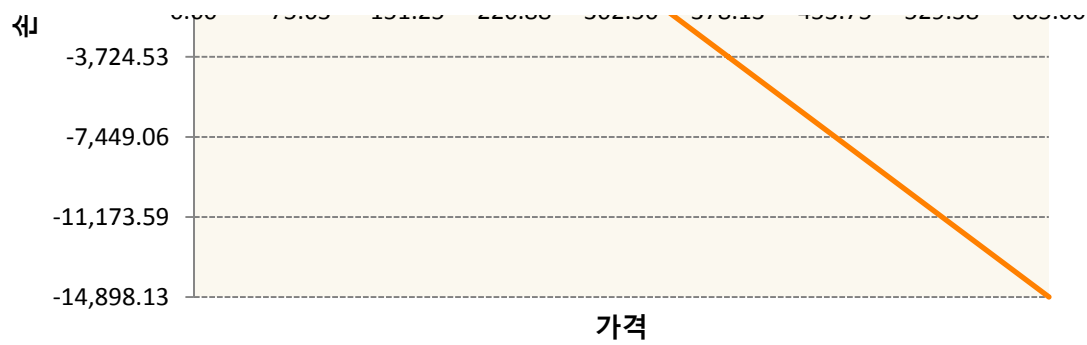
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물

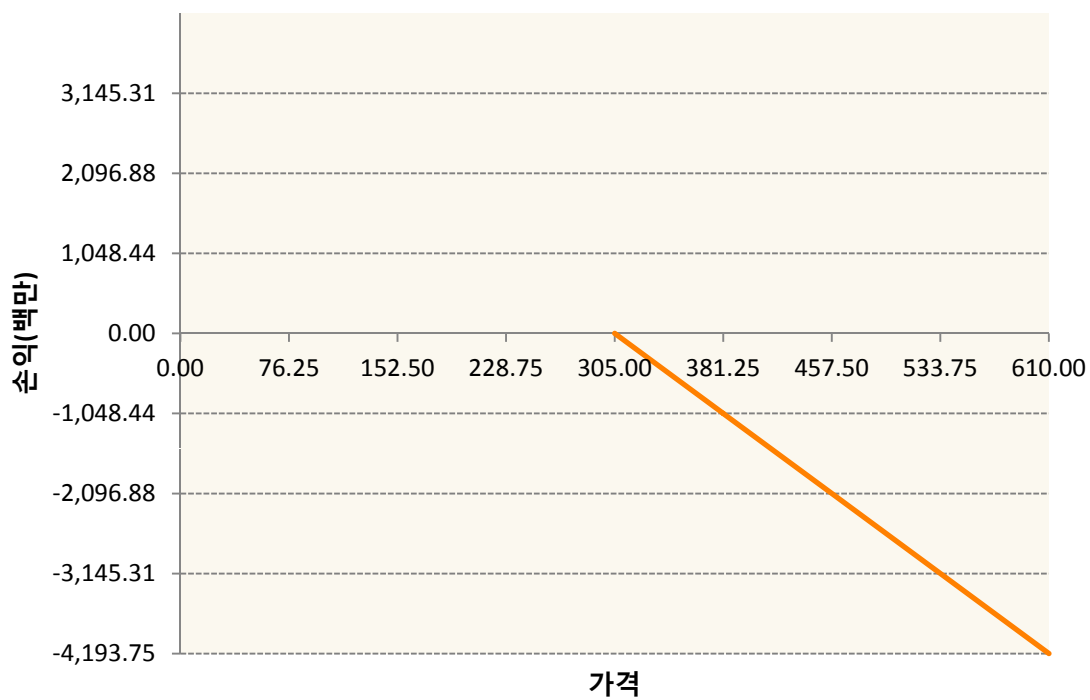


KR4201Q73029-2020-07 콜302.5

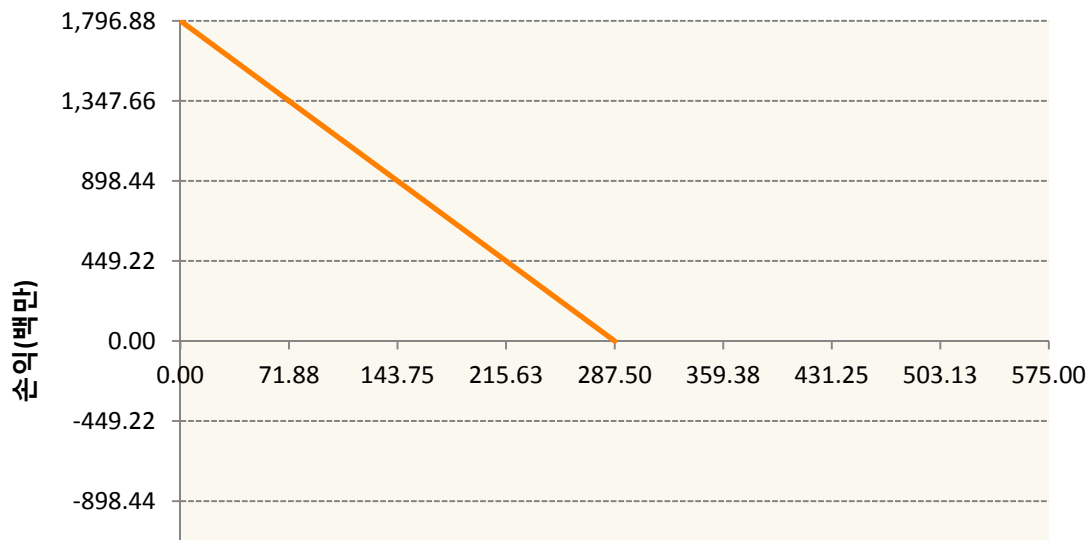


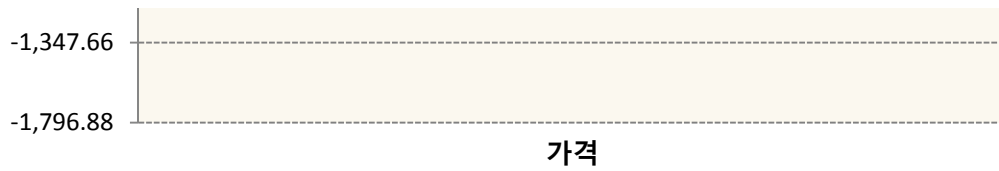
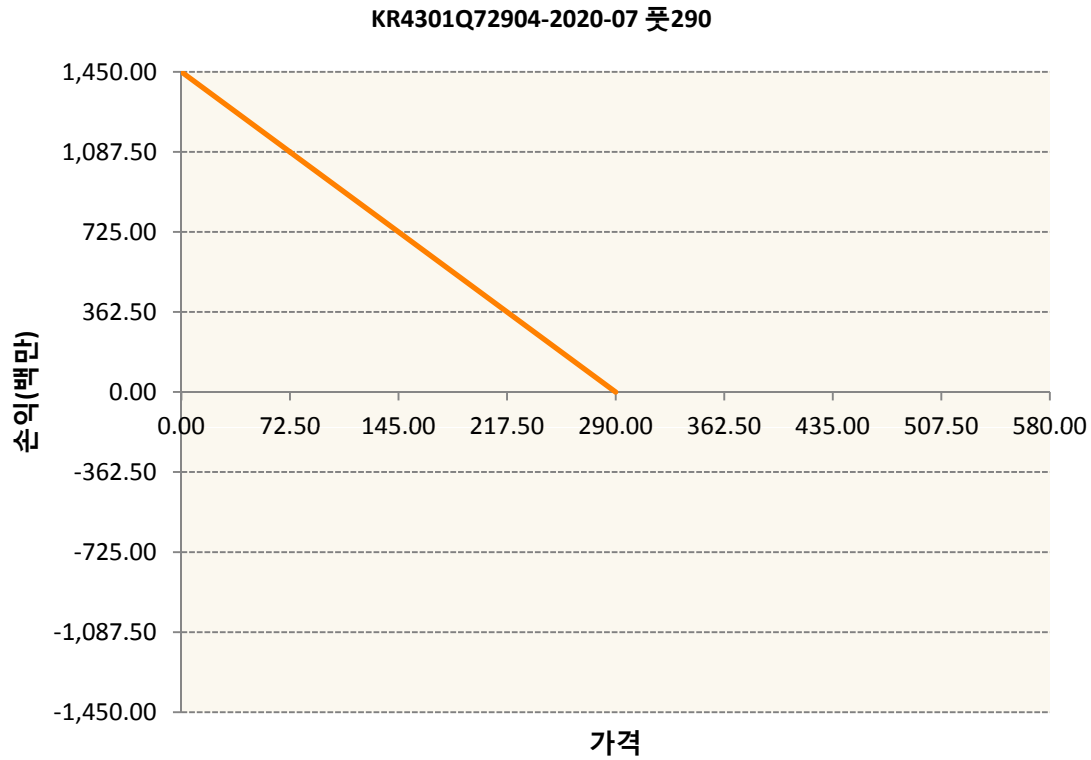


