

공시일	2020-06-16
기준일	2020-06-15

## 포커스농산물모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	3	0	3	장외
누계	지수	스왑	3	0	3	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2020-06-16
기준일	2020-06-15

## 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

1,044

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,247

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-06-16
기준일	2020-06-15

## 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

582
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

848
-----

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-06-16
기준일	2020-06-15

## 유로인덱스모(주식-파생형)

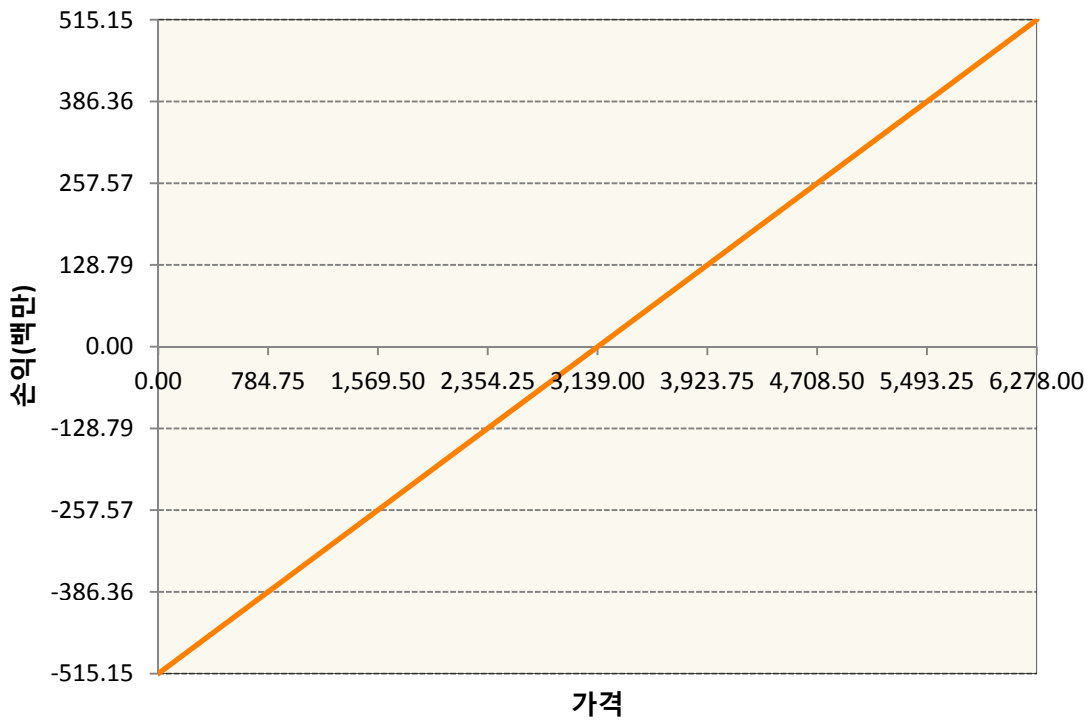
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	515	0	515	

### 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	2020-06-16
기준일	2020-06-15

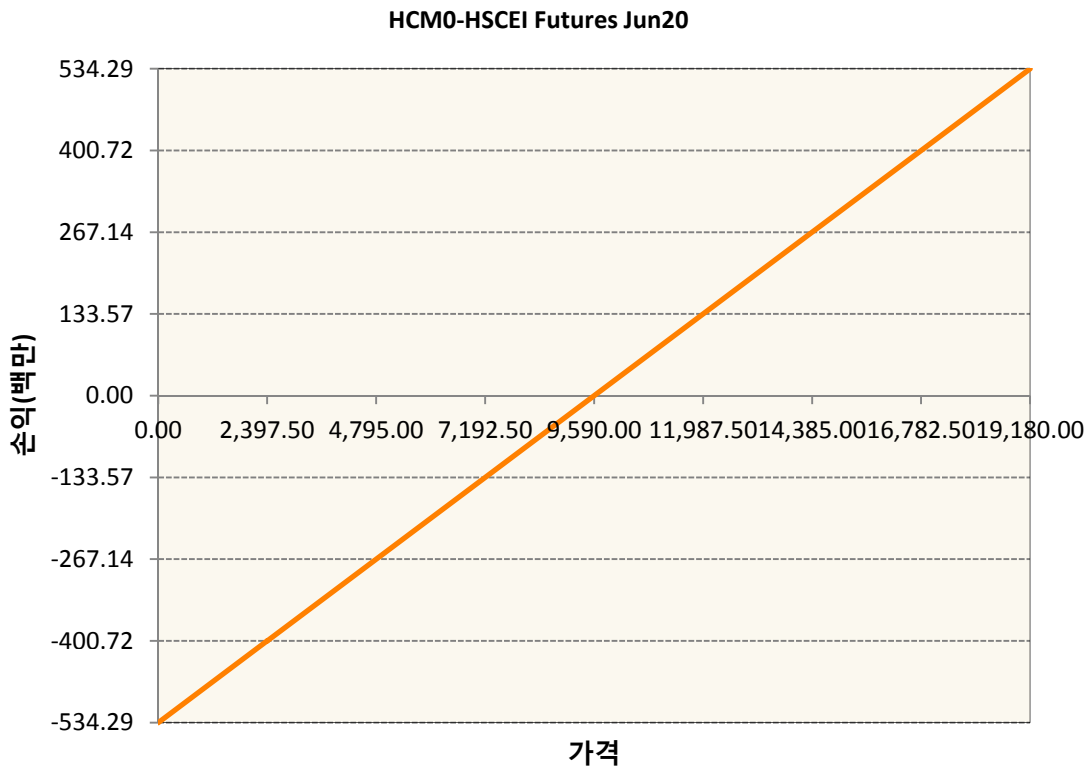
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	534	0	534	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM0	HSCEI Futures Jun20	43
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

46
----

공시일	2020-06-16
기준일	2020-06-15

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

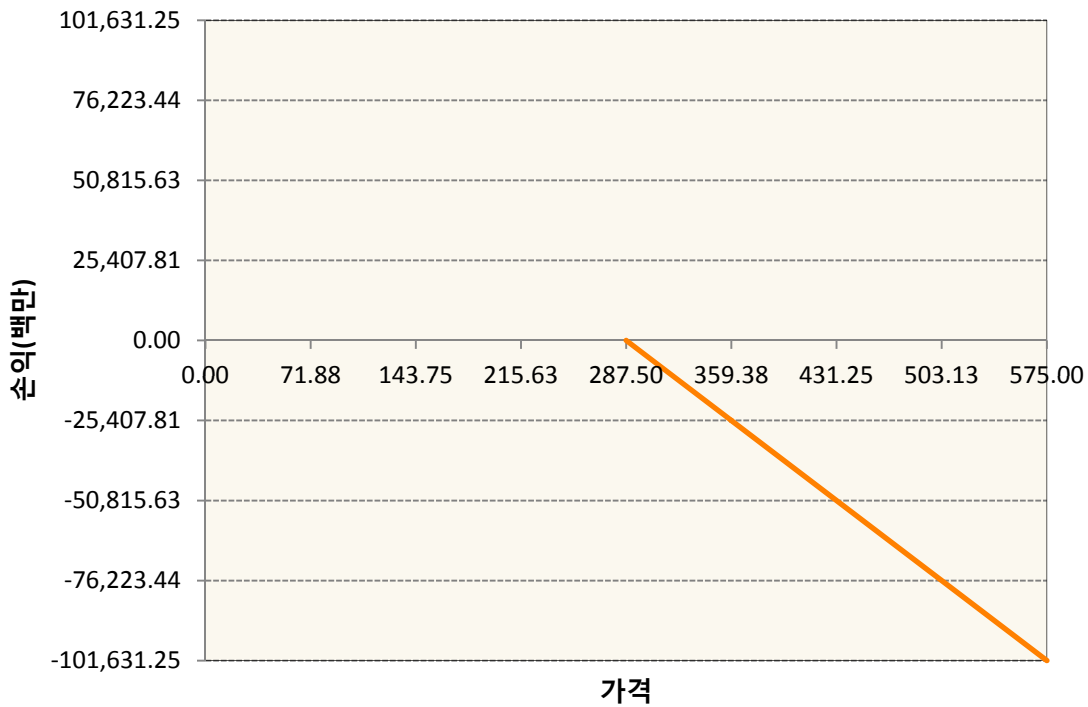
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

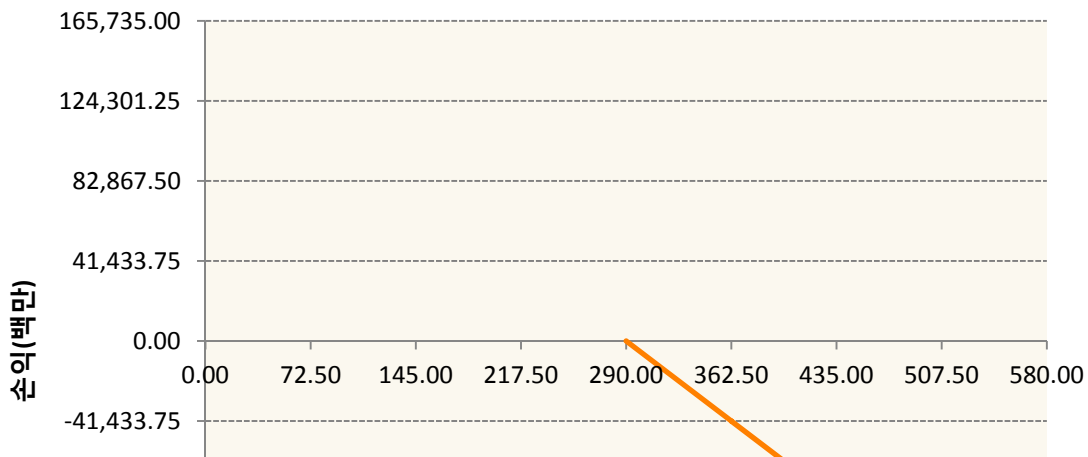
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	3,834	-3,834	장내
누계	유가증권	옵션	0	367,991	-367,991	장내

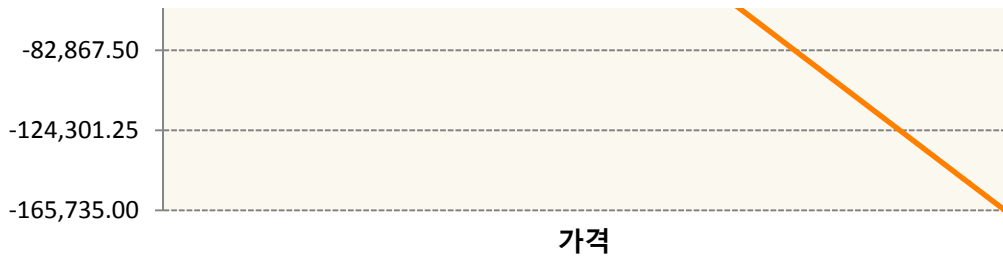
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201Q72872-2020-07 콜287.5**

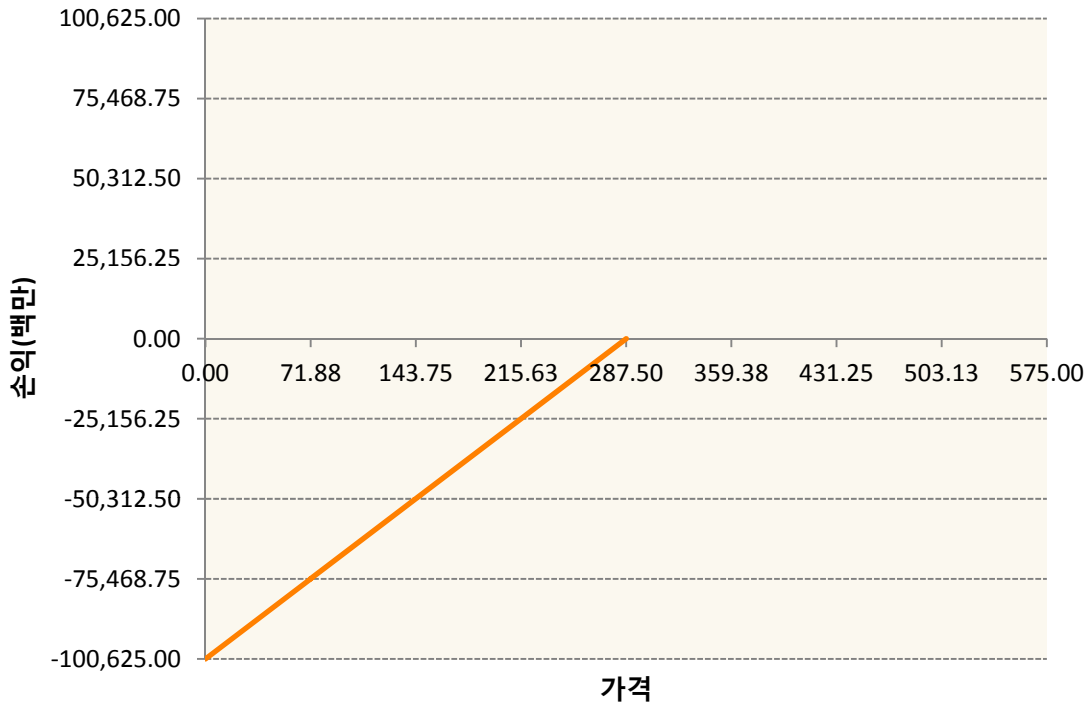


**KR4201Q72906-2020-07 콜290**





KR4301Q72870-2020-07 풋287.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q72872		2020-07 콜287.5					4,440	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,942	1,832	1,694	1,530	1,343	1,136	911	
-5.33%	1,762	1,592	1,394	1,173	931	673	399	
-2.67%	1,452	1,214	952	671	375	67	-252	
0%	966	658	335	0	-344	-696	-1,055	
2.67%	258	-108	-482	-860	-1,243	-1,630	-2,018	
5.33%	-704	-1,109	-1,515	-1,922	-2,330	-2,738	-3,147	
8.00%	-1,935	-2,353	-2,770	-3,188	-3,605	-4,023	-4,440	
KR4201Q72906		2020-07 콜290					6,860	
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2,839	2,684	2,485	2,243	1,964	1,651	1,308	

