공시일	2020-06-22
기준일	2020-06-19

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	2020-06-22
기준일	2020-06-19

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	1,069

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,278

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-06-22
기준일	2020-06-19

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	605

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

883

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-06-22
기준일	2020-06-19

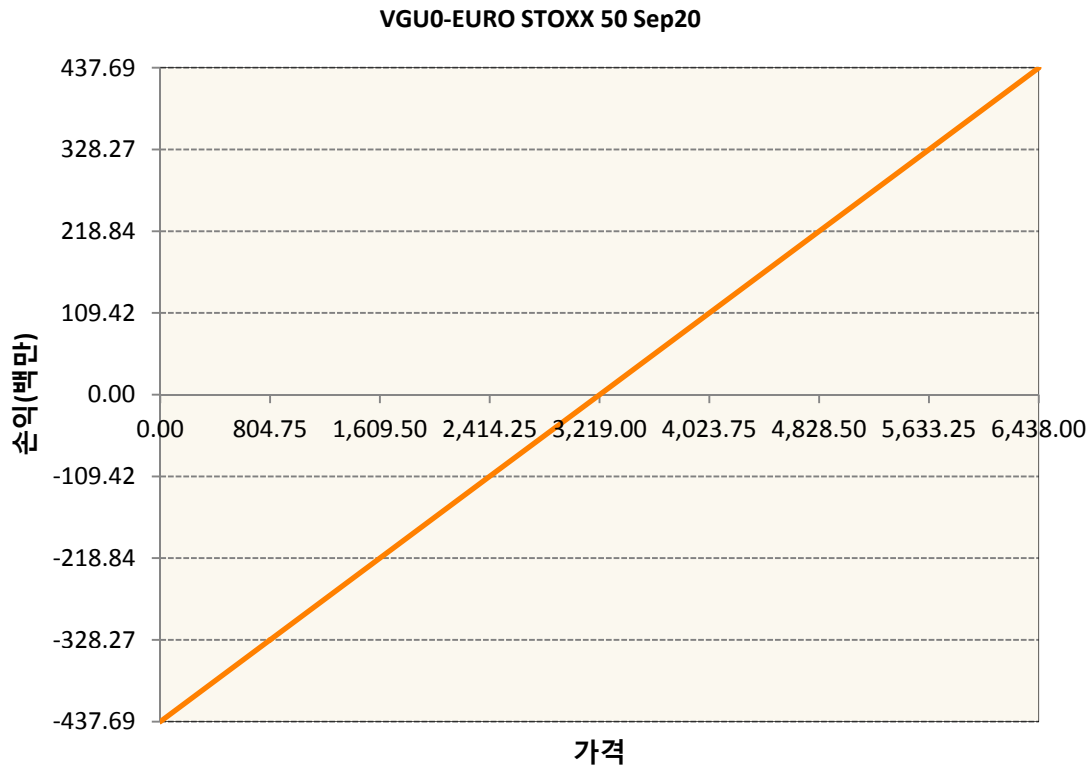
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	438	0	438	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU0	EURO STOXX 50 Sep20	35

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

(단위:백만원)

47

공시일	2020-06-22
기준일	2020-06-19

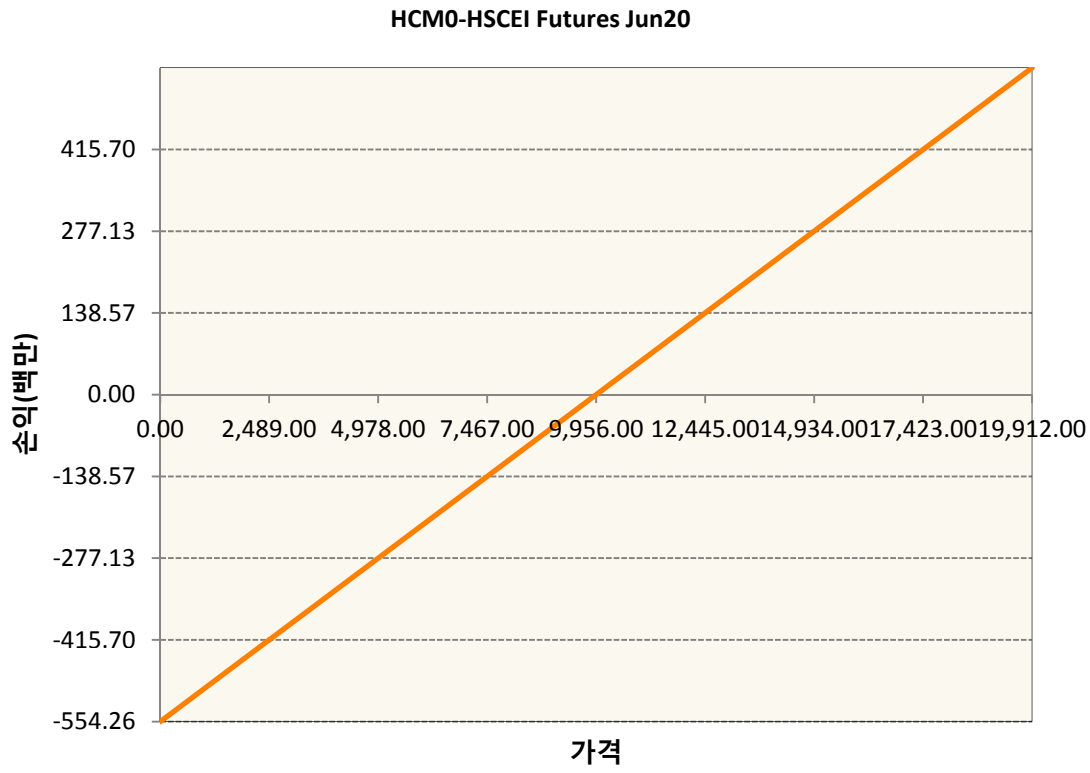
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	554	0	554	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	2020-06-22
기준일	2020-06-19

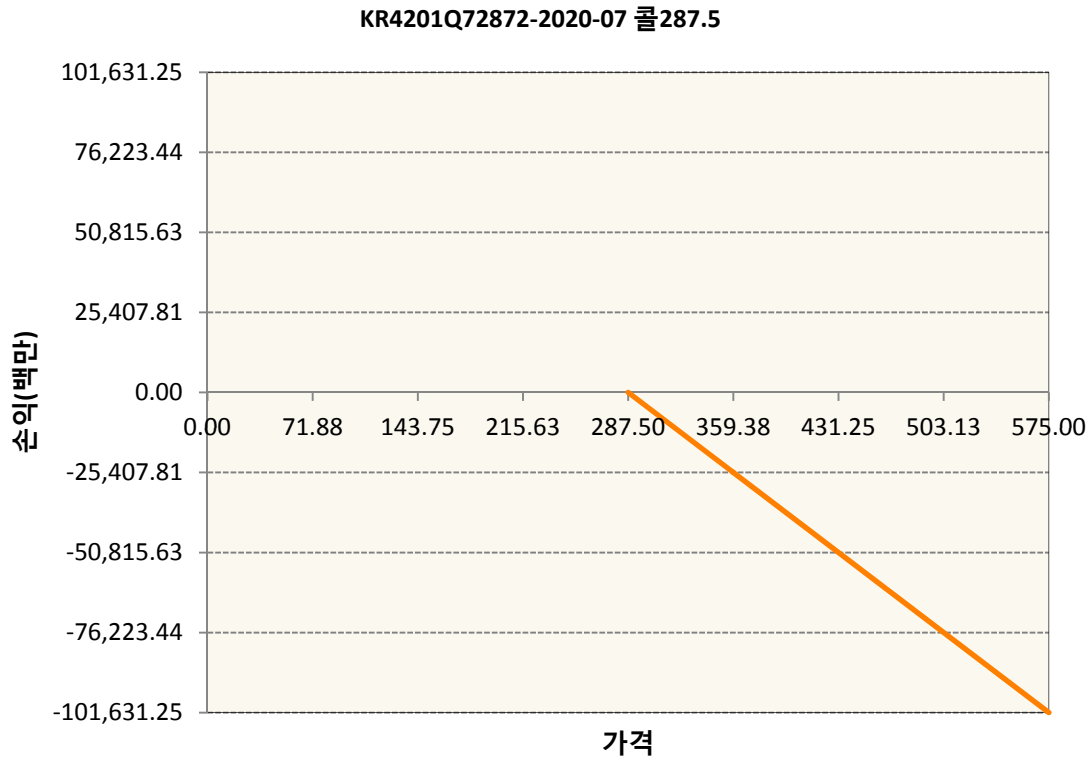
커버드콜모(주식혼합-파생형)

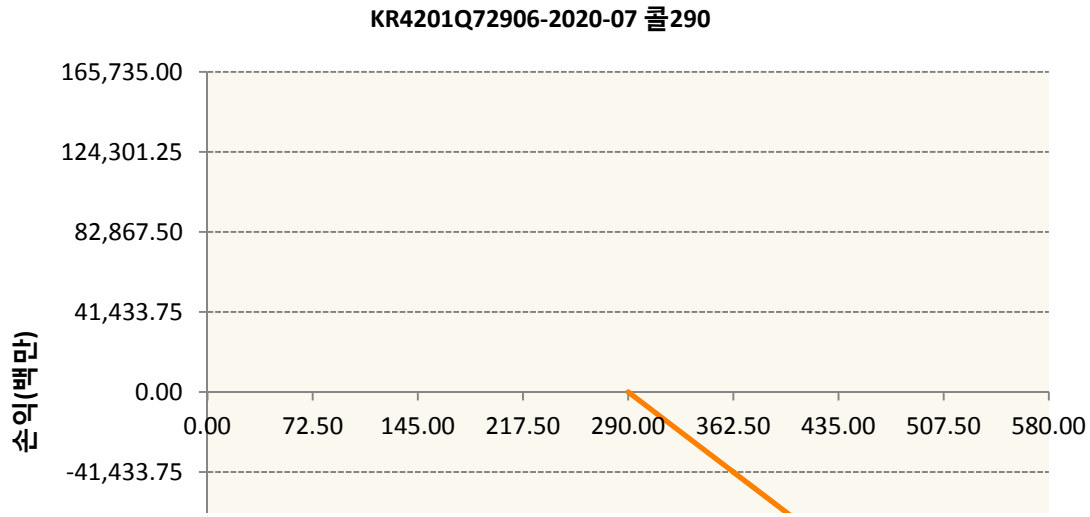
1. 계약금액

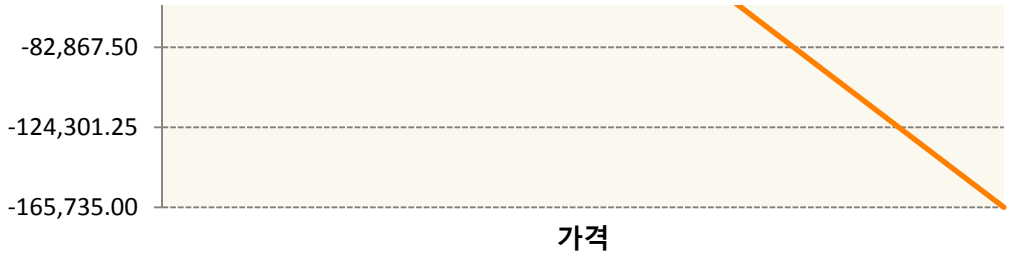
(단위:백만원)

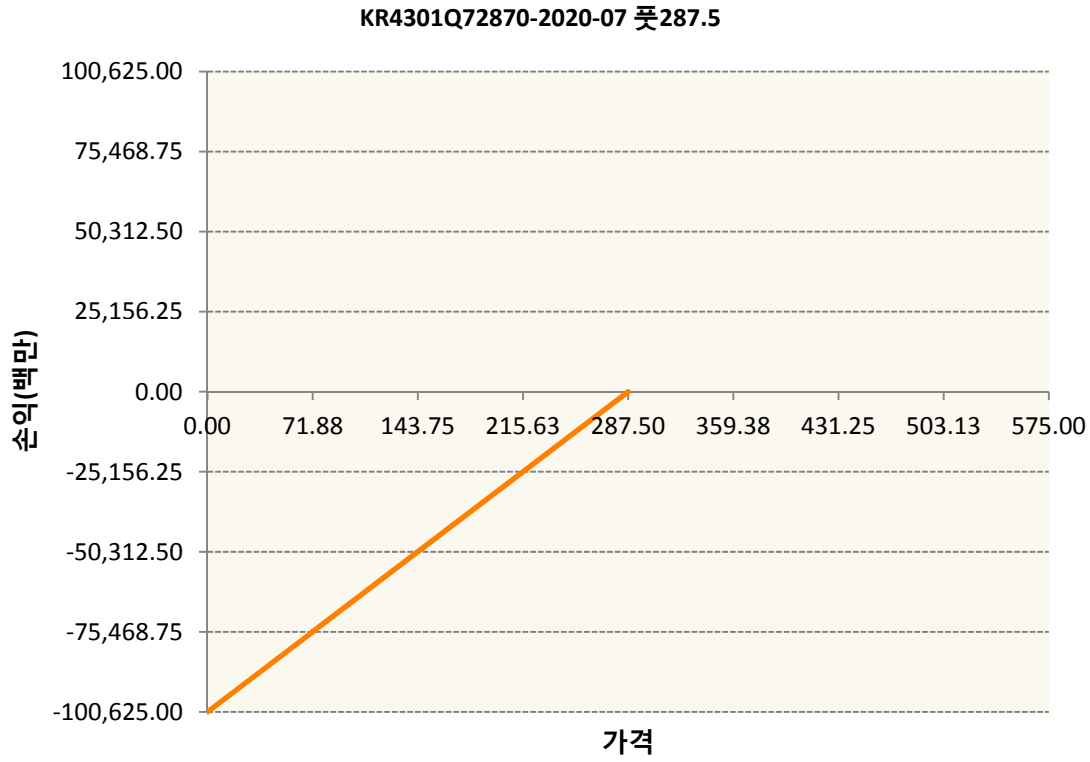
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	367,991	-367,991	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q72872	2020-07 콜287.5						5,847
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,237	3,052	2,844	2,617	2,374	2,118	1,851
-5.33%	2,799	2,541	2,267	1,981	1,685	1,380	1,070
-2.67%	2,101	1,779	1,450	1,115	777	435	91
0%	1,089	727	364	0	-364	-729	-1,094
2.67%	-261	-631	-1,001	-1,372	-1,742	-2,113	-2,484
5.33%	-1,940	-2,285	-2,636	-2,991	-3,349	-3,710	-4,073
8.00%	-3,907	-4,205	-4,516	-4,837	-5,168	-5,505	-5,847
KR4201Q72906	2020-07 콜290						9,127
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,791	4,524	4,218	3,878	3,510	3,118	2,705

-5.33%	4,190	3,805	3,390	2,951	2,494	2,020	1,534
-2.67%	3,203	2,707	2,196	1,672	1,139	599	52
0%	1,735	1,160	582	0	-584	-1,169	-1,756
2.67%	-268	-873	-1,478	-2,082	-2,687	-3,291	-3,895
5.33%	-2,808	-3,390	-3,977	-4,569	-5,163	-5,760	-6,359
8.00%	-5,837	-6,353	-6,885	-7,432	-7,989	-8,554	-9,127
KR4301Q72870			2020-07 풋287.5				6,281
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,622	-5,692	-5,780	-5,885	-6,004	-6,137	-6,281
-5.33%	-3,196	-3,329	-3,478	-3,641	-3,816	-3,999	-4,191
-2.67%	-1,027	-1,230	-1,441	-1,660	-1,883	-2,111	-2,343
0%	759	507	254	0	-255	-511	-767
2.67%	2,087	1,828	1,569	1,308	1,048	787	526
5.33%	2,966	2,743	2,512	2,275	2,034	1,790	1,543
8.00%	3,481	3,317	3,137	2,944	2,742	2,530	2,312