KR4201Q73052-2020-07 콜305



KR4301Q72870-2020-07 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q90009 2020-09 코스피200지수선물 785							
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-785	-785	-785	-785	-785	-785	-785
-5.33%	-523	-523	-523	-523	-523	-523	-523
-2.67%	-262	-262	-262	-262	-262	-262	-262
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	262	262	262	262	262	262	262
5.33%	523	523	523	523	523	523	523
8.00%	785	785	785	785	785	785	785
KR4201Q73029 2020-07 콜302.5 443							
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	62	62	61	60	57	54	49
-5.33%	61	60	57	53	48	41	32
-2.67%	57	52	45	36	26	13	-1

0%	42	30	16	0	-18	-37	-58
2.67%	0	-21	-44	-68	-93	-120	-147
5.33%	-88	-118	-149	-179	-211	-242	-274
8.00%	-242	-275	-309	-342	-376	-409	-443
KR4201Q73052 2020-07 콜305							111
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	14	14	13	13	13	12	11
-5.33%	13	13	13	12	11	9	7
-2.67%	13	12	10	8	6	3	-1
0%	10	7	4	0	-4	-9	-15
2.67%	1	-4	-10	-16	-22	-29	-36
5.33%	-19	-27	-35	-43	-51	-60	-68
8.00%	-55	-65	-74	-83	-93	-102	-111
KR4301Q72870 2020-07 풋287.5							127
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	126	126	126	126	127	127	127
-5.33%	80	80	80	81	81	82	83
-2.67%	34	35	36	37	39	40	42
0%	-6	-4	-2	0	2	5	7
2.67%	-36	-33	-31	-28	-25	-23	-20
5.33%	-52	-50	-48	-46	-43	-41	-39
8.00%	-58	-57	-56	-54	-53	-51	-50
KR4301Q72904 2020-07 풋290							104
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	104	104	104	104	104	104	104
-5.33%	67	67	67	67	68	68	68
-2.67%	30	30	31	32	33	34	35
0%	-4	-3	-2	0	2	3	5
2.67%	-31	-29	-27	-25	-23	-21	-19
5.33%	-48	-46	-44	-42	-40	-38	-36
8.00%	-55	-54	-52	-51	-50	-48	-47

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

(단위:백만원)

1,799

공시일	2020-07-02
기준일	2020-07-01

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	1,428	-1,428	
누계	유가증권	수익증권	133,067	0	133,067	

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	2020-07-02
기준일	2020-07-01

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	1,547	-1,547	
누계	유가증권	수익증권	94,781	0	94,781	

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	2020-07-02
기준일	2020-07-01

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	457,089	0	457,089	
누계	통화	선도	0	440,926	-440,926	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J03 KRW/USD 24-07-20E	2,166
FX21020J04 KRW/USD 24-07-20E	1,733
FX21020J04 KRW/USD 24-07-20E	1,925
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	2,349
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	963
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,011
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,598
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	3,370
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	6,835
FX21020M0 KRW/USD 26-08-20E	578
FX21020M01 KRW/USD 26-08-20E	4,717
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	2,002
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	2,426
FX21020M05 KRW/USD 22-09-20E	1,001
FX21020M05 KRW/USD 22-09-20E	2,599

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

18,191

공시일	2020-07-02
기준일	2020-07-01

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

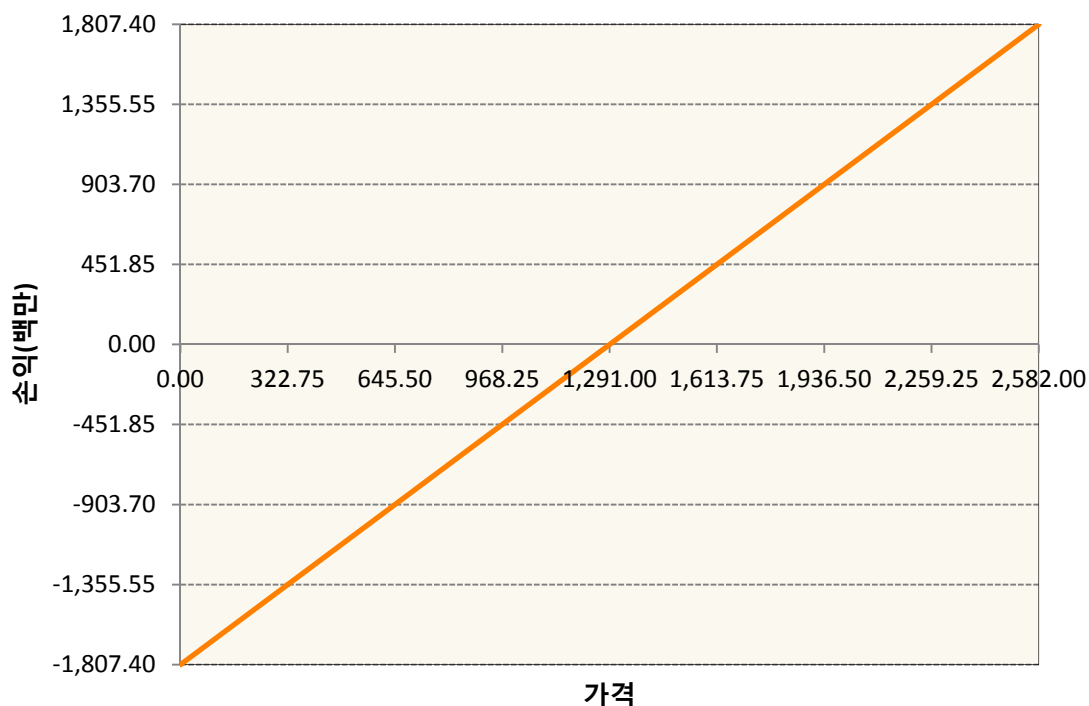
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,807	0	1,807	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	2020-07-02
기준일	2020-07-01

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	7,534	0	7,534	
누계	통화	선도	0	7,473	-7,473	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 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	37
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

