

공시일	2020-06-18
기준일	2020-06-17

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	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	2020-06-18
기준일	2020-06-17

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

1,071

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,281

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-06-18
기준일	2020-06-17

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

599

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

873

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-06-18
기준일	2020-06-17

유로인덱스모(주식-파생형)

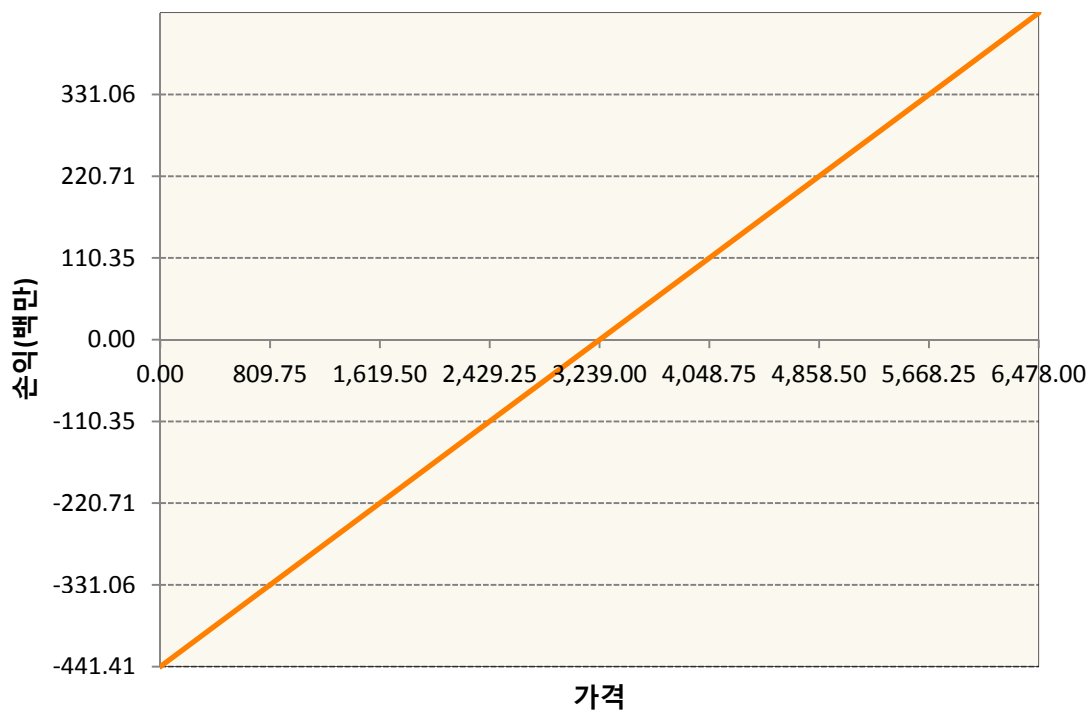
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	441	0	441	

2. 만기시점의 손익구조

VGM0-EURO STOXX 50 Jun20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	35
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

47

공시일	2020-06-18
기준일	2020-06-17

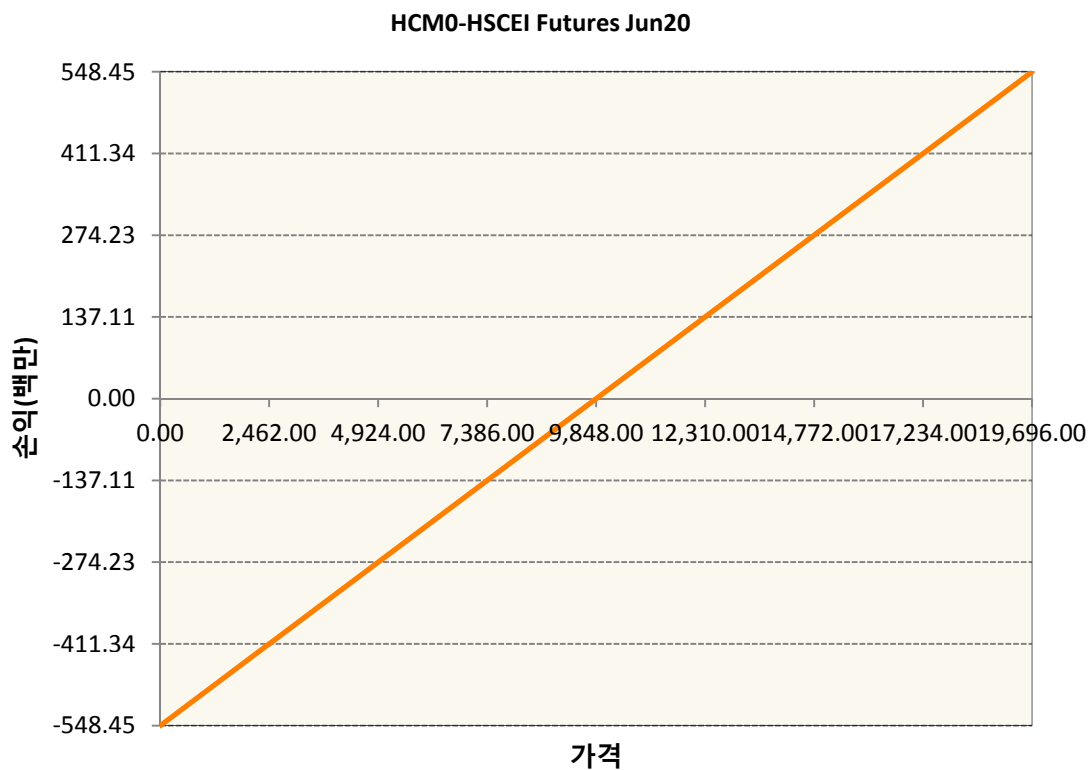
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	548	0	548	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

48

공시일	2020-06-18
기준일	2020-06-17

커버드콜모(주식혼합-파생형)

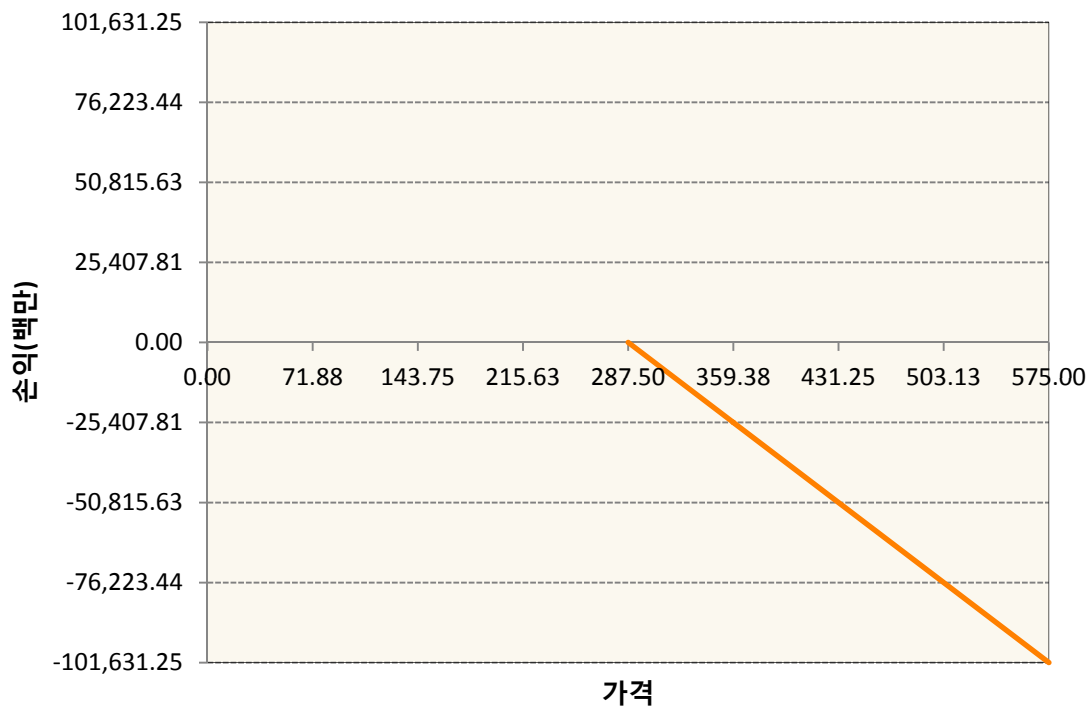
1. 계약금액

(단위:백만원)

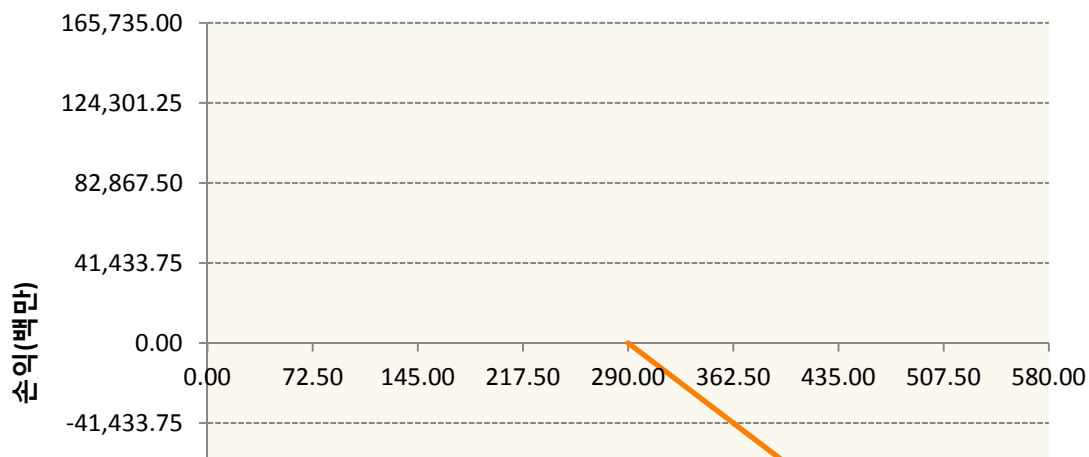
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	367,991	-367,991	장내

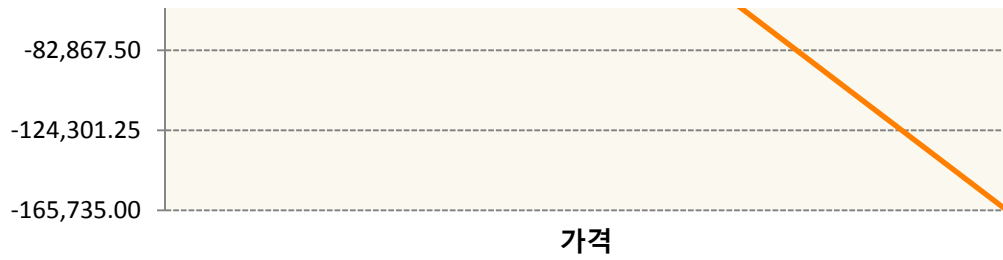
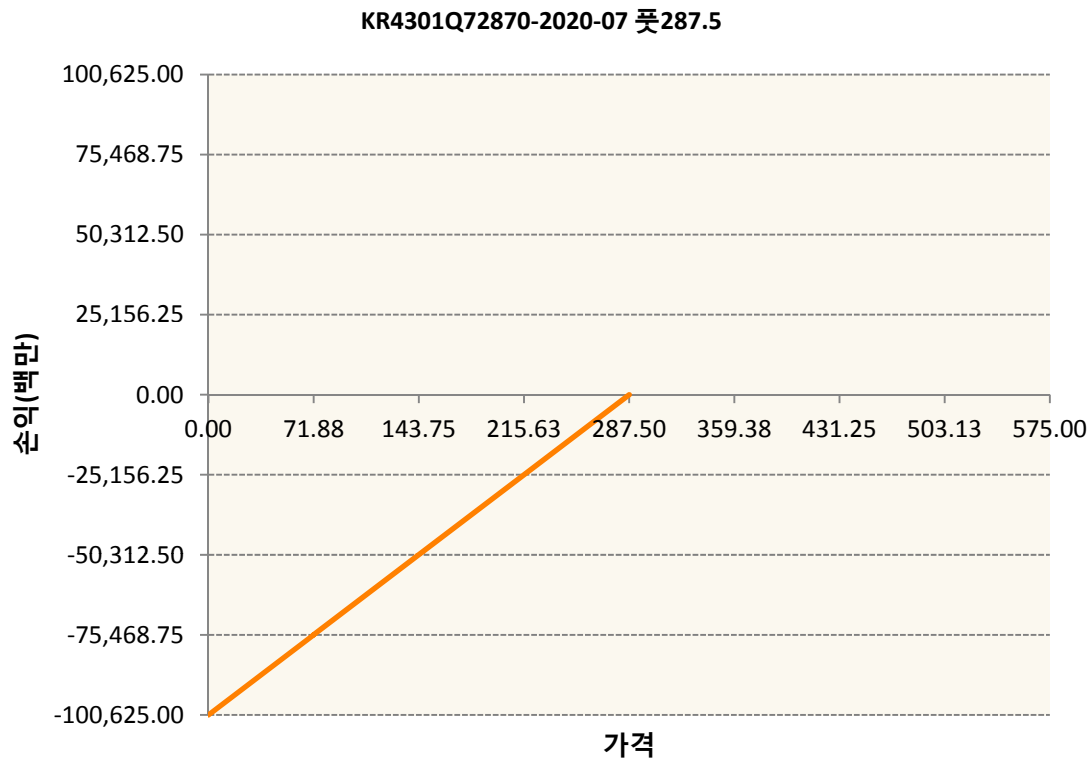
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q72872-2020-07 콜287.5



KR4201Q72906-2020-07 콜290





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q72872			2020-07 콜287.5				5,873
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,392	3,179	2,943	2,688	2,417	2,133	1,839
-5.33%	2,916	2,631	2,329	2,016	1,692	1,361	1,023
-2.67%	2,189	1,841	1,486	1,125	760	392	22
0%	1,167	779	390	0	-390	-781	-1,172
2.67%	-171	-568	-966	-1,364	-1,762	-2,160	-2,557
5.33%	-1,816	-2,192	-2,574	-2,959	-3,347	-3,737	-4,128
8.00%	-3,735	-4,067	-4,412	-4,767	-5,130	-5,499	-5,873
KR4201Q72906			2020-07 콜290				9,189
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,061	4,750	4,398	4,012	3,598	3,160	2,702

-5.33%	4,397	3,967	3,507	3,023	2,520	2,002	1,471
-2.67%	3,357	2,818	2,263	1,696	1,120	537	-53
0%	1,862	1,245	624	0	-626	-1,254	-1,883
2.67%	-134	-782	-1,431	-2,079	-2,727	-3,375	-4,022
5.33%	-2,630	-3,261	-3,896	-4,534	-5,175	-5,818	-6,463
8.00%	-5,587	-6,158	-6,744	-7,343	-7,951	-8,567	-9,189
KR4301Q72870 2020-07 풋287.5							6,223
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,373	-5,471	-5,590	-5,727	-5,879	-6,045	-6,223
-5.33%	-3,008	-3,174	-3,356	-3,553	-3,760	-3,977	-4,201
-2.67%	-901	-1,136	-1,379	-1,629	-1,884	-2,143	-2,406
0%	850	568	284	0	-285	-571	-857
2.67%	2,189	1,898	1,606	1,314	1,022	730	437
5.33%	3,123	2,862	2,594	2,322	2,046	1,767	1,485
8.00%	3,716	3,509	3,288	3,056	2,813	2,564	2,308

