

공시일	2020-07-06
기준일	2020-07-03

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	2020-07-06
기준일	2020-07-03

스마트인덱스모

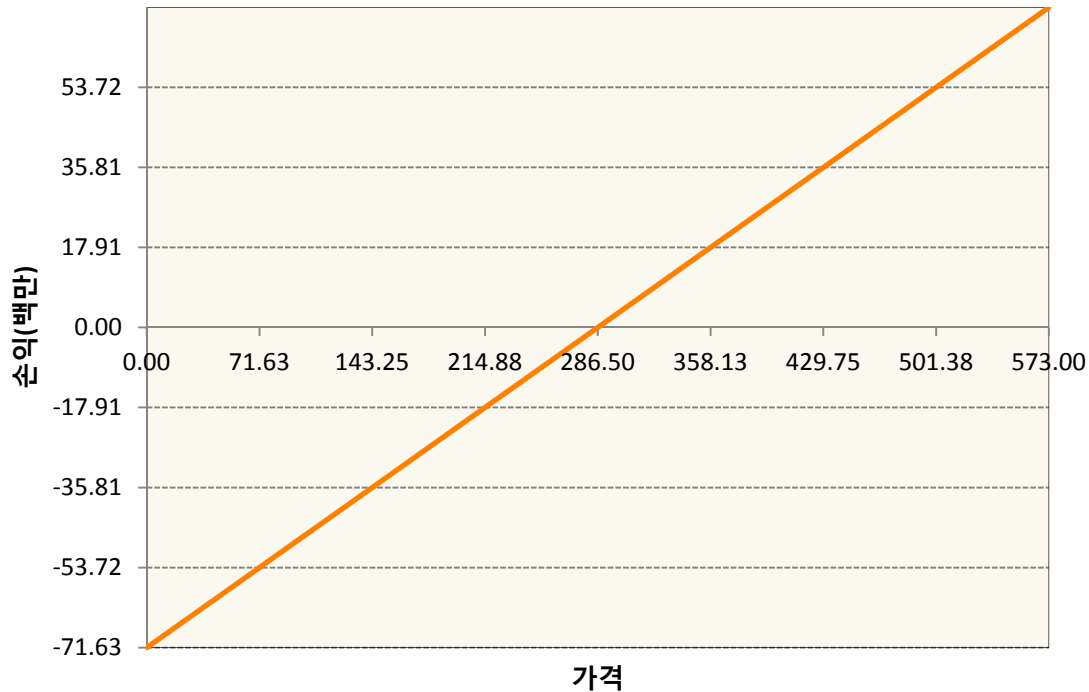
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009				2020-09 코스피200지수선물				6
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6	
-5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4	
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	2	2	2	2	2	2	2	
5.33%	4	4	4	4	4	4	4	
8.00%	6	6	6	6	6	6	6	

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

(단위:백만원)

9

공시일	2020-07-06
기준일	2020-07-03

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

1,074

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,292

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-07-06
기준일	2020-07-03

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

635

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

914

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-07-06
기준일	2020-07-03

유로인덱스모(주식-파생형)

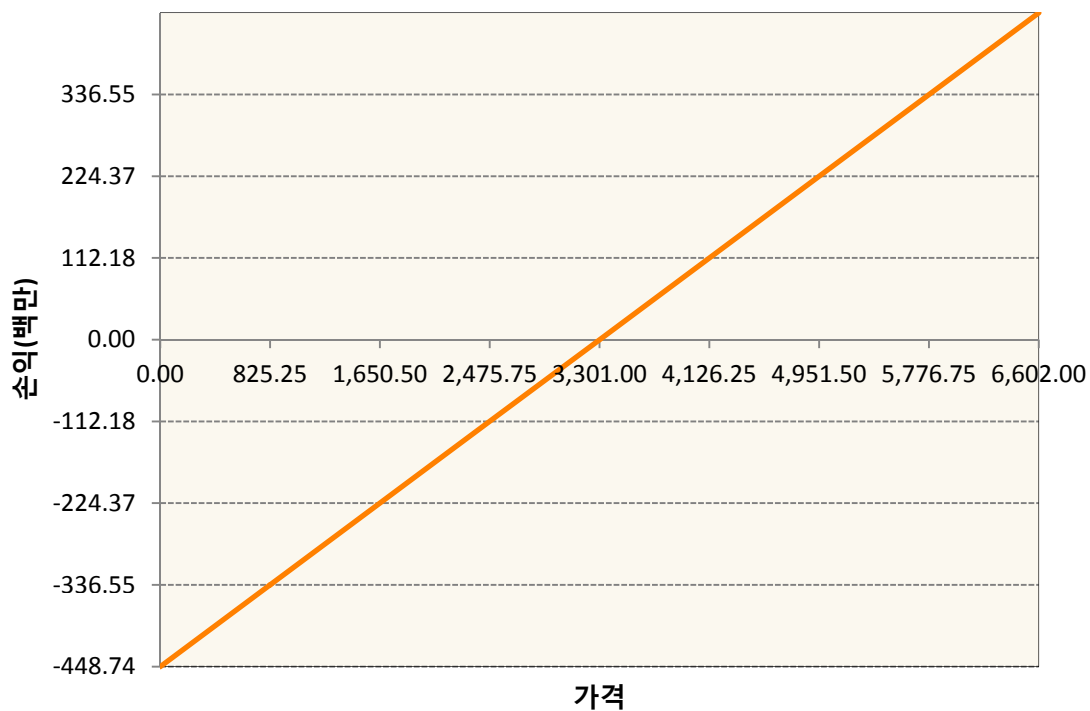
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	449	0	449	

2. 만기시점의 손익구조

VGU0-EURO STOXX 50 Sep20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU0 EURO STOXX 50 Sep20

36

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

(단위:백만원)

49

공시일	2020-07-06
기준일	2020-07-03

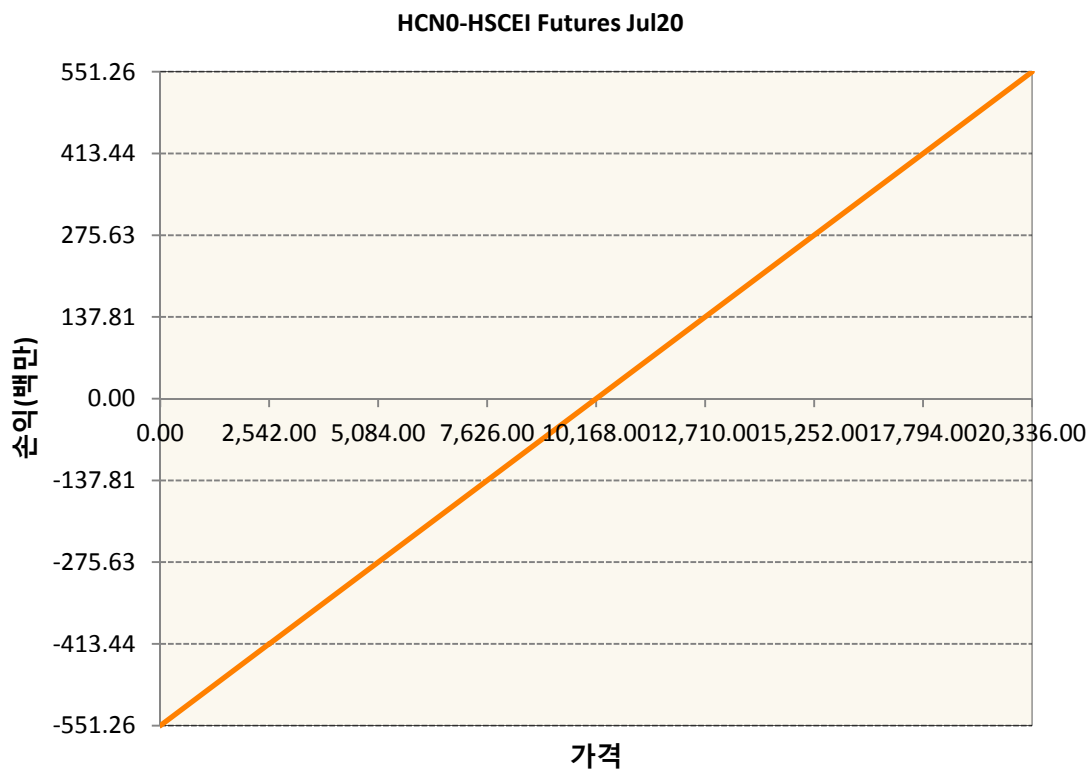
차이나인덱스모(주식-파생형)

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



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN0	HSCEI Futures Jul20	44
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

48

공시일	2020-07-06
기준일	2020-07-03

커버드콜모(주식혼합-파생형)

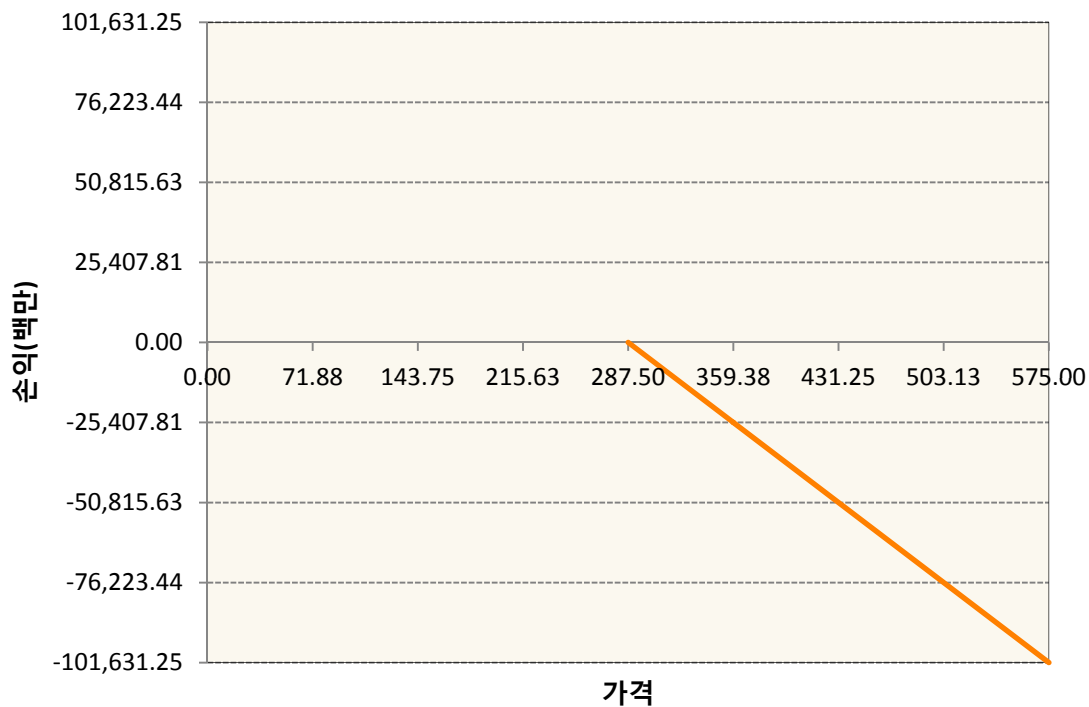
1. 계약금액

(단위:백만원)

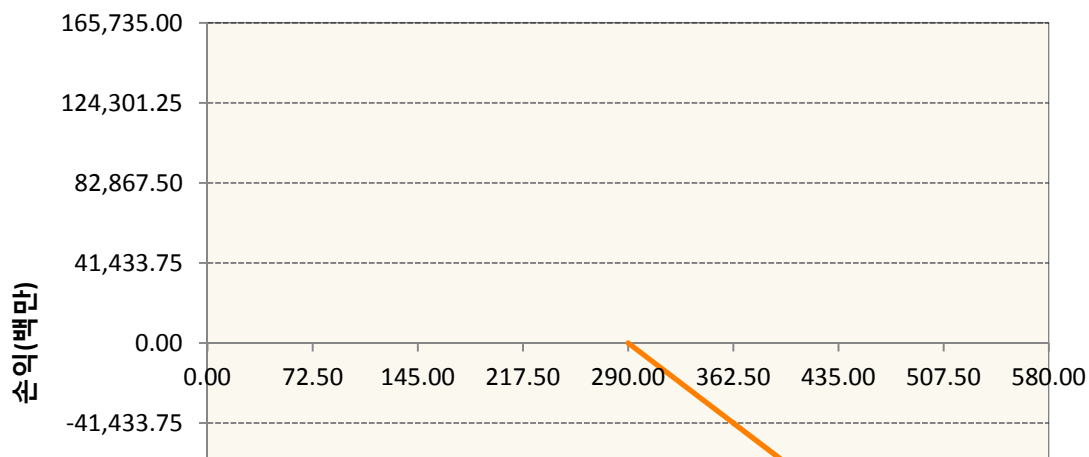
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	367,991	-367,991	장내

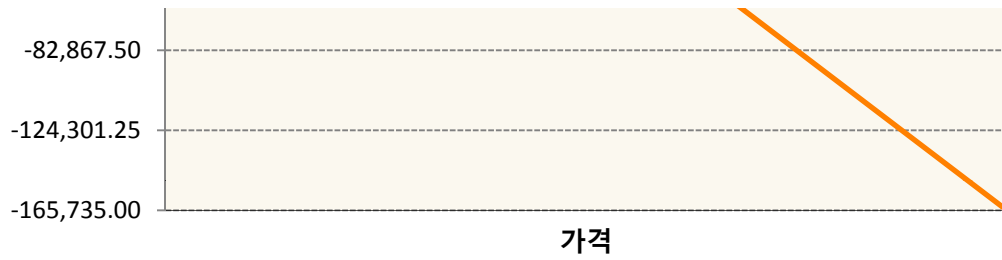
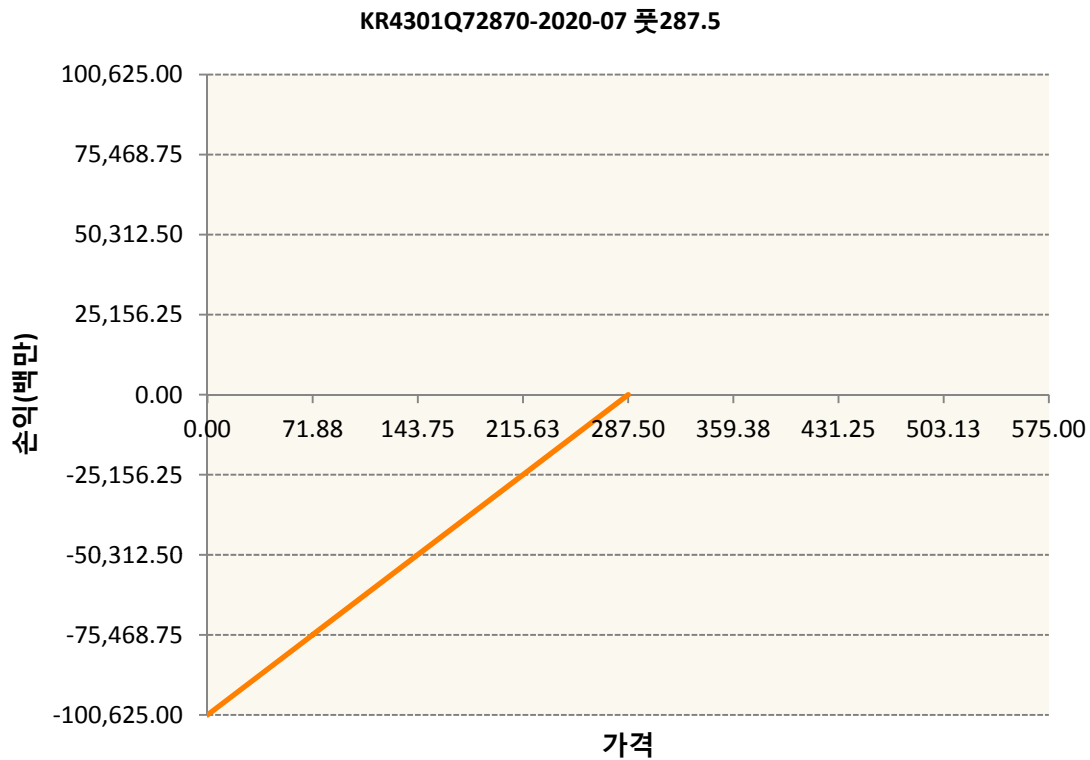
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q72872-2020-07 콜287.5