308

공시일	2020-07-02
기준일	2020-07-01

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

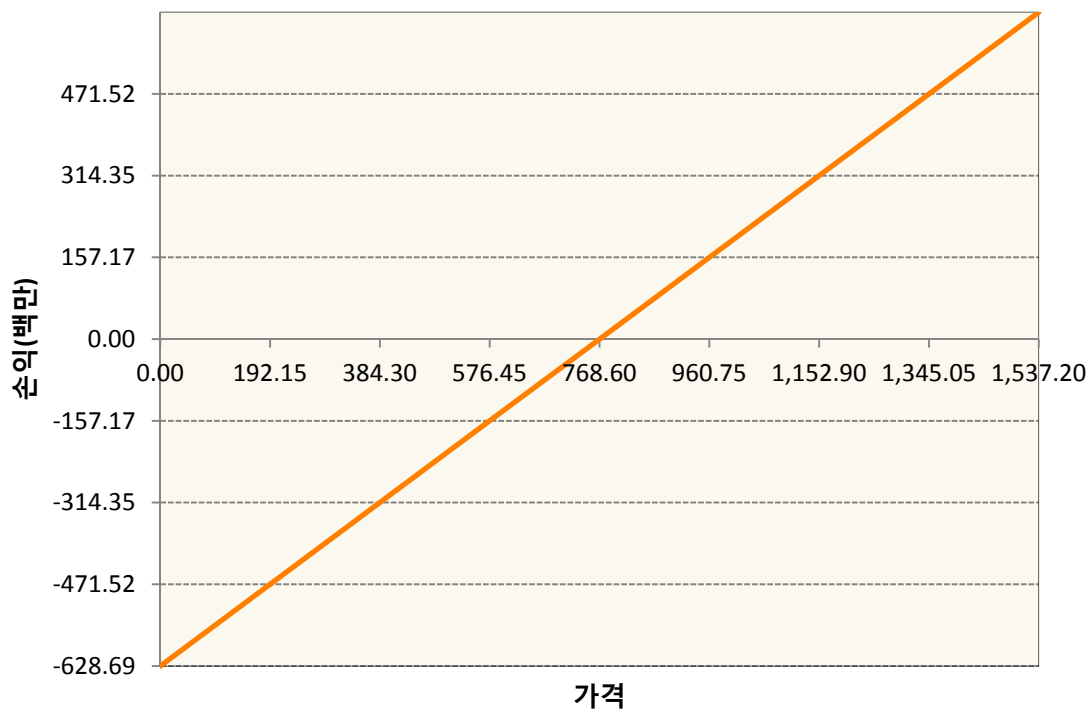
1. 계약금액

(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	629	0	629	
누계	유가증권	스왑	980	0	980	장외
누계	통화	선도	95	676	-581	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCN0-VN30 Index Future Jul20



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
FX21020N00 EUR/KRW 28-08-20E
VNCN0 VN30 Index Future Jul20

5
9
22
8
50

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

(단위:백만원)

158

공시일	2020-07-02
기준일	2020-07-01

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

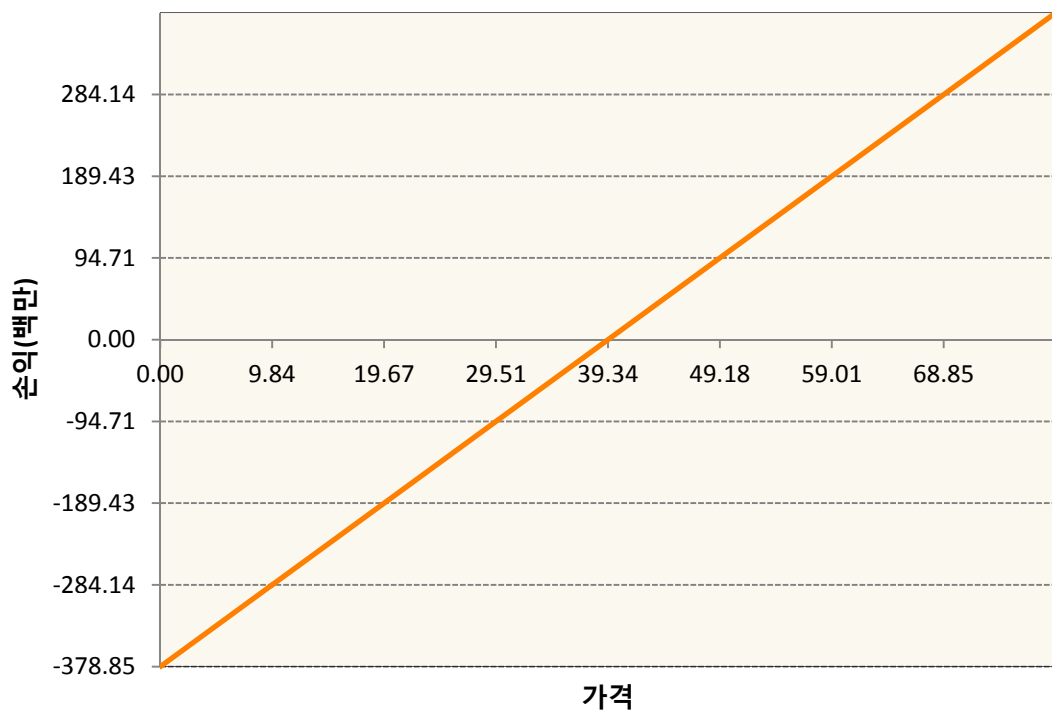
1. 계약금액

(단위:백만원)

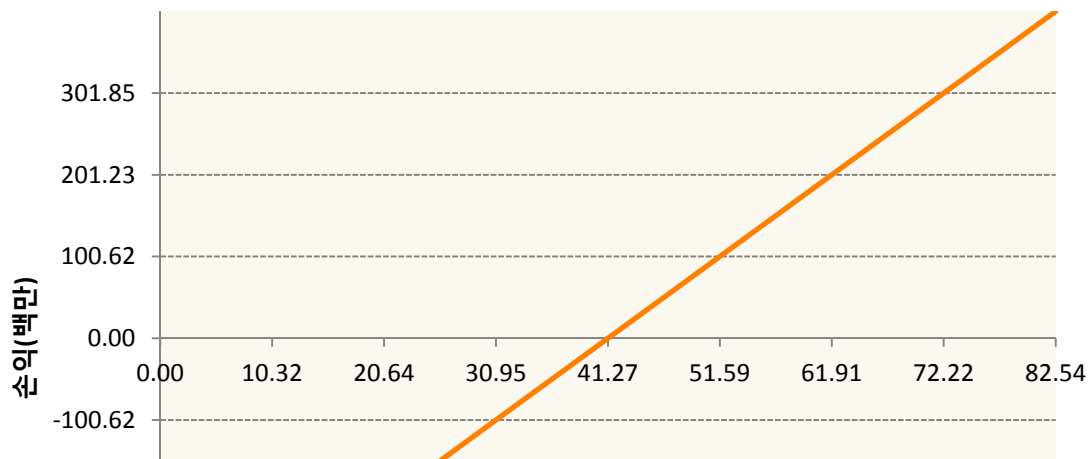
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,859	361	1,498	

