

공시일	2020-06-11
기준일	2020-06-10

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	2020-06-11
기준일	2020-06-10

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

1,095

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,288

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-06-11
기준일	2020-06-10

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S200610

586

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

864

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-06-11
기준일	2020-06-10

유로인덱스모(주식-파생형)

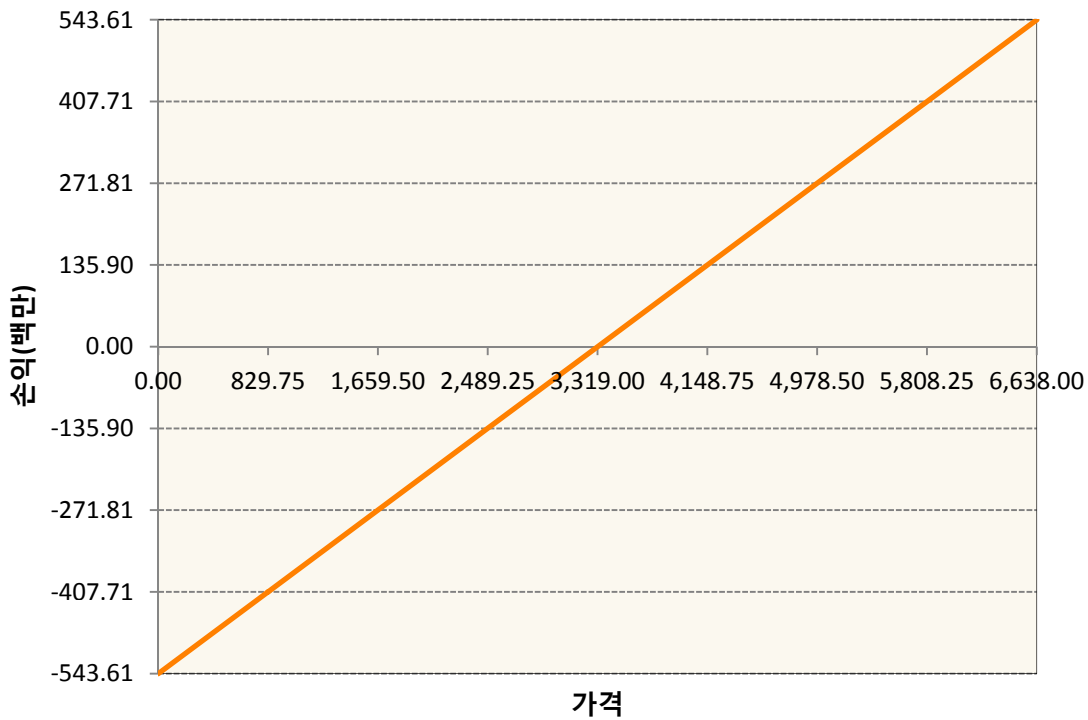
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	43
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

57

공시일	2020-06-11
기준일	2020-06-10

차이나인덱스모(주식-파생형)

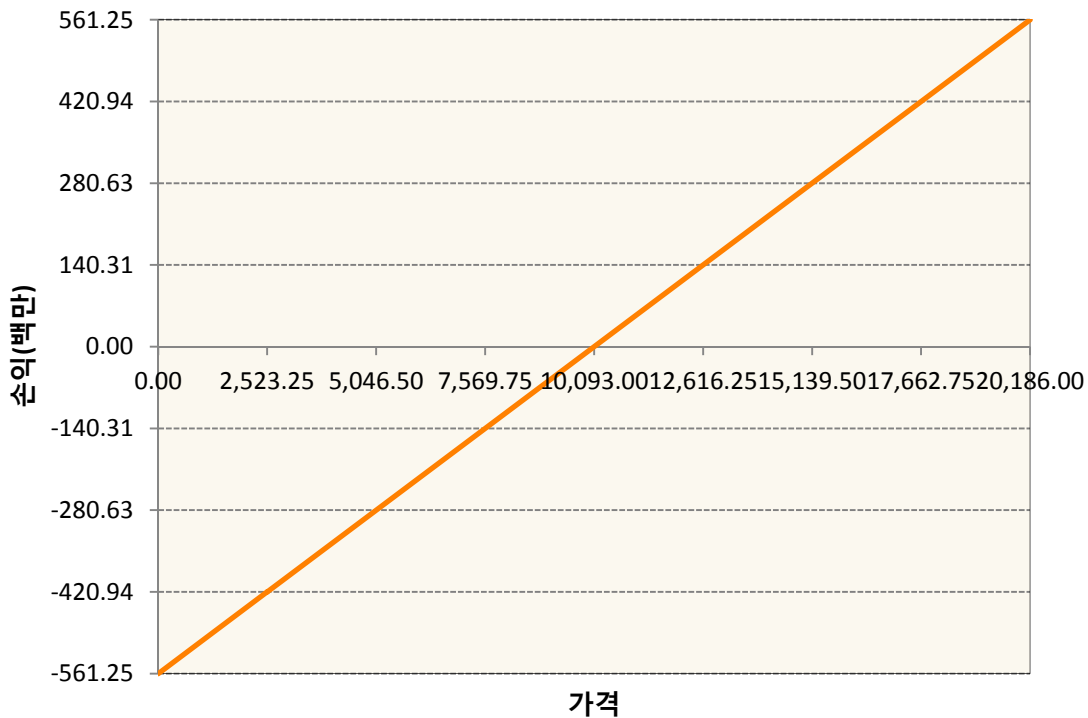
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	561	0	561	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)

49

공시일	2020-06-11
기준일	2020-06-10

커버드콜모(주식혼합-파생형)

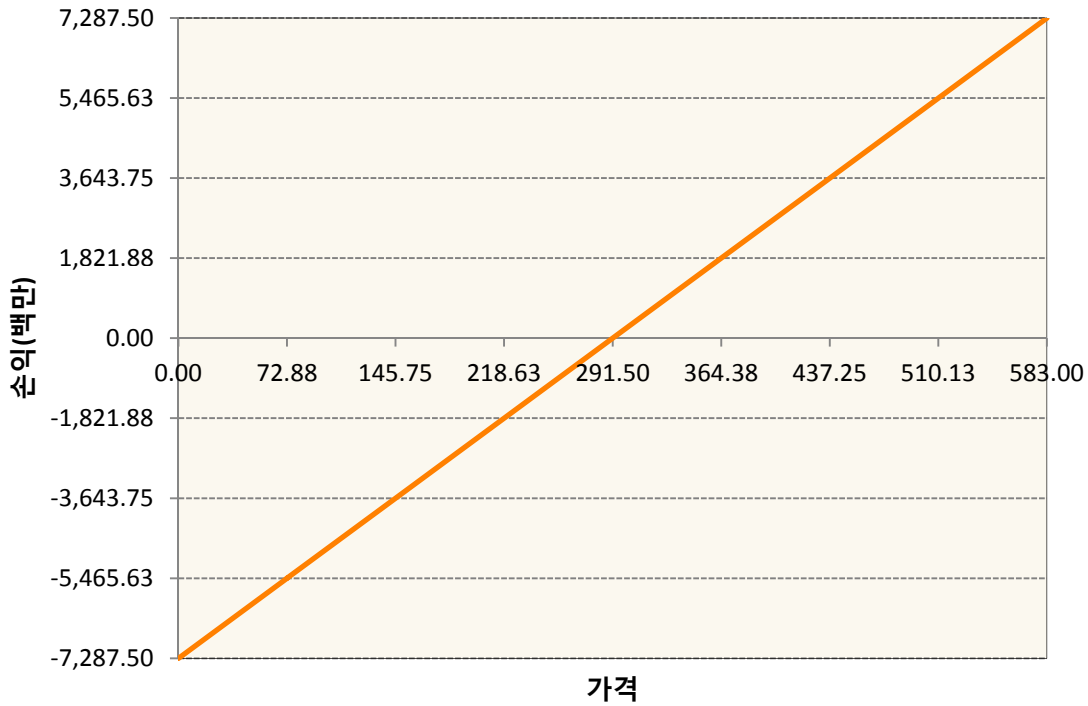
1. 계약금액

(단위:백만원)

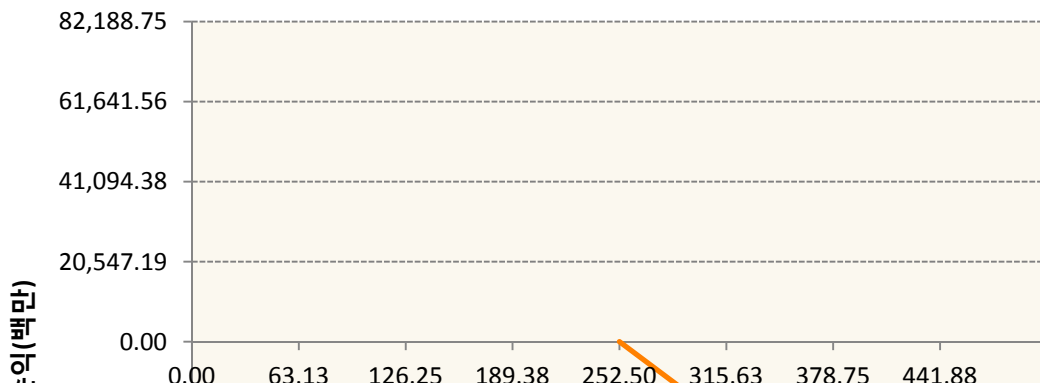
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,288	0	7,288	장내
누계	유가증권	옵션	0	329,306	-329,306	장내

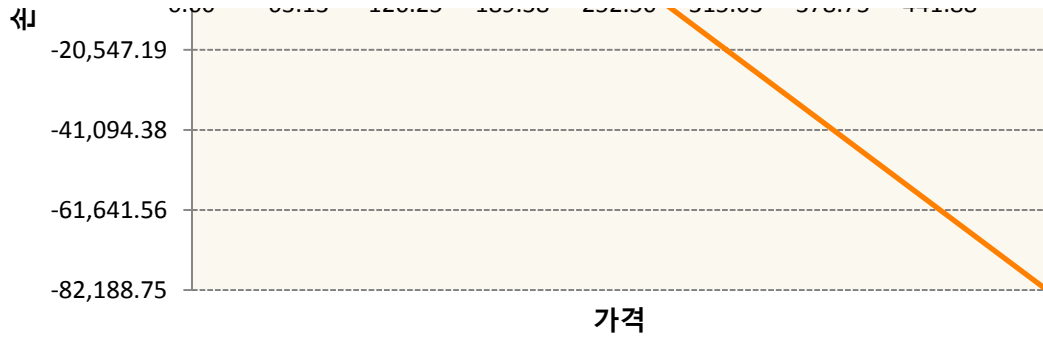
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