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

18,421

공시일	2020-06-22
기준일	2020-06-19

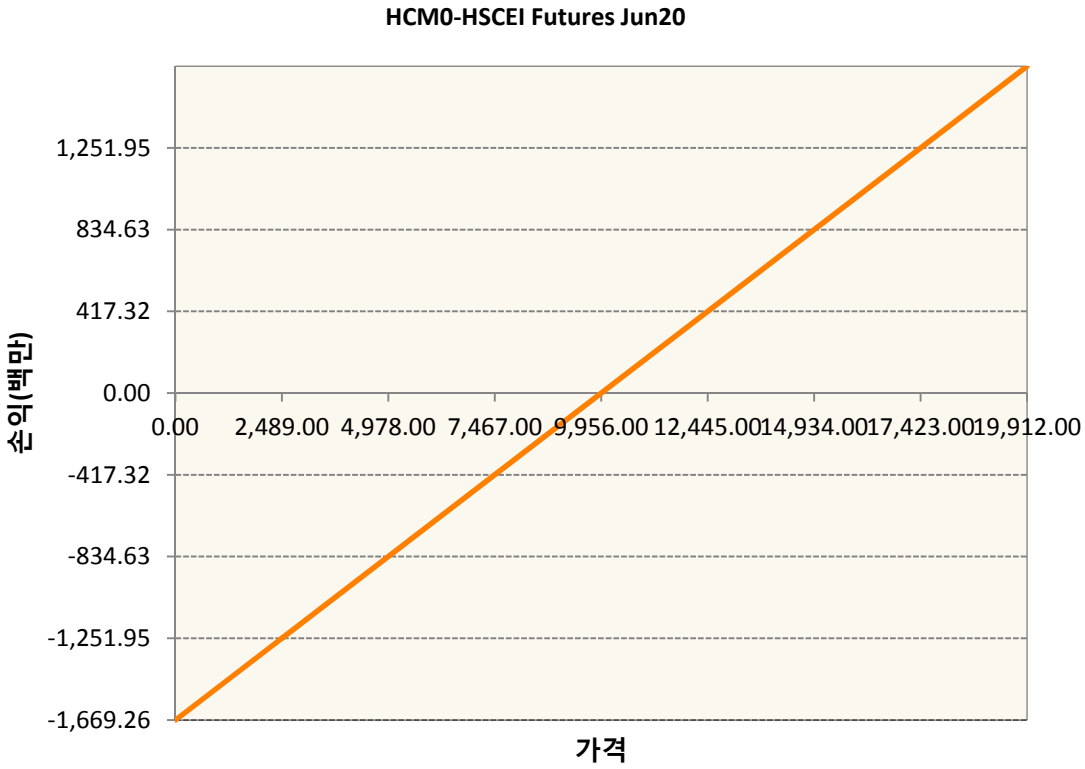
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

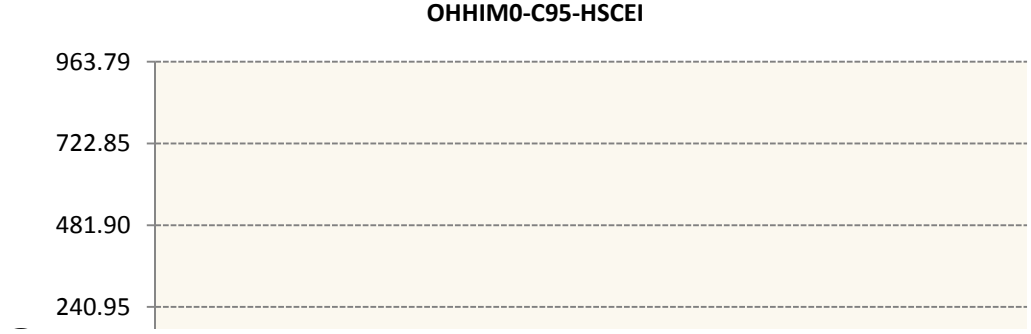
1. 계약금액

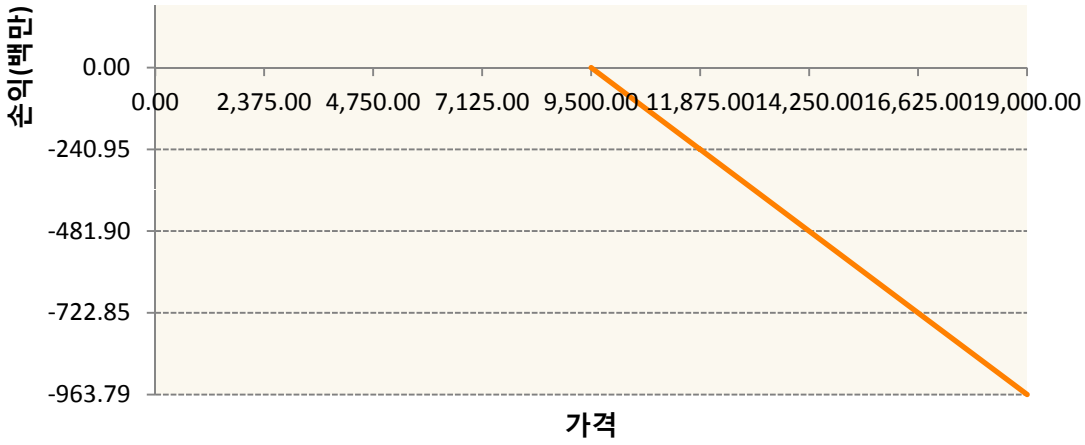
(단위:백만원)

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	1,669	0	1,669	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,250	-4,250	장내
누계	통화	선도	0	1,511	-1,511	장외

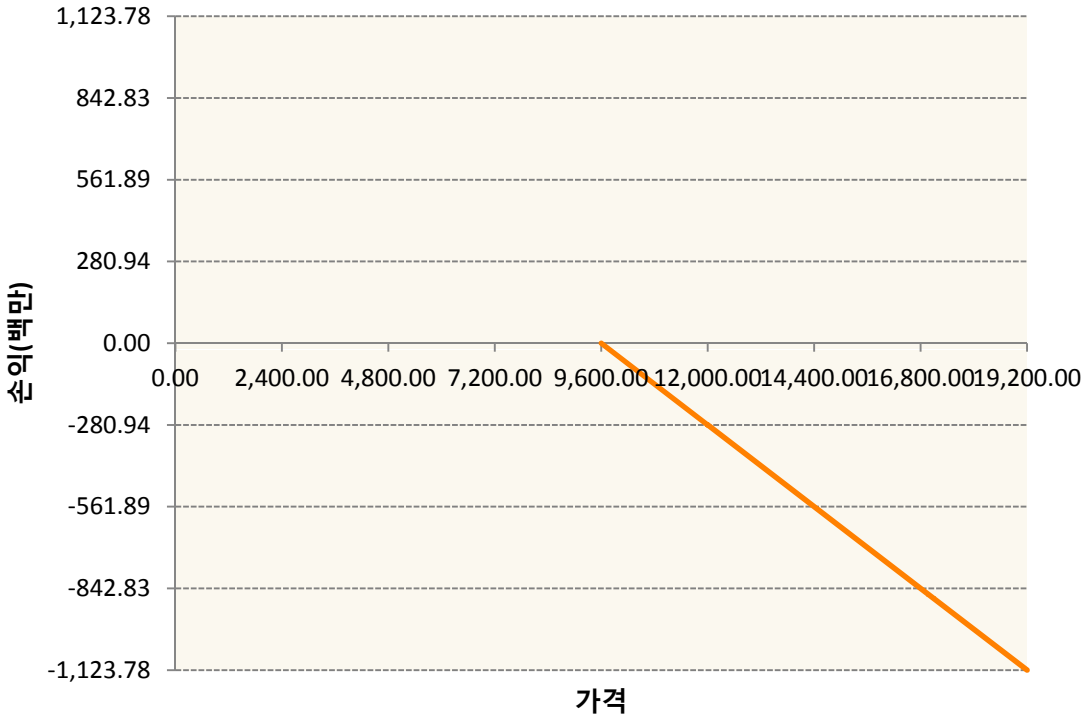
2. 만기시점의 손익구조



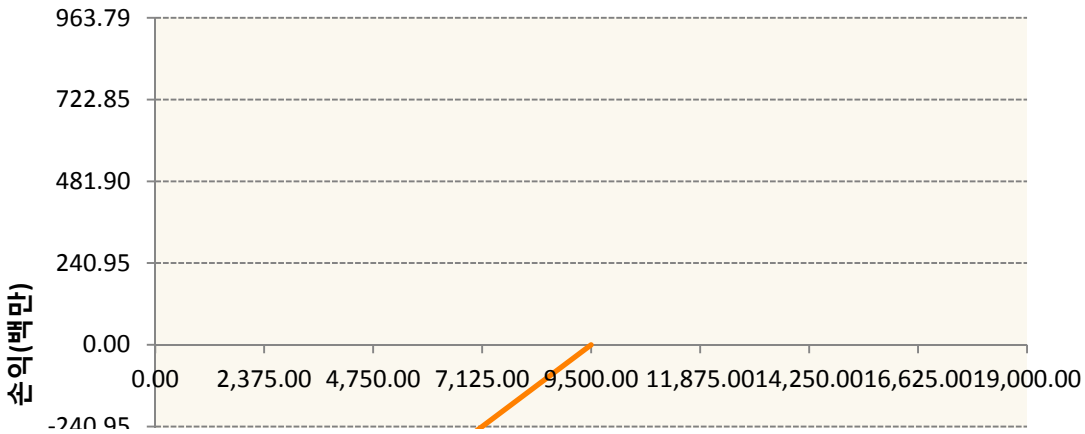


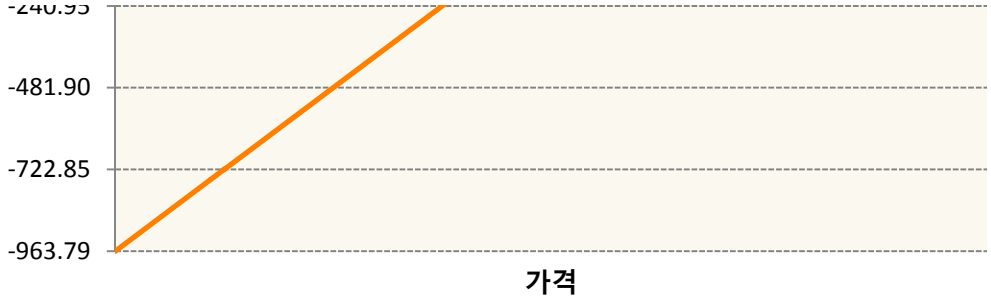


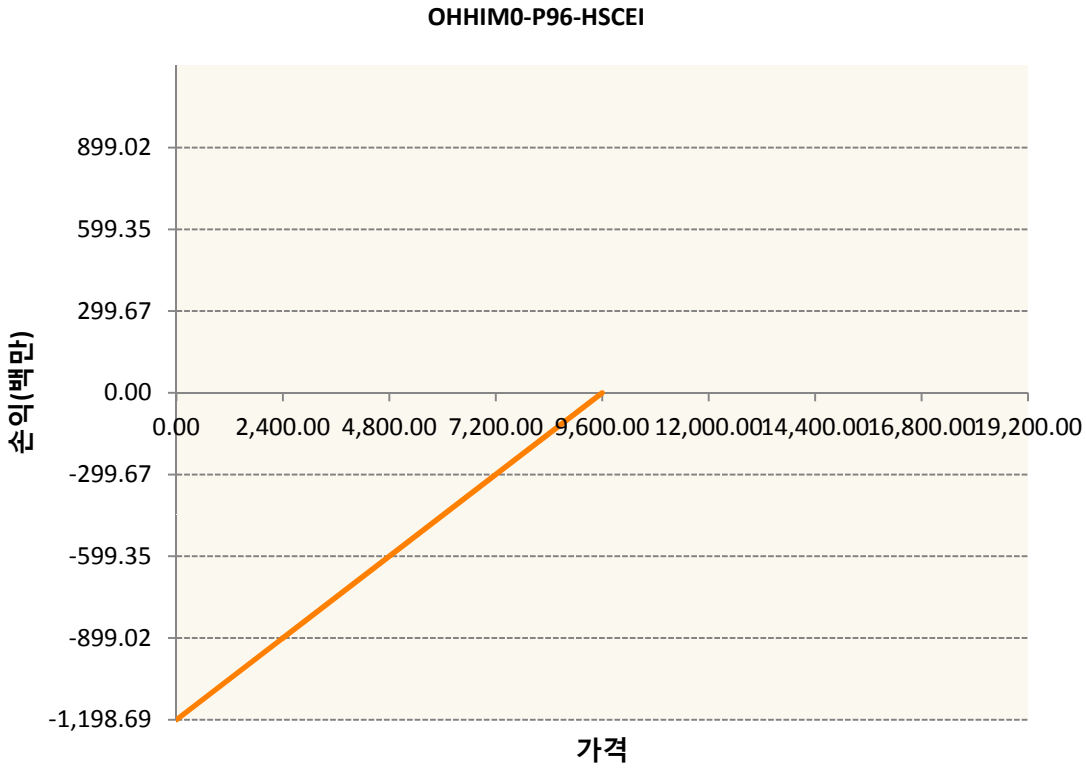
OHHIM0-C96-HSCEI



OHHIM0-P95-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E	121
HCM0 HSCEI Futures Jun20	134
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)
	575

공시일	2020-06-22
기준일	2020-06-19

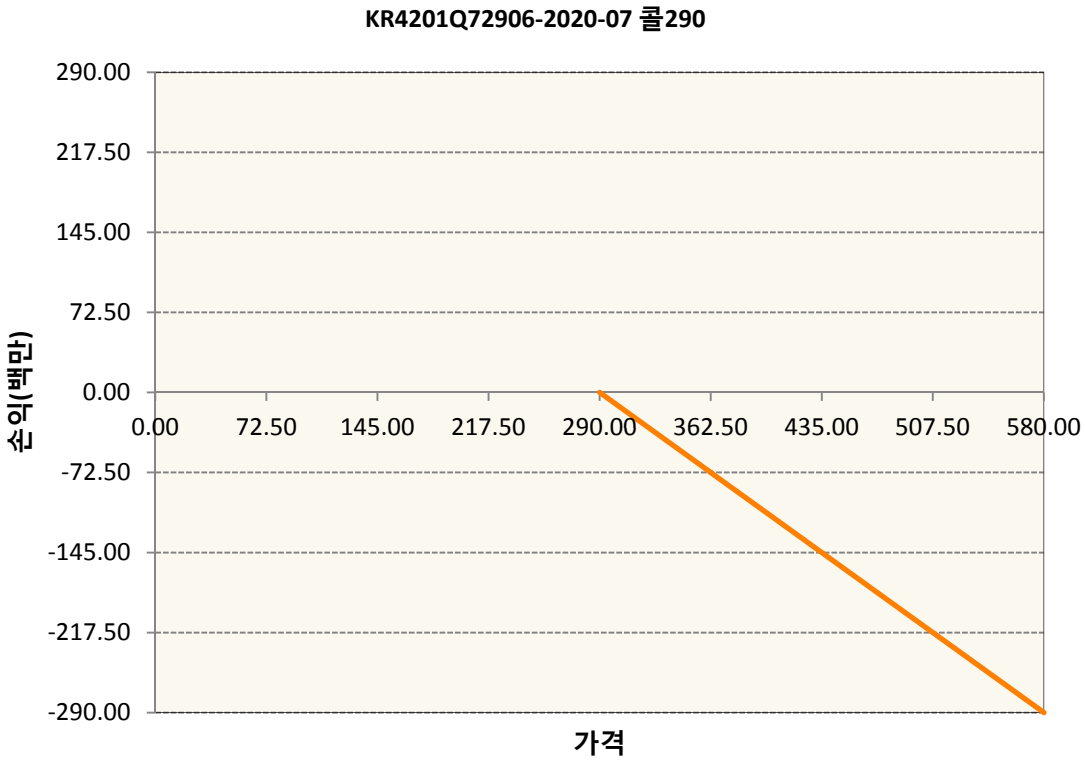
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

