

공시일	2020-06-15
기준일	2020-06-12

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

공시일	2020-06-15
기준일	2020-06-12

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

1,039

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,241

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-06-15
기준일	2020-06-12

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

583

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

849

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-06-15
기준일	2020-06-12

유로인덱스모(주식-파생형)

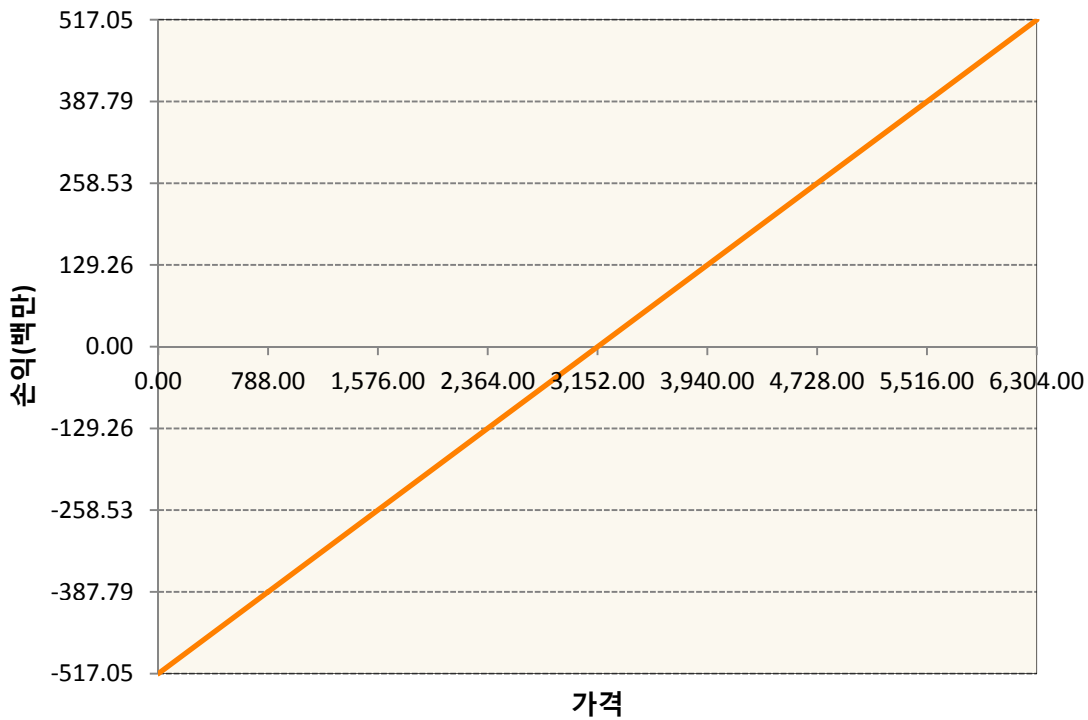
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	517	0	517	

2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	41
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

55

공시일	2020-06-15
기준일	2020-06-12

차이나인덱스모(주식-파생형)

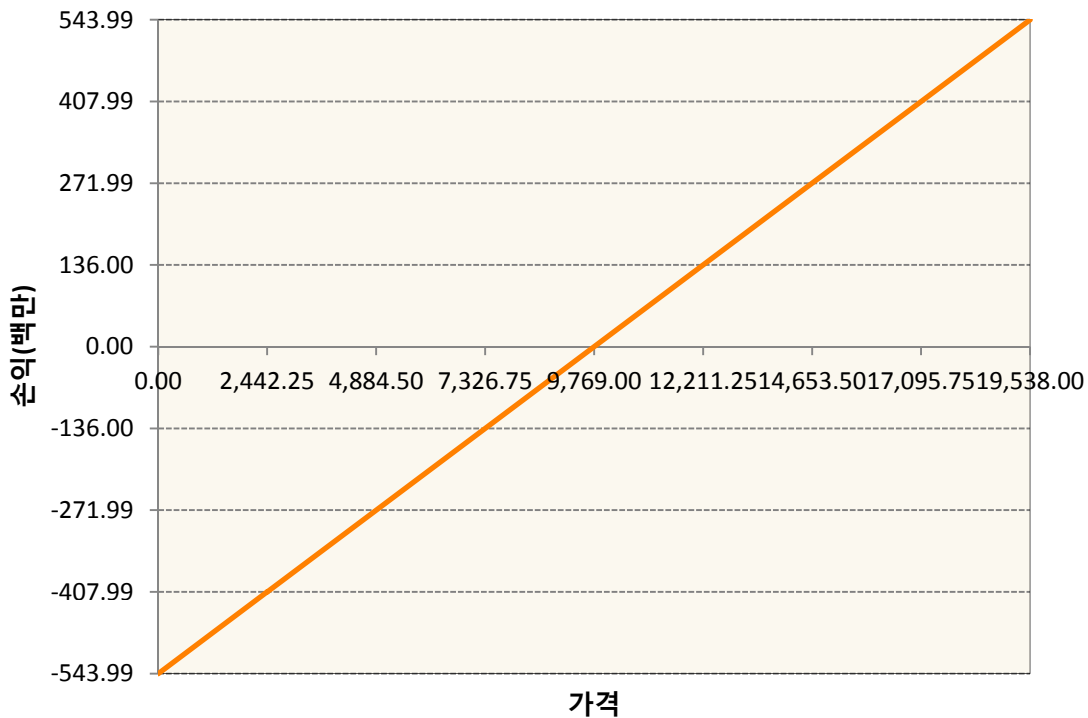
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

HCM0-HSCEI Futures Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM0	HSCEI Futures Jun20	44
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

47

공시일	2020-06-15
기준일	2020-06-12

커버드콜모(주식혼합-파생형)

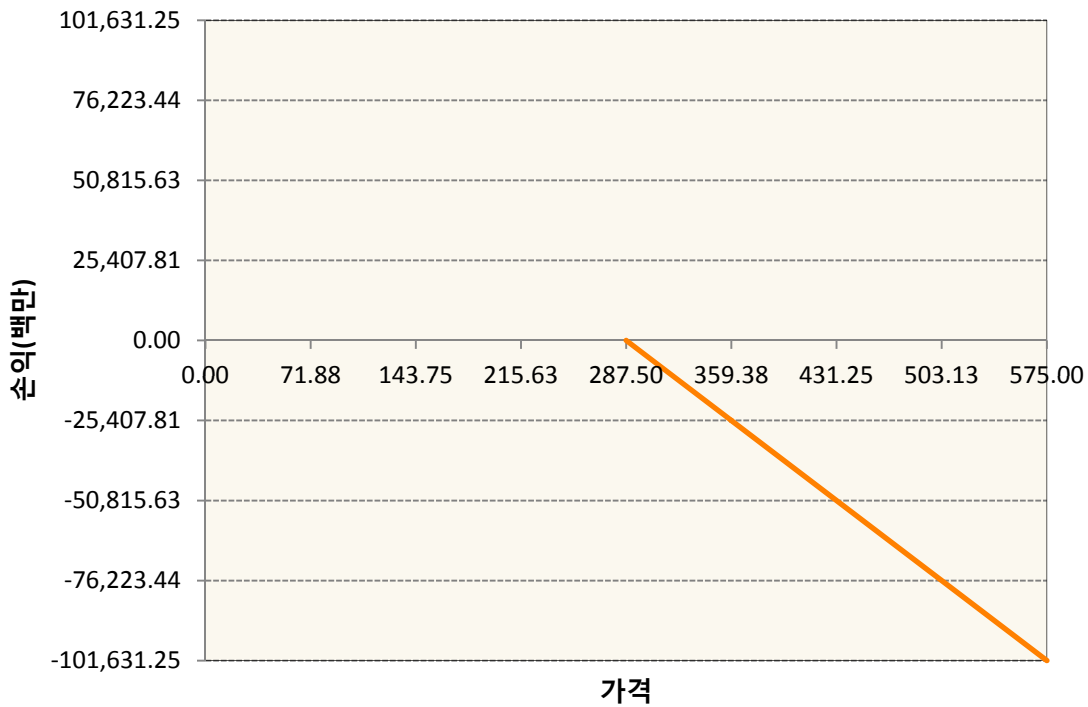
1. 계약금액

(단위:백만원)

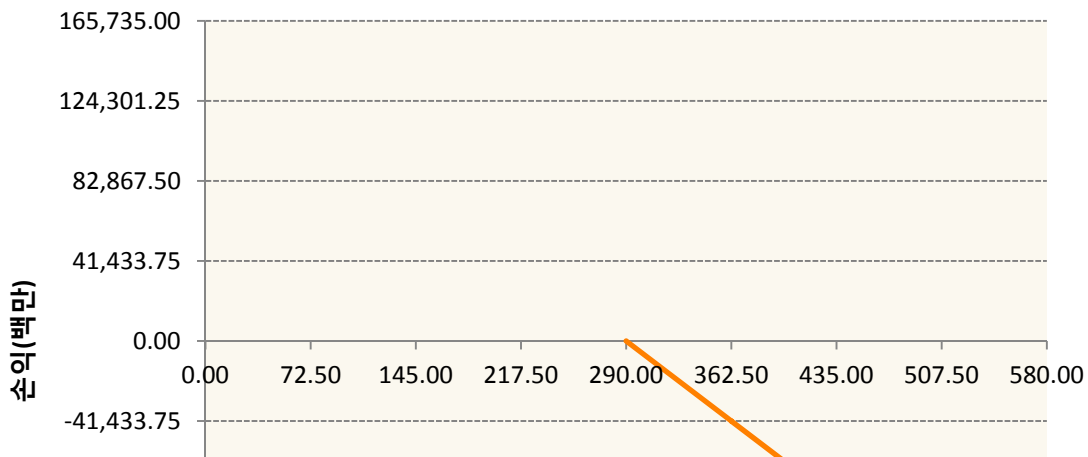
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	211,311	-211,311	장내
누계	유가증권	옵션	0	364,398	-364,398	장내

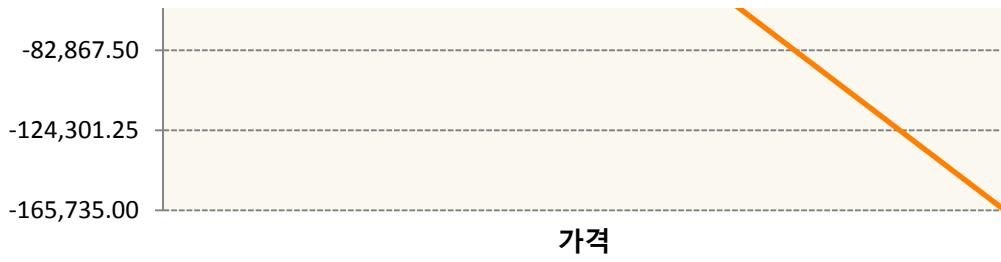
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q72872-2020-07 콜287.5

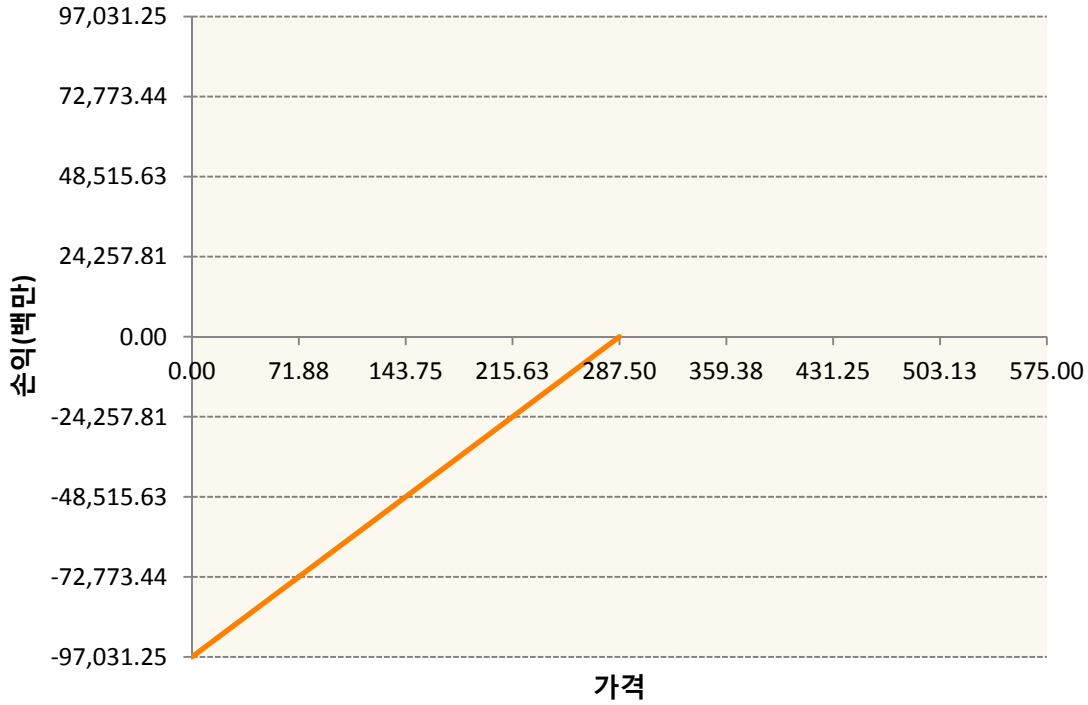


KR4201Q72906-2020-07 콜290





KR4301Q72870-2020-07 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q72872		2020-07 콜287.5					5,814
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,420	3,190	2,936	2,661	2,371	2,067	1,751
-5.33%	2,939	2,636	2,316	1,983	1,640	1,289	931
-2.67%	2,222	1,856	1,481	1,101	716	327	-64
0%	1,231	822	412	0	-412	-826	-1,239
2.67%	-54	-477	-901	-1,324	-1,747	-2,170	-2,593
5.33%	-1,627	-2,037	-2,450	-2,865	-3,282	-3,701	-4,121
8.00%	-3,466	-3,837	-4,219	-4,609	-5,006	-5,408	-5,814
KR4201Q72906		2020-07 콜290					9,108
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,128	4,789	4,407	3,990	3,544	3,073	2,581

-5.33%	4,450	3,991	3,501	2,986	2,452	1,901	1,337
-2.67%	3,417	2,849	2,264	1,666	1,057	440	-183
0%	1,961	1,312	658	0	-661	-1,324	-1,989
2.67%	41	-647	-1,335	-2,022	-2,710	-3,397	-4,084
5.33%	-2,349	-3,030	-3,713	-4,398	-5,085	-5,773	-6,461
8.00%	-5,180	-5,811	-6,455	-7,108	-7,769	-8,436	-9,108
KR4301Q72870 2020-07 풋287.5							6,107
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,409	-5,484	-5,578	-5,689	-5,815	-5,955	-6,107
-5.33%	-3,087	-3,223	-3,376	-3,544	-3,723	-3,912	-4,110
-2.67%	-992	-1,195	-1,409	-1,630	-1,858	-2,090	-2,327
0%	772	517	259	0	-261	-522	-785
2.67%	2,135	1,863	1,592	1,320	1,049	777	505
5.33%	3,090	2,842	2,589	2,333	2,074	1,812	1,549
8.00%	3,695	3,498	3,288	3,068	2,840	2,605	2,365