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

(단위:백만원)

18,056

공시일	2020-06-18
기준일	2020-06-17

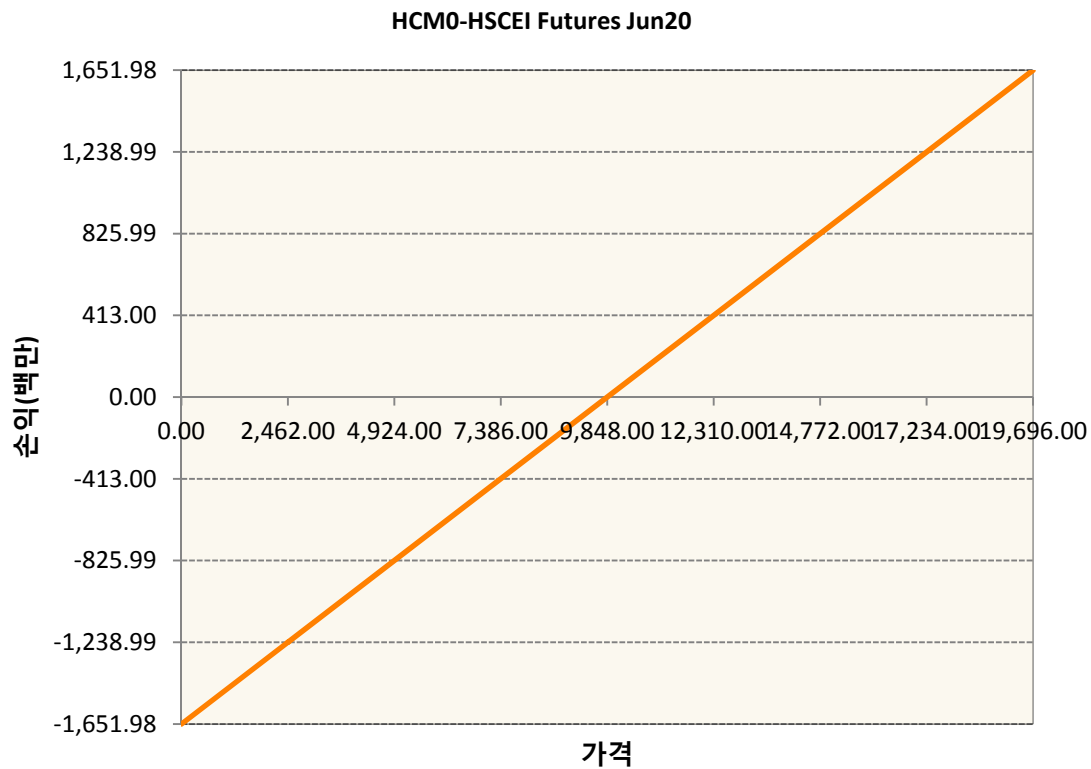
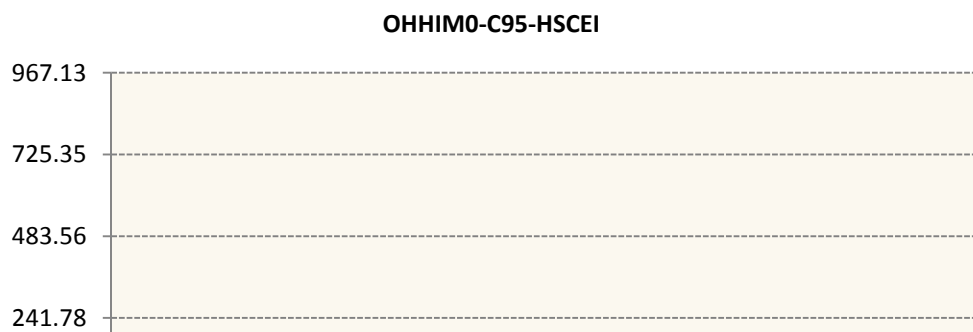
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

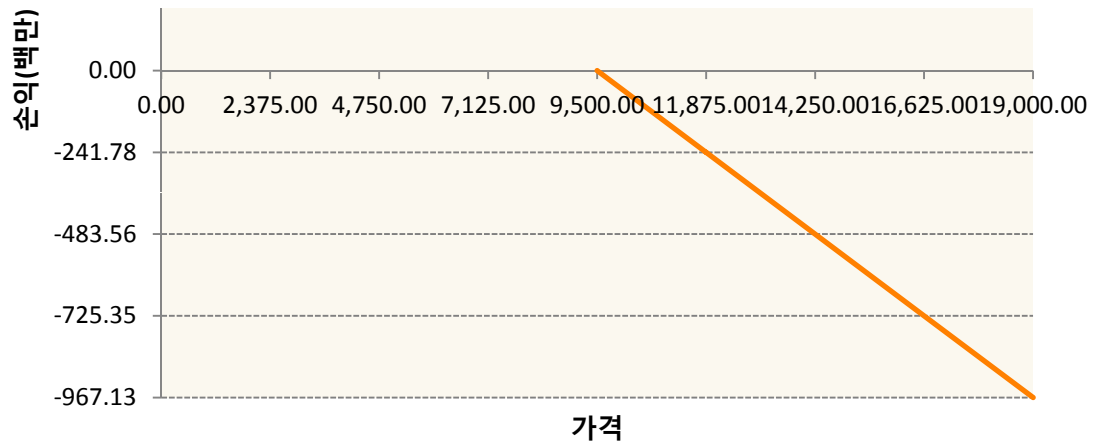
1. 계약금액

(단위:백만원)

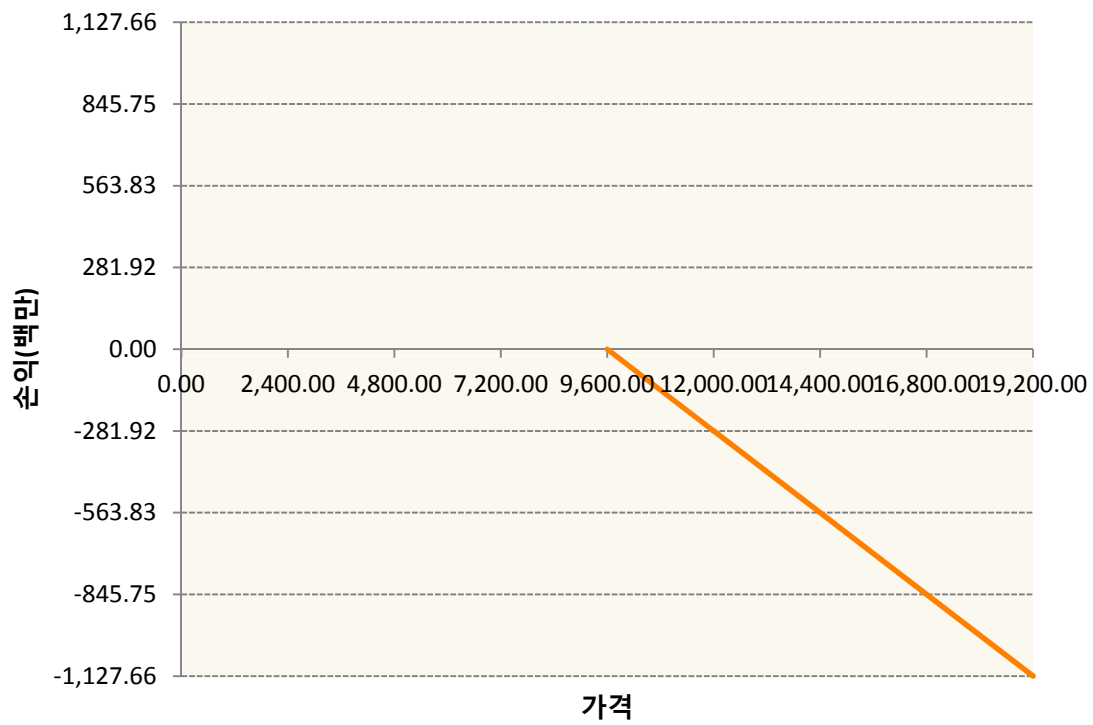
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,652	0	1,652	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,265	-4,265	장내
누계	통화	선도	0	1,516	-1,516	장외

2. 만기시점의 손익구조

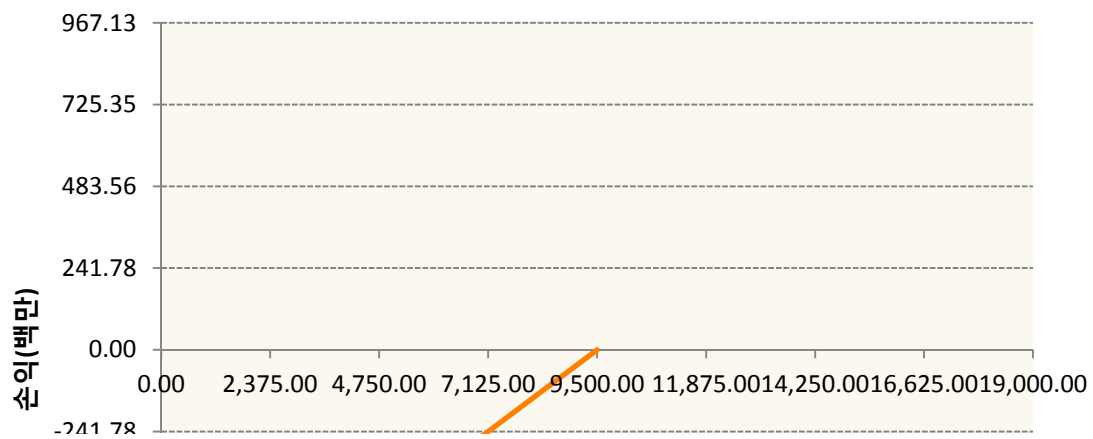


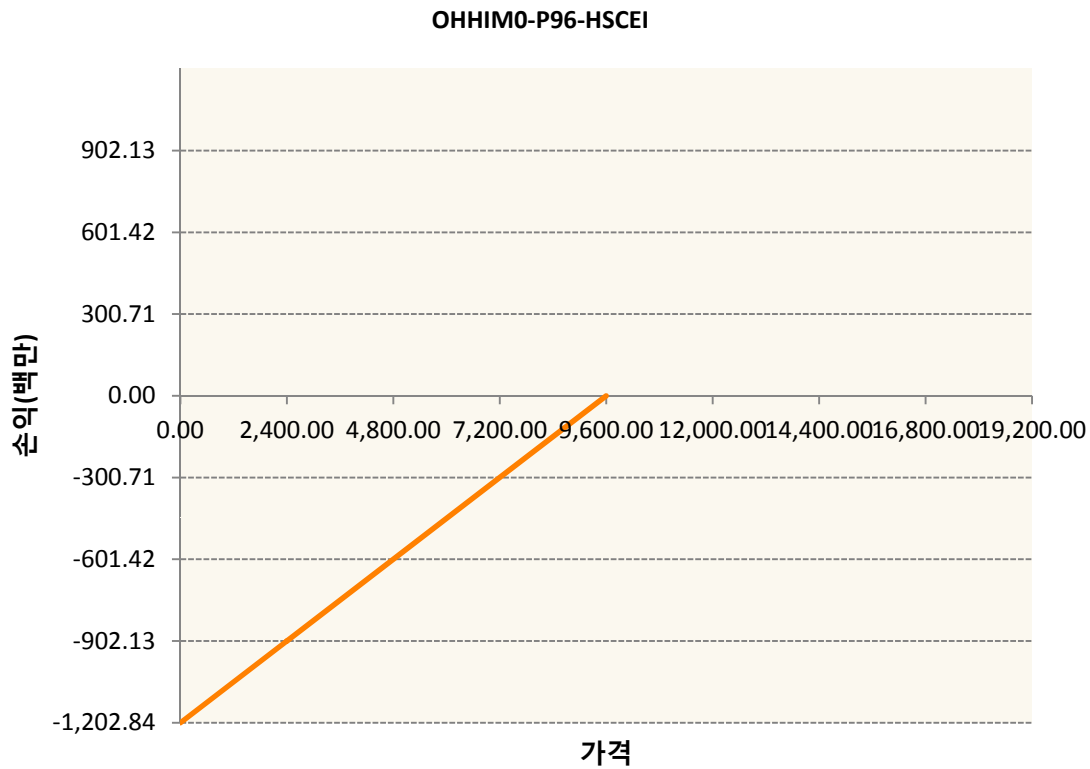


OHHIM0-C96-HSCEI



OHHIM0-P95-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E		121
HCM0 HSCEI Futures Jun20		132
OHHIM0-C9 HSCEI		77
OHHIM0-C9 HSCEI		90
OHHIM0-P9 HSCEI		77
OHHIM0-P9 HSCEI		96

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	576

공시일	2020-06-18
기준일	2020-06-17

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

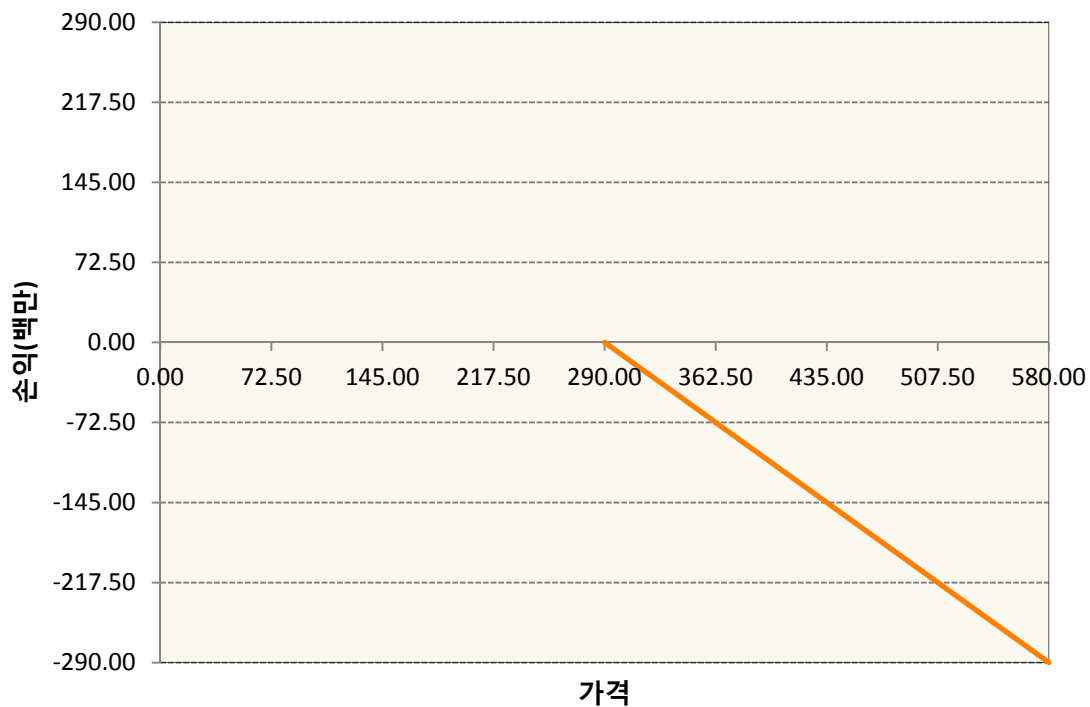
1. 계약금액

(단위:백만원)

