공시일	2020-10-08
기준일	2020-10-07

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	0	0	0	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	2020-10-08
기준일	2020-10-07

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	14,414	0	14,414	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S200824	1,150

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,410

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-10-08
기준일	2020-10-07

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	8,587	0	8,587	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래200910	676

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,055

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-10-08
기준일	2020-10-07

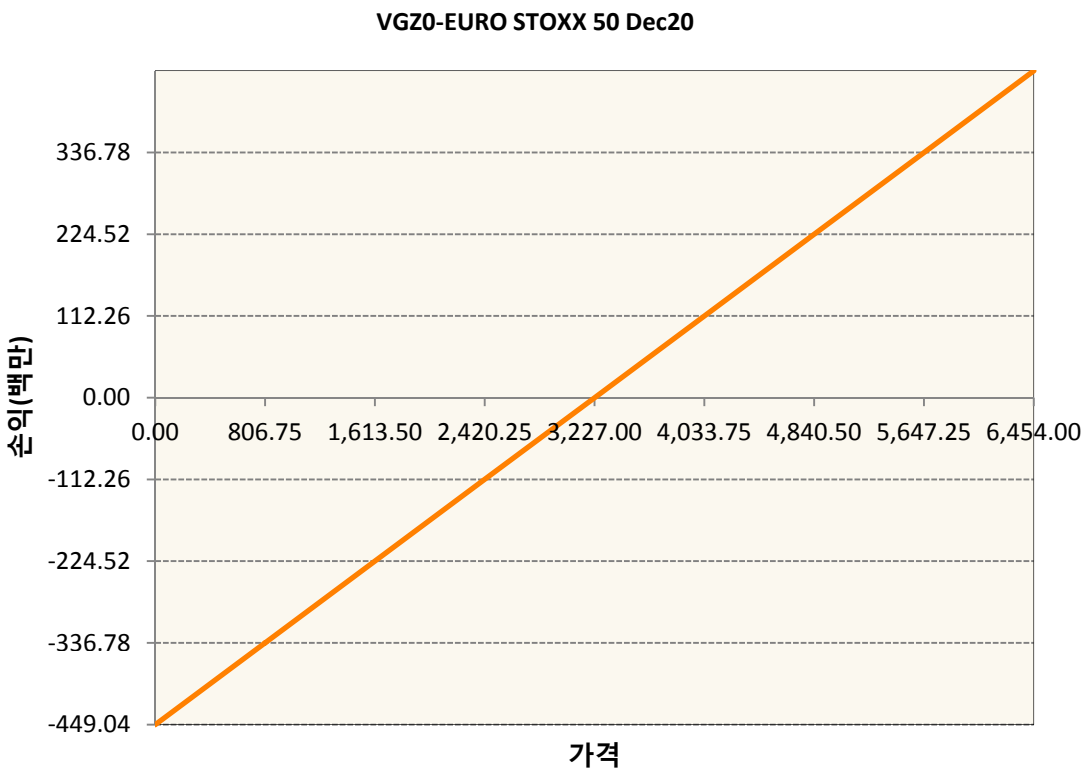
유로인덱스모(주식-파생형)

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



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ0	EURO STOXX 50 Dec20	36

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

(단위:백만원)

50

공시일	2020-10-08
기준일	2020-10-07

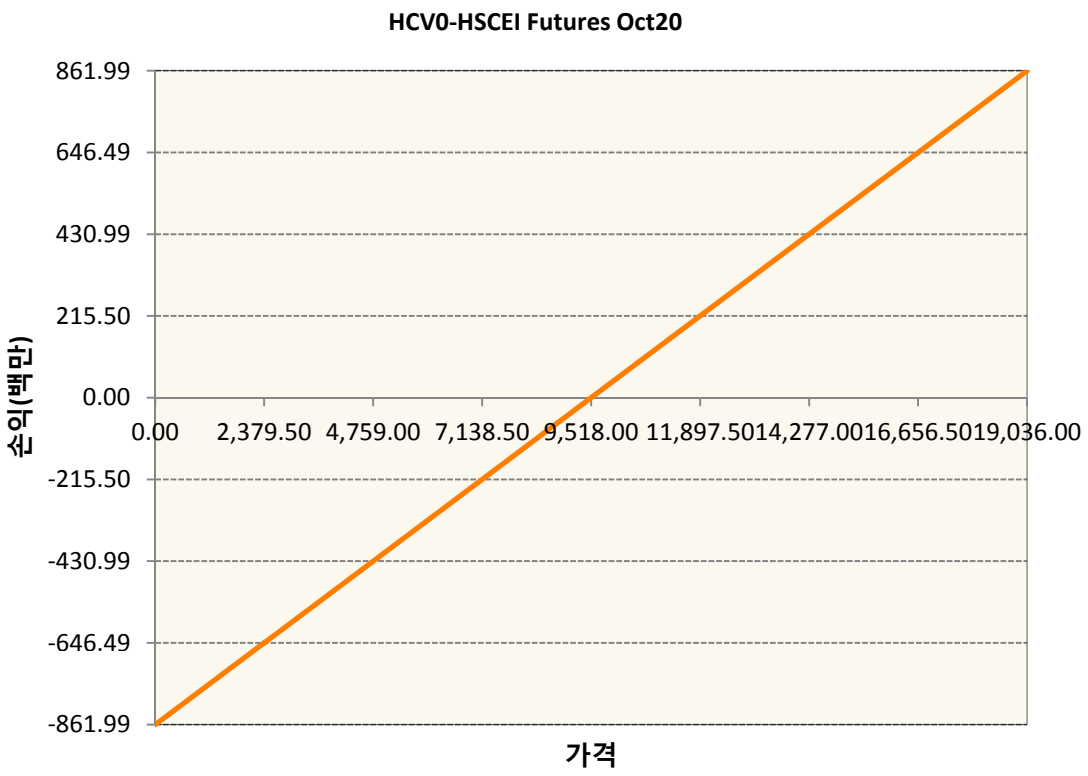
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	862	0	862	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV0	HSCEI Futures Oct20	69

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

(단위:백만원)

77

공시일	2020-10-08
기준일	2020-10-07

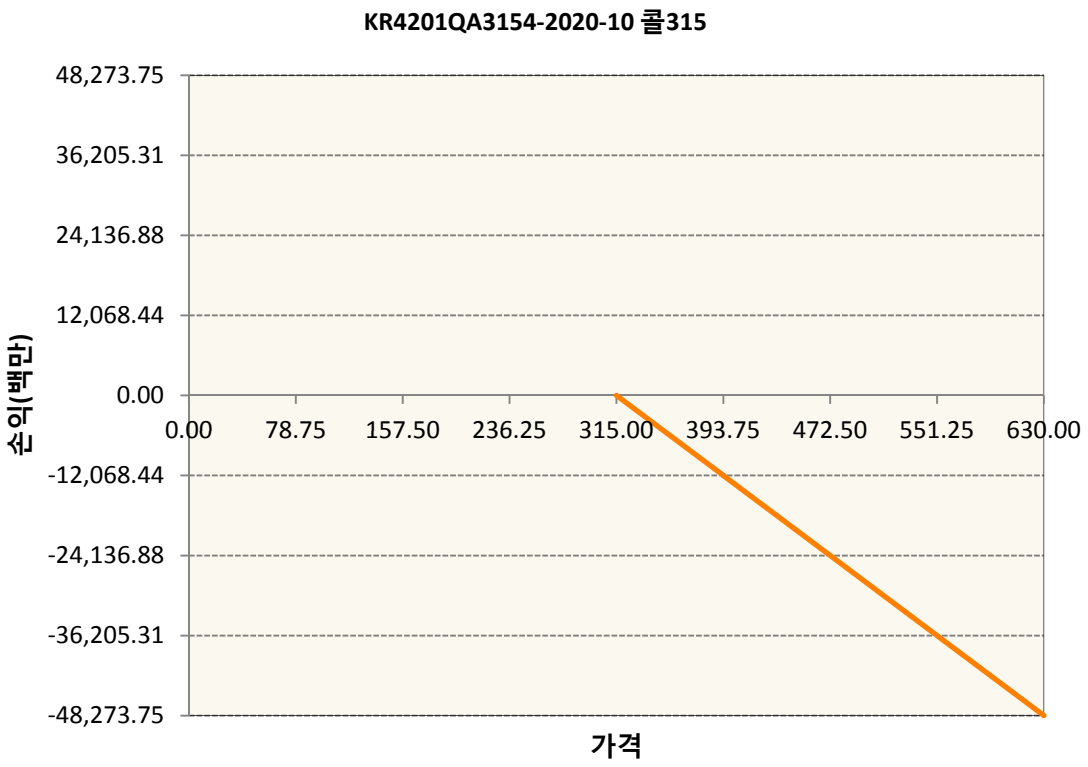
커버드콜모(주식혼합-파생형)

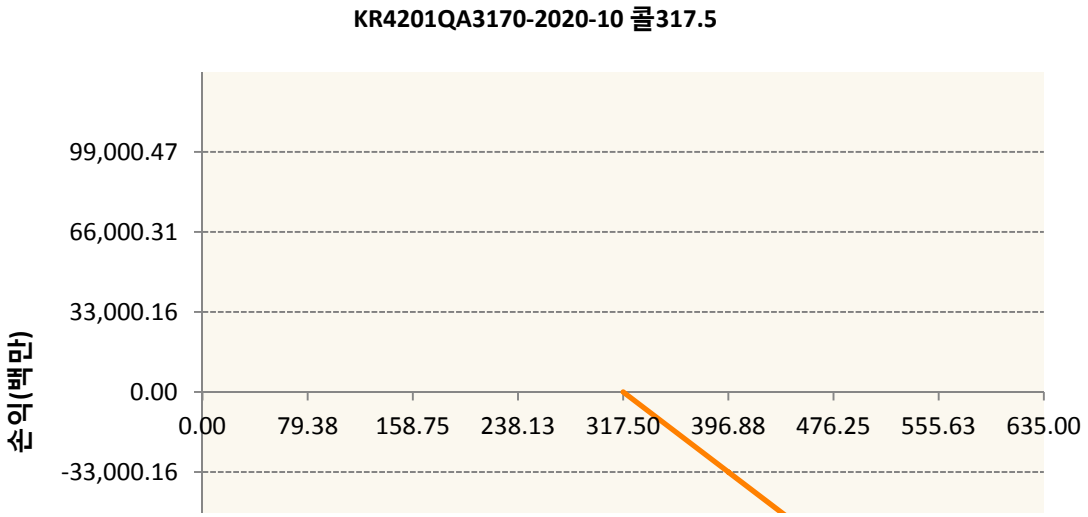
1. 계약금액

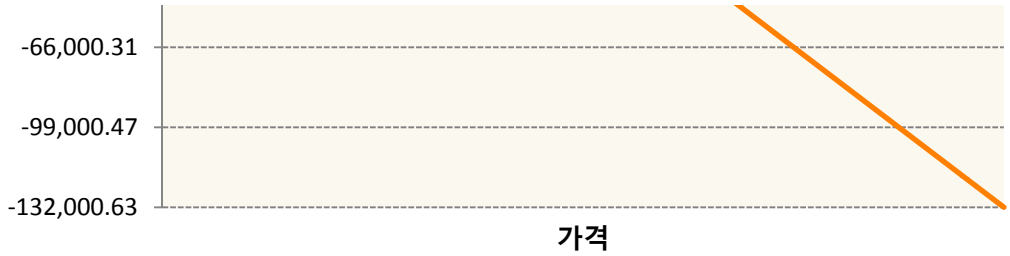
(단위:백만원)

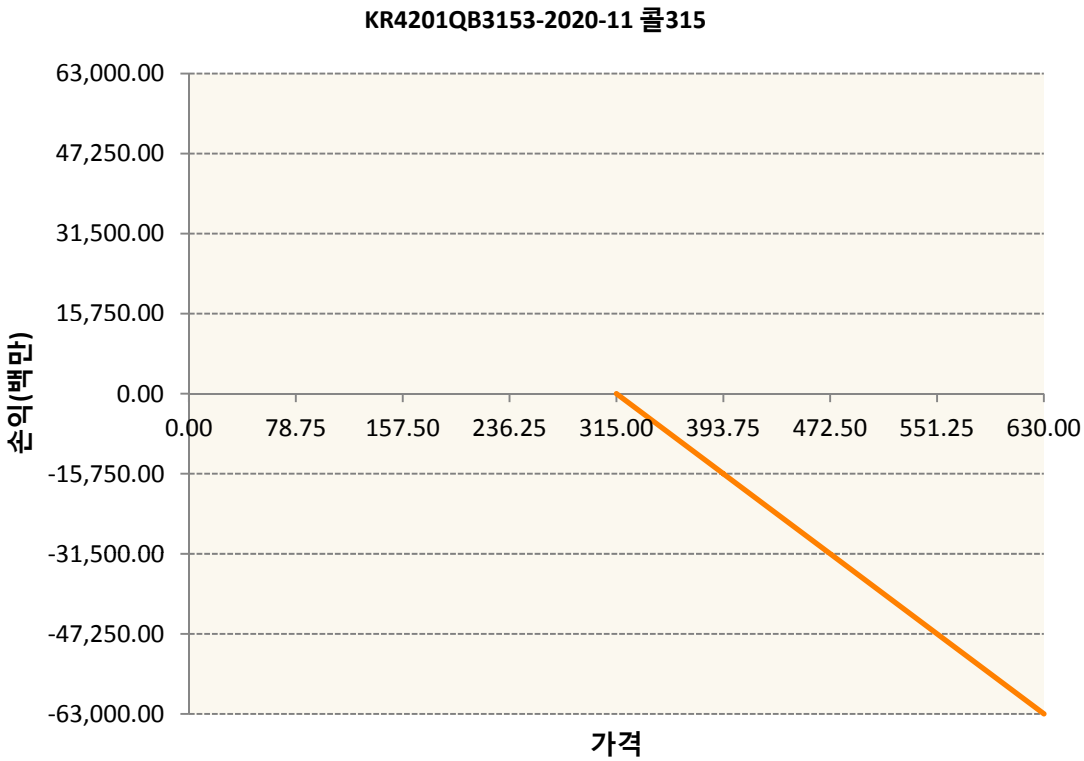
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	63,138	64,631	-1,493	장내
누계	유가증권	옵션	0	322,164	-322,164	장내

