

공시일	2020-06-10
기준일	2020-06-09

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	4	0	4	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

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

(단위:백만원)

54

공시일	2020-06-10
기준일	2020-06-09

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

1,102

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,295

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-06-10
기준일	2020-06-09

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	7,308	0	7,308	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S200310

587

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

870

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-06-10
기준일	2020-06-09

유로인덱스모(주식-파생형)

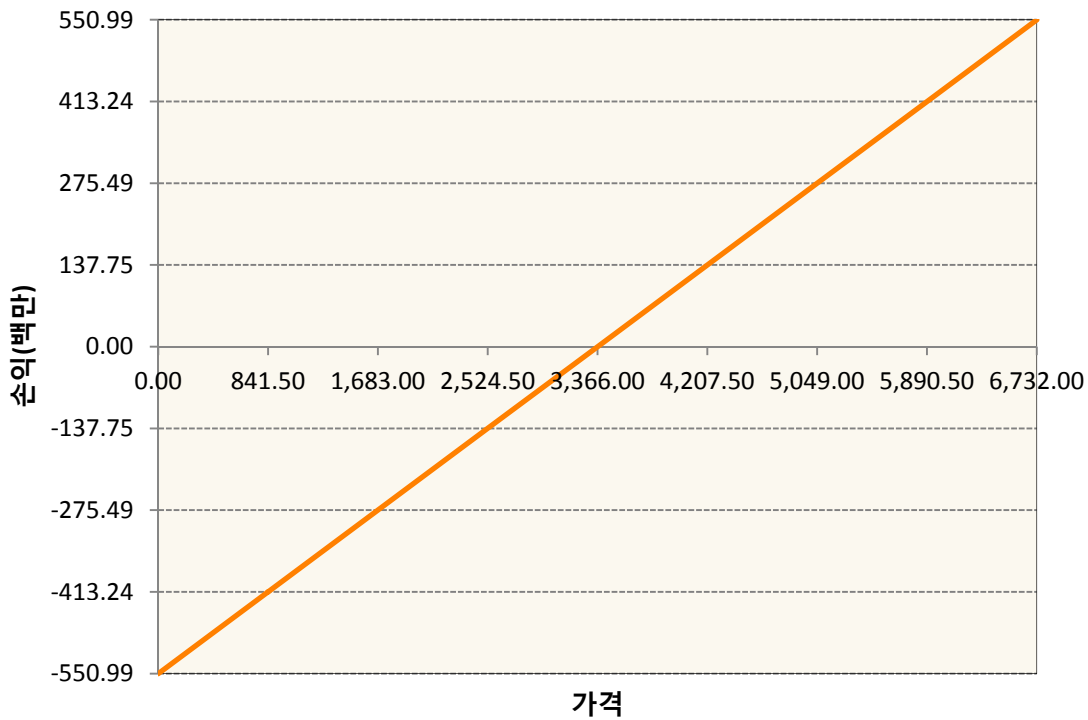
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	44
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

58

공시일	2020-06-10
기준일	2020-06-09

차이나인덱스모(주식-파생형)

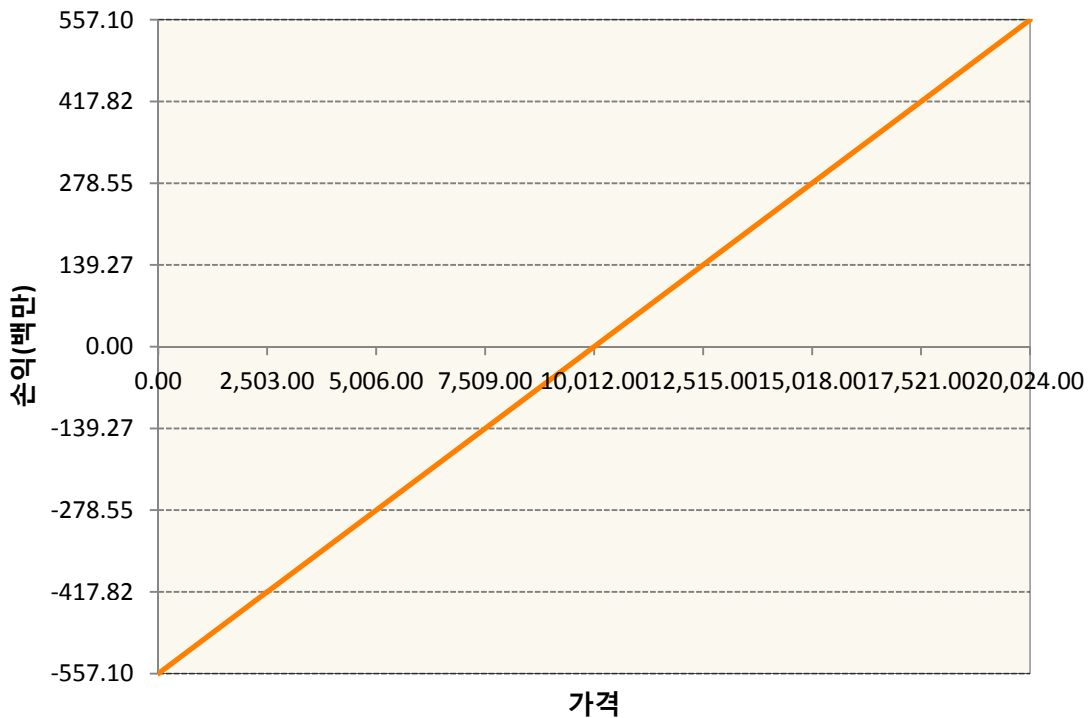
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	557	0	557	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCM0-HSCEI Futures Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM0	HSCEI Futures Jun20	45
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

48

공시일	2020-06-10
기준일	2020-06-09

커버드콜모(주식혼합-파생형)

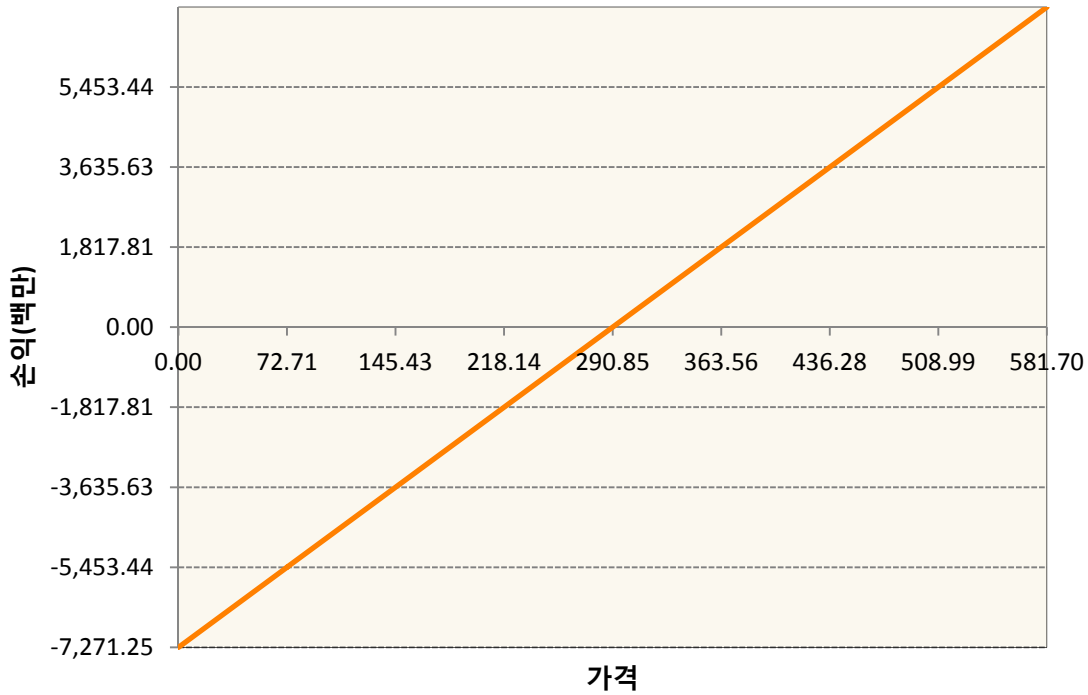
1. 계약금액

(단위:백만원)

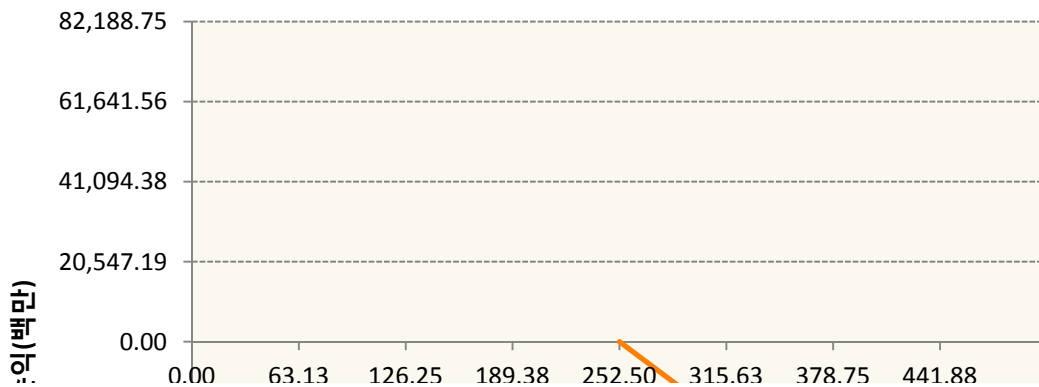
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,271	0	7,271	장내
누계	유가증권	옵션	0	329,306	-329,306	장내

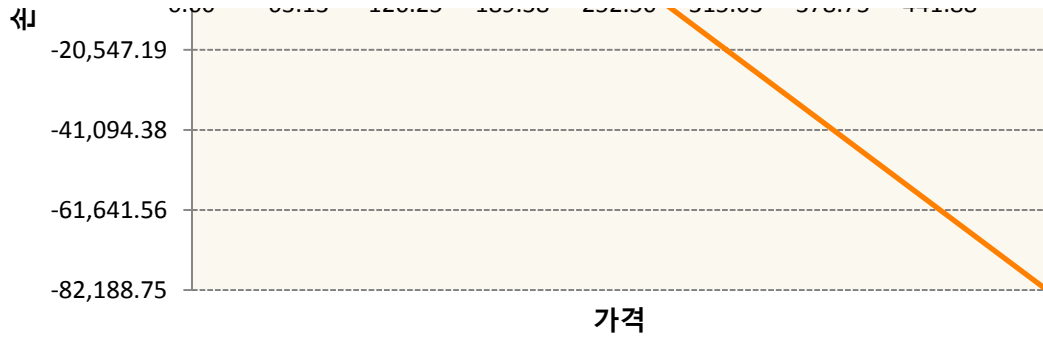
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