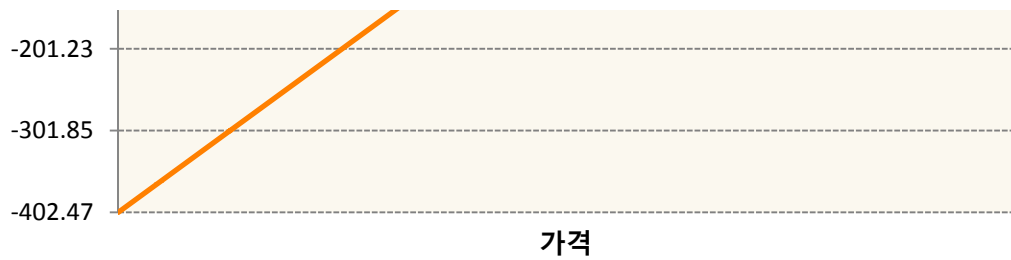
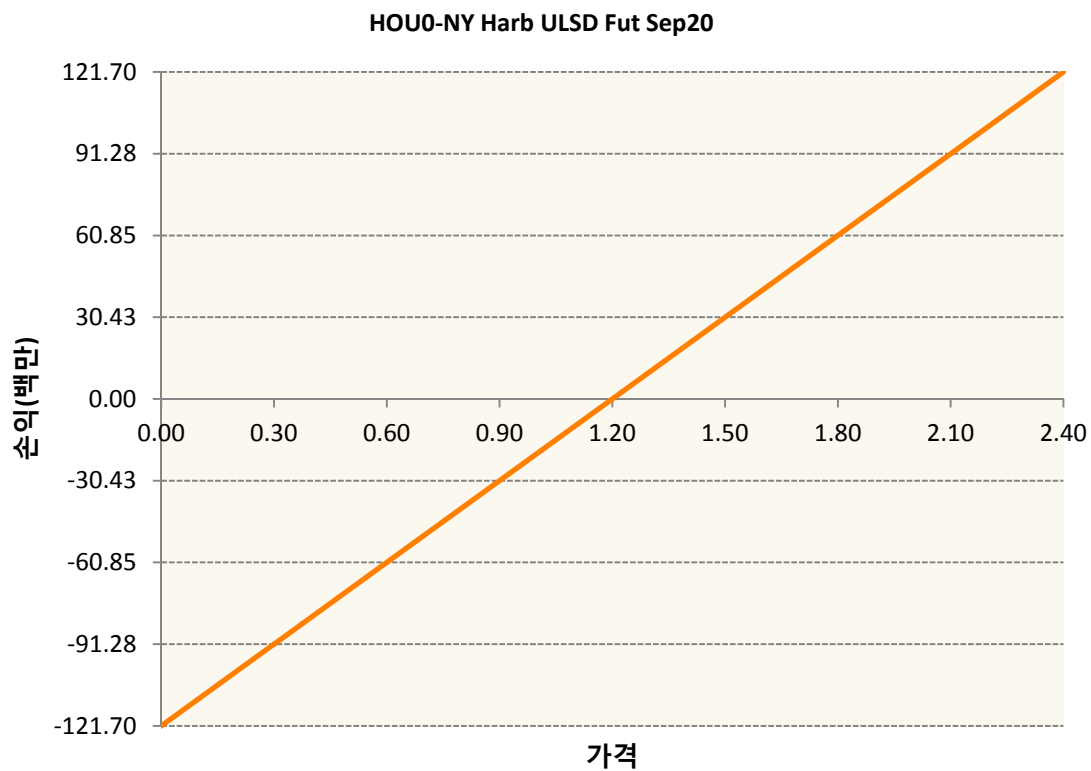
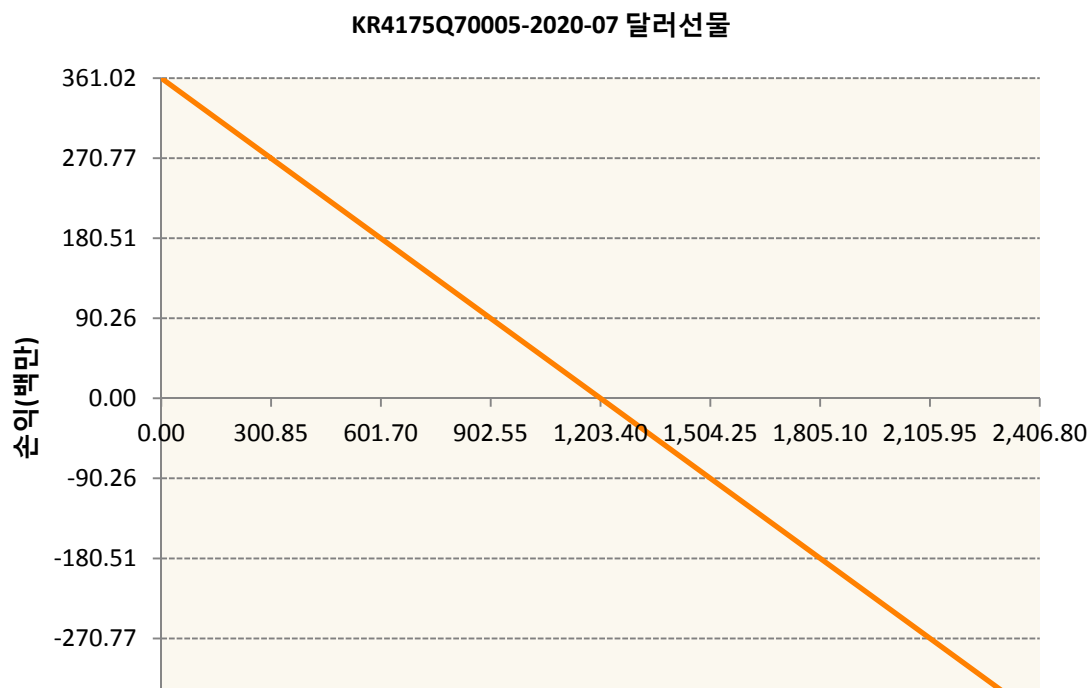
2. 만기시점의 손익구조

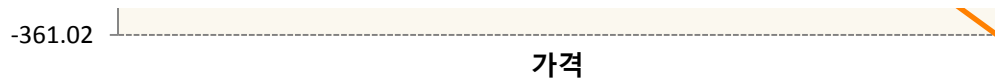
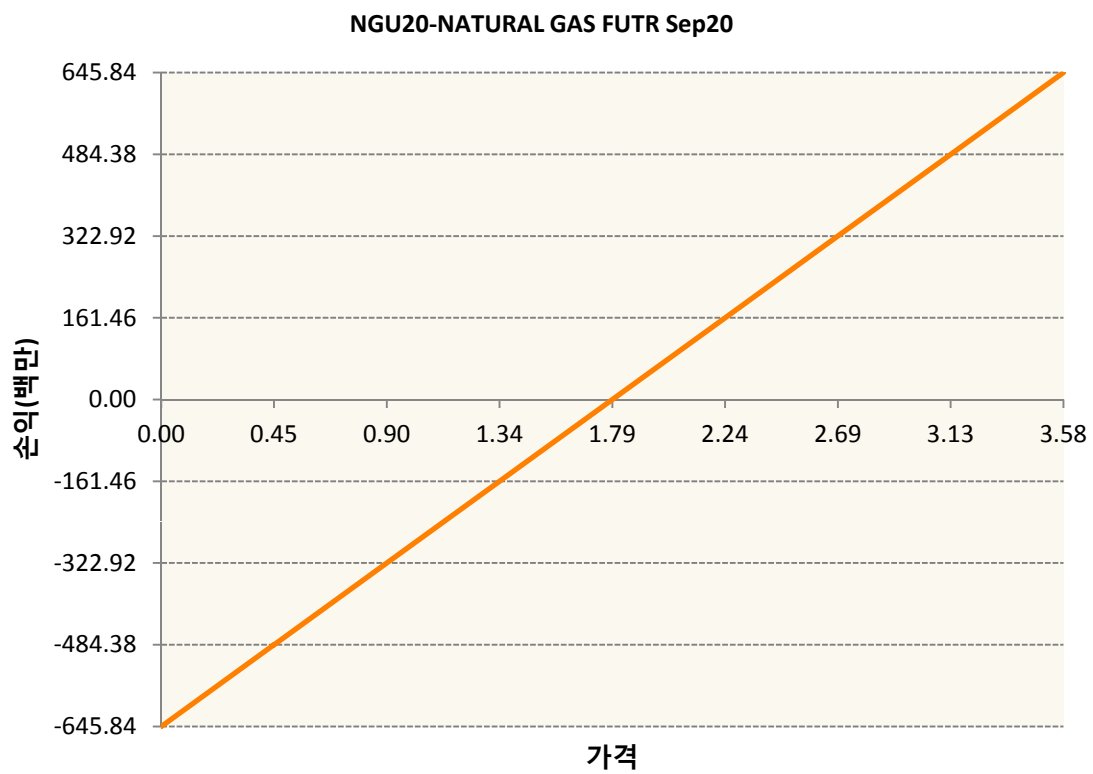
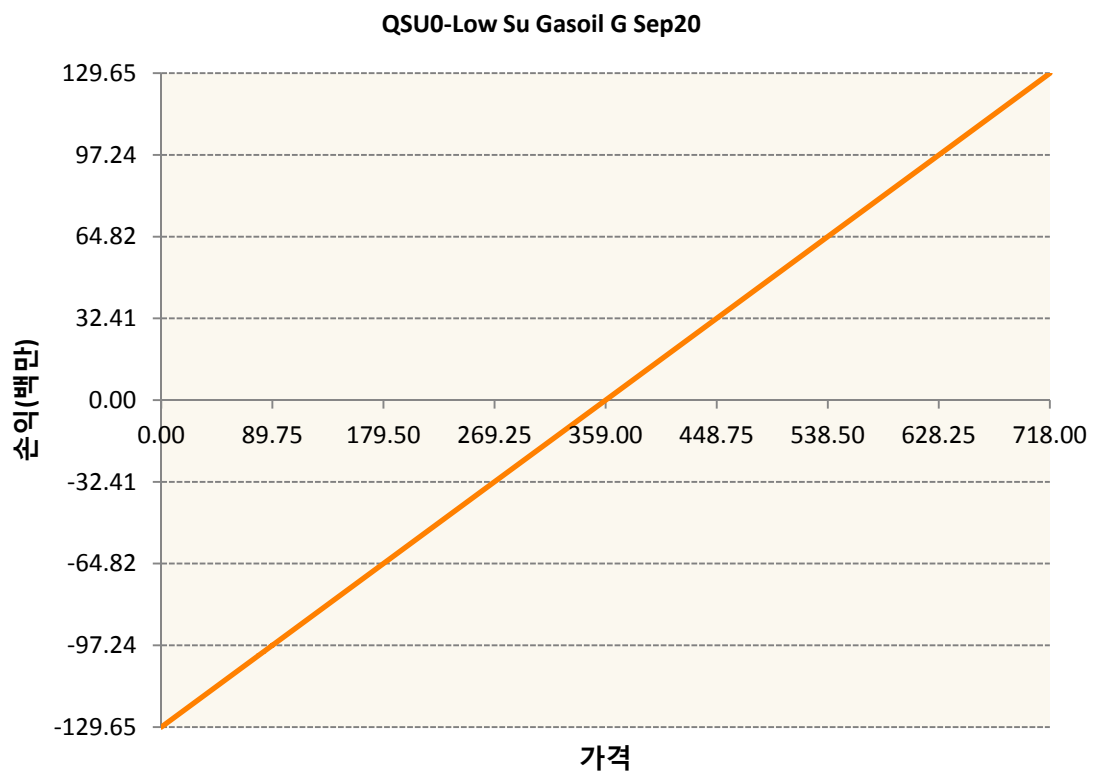
CLU0-WTI CRUDE FUTURE Sep20