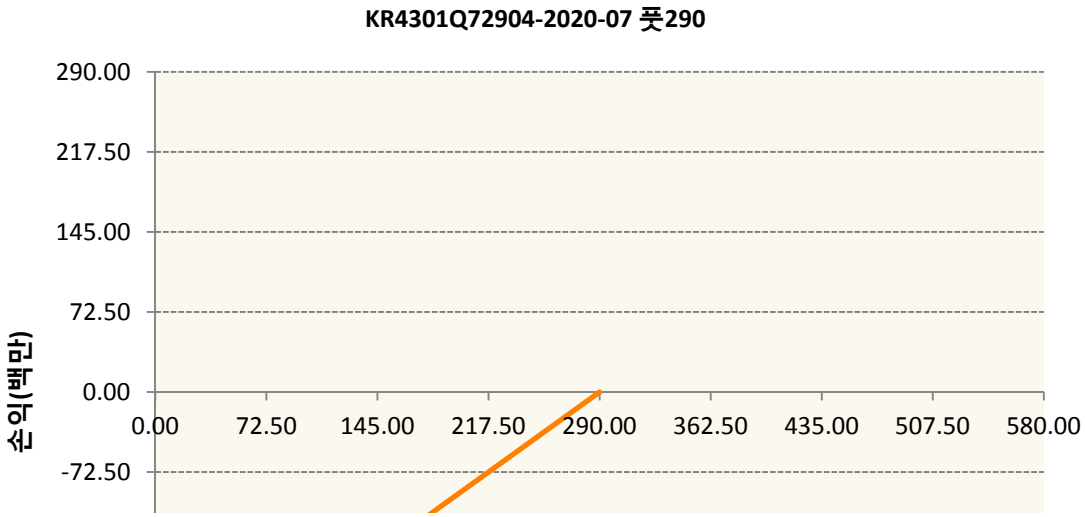
1. 계약금액

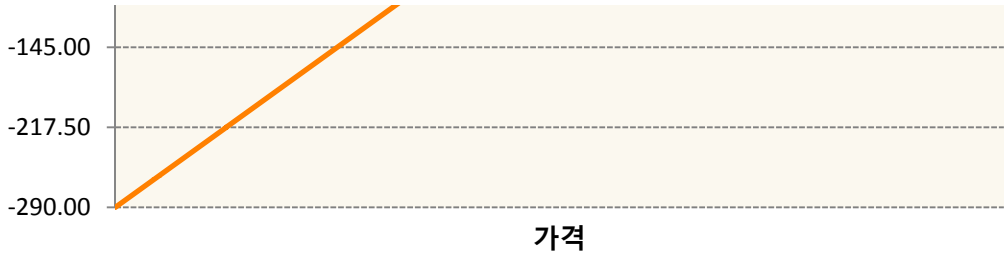
(단위:백만원)

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







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%	8	8	7	7	6	5	5
-5.33%	7	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	-2	-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					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	-12
-2.67%	-3	-4	-4	-5	-6	-6	-7
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	6	6	5	4	3	3	2
5.33%	9	9	8	7	6	6	5
8.00%	11	11	10	9	9	8	7

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

31

공시일	2020-06-22
기준일	2020-06-19

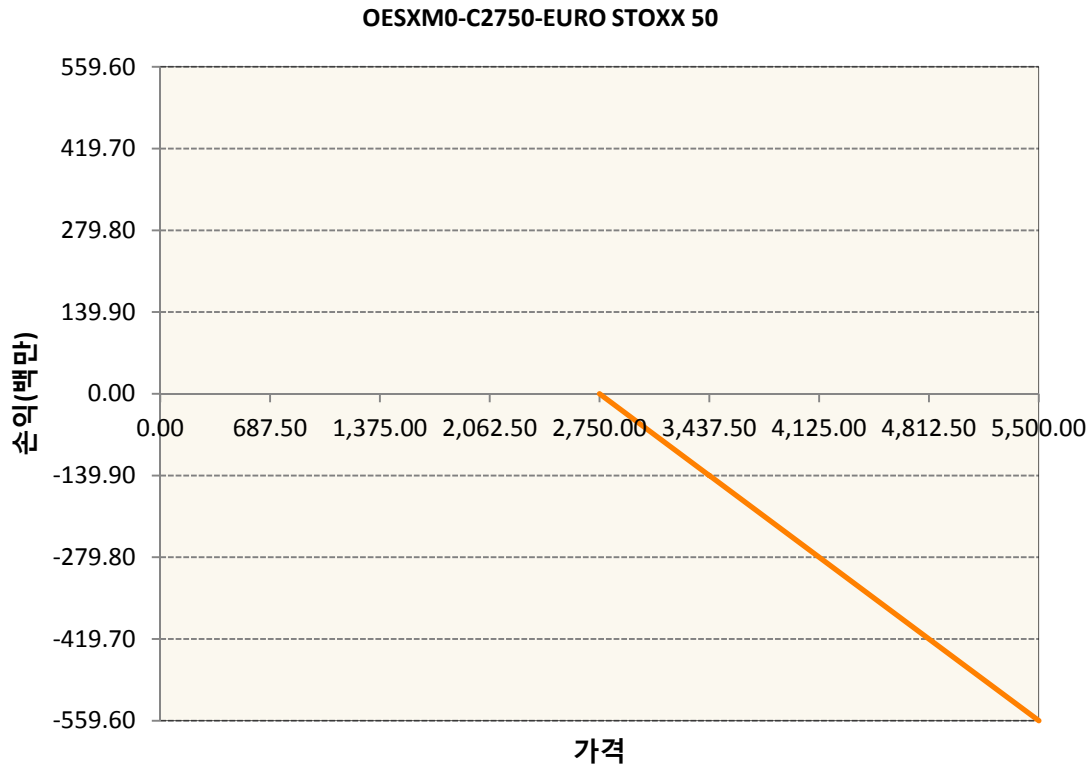
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

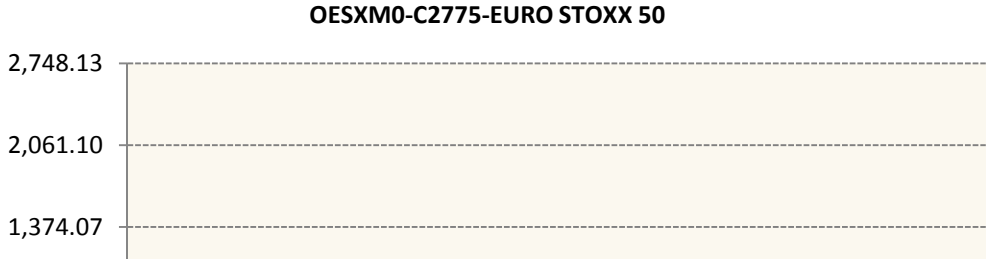
1. 계약금액

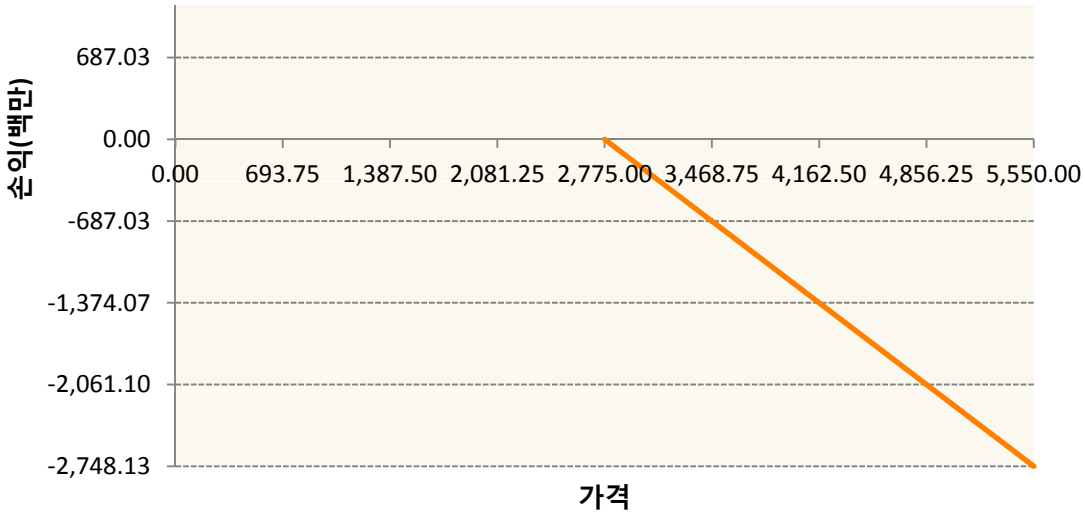
(단위:백만원)

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	1,263	0	1,263	
누계	유가증권	스왑	8,091	0	8,091	장외
누계	유가증권	옵션	0	6,653	-6,653	장내
누계	통화	선도	0	2,936	-2,936	장외

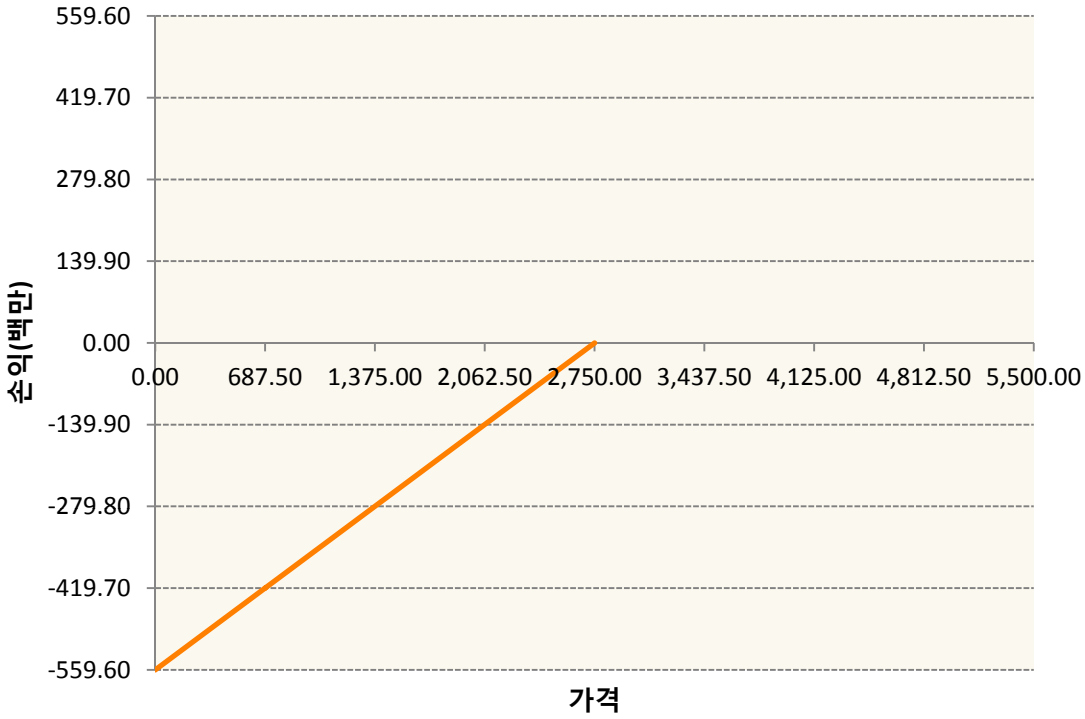
2. 만기시점의 손익구조



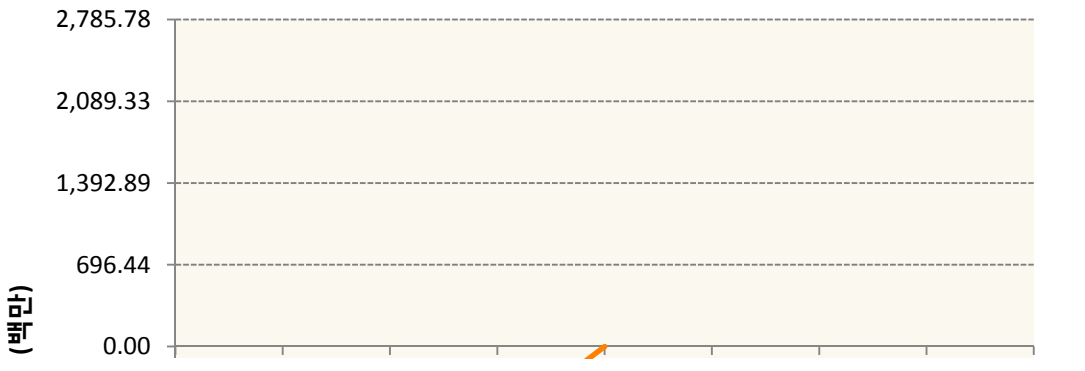


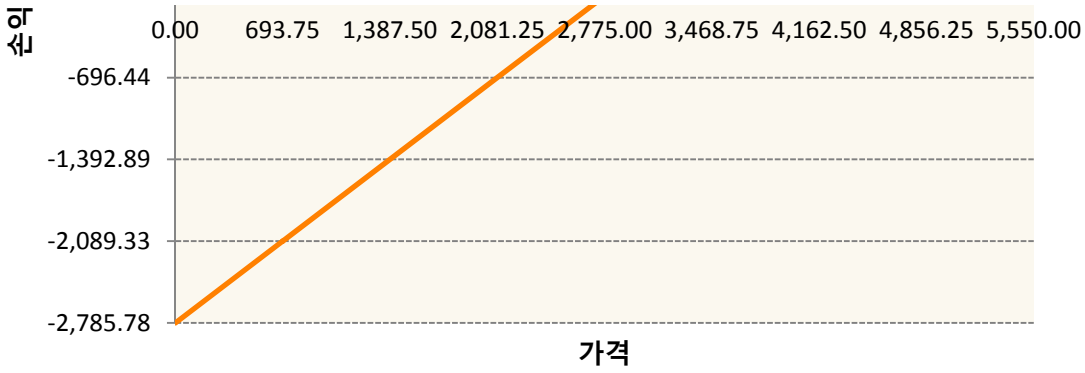


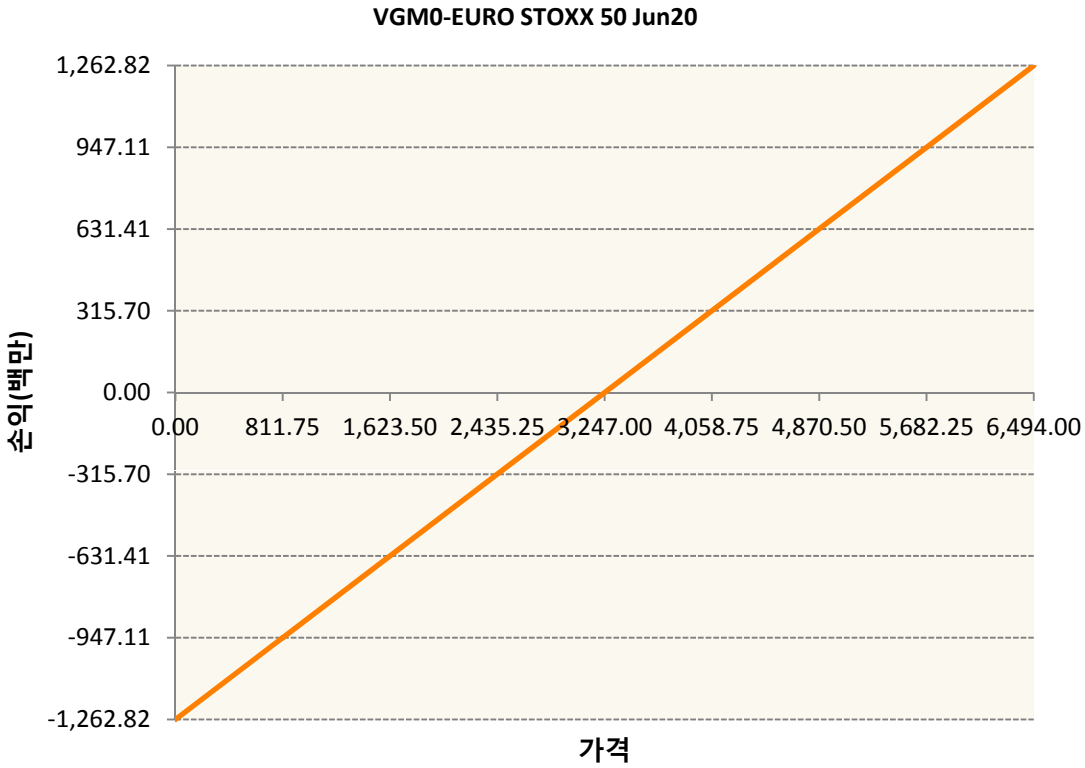
OESXM0-P2750-EURO STOXX 50



OESXM0-P2775-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	23
FX21020H09	KRW/EUR 26-06-20E	220
FX21020K02	KRW/EUR 26-06-20E	15
OESXM0-C2	EURO STOXX 50	45
OESXM0-C2	EURO STOXX 50	220
OESXM0-P2	EURO STOXX 50	45
OESXM0-P2	EURO STOXX 50	223
VGM0	EURO STOXX 50 Jun20	101