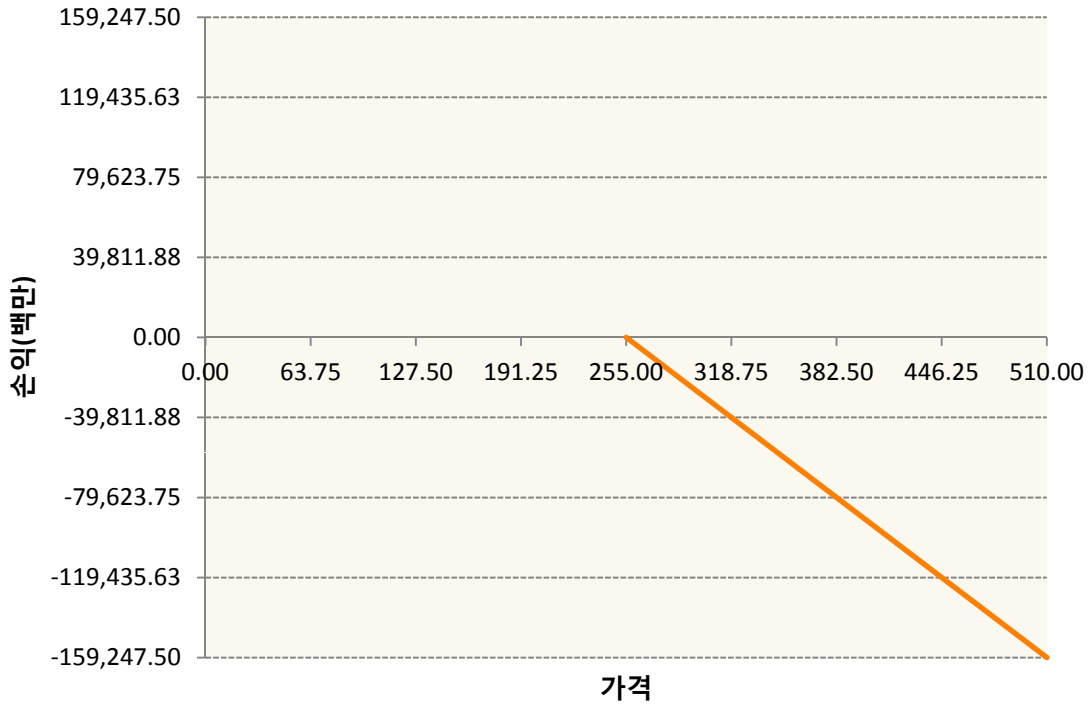


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

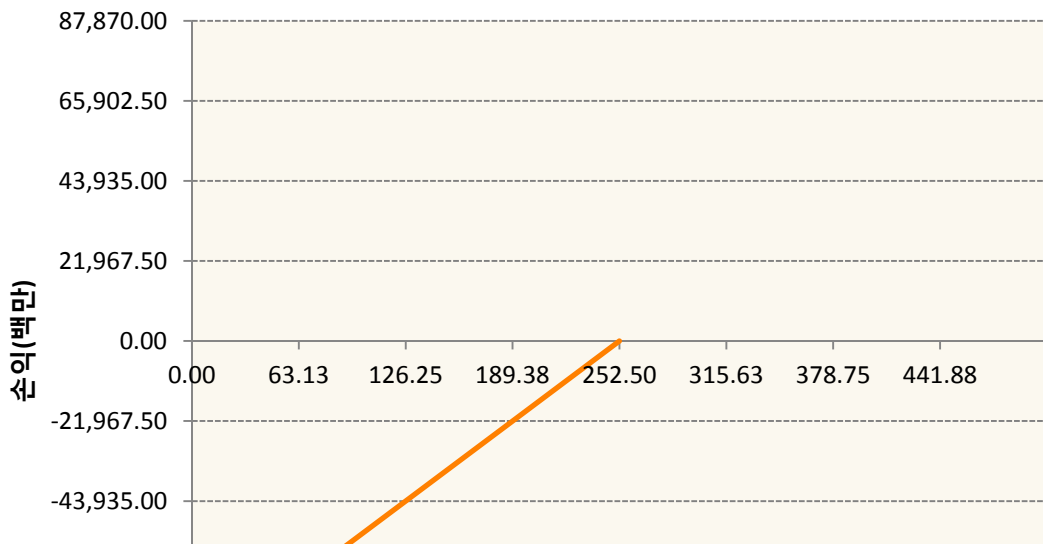


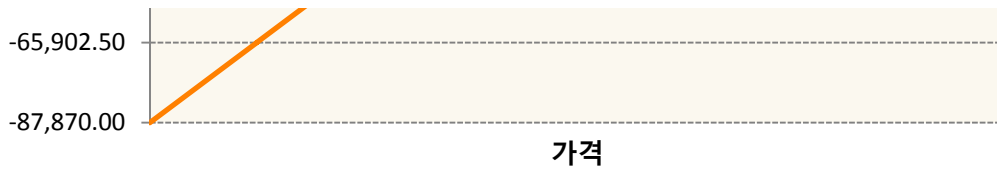


KR4201Q62550-2020-06 콜255



KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						583
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-583	-583	-583	-583	-583	-583	-583	
-5.33%	-388	-388	-388	-388	-388	-388	-388	
-2.67%	-194	-194	-194	-194	-194	-194	-194	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	194	194	194	194	194	194	194	
5.33%	388	388	388	388	388	388	388	
8.00%	583	583	583	583	583	583	583	
KR4201Q62527		2020-06 콜252.5						7,585
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	7,581	7,575	7,565	7,552	7,533	7,510	7,483	
-5.33%	5,057	5,056	5,056	5,054	5,051	5,047	5,040	
-2.67%	2,528	2,528	2,528	2,528	2,528	2,527	2,526	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-2,528	-2,528	-2,528	-2,528	-2,528	-2,528	-2,528	
5.33%	-5,057	-5,057	-5,057	-5,057	-5,057	-5,057	-5,057	
8.00%	-7,585	-7,585	-7,585	-7,585	-7,585	-7,585	-7,585	
KR4201Q62550		2020-06 콜255						14,553
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	14,525	14,499	14,463	14,416	14,359	14,292	14,216	
-5.33%	9,701	9,700	9,696	9,689	9,678	9,661	9,638	
-2.67%	4,851	4,851	4,851	4,850	4,849	4,847	4,842	
0%	0	0	0	0	0	0	-1	
2.67%	-4,851	-4,851	-4,851	-4,851	-4,851	-4,851	-4,851	
5.33%	-9,702	-9,702	-9,702	-9,702	-9,702	-9,702	-9,702	
8.00%	-14,553	-14,553	-14,553	-14,553	-14,553	-14,553	-14,553	
KR4301Q62525		2020-06 풋252.5						3
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	0	0	0	0	-1	-2	-3	
-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	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

23,019

공시일	2020-06-10
기준일	2020-06-09

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

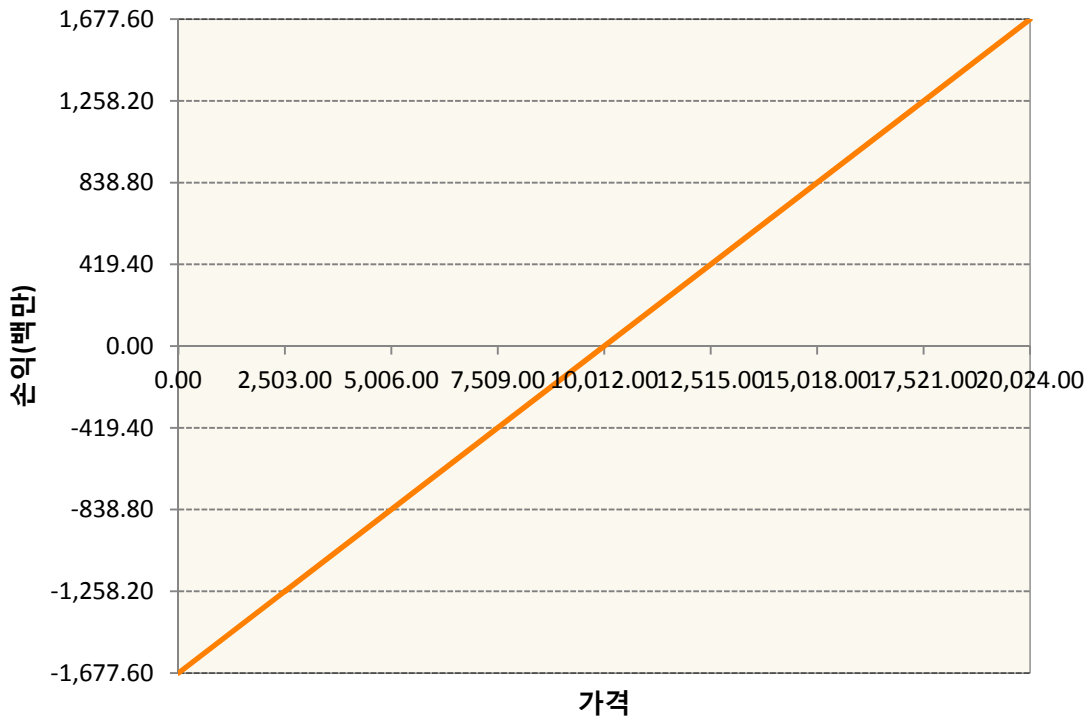
1. 계약금액

(단위:백만원)

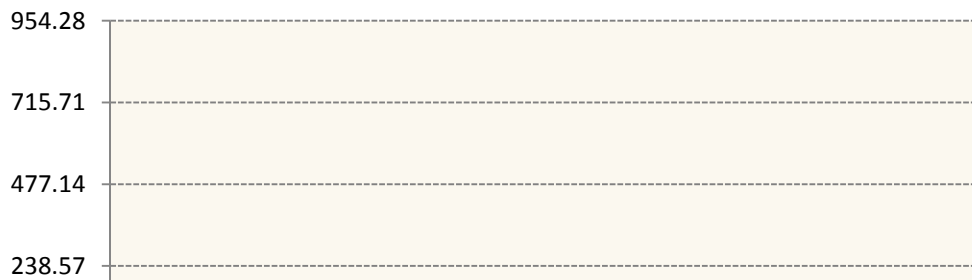
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,678	0	1,678	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,134	-4,134	장내
누계	통화	선도	0	1,496	-1,496	장외

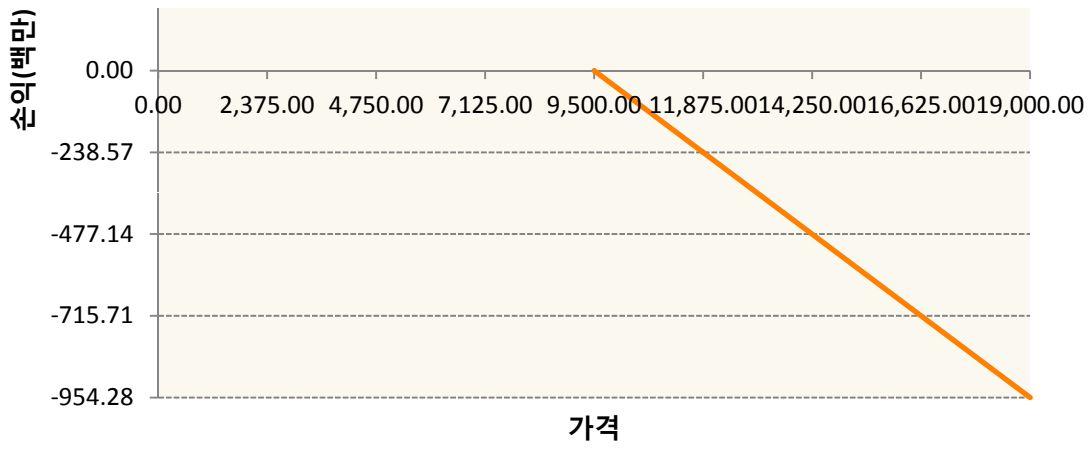
2. 만기시점의 손익구조

HCM0-HSCEI Futures Jun20

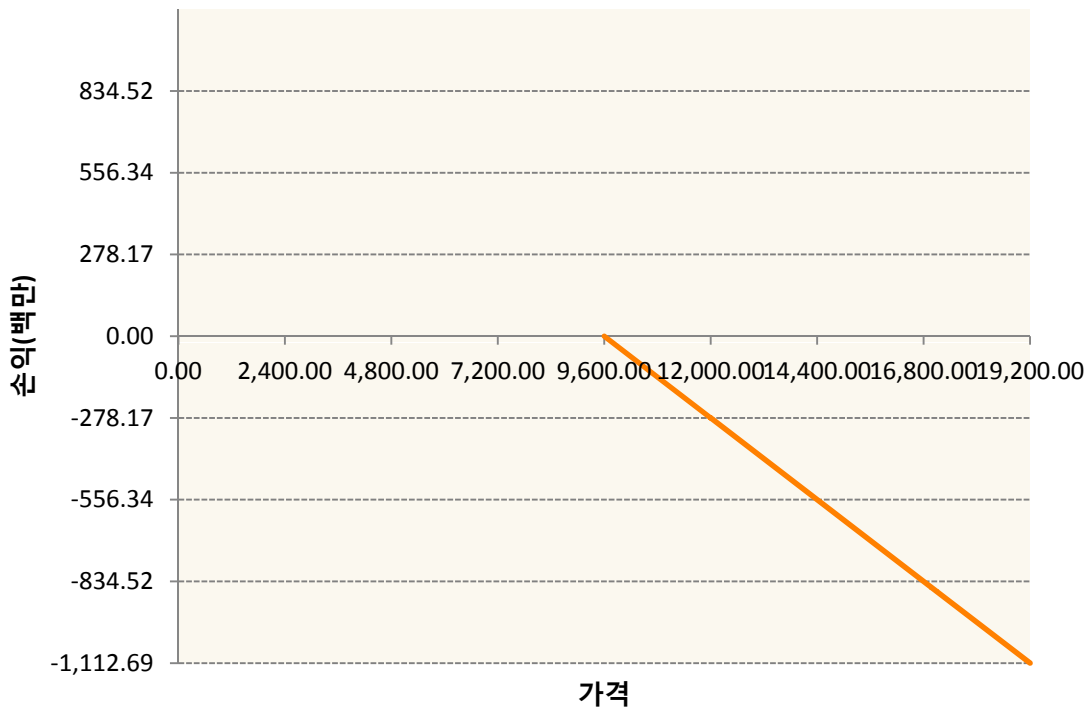


OHHIM0-C95-HSCEI

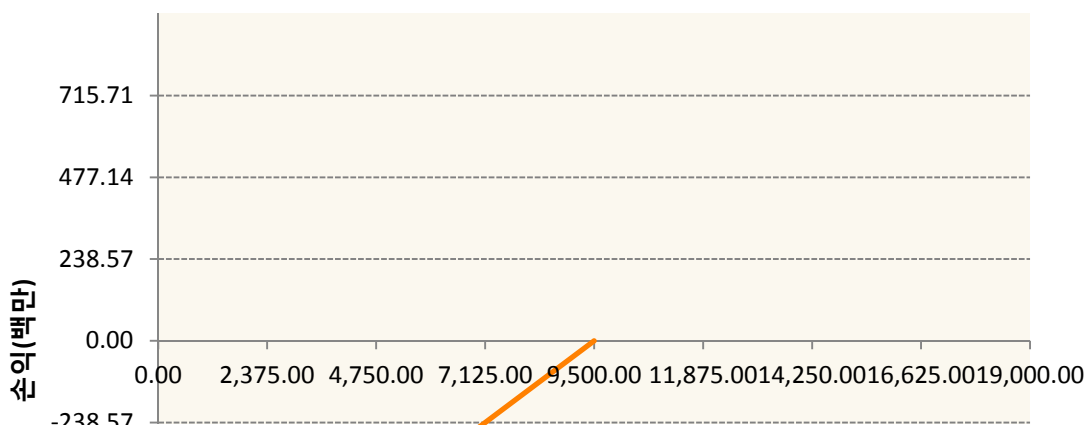


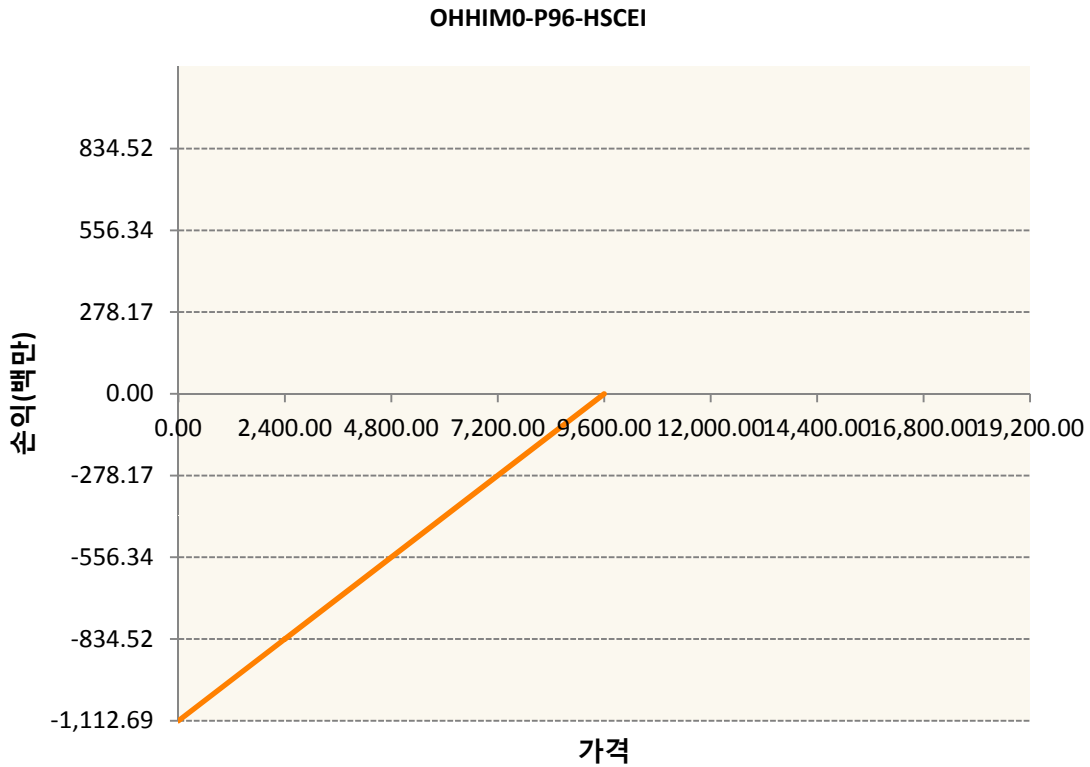


OHHIM0-C96-HSCEI



OHHIM0-P95-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E	120
HCM0 HSCEI Futures Jun20	134
OHHIM0-C9 HSCEI	76
OHHIM0-C9 HSCEI	89
OHHIM0-P9 HSCEI	76
OHHIM0-P9 HSCEI	89