KR4201Q72906-2020-07 콜290





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q72872			2020-07 콜287.5				6,104
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,964	1,939	1,904	1,858	1,801	1,734	1,658
-5.33%	1,849	1,776	1,690	1,592	1,485	1,368	1,245
-2.67%	1,464	1,322	1,172	1,017	858	694	528
0%	564	376	188	0	-188	-377	-566
2.67%	-989	-1,162	-1,338	-1,516	-1,697	-1,879	-2,062
5.33%	-3,112	-3,226	-3,351	-3,486	-3,628	-3,777	-3,931
8.00%	-5,585	-5,640	-5,710	-5,792	-5,886	-5,991	-6,104
KR4201Q72906			2020-07 콜290				9,294
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,597	2,571	2,530	2,473	2,400	2,311	2,207

-5.33%	2,478	2,389	2,278	2,148	1,999	1,835	1,657
-2.67%	2,033	1,837	1,624	1,399	1,163	919	667
0%	882	591	297	0	-298	-598	-898
2.67%	-1,279	-1,580	-1,883	-2,187	-2,492	-2,798	-3,105
5.33%	-4,437	-4,658	-4,894	-5,142	-5,399	-5,664	-5,935
8.00%	-8,282	-8,402	-8,544	-8,707	-8,888	-9,084	-9,294
KR4301Q72870 2020-07 풋287.5							6,962
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,939	-6,939	-6,940	-6,942	-6,946	-6,953	-6,962
-5.33%	-4,277	-4,285	-4,298	-4,316	-4,340	-4,369	-4,404
-2.67%	-1,714	-1,764	-1,823	-1,887	-1,958	-2,032	-2,111
0%	327	219	109	0	-110	-220	-330
2.67%	1,353	1,269	1,181	1,089	995	897	798
5.33%	1,616	1,591	1,559	1,518	1,471	1,417	1,358
8.00%	1,648	1,645	1,639	1,629	1,614	1,595	1,571

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

(단위:백만원)

22,970

공시일	2020-07-06
기준일	2020-07-03

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

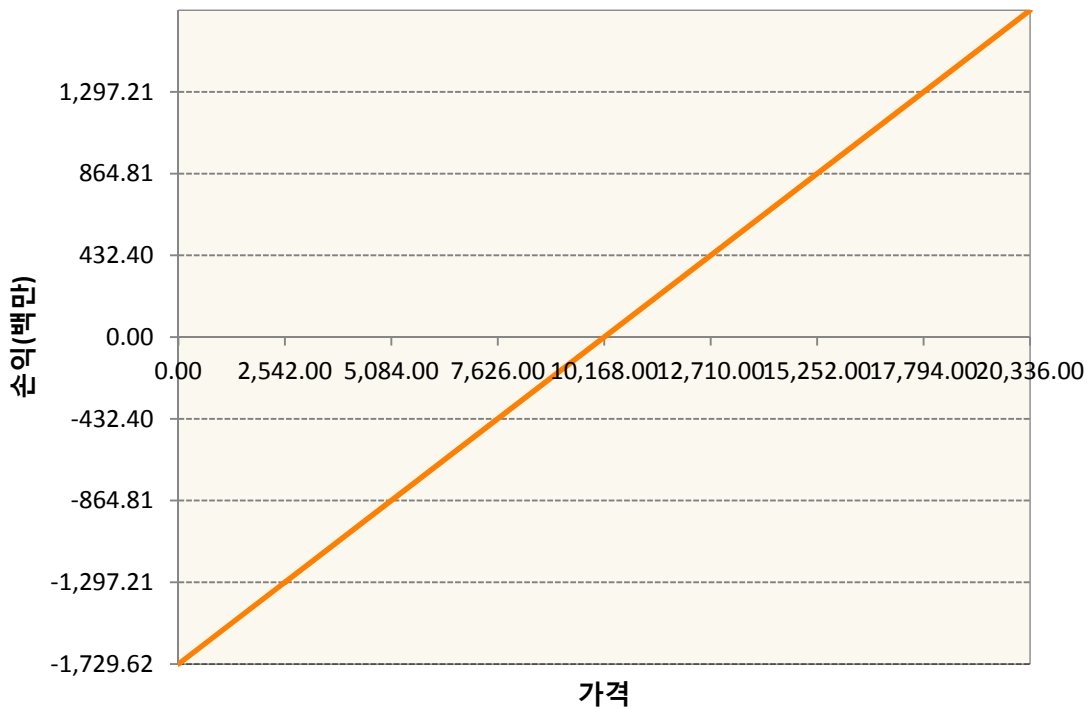
1. 계약금액

(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	1,730	0	1,730	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,377	-4,377	장내
누계	통화	선도	0	1,497	-1,497	장외

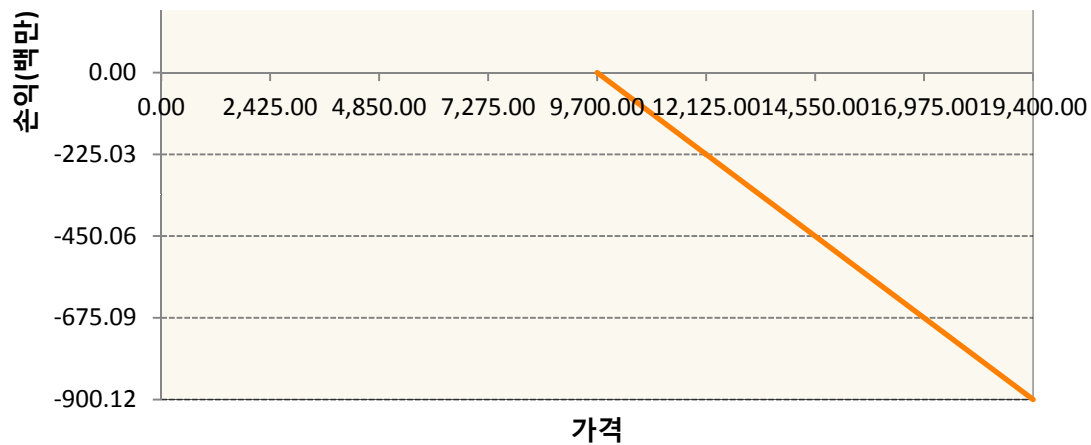
2. 만기시점의 손익구조

HCN0-HSCEI Futures Jul20

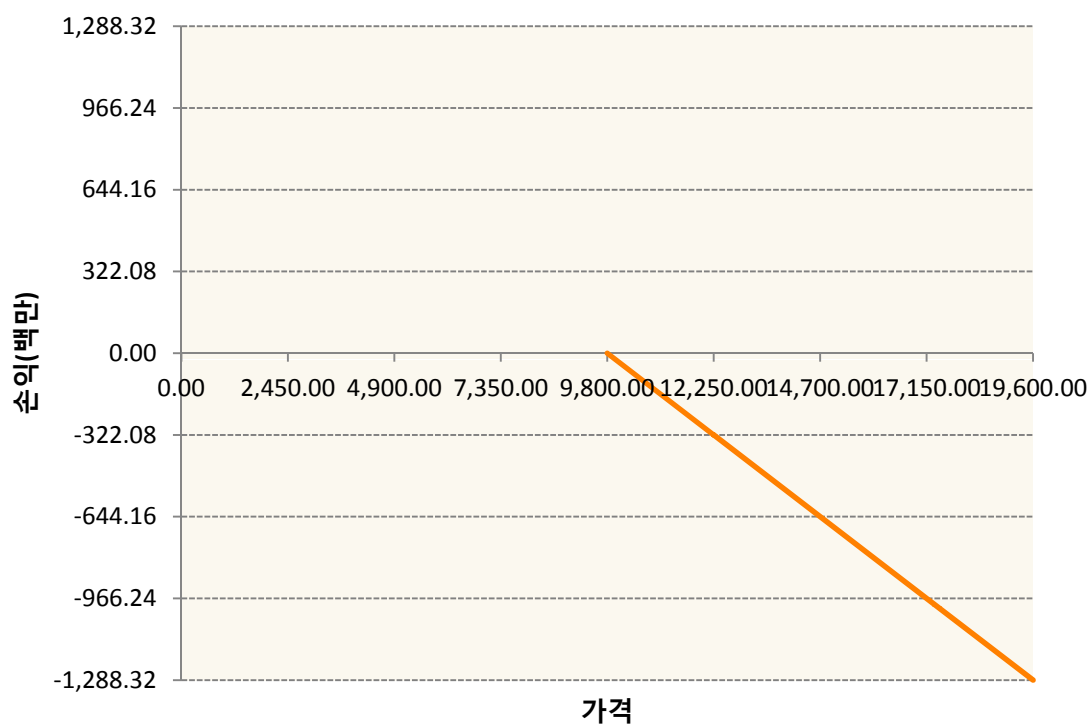


OHHIN0-C97-HSCEI

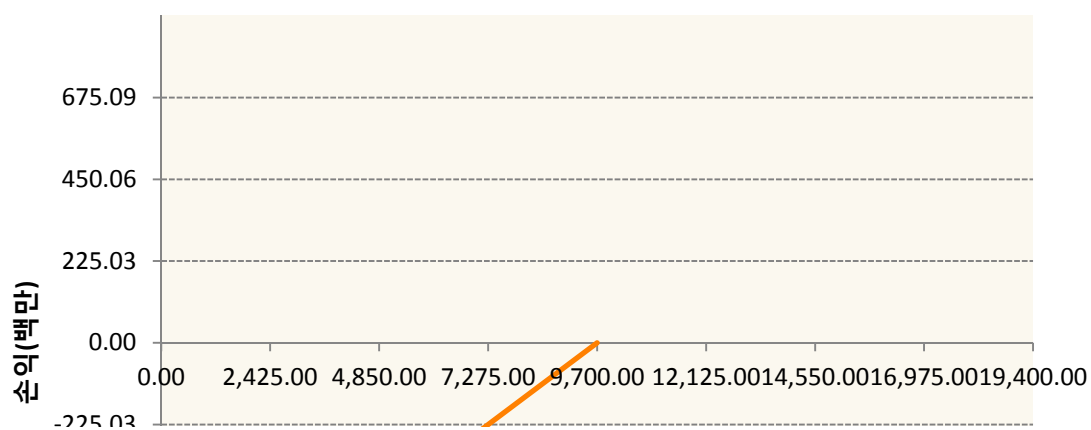


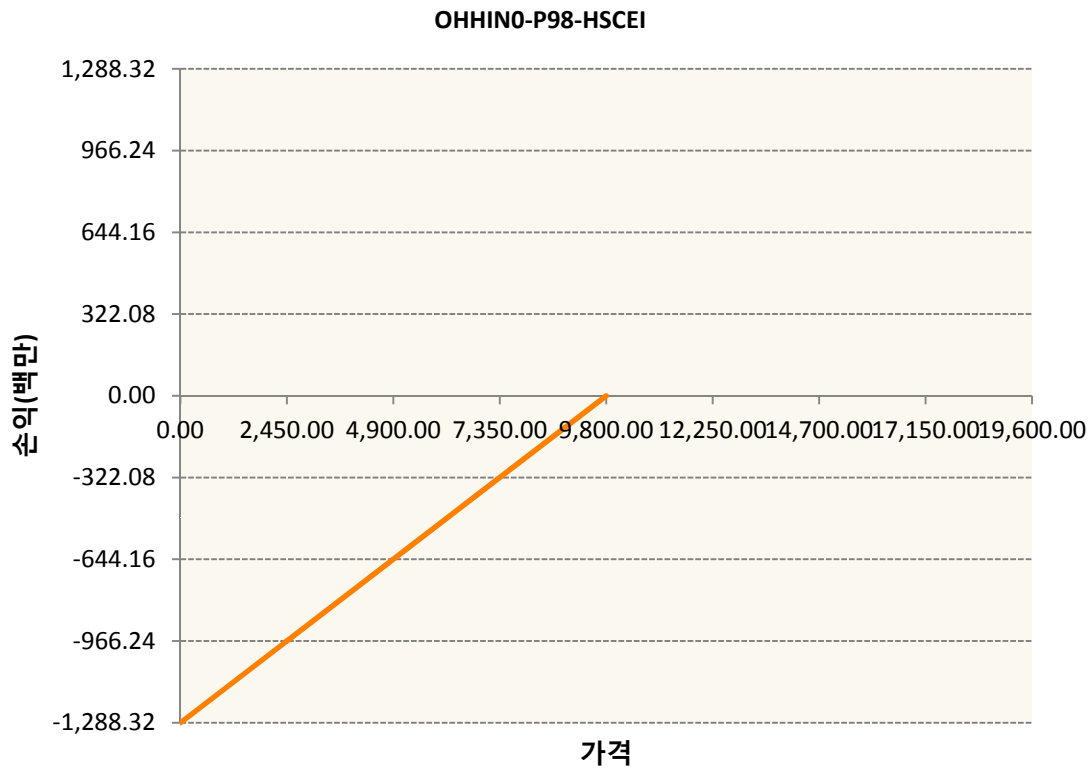


OHHIN0-C98-HSCEI



OHHIN0-P97-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E		120
HCN0 HSCEI Futures Jul20		138
OHHIN0-C9 HSCEI		72
OHHIN0-C9 HSCEI		103
OHHIN0-P9 HSCEI		72
OHHIN0-P9 HSCEI		103