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

(단위:백만원)

17,633

공시일	2020-06-15
기준일	2020-06-12

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

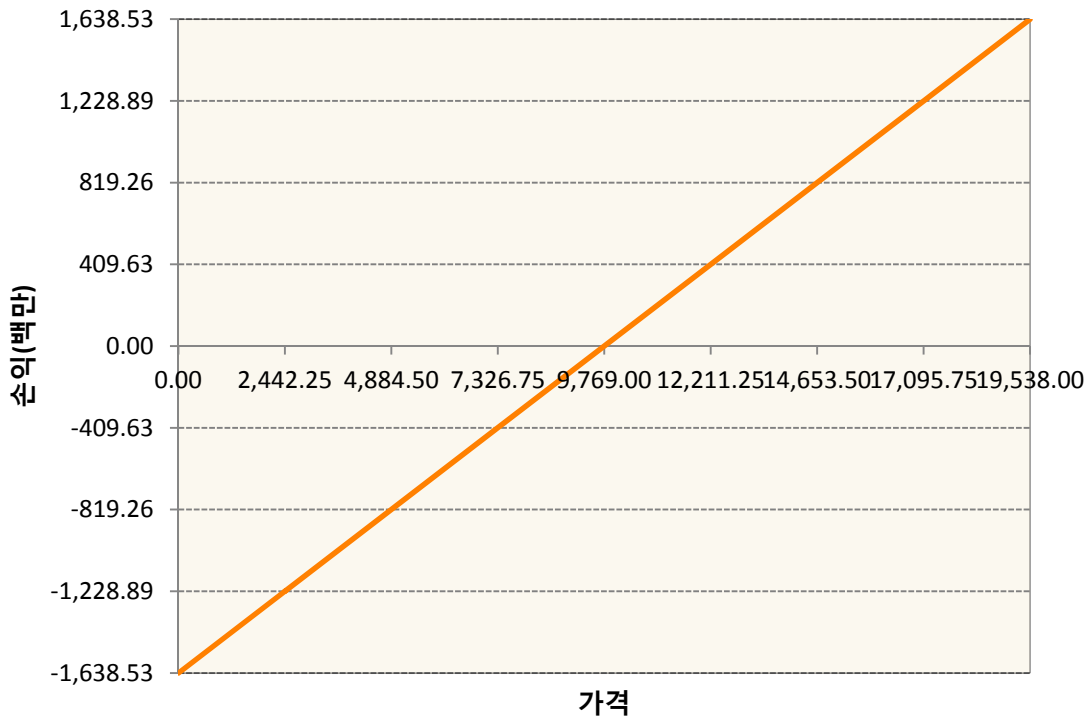
1. 계약금액

(단위:백만원)

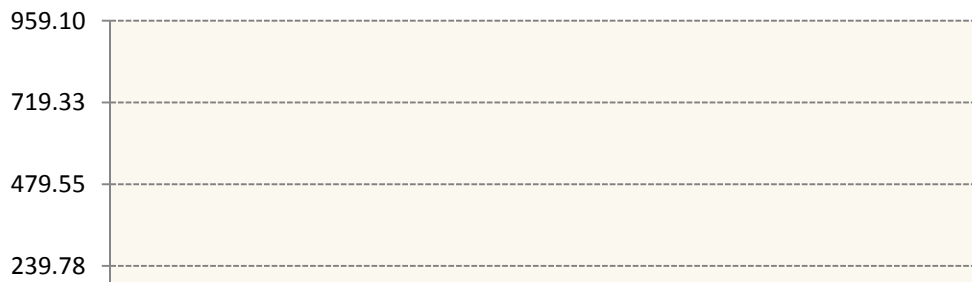
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,639	0	1,639	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,229	-4,229	장내
누계	통화	선도	0	1,504	-1,504	장외

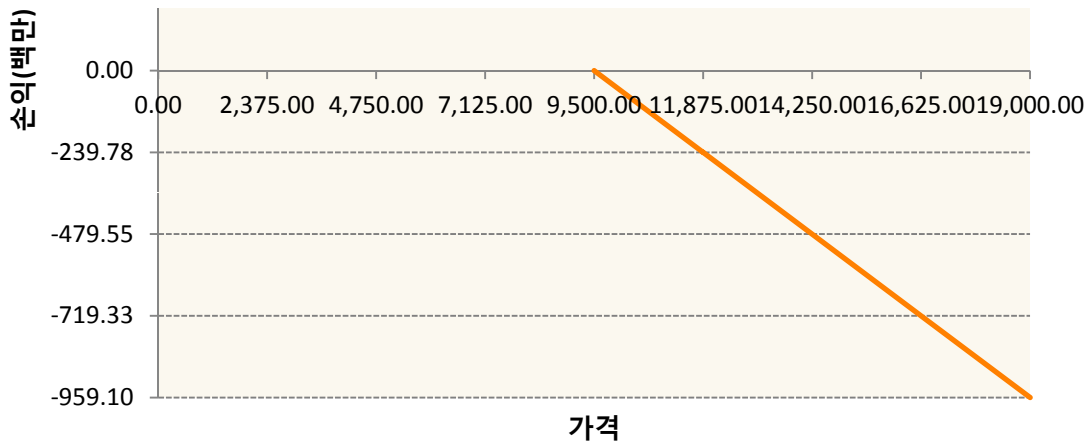
2. 만기시점의 손익구조

HCM0-HSCEI Futures Jun20

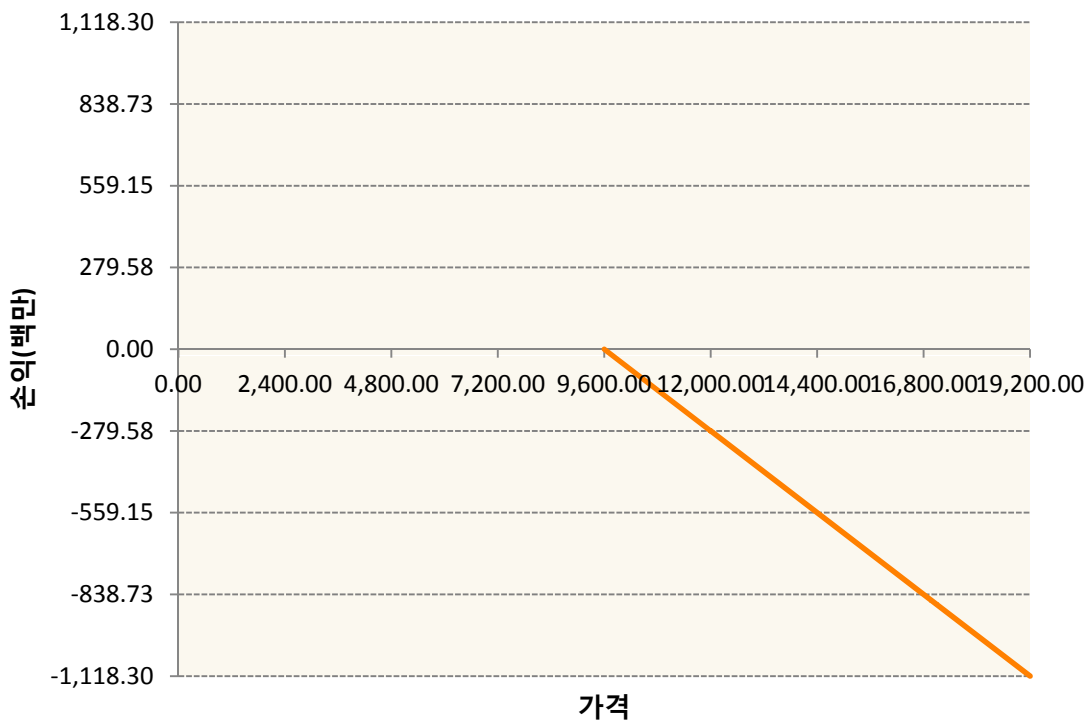


OHHIM0-C95-HSCEI

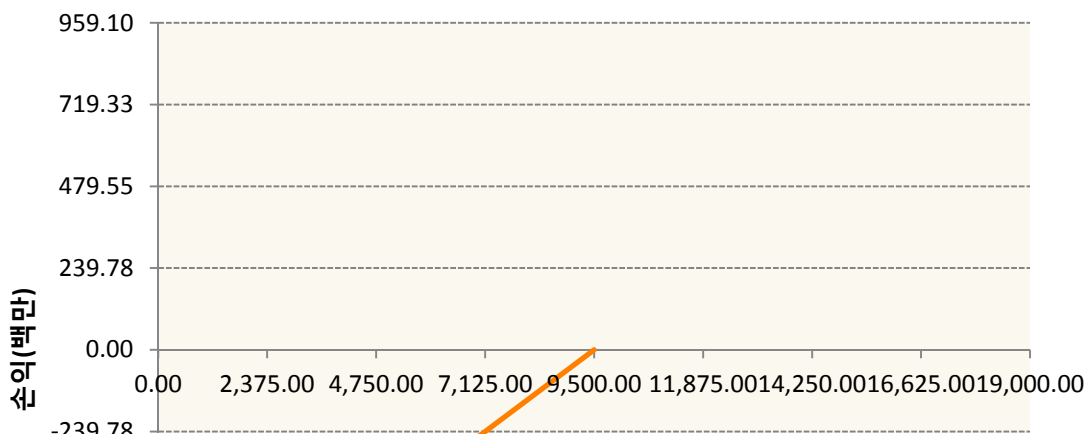


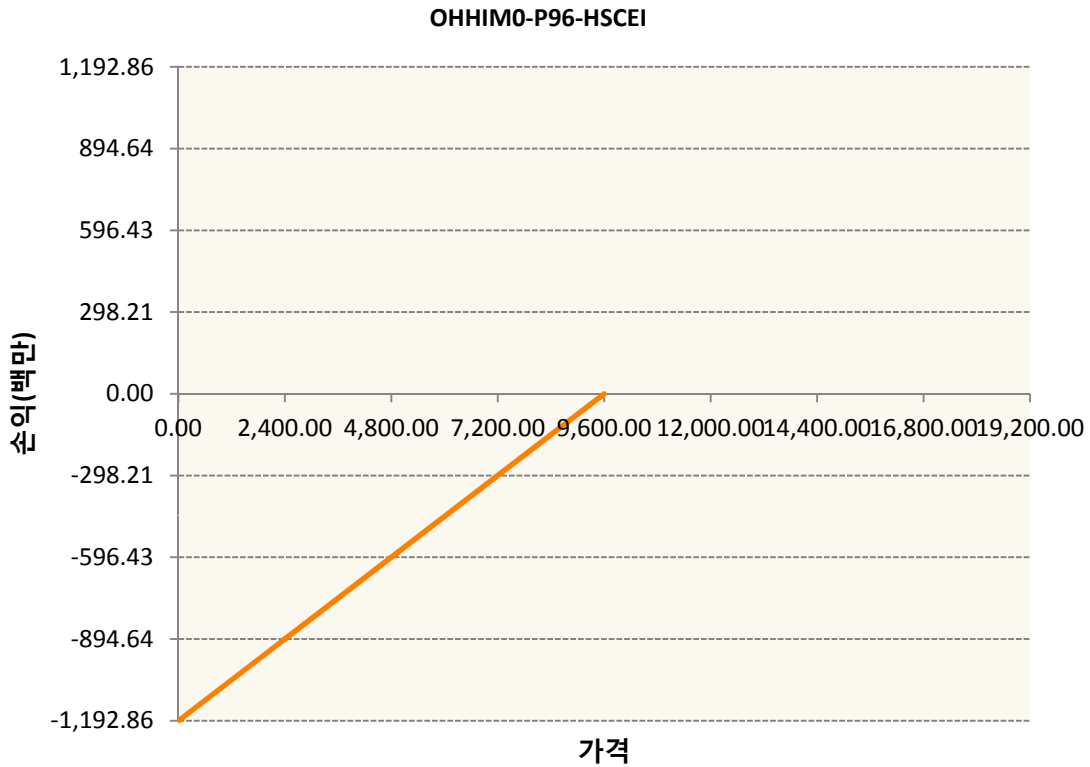
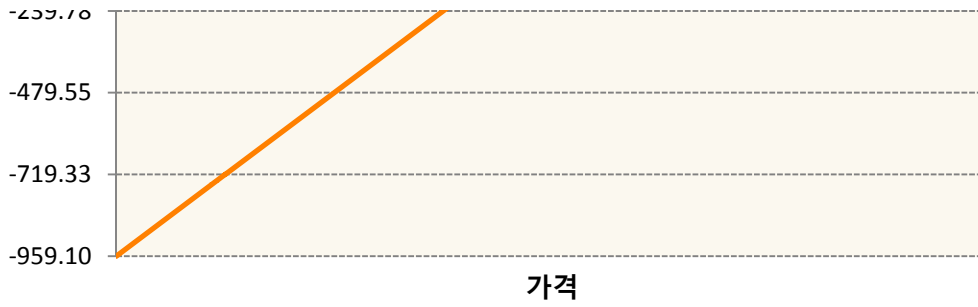


OHHIM0-C96-HSCEI



OHHIM0-P95-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E	120
HCM0 HSCEI Futures Jun20	131
OHHIM0-C9 HSCEI	77
OHHIM0-C9 HSCEI	89
OHHIM0-P9 HSCEI	77
OHHIM0-P9 HSCEI	95

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

571

공시일	2020-06-15
기준일	2020-06-12

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

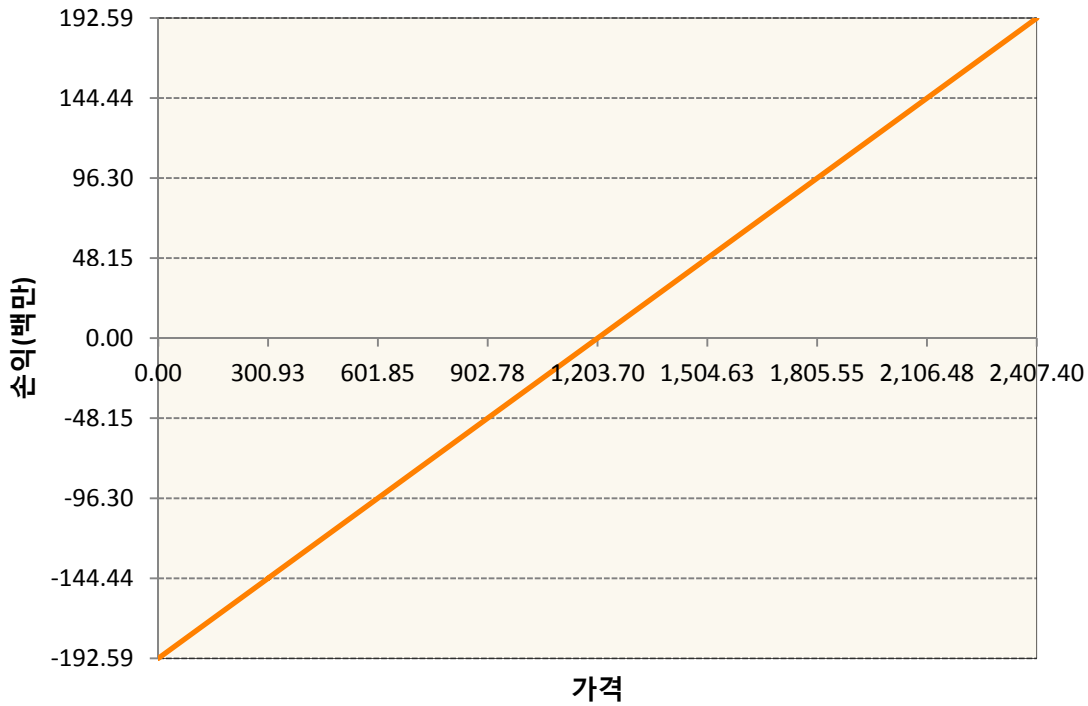
1. 계약금액

(단위:백만원)