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

563

공시일	2020-06-10
기준일	2020-06-09

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

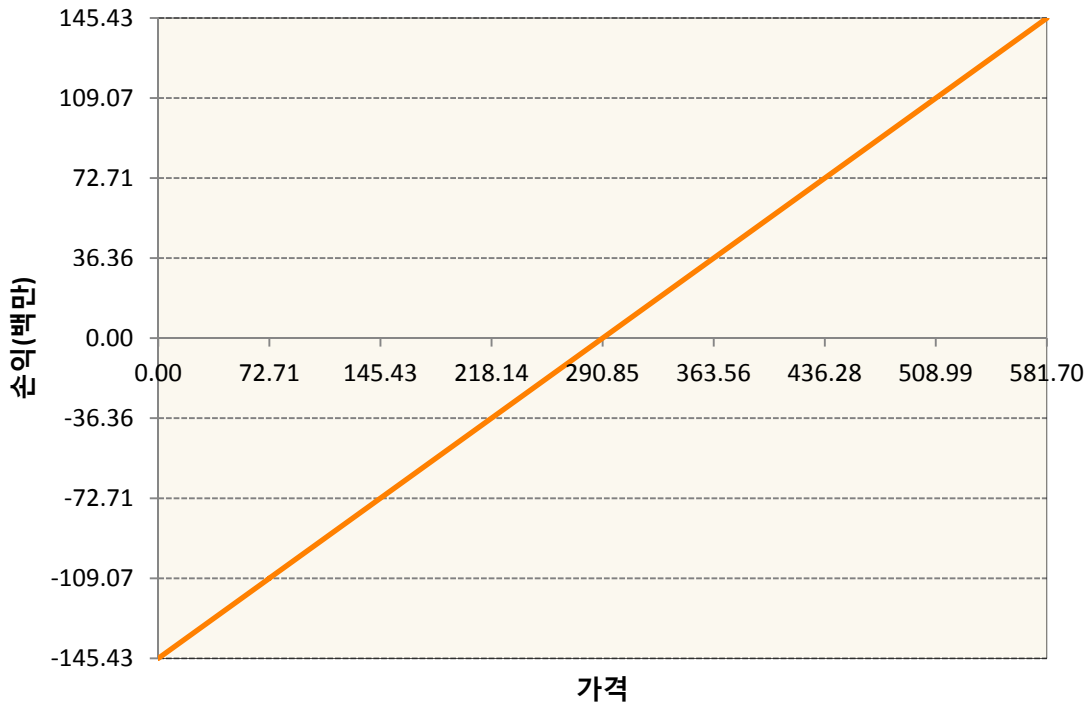
1. 계약금액

(단위:백만원)

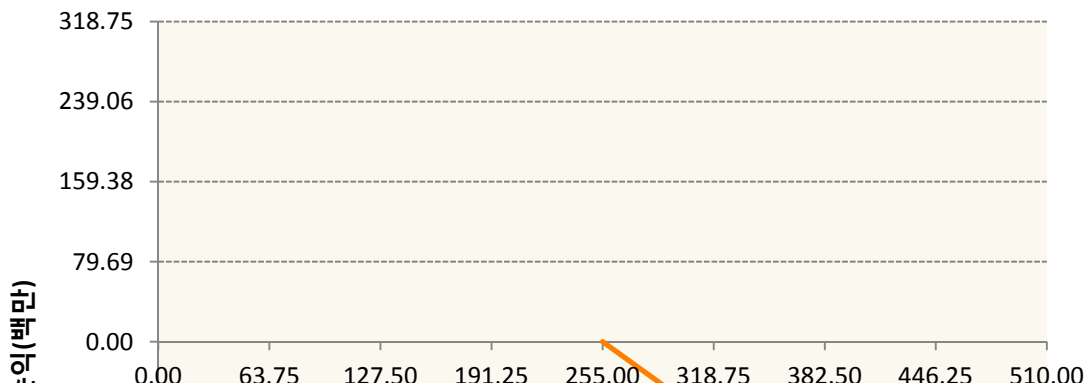
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	73	-73	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	145	0	145	장내
누계	유가증권	옵션	0	319	-319	장내

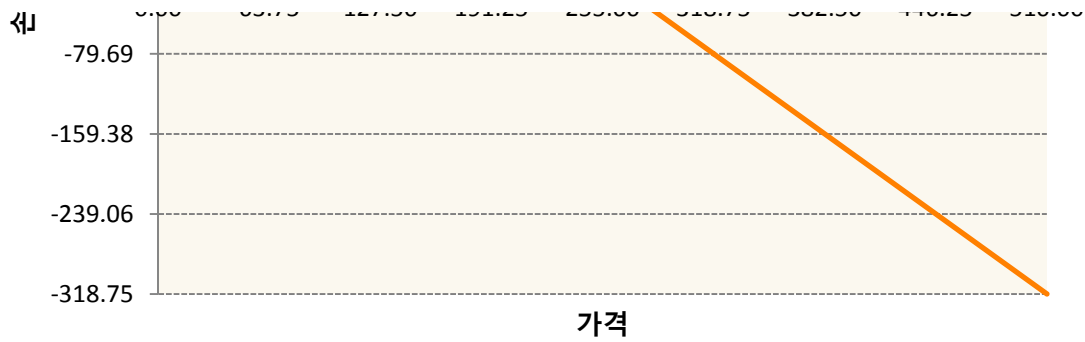
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



KR4201Q62550-2020-06 콜255





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						12
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
-5.33%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	4	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	8	8	8	8	8	8	8	8
8.00%	12	12	12	12	12	12	12	12
KR4201Q62550		2020-06 콜255						29
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	29	29	29	29	29	29	29	28
-5.33%	19	19	19	19	19	19	19	19
-2.67%	10	10	10	10	10	10	10	10
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
5.33%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
8.00%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29

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

47

공시일	2020-06-10
기준일	2020-06-09

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

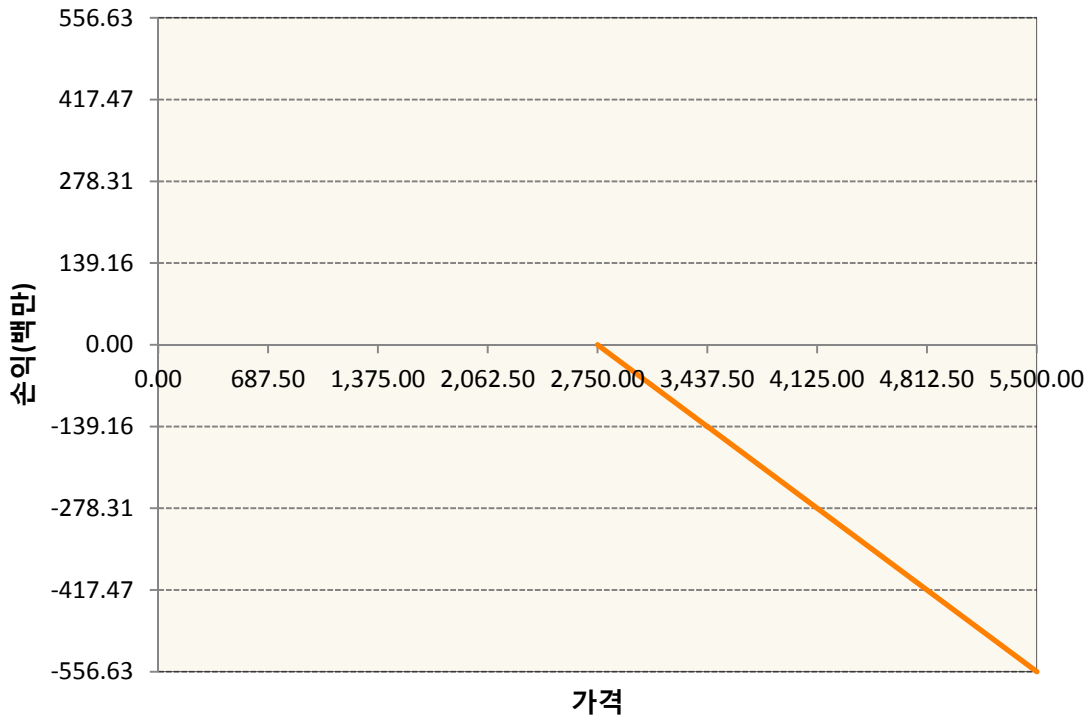
1. 계약금액

(단위:백만원)

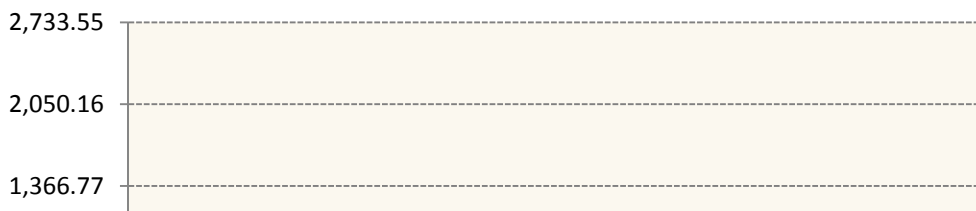
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,309	0	1,309	
누계	유가증권	스왑	8,048	0	8,048	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,618	-6,618	장내
누계	통화	선도	0	2,920	-2,920	장외