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	595

공시일	2020-07-06
기준일	2020-07-03

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

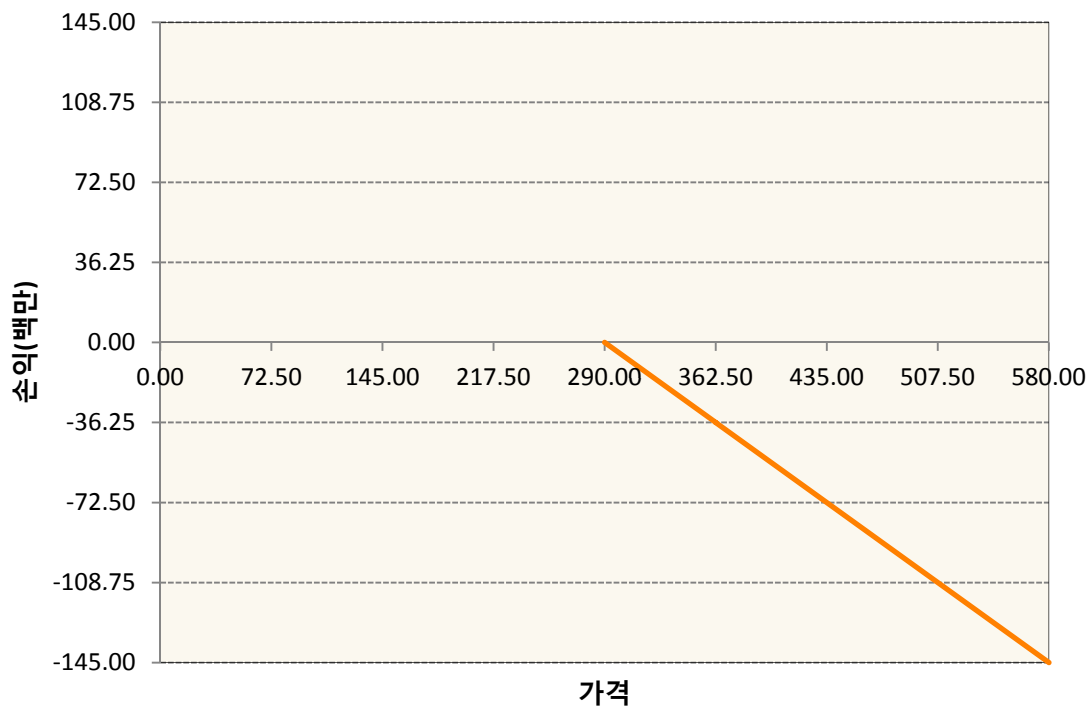
1. 계약금액

(단위:백만원)

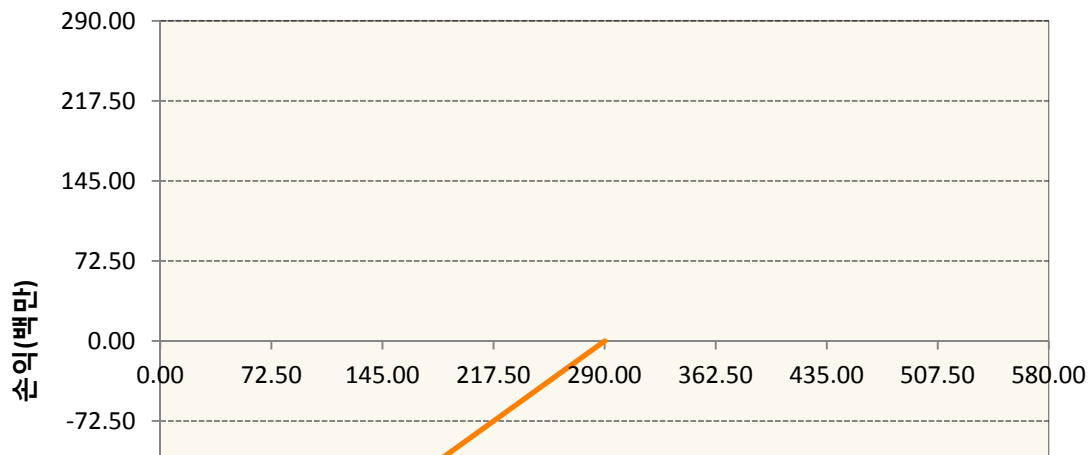
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	435	-435	장내

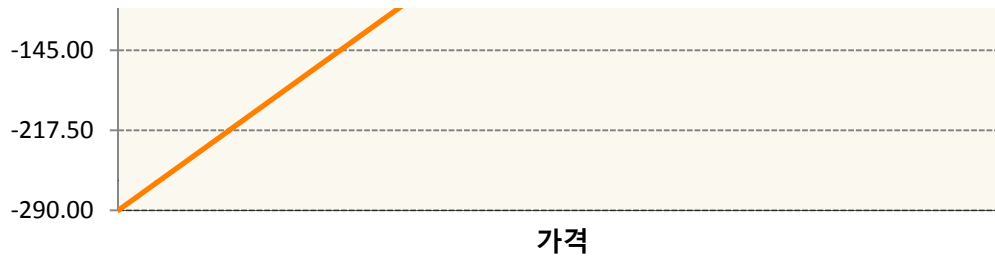
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q72906-2020-07 콜290



KR4301Q72904-2020-07 풋290





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q72906			2020-07 콜290				8
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2	2	2	2	2	2	2
-5.33%	2	2	2	2	2	2	1
-2.67%	2	2	1	1	1	1	1
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	-1	-1	-2	-2	-2	-2	-3
5.33%	-4	-4	-4	-4	-5	-5	-5
8.00%	-7	-7	-7	-8	-8	-8	-8

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	-13	-13	-13
-2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-7
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	5	4	4	4	4	3	3
5.33%	6	6	6	6	5	5	5
8.00%	6	6	6	6	6	6	6

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

32

공시일	2020-07-06
기준일	2020-07-03

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

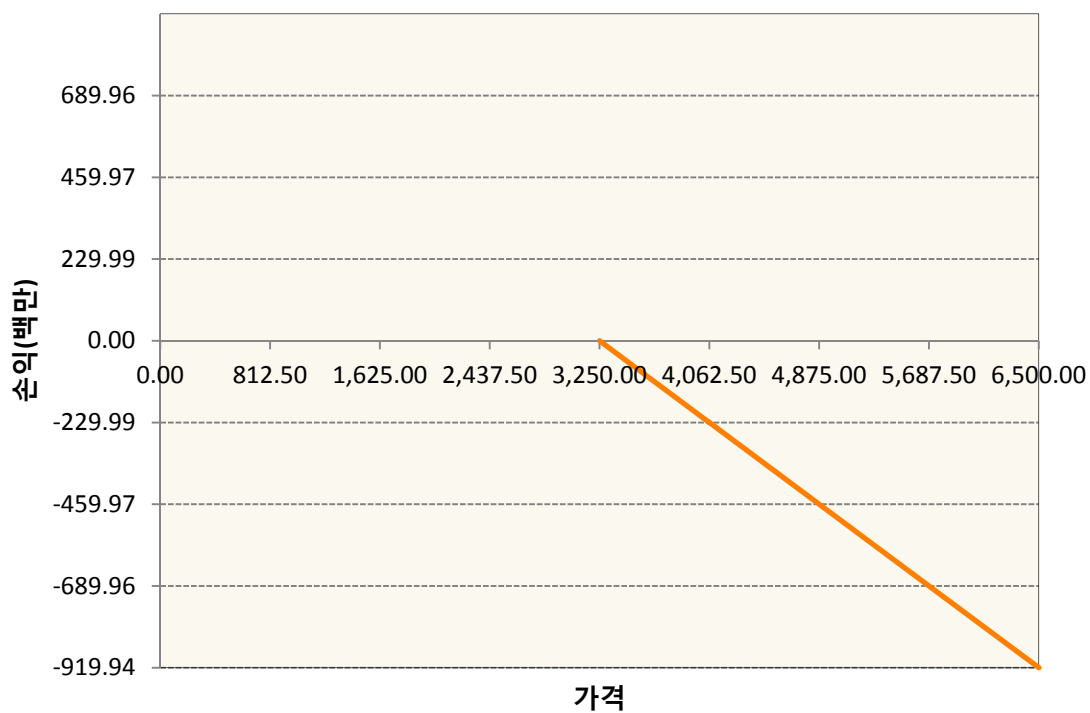
1. 계약금액

(단위:백만원)

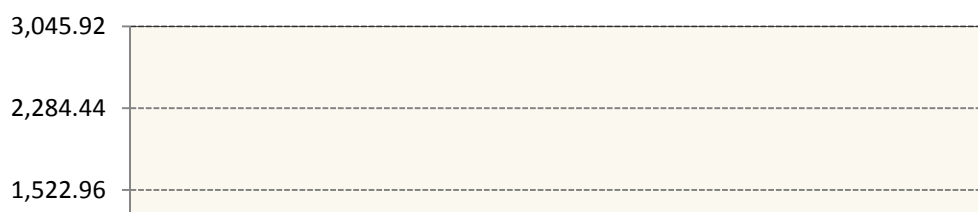
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,348	0	1,348	
누계	유가증권	스왑	8,039	0	8,039	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,932	-7,932	장내
누계	통화	선도	0	2,917	-2,917	장외

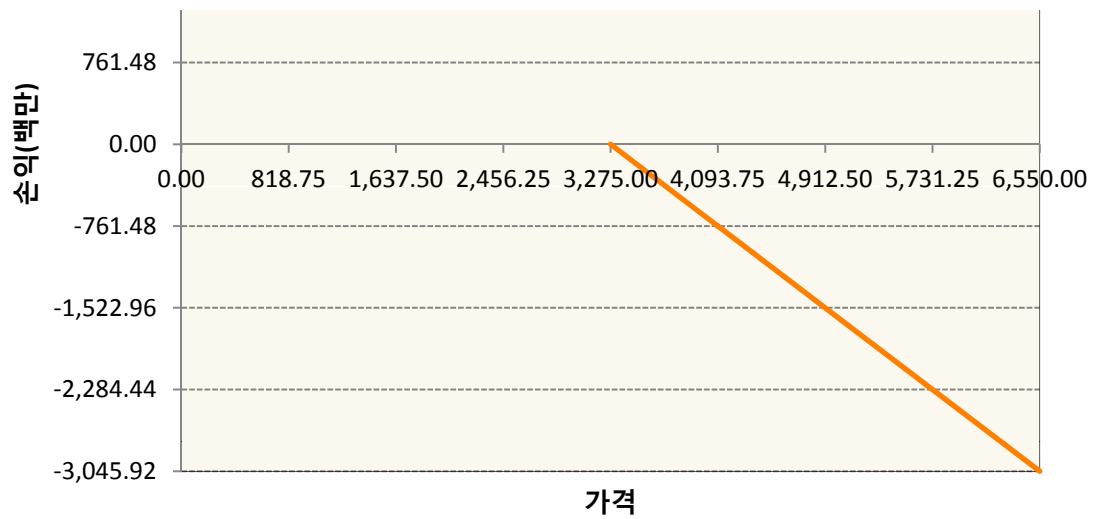
2. 만기시점의 손익구조

OESXN0-C3250-EURO STOXX 50

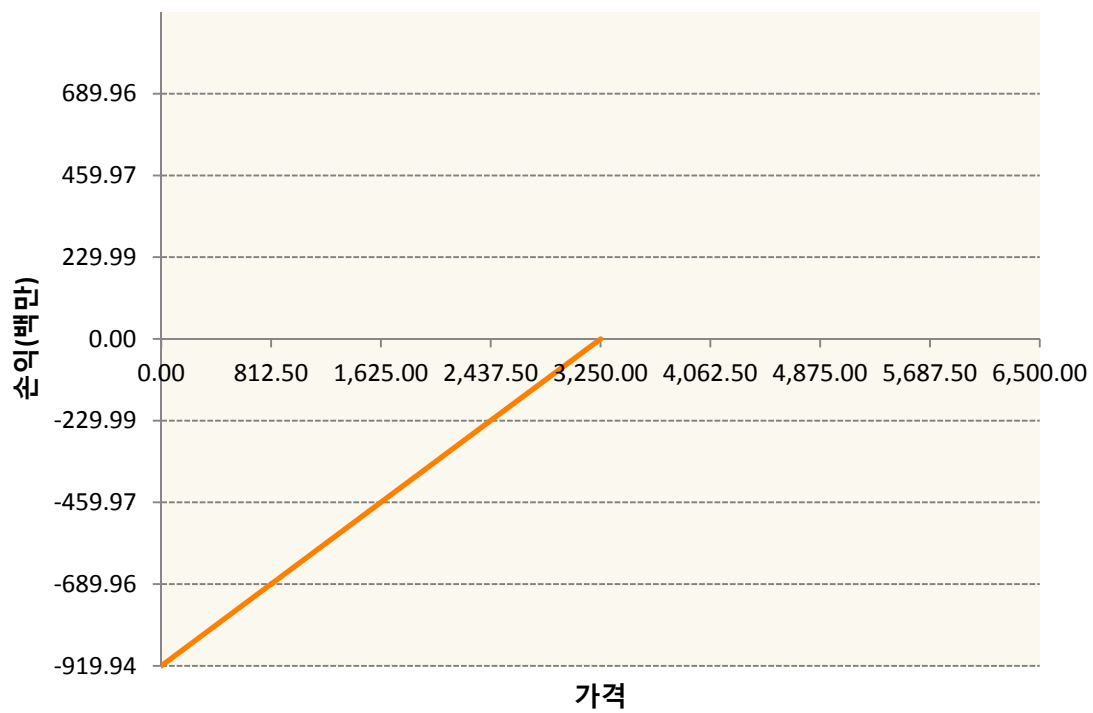


OESXN0-C3275-EURO STOXX 50



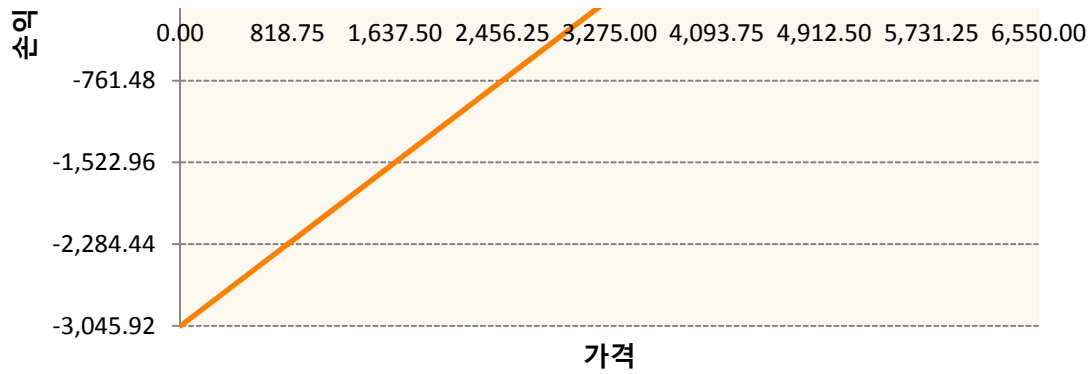
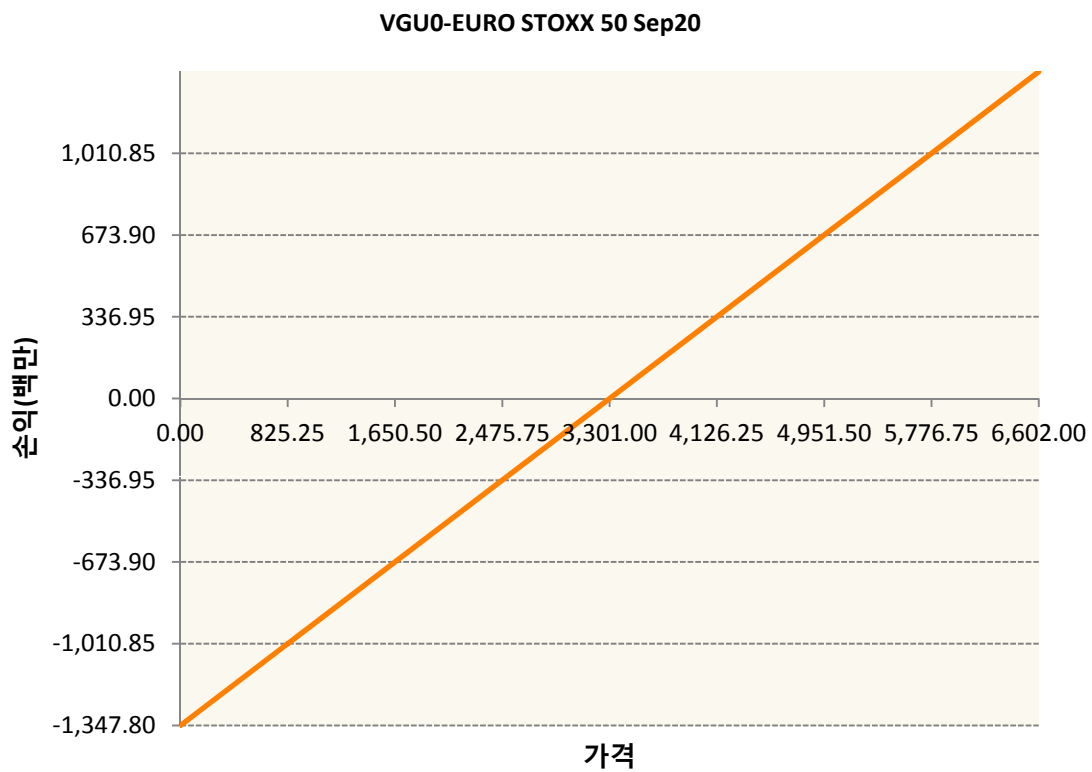