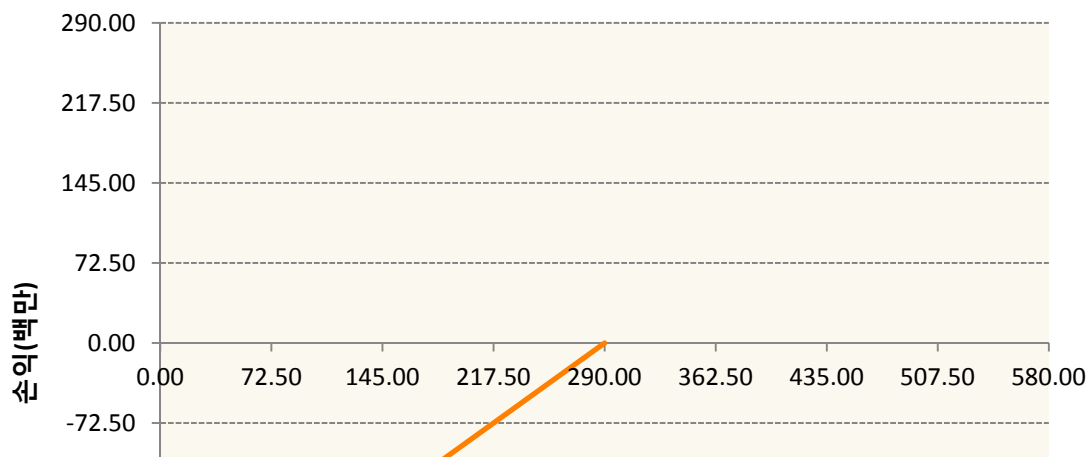
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	580	-580	장내

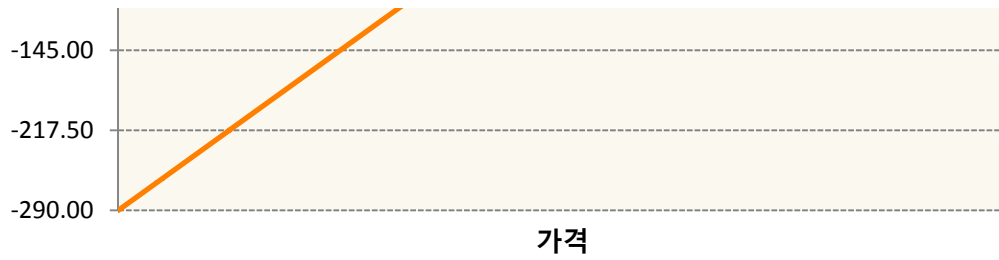
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q72906-2020-07 콜290



KR4301Q72904-2020-07 풋290





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q72906			2020-07 콜290				16
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9	8	8	7	6	6	5
-5.33%	8	7	6	5	4	4	3
-2.67%	6	5	4	3	2	1	0
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	0	-1	-3	-4	-5	-6	-7
5.33%	-5	-6	-7	-8	-9	-10	-11
8.00%	-10	-11	-12	-13	-14	-15	-16
KR4301Q72904			2020-07 풋290				18
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-16	-16	-17	-17	-17	-18	-18
-5.33%	-9	-10	-10	-11	-11	-12	-12
-2.67%	-3	-4	-4	-5	-6	-6	-7
0%	2	2	1	0	-1	-2	-2
2.67%	7	6	5	4	3	2	2
5.33%	10	9	8	7	6	6	5
8.00%	12	11	10	10	9	8	7

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

30

공시일	2020-06-18
기준일	2020-06-17

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

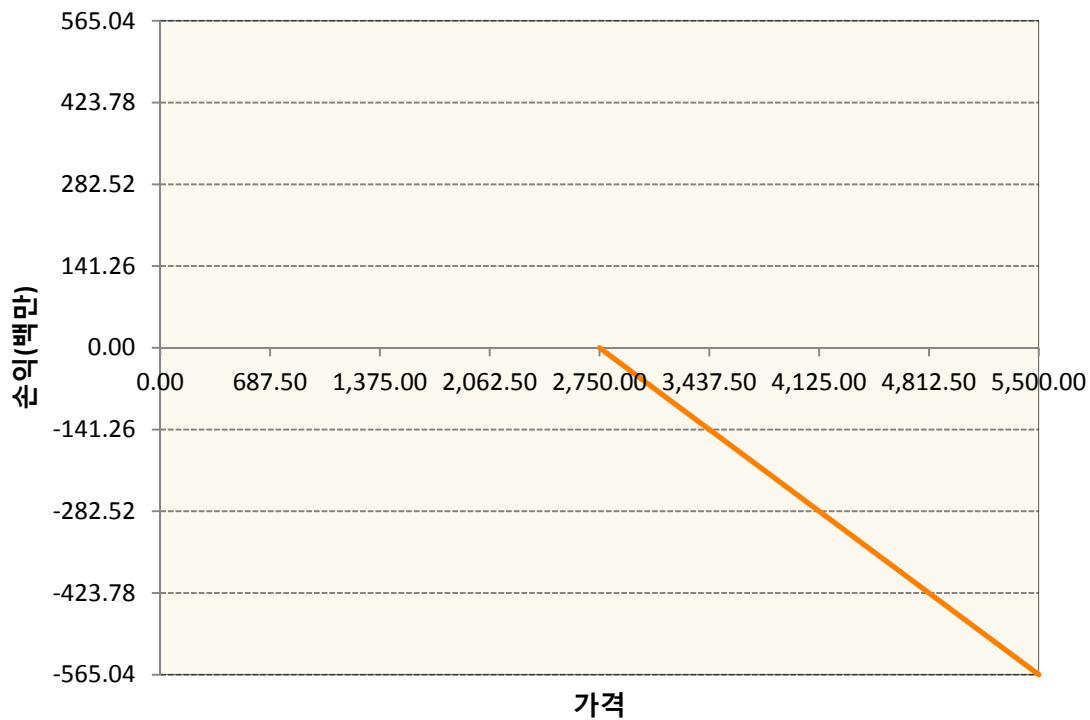
1. 계약금액

(단위:백만원)

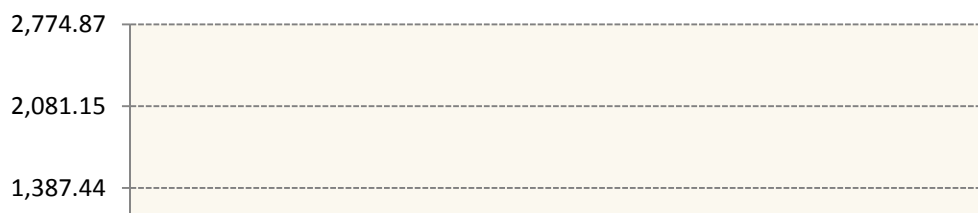
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,261	0	1,261	
누계	유가증권	스왑	8,169	0	8,169	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,718	-6,718	장내
누계	통화	선도	0	2,964	-2,964	장외

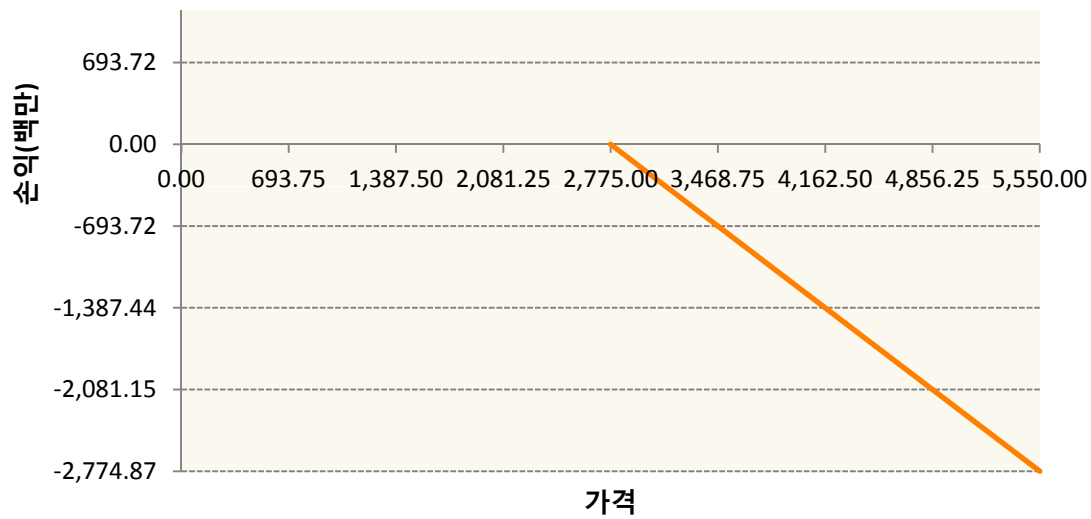
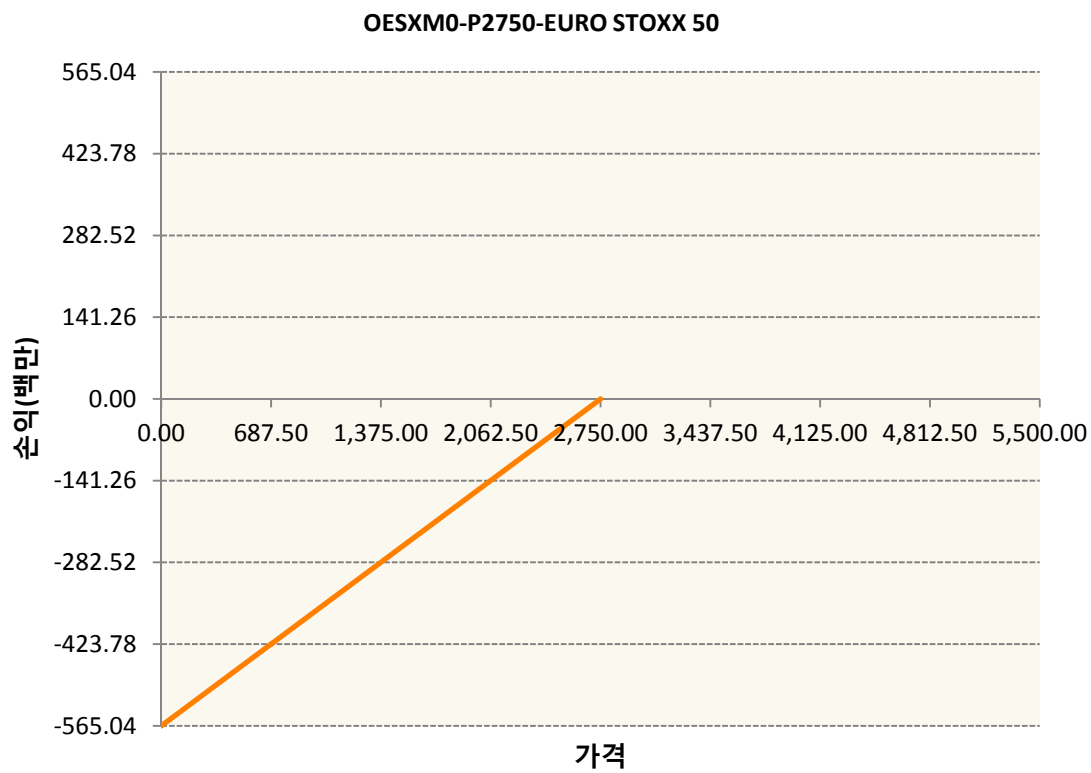
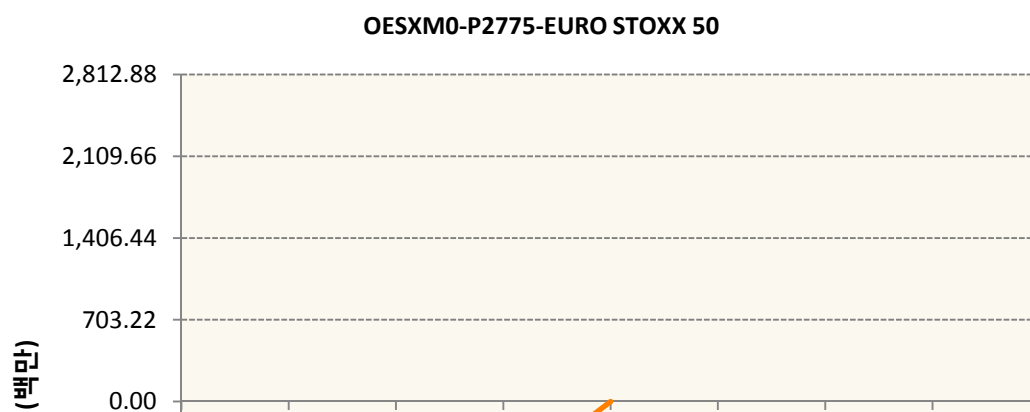
2. 만기시점의 손익구조