-5.33%	2,596	2,350	2,059	1,727	1,361	965	543
-2.67%	2,168	1,815	1,421	994	539	61	-437
0%	1,482	1,015	519	0	-537	-1,090	-1,655
2.67%	461	-107	-692	-1,288	-1,894	-2,507	-3,126
5.33%	-951	-1,595	-2,242	-2,894	-3,548	-4,204	-4,861
8.00%	-2,791	-3,470	-4,148	-4,827	-5,505	-6,183	-6,860
KR4301Q72870                      2020-07 풋287.5							6,810
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,387	-6,418	-6,464	-6,526	-6,605	-6,700	-6,810
-5.33%	-3,950	-4,016	-4,102	-4,208	-4,331	-4,470	-4,623
-2.67%	-1,598	-1,717	-1,857	-2,016	-2,191	-2,379	-2,578
0%	603	418	216	0	-227	-462	-705
2.67%	2,571	2,321	2,062	1,797	1,526	1,251	972
5.33%	4,234	3,938	3,641	3,342	3,042	2,741	2,439
8.00%	5,548	5,239	4,929	4,620	4,310	4,000	3,691

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

(단위:백만원)

**14,633**

공시일	2020-06-16
기준일	2020-06-15

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

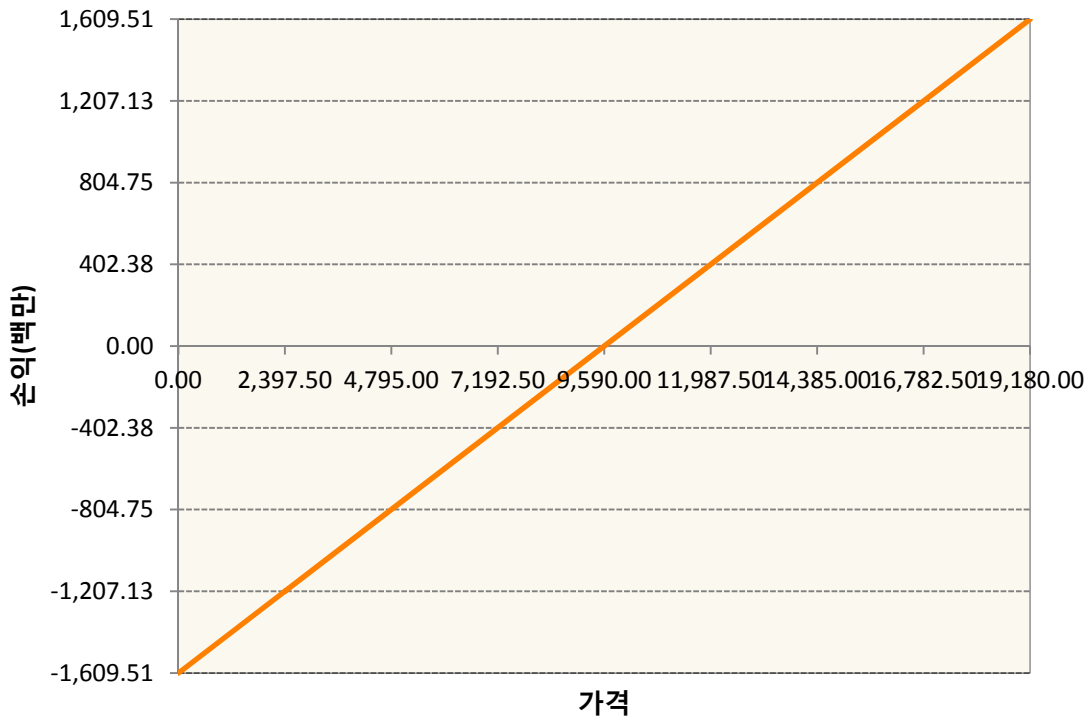
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

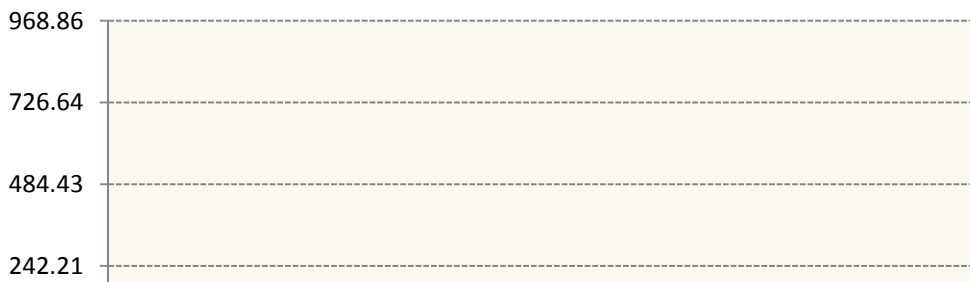
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,610	0	1,610	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,272	-4,272	장내
누계	통화	선도	0	1,519	-1,519	장외

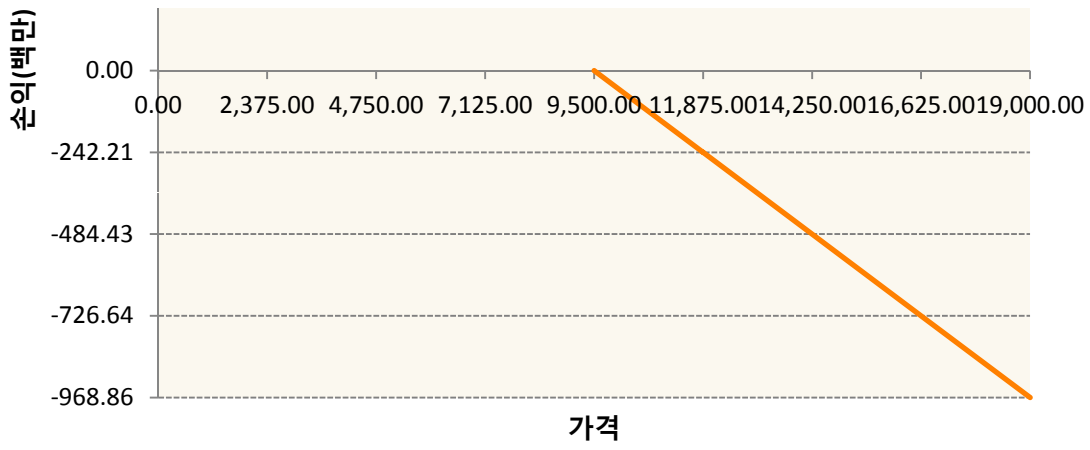
### 2. 만기시점의 손익구조

HCM0-HSCEI Futures Jun20

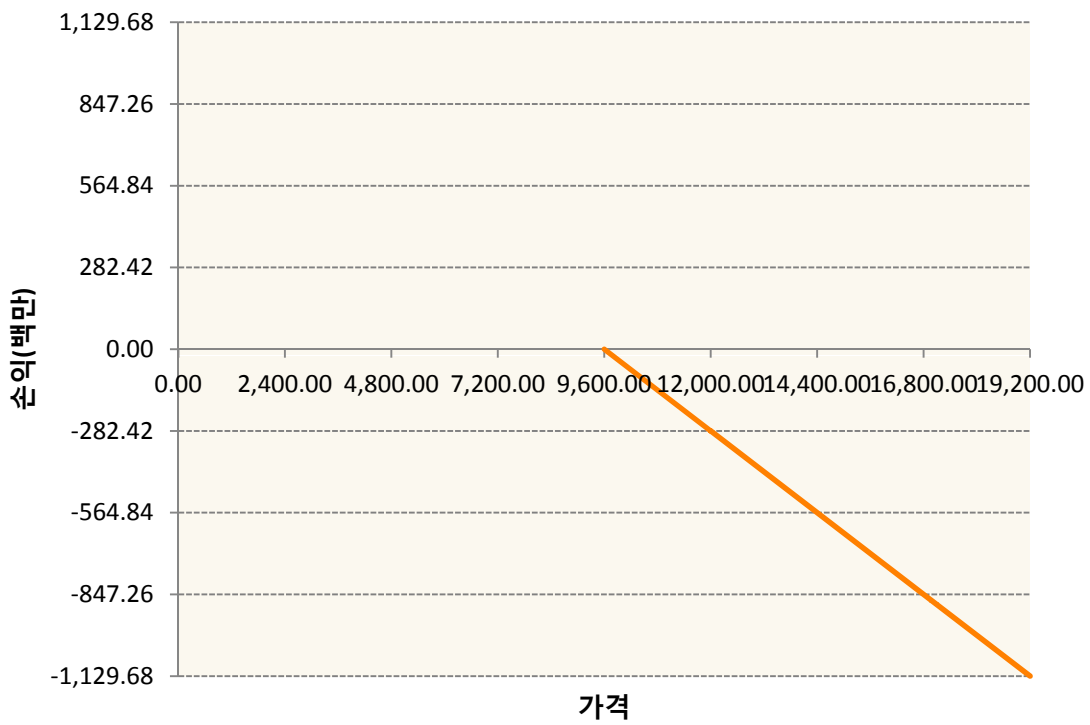


OHHIM0-C95-HSCEI

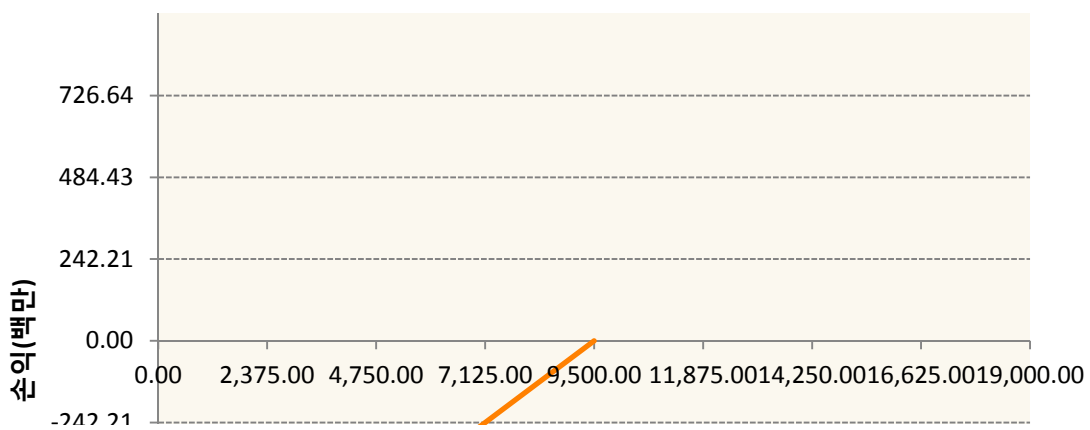


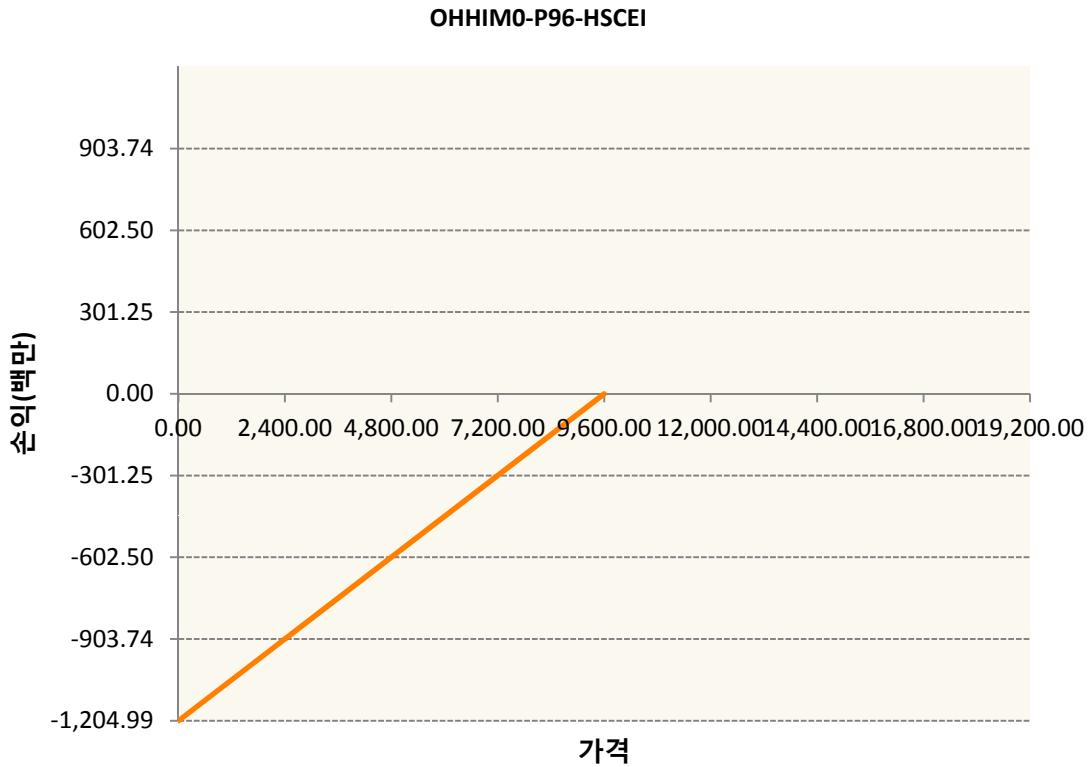
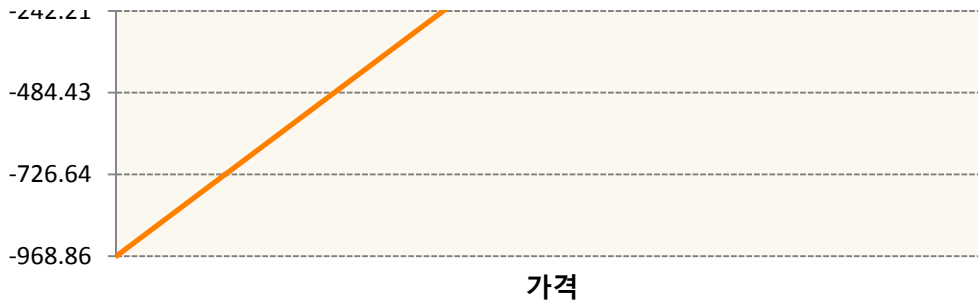


OHHIM0-C96-HSCEI



OHHIM0-P95-HSCEI





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E	122
HCM0 HSCEI Futures Jun20	129
OHHIM0-C9 HSCEI	78
OHHIM0-C9 HSCEI	90
OHHIM0-P9 HSCEI	78
OHHIM0-P9 HSCEI	96