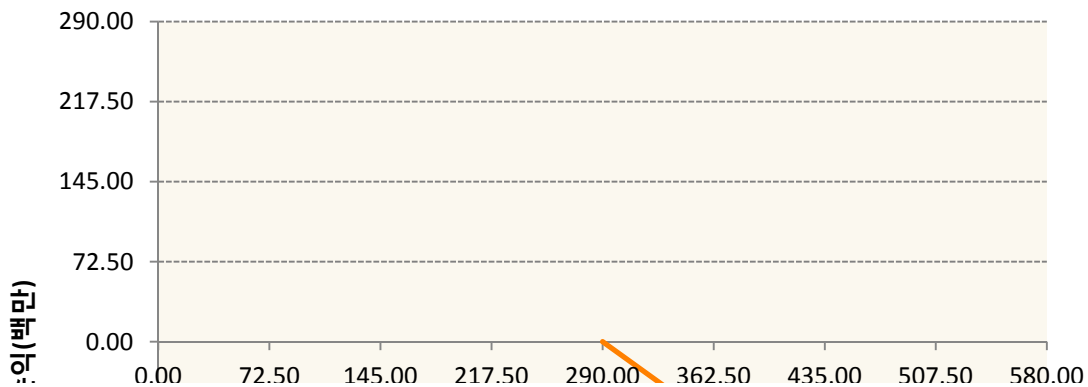
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선물	241	48	193	장내
누계	유가증권	옵션	0	580	-580	장내
누계	통화	선물	193	0	193	장내

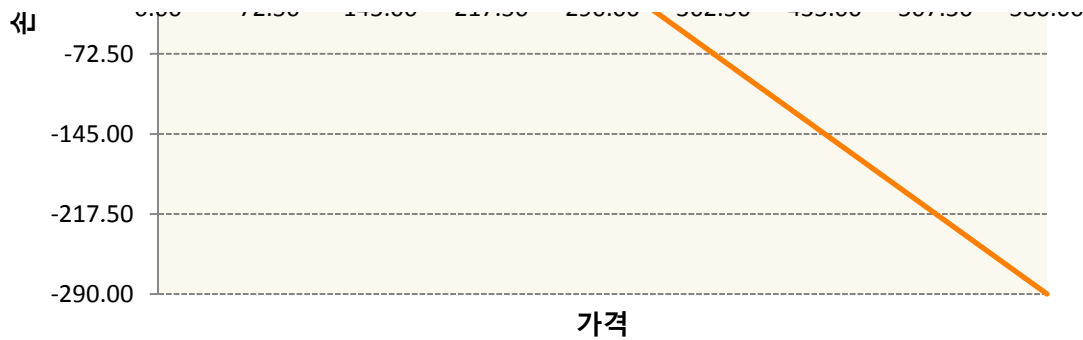
2. 만기시점의 손익구조

KR4175Q70005-2020-07 달러선물

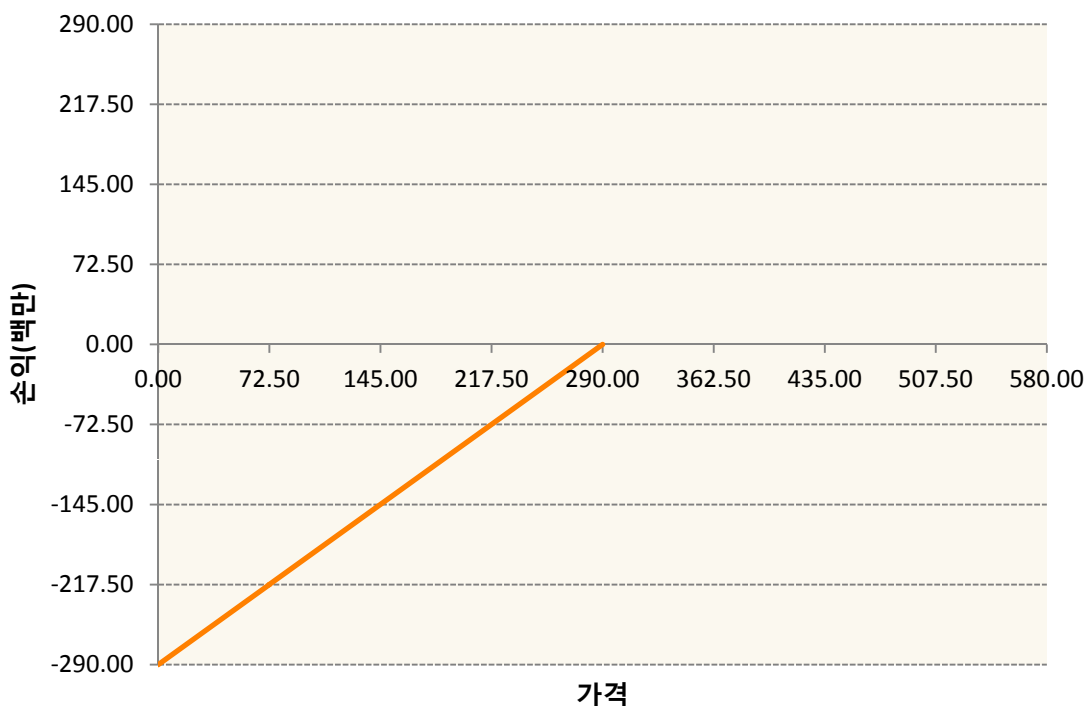


KR4201Q72906-2020-07 콜290





KR4301Q72904-2020-07 풋290



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4175Q70005		2020-07 달러선물						15
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
-5.33%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
-2.67%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	5	5	5	5	5	5	5	5
5.33%	10	10	10	10	10	10	10	10
8.00%	15	15	15	15	15	15	15	15
KR4201Q72906		2020-07 콜290						16
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9	8	8	7	6	5	5
-5.33%	8	7	6	5	4	3	2
-2.67%	6	5	4	3	2	1	0
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	0	-1	-2	-4	-5	-6	-7
5.33%	-4	-5	-6	-8	-9	-10	-11
8.00%	-9	-10	-11	-12	-14	-15	-16

KR4301Q72904 2020-07 풋290 19

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17	-17	-17	-18	-18	-18	-19
-5.33%	-10	-10	-11	-11	-11	-12	-13
-2.67%	-3	-4	-4	-5	-6	-6	-7
0%	2	1	1	0	-1	-2	-2
2.67%	7	6	5	4	3	3	2
5.33%	10	9	8	8	7	6	5
8.00%	12	11	11	10	9	9	8

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

(단위:백만원)

39

공시일	2020-06-15
기준일	2020-06-12

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

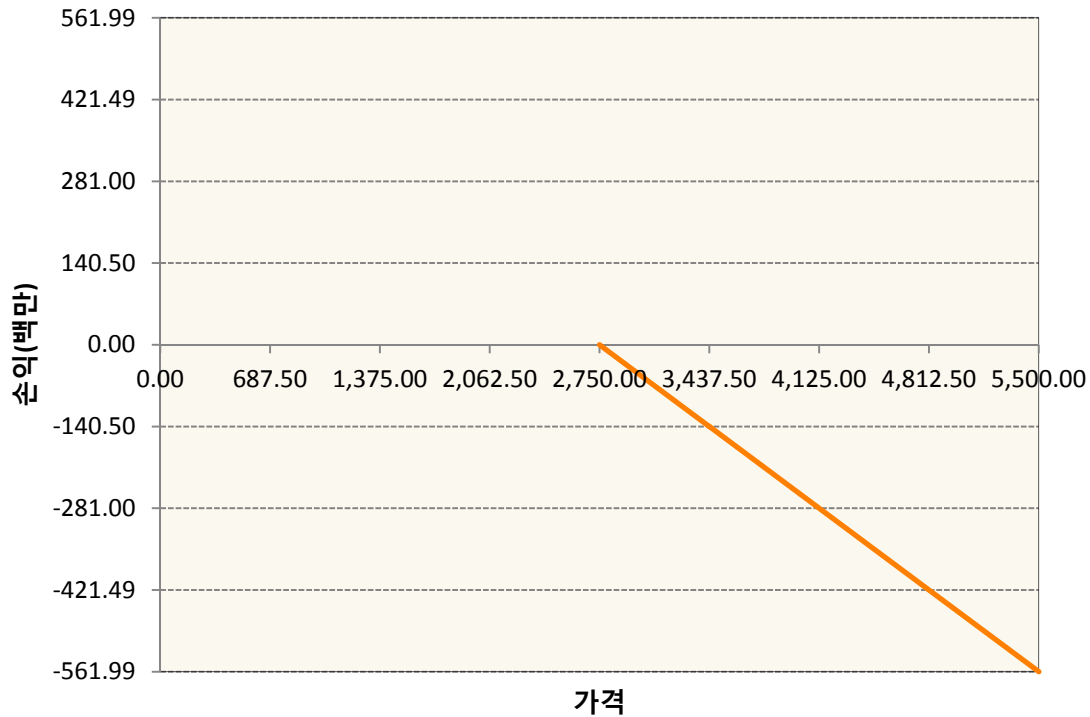
1. 계약금액

(단위:백만원)

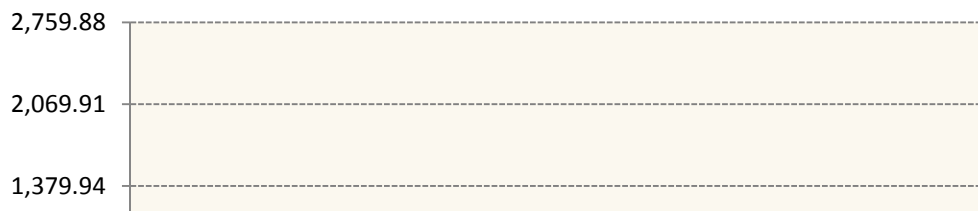
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,226	0	1,226	
누계	유가증권	스왑	8,125	0	8,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,682	-6,682	장내
누계	통화	선도	0	2,948	-2,948	장외