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

1,037

공시일	2020-06-22
기준일	2020-06-19

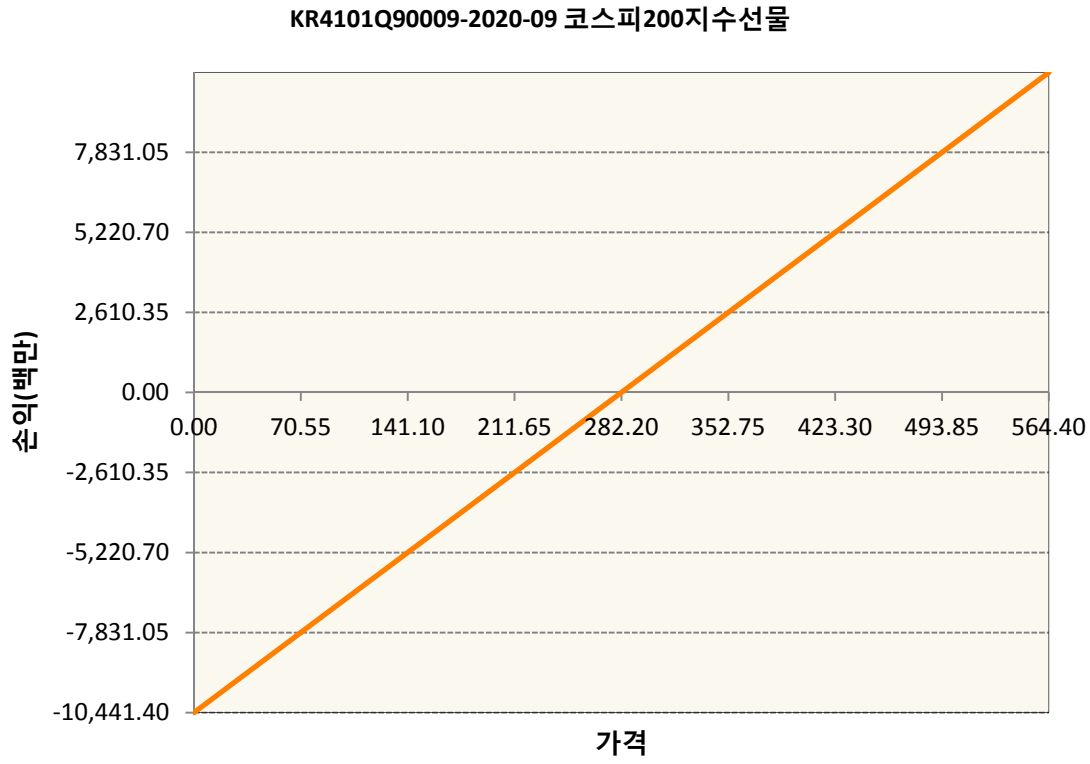
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	10,441	0	10,441	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009	2020-09 코스피200지수선물						839
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-839	-839	-839	-839	-839	-839	-839
-5.33%	-559	-559	-559	-559	-559	-559	-559
-2.67%	-280	-280	-280	-280	-280	-280	-280
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	280	280	280	280	280	280	280
5.33%	559	559	559	559	559	559	559
8.00%	839	839	839	839	839	839	839

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

1,319

공시일	2020-06-22
기준일	2020-06-19

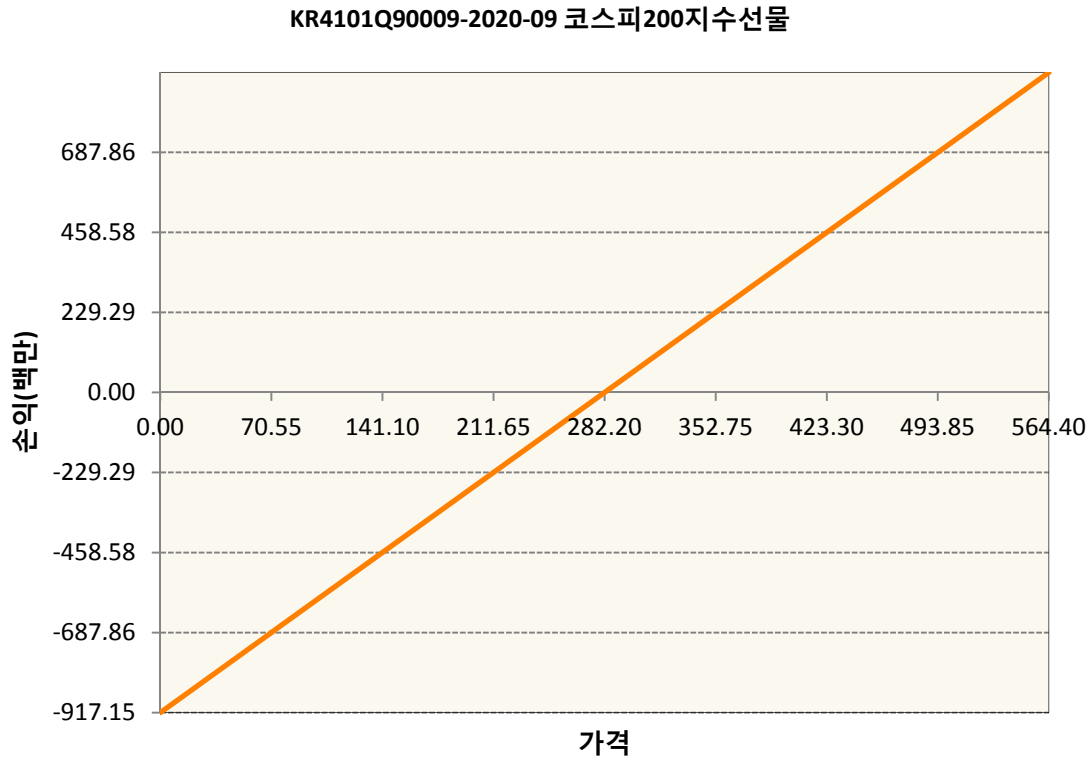
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	917	0	917	장내

2. 만기시점의 손익구조



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

공시일	2020-06-22
기준일	2020-06-19

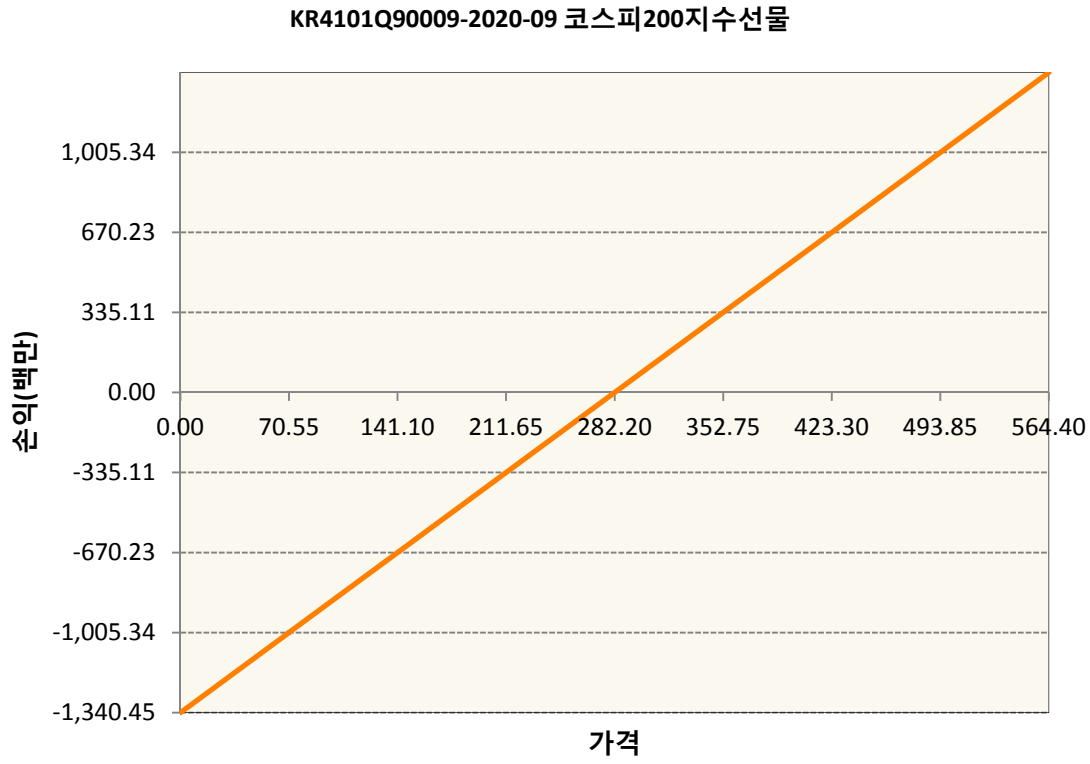
ETF스마트레버리지목표전환형10호

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	1,340	0	1,340	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009	2020-09 코스피200지수선물						108
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-108	-108	-108	-108	-108	-108	-108
-5.33%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
-2.67%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	36	36	36	36	36	36	36
5.33%	72	72	72	72	72	72	72
8.00%	108	108	108	108	108	108	108

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

169

공시일	2020-06-22
기준일	2020-06-19

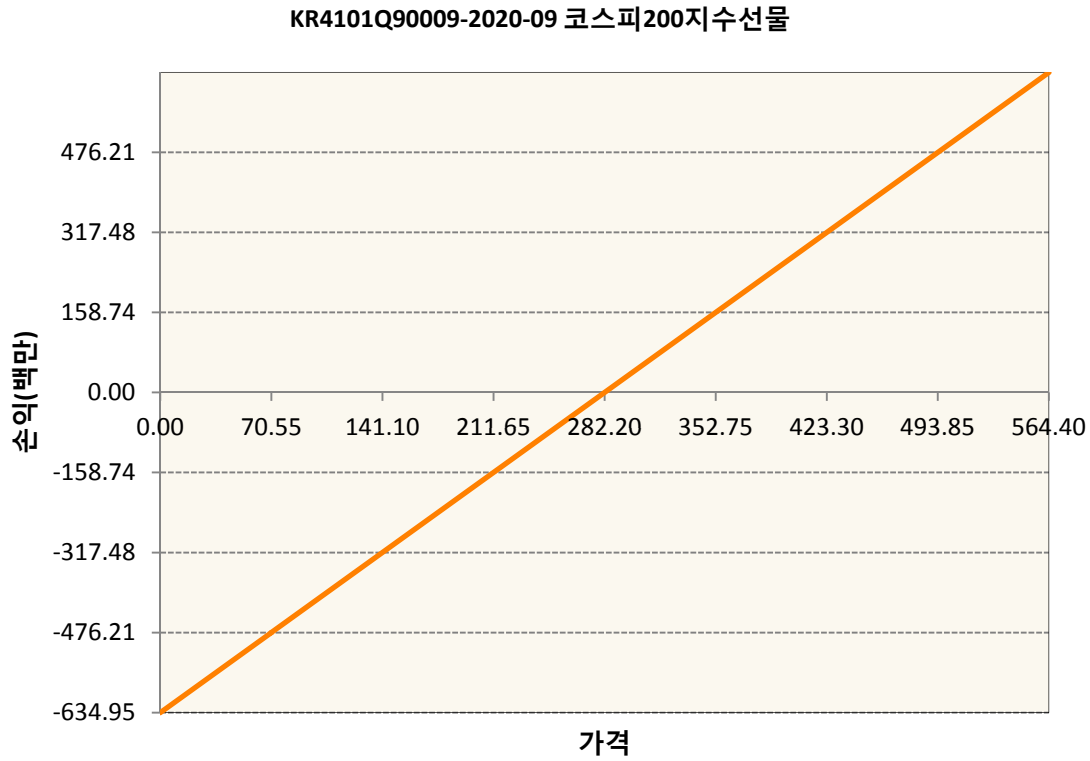
스마트KRX300인덱스목표전환형1호

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	635	0	635	장내

2. 만기시점의 손익구조



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
-5.33%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	17	17	17	17	17	17	17
5.33%	34	34	34	34	34	34	34
8.00%	51	51	51	51	51	51	51

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

80

공시일	2020-06-22
기준일	2020-06-19

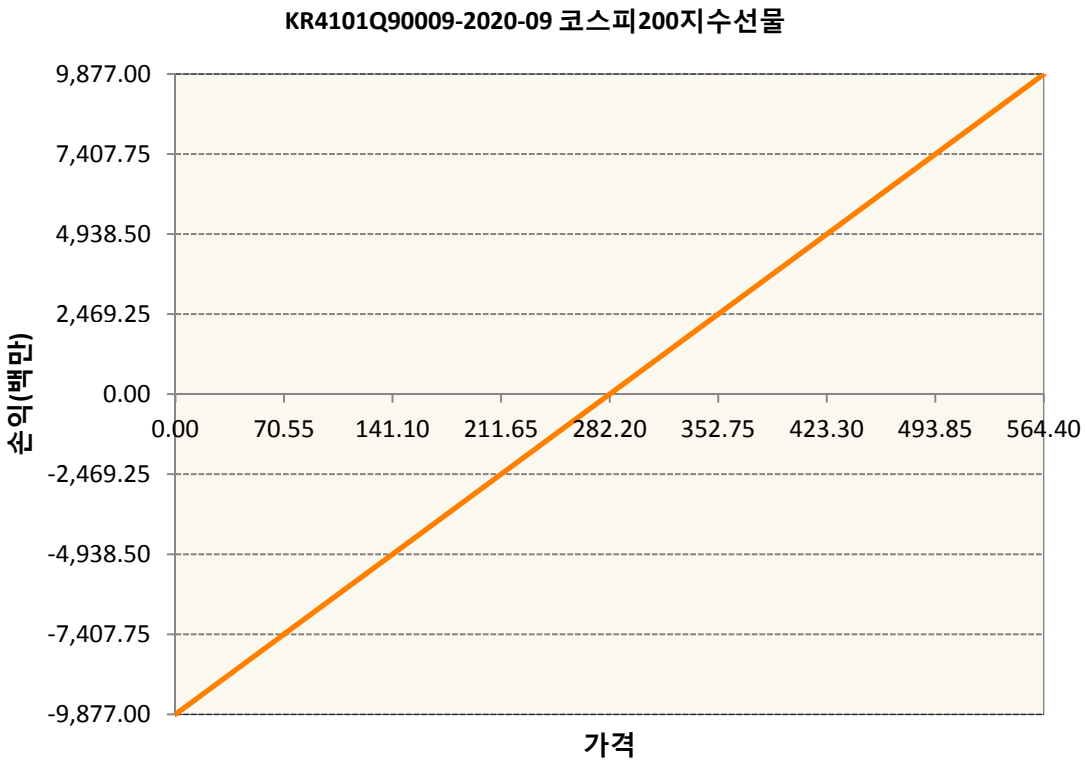
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

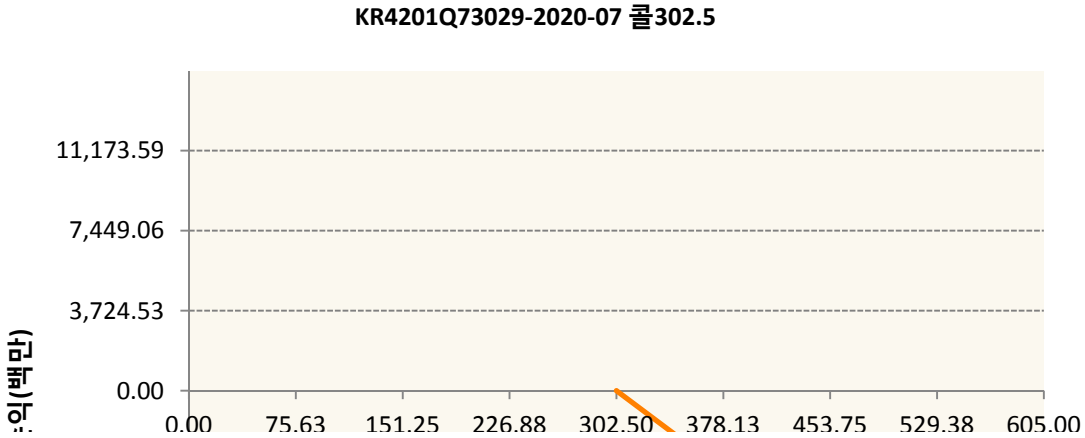
1. 계약금액

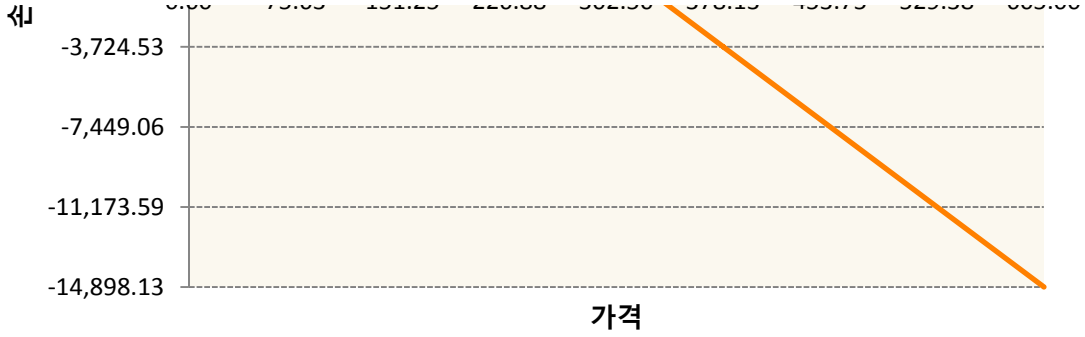
(단위:백만원)