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

573

공시일	2020-06-16
기준일	2020-06-15

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

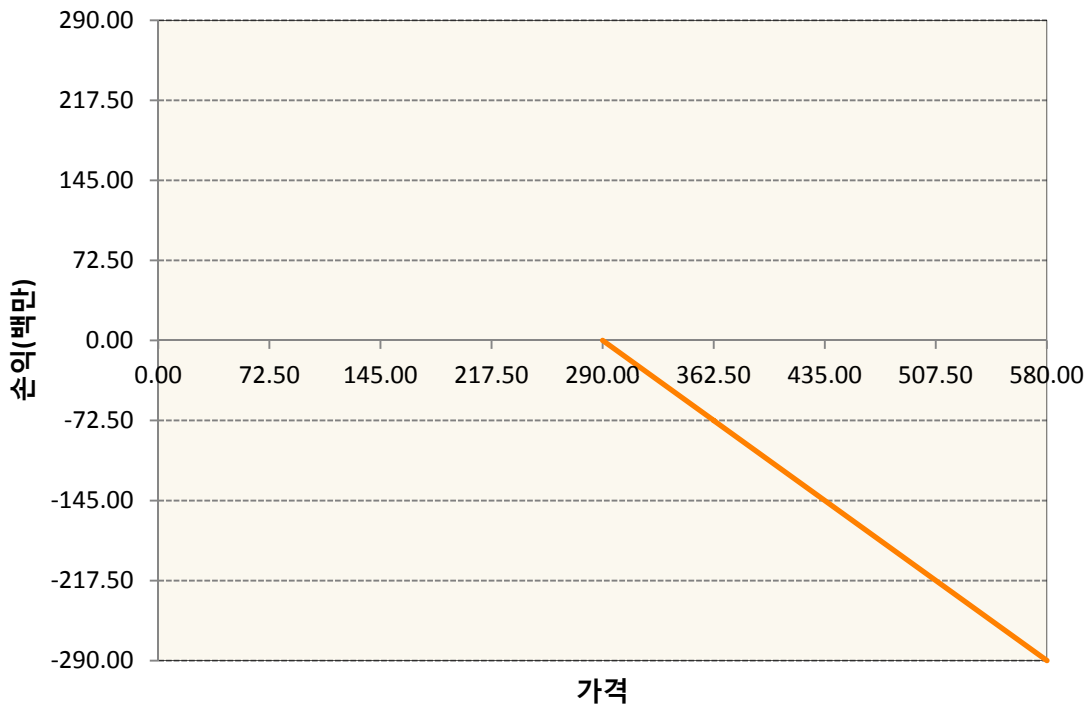
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

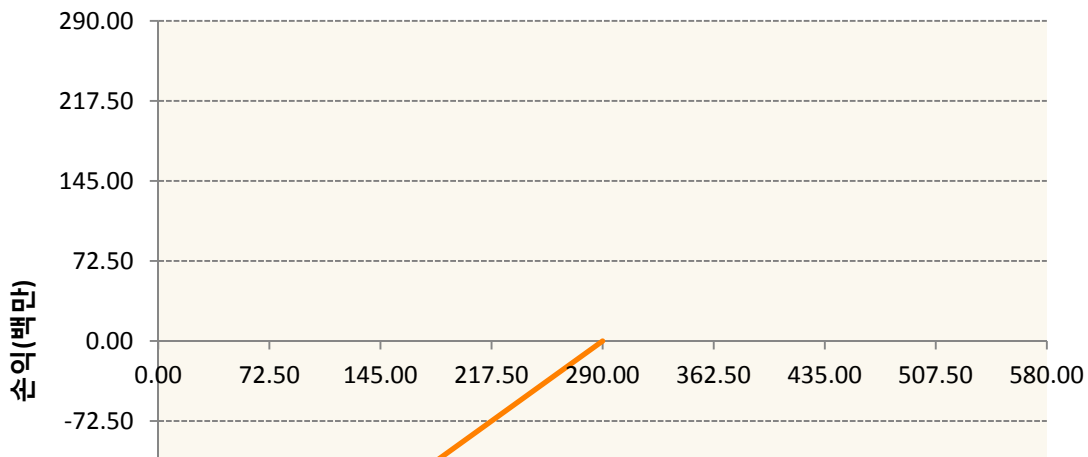
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	580	-580	장내

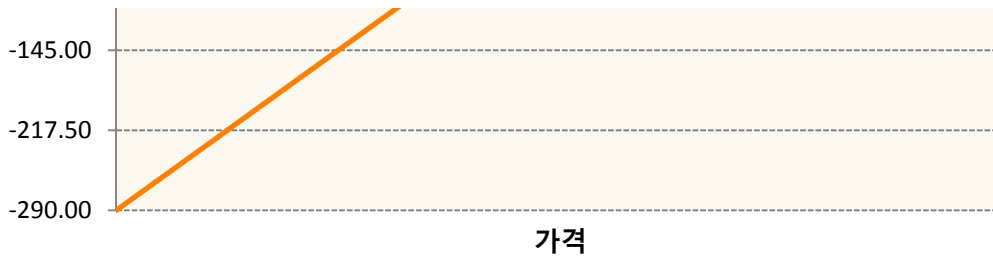
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q72906-2020-07 콜290



KR4301Q72904-2020-07 풋290





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4201Q72906		2020-07 콜290						12
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5	5	4	4	3	3	2	
-5.33%	5	4	4	3	2	2	1	
-2.67%	4	3	2	2	1	0	-1	
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3	
2.67%	1	0	-1	-2	-3	-4	-5	
5.33%	-2	-3	-4	-5	-6	-7	-9	
8.00%	-5	-6	-7	-8	-10	-11	-12	
KR4301Q72904		2020-07 풋290						20
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-20	
-5.33%	-12	-12	-12	-12	-13	-13	-13	
-2.67%	-5	-5	-6	-6	-6	-7	-7	
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2	
2.67%	7	7	6	5	5	4	3	
5.33%	12	12	11	10	9	8	7	
8.00%	17	16	15	14	13	12	11	

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

28

공시일	2020-06-16
기준일	2020-06-15

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

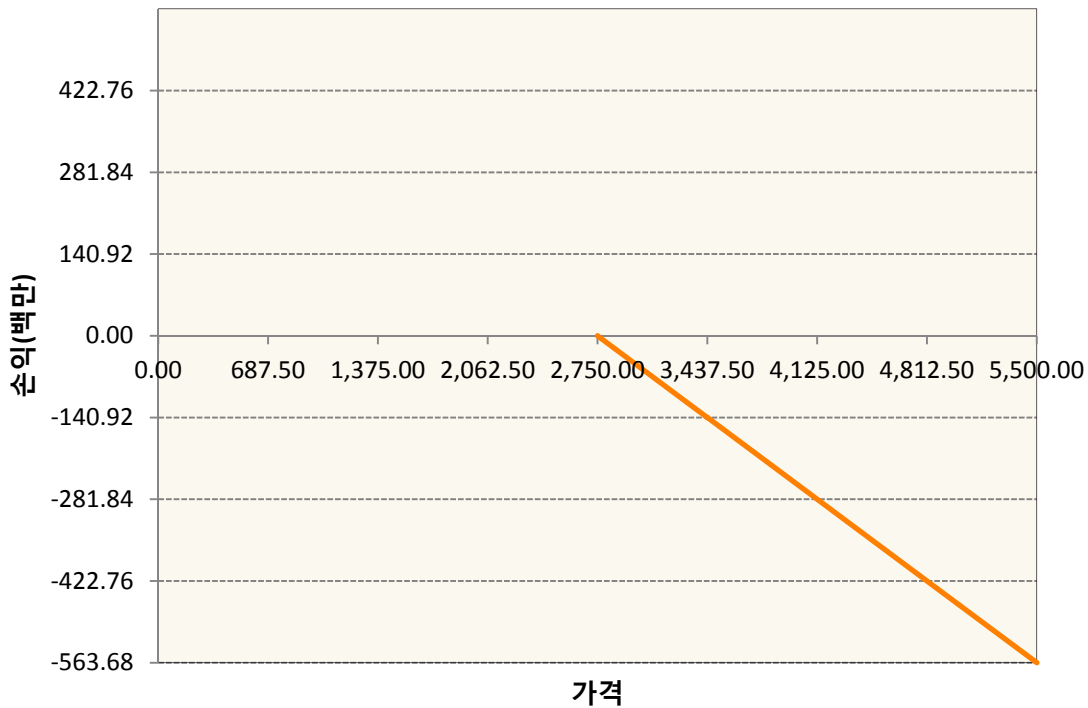
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

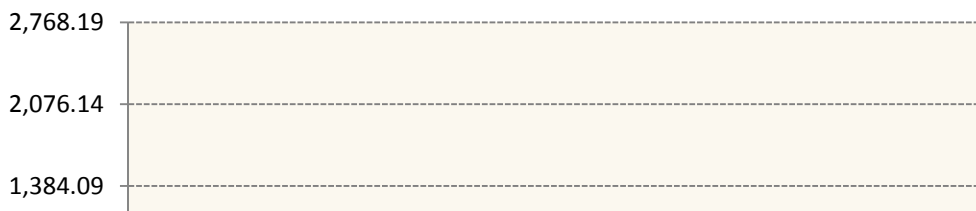
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,221	0	1,221	
누계	유가증권	스왑	8,150	0	8,150	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,702	-6,702	장내
누계	통화	선도	0	2,957	-2,957	장외