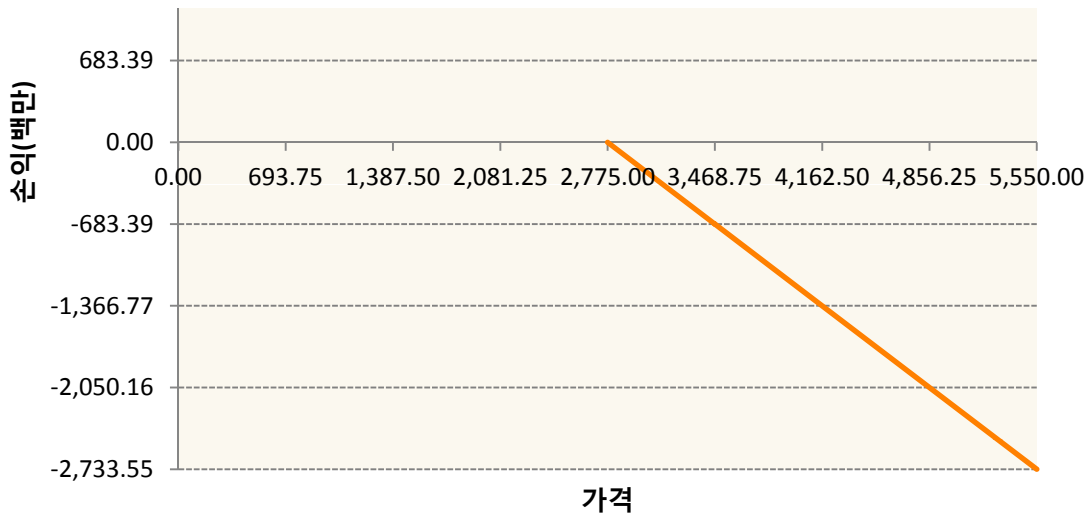
2. 만기시점의 손익구조

OESXM0-C2750-EURO STOXX 50

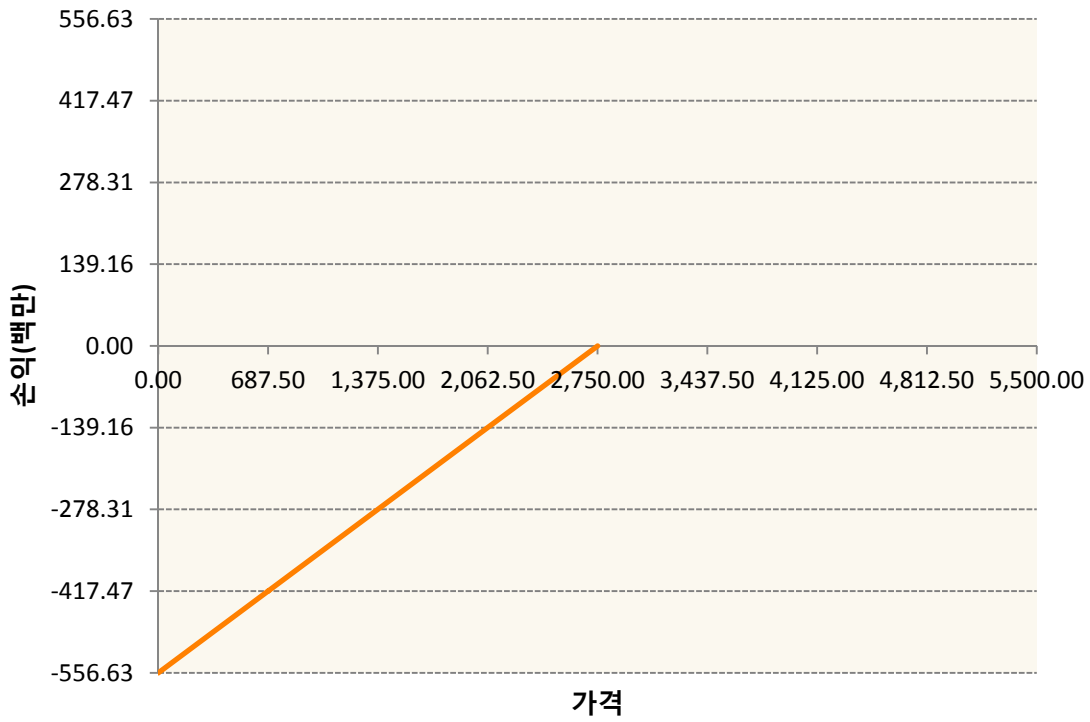


OESXM0-C2775-EURO STOXX 50

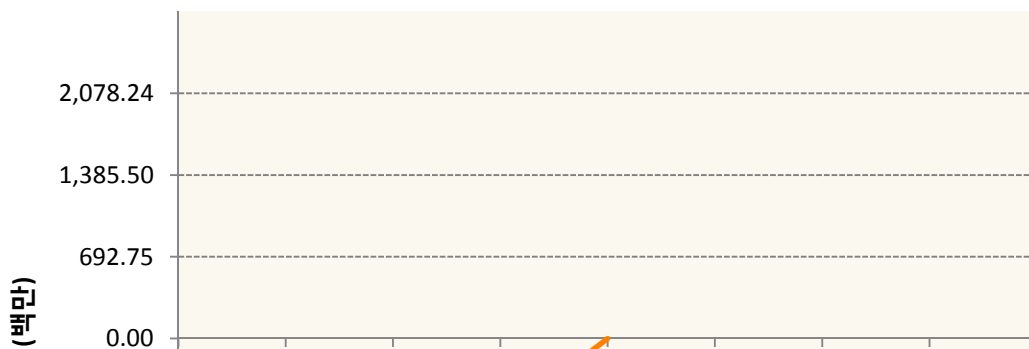


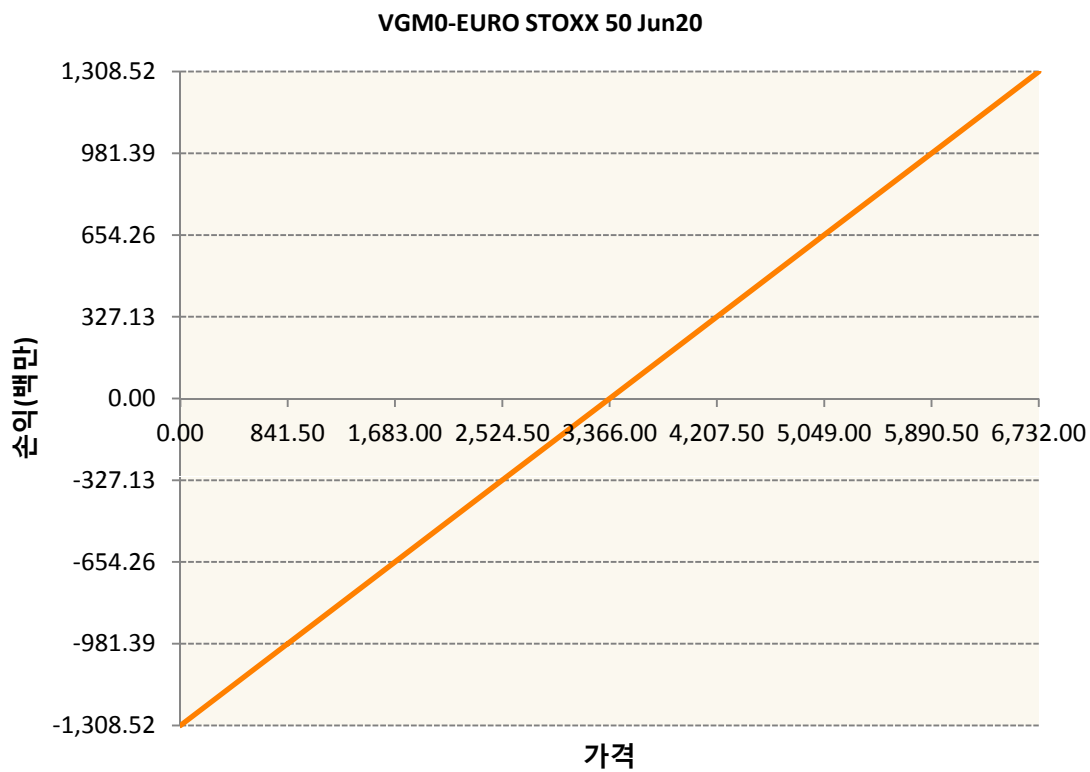
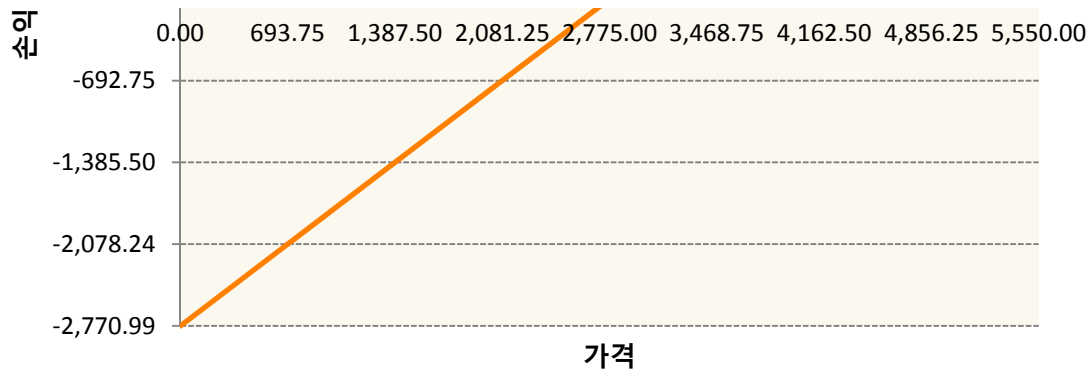


OESXM0-P2750-EURO STOXX 50



OESXM0-P2775-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY	23
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E	219
FX21020K02 KRW/EUR 26-06-20E	15
OESXM0-C2' EURO STOXX 50	45
OESXM0-C2' EURO STOXX 50	219
OESXM0-P2' EURO STOXX 50	45
OESXM0-P2' EURO STOXX 50	222
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20	105

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

(단위:백만원)

1,022

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

(단위:백만원)

1,318

공시일	2020-06-10
기준일	2020-06-09

ETF스마트레버리지목표전환형9호

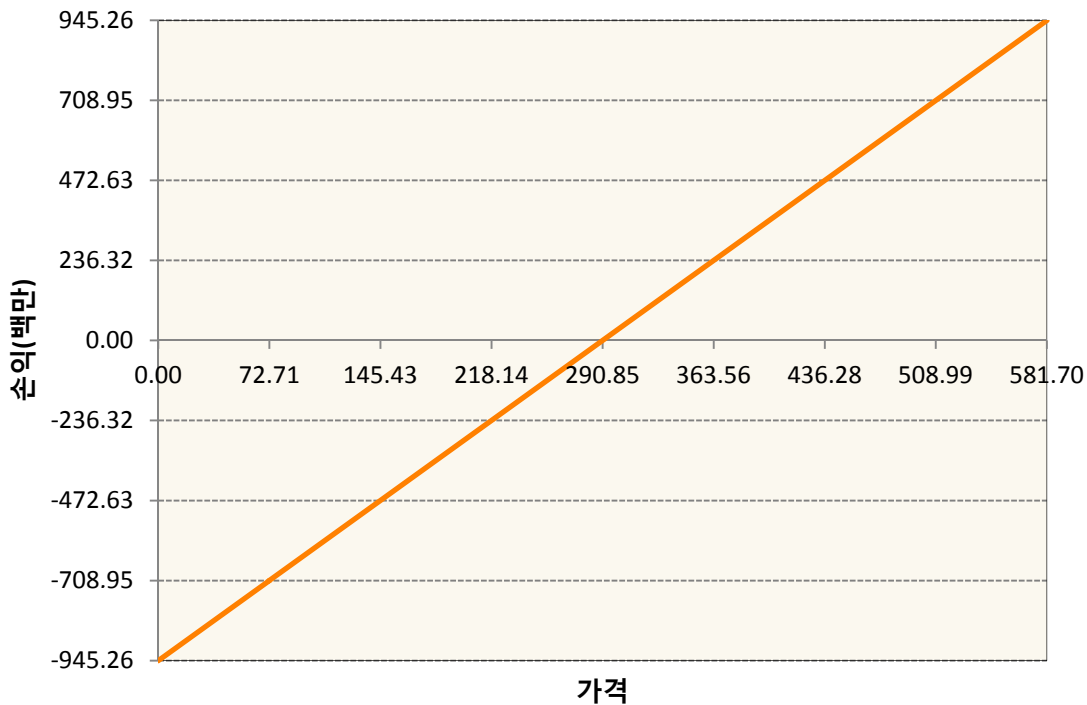
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	945	0	945	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 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%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	
-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%	50	50	50	50	50	50	50	
8.00%	76	76	76	76	76	76	76	

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

(단위:백만원)

114

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

(단위:백만원)

167

공시일	2020-06-10
기준일	2020-06-09

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

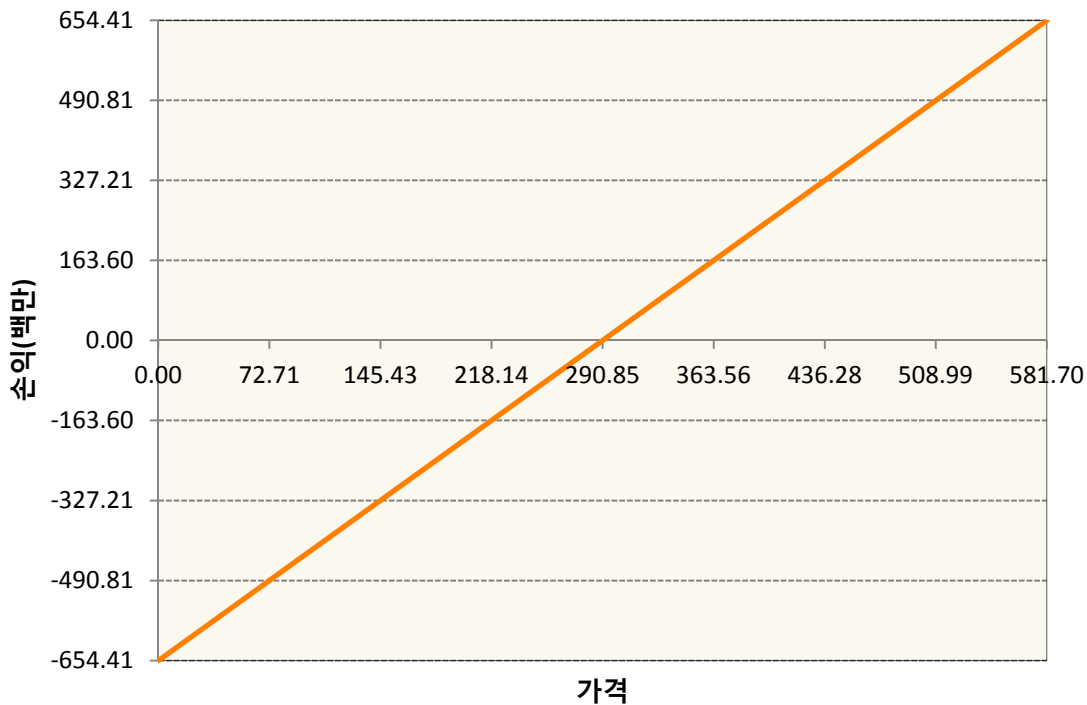
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	654	0	654	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						52
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52	
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	17	17	17	17	17	17	17	
5.33%	35	35	35	35	35	35	35	
8.00%	52	52	52	52	52	52	52	

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

(단위:백만원)

79

공시일	2020-06-10
기준일	2020-06-09

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

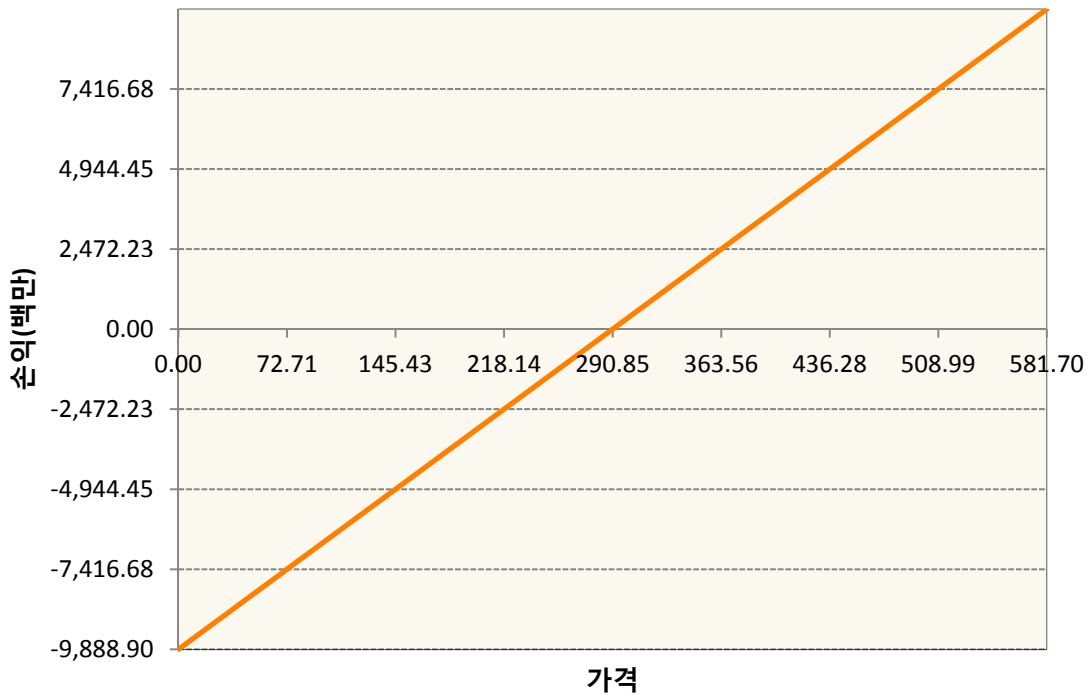
1. 계약금액

(단위:백만원)

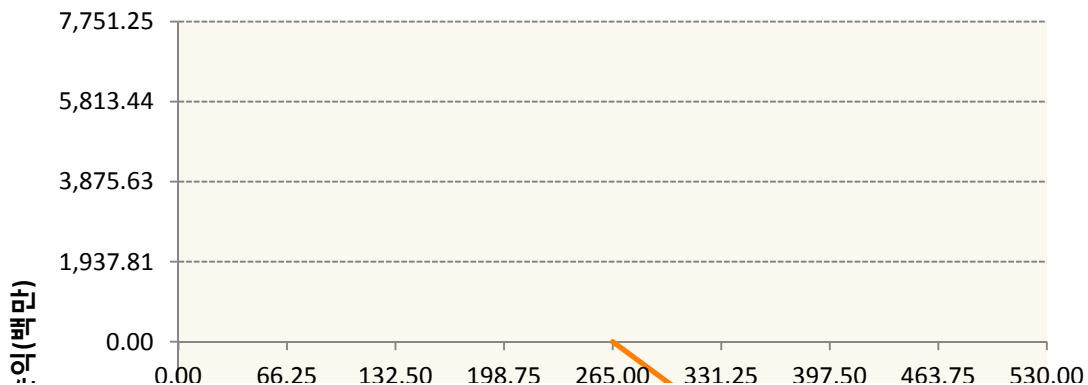
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,889	0	9,889	장내
누계	유가증권	옵션	2,917	16,646	-13,729	장내

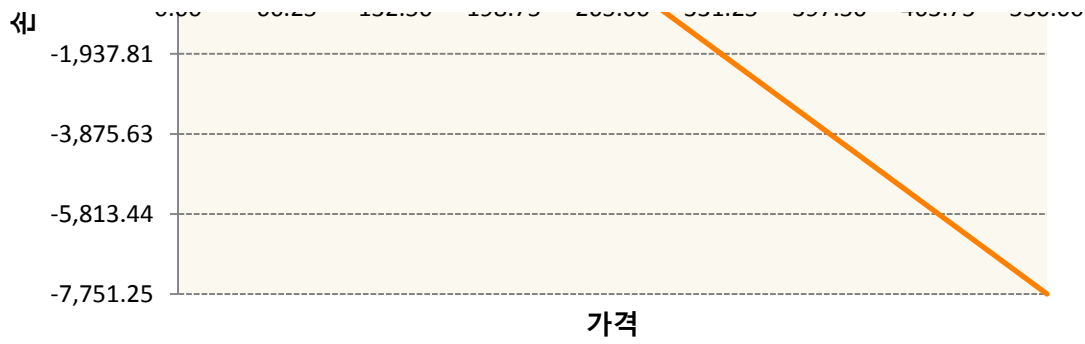
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