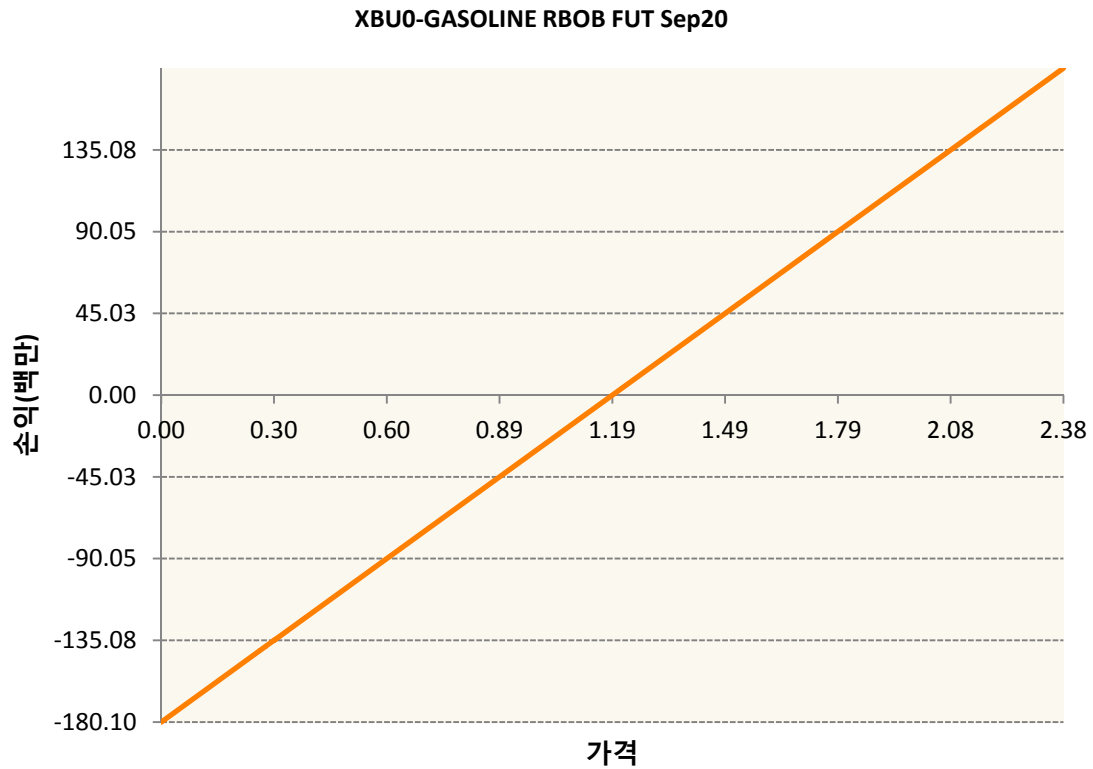


COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLU0	WTI CRUDE FUTURE Sep20		30
COU0	BRENT CRUDE FUTR Sep20		32
HOU0	NY Harb ULSD Fut Sep20		10
KR4175Q70C 2020-07 달러선물			29
NGU20	NATURAL GAS FUTR Sep20		52
QSU0	Low Su Gasoil G Sep20		10
XBU0	GASOLINE RBOB FUT Sep20		14

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	905

공시일	2020-07-02
기준일	2020-07-01

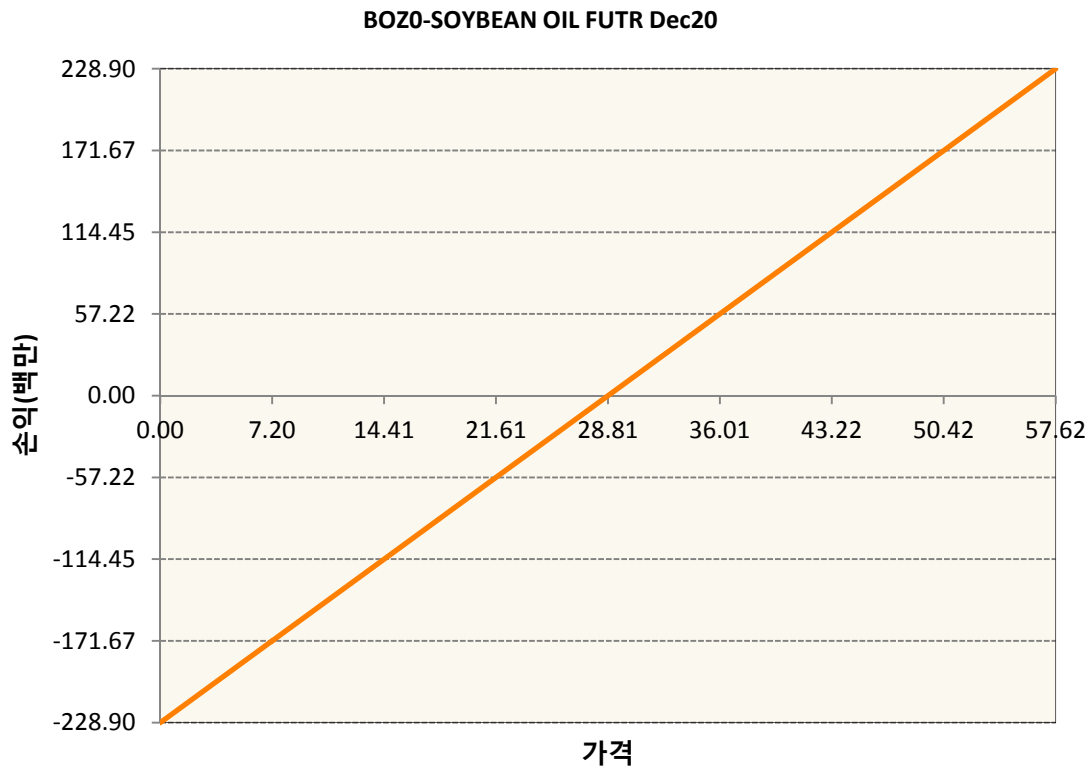
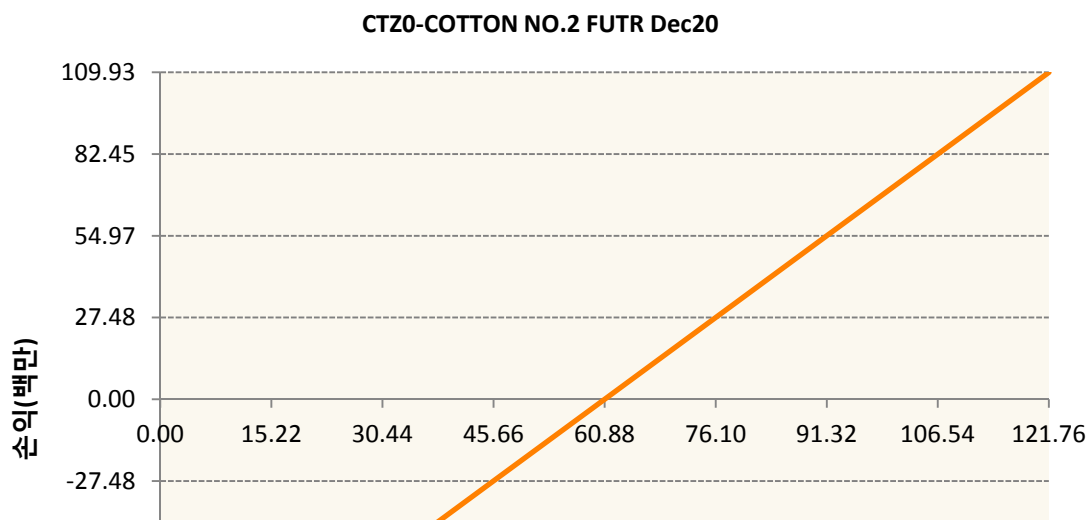
애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