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	9,877	0	9,877	장내
누계	유가증권	옵션	3,247	19,092	-15,845	장내

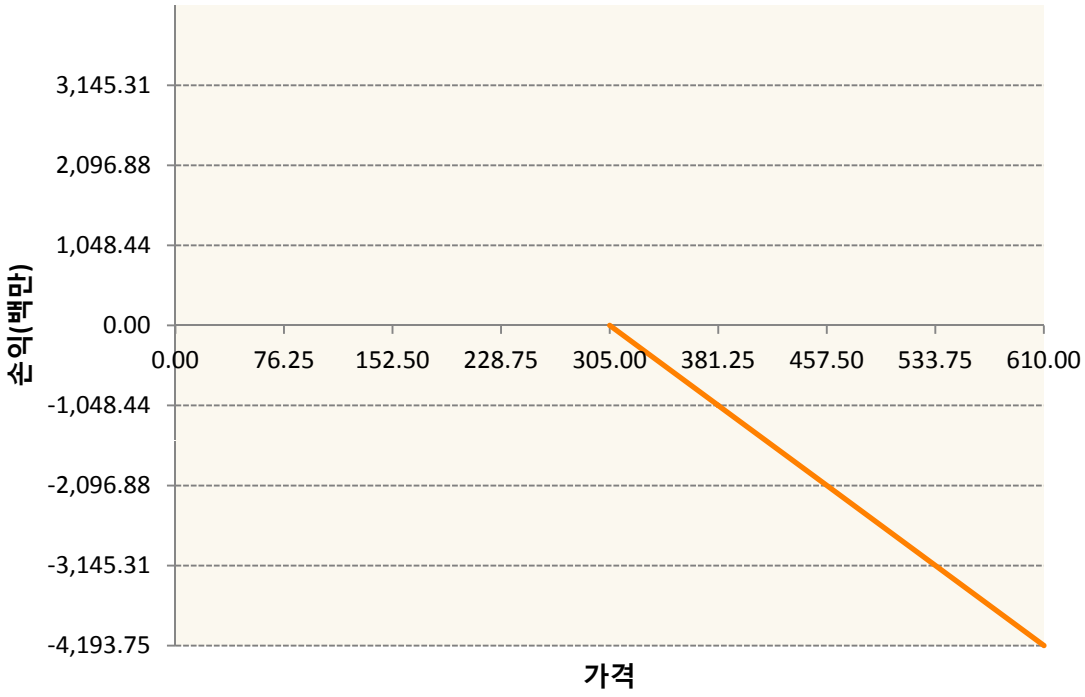
2. 만기시점의 손익구조



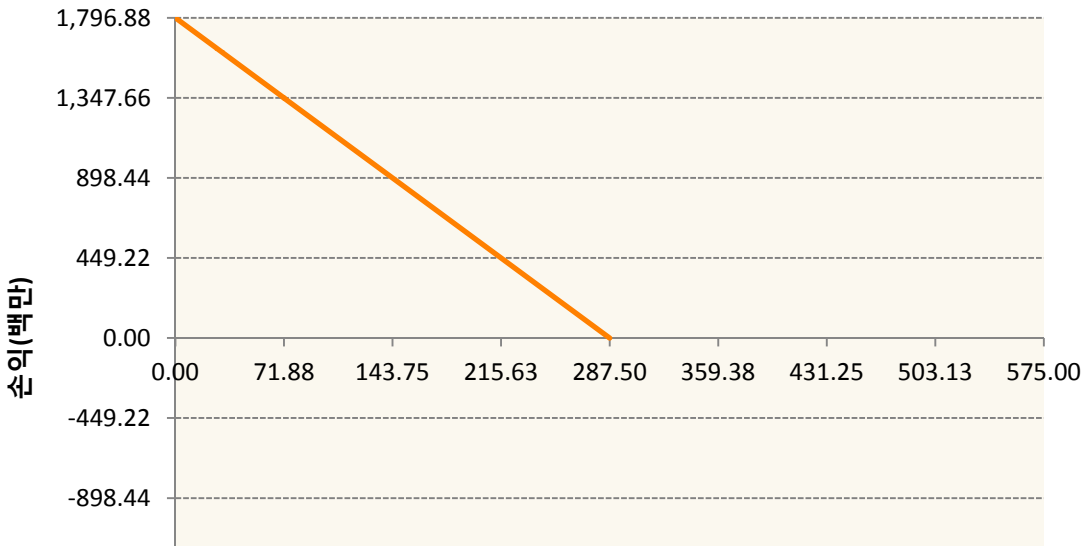


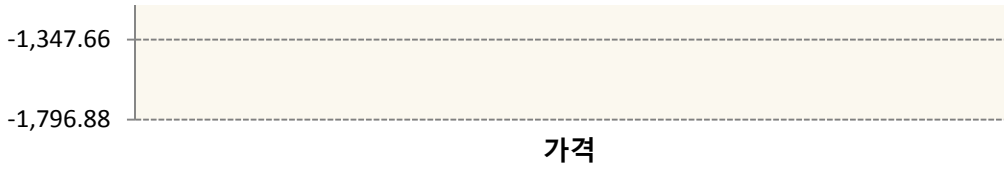


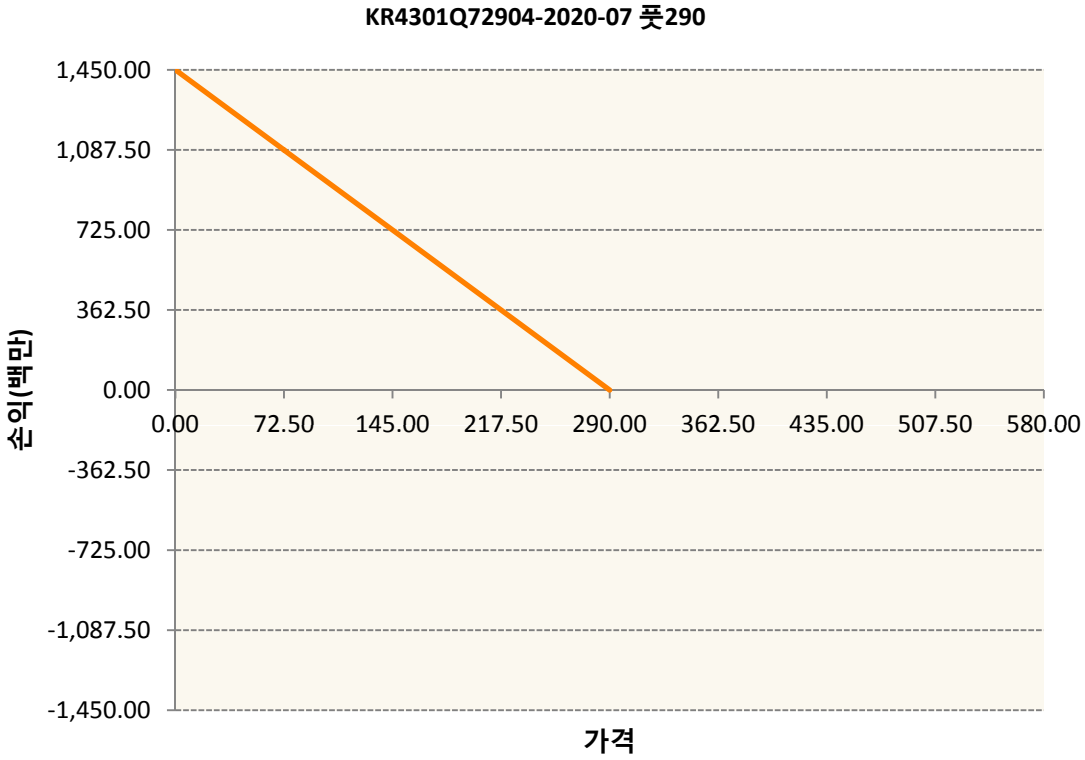
KR4201Q73052-2020-07 콜305



KR4301Q72870-2020-07 풋287.5







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q90009	2020-09 코스피200지수선물						793
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-793	-793	-793	-793	-793	-793	-793
-5.33%	-529	-529	-529	-529	-529	-529	-529
-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%	529	529	529	529	529	529	529
8.00%	793	793	793	793	793	793	793
KR4201Q73029	2020-07 콜302.5						637
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	250	238	223	205	184	159	133
-5.33%	229	210	187	160	131	100	66
-2.67%	190	161	129	94	56	17	-23

0%	124	85	43	0	-44	-90	-136
2.67%	22	-26	-75	-124	-175	-225	-276
5.33%	-122	-175	-229	-282	-336	-389	-443
8.00%	-311	-365	-420	-474	-528	-583	-637
	KR4201Q73052		2020-07 콜305				169
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	62	60	56	51	46	40	33
-5.33%	58	53	47	40	33	25	16
-2.67%	49	41	33	24	14	4	-7
0%	33	22	11	0	-12	-24	-37
2.67%	7	-5	-19	-32	-46	-59	-73
5.33%	-29	-44	-58	-73	-88	-103	-118
8.00%	-78	-93	-108	-123	-139	-154	-169
	KR4301Q72870		2020-07 풋287.5				112
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	100	102	103	105	107	110	112
-5.33%	57	59	62	65	68	71	75
-2.67%	18	22	26	30	34	38	42
0%	-14	-9	-5	0	5	9	14
2.67%	-37	-33	-28	-23	-19	-14	-9
5.33%	-53	-49	-45	-41	-36	-32	-28
8.00%	-62	-59	-56	-53	-49	-45	-41
	KR4301Q72904		2020-07 풋290				93
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	85	85	87	88	89	91	93
-5.33%	49	51	53	55	57	60	62
-2.67%	17	20	22	25	28	31	35
0%	-10	-7	-4	0	4	7	11
2.67%	-32	-28	-24	-20	-17	-13	-9
5.33%	-46	-43	-39	-36	-32	-29	-25
8.00%	-55	-53	-50	-47	-44	-40	-37

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

1,984

공시일	2020-06-22
기준일	2020-06-19

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	142,049	0	142,049	

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	2020-06-22
기준일	2020-06-19

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	100,088	0	100,088	

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	2020-06-22
기준일	2020-06-19

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	466,321	0	466,321	
누계	통화	선도	0	494,484	-494,484	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J027	KRW/USD 22-06-20E	1,490
FX21020J028	KRW/USD 22-06-20E	1,935
FX21020J039	KRW/USD 24-07-20E	2,177
FX21020J043	KRW/USD 24-07-20E	1,742
FX21020J043	KRW/USD 24-07-20E	1,935
FX21020K01	KRW/USD 22-06-20E	677
FX21020K01	KRW/USD 18-08-20E	2,361
FX21020K01	KRW/USD 18-08-20E	968
FX21020K03	KRW/USD 26-08-20E	1,016
FX21020K03	KRW/USD 26-08-20E	1,606
FX21020K05	KRW/USD 03-08-20E	3,387
FX21020K05	KRW/USD 03-08-20E	6,871
FX21020M0(	KRW/USD 26-08-20E	581
FX21020M01	KRW/USD 26-08-20E	4,742
FX21020M02	KRW/USD 14-09-20E	2,013
FX21020M02	KRW/USD 14-09-20E	2,439
FX21020M05	KRW/USD 22-09-20E	1,006
FX21020M05	KRW/USD 22-09-20E	2,613
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

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

(단위:백만원)

20,509

공시일	2020-06-22
기준일	2020-06-19

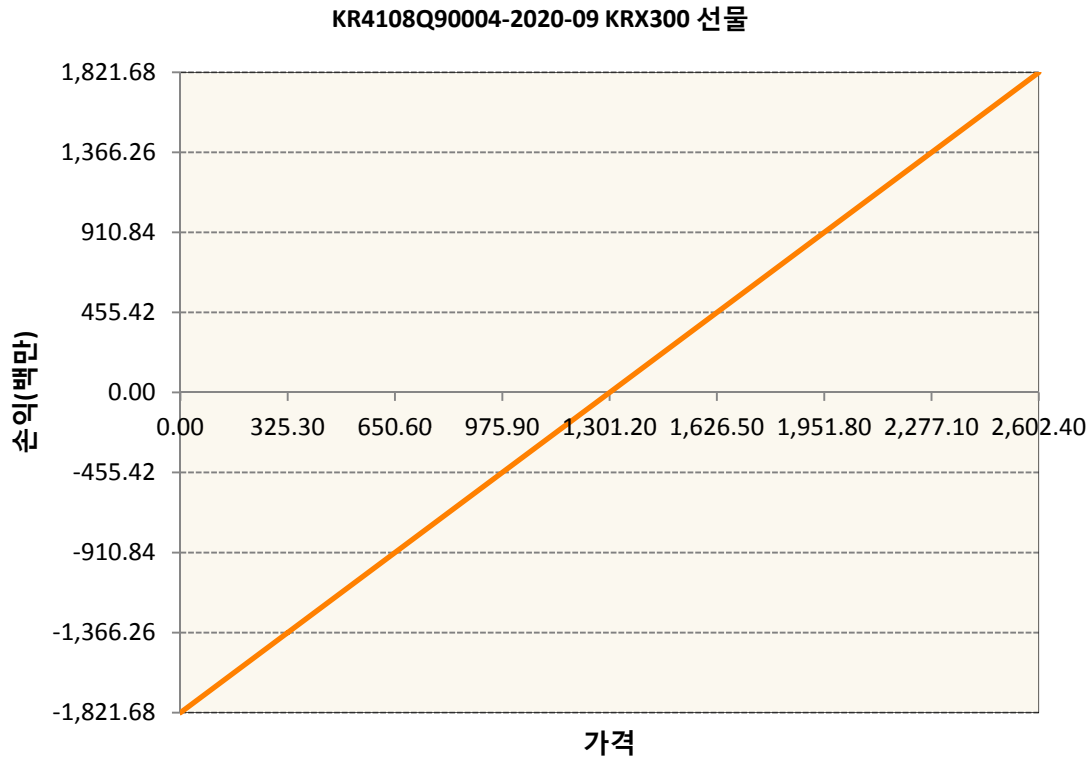
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,822	0	1,822	장내

2. 만기시점의 손익구조



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	2020-06-22
기준일	2020-06-19

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	7,686	0	7,686	
누계	통화	선도	0	7,512	-7,512	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	77
FX21020M0(KRW/USD 20-07-20E	10
FX21020M02 KRW/USD 20-07-20E	15
FX21020M03 KRW/USD 06-07-20E	48
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	2020-06-22
기준일	2020-06-19

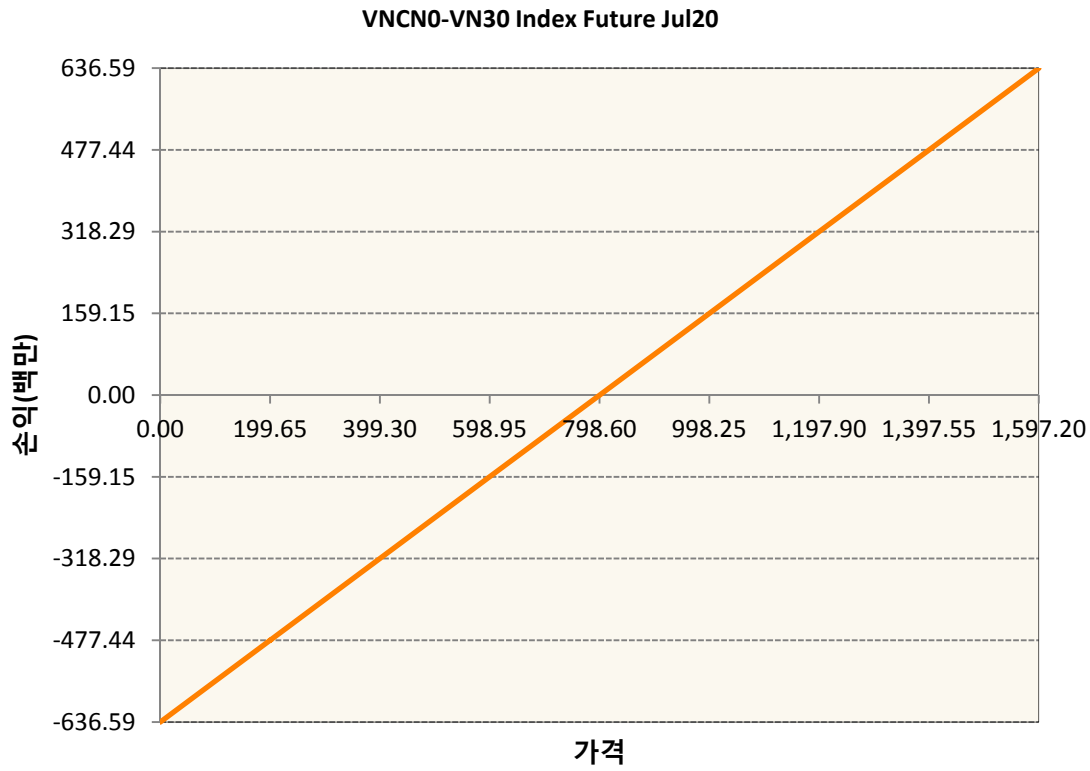
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	637	0	637	
누계	유가증권	스왑	984	0	984	장외
누계	통화	선도	209	887	-678	장외