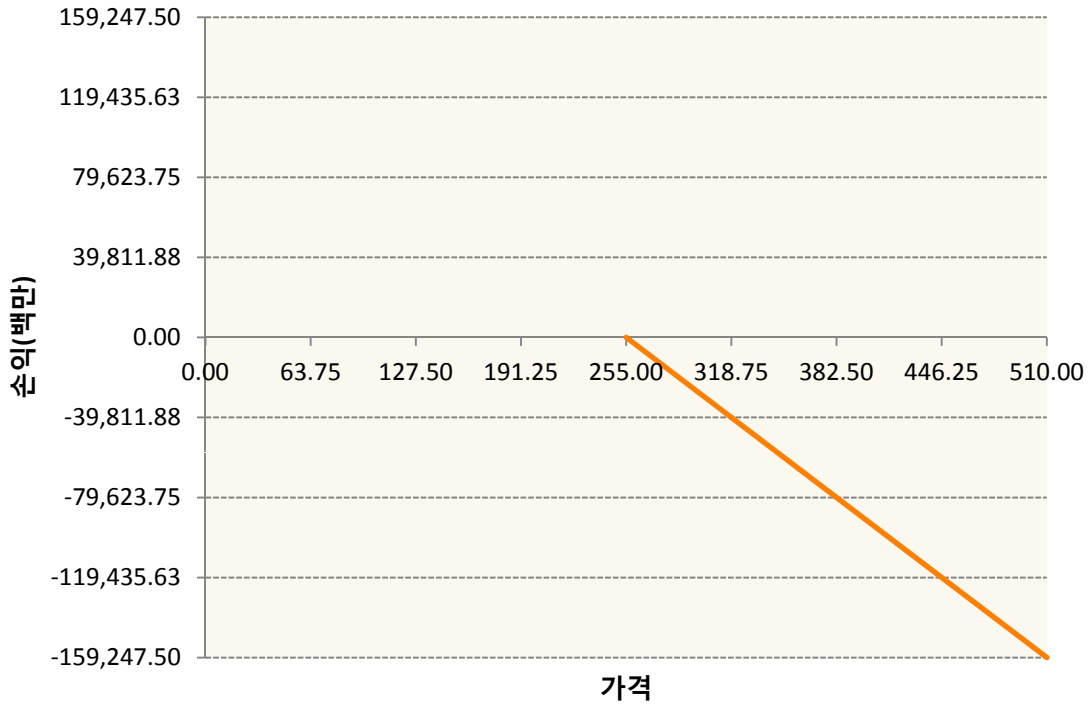


KR4201Q62527-2020-06 콜252.5

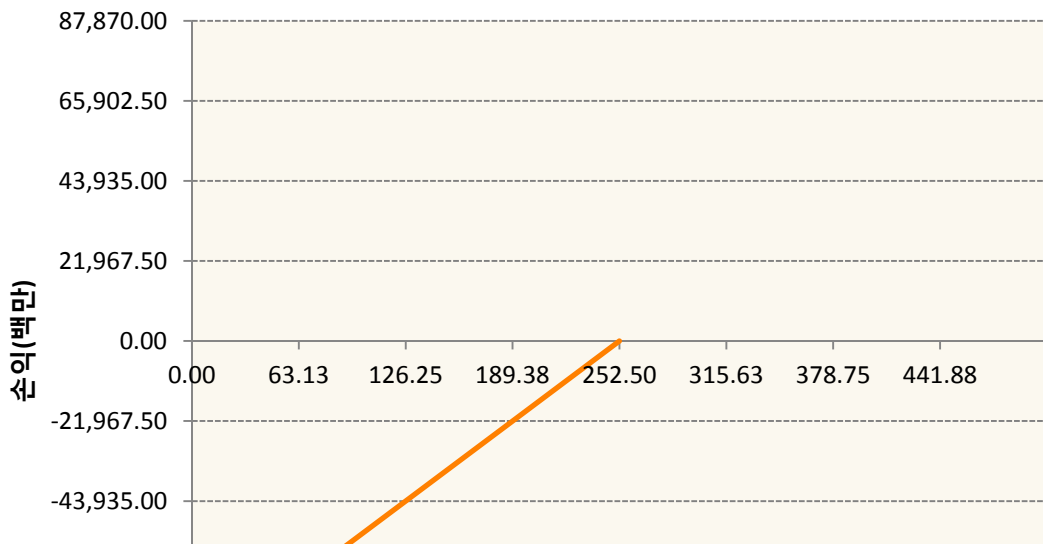


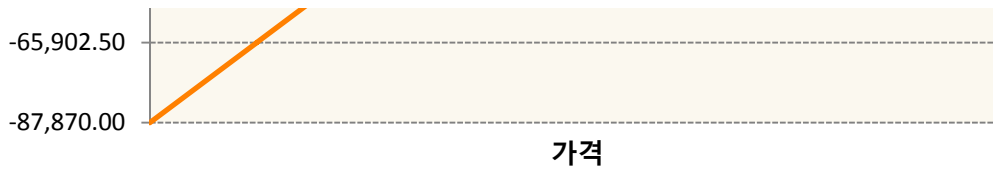


KR4201Q62550-2020-06 콜255



KR4301Q62525-2020-06 풋252.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						584
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-584	-584	-584	-584	-584	-584	-584	
-5.33%	-389	-389	-389	-389	-389	-389	-389	
-2.67%	-195	-195	-195	-195	-195	-195	-195	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	195	195	195	195	195	195	195	
5.33%	389	389	389	389	389	389	389	
8.00%	584	584	584	584	584	584	584	
KR4201Q62527		2020-06 콜252.5						7,601
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	7,601	7,600	7,600	7,599	7,596	7,593	7,588	
-5.33%	5,067	5,067	5,067	5,067	5,067	5,067	5,067	
-2.67%	2,534	2,534	2,534	2,534	2,534	2,534	2,534	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-2,534	-2,534	-2,534	-2,534	-2,534	-2,534	-2,534	
5.33%	-5,067	-5,067	-5,067	-5,067	-5,067	-5,067	-5,067	
8.00%	-7,601	-7,601	-7,601	-7,601	-7,601	-7,601	-7,601	
KR4201Q62550		2020-06 콜255						14,582
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	14,582	14,579	14,575	14,568	14,556	14,540	14,519	
-5.33%	9,722	9,722	9,722	9,721	9,721	9,720	9,718	
-2.67%	4,861	4,861	4,861	4,861	4,861	4,861	4,861	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-4,861	-4,861	-4,861	-4,861	-4,861	-4,861	-4,861	
5.33%	-9,722	-9,722	-9,722	-9,722	-9,722	-9,722	-9,722	
8.00%	-14,582	-14,582	-14,582	-14,582	-14,582	-14,582	-14,582	
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

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

(단위:백만원)

23,063

공시일	2020-06-11
기준일	2020-06-10

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

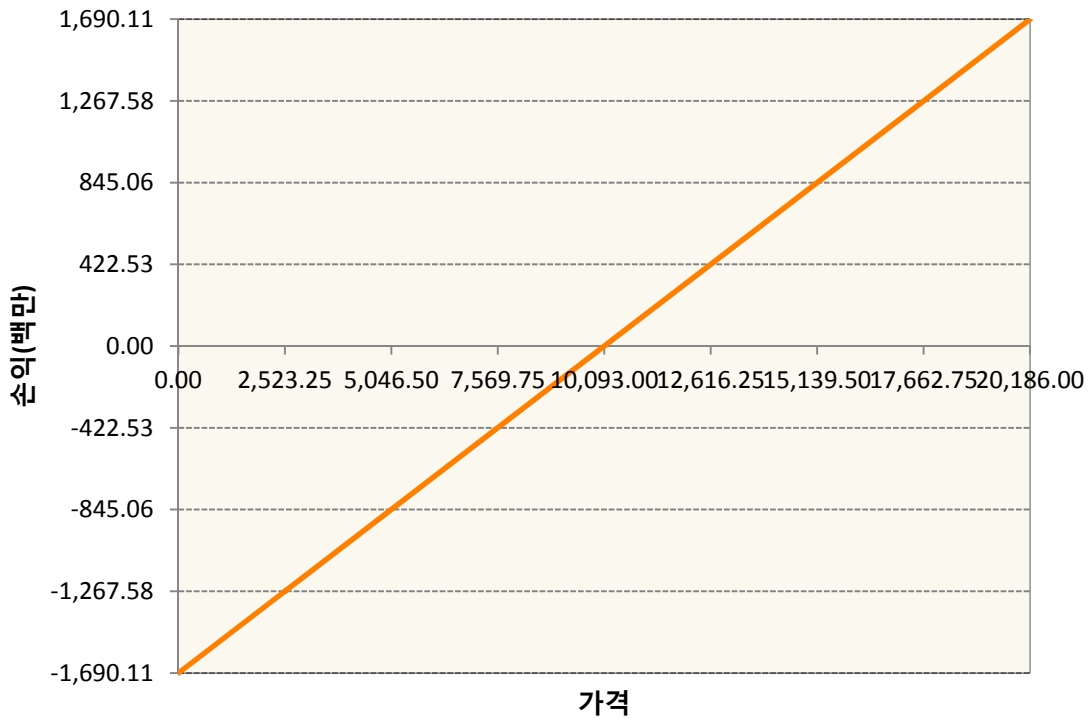
1. 계약금액

(단위:백만원)

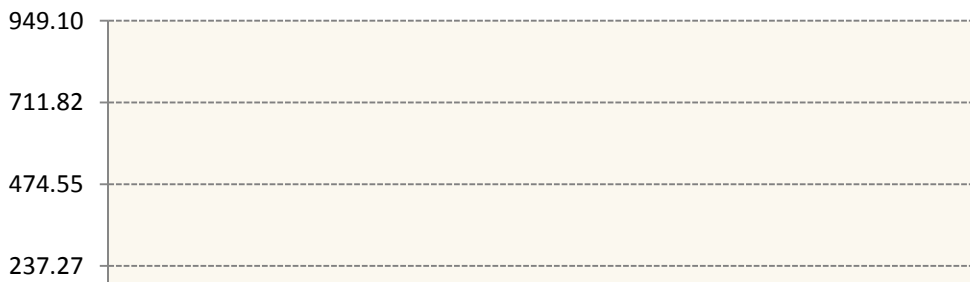
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,690	0	1,690	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,111	-4,111	장내
누계	통화	선도	0	1,488	-1,488	장외

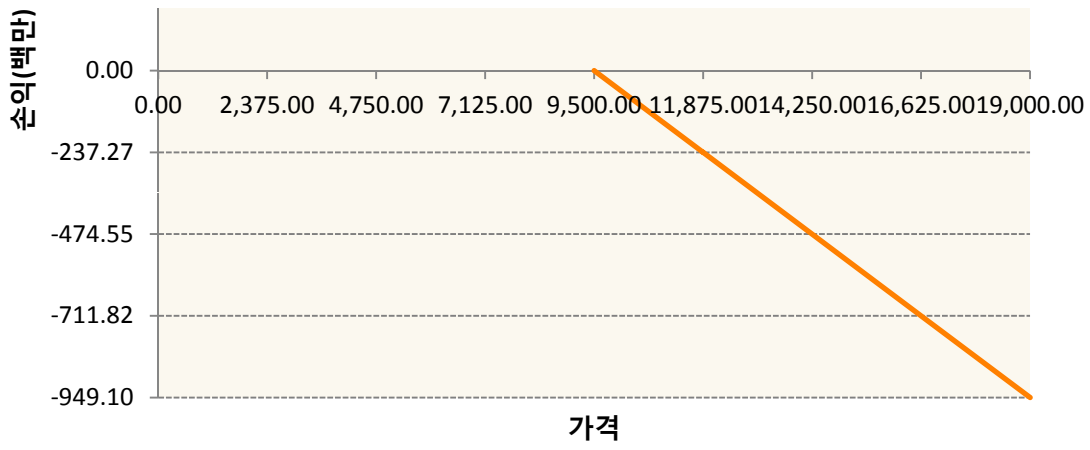
2. 만기시점의 손익구조

HCM0-HSCEI Futures Jun20

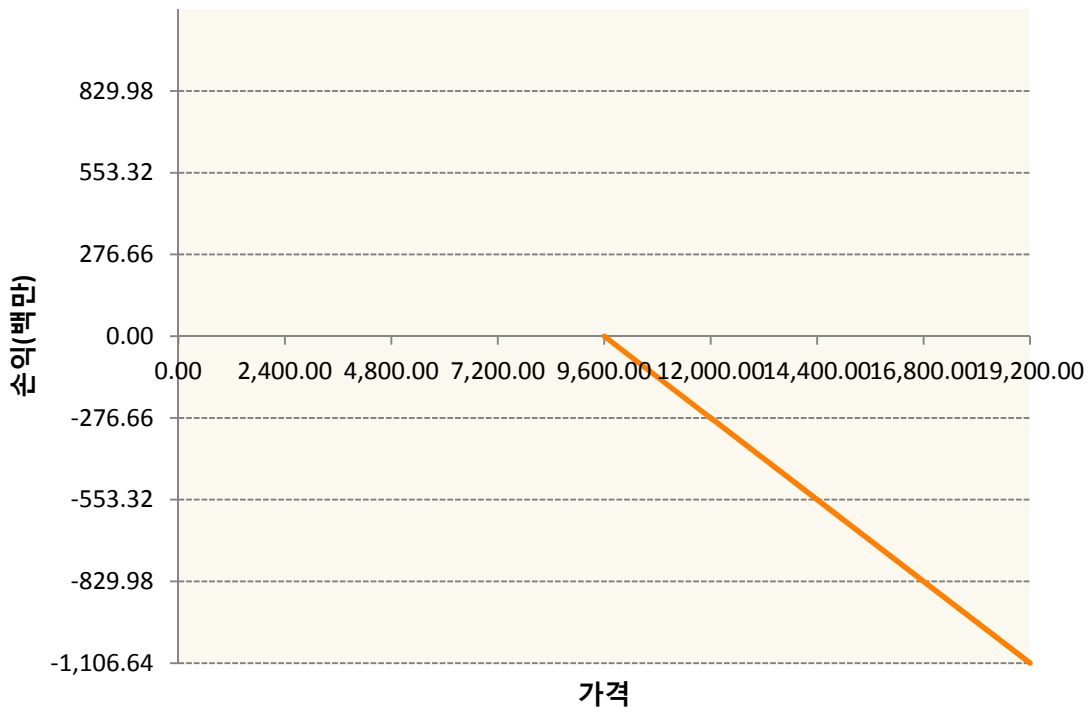


OHHIM0-C95-HSCEI

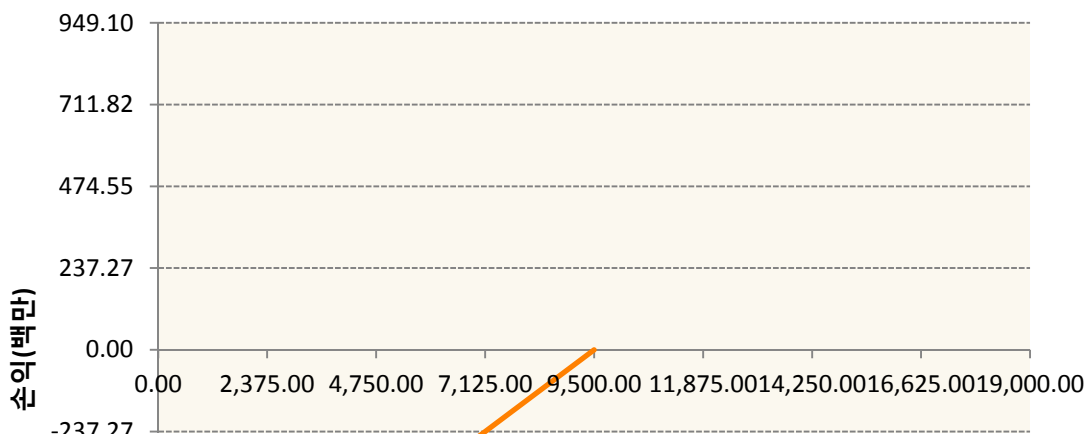


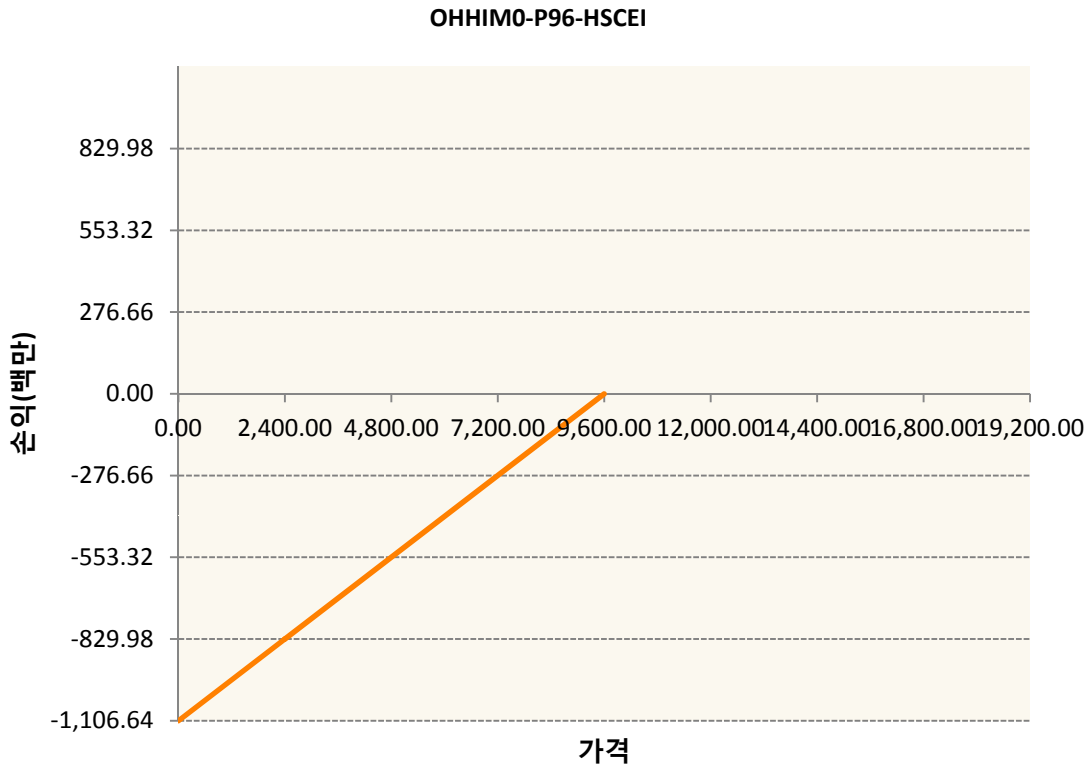


OHHIM0-C96-HSCEI



OHHIM0-P95-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E	119
HCM0 HSCEI Futures Jun20	135
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)
	562