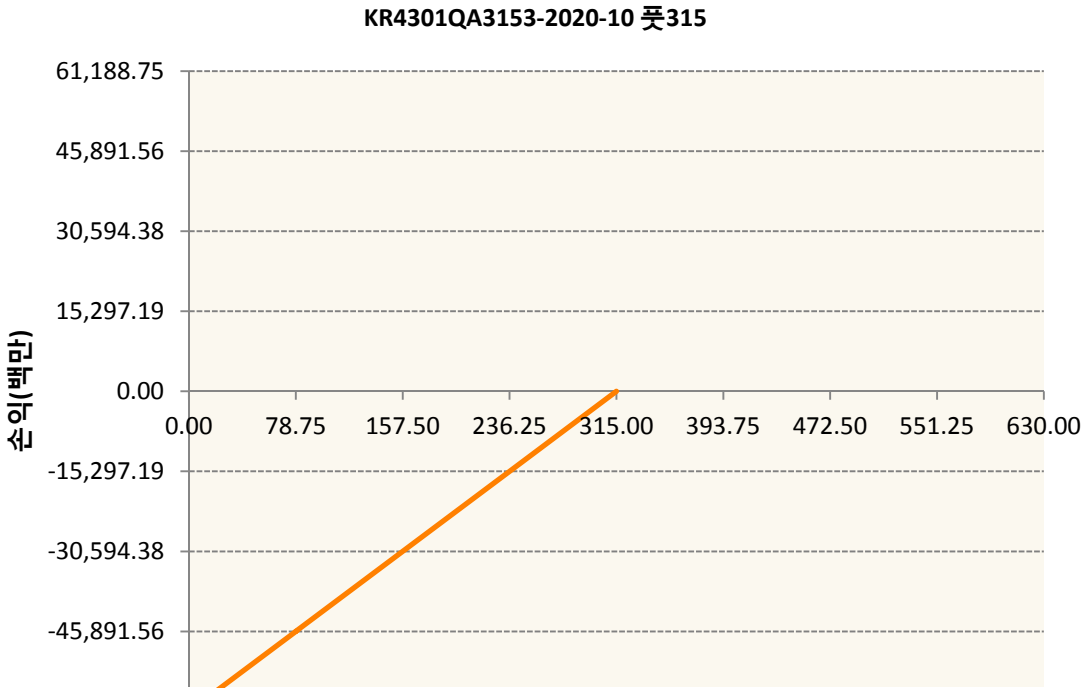
2. 만기시점의 손익구조

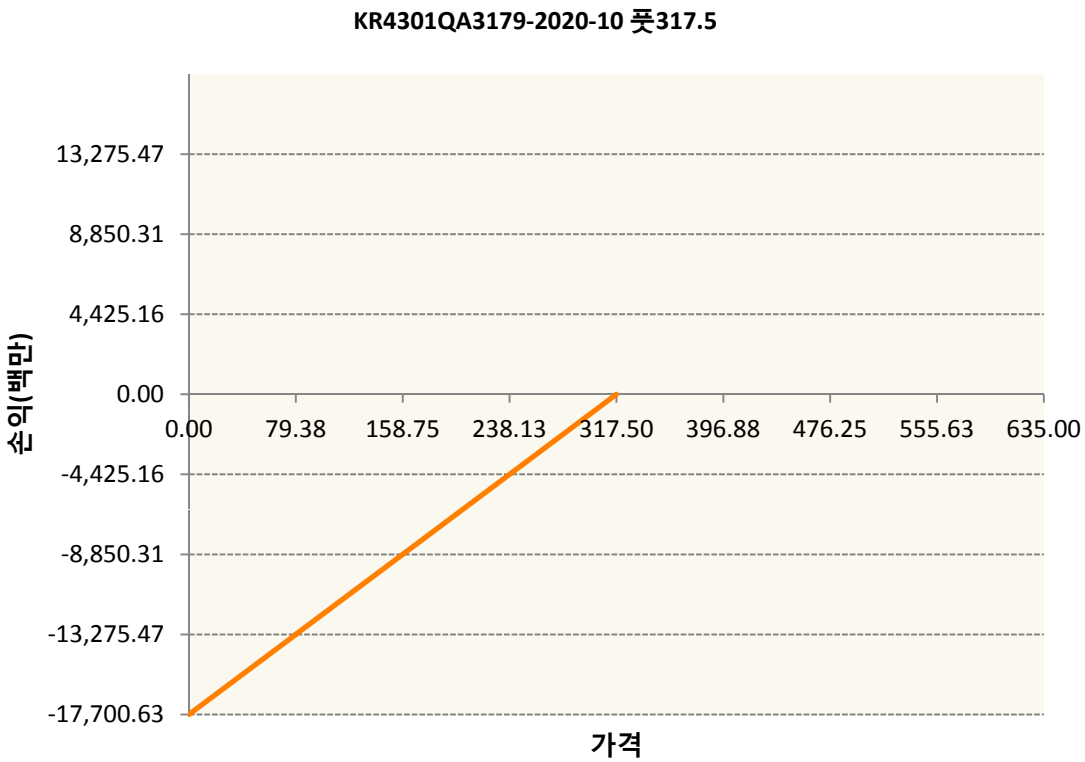





-66,000.31
-99,000.47
-132,000.63
가격


KR4201QB3153-2020-11 콜315
63,000.00
47,250.00
31,500.00
15,750.00
0.00
-15,750.00
-31,500.00
-47,250.00
-63,000.00
손익(백만)
0.00
78.75
157.50
236.25
315.00
393.75
472.50
551.25
630.00
가격


KR4301QA3153-2020-10 풋315
61,188.75
45,891.56
30,594.38
15,297.19
0.00
-15,297.19
-30,594.38
-45,891.56
손익(백만)
0.00
78.75
157.50
236.25
315.00
393.75
472.50
551.25
630.00



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201QA3154	2020-10 콜315						3,597
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	653	653	653	652	652	652	651
-5.33%	652	650	648	644	639	631	623
-2.67%	598	577	553	528	501	473	444
0%	105	71	36	0	-36	-72	-108
2.67%	-1,012	-1,019	-1,029	-1,041	-1,055	-1,072	-1,091
5.33%	-2,300	-2,300	-2,301	-2,302	-2,304	-2,307	-2,311
8.00%	-3,597	-3,597	-3,597	-3,597	-3,597	-3,597	-3,597

KR4201QA3170	2020-10 콜317.5						9,299
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,195	1,195	1,195	1,195	1,194	1,194	1,192
-5.33%	1,194	1,193	1,190	1,186	1,178	1,168	1,153
-2.67%	1,138	1,105	1,065	1,018	964	906	844
0%	307	205	102	0	-102	-205	-307
2.67%	-2,330	-2,369	-2,415	-2,468	-2,527	-2,591	-2,659

5.33%	-5,777	-5,779	-5,783	-5,791	-5,802	-5,817	-5,837
8.00%	-9,294	-9,294	-9,294	-9,294	-9,295	-9,296	-9,299
	KR4201QB3153		2020-11 콜315				4,096
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,876	2,654	2,422	2,183	1,937	1,687	1,433
-5.33%	2,379	2,118	1,854	1,585	1,315	1,042	767
-2.67%	1,717	1,431	1,145	858	571	283	-4
0%	882	588	294	0	-294	-587	-881
2.67%	-122	-408	-696	-985	-1,275	-1,567	-1,859
5.33%	-1,281	-1,544	-1,814	-2,089	-2,367	-2,649	-2,933
8.00%	-2,574	-2,805	-3,048	-3,300	-3,560	-3,826	-4,096
	KR4301QA3153		2020-10 풋315				4,369
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,369	-4,369	-4,369	-4,369	-4,369	-4,369	-4,369
-5.33%	-2,726	-2,726	-2,726	-2,726	-2,726	-2,726	-2,726
-2.67%	-1,084	-1,086	-1,089	-1,093	-1,099	-1,106	-1,114
0%	52	36	18	0	-19	-38	-58
2.67%	107	107	107	107	107	106	105
5.33%	107	107	107	107	107	107	107
8.00%	107	107	107	107	107	107	107
	KR4301QA3179		2020-10 풋317.5				1,340
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,340	-1,340	-1,340	-1,340	-1,340	-1,340	-1,340
-5.33%	-868	-868	-868	-868	-868	-868	-868
-2.67%	-396	-396	-396	-397	-397	-398	-399
0%	20	13	7	0	-7	-13	-20
2.67%	84	84	84	84	83	82	81
5.33%	84	84	84	84	84	84	84
8.00%	84	84	84	84	84	84	84

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

27,657

공시일	2020-10-08
기준일	2020-10-07

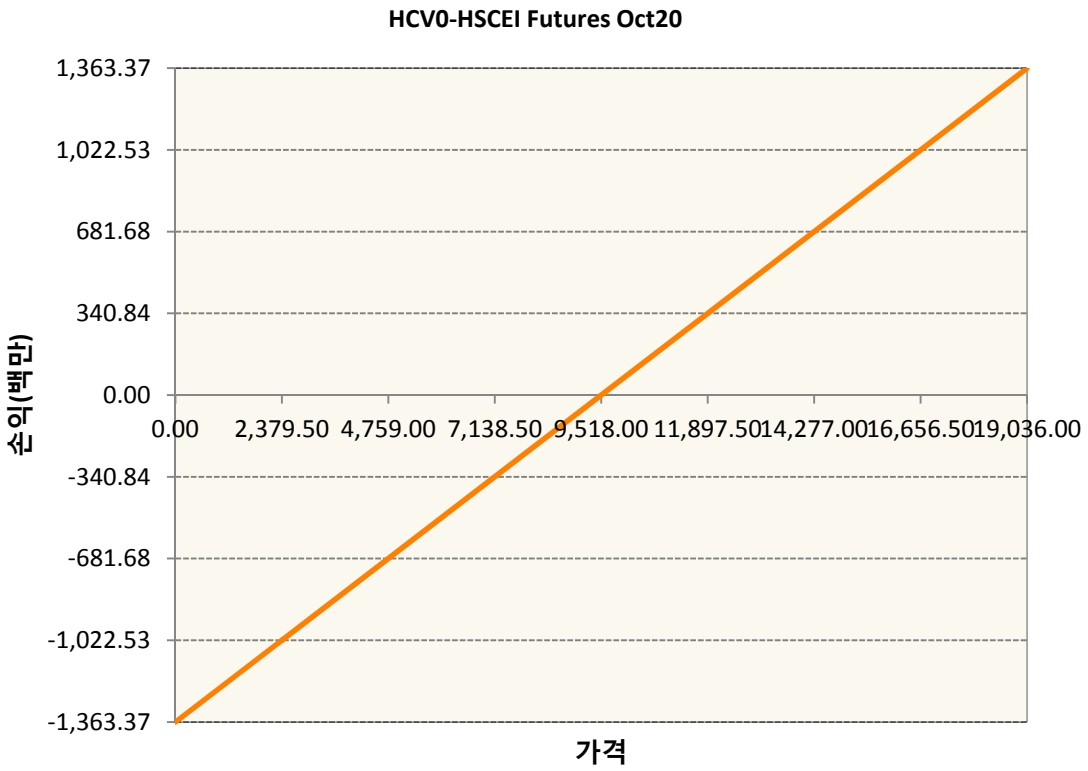
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

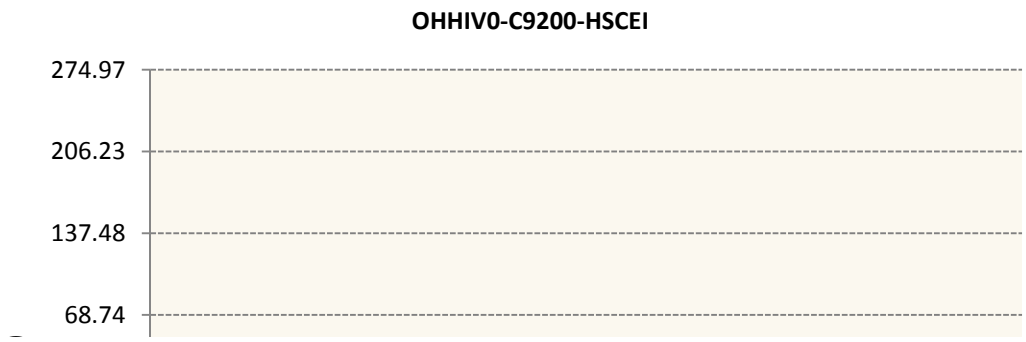
1. 계약금액

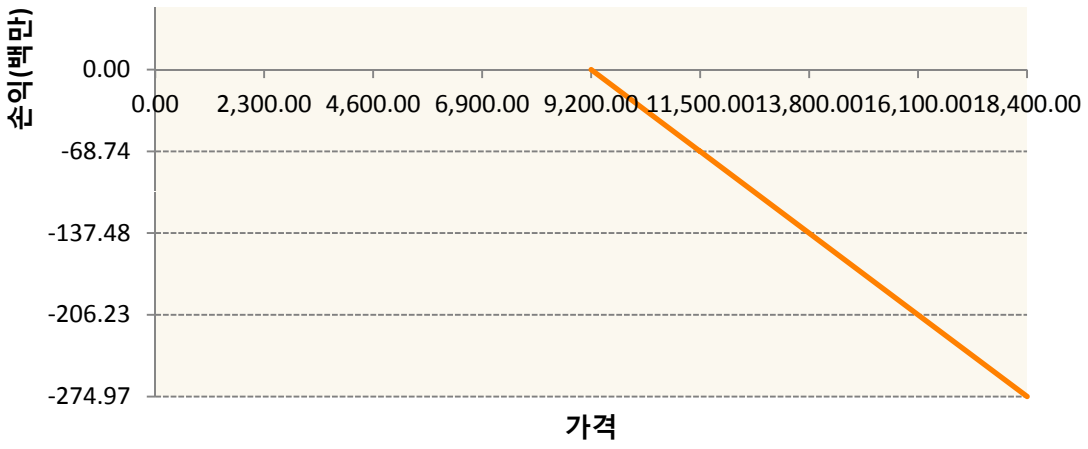
(단위:백만원)

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	1,363	0	1,363	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,607	-3,607	장내
누계	통화	선도	120	1,297	-1,178	장외