OESXN0-P3250-EURO STOXX 50



OESXN0-P3275-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY		34
FX21020M0₩KRW/EUR 25-09-20E		233
OESXN0-C3₩EURO STOXX 50		74
OESXN0-C3₩EURO STOXX 50		244
OESXN0-P3₩EURO STOXX 50		74
OESXN0-P3₩EURO STOXX 50		244
VGU0 EURO STOXX 50 Sep20		108

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

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

(단위:백만원)

1,344

공시일	2020-07-06
기준일	2020-07-03

ETF스마트레버리지목표전환형9호

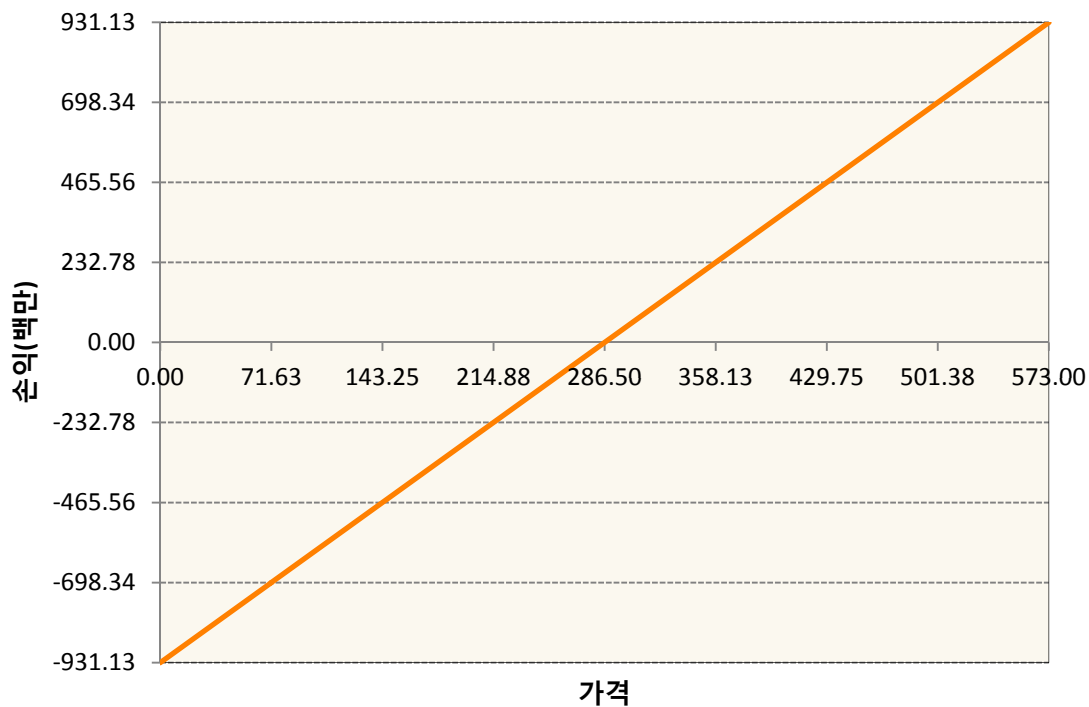
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	931	0	931	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009							2020-09 코스피200지수선물		74
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74	
-5.33%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	25	25	25	25	25	25	25	25	
5.33%	50	50	50	50	50	50	50	50	
8.00%	74	74	74	74	74	74	74	74	

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

(단위:백만원)

118

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

(단위:백만원)

172

공시일	2020-07-06
기준일	2020-07-03

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

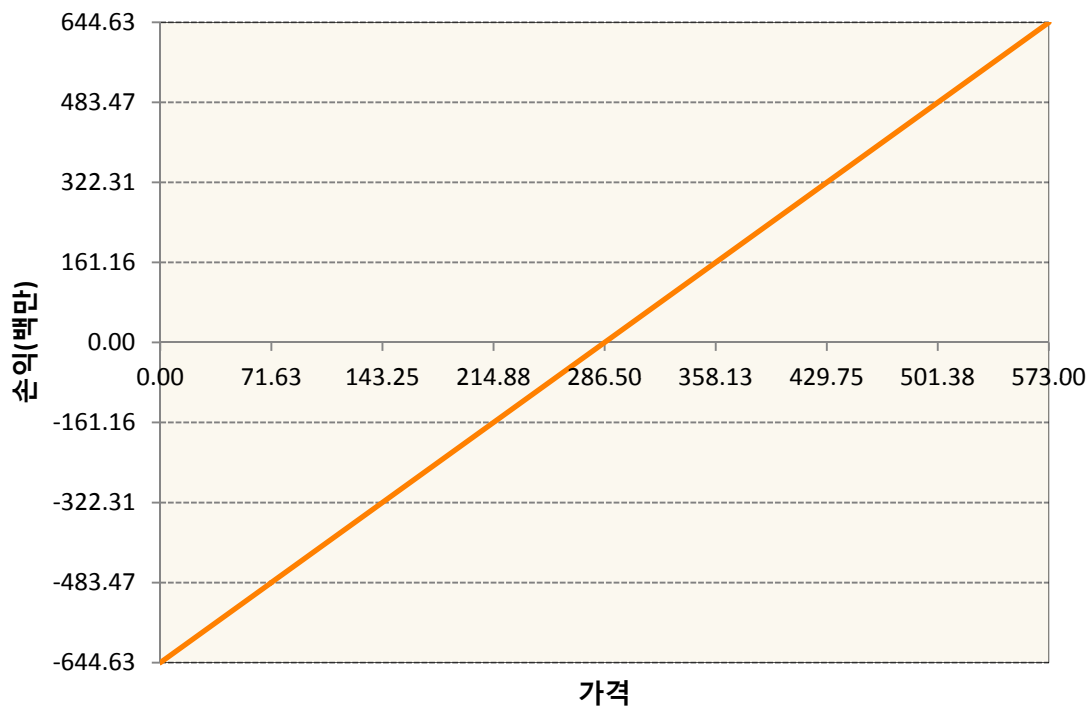
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	645	0	645	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009							2020-09 코스피200지수선물		51
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51	
-5.33%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	17	17	17	17	17	17	17	17	
5.33%	34	34	34	34	34	34	34	34	
8.00%	51	51	51	51	51	51	51	51	

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

(단위:백만원)

82

공시일	2020-07-06
기준일	2020-07-03

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

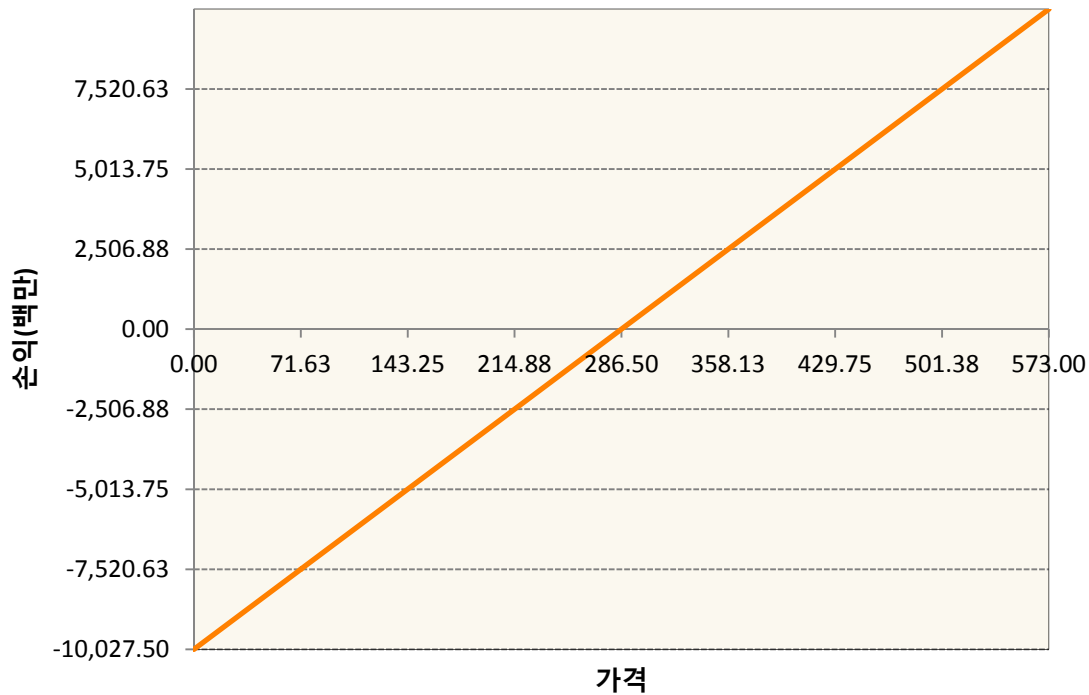
1. 계약금액

(단위:백만원)

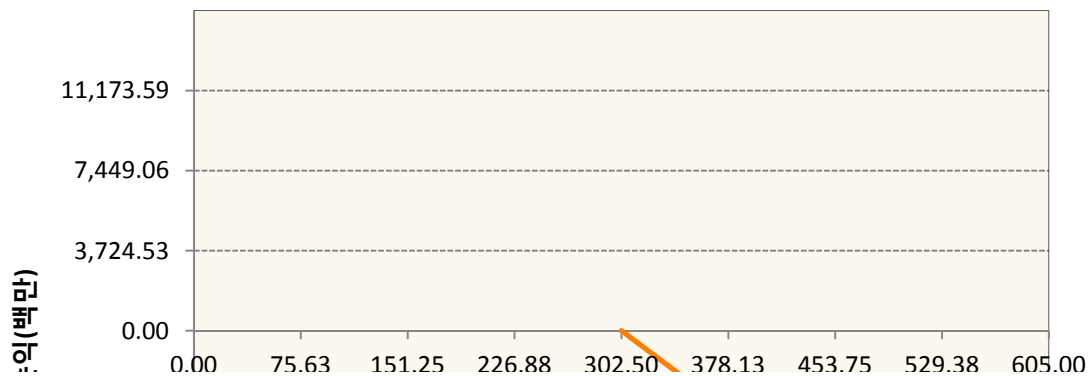
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,028	0	10,028	장내
누계	유가증권	옵션	3,247	19,092	-15,845	장내

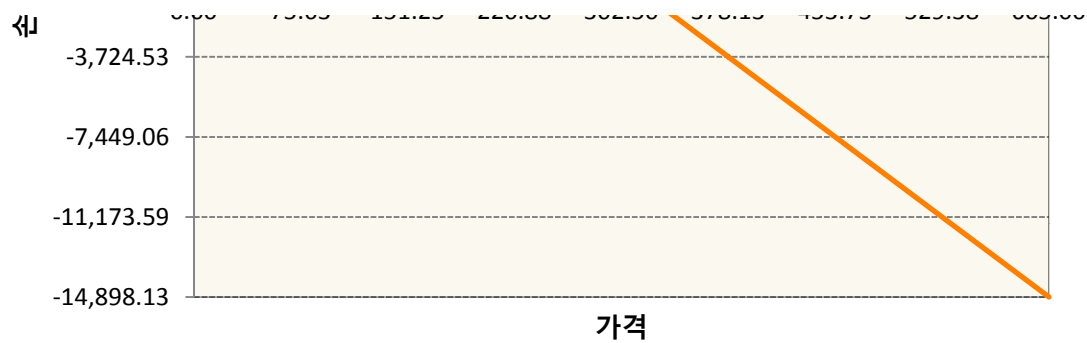
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물