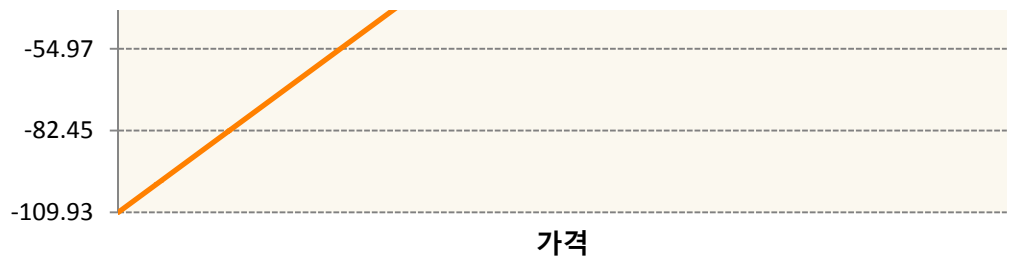
1. 계약금액

(단위:백만원)

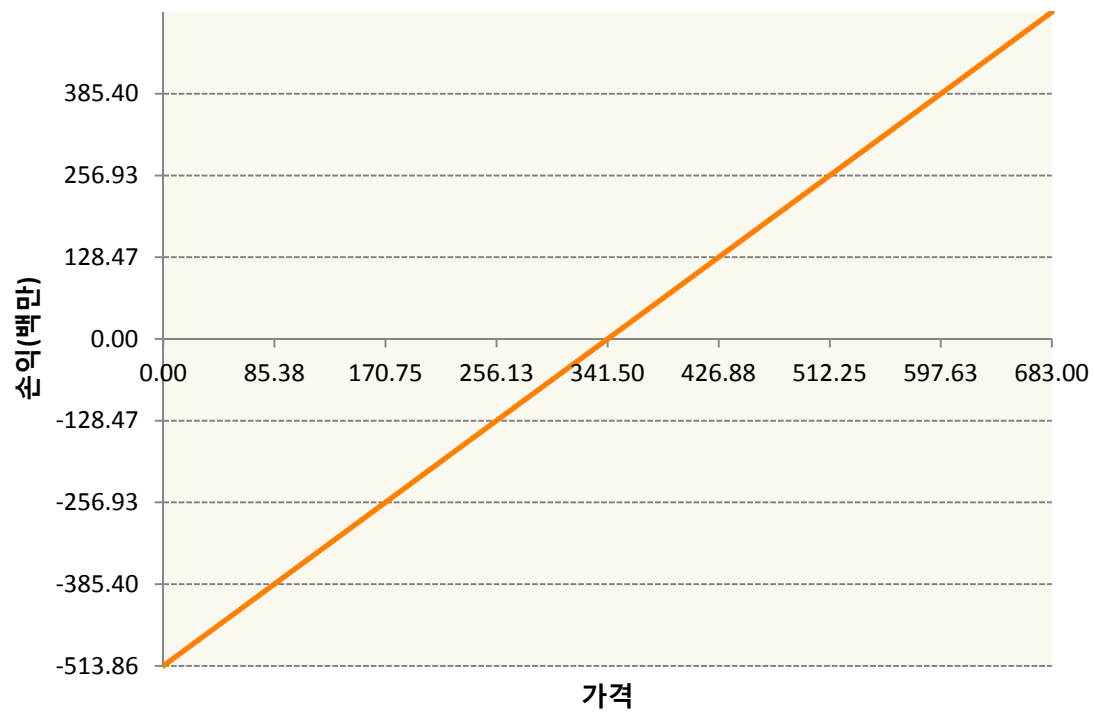
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,589	72	2,516	