2. 만기시점의 손익구조



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

FX21020J018	KRW/EUR 24-07-20E	3
FX21020J025	KRW/EUR 24-07-20E	5
FX21020J033	KRW/EUR 26-06-20E	5
FX21020J038	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
VNCN0	VN30 Index Future Jul20	51

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

172

공시일	2020-06-22
기준일	2020-06-19

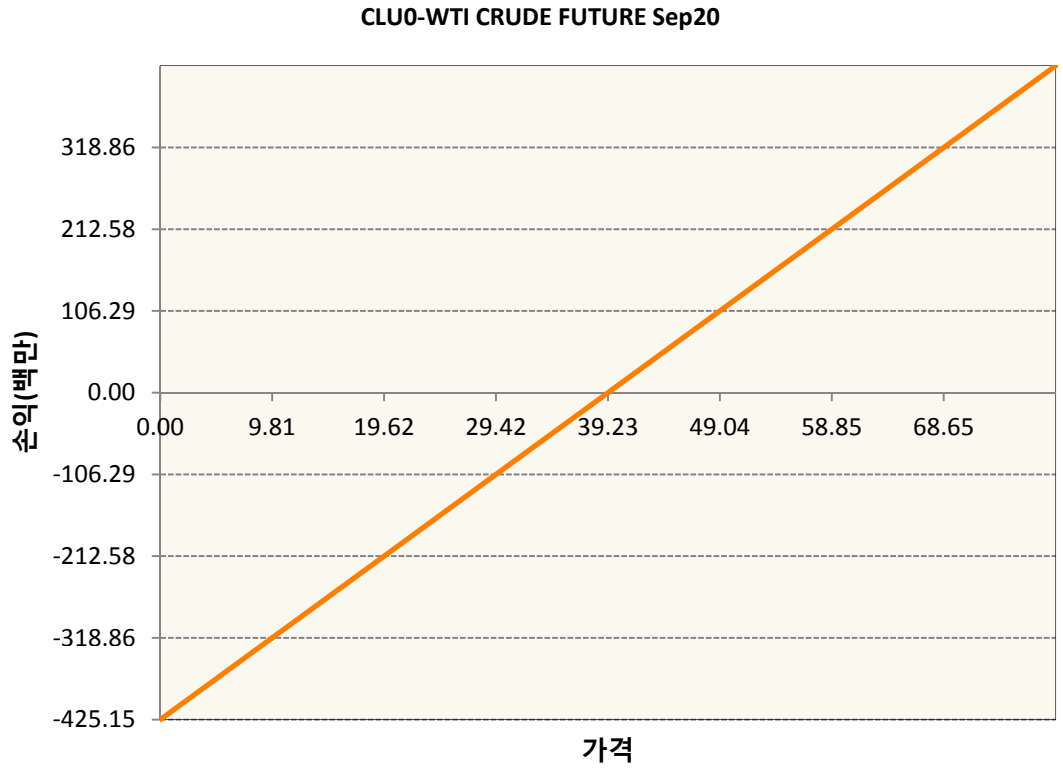
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

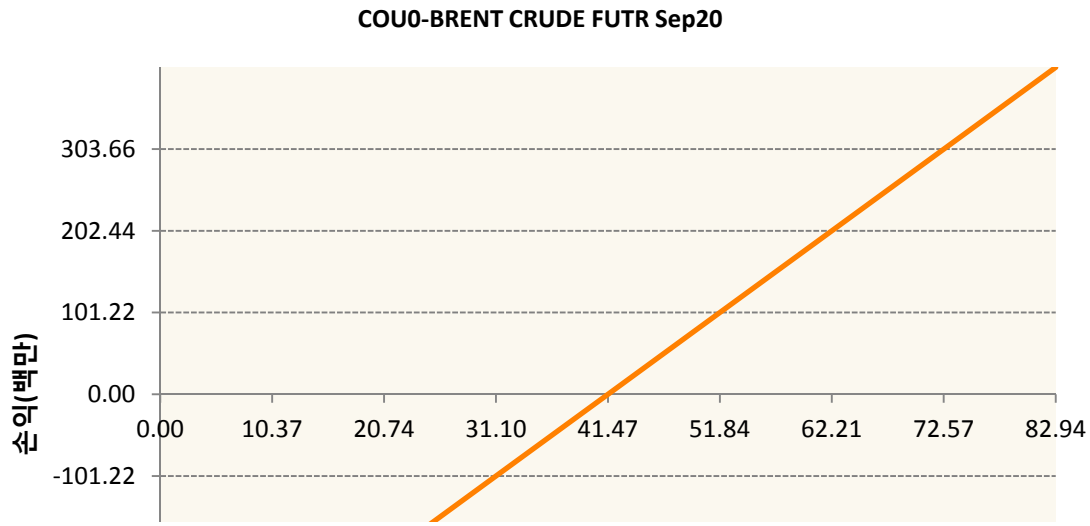
1. 계약금액

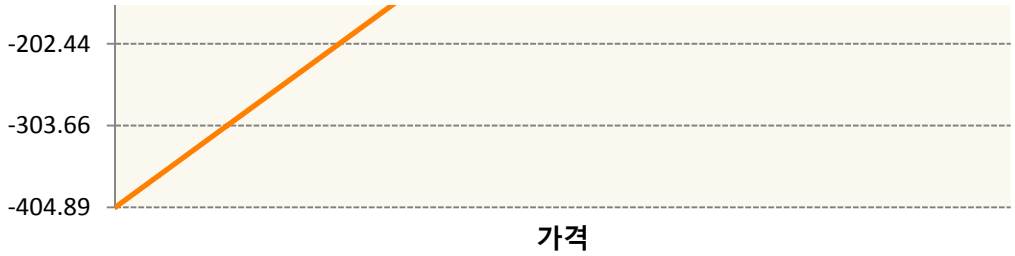
(단위:백만원)

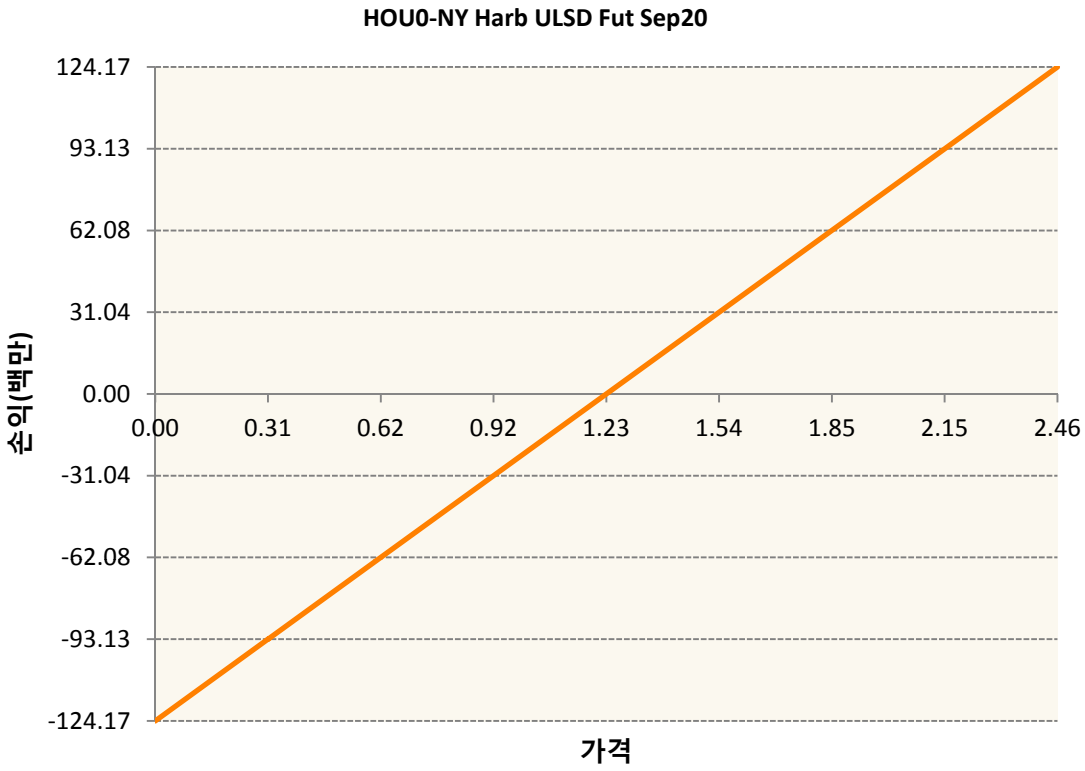
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,918	362	1,555	