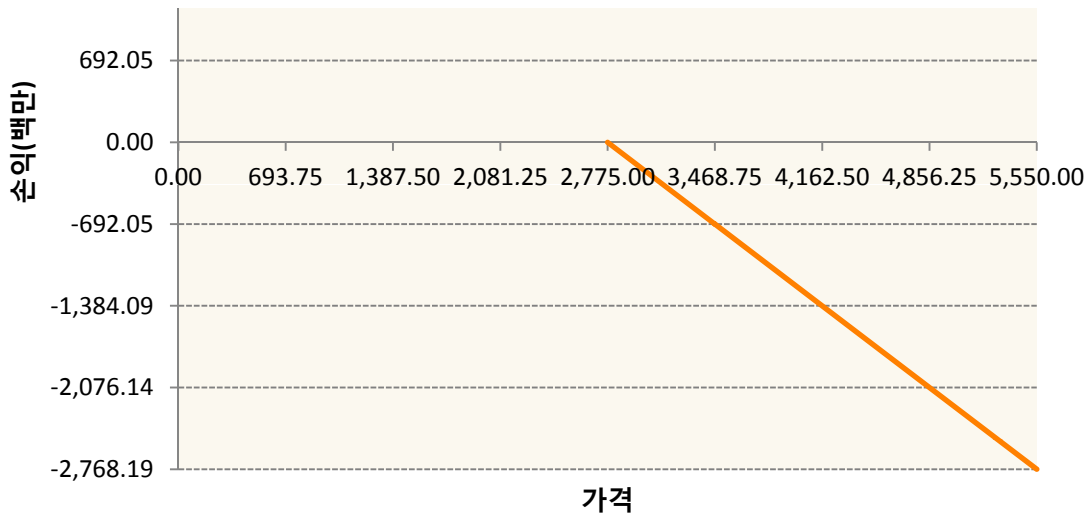
### 2. 만기시점의 손익구조

**OESXM0-C2750-EURO STOXX 50**

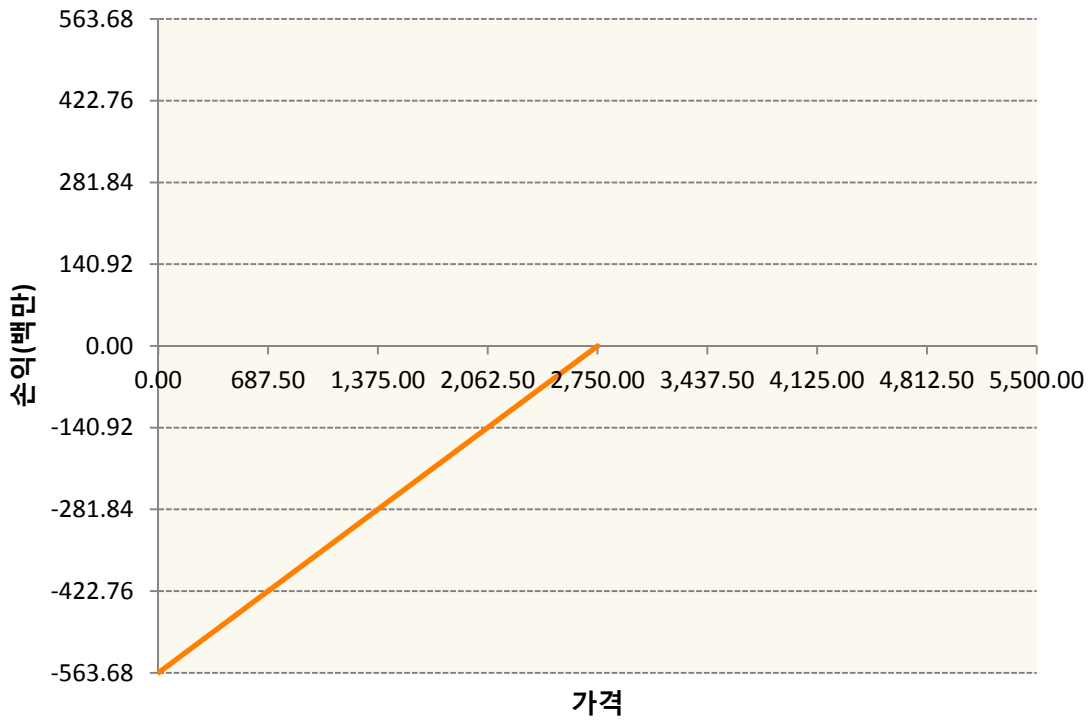


**OESXM0-C2775-EURO STOXX 50**

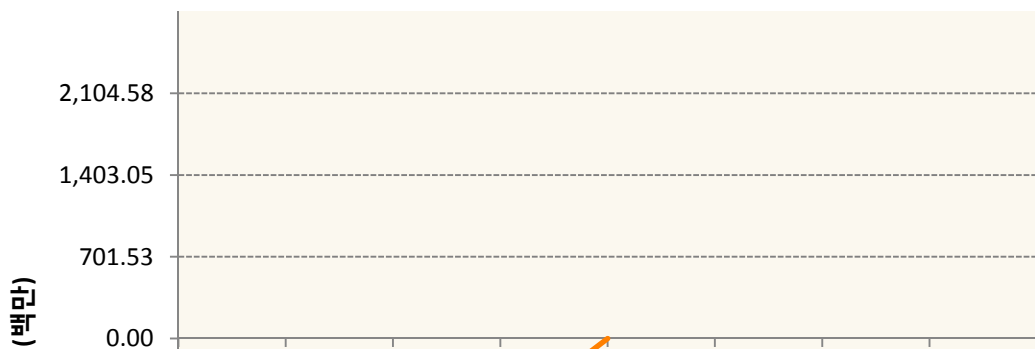


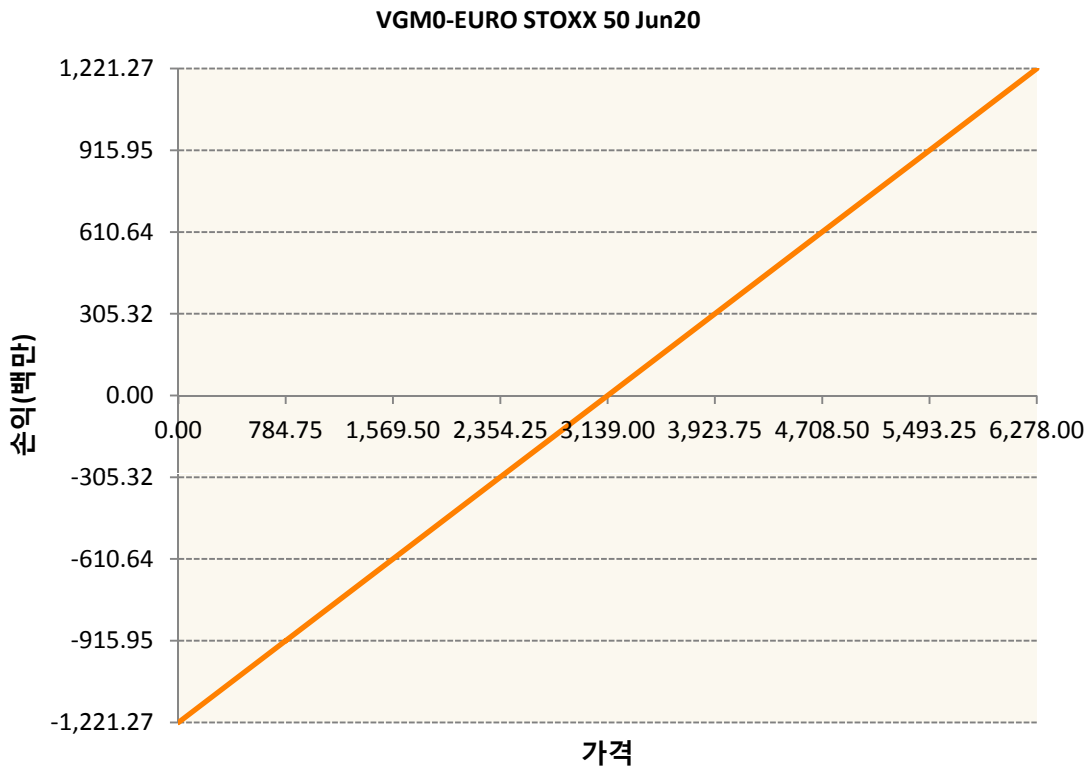
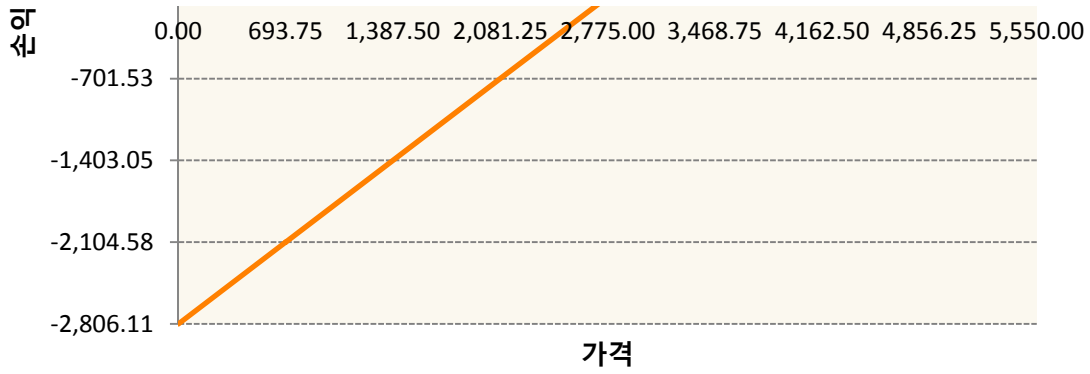


OESXM0-P2750-EURO STOXX 50



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)

1,033



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

(단위:백만원)

1,223



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

(단위:백만원)

107



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

(단위:백만원)

157

공시일	2020-06-16
기준일	2020-06-15

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1호

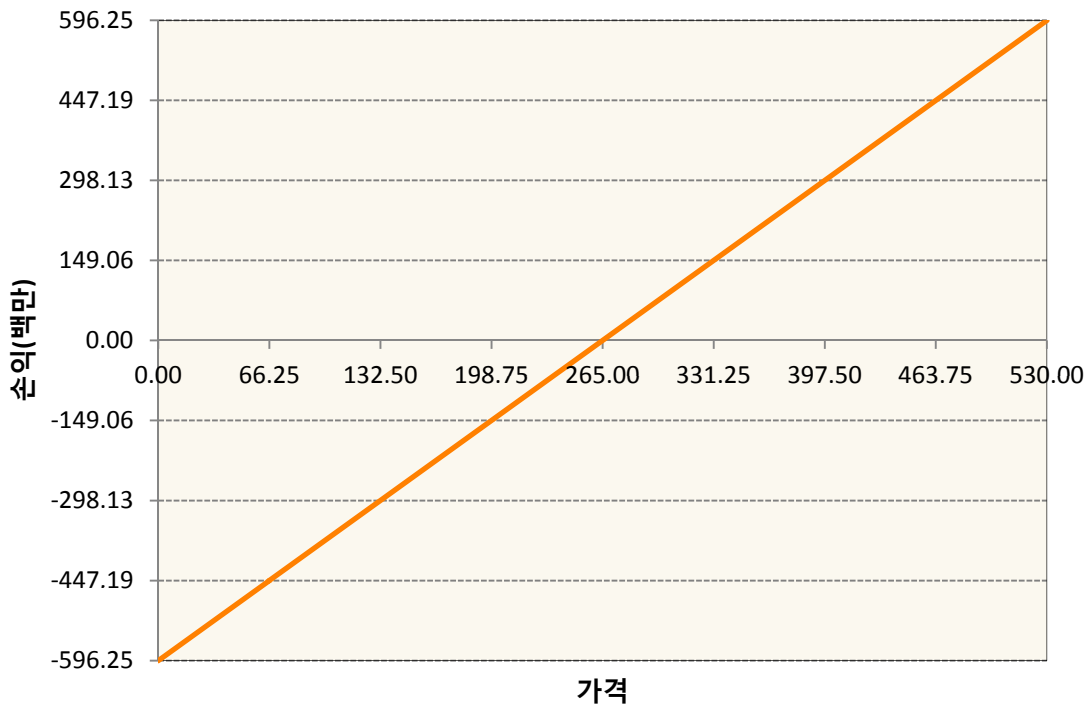
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	596	0	596	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009		2020-09 코스피200지수선물						48
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48	
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	16	16	16	16	16	16	16	
5.33%	32	32	32	32	32	32	32	
8.00%	48	48	48	48	48	48	48	

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

(단위:백만원)

74

공시일	2020-06-16
기준일	2020-06-15

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

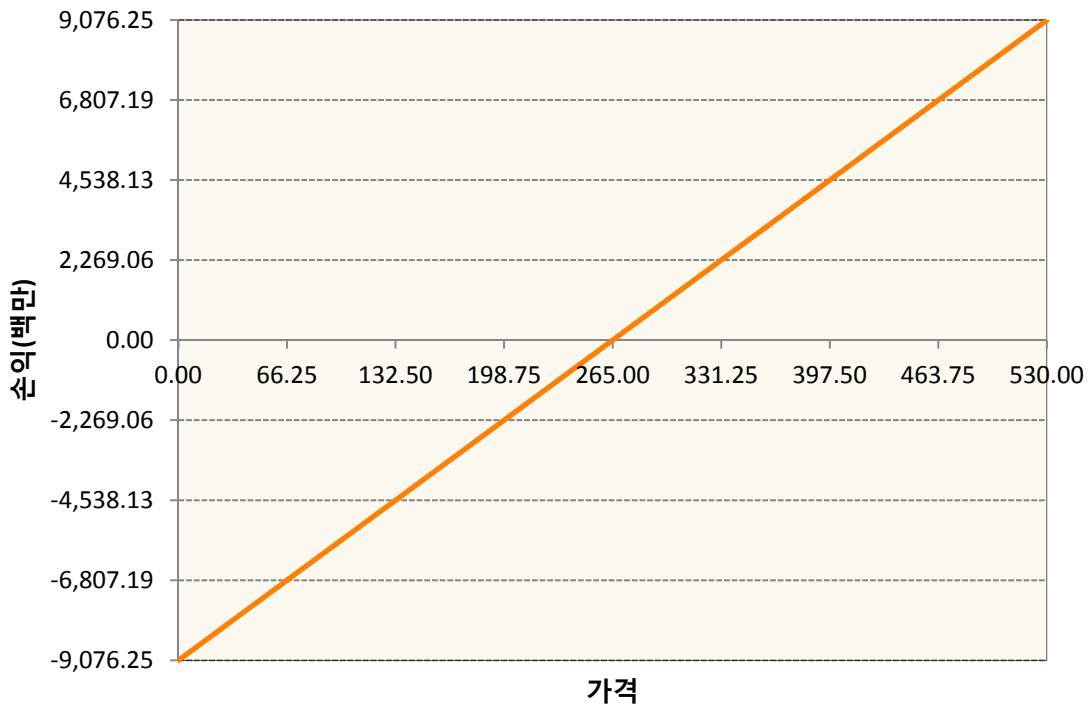
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

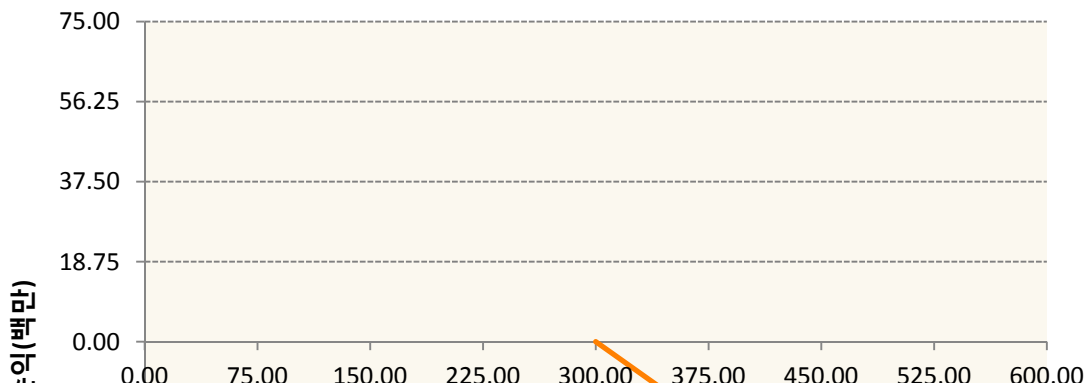
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,076	0	9,076	장내
누계	유가증권	옵션	3,247	18,864	-15,617	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물