공시일	2020-06-11
기준일	2020-06-10

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

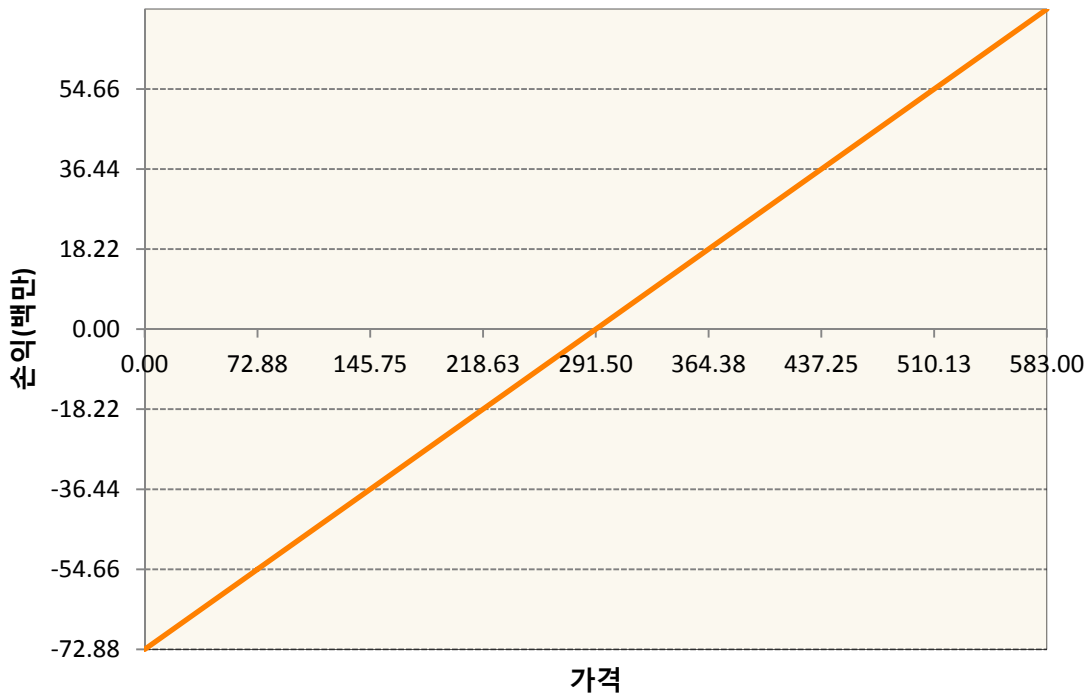
1. 계약금액

(단위:백만원)

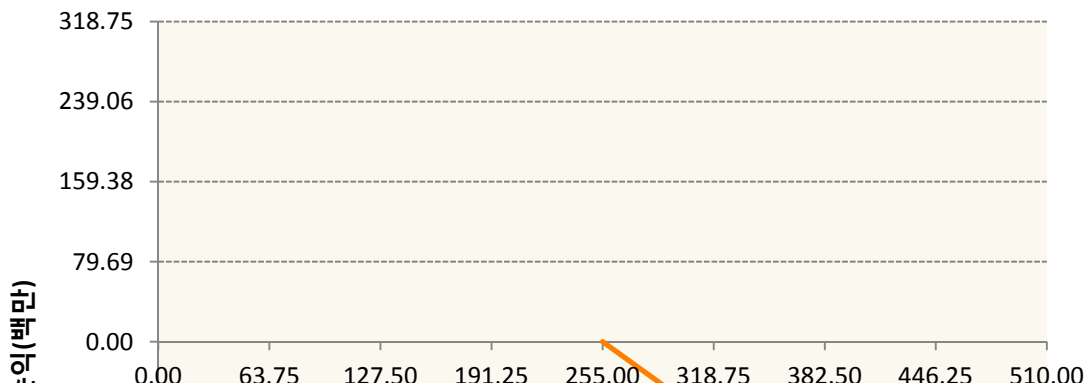
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	73	-73	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	73	0	73	장내
누계	유가증권	옵션	0	319	-319	장내

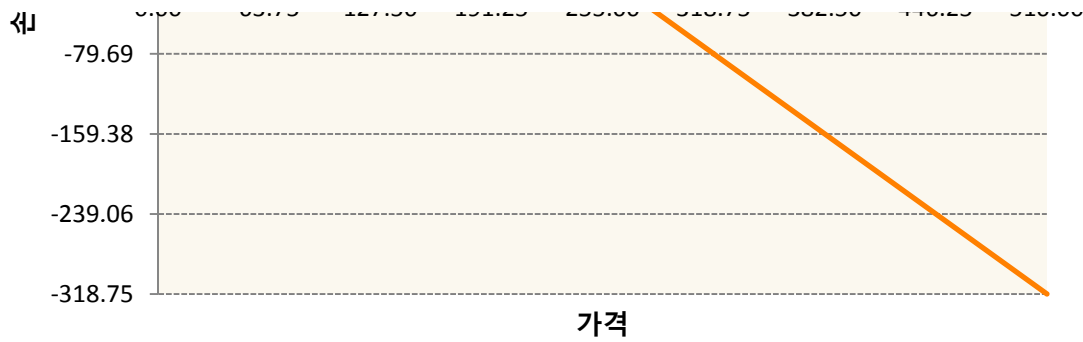
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



KR4201Q62550-2020-06 콜255





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						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	-6
-5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	2	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	4	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	6	6	6	6	6	6	6	6
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	29
-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)

38

공시일	2020-06-11
기준일	2020-06-10

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

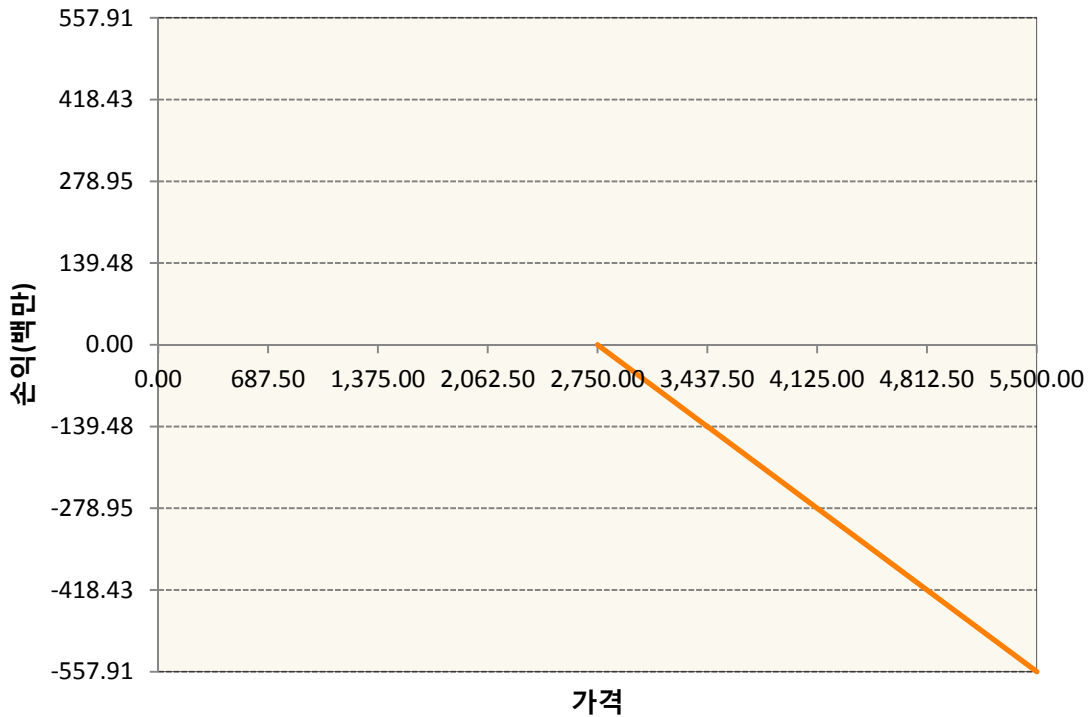
1. 계약금액

(단위:백만원)

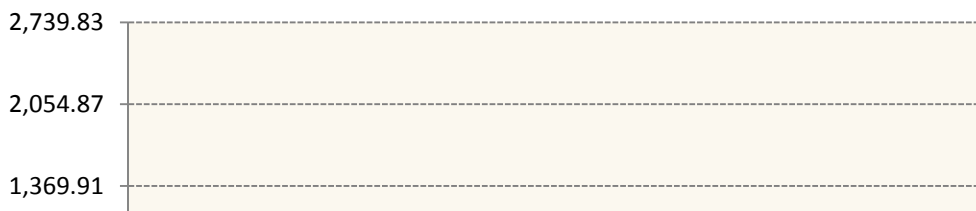
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,291	0	1,291	
누계	유가증권	스왑	8,067	0	8,067	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,633	-6,633	장내
누계	통화	선도	0	2,927	-2,927	장외