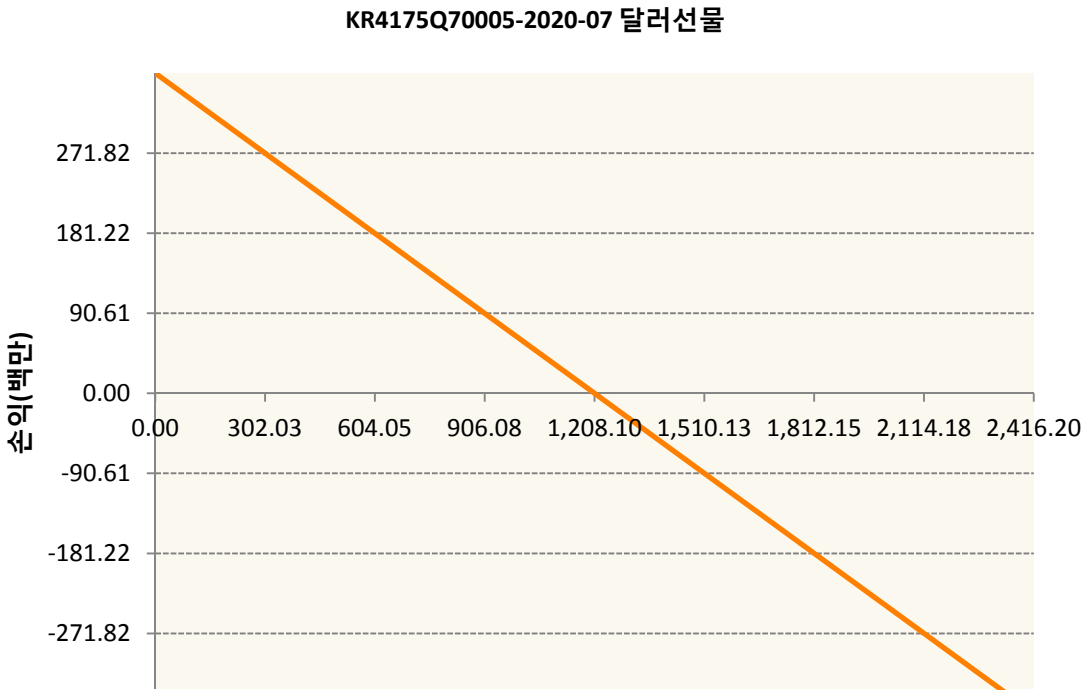
2. 만기시점의 손익구조

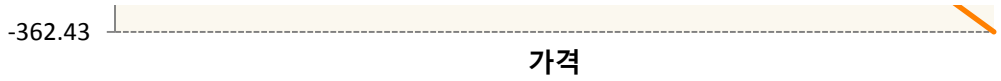


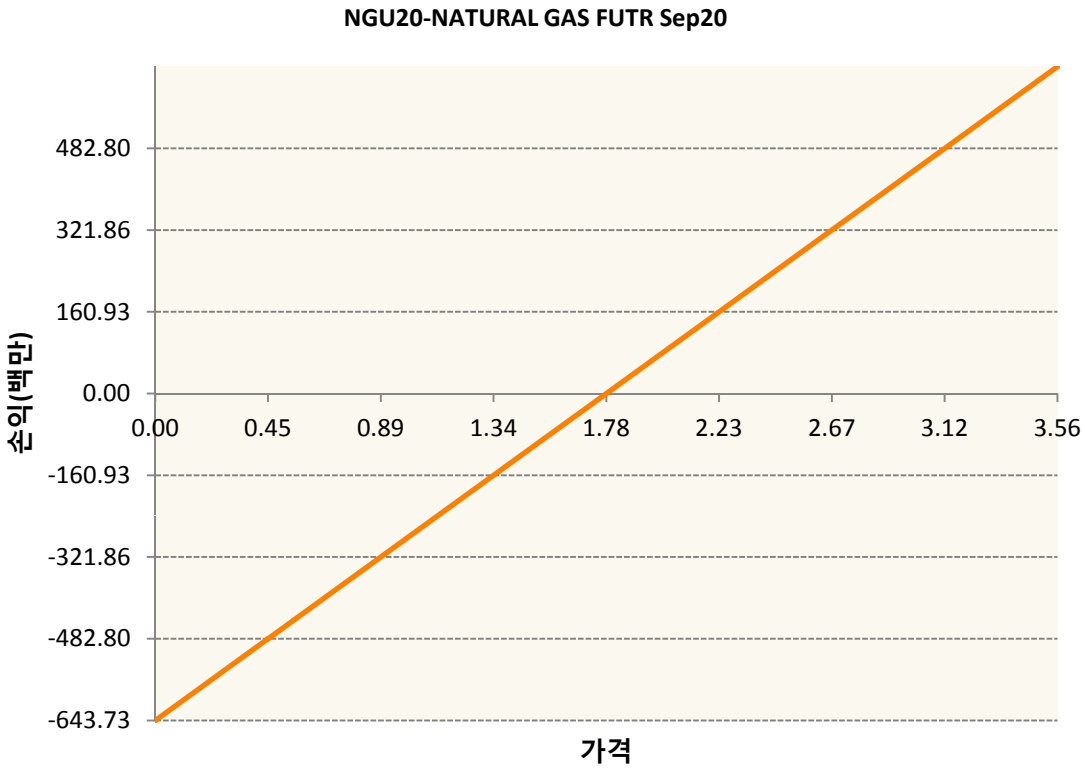


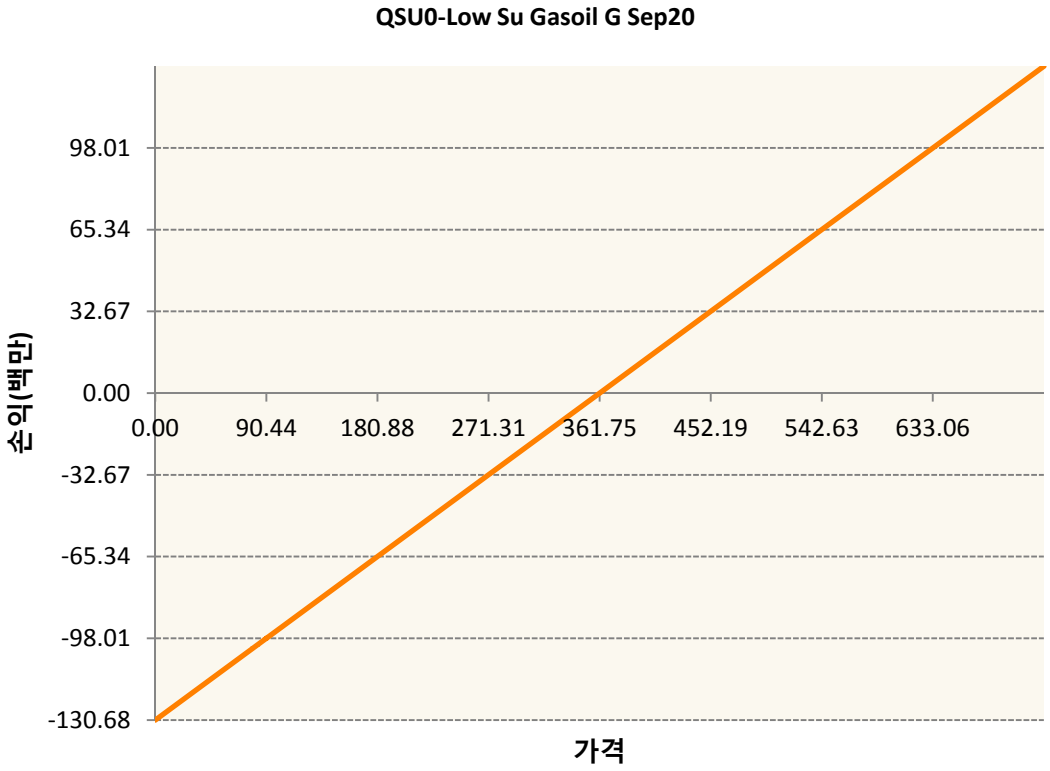

-202.44
-303.66
-404.89
가격

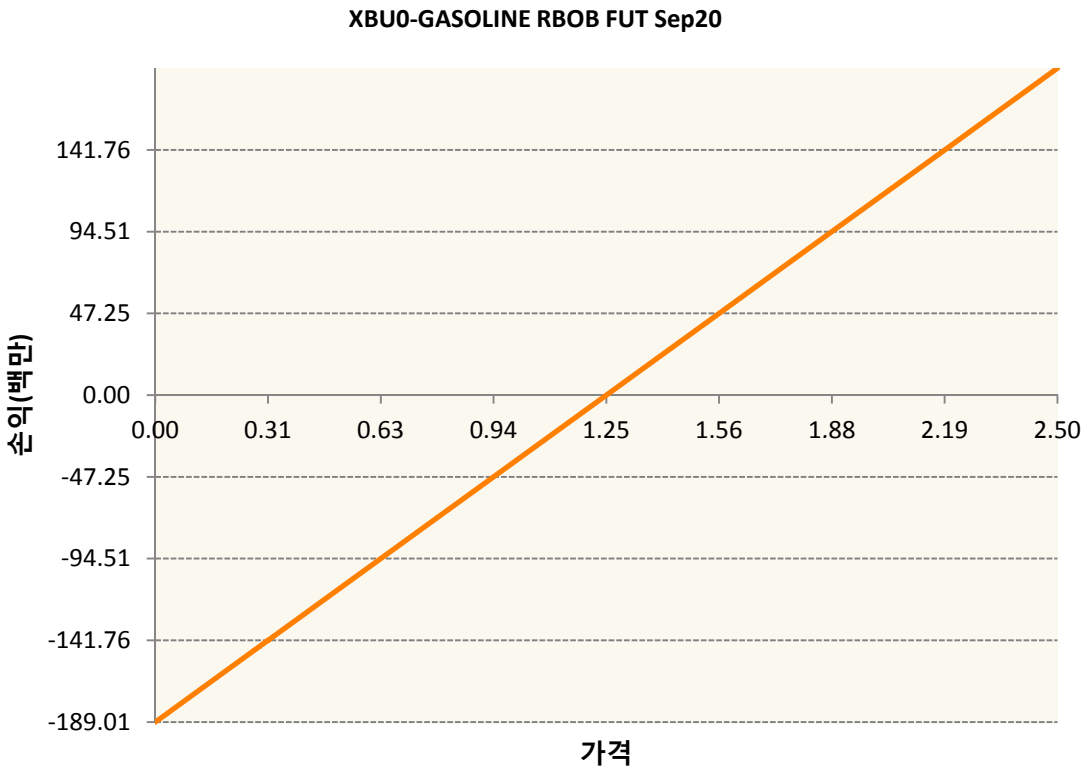

HOU0-NY Harb ULSD Fut Sep20
124.17
93.13
62.08
31.04
0.00
-31.04
-62.08
-93.13
-124.17
0.00
0.31
0.62
0.92
1.23
1.54
1.85
2.15
2.46
손익(백만)
가격


KR4175Q70005-2020-07 달러선물
271.82
181.22
90.61
0.00
-90.61
-181.22
-271.82
0.00
302.03
604.05
906.08
1,208.10
1,510.13
1,812.15
2,114.18
2,416.20
손익(백만)


-362.43
가격


NGU20-NATURAL GAS FUTR Sep20
482.80
321.86
160.93
0.00
-160.93
-321.86
-482.80
-643.73
0.00
0.45
0.89
1.34
1.78
2.23
2.67
3.12
3.56
손익(백만)
가격


QSU0-Low Su Gasoil G Sep20
98.01
65.34
32.67
0.00
-32.67
-65.34
-98.01
-130.68
0.00
90.44
180.88
271.31
361.75
452.19
542.63
633.06
손익(백만)
가격



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
KR4175Q70(	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)
	975

공시일	2020-06-22
기준일	2020-06-19

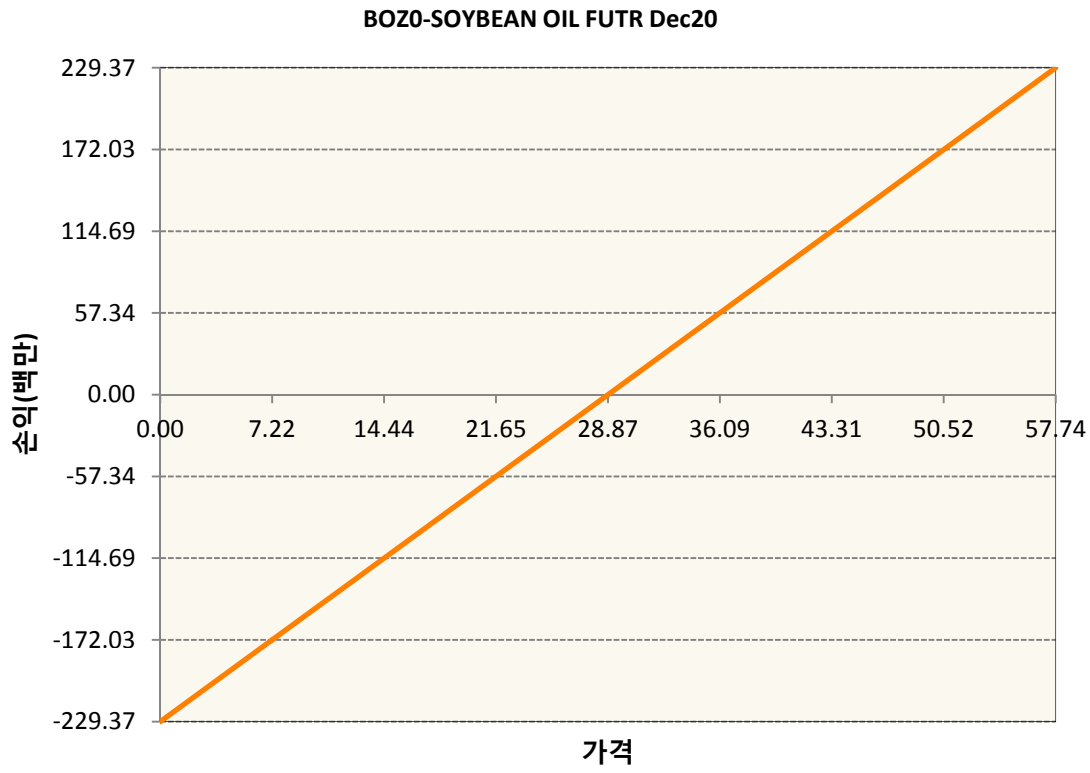
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

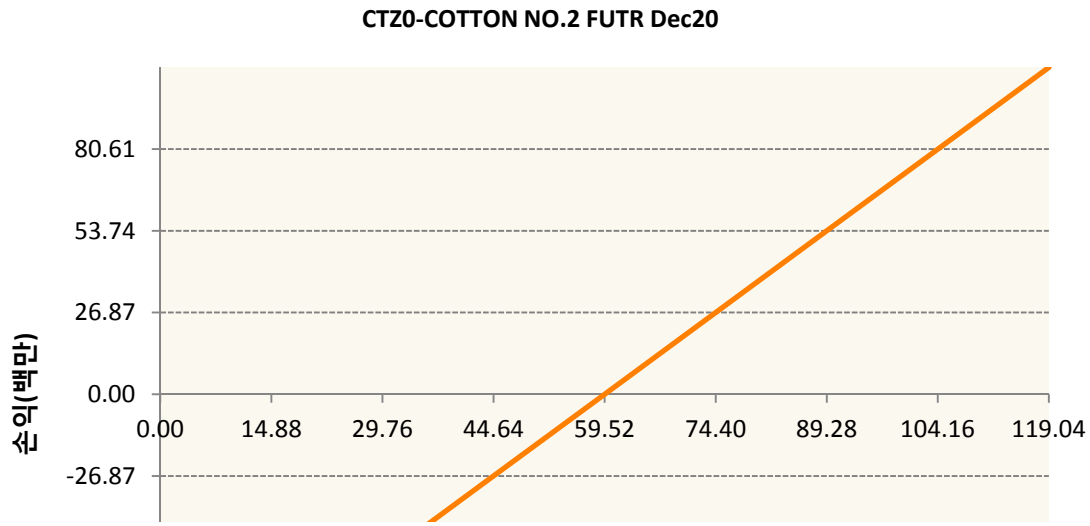
1. 계약금액

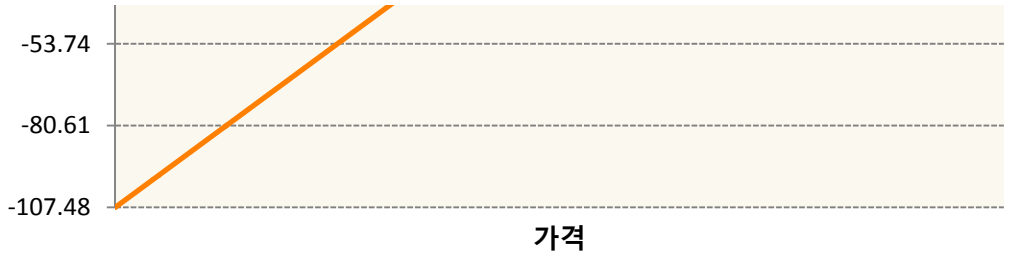
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,563	72	2,490	