2. 만기시점의 손익구조

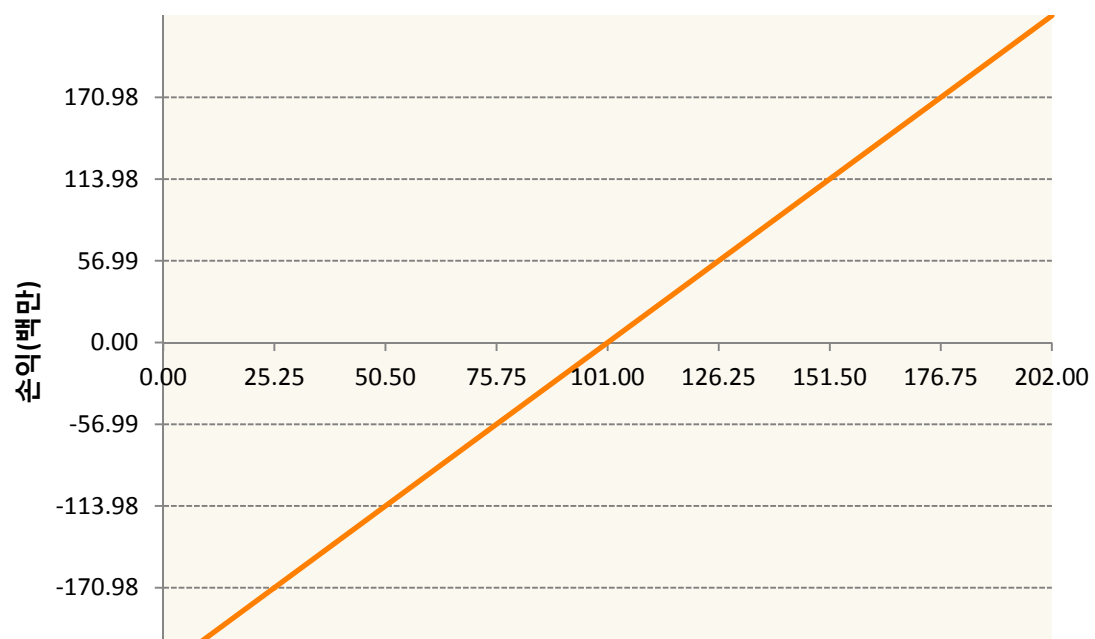


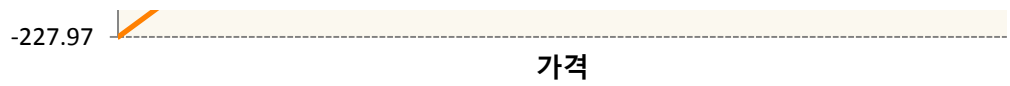
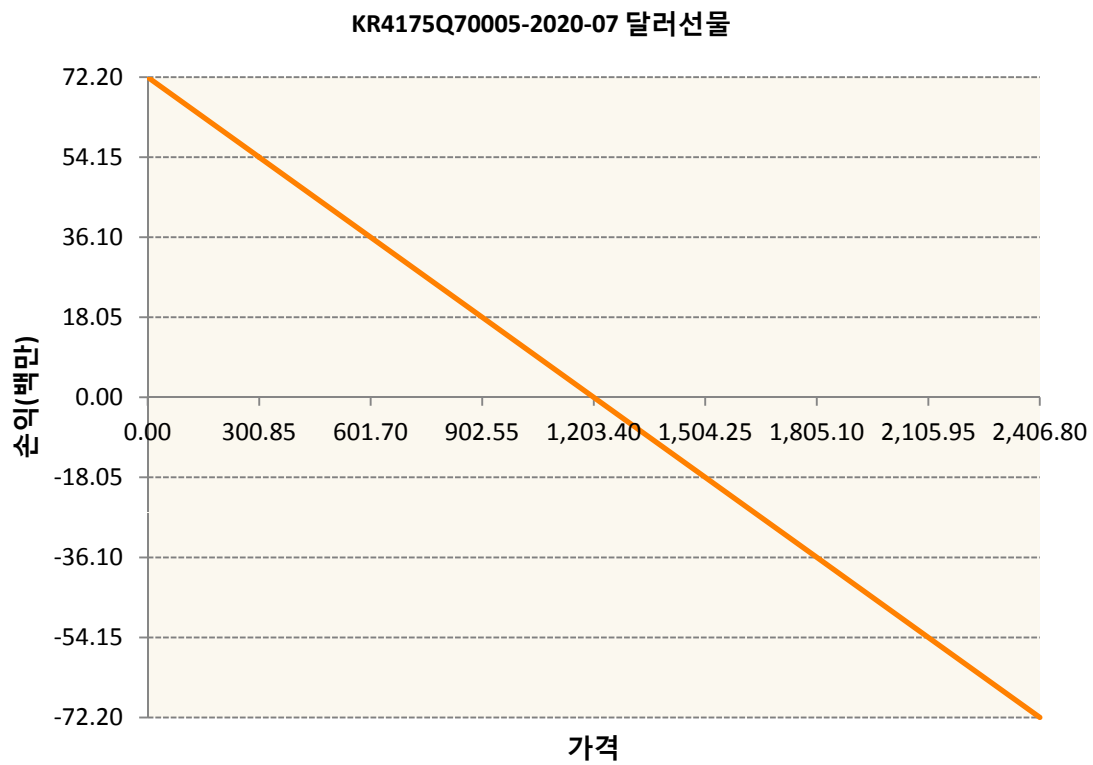
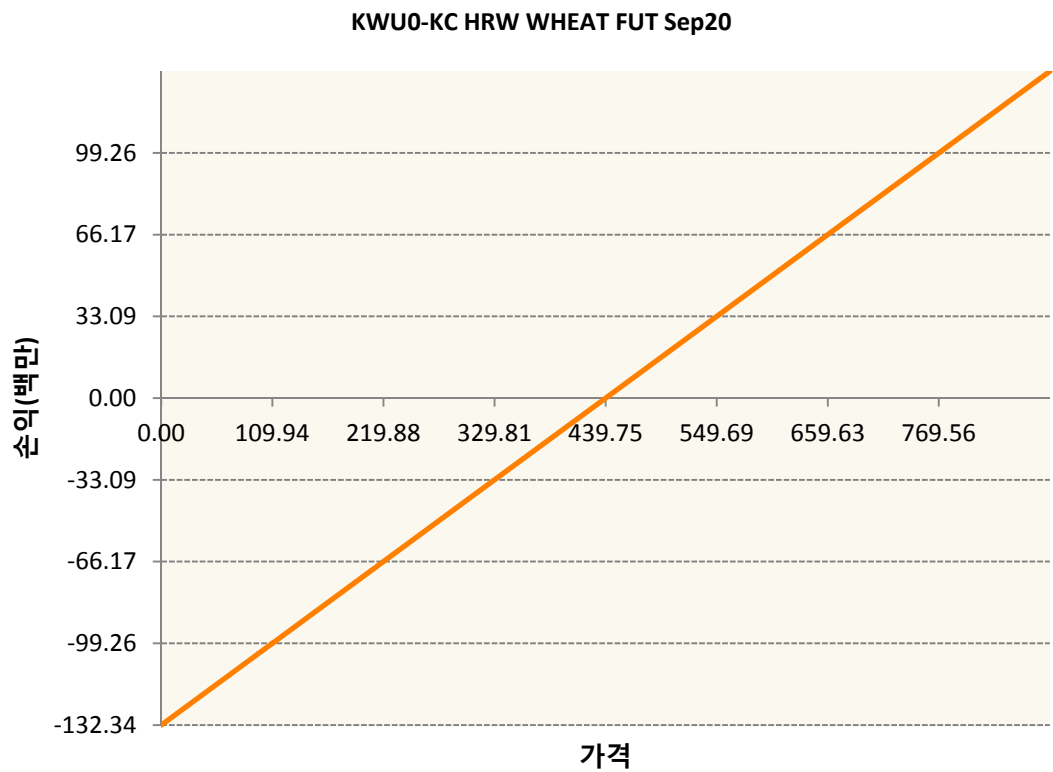