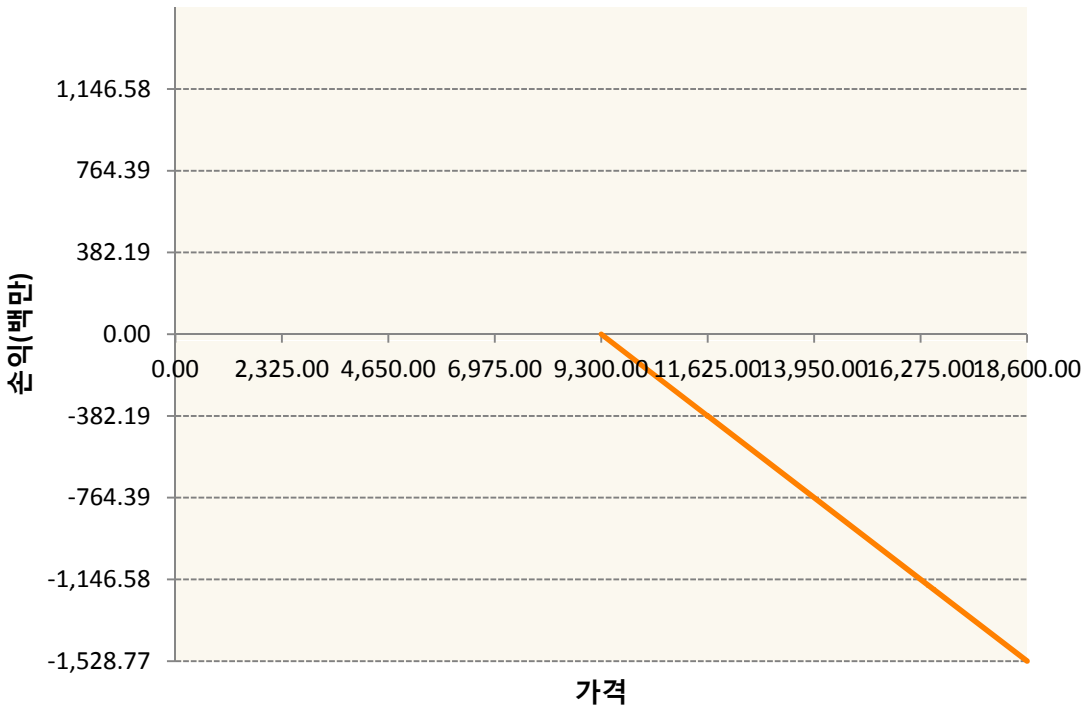
2. 만기시점의 손익구조



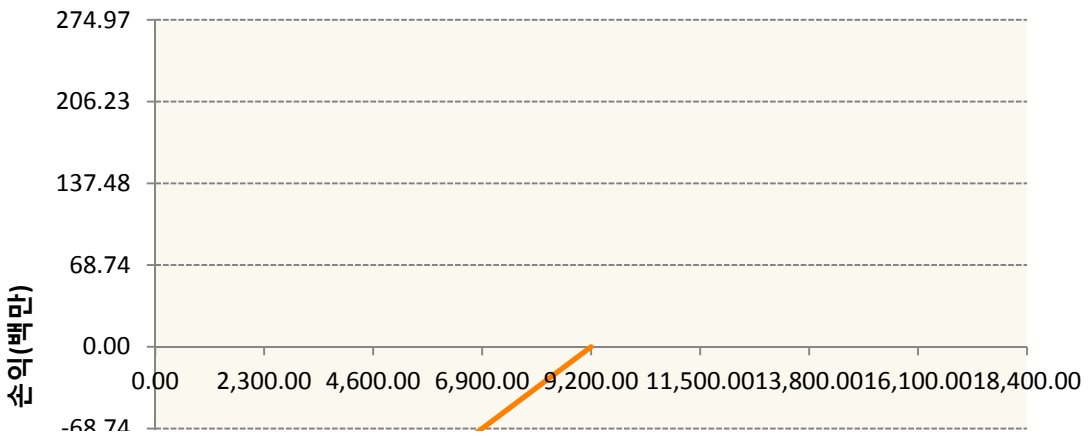


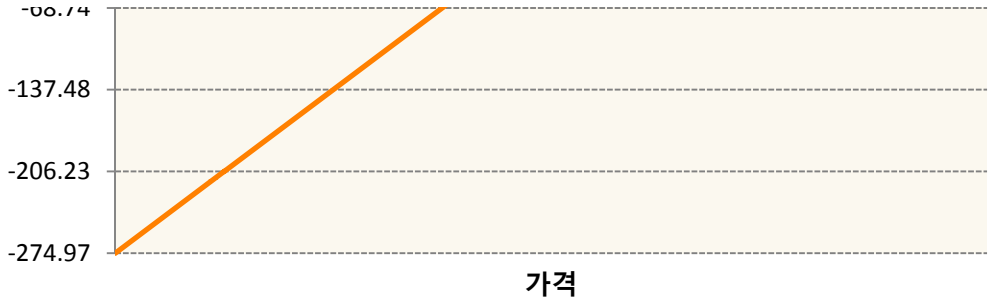


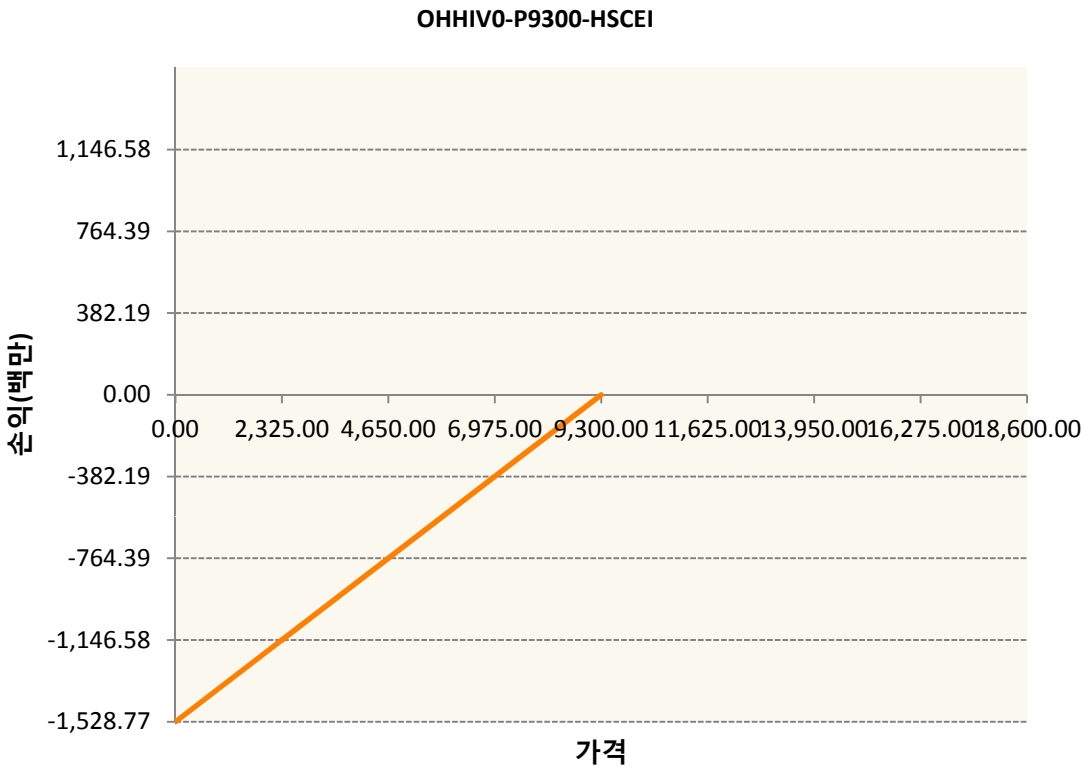
OHHIV0-C9300-HSCEI



OHHIV0-P9200-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21020Q03 KRW/HKD 20-11-20E	104
FX21020U06 HKD/KRW 20-11-20E	10
HCV0 HSCEI Futures Oct20	109
OHHIV0-C92 HSCEI	22
OHHIV0-C93 HSCEI	122
OHHIV0-P92 HSCEI	22
OHHIV0-P93 HSCEI	122

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	502

공시일	2020-10-08
기준일	2020-10-07

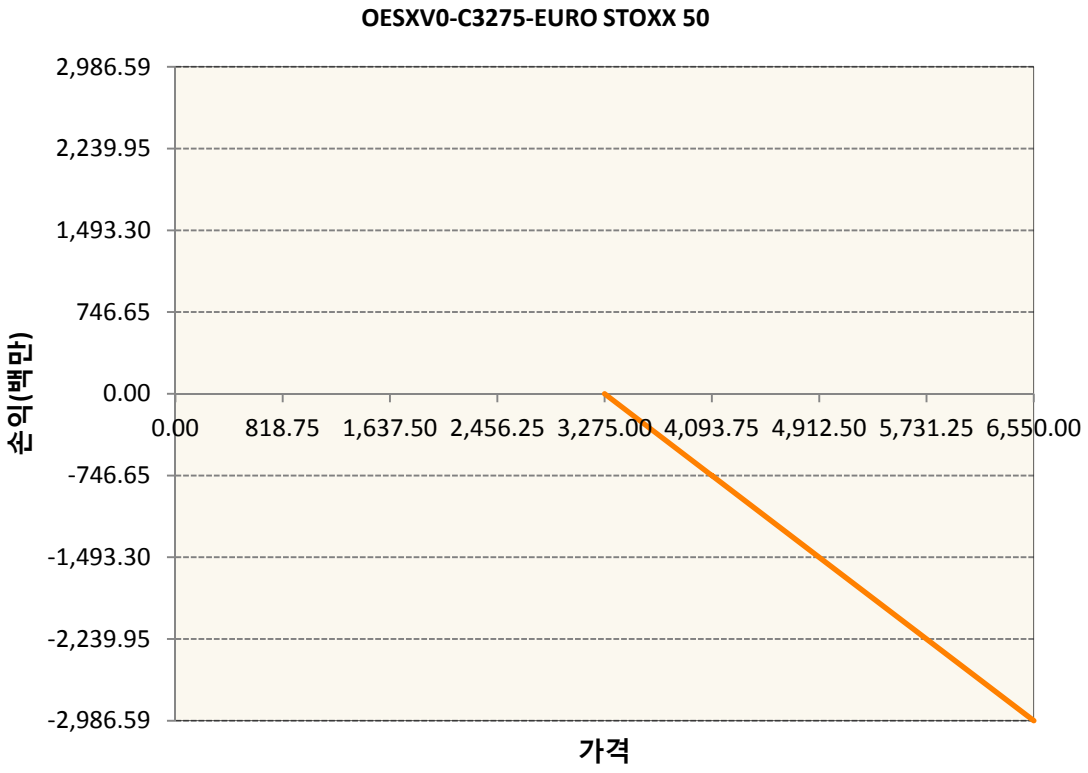
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

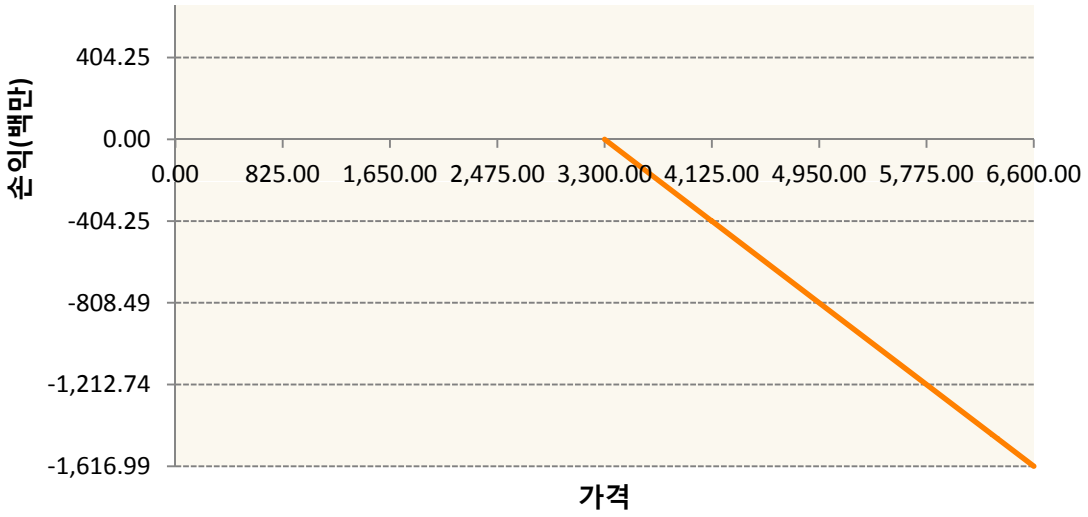
1. 계약금액

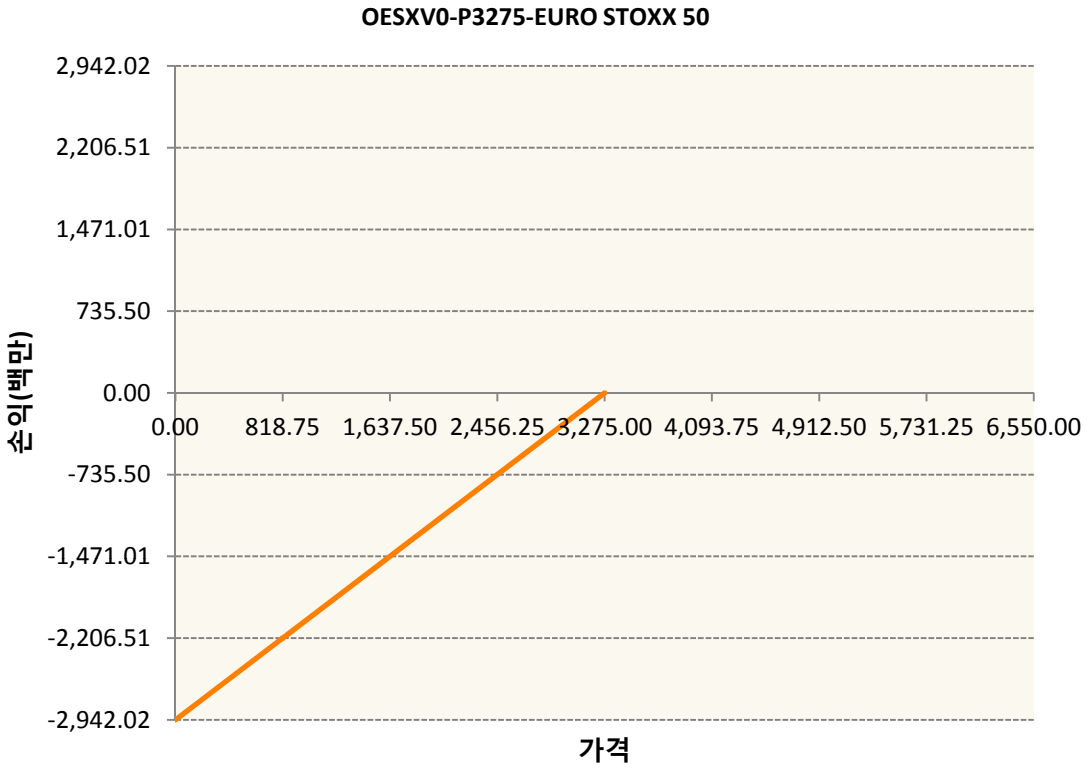
(단위:백만원)

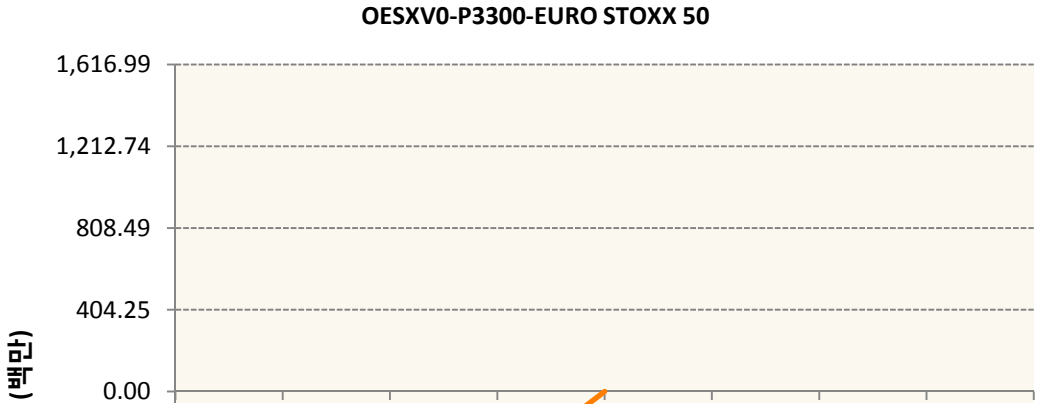
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,063	0	1,063	
누계	유가증권	스왑	10	0	10	장외
누계	유가증권	옵션	0	9,163	-9,163	장내
누계	통화	선도	0	4,219	-4,219	장외

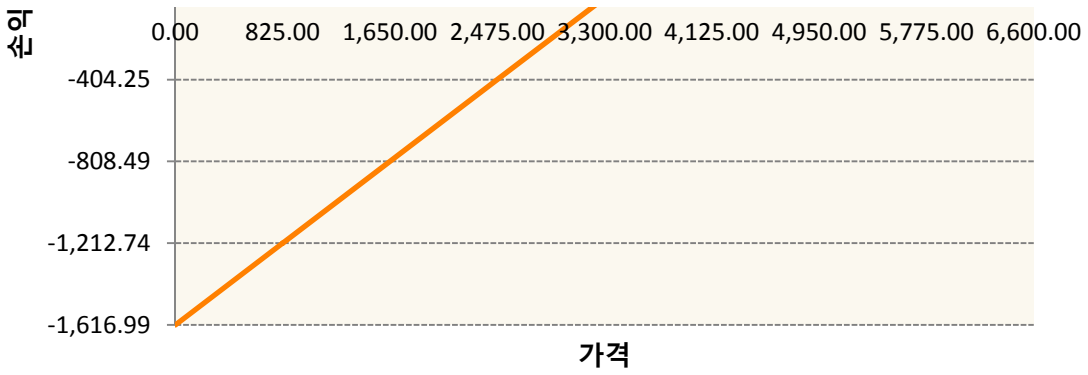
2. 만기시점의 손익구조

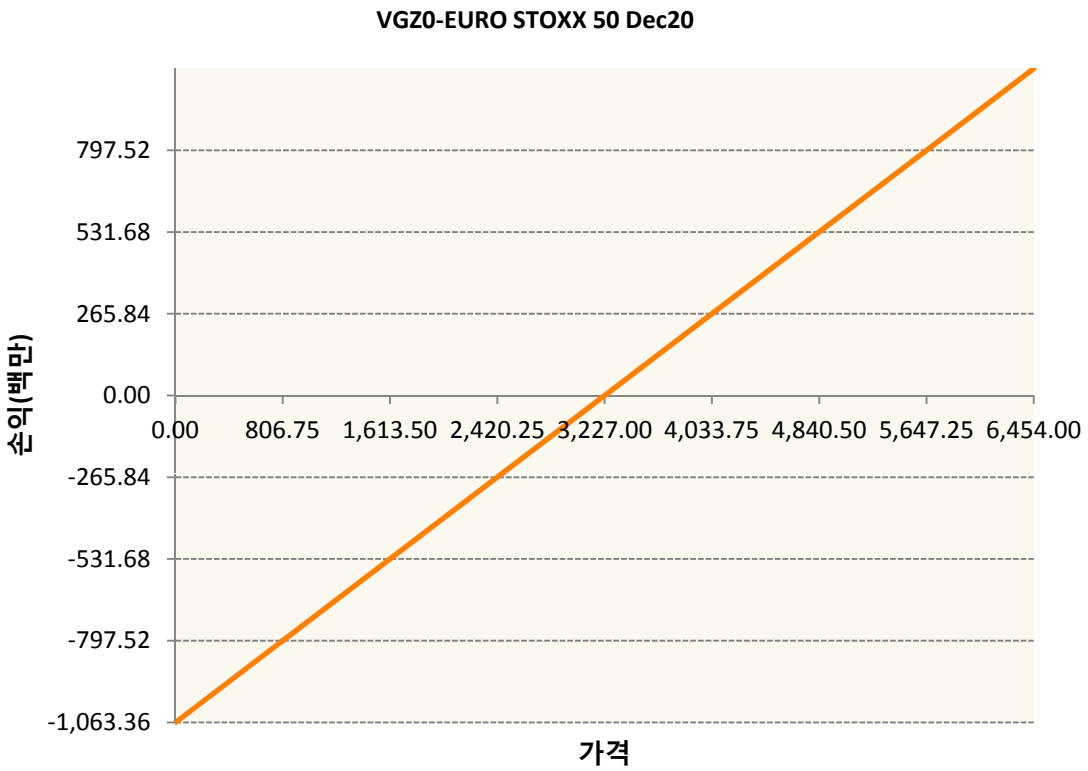



404.25
0.00
-404.25
-808.49
-1,212.74
-1,616.99
0.00
825.00
1,650.00
2,475.00
3,300.00
4,125.00
4,950.00
5,775.00
6,600.00
손익(백만)
가격