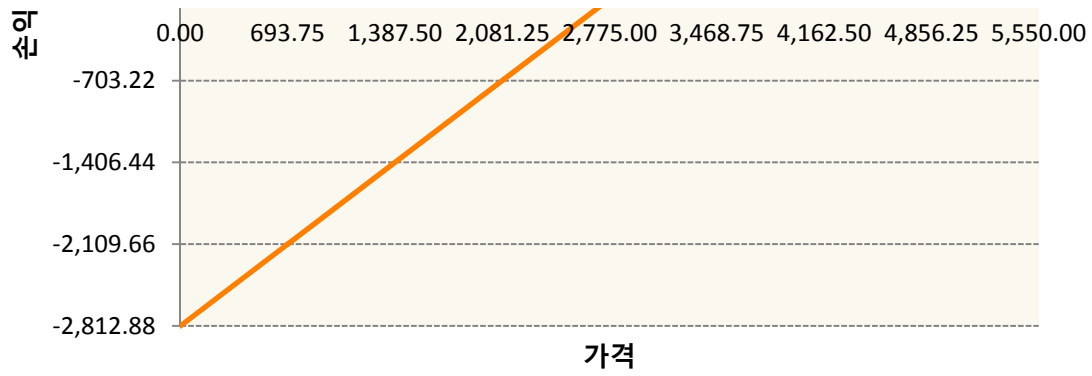
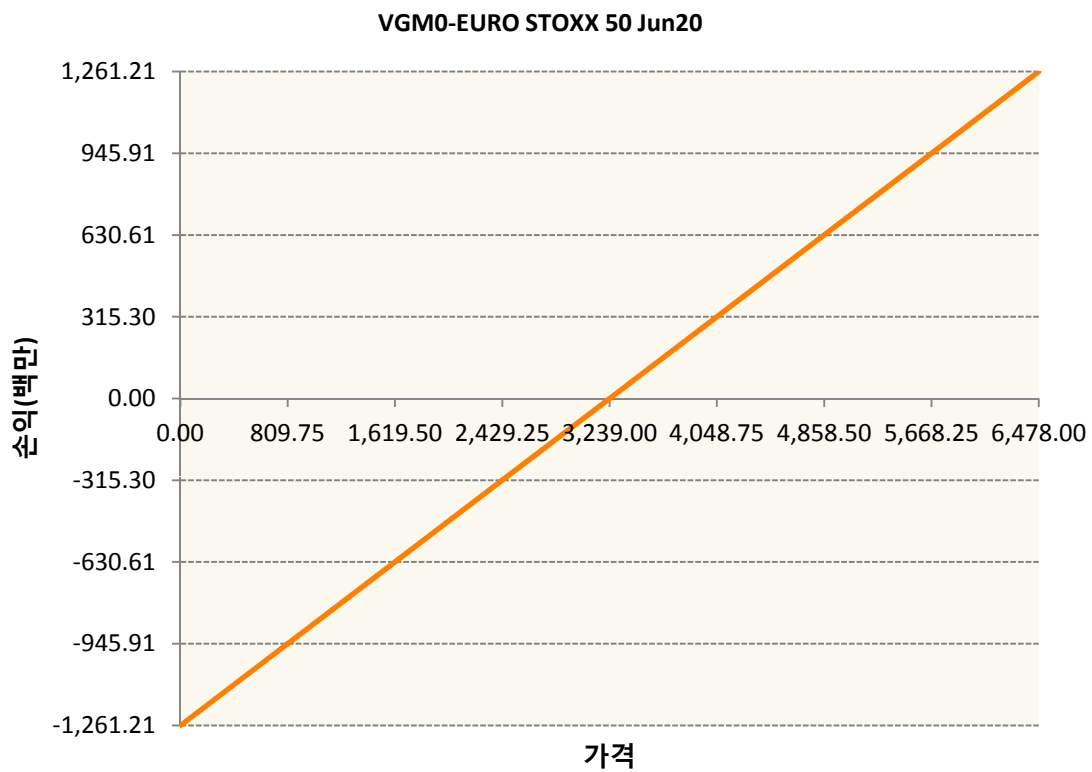
OESXM0-C2750-EURO STOXX 50



OESXM0-C2775-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY		23
FX21020H09 KRW/EUR 26-06-20E		222
FX21020K02 KRW/EUR 26-06-20E		15
OESXM0-C2' EURO STOXX 50		45
OESXM0-C2' EURO STOXX 50		222
OESXM0-P2' EURO STOXX 50		45
OESXM0-P2' EURO STOXX 50		225
VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	101

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

(단위:백만원)

1,048

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

(단위:백만원)

1,317

공시일	2020-06-18
기준일	2020-06-17

ETF스마트레버리지목표전환형9호

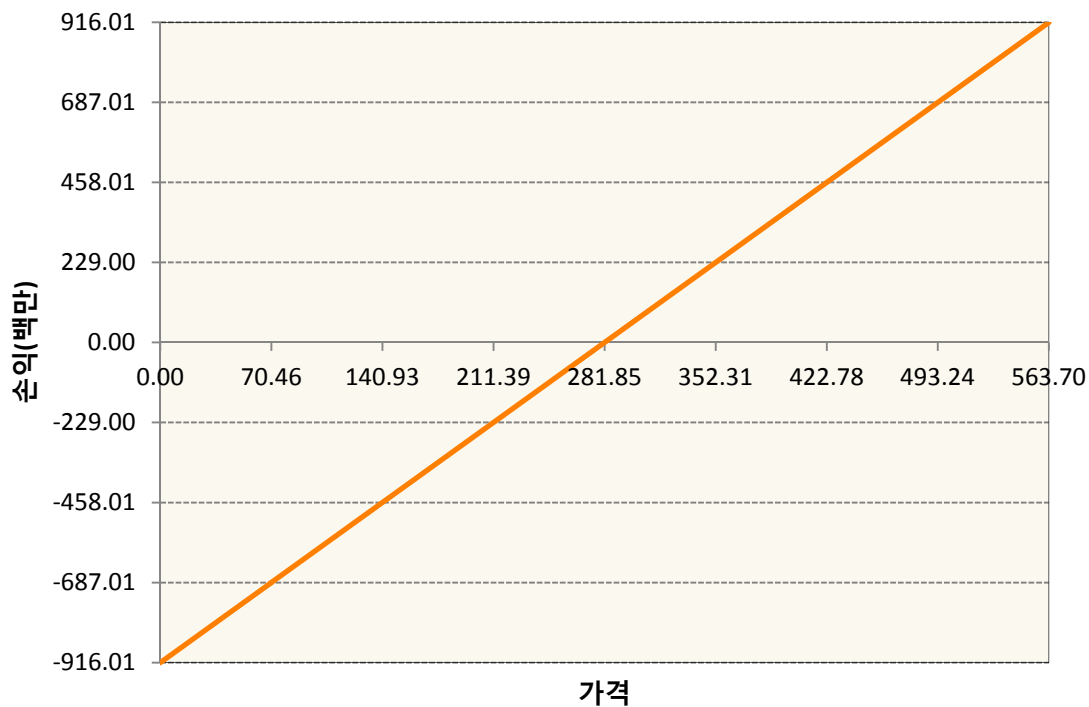
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	916	0	916	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009				2020-09 코스피200지수선물				74
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74	
-5.33%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
-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%	49	49	49	49	49	49	49	
8.00%	74	74	74	74	74	74	74	

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

(단위:백만원)

116

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

(단위:백만원)

169

공시일	2020-06-18
기준일	2020-06-17

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

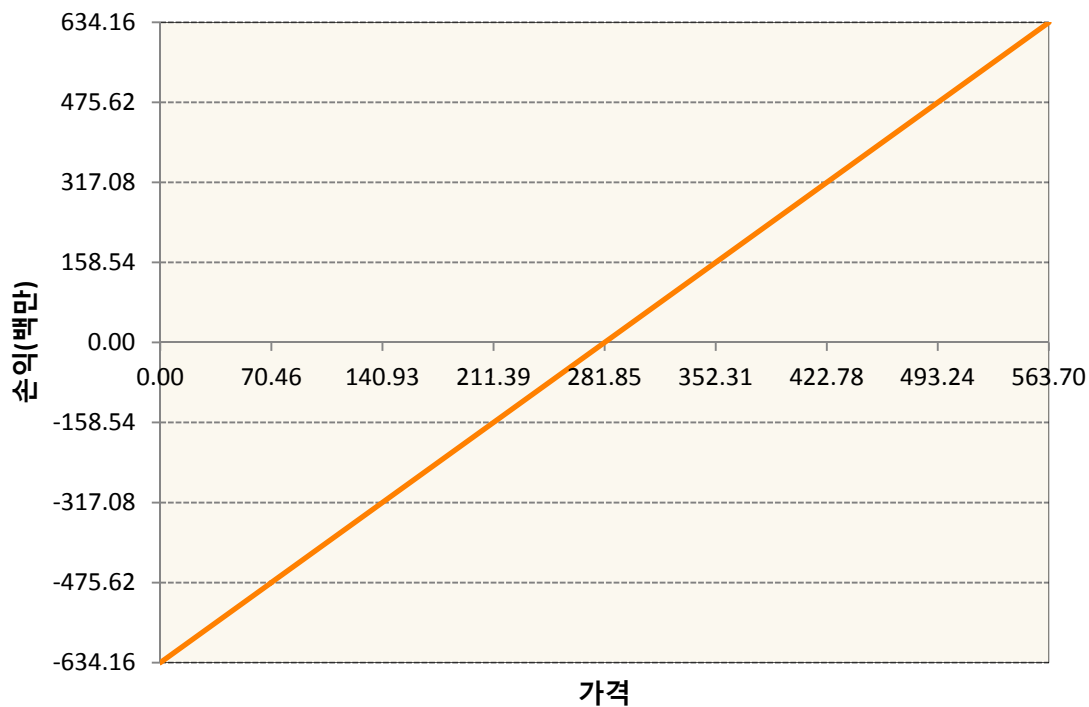
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	634	0	634	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009							2020-09 코스피200지수선물		51
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51	
-5.33%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	17	17	17	17	17	17	17	17	
5.33%	34	34	34	34	34	34	34	34	
8.00%	51	51	51	51	51	51	51	51	

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

(단위:백만원)

80

공시일	2020-06-18
기준일	2020-06-17

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

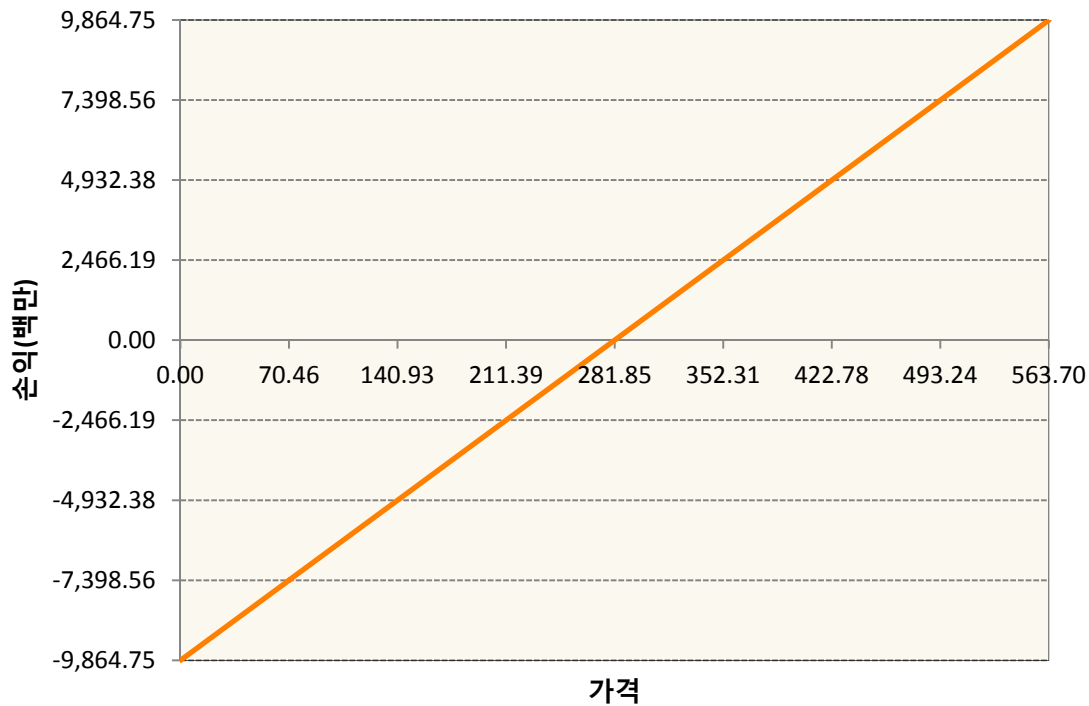
1. 계약금액

(단위:백만원)

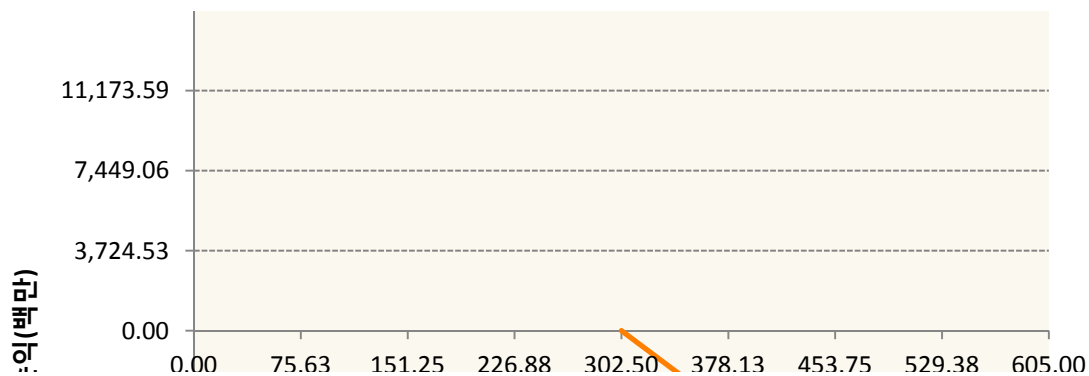
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,865	0	9,865	장내
누계	유가증권	옵션	3,247	19,092	-15,845	장내

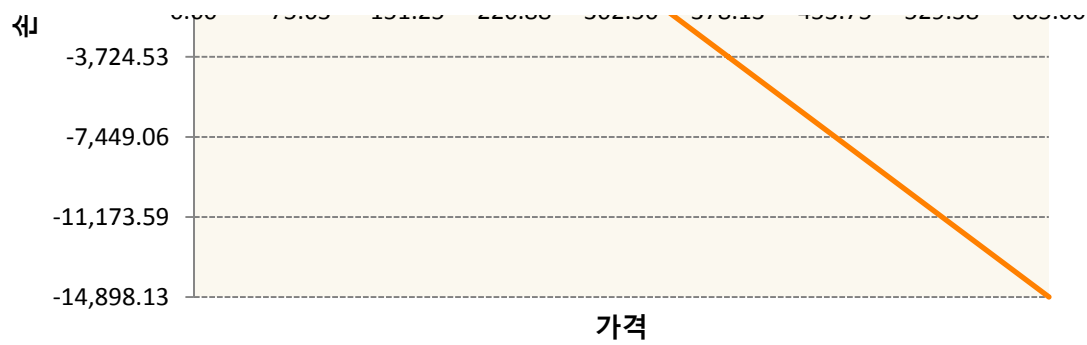
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물