CU0-CORN FUTURE Sep20

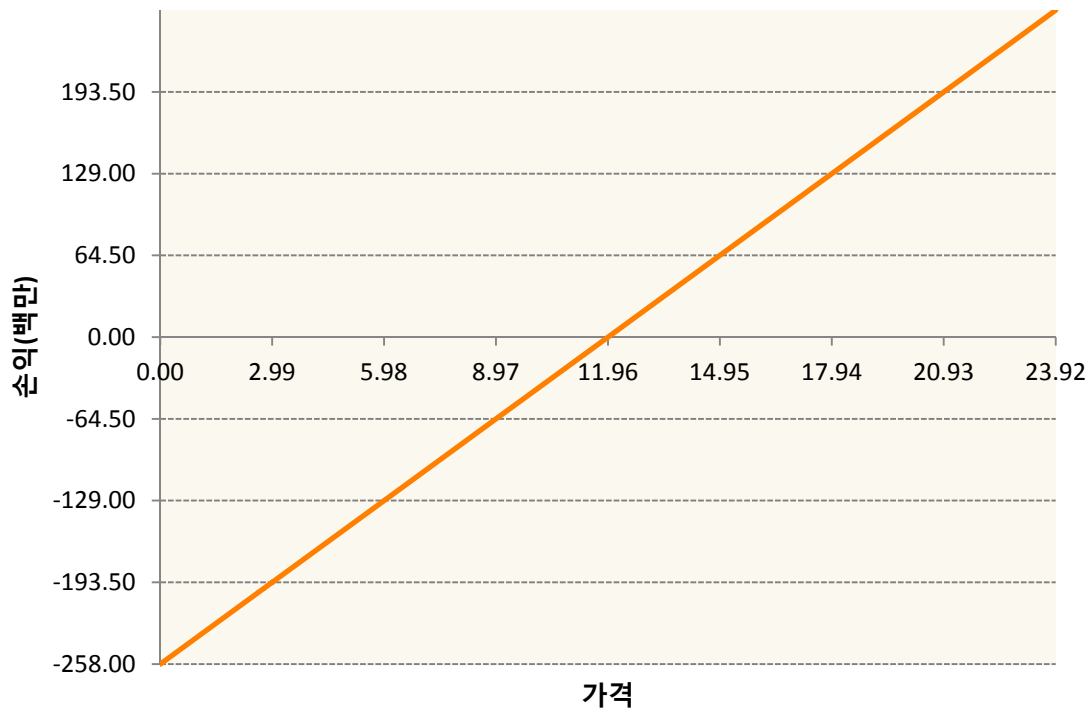


KCU0-COFFEE 'C' FUTURE Sep20

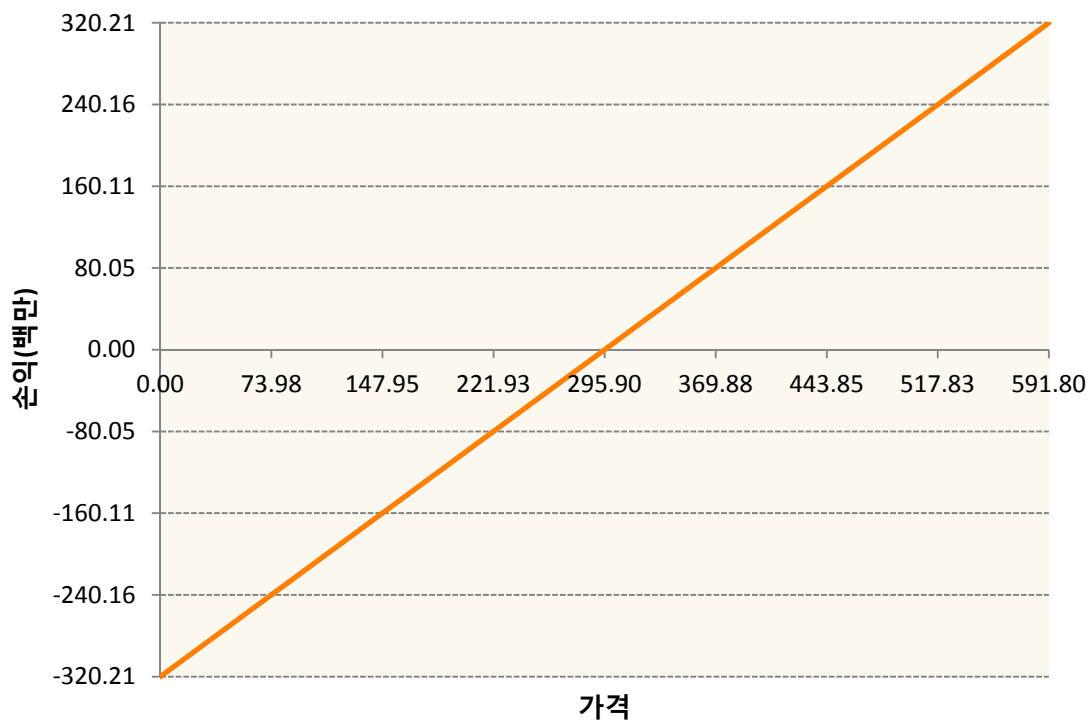




SBV0-Sugar Oct20

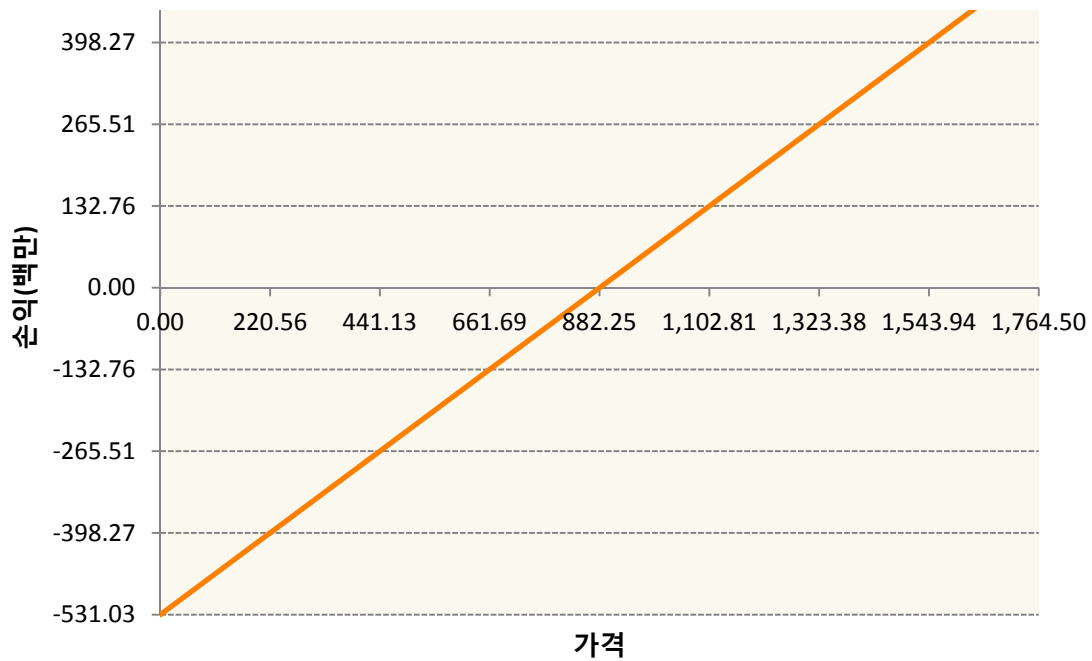


SMZ0-SOYBEAN MEAL FUTR Dec20

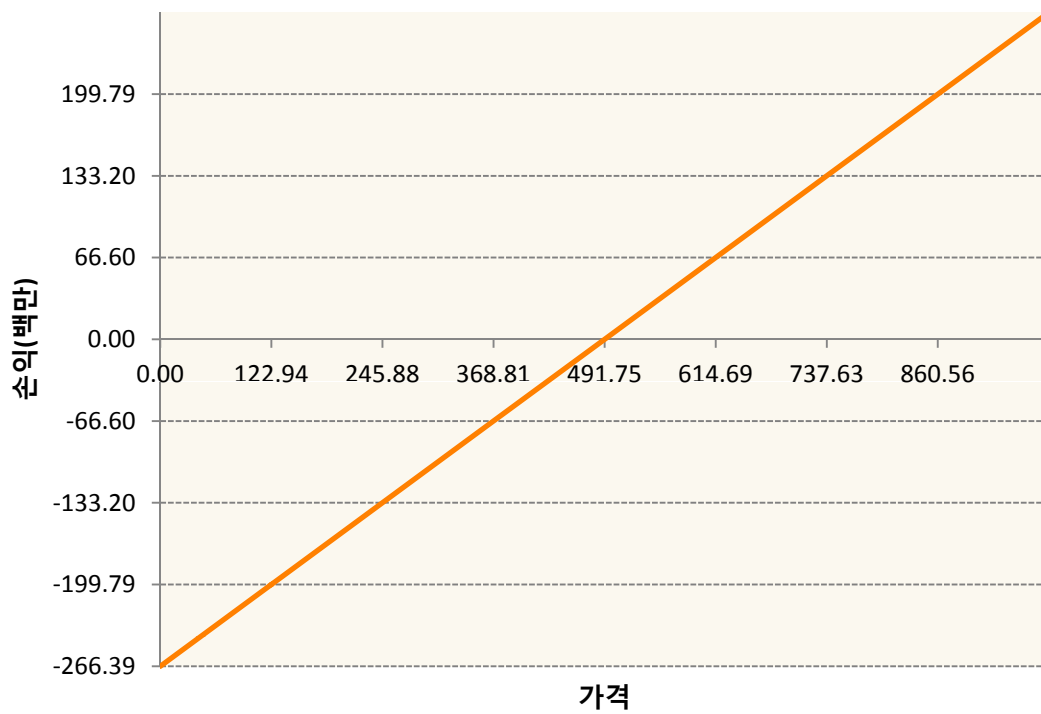


SX0-SOYBEAN FUTURE Nov20





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	41
KCU0	COFFEE 'C' FUTURE Sep20	18
KR4175Q70C 2020-07 달러선물		6

KWU0	KC HRW WHEAT FUT Sep20	11
SBV0	Sugar Oct20	21
SMZ0	SOYBEAN MEAL FUTR Dec20	26
SX0	SOYBEAN FUTURE Nov20	42
WU0	WHEAT FUTURE(CBT) Sep20	21

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

(단위:백만원)

243