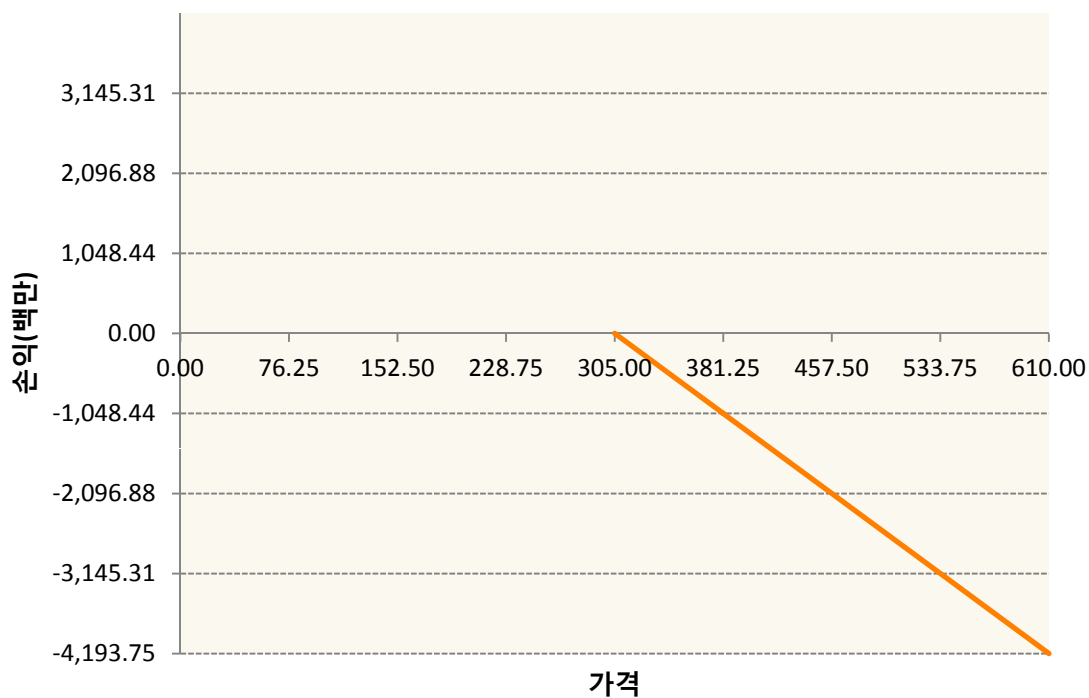


KR4201Q73029-2020-07 콜302.5

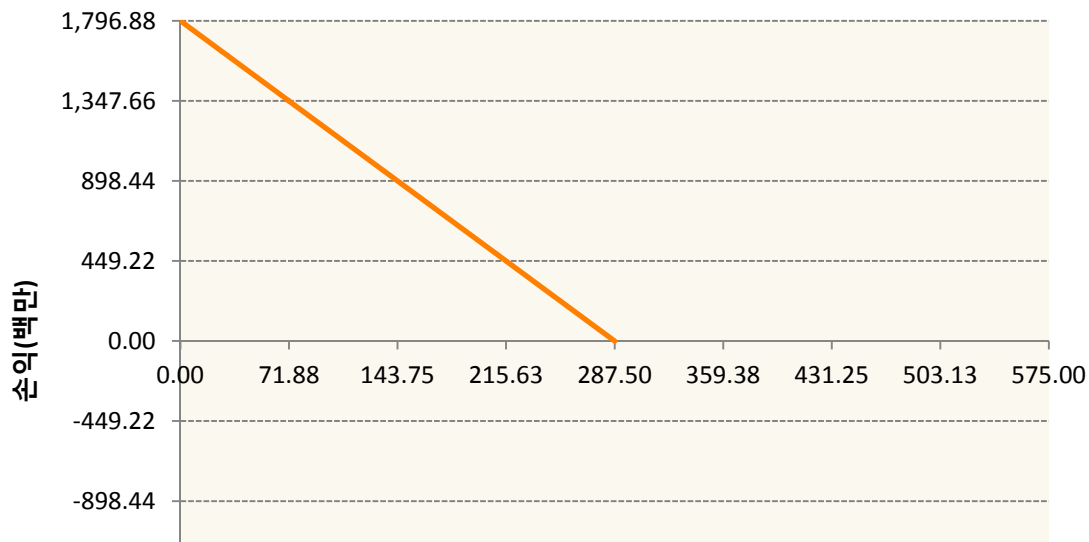


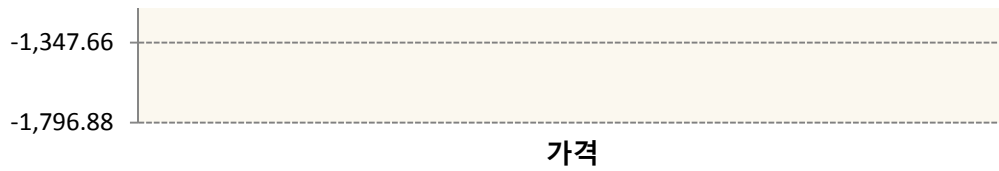
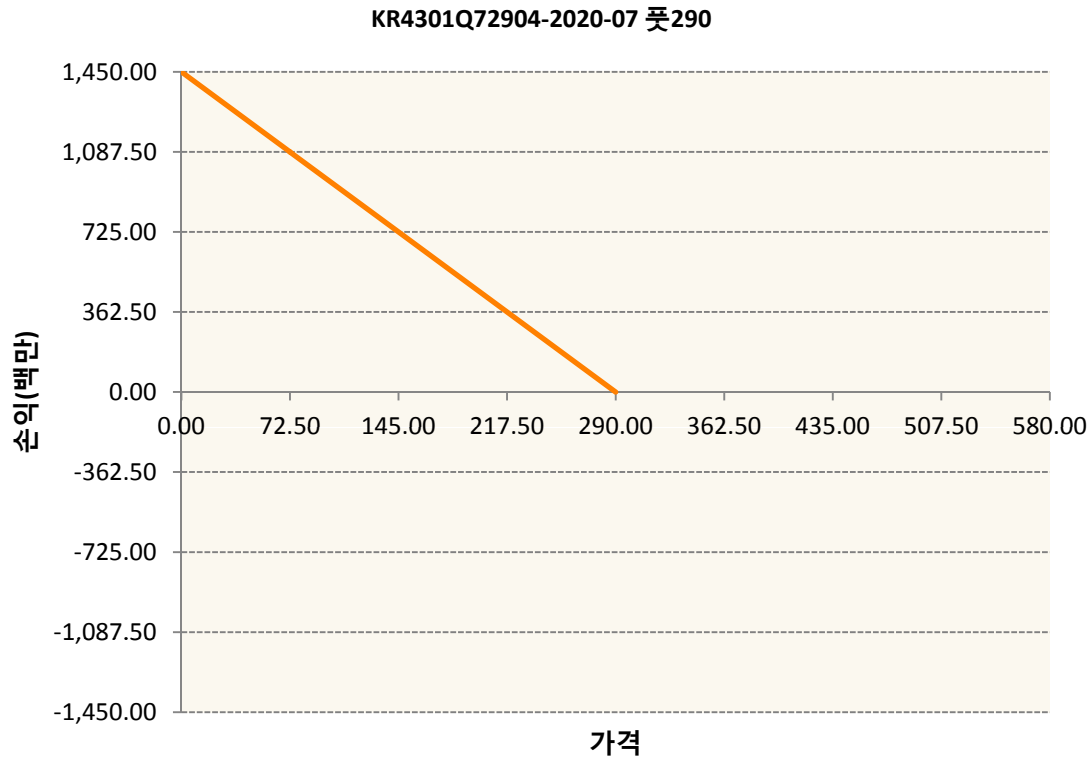


KR4201Q73052-2020-07 콜305



KR4301Q72870-2020-07 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q90009			2020-09 코스피200지수선물				800
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-800	-800	-800	-800	-800	-800	-800
-5.33%	-534	-534	-534	-534	-534	-534	-534
-2.67%	-267	-267	-267	-267	-267	-267	-267
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	267	267	267	267	267	267	267
5.33%	534	534	534	534	534	534	534
8.00%	800	800	800	800	800	800	800
KR4201Q73029			2020-07 콜302.5				525
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	67	67	66	65	64	61	58
-5.33%	66	65	63	60	55	50	43
-2.67%	61	57	51	43	33	22	9

0%	41	29	16	0	-17	-35	-54
2.67%	-19	-40	-63	-86	-110	-135	-160
5.33%	-150	-177	-205	-233	-260	-288	-316
8.00%	-368	-393	-419	-445	-471	-498	-525
KR4201Q73052 2020-07 콜305							131
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	14	14	14	14	13	13	12
-5.33%	14	14	13	13	12	11	9
-2.67%	13	12	11	9	7	4	1
0%	9	7	4	0	-4	-9	-13
2.67%	-3	-8	-14	-20	-26	-32	-39
5.33%	-32	-40	-47	-55	-62	-70	-78
8.00%	-85	-93	-100	-108	-116	-124	-131
KR4301Q72870 2020-07 풋287.5							124
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	124	124	124	124	124	124	124
-5.33%	76	77	77	77	77	78	79
-2.67%	31	32	33	34	35	36	38
0%	-6	-4	-2	0	2	4	6
2.67%	-24	-23	-21	-19	-18	-16	-14
5.33%	-29	-28	-28	-27	-26	-25	-24
8.00%	-29	-29	-29	-29	-29	-28	-28
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%	66	66	66	66	66	67	67
-2.67%	28	29	29	30	31	32	33
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-24	-22	-21	-19	-18	-16	-15
5.33%	-30	-30	-29	-28	-27	-26	-25
8.00%	-31	-31	-31	-31	-30	-30	-30

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

(단위:백만원)

1,909

공시일	2020-07-06
기준일	2020-07-03

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	132,526	0	132,526	

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	2020-07-06
기준일	2020-07-03

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	95,251	0	95,251	

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	2020-07-06
기준일	2020-07-03

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	459,353	0	459,353	
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)

18,124

공시일	2020-07-06
기준일	2020-07-03

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

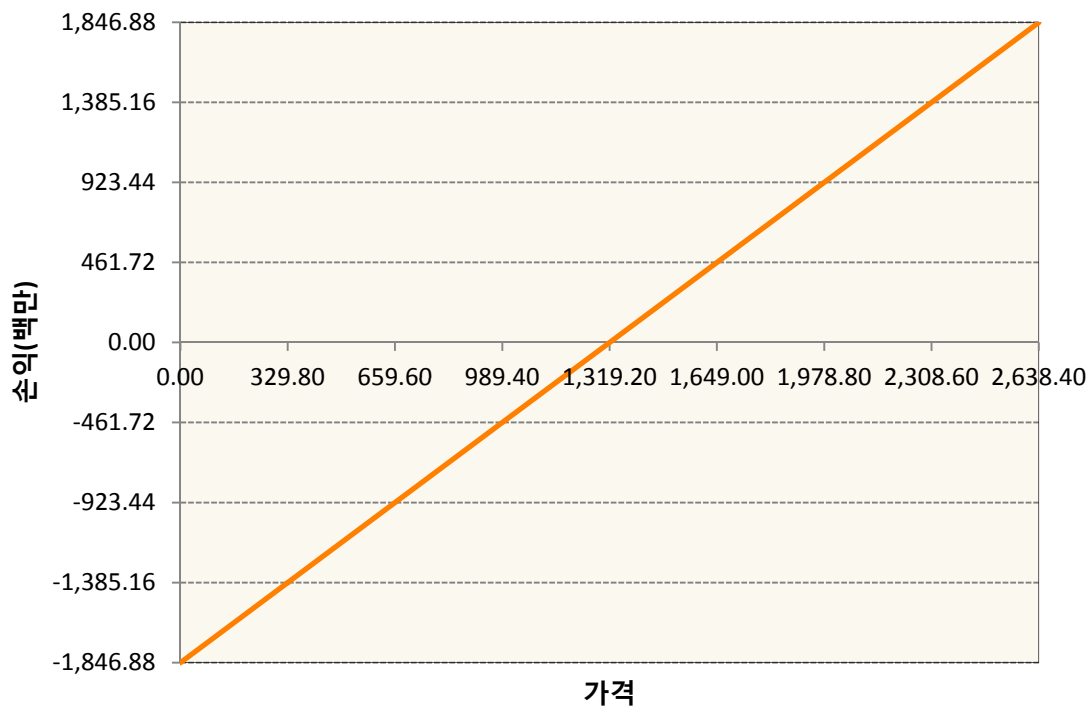
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,847	0	1,847	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4108Q90004-2020-09 KRX300 선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4108Q90004						2020-09 KRX300 선물		148
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-148	-148	-148	-148	-148	-148	-148	
-5.33%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99	
-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%	99	99	99	99	99	99	99	
8.00%	148	148	148	148	148	148	148	

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

(단위:백만원)

236

공시일	2020-07-06
기준일	2020-07-03

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	7,571	0	7,571	
누계	통화	선도	0	8,043	-8,043	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 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
FX21020N00 KRW/USD 06-08-20E	48
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

332

공시일	2020-07-06
기준일	2020-07-03

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

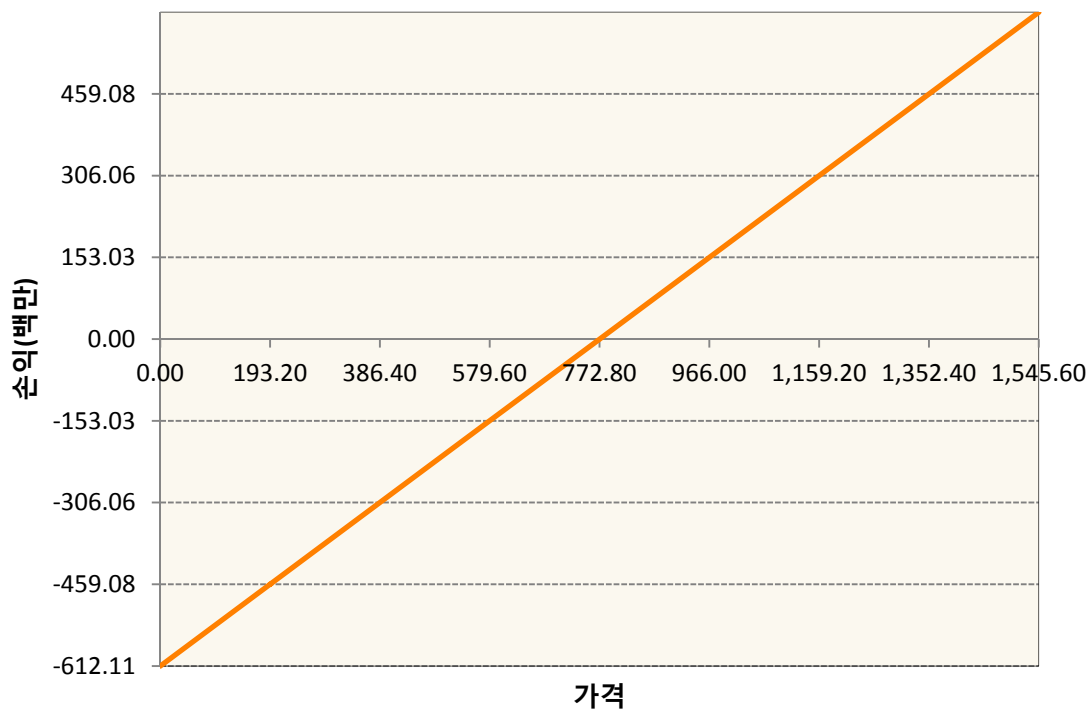
1. 계약금액

(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	612	0	612	
누계	유가증권	스왑	978	0	978	장외
누계	통화	선도	94	674	-580	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
49

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

(단위:백만원)