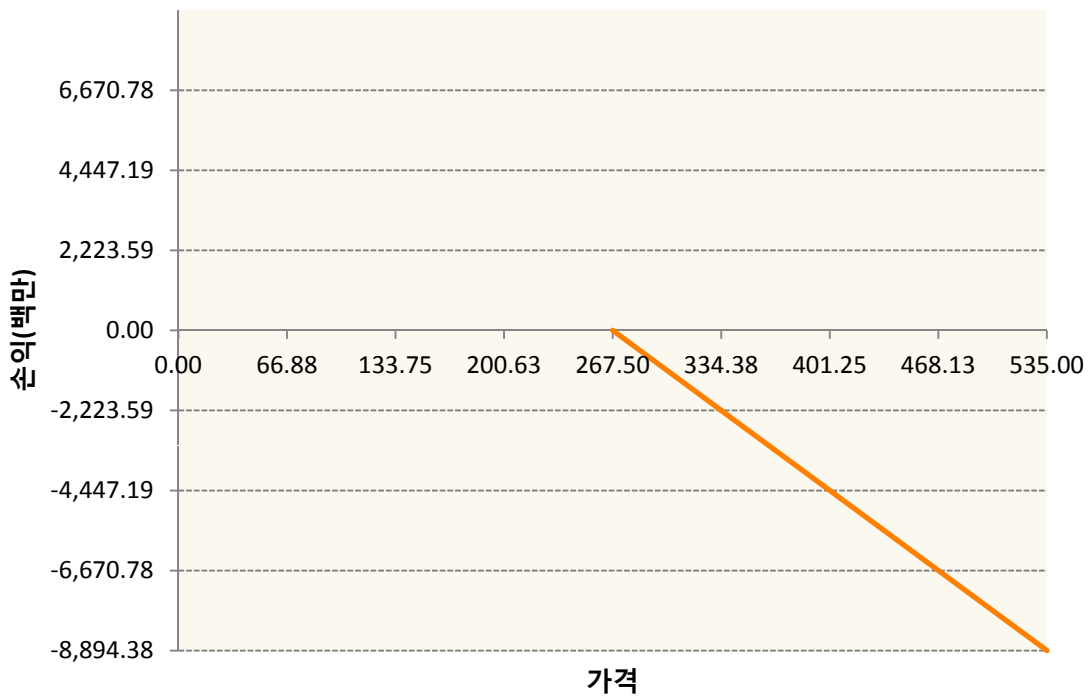


KR4201Q62659-2020-06 콜265

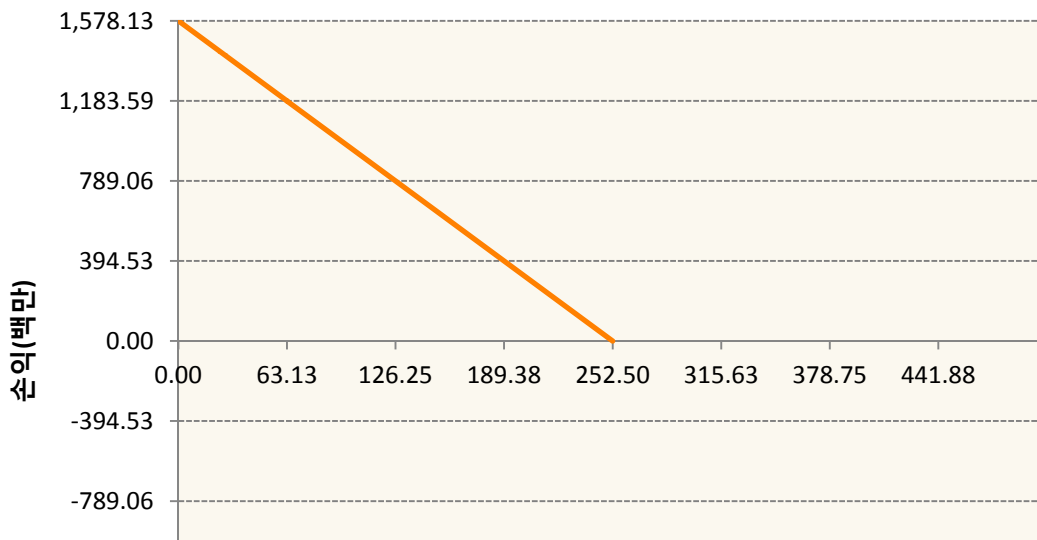


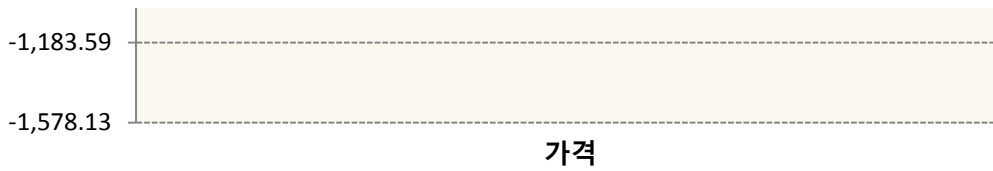


KR4201Q62675-2020-06 콜267.5

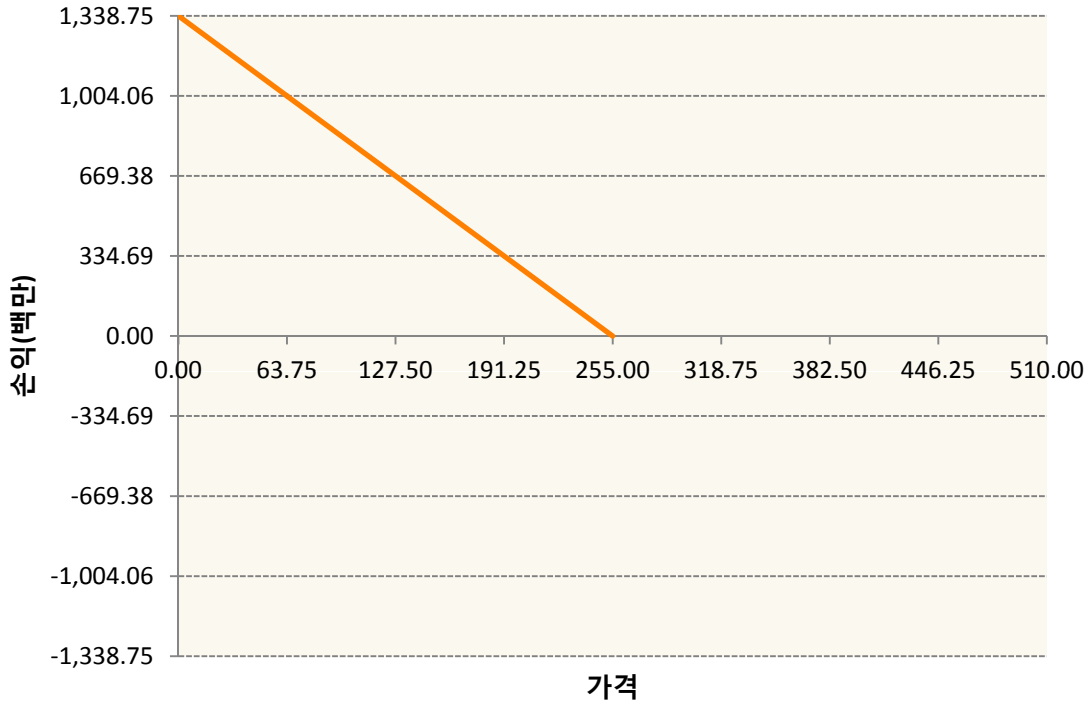


KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





KR4301Q62558-2020-06 풋255



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						792
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-792	-792	-792	-792	-792	-792	-792	
-5.33%	-528	-528	-528	-528	-528	-528	-528	
-2.67%	-264	-264	-264	-264	-264	-264	-264	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	264	264	264	264	264	264	264	
5.33%	528	528	528	528	528	528	528	
8.00%	792	792	792	792	792	792	792	
KR4201Q62659		2020-06 콜265						681
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	643	635	628	620	612	604	596	
-5.33%	451	448	445	442	437	433	428	
-2.67%	227	227	226	226	225	223	221	

0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	-227	-227	-227	-227	-227	-227	-227
5.33%	-454	-454	-454	-454	-454	-454	-454
8.00%	-681	-681	-681	-681	-681	-681	-681
KR4201Q62675 2020-06 콜267.5							774
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	698	688	679	669	660	650	641
-5.33%	506	502	496	490	484	477	470
-2.67%	258	257	256	255	252	250	247
0%	0	0	0	0	0	-1	-2
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
KR4301Q62525 2020-06 풋252.5							0
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	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0
KR4301Q62558 2020-06 풋255							0
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	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

2,664

공시일	2020-06-10
기준일	2020-06-09

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	157,236	0	157,236	

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	2020-06-10
기준일	2020-06-09

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	104,159	0	104,159	

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	2020-06-10
기준일	2020-06-09

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	468,357	0	468,357	
누계	통화	선도	0	490,578	-490,578	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J00(KRW/USD 10-06-20E	2,874
FX21020J02(KRW/USD 10-06-20E	1,303
FX21020J02(KRW/USD 22-06-20E	1,476
FX21020J02(KRW/USD 22-06-20E	1,916
FX21020J03(KRW/USD 24-07-20E	2,156
FX21020J04(KRW/USD 24-07-20E	1,725
FX21020J04(KRW/USD 24-07-20E	1,916
FX21020K00(KRW/USD 12-06-20E	1,993
FX21020K00(KRW/USD 12-06-20E	1,897
FX21020K01(KRW/USD 22-06-20E	671
FX21020K01(KRW/USD 18-08-20E	2,338
FX21020K01(KRW/USD 18-08-20E	958
FX21020K03(KRW/USD 26-08-20E	1,006
FX21020K03(KRW/USD 26-08-20E	1,591
FX21020K05(KRW/USD 03-08-20E	3,354
FX21020K05(KRW/USD 03-08-20E	6,803
FX21020M0(KRW/USD 26-08-20E	575
FX21020M01(KRW/USD 26-08-20E	4,695

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

20,078

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

(단위:백만원)

227

공시일	2020-06-10
기준일	2020-06-09

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	7,720	0	7,720	
누계	통화	선도	0	7,438	-7,438	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020K01 KRW/USD 15-06-20E	313
FX21020K03 KRW/USD 15-06-20E	11
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
FX21020M0(KRW/USD 20-07-20E	10
FX21020M0(KRW/USD 20-07-20E	14
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

304

공시일	2020-06-10
기준일	2020-06-09

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

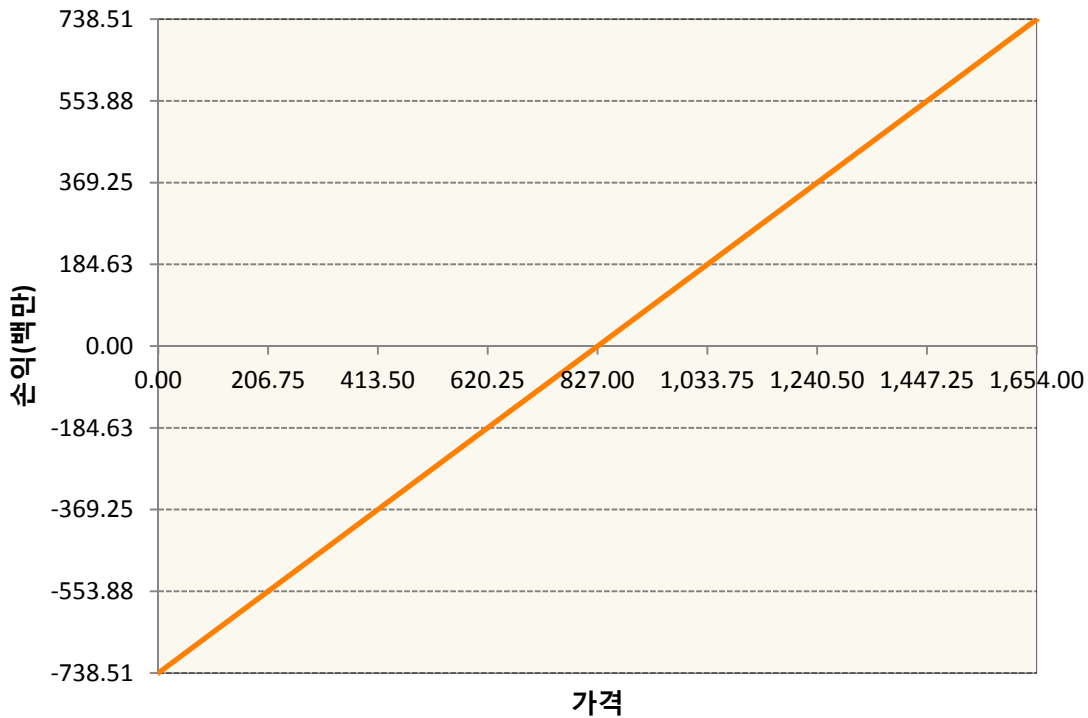
1. 계약금액

(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	739	0	739	
누계	유가증권	스왑	979	0	979	장외
누계	통화	선도	208	883	-675	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCM0-VN30 Index Future Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	78
FX21020G05 KRW/EUR 26-06-20E	12
FX21020H09 EUR/KRW 26-06-20E	8
FX21020H11 EUR/KRW 26-06-20E	9
FX21020J00€ KRW/EUR 24-07-20E	3
FX21020J00¢ KRW/EUR 24-07-20E	5

FX21020J01	KRW/EUR 24-07-20E	3
FX21020J02	KRW/EUR 24-07-20E	5
FX21020J03	KRW/EUR 26-06-20E	5
FX21020J03	KRW/EUR 24-07-20E	1
FX21020K00	KRW/EUR 24-07-20E	5
FX21020K01	KRW/EUR 24-07-20E	9
FX21020K03	KRW/EUR 28-08-20E	22
VNCM0	VN30 Index Future Jun20	59

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

(단위:백만원)

175

공시일	2020-06-10
기준일	2020-06-09

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

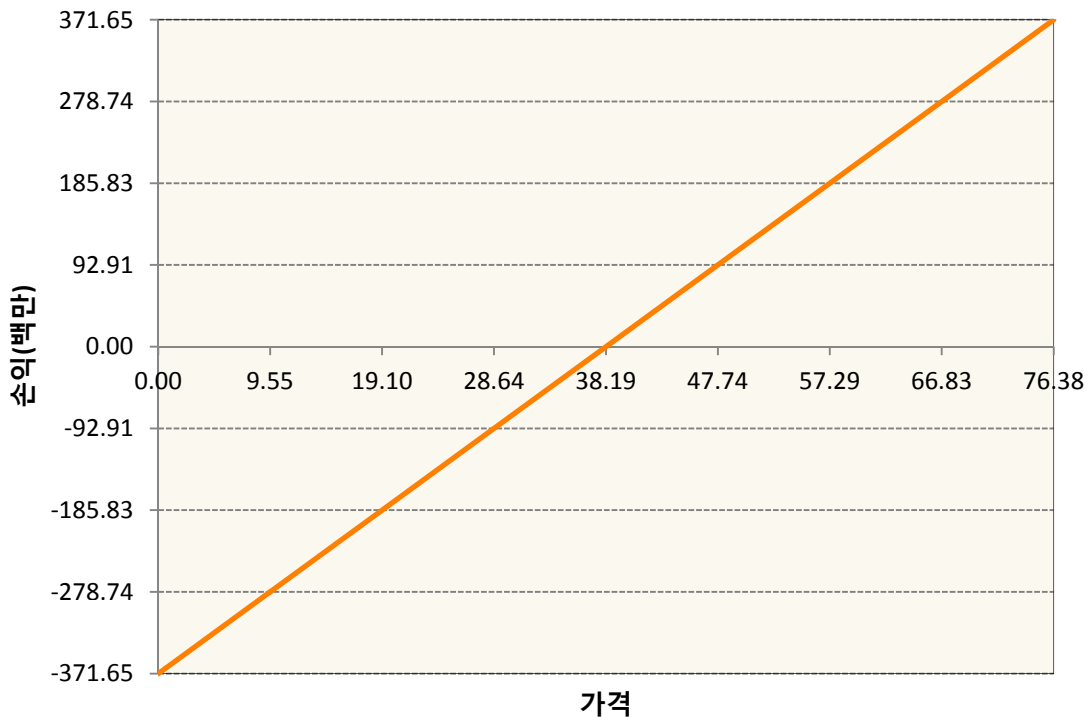
1. 계약금액

(단위:백만원)