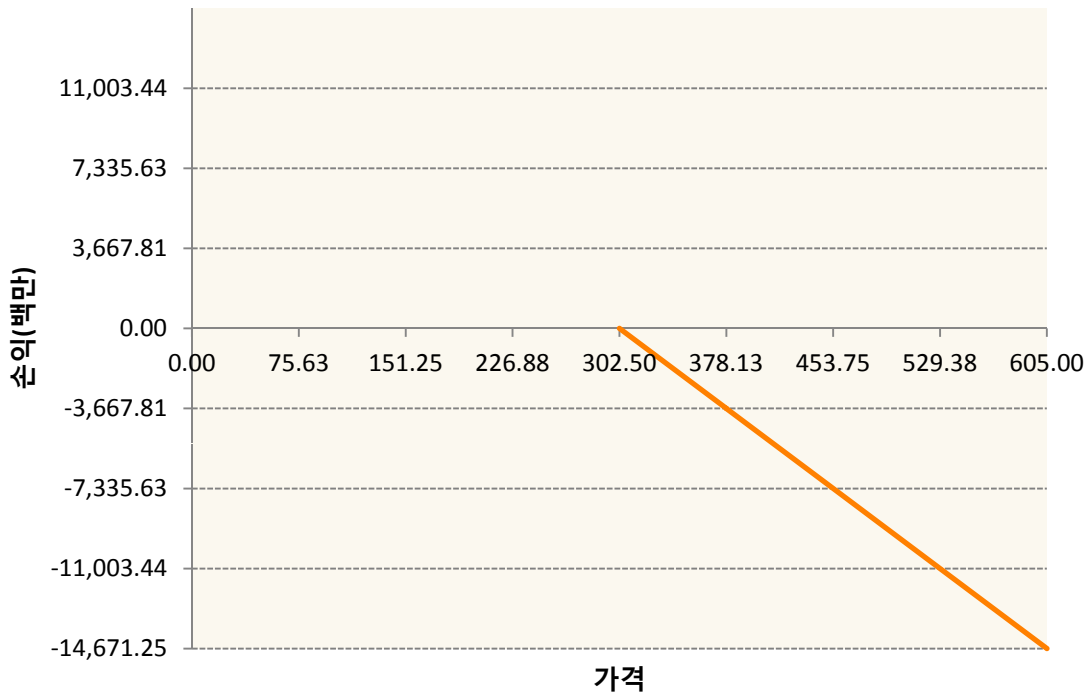


KR4201Q73003-2020-07 콜300

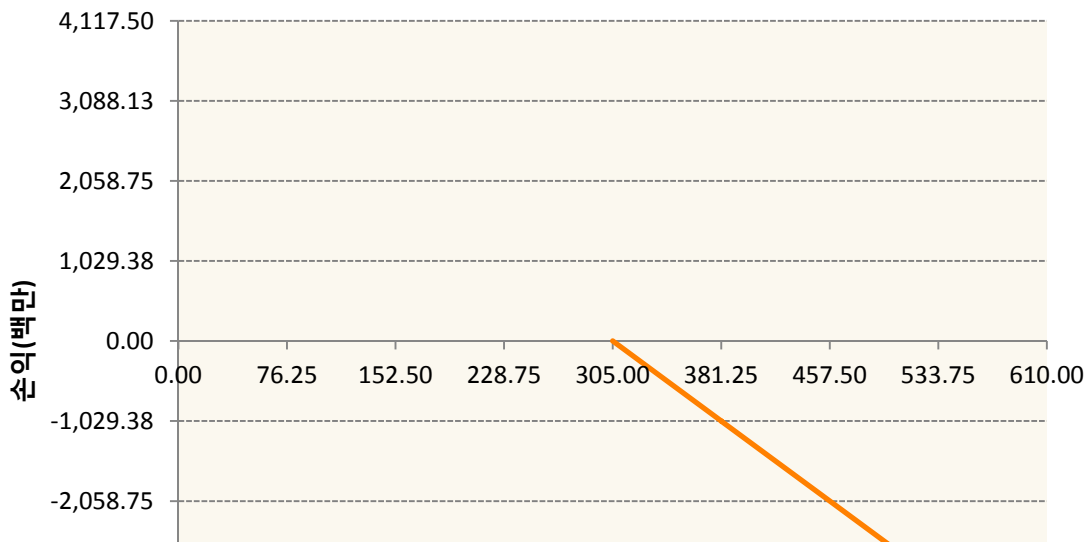


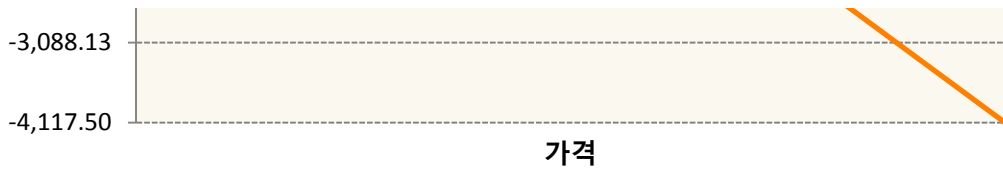


KR4201Q73029-2020-07 콜302.5

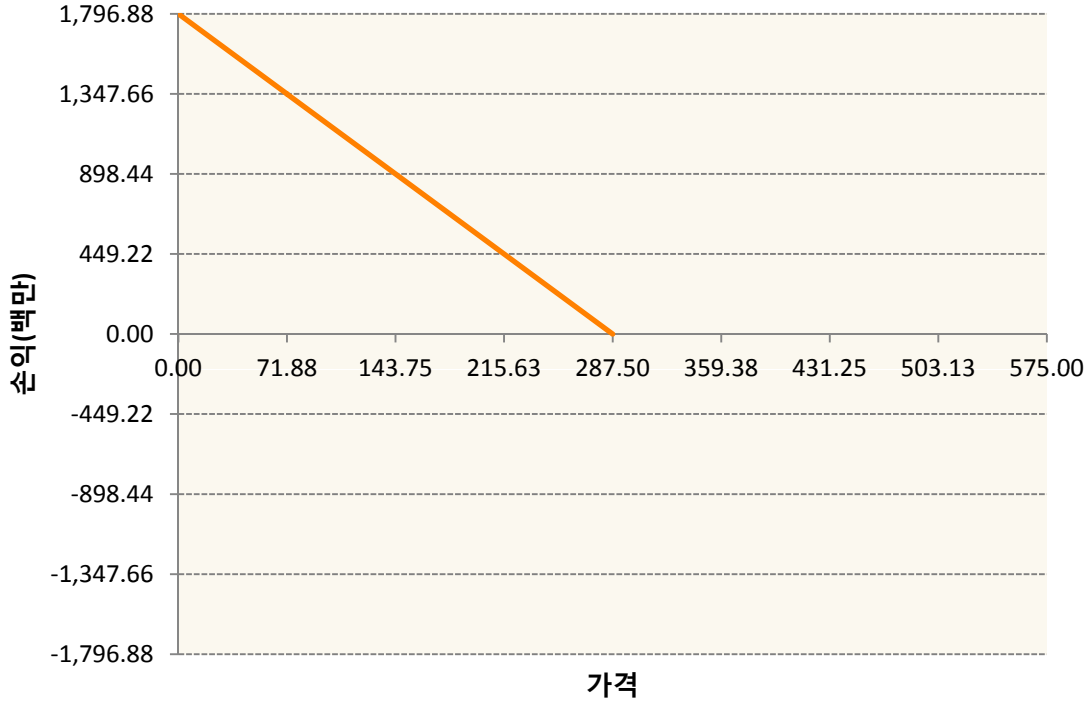


KR4201Q73052-2020-07 콜305

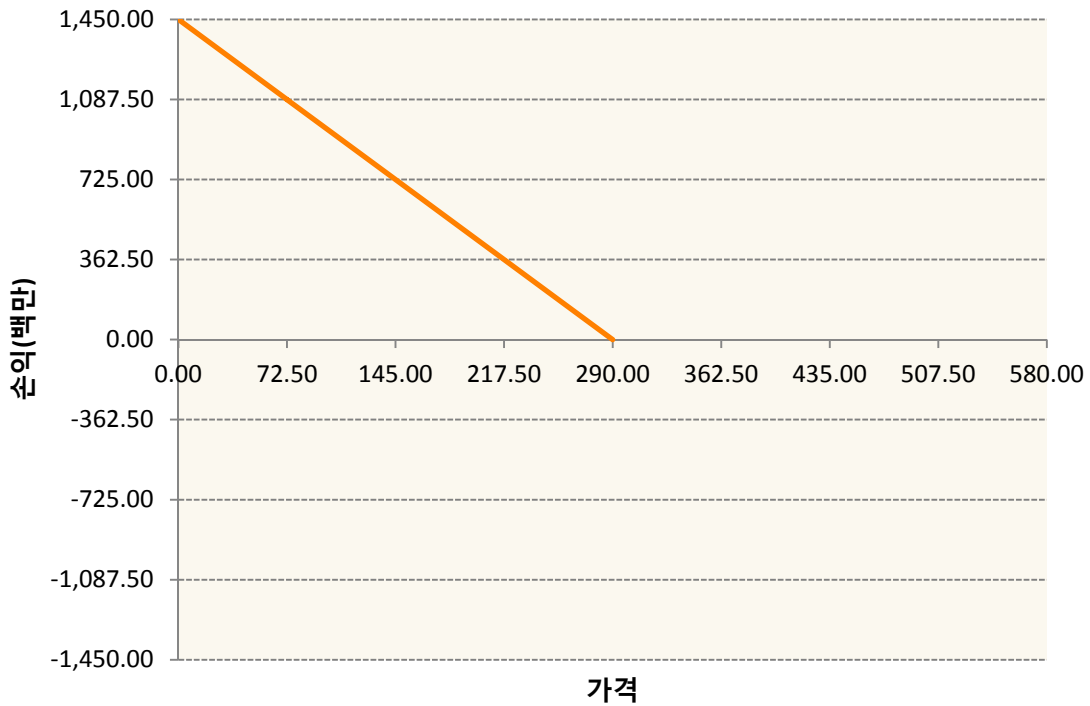




KR4301Q72870-2020-07 풋287.5



KR4301Q72904-2020-07 풋290



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101Q90009 2020-09 코스피200지수선물							734
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-734	-734	-734	-734	-734	-734	-734
-5.33%	-489	-489	-489	-489	-489	-489	-489
-2.67%	-245	-245	-245	-245	-245	-245	-245
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	245	245	245	245	245	245	245
5.33%	489	489	489	489	489	489	489
8.00%	734	734	734	734	734	734	734
KR4201Q73003 2020-07 콜300							2
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1	1	1	1	1	0	0
-5.33%	1	1	1	1	0	0	0
-2.67%	1	1	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	0	0	0	0	-1	-1	-1
5.33%	0	0	-1	-1	-1	-1	-2
8.00%	-1	-1	-1	-2	-2	-2	-2
KR4201Q73029 2020-07 콜302.5							451
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	139	133	124	112	97	79	58
-5.33%	131	121	106	88	67	42	15
-2.67%	116	99	77	52	24	-8	-42
0%	89	63	33	0	-36	-74	-115
2.67%	44	9	-30	-71	-115	-160	-206
5.33%	-25	-69	-116	-165	-215	-266	-318
8.00%	-122	-175	-229	-284	-339	-394	-451
KR4201Q73052 2020-07 콜305							118
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	34	33	31	28	24	19	14
-5.33%	33	30	27	22	17	10	3
-2.67%	29	25	19	13	6	-3	-11
0%	23	16	9	0	-9	-20	-30
2.67%	12	3	-7	-18	-30	-42	-54
5.33%	-5	-17	-29	-42	-56	-69	-83
8.00%	-29	-43	-58	-73	-88	-103	-118

KR4301Q72870		2020-07 풋287.5						122
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	114	115	115	117	118	120	122	
-5.33%	71	72	73	75	77	80	83	
-2.67%	29	31	33	36	39	42	46	
0%	-11	-7	-4	0	4	8	13	
2.67%	-46	-41	-37	-32	-27	-22	-17	
5.33%	-76	-70	-65	-60	-54	-49	-44	
8.00%	-99	-94	-88	-82	-77	-71	-66	
KR4301Q72904		2020-07 풋290						99
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	94	94	94	95	96	97	99	
-5.33%	59	59	60	62	63	65	67	
-2.67%	24	26	28	30	32	34	37	
0%	-8	-5	-3	0	3	6	10	
2.67%	-37	-34	-30	-27	-23	-19	-15	
5.33%	-62	-58	-54	-50	-46	-42	-37	
8.00%	-83	-79	-74	-70	-65	-61	-56	

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

(단위:백만원)

1,663

공시일	2020-06-16
기준일	2020-06-15

## 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	156,189	0	156,189	

### 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	2020-06-16
기준일	2020-06-15

## 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	103,466	0	103,466	

### 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	2020-06-16
기준일	2020-06-15

## 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	465,247	0	465,247	
누계	통화	선도	0	451,622	-451,622	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J027 KRW/USD 22-06-20E	1,498
FX21020J028 KRW/USD 22-06-20E	1,946
FX21020J039 KRW/USD 24-07-20E	2,189
FX21020J043 KRW/USD 24-07-20E	1,751
FX21020J043 KRW/USD 24-07-20E	1,946
FX21020K01 KRW/USD 22-06-20E	681
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	2,374
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	973
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,021
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,615
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	3,405
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	6,907
FX21020M00 KRW/USD 26-08-20E	584
FX21020M01 KRW/USD 26-08-20E	4,767
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	2,023
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	2,451

IE00BD8RGM75

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

**18,663**



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

(단위:백만원)

214

공시일	2020-06-16
기준일	2020-06-15

## 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	7,669	0	7,669	
누계	통화	선도	0	7,551	-7,551	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020K04 KRW/USD 27-07-20E	39
FX21020K04 KRW/USD 27-07-20E	97
FX21020K04 KRW/USD 30-06-20E	37
FX21020K04 KRW/USD 20-07-20E	78
FX21020M00 KRW/USD 20-07-20E	10
FX21020M01 KRW/USD 20-07-20E	15
FX21020M02 KRW/USD 06-07-20E	49
FX21020M03 KRW/USD 15-07-20E	224
FX21020M04 KRW/USD 20-07-20E	56
IE00BD8RGM75	

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

<b>312</b>
------------

공시일	2020-06-16
기준일	2020-06-15

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

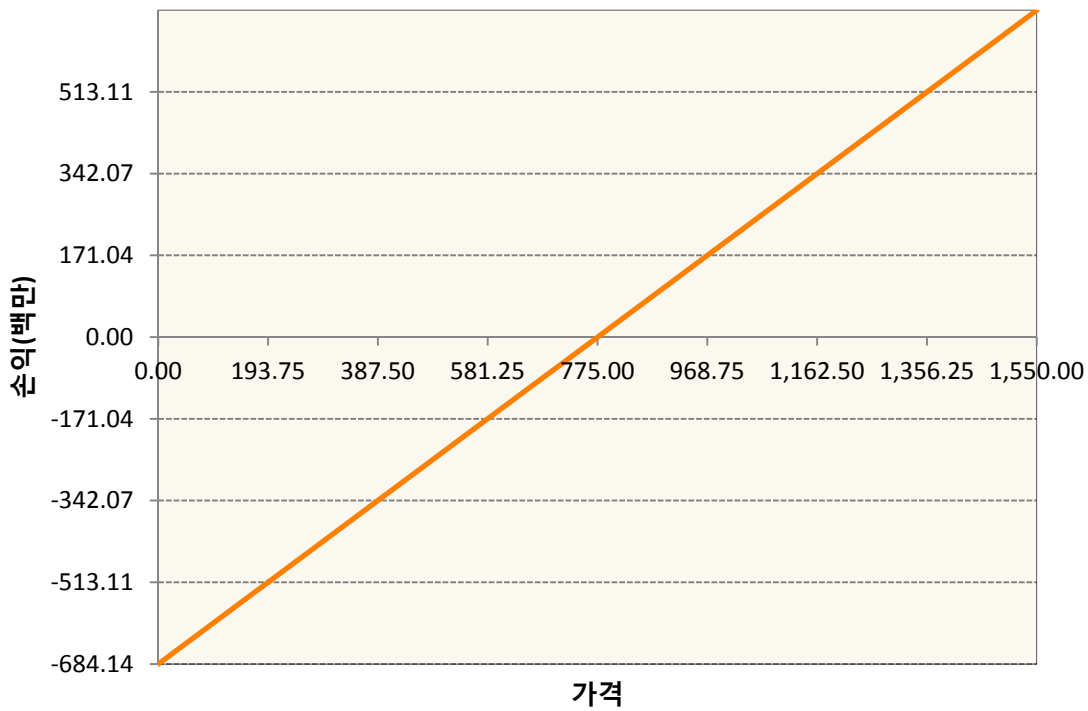
### 1. 계약금액

(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	684	0	684	
누계	유가증권	스왑	991	0	991	장외
누계	통화	선도	210	894	-683	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	55

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

(단위:백만원)