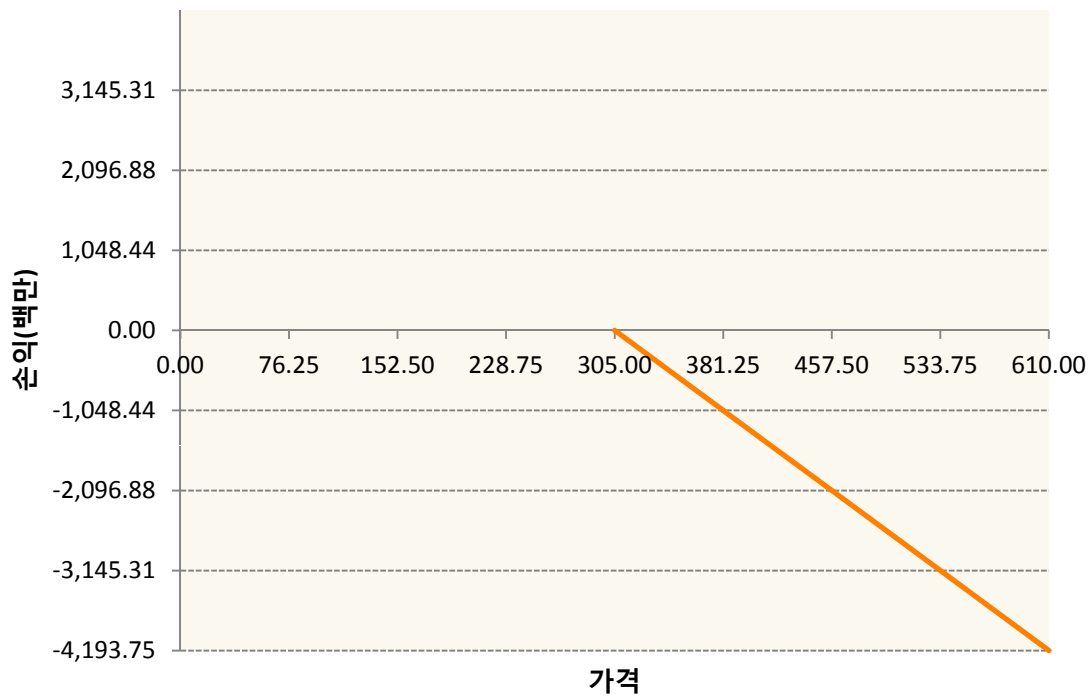


KR4201Q73029-2020-07 콜302.5

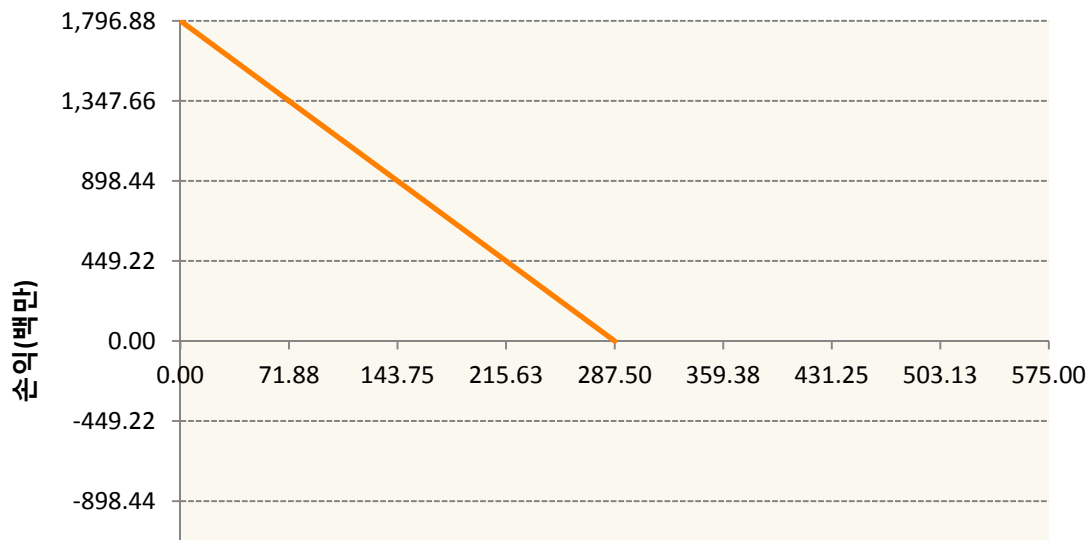


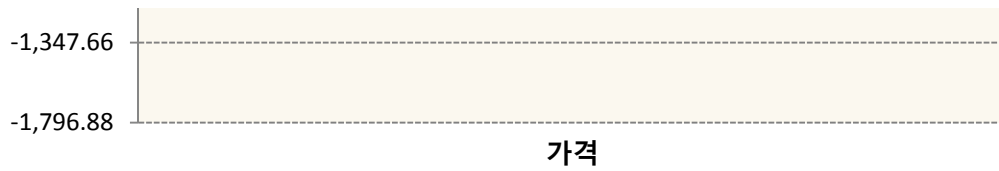
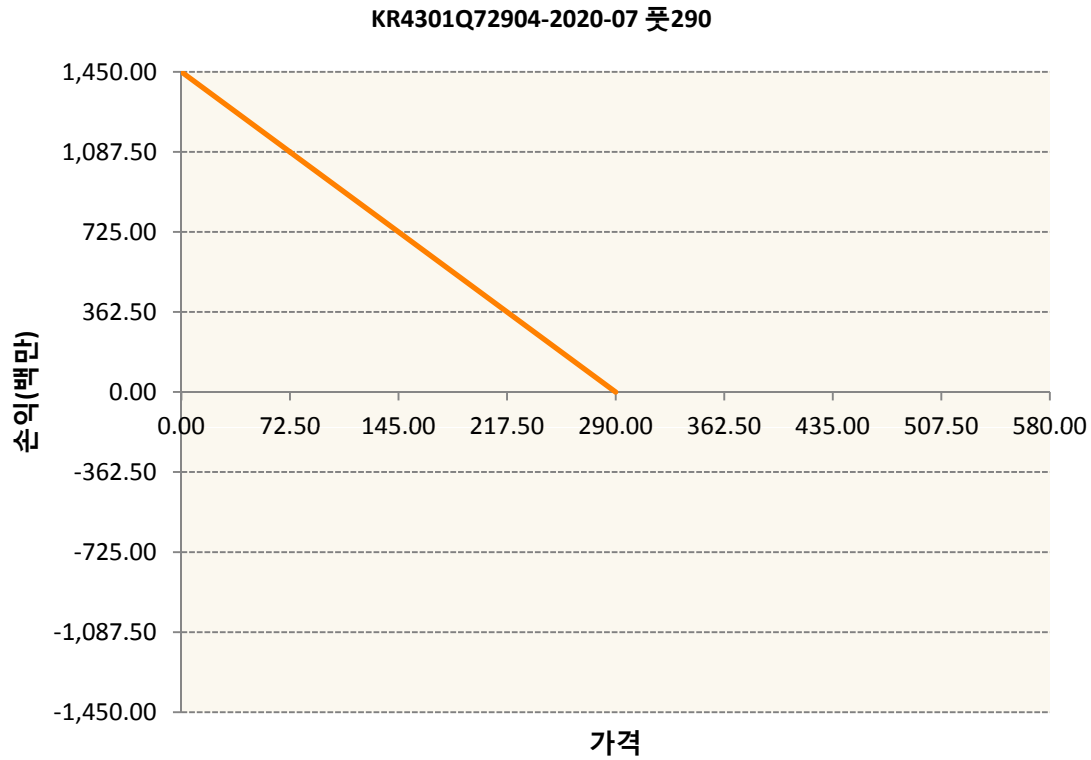


KR4201Q73052-2020-07 콜305



KR4301Q72870-2020-07 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q90009		2020-09 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
KR4201Q73029		2020-07 콜302.5						652
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%		277	262	244	222	196	168	137
-5.33%		252	228	201	171	138	102	64
-2.67%		207	174	138	99	57	14	-30

0%	136	93	47	0	-48	-98	-148
2.67%	30	-22	-74	-128	-182	-236	-291
5.33%	-115	-172	-229	-287	-344	-401	-459
8.00%	-302	-361	-419	-477	-536	-594	-652
KR4201Q73052 2020-07 콜305							174
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	70	66	62	56	50	42	34
-5.33%	64	58	51	43	35	25	15
-2.67%	53	45	35	25	14	3	-9
0%	36	25	13	0	-13	-26	-40
2.67%	10	-4	-19	-33	-48	-63	-78
5.33%	-27	-43	-59	-75	-90	-106	-122
8.00%	-76	-92	-109	-125	-141	-158	-174
KR4301Q72870 2020-07 풋287.5							111
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	96	98	100	102	105	108	111
-5.33%	54	57	60	63	67	71	75
-2.67%	16	20	25	29	34	38	43
0%	-15	-10	-5	0	5	10	15
2.67%	-39	-34	-29	-23	-18	-13	-8
5.33%	-56	-51	-46	-41	-37	-32	-27
8.00%	-66	-63	-59	-55	-50	-46	-41
KR4301Q72904 2020-07 풋290							92
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	81	82	84	85	87	89	92
-5.33%	46	48	51	53	56	59	62
-2.67%	15	18	21	25	28	32	35
0%	-12	-8	-4	0	4	8	12
2.67%	-33	-29	-24	-20	-16	-12	-8
5.33%	-48	-44	-40	-36	-32	-28	-24
8.00%	-58	-55	-51	-48	-44	-40	-37

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

(단위:백만원)

1,988

공시일	2020-06-18
기준일	2020-06-17

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	5,981	-5,981	
누계	유가증권	수익증권	147,265	0	147,265	

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	2020-06-18
기준일	2020-06-17

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	1,196	-1,196	
누계	유가증권	수익증권	100,706	0	100,706	

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	2020-06-18
기준일	2020-06-17

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	463,555	0	463,555	
누계	통화	선도	0	450,842	-450,842	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J027 KRW/USD 22-06-20E	1,496
FX21020J028 KRW/USD 22-06-20E	1,942
FX21020J039 KRW/USD 24-07-20E	2,185
FX21020J043 KRW/USD 24-07-20E	1,748
FX21020J043 KRW/USD 24-07-20E	1,942
FX21020K01 KRW/USD 22-06-20E	680
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	2,370
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	971
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,020
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,612
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	3,399
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	6,895
FX21020M00 KRW/USD 26-08-20E	583
FX21020M01 KRW/USD 26-08-20E	4,758
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	2,020
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	2,447

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

18,652

공시일	2020-06-18
기준일	2020-06-17

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

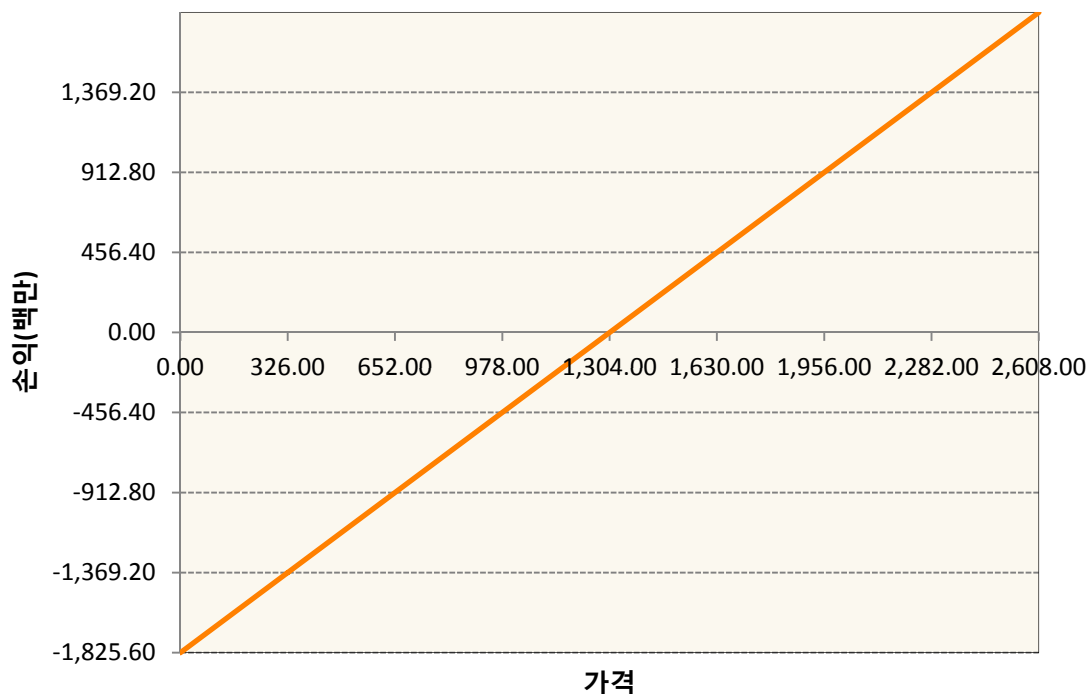
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,826	0	1,826	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4108Q90004-2020-09 KRX300 선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4108Q90004 2020-09 KRX300 선물							147
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-147	-147	-147	-147	-147	-147	-147
-5.33%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98
-2.67%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	49	49	49	49	49	49	49
5.33%	98	98	98	98	98	98	98
8.00%	147	147	147	147	147	147	147

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

(단위:백만원)

231

공시일	2020-06-18
기준일	2020-06-17

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	7,641	0	7,641	
누계	통화	선도	0	7,538	-7,538	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
FX21020M02 KRW/USD 20-07-20E	15
FX21020M03 KRW/USD 06-07-20E	49
FX21020M03 KRW/USD 15-07-20E	223
FX21020M03 KRW/USD 20-07-20E	56

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

312

공시일	2020-06-18
기준일	2020-06-17

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

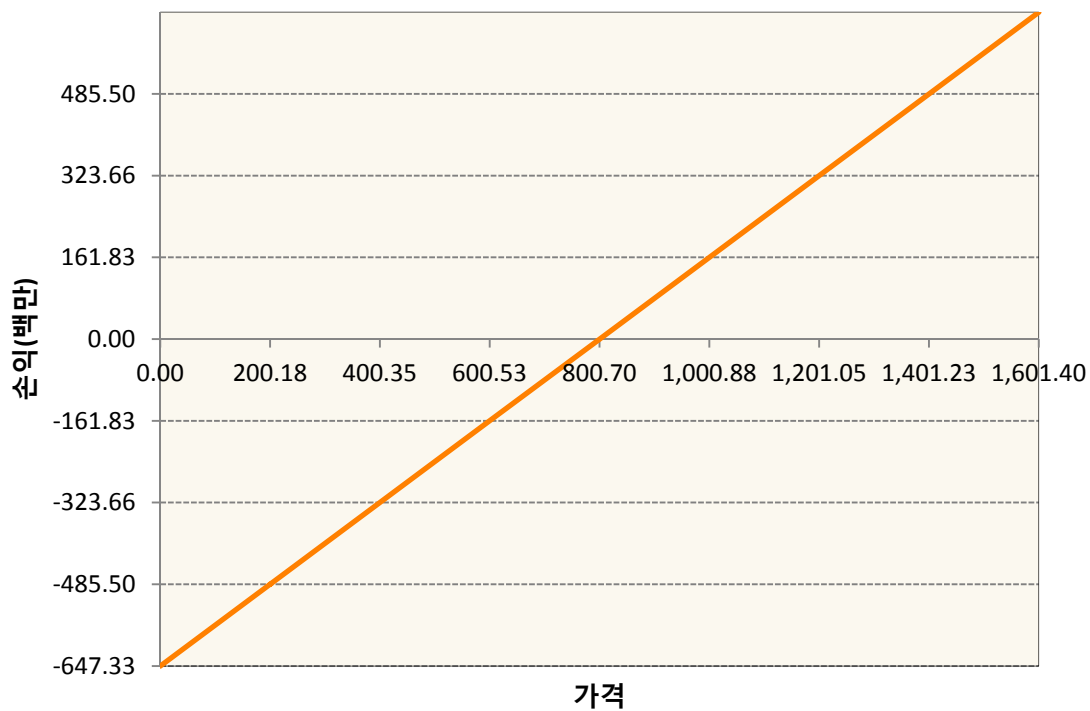
1. 계약금액

(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	647	0	647	
누계	유가증권	스왑	994	0	994	장외
누계	통화	선도	211	896	-685	장외