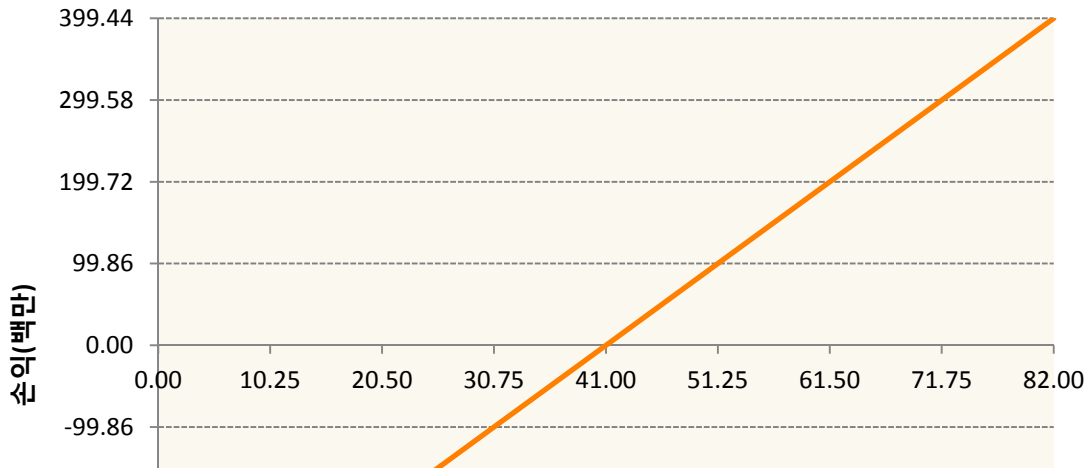
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,837	359	1,478	

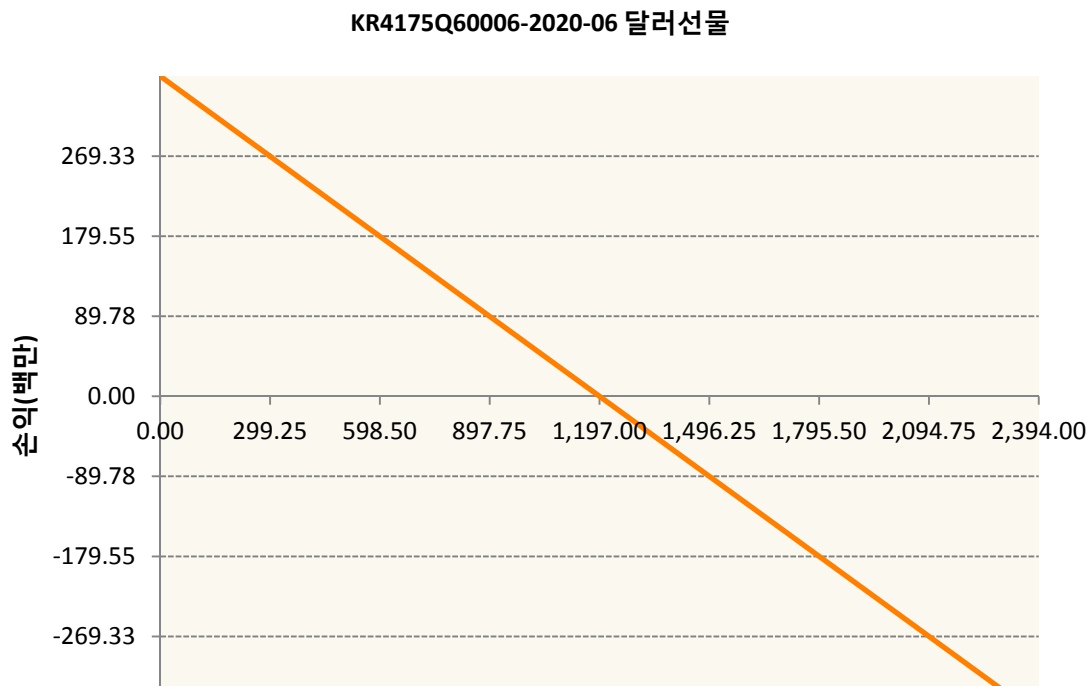
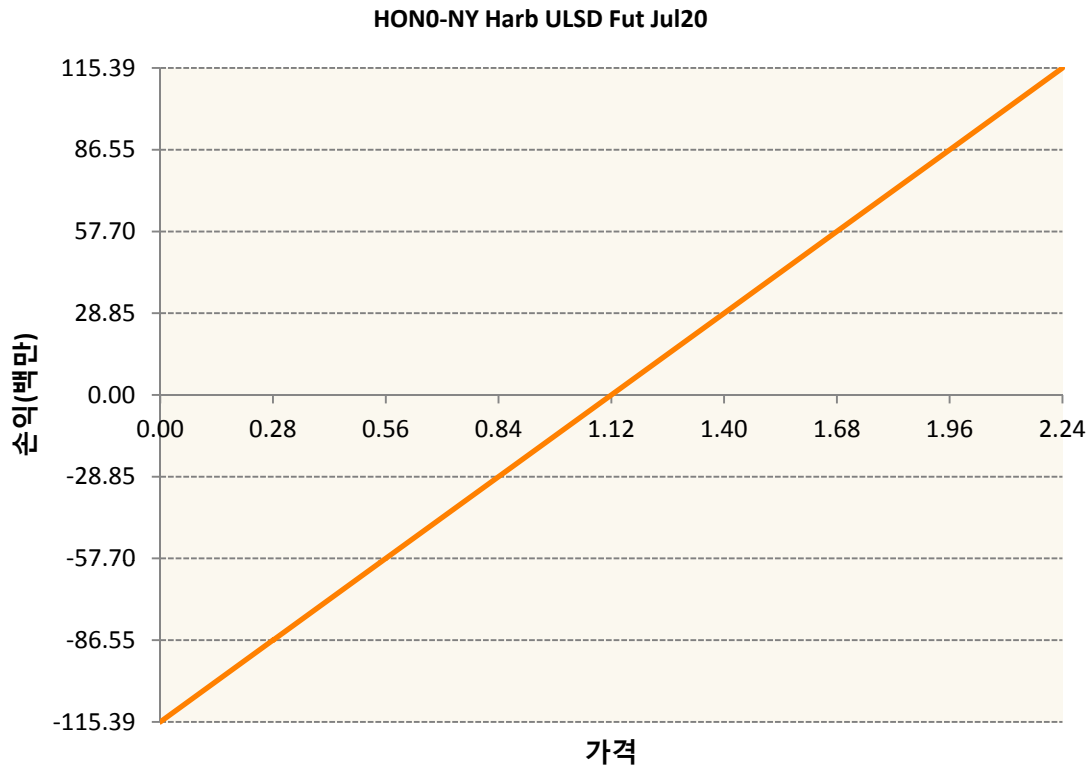
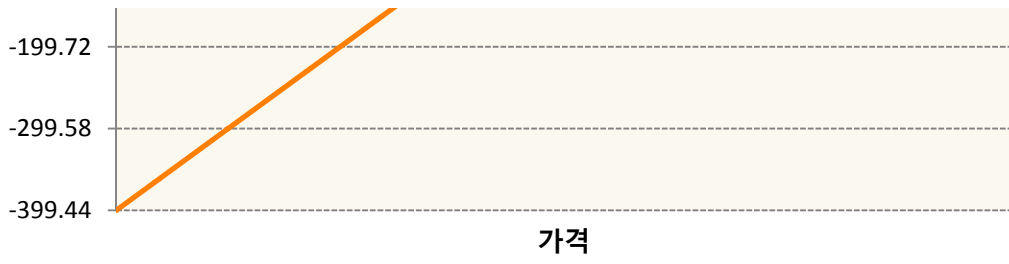
2. 만기시점의 손익구조

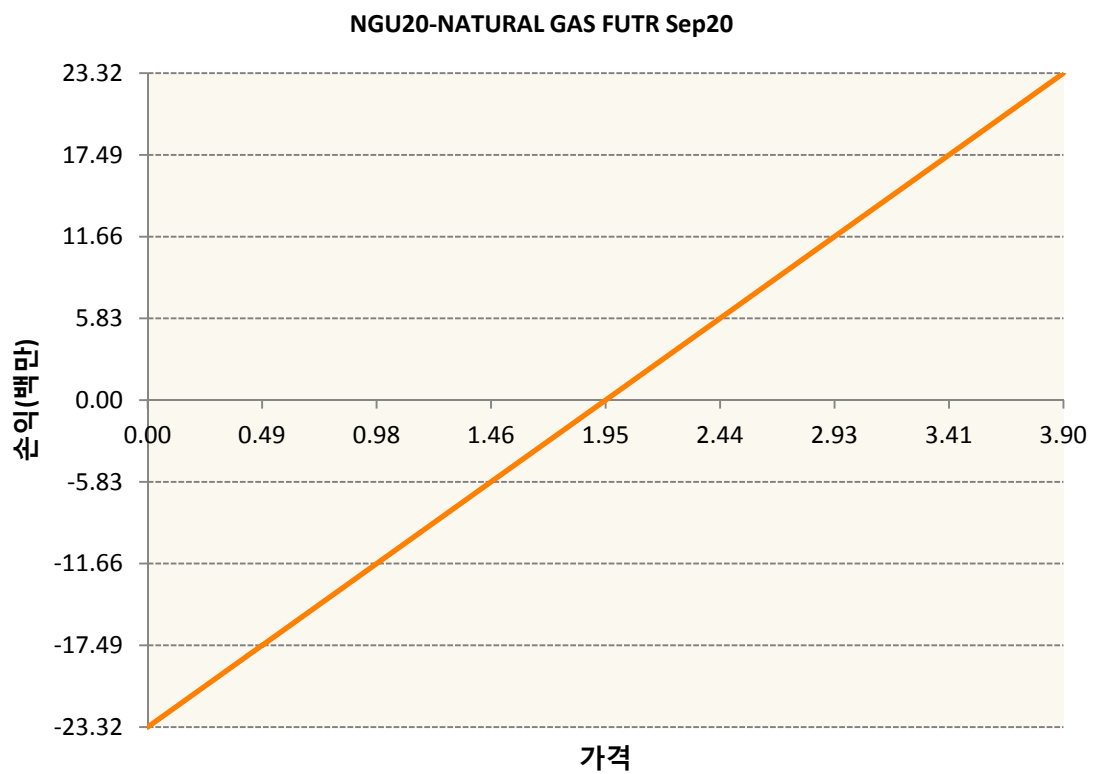
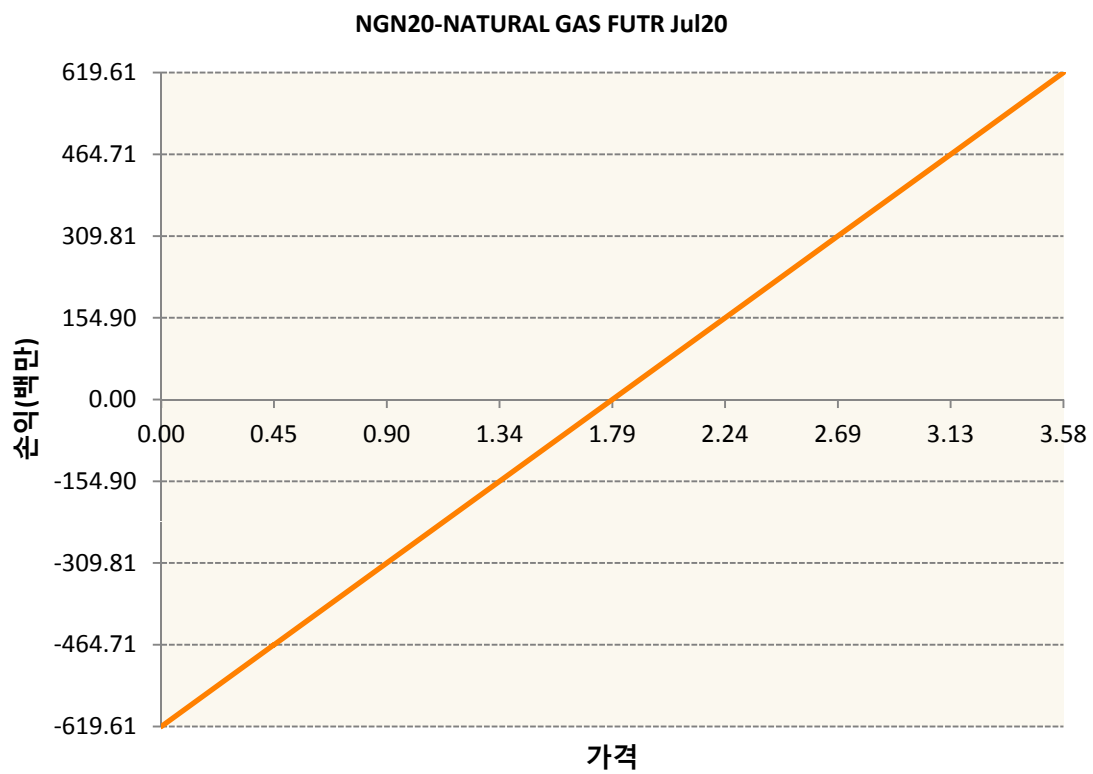
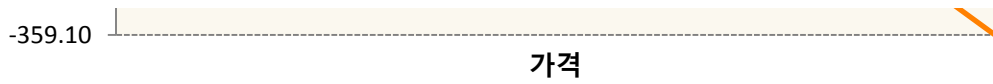
CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20