**175**

공시일	2020-06-16
기준일	2020-06-15

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

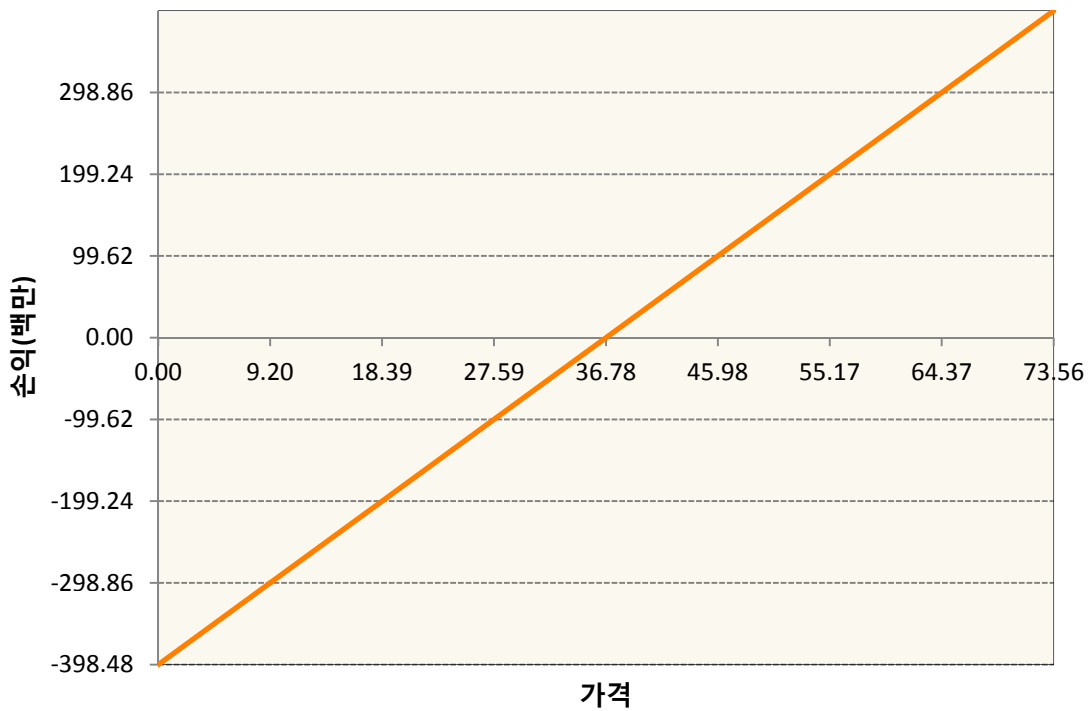
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

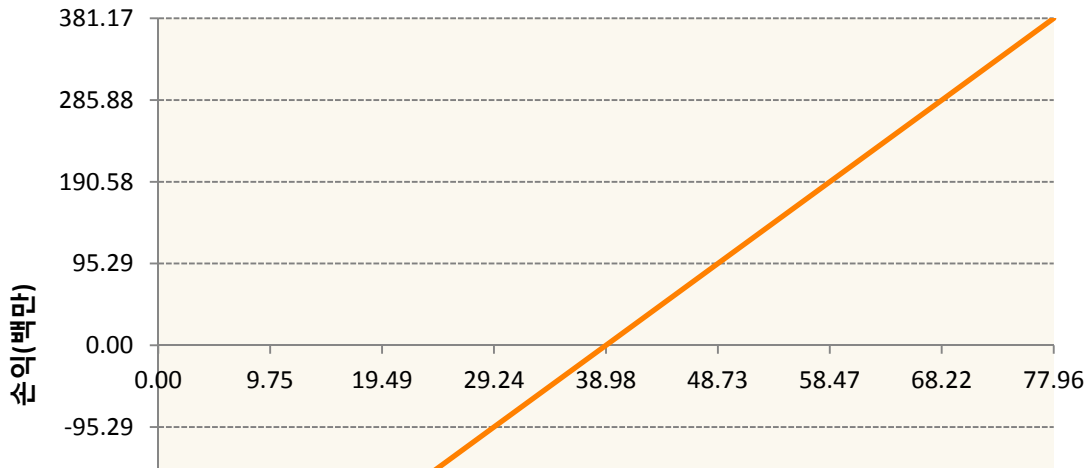
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,864	365	1,499	

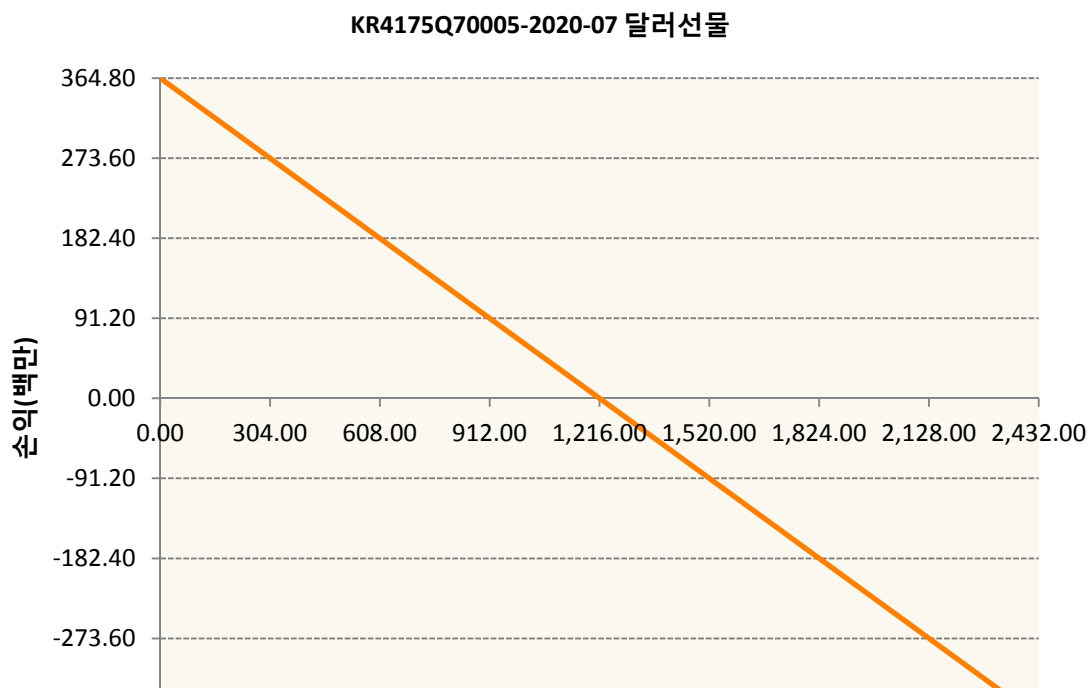
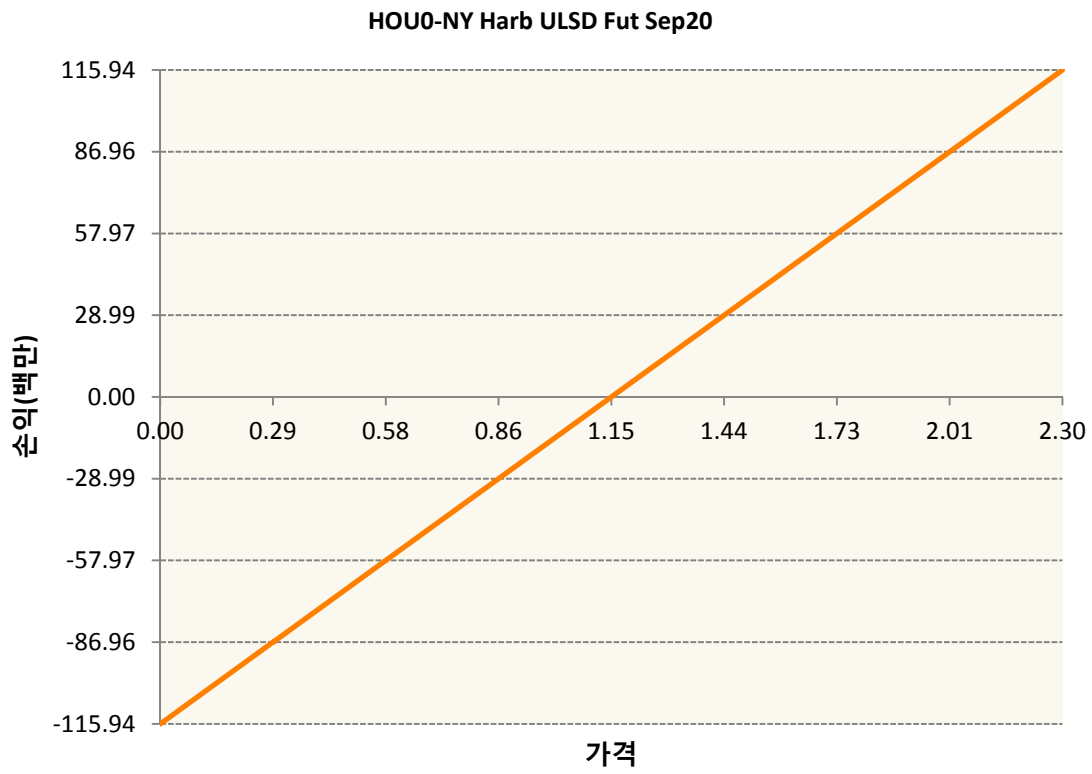
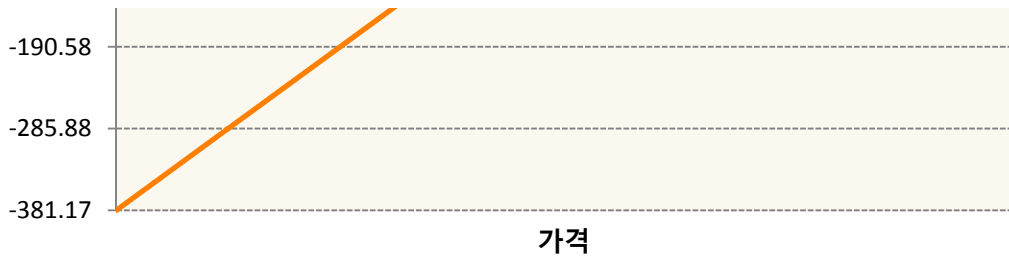
### 2. 만기시점의 손익구조

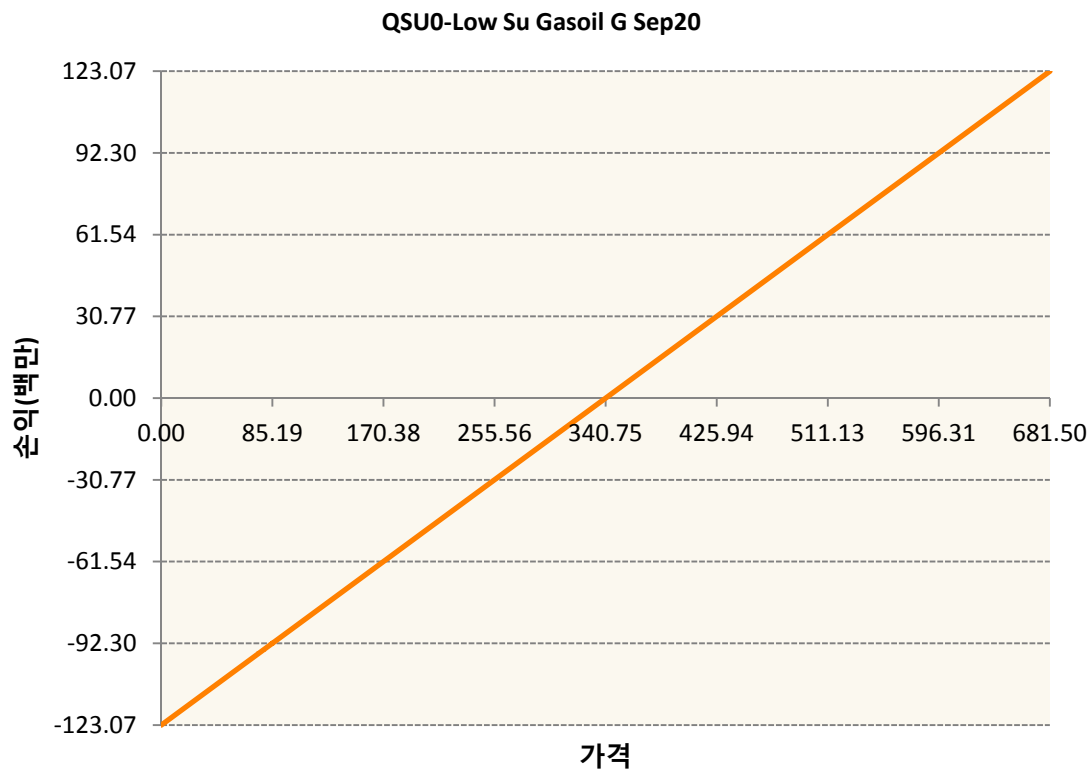
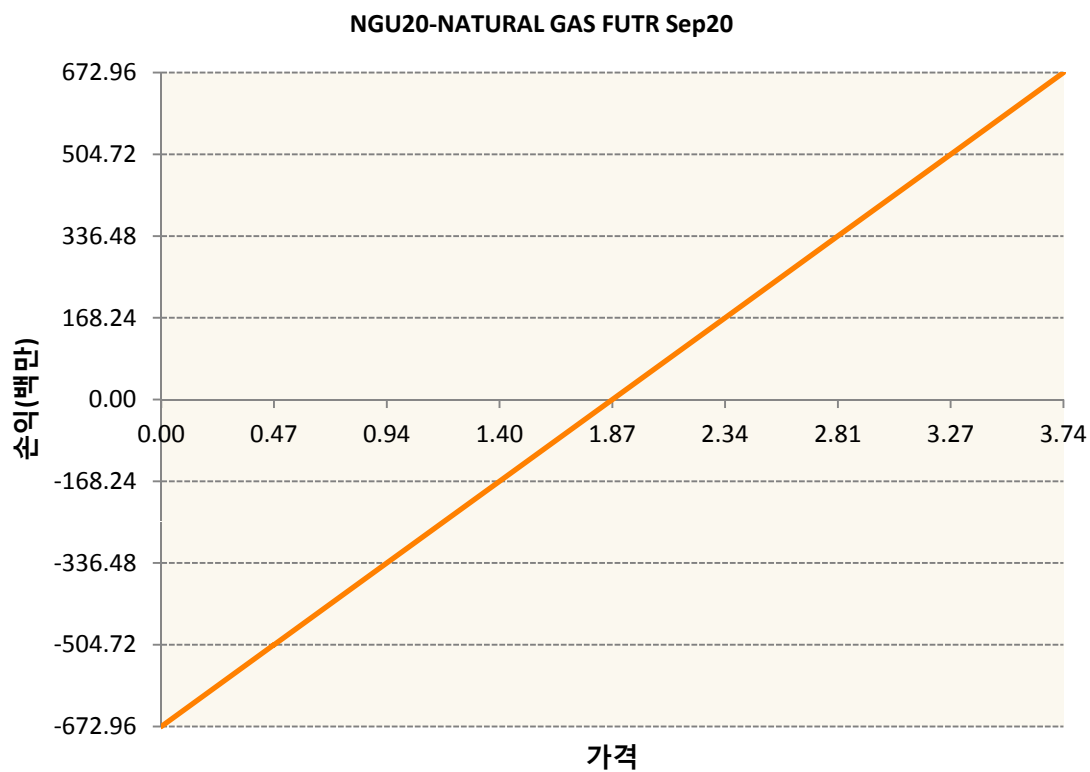
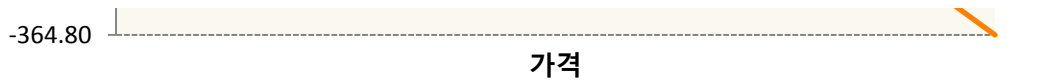
CLU0-WTI CRUDE FUTURE Sep20