157

공시일	2020-07-06
기준일	2020-07-03

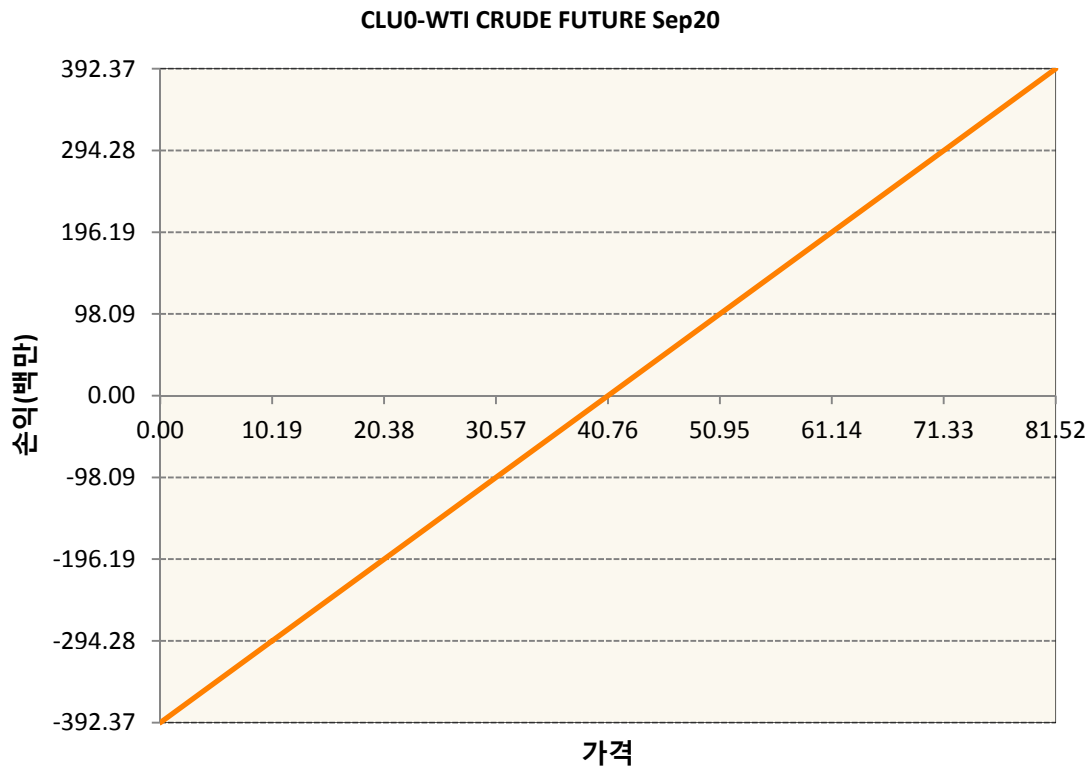
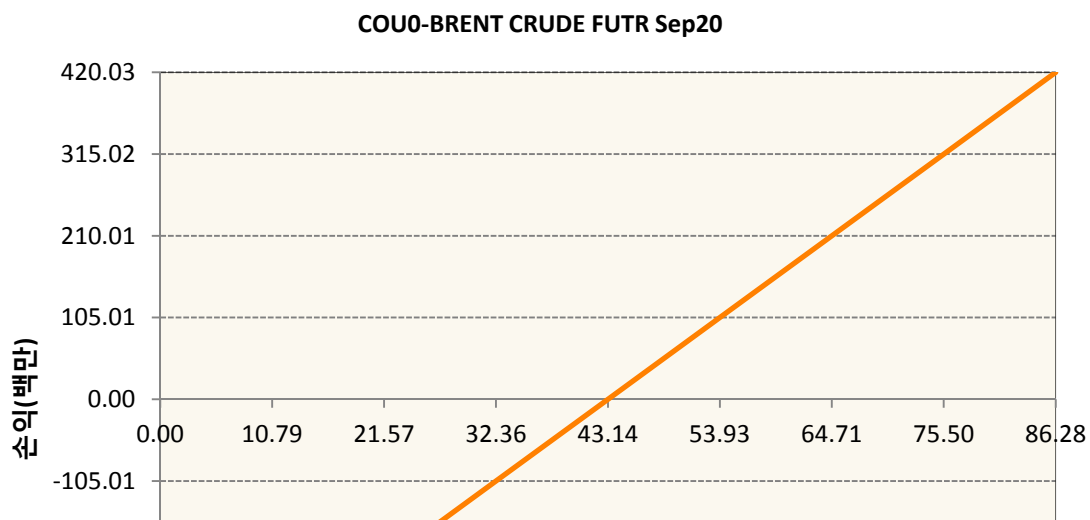
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

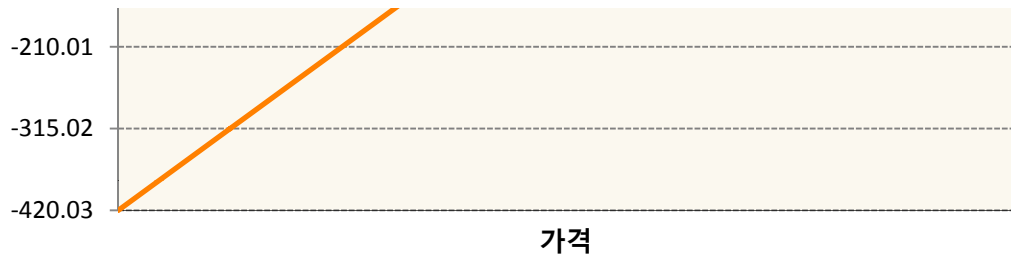
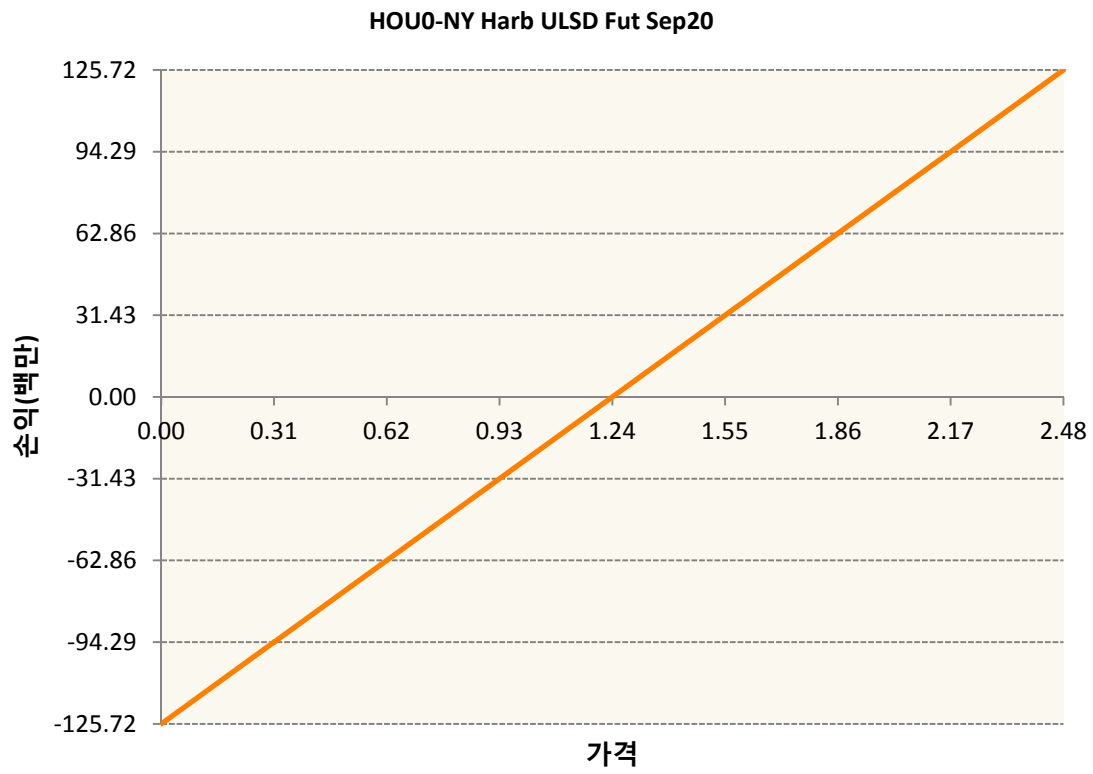
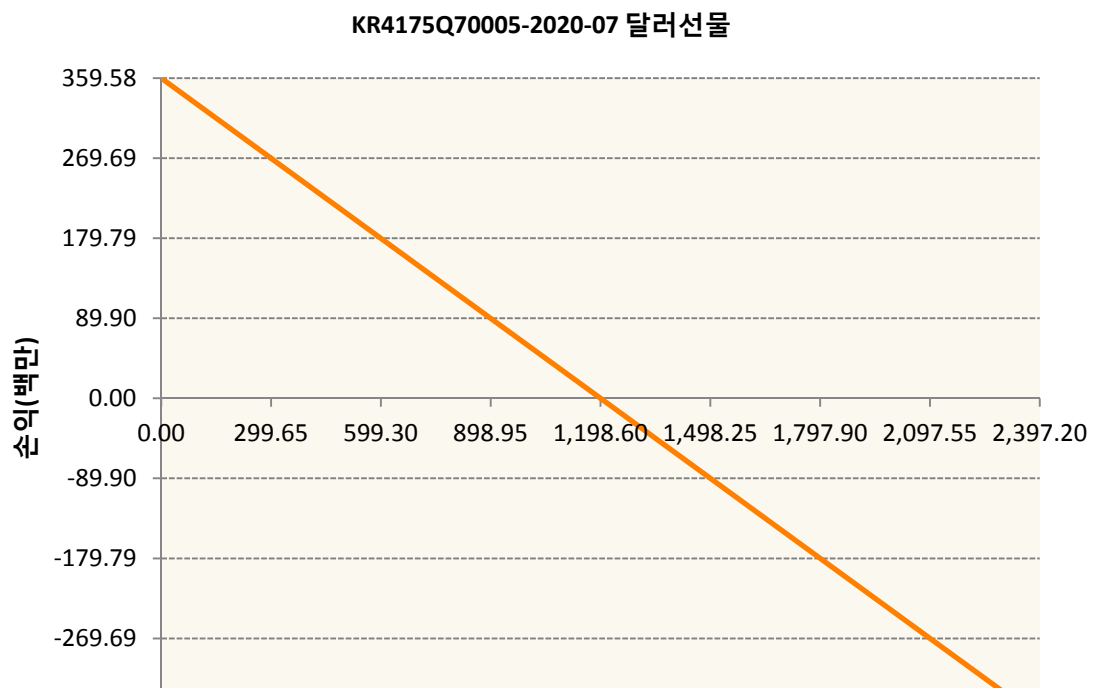
1. 계약금액

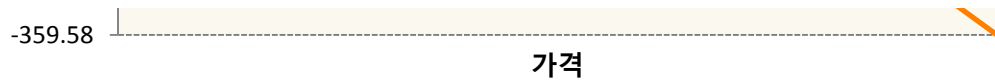
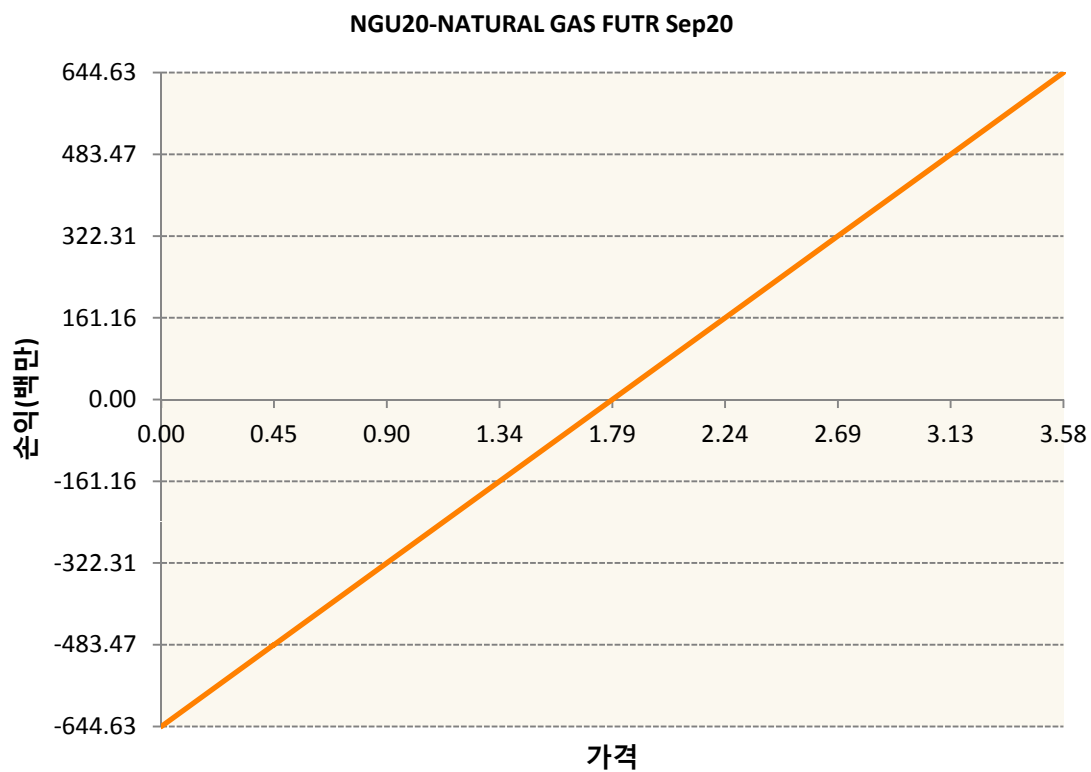
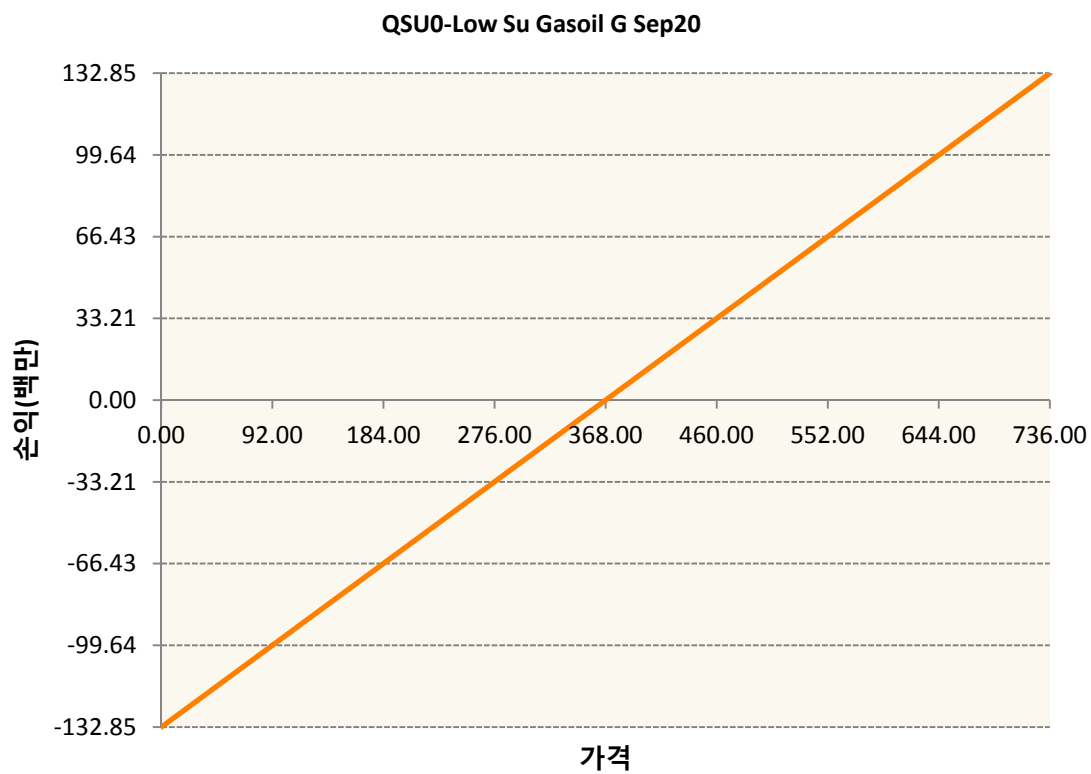
(단위:백만원)