OESXV0-P3275-EURO STOXX 50
2,942.02
2,206.51
1,471.01
735.50
0.00
-735.50
-1,471.01
-2,206.51
-2,942.02
0.00
818.75
1,637.50
2,456.25
3,275.00
4,093.75
4,912.50
5,731.25
6,550.00
손익(백만)
가격


OESXV0-P3300-EURO STOXX 50
1,616.99
1,212.74
808.49
404.25
0.00
(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	14
FX21020U05 KRW/EUR 24-12-20E	120
FX21020U05 KRW/EUR 24-12-20E	218
OESXV0-C32 EURO STOXX 50	239
OESXV0-C33 EURO STOXX 50	129
OESXV0-P32 EURO STOXX 50	235
OESXV0-P33 EURO STOXX 50	129
VGZ0 EURO STOXX 50 Dec20	85

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,365

공시일	2020-10-08
기준일	2020-10-07

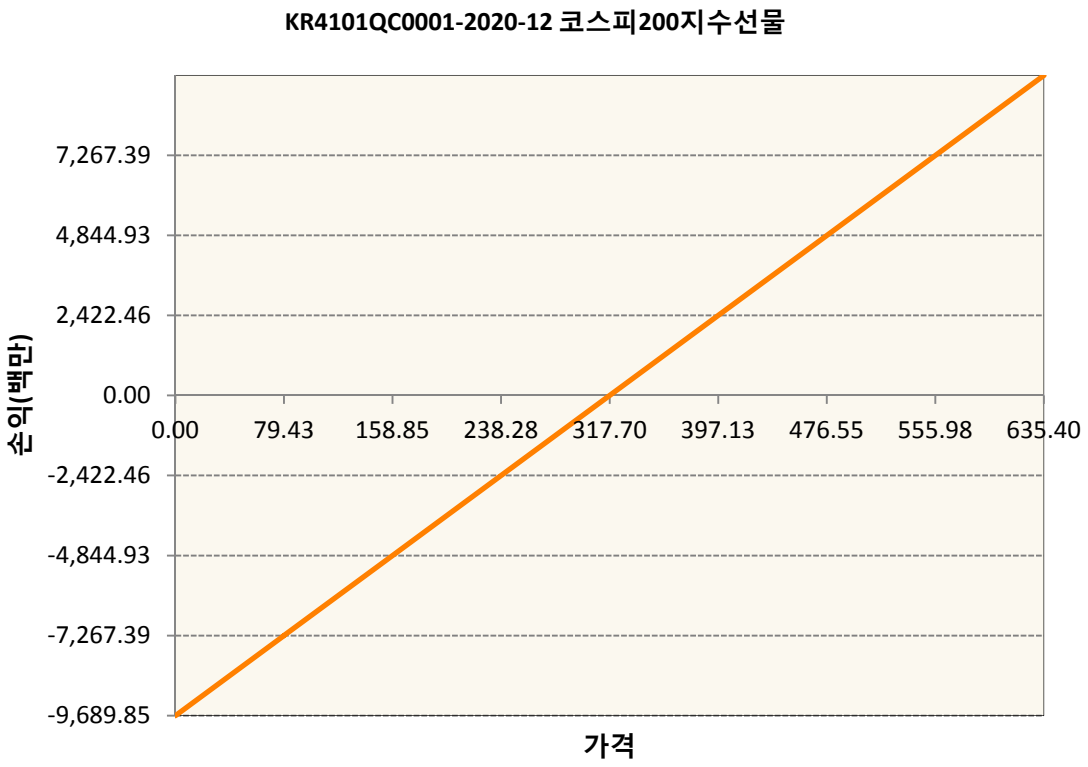
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	9,690	0	9,690	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101QC0001	2020-12 코스피200지수선물						774
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-774	-774	-774	-774	-774	-774	-774
-5.33%	-516	-516	-516	-516	-516	-516	-516
-2.67%	-258	-258	-258	-258	-258	-258	-258
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	258	258	258	258	258	258	258
5.33%	516	516	516	516	516	516	516
8.00%	774	774	774	774	774	774	774

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,258

공시일	2020-10-08
기준일	2020-10-07

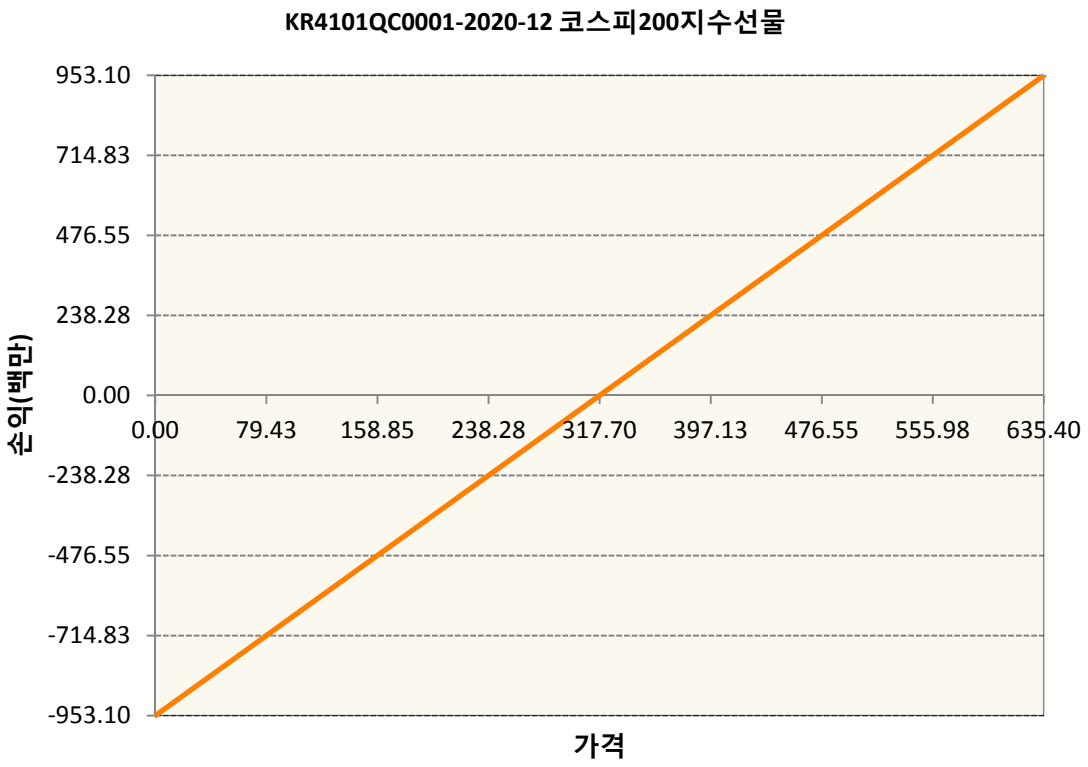
ETF스마트레버리지목표전환형10호

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	953	0	953	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101QC0001	2020-12 코스피200지수선물						76
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
-5.33%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	25	25	25	25	25	25	25
5.33%	51	51	51	51	51	51	51
8.00%	76	76	76	76	76	76	76

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

124

공시일	2020-10-08
기준일	2020-10-07

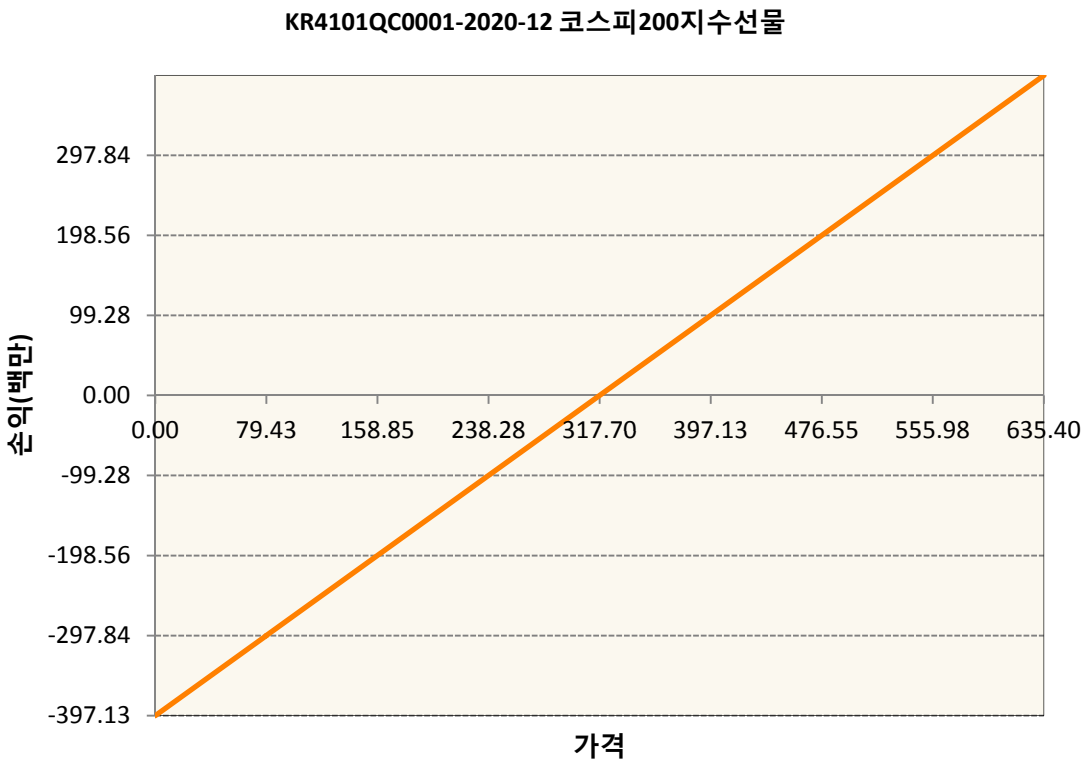
스마트KRX300인덱스목표전환형1호

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	397	0	397	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101QC0001	2020-12 코스피200지수선물						32
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
-5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	11	11	11	11	11	11	11
5.33%	21	21	21	21	21	21	21
8.00%	32	32	32	32	32	32	32

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	52

공시일	2020-10-08
기준일	2020-10-07

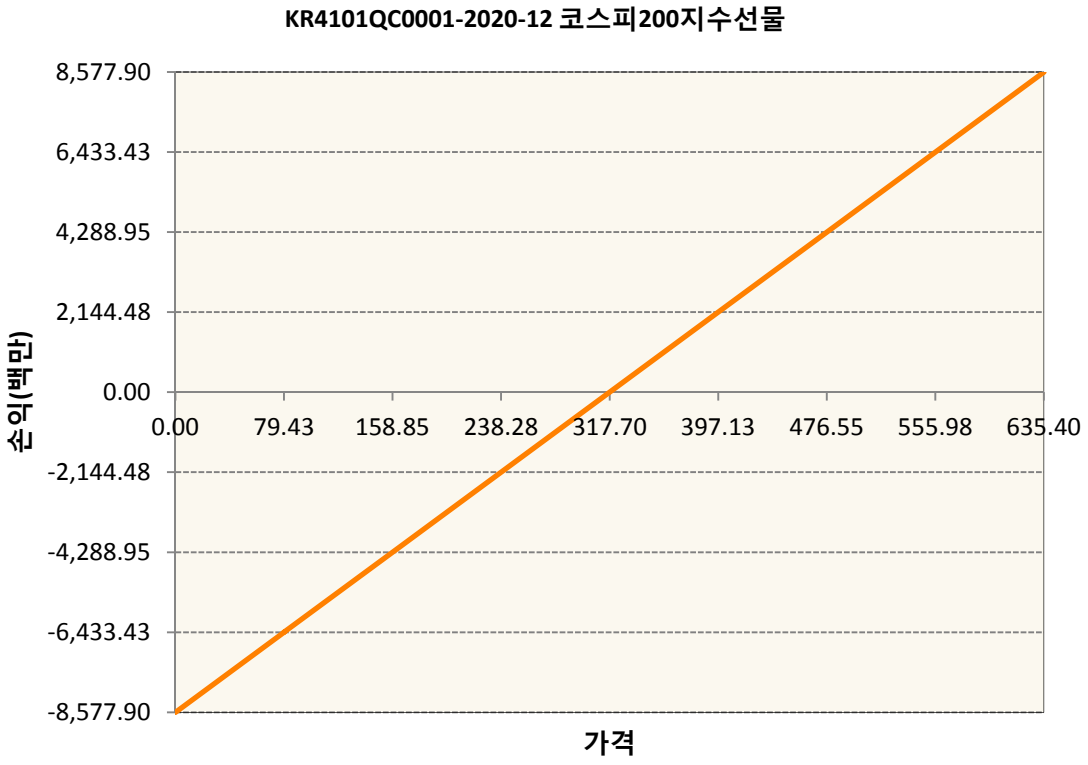
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

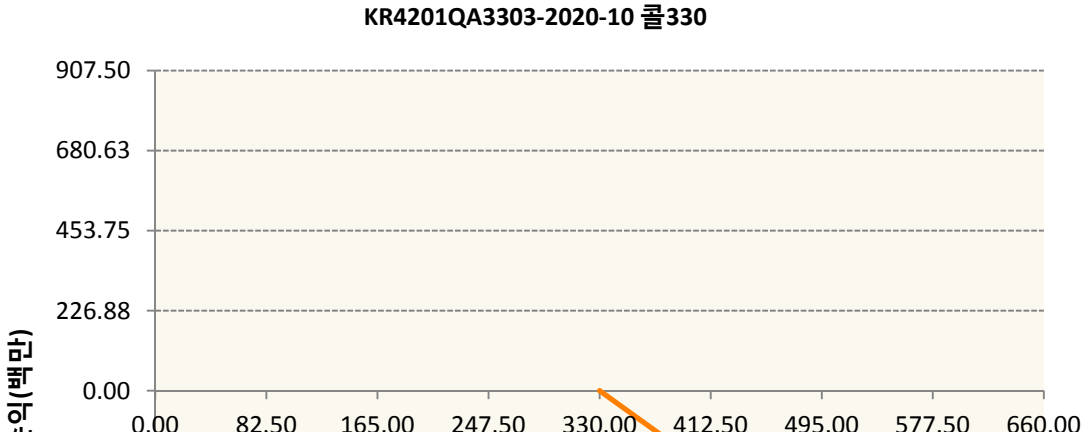
1. 계약금액

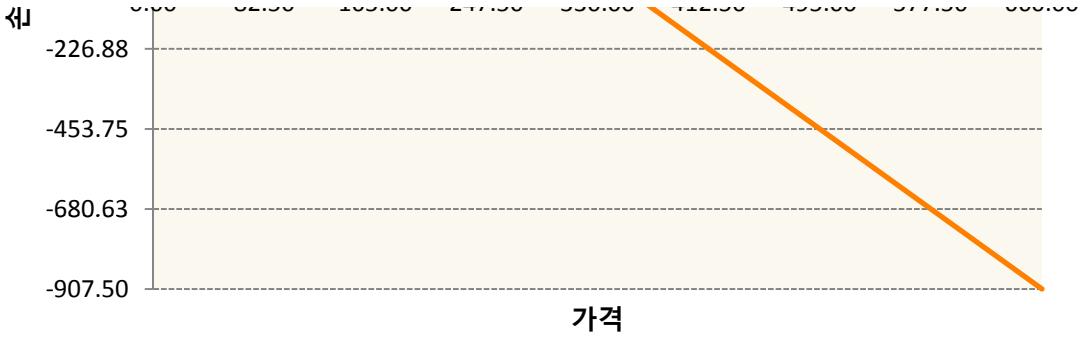
(단위:백만원)