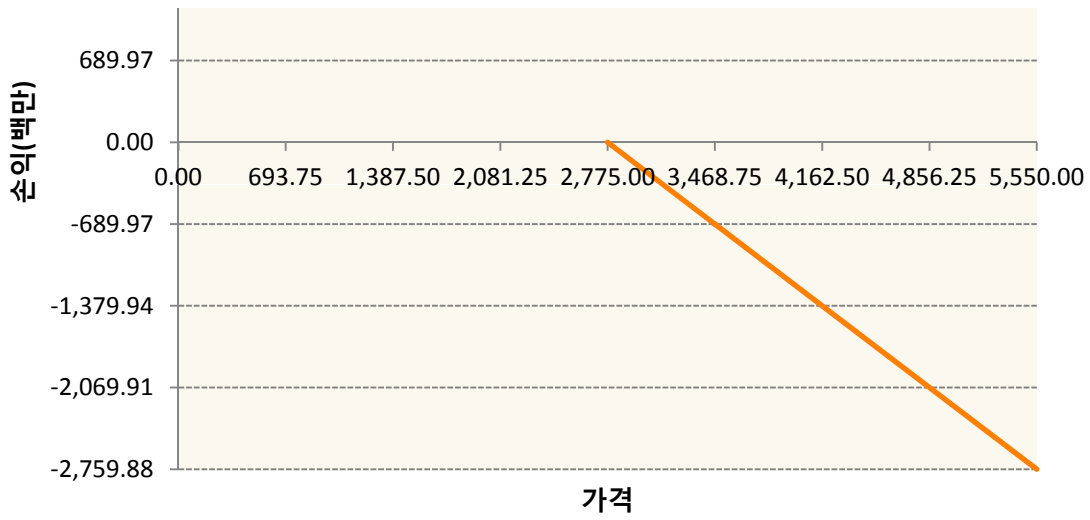
2. 만기시점의 손익구조

OESXM0-C2750-EURO STOXX 50

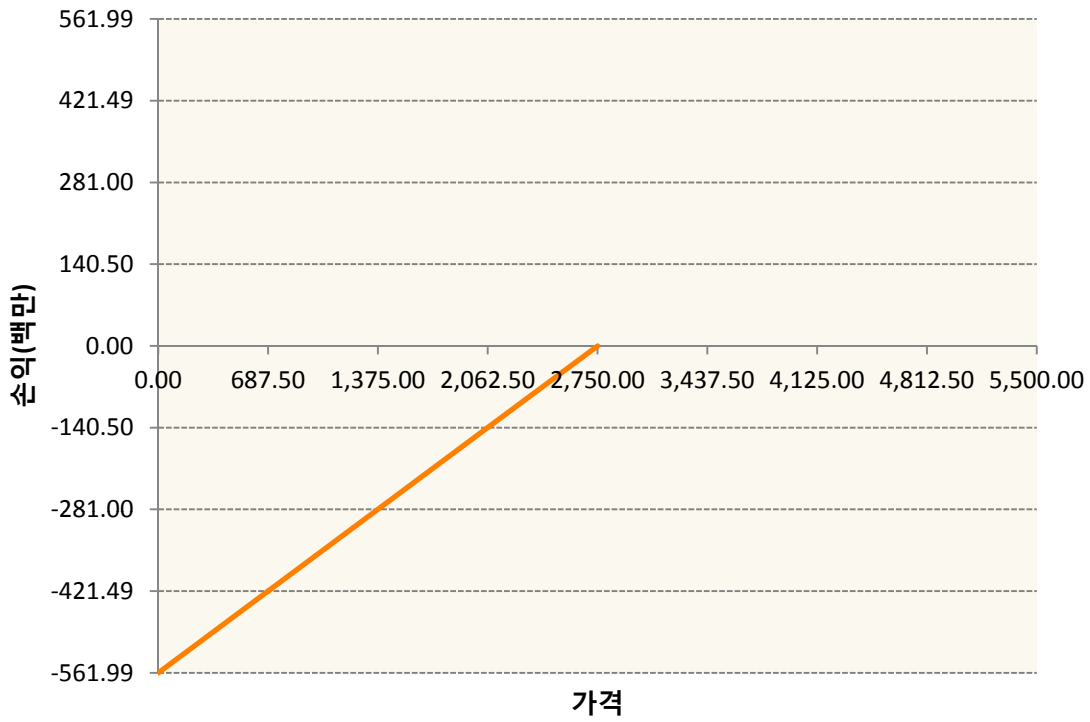


OESXM0-C2775-EURO STOXX 50

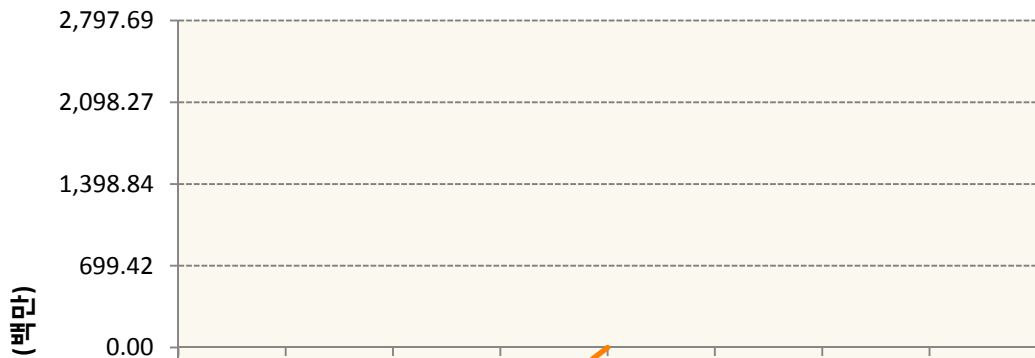


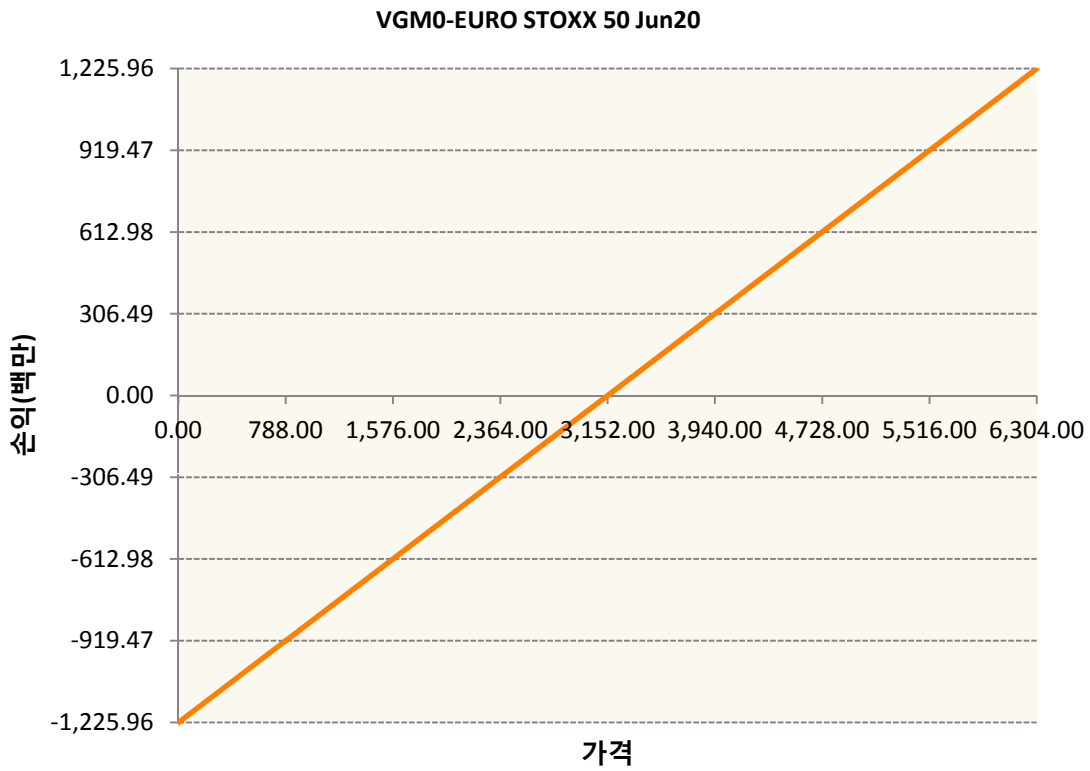
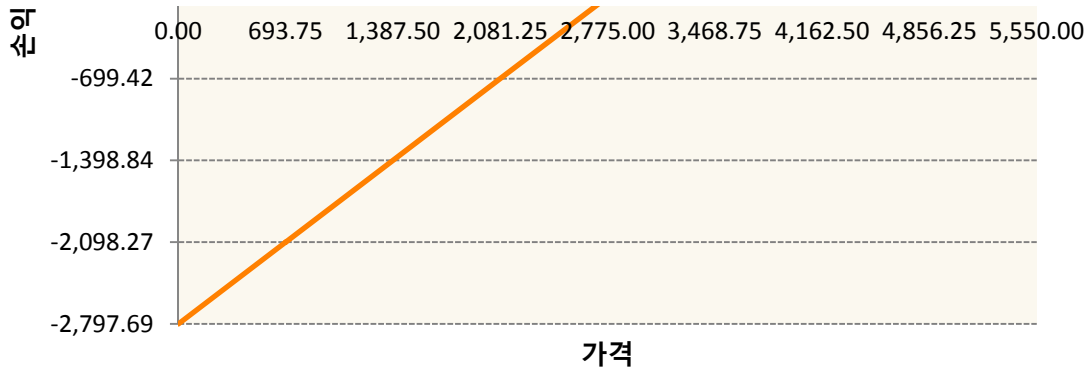


OESXM0-P2750-EURO STOXX 50



OESXM0-P2775-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		22
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E		221
FX21020K02 KRW/EUR 26-06-20E		15
OESXM0-C2' EURO STOXX 50		45
OESXM0-C2' EURO STOXX 50		221
OESXM0-P2' EURO STOXX 50		45
OESXM0-P2' EURO STOXX 50		224
VGM0 EURO STOXX 50 Jun20		98

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

(단위:백만원)

1,031

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

(단위:백만원)

1,262

공시일	2020-06-15
기준일	2020-06-12

ETF스마트레버리지목표전환형9호

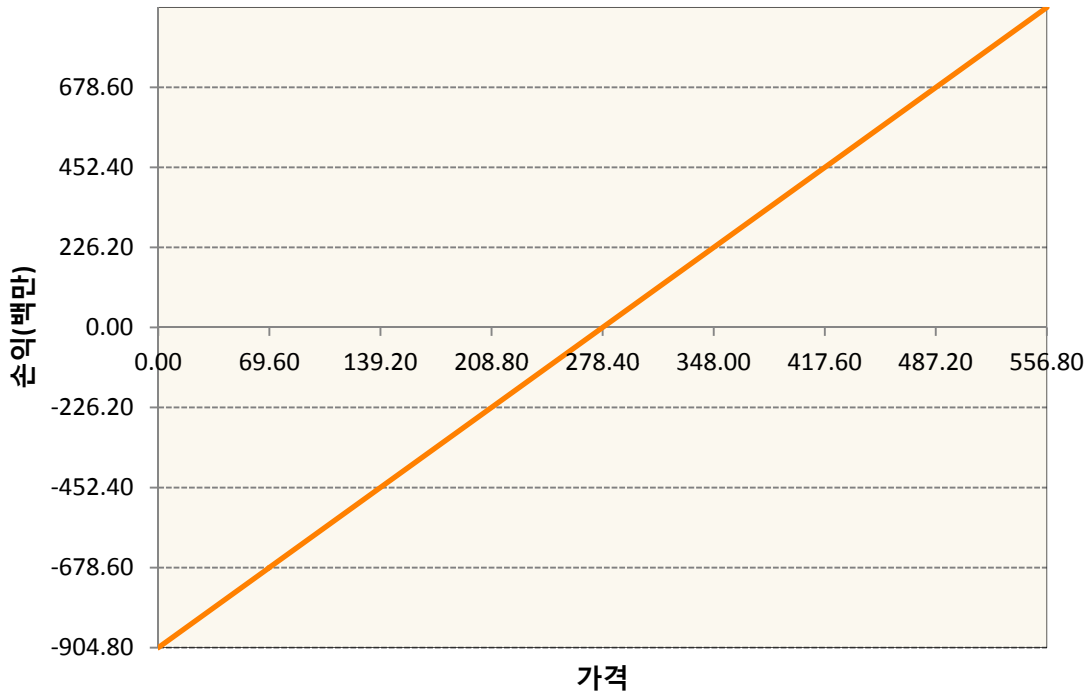
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	905	0	905	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009		2020-09 코스피200지수선물						73
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73	
-5.33%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
-2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	24	24	24	24	24	24	24	
5.33%	49	49	49	49	49	49	49	
8.00%	73	73	73	73	73	73	73	

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

(단위:백만원)

111

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

(단위:백만원)

162

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

(단위:백만원)

77

공시일	2020-06-15
기준일	2020-06-12

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

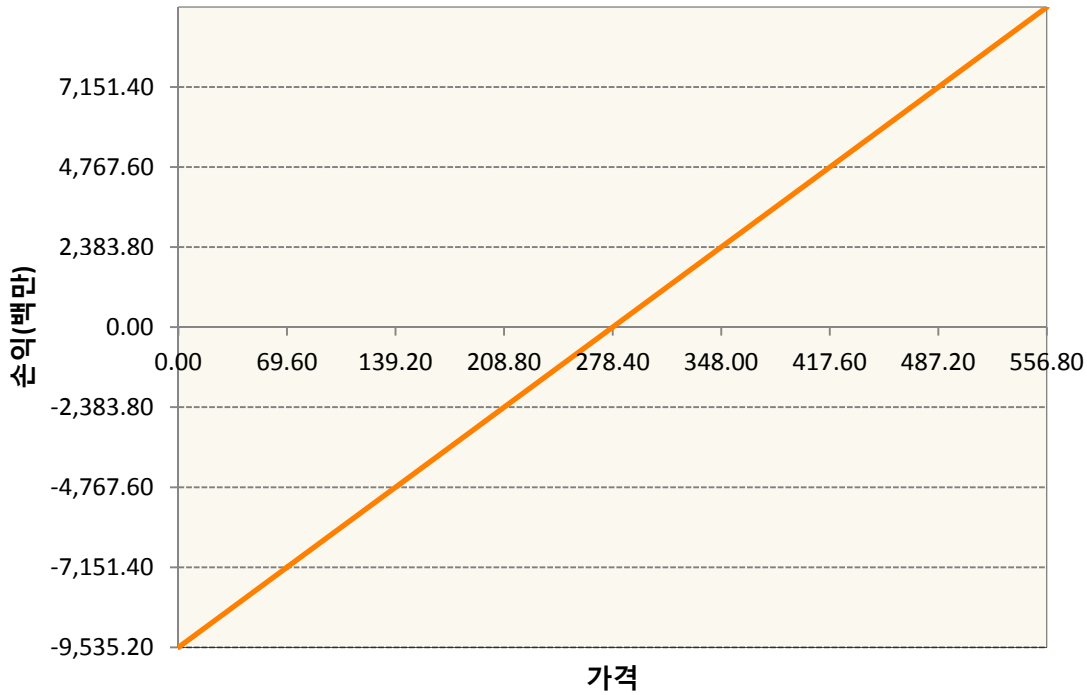
1. 계약금액

(단위:백만원)

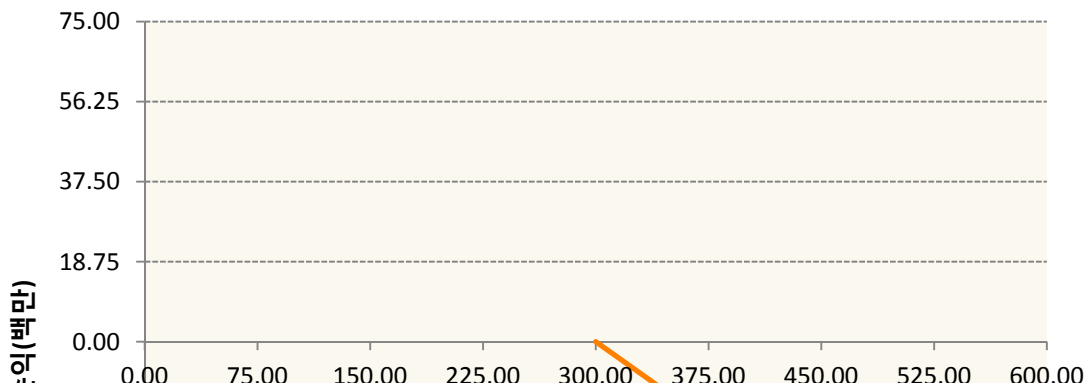
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	70	0	70	장내
신규	유가증권	옵션	6,077	7,220	-1,143	장내
누계	유가증권	선물	9,535	0	9,535	장내
누계	유가증권	옵션	3,247	18,864	-15,617	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물