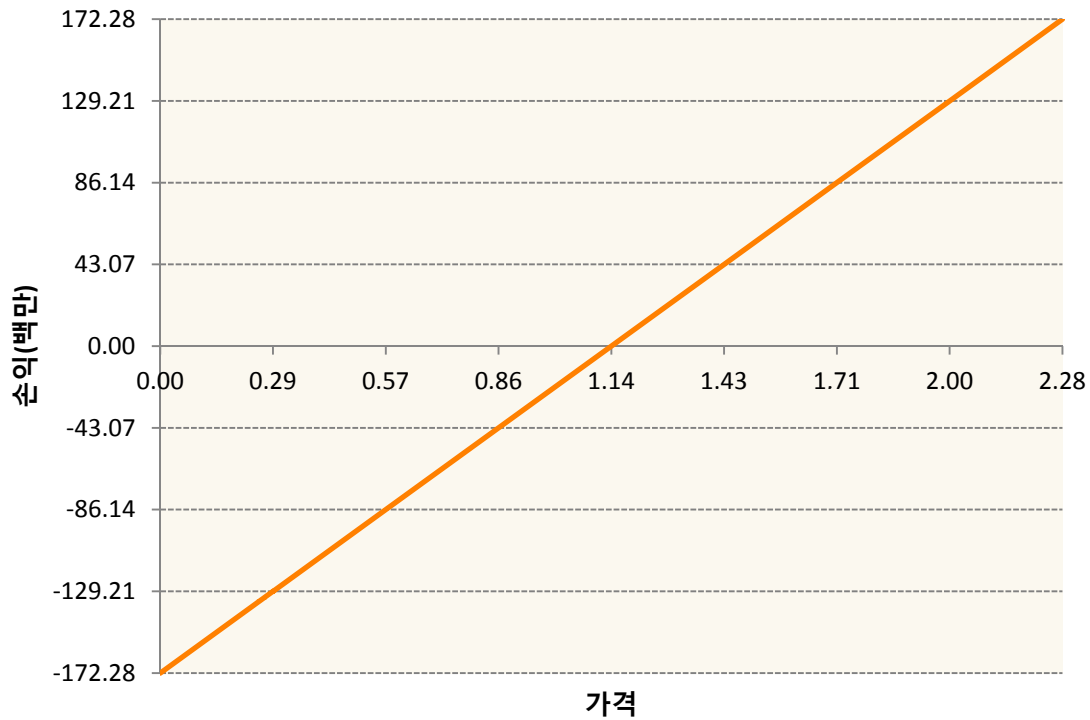
COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20







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
KR4175Q70C	2020-07 달러선물	29
NGU20	NATURAL GAS FUTR Sep20	54
QSU0	Low Su Gasoil G Sep20	10
XBU0	GASOLINE RBOB FUT Sep20	14

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

(단위:백만원)

931

공시일	2020-06-16
기준일	2020-06-15

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

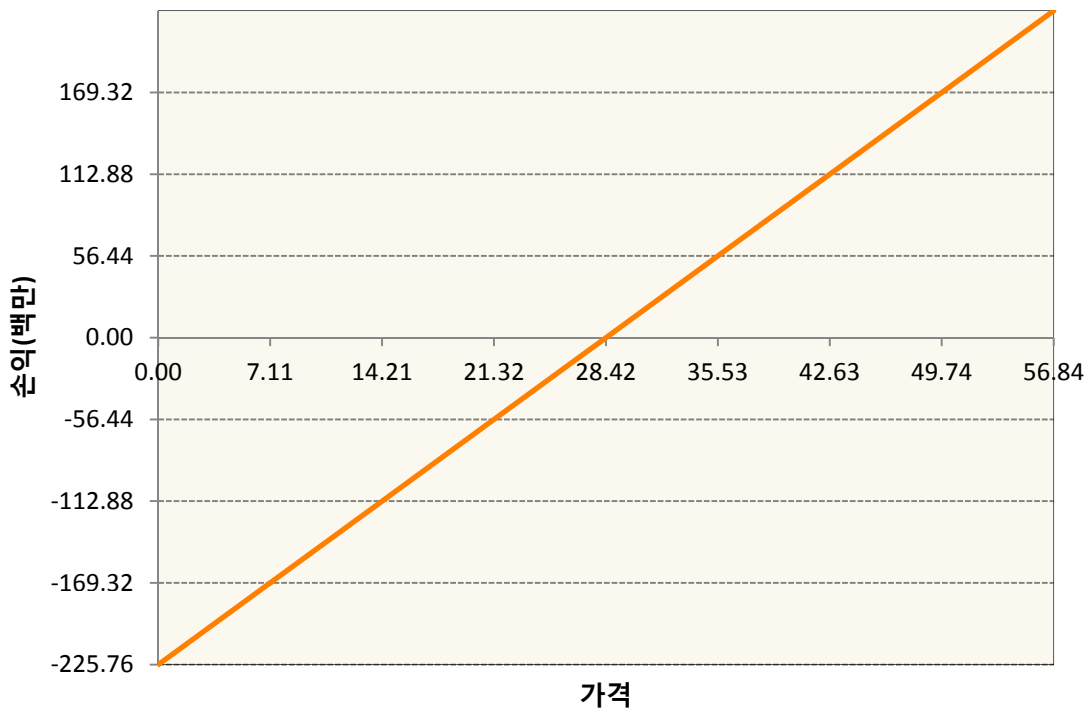
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

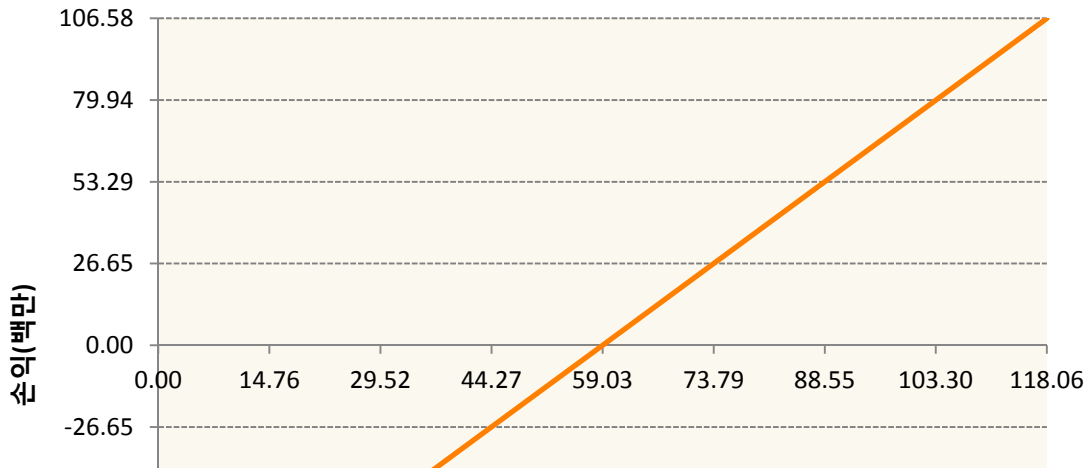
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,579	73	2,506	

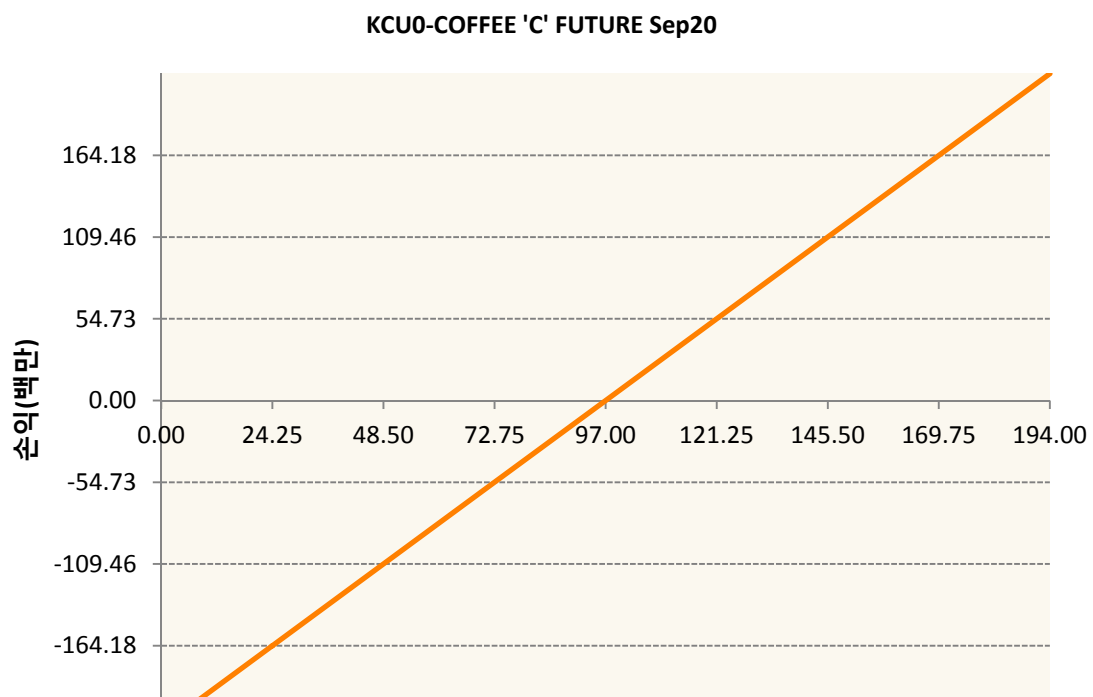
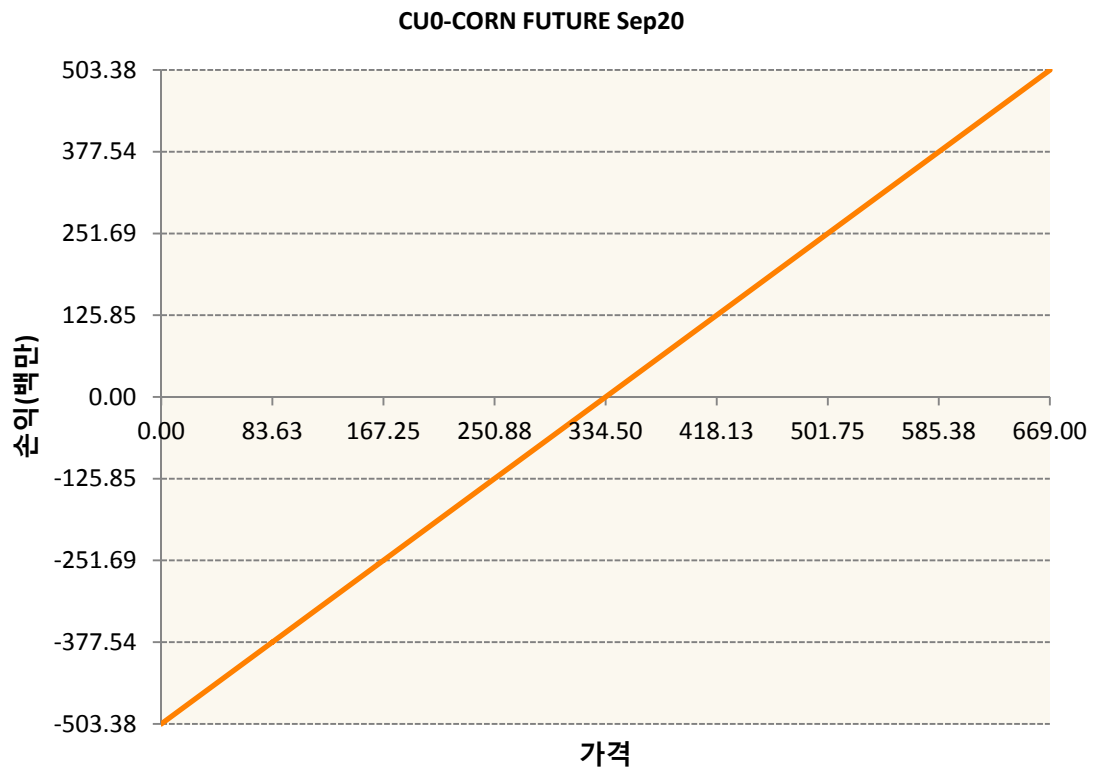
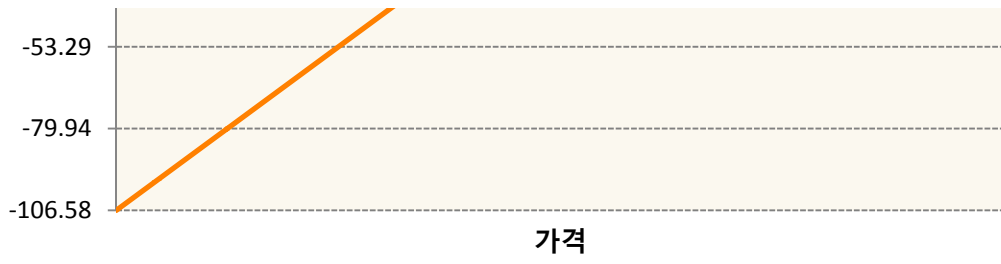
### 2. 만기시점의 손익구조