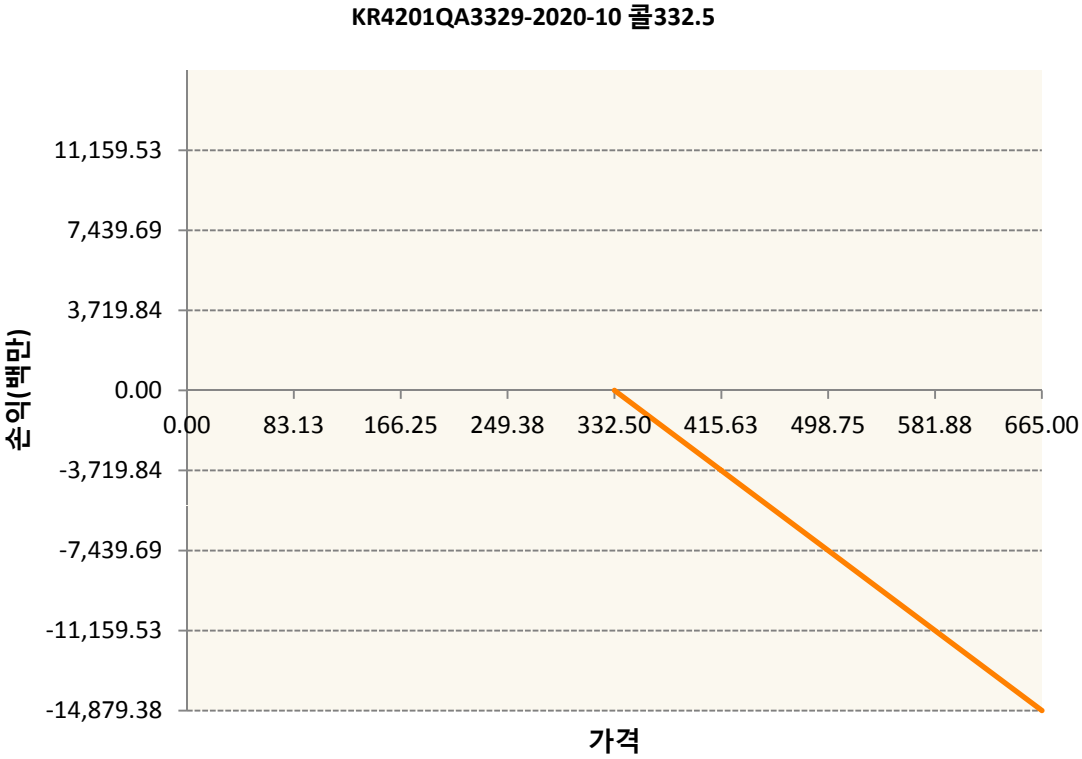
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	159	-159	장내
신규	유가증권	옵션	166	0	166	장내
누계	유가증권	선물	8,578	0	8,578	장내
누계	유가증권	옵션	2,453	15,787	-13,334	장내

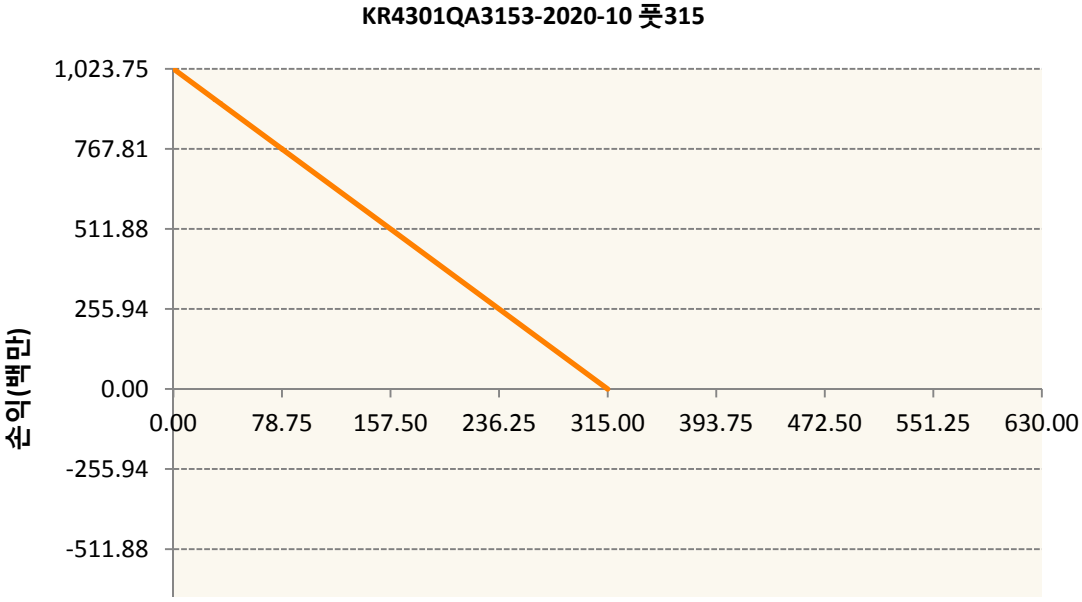
2. 만기시점의 손익구조

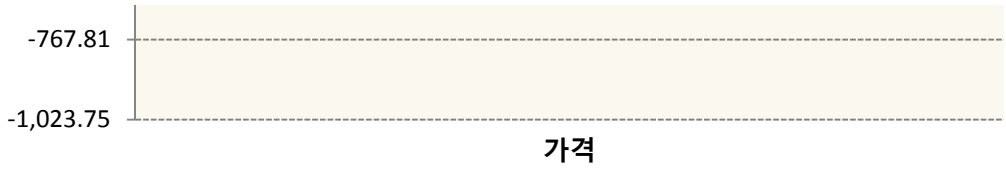


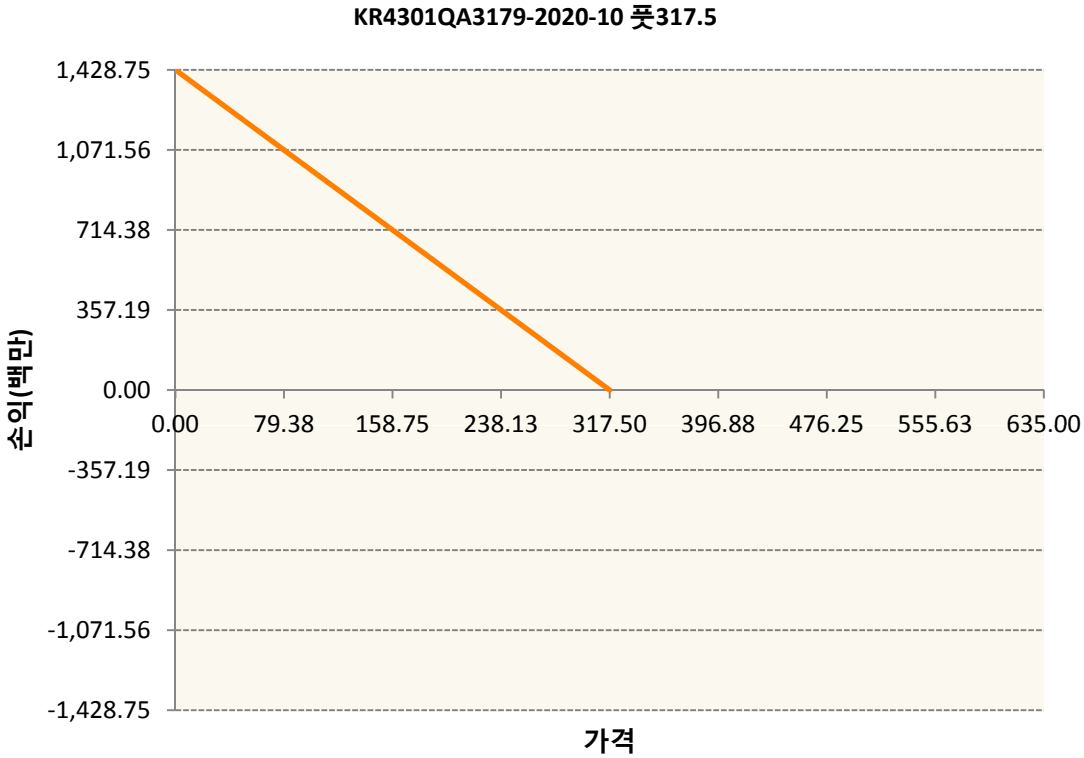



-226.88
-453.75
-680.63
-907.50
가격


KR4201QA3329-2020-10 콜332.5
11,159.53
7,439.69
3,719.84
0.00
-3,719.84
-7,439.69
-11,159.53
-14,879.38
0.00
83.13
166.25
249.38
332.50
415.63
498.75
581.88
665.00
손익(백만)
가격


KR4301QA3153-2020-10 풋315
1,023.75
767.81
511.88
255.94
0.00
-255.94
-511.88
0.00
78.75
157.50
236.25
315.00
393.75
472.50
551.25
630.00
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101QC0001	2020-12 코스피200지수선물						685
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-685	-685	-685	-685	-685	-685	-685
-5.33%	-457	-457	-457	-457	-457	-457	-457
-2.67%	-228	-228	-228	-228	-228	-228	-228
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	228	228	228	228	228	228	228
5.33%	457	457	457	457	457	457	457
8.00%	685	685	685	685	685	685	685
KR4201QA3303	2020-10 콜330						36
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0

0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	-2	-2	-3	-3	-4	-5	-5
5.33%	-13	-14	-15	-15	-16	-16	-17
8.00%	-35	-35	-35	-35	-35	-36	-36
	KR4201QA3329		2020-10 콜332.5				489
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3	3	3	3	3	3	3
-5.33%	3	3	3	3	3	3	3
-2.67%	3	3	3	3	3	2	2
0%	3	2	1	0	-2	-4	-7
2.67%	-13	-19	-26	-33	-41	-50	-59
5.33%	-145	-157	-168	-179	-190	-202	-213
8.00%	-459	-462	-466	-471	-476	-482	-489
	KR4301QA3153		2020-10 풋315				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
-5.33%	46	46	46	46	46	46	46
-2.67%	18	18	18	18	18	19	19
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
	KR4301QA3179		2020-10 풋317.5				108
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	108	108	108	108	108	108	108
-5.33%	70	70	70	70	70	70	70
-2.67%	32	32	32	32	32	32	32
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7

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

1,430

공시일	2020-10-08
기준일	2020-10-07

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	43,749	0	43,749	

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	2020-10-08
기준일	2020-10-07

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	28,261	0	28,261	

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	2020-10-08
기준일	2020-10-07

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	118,992	0	118,992	
누계	통화	선도	290,129	422,048	-131,919	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020N06	KRW/USD	03-11-20E	3,243
FX21020N06	KRW/USD	03-11-20E	6,764
FX21020Q02	KRW/USD	26-10-20E	927
FX21020Q02	KRW/USD	26-10-20E	2,261
FX21020Q03	KRW/USD	24-11-20E	3,567
FX21020Q03	KRW/USD	24-11-20E	1,668
FX21020Q04	KRW/USD	24-11-20E	6,078
FX21020Q04	KRW/USD	24-11-20E	1,529
FX21020Q06	USD/KRW	24-11-20E	649
FX21020U00	USD/KRW	24-11-20E	278
FX21020U02	KRW/USD	26-10-20E	2,335
FX21020U02	KRW/USD	26-10-20E	1,927
FX21020U02	USD/KRW	24-11-20E	2,780
FX21020U02	USD/KRW	24-11-20E	5,939
FX21020U02	USD/KRW	24-11-20E	3,197
FX21020U03	USD/KRW	03-11-20E	1,334
FX21020U03	USD/KRW	26-10-20E	1,242
FX21020U03	USD/KRW	03-11-20E	5,430
FX21020U03	USD/KRW	26-10-20E	1,112
FX21020U04	USD/KRW	26-10-20E	1,112
FX21020U04	KRW/USD	26-10-20E	964
FX21020U04	KRW/USD	26-10-20E	2,502
FX21020U06	USD/KRW	03-11-20E	139
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음		
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음		

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	28,672

공시일	2020-10-08
기준일	2020-10-07

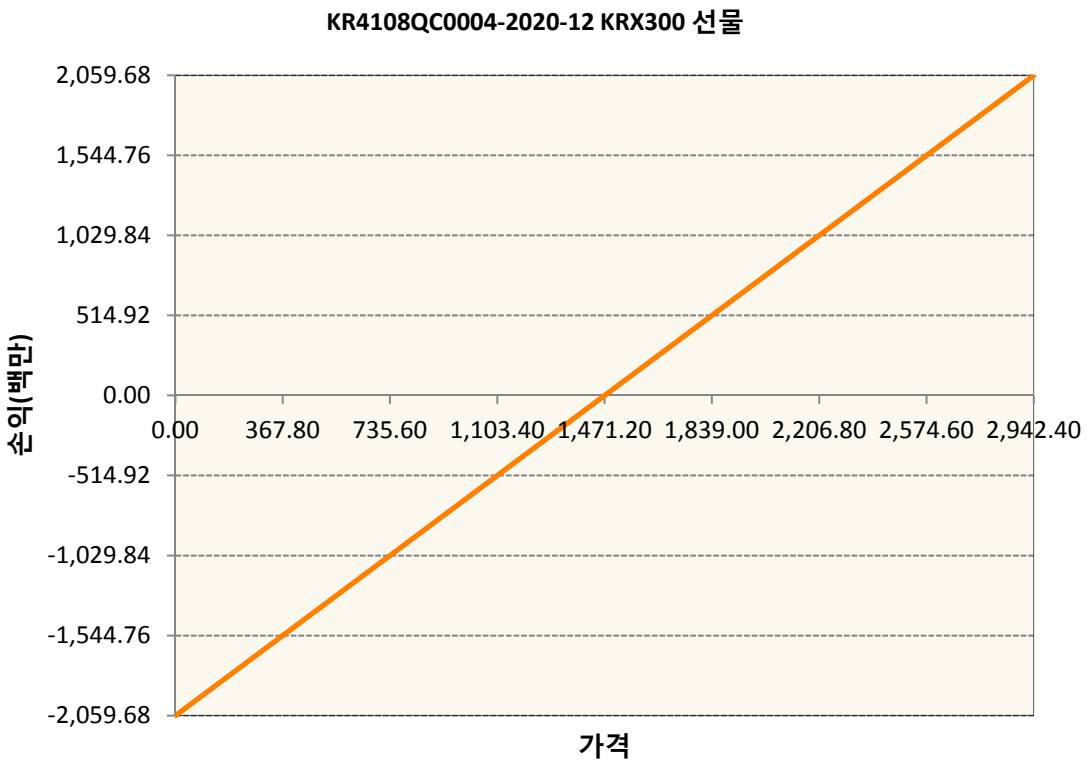
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	2,060	0	2,060	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4108QC0004	2020-12 KRX300 선물						165
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-165	-165	-165	-165	-165	-165	-165
-5.33%	-110	-110	-110	-110	-110	-110	-110
-2.67%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	55	55	55	55	55	55	55
5.33%	110	110	110	110	110	110	110
8.00%	165	165	165	165	165	165	165

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	268

공시일	2020-10-08
기준일	2020-10-07

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	3,822	0	3,822	
누계	통화	선도	429	4,204	-3,776	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020U02 KRW/USD 13-10-20E	160
FX21020U03 KRW/USD 21-10-20E	45
FX21020U05 KRW/USD 28-10-20E	4
FX21020U05 KRW/USD 28-10-20E	127
FX21020U06 USD/KRW 13-10-20E	3
FX21020V00 USD/KRW 13-10-20E	32
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

187

공시일	2020-10-08
기준일	2020-10-07

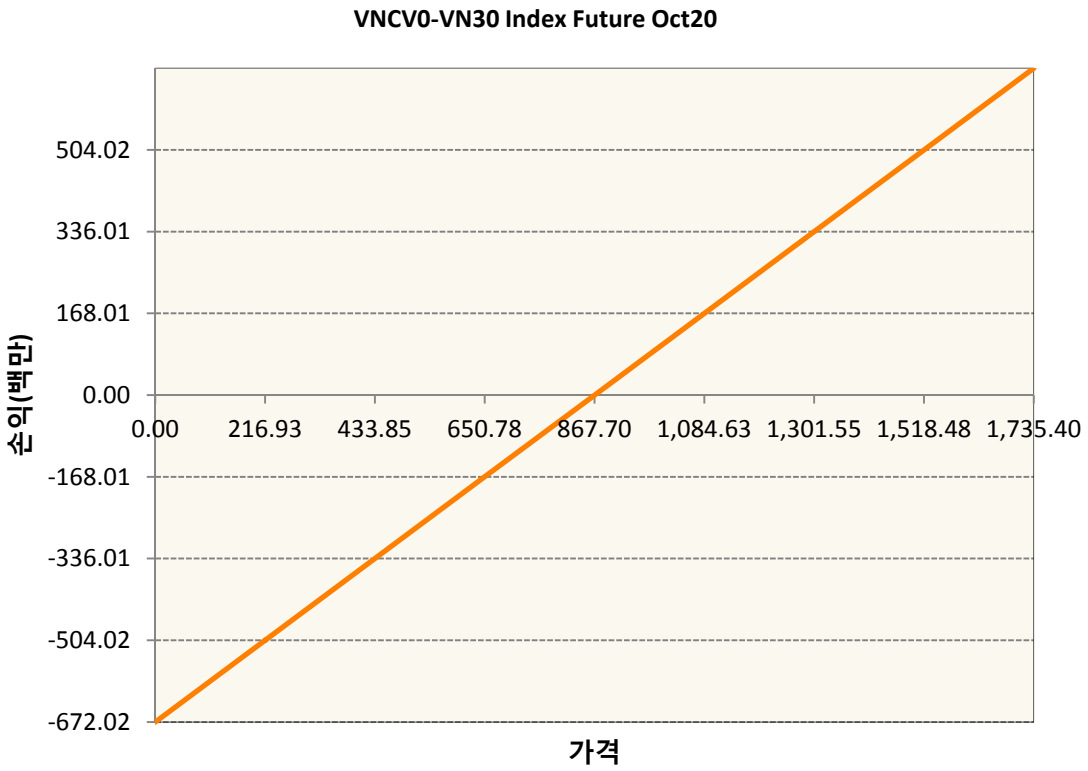
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	672	0	672	
누계	유가증권	스왑	949	0	949	장외
누계	통화	선도	0	789	-789	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	76
FX21020N04 KRW/EUR 23-10-20E	33
FX21020Q00 KRW/EUR 23-10-20E	5
FX21020Q05 KRW/EUR 27-11-20E	9
FX21020Q05 KRW/EUR 27-11-20E	5
FX21020U05 KRW/EUR 27-11-20E	5