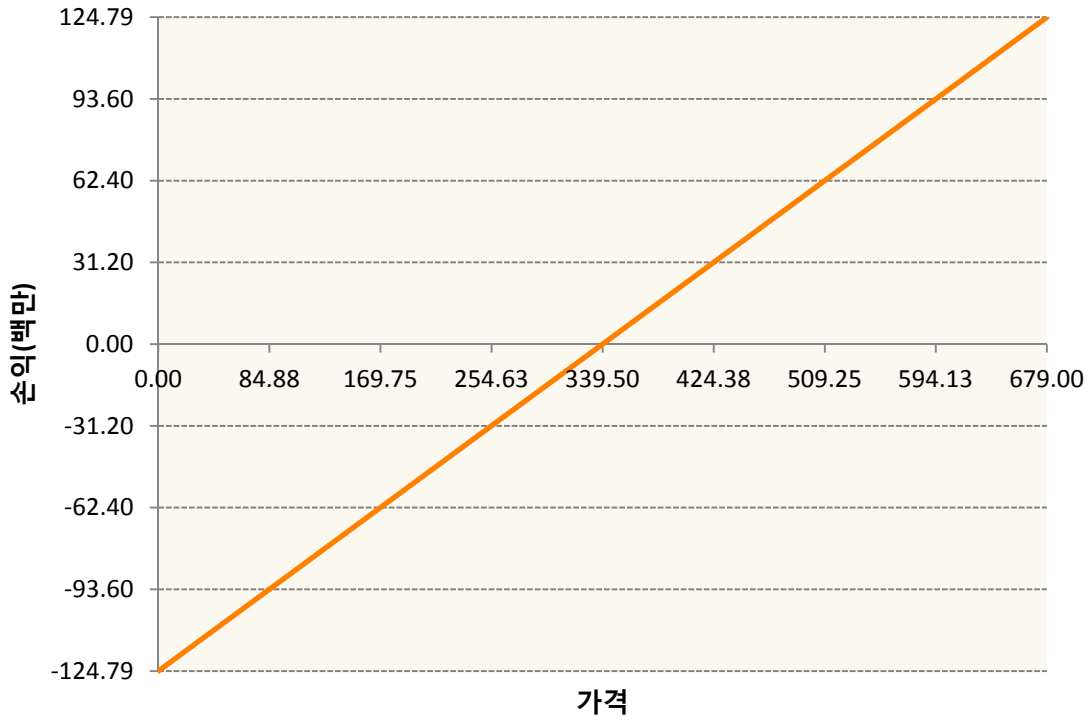
COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20



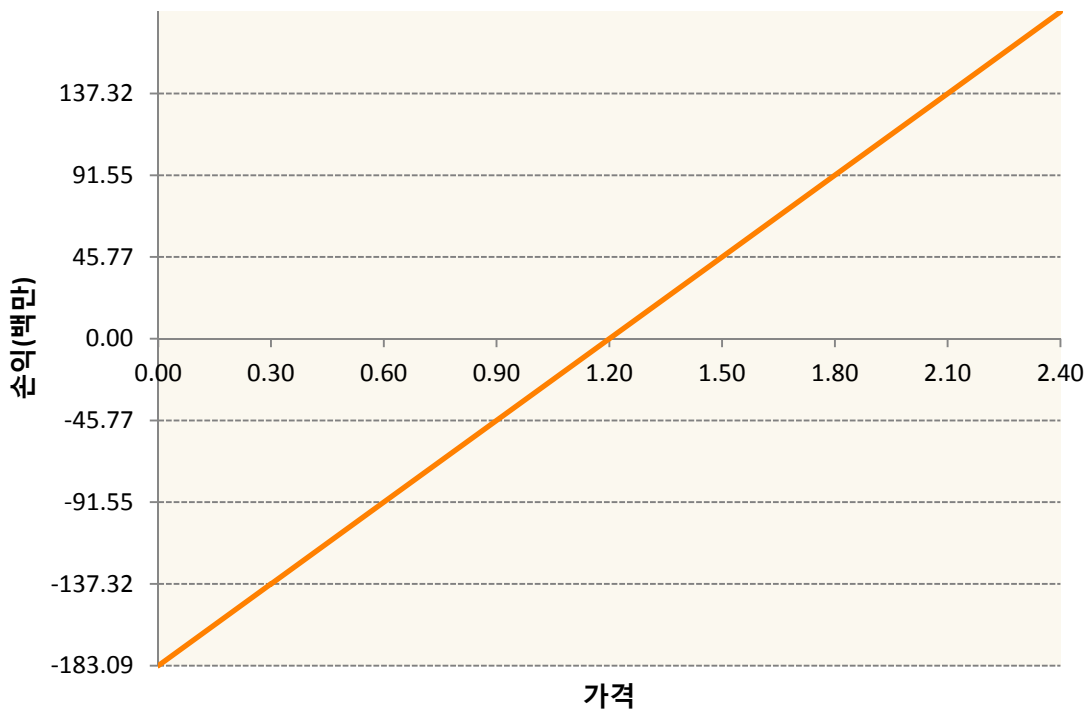




QSN0-Low Su Gasoil G Jul20



XBN0-GASOLINE RBOB FUT Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN0 WTI CRUDE FUTURE Jul20

30

COU0	BRENT CRUDE FUTR Sep20	32
HON0	NY Harb ULSD Fut Jul20	9
KR4175Q60C	2020-06 달러선물	29
NGN20	NATURAL GAS FUTR Jul20	50
NGU20	NATURAL GAS FUTR Sep20	2
QSN0	Low Su Gasoil G Jul20	10
XBN0	GASOLINE RBOB FUT Jul20	15

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

(단위:백만원)

895

공시일	2020-06-10
기준일	2020-06-09

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

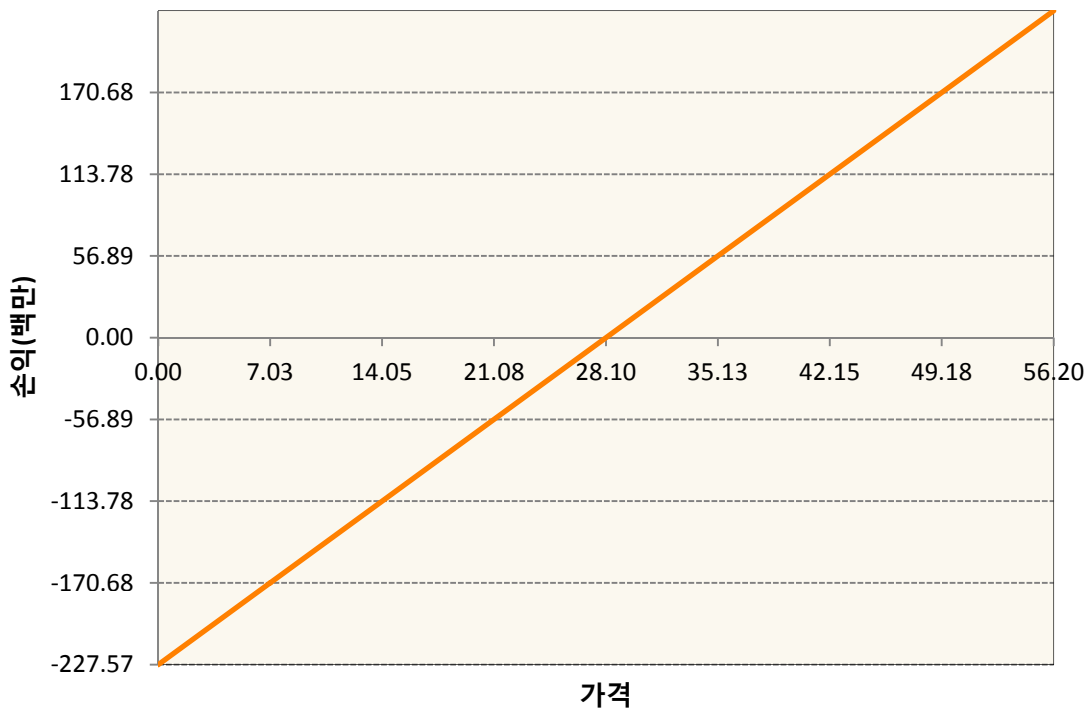
1. 계약금액

(단위:백만원)

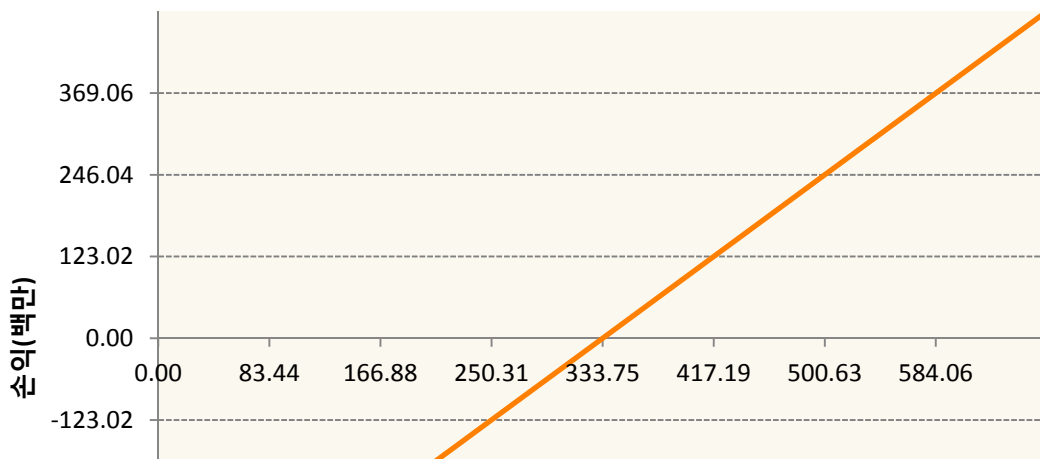
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,492	72	2,420	

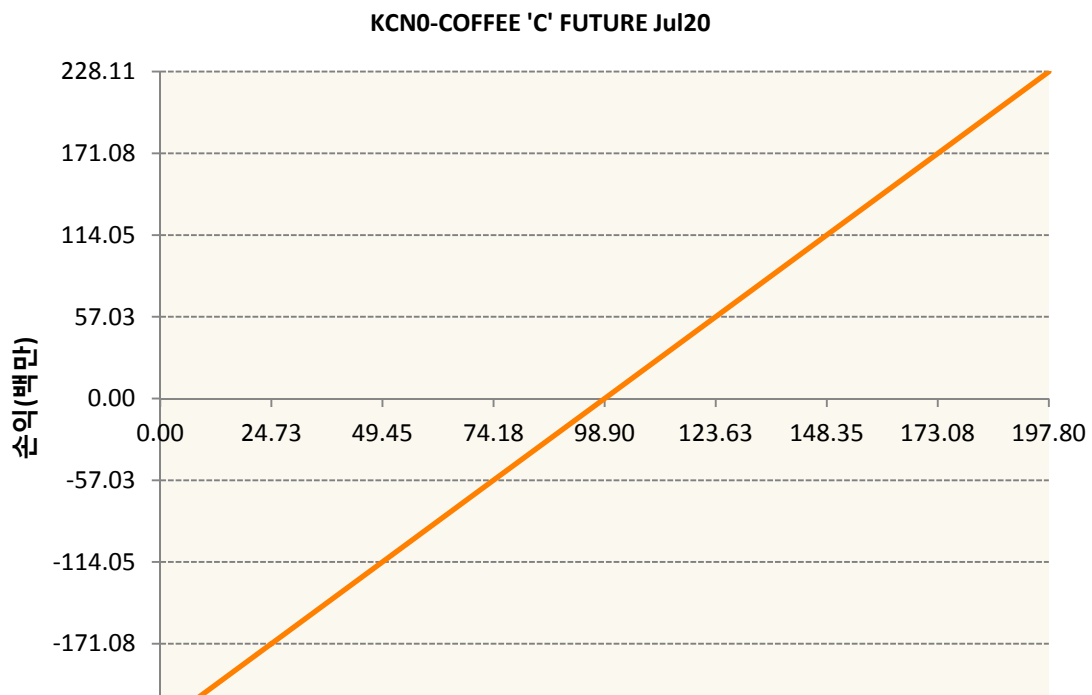
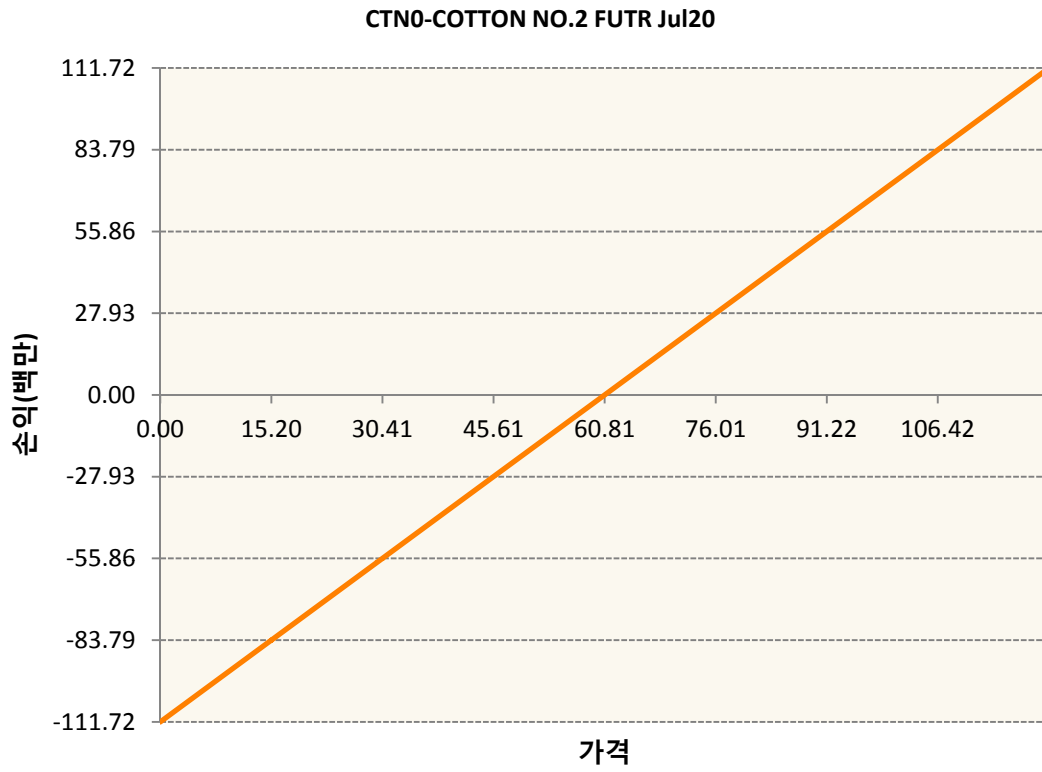
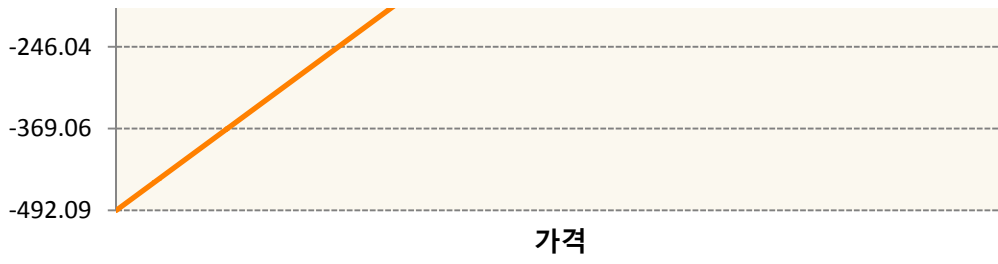
2. 만기시점의 손익구조

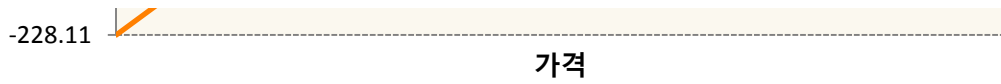
BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20