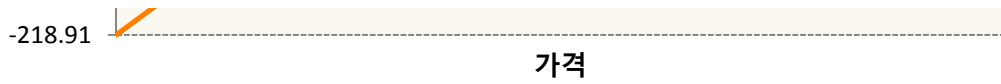
BOZ0-SOYBEAN OIL FUTR Dec20



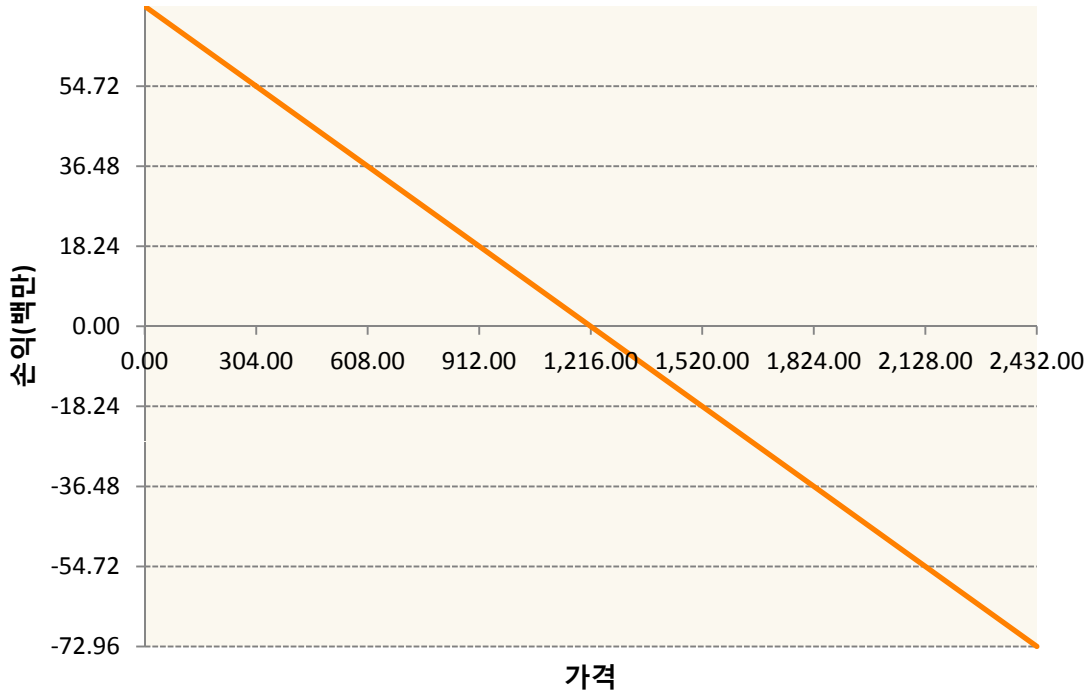
CTZ0-COTTON NO.2 FUTR Dec20



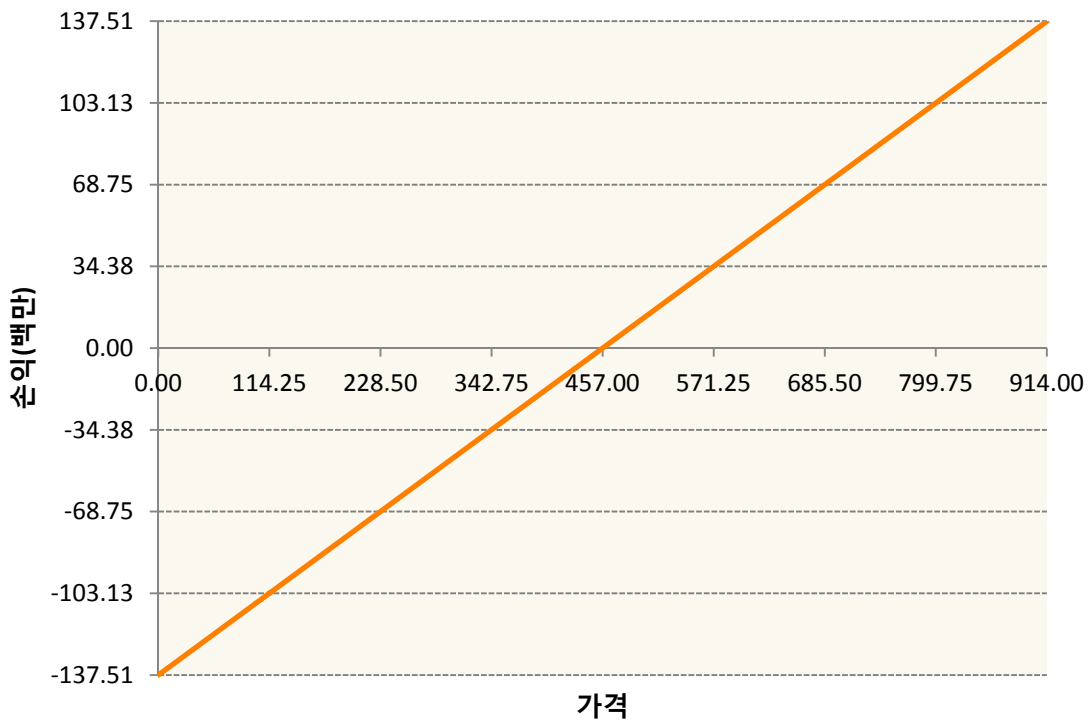




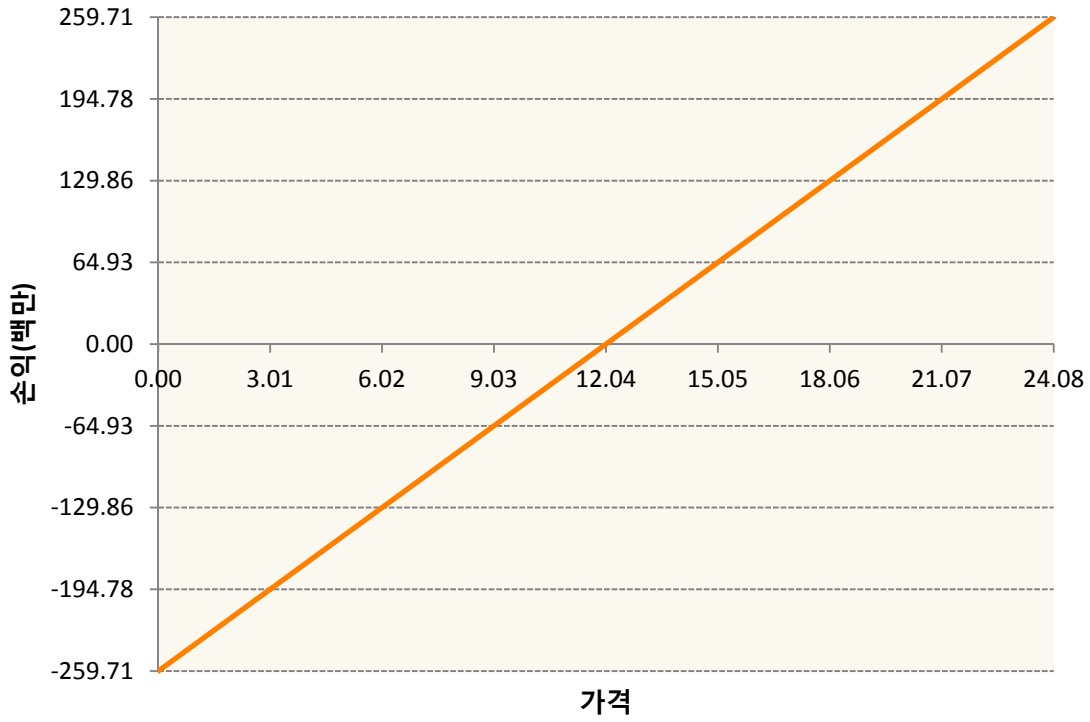
KR4175Q70005-2020-07 달러선물



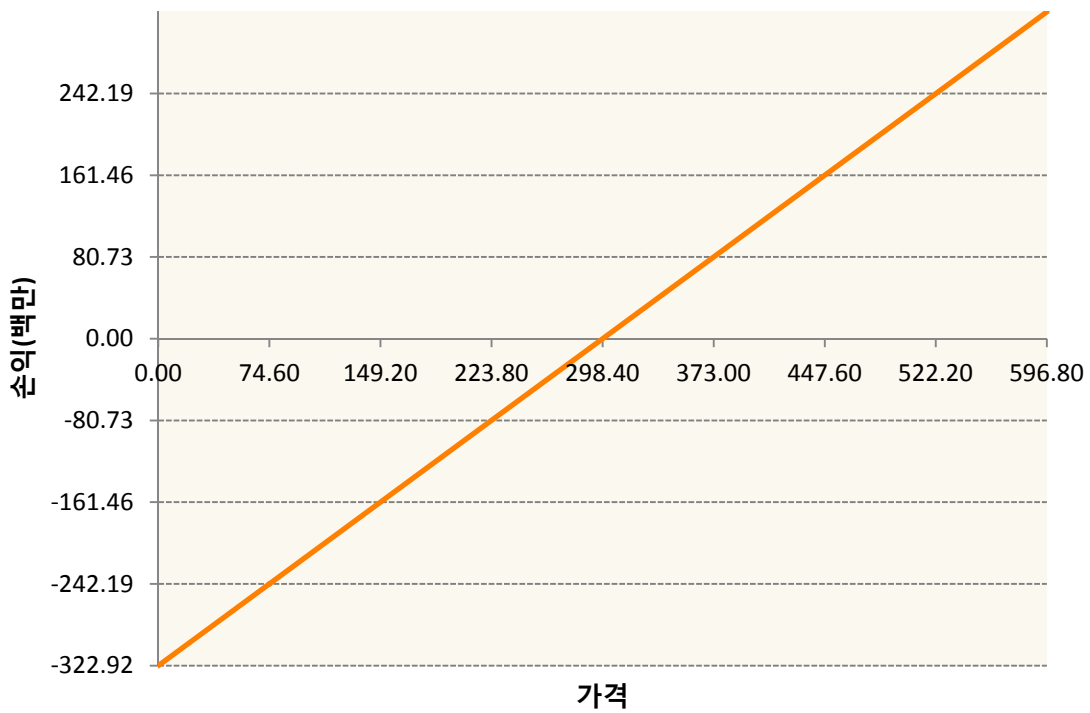
KWU0-KC HRW WHEAT FUT Sep20



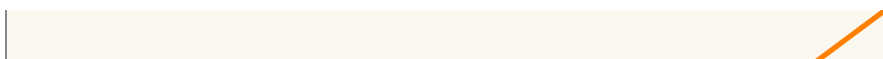
SBV0-Sugar Oct20

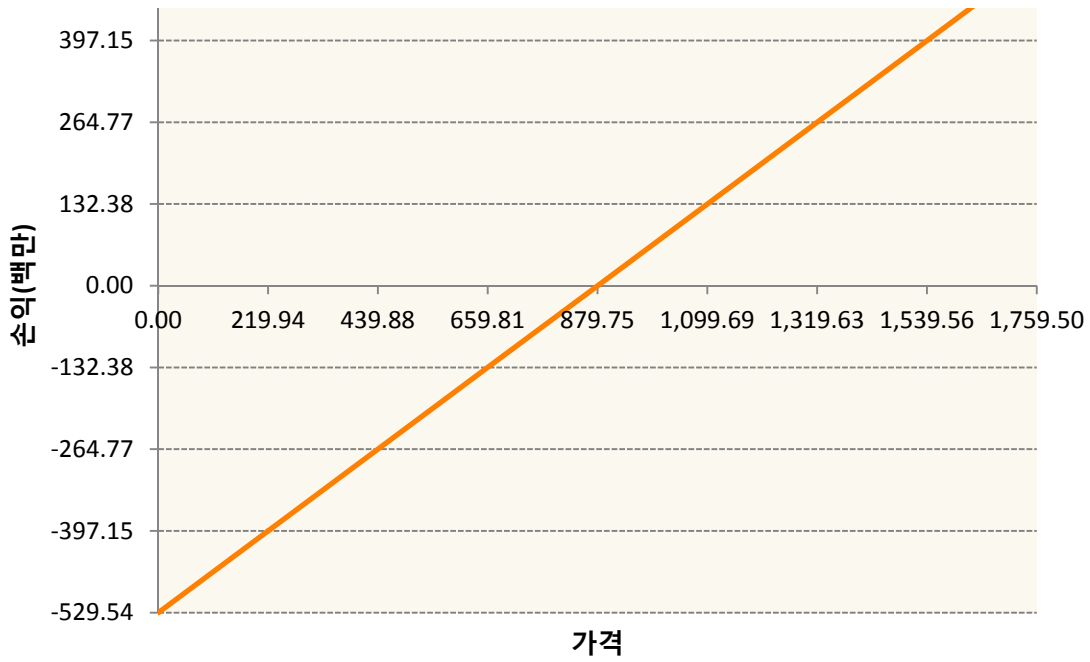


SMZ0-SOYBEAN MEAL FUTR Dec20

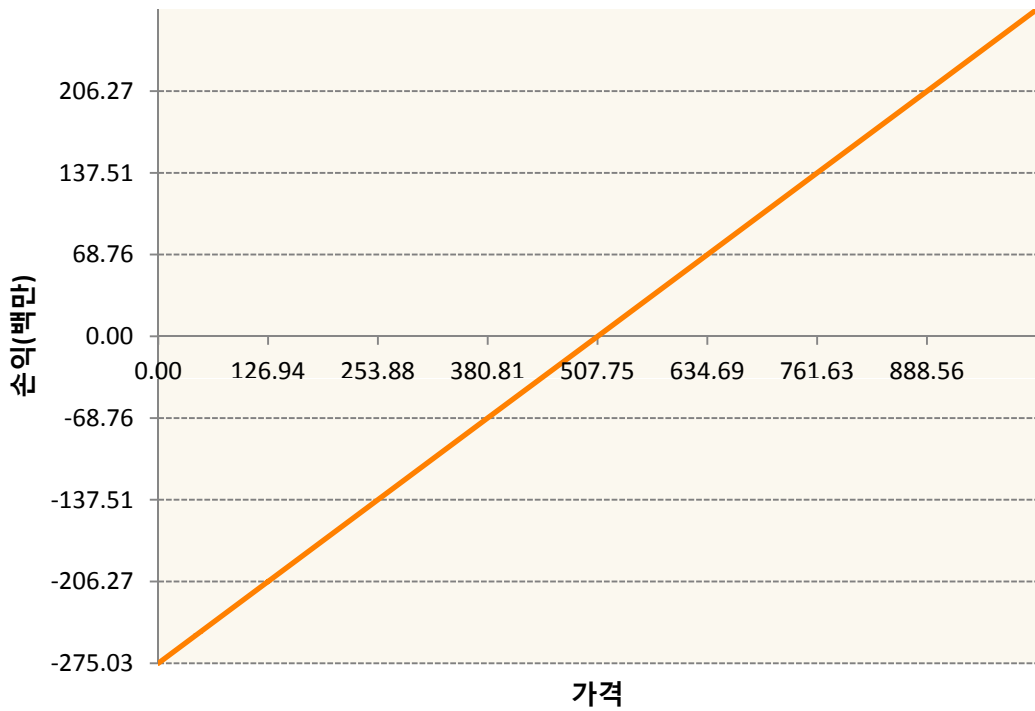


SX0-SOYBEAN FUTURE Nov20





WU0-WHEAT FUTURE(CBT) Sep20



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
KR4175Q70C	2020-07 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)

**241**