FX21020U06	KRW/EUR 27-11-20E	5
VNCV0	VN30 Index Future Oct20	54

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

166

공시일	2020-10-08
기준일	2020-10-07

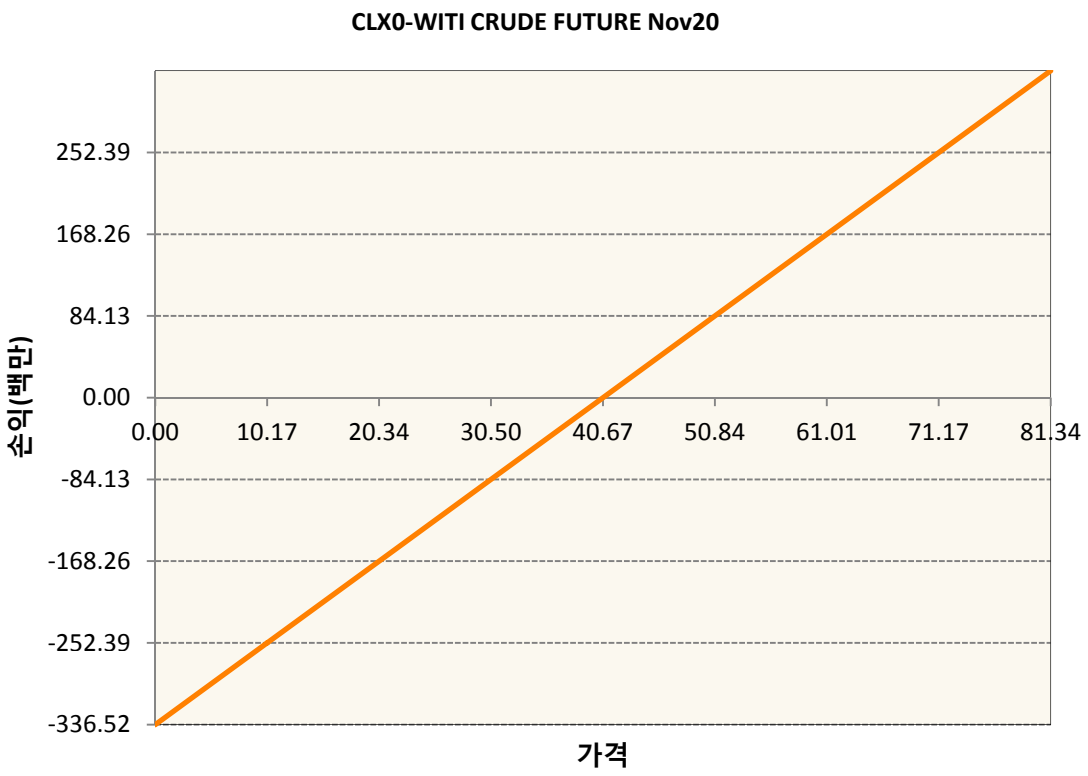
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

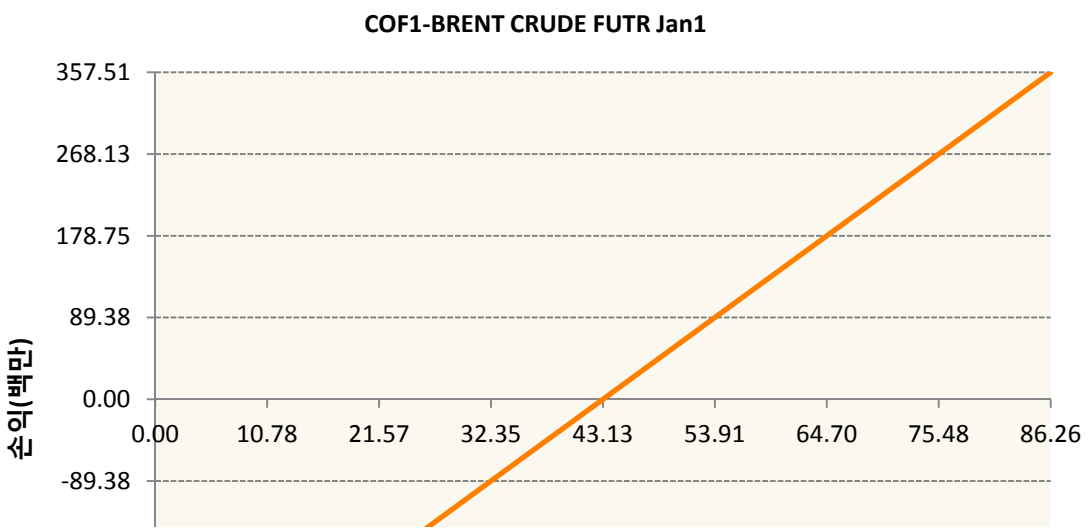
1. 계약금액

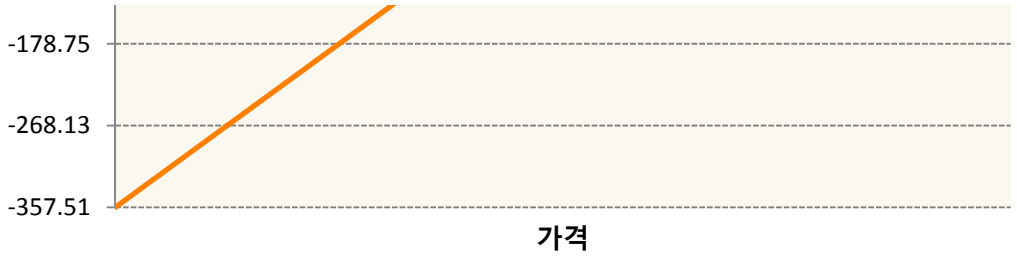
(단위:백만원)

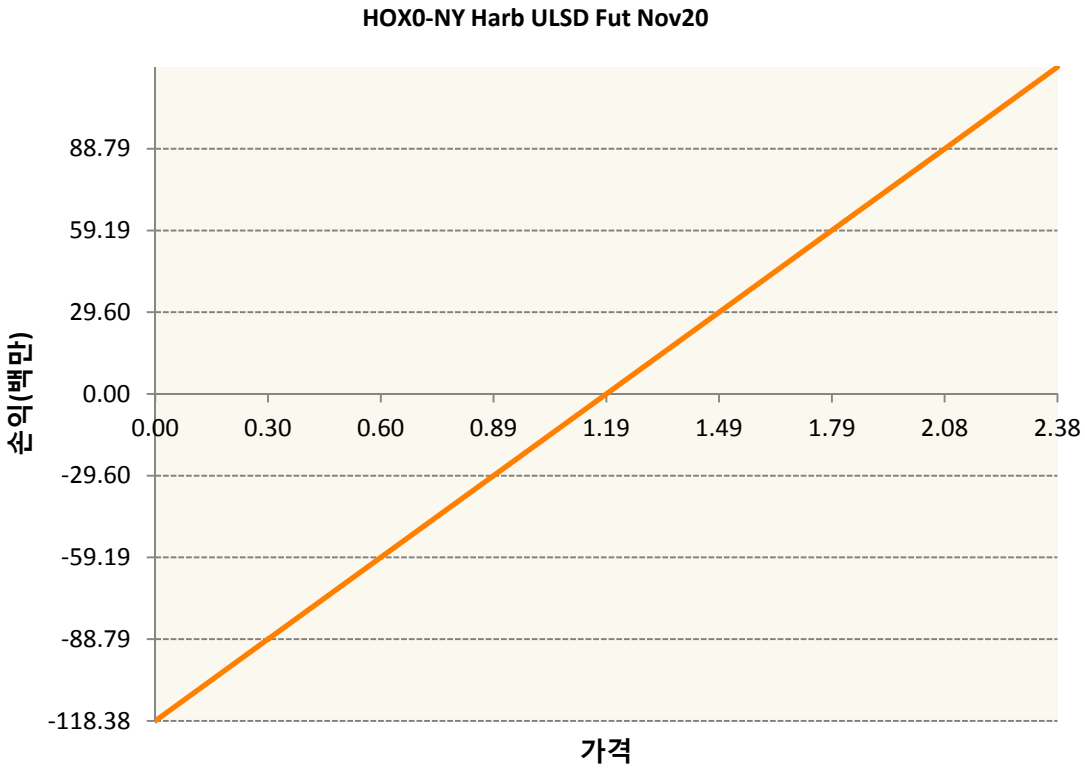
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,806	232	1,574	