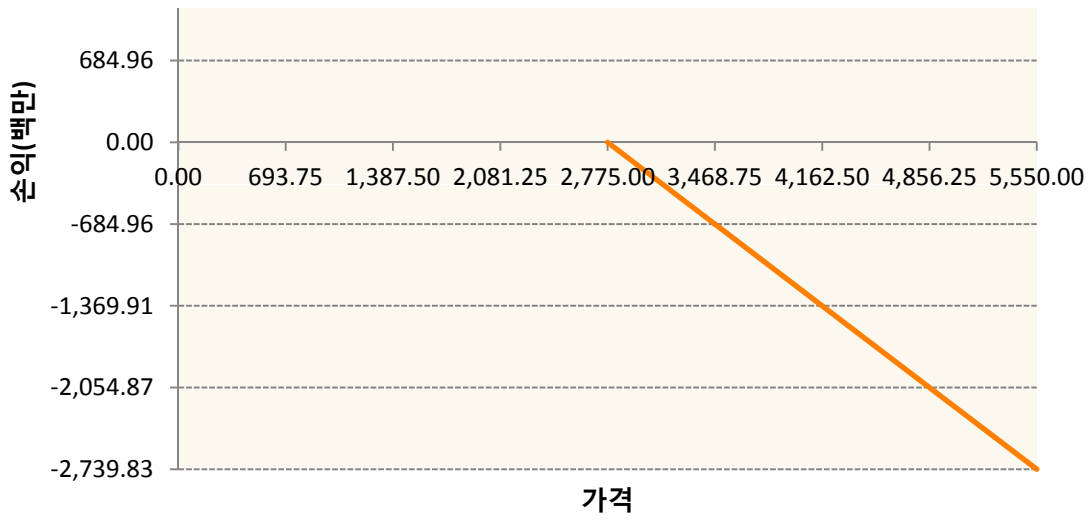
2. 만기시점의 손익구조

OESXM0-C2750-EURO STOXX 50

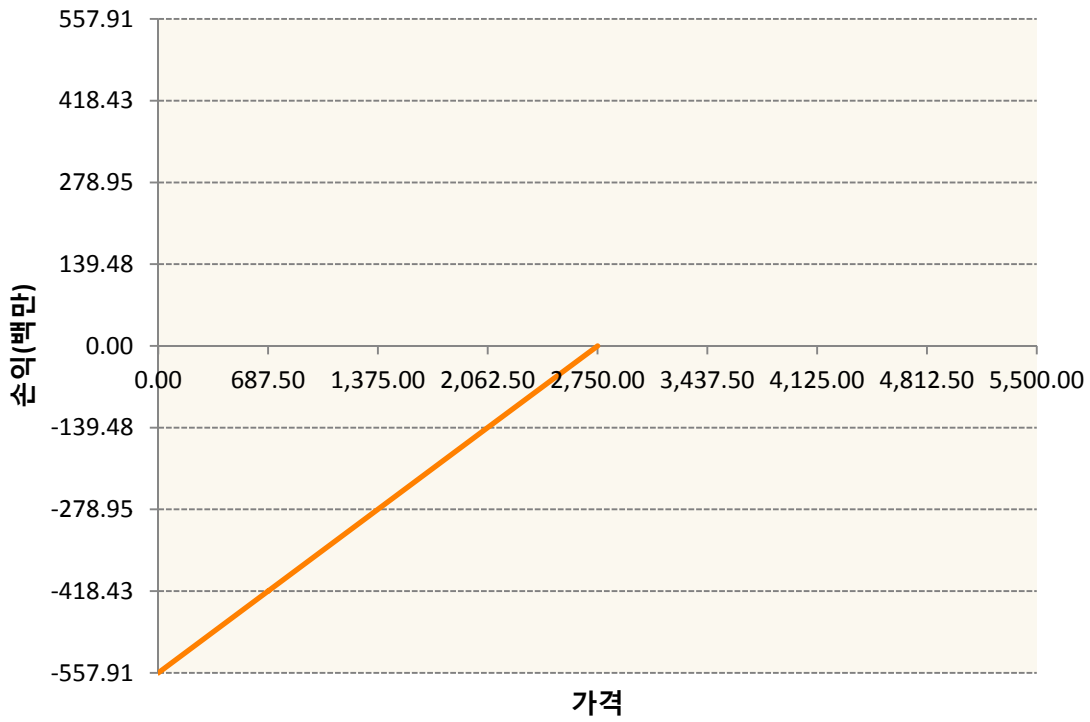


OESXM0-C2775-EURO STOXX 50

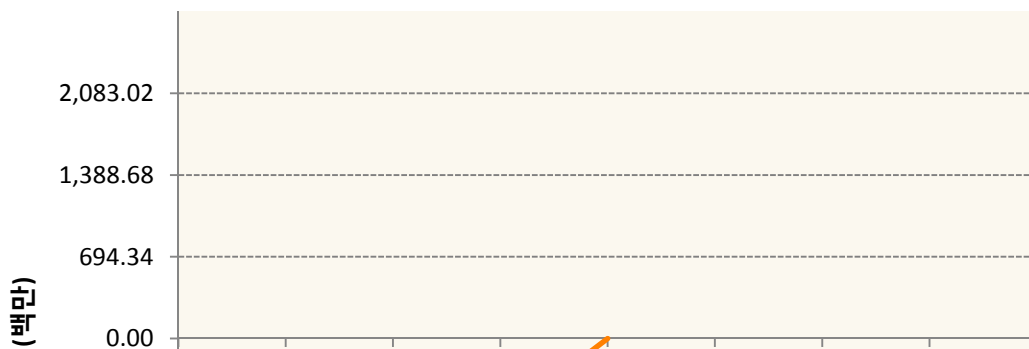


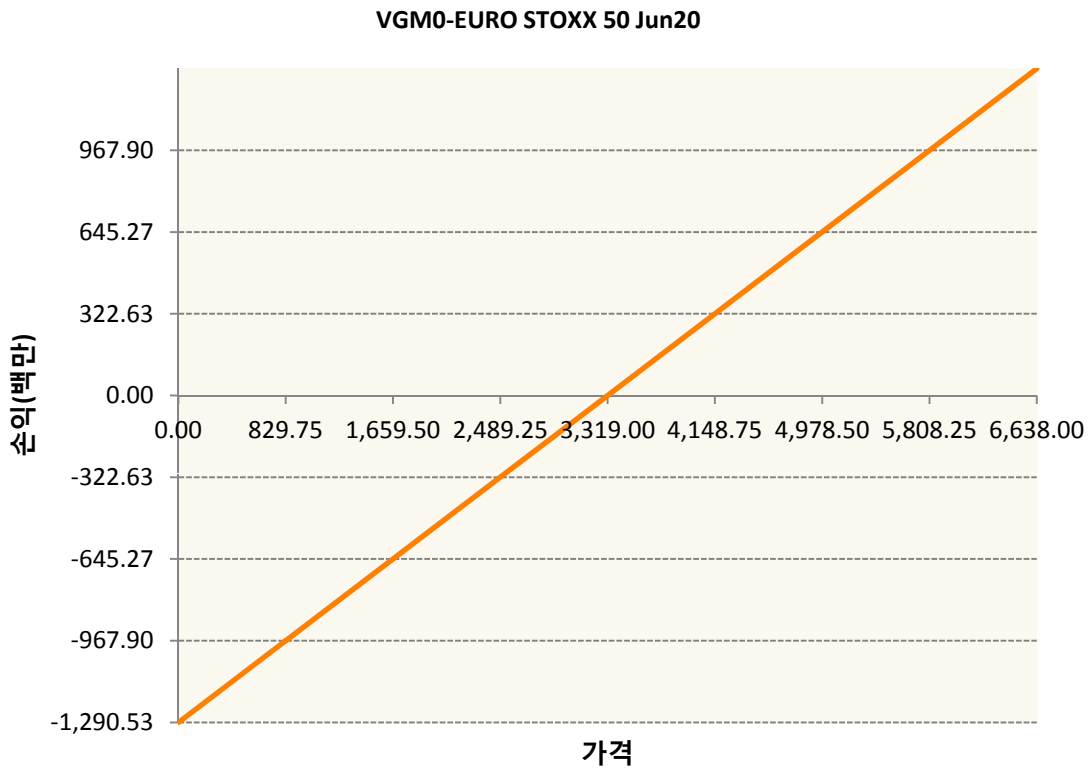
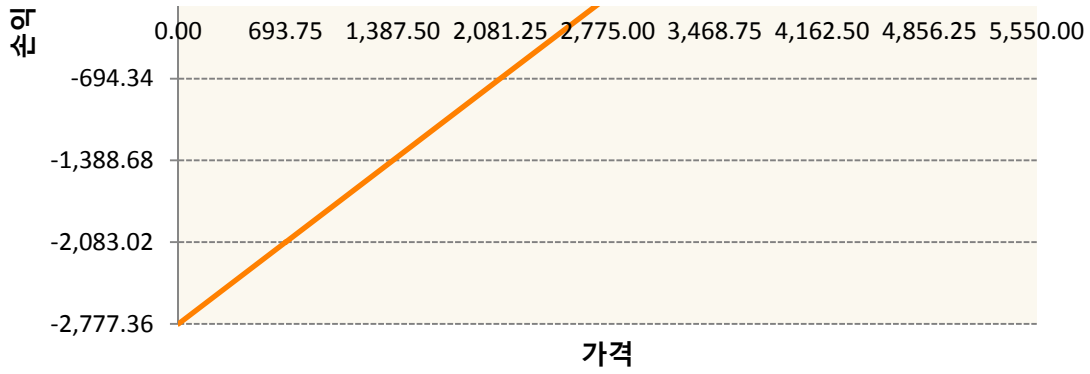


OESXM0-P2750-EURO STOXX 50



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	103

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

(단위:백만원)

1,023

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

(단위:백만원)

1,320

공시일	2020-06-11
기준일	2020-06-10

ETF스마트레버리지목표전환형9호

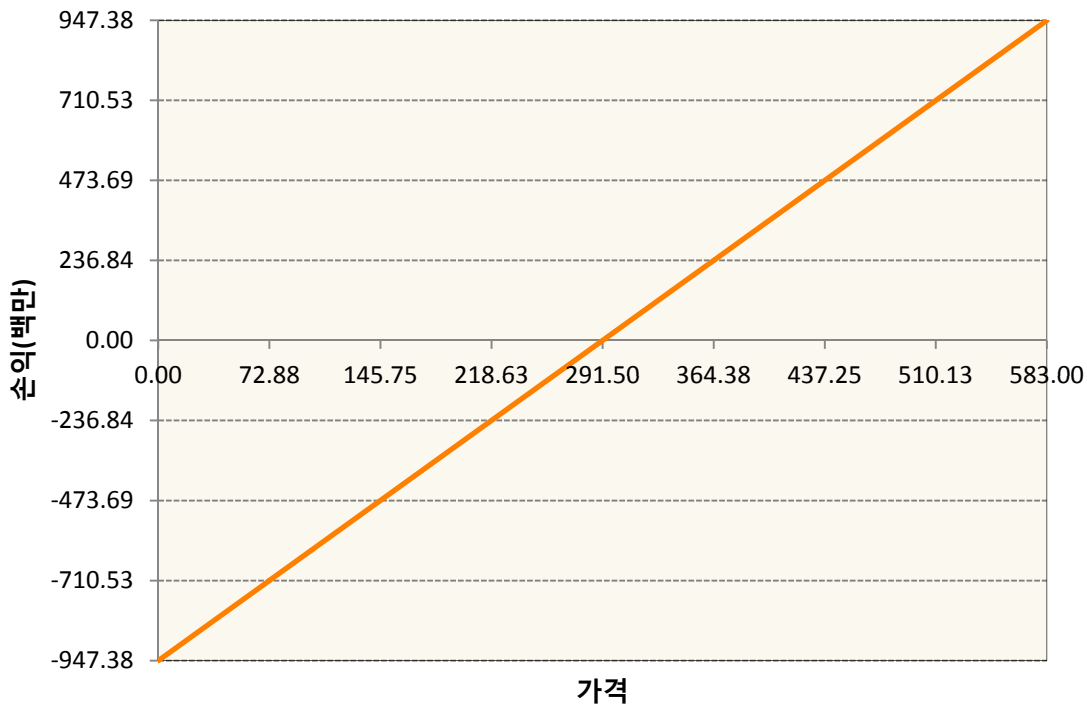
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	947	0	947	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%	-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)

114

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

(단위:백만원)

167

공시일	2020-06-11
기준일	2020-06-10

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

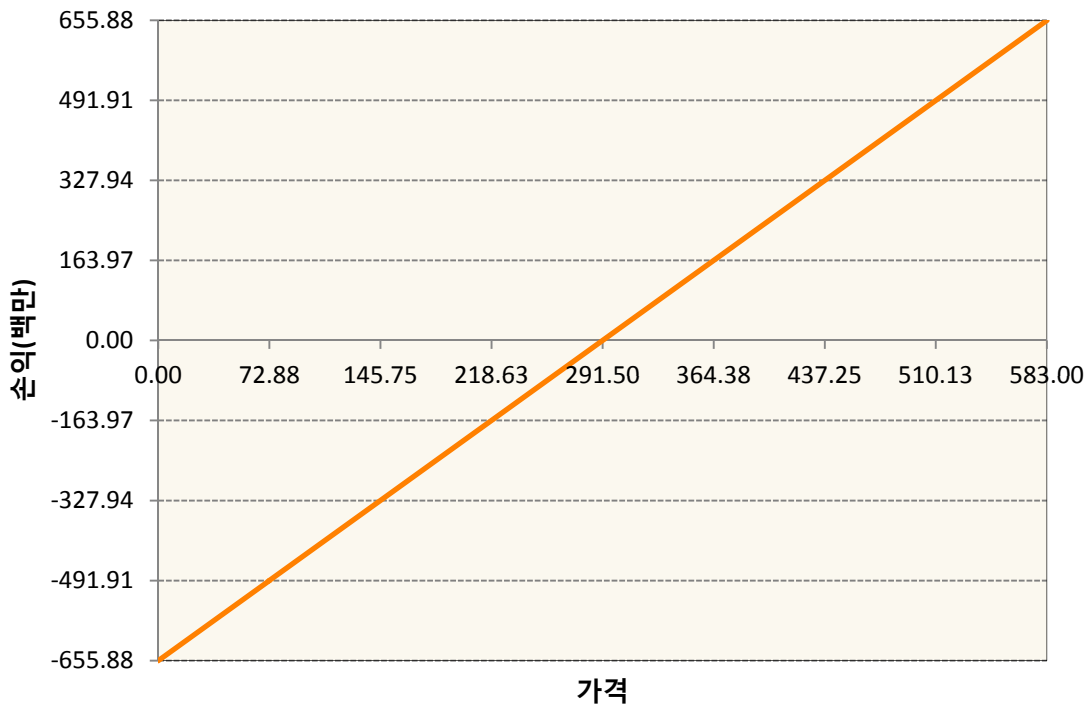
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	656	0	656	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						53
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53	
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	18	18	18	18	18	18	18	
5.33%	35	35	35	35	35	35	35	
8.00%	53	53	53	53	53	53	53	

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

(단위:백만원)

79

공시일	2020-06-11
기준일	2020-06-10

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

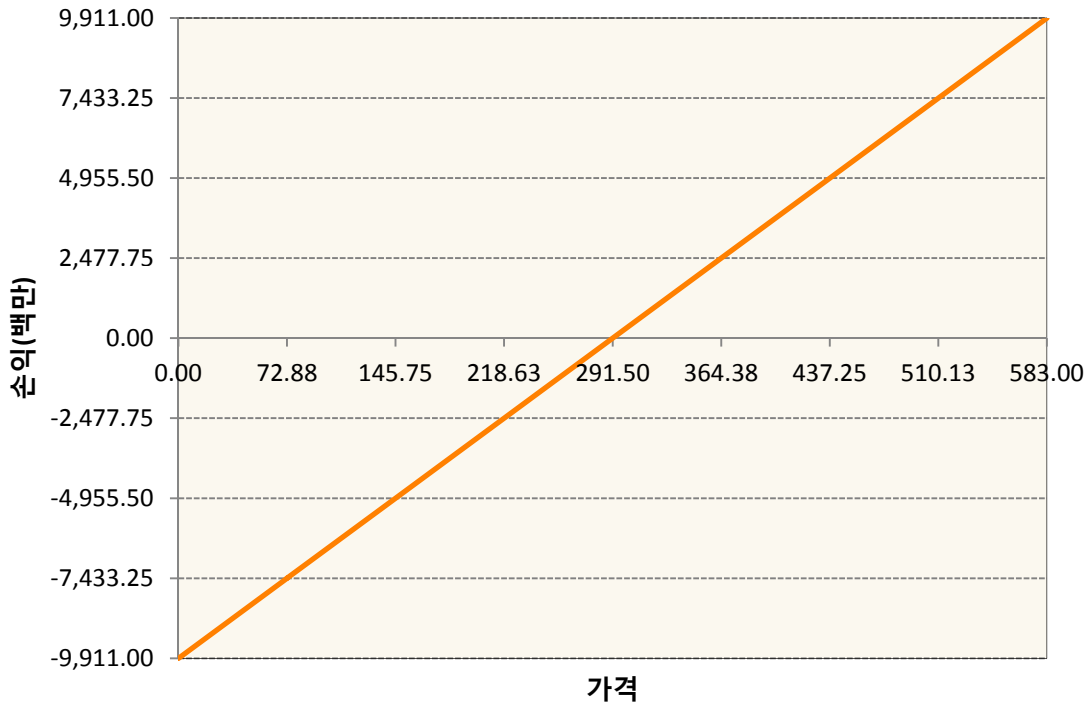
1. 계약금액

(단위:백만원)

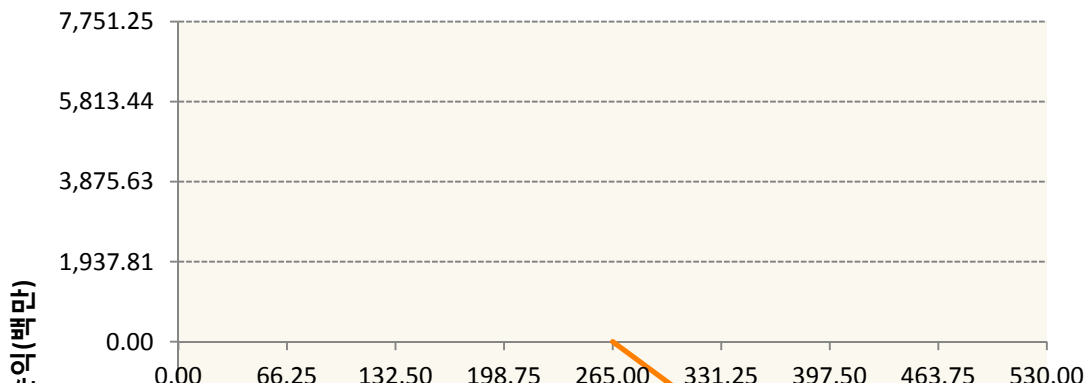
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,911	0	9,911	장내
누계	유가증권	옵션	2,917	16,646	-13,729	장내

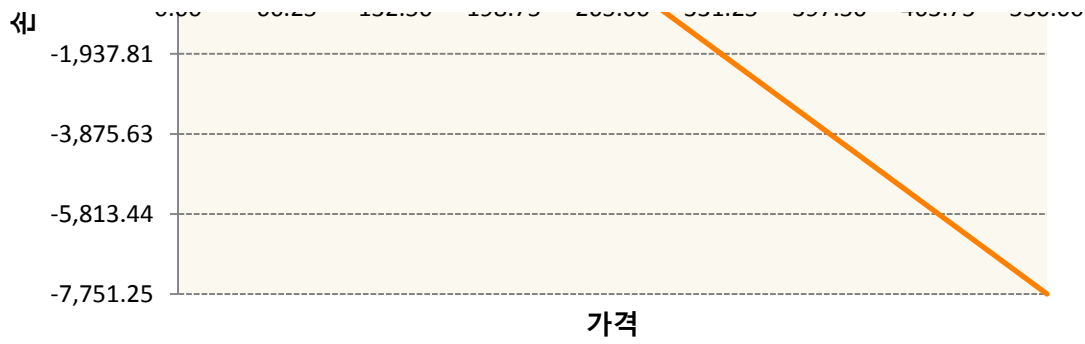
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물