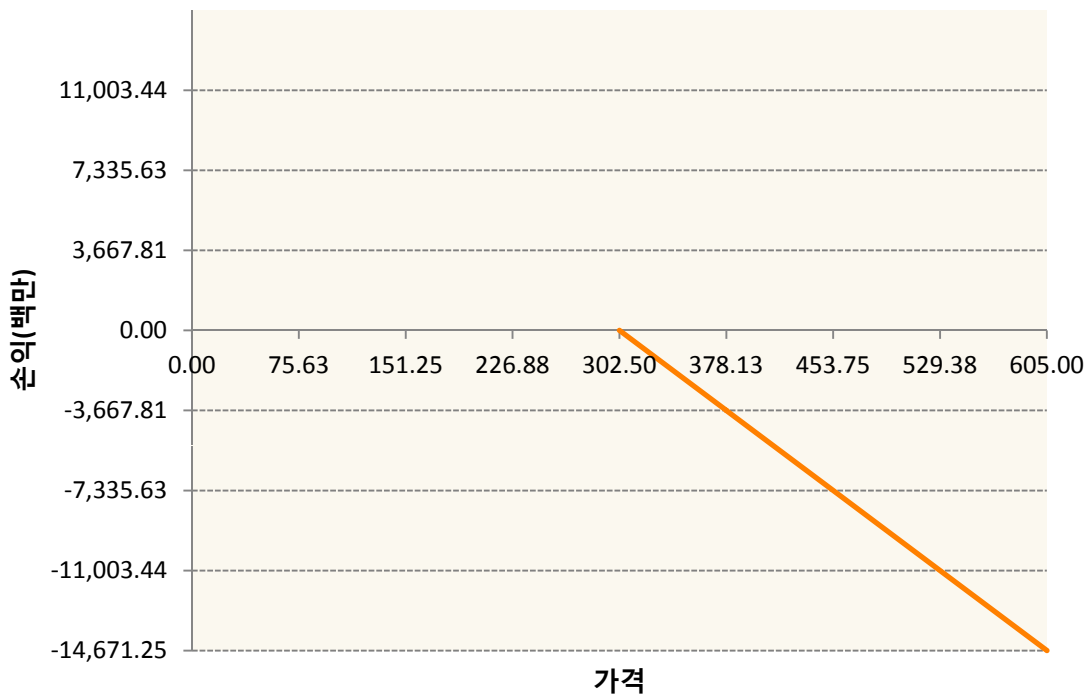


KR4201Q73003-2020-07 콜300

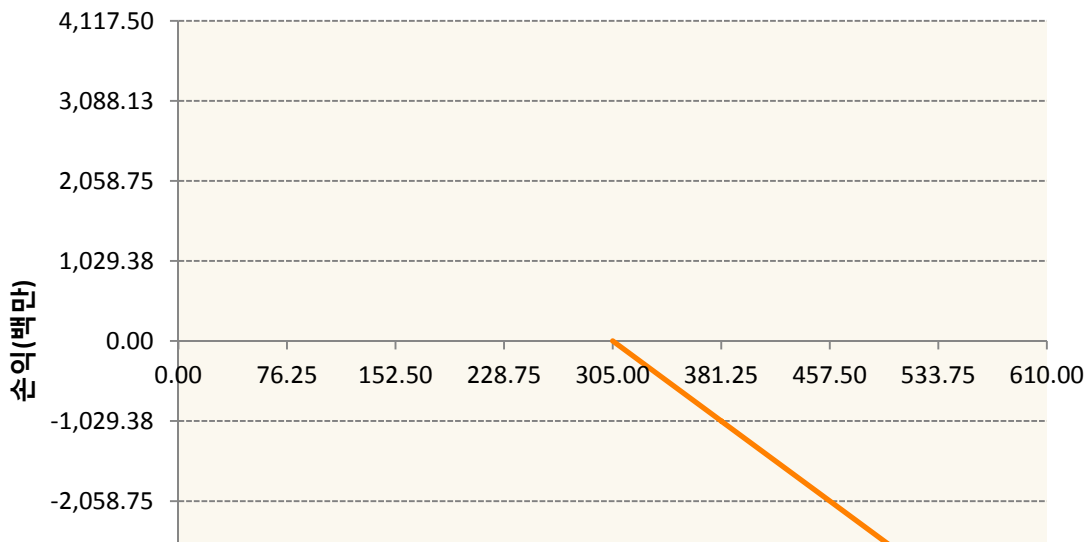


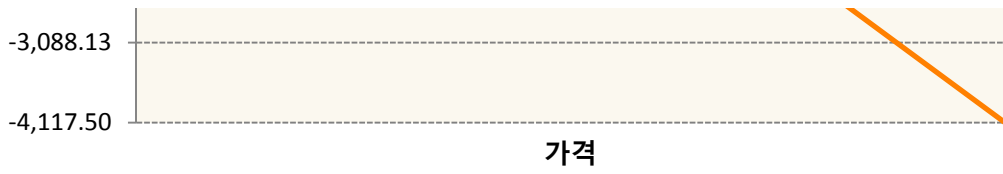


KR4201Q73029-2020-07 콜302.5

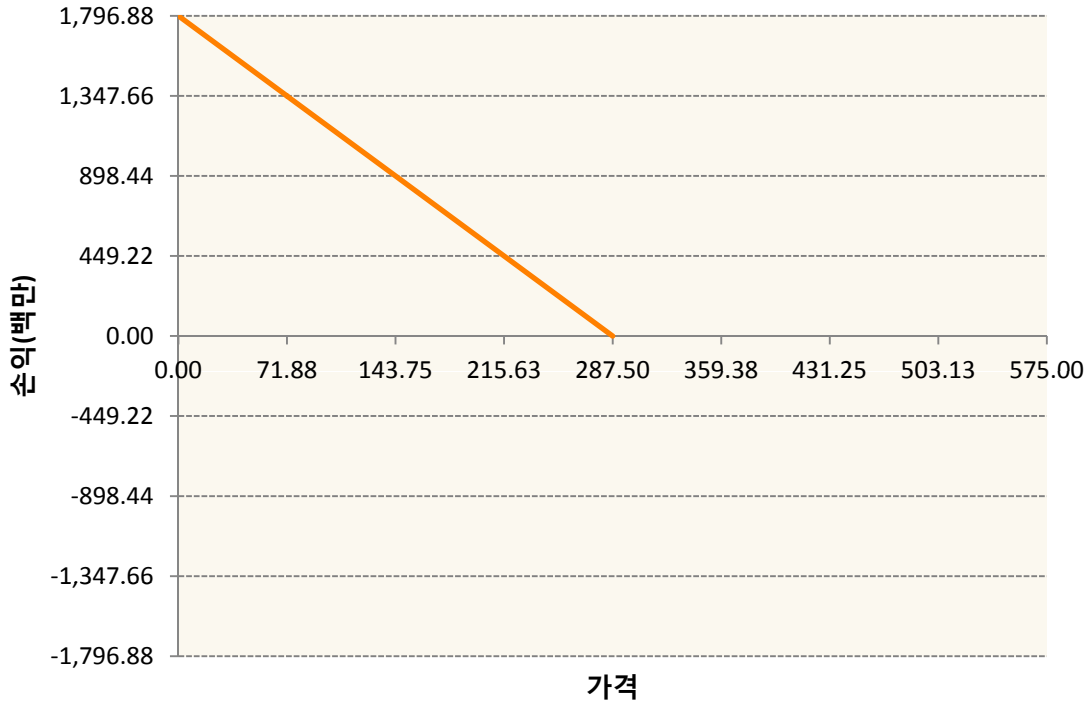


KR4201Q73052-2020-07 콜305

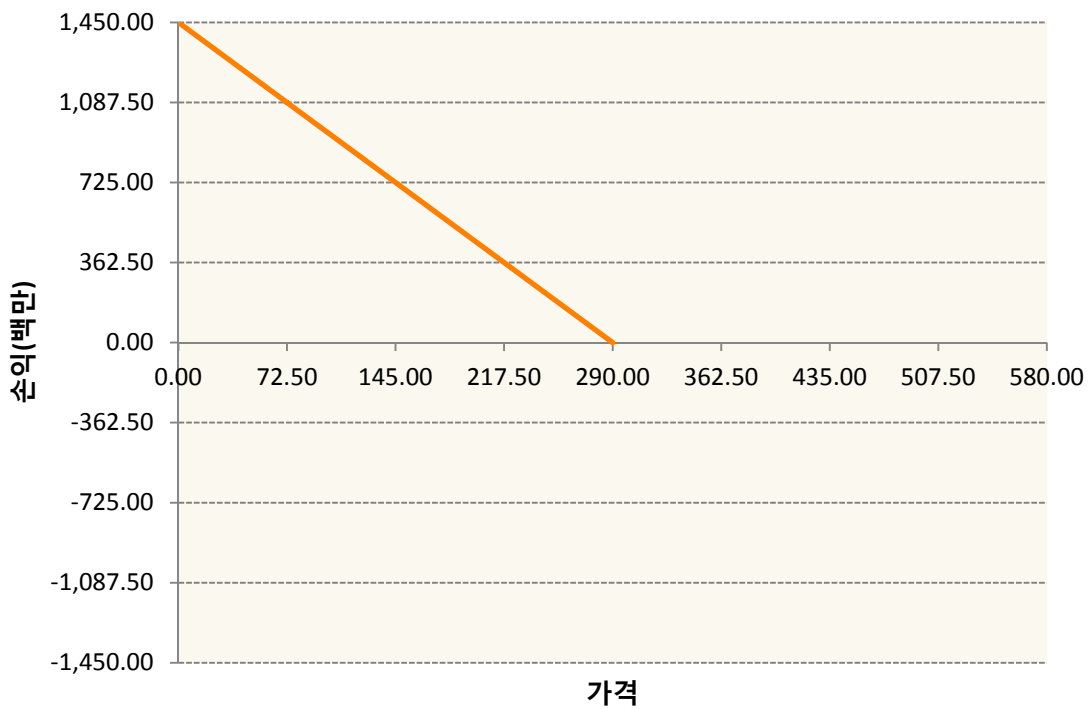




KR4301Q72870-2020-07 풋287.5



KR4301Q72904-2020-07 풋290



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q90009 2020-09 코스피200지수선물							772
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-772	-772	-772	-772	-772	-772	-772
-5.33%	-515	-515	-515	-515	-515	-515	-515
-2.67%	-257	-257	-257	-257	-257	-257	-257
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	257	257	257	257	257	257	257
5.33%	515	515	515	515	515	515	515
8.00%	772	772	772	772	772	772	772
KR4201Q73003 2020-07 콜300							3
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2	2	1	1	1	1	1
-5.33%	1	1	1	1	1	1	0
-2.67%	1	1	1	1	0	0	0
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	0	0	0	-1	-1	-1	-2
5.33%	-1	-1	-1	-2	-2	-2	-2
8.00%	-2	-2	-2	-3	-3	-3	-3
KR4201Q73029 2020-07 콜302.5							643
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	285	268	248	223	195	165	131
-5.33%	258	233	203	171	135	97	57
-2.67%	213	177	139	97	54	9	-38
0%	142	97	49	0	-50	-102	-155
2.67%	39	-14	-69	-124	-180	-237	-294
5.33%	-99	-159	-218	-278	-337	-397	-457
8.00%	-276	-337	-399	-460	-521	-582	-643
KR4201Q73052 2020-07 콜305							172
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	72	68	63	57	50	42	33
-5.33%	66	60	52	44	34	24	13
-2.67%	55	46	36	25	13	1	-11
0%	38	26	13	0	-14	-28	-42
2.67%	12	-2	-17	-32	-48	-63	-79
5.33%	-23	-40	-56	-72	-89	-105	-122
8.00%	-69	-86	-103	-120	-137	-154	-172

KR4301Q72870

2020-07 풋287.5

113

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	100	102	103	105	108	110	113
-5.33%	57	60	63	66	69	72	76
-2.67%	18	22	26	30	34	39	43
0%	-14	-10	-5	0	5	10	15
2.67%	-40	-35	-29	-24	-19	-14	-9
5.33%	-57	-53	-48	-43	-38	-34	-29
8.00%	-68	-65	-61	-57	-53	-48	-44

KR4301Q72904

2020-07 풋290

93

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	84	85	86	88	89	91	93
-5.33%	49	51	53	55	57	60	63
-2.67%	17	20	22	26	29	32	35
0%	-11	-7	-4	0	4	8	11
2.67%	-33	-29	-25	-21	-17	-13	-9
5.33%	-49	-45	-42	-38	-34	-30	-26
8.00%	-60	-57	-53	-50	-46	-43	-39

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

(단위:백만원)

1,898

공시일	2020-06-15
기준일	2020-06-12

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	156,603	0	156,603	

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	2020-06-15
기준일	2020-06-12

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	103,738	0	103,738	

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	2020-06-15
기준일	2020-06-12

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	466,454	0	466,454	
누계	통화	선도	0	447,091	-447,091	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J027 KRW/USD 22-06-20E	1,483
FX21020J028 KRW/USD 22-06-20E	1,926
FX21020J039 KRW/USD 24-07-20E	2,167
FX21020J043 KRW/USD 24-07-20E	1,733
FX21020J043 KRW/USD 24-07-20E	1,926
FX21020K01 KRW/USD 22-06-20E	674
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	2,350
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	963
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,011
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,599
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	3,371
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	6,838
FX21020M00 KRW/USD 26-08-20E	578
FX21020M01 KRW/USD 26-08-20E	4,719
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	2,003
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	2,427

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

18,326

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

(단위:백만원)

221

공시일	2020-06-15
기준일	2020-06-12

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	7,689	0	7,689	
누계	통화	선도	0	11,544	-11,544	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020K01 KRW/USD 15-06-20E	315
FX21020K03 KRW/USD 15-06-20E	11
FX21020K04 KRW/USD 27-07-20E	39
FX21020K04 KRW/USD 27-07-20E	96
FX21020K04 KRW/USD 30-06-20E	37
FX21020K04 KRW/USD 20-07-20E	77
FX21020M00 KRW/USD 20-07-20E	10
FX21020M01 KRW/USD 20-07-20E	14
FX21020M02 KRW/USD 06-07-20E	48
FX21020M03 KRW/USD 15-07-20E	221
FX21020M04 KRW/USD 20-07-20E	56

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

473

공시일	2020-06-15
기준일	2020-06-12

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

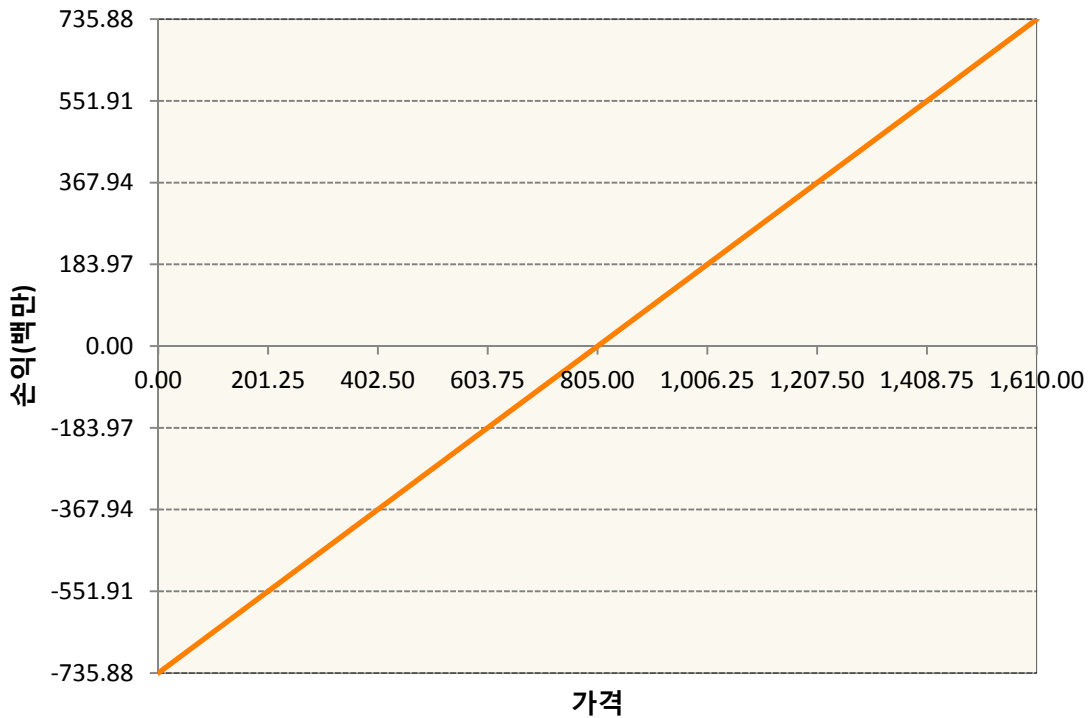
1. 계약금액

(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	736	0	736	
누계	유가증권	스왑	988	0	988	장외
누계	통화	선도	210	891	-681	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCM0-VN30 Index Future Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	79
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)