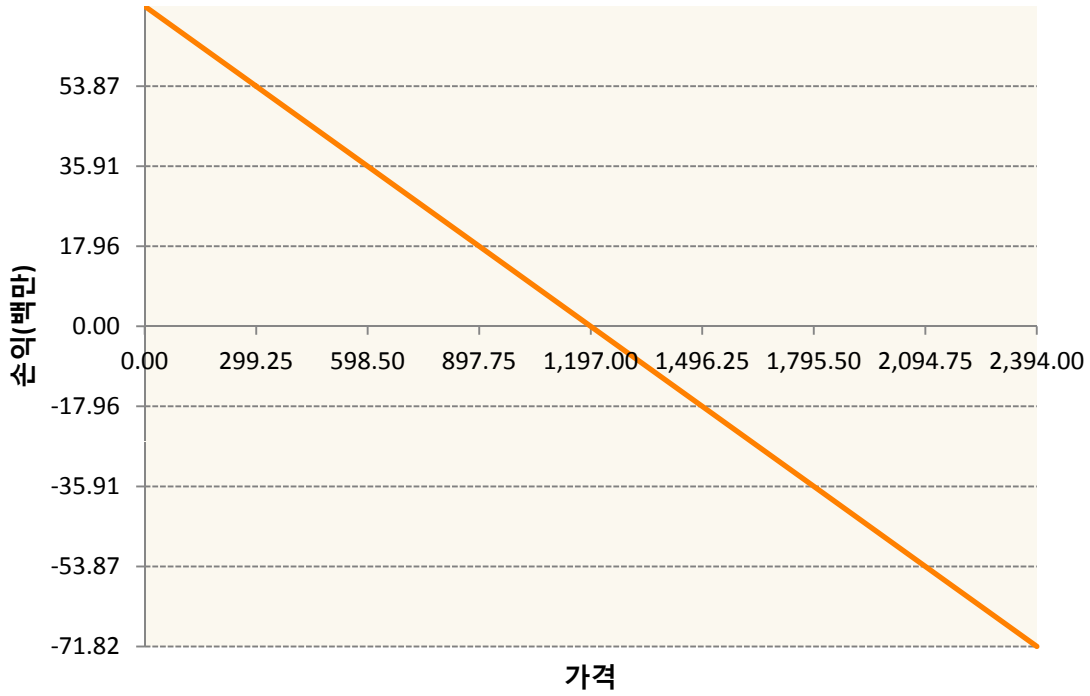
CN0-CORN FUTURE Jul20



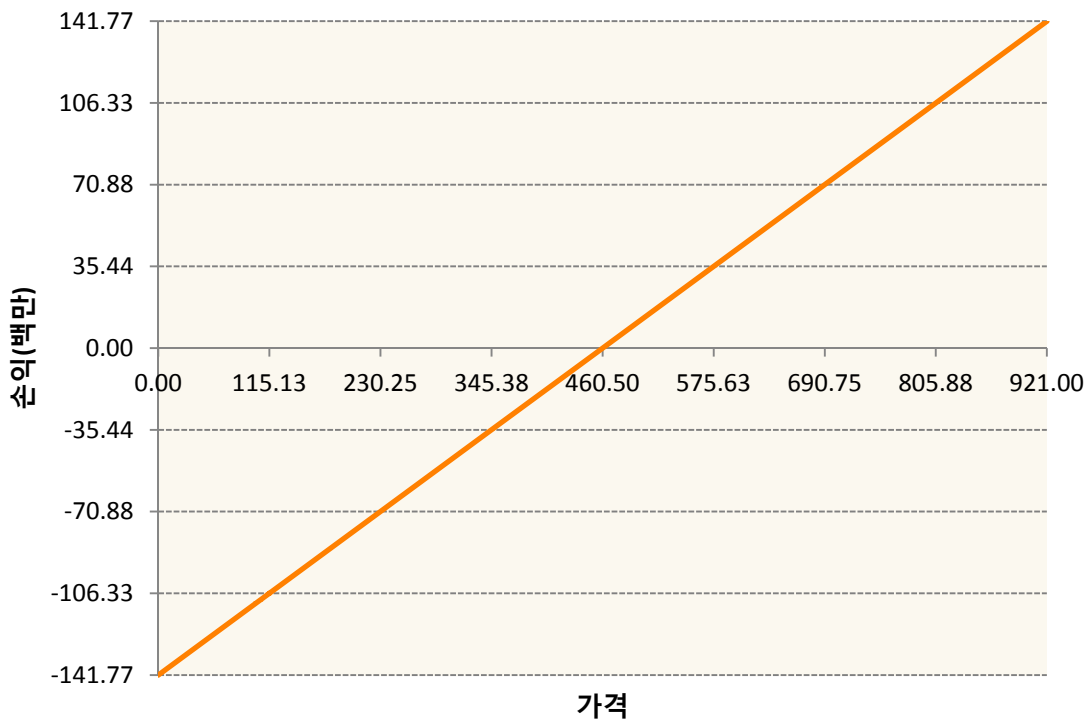




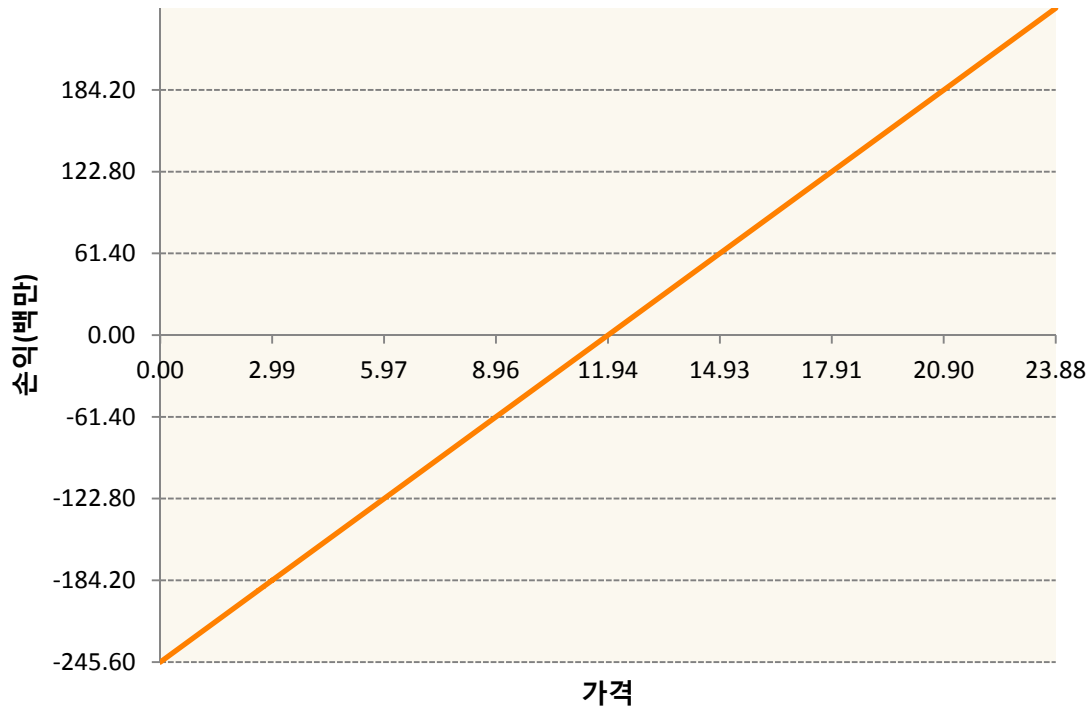
KR4175Q60006-2020-06 달러선물



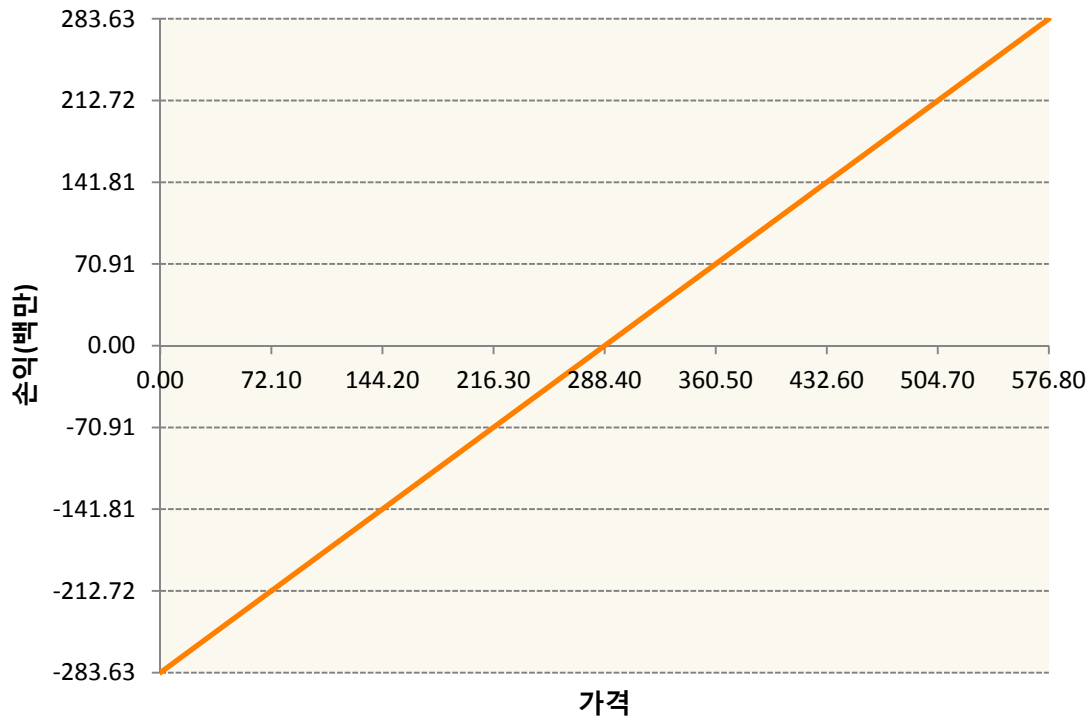
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



SBN0-Sugar Jul20

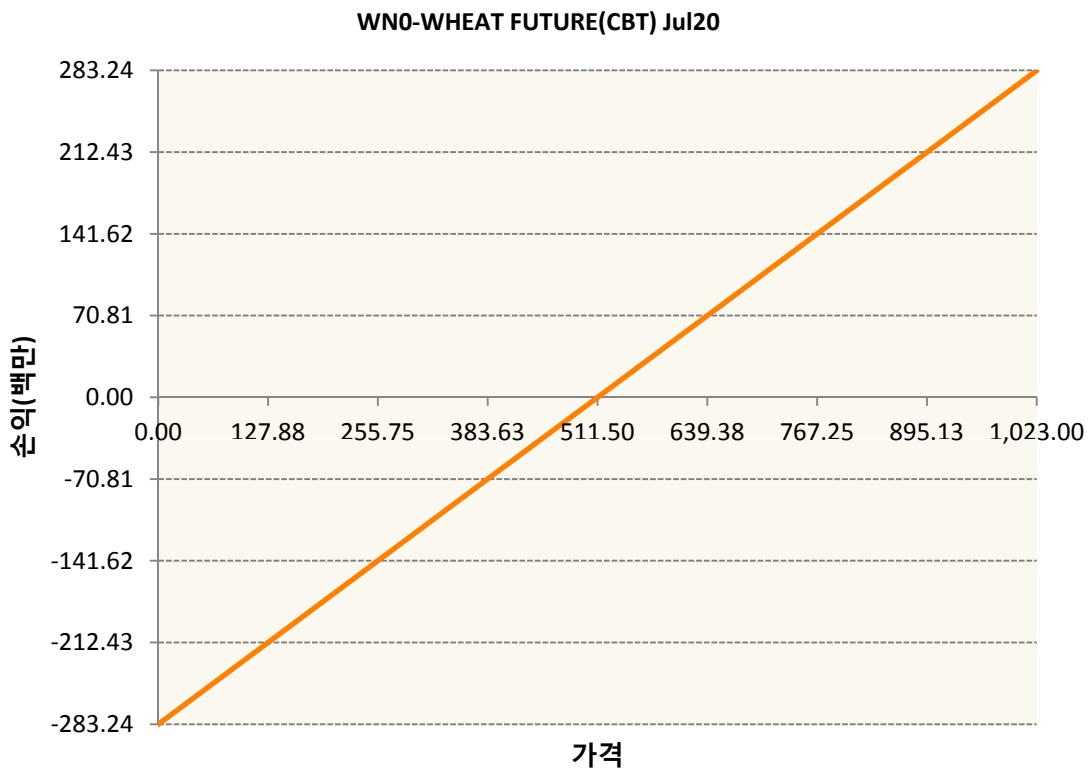
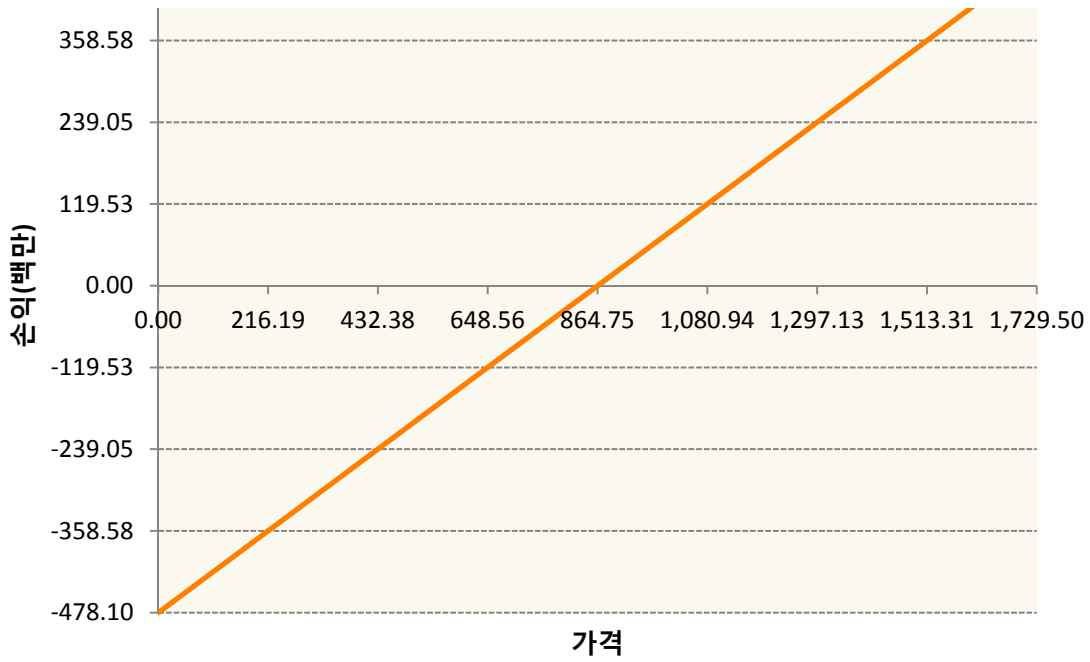


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20



SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BON0	SOYBEAN OIL FUTR Jul20	18
CN0	CORN FUTURE Jul20	39
CTN0	COTTON NO.2 FUTR Jul20	9
KCN0	COFFEE 'C' FUTURE Jul20	18
KR4175Q60(2020-06 달러선물		6

KWN0	KC HRW WHEAT FUT Jul20	11
SBN0	Sugar Jul20	20
SMN0	SOYBEAN MEAL FUTR Jul20	23
SN0	SOYBEAN FUTURE Jul20	38
WN0	WHEAT FUTURE(CBT) Jul20	23

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

(단위:백만원)

236