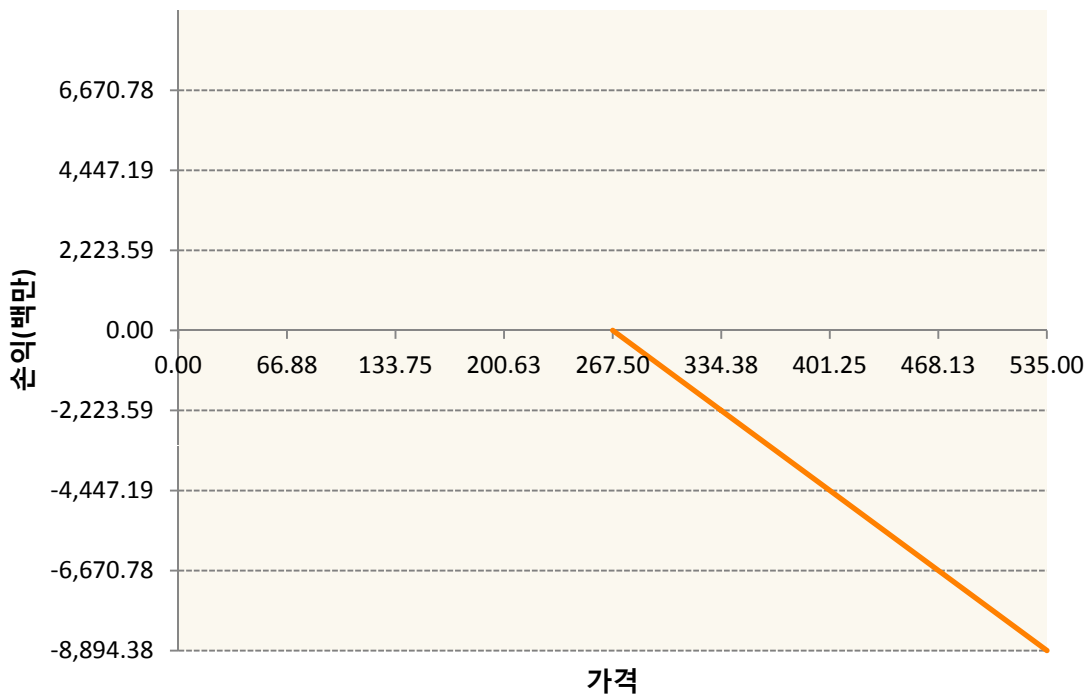


KR4201Q62659-2020-06 콜265

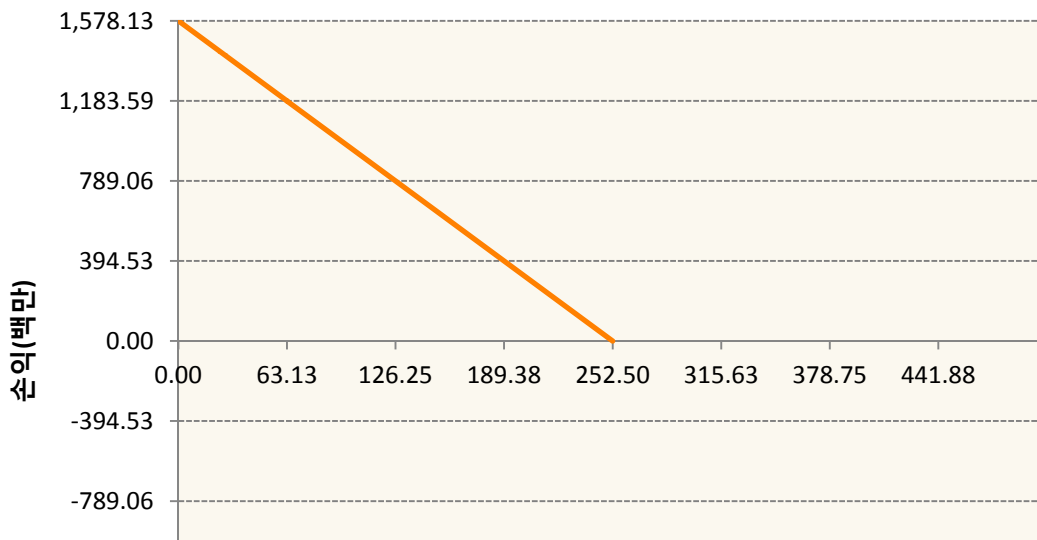




KR4201Q62675-2020-06 콜267.5



KR4301Q62525-2020-06 풋252.5



0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-228	-228	-228	-228	-228	-228	-228
5.33%	-455	-455	-455	-455	-455	-455	-455
8.00%	-683	-683	-683	-683	-683	-683	-683
KR4201Q62675 2020-06 콜267.5							776
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	731	725	718	712	705	698	692
-5.33%	516	515	513	511	508	505	501
-2.67%	259	259	259	259	258	258	257
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-259	-259	-259	-259	-259	-259	-259
5.33%	-518	-518	-518	-518	-518	-518	-518
8.00%	-776	-776	-776	-776	-776	-776	-776
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)

2,658

공시일	2020-06-11
기준일	2020-06-10

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	156,227	0	156,227	

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	2020-06-11
기준일	2020-06-10

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	103,490	0	103,490	

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	2020-06-11
기준일	2020-06-10

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	465,347	0	465,347	
누계	통화	선도	0	490,774	-490,774	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J027 KRW/USD 22-06-20E	1,468
FX21020J028 KRW/USD 22-06-20E	1,906
FX21020J039 KRW/USD 24-07-20E	2,144
FX21020J043 KRW/USD 24-07-20E	1,715
FX21020J043 KRW/USD 24-07-20E	1,906
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	1,982
FX21020K00 KRW/USD 12-06-20E	1,887
FX21020K01 KRW/USD 22-06-20E	667
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	2,325
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	953
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,001
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,582
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	3,335
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	6,766
FX21020M00 KRW/USD 26-08-20E	572
FX21020M01 KRW/USD 26-08-20E	4,670
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	1,982
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	2,401

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

20,122

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

(단위:백만원)

228

공시일	2020-06-11
기준일	2020-06-10

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	7,670	0	7,670	
누계	통화	선도	0	7,397	-7,397	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020K01 KRW/USD 15-06-20E	312
FX21020K03 KRW/USD 15-06-20E	10
FX21020K04 KRW/USD 27-07-20E	38
FX21020K04 KRW/USD 27-07-20E	95
FX21020K04 KRW/USD 30-06-20E	36
FX21020K04 KRW/USD 20-07-20E	76
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)

303

공시일	2020-06-11
기준일	2020-06-10

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

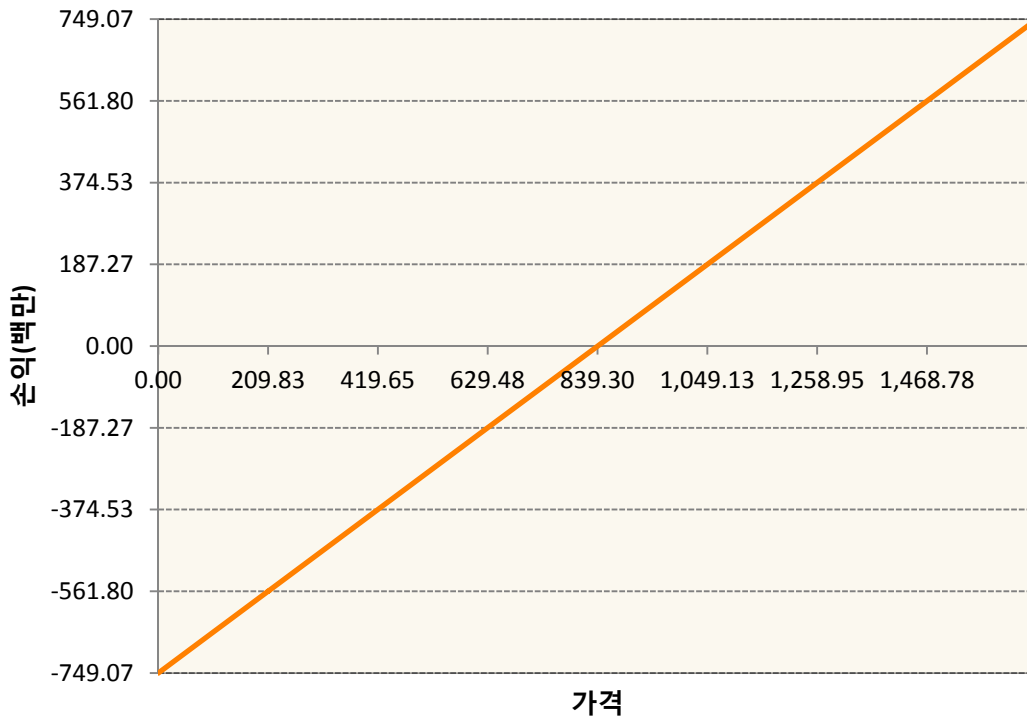
1. 계약금액

(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	749	0	749	
누계	유가증권	스왑	981	0	981	장외
누계	통화	선도	208	885	-676	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	60

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

(단위:백만원)

176

공시일	2020-06-11
기준일	2020-06-10

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

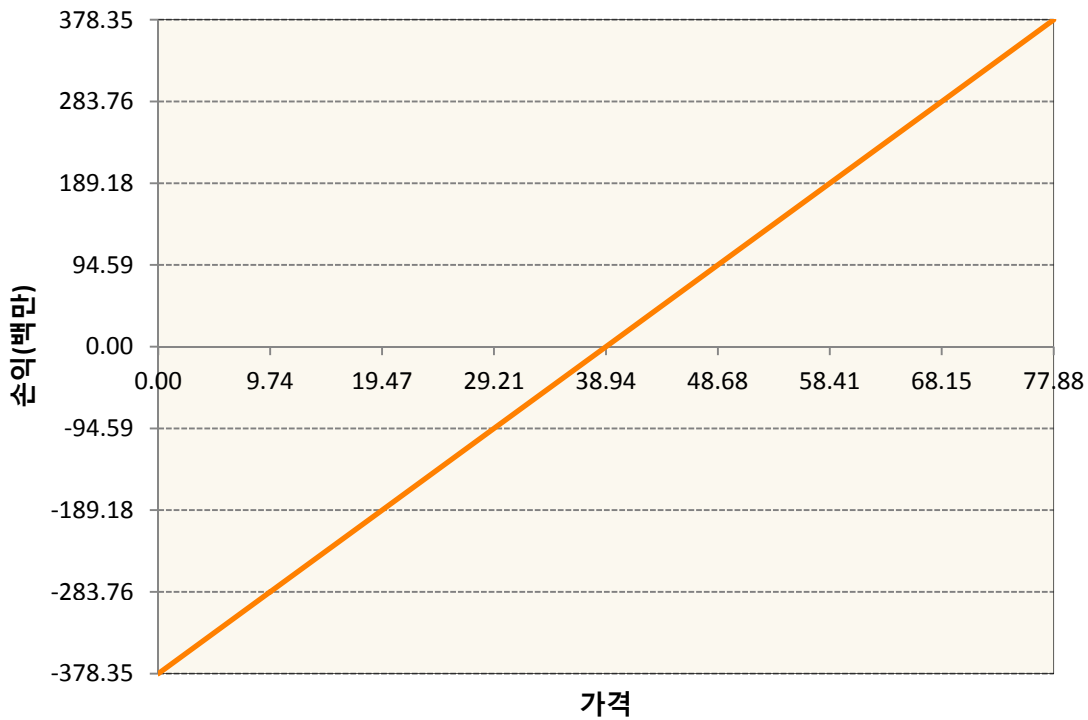
1. 계약금액

(단위:백만원)

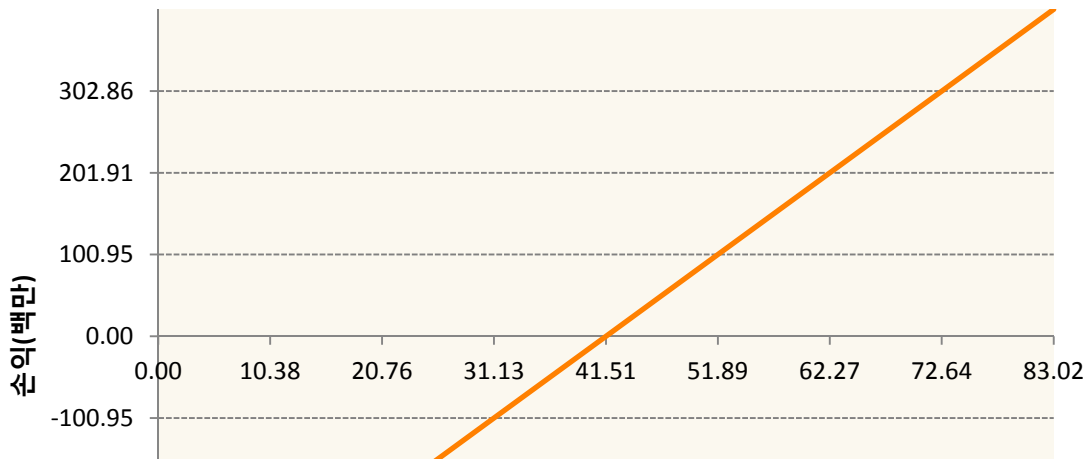
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,846	358	1,489	