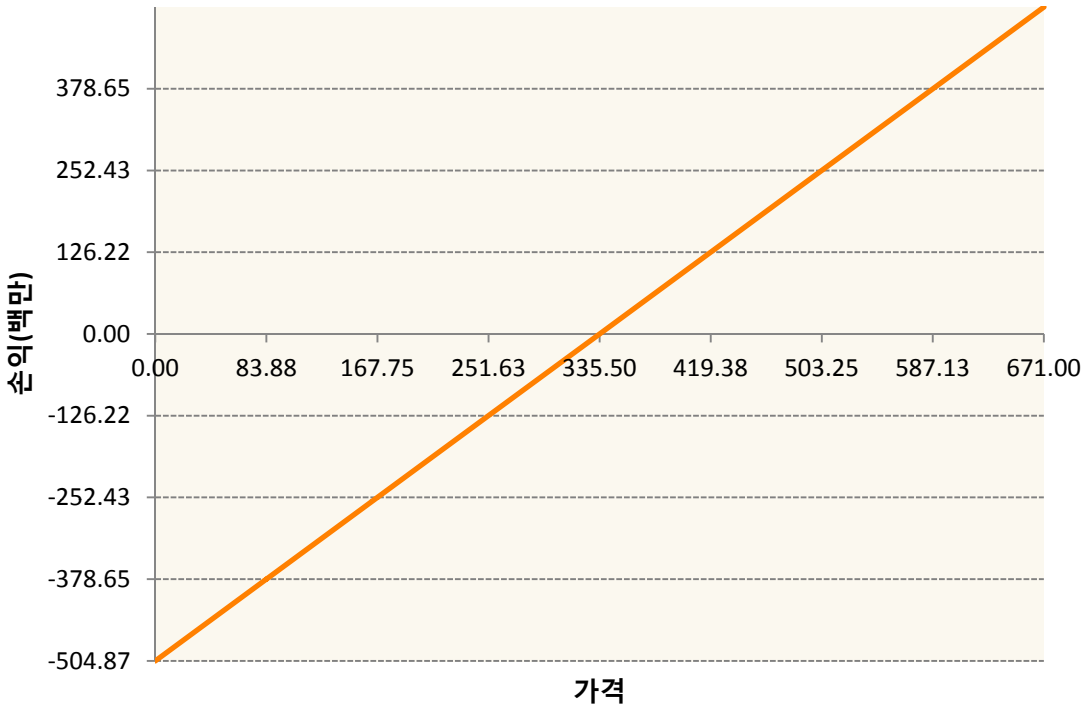
2. 만기시점의 손익구조



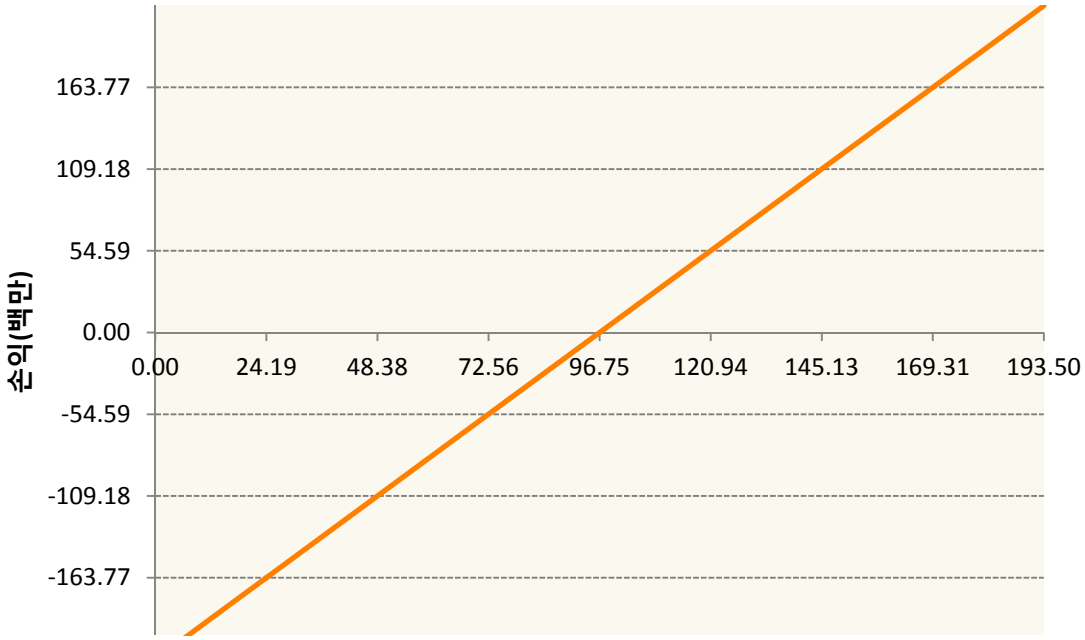


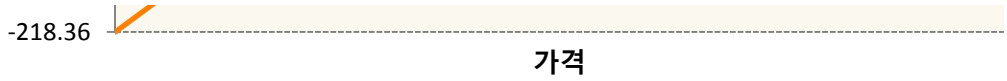


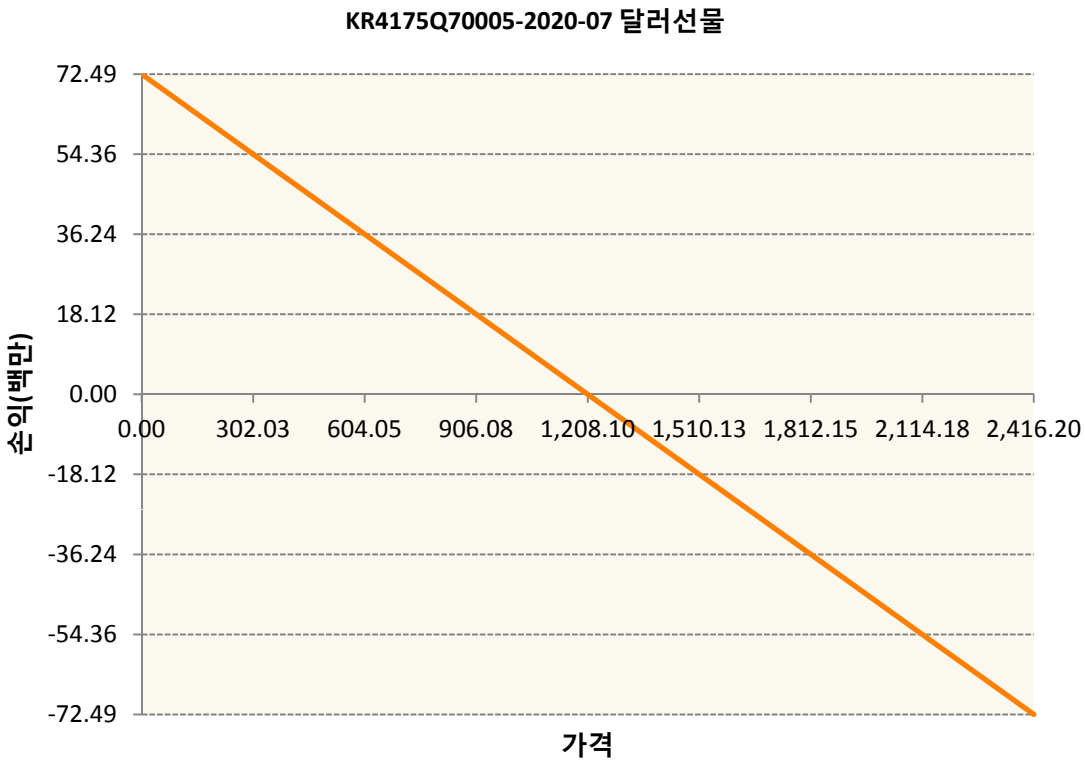
CU0-CORN FUTURE Sep20

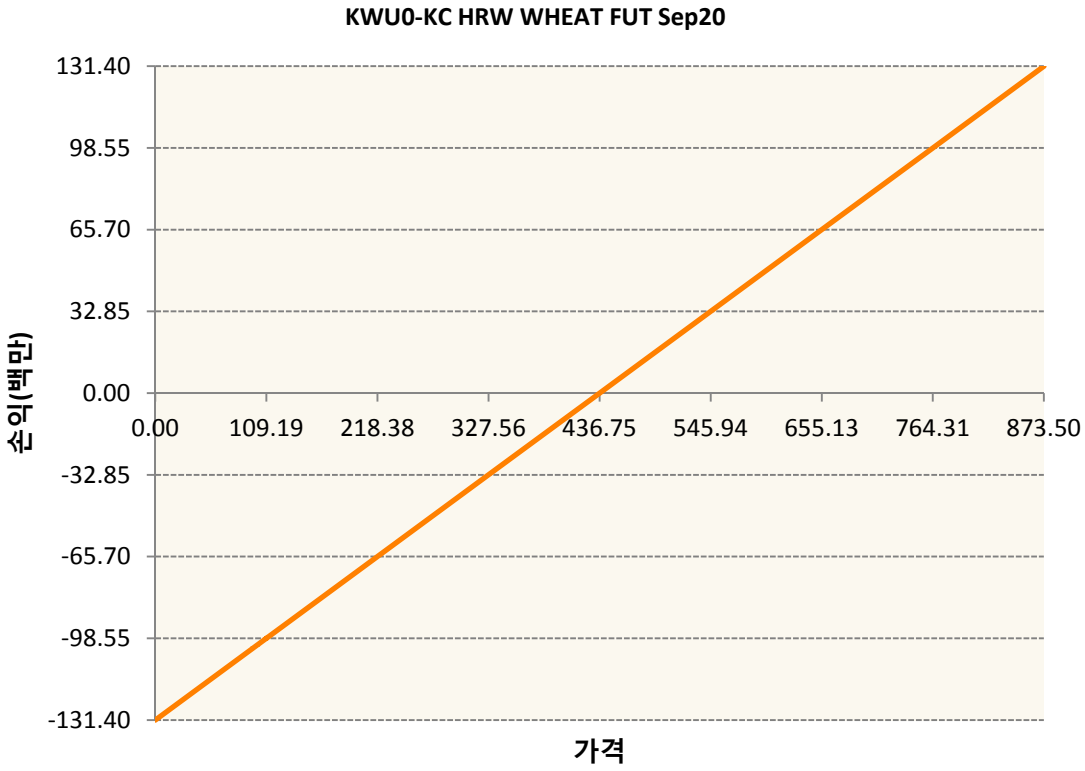


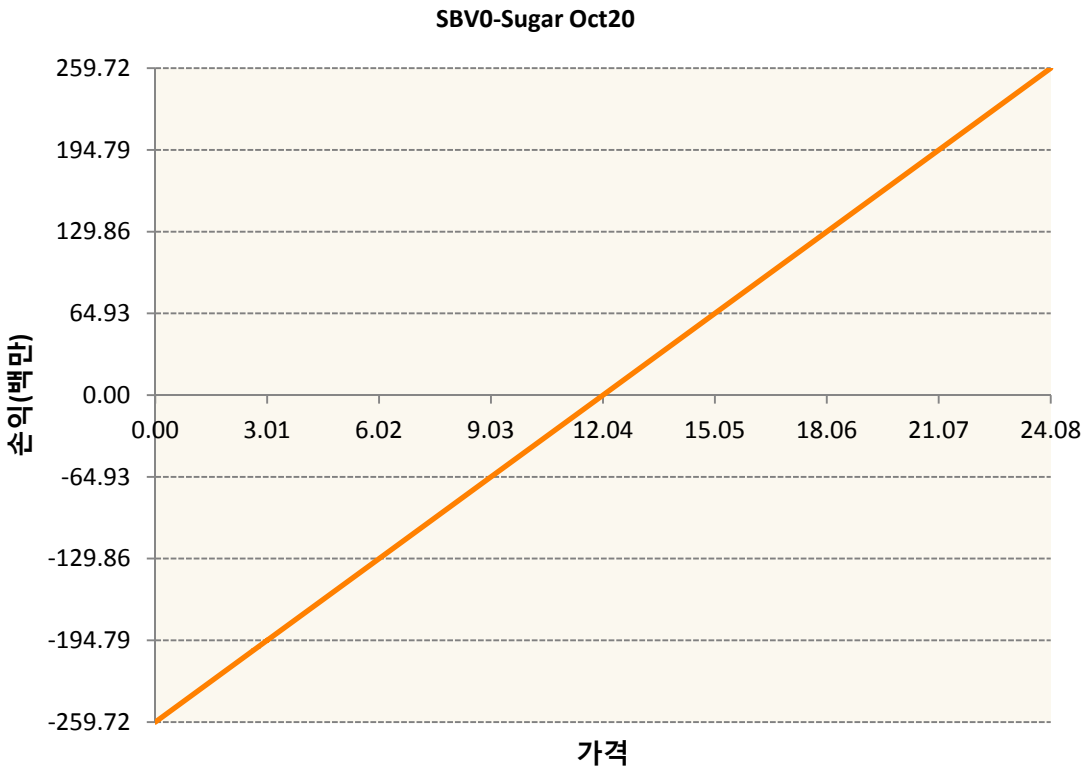
KCU0-COFFEE 'C' FUTURE Sep20

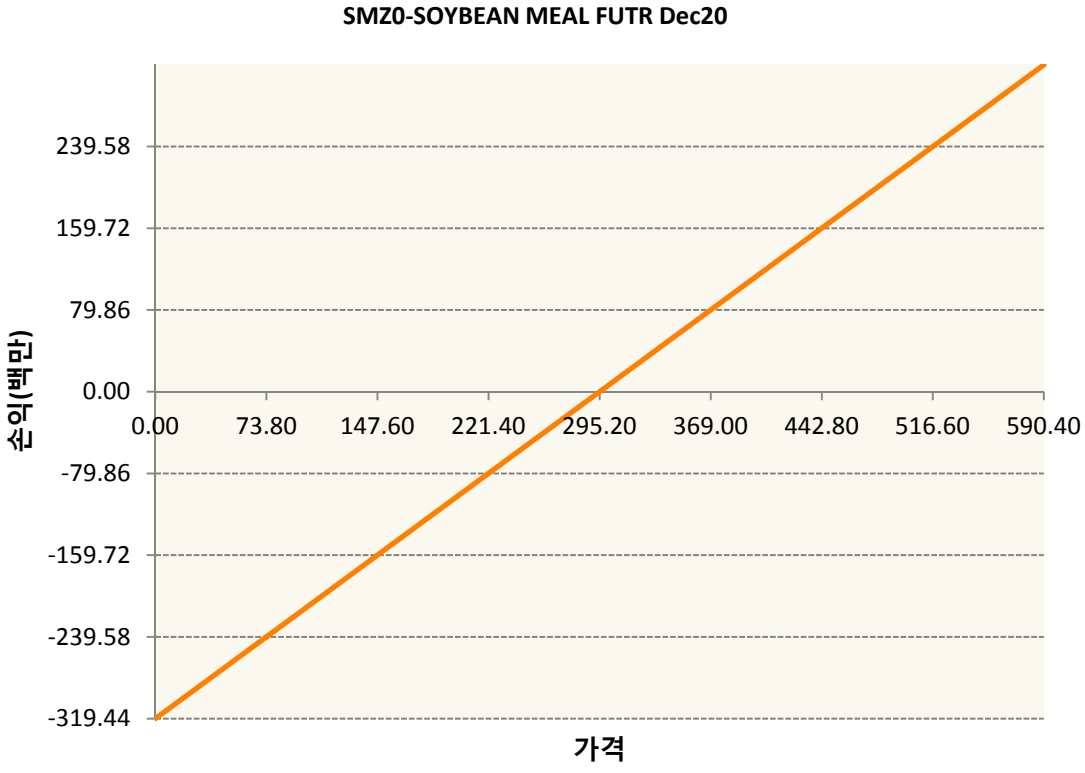


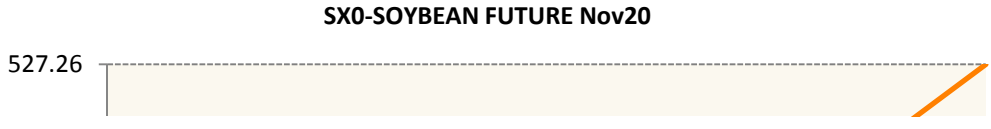

-218.36
가격

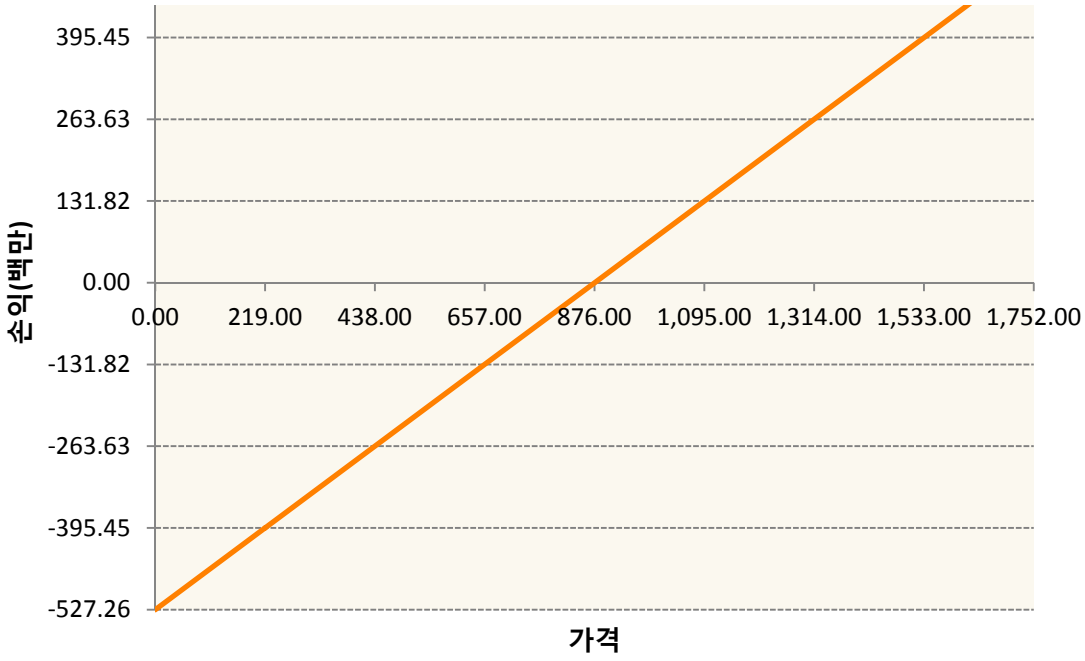

KR4175Q70005-2020-07 달러선물
72.49
54.36
36.24
18.12
0.00
-18.12
-36.24
-54.36
-72.49
0.00
302.03
604.05
906.08
1,208.10
1,510.13
1,812.15
2,114.18
2,416.20
손익(백만)
가격

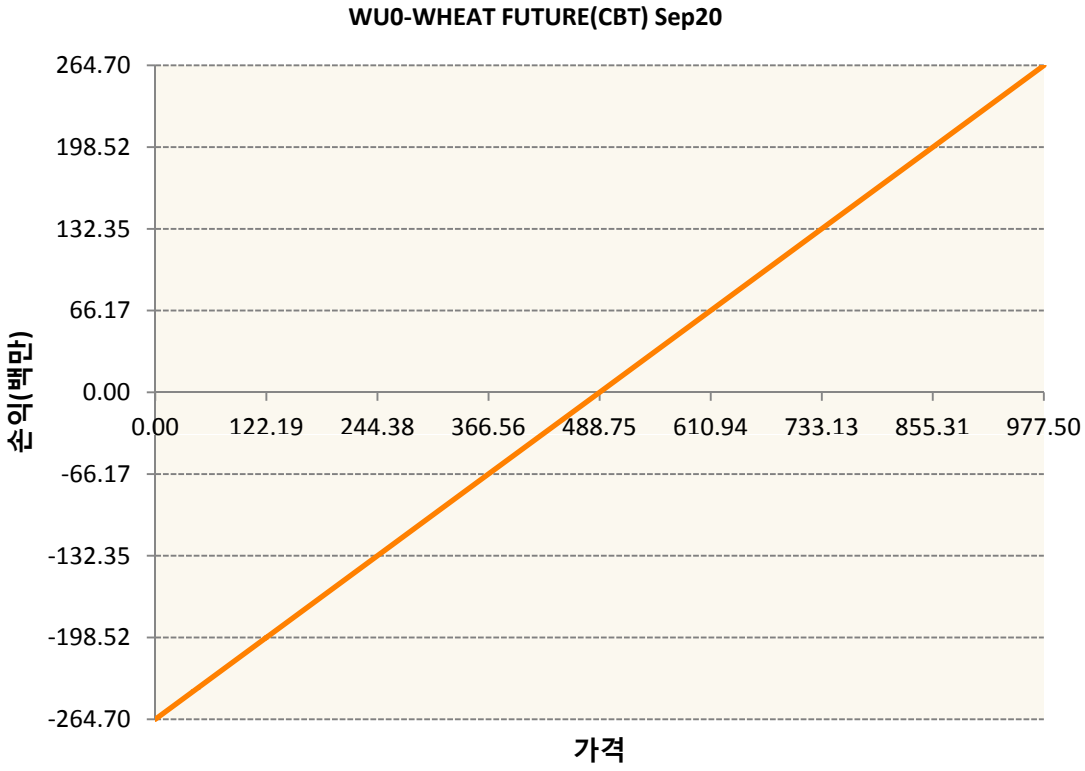

KWU0-KC HRW WHEAT FUT Sep20
131.40
98.55
65.70
32.85
0.00
-32.85
-65.70
-98.55
-131.40
0.00
109.19
218.38
327.56
436.75
545.94
655.13
764.31
873.50
손익(백만)
가격


SBV0-Sugar Oct20
259.72
194.79
129.86
64.93
0.00
-64.93
-129.86
-194.79
-259.72
0.00
3.01
6.02
9.03
12.04
15.05
18.06
21.07
24.08
손익(백만)
가격


SMZ0-SOYBEAN MEAL FUTR Dec20
239.58
159.72
79.86
0.00
-79.86
-159.72
-239.58
-319.44
0.00
73.80
147.60
221.40
295.20
369.00
442.80
516.60
590.40
손익(백만)
가격


SX0-SOYBEAN FUTURE Nov20
527.26





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
KR4175Q70(	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	21

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

239