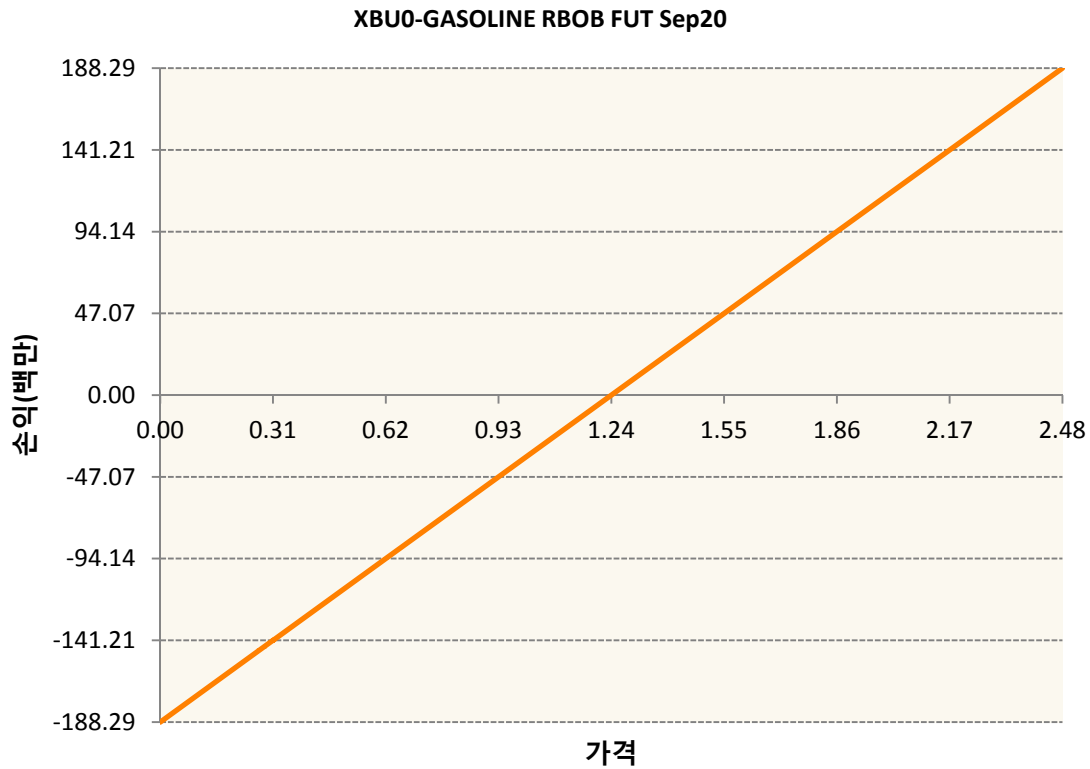
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,904	360	1,544	

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU0	WTI CRUDE FUTURE Sep20	31
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	15

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

934

공시일	2020-07-06
기준일	2020-07-03

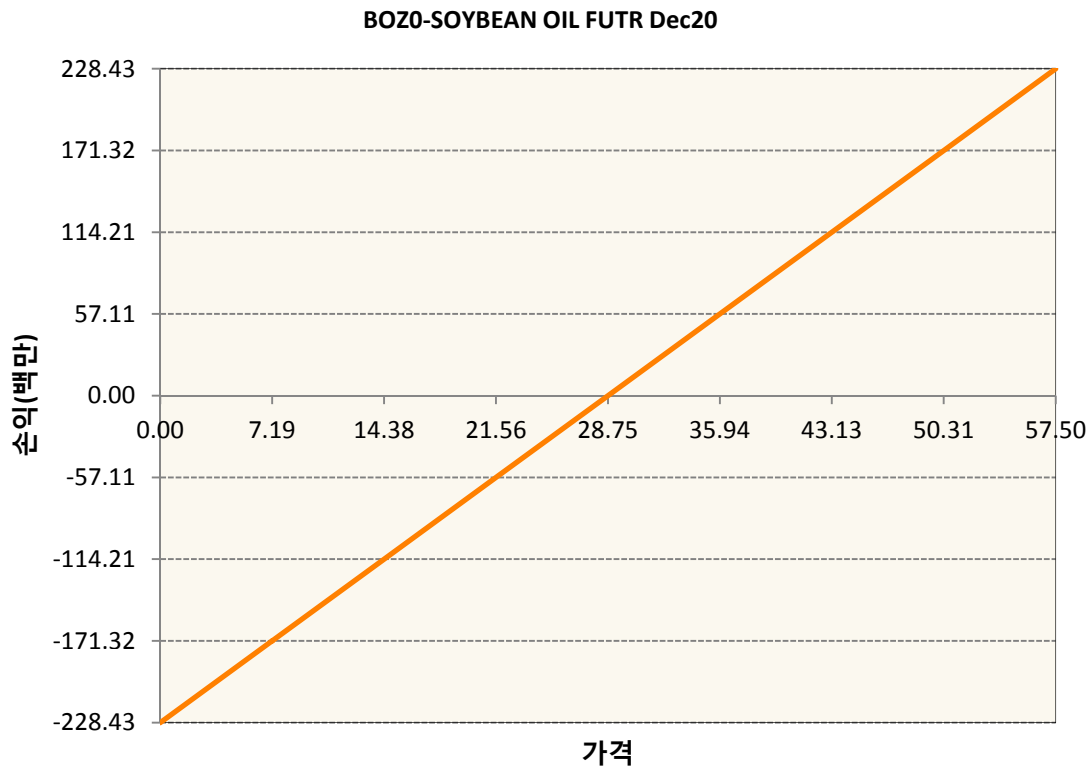
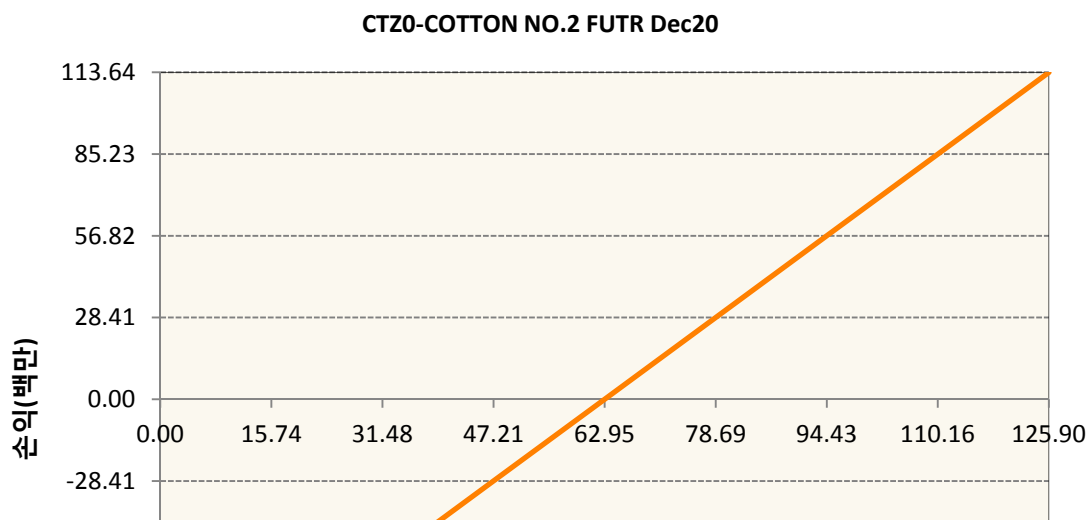
애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

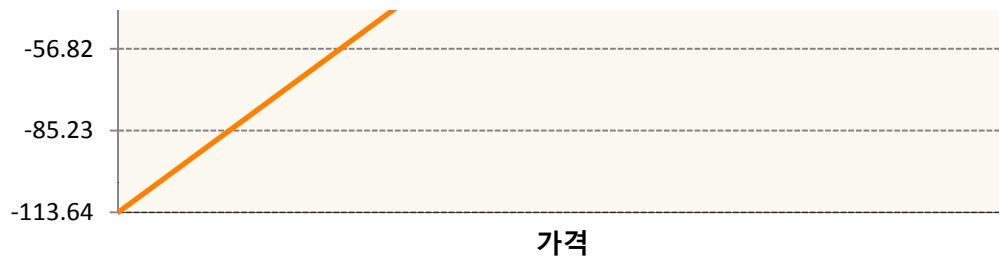
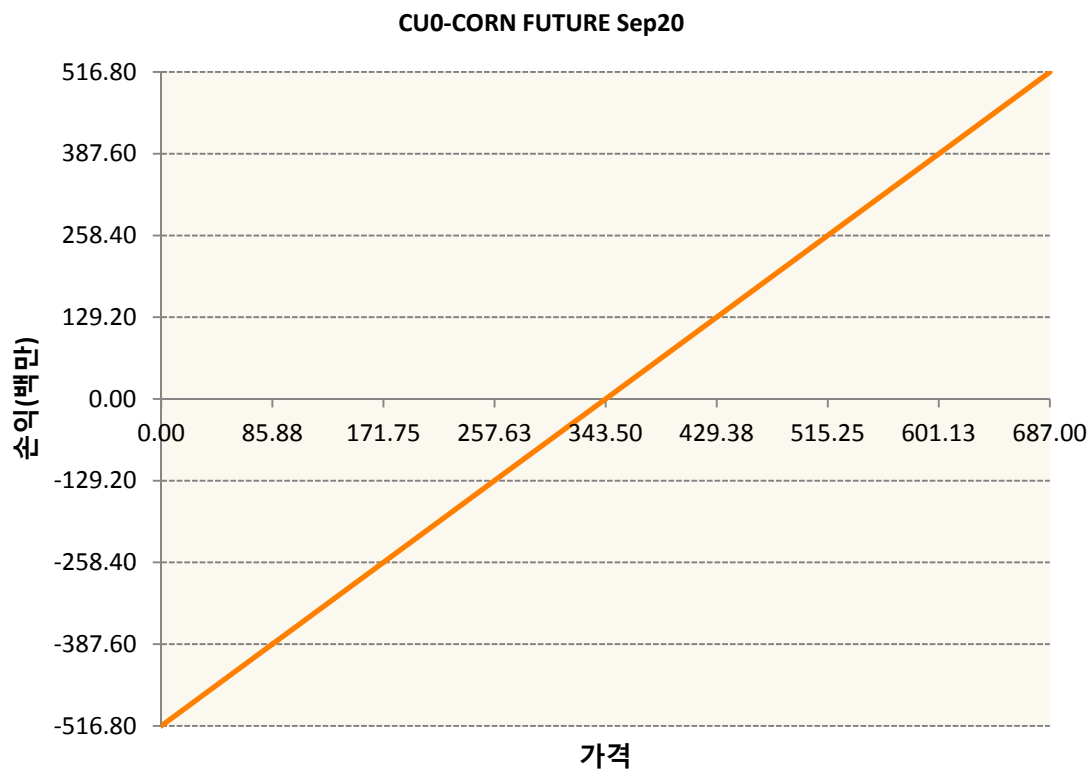
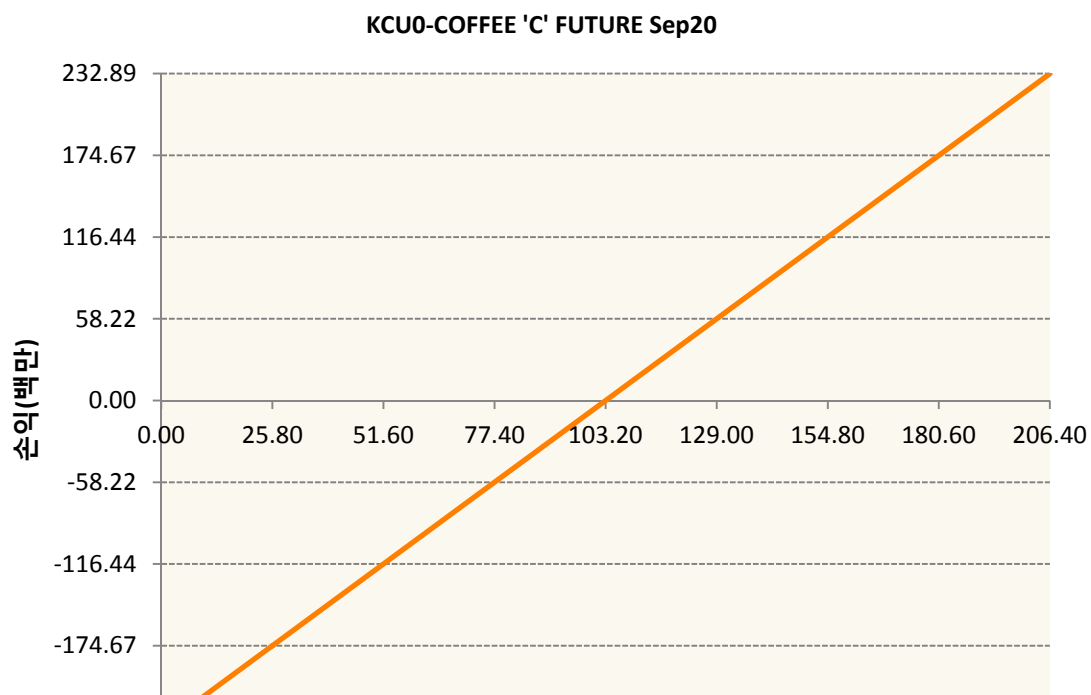
1. 계약금액