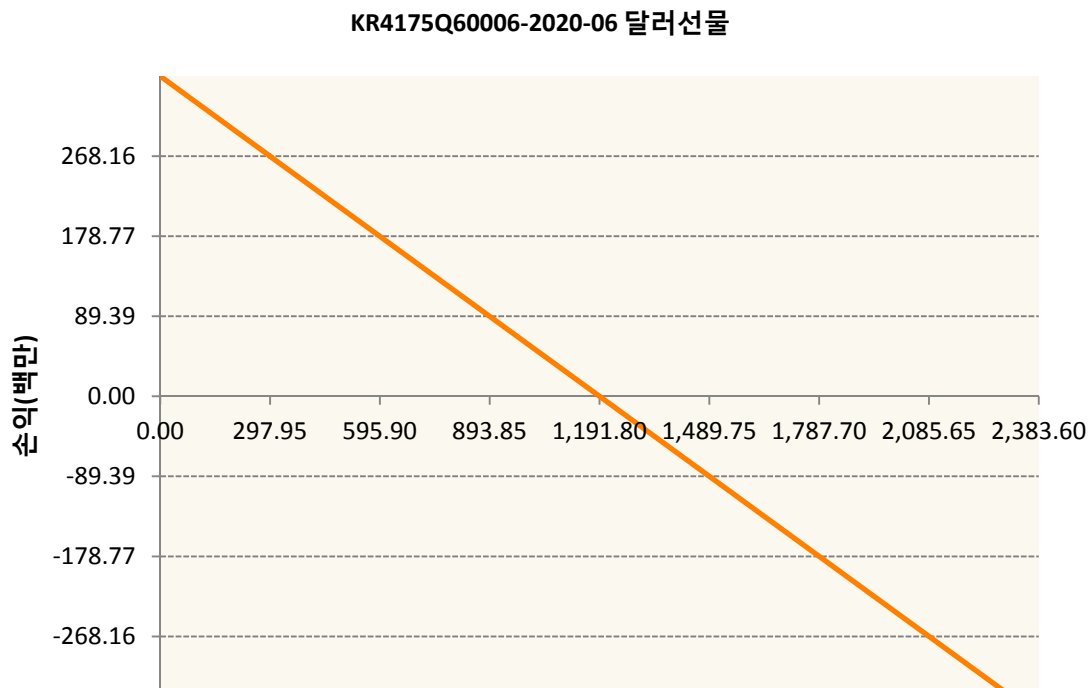
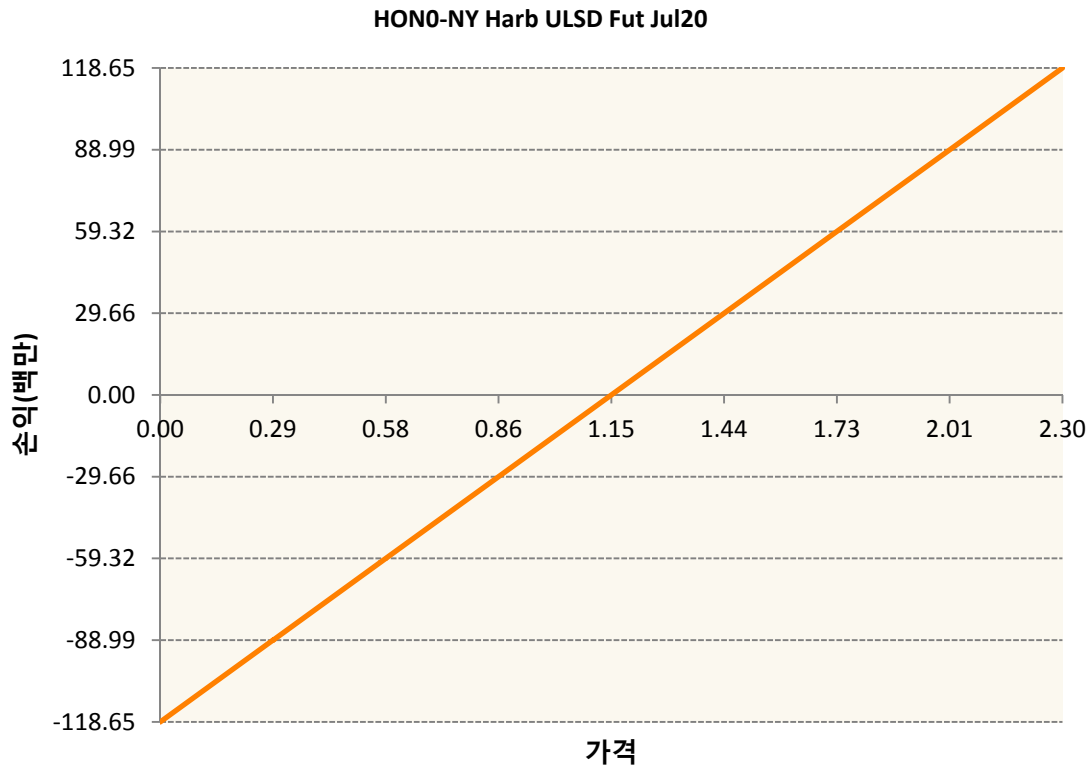
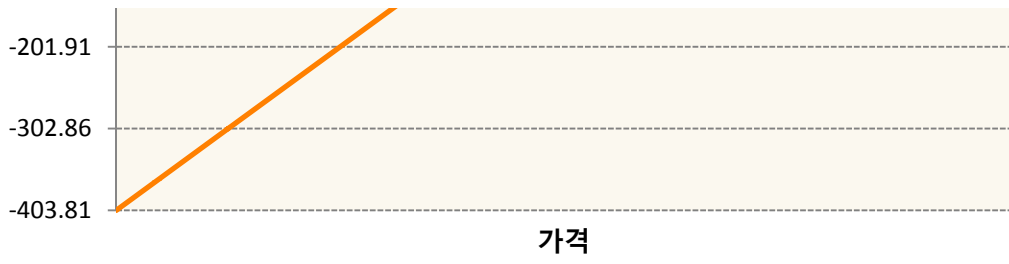
2. 만기시점의 손익구조

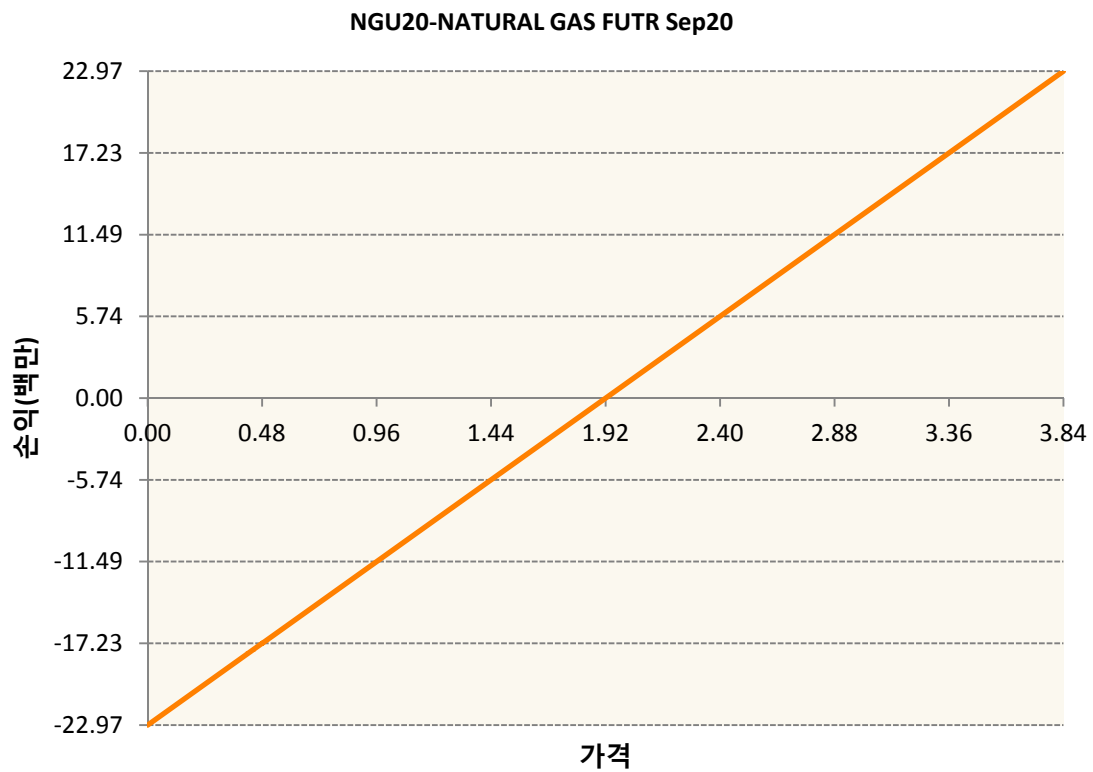
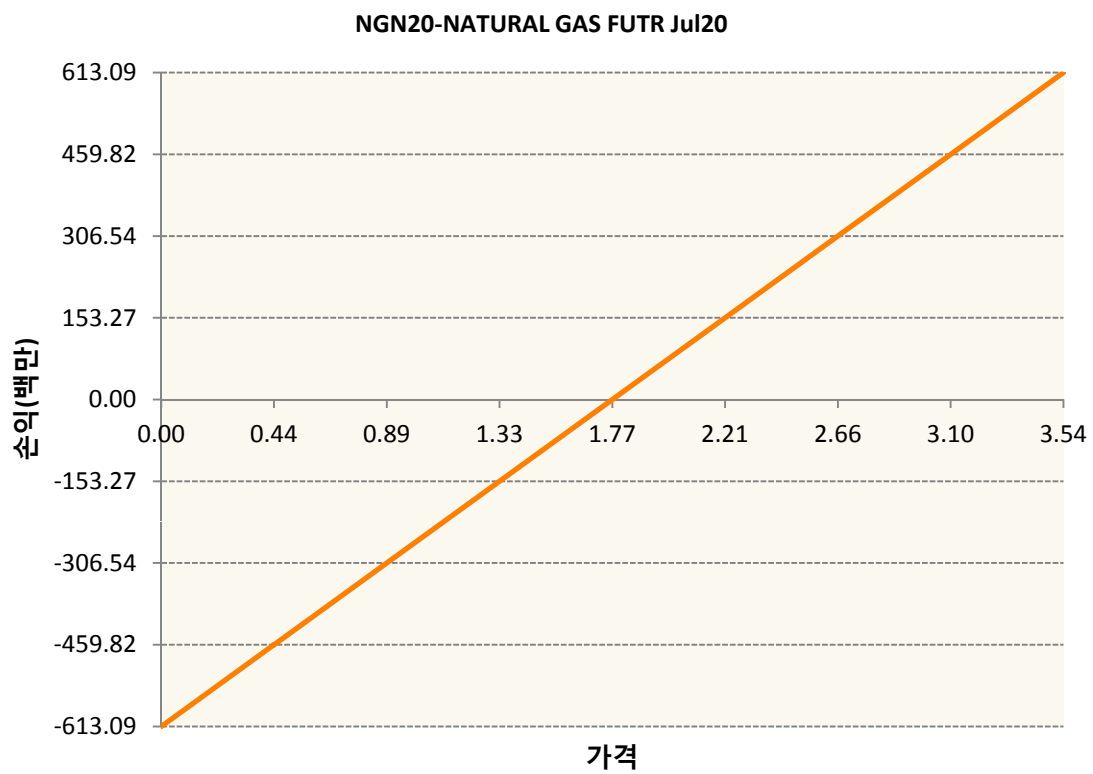
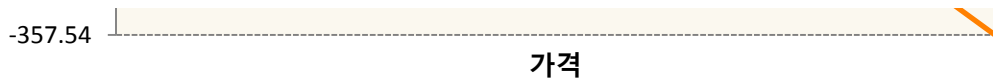
CLN0-WTI CRUDE FUTURE Jul20



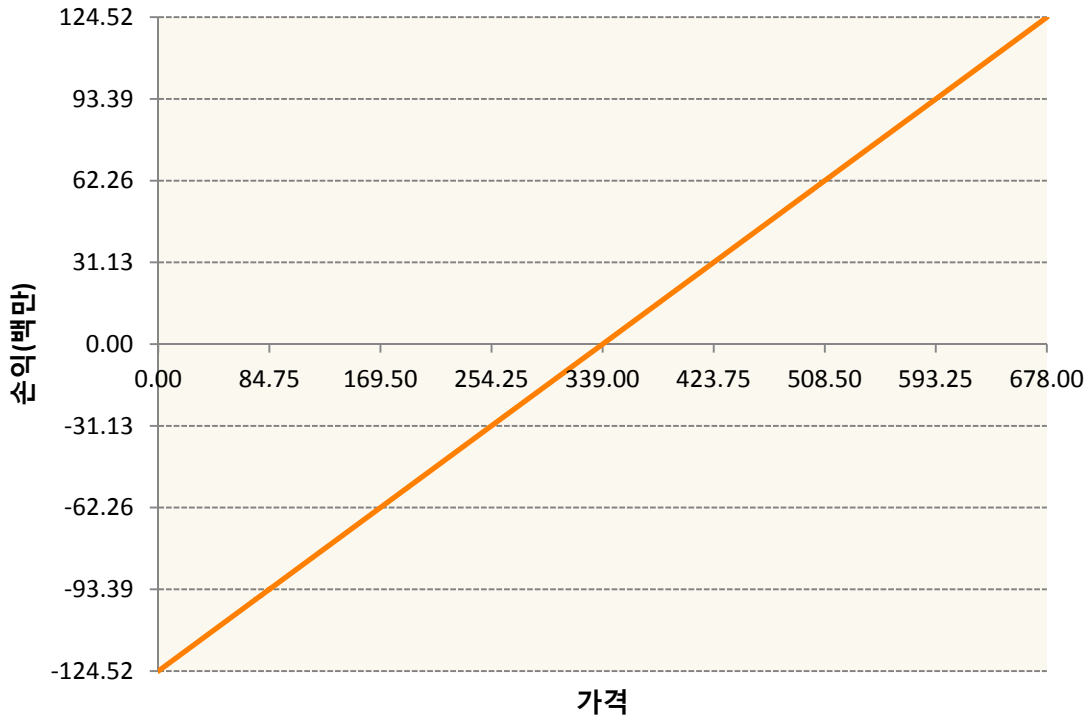
COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20