2. 만기시점의 손익구조

VN30TR 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	52

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	175

공시일	2020-06-18
기준일	2020-06-17

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

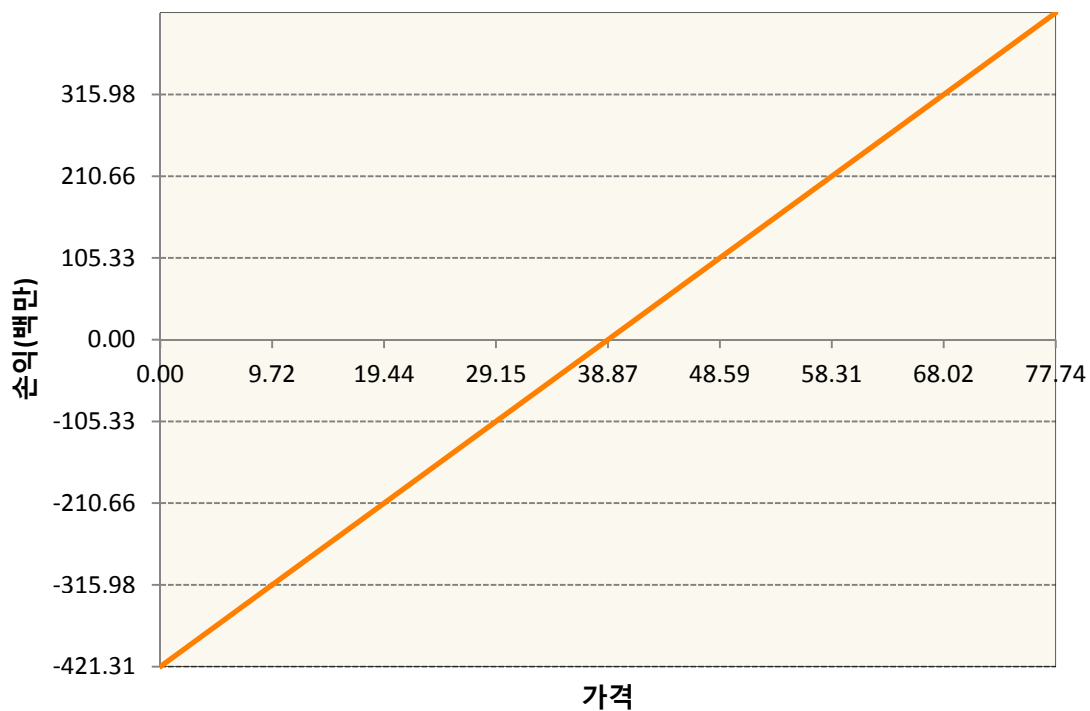
1. 계약금액

(단위:백만원)

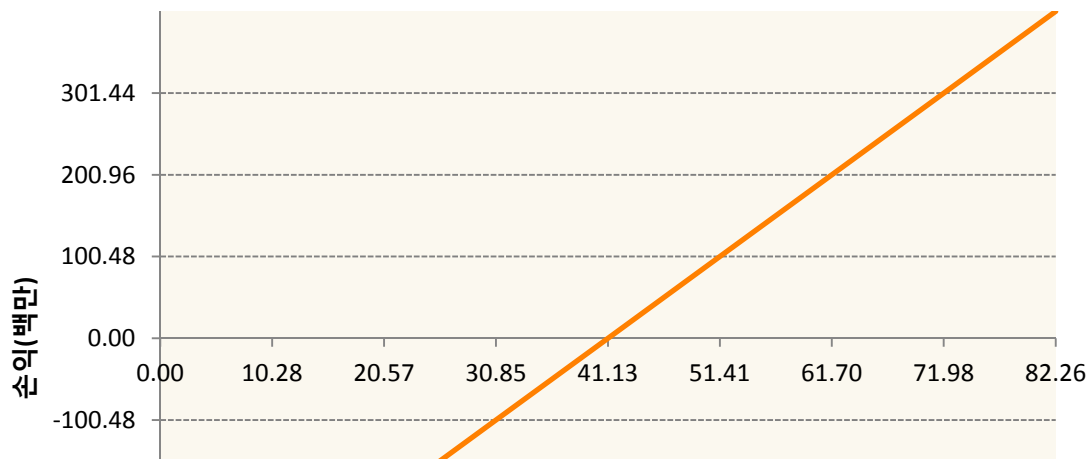
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,892	364	1,528	

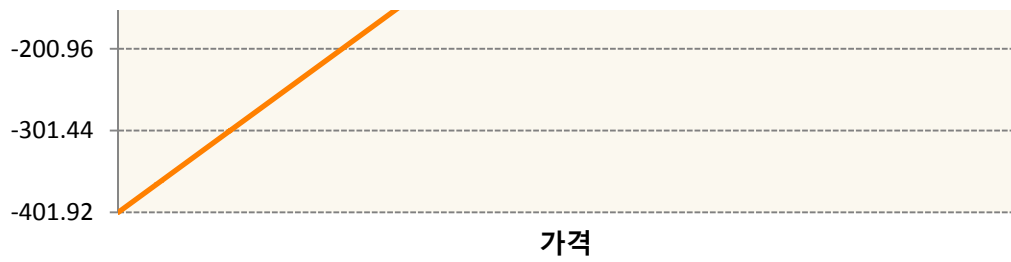
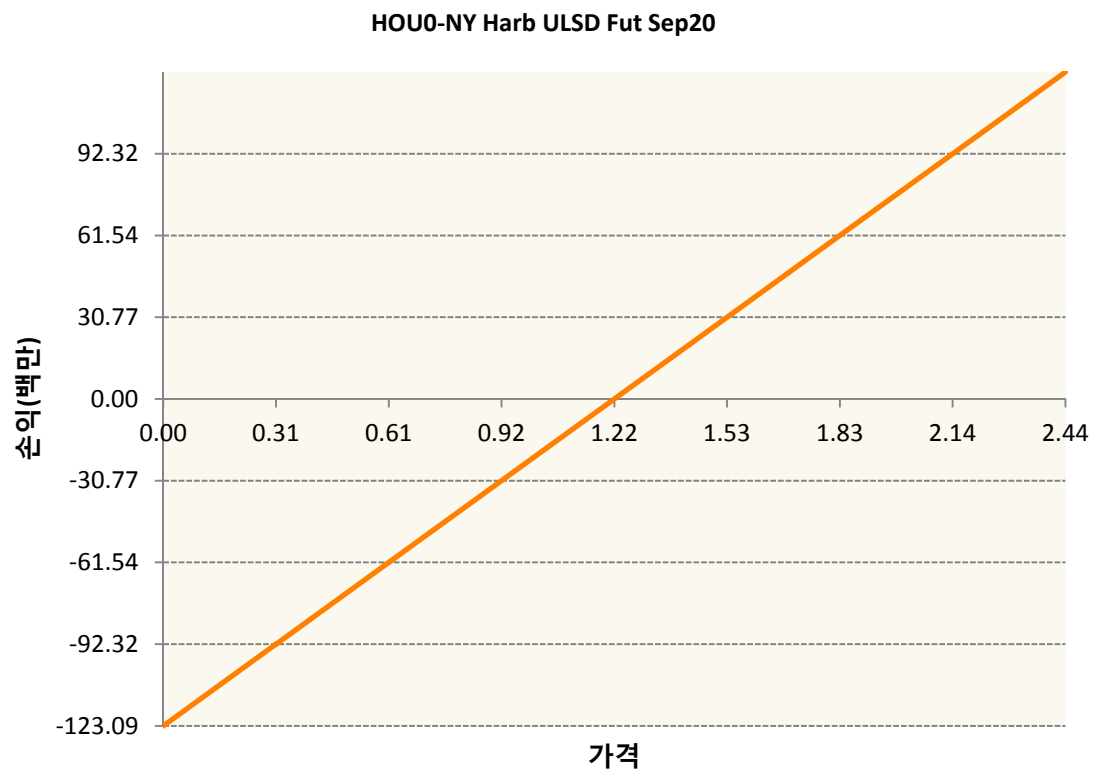
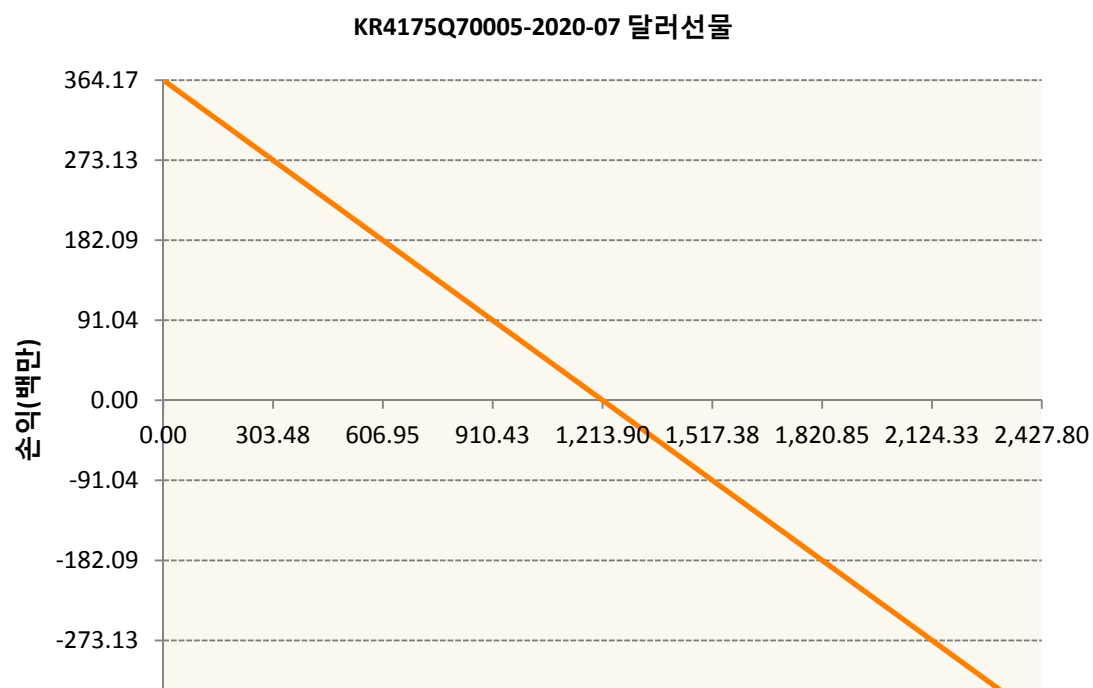
2. 만기시점의 손익구조

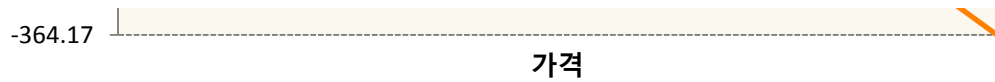
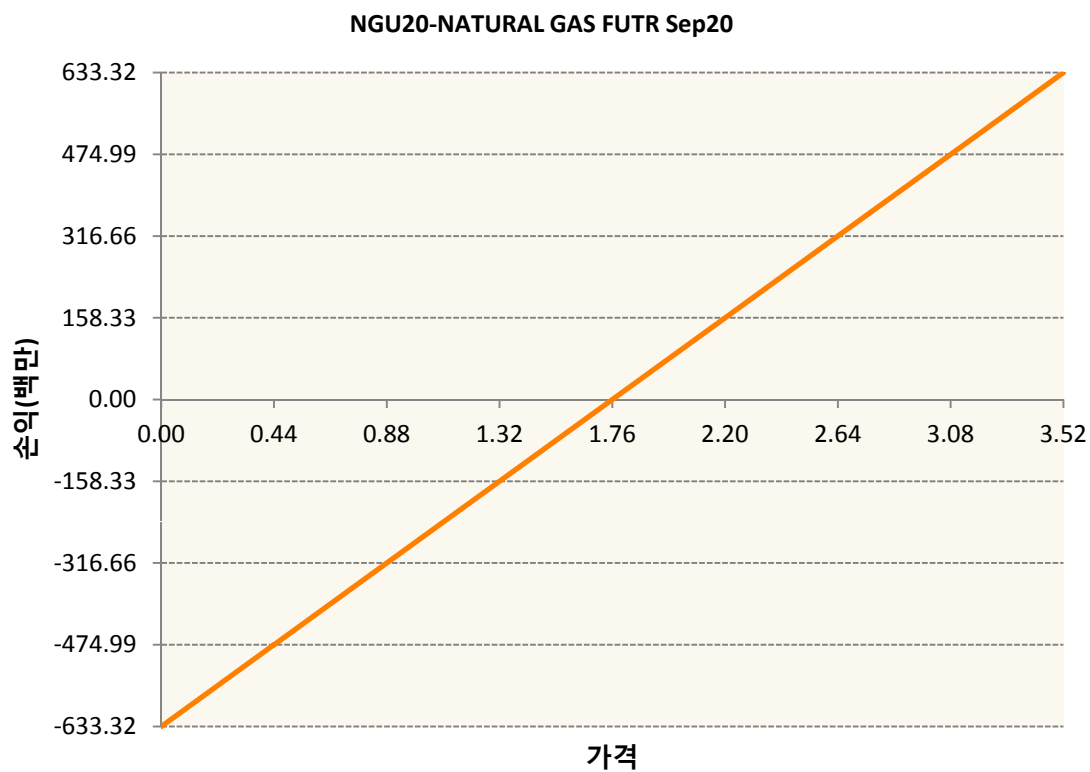
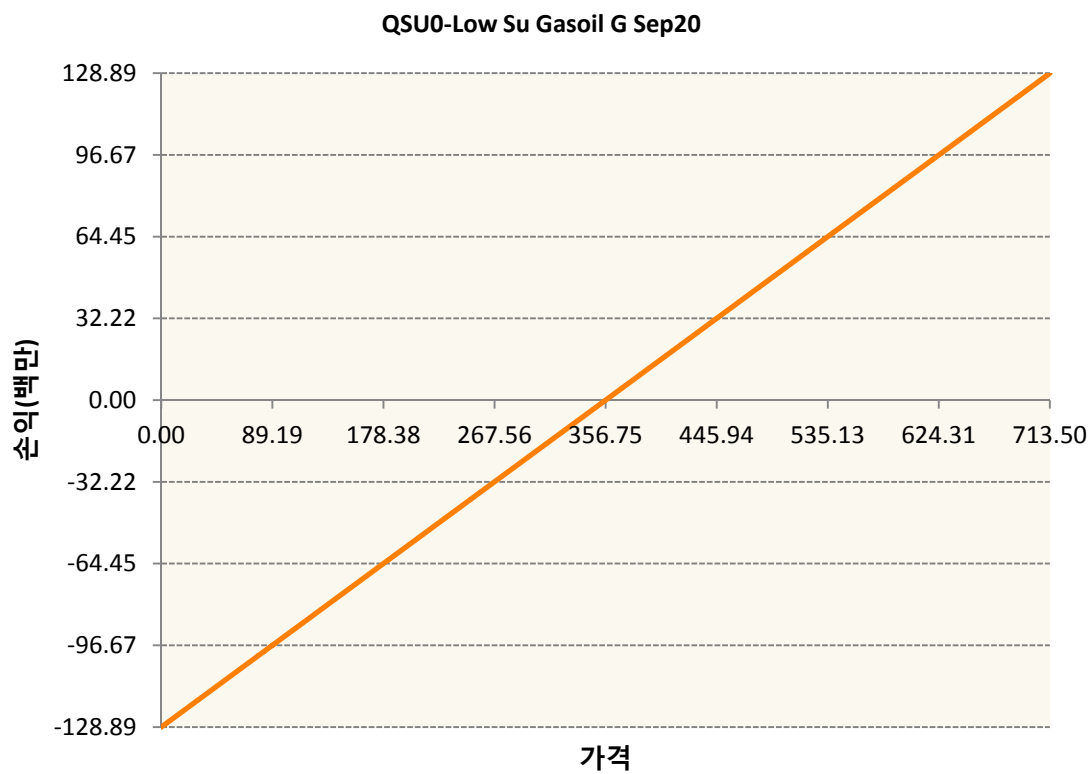
CLU0-WTI CRUDE FUTURE Sep20