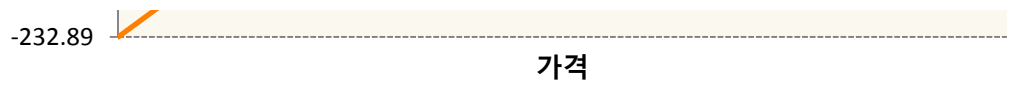
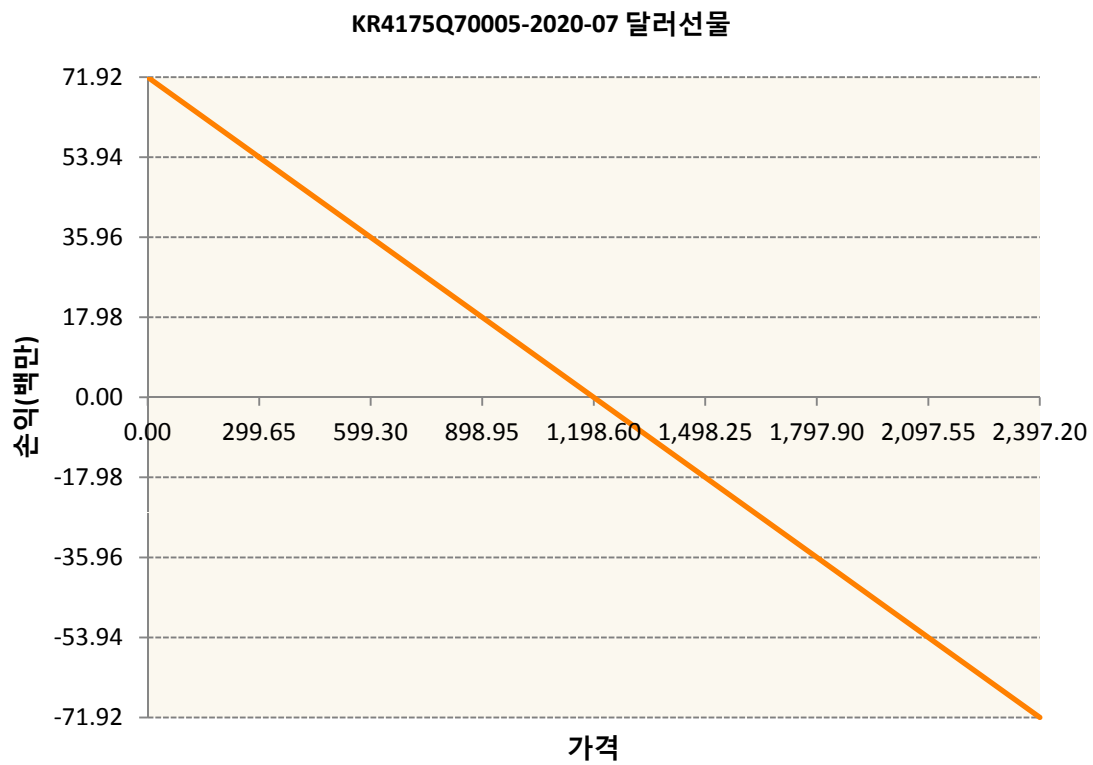
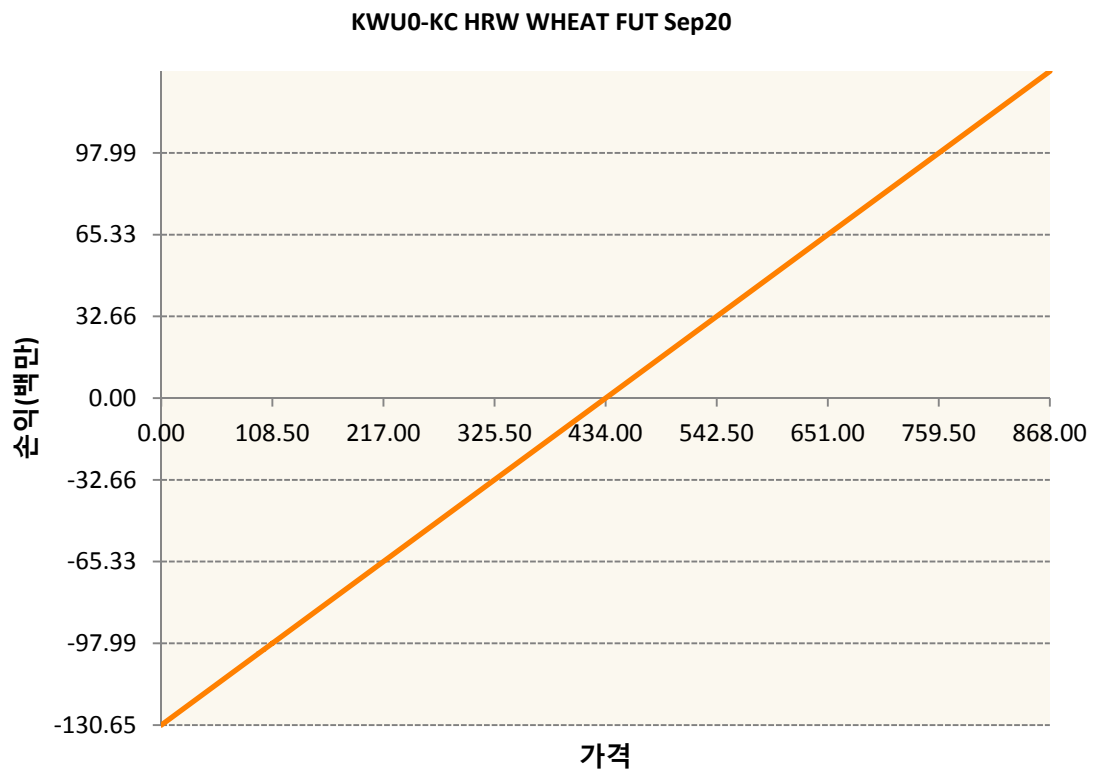
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,622	72	2,550	

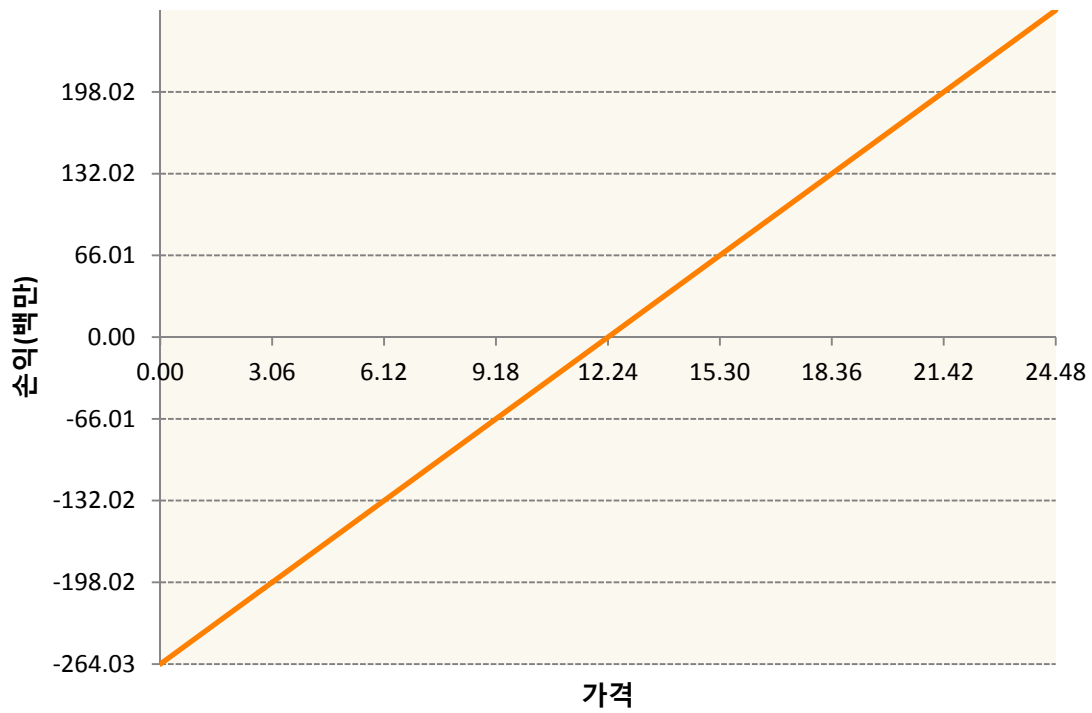
2. 만기시점의 손익구조



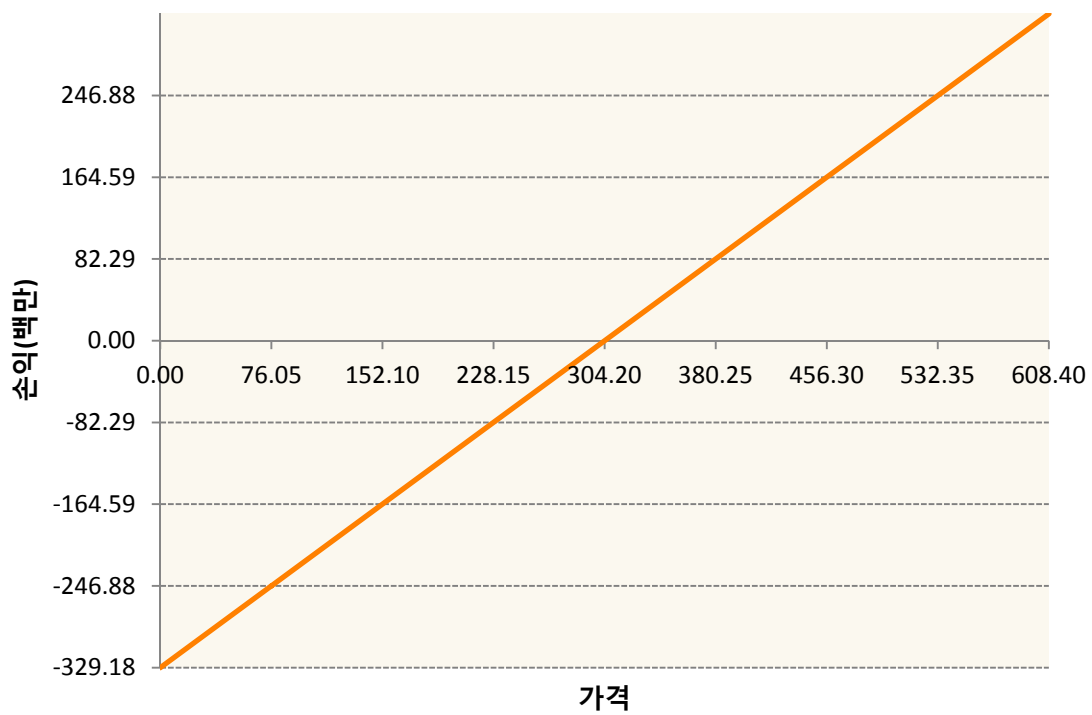




SBV0-Sugar Oct20

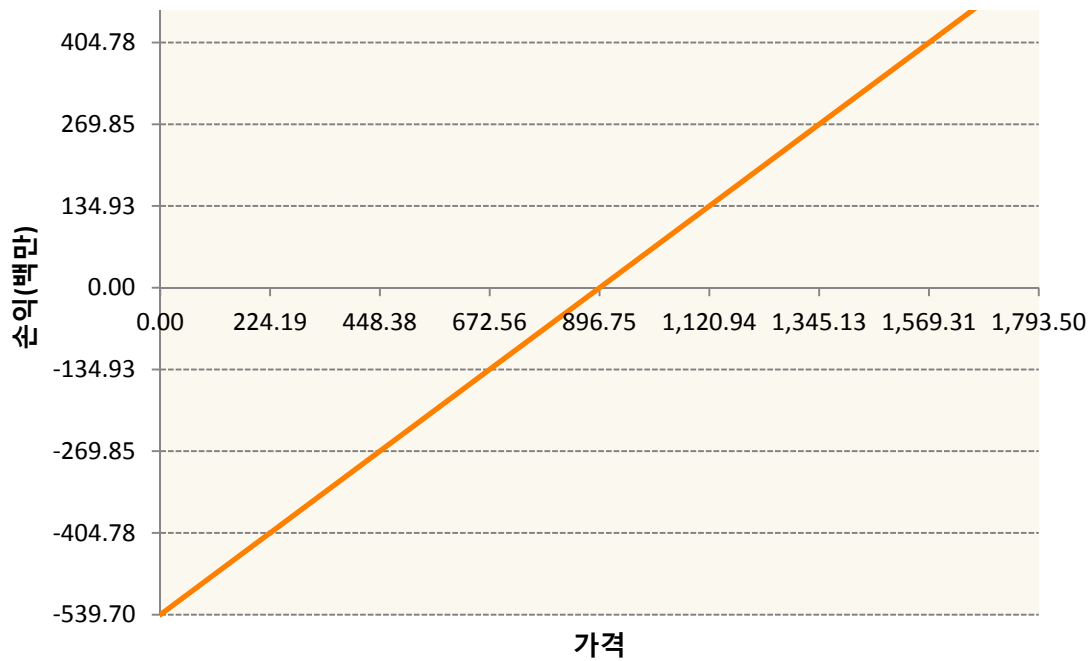
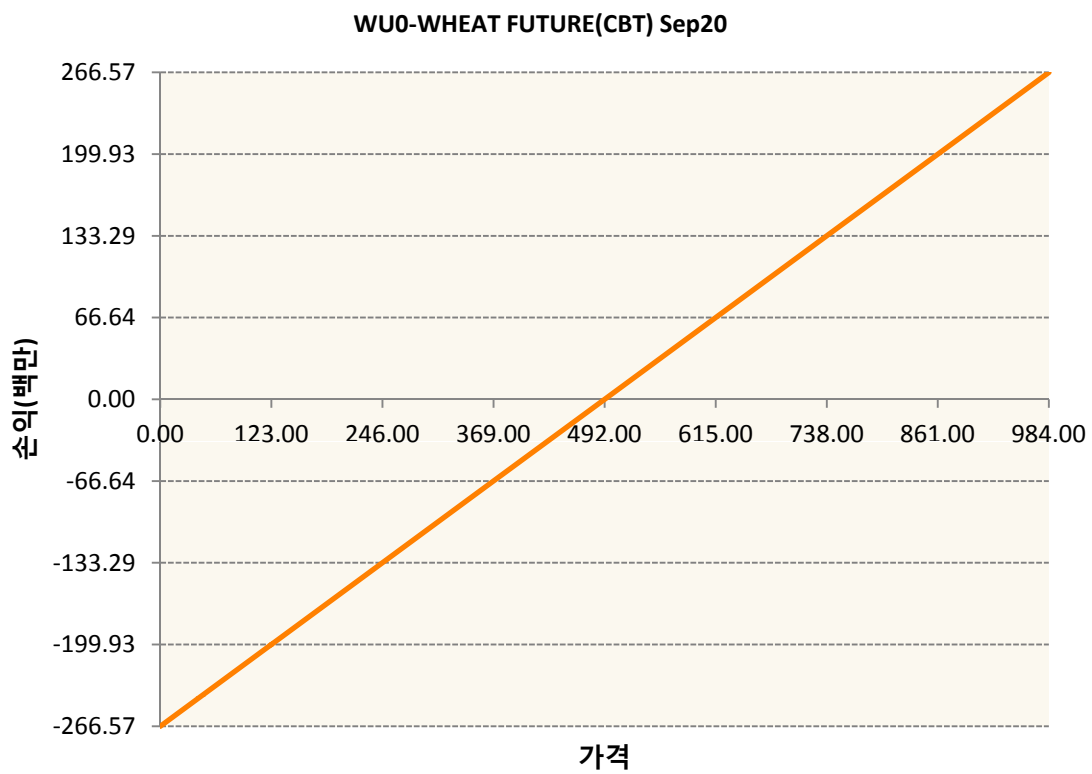


SMZ0-SOYBEAN MEAL FUTR Dec20



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	41
KCU0	COFFEE 'C' FUTURE Sep20	19
KR4175Q70C 2020-07 달러선물		6

KWU0	KC HRW WHEAT FUT Sep20	10
SBV0	Sugar Oct20	21
SMZ0	SOYBEAN MEAL FUTR Dec20	26
SX0	SOYBEAN FUTURE Nov20	43
WU0	WHEAT FUTURE(CBT) Sep20	21

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

(단위:백만원)

247