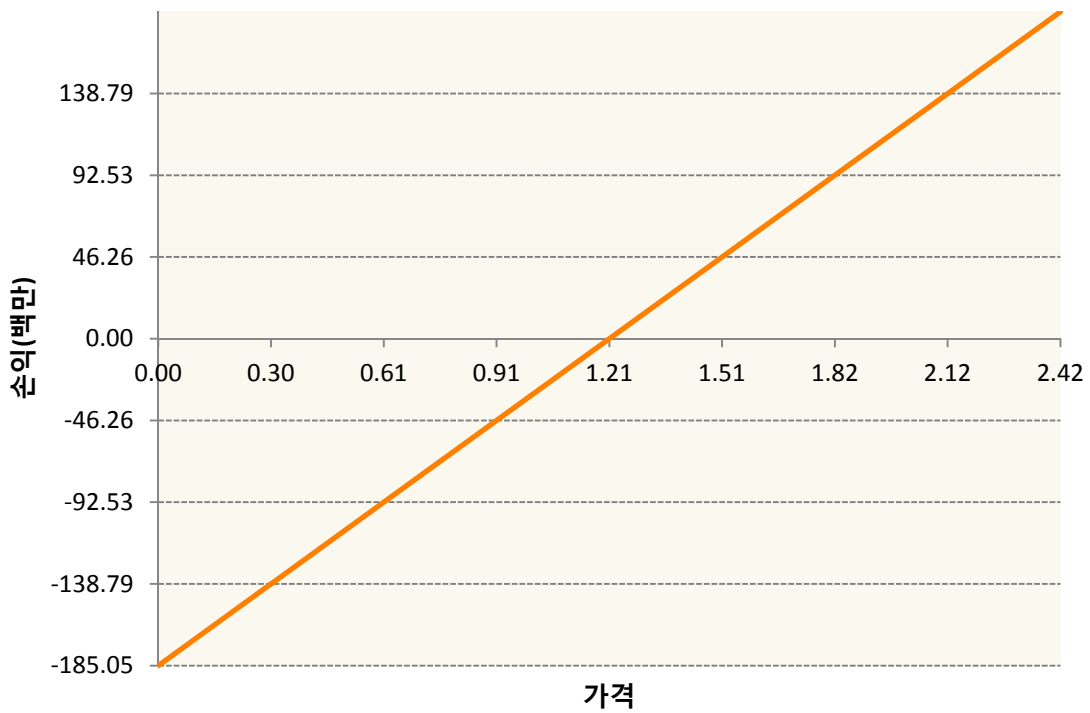




QSN0-Low Su Gasoil G Jul20



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	49
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)

905

공시일	2020-06-11
기준일	2020-06-10

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

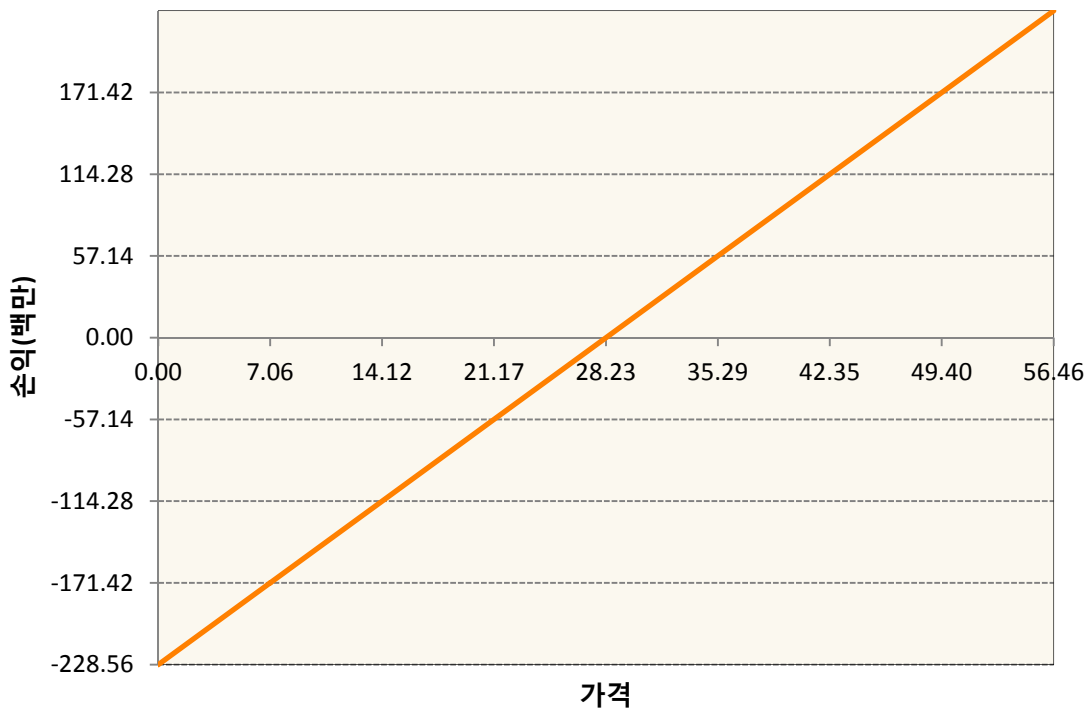
1. 계약금액

(단위:백만원)

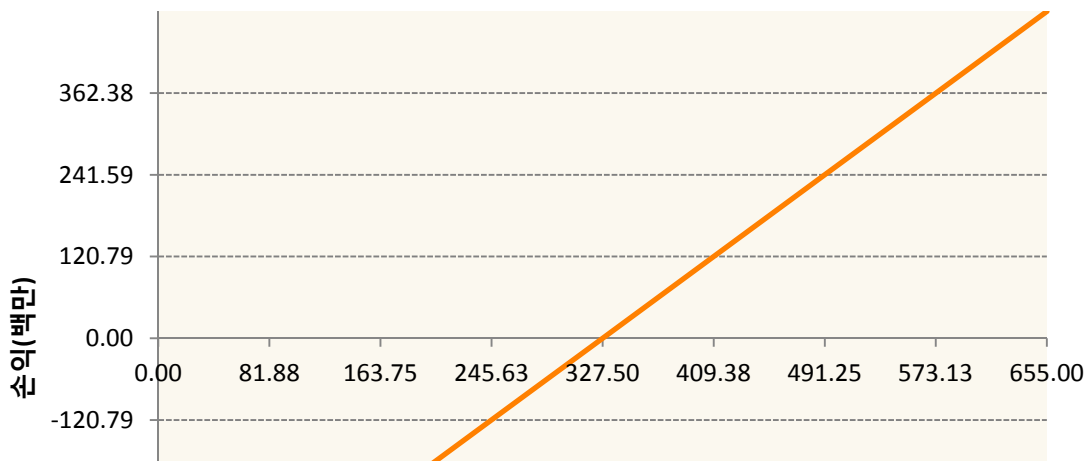
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,511	72	2,440	

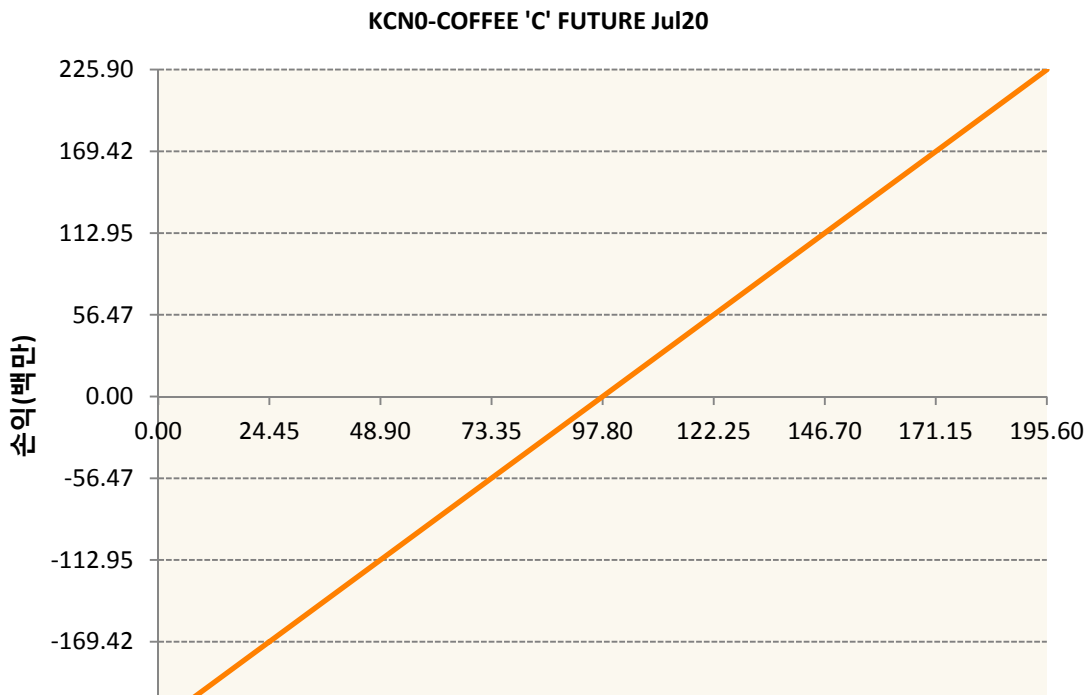
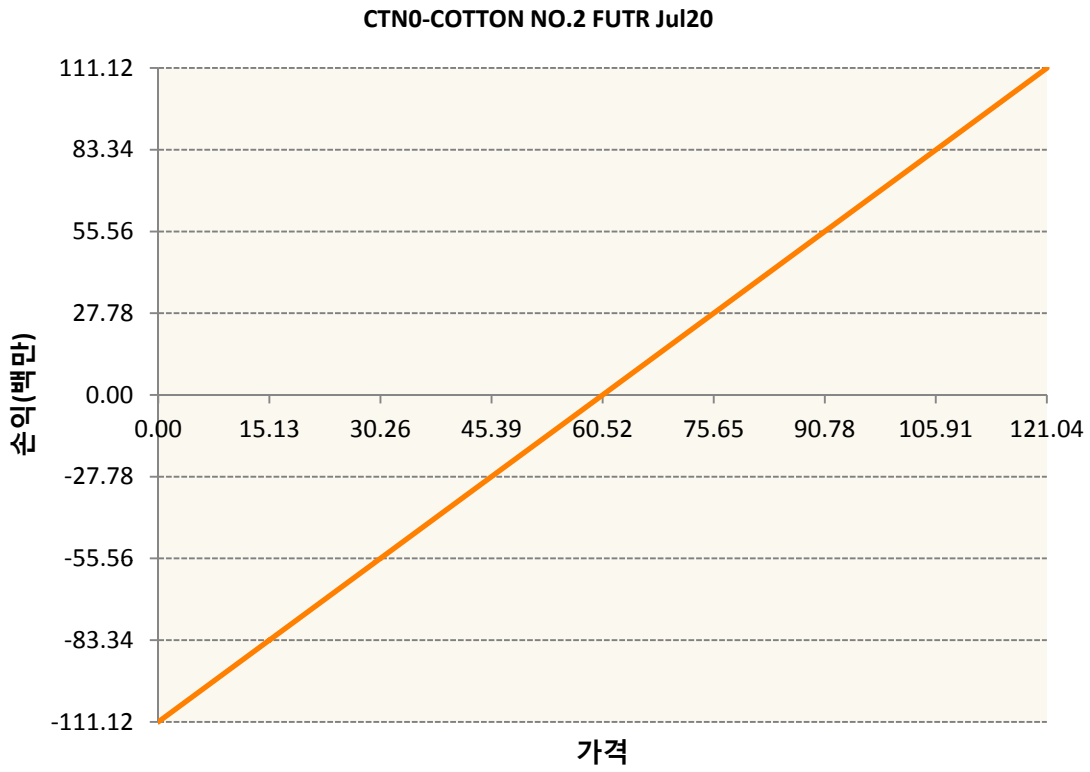
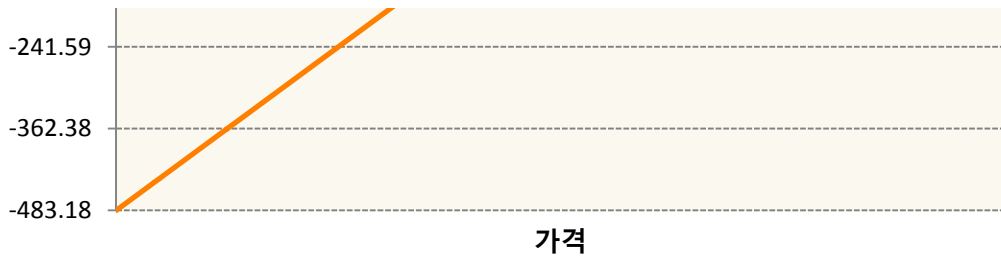
2. 만기시점의 손익구조