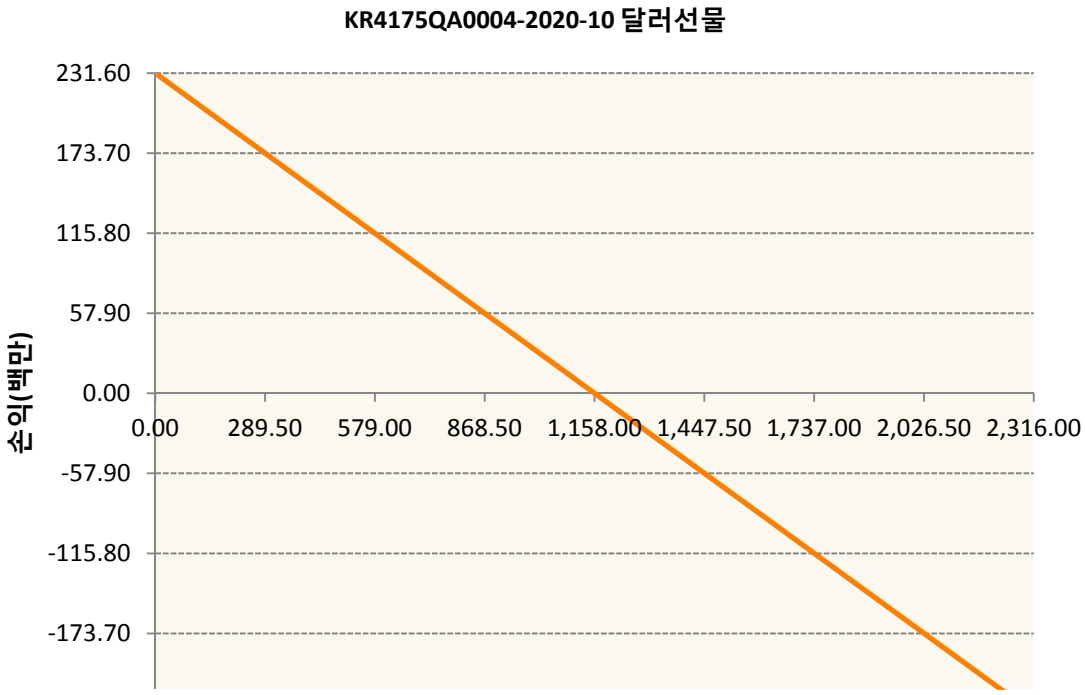
2. 만기시점의 손익구조

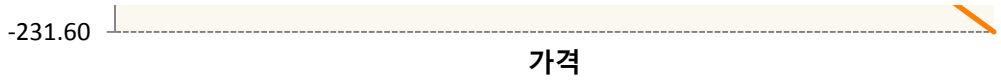


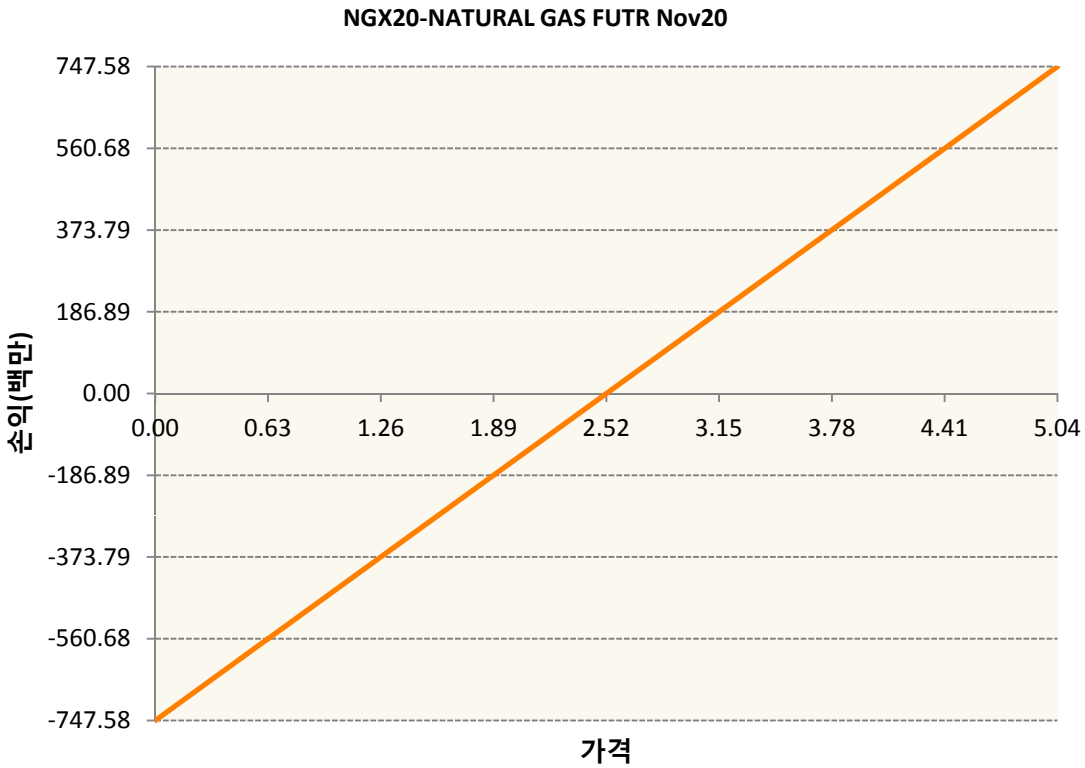


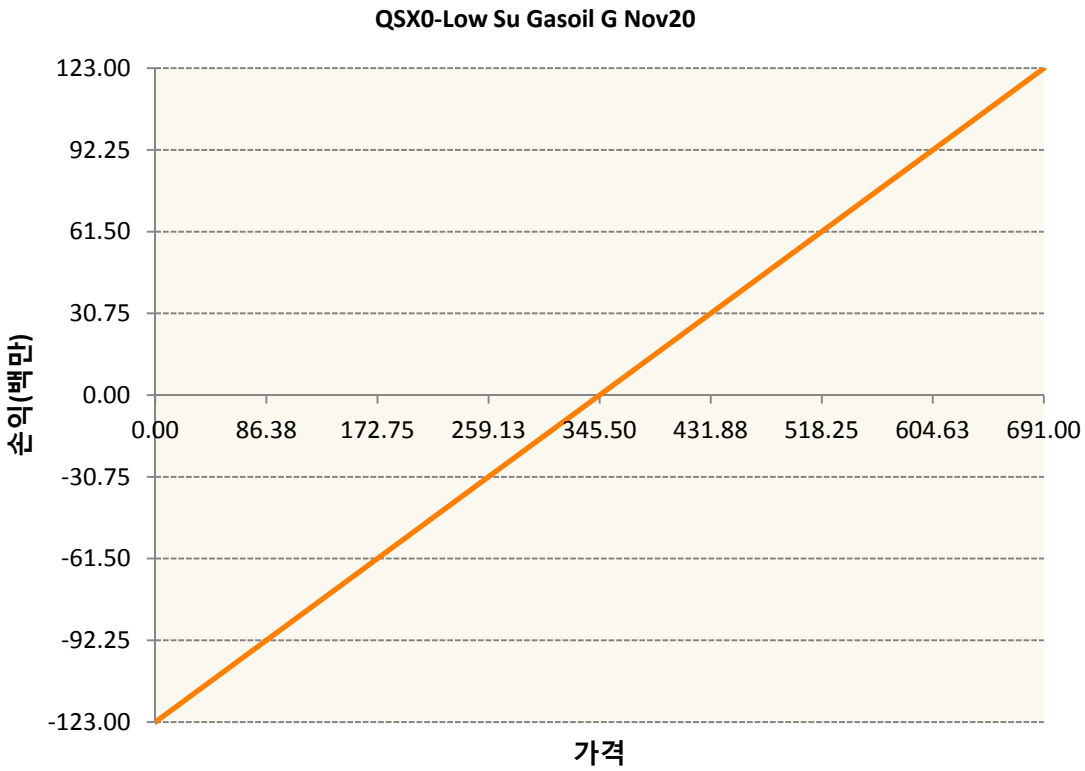

-178.75
-268.13
-357.51
가격

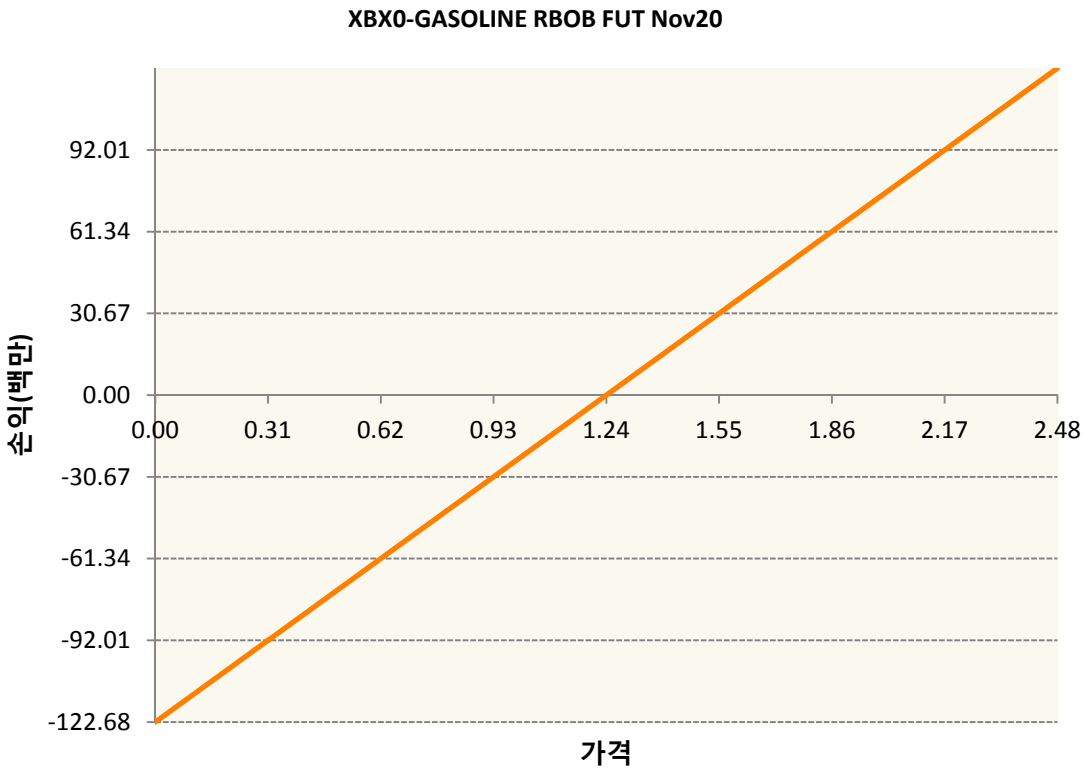

HOX0-NY Harb ULSD Fut Nov20
88.79
59.19
29.60
0.00
-29.60
-59.19
-88.79
-118.38
손익(백만)
0.00
0.30
0.60
0.89
1.19
1.49
1.79
2.08
2.38
가격


KR4175QA0004-2020-10 달러선물
231.60
173.70
115.80
57.90
0.00
-57.90
-115.80
-173.70
손익(백만)
0.00
289.50
579.00
868.50
1,158.00
1,447.50
1,737.00
2,026.50
2,316.00


-231.60
가격


NGX20-NATURAL GAS FUTR Nov20
747.58
560.68
373.79
186.89
0.00
-186.89
-373.79
-560.68
-747.58
0.00
0.63
1.26
1.89
2.52
3.15
3.78
4.41
5.04
손익(백만)
가격


QSX0-Low Su Gasoil G Nov20
123.00
92.25
61.50
30.75
0.00
-30.75
-61.50
-92.25
-123.00
0.00
86.38
172.75
259.13
345.50
431.88
518.25
604.63
691.00
손익(백만)
가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX0	WITI CRUDE FUTURE Nov20	27
COF1	BRENT CRUDE FUTR Jan1	29
HOX0	NY Harb ULSD Fut Nov20	9
KR4175QA0(	2020-10 달러선물	19
NGX20	NATURAL GAS FUTR Nov20	60
QSX0	Low Su Gasoil G Nov20	10
XBX0	GASOLINE RBOB FUT Nov20	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	855

공시일	2020-10-08
기준일	2020-10-07

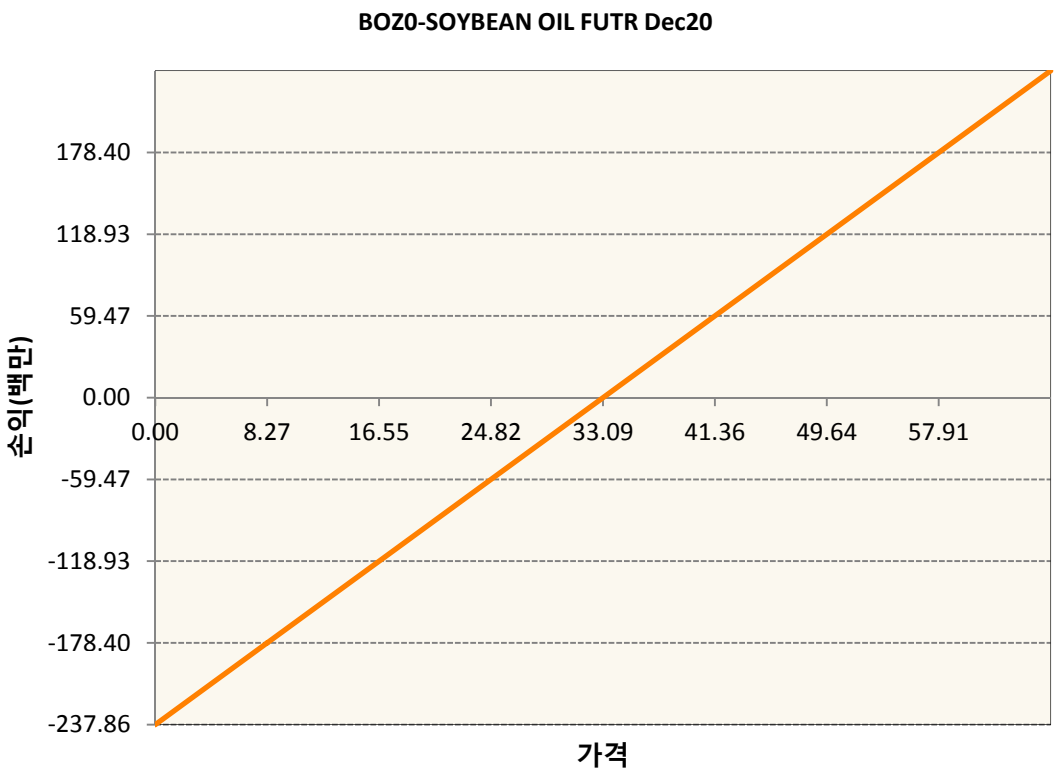
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

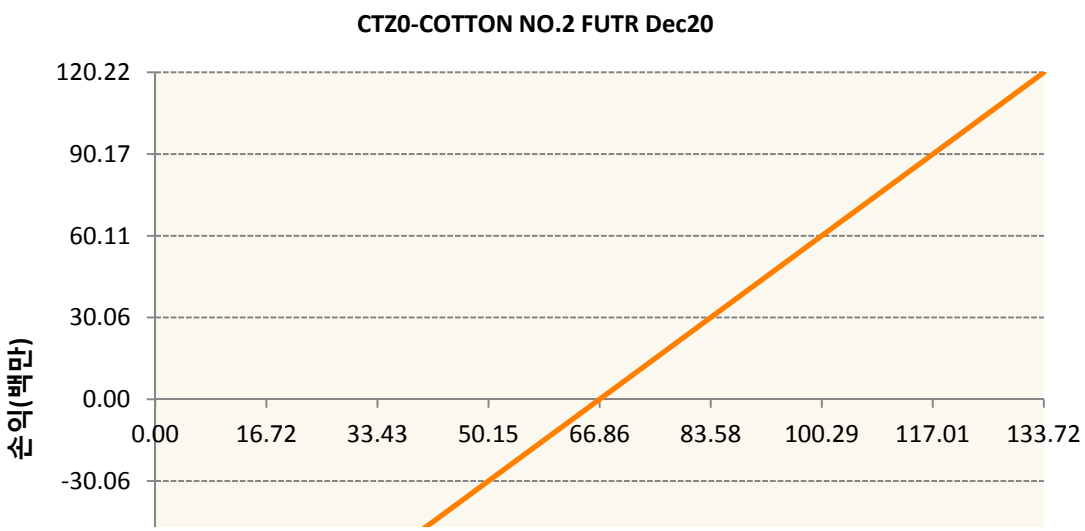
1. 계약금액

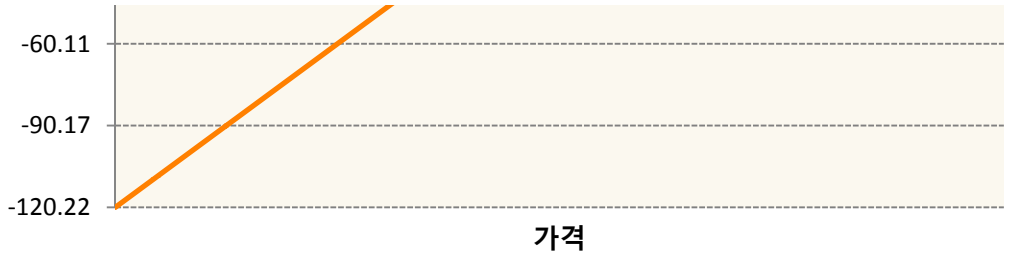
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,735	232	2,503	