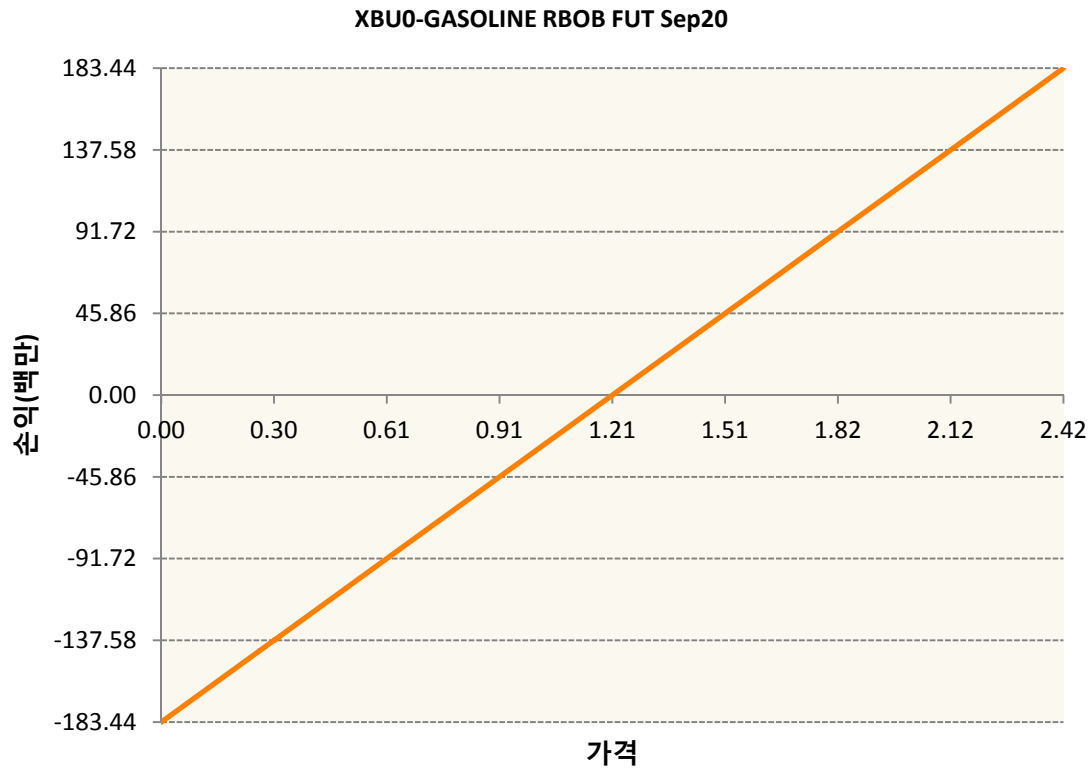


COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU0	WTI CRUDE FUTURE Sep20	34
COU0	BRENT CRUDE FUTR Sep20	32
HOU0	NY Harb ULSD Fut Sep20	10
KR4175Q70C 2020-07 달러선물		29
NGU20	NATURAL GAS FUTR Sep20	51
QSU0	Low Su Gasoil G Sep20	10
XBU0	GASOLINE RBOB FUT Sep20	15

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

969

공시일	2020-06-18
기준일	2020-06-17

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

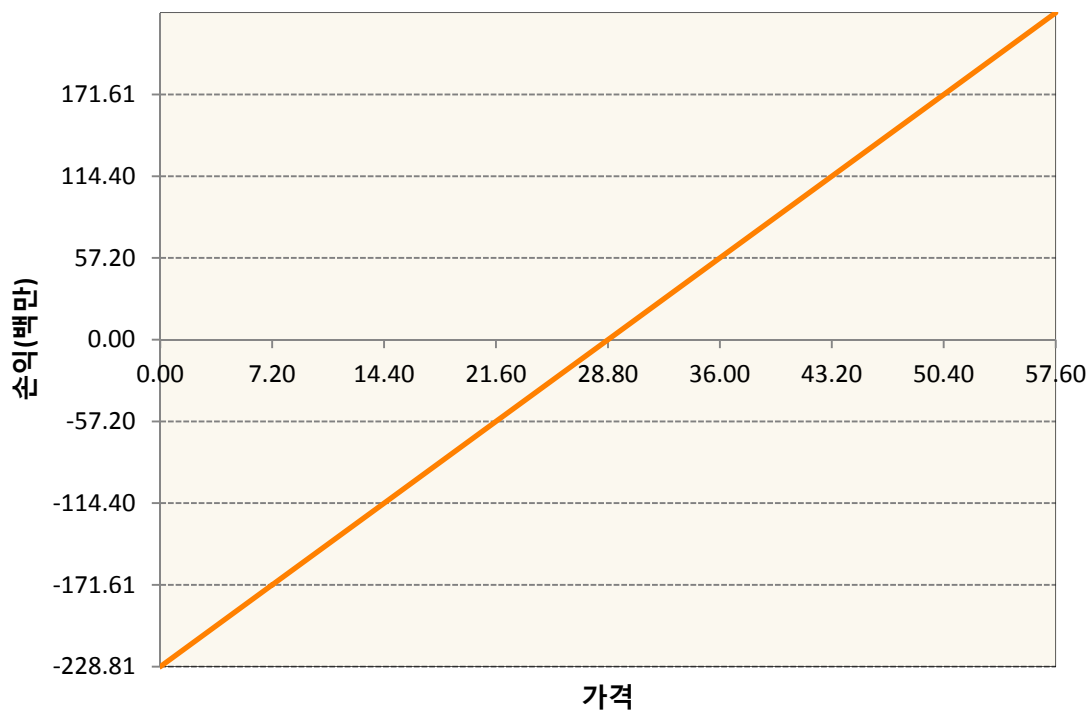
1. 계약금액

(단위:백만원)

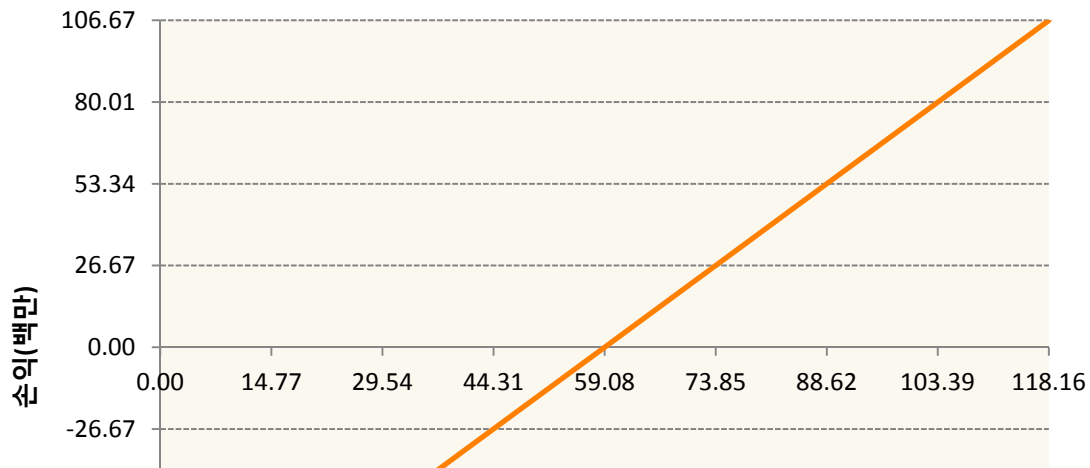
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,571	73	2,498	