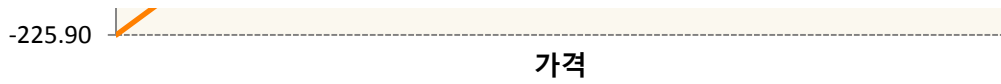
BON0-SOYBEAN OIL FUTR Jul20



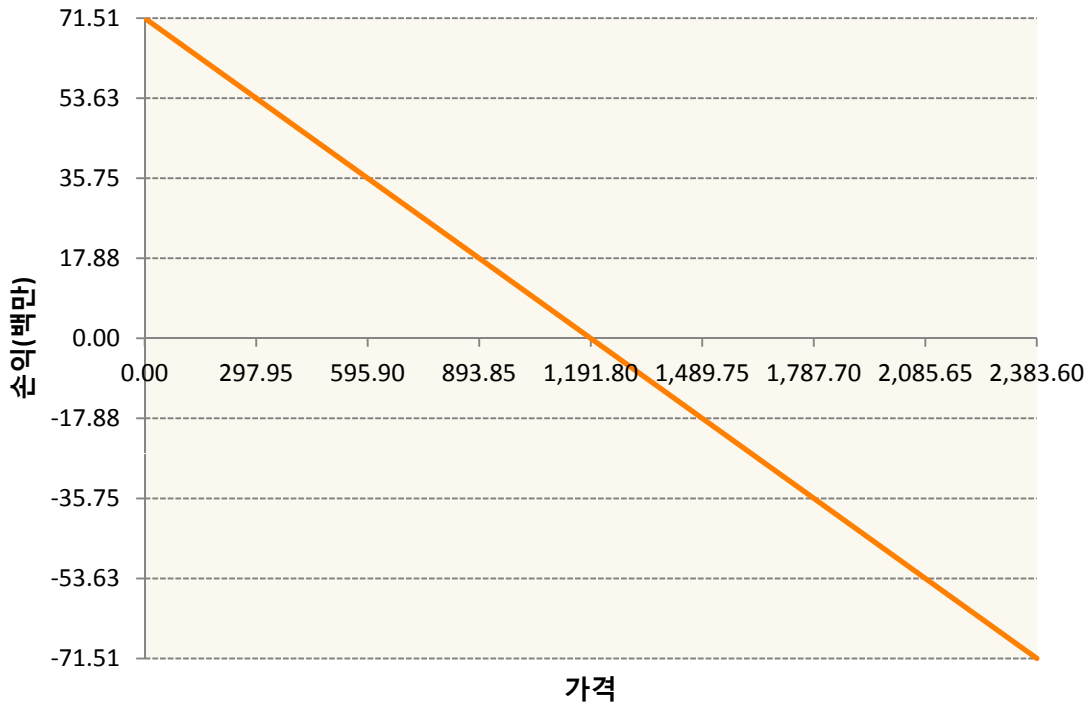
CNO-CORN FUTURE Jul20



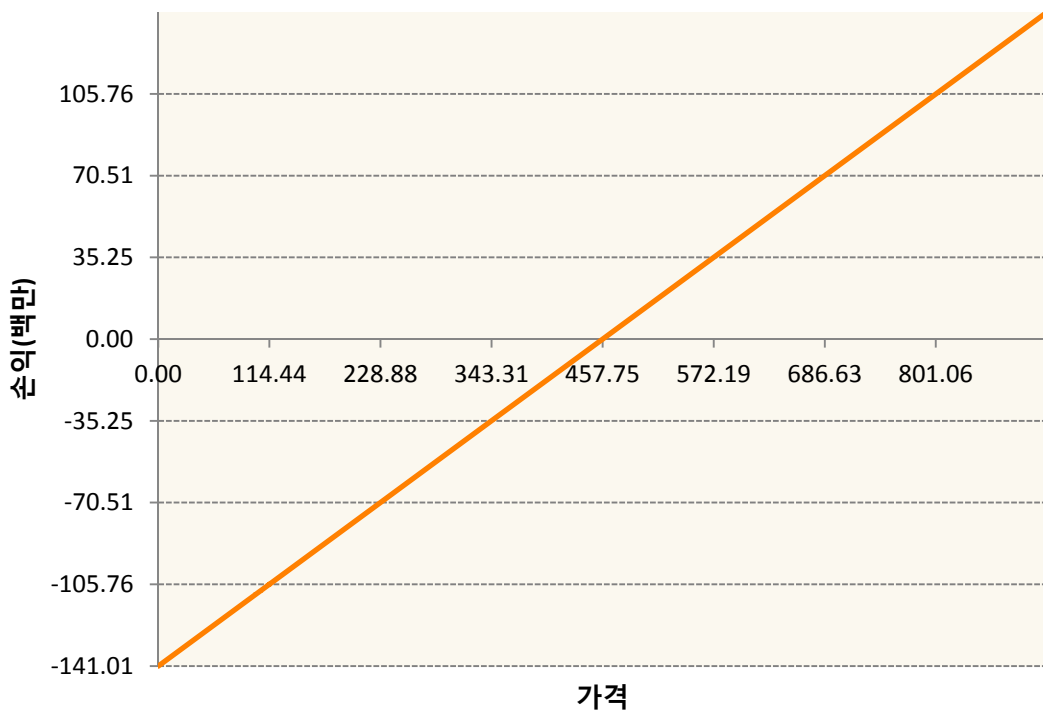




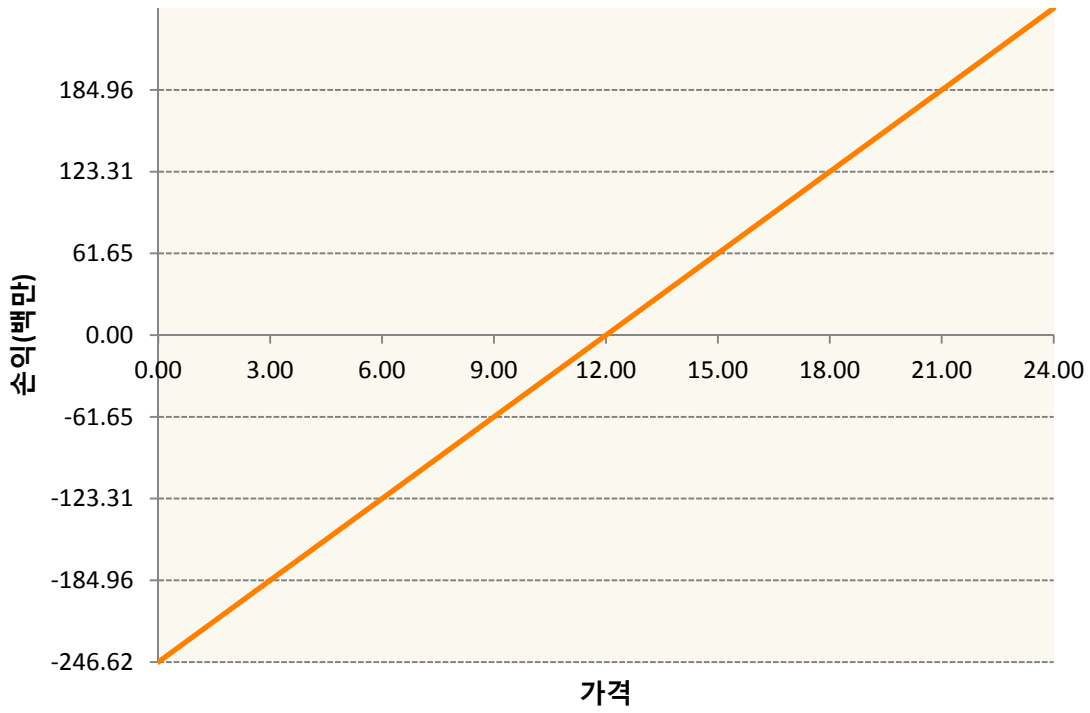
KR4175Q60006-2020-06 달러선물



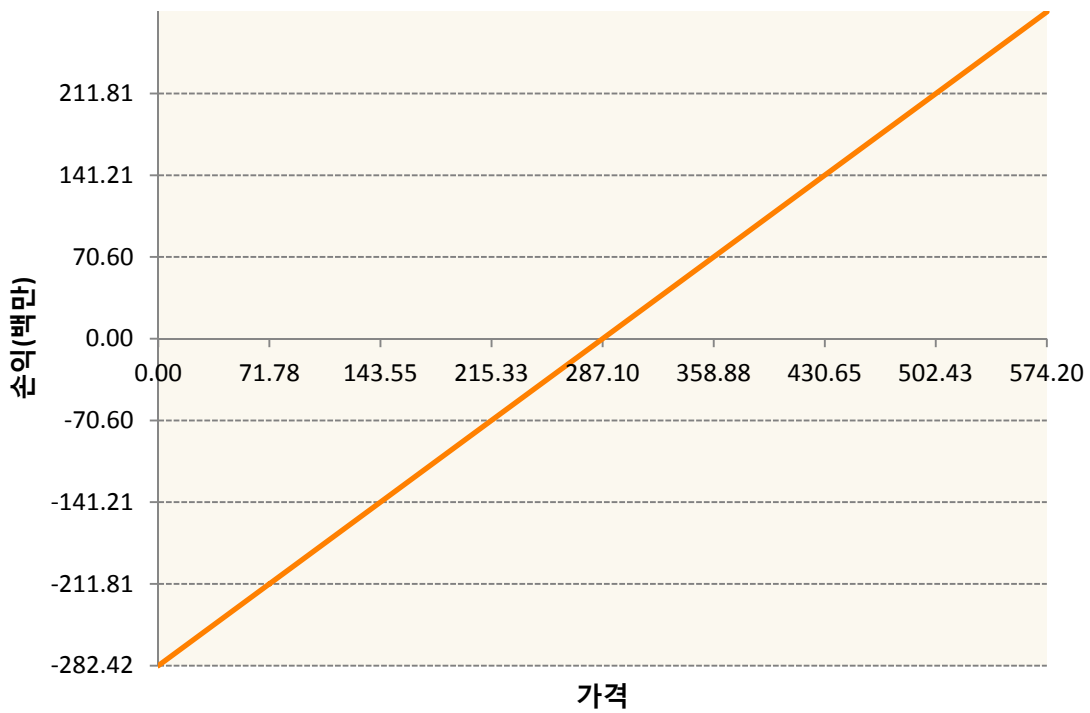
KWN0-KC HRW WHEAT FUT Jul20



SBN0-Sugar Jul20

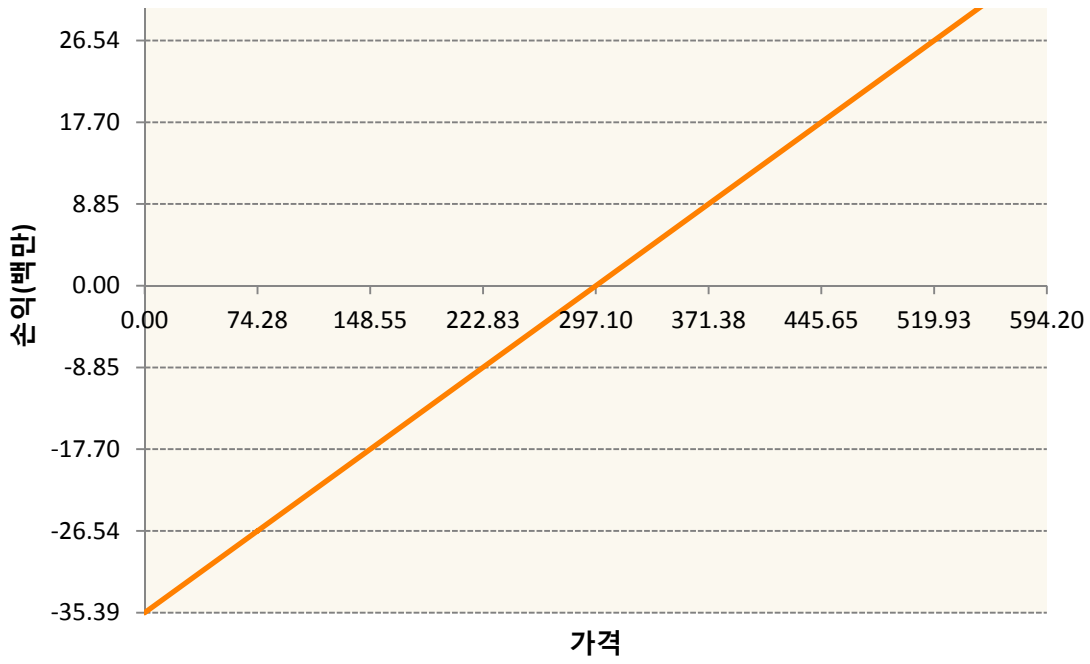


SMN0-SOYBEAN MEAL FUTR Jul20

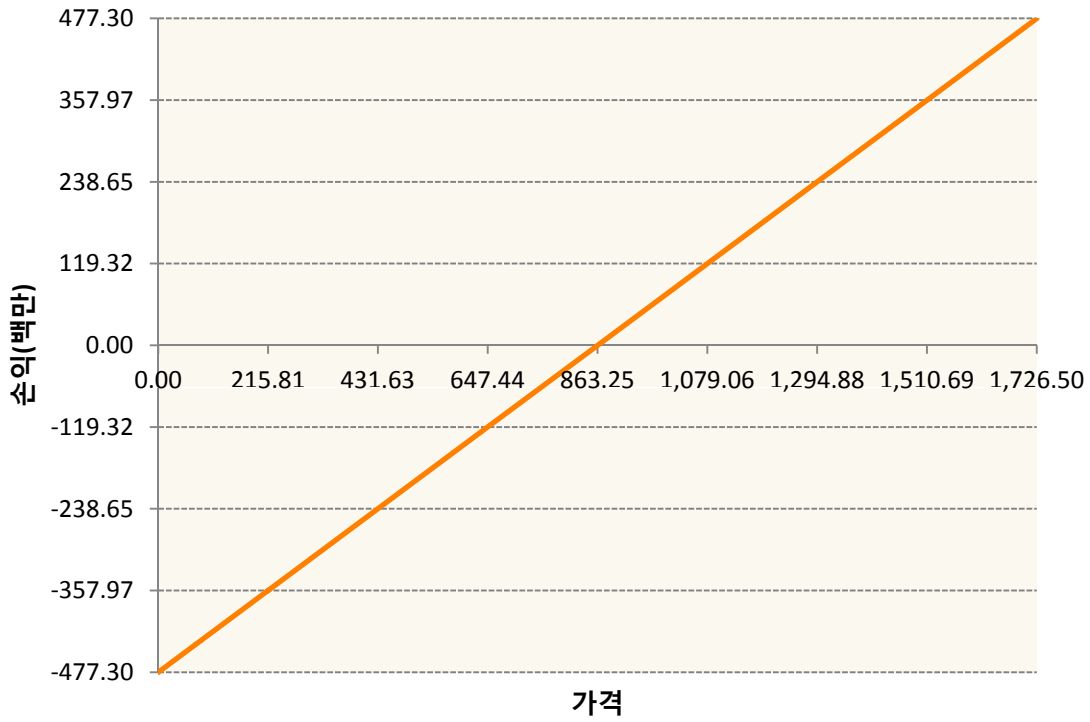


SMZ0-SOYBEAN MEAL FUTR Dec20



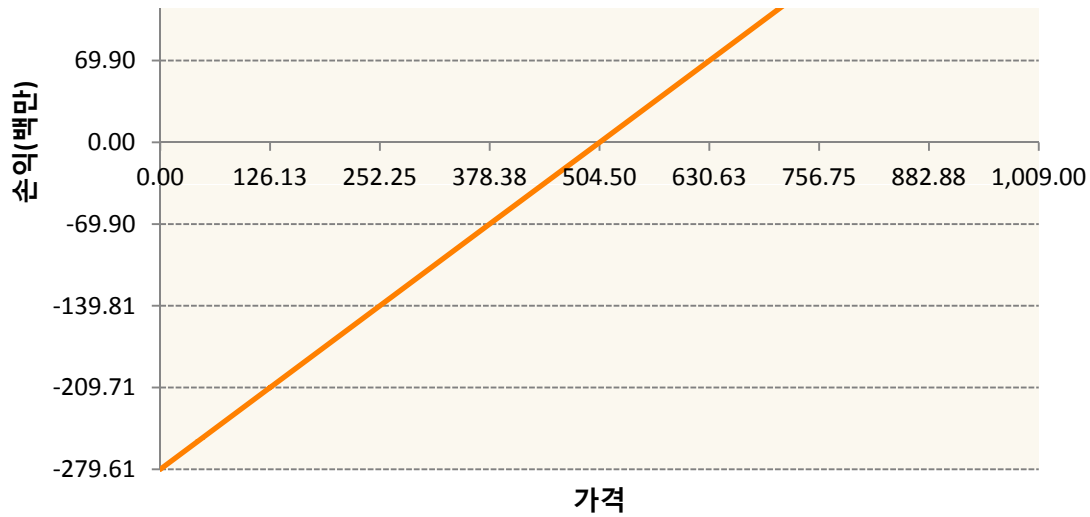


SNO-SOYBEAN FUTURE Jul20



WN0-WHEAT FUTURE(CBT) 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
KR4175Q60C	2020-06 달러선물	6
KWN0	KC HRW WHEAT FUT Jul20	11
SBN0	Sugar Jul20	20
SMN0	SOYBEAN MEAL FUTR Jul20	23
SMZ0	SOYBEAN MEAL FUTR Dec20	3
SN0	SOYBEAN FUTURE Jul20	38
WN0	WHEAT FUTURE(CBT) Jul20	22

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

(단위:백만원)

237