178

공시일	2020-06-15
기준일	2020-06-12

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

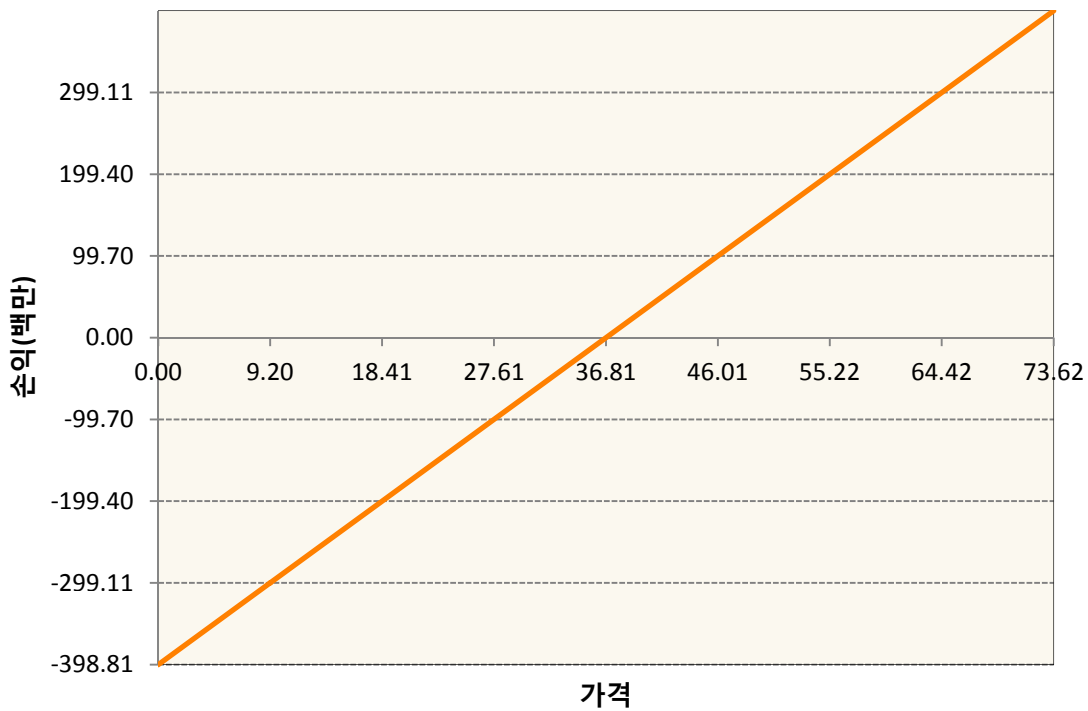
1. 계약금액

(단위:백만원)

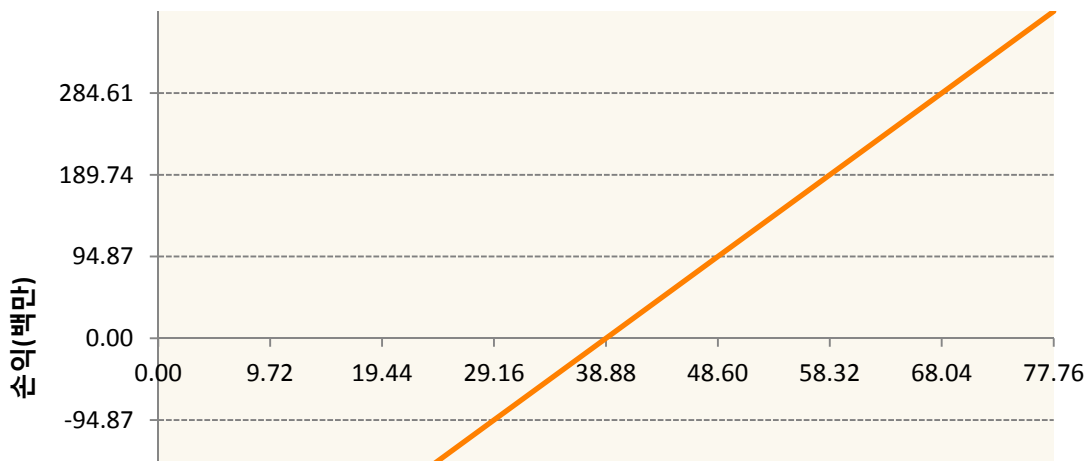
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,893	361	1,531	

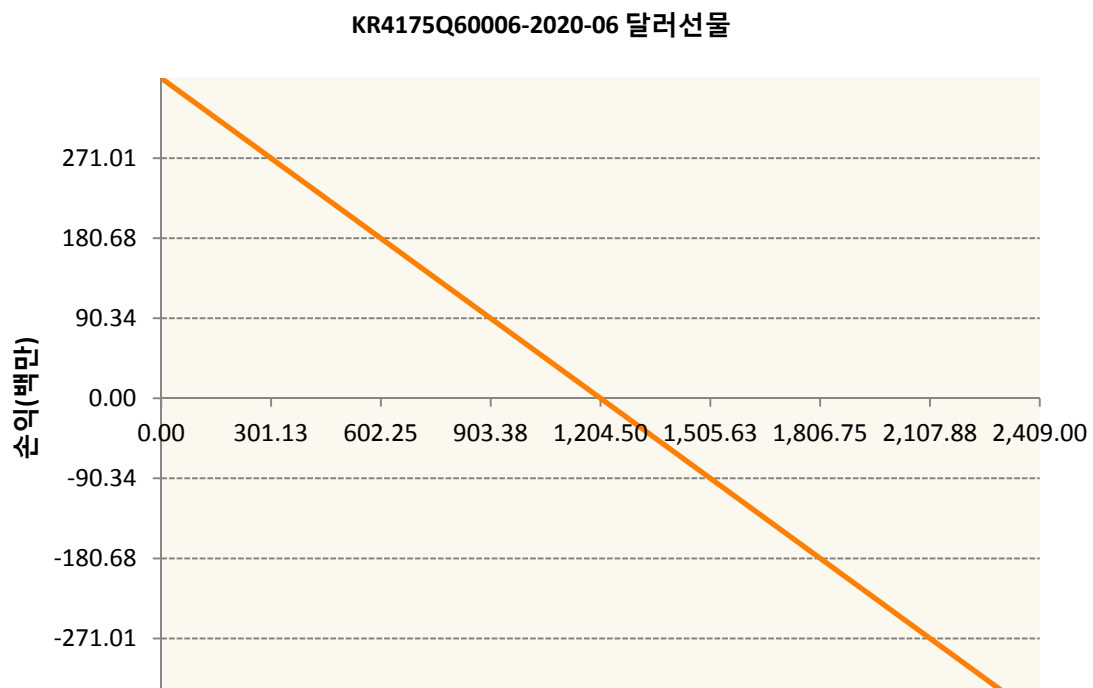
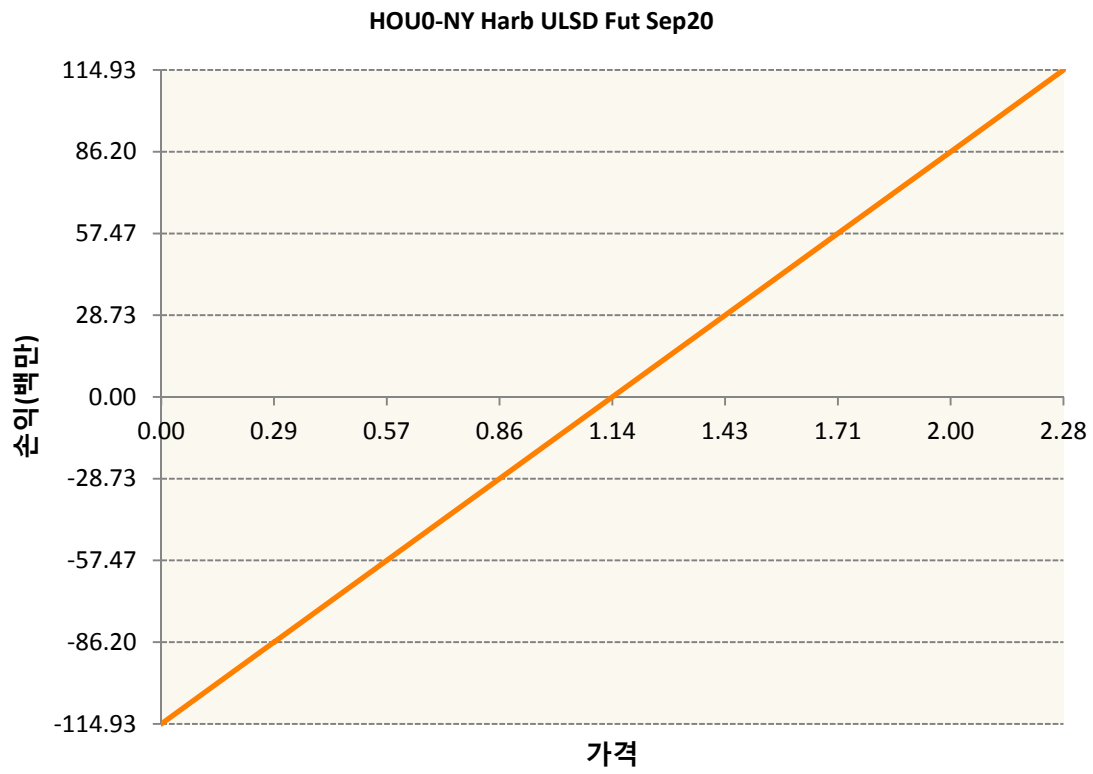
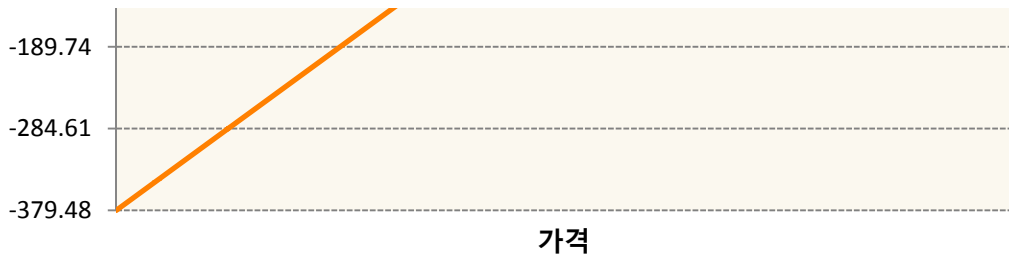
2. 만기시점의 손익구조

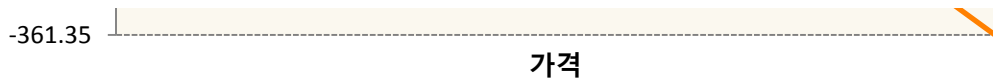
CLU0-WTI CRUDE FUTURE Sep20



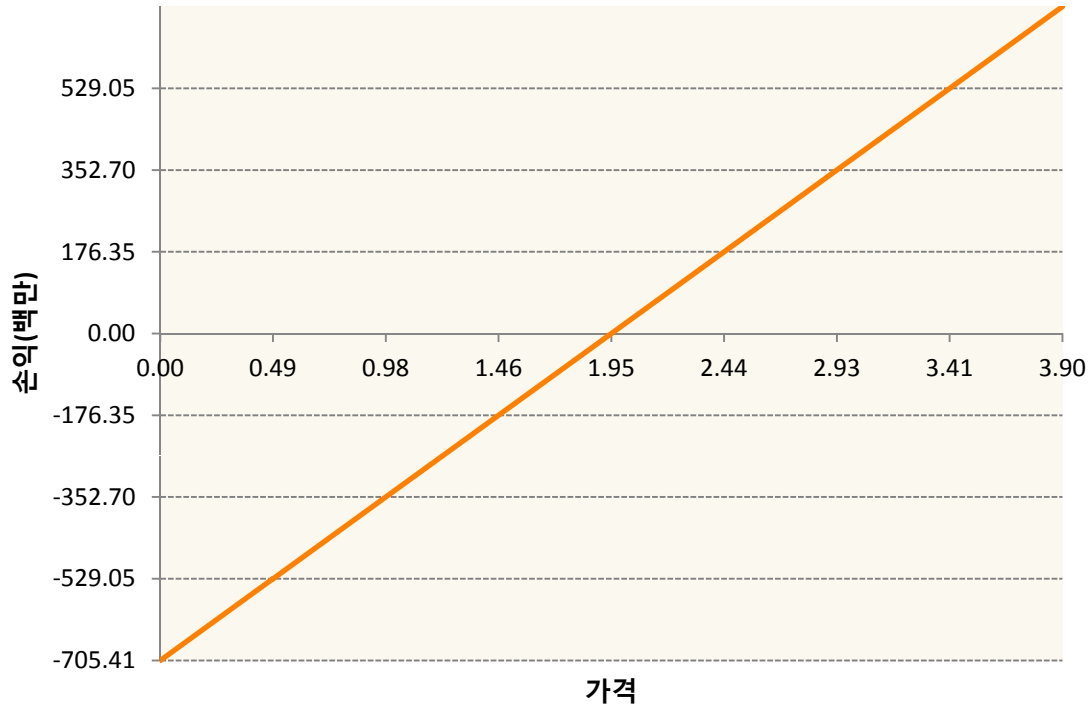
COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20