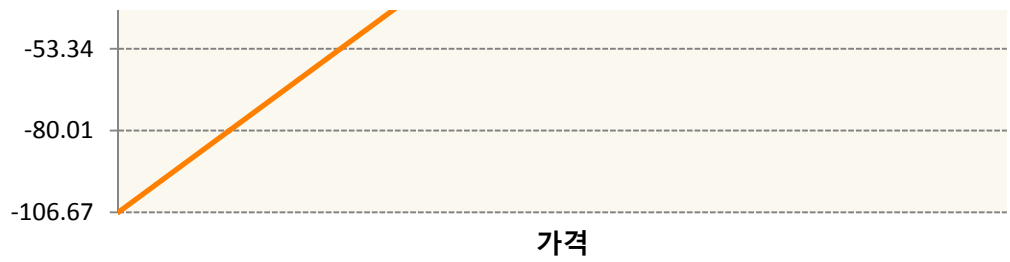
2. 만기시점의 손익구조

BOZ0-SOYBEAN OIL FUTR Dec20

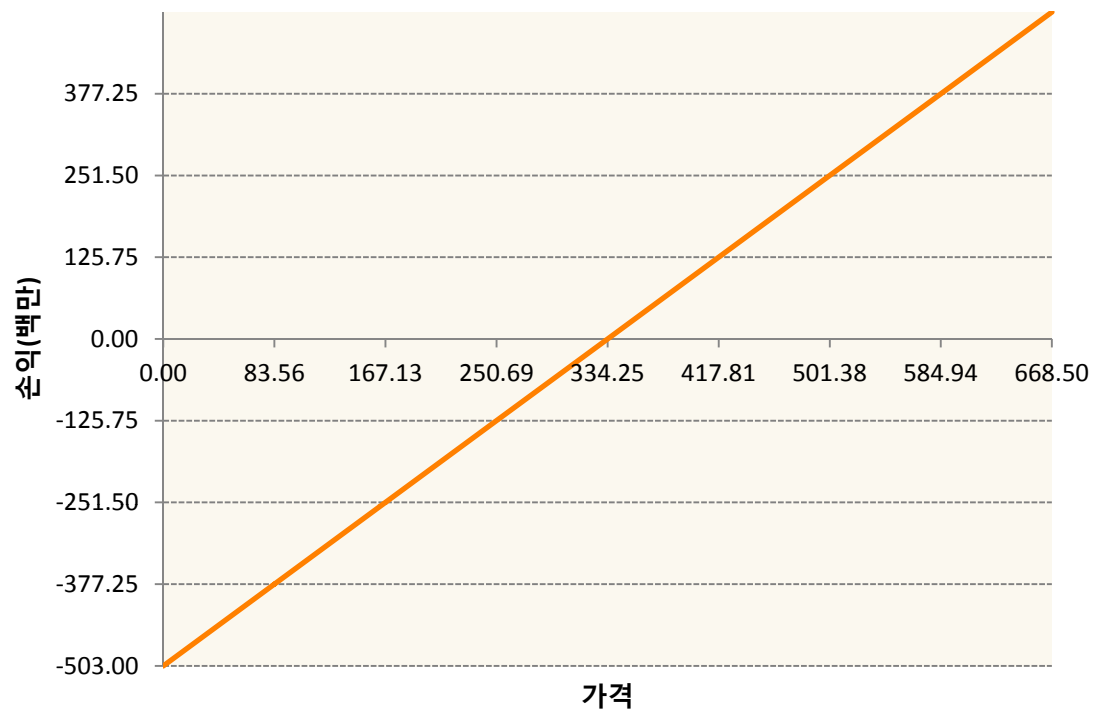


CTZ0-COTTON NO.2 FUTR Dec20

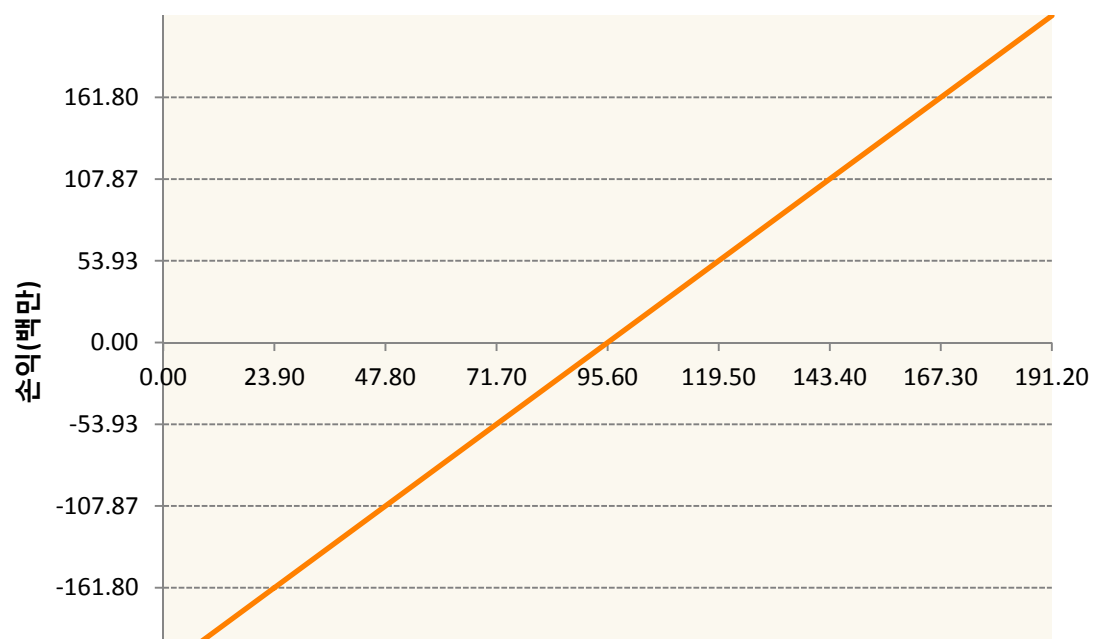


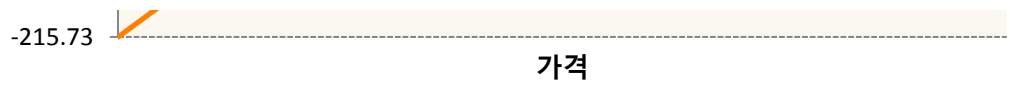


CU0-CORN FUTURE Sep20

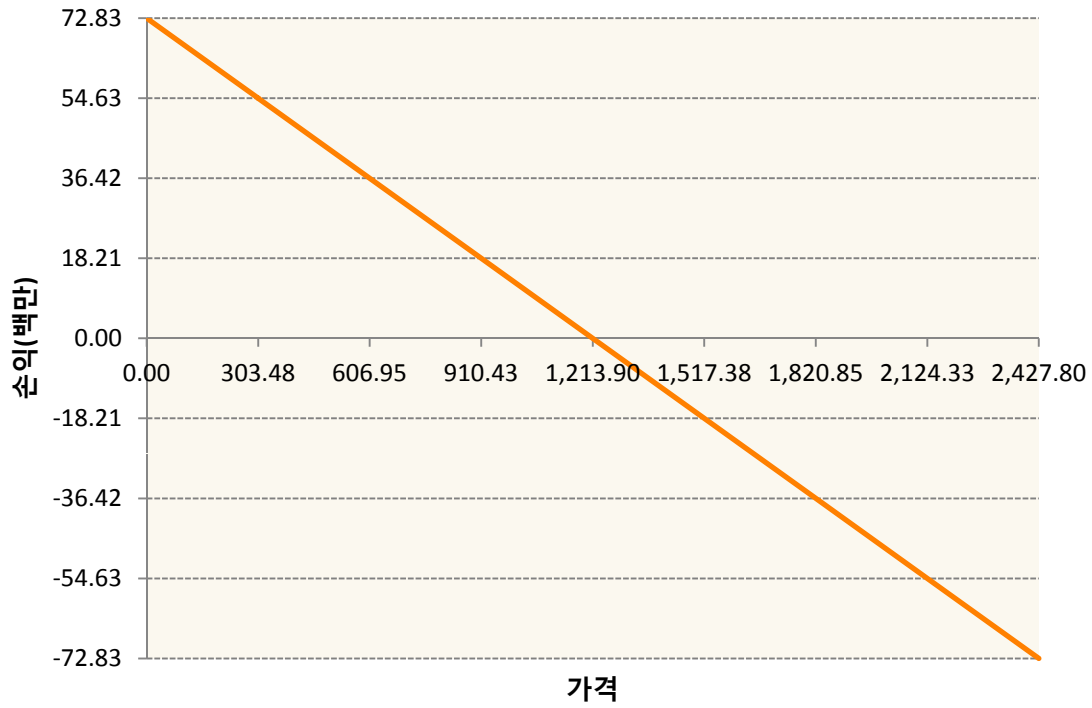


KCU0-COFFEE 'C' FUTURE Sep20

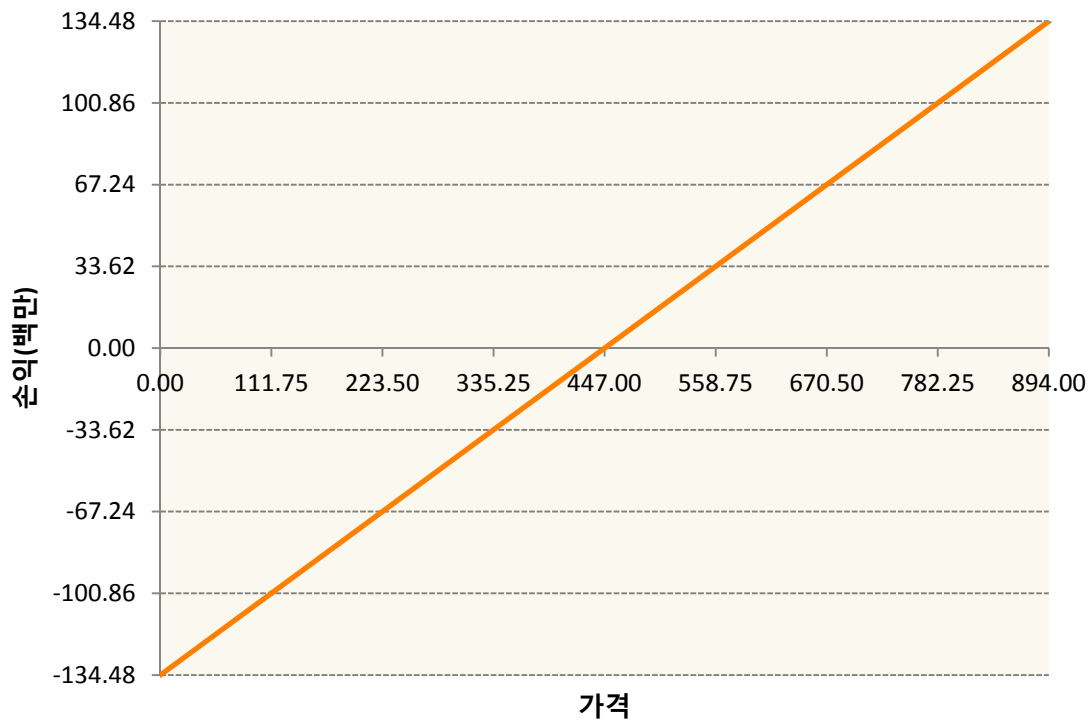


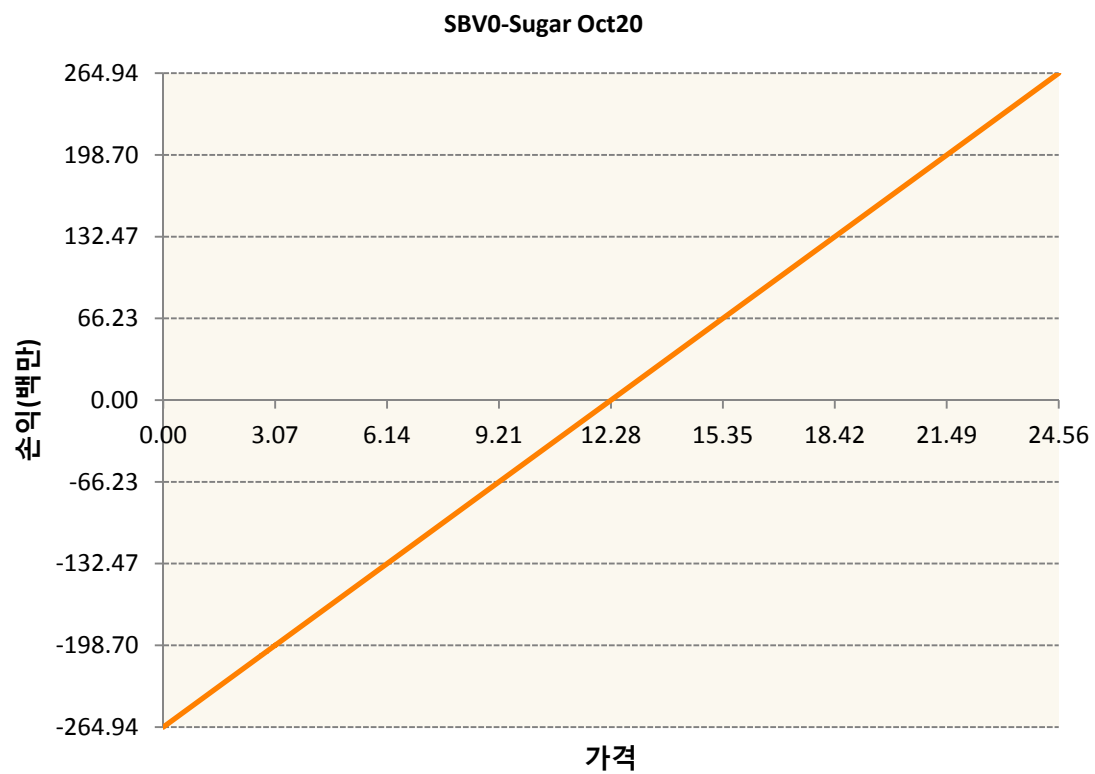
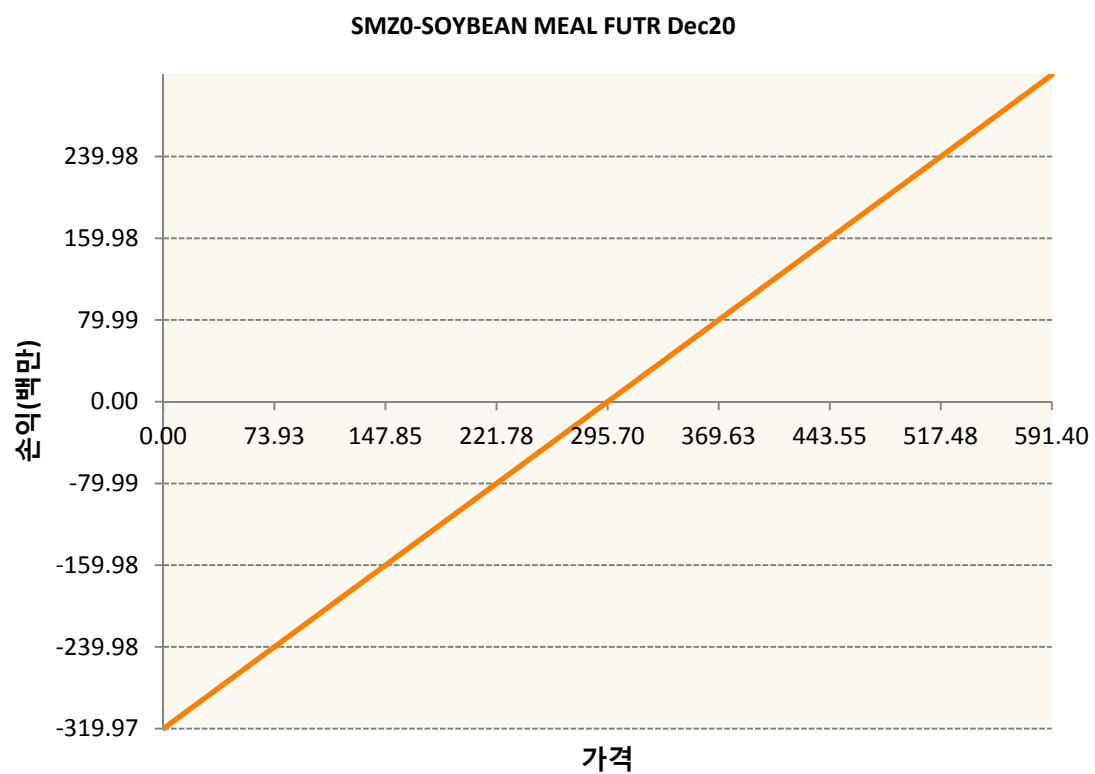
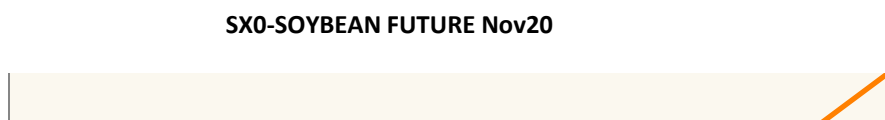


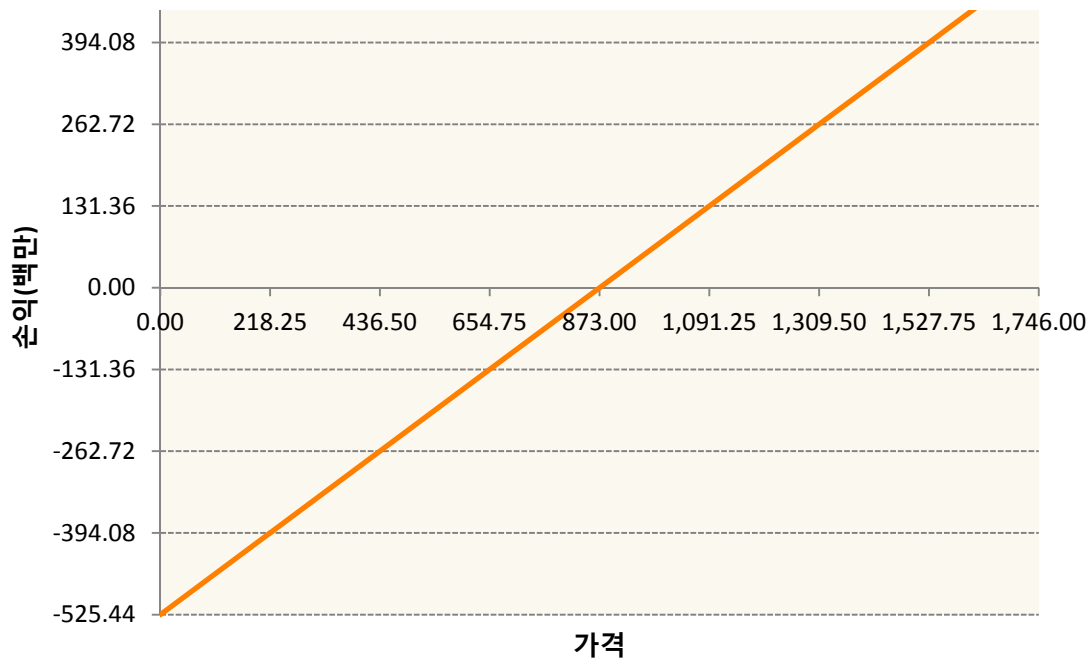
KR4175Q70005-2020-07 달러선물



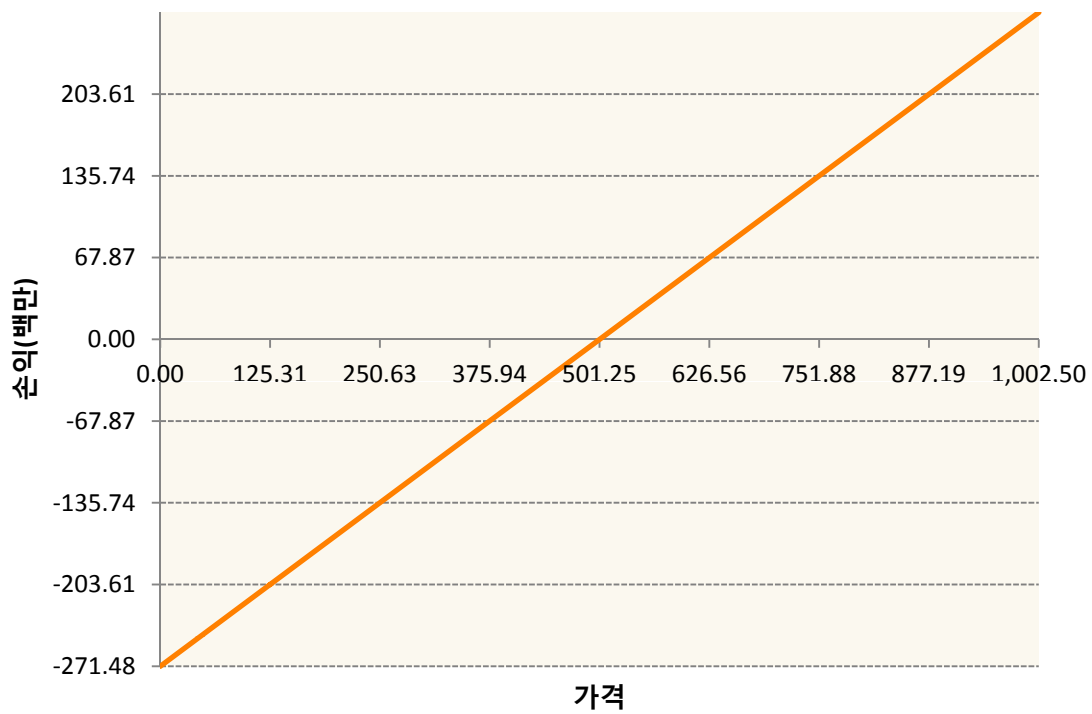
KWU0-KC HRW WHEAT FUT Sep20







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	17
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)

240