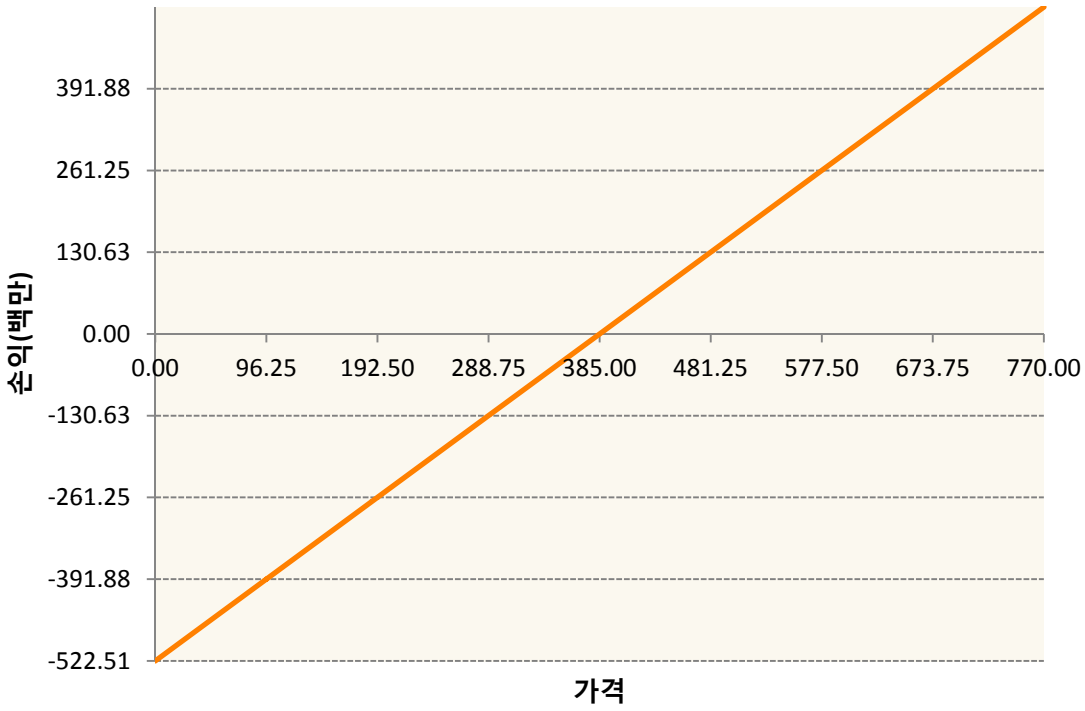
2. 만기시점의 손익구조



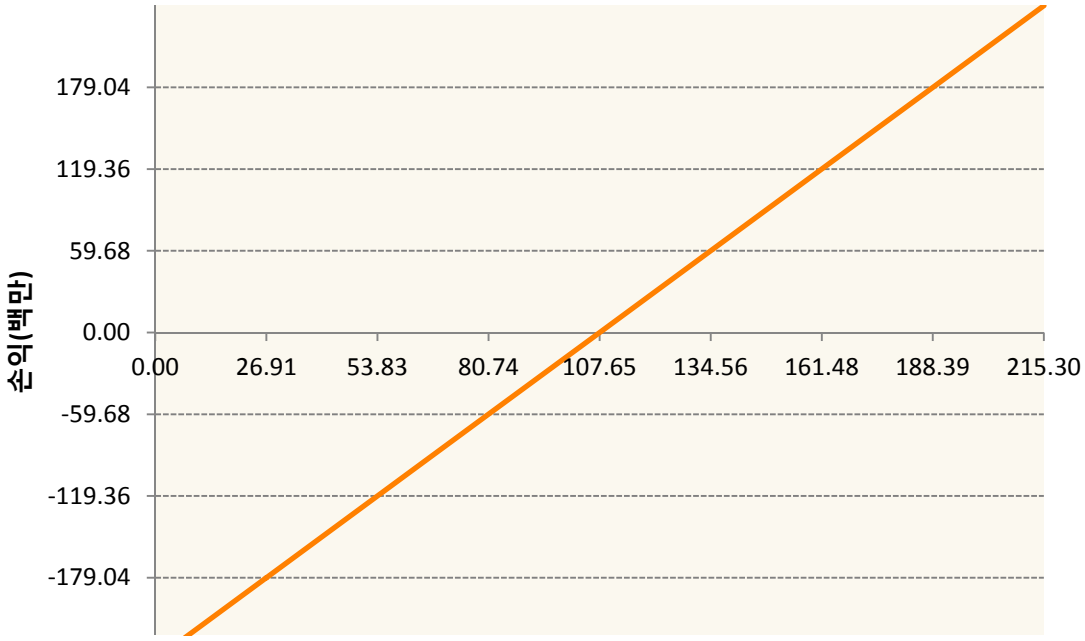


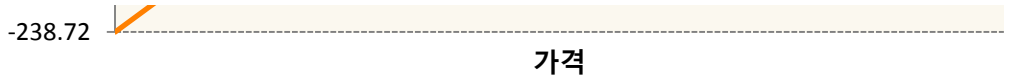


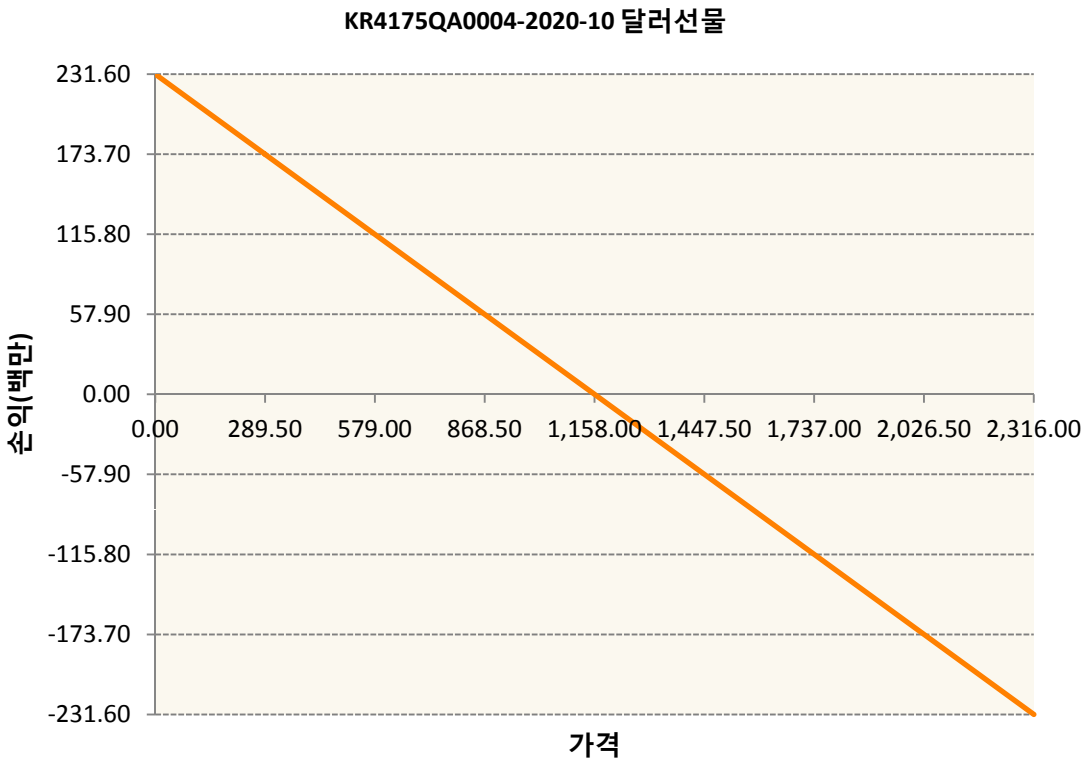
CZ0-CORN FUTURE Dec20

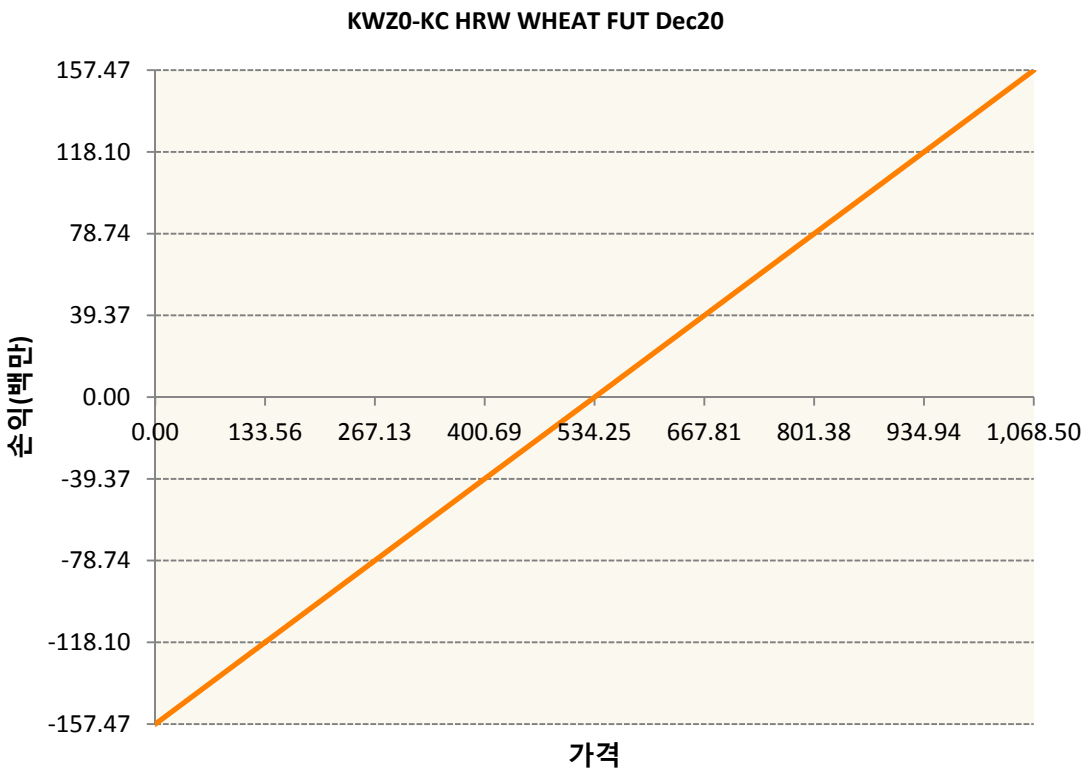


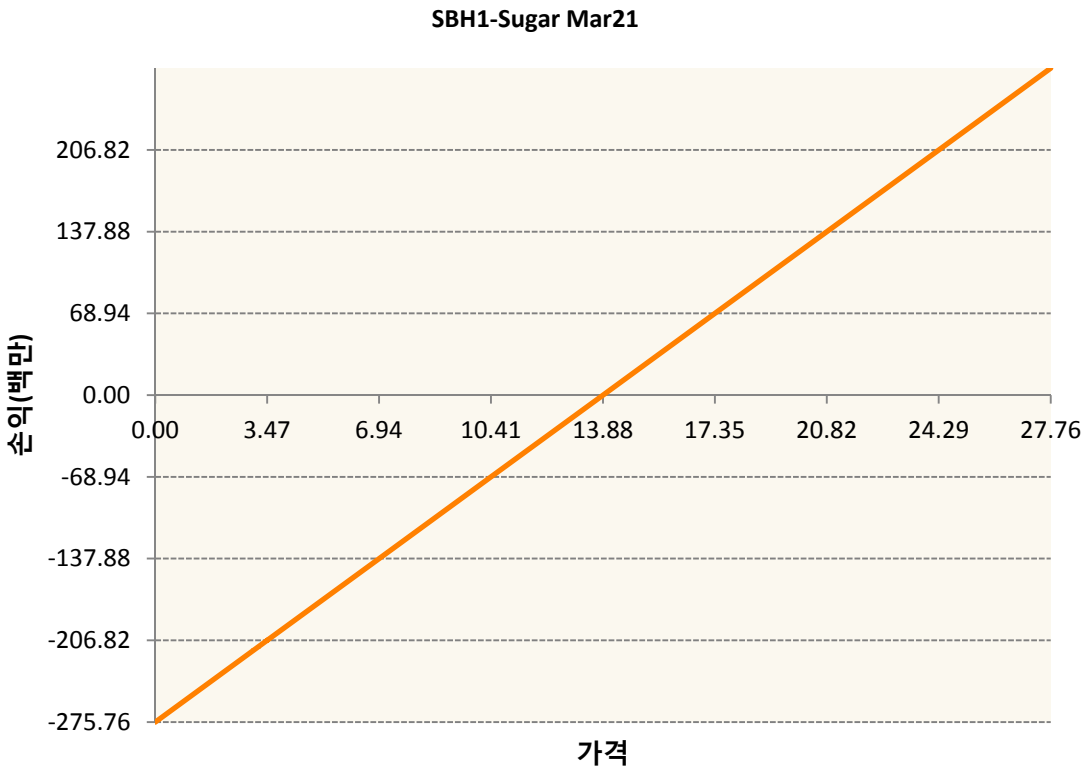
KCZ0-COFFEE 'C' FUTURE Dec20

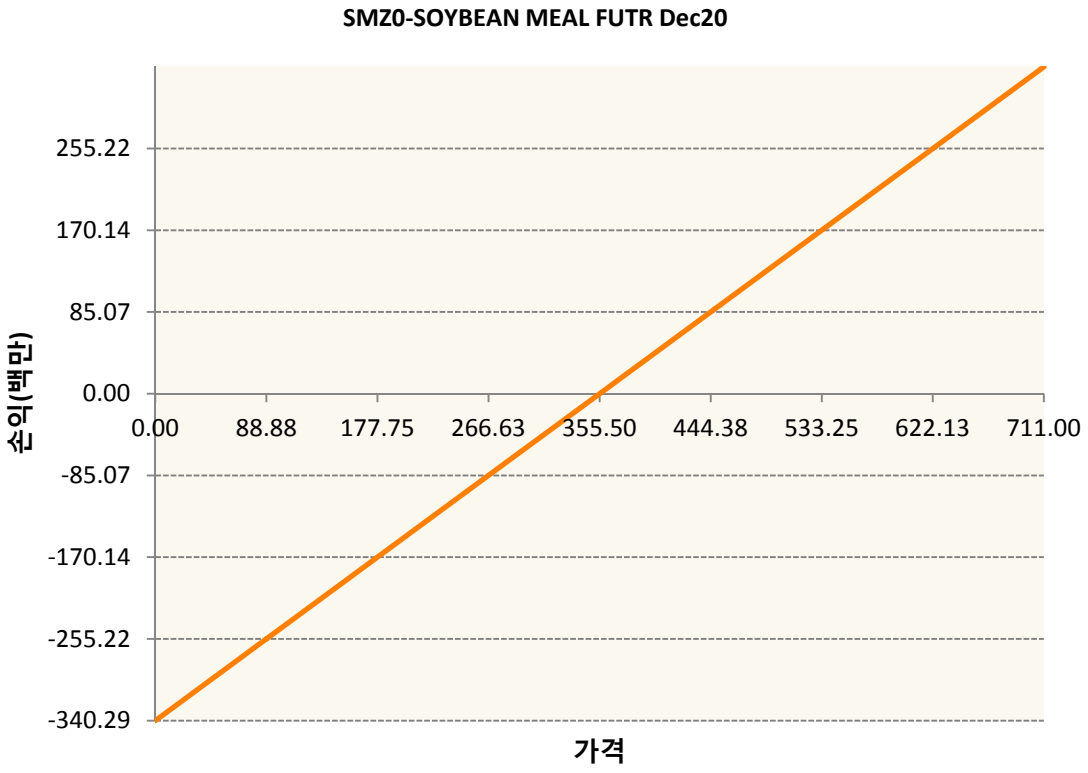


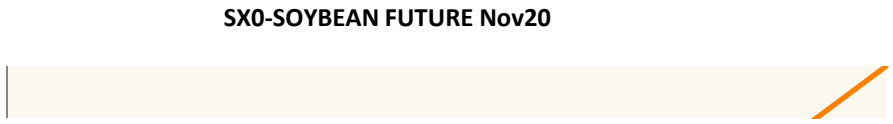

-238.72
가격

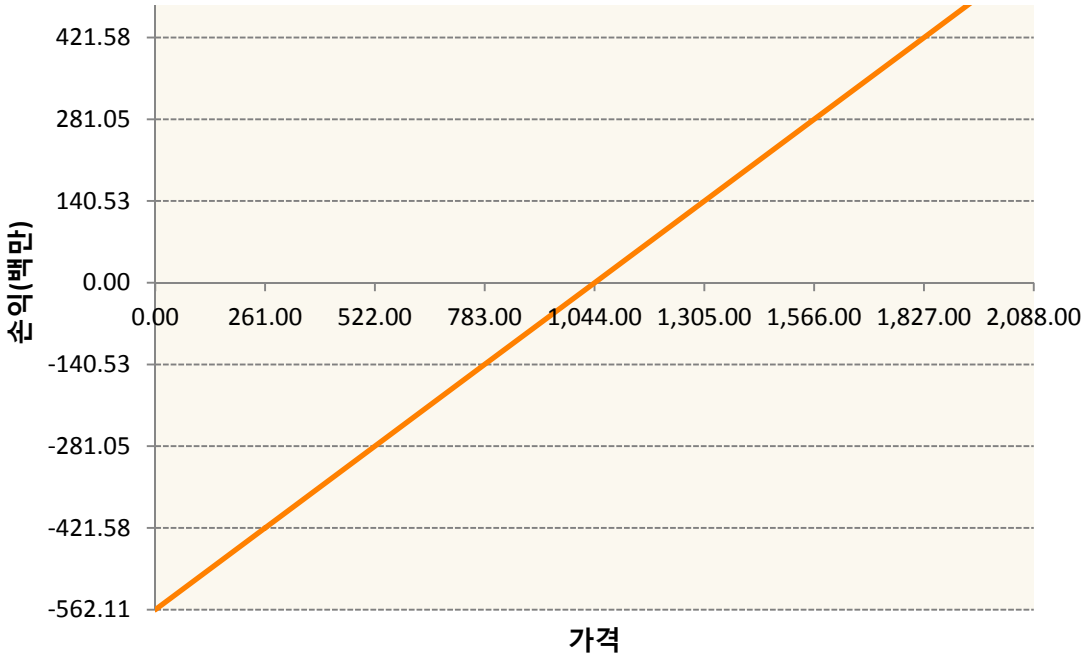

KR4175QA0004-2020-10 달러선물
231.60
173.70
115.80
57.90
0.00
-57.90
-115.80
-173.70
-231.60
손익(백만)
0.00
289.50
579.00
868.50
1,158.00
1,447.50
1,737.00
2,026.50
2,316.00
가격

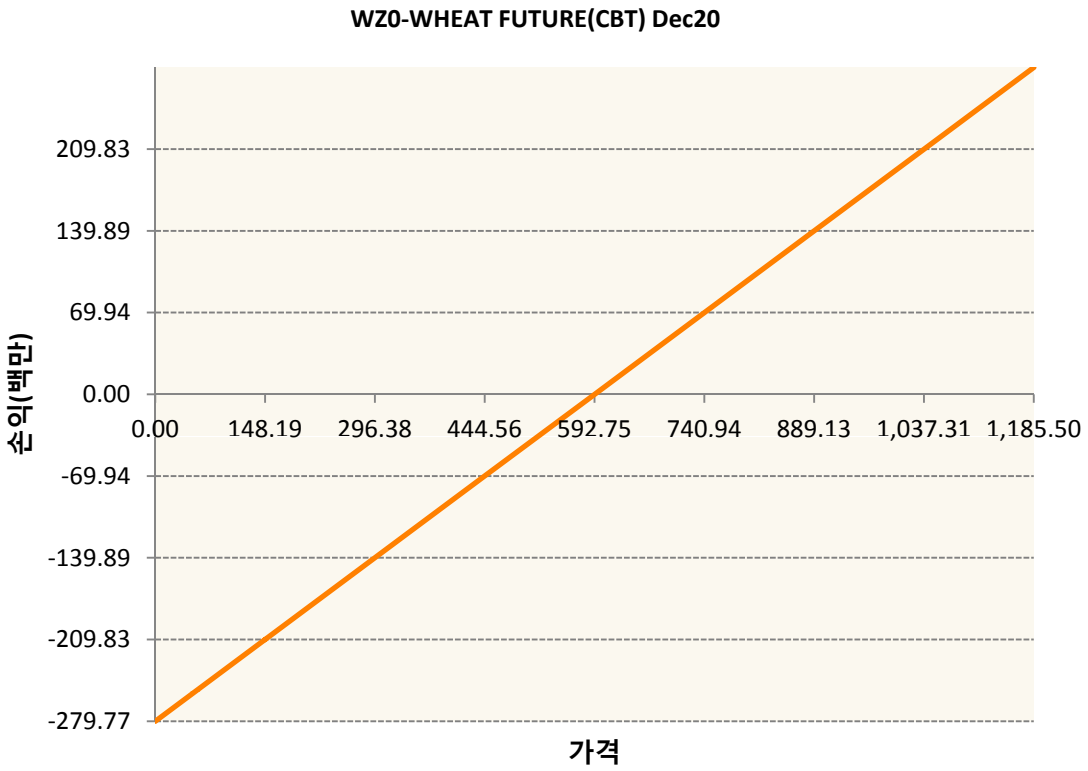

KWZ0-KC HRW WHEAT FUT Dec20
157.47
118.10
78.74
39.37
0.00
-39.37
-78.74
-118.10
-157.47
손익(백만)
0.00
133.56
267.13
400.69
534.25
667.81
801.38
934.94
1,068.50
가격


SBH1-Sugar Mar21
206.82
137.88
68.94
0.00
-68.94
-137.88
-206.82
-275.76
0.00
3.47
6.94
10.41
13.88
17.35
20.82
24.29
27.76
손익(백만)
가격


SMZ0-SOYBEAN MEAL FUTR Dec20
255.22
170.14
85.07
0.00
-85.07
-170.14
-255.22
-340.29
0.00
88.88
177.75
266.63
355.50
444.38
533.25
622.13
711.00
손익(백만)
가격


SX0-SOYBEAN FUTURE Nov20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ0	SOYBEAN OIL FUTR Dec20	19
CTZ0	COTTON NO.2 FUTR Dec20	10
CZ0	CORN FUTURE Dec20	42
KCZ0	COFFEE 'C' FUTURE Dec20	19
KR4175QA0(	2020-10 달러선물	19

KWZ0	KC HRW WHEAT FUT Dec20	13
SBH1	Sugar Mar21	22
SMZ0	SOYBEAN MEAL FUTR Dec20	27
SX0	SOYBEAN FUTURE Nov20	45
WZ0	WHEAT FUTURE(CBT) Dec20	22

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

273