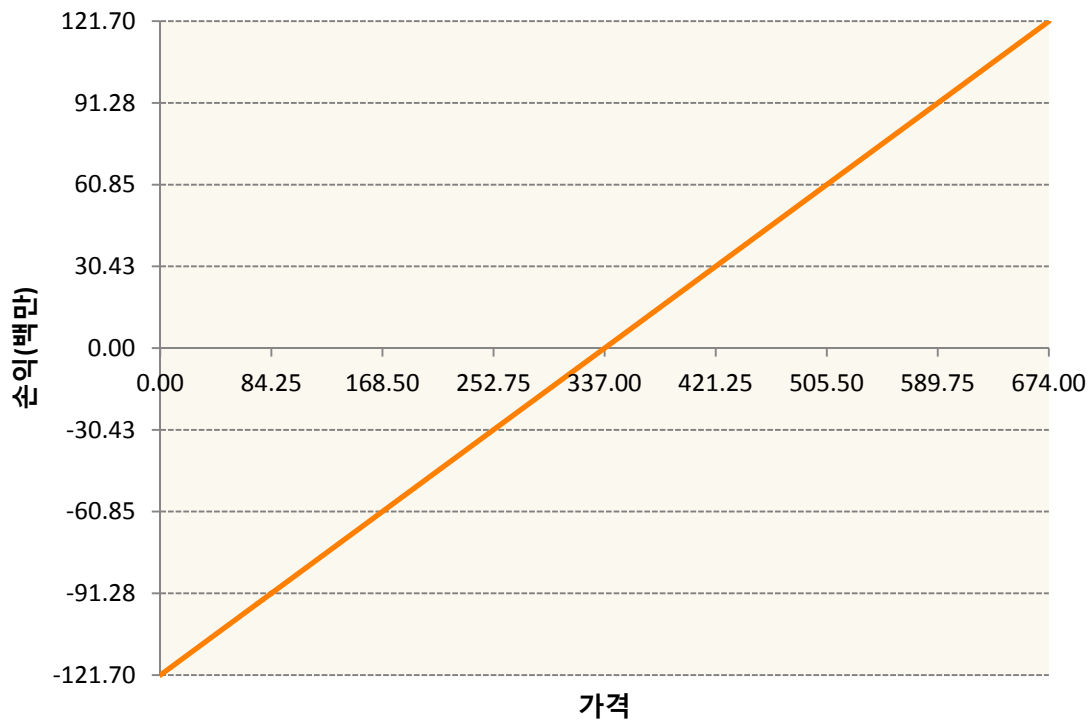




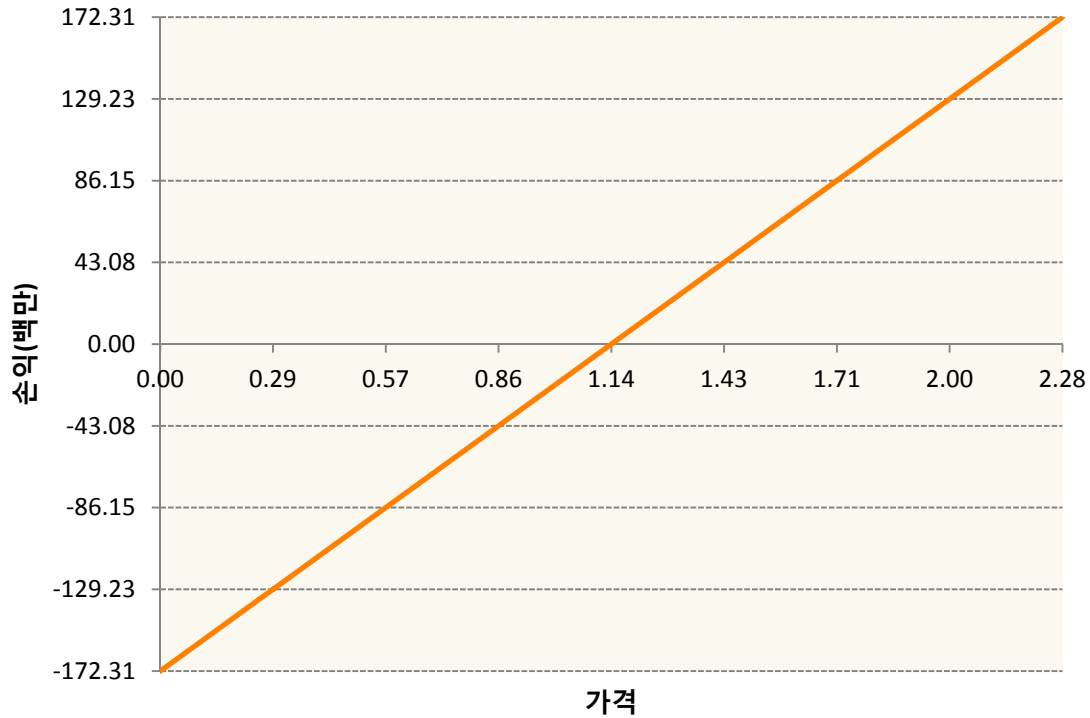
NGU20-NATURAL GAS FUTR Sep20



QSU0-Low Su Gasoil G Sep20



XBU0-GASOLINE RBOB FUT Sep20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLU0	WTI CRUDE FUTURE Sep20	32
COU0	BRENT CRUDE FUTR Sep20	30
HOU0	NY Harb ULSD Fut Sep20	9
KR4175Q60C	2020-06 달러선물	29
NGU20	NATURAL GAS FUTR Sep20	56
QSU0	Low Su Gasoil G Sep20	10
XBU0	GASOLINE RBOB FUT Sep20	14

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

(단위:백만원)

936

공시일	2020-06-15
기준일	2020-06-12

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

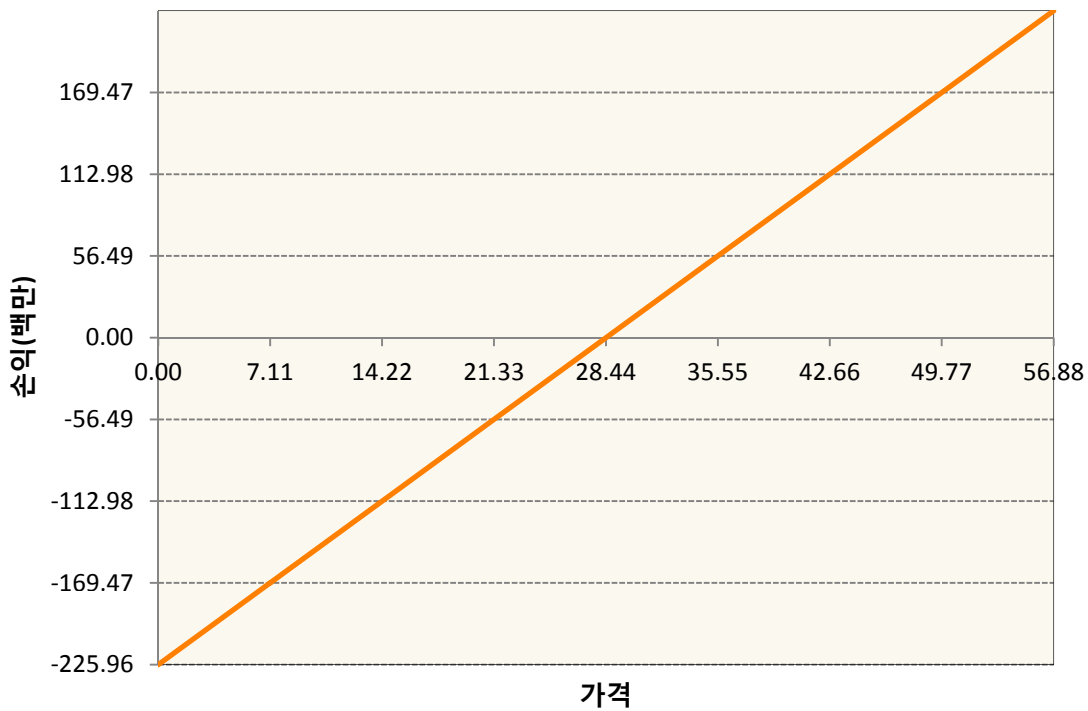
1. 계약금액

(단위:백만원)

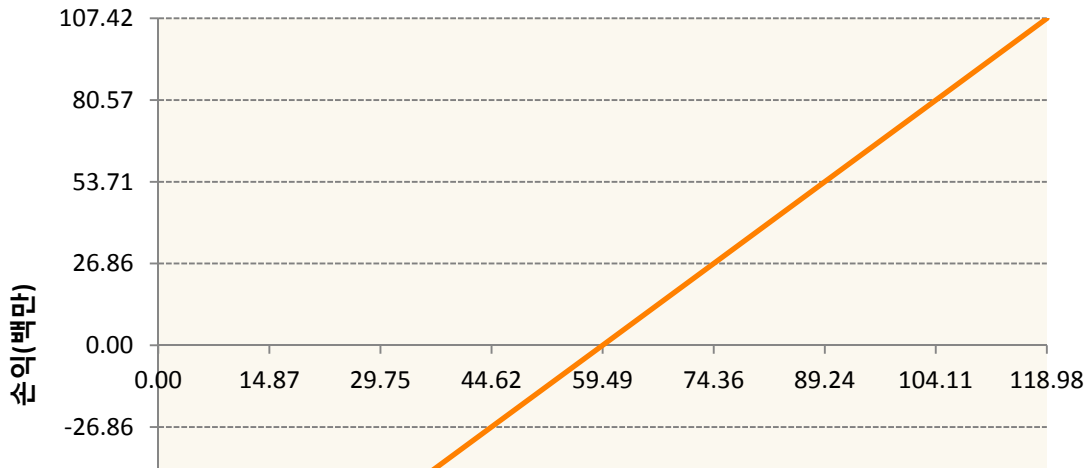
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,582	72	2,510	

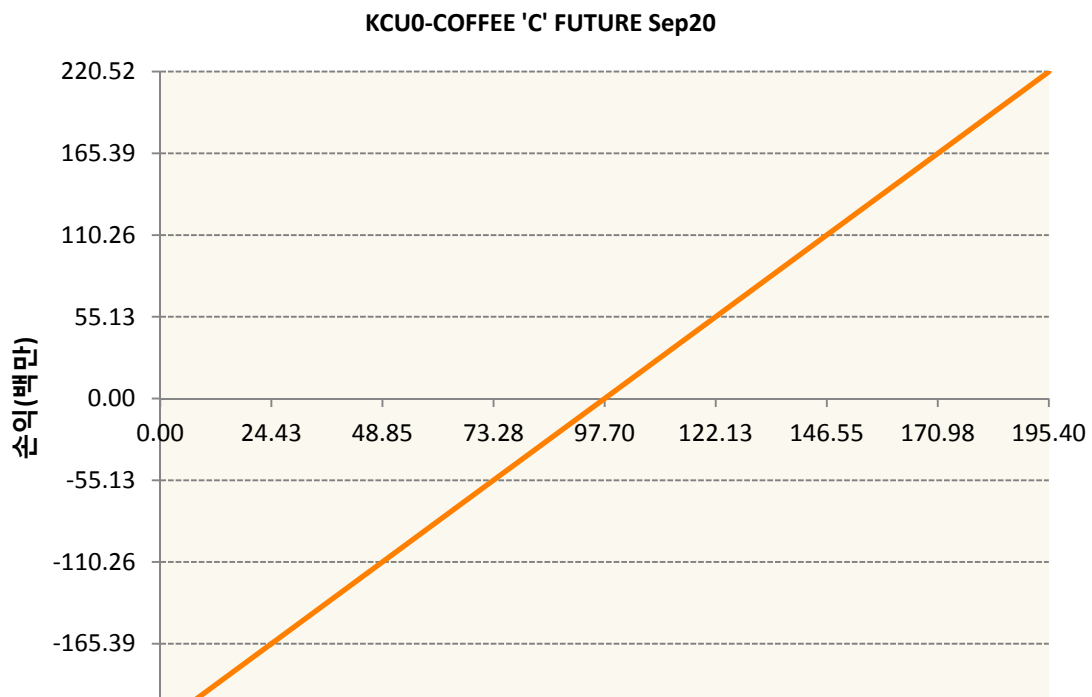
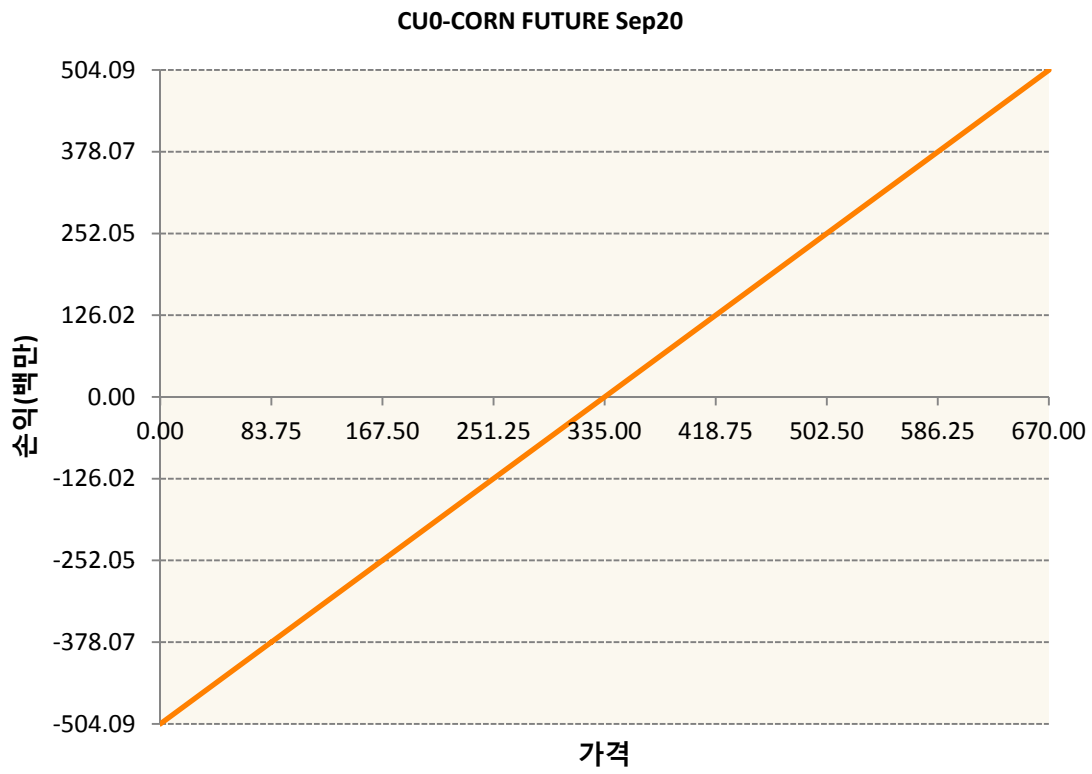
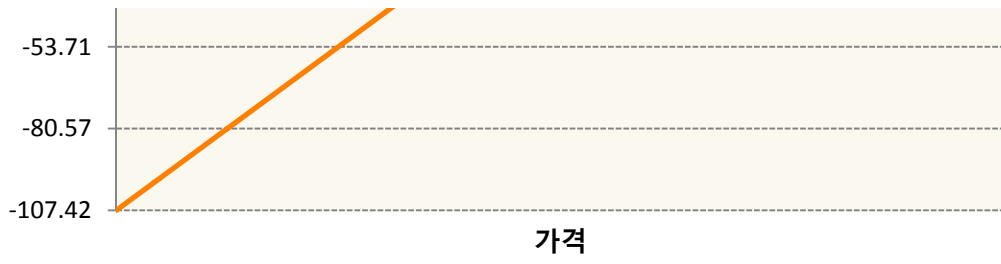
2. 만기시점의 손익구조

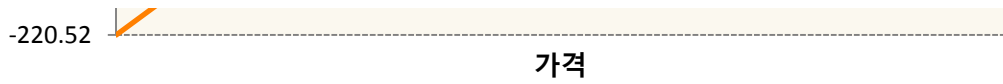
BOZ0-SOYBEAN OIL FUTR Dec20



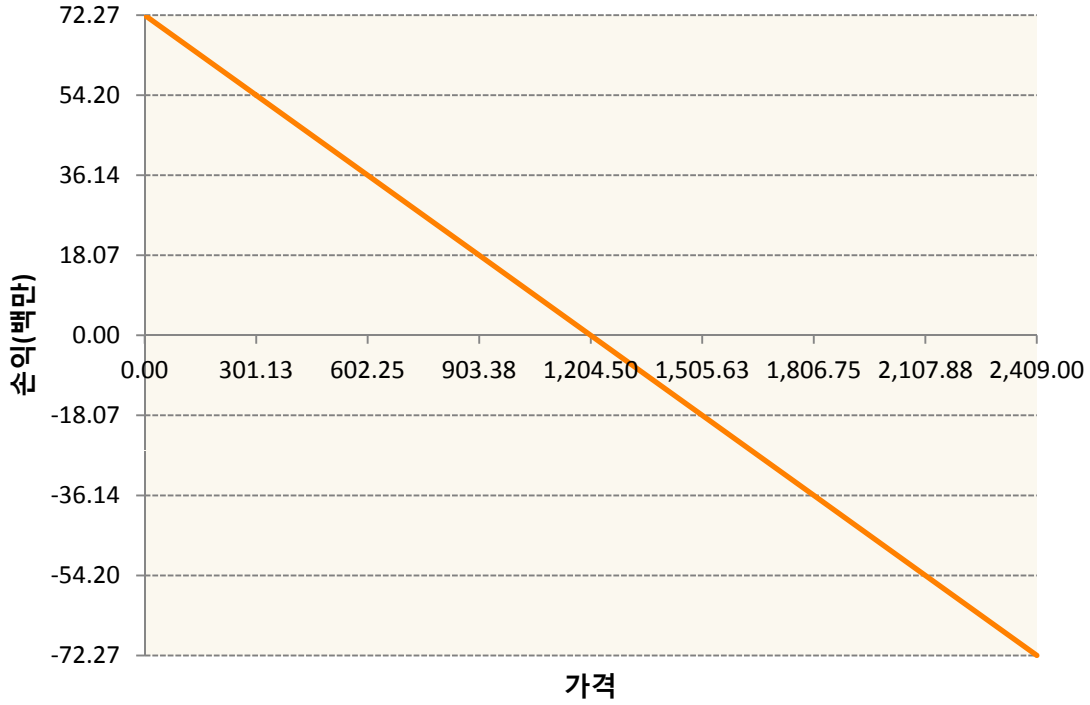
CTZ0-COTTON NO.2 FUTR Dec20



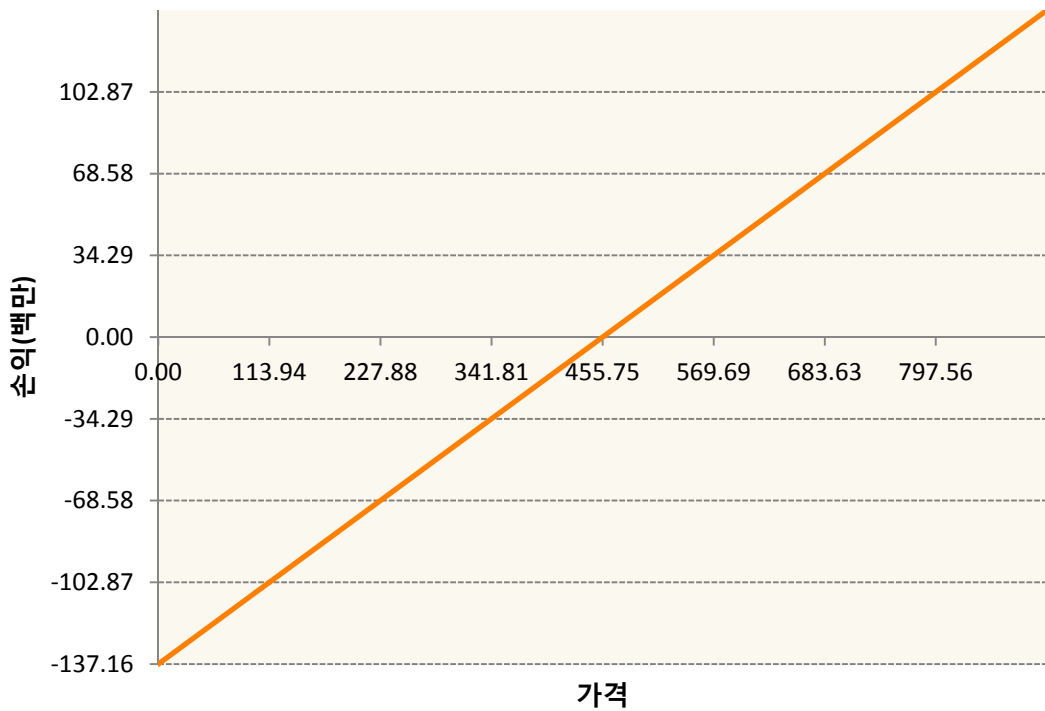




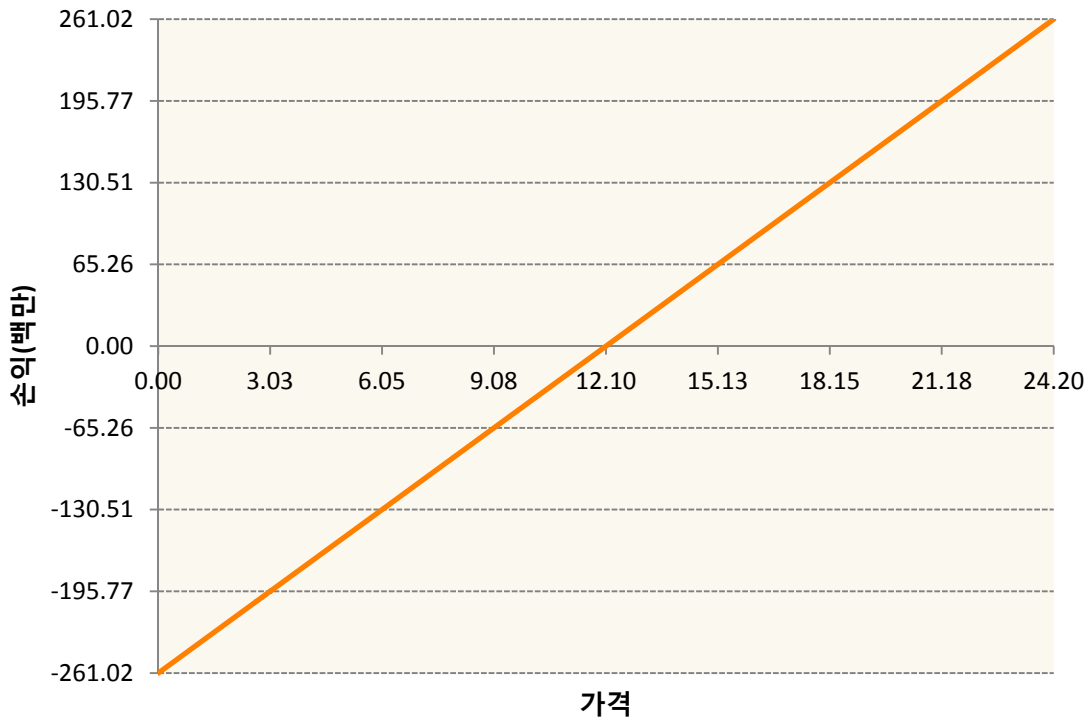
KR4175Q60006-2020-06 달러선물



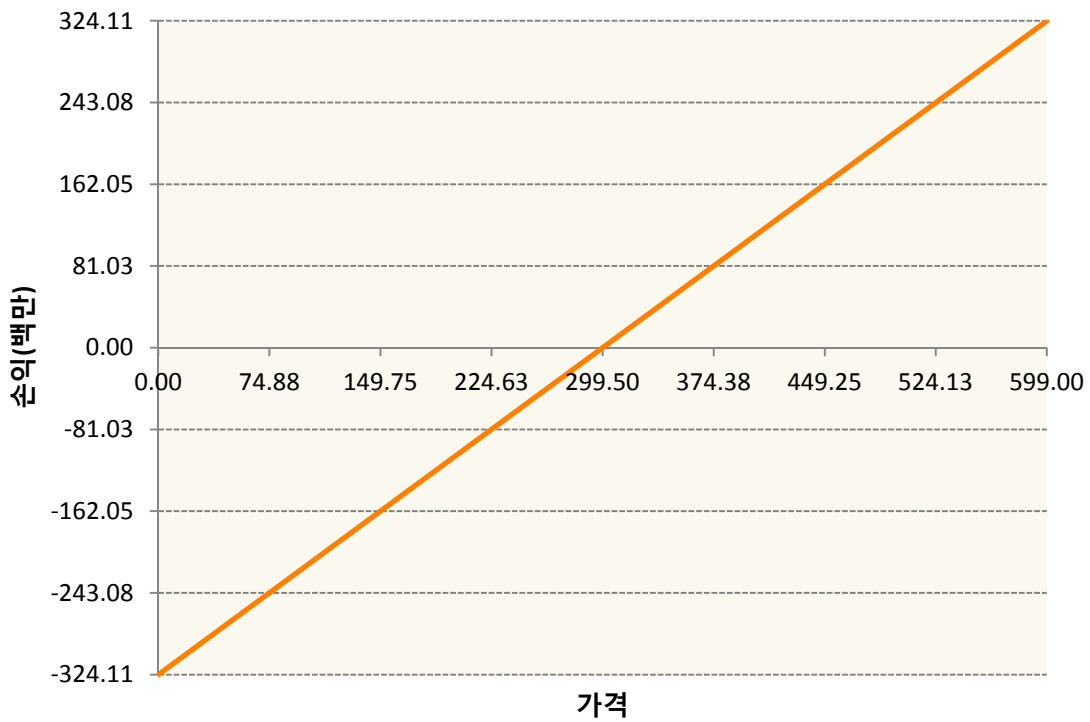
KWU0-KC HRW WHEAT FUT Sep20



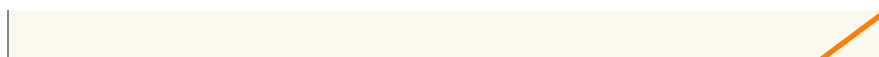
SBV0-Sugar Oct20

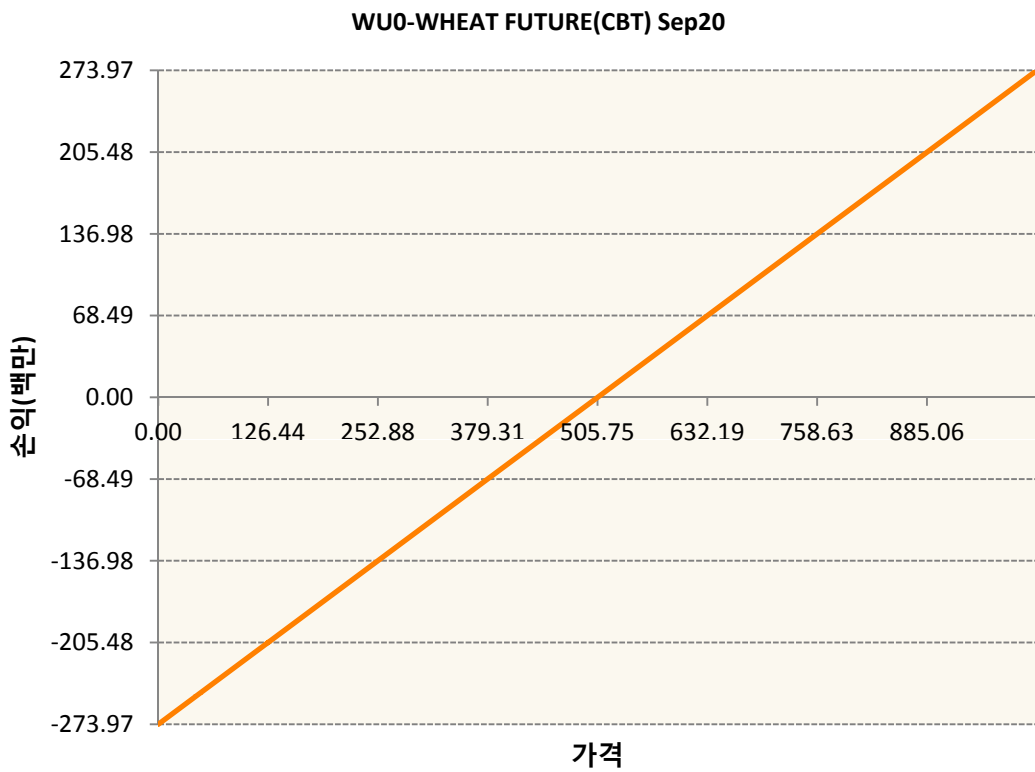
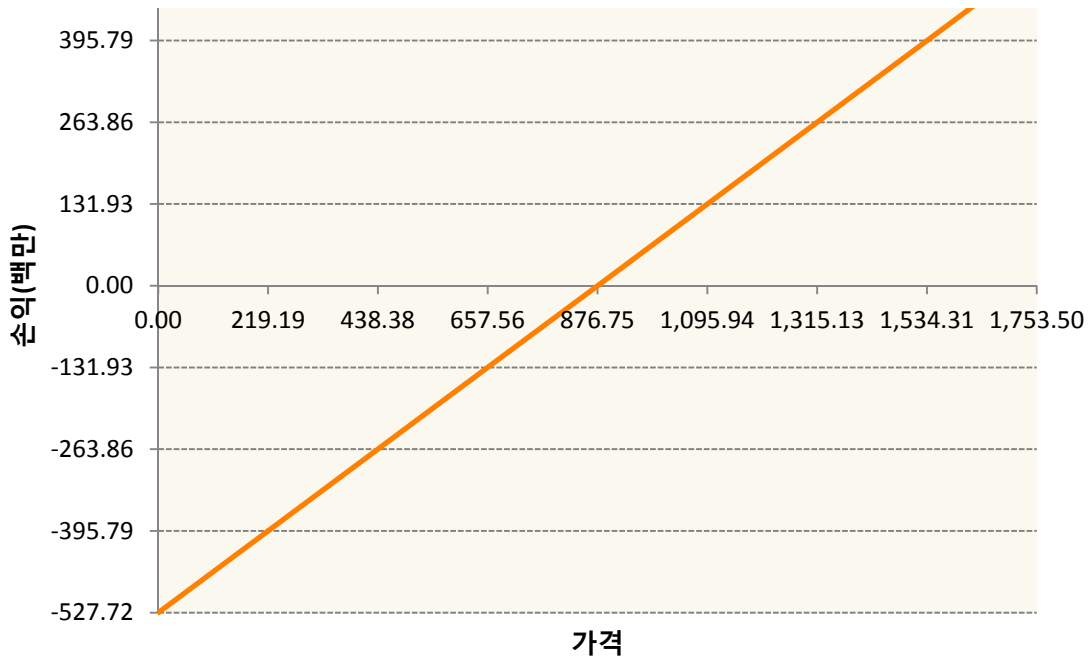


SMZ0-SOYBEAN MEAL FUTR Dec20



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	40
KCU0	COFFEE 'C' FUTURE Sep20	18
KR4175Q60C	2020-06 달러선물	6

KWU0	KC HRW WHEAT FUT Sep20	11
SBV0	Sugar Oct20	21
SMZ0	SOYBEAN MEAL FUTR Dec20	26
SX0	SOYBEAN FUTURE Nov20	42
WU0	WHEAT FUTURE(CBT) Sep20	22

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

(단